

**НОВОСИБИРСК**

14.10.2017

# Тимофей Мартынов

Телеведущий РБК 2007-2013

Прибыльный трейдер 2008-2013

Автор книги “Механизм трейдинга”

Тимофей Мартынов



# МЕХАНИЗМ ТРЕЙДИНГА

Как построить бизнес на бирже



## Цели моего доклада

Дать свое видение развития событий

Как можно заработать на этом

Убедить, что инвестиции лучше чем спекуляции

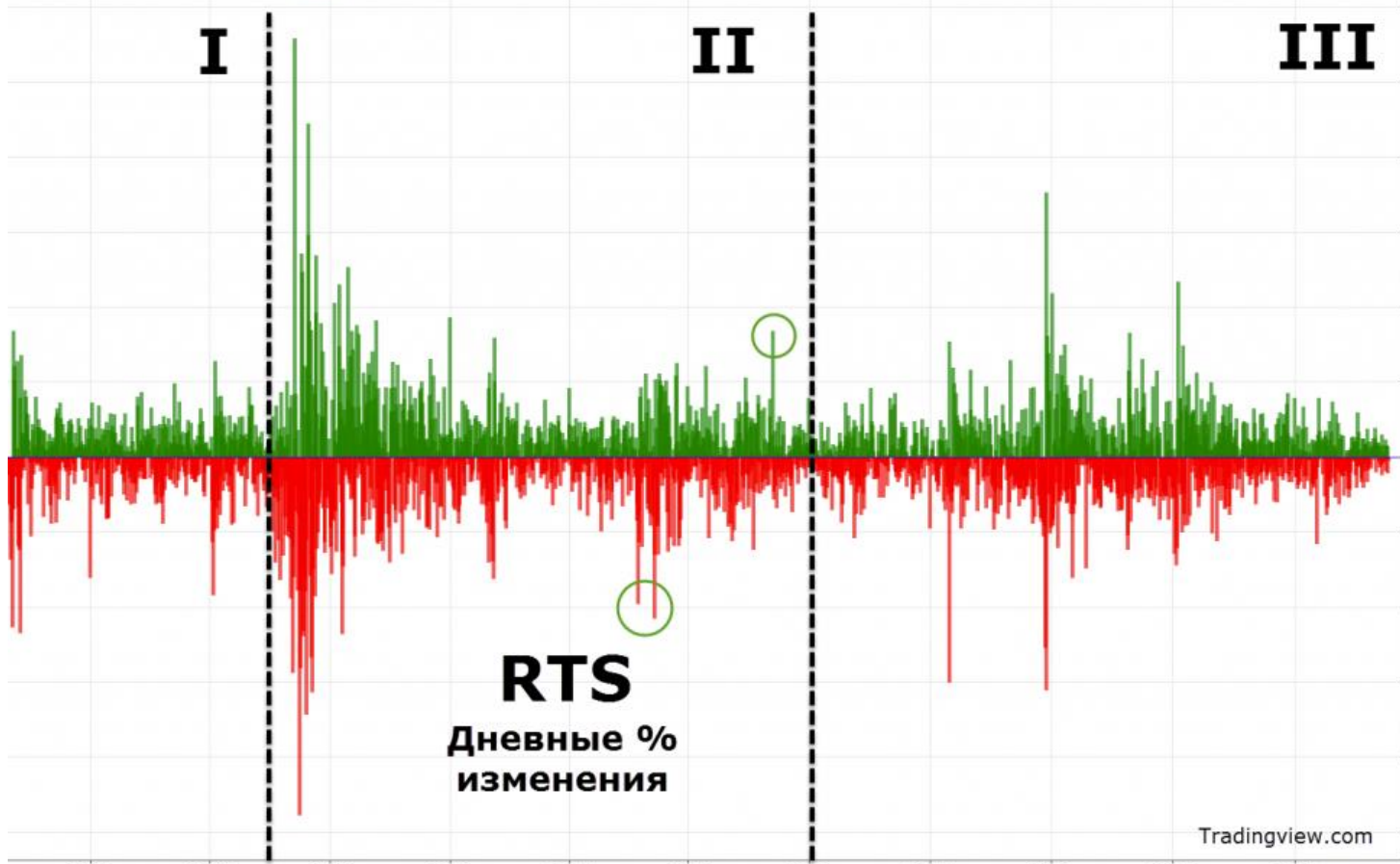
RTS INDEX, MOEX

2000.00  
1132.76

**I**

**II**

**III**



**RTS**  
Дневные %  
изменения

Tradingview.com

2007 2008 2009 2010 2011 2012 2013 2014 2015 2016 2017

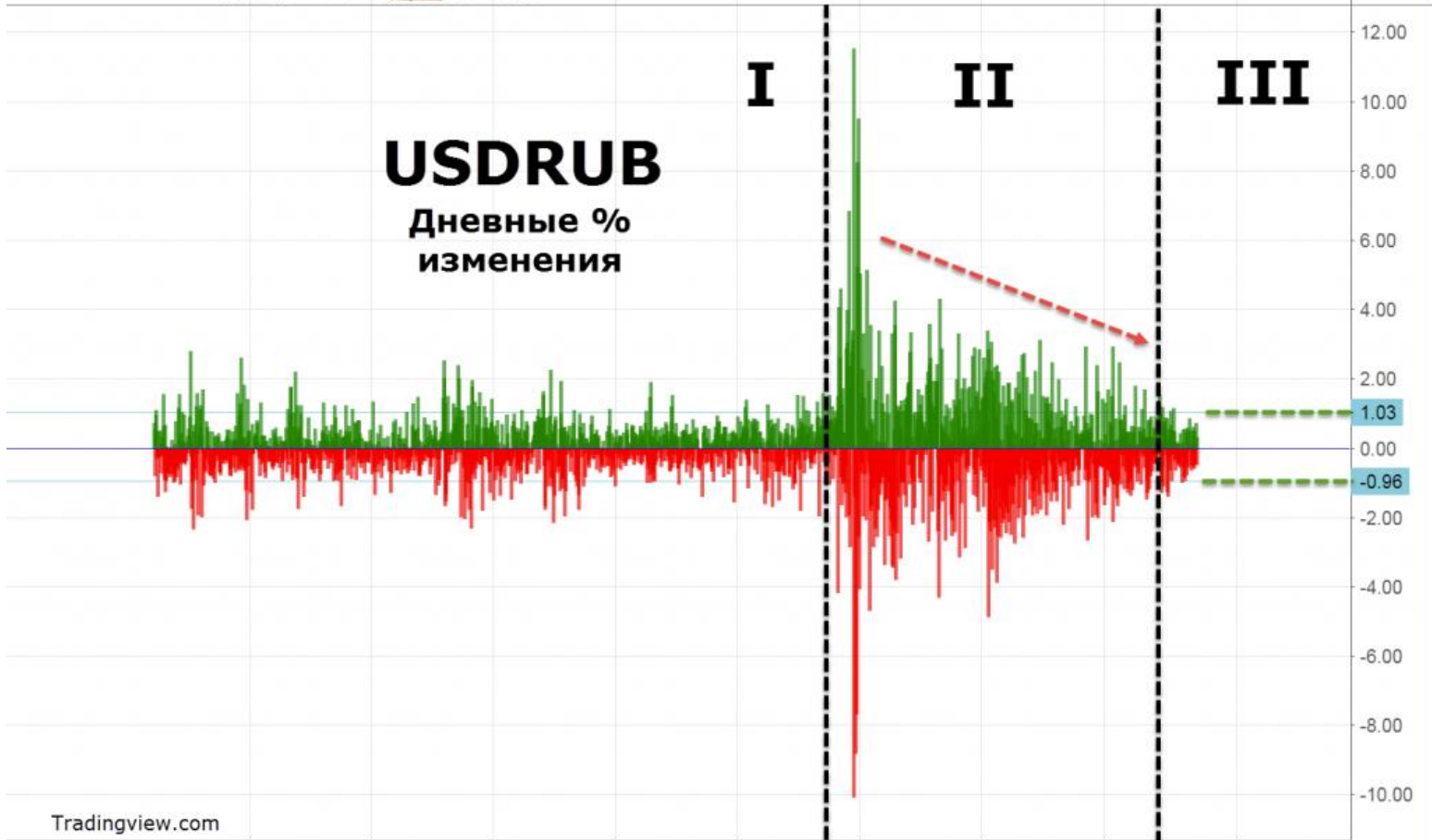
# USDRUB

Дневные %  
изменения

I

II

III

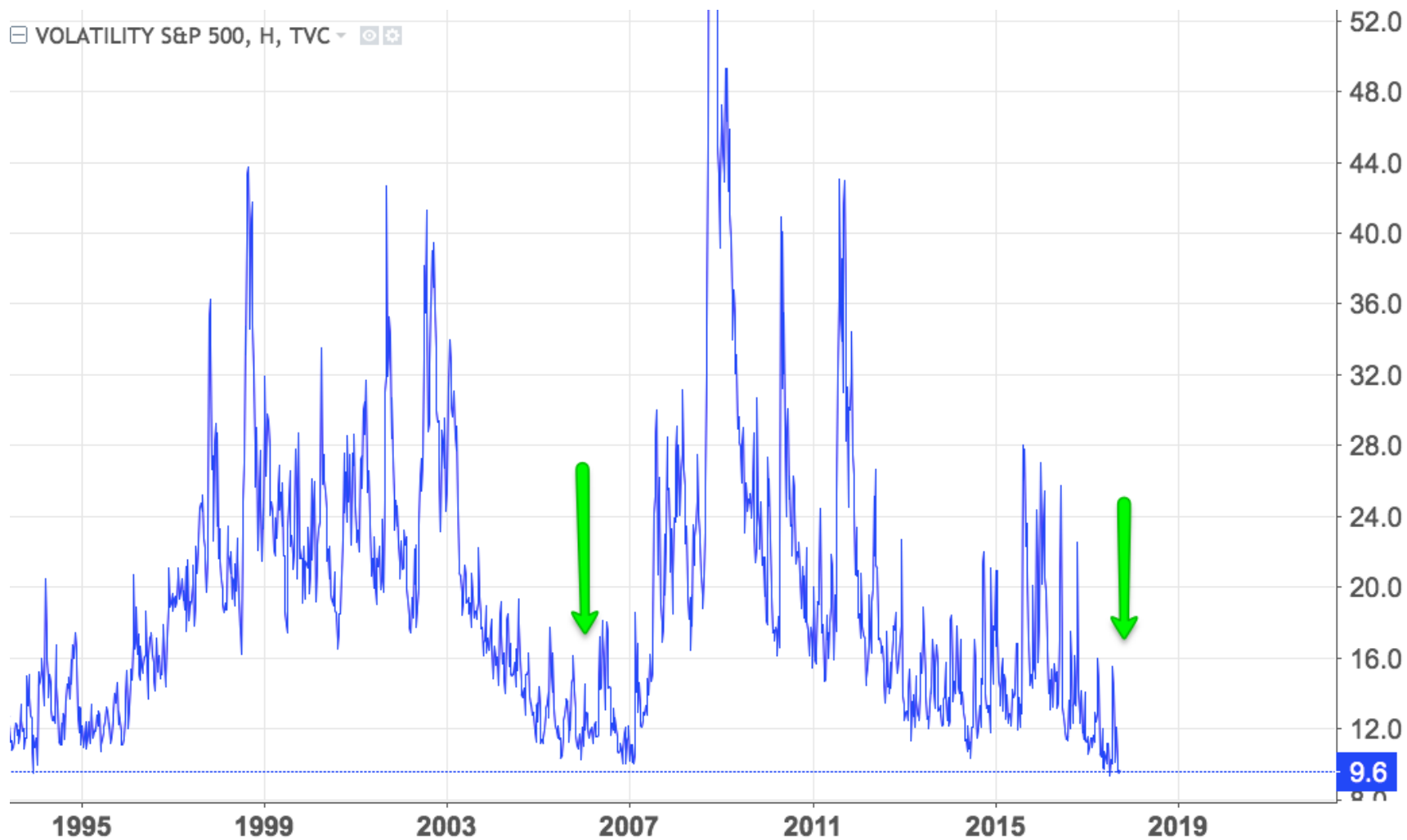


для профессиональных трейдеров

**Волатильность = деньги**



VOLATILITY S&P 500, H, TVC



9.6

в активном трейдинге сейчас **денег НЕТ**

зато деньги **пока есть в инвестициях**

MICEX INDEX, H, MOEX

Рынок закрыт



MICEX INDEX, H, MOEX

Рынок закрыт



# Спекулянты становятся инвесторами, чтобы выжить

## Индекс оптимизма инвесторов Россия

Выделите участок который хотите увеличить



**ТРЕЙДИНГ**

ИТОГ =

**РЕЗУЛЬТАТ**

**МИНУС**

**КОМИССИИ**

**ИНВЕСТИЦИИ**

ИТОГ =

**РЕЗУЛЬТАТ**

**ПЛЮС**

**ДИВИДЕНДЫ**

~ **90%** активных трейдеров

**плохо кончают**



Чем выше кредитное плечо

**ТЕМ БЫСТРЕЕ КОНЕЦ**

ВАМ БУДЕТ СЛОЖНО ОЦЕНИТЬ  
РЕАЛЬНОЕ ЗНАЧЕНИЕ МОИХ СЛОВ  
И ПОВЕРИТЬ МНЕ

“ Я ЖЕ НЕ ТАКОЙ КАК ВСЕ ”

Если вы **РЕГУЛЯРНО** инвестируете,

не используете **кредитное плечо**

и держите **МНОГО** акций

**ПОТЕРЯТЬ ОЧЕНЬ ТЯЖЕЛО**

## СЕРВИСЫ ДЛЯ ИНВЕСТОРОВ SMART-LAB.RU

= КОТИРОВКИ АКЦИЙ =

= НОВОСТИ АКЦИЙ =

= КАЛЕНДАРЬ АКЦИЙ =

= ФОРУМ АКЦИЙ =

= ДИВИДЕНДЫ =

= ФУНДАМЕНТАЛЬНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ =

= ВИРТУАЛЬНЫЙ ПОРТФЕЛЬ =

Что будет дальше?

= Скорее всего, будет бум как в 2006-2008

= много денег/сбережений

= акции дешевы

= ставки падают

= вола низкая

**ЧТО ПОКУПАТЬ?**













ИЩИТЕ АКЦИИ НА

**[smart-lab.ru/q](https://smart-lab.ru/q)**

ОТВЕТЫ НА

**[smart-lab.ru/forum](https://smart-lab.ru/forum)**

# МОЙ ПОРТФЕЛЬ

№	Название			Цена посл	Изм, день %
1	ГАЗПРОМ ао			126.86	+ 0.74%
2	ФСК ЕЭС ао			0.17175	+ 0.12%
3	Сургнфгз			29.785	-0.38%
4	Сургнфгз-п			29.910	0%
5	AGRO-гдр			686	0%
6	IQIWI			999	-1.38%

# Стратегии поведения

1. Держать 100% в акциях в надежде на бум
2. Держать 50% в акциях, 50% в коротких ОФЗ
3. Держать 100% в ОФЗ и ждать кризиса
4. Спекулировать акциями экстрадей
5. Ждать волатильности для спекуляций



## ХУДШИЕ СТРАТЕГИИ:

1. “ШОРТИТЬ” РОСТ из-за того что “дорого”
2. Покупать акции, которые уже многократно выросли
3. Брать слишком много одной бумаги в портфель
4. Спекулировать внутри дня

? Держать доллары ?

# ВОЛАТИЛЬНОСТЬ

1. Измеряйте дневные изменения индекса
2. Когда начнется рост волатильности, а акции на максимумах, это плохой знак
3. Можно уходить из акций в ОФЗ
4. Включать спекулятивные трендовые стратегии

Мало кто ждет кризиса в ближайшее время

Это настораживает

Потому что кризис начинается именно тогда,

когда его никто не ждет