

Учебный курс
Торговая система Pro_trader

2013

Содержание:

Глава 1. Принципы рынка.....	3
Глава 2. Структура рынка.....	7
Глава 3. Анализ рынка на разных временных интервалах.....	9
Глава 4. Поддержка и сопротивление.....	12
Глава 5. Тренды.....	16
Глава 6. Сила и слабость.....	23
Глава 8. Первоначальный процесс анализа рынка.....	31
Глава 7. Направление будущего тренда.....	37
Глава 9. Анализ рынка.....	39
Глава 10. Сетап.....	43
Глава 11. Вход.....	53
Глава 12. Управление капиталом.....	60

Глава1. Принципы рынка

Одна из причин, по которой трейдеры не могут добиться успеха заключается в том, что они не понимают, в какую игру они играют. Они не понимают природу рынка. Они не понимают природу трейдинга.

В конце этой главы вы сможете понимать:

Природу рынка.

Природу трейдинга.

Вы, наконец, поймете, почему все эти системы, которые вы испытывали, были неэффективные. Вас больше не будут интересовать системы. Вы не будете больше искать Святой Грааль.

То, что мы воспринимаем как реальность, может быть иллюзией.

Я считаю, что большинство людей не понимают, что такое рынок.

Они видят график и воспринимают движение цены, паттерны технического анализа и сигналы индикаторов.

Они думают, что это и есть реальность, это все, что они знают. И это то, чему учат в большинстве книг, на курсах.

К сожалению, эти трейдеры, как узники в пещере. Они прикованы к своему мнению и верят в свою реальность, которая на самом деле просто иллюзия. Они не могут понять, что на рынке есть правда, которая лежит глубже. Большинство трейдеров торгуют по теням, не понимая, что за реальность стоит за этими тенями.

Когда у трейдеров не получается торговать по сетапам или индикаторам, они начинают искать новые. Но они никогда так и не узнают правду, потому что торгуют по теням и не воспринимают реальность.

Успешная торговля заключается в понимании реальности, которая лежит за тенями. Это та реальность, которая двигает цену и только потом формирует ценовые паттерны и сигналы индикаторов.

Что заставляет цену двигаться?

Перед тем, как ответить на этот вопрос, я попробую вам объяснить, что такое цена.

Цена - это сумма, которую платит покупатель продавцу за товар.

В любой сделке должен быть товар, покупатель и продавец. Продавец имеет товар, покупатель хочет его купить.

Цена это сумма, за которую они договорились. И главное слово в этом предложении – договорились.

Покупатель готов купить по этой цене, продавец готов продать, это и есть сделка.

С точки зрения трейдинга, цена это решение 2 трейдеров о продаже или покупке.

Движение цены это функция спроса и предложения. Или простыми словами:

Предложение это количество продукта, который продавцы хотят продать по определенной цене.

Спрос это количество продукта, который покупатели хотят купить по определенной цене.

Цена будет двигаться, когда изменяется спрос и предложение.

Давайте рассмотрим несколько примеров...

Первый пример будет простой и он знаком всем – продажа дома. Здесь у нас есть предложение – один дом на продажу. А спрос будет разный, в зависимости от восприятия людей. Дом, который находится в хорошем районе, будет стоить дороже, и будет больше желающих его купить. Они будут соревноваться за дом. Но, если дом будет стоить слишком дорого, то потенциальных покупателей будет очень мало. Например, предположим, что у нас много покупателей, и все хотят купить дом по цене 650 000\$ и 750 000\$. Риэлтор начинает с 550 000\$, и покупатели начинают соревноваться между собой и повышают цены. Они хотят остаться одни в конце этого процесса. Сначала цена будет подниматься выше быстро, \$575,000 - \$600,000 - \$620,000 - \$640,000 - \$650,000 - \$660,000. Но когда у некоторых покупателей будет достигнут их предел они станут выходить их гонки. Цена начнет двигаться медленнее, и покупатели будут дольше думать над следующим шагом. Если у участников достаточно эмоций, то цена может пойти выше первоначальных ожиданий, в итоге не останется уже желающих купить и дом будет продан по высшей цене.

В этом примере покупатели хотят покупать и готовы платить. Предложение, по сути, сводилось к одному продавцу, который позволил цене расти до самого высокого предела.

Спрос захлестнул предложение, и это привело к скачку цены. Цена продолжала расти, пока не осталось больше покупателей готовых дать еще большую цену.

Давайте теперь рассмотрим другой пример, где будет 2 продавца, которые очень хотят продать, и они продают два одинаковых дома. Скажем два дома рядом, абсолютно одинаковые и с одинаковой стоимостью, и есть только один покупатель. Теперь, как вы понимаете, процесс будет совершенно обратный, чем в первом примере.

Покупатель будет торговаться, а продавцы будут соревноваться между собой. Продавцам придется снижать цену, пока они не дойдут до точки, ниже которой не смогут опуститься. Если покупатель примет цену, то сделка состоится.

Предложение захлестнуло спрос. Цена будет падать до тех пор, пока цена не будет настолько низкой, что продавцы уже не захотят продавать.

Вот что важно... это не просто количество участников, а их отчаянное желание, крайняя необходимость, с которой они хотят совершить сделку.

Давайте вернемся к первому примеру, покупатели готовы заплатить не более 750 000\$, но в этот раз продавец хочет слишком много, аукцион открывается с 850 000\$, но никто не покупает, сделки не будет, даже не смотря на то, что есть много покупателей и только один продавец. Дом будет продан только, если кто-то из покупателей решит, что ему нужен именно этот дом и готов заплатить цену выше, или если продавец согласится опустить цену.

Предположим, что продавец очень хочет продать дом, тогда он скажет опустить цену, пока не появится покупатель.

Предложение захлестнуло спрос, и цена упала.

Теперь перейдем к финансовым рынкам. Это двойной аукцион. Много покупателей и много продавцов, соревнуются между собой на рынке.

Цена может идти и вверх и вниз в зависимости от того, кто доминирует на рынке в это время, спрос или предложение.

Цена идет вверх, когда спрос выше предложения, и пока покупатели готовы платить выше и выше.

Цена будет идти вверх до тех пор, пока не закончатся покупатели, или пока предложение не перекроет спрос.

Цена падает, если предложение превышает спрос, и пока продавцы готовы продавать все ниже и ниже.

Цена будет падать до тех пор, пока не закончатся продавцы, или пока спрос не перекроет предложение.

Движение цены это функция спроса и предложения.

Или, если сказать еще правильнее, движение цены это результат дисбаланса между спросом и предложением. Этот дисбаланс создается желанием трейдера срочно открыть сделку.

При бычьем настроении цена растет.

При медвежьем настроении цена падает.

Нейтральные настроения ведут к узкому ренжу или боковому движению цены.

Обратите внимание на то, что цена не идет по прямой линии, она постоянно колеблется. Рынок состоит из покупателей и продавцов, которые работают по-разному, на разных временных интервалах, у них свои причины для открытия и закрытия позиции. Мы не знаем эти причины, но нам это и не нужно, нас интересует общее настроение рынка, а цена идет туда, куда стремится и толпа.

Все сводится к настроению участников рынка.

Когда у трейдера появляется желание покупать, он присоединяется к группе покупателей и добавляет бычьи настроения на рынке. Если трейдеров достаточно, то цена начинает идти вверх, и наоборот для медведей.

Цена двигается под воздействием сил спроса и предложения.

Спрос и предложение меняется, когда меняется настроение толпы.

Настроение толпы меняется с изменением настроения участников рынка.

Итак, вот мы и подошли к главному...

Мы поняли, что цена это решение двух индивидуумов, которые принимают решение о покупке или продаже, мы также поняли, что цена движется в результате решения людей. Некоторые основывают свое решение на фундаментальных показателях, другие на технических, не важно, самое главное, люди принимают решения.

Цена не идет вверх или вниз из-за фундаментальных или технических данных, люди принимают решения на их основе, продавать или покупать.

Общее решение формирует настроение толпы, и это общее решение ведет к тому, что цена движется.

Даже если выходят хорошие фундаментальные данные о компании, но люди не хотят покупать ее акции, цена не пойдет вверх.

Любая модель, например голова и плечи, не будет работать, если она указывает вниз, а люди хотят покупать.

Все дело в людях и их решении о направлении рынка.

Цена меняется, когда меняется спрос и предложение, а спрос и предложение меняется, когда меняются решения участников рынка.

Итак, подведем итог – как движется цена?

- Движение цены это дисбаланс спроса и предложения.
- Изменение спроса и предложения приводят к изменению настроения участников рынка.
- Таким образом, цена зависит от настроения участников рынка.
- Когда большинство настроены покупать, цена растет.
- Цена будет расти до тех пор, пока не закончатся покупатели, или высокие цены не привлекут продавцов.
- Обратный процесс происходит, когда цена падает.

Цена движется в результате коллективного решения покупать или продавать.

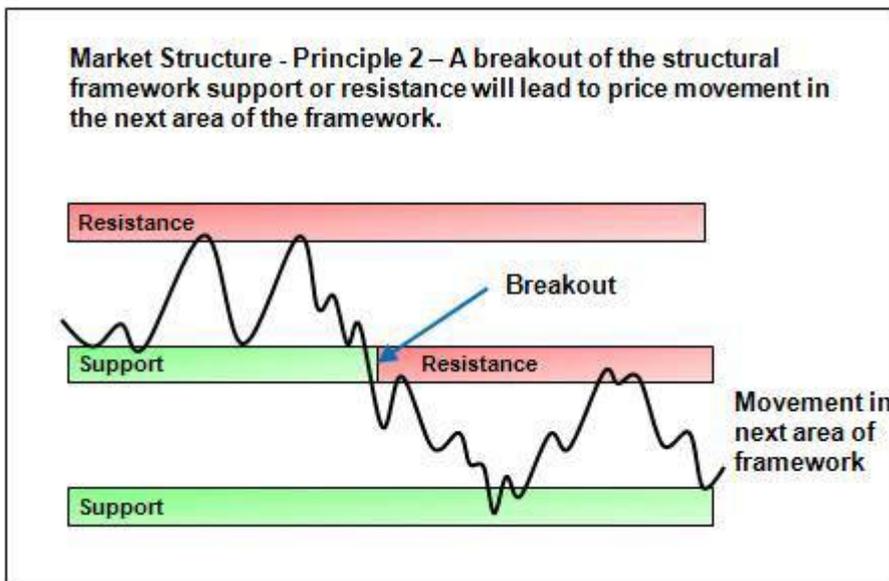
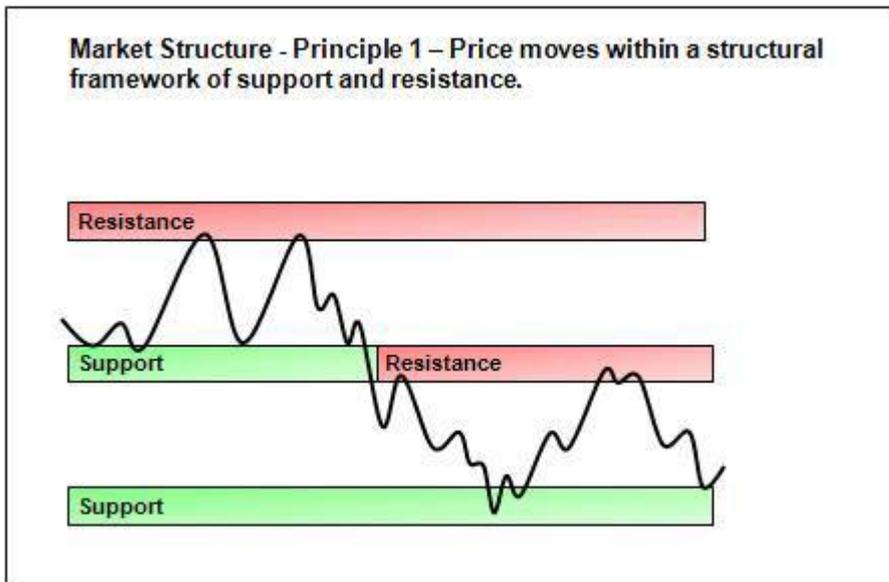
Глава 2. Структура рынка

Рынок работает основываясь на 2 принципах:

- 1) Цена движется между уровнями поддержки и сопротивления
- 2) Если цена пробивает уровень поддержки или сопротивления, то она пойдет к следующему уровню

Определяя зоны поддержки и сопротивления, мы определяем зоны, которые станут барьерами для цены. Мы определяем поле боя.

Цена движется в определенных границах, назад и вперед между уровнями поддержки и сопротивления, на основе решений трейдеров. Это зоны принятия решения, цена или откатит или прошьет уровень.



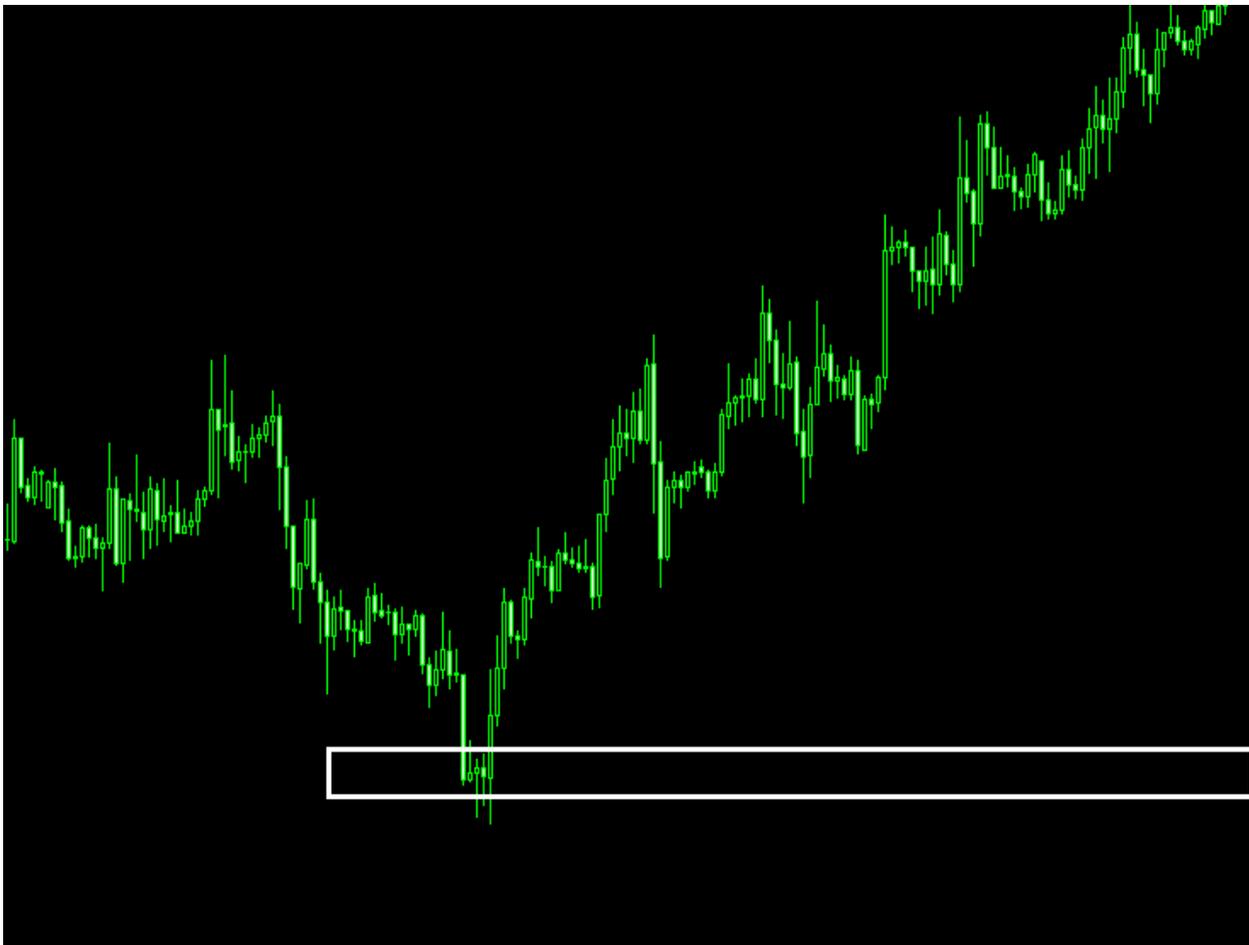
Открываем старший график и определяем зоны поддержки и сопротивления. Не все уровни поддержки и сопротивления будут на графике.

Наша задача определить возможные точки разворота цены, то есть самые очевидные уровни.

Ничего не нужно усложнять, все просто, если вы думаете, что это хороший уровень поддержки или сопротивления, то так скорее всего и есть.

Лучшие уровни поддержки и сопротивления

Самые лучшие уровни, которые нельзя пропустить, это уровни, которые показывают самый большой дисбаланс спроса и предложения. Это такие моменты, когда быки или медведи уже не могут ждать, что ведет к быстрому движению цены. Это хорошо видно на впадинах и пиках, где цена резко разворачивается, и в зонах скопления, когда прорыв ведет к резкому движению цены.



Быстрый откат из зоны показывает дисбаланс, это будет хороший уровень, если цена вернется сюда.

И именно такие зоны мы ищем для анализа.

Глава 3. Анализ рынка на разных временных интервалах

Сделки на рынке происходят в реальном времени, концепции временных интервалов существует только для того, чтобы мы могли видеть прошлое и настоящее поведение цен. Чем выше временной интервал, тем лучше видна общая картина рынка. Чем ниже временной интервал, тем детальнее трейдер может рассмотреть поведение цены.

Основная трудность для нас заключается в том, что торгует на рынке очень большое количество участников, которые используют разные временные интервалы. Возникает вопрос, какой временной интервал использовать нам?

Я лично рекомендую использовать 3 временных интервала. Конечно, в начале дня я могу посмотреть и на другие временные интервалы, но во время торговли, смотрю только на 3. Старший временной интервал, торговый график и меньший временной интервал.

Обычная ошибка начинающих трейдеров заключается в том, что они пытаются найти тренд на всех временных интервалах, например, восходящий тренд на всех трех графиках и торговать только в направлении тренда. Это сильно уменьшает количество входов и снижает эффективность.

Эти трейдеры похожи на тех, кто входит в сделку по сигналу запаздывающих индикаторов. Они надеются, что тренд еще какое-то время продолжится, чтобы они могли получить прибыль. Они считают, что если найдут тренд на всех графиках, то таким образом, смогут отфильтровать плохие сделки.

Но, в их анализе нет понимания, какие барьеры может встретить цена на своем пути в тренде. Они также не учитывают, что в основном цена движется в боковом канале.

Мы будем делать по-другому.

Для нас старшим графиком будет 240 минут (альтернатива 60 минут). Здесь мы будем определять поддержку и сопротивление.

Торговым графиком будет 60 минуты (альтернатива 15 минут). Определяем тренд и возможные паттерны прайс экшен. Мы торгуем вершины и впадины, определяем силу и слабость движения цены и куда она может пойти. Контрольный график 5 минут, для входа и выхода. Это детали, мы как бы приближаемся к уровням, чтобы лучше рассмотреть их.

Давайте теперь посмотрим на примеры.



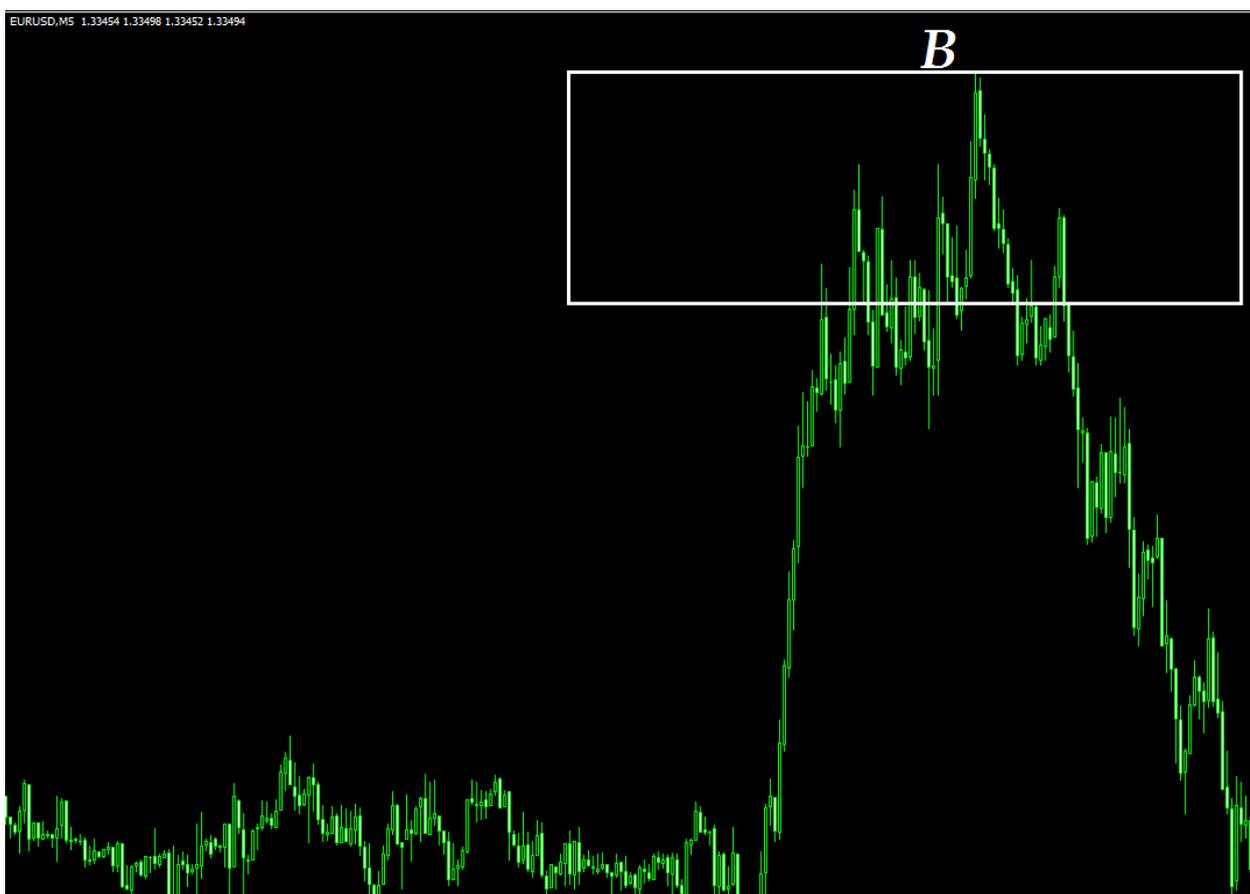
Это 240 минутный график (4х часовой).

Посмотрите на зону, отмеченную белым прямоугольником, где поддержка стала сопротивлением в точке А. Нас интересует точка В, куда цена возвращается для теста.



Дальше идет 60 минутный график, здесь мы ищем прайс экшен и сетап. Повторный тест в точке В. Цена подходит к уровню, и мы ждем или пробой, откат и сделку, или ложный прорыв.

И 5 минутный график, показывающий детали.



Мы видим как цена останавливается, подходя к этому уровню, рисуя шпильки.
Те трейдеры, которые купили на пробой, поставили стопы под уровнем, а мы будем там продавать.

Вот так работает анализ 3х графиков.

Глава 4. Поддержка и сопротивление

Чтобы правильно проводить анализ рынка очень важно научиться правильно определять уровни поддержки сопротивления. Эти уровни являются барьерами для движения цены. Поддержка это как бы «пол», который не дает упасть цене, а сопротивление «потолок», который ограничивает дальнейшее движение вверх.



Уровни поддержки и сопротивления это результат действия трейдеров на рынке. Вы должны помнить, что движение цены это результат закона спроса и предложения.

- Цена растет, когда у трейдеров бычье настроение и есть и пока есть покупатели, до тех пор, пока не появится избыток предложения.
- Цена падает, когда у трейдеров медвежье настроение и пока есть продавцы, или пока спрос не захлестнет предложение.

На примере видно как цена несколько раз шла к уровню сопротивления. Повышение цены говорит о бычьем настроении игроков. Но уровень удерживал цену и она каждый раз откатывала.

Цена падала:

1. Трейдеры не хотели покупать по высокой цене. Спрос упал, и больше не было необходимости покупать.
2. Высокие цены привлекли продавцов. Те, кто стояли в покупке фиксировали профит, и в рынок вошли продавцы, что добавило силу движению вниз.

Результатом этих двух причин стало то, что быки не могли переломить медведей. Цена упала, и получился новый локальный максимум на сопротивлении.

Почему цена останавливается на тех же самых уровнях или зонах? И почему поддержка становится сопротивлением и наоборот?

Нет ничего удивительного, это трейдеры, которые принимают решения.



При подходе цены к уровню 1.3115 медведи начинают потихоньку продавать EUR, потому что для них это наиболее выгодная цена, поймать максимум. Большая часть быков, наблюдая большие объемы (перевес) медведей, начинают фиксировать свою прибыль и выходить из сделок, что больше прибавляет интереса к продажам. Быкам уже не выгодно покупать по высокой цене. Далее мы видим как цена нащупала сопротивление, здесь самое интересное. Толпа, думая что это лишь был откат начинают скупать здесь валюту. Но сила на стороне медведей, интереса к покупкам у больших дядек уже нету. Нащупав сопротивление толпа начинает нервничать и выходить с минусами, а продавцам выпадает шанс еще раз продать по выгодной цене. Поддержка пробивается и цена стремительно падает.

И внизу графика видно, как поддержка становится сопротивлением. И снова речь идет о страхе, надежде и сожалении. Подумайте о тех, у кого были позиции на покупку. Если трейдер не поставил стоп, он увяз в убыточной позиции, сейчас он испытывает стресс, и молится, чтобы цена хоть чуть-чуть вернулась, и он смог выйти в безубытке.

Теперь давайте подумаем о тех, кто вовремя не продал. Они надеются, что цена вернется протестировать зону и они смогут открыть короткую позицию.

Есть еще трейдеры, которые продали вовремя и теперь они планируют добавить к своей позиции. Теперь поддержка стала сопротивлением.

Обратный процесс происходит, когда сопротивление становится поддержкой. Советую вам поискать

примеры на графике и поработать с этим.

Поддержка и сопротивление это уровни, которые создают трейдеры своими решениями, так как им приходится работать в условиях неопределенности.

Решения продавать или покупать проходят через призму предыдущих зон эмоциональной напряженности, это зоны сожаления об упущенной возможности, или зоны где трейдеры попали в ловушку.

Есть и другие факторы. Представьте, что на графике вы видите сильную зону сопротивления. Если цена дойдет до этого уровня, то большинство трейдеров будут ждать, что цена будет сдержана сопротивлением.

Покупателей станет меньше, а продавцов больше, что приведет к падению цены. Ожидание трейдеров ограничит движение вверх и создаст сопротивление. То же самое применимо и к поддержке.

Поддержка это зона, где спрос превышает предложение, ограничивая движение цены вниз.

Сопротивление это зона, где предложение превышает спрос, ограничивая движение цены вверх.

Определяем уровни поддержки и сопротивления.

Зоны сопротивления и поддержки, это зоны, которые были препятствием для преодоления цены, в большинстве случаев это точки разворота цены.

Чертим зоны, а не линии

Когда я показываю зоны поддержки и сопротивления на графике, обычно, я показываю их с помощью линий. Но, вы должны знать, когда цена подходит к таким уровням, она не всегда четко останавливается на линии. Поддержка и сопротивление, это ЗОНЫ, где трейдеры принимают решения. Трейдеры по-разному определяют зону.

Поэтому, когда вы делаете анализ, важно, чтобы вы помнили о зоне, даже если на графике может быть просто линия. Иногда цена чуть-чуть прошивает линию, но это еще не значит пробой. Может быть вам больше понравится чертить «коробку», это легче визуализирует зоны поддержки и сопротивления. Иногда я могу включить всю консолидацию в эту зону.

Если свечи большие в консолидации, то я могу переключиться на меньший временной интервал, чтобы лучше увидеть зону.

Как вы понимаете, здесь нет четких правил. Уровни поддержки и сопротивления это не кирпичная стена, это просто зона, где есть эмоциональная привязанность у трейдеров, как следствие прошлого дисбаланса спроса и предложения на этом уровне, поэтому это стало зоной, где трейдеры будут, скорее всего, принимать решение. Границы эмоциональной сферы людей не могут быть точно обозначены.

Самое важное, не бояться субъективности, и не заикливаться на точности. Позднее вы увидите, что это скорее зоны интереса, чем зону, от которых обязательно откатит цена, иногда мы будем торговать откат, иногда пробой.



Глава 5. Тренды

Я расскажу вам о том, как я определяю тренд. Поведение цены одинаковое не зависимо от временного интервала. Цена это следствия спроса и предложения, она движется в зонах поддержки и сопротивления. На 240 мин графике мы определяем эти зоны.

На 60 мин графике, как мы и договаривались, мы будем определять уровни поддержки и сопротивления как вершины и впадины.



Направление тренда

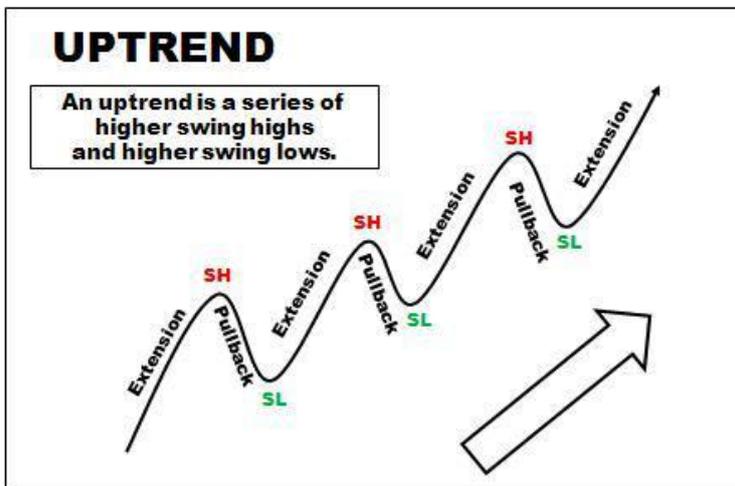
Цена движется в пределах зон поддержки и сопротивления в восходящем тренде, нисходящем или в боковом движении.

Определение восходящего тренда

Восходящий тренд состоит из:

- 1) Расширяющее движение вверх
- 2) Вершина
- 3) Откат вниз
- 4) Впадина

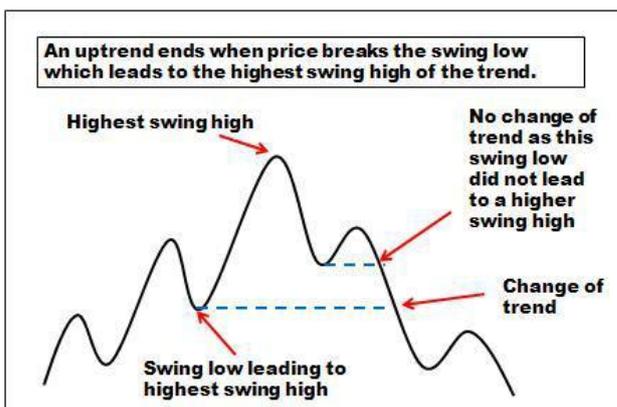
Это показано на картинке:



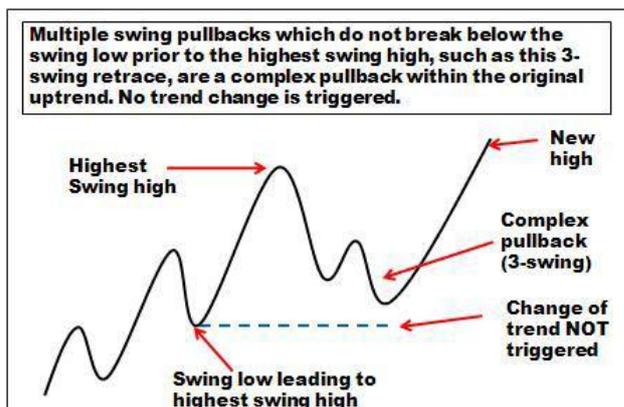
- Движение вверх больше, чем откаты.
- Появляются новые вершины.
- Откаты не делают новые впадины.



Восходящий тренд заканчивается, когда цена делает впадину ниже.



Если цена не смогла сделать новую впадину, то это просто сложный откат



Определение восходящего тренда с точки зрения спроса и предложения

Поддержка была сформирована трейдерами, которые посчитали, что впадина это хорошая цена для покупки. Позиции на покупку вызвали рост цены. Трейдеры продолжают покупать, что приводит к новым вершинам.

Со временем покупатели начнут фиксировать прибыль, и продавцы начнут вступать в игру. Это сформирует сопротивление. Падение цены привлечет еще больше продавцов и покупатели активней начнут фиксировать профит. Цена пойдет вниз, но это не признак разворота тренда, если не будет достаточной силы медведей, чтобы пробить предыдущую впадину. Скорее всего, откат привлечет еще больше покупателей, продавцы поймут, что это был просто откат, и закроют свои позиции. Цена пойдет еще выше. И все повторится сначала.

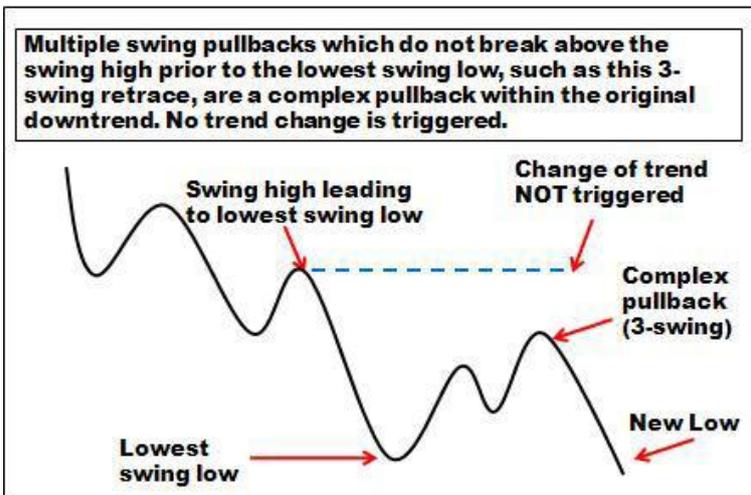
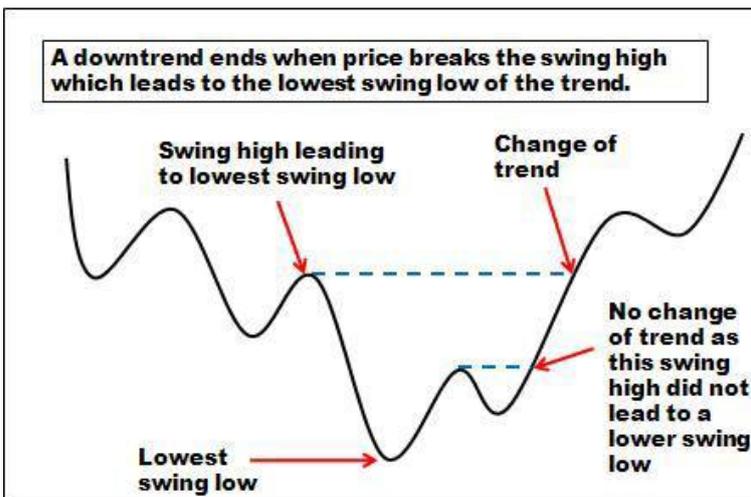
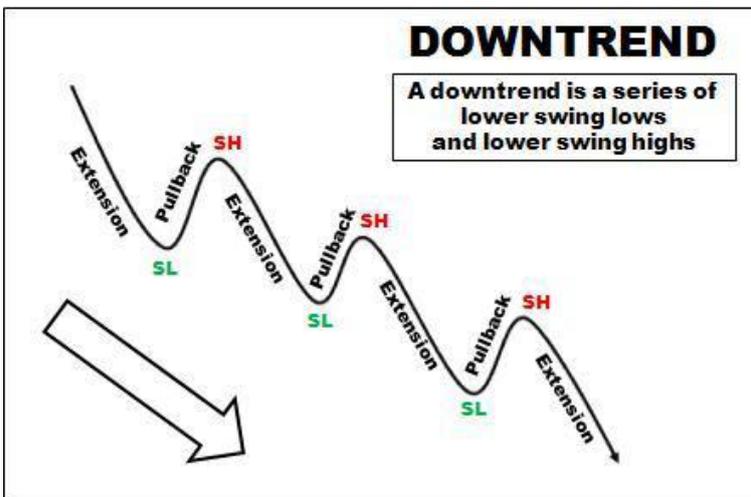
Интересно то, что для восходящего тренда нужны не только покупатели, но и продавцы. Любое движение цены это следствие и покупателей и продавцов. Часто хорошее восходящее движение

обусловлено продавцами, которые в экстренном порядке закрывают свои позиции.

Подумайте о психологии большинства. Пропустив начальное движение вверх, трейдеры охвачены сожаленьем и злостью на себя, что не открыли сделки во время. Они понимают, что цена не может все время идти вверх, поэтому они открывают сделки на продажу при первом признаке разворота тренда, надеясь заработать на развороте. Как правило, они ошибаются, потому что это скорее откат, чем разворот. Конечно, когда цена начинает снова расти, они вынуждены закрыть позиции, или их закрывает по стопу.

Большая часть движения вверх, это как раз стопы продавцов, которые пытались поймать разворот.

Для нисходящего тренда все будет также, только наоборот

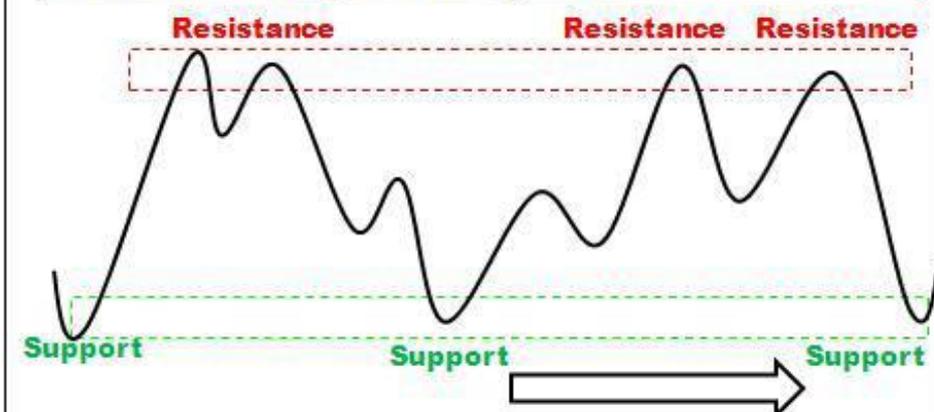


Боковое движение

Боковое движение, или боковой тренд это серия волн, которые не выходят за пределы зоны поддержки сверху, и зоны сопротивления снизу. Эти границы (поддержка и сопротивление) могут быть сформированы как на более старшем временном интервале, так и на меньшем.

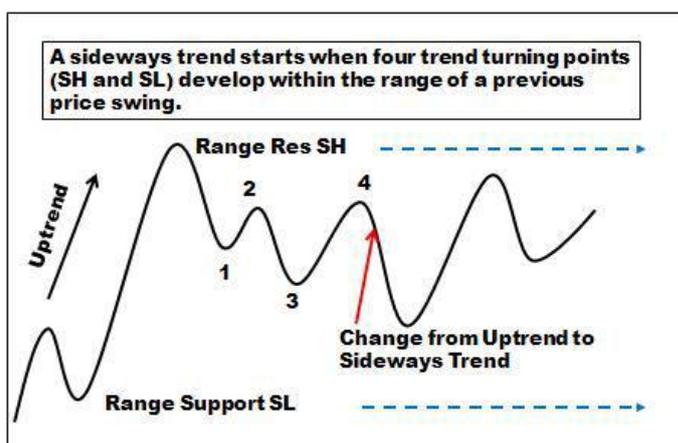
SIDEWAYS TREND

A sideways trend comprises a series of price swings existing within the range of an upper significant resistance area and a lower significant support area.

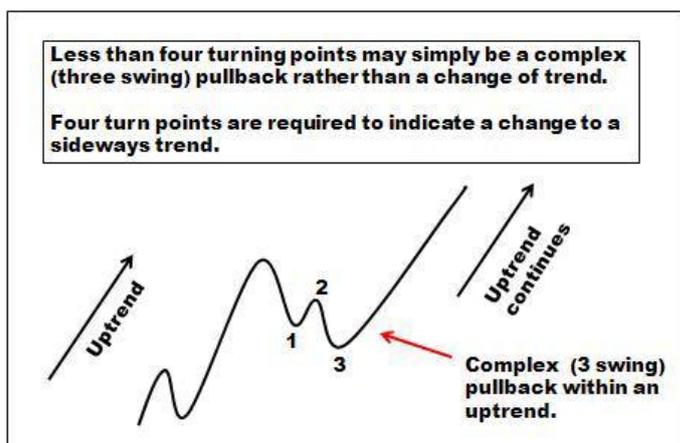


Я так определяю начало бокового движения:

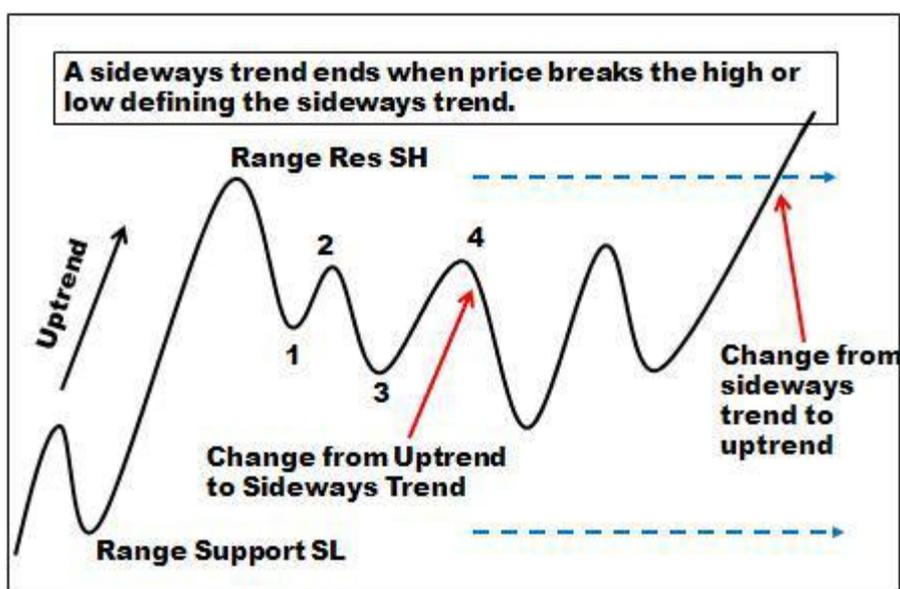
Боковое движение начинается, когда 4 точки тренда (вершины/впадины) находятся в пределах предыдущей волны.



Если точек меньше, чем 4, то это просто может быть сложный откат в тренде. 4 точки нужны, чтобы показать боковой тренд.



Я определяю окончание бокового движения, когда цена пробивает или поддержку или сопротивление.



Боковое движение с точки зрения спроса и предложения

Поддержка показывает трейдерам хороший уровень для покупки. Продавцы будут фиксировать прибыль, а покупатели добавлять в позицию. Но, когда цена подходит к сопротивлению, происходит обратное.

Направление тренда зависит от дисбаланса спроса и предложения, что в свою очередь зависит от трейдеров, которые принимают решения. Трейдеры принимают решение, как правило, на прошлых уровнях поддержки и сопротивления. Это не просто линии, это линии, которые определяют тренд.

Будет ли тренд меняться – покажет пробитие поддержки или сопротивления, и факт, сможет ли цена закрепиться на уровне.

Как я уже говорил, рынок нельзя загнать в рамки жестких правил и математических моделей. Это эмоциональный зверь.

Любая попытка подойти к определению тренда с объективной стороны рано или поздно провалится. Вы можете придумать правило, как определить направление тренда, но появится откат, который выйдет за границы вашего определения. Здесь главное это субъективность, но новичкам это трудно принять.

Может быть откат, который объективно будет показывать изменение тренда, но на самом деле это не так.

Решение очень простое, нужно допустить немного субъективности. Пусть цена подойдет к точке изменения тренда, пусть даже пройдет этот уровень. Изменение тренда это не прорыв линии, изменение тренда происходит тогда, когда цена принимает новую зону.

Важно, если вы думаете, что это восходящий тренд (цена движется слева снизу вправо вверх), то это восходящий тренд и наоборот для нисходящего тренда. Все остальное это боковой тренд.

Все остальные правила имеют второстепенное значение.

Со временем вы сможете без проблем применять субъективизм в работе, а также научитесь с практикой определять, какие вершины и впадины важные, а какие нет.

Не нужно усложнять. Тренд это движение цены в одном направлении. Ваш разум лучше определить тренд, чем любое правило. А если вы ошиблись, то прайс экшен быстро подскажет вам это.

Глава 6. Сила и слабость

Самым важным является определение силы и слабости тренда и каким может быть дальнейший прайс экшен.

Или проще говоря:

Где была цена?

Куда пойдет цена?

Структура рынка и анализ тренда показывает нам, где была цена. Давайте, теперь научимся определять, куда она пойдет.

Концепции будущего тренда:

1) Прайс экшен дает ключ к силе или слабости, как быков, так и медведей. Это позволяет нам увидеть, кто сейчас контролирует ситуацию.

2) Будущие сетапы прайс экшен скорее всего будут в направлении того, кто сильнее.

Получается, мы анализируем силу и слабость медведей и быков, и проецируем это в будущее.

Рынок движется в направлении силы.

Определяем силу и слабость

Мы будем определять силу и слабость тренда с помощью различных свойств цены, а именно :

моментума, проекции и глубины.

Этот анализ мы будем делать на рабочем графике n1.

Моментум (движущая сила)

Что такое моментум?

Наблюдение за ценой с целью проанализировать скорость и ускорение. Этот анализ поможет нам понять потенциал будущего тренда и его направление.

На самом деле моментум это два качества цены: скорость и ускорение.

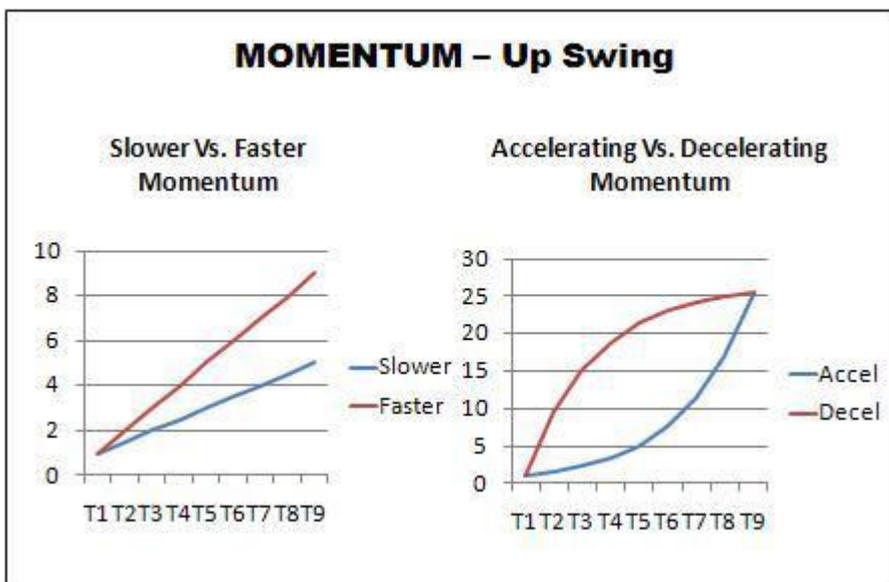
Моментум это не индикатор, это свойство движения цены.

Мы просто наблюдаем прайс экшен и сравниваем скорость и ускорение настоящего с прошлым движением цены.

На графике моментум можно проследить с помощью наклона движения цены. На графике видно вертикальную и горизонтальную ось. На графике представлены восходящие движения.

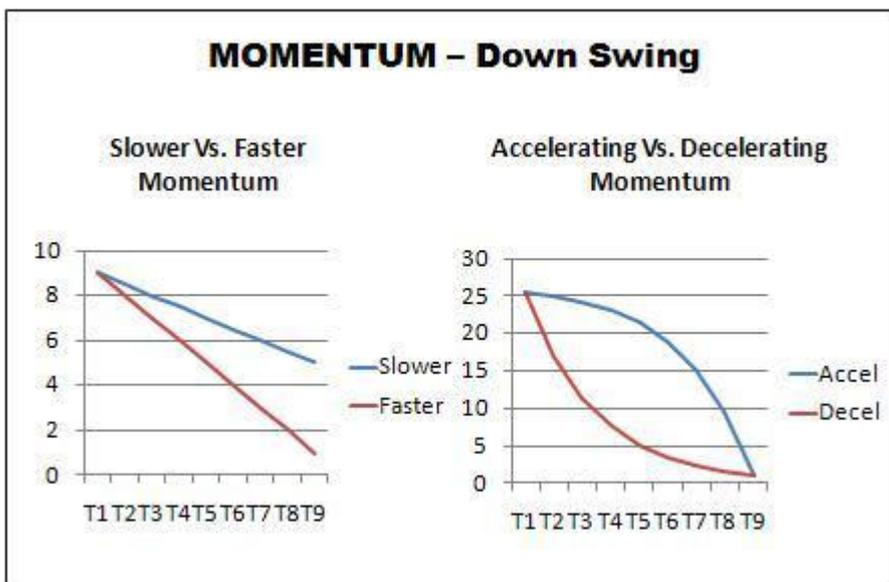
Прямая красная линия слева это скорость цены, изменение цены за единицу времени.

Голубая линия это тот же период времени, но цена меньше выросла. Голубая линия показывает меньше моментума, чем красная, она слабее.



Справа мы видим ускорение или замедление в изменении скорости. Голубая линия показывает ускорение, усиление силы быков. Красная линия наоборот показывает слабость.

Тоже самое, только вниз.



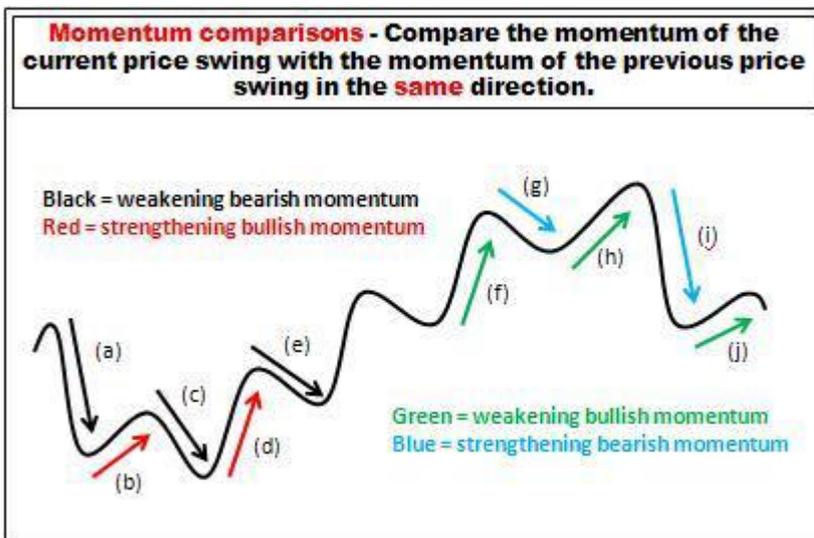
Итак, что важно? При анализе импульса важно не измерение самого импульса, а сравнение текущего движения цены с прошлым импульсом.

1) Сравните импульс текущей волны с прошлой волной, они в одном направлении? Цена движется быстрее или медленнее, чем раньше? Что это значит?

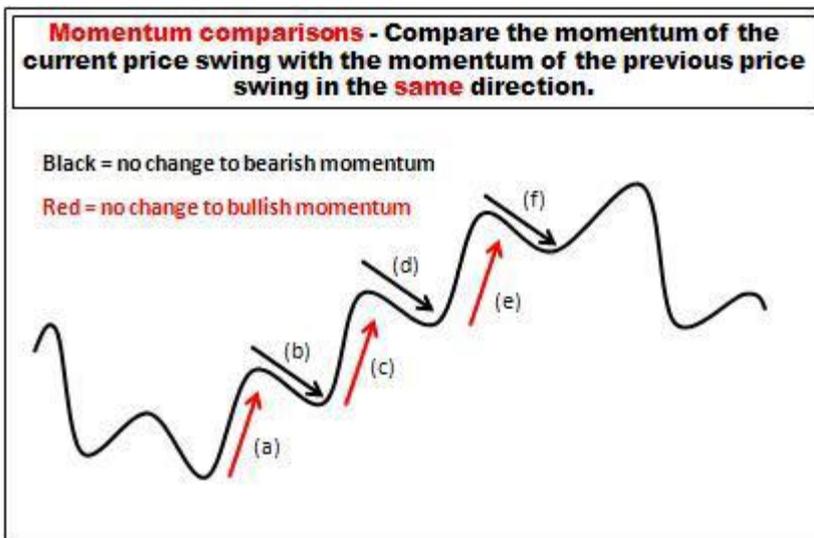
Посмотрите на пример, в ту точку, где цена ослабевает и переходит в восходящий тренд. Сравните наклоны (a) (c) (e). Видите, как уменьшается скорость, показывая уменьшение медвежьего импульса. Слабость проявляется на стороне медведей.

Посмотрите на (b) (d), скорость увеличивается, увеличивается сила и импульс быков.

Цена скорее всего продолжит движение в сторону силы. Бычий импульс становится сильнее медвежьего.



Теперь посмотрите, что происходит дальше, (f), (h), (j). Посмотрите на скорость, изменение бычьего момента. Показатель слабости быков. Сравните с (g) (i), здесь сила на стороне медведей. Конечно, не всегда будет так понятно, как на графике. Часто нет разницы в скорости, и нет четкой картины, кто сильнее.



Когда нет изменения момента, мы ожидаем, что цена продолжит движение в заданном направлении. Это будет до тех пор, пока не появится доказательство, что моментум меняется.

2) Сравните моментум текущей волны с прошлой волной, они в разных направлениях? Цена движется быстрее или медленнее, чем раньше? Что это значит?

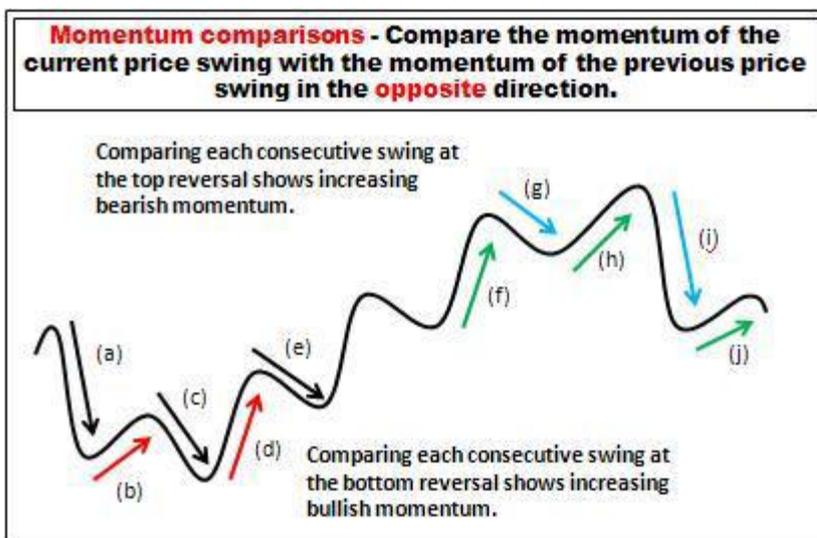
Еще один способ определить силу и слабость это сравнить силу волны движения цены с предыдущей, которая была в обратном направлении. То есть, сравнить бычью волну с медвежьей и наоборот.

Посмотрите на пример, и обратите внимание на угол (a), который почти вертикальный и волну (b), под углом 45%. Эта волна была слабее, чем предыдущая, сила на стороне медведей.

Бычья волна (d) показывает небольшое увеличение скорости по сравнению с (c). Теперь сила на стороне быков, но пока еще разница незначительная.

Волна (e) показывает уменьшение момента, и угол уже меньше. Теперь сила явно на стороне быков.

Мы ждем, что цена пойдет вверх в сторону силы. Тренд поменялся.

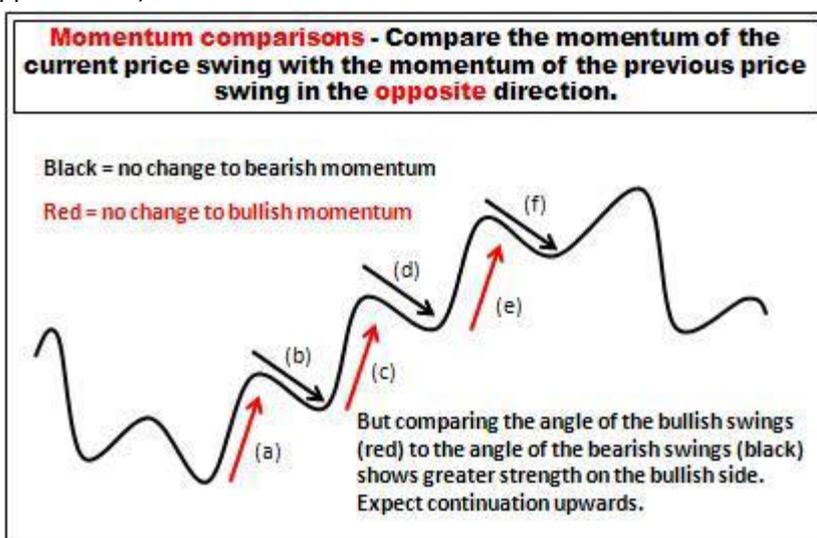


Такой же анализ применим и к развороту на вершине. Волны (f) и (g) показывают восходящий тренд.

Волны (g) и (h) показывают одинаковый моментум. Нужна еще информация.

Волны (h) и (i) показывают изменение ситуации, моментум переходит на медвежью сторону. Это подтверждает и волна (j). Моментум волны (j) слабее, чем (i), теперь цена движется в нисходящем тренде.

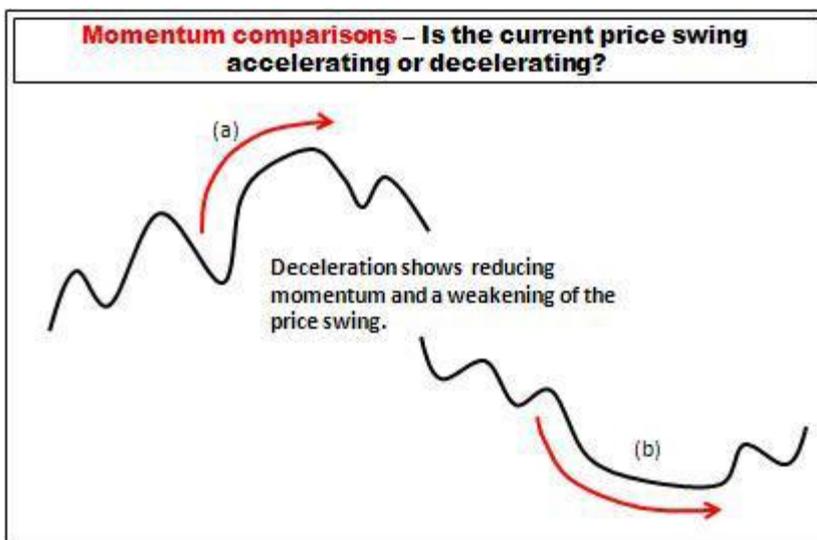
На следующем примере показано, почему нужно сравнивать с волной противоположного движения, а не того же самого.



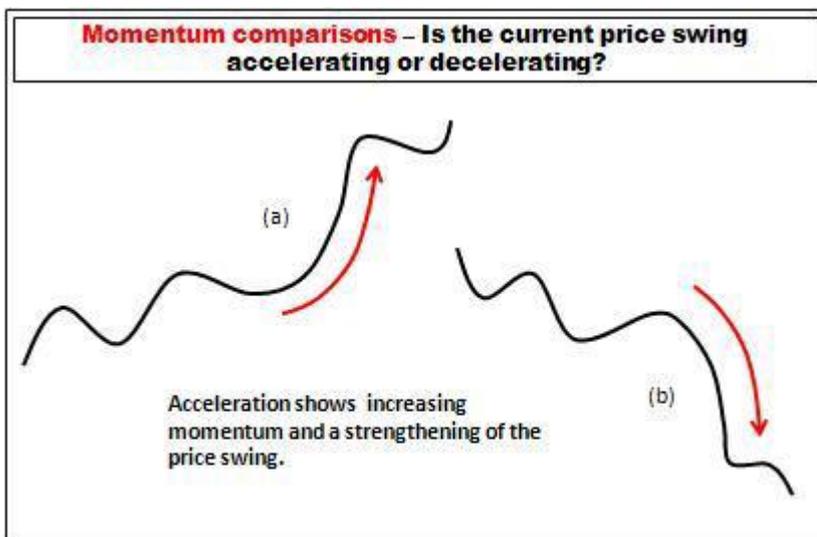
Если вы посмотрите на волны (b) (d) (f), вы не увидите изменений импульса. Нет доказательств силы или слабости цены. То же самое, если мы сравним (a) (c) и (e). Но если сравнивать волны противоположных движений, то мы получим нужную информацию. Сравнивая (a) и (b) мы видим, что быки сильнее, то же верно и для других волн.

3) Сейчас цена ускоряется или останавливается, что это значит?

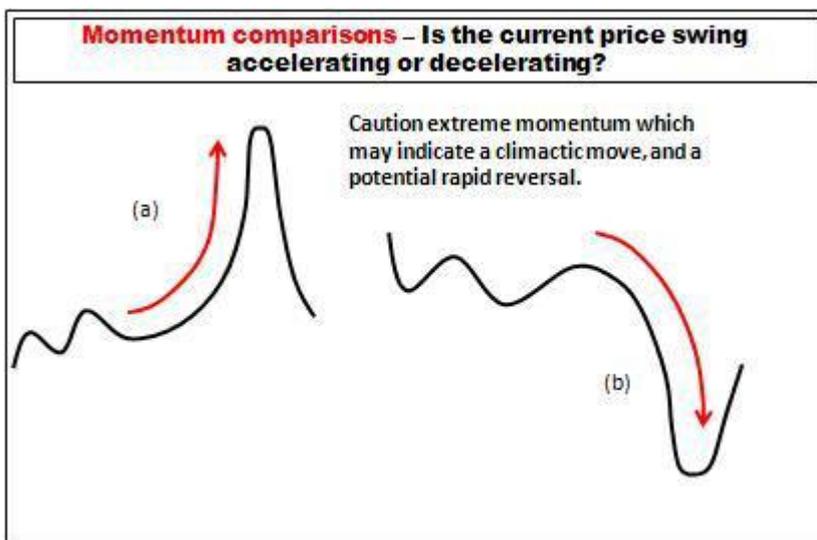
На примере показано замедление цены и ослабление импульса. Но это не обязательно показывает разворот, просто это показатель того, что цена начинает ослабевать.



Ускорение импульса



Но, слишком большое ускорение может быть сигналом разворота, потому что большие и сильные движения показывают кульминацию движения, после которого следует разворот.



Кульминационные движения показывают последнюю толпу, которая покупает с рынка по любой цене, в погоне за ценой выше и выше. Когда уже не остается продавцов, цена разворачивается, и они попадают в ловушку. Они вынуждены закрывать позиции, от чего цена падает еще быстрее. То же верно и для движения вниз.

Итак, ускорение цены показывает силу, но чрезмерное ускорение, скорее всего, показывает кульминацию движения, после которого следует разворот. Нужно научиться различать виды ускорения, чтобы знать, о каком сценарии идет речь.

Подведем итоги по моментуму...

Не каждая волна дает нам полезную информацию о моментуме. Но мы постоянно следим за ценой, чтобы вовремя заметить любые изменения. Это может быть изменение скорости от одной волны к другой, или изменение скорости одной волны (ускорение, замедлении).

- Сравниваем моментум одной волны и другой волны того же направления. Цена движется быстрее или медленнее? Что это значит?
- Сравниваем моментум одной волны и другой волны противоположного направления. Цена движется быстрее или медленнее? Что это значит?
- Сейчас цена ускоряется или замедляется? Что это значит?

Анализ моментума позволяет нам увидеть изменения силы и слабости в тренде, другими словами видеть силу и слабость тренда.

Цена пойдет, скорее всего, в направлении силы и против слабости.

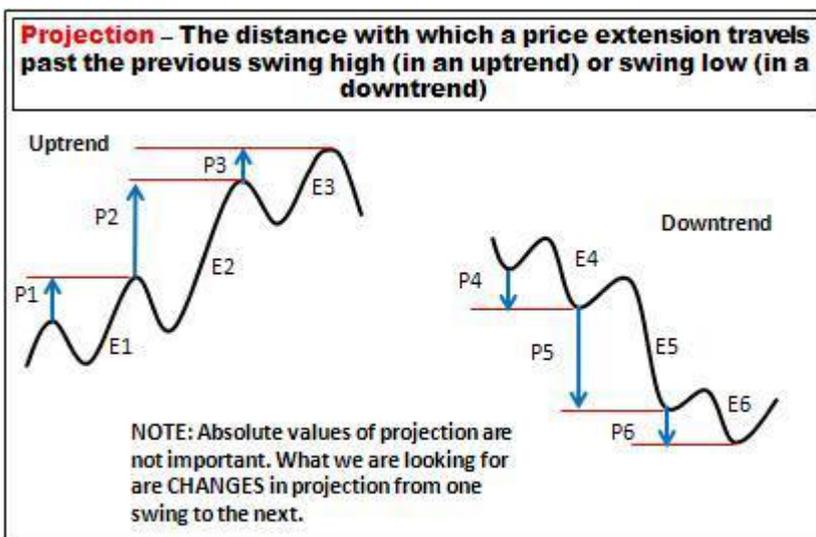
Такая способность знать силу и слабость тренда дает нам возможность зарабатывать на тех трейдерах, у которых нет этой информации, не смотря на то, что она прямо перед их глазами.

Проекция и глубина

Силу и слабость тренда можно также анализировать с помощью проекции и глубины.

Проекция это расстояние, которое цена проходит в волне. Само расстояние не важно, важно

изменение этого расстояния от одной волны к другой.



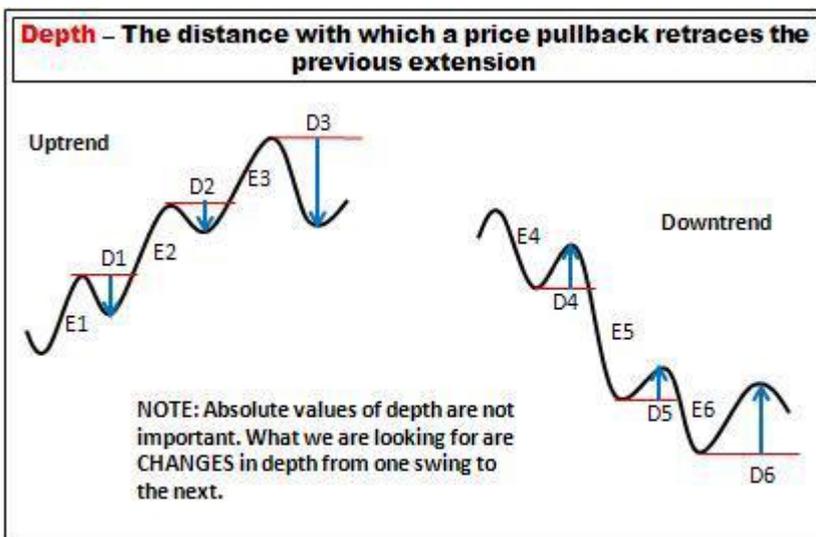
Если посмотреть на пример, восходящий тренд, то мы увидим, что прайс экшен сделало 3 расширения цены E1, E2 и E3. Проекция показана P1, P2 и P3. P1 это расстояние, которое E1 прошло выше предыдущей высшей точки и так далее.

Обратите внимание на проекцию E2 (P2) в сравнении с E1 (P1), расширение E2 гораздо больше чем E1, что показывает, как тренд набирает силу.

P3 короче P2, что показывает слабость. Тоже самое верно и для нисходящего тренда.

Увеличивающаяся проекция это признак силы тренда. Уменьшающаяся проекция признак слабости тренда.

Глубина относится к расстоянию, на которое цена откатывается от расширения.



На примере мы видим расширение E1, E2 и E3. D1, D2 и D3 это глубина.

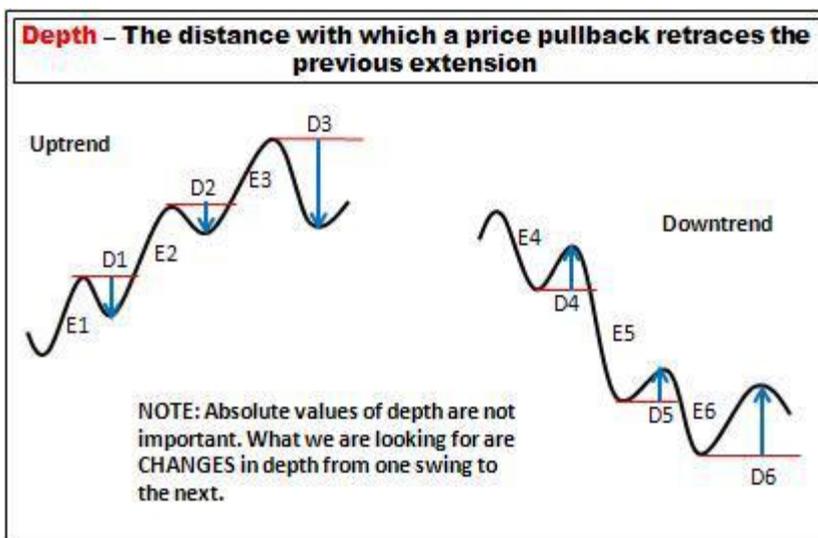
Как и в случае с проекцией нас не интересуют показатели глубины, нас интересуют изменения глубины от одной волны цены к другой.

Обратите внимание, что D2 гораздо меньше идет вниз, чем D1, что говорит нам о слабости медведей, а следовательно, силе восходящего текущего тренда. D3 в свою очередь гораздо больше, чем D2, что говорит о потенциальной силе медведей, а следовательно потенциальной слабости текущего тренда.

Те же концепции применимы и к нисходящему тренду.

Увеличение глубины это признак потенциальной слабости тренда, уменьшение глубины отката это признак потенциальной силы тренда.

На волатильном рынке большие откаты могут быть нормальными, как показано на примере:



В такой ситуации глубина 65-75% считается нормальной. Ослабление тренда можно было заметить только, когда откаты стали еще больше. PB3 и 4 превысило длину их расширения. Это был знак, что баланс сил меняется и переходит на сторону медведей. Только здесь тренд показал нам признаки слабости.

Подведем итог проекции и глубине...

Когда мы с вами делаем анализ, мы ищем доказательства того, что что-то изменилось. Если ничего не изменилось, то новые откаты и расширения будут оставаться в рамках предыдущих. Если мы видим доказательства изменений, то мы знаем, что расстановка сил меняется. Нужно это проанализировать, что это нам дает с точки зрения законов спроса и предложения? Что это значит с точки зрения других трейдеров, их эмоций, мыслей и решений?

Все это можно заметить и с помощью анализа импульса, но не всегда. Часто анализ проекции и глубины быстрее показывает изменение настроения рынка с точки зрения прайс экшен.

Неудачное продолжение.

Концепция, которую я называю «неудачное продолжение» тесно связана с такими понятиями как импульс, а также проекция и глубина.

Вы будете часто видеть на графике паттерны, которые для толпы будут выглядеть как очевидные знаки будущего движения цены. Когда цена не оправдывает ожидания, рынок дает нам подсказки по поводу силы и слабости тренда.

Глава 7. Направление будущего тренда

Проанализировав прошлый тренд, а также признаки слабости и силы рынка в тренде, теперь мы можем перейти к анализу возможному будущему направлению движения цены.

Большинство трейдеров не задумываются о будущем направлении цены, они просто торгуют по тренду, исходя из принципа – тренд твой друг. Это конечно хороший принцип, так как больше шансов, что цена продолжит движение, чем развернется, но в один прекрасный момент он все-таки развернется и ваш друг вас подведет.

Признаки слабости и силы помогут вам понять, когда ваш друг перестанет вам быть другом, и когда можно брать хорошие сделки против тренда на разворот.

В контексте поддержки и сопротивления:

Первый принцип – мы ждем, что цена будет идти вверх или вниз по тренду до следующего уровня поддержки или сопротивления, или до тех пор, пока не появятся признаки ослабления тренда.

Второй принцип – когда тренд показывает слабость, то мы скорее будем ждать сложную коррекцию, чем разворот, до тех пор, пока цена не покажет силу в новом направлении движения.

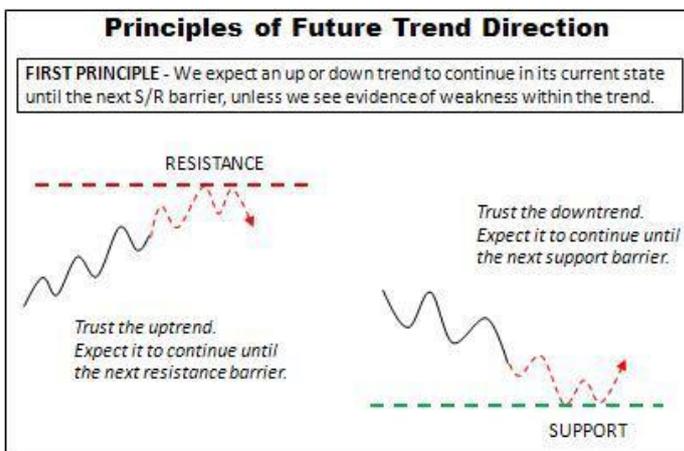
Третий принцип – боковой тренд будет продолжаться до тех пор, пока мы не увидим силу по направлению к границе.

Четвертый принцип – Когда мы видим силу по направлению к границе в боковом тренде, мы, скорее всего, ожидаем пробой границы. Мы смотрим на поведение цены после прорыва, чтобы увидеть признаки ее дальнейшего движения:

- слабость цены после пробоя – скорее всего, прорыв был ложный и цена развернется.
- слабость при откате к пробитому уровню – скорее всего цена пойдет дальше в направлении пробоя.

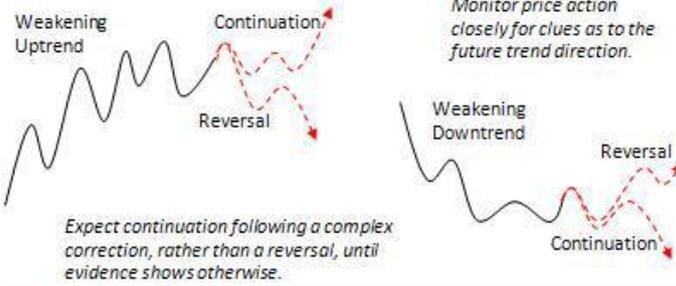
Пятый принцип – мы ждем, что цена откатит уровня, только если она не показывает силу на подходе к уровню.

Шестой принцип – если цена показывает силу при подходе к уровню, мы ждем прорыв, а потом ищем ключи, куда дальше пойдет цена.



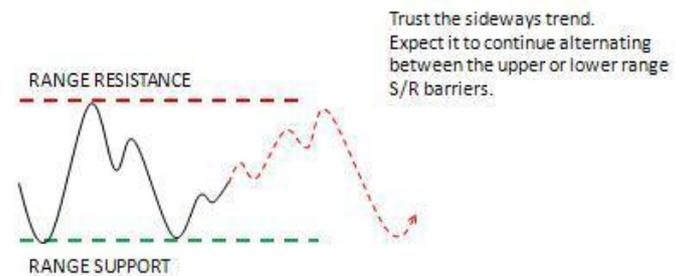
Principles of Future Trend Direction

SECOND PRINCIPLE - When an up or down trend shows evidence of weakness, we expect a higher likelihood of a complex correction rather than a reversal, until such time as the market shows both price acceptance and strength in the new trend direction.



Principles of Future Trend Direction

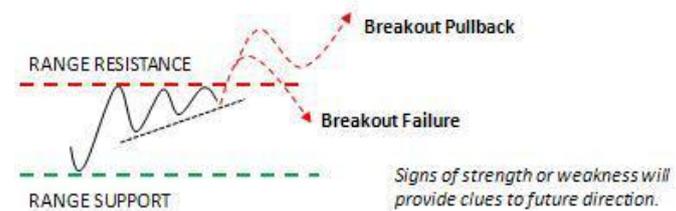
THIRD PRINCIPLE - A sideways trend within the framework is expected to continue in its current state, unless displaying evidence of strength towards the range boundary.

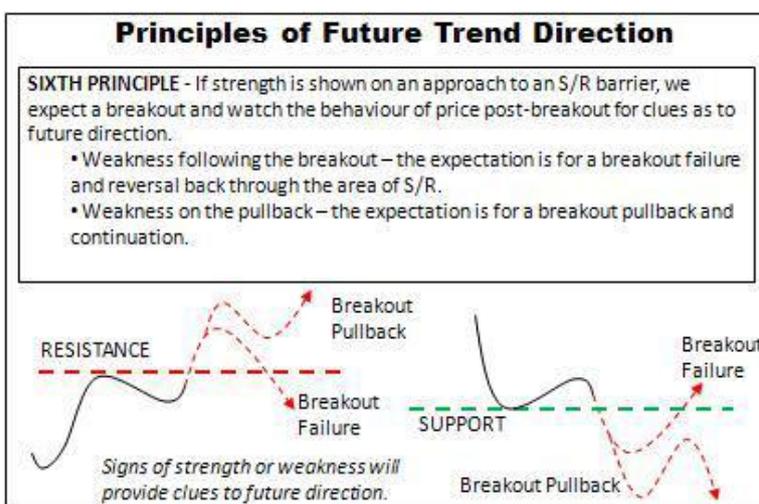
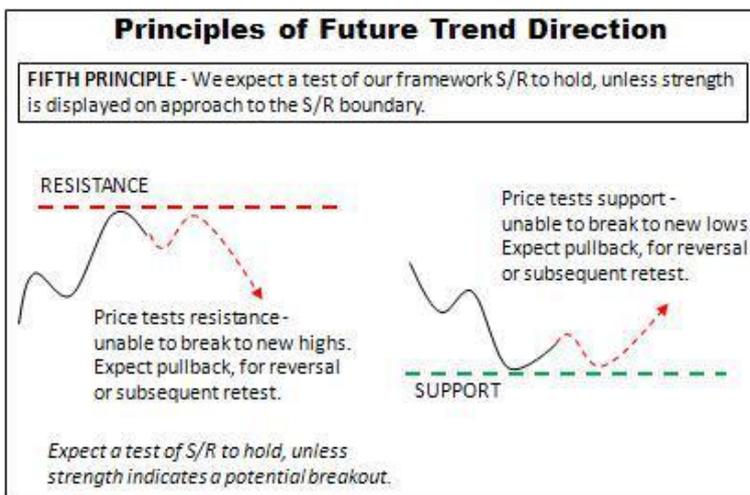


Principles of Future Trend Direction

FOURTH PRINCIPLE - When a sideways trend shows evidence of strength towards the range boundary, we expect a break of the boundary. We observe the behaviour of price post-breakout for clues as to future direction:

- Weakness following the breakout – the expectation is for a breakout failure and reversal back within the trading range
- Weakness on the pullback – the expectation is for a breakout pullback and continuation.





Шесть принципов перечисленных выше помогут вам определить направление будущего тренда. Но это только начальные предположения. Не усложняйте вещи, скоро мы добавим анализ баров и прайс экшен. Рынок вам даст сам понять, были ваши предположения верными или нет.

Представляем будущий тренд

Мы уже научились предполагать будущий тренд, теперь мы увидим, как рынок свечка за свечкой или бар за баром покажет нам, были мы правы или нет. Мы предположили направление будущего тренда, теперь нужно предположить дальнейшее поведение цены.

Все очень просто:

- Какое поведение цены подтвердит предполагаемый будущий тренд?
- Какое поведение цены не подтвердит предполагаемый будущий тренд?

Продemonстрируем это с помощью графиков:

EURUSD H4



На примере мы видим боковой тренд. Мы предполагаем, что боковое движение продолжится.

Какое поведение цены подтвердит наше предположение?

Если я увижу большую зеленую (бычью) свечу от поддержки, то я предполагаю, что цена пойдет к сопротивлению. Я предполагаю, что когда начнет приближаться к сопротивлению, то я увижу замедление момента, и сопротивление удержит цену.

Какое поведение цены не подтвердит предполагаемый будущий тренд?

Если цена начнет падать и упадет ниже последней зеленой свечи, то я пересмотрю свои предположения. Получается, что медведи потенциально сильнее быков и может быть пробой поддержки.

Я готов к дальнейшему поведению цены – я знаю, как будут выглядеть будущие свечи, если мое предположение будущего тренда верно, и я знаю, как будут выглядеть свечи, если оно не верно.

Как видите, визуализация это просто процесс, когда вы спрашиваете себя, что произойдет дальше.

Мы не закичиваемся на конкретном сценарии, более того, мы знаем, когда цена поведет себя не так, как мы ждали.

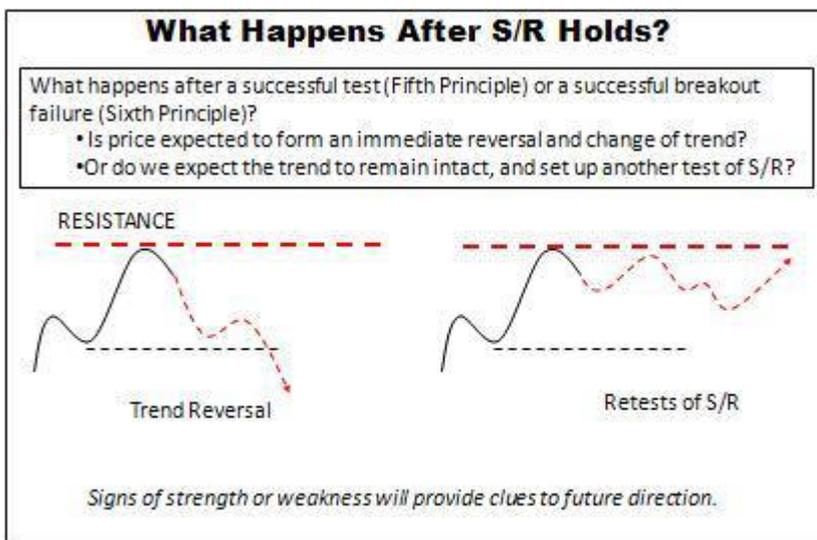
Что происходит после того, как поддержка/сопротивление сдержат цену?

Я показал вам 6 принципов, которыми пользуюсь в торговле, чтобы определить будущее движение цены. Но есть одна область на графике, которая вызывает трудности. Я хочу остановиться на этом подробнее.

Что происходит после того, как цена успешно протестировала уровень (5 принцип) или пробила уровень (6 принцип)?

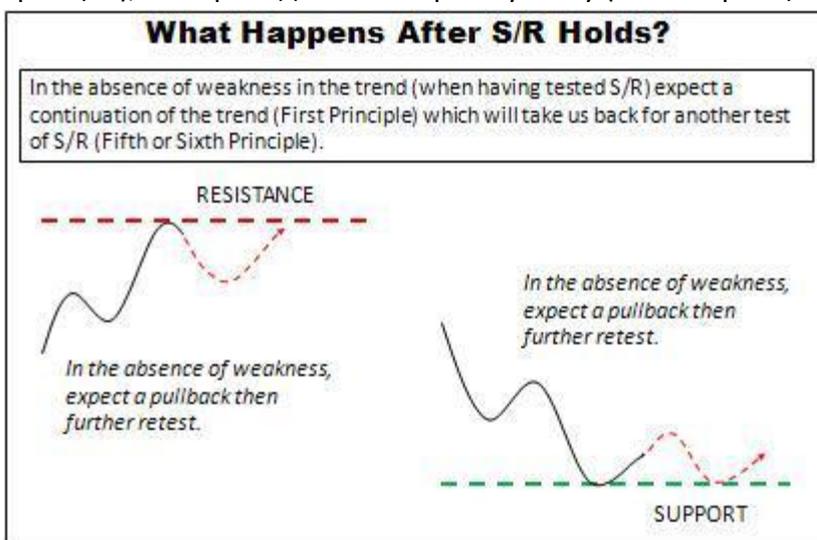
Цена сразу развернется или изменит направление?

Или будут повторные тесты?

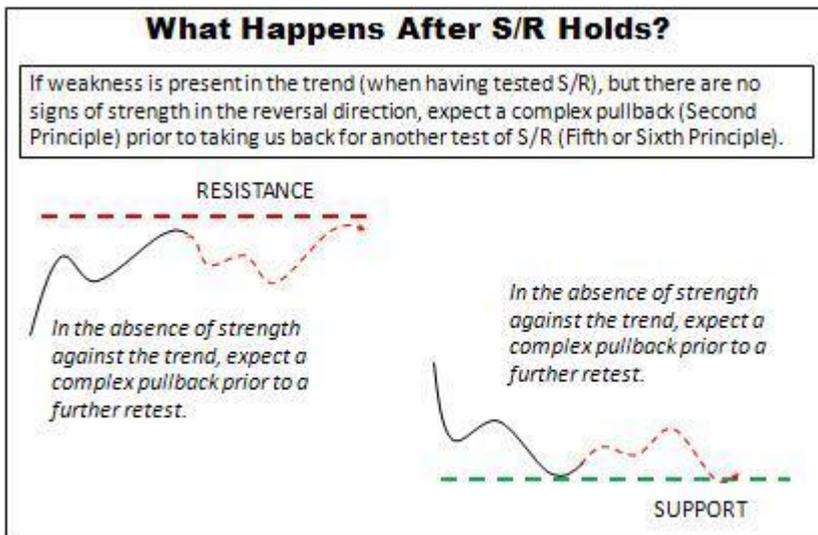


Для меня уровни поддержки и сопротивления это препятствия для тренда. Они могут вызвать движение против тренда, но они не значат сами по себе разворот тренда до тех пор, пока мы не увидим доказательства, подтверждающие разворот. Доказательством разворота будет прохождение цены точки разворота тренда и признаки силы в новом направлении. Подтверждением разворота будет, когда волны подтверждают силу нового направления, и слабость старого, даже если цена не прошла еще точку разворота тренда. Пока мы не увидим этого, мы предполагаем, что тренд продолжится, и вернется либо к повторному тесту, либо попытке прорыва. Итак, если мы видим тест или прорыв, мы ждем подсказки от цены, где сила, на стороне быков или медведей. Признаки силы и слабости покажут нам будущее движение цены. Если вы не уверены, то мой вам совет, всегда следуйте за трендом.

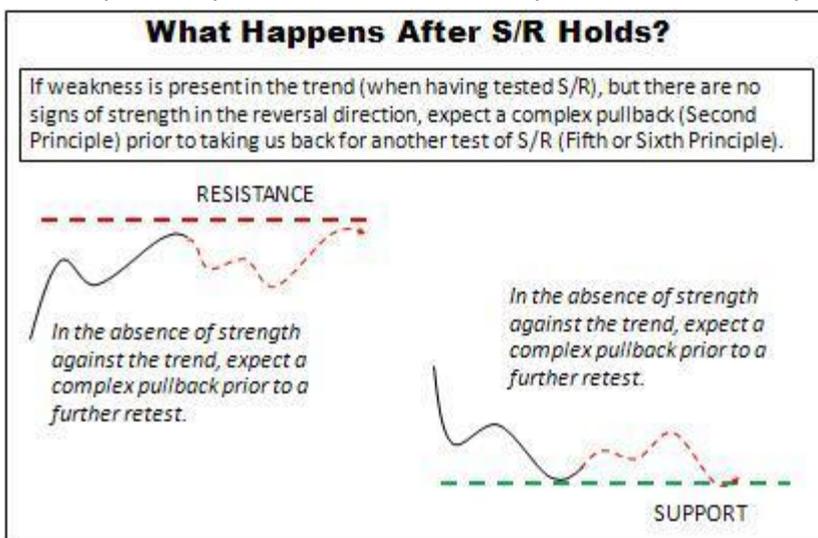
Давайте, я расскажу простыми словами. При отсутствии слабости тренда (когда был тест П/С) ждите продолжения тренда (первый принцип), что приведет к повторному тесту (пятый принцип).



Если есть слабость тренда (при тесте П/С), но нет признаков силы в разворотном направлении, то будет, скорее всего, сложный откат (2 принцип) прежде чем произойдет еще один тест П/С (5 принцип).



Если сила против тренда, ждите разворот. В этом случае, любой повторный тест П/С можно рассматривать как откат по направлению нового тренда (5 принцип).



Глава 8. Первоначальный процесс анализа рынка

Мы рассмотрели теорию, теперь рассмотрим процесс. Подводим итоги:

1. Определяем структуру
2. Определяем тренд
3. Определяем силу и слабость
4. Определяем будущее возможное направление цены
5. Представляем будущий возможный прайс экшен
6. Находим зоны, от которых будем торговать

Это первоначальный анализ рынка, который состоит из 6 пунктов. Теперь напишем проверочный лист, который вам поможет в процессе.

Шаг 1 – определяем структуру

Ваши действия:

Определяем зоны поддержки и сопротивления на старшем графике (в нашем случае это 30 минутный график), определяем минимумы и максимумы.

Шаг 2 – определяем тренд

Ваши действия:

- Определяем важные максимумы и минимумы на рабочем графике (в нашем случае это 60 минутный график).

- Определяем направление тренда (вверх, вниз или боковой).

Шаг 3 – определяем слабость и силу

Ваши действия:

Анализируем моментум недавних волн. Сравниваем моментум текущей цены с моментумом прошлой волны в том же направлении. Стало быстрее или медленнее? Что это значит?

Сравниваем моментум текущей цены с моментумом прошлой волны в противоположном направлении. Стало быстрее или медленнее? Что это значит?

Цена ускоряется или замедляется? Что это значит?

Сравниваем глубину недавних волн. Возрастающая проекция это признак потенциальной силы тренда.

Уменьшающаяся проекция это признак потенциальной слабости тренда.

Увеличивающаяся глубина это признак потенциальной слабости тренда, уменьшающаяся глубина это признак потенциальной силы рынка.

Есть ли признаки того, что цена не может продолжать свое движение (это признак слабости)?

Используйте дополнительные способы анализа слабости и силы тренда:

- Объем
- Другие индикаторы рынка

Шаг 4 – определяем будущее направление тренда

Как, скорее всего, поведет себя в дальнейшем цена?

Ваши действия:

Определяем будущий прайс экшен с помощью 6 принципов:

Внутри уровней поддержки и сопротивления:

1 принцип – мы ждем, что тренд продолжится до следующего уровня поддержки или сопротивления до тех пор, пока не появятся признаки слабости тренда.

2 принцип – когда мы видим признаки слабости тренда, то мы ожидаем в первую очередь сложный откат, чем разворот, до тех пор, пока рынок не покажет нам силу в новом направлении.

3 принцип – боковой тренд будет продолжаться до тех пор, пока мы не увидим, что цена набирает силу при подходе к границе канала.

4 принцип – если цена набирает силу при подходе к границе бокового канала, мы ожидаем прорыв.

Далее мы следим за ценой, и ждем пока она не покажет нам, куда собирается дальше пойти:

Слабость после прорыва – скорее всего прорыв ложный и цена развернется.

Слабость при откате – скорее всего после отката цена продолжит свое движение в направлении пробоя.

На границе уровней поддержки и сопротивления:

5 принцип – мы ждем, что при тесте поддержка или сопротивления удержат цену, только если мы не видим, что при подходе к границе цена набирает силу.

6 принцип – если мы видим силу при подходе к границе, мы ждем прорыв, и далее следим за ценой.

Слабость после прорыва – скорее всего прорыв ложный и цена развернется. Слабость при откате – скорее всего после отката цена продолжит свое движение в направлении пробоя.

Шаг 5 - представляем будущий возможный прайс экшен

Как, по-вашему, цена может себя повести? Представьте будущие сетапы прайс экшен на основе вашего анализа будущего движения цены и уровней поддержки и сопротивления.

Ваши действия:

Какое поведение цены подтвердит ваши предположения о дальнейшем движении цены?

Какое поведение цены опровергнет ваши предположения о дальнейшем движении цены?

Шаг 6 - находим зоны, от которых будем торговать

Ваши действия:

Будет скоро...)))

Глава 9. Анализ рынка

Первоначальный анализ дает нам первоначальное понимание будущего тренда. Далее требуется анализ каждого бара, так как цена показывает нам больше и больше. Новые данные поступают с каждой новой свечой. Большинство свечей не дадут нам какой-либо ценной информации, но некоторые свечи подтвердят наш анализ будущего движения цены.

Определяем настроение свечи

Существуют следующие виды свечей:

Бычье настроение

1. Бычья свеча с высоким закрытием
2. Бычья свеча со средним закрытием
3. Бычья свеча с низким закрытием

Нейтральное настроение

1. Свеча в ренже с высоким закрытием
2. Свеча в ренже со средним закрытием
3. Свеча в ренже с низким закрытием

Медвежье настроение

1. Медвежья свеча с высоким закрытием
2. Медвежья свеча со средним закрытием
3. Медвежья свеча с низким закрытием

Такая классификация помогает нам сразу понять настроение свечных паттернов. Все бычьи свечи имеют бычье настроение, но они отличаются уровнем этого настроения (высокое, среднее, низкое).

То же самое и для нейтральных и для медвежьих свечей.

Классификация основана на наблюдении за свечами:

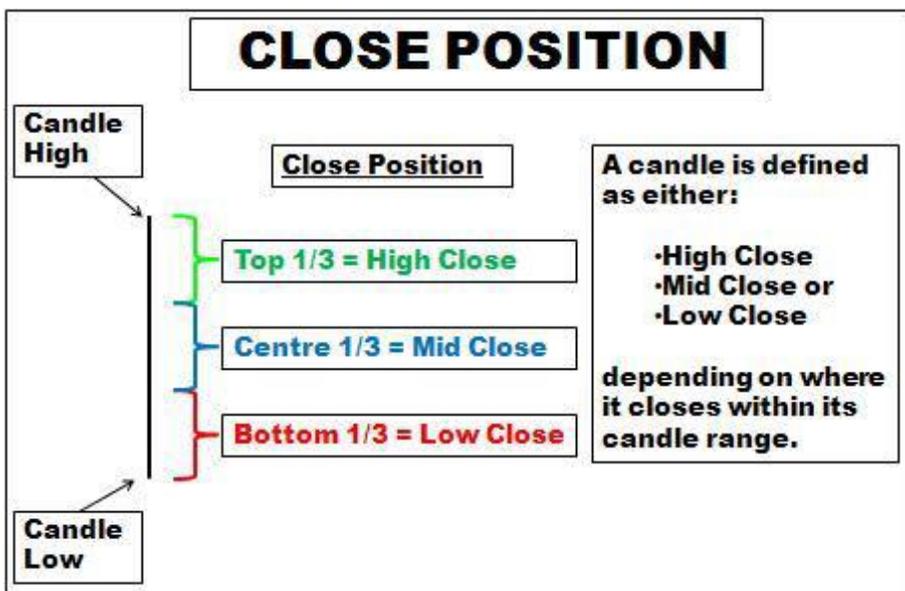
- Сравнение цены закрытия
- Сравнение позиции

Я научу вас, как читать свечи. Я считаю, что мой способ лучше обычного анализа свечей...

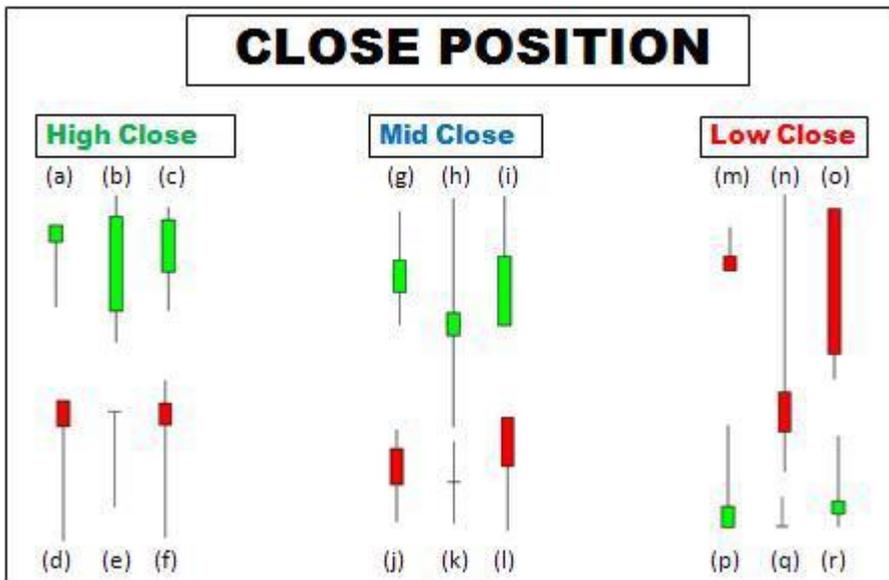
Сравнение позиции

Сравнение позиции позволяет нам определить настроение одной конкретной свечи.

Мы уже говорили о том, что закрытие может быть высоким, средним и низким. Вот как это выглядит (зеленое это высокое закрытие, синие – среднее, красное – низкое):



Высокое закрытие это когда свеча закрывается в верхней третьей части свечи. Эти свечи показывают настроение бычье свечи. Под зеленой надписью все бычьи свечи с высоким закрытием, но они отличаются степенью силы.

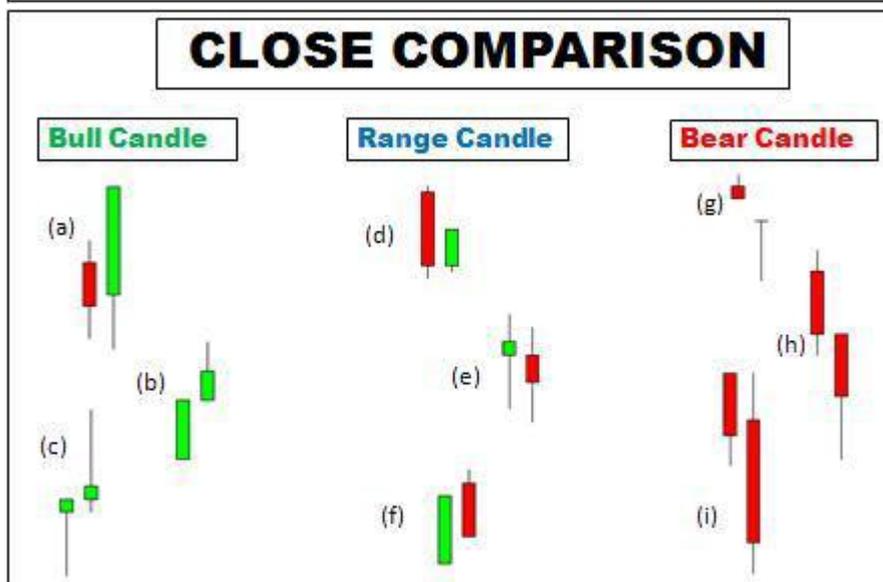
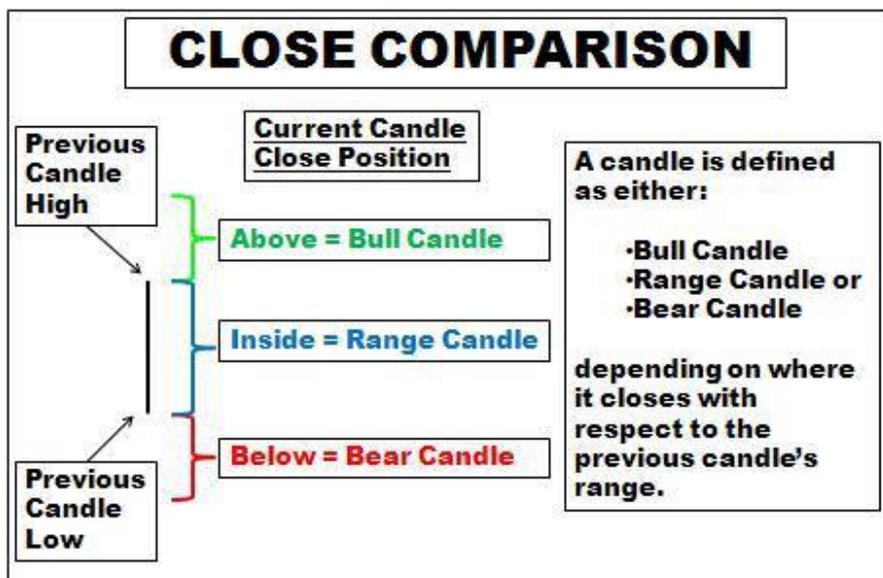


Настроение свечей со средним закрытием считается нейтральным, так как цена равномерно двигалась вверх и вниз. И снова есть небольшая разница в степени силы. Свечи с низким закрытием, это когда свеча закрывается в нижней третьей части свечи. Все они показывают медвежье настроение.

Такие наблюдения помогают нам получить представление о каждой свече, какая она – бычья, нейтральная или медвежья.

Сравнение цены закрытия

Есть бычьи свечи, нейтральные и медвежьи, в зависимости от того, где закрывается свеча. Бычья показана зеленым, нейтральная синим цветом, а медвежья красным.



Весь процесс анализа должен занимать не более нескольких секунд. Мы получаем информацию, кто в данный момент контролирует рынок.

Оценивайте обстановку

Это значит, что вы должны видеть где, в каком месте, находится свеча.

Допустим, возле уровня сопротивления появилась свеча с низким уровнем закрытия, что означает слабость быков и вероятностный поход вниз. Мы должны брать во внимание такую ситуацию.

Или такая же свеча появилась в середине бокового движения, что ничего для нас не значит.

Для меня важно следующее, где находится свеча по отношению к уровням поддержки и сопротивления, где находится свеча по отношению к тренду, а также где находится свеча по отношению к пикам и впадинам.

Есть ли поддержка наших предположений?

Рассмотрев настроение паттерна, и он расположен в отношении структуры рынка, мы теперь должны спросить, есть ли поддержка наших предположений?

Под предположениями, я имею в виду наши ожидания будущего тренда и поведения цены, которые будут поддерживать тренд.

Подходит ли эта модель под наши ожидания в отношении будущих действий цены?

- Да ... Мы ждем следующей свечи.

- Нет ... Решите, будете ли вы ждать следующую свечу, или пересмотрите с самого начала первоначальный анализ рынка.

- Не уверен ... Подождите ... будет новая свеча в ближайшее время.

Вы будете знать, когда что-то не так и цена приятно удивит вас.

Вы ждете, что цена будет медленно подходить в область сопротивления, и вдруг неожиданно вы увидите сильный импульс, и цена закроется выше сопротивления.

В ожидании прорыва уровня, вы увидите вторую неудачную попытку пройти через уровень. Неожиданная слабость!

Ожидая продолжения восходящего тренда, следующее расширение цены застрянет на прежнем пике, демонстрируя неожиданный медвежий потенциал.

Практика

Анализ рынка следует практиковать как можно больше. Практика должна никогда не заканчиваться, так как всегда есть чему поучиться. Это процесс постоянного роста и развития личности, так как со временем мы учимся понимать рынок все лучше и лучше.

- Опыт приводит к лучшему пониманию и оценке будущего направления цены.

- Более точная оценка вероятного будущего направления цены приводит к улучшению возможностей.

Практика позволяет отточить наш анализ. Реальная торговля дает нам возможность постоянно практиковаться в нашем анализе, и это обеспечивает возможность сравнивать наши показатели с тем, что мы ранее предполагали. Постоянная торговля позволяет научиться интуитивно читать цену.

Я не призываю вас торговать на реале. Достаточно просто проводить анализ рынка, а затем следить за ценой. Определите, куда пойдет цена с помощью первоначального процесса анализа рынка. Затем наблюдайте за рынком с появлением каждой новой свечи.

Потратьте время на практику. Просто следите за ценой. Решите, куда вы ожидаете, что она пойдет, что будет делать дальше, и следите, за каждой появляющейся свечой.

Я еще раз хотел бы подтвердить важность простоты. Не усложняйте торговлю больше, чем нужно. Просто смотрите на каждую свечу, поддерживает ли она ваши первоначальные оценки? Если да, отлично! Если же появляется что-то неожиданное, решите, изменяет ли это ваши ожидания по поводу будущего направления цены, или вы будете ждать еще информацию. Если вы не уверены, то просто подождите.

Другая свеча появиться в ближайшее время.

И не беспокойтесь по поводу сделок. Просто следуйте за ценой.

Глава 10. Сетап

Принципы стратегии

Рынок это не движение цены, это трейдеры, которые принимают решения и двигают цену. Чтобы постоянно зарабатывать деньги, нужно искать возможности с большой вероятностью, там где большинство трейдеров решат открыть сделку, что создает объем, а мы движемся вместе с этим объемом.

Решения одного трейдера могут быть непредсказуемыми, но в определенные моменты эти решения становятся предсказуемыми. Итак, мы должны понять, как зарабатывать на рынке. Мы определяем зоны, где скорее всего трейдеры будут покупать или продавать, и принимаем решение на основе этого знания.

Можно сказать и другими словами, мы работаем против тех, кто пытается бороться с рынком. Нужно найти место на графике, где есть хорошие шансы (уровень поддержки/сопротивления, возможный тренд), мы находим эти зоны. За всеми моими сетапами стоят 2 принципа: слабость и трейдеры, которые попали в ловушку.

Слабость рынка

Будущий тренд движется от слабого движения к сильному. Конечно, мы хотим торговать по тренду, чтобы быть в сильном движении рынка. Не стоит сразу прыгать в сделку, как только вы видите сильное движение.

Как правило, такой вход будет слишком поздний. Я предпочитаю найти слабое движение, чтобы войти в противоположном направлении, до того, как начнется сильное движение.

Это точка, когда те, кто торговал на слабом движении, поймут, что они были неправы и выйдут из сделок, либо их закроет по стопу. Итак, как найти такие зоны? Мы будем искать возле уровней поддержки/сопротивления, на вершинах и впадинах, а также в откате тренда.

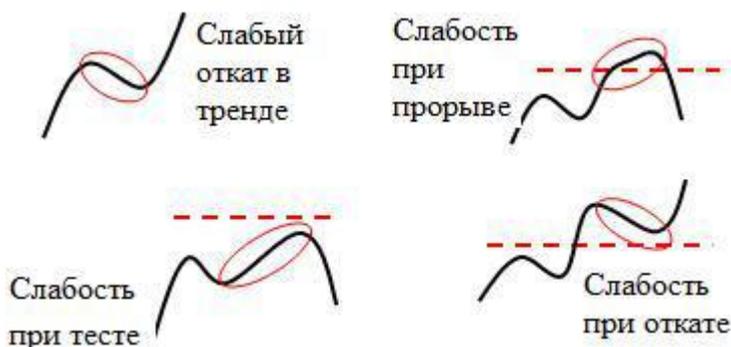
- Сделки в направлении слабого движения цены в уровни поддержки или сопротивления, это сделки с низким процентом вероятности. Скорее всего, это будут убыточные сделки.

- Сделки на прорыв, тоже скорее всего будут убыточными.

- Сделки на разворот тренда, сделки против тренда на слабом откате, тоже скорее всего, будут убыточными.

Вы скоро поймете, как понимание будущего тренда поможет нам определять, где входить в сделку.

Определяем слабость рынка



Нужно идти против толпы, но это не значит, что нужно торговать против любого движения цены. Это глупо.

Нужно быть избирательным, нужно выбирать моменты, когда толпа берет плохие сделки, это когда движение слабое.

Трейдера, пойманные в ловушку

Еще один подход основан на том, чтобы определить трейдеров, которые попали в ловушку. Мы должны научиться находить на графике зоны, где остальные трейдеры торгуют против будущего тренда. Мы ищем, где они откроют сделки и будут сидеть с убытком, я называю таких трейдеров – пойманные в ловушку.

Это очень важная концепция для моей стратегии. Все мы знаем как чувствуешь себя, находясь в такой сделке, потому что все мы брали такие сделки. Вспомните, как вы брали сделку на прорыв, и вдруг цена снова заходит за линию. Начинается паника, вы можете даже не закрыть сделку по стопу, так как ждете откат.

Я приведу пример:



Слева был сильный бычий тренд. Откат показан сильными медвежьими свечами и прорывом вниз. Но силы в движении вниз нет. Цена много раз тыкалась в этот уровень, оставляя длинный хвосты, снова набирая высоту. Медведи попали в ловушку, большая свеча показывает, что сработали стопы.

Ваша задача не искать сетапы, самое важное для вас это постоянно помнить о структуре рынка, и пытаться найти будущее движение. Просто будьте внимательны и сетапы сами обнаружат себя. Вы сразу увидите, где трейдеры попали в ловушку.

Если вы будете искать сетапы, то потеряете чувство рынка и перестанете видеть большую картину рынка. В конце концов, вы начнете брать все сетапы подряд, у которых нет шансов на успех. Вы знаете, кто такие трейдеры, которые попали в ловушку, не попадайте сами в такие ловушки.

Не стоит торопиться открывать сделки. Найдите слабые места. Найдите трейдеров, которые попали в ловушку и торгуйте с силой рынка.

Сетапы

Итак, мы ищем вход на уровнях поддержки/сопротивления (старших временных интервалах, на вершинах и впадинах) и при откате в тренде. На этих уровнях мы ищем слабость, которую покажет прайс экшен, покажет трейдеров, которые попали в ловушку.

Определение сетапа

В системе pro_trader существует 5 сетапов, 3 из них мы будем искать возле уровней поддержки/сопротивления.

- 1) TST – тест сопротивления или поддержки, которые должны сдерживать цену.
- 2) BOF – ложный прорыв, цена проходит через уровень поддержки/сопротивления и разворачивается.
- 3) VPB – откат после прорыва уровня.

И 2 других сетапа будут в тренде:

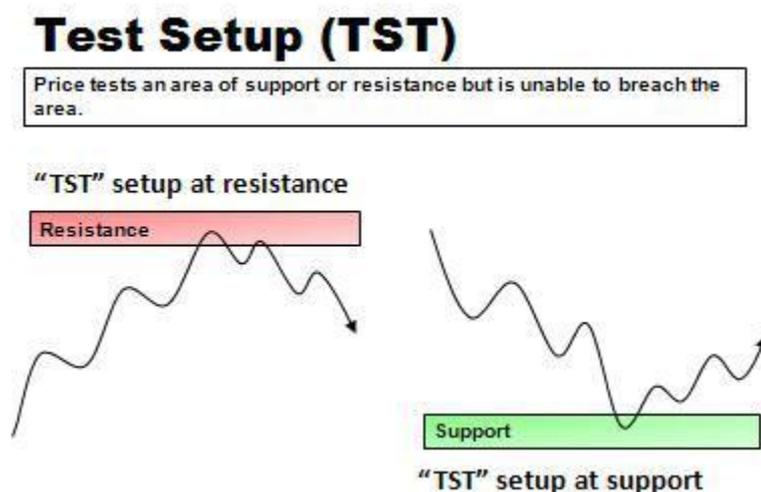
- 1) PB – простой откат в тренде.
- 2) CPB – сложный откат в тренде (несколько волн или долгий по времени)

Сетап TST

Это сетап, который образуется, когда цена тестирует уровень поддержки или сопротивления, и уровень сдерживает цену. Лучше всего, если эти уровни будут со старшего временного интервала или границы бокового канала. Этот сетап может также появляться, когда тренд слабый на вершине или впадине, давая возможность для короткой сделки против тренда.

Мы ждем этот сетап только если ожидание будущего тренда дает нам возможность предположить, что уровень сдержит цену. Открываем сделку только если соотношение прибыль : убыток не меньше 1 к 1.

На диаграмме показан TST сетап:



Цена показывает слабость при подходе к уровню, это происходит, когда начинают слишком поздно покупать или продавать и попадают в ловушку. Разворот снимет стопы и добавит силу движению.

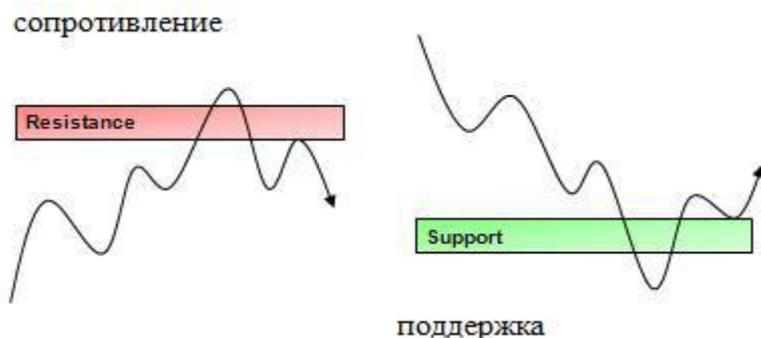


Цена подходит к сопротивлению, мы ждем TST сетап. Только при хорошем соотношении мы открываем сделку, но об этом потом, а пока мы просто ищем зоны для сетапа. Обратите внимание, что цена не доходит до самой линии сопротивления, но доходит до зоны сопротивления. Это важно, мы ищем зоны, а не линии.

Сетап BOF

Сетап BOF – это сетап, когда цена делает ложное пробитие поддержки или сопротивления. Лучше, если эти уровни будут с большего временного интервала или границы канала флета. Если тренд слабый, то данный сетап может быть сделкой против тренда на вершине или впадине.

Как всегда, когда цена подходит к уровню сопротивления или поддержки мы готовы к тому, что может быть сетап BOF. Вот диаграмма, которая показывает этот сетап:



Этот сетап прайс экшен работает, потому что прорыв линии привлекает трейдеров, которые работают на пробой линии. Но, если у прорыва нет достаточной силы, то те трейдеры, которые торговали на прорыв, попадают в ловушку. Откат к уровню вынуждает

их закрывать позиции, что добавляет силы против прорыва. Вот именно этот откат мы и хотим поймать.

Например, рынок пытается 2 раза пробить уровень, вторая попытка отлично показывает, что цена, скорее всего, развернется. Я буду искать сетап BOF. Но, помните, чем быстрее цена начнет движение, тем лучше.

Вот пример сетапа BOF у сопротивления:



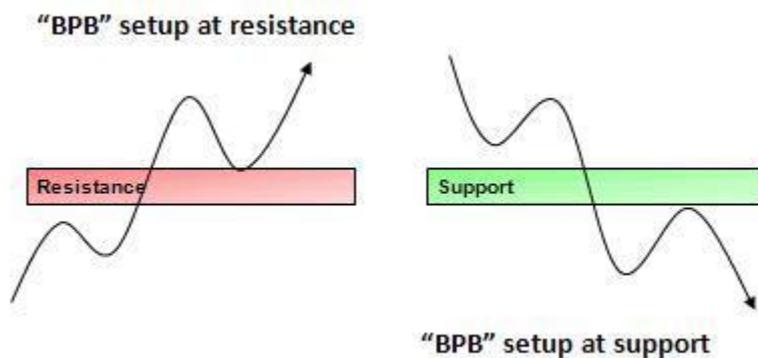
В данном примере прорыв был на новостях, самое волатильное время на рынке. Мы видим, что цены остановились на уровне, это признак слабого движения, если бы у прорыва была сила, то цена бы пошла дальше вверх. Я советую немного подождать, когда все уляжется и не торговать на новостях.

Сетап ВРВ

Это сетап, который показывает прорыв уровня поддержки или сопротивления, цена закрепляется выше уровня и показывает небольшой откат. Как всегда, выбираем уровни с более старшего временного интервала.

Когда мы ждем, что цена пробьет уровень, мы следим за ценой и ждем откат, который покажет нам возможный ВРВ сетап. Входим в сделку только при хорошем соотношении риск/прибыль.

Вот диаграмма, которая показывает сетап:



Этот сетап построен на принципе, что многие будут считать прорыв ложным. Но, если прорыв не ложный, то будет лишь слабый откат.

Помните, что сетап BOF должен как можно быстрее переводиться в безубыток, так как он может стать сетапом BPB.

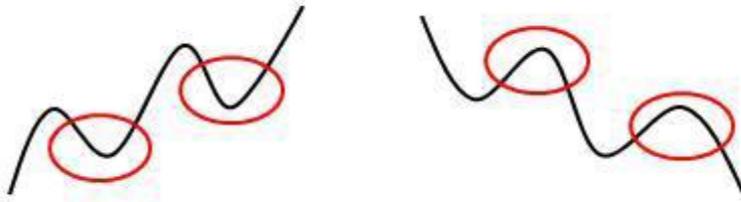


На примере показано два отката. Первый откат был слабым, что должно было натолкнуть вас на мысль о сетапе BPB. Если вы взяли сетап BOF, то это был небольшой убыток, первый сетап BPB дал небольшую прибыль. Второй откат был через несколько часов после прорыва. Хвост показал, что цена не пойдет дальше, здесь сетап BPB отработал отлично.

Сетап PB

Сетап PB – это просто единичный откат в тренде. На диаграмме показан этот сетап:

"PB" setup in uptrend



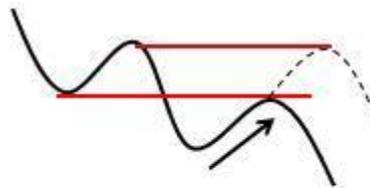
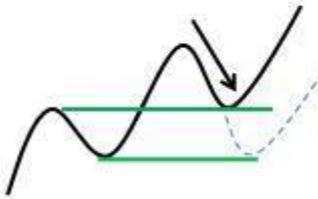
"PB" setup in downtrend

Этот сетап работает, потому что трейдеры ищут разворот. И хотя они знают, что тренд наш друг, но природа человека такова, что легче брать сделки на разворот.

Правда в том, что цена движется в направлении силы против слабости. Мы ищем слабые откаты, которые поймают тех, кто торгует против тренда и убыточная сделка заставит их закрыть позиции. Наш сетап будет прибыльный.

Любой откат может быть неудачным, поэтому следим за уровнями поддержки и сопротивления. На этих уровнях может появиться дополнительная сила в виде новых позиций, и это поможет понять нам, куда будет двигаться цена. Это показано на примере:

предыдущее сопро-
т. стало поддержкой



предыдущее
поддержка уже стала
сопротивлением

Мы как всегда ждем, что будет цена делать возле этих уровней. Анализ баров и прайс экшен покажет нам, когда появится возможность войти в сделку

Пример:

EURUSD, H4 1.34557 1.34571 1.34417 1.34490

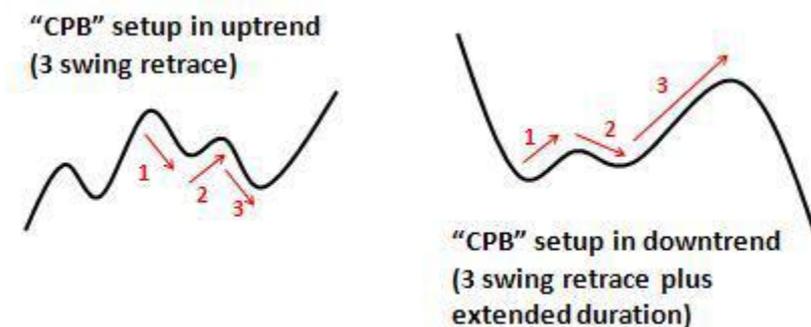


Это простой откат в тренде. Откат к прошлой поддержке, задержка показывает слабость в откате.

Сетап CPB

Сетап CPB это сложный откат в тренде, это либо откат, состоящий из нескольких волн, либо длительный по времени откат. Сетап PB, который был ложный и тренд не развернулся, может стать сетапом CPB.

На диаграмме показан сетап CPB:



Сложный откат предоставляет отличную возможность для входа в рынок. Часто сигнал CPB гораздо лучше, чем PB. Посмотрите на восходящий тренд на примере. В точке 3 многие трейдеры будут продавать и тем самым попадут в ловушку.

EURUSD,H4 1.34557 1.34571 1.34417 1.34485



Как узнать, что лучше, ждать CPB сетап или взять PB? Ваше чутье поможет вам определиться, это чутье будет опираться на ваш опыт. Как я уже говорил, откат в тренде дает возможность ожидать CPB. Тренд откатывает, а затем набирает силу. Тренд, как бы, делает паузу.

Подводим итоги:

- Если на рынке присутствует ярко выраженный тренд, то лучшими сделками будут РВ и СРВ.
- Если тренд начинает затухать, то лучше всего брать СРВ и РВ, если была пробита предыдущая впадина при восходящем тренде или предыдущая вершина при нисходящем. Более рискованными сделками будут РВ без пробития вершины или впадины. Сделка против тренда ТСТ или ВOF от вершины при восходящем тренде и впадине, при нисходящем.
- Во флете, когда нет тренда, можно брать РВ или СРВ, но это рискованные сделки.
- Если цена подходит к важному уровню поддержки или сопротивления, и не показывает силу, ждем сигнал ТСТ.
- Если цена подходит к важному уровню поддержки или сопротивления и показывает, что будет прорыв уровня, то ждем сетапы ВOF или ВРВ.

Важно!

Сделки против тренда всегда рискованные, если тренд сильный. Природа человека такова, что если мы пропустили хороший вход по тренду, мы стремимся поймать разворот, чтобы отыграться. Рынок очень щедро предоставляет входы для сделок против тренда, некоторые выглядят очень заманчиво, но в большинстве случаев это просто ловушка.

Всегда будьте настроены на то, что тренд будет продолжаться, пока вы не увидите явные доказательства обратного. Когда цена пробивает уровень в тренде, ждите небольшой откат к уровню и открывайте сделку в направлении пробоя.

Доказательствами ослабления тренда могут быть сильные и глубокие откаты, каких раньше не было, цена не может сделать новую вершину или впадину и т.д.

Первоначальный анализ рынка – проверочный лист:

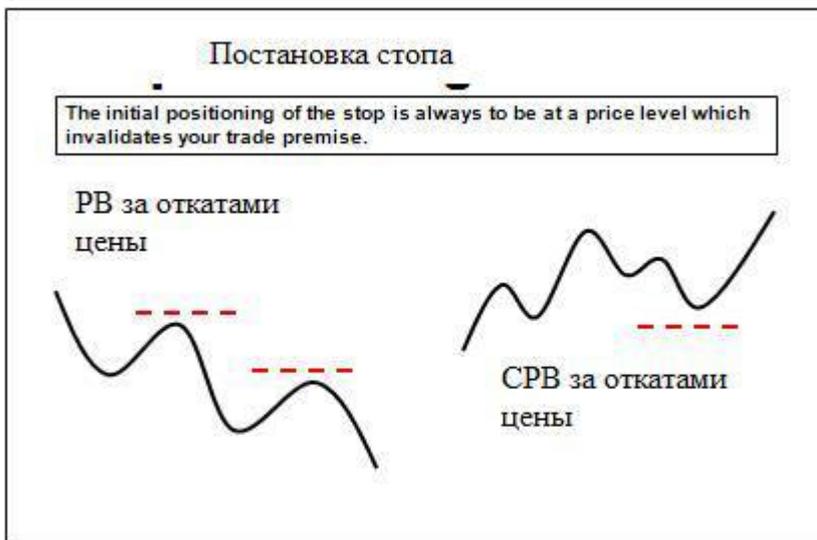
1. Определяем структуру
2. Определяем тренд
3. Определяем силу и слабость рынка
4. Определяем будущее направление тренда
5. Представляем возможный сетап прайс экшен
6. Находим зоны для входа в сделку

Все, что перечислено выше уже обсуждалось, кроме пункта 6, о нем мы поговорим подробнее далее.

Что делать, когда цена подходит к зоне входа в рынок?

Если цена подходит к зоне, это еще не значит, что мы должны торговать. Но, мы готовимся к тому, что может появиться сигнал на вход. Нужно сконцентрироваться.

Давайте теперь поговорим о такой важной теме, как постановка стопа. Как только цена входит в зону, я ищу место, куда поставлю стоп. Я это делаю до того, как ищу сетап. Я ставлю стоп в такое место, если цена дойдет до него, уже не будет прибыльной сделки. Если сделка закрылась по стопу, это значит, что либо ваш анализ был неправильный, либо вы неправильно выбрали время для входа в сделку. На диаграммах показаны варианты постановки стопа для разных сетапов.



Вопрос очень важный, как далеко за этими уровнями нужно ставить стоп? Все зависит от вашего предположения. Если цена показывает вам, что стоп не будет задет, и вы в этом уверены, то ставьте прямо за уровнем. Если вы не уверены, вы думаете, что цена может еще раз протестировать уровень, то поставьте стоп подальше от уровня.

И еще один важный момент, не думайте, что если я открыл сделку, поставил стоп и профит, я буду сидеть и ждать, когда сделка сама закроется. Я активно управляю сделкой в процессе и очень редко сделка действительно закрывается по первоначальному стопу, это самый худший сценарий!

Глава 11. Вход

Давайте начнем с основных принципов для входа. Несовершенство рынка, какую сделку лучше открывать, когда цена подходит к уровню, на пробой или на откат? К сожалению, самый лучший вход виден только после того, как сетап отработал, то есть на истории. На картинке показано, что было лучше в данной конкретной ситуации:



Еще пример:



Структура рынка и прайс экшен дают нам подсказки в таких ситуациях. Ровный сильный тренд дает больше шансов на пробой. Когда рынок неопределенный или в консолидации, то больше шансов, что цена откатит от уровня. Но, конечно это не всегда так.

Нужно принять тот факт, **что мы увидим лучший вариант, только когда пройдет время.** Все что мы можем сделать, так это найти хорошую зону для входа, найти сетап и открыть сделку. Если сделка будет прибыльная – отлично! Если нет, просто принять это. Нужно проанализировать, что бы улучшило вход в сделку в следующий раз, но не стоит сильно переживать из-за убытка.

Как определить зону где входить в сделку?

Я стараюсь входить как можно быстрее, вместе с толпой. Некоторые скажут, что это попытка поймать вершину или впадину, но почему бы и нет, когда у вас будет маленький стоп, но потенциально большой профит.



Как определять зоны всеобщей продажи?

В основе всех сетяпов лежит определение слабости рынка, когда цена подходит к уровням сопротивления или поддержки, вершине или впадине или откате в тренде. Розничной продажей я называю тех трейдеров, которые слишком поздно входят в движение, они становятся заложниками плохих сделок и вынуждены закрывать позиции с убытком. Нам нужно войти до того, как эти трейдеры поймут, что пора закрывать сделку.

Эту точку легко определить, это либо прорыв, после которого появляется разворотная модель, или зона схождения. Все что до этой точки это зона всеобщей продажи, все что за этой точкой это розничная продажа.

Я называю эту точку – Последняя Точка Всеобщей Продажи (ПТВП). Я всегда вхожу до этой точки и никогда не стану открывать сделку после этой точки. Если я пропущу точку входа, я буду терпеливо ждать следующий сетап.

Хочу обратить ваше внимание на то, что мы не просто открываем сделку в этой точке, мы переключаемся на меньший временной интервал, и ищем где лучше открыть сделку. Точка это просто последняя цена по которой мы можем открыть сделку со всеобщей продажей.

Итак, нужно входить в точке всеобщей продажи или до этой точки. Если вы пропустили вход, не гонитесь за рынком, ждите следующий вход.

Сначала определяем стоп, потом цель, потом взвешиваем соотношении риск/прибыль и только потом открываем сделку.

Часто трейдеры находят вход, потом ставят стоп за уровнем, а затем выставляют профит в 2-3 раза больше и ждут, когда цена дойдет до профита или стопа. Это плохо! Они не рассматривают реальную картину рынка.

Рынок дает нам точки входа в зонах, где мы ждем сильное движение. Прайс экшен дает нам точку для стопа, мы знаем, что если цена дойдет туда, то сделка уже не актуальна. Прайс экшен дает нам точку для профита, мы знаем, что там вступят в игру силы, которые будут противоположны нашей сделки. Цена либо остановится там на некоторое время, либо развернется.

Зона входа

У нас есть две точки входа, одна на основе прайс экшен ПТВП, другая определяется параметрами риска ПР.

Мы работаем с зонами входа и хорошим соотношением риск/прибыль.

Предсказание входа

Цена входит в зону

- Мы ищем слабость, когда цена подходит к уровню поддержки или сопротивления, к вершине или впадине. Это также может быть откат в тренде.
- Находим точку постановки стоп-лосса, это уровень, если до него дойдет цена, то сделка уже не будет актуальна. В идеале стоп нужно ставить за уровнем поддержки или сопротивления или за свингом.
- Определяем наши цели, это следующий уровень поддержки или сопротивления или вершина и впадина.
- Когда все сошлось, можно открывать сделку.

Обходите ловушки и ищите будущее сильное движение!

Принимаем решение о входе в сделку

Давайте вспомним вот о чем, мы сможем увидеть лучший вход только, когда пройдет время. Поэтому все, что мы можем сделать, это дождаться, когда цена войдет в зону, найти лучшую точку входа и управлять сделкой.

В идеале, мы должны без проблем определять вход, но если нет опыта, то это сделать сложно. Со временем этот навык будет улучшаться. Пока мы учимся, нам нужен сигнал,

который покажет, что пора открывать сделку. Некоторые признаки покажут нам, что пора нажимать кнопку.

Сперва, я ищу один из двух знаков, которые помогут мне принять решение об открытии позиции. Первый знак, это затор цены, второй это ценовая модель. Затор бывает редко и это довольно сложный знак, поэтому я расскажу о каждом знаке отдельно.

Итак, затор это когда цена не может пройти через уровень поддержки или сопротивления. Трудно сказать, сколько должно быть свечей, каждая ситуация уникальна, но не менее 3 свечей.

Если вы уверены, что уровень сдержит цену, то можно поставить ордер рядом с уровнем. Если вы окажетесь неправы, то риск будет очень маленький, а если правы, то профит будет большой.

Ценовые паттерны

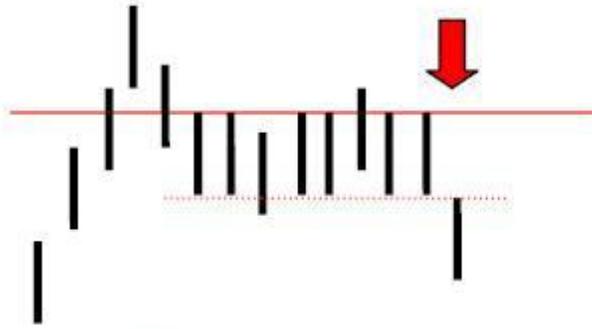
Давайте разберем ценовые модели, это то, что мы ищем на более низких временных интервалах, помните, паттерны подтверждают движение в направлении тренда, также они помогают обозначить зону, куда цена не должна пойти, для стоп-лосса.

1. Любая свечная модель, которая показывает разворот
2. Любая баровая модель, которая показывает разворот
3. Любая модель, которая показывает, что трейдеры попали в ловушку

- А) Хвосты и полки
- Б) двойная вершина или впадина
- В) Верхнее или нижнее спружинивание
- Г) Тройной откат
- Д) Модель 123
- Е) Тест пробитой зоны
- Ж) Расширяющийся бар

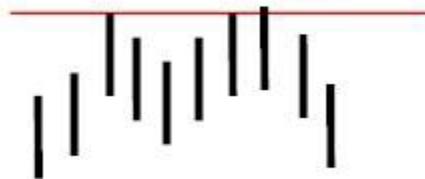
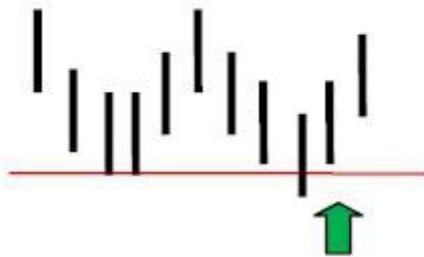
Вот примеры:





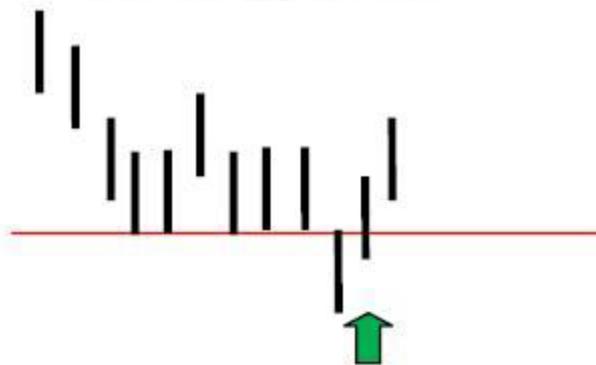
Хвосты и полки

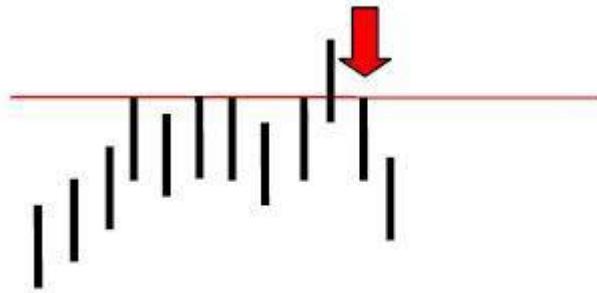
Двойная впадина



Двойная вершина

Нижнее спружинивание



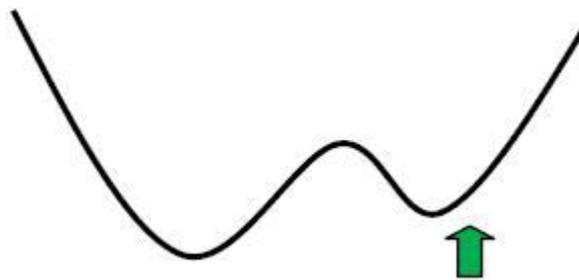


Нижнее спружинивание



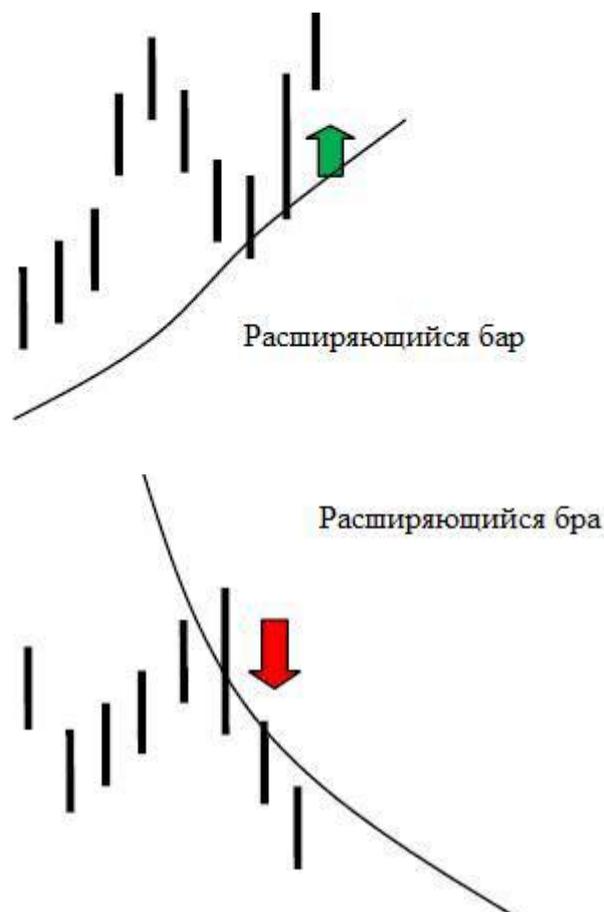
Тройной откат

Модель 123



Регресс уровня





Я предпочитаю отложенные ордера, в процессе я могу их переставлять, но я не ставлю ордера ниже точки ПТВП. Я не рекомендую входить с рынка, так как вы можете попасть под проскальзывание цены и не успеть хорошо войти.

Чтобы не пропустить вход, нужно помнить о 2 вещах:

- 1) Нам нужна самая лучшая цена.
- 2) Мы должны быть уверены, что если цена начнет быстро двигаться, то мы не пропустим сделку. Когда цена входит в зону, мы сразу ставим отложенный ордер.

Если вы пропустили сделку, то не стоит гоняться за ценой. Входит нужно только по правилам, то есть в зоне поддержки или сопротивления. Если вы сделали ошибку, то проанализируйте ее с помощью журнала сделок. И помните, следующая сделка уже близко.

Подводим итоги

Рабочий график показывает зону, где нужно открывать сделку.

Меньший временной интервал используем для входа в позиции.

Когда цена входит в зону, мы берем это себе на заметку, но сделку пока не открываем. Мы смотрим, что будет делать цена, смотрим, как она будет реагировать на уровень. Мы ищем слабость и трейдеров, которые попали в ловушку. Сделки можно открывать только там, где неудачники начинают закрывать позиции.

Мы понимаем, что самый лучший вход можно увидеть только потом, поэтому мы просто ищем лучшую точку входа в зоне. Мы ставим отложенный ордер, чтобы не пропустить сделку.

Глава12. Управление капиталом

Все знают, что управление капиталом является одним из важнейших аспектов успешной торговли на Форексе. Тем не менее, люди не утруждают себя сосредоточиться на разработке и реализации плана управления капиталом. Парадокс в том, что пока вы не разовьете свои навыки управления капиталом и не будете стабильно их выполнять в каждой сделке, вы никогда не будете стабильно зарабатывающим трейдером. Я хочу дать вам профессиональный взгляд на управление капиталом и развеять некоторые мифы витающие в мире торговли в отношении концепции управления капиталом. Из разных источников мы слышим много разных идей о контроле риска и взятия прибыли, большая часть этой информации противоречива и поэтому неудивительно, что многие трейдеры путаются и просто отказываются от осуществления плана управления капиталом, что в итоге приводит к их гибели. Я успешно торгую на финансовых рынках в течении почти шести лет и я овладел мастерством соотношения риска к прибыли и как эффективно использовать его для роста малых сумм до больших сумм денег довольно быстро.

Мифы управления капиталом:

Миф 1: трейдеры должны фокусироваться на пунктах.

Вы, наверное, слышали, что должны фокусироваться на пунктах прибыли и потерь, а не на суммах в долларах потерь и прибылей. Смысл этого метода управления капиталом в том, что если вы концентрируетесь на пунктах, а не долларах вы каким-то образом не будете эмоциональны, так как не будете думать о вашем торговом счете в денежном выражении а как о игре пунктов. Если это не казалось вам смешным раньше, то должно быть сейчас. Весь смысл торговли и инвестирования в том, чтобы заработать денег, и вы должны осознавать какой суммой рискуете в каждой сделке так чтобы знать реальную ситуацию. Вы думаете, что собственники бизнеса относятся к квартальным отчетам о прибыли как к игре пунктов, которые каким-то образом отдаляют от реальных потерь или прибылей? Конечно, нет, если подумать это выглядит глупо относиться к вашей торговой деятельности как к игре. Вы должны рассматривать трейдинг как бизнес, потому что это так и есть, если вы хотите быть стабильно прибыльным, то должны рассматривать каждую сделку как деловую операцию в бизнесе. В каждой деловой операции существует риск потерь и возможные прибыли, так же и в каждой вашей сделке. Суть в том, что если вы будете думать о вашей торговле в пунктах, а не в долларах, вам будет казаться все это менее реальным, и вы будете относиться к этому менее серьезно, чем могли бы.

С математической точки зрения, думать о трейдинге с точки зрения «сколько пунктов я заработал и сколько потерял» абсолютно нелогично. Проблема в том, что каждый трейдер торгует разным размером позиции, поэтому мы должны определять риск с точки зрения «долларов прибыли, и долларов убытков». То, что вы рискуете большим количеством пунктов, не означает, что вы рискуете слишком большой частью вашего капитала, тоже можно сказать, что маленький стоп не означает, что вы рискуете маленькой суммой от вашего торгового счета.

Миф 2: хороший способ наращивать ваш счет это рисковать 1% или 2% от торгового капитала.

Это один из наиболее распространенных мифов, который вы, наверное, уже слышали. Хотя это хорошо звучит в теории, реальность такова, что большинство обычных трейдеров начинают торговлю со счетом 5000\$ или даже меньше. Поэтому верить, что вы будете увеличивать свой счет быстро и эффективно, рискуя 50\$ или 100\$ в каждой сделке просто глупо. Скажем, у вас случилась серия из 5 убыточных сделок, если вы рисковали 2% вашего счета, теперь у вас 4500\$, но вы продолжаете торговать 2% в каждой сделке, и теперь чтобы вернуть ваш счет на уровень безубыточности, вам необходимо сделать подряд уже шесть прибыльных сделок. Каждый трейдер торгующий реальными деньгами за любой период времени знает как тяжело получить подряд шесть прибыльных сделок. В конечном итоге, когда трейдеры используют такую модель риска, они начинают хорошо, рискуя 1% или 2% в нескольких своих первых сделках, и даже возможно все они будут прибыльны. Но как только они попадают в полосу неудач, они понимают, что все их достижения уничтожены, и теперь пройдет много времени только чтобы вернуть утраченное. Потом они приходят к переторговыванию и зарабатывают меньше чем на качественных сетапах, потому что понимают как долго им займет возврат к безубыточности если будут продолжать рисковать 1% или 2% в каждой сделке.

Хотя такой метод управления капиталом позволит вам торговать небольшими суммами в каждой сделке, и поэтому теоретически ограничивает эмоциональные ошибки в торговле, большинство людей просто не имеет столько терпения рисковать 1% или 2% в каждой сделке относительно их небольшого торгового счета. В конечном итоге это приводит к переторговыванию, что является самым плохим для вашей прибыли. Также при таком методе трудно оправиться после убыточного периода. Помните, один раз вы получили убыток, используя метод 2% в каждой сделке, ваш риск в последующей сделке будет меньше, следовательно ваша скорость восстановления будет медленнее и мешает прикладываемым усилиям трейдеров.

Самый главный факт в том, что... если вы начнете с 10000\$, и спустите к 5000\$, используя метод фиксированного риска, вам будет намного дольше восстанавливать счет, так как вы начинали с 2% риска в каждой сделке, что составляло 200\$, а теперь будете рисковать 100\$ в каждой сделке, и только при условии хорошей прибыльной серии, ваш капитал восстановится в два раза медленнее, чем при использовании фиксированного риска в долларах в каждой сделке.

Миф 3: большой стоп означает больше денег риска

Многие трейдеры ошибочно считают, что если будут ставить большой стоп, то обязательно увеличивают риск. Так же, многие трейдеры считают, что устанавливая меньший стоп они обязательно уменьшают свой риск в сделке. Трейдеры придерживающиеся этих убеждений, так поступают потому что не понимают концепции

установки размера позиции. Концепция установки размера позиции предполагает расчет количества торгуемых лотов в сделке, для удовлетворения желаемых размеров риска. Например, вы рискуете 200\$ в одной сделке, при стопе 100 пунктов вы должны торговать 0.2 лота: $2\$ \text{ за пункт} \times 100 \text{ пунктов} = 200\$$. А теперь вам необходимо открыть сделку от пин бара но хвост его очень большой, и необходимо установить стоп над хвостом, что будет означать 200 пунктов стоп. Вы все еще можете рисковать 200\$ в сделке, вам просто необходимо настроить размер позиции, чтобы можно было поставить такой большой стоп, то есть вы откроете сделку размером 0.1 лота со стопом 200 пунктов. Все это означает, что вы можете рисковать одной и той же суммой в каждой своей сделке, увеличивая или уменьшая размер позиции, чтобы выйти на величину стопа.

Теперь давайте посмотрим на пример того, что может произойти, если не придерживаться установки размера позиции, не уменьшая количество лотов при увеличении длины стопа. Пример: два трейдера рискуют одинаковым количеством лотов в одном торговом сетапе. Трейдер А рискует 5 лотами и стоп у него установлен на 50 пунктах, трейдер В также рискует 5 лотами, но у него стоп находится на расстоянии 200 пунктов, так как он верит что в сетапе почти 100% вероятность того что цена не пойдет против него на 200 пунктов. Ошибка в такой логике в том, что когда цена идет против вашего сетапа и импульс увеличивается, теоретически нету ограничений когда он остановится. И мы все знаем, какие могут быть сильные тренды на Форексе.

У трейдера А сделка закрылась по заранее определенному стопу и он понес убытки 5 лотов $\times 50 \text{ пунктов} = 250\$$. Трейдер В также понес убытки, но значительно больше, так как он ошибочно надеялся, что рынок развернется и не пройдет 200 пунктов против него. Таким образом трейдер В потерял 5 лотов $\times 200 \text{ пунктов} = 1000\$$, потери колоссальные по сравнению с 250\$, которые он мог потерять.

В данном примере видно, почему убеждение в том, что увеличение стопа в сделке не является эффективным для увеличения торгового счета, на самом деле как раз наоборот, это быстрый путь уменьшить свой торговый счет. Основная проблема, которая затрагивает таких трейдеров это отсутствие понимания силы соотношения риска к прибыли и установки размера позиции.

Сила соотношения риска к прибыли

Профессиональные трейдеры концентрируются на соотношении риска к прибыли, и не делают основной упор на анализе рынков и поиске нереально далеких целей для сделок. Это потому, что профессиональные трейдеры понимают, что трейдинг является игрой вероятностей и управления капиталом. Все начинается с наличия описанной стратегии или торгового метода, которые будут хоть чуточку лучше от случайного выбора направления рынка. Стратегия прайс-экшн может иметь прибыльных сделок до 70-80% при разумном Сила соотношения риска к прибыли состоит в том, что оно способно эффективно и последовательно растить ваш торговый счет. Все слышали торговую аксиому «дайте вашим прибылям расти» и «режьте убытки быстро», и это звучит прекрасно, но на самом деле не несет начинающим трейдерам никакой полезной

информации для использования. Суть заключается в том, что если вы торгуете чем то меньшим чем 25000\$, вы должны будете забирать прибыль в заранее определенно м интервале если хотите сохранить хладнокровие и рост вашего счета. Вход в сделку с открытыми целями обычно не работает для маленьких счетов, потому что конечная цель не достигается без кардинальных движений рынка против основного направления. (Я считаю что это очень важно, прочитайте последнее предложение еще раз)

Если вы знаете что попадаете в цель в 40-50% случаев, то вы можете стабильно зарабатывать деньги на рынках применив соотношение риска к прибыли. Научившись использовать четко определенные сетапы прайс-экшн для входа в сделку, вы можете получить большой процент прибыльных сделок, при условии, что вы фиксируете прибыль.

Давайте рассмотрим два примера – один трейдер использует правило 2%, второй трейдер рискует фиксированной суммой в каждой сделке.

Пример 1. Ваше соотношение риска к прибыли 1:3 в каждой сделке. Это означает, что вы будете забирать прибыль в размере трех рисков в каждой сделке, и если у вас будет 50% прибыльных сделок, вы все еще останетесь в прибыли:

Допустим, размер вашего торгового счета составляет 5000\$ и вы рискуете 200\$ в каждой сделке.

Первая сделка убыточная: $5000\$ - 200\$ = 4800\$$

Вторая сделка убыточная: $4800\$ - 200\$ = 4600\$$

Третья сделка прибыльная: $4600\$ + 600\$ = 5200\$$

Четвертая сделка прибыльная: $5200\$ + 600\$ = 5800\$$

Из этого примера видно, что при потерях в 2 из 4 сделок, вы все еще имеете приличную прибыль за счет эффективного использования силы соотношения риска к прибыли. Для сравнения, давайте посмотрим на следующий пример, где используется модель 2% риска капитала:

Пример 2. Снова у вас торговый счет 5000\$ но теперь в каждой сделке вы рискуете 2% от капитала, и помните, что у вас соотношение риска к прибыли 1:3 в каждой сделке. Это означает, что вы будете забирать прибыль в размере трех рисков в каждой сделке, и если у вас будет 50% прибыльных сделок, вы все еще останетесь в прибыли:

Первая сделка убыточная: $5000\$ - 100\$ = 4900\$$

Вторая сделка убыточная: $4900\$ - 98\$ = 4802\$$

Третья сделка прибыльная: $4802\$ + 288\$ = 5090\$$

Четвертая сделка прибыльная: $5090\$ + 305\$ = 5395\$$

Теперь вы видите почему рисковать 2% своего капитала в каждой сделке не так эффективно как определенной суммой. Важно отметить, что после 4-х сделок, рискуя определенной суммой в сделке, используя соотношения риска к прибыли 1:3, у первого трейдера прибыль 800\$ против 395\$.

Если у второго трейдера, использующего правило 2%, случится неудачный период где он потеряет 50% своего капитала, ему необходимо будет заработать 100% от счета, чтобы вернуться на уровень безубыточности, это будет также трудно сделать и первому трейдеру, использующему фиксированную сумму риска, но как вы думаете, у кого больше шансов на восстановление? Seriously, восстановление может занять очень много времени если использовать метод 2%. Конечно, многие скажут что используя фиксированный риск можно слить больше чем половину капитала, и это очень рискованно, но мы сейчас говорим о реальной торговле, где мы должны использовать метод который даст мне шансы на восстановление, а не только защищает от потерь. Совместно с хорошей стратегией и опытом вы сможете использовать фиксированный риск, вот почему я хотел открыть вам на него глаза.

Благодарю за прочтение!

Надеюсь, весь мой опыт, описанный в этой книге, поможет вам в этом нелегком бизнесе.

Профитов и удачи!