

Евгений Базарный

Основы биржевой торговли



Часть первая
Теория

Евгений Базарный

**Основы биржевой
торговли. Часть 1. Теория**

«Автор»

2023

Базарный Е.

Основы биржевой торговли. Часть 1. Теория / Е. Базарный —
«Автор», 2023

Данная книга написана простым и понятным языком для любого уровня и возраста человека. В ней изложена основная теоретическая часть, а также не много практики. После прочтения данной книги я с уверенностью могу сказать, что вы готовы начать практиковать торговлю на бирже и зарабатывать первые деньги. Вся информация в книги универсальна и подходит для торговли на любой торговой площадке и для любых активов.

© Базарный Е., 2023

© Автор, 2023

Евгений Базарный

Основы биржевой торговли. Часть 1. Теория

Курс обучения трейдингу и инвестированию.

Добро пожаловать на обучающий курс по трейдингу и инвестированию. В его основе лежит собственный опыт и адаптированные материалы с нескольких трейдерских школ.

Я знаю, что вы выбросите из головы все предостережения и начнете глотать уроки один за другим. Потому что изучения основ трейдинга, очень увлекательно, все это очень интересно и занимательно, дело понятное.

Важно понимать. Этот курс обучения рассчитан минимум на 2-3 месяца. Без практики, переосмысления и отработки на графиках, все эти знания вам не особо пригодятся.

Кроме того Курс – живой организм. Идут годы, статьи обновляются, дополняются, переписываются, вылизываются и так будет впрямь.

Представленные тут знания универсальны – их также можно использовать в фиксированных и цифровых контрактах, в форексе, фондовом рынке, криптовалютах и так далее.

Курс обучения призван бережно провести новичка до сосредоточенного мастера делать деньги на каждом движении цены. Данный курс дает психологический и технический базис, осмысление и практика которого позволит, как минимум, не терять деньги и как максимум – научит их зарабатывать.

Введение.

Трейдинг, опционы, графики, котировки... все это звучит сложно. Почти сразу новичок задумается: тут столько всего, а я не изучал математику, экономику, финансы, политику... еле еле считаю ипотечные проценты на калькуляторе. И какие здесь у меня шансы?

Вот смотрю я экономические новости, а там:

- инфляция;
- учетная ставка центробанка;
- индекс промышленного производства;
- еврооблигации.

И масса других терминов. Читаешь все это, и думаешь – неужели трейдинг для меня?

В действительности, весь мир трейдинга можно условно разделить на 2 типа:

- алгоритмический;
- интуитивный.

Читая интервью с успешными трейдерами или книги о них, мы вдруг выясняем, что у одних нет экономического или математического образования, а у других – блестящие математические способности.

И эти два мира практически не пересекаются. Математики в трейдинге работают на фондовых биржах, в крупных инвестиционных компаниях и применяют сложнейшие алгоритмические теории вроде статистического арбитража конверсионных облигаций.

Этот мир гуманитариям недоступен. Однако, у них есть другой инструмент – собственный интеллект и чутье. Что с практикой превращается в ту самую трейдерскую интуицию.

Поэтому гуманитарии работают с рынком вручную, прислушиваясь к себе и нажимая кнопки в нужный момент. Математики же создают умных, высокоинтеллектуальных роботов,

которые соревнуются с такими же роботами в поисках рыночных уязвимостей. Это совершенно разные планеты, их орбиты почти не пересекаются.

Многие новички путают практическую интуицию с гаданием. Под «трейдерской интуицией» следует понимать сумму практического накопленного опыта.

На рынке очень много экономистов, но деньги во многих случаях делают совершенно посторонние рынку люди.

Есть ли шансы в трейдинге у простого человека?

Да, безусловно. Человек гуманитарного склада ума работает вовсе не с рынком – а с самим собой. С отражением рынка в своем сознании. Для алгоритмиста этим отражением служит математическая модель, вкладываемая в торгового робота. Гуманитарию же таким зеркалом служит его собственный внутренний мир, личное восприятие рыночных реалий и их интерпретация.

В результате, залогом успеха интуитивного трейдера служит вовсе не математика, а способность контролировать собственные эмоции, бесконечное терпение и обширная практика.

Мы не первые, кто столкнулся с необходимостью правильно прогнозировать цену актива, не так ли? Люди занимаются этим сотни лет. Прогнозируют все, от цены акций до стоимости товаров и услуг. И для этого давно придуманы соответствующие инструменты:

– фундаментальный анализ – изучение экономических новостей;

– технический анализ – теория Доу, тренды, поддержка и сопротивление, свечной анализ и прайс экшн;

– объемный анализ – изучение потока ордеров;

– индикаторы – математические формулы для анализа рынка.

И вот что – для освоения этих инструментов не надо быть профессором квантовых наук. На рынках предостаточно примеров, где свой первый миллион долларов зарабатывали молодые ребята в возрасте 18-22 лет. Деньги зачастую делаются на банальных линиях тренда – а соединить две пиковые ценовые вершины не так уж и сложно. Важно иметь абсолютное терпение, чтобы отработать сотни условий таких линий, «прокачивая» свою интуицию, а вовсе не умение их рисовать, доступное и 5-летнему ребенку.

Должен ли трейдер быть экономистом?

Со временем до вас дойдет, что трейдинг не сложнее любой работы. Любой специалист, профессионал своего дела, занимается чем-то, что можно сравнить с трейдингом. Он анализирует, изучает, делает практические выводы, учится на своих ошибках – это и есть трейдинг.

Когда слушаешь речь экономиста, то кажется, боже мой – я никогда не смогу в этом всем разобраться! Да вам и не нужно. Экономисты вовсе не зарабатывают в форексе или на биржах. В результате, многие профессиональные трейдеры, что уже заработали свой первый миллион долларов (а это для трейдинга – небольшая сумма), до сих пор не понимают, о чем вещают финансисты с экрана. Это правда. У них совершенно разные задачи.

Трейдинг – одна из самых демократичных сфер деятельности.

Однако, получается здесь мало у кого. Это факт. Успешных ребят мало. А уж если вы будете бегать по сигналам, которые предлагаются в интернете или надеяться, что волшебный индикатор вдруг предугадает рынок, вас будет ждать большое разочарование.

Успеха здесь добиваются граждане, что крепко усвоили основы, «набили» тысячи часов практики и создали свою, эффективную торговую систему под себя. И возраст здесь не помеха, отнюдь. Уорен Баффет купил свою первую акцию в 11 лет. Тут чем раньше начнешь, тем лучше, как и любом другом деле.

Помните – усложнять не надо. Если поставить на график 10 индикаторов, лучше не станет. Надо взять технический анализ, немного разобраться в новостях, добавить по желанию 1-2 индикатора, что вам иногда будут помогать и так начнется дорога в трейдинг.

Ну а какая она будет – вы и сами увидите. Трейдинг – это жизнь, и скучной она не будет.

Тем и хорош этот рынок – шансы есть у всех. За них нужно бороться, решительно и целеустремленно, понимая, что время здесь роли не играет.

Основы и основные понятия

Краткий словарь начинающего трейдера.

Актив

Нечто, имеющее цену, которую мы видим на графиках. Мы прогнозируем движение цены (котировку) и зарабатываем с этого.

Например:

–Валюты: EUR/USD

–Акции: AAPL

–Индексы: S&P500

–Биржевые товары: UKOIL

–Криптовалюты: BTC/USDT

Быки

Трейдеры, зарабатывающие на повышении цены



Медведи

Трейдерам, зарабатывающим на понижении цен



актива.

Лонг
Сделка на повышение



Шорт

Сделка на понижение



Тейк-профит (TP) и Стоп-Лосс (SL)

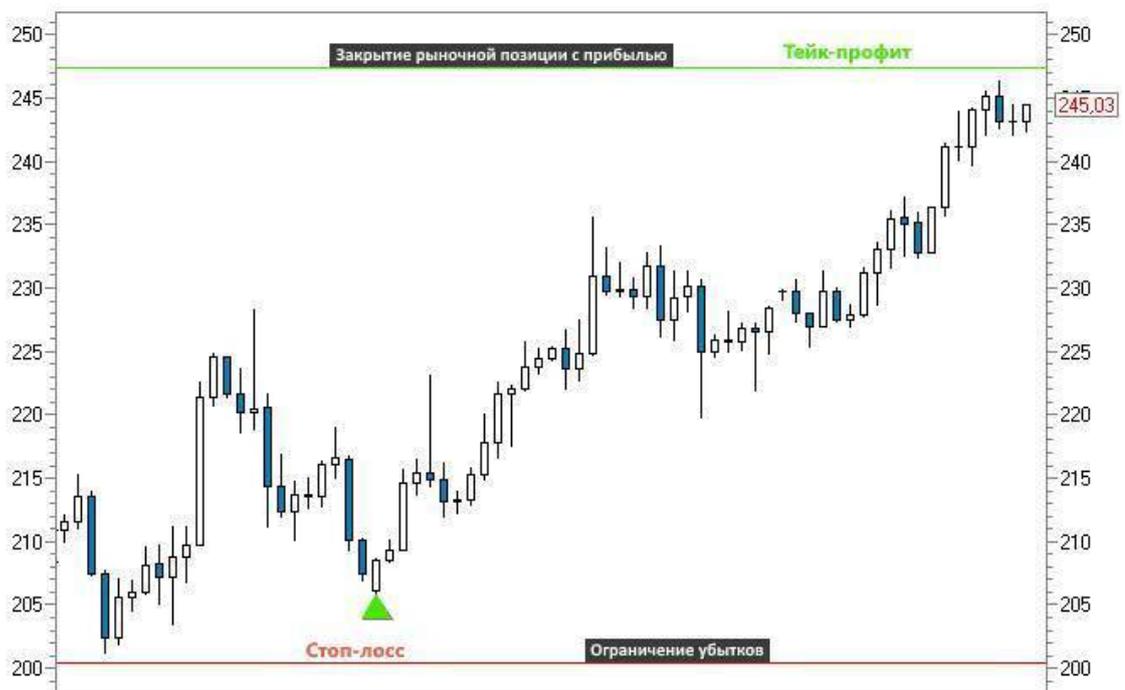
Тейк-профит

Ордер установленный на закрытия позиции и для фиксирования прибыли.



Стоп-лосс

Ордер установленный для защиты позиции и ограничения убытков



Фьючерс

Производный биржевой инструмент, от какого-либо базового актива: акции, облигации, валюты, сырье и т.д. Движения цены фьючерса, практически идентичны движению цены его базового актива.

Фьючерсная торговля пользуется популярностью среди трейдеров, так как комиссия на фьючерсные контракты, как правило ниже комиссии при покупке базового актива, например акций.



Валютная пара

Соотношение цены двух валют. В момент покупки одной валюты продается другая.
EUR/USD

В данном случае EUR – это базовая валюта, USD – котируемая.

Таким образом получается, что за EUR – евро, мы покупаем USD – доллары.

Котировка

От франц. «Coter», в переводе «нумеровать»/«отмечать». Установленный курс цены актива.

На фондовой бирже:

Сколько необходимо заплатить #,\$ (или другой валюты) для приобретения



Котировка – это сколько нужно одной валюты для покупки другой.



Волатильность

Это скорость и сила ценовых движений.

Сильная волатильность



Слабая волатильность



Индикатор

Формула измеряющая ценовые движения, объемы и другую рыночную информацию. Используется трейдерами для прогнозирования будущего движения цены.



Таймфрейм

Временной период внутри которого группируются котировки(ценовые показатели).

Например, 5М – период, равный 5 минутам. Каждая свеча в данном случае, будет формироваться на графике 5 минут.



Уровни поддержки и сопротивления.

Поддержка





Флет

Боковое движение ценового графика. Ситуация когда цена консолидируется, не показывая четко выраженного движения вверх или вниз.



Технический анализ.

Способ прогнозирования будущего движения цены при помощи анализа ценовых графиков.

Горизонтальные

и

наклонные



Фигуры



Фундаментальный анализ.

Способ прогнозирования цены активов с использованием экономических показателей, факторов и новостного фона.



Психология трейдинга.

Часто сделка, совершенная по всем правилам, оказывается провальной. Казалось бы, все условия – нужный тренд, правильные свечи, корректный откат от линии тренда и... Минус. Неудача.

Это – реальность трейдинга, с которой мы сталкиваемся постоянно. Нет ни одного трейдера, который никогда не делал бы ошибок.

И проблема не в том, что мы регулярно теряем деньги – все теряют. А в том, как с этим справиться и найти в себе внутренние силы продолжать. Как вообще справляться с подобным стрессом? Ведь терять деньги нелегко.

Мы приходим в трейдинг ради заработка, а выясняется, что первые месяцы ты деньги, напротив, непрерывно отдаешь. Отсюда стресс и внутренняя боль, голова забита разнообразными негативными мыслями, а раздражение из-за неудач выплескивается на семью и друзей.

Эмоции трейдера.

Вы должны сразу осознать, что наш мозг во время стресса действует совершенно не так, как в обычных условиях. Другими словами, когда речь идет о наших денежках – мы видим все иначе, чем в обычной ситуации.

И чтобы совладать с таким раздвоением личности, нужно постараться.

Дисциплина.

Дисциплина-слово, без которого не возможно стать стабильно зарабатывающим трейдером.

Один из способов стать дисциплинированным трейдером – сосредоточиться на определенном решении до открытия сделки. Почему это так важно?

Потому что до открытия сделки ваша логика еще не находится под эмоциональным воздействием и работает так, как и должна. Но стоит вам открыть сделку и начать торговать – все меняется. В голове крутятся:

- страх потерять деньги;
- жадность;

неуверенность.

Поэтому все, что относится к сделке, вы должны в себе проработать до ее открытия. Дальше же вам остается только спокойно дожидаться ее результата. Еще до нажатия кнопки у вас должно быть все готово.

Три основных пункта дисциплины, это:

торговый план;
мани менеджмент;
риск менеджмент.

Да, их всего три. Все трейдинговые книги сводятся, в итоге, лишь к ним.

Терпение

Без терпения здесь делать нечего. Я часто запрыгивал в сделку до того, как моя торговая стратегия давала хороший сигнал, просто потому что мне казалось – сейчас самое время это сделать! Результат оказывался предсказуемым – прощайте, денежки. Торговые стратегии бывают очень разные, в одних 2 критерия для входа, в других 22. Так вот: пока все условия не выполнены, сделку просто открывать нельзя.

Что это за условия? Те что относятся к вашей стратегии. Например:

цена подошла к линии сопротивления;
линии стохастика пересеклись в перекупленности;
свечи демонстрируют сетап пинбар или PPR;
до сетапа нет сильных бычьих свечей;
через час после значимой новости;
только азиатская сессия.

Если поспешить и не выполнить хоть одно из условий – это может вам стоить сделки.

Умиротворение

Принять возможную потерю еще до открытия сделки.

Если вы заранее понимаете, что после щелчка на кнопке “Long” или “Short” вы, вероятно, потеряете сумму, поставленную в этой сделке, вам будет намного легче. Если вы уже смирились с возможной потерей, что может случиться плохого? Абсолютно ничего.

Трейдер деньги всегда теряет и будет... терять. Просто специалист теряет меньше, чем зарабатывает (поэтому останется в плюсе), а новичок – наоборот.

Еще очень важное качество «Уметь делать выводы».

Допустим, сегодня вы совершили 10 сделок, 3 из них неудачные. Прекрасный день, вы и не подумаете разобрать ошибки этих неудачных сделок. А ошибки имеют свойство накапливаться.

Мани – менеджмент.

Основная причина по которой новички теряют свои деньги – это не неудачный прогноз, вовсе, а полное отсутствие риск-и мани-менеджмента.

Мани – менеджмент – это набор правил и принципов, которые позволят уберечь ваш депозит от потери.

В трейдинге невозможно быть всегда правым. 100% успешных прогнозов не существует. Как не существует 90% и даже 80% на продолжительном промежутке времени. Кратковременно – да, долгосрочно – нет. Поэтому ключевая задача трейдера состоит в том, чтобы научиться переживать период потерь таким образом, чтобы это не сказалось катастрофически на сумме его капитала.

Вот например, у вас 100 долларов и вы открываете сделки по 25 долларов. Не нужно быть гением, чтобы понять: через 4 неудачных сделки ваш депозит = 0. Вы потеряли все деньги. Брокер же забрал ваши 100 долларов и ждет, что вы снова пополните депозит. Отличный бизнес

Рынок – чрезвычайно хаотичное место. Поэтому результат каждой сделки гарантированно предугадать нельзя. Однако, с ростом числа сделок и опыта можно «вытягивать» математическое ожидание в свою сторону. Делая так, чтобы удачных сделок было больше, чем неудачных.

Каждый трейдер знает – за удачным периодом часто идет период «просадки», когда происходит не понятно что. Чтобы вы не делали, сделки идут неудачно, одна за другой. И даже трудно понять, что происходит:

то ли рынок изменился так, что ваша стратегия не работает;

то ли вы сами изменились и рынок не понимаете.

По сути, это две грани одной монеты. И это не важно. Главное, что вы должны уметь – это сокращать свои убытки в том случае, если рынок идет против вас. И единственный способ это сделать – беречь ваш депозит.

Самое простое правило мани-менеджмента.

Максимальная сумма сделки должна быть 1-5% от депозита

Как правило, чем больше размер вашего депозита, тем меньше должен быть процент, чтобы устранить психологические эффекты от риска большими суммами.

Оценка риска при мани – менеджменте

Допустим, у нас депозит, равный 5000 долларов. Риск в 5% от этой суммы составит 250 долларов. Представьте, что у вас 3 неудачных сделки подряд (дробь округляем):

1 сделка: $5000 - 250$ (5% от 5000) = 4750;

2 сделка: $4750 - 237$ (5% от 4750) = 4512;

3 сделка: $4512 - 225$ (5% от 4512) = 4278.

Каждый раз мы берем 5% от суммы депозита. Потеряли 250 долларов, осталось 4750. Снова отсчитываем от них 5%, получаем 237. Неудача – вычитаем их. И т. д.

Итого, за три сделки мы потеряли 722 доллара. Это для вас существенная сумма? Скорее всего да. Причем мы потеряли бы еще больше, если бы всегда брали 5% от первоначальной суммы ($250 * 3 = 750$ долларов).

А если бы мы каждый раз рисковали 1%? После трех неудач, от 5000 осталось бы (дробь округляем):

1 сделка: $5000 - 50$ (1% от 5000) = 4950;

2 сделка: $4950 - 49$ (1% от 4950) = 4901;

3 сделка: $4901 - 49$ (1% от 4901) = 4852.

Мы потеряли 148 долларов.

Сравните, для трех неудачных сделок подряд и депозита в 5000 долларов:

Риск 5%: потеряли 722 долларов.

Риск 1%: потеряли 148 долларов.

Разница очевидна. Чем более консервативен ваш мани-менеджмент, тем лучше вы контролируете риски. А 5% является общепризнанным потолком.

Многие новички заходят на биржу с очень не большим депозитом и сразу начинать нарушать ММ, завели к примеру 20\$. А открывать сделки в 5%, ну объективно, не очень хочется копейки гонять, я уже не говорю про 1%. И начинают пытаться «разгонять» депозит, все может

прекрасно получиться, «разгоните» до 100-200-500-1000\$, но остановиться потом и вернуться к соблюдению ММ не все уже способны и приводит это как правило к «сливу» депозита.

Если же вы настроены серьезно, то нет иного пути, кроме как позаботиться о достаточном для ММ депозите и работать так, как и должен работать профессиональный трейдер. Холодно оценить риски, знать свои лимиты и работать на результат.

Риск-менеджмент.

Риск менеджмент – это управленческие решения, призванные снизить вероятность возникновения неблагоприятного результата и минимизирующие возможные потери.

Во время торговой сессии вы терпите неудачи одна-вторая-третья-четвертая, неудача за неудачей. Вам плохо, душевно больно от потери денег. Как от этого избавиться?

Правильно – **отыграться!!!** Т.е. воспринять трейдинг как игру.

А теперь подумайте!

Вы 3 раза подряд теряли деньги. Вы – не понимаете рынок. С чего вы взяли, что следующие сделки будут удачными?

После 3-4 неудач подряд вы:

останавливаете торги на срок не менее часа;

пару часов вообще не подходите к графику, чтобы эмоционально успокоиться;

разбираете ошибки, записываете их в трейдерский дневник;

спустя несколько часов, делаете несколько прогнозов просто по графику

И только после 2-3 удачных прогнозов подряд, возвращаетесь к работе с реальными средствами.

Это – универсальное, мощное правило. Но следовать ему тяжело – ведь вам придется, психологически, смириться с убытком. Однако, у вас нет шансов это делать, если вы не научились принимать тот простой факт, что вы не умнее рынка и потери будут случаться регулярно.

Если вы хотите уберечь себя от математических последствий – в вашем распоряжении мани-менеджмент. Спасти же психику и, отсюда, депозит, поможет психологический риск-менеджмент.

Вы можете придумать свои вариации, но остановка торгов (стоп-лосс) должна быть обязательно, без исключения. В этом вся суть «профилактики риска» – вы останавливаетесь, когда плохо, чтобы не стало еще хуже. Намного хуже. Иначе несоблюдение этих правил убивает не только ваш депозит, но и вашу веру в себя.

Тесный союз риск и мани-менеджмента позволит утихомирить вашу жадность и эмоции. Все это поможет вам, достаточно быстро, выйти на этап стабильного депозита, который весьма сложно потерять. Депозит буквально становится «железобетонным», он стоит на месте и не теряется.

Основная задача трейдера – сбережение средств. А вовсе не заработок, как думают новички. Это невозможно сделать без правильного риск-, мани- и тайм-менеджмента. Без грамотного управления рисками, деньгами и временем.

Берегите ваши деньги. Используйте те инструменты, что созданы для решения этой задачи. Лишь тогда вы сможете сделать качественный скачок вперед и сможете насладиться всеми прелестями сложного процента – когда на сбереженный капитал наваливается прибыль, на него новая прибыль и так до победы.

Тайм – менеджмент.

Чтобы понять, как вам торговать, необходимо определиться с тем, зачем вы пришли в торговлю, не важно, бинарные ли это, форекс или фьючерсы.

Профессиональные трейдеры, что работают из дома, не сидят за графиками постоянно. Они работают в определенную торговую сессию, делают прогнозы, открывают позиции и отходят от графиков.

Трейдеры, что работают по найму, работают как и обычные офисные сотрудники. Это могут быть трейдеры в инвестиционных банках или многочисленных фондах.

Выделим два вида трейдеров:

Трейдер, который торгует время от времени

Трейдер, который живет с трейдинга

Трейдеры, живущие с трейдинга. Они встают утром и у них весь день для торгов, но это не означает, что они проводят его, созерцая графики. Обычно тратится лишь несколько часов. Но они в любой момент могут этот график открыть. Они полностью распоряжаются своим торговым временем.

И у трейдера «на постоянке» времени в разы больше, чем у офисного сотрудника.

Правила тайм-менеджмента.

В трейдинге в нашем распоряжении 24 часа в сутки, и это замечательно. Однако, у большинства есть работа, а значит для торгов остается лишь несколько часов.

Поэтому первое, что нужно сделать – определиться, когда именно вы торгуете.

Только когда у вас специально выделенное для этого время, например с 9 до 12 дня или с 8 до 11 вечера. Трейдинг невозможен без сосредоточения, без возможности полностью погрузиться в мир графиков. Вы не сможете помогать детишкам делать домашку и мыть посуду, параллельно открывая сделки. Так вы мгновенно скатитесь в обычную азартную игру.

Торговля – это профессия, это, потенциально, ваша новая постоянная работа. Относитесь к ней ответственно.

Выберите 1-2 любимых актива, например евро/доллар и ETHUSDT. Отмотайте график подальше назад и посмотрите на истории, какое поведение, в среднем, демонстрировал ваш актив в это время. Вы сразу найдете массу интересных закономерностей, которые можно использовать.

Если бегать по куче активов, внимание сразу рассеивается, вы быстро устаете. Даже с одним активом работать трудно. Начните с малого, 1-2 пары.

Для прибылей и убытков нужно поставить четкие ограничения – это крайне важно. Новички очень часто переоценивают свои силы и, забыв про мани-менеджмент, пытаются «отыграться» после серии неудач. Время для них вообще перестает иметь значение.

Аналогично и для прибылей. Если у меня все получается, я обязательно выйду за свой лимит с 9 до 11 и будут сидеть до 3 часов ночи. Не замечая, как:

накопилась усталость;

рынок изменился;

нарушилась концентрация;

вы потеряли уже больше, чем заработали.

Лимит на прибыль

Самое простое решение – у вас должен быть предел не только потерь, но и доходов. Скажем, новичок может поставить себе задачу увеличить депозит за день на 1-5%. Если вы этого достигли – немедленно прекратите торговать, хватит. Займитесь чем-то другим, отлипните вообще от графиков.

Под конец месяца (вы же ведете трейдерский дневник), подведите результаты по вашим доходам и убыткам. И адаптируйте под них ваш торговый план. Скажем, если цели за месяц достигнуты, некоторые трейдеры позволяют себе потерять на пару процентов больше. Это увеличивает их торговый оборот, как и шансы восстановиться после убытков.

Торговый дневник.

Прежде чем вы начнете, вне себя от счастья, жать кнопки «Купить» и «Продать», необходимо позаботиться о торговом дневнике трейдера.

Вы столкнетесь в трейдинге с колоссальным объемом информации, совершенно невероятным. Эмоции, которые вы при этом испытаете, тоже будут ни на что не похожи. Поэтому дневник вам понадобится.

Здесь все просто. Записи ваших сделок помогают контролировать не только процесс торгов, но и эмоции. Они показывают полную картину вашей борьбы с рынком. Картину, на которой вы же сможете потом учиться.

Вести торговый дневник вовсе не так трудно. Это можно делать в эксель или google docs, а так же на бумажных носителях, или использовать уже готовые приложения, выбрав для себя наиболее подходящее.

В дневнике вам понадобятся:

Время сделки

Название актива

Сумма сделки

Причина входа(обоснование)

Примечание(описываете индикаторы которые используете)

Такой дневник даст вам массу возможностей для анализа совершенных сделок. И главное – избавит вас от импульсивных входов, потому что вы забыли, как это делали ранее.

Все эти данные – это доказательства. И вы предъявите их себе потом, если сделка была удачной или нет. Если удачной – отметите, что это был прекрасный вход по вашему плану. Если нет – разберете свои ошибки и запишите их.

Фиксируйте в своем дневнике эмоции, которые испытываете когда заходите в сделку, во время сделки и после закрытия позиции.

Вижу график – чувствую азарт – смотрю на индикатор (страх, вдруг не работает) – открываю сделку (нервничаю) – финал сделки (удовольствие, что сработало).

И если вы хотите действительно чему-то научиться на этом рынке, вам нужно непрерывно фиксировать свои достижения.

Единственный способ зарабатывать на этом рынке – быть трезвомыслящим, холодным и циничным профессионалом. И вот такому специалисту дневник – первый помощник. Всем остальным он и правда необязателен. В конце-концов, кому-то же нужно пополнять брокерскую кассу.

Все, что относится к торгам: до них, во время и после. Трейдинг – это набор навыков и определенных умений, вне зависимости от того, какие конкретно методики или инструменты выбираются. И финальный результат зависит от систематизации ваших умений. От того, насколько вы соблюдаете свой же составленный план, как вы его выполняете и отслеживаете это выполнение.

Все должно быть прописано. Можно простым списком, можно комплексной программой – кому как нравится. Формализуйте ваш подход к трейдингу. Только так из любителя можно превратиться в профессионала.

Поэтому, в вашем торговом плане, о котором мы поговорим далее, вы должны четко описать как именно вы входите. Пусть это даже пересечение скользящих, почему ДА. Постепенно вы добавите условия, когда входить на пересечении, когда нет и так, плавно и неспешно, будет рождаться ваша система.

Как известно, технический анализ – не строгая наука, а борьба с теорией вероятности, с математическим ожиданием. Поэтому не существует 100% правил для открытия сделки – но есть зоны повышенной вероятности.

Делайте скриншоты и прикрепляйте их в свой дневник.

Дневник – драгоценность. Это ваша трейдерская жизнь. Хотя бы раз в неделю вы должны обязательно открыть свой дневник и погрузиться в изучение своей торговой недели. Просматривая его, постарайтесь ответить на следующие вопросы:

Насколько, с учетом рисков, был корректный размер сделки?

Действительно ли вход был таким удачным, как вам казалось?

Какими инструментами можно было бы его улучшить?

Вы все терпеливо продумали или открывали сделку, потому что ждать было нельзя?

Соблюдался ли торговый план при открытии сделки?

Что происходило с уровнями поддержки и сопротивления во время сделки?

Были ли важные новости?

Постоянно задавая себе эти и аналогичные вопросы, вы научитесь контролировать свои эмоции и сможете относиться к рынку, как к обычной, структурированной работе, где никаких сюрпризов с вами приключиться не может, ведь вы все продумали заранее и знаете, как действовать в случае прибылей и убытков.

Когда в дневнике накопится достаточная статистика сделок, что с ней всей делать? Ничего сложного. Дневник вам нужен, фактически, для двух вещей:

поиска того, что работает;

и того, что заведомо бесполезно.

Именно дневник позволяет найти ответы на множество вопросов по отношению к валютам, лучшим торговым дням недели, специальным инструментам и многому другому.

Торговлю нужно начинать с дневника, им же и заканчивать.

Торговый план.

Теперь мы переходим к мегаважной теме, без которой вы не станете успешным трейдером. Это – ваш торговый план.

Как вы уже знаете, чужие торговые системы чуда не сделают. В нашем трейдерском супермаркете невозможно прочитать чужую стратегию и сразу на ней зарабатывать, иначе трейдинг был бы проще, чем поход в магазин за булочкой с маком. Успеха здесь добиваются лишь люди, которые создают торговую систему под себя на основе других, изученных ими систем.

Именно так я сам бегал по форумам и искал «прибыльную стратегию» (дико смешно это вспоминать теперь). Выяснилось, что ты получаешь лишь теоретический базис системы, но в комплекте с ней не идут десятки тысяч часов опыта и трейдерская интуиция ее автора. Нельзя каким-то чудом мгновенно телепортировать себе в мозг чужой опыт.

План должен быть четким, ясным и понятным. Таким, чтобы у вас не возникало каждый раз сомнений, как его использовать.

Задача плана проста – что делать, по какой причине, когда и в каком объеме. В плане отражается все – ваша личность, ожидания от сделок, описан риск- и мани-менеджмент, не говоря уже о вашей торговой системе.

Работать без плана – значит полагаться на удачу. Торговый план поможет устранить сиюминутные сделки, продиктованные эмоциональным восприятием цены.

Лучший способ этого избежать – минимизировать риски, создав торговый план, охватывающий определенное рыночное движение. В результате, вам не придется спешить или хвататься за голову. Что есть в плане – то вы и торгуете, переживать нет причин.

А чем отличается торговый план от торговой системы

Торговая система – это точное описание причин для открытия сделок. Это часть вашего торгового плана, наравне с анализом рынка, риск- и мани-менеджментом. Рыночные условия постоянно меняются, поэтому в торговом плане нередко прописывается несколько торговых систем.

О системах мы поговорим позднее, а пока что просто запомните, что план – это глобальная конструкция, а торговая система – производная от нее.

Торговый план создается под вашу личность

Только реалистичный взгляд на трейдинг позволит вам создать действительно толковый план. Только анализ себя и своей психологии. Ведь вы единственный, кто будет использовать этот план. Он только для вас. В зависимости от того, каким трейдером вы собираетесь стать, зависят и конкретные детали вашего плана.

Конкретные цели трейдинга

Цель должна быть не абстрактная, а конкретная в определенных аспектах. Например:

я хочу 1% дохода в неделю;

я хочу более 50% удачных сделок за этот год;

я удвою свой депозит за эти 3 месяца.

Ваш мани-менеджмент

О нем мы уже все рассказали и ваш мани-менеджмент прописывается именно в торговом плане. Запишите, какой суммой или, еще лучше, процентом от депозита вы рискуете в каждой сделке. Поэтому в вашем ТП должны быть четко прописаны ваши риски. Можно прописать и условия, при соблюдении которых вы перейдете с демо-счета на реальный.

Сколько времени вы уделите трейдингу

Это мы обсудили в уроке про тайм менеджмент. Время – наш самый ценный ресурс и оно должно быть прописано в торговом плане. Сколько дней в неделю или часов в день вы хотите посвятить трейдингу. От этого зависит многое, в частности – ваша торговая манера.

Чем меньше выбранный таймфрейм, тем больше времени вам придется проводить за графиками, так всегда. Скажем, если вы работаете с дневными графиками, их можно спокойно проверять раз в 1-2 дня. На 5-минутном же графике можно «зависнуть» на 10 утомительных часов подряд, после которых в душе будет лишь чувство усталости и опустошения.

Ожидаемый доход

От ответа на этот вопрос зависит выбранная вами манера торгов (агрессивная, умеренная или консервативная), конкретные торговые пары и риски, связанные с вашим торговым процессом.

Необходимо записать и возможную просадку. Это значение от максимального уровня депозита до его минимального значения. Скажем, ваша просадка составляет, максимум, 30% от депозита. Что делать по ее достижении? Срочно пересматривать ваш торговый план, уточнять стратегии. Прекратить торги, засесть за риск-менеджмент.

Подготовка к открытию сделки

Следующее, что мы прописываем в плане – это шаги, которые предпринимаются перед открытием сделки.

Не помешает и заново нарисовать линии поддержки/сопротивления на всех таймфреймах

Выполнив предварительные шаги, вы готовы к открытию сделки. Чрезвычайно важно, чтобы в торговом плане эта процедура была прописана четко и понятно. Чтобы вы не ломали голову, с чего же начать и на что смотреть. Все уже написано – вам лишь нужно это выполнить. Разумеется, должен быть прописан и запасной план на случай, если рынок поведет себя не так, как вы задумали.

Торговые инструменты

Кратко опишите, какие инструменты вы используете, какие графики, программы и сайты. Непытайтесь хватать как можно больше технических средств.

Идеальный торговый план

Если все запланировано, продумано и отработано, ваши шансы внезапно потерять деньги мизерны. Это факт. На этап несливаемого депозита выйти вовсе нетрудно. Да, это не могут

сделать 80% трейдеров, но лишь потому, что не обладают необходимыми психологическими качествами, не меняются и не используют структурное мышление. Депозит, что стоит на месте – этап замечательный. «Ой, я просадил весь депозит за 1 день» – эта история навсегда уйдет в прошлое. Риск- и мани-менеджмент, психологические правила – все это, добавленное вами в торговый план, сохранит ваши деньги.

Не забывайте и важный момент: торговый план нужно постоянно модифицировать.

Графики

Мы разобрались с трейдерской психологией и самое время взглянуть на основное – графики. Именно за ними вы будете проводить все время, ибо трейдинг есть ничто иное, как анализ котировок, отображаемых на разнообразных графиках.

Первое, что вы, как новичок, увидите после регистрации на бирже – это график.

Что показывают графики

Брокер нам предлагает делать ставки на самые разные активы. Давайте возьмем самый популярный из них. Пусть это будет евро/доллар.

Вопрос – что вообще такое евро/доллар, откуда эта пара взялась, откуда графики, откуда цены? Что все это такое?

Ничего сложного. Представьте себе, что:

крупнейшие банки мира постоянно торгуют между собой, продавая и покупая валюту; информация об этих торгах – котировки – транслируются поставщиками ликвидности; брокеры используют котировки ПЛ и отображают их клиентам.

Вот эти котировки межбанковских торгов вы и видите на графике. На реальный межбанк вас никто с вашими 30 рублями не пустит, как вы уже знаете. Однако, котировки свеженькие и действительно банковские. Поэтому мы делаем ставки на основе реальных межбанковских данных.

Лучшие графики

На каких сайтах есть хорошие бесплатные графики с нормальными котировками:

TradingView(использую сам)

Investing

NetDania

FreeStockCharts

MT5

Финам

БКС Экспресс

Vinance (использую сам)

Ну а про графики брокеров... их возможности, в плане технического анализа, существенно уступают графикам нормальным. Поэтому лично я использую TradingView, а брокерский график использую, только открытия и закрытия сделки. Что и вам советую.

Виды графиков

Цена – это просто набор цифр. Каждую секунду они меняются.

Выделим три самых распространенных графиков:

Линейный (пользуется меньшей популярностью)

Японские свечи(про которые буду рассказывать)

Бары

Анализ графиков

Теперь на живом графике мы проводим технический анализ пары (чему собственно и будет посвящен весь курс)

Осталось решить, что произойдет с нашей парой, вырастет котировка или упадет. Проанализировали, нажали кнопки “Купить” или “Продать”. Спустя время вы увидите был ли ваш прогноз верным, вы получаете ваши кровные на счет.

Вот, собственно, алгоритм использования таких графиков, ничего сложного. Графики вообще весьма простые. Трудности трейдинга – не в графиках, а в умении давать правильные прогнозы по движению цены. Графики же будут нашими помощниками в этом и они, сами по себе, совсем несложный инструмент.

Как стать трейдером – Успешным.

Вот мы и подошли к основной части изучения рынков, а именно к их анализу.

Но прежде чем окунуться в технический анализ хотел бы рассказать немного о том с чем вы столкнетесь в первое время и постараюсь ответить на вопросы, которые будут возникать у вас в головах в первое время.

В этот бизнес – заработка на рыночных прогнозах – приходят очень разные люди. Но многое их объединяет. Одни забивают свои мозги рекламой, сидят на азартных торговых системах, постоянно рискуют, ищут «100% стратегии и сигналы», покупают «рабочих роботов», платят за обучение «успешным трейдерам». Другие самостоятельно учатся каждый день, читают книги, медитируют на графики, знают что такое управление временем, рисками и капиталом.

В минусе будут оба типа. Долго будут и стабильно. Вот только у вторых больше шансов выйти в стабильный плюс, причем в разы, нежели у первых.

Вот вы торгуете на демо-счете уже несколько недель подряд и у вас все очень не плохо получается вы с легкостью наторговываете 10-20-30-50 тысяч долларов с виртуальной тысячи. И думаете: «Почему так просто? От чего так все ловко получается? А может просто я талантливый трейдер? Ведь мама говорила, что я совсем не такой ребенок как все, я особенный». Так вот он – мой шанс.

Находите брокера с минимальным депозитом и начинаете торговать. Ждать вам не охота, никаких длинных сделок, только краткосрочные сделки. В день проводите множество сделок. Это увлекательная игра захватывает все ваше внимание.

Игра(а вы именно считаете это игрой) идет отлично. Иногда везение идет как по маслу и вы выводите деньги в особо удачную неделю. Дела идут. Пока вы не спускаете депозит. Потом еще. И еще. То, что вроде работало, почему-то работать перестает.

Вы решаете быть умнее – и отыгрываться, удваивая каждый раз ставку, если она была неудачная. Или открываете две сделки, одну купить, другую продать. Иногда это срабатывает! Помучавшись еще с сомнениями и переспав с разочарованиями, до вас постепенно доходит – наверное, не все так просто. Похоже, придется учиться.

Вы начинаете искать в интернете различную информацию и натываетесь на сигналы, стратегии, индикаторы, которые гарантируют вам 100% прибыль, но они стоят денег.

И в один прекрасный момент, когда вы все сигналы и индикаторы платные перепробуете, то наконец поймете, что НЕТ этих сигналов и НЕТ тех индикаторов, которые бы вам гарантировали на 100% прибыльную трейдерскую деятельность.

Ни один индикатор в мире, оказывается, не способен предсказать, куда пойдет цена. Они все намного чаще ошибаются, нежели дают удачный прогноз.

Индикатор – это лишь простая формула. Он показывает только прошлое. И не может предсказать живой рынок.

Нужно думать лишь своей головой и прийти к своему, индивидуальному методу торговли. Со своими таймфреймами, экспирациями, графиками и объемами сделок.

Вы начинаете вести **торговый дневник**, составляете **торговый план**. Записываете правила и следуете им. Изучаете себя, свою реакцию на удачные и неудачные сделки. Вы понимаете – если 2-3 неудачных сделки подряд, торги нужно останавливать. Минимум на час, лучше вообще на день, а порой и на целый месяц.

Вы должны усвоить несколько простых правил:

в трейдинге все индивидуально: не существует и никогда не существовало лучших рынков, валют, стратегий, индикаторов, экспираций, таймфреймов;

не надо использовать слова “выиграл” и “проиграл”, трейдинг – не игра;

нет никаких школ и гур, что могут помочь или сделать сказку за тебя, пока ты сидишь и чего-то ждешь;

не надо нервничать из-за потерянных депозитов;

трейдинг может тебя сломать;

ты не особенный, ровно наоборот;

критически важно научиться управлять деньгами, рисками и временем;

не существует гарантированных рабочих сигналов, роботов или копировальных сервисов, платных или бесплатных.

Технический анализ

Это курс технического анализа – основного рабочего инструмента трейдера. От теории Доу, свечей и П/С до Ганна и Эллиота. В курсе дана полная картина современного технического анализа.

Основные секреты

Чтобы разобраться в этом, понадобятся:

технический анализ – искусство графического прогнозирования;

фундаментальный анализ – искусство давать прогнозы на основе экономических данных.

Это – два ключевых инструмента, основами которых нужно владеть, чтобы зарабатывать на этом рынке. Без них никак. Потом инструментарий расширяется, к нему добавляются прочие виды «анализов», скажем:

свечной анализ – искусство прогнозировать по свечным моделям;

индикаторный анализ – прогнозы по показаниям индикаторов;

объемный анализ – прогнозы по данным об объемах торгов;

безиндикаторный анализ – расширение свечного анализа;

статистический анализ – царство статистики и обработки исторических данных;

комплексный анализ – комбинация всех прочих видов анализа.

Как правильно учиться трейдингу

вы изучаете все основы, которые только можете; учитесь долго и упорно;

вы изучаете готовые системы, индикаторы, жадно перенимаете чужой опыт;

вы, как губка, впитываете в себя все-все-все, что только можно впитать;

вы читаете трейдерские книги, форумы, сайты и трейдерские системы.

В вашей голове регулярно будет такая непроходимая каша, просто до слез, до отчаяния. Но это не страшно – нужно передохнуть, порой неделю не открывая график и трейдерские книги. И затем возвращаться к делу.

И все это должно привести вас к тому, что у вас появится листик А4, где будет описана суть вашей ТС – торговой системы. Это случится, когда вы найдете то самое, “свое”.

Этот листик вы будете переписывать много раз. Раз за разом вам будет казаться, что вы нашли ее, Лучшую Стратегию.

Именно поэтому на рынке не выдерживает более 95% трейдеров (а то и все 99%). Сюда приходят за деньгами и совершенно не готовы к тому, что их ждет. Что:
готовых систем нет;
что нужно обладать колоссальным упорством и терпением;
что месяцы и годы могут пройти, прежде чем вы найдете свой путь.

Терия Доу

Почти вся основа технического анализа – это теория Доу. Именно ее изучают абсолютно все трейдеры, прежде чем попадают на Уолл Стрит. Ее знает каждый трейдер, банкир и инвестиционный менеджер в мире, без исключения. Это базис.

Рынок учитывает все

Это первое, что нужно усвоить. По мнению Доу, в цене актива уже заложена вся необходимая информация о прошлом, настоящем и даже будущем.

Эмоции, инфляции, данные об учетных ставках, все это уже заложено в ценах, заранее. Кроме, конечно, даже теоретически недоступных данных вроде точной даты нового землетрясения. Но даже риск этого чрезвычайного события тоже заложен в рыночных ценах.

Все это не означает, что участники рынка могут гарантированно прогнозировать будущие события. В действительности, в рыночных ценах просто заключены все факторы, что на них влияют и могут повлиять в будущем. По мере того, как ситуация и рыночные риски меняются, изменяется и сам рынок, реагируя на новую информацию.

В отношении всего рынка, по теории Доу необходимо смотреть за движением главных рыночных индексов. Если они идут в тренде, то влияют на настроение инвесторов. Заложены в теорию и некоторые фундаментальные концепции, учитывающие оценку финансового состояния компаний, что важно при торговле акциями. Вывод – рынок учитывает все и дает предостаточно подсказок, по которым можно понять его дальнейшее движение.

Анализ трендов – следующий этап теории Доу. Когда рынок движется в определенном направлении, он никогда не делает это прямой красивой линией.

Рынок всегда движется так:

новая вершина;

откат;

новая вершина.

За откатом следует новое максимальное значение, новый откат и так пока тренд не меняется.

В результате, любой тренд можно разложить на несколько этапов. У каждого этапа будет свое максимальное и минимальное значение.

Если тренд идет вверх, то каждое максимальное значение будет больше предыдущего. Аналогично и для нисходящего тренда, где каждый минимум обновляет предыдущее минимальное значение.



По теории Доу существует 3 типа трендов:
основной;
второстепенный;
незначительный.

Основной тренд длится более года. Второстепенный – от 3 недель до 3 месяцев, причем зачастую он может идти против общего тренда. Незначительный тренд длится до трех недель и, как правило, идет в рамках общего тренда.

Основной тренд

Это ключевое движение рынка. Для его определения необходимо на графике открыть таймфрейм побольше, скажем, месячный или недельный. Этот глобальный тренд, в конечном итоге, влияет на все, в том числе на второстепенный и незначительный тренды.

По теории Доу глобальный тренд длится 1-3 года что, впрочем, может меняться. Для скриншота ниже мы переходим на 1-месячный ТФ и рисуем линию тренда.



Основной тренд остается в силе, пока не будет четких указаний на его завершение. Одним из таких указаний может быть, например, закрытие рынка ниже предыдущего максимума.

Второстепенный тренд

Рынок движется в направлении основного тренда. Второстепенный же тренд, как правило, идет против основного тренда либо как коррекция к нему.

Вот так основной тренд может идти вверх, а второстепенные тренды – вниз. В данном случае, мы переходим на 1-дневный ТФ и рисуем второстепенные линии трендов. Как видите, в точности по теории они идут против основного тренда.



По теории Доу, второстепенные тренды длятся от 3 недель до 3 месяцев, а откат против основного тренда длится от 30 до 60% от его движения.

Также второстепенный тренд обычно куда более волатильный, нежели основной.

Незначительный тренд

В теории, это движение рынка продолжительностью до 3 недель. Как правило, представляет собой коррекцию к второстепенному тренду. Для скриншота ниже мы используем ТФ 1 час.



Теория рассчитана, как вы поняли, в первую очередь на фондовый рынок (других во времена Доу не было). Отсюда такие продолжительные периоды: 1-3 года, 1-3 месяца и т. д.

Однако, в тех же фьючерсных и прочих контрактах, а также в форексе трейдеры, в основном, работают с экспирацией до 1 часа, ждать никто не любит (для длительных периодов есть акции).

Поэтому мы можем используя принцип номер 1 – рынок учитывает все – чтобы адаптировать эти сроки для интрадея. Такая адаптация уже проведена на скриншотах выше, где мы использовали более “мелкие” таймфреймы.

Например:

основной тренд: 1-месячный ТФ;

второстепенный тренд: 1-дневный ТФ;

незначительный тренд: 1-часовой ТФ.

Другой вариант:

основной тренд: 1-дневный ТФ;

второстепенный тренд: 1-часовой ТФ;

незначительный тренд: 15 или 5-минутный ТФ.

Именно так и проводится анализ на графике. Открываете график на 1 дневном ТФ, рисуете линию тренда или канал. Затем на 1 часе, повторяете, и на 15 минутах. Готово – 3 цикла движения цены.

3 фазы рыночного тренда

Согласно теории Доу, у каждого основного тренда есть 3 ключевые фазы:

фаза накопления (распределения);

фаза публичного участия;

фаза паники (реализации).



Фаза накопления

Это первая фаза, начало восходящего тренда. Именно на этом этапе инвесторы входят в рынок. Как правило, эта фаза начинается по завершению нисходящего тренда. К этому моменту большинство негативных новостей уже учтено рынком, за счет чего инвесторы, несмотря на низкие цены, начинают видеть в активе перспективу.

Конец ознакомительного фрагмента.

Текст предоставлен ООО «ЛитРес».

Прочитайте эту книгу целиком, [купив полную легальную версию](#) на ЛитРес.

Безопасно оплатить книгу можно банковской картой Visa, MasterCard, Maestro, со счета мобильного телефона, с платежного терминала, в салоне МТС или Связной, через PayPal, WebMoney, Яндекс.Деньги, QIWI Кошелек, бонусными картами или другим удобным Вам способом.