

# Системный трейдинг на бирже

Ведущий: Ильшат Байтурин



- Начал карьеру трейдера в 2008 году;
- Работал в команде тренера управляющих европейских хедж-фондов;
- Рекорд доходности 900% за 3 месяца;
- Провел 100+ вебинаров по трейдингу на бирже;
- Обучил 300+ трейдеров и инвесторов в России и Европе;
- Сторонник использования простых и понятных инструментов;
- Добиваюсь формирования необходимых навыков у своих учеников;
- Работал в крупных брокерских компаниях.

Это совокупность инструментов анализа и правил, которых придерживается трейдер в собственной работе на рынке.

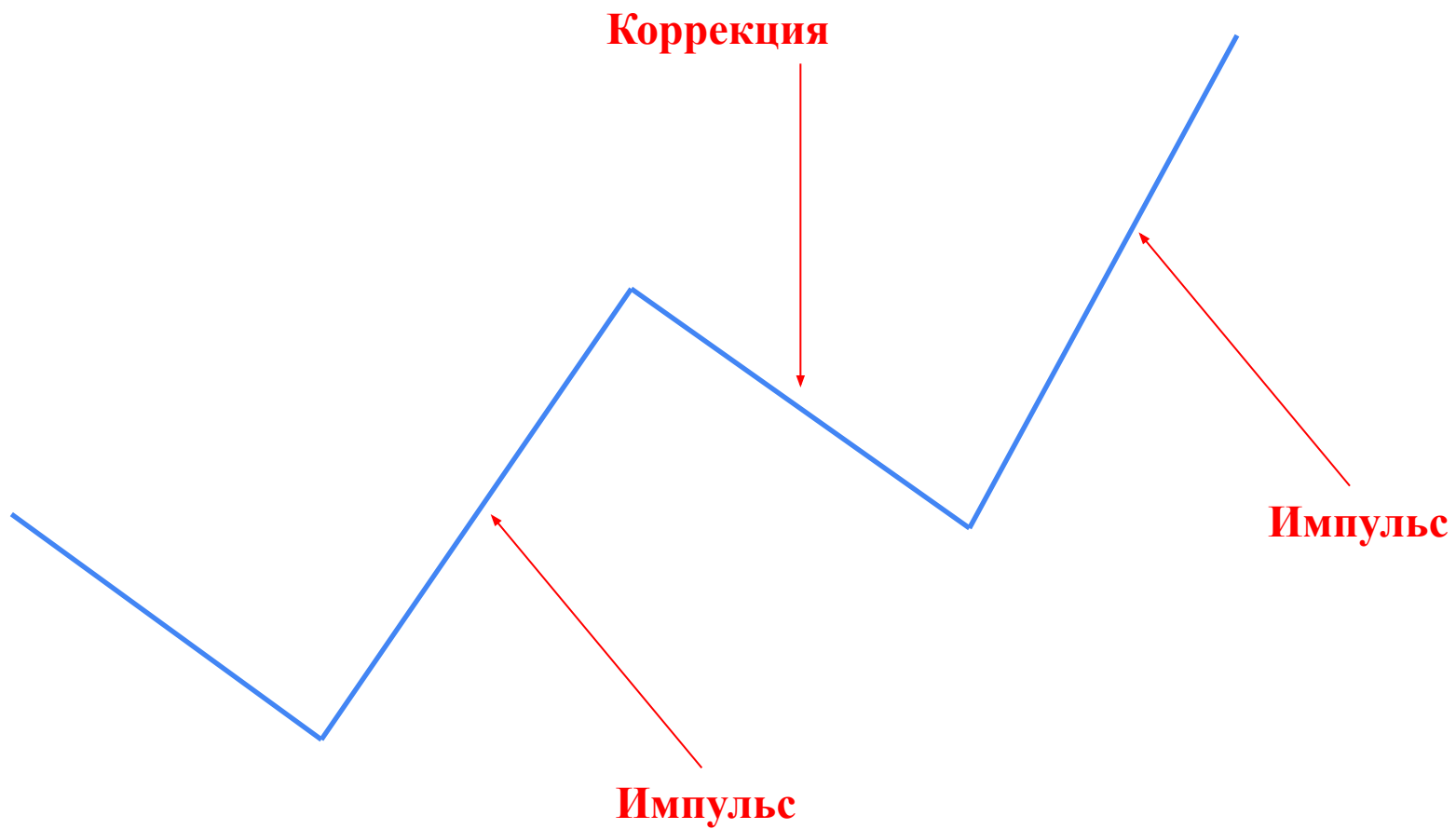
Одновременное достижение заданных значений дает сигнал на покупку или продажу торгового инструмента.

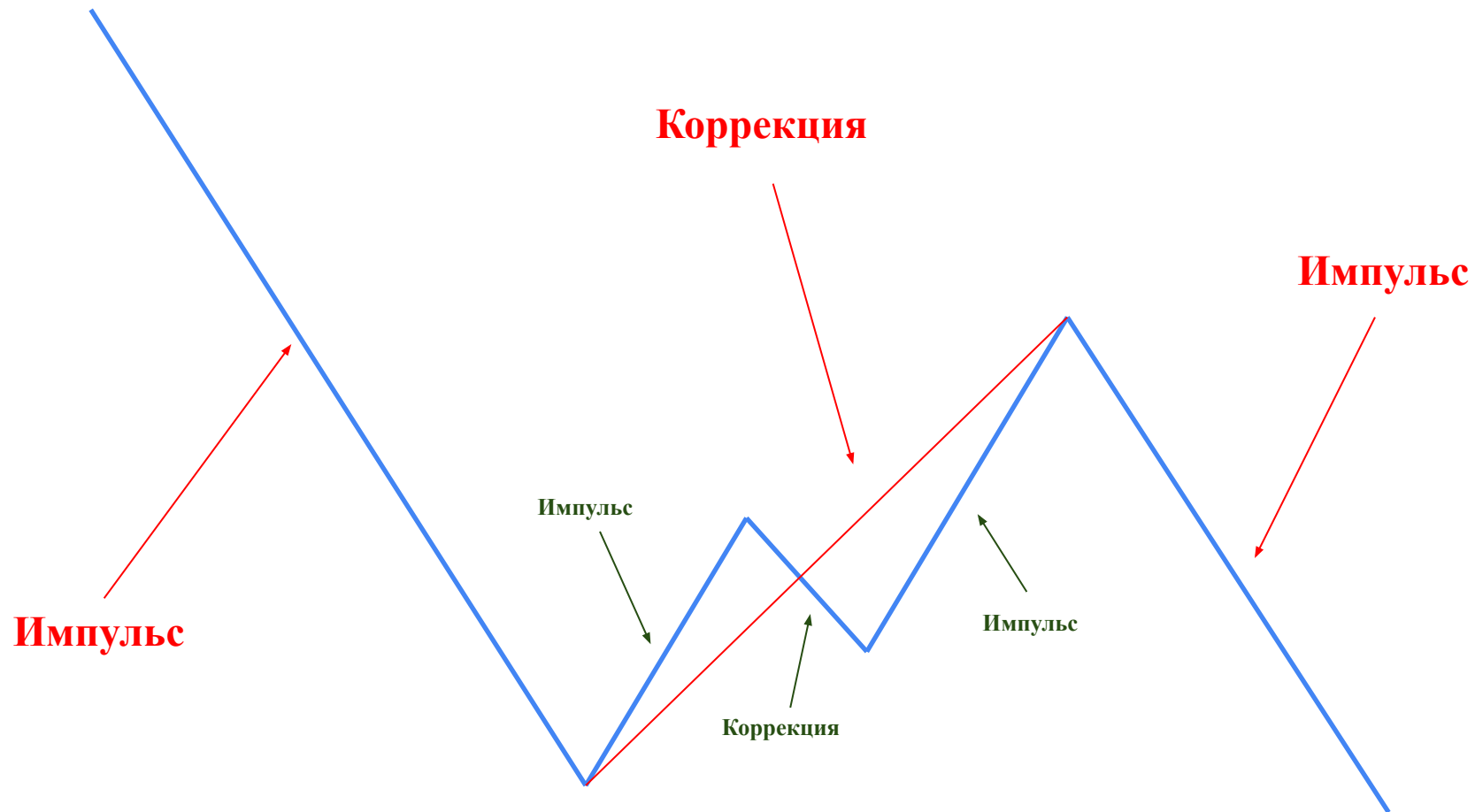
**Ф**актически это модель принятия решений.

1. В каком рынке торговать? Когда торговать?
2. Степень “живучести” системы
3. Критерии входа в рынок
4. Управление капиталом
5. Стоп-приказы
6. Критерии выхода из рынка

## Правило “3 (три) П”

- Прибыльная торговая система
- Понятная торговая система
- Простая торговая система

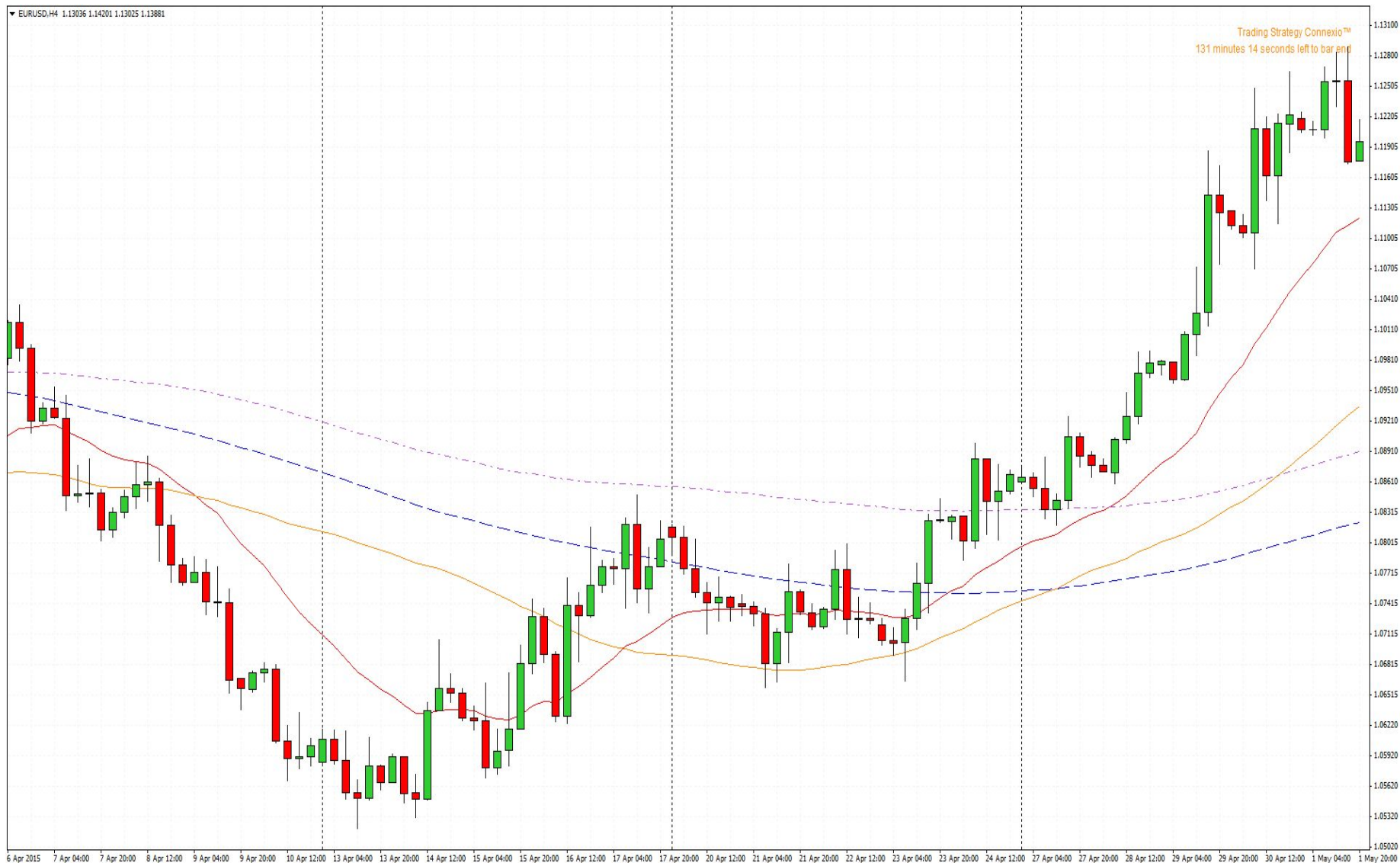


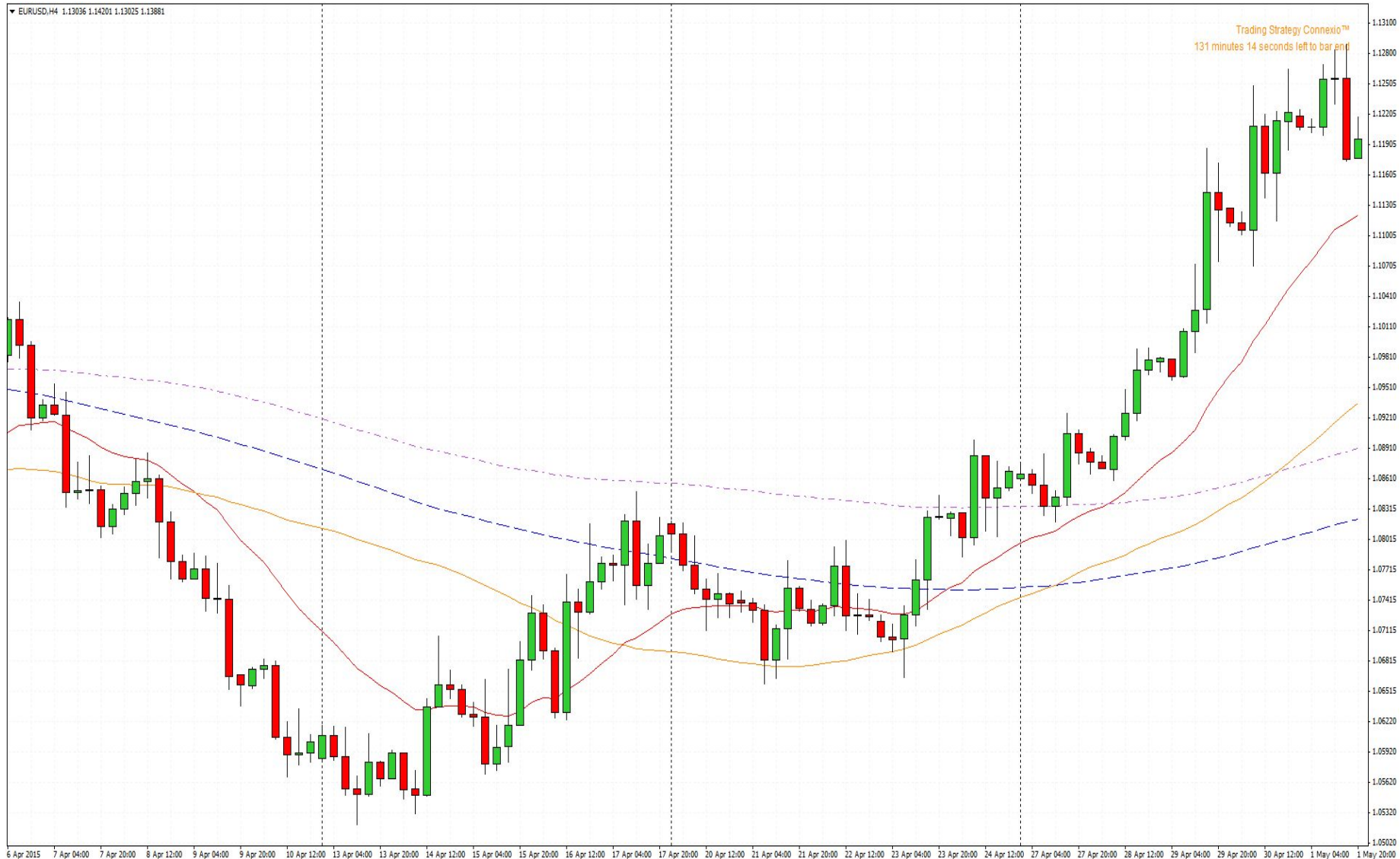


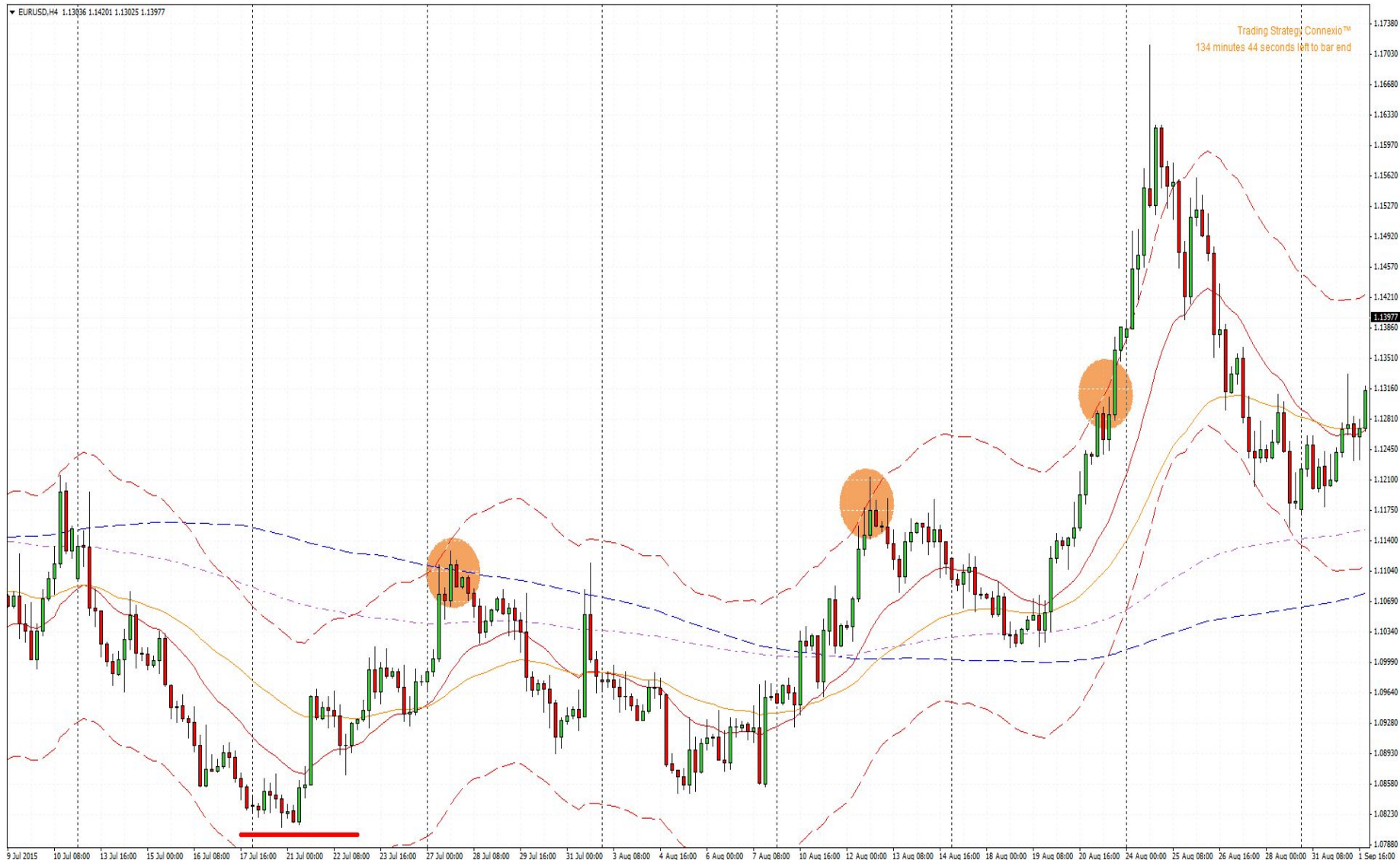


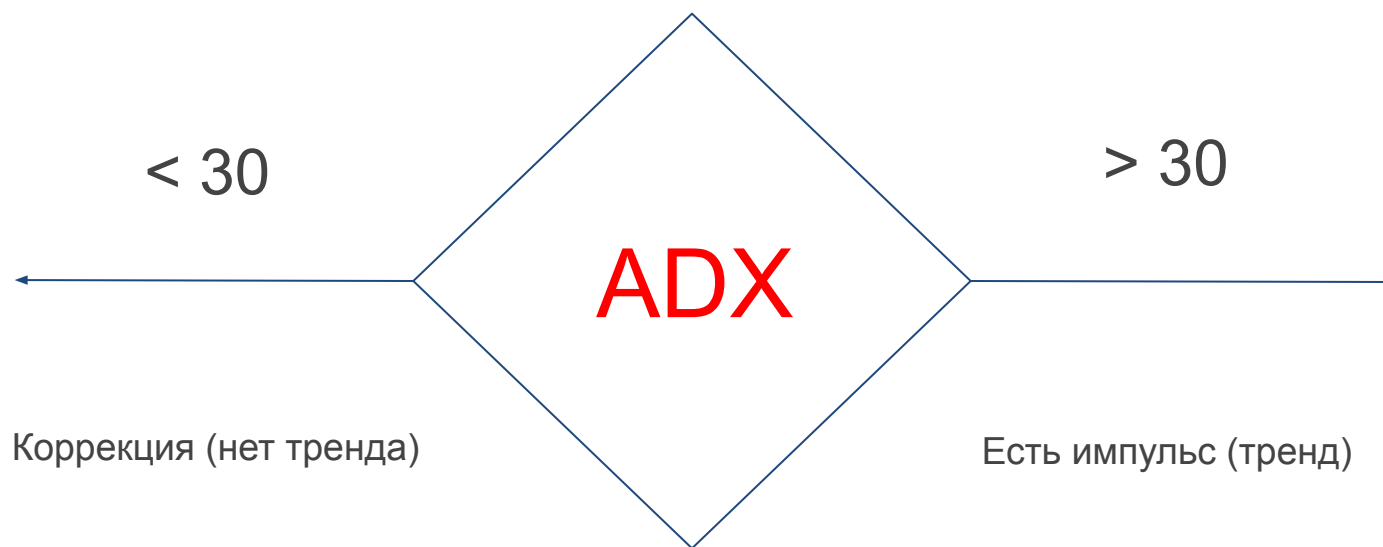


Период и тип	Пояснение
<b>21 EMA</b>	Информация за 1 торговый месяц
<b>50 SMA</b>	Информация за квартал (среднесрок)
<b>200 SMA</b>	Информация за год (долгосрок)
<b>200 EMA</b>	Зачем дубль?









1. Доходность
2. Максимальная просадка
3. Количество убыточных сделок подряд
4. Количество прибыльных сделок / количество убыточных сделок
5. Средняя прибыльная сделка / средняя убыточная сделка
6. Математическое ожидание

**W** = число пунктов прибыли / число успешных сделок,  
где  $W$  - средний размер выигрышей

**L** = число пунктов убытка / число убыточных сделок,  
где  $L$  - средний размер потерь

**%W** = количество выигрышных сделок / общее число сделок,  
где  $\%W$  = коэффициент успешных сделок

*Примечание!!! Сделки с нулевым результатом, без прибыли и убытка, также причисляются к выигрышным.*

$$(W / L + 1) * \%W - 1 \geq 0.6$$

*Пример*

+60, +60, -30, +60, -20, +50, -30, +40, -20, +30

$$W = 300/6 = 50$$

$$L = 100/4 = 25$$

$$\%W = 6/10 = 0.6$$

$$(50 / 25) + 1) * 0.6 = 0.8$$



МОЯ ТОРГОВАЯ СТРАТЕГИЯ И АЛГОРИТМ РАБОТАЕТ ЧЕТКО, НО Я САМ НЕ ЗАХОЖУ, В НУЖНОЙ ТОЧКЕ, ПОТОМУ ЧТО МНЕ СТРАШНО ЛЕЗТЬ В РЫНОК.

ПОСЛЕ ТОГО, КАК Я ПОЛУЧАЮ СТОП-ЛОСС, МНЕ СТАНОВИТСЯ НЕ ПО СЕБЕ. ИЗ ЗА ЧЕГО, Я ПРОПУСКАЮ СЛЕДУЮЩИЙ СИГНАЛ СВОЕЙ СИСТЕМЫ, Т.К. БОЮСЬ ЕЩЕ РАЗ ПОТЕРЯТЬ, НО СИГНАЛ ОКАЗЫВАЕТСЯ ПРИБЫЛЬНЫМ.

Я ЗАШЕЛ В СДЕЛКУ ПО СИСТЕМЕ, ПОСЛЕ ЧЕГО  
ОНА ПОШЛА В МОЮ СТОРОНУ, НО ЧЕРЕЗ  
НЕКОТОРОЕ ВРЕМЯ Я ВЫХОЖУ ИЗ ПОЗИЦИИ,  
ХОТЯ СИГНАЛА НА ВЫХОД НЕ БЫЛО. Я  
ЗАФИКСИРОВАЛ ГОРАЗДО МЕНЬШЕ ПРИБЫЛИ,  
ЧЕМ ДОЛЖЕН БЫЛ.

ПЕРИОДИЧЕСКИ БЫВАЮТ СЛУЧАИ, КОГДА Я ПОЛНОСТЬЮ ПЕРЕСТАЮ КОНТРОЛИРОВАТЬ СЕБЯ И ДЕЛАЮ ОГРОМНОЕ КОЛИЧЕСТВО НЕОБОСНОВАННЫХ СДЕЛОК. Я ПРОСТО НЕ МОГУ ОСТАНОВИТЬСЯ И ИЗ ЗА ЭТИХ СДЕЛОК Я ЗНАЧИТЕЛЬНО ПРОСАЖИВАЮ СВОЙ ДЕПОЗИТ.

Я НЕ МОГУ ЗАКРЫТЬ УБЫТОЧНУЮ СДЕЛКУ, ЧАСТО ПЕРЕДВИГАЮ СТОП ДАЛЬШЕ, НАДЕЯСЬ, ЧТО РЫНОК РАЗВЕРНЕТСЯ И ПОЙДЕТ В МОЮ СТОРОНУ...НО УВЫ, ТАКОЕ ПОЧТИ НИКОГДА НЕ ПРОИСХОДИТ И Я ВЫНУЖДЕН БРАТЬ УБЫТОК, ГОРАЗДО БОЛЬШЕ, ЧЕМ ОН МОГ БЫ БЫТЬ.

**Спасибо за внимание!**

Ведущий: Ильшат Байтурин