

«Матрица_Т» - метод торговли
опционами как раскоррелированными
активами.

Игорь Такоев

НОК-10

Москва 2016

Год назад на НОК-9

Игорь Такоев



1. Не используются приложения для анализа опционов
2. Для описания метода не используются узкоспециализированные термины и понятия
3. Для расчетов применяются только арифметические действия
4. Не требуется постоянное нахождение перед монитором

21 год назад

ТМБ "Гермес" № 2 пр. ф. "ФОРС"
 Таков Март Муратович.
 ТЮМЕНСКО-МОСКОВСКАЯ БИРЖА "ГЕРМЕС"

УТВЕРЖДЕНО
ПРАВЛЕНИЕМ ТМБ "ГЕРМЕС"

12 МАЯ 1995 г.

Вексель РАОЭС по. 50 млн. Выход 89 1/2%

ПРАВИЛА
ТОРГОВЛИ
ФЬЮЧЕРСНЫМИ
И
ОПЦИОННЫМИ
КОНТРАКТАМИ

МОСКВА
 1995

БРОКЕРСКАЯ ФИРМА РФЗ ФОРС 4 25 Май 95

Вид залога	На счете	Св. ср-ва	Маржа	Вид контр.	Прибыль/убытки
Деньги	-176000	0	-176000	Фьючерс	-574000
Бумаги	3000000	839000	0	Опцион	129000
Всего	2824000	839000	-176000	Всего	-445000

Депозит : 2161000 Комиссия : 13000

орт-1000 РФЗ ФОРС Экспирация : 15 Авг 95(82)

Цена инструмента :	5375.00	Комиссионные :	13000.00
Н.прибыль/убыток :	76000.00	Р.прибыль/убыток :	76000.00
-Call :	5/232000.00	+Call :	6/146000.00

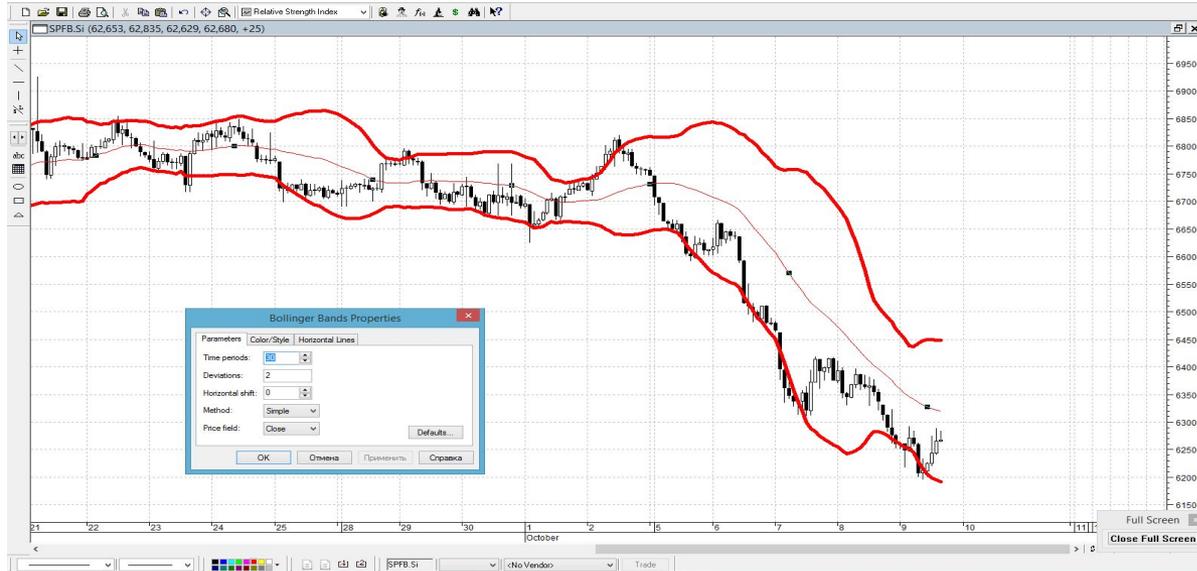
Портфель : АВГУСТ

Дата	+	Страйк	С/Р	Премия	К-во	Дата	+	Страйк	С/Р	Премия	К-во
25Май95	+	5400	С	30	1	17Май95	+	6000	С	10	1
12Май95	+	5800	С	50	1	12Май95	+	5900	С	20	3
10Май95	+	6600	С	6	1	03Май95	-	6000	С	31	2
03Май95	-	6000	С	40	1	03Май95	-	6000	С	40	2
14Апр95	-	6600	С	50	1						

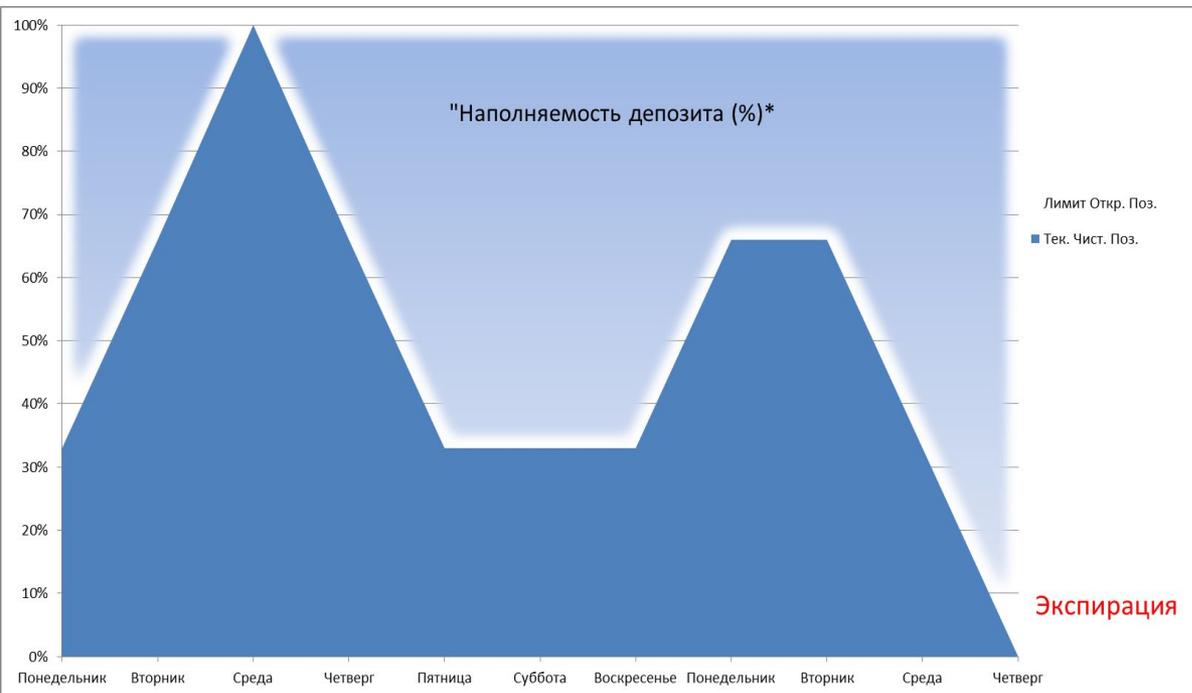
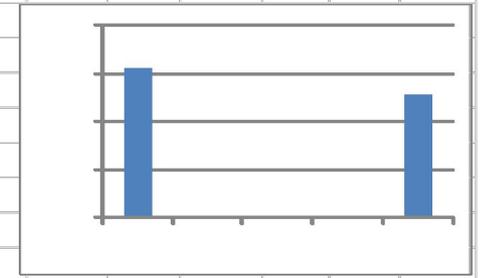
ТМБ "ГЕРМЕС"
 25 МАЯ 1995
 ОТДЕЛ КЛИЕНТОВ

FORCE

Исходные условия



К-во	Цена	Сумма	Страйк	К-во	Цена	Сумма
	1073	0	63000		377	0
	919	0	63250	0	473	0
4	781	3124	63500	0	585	0
	660	0	63750	0	714	0
	555	0	64000	3	859	2577
	465	0	64250		1019	0
	388	0	64500		1192	0
		3124				2577



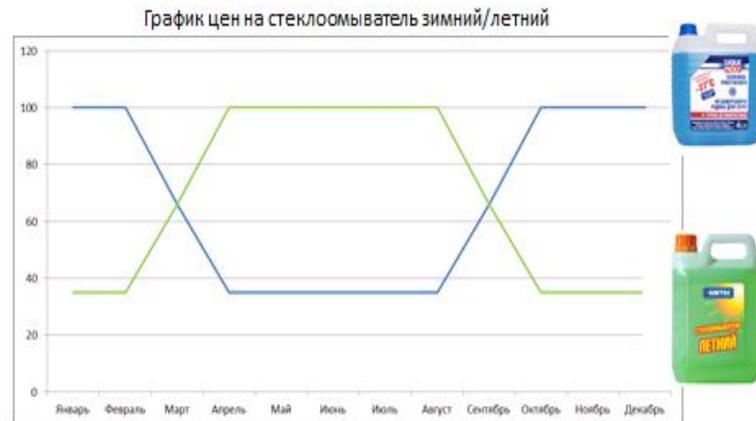
Отношение стоимости позиции (СП) к гарантийному обеспечению (ГО)

Наименование позиции	Стоимость позиции (СП)			ГО	СП/ГО
	Call	Put	(Call+Put)		
RASKORIAKA	1066	1207	2273	169	13,4
STRADDLE	428	496	924	222	4,2
STRANGLE	139	134	273	150	1,8

SiZ6 201016C 63500M



Отрицательная корреляция цен



~~Скальпирование~~



Вид экрана 1366x720

Такоев Игорь Муратович UID: 88795] Информационно-торговая система QUIK (версия 7.5.0.72)

Система Создать окно Действия Брокер Расширения Сервисы Окна

iPhone 7 в подарок!

Доска опционов [Si-12.16, 15.12.2016] Страйков: 7

Спрос	Предлс	Теор. це	Страйк	Теор. Спрос	Предло:
3	19 981	898	62 750	275	230 289
694	727	737	63 000	364	326 347
16	608	595	63 250	472	432 493
442	465	475	63 500	602	563 593
339	400	374	63 750	751	718 1 200
275	289	293	64 000	920	886 922
3	252	228	64 250	1 105	5 1 127

Текущая таблица пара

Код бумаги	Цена послед.	% измен.	Ср. взв. цен
SiZ6	63 372	-0,11	63 428

Таблица заявок

Время	Код бумаги	Операци.	Цена	Кол-в	Оста	Сост
15:23:40	Si63500BL6	Продажа	500	1	0	Исп.
16:12:05	Si63500BL6	Купля	500	1	0	Исп.
17:12:39	Si63500BL6	Продажа	550	1	0	Исп.
18:15:16	Si63500BL6	Купля	500	1	0	Исп.
19:15:25	Si63500BL6	Продажа	550	1	0	Исп.
20:15:49	Si63500BL6	Купля	500	1	0	Исп.
21:16:04	Si63500BL6	Продажа	550	1	0	Исп.
22:16:50	Si63500BL6	Продажа	600	1	0	Исп.
23:17:28	Si63500BL6	Купля	550	1	0	Исп.
24:19:05	Si63500BL6	Купля	500	1	0	Исп.
25:19:05	Si63500BL6	Продажа	550	1	1	Актив.

Si63500BL6 Графики цены и объема - [15 минут]

11h	16h	21h	12h	17h	23h	14h	20h	11h	16h	21h
5			6		7			8		

Продажа Цена Покуп

Прода	Цена	Покуп
1	1 126	
2	791	
7	727	
	694	7
	665	2
	620	1
	500	1

Прода Цена Покуп

Прода	Цена	Покуп
10	500	
9	499	
7	465	
	442	8
	441	7
	391	100
	390	1

Прода Цена Покуп

Прода	Цена	Покуп
7	927	
9	926	
25	922	
	886	7
	833	25
	832	2
	811	5

Время сервера: 21:03:43; последняя полученная запись: 37610512 195.226.204.208:15208 08.12.2016

Матр...

Файл Гла Вст Раз Фол Даг Рел Вид Еас

Вставить Шрифт Выравнивание Число Стили Ячейки

Буфер об... Редак

M7

	H	I	J	K	L	M	N	O	P
1			К-во	Цена	Сумма	Страйк	К-во	Цена	Сумма
2				898	0	62750		275	0
3				737	0	63000	0	364	0
4			4	595	2380	63250	0	472	0
5				475	0	63500	0	602	0
6				374	0	63750	3	751	2253
7				293	0	64000		920	0
8				228	0	64250		1105	0
9									
10					2380		127		2253
11									
12									
13									
14									
15									
16									
17									
18									
19									
20									
21									

Готово

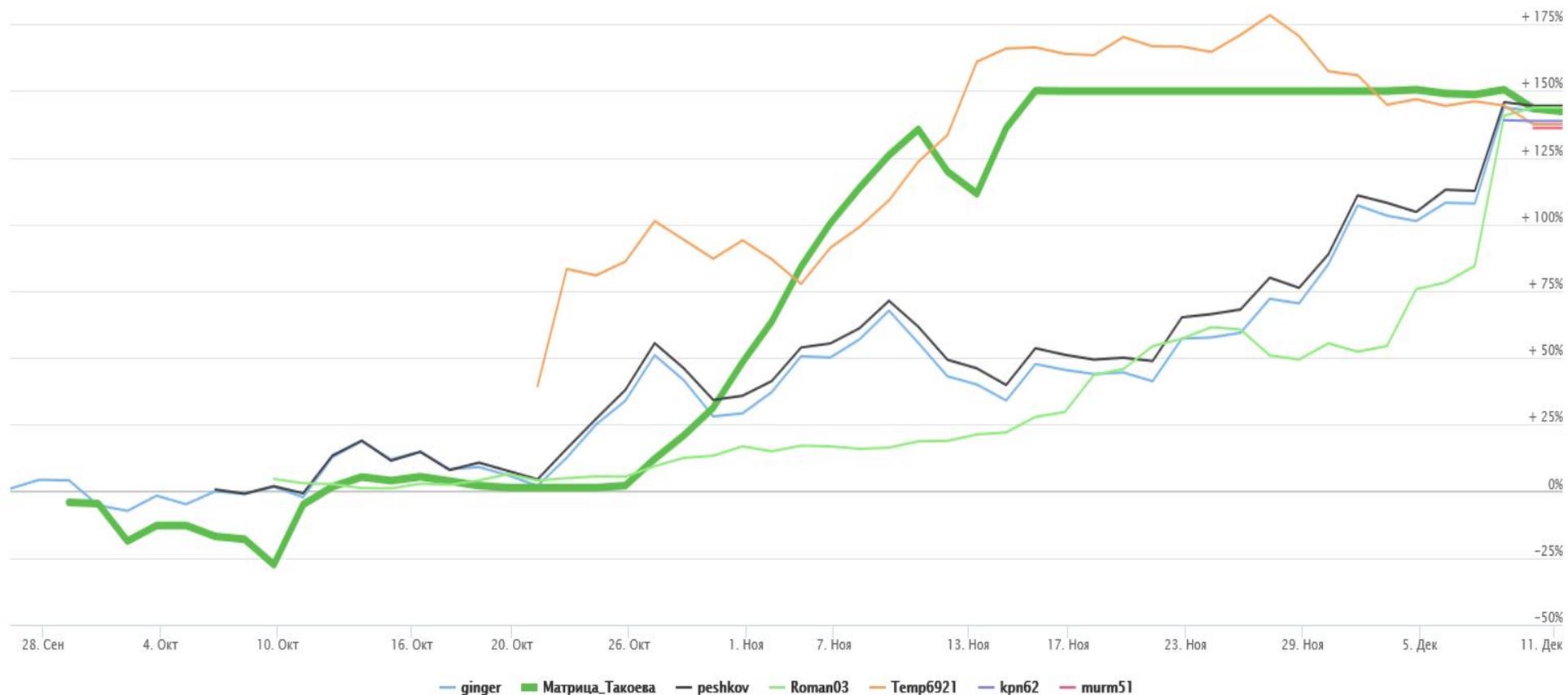
120%

21:03 08.12.2016

Доходность участника «Матрица_Т»

ЛЧИ-2016

+142%



1 декабря 2016г. Альфа-Банк прекратил обслуживание на рынке ОПЦИОНОВ

Позиция на конкурсе ЛЧИ-2016 по состоянию на 10.12.2016

Статистика конкурса "Лучший частный инвестор 2016 года"

Конкурс брокеров | Конкурс менеджеров | Лучший дуэлянт

Портфель инвестора

Матрица_Такоева

Брокер: ООО "Компания БКС"
Дата регистрации в конкурсе: 27.09.2016

Поделиться:

В 44 f 1 +3

Статистика на 2016-12-12

Основной счет	Стартовая сумма	Заявок	Сделок	Оборот, руб	Доля оборота, %	Доход, %	Доход, руб	Доля дохода, %
На всех рынках	50000	1448	692	106319445	100.00	142.35	71174.66	100.00
Срочный	50000	1448	692	106319445	100.00	142.35	71174.66	100.00

Доходность

Позиция в номинациях на 2016-12-12

Название номинации	Позиция
Лучший частный инвестор на всех рынках	31
Лучший частный инвестор на срочном рынке	19
Лучший трейдер валютными фьючерсами	1600
Ветеран ЛЧИ	4

Анализ операций

Счет:	46068
Клиент:	Такоев Игорь Муратович
Отчетный период:	16/09/2015 - 09/12/2016 450 торговых дней
Валюта баланса:	RUR
Безрисковая доходность:	5% годовых
Сравнительный индекс:	MICEX(100.00%)
Капитал (взвешенный во времени):	27 792.8100 RUR
начальный:	32 202.7100 RUR
дополнительный:	68 400.0000 RUR
изъятый:	125 931.3300 RUR

Финансовый результат (прибыль + / убыток -): 90 441.7600 RUR (89.90%)

Экспертное заключение по итогам управления

Мы узнали Вас. Вы Уоррен Баффет :-)

Прибыль / убыток счета	90 441.7600 RUR	(89.90 %)
на спот рынках	1 933.5100 RUR	(1.92 %)
на срочном рынке	88 508.2500 RUR	(87.98 %)
Максимальный убыток в отчетном периоде	37 182.9500	(35.95 %)
Всего расходов	-8 925.84 RUR	
доля расходов в итоговом финансовом результате)		-9.87 %

Группа «Опционная матрица»

Опционная матрица Такоева

	666	0	64000		1333	0
10	1000	10000	65000	10	1000	10000
	1333	0	66000		666	0
	1666	0	67000		333	0

Опционная матрица Такоева
общедоступная группа

Присоединился(-ась) | Поделиться | Уведомления

Обсуждение | Участники | Мероприятия | Фото | Файлы

4 человека хотят вступить в эту группу

Игорь Такоев поделился event Alldervatives | Школа срочного рынка.
14 ноября в 0:49
<https://www.facebook.com/events/575297819331221/>

Alldervatives cafe: вечер торговли...
Ср 19:00 · Москва
Интересуются: 7 · Пойдут: 3

Грин Богданов 23ч
Алина Ананьева 2ч
Olga Cherry 1ч
Юрий Терко
Андрей Дронин
Ирина Шенцева 5ч
Пonomarev Сергей 1ч
Елена Змеева 2ч
Наталья Трейдер 1ч
Валерий Левит 32мин
Сергей Гераськин 1ч
Александр Баранов 7ч
Андрей Верников 3ч
Михаил Ханов 1ч
Konstantin Poltev 5ч
Анатолий Гавриленко 8ч
Сергей Тулупов 1ч
Евгений Сердюков 13ч
Alexander Subochev 4ч
Патриция Джарагетти 1ч

<https://www.facebook.com/groups/1751508781776036/>

Результаты торговли опционами ноябрьской серии

1. Борис Б.	+104%
2. Никита Х.	+56%
3. Игорь Т.	+46% (ЛЧИ-2016, 7.11 – 17.11)
4. Армен С.	+28% (практикум 15.10.2016)
5. Владимир Г.	+25%
6. Фёдор Г.	+24%
7. Сергей С.	+17%
8. Евгения Б.	+10%
9. Ольга Ч.	0%
10.	Н/д
11.	Н/д
12.	Н/д

Из 12-ти человек 8 закончили месяц с прибылью (67 %)*

* Из них двое признались в применении теханализа

Доля прибыльных счетов (%) /Данные на 08.12.2016г./

	Всего счетов	Прибыльных	Доля (%)	Источник
Матрица_Т	12	8	67	https://www.facebook.com/groups/1751508781776036/
ЛЧИ (фонд.)	11 924	4515	38	http://investor.moex.com/
ЛЧИ (срочн.)	7490	1125	15	http://investor.moex.com/
FOREX	н/д	н/д	3	 <p align="center">"Пришло время качественного форекса" А.Герчик</p>

Спасибо за внимание!



#НОК-9

#НОК-10

#LowRisk

#Матрица_T

#Allderivatives

#кто может пусть сделает лучше

Часто задаваемые вопросы