

Методика анализа финансовых рынков по объему

Евгений Байраковский



Понятие о объеме

- **1. Объем и его классификация.**
- **Данные об объемах**, и тем более возможность их анализировать, предоставлялась до недавнего времени исключительно **инсайдерам**, — людям владеющим закрытой предрыночной информацией, используемую трейдерами «на полу», непосредственно ведущими торги в зале биржи. Почему объем – это так важно? Потому что объем показывает настроения рынка. Он его формирует. Каждое движение цены сопровождается тем, что кто-то купил или продал по одной цене. Но чтобы понять, как действуют самые крупные инсайдеры-операторы рынка, и какого ценового трендового движения и изменения рынка следует ожидать, необходимо учитывать многие факторы. **Объем** – это количество акций или контрактов, купленных или проданных за определенный период времени по определенной цене. Объем является первоисточником, двигателем рынка. Движение рынка определяет его объем. Торговля "вслепую" остается в прошлом. Ведь крупные игроки денег не теряют. Не теряют денег ни инсайдеры, ни крупные инвесторы. Они определенно знают куда пойдет рынок. Умение правильно понимать накопленные объемы и видеть крупные позиции, является залогом успешной торговли, так как человек присоединяется к "движению", а не выходит против.

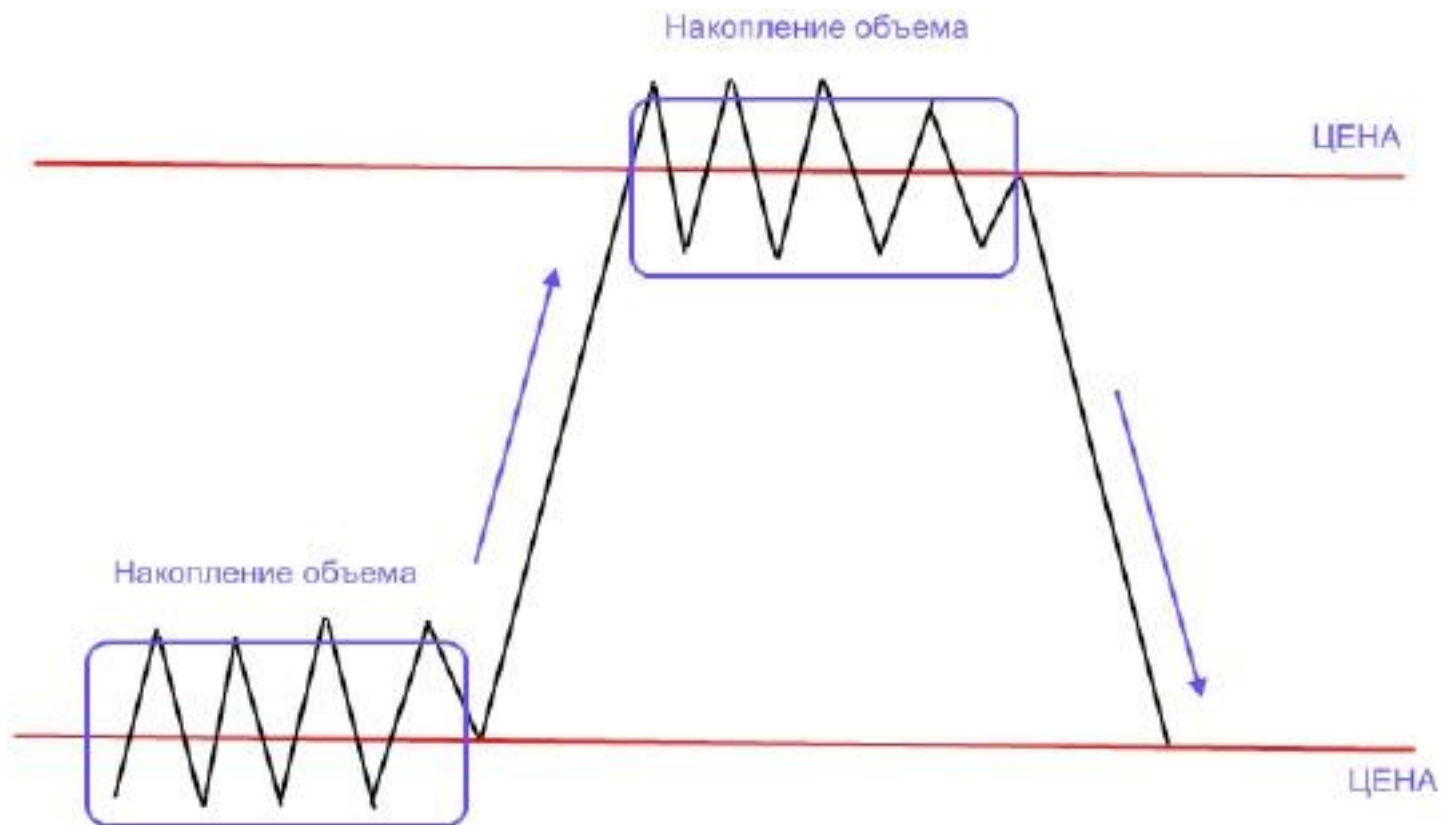
Тенденции



Флет.Накопление.Объем



Рынок от объема к объему



2.Значение объема при анализе финансовых рынков.

- **Одним из наиболее эффективных способов спекулятивной торговли** является торговля валютными фьючерсными контрактами на таких всемирно известных и самых больших по капитализации товарных биржах США CME (Chicago Mercantile Exchange) и NYMEX (New York Mercantile Exchange), которые подотчетны CME GROUP
- <http://www.cmegroup.com/>
- На основе получаемых данных по объемам ,совершенных предварительно сделок или в режиме онлайн ,мы имеем возможность отслеживать предстоящие смены тенденций. Преимущество торговли объемами заключается прежде всего в получении информации об уровнях входа с точностью 5-15 пунктов (в зависимости от торгуемого фьючерсного контракта).

Временная последовательность накопления объема

- Таким образом, отношение «прибыль\убыток» составляет $3\backslash 1 - 5\backslash 1$, что позволяет получить существенную прибыль даже при равном отношении прибыльных и убыточных сделок. Суть методики заключается в нахождении уровней цен, на которых совершено максимальное количество сделок за разные периоды времени. За все время жизни фьючерсного контракта, месяц, неделю и предыдущий день, сессию, час.
- **ТИК – МИНУТА – ЧАС – ДЕНЬ – НЕДЕЛЯ – МЕСЯЦ – КОНТРАКТ**
- В целом этот метод подразделяется на торговлю с применением данных об объемах внутри дня и на позиционную торговлю от более значимых уровней уровней контракта , месяца, недели.

Связь FOREX и товарных рынков

- **Рынок FOREX** — это внебиржевой межбанковский рынок, в котором в основном
- участвуют банки, финансовые структуры и организации с крупной капитализацией. В отличие от FOREX на фьючерсах фиксированный спред отсутствует, есть единая цена разницы **BID / ASK**, которая формируется самими клиентами в зависимости от их ордеров. **На FOREX не виден объем сделок**, не видно того, что движет цену. Объем является первоисточником, двигателем рынка. **Важно помнить, что цена фьючерсного контракта на любую из валют, определяет цену курса межбанковских валютных пар.**
- С помощью данной программы анализа найдена эффективная **Методика ведения торговли по-сессионно Азия-Европа-США.** Каждая из сессий формирует ценновой уровень с подтверждением тенденции на последующую.

Рынок фьючерсных контрактов

- **Рынок фьючерсных контрактов** — это прозрачный централизованный рынок, с совершенной системой клиринга сделок, благодаря которой сделки клиентов подлежат отчетности по объему совершаемых финансовых операций, свыше установленными требованиями **NFA и CFTC**.
- **NFA (Национальная фьючерсная ассоциация, 1982 г.)** — является независимой саморегулируемой организации фьючерсной торговли в США. Контролирует и защищает инвесторов от мошеннических товаров и фьючерсных деятельности. NFA также предусматривает посредничество и арбитражное урегулирование жалоб потребителей, защиту от рисков.
<http://www.nfa.futures.org/>
- **CFTC (Commodity Futures Trading Commission, 1974 г.)** — торговая комиссия товарными фьючерсами является независимым агентством правительства США. Ее задача — защита участников рынка от манипуляций и злоупотреблений, связанных с продажей товарных и финансовых фьючерсов и опционов, а также укрепление открытых, конкурентных и здоровых в финансовом отношении фьючерсных и опционных рынков.
<http://www.cftc.gov/>

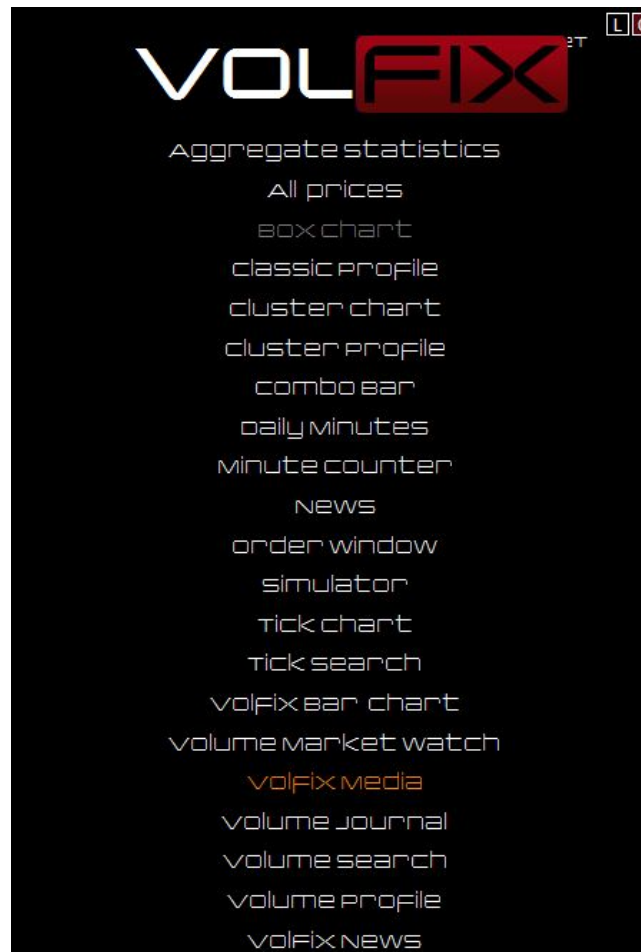
О CFTC

- CFTC собирает информацию о контрактах, по которым еженедельно отчитываются трейдеры каждой категории по биржевым инструментам, позициям на товарных рынках, и еженедельно публикует ее под названием «**Отчет по сделкам трейдеров**» («**Commitment of Traders**» — **COT Index**)
- <http://www.timingcharts.com/>
- **Объем** нас интересует больше всего, так как именно этот показатель говорит о фиксированной заинтересованности рынка относительно каких-то цен или ценовых диапазонов. Цена, на которой наторговано наибольшее количество, к примеру, контрактов. Значит рынок проявляет повышенный интерес к этой цене, так как по этой цене было совершено наибольшее кол-во сделок крупным объемом. Это как раз те цены, которые задают направление рынка. Важно запомнить, под объемом мы будем в последующем понимать цену, на которой произошло накопление денег. Если например, говорим «от объема к объему» - это будет означать, что рынок идет от одной цены к другой, важной по рейтингу объемов.

VolFix

- **3.VolFix**— графическая многофункциональная аналитическая программа, основана на обработке информации о объемах. Которая проводит **анализ рынка по 3-м факторам: -объем; - время; -цена.**
- **VolFix** – информационная платформа, с технологией неограниченных возможностей и преимуществ в современном профессиональном трейдинге.
- Преимущество ТС (торговых систем) разработанных на основе использования данной программы анализа финансовых рынков по объему,предусматривает **минимальные риски** по разным моделям торговли,от внутридневной и до позиционной, **точность совершения сделки**, и возможность истории и визуально отслеживать **объемное формирование ценнового уровня** в режиме онлайн.
- В программе задано время по г.Чикаго , штат Иллинойс, США

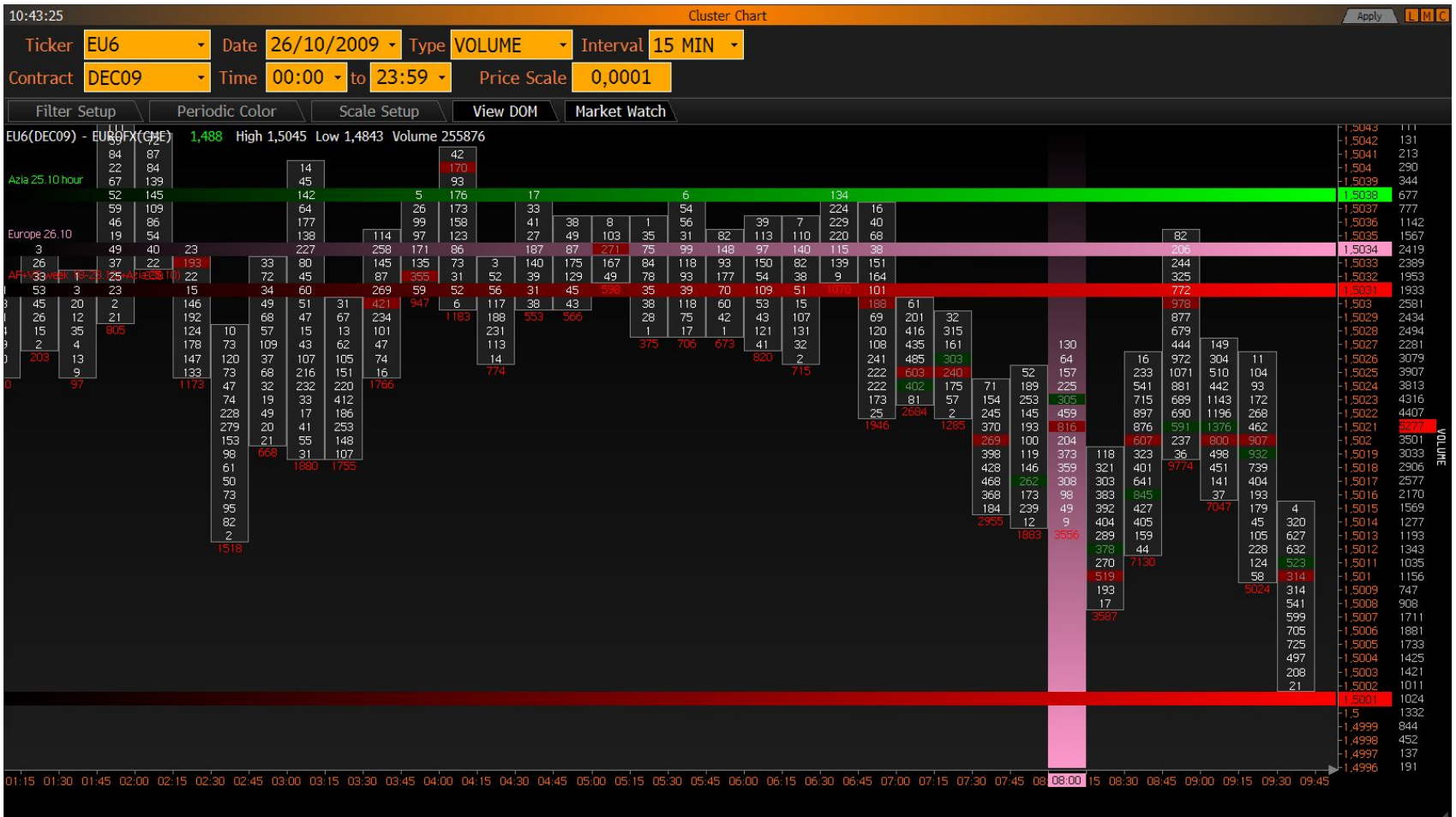
Многофункциональность программы по классам анализа объемов



Примеры принятия торговых решений с минимальными рисками, по разным валютным фьючерсным контрактам
ВАЛЮТНЫЙ ДЕКАБРЬСКИЙ ФЬЮЧЕРСНЫЙ КОНТРАКТ НА ЕВРО. СДЕЛКА SHORT ОТ ОБЪЕМА ЕВРОПА НА СЕССИИ США.
ВХОД ПО ЦЕНЕ 1.5034



ЕВРО.ВНУТРЕННЯЯ СТОРОНА БАРОВОГО ГРАФИКА.КЛАСТЕРНОЕ НАКОПЛЕНИЕ ЛОТАЖА.



Поисковик максимальных объемов, накопленных за сессию Европы

10:54:17 Volume Search Apply

Ticker EU6 Date 26/10/2009 to 26/10/2009 Bar Size 0

Contract DEC09 Time 00:00 to 08:00 Interval 240 Shift 0

Time	Price	Max Volume	Total Volume
26.10 00:00	1,5034	870	12855
26.10 04:00	1,5033	1375	18786
26.10 08:00	1,5017	81	113

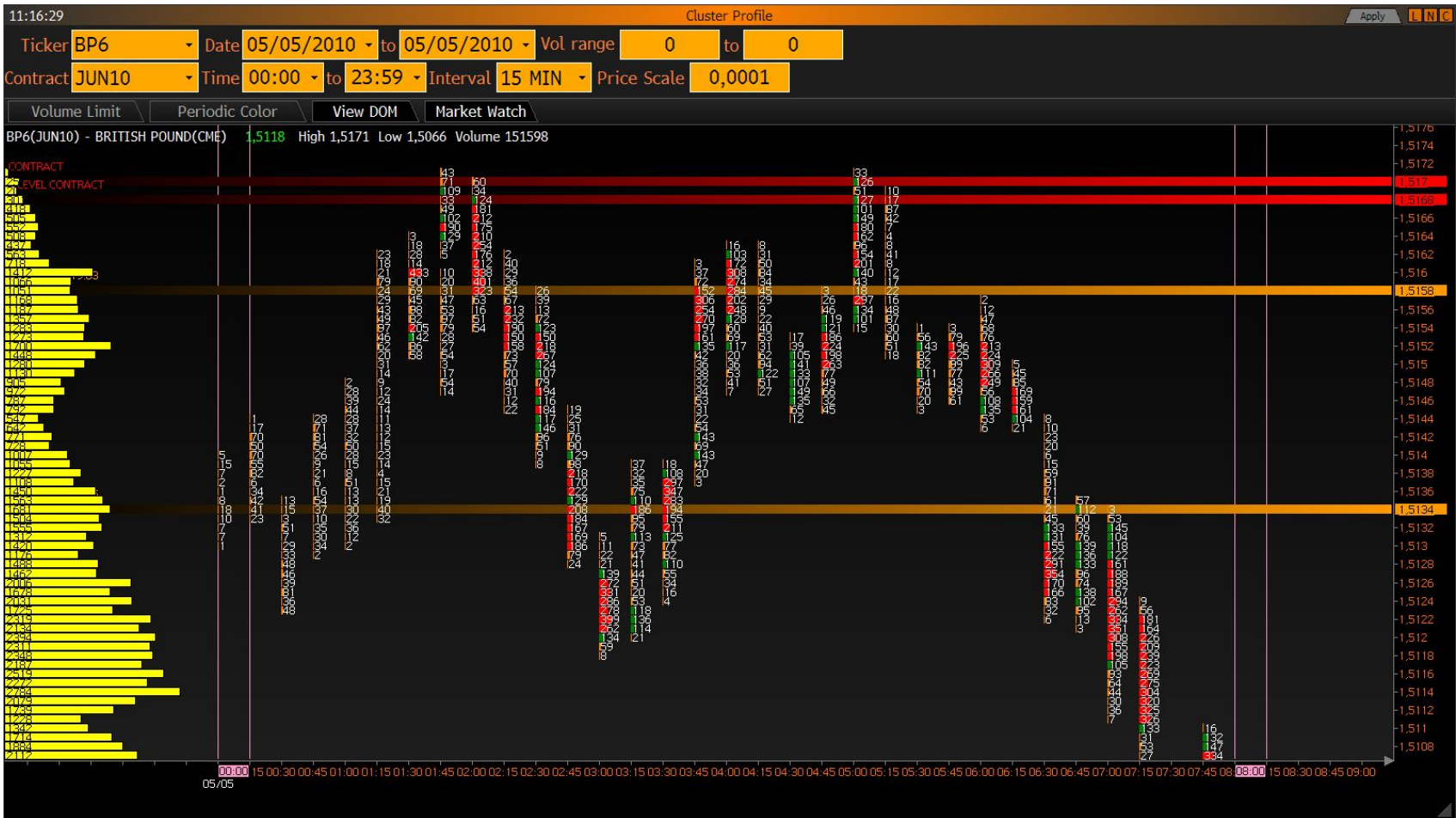
EU6(DEC09) - EUROFX(CME)

ПРИМЕР № 2

ВАЛЮТНЫЙ ИЮНСКИЙ ФЬЮЧЕРСНЫЙ КОНТРАКТ НА ФУНТ СТЕРЛИНГОВ. СДЕЛКА SHORT
ОТ ОБЪЕМА КОНТРАКТА **ВХОД ПО ЦЕНЕ 1.5170**, С ПОДТВЕРЖДЕНИЕМ ТЕНДЕНЦИИ ТRENDA
РЫНКА.



ФУНТ СТЕРЛИНГОВ. АКТИВНОСТЬ РЫНКА В ЛОТАЖЕ НА СФОРМИРОВАННОМ УРОВНЕ КОНТРАКТА



ФУНТ СТЕРЛИНГОВ. СУМАРНЫЙ ОБЪЕМ КОНТРАКТА НА 05.05.2010

11:22:29 All prices Apply

Ticker BP6 Date 05/05/2010 to 05/05/2010

Contract JUN10 Time 00:00 to 23:59 Price Scale 0,0001

Volume Limit Full Contract Time Interval

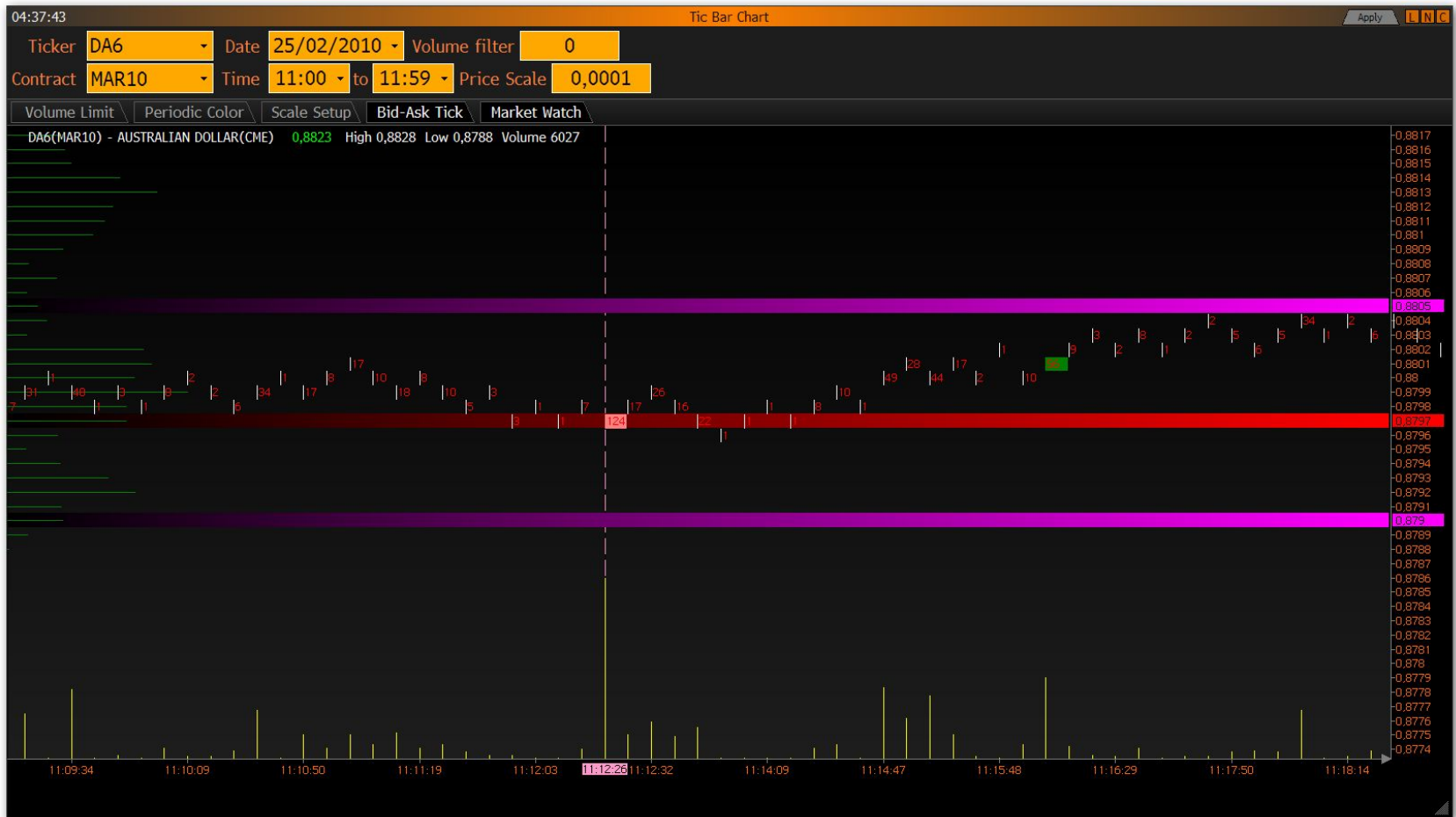
Price	Trades	Volume
1,517	9656	13957
1,537	8807	13823
1,516	8882	13729
1,5362	9446	13644
1,5365	8815	13462
1,5363	9389	13320
1,5356	8789	12939
1,5168	8988	12916
1,5361	9041	12726
1,535	8208	12599
1,5354	8299	12591
1,5364	8753	12499
1,527	7972	12454
1,5366	8620	12384
1,5171	8674	12338
1,5169	8707	12329
1,536	8279	12297
1,5161	8516	12235
1,5369	8524	12195
1,5232	8003	12177
1,5368	8295	12053
1,5268	7785	11814
1,5162	8401	11790

BP6(JUN10) - BRITISH POUND(CME)

ПРИМЕР №3
ВАЛЮТНЫЙ МАРТОВСКИЙ КОНТРАКТ НА АВСТЛИЙСКИЙ ДОЛЛАР. СДЕЛКА BUY ОТ 2-ГО
УРОВНЯ
КОНТРАКТА С ПОДТВЕРЖДЕНИЕМ СМЕНЫ ТЕНДЕНЦИИ, ВХОД ПО ЦЕНЕ 0.8797



АВСТРАЛИЙСКИЙ ДОЛЛАР. ПОДТВЕРЖДЕНИЕ УРОВНЯ ТИКОВЫМ ОБЪЕМОМ 124 ЛОТ



АВСТРАЛИЙСКИЙ ДОЛЛАР. ПОИСКОВИК ТИКОВЫХ ОБЪЕМОВ. ПОТВЕРЖДЕНИЕ ПО ВРЕМЕНИ.

04:24:50 Tic Search APPLY

Ticker DA6 Date 25/02/2010

Contract MAR10 Time 11:00 to 11:59

Time	Price	Volume
11:12:26	0,8797	124
11:34:03	0,8802	91
11:22:50	0,8802	91
11:35:03	0,8807	86
11:42:43	0,8814	80
11:51:24	0,8819	78
11:55:07	0,8823	72
11:37:45	0,8811	71
11:05:07	0,8792	69
11:34:22	0,8805	66
11:56:22	0,8827	60
11:41:43	0,8816	59
11:55:37	0,8825	57
11:15:53	0,8801	56
11:35:22	0,881	55
11:25:40	0,8799	53
11:44:06	0,8812	52
11:36:18	0,8814	52
11:26:57	0,8798	51
11:14:47	0,88	49
11:34:22	0,8804	49
11:09:34	0,8799	48
11:01:03	0,8793	48
11:36:18	0,8813	47
11:06:40	0,8792	47

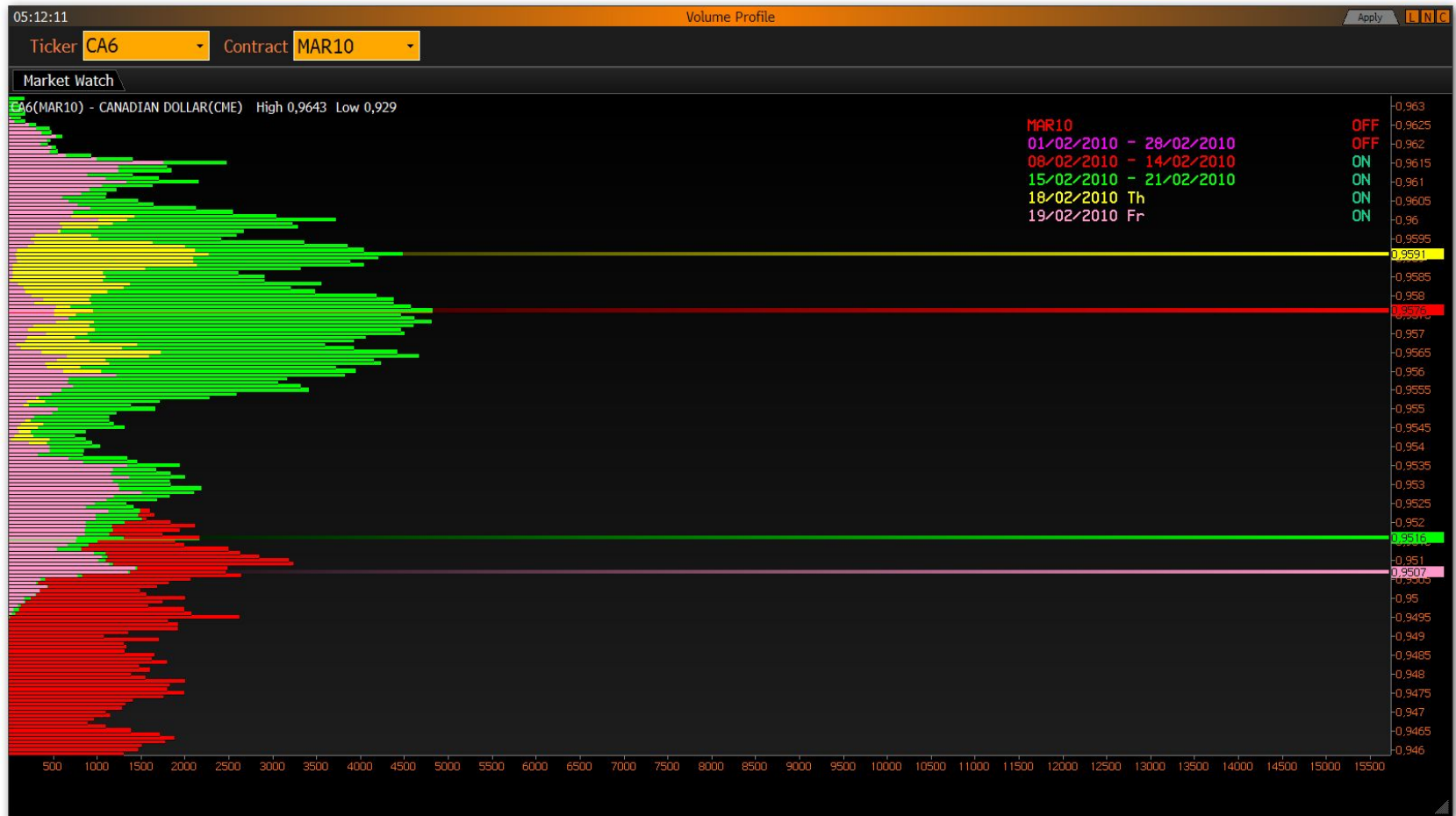
DAB(MAR10) - AUSTRALIAN DOLLAR(CME)

ПРИМЕР №4

ВАЛЮТНЫЙ МАРТОВСКИЙ КОНТРАКТ НА КАНАДСКИЙ ДОЛЛАР. СДЕЛКА BUY ОТ УРОВНЯ ЕВРОПЫ, В ЧАС ПЕРЕХОДА Europe-USA, **ВХОД ПО ЦЕНЕ 0.9507**



КАНАДСКИЙ ДОЛЛАР. ПОДТВЕРЖДЕНИЕ ПО ГИСТОГРАММЕ НАКОПЛЕНИЯ СУМАРНОГО ОБЪЕМА. ДИАПАЗОН РАЗНЫХ ПЕРИОДОВ ВРЕМЕНИ



КАНАДСКИЙ ДОЛЛАР. ПОИСКОВИК СУММАРНОГО ОБЪЕМА ПО ВРЕМЕНИ

05:25:32 All prices Apply

Ticker CA6 Date 19/02/2010 to 19/02/2010
Contract MAR10 Time 00:00 to 07:21 Price Scale 0,0001

Volume Limit Full Contract Time Interval

Price	Trades	Volume
0,9508	866	1392
0,9507	792	1340
0,9509	722	1104
0,951	587	910
0,9511	507	836
0,9506	492	779
0,9523	470	624
0,9512	374	599
0,9525	376	576
0,9532	360	564
0,9526	353	548
0,9517	393	546
0,9515	369	533
0,9528	347	520
0,9521	377	516
0,9516	376	508
0,9527	366	436
0,9503	246	436
0,9522	337	425
0,9519	291	411
0,9518	287	405
0,9529	309	382
0,9524	303	365
0,952	308	361

CAS(MAR10) - CANADIAN DOLLAR(CME)

По вопросам Методики, Торговой Системы, Сотрудничества, Обучения, Программы анализа VolFix, обращаться по контактам:

- **Трейдер на финансовых рынках Евгений Байраковский**

- Phone : + 38 096 599 73 15
- E-mail : evgeniy.bayrakovskiy@gmail.com
- Skype : bayrakovskiy_e



Содержание Программы Обучения

1. Система финансовых рынков.

- классификация финансовых рынков;
- возможности инвестирования;
- основные и производные инструменты биржевой торговли.

2. Модели анализа. Понятие объема.

- значимость фундаментального и технического анализа рынка с применением информации о объеме;
- данные об объемах и возможность их анализировать;
- объем как первоисточник основных тенденций финансовых рынков.

Содержание Программы Обучения

3. VolFix .Программа анализа рынка на основе информации о объеме.

- VolFix – аналитическая информационный сервис анализа финансовых рынков;
- инновационные возможности программы в сфере профессионального трейдинга;
- технология неограниченных способов ведения биржевой торговли, многофункциональные и эффективные методы анализа информации о объеме.

4. COT INDEX.

- COT INDEX как основной показатель отчетности товарных рынков
- определяющий фактор индекса для тенденций изменений финансовых рынков;
- взаимосвязь индекса и информации о объеме.

Содержание Программы Обучения

5. Торговая система.

- виды торговых систем;
- основные факторы и определяющие аспекты совершения биржевых операций;
- преимущества торговой системы основанной на возможности анализа рынка по объему.

6. Психология трейдинга.

- оптимальное принятие торговых решений;
- управление рисками, как гарантии сохранения и увеличения капитала;
- основные положения успешной торговли.

7. Практические занятия.

- детальное изучение и применение функций программы VolFix;
- практические способы анализа, учитывая факторы объема, цены и времени;
- точность совмещения всех торговых стратегий для эффективности биржевых операций.

Доверительное Управление Активами. Биржевая торговля валютными фьючерсными контрактами.

Название проекта: Биржевая торговля фьючерсными контрактами через электронное торговое подразделение GLOBEX CME (Чикаго товарная биржа), с помощью эффективной Методики анализа финансовых рынков по объему

Цель проекта: Инвестирование в фьючерсные контракты на срочном товарном рынке США, с целью получения 60-80% годовой доходности от первоначальной суммы финансового актива

Форма сотрудничества: Партнерство Инвестор-Финансовый Управляющий

Срок управления : от 6 месяцев до 1года, в зависимости от модели ведения биржевой торговой деятельности, с возможностью реинвестирования средств

Инвестиции: от 10,000-25,000 тыс. долларов США

Форма привлеченных активов: открытие торгового счета через брокера предоставляющего услуги на срочных финансовых рынках, с зачислением средств в долларах США

Актив прибыли инвестора: ожидаемая ежемесячная доходность 5-7% от первоначальной суммы инвестиций, с выплатой по завершению партнерского соглашения

Байраковский Евгений

Контактные данные:

phone :+38 096 599 73 15

e-mail:

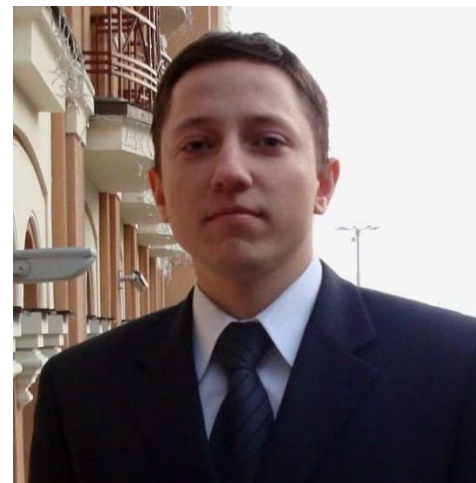
evgeniy.evgeniy.bayrakovskiy@evgeniy.bayrakovskiy@gmail.com
evgeniy.bayrakovskiy@gmail.com

skype : bayrakovskiy_e

Дата рождения: 16.04.1985 г.

Семейное положение: не женат

Место жительства: Киев, Украина



Резюме

Специальность: трейдер на финансовых рынках с апреля 2008 года, как физическое лицо, имею опыт во всех направлениях NYSE, NASDAQ, CME, CBOT, NYMEX, FOREX

Основная специализация: 2 года, валютные фьючерсные контракты CME(GLOBEX), CBOT, фьючерсный контракт на индекс SP-500 , фьючерсный контракт на GC(золото) NYMEX(COMEX), основные валютные пары FOREX.

Профессиональные знания и навыки:

При анализе финансовых рынков, применяю информационный сервис, программу анализа по объемам VolFix, не применяю технических и фундаментальных методов.

Имею авторскую Методику по анализу, которая **показывает четкую взаимосвязь валютного рынка по объему совершенных сделок, при ведении торговли по-сессиию Азия-Европа-США**, так как именно цена фьючерсного контракта определяет изменения трендовых тенденций на межбанке. Методика эффективна как при внутрисуточной, так и при позиционной модели ведения биржевой торговли.

Интересы:

Биржевая торговля ,фондовые и товарные срочные рынки, фьючерсные контракты, хедж и венчурные фонды, международная политика, экономика, инвестиции, философия, психология.

Личные достижения:

Авторская Методика анализа финансовых рынков по объему, проводил семинары в компаниях

«X-Trade Brokers Украина», «Украинский клуб трейдеров», побеждал в конкурсах брокеров

Цели: доверительное управление активами, бизнес партнерство, создание Хедж Фонда