



**ДОБРО ПОЖАЛОВАТЬ!**



**КРАТКОСРОЧНАЯ  
ТОРГОВАЯ СТРАТЕГИЯ  
А. БУЛАНОВА  
“ДВУСТВОЛКА”**

- 1. Краткое знакомство со стратегией**
- 2. Правила стратегии**
  - a) Определение направления тренда**
  - b) Волатильность финансового инструмента**
  - c) Правила открытия и закрытия позиции**
- 3. Управление капиталом**
- 4. Показатели эффективности стратегии**

**1. Методы анализа (25%)**

**2. Управление капиталом (25%)**

**3. Психология трейдинга (50%)**

- **Инвестиционные инструменты**
- **Методы анализа**
- **Принцип действия стратегии**
- **Временные интервалы**
- **Аналитические инструменты**
- **Правила стратегии**
- **Управление капиталом**
- **Показатели эффективности стратегии**

❖ FOREX

❖ ФЬЮЧЕРСЫ

❖ АКЦИИ

- ❖ **Фундаментальный Анализ(ФА)**
- ❖ **Технический Анализ(ТА)**
- ❖ **Количественный Анализ(QA)**

- ❖ **Следование за трендом**
- ❖ **Торговля в ценовом диапазоне**
- ❖ **Другие стратегии**

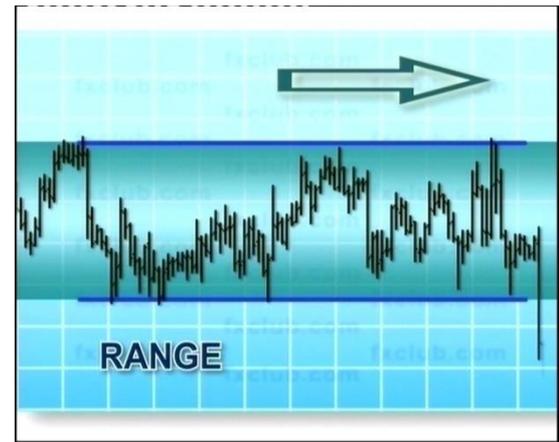
# Стратегии следующие за трендом



**ПОКУПКА**



**ПРОДАЖА**



**ВНЕ РЫНКА**

## Аналитические инструменты:

❖ **SMA(10m)200**

❖ **EMA(10m)200**

❖ **EMA(10m)20**

❖ **ADV(D)20**

# Временные интервалы



Мин: 1m-2m-3m-4m-5m-6m-10m-12m-15m-20m-30m

Час: 1H-2H-3H-4H-6H-8H-12H

День: D

Неделя: W

Месяц: M

Квартал: Q

Год: Y

# Торговая стратегия “Двустволка” (MT4)



**ОПРЕДЕЛЕНИЕ  
НАПРАВЛЕНИЯ  
ТЕКУЩЕЙ РЫНОЧНОЙ  
ТЕНДЕНЦИИ**

# EUR/USD SMA(D)200+EMA(D)200



# EUR/JPY SMA(H)200+EMA(H)200



# BRENT SMA(10)200+EMA(10)200



# GBP/USD SMA(1)200+EMA(1)200



# Окончание нисходящего тренда



# Окончание восходящего тренда



# Восходящий тренд



# Нисходящий тренд



# No Trade - боковая тенденция



# ПРАВИЛА ОТКРЫТИЯ И ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИИ

❖ **Открытие LONG позиции**

❖ **Закрытие LONG позиции**

❖ **Открытие SHORT позиции**

❖ **Закрытие SHORT позиции**

# Условия для открытия LONG (S&P 500)



# Условия для открытия SHORT (XAUUSD)



# Установка ордеров

Open ↑  
Long

— Take Profit  
↓

— Stop Loss  
↓

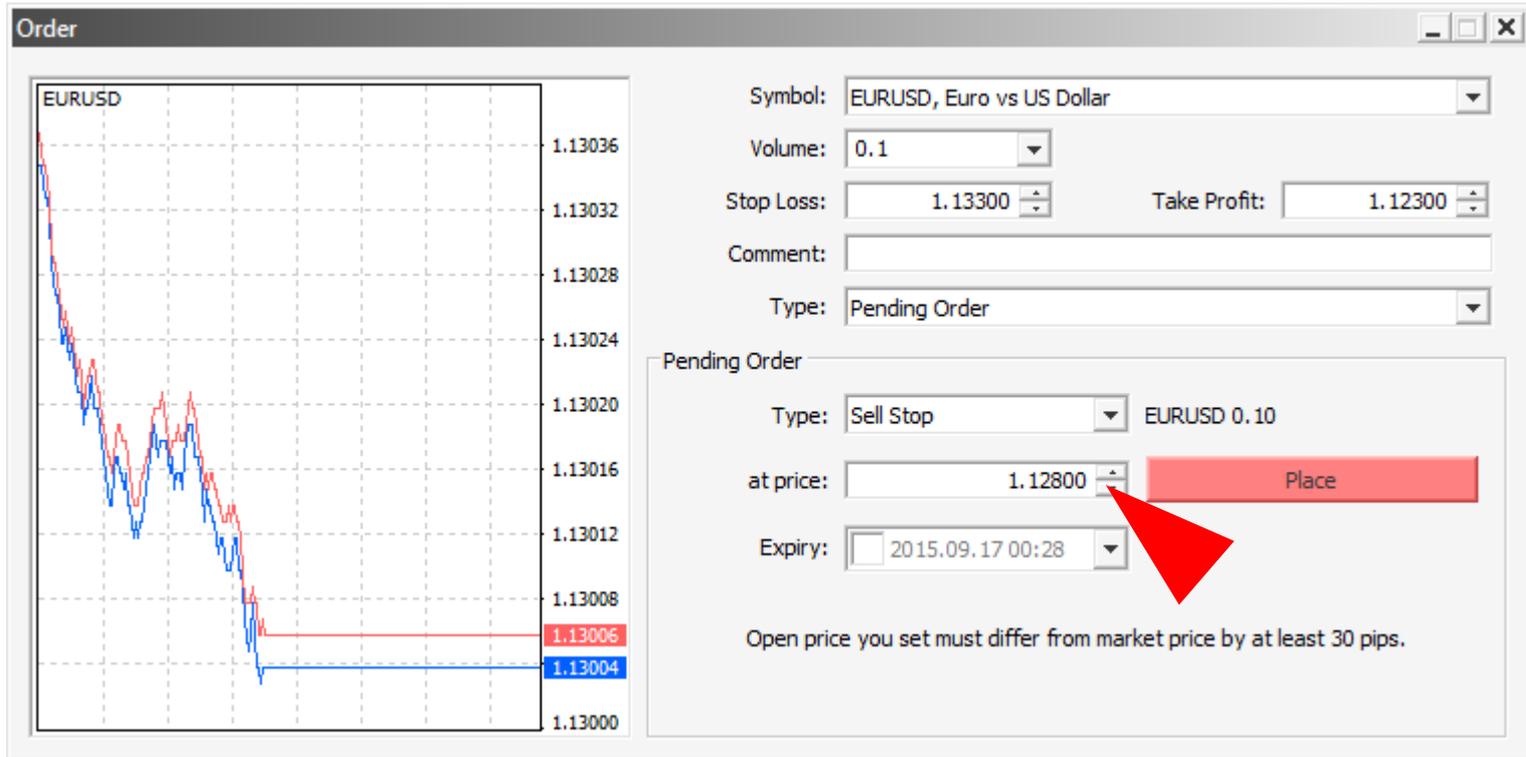
Open  
Short ↓

— Stop Loss  
↑

— Take Profit  
↑

# Установка ордеров IF DONE (MT4)

Order



The screenshot shows the 'Order' window in MetaTrader 4. On the left is a price chart for EURUSD with a grid. The y-axis ranges from 1.13000 to 1.13036. A red line represents the current price, and a blue line represents the order price. On the right, the order details are as follows:

- Symbol: EURUSD, Euro vs US Dollar
- Volume: 0.1
- Stop Loss: 1.13300
- Take Profit: 1.12300
- Comment: (empty)
- Type: Pending Order

Under the 'Pending Order' section:

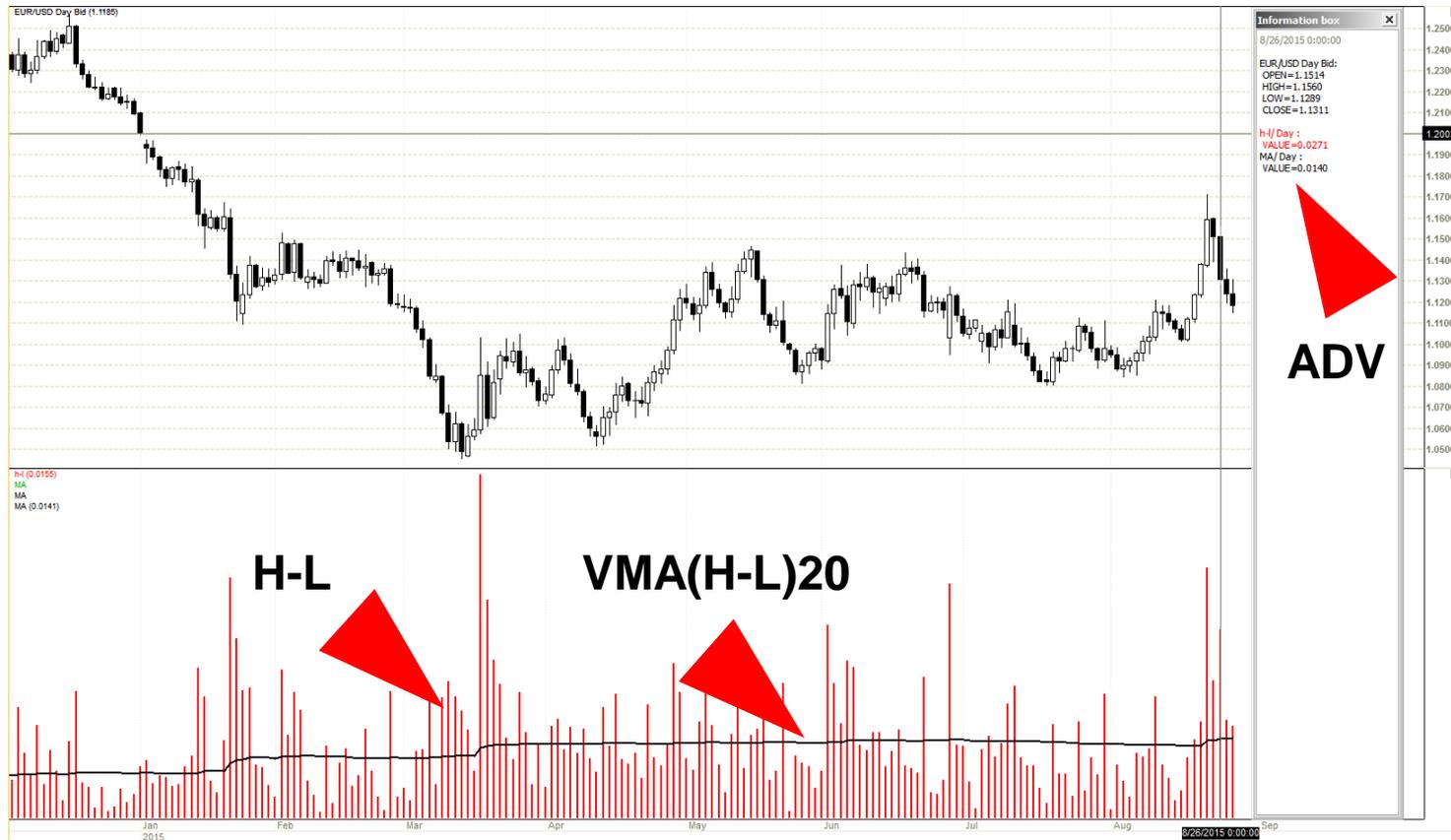
- Type: Sell Stop
- EURUSD 0.10
- at price: 1.12800
- Expiry: 2015.09.17 00:28

A red arrow points to the 'at price' field. A red 'Place' button is visible next to the price field. At the bottom, a note states: 'Open price you set must differ from market price by at least 30 pips.'



$$((H1-L1)+...+(Hn-Ln))/n$$

# Среднедневная волатильность (ADV)

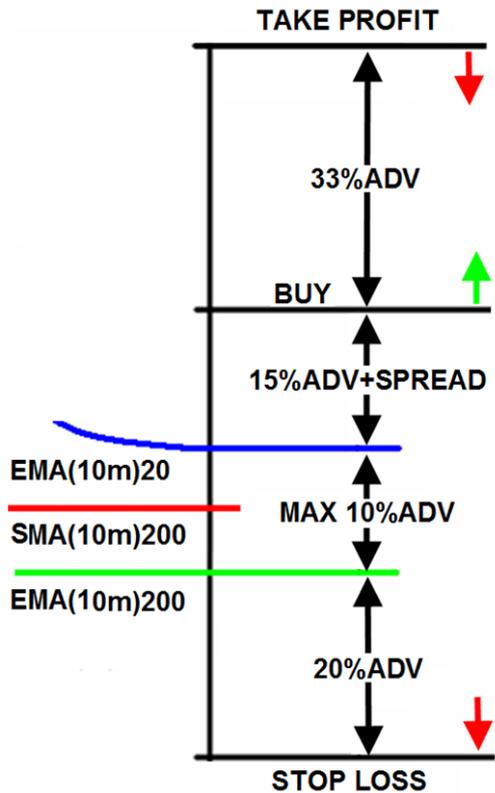


# Среднедневная волатильность (ADV)

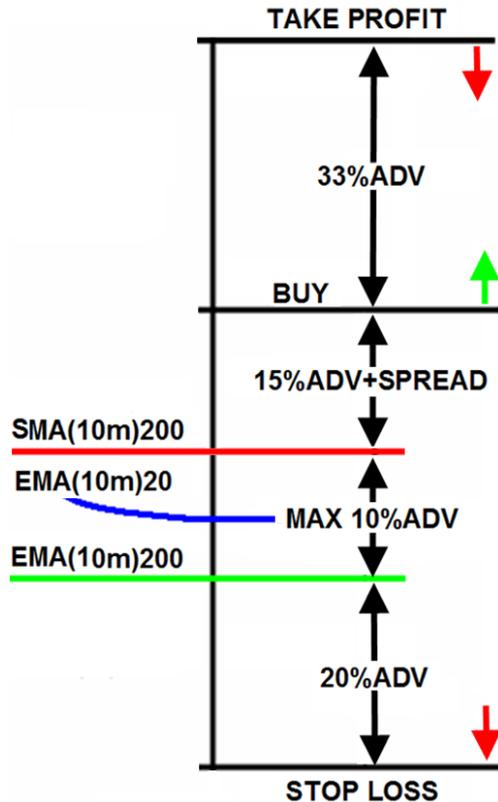
<b>Инструмент</b>	<b>ADV</b>	<b>Спред</b>	<b>Ratio</b>
<b>EURUSD</b>	<b>0.0138</b>	<b>0.0002</b>	<b>&gt;60</b>
<b>USDJPY</b>	<b>1.15</b>	<b>0.0002</b>	<b>&gt;50</b>
<b>GBPUSD</b>	<b>0.0135</b>	<b>0.0002</b>	<b>&gt;60</b>
<b>EURJPY</b>	<b>1.50</b>	<b>0.04</b>	<b>&gt;30</b>
<b>GBPJPY</b>	<b>1.90</b>	<b>0.05</b>	<b>&gt;30</b>
<b>XAUUSD</b>	<b>21.00</b>	<b>0.5</b>	<b>&gt;40</b>
<b>BRENT</b>	<b>2.30</b>	<b>0.05</b>	<b>&gt;40</b>
<b>S&amp;P500(ES)</b>	<b>34.00</b>	<b>0.5</b>	<b>&gt;60</b>
<b>DJI(YM)</b>	<b>280</b>	<b>5</b>	<b>&gt;50</b>

# ПРАВИЛА УСТАНОВКИ ОРДЕРОВ

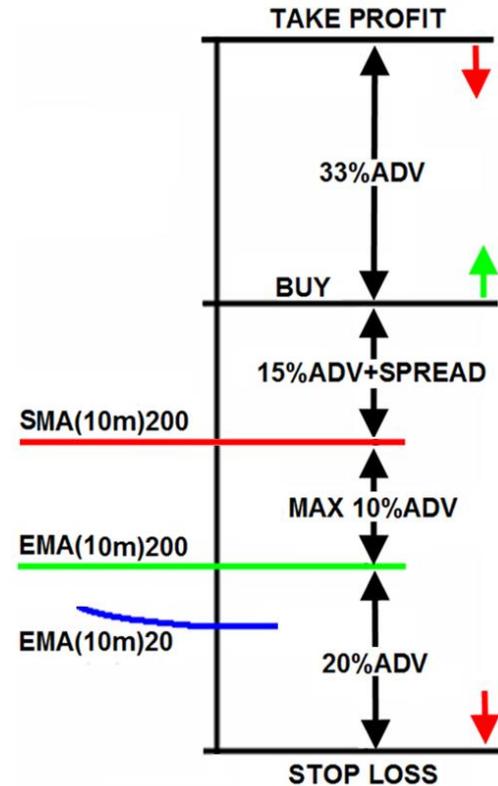
# Схема для открытия позиции LONG



Ситуация 1

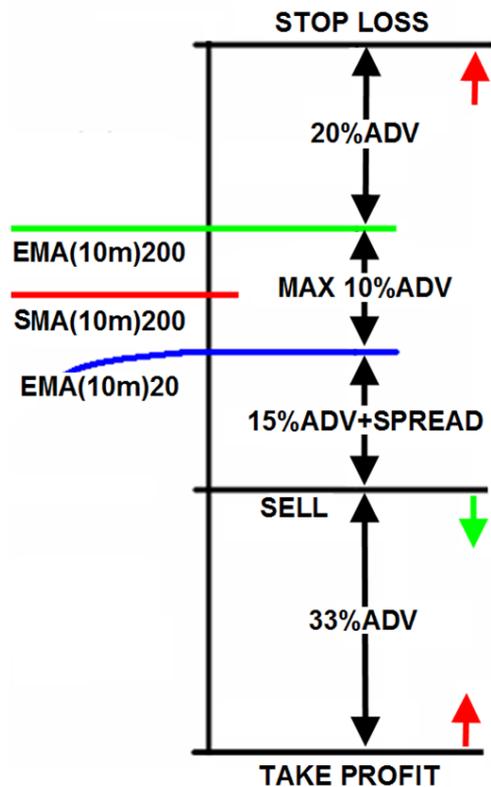


Ситуация 2

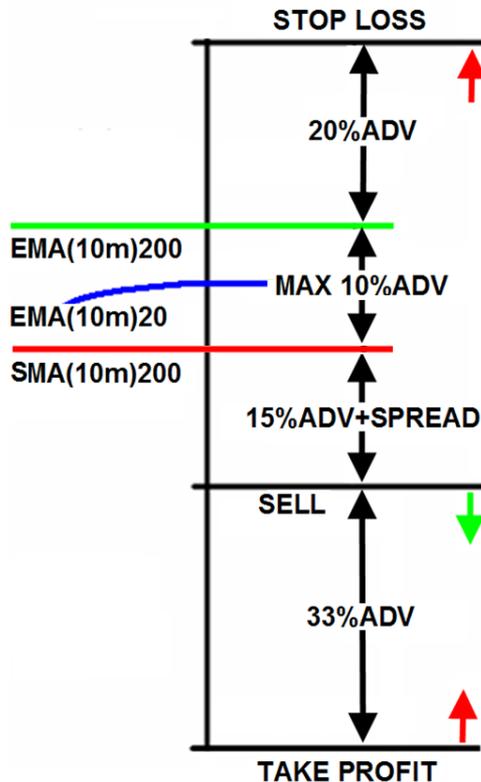


Ситуация 3

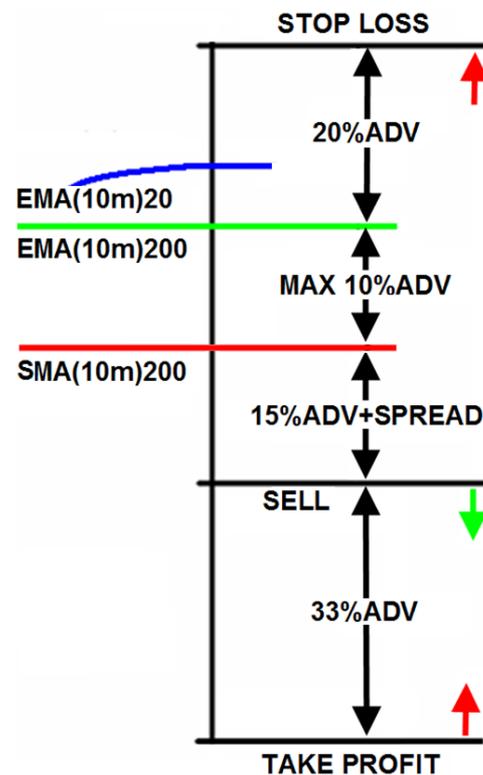
# Схема для открытия позиции SHORT



Ситуация 1

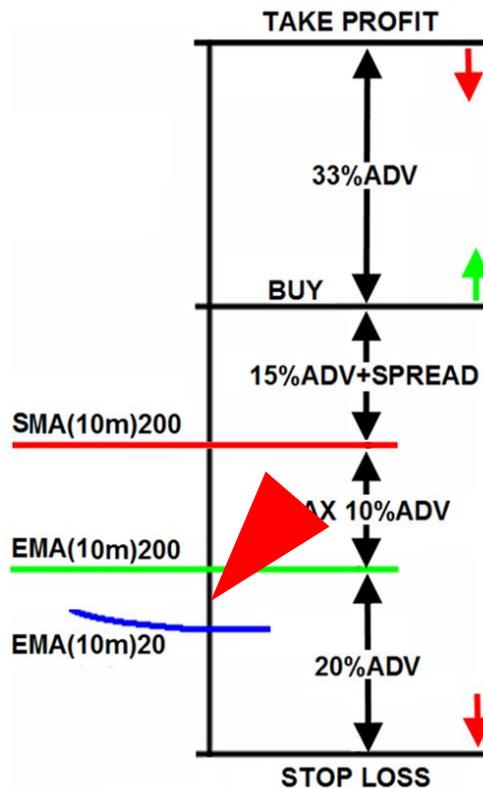
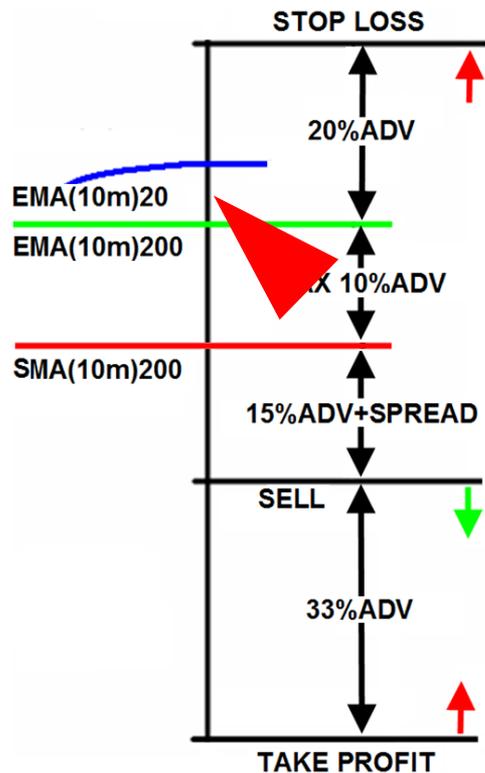


Ситуация 2



Ситуация 3

# Критерий окончания тренда



**Размер просвета более 10% ADV = Смена направления тренда**

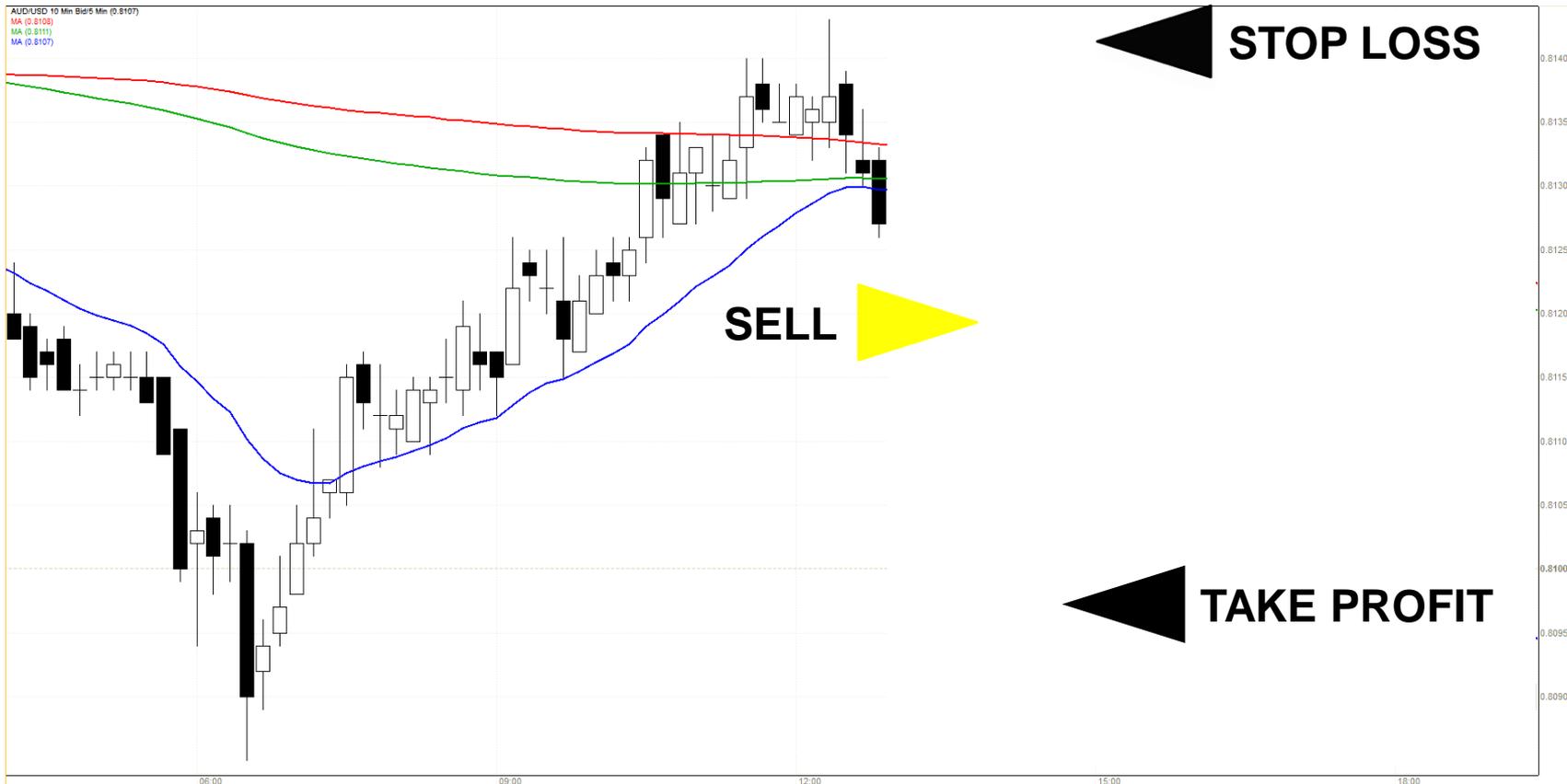
# Таблица параметров позиции



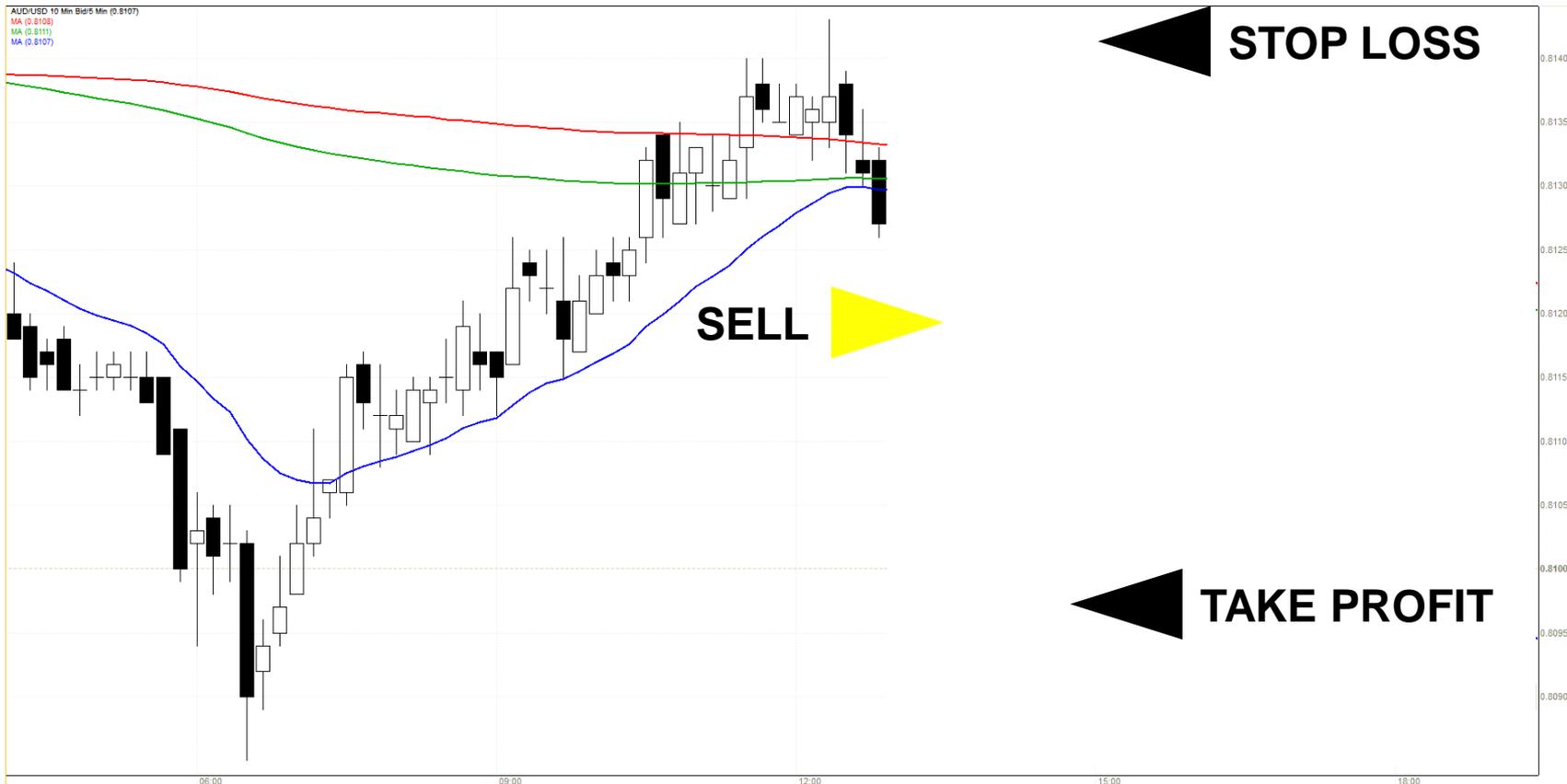
	PRC	OPR	ADV	MMUP	MMDW	%ADV	BUF	OPEN	T/P	S/L	LOT	1PIP	RSK	RWD	M/OPEN	M/RSK	M/TGT	M/RWD	SPR
		BUY		7751	7746		5	7769	7803	7725		2.00	87.50	69.30	7746	42.00	7781	114.8	
AUD	0.72		105			10	11				20								2
		SELL		7849	7840		9	7824	7790	7872		2.00	95.5	69.30	7849	46.00	7814	118.8	
		BUY		13185	13180		5	13204	13241	13157		1.52	70.53	56.50	13180	34.24	13217	92.79	
CAD	1.32		113			10	11				20								2
		SELL		13015	13010		5	12993	12956	13040		1.52	70.53	56.50	13015	37.27	12978	89.76	
		BUY		9480	9474		6	9499	9538	9451		2.06	100.21	78.93	9474	47.84	9515	131.30	
CHF	0.97		116			10	12				20								2
		SELL		9242	9236		6	9219	9180	9267		2.06	100.21	78.93	9242	51.96	9201	127.18	
		BUY		11267	11257		10	11289	11334	11240		2.00	98.50	89.10	11257	34.00	11302	153.60	
EUR	1.12		135			10	14				20								2
		SELL		11067	11060		7	11040	10995	11096		2.00	112.50	89.10	11067	58.00	11022	143.60	
		BUY		15376	15369		7	15399	15444	15342		2.00	113.90	90.42	15369	54.80	15417	149.52	
GBP	1.54		137			10	14				20								2
		SELL		15714	15703		11	15682	15637	15743		2.00	121.90	90.42	15714	58.80	15669	153.52	
		BUY		12000	11990		10	12019	12059	11967		1.67	85.917	65.92	11990	37.67	12030	114.17	
JPY	120		113			10	11				20								2
		SELL		11950	11940		10	11923	11884	11975		1.67	85.917	65.92	11950	41.00	11910	110.83	
		BUY		6670	6660		10	6688	6722	6639		2.00	97.50	69.30	6660	42.00	6695	124.80	
NZD	0.63		105			10	11				20								2
		SELL		6661	6656		5	6640	6604	6684		2.00	87.50	73.50	6661	46.00	6624	115.00	
	PRC	OPR	ADV	MMUP	MMDW	%ADV	BUF	OPEN	T/P	S/L	LOT	1PIP	RSK	RWD	M/OPEN	M/RSK	M/TGT	M/RWD	SPR

- 1. Определить параметр волатильности инструмента, ADV**
- 2. Определить размер буфера между EMA20 и MA200 или EMA200 и SMA200, BUF (не более 10% ADV)**
- 3. Определить уровень открытия позиции, OPEN**
- 4. Определить уровень ограничения убытков, S/L**
- 5. Определить уровень фиксации прибыли, T/P**
- 6. Выставить все необходимые ордера**
- 7. Корректировать ценовые значения ордеров**

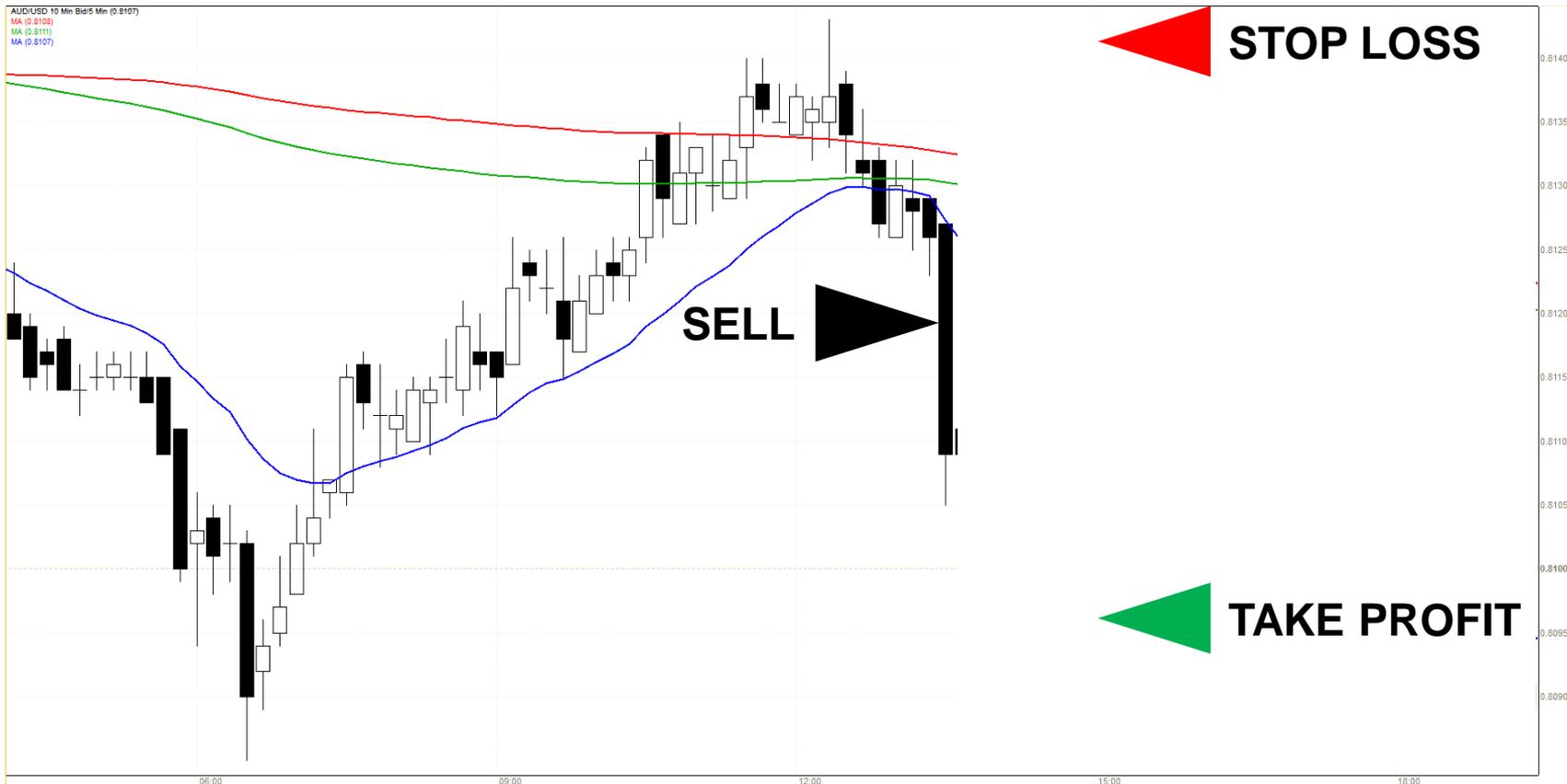
# Условия для открытия позиции SHORT



# Условия для открытия позиции SHORT



# Условия для открытия позиции SHORT



# Условия для открытия позиции LONG



# Условия для открытия позиции LONG



# Условия для открытия позиции LONG



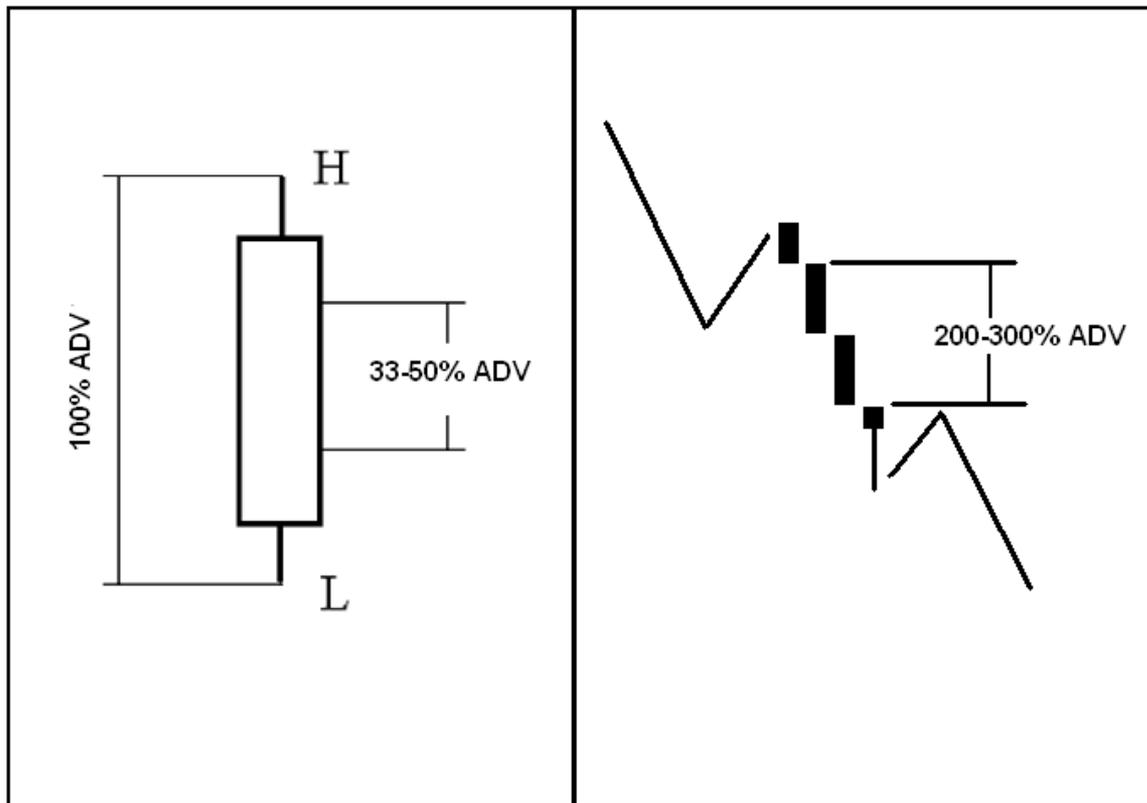
# ПРАВИЛА УПРАВЛЕНИЯ КАПИТАЛОМ

# Среднесрочная vs краткосрочная торговля

Высокий %  
прибыльных  
сделок

Большое  
количество  
сделок

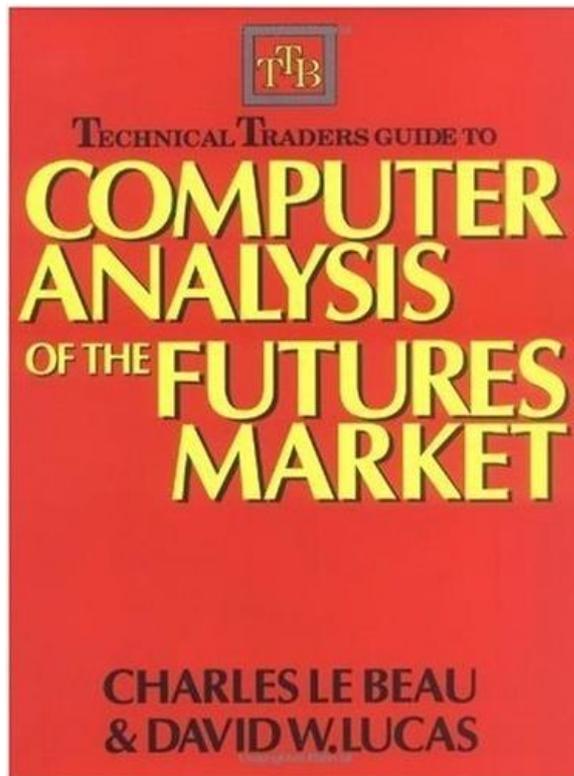
Низкие  
результаты  
в пунктах



Выгодное  
соотношение  
P/L

Высокие  
результаты  
в пунктах

Малое  
количество  
сделок



# Матрица вероятностей провала ТС



P/L	% WIN									
	25	30	35	40	45	50	55	60	65	70
750:1000	100	100	100	100	100	98	77	15	1	0
1000:1000	100	100	100	99	92	50	7	1	0	0
1500:1000	100	99	90	50	12	2	0	0	0	0
2000:1000	97	79	35	9	2	1	0	0	0	0
2500:1000	79	38	12	4	1	0	0	0	0	0
3000:1000	50	19	6	2	1	0	0	0	0	0
3500:1000	31	12	5	2	1	0	0	0	0	0
4000:1000	21	9	4	2	1	0	0	0	0	0

Провал стратегии \$12k

Начальный баланс \$25k

Успех стратегии \$50k

## 1. Соотношение Profit/Loss

**Long/Medium Term**

**2:1 или 3:1**

**Short Term**

**$\frac{2}{3} : 1$  или  $\frac{3}{4} : 1$**

## 2. % Прибыльных Сделок

**Long/Medium Term**

**30-50%**

**Short Term**

**60-70%**

## 3. Достаточность капитала

## Начальный депозит: \$5000

- ❖ Максимальное количество сделок в портфеле – 3
- ❖ Лимит риска на сделку в процентах: 2%
- ❖ Лимит риска на сделку в деньгах:  $\$5000 * 0.02 = \$100$
- ❖ Размер риска: от  $\frac{1}{4}$  до  $\frac{1}{2}$  ADV
- ❖ **R=OPEN - STOP LOSS (LONG) или R=STOP LOSS - OPEN (SHORT)**
- ❖ Величина торгового лота:  $\$100 / 0.0050(\text{pps}) = 20000 \text{ units}$

## Leverage:

$20000 \text{ units} / \$5000 = 4$  (4:1, если 1 позиция)

$3 * 20000 \text{ units} / \$5000 = 12$  (12:1, если 3 позиции)



## Стратегия Рулетка

Соотношение P/L – 1:1, Вероятность P/L – 50:50

1. Ставка \$10

Результат → Loss (\$10)

2. Ставка \$20

Результат → Loss (\$20, Итого =  $-10-20=-\$30$ )

3. Ставка \$40

Результат → Loss (\$40, Итого =  $-10-20-40=-\$70$ )

4. Ставка \$80

Результат → Loss (\$80, Итого =  $-10-20-40-80=-\$150$ )

5. Ставка \$160

Результат → Profit (\$160, Итого =  $160-150=\$10$ )

## Стратегия «Двустволка»

Соотношение P/L – 33:45, Вероятность P/L – 60:40

1. Лот  $\$100 * 100 = 10000$

Результат → Profit ( $33\text{pps} * \$1 = \$33$ )

2. Лот  $\$100 * 100 = 10000$

Результат → Loss ( $45\text{pps} * \$1 = \$45$ )

3. Лот  $\$200 * 100 = 20000$

Результат → Profit ( $33\text{pps} * \$2 = \$66$ , Итого =  $66 - 45 = \$21$ )

4. Лот  $\$100 * 100 = 10000$

Результат → Profit ( $33\text{pps} * \$1 = \$33$ )

## Стратегия «Двустволка»

Соотношение P/L – 33:45, Вероятность P/L – 60:40

1. Лот  $\$100 * 100 = 10000$

Результат → Profit ( $33\text{pps} * \$1 = \$33$ )

2. Лот  $\$100 * 100 = 10000$

Результат → Loss ( $45\text{pps} * \$1 = \$45$ )

3. Лот  $\$200 * 100 = 20000$

Результат → Loss ( $45\text{pps} * \$2 = \$90$ , Итого =  $-45 - 90 = -\$135$ )

4. Лот  $\$100 * 100 = 10000$

Результат → Profit ( $33\text{pps} * \$1 = \$33$ )

## Начальный депозит: \$5000

- ❖ Максимальное количество сделок в портфеле – 3
- ❖ Лимит риска на сделку в процентах: 2% или 4%
- ❖ Лимит риска на сделку в деньгах:  $\$5000 * 0.02 = \$100$  или  $\$5000 * 0.04 = \$200$
- ❖ Размер риска: от  $\frac{1}{4}$  до  $\frac{1}{2}$  ADV
- ❖  $R = \text{OPEN} - \text{STOP LOSS (LONG)}$  или  $R = \text{STOP LOSS} - \text{OPEN (SHORT)}$
- ❖ Величина лота:  $\$100 / 0.0050(\text{pps}) = 20000$  или  $\$200 / 0.0050(\text{pps}) = 40000$

## Leverage:

$20000 \text{ units} / \$5000 = 4$  или  $40000 / \$5000 = 8$  (4:1 или 8:1, если 1 позиция)

$(2 * 20000 \text{ units} + 1 * 40000 \text{ units}) / \$5000 = 16$  (16:1, если 3 позиции, 2+1)

$(1 * 20000 \text{ units} + 2 * 40000 \text{ units}) / \$5000 = 20$  (20:1, если 3 позиции, 1+2)

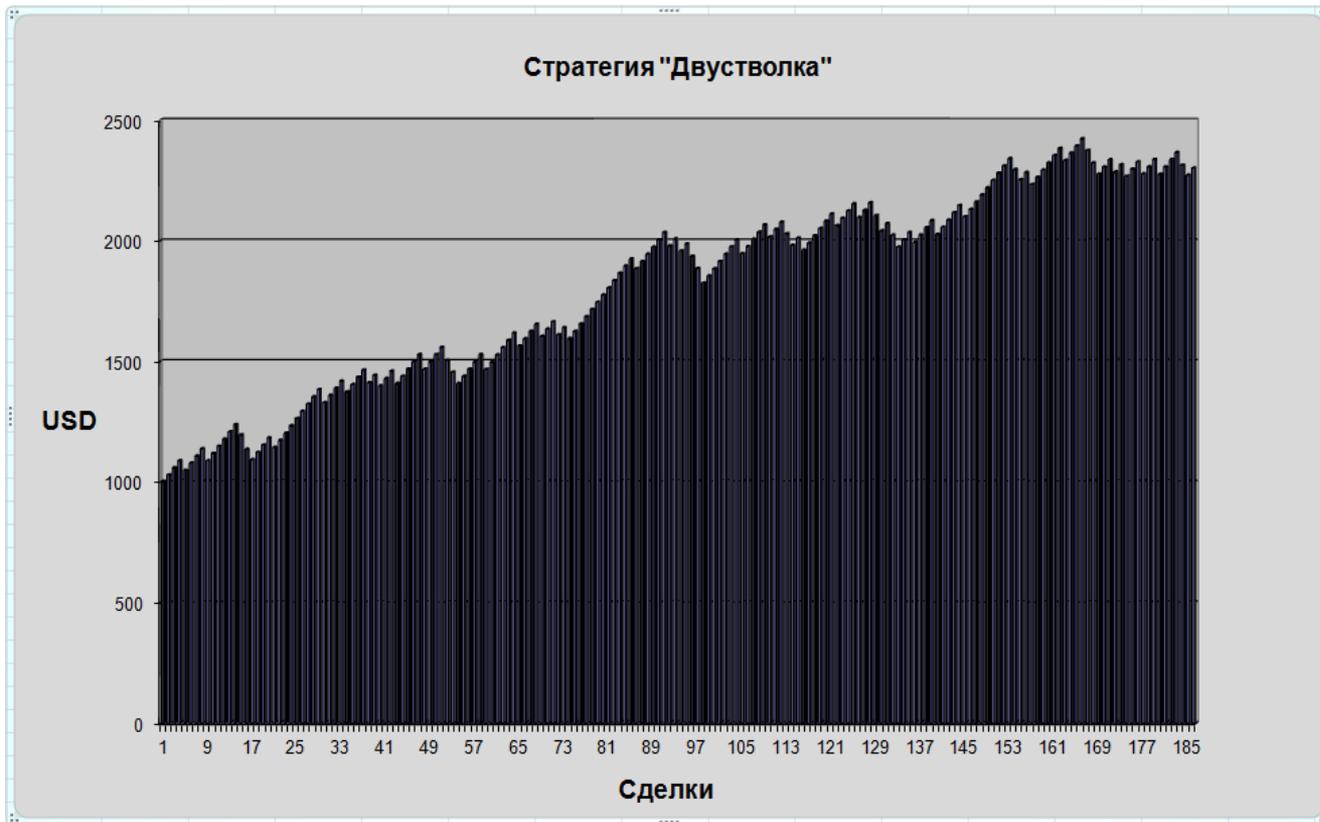
# **ПАРАМЕТРЫ ПРОИЗВОДИТЕЛЬНОСТИ СТРАТЕГИИ**

# Показатели эффективности стратегии

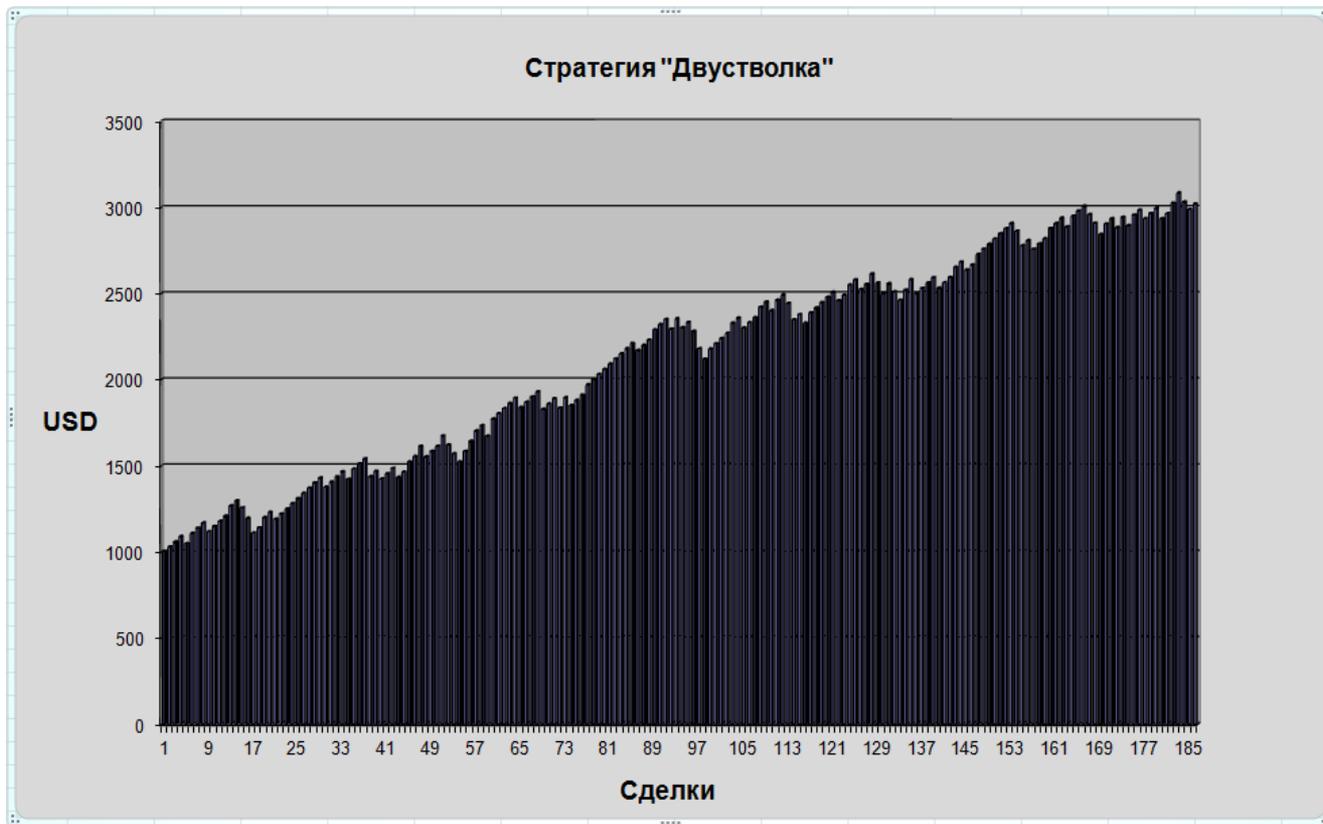


- СУММАРНАЯ ПРИБЫЛЬ
- СУММАРНЫЙ УБЫТОК
- ЧИСТАЯ ПРИБЫЛЬ
- МАКСИМАЛЬНАЯ ПРИБЫЛЬ В СДЕЛКЕ
- МАКСИМАЛЬНЫЙ УБЫТОК В СДЕЛКЕ
- СРЕДНЯЯ ПРИБЫЛЬ
- СРЕДНИЙ УБЫТОК
- МАКС. КОЛИЧЕСТВО ПРИБЫЛЬНЫХ СДЕЛОК В СЕРИИ
- МАКС. КОЛИЧЕСТВО УБЫТОЧНЫХ СДЕЛОК В СЕРИИ
- МАКС. НАРАСТАЮЩИЙ УБЫТОК
- PROFIT ФАКТОР
- ДЕЙСТВИТЕЛЬНЫЙ ПРОФИТ ФАКТОР
- ФАКТОР ВОССТАНОВЛЕНИЯ

# График доходности (консервативный ММ)



# Доходность стратегии (агрессивный ММ)



## Формула Математического Ожидания

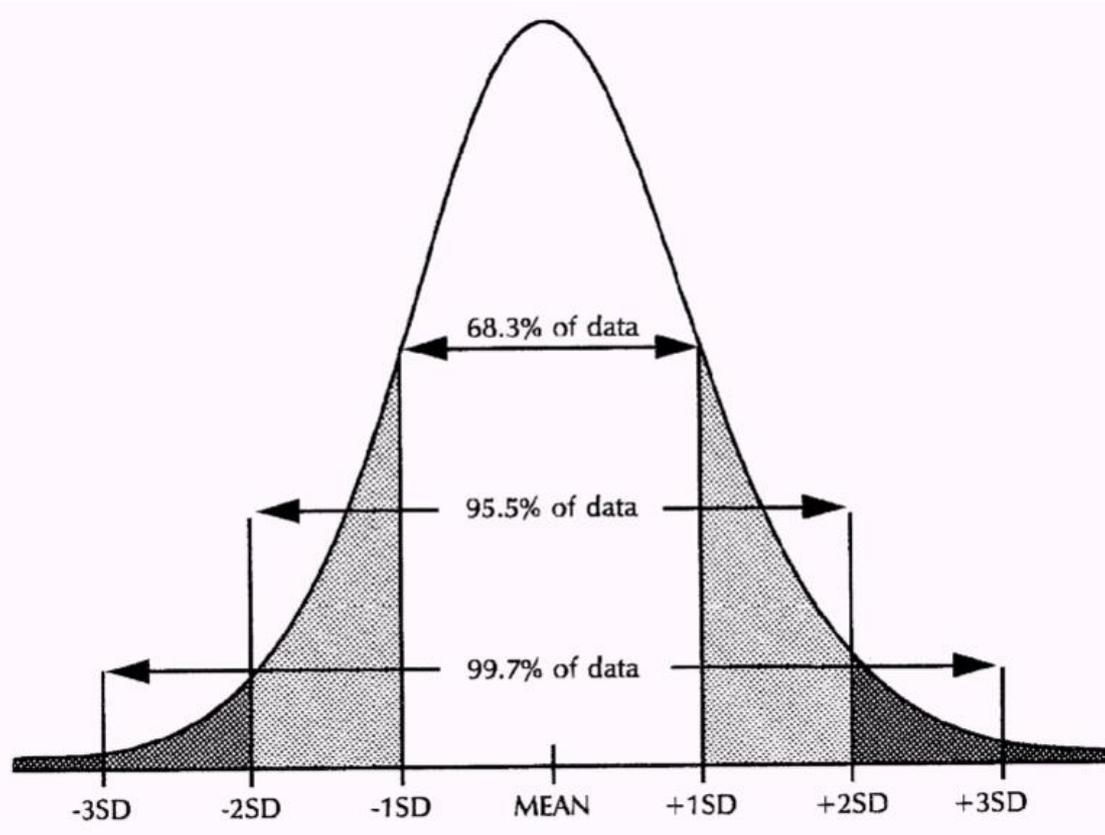
$$[1 + (W/L)] * P - 1$$

- ❖ Вероятность прибыльных сделок(P)
- ❖ Вероятность убыточных сделок
- ❖ Размер средней прибыльной сделки(W)
- ❖ Размер средней убыточной сделки(L)

- ❖ Вероятность прибыльных сделок(65%)
- ❖ Вероятность убыточных сделок
- ❖ Размер средней прибыльной сделки(\$33)
- ❖ Размер средней убыточной сделки(\$45)

$$[1 + (33/45)] * 0.65 - 1 = 0.127$$

# Стандартное отклонение



**% Прибыльных Сделок**

**Long/Medium Term**

**30-50%**

**Short Term**

**60-70% → 65-75%**

# Индикатор настроений участников рынка

## FX MAJORS (ALL VS USD)

	ALL	LT	MT	ST	W&L			
NON USD BULLS	44.4%	33%	81%	19%	AUD	22%	AUD	
					CAD	44%	CAD	
					CHF	44%	CHF	
					EUR	44%	EUR	
					GBP	44%	GBP	
JPY	56%	JPY						
						NZD	56%	NZD
NEUTRALS	46.0%	52%	19%	67%	AUD	56%	AUD	
					CAD	56%	CAD	
					CHF	56%	CHF	
					EUR	22%	EUR	
					GBP	44%	GBP	
					JPY	44%	JPY	
					NZD	44%	NZD	
NON USD BEARS	9.5%	14%	0%	14%	AUD	22%	AUD	
					CAD	0%	CAD	
					CHF	0%	CHF	
					EUR	33%	EUR	
					GBP	11%	GBP	
					JPY	0%	JPY	
					NZD	0%	NZD	
ALL	LT	MT	ST	W&L				

- ❖ **LT – долгосрочная техническая перспектива**
- ❖ **MT – среднесрочная ТЕХНИЧЕСКАЯ перспектива**
- ❖ **ST – краткосрочная ТЕХНИЧЕСКАЯ перспектива**
- ❖ **Желтый цвет – нейтральные настроения**
- ❖ **Зеленый цвет – валюту/актив покупают**
- ❖ **Красный цвет – валюту/актив продают**
- ❖ **Жирный шрифт – настроения более выражены**
- ❖ **ALL – общий баланс сил по всем инструментам**
- ❖ **W&L – наиболее сильные/слабые инструменты**

# Подписка (анализ сентимента по сегментам)



- ❖ **FOREX - основные валютные пары (USD/EUR/JPY/GBP/CHF/AUD/CAD/NZD)**
- ❖ **FOREX - кросс-курсы основных валют (EUR/JPY/GBP/CHF/AUD/CAD/NZD)**
- ❖ **Энергоносители (Brent/WTI/Natural Gas/Heat Oil/RBOB)**
- ❖ **Драгоценные металлы (XAU/XAG/PL/PA)**
- ❖ **Фондовые индексы США (DJI, S&P500, NASDAQ, RUSSEL2000)**
- ❖ **FOREX - валюты развивающихся стран (CNY, BRL, INR, RUB, KRW, MXN, TRY, PLN, ZAR)**
- ❖ **Долговые обязательства США (30YB, 10YB, 5YN, 2YN)**
- ❖ **Промышленные металлы (Copper, Aluminum, Nickel, Zinc, Lead, Tin)**
- ❖ **Зерновые культуры (Soybeans, Wheat, Corn, Rice, Oats)**
- ❖ **Скот (Live Cattle, Feeder Cattle, Lean Hogs)**
- ❖ **Акции российских и американских компаний**

**Соотношение  
Profit/Loss**

**Long/Medium Term**

**2:1 или 3:1**

**Short Term**

**$\frac{2}{3} : 1$  или  $\frac{3}{4} : 1 \rightarrow 1:1$**



**СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!**