

LEPRECON

REVIEW

Выпускается при поддержке
Интернет-ресурса



<http://www.lepreconreview.com>

№2 2012
(26)

ГЕНЕРАЛЬНЫЙ СПОНСОР ВЫПУСКА **NORD FX**



Обзоры торговых систем

TWO PERCENT DAILY TURBO
ПРОГРАММЫ ДЛЯ УЧЁТА И АНАЛИЗА СДЕЛОК

Уроки программирования
ШКОЛА MQL4 (Уроки 73-75)

Практический трейдинг
ПРИЕМЫ СЕЗОННОЙ ТОРГОВЛИ (Март 2012)
АНАЛИЗ ОБЪЕМОВ ФЬЮЧЕРСОВ (Часть 4)

Биржевой ликбез
ФОРЕКС ДЛЯ ВСЕХ (Часть 10:
Обзор торговых платформ)
ТОРГОВЛЯ ОПЦИОНАМИ (Часть 3)

Дневник трейдера
АЛИНА СИБИРЁВА

Конкурс RSQForex
ИТОГИ 4-ГО КОНКУРСА

а также **НОВОСТИ, АНАЛИТИКА, РЕЙТИНГИ**





СОДЕРЖАНИЕ

ОТ РЕДАКТОРА	3
НОВОСТИ ЛЕПРЕКОНА	4
АНАЛИТИКА	9
ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ	
Two Percent Daily Turbo	18
Программы для учёта и анализа сделок	29
ВЫБЕРИ СОВЕТНИК	46
УРОКИ ПРОГРАММИРОВАНИЯ	
Школа MQL4 (Уроки 73-75):	
Управление капиталом – начало.....	47
ПРАКТИЧЕСКИЙ ТРЕЙДИНГ	
Приёмы сезонной торговли. Март 2012	53
Анализ объёмов фьючерсов и его применение при торговле на Форекс (Часть 4 - VSA: Признаки слабости)	66
БИРЖЕВОЙ ЛИКБЕЗ	
Форекс для всех (Часть 10: Обзор торговых платформ)	76
Торговля опционами (Часть 3)	83
ДНЕВНИК ТРЕЙДЕРА	
Алина Сибирёва: Позитива полный мешок	90
КОНКУРС RSQFOREX	
Итоги 4-го конкурса	95
РЕЙТИНГ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ.....	100
РЕЙТИНГ СИГНАЛЬНЫХ СЕРВИСОВ.....	107
КТО ТАКОЙ ЛЕПРЕКОН?	108

Сайт журнала <http://www.lepreconreview.com>

© 2012 Все права на данные материалы принадлежат [LepreconTrading.com](http://www.leprecontrading.com)
Полная или частичная перепечатка запрещены!

ОТ РЕДАКТОРА



Приветствую всех читателей журнала «Leprecon Review». Вот и подходит к концу зимний тренд, который в этом году, если честно, слегка утомил своим гололёдом и аномальными февральскими морозами: виданное ли дело, даже в Венеции впервые за последние 80 лет замерзли каналы, а в Японии - рекордные для страны снегопады! Кто-то может попытаться увидеть в этом какие-то предзнаменования, но только не мы. И если проводить аналогию с торговлей, то эти явления вполне можно считать очередным напоминанием о том, что всегда и везде есть место неожиданностям, к которым стоит быть готовыми, чтобы принять удар во всеоружии. С природными стихиями бороться мы пока не научились, а вот обеспечить вас знаниями о торговых системах и техниках, которые помогут уберечь вас от рыночных форс-мажоров, мы вместе с дружным коллективом наших авторов вполне способны.

Вот и в сегодняшнем номере вас ждет продолжение нескольких обучающих циклов – в рубрике «Анализ объемов фьючерсов» Инна Солнечная продолжит рассмотрение принципов движения цены благодаря объемам, а в рубрике «Биржевой ликбез» Радик Шамсутдинов расскажет о «Торговле опционами». Кирилл Еременко в «Школе MQL4» затронет немаловажную тему управления капиталом, а Леонид Борский в «Приемах сезонной торговли» даст готовые к применению рекомендации по торговле некоторыми товарными и фондовыми спредами. Если же вы еще считаете себя начинающим трейдером, то вас ждет продолжение цикла статей «Форекс для всех» от компании RSQForex.

Также хочу обратить ваше внимание на обзор «Программы для учёта и анализа сделок», в котором пойдет речь о программах, призванных помочь стать настоящими профессионалами в трейдинге и разработанных специально для ведения статистики и анализа прибыльных и убыточных сделок. Ну и, конечно, как обычно, у нас вы найдете новости, мониторинги, аналитику и многое другое.

Оставайтесь с нами!

Главный редактор Алекс Миньков



С нами возможности на Вашей стороне!
LepreconTrading является первой независимой компанией, предоставляющей денежные выплаты трейдерам на основе каждой совершаемой ими сделки. Мы сфокусированы на предоставлении нашим клиентам сервиса премиум-класса!

1. Создаём аккаунт [Подробнее](#)
2. Выбираем брокера [Подробнее](#)
3. Получаем БОНУСЫ [Подробнее](#)

Статистика

Количество регистраций:

12371

Количество клиентов компании «Leprecon Trading» превысило **12370!**

Всего клиентам выплачено:

1379720.9
USD

Сумма выплат клиентам с момента основания компании «Leprecon Trading» превысила **1 млн. 379 тыс. долларов!**

Список брокеров, доступных для регистрации в компании «Leprecon Trading» (по состоянию на февраль 2012 г.):

Брокеры

Если Вы торгуете в компании, которой нет в нашем списке, то свяжитесь с нами и мы постараемся добавить такую компанию в самые короткие сроки.

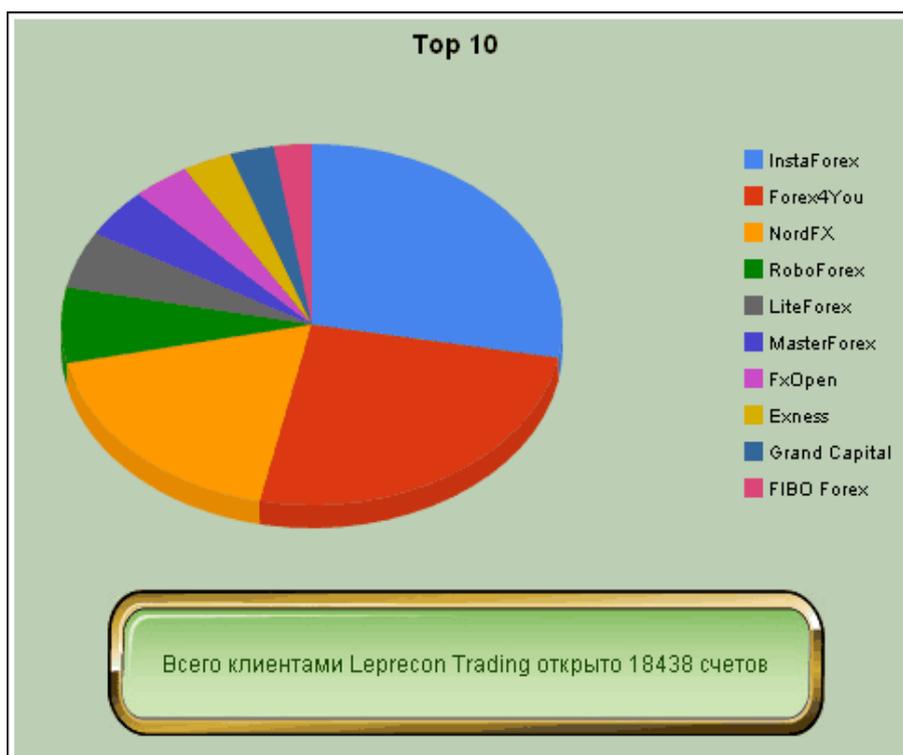
Календарь начислений по брокерам
(по состоянию на февраль 2012 г.):

Календарь начислений

В данном разделе мы решили упорядочить даты начислений по каждой компании. И хотя большинство компаний выплачивают нам в течении первых 10 дней нового месяца, остаются несколько компаний, переводы от которых приходят после 15 числа нового месяца.

Компания	Начисление выплат	Компания	Начисление выплат
HOTFOREX FOR TRADERS THAT WANT MORE	в первые 25 дней нового месяца.	888 800 0000 FX50	в первые 10 дней нового месяца.
MASTER FOREX	в первые 10 дней нового месяца.	FIBO GROUP LTD	в первые 20 дней нового месяца.
Best online broker of Russia and CIS	в первые 15 дней нового месяца.	Forex4you	в первые 10 дней нового месяца.
FXOPEN when money makes money	в первые 10 дней нового месяца.	FBS FINANCIAL BROKERAGE SERVICES	в первые 10 дней нового месяца.
instaforex Instant Forex Trading	в первые 25 дней нового месяца.	ACM1 online trading services	в первые 15 дней нового месяца.
nordFX	в первые 10 дней нового месяца.	ТРЕЙДФОРТ	в первые 20 дней нового месяца.
FOREX.com FOREX CAPITAL GROUP	в первые 20 дней нового месяца.	YACOWULFX	в первые 15 дней нового месяца.
Admiral Markets Trading for everyone	в первые 10 дней нового месяца.	freshforex	в первые 15 дней нового месяца.
FOREX TREND	в первые 15 дней нового месяца.	www.grandcapital.net	в первые 25 дней нового месяца.
DUKASCOPY Swiss Forex Marketplace	в первые 15 дней нового месяца.	EXNESS	в первые 10 дней нового месяца.
IKON FX GROUP	в первые 15 дней нового месяца.	LiteForex and International representatives	в первые 15 дней нового месяца.
FxCompany	в первые 15 дней нового месяца.	ZuluTrade	в первые 20 дней нового месяца.
ForexMarket	в первые 15 дней нового месяца.	ADRENALIN	в первые 15 дней нового месяца.
RoboForex International Broker	в первые 15 дней нового месяца.	systemforex	в первые 15 дней нового месяца.
ForexClub United States	в первые 20 дней нового месяца.	FOREX MFCIS group	в первые 20 дней нового месяца.

Распределение мест в Топ-10 среди брокеров по количеству открытых счетов
(по состоянию на февраль 2012 г.):



Напоминаем, что для заказа бонусов от компании «LepreconTrading» доступны следующие интернет-магазины:

Запрос бонуса:

	Предлагает книги, музыкальную и видеопродукцию, электронику и цифровую технику, программные продукты и мультимедийные игры, а также косметику, парфюмерию и ювелирные изделия.	<input checked="" type="checkbox"/> ЗАКАЗАТЬ БОНУС
	Интернет-магазин Rozetka поможет вам избежать необходимости посещать десятки магазинов. Вы можете заказать любой товар, не вставая со своего кресла, а наш курьер вовремя доставит покупку по указанному адресу.	<input checked="" type="checkbox"/> ЗАКАЗАТЬ БОНУС



Напоминаем нашим клиентам, что по всем возникающим вопросам по работе сервиса Вы можете обращаться в нашу дружелюбную и отзывчивую Техподдержку, доступ к которой возможен из Личного Кабинета (ЛК) клиента.



«LepreQuotes» представляет собой онлайн библиотеку рыночных котировок. Так как история котировок очень важна и, самое главное, серьезно востребована среди пользователей автоматических торговых систем, нами была создана база данных котировок, запись в которую происходит круглосуточно и в реальном времени.

<p>▶ Статистика:</p> <p>Компаний: 17 Типов счетов: 49 Символов: 4018 Скачано раз: 6615 Котировок: 614344880</p>	Компания: <input type="text" value="Выберите компанию"/>	<input checked="" type="button" value="СКАЧАТЬ"/>
	Тип счета: <input type="text" value="Выберите тип счета"/>	
	Символ: <input type="text" value="Выберите символ"/>	
	Дата: <input type="text" value="01.04.2010"/> до <input type="text" value="01.04.2010"/>	

Если в списке нет компании, которая Вам нужна - пишите нам на info@leprequotes.com, и мы постараемся добавить эту компанию как можно быстрее!



Редакция журнала «Leprecon Review» приглашает к сотрудничеству авторов различных направлений, связанных с биржевой торговлей. Мы заинтересованы в публикации авторских обзорных, аналитических и практических статей, касающихся торговли на фондовом и валютном рынке.

ЧТО ЭТО ДАЁТ ВАМ, КАК АВТОРУ:

Вы можете заявить всему миру о себе, указав в статье свой сайт или блог, которые попадут не только в наши еженедельные рассылки (более 7500 подписчиков) и сам журнал, но и в архив, где останутся навсегда.

Возможно, после публикации Вы найдёте себе новых друзей или единомышленников. Если Вы имеете свой инвестиционный проект и Вам нужны инвесторы, после публикации результатов торговли Вашей системы Вы можете получить предложения от потенциальных инвесторов, что позволит увеличить Вашу прибыль и количество клиентов.

Мы ценим и уважаем Ваш труд, поэтому Ваша статья после публикации будет оплачена.

ОСНОВНЫЕ ТРЕБОВАНИЯ:

- статьи объемом менее 2 страниц мы не публикуем, поэтому пишите немного более развёрнуто, стараясь раскрыть заявленную тему. Обычно оптимальный размер статьи составляет 2-4 страницы или 8000 знаков (без пробелов);
- обязательно сопровождение статьи графическими иллюстрациями;
- статья должна быть написана в простой и доступной для понимания форме;
- если нужно будет сделать поправки, то мы с Вами свяжемся.

ГЛАВНЫЕ УСЛОВИЯ ПУБЛИКАЦИИ:

- статья должна отвечать описанным выше требованиям;
- Вы должны являться автором статьи и иметь полное право (авторские права) на её публикацию;
- то, что Вы присылаете нам материал, автоматически означает, что Вы даёте согласие на его публикацию;
- каждая одобренная на публикацию статья позволяет автору получить за неё вознаграждение, рамки которого оговариваются отдельно с Администрацией журнала.

В ПРИСЛАННОМ МАТЕРИАЛЕ ДОЛЖНО ПРИСУТСТВОВАТЬ:

- Ваши Ф. И. О. (никнэйм);
- Ваше качественное фото;
- краткое сообщение об авторе, включая Ваш опыт биржевой торговли.

А также, по желанию, можно указать Ваши контактные данные (адрес сайта, блога).

КУДА И КОМУ ОТПРАВЛЯТЬ МАТЕРИАЛ:

Весь материал перед одобрением проходит предварительную проверку в редакции журнала. Статью в формате Microsoft Word, а также графические и прочие материалы необходимо присылать на e-mail: editor@leprecontrading.com.

На этот же адрес Вы можете отсылать вопросы по публикациям и другим темам, которые касаются некоммерческого размещения материала в нашем журнале.

В случае, если Вы не получили от нас ответа в течение 5 дней, пожалуйста, продублируйте ещё раз Ваше письмо на этот же адрес.

ВНИМАНИЕ:

Журнал «**Leprecon Review**» является независимым изданием, и мы оставляем за собой право отказать в публикации предоставленного нам материала без объяснения причин.

Также причины для отказа могут быть следующие: работы автора не отвечают заданной тематике, противоречат действующему законодательству, содержат оскорбления и клеветнические выпады по отношению к каким-либо группам людей/персонам, призывы к насилию, разжиганию межнациональной розни, нецензурные выражения или нарушают права третьих лиц.

Если у Вас возникли вопросы о причине отказа, Вы всегда можете связаться с Администрацией журнала для уточнения этой информации.

Написать письмо





Михаил Трофимов (Hunter_GB)

Трейдер со стажем более 10 лет. В 2002 году начал разрабатывать для российского фондового рынка аналитические торговые системы, известные как "Gold Cross". С 2004 года торгует индексы, металлы, валютные пары, реже энергетику. Автор собственных разработок по торговым системам. Также занимается переводами, аналитическими обзорами, проведением тренингов по торговым системам.

АНАЛИТИЧЕСКОЕ ИССЛЕДОВАНИЕ РЫНКА

ИТОГИ ЯНВАРЬ 2011

ПРОГНОЗ ФЕВРАЛЬ 2012

(ПО МАТЕРИАЛАМ РОССИЙСКИХ И ИНОСТРАННЫХ СМИ)

БЕЗРАБОТИЦА В ЕВРОЗОНЕ ДОСТИГЛА РЕКОРДНОГО МАКСИМУМА

«Уровень безработицы в странах еврозоны в 2011 году достиг нового рекордного максимума», - сообщает агентство Eurostat.

В декабре он составлял 10,4%: это означает, что безработными в 17 странах еврозоны числились около 16,5 млн человек, что на 751 тыс. больше, чем в ноябре.

Самый высокий уровень безработицы по-прежнему остается в Испании (22,9%), самый низкий – в Австрии (4,1%).

За 12 месяцев с декабря 2010 года средний уровень безработицы в еврозоне вырос на 3%.

Экономист Citigroup Гийом Менюэ полагает, что в 2012 году количество безработных в странах Евросоюза будет только увеличиваться.

ГРЕЧЕСКИЕ ВЛАСТИ НЕ ДОГОВОРИЛИСЬ ОБ УСЛОВИЯХ ПОМОЩИ ОТ ЕС

Лидеры партий, входящих в правящую коалицию Греции, не смогли достигнуть соглашения на переговорах по поводу условий предложенного ЕС пакета помощи объемом в 130 млрд. евро. К настоящему моменту Греция подготовила план, по которому ее долги частным кредиторам урезаются вдвое, в обмен на что она получает новую порцию займов сроком на 30 лет в среднем под менее чем 4% годовых. Целью реструктуризации является сокращение долга Греции со 160% от ее ВВП в настоящее время до 120% к 2020 году.

ЭКОНОМИКА США: ИТОГИ ГОДА

На протяжении 2011г. ежеквартально экономика США развивалась по нарастающей, а итоги последних трёх месяцев, по всей вероятности, будут лучше показателей предыдущих кварталов. В 4 квартале экономический рост составил примерно 3% (в годовом разрезе). В последний раз темпы экономического роста превысили 3% рубеж весной 2010 г.

Необходимо принимать во внимание, что материалы раздела «Аналитика» носят информационный характер и не являются четкими торговыми рекомендациями. Публикуемые рекомендации являются частным мнением аналитиков и не должны восприниматься как прямое руководство к действию. Редакция журнала «Leprecon Review» не несет ответственности за инвестиционные и прочие решения, принятые пользователями на основании информации, представленной в данном разделе, а также за результаты, полученные в ходе принятия таких решений.

Предполагается, что в 2012 г. экономика США будет развиваться умеренными темпами, без каких-либо резких скачков в том или ином направлении (если, конечно, не будет сильных внешних потрясений, в частности, из Европы). Хотя в силу ряда обстоятельств не приходится ожидать значительного роста темпов экономического развития, негативный сценарий событий выглядит все менее вероятным. Предполагается, что наилучших показателей экономика США достигнет во втором-третьем кварталах. Стоит ли говорить, что исход предстоящих в ноябре президентских выборов будет во многом зависеть от того, сумеет ли американская экономика окончательно преодолеть последствия затяжной рецессии последних лет.

ВЛАДИМИР ПУТИН: «О НАШИХ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ЗАДАЧАХ»

МЫ ЖИВЕМ В ПЕРИОД КАРДИНАЛЬНЫХ ПЕРЕМЕН В ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ЖИЗНИ ВСЕГО МИРА

Место России в глобальном разделении труда

— Сегодня Россия зависит от мировой экономики, интегрирована в нее очень сильно - сильнее, чем большинство других стран.

— Общим местом стала констатация сырьевого характера экономики... Фактически мы пережили масштабную деиндустриализацию, потерю качества и тотальное упрощение структуры производства.

— Иметь экономику, которая не гарантирует нам ни стабильности, ни суверенитета, ни достойного благосостояния - для России непозволительно. Нам нужна новая экономика, с конкурентоспособной промышленностью и инфраструктурой, с развитой сферой услуг, с эффективным сельским хозяйством.

Макроэкономические условия роста

— Нами уже взяты немалые долгосрочные бюджетные обязательства прежде всего в социальной сфере, и мы их намерены неукоснительно соблюдать. Также значительные расходы предстоят в связи с модернизацией наших Вооруженных сил. Большие расходы потребуются для развития здравоохранения, образования, для строительства и ремонта дорог. Как мы сможем их обеспечить?

— Первое - эффективность расходов. Четкий выбор приоритетов, отказ от всего избыточного. Жесткий контроль за стоимостью и качеством строительства, ценами при госзакупках. А по сути - ликвидация "откатов" при использовании государственных денег как на федеральном, так и на региональном уровнях. Мы должны с этим справиться, и это позволит нам сэкономить, по оценкам, как минимум 5%, а, возможно, и 10% бюджета - от 1 до 2% ВВП ежегодно.

— В бюджетной сфере требуется решительный отказ от инерции, когда мы продолжаем финансировать учреждения вместо социальных услуг, которые они должны предоставлять. Везде, где это возможно, надо перейти на нормативно-подушевое финансирование, когда деньги закрепляются за гражданами, которые обращаются за услугами, развитие конкуренции. Это еще 10-15% внутренней экономики...

— Второе. Нужна сбалансированная пенсионная система, что снизит уровень трансфертов из бюджета в Пенсионный фонд.

— Третье. Понадобится определенный "налоговый маневр". Мы не будем увеличивать налоговую нагрузку на несырьевые сектора. Но у нас есть резерв роста налоговых доходов по ряду направлений: дорогая недвижимость, потребление люксовых товаров, алкоголя, табака, сбор рентных платежей в тех секторах, где он пока занижен. Прежде всего - то, что называется дополнительным налогом на богатство, а точнее - на престижное потребление. Основные решения должны быть приняты уже в этом году, с тем чтобы со следующего года владельцы дорогих домов и машин платили повышенные ставки налогов.

— Большой резерв - в наведении порядка с уходом от налогов через фирмы-однодневки, через офшоры.

— Россия сегодня уступает развитым экономикам по производительности труда в три-четыре

раза. А что это значит? В масштабах страны низкая производительность труда - это глобально неконкурентоспособная экономика. Для конкретного человека низкая производительность труда - это "плохая работа", которая не может обеспечить хорошую зарплату.

— Новое поколение российских граждан - те, кто только начал работу, и те, кто еще учится, имеет очень высокие ожидания, очень высокие требования к своей работе. Наша страна еще никогда не встречалась с таким образовательным и культурным вызовом. И это позитивный вызов - я глубоко убежден в этом.

— Новая экономика России - это экономика диверсифицированная, где, кроме современного ТЭК, будут развиты и другие конкурентоспособные сектора. Доля высокотехнологичных и интеллектуальных отраслей в ВВП должна к 2020 году увеличиться в полтора раза. При этом высокотехнологичный экспорт России вырастет вдвое.

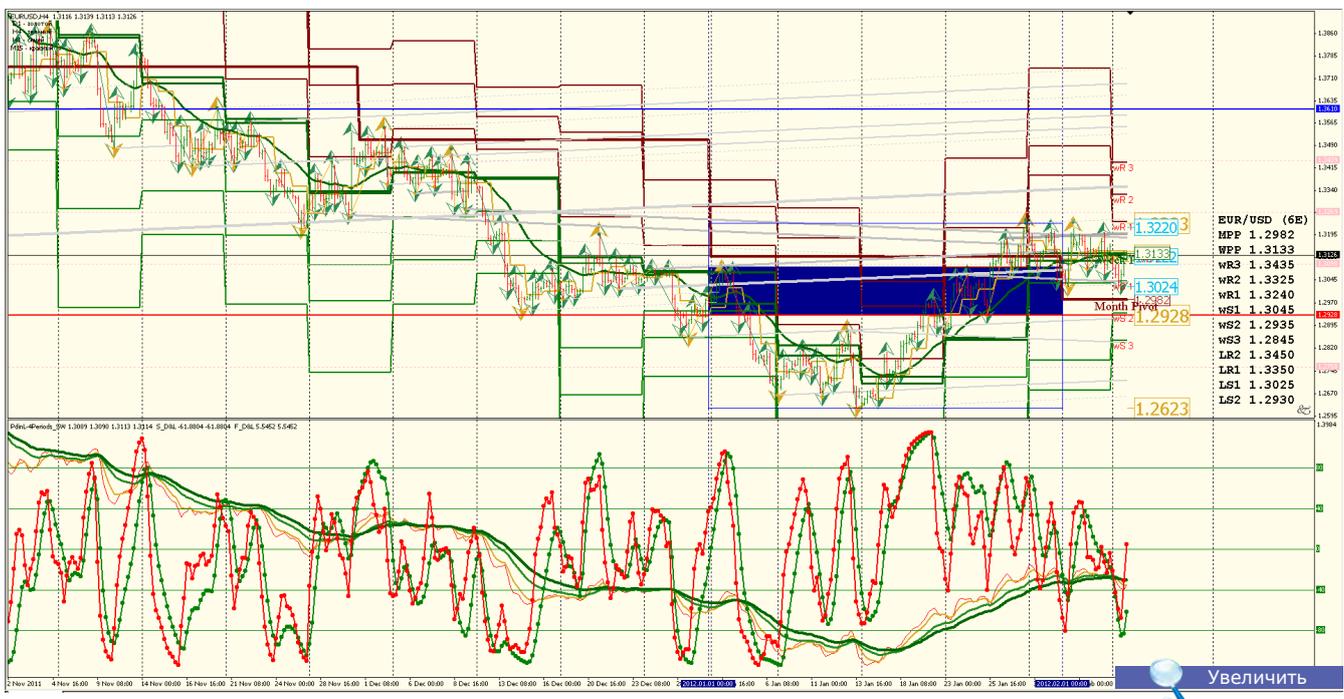
Это - эффективная экономика с высокой производительностью труда и низкой энергоемкостью. Мы должны значительно сократить отставание от стран-лидеров. Это значит, что надо обеспечить рост производительности по экономике в 2 раза, а в ключевых секторах - выйти на уровень производительности, сопоставимой или даже выше, чем у наших конкурентов.

Это - высокопроизводительные рабочие места с высокой оплатой. Средняя заработная плата по экономике вырастет в реальном выражении в 1,6-1,7 раза, почти до 40 тысяч рублей в ценах 2011 года.

Это экономика постоянно обновляющихся технологий. Доля предприятий, внедряющих технологические инновации, должна вырасти в два с половиной раза к концу десятилетия с нынешних 10,5 до 25%, то есть достигнуть сегодняшнего средневропейского уровня.

Это экономика, где малый бизнес представляет не менее половины рабочих мест в экономике. При этом значительная часть малого бизнеса 2020 года - это должны быть сектора интеллектуального и творческого труда, работающие в глобальном рынке, экспортирующие свои продукты и услуги.

EUR/USD (6E)



Анализ: Коррекция вероятна до 1.2930

Уровни сопротивления: LR2 1.3450 и LR1 1.3350

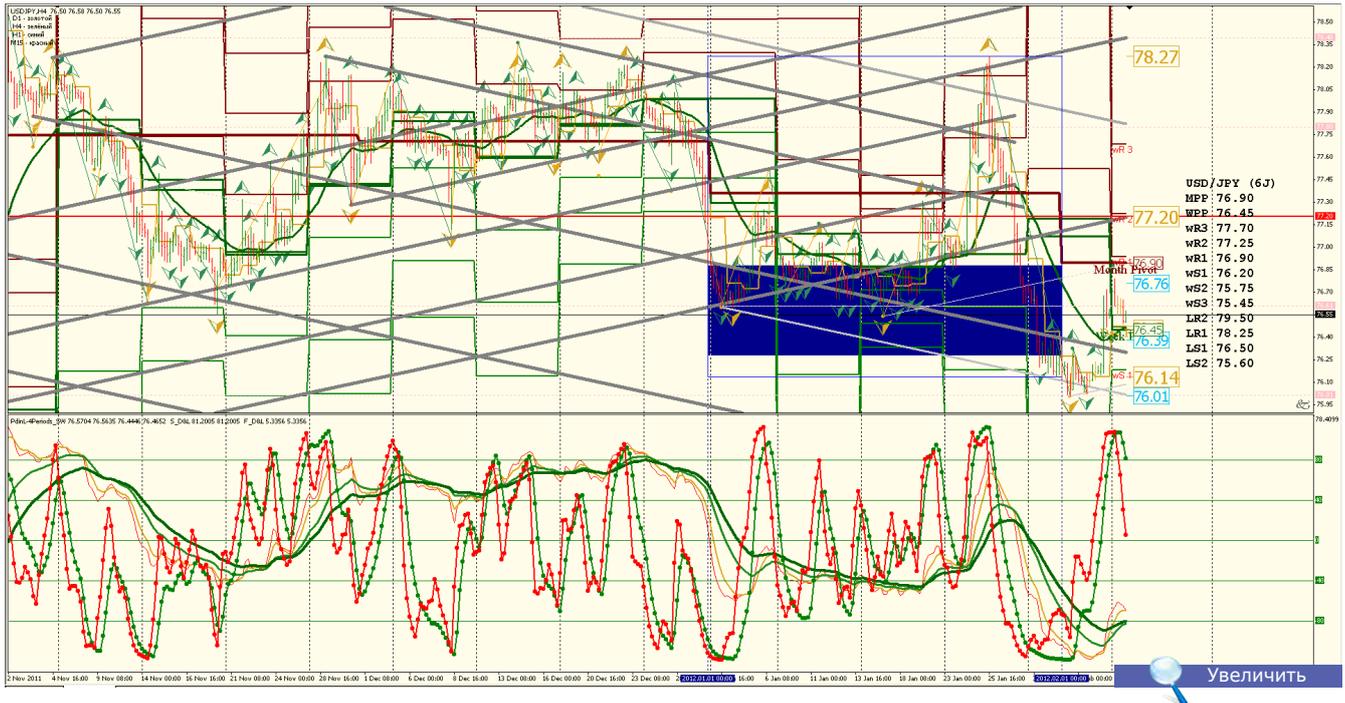
Уровни поддержки: LS1 1.3025 и LS2 1.2930

Точки разворота: MPP 1.2982 и WPP 1.3133

Мнение: Продавать от LR2 1.3450 и LR1 1.3350 до LS2 1.2930

Альтернативный сценарий: Отсутствует, продавать на росте.

USD/JPY (6J)



Анализ: Флэт, торговать в канале 79.50 — 75.60

Уровни сопротивления: LR2 79.50 и LR1 78.25

Уровни поддержки: LS1 76.50 и LS2 75.60

Точки разворота: MPP 76.90 и WPP 76.45

Мнение: Продавать от LR2 77.95 и LR1 77.50 до 75.55

Альтернативный сценарий: Отсутствует. Флэт, торговать в канале 79.50 — 75.60.

ES_CONT (SPX — S&P) - (GLOBEX)



Анализ: Коррекция вероятна до 1140.00

Уровни сопротивления: LR2 1380.00 и LR1 1360.00

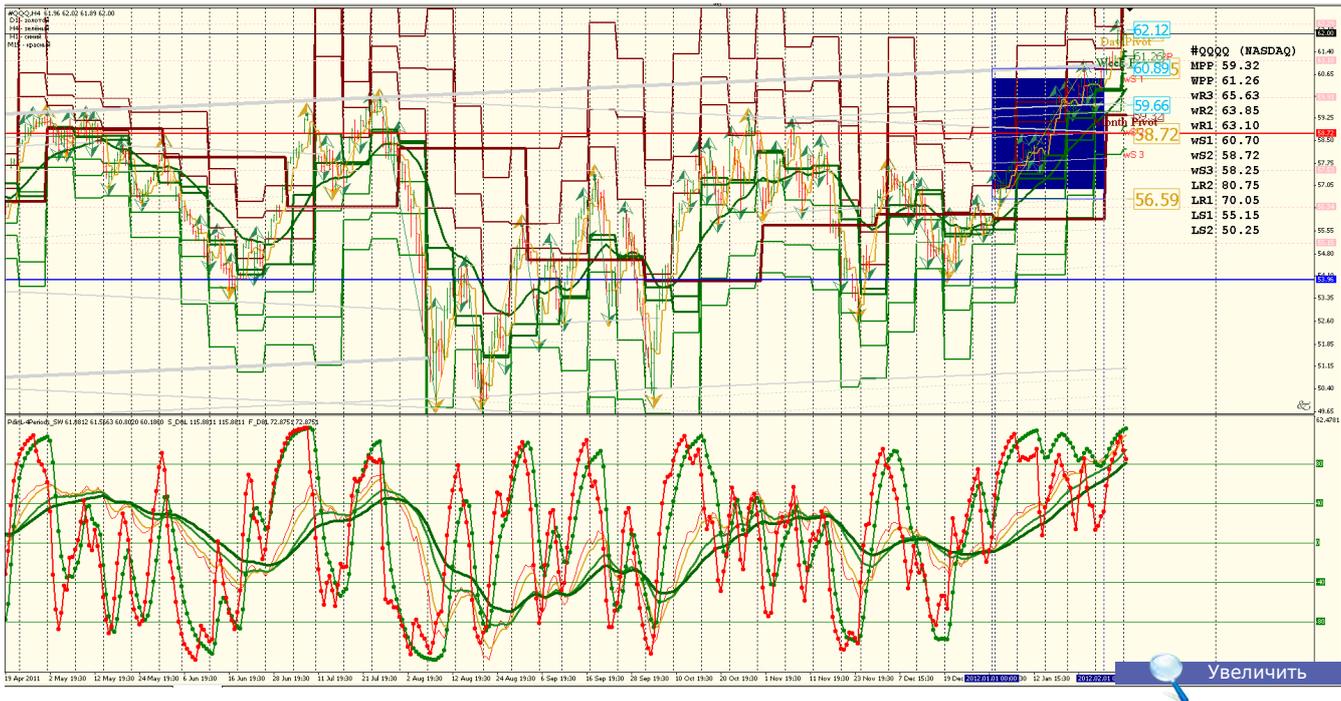
Уровни поддержки: LS1 1292.00 и LS2 1245.00

Точки разворота: MPP 1296.00 и WPP 1325.75

Мнение: Продавать от LR2 1380.00 и LR1 1360.00 до LS2 1245.00

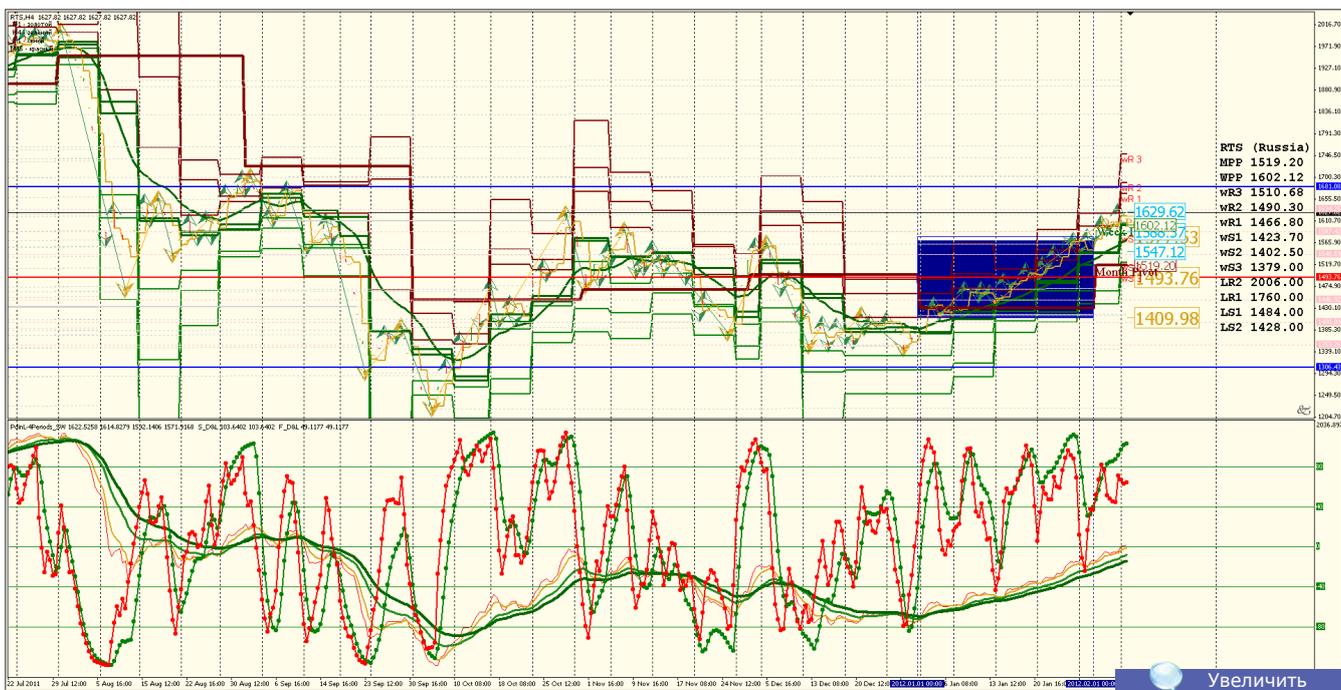
Альтернативный сценарий: Отсутствует.

QQQQ (POWERSHARES - NASDAQ)



Анализ: Коррекция вероятна до 50.25
Уровни сопротивления: LR2 80.75 и LR1 70.05
Уровни поддержки: LS1 55.15 и LS2 50.25
Точки разворота: MPP 59.32 и WPP 61.26
Мнение: Продавать от LR2 80.75 и LR1 70.05 до 50.25
Альтернативный сценарий: Отсутствует, продавать на росте.

RTS (RUSSIA)



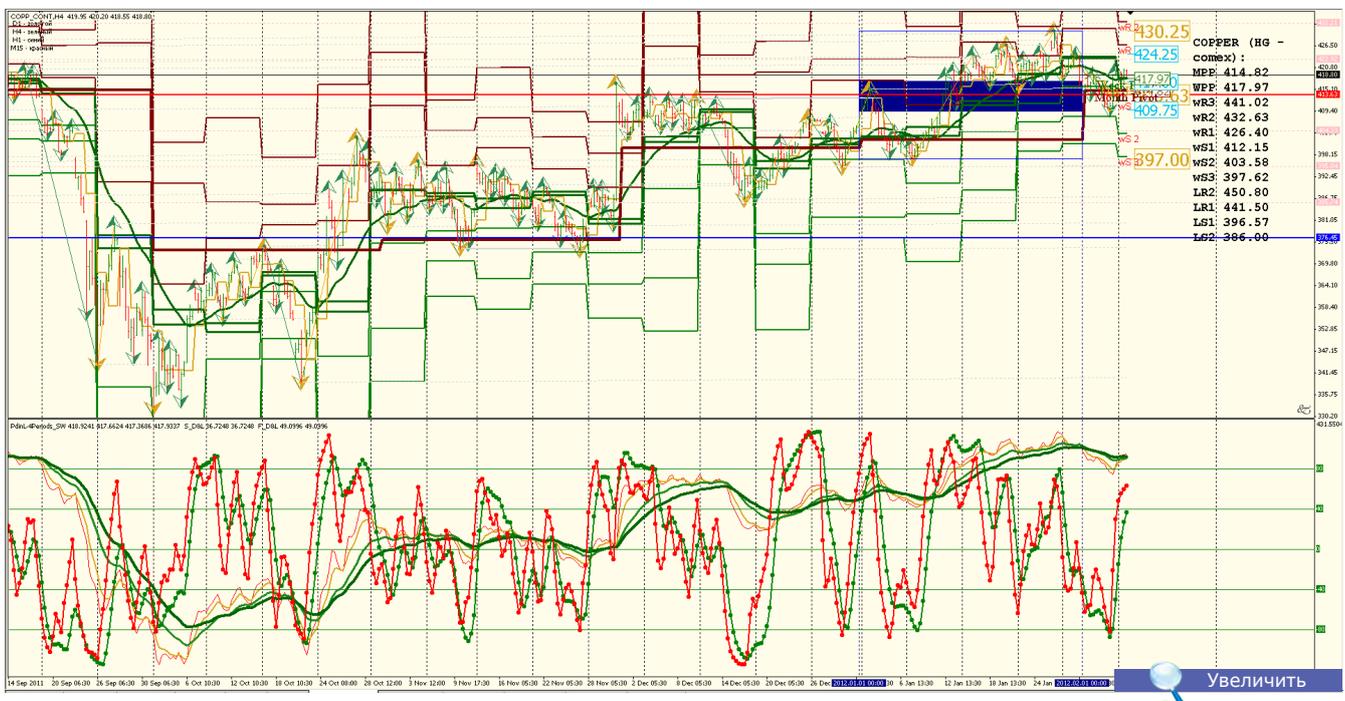
Анализ: Коррекция вероятна до 1428.00
Уровни сопротивления: LR2 2006.00 и LR1 1760.00
Уровни поддержки: LS1 1484.00 и LS2 1428.00
Точки разворота: MPP 1519.20 и WPP 1602.12
Мнение: Продавать от LR2 2006.00 и LR1 1760.00 до LS2 1428.00
Альтернативный сценарий: Отсутствует, продавать на росте.

GOLD (XAU – SPOT)



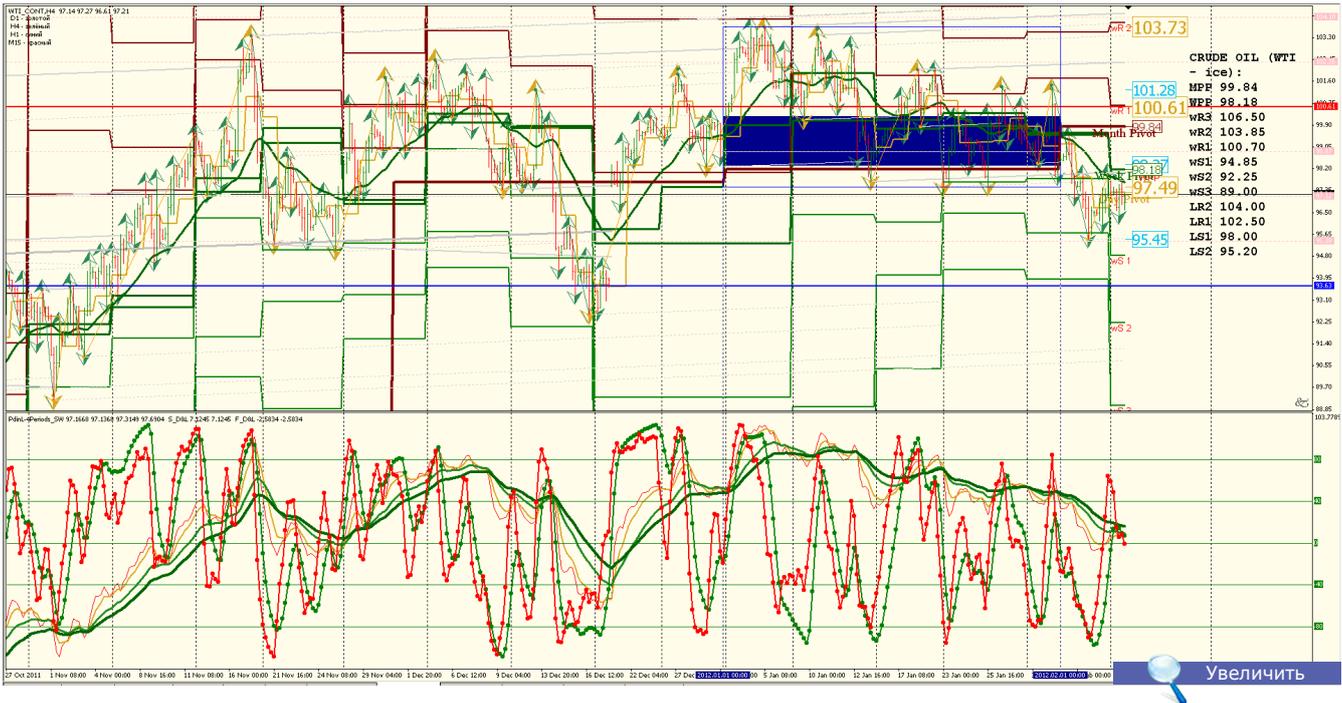
Анализ: Коррекция вероятна до 1802.00
Уровни сопротивления: LR2 1802.00 и LR1 1762.00
Уровни поддержки: LS1 1704.00 и LS2 1656.63
Точки разворота: MPP 1683.16 и WPP 1634.64
Мнение: Покупать от LS2 1656.63
Альтернативный сценарий: Отсутствует.

COPPER (HG – COMEX)



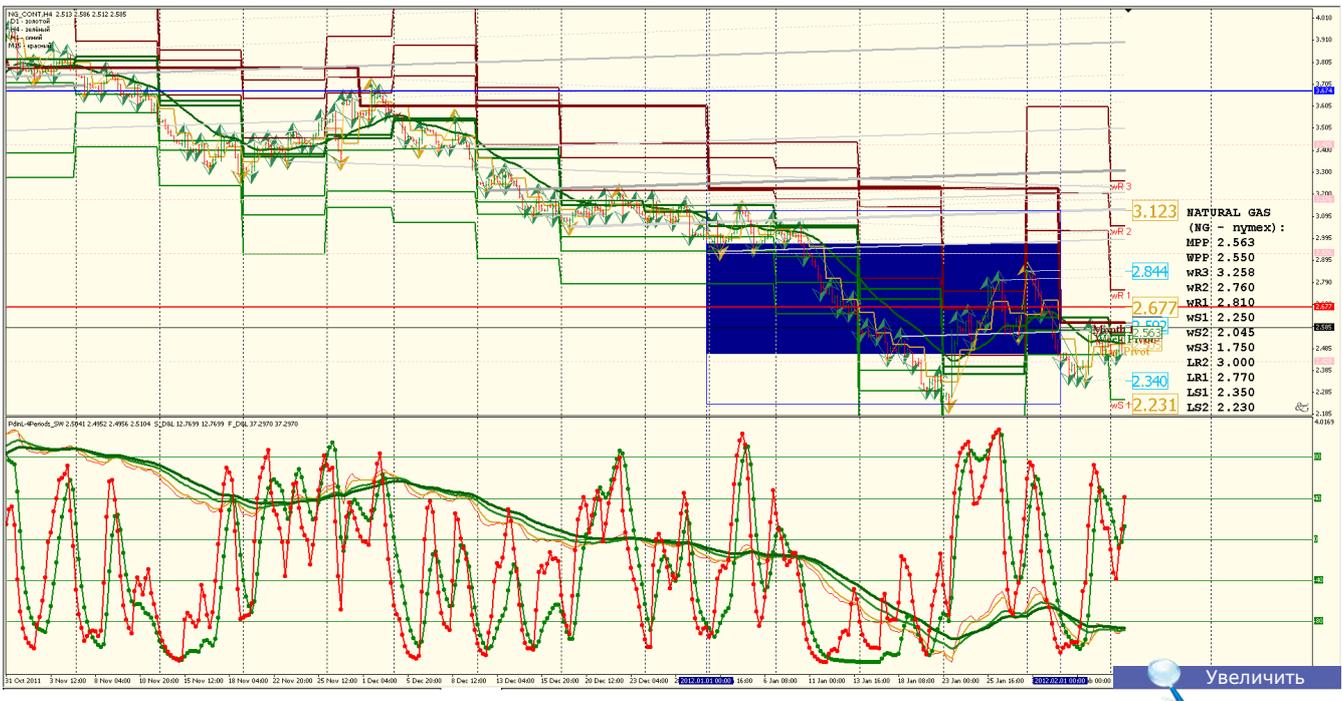
Анализ: Коррекция вероятна до 450.80
Уровни сопротивления: LR2 450.80 и LR1 441.50
Уровни поддержки: LS1 396.57 и LS2 386.00
Точки разворота: MPP 414.82 и WPP 417.97
Мнение: Продавать от LR2 450.80
Альтернативный сценарий: отсутствует, возможен флэт в канале 450.80 – 386.00.

CRUDE OIL (WTI – ICE)



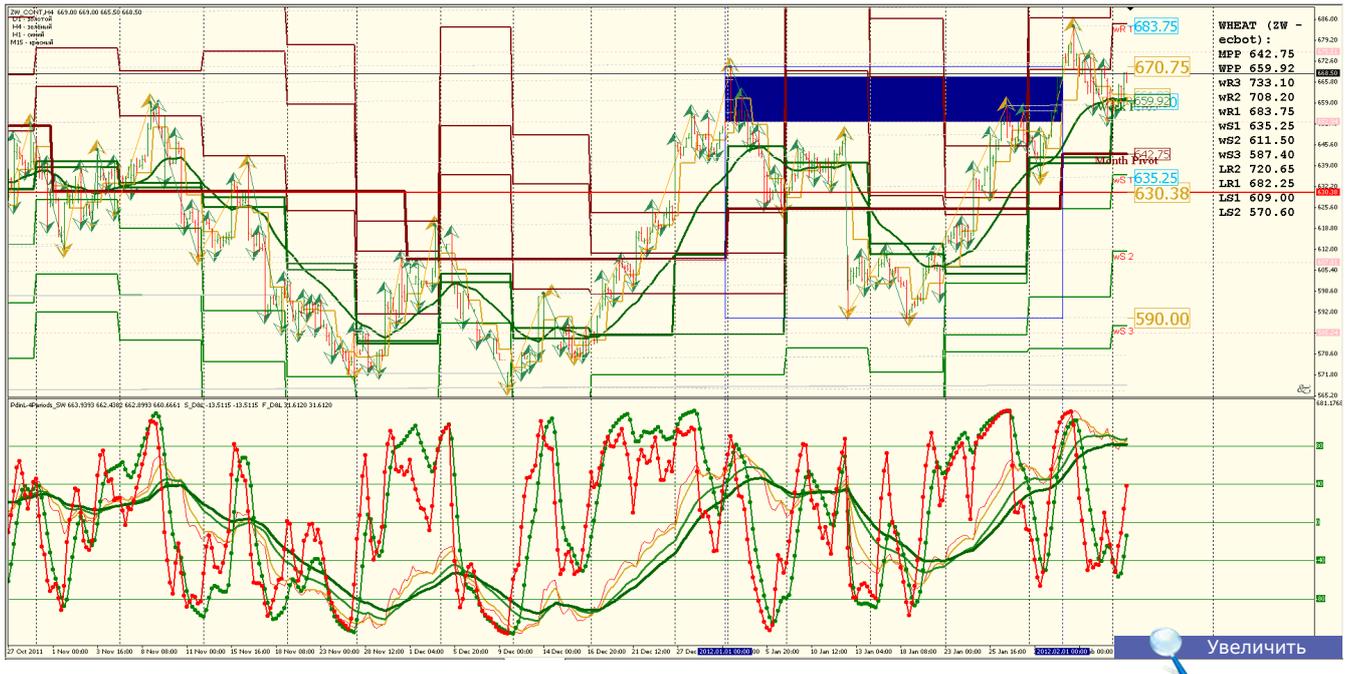
Анализ: Коррекция вероятна до 109.05
Уровни сопротивления: LR2 104.00 и LR1 102.50
Уровни поддержки: LS1 98.00 и LS2 95.20
Точки разворота: MPP 99.84 и WPP 98.18
Мнение: Торговать в диапазоне 109.05 - 95.20
Альтернативный сценарий: в связи с сезонным спросом возможен рост до 109.05.

NATURAL GAS (NG – NYMEX)



Анализ: Коррекция вероятна до 2.230
Уровни сопротивления: LR2 3.000 и LR1 2.770
Уровни поддержки: LS1 2.350 и LS2 2.230
Точки разворота: MPP 2.563 и WPP 2.550
Мнение: Торговать в диапазоне LR2 3.000 и LR1 2.770 до LS2 2.230
Альтернативный сценарий: отсутствует, сезонная тенденция.

WHEAT (ZW – ECBOT)



Анализ: Коррекция вероятна до 570.60
Уровни сопротивления: LR2 720.65 и LR1 682.25
Уровни поддержки: LS1 609.00 и LS2 570.60
Точки разворота: MPP 642.75 и WPP 659.92

Мнение: Торговать в диапазоне от LR2 720.65 и LR1 682.25 до LS2 570.60

Альтернативный сценарий: Увеличение экспорта зерновых из России и Украины, а также большие урожаи в других странах могут привести к снижению цен на мировых рынках.

CORN (ZC – ECBOT)

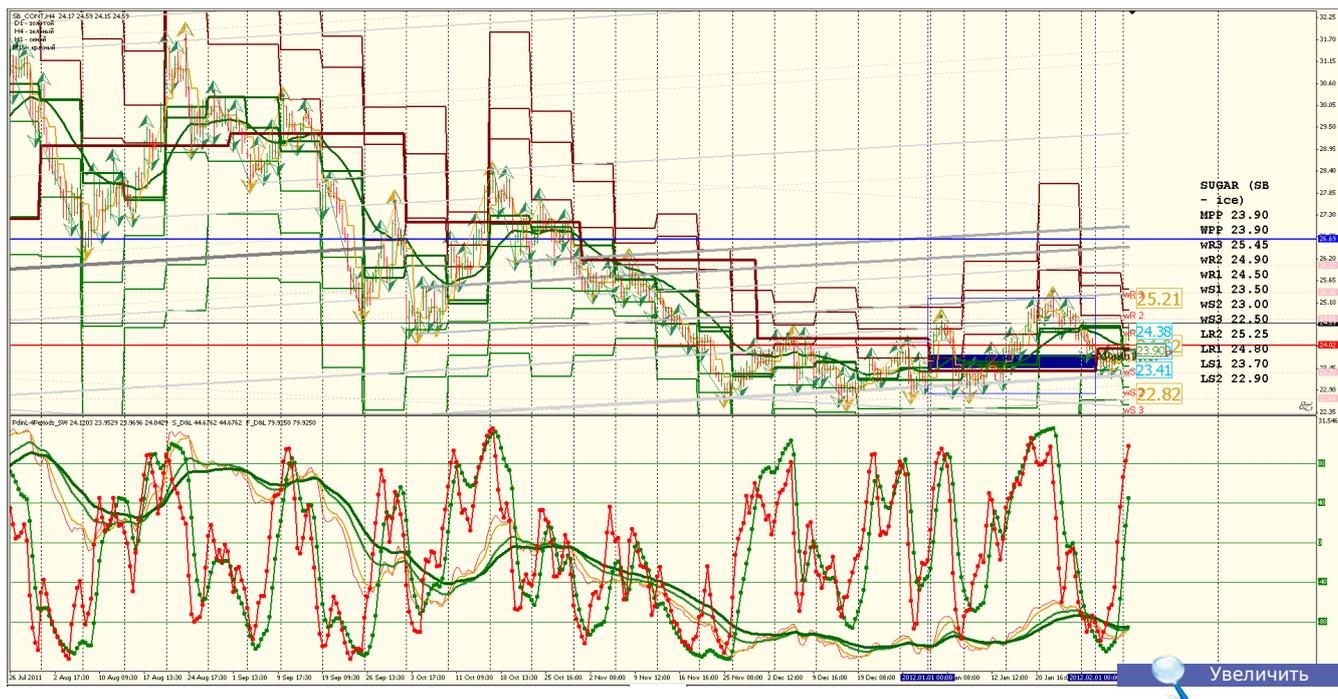


Анализ: Коррекция вероятна до 508.40
Уровни сопротивления: LR2 662.75 и LR1 648.10
Уровни поддержки: LS1 626.00 и LS2 620.20
Точки разворота: MPP 632.25 и WPP 640.17

Мнение: Торговать в диапазоне от LR2 662.75 и LR1 648.10 до LS2 620.20

Альтернативный сценарий: Увеличение экспорта зерновых из России и Украины, а также большие урожаи в других странах могут привести к снижению цен на мировых рынках.

SUGAR (SB – ICE)



Анализ: Коррекция вероятна до 22.90

Уровни сопротивления: LR2 25.25 и LR1 24.80

Уровни поддержки: LS1 23.70 и LS2 22.90

Точки разворота: MPP 23.90 и WPP 23.90

Мнение: Продавать от LR2 25.25 и LR1 24.80 до LS2 22.90

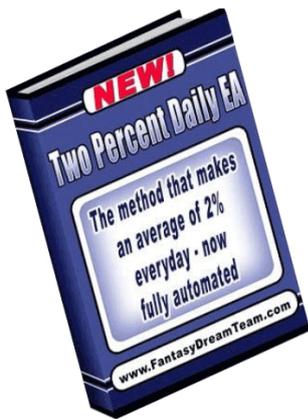
Альтернативный сценарий: Спрос на сахар будет оставаться на высоком уровне.

Удачи в торговле! ■



TWO PERCENT DAILY EA

«Two Percent Daily EA» реализует представленную в 2010 году механическую торговую систему. Включает в себя 3 торговые стратегии: 2 пробойные и 1 секретную (как называет ее автор). Торговля ведется на паре EUR/USD. Рабочий таймфрейм - H1.



Сайт разработчика: <http://www.fantasydreamteam.com/>

Платформа: MetaTrader 4

Стоимость лицензии: 99\$

Торгуемые пары: EUR/USD

Рабочий TF: H1

Минимальный депозит: любой

Размер дистрибутива: 2 МБ

Версия: 3.0

Тестирование в Лаборатории Лепрекона: с 17 ноября 2011 г. (<http://ealab.ru/ea.php?id=211>)

Сегодня мы рассмотрим советник «Two Percent Daily». С самого начала нас насторожило некоторое несоответствие - заголовок сайта, на котором можно приобрести советник, обещает нам 1% в день...



...а название советника предполагает, что таких процентов в день будет все-таки 2. 😊

Однако далее автор сам объясняет это тем, что 1% (и иногда больше) предполагается получать по механической системе, т.е. без советника. А вот уже при использовании советника прибыль должна возрасти до 2% в день.

Скажем честно, мы не против такого прироста, и 2% в день нас вполне устроит – будем надеяться, что это не пустая похвальба, и советник покажет положительные результаты.

Практически весь сайт состоит из отзывов благодарных клиентов (их мы рассмотрим чуть позже), а нас больше интересуют характеристики советника. Вот, что пишет об этом сам разработчик:

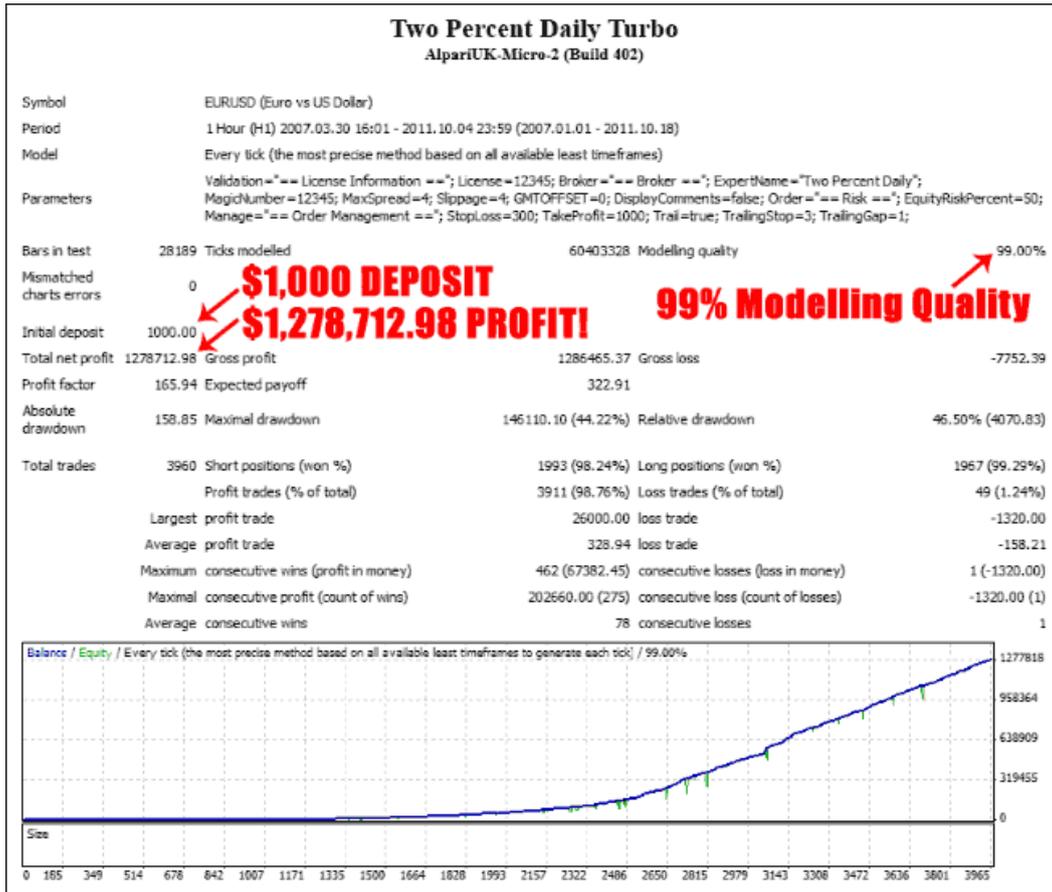
«Торговая система «One Percent Daily» работает на парах EUR/USD и GBP/USD на часовом ТФ. Торговля ведется на Лондонской и Нью-Йоркской торговых сессиях. Торговый метод не использует для анализа запаздывающих индикаторов и имеет великолепную систему MM».

Особенности Two Percent Daily EA:

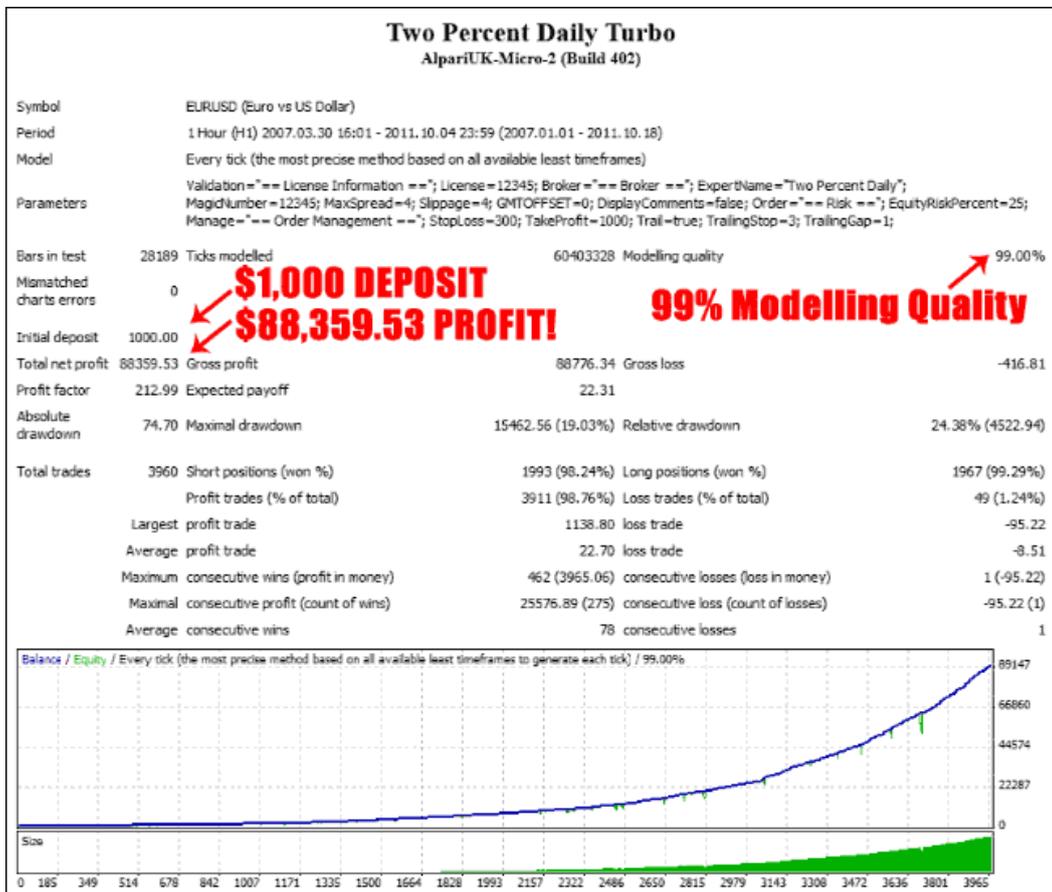
-  **Фильтр по максимальному спреду / проскальзыванию;**
-  **Настраиваемый уровень риска (% от эквити);**
-  **Режим восстановления (торговля увеличенным лотом после лосса);**
-  **Фильтр на SMA и MACD помогает торговать в сторону основного тренда;**
-  **Простота установки сдвига по GMT;**
-  **Отключаемый трейлинг-стоп;**
-  **Протестировано на котировках 99% точности;**
-  **Не Мартингейл – присутствует уровень стоп-лосса;**
-  **Открывает одновременно максимум одну позицию;**
-  **Настройки по умолчанию готовы к работе – нужно только выставить нужный сдвиг по GMT;**
-  **Бесплатная поддержка и обновления для клиентов;**
-  **В среднем 1% прироста депозита в день;**
-  **Нет ограничений по величине начального депозита;**
-  **Полностью автоматизированная система;**
-  **Установка за пару минут;**
-  **Работает с брокерами с FSA-регулированием;**
-  **30-дневный манибек, если что-то не устроит в работе советника.**

Далее автор приводит несколько однотипных тестов советника на истории.

Стартовый депозит 1000\$, риск 50%:

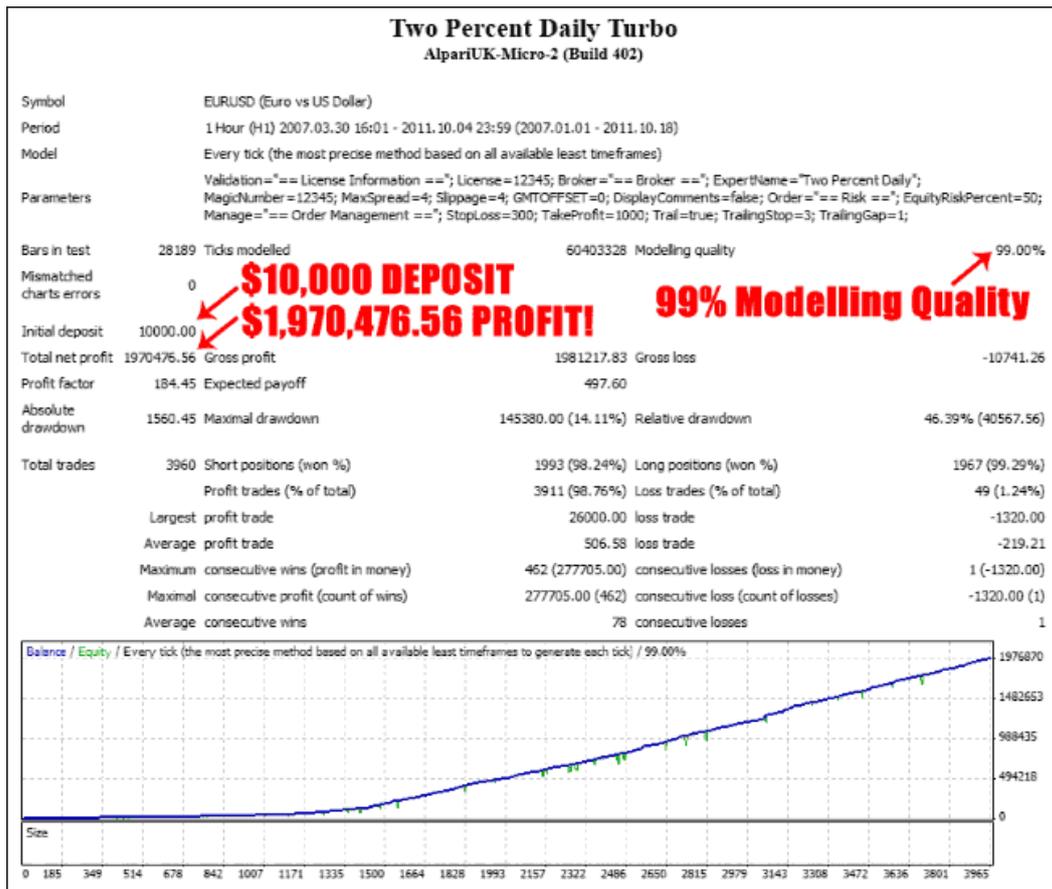


Стартовый депозит 1000\$, риск 25%:

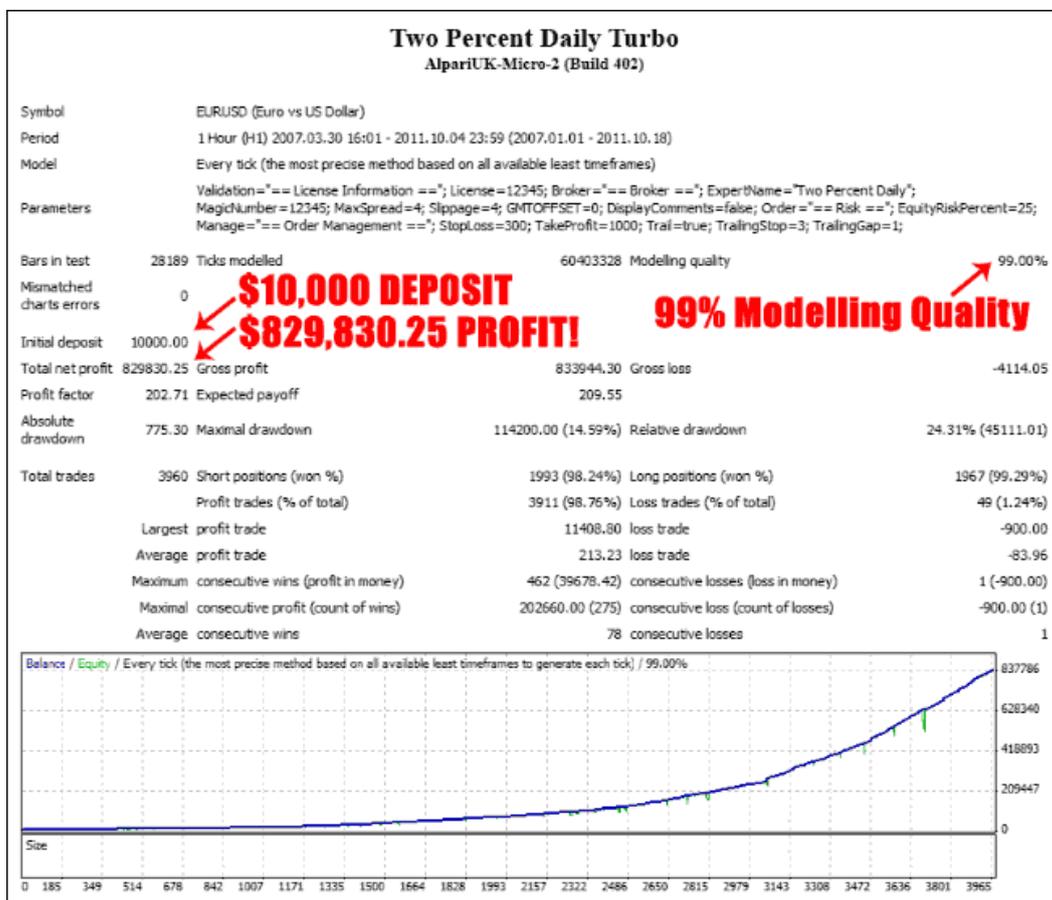


ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

Стартовый депозит 10000\$, риск 50%:

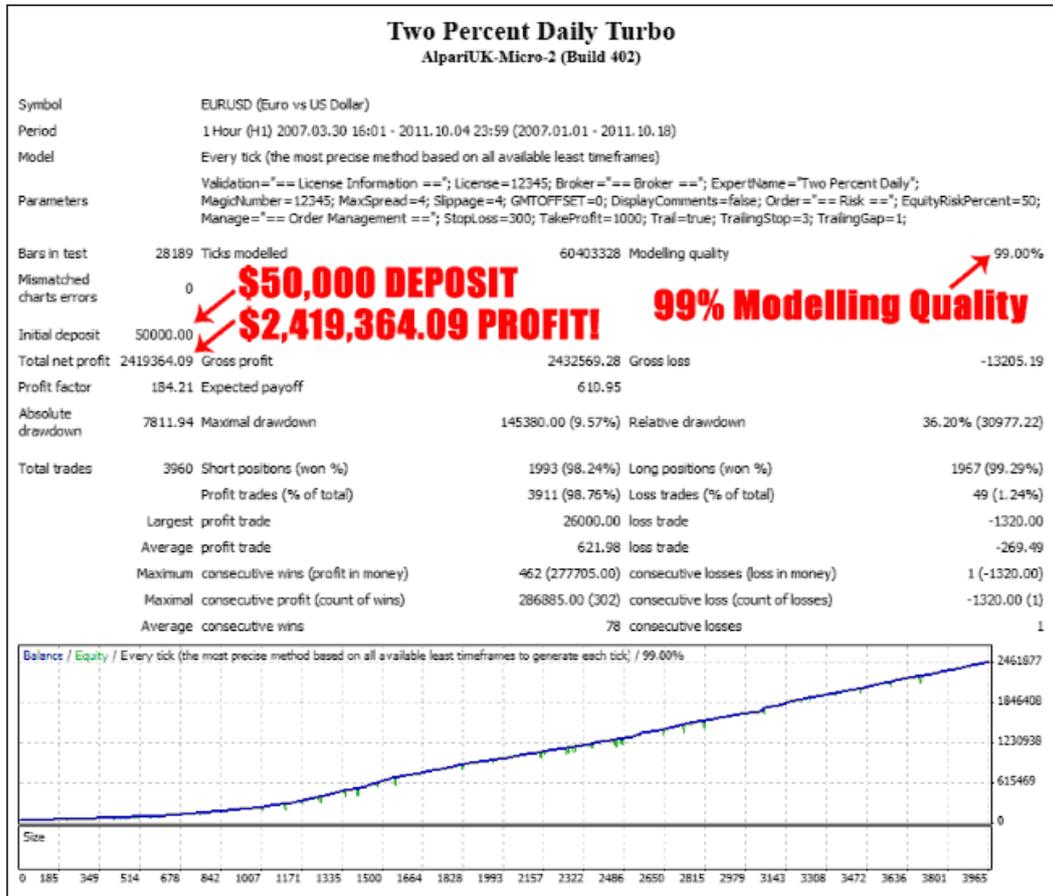


Стартовый депозит 10000\$, риск 25%:

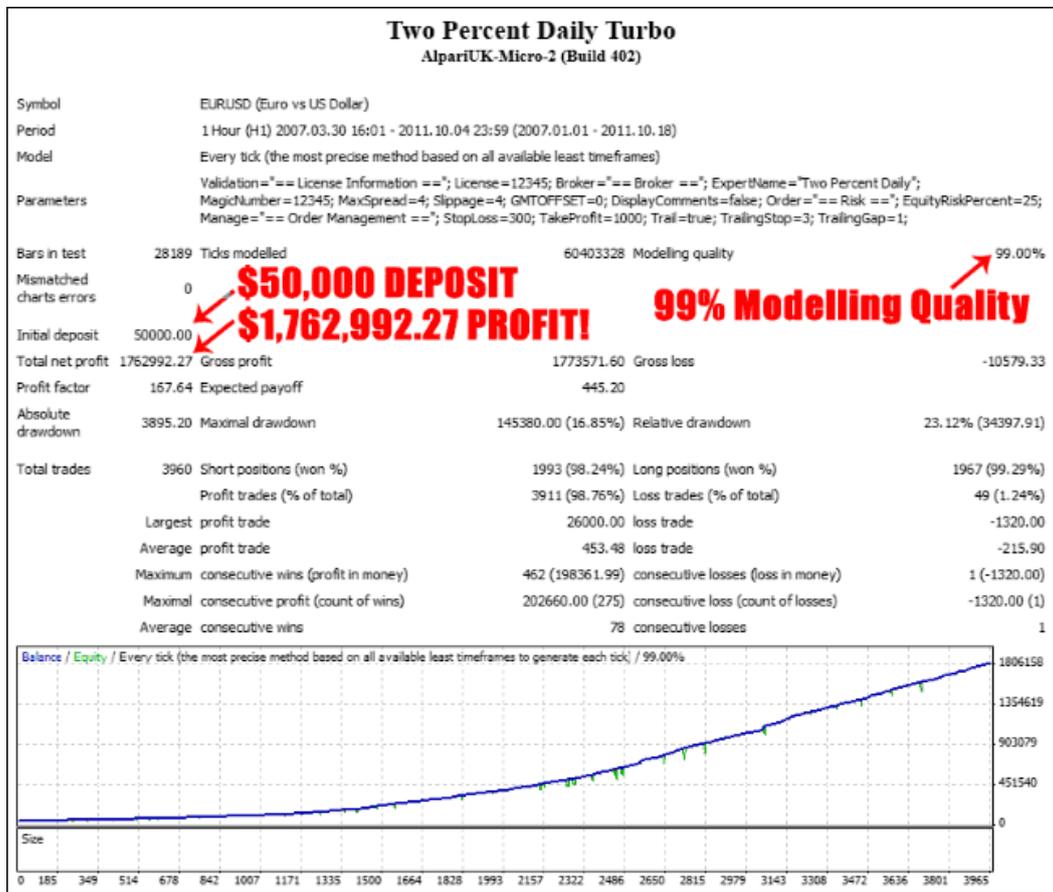


ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

Стартовый депозит 50000\$, риск 50%:



Стартовый депозит 50000\$, риск 25%:



ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

Куча тестов, толку от которых - минимум, так как рассмотрен всего один торговый промежуток. Было бы гораздо интересней и логичней сделать тест с постоянным лотом, чтобы видеть торговлю советника без прикрас, ну и, если уж очень хочется увидеть миллионы прибыли в тестере, то - максимум один тест с раскачанным MM.

Вот практически и вся информация на сайте - далее идут только отзывы благодарных клиентов, будто бы купивших советник:

READ All About It! "what our customers are saying ..."

I just made 1.94% net profit on a trade. I am calling it a day and going back to bed :)

Kathy.

Real-Customer-Testimonial

READ All About It! "what our customers are saying ..."

Dear Richard,

Been using your 1 percent strategy for the last couple of months & loving it!

Kacper Gladysz.

Real-Customer-Testimonial

READ All About It! "what our customers are saying ..."

Hey Rich!

Had 4 winners last night! Off to a great start!

Thanks!

Tim.

Real-Customer-Testimonial

READ All About It! "what our customers are saying ..."

Hello Rich, good morning.

Received your statement, looks very impressive indeed. It made indeed 1% per day, 10% for the week. If it is stable then by definition you will be a rich man, like says your name!

Yours,

Marcus.

Real-Customer-Testimonial

READ All About It! "what our customers are saying ..."

Hi Rich,

I finally got the ea to set at .01 lots, working great. I noticed a 10% profit on one trade today!

-James

Real-Customer-Testimonial

Это лишь малая часть отзывов, переводить которые, в общем-то, смысла нет – все хвалят Рича (автора системы) и на разные лады расхваливают его детище. Количество отзывов просто превышает все допустимые культурой создания сайтов пределы 😊

И ладно бы отзывы были уникальные, а то некоторые отзывы просто размещены несколько раз – видимо, в надежде, что никто и не заметит – главное количество. В очередной раз убеждаемся в бессмысленности чтения подобных отзывов на сайте разработчиков. Если уж решили узнать о советнике больше, то читайте независимые обзоры, подобные тем, что публикуются в нашем журнале. Мы зря хвалить не будем, как, впрочем, и ругать – исключительно за дело!

Ну а рассмотрение сайта тем временем подошло к концу, так как больше ничего интересно для нас там не подготовили. Переходим к покупке и видим, что советник можно купить за 99\$ - со скидкой в целых 500\$ 😊

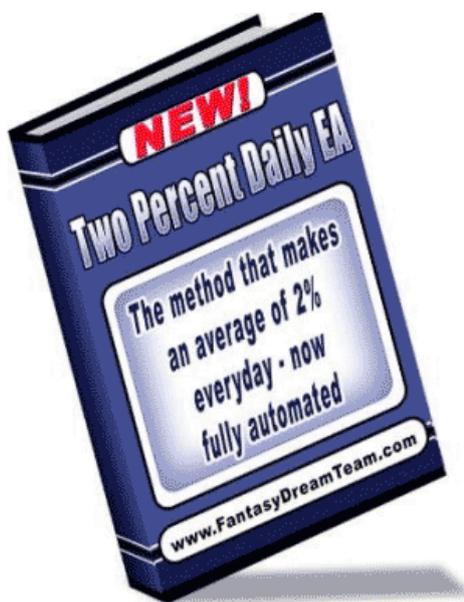
Buy now for just \$599, buy today for the limited offer price of just \$99! You get the manual & automated system with instructions for a saving of \$500!

Покупка производится через ClickBank, что не может не радовать: если покупка нас не устроит, то мы сможем ее вернуть (как это можно сделать - см. подробнее в №8 «Leprecon Review» <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jyrnala/8>, статья «ClickBank Refund: Подробные инструкции по возврату денег через систему ClickBank в случае если Вам не понравился купленный товар», стр. 41).

CLICKBANK MARKETPLACE	
Secure Payment Form	
Your Order	
ITEM	PRICE (USD)
 One Percent Daily Forex Trading System Package - Manual & Automated	\$99.00
<i>Immediate access to this product or service is available once payment is approved.</i>	
TAX:	\$0.00
PAYMENT:	\$99.00
	<small>One payment (US Dollar)</small>
Choose currency:	(USD) US Dollar

В архиве находим руководство пользователя: **Instructions.pdf**, сам советник **Two Percent Daily Turbo** и индикатор **dyn_s_r**, показывающий динамично изменяющиеся уровни поддержки / сопротивления.

Для начала обратим свое внимание на инструкцию к советнику:

TWO PERCENT DAILY TURBO
EA INSTALLATION GUIDE

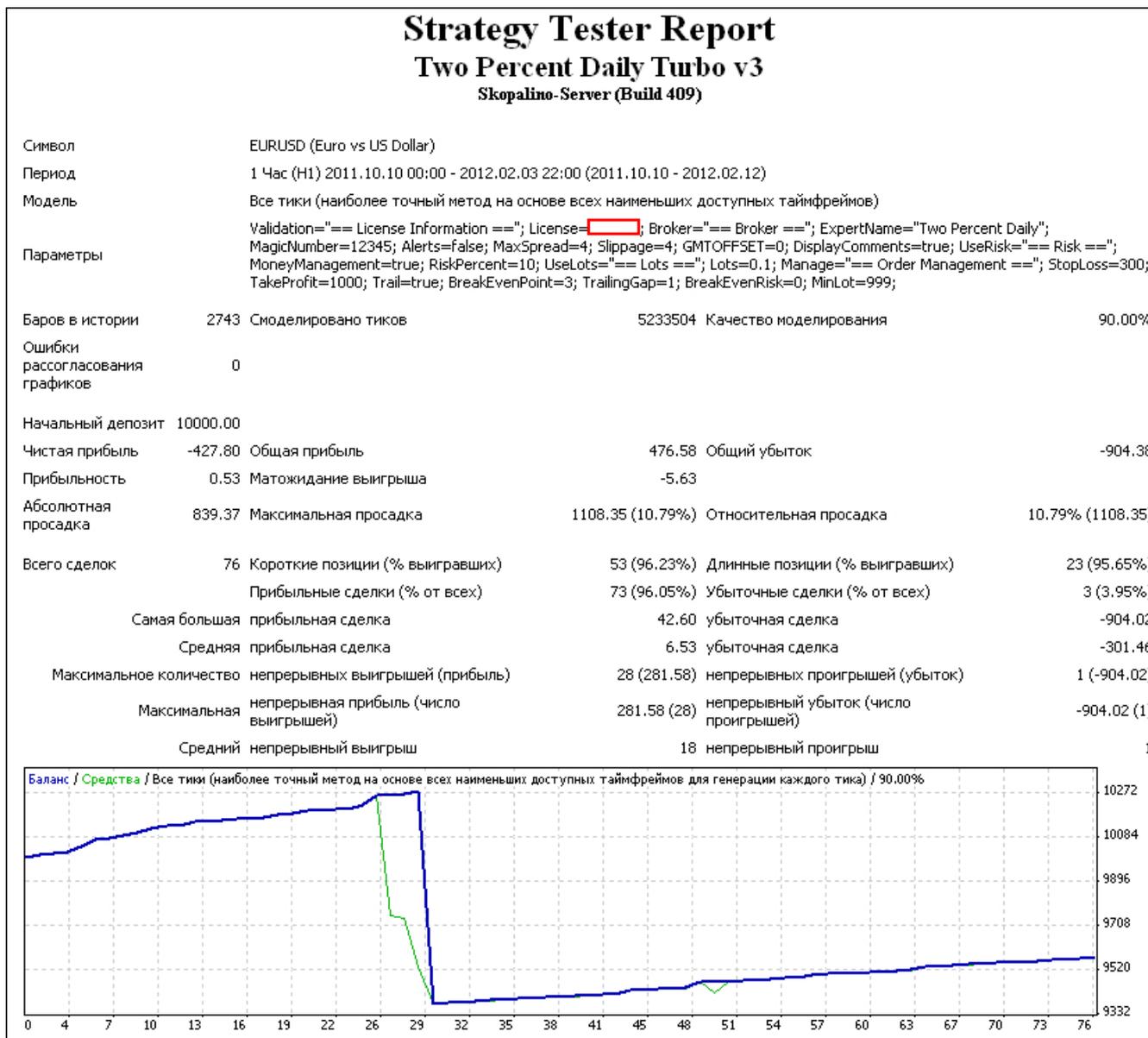
Инструкция представляет собой файл в формате PDF. Инструкция подробная, понятная – включает в себя все этапы использования советника: от выбора брокера, установки терминала и советника до настроек и советов по его применению.

Установку терминала и советника мы рассматривать не будем – это стандартные процедуры, перейдем сразу к настройкам советника:

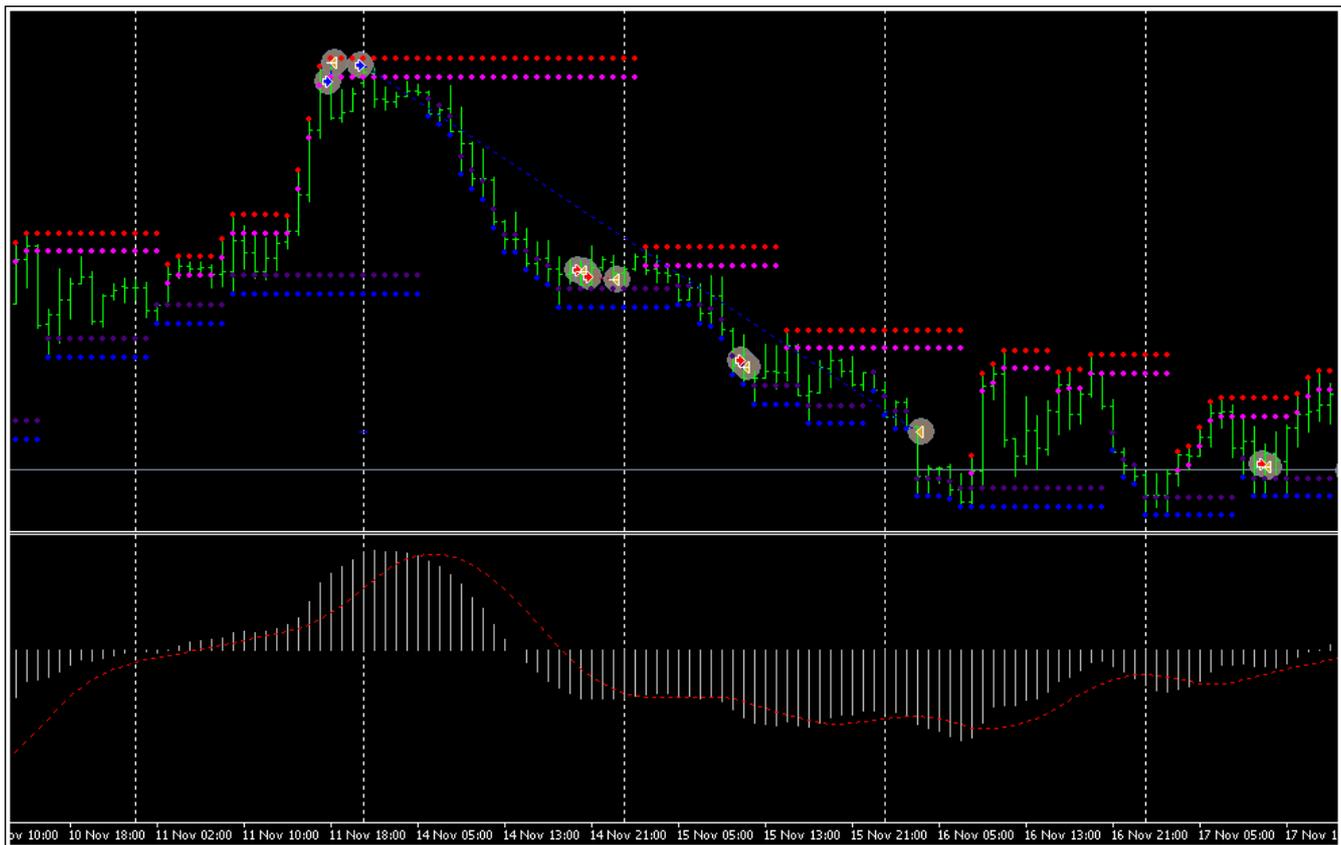
Переменная	Описание переменной
License	Номер лицензии, выданный при покупке советника.
Expert Name	Название, которое будет выводиться в комментарии к ордеру.
Magic Number	Уникальное число, позволяющее советнику отличать свои сделки от «чужих», в том числе и ручных.
Alerts	Звуковой сигнал при открытии ордера.
Max Spread	Ограничение торговли при превышении максимально допустимого уровня спреда.
Slippage	Задаёт уровень проскальзывания при торговле.
GMTOFFSET	Установка нужного сдвига GMT.
Chart Comments	Позволяет выводить торговые комментарии на график.
Money Management	Активирует торговлю % от эквити.
Equity Risk Percent	Риск в % от эквити при активированном Money Management.
Lots	Величина лота при выключенном Money Management.
Stop Loss	Задаёт величину стоп-лосса.
Take Profit	Задаёт величину тейк-профита.
Trail	Активация режима трейлинга открытой позиции.

Break Even Point	Задаёт уровень безубытка в пипсах для частичного закрытия позиции.
Trailing Gap	Разница между уровнем стопа и ценой при выставлении безубытка. Можно не менять – выставляется минимально возможный.
Break Even Risk	Задаёт нужное количество лотов, которое будет закрыто при выставлении уровня безубытка.
Min Lot	Минимальная величина лота, до которой будет производиться частичное закрытие ордера.

Перейдем теперь к тестированию советника на истории и рассмотрим отрезок времени, следующий за тем, на котором остановилось тестирование автора (4 октября 2011 года):



Вот такие неутешительные результаты... Посмотрите, как выглядит эта убыточная сделка по отношению к прибыльным в визуальном режиме:



Несмотря на то, что уровень профита в настройках установлен в 1000 пипсов, реально берется прибыль только в 10-25 пипсов и лишь изредка - до 50-60 пипсов (все параметры для 5-значного счета), а стоп, кроме небольших 80-100 пипсов, бывает, берется и полностью – 300 пипсов. В итоге 1 убыточная сделка может перекрыть профит 10-30 прибыльных. Ну а если будет последовательно совершено несколько убыточных сделок, то советник практически все время будет занят выходом из очередной просадки.

Время	Тип	Ордер	Объем	Цена	S / L	T / P	Прибыль	Баланс
2011.11.16 03:02	s/l	26	0.30	1.34904	1.34904	1.47904	-904.02	9377.56
2011.11.17 11:33	sell	30	0.30	1.34642				
2011.11.17 11:33	modify	30	0.30	1.34642	1.37642	1.24642		
2011.11.17 11:33	modify	30	0.30	1.34642	1.34619	1.24642		
2011.11.17 11:33	s/l	30	0.30	1.34619	1.34619	1.24642	3.90	9381.46
2011.11.17 19:02	sell	31	0.30	1.34591				
2011.11.17 19:02	modify	31	0.30	1.34591	1.37591	1.24591		
2011.11.17 19:03	modify	31	0.30	1.34591	1.34570	1.24591		
2011.11.17 19:04	s/l	31	0.30	1.34570	1.34570	1.24591	3.30	9384.76
2011.11.17 20:39	sell	32	0.30	1.34608				
2011.11.17 20:39	modify	32	0.30	1.34608	1.37608	1.24608		

Осталось перейти в нашу Лабораторию, чтобы посмотреть, как показал себя советник на реальном счете:

<http://ealab.ru/ea.php?id=211>

Статус	Название	Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста
	Two Percent Daily Turbo	-433	8,595.00	7,948.59	100 дней

На реале дела советника обстоят еще хуже. Видим: целых два крупных стопа идут практически друг за другом, и в итоге после 100 дней мониторинга начальный депозит уменьшен на 14%. Кроме этого, присутствует также и плавающая просадка, которая вполне может превратиться в очередной лосс:



1321777	2012.02.15 19:39	sell	0.29	eurusdf	1.3068	1.30739	1.20679	2012.02.15 19:02	1.30739	0	0	-6	-17.11	
1322393	2012.02.15 20:06	sell	0.29	eurusdf	1.30585	1.30605	1.20576	2012.02.15 20:02	1.30605	0	0	-2	-5.8	
1334994	2012.02.16 10:33	sell	0.29	eurusdf	1.30003	1.29998	1.20015	2012.02.16 11:02	1.29998	0	0	1	1.45	
1352701	2012.02.16 23:48	buy	0.29	eurusdf	1.31348	1.31351	1.41348	2012.02.17 02:02	1.31351	0	0	0	0.87	
1374417	2012.02.20 00:44	buy	0.28	eurusdf	1.32274	1.32186	1.42287	2012.02.20 11:02	1.32186	0	0	-9	-24.64	
1410184	2012.02.21 17:05	buy	0.28	eurusdf	1.32673	1.32648	1.42674	2012.02.21 17:02	1.32648	0	0	-3	-7	
1434818	2012.02.22 23:48	buy	0.28	eurusdf	1.32476	1.32421	1.42476	2012.02.23 01:02	1.32421	0	0	-6	-15.4	
1450653	2012.02.23 17:05	buy	0.27	eurusdf	1.33046	1.33058	1.43052	2012.02.23 17:02	1.33058	0	0	1	3.24	
Total											0	0	-433	-1405

Open Trades:

Ticket	Open Time	Type	Size	Item	Price	S / L	T / P	Price	Commission	Taxes	Swap	Profit		
1370797	2012.02.17 20:06	sell	0.29	eurusdf	1.31479	1.34479	1.21479	1.33708	0.00	0.00	0.00	-646.41		
											0.00	0.00	0.00	-646.41
											Floating P/L:			-646.41

Working Orders:

Ticket	Open Time	Type	Size	Item	Price	S / L	T / P	Market Price
No transactions								

Summary:

Deposit/Withdrawal:	10 000.00	Credit Facility:	0.00
Closed Trade P/L:	-1 405.00	Floating P/L:	-646.41
Balance:	8 595.00	Equity:	7 948.59
		Free Margin:	7 872.33
		Margin:	76.26

Плюсы советника:

- Недорогая стоимость лицензии (менее 100\$);
- Нет ограничений по минимальному депозиту;
- Техподдержка и бесплатные обновления.

Минусы:

- Отсутствие реального мониторинга советника на сайте разработчика;
- **Внимание!** Существует большая вероятность подгона советника под историю.

Вывод: Соотношение величин прибыльной сделки к убыточной достаточно велико – убыток от одной сделки может перекрывать профит от 10 до 30 прибыльных сделок, в зависимости от того, какой величины были тейки. При этом кривая роста прибыли, показанная разработчиком на сайте, выглядит ровной – на ней отсутствуют крупные лоссы, тогда как в реальности они случаются. А также, учитывая тот факт, что тесты на сайте обрываются октябрём 2011 года и не обновляются, возникает подозрение, что, возможно, советник подогнан под историю и, в итоге, может не пройти более продолжительное реальное форвард-тестирование. Впрочем, окончательный вывод мы пока делать не будем – лоссы советника пришлись на достаточно трудное время на рынке, и, возможно, что это все-таки временные трудности, и советник еще покажет нам обещанные разработчиком заветные 2% в день. Однако до этого результата, с учетом уже полученных лоссов, ему будет добраться непросто. В итоге заявленной разработчиком прибыли мы не видим и рекомендуем быть осторожными с данным советником - не ставьте его на большие реальные счета! А мы обязательно продолжим следить за торговлей советника в нашей Лаборатории и будем держать вас в курсе!

Удачи в торговле!

Всегда с Вами, Лаборатория Лепрекона! ■



Sayfuji

Трейдер со стажем более 7 лет. Занимается торговлей на рынках товарных фьючерсов и опционов, в прошлом – аналитик, сотрудник нескольких инвестиционных компаний.

Почта для писем: snakehammer@mail.ru

ПРОГРАММЫ ДЛЯ УЧЁТА И АНАЛИЗА СДЕЛОК

Трейдинг как один из наиболее интеллектуальных и прибыльных видов деятельности требует, пожалуй, самого обстоятельного подхода к решению повседневных рабочих задач. Среди них – целый ряд обязательных элементов: как выбор аналитического инструментария, так и тщательное создание качественной рабочей среды.

Одним из наиболее важных элементов трейдинга является контроль финансового результата, управление рисками, анализ и подведение итогов по результатам отчётного периода. Именно взгляд в прошлое, его изучение и исключение ошибок даёт ощущение уверенности в будущем.

Как вы уже догадались, в нашей статье речь пойдет об аналитических программных решениях, которые позволяют вести учёт и анализ сделок, стейтментов. Такой инструментарий в идеале должен обладать достаточным функционалом, чтобы в повседневной работе обеспечить возможность наглядно (в виде различных графических решений – диаграмм, таблиц, графиков) отобразить результаты торговли; должен иметь простой и удобный интерфейс, интеграцию с популярными торговыми продуктами; давать возможность анализировать слабые места торговой системы.

Практика трейдинга показывает, что работа трейдера состоит из двух аспектов – собственно системная работа (вход и выход из сделки на основе торговой системы) и управление капиталом. Какое-то время мне довелось поработать в некоторой довольно крупной инвестиционной компании. В связи с этим, хочу вас, уважаемые читатели, заверить в том, что всякая уважаемая инвестиционная компания или хедж-фонд сама разрабатывает софт для учёта и анализа сделок. Ведь именно так можно отследить и впоследствии отобразить ордера и позиции в том или ином виде. Это же открывает возможность демонстрировать инвесторам и топ-менеджерам то, как обстоят дела в компании.

Разработчики торговых платформ на этом аспекте не делают акцента – это общепринятая мировая практика, когда History of Orders или Statements в торговой платформе даются таблично и довольно просто, чтобы предоставить информацию о позициях «здесь и сейчас». Осуществление последующего детального анализа возлагается на самого трейдера, предполагая, что в распоряжении у всякого серьёзного трейдера есть такое программное обеспечение, обеспечивающее его нужды.

В связи с этим, перенимая практику работы западных профессиональных и крупных retail-трейдеров, предлагаю остановиться на наиболее примечательных программах, которые позволят трейдеру решить вышеуказанные задачи. Сравнение будет носить описательный характер, так как такие решения, хоть и имеются на рынке, но заслуживающих серьёзного внимания значительно меньше. Постараемся хотя бы условно пройти от простого – к сложному. В обзор не включались программы, имеющие примитивные функциональные возможности, либо заброшенные годами проекты.

Основная задача обзора состоит в том, чтобы предоставить вам максимально ёмко и сжато информацию о всех программных решениях в рамках заданной темы. А в конце статьи вас ждет сравнительная таблица оценок по наиболее важным критериям. По её итогам мы вместе выберем наиболее сбалансированный программный продукт.

«ПЕРСОНАЛЬНЫЙ БЛОКНОТ ТРЕЙДЕРА»

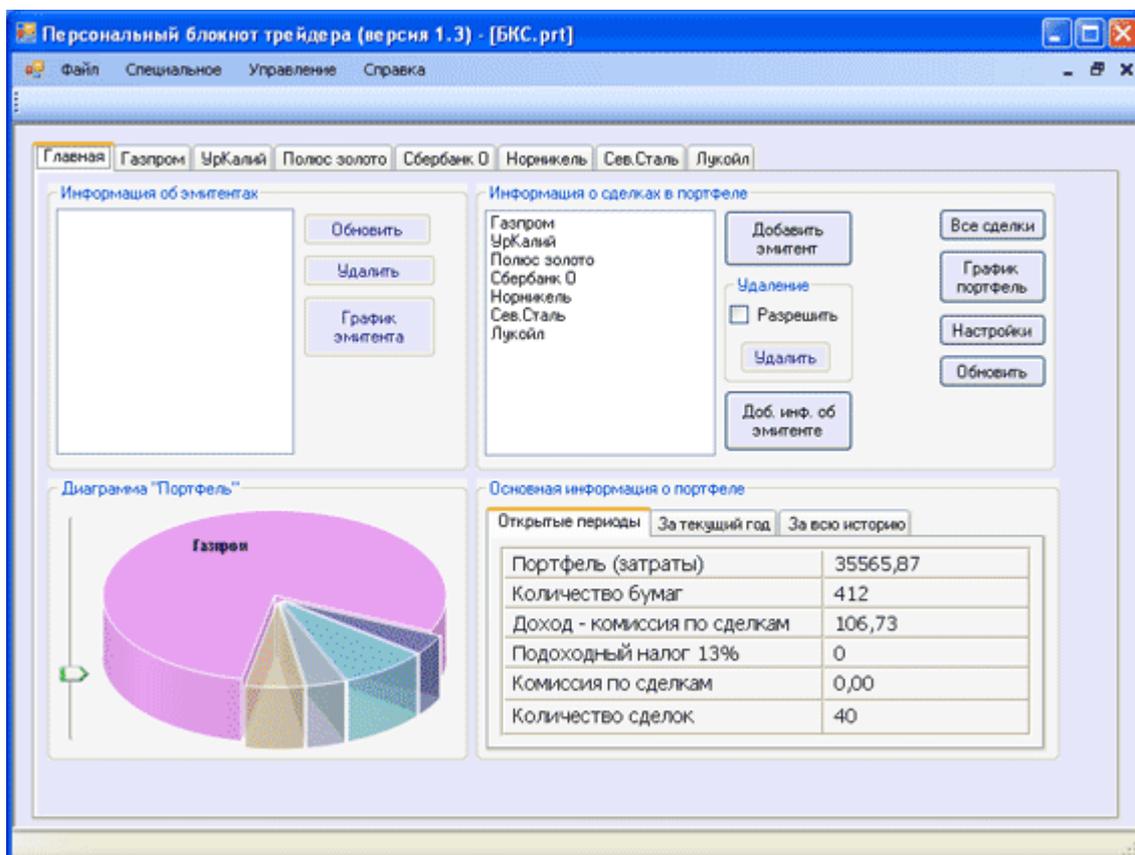


Разработчик: <http://htsoft.ru>
Цена: 32\$

Программа направлена на трейдеров, как занимающихся внутрисуточными спекуляциями, так и использующих среднесрочные стратегии.

Среди функционала можно выделить следующие интересные моменты:

- регистрация совершенных сделок на рынке акций;
- хранение статистики по совершенным сделкам на локальном компьютере в собственной базе данных;
- графическая интерпретация основных параметров статистики совершенных сделок по каждому отдельному эмитенту;
- создание профиля пользователя по каждому отдельному проекту;
- импорт данных из внешних файлов (импорт сделок осуществляется из файла Excel, текстового файла и из буфера обмена; импорт дополнительной информации – из текстового файла, загружаемого с официального удаленного ресурса);
- дополнительные инструменты расчета иных параметров (калькулятор расчетов).



Сделки

с 1 ноября 2008 г. по 26 декабря 2008 г. показать Все

Минимум Максимум Обновить

	Назв. эмит.	Дата сделки	Тип сделки	Стоим. акции	Акция в сделке	Комментарий
28	Сбербанк O	11.12.2008	Покупка	21,75	1	
29	Сбербанк O	11.12.2008	Продажа	21,88	1	
30	Сбербанк O	11.12.2008	Продажа	21,93	1	
31	Сбербанк O	11.12.2008	Покупка	21,97	1	
32	Сбербанк O	11.12.2008	Продажа	21,85	1	
33	Сбербанк O	12.12.2008	Покупка	21,33	1	
34	Сбербанк O	12.12.2008	Покупка	21,10	100	
35	Сбербанк O	12.12.2008	Продажа	22,04	100	
36	Сбербанк O	26.12.2008	Покупка	22,42	50	
37	Сев.Сталь	12.12.2008	Покупка	90,22	10	
38	Сев.Сталь	18.12.2008	Покупка	85,00	5	
39	Лукойл	23.12.2008	Покупка	985,00	2	
*						

Операции над сделками по эмитенту

Газпром График Доб. сделку Удалить Импорт Закреть

Как видим, софт имеет очень простой функционал. Из минусов можно назвать несовершенную систему импорта данных извне; актуальность – только для акций, другие рынки не поддерживаются; слабые графические и функциональные возможности, нет аналитики; проект не активный, нововведения не вводились уже несколько лет.

К преимуществам можно отнести низкую цену – около 32\$

«ДНЕВНИК ТРЕЙДЕРА»



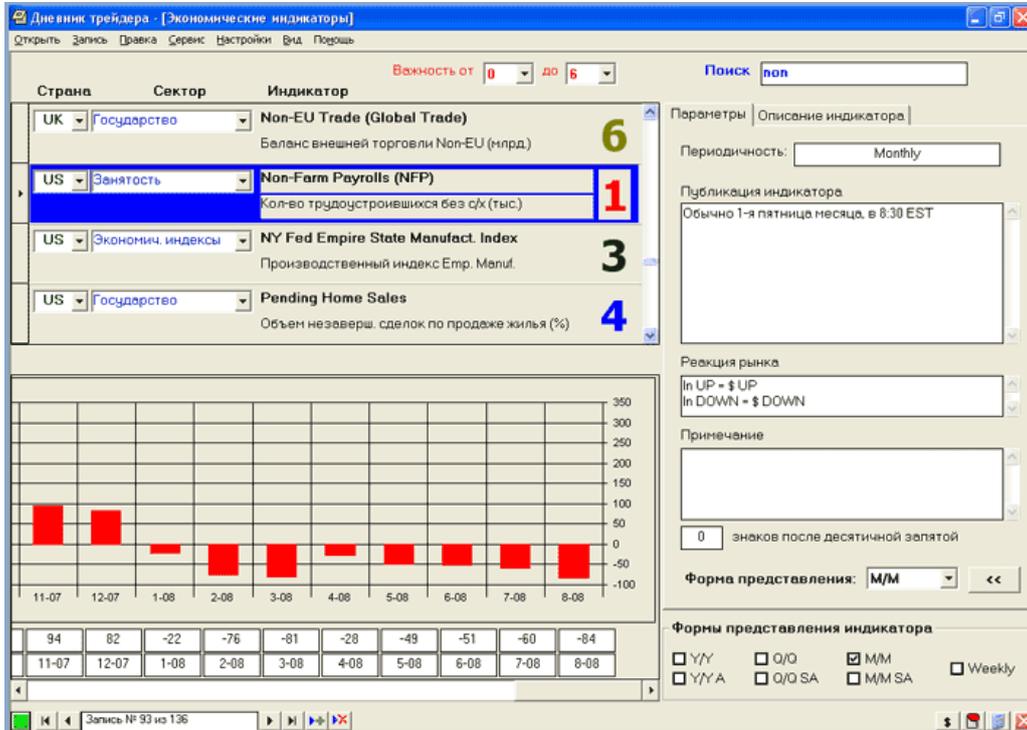
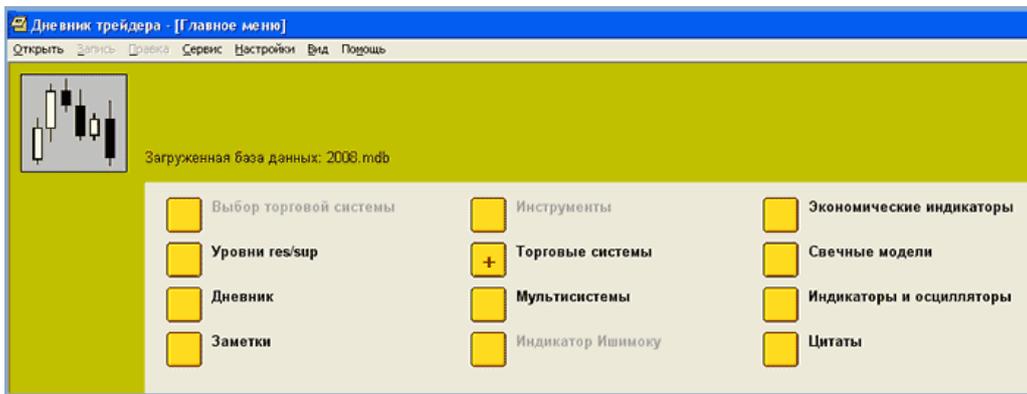
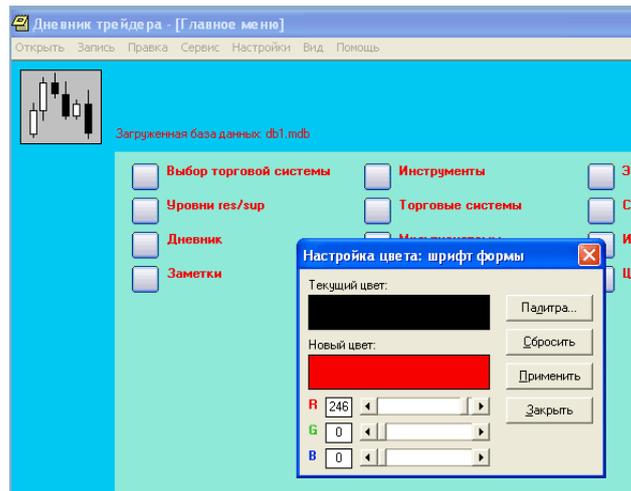
Разработчик: <http://harami.ru>

Цена: 16\$

Программа позволяет:

- Регистрировать все параметры совершенных сделок, в том числе автоматически сохранять скриншоты (или их фрагменты) из любой программы технического анализа;
- Осуществлять поиск, сортировку и фильтрацию сделок по заданным параметрам;
- Строить диаграммы торговли;
- Отображать в виде графика и анализировать гипотетические результаты торговли по торговой системе или портфелю систем;
- Вести статистику успешности свечных моделей;

Выглядит так:



Говоря коротко и объективно, проект - с потенциалом, для торговцев по свечным паттернам он может быть интересен как справочник. Но в целом, слабая реализация заявленных возможностей и периодические проблемы в работе привели к тому, что приверженцев данного программного обеспечения не так много. Также программа сложна в освоении. Сами авторы на своем ресурсе говорят, что «привыкание» к программе занимает 4 недели! К плюсам можно отнести совсем символическую цену в 16\$.

Из очевидных плюсов сайта – простота, небольшой, но понятный функционал, цена за Light-версию 60\$ в год (Standard, который включает более-менее полноценную работу с Excel – 80\$ в год). Также веб-ресурс имеет приятный дизайн графиков и диаграмм, большое количество критериев сортировки таблиц результатов.

Однако вместе с этим открывается негативная сторона – проект реализован в виде веб-сайта, что является не совсем удобным и надёжным решением. Для трейдеров, которые по роду своей деятельности очень бережливы и осторожны, очень важно иметь возможность работать с результатами своей торговли локально, никуда не выгружая свои личные данные. С таким решением сложно быть откровенным в своем учете, потому что знаешь, что кто-то кроме тебя может получить доступ к твоей личной информации. К тому же, веб-решения имеют некоторые особенности, что накладывает ограничение на будущую перспективу проекта. Импорт данных из MT4 не полон и показывает не намного большую функциональность, чем отчёт в самом MT4.

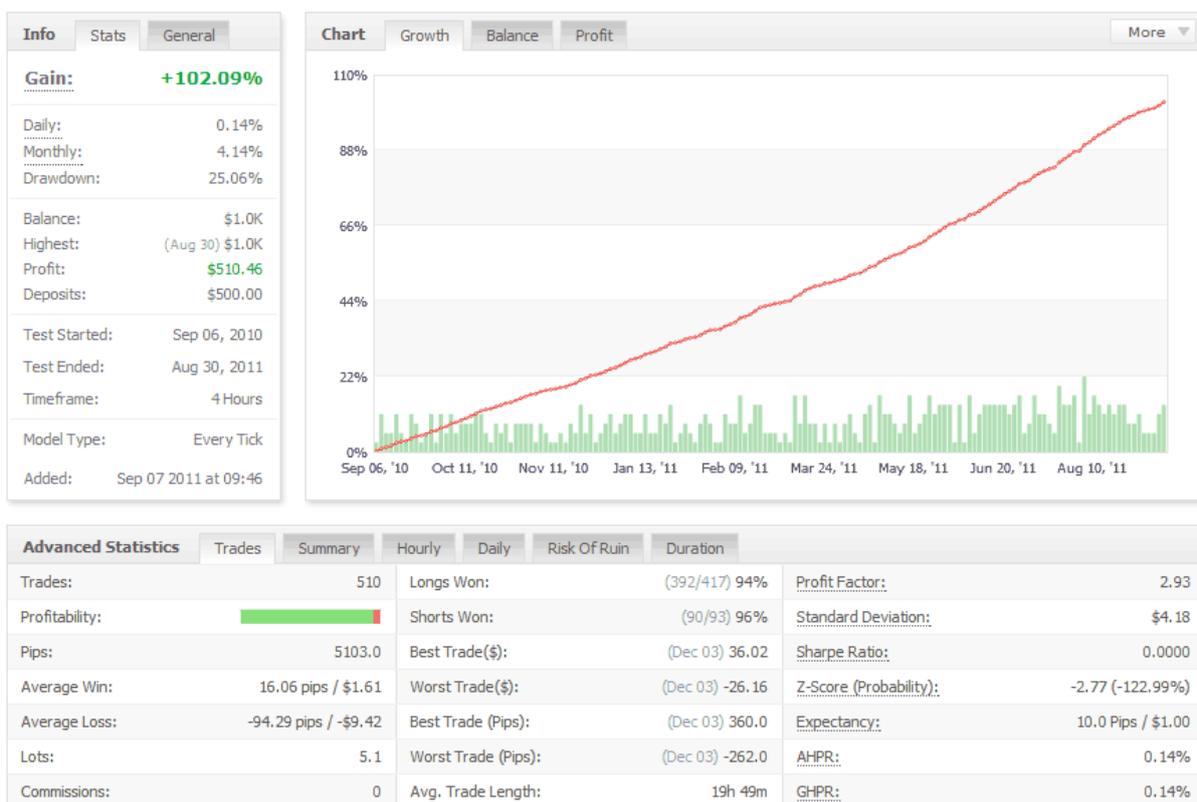
В целом, веб-решение неплохое, простое в использовании, в меру удобное – удовлетворит начальные требования новичков.

«MYFXBOOK»

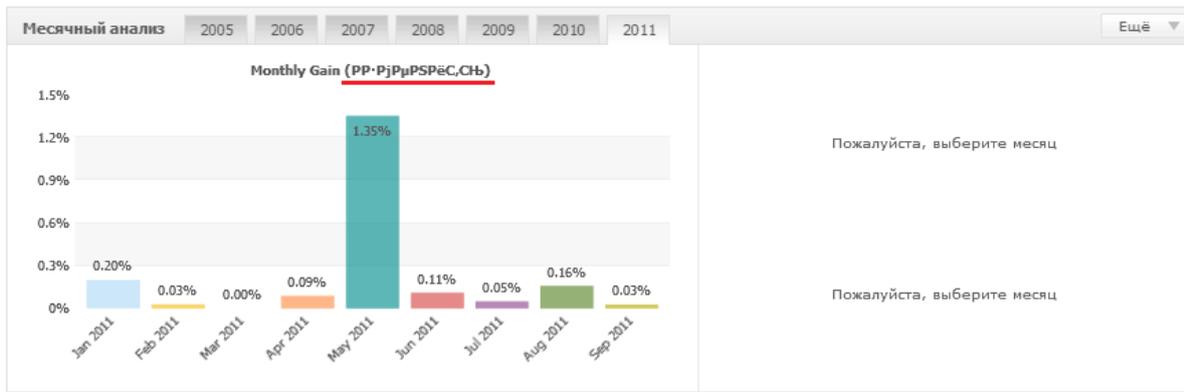


Разработчик: <http://myfxbook.com>
Цена: -

Прежде всего, Myfxbook – это сервис мониторинга сделок, поэтому аналитическая составляющая реализована больше в виде сборной статистики. Всё очень просто, графически, безусловно, довольно красиво. Но ожидать возможностей полноценной аналитической программы для работы с историей сделок и анализа транзакций не стоит. Здесь всё - в угоду простоте.

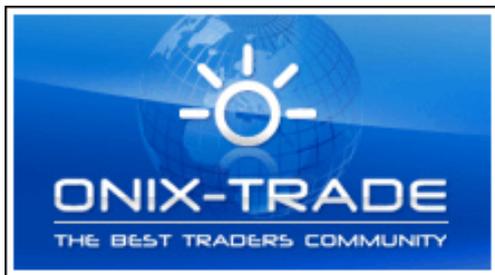


Недавно появилась русификация сервиса. Но пока она не на высшем уровне – бывают лаги кодировок:



В общем, как сервис мониторинга, данный веб-ресурс, пожалуй, лучший.

«ОНИКС»



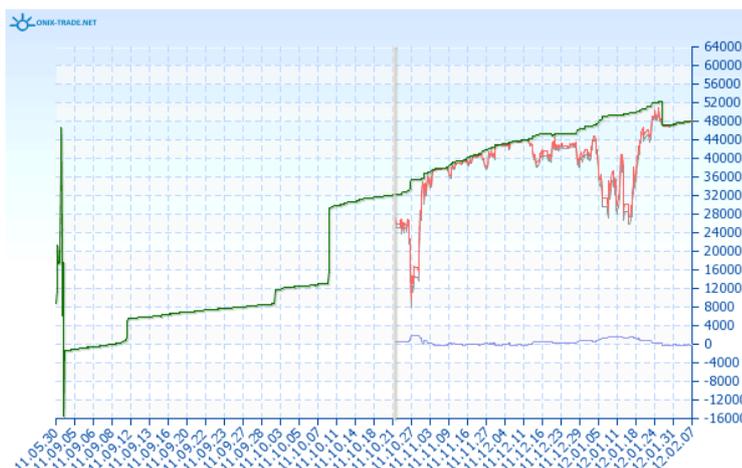
Разработчик: <http://onix-trade.net/>

Цена: -

На рынке СНГ услуги, подобные сервису Mufxbook, предоставляет старейший ресурс Оникс: <http://onix-trade.net/?act=monitoring>

В графическом плане данный веб-ресурс смотрится несколько архаично (сайт переживает переходной этап с переездом на новый графический движок), но в надёжности сервиса можно не сомневаться:

Trader	vaitrait	Recharge Withdrawal, USD	137395.12 -87914.87
Server		Current balance Equity, USD	48 524.98 48 070.74
Account type Currency	Real USD	Change balance Equity, %	1 037.11% 1 026.47%
Login		Profit: USD in pips	26 057.79 7985
Password	*****	Annual forecast, %	1 490.34%
Account opened	30/05/2011. days: 254	Profit factor	1.42
Monitoring started	21/10/2011. days: 110	Expected payoff	9.52
Last activity	07/02/2012. days: 1	Absolute DD Maximal DD	0 8086.68
Beginning balance, USD	9 000.00	Sharp	-0.06
Total trades	2738	Leverage	1:300





В целом, такие решения нельзя отнести к аналитическим, но как демонстрационные и мониторинговые - они выполняют свои функции сполна.

— — —

Далее в нашем обзоре программные продукты более высокого уровня, целевая аудитория которых – серьёзные трейдеры, которые относятся к рынкам не как к развлечению, а как к источнику дохода и солидному бизнесу. Критерий отбора программного обеспечения – не цена, а прежде всего качество реализации софта, его функциональность и сбалансированность.

Открывает обзор в данной группе - программа учёта и анализа инвестиций...

«EFFECTIVETRADE»



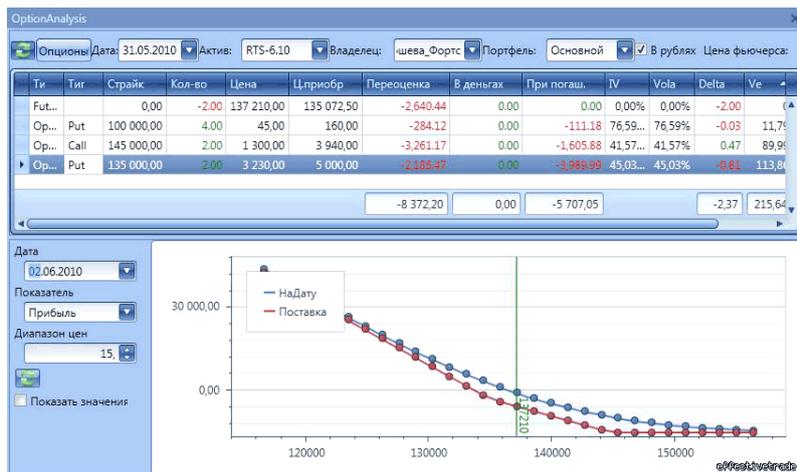
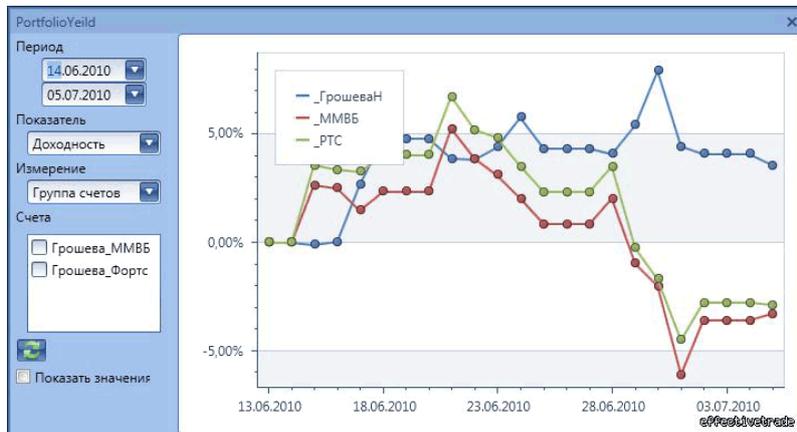
Разработчик: <http://effectivetrade.ru>
Цена: полный пакет около 70\$/мес.

Данное программное обеспечение оставило довольно приятное впечатление в плане точности реализации. Это касается хорошей теоретической базы знаний у разработчиков. Программа даёт возможность анализировать акции, облигации, фьючерсы и опционы российских рынков.

Position

Дата: 28.06.2010 Счет: (Все) Автообновление Шаблон

Grand Total								
Счет	Ак...	Тек. ост.	Цена. при...	Ст-ть приобр.	Рын. цена.	Рын. ст-ть	Дн. Прибыль	Переоценка
Грошева_ММВБ Т...				248 981,66		257 429,56	1 804,73	8 447,90
RUR		54 199,06	0,0000	54 199,06	1,0000	54 199,06	0,00	0,00
Акрон		30,00	855,0000	25 650,00	816,8900	24 506,70	296,70	-1 143,30
Дорогбж ап		2 500,00	11,8080	29 520,00	9,9650	24 912,50	-235,00	-4 607,50
ИнтерРАОао		303 000,00	0,0490	14 847,00	0,0471	14 271,30	0,00	-575,70
Проекти ао		4 500,00	6,6120	29 754,00	7,0000	31 500,00	1 743,03	1 746,00
ЦМТ ао		10 000,00	9,5012	95 011,60	10,8040	108 040,00	0,00	2 028,40



Также приятно порадовала интеграция с внешними приложениями - с системами интернет-трейдинга: QUIK, NetInvestor, AlfaDirect, Transaq; с биржей РТС по протоколу Plaza II.

В системе EffectiveTrade реализованы различные аналитические отчеты, позволяющие в режиме реального времени контролировать состав и структуру портфеля, отслеживать финансовые показатели портфеля, контролировать уровень доходности и риска и т.д. Отчеты могут быть построены за любой исторический период или дату.

В целом, программа оставила приятные впечатления; для трейдера, торгующего российскими инструментами – это неплохое решение.

Из минусов – недостаточная наглядность (данные в основном представляются таблично, что усложняет анализ сделок и быстрое восприятие), ограниченность рынков (не актуально для Forex-трейдеров и торгующих фьючерсами на товары на американских биржах); достаточно высокая цена.

Продукт заслуживает внимания, причём пристального, но с некоторыми оговорками. Подождём следующих версий, возможно, разработчики сделают более дружелюбный и наглядный интерфейс.

«FOREXSMARTTOOLS»



Разработчик: <http://forexsmarttools.com>

Цена: Lite-версия - 149\$;
Pro-версия - 389\$.

Среди функциональных особенностей выделим следующие:

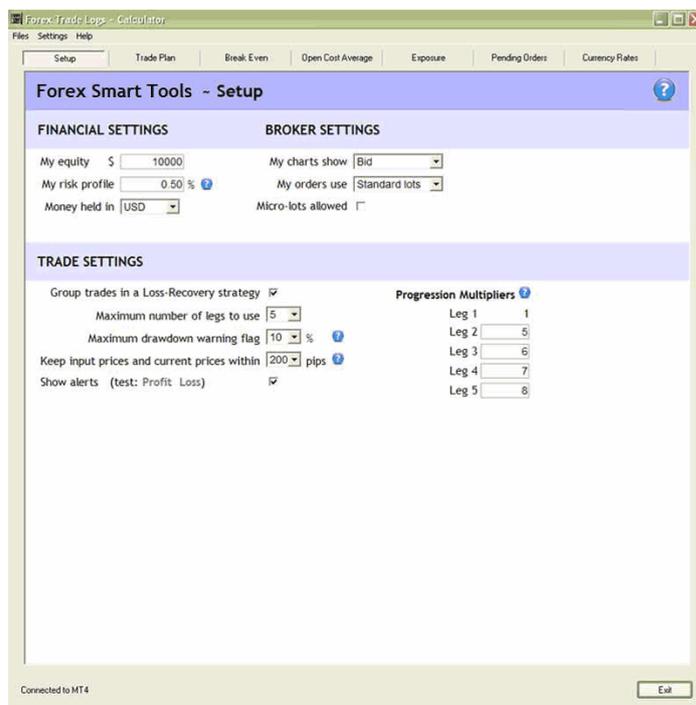
- Каждый модуль выведен отдельной вкладкой;
- Включает возможность составления торгового плана;
- Калькуляторы и учёт сделок по портфелям;
- Модуль Spread Betting.

	LEG ONE	LEG TWO	LEG THREE	LEG FOUR
My standard lots size	0.05	0.08	0.14	0.30
My entry price	1.3475	1.3455	1.3435	1.3415
My Break Even price	1.3431			

Estimate your gain	
Actual exit price	1.3520
Net effective pips	+1063
Net profit / loss	+5505.21
Equity change	+5.05%

Estimate your risk	
Stop loss for ALL positions	1.3395
Net effective pips	-421
Net loss	-5200.00
Equity loss	-2.00%

	LEG ONE	LEG TWO	LEG THREE	LEG FOUR
Direction	Sell	Buy	Sell	Buy
Entry price	1.4380	1.4408	1.4372	1.4413
Stop	1.4407	1.4375	1.4408	1.4370
Set stop loss	1.4411 (31 pips)	1.4373 (35 pips)	1.4412 (40 pips)	1.4368 (45 pips)
Suggested lots	0.2	1.0	1.2	1.4
Lots you use	0.2	1	1.2	1.4
Effective pip goal	30	10	36	0
Set take profit	1.4350 (30 pips)	1.4417 (7 pips)	1.4331 (41 pips)	1.4477 (64 pips)
Stop loss looks like	1.4413	1.4373	1.4414	1.4373
Take profit looks like	1.4352	1.4417	1.4333	1.4417
Break even	1.4415 (7 pips)	1.4327 (37 pips)		
Net profit or loss	+€42	-€43	+€20	-€287
Effective pips	30	-31	14	-205
Equity change	0.42%	-0.43%	0.20%	-2.87%
This trade only	+€42	-€43	+€63	-€244
Risk : Reward	1.02 : 1	14.35 : 1	10.91 : 1	528 : 1



Из минусов: программа адаптирована только для рынка Forex, и ее функциональность находится не на самом высоком уровне. Цена как для аналитики только для Forex высока – от 149\$ за Lite-версию до 389\$ за Pro.

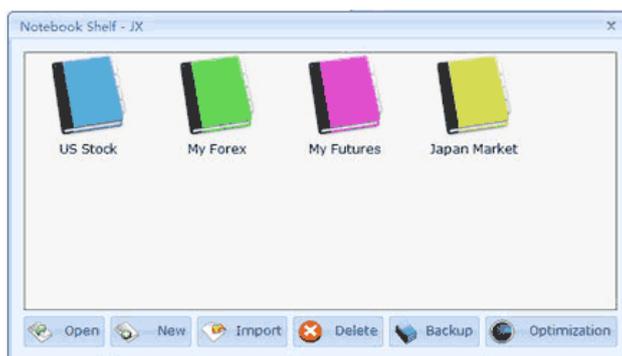
Положительным является факт того, что качество реализации всех вкладок и модулей на высоком уровне. Есть некоторые функциональные особенности, которых нет у конкурентов, например, SpreadBettingModule.

«TRADERPAD»

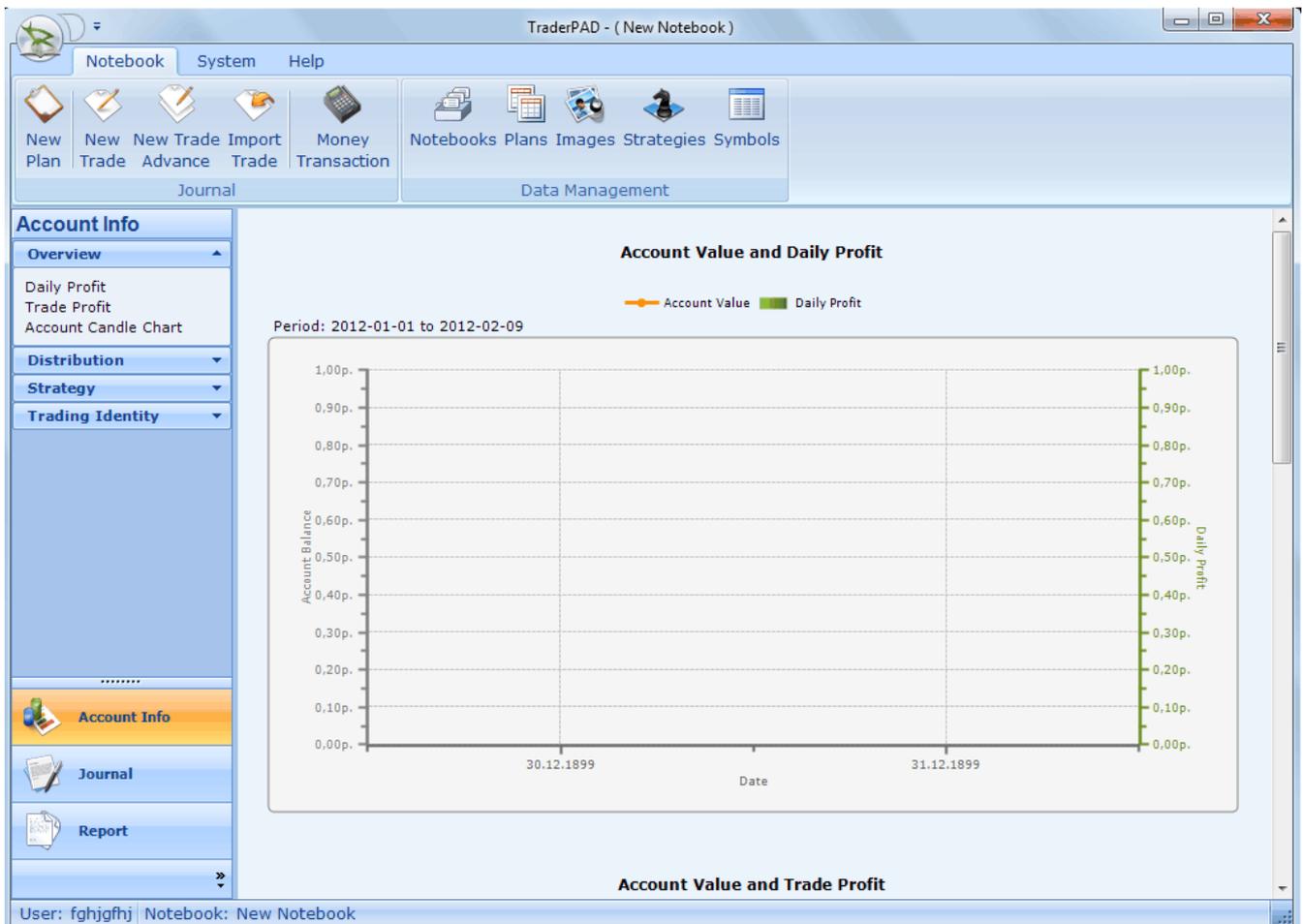


Разработчик: <http://traderpad.net>
Цена: 149,95\$.

Серьезность данного программного решения подтверждает тот факт, что актуален он для трейдеров, торгующих на различных рынках – от Forex до Stocks:



Интерфейс программы напоминает дизайн элементов популярного офисного текстового редактора Office:



Надеюсь, у автора нет проблем с компанией Microsoft. ☺

ОБЗОРЫ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

Advance Trade Input

Orders Trade Plan

Order Input

Symbol: EURUSD Direction: Buy Sell

Date: 08.02.2012 1:19:29

Quantity: 1 Price: 0 Fee: 0.0

Stop: 0.0 Limit: 0.0

Strategy: Others

Trade Summary

Open Orders
Order(s): 0
Avg Price: 0,00p.
Quantity: 0

Close Orders
Order(s): 0
Avg Price: 0,00p.
Quantity: 0

Trade Summary
Order(s): 0 Position(s): 0
Fee(s): 0,00p. Net profit: 0,00p.

Order Time	Direction	Quantity	Order Price	Stop Price	Limit Price	Fee	Strategy ID	Ord

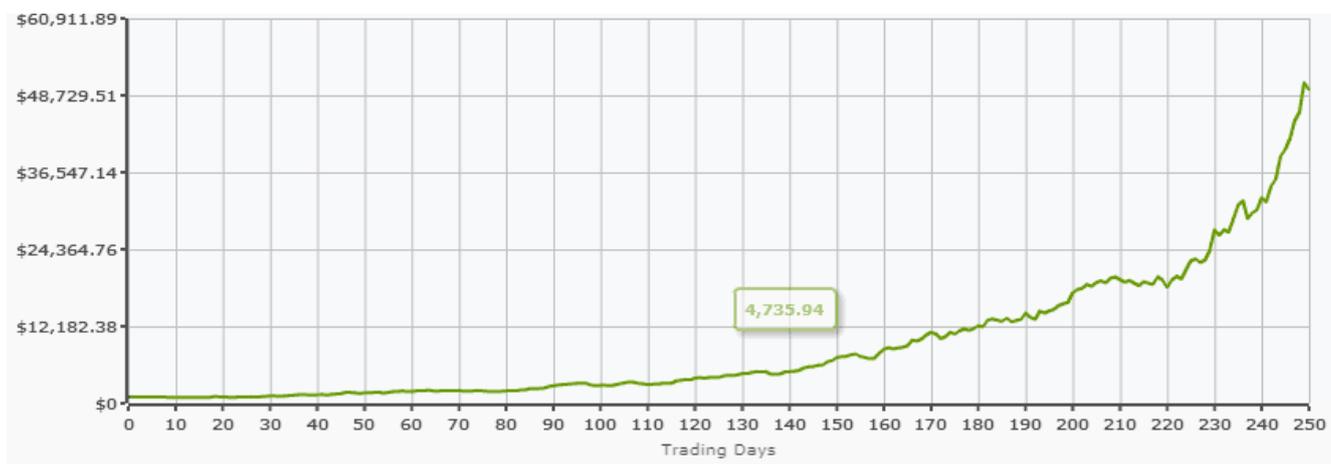
Trade Note: Emotion: Excitement Reference Image:

Symbol Info

The EURUSD is a new symbol.
Please set the symbol info here.

Change Unit: 1 Unit Value: 1

Type: Stock Fee: 0



В сухом остатке – данное программное обеспечение даёт возможность вести полноценную статистику сделок, отображать результаты графически и сортировать данные по различным критериям.

Из недостатков можно выделить отсутствие автоматизации (интеграции с торговыми платформами, только Excel) и слабый графический движок.

Цена составляет 149,95\$, что для довольно качественного софта не много.

И в конце обзорной статьи хотелось бы рассмотреть поближе, пожалуй, одну из наиболее примечательных и оптимальных программ для анализа сделок.

«MAXPROFIT»



Разработчик: <http://mxprofit.ru>

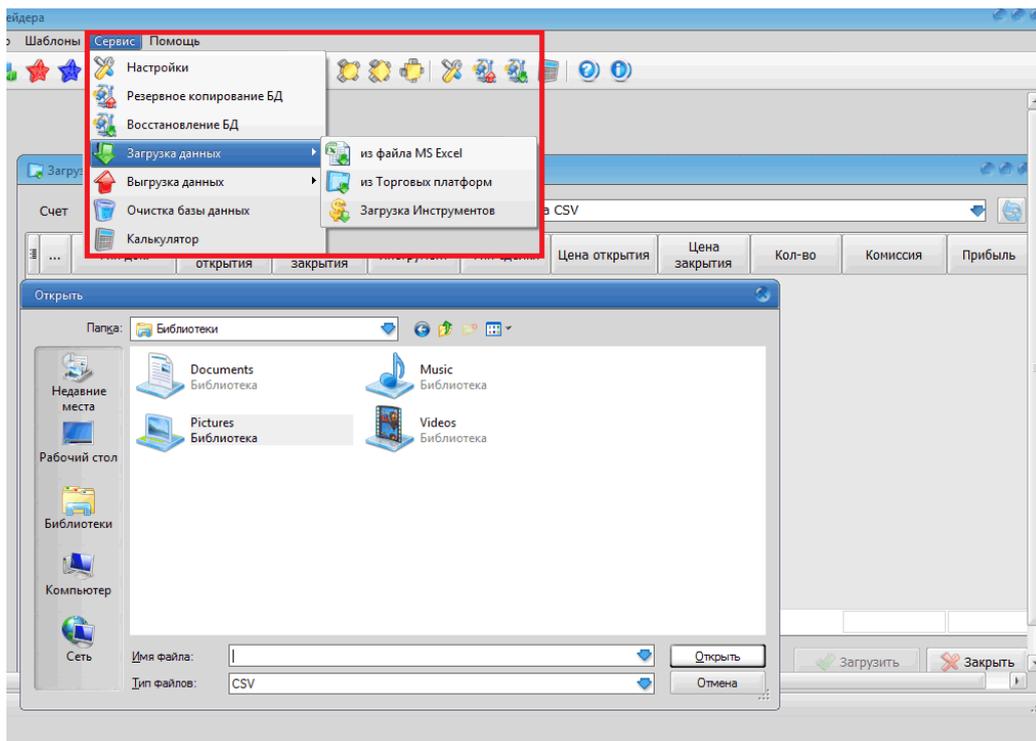
Цена: от 32\$ до 95\$ в зависимости от типа лицензии.

Функционал MaxProfit позволяет вести учет и проводить анализ торговых операций, совершенных на рынке Forex, Stocks и Futures.

Обращу ваше внимание только на те функции, которых нет ни в одной другой из вышеприведенных программ. Одна из главных особенностей: загрузка данных из популярных торговых платформ MetaTrader 4 и Ninja Trader в режиме реального времени – все совершаемые операции в терминале автоматически переносятся в программу вместе со скриншотами. Нет никакой дополнительной ручной работы по переносу данных. Все происходит полностью в автоматическом режиме.

Также она позволяет:

- Вести свой торговый дневник (ежедневник), планировать свою торговлю, выставлять напоминания и хранить важную информацию в удобном виде;
- Вести учет по неограниченному количеству торговых счетов;
- Добавлять к сделкам кроме скриншотов также аудио и видео файлы;
- Добавлять неограниченное количество дополнительных характеристик для последующего более глубокого анализа торговли;
- Выставлять оценку за открытие и закрытие позиции с последующим анализом своих ошибок;
- Автоматически рассчитывать результат сделки;
- Загружать исторические данные по счету из различных торговых платформ и файлов MS Excel в 2 клика.



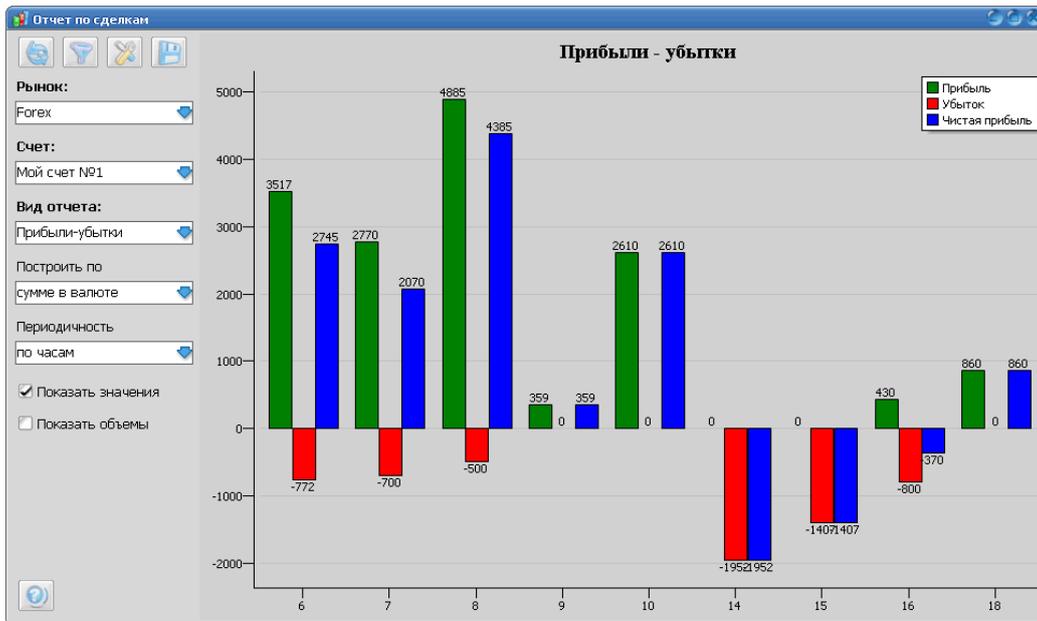
Анализ сделок позволяет:

- Посмотреть значения по 30 самым важным показателям, таким как профит-фактор, фактор восстановления, матожидание, MIDD и т.д.:

Наименование показателя	Значение	
Депозит на начало периода	50000	
Пополнение счета	0.00	
Снятие со счета	0.00	
Депозит на конец периода (реальный остаток)	64308.58	
Депозит на конец периода (возможный, с учетом отбора)	63469.40	
Чистая прибыль в валюте (в пунктах)	13469.4 (1456)	
Общая прибыль в валюте (в пунктах)	24694.4 (3204)	
Общий убыток в валюте (в пунктах)	-11225 (-1748)	
PF (профит фактор)	2.20	
RF (фактор восстановления)	3.71	
APF (достоверный профит фактор)	2.06	
Матожидание выигрыша	0.54	
Максимальная просадка в валюте (в пунктах)	3628 (691)	
Всего сделок		73
Короткие позиции (% выигрышных)	32 (53.10%)	
Длинные позиции (% выигрышных)	41 (56.10%)	
Прибыльные сделки (% от всех)		40 (54.80%)
Убыточные сделки (% от всех)		33 (45.20%)
Нулевые сделки (% от всех)		
Сделки с грубыми ошибками за открытие (% от всех)		20 (27.40%)
Сделки с грубыми ошибками за закрытие (% от всех)		20 (27.40%)
Сделки с грубыми ошибками за открытие или закрытие (% от всех)		22 (30.10%)

- Построить 16(!) линейных графиков и более 62(!) диаграмм:



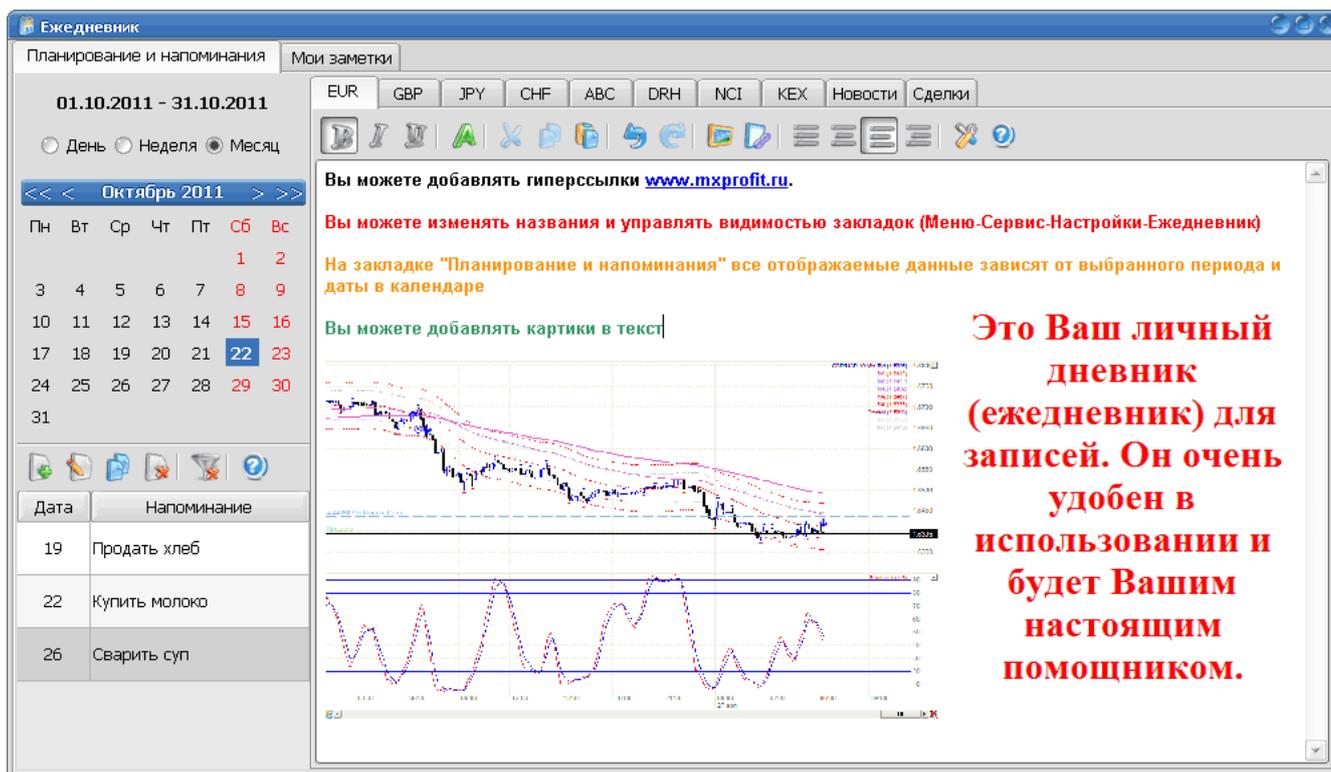


- Узнать, какие инструменты, торговые системы, время работы и т.д. приносят наибольшую прибыль или убыток;
- Строить графики и диаграммы по сделкам, дням, неделям, месяцам и годам;
- Узнать, какой убыток принесли трейдеру его ошибки.

А также:

- Воспользоваться формой для расчета лота перед входом в рынок:

- Записывать все мысли в свой личный дневник:



Программа оставила приятное впечатление огромным количеством функциональных возможностей, тесной интеграцией с торговыми платформами, удобным интерфейсом, небольшой ценой и отзывчивой службой поддержки. Существенных недостатков не обнаружено, разве только хотелось бы в будущих версиях увидеть возможность работы с опционами.



По итогам обзора предлагаю финальное сравнение программного обеспечения для учёта и анализа сделок с тем, чтобы определиться, какое из решений позволит сделать торговлю каждого серьёзного трейдера более эффективной и продуктивной. Максимальная оценка - 10 баллов.

Максимальная оценка - 10 баллов	Основные функции	Интерфейс и удобство работы	Поддерживаемые рынки	Интеграция с торговыми платформами	Автоматизация	Простота интеграции в рабочее пространство (адаптация трейдера)	Дополнительные возможности	СУММА
Персональный блокнот трейдер htsoft.ru	4	4	3	2	2	4	3	22
Дневник трейдера harami.ru	3	3	2	0	1	2	4	15
Статистика трейдера marketstat.ru	5	5	6	5	4	5	3	33
EffectiveTrader effectivetrade.ru	8	6	9	6	5	5	4	43
ForexSmartTools forexsmarttools.com	5	4	4	4	5	6	6	34
TraderPad traderpad.net	6	5	8	5	4	6	5	39
MaxProfit mxprofit.ru	8	7	8	8	7	8	8	54

По итогам сравнения можно выделить 2 группы: явных победителей с главным лидером и группу отстающих.

Пожелаем всем успехов и поблагодарим всех авторов и разработчиков программного обеспечения за их труд!

Удачи в торговле! ■

ВЫБЕРИ СОВЕТНИК



ВЫБЕРИ СОВЕТНИК!

В каждом номере нашего журнала мы проводим обзоры советников и торговых систем. Поскольку мы всегда прислушиваемся к мнению наших читателей, нам интересно узнать, какие еще из множества представленных в сети советников интересуют именно Вас!

В связи с этим мы предлагаем Вам **поучаствовать в опросе на тему «Выбери советник!»**

Чтобы стать участником опроса, нужно написать письмо на наш ящик с указанием названия советника, сайта разработчика и небольшого комментария о том, почему, по Вашему мнению, данный советник или система заслуживают внимания. А мы в свою очередь выберем наиболее интересующие Вас советники, получившие самое большое количество отзывов, подключим их к нашей Лаборатории и сделаем их подробный обзор на страницах нашего журнала.

Статус	Название	Пипс	Баланс	Звюти	Общее время теста
	Primeval-EA	21045	15,785.80	16,865.60	119 дней
	MultiMartingail	11938	13,673.90	11,113.50	174 дней
	Gelan Trawler 3.5	5205	12,938.20	15,902.50	160 дней
	Pips Miner EE	4046	20,664.40	25,247.30	165 дней

Написать письмо

Кирилл Еременко



Программист со стажем работы на рынке FOREX более трёх лет. Имеет техническое образование. Является автором многих механических торговых систем. Технический аналитик и ведущий MQL4-разработчик компании Forex4You. Ведущий очных курсов по программированию на языке MQL4.

ШКОЛА MQL4 (ПРОДОЛЖЕНИЕ)

(начало №1-25 «Leprecon Review» <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jyrnala>)

Урок 73

ФУНКЦИЯ ORDERCLOSEBY()

Здравствуйтесь, друзья! Недавно я получил такой вопрос:

"Кирилл, объясни, пожалуйста, работу функции `OrderCloseBy()`, и откуда берется 2-й тикет для нее?"

Итак, сегодня мы разберем функцию **OrderCloseBy()**.

Синтаксис:

```
bool OrderCloseBy(int ticket, int opposite, color Color=CLR_NONE)
```

Описание:

Закрытие одной открытой позиции другой позицией, открытой по тому же самому инструменту, но в противоположном направлении. Возвращает TRUE при успешном завершении функции. Возвращает FALSE при неудачном завершении функции. Чтобы получить информацию об ошибке, необходимо вызвать функцию `GetLastError()`.

Параметры:

`ticket` - уникальный порядковый номер закрываемого ордера;
`opposite` - уникальный порядковый номер противоположного ордера;
`Color` - цвет стрелки закрытия на графике. Если параметр отсутствует или его значение равно CLR_NONE, то стрелка на графике не отображается.

Функция достаточно проста в обращении и используется для закрытия локированных ордеров. Например, если у Вас есть открытые ордера по EUR/USD: **ticket1** BUY 0.1 лот и **ticket2** SELL 0.1 лот. Вместо того чтобы их закрывать по отдельности, их можно закрыть через `OrderCloseBy()`:

```
OrderCloseBy(ticket1, ticket2);
```

Причем, в случае, если ордера имеют разные объемы, закрытие произойдет из расчета меньшего лота.

Надеюсь, что Вы найдете полезной эту функцию.

УПРАВЛЕНИЕ КАПИТАЛОМ (Часть 1)

Сегодняшний и несколько последующих уроков будут посвящены одной из наиважнейших тем в торговле - теме управления капиталом (мани-менеджмента). Для начала мы рассмотрим теоретические аспекты и определим понятия, которыми мы будем оперировать, затем я планирую разобрать несколько известных примеров изящных алгоритмов управления капиталом, а в заключение мы напишем несколько блоков кода для наших советников.

Итак, начнем!!

Управление капиталом / Мани-менеджмент (англ. Money Management) — процесс управления деньгами (личным капиталом). Мани-менеджмент включает в себя инструменты, приёмы и методы для приумножения (страхования, выгодного перераспределения) средств инвестирования, банковских сбережений, налогов и расходования бюджета.

Wikipedia

Глобально мани-менеджмент разделяется на два уровня - **стратегический мани-менеджмент** и **тактический мани-менеджмент**.

Стратегический мани-менеджмент мы рассматривать не будем, но для общего развития я скажу пару слов о том, что это такое. Данный уровень управления капиталом является весьма долгосрочным и включает в себя такие элементы, как выбор валюты, в которой будет храниться депозит, исследование макроэкономических показателей для фильтрации торгуемых валют, чтобы при входе в долгосрочные позиции минимизировать потери, возникающие из-за падения покупаемой валюты. Также некоторые инвесторы (особенно институциональные инвесторы) уделяют огромное внимание таким элементам стратегического мани-менеджмента, как хеджирование позиций.

Тактический мани-менеджмент. Именно этот вид мани-менеджмента мы будем рассматривать в данном курсе. Подобное управление капиталом акцентирует внимание на каждой конкретной сделке: **размер лота, величина стоп-лосса** - вот основные параметры, с которыми мы будем играть. 😊

Существует множество методов управления капиталом. Ниже представлены самые известные из них:

1. **Метод Фиксированного лота** - все позиции открываются некоторым постоянным количеством лотов (объёмом), определенным заранее (т.е., например, 0.1, или 1, или 2.5, 10, 1000 и т.д. лотов – причем независимо от исхода предыдущего трейда, текущего размера депозита и других текущих показателей торговли);

2. **Фиксированный процент** (Ларри Вильямс (Larry Williams)) - в каждой сделке рискуем неким заранее выбранным фиксированным процентом имеющегося депозита;

3. **Фиксированная пропорция** (Райан Джонс (Ryan Jones)) - вариант фиксировано-фракционной системы;

4. **Торговля всем капиталом** - тактика управления капиталом, согласно которой в каждой очередной сделке мы открываемся максимально возможным количеством лотов;

5. **Мартингейл** - удваивание позиции после убыточной сделки.

В заключение данного урока скажу, что, с моей точки зрения, современные трейдеры уделяют слишком мало внимания мани-менеджменту. Все сконцентрированы на стратегиях входа-выхода, которые действительно важны, но стратегия управления капиталом ровно столь же важна и является мощным оружием в арсенале умелого трейдера. Это будет более наглядно продемонстрировано в следующем уроке, когда мы будем говорить о стратегии Райана Джонса.

Урок 75

УПРАВЛЕНИЕ КАПИТАЛОМ (Часть 2)

В этом уроке мы разберем стратегию управления капиталом от **Ларри Вильямса**.

Формула Келли — формула, показывающая оптимальную долю капитала, которой можно рискнуть в одной сделке. Применяется в управлении капиталом при игре на финансовых рынках, в азартных играх и др.

Рассматривается следующая ситуация. Участник при каждой сделке может с вероятностью p получить прибыль, в A раз превышающую поставленный капитал X или с вероятностью $q = 1 - p$ получить убыток, в B раз превышающий ставку X . Возникает задача, какую долю общего капитала K надо каждый раз ставить, чтобы максимизировать среднюю величину логарифма прибыли при большом числе повторяемых сделок.

Обозначим долю капитала $f = x / K$.

Формула Келли гласит, что оптимальное значение:

$$f^* = \frac{p}{B} - \frac{q}{A}$$

(предполагается, что математическое ожидание сделки положительно, то есть $pA - qB > 0$).

Метод дробной части

Наиболее известными способами оценки рисков, основанными на определении некоторой фиксированной доли торгового капитала, определяющей допустимые риски при торговых операциях, являются **формула Келли** и **метод Винса**. Формула Келли связывает величину риска на одну сделку со статистическими параметрами торговой стратегии следующим выражением:

$$f = P - (1-P)/(W/L)$$

где: f - часть капитала, которой можно рисковать в одной сделке;

P - доля выигрышных сделок;

W - средний размер выигрыша;

L - средний размер проигрыша.

Например, для системы, которая дает 65% выигрышей и показывает отношение $W/L=1$, можно получить $f = 0,3$. Таким образом, процент активов, который обеспечил бы максимальную отдачу - 30%.

Основным недостатком формулы Келли является ее неполное соответствие практике торговли. Формула Келли хорошо работает в случае, когда потенциальный проигрыш в игре

ограничен суммой ставки, а потенциальный выигрыш всегда остается одинаковым в отношении поставленной суммы. В торговле размеры и выигрышей, и проигрышей постоянно меняются, т.е. формула Келли не вполне адекватна для описания и оценки допустимых рисков при торговых стратегиях. Для случая, когда величина выигрыша и проигрыша переменная, можно воспользоваться следующей оценкой минимального размера капитала $K(1)$, позволяющего торговать одним стандартным контрактом:

$$f = P - (1-P)/(W/L) = L/K(1), \text{ откуда следует } K(1) = L*W/(PW - (1-P)L).$$

Более жесткое ограничение можно получить, если использовать не среднее значение потерь L , а максимальный полученный при тестировании на истории (или при системной торговле в прошлом) убыток L_{max} :

$$K(1) = L_{max} * W / (PW - (1-P)L).$$

Модификацию формулы Келли для управления капиталом при торговых операциях разработал **Ральф Винс** (Ralph Vince) и назвал ее формулой для fort. Метод Винса основан на достаточно сложном расчете величины fort путем последовательных приближений на основании серии сделок, характеризующих некоторую торговую систему. Главная проблема при использовании как f , полученного с помощью формулы Келли, так и fort, рассчитанного по методу Винса, это просадки (дродаун). Нарастивание количества торгуемых контрактов с ростом прибыли происходит достаточно быстро, но тем быстрее последующее уменьшение торгового счета при серии убыточных сделок. Если учесть, что даже при высокой вероятности прибыльной сделки в течение продолжительной торговли можно получить убыток несколько раз подряд, то риск слишком высоким процентом от капитала может привести к катастрофическим последствиям для торгового счета. Поэтому трейдеры-практики используют более низкие, по сравнению с определяемыми по формуле Келли и методу Винса, риски. В частности, формула, применяемая для оценки допустимых рисков **Л. Вильямсом**, имеет вид:

$$n = f * K / L_{max},$$

где: n - число торгуемых контрактов;
 f - процент риска;
 K - текущий остаток на торговом счете;
 L_{max} - самый большой проигрыш на одну сделку (один контракт).

Величина f может быть определена из формулы Келли или по методу Винса, но обычно принимается не более 25%.

Метод Ларри Вильямса

Л.Вильямс рекомендует использовать пределы величины f от 5% при консервативном стиле управления капиталом, 10-15% при повышенном уровне риска и до 20% и более - при рискованных торговых стратегиях. Если торговая стратегия в качестве составного элемента содержит правила определения риска для каждой конкретной сделки, то аналогичная формула будет иметь вид:

$$n = f * K / L_o,$$

где: n - число контрактов для данной сделки;
 f - процент риска;
 K - текущий остаток на торговом счете;
 L_o - текущий уровень риска на один контракт для открываемой позиции.

Отметим, что эта формула обеспечивает гораздо большую гибкость для определения размера

открываемой позиции в процессе торговли, так как мы заранее знаем величину возможного убытка по данной транзакции.

Надеюсь, что Вы найдете полезным данный урок. В следующий раз мы разберем практический пример применения метода Ларри Вильямса, а также обсудим более детально преимущества и недостатки метода.

До встречи на следующем уроке! ■

Если у Вас возникли вопросы по этой статье, пишите – мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

Написать письмо





ПРЯМОЙ ДОСТУП К ECN INTEGRAL



Леонид Борский (leonid553)



Стаж работы на рынке Forex с января 2006 года. В сферу его интересов также входят фьючерсные инструменты товарных и фондовых рынков. Автор нескольких публикаций, в том числе и нашумевшей статьи «Нестандартная автоматическая торговля» <http://articles.mql4.com/ru/403> Леонид активно занимается кодингом и поиском нестандартных решений для автоматизации торговли.

ПРИЕМЫ СЕЗОННОЙ ТОРГОВЛИ МАРТ 2012 ГОДА

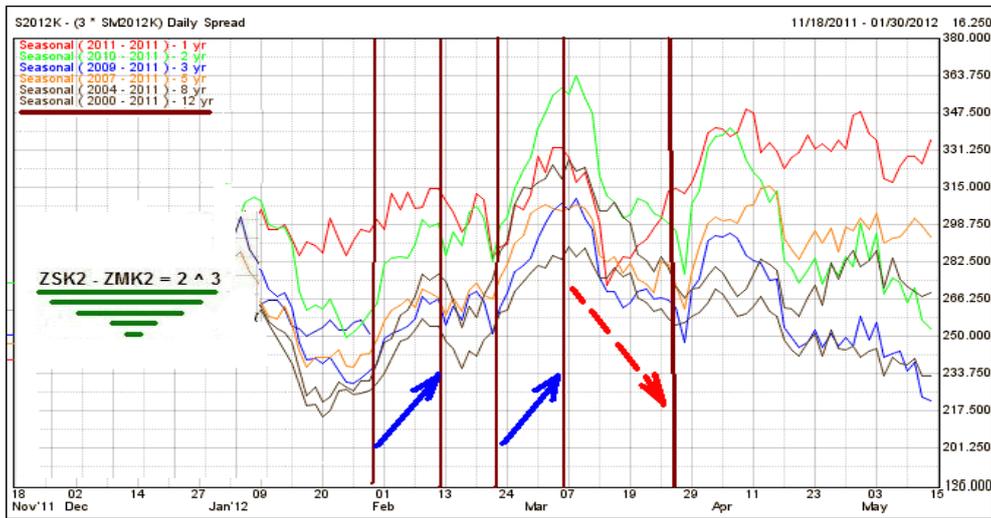
В этом выпуске будут предложены к рассмотрению перспективные средне- и долгосрочные мартовские парные входы по многолетним сезонным тенденциям некоторых товарных и фондовых спредов, доступных к реализации в торговой платформе **MT4** от **ГК БРОКО, GRAND CAPITAL, EXNESS** и других брокерских компаний. Кроме того, по многочисленным просьбам наших читателей мы расскажем о предполагаемых мартовских сезонных движениях отдельных инструментов товарного рынка. Мартовская сезонная торговля в этом году ожидается достаточно насыщенной и профитной. Перспективные сезонные входы здесь имеются даже в сегменте валютного рынка!

— — —

Актуальной остается покупка спреда соевых инструментов бобы-мука:



Сезонность первой половины февраля отработала в этом году очень неплохо! Напомню, что я работаю в MT4 с этим спредом иным соотношением. Размер позиции муки беру чуть больше, чтобы соотношение было лучше сбалансировано. При этом предполагаемая прибыль получается меньше, но значительно уменьшается риск и увеличивается комфортность торговли этим спредом! Вот подробный график многолетних сезонных тенденций для соотношения **ZSH2-ZMH2 = 2^3**:



Здесь хорошо видно, что с 22-23 февраля нам можно возобновить покупки спреда **ZSK2-ZMK2=2^3**, а с 7-10 марта мы уже будем оценивать возможность продажи спреда до последних дней месяца.

— — —

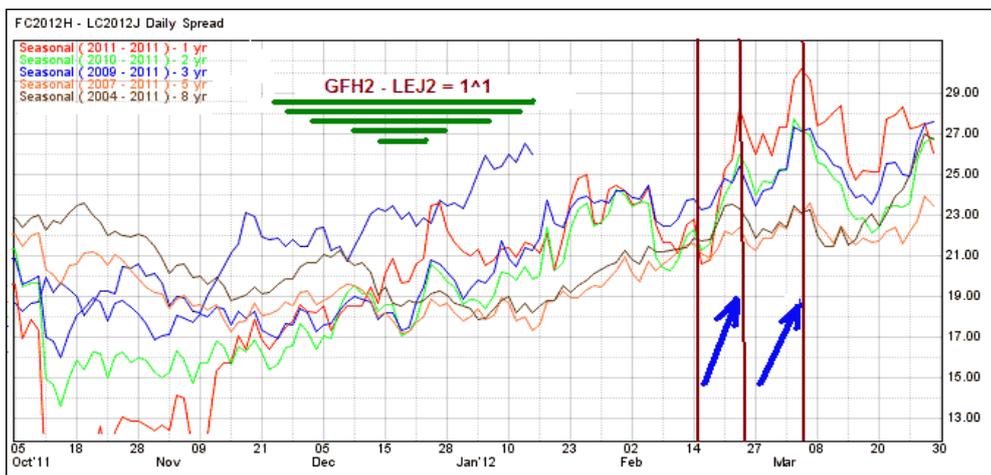
Также актуальным остается удержание позиций долгосрочного перспективного свиного календарного спреда **HEJ2 – HEK2** (апрель-май), описанного в предыдущих номерах нашего журнала:



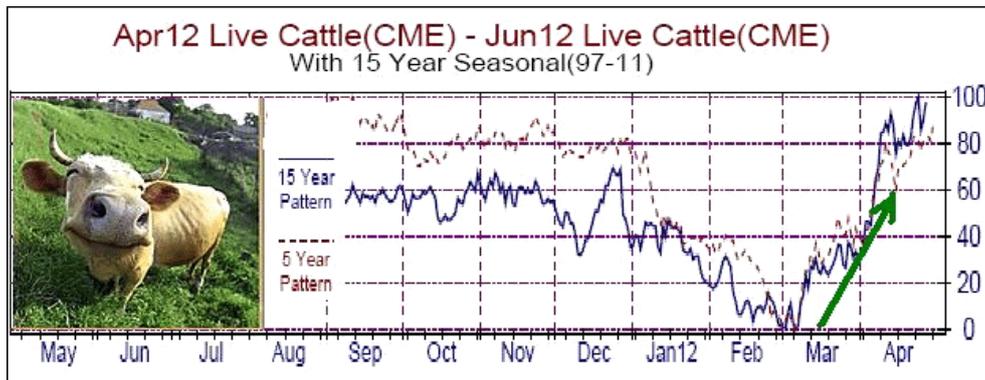
Закрываем позиции этого спреда в первых числах апреля.

— — —

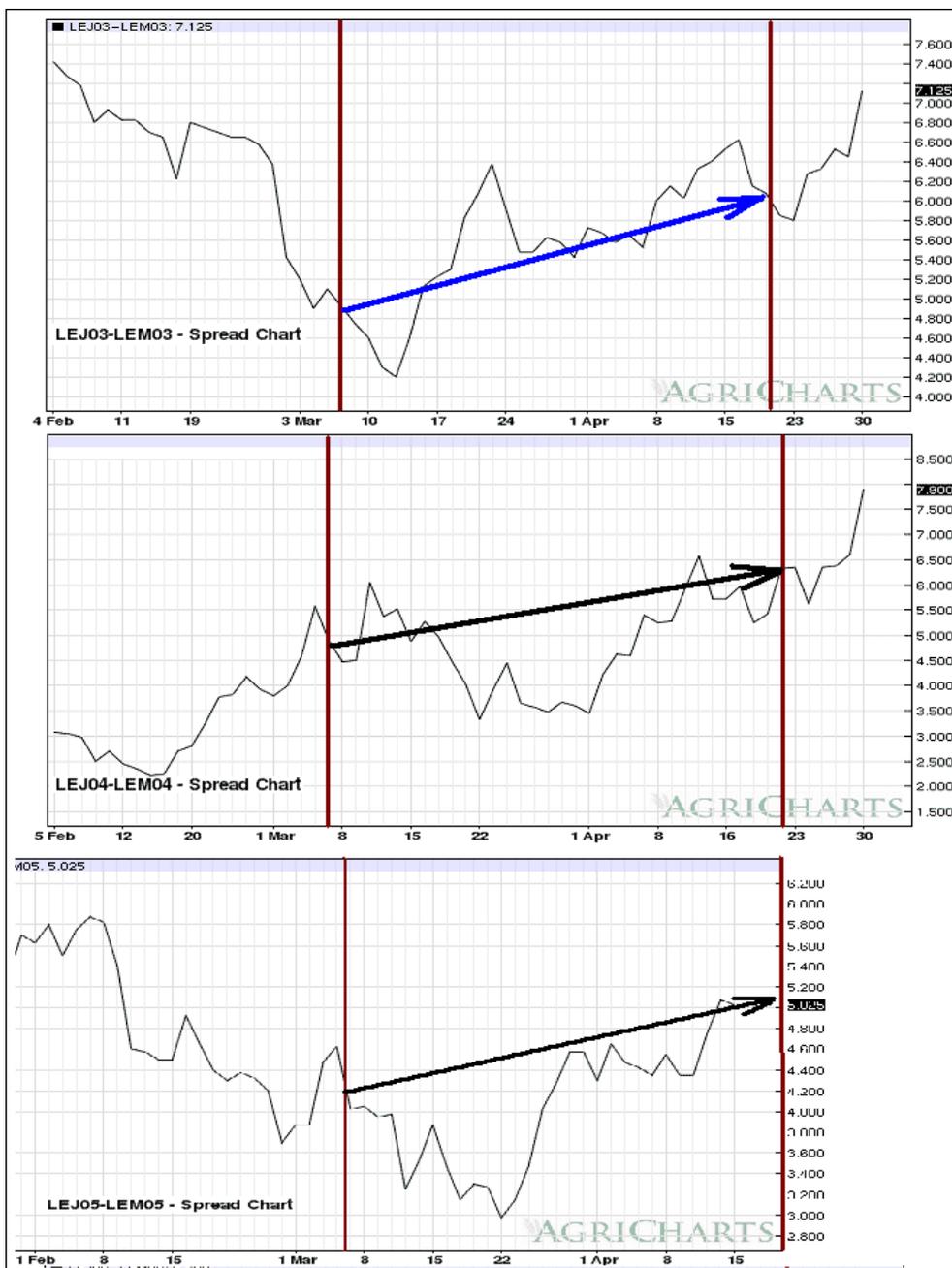
Спред скотины **GFH2 – LEJ2 = 1^1** (молодые бычки – крупная рогатая скотина) с последних чисел февраля настроен на рост примерно до 6-7 марта:



И еще по скотине. Календарный спред крупной рогатой скотины **LEJ2-LEM2** считается перспективным в марте-апреле. Помнится, в прошлом году я достаточно успешно отработал в покупку этого спреда с середины первой декады марта:



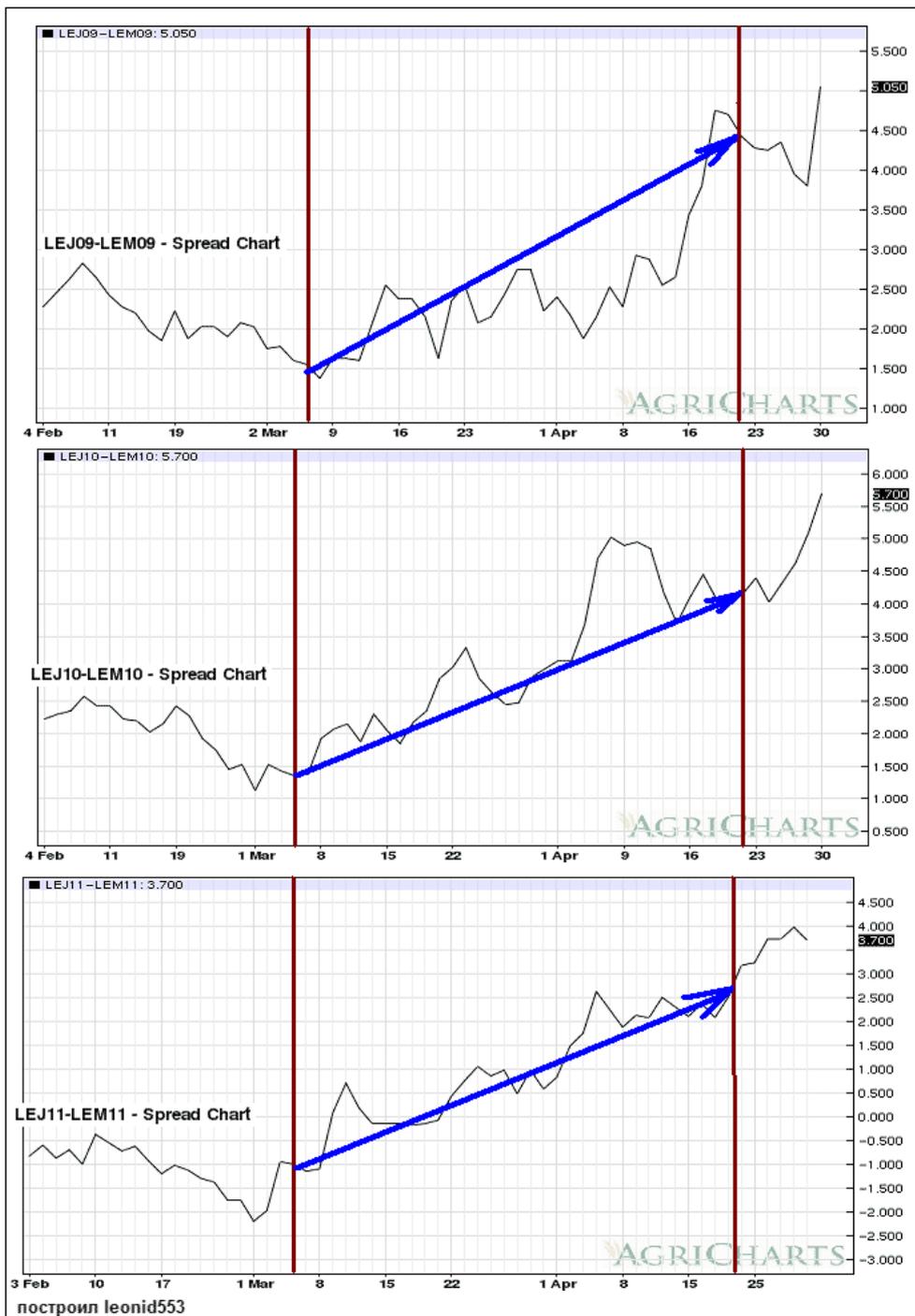
Чтобы более конкретно оценить перспективы этого входа, разложим «по годам» график многолетних сезонных тенденций за последние несколько лет:



ПРАКТИЧЕСКИЙ ТРЕЙДИНГ



ПРАКТИЧЕСКИЙ ТРЕЙДИНГ

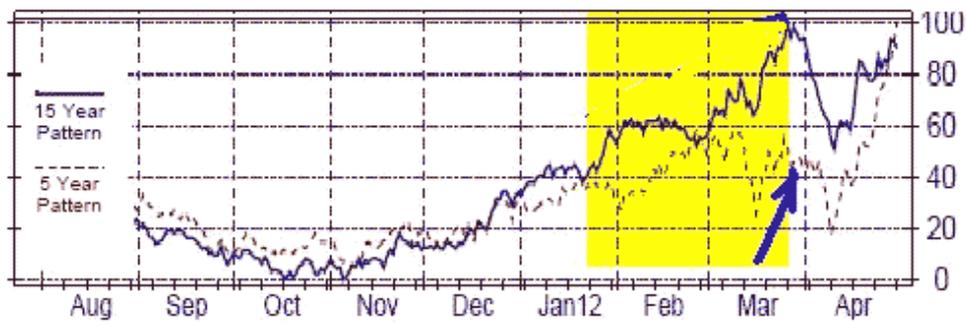


Достаточно уверенно, особенно в последние три года, идет сезонная отработка! Удерживаем позиции календарного спреда **LE**-скотины до конца второй декады апреля.

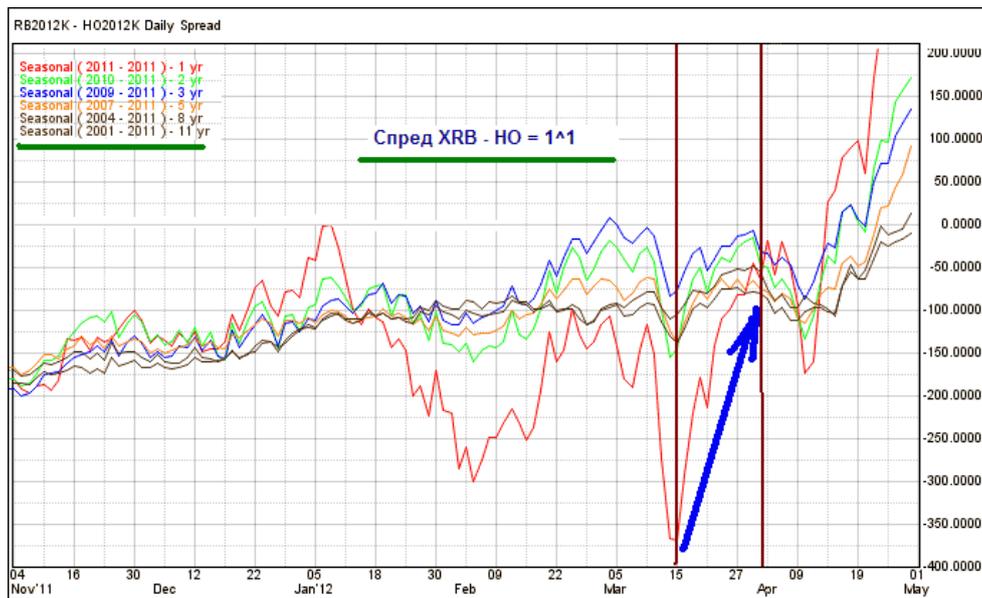
— — —

Сырьевой спред бензин-мазут мы будем отслеживать со второй декады марта на предмет его покупки: **BUY XRBK2 – SELL HOK2 = 1:1**. Предположительная дата входа – 15 марта:

May12 Gasoline(NYMEX) - May12 Heating Oil(NYM)
With 15 Year Seasonal(97-11)

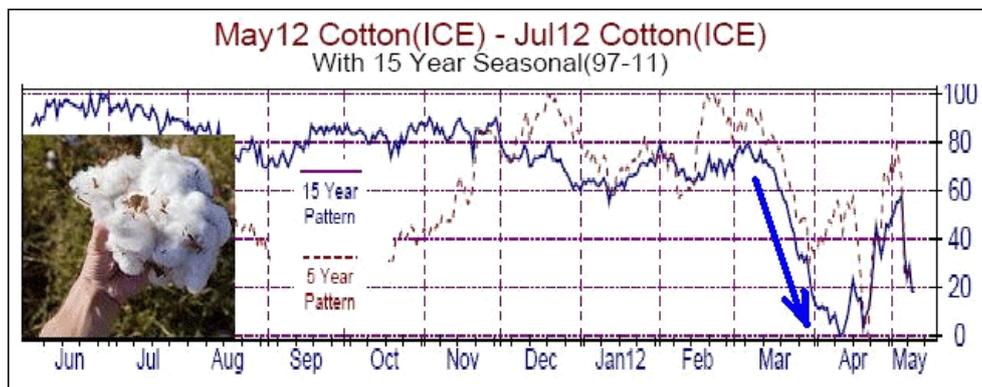


Вот более подробный график многолетних сезонных тенденций этого спреда:

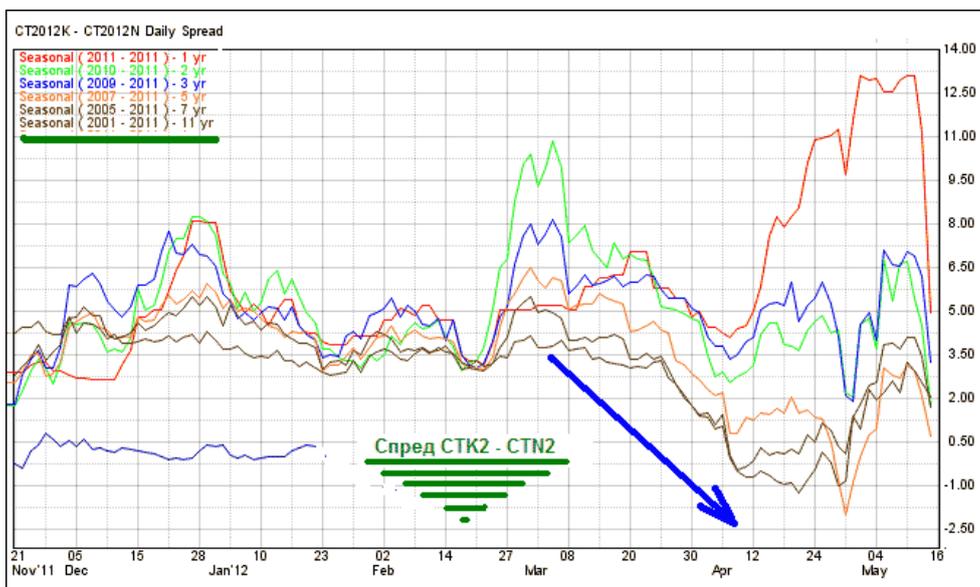


Удерживаем позиции до конца месяца либо до достижения суммарного профита примерно +350+400 пунктов по шкале этих инструментов.

В первой декаде марта в торговой платформе МТ4 будет доступен июльский контракт хлопка. И мы сразу же будем отслеживать календарный хлопковый спред **СТК2-СТН2** на предмет его продажи. Сезонный график (5-ти и 15-ти летний) спреда по версии сайта МРСИ представлен на рисунке:



Предполагаемый профит – несколько сотен пунктов по хлопковой шкале, что хорошо видно на более подробном графике многолетних сезонных тенденций:

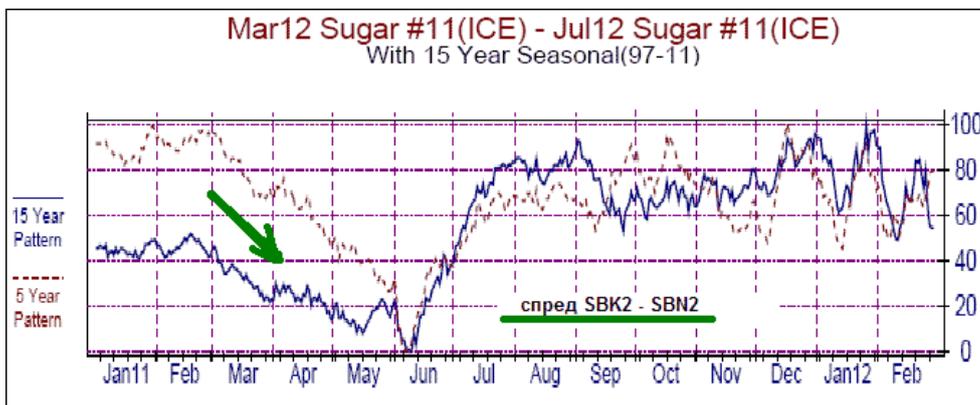


Удерживаем позиции до последних дней первой декады апреля. Впрочем, исходя из своего скромного опыта по прошлому году, замечу, что данный хлопковый спред был достаточно волатильный. И здесь есть резон работать в продажу спреда среднесрочными парными входами на откатах линии спреда. Посмотрим по ситуации.

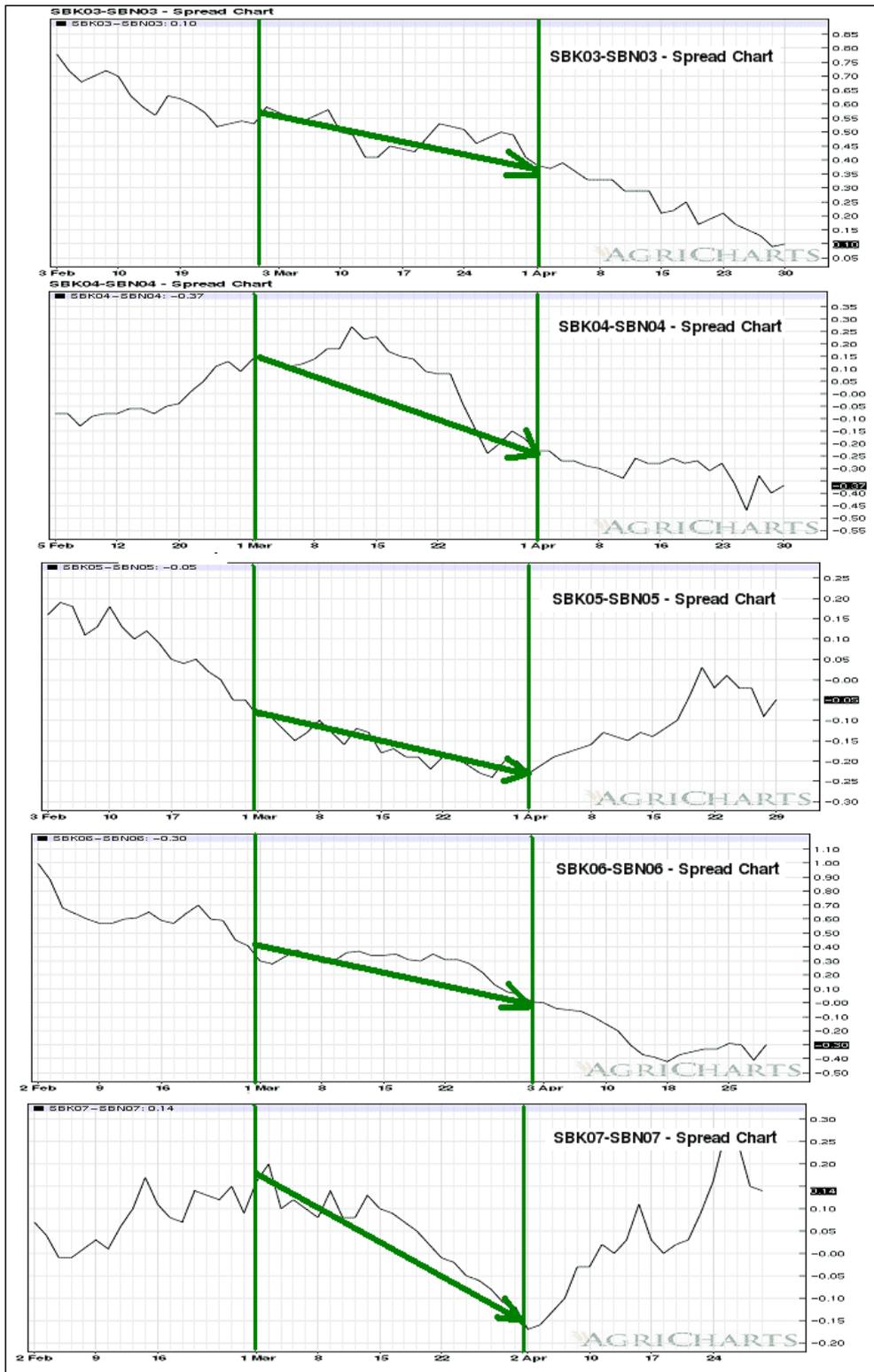
— — —

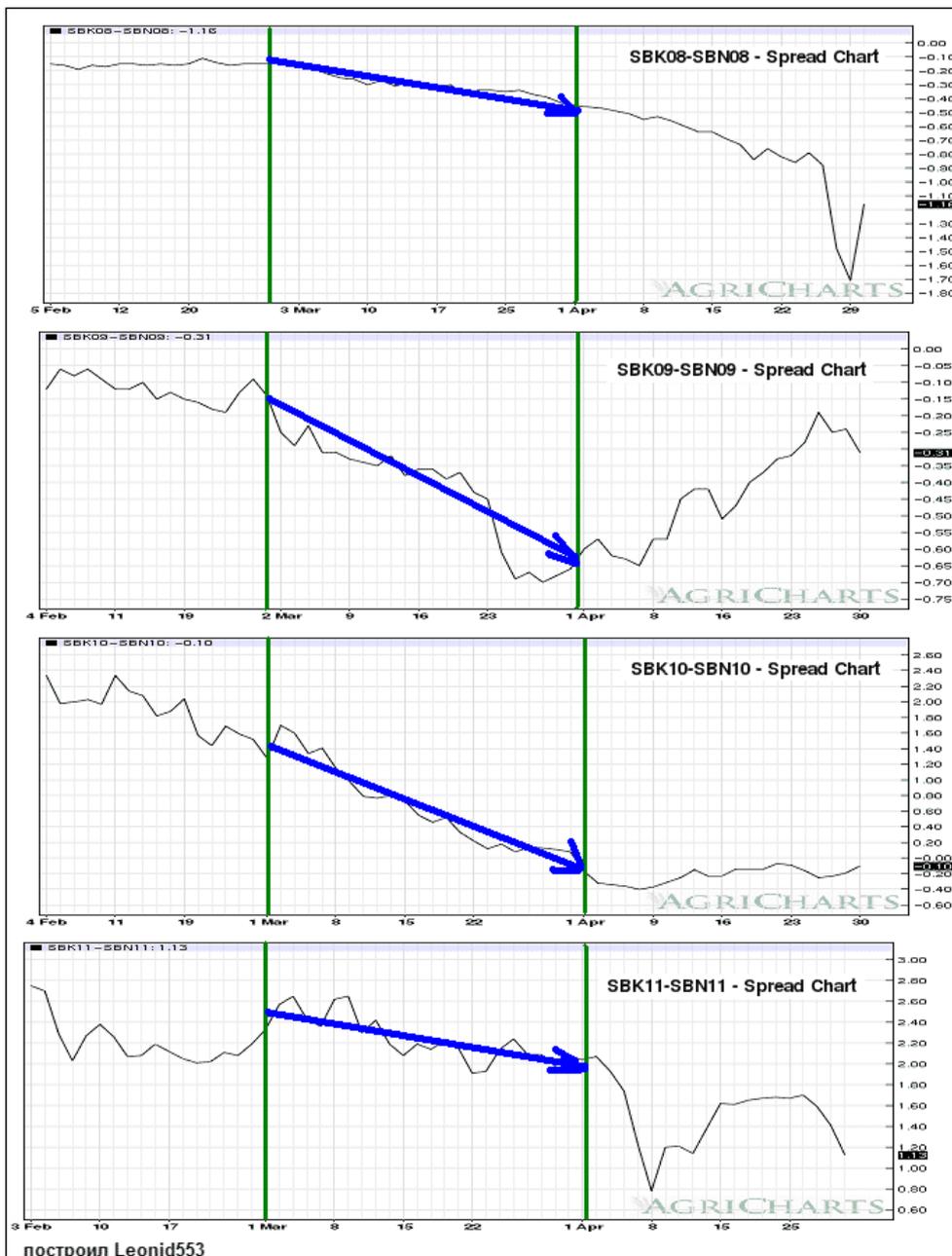
Далее рассмотрим календарный сахарный спред **SBK2-SBN2**, который запомнился мне неплохой надежностью прошлогодних сезонных отработок. Этот перспективный «сладкий сахарный» вход в самых первых числах марта я дарю представительницам прекрасного пола к их празднику - международному Женскому дню 8 марта!

Вот график многолетних сезонных тенденций от сайта МРСИ:



Чтобы конкретизировать точку входа, разложим усредненный график спреда «по годам»:

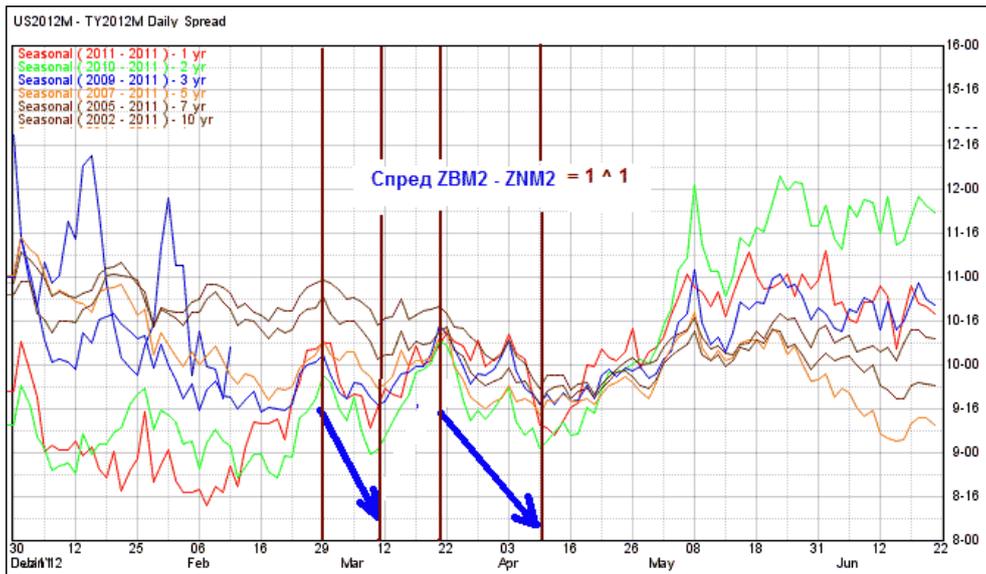




Реализуя продажу спреда (**SELL SBK2 – BUY SBN2**) с 1-2 марта и удерживая позиции до 1-2 апреля, мы с большой вероятностью получим при закрытии позиций прибыль до +60+80 пунктов по сахарной шкале. Пусть профит не так велик, как в иных сезонных входах, но (повторюсь) он интересен именно своей высокой надёжностью!

— — —

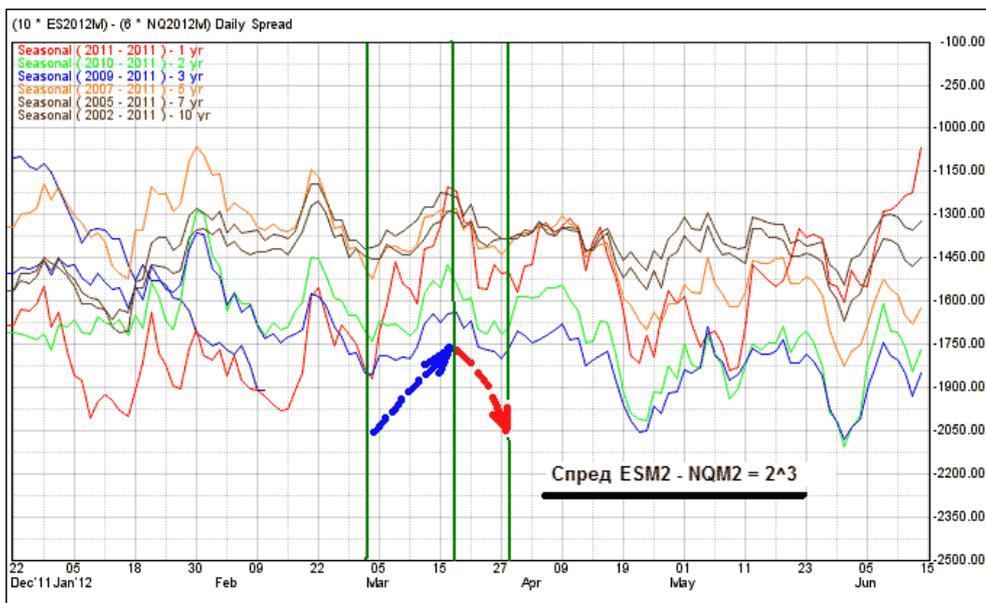
Ещё один интересный мартовский вход - по спреду американских бондов (30-10-ти летних облигаций) **ZBM2 – ZNM2 =1:1**. По статистике сезонного сайта МРСИ линия этого спреда снижается до середины апреля. Я же выделил бы на многолетнем сезонном графике два участка для продажи спреда - с последних чисел февраля до 10 марта и с 20 марта до 10 апреля (показано стрелками):



Еще раз напомню, что для лучшей балансировки позиций и для уменьшения риска по данному спреду в этом конкретном случае я рекомендую брать соотношение: **SELL ZBM2 – BUY ZNM2 = 2^3**. Предполагаемая прибыль будет немного меньше при таком соотношении, но риск при этом значительно уменьшается! Добавлю также, что в настоящее время в финансовом мире неспокойная и непростая ситуация, и, думаю, что прежде, чем входить в продажу, следует оценить фундаментальные перспективы индекса доллара **DXM2**, который имеет неплохую корреляцию с линией описанного выше спреда **ZB-ZN**.

— — —

Спред американских фондовых индексов **ESM2 – NQM2 = 2^3** (мини СР500 – мини Насдак) сезонно растет в первой половине марта и снижается во второй половине. Отмечу, что данный спред бывает капризным, и я обычно работаю по нему небольшими размерами!

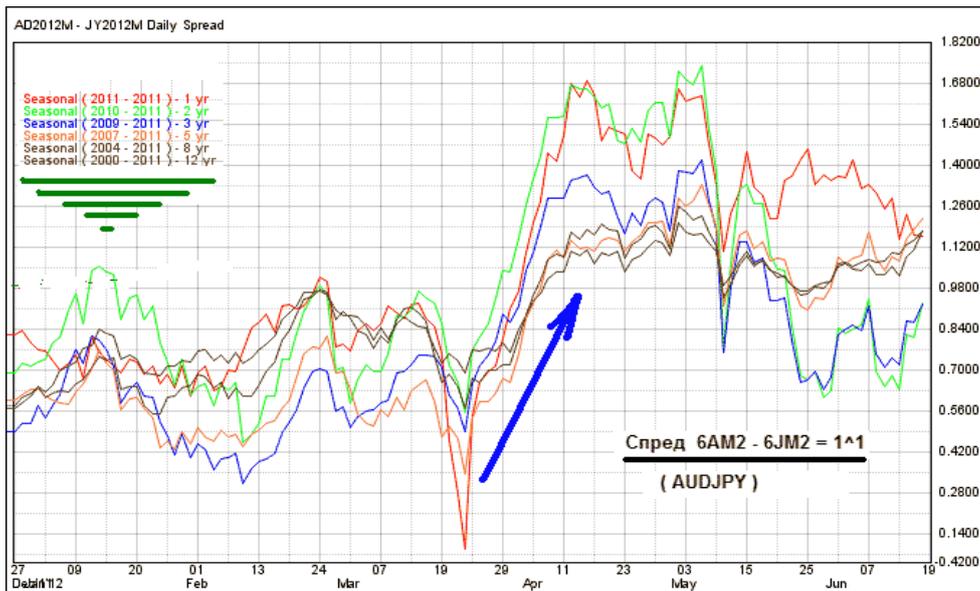


— — —

И, наконец, рассмотрим валютные спреды, как мы и обещали в самом начале статьи.

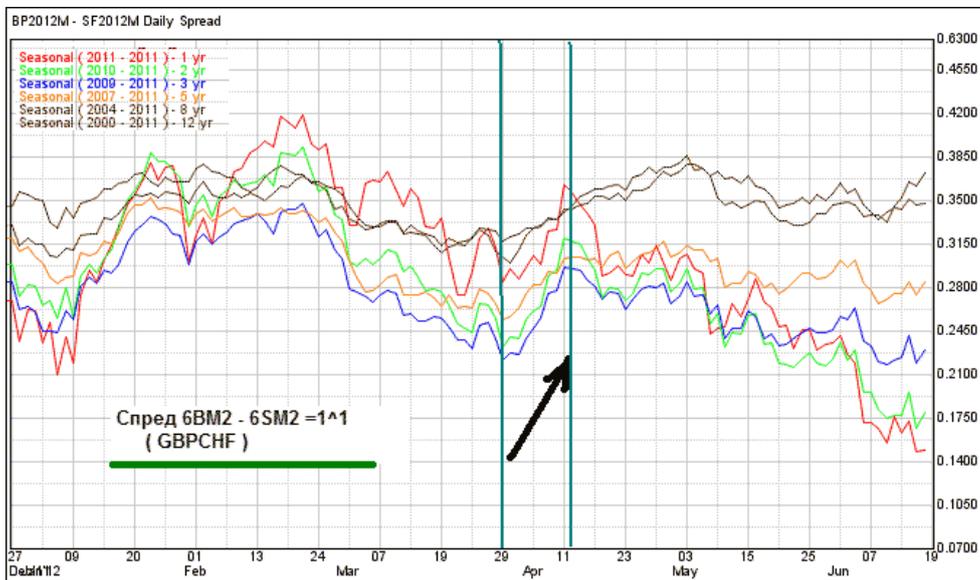
Спред **6AM2-6JM2=1^1** (австралийский доллар – японская йена) мы будем отслеживать по валютной паре **AUD/JPY** на таймфрейме Н1 после 20 марта средствами стандартного

технического анализа. И при первых признаках разворота - входим в покупку указанного спреда либо в покупку валютной пары **AUD/JPY**:



Держим покупку до конца первой декады апреля либо работаем средне- и краткосрочными Buy-сделками на откатах цены.

И еще один валютный спред, сезонный вход по которому традиционно считается достаточно надежным. Фунт - швейцарский франк, **6BM2 - 6SM2 = 1:1** отслеживаем по валютной паре **GBP/CHF** аналогичным образом с середины последней декады марта. При сигнале на рост цены (а таковой ожидается примерно с 28-29 марта) реализуем покупку спреда: **BUY 6BM2 - SELL 6SM2 = 1^1** либо покупку валютного кросса **GBP/CHF**:



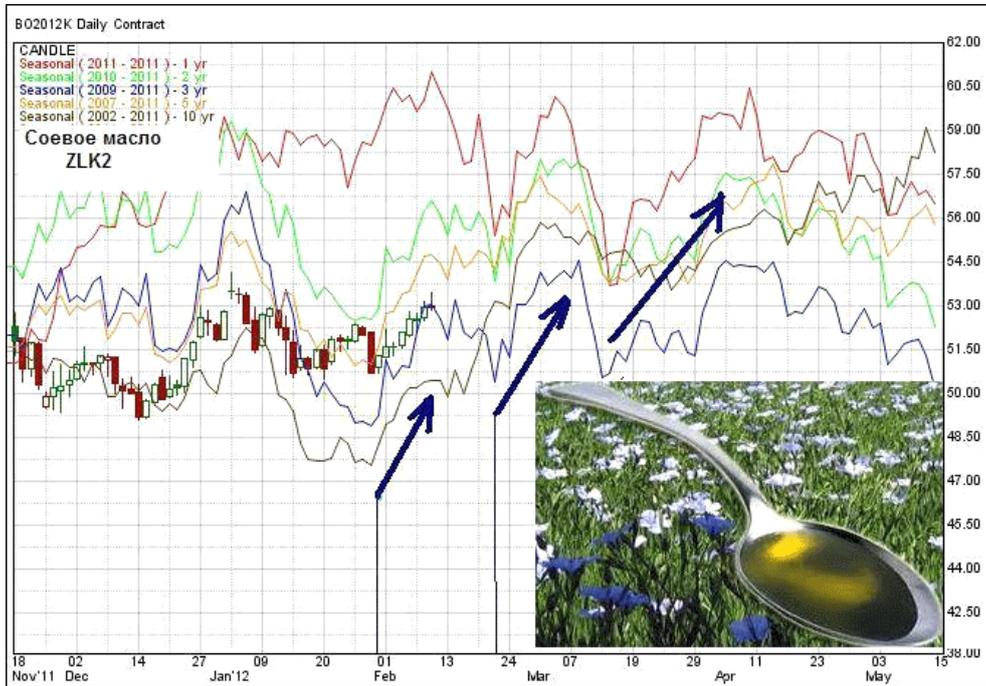
Работаем только в покупки средне- и краткосрочно на откатах цены, либо держим сделку долгосрочно до 10-12 апреля. Должен, однако, заметить, что, в связи с недавней привязкой курса швейцарского франка к европейской валюте, нужно в это время более внимательно просматривать текущую фундаментальную информацию от Национального банка Швейцарии.

С мартовскими спредами мы, наконец, закончили! Далее (если я ещё не притомил читателя), по установившейся традиции и в соответствии с пожеланиями читателей переходим к мартовским

ПРАКТИЧЕСКИЙ ТРЕЙДИНГ

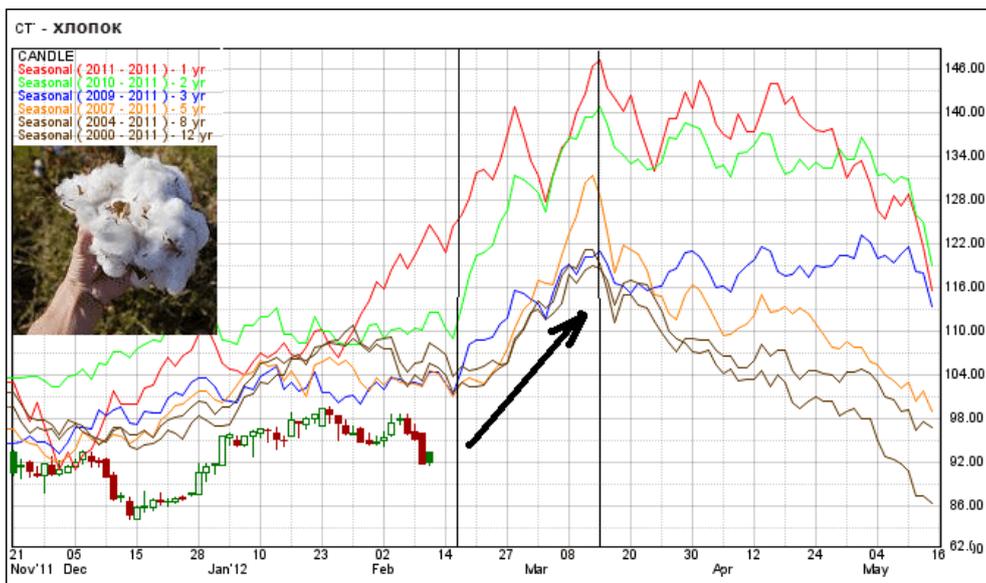
сезонным тенденциям отдельных инструментов товарного рынка.

В марте продолжается сезонный рост соевого масла **ZL**. Сезонность масла первой половины февраля отработала достаточно прилично (первая стрелка на графике). С 20-х чисел февраля начинается очередная волна роста, которая продолжается до 5-7 марта. И, наконец, после небольшой коррекции с 15-18 марта до 10 апреля пойдет заключительная **UP**-волна:



— — —

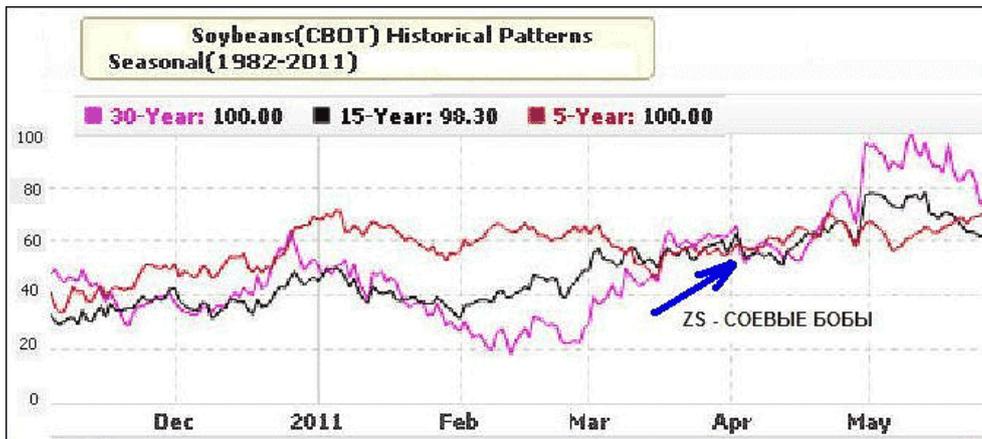
Хлопок **СТ** по сезонности растет с середины февраля до 10-12 марта. Инструмент волатильный, и я предполагаю в указанный период работать средне- и краткосрочно только в покупку на откатах цены:



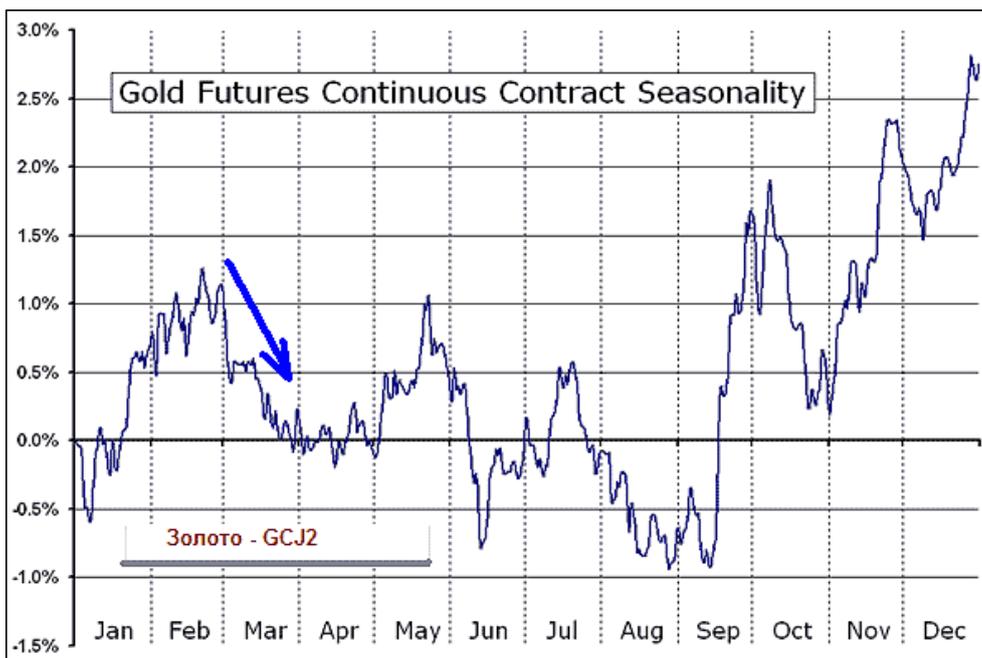
После 25 марта сезонный сайт МРСИ рекомендует вставить в продажи майского контракта хлопка **СТК2** до середины апреля.

— — —

Тот же сайт MPCSI дает статистическую рекомендацию на покупку соевых бобов **ZSK2** (майский контракт) с середины марта и до 27-го числа. Предполагаемый профитный потенциал составляет +\$540.00 на 1 контракт.



По статистике MPCSI, с 3 марта по 25 марта есть резон работать в продажи золота. 20-ти летний усредненный сезонный график представлен на рисунке ниже:



На этом мы заканчиваем очередной выпуск нашего цикла. До встречи в следующих номерах журнала!

Удачи всем! ■

Если у Вас возникли вопросы по этой статье, пишите – мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

Написать письмо



Инна Солнечная

Высшее экономическое образование. На рынке фьючерсов СМЕ с января 2009 года. Ведущая проекта Voltrading на сайте <http://eurtrader.org/>, а также автор нескольких вебинаров на сайте <http://www.speculant.org/>. Использует в торговле дискреционный подход, основанный на таких методиках, как определение уровней поддержек/сопротивлений, Прайс Экшн, ВСА и метод Вайкоффа, Объемный профиль рынка, футпринт и лента.

АНАЛИЗ ОБЪЕМОВ ФЬЮЧЕРСОВ И ЕГО ПРИМЕНЕНИЕ ПРИ ТОРГОВЛЕ НА ФОРЕКС

ЧАСТЬ 4.VSA: ПРИЗНАКИ СЛАБОСТИ

(начало см. №23-25 «Leprecon Review» <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jyrnala/>)

Многие трейдеры знают, что цены в прошлом не являются причиной движения цен в будущем. За движением цены всегда скрываются профессиональные деньги, то есть причиной движения цены является активность так называемых Умных денег, которая заключается либо в продажах, либо в покупках. И эту активность можно увидеть только через анализ объема на графиках, и делать это лучше на разных таймфреймах. По приблизительным подсчетам, около 85-90% объема на рынках принадлежит крупным фондам (таким как, например, фонд Джорджа Сороса), институциональным банкам (таким как Голдман Сакс) и профессиональным безымянным торговым синдикатам, подобным тому, в котором работал когда-то Том Вильямс, создатель метода торговли, о котором мы будем говорить сегодня. Объем сам по себе не показывает полной картины рынка, поэтому мы анализируем не только его, но и спред, либо диапазон баров и их закрытия.

Чтобы определить, что именно делают Умные деньги, надо обращать внимание на крайне-высокий объем и на крайне-низкий объем. Когда вы видите такой объем в правильном месте в контексте с фоном рынка, тогда он и является сигналом от Умных денег об их истинных намерениях.

Известный экономист Адам Смит несколько сотен лет назад предположил, что, когда предложение превышает спрос, цены снижаются, и наоборот. Любой рынок движется по закону спроса и предложения, а также отсутствия спроса и отсутствия предложения. Взаимодействие спроса и предложения, их дисбаланс вызывает активность, благодаря которой функционирует любой рынок. И, как говорилось ранее, мерой этой активности, доступной для нашего обозрения, является объем. Объем дает информацию об активности рыночных игроков на каждом отдельном баре. Если объем торгов большой, то мы можем быть уверены в том, что в данном баре на рынке оперировали Большие деньги. Если же объем маленький — то сделки совершались между мелкими трейдерами, а большие акулы отсутствовали.

Известный физик Исаак Ньютон в своих трех законах движения указал, что объект останется в движении, пока не встретится с равной или большей силой. Эти два простых, но блистательных принципа выдержали испытание временем и непосредственно отвечают за движение цены на рынках, где мы торгуем, потому что, если рынок идет вверх на крайне-высоком объеме, а в

результате появляются более низкие цены — ищите шорт. Почему шорт? Да потому что усилия цены идти вверх не дают результата — более высоких цен.

Методика Вайкоффа, часть которой мы рассматривали в прошлых статьях, была первоисточником для создания другой методики анализа объёма. Её название — VSA (далее BSA) или, в переводе на русский, Анализ Спреда и Объёма (Volume Spread Analysis). Том Вильямс является создателем этого метода торговли, он бывший синдикатный трейдер (трейдер хедж-фонда), вышедший в отставку в 40 лет, автор таких книг, как "Неописанные тайны, двигающие рынок акций" и "Хозяева рынков". Его компания «ТрейдГайдер» предоставляет трейдерам программу, которая генерирует сигналы слабости и силы рынка. BSA уделяет пристальное внимание именно анализу объёма (анализируется активность в баре), спреда (диапазон ценового бара), а также закрытия (ценовой уровень, на котором произошло закрытие ценового бара). Закрытие бара (см. рис. 1) является самым главным из всех трёх критериев анализа.

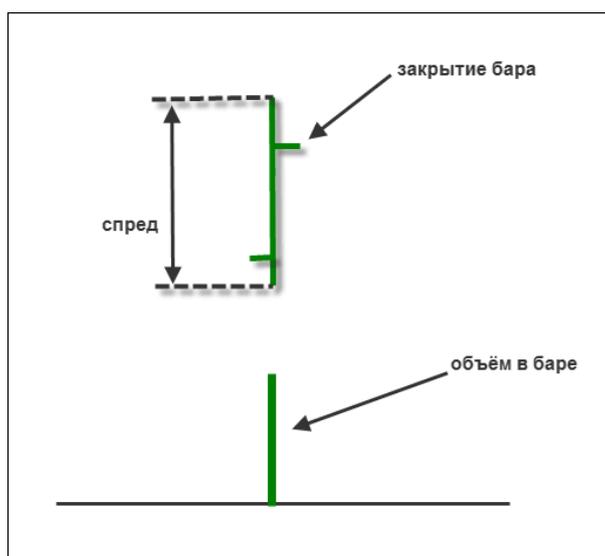


Рис. 1

Закрытие может произойти либо в нижней половине спреда, либо в верхней, либо посередине, и, в зависимости от этого, бары классифицируются следующим образом:

1. ап-бары — бары с закрытием выше, чем в предыдущем баре (см. рис. 2).

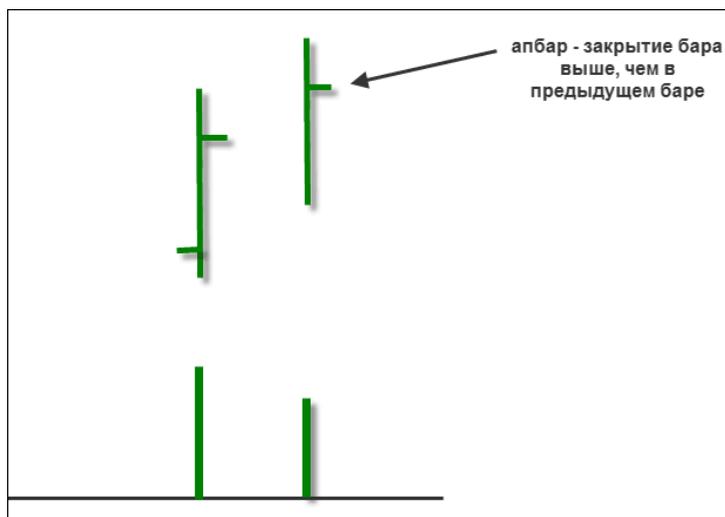


Рис. 2

2. даун-бары — бары с закрытием ниже, чем в предыдущем баре (см. рис. 3).

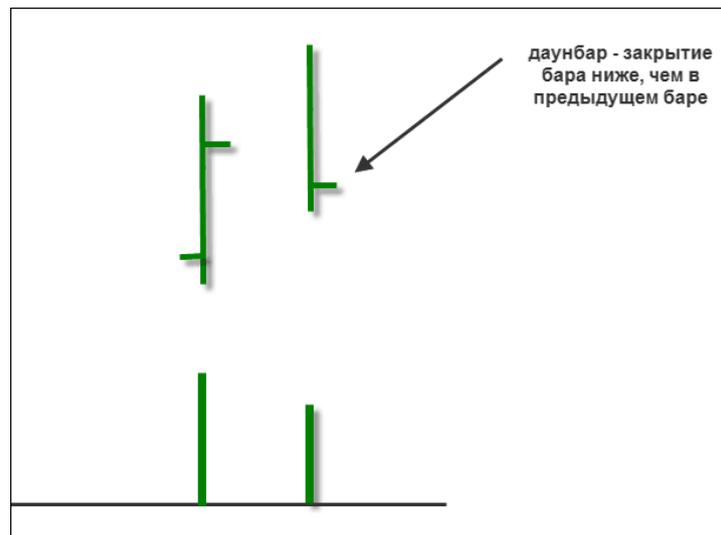


Рис. 3

3. левел-бары — бары с закрытиями на одном ценовом уровне (см. рис. 4).

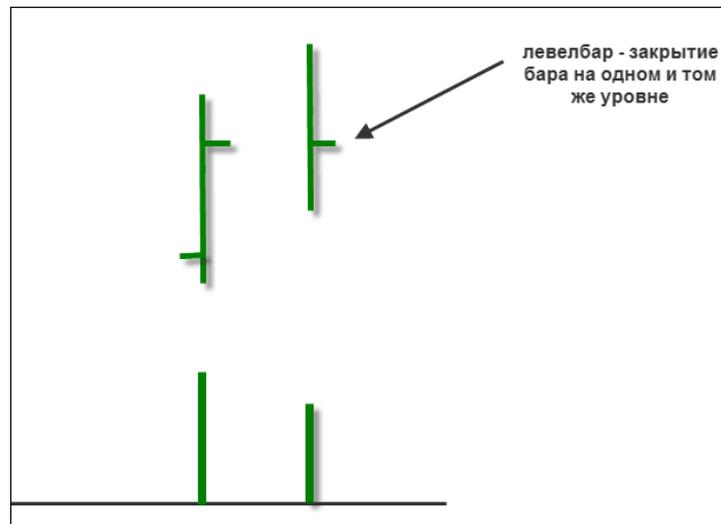


Рис. 4

Спреды также делятся на категории и анализируются в сравнении с предыдущими барами. Они бывают:

1. Широкими;
2. Узкими;
3. Средними.

Объёмы классифицируются на:

1. Низкие;
2. Крайне-низкие;
3. Средние;
4. Высокие;
5. Крайне-высокие.

Как и в случае со спредами, объёмы анализируются в сравнении с объёмами в предыдущих барах.

Как уже говорилось ранее, объём - это активность рынка. Мы заинтересованы в объёме, потому что он говорит нам о консенсусе мнений среди Умных денег. Спред бара - его диапазон от верха до низа - и закрытие по отношению к предыдущим барам, появившимся ранее, подтверждают наш вход и дают нам возможность брать высоковероятностные сетапы.

Итак, из всего вышесказанного можно сделать следующий вывод:

рынок работает, потому что у людей есть две сильные эмоции, которые очень трудно контролировать — это страх и жадность. Вся необходимая информация для успешной торговли появляется на графиках в реальном времени, и всё, что мы должны уметь - это анализировать спрос и предложение.

сетапы в шорт на основе метода ВСА.

Сначала ответим на вопрос, какой же объём самый важный на графиках и почему?

Как вы уже догадались, крайне-высокий объём является самым важным, потому что он очень часто указывает на вершину или дно рынка и даёт нам заблаговременное предупреждение о том, что толпу заманивают в ловушку.

Одно из главных правил ВСА гласит о том, что слабость появляется на графиках на ап-барах (на барах, в которых закрытие выше, чем в предыдущем баре) на крайне-высоком объёме, а впоследствии подтверждается на ап-барах на крайне-низком объёме.

Одним из основных признаков слабости является Кульминация покупок. Это ап-бар на широком спреде с закрытием в середине или ниже на крайне-высоком объёме. Это очень сильный признак слабости, если слева от его возникновения отсутствуют предыдущие зоны сопротивления, то есть если цена делает новые максимумы. Когда рынок изо дня в день продолжает двигаться вверх, в какой-то момент будет достигнут такой уровень цен, где те, кто продал преждевременно или те, кто сидят без позиции, больше не смогут выдержать постоянно повышающихся цен. Ажиотаж при покупках даёт отличную возможность торговым синдикатам и маркетмейкерам разгрузить большое количество актива по более высоким ценам без снижения цены в результате их активности. Бар Кульминации покупок указывает на вершину рынка.



Рис. 5

Давайте посмотрим, что показывали графики весной 2011 года, за неделю до падения на рынке серебра (см. рис. 6).

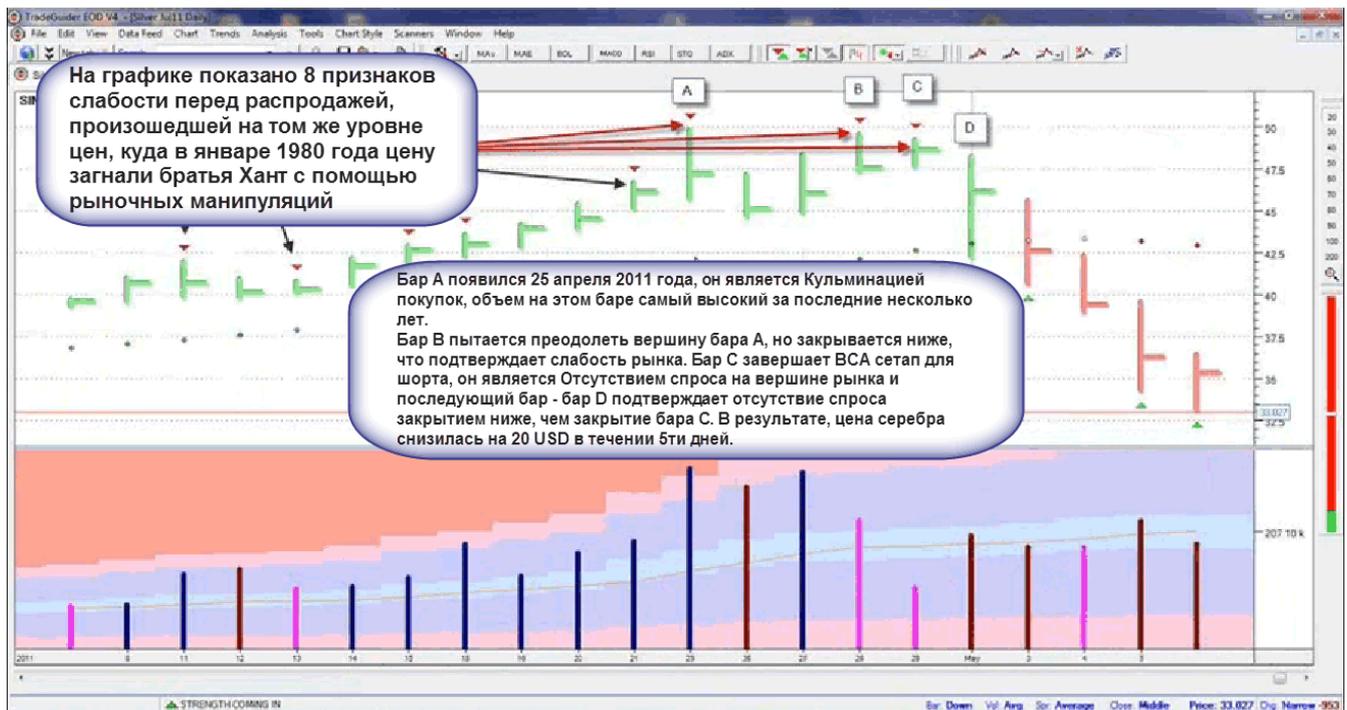


Рис. 6

Как мы видим, стали появляться признаки слабости. Эти признаки появляются во время движения рынка вверх. Самое главное в чтении графиков — это интерпретация объёма, потому что объём является отражением активности Умных денег. Так как активность проявляется в объёме, то тут на графике вы видите, что наибольший объём возник на баре А. Для серебра — это был огромный объём, наибольший за последние несколько лет. Также мы видим, что спред бара или диапазон бара от вершины до низа — тоже самый широкий за последние несколько десятков баров, но закрытие произошло в нижней части диапазона. Исходя из того, что объём — это активность профессионалов, а закрытие отражает консенсус сил между покупателями и продавцами, то нам сразу становится ясно, что они продают. Если это было бы наоборот, то закрытие цены произошло бы вверх.

Итак, далее появляются бары В и С, которые являются подтверждениями продаж. Это не значит, что вы сразу должны шортить, потому что фаза дистрибуции или распределения актива может продолжаться на протяжении нескольких дней, а может и затянуться на несколько недель или месяцев. В этом случае, бар С на низком объёме, возникший на том же уровне цен, что и бар А и В, подтвердил, что продавцы доминировали в баре А, потому что на баре С объём совсем низкий, то есть, иными словами, активность Больших денег отсутствует, они не покупают на этих уровнях, они продали уже раньше. В методике ВСА есть принцип под названием «Отсутствие спроса». Этот признак Отсутствия спроса появляется после Кульминации покупок, и если вы видите такую комбинацию, то вы понимаете, что Умные деньги продали, и сейчас пришло время шортить вместе с ними.

Когда вы видите крайне-высокий объём на ап-баре, то знайте, что толпу заманивают в ловушку. Она покупает на вершине рынка, а Умные деньги в это время кроются и шортят. Если вы замечали, то вершина рынка всегда совпадает с отличными новостями по всему фронту. Ваши соседи, родители, друзья, далекие от рынка, все хором говорят, что пора покупать, потому что вскоре цена улетит в небеса — как раз на таком настроении толпы происходят развороты.

И как мы видим на графике (см. рис. 7), цена упала довольно сильно после возникновения таких признаков слабости, как Кульминация покупок и Отсутствие спроса. Эти признаки привели к снижению цены и перемене тренда. На баре А (см. рис. 7) возникло Отсутствие спроса, там же мог осуществляться вход в шорт, а следующий бар с закрытием ниже подтвердил намерения рынка идти вниз.



Рис. 7

Кульминации покупок появляются на всех рынках и на всех таймфреймах. Если вы наблюдаете появление Кульминации покупок на минутном графике, то в результате движение вниз будет намного более краткосрочным, в сравнении с движением, которое может произойти после того, как вы увидели Кульминацию покупок на недельном графике того же самого актива. Как мы уже знаем, Вайкофф говорит о том, что рынок движется от одной фазы к другой, и при рассмотрении графиков вы увидите, что так и есть. Очень важно знать, в какой фазе рынка находится актив, который вы торгуете. Потому что, когда появляется Кульминация покупок, вы можете предполагать, что начинается фаза распределения. Для того чтобы Умные деньги могли распределить актив, толпа должна покупать на новых вершинах рынка. Настоящая Кульминация покупок должна появляться на новых высотах на том уровне, где цена не была 500 баров и более назад в любом из таймфреймов. Но также не стоит игнорировать и те Кульминации покупок, которые появились в течение 500 баров движения цены, потому что это всё равно считается сильным признаком слабости.

Как и во многих сетапах ВСА, вы должны ждать подтверждения перед тем, как открывать сделку. Это требует терпения. После появления Кульминации покупок рынок всё еще может идти вверх, даже несмотря на то, что начались продажи Умных денег. И это происходит из-за инерции рынка. Очень часто рынок сразу не падает, а начинает торговаться в боковике. Потом, когда начнется формирование тренда вниз, вы будете видеть дополнительные доказательства распределения. Но помните, что эти признаки распределения будут появляться на ап-барах при попытках рынка подняться выше в тренде вниз.

Рассмотрим пример появления Кульминации покупок на более низком таймфрейме на 15-минутном графике фьючерса на евро (см. рис. 8). После Кульминации покупок в пункте А активу потребовалось несколько часов времени для того, чтобы начать падение. Возможности агрессивного шорта появляются в пункте В, а более консервативного шорта - в пунктах С и D. Тут мы видим примеры возникновения Аптраста и баров Отсутствия спроса.

Обратите внимание на два бара в красном прямоугольнике — это движение цены очень важно, потому что оно также подтверждает слабость. Важно то, что мы видим это движение

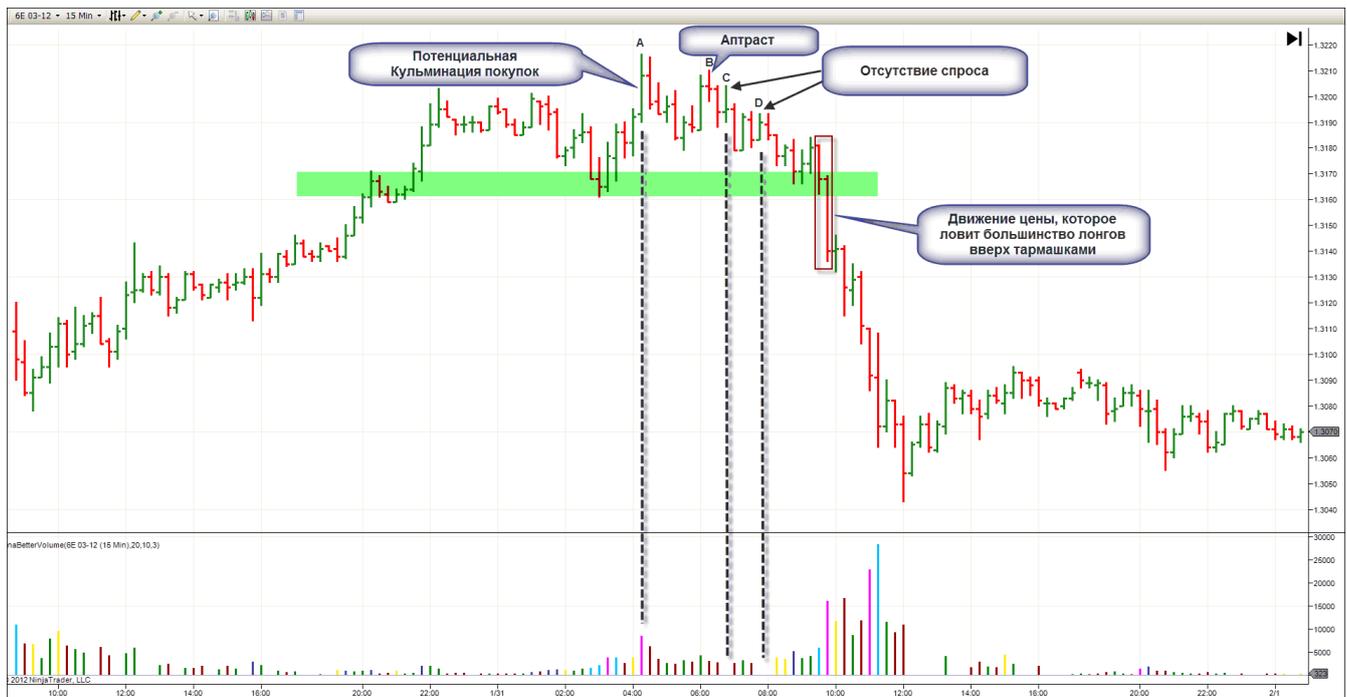


Рис. 8

после бара Кульминации покупок, и оно на широком спреде пробивает всю зону цен, которая раньше служила поддержкой на протяжении предыдущих нескольких часов. Это движение ловит большинство трейдеров, открывших позиции лонг, в западню.

Так как уже упоминались такие признаки слабости, как Аптраст и Отсутствие спроса, то рассмотрим и их.

Аптраст может появиться на крайне-высоком объёме, на высоком объёме, на среднем объёме и на низком объёме. Цель Аптраста - выбить стопы тех, кто уже в шорте на слабом рынке, а также вовлечь покупателей, которые видят быстрое повышение цены и спешат открыть позицию лонг. Очень часто трейдеры, торгующие на пробой, бывают пойманы в ловушку Аптрастами, потому что обычно они появляются на важных уровнях, таких как пивоты и уровни сопротивления.

Наиболее высоковероятностный сетап в шорт возникает тогда, когда вы видите Аптраст на крайне-высоком объёме после того, как возник такой серьёзный признак слабости, как Кульминация покупок. Аптрасты на 15-минутном графике евро (см. рис. 9) возникли на высоком и крайне-высоком объёме. Так как эти Аптрасты возникли на крайне-высоком объёме, то возросла вероятность более длительного движения вниз. Когда описывается кульминационный объём, то это означает, что и Умные деньги, и толпа (то есть все) вовлечены в движение, и тем самым создается крайне-высокий объём.

Когда крайне-высокий объём появляется на графике, то очень часто он ознаменует разворот тренда или откат в тренде. Поэтому надо обращать внимание на появление крайне-высокого объема, потому что может появиться отличная вероятность заработка.

В пункте А и В (см. рис. 9) возникли так называемые Скрытые Аптрасты, потому что закрытие данных баров произошло ниже, чем закрытие предыдущего бара. Они называются скрытыми также потому, что находятся в теле предыдущего бара. Но, тем не менее, оба этих Аптраста находятся в правильном месте.

Что мы подразумеваем под правильным местом? Просто очень часто в тренде вверх, когда на фоне присутствуют признаки силы, мы будем видеть появление Аптрастов. Эти отдельные бары будут выглядеть как бары в пунктах А и В (см. рис. 9). Однако если на фоне есть признаки силы, то тогда аптраст будет в неправильном месте. Для открытия шорт-позиции, когда появляется

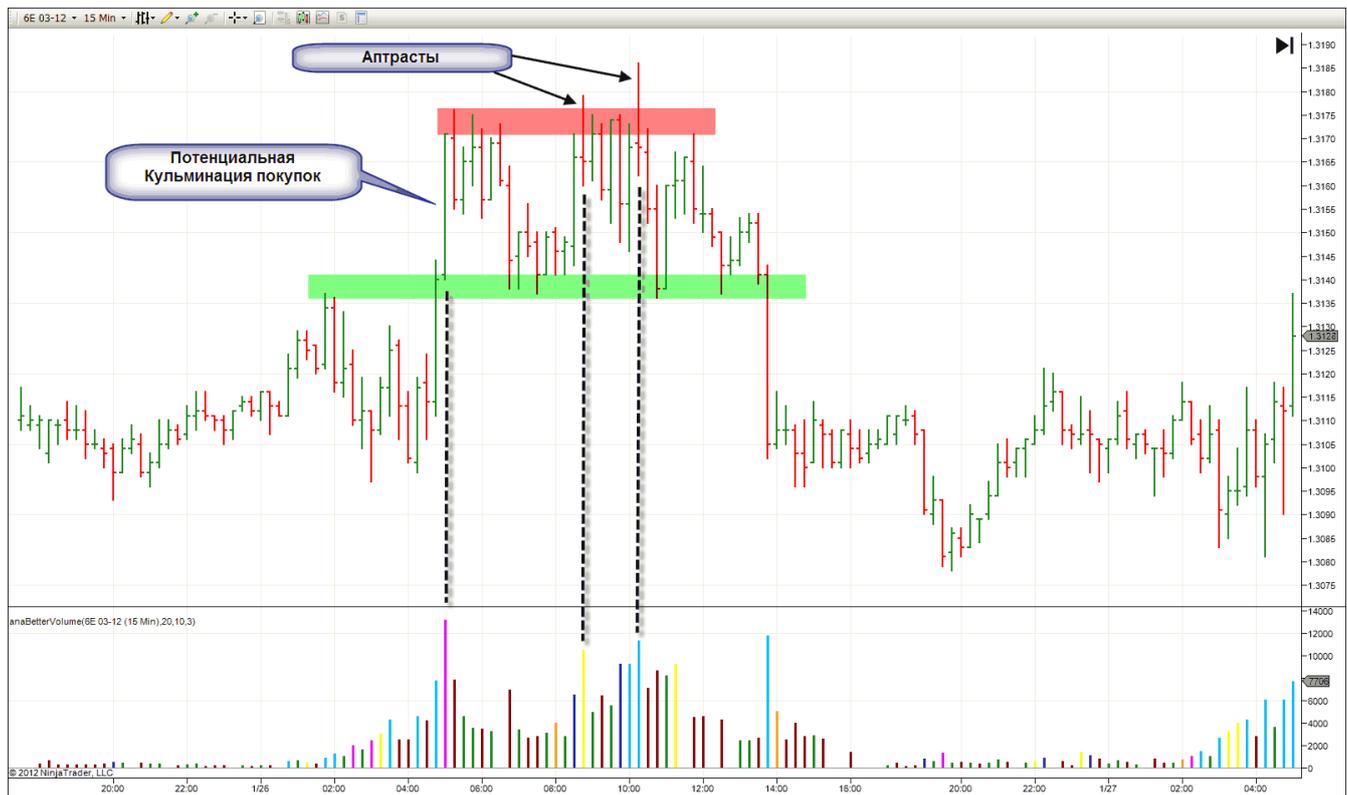


Рис. 9

Аптраст, вы должны видеть на фоне признаки слабости, а не силы.

Теперь немного коснёмся баров Отсутствия спроса.

Существует 3 типа баров Отсутствия спроса:

- Отсутствие спроса в тренде вверх — не является подтверждением медвежьего настроения на рынке;
- Отсутствие спроса в тренде вниз — является подтверждением чрезвычайного медвежьего настроения на рынке;
- Отсутствие спроса на вершинах рынка — является подтверждением медвежьего настроения на рынке.

Лучшее место для шорта возникает тогда, когда вы видите бар Отсутствия спроса в тренде вниз, особенно если на фоне имеются какие-либо кульминационные действия, подобные Кульминации покупок. Итак, бар Отсутствия спроса - это ап-бар с узким спредом на объёме, меньшем, чем в двух предыдущих барах. Он означает Отсутствие спроса со стороны профессиональных денег. Очень важно, чтобы данный принцип был именно ап-баром, баром закрытие которого выше, чем закрытие предыдущего бара. После того, как вы увидели бар Отсутствия спроса, то по методу ВСА не следует продавать по рынку, а следует поставить селл-стоп под минимумом этого бара. Это будет означать, что рынок сам придёт к вам, и откроется позиция в шорт. В этом случае вы не будете пересидеть в позиции ситуацию, при которой рынок будет продолжать движение вверх на последующих барах Отсутствия спроса. Иногда после бара Отсутствия спроса может последовать также и Аптраст, поэтому, если вы уже в позиции, то можете оказаться в затруднительном положении.

Отсутствие спроса в методе ВСА значит, что отсутствует интерес со стороны Умных денег в более высоких ценах на том таймфрейме, на котором вы его увидели. Многие из баров Отсутствия спроса требуют подтверждения, и подтверждение появляется, когда следующий бар закрывается ниже, чем сам бар Отсутствия спроса.

Рассмотрим краткосрочный таймфрейм — 15-минутный график евро (см. рис. 10). Здесь мы видим бары Отсутствия спроса, которые возникли в правильном месте. Мы видим предложение на рынке (Кульминацию покупок), последующие Аптрасты на высоком объеме, после которых следует ап-бар Отсутствия спроса в пункте А, который подтверждается следующим баром с закрытием ниже. Также ещё один бар Отсутствия спроса возникает в пункте В, после которого следует движение цены вниз.

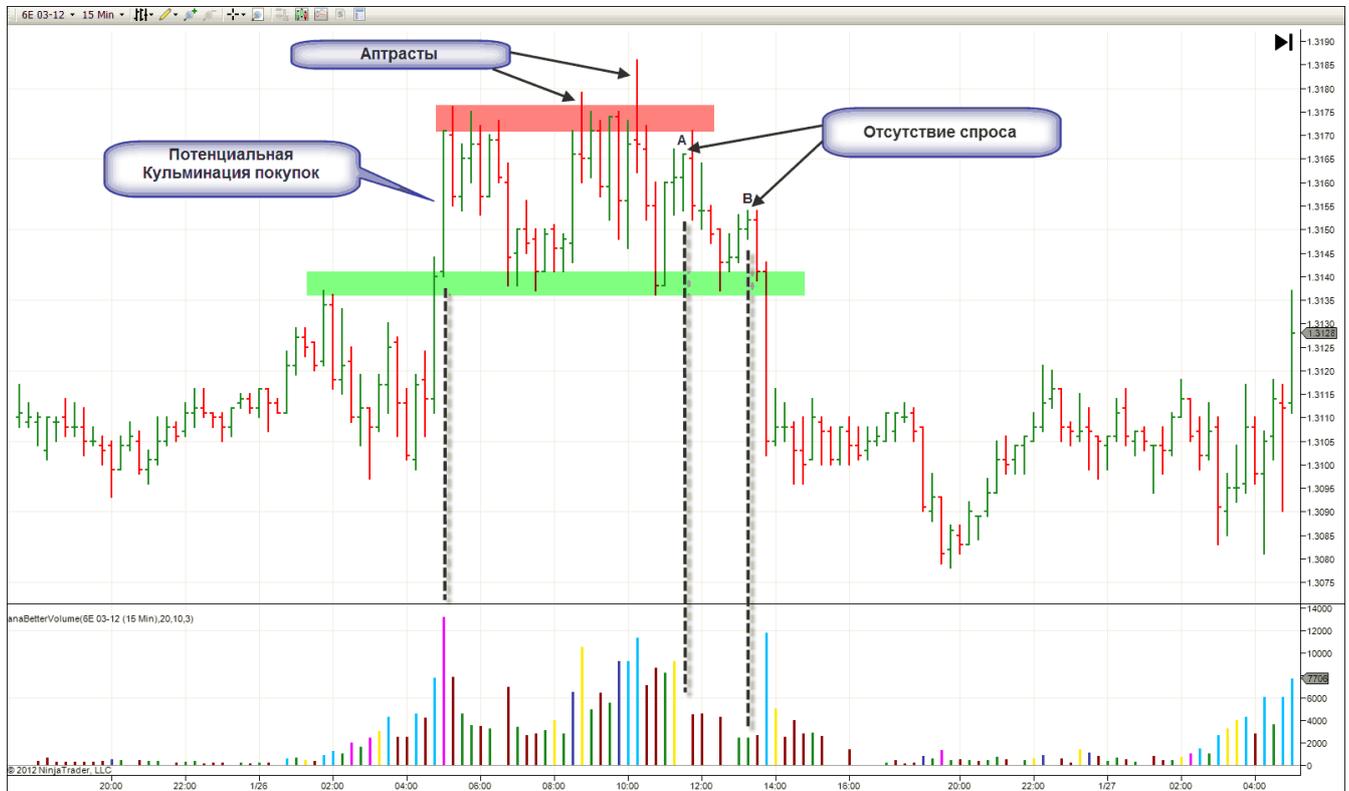


Рис. 10

Итак, сегодня мы затронули несколько признаков слабости, и в заключение хотелось бы упомянуть несколько советов от создателя данного метода Тома Вильямса, касающихся того, на какие вопросы нужно себе ответить перед входом в позицию шорт:

- Видели ли вы изменение в направлении рынка? Находится ли он в начальной стадии тренда вниз или еще в тренде вверх?
- Падает ли рынок без особого противодействия со стороны Умных денег?
- Является ли минимум каждого из баров ниже предыдущего?
- Находится ли цена на совсем новых максимумах, когда начинается распределение актива?
- Есть ли какой-то флетовый участок рынка слева?
- Много ли звучит хороших новостей об определенном рынке?
- Находится ли рынок в зоне перекупленности трендового канала?
- Присутствует ли бар Кульминации покупок на фоне?
- Входите ли вы на даун-баре или на ап-баре? Помните ли вы то, что слабость появляется на ап-барах?

На этом сегодня всё, а в следующей статье рассмотрим более подробно признаки силы по методу ВСА, которые создают условия для входа в позицию лонг. ■

*В статье использованы следующие материалы:
обучающие материалы компании ТрейдГайдер,
графики программ ThinkorSwim, NinjaTrader и TradeGuider.*

Если у Вас возникли вопросы по этой статье – пишите, мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

Написать письмо





Компания «RSQForex» представляет цикл обучающих статей
«ФОРЕКС ДЛЯ ВСЕХ»

ЧАСТЬ 10.

ОБЗОР ТОРГОВЫХ ПЛАТФОРМ

(начало см. №16-25 «Leprecon Review» <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jyrnala>)

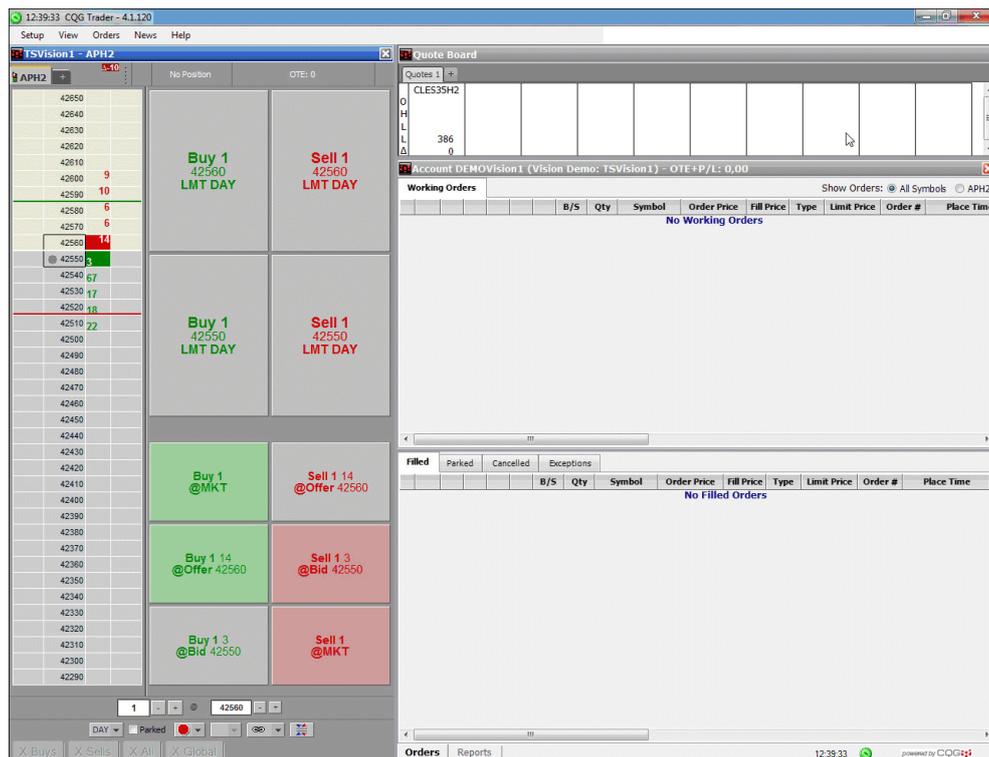
Приветствуем читателей! В предыдущем выпуске мы познакомились с процессом автоматизации торговых систем. Сегодня мы рассмотрим существующие торговые платформы.

Наверное, не найдется такого трейдера, который никогда не задавался бы вопросом о том, какую торговую платформу выбрать?

Все мы являемся свидетелями той эпической пиар-битвы, которая развернулась на просторах Интернета между создателями различных торговых платформ. Данная статья призвана помочь Вам, наши дорогие читатели, сделать правильный выбор.

Онлайн торговая платформа – это компьютерное программное обеспечение, которое предоставляется банками, брокерами и другими финансовыми институтами, предлагающими торговые услуги на финансовых рынках. Все они имеют свои функции, позволяющие Вам организовывать и вести торги так, чтобы они приносили Вам прибыль.

1. CQG



CQG — это прямой доступ на международные биржи CME, CBOT, NYMEX, ICE, EUREX. Торговые терминалы **CQG Trader** покорили авторитетных трейдеров скоростью и надежностью. CQG доставляет данные в реальном времени в среднем в пределах 10 миллисекунд. У CQG более чем 450 сотрудников по всему миру с офисами для поддержки клиентов в Чикаго, Нью-Йорке, Денвере, Гленвуд Спрингсе, Лондоне, Франкфурте, Токио, Сиднее, Сингапуре, Москве и во всей Восточной Европе. CQG предоставляет рыночные данные и ISV-услуги почти в шестидесяти странах мира. В одном терминале доступен широкий спектр инструментов (фьючерсы, опционы, индексы, биржевые и синтетические спреды).

CQG более четверти века поставляет котировки мировым банкам, инвестиционным компаниям, брокерам и другим крупнейшим участникам финансового мира. Обладая собственной инфраструктурой, компания получает котировки от бирж напрямую, без посредников, а мониторинговые центры следят за котировками 24 часа в сутки.

В стакан CQG котировки идут через протокол FIX/FAST — признанный мировой стандарт обмена финансовой информацией.

CQG имеет возможность предоставить внутриденные данные за 9 лет, что является важным для проведения полноценного анализа.

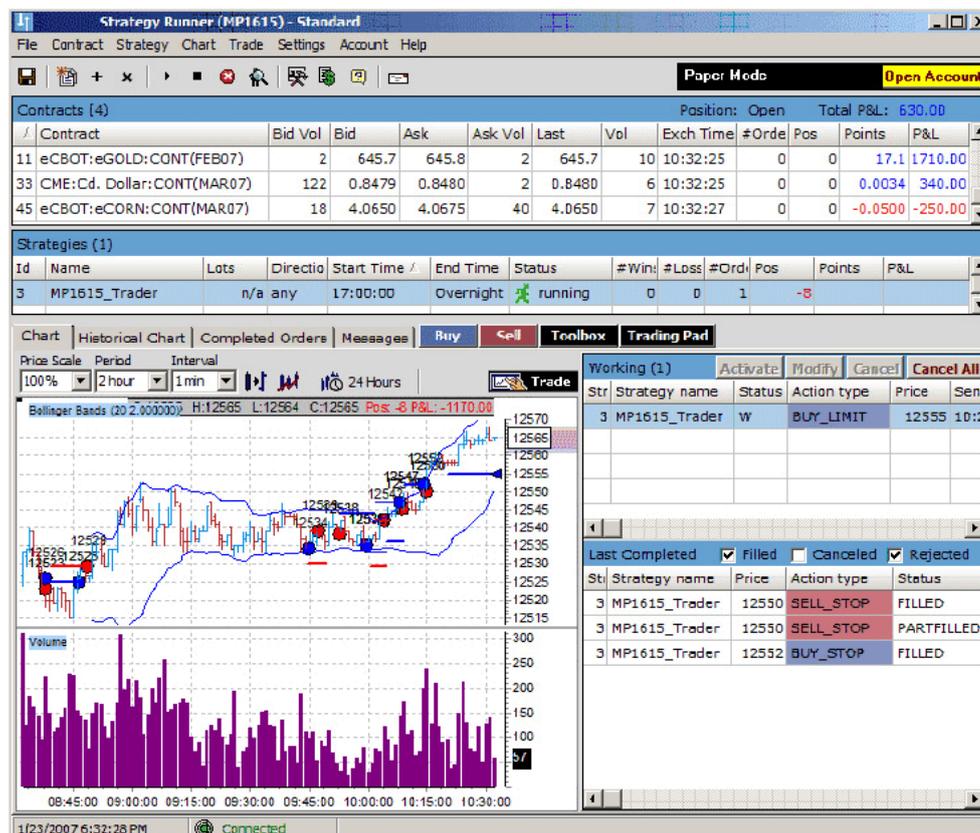
Для кого:

CQG — это оптимальные терминалы для профессиональных трейдеров, как для инвесторов, так и для скальперов, которые:

- предпочитают работать на биржевом рынке;
- используют инновационные технологические решения;
- ценят молниеносное исполнение приказов;
- предпочитают прозрачные котировки.

2. STRATEGY RUNNER

Strategy Runner представляет собой лидирующую торговую платформу на международном рынке фьючерсов и обладает многочисленными возможностями технического анализа и автоматической (алгоритмической) торговли.



Главное преимущество – это серверное решение Strategy Runner, благодаря которому стратегия пользователя выполняется не на его компьютере, а на сервере у брокера, что гарантирует высокую надежность и качество исполнения. Со своего терминала пользователь может следить за работой стратегии, видеть все ее транзакции, контролировать состояние счета. Пользователь всегда может отключить стратегию, и она перестанет работать.

Strategy Runner обеспечивает прямой доступ на лидирующие биржи, такие как NYMEX, COMEX, CME, CBOT, ICE, EUREX, LIFFE, ECX, HKEX, SGX и другие.

Технические преимущества платформы Strategy Runner:

- **Скорость:**

Strategy Runner исполняет ордера через сервер компании, что обеспечивает моментальность и защиту от разрыва соединения. Это означает, что все транзакции, сгенерированные стратегиями, выполняются быстро и качественно, не зависимо от работы Интернета и самого компьютера.

- **Простота использования:**

Подходит как для начинающих, так и для профессиональных трейдеров. Интерфейс в стиле Windows с использованием двойного клика, правой кнопки мыши, перетаскивания и т. д.

- **Полный набор графиков:**

Программа способна отображать графики котировок в реальном времени или на основе исторических данных (неограниченное число окон с графиками, полностью настраиваемое визуальное оформление), а также содержит обширный набор индикаторов технического анализа (40 полностью настраиваемых индикаторов технического анализа, распределенных по категориям, с возможностью занесения в Избранное).

- **Трейдинг на графиках:**

Интуитивно понятный способ ввода ордера прямо на графике. Одного нажатия кнопки мыши достаточно для отмены ордера или его изменения путем простого передвижения по графику.

- **Управление ордерами:**

Strategy Runner содержит целый арсенал инструментов управления ордерами, от ордеров с bracketами до скользящего стопа, продвинутых стратегий скейл-аут и т. д. Множество типов ордеров: Market, Limit, Stop, Stop Limit, Stop Conditional, Stop Limit Conditional, MIT. Возможность исполнения Market, Stop и Limit ордеров в «умном» (Smart) режиме, что позволяет минимизировать потери из-за проскальзывания текущей цены.

- **Портфельный трейдинг:**

Уникальная технология позволяет Вам выбирать и использовать неограниченное число стратегий сразу на нескольких контрактах.

- **Открытый API:**

Открытый для использования API позволяет Вам как с легкостью адаптировать существующие алгоритмы, так и создавать собственные. Поддерживаются программные языки Java, Visual Basic, C, C++.

3. VISIONQST

Единственная платформа, отобранная и представляемая биржей CME (CME Group) как собственный фронт-энд для доступа на биржевые торги - это VisionQST (Quick Screen Trading).



Торговая платформа ориентирована на результат и позволяет совершать сделки практически из любого окна приложения. Возможность торговать по системе "один клик" сочетается в **VisionQST** с продвинутым интерфейсом управления счетом, включая доступ к нескольким счетам.

На сегодняшний день API (Application Programming Interfaces) торгового терминала VisionQST позволяет устанавливать соединение со следующими биржами: Eurex, USFE, Euronext (Liffe), Euronext (Matif), iTOPS, CME iLink (GLOBEX), eCBOT, CBOT Order Direct, NYMEX, NYBOT, One Chicago, TOPS, ICE, NYBOT ICE.

Основные преимущества торговой платформы VisionQST:

- Трейдинг из любого окна терминала;
- Торговля в "один клик";
- Улучшенные возможности выставления/модификации ордеров;
- Полностью настраиваемое рабочее пространство трейдера;
- Работа с графиками: широкий спектр индикаторов с возможностью построения собственных;
- Улучшенная функциональность при торговле опционами: real-time отображение параметров контракта, волатильностей и греков;
- Расширенные возможности риск-менеджмента;
- Мобильный рабочий стол позволяет трейдерам подключаться к торгам с любого компьютера и получать доступ к своим сохраненным настройкам рабочего окружения;
- Соединение с приложением "Excel" в режиме реального времени.

4. NINJA TRADER

Ninja Trader – это скорее не торговый терминал, а сложная структурированная биржевая программа с огромным количеством функций.

БИРЖЕВОЙ ЛИКБЕЗ



Эта торговая система подключается напрямую к различным биржевым площадкам, что позволяет исключить любое влияние посредников на торговые операции. Таким образом, на исполнение ордеров влияют только активность трейдера и ликвидность актива.

Особенностями Ninja Trader, на которых нужно сосредоточить отдельное внимание, являются SuperDOM и Level II. Первый инструмент – это так называемый биржевой стакан, который позволяет проводить постоянный мониторинг реальных предложений о покупке/продаже активов с учетом изменения спроса и предложения на рынке. В этом окне можно сразу выставить ордер.

Level II – это инструмент, который позволяет видеть все ордера трейдеров, но только те, что расположены на определенном расстоянии от текущего уровня цены. Эта функция интересна как скальперам, так и другим типам трейдеров, целью которых является исполнение собственных крупных заявок по самой лучшей цене.

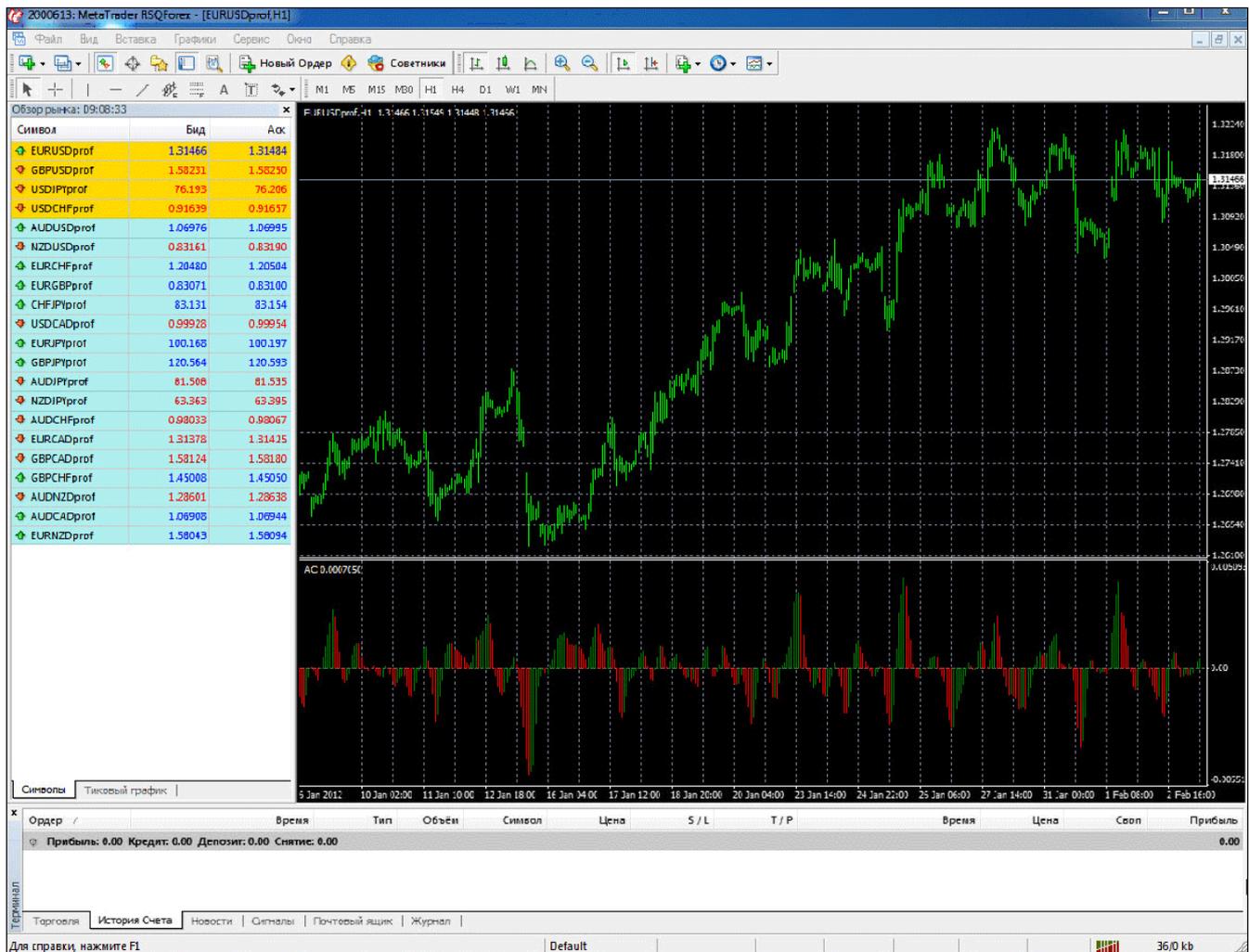
К дополнительным возможностям Ninja Trader можно отнести:

- Поддержку 24 часа в сутки;
- Возможность бесплатной работы с демо-счетами;
- Использование трейлинг-стопов и автоматических безубытков;
- Применение таких инструментов, как Level II, SuperDOM, Bracket Orders и т.д.;
- Возможность автоматизации торговых операций;
- Простота разработки своих стратегий и скриптов.

5. METATRADER 4

Для тех, кто работает на Форекс, важно всегда быть в курсе событий (отслеживать новости, видеть движение цены), чтобы вовремя предпринять необходимые действия по управлению своим торговым счетом.

MetaTrader 4 как нельзя лучше подходит для таких трейдеров.



Данная платформа имеет много достоинств, но мы не будем перечислять все мелочи вплоть до простоты и интуитивности интерфейса. Остановимся на главном:

- Это единственная из платформ, по-настоящему предоставляющая полноценный технический анализ, благодаря множеству встроенных индикаторов и линейных инструментов. Поддержка различных временных периодов позволяет строить графики любой продолжительности. Выбор тех, кто зарабатывает умом, а не полагается на интуицию и удачу;
- Встроенный язык программирования торговых стратегий MetaQuotes Language 4 позволяет писать собственные программы и совершенствовать платформу под индивидуальные запросы. Программирование собственных торговых стратегий. Создание уникальных индикаторов и скриптов;
- Многообразие технологий исполнения ордеров: Instant Execution и Request Execution;
- Экспорт котировок в реальном времени через DDE;
- Высочайшая степень защиты информации. Передача данных между клиентским

терминалом и торговым сервером Компании при совершении торговых операций производится с использованием 128-битного ключа шифрования.

— — —

В заключение добавим, что RSQForex предоставляет своим клиентам доступ как ко всем упомянутым платформам (CQG, Strategy Runner, VisionQST, Ninja Trader, Meta Trader 4), так и к другим платформам, таким как: eSignal, MultiCharts, Trade Navigator и другим.

Подробнее

Надеемся, что данная статья поможет Вам сделать информированный выбор торговой платформы при работе на финансовых рынках.

До скорых встреч!

Red Squirrel Investments Group Ltd

Продолжение следует...

Если у Вас возникли вопросы по этой статье – пишите, мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

Написать письмо



RSQ FOREX
ПЕРЕХОДИ НА НОВЫЙ УРОВЕНЬ!

- Плавающие спреды от 0.4 пункта
- Моментальное исполнение ордеров
- Прямой доступ к ECN Integral
- Скальпинг и автоматическая торговля



Радик Шамсутдинов

Врач-психиатр. Торгует на Форекс с 2006 года. С 2010 года перешел на торговлю опционами (срочная секция РТС). В последние полгода тестирует стратегии торговли волатильностью.

ТОРГОВЛЯ ОПЦИОНАМИ (Часть 3)

(начало см. №24-25 «Leprecon Review» <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jyrnala/>)

Перед тем, как идти дальше, давайте резюмируем то, что мы уже узнали:

Опцион – контракт.

У него есть: **базовый актив** и цена исполнения (**страйк**).

Тип: **кол или пут**.

Время жизни (истечения).

Покупатель – имеет право, продавец – обязан!

Покупатель платит премию продавцу.

Колл опцион – право купить базовый актив по цене страйк до или в момент истечения опциона (продавец данного опциона **обязан продать** базовый актив по цене страйк по первому требованию покупателя).

Пут опцион – право продать базовый актив по цене страйк до или в момент истечения опциона (продавец данного опциона **обязан купить** базовый актив по цене страйк по первому требованию покупателя).

Цена опциона зависит от цены базового актива и 4-х параметров, называемых «**греки**»:

«**Дельта**» показывает, насколько изменится цена опциона при изменении цены базового актива на 1 пункт. Еще одно замечательное свойство дельты - она показывает эквивалент владения базовым активом, и это свойство называется **экспозиция**.

Например: суммарная дельта портфеля опционов = 2.0. Значит, этот портфель будет себя вести так же, как позиция из двух купленных лотов базового актива!

«**Гамма**» - показывает, насколько изменится сама «дельта» при изменении цены базового актива на 1 пункт;

«**Вега**» - показывает, насколько изменится цена опциона при изменении волатильности на 1%.

«**Тета**» - показывает, сколько стоимости теряет опцион в день.

Не забываем, что стоимость опциона = внутренняя стоимость + временная стоимость.

Внутренняя стоимость опционов «без денег» и «около денег» = 0 и полностью состоит из временной.

Для лучшего усвоения разберем пример:

Покупка мартовского колл опциона со страйком 1740\$ GOLD - 3.12

Тип	Страйк	Дата исп.	Контракт	К-во	Поз. откр. по	Цена	Цена, руб.	IV, %	До исп.	Дельта	Гамма	Вега	Тетта
Call	1 740	15.03.12	GD1740BC2	1	49,3	49,3	1 493	19,44	46	0,52	0,003317	2,46	-0,52
Итого:						0,00%				0,52	0,003317	2,46	-0,52

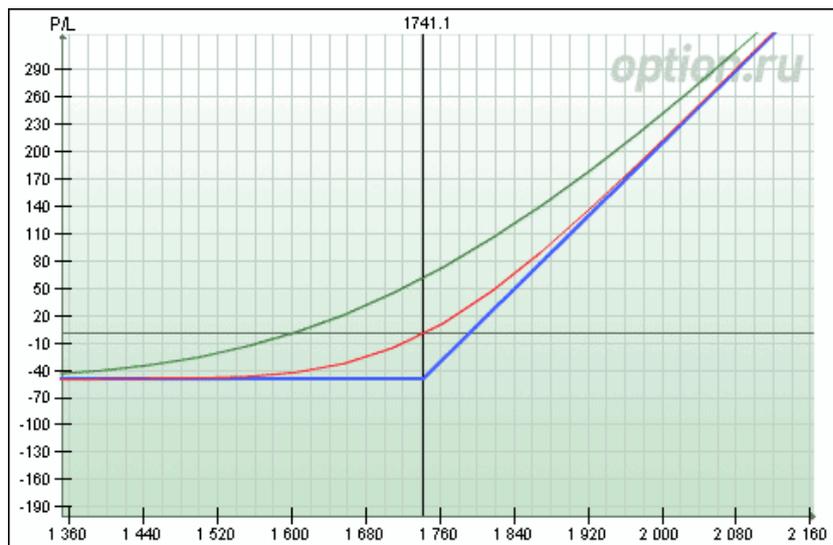
Цена = 49,3\$ (максимально возможный убыток).

До экспирации осталось 46 дней.

IV = 19,44 – это волатильность.

Дельта = 0,52, то есть наш опцион будет себя вести, как будто мы купили половину лота фьючерса на золото. При изменении цены базового актива на 1\$ Дельта будет меняться на 0,003317 (это Гамма).

При изменении волатильности на 1% цена нашего опциона изменится на 2,46\$. И каждый день цена купленного опциона будет уменьшаться на 0,52\$ (это Тета). Вот график прибылей/убытков данной позиции:



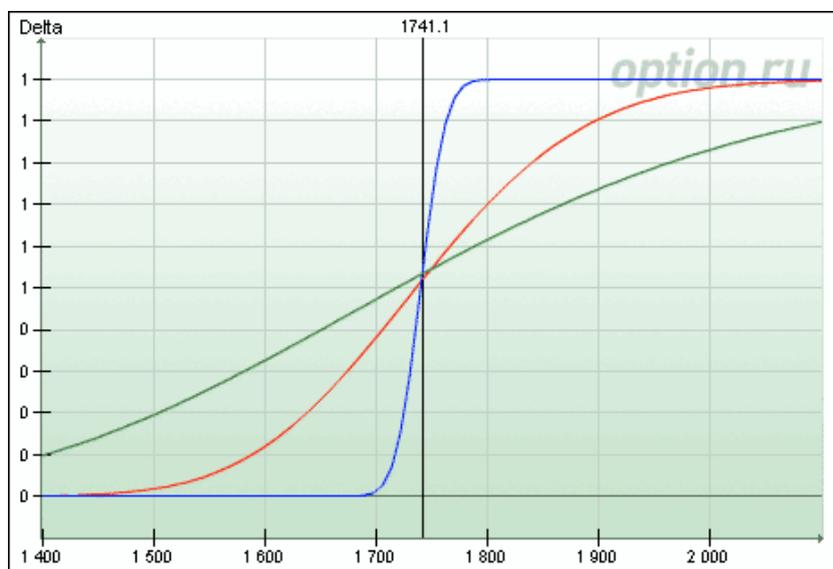
Синяя линия – цена опциона на момент исполнения.

Красная – текущая цена.

Зеленая - цена при повышенной волатильности (IV = 45).

Посмотрите, как меняется цена опциона в зависимости от цены базового актива, и как сильно влияет на цену изменение волатильности!

График показывает, как меняется дельта купленного нами опциона в зависимости от цены базового актива:



Мы видим, что дельта растет при повышении цены БА и снижается при падении цены БА. Так, при повышении цены фьючерса до 1800 дельта станет = 0,7. До 1900, дельта = 0,9. И, наоборот, при падении цены БА до 1600 наша дельта тоже упадет до = 0,118. На графике, к сожалению, не видно этих цифр, но по красной линии Вы можете увидеть эту тенденцию.

Вместе с дельтой меняется и стоимость портфеля:

при покупке позиция эквивалентна 0,52 лота БА, при повышении цены до 1900 станет эквивалента 0,9 БА. А при падении до 1600 наш портфель обесценится до 0,11 БА.

Мы разобрали наиболее простую стратегию – покупка колл опциона, которую можно применить в том случае, если Вы ожидаете сильное движение базового актива вверх.

Как и в любой торговле, при торговле опционами, конечно же, нужно придерживаться плана, составленного до входа в позицию. Где и когда Вы будете выходить? При падении БА до 1700 или 1600? При повышении до 1800 или выше? Или будете держать опцион до срока экспирации (исполнения)? Соблюдение правил управления рисками и составленного плана сможет уберечь Ваш депозит от крупных убытков.

Мы уже говорили, что опцион – это торговый инструмент, и его можно также покупать и продавать в любой момент. И в большинстве случаев исполнять его **невыгодно**.

Возьмем тот же пример:

Купили колл опцион (1740) за 49,3\$. Цена БА = 1741\$. Представим, что цена базового актива выросла до 1800\$. Наш опцион стал стоить около 79\$.

(дельта = 0,5. Цена БА выросла на 60\$, значит, наш опцион подорожал на 30\$).

Так как опцион «в деньгах», Вы решаете его немедленно исполнить.

Что же происходит при исполнении:

- опцион погашается по цене 0\$. Убыток = - 49\$;
- Вам происходит поставка фьючерса по цене страйк, то есть по 1740\$;
- Вам перечисляется вариационная маржа 1800-1740= 60\$;
- и Вы - владелец длинной позиции по фьючерсу;

Прибыль в данном случае равна **60-49 = 11\$**.

Вместо исполнения мы можем просто **продать опцион - и все!** Нет никаких поставок фьючерса, никакой маржи и т.п. В этом случае прибыль составит около **79-49 = 30\$!!!**

В случае ожидания крупного падения цены базового актива, например, при отбросе вниз от значимого уровня сопротивления, Вы можете, рассуждая аналогично, спланировать сделку по покупке пут опциона. Покупая пут или колл опцион, можно еще больше снизить риски, если покупать опционы со страйком у целевых уровней. Но не советую этим слишком увлекаться, ибо опционы «далеко без денег» имеют меньшую дельту, и иногда их стоимость «тает на глазах» - я сам несколько раз так ошибался! Так что, покупая опционы без денег, не берите далекие страйки. Большинство новичков этим «грешат», соблазняясь низкими ценами опционов «глубоко без денег». В большинстве случаев они истекают бесполезно.

Продажа опционов бывает оправданной после больших движений цены базового актива, прогнозируемого периода флета или консолидации. У продажи тоже есть преимущества. Посмотрите, у актива есть три возможности: вверх, вниз, флет. При покупке опциона нам нужна одна из трех, чтобы рынок шел в нашу сторону. А при продаже нас устроит две возможности из трех: чтобы рынок шел в противоположную сторону или просто стоял на месте! В данном случае, вероятность выше (2 из 3 вместо 1 из 3).

Что же делать, если нет уверенности в хорошем движении цены в какую-либо сторону? Как снизить риски при покупке опциона?

Решением задачи может стать **вертикальный спред**.

Суть заключается в том, что Вы одновременно покупаете и продаете два опциона с одним сроком исполнения, но разными страйками.

Рассмотрим пример - график фьючерса на золото:



Цена пробила уровень сопротивления и движется вверх, но у нас нет уверенности в дальнейшем мощном движении.

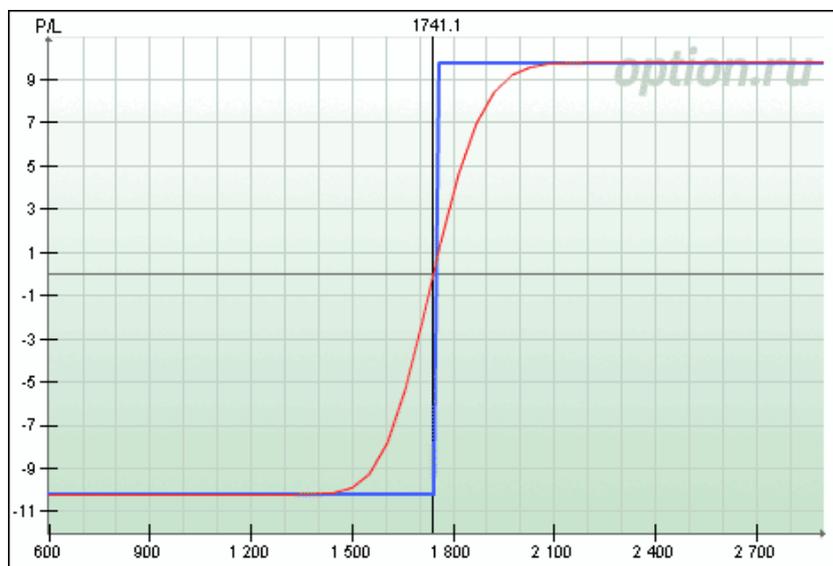
Мы строим вертикальный спред:

покупаем мартовский колл (1740) за 49,3\$ и продаем мартовский колл (1760) за 39,1\$. Таким образом, мы ограничиваем свои риски всего лишь 10\$. Правда, мы ограничиваем себя и в прибыли, но нам нужно в первую очередь ограничивать убытки.

Вот, что получилось:

Инструмент	Тип	Страйк	Дата исп.	Контракт	К-во	Поз. откр. по	Цена	Цена, руб.	IV, %	До исп.	Дельта	Гамма	Вега	Тетта	
<input checked="" type="checkbox"/>	Опцион	Call	1 740	15.03.12	GD1740BC2	1	49,3	49,3	1 493	19,44	46	0,52	0,003317	2,46	-0,52
<input checked="" type="checkbox"/>	Опцион	Call	1 760	15.03.12	GD1760BC2	-1	39,1	39,1	1 184	19,01	46	-0,45	-0,003368	-2,45	0,51
Итого:							0,00%				0,07	-0,000051	0,02	-0,02	

И график позиции:

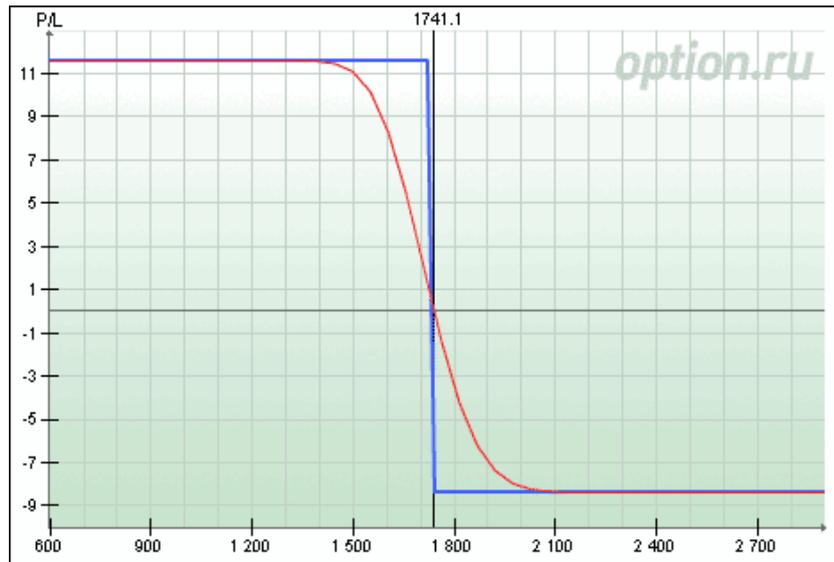


Теперь, если цена фьючерса пойдет вниз, мы рискуем потерять 10\$ максимум. При движении вверх максимальная прибыль составит тоже 10\$. Пример, может, и не совсем удачный, но помогает понять принцип построения вертикальных спредов.

Точно так же мы можем построить спред и из пут опционов:

Инструмент	Тип	Страйк	Дата исп.	Контракт	К-во	Поз. откр. по	Цена	Цена, руб.	IV, %	До исп.	Дельта	Гамма	Вега	Тетта	
<input checked="" type="checkbox"/>	Опцион	Put	1 740	15.03.12	GD1740BO2	1	48,2	48,2	1 460	19,44	46	-0,48	0,003317	2,46	-0,52
<input checked="" type="checkbox"/>	Опцион	Put	1 720	15.03.12	GD1720BO2	-1	39,8	39,8	1 206	19,92	46	0,42	-0,003171	-2,41	0,52
Итого:							0,00%					-0,06	0,000146	0,05	0,00

Максимальный риск по позиции составляет -8,4\$.



А возможная прибыль при падении цены БА - около 11\$.

В интернете очень много программ для анализа опционных позиций, но я пользуюсь сервисом на <http://www.option.ru/analysis/option#position>.

Анализ позиций
Графики волатильности
Опционный калькулятор
Улыбка волатильности
Экспорт данных

Обновлять через 29.01.2012 16:00:21

Создание нового портфеля

Введите название портфеля Выберите базовый актив

Графики

PL / Delta Gamma Theta Vega

option.ru

Портфель

Выберите портфель

В рублях:

До исп.: дней

БИРЖЕВОЙ ЛИКБЕЗ

Коротко опишу, как им пользоваться.

В окне «базовый актив» выбираем БА (только торгуемые на ФОРТС).

Вводим названием портфеля, жмем «создать портфель».

В строке «Новая позиция» выбираем тип опциона, страйк, сроки исполнения и направление сделки (1 - покупка; -1 - продажа) и нужное количество лотов. Жмем «добавить позицию».

В графе «цена» указана теоретическая цена опциона. Не всегда удастся исполнить приказ по этой цене. Поэтому, после открытия позиции, в «Поз.откр.по» вводим фактическую цену сделки.

Сервис автоматически выводит IV, количество дней до исполнения, все «греки».

Ниже расположены графики позиции по прибылям/убыткам, дельте, веге, гамме и тете. При наведении курсора на график прибылей/убытков показываются текущие значения и значения на момент экспирации.

Перейдя на вкладку «What if», можно вводить различные даты, изменять волатильность (IV) и смотреть, как изменяется профиль цены опциона в зависимости от времени и IV. Есть возможность сохранять портфели на локальном диске с тем, чтобы впоследствии не строить заново, а просто открыть нужный файл и смотреть, как в динамике идет Ваша позиция. Таким образом, Вы можете еще до открытия счета у брокера поторговать «на бумаге», опробовать те или иные стратегии опционной торговли.

Начните с самых простых, нами изученных: покупка, продажа опционов, построение вертикальных пут и колл спредов. Посмотрите, как меняется в динамике состояние Вашего портфеля. Это будет великолепной безрисковой практикой для начинающего опционного трейдера!

Кстати, на сайте также есть описание всевозможных стратегий и принципов их построения.

В заключение остановлюсь на синтетических позициях. В предыдущей статье я упоминал о том, что **БА = колл-пут**. Это основная формула для создания синтетики. То есть вместо покупки фьючерса мы можем купить колл опцион «около денег» и продать пут опцион с таким же страйком.

Посмотрите на график прибылей/убытков купленного фьючерса и график синтетической позиции из купленного колла и проданного пута (все это можно сделать на описанном выше сервисе). Они идентичны! Отсюда вытекают различные возможности.

Например, Вы решили купить фьючерс и подстраховались от падения покупкой пут опциона. Исходя из формулы, мы получаем, БА + пут = колл – пут + пут = **колл**.

Таким образом, созданная позиция полностью эквивалентна купленному колл опциону. Может, тогда проще купить колл?!

Или построить вертикальный колл спред: можно купить колл с одним страйком и продать с другим;

А можно создать эту позицию и синтетически:

- * Лонг пут А, шорт колл В, лонг базовый актив;
- * Лонг колл А, шорт пут В, шорт базовый актив.

В некоторых случаях это бывает необходимо. Поэтому помните о синтетике и, например, набирая в портфель различные опционы на один и тот же базовый актив, посмотрите – может

быть, есть возможность сократить некоторые позиции, как мы с Вами сделали только что выше.

Вот и все на сегодня, а в следующей статье мы займемся разбором волатильности.

Удачи всем! ■

Продолжение следует...

Если у Вас возникли вопросы по этой статье, пишите – мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

Написать письмо





Алина Сибирева (Сонька-Золотая Мышка)

Треjder с опытом работы на бирже более трёх лет. Торгует на фондовой бирже по собственной торговой системе.

ПОЗИТИВА ПОЛНЫЙ МЕШОК

Ну вот уже и позади короткие для трейдеров в этом году праздники. Ёлки выброшены, шампанское выпито, а подарки подарены... Но видно, что хорошее настроение наши рынки пока покидать не спешит.

И плевать всем на Грецию, доллар и прочие мелочи жизни. Вперёд (в смысле, вверх) и только вперёд! Получилось такое «посленовогоднее ралли». Что, кстати, явление не столь уж и редкое: если мы посмотрим на графики, то январь — это традиционный месяц роста. Уж не знаю, как это объяснить с точки зрения логики, да это и не нужно. Растёт - и хорошо.

Меня такое положение дел более чем устраивает. А что? Открытые ещё в прошлом месяце длинные позиции приносят неплохую прибыль. Конечно, и без разочарований не обошлось. Но так ведь это трейдинг — куда ж без них? А теперь расскажу обо всём по порядку. Поехали.

ФЬЮЧЕРС РТС

В январе, так уж вышло, я не открыла ни одной позиции в этом активе. Почему? Ведь был такой отличный восходящий тренд, причём весь январь месяц! Ответить очень сложно. Ну, наверное, я просто испугалась. Ведь у меня уже были открыты две длинные спекулятивные позиции в Газпроме и Сбербанке, и я решила, что открывать лонг ещё и во фьючерсе РТС — это перебор.

Конечно, теперь понятно, что зря я испугалась. Но после драки кулаками не машут. Что же теперь? Посмотрите на **30-ти минутный график фьючерса на индекс РТС**: видно, что цена продолжает двигаться в рамках восходящего канала.



Покупать так высоко уже как-то не очень интересно. Думаю, после такого роста можно бы и скорректироваться немного. При пробое диагонального уровня поддержки (на графике -

сиреневая линия) я буду открывать короткие позиции.

Вот пока и все ориентиры. Если рост продолжится дальше - буду просто смотреть со стороны и тихонько кусать локти.

СБЕРБАНК

В прошлом месяце я писала:

«... конечно же, я решила не упускать момент и открыла длинную позицию. Получилось по 85.1 рубля... Стоп за уровнем на 82 рублях».

Как мы видим на **часовом графике акций Сбербанка**, цена с тех пор здорово подросла, а стоп устоял. Но фиксировать прибыль я не тороплюсь. Это, без сомнения, полноценный восходящий тренд. Сейчас стоп у меня стоит за уровнем на 89 рублях.



Как мы видим, сейчас там проходят сразу два уровня поддержки: горизонтальный и диагональный. Для закрытия сделки буду ждать закрытия часа ниже этого значения. А со временем, конечно, планирую подтянуть стоп ещё ближе. Этот всё-таки далековат, но ближе пока хороших ориентиров нет.

Целей движения по-прежнему нет. Хотя, если цена пойдёт выше, в район 100 рублей, то, думаю, всё-таки не выдержу и зафиксирую прибыль. Да, это было бы здорово! Больше 15% прибыли в одной сделке!

Эх, как бы мне избавиться от привычки делить шкуру неубитого медведя?..

ГАЗПРОМ

Как вы помните, в декабре я открыла длинную позицию в акциях Газпрома:

«При пробое этого уровня я, конечно, открыла длинную позицию. Получилось купить только по 175,3 рубля... Мой стоп пока находится за уровнем на 174 рублях (жду закрытия часа ниже него). Но как только цена пойдёт выше, и появится диагональный уровень поддержки восходящего тренда (если, конечно, появится), то тянуть стоп буду под ним».

Как мы видим на **часовом графике акций Газпрома**, после моей покупки цена продолжила рост. Восходящий тренд образовался, и именно под ним я тянула свой стоп. На том же графике видно, что в конце января стоп этот сработал, и по 183.5 рубля я закрыла свою длинную позицию.

Итого получилось 8,2 рубля прибыли на акцию или +4,7% на сделку. Как ни обидно, но после того, как я зафиксировала прибыль, цена продолжила рост. Ох, как неприятно смотреть



уходящему вдаль поезду. Поезду, на котором могла быть и я, но слишком рано вышла. Но ничего не поделаешь. Стоп есть стоп, это святое.

Какие теперь ориентиры по Газпрому? Ну, пока восходящий тренд продолжается, но если мы посмотрим на **4-х часовой график** акций Газпрома, то увидим, что цена оттолкнулась от сильного горизонтального уровня сопротивления в районе 190 рублей. Не исключено, что я встану в шорт в самое ближайшее время.



Ориентир для стопа в случае открытия коротких позиций, кстати, очень хороший и достаточно близкий. Это тот самый уровень сопротивления, от которого цена и отбивается. Ну, для верности можно добавить пару рублей и ждать закрытия часа выше этого уровня.



ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ПОРТФЕЛЬ

В этой рубрике я описываю свои долгосрочные инвестиционные позиции. В свой «портфель» я буду «складывать» разные акции, как самые ликвидные, так и не очень. Горизонт удержания позиций - от нескольких недель до нескольких месяцев или даже лет (тут главное - про них не забыть). В общем, интересно посмотреть, какие плоды принесёт стратегия buy&hold, правда?

В моём инвест-портфеле пока без изменений. Как-то пока больше ничего интересного не заметила. Так и остались у меня два «металлурга» и одна любимая Газпромнефтьюшка.

НЛМК

Как вы помните, ещё в ноябре я открыла долгосрочные длинные позиции в акциях НЛМК: **«... взяла немного, в районе 65 рублей. Стоп за уровнем на 60 рублях. Буду ждать закрытия дневной свечи ниже этого уровня».**

Долгое время цена оставалась на месте, и вот, наконец, в январе начала расти. Счастью моему не было предела, ведь я уже была почти уверена, что ничего не заработаю в этой сделке. Но, как говорится в пословице: «Удача любит терпеливых». И я дотерпела!

Посмотрите на **дневной график акций НЛМК.**



Видно, что с момента покупки цены выросла больше чем на 10 рублей. Медленно, как по ступенькам, цена поднимается практически без откатов. Вперед, и только вперед, НЛМК!

Да, кстати, я думаю, пришло время подтянуть стоп. Закрою позицию при закрытии дневной свечи ниже 65 рублей. Цель? Ну, в районе 90 рублей, думаю, можно и зафиксировать прибыль.

ГАЗПРОМНЕФТЬ

В прошлом месяце я положила акции Газпромнефти в свой долгосрочный портфель:

«Цена пробилась сильный диагональный уровень сопротивления. И я, конечно, нажала на кнопку BUY. В среднем получилось по 145 рублей где-то. Стоп пока ниже 130 рублей (закрытие дневной свечи)... Цель? 175-180 было бы идеально».

К сожалению, за последний месяц ничего интересного с этой бумагой так и не случилось. Цена фактически стоит на месте. Хотя, стойте! Кое-что интересное всё же было.

Посмотрите на **дневной график акций Газпромнефти.**

Видите две огромные свечи? Впечатляют! Всё-таки это неликвидище :), как бы я не сопротивлялась. Хотя наш рынок такой... может и в самых голубых фишках подобное получиться. Вот в ВТБ я такое минимум два раза видела. А ведь первый эшелон! Пример, так сказать, для подражания. Вот, кстати, почему я физических стопов никогда не ставлю, всё держу в голове и выхожу только ручками лимитными ордерами.

Но сейчас не об этом. Я вот что хочу сказать. Было очень обидно. Цена в моменте поднималась почти на 170 рублей. А моя цель - на 175 рублях. Думаю, надо выставить заявку на продажу своих контрактов по цене... ну, скажем, 174 рубля за штуку (круглых чисел лучше избегать — туда ставят заявки большинство трейдеров). А вдруг такая свечка или даже больше ещё раз нарисует? Тогда моя заявка исполнится. Вот будет здорово...



Размечталась. Опять. Но заявку на всякий случай поставила. А вдруг?..

ТМК

В декабре я успела купить ещё и акции ТМК на долгосрочный период:

«Купила я по 82 рубля, а стоп поставила за уровень на 70 рублях. Буду ждать закрытия дневной свечи ниже этого уровня. Определить цель сложно, но, думаю, если и будет рост, то в район следующего уровня сопротивления - в район 110-120 рублей».

Посмотрите на **дневной график акций ТМК**.



Видно, что цена пока не торопится расти. В данной ситуации плохо то, что цена упёрлась в уровень сопротивления, который сейчас проходит в районе 90 рублей. И хватит ли у цены сил пробить этот уровень - пока не понятно. Но я надежды не теряю. Ведь позиция-то долгосрочная.

И хотя кратковременный отбой очень и очень вероятен в ближайшее время, закрывать позицию не спешу. И стоп пока подтягивать не буду, оставляю там же, за уровнем на 70 рублях.

Ну вот, пожалуй, и всё на сегодня.

Всем удачной торговли, и не забывайте выставлять стопы. ■

Если у Вас возникли вопросы по изложенному материалу, пишите – мы обязательно ответим на них в следующих номерах нашего журнала.

Написать письмо

«TRY RSQFOREX» : ИТОГИ 4-ГО КОНКУРСА



Приветствуем, уважаемые читатели!

Время пролетело незаметно, и пора подводить итоги 4-го конкурса «TRY RSQForex», завершившегося 3 февраля.

1	clarino	51517.50
2	demgen	31506.40
3	Марина	10734.80
4	Verta	10525.00
5	screen	10152.10
6	RusSpy	10003.40
7	Kuvalda	10000.00
8	Psycho	10000.00
9	Valet	10000.00
10	Gennadiy	10000.00

Участие в состязании трейдеров приняли клиенты и гости компании RSQForex. Мы были очень рады видеть всех участников! В этот раз их собралось 71 человек. Полный рейтинг конкурсантов и стейтменты победителей можно просмотреть на странице:

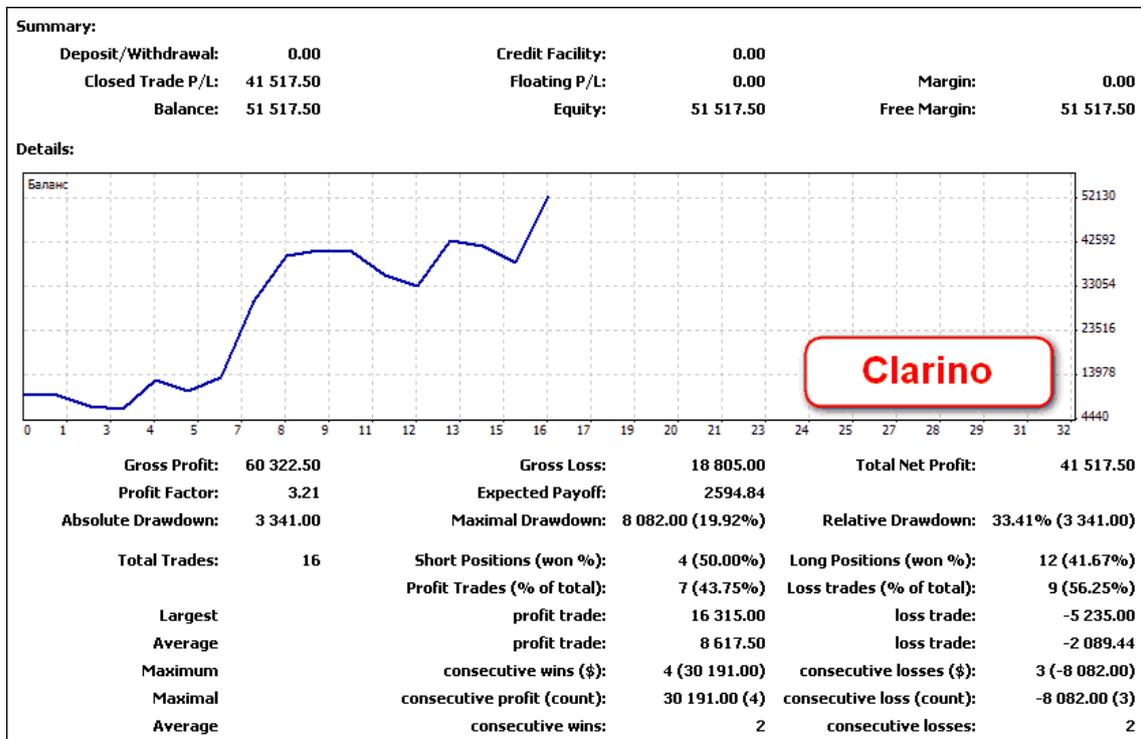
Результаты

За месяц, в течение которого длился конкурс, участниками было совершено 2440 сделок: 32% из них – убыточные, 68% – прибыльные. Самая убыточная сделка была совершена участником с ником **dirbas**: 20 лотов, SELL EUR/USD – этот участник потерял более 26 000 USD!

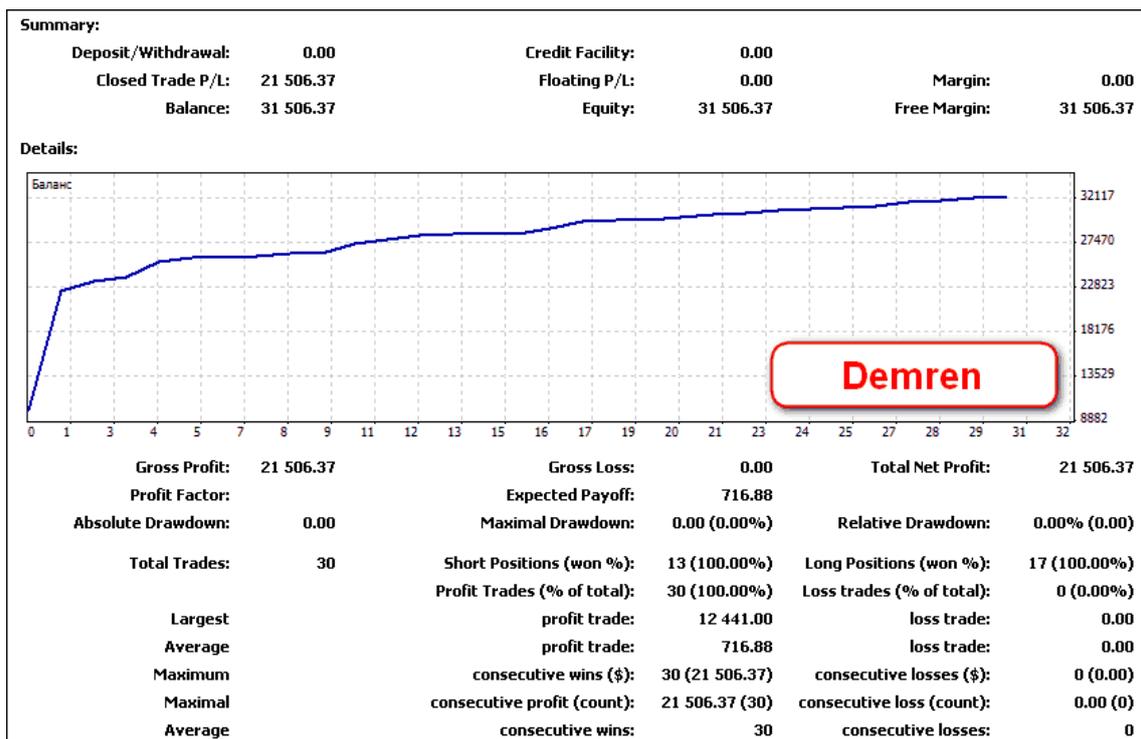
Самая прибыльная сделка тоже была заключена по EUR/USD и тоже продажа: участник с ником **clarino** сделкой объемом 10 лотов смог заработать 16 360 USD. Сделка была заключена 25 января, и отчасти именно она позволила участнику **clarino** занять лидирующую позицию.

2012-й начался с вопроса: что же будет с евро? Он задавался чаще, чем любой другой, и до сих пор ведущие экономисты не могут прийти к единому мнению. Не проходит и недели без прогноза о распаде евросоюза и крахе европейской валюты. Время проведения конкурса совпало с обострением долгового кризиса в Евросоюзе, и некоторые трейдеры смогли заработать на падении евро по отношению к доллару. А теперь узнаем, кто же пересек финишную черту!

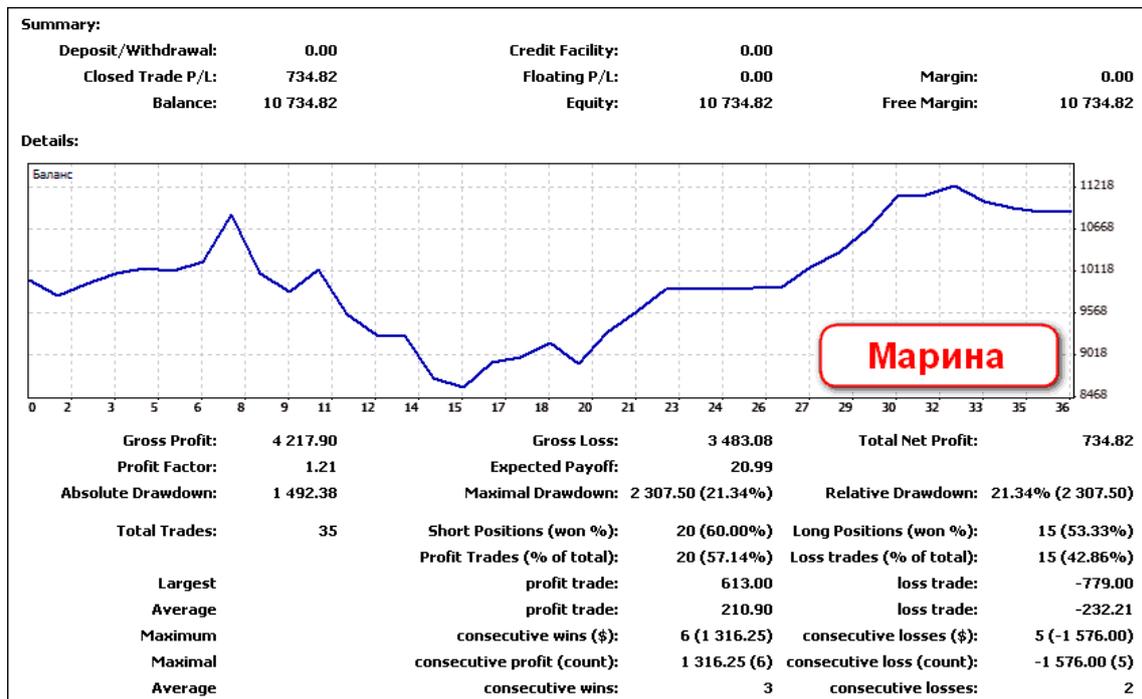
Большой куш сорвал **clarino**, сумевший увеличить начальный депозит более чем в 5 раз! Он торговал с большим разбросом лотов: от 1 до 20 лотов на сделку.



Хороших показателей достиг **demren**, став нашим серебряным призером. Все сделки, заключенные им за время конкурса, были прибыльными! Торговля шла без лишних рисков, в результате чего рост его депозита был ровным и постепенным.



Третье место с почетом занимает **Румба Марина**. Марина обладает качествами настоящего трейдера. Она была твердо настроена на победу и совершала сделки с первого и буквально до последнего конкурсного дня. Впервые за историю конкурса победительницей становится девушка. Надеемся, прекрасная половина участников и в будущем будет столь же активна.



ИНТЕРВЬЮ С ПРИЗЕРАМИ



1-ое МЕСТО: ИЛЬКАЕВ АЗАТ (CLARINO)

Расскажите немного о себе.

Меня зовут Азат, мне 42 года.

Какой у Вас опыт торговли на рынке Форекс? Является ли торговля на Форексе основным источником Вашего дохода?

Торговлей валютой занимаюсь с февраля 2010 года.

Чем Вы занимаетесь помимо Форекса?

Помимо форекса я занимаюсь ремонтом электродвигателей и электроинструментов.

Какие планы на будущее Вы связываете с торговлей на рынке Форекс?

В будущем я желаю продолжить торговлю валютой на форексе, ибо уверен в пользе такого дела не только для себя, а и для людей, и для рынка валют, и для экономики. Чем больше участников на рынке валют, тем меньше шансов у небольшой группы людей влиять на курсы валют в своих корыстных целях. Возможно, моя мысль спорна, однако она помогает мне торговать валютой.

Исходя из вашей торговли во время конкурса, что Вы можете сказать об условиях и качестве услуг, предоставляемых компанией RSQForex?

Во время участия в конкурсе у меня не появилось никаких претензий к работе терминала RSQForex.

Расскажите, пожалуйста, некоторые подробности о своей торговой стратегии, которую Вы использовали в конкурсе "Try RSQForex".

Своей торговой системы у меня ещё нет, однако за 2 года тренировок на демо, центовых и реальных счетах я приобрёл опыт в торговле валютой и занял призовое место в демо-конкурсе "Try RSQForex". В торговле я использую фракталы, каналы Фибоначчи и полосы Боллинджера. Я желаю удачи участникам конкурса и советую не падать духом при неудачах. Участвуйте в конкурсах вновь и вновь, и вы получите награду за терпение!



2-ое МЕСТО: МЯСНИКОВ ДМИТРИЙ (DEMREN)

Расскажите немного о себе: откуда Вы, кто Вы по образованию, как пришли на Форекс, откуда узнали о нашей компании?

Меня зовут Дмитрий. Вот уже 25 лет (мне сейчас уже 29 лет) живу в городе Макеевка Донецкой области. По образованию я бухгалтер, работаю на производстве еврозаборов. О компании RSQForex я узнал из поисковика Google.

Какой у Вас опыт торговли на рынке Форекс? Является ли торговля на Форексе основным источником Вашего дохода?

Опыт торговли у меня в данный момент 1,5 года. Торгую на микросчетах на сумму в 200 \$. Forex в данный момент является моим дополнительным источником дохода.

Чем Вы занимаетесь помимо Форекса?

Основных увлечений у меня 2: охота и рыбалка, также увлекаюсь плаванием и новинками в мире цифровых технологий. Являюсь продвинутым пользователем персонального компьютера, время от времени занимаюсь ремонтом компьютерной техники.

Какие планы на будущее Вы связываете с торговлей на рынке Форекс?

Надеюсь, что Forex года через 3 станет моим основным источником дохода. А для этого в настоящее время я постоянно повышаю своё образование: посещаю онлайн-вебинары, покупаю литературу и различные курсы на DVD-дисках.

Исходя из вашей торговли во время конкурса, что Вы можете сказать об условиях и качестве услуг, предоставляемых компанией RSQForex?

Качество услуг очень хорошее, условия конкурса расписаны абсолютно доступно для понимания всех требований, которые компания RSQForex предъявляет к претендентам на победу в конкурсе.

Расскажите, пожалуйста, некоторые подробности о своей торговой стратегии, которую Вы использовали в конкурсе "Try RSQForex".

В торговле использую стандартный шаблон из MetaTrader 4, который называется Dinapoli. В Dinapoli я добавил Hieken Ashi (индикатор хорошо "сглаживает цены") и zigzag. Также обязательно строю линии поддержки и сопротивления. Время от времени использую H4. В рынок вхожу после того, как цена отобьется от линии минимум 3 раза: от поддержки вхожу в BUY, от сопротивления - в SELL, а закрываю сделки, когда цена пройдет нарисованный мной канал. Стараюсь торговать по тренду (Trend is my friend).

Есть ли у Вас какие-либо пожелания для компании RSQForex?

Пожеланий у меня будет несколько: хотелось бы увидеть в торговле больше кроссовых пар, CFD (контракты на разницу), а также еженедельные конкурсы НА РЕАЛЬНЫХ СЧЕТАХ.



3-е МЕСТО: РУМБА МАРИНА (МАРИНА)

Расскажите, откуда Вы узнали о нашей компании?

Прочитала о вас на сайте TradersTalk.

Какой у Вас опыт торговли на рынке Форекс? Является ли торговля на Форексе основным источником Вашего дохода?

Опыт 4 года. Основным источником дохода пока не является, но я к этому стремлюсь.

Чем Вы занимаетесь помимо Форекса?

Дизайном.

Какие планы на будущее Вы связываете с торговлей на

рынке Форекс?

Надеюсь, что Форекс станет основным источником дохода и основной профессией.

Исходя из вашей торговли во время конкурса, что Вы можете сказать об условиях и качестве услуг, предоставляемых компанией RSQForex?

Качество ваших услуг отличное, нареканий нет никаких.

Расскажите, пожалуйста, некоторые подробности о своей торговой стратегии, которую Вы использовали в конкурсе "Try RSQForex".

Работа ведется по тренду, вход на коррекциях. Применяю различные MA, OSMu, дивергенции и конвергенции. Работа на интервале 4 часа, реже - час. Очень консервативный MM.

Напоминаем, что все победители конкурса получили реальные денежные призы. Детализированные отчеты доступны для просмотра на сайте компании. Благодарим всех за участие и поздравляем призеров.

Мы будем рады снова видеть Вас на нашем следующем конкурсе Try RSQForex, который пройдет уже с 5 по 30 марта, – надеемся, что в этот раз и Вам улыбнется удача!

Регистрация на новый конкурс: <http://rsqforex.com/ru/contest/>

До встречи,
Команда RSQForex!
www.rsqforex.com



RSQ FOREX
ПЕРЕХОДИ НА НОВЫЙ УРОВЕНЬ!

- Плавающие спреды от 0.4 пункта
- Моментальное исполнение ордеров
- Прямой доступ к ECN Integral
- Скальпинг и автоматическая торговля

РЕЙТИНГ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ

В данном разделе нашей Лаборатории мы проводим мониторинг советников, торгующих только на реальных счетах. Вы можете оценить основные характеристики представленных советников и наблюдать за их работой.

Рейтинговая таблица лидеров на сегодняшний день выглядит следующим образом:

Статус	Название	Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста
	Reliability EA	41302	42,437.30	25,615.20	451 дней
	Adroitea	8801	21,462.80	19,952.90	451 дней
	Forex High Voltage	836	15,625.20	15,625.20	541 дней
	Pro Forex Robot	-2049	14,034.50	14,042.70	637 дней
	GPS Forex Robot	82	13,326.20	13,358.20	427 дней

— — —

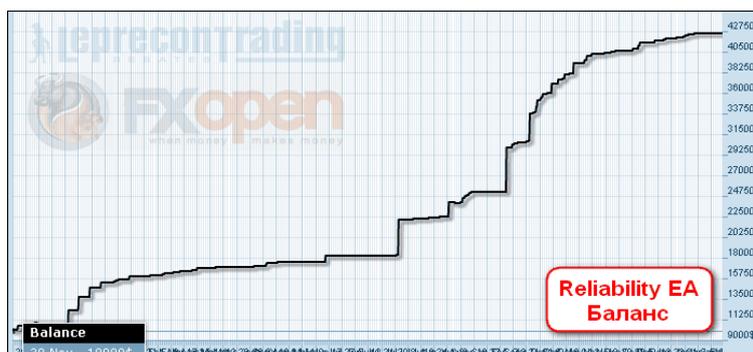
«RELIABILITY EA»

(обзор советника см. «Leprecon Review» №18 <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jrnala/18> стр. 30)



«Reliability EA» торгует одновременно по таким парам как USD/JPY, USD/CAD, NZD/JPY, GBP/CHF, EUR/USD, EUR/CHF и AUD/USD, чем обеспечивает общую профитность системы за счет перекрытия минусов на одной паре плюсами на другой.

Общая прибыль советника «Reliability EA» за 451 день мониторинга составила 324% при максимальной просадке 3.07%.



Советник торгует без стопов, что хорошо заметно по графику эквити, невыгодно отличающемуся от графика баланса:



Просадка по эквити с каждым месяцем все увеличивается и увеличивается:

54638861	2010.12.01 02:41	buy	0.01	gbpCHF	1.5617	0.0000	0.0000	1.4241	0.00	0.00	-1.58	-151.36
54643545	2010.12.01 04:11	buy	0.01	gbpCHF	1.5614	0.0000	0.0000	1.4241	0.00	0.00	-1.58	-151.03
54644286	2010.12.01 04:48	buy	0.01	gbpCHF	1.5609	0.0000	0.0000	1.4241	0.00	0.00	-1.58	-150.48
54644473	2010.12.01 04:52	buy	0.01	gbpCHF	1.5610	0.0000	0.0000	1.4241	0.00	0.00	-1.58	-150.59
54649931	2010.12.01 06:13	buy	0.01	gbpCHF	1.5604	0.0000	0.0000	1.4241	0.00	0.00	-1.58	-149.93
54650014	2010.12.01 06:14	buy	0.01	gbpCHF	1.5599	0.0000	0.0000	1.4241	0.00	0.00	-1.58	-149.38
85996115	2012.01.19 16:00	sell	0.18	nzdJPY	61.69	0.00	0.00	66.62	0.00	0.00	-44.80	-105.52
86342621	2012.01.30 17:08	sell	0.18	nzdJPY	62.49	0.00	0.00	66.62	0.00	0.00	-33.89	-926.12
86434259	2012.02.01 13:35	sell	0.18	nzdJPY	63.29	0.00	0.00	66.62	0.00	0.00	-32.62	-746.73
86602389	2012.02.07 04:30	sell	0.18	nzdJPY	64.09	0.00	0.00	66.62	0.00	0.00	-24.90	-567.33
84091018	2011.11.28 12:01	buy	0.23	usdCAD	1.0330	0.0000	0.0000	0.9991	0.00	0.00	-74.05	-780.40
84101014	2011.11.28 15:14	buy	0.23	usdCAD	1.0312	0.0000	0.0000	0.9991	0.00	0.00	-74.05	-738.97
84120157	2011.11.29 21:57	buy	0.23	usdCAD	1.0361	0.0000	0.0000	0.9991	0.00	0.00	-74.05	-851.77
84151880	2011.11.29 11:31	buy	0.23	usdCAD	1.0292	0.0000	0.0000	0.9991	0.00	0.00	-73.09	-632.92
72666409	2011.05.19 15:55	buy	0.10	usdJPY	82.10	0.00	0.00	80.26	0.00	0.00	-32.45	-229.25
73237007	2011.05.26 14:48	buy	0.10	usdJPY	81.30	0.00	0.00	80.26	0.00	0.00	-31.29	-129.58
											-1	-15
											792.39	030.55
											Floating P/L:	-16 822.94

Прибыльность	16.23
Сделок	318
Прибыльных сделок	297
Убыточных сделок	21

«FOREX HIGH VOLTAGE»

(обзор советника см. «Leprecon Review» №10 <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jyrnala/10>, стр. 43)

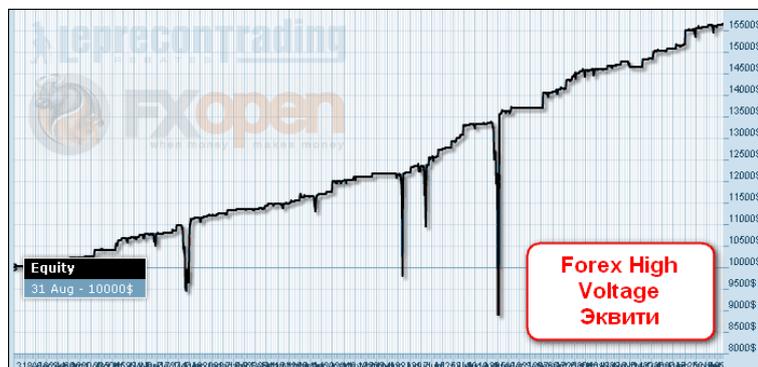


«Forex High Voltage» - трендовый советник, предназначенный для торговли парами EUR/USD и USD/JPY на минутном таймфрейме.

«Forex High Voltage» за 541 день мониторинга увеличил баланс на 56% при максимальной просадке в 5.25%.



Несмотря на видимость установки стопов, их фактическая величина настолько велика, что даже при значительной просадке цена их не задевает, и фактически депозит оказывается защищенным не намного сильнее, чем в случае торговли без стопов.



На момент написания обзора открытых сделок у советника не было:

Open Trades:													
Ticket	Open Time	Type	Size	Item	Price	S / L	T / P	Price	Commission	Taxes	Swap	Profit	
No transactions													
										0.00	0.00	0.00	0.00
										Floating P/L: 0.00			

Прибыльность	1.57
Сделок	262
Прибыльных сделок	221
Убыточных сделок	40

— — —

«PRO FOREX ROBOT»

(обзор советника см. «Leprecon Review» №8 <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jyrnala/8>, стр. 22)



«Pro Forex Robot» торгует на парах EUR/USD, GBP/USD, USD/JPY, USD/CHF. Имеется 4 уровня риска: консервативный, стандартный, агрессивный и супер-агрессивный. Ордера закрываются по достижению уровней TakeProfit или StopLoss. Если срабатывает StopLoss, то лот следующего ордера удваивается.

«Pro Forex Robot» за 637 дней мониторинга увеличил баланс на 40% при максимальной просадке в 4.74%. Нужно отметить, что, по сравнению с прошлым месяцем, советник сработал в минус и потерял 8%.



График сложно назвать радующим глаз, и если раньше, несмотря на просадки, он все же шел вверх, то сейчас движение затухающее, и как долго продержится советник при такой торговле - неизвестно.

Прибыльность	1.03
Сделок	1041
Прибыльных сделок	497
Убыточных сделок	544

— — —

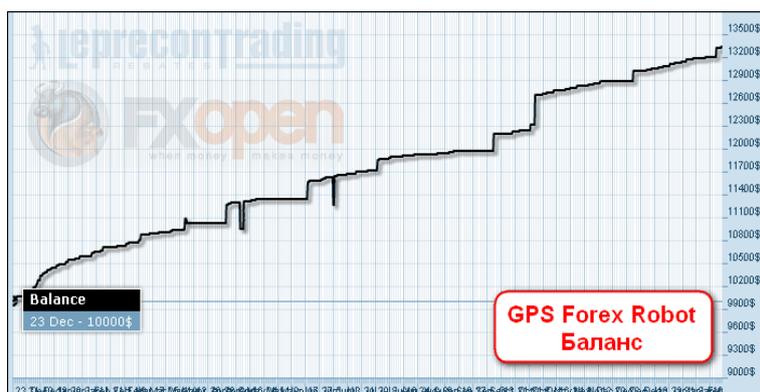
«GPS FOREX ROBOT»

(обзор советника см. «Leprecon Review» №14 <http://www.lepreconreview.com/arhiv-jyrnala/14>, стр. 32)



«GPS Forex Robot» разработан для пар EUR/USD, USD/CHF, EUR/GBP и работает на часовом или 15-минутном таймфрейме. Это скальпер, работающий, в основном, в ночное время и использующий в своей работе принцип Мартингейла – повышения лота при получении убытка.

«GPS Forex Robot» за 427 дней мониторинга увеличил баланс на 33% при максимальной просадке в 3.24%.



Очередной советник, который предпочитает не ставить стопы, а убытки пересидживать, хотя график эквити не так плох, как у его предыдущих «коллег», и видна только одна значительная просадка по эквити в виде шпильки:

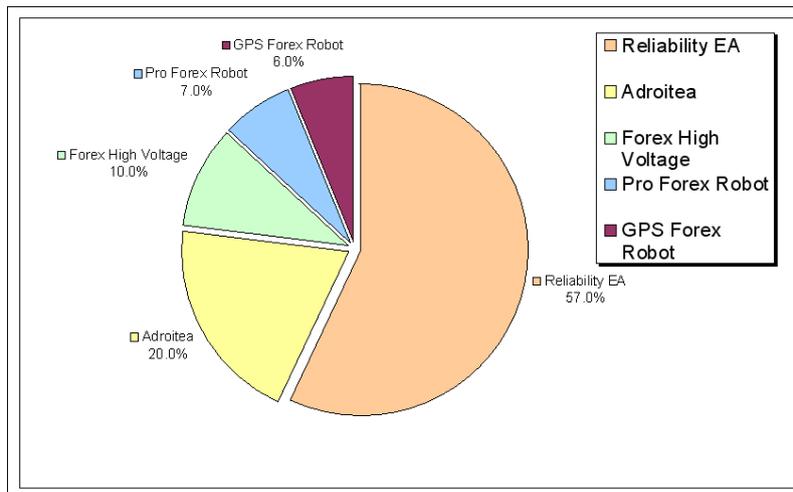


Прибыльность	2.22
Сделок	117
Прибыльных сделок	110
Убыточных сделок	6

— — —

Суммарные итоги торговли советников Вы можете увидеть в следующей таблице:

ПРОЦЕНТНОЕ СОТНОШЕНИЕ ПРИБЫЛИ, ПОЛУЧЕННОЙ СОВЕТНИКАМИ:



**ИТАК, ПОБЕДИТЕЛЕМ РЕЙТИНГА ПО ПОЛУЧЕННОМУ ПРОФИТУ
В ОЧЕРЕДНОЙ РАЗ СТАНОВИТСЯ...**

«RELIABILITY EA»



за 451 день мониторинга советнику удалось увеличить депозит на 324%

Кто станет победителем в следующем месяце - читайте в очередном выпуске нашего журнала.

— — —



Вспоминая поговорку «Семь раз отмерь – один раз отрежь», мы призываем вас не рисковать своими деньгами и делать выводы о целесообразности покупки того или иного советника только после наблюдения за его работой на реальных счетах в нашей Лаборатории!

Перейти в Лабораторию

РЕЙТИНГ СИГНАЛЬНЫХ СЕРВИСОВ

Данный раздел посвящен сервисам, предоставляющим торговые сигналы. Для того чтобы оценить множество таких сервисов в одном месте, не шаря по интернету в поисках информации, мы создали данный раздел. Мы предоставим вам всю необходимую информацию, и вы сами сможете решить, чьими сигналами хотели бы воспользоваться.

В рейтинге сигнальных сервисов изменений не произошло. По-прежнему он представляет собой лишь рейтинг сливших сервисов – у кого-то это получилось быстрее, кто-то тянул дольше:

Статус	Название	Пипс	Балаис	Зивити	Общее время теста
+	RadovSignals	424	11,350.50	11,350.50	445 дней
+	FxForecaster	-978	9,359.24	9,359.24	210 дней
+	NewLifeTrader	-511	9,120.23	9,120.23	183 дней
+	ProfSignal	-1408	8,783.16	8,783.16	183 дней
+	VamSignal 2.0	-4166	6,464.87	8,520.81	215 дней
+	Profit - IntraDay System	-7020	612.22	612.21	77 дней
+	FxproDroid	-1742	510.79	5,510.79	49 дней
+	Trend & Swing System	-2213	293.57	196.36	24 дней
+	Night Trader 2	-3726	227.82	227.82	30 дней
+	Auto - Profit	-3330	121.09	121.09	24 дней
+	ForexHelpSystem	-406	81.84	81.84	63 дней
+	SelfInvestor	-248	64.34	64.34	32 дней
+	Night Trader	-6503	24.21	24.20	65 дней
+	Pirest AG	-31	13.21	13.21	52 дней
+	VamSignal	-933	9.43	9.43	31 дней
+	ForexHelpSystem 2	-96755	2.98	2.98	43 дней
+	ForSig	-517	1.87	1.87	65 дней
+	FxProf	-942	0.88	2.75	51 дней
+	Forex Step LTD	-982	0.68	7.38	29 дней

В чем же причина? Неужели прибыльная торговля по сигналам в принципе невозможна?! Не хочется в это верить, и мы надеемся, что в новом году к нам обратятся представители прибыльных сигнальных сервисов, которые смогут доказать нам, нашим читателям и всем, кто следит за событиями в нашей Лаборатории, что такая торговля может приносить прибыль!

Прибыльно торгующие сигнальные сервисы, отзовитесь! Мы ждем вас!

[Написать письмо](#)



С нами возможности на Вашей стороне!

LepreconTrading является первой независимой компанией, предоставляющей денежные выплаты трейдерам на основе каждой совершаемой ими сделки. Мы сфокусированы на предоставлении нашим клиентам сервиса премиум-класса!

1. Создаём аккаунт [Подробнее](#)
2. Выбираем брокера [Подробнее](#)
3. Получаем БОНУСЫ [Подробнее](#)

КТО ТАКОЙ ЛЕПРЕКОН?

Сначала позволим себе сказать пару слов о том, для чего создавалась данная статья. Дело в том, что, когда мы начали делать наш журнал «Leprecon Review», он планировался больше для клиентов компании. Но потом мы увидели интерес к нашему изданию также со стороны тех, кто пока еще не примкнул к дружным рядам наших клиентов, но интересуется вопросами биржевой торговли, ее автоматизации, поиска различных методов и стратегий для успешной работы на рынке. Количество наших читателей растет с каждым днем, на наш электронный адрес постоянно поступают письма с просьбами, пожеланиями и предложениями, среди которых достаточно часто можно увидеть похожие вопросы:

- А кто такой Лепреконт?
- Почему именно Лепреконт?
- Чем занимается компания «Leprecon Trading»?

Поэтому мы решили, что эта статья поможет каждому новому клиенту компании «Leprecon Trading» узнать больше о нас и о том, что Лепреконт - это не просто название, а символ будущего успеха!

ИТАК, КТО ЖЕ ТАКОЙ ЛЕПРЕКОН?



Лепреконт – это маленький сказочный человечек в шляпе и зеленом костюме, владеющий спрятанным горшком золота. Если удачливому искателю сокровищ удастся поймать Лепреконт, то это существо должно рассказать человеку о том, где спрятаны его сокровища.



Лепреконт считается символом Дня Святого Патрика, который празднуется 17 марта во многих странах мира. Родиной этого праздника является Ирландия. Изображение Лепреконт можно встретить в этот день где угодно: на майках, плакатах, значках и т.д. Этот праздник принято встречать в зеленой одежде (зеленый - цвет весны, Ирландии и трилистника). Желательно также

декорировать свой костюм стилизованным трилистником и в цветах ирландского флага. Особым шиком считается приколотый к лацкану пучок живого трилистника, который ирландцы перед Днем Святого Патрика развозят по всему миру для продажи.

На вопрос о том, почему же компания «Leprecon Trading» стала называться в честь Лепрекона, во втором номере нашего журнала ответил основатель, руководитель и идейный вдохновитель компании Игорь Дягилев, известный в сети под ником Ree:

«Я долгое время жил и работал в Ирландии. Символика зелёного листка и самого Лепрекона используется ирландцами везде, где только можно. Считается, что это приносит удачу не только в бизнесе, но и в личной жизни. Назвав так компанию, мы хотим принести удачу всем нашим клиентам. Скажу по секрету, у меня тоже есть статуэтка Лепрекона, купленная в одной из небольших деревушек северного Корка в Ирландии. Она всегда со мной, когда я работаю и отдыхаю».

ЧЕМ ЗАНИМАЕТСЯ КОМПАНИЯ «LEPRECON TRADING»?

«LepreconTrading» - крупнейший в рунете сервис по компенсации затрат на спред в большинстве известных ДЦ и Брокерских компаний. Торгуя через «LepreconTrading», Вы сможете получать часть спреда на свой счет по каждой закрытой Вами сделке, независимо от ее результата.

Чтобы разобраться в нюансах, рассмотрим, что же вообще такое спред.

В терминале MetaTrader Вы можете увидеть такую картинку.

Символ	Бид	Аск
EURUSD	1.4397	1.4399
GBPUSD	1.6411	1.6414
USDCHF	1.0250	1.0253
EURCAD	1.4768	1.4777
AUDNZD	1.2509	1.2521
EURJPY	130.34	130.37
USDJPY	90.52	90.55

Справа от каждой валютной пары находятся две цены: Бид и Аск – цены спроса и предложения. Разница между ними - и есть тот самый спред, который при открытии сделки трейдер уже заплатил брокеру.

Для примера, на приведенном скрине спред по EUR/USD равен 2 пипса, по GBP/USD 3 пипса, по USD/CHF 3 пипса, по EUR/CAD 9 пипсов. Таким образом, торгуя через брокера напрямую, Вы теряете с каждой сделки сумму, эквивалентную величине спреда.



А при торговле через компанию «LepreconTrading» часть этого спреда возвращается компании, которая, в свою очередь, выплачивает 70% от данной суммы клиенту.

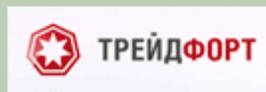
У тех брокеров, у которых вместо спредов с каждой сделки удерживается комиссия, расчет ведется аналогично, но производится не со спреда, а с комиссии.

При всем при этом подключение к сервису совершенно бесплатное и нет никаких скрытых платежей.

В настоящее время для подключения доступны 34 компании, и этот список не окончательный – если вы торгуете в компании, которой пока нет в списке, то пишите нам – мы постараемся, чтобы интересующая Вас компания была в нашем списке:

Брокеры

Если Вы торгуете в компании, которой нет в нашем списке, то свяжитесь с нами и мы постараемся добавить такую компанию в самые короткие сроки.



ТАКЖЕ «LEPRECON TRADING» ЭТО:

ЛАБОРАТОРИЯ



<http://ealab.ru>

Лаборатория, посвященная тестированию торговых систем, сигналов, включая АТС и МТС. Как известно, в последние несколько лет в Интернете активизировались продажи торговых систем, которые, при более близком рассмотрении, зачастую оказываются обманом. Так как мы сами являемся трейдерами и знаем, насколько важна в наши дни правильная информация, мы решили создать этот раздел для помощи трейдерам.

АТС			МТС			Сигналы			Второй шанс																	
#	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q	R	S	T	U	V	W	X	Y	Z
Статус	Название		Пипс	Баланс	Эквити	Общее время теста	Прибыль с бонусов Лепрекона		Ссылки																	
	MultiMartingail		9345	12,578.80	10,198.20	107 дней	1.51		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	Primeval-EA		5005	10,519.60	14,626.40	52 дней	12.07		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	GeLan Trawler 2.0		3994	10,838.40	15,740.10	93 дней	0.09		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	Pips Miner EE		3003	17,780.60	21,742.50	98 дней	4.14		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	Aladdin 2 FX		2280	73.01	5,073.02	34 дней	7.45		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	Forex No Loss Robot		1503	11,364.60	7,154.29	120 дней	1.26		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	Magic Forex Bot		895	11,344.50	16,322.20	23 дней	0.15		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	SPIKE EA		652	15,775.10	15,775.10	100 дней	3.83		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	EXDeLuxe		509	36,441.20	41,441.20	65 дней	29.43		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	MegaDroid		379	144.37	144.37	230 дней	3.75		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	Euronis_v4		378	138.10	138.10	204 дней	398.72		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	
	Forex Shocker 2.0		288	133.84	133.84	107 дней	17.67		↘ Просмотреть statement ↘ Обсудить на форуме ↘ Оставить комментарий																	

ФОРУМ

<http://forum.leprecontrading.com>

Форум создан для общения и обмена опытом между трейдерами. На форуме обсуждается множество важных вопросов: торговые стратегии - их оптимизация и практическое использование, механические торговые системы, выбор брокера, а также рассматриваются сопутствующие трейдингу темы - банки, платежные системы, инвестиции, ПАММ-счета и многое другое.

FREELANCE РАБОТА И ПРЕДЛОЖЕНИЯ		ТЕМЫ	СООБЩЕНИЯ	ПОСЛЕДНЕЕ СООБЩЕНИЕ
	Правила и условия обсуждения 0.04 Правила подачи заявки	2	2	rigal 31 авг 2009, 14:52
	Заявки 0.04 Здесь оставляем свои заявки и общаемся с кодерами	2	11	Papirus 16 янв 2010, 14:59
ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК FOREX		ТЕМЫ	СООБЩЕНИЯ	ПОСЛЕДНЕЕ СООБЩЕНИЕ
	Торговые стратегии и сигналы 0.04 Обсуждаем торговлю и сигналы. Делимся секретами, высказываем идеи. Модератор: Ree	16	231	fxprofit 31 мар 2010, 10:42
	Прогнозы, аналитика, мнения 0.02 Технический и фундаментальный анализ ситуации на рынке. Модераторы: Ree , Андрей, Ленточка	8	458	dmitrievsky 30 июл 2010, 12:55
	Механические торговые системы 0.06 Обсуждение МТС Модератор: Ree	5	49	Ajuy 30 апр 2010, 13:22
	Торговая комната 0.02 Торгуем и обсуждаем в реальном времени. Модератор: Ree	3	88	Nikospart 06 май 2010, 13:44

Re: Моя стратегия лучше вашей! :)

begemor » 20 фев 2010, 03:51

“ЦИТАТА”

begemor

Сообщения: 2
Зарегистрирован: 13 фев 2010, 21:41
Благодарил(а): 1 раз.
Поблагодарили: 1 раз.
Сказали "Фу": 0 раз.
Банк: 0.04

II_AlexUnder_II а как по твоему лучше применять манименеджмент к THV? Лично я не приветствую короткие таймфреймы потому как сливаю на них. Нашел для себя среднесрочную стратегию Kijun-Sen Bandit. Основана на 6ти индикаторах. В среднем дает 2-3 сильных сигнала в неделю по основным парам. Сделки держу от нескольких часов до нескольких суток. Таймфрейм H1 реже H4. Прибыль в среднем от 50ти до 200 пунктов от сделки. На кросах лучше не использовать так как часто дает ложные сигналы.



СПАСИБО

ФУ

АРХИВ КОТИРОВОК



<http://leprequotes.com>

Этот сайт представляет собой онлайн библиотеку рыночных котировок. Нами была создана база данных котировок, запись в которую происходит круглосуточно в реальном времени.

Являетесь ли вы активным пользователем советников и торговых систем или только собираетесь им стать? А может быть вы - программист, занимающийся созданием новых советников или тестированием и оптимизацией уже известных в сети разработок?

В любом случае, если вы планируете тестировать или торговать советником у выбранного вами брокера, то желательно делать это на котировках именно того брокера, которого вы выбрали для торговли, чтобы результат тестирования максимально совпадал с реальностью. А котировки с реальных счетов у разных брокеров, как правило, имеются только за две последние недели (максимум месяц), и если у вас возникнет желание провести тест на котировках с реальных счетов компаний, то «**LepreQuotes**» - это то, что вам нужно.

Все котировки хранятся в формате .hst и записываются ТОЛЬКО с минутного временного периода (M1), как с реальных, так и с демо-счетов, так как котировки у таких счетов зачастую довольно сильно отличаются. Мы ввели возможность скачивания архивов обоих типов счетов.

Каждый желающий может совершенно бесплатно скачать архив за любой выбранный отрезок времени для последующего сравнения или использования для исторических тестов своей торговой системы.

Для получения ссылки на архив достаточно выбрать компанию, тип счёта, торговый символ, диапазон дат, и при нажатии на кнопку «Скачать» на ваш e-mail будет выслана ссылка для скачивания выбранного вами участка истории котировок.

Статистика: Компаний: 17 Типов счетов: 49 Символов: 4018 Скачано раз: 5612 Котировок: 614344880	Компания: Выберите компанию Тип счета: Выберите тип счета Символ: Выберите символ Дата: 01.04.2010 до 01.04.2010	СКАЧАТЬ
---	---	----------------

На данный момент по всем компаниям доступна только история котировок с 01 Апреля 2010 года.

Ссылка на архив действительна только в течение определённого времени (указывается в полученном e-mail) и автоматически становится неактивной, как только указанное время заканчивается.

Пример письма со ссылкой на архив котировок:



Уважаемый/Уважаемая

Вами был запрошен архив котировок FIBO Forex EURUSD, 2010-04-01 00:00:00-2010-04-30 00:00:00. Ниже, Вы сможете найти ссылку для скачивания архивного файла с наших серверов. Ссылка остаётся активной в течении 60 минут (один час) и автоматически становится неактивной, как только 60 минут истекут.

Ссылка для скачивания архива:

http://leprequotes.com/downloads/1272792900_EURUSD_FIBO_Forex.hst

Внимание! Данный email не отслеживается Администрацией сервиса, если у Вас возникли вопросы по работе сервиса, обращайтесь по следующему адресу: info@leprequotes.com.

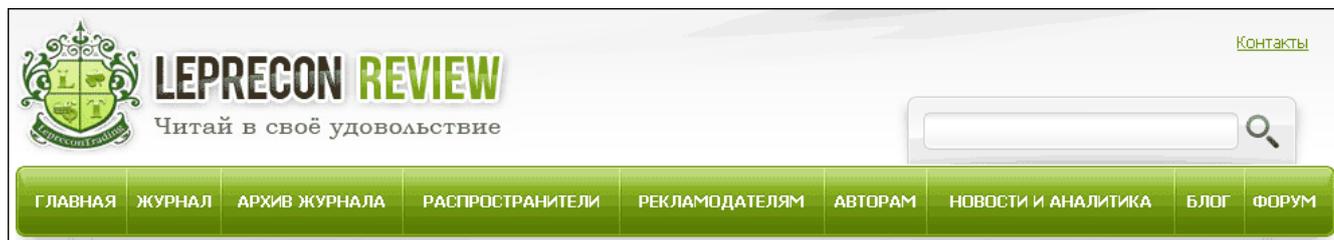
Спасибо за интерес к нашему сервису!

С уважением,

Администрация LepreQuotes.com

Количество брокеров постоянно увеличивается, и, соответственно, накапливается история котировок. Если в списке вы не найдете брокера, у которого торгуете, то пишите нам – мы постараемся добавить интересующие вас компании в наш список в ближайшее время.

ЖУРНАЛ «LEPRECON REVIEW»

<http://www.lepreconreview.com>

Журнал «Leprecon Review» – это электронное издание, которое станет Вашим незаменимым помощником в получении самой свежей информации о биржевой торговле. В журнале делается акцент на тестировании коммерческих и «домашних» торговых советников, рассматриваются интересные торговые системы, а также затрагиваются психологические, правовые и другие аспекты биржевой торговли.

Представляем Вам сайт нашего журнала:

www.lepreconreview.com

www.lepreconreview.ru

Новый сайт несёт в себе много различных возможностей не только для читателей, но и для наших партнёров:

- Просмотр журнала в онлайн режиме с пролистыванием и обновлением информации в реальном времени;
- Регистрация в разделе распространителей с полным списком выбора баннеров для своих сайтов и блогов;
- Полный архив всех номеров за всю историю существования журнала;
- Новости и анализ рынка;
- Различные конкурсы и призы для самых активных распространителей;
- Самая полезная и интересная информация по тестированию торговых систем, интервью, анализ рынка, интересные проекты и т.д. Все собрано в одном месте, искать больше не надо;
- И ещё много другой интересной информации.

РАССЫЛКА «LEPRECON'S WEEK»

<http://forum.leprecontrading.com/viewforum.php?f=88>



Последние новости, рейтинг торговых систем, обзор ПАММ-счетов, аналитика и анонсы от компании «Leprecon Trading».

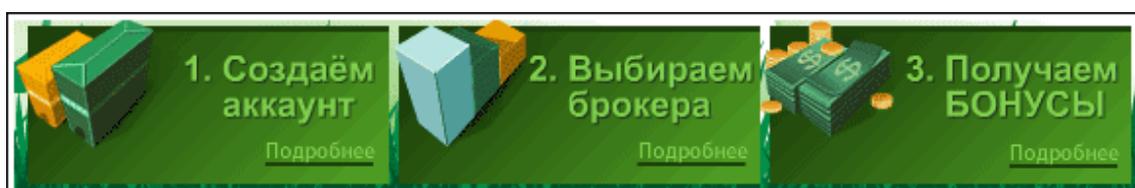
А ТАКЖЕ «LEPRECON TRADING» ЭТО:

- Более **12370** клиентов!
- Бесплатный чат в Skype, где Вы можете задать интересующие Вас вопросы по торговле и получить на них ответы опытных трейдеров
- Наша группа «ВКонтакте»
- Дополнительные бонусы
- Отсутствие комиссий и минимума на вывод
- Различные акции и конкурсы для клиентов
- Бесплатные вебинары по биржевой торговле, организованные совместно с нашими партнерами.

<http://leprecontrading.com>

КАК ЖЕ СТАТЬ КЛИЕНТОМ КОМПАНИИ «LEPRECON TRADING»?

Достаточно перейти по ссылке <http://leprecontrading.com> и следовать пошаговой инструкции:



Более подробное описание всегда можно найти в разделе FAQ на сайте:
<http://leprecontrading.com/faq.php>



**Компания "Lepreson Trading"
поздравляет всех мужчин
с Днем защитника Отечества!**

**Желаем Вам всегда оставаться
здоровыми, сильными,
смелыми, любящими
и любимыми!**

Мирного неба над головой!

Администрация "Lepreson Trading"

КОНТАКТЫ

Сайт журнала:
<http://www.lepreconreview.com>

Редакция журнала:
review@leprecontrading.com

Главный редактор:
editor@leprecontrading.com

Для рекламодателей:
advertising@leprecontrading.com

По всем вопросам, связанным с содержанием материалов журнала, а также с замечаниями и предложениями обращаться на электронный адрес редакции журнала.

Напоминаем, что торговля на рынке Forex является высокорискованным видом инвестиций. Опубликованные в журнале обзоры и аналитические материалы носят рекомендательный характер и не являются руководством к действию.





А ТЫ

**ЗАПИСАЛСЯ В
ЛЕПТРЕКОНЫ?**

