



Информационные технологии валютного трейдинга

The background of the slide is a photograph of a street sign for Wall Street. The sign is dark with white text. It features an arrow pointing left, followed by the numbers '105-120', and then the words 'WALL ST' in large, bold, sans-serif capital letters. The entire image is covered with a semi-transparent blue overlay.

Лабораторная работа. Торговые системы.

ИВАНОВ ФЕДОР

Торговая идея*.

- Тип системы-
- Валютная пара -...
- ...

**Принцип работы системы – по тренду, против тренда или в канале?*

Какие валютные пары и временные интервалы будут использоваться при проведении операций?

1. Система правил.*

- MACD растет
- SMA быстрая пересекает медленную
- BB (5,13,28)
- ...

*Какой из методов анализа будет применяться?

Графический, математический, комбинация методов?

Какие индикаторы используются?

Будут ли использоваться комбинации свечей (какие, как именно)?

Какие индикаторы?

Параметры индикаторов.

2. Торговая тактика*.

- Критерии открытия позиции
- Параметры SL
- Методы сопровождения открытой позиции
- Критерии закрытия позиции

* По каким правилам открывать и закрывать позиции? Какие конкретные критерии будут использоваться для вхождения на рынок или для выхода из него? Когда лучше открывать позиции? Когда эффективнее их закрыть?

Будут ли использоваться ордера, в частности, stop-loss?

Какой величины будет stop-loss?

3. Тестирование ТС на исторических данных.

График с отмеченными моментами входа/выхода.



Отчет.*

№	Дата и время сигнала на открытие	курс открытия позиции	пояснения к открытию позиции	уровень ордера stop-loss	уровень ордера take-profit, если такой выставляется	дата и время сигнала на закрытие позиции (или срабатывания ордера)	курс закрытия позиции	пояснения к закрытию позиции	итог сделки (итог сделки = курс закрытия - курс открытия)	сальдо по счету (предыдущее сальдо + итог сделки)

**Результаты записать в таблицу (см. приложение). Тестирование проводится на непрерывном интервале времени (например, год для дневных свечей), в таблицу заносятся все сделки, удовлетворяющие критериям ТС (вне зависимости от дальнейшего поведения рынка), т.о. количество сделок не должно быть менее 10 (ПОДРЯД!). Начальный депозит рекомендуется установить на уровне = 5000 дол. США. Важно! Для достоверности проверки эффективности ТС необходимо при тестировании «открывать» позиции всегда, если ситуация на рынке удовлетворяет критериям Вашей ТС.*

4. Оценка эффективности ТС.

Показатель	Значение
Валовая прибыль	
Валовый убыток	
Чистая (итоговая) прибыль	
Изменение депозита (%)	
Профит-фактор	
МИДД	
Фактор восстановления	