



КИРИЛЛ БУШУЕВ, КОНСТАНТИН ИВАЙЛОВСКИЙ

КРЕСТИКИ И НОЛИКИ НА ДЕНЬГИ

КАК ТОРГОВАТЬ С ПОМОЩЬЮ ГРАФИКОВ «КРЕСТИКИ-НОЛИКИ» И КАКИЕ КОМПЬЮТЕРНЫЕ ПРОГРАММЫ ДЛЯ ЭТОГО ПРИМЕНЯЮТСЯ

«Крестики-нолики» — это метод отображения рыночных цен не в виде традиционных линейных графиков, а в виде столбцов крестиков (X), обозначающих рост, и ноликов (0) — снижение. Популярность этого метода связана с тем, что график регистрирует «чистые тенденции» без мелких флуктуаций цены — иными словами, убирает ненужную волатильность. «Крестики-нолики» достаточно популярны на Западе, теперь же этот метод стал доступен пользователям терминала NetInvestor.

КАК СТРОИТЬ ГРАФИКИ XO

Для того чтобы построить график «крестики-нолики», необходимо определить два важных параметра: величину изменения цены, которую нужно отобразить на графике в виде X или O (box size), и параметр разворота (reversal), который будет использовать-

ся для отображения изменения тенденции на противоположную.

Разберем правила построения графиков XO на примере фьючерса на индекс РТС, который имеет вид 145 000 пунктов. Box size будет равен 1000 пунктам, reversal — 3. Восходящее движение записывается в виде столбца из крести-

Метод «крестики-нолики» имеет одну особенность: возникающая, паттерн однозначно говорит о тренде, в сторону которого можно торговать

Сигналы к совершению сделок



S1. Простая продажа (двойная вершина). Сигналом к продаже служит нолик на одну клеточку ниже предыдущего O-столбца



B1. Простая покупка (двойная вершина). Сигналом к покупке служит крестик на одну клеточку выше предыдущего X-столбца

ков: каждые 1000 пунктов по фьючерсу на индекс РТС новый крестик записывается над предыдущим. Если движение становится нисходящим, то начинает формироваться столбец ноликов, но перед этим величина порога должна быть пройдена столько раз, сколько указано в параметре разворота. В нашем случае, чтобы на графике отобразился разворот в виде трех ноликов, цена должна упасть на 3 x 1000 пунктов. После того как цена опустится ниже очередного порога, новый нолик дописывается под предыдущим. И так до тех пор, пока цена опять не развернется вверх. Для удобства квадратом отмечаются цены закрытия дня.

РТС В КЛЕТЧКУ

Паттернов ХО для открытия позиции может быть несколько, мы рассмотрим сигналы простой продажи и покупки и поищем их на фьючерсе на индекс РТС. Метод «крестики-нолики» имеет одну особенность: возникая, паттерн однозначно говорит о тренде, в сторону которого можно торговать до тех пор, пока не появляется противоположный сигнал. Таким образом, в методе ХО четко определяются уровни входа и выхода из позиции.

Итак, протестируем простейшую торговую стратегию на июньском фьючерсе РТС с таймфреймом 15 минут на интервале с 11.01.2010 до 19.05.2010. Величина порога — 1000 пунктов, значение разворота — 3.

Как видно из рисунка, в окне NetInvestor сигналы для совершения сделок помечены желтым цветом. Зона 1 демонстрирует возможность для входа, и появляется сигнал на покупку.

Зона 2 показывает уровень поддержки. В зоне 3 происходит смена тренда, и появляется сигнал на продажу. В зоне 4 уровень сопротивления пробивается. Зона 5 — закрытие позиции. Серая область говорит о повышенной волатильности на рынке и сообщает о большем риске при появлении сигнала.

Рассмотренная стратегия имеет свои недостатки и преимущества. Она скорее подойдет среднесрочным инвесторам, которые торгуют при небольшой волатильности. В случае же, когда изменения рынка достигают 5% в день и более, стоит выйти в кэш либо поднять порог чувствительности. Иными словами, если 15-минутный график у вас похож на зону 5, то нужно перейти к более длинному таймфрейму, например к 60-минутному.

СПЕЦИАЛЬНЫЙ ХО-СОФТ

Графическое представление в виде ХО есть практически во всех программах теханализа. Для истинных же ценителей этого метода имеется специализированный софт, например Bull's-Eye Broker. Программа поддерживает все популярные форматы данных, а также имеет свой собственный платный источник подкачки ценовой истории. В Bull's-Eye Broker хорошо реализован поиск паттернов, на исторических данных можно поискать успешно реализующиеся условия на покупку и продажу. В программу заложено умение работать с циклами Эллиота, а рисовать ХО можно несколькими способами. Величина порога задается не только в абсолютных значениях, но и в



Бытует мнение, что «крестики-нолики», как и «свечи», пришли из далекой Японии. Так записывали изменения цен на рис: если цена росла, прирост отмечали крестиком, если падала — в соседнем столбце рисовали нолик. На Западе метод получил распространение в начале XX века. Сначала его называли «книжным» — именно такое название использовал Чарльз Доу в редакционной статье The Wall Street Journal от 20 июля 1901 года, после публикации которой «крестики-нолики» приобрели известность в США. Впервые наиболее полно этот метод был описан в 1904 году Джозефом Клейном, который называл его «методом регистрации тенденций». По Клейну, использовать метод начали примерно с 1881 года.

процентах, а также оптимизируется графически. Триал-версию программы можно скачать с сайта разработчиков www.archeranalysis.com. Пакет «стандарт» будет стоить \$69. Поддержка встроенного поставщика данных обойдется в €59 в месяц — за эту сумму вы получите доступ к рынкам десяти стран мира. **D'**

