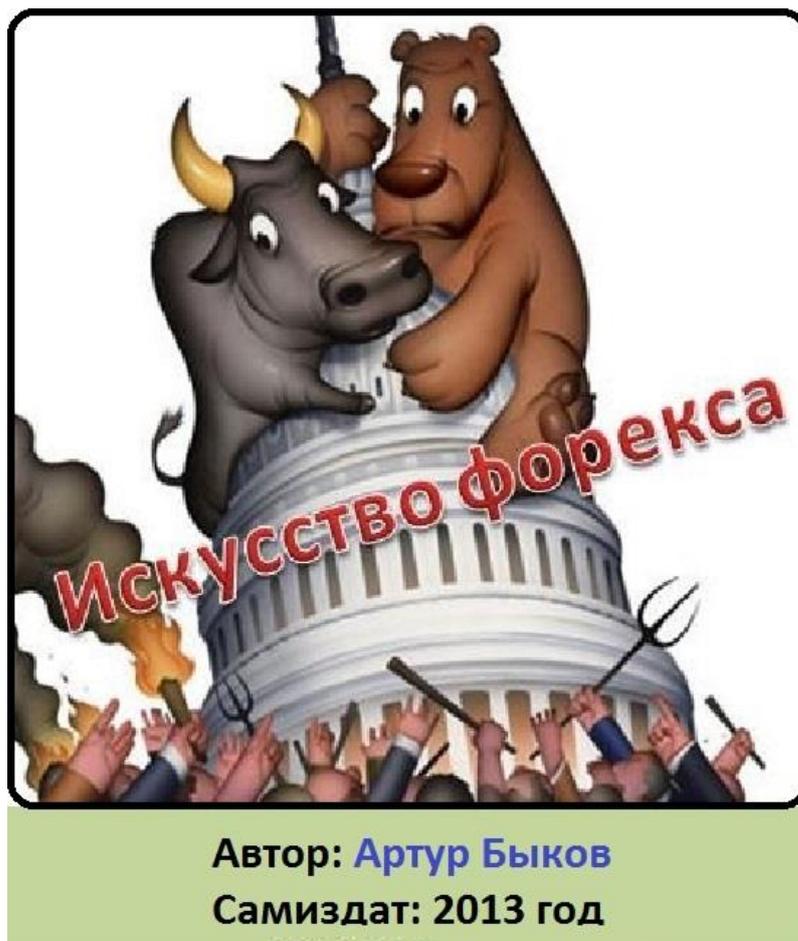


Искусство форекса (трейдинга на валютном рынке).

Автор: Артур Быков (Serious_Trading)

Методическое пособие для тех, кто желает зарабатывать деньги на форексе системным способом!



>>> Книга для бесплатного распространения<<<

Оглавление

[Введение](#)

[Раздел I. Философия \(психология\) успеха](#)

- [1\) Откуда берётся «стресс» и как с ним работать?](#)
- [2\) Простая техника для снятия стресса \(успокоения ума\).](#)
- [3\) Правильные цели и хорошие планы](#)
- [4\) Естественный ход вещей. Действуй покоем!](#)
- [5\) Остерегайтесь авторитетов \(гуру\) и прогнозистов \(аналитиков\)!](#)

[Раздел II. Риск менеджмент или «Укрощение риска»](#)

- [1\) Пойми и прими риск!](#)
- [2\) Как рассчитать торговый лот?](#)
- [3\) Управляй рисками правильно! Или фиксированная доля риска.](#)
- [4\) Неправильные \(опасные\) методы управление деньгами \(мартингейл, неизменный лот\)](#)

[Раздел III. Концепции прибыльной торговли](#)

- [1\) Рыночные фазы](#)
- [2\) Торгуем волатильность](#)
- [3\) Торгуем импульсы \(пробойные методы торговли\)](#)
- [4\) Входим в тренд \(рыночное движение\) на откате](#)
- [5\) Используем ложные пробойи](#)
- [6\) Зарабатываем на паттернах](#)

[Заключение](#)

[Об авторе](#)

Введение

Первоначально, книга издана в 2013 году.

В 2024 году книга была переработана. Полностью переработан раздел «психология трейдинга». Так же изменены некоторые картинки и пояснения к ним.

Данная книга адресована трейдерам, которые уже освоили азы форекса, но ещё не достигли стабильных и положительных результатов. Даже это скорее не книга, а краткое методическое пособие. Заранее извиняюсь за краткость. Дело в том, что я практикующий трейдер и поэтому много времени уходит на разработку торговых стратегий и на сам процесс торговли. Поэтому у меня нет ни времени, ни желания писать много «воды» и переливать из пустого в порожнее.

Я постарался коротко и ясно объяснить суть успешного трейдинга (так как его сам понимаю).

Книга состоит из трех разделов:

Раздел 1. Философия успеха

Раздел 2. Риск менеджмент или «Укрощение риска»

Раздел 3. Торговые стратегии или «Основные концепции трейдинга»

Рекомендую изучить все разделы. Понимаю, многим новичкам не терпится добраться до концепций прибыльной торговли. Хочется получить волшебную формулу делания денег. Не торопитесь. Без основательного «ремонта мозга» вам вряд ли достичь успеха! Что толку от торговых стратегий, если в решающий момент трейдер испытает панический страх, и не будет следовать своему торговому методу?

Риск менеджмент также очень важен. От того как вы управляете своими деньгами и рисками (а это почти одно и тоже, ведь риски влияют на ваши деньги, а ваши деньги приходится подвергать риску) зависит ваш успех.

Третий раздел говорит сам за себя.

Уверен, данная книга поможет вам стать более успешным трейдером.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Раздел I — Философия (психология) успеха.



Откуда берётся «стресс» и как с ним работать?

Трейдинг — очень стрессовый вид деятельности. Трейдеров преследуют постоянные перепады эмоций: если есть прибыль — радость, если убыток — печаль. И постоянное волнение когда цена болтается туда-сюда (нет ни прибыли ни убытка).

Поэтому очень важно научиться работать со своими эмоциями и справляться с психологическими перегрузками.

Давайте рассмотрим вопрос — что такое «стресс»?

Кратко, стресс — это реакция организма на неблагоприятные внешние воздействия (или реакция на угрозу «негативной ситуации»).

Например, угроза (вероятность) увольнения или распада семьи может вызвать сильный стресс (хотя сама ситуация, фактически, ещё не произошла. Может она вообще не произойдёт).

Давайте посмотрим действительно ли «неблагоприятные воздействия» (ситуации) являются таковыми или это просто «игры нашего ума».

Для большинства людей распад семьи или потеря работы — серьёзный стресс.

Но есть и такие люди, которые женятся и разводятся много раз (и каждый раз по любви!). Для них создание (и прекращение) семейных отношений не является чем-то сложным.

Таким образом дело не в самих ситуациях, не в самом «стрессе», дело в нашем уме. Точнее, дело в шаблонах нашего ума.

То, что разрушает наши шаблоны — и есть наш личный стресс!

Человеческий ум стремится к стабильности и шаблонности. Почти все люди мыслят и действуют по шаблонам, которые внедрило в них общество и семья.

Ум говорит нам, что «правильно», а что «неправильно». Что «полезно», а что «вредно».

Наш ум — это наша проблема. Чем больше вы знаете информации — тем больше шаблонов сформировано.

Шаблоны поведения (мышления и действий) немного упрощают нам жизнь. Но именно они являются источником СТРЕССА!

Почему у детей почти не бывает стрессов?

Они легко ругаются, мирятся и редко о чём-то сильно переживают!

У детей ещё мало шаблонов в голове. А раз мало шаблонов, то и стрессу взяться неоткуда.

Промежуточный вывод:

Стресс = несоответствие реальности нашим ожиданиям (нашим стереотипам и шаблонам).

Что бы уменьшить стресс — надо успокоить ум. Это можно сделать с помощью физических упражнений (бег, плавание, умеренные занятия в тренажерном зале и т. п.) Путешествия и периодическая смена деятельности — тоже немного помогают.

Моя любимая техника успокоения ума — ждёт вас в следующей главе.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Простая техника для снятия стресса (успокоения ума).



Живая (динамическая) медитация Артура Быкова

Упражнение опирается на даосизм и на мысли Джидду Кришнамурти.

Краткая суть:

Мы действуем через РАСЛАБЛЕНИЕ, НАБЛЮДЕНИЕ и ПОКОЙ.

Когда мы НАБЛЮДАЕМ — ум успокаивается (он не думает о прошлом или будущем).

В даосизме сказано:

«покой является началом всякого движения»

Сама техника: Покой, наблюдение и отсутствие критики.

1. Поставьте будильник (таймер) на ЛЮБОЕ удобное для вас время (5-10, 20 или больше минут). Каждый раз вы можете варьировать время по настроению.
2. Примите любую удобную позу (сидя, лёжа или стоя)
3. Наблюдайте свои мысли или внешние звуки или ощущения в своём теле.
4. Внимательно следите за всем на что обращает внимание ваш ум.
5. Не пытайтесь контролировать или оценивать (осуждать). Просто следите за этим потоком мыслей, внешних звуков и ваших ощущений.

Пример (как может происходить ваша живая медитация):

Вы услышали лай собаки за окно – наблюдаете за этим лаем. Затем вы вспомнили что-то из вашего прошлого – смотрите за этим. Потом возникло покалывание в левой ноге – вы следите за этим.

Артур Быков. Сайт: blog-forex.org

Возникла картина из прошлого и эмоция (гнев, обида и т.п.) – вы просто наблюдаете за этим. И т.д. и т.п.

Всё это делаете внимательно без осуждения, без контроля и без напряжения.

Идёт поток мыслей, образов и чувств – вы наблюдаете за ним.

Каждый день, каждый раз у вас будет уникальная живая медитация (т.к. поток мыслей и эмоций будет всегда разниться).

Что это даст?

Вскоре вы заметите, что ваши мысли и чувства меняются.

Вы становитесь более внимательны, собраны и спокойны.

Но это «живое» спокойствия (не вялость!). В любой момент (если нужно) вы можете перейти к активным действиям!

Ваши изменения происходят не через напряжение, а через РАССЛАБЛЕНИЕ и НАБЛЮДЕНИЕ!

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>

Правильные цели и хорошие планы



Итак, вы верите в себя и свои силы, это уже хорошо. Настала пора действовать. Для этого нужны правильные цели и хороший план действий.

Чем мечта отличается от цели?

Мечта – это что-то очень хорошее, но далёкое, и непонятно как достижимое.

Например, мечта быть богатым. Богатым – это сколько денег? Миллион? Миллиард? Нет конкретики, поэтому мечты редко сбываются.

Цель – это уже что-то более конкретное, осязаемое.

Достичь чего-то, выйти на уровень дохода в «XXX»\$

План действий – это меры, направленные на достижение цели.

Правильная цель должна:

- 1) Быть чётко и ясно сформулирована
- 2) Иметь срок достижения
- 3) Быть реалистичной
- 4) Зависеть от ваших усилий

Например, трейдер поставил цель: «Изучить методы торговли по тренду за 2 недели»

Цель чётко сформулирована, имеет срок реализации, реалистична и полностью зависит от усилий трейдера.

Пример неправильной цели:

Артур Быков. Сайт: blog-forex.org

«Заработать 10000\$ на форексе в течение 1 месяца»

Несмотря на то, что эта цель четко и ясно сформулирована и имеет срок достижения, она мало реалистична и успех зависит от многих внешних факторов.

Например, если у трейдера депозит 5 копеек, то цель (получение дохода в 10000\$) невыполнима.

Но самое главное, что когда мы ставим цель, связанную с конкретным доходом, мы рискуем попасть в опасную ловушку. Дело в том, что наш доход на форексе зависит от наших умений, нашего торгового капитала и от... самого рынка.

В бизнесе, спорте и на форексе случайный фактор очень велик. Знания и опыт значительно уменьшают роль случайного фактора, но устранить его полностью невозможно.

Желательно ставить такие цели, которые на 100% (или почти на 100%) зависят от вас. Узнать что-то новое, прочитать книгу, посетить семинар, «прокачать» навык – эти цели полностью зависят от вас.

План действий.

Любой план действий – это уже хорошо.

Я постоянно пишу себя ежедневные (ежемесячные) планы. Часто бывают, что планы выполняются мной процентов на 20-50%.

Почему так происходит?

Почему одни цели и планы легко выполняются (достигаются), а другие «тормозят и буксуют».

Потому что они (цели и планы) могут нарушать естественный ход вещей!

Об этом смотрите следующую главу!

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Естественный ход вещей. Действуй покоем (недеянием)!



Мы привыкли к тому, что успех достигается путём планирования, активных действий, напряжения. Но есть и другой подход — это достижение целей через расслабление. Это «действие покоем». Это «восточный подход», который практикуется в йоге и даосизме.

Мало людей знают про этот подход т. к. большинство книжек и видео рассказывают про «мотивацию», «успешный успех», «повышение эффективности» и тому подобный бред.

Недеяние (у вэй) в даосизме — это отрицание целенаправленной деятельности, идущей вразрез с естественным миропорядком.

Это отказ от деятельности, которая может нарушить естественный ход событий.

Важно отметить, что у вэй — это не бездействие, а **деятельность человека, которая согласовывается с естественным ходом миропорядка**. Всякое действие, противоречащее Дао, означает пустую трату сил и приводит к неудаче и гибели.

При руководстве коллективом тоже можно пользоваться “недеянием”.

Эту идею в даосизме считают уместной даже при выборе стратегии руководства государством: правитель должен ограничить своё вмешательство в жизнь государства и народа, его деятельность должна быть сведена к минимуму.

Но что значит деятельность, которая согласуется с естественным ходом миропорядка?

Есть два основных критерия, которые помогут понять (почувствовать) естественный ход вещей.

1) Ваши мысли и чувства.

Если задуманное вами действие вызывает у вас протест или дискомфорт – это признак нарушения естественного хода вещей.

2) Окружающие вас люди и ситуации

Если всё получается легко и просто, люди вам помогают (всё идёт “как по маслу”) – значит ваши действия согласуются с естественным природным ритмом. Вы на правильном пути.

В противном случае – если обстоятельства и люди против вас – лучше успокоиться и ничего не делать!

Давайте рассмотрим примеры ИЗ ЖИЗНИ когда люди «действуют покоем».

— — —

Пример №1 Неподвижная цапля

Цапля неподвижно стоит в ожидании добычи. Она не гоняется за своей едой по всему озеру (это глупо). Она неподвижна, расслаблена, но при этом, внимательна и собрана (бдительна). Как только представится подходящий случай – она будет действовать!

Пример №2 Поздравлять ли родственника (друга) с днём рождения?

По правилам приличия – это надо сделать (поздравить). Но Василию именно сегодня и именно сейчас не хочется этого.

Как же быть?

Следуя принципу недеяния Василий не должен поздравлять. Может быть, завтра ситуация (настроение) изменится и он поздравит завтра (но это не точно).

Пример №3 Пётр хочет просить повышение зарплаты у начальника

Вариант А.

Пётр чувствует, что ему мало платят и было бы правильно, что бы платили больше. Однако, он боится говорить об этом с начальством. Т.к. это, возможно, ухудшит его отношения с руководством.

Что делать?

Ничего не делать. Раз это (потенциальное) действие вызывает негативные эмоции (страх, тревогу и т.п.) значит оно сейчас неуместно.

Вариант Б.

Пётр почувствовал, что ему надо говорить с начальством о повышении зарплаты. При этом ему стало всё равно – испортятся ли его отношения с начальством или нет. Он осознал, что является ценным специалистом. Поэтому без проблем получит более высокую зарплату (здесь или в другой фирме).

Это уже совершенно другая ситуация! Можно смело говорить с руководством т.к. этот шаг

полностью соответствует «действию покоем»!

Пример №4 Юлия пытается «спасти» свою подругу

Подруга Юли познакомилась с явным аферистом. Очевидно, что он её использует и бросит.

Юля пытается сообщить о своих подозрениях подруге, но не встречает понимания. Подруга даже слышать ничего не хочет!

Что делать дальше?

Если Юлия будет упорствовать (убеждать подругу) – это нарушит естественный ход вещей. Похоже, что в данном случае, подруга должна быть обманута.

Есть классное выражение:

Если вы не смогли убедить человека за 5 минут, то не сможете убедить его и за 5 лет.

Поэтому просто не тратьте на это свои силы!

Общий вывод:

Ваши цели и планы могут быть ЛЕГКО достигнуты в 2-х случаях:

- 1) Вы спокойны, собраны и бдительны!
- 2) Вселенная (судьба) не противодействует вашим намерениям (в идеале — люди и обстоятельства помогают вам).

! Следите за реакциями своего тела (Нет ли дискомфорта и напряжения в теле?)

Тело, часто, будет сигнализировать нам, если мы занимаемся «не тем делом» или общаемся «не с теми» людьми!

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Остерегайтесь авторитетов (гуру) и прогнозистов (аналитиков)!



Большинство людей склонны доверять авторитетам. Наша культура построена на этом: авторитет родителей, учителей, учёных, звёзд шоу-бизнеса, «духовных лидеров» и т. п.

Действительно, зачем думать самому, когда за тебя сделают это компетентные люди?

Конкретно на Форекс это не работает! Проблема в том, что:

- 1) Невозможно точно определить квалификацию «авторитетов» и «прогнозистов» (среди них много жуликов)
- 2) Когда вы следуете чужому мнению, то сами не думаете (и не развиваетесь).
- 3) Даже если у человека была высокая квалификация в прошлом, то далеко не факт, что она таковой является в настоящем.

Дело в том, что рынки меняются. Торговые методы и системы, со временем, теряют свою эффективность. Не факт, что гуру сможет перестроиться под текущие рыночные условия.

Поэтому не тратьте времени на «авторитетов» и «прогнозистов»! Лучше разберитесь с рыночными закономерностями и создайте собственную торговую систему (стратегию).

Есть хорошая поговорка:

«На финансовых рынках нет авторитетов (кроме самих рынков)».

Ваш торговый метод должен говорить вам когда покупать и когда продавать ценовые активы.

[<<Вернуться к оглавлению>>](#)

Раздел II - Риск менеджмент или «Укрощение риска».



Пойми и прими риск!

Давайте рассмотрим, как делаются деньги в реальном секторе экономики. Упрощенно, работает следующая схема:

деньги => товар => деньги

Теперь давайте рассмотрим, как делаются деньги в форекс трейдинге:

деньги => риск => еще большие деньги

Что бы делать деньги, трейдер должен подвергать свой капитал риску.

Риск (упрощенно) - это вероятность возникновения неблагоприятного события. Например, трейдер купил евро-доллар. Существует риск того, что трейдер понесет убытки (если евродоллар начнет падать). Обратите внимание, **СУЩЕСТВУЕТ ВЕРОЯТНОСТЬ** убытков (но не факт, что будут именно убытки).

Большинство людей ненавидят форекс риск и любят стабильность. Сама мысль о том, деньги могут быть потеряны, ввергает народ в ступор (или панику). Если вы хотите быть трейдером профессионалом, вам просто необходимо грамотно управлять своими рисками.

Артур Быков. Сайт: blog-forex.org

Важно понять следующие вещи:

- 1) Риск существует не только на форексе, но и в любой сфере деятельности человека (например, риск быть уволенным, брошенным и т.п.), просто на форексе риск выражен более явно.
- 2) Избежать риска полностью – НЕВОЗМОЖНО. Но можно ГРАМОТНО УПРАВЛЯТЬ СВОИМИ РИСКАМИ.
- 3) Риску должна подвергаться небольшая часть вашего капитала.

В этом случае трейдер сможет пережить серию неблагоприятных событий (несколько убыточных сделок подряд) и у него останется капитал для продолжения игры.

Трейдеры бывают двух типов – те, у кого есть капитал для совершения сделок и те, у кого закончились деньги. Если у вас закончатся деньги, вы не сможете отыграть убытки.

Давайте поговорим о прибылях.

Сколько зарабатывают форекс трейдеры – это вопрос, который волнует большинство новичков.

Конкретного ответа нет, так как заработок трейдеров зависит, как минимум, от 4 вещей:

- 1) Эффективности торговой системы
- 2) Количества совершаемых сделок
- 3) Размера торгового депозита
- 4) Величины риска в каждой сделки

Про торговые системы мы подробнее поговорим в последующих главах книги.

Количество сделок – думаю, тут все понятно. Чем больше у нас сделок, тем выше наша «оборачиваемость» - тем выше наши потенциальные доходы.

Размер торгового депозита – тоже все просто. Если у трейдера депозит 5 копеек, то и доход будет копейки...

Четвёртый пункт (величина риска в каждой сделки) разберем подробнее на примере.

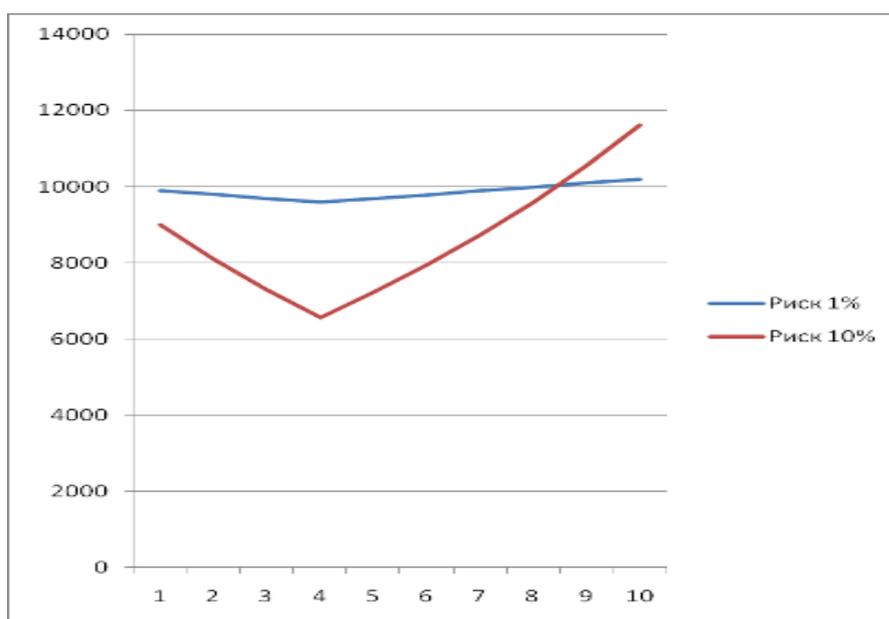
Пример:

Два трейдера торгуют по одинаковой системе, на одинаковом депозите в 10000\$. Единственное различие - в уровне риска.

Трейдер «А» торгует с риском 1% на сделку

Трейдер «Б» торгует с риском 10% на сделку

Торговая система дала следующий результат: 4 убыточных сделки подряд, затем 6 прибыльных сделок подряд (размер 1 убытка = размеру 1 прибыли). Давайте посмотрим на то, как изменялся размер торговых депозитов обоих трейдеров.



Трейдер «А» торговал на форексе почти без риска для своего капитала. А вот у трейдера «Б» наблюдалась драматическая картина. Сначала депозит упал с 10000 до 6561\$ (4 убытка подряд), затем поднялся до 11600\$ (6 прибылей подряд).

Как видно на этом условном (но реалистичном) примере – хорошая прибыль возможно при больших ставках (рисках на 1 сделку). Единственная опасность больших рисков в том, что торговый депозит может «треснуть» - не выдержит убыточной фазы. Может получиться, что трейдер не доживет до выигрышной серии сделок.

Всегда контролируйте свои риски на фореке!

Даже если вы очень уверен в себе (имеет хорошую торговую систему) я не рекомендую рисковать в 1 сделке более чем 15% торгового депозита. На самом деле, рисковать пятнадцатью процентами в одной сделке – это огромный риск.

Ещё раз хочу подчеркнуть – потери денег на фореке неизбежны.

Все люди сталкиваются с рисками. Например, боксер понимает, что периодически будет получать удары по голове. Таксист понимает, что периодически будет иметь дело с пьяными и дерзкими пассажирами и т.д.

Риски и потери в трейдинге – это неотъемлемая часть игры. Это надо понять и принять. Но в тоже время надо следить, что бы риску подвергалось МАЛЕНЬКАЯ часть вашего торгового капитала.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>

Как рассчитать торговый лот?



В этой главе мы поговорим о грамотном риск менеджменте форекс. Тема эта очень важная и от неё во многом зависит ваш успех на ниве форекса.

Мы не можем точно определить - будет ли наша сделка прибыльной или убыточной. Но мы можем управлять риском, держать его под строгим контролем, что бы убытки нас не разорили.

Для эффективного контроля рисков нам надо использовать стоп лоссы (stop loss) и правильно выбирать размер (лот) открываемой сделки.

Величина открываемой сделки определяется с помощью простой формулы:

Торговый лот = Величина риска в долларах / на величину стопа / стоимость пункта

Не очень понятно?

Давайте разберём все действия пошагово и на примере:

1) Надо определить количество денег, которым мы будем рисковать в 1 сделке.

Допустим, депозит трейдера 1500\$. Он желает рисковать в одной сделке 5% от депозита.

Надо найти, сколько это будет в долларовом эквиваленте. Для этого мы:

величину депозита * величину риска / 100

Риск в долларах будет равен:

$1500 * 5 / 100 = 75\$$

2) Нам необходимо учесть величину стоп лосса.

Величину стопа мы берем согласно нашей торговой системе (ТС).

Предположим, трейдер купил евро по 1,2600, а стоп-лосс установил на отметку 1,2410.

Величина стопа равна $1,2600 - 1,2410 = 0,0190$ или 190 пунктов.

3) Затем, нам необходимо учесть стоимость 1 пункта.

По валютным парам EUR/USD, GBP/USD, AUD/USD, NZD/USD стоимость пункта - фиксированная и составляет 10\$ на 1 лот. Для того что бы узнать стоимость 1 пункта по другим валютам можно воспользоваться калькулятором трейдера (калькулятор трейдера можно легко найти интернете).

В приведенном примере, мы знаем величину риска в долларах (75\$), мы знаем величину стопа (190 п.), мы знаем стоимость 1 пункта (10\$). Единственное чего мы не знаем – это размер позиции (торговый лот).

4) Торговый лот = Величина риска в долларах / на величину стопа / стоимость пункта

5) В цифрах: $75 / 190 / 10 = 0,0394$

Округляем и получаем 0.04

Мы выяснили величину нашего рабочего лота. Теперь нам необходимо открыть сделку нужным лотом (0,04 л.), задав нужную величину стоп лосса (190 п.)

В этом и заключается суть грамотного управления риском форекс.

Разные ТС будем иметь разные величины стоп-лосса. Долларовый и процентный риск на одну сделку также может быть разным у разных ТС. По некоторым парам стоимость 1 пункта будет больше или меньше 10\$. Поэтому торговый лот (размер открываемой позиции) будет иметь разное значение.

!!!Внимание!!! Есть несколько важных уточнений.

1) Если у вас небольшой депозит (в пределах нескольких сотен долларов), то для грамотного выбора торгового лота вам желательно открыть реальный счет в центовом ДЦ. В противном случае вам придется значительно округлять торговый лот, что может вызвать негативные последствия для вашей торговли.

2) Если у вас центовый тип счета, то размер лота вычисляется по той же формуле, но результат необходимо умножить на сто. Например, 0,04 долларового лота, эквивалентно 4 центовым лотам ($0,04 * 100$).

3) Если у вас депозит не в долларах (например, в рублях или евро), то расчеты невозможно будет произвести со 100% точностью. Дело в том, что пока будет открыта сделка – может измениться курс рубля или евро – что может внести небольшие искажения. Как правило, данные искажения несущественны.

4) В приведенных расчётах использовались четырехзначные пункты (4 знака после запятой).
Пятый знак не учитывался.

Используйте стоп лоссы, грамотно рассчитывайте торговый лот, управляйте рисками! Это залог успешного риск менеджмента форекс, это залог ваших будущих побед.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Управляй рисками правильно! Или фиксированная доля риска.



Большинство трейдеров

относятся халатно к вопросу расчёта риска. Многие вообще его не рассчитывают. Действуют на глазок или по упрощенной схеме.

Например, «Рискуют 0.1 лотом на каждую 1000\$ депозита». Если депозит 4000\$, то будут рисковать 0.4 лотами.

Это неправильно!

Правильно в каждой сделке рисковать определенным процентом депозита. После получения прибыли (или убытка) величина депозита изменяется и надо снова рассчитывать риск от величины (уже изменившегося) депозита.

Пример:

Депозит 1000\$ Риск 7%

Риск в долларах будет равен:

$$1000 * 7 / 100 = 70\$$$

Трейдер открыл сделку. Допустим, получил убыток. Теперь депозит равен 930\$

7% от 930\$ будет 65.1\$

Теперь мы должны поставить на кон 65.1\$. Если депозит снова уменьшится, то необходимо высчитывать 7% риска от новой величины депозита. И так далее.

Процент риска должен оставаться неизменным. Но величина риска в долларах и торговый лот будут постоянно меняться (из-за изменения депозита)

Артур Быков. Сайт: blog-forex.org

Такая тактика управления капиталом даёт вам огромное преимущество.

Если вы попадете в неудачную полосу (несколько убытков подряд), то вы сможете достаточно безболезненно пережить её (так как будете уменьшать ваш долларовый риск). В прибыльной фазе, напротив, вы будете увеличивать свой долларовый риск, потому что ваш депозит тоже будет увеличиваться.

Примеры:

Депозит 100\$. Мы рискуем 10% от нашего депозита. Если депозит уменьшается, то мы уменьшаем риск в \$ (риск в % остается неизменным).

Депозит в \$	Процент риска	Риск на 1 сделку в \$	Результат	Депозит после получения убытка
100	10%	10	Убыток	90
90	10%	9	Убыток	81
81	10%	8,1	Убыток	72,9
72,9	10%	7,29	Убыток	65,61
65,61	10%	6,56	Убыток	59,05
59,05	10%	5,9	Убыток	53,14
53,14	10%	5,31	Убыток	47,83
47,83	10%	4,78	Убыток	43,05
43,05	10%	4,3	Убыток	38,74
38,74	10%	3,87	Убыток	34,87

После 10 убытков мы имеем 34,8\$. Т.е. потеряли почти 66%, но у нас есть деньги, мы можем совершать сделки!

А вот, что будет после 10 прибыльных сделок подряд.....

Депозит в \$	Процент риска	Риск на 1 сделку в \$	Результат	Депозит после получения прибыли
100	10%	10	Прибыль	110
110	10%	11	Прибыль	121
121	10%	12,1	Прибыль	133,1
133,1	10%	13,31	Прибыль	146,41
146,41	10%	14,64	Прибыль	161,05
161,05	10%	16,11	Прибыль	177,16
177,16	10%	17,72	Прибыль	194,87
194,87	10%	19,49	Прибыль	214,36
214,36	10%	21,44	Прибыль	235,79
235,79	10%	23,58	Прибыль	259,37

У нас 259\$!

Метод «Фиксированная доля (процент) риска очень хорош, но он имеет один недостаток. Это, так называемый, асимметричный рычаг. Это ситуация при которой приходится отыгрывать убытки меньшим торговым лотом, чем был до этого (до убытков). Следовательно, при равенстве прибыльных и убыточных сделок депозит трейдера будет уменьшаться.

Разберем эту ситуацию на примере.

У нас опять условный депозит в 100\$, риск 10%, были получены 5 прибылей, а затем 5 убытков.

Депозит в \$	Процент риска	Риск на 1 сделку в \$	Результат	Депозит после получения прибыли (убытка)
100	10%	10	Прибыль	110
110	10%	11	Прибыль	121
121	10%	12,1	Прибыль	133,1
133,1	10%	13,31	Прибыль	146,41
146,41	10%	14,64	Прибыль	161,05
161,05	10%	16,1	Убыток	144,94
144,94	10%	14,49	Убыток	130,45
130,45	10%	13,04	Убыток	117,4
117,4	10%	11,74	Убыток	105,66
105,66	10%	10,56	Убыток	95,09

Несмотря на то, что количество прибылей равно количеству убытков наш конечный депозит после серии сделок уменьшился (составил 95\$). Это было вызвано пресловутым эффектом асимметричного рычага.

Общий вывод

Несмотря на определенные недостатки, методы «Фиксированная доля (процент) риска является наиболее оптимальным. Он позволяет «пережить» значительные убыточные фазы (это самое главное)! А при наступлении прибыльных фаз в работе торговой стратегии, он позволяет значительно увеличить суммарную прибыль (за счёт реинвестирования).

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Неправильные (опасные) методы торговли и управления деньгами.



1) Торговля без защитных стоп лоссов.

Очень много новичков грешат этим «методом». Дело в том, что начинающему трейдеру непросто правильно выбрать точку фиксации убытков (если цена пойдёт «не туда»).

К тому же каждый человек по психологическим соображениям стремится всегда быть правым. Фиксация убытка – это признак «неправоты». Новичкам тяжело принимать убытки. Но делать это просто необходимо, т.к. это часть бизнеса под названием форекс трейдинг!

Стоп лосс должен быть обязательно. Как его правильно ставить – на этот вопрос должна отвечать ваша торговая стратегия. В большинстве случаев стоп лосс должен быть установлен в точке слома торгового сценария.

Например, трейдер торгует предполагаемый восходящий тренд. Необходимо задать себе вопрос:

- «На каком ценовом уровне тренд будет сломлен»? (вот туда и надо будет установить защитный стоп ордер).

2) Усреднение и мартингейл

Суть обоих методов в том, что трейдер открывает новые сделки против движения цены, тем самым наращивая свои убытки.

Например, трейдер купил 1 лот евро по цене 1.2500

Затем купил ещё 1 лот по цене 1.2400

Затем купил ещё 2 лота по цене 1.2300 и т.д. и т.п.

Суть этих действий в том, что незначительное движение в «нашу» сторону позволяет закрыть все сделки с суммарной прибылью.

Однако, если движения в «нашу» сторону не последует, то произойдет очень быстрое разорение (что чаще всего и происходит на практике).

Кстати, мартингейл по своей сути является полной противоположностью «Фиксированной доле риска». При усреднении и мартингейле трейдер наращивает свой риск при наступлении убытков (с целью быстро отыграться). А при «Фиксированной доли риска» трейдер, наоборот, уменьшает свой долларовый риск во время убыточной фазы торговой стратегии.

Мартингейл плох тем, что не противодействует разорению. Наоборот, в некоторых ситуациях (длительные убыточные серии) мартингейл ускоряет приход банкротства.

3) Пипсовка

Под пипсовкой понимают совершение множества сделок, каждая из которых приносит маленькую прибыль (несколько пунктов).

Проблема пипсовки в том, что приходится устанавливать стоп лосс значительно превышающий прибыль по сделкам. Таким образом, несколько убытков будут съедать всю прибыль.

К тому же, чем больше сделок, тем больше трейдер теряет денег на комиссии, спреде и проскальзываниях.

4) Одновременное открытие множества сделок

Допустим, трейдер открыл сделку по евро с риском 10%. Цена болтается туда-сюда, не задевая ни стоп лосс, ни тейк профит. Чтобы не терять время даром, трейдер решает открыть ещё одну сделку по фунту тоже с риском 10%.

Это уже опасный шаг. Т.к. суммарный риск по всем сделкам составляет 20%, что очень много.

Желательно иметь лимит риска по всем открытым сделкам. Например, лимит риска 15%. Это значит, что трейдер может одновременно открыть 3 сделки по 5%. Но если он захочет открыть новые сделки, то надо, либо закрыть часть предыдущих позиций, либо не открывать новые сделки вообще!

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Раздел III - Концепции прибыльной торговли

Рыночные фазы.

Давайте рассмотрим основные рыночные фазы:

Тренд



Данная рыночная фаза характеризуется плавным движением (в приведенном примере – восходящий тренд) и маленькими ценовыми откатами (движениями против тренда).

При данном состоянии рынка хорошо работают трендовые и пробойные стратегии всех типов (вход при пробое уровня или вход в тренд с отката)

Фаза флета.



Данная фаза характеризуется значительными ценовыми движениями как вверх так вниз. При этом направление движения не играет решающей роли. То есть, во время фазы флета мы можем открывать сделки, как на покупку, так и на продажу – цена, как правило, движение достаточное для получения хорошей прибыли.

Размашистая консолидация.



Если в предыдущих фазах цена двигается «правильно», то есть ровно и плавно, то при размашистой консолидации всё происходит иначе. Цена совершает разки броски (движения) в разные стороны. И при этом часто переписываются предыдущие максимумы и минимумы, что сбивает с толку трейдеров пытающихся торговать пробойные и трендовые сценарии.

При данной рыночной фазе хорошо работают стратегии, основанные на ложных прорывах.

Основная сложность при создании торговых стратегий (систем) заключается в том, что:

- 1) Торговая стратегия, идеально заточенная под одну из фаз, будет «сливать» в других фазах.
- 2) Мы точно не можем определить, когда закончится текущая рыночная фаза.

Решить данные проблемы можно следующими способами:

- 1) Разработать «Супер» стратегию, которая будет зарабатывать на благоприятных для неё участках рынка, при этом отфильтровывать все неблагоприятные участки
- 2) Создать несколько торговых стратегий под разные фазы рынка. Эти стратегии должны зарабатывать на благоприятных участках рынка больше денег, чем терять на неблагоприятных.

Первый путь – качественный, второй – количественный.

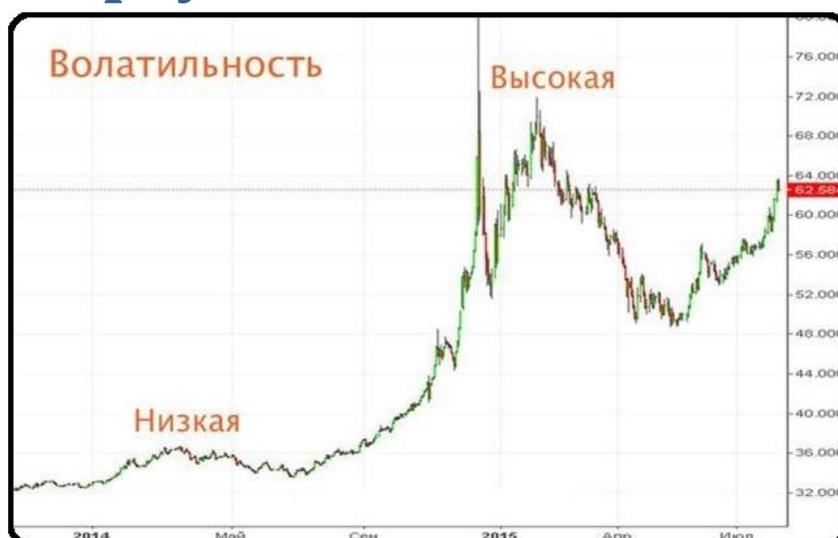
Новичкам больше нравится первый путь, а мне – второй. Наверно, поэтому большинство новичков всю жизнь гоняются за миражом «стабильно прибыльной системы», вместо того, что бы использовать множество систем, которые в целом будут зарабатывать больше, чем терять.

Какой путь для вас ближе – решать только вам.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Торгуем волатильность



Что такое волатильность?

Не буду вдаваться в академические тонкости и сложные формулы. По-простому, волатильность рынка – это размах колебаний цен за определенный период времени. Иными словами – это величина (в пунктах или процентах) которую цена проходит за 1 минуту (1 час, 1 день) и т.д.

Чаще всего волатильность считается в процентах, это позволяет сравнивать различные инструменты друг с другом (например, акции, валюты и фьючеры). На форексе, чаще всего расчет волатильности производят в пунктах (в пипсах).

Факторы, влияющие на величину ценовых колебаний:

- 1) Макроэкономические новости (ведут к кратковременным всплескам цен)
- 2) День недели
- 3) Месяцы (в летние месяцы и перед новым годом цены, как правило, очень вялые)
- 4) Тайм фрейм и т.д.

Значение для практического трейдинга

Волатильность имеет важнейшее значение для практического трейдинга, а именно:

- Позволяет выбрать наиболее перспективную (подвижную) валютную пару для торговли
- Позволяет отсеивать рыночный шум
- Позволяет грамотно рассчитывать стоп лоссы и тейк профиты

Артур Быков. Сайт: blog-forex.org

- Цикличность

Последний пункт (цикличность волатильности) позволяет создавать простые, но в тоже время прибыльные торговые стратегии.

Цикличность волатильности можно легко увидеть с помощью множества индикаторов. Например, с помощью полос Болинджера.



Обратите внимание, полосы расширяются вслед за ростом волатильности. И, наоборот, сжимаются при её снижении.

Стратегия торговли, основанная на пробое (всплеске, взрыве) волатильности достаточно проста:

- 1) Ждем периода сжатия (снижения) волатильности.
- 2) Выставляем отложенные ордера бай стоп (buy stop) и (sell stop) вблизи границ образовавшегося консолидационного канала.

Как это выглядит смотрите на рисунке:



Так как нам не было известно направление движения цен, мы выставили ордера в обе стороны.

Цена пробилла верхнюю границу канала, ордер бай стоп сработал и мы вошли в рынок. Если бы цена пошла вниз – то сработал бы ордер селл стоп.

Методы, использующие волатильность, не пытаются прогнозировать направление движения цен. Они лишь делают ставку на то, что после сужения волатильности последует её всплеск. И не важно, в какую сторону – вверх или вниз.

Достоинства метода:

(+) Простота

Недостатки метода

(-) Большое количество убыточных сделок

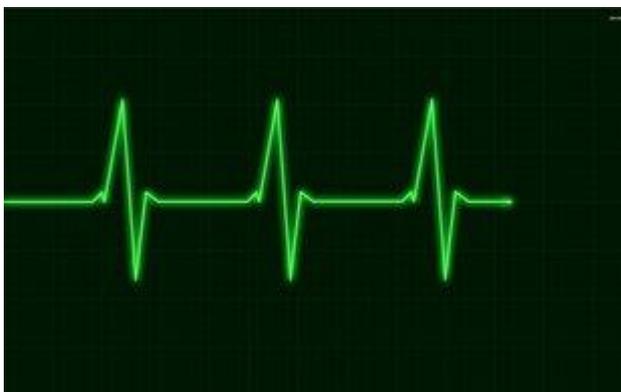
Количество убыточных трейдов будет примерно равно количеству прибыльных. Но потенциал прибыли в «хороших» сделках будет больше потенциала убытка в «плохих» сделках.

Следовательно, наш тейк профит будет больше стоп лосса, что позволяет зарабатывать в конечном итоге.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Торгуем импульсы (трендовые и пробойные методы торговли)



Трендовые и пробойные методы торговли. Данная концепция торговли перекликаются с пробоем волатильности. По сути это родственные методы торговли. Данная глава является логическим дополнением и продолжением предыдущей.

Пробойные методы базируются на второй аксиоме технического анализа. То есть на том, что начавшееся ценовое движение, скорее всего, продолжится.

Классическая схема действий при трендовой (пробойной) торговли:

- 1) Определяем зону консолидации цен (это может быть ценовой канал, полосы Болинджера и т.п.)
- 2) Дожидаемся выхода цены из зоны консолидации
- 3) Открываем сделку в расчете на продолжение ценового движения

Давайте посмотрим на дневной график пары евродоллар (конец 2010 года)



Горизонтальными линиями отмечен 20-и дневной ценовой канал. Пока цена движется в рамках канала трендовые трейдеры не предпринимают никаких действий.

Затем, в начале января произошел пробой нижней границы канала. Это сигнал для трендовых трейдеров играть на понижение. Прорыв оказался ложным – получили убыток.

В середине января цена пробивает верхнюю границу канала – это сигнал покупать для торговцев тренда. На этот раз пробой был успешен (цена несколько месяцев была в восходящем тренде). Обратите внимание, что при трендовой торговле можно позволить маленькие стоп лоссы. Если прорыв будет ложным, то это приведет к небольшому убытку. Рано или поздно установится тренд, который окупит все мелкие убытки.

Ключевым моментом при торговле истинных пробоев является фильтрация рынка с целью отсеивания ложных пробоев.

Наиболее действенные методы фильтрации рынка:

- А) Вход в рынок значительно ВЫШЕ уровня сопротивления или НИЖЕ уровня поддержки.
- Б) Вход в рынок на втором рыночном движении.

Давайте посмотрим, как эти две техники позволили бы нам отфильтровать ложные пробойи.



Вход ниже уровня поддержки. Если бы мы разместили ордер «sell stop» на 30-50 пунктов ниже уровня поддержки, то он просто бы не сработал. Цена отскочила, не задев наш ордер.



На графике рассмотрена ситуация «Б».

- 1) Цена пробила уровень 1.2805

Артур Быков. Сайт: blog-forex.org

- 2) Мы подождали несколько свечей после пробоя и выставили ордер sell stop на локальный минимум предполагаемого прорыва (1.2754)
- 3) Второго движения вниз не последовало, и мы снова избежали убытков!

Вход на втором движении – это одна из моих самых любимых техник торговли!

Общий вывод:

В момент непосредственного пробоя лучше всего выжидать. Принимайте торговые решения спустя несколько торговых свечей.

Если цена проходит через технический уровень, как нож сквозь масло, то прорыв, скорее всего истинный (такие ситуации бывают нечасто).

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Входим в тренд (рыночное движение) на откате ценовой волны



При входе в тренд с отката схема действий трейдера выглядит следующим образом:

1) Ждем формирования устоявшегося тренда (для этого используем либо индикаторы, либо ценовые уровни)

2) Ждем, когда цена сделает коррекцию (движение против основного тренда)

Для определения коррекции можно использовать индикаторы, ценовые уровни или скользящие средние.

3) Открываем сделку против коррекционного движения, т.е. делаем ставку на то, что коррекция будет преодолена и возобладает основное (трендовое) движение.

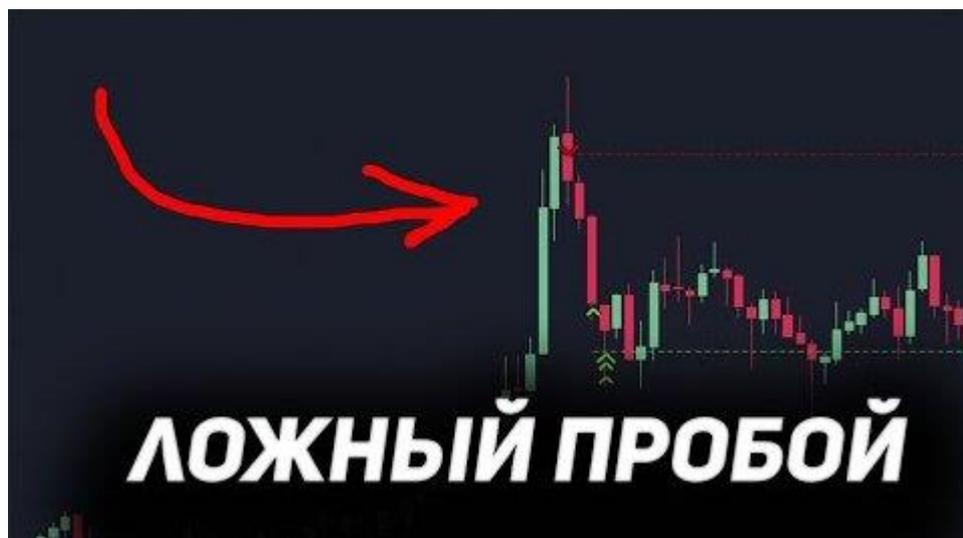


На рисунке в качестве сигнала для вход использовалась 50-и дневная скользящая средняя. Можно использовать скользящие средние с другими периодами. Главное, что бы не нарушалась логика действий, которая описана выше.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Торгуем ложные пробой



Ложные прорывы являются, пожалуй, моим самым любимым методом торговли. Существует множество схем торговли ложных пробоев, я опишу ту, которую использую сам при торговле на паре евродоллар.

Схема торговли ложных прорывов:

- 1) Определяем некую «точку равновесия цены» (это может быть цена открытия дня (свечи), скользящая средняя или ценовой уровень).
- 2) Ждем, когда цена сделает значительный рывок (вверх или вниз – не важно) от точки равновесия
- 3) В ближайшее время (чем быстрее, тем лучше) цена должна полностью отыграть ценовое движение, обозначенное в пункте «2».
- 4) Открываемся в противоположную сторону (против первоначального движения) вблизи «точки равновесия цены».



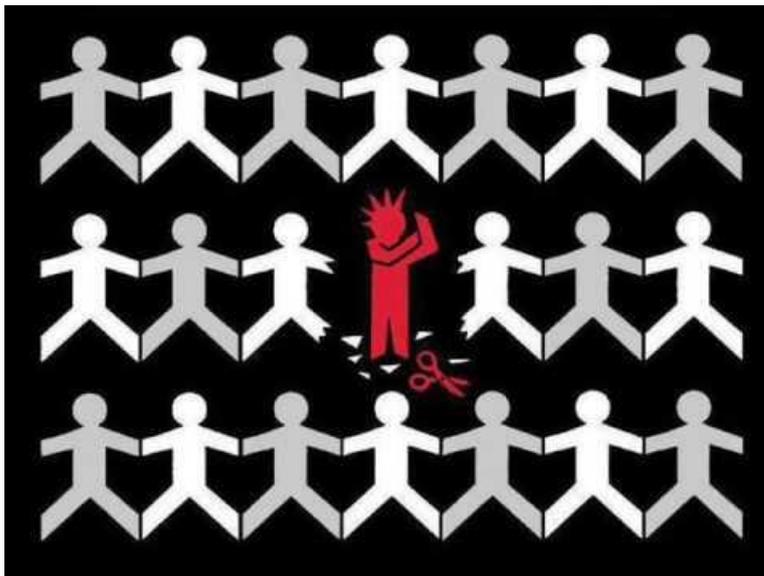
На рисунке мы видим «мощное» движение (по отношению к предыдущим свечам) и «быстрый разворот». Чем быстрее (по времени) состоится разворот, тем больше шансов на мощное движение в противоположную сторону.

Если, допустим, после сильного движения цена быстро не отскакивает, начинает консолидироваться – болтается туда-сюда, то данная ситуация мало подходит для торговли ложного прорыва.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Зарабатываем на паттернах (шаблонах)



Паттерн в переводе с английского означает «шаблон». Это тактическая ситуация на рынке, которая дает существенные шансы на движение цены в строго определенную сторону.

В отличие от трендовых торговых систем, которые делают ставку на продолжение движения цены или контр трендовых стратегий, которые ищут точку разворота, торговля паттернов не всегда учитывает ценовое движение в чистом виде.

То есть нам не важно, где тренд, нам важно определить тактические рыночные ситуации (паттерны), которые мы можем однозначно трактовать и использовать для получения прибыли.

Примером паттернов на форекс могут служить: комбинации японских свечей, фигуры классического теханализа (голова и плечи, флаги, вымпелы, треугольники и т.п.), ценовые формации из теории Эллиотта. Строго говоря, паттерном может быть все что угодно. Например, трейдер увидел закономерность движения цены после комбинаций:

Три растущие дня подряд + 1 снижающийся день

Это тоже будет паттерном (хотя не факт, что он даст нам существенное преимущество).

В контексте паттернов трейдер не обращает внимание на глобальные вещи (такие как тренд, уровни поддержки и сопротивления и т.п.). Здесь главное поиск тактических ситуаций с быстрым входом и выходом из рынка.

Давайте рассмотрим некоторые свечные паттерны форекс.

Тема японских свечей обширная и хорошо изученная. По данному вопросу написаны целые книги. Поэтому не будем уходить далеко в теоретические дебри, а рассмотрим только самую сильную комбинацию свечей, которая приносит прибыль на фьюресе.

Рекомендую обратить внимание на свечи под названием «висельник» и «повешенный». Отличительный признак данного типа свечей в том, что они имеют большую (даже огромную) тень и маленькое тело свечи.

Свечи молот



Строго говоря, первая свеча не является «висельником». Формально эта свеча является «бычьим поглощением». Но, тем не менее, она взята в качестве примера т.к. у данной свечи большая тень (и размер тени больше размера тела свечи).

Как действовать трейдеру, торгующему данный свечной паттерн?

- 1) Надо дождаться свечи, с большой тенью и маленьким телом
- 2) Открываем сделку против направления тени. То есть, если большая тень была направлена вверх, мы должны продавать. Если большая тень направлена вниз, мы должны покупать.
- 3) Защитный стоп лосс располагаем на уровне тени свечи.
- 4) Прибыль фиксируем, при движении цены на расстояние равное (или большее) тени «сигнальной свечи».

(См. рисунок)



По моим наблюдениям – это самая сильная комбинация, которая работает на всех временных интервалах (например, на часовом или на дневном графике). Конечно, есть и другие свечные паттерны, но они не такие мощные.

Мне очень нравится **паттерн «голова и плечи»**. В отличие от предыдущего он весьма субъективен. То есть успех его использования во многом зависит от опыта и навыков конкретного трейдера.



Существует огромное количество паттернов Forex, как общеизвестных так и авторских. **Однако, у всех паттернов существует «общий знаменатель»:**

На рынке происходит необычная ситуация, которая заставляет большинство трейдеров **ДЕЙСТВОВАТЬ.**

По сути, поиск прибыльных форекс паттернов заключается в умении находить такие необычные ситуации.

Суть любого паттерна – необычная ситуация на рынке, которая вызовет у трейдеров приступ оптимизма или страха, которая заставит их действовать.

Еще одно важное замечание.

Многие паттерны работают не так, как написано в книгах. Дело в том, что большинство материалов по форексу написаны по мотивам книг 30 летней давности. Тогда был немного другой рынок. То есть надо сверять полученные знания с текущей рыночной обстановкой.

Тема паттернов поистине неисчерпаема! Например, ситуация с трендами гораздо проще. Тренд либо есть, либо его нет. Если тренда нет, то ЛЮБАЯ трендовая система будет давать убытки.

Напротив, поиск торговых моделей дает почти безграничные возможности в плане успешного трейдинга. Мы можем найти шаблоны, которые работают в обстановке тренда и флета. Мы можем искать простые паттерны, которые формируются в течение 1-2 свечей или напротив, многофигурные и многофазовые комбинации...

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

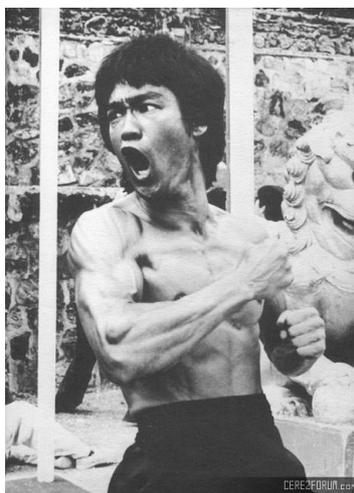
[<<<Для прочтения следующей главы листайте вниз>>>](#)

Заключение

Рекомендую выбрать понятные ЛИЧНО вам паттерны, торговые методы, стратегии и оттачивать их до совершенства.

Как сказал Брюс Ли:

Неопасен мастер, который знает 10000 ударов. Опасен мастер, который изучил 1 удар 10000 раз!



Может получиться, что вы потратите много сил времени и денег, а результата в трейдинге не добьётесь...

Что делать в такой ситуации?

Действовать покоем!

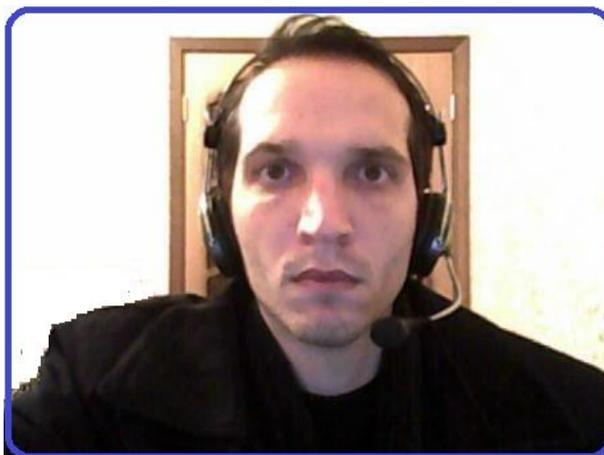
А если это не помогает, что делать?

Всё равно действовать покоем!

Добьётесь или не добьётесь вы успеха на форексе – это не имеет никакого принципиального значения! Если вы действуете покоем, то обязательно сможете реализовать себя в какой-либо другой сфере.

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

Об авторе



Зовут меня Артур Быков. Много лет занимаюсь финансовыми рынками (более 8 лет).

Моя деятельность:

- Торгую на личных счетах.
- Разрабатываю торговые системы и стратегии.
- Создаю собственные автоматические торговые системы

Моя скромная обитель (блог по ТРЕЙДИНГУ):

<http://blog-forex.org/>

Мой блог по вопросам духовного развития, философии и конспирологии:

<http://agydar.ru/>

Заходите, читайте статьи, смотрите видео!

[<<<Вернуться к оглавлению>>>](#)

>>> Книга для бесплатного распространения<<<