

ЭТОМ НОМЕРЕ:



Стоп-лоссы в NetInvestor

Расчет стоп-лоссов на графика ХО

Как определить уровень стоп-лосса на «крестикахноликах» и просто выставить приказ

ст. 1-2

Создание стоп-лоссов в Мастере стратегий NetInvestor

- Преимущества стратегии перед приказами стоп-лосс
- Индикаторы, на которых можно построить стоп-лосс
- Пример стратегии-SL на канале Боллинджера ст. 3-4

Наши вебинары для начинающих и опытных трейдеров ст. 3

Технологии NetInvestor брокеру Модуль отчетов и Модуль неторговых поручений Назначение. **Credit Card** Возможности. 6

Приложение к электронному

изданию MFD.RU ©

Преимущества. ст. 5

Можно ли вместо обычного стоплосса использовать стратегию? Как рассчитать и выставить стоп лосс на графике ХО?

№24 июль 2011

Этот выпуск Вестника посвящен стоп-лоссам и новым способам защиты своих позиций в терминале NetInvestor.

 \bigcirc



«Крестики-нолики» с защитой от убытков

🗩 МФД-ИнфоЦентр

В одном из прошлых номеров вестника поднималась тема графиков point&figure, они же графики XO, и торговых сигналов на «крестиках-ноликах». В этом выпуске мы рассмотрим еще один важный аспект работы с графиками ХО - определение уровней стоплоссов (SL) для открытых позиций.

Крестики-нолики - метод анализа рыночных данных, который применяется для долгосрочных и среднесрочных инвестиций. При построении графиков ХО данные проходят фильтрацию, мелкие колебания цены не учитываются. A NetInvestor Professional – торговый терминал, который позволяет легко и удобно работать с графиками ХО.

О построении «крестиков-ноликов» и о методах анализа этого типа графика рекомендуем прочитать в статье «Крестикинолики для трейдеров» (Вестник NetInvestor, № 20).

Одно из преимуществ графиков ХО заключается в том, что с их помощью легко находить трендовые линии, уровни поддержки и сопротивления:

- на боковом тренде уровни поддержки и сопротивления отображаются горизонтальными линиями;
- для бычьих или медвежьих трендов линии поддержки и сопротивления проводятся под углом 45° к осям.

Именно это свойство «крестиков-ноликов» можно использовать для расчета уровней стоп-лоссов.

Простейший метод расчета стоп-лоссов состоит в том, что уровни приказов совпадают с линиями поддержки или сопротивления.

В случае длинной позиции SL выставляется на уровне бычьей поддержки.

В случае короткой SL выставляется на уровне медвежьего сопротивления.



Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте www.netinvestor.ru





🕖 МФД-ИнфоЦентр

Стоп-лоссы для «крестиков-ноликов». Продолжение





Рассматривается график XO инструмента RTS-6.11.

Параметры графика: таймфрейм – 1 час (60 минут); порог (box size) – 1000; разворот (reversal) - 3.

На рисунке обозначены: линия медвежьего сопротивления зеленым цветом; точки входа и выхода из позиции - желтым.

Рассмотрим фрагмент графика RTS-6.11 (см. рис. выше) и попробуем применить к нему методику расчета уровней SL для графиков XO.

Предположим, сигналом входа в короткую продажу выступает прорыв тройного основания (в специальной литературе «паттерн S3»). Сигнал обнаруживается на столбце №1 (рисунок). До столбца 1 на графике можно провести горизонтальный уровень сопротивления; CO столбца 1 – линию медвежьего сопротивления.

Пока позиция открыта, при формировании каждого следующего столбца О нужно выставлять стоплоссы со следующими уровнями:

№ столбца (см. рис.)	Изменение уровней SL
1	SL(1) = 202 000
3	SL(3) = 198 000
5	SL(5) = 196 000
	Уровни стоп-лоссов методично
15	переносятся вниз по линии медвежьего сопротивления

Выход из рынка можно предположить на столбце 16 (простая покупка с растущим основанием или «паттерн B2») на уровне 180 000. Между прочим, для рассматриваемого здесь примера, очень хороший результат дает метод **горизонтального счета**.

Горизонтальный счет – способ оценки силы тренда, который позволяет прогнозировать целевой уровень цены. При горизонтальном счете максимальная ширина фигуры, которая сформировалась до начала тренда, умножается на 3. В данном примере ожидается нисходящий тренд такой силы, что цена упадет на 7 x 3 = 21 клетку. Этот целевой уровень 180 000 показан на рисунке и является удачным уровнем для тейк-профита.

- В терминале NetInvestor Professional создавать стоп-лоссы и тейк-профиты можно непосредственно с графиков, для чего достаточно:
- а) нацелиться мышью на уровень стоп-лосса по шкале цены в любом месте графика;
- б) щелкнуть в этом месте правой кнопкой и вызвать контекстное меню;
- в) выбрать из меню «Выставить стоп-лосс».

Напомним также, что если в настройках графика установлено «Включить торговые операции», то стоп-лоссы можно «перетаскивать» с одного уровня цены на другой мышью.



Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте www.netinvestor.ru



№24 июль 2011

厄 МФД-ИнфоЦентр

Автоматизация торговли и роботы



Создание стоп-лоссов в Мастере стратегий

Наши вебинары. Роботы, крестики-нолики и другие полезные знания

Компания МФД-ИнфоЦентр проводит обучающие вебинары для трейдеров в рамках проекта iLearney.ru.

Видеоконференции, транслирующиеся онлайн реальном В времени, позволяют всем заинтересованным лицам регулярно знакомиться C возможностями торгового терминала Вебинары NetInvestor. бесплатны и должны заинтересовать частных инвесторов, которые не могут посещать наши очные мастер-классы.

Весь цикл вебинаров от NetInvestor охватывает значительный объем знаний практических И навыков трейдинга. Особое внимание уделяется таким актуальным темам, как анализ рынка с помощью графиков «крестики-нолики», разработка торговых систем и роботов, рынок опционов.

Так, в июне прошли три вебинара, посвященные опционам:

16 июня 2011 г. Опционы в NetInvestor: введение в рынок опционов

23 июня 2011 г. Опционы в NetInvestor: доска опционов

30 июня 2011 г. Опционы в NetInvestor: расширенные возможности анализа и торговли.

С актуальным расписанием вебинаров всегда можно ознакомиться на нашем сайте:

http://www.netinvestor.ru/calendar.aspx

Видеозаписи прошедших вебинаров можно посмотреть по ссылке: http://www.netinvestor.ru/TV.aspx Стоп-лосс – приказ, который исполняется при достижении определенного, ранее заданного уровня рынка.

В NetInvestor приказы типа «стоп-лосс» хранятся на сервере системы, и только в момент срабатывания отправляются на биржу. Альтернативный метод создания стоп-лоссов – использование Мастера стратегий.

Мастер стратегий – новая разработка, включенная в состав терминала NetInvestor, и представляющая собой модуль автоматизации торговли и создания советников на базе технических индикаторов.

Мастер стратегий можно использовать для написания собственных стоп-лоссов, которые, в отличие от обычных приказов:

- а) работают по сложному алгоритму;
- б) появляются только в момент сигнала, а не хранятся в таблице, о них нельзя «забыть»;
- в) их работу можно наблюдать на исторических данных.

Используя стратегию, инвестор может закрывать позицию не просто при пересечении критичного уровня, а только тогда, когда один или несколько индикаторов ТА подтверждают неблагоприятное движение рынка. Для разработки стратегии-SL можно использовать различные индикаторы из библиотеки NetInvestor.

Индикатор	Алгоритм стоп-лосса
Moving Average	С помощью индикатора МА можно задать алгоритм «скользящего» стоп-лосса. Сигналом будет служить пересечение графика цены со смещенной вниз (длинная позиция) или смещенной вверх (короткая позиция) средней.
ADX (Average Directional Index)	Учитывать силу тренда в алгоритме стоп-лосса позволяет индикатор ADX. Сигналом для закрытия может служить, например, снижение ADX ниже 20.
ATR (Average True Range)	Влияние волатильности рынка помогает учесть индикатор ATR. Например, можно использовать критическое значение волатильности, при падении рынка ниже которого следует закрыть позицию.
Parabolic SAR	Еще один вариант «скользящего» SL может быть реализован на параболической системе. Положение индикатора относительно цены зависит от тренда (на растущем – снизу, на падающем – сверху), поэтому такая стратегия может закрывать как длинные, так и короткие позиции.

Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте www.netinvestor.ru





🕖 МФД-ИнфоЦентр



Автоматизация торговли и роботы

Создание стоп-лоссов в Мастере стратегий. Продолжение



В качестве примера стратегии-SL составим систему с индикатором Боллинджера, что позволит получить «скользящий» стоп-лосс и одновременно учитывать волатильность.

Bollinger Bands состоят из трех линий: скользящее среднее, верхняя граница, нижняя граница.

Ширина канала зависит от волатильности рынка. В Mactepe стратегии эти линии называются outRealUpperBand (верхняя граница канала), outRealMiddleBand (среднее) и outRealLowerBand (нижняя граница канала).

Полосы Боллинджера обладают замечательной особенностью: пока тренд восходящий, цена всегда выше нижней границы outRealLowerBand. И наоборот, пока тренд нисходящий, цена всегда ниже верхней границы outRealUpperBand.

Исходя из этого, можно сформулировать алгоритм стратегии.

Для длинной покупки алгоритм стоп-лосса следующий:

закрыть позицию продажей, если outRealLowerBand > Последняя (цена).

Для короткой продажи:

закрыть позицию покупкой, если outRealUpperBand < Последняя (цена).

Первый случай стратегии-SL для длинной позиции, показан на рисунке справа.

На графике инструмента ГМКНорНик наблюдается рост цены 6 мая и 10 мая 2011 г. Если на этом промежутке времени мы откроем длинную позицию и используем стратегию, которая работает по описанному выше алгоритму, то 11 мая позиция будет принудительно закрыта первым же сигналом (первая красная стрелочка вниз).

Последующие свечи также будут генерировать сигналы, но это не имеет значения – позиция уже закрыта. Как только мы совершим длинную сделку и перезапустим стратегию, описанный цикл повторится сначала.



В нашем примере, когда позиция была открыта в начале тренда, стратегия фактически зафиксировала прибыль. Тем не менее, она работает как стоп-лосс: закрывает длинную позицию, если трейдер не успел выйти из рынка раньше, чем цена начала падать.

Стратегия «SL BollingerB», рассматриваемая в примере, может быть создана в Мастере стратегий с помощью следующих поэтапных действий:

Шаг Мастера стратегий	Создание стратегия SL BollingerB
1	Выбрать индикатор Bollinger Bands
2	Указать, что индикатор Bollinger Bands outRealLowerBand выбран сигналом для события «закрыть продажей»
3	Ввести условие «Bollinger Bands outRealLowerBand > Последняя»
4	Выбрать «Разрешить торговлю стратегии»

Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте www.netinvestor.ru





Netinvestor

Технологии NetInvestor брокеру

Модуль отчетов и Модуль неторговых поручений

Модуль отчетов. Наличие этого модуля в комплексе NetInvestor позволяет клиентам запрашивать отчеты по заключенным сделкам и другие виды отчетов непосредственно через торговый терминал.

Модуль отчетов умеет рассылать документы любой необходимой формы через торговый терминал. Сами отчеты при этом могут формироваться бэк-офиса. средствами Подписываются отчеты ЭЦП (электронноцифровой подписью), что освобождает клиентов от необходимости лично присутствовать в офисе брокера.

Модуль неторговых поручений. Поддерживает перемещение денежных средств между торговыми и внешними расчетными счетами клиентов. Гарантирует контроль лимитов при проведении неторговых операций.

В зависимости от того, как именно Модуль неторговых поручений интегрирован со средой бэк-офиса, могут быть реализованы следующие схемы:

а) ввод/вывод денег в NetInvestor
инициируется клиентами через торговый
терминал, а брокер акцептует операцию
«вручную»;

б) вводом/выводом денег управляет внешняя система ЭДО (система электронного документооборота);

 в) клиенты через терминал, программыклиенты бэк-офиса, любые другие
бизнес-процессы могут одновременно инициировать перемещение средств.

Используя Модуль неторговых поручений, банки предоставляют своим клиентам

Служба технической поддержки NetInvestor всегда с Вами в режиме online

по телефонам (495) 921-1550 добавочный 643 электронной почте SERVICE@MFD.RU

Приложение к электронному изданию MFD.RU. Издание MFD.RU зарегистрировано Министерством РФ по делам печати, телерадиовещания и средств массовых коммуникаций, Свидетельство о регистрации № Эл №77-4042 от 08.08.2000 г.). Издатель ООО «МФД-ИнфоЦентр», зарегистрировано как средство массовой информации в форме информационного агентства Государственным комитетом РФ по печати, Свидетельство № 03178 от 09.01.1997 г.)

Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте www.netinvestor.ru

средства управление счетами (интернет-банк, личные web-кабинеты и т.д.).

Еще одно привлекательное для клиентов применение модуля – вывод денег со счетов брокерского обслуживания на платежные карты.

Модуль Неторговых поручений



Модуль отчетов и Модуль неторговых поручений поддерживают операционный документооборот внутри NetInvestor и легко интегрируются с любой системой ЭДО. Юридическую значимость документооборота обеспечивает подпись документов ЭЦП как со стороны брокера, так и со стороны его клиентов.

NetInvestor Professional

Бесплатный торговый терминал NetInvestor Professional предоставляют своим клиентам инвестиционные компании и банки, которые выбрали платформу NetInvestor для организации брокерского обслуживания. В свою очередь, инвесторы и частные трейдеры могут бесплатно установить программу NetInvestor Professional и выбрать подходящую

брокерскую компанию

Посетите сайт NETINVESTOR.RU и узнайте больше!

O NetInvestor Professional Бесплатное приложение Руководство пользователя



