

**МЕЖДУНАРОДНЫЙ ЦЕНТР НАУЧНОГО СОТРУДНИЧЕСТВА  
«НАУКА И ПРОСВЕЩЕНИЕ»**



# **ИННОВАЦИОННЫЕ НАУЧНЫЕ**

# **ИССЛЕДОВАНИЯ:**

## **ТЕОРИЯ, МЕТОДОЛОГИЯ, ПРАКТИКА**

**СБОРНИК СТАТЕЙ ПОБЕДИТЕЛЕЙ МЕЖДУНАРОДНОЙ НАУЧНО-ПРАКТИЧЕСКОЙ КОНФЕРЕНЦИИ  
«ИННОВАЦИОННЫЕ НАУЧНЫЕ ИССЛЕДОВАНИЯ: ТЕОРИЯ, МЕТОДОЛОГИЯ, ПРАКТИКА», СОСТОЯВШЕЙСЯ**

**30 АВГУСТА 2016 Г. В Г. ПЕНЗА**

**ПЕНЗА  
МЦНС «НАУКА И ПРОСВЕЩЕНИЕ»  
2016**

УДК 001.1

ББК 60

Ответственный редактор:

Гуляев Герман Юрьевич, кандидат экономических наук

И43

**ИННОВАЦИОННЫЕ НАУЧНЫЕ ИССЛЕДОВАНИЯ: ТЕОРИЯ, МЕТОДОЛОГИЯ, ПРАКТИКА:** сборник статей Международной научно-практической конференции / Под общ. ред. Г.Ю. Гуляева – Пенза: МЦНС «Наука и Просвещение». – 2016. – 340 с.

ISBN 978-5-9908882-2-7

Настоящий сборник составлен по материалам Международной научно-практической конференции **«ИННОВАЦИОННЫЕ НАУЧНЫЕ ИССЛЕДОВАНИЯ: ТЕОРИЯ, МЕТОДОЛОГИЯ, ПРАКТИКА»**, состоявшейся 30 августа 2016 г. в г. Пенза. В сборнике научных трудов рассматриваются современные проблемы науки и практики применения результатов научных исследований.

Сборник предназначен для научных работников, преподавателей, аспирантов, магистрантов, студентов с целью использования в научной работе и учебной деятельности.

Ответственность за аутентичность и точность цитат, имен, названий и иных сведений, а также за соблюдение законодательства об интеллектуальной собственности несут авторы публикуемых материалов.

УДК 001.1

ББК 60

© МЦНС «Наука и Просвещение» (ИП Гуляев Г.Ю.), 2016

© Коллектив авторов, 2016

ISBN 978-5-9908882-2-7

ИЗМЕНИТСЯ ЛИ СРЕДА ПЕРЕДАЧИ В БУДУЩИХ ВОЛОКОННО-ОПТИЧЕСКИХ СЕТЯХ? ОСЫКО М.С. ....	63
<b>ЭКОНОМИЧЕСКИЕ НАУКИ</b> .....	71
НАЛОГОВЫЕ АСПЕКТЫ ГОСУДАРСТВЕННОЙ ПОДДЕРЖКИ СУБЪЕКТОВ МАЛОГО ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСТВА В УСЛОВИЯХ ГЛОБАЛЬНЫХ ИЗМЕНЕНИЙ СМИРНОВА Е.Е. ....	72
О НЕКОТОРЫХ АСПЕКТАХ МЕТОДИКИ ОЦЕНКИ И ОБОСНОВАНИЯ СТРУКТУРЫ МАТЕРИАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ В УСЛОВИЯХ КРАЙНЕГО СЕВЕРА И АРКТИЧЕСКОЙ ЗОНЫ НЕМТИН В.Г., КАТУН Е.С. ....	83
БУХГАЛТЕРСКАЯ ИНФОРМАЦИЯ - ОТРАЖЕНИЕ СДЕЛОК РАСЧЕТНО-КАССОВЫМ И БЕЗНАЛИЧНЫМ ПУТЕМ МИКУШИНА М.М., ТАРАНОВА А.А. ....	88
СТРАТЕГИЯ ТОРГОВЛИ НА РЫНКЕ ФОРЕКС ПО ПАРЕ EUR/USD НА ОСНОВЕ АНАЛИЗА ОПЦИОННЫХ УРОВНЕЙ НА ВАЛЮТНЫЕ ФЬЮЧЕРСЫ ПО ДАННЫМ ЕЖЕДНЕВНЫХ ОТЧЕТОВ ЧИКАГСКОЙ БИРЖИ (CME GROUP) АНАНЧЕНКО И.В. ....	95
ТУРИСТСКАЯ ДЕСТИНАЦИЯ КАК ФАКТОР РАЗВИТИЯ РЕГИОНА КОТЕНЕВ А.Д. ....	100
ИНТЕЛЛЕКТУАЛИЗАЦИЯ ЧЕЛОВЕЧЕСКОГО КАПИТАЛА В ИНФОРМАЦИОННОЙ ЭКОНОМИКЕ ЖУЙКОВА И.Б. ....	107
КОМПЛЕКСНОЕ РАЗВИТИЕ ИНФРАСТРУКТУРЫ ТУРИЗМА В АЗЕРБАЙДЖАНЕ И ВОПРОСЫ ЕЕ РЕГУЛИРОВАНИЯ АХУНДОВА А. Г. ....	113
КАДРОВЫЙ ПОТЕНЦИАЛ СЕВЕРНОГО РАЙОНА РЕСПУБЛИКИ САХА (ЯКУТИЯ) ПЛАТОНОВ В.П. ....	124
ПОВЫШЕНИЕ ЭФФЕКТИВНОСТИ РАБОТЫ ПЕРСОНАЛА В РЕСПУБЛИКЕ САХА (ЯКУТИЯ) НА ОСНОВЕ СИСТЕМЫ ГРЕЙДОВ КИТИЦА В.В. ....	130

УДК 336.76

# СТРАТЕГИЯ ТОРГОВЛИ НА РЫНКЕ ФОРЕКС ПО ПАРЕ EUR/USD НА ОСНОВЕ АНАЛИЗА ОПЦИОННЫХ УРОВНЕЙ НА ВАЛЮТНЫЕ ФЬЮЧЕРСЫ ПО ДАННЫМ ЕЖЕДНЕВНЫХ ОТЧЕТОВ ЧИКАГСКОЙ БИРЖИ (CME GROUP)

АНАНЧЕНКО И.В.

канд. техн. наук, доцент, доцент кафедры программных систем,  
Университет ИТМО,  
доцент кафедры системного анализа, Санкт-Петербургский государственный  
технологический институт (технический университет)

**Аннотация:** рассматриваются аспекты разработки стратегии торговли на рынке Форекс по паре EUR/USD на основе анализа опционных уровней на валютные фьючерсы по данным ежедневных отчетов Чикагской биржи (CME Group)

**Ключевые слова:** Форекс, торговля, опционные уровни, валютные фьючерсы

**TRADING STRATEGY ON THE FOREX MARKET EUR/USD ON THE BASIS OF THE ANALYSIS OF  
OPTION LEVELS FOR CURRENCY FUTURES ACCORDING TO THE DAILY REPORTS OF THE  
CHICAGO STOCK EXCHANGE (CME GROUP)**

Ananchenko I.V.

**Abstract:** the article discusses the aspects of developing a trading strategy on the Forex market EUR/USD based on the analysis of option levels for currency futures according to the daily reports of the Chicago stock exchange (CME Group)

**Key words:** Forex, trade, optional levels, currency futures

Торговля на Форекс, основанная на данных технического анализа [1, с. 44], без учета данных фундаментального, неточна. Дополнительную информацию о изменениях финансового инструмента можно получить, анализируя данные контрактов по опционам и фьючерсам. Для анализа могут использоваться данные отчетов CME Group – информация Daily Bulletin

([http://www.cmegroup.com/daily\\_bulletin/current/Section39\\_Euro\\_FX\\_And\\_Cme\\$Index\\_Options.pdf](http://www.cmegroup.com/daily_bulletin/current/Section39_Euro_FX_And_Cme$Index_Options.pdf) – доступен для просмотра последний из выпущенных отчетов по EUR/USD). Открываем отчет и находим данные в секции *EURO FX CALL* по опционам на ближайший месяц (в рассматриваемом примере *SEP16* – сентябрь 2016 г., отчет от 26 августа 2016 г.) В колонке **OPEN INTEREST** (4-я справа) находим наибольшее число (Рис. 1): 4745, затем смотрим число в данной строке в первой колонке. Найденное число 1125 делим на 1000 и получаем значение верхней границы ценового уровня, 1.1250, который отметим на графике торгового терминала Metatrader. Находим нижнюю границу уровня. Секция *EURO FX PUT* также для *SEP16* (Рис. 2): 4-я колонка справа наибольшее 5784 – в данной строке в первой колонке 1100 делим на 1000, получаем значение нижней границы ценового уровня 1.1000 (Рис. 3). Ширина между верхней и нижней границей составляет 250 пунктов (четырёхзнак). Значения верхней и нижней границы могут меняться от отчета к отчету, что обусловлено торговой деятельностью крупных игроков, продающих и покупающих опционы, поэтому с выходом очередного отчета следует уточнять новые значения нижней и верхней границы рынка.

EURO FX & CME\$INDEX OPTIONS											
2016 DAILY INFORMATION BULLETIN - <a href="http://www.cmegroup.com/dailybulletin">http://www.cmegroup.com/dailybulletin</a>											
CME Group, Inc.											
20 South Wacker Drive Chicago, Illinois 60605-7499											
PRELIMINARY											
PG39 BULLETIN #1656											
EURO FX & CME\$INDEX OPTIONS											
Fri, Aug 26, 2016 PG39											
EURO FX L (CALL)	EURO FX C (PUT)										
1150		5.25%	3.70	15	144			1	UNOI	27,988	3.25%
1100		2.75%	1.90	8	080			7	UNOI	36,585	1.90%
1110		1.90%	1.30	8	018			12	UNOI	18,498	1.30%
1094								315			
1128		11.30%	9.60	25	250			3	UNOI	35,488	7.50%
1098								3			
EURO FX CALL	EURO FX CALL										
1050		118.90%	119.70	92	1,000			2	UNOI	116,505	98.35%
1055		98.90%	99.70	92	999			1	UNOI	117,500	72.35%
1060		78.90%	79.70	97	997			17	UNOI	118,500	50.90%
1065		59.00%	59.70	93	991			14	UNOI	120,300	41.30%
1070		34.00%	34.70	93	990			7	UNOI	98,600	26.00%
1075		9.00%	9.80	92	985			51	UNOI	100,900	12.70%
1080		34.00%	34.80	95	980			3	UNOI	89,700	78.85%
1085		59.10%	59.90	92	970			38	UNOI	91,300	64.85%
1090		84.10%	84.90	91	915			42	UNOI	81,900	20.90%
1095		99.10%	99.90	90	912			338	UNOI	82,500	17.30%
1005		34.40%	35.20	87	897			480	UNOI	78,000	14.35%
1100		29.70%	31.10	84	848			780		71,800	11.70%
1105		27.10%	17.10	80	780			13	2,500	65,600	9.40%
1110		20.75%	15.10	74	702			64	18,27	61,500	7.15%
1115		16.40%	10.80	66	640			123	14,60	61,800	5.65%
1120		3.80%	6.90	88	888			888	42,45	35,000	3.15%
1125		7.00%	3.70	27	53			418	4,57	31,000	7.45%
1130		4.90%	7.10	28	196			641	14,80	31,800	1.70
1140		5.35%	1.40	19	130			1392	45,40	30,500	1.20
1145		5.75%	7.80	14	191			426	16,92	30,500	9.00

Рис. 1. определение верхней границы рынка (EURO FX CALL)

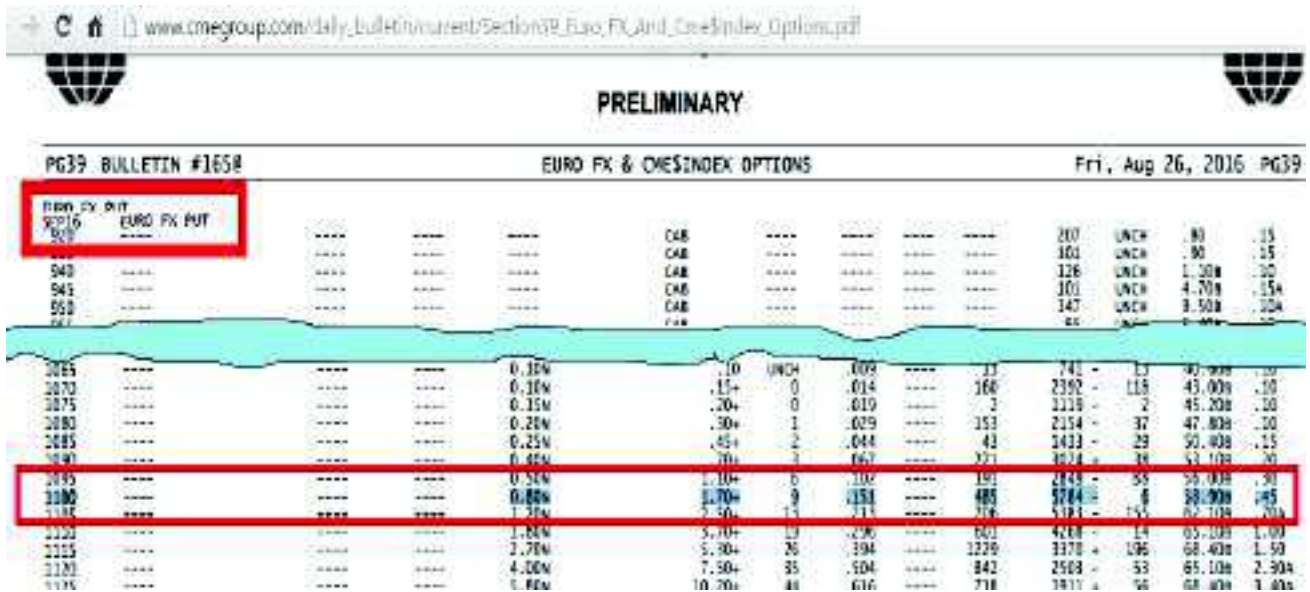


Рис. 2. Определение нижней границы рынка (EURO FX PUT)

Значения текущей цены фьючерса по данным отчета CME Group и текущей цены финансового инструмента EUR/USD на Форекс могут отличаться на несколько пунктов (Forward points), обычно это значение составляет для EUR/USD 1.5-2 пункта, поэтому данным расхождением можно пренебречь.



Рис. 3. Линия начала опционного месяца, линии границ рынка

Основываясь на оперативно обновляемых с каждым новым отчетом границах рынка, называемых (<http://www.forexlife.pro> Роман Анкудинов) границами первого порядка, можно создавать разные системы для торговли на Форекс, конкурентоспособные с существующими [2, с. 5].

Рассмотрим в качестве примера одну из таких торговых систем. Торговлю начинаем после открытия нового опционного месяца. На графике (Рис. 3) начало опционного месяца отмечено вертикальной линией. Цена должна на момент открытия опционного месяца находиться внутри ценового коридора, а расстояние между нижней и верхней границей должно быть достаточным (равно или больше 250 пунктов). Для открытия ордера ждем, пока цена уйдет за пределы границ рынка и закрепится над верхней или под нижней границей (ждем закрытие и последующее открытие рынка, когда цена продолжает находиться вне границ ценового коридора). Время открытия оцениваем по среднеевропейскому времени, так как для торгуемых опционов на валютные фьючерсы используется данное время, отстающее на 2 часа от Московского времени. Если цена находится вне границ ценового коридора и закрепились вне его, то сигнал на открытие сделки – закрытие свечи на часовом графике (H1) по торгуемому направлению (если над верхней границей, то открываем отложенный ордер на продажу, если под нижней, то отложенный ордер на покупку на расстоянии 50 пунктов (4-х знак) от цены закрытия свечи) после 10 часов по Москве (после 8 часов по терминальному, среднеевропейскому времени). Уровень закрытия ордера по убытку (стоплосс) устанавливаем 130 пунктов, уровень закрытия ордера по достижении прибыли (профит) – за противоположной стороной границы рынка (в наиболее простом и менее прибыльном варианте закрываем ордер на границе рынка). Использование отложенного ордера позволяет уменьшить число неудачных входов в рынок с одной стороны, но с другой потенциально уменьшает на 50 пунктов возможную прибыль. Если отложенный ордер до 10 часов по Москве следующего дня не сработал, то ордер удаляется, а процедура анализа ситуации для открытия ордера повторяется по описанному выше алгоритму. После того, как цена ушла на некоторое расстояние в “нашу сторону”, например, 100 пунктов и была получена незафиксированная прибыль, то для защиты

части этой прибыли (исключение убытка, если рынок развернулся не в “нашу сторону”), стоплосс переносим в безубыток. Условия закрытия ордера. Ордер закрывается, если на конец опционного месяца не был достигнут заданный уровень прибыли (профита). Граница уровня прибыли (тейкпрофит), как было отмечено раньше, может быть установлена на противоположной границе рынка или за этой границей, в этом случае необходимо определить условие закрытия ордера. Условием выхода может быть достижение одного из опционных уровней, расположенных за границей рынка. Другой возможный вариант – после пересечения границы рынка решение о закрытии ордера принимается на основе одного из индикаторов, например, может использоваться разработанный автором индикатор **Channel Trading** (доступен для тестирования и покупки <https://www.mql5.com/ru/market/product/9309>). Отметим достоинства и недостатки стратегии. Недостаток – достаточно большое (130 пунктов) значение устанавливаемого стоплосса, достоинство – прибыль от одной сделки может достигать 250-350 и более пунктов, а число прибыльных сделок существенно превышает число убыточных. Следует заметить, что после открытия опционного месяца верхняя и нижняя граница рынка могут отстоять друг от друга на расстояние менее 250 пунктов, совпадать, а также цена открытия может находиться выше или ниже границ рынка. В этих случаях решение об открытии ордера принимается на основе дополнительных условий (в упрощенном варианте можно применять правило – в рынок не входим, ордер не открываем).

### Список литературы

1. Разработка программного обеспечения моделирования торговых стратегий (на примере обработки ситуации ГЭП) Ананченко И.В., Шестаков И.В., Камашев А.О. Успехи современной науки. 2015. № 2. С. 44-47.
2. Разработка программного обеспечения для торговли на рынке Форекс на основе рыночно-нейтральной стратегии оценки изменения коррелирующих валютных пар. Ананченко И.В., Шестаков И.В., Камашев А.О. Успехи современной науки. 2015. № 1. С. 5-8.