

Корреляция

Венчурная торговая система



## В двух словах о системе

Идея торговой системы “Корреляция” основана на предположении, что рынок это пружина.

Каждая пружина имеет свой коэффициент упругости, соответственно, бесконечно долго растягиваться не может и должна рано или поздно сужаться и снова растягиваться.



Торговля ведётся только кросс-курсами. И для того, чтобы определить по какому кросс-курсу пружина растянута больше всего, каждая валюта из основных валют (AUD/CAD/EUR/GBP/JPY/NZD/CHF) сравнивается с USD.

Полная информация от автора стратегии на следующем слайде в видео

Корреляция

Видео от создателя системы



# Корреляция



Пример из видео за 14.07.2017 на реальном счете

07.18.2017 10:11	07.18.2017 17:22	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.83000	88.52400	30.6	54.72	7h 11m	0.26%
07.18.2017 05:04	07.18.2017 17:22	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.67400	88.52400	15.0	26.83	12h 18m	0.13%
07.18.2017 04:09	07.18.2017 17:22	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.51700	88.52400	-0.7	-1.25	13h 13m	-0.01%
07.17.2017 17:53	07.18.2017 04:08	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	89.17300	88.52300	65.0	113.59	10h 15m	0.54%
07.14.2017 18:37	07.18.2017 04:08	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.99000	88.52300	46.7	78.74	3d	0.37%
07.14.2017 17:43	07.18.2017 04:08	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.82300	88.52300	30.0	48.98	3d	0.23%
07.14.2017 17:24	07.18.2017 04:08	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.66500	88.52300	14.2	20.83	3d	0.10%
07.14.2017 16:36	07.18.2017 04:08	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.51100	88.52300	-1.2	-6.62	3d	-0.03%
07.14.2017 15:53	07.18.2017 04:08	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.35800	88.52300	-16.5	-33.88	3d	-0.16%
07.12.2017 20:30	07.14.2017 17:27	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.60	89.09800	88.70800	39.0	181.29	1d	0.87%
07.14.2017 15:33	07.14.2017 15:52	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	88.59800	88.36800	23.0	40.93	19m	0.20%
07.14.2017 02:45	07.14.2017 15:30	<a href="#">CADJPY</a>	Sell	0.20	89.10000	88.79000	31.0	54.99	12h 45m	0.27%

## Корреляция

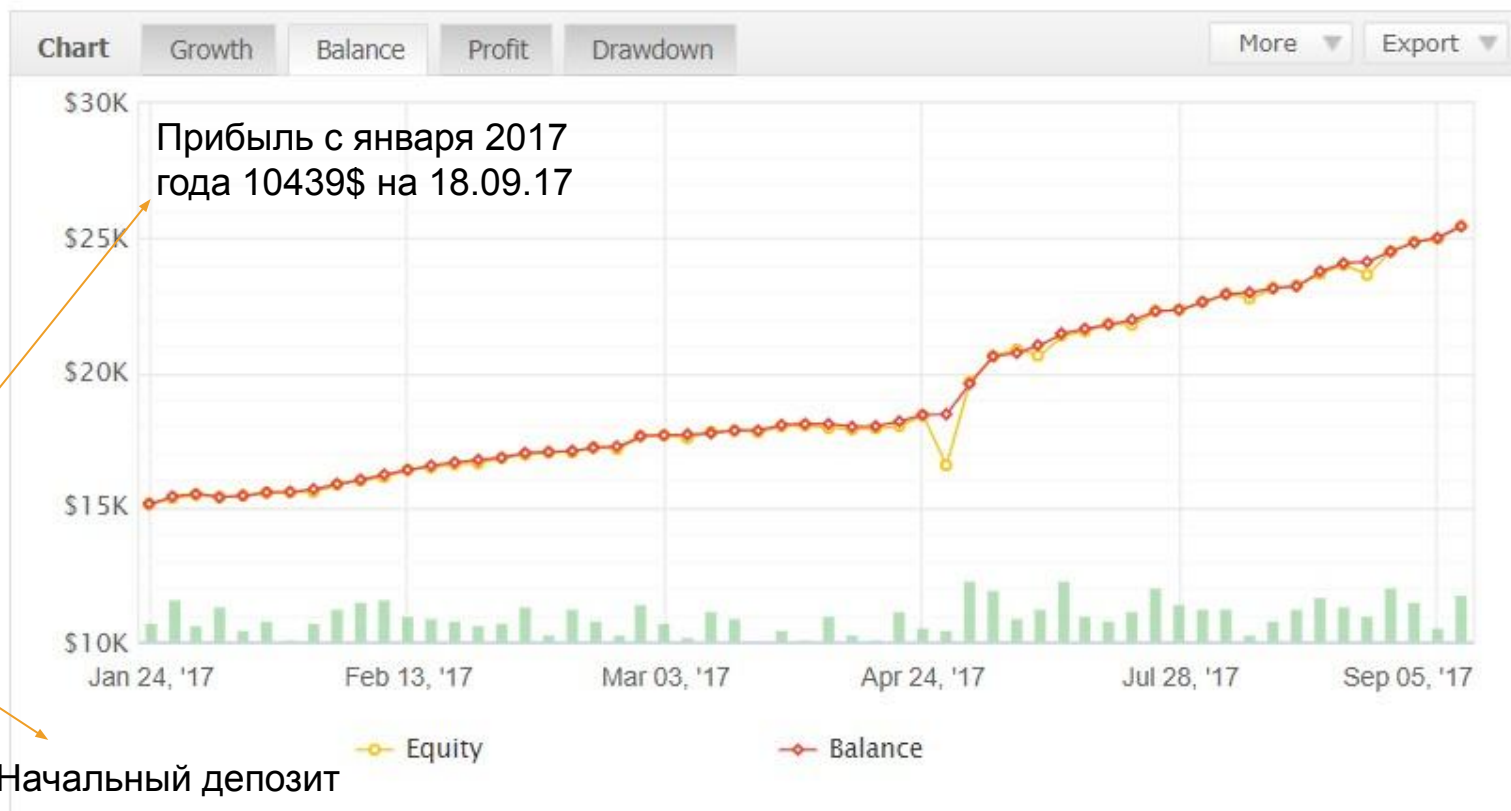


Результат сделок которые были в видео

08.14.2017 14:23	08.18.2017 11:36	<u>CADCHF</u>	Sell	0.25	0.76291	0.76011	28.0	57.80	3d	0.24%
08.16.2017 16:06	08.18.2017 11:36	<u>CADCHF</u>	Sell	0.25	0.76705	0.76011	69.4	170.48	1d	0.71%
08.11.2017 16:02	08.18.2017 11:36	<u>CADCHF</u>	Sell	0.25	0.75875	0.76011	-13.6	-52.90	6d	-0.22%
08.11.2017 10:51	08.18.2017 11:36	<u>CADCHF</u>	Sell	0.25	0.75624	0.76011	-38.7	-118.18	7d	-0.49%

# Подробная статистика по счету с 24 января 2017 года

Info	Stats	General
<b>Gain:</b>	<b>+69.59%</b>	
Abs. Gain:	+69.59%	
Daily:	0.21%	
Monthly:	6.89%	
Drawdown:	13.84%	
Balance:	\$25439.04	
Equity:	(100.00%) \$25439.04	
Highest:	(Sep 18) \$25439.04	
Profit:	\$10439.02	
Interest:	-\$1928.52	
Deposits:	\$15000.00	
Withdrawals:	\$0.00	
Updated:	1 Hour ago	
Tracking	2	



Прибыль в %  
Средняя За день  
Средняя За месяц  
Макс просадка

# Корреляция


Отношение полученной прибыли к убытку

Кол-во сделок всего

Отношение  
прибыльных к  
убыточным

Средняя прибыль  
по сделке

Средняя убыточная  
сделка

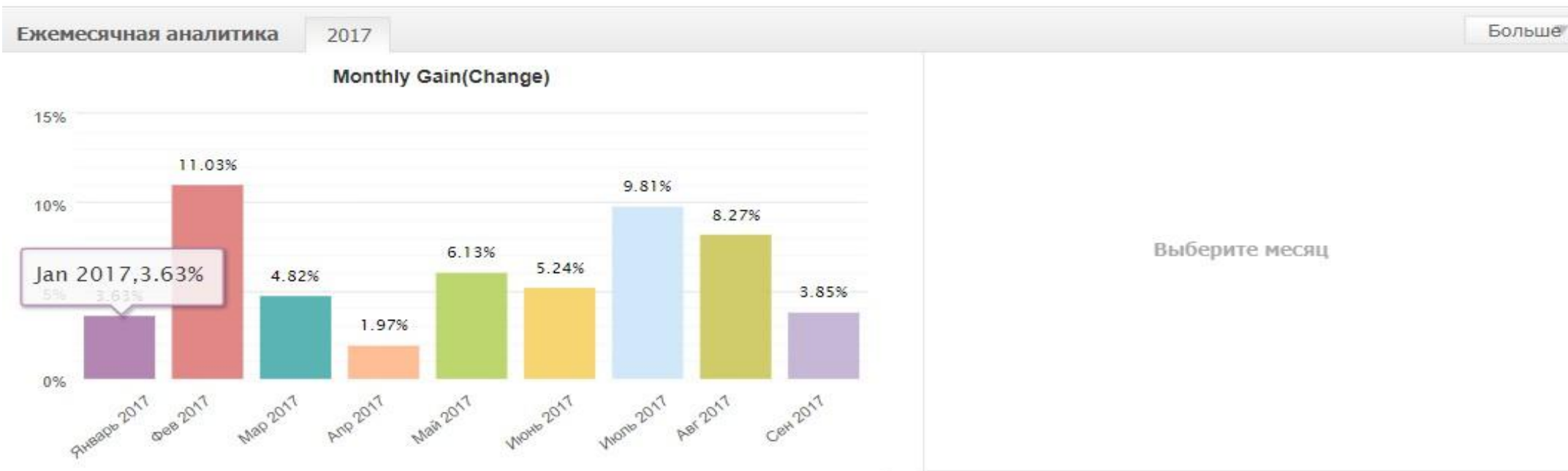
Advanced Statistics		Trades	Summary	Hourly	Daily	Risk Of Ruin	Duration	MAE/MFE	
Trades:		378		Longs Won:	(180/239) 75%			<b>Profit Factor:</b>	3.70
Profitability:				Shorts Won:	(102/139) 73%			Standard Deviation:	\$82.21
Pips:	Всего заработано пунктов	12149.0		Best Trade(\$):	Лучшая сделка (May 23) 594.90			Sharpe Ratio:	0.34
Average Win:		54.16 pips / \$50.75		Worst Trade(\$):	Худшая сделка (Sep 18) -331.52			Z-Score (Probability):	-6.90 (99.99%)
Average Loss:		-32.55 pips / -\$40.33		Best Trade (Pips):	Лучшая сделка в пунктах (Apr 07) 2143.0			<b>Expectancy:</b>	32.1 Pips / \$27.62
Lots:	Общий объем сделок в лотах	55.96		Worst Trade (Pips):	Худшая сделка в пунктах (May 23) -263.7			AHPR:	0.14%
Commissions:		-\$4.59		Avg. Trade Length:			2d	GHPR:	0.14%

Максимальная  
длинна сделка

Ожидание при открытии каждой  
сделки, в данном случае ожидание  
равно 27.62\$ прибыли



## Результат торговли по месяцам



Расширенная статистика:

<http://www.myfxbook.com/members/EfimVulpy/correlation/2198975>