

Торговые системы

Элементы торговой системы

- Ориентации системы торговли
- Технологии фильтрации
- Позиции входа в рынок
- Первоначальное управление риском
- Защитные стоп- сигналы
- Позиции выхода из рынка
- Методология открытия позиции
“вдогонку” или в противоположном
направлении

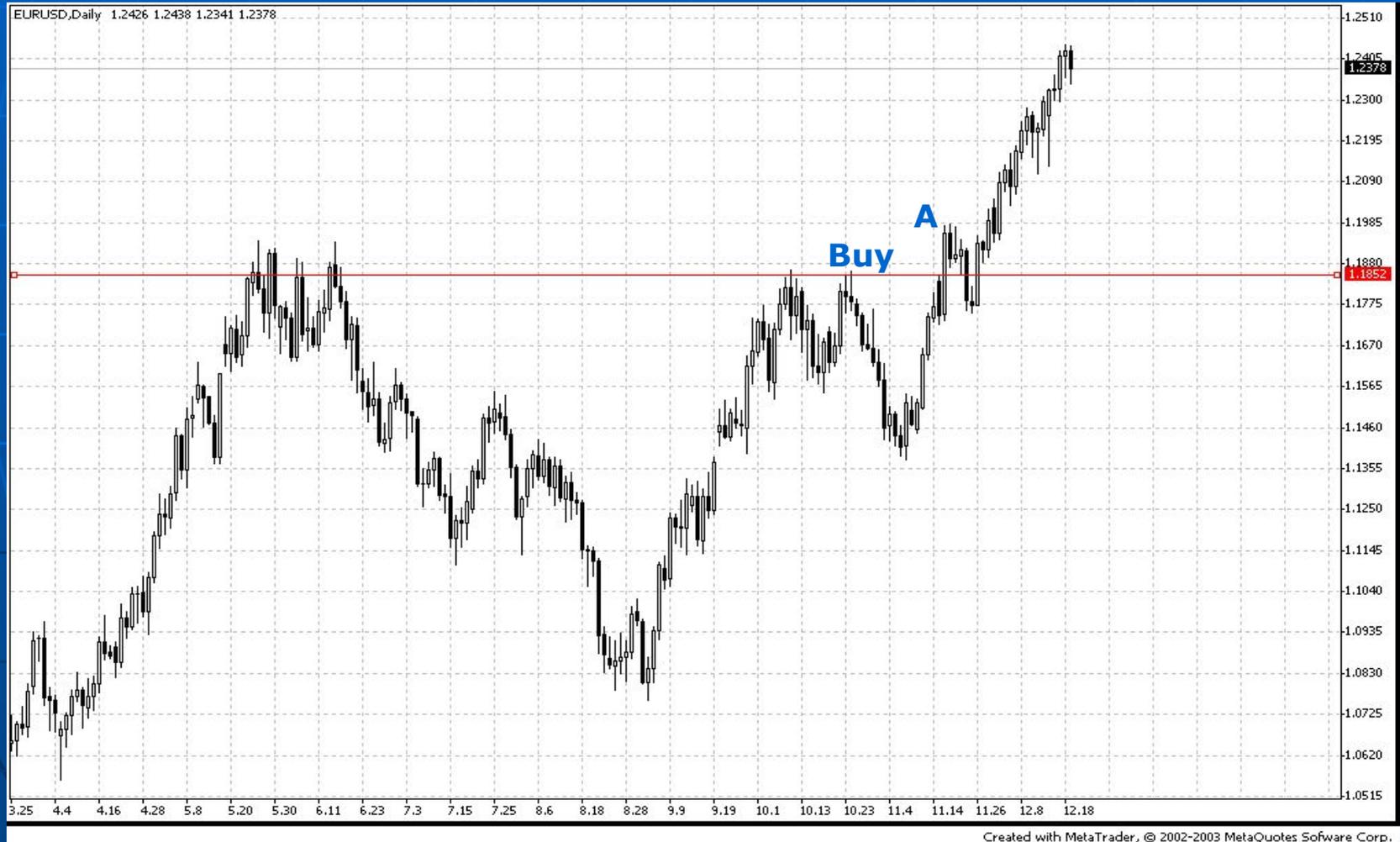
Ориентации системы торговли

- Следующие за трендом: В этом случае нам нужна система, чтобы различать, движется ли рынок вверх, вниз или в сторону. Это можно достичь с помощью простого правила, или используя несколько правил, чтобы определить направление тренда.
- Прорыв уровней сопротивления или поддержки: системы, которые следуют по направлению прорыва после смены тренда или после бокового тренда.
- Коридор цен: Система, созданная специально, чтобы получить прибыль в течение периодов, когда рынок находится в каком-либо диапазоне цены.

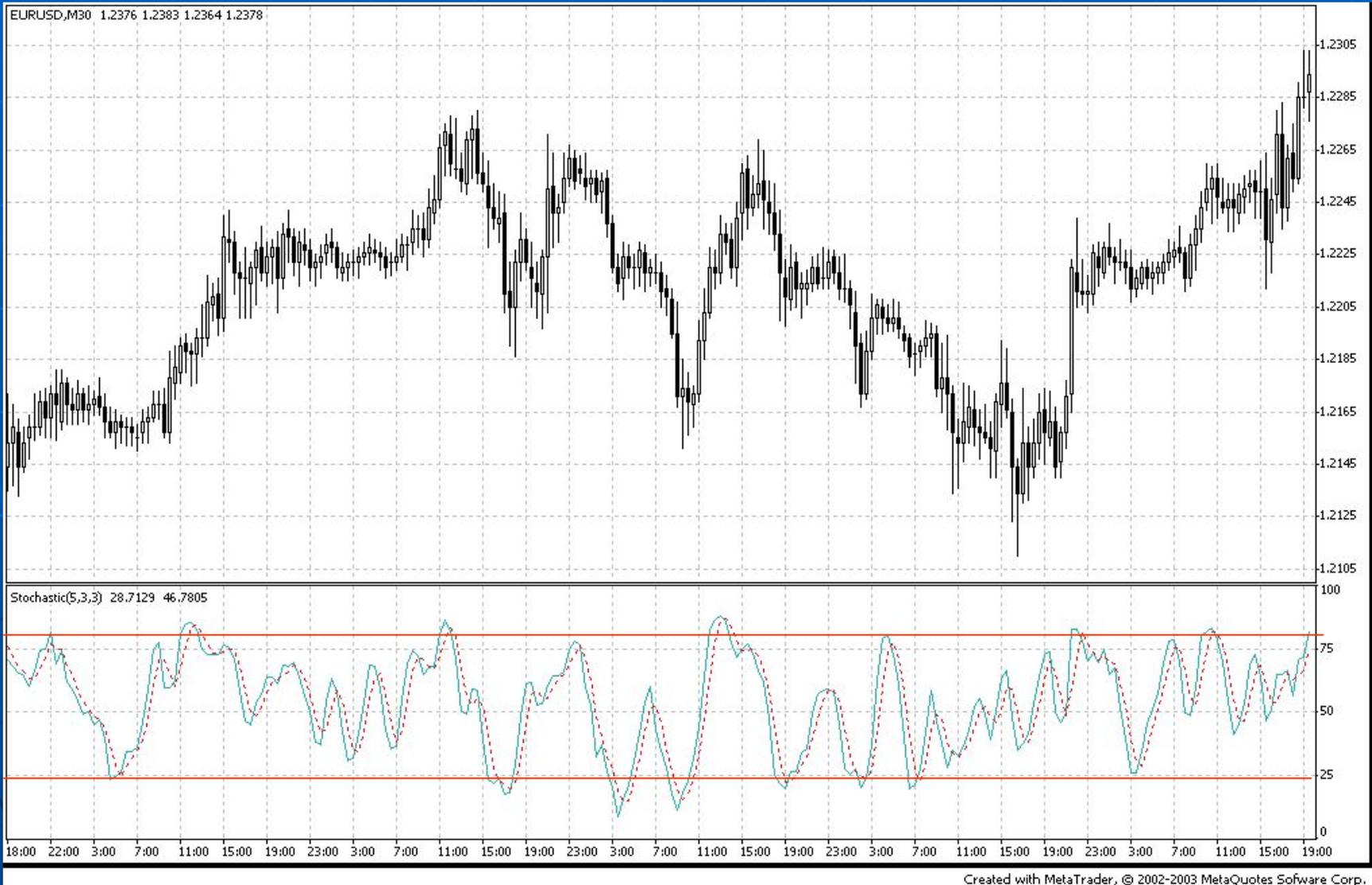
Системы следующие за трендом



Системы основанные на прорыве



Системы работы в коридоре цен



Технологии фильтрации

- Самые простые фильтры принимают меры для исключения сигнала к торговле, если тренд или некоторые другие факторы недостаточно благоприятны.
- Фильтрация может включать в себя отклонения торговых сделок или выбор между сигналами в пользу самого сильного.
- Основное назначение простых фильтров: по возможности отсеивать и уменьшать количество ложных сигналов.
- Общеизвестными фильтрами систем торговли являются индикаторы технического анализа, такие как индекс относительно силы (RSI), объем и стохастики.

Правила открытия позиции

- Не менее двух сигналов.
- Определение размера открытой позиции.
- Время удержания позиции
- Определение возможной прибыли и убытков.

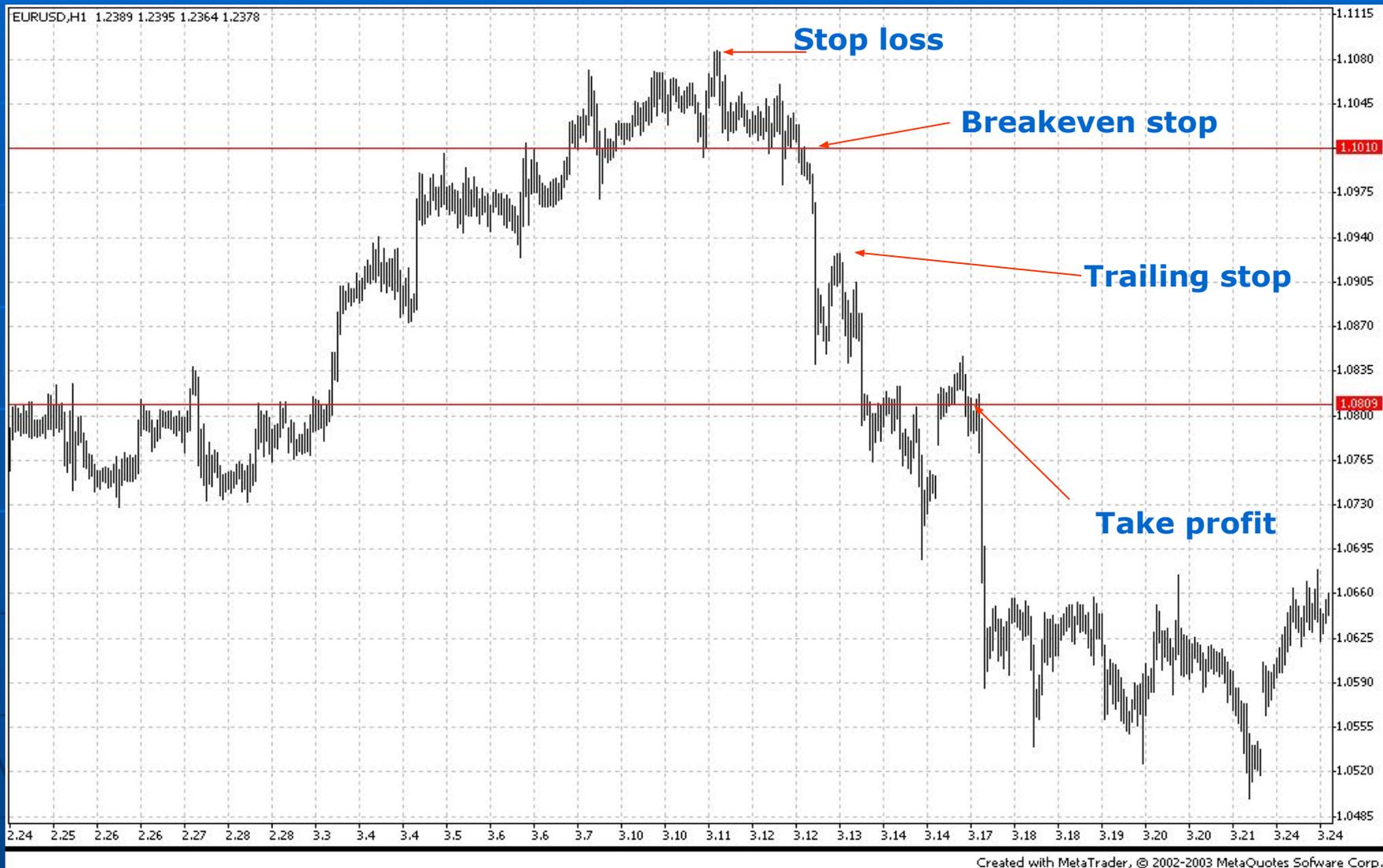
Правила открытия позиции



Стоп сигналы

- Наиболее популярные стоп- сигналы, используемые в построении торговых систем:
 - Исходный стоп-сигнал (Initial stop): Сигнал, относящийся к первоначальному уровню входа- это может быть процент или фиксированное количество валюты, находящееся в обращении.
 - “Плавающий” стоп- сигнал(Trailing stop): Закрытия позиции, когда predetermined количество текущей прибыли- потеряно, то есть стоп- сигнал следует за рынком, когда прибыль возрастает- это также может быть процент или долларовая сумма.
 - Снятие прибыли(Profit target): Этот стоп- сигнал закрывает позицию, когда достигнуто определенное количество прибыли.
 - Уровень безубыточности(breakeven): Позволяет пользователю определить уровень текущей прибыли, и когда рынок превосходит этот уровень, цена открытия позиции становится стоп-сигналом к выходу.
 - Отсутствие активности/ стоп- сигналы по времени (Inactivity/ Time Stops): Существенно то, что этот тип стоп-сигнала запускается, когда рынок оказывается не в состоянии обеспечивать определенный процент дохода в направлении открытой позиции в течение обозначенного периода.

Стоп сигналы



Выход из позиции

- По истечении расчетного времени
- При получении расчетное прибыли
- При получении расчетных убытков
- При достижении максимальной прибыли
- При получении сигналов о смене тренда.