

## **Теория пар траекторий. Новый аналитический метод. Простые пары. Анти пары. Точки продолжения. Точки перелома.**

Теория основана на исследовании динамики изменения цен следующих инструментов: акции ОАО "Газпром", источник данных: Московская Фондовая Биржа, период: 1999 год, валютная пара USD/JPY, источник данных: Росбизнесконсалтинг, период: 1999 год, валютная пара USD/CHF, источник данных: Форексclub, период: 2008 год.

Суть теории пар заключается в том, что существует пара траекторий изменения цены, время начала и конца которых привязано ко времени начала торговой сессии и направление которых всегда устойчиво противоположно друг другу или всегда совпадает.

При этом считается, что направление траекторий совпадает, если обе траектории направлены вверх или обе траектории направлены вниз. Направление считается противоположным, если из двух траекторий одна направлена вверх, а другая вниз.

### **Принцип простой пары:**

Существует пара траекторий изменения цены, время начала и конца которых зафиксировано относительно времени начала торговой сессии и направление которых всегда устойчиво совпадает. Такая пара траекторий называется "простой парой". [Рис. 1]

Если траектории, составляющие простую пару, примыкают друг к другу, то они образуют **точку продолжения** тренда. [Рис. 2]

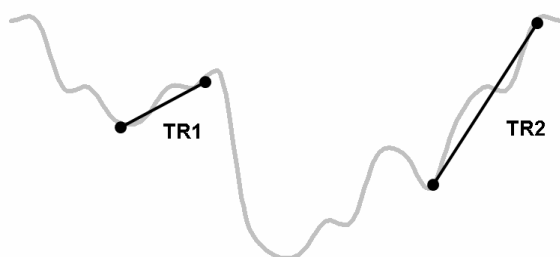


Рис. 1

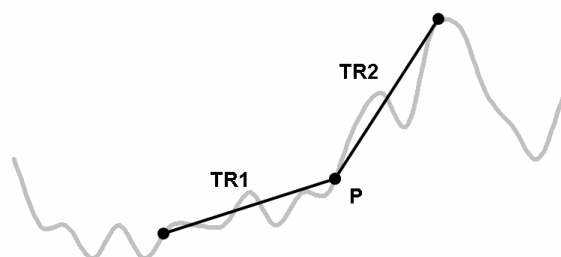


Рис. 2

### **Принцип анти пары:**

Существует пара траекторий изменения цены, время начала и конца которых зафиксировано относительно времени начала торговой сессии и направление которых всегда устойчиво противоположно.

Такая пара траекторий называется "анти парой". [Рис. 3]

Если траектории, составляющие анти пару, примыкают друг к другу, то они образуют **точку перелома** тренда. [Рис. 4]

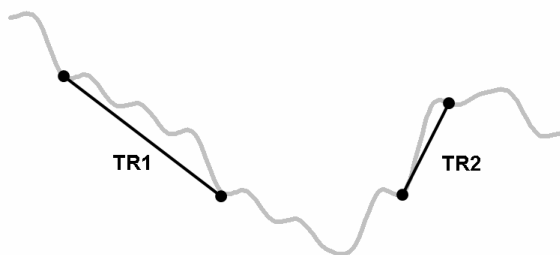


Рис. 3

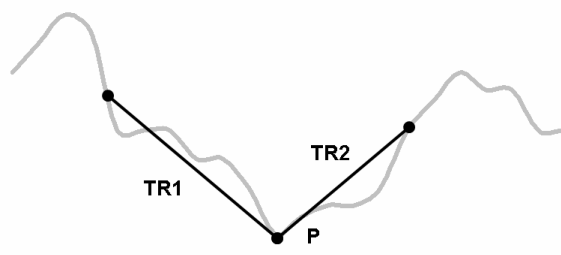


Рис. 4

TR1 и TR2 на рисунках - это обозначение соответственно первой и второй траектории пары. Начало и конец траекторий на рисунках соединены прямой линией. Точки начала и конца траекторий смещены по времени относительно момента начала торговой сессии на постоянную фиксированную величину.

### **Выявленные свойства простых пар и анти пар:**

1. Каждая торговая сессия длительностью  $T$  делится на 5 подсессий длительностью  $T/5$ . Каждая подсессия также может делиться на 5 сессий еще меньшего порядка и так до бесконечности.  
Если для торговой сессии длительностью  $T$  существуют простая пара или анти пара траекторий, то для торговой сессии большего и меньшего порядка также могут существовать простая пара или анти пара траекторий соответственно большего и меньшего порядков с такими же свойствами.  
Например, если в торговой сессии длительностью  $T$  существует анти пара траекторий, образующих точку перелома, удаленную от начала сессии на  $K \times T$ , где  $K$  коэффициент меньший единицы, то для торговой сессии длительностью  $T/5$  также может существовать анти пара, образующая точку перелома, удаленную от начала уже этой сессии на  $K \times T/5$ .
2. Траектории, составляющие простую пару или анти пару, могут располагаться в разных торговых сессиях.
3. Точки начала и конца одной траектории составляющей простую пару или анти пару могут располагаться в разных торговых сессиях.
4. Несколько простых пар или анти пар могут иметь общие траектории.
5. Теория пар может быть применена к динамике изменения активности любых процессов в природе, а не только динамике цен на финансовые инструменты.

### **Аналитический метод, основанный на теории пар.**

Аналитический метод сводится к поиску простых пар и анти пар траекторий, анализу того, какое фактическое направление имеет первая траектория пары и определению исходя из направления первой траектории вероятного будущего направления второй.

Зарабатывать деньги, используя теорию пар очень просто.

Достаточно найти участки TR1 и TR2 торговой сессии, обладающие свойствами простой пары или анти пары, то есть участки торговой сессии, которые всегда имеют одинаковое направление или всегда имеют противоположное направление.

Далее после прохождения рынком первого участка TR1 торговой сессии мы определяем направление движения рынка на этом участке. Зная это направление, мы точно можем определить, как рынок будет двигаться на втором участке TR2 торговой сессии.

В начале участка TR2 мы и будем открывать позицию.

## Статистика торговой стратегии, построенной на основе теории пар.

Начальный депозит: 1000\$

Максимальное плечо: 1:500

Торговый интервал: 6 месяцев

Инструмент: USD/CHF (US Dollar vs. Swiss Franc), период: 1 Минута (M1)

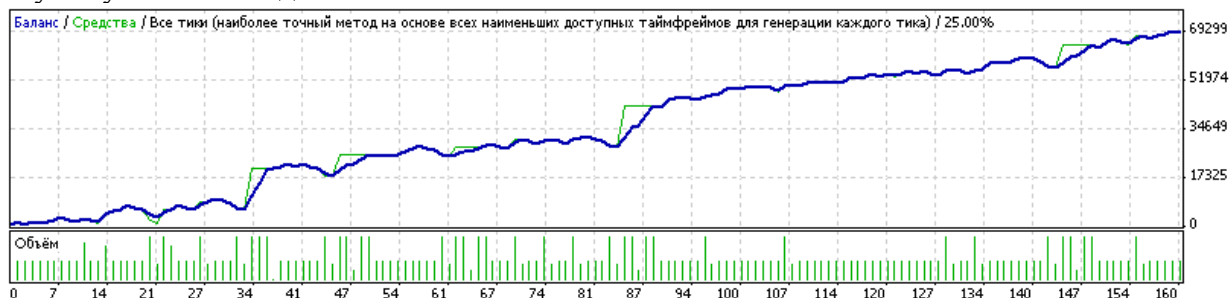
Метод: используется одна точка перелома внутри каждой вечерней 12 часовой торговой сессии.

Начальный уровень TP = 39 pips, SL = 35 pips при размере пункта: 0.0001

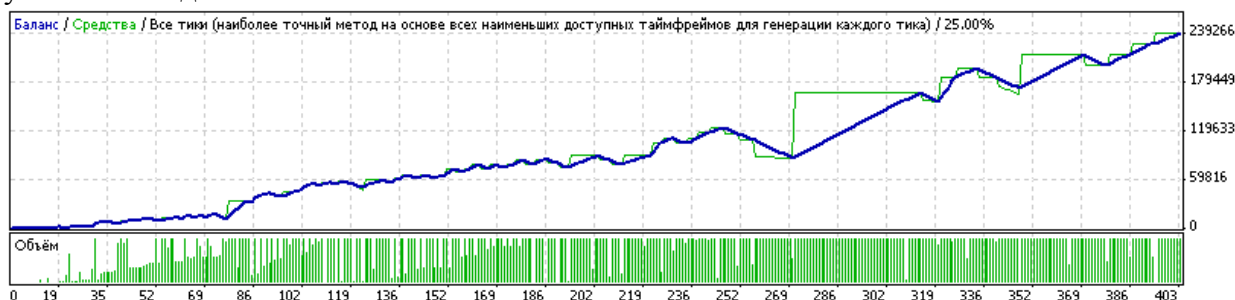
С постоянным лотом:



Без реинвестирования прибыли, но с лимитированной 2-х шаговой прогрессией лота в случае убыточных сделок:



С реинвестированием прибыли и лимитированной 2-х шаговой прогрессией лота в случае убыточных сделок:



Эффективность торговой стратегии, основанной на теории пар, во многом зависит от метода анализа рабочего направления первой траектории пары.

Теория пар позволяет предсказывать изменение трендов активности любых процессов, поэтому существует возможность ее использования и в военных целях.

Наибольший ущерб противнику может быть нанесен в момент, когда тренд активности противника сменяется на нисходящий.

Использование теории пар в бою будет выглядеть примерно так:

В тренде изменения активности любого противника существует точка перелома тренда, когда тренд обязательно сменяется на противоположный. Точка перелома образована анти парой траекторий примыкающих друг к другу и имеющих противоположное направление. Точка перелома фиксирована относительно момента начала боя (взаимодействия).

Если моменту точки перелома предшествует рост активности противника, это значит, что в точке перелома начнется ее падение и, следовательно, в точке перелома необходимо наносить решающий удар. Таким образом, для того чтобы в боксе отправить противника в нокаут достаточно лишь грамотно нанести удар в определенный момент времени, отмеряемый от момента начала боя.



Важно заметить, что определение момента точки перелома, возможно, и не такая уж и сложная задача, ведь у трендов изменения активности вообще всех процессов происходящих в природе точки перелома, точки продолжения, простые пары и анти пары могут оказаться одинаковыми!

Продолжение следует...

Автор теории пар: Андрей Васильев  
Официальный сайт: [www.vassiliev.ru](http://www.vassiliev.ru)

Работу на финансовом рынке начал в 1994 году с торговли предъявительскими ценными бумагами на Центральной Российской Универсальной Бирже (ЦРУБ).

Работал в компании ОАО "ИК БАРРЕЛЬ", являющейся инвестиционным подразделением Нефтяной Корпорации "НИТЭК".