

“Статистические законы в пределах времени”

Декабрь 2015г



Автор : Алексей Штернкукер Skype alex.shternkuker

Введение в теорию.

Статистические законы действуют в пределах времени и места, в которых они обнаружены.

Полная и достоверная статистическая информация является тем необходимым основанием, на котором базируется процесс управления экономикой. Вся информация, имеющая на графике в конечном счете, обрабатывается и анализируется с помощью статистики.

Говоря о статистике следует помнить, что цифры в статистике не абстрактные, а выражают глубокий экономический смысл. Каждый должен уметь пользоваться статистическими цифрами, анализировать их, уметь использовать для обоснования своих выводов.

Введение в теорию.

Окружающий мир состоит из массовых явлений. Если отдельный факт зависит от законов случая, то масса явлений подчиняется закономерностям. Для обнаружения этих закономерностей используется закон больших чисел.

На первой стадии исследования применяются методы массового наблюдения, собирается первичный статистический материал. Основное условие - массовость, т.к. закономерности проявляются в достаточно большом массиве данных в силу действия закона больших чисел

От того, как собран первичный статистический материал, как он обработан и сгруппирован в значительной степени зависят результаты и качество всей последующей работы, а в конечном итоге при нарушениях могут привести к абсолютно ошибочным выводам.

Введение в теорию.

На всех стадиях исследования статистика использует различные методы. Методы статистики - это особые примеры и способы изучения массовых явлений.

На второй стадии исследования, когда собранная информация подвергается статистической обработке, используется метод группировок. Применение метода группировок требует неизменного условия - качественного построения совокупности.

На третьей стадии исследования проводится анализ статистической информации с помощью таких методов как метод обобщающих показателей, табличный и графический методы, методы оценки вариации, балансовый метод, индексный метод.

Введение в теорию.

Аналитическая работа должна содержать элементы предвидения, указывать на возможные последствия складывающихся ситуаций.

Метод статистического наблюдения

К статистическому наблюдению предъявляются следующие требования: полнота охвата изучаемой совокупности, достоверность и точность данных, их однообразии и сопоставимости.

Статистическое наблюдение осуществляется в двух формах: отчетность и специально организованное статистическое наблюдение.

Сводка и группировка материалов

Сводка - это операция по обработке конкретных единичных фактов, образующих совокупность и собранных в результате наблюдения. В результате сводки множество индивидуальных показателей относящихся к каждой единице объекта наблюдения, превращаются в систему статистических таблиц и итогов, проявляются типические черты и закономерности изучаемого явления в целом.

Проведение сводки включает следующие этапы:

выбор группировочного признака;

определение порядка формирования группы;

разработка системы показателей в целом;

разработка макетов таблиц для представления результатов сводки.

Ряды динамики

Рядом динамики называется ряд последовательно расположенных во времени статистических показателей, которые в своем изменении отражают ход развития изучаемого явления.

Ряд динамики состоит из двух элементов: момента или периода времени, которым относятся данные и статистических показателей (уровней). Оба элемента вместе образуют члены ряда. Уровни ряда обычно обозначают через "у", а период времени - через "t".

Заключение

Рассмотрев основные методы статистического исследования, становится отчетливо видно, что такая наука, как статистика оказывает незаменимую помощь в решении экономических вопросов и во многом способствует развитию и учета времени в любых процессах.

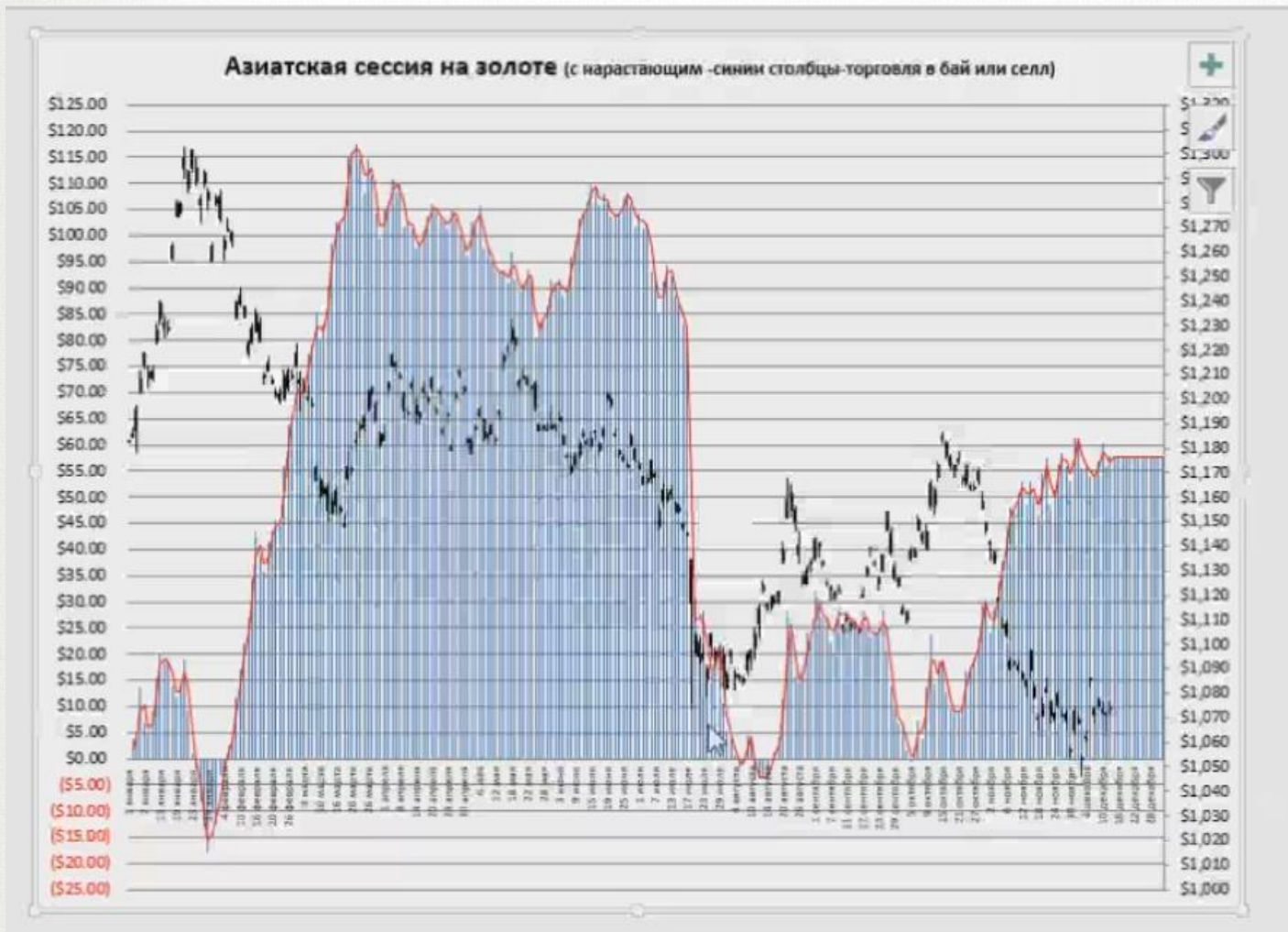
Учитывая тот факт, что влияние статистики распространяется на управленческую и экономическую деятельность, можно заключить что эта наука очень важна для функционирования роста и успешности. Применение статистических данных и проведение статистического наблюдения, с последующим анализом полученной информации, - неотъемлемая часть деятельности любого аналитика, трейдера.

Правильно проведенный сбор, анализ данных и статистические расчёты позволяют информацией о развитии экономики, о направлении её развития, показать эффективность использования рычагов, определить паттерны роста цен и влияние торговли на сам рынок.

Практика Исследования

Выявления торговой сессии на рост или падения

ПРИМЕР Азия



Практика Исследования Выявления торговой сессии на рост или падения

ПРИМЕР Европа



Практика Исследования

Выявления торговой сессии на рост или падения

ПРИМЕР Америка



Практика Исследования

Волновой анализ

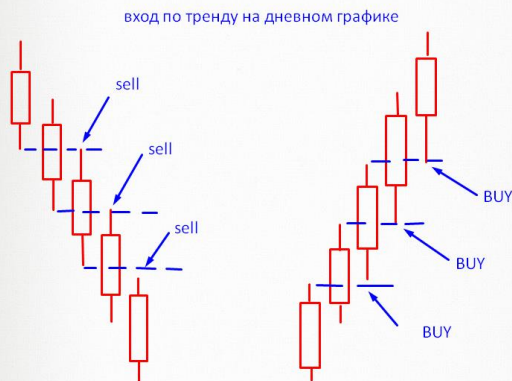
Таблица дней Золота

3 волна	100	Тренд	2012.10.05	188	21					15			99					37			16								
					3	2	9	5	2	5	5	5	19	21	21	27	11	11	13	13	2	5	4	1	4				
4 волна Зигзаг	106	А	2013.06.28	44	18								10								16								
					3	3	4	4	4												4					1	3	3	5
					33					10			25					6			13								
					3	4	7	14	5	3	2	5	5	2	13	4	1	2	1	3	2	2	3	5	1				
С	2013.12	55	14					10			12					9			10										
			4	2	3	3	2	3	3	4	2	2	4	1	3	2	4	3	1	1	2	2	4						
5 волна	405	1 волна	2014.03.17	156	57					28			59					12			11								
					12	9	7	23	6	8	10	10	14	9	21	9	6	4	5	3	2	3	3	2	1				
		2 волна	2014.11.07	53	23								10								20								
					8	8	1	4	2				4								4					2	6	2	6
		3 волна	2015.01.23	188	38					43			50					57			35								
5	4				5	12	12	13	20	10	15	10	13	3	9	20	28	9	3	6	12	5	9						
4 волна	2015.11.30	8	8								0								0										
			2	6																									

Практика Исследования

Допустим вы решили исследовать паттерн на предмет входа
Для примера возьмем паттерн на продолжение на дневном графике.

Что для этого нужно!



1. Сколько торговых дней в месяце
2. День недели входа
3. АТР месяца (для цели)
4. Сессия входа (Азия, Европа, Америка)
5. Вход к объему недели или против .
6. Вход к объему месяца или против.
7. Стоп количества пунктов (тиков)

На выходе вы получаете

1. торговых дней 25 в году.
2. вход был пн =1 вт=7 ср = 7 чт=4 пт= 6
3. АТР мес средний 700 тик
4. пн = вход Азия. (пример)
5. вход от объема недели 20 раз (продолжение) и 5 раз к объему.
6. вход от объема месяца 20 раз (продолжение) и 5 раз к объему.
7. стоп средний 70тиков .

Отчете становится ясно ,что входы которые были в американскую, европейскую сессию приводили к убытку, независимо от дня недели.

А вот входы в азиатскую сессию приводили к прибыли независимо от дня недели.

Если вход осуществлялся в начале месяца, то профит приносил по АТР в соотношении 1 к 8 , вход в середине месяца, всегда на след баре был профит, но потом выбивало по б\у.

Со стопом статистика не собиралась . (Видео комментарии)

Практика Исследования

Самое главное исследуйте ваши паттерны на предмет времени когда он образован с точностью до часа ,возможно это станет вашим фильтром и поможет исключить убыточные ситуации на рынке.

На чем проводить Исследования времени.

Объем контракт, месяца, недели, дня.(к чему от чего вы торгуете)

АТР месяца, дня, свечи. (для свечей учет спреда)

Уровни опционной линейки(очень применима на золоте)

День недели ,месяца, количество торговых дней в месяце.

Время бара

И многое другого.