

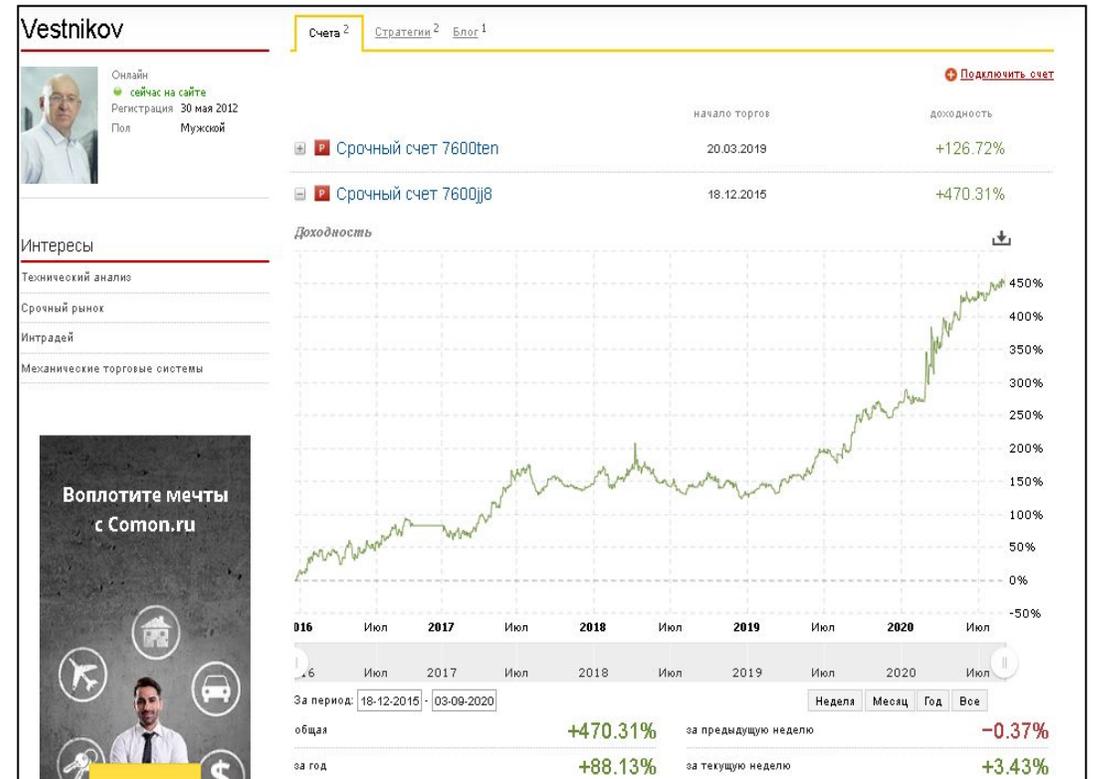
Почему и как участвовать в конкурсе «Лучший частный инвестор»

Валентин Витковский, трейдер,
ник на ЛЧИ-2020 - **ВВЕ**

Зачем нам конкурс?



<https://www.comon.ru/user/Vestnikov/profile/>



Зачем нам конкурс?

1.2. Целью Конкурса является популяризация идеи финансовых инвестиций на российском фондовом и срочном рынках, валютном рынке и рынке драгоценных металлов, а также увеличение числа активных частных инвесторов на всех рынках организатора торговли («Положение об ЛЧИ»)

Финансовые результаты пяти последних конкурсов ЛЧИ говорят о том, что отношение **выигравших** к **проигравшим** составляет ~ 45/55

Год	Категория участников	Кол-во участников	Стартовый капитал (млн.руб)	Результат (млн.руб.)	Количество сделок	Доходность на стартовый капитал
2015	Выигравшие	3 909	660	161	1 070 000	24%
	Проигравшие	5 257	887	-180	1 918 000	-20%
	Все вместе	9 166	1 547	-19	2 988 000	-1%
2016	Выигравшие	4 366	879	264	1 102 000	30%
	Проигравшие	4 512	805	-177	1 962 000	-22%
	Все вместе	8 878	1 684	87	3 064 000	5%
2017	Выигравшие	1 268	614	78	640 000	13%
	Проигравшие	2 304	1 186	-218	1 641 000	-18%
	Все вместе	3 572	1 800	-140	2 281 000	-8%
2018	Выигравшие	1 392	542	92	1 057 000	17%
	Проигравшие	2 437	1 041	-212	2 118 000	-20%
	Все вместе	3 829	1 583	-120	3 175 000	-8%
2019	Выигравшие	2 806	875	151	869 000	17%
	Проигравшие	2 741	951	-188	1 741 000	-20%
	Все вместе	5 547	1 826	-37	2 610 000	-2%
Итого	Выигравшие	13 741	3 570	746	4 738 000	21%
	Проигравшие	17 251	4 870	-975	9 380 000	-20%
	Все вместе	30 992	8 440	-229	14 118 000	-3%

95% трейдеров сливает?

За 27 месяцев с 1.01.14 года по 31.03.16				Всех клиентов	Клиентов с более 30000 руб
Всего:				470	256
Прибыльных:					126
Доля прибыльных клиентов				27%	49%

Зачем нам конкурс?

Конкурс даёт возможность на протяжении ряда лет представить и отследить результаты трейдинга:

Ник	год	доходность
Vestnikov	2008	-43,57%
Vestnikov	2009	89,14%
Vestnikov	2010	-18,96%
Вестников	2011	6,26%
Вестников	2012	-15,72%
Vestnik_SL	2013	-13,90%
BBE	2014	92,09%
BBE	2015	30,35%
Astray	2016	40,06%
BBE	2017	-4,60%
BBE	2018	0,30%
BBE	2019	12,22%
	Итого	173,67%
среднегодовая		57,89%

Играй по правилам – используй неэффективности («Трейдинг для начинающих», глава 2)

Зачем нам конкурс?

Конкурс даёт возможность на протяжении ряда лет представить и отследить результаты трейдинга <https://investor.moex.com/ru/statistics/2008/default.aspx>

данные за 2008-10-02

КОНТАКТЫ

ТЕКУЩАЯ ПОЗИЦИЯ	ПОЗИЦИЯ ЗА ПРЕДЫДУЩИЙ ДЕНЬ	УЧАСТНИК	ЖЕН.	БРОКЕР	ДАТА РЕГИСТРАЦИИ	СТАРТОВАЯ СУММА	ТЕКУЩИЙ ДЕНЬ		ДОХОД %
							АКТИВНОСТЬ (СДЕЛОК)	ИЗМЕНЕНИЕ %	
22	22	robot_kipa2		ОАО "ИК "Церих Кэпитал Менеджмент"	12.09.2008	1 000 000,00	2811	0,82	233,95
25	25	kassir		ОАО "ИК "Церих Кэпитал Менеджмент"	12.09.2008	1 095 808,56	61	0,08	196,06
+ 28	26	omerta1 [DISQ]	*	ОАО "ИК "Церих Кэпитал Менеджмент"	12.09.2008	1 000 000,00	145	-0,14	181,10
+ 62	58	srg08		ЗАО "Инвестиционная компания "ФИНАМ"	11.09.2008	1 011 973,00	294	-0,69	50,52
+ 68	67	omerta2		ЗАО "ИК "Ай Ти Инвест"	11.09.2008	1 540 987,70	0		44,93
+ 83	85	lossboy [DISQ]		ООО "Компания "Брокеркредитсервис"	15.09.2008	1 025 694,00	0	-0,62	26,75
+ 93	94	mcmore		ЗАО "ИК "Ай Ти Инвест"	12.09.2008	1 000 000,00	58	0,11	20,16
+ 127	128	aaa		ОАО "Альфа-Банк"	15.09.2008	1 023 617,55	0	0,42	-4,35
+ 133	136	robot_nebotov [DISQ]		ОАО "ИК "Церих Кэпитал Менеджмент"	12.09.2008	1 000 000,00	25	0,57	-7,18
+ 135	134	ognevm		ЗАО "Инвестиционная компания "ФИНАМ"	02.10.2008	1 950 000,00	0		-7,53
+ 197	199	vestnikov		ООО "КИТ Финанс"	03.10.2008	1 156 508,59	161	1,15	-43,57

«А что это ЛЧИ? Фигачить на всю котлету, рискуя всеми деньгами, чтобы попасть на первые строчки - это говорит о болезни – лудомании»

GoodBargains 15 сентября 2019, 07:21
<https://smart-lab.ru/blog/561779.php>

Положение о конкурсе «Лучший частный инвестор»

6.8. Объем начальных активов Участника Конкурса считается равным 100 000 (ста тысячам) рублей.

6.9. в случае если в результате открытия позиций или объявления заявок за счет Участника Конкурса размер гарантийного обеспечения превышает объем текущих денежных средств Участника Конкурса, начальные активы Участника Конкурса увеличивается на величину такого превышения.

6.13. Положительные значения вариационной маржи увеличивают текущую сумму денежных средств. Отрицательные значения вариационной маржи уменьшают текущую сумму денежных средств.

Наш оптимальный портфель:

В настоящее время ГО по **$S_i \approx 5000$ рублей, по $R_i \approx 20000$ рублей .**

Для максимизации доходности наша задача поддерживать совокупную позицию так, чтобы сумма задействованного ГО была не больше 100 т.р.

Объём одного контракта $S_i \approx 75$ т. р., одного контракта $R_i \approx 180$ т. руб.

При доле по рублёвым позициям 45/55 и ГО = 100 т.р. в портфеле будет 6 контрактов S_i и 3 контракта R_i , с объемом контрактов ≈ 450 т.р. + 550 т.р. = 1 млн.р.

А значит оптимальное плечо в моменте **$\approx 10:1$** .

Так всё таки лудоманим?

Наш депозит

Ну, может быть и так, если эти 100 тысяч рублей у вас - единственные.

Усреднение – зло.

А если не единственные, то всё равно на старте конкурса следует открывать позиции, задействовав ГО только в 100 тысяч рублей.

Бóльшая задействованная сумма увеличит Вашу начальную сумму, от которой считается доходность. Поэтому лучше её оставить в резерве. Может быть даже для усреднения. Или, чтобы «моргнуть» счётом к концу конкурса, .

3,6	-0,2%	2 дек 19	568 148	138,8%	99,9%	-10000	3,1	5,6	2 дек 19	195 267	124,1%	99,6%	10000	3,4	2 дек 19	1 287 830	129,5%
3,6	0,5%	3 дек 19	569 896	139,2%	100,3%		2,1	8,6	3 дек 19	197 222	125,3%	101,0%		3,4	3 дек 19	1 293 570	130,0%
3,6	0,4%	4 дек 19	571 747	139,7%	100,3%		2,3	8,1	4 дек 19	198 752	126,3%	100,8%		3,4	4 дек 19	1 299 178	130,6%
3,6	-0,3%	5 дек 19	570 466	139,4%	99,8%		2,4	7,6	5 дек 19	197 420	125,5%	99,3%		3,4	5 дек 19	1 294 556	130,1%
2,9	0,2%	6 дек 19	570 752	139,4%	100,1%		1,8	6,6	6 дек 19	197 859	125,7%	100,2%		2,7	6 дек 19	1 298 190	130,5%
3,4	0,6%	9 дек 19	572 873	140,0%	100,4%		2,1	8,1	9 дек 19	200 478	127,4%	101,3%		3,2	9 дек 19	1 305 509	131,2%
3,5	-0,2%	10 дек 19	572 062	139,8%	99,9%		2,3	7,3	10 дек 19	199 973	127,1%	99,7%		3,3	10 дек 19	1 303 312	131,0%
3,5	0,1%	11 дек 19	572 194	139,8%	100,0%		2,2	7,5	11 дек 19	200 369	127,3%	100,2%		3,3	11 дек 19	1 305 802	131,3%
3,5	4,6%	12 дек 19	590 100	144,2%	103,1%		2,3	7,5	12 дек 19	218 987	139,2%	109,3%		3,3	12 дек 19	1 361 388	136,8%
3	-0,3%	13 дек 19	589 768	144,1%	99,9%		1,8	6,9	13 дек 19	217 305	138,1%	99,2%		2,8	13 дек 19	1 356 298	136,3%
3	1,8%	16 дек 19	595 121	145,4%	100,9%		1,4	8,1	16 дек 19	226 801	144,1%	104,4%		2,8	16 дек 19	1 378 063	138,5%
3,4	-0,6%	17 дек 19	563 914	145,1%	99,8%	-30000	1,4	8	17 дек 19	263 532	142,0%	98,6%	40000	3,1	17 дек 19	1 371 289	137,8%
2,6	0,1%	18 дек 19	564 100	145,2%	100,0%		1,3	5,9	18 дек 19	264 202	142,4%	100,3%		2,4	18 дек 19	1 372 960	138,0%
3,3	#ДЕЛО!	19 дек 19		0,0%	0,0%		1,8	7,1	19 дек 19		0,0%	0,0%		3,1	19 дек 19		0,0%
3,3				ВТ			1,8	7,1	8,3	когда доходит, снижаем	ЛЧИ	1369514		3,1		С	

Резерв – это добро

И этот резерв пропорционально уменьшает ваше общее плечо, приходящееся на весь ваш капитал.

Этот резерв можно держать на своём конкурсном счёте и тогда, при тех же позициях, будет меньшее фактическое плечо на этом счёте, либо держать на своих неконкурсных счетах.

3,6	-0,2%	2 дек 19	568 148	138,8%	99,9%	-10000	3,1	5,6	2 дек 19	195 267	124,1%	99,6%	10000	3,4	2 дек 19	1 287 830	129,5%
3,6	0,5%	3 дек 19	569 896	139,2%	100,3%		2,1	8,6	3 дек 19	197 222	125,3%	101,0%		3,4	3 дек 19	1 293 570	130,0%
3,6	0,4%	4 дек 19	571 747	139,7%	100,3%		2,3	8,1	4 дек 19	198 752	126,3%	100,8%		3,4	4 дек 19	1 299 178	130,6%
3,6	-0,3%	5 дек 19	570 466	139,4%	99,8%		2,4	7,6	5 дек 19	197 420	125,5%	99,3%		3,4	5 дек 19	1 294 556	130,1%
2,9	0,2%	6 дек 19	570 752	139,4%	100,1%		1,8	6,6	6 дек 19	197 859	125,7%	100,2%		2,7	6 дек 19	1 298 190	130,5%
3,4	0,6%	9 дек 19	572 873	140,0%	100,4%		2,1	8,1	9 дек 19	200 478	127,4%	101,3%		3,2	9 дек 19	1 305 509	131,2%
3,5	-0,2%	10 дек 19	572 062	139,8%	99,9%		2,3	7,3	10 дек 19	199 973	127,1%	99,7%		3,3	10 дек 19	1 303 312	131,0%
3,5	0,1%	11 дек 19	572 194	139,8%	100,0%		2,2	7,5	11 дек 19	200 369	127,3%	100,2%		3,3	11 дек 19	1 305 802	131,3%
3,5	4,6%	12 дек 19	590 100	144,2%	103,1%		2,3	7,5	12 дек 19	218 987	139,2%	109,3%		3,3	12 дек 19	1 361 388	136,8%
3	-0,3%	13 дек 19	589 768	144,1%	99,9%		1,8	6,9	13 дек 19	217 305	138,1%	99,2%		2,8	13 дек 19	1 356 298	136,3%
3	1,8%	16 дек 19	595 121	145,4%	100,9%		1,4	8,1	16 дек 19	226 801	144,1%	104,4%		2,8	16 дек 19	1 378 063	138,5%
3,4	-0,6%	17 дек 19	563 914	145,1%	99,8%	-30000	1,4	8	17 дек 19	263 532	142,0%	98,6%	40000	3,1	17 дек 19	1 371 289	137,8%
2,6	0,1%	18 дек 19	564 100	145,2%	100,0%		1,3	5,9	18 дек 19	264 202	142,4%	100,3%		2,4	18 дек 19	1 372 960	138,0%
3,3	#ДЕЛО!	19 дек 19		0,0%	0,0%		1,8	7,1	19 дек 19		0,0%	0,0%		3,1	19 дек 19		0,0%
3,3				ВТ			1,8	7,1	8,3	когда доходит, снижаем	ЛЧИ	1369514		3,1		С	

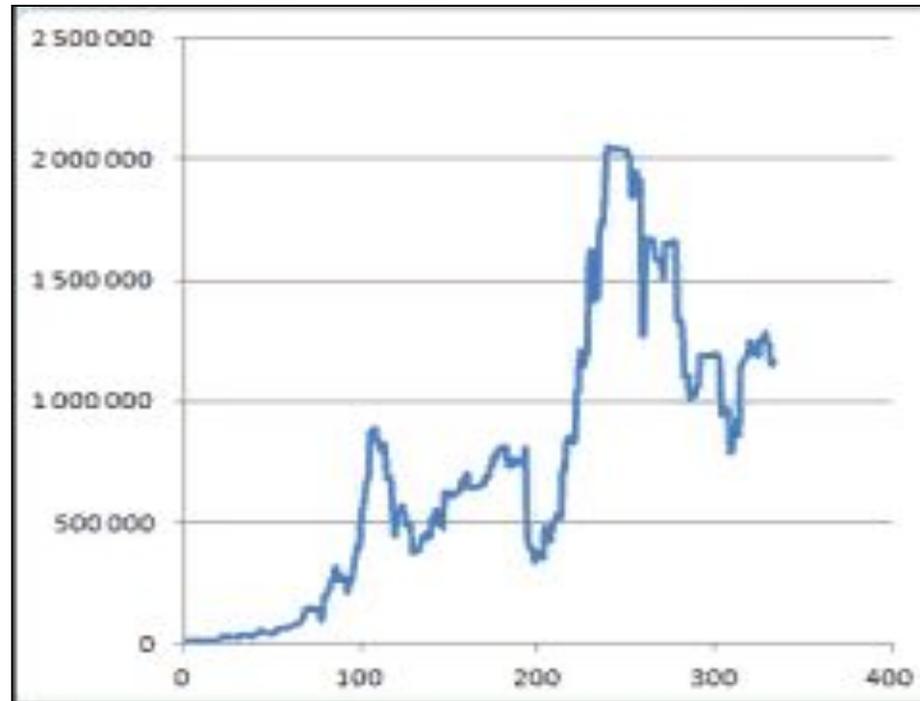
«Пирамидьтесь!»

А вот по мере роста прибыли на Вашем счёте – не забывайте наращивать позиции на конкурсном счёте с учётом этой прибыли.

Прибыль увеличивает Ваш текущий капитал, но не увеличивает Ваш стартовый капитал, от которого считается доходность!

Так поступал Ларри Вильямс?

Так, говорят, поступал Ларри Вильямс в победном 1987 году на Кубке Роббинса:



Наш риск – чей-то шанс

Эта презентация – мой шанс на профессиональное признание.

Но и риск, что на ЛЧИ меня в призах обойдёт кто-то из слушателей.

А может быть из читателей вот этих блогов о конкурсе ЛЧИ:

<https://smart-lab.ru/blog/640059.php>

<https://smart-lab.ru/blog/642083.php>

Благодарю авторов за информацию, которая была использована в презентации.

Спекулянт – это инвестор в свой трейдинг

Победных вам трейдов и инвестиций!
До встречи на ЛЧИ!

ник на «ЛЧИ-2020» - **ВВЕ**

Приглашаю на бесплатный
онлайн-курс «Инвестиционный
подход к спекуляциям»
<https://school.moex.com/courses/11877>

Валентин Витковский, трейдер
vestnikov64@yandex.ru