



ПО МАТЕРИАЛАМ ЖУРНАЛА FORTRADER.ORG

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА

часть 2

О РАБОТЕ ТОРГОВЫХ СТРАТЕГИЙ

- Как выбрать хорошую торговую стратегию?
- Как оценить прибыльность торговой стратегии?
- Пересиживание убытка на валютном рынке
- Как из запаздывающего индикатора сделать работающий Грааль

СОДЕРЖАНИЕ

Не муки выбора стратегии	4
Глава 1. Как выбрать хорошую торговую стратегию	5
Глава 2. Коэффициент R. Оцениваем успешность вашей торговли	10
Глава 3. Коэффициент Шарпа. Оцениваем эффективность стратегии	14
Глава 4. Коэффициент Кальмара: оценка торговых счетов по просадке	18
Глава 5. Зоны поддержки и сопротивления. Новый взгляд трейдера	23
Глава 6. Путь к Граалю. Индикаторы технического анализа	29
Глава 7. Как из запаздывающего индикатора сделать работающий Грааль ...	33
Глава 8. Реинвестирование или разгон депозита.....	39
Глава 9. Пересиживание убытка	44
Глава 10. Безопасный Мартингейл. Как отдельными элементами увеличить прибыльность стратегии	49
Глава 11. Торговая стратегия «Искусство не соглашаться». Не следуй за толпой!	63
Глава 12. Об адаптации валютных стратегий под бинарные опционы	68
Заключение	74



Время торговать с Grand Capital!

Стабильность: работаем с 2006 года.

Прогресс: эволюционируем с каждым годом.

Ответственность: работаем в интересах трейдеров.

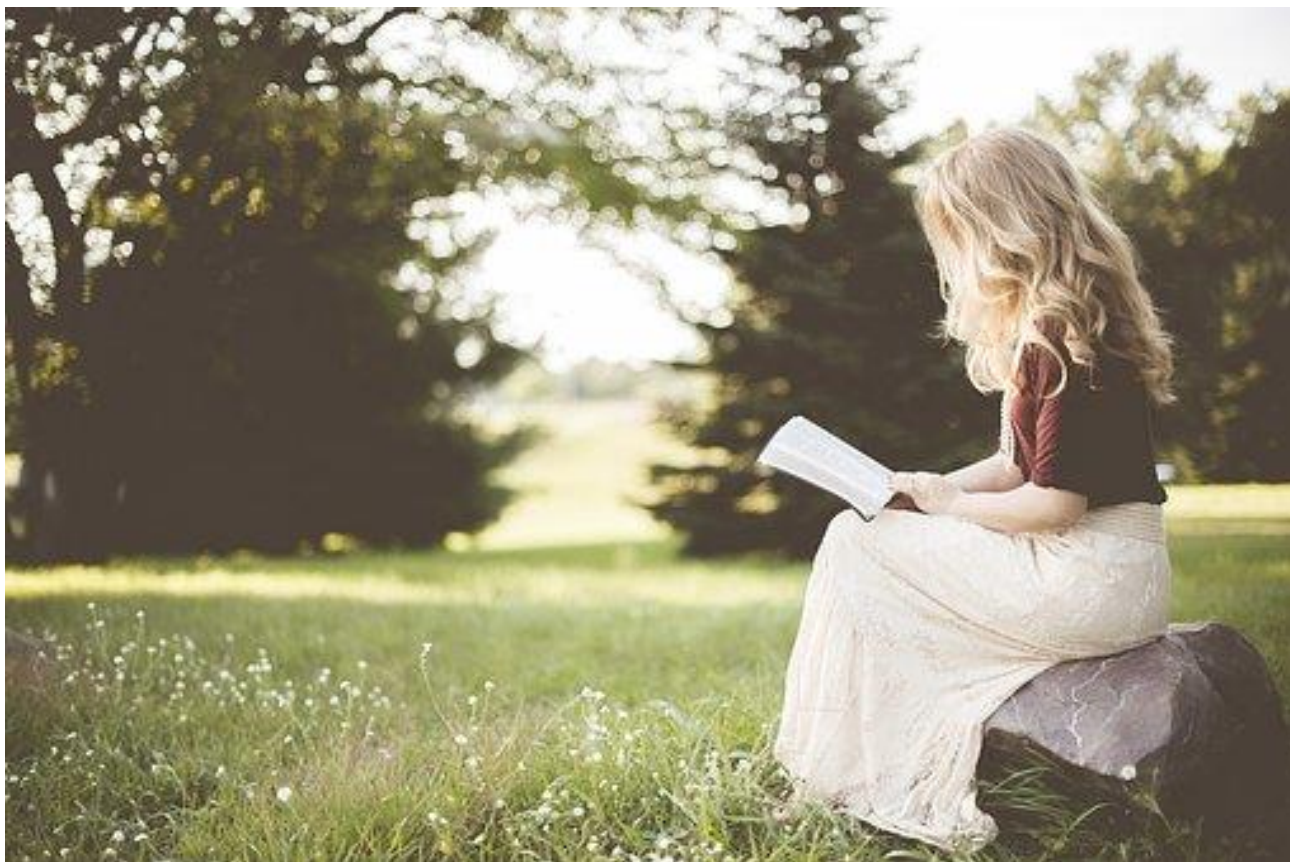
Реальные бонусы – бонус 40% при активной торговле можно перевести в собственность. Прибыль с бонуса – выводимая! Выдерживает просадку.

- Спреды ниже 1 пункта в 4-м знаке.
- Исполнение - тысячные доли секунды.
- Более 330 инструментов.
- Ненавязчивый сервис.
- Профессиональные торговые платформы.
- Мобильная торговля.

Зарегистрироваться

grandcapital.ru

Не муки выбора стратегии



Часто в статьях по психологии трейдинга написано, что торговая стратегия – это половина успеха на Форекс. Вторая половина – это состояние ума спекулянта. В какой-то степени это верно, однако, мы считаем, что нет никакого деления, совместимость трейдера с тактикой – это внутренняя часть хорошей стратегии. Но подойти к вопросу выбора нужно ответственно.

Четвертая книга журнала Фортрейдер посвящена хитростям трейдера по оценке и работе с тактиками на валютном рынке. Мы рассмотрим вопросы выбора стратегии, подбора индикаторов, улучшения некоторых стандартных правил анализа и управления капиталом. И даже модифицируем тактику под смежный рынок.

Конечно, все эти вопросы давно обсуждались в среде спекулянтов, и внимательный трейдер знает ответы на них все, однако тому, кто только начал свой путь на валютном рынке или же не особенно любит трейдерские сообщества, книга придется очень кстати в качестве подспорья в том, что является самым важным для прибыльной торговли. Да и опытным спекулянтам будет интересно напомнить себе давно подзабытые, но столь важные правила выбора торговой стратегии, а также найти интересный лайфхаки, как улучшить ее работу.

Приятного прочтения!
С уважением, Юлия Апель

Глава 1

Как выбрать хорошую торговую стратегию



Как из всего многообразия на валютном рынке выбрать действительно хорошую торговую стратегию?

Каждый трейдер рано или поздно приходит к мысли, что важнейшим инструментом для получения прибыли на валютном рынке является торговая стратегия. Профильные ресурсы предлагают множество всевозможных систем, по словам авторов, являющихся высоко прибыльными и максимально эффективными. Как из всего многообразия выбрать действительно хорошую торговую стратегию?

Что такое торговая стратегия и зачем она нужна

Торговая стратегия на валютном рынке – это свод правил в форме алгоритма, который дает возможность прогнозировать движение актива, учитывая ситуацию на рынке, и получать при выполнении этого алгоритма определенную прибыль.

Например, это может быть комбинация нескольких технических индикаторов: открытие и закрытие будет осуществляться только при определенном совпадении их значений.

Справедливости ради стоит отметить, что торговой стратегии, гарантирующей 100%-ную прибыль, не существует. При этом прибыльность стратегии совершенно не зависит от «свежести» индикаторов. Вы можете использовать как самые новые и лучшие индикаторы, так и уже давно себя зарекомендовавшие традиционные, это не сделает стратегию универсальной и суперприбыльной.

Но, что более важно, для начала необходимо подобрать именно «подходящую» стратегию. Дело в том, что каждый трейдер видит рынок по-своему. К этому стоит добавить и характерные особенности личности, например, темперамент и эмоциональную устойчивость. Именно поэтому одна и та же стратегия может приносить одному трейдеру прибыль, а другому убытки.

Каждому трейдеру свою стратегию

Импульсивным трейдерам стоит обратить внимание на агрессивные торговые стратегии, при правильном их использовании это позволит получать весомую прибыль. Это могут быть внутридневные стратегии, скальпинг, а также стратегии, построенные с использованием метода Мартингейла.

Спокойным и терпеливым трейдерам больше подойдут среднесрочные и долгосрочные трендовые стратегии, обладающие минимальным уровнем риска и обеспечивающим стабильный рост депозита.

Оцениваем метод прогнозирования стратегии

На финансовых рынках принято выделять три основных подхода к прогнозированию цены актива:

- **Фундаментальный анализ**

В первую очередь, торговые стратегии, основанные на фундаментальном анализе, подразумевают наличие у трейдера определенных знаний. Чтобы прогнозировать движение цены, трейдер должен четко понимать функционирование рыночных механизмов, влияние ключевой макроэкономической статистики на курсы национальных валют, внимательно следить за новостным фоном и экономическим календарем. Этот способ прогнозирования больше подходит для трейдеров, ориентирующихся на долгосрочную перспективу.

- **Технический анализ**

Торговые стратегии, в основе которых лежит технический анализ, построены на прогнозировании цены путем выявления рыночных закономерностей. Для этого используются графические построения (уровни поддержки и сопротивления, круглые и технические уровни), фигуры ТА и свечные паттерны, а также показания технических индикаторов.

В большинстве случаев такие стратегии имеют четкие правила открытия сделок, установки ордеров стоп-лосс и тейк-профит. Получение прибыли тут сводится к четкому следованию этим правилам.

Торговых стратегий, построенных на инструментах технического анализа, очень много – от скальпирующих и трендовых, до канальных и пробойных.

- **Комбинированный подход**

Как вы уже поняли, комбинированный подход подразумевает комплексное использование двух способов анализа, описанных выше. Это «высший пилотаж» трейдинга, который подойдет только опытным трейдерам, обладающим необходимыми знаниями и практическим опытом.

Оцениваем временные характеристики стратегии

Не у каждого трейдера есть возможность проводить целый день у торгового терминала. Кто-то может потратить на трейдинг 6-8 часов, сделав его основным занятием, а кто-то всего 1-2 часа, и торговля на валютном рынке используется как способ дополнительного заработка.

Исходя из этого, необходимо оценить временной показатель стратегии. Если вы можете позволить себе выделить на торговлю всего несколько часов в день, то лучше всего вам подойдут средне- и долгосрочные торговые стратегии, и ни о каком скальпинге, пипсовке и дейтрейдинге не может быть и речи.

Но, если вы тратите на рынок намного больше времени, это не значит, что ваш удел – пипсовка и скальпинг. Это значит, что, в принципе, для выбора вам доступен весь спектр стратегий.

Оцениваем характеристики риска

В первую очередь стоит помнить, что уровень риска является спутником уровня прибыли – чем выше прибыль, тем выше и торговые риски. Например, стратегии, построенные на использовании метода Мартингейла, обладают заоблачной прибыльностью, но и риск слить депозит находится на примерно том же уровне. По этой причине, торговую стратегию стоит оценивать сначала по факторам риска, а уже потом смотреть ее прибыльность.

В описании большинства стратегий содержатся рекомендации по управлению капиталом. Оцените потенциальные потери серии убыточных сделок в зависимости от ваших правил манименеджмента и размера депозита.

Также отметим, что по какой-то причине многие начинающие трейдеры считают, что количество обязательно должно перейти в качество – чем больше сделок они будут открывать, тем больше прибыли в итоге получат. Именно поэтому у новичков повышенной популярностью пользуются скальпинговые и внутрисуточные торговые стратегии.

Однако следует помнить, что чем меньше используемый таймфрейм, тем больше рыночный шум, соответственно, выше и риск.

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

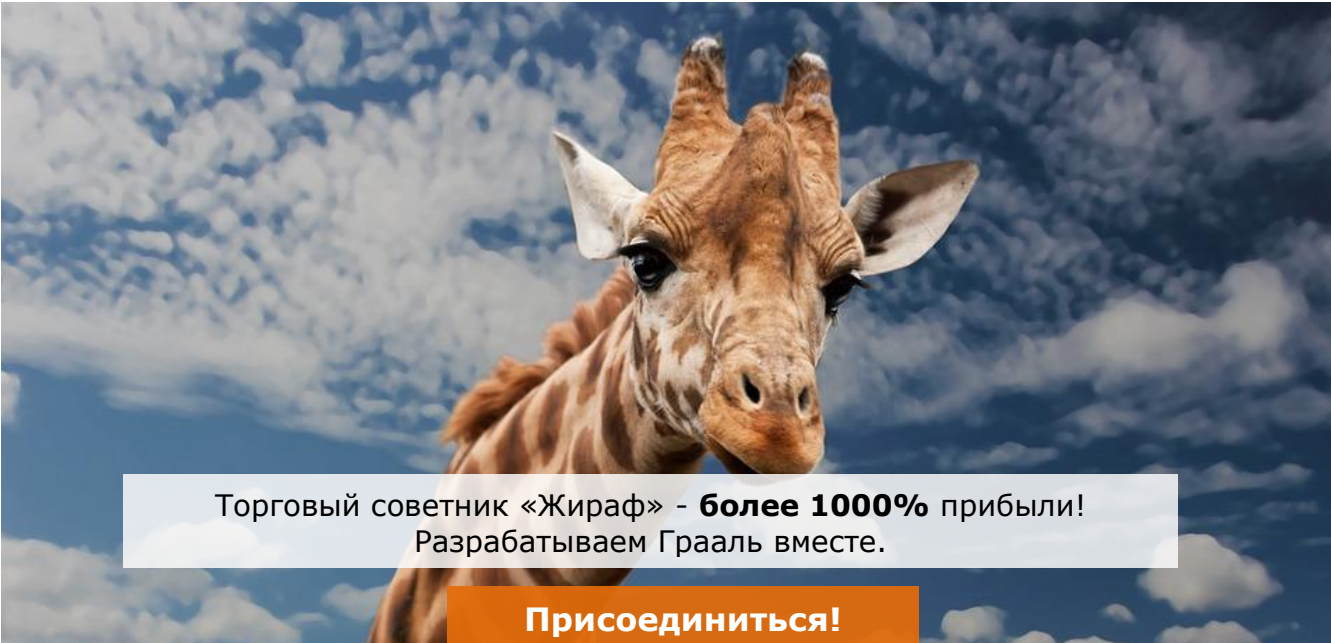
Стратегий «хочу все и сразу» с минимальным уровнем риска не бывает. Долгосрочная трендовая стратегия подразумевает небольшой риск убытка, но прибыль придется ждать очень долго. Эту прибыль можно «наколотить» скальпингом и пипсовкой, но риск получить убыток также будет высоким.

Оценить торговую стратегию на практике поможет тестер стратегий, дав для размышления первичную информацию по соотношению риск/прибыльность.

Выбор хорошей торговой стратегии при всем имеющемся изобилии «прибыльных», «эффективных» и «лучших» — дело, отнюдь не простое, требующее от трейдера полной отдачи. Об этом написано множество статей и даже книг, и наша будет об этом.

Безусловно, приведенная выше информация – это только начало. Например, для более глубокой оценки эффективности стратегий опытные трейдеры используют коэффициенты R, Шарпа и Кальмара, о которых мы поговорим ниже. Все дело только в вашем желании стать обладателем прибыльной торговой стратегии. Ведь, как вы яхту назовете, так она и поплывет. Как вы подойдете к выбору стратегии, такую прибыль и получите.

#



Торговый советник «Жираф» - **более 1000%** прибыли!
Разрабатываем Грааль вместе.

Присоединиться!

Глава 2

Коэффициент R: оцениваем успешность вашей торговли



Как оценить эффективность торговой стратегии через размер потенциального убытка? Используем коэффициент R.

Первую главу книги мы закончили на идее о том, что эффективность торговой стратегии важно проверять различными способами, чтобы видеть ее потенциал. Как правильно оценить прибыльность торговой стратегии и работы трейдера? По уровню прибыли это будет не совсем корректно. Поэтому используется соотношение прибыли к риску.

Давайте спросим у нескольких трейдеров, сколько они заработали за месяц на валютном рынке. Один ответит, что его месячная прибыль составила 1000 долларов, второй – 700, а третий – 500. Из этого можно сделать вывод, что эффективнее всех торгует первый трейдер. Но такой способ оценки далек от профессионализма и грешит однобокостью.

Как же правильно оценить успешность своего трейдинга? В этом деле на помощь трейдеру приходит R-коэффициент.

Оценка прибыли и риска

Для начала приведем обычную ситуацию: имеются два трейдера, торгующие на валютном рынке. Каждый из них закрыл сделку с прибылью в 100 пунктов. Казалось бы, сделки равнозначны, но для понимания необходимо вникнуть в детали:

- прибыль по сделке трейдера №1 составила 100 пунктов, при этом был выставлен стоп-лосс в размере 50 пунктов;

- прибыль по сделке трейдера №2 равна тем же 100 пунктам, но стоп-лосс был выставлен в размере 300 пунктов.

Если взглянуть на обычную статистику трейдинга, то эти сделки ничем не будут отличаться, поскольку принесли одинаковое количество прибыли в пунктах.

В этом и состоит вся суть проблемы – оценка статистики оставляет за рамками то количество денег, которые находились в зоне риска.

По этой причине оценка эффективности торговли с точки зрения объема полученной прибыли и является однобокой. Более четкую картину дает оценка премии за риск.

Для первого трейдера она составила 2 к 1, а для второго 0,33 к 1. Как говорится, разница налицо – риски трейдера №2 в целых шесть раз превышали риски трейдера №1! Именно для определения премии за риск и используется коэффициент R.

Что такое коэффициент R?

Под символом R подразумевается размер потенциального убытка, который трейдер может получить в одной сделке. Грубо говоря, R – это размер ордера стоп-лосс, который может быть выражен в пунктах, в валюте депозита или процентах.

Как правило, эта величина выражается в процентах по отношению к текущему депозиту. Допустимым уровнем риска для одной торговой сделки принято считать диапазон от 2 до 5% от имеющегося депозита. Мы будем рассматривать минимальные риски. Это значит, что величина R будет равна 2%.

Например, у трейдера есть депозит в 10 тыс. долларов. Соответственно, максимальная величина убытка для одной сделки будет равна 200 долларов. То есть, если при планировании сделки размер стоп-лосс будет превышать R=200 долларов, то такую сделку открывать нельзя – трейдер не может позволить себе терять денег больше, чем это допустимо расчетами.

Получив убыток в 200 долларов, считается, что трейдер потерял 1R. При этом, если трейдер получил серию убыточных сделок, а депозит составляет меньше 10 тыс. долларов, методика оценки коэффициента R подразумевает, что величина потенциального убытка остается без изменений на уровне 200 долларов.

Кратность коэффициента R и ведение статистики

Для одной сделки все рассчитывается достаточно просто и не вызовет никаких затруднений у трейдера при наличии знаний математики в объеме средней школы. Однако проблемы начинаются при ежедневных расчетах большого количества сделок и ведении статистики торговли.

Не спешите огорчаться? на самом деле, все намного проще, чем кажется. Коэффициент R применяется для каждой отдельно взятой сделки, а для ведения статистики используется общий R-кратный коэффициент. На практике это выглядит следующим образом.

Трейдер открыл сделку и установил стоп-лосс в размере $R=200$ долларов. Однако цена еще не достигла убытка, но трейдер уже понял, что его прогноз был ошибочным. Естественно, ждать закрытия сделки по стопу смысла нет. Допустим, трейдер закрыл сделку вручную с убытком 50 долларов. В статистику заносится ее результат: $-0,25R = \text{прибыль} / \text{риск} = -50 / 200$ долларов.

Соответственно отображается и прибыль. Например, сделка была закрыта вручную, не достигнув тейк-профита, с прибылью 342 доллара. В статистику идет результат: $1,71R = \text{прибыль} / \text{риск} = 342 / 200$ долларов.

В дальнейшем показатели по каждой сделке складываются. В результате трейдер получает показатель, отражающий уровень полученной прибыли в соотношении с установленным уровнем риска. Это дает возможность объективно оценить эффективность трейдинга, чем просто значения полученной прибыли или убытка в пунктах или валюте депозита.

Как говорит один из членов форума трейдеров forexsystemsru.com: «я на Форекс за деньгами пришел, а не для того, чтобы умным быть». Вполне возможно, что многие с ним согласятся, сочтя метод излишне академическим и не желая утруждать себя какими-то расчетами, сосредоточившись на выборе прибыльной торговой стратегии, поисках индикатора-Грааля и 100%-прибыльного робота.

К сожалению, ни то, ни другое, ни третье не даст трейдеру ответы на вопросы

- как прибыльно я торгую?
- Насколько хороша моя торговая стратегия?
- Хороший ли я вообще трейдер?

Именно использование коэффициента R позволит найти нужные вам ответы, увеличить эффективность своей торговли, адекватно оценивать и управлять своими торговыми рисками.

#

Глава 3

Коэффициент Шарпа: оцениваем эффективность торговой стратегии

Коэффициент Шарпа является одним из самых распространенных показателей на валютном рынке, с помощью которого можно определить эффективность как отдельной торговой стратегии, так и инвестиционного портфеля.

Формула Шарпа

Как мы говорили в предыдущей главе, универсальной оценкой торговых стратегий принято считать соотношение дохода от торговых операций, совершенных в рамках стратегии, и принимаемых трейдером рисков в рамках той же стратегии.

Коэффициент Шарпа является выражением этого отношения, соответственно, чем оно выше, тем эффективнее применяемая стратегия.

Коэффициент Шарпа рассчитывается по формуле:

$$\text{Sharp} = \frac{\text{Средняя избыточная доходность}}{E(R - R_f) / \text{Среднее отклонение или волатильность}} \cdot \text{Si}$$

R - доходность

R_f - безрисковый доход

Si - стандартное отклонение доходности (волатильность)

Рис. 1. Формула коэффициента Шарпа.

С первого взгляда, формула кажется довольно сложной, но в практике все намного проще и понятнее. В числителе формулы находится величина среднего торгового дохода за определенный период. При этом стоит отметить, что при расчете не учитывается сумма дохода, полученная от безрисковых активов (банковский депозит и прочее).

В знаменателе находится показатель риска, который представляет собою среднее отклонение от среднего показателя доходности. Риск находится в прямой зависимости от волатильности финансового инструмента. В итоге, выполнив деление, получаем коэффициент Шарпа.

Если коэффициент оказался ниже нуля, это свидетельствует о том, что эффективность актива является крайне низкой. Если коэффициент Шарпа превышает значение 1, это расценивается как показатель позитивной эффективности. Тем не менее, автор формулы рекомендует принимать за оптимальное значение коэффициента число около 2.

Стоит отметить, что подобные активы на рынке встречаются крайне редко.

Оценка стратегий через показатель

Информацию по результатам торговых операций берем из вкладки «Отчет» торгового терминала MetaTrader 4. Средняя доходность нам нужна в процентном выражении от величины первоначального депозита за требуемый для анализа период.

Далее определяем величину риска, за которую принимаем среднее значение волатильности валютной пары или другого финансового инструмента. Среднюю волатильность конкретного инструмента можно узнать через любой онлайн-сервис или же калькулятор волатильности. Делим показатель доходности на показатель риска, получаем коэффициент Шарпа.

Коэффициент Шарпа удобен в применении для сравнения эффективности двух торговых систем. Если у обеих стратегий одинаковая доходность, но показатель риска выше у первой, то и коэффициент Шарпа у нее окажется меньше, что свидетельствует о ее меньшей эффективности по сравнению со второй стратегией.

Нюансы определения эффективности ПАММ-счетов

Коэффициент Шарпа может применяться и для сравнения эффективности ПАММ-счетов. Однако, стоит отметить, что здесь существует определенная трудность: как правило, прибыльные управляющие торгуют портфелями и не особо делятся информацией об их составе. Тем не менее, при копировании сделок эффективность управляющего ПАММ-счета можно подсчитать, поскольку пользователь видит все используемые инструменты. Помимо этого, некоторые ПАММ-сервисы указывают уже рассчитанный коэффициент Шарпа своих управляющих.

Подробнее об этом можно прочитать в нашей [3 книге «Эффективные валютные инвестиции»](#).

Недостатки коэффициента Шарпа

Не избежал коэффициент Шарпа и определенных недостатков. Например, если сделки осуществляются с низкой периодичностью, но при этом имеют высокий уровень дохода, то коэффициент Шарпа при этом будет низким. Причиной этого является высокая средняя волатильность такого дохода.



Рис. 2. Прибыльность стратегии 1.



Рис. 3. Прибыльность стратегии 2.

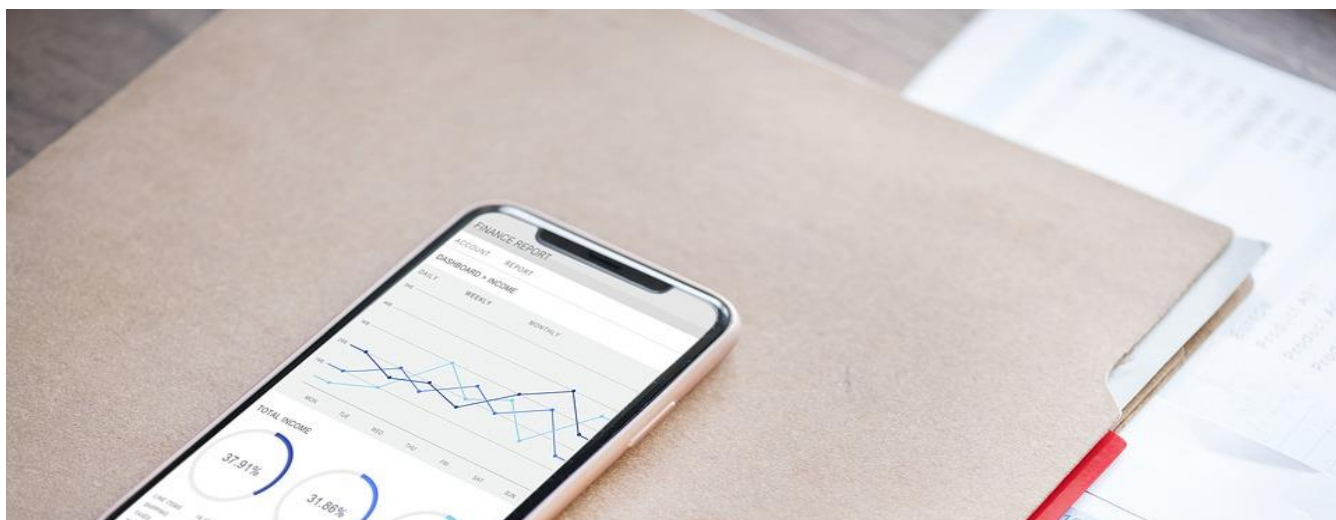
Примеры показаны на рисунках. Первая и вторая стратегии имеют разную прибыльность, а коэффициент Шарпа для них существенно отличается.

Подведя итоги, можно сделать вывод, что коэффициент Шарпа, несмотря на кажущуюся сложность, является практическим показателем эффективности стратегий и финансовых активов, что дает любому трейдеру возможность провести сравнение своей торговой системы с любой другой.

#

Глава 4

Коэффициент Кальмара: оценка торговых счетов по просадке



В предыдущих главах книги мы рассмотрели удобные инструменты оценки эффективности стратегий, активов и ПАММ-счетов – коэффициент Шарпа и коэффициент R. Теперь поговорим о еще одном способе анализа прибыльности торговых счетов, основанном на просадке, – коэффициенте Кальмара.

Просадка на валютном рынке и ее виды

Стопроцентно успешных трейдеров на валютном рынке не бывает. Об этом знают все – от новичка до профессионала. Каждый трейдер в торговле периодически терпит убыток. Однако если использовать грамотное управление капиталом, то эти минусы через какой-то промежуток времени окупаются. Для понимания сути коэффициента Кальмара сначала необходимо разобраться, что стоит за термином «просадка».

Просадка – это потери или убытки по депозиту, открытому для ведения торговой деятельности на биржах. Чаще всего величину просадки оценивают в процентах от начальной или максимально достигнутой суммы – 100%.

Просадка при торговле на валютном рынке отображает влияние убытка на состояние депозита. Она бывает двух видов:

- Фиксированная – убыток, полученный при закрытии убыточных сделок.
- Текущая – убыток, получаемый по сделкам, которые еще не закрыты и имеют отрицательную величину. Баланс при этом не меняется, но количество средств на депозите уменьшается.

К примеру, имеется депозит 5000 долларов. Трейдер открывает две позиции, которые начинают приносить суммарный убыток 1000 долларов. Несмотря на то, что

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

баланс депозита остается равным 5000, доступных средств остается только 4000. Соответственно, текущая просадка составляет 1000 долларов. Если оставить сделки открытыми, просадка может уменьшиться и даже перейти в прибыль, однако возможно и ее увеличение до уровня стоп-лосса или же вплоть до потери всего депозита.



Рис. 4. Пример убыточной сделки.

Показатель просадки используется в описаниях стратегий и ПАММ-счетов. Поэтому, при выборе тактики, торгового советника или счета для инвестиций необходимо обратить внимание на величину просадки, которая покажет эффективность того или иного инструмента.

Напомним, что просадку обозначают в процентах. Например, на вашем депозите 500 долларов, вы получили убыток 250 долларов. Просадка в процентном отношении составляет 50%. Таким образом, чтобы вернуться к первоначальному количеству средств, вам необходимо отработать 100%. Если в описании стратегии, ПАММ-счета или эксперта обозначена эффективность 60%, то 40% являются возможным убытком, заложенным в стратегию.

Также имеет место понятие максимальной просадки. Грубо говоря, это минимальное значение, до которого опускались ваши средства. Этот показатель позволяет провести эффективную оценку всех убытков, полученных во время тестирования стратегии. Если не учитывать максимальную просадку в соотношении с остальной статистикой, уровень риска неизбежно увеличится, повысив вероятность «слива» депозита.

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

Исходный депозит	1000.00				
Чистая прибыль	1235.45	Общая прибыль	2286.07	Общий убыток	-1050.63
Прибыльность	2.18	Матожидание выигрыша	4.68		
Абсолютная просадка	9.30	Максимальная просадка	268.40 (14.18%)	Относительная просадка	14.18% (268.40)
Всего сделок	264	Короткие позиции (% выигравших)	136 (86.03%)	Длинные позиции (% выигравших)	128 (82.81%)
		Прибыльные сделки (% от всех)	223 (84.47%)	Убыточные сделки (% от всех)	41 (15.53%)
Самая большая		прибыльная сделка	26.04	убыточная сделка	-120.00
Средняя		прибыльная сделка	10.25	убыточная сделка	-25.63

Рис. 5. Максимальная просадка в детализированном отчете МТ4.

С просадкой все ясно, теперь можно переходить, собственно, к коэффициенту Кальмара.

Коэффициент Кальмара: расчет и практическое применение

Автором коэффициента Кальмара является Тэрри Янг. Он аналогичен стандартному показателю, оценивающему отношение доходности и риска, за одним исключением. В формуле коэффициента Кальмара в числителе стоит так называемый сложный процент, выражающий средний геометрический доход. Чем больше временной период, за который учитываются сделки, тем объективнее значение показателя. В знаменателе стоит значение максимальной просадки.

Коэффициент Кальмара = $CAGR / MaxDrawdown$, где

- CAGR – средняя геометрическая доходность торговли за период (оптимально от года и более).
- MaxDrawdown — значение максимальной просадки за выбранный период.

Отметим еще один важный момент: при расчете коэффициента Кальмара не учитывается динамика роста средств. Можно учитывать и ее, но такие расчеты займут слишком много времени и не будут отличаться точностью. Зато по коэффициенту Кальмара очень просто определить эффективность стратегии или торгового робота. Например, годовая доходность эксперта составила 70%, максимальная просадка – 14%. Таким образом, показатель эффективности эксперта будет равен 5.

Принято считать, что для успешной торговой стратегии коэффициент Кальмара должен составлять не меньше 3. При получении значения меньше 3, тактику или торгового робота необходимо оптимизировать.

Безусловно, коэффициент Кальмара не является единственно верным и на 100% эффективным средством оценки эффективности инструмента, однако, в комплексе с другими показателями, он может оказать существенную помощь трейдеру при выборе стратегии, торгового эксперта или ПАММ-счета. #

Авторские курсы



Пользуйтесь опытом и знаниями профессионалов и зарабатывайте в плюс с первых шагов в трейдинге.

Выберите один или несколько курсов. Узнайте тонкости торговли!

Основы валютного рынка
Экспресс-курс для новичков

Бинарные опционы от А до Я
Для тех, кто хочет научиться торговать опционами в плюс

Умная торговля на финансовых рынках
Объемный курс с погружением в различные торговые системы, большим количеством практики, контролем торговли преподавателем.

Автоматическая торговля на валютном рынке
4 вида советников, настройка, запуск, извлечение прибыли из алгоритмической торговли.
Практическая отработка навыков.

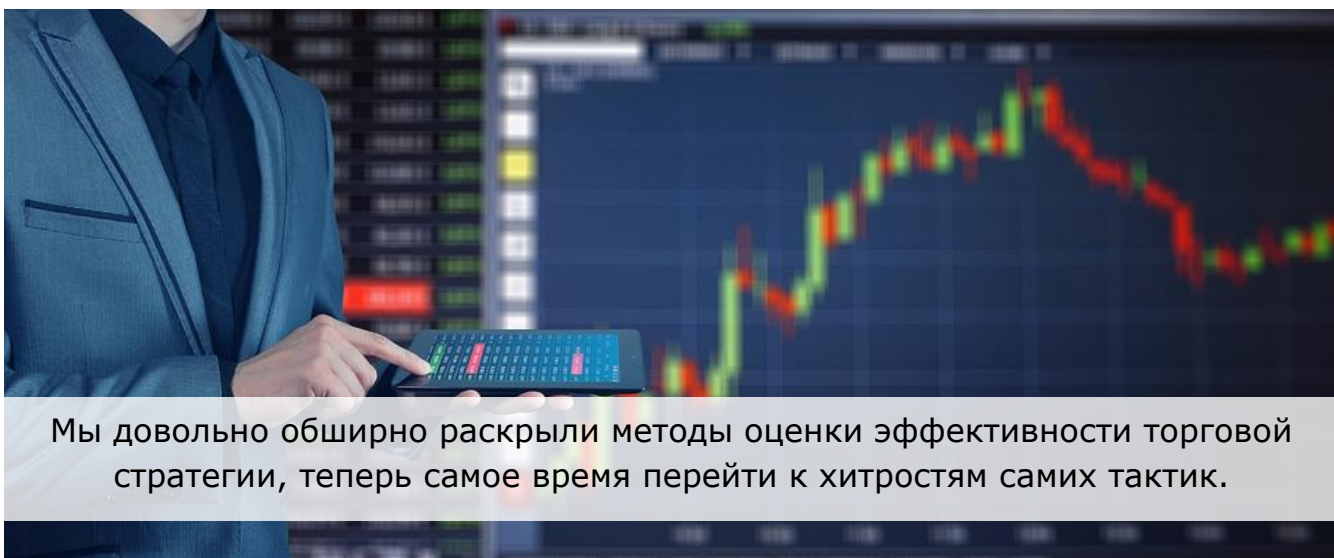
[Записаться на курсы](#)

Авторские курсы ведет
Евгений Богурев,
трейдер-практик,
аналитик и
преподаватель

Более 500 успешных учеников
Секреты от гуру
100% работающая система
обучения

Глава 5

Зоны поддержки и
сопротивления. Новый взгляд
валютного трейдера!



Мы довольно обширно раскрыли методы оценки эффективности торговой стратегии, теперь самое время перейти к хитростям самих тактик.

На самом деле, на рынке Форекс стратегий существует великое множество, но не все так страшно. Во-первых, многие из них повторяются, особенно спустя некоторое время, т.к. рынку свойственна цикличность. А во-вторых, многие хитрости применимы практически к каждой стратегии, потому что разнообразие приемов, из которых состоят стратегии, не такое большое. В 5 главе начнем говорить о поддержках и сопротивлениях.

Зоны поддержки и сопротивления на валютном рынке – это расширенные уровни, которые также строятся по экстремумам, но при этом расширяются с тем, чтобы уменьшить количество ложных сигналов на вход.

Технические уровни на графиках строят все – и матерые зубры трейдинга и зеленые новички. Построение уровней поддержки и сопротивления – это, пожалуй, первое, чему учится пришедший на валютный рынок трейдер.

Казалось бы, что тут сложного? Провел линию через локальный минимум – вот тебе и уровень поддержки, через максимум – вот и сопротивление готово. А между тем, в таком способе построения кроется серьезная ошибка, приводящая к упущенным входам в сделку или неправильным входам. Как же правильно строить уровни поддержки и сопротивления? Обсудим.

Не уровни, а зоны

Для начала эксперты журнала Фортрейдер предлагают напомнить формулировку ценового уровня на валютном рынке.

Ценовой уровень – это область или зона значений, которую цена не может сразу преодолеть.

Обратите внимание на слова «область или зона значений», именно в них кроется подвох. Проводя линию на графике через максимум или минимум, трейдер

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

обозначает конкретное ценовое значение, в зависимости от которого трейдер и определяет что произошло – пробой или откат.



Рис. 6. Пример уровней поддержки и сопротивления, построенных по максимумам и минимумам.

Для большего понимания возьмем один из построенных на часовом графике уровней. Например, это уровень сопротивления в паре евро/доллар, построенный по цене 1,23966.



Рис. 7. Уровень сопротивления в паре EUR/USD, построенный на графике H1.

А теперь посмотрим на тот же уровень на меньшем временном интервале. Как вы сами можете убедиться, здесь уже он работает немного не так, как на H1.

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2



Рис. 8. Этот же уровень сопротивления на таймфрейме M5.

В первом случае можно было бы открыть сделку на продажу на отбое от уровня сопротивления, но трейдер этого не сделал, поскольку цена не дошла до нарисованной им отметки. Во втором случае была бы открыта длинная сделка на пробое уровня. В лучшем случае, она принесла бы совсем небольшую прибыль или закрылась бы по безубытку. В худшем – сделка принесла бы убыток.

Но если бы сопротивление было построено не в виде линии, а в виде области, то тогда картина выглядит совсем иначе. Отчетливо видно, что цена не смогла преодолеть зону сопротивления, и в этом случае сделка на продажу на отскоке от зоны была бы открыта.



Рис. 9. То же сопротивление в виде зоны.

Как вы сами можете убедиться, использование зон поддержек и сопротивлений более эффективно, чем использование просто линий.

Откуда берутся зоны сопротивления и поддержки

Каждый трейдер знает, что технический анализ – это основа трейдинга. Спросите у любого трейдера, он вам сразу же скажет, что ордер тейк-профит нужно выставлять у противоположной линии тренда, а стоп-лосс – выше или ниже предыдущего локального максимума или минимума. И таких трейдеров на валютном рынке миллионы. Так вот зоны сопротивления и поддержки – это именно те места, в которых трейдеры и располагают свои тейк-профиты и стоп-лоссы.

Скопления этих ордеров очень важны – когда цена доходит до них, то сотни тысяч, например, стоп-лоссов срабатывают практически одновременно. Соответственно, цена получает внушительный импульс для дальнейшего движения.

Однако, трейдеры – не роботы, поэтому значения стоп-лоссов отличаются, хоть и находятся в пределах одного узкого диапазона. Именно этот диапазон и является зоной поддержки или зоной сопротивления.



Рис. 10. Пример зоны сопротивления.

Строить такие ценовые зоны достаточно просто. Достаточно найти на графике соответствующую реакцию цены и на ней выделить соответствующую зону. Пролитайте историю – вы убедитесь, что нанесенные вами зоны действительно работают и намного эффективнее, чем проведенные по экстремумам линии.



Рис. 11. Зоны поддержки и сопротивления.

Итак, используя в торговле зоны поддержки и сопротивления, трейдер четче видит рыночную картину и не пропустит сигнал на открытии позиции в отличие от трейдера, который оперирует обычными техническими уровнями. «Классический» трейдер просто не будет открывать сделку, поскольку цена не дошла до его уровня.

Зоны сопротивления и поддержки будут работать на любом временном интервале, отличаться будет только их ширина. Попробуйте этот метод, и вы увидите, что ваша торговля станет эффективнее.

#

Торгуем онлайн

Обсуждаем советников

Обсуждаем работу брокеров

Занимаемся поисками
Грааля

FOREXSYSTEMSRU.COM
Присоединяйтесь!

Глава 6

Путь к Граалю. Индикаторы технического анализа



Как применять индикаторы технического анализа правильно? Как выбрать из многообразия индикаторов? Что необходимо понимать и знать об индикаторе? Еще один лайфхак трейдера в отношении торговых стратегий.

Казалось бы, что проще – поставил индикатор и торгуй, благо в Интернете их миллионы. Однако как разобраться в таком количестве? Как выбрать именно то, что будет подходить вам, вашему менталитету и навыкам? Обсудим этот вопрос в 6 главе нашей книги.

Многим трейдерам анализ технических индикаторов кажется священным Граалем. Мол, если с классическим анализом заработать не получилось, то магические сложные индикаторы обязательно принесут прибыль. Ведь их строит компьютер, а компьютер же умнее человека.

Зачем я, Буренка, тебя продаю?

Частенько, когда трейдеры узнают о технических/компьютерных индикаторах, их посещает вопрос: а зачем же их создатели, продают «Буренок», которые тоннами дают молоко? Ответ прост: на самом деле в стандартной раскладке и при стандартном применении индикаторы не умеют давать денег больше, чем методы классического технического анализа. Они хороши для тех, кто рассчитывает на скромную доходность в 30-40% годовых, но кому анализ визуальный неудобен.

Кто-то скажет: «Эх, мне бы такую скромную доходность...» Кто-то удивится, что пользовался индикаторами и ждал миллионы процентов годовых, и был жестоко обманут. Попробуем дать несколько простых советов даже не о том, как

оптимизировать индикаторные стратегии, а о том, что в первую очередь о них нужно знать. Огромное количество трейдеров, годами торгуя по индикаторам, не выполняют элементарную технику безопасности обращения с ними.

Техника безопасности для технических индикаторов

Каждый сверчок знай свой шесток

Прежде чем использовать индикаторы, в первую очередь стоит посчитать, удовлетворяет ли вас среднее количество сигналов в год. Большинство потерь у новичков происходит не из-за плохих индикаторов, а так как они берут фильтры с редкими сигналами. И между точками входа трейдеры умудряются сделать тысячи интуитивных сделок.

Бывает и наоборот, трейдер выбирает неверный таймфрейм или слишком мелкий период индикатора и не успевает делать часть сигналов или вообще искусственно их фильтрует, и в итоге – результат плачевный, ибо хорошие входы и выходы упущены.

Почему люди не считают количество сигналов до того, как начинают пользоваться индикаторами? Просто многие не знают и не догадываются, что это нужно делать. На курсах для новичков учитель им дает Грааль в руки и говорит: «Пользуйтесь!» Плохой учитель? Нет! Просто не все слышат про таймфрейм, про то, на каких активах нужно применять индикатор. Рынок бесспорно самоподобен, но это правило распространяется на классический технический анализ. Индикаторы же чаще создавались под какую-то свою более узкую задачу.

Совет: Ищите длинную историю пары на нужном вам таймфрейме. Пока ее у вас нет, у вас не будет спокойствия и уверенности в вашей индикаторной системе.

Знай, кто это все затеял!

Из первого пункта сразу вытекает второй. Необходимо строго представлять, кто создал индикатор и зачем.

О, сколько бы неприятностей удалось избежать, если бы индикаторы Дж. Уэллс Уайлдера младшего использовались на высоколиквидных ценных бумагах, с соблюдением особой уайлдеровской системы риск менеджмента. Сколько бы денег люди не потеряли, если бы перестали использовать полосы Боллинджера на инструментах, остро реагирующих на новости. Эра благоденствия и богатства трейдеров началась бы, если бы, наконец, они воссоединили разорванную систему Била Вильямса воедино и перестали разлучать его индикаторы и пользоваться ими по отдельности.

Совет: Не торгуйте по индикатору, создателя которого или хотя бы идею не знаете. С некоторыми авторами можно познакомиться почти лично. Бизнес продажи

компьютерных индикаторов молод и создатели многих живы, процветают и имеют сайты.

Будьте реалистами, требуйте невозможного!

Выше мы уже говорили, что многие трейдеры ждут от индикаторов вовсе не то, что те умеют. И это касается не только количества сигналов, но и качества. А проще говоря, доходности!

Сейчас доступны программные средства, которые позволяют быстро прогнать на истории индикатор, проверить все ваши идеи, а при наличии небольших навыков программирования еще и сделать это автоматически. Это большое подспорье в поиске хороших сигналов индикаторов, не отказывайтесь от него, не ленитесь.

Совет: Проверяйте на истории доходность всех прошлых сигналов, играйте с фильтрами и критериями их получения, отмечайте силу сигнала на растущих и падающих трендах.

Глас толпы

Кстати, о толпе. Многие начинающие трейдеры, которые берутся анализировать рынок с помощью индикаторов, тратят много времени на подбор своих параметров для них. Они придумывают просто невообразимые периоды, основанные на циклах луны, новостях, любимых числах. Все гораздо проще, биржевая толпа так не заморачивается. Есть общепринятые приемы и в лучшем случае трейдеры их пробуют применять. А в худшем, даже не знают, что какие-то параметры там нужно подбирать. Серьезно, у многих индикаторы на графиках исключительно для красоты.

Совет: Узнайте, какие параметры и для какого таймфрейма рекомендовал сам создатель индикатора. Обратите внимание, что, вероятнее всего, в качестве таймфрейма брался дневной срез, и, исходя из этого стандарта, начинайте тестирование. Также не брезгуйте мнениями форумов, спросите своих коллег об интересующим вас индикаторе, какие параметры им нравятся и на каком интервале. А дальше уже начинайте игру фильтров, четких стоп-лоссов и продуманных рисков.

Ловите суть, а не формулу

Многие трейдеры боятся индикаторов, потому что они имеют страшные формулы. На самом деле, если постараться понять его физический смысл, мир становится проще. Можно знакомиться с создателем индикатора, попытаться понять, что он индикатором хотел сказать. Иногда, когда это невозможно, вам помогут хорошие книги, статьи, форумы.

Совет: Если вы не можете сделать окончательный вывод по индикаторам, так как не понимаете какие-то нюансы по ним, ищите. Берите чужой опыт. Учиться можно всему и всегда. И тогда вы сможете шагнуть за стандартные возможности по доходности индикаторов. Как? Читайте в следующей главе. #

Глава 7

Как из запаздывающего
индикатора сделать
работающий Грааль?



Из каждого ли технического индикатора можно сделать работающий Грааль? Почему не каждый индикатор – Грааль?

Трейдеры всего мира бьются над задачей создания индикатора, максимально точно описывающего текущую рыночную ситуацию, такой вот торговый Грааль. Попыток было много, но одна проблема остается нерешённой по сей день – запаздывание сигналов.

Под запаздыванием индикаторов обычно понимается ситуация, когда после получения сигнала на вход мы замечаем, что выгоднее было открыть ордер немного раньше по более привлекательной цене...

Что влияет на запаздывание индикатора?

Идеального индикатора не существует. На рынке есть инсайдеры, которые получают сигналы с минимально возможным запаздыванием. Обычные же трейдеры анализируют фактический поток цен, поэтому в любом случае существует некоторая задержка.

Одним из главных факторов, влияющих на запаздывание индикатора, является период расчетов. Чем меньше период, тем меньше данных анализируется, и тем быстрее мы получаем сигнал на вход. Чем период больше, тем большее количество данных принимает участие в расчетах. Следовательно, чаще всего такой сигнал появляется позднее и он констатирует уже случившуюся рыночную ситуацию.

Всегда ли запаздывание – плохо?

Кое-кто причисляет запаздывание к преимуществам, что еще раз подтверждает теорию субъективности восприятия рынка. Это тоже достаточно легко объяснить. Дело в том, что запаздывание позволяет отфильтровать резкие ценовые всплески или флетовое движение. То есть большой период позволяет лучше осмыслить участок истории и принять более правильное торговое решение.

И все же половина решения – это правильно поставленная задача. Не всегда корректно ждать от индикатора только получения сигнала без запаздываний и с максимально возможной точностью. Дело опять в том, что восприятие рынка очень субъективно. Когда в один трейдер видит хорошую возможность для покупки, другой в том же месте откроет позицию на продажу и будет вполне доволен результатом.

Это можно хорошо проиллюстрировать с помощью индикатора скользящей средней. Вариантов исполнения этого фильтра десятки, а то и сотни, тем не менее, популярность трейдеров заслужили всего несколько видов. Давайте попробуем на примере скользящей определить характеристики запаздывающего и не запаздывающего индикаторов. В качестве фитнес-функции будем считать время реакции на изменение тренда.

Сравним запаздывание скользящих средних

Начнем, пожалуй, с простой скользящей средней – SMA. Индикатор рассчитывается как простое арифметическое среднее за указанный период. Вычислить время его запаздывания просто – при примерно равной волатильности, оно будет равно половине периода. То есть, при периоде в 14 баров SMA покажет изменение тренда через 7 баров после факта разворота. Это достаточно сильное запаздывание, что многие трейдеры считают главным минусом простой скользящей.

В свою очередь экспоненциальная скользящая средняя почти полностью лишена этой проблемы. EMA при расчете отдает предпочтение последним данным. То есть, более новые бары имеют гораздо больший вес и больше влияют на значение индикатора. Это позволяет средней практически моментально реагировать на изменение тренда, пока простая скользящая даже не думает разворачиваться.

На рисунке 12 показано сравнение SMA и EMA с периодом в 14 баров. Тут сразу виден недостаток SMA, и насколько мало запаздывание EMA с абсолютно тем же периодом расчета.

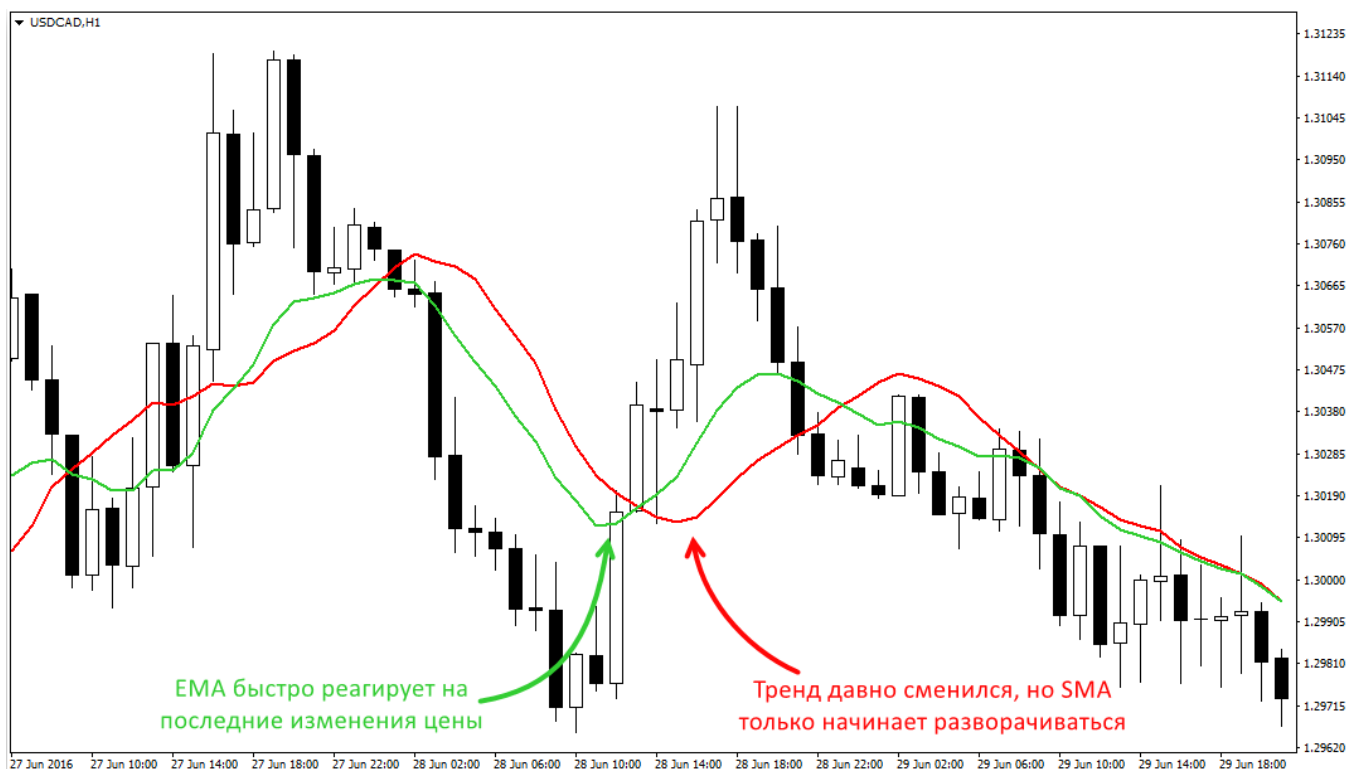


Рис. 12. Сравнение показаний скользящих средних с периодом 14. EMA и SMA

Идеальный индикатор для трейдера

Встает вопрос, если EMA уже работает на пределе возможностей и показывает наиболее актуальные изменения цены, то почему трейдеры не используют EMA постоянно? Дело в том, что для EMA вообще не важно, насколько продолжителен изучаемый тренд. Любой более-менее значительный ценовой всплеск кардинально изменяет направление прогноза, что может сильно вводить в заблуждение и привести к потерям.

Выходит, что трейдерам не обязательно иметь индикаторы с малым запаздыванием, нам нужен некоторый баланс между малым временем реакции и фильтрацией ложных выбросов.

Самая известная из подобных разработок – это адаптивная скользящая средняя – АМА. Вариаций ее тоже достаточно много.

Золотая индикаторная середина

Простые средние работают замечательно, пока на рынке наблюдается стабильный тренд. Когда же тренд заканчивается, все они подбирают большое количество торгового шума, что создает множество ложных сигналов. АМА же дает преимущества одновременно как быстрой, так и медленной МА.

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

- Быстрые скользящие дают преимущество при торговле по тренду.
- Средние, с большим периодом расчета (медленные), дают преимущество во флете, фильтруя торговый шум.

То есть, предназначение адаптивной скользящей состоит в том, чтобы ускоряться, когда на рынке появляется тренд и замедляться, когда рынок идет в канале. Другими словами, АМА способна подстроиться под текущую ситуацию на рынке.

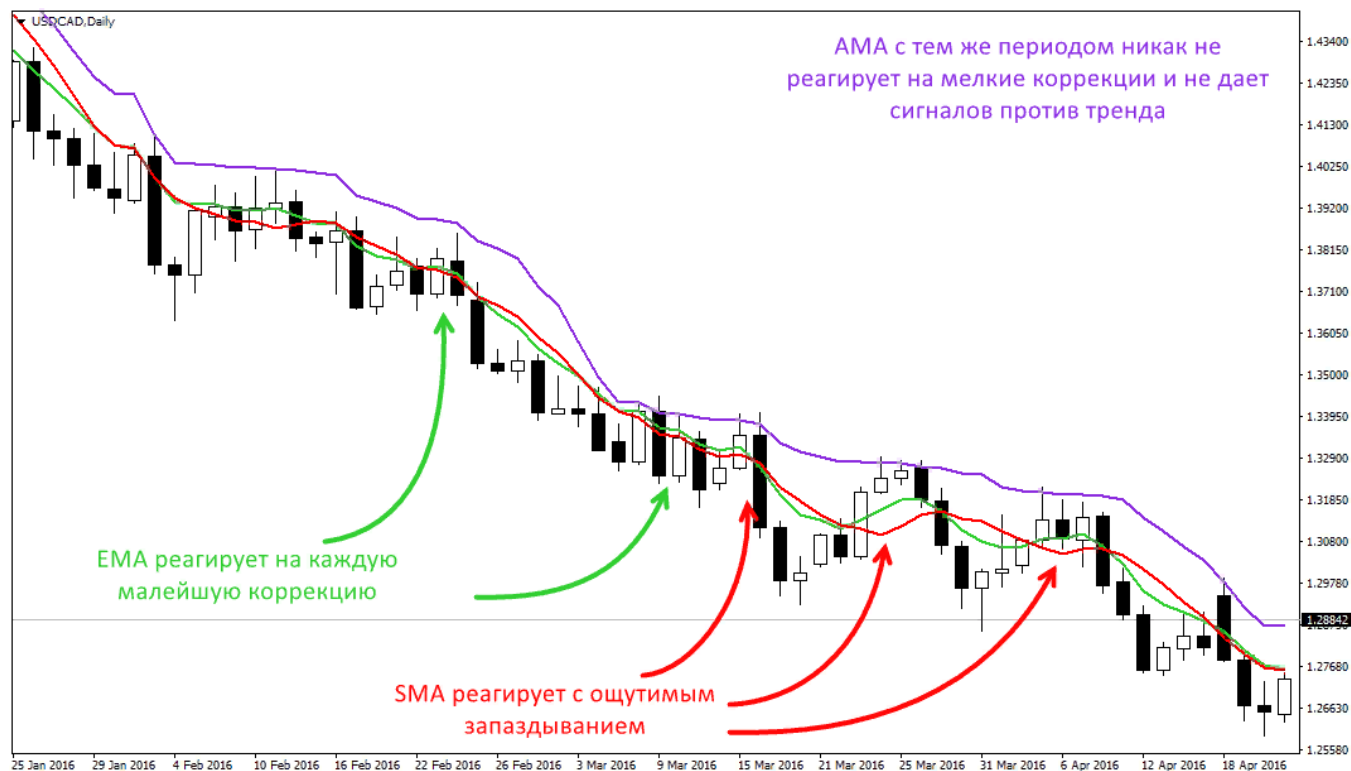


Рис. 13. Сравнение показаний скользящих средних с периодом 14. EMA, SMA и АМА.

В итоге, по скорости АМА представляет собой нечто среднее между медленной SMA и быстрой EMA. Но, благодаря фильтрации по волатильности и направлению, общее качество сигналов значительно повышается.

Увы, идеального индикатора без запаздываний не существует. Торговля чаще всего зависит от субъективного восприятия рынка и понятия терминов тренд и флет конкретным трейдером.

Тем не менее, на своем примере АМА показывает, как можно увеличить эффективность торговой системы с помощью комбинации нескольких простых и уже устоявшихся методов, даже если по отдельности они не идеальны.

Как и в любом другом деле, в трейдинге важен баланс, без перехода в крайности, а также здравый смысл. Если ваш индикатор долго реагирует на торговый сигнал, ищите ему в пару такой, который сигнализирует быстрее, но не всегда точно. На такой концепции чаще всего построены самые удачные торговые стратегии из самых простых технических индикаторов.

#



grandcapital.ru

Grand Capital – профессиональные инструменты для трейдинга

Моментальное исполнение. Спреды ниже 1 пункта
в 4-м знаке

Торговля на MT5 и ECN Prime.
Депозит от \$100

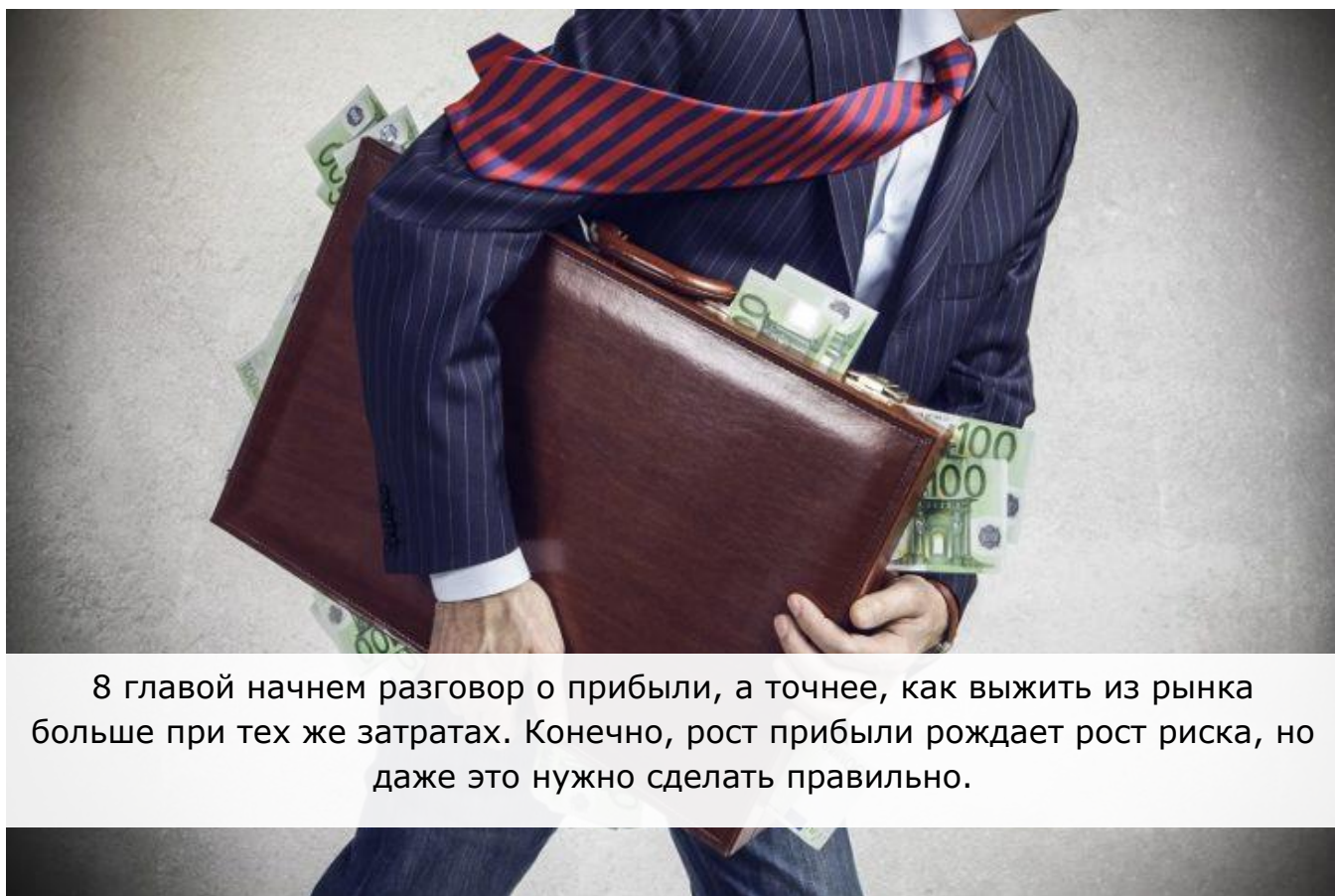
Плавающие плечи. Быстрые выводы. Стоит
попробовать



[Зарегистрироваться](#)

Глава 8

Реинвестирование или разгон депозита. Как все сделать правильно?



8 главой начнем разговор о прибыли, а точнее, как выжить из рынка больше при тех же затратах. Конечно, рост прибыли рождает рост риска, но даже это нужно сделать правильно.

Разгон депозита и правильное реинвестирование на валютном рынке - дело непростое. Требуется все продумать до мелочей, чтобы желание быстрого заработка не превратилось в убыточную стратегию.

В наше время торговля на Форекс превратилась из своеобразного «элитного клуба» в то, чем может заниматься любой желающий. Имея в кармане всего лишь несколько десятков долларов, можно открыть торговый счет и гордо заявлять: «я — валютный трейдер!»

Тем не менее, поторговав некоторое время на мини-, микро-, нано- и прочих центовых счетах, трейдер расстается с мыслью заработать миллион с начального депозита в 100 долларов и начинает понимать, что большая прибыль возможна только при наличии большого торгового счета.

Реинвестирование – путь к скрытым убыткам

Не каждый трейдер может (да и хочет) вкладывать в торговлю на валютном рынке большую сумму собственных денег. Конечно, можно брать деньги в доверительное управление, но об этом в данной главе мы говорить не будем, тем более, что чужие деньги – они чужие и есть.

Многие трейдеры идут по пути разгона своего собственного депозита. Для этого они оставляют на счете всю полученную прибыль, то есть, реинвестируют ее. Однако, оставляя 100% прибыли на депозите, среднестатистический трейдер, сам того не видя, несет незапланированные убытки.

Не может быть – скажете вы! Давайте посчитаем вместе.

Простые расчеты

Например, депозит трейдера составляет 1000 долларов. Прибыльность его торговой стратегии составляет 50%, а соотношение тейк-профита к стоп-лоссу выглядит как 1:1 с допустимым уровнем риска 10% от депозита.

Допустим, первая сделка была закрыта с профитом. Это дало 10% прироста к депозиту, который теперь составляет 1100 (1000 + 100) долларов. Следующая сделка закрылась по стоп-лоссу, депозит уменьшился на 10%. Но если в первой сделке 10% составляли 100 долларов, то уже во второй 10% — это 110 долларов. То есть, торговый счет теперь равен 990 долларам против начальных 1000.

«Ок», скажете вы, но ведь можно использовать и стратегии с более высокой доходностью и снизить уровень риска. Но мы же не просто торгуем, а разгоняем депозит, что подразумевает высокий уровень риска – без этого ни о каком разгоне речь не идет.

Реинвестируем правильно!

Как вы уже поняли из описанного выше примера, стопроцентное реинвестирование прибыли приводит к скрытым убыткам, которые, зачастую, способны уменьшить начальный депозит. Но так как мы не вкладываем больше в депозит личные средства, то без реинвестирования никакого разгона быть не может. А значит, нужно реинвестировать свою прибыль правильно. Как это сделать?

Мы предлагаем идти по пути компенсации издержек, капитализируя свой депозит только в положительной зоне. Достигается это следующим образом.

Необходимо проанализировать результаты вашей торговли и определить начальный уровень риска. Допустим, вы определили его как 5% от депозита. То есть при начальном депозите в 1000 долларов закрытая по стоп-лоссу сделка принесет вам убыток в 50 долларов.

После того, как ваша прибыль увеличит депозит на 50% до 1500 долларов, увеличиваем уровень риска до 7,5% и последовательно наращиваем его дальше:

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

- увеличение начального депозита на 100% — уровень риска 10%;
- увеличение на 300% — уровень риска 20% и т.д.

При этом данная пропорция работает только в сторону роста – если размер депозита начал снижаться, то уровень риска не уменьшается.

Как вы сами знаете, жадность и страх – это главные причины потери средств на валютном рынке. Поэтому, если у вас вдруг пошла череда убытков, то не нужно вступать с рынком в борьбу – вы все равно проиграете.

Необходимо остановить торговлю, вывести полученную прибыль, приведя депозит в первоначальную состояние. Немного отдохните, придите в себя – и можно начинать все заново. Поверьте, вы ничего не потеряете, а отдых практически всегда идет трейдеру на пользу.

Как долго можно разгонять депозит?



Теоретически, процесс разгона депозита можно продолжать бесконечно. На практике, у трейдера возникает одна из таких проблем:

Недостаток ликвидности

Суть проблемы заключается в том, что при увеличении депозита до определенного уровня работавшая раньше стратегия перестает быть таковой. Простыми словами, увеличить в два раза депозит в 1000 долларов не очень сложно, а вот удвоить торговый счет в 100 тыс. долларов достаточно проблематично. Поэтому с ростом вашего депозита необходимо будет корректировать торговую стратегию.

Человеческий фактор

Миллион долларов – очень и очень серьезная сумма, и заработать ее может только тот, кто готов к этому. А вы готовы рискнуть суммой в 300 тыс. долларов, чтобы заработать миллион?

Недобросовестный брокер

Ваша прибыль – это иногда убытки недобросовестного брокера. Поэтому есть вероятность, что через какое-то время брокер начнет вам ставить «палки в колеса». Невероятно? Достаточно просто посмотреть тему «Черный список на Форекс и претензии к форекс брокерам» на форуме трейдеров.

Вообще, разгон депозита – достаточно тонкое дело. Торговля на валютном рынке может поправить ваше финансовое положение, но если вы хотите из инженера превратиться в миллионера, то вряд ли стоит питать такие иллюзии. Легенды о трейдерах, сделавших миллионы на рынке, имея в кармане 100 долларов, – это, конечно, мотивирует, но о таких реальных людях никто и ничего не знает.

Итак, принимаясь за разгон депозита, следует знать об очень важной вещи, без которой вся эта затея будет абсолютно бессмысленной. Мы говорим о разгоне депозита путем реинвестирования прибыли. Ключевое слово здесь – это «прибыль». То есть, ваша торговля на валютном рынке должна быть успешной. Ни один из описанных выше приемов не будет работать, если ваш трейдинг убыточен. Поэтому, для начала, нужно правильно подобрать торговую стратегию, добиться стабильных положительных результатов, и только после этого приниматься за разгон вашего торгового депозита.

#

Глава 9

Пересиживание убытка



О неприятном и неизбежном. Поговорим об убытках на валютном рынке и можно ли их как-то сократить?

Убыток на валютном рынке – дело регулярное. Трейдеры привыкают к ним с течением времени, а вот новички используют стоп-лосс с осторожностью, считая его врагом и предпочитая пересиживать убытки. Можно ли так работать обсудим в 9 главе.

Манименджмент – это один из краеугольных камней торговли на рынках, а без соблюдения его правил прибыльный трейдинг попросту невозможен. Какой бы не была ваша торговая стратегия, прибыль будет зависеть от того, как вы сопровождаете сделку и ограничиваете свои риски.

Две тактики работы с убытками

Моделей управления капиталом существует несколько десятков, а вот подходы к сопровождению сделки можно условно разделить на две большие группы:

- тактика ограничения убытка;
- тактика пересиживания убытка.

С тактикой ограничения убытка все ясно: при открытии сделки выставляется ордер стоп-лосс, который закрывает ее с фиксированным убытком, если цена идет в противоположном направлении от спрогнозированного.

Пересиживание убытков – это такой способ управления рисками (если его вообще можно так назвать), при котором в открытой сделке стоп-лосс или отсутствует, или имеет очень большой размер, играя, скорее, психологическую, чем практическую роль.

Как правило, такой подход используют начинающие трейдеры, не обладающие достаточным практическим опытом торговли на рынке. И со 100%-ной вероятностью тактика пересиживания приводит к огромным убыткам вплоть до слива депозита.

Почему трейдеры не выставляют стоп-лосс, а пытаются переждать убыток?

В большинстве своем пересиживание убытков является следствием психологического состояния трейдера. Например, получив закрытую по стоп-лоссу сделку, такой трейдер не пытается разобраться – возможно ли что, причина в неверной точке входа, что повлекло за собой и неправильно выставленный стоп-лосс? Он злится на рынок, вступая с ним в противоборство – «все равно возьму свое». Естественно, чтобы не получать убыток по стоп-лоссу, в следующей сделке он просто не выставляется.

Стоит отметить, что пересиживанием убытков пользуются не только новички, но и более опытные трейдеры в надежде поймать разворот цены. Несмотря на то, что пересиживание само по себе является негативным, тем не менее, его можно логически объяснить.

Цена актива всегда движется в каком-то диапазоне, сформированном экономическими и политическими факторами в странах, из валют которых состоит валютная пара. Рынок находится в постоянном движении. Участники рынка двигают цену актива внутри какого-то диапазона, при этом цена может подходить к его границам и отбиваться от них, возвращаясь к исходной точке. И этот процесс может повторяться многократно.

Если в валютной паре присутствует высокая волатильность, то трейдеры не устанавливают стоп-лосс, рассчитывая на возврат цены из-за цикличности рынка.

Четыре варианта пересиживания убытков

Тактика пересиживания убытков достаточно разнообразна. Мы рассмотрим четыре варианта ее использования:

1) Тактика пережидания убытков с большим стоп-лоссом и маленьким профитом

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

Несмотря на то, что пересиживание убытков практически всегда заканчивается печально, в такой форме она очень часто применяется в скальпинге и пипсовке.

Открывая позицию, с учетом спреда, скальпер или пипсовщик уже получает минус, а малейший ценовой шум этот минус увеличивает, закрывая сделку с маленьким стоп-лоссом. Поэтому зачастую скальперы и пипсовщики используют увеличенный стоп-лосс, превышающий размер ордера тейк-профит иногда в несколько раз.

Логика здесь проста: вероятность того, что цена пройдет 5 пунктов до тейк-профита выше, чем вероятность того, что цена пройдет 10-15 пунктов до стоп-лосса.

2) Пересиживание убытков с использованием Мартингейла



При использовании метода Мартингейла (читайте о нем в следующей главе книги), трейдер не выставляет стоп-лосс. Если цена идет против сделки, то в расчетных точках открываются сделки в первоначальном направлении с увеличенным лотом.

Идея проста: при откате цены увеличенный лот сделок позволит закрыть всю серию сделок даже при небольшом ценовом движении.

В использование данной тактики вносят свои коррективы затяжные тренды или глубокие безоткатные движения цены. У трейдера заканчиваются средства для открытия следующих сделок по Мартингейлу, поскольку лот нужно наращивать. В итоге, затяжные тренды приводят к очень быстрому сливу депозита.

3) Пересиживание убытков за счет локирования ордеров

О замках на валютном рынке сказано очень много. Существует много как противников, так и горячих поклонников такого метода. Напомним, что при постановке замка, ордер стоп-лосс не выставляется, а открывается сделка тем же лотом, но в направлении, противоположном изначальному.

«Разрулить» замок намного сложнее, чем кажется, поэтому, трейдер чаще всего не фиксирует убыток, а пытается найти точку для позитивного выхода из ситуации.

Как следствие первый прибыльный ордер замка закрывается с прибылью, а на второй полагаются надежды, что рынок откатится и убыток уменьшится.

4) Просто отсутствие стоп-лосса

Этим, как правило, грешат многие новички, которые попросту не умеют рассчитывать правильную точку входа в рынок и, соответственно, оценивать свои риски.

«Прозевав» правильную точку, такой трейдер, например, открывает сделку на покупку в восходящем тренде не возле линии поддержки тренда, а в его середине. Установленный под линией поддержки стоп-лосс слишком велик, а если установить его ниже предыдущего локального минимума, его с большой степенью вероятности заденет микрокоррекция цены. Выход найден – не ставить стоп-лосс вообще, а если что, закрыть сделку руками.

Естественно, никто руками убыток не закрывает, надеясь на то, что цена вот-вот развернется. Попав на затяжное ценовое движение, такой трейдер или сливает депозит, или все-таки собирается с силами и фиксирует убыток вручную, но его размер уже несопоставим с тем, который мог быть получен по правильно выставленному стоп-лоссу.

Стоит ли вообще пережидать убытки?

Вряд ли валютный рынок можно назвать местом, где можно пережидать убыток. Высокая волатильность валютных пар вместе с кредитным плечом могут практически в одно мгновение оставить на депозите одни нули.

Тем не менее, тактика пережидания убытка с успехом используется на фондовом рынке. Например, для получения дивидендов по акциям, а также при отсечке, когда просто необходимо переждать образовавшийся ценовой разрыв дабы выйти с прибылью.

Использовать ли в торговле стоп-лосс или каким-то другим способом ограничивать свои риски – сугубо личное дело каждого трейдера. Никто не запрещает вам торговать без стоп-лоссов, ерзая на стуле и наблюдая, как отрицательное число в графе «Прибыль» увеличивается, а полоска баланса из серой становится красной, сигнализируя о близком маржин колле. Но если вы пришли на Форекс за деньгами, то пережидание убытков – однозначно не ваша тактика. О том, как рискованно, но все же более безопасно торговать без стоп-приказов, поговорим в главе о принципах Мартингейла. #

Глава 10

Безопасный Мартингейл.
Как отдельными элементами
увеличить прибыльность
стратегии?



Безопасная система по принципу Мартингейла - миф или реальность? Поговорим о безопасных и прибыльных частях системы Мартингейла, которые улучшат ваш торговый результат.

Опасный метод мани менеджмента Martingale пришел на всемирно известную Foreign Exchange с легкой руки любителей азартных игр. Часть трейдеров, особенно новички, воспринимают метод как торговую стратегию и считают мартингейл единственной возможностью добиться 100%-го профита. Опытные профи осторожно воспринимают тактику картежников, так как не только прибыль ожидает трейдера в конце пути, но и весьма вероятный слив депозита.

Что такое Мартингейл?

Мартингейл, мартингал (фр. martingale) – система управления ставками, открытая французским математиком Полом Пьерром Леви. Изначально система Мартингейл использовалась только в азартных играх для расчета ставок, позднее ее стали активно использовать и преобразовывать трейдеры на фондовых и валютном рынках.

В чем суть системы Мартингейла?

Для тех, кто не в курсе, поясним принцип классической системы Мартингейла. Изначально, метод был ориентирован на игру в рулетку. Например, на красное

ставился 1 доллар. При выпадении черного ставка удваивалась, то есть на красное ставилось уже 2 доллара. При следующем проигрыше ставка снова удваивалась и составляла уже 4 доллара на красное. И так вплоть до выпадения выигрышного цвета. Грубо говоря, метод Мартингейла – это адаптированная для рулетки геометрическая прогрессия.

Как Мартингейл применяется на форекс?

С развитием биржевых торгов метод Мартингейла стал применяться на валютном рынке. Общий принцип его использования очень похож на игру в рулетку, только вместо «красного» и «черного» используются ордера на покупку и продажу.

Выглядит это следующим образом:

На каком-то уровне открывается позиция на продажу объемом 1 лот. Если, против ожиданий, цена продолжает рост, убыточная позиция не закрывается, а открывается еще одна продажа с удвоенным объемом. Такая последовательность продолжается до тех пор, пока цена не развернется и не позволит трейдеру закрыть сделки с прибылью или, как минимум, без убытка.



Рис. 14. Классический метод Мартингейла.

В общем, такой подход к методу Мартингейла создает впечатление, что убыточные сделки закрывать необязательно, а существует чуть ли не 100%-ная вероятность «выйти сухим из воды», избежав потерь, а то и получив еще сверху какую-то прибыль. Однако, в таком использовании стратегии есть несколько очень существенных «но».

- Во-первых, увеличение открытых сделок и наращивание их объемов приводит к нагрузке на депозит и, как следствие, к Margin Call, когда средств на открытие новых ордеров не хватает, в лучшем случае. В

худшем, результатом таких торгов будет Stop Out, когда брокер начнет принудительно закрывать открытые сделки.

- Во-вторых, для использования Мартингейла необходим тонкий расчет и навык анализа технических графиков, индикаторов и проч. Позиции открываются не абы где. Каждый ордер открывается в месте потенциального разворота, которое определить не так уж и просто. А, попав на сильный тренд, можно запросто остаться без депозита. Печально, но именно на этом и попадают начинающие трейдеры, пробуя этот метод.

Стоит отметить, что большинство торговых систем, основанных на методе Мартингейла, при неправильном использовании ведут к практически 100% потере средств. Это касается и советников, типа ILAN. Обратной стороной медали является то, что при грамотном подходе и соответствующих навыках такие системы и роботы позволяют получить довольно хорошую прибыль.

Достоинства и недостатки принципа Мартингейла

К достоинствам Мартингейла относится принцип, при котором трейдер, даже часто получающий убыток, все равно будет оставаться в плюсе. При этом использование Мартингейла иногда позволяет «вытащить» в безубыток, а то и в плюс, казалось бы уже безнадежную позицию.

Наряду с возможностью выйти с ощутимой прибылью метод обладает рядом существенных недостатков:

- во-первых, принцип Мартингейла, в отличие от использования его в азартных играх, представляет собой сложную математическую систему, основанную не на обычном удвоении последующей ставки, а зависящую от волатильности валютной пары, объема начальной позиции и размера депозита трейдера.
- во-вторых, стратегия предполагает наличие достаточно большого депозита, который будет в состоянии выдерживать просадку по открытым сделкам и позволит открывать новые позиции с увеличенным объемом.
- в-третьих, эффективность принципа напрямую зависит от торговой стратегии, в которой он применяется. Если стратегия обладает низкой эффективностью или вовсе убыточна, то ее не спасет никакая система Мартингейла.
- в-четвертых, метод Мартингейла обладает повышенным уровнем риска. Если классические правила манименеджмента допускают риск в размере 3-5% от депозита, то рисковость стратегий с Мартингейлом составляет около 60%.

Как работают торговые стратегии на Мартингейле?

1. Выбираем любую валютную пару.
2. Входим в позиции покупки или продажи четко по направлению текущего тренда с минимальным лотом. Для определения тренда можете использовать график с большим таймфреймом (например, D1). После того, как определили направление цены (к примеру, восходящий), открываем позицию (в нашем случае, на покупку Buy).



Рис. 15. Работа по принципу Мартингейла.

3. К открытой сделке обязательно устанавливаем равноудаленные ордера стоп-лосс и тейк-профит (по 50 пунктов для каждого от входа в рынок).
4. Если цена выбивает наш тейк-профит, на этом же уровне открываем новую позицию, также на покупку и с аналогичными ордерами.



Рис. 16. Работа по принципу Мартингейла.

5. Если же цена выбила стоп-лосс, на его же уровне открываем новую сделку в Buy с теми же ордерами, но лот для позиции должен быть в 2 раза больше предыдущей (уже закрытой) позиции.



Рис. 17. Работа по принципу Мартингейла.

То есть, если первая сделка была с лотом 0,1 и сработал стоп-лосс, то для новой открытой сделки (в том же направлении что и первая) лот должен быть уже 0,2 (именно в этом и заключается главный принцип Мартингейла). И так далее.

Для того чтобы не ждать, когда цена дойдет до take profit или stop loss, можно предварительно на их уровнях поставить соответствующие отложенные ордера для автоматического открытия новых сделок в нужном направлении.



Рис. 18. Работа по принципу Мартингейла.

Метод Мартингейла на валютном рынке не «жалуют» спекулянты, поскольку для получения незначительной, но ожидаемой прибыли необходимо «увесистое» депо. Трейдеры, как правило, создают некую усредненную модель, схожую с известной формулой «мыльного пузыря»: оперируют крупными суммами и, применяя Мартингейл в торговле, повышают убытки в надежде на пропорциональный рост прибыли.

Тем не менее, несмотря на высокие риски потери депозита, торговые стратегии, основанные на принципе Мартингейла, пользуются большой популярностью среди трейдеров, поскольку позволяют за короткий промежуток времени получить ощутимую прибыль, вплоть до увеличения депозита в несколько раз. Подробнее с лучшими стратегиями по Мартингейлу можно познакомиться [здесь](#).

Что нужно знать трейдеру при использовании стратегии Мартингейла?

На практике Мартингейл – эффективный инструмент в руках того, кто принимает принципы стратегии. Термин, к слову, сначала применялся для обозначения хомута, который не позволял лошади запрокинуть шею, а также упоминался как фрагмент оснастки корабля для укрепления кливера и бушприта от силы штагов... в общем, принцип заключается в применении повышенной силы к негативному результату.

Что нужно знать трейдеру для правильного применения системы Мартингейла? Совершение прибыльных сделок может быть увеличено до 87% (против 50%) даже в случае, если трейдер работает с минимальным депозитом. Учитывая принцип удвоения, необходимо рассчитать свои силы, ограничиться мелкими объемами сделок и обеспечить, еще до экспериментов, большой депозит.

Шутя, профи рынка рекомендуют испробовать стратегию картежников тем, кому брокер готов открыть безграничную кредитную линию. Однако факт остается фактом: Мартингейл является стратегией с зашкаливающим уровнем риска – 62% против 2%, принятым на рынке. Классический вариант системы картежников – вход наобум (против тренда) крайне не рекомендуется. Если уж и использовать метод, то в модифицированных вариантах, адаптированных под Foreign Exchange:

- **Простой метод**

Увеличивать номинал лота и удваивать торговые позиции после каждого убытка, но входить в рынок только по тренду. Недостаток метода – высокий уровень риска, так как торговля связана с вложением значительных денежных средств.

- **Сложный метод**

Повышение номинала после каждой следующей убыточной сделки в пределах 40% (в 1,3-1,6 раза в сравнении с удвоением). Такой метод существенно сокращает

диапазон убытков и вероятность слива депозита, но обеспечивает меньшую прибыль. При выборе этого метода необходимо ограничить использование take profit и жестко контролировать stop loss, повышая уровень при положительной динамике.

При выборе метода Мартингейла обязательно принимать решение о sell или buy на основе или самостоятельных исследований, или достоверной аналитики. Вход «наобум» недопустим, хотя возможно применение картежной системы, как дополнение к стратегии при неудачном входе. Однако стоит учесть, что откорректировать плохую торговую стратегию (до 40% прибыльных сделок) martingale не сможет.

Еще одно условие профита при использовании метода – начинать торговлю с минимальным лотом. Прибыль в таком случае будет незначительной, независимо от выбранного варианта (простой, сложный), но, благодаря усреднению позиции, вероятность слива депозита – тоже минимальна.

Существует ли безопасный Мартингейл?

Как правило, метод Мартингейла ассоциируется у большинства трейдеров с чем-то опасным. А для новичков это вообще одна из самых популярных «страшилок». Безусловно, использование его в торговле несет в себе повышенные риски. А существует ли безопасный Мартингейл?

Вы не поверите, существует! Использование отдельных его элементов может повысить прибыльность торговли и даже снизить психологическую нагрузку на трейдера. Как? Очень просто!

Давайте рассмотрим ряд элементов метода, которые можно использовать в торговой стратегии, повысив ее прибыльность.

Что необходимо для безопасного Мартингейла?

В первую очередь нам будет необходима прибыльная торговая стратегия. Интернет предлагает огромный выбор систем на любой вкус, поэтому выбрать из уже имеющихся ту, что потенциально дает прибыль не составит огромного труда. Помните, применение безопасного «Мартина» даст нам увеличение дохода и снизит психологическую нагрузку, однако, если стратегия заведомо убыточная, то у Вас вряд ли что-то выйдет.

Кроме прибыльной торговой стратегии необходим торговый счет с большим кредитным плечом. Адекватно используя правила мани-менеджмента, кредитного плеча 1:100 будет достаточно.

Подготовка к безопасному «Мартину»

Итак, торговая стратегия подобрана, торговый счет с необходимым кредитным плечом в наличии. Продолжаем готовить наш безопасный Мартингейл. Остановимся на следующих ключевых элементах:

- **Использование в торговле ордеров стоп-лосс**

Большинство трейдеров почему-то считает, что торговля с использованием метода Мартингейла происходит без стоп-лоссов. Нужно ли говорить, что стоп-лосс – это страховка от большого убытка и торговать без них глупо и опасно? Ордера стоп-лосс в системе Мартингейла использовать можно и даже нужно.

- **Определение серии убыточных сделок торговой стратегии**

Всем известно, что Грааля на Форекс не существует, и даже самая прибыльная торговая стратегия «грешит» убыточными сделками. Перед нами стоит задача определить среднюю серию убыточных сделок. Обратите внимание, не максимальное значение, а именно среднее количество идущих подряд убыточных сделок за тестовый период.

К тестовому периоду нужен индивидуальный подход. Если торговая стратегия предназначена для торговли на интервале М5, то тестовый период должен составлять не менее 1-2 месяцев. Если торговля подразумевается на дневном таймфрейме, то период тестирования составляет уже несколько лет.

Для оптимизации тестирования торговой стратегии можно использовать одну из утилит, которых сейчас великое множество.

Практический пример безопасного Мартингейла

Допустим, средняя серия убыточных сделок в протестированной стратегии равняется 3. Наша торговая стратегия предполагает фиксированные стоп-лосс и тейк-профит в размере 10 пунктов и 20 пунктов соответственно.

По правилам тактик появляется сигнал на продажу. Открываем сделку на продажу объемом 1 лот. Цена продолжает восходящее движение – получаем убыток в размере 10 пунктов.



Рис. 19. Пример торговли по системе Мартингейла.

Цена продолжает рост, снова появляется сигнал на продажу. Открываем сделку SELL, но уже увеличенным лотом.

Здесь стоит обратить внимание на крайне важный момент. Почему-то принято считать, что при использовании «Мартина» лот необходимо удваивать. На самом деле строгой зависимости нет. Множитель зависит только от желаний трейдера и его склонности к риску и может быть произвольным. Мы будем увеличивать объем наших сделок на 50%.

Вернемся к нашему примеру – получен сигнал на продажу. Открываем SELL объемом 1,5 лота. Снова цена идет вверх, сделка закрывается по стоп-лоссу с убытком 10 пунктов.



Рис. 20. Второй убыток.

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

Наблюдаем дальше. Ситуация повторяется: появляется сигнал на продажу. Открываем позицию в объеме, увеличенном на 50% от предыдущего, то есть, 2 лота. Цена наконец-то идет в необходимом нам направлении, и сделка закрывается по тейк-профит в размере 20 пунктов.



Рис. 21. Профит, который покрывает убытки.

Минутка занимательной арифметики

Деньги счет любят, настало время поупражняться в арифметике. Что было бы, если бы мы открывали сделку не увеличенным, а обычным объемом 1 лот? Для удобства расчеты будем проводить на паре евро/доллар (при стандартном лоте стоимость 1 пункта составляет 10 долларов).

- Первая сделка дала нам убыток в 10 пунктов = 100 долларов.
- Вторая сделка принесла бы нам еще 100 долларов убытка.
- Третья сделка закрылась бы с прибылью в 20 пунктов = 200 долларов.

Результатом наших торгов стала бы нулевая прибыль. Учитывая, что убыток тоже нулевой, это довольно неплохо.

Теперь давайте посчитаем наши торговые результаты с применением увеличенного лота.

- Первая сделка дала нам убыток 10 пунктов = 100 долларов.
- Вторая сделка принесла нам еще 150 долларов убытка (напомним, что объем второй сделки составлял 1,5 лота).
- Третья сделка объемом 2 лота закрылась с прибылью в 20 пунктов = 400 долларов.

Таким образом, увеличение лота дало нам $400 - 150 - 100 = 150$ долларов прибыли, в отличие от нулевого результата в варианте с постоянным лотом.

Что делать, если все не так гладко?

А если бы третья сделка, открытая объемом 2 лота, закрылась бы по стоп-лосс с убытком, цена продолжила бы рост, и снова бы появился сигнал на продажу? Снова нужно открывать позицию на продажу, но каким объемом?

Классический Мартингейл подразумевает дальнейшее увеличение объема позиций, однако, этот подход нам не подходит из-за очень высокого риска.

В процессе тестирования нами было выяснено, что средняя серия убыточных сделок **равняется 3**. Соответственно, мы можем открывать только 3 сделки. Четвертый раз не соответствует стандартной ситуации, поэтому лучше не рисковать. В этом случае можно открыть сделку на продажу пониженным объемом 1,5 лота или же сразу вернуться к исходному объему 1 лот и торговать им до тех пор, пока торговая стратегия снова не вернется к обычному соотношению прибыльных и убыточных сделок.

Не цепляйтесь за одно направление

Использование метода Мартингейла в трейдинге построено на том, что цена рано или поздно развернется и пойдет в необходимом направлении. Именно это становится причиной того, что многие трейдеры упрямо продолжают открывать сделки против цены, сливая свой депозит, так и не дождавшись разворота. Но мы же умные трейдеры, мы так делать не будем.

Допустим, открытая нами сделка на продажу закрылась по стоп-лосс, принеся нам убыток. После этого торговая стратегия дает нам сигнал на покупку. Так зачем нам его игнорировать, продолжая убыточные продажи только потому, что «так устроен метод Мартингейла»?

Открываем позицию на покупку, но с увеличенным объемом в 1,5 лота. Закрылась по тейк-профиту – хорошо, забираем прибыль. Закрылась по стоп-лосс – не игнорируем следующий сигнал, а открываемся в указанном направлении объемом 2 лота.

ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2



Рис. 22. Прибыльный Мартингейл. Нюансы.

При этом не стоит забывать о средней серии убыточных сделок, определенной нами при тестировании стратегии. Если она составляет, как в нашем примере, 3 – больше трех сделок наращивать объем не рекомендуется.

И снова о мани-менеджменте

Журнал Фортрейдер, наверное, уже 100500 раз писал о соблюдении правил мани-менеджмента, и еще столько же напишет, потому что без их соблюдения о какой-то стабильной прибыльной торговле говорить не имеет смысла.

Мы рекомендуем придерживаться следующего правила: рассчитывайте множитель объема таким образом, чтобы возможный убыток по последней открываемой в серии сделки не превышал 10% от депозита.

Безусловно, наши торговые риски немного увеличены. Но придерживаясь строгих правил и не давая волю эмоциям, описанный выше безопасный Мартингейл не сольет депозит, а принесет дополнительную прибыль, повысив эффективность используемой торговли.

Поэтому, будьте благоразумны, соблюдайте правила мани-менеджмента. Даже если вы не согласны с толпой...

#



Инвестиции с доходностью до 25% в месяц

Создавайте собственные или
используйте **ГОТОВЫЕ** инвестиционные
портфели.

Готовые инвестиционные портфели – это набор CFD-
контрактов на акции, фьючерсы или индексы.
Портфели создают аналитики, используя большой массив
данных.

За счет грамотного подбора инструментов и
диверсификации рисков реальная доходность составляет до
25% в месяц.

Более 200 CFD-контрактов.
Портфели обновляются каждый месяц

Скачать портфель

grandcapital.ru

Глава 11

Торговая стратегия
«Искусство не соглашаться».
Не следуй за толпой!



Торговля против толпы или торговая стратегия "Искусство не соглашаться" - то, на чем Сорос обыграл Банк Англии.

Стратегия рискованная и требующая значительных знаний, но дающая результат. Принцип трейдинга «Покупай на падении и продавай на росте» — это практическое применение теории «противоположного времени», которое уже долгое время существует на финансовых рынках. В 1954 году такой подход был сформулирован более изящно, и сейчас многие трейдеры знают его как стратегию «Искусство не соглашаться».

Суть стратегии «Искусство не соглашаться»

Общий принцип этой тактики достаточно прост – не делать то, что делает большинство участников рынка, то есть, движение против толпы.

С одной стороны, это выглядит сплошным безумием, ведь, например, торговля против тренда – это огромные риски и убытки. С другой стороны, в этом методе есть рациональное зерно. По такому принципу, к примеру, работают технические осцилляторы: линия индикатора падает, преодолев уровень перепроданности, но грамотный трейдер уже не продает, а совершает первые покупки на подходящих уровнях.

В этой связи, несмотря на логичность тактики, прибыльных торговых стратегий, которые построены исключительно по ней, не существует. Этому есть достаточно простое объяснение – применять «Искусство не соглашаться» в практическом трейдинге очень сложно из-за большой вероятности ошибки.

Лучше всего риски подобной ТС описал «человек, который обвалил Банк Англии» — американский трейдер, финансист и инвестор Джордж Сорос:

«Большинство событий, которые можно спрогнозировать, происходят. Чаще всего, расчеты большинства оправдываются и сбываются. Этого не происходит только в ключевых точках перегиба, но заранее определить эти точки очень сложно. Сейчас модно использовать в трейдинге метод противоположного мнения, что очень рискованно. После появления на рынке тактики «Искусство не соглашаться», я превратился в ее противника».

Применима ли тактика на практике

Как мы уже говорили, наряду с противниками существует и большое количество поклонников этой тактики. Адепты «Искусства не соглашаться» аргументирует свое решение тем, что такой метод является хорошим способом увидеть будущее. Рыночное противостояние большинства и меньшинства они видят следующим образом:

- когда тренд находится в активной фазе, большинство является правым;
- большинство участников рынка ошибается в фазах начала и конца тренда.

С этими утверждениями очень сложно поспорить. Большинство трейдеров получает прибыль, используя для этого трендовое движение цены. Но это же большинство, не сумев распознать окончание тренда и его разворот, получает убытки.

В этом и заключается основная проблема практического применения ТС «Искусство не соглашаться». Правильно определить, в какой фазе находится текущий тренд, могут не все трейдеры, несмотря на множество эффективных помощников – технических индикаторов, графических фигур и свечных паттернов. Если вам кажется, что ничего сложного в этом нет – вспомните, сколько раз ваша сделка закрывалась по стоп-лосс из-за разворота цены.

Как проверить работоспособность?

Проверить всю сложность тактики можно, используя виджеты, которые отображают рекомендации трейдеров. Их с легкостью можно найти на сайтах форекс брокеров.

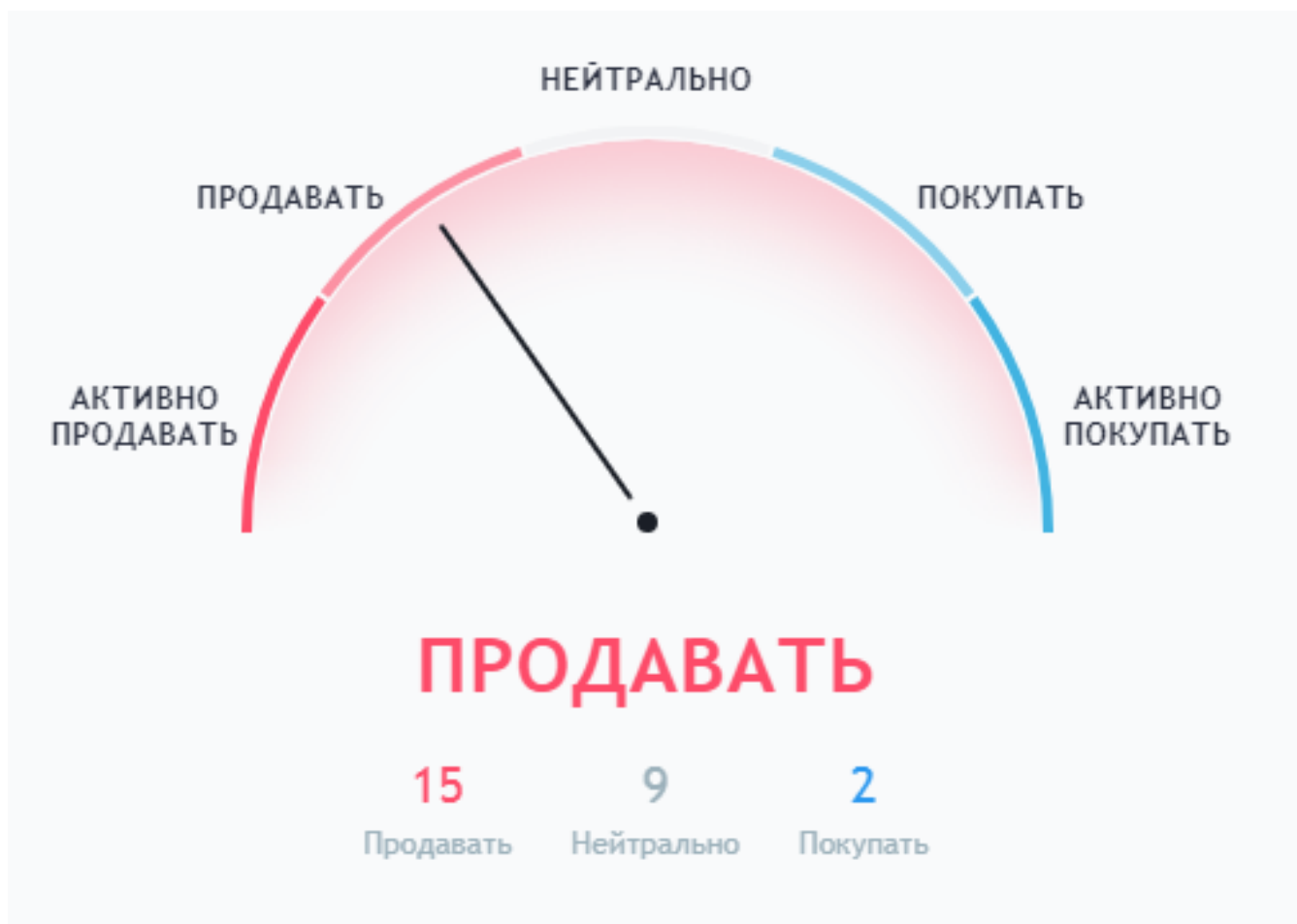


Рис. 23. Пример виджета торговых решений.

Попробуйте открывать позиции в направлении торговых рекомендаций и против них. Полученные вами результаты вряд ли можно будет назвать удовлетворительными, потому что есть моменты, когда нужно соглашаться с мнением большинства, а есть моменты, когда стоит идти против него. Умение находить четкие границы между такими моментами – это и есть главная проблема практического применения тактики «Искусство не соглашаться».

Тем не менее, сам посыл, заложенный в тактику, остается верным: чем больше участников рынка верит в прогноз, тем больше ценности этот прогноз теряет.

Есть и примеры

За примерами далеко ходить не нужно, достаточно посмотреть [на курс биткоина](#). Когда биткоин стоил 1 тысячу долларов, прогнозы о росте его курса к отметке 10 тысяч воспринимались со скептической улыбкой, и лишь немногие трейдеры покупали его. Чем больше рос курс BTC, тем больше участников рынка примыкали к восходящему движению, тем самым подталкивая биткоин к падению. В

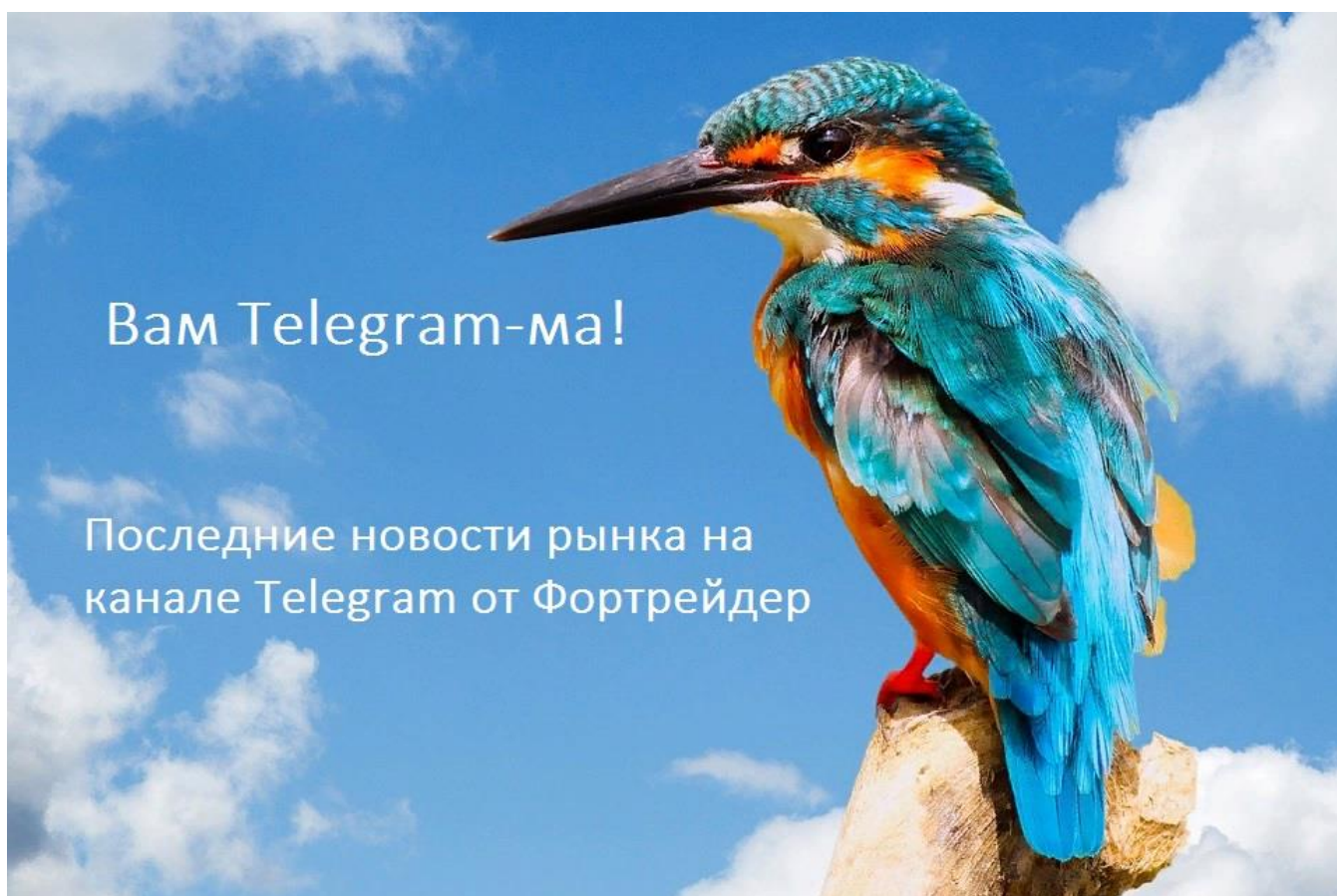
ЛАЙФХАК ДЛЯ ТРЕЙДЕРА Ч.2

итоге, имеем текущий курс BTC/USD на уровне ~3500 долларов и множество трейдеров, закупившихся битком по 15-20 тыс. долларов за монету.

Как мы уже говорили выше, тактика «Искусство не соглашаться» является очень популярной. Любой трейдер рано или поздно задумывается о ее применении. Тем не менее, стоит помнить, что, торгуя исключительно по этой тактике, вы будете всегда торговать против толпы, а это верный способ потерять свои деньги.

Как сказал Джон Боллинджер, само по себе, несогласие с мнением большинства мало, что значит. Для использования его в торговле необходимо четкое понимание факторов, влияющих на мнение большинства, умение распознавать эти перемены. И только тогда применение тактики «Искусство не соглашаться» в точках этих перемен способно принести прибыль.

#



Глава 12

Об адаптации валютных стратегий под бинарные ОПЦИОНЫ



Валютный рынок значительно старше бинарного. За это время было создано очень много торговых стратегий, которые приносили прибыль трейдерам. Можно ли адаптировать их на рынок бинарных опционов? Рассмотрим доступные методы.

Валютный рынок пестрит многообразием разнообразных торговых стратегий. Какого бы стиля торговли не придерживался трейдер, всегда можно найти себе прибыльную систему – от скальпинга и пипсовки до долгосрока. Многие торговые стратегии уже давно перешагнули возраст в несколько десятилетий, оставаясь при этом прибыльными и эффективными.

Рынок бинарных опционов, по сравнению с валютным, намного моложе и пока не может порадовать трейдера огромным количеством торговых систем. Однако, все новое – это хорошо забытое старое, и многие трейдеры идут по пути адаптации стратегий для валютного рынка под торговлю бинарными опционами.

В последней главе мы расширим наш инструментарий с помощью бинарных опционов, достаточно популярных на современном рынке и присутствующих у многих брокеров, и расскажем, как правильно адаптировать валютные торговые стратегии под рынок БО.

Отличия валютного трейдинга и торговли БО

Чтобы адаптировать стратегию под бинарные опционы, необходимо, в первую очередь, четко понимать, чем отличаются эти два рынка. Можно выделить два ключевых отличия рынка бинарных опционов от валютного рынка:

- На валютном рынке сделка может жить сколь угодно долго. На рынке БО все контракты имеют четко обозначенное время действия (время экспирации).

- На валютном рынке прибыль и убыток зависит от уровней тейк-профит и стоп-лосс, которые устанавливает трейдер. В ситуации с бинарными опционами эти ордера отсутствуют в принципе, прибыль и убыток имеют фиксированный размер.

Отсюда вытекает особенность торговли бинарами: нет необходимости определять, которая цена должна пройти, чтобы ордер закрылся с прибылью или убытком.

В остальном же, суть торговли БО ничем не отличается от классического трейдинга – необходимо правильно спрогнозировать направление движения цены актива и открыть сделку в соответствующем направлении:

- Call – если прогнозируется рост цены;
- Put – если прогнозируется снижение цены.

Какие торговые стратегии подходят для адаптации

Исходя из того, что основной принцип трейдинга «прогнозирование ценового направления» остается неизменным, под торговлю бинарными опционами можно адаптировать практически любую торговую систему. Наиболее популярными являются:

- Трендовые стратегии – самые простые и, наряду с этим, самые эффективные, поскольку в рамках тренда прогнозировать направление цены намного проще.
- Пробойные стратегии – системы, ориентированные на построение важных ценовых уровней и каналов (статических и динамических) и открытие сделки при их пробитии ценой.
- Скальпинг и пипсовка – системы, подразумевающих большое количество сделок с очень коротким временем жизни и небольшой прибылью от каждой.
- Стратегии на паттернах технического анализа – системы, построенные на отработках фигур разворота и продолжения тренда (Голова и плечи, Двойные и тройные вершины, Флаг и т.д.), которые позволяют с высокой точностью спрогнозировать движение цены.

Тем не менее, если «отпилить» у этих стратегий постановку уровней стоп-лосс и тейк-профит, они не станут автоматически пригодны для торговли БО. И этому есть одна причина – время.

Время – ключевой момент в адаптации стратегий



Как мы уже говорили выше, на валютном рынке сделка может жить любое количество времени. Поэтому классические стратегии можно применять для торговли на любом временном интервале.

Наличие в бинарных опционах времени экспирации, жестко ограничивающее время жизни позиции, не позволяет торговать на произвольных таймфреймах, а диктует необходимость их правильного выбора.

Соответственно, главной задачей при адаптации стратегии под торговлю бинарными опционами является правильное сопоставление ценового направления на выбранном таймфрейме и времени экспирации БО. Другими словами, по истечению времени экспирации, цена на указанном временном интервале должна двигаться в нужном направлении.

Таймфрейм для трейдинга бо

На данный момент существует целый ряд способов и методик для определения временного интервала при торговле БО. Почитать о них подробнее можно в нашем [журнале](#). Поэтому мы остановимся на уже давно опробованном трейдерами универсальном методе таймфрейма.

Для этого необходимо протестировать торговую стратегию на демо-счете, центовом счете или даже истории. Согласно правилам стратегии, нужно открывать сделки в течение какого-то промежутка времени, достаточного для накопления статистики.

Далее для анализа необходимо отобрать прибыльные сделки. Анализируем время жизни каждой позиции (до ее закрытия по тейк-профиту или в ручном режиме), сравниваем его со временем других сделок и определяем среднее значение. Это среднее значение и будет оптимальным таймфреймом для торговли бинарными опционами.

Адаптация правил манименджмента

К счастью, с правилами манименджмента при адаптации стратегии под торговлю БО никаких особых трудностей нет. Все даже немного проще, ведь размер прибыли и убытка заранее известен. Поэтому трейдеру остается придерживаться правила выбора такого объема опциона, который не превышал бы установленного самим трейдером уровня риска. Как правило, этот уровень находится в диапазоне от 1 до 5%.

Тем не менее, есть нюансы с торговыми стратегиями, построенными на методе Мартингейла, о котором мы говорили ранее в книге. При их использовании для торговли БО рекомендуется использовать специальный мартингейл-калькулятор для бинарных опционов, множество вариантов которого на любой вкус можно без труда найти в Интернете.

За время существования трейдинга было создано огромное количество торговых стратегий, поэтому, при всем желании, вряд ли среднестатистический трейдер придумает что-то принципиально новое. Да и стоит ли выдумывать велосипед?

Намного проще воспользоваться уже давно знакомой вам стратегией, которая постоянно приносит прибыль на валютном рынке, адаптировав ее к торговле бинарами. Это намного проще, чем вы думаете, а адаптированные под БО системы зачастую не только сохраняют свою эффективность, а даже увеличивают ее.

#



Зарабатывай на бинарных опционах в МТ4

Профессиональный терминал – это половина успеха в торговле!

Все инструменты технического анализа: индикаторы, графики, 27 валютных пар, торговые сигналы

Торговые условия:

Три терминала: MetaTrader 4, WebTrader PRO

Досрочное закрытие

Срок от 1 минуты, ставка от \$1

Депозит от \$10

Торговля со смартфона

WebTrader Classic

Возврат 10% живых денег от убытков

День безубыточной торговли

Прибыль до 86%

.....

Дополнительные сервисы:

Обучение и аналитика, торговля роботами, персональный менеджер

**Получить \$20.000 на
демо-счет**

gcoption.com

Заключение

Трейдинг на валютном рынке – это на 100% удачная торговая стратегия. Более половины ее успешности зависит от внимательности, дисциплинированности трейдера, а также от умения применять, модифицировать и адаптировать под текущее рыночное движение. Остальные проценты отдаем под психологическую подготовленность и выбор брокера, о чем обязательно поговорим в следующих книгах.

Стратегия – это очень глобальный вопрос, который требует собранности и гибкости одновременно, это практически ваша интерпретация рынка, которую вы применяете, чтобы получить прибыль.

Надеемся, что наши лайфхаки стали полезны для вас и усилили вашу торговую стратегию и уверенность в себе как в трейдере. С радостью раскроем и другие секреты рынка, если у вас остались вопросы по торговым стратегиям. Пишите в редакцию журнала Фортрейдер ваши предложения по темам, которые вам интересны. Мы обязательно раскроем их для вас.

А пока, возможно, вас заинтересуют уже опубликованные наши книги:

- Книга 1. Легендарный Ишимоку. Торговая стратегия по индикатору Ишимоку в деталях.
- Книга 2. Лайфхак для трейдера ч.1. Секреты прибыльных спекуляций
- Книга 3. Эффективные валютные инвестиции. 4 постулата доверительного управления

