

Комплексный подход в режиме торговой системе консервативного скальпинга

Т.Н. Кондратьева, Е.Н. Сидоренко

При анализе рынка наряду с фундаментальным, техническим анализами необходимо учитывать и скальпинговые стратегии динамики тренды [1]. Основным элементом управления капиталом является получения максимума из прибыльных позиций и сокращения убыточных позиций. Классическое правило: дайте прибыли расти урежьте убытки, работает всегда и везде. Наша задача будет заключаться не в умении прогнозировать рынок, а в режиме реального времени работать по текущей ситуации с лучших уровней.

Условия работать рентабельно возможно при создании прибыльной стратегии, предполагающей работу на тайм-фреймах различных временных периодах [2]. В качестве инструмента такой работы могут выступать трендовые индикаторы принцип работы, которых заключается в определении господствующего направления движения цены путем сглаживания ценовых значений за определенный период времени [3].

Будем использовать комплексный подход в режиме торговой системе консервативного скальпинга intraday. Рассмотрим несложную стратегию FOREX основанную на показании нескольких индикаторов технического анализа [4]. Схождение-расхождение скользящего среднего (moving average convergence-divergence, MACD), при помощи которого можно определить точки ослабления сложившегося тренда и его разворота, а так же он позволяет определить наиболее подходящие моменты закрытия и открытия позиций в тот момент, когда сила основного тренда ослабевает либо возможен его будущий разворот, если такой разворот вообще говоря существует [5,6]. Для построения индикатора схождения-расхождения скользящего среднего используются экспоненциальные скользящие средние.

Математические формулы для расчета составляющих индикатора схождения-расхождения скользящего среднего имеют вид:

$$MACD = EMA_{sh}(P_i, N_{sh}) - EMA_l(P_i, N_l) \quad (1)$$

$$EMA_{sh,l} = (EMA_{sh,l}(N_{sh,l} - 1) + 2(P_i(N_{sh,l}) - EMA_{sh,l}(N_{sh,l} - 1)))/(N_{sh,l} + 1) \quad (2)$$

$$MA(N_s) = (\sum_{i=1}^n P_i(N_s)/N_s) \quad (3)$$

$EMA_{sh}(P_i, N_{sh})$ - экспоненциальное скользящее среднее с периодом N_{sh} , $EMA_l(P_i, N_l)$ - экспоненциальное скользящее среднее с периодом N_l , P_i - цены закрытия за период расчета, $i = \{1:n\}$, n - число цен закрытия для формулы (1).

$EMA_{sh,l}$ - экспоненциальное скользящее среднее с периодом $N_{sh,l}$, $EMA_{sh,l}(N_{sh,l} - 1)$ - экспоненциальная средняя за период, предшествующий периоду расчета, $N_{sh,l} - 1$ - период, предшествующий периоду расчета, $P_i(N_{sh,l})$ - цены закрытия за период расчета, $i = \{1:n\}$, n - число цен закрытия ($N_{sh,l}$ - короткий и длинный периоды соответственно) для формулы (2).

$MA(N_s)$ - простое скользящее среднее с периодом N_s , $P_i(N_s)$ - цены закрытия за период расчета N_s , $i = \{1:n\}$, n - число цен закрытия для формулы (3).

Выполним анализ валютного рынка по данным сайта компании Forex (Форекс), на период с 21 июля по 21 октября 2013 г. Рассмотрим действующие котировки валют онлайн в самой популярной для трейдинга валютной пары, а именно валютную пару EUR/JPY. Выберем два периода (короткий и длинный) для построения кривых экспоненциального скользящего среднего $EMA(N_{sh} = 7$ и $N_l = 12)$, рассчитаем простое скользящее среднее MA для сигнальной линии с периодом $N = 5$.

На рисунке 1 показано схождение-расхождение скользящего среднего на примере котировки EUR/JPY.

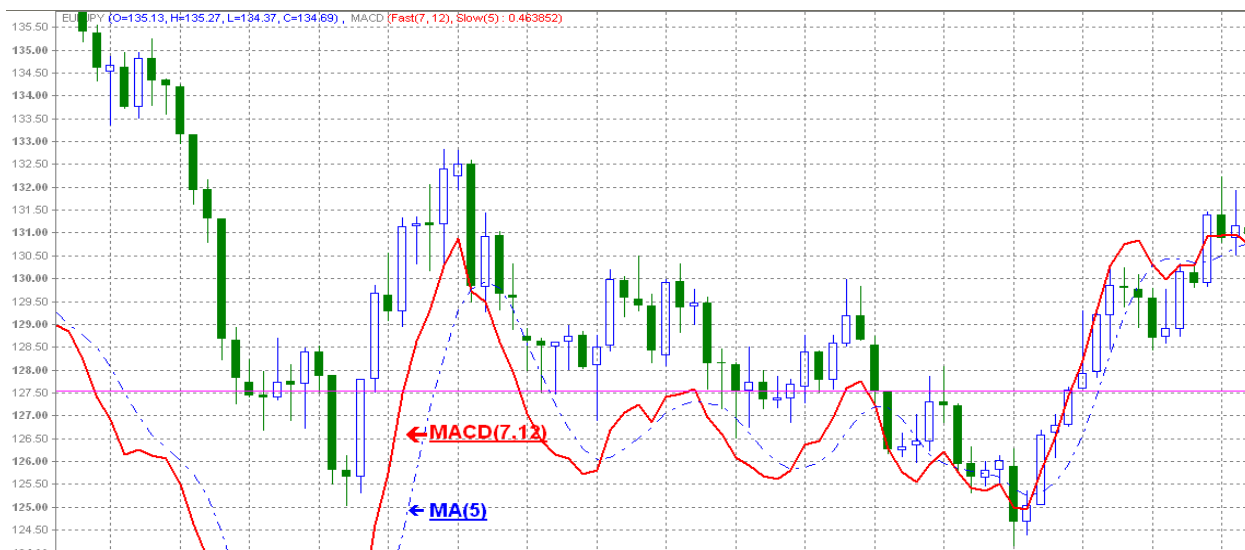


Рис. 1. Схождение-расхождение скользящего среднего на примере котировки EUR/JPY.

На графике Форекс онлайн-режима отражены изменения стоимости данных валют и их котировки [6]. Основные ценовые параметры: $C=135,17$ цена открытия, $C=135,13$ цена закрытия, $H=135,27$ максимальная цена и $L=134,37$ минимальная цена.

На данном графике представлен комплексный анализ отображения европейской валюты к японской иене в однодневном формате. Применение краткосрочных планов анализа трейдов в течение дня более простой способ, чем отслеживание долгосрочных колебаний [7,8]. На выбранном периоде дневной график отображения дает нам несколько больше возможностей входа в рынок. Соответственно, становится более понятна, точность восприятия тенденции рынка и появляется возможность неоднократного совершения сделок внутри дня. Например, на трендовом участке наблюдается само направление тенденции рынка и более того видно как нам к ней присоединиться [9]. Отображены четыре позиции (сигнала) по открытию и четыре позиции по закрытию рынка, при этом две из них являются достаточно прибыльными 1 и 4, а 2 и 3 менее прибыльными. В первом случае прибыль составляет $129,50 - 125,00 = 4,50$ пунктов ($P_c - P_o$), во втором $127,25 - 126,00 = 1,25$, в третьем $127,15 - 125,25 = 1,90$, в

четвертом $130,35 - 125,25 = 5,10$ пунктов. Общий доход будет зависеть от выбранного плеча [10].

На рисунке 2 показаны сигналы по открытию и закрытию.

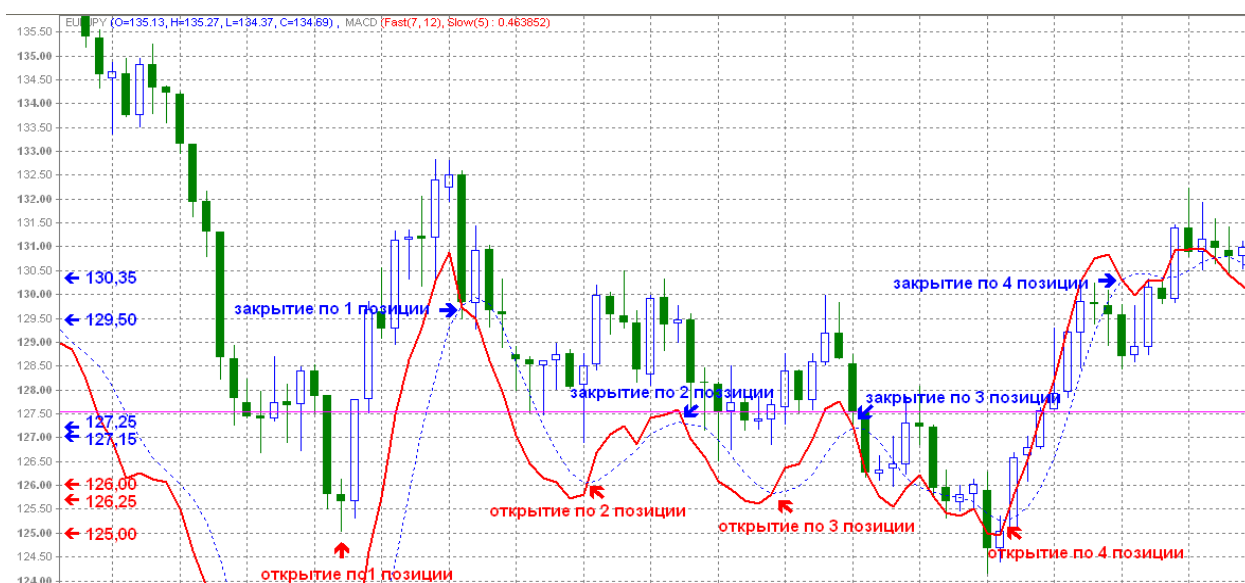


Рис. 2. Схема торговой системы схождение-расхождение скользящего среднего на примере котировки EUR/JPY.

Таким образом, преимущества полученной системы, при условии варьирования рабочего времени с данной системой, является возможность неоднократного вхождения трейдера в рынок, что позволяет обеспечить потенциальную доходность за выбранный временной период.

Комплексный подход в режиме торговой системе консервативного скальпинга раскрывает новую прибыльную внутридневную торговую систему для работы на валютном рынке Forex. Предложенная система является вполне рабочей и прибыльной.

Литература:

1. Ширяев Н.А. Консервативный скальпинг intraday // Курс обучения форекс - www.forex4everyone.ru. – Новочеркасск: НГТУ, 2004. – 256 с.
2. Эрик Л. Найман. Малая энциклопедия трейдера. // «Альпина Бизнес Букс», 2007 г. ISBN: 978-5-9614-0464-7.
3. Кондратьева Т.Н. Принцип работы трендовых индикаторов [Электронный ресурс] // «НАУКОВЕДЕНИЕ» 2013 №3 (16)– Режим доступа:

http://naukovedenie.ru/sbornik13/16_57ЭРГСУ313 (доступ свободный) – Загл. с экрана. – Яз. рус., идентификационный номер статьи в журнале: 63ТРГСУ313.

4. Ю. Жваколюк. Внутрдневная торговля на рынке Форекс //2011 г. rynok-valjut-forex.trust-list.ru/...forex/skachat-iuriy-zhvakoliuk-vnutrid../ISBN: 5-272-00131-1.

5. Муравьева М.П. Принципы оптимальности в изучении социально-экономических процессов рынка труда [Электронный ресурс] // «Инженерный вестник дона» 2012 №4 (часть 2) – Режим доступа: <http://www.ivdon.ru/magazine/archive/n4p2y2012/1245>(доступ свободный) – Загл. с экрана. – Яз. рус.

6. Горгорова Ю.В., Кондратьева Т.Н. Динамика вторичного рынка жилья г. Ростова-на-Дону [Электронный ресурс] // «НАУКОВЕДЕНИЕ» 2012 №3 (12), – Режим доступа: <http://naukovedenie.ru/sbornik12/12-85.pdf> свободный – Загл. с экрана.

7. Ширяев А.Н. Вероятностно-статистические модели эволюции финансовых индексов. // Обозрение прикладной и промышленной математики. Москва. ТВП. 1995. Т.2. №4.С.527-555.

8. Jack D. Schwager, Technical Analysis // ID 5040489, ISBN 0471020516; 2012 г., pp. 104-129.

9. Hansen A.T. Complete market pricing in the Wiener filtration without existence of a martingale measure. // Preprint. Aarhus University. Dept. of Operation Research. 1996. pp. 526

10. Khaled S. Al-Sultan, Maroof Khan M. Computational experience on four algorithms for the hard clustering problem.// Pattern recognition letters 17, 1996, pp. 295-308.