

# **Технический анализ рынка ценных бумаг**

# Вопросы лекции

- Понятие и принципы технического анализа
- Построение графиков
- Поддержка и сопротивление
- Тенденция и ее характеристики
- Коррекции

- Ценовые модели
- Технические индикаторы
- Торговые системы
- Интернет-трейдинг

# Литература

- Мерфи Дж. Технический анализ фьючерсных рынков: теория и практика. - М.: Диаграмма, 2000.
- Мерфи Дж. Межрыночный технический анализ (торговые стратегии для мировых рынков акций, облигаций, товаров и валют). – М.: Диаграмма, 1999.
- Найман Э.Л. Малая энциклопедия трейдера. Альфа Капитал, 1997.
- Элдер А. Как играть и выигрывать на бирже. – М.: Диаграмма, 2000.
- Швагер Дж. Технический анализ: полный курс. – М.: Альпина Паблишер, 2001.
- Швагер Дж. Биржевые маги. – М.: Диаграмма, 2004.
- Швагер Дж. Новые маги рынка. – М.: Альпина Паблишер Букс, 2004.

# Понятие и принципы технического анализа

«Технический анализ — это исследование динамики рынка посредством графиков с целью прогнозирования будущего направления движения цен»

Дж. Мерфи

Технический анализ позволяет:

- 1) выбрать момент времени для совершения сделок.
- 2) минимизировать риск при осуществлении торговых операций.

Методы технического анализа не всегда научно обоснованы.

# Принципы технического анализа

# Принцип 1

## Рынок учитывает все

В объемах сделок и уровне цен учтены все факторы, влияющие на рынок, в том числе преобладающие эмоции участников

В текущие рыночные цены сделок заложено дальнейшее направление динамики цен в виде ожиданий его участников

# Принцип 2

## История повторяется

Изучение сложившихся в прошлом комбинаций цен и объемов сделок позволяет выявить переоцененность или недооцененность конкретных ценных бумаг.

# Принцип 3

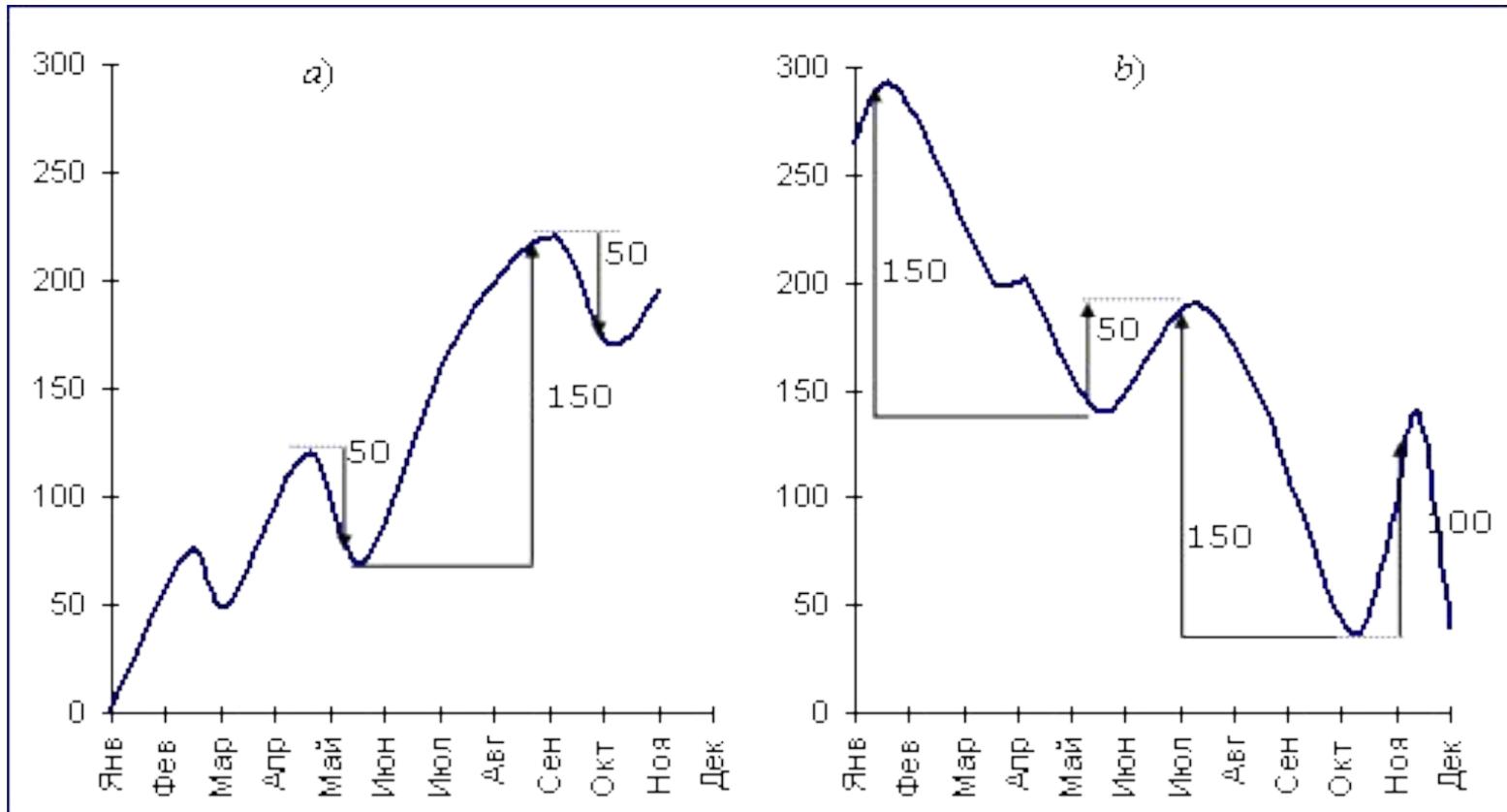
## Движение цен подчинено тенденциям

На рынке существует одновременно три типа тенденций: основная, вторичная и малая (внутридневная).

Движения рынка происходят волнами: фаза повышения сменяется фазой понижения.

Основные движения сменяются вторичными реакциями.

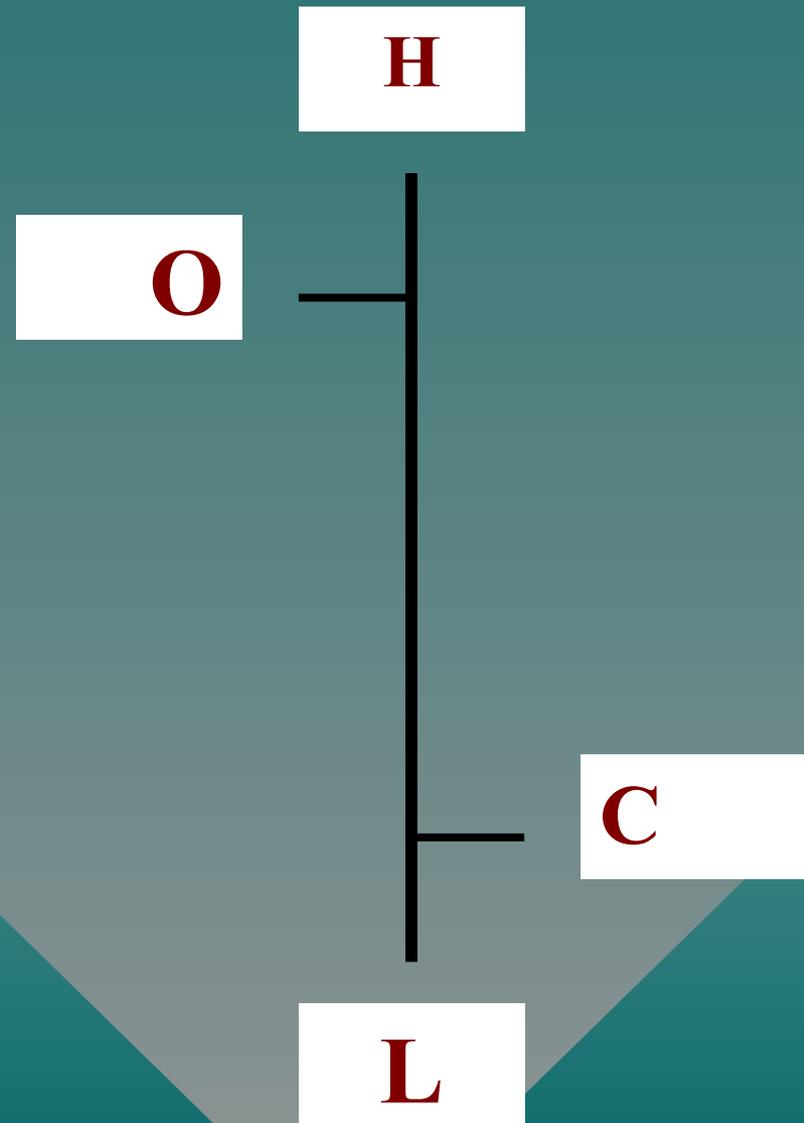
# Тенденции и реакции



# Построение графиков

# Ценовой бар

- Н- максимальная цена
- L - минимальная цена
- О - цена открытия
- С - цена закрытия



# Изображение цен методом японских свечей

## Белая свеча

(цена открытия ниже  
цены закрытия)



Максимальная  
цена

Цена  
закрытия

Цена  
открытия

Минимальная  
цена

# Метод японских свечей

## Черная свеча

(цена открытия выше цены закрытия)



Максимальная  
цена

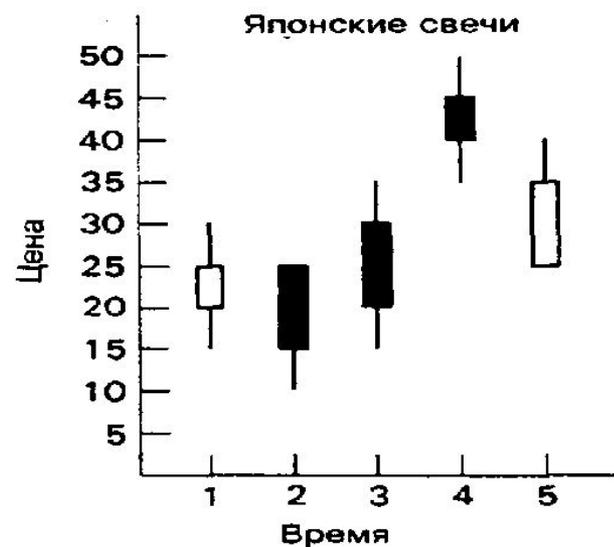
Цена  
открытия

Цена  
закрытия

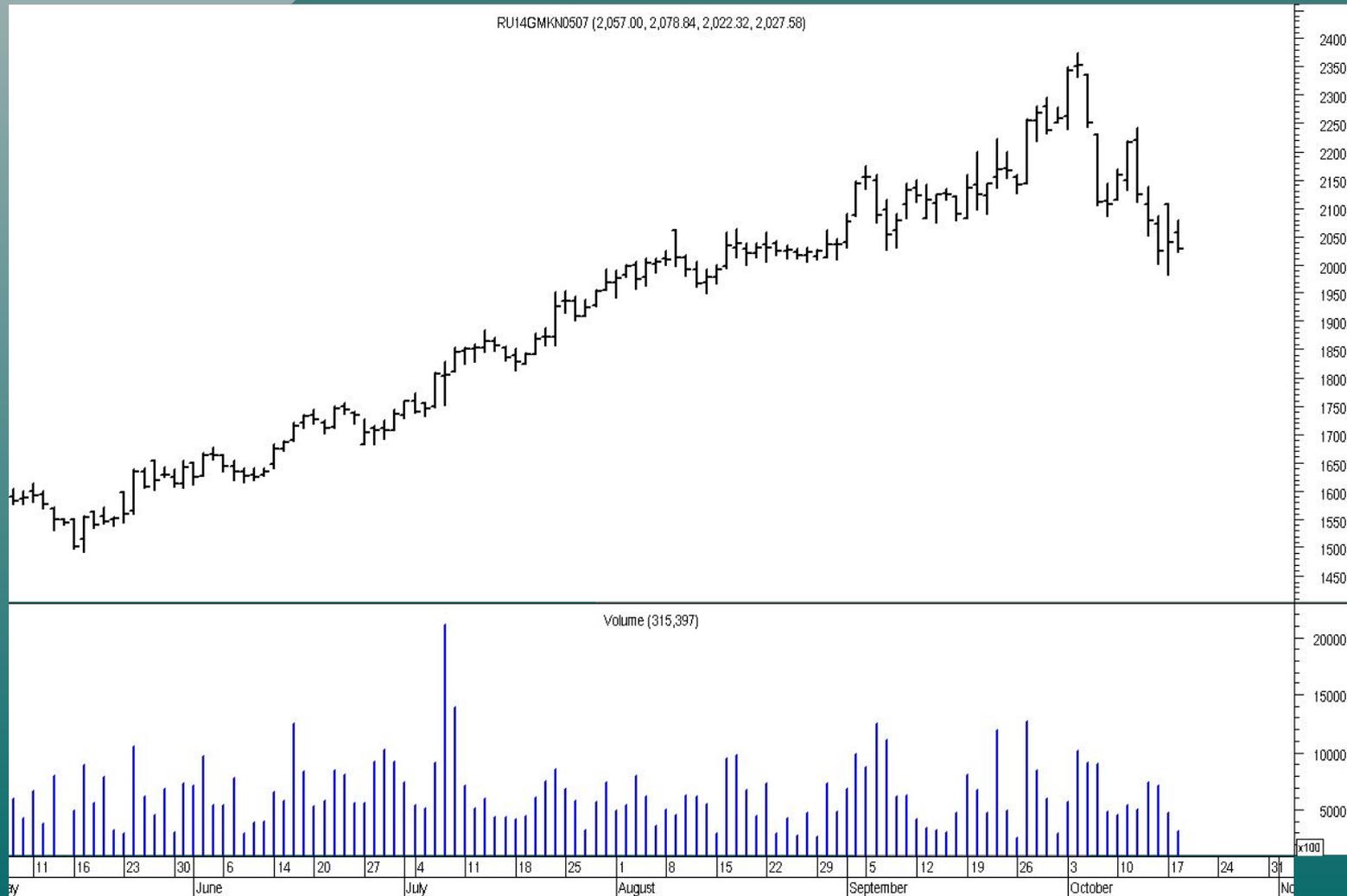
Минимальная  
цена

# Два метода построения ценового графика

| Период времени | Откр. | Макс. | Мин. | Закр. |
|----------------|-------|-------|------|-------|
| 1              | 20    | 30    | 15   | 25    |
| 2              | 25    | 25    | 10   | 15    |
| 3              | 30    | 35    | 15   | 20    |
| 4              | 45    | 50    | 35   | 40    |
| 5              | 25    | 40    | 25   | 35    |



# Гистограмма объема



**Уровень поддержки** -  
нижняя граница диапазона  
колебания курса ценной бумаги.

Это уровень или область на  
графике ниже существующего  
уровня цен, где спрос  
превосходит предложение.

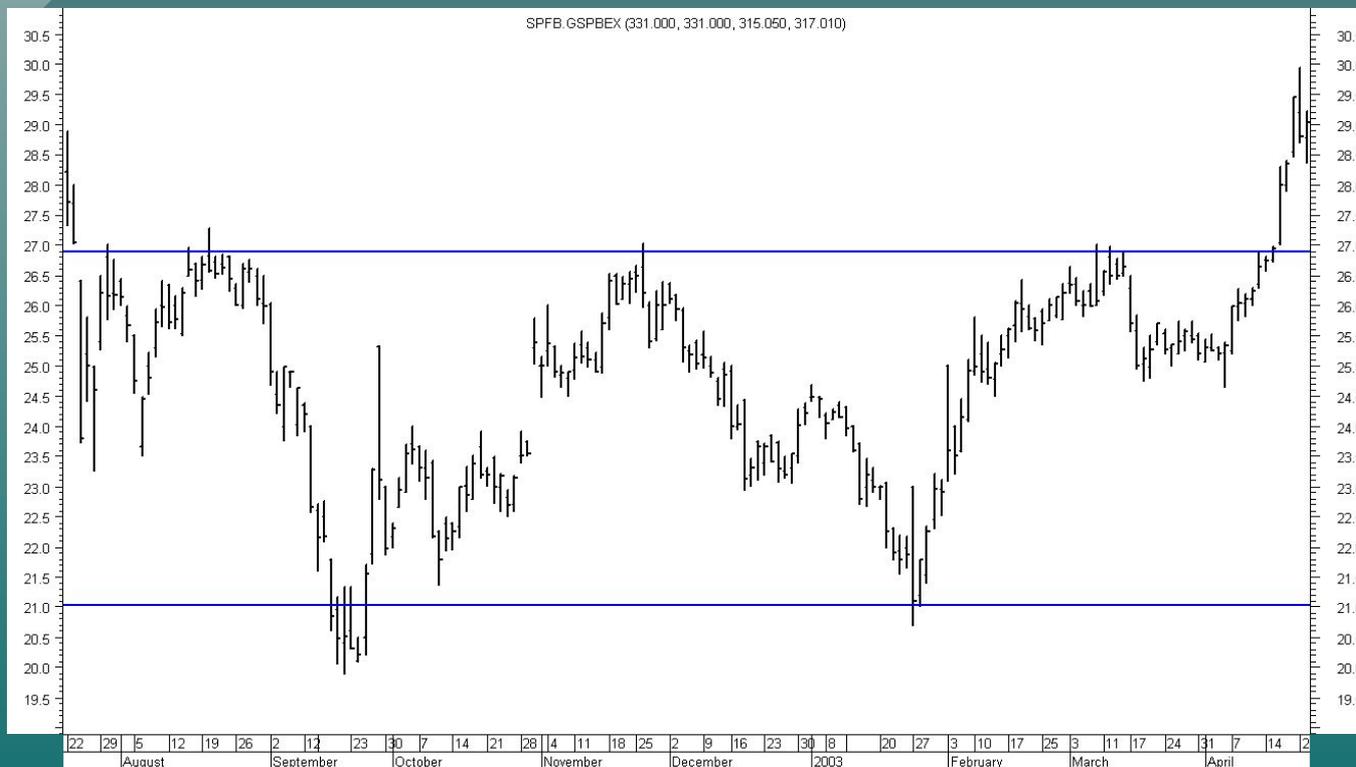
**Уровень сопротивления** -  
верхняя граница диапазона  
колебания курса ценной бумаги.

Это уровень, где предложение  
превосходит спрос, т.е. давление  
продавцов превосходит давление  
со стороны покупателей.

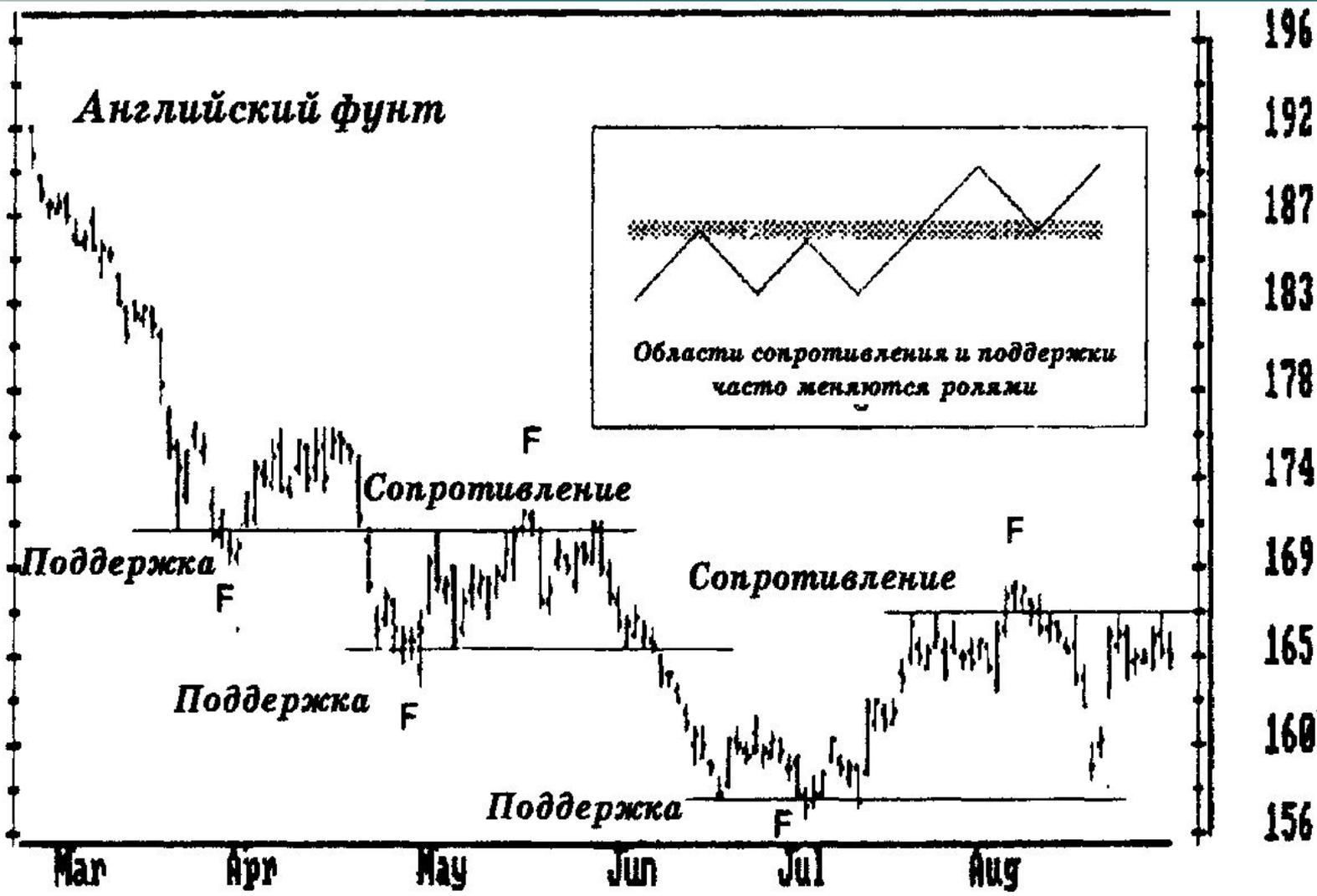
# Поддержка и сопротивление



# Уровни поддержки и сопротивления на рынке Газпрома



# Английский фунт



Области сопротивления и поддержки  
часто меняются ролями

Сопротивление

Поддержка

Сопротивление

Поддержка

Поддержка

Mar

Apr

May

Jun

Jul

Aug

196

192

187

183

178

174

169

165

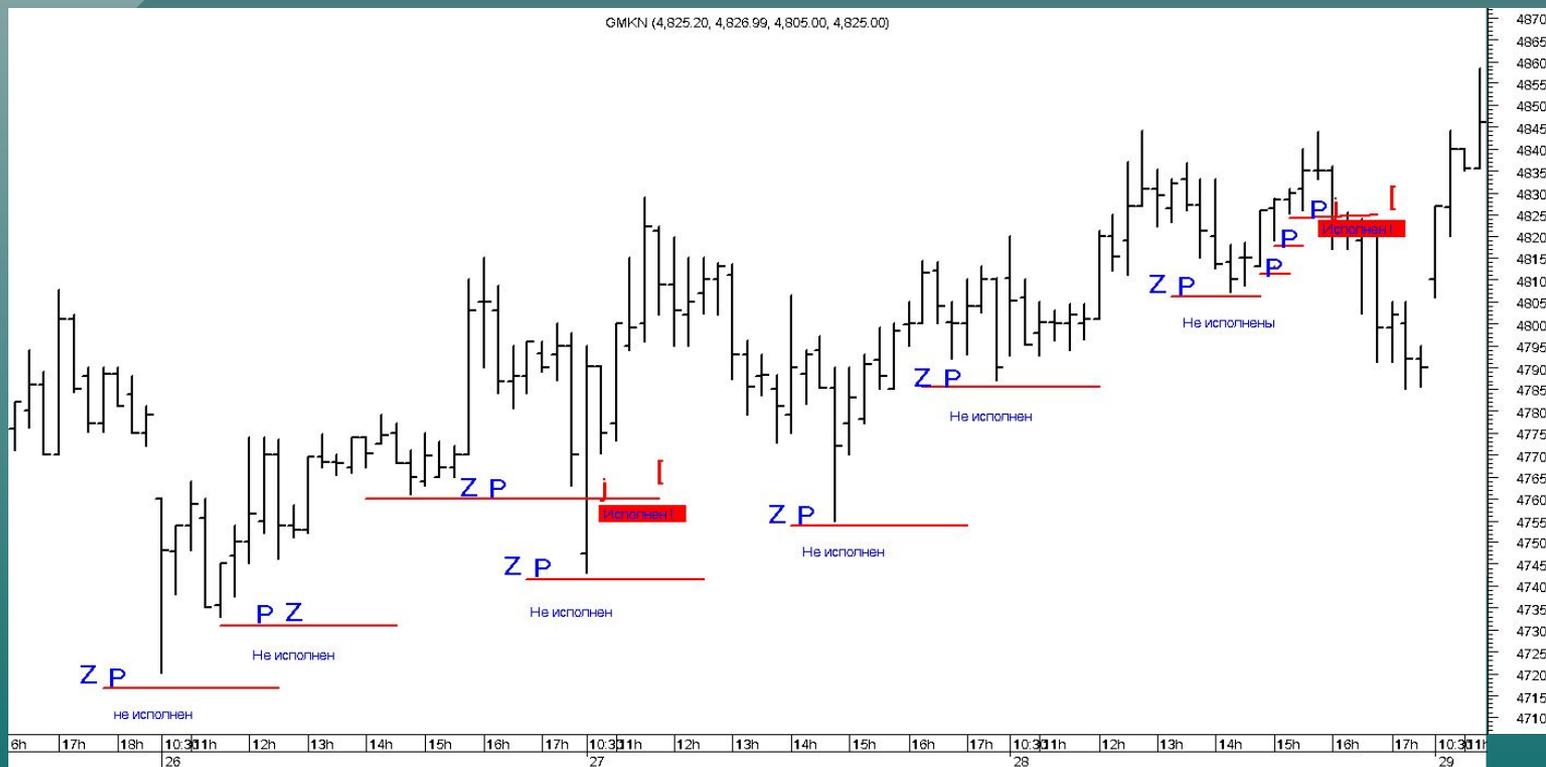
160

156

# Правила для трейдеров

1. Различать краткосрочную и долгосрочную поддержку и сопротивление. Долгосрочная имеют большее значение.
2. Линии поддержки и сопротивления следует использовать для помещения приказов на закрытие убыточных или прибыльных позиций.

# Стоп-приказы на продажу



# Тенденция (тренд) - это направление движения рыночных цен

Тенденция может быть:

- восходящей;
- нисходящей;
- горизонтальной.

# Примеры тенденций на рынке MTS

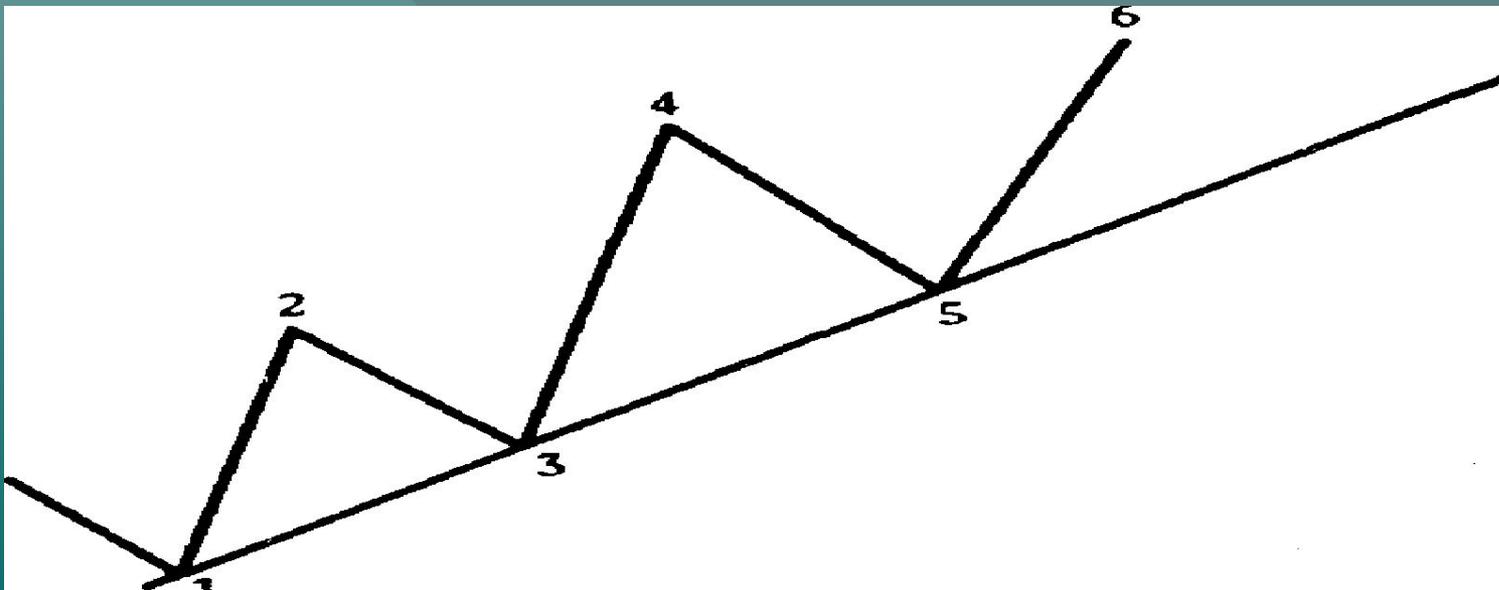


При **растущем тренде** каждый последующий уровень поддержки или сопротивления превышает предыдущий

В **убывающем тренде** каждый последующий уровень поддержки и сопротивления меньше предыдущего

# Метод определения тенденции с помощью максимумов и минимумов

**Восходящая линия тренда** - это прямая, прочерченная вверх слева направо через последовательно возрастающие точки спадов.



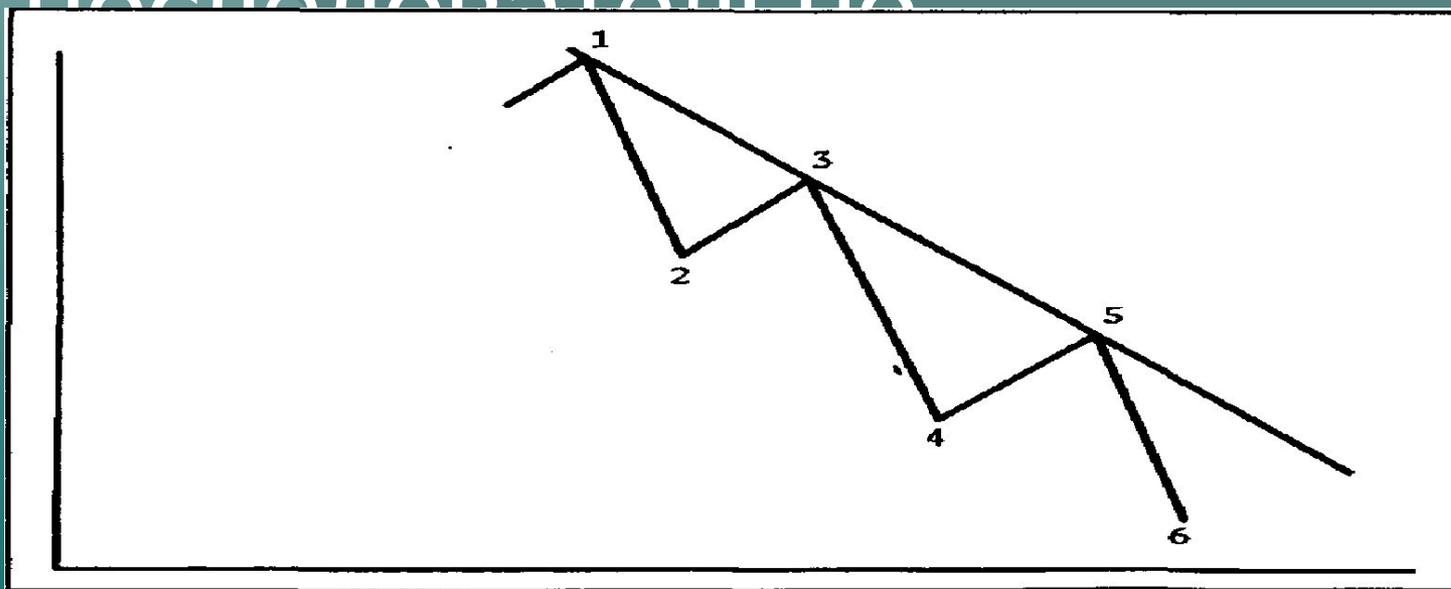
RU14GMKN0507 (2,057.00, 2,078.84, 2,022.32, 2,027.58)



# Примеры тенденций на рынке ОАО «Норникель»



**Нисходящая линия тренда** прочерчивается вниз слева направо и проходит через последовательно



# Нисходящий тренд на рынке Транснефти



# Нисходящий тренд МТС



# Коррекции

Развитие тенденции происходит зигзагообразно.

После очередного движения рынка происходит частичная временная коррекция в противоположном направлении

Корректирующие движения часто можно описать и предсказать с помощью процентных соотношений Фибоначчи

# Числовая последовательность Фибоначчи

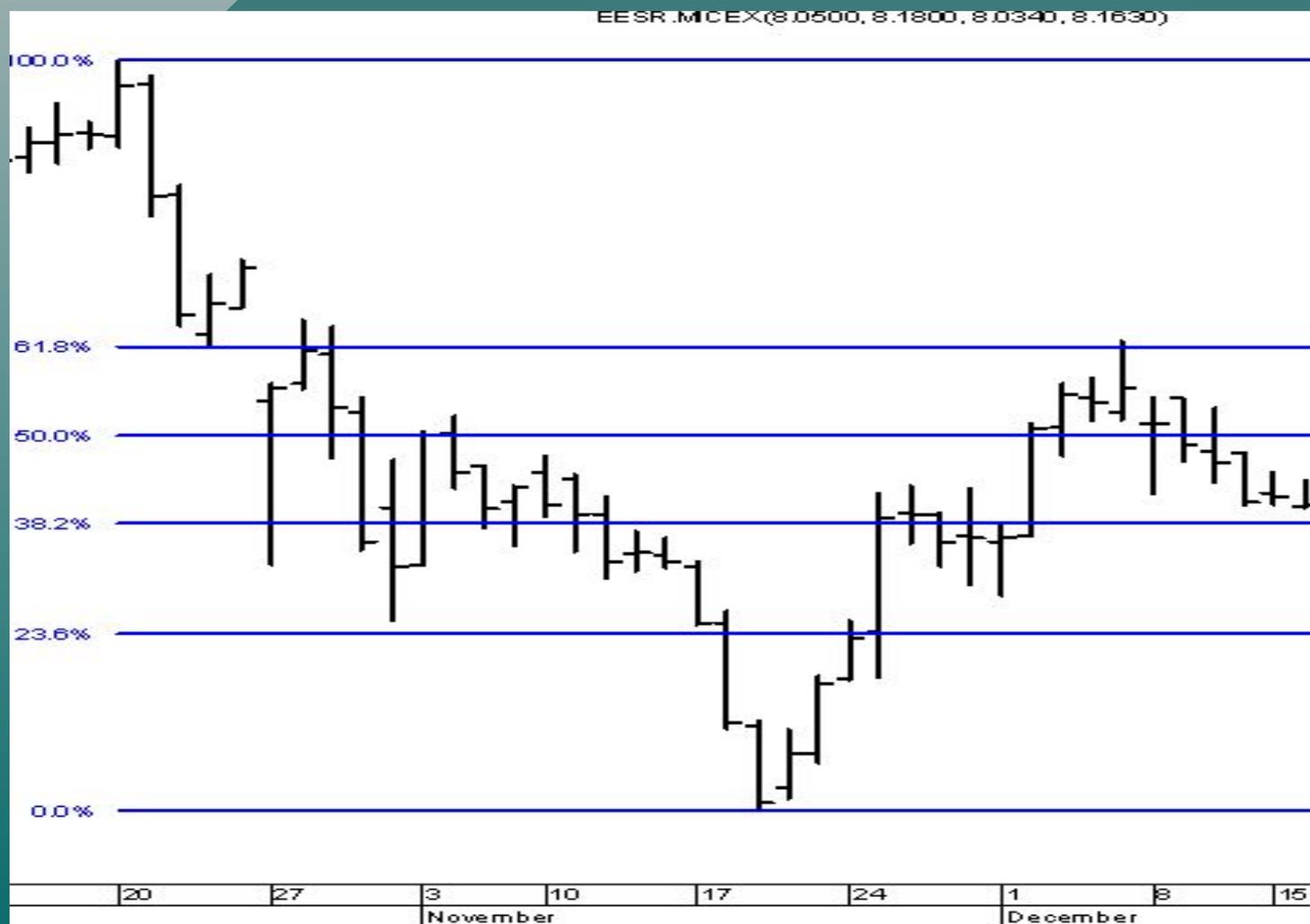
1, 2, 3, 5, 8, 13, 21, 34, 55 — и т. д.

Каждое последующее число ряда  
получается путем сложения двух  
предыдущих чисел

# Коэффициенты коррекции Фибоначчи

- 0,382
- 0,618
- 1,000
- 1,382
- 1,618

# Цена акций РАО ЕЭС России – коррекция на 61,8%



**Ценовыми моделями** называют фигуры или образования на графиках цен, используемые для прогнозирования динамики рынка

Ценовые модели  
объединяются в две  
группы:

1) модели перелома  
тенденции

2) модели продолжения  
тенденции

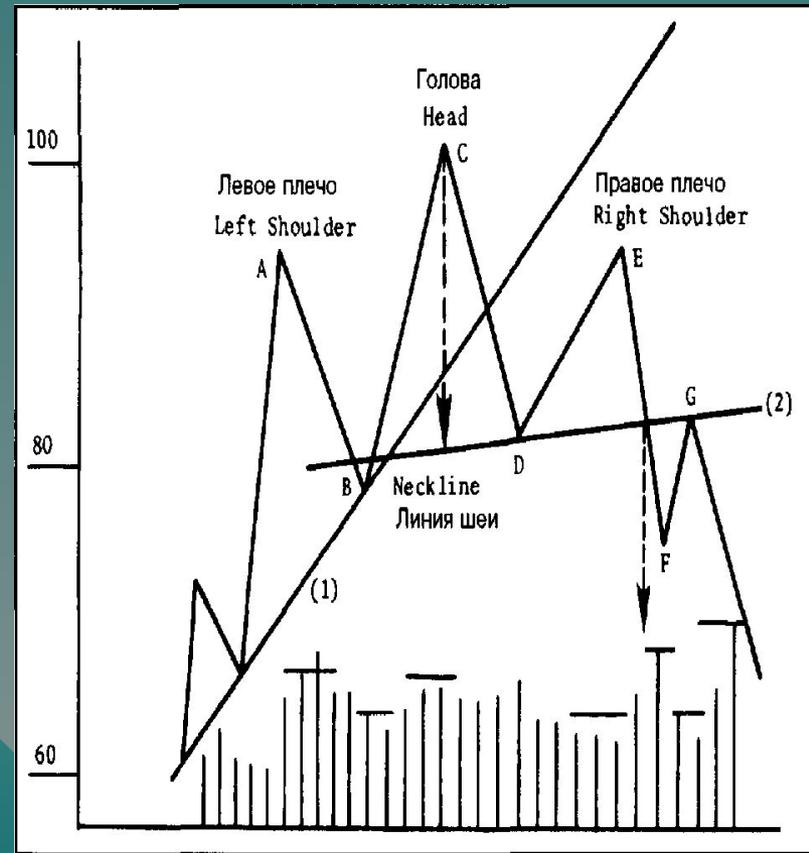
# МОДЕЛЬ ПЕРЕЛОМА "ГОЛОВА И ПЛЕЧИ"

Левое и правое плечо (А и Е) находятся примерно на одной высоте.

Голова (С) выше, чем каждое из плеч.  
Каждый последующий пик сопровождается снижением объема торговли.

Модель считается завершенной, когда цена закрытия фиксируется ниже линии "шеи" (линия 2).

При последующем подъеме возможен возврат до уровня линии шеи, но ценам не удастся пересечь ее.



# **Модели продолжения тенденции**

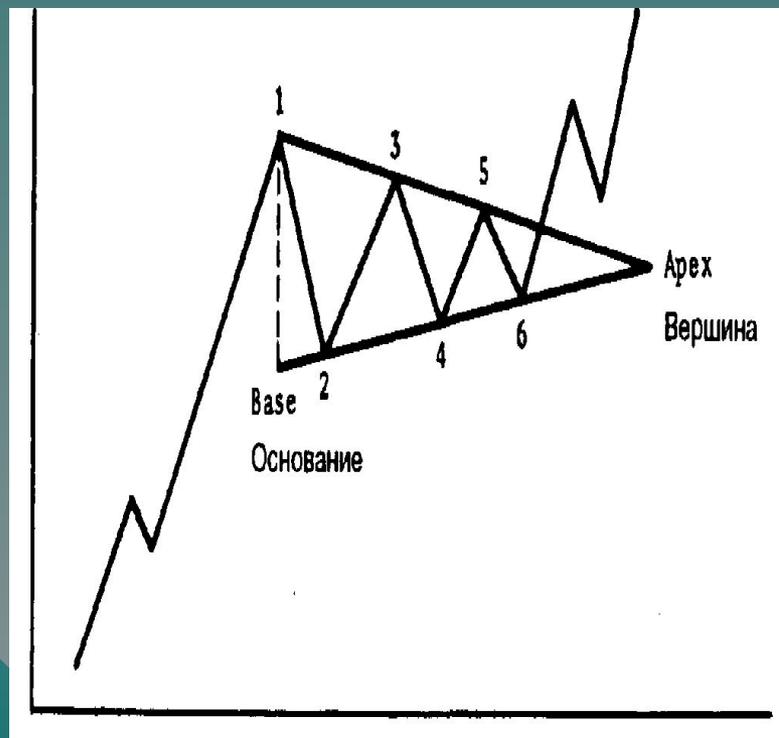
отражают перерыв в развитии  
господствующей тенденции, и  
указывают ее вероятное  
продолжение

# Бычий треугольник

Обратите внимание на две сходящиеся линии.

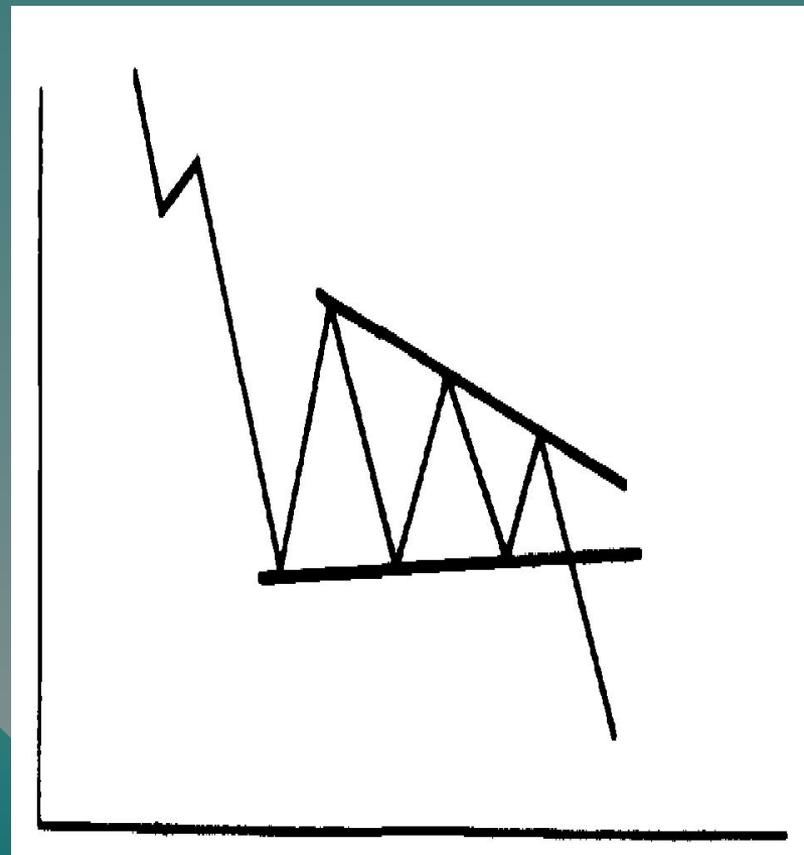
Модель завершается, когда на рынке фиксируется цена закрытия за пределами любой из двух линий тренда.

Вертикальная линия слева - основание модели, а точка справа, где сходятся две линии, является вершиной.



# Нисходящий треугольник

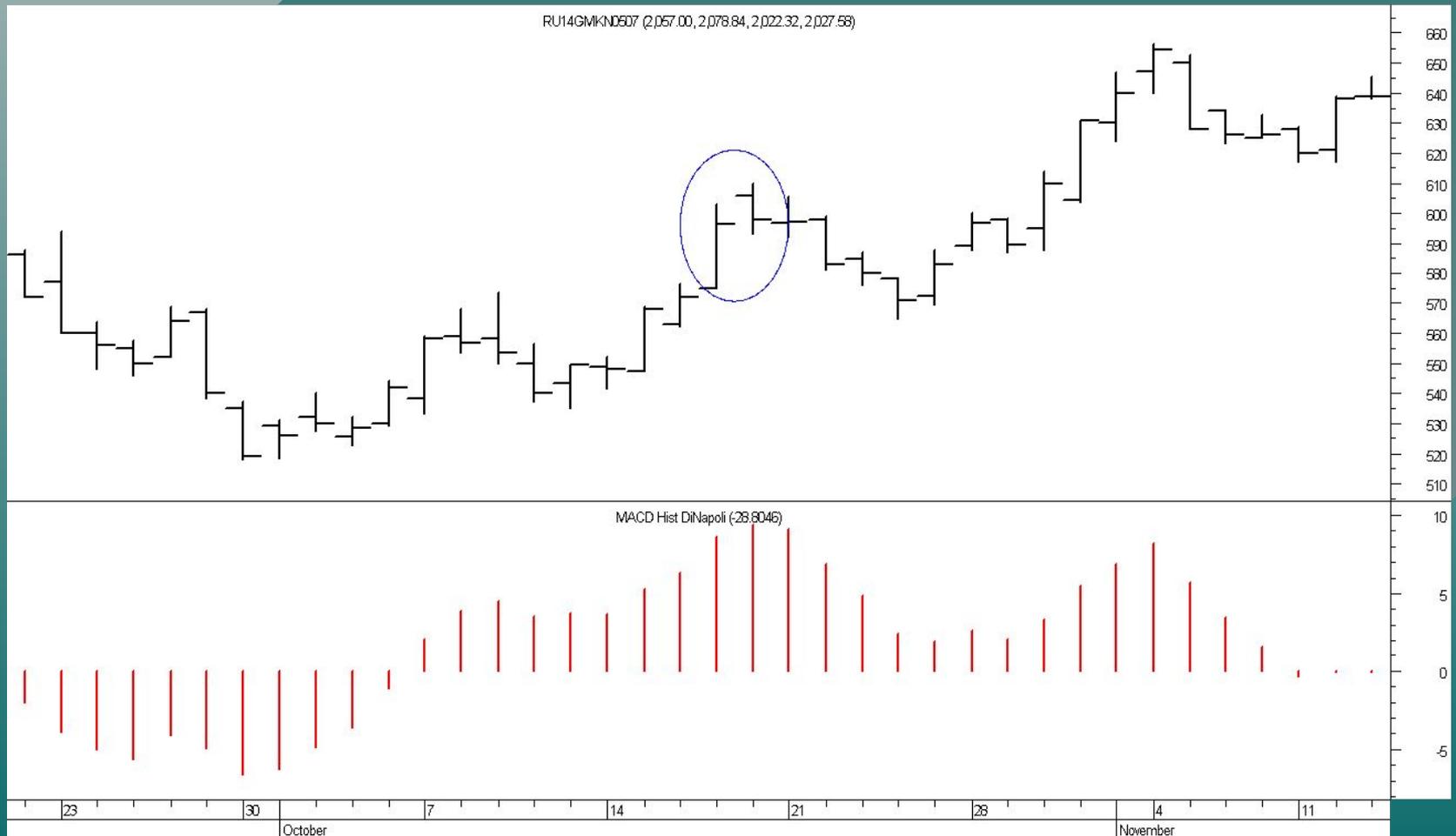
Обратите внимание на горизонтальную нижнюю и нисходящую верхнюю линии. Такая модель обычно показывает медвежьей тенденции на рынке.



# Лукойл. Модель «треугольник»

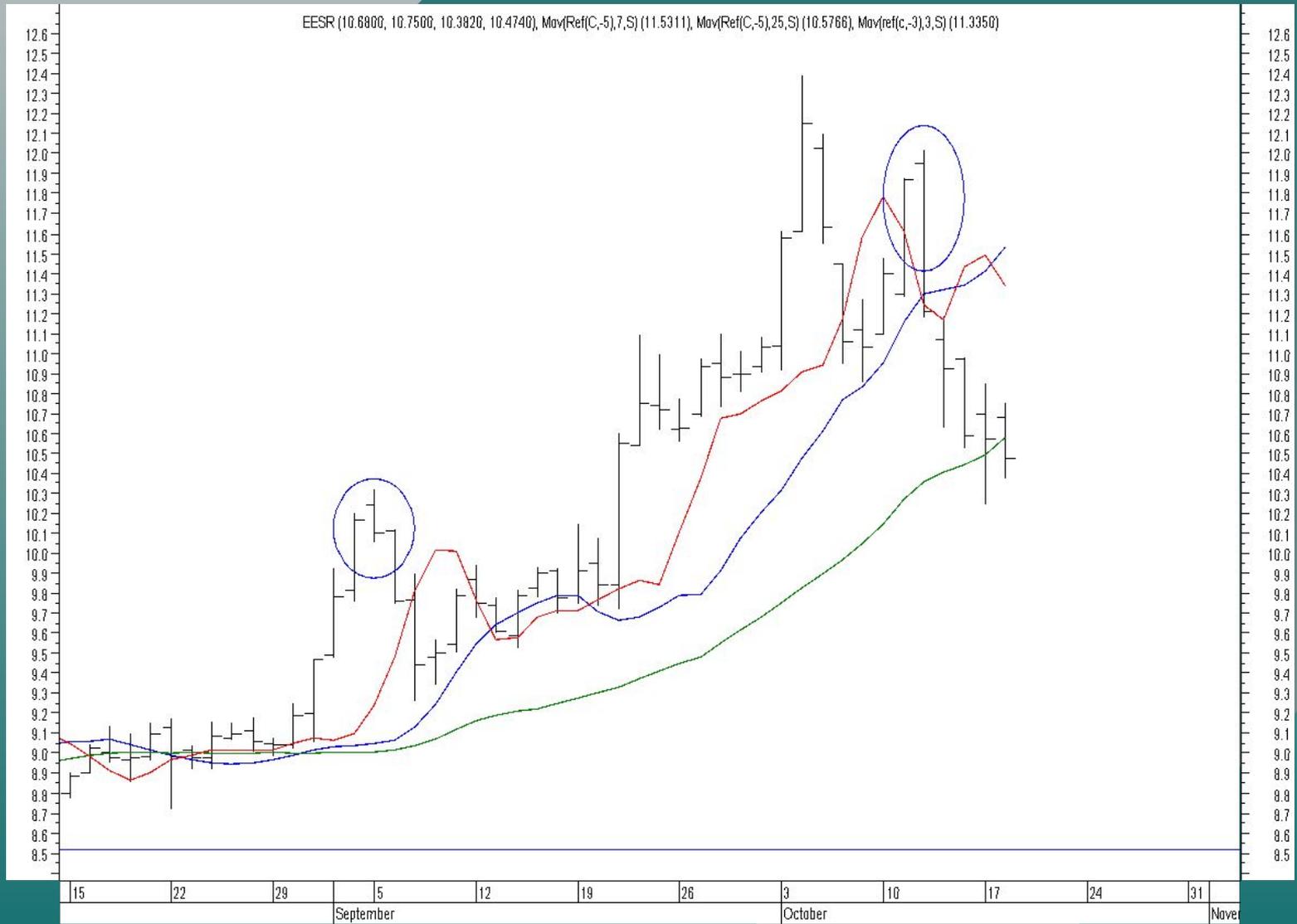


# Модель УОПС



SPFB.GSPBEX





# ИНДИКАТОРЫ

## **Индикаторы, следующие за трендом**

(скользящие средние, MACD, MACD-гистограммы) относятся к классу сопровождающих или запаздывающих.

**Осцилляторы** (стохастик-индикатор, %R Вильямса) – индикаторы, используемые для выявления точки разворота тренда. Их изменения часто предшествуют изменениям цен на рынке.

# Скользящие средние значения

1. Используются для отслеживания тенденций в процессе их развития

2. Не предназначены для прогнозирования движения цен, поскольку являются отстающими индикаторами

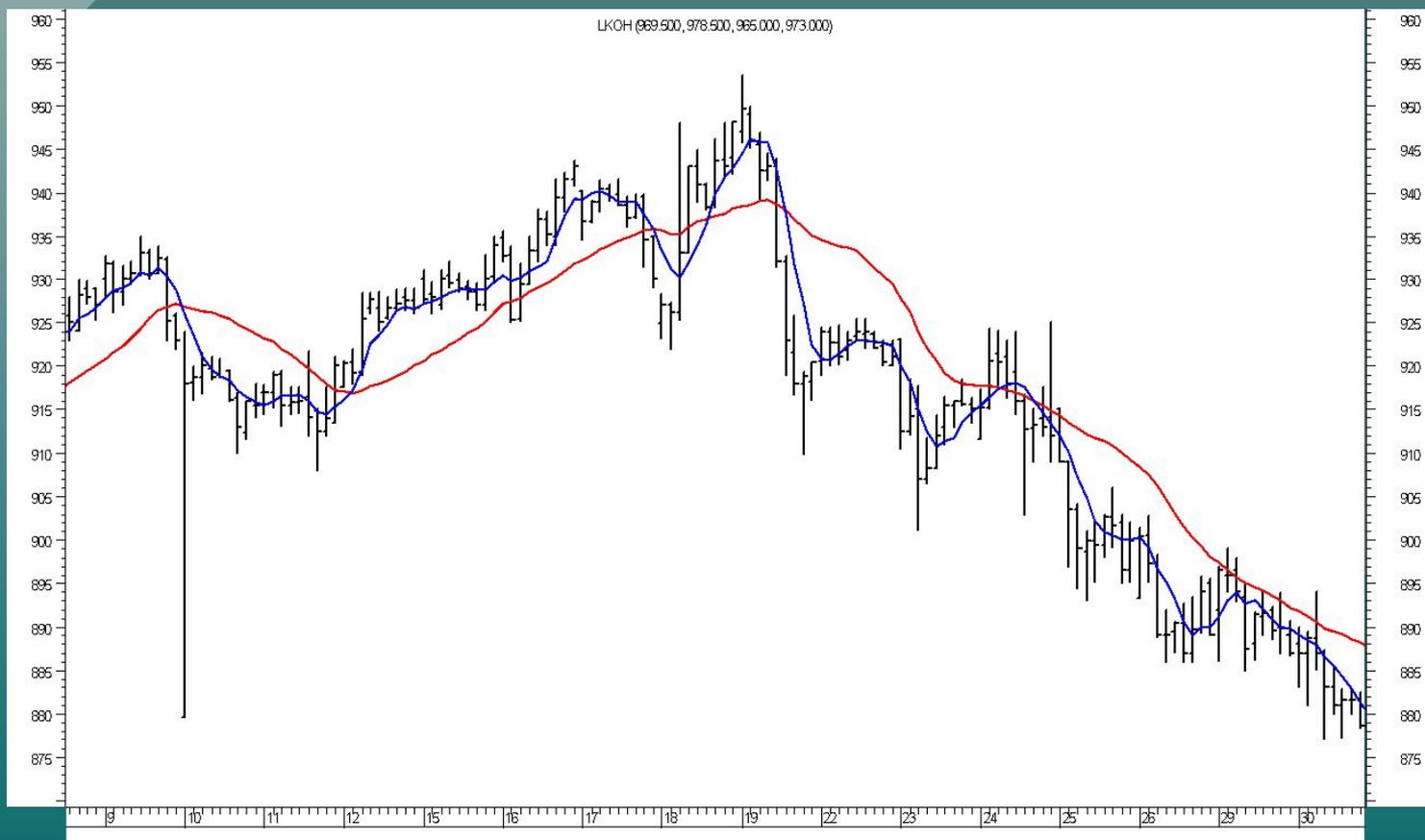
# Формула расчета простой средней

$$\text{Простое МА} = \frac{P_1 + P_2 + \dots + P_n}{n}, \text{ где}$$

$P$  - усредняемая цена,

$n$  - период усреднения (выбирается игроком).

# Пример простого 5-дневного и 20-дневного скользящего среднего



# Тактика игры

Самый важный сигнал НАПРАВЛЕНИЕ НАКЛОНА.

При восходящем МА – играем на повышение:

- 1) **ПОКУПАЕМ** при снижении цены до МА или немного ниже.
- 2) Выставляем **СТОП-ПРИКАЗ** ниже предыдущего минимума.

# Тактика игры

При нисходящем ЕМА играем на понижение:

- 1) Открываем **КОРОТКИЕ ПОЗИЦИИ**, когда цены отскочат до ЕМА или немного выше.
- 2) Размещаем защитный **СТОП-ПРИКАЗ** немного выше недавнего максимума.



# Метод схождения /расхождения показателя среднего движения курса (MACD)

Индикатор MACD состоит из двух линий:  
сплошной - линией MACD, и  
пунктирной - сигнальной линией.

# Расчет MACD

1. Рассчитайте 12-дневное ЕМА по ценам закрытия.
2. Рассчитайте 26-дневное ЕМА по ценам закрытия.
3. Вычтите 26-дневное ЕМА из 12-дневного ЕМА и нарисуйте эту разность сплошной линией. Это быстрая линия MACD (MACD Line).
4. Рассчитайте 9-дневное ЕМА от быстрой линии, и нарисуйте результат пунктирной линией. Это медленная сигнальная линия (Signal Line)

# Пример расчета MACD

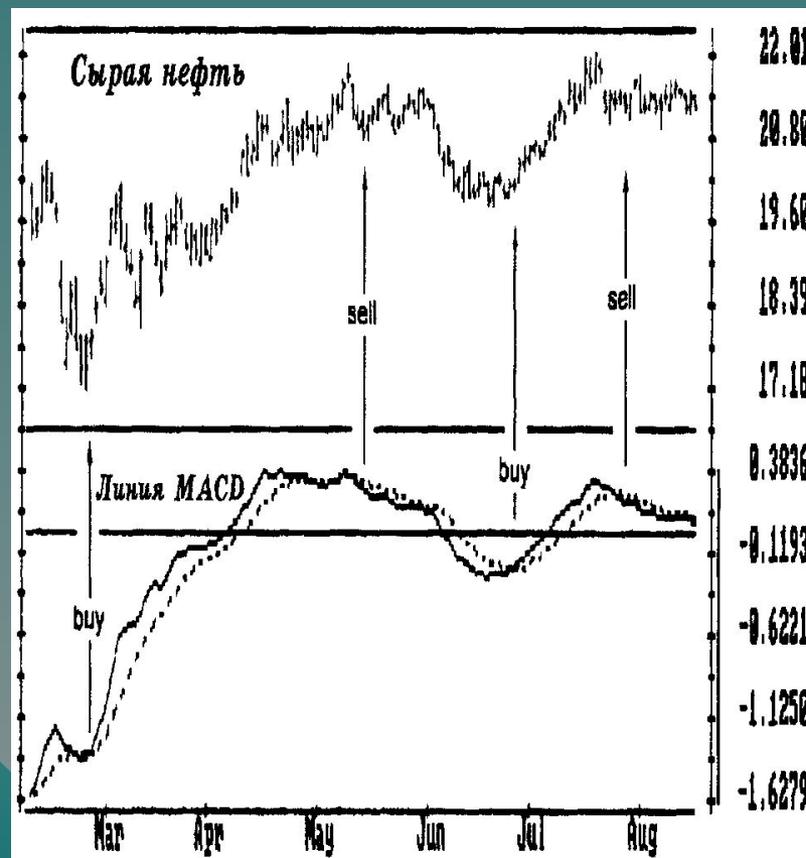
*Сырая нефть*

| DAY | CLOSE | 12-<br>EMA | 26-<br>EMA | MACD  | SIGNAL | MACD-hist |
|-----|-------|------------|------------|-------|--------|-----------|
| 1   | 20.70 | 20.39      | 20.46      | -0.07 | -0.16  | 0.09      |
| 2   | 20.55 | 20.41      | 20.47      | -0.06 | -0.14  | 0.08      |
| 3   | 20.72 | 20.46      | 20.49      | -0.03 | -0.12  | 0.09      |
| 4   | 21.03 | 20.55      | 20.53      | 0.02  | -0.09  | 0.11      |
| 5   | 21.10 | 20.63      | 20.57      | 0.06  | -0.06  | 0.12      |
| 6   | 21.29 | 20.73      | 20.62      | 0.11  | -0.02  | 0.13      |
| 7   | 21.09 | 20.79      | 20.66      | 0.13  | 0.01   | 0.12      |
| 8   | 21.48 | 20.90      | 20.72      | 0.18  | 0.04   | 0.14      |
| 9   | 21.23 | 20.95      | 20.76      | 0.19  | 0.07   | 0.12      |

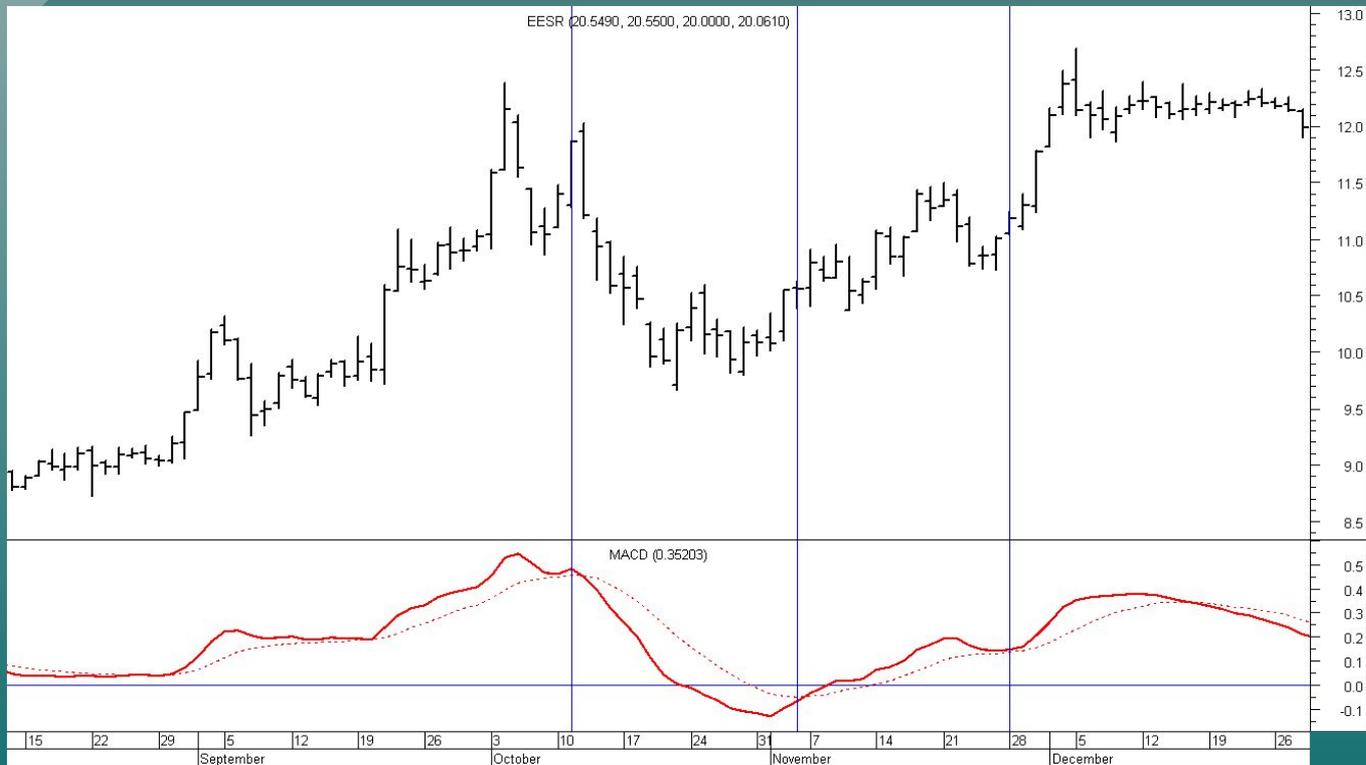
# Торговые сигналы MACD

Сигнал к покупке - быстрая линия MACD пересекает медленную сигнальную линию снизу вверх.

Сигнал к продаже - быстрая линия MACD пересекает медленную сверху вниз.



# MACD



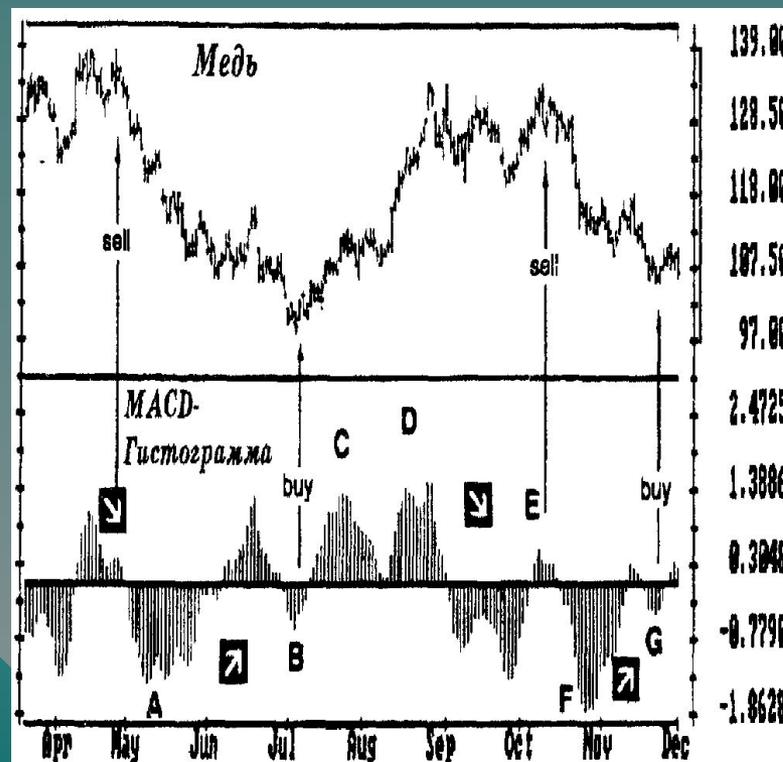
# Гистограмма MACD

*Рассчитывается путем  
вычитания сигнальной линии из  
линии MACD*

**MACD-гистограмма = MACD линия -  
Сигнальная линия**

# Обычный торговый сигнал гистограммы MACD

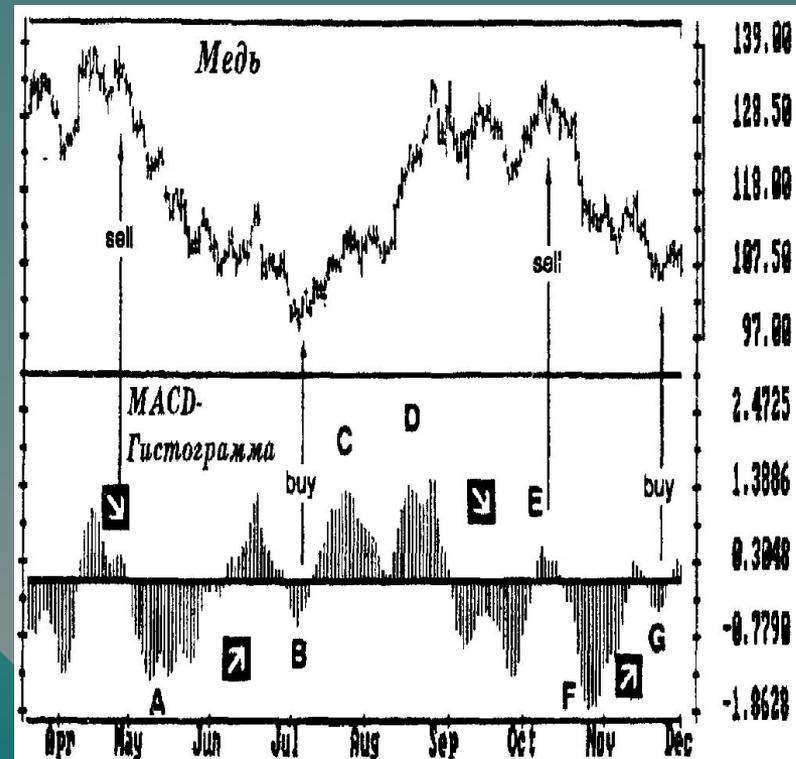
*MACD-гистограмма подтверждает тренд, когда достигает новых максимумов и минимумов одновременно с ценами (C,D).*



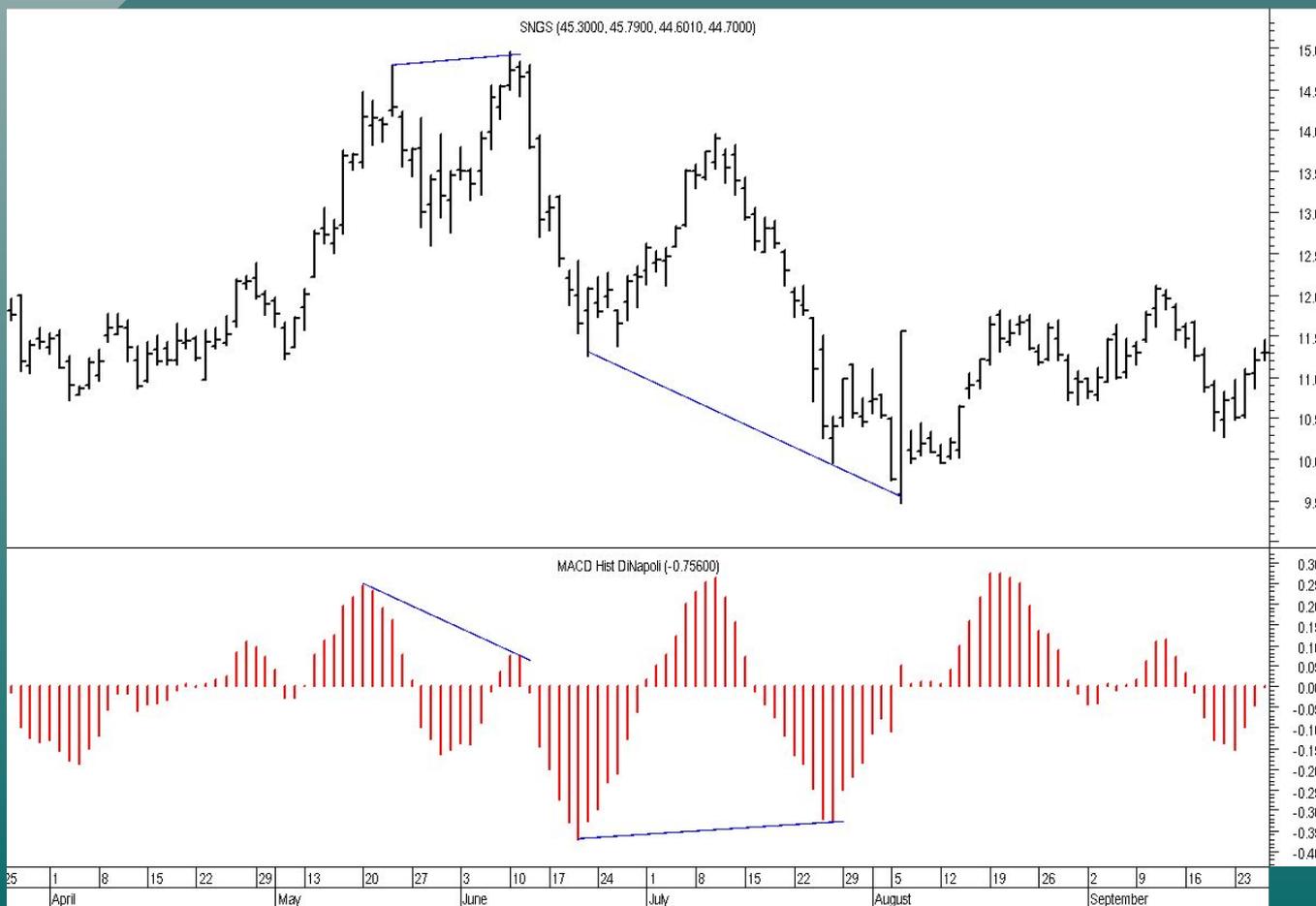
# Расхождения MACD-гистограммы

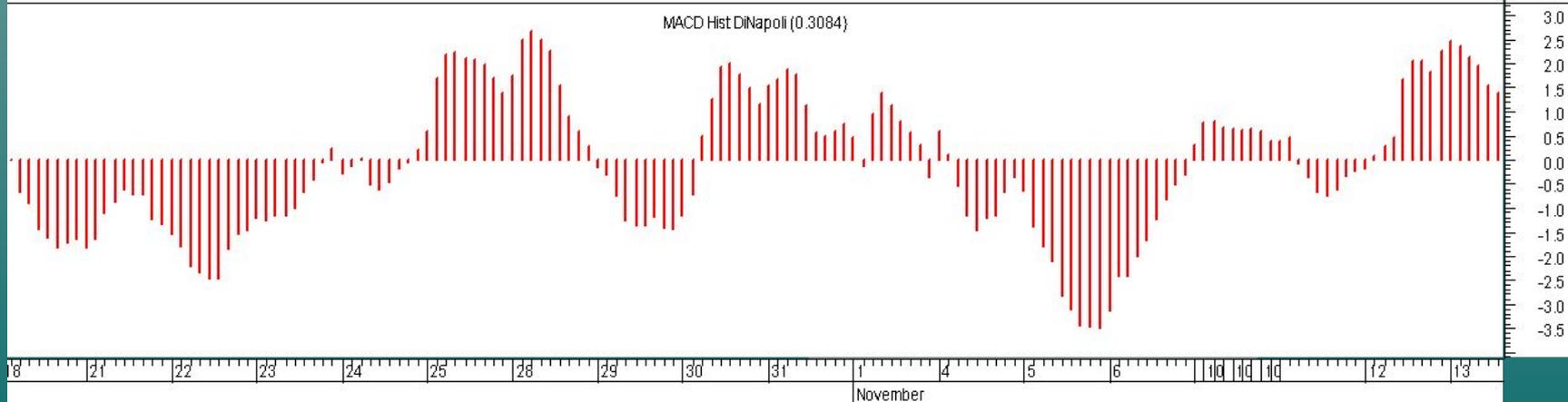
**Продажа - MACD-гистограмма движется вниз от своего второго более низкого максимума, в то время как цены достигли большего максимума.**

**Покупка - MACD-гистограмма двинется вверх из своего второго, менее глубокого минимума, в то время как цены падают до нового минимума.**



# Дивергенция MACD на рынке акций ОАО «Сургутнефтегаз»





November

**Осцилляторы** -  
технические индикаторы,  
предназначенные для  
определения точки  
поворота тенденции и  
оценки скорости движения  
рынка

Рынок считается **перекупленным**,  
когда осциллятор поднимается до  
необычно высокого уровня

Рынок считается **перепроданным**,  
когда осциллятор падает до  
необычно низкого уровня

# Процентный диапазон Вильямса %R

- $r$  — интервал времени, выбираемый игроком, например, 7 дней,
- $H_r$  — максимальный дневной максимум за этот интервал, например, за 7 дней,
- $L_r$  — минимальный дневной минимум за то же время, например, за 7 дней,
- $C$  — последняя цена закрытия.

$$Wm\%R = 100 * \frac{H_r - C}{H_r - L_r}, \text{ где}$$

$Wm\%R$  колеблется между 0 и 100%. Он равен 0, когда "быки" в максимальной силе и устанавливают цену закрытия на вершине интервала. Он достигает 100 процентов когда "медведи" в полной силе и устанавливают цену закрытия на нижней границе интервала.

# Торговые сигналы %R

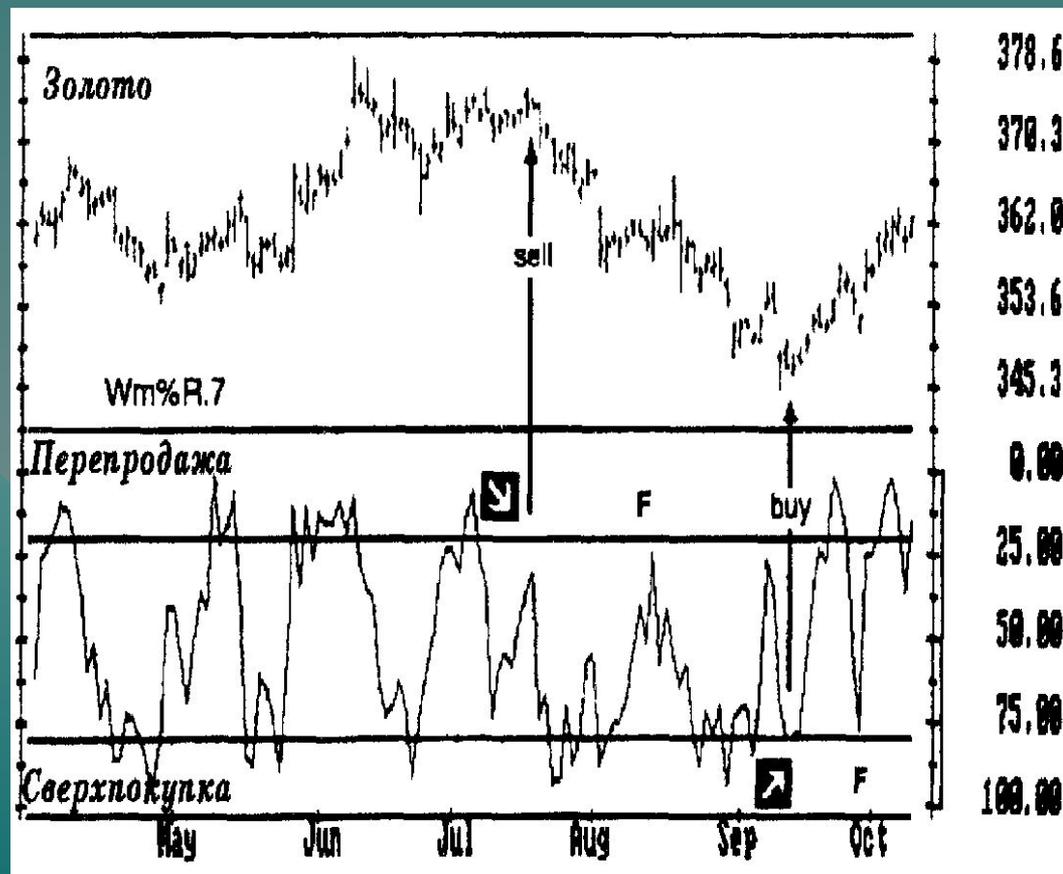
Wm%R дает три типа сигналов:

- 1) Дивергенция пиков или впадин
- 2) Разворот
- 3) указание на перекупленность или перепроданность рынка

# Дивергенция

Дивергенция  
цен и %R в  
июле дает  
сигнал к  
продаже  
(стрелка)

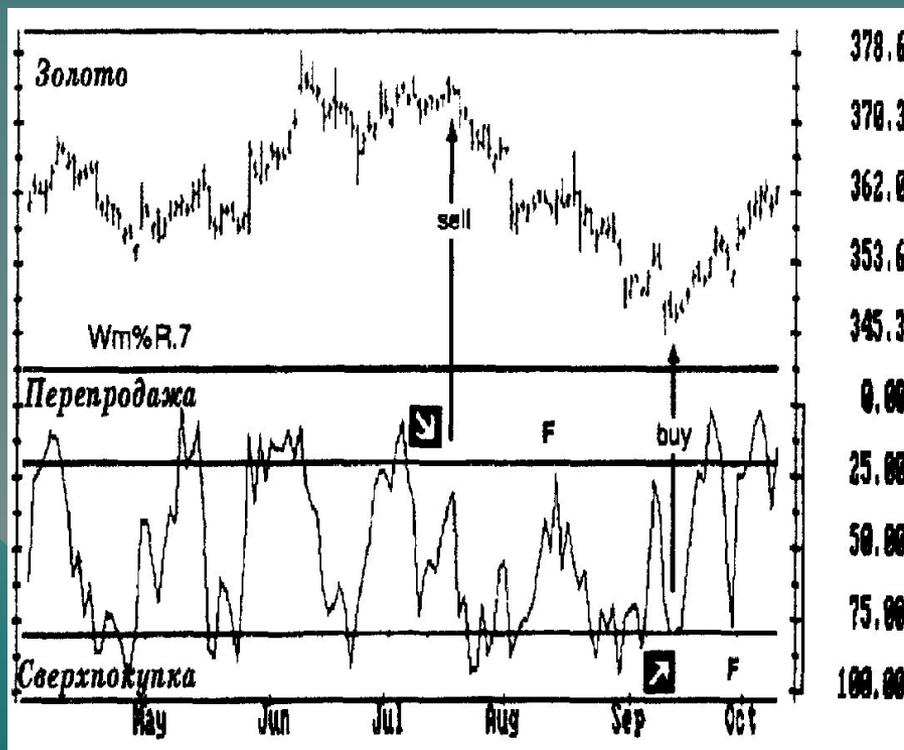
Дивергенция в  
сентябре  
дает сигнал к  
покупке



# Разворот

Разворот индикатора, не достигшего линии 10 дает сигнал на продажу (точка F)

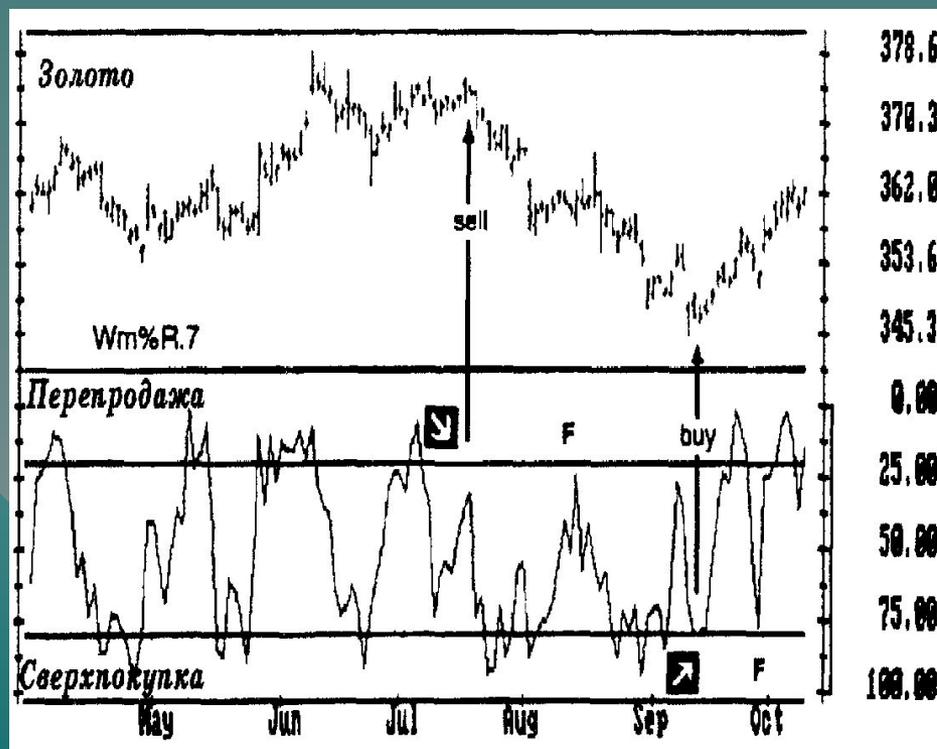
Разворот индикатора ранее 90, дает сигнал на покупку



# Перепроданность и перекупленность

**Wm%R поднимается выше верхней справочной линии (10) - рынок перекуплен (сигнал к продаже)**

**Wm%R опускается ниже нижней справочной линии (90) - рынок перепродан (сигнал к покупке)**



# Торговая система «Тройной экран» А.Элдера

Каждая сделка проходит проверку в три этапа, соответствующих различным масштабам времени и трем основным типам движения рынка (течение, волны и рябь).

Сделка, прошедшая проверку имеет более высокую вероятность успеха.

1) Выбираем масштаб времени для проведения торговых операций (например, дневной график). Этот масштаб называется СРЕДНИМ.

Масштаб, на порядок больший, называется ДОЛГОСРОЧНЫМ (недельный график).

Масштаб, на порядок меньший, называется КРАТКОСРОЧНЫМ (часовой график).

# Первый выбор (рыночное течение)

Выявляем долговременное направление рынка на ДОЛГОСРОЧНОМ (недельном) графике.

В качестве индикатора можно использовать MACD, угол наклона скользящей средней и другие индикаторы.

# Второй выбор (рыночная волна)

Используем СРЕДНИЙ масштаб графика (дневной) для выявления движения цен против рыночной тенденции, выявленной на предыдущем шаге.

Используем для анализа дневного графика осцилляторы.

Для покупки на недельных восходящих тенденциях используем дневные спады. От осцилляторов принимаем только сигналы к покупке.

Для продажи на недельных нисходящих тенденциях используем дневные подъемы. От осцилляторов принимаем только сигналы к продаже.

Ориентируемся только на тенденцию на ДОЛГОСРОЧНОМ графике.

# Третий выбор (внутридневной прорыв)

Цель – выявить «зыбь» в направлении течения и выбрать момент для открытия позиции в направлении недельной тенденции.

Третий выбор – это метод скользящего стоп-приказа о покупке (при восходящих тенденциях) или продаже (при нисходящих).

Не требуется использовать график или индикатор.

Например: разместите скользящий стоп на один тик выше максимума предыдущего дня при восходящей тенденции.

# Сводная таблица системы

| Тенденция недельная | Тенденция дневная | Действия            | Приказ брокеру      |
|---------------------|-------------------|---------------------|---------------------|
| Восходящая          | Восходящая        | Воздержаться        | Никакого            |
| Восходящая          | Нисходящая        | Играть на повышение | Скользкий о покупке |
| Нисходящая          | Нисходящая        | Воздержаться        | Никакого            |
| Нисходящая          | Восходящая        | Играть на понижение | Скользкий о продаже |

# Стоп-приказы

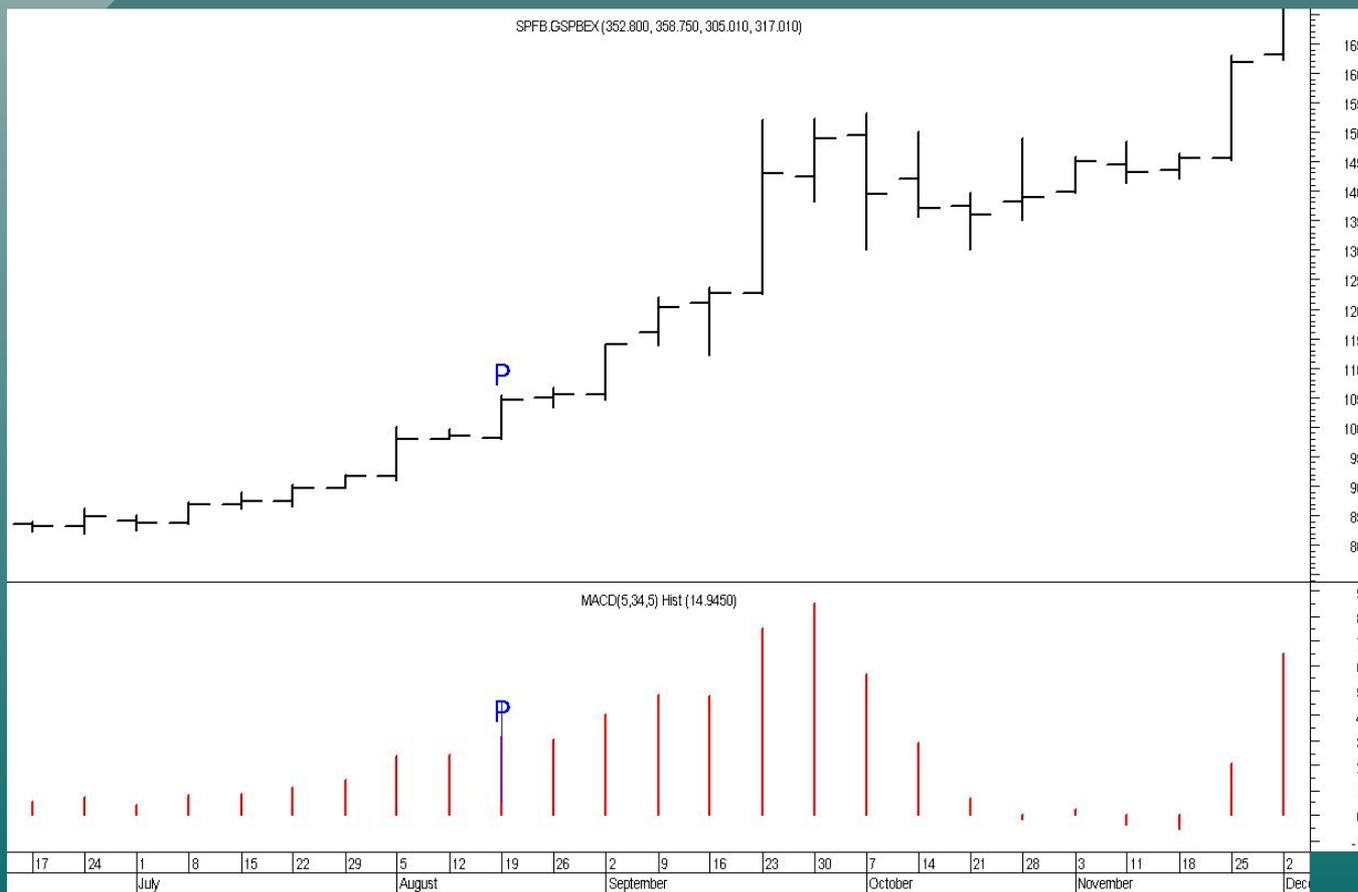
Система требует установки плотных стоп-приказов для ограничения возможных убытков.

Рекомендуется:

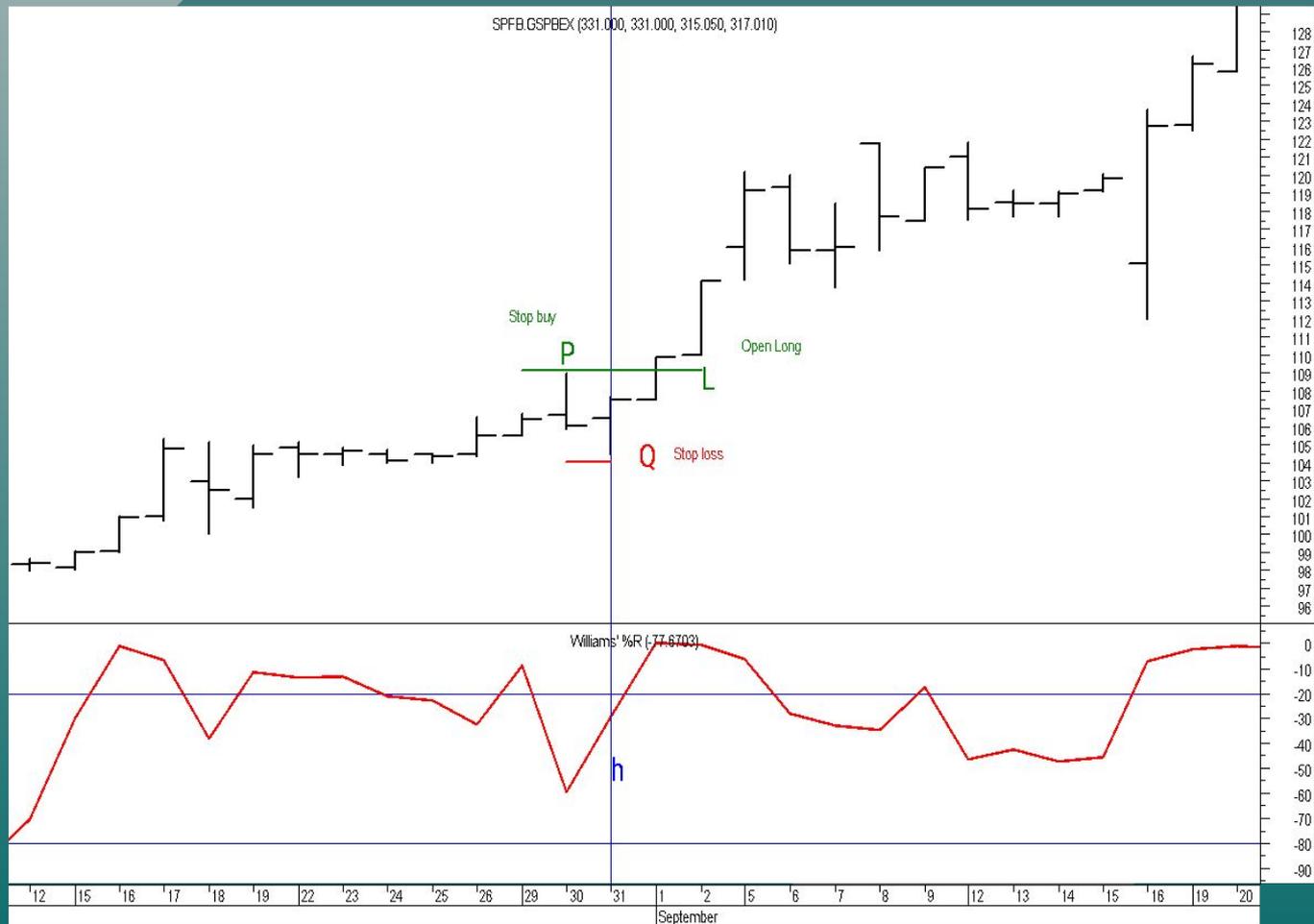
ставить стоп-приказ на продажу после открытия длинной позиции на один тик ниже минимума данного или предыдущего дня.

Ставить стоп-приказ на покупку после открытия короткой позиции на один тик выше максимума данного или предыдущего дня.

# Восходящая тенденция на рынке акций Газпрома



# Покупка Газпрома 1.09.05



# Торговая система «Тройной экран» А.Элдера

Система использует ТРИ МАСШТАБА ВРЕМЕНИ,  
связанных КОЭФФИЦИЕНТОМ 5.

Каждая сделка проходит проверку в три этапа,  
соответствующих различным масштабам  
времени и трем основным типам движения

рынка (**Течение**, волны и рябь).

Сделка, прошедшая проверку имеет более высокую  
вероятность успеха.

Выбираем **СРЕДНИЙ** масштаб времени для проведения торговых операций (например, **дневной** график).

Масштаб, на порядок больший, называется **ДОЛГОСРОЧНЫМ** (**недельный** график).

Масштаб, на порядок меньший, называется **КРАТКОСРОЧНЫМ** (**часовой** график).

# Первый выбор (рыночное течение)

Выявляем долговременное направление рынка на ДОЛГОСРОЧНОМ (недельном) графике.

В качестве индикатора можно использовать MACD, угол наклона скользящей средней и другие индикаторы.

# Второй выбор (рыночная волна)

Используем СРЕДНИЙ масштаб графика (дневной) для выявления движения цен ПРОТИВ рыночной тенденции, выявленной на предыдущем шаге.

Используем для анализа ДНЕВНОГО графика ОСЦИЛЛЯТОРЫ.

Для ПОКУПКИ на НЕДЕЛЬНЫХ восходящих тенденциях используем ДНЕВНЫЕ СПАДЫ. От осцилляторов принимаем только сигналы к покупке.

Для ПРОДАЖИ на НЕДЕЛЬНЫХ нисходящих тенденциях используем ДНЕВНЫЕ ПОДЪЕМЫ. От осцилляторов принимаем только сигналы к продаже.

# Третий выбор (внутридневной прорыв)

Цель – выявить «зыбь» в направлении течения и выбрать момент для открытия позиции в направлении недельной тенденции.

Третий выбор – это **метод скользящего стоп-приказа** о покупке (при восходящих тенденциях) или продаже (при нисходящих).

Не требуется использовать график или индикатор.

Например: разместите скользящий стоп на один тик выше максимума предыдущего дня при восходящей тенденции.

# Сводная таблица системы

| Тенденция недельная | Тенденция дневная | Действия            | Приказ брокеру      |
|---------------------|-------------------|---------------------|---------------------|
| Восходящая          | Восходящая        | Воздержаться        | Никакого            |
| Восходящая          | Нисходящая        | Играть на повышение | Скользкий о покупке |
| Нисходящая          | Нисходящая        | Воздержаться        | Никакого            |
| Нисходящая          | Восходящая        | Играть на понижение | Скользкий о продаже |

# Стоп-приказы

Система требует установки плотных стоп-приказов для ограничения возможных убытков.

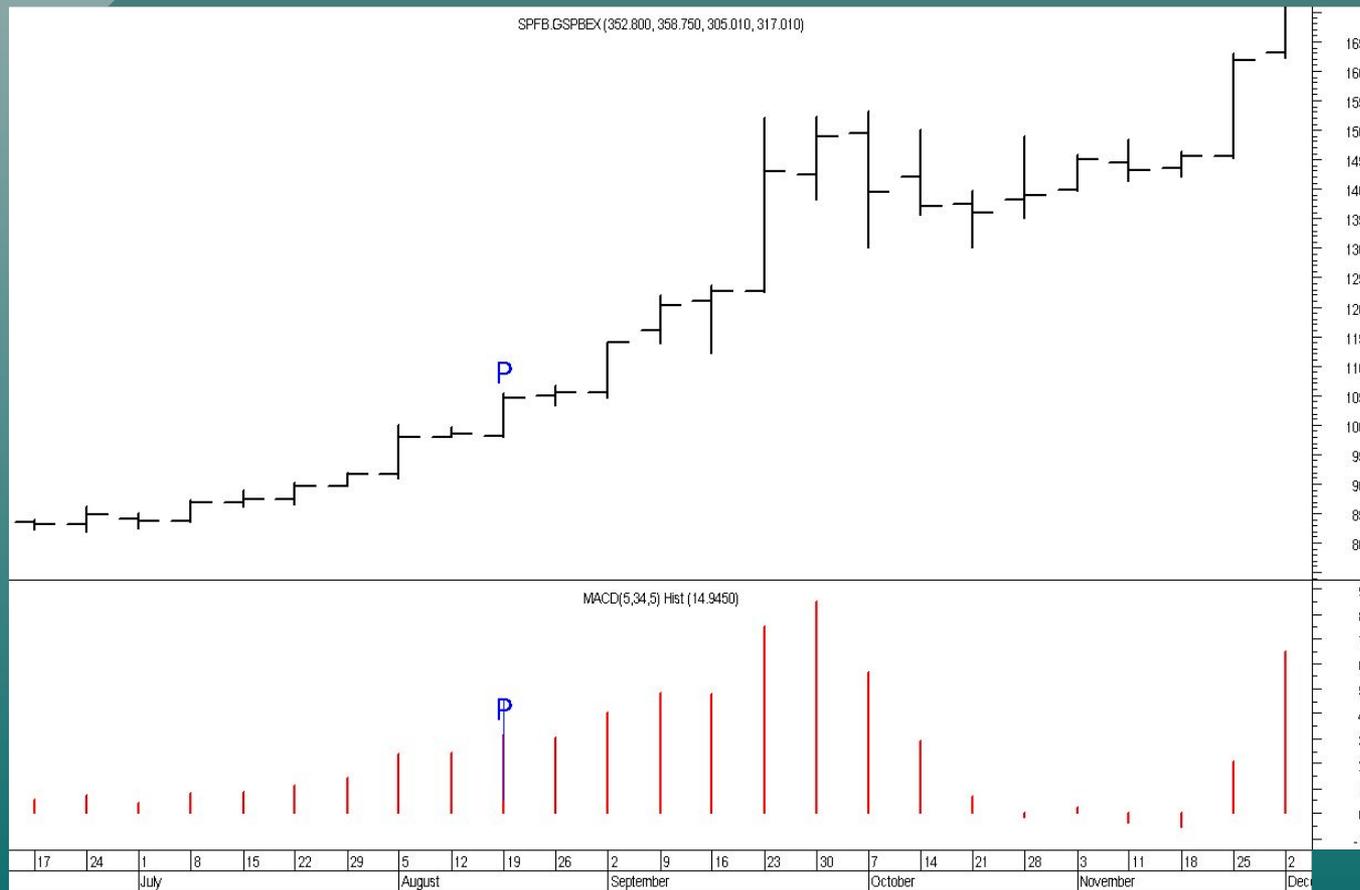
Рекомендуется:

ставить **стоп-приказ на продажу** после открытия длинной позиции на один тик ниже минимума данного или предыдущего дня.

Ставить **стоп-приказ на покупку** после открытия короткой позиции на один тик выше максимума данного или предыдущего дня.

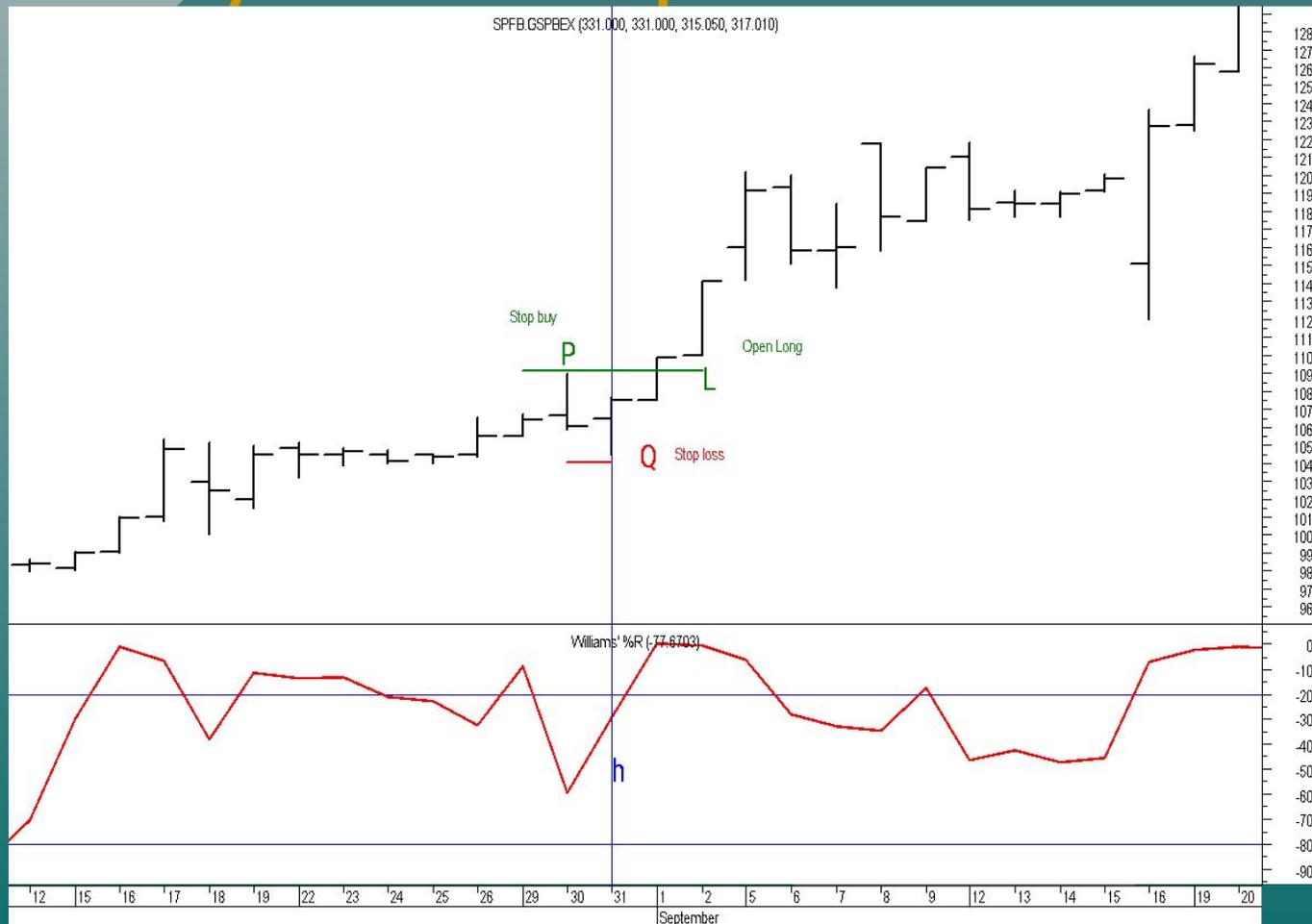
# Первый экран

## Восходящая тенденция на рынке акций Газпрома

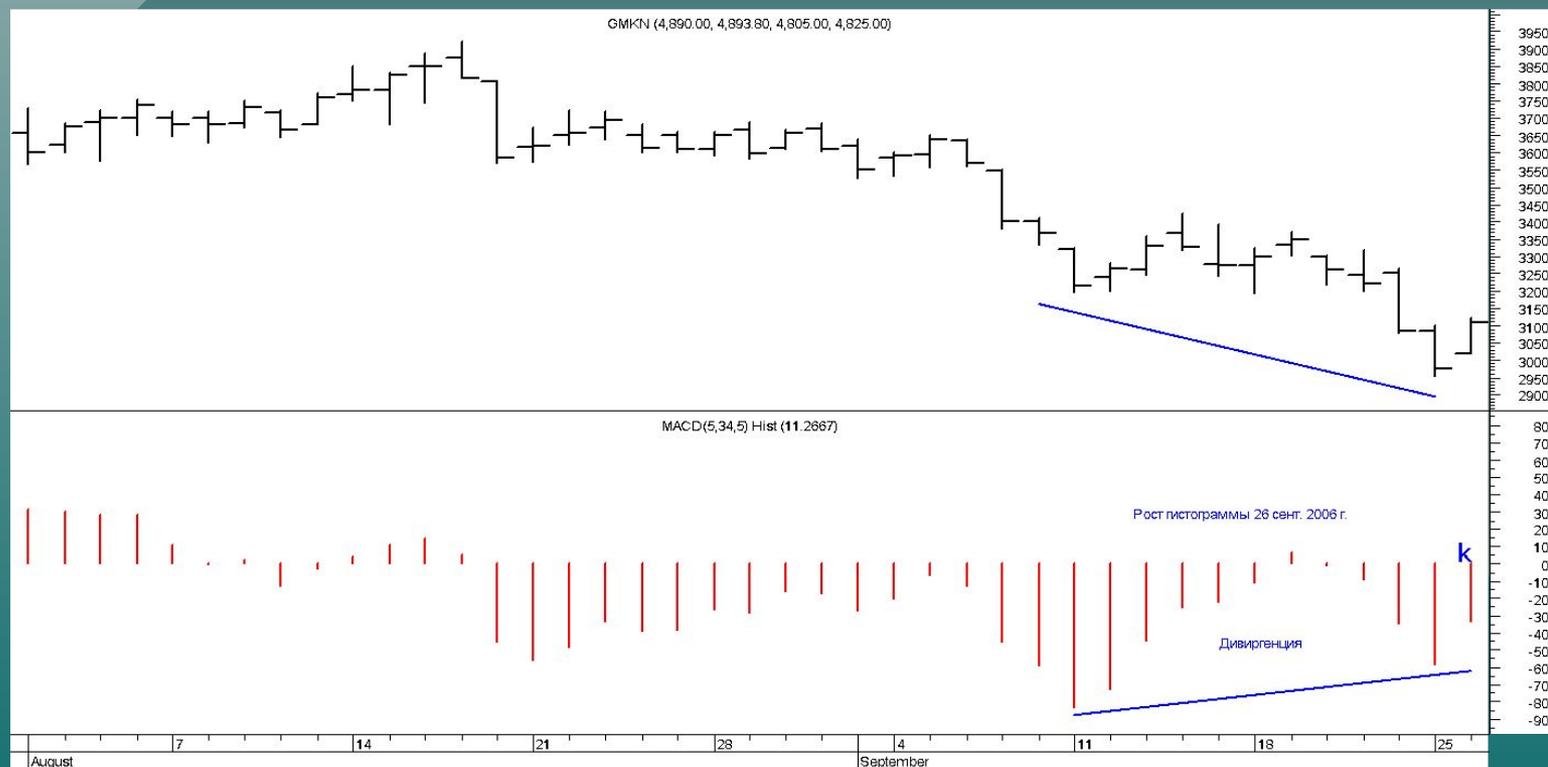


# 2 и 3 экран

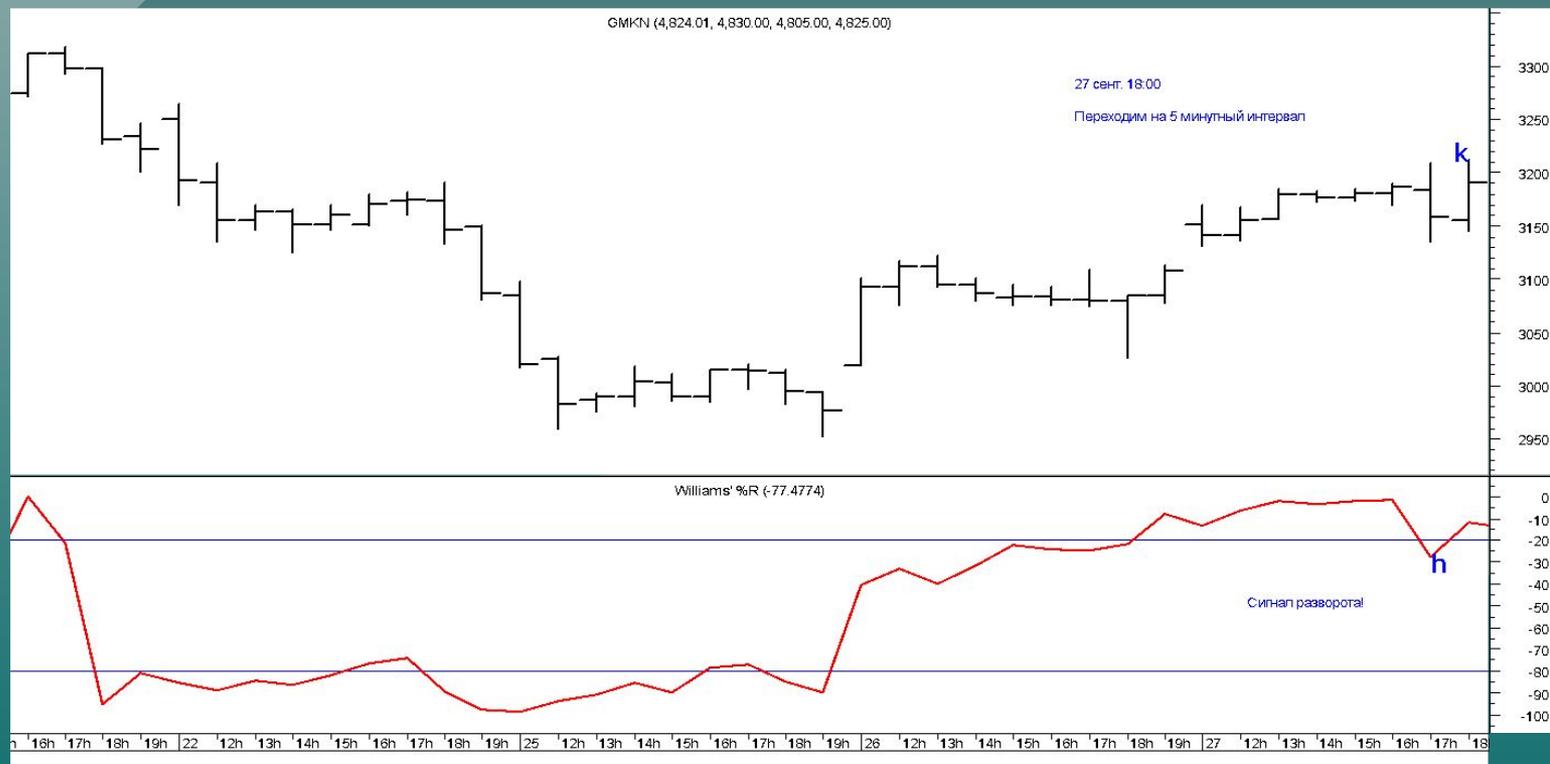
## Покупка Газпрома 1.09.05



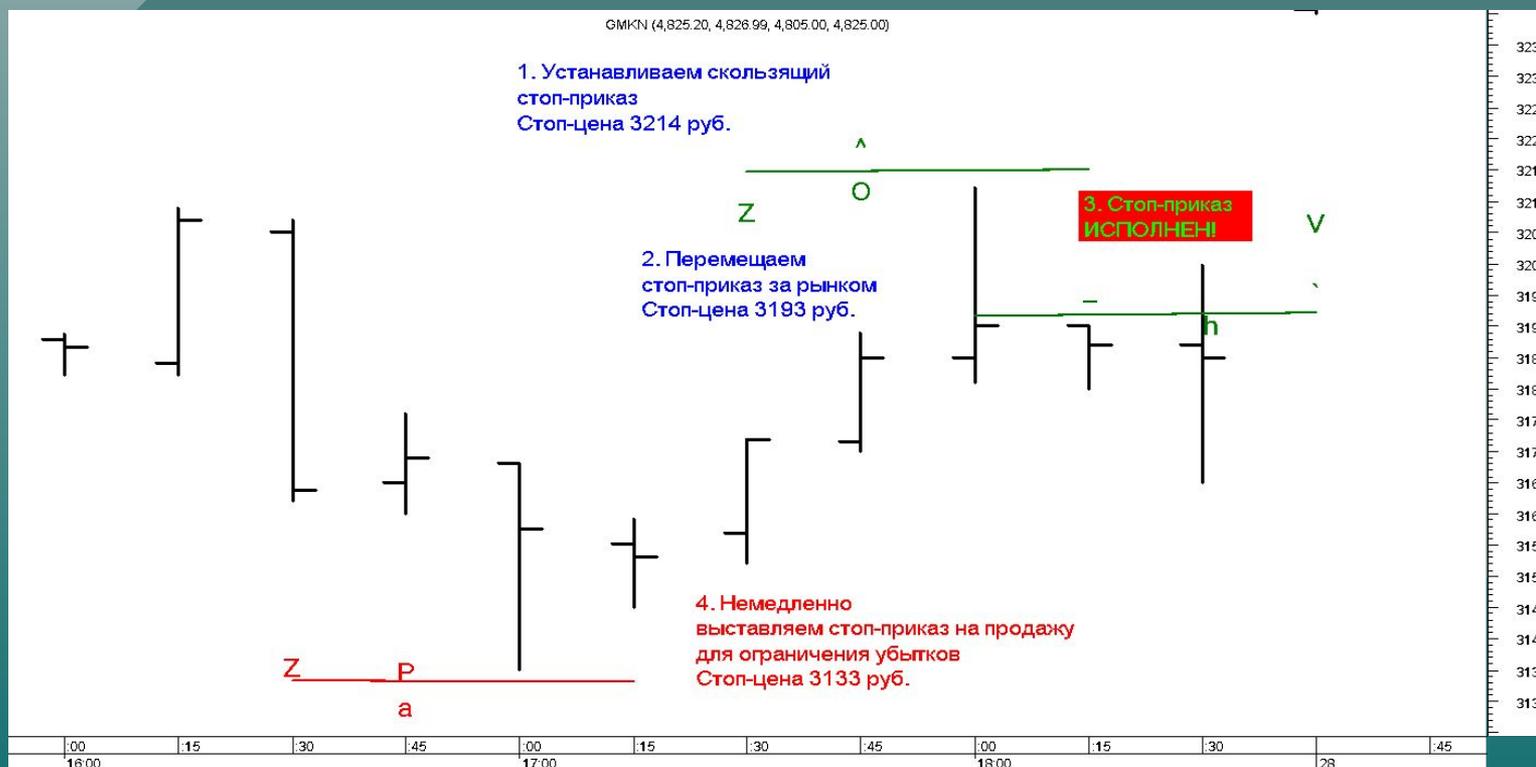
# Первый экран – 1 день



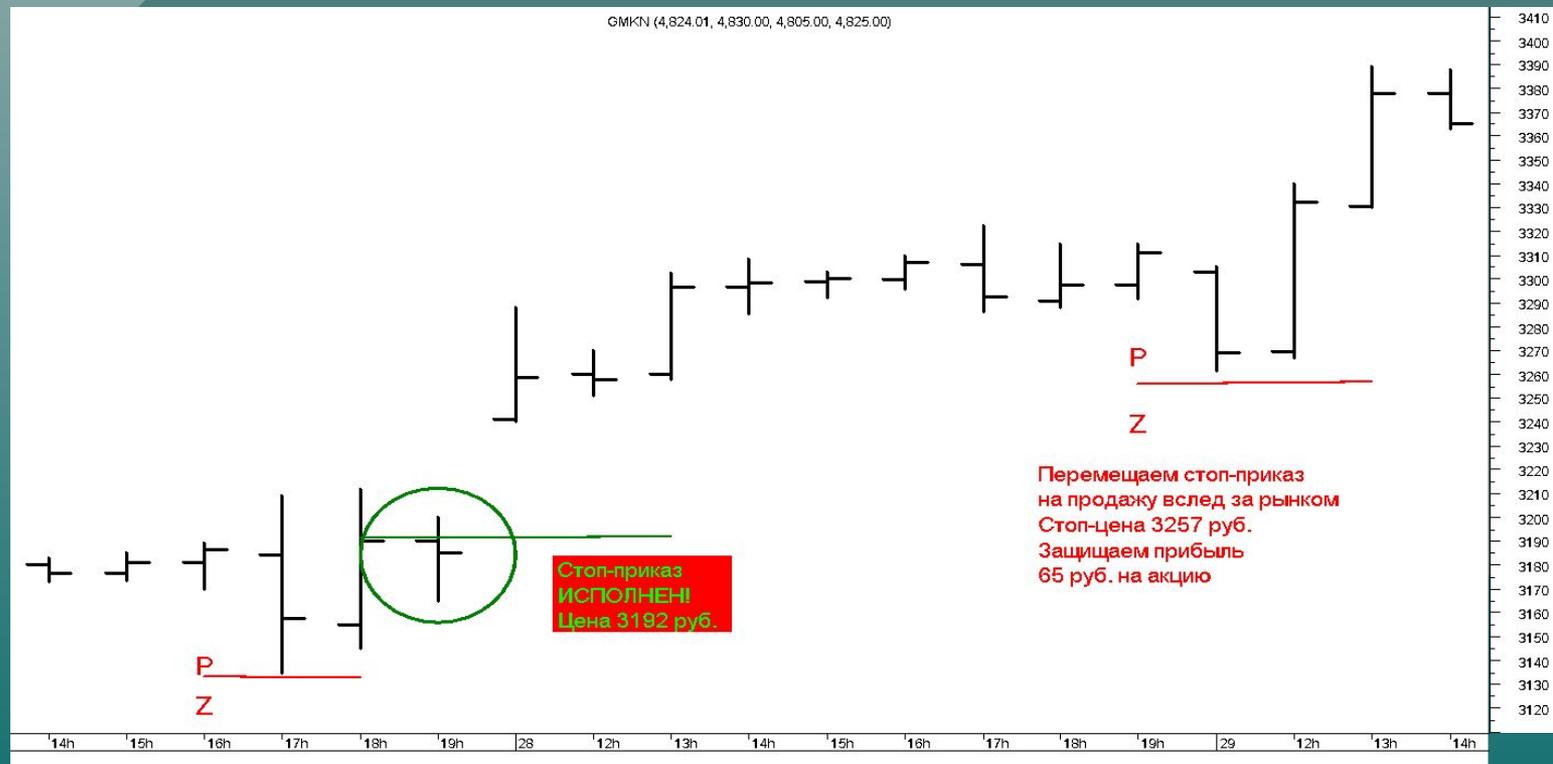
# Второй экран – 1 час



# 3 экран – 5 минут



# Развитие ситуации



# Развитие ситуации в течение 2 месяцев



# Система Интернет-трейдинга



**Сервер QUIK** - центральное звено системы, подключен к торговым системам бирж через специальные «шлюзы».

### **«Шлюзы»**

- передают серверу информацию о торгах и средствах брокера на бирже
- принимают поручения на покупку/продажу.

**Сервер** транслирует информацию всем активным (подключенным) клиентам с минимально возможной задержкой.

## **Администратор системы**

- регистрирует пользователей
- устанавливает для них права на пользование информацией
- определяет лимиты средств клиента, в пределах которых он может совершать сделки

## **Пользователь системы**

- **соединяется с сервером системы через Интернет**
- **получает биржевую информацию о ходе биржевых торгов, доступных для торговли средствах**
- **может самостоятельно участвовать в торгах, посылая заявки в торговую систему непосредственно с рабочего места QUIK**

# Информационно-торговая система QUIK

программный комплекс для  
предоставления доступа к биржевым  
торгам через сеть Интернет в  
режиме реального времени  
(интернет-трейдинг).

# Интерфейс QUIK

1 2 3 4 5 6 7 8

[Дюкарев Андрей Владимирович] Информационная система QUIK (версия 4.05)

Связь Экспорт данных Таблицы Дилер Новости Лимиты Сообщения Настройки Окна Справка

111 16:48:33 Соединение установлено

ММВБ СФР ММВБ ЦББ РТС ФБ "Санкт-Петербург" FORTS СПбБ Внебиржевой рынок Свободная Графики Новости Сообщения Портфели Для экспорта

### Текущая таблица параметров #2

|                  | Спрос   | Заяв. Предл. | Заяв.   | Откр. | Макс. цена | Мин. цена | Цена посл | Измен. | Кол-во посл | Всего бумаг | Оборот      | Ср. взв. | Лучш. спл | Лучш. пред | Кол-во сд | Цена за | Пред. оц |
|------------------|---------|--------------|---------|-------|------------|-----------|-----------|--------|-------------|-------------|-------------|----------|-----------|------------|-----------|---------|----------|
| ИркЭнЭр [Акц]    | 1.820   | 23           | 1.834   | 41    | 1.830      | 1.780     | 1.820     | 0.013  | 500         | 607 700     | 1 098 434   | 1.808    | 1.830     | 1.780      | 47        | 1.807   | 1.857    |
| ЛУКОЙЛ [Акц]     | 508 060 | 95           | 509 000 | 116   | 502 500    | 513 000   | 495 000   | 0.013  | 10          | 352 465     | 197 438 255 | 503 070  | 515 000   | 490 000    | 1 060     | 494 500 | 488 510  |
| МосЭнерг-3 [Акц] | 0.993   | 149          | 0.994   | 181   | 0.999      | 1.013     | 0.994     | 0.027  | 1 000       | 30 720 000  | 30 471 402  | 0.992    | 1.019     | 0.900      | 544       | 0.967   | 0.965    |
| МосЭнерг-3 [Акц] | 0.977   | 8            | 0.993   | 10    | 0.989      | 0.990     | 0.990     | 0.021  | 1 000       | 151 200     | 148 986     | 0.985    | 0.990     | 0.970      | 8         | 0.969   | 0.945    |
| РАО ЭЭС [Акц]    | 3 113   | 557          | 3 117   | 511   | 3 120      | 3 140     | 3 117     | 0.126  | 105         | 317 288 300 | 980 063 681 | 3 089    | 4 000     | 2 000      | 8 099     | 2 991   | 3 008    |
| РАО ЭЭС-п [Акц]  | 2 533   | 40           | 2 554   | 70    | 2 530      | 2 580     | 2 461     | 0.104  | 107         | 4 050 700   | 10 172 447  | 2 511    | 3 101     | 2 300      | 116       | 2 450   | 2 433    |
| Ростел-Тар [Акц] | 17.15   | 21           | 17.25   | 44    | 17.00      | 17.40     | 16.80     | 0.45   | 150         | 211 629     | 3 629 281   | 17.15    | 17.35     | 16.29      | 53        | 16.70   | 16.97    |
| Ростел-Тар [Акц] | 31.270  | 117          | 31.340  | 239   | 32.000     | 30.600    | 31.250    | 0.150  | 4 000       | 3 151 017   | 98 808 317  | 31.360   | 35.000    | 30.000     | 1 325     | 31.100  | 31.470   |

### Таблица лимитов по денежным средствам

| Ф.Вал. | Группа      | Входящий ост | Входящий лим | Текущий ост. | Текущий лим  | Заблокировано | Всего        | Доступно     | Баланс       |
|--------|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
| 1      | NC SUF EQTV | 5 380 237.08 | 3 513 307.21 | 5 380 237.08 | 3 513 307.21 | 0.00          | 8 893 544.29 | 8 893 544.29 | 5 380 237.08 |

### Таблица лимитов по бумагам

| № | Ф.Название б  | Входящий ост | Входящий лим | Текущий ост. | Текущий лим | Заблокировано | Всего   | Доступно | Баланс  |
|---|---------------|--------------|--------------|--------------|-------------|---------------|---------|----------|---------|
| 1 | NC ЛУКОЙЛ     | -5 000       | 0            | -5 000       | 0           | 0             | -5 000  | -5 000   | -5 000  |
| 2 | NC РАО ЭЭС    | 493          | 15 661       | 493          | 15 661      | 0             | 16 154  | 16 154   | 493     |
| 3 | NC РАО ЭЭС-п  | 0            | 0            | 0            | 0           | 0             | 0       | 0        | 0       |
| 4 | NC Ростел-Тар | -12 000      | 0            | -12 000      | 0           | 0             | -12 000 | -12 000  | -12 000 |
| 5 | NC Сбербанк   | -200         | 0            | -200         | 0           | 0             | -200    | -200     | -200    |
| 6 | NC Сургнфгз-п | 173          | 0            | 173          | 0           | 0             | 173     | 173      | 173     |
| 7 | NC ЮКОС-ао-2  | -1 700       | 0            | -1 700       | 0           | 0             | -1 700  | -1 700   | -1 700  |

### Портфель

| Задолженность брокеру | Только деньги клиента | Оценка        | Средства в рублях | Все средства  | Уровень на    | Состояние |                                   |
|-----------------------|-----------------------|---------------|-------------------|---------------|---------------|-----------|-----------------------------------|
| 1                     | 2 545 500.00          | 5 380 237.08  | 153 470.90        | 5 380 237.08  | 5 533 707.98  | 54.00     | Необх. запрет ухудшающих операций |
| 5                     | 0.00                  | 15 913 294.54 | 0.00              | 15 913 294.54 | 15 913 294.54 | 100.00    | OK                                |

### Окно сообщений Трейдера

| Время    | Тип адрес:   | Имя ад:  | Статус:       | Сообщение           |
|----------|--------------|----------|---------------|---------------------|
| 17:15:16 | Отправитель: | Курляндч | Тестируешься? | Отправить сообщение |

### Новости (Всего: 386, Всего: 27.06.02)

| Д. | Агентство  | Заголовок               |
|----|------------|-------------------------|
| 1  | МФД        | В.Христенко: Правительс |
| 2  | Прайм-Тасс | Сумма средств в торго   |
| 3  | Прайм-Тасс | Курсы обмена наличной   |

### Курсы обмена наличной валюты в банках Москвы на 27.06.2002

| ! Банк        | ! Валюта | ! Сумма | ! Покупка | ! Продажа |
|---------------|----------|---------|-----------|-----------|
| ! Авангард    | ! USD    | !       | ! 31.1    | ! 31.65   |
| ! Авангард    | ! EUR    | !       | ! 30      | ! 30.85   |
| ! Альфа-банк  | ! USD    | !       | ! 30.95   | ! 31.6    |
| ! Альфа-банк  | ! EUR    | !       | ! 30.15   | ! 31.5    |
| ! Банк Москвы | ! USD    | !       | ! 30.9    | ! 31.56   |

### Индексы

| Индексы               | Знач.  | Закр.  |
|-----------------------|--------|--------|
| ММВБ10 [Индексы ММВБ] | 522.17 | 507.18 |
| СФИ [Индексы ММВБ]    | 297.46 | 290.48 |
| ТехСФИ [Индексы ММВБ] | 639.20 | 622.35 |
| RTSI [Индексы РТС]    |        |        |
| RTSIF [Индексы РТС]   |        |        |
| RTSIF_R [Индексы РТС] |        |        |
| RTST [Индексы РТС]    |        |        |

### РАО ЭЭС ао (5 мин)

### Информационное окно #2

| Время на связи          | 01:04:14 |
|-------------------------|----------|
| Принято всего байт      | 2755170  |
| Передано всего байт     | 18758    |
| Средняя скорость приема | 714      |

Время сервера: 14:52:49; записей: 11320; текущая: 51113

# Таблица текущих значений параметров

В заголовках строк таблицы указаны финансовые инструменты, в заголовках столбцов – параметры.

|                | Спрос     | Предл.  | Откр.     | Макс. цена | Мин. цена | Цена после | % измен | Ср. взв. цен |
|----------------|-----------|---------|-----------|------------|-----------|------------|---------|--------------|
| ЛУКОЙЛ [А]     | 567.890   | 567.980 | 585.000   | 587.800    | 567.890   | 567.980    | -7.59   | 582.140      |
| РАО ЕЭС [А]    | 11.739    | 0.000   | 12.407    | 12.407     | 10.776    | 10.778     | -10.29  | 11.382       |
| РАО ЕЭС-п [А]  | 6.789     | 6.798   | 6.789     | 6.798      | 6.789     | 6.789      | 0.00    | 6.791        |
| МосЭнерго [А]  | 1.620     | 1.638   | 1.590     | 1.621      | 1.590     | 1.621      | 5.60    | 1.618        |
| Ростел-1ао [А] | 74.810    | 74.970  | 74.690    | 74.810     | 64.100    | 74.810     | -0.60   | 71.060       |
| Ростел-1ап [А] | 27.48     | 0.00    | 28.43     | 28.43      | 28.43     | 28.43      | -4.05   | 28.43        |
| Сбербанк [А]   | 6 823.100 | 0.000   | 6 823.100 | 6 823.100  | 6 823.100 | 6 823.100  | 0.16    | 6 823.100    |
| Татнфт Зао [А] | 43.760    | 0.000   | 40.270    | 44.950     | 40.270    | 44.950     | 4.49    | 41.430       |
| Татнфт Зап [А] | 0.000     | 17.675  | 17.675    | 17.675     | 17.675    | 17.675     | -12.40  | 17.675       |

# Вид котировочного окна

| ЛУКОЙЛ [Акци...] |            |           |            | ТНК5в1т-об [Облигаци...] |       |       |       |       | ESU2 [Фьючерсы FORTS] ... |          |       |       |      |       |
|------------------|------------|-----------|------------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|---------------------------|----------|-------|-------|------|-------|
| Цена             | Объем      | Свой      | Сумма      | Доход                    | Прода | Цена  | Покуп | Доход | Сумма                     | Покуп    | Цена  | Цена  | Прод | Сумма |
| 557,700          | 46         | 35        | 484        | 17,44                    | 2 500 | 94,59 |       |       | 4                         | 4        | 2 964 | 2 966 | 80   | 80    |
| 557,900          | 5          |           | 438        | 17,46                    | 1 000 | 94,58 |       |       | 104                       | 100      | 2 963 | 2 969 | 42   | 122   |
| <b>558,000</b>   | <b>413</b> | <b>20</b> | <b>433</b> | 17,48                    | 1 000 | 94,57 |       |       | 109                       | 5        | 2 961 | 2 970 | 500  | 622   |
| 559,000          | 20         |           | 20         | 17,49                    | 1 014 | 94,56 |       |       | 120                       | 11       | 2 960 | 2 975 | 1    | 623   |
| 559,865          | 33         |           | 33         |                          |       | 94,53 | 3 000 | 17,54 | 121                       | 1        | 2 959 | 2 979 | 5    | 628   |
| 560,590          | 1          | <b>1</b>  | 34         | <b>2</b>                 |       | 94,52 | 3 541 | 17,56 | 232                       | <b>3</b> | 2 955 | 2 986 | 25   | 653   |
| 562,281          | 524        |           | 558        |                          |       | 94,51 | 75    | 17,57 | 234                       |          | 2 952 | 2 990 | 500  | 1 153 |
| 562,503          | 6          |           | 564        |                          |       | 94,50 | 1 057 | 17,59 | 434                       | 200      | 2 951 | 2 993 | 30   | 1 183 |

# График цены и объема



# Ввод заявки

**A1-Акции Ввод заявки**

Инструмент: ЛУКОЙЛ | Торговый Счет: L01-00000F00

Рыночная |  **Покупка**  
 Лимитированная |  Продажа

В поле "Цена":  
 Цена  
 Доходность  
 Срвзв.цена

Условие исполнения:  
 Поставить в очередь  
 Немедленно или отклонить  
 Снять остаток

Цена: 588.000 | Количество: 10 | Размер лота: 1

Все сделки по одной цене | На покупку: 87

Код Клиента: E5 | Поручение: **1**

Да | Отмена

**A1-Акции Ввод заявки**

Инструмент: ЛУКОЙЛ | Торговый Счет: L01-00000F00

Рыночная |  Покупка  
 Лимитированная |  **Продажа**

Цена: 588.000 | Количество: 10 | На продажу: 0

Код Клиента: E5 | Поручение: **2**

Да | Отмена

# Ввод стоп-заявки

**A1-Акции Стоп-заявка**

Тип стоп-заявки  
Стоп-лимит

Действует  по 06.10.03  до отмены

Инструмент: ЛУКОЙЛ | Лот: 1 | Торговый Счет: L01-00000F00

Условие активации стоп-заявки  
Брать стоп-цену для инструмента:  
A1-Акции | ЛУКОЙЛ

Покупка  если цена  $\geq$  588.000  
 Продажа  если цена  $\leq$  588.000

Цена: 588.000 | Количество: 10 | На покупку: 49

Код Клиента: E2 | Поручение: **1**

Выставить заявку на покупку по цене: 588.000

Да | Отмена

**A1-Акции Стоп-заявка**

Инструмент: ЛУКОЙЛ | Торговый Счет: Y883/0000001

Покупка  Продажа  если цена  $\geq$  588.000  
 если цена  $\leq$  588.000

Цена: 588.000 | Количество: 10 | На продажу: 0

Код Клиента: | Поручение: **2**

Да | Отмена

# Таблица заявок

|     | Номер    | Время    | Бумага          | Опера  | Цена  | Колич | Остаток | Объем  | Доход | Комме | Исходный | Тип | Состояние |
|-----|----------|----------|-----------------|--------|-------|-------|---------|--------|-------|-------|----------|-----|-----------|
| 208 | 50532183 | 18:53:22 | РАО ЕЭС (Акции) | Продаж | 3,500 | 1     | 0       | 350,00 | 0,00  | 001   | 0        | ЛРО | Исполнена |
| 209 | 50532208 | 19:03:42 | РАО ЕЭС (Акции) | Купля  | 3,500 | 1     | 1       | 350,00 | 0,00  | 001   | 0        | ЛРО | Активна   |
| 210 | 50532211 | 19:03:58 | РАО ЕЭС (Акции) | Купля  | 3,499 | 1     | 1       | 349,90 | 0,00  | 001   | 0        | ЛРО | Снята     |

# Таблица лимитов

| Таблица лимитов по бумагам |              |           |          |        |              |              |             |             |        |       |          |        |
|----------------------------|--------------|-----------|----------|--------|--------------|--------------|-------------|-------------|--------|-------|----------|--------|
|                            | Фирма        | Название  | Код бум  | Код кл | Входящий ост | Входящий лим | Текущий ост | Текущий лим | Заблок | Всего | Доступно | Баланс |
| 1                          | НС0038900000 | ЛУКОЙЛ    | RU000902 | 001    | 50           | 25           | 0           | 5           | 0      | 5     | 5        | -20    |
| 2                          | НС0038900000 | МосЭнерго | RU000895 | 001    | 500          | 250          | 664         | 250         | 0      | 914   | 914      | 664    |
| 3                          | НС0038900000 | РАО ЕЭС   | RU000892 | 001    | 1 000        | 500          | 0           | 500         | 0      | 500   | 500      | 0      |

| Таблица лимитов по денежным средствам |              |        |        |        |              |              |              |             |          |              |              |              |
|---------------------------------------|--------------|--------|--------|--------|--------------|--------------|--------------|-------------|----------|--------------|--------------|--------------|
|                                       | Фирма        | Валюта | Группа | Код кл | Входящий ост | Входящий лим | Текущий ост  | Текущий лим | Заблок   | Всего        | Доступно     | Баланс       |
| 1                                     | НС0038900000 | SUR    | EQTV   | 001    | 1 000 000,00 | 500 000,00   | 1 074 096,30 | 500 000,00  | 8 921,73 | 1 574 096,30 | 1 565 174,57 | 1 074 096,30 |

# Торговая система «Тройной экран» А.Элдера

Система использует ТРИ МАСШТАБА ВРЕМЕНИ,  
связанных КОЭФФИЦИЕНТОМ 5.

Каждая сделка проходит проверку в три этапа,  
соответствующих различным масштабам  
времени и трем основным типам движения  
рынка (течение, волны и рябь).

Сделка, прошедшая проверку имеет более высокую  
вероятность успеха.

Выбираем масштаб времени для проведения торговых операций (например, дневной график). Этот масштаб называется СРЕДНИМ.

Масштаб, на порядок больший, называется ДОЛГОСРОЧНЫМ (недельный график).

Масштаб, на порядок меньший, называется КРАТКОСРОЧНЫМ (часовой график).

# Первый выбор (рыночное течение)

Выявляем долговременное направление рынка на ДОЛГОСРОЧНОМ (недельном) графике.

В качестве индикатора можно использовать MACD, угол наклона скользящей средней и другие индикаторы.

# Второй выбор (рыночная волна)

Используем СРЕДНИЙ масштаб графика (дневной) для выявления движения цен ПРОТИВ рыночной тенденции, выявленной на предыдущем шаге.

Используем для анализа ДНЕВНОГО графика ОСЦИЛЛЯТОРЫ.

Для ПОКУПКИ на НЕДЕЛЬНЫХ восходящих тенденциях используем ДНЕВНЫЕ СПАДЫ. От осцилляторов принимаем только сигналы к покупке.

Для ПРОДАЖИ на НЕДЕЛЬНЫХ нисходящих тенденциях используем ДНЕВНЫЕ ПОДЪЕМЫ. От осцилляторов принимаем только сигналы к продаже.

# Третий выбор (внутридневной прорыв)

Цель – выявить «зыбь» в направлении течения и выбрать момент для открытия позиции в направлении недельной тенденции.

Третий выбор – это метод скользящего стоп-приказа о покупке (при восходящих тенденциях) или продаже (при нисходящих).

Не требуется использовать график или индикатор.

Например: разместите скользящий стоп на один тик выше максимума предыдущего дня при восходящей тенденции.

# Сводная таблица системы

| Тенденция недельная | Тенденция дневная | Действия            | Приказ брокеру      |
|---------------------|-------------------|---------------------|---------------------|
| Восходящая          | Восходящая        | Воздержаться        | Никакого            |
| Восходящая          | Нисходящая        | Играть на повышение | Скользкий о покупке |
| Нисходящая          | Нисходящая        | Воздержаться        | Никакого            |
| Нисходящая          | Восходящая        | Играть на понижение | Скользкий о продаже |

# Стоп-приказы

Система требует установки плотных стоп-приказов для ограничения возможных убытков.

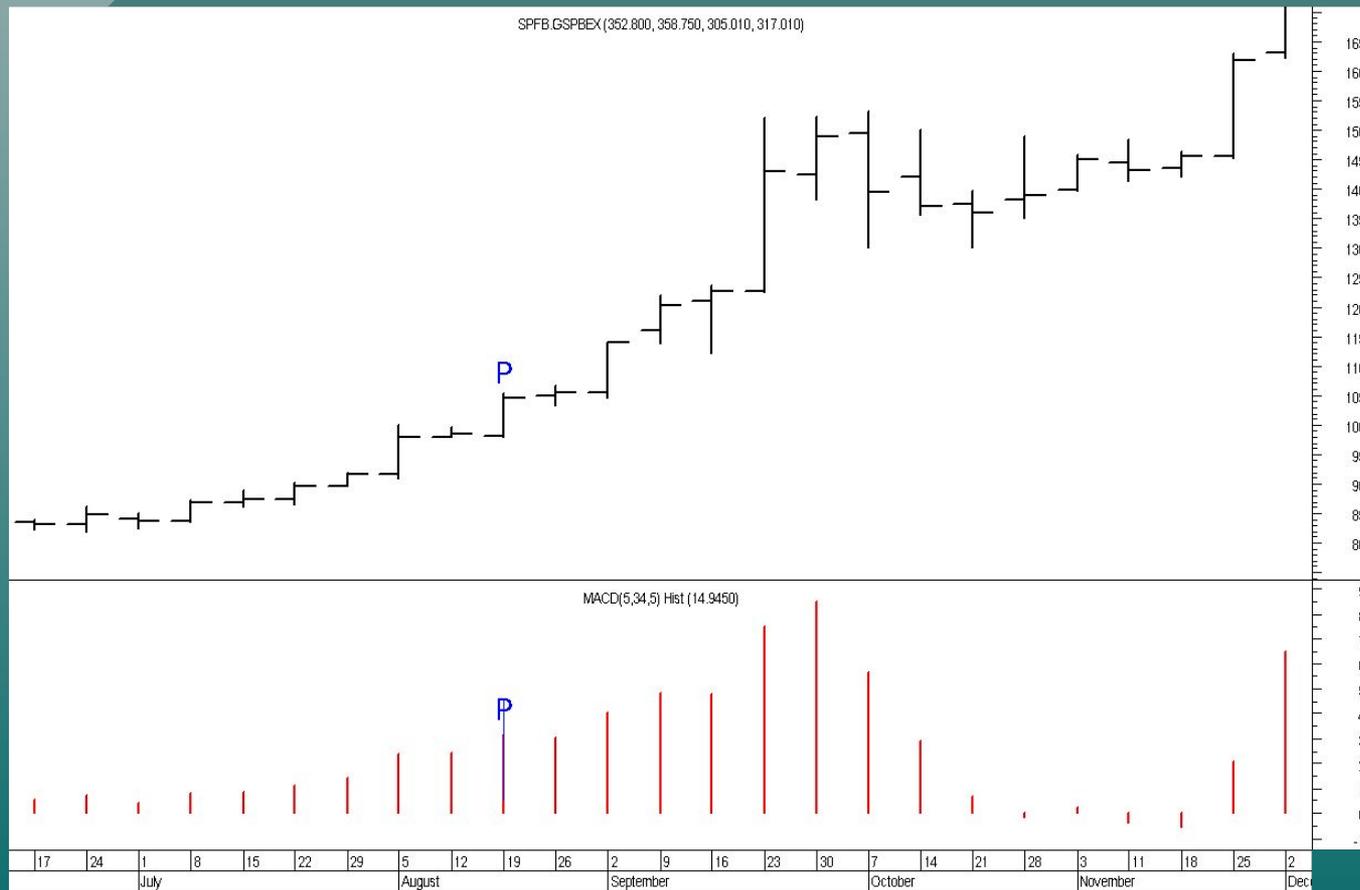
Рекомендуется:

ставить **стоп-приказ на продажу** после открытия длинной позиции на один тик ниже минимума данного или предыдущего дня.

Ставить **стоп-приказ на покупку** после открытия короткой позиции на один тик выше максимума данного или предыдущего дня.

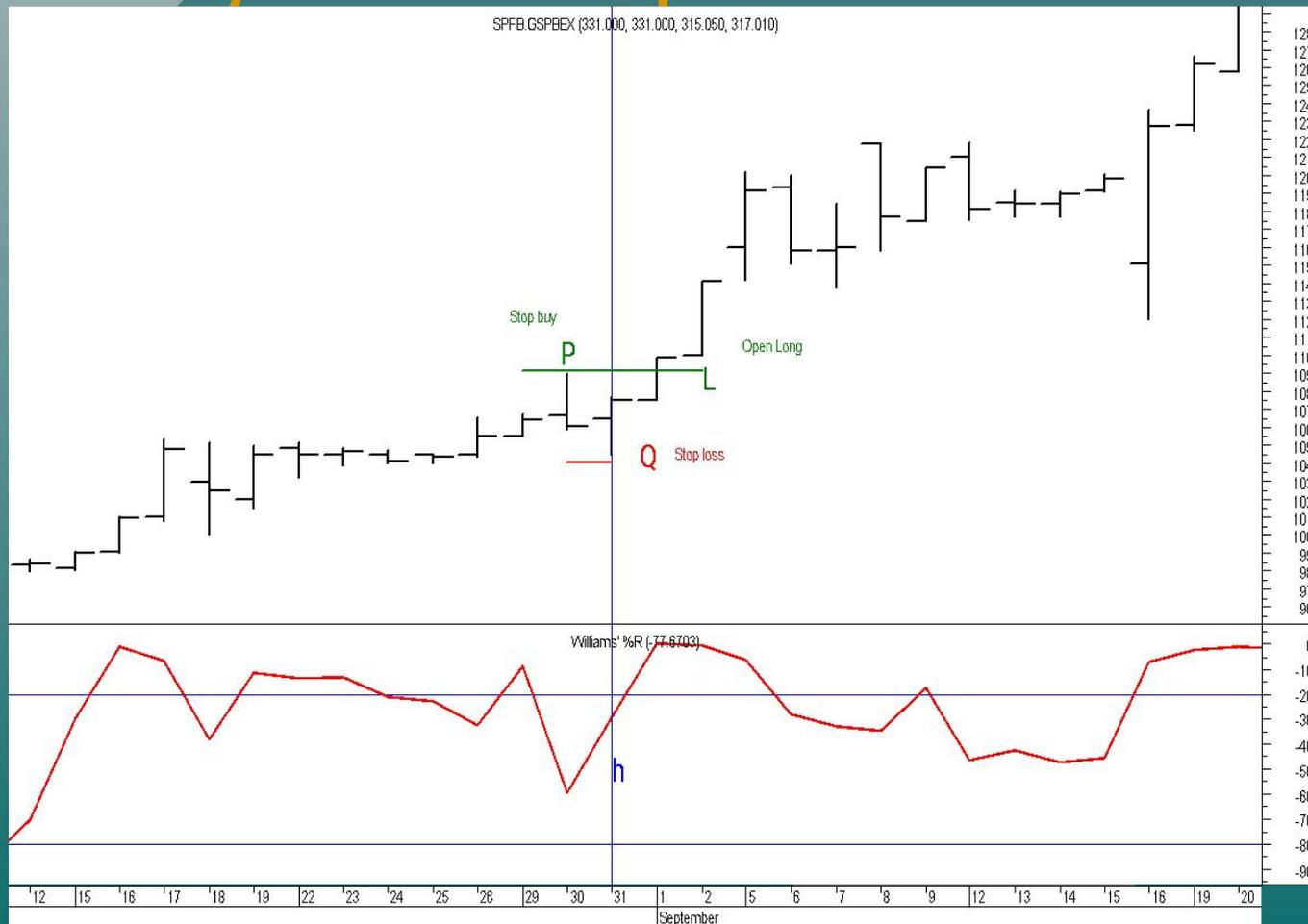
# Первый экран

## Восходящая тенденция на рынке акций Газпрома

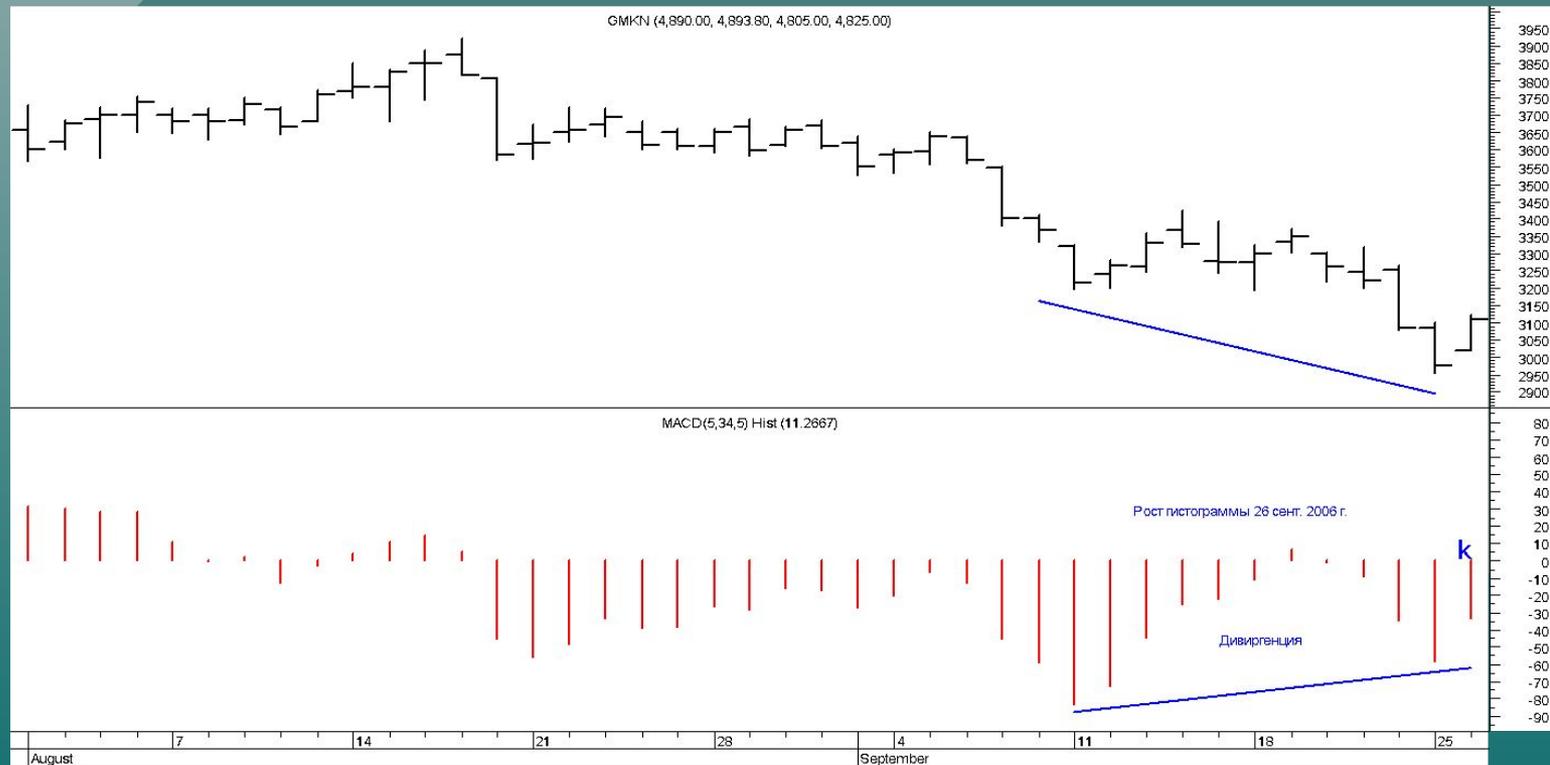


# 2-3 экран

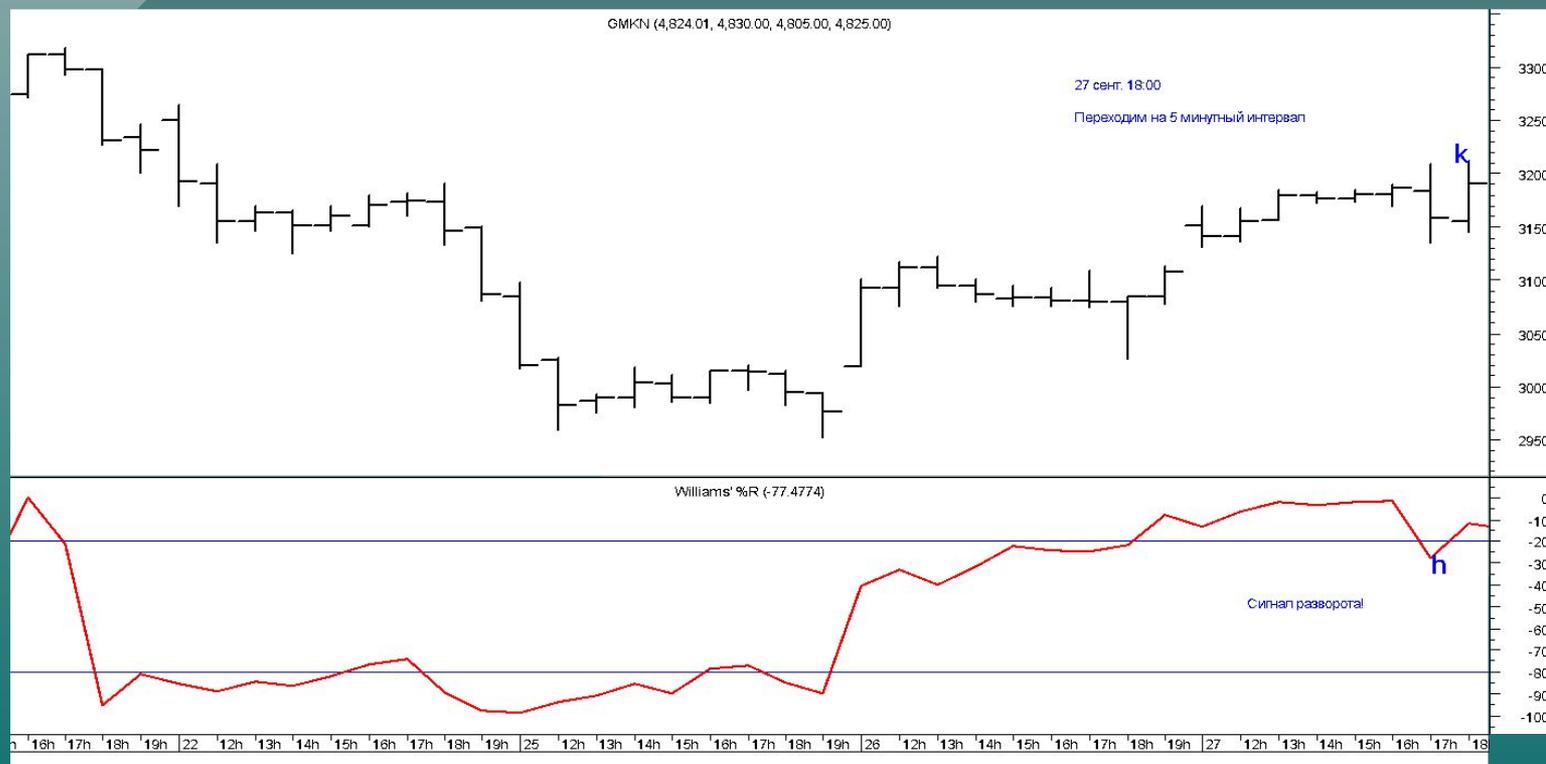
## Покупка Газпрома 1.09.05



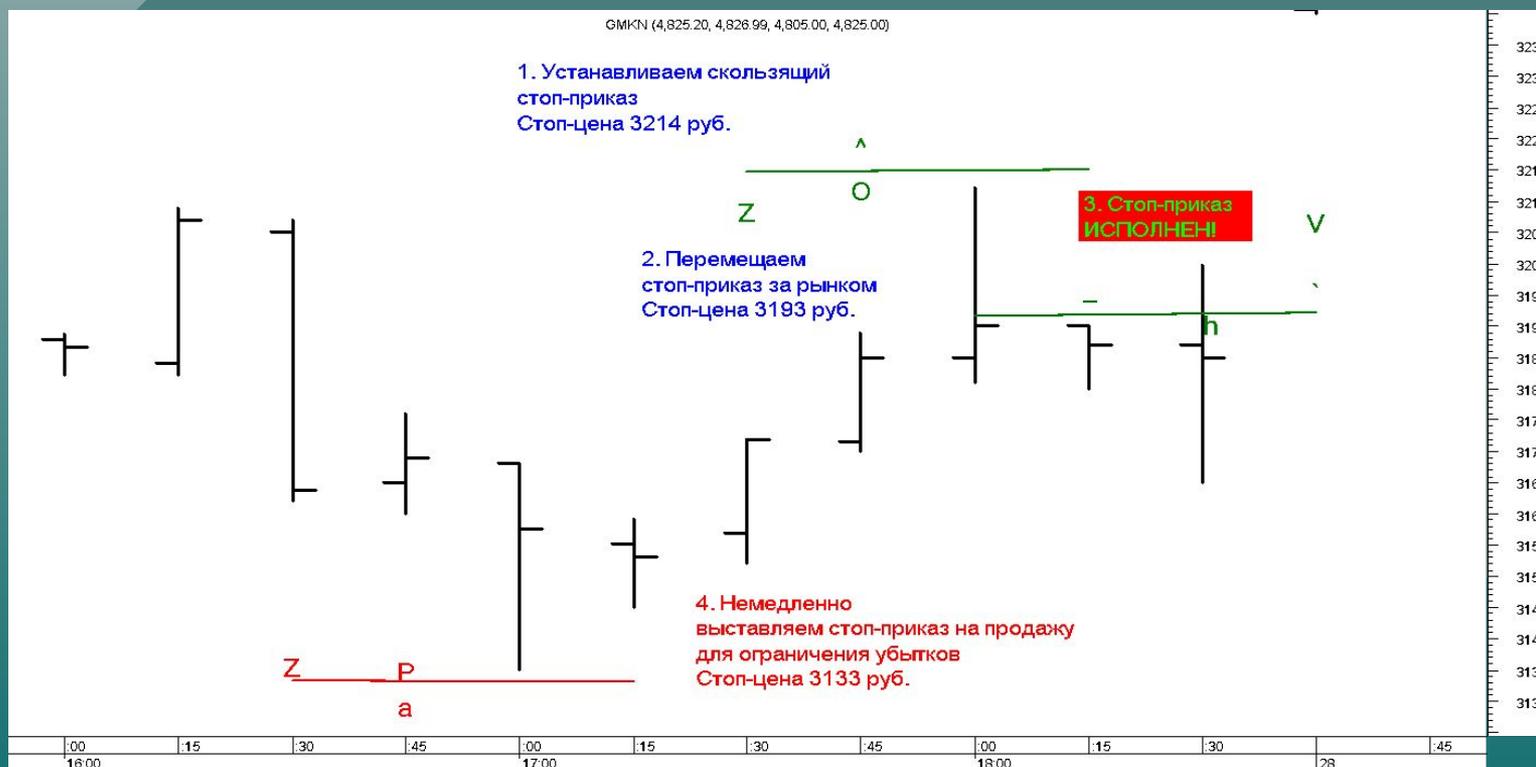
# Первый экран – 1 день



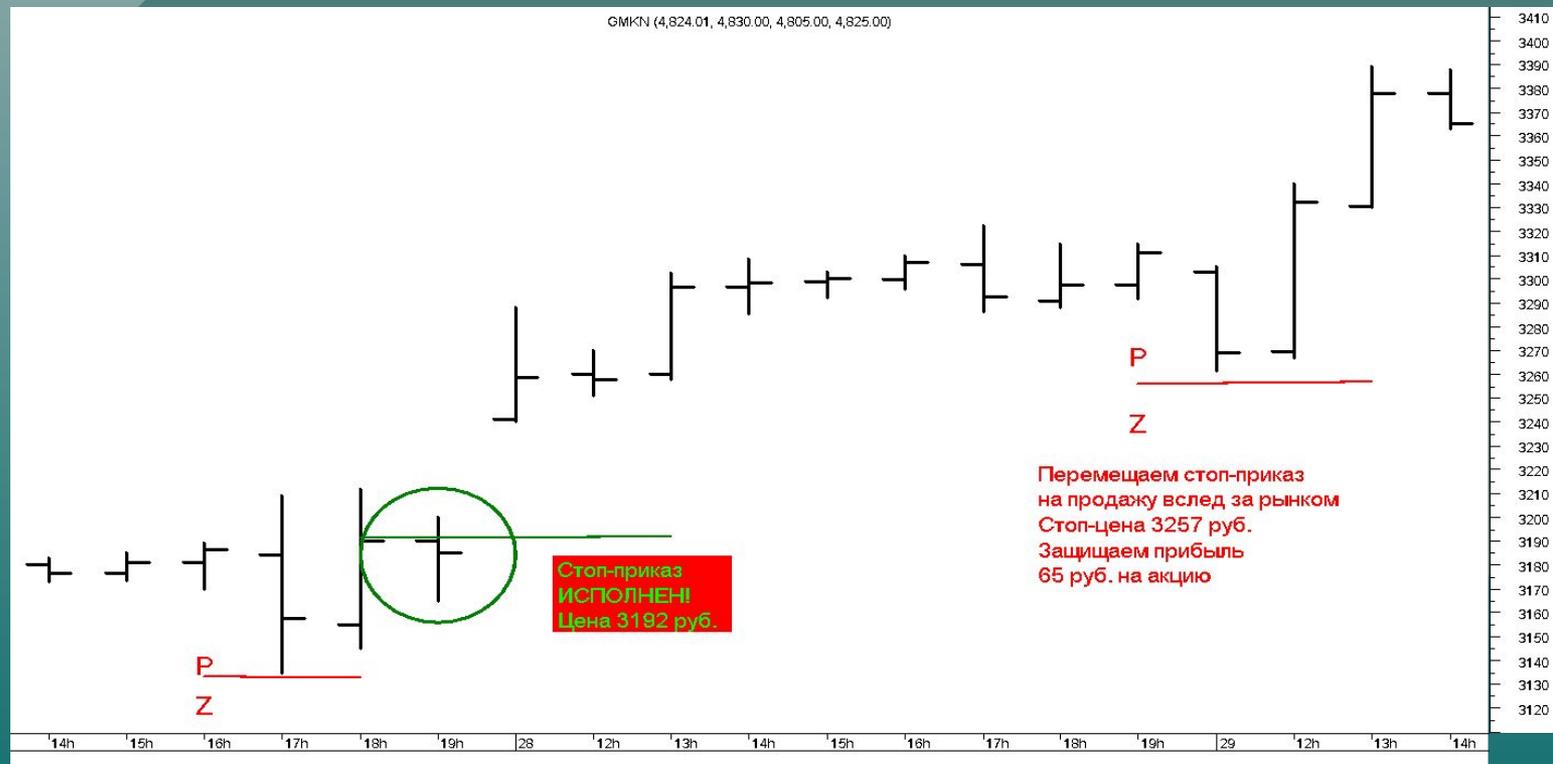
# Второй экран – 1 час



# 3 экран – 5 минут



# Развитие ситуации



# Развитие ситуации в течение 2 месяцев



# Система Интернет-трейдинга



**Сервер QUIK** - центральное звено системы, подключен к торговым системам бирж через специальные «шлюзы».

### **«Шлюзы»**

- передают серверу информацию о торгах и средствах брокера на бирже
- принимают поручения на покупку/продажу.

**Сервер** транслирует информацию всем активным (подключенным) клиентам с минимально возможной задержкой.

## **Администратор системы**

- регистрирует пользователей
- устанавливает для них права на пользование информацией
- определяет лимиты средств клиента, в пределах которых он может совершать сделки

## **Пользователь системы**

- **соединяется с сервером системы через Интернет**
- **получает биржевую информацию о ходе биржевых торгов, доступных для торговли средствах**
- **может самостоятельно участвовать в торгах, посылая заявки в торговую систему непосредственно с рабочего места QUIK**

# Информационно-торговая система QUIK

программный комплекс для  
предоставления доступа к биржевым  
торгам через сеть Интернет в  
режиме реального времени  
(интернет-трейдинг).

# Интерфейс QUIK

1 2 3 4 5 6 7 8

[Дюкарев Андрей Владимирович] Информационная система QUIK (версия 4.05)

Связь Экспорт данных Таблицы Дилер Новости Лимиты Сообщения Настройки Окна Справка

111 16:48:33 Соединение установлено

ММВБ СФР ММВБ ЦББ РТС ФБ "Санкт-Петербург" FORTS СПбБ Внебиржевой рынок Свободная Графики Новости Сообщения Портфели Для экспорта

### Текущая таблица параметров #2

|                  | Спрос   | Заяв. Предл. | Заяв.   | Откр. | Макс. цена | Мин. цена | Цена посл | Измен. | Кол-во посл | Всего бумаг | Оборот      | Ср. взв. | Лучш. спл | Лучш. прец | Кол-во са | Цена за | Пред. оц |
|------------------|---------|--------------|---------|-------|------------|-----------|-----------|--------|-------------|-------------|-------------|----------|-----------|------------|-----------|---------|----------|
| ИркЭнЭр [Акц]    | 1.820   | 23           | 1.834   | 41    | 1.830      | 1.780     | 1.820     | 0.013  | 500         | 607 700     | 1 098 434   | 1.808    | 1.830     | 1.780      | 47        | 1.807   | 1.857    |
| ЛУКОЙЛ [Акц]     | 508 060 | 95           | 509 000 | 116   | 502 500    | 513 000   | 495 000   | 0.013  | 10          | 352 465     | 197 438 255 | 503 070  | 515 000   | 490 000    | 1 060     | 494 500 | 488 510  |
| МосЭнерг-3 [Акц] | 0.993   | 149          | 0.994   | 181   | 0.999      | 1.013     | 0.994     | 0.027  | 1 000       | 30 720 000  | 30 471 402  | 0.992    | 1.019     | 0.900      | 544       | 0.967   | 0.965    |
| МосЭнерг-2 [Акц] | 0.977   | 8            | 0.993   | 10    | 0.989      | 0.990     | 0.990     | 0.021  | 1 000       | 151 200     | 148 986     | 0.985    | 0.990     | 0.970      | 8         | 0.969   | 0.945    |
| РАО ЭЭС [Акц]    | 3 113   | 557          | 3 117   | 511   | 3 120      | 3 140     | 3 117     | 0.126  | 105         | 317 288 300 | 980 063 681 | 3 089    | 4 000     | 2 000      | 8 099     | 2 991   | 3 008    |
| РАО ЭЭС-п [Акц]  | 2 533   | 40           | 2 554   | 70    | 2 530      | 2 580     | 2 461     | 0.104  | 107         | 4 050 700   | 10 172 447  | 2 511    | 3 101     | 2 300      | 116       | 2 450   | 2 433    |
| Ростел-Тар [Акц] | 17.15   | 21           | 17.25   | 44    | 17.00      | 17.40     | 16.80     | 0.45   | 150         | 211 629     | 3 629 281   | 17.15    | 17.35     | 16.29      | 53        | 16.70   | 16.97    |
| Ростел-Тар [Акц] | 31.270  | 117          | 31.340  | 239   | 32.000     | 30.600    | 31.250    | 0.150  | 4 000       | 3 151 017   | 98 808 317  | 31.360   | 35.000    | 30.000     | 1 325     | 31.100  | 31.470   |

### Таблица лимитов по денежным средствам

| Ф.Вал. | Группа      | Входящий лимит | Текущий ост. | Текущий лимит | Заблокировано | Всего | Доступно     | Баланс       |
|--------|-------------|----------------|--------------|---------------|---------------|-------|--------------|--------------|
| 1      | NC SUF EQTV | 5 380 237.08   | 3 513 307.21 | 5 380 237.08  | 3 513 307.21  | 0.00  | 8 893 544.29 | 8 893 544.29 |

### Таблица лимитов по бумагам

| № | Ф.Название б  | Входящий лимит | Текущий ост. | Текущий лимит | Заблокировано | Всего   | Доступно | Баланс  |
|---|---------------|----------------|--------------|---------------|---------------|---------|----------|---------|
| 1 | NC ЛУКОЙЛ     | -5 000         | 0            | -5 000        | 0             | -5 000  | -5 000   | -5 000  |
| 2 | NC РАО ЭЭС    | 493            | 15 661       | 493           | 15 661        | 16 154  | 16 154   | 493     |
| 3 | NC РАО ЭЭС-п  | 0              | 0            | 0             | 0             | 0       | 0        | 0       |
| 4 | NC Ростел-Тар | -12 000        | 0            | -12 000       | 0             | -12 000 | -12 000  | -12 000 |
| 5 | NC Сбербанк   | -200           | 0            | -200          | 0             | -200    | -200     | -200    |
| 6 | NC Сургнфгз-п | 173            | 0            | 173           | 0             | 173     | 173      | 173     |
| 7 | NC ЮКОС-ао-2  | -1 700         | 0            | -1 700        | 0             | -1 700  | -1 700   | -1 700  |

### Портфель

| Задолженность брокеру | Только деньги клиента | Оценка        | Средства в рублях | Все средства  | Уровень на    | Состояние |                                  |
|-----------------------|-----------------------|---------------|-------------------|---------------|---------------|-----------|----------------------------------|
| 1                     | 2 545 500.00          | 5 380 237.08  | 153 470.90        | 5 380 237.08  | 5 533 707.98  | 54.00     | Необ. запрет ухудшающих операций |
| 5                     | 0.00                  | 15 913 294.54 | 0.00              | 15 913 294.54 | 15 913 294.54 | 100.00    | OK                               |

### Окно сообщений Трейдера

| Время    | Тип адрес:   | Имя ад:  | Статус:       | Сообщение           |
|----------|--------------|----------|---------------|---------------------|
| 17:15:16 | Отправитель: | Курляндч | Тестируешься? | Отправить сообщение |

### Новости (Всего: 386, Всего: 27.06.02)

| Д. | Агентство  | Заголовок               |
|----|------------|-------------------------|
| 1  | МФД        | В.Христенко: Правительс |
| 2  | Прайм-Тасс | Сумма средств в торго   |
| 3  | Прайм-Тасс | Курсы обмена наличной   |

### Курсы обмена наличной валюты в банках Москвы на 27.06.2002

| ! Банк        | ! Валюта | ! Сумма | ! Покупка | ! Продажа |
|---------------|----------|---------|-----------|-----------|
| ! Авангард    | ! USD    | !       | ! 31.1    | ! 31.65   |
| ! Авангард    | ! EUR    | !       | ! 30      | ! 30.85   |
| ! Альфа-банк  | ! USD    | !       | ! 30.95   | ! 31.6    |
| ! Альфа-банк  | ! EUR    | !       | ! 30.15   | ! 31.5    |
| ! Банк Москвы | ! USD    | !       | ! 30.9    | ! 31.56   |

### Индексы

| Индексы               | Знач.  | Закр.  |
|-----------------------|--------|--------|
| ММВБ10 [Индексы ММВБ] | 522.17 | 507.18 |
| СФИ [Индексы ММВБ]    | 297.46 | 290.48 |
| ТехСФИ [Индексы ММВБ] | 639.20 | 622.35 |
| RTSI [Индексы РТС]    |        |        |
| RTSIF [Индексы РТС]   |        |        |
| RTSIF_R [Индексы РТС] |        |        |
| RTST [Индексы РТС]    |        |        |

### РАО ЭЭС ао (5 мин)

### Информационное окно #2

| Время на связи          | 01:04:14 |
|-------------------------|----------|
| Принято всего байт      | 2755170  |
| Передано всего байт     | 18758    |
| Средняя скорость приема | 714      |

Время сервера: 14:52:49; записей: 11320; текущая: 51113

# Таблица текущих значений параметров

В заголовках строк таблицы указаны финансовые инструменты, в заголовках столбцов – параметры.

|                | Спрос     | Предл.  | Откр.     | Макс. цена | Мин. цена | Цена после | % измен | Ср. взв. цен |
|----------------|-----------|---------|-----------|------------|-----------|------------|---------|--------------|
| ЛУКОЙЛ [А]     | 567.890   | 567.980 | 585.000   | 587.800    | 567.890   | 567.980    | -7.59   | 582.140      |
| РАО ЕЭС [А]    | 11.739    | 0.000   | 12.407    | 12.407     | 10.776    | 10.778     | -10.29  | 11.382       |
| РАО ЕЭС-п [А]  | 6.789     | 6.798   | 6.789     | 6.798      | 6.789     | 6.789      | 0.00    | 6.791        |
| МосЭнерго [А]  | 1.620     | 1.638   | 1.590     | 1.621      | 1.590     | 1.621      | 5.60    | 1.618        |
| Ростел-1ао [А] | 74.810    | 74.970  | 74.690    | 74.810     | 64.100    | 74.810     | -0.60   | 71.060       |
| Ростел-1ап [А] | 27.48     | 0.00    | 28.43     | 28.43      | 28.43     | 28.43      | -4.05   | 28.43        |
| Сбербанк [А]   | 6 823.100 | 0.000   | 6 823.100 | 6 823.100  | 6 823.100 | 6 823.100  | 0.16    | 6 823.100    |
| Татнфт Зао [А] | 43.760    | 0.000   | 40.270    | 44.950     | 40.270    | 44.950     | 4.49    | 41.430       |
| Татнфт Зап [А] | 0.000     | 17.675  | 17.675    | 17.675     | 17.675    | 17.675     | -12.40  | 17.675       |

# Вид котировочного окна

| ЛУКОЙЛ [Акци...] |            |           |            | ТНК5в1т-об [Облигаци...] |       |       |       |       | ESU2 [Фьючерсы FORTS] ... |          |       |       |      |       |
|------------------|------------|-----------|------------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|---------------------------|----------|-------|-------|------|-------|
| Цена             | Объем      | Свой      | Сумма      | Доход                    | Прода | Цена  | Покуп | Доход | Сумма                     | Покуп    | Цена  | Цена  | Прод | Сумма |
| 557,700          | 46         | 35        | 484        | 17,44                    | 2 500 | 94,59 |       |       | 4                         | 4        | 2 964 | 2 966 | 80   | 80    |
| 557,900          | 5          |           | 438        | 17,46                    | 1 000 | 94,58 |       |       | 104                       | 100      | 2 963 | 2 969 | 42   | 122   |
| <b>558,000</b>   | <b>413</b> | <b>20</b> | <b>433</b> | 17,48                    | 1 000 | 94,57 |       |       | 109                       | 5        | 2 961 | 2 970 | 500  | 622   |
| 559,000          | 20         |           | 20         | 17,49                    | 1 014 | 94,56 |       |       | 120                       | 11       | 2 960 | 2 975 | 1    | 623   |
| 559,865          | 33         |           | 33         |                          |       | 94,53 | 3 000 | 17,54 | 121                       | 1        | 2 959 | 2 979 | 5    | 628   |
| 560,590          | 1          | <b>1</b>  | 34         | <b>2</b>                 |       | 94,52 | 3 541 | 17,56 | 232                       | <b>3</b> | 2 955 | 2 986 | 25   | 653   |
| 562,281          | 524        |           | 558        |                          |       | 94,51 | 75    | 17,57 | 234                       |          | 2 952 | 2 990 | 500  | 1 153 |
| 562,503          | 6          |           | 564        |                          |       | 94,50 | 1 057 | 17,59 | 434                       | 200      | 2 951 | 2 993 | 30   | 1 183 |

# График цены и объема



# Ввод заявки

**A1-Акции Ввод заявки**

Инструмент: ЛУКОЙЛ | Торговый Счет: L01-00000F00

Рыночная |  **Покупка**  
 Лимитированная |  Продажа

В поле "Цена":  
 Цена  
 Доходность  
 Срвзв.цена

Условие исполнения:  
 Поставить в очередь  
 Немедленно или отклонить  
 Снять остаток

Цена: 588.000 | Количество: 10 | Размер лота: 1

Все сделки по одной цене | На покупку: 87

Код Клиента: E5 | Поручение: **1**

Да | Отмена

**A1-Акции Ввод заявки**

Инструмент: ЛУКОЙЛ | Торговый Счет: L01-00000F00

Рыночная |  Покупка  
 Лимитированная |  **Продажа**

Цена: 588.000 | Количество: 10 | На продажу: 0

Код Клиента: E5 | Поручение: **2**

Да | Отмена

# Ввод стоп-заявки

**A1-Акции Стоп-заявка**

Тип стоп-заявки  
Стоп-лимит

Действует  по 06.10.03  до отмены

Инструмент: ЛУКОЙЛ | Лот: 1 | Торговый Счет: L01-00000F00

Условие активации стоп-заявки  
Брать стоп-цену для инструмента:  
A1-Акции | ЛУКОЙЛ

Покупка  если цена  $\geq$  588.000  
 Продажа  если цена  $\leq$  588.000

Цена: 588.000 | Количество: 10 | На покупку: 49

Код Клиента: E2 | Поручение: **1**

Выставить заявку на покупку по цене: 588.000

Да | Отмена

**A1-Акции Стоп-заявка**

Инструмент: ЛУКОЙЛ | Торговый Счет: Y883/0000001

Покупка  Продажа  если цена  $\geq$  588.000  
 если цена  $\leq$  588.000

Цена: 588.000 | Количество: 10 | На продажу: 0

Код Клиента: | Поручение: **2**

Да | Отмена

# Таблица заявок

|     | Номер    | Время    | Бумага          | Опера  | Цена  | Колич | Остаток | Объем  | Доход | Комме | Исходный | Тип | Состояние |
|-----|----------|----------|-----------------|--------|-------|-------|---------|--------|-------|-------|----------|-----|-----------|
| 208 | 50532183 | 18:53:22 | РАО ЕЭС (Акции) | Продаж | 3,500 | 1     | 0       | 350,00 | 0,00  | 001   | 0        | ЛРО | Исполнена |
| 209 | 50532208 | 19:03:42 | РАО ЕЭС (Акции) | Купля  | 3,500 | 1     | 1       | 350,00 | 0,00  | 001   | 0        | ЛРО | Активна   |
| 210 | 50532211 | 19:03:58 | РАО ЕЭС (Акции) | Купля  | 3,499 | 1     | 1       | 349,90 | 0,00  | 001   | 0        | ЛРО | Снята     |

# Таблица лимитов

| Таблица лимитов по бумагам |              |           |          |        |              |              |             |             |        |       |          |        |
|----------------------------|--------------|-----------|----------|--------|--------------|--------------|-------------|-------------|--------|-------|----------|--------|
|                            | Фирма        | Название  | Код бум  | Код кл | Входящий ост | Входящий лим | Текущий ост | Текущий лим | Заблок | Всего | Доступно | Баланс |
| 1                          | НС0038900000 | ЛУКОЙЛ    | RU000902 | 001    | 50           | 25           | 0           | 5           | 0      | 5     | 5        | -20    |
| 2                          | НС0038900000 | МосЭнерго | RU000895 | 001    | 500          | 250          | 664         | 250         | 0      | 914   | 914      | 664    |
| 3                          | НС0038900000 | РАО ЕЭС   | RU000892 | 001    | 1 000        | 500          | 0           | 500         | 0      | 500   | 500      | 0      |

| Таблица лимитов по денежным средствам |              |        |        |        |              |              |              |             |          |              |              |              |
|---------------------------------------|--------------|--------|--------|--------|--------------|--------------|--------------|-------------|----------|--------------|--------------|--------------|
|                                       | Фирма        | Валюта | Группа | Код кл | Входящий ост | Входящий лим | Текущий ост  | Текущий лим | Заблок   | Всего        | Доступно     | Баланс       |
| 1                                     | НС0038900000 | SUR    | EQTV   | 001    | 1 000 000,00 | 500 000,00   | 1 074 096,30 | 500 000,00  | 8 921,73 | 1 574 096,30 | 1 565 174,57 | 1 074 096,30 |