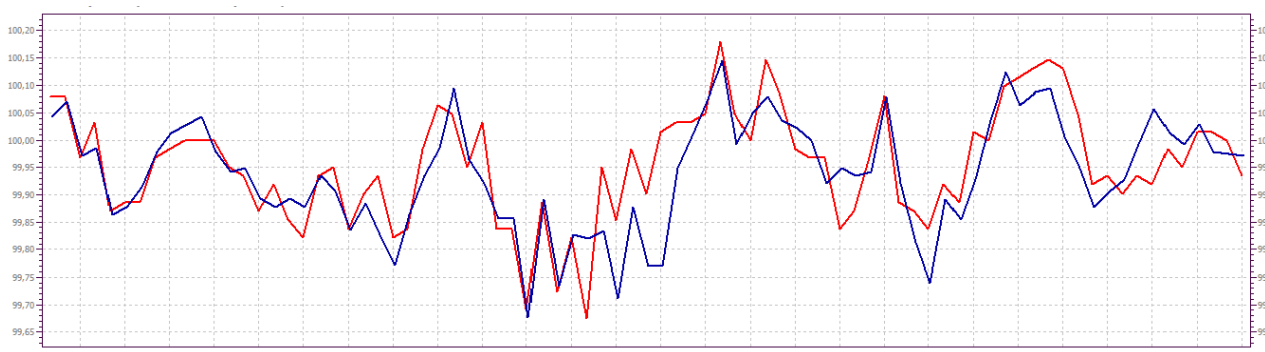


Стратегия Кэп-1

Стратегия Кэп-1 представляет собой вариацию на тему Парного трейдинга. Для начала следует отобрать инструменты с положительной корреляцией. Берем два графика и смотрим, насколько один повторяет другой. Далее нужно совместить индикаторы Momentum у этих инструментов. Временной интервал графика ставим «1 минута», период индикаторов подбираем от 5 до 30 (но периоды должны быть одинаковыми). В терминале QUIK должно быть примерно так:



Заходить в сделку следует при большом расхождении, оно определяется по историческим данным. Как только момент для захода наступает, необходимо продать инструмент, который наверху и купить инструмент, находящийся внизу. Позицию необходимо закрыть при схождении линий.

