

Солодова Елизавета Владимировна

студентка

ФГБОУ ВО «Юго-Западный государственный университет»

г. Курск, Курская область

«ПРИНЦИП МАРТИНГЕЙЛА» ДЛЯ РАБОТЫ В БИНАРНЫХ ОПЦИОНАХ

Аннотация: в данной статье рассматривается принцип «Мартингейла» для работы в бинарных опционах на примере схемы бинарных опционов, а также рассматриваются его преимущества и недостатки.

Ключевые слова: бинарный опцион, опцион, принцип «Мартингейла», цифровой контракт.

Каждый начинающий инвестор пребывает в поиске стабильной и надежной системы торговли, которая бы обеспечивала стабильный доход. Подавляющее большинство актуальных методов, предполагает использование дополнительных инструментов. Разумеется, что все это влечет за собой необходимость тщательного изучения тонкостей торгового процесса, однако, не каждый вкладчик располагает свободным временем, которое можно было бы потратить на изучение новых стратегий. Особенно это касается торговцев, которые пытаются совмещать торговлю бинарными опционами и основную работу.

Исходя из всего сказанного выше, необходимо соответствующее решение - обеспечивающее простую, но в тоже время весьма прибыльную систему трейдинга.

Одной из наиболее простых, но в тоже время эффективных систем для работы с цифровыми контрактами является «принцип Мартингейла».

Стратегия Мартингейла не является профильной системой для работы с бинарными опционами, скорее это принцип управления финансовыми активами, т.е. собственным капиталом [1, с. 23–24].

Таким образом, «принцип Мартингейла» считается не полноценной, независимой стратегией, а лишь видом системы управления рисками, которая

предполагает планомерное наращивание торгового лота. Базируется рассматриваемый метод на математических основах, а именно теории вероятности. Постоянно увеличивая ставку на покупку опциона, с каждым разом увеличивается вероятность положительного исхода торговой операции.

Схема расчета торгового лота по стратегии «принципа Мартингейла» выглядит следующим образом:

При трейдинге бинарными опционами инвестор работает с фиксированным профитом и рисками, что существенно упрощает заключением прибыльной торговой операции. В среднем, доходность цифрового контракта колеблется в диапазоне 70–85%, детали зависят от брокерской фирмы, с которой сотрудничает торговец [2, с. 200].

Чтобы наглядно понять, как работает стратегия «принцип Мартингейла» в бинарном трейдинге, смоделируем конкретную ситуацию. Предположим, что инвестор работает с брокером, который выплачивает 80% от суммы инвестируемых средств за верный прогноз. Таким образом, чтобы покрыть прошлую, т.е. проигрышную сделку, необходимо увеличить размер торгового лота на размер процентного отчисления, непосредственно в нашей ситуации это значение составляет 0,8.

Следовательно, при первоначальной сделке в размере одного доллара, следующая торговая операция заключается 1 доллар и 25 центов. В том случае, если вторая по счету сделка принесет прибыль, то суммарный доход составит 2 доллар и 25 центов. В этой системе трейдинга расчет делается на полное перекрытие убыточной торговой операции, в результате осуществляется безубыточная торговля.

Специфика увеличения торгового лота отражена в таблице бинарных опционов.

Таблица

№ ставки	Ставка в \$	Накопленный убыток, в \$	Ожидаемый выигрыш, в \$
1	1	1	1,8
2	1,25	2,25	2,25

3	2,82	5,07	5,076
4	6,34	11,41	11,41
5	14,27	25,68	25,69
6	32,1	57,78	57,78
7	72,23	130,01	57,78
8	162,52	292,53	292,54
9	365,67	658,2	658,21
10	822,75	1480,95	1480,95

Из указанной выше таблицы отчетливо видно, что при девяти убыточных торговых операциях, совершенных подряд, общая сумма просадки составит практически 660 доллара. Однако если десятая сделка окажется прибыльной, то в итоге торговец получит примерно 1500 долларов.

Основные сильные и слабые стороны стратегии «принцип Мартингейла» [3, с. 45–46] Если руководствоваться отзывами инвесторов, которые уже пробовали эту стратегию на практике, то можно спокойно определить основные преимущества и недостатки. Разумеется, что перед тем как начать торговать по этой схеме, следует проанализировать эту информацию и сделать определенные выводы.

Ключевые преимущества [3, с. 146]:

Применение системы трейдинга «принцип Мартингейла» можно составлять прогнозы ценового движения, опираясь на простые математические расчеты.

Если инвестор применяет проверенный метод торговли, то тогда серия проигрышных торговых операций не будет продолжительной, соответственно, просадка спокойно перекрывается профитом, и инвестор выходит в плюс.

Что касается слабых сторон рассматриваемой стратегии, то следует выделить следующие аспекты:

Значительное увеличение размера торгового лота требует наличия внушительного торгового счета.

Если инвестор начинает использовать стратегию «принцип Мартингейла» и опирается на данные таблицы бинарных опционов, но при этом у него небольшой торговый счет, то он может рассчитывать на проигрыш.

Разумеется, что окончательно решение, несомненно, остается именно за торговцем. Однако эксперты рекомендуют использовать этот метод управления капиталом только в том случае, если в распоряжении инвестора есть прибыльная стратегия, которая стабильно приносит порядком 70% профита. В результате, убыточные серии сделок не будут превышать отметку в 5 торговых операций.

Использование рассмотренного принципа в «чистом» виде превратит торговлю бинарными опционами в обыкновенную игру в рулетку. Шансы получить прибыль составляют 50:50, естественно, что это далеко не самый выгодный способ проведения бинарных опционов.

Список литературы

1. Иванова Е.В. Опционный контракт: феномены регулирования // Международные банковские операции. – 2009. – №3. – С. 109.

2. Колмыкова Т.С. Модель системы управления рисками инновационных проектов / Т.С. Колмыкова, Э.В. Ситникова // Известия Юго-западного государственного университета. Сер. Экономика. Социология. Менеджмент. – 2014. – №1. – С. 198–203.

3. Ситникова Э.В. Повышение инвестиционной привлекательности региона в решении проблем его устойчивого сбалансированного развития / Э.В. Ситникова, П.В. Сергеев // Регион: системы, экономика, управление. – 2013. – №4. – С. 145–152.

4. Чесноков А.С. Инвестиционная стратегия, опционы и фьючерсы / Под ред. Э.А. Азроянца. – М.: ПАИМС, 2012. – С. 223.

5. Таблица бинарных опционов [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://richinvest.biz/binarnye-opciony/tablica-binarnyx-opcionov> (дата обращения: 26.11.2018).