

С. Гребенщиков

Forex и мы

Оглавление

Оглавление	1
1. Предисловие	1
2. Требования мистера Форекса к господину Трейдеру	3
3. Убытки, как неотъемлемая часть трейдинга	4
4. Кое-что об ММ	6
5. Ждем-с...	7
6. Кое-что об индикаторах и теханализе	8
➤ Общие соображения	8
➤ Индикатор объема	10
7. Кое-что об МТС	10
8. Пример механического входа в торги	11
9. Торговые стратегии	15
➤ Общие соображения	15
➤ Канал	19
➤ Ошибки	21
➤ По тренду	22
➤ «Быстрая» торговая сессия	26
➤ Агрессивный вход в торги	27
➤ Хэджирование рисков	28
➤ Ошибки:	29
10. Нестандартные ситуации на рынке Forex	30
➤ Гэп	30
➤ «Пьяный кенгуру»	30
11. В заключение	33
12. Благодарности	34

1. Предисловие

Чтобы читатели поняли, о чем и для кого эта книга, мне придется начать издалека. Я не думаю, что большинство из тех людей, которые будут читать эту книгу, начнут именно с предисловия. Скорее, со стр. 15... ☺. Но, тем не менее...

По моим наблюдениям, есть две разные группы трейдеров, которые преследуют две разные цели на этом рынке. Есть трейдеры, которые (часто даже не осознанно) стремятся не работать на Форексе, а изучать Форекс. Это вечные путники, вечные искатели, так как они попали на дорогу, которая идет «по кругу». Как мне кажется, Форекс – это такое явление, которое изучать можно бесконечно. Невозможно составить даже какого-то внятного плана продвижения по этому пути. Постоянно появляются новые стратегии, индикаторы, нейросети, методы анализа... Честь и хвала людям, которые стараются узнать об этом все, но мне их немного жаль. В самом деле, когда же они это все изучат, и начнут, наконец, просто работать и зарабатывать? По-моему, жизни не хватит - ведь каждая новая стратегия требует не только детального изучения, но и длительного тестирования в реалтайме, набора необходимой статистики за длительный период времени... А там

новая идея, новые разработки... Новые восторженные отзывы сообщества о "потрясающей эффективности"... И опять с нуля - качаем, устанавливаем, тестируем на учебных счетах, набираем статистику! Новый виток все того же круга... Сколько лет существует Форекс? И сколько лет существует компьютерный анализ? И что, за это время уже появилась сверхприбыльная, или хотя бы безубыточная система? Как бы не так! Трейдинг стал менее рискованным? Опять - нет! Анализ стал проще? Наоборот, сложнее! Может быть, он стал намного эффективнее? А тогда почему депозиты люди теряют?

Другая же (меньшая и неорганизованная) группа трейдеров, ставит перед собой задачу зарабатывать на Форексе. И составить четкий и разумный план на этом пути вполне реально. Скажем, "я освоил трейдинг без убытков, теперь задача - начать зарабатывать, затем увеличить депозит и перейти на работу двумя лотами, не повышая рисков, затем тремя лотами...". Ну и т. д. Они пришли именно зарабатывать. Делать деньги, если хотите. А для этого не надо знать все! Для этого надо знать только одно - как торговать на рынке Форекс. И вполне достаточно выбрать одну-две прибыльных стратегии, и, изучив и протестировав ИМЕННО ЭТИ ОДНУ-ДВЕ стратегии, просто начать применять их в практическом трейдинге! Начать ДЕЛАТЬ ДЕНЬГИ. И попутно изучать, скажем, живопись эпохи Ренессанса... Эта книга предназначена именно для этих людей. А родилась она спонтанно, из моей переписки в одном из дискуссионных листов с начинающими трейдерами. После нескольких моих постов, размещенных в этом листе, ко мне стали приходить десятки писем с вопросами, требующими разъяснения тех или иных вопросов. Часто вопросы повторялись, мне приходилось по нескольку раз отвечать на один и тот же вопрос. В конце концов, я собрал все свои публикации в один файл, дополнил его своими ответами на ЧАВО и выложил в листе. Однако, вопросы продолжали поступать, интенсивность переписки не ослабевала, а, напротив, занимала все больше времени. Я обнаружил, что зачастую те вещи, которые мне кажутся очевидными, не всегда так же очевидны тем трейдерам, которые только столкнулись с ними. И тогда я решил: раз мой опыт может быть кому-то полезен, надо сделать его доступным всем. Так родилась идея этой книги.

Эта книга - не учебник по теханализу и не инструкция по успешному трейдингу - это попытка обобщить мой, почти семилетний опыт работы на рынке Форекс, и поделиться им с начинающими трейдерами. При этом я не ставил перед собой таких задач, как, например, трактовка показаний индикаторов при проведении анализа, или объяснение основ фундаментального анализа. На эту тему уже написано достаточное количество книг, статей, обзоров и т. д. Соревноваться с профессионалами в этих вопросах - делать из себя клоуна. Например, что нового я могу добавить к книге Акелеса "Технический анализ от А до Я"? Или к книге Лебо и Лукаса "Компьютерный анализ фьючерсных рынков"? Ничего. В то же время, любой трейдер может найти у этих авторов исчерпывающую информацию по индикаторам теханализа. Да и любые теоретические вопросы по Форексу описаны сотнями авторов - от классиков до ныне действующих трейдеров - литературы такого рода полно и в Интернете, и в книжных магазинах. Поэтому, при работе над этой книгой я имел в виду, что ее читателями станут люди, знакомые с основами технического анализа - во всяком случае, знающие, что такое тренд, флэт, коррекция, консолидация, дивергенция, фрактал... И которые могут отличить мувинг от билдинга.

Я в этой книге хочу показать, что для успешного трейдинга вполне достаточно очень простых методов, основанных на столь же простых правилах. Но при безусловном соблюдении этих правил! По моему мнению, вообще-то, трейдинг с технической стороны - дело довольно простое, сложным он становится, когда мы сами начинаем усложнять его, пытаясь изобрести нечто универсальное, что сделает нашу торговлю сверхприбыльной. Кроме того, он достаточно труден с психологической точки зрения. Как я уже сказал, это не есть учебник: я не могу и не хочу претендовать на роль Учителя, но, поскольку я собираюсь здесь говорить (в том числе) и вещи, которые начинающему трейдеру могут показаться банальными, или несуразными, или неважными, или не касающимися его ЛИЧНО, или вообще бредом сивой кобылы, то сразу оговорюсь: все равно Вы придете к тем же самым выводам, но только после множества психологических шишек и материальных потерь. Поверьте, для работы на рынке Форекс, не надо быть семи пядей во лбу, не надо быть финансовым гением - надо быть дисциплинированным человеком и только! А для этого

нужно суметь исключить свои эмоции из процесса проведения транзакций, и четко выполнять те правила, которые Вы сами для себя напишете (или позаимствуете). Вы и не должны воспринимать эту книгу как учебник - воспринимайте ее просто как попытку поделиться опытом. А уж удачная, или нет эта попытка - Вам решать... ☺

Попутного тренда!

2. Требования мистера Форекса к господину Трейдеру

Первый постулат: рынок непредсказуем и неуправляем. На рынке ничего нельзя утверждать, на рынке можно только предполагать. Все решения на рынке трейдером принимаются **ТОЛЬКО НА ОСНОВЕ ПРЕДПОЛОЖЕНИЙ!**

Второй постулат: рынок нам не друг и не враг. Мы ему глубоко безразличны! Он даже не подозревает о нашем существовании! И он не обязан ни в коей мере учитывать наши индивидуальные особенности или предпочтения. Он, в каждый момент времени, делает то, что считает нужным делать, не задумываясь над тем, имеет ли он право отнимать у нас последнюю копейку, или не будет ли ему жалко подарить нам сотню-другую тысяч долларов... Его характер (не поведение, а именно характер - независимый, глухой к мольбам или приказам, равнодушный и жестокий) одинаков на всем протяжении его жизни.

А мы все разные. Среди нас есть холерики и флегматики, жадные и великодушные, умные и очень умные, торопыги и увальни, склонные к панике и непробиваемые... Словом, **ВСЕ РАЗНЫЕ...**

А для **УСПЕШНОЙ** работы всех(!) на Форексе нужно, чтобы все были **ОДИНАКОВЫМИ** и соответствовали **ИМЕННО ЕГО, МИСТЕРА ФОРЕКСА**, критериям, а не своей невесты! Это рынок имеет право предъявлять к нам требования, а не мы к нему... Мы все должны одинаково думать, и одинаково действовать, для того, чтобы долго и успешно торговать не Forex!

Вы согласны ломать себя? Гнуть характер через коленку, обуздывать эмоции, скрипеть зубами? Кто не согласен, пусть покупает себе нефтяное месторождение, и зарабатывает добычей нефти. На Форексе ему делать нечего. Это рынок установил те правила и те требования, о которых я Вам хочу рассказать.

Почему многие теряют депозит? Вот заковыка: все ведь знают одно и то же, поскольку читали одни и те же учебники по анализу, изучали книги одних тех же классиков, используют одни те же графики, видят одни и те же индикаторы... Но кто-то зарабатывает, а кто-то теряет... Почему? На мой взгляд, все дело, конечно же, в ошибках, но не в ошибочном анализе, как многие думают, а в ошибочном поведении трейдера за монитором. Проанализировать рынок мало-мальски грамотный трейдер сможет, а вот постоянно извлекать из анализа пользу...

Ну вот, давайте представим, что Вы торгуете по одной из стратегий, которые я приведу ниже в качестве примеров - ну, скажем, стратегии «по тренду». Сидя перед монитором, Вы анализируете рынок, готовясь принимать решение по выставлению-невываиванию ордеров, по определению разносрочных трендов и вдруг видите, что после скромненького флэта цена резко пошла вверх. Вы открываете длинную большими силами, ждете какое-то время остановки движения, затем закрываетесь с прибылью 100 пунктов. В следующий раз Вы повторяете этот эксперимент, и опять получаете хорошую прибыль... Вы вполне довольны собой. Депозит вырос! Вы чувствуете себя чуть ли не финансовым гением!

Но на самом деле Вы совершили первую грубейшую ошибку! В чем, спросите Вы? Да в том, ответу я, что Вы **НАРУШИЛИ ПРАВИЛА ТОРГОВЛИ ПО ЭТОЙ СТРАТЕГИИ**. Вы, получив прибыль по этим сделкам, будете продолжать использовать этот прием - открыться вдогонку - и раз за разом получать лоссы.

"Но первая-то сделка показала, что этот прием может быть прибыльным, а вторая подтвердила это: не повезло сейчас, - думаете Вы - так уж в следующий-то раз!..." Надежда на везение - это вторая **ГРУБАЯ ОШИБКА**. На рынке рассчитывать на везение, значит очень скоро стать банкротом! Рынок - это не казино, хотя даже в казино настоящие игроки не делают ставок

бессистемно! Рынок же просто обязывает трейдера принимать решения осознанно, поэтому игра в "повезет-не-повезет" на рынке недопустима в принципе, и является просто авантюрой, недостойной умного человека. А спровоцирована она первой: **НАРУШЕНИЕМ ПРАВИЛ**, установленных для этой стратегии рынком и Вами, трейдером. И плюс жадностью - как же, я ведь могу пропустить сильное движение! Жадность - это уже третья **ГРУБАЯ ОШИБКА**. Даже не сама жадность - это человеческое качество, грызущее всех нас, но то, что решение об открытии торгов принималось под его влиянием. Вы позволили этому чувству управлять мышкой и клавиатурой, а управлять ими могут **ТОЛЬКО ТЕ НЕСКОЛЬКО ПРОСТЫХ ПУНКТОВ, КОТОРЫЕ ЗАПИСАНЫ В ВАШИХ ПРАВИЛАХ!**

А как надо было поступить в этой ситуации? - спросите Вы. А надо было - ответим мы с мистером Фогехом - попросту продолжать анализировать рынок, выявить наличие или отсутствие тренда, дождаться коррекции, если тренд подтвердился, выставить отложенный ордер по тренду, поставить приемлемый стоп-лосс и идти спать. Почему?

ПОТОМУ, ЧТО ВЫ ТРЕЙДЕР И ПОТОМУ, ЧТО ТАК НАПИСАНО В ПРАВИЛАХ!!! ДРУГИХ ПРИЧИН НЕТ!!!

Или, если тренд не подтвердился, посмотреть, не образовался ли канал и сменить тактику на канальную. **НО!!!** опять-таки, с соблюдением **ВСЕХ ПРАВИЛ ТОРГОВЛИ**, которые Вы определили именно для этой, канальной, тактики!

Но! Правила - это догма, но только до тех пор, пока рынок не изменился! Если Вы торгуете по правилам канала, а канал оказался прорванным и рынок уходит, правила **ДОЛЖНЫ БЫТЬ** оперативно изменены на работу по правилам тактики «по тренду».

В этой книге я постараюсь показать вам несколько приемов торговли, которые я использую сам в реальной торговле. По мере выдачи рекомендаций того или иного действия, я буду объяснять, почему мы хотим принять то или иное решение, какие резоны движут нами.

В заключение я хочу еще раз напомнить: на рынке нельзя ничего **УТВЕРЖДАТЬ!** Все решения на рынке принимаются на основании **ПРЕДПОЛОЖЕНИЙ** (есть еще один термин - ожидание)! А потому никто не застрахован от убытков! Но наша задача сохранить и увеличить начальный депозит! А в общем смысле, задача - прибыльно работать на этом рынке всю оставшуюся жизнь. И значит, мы должны раз за разом, день за днем, год за годом выполнять то, что требует от нас рынок, а не то, что хочется нам! А рынок требует, чтобы мы, однажды написав для себя правила, неукоснительно соблюдали их **ВСЕГДА!** Рутинно!

Напомню: все решения на рынке принимаются (всегда!) исходя из предположений - не утверждений, а именно предположений! Когда мы видим на графиках какую-то стандартную ситуацию, которая нам говорит, что надо покупать, мы исходим из предположения, что цена пойдет вверх. На самом деле, она не обязана идти вверх, просто мы с вами знаем, что (по статистике) в среднем, в 7 случаях из 10 она в таких ситуациях поступает именно так - идет вверх! И мы не можем изменить это - сделать, например, так, чтобы она в 9 случаях из 10 шла именно вверх! Если на этот раз цена пошла вниз, то это вовсе не означает, что мы ошиблись, просто сейчас мы находимся в оставшихся 30% поведения рынка. Мы не должны менять своих методов (читай - **ПРАВИЛ!**) на основании неподтвердившегося данного прогноза, иначе мы перейдем из категории «7 профитов/3 лосса» в обратную категорию («3 профита/7 лоссов»). Оно нам надо?

3. Убытки, как неотъемлемая часть трейдинга

В этой главе мы поговорим об убытках. Тему эту я считаю архиважной: дело в том, что трейда без убытков не бывает - просто по определению: **НЕ БЫ-ВА-ЕТ!!!** На свете нет такого профи, который, проведя 100 транзакций, имел бы только прибыльные сделки. Даже если кто-то Вам клянется мамой, что он имеет 90% прибыльных сделок - не верьте. Такого не бывает в принципе на сколь-нибудь длительном периоде трейда. Да, в 10-20 сделках такой показатель возможен, но в 100-200... В 1000...

Отсюда вывод: необходимо понять и принять, что убыточные торги (при соблюдении ПРАВИЛ, конечно) не есть ошибки трейдера. Это просто издержки профессии. Ну, скажем, Вы работаете на заводе слесарем, или инженером, или даже главным инженером. Понедельник, раннее утро, на улице хлещет дождь (сумасшедший мороз, наводнение - придумайте сами...), а Вам надо идти на работу. А Вы, простите за просторечие, с бодуна... Неприятно? Что делать - издержки профессии!

Или Вы олигарх и Вам принесли повестку в прокуратуру, из-за которой Вы можете пропустить ближайший матч любимой футбольной команды в Лондоне. Неприятно? Что делать - издержки профессии!

Предположим, что Вы используете какую-то определенную тактику. Вы открыли позицию, соблюдая ВСЕ ПРАВИЛА ДЛЯ ЭТОЙ ТАКТИКИ, а она оказалась убыточной. Ваша реакция? "Ах, я идиот, ах я недоумок, черт меня дернул, да чтобы я еще раз...!" Или: "Вот не повезло! Ну почему я такой невезучий!? Почему кому-то везет, почему не мне?" Это убийственная для Вашего депозита реакция! Реакция должна быть спокойной, а вывод следующим: "это не я ошибся, это рынок ошибся. Но рынок ошибается намного реже, чем, человек, нарушающий правила. Поэтому я буду работать так же, как всегда".

Иными словами, к убыткам надо (нужно, необходимо) относиться так, как столяр относится к опилкам из-под ножовки, или стружке из-под топора. Могут опилки быть поводом для огорчения? Нет, конечно (хотя подмести помещение придется).

Вы заметили - я не говорю о величинах стоп-лоссов, о ММ, об анализе?... Дело в том, что, по Моему Глубокому Убеждению (во выдал! предлагаю ввести в обиход еще одно сокращение - ПМГУ, наряду с ИМХО ☺), эти темы суть вторичны. Первичным является поведение трейдера за монитором. А убытки, если к ним относиться как к трагедии (т. е. неадекватно), часто приводят трейдера в состояние, когда и адекватное поведение трейдера за монитором, и адекватное восприятие трейдером рынка становится невозможным. Поймите и примите – это издержки профессии, это просто опилки из-под ножовки!

Но вот что я еще скажу, и не бросайте в меня камни: к прибыли на открытых позициях надо относиться точно так же! Объясняю: когда Вы видите, как цена пошла навстречу Вашему трейду и Ваша прибыль с каждой минутой уменьшается, а ПРАВИЛА запрещают Вам закрываться, и когда, наконец, захлопнется стоп-лосс, отдав значительную часть прибыли назад рынку, реакция та же и вывод тот же: "это не я ошибся, это рынок ошибся. Но рынок ошибается намного реже, чем человек, нарушающий правила. Поэтому я буду работать так же, как всегда. **Иначе я перейду из категории «7 профитов/3 лосса» в обратную категорию («3 профита/7 лоссов»). Оно мне надо?»**".

Я поставил эти два правила рядом, в одну главу, но значение они имеют разное: если правило об убытках позволит Вам, взяв лосс, не потерять голову и не кинуться немедленно отыгрываться, совершая необдуманные действия и нанося еще больший ущерб депозиту, то правило о прибыли позволит Вам в итоге зарабатывать значительно больше денег!

Я открою вам, коллеги, свой маленький секрет: у меня на рабочем столе во время торгов висит, кроме терминала, лист Excel. Очень удобная штука для расчета стопов, добавлений, управления торгами вообще. Все довольно просто - вводи значения, он сам выдаст результат, можно ли добавляться с планируемыми стопами, или следует подождать, чтобы сессия стала безубыточной, и сколькими лотами можно добавиться в том или ином случае. Он сразу говорит: если добавишься столькими-то лотами, да поставишь стоп ниже (если речь идет о Longe) последнего встречного фрактала, то при срабатывании стопов твоя прибыль-убыток будут такими-то. Сейчас на терминале столько-то, а зафиксируешь по стопам не больше 1/5. Тем не менее, ПРАВИЛА заставляют добавиться, и иногда значительную часть прибыли теряешь, но в итоге теряешь меньше, чем находишь! Такие расчеты можно, конечно, сделать и на калькуляторе, но считать 5-7-10 позиций... Я отдал этот лист трейдерам, обучающимся у меня в мастерклассе – люди оценили. К хорошему привыкаешь быстро... ☺

Впрочем, как считать позиции, индивидуальное дело каждого. Важно СЧИТАТЬ! И не стремиться взять максимума на данной текущей торговой сессии, а брать максимум только тогда,

когда позволит мистер Форекс, но на протяжении многих будущих лет жизни в трейдинге. Мы ведь пришли на этот рынок не на денек-другой, верно?

4. Кое-что об ММ

На эту тему написано столько трудов и такими уважаемыми авторами, что соревноваться с профессионалами в рекомендациях, я не вижу никакой возможности, а просто повторять их выкладки не хочу. Единственное, что я могу сделать в рамках данной книги, это сказать о том, как лично я пришел к пониманию того, чем на самом деле является Money Management. Наверное новичков это несколько позабавит, но, как говорится, истина дороже... А профессионалы важно покивают головами и изрекут: «Истину глаголет...»

В начале своей деятельности на рынке Форекс (особенно в начале обучения на демосчетах), и мало что понимая в принципах управления капиталом, из-за отсутствия экономического или финансового образования, я лихо экспериментировал с открытием позиций: если мне казалось, что я точно знаю, куда пойдет рынок, я открывался в этом направлении половиной депозита. И когда это срабатывало так, как я задумывал, у меня душа пела, а ум приобретал уверенность, что ММ придумали недалекие люди, неудачники, которые сами не умеют торговать, и других пугают. «Смотри - говорил я себе - сколько можно ухватить здесь за один раз! Нужно только правильно прогнозировать рынок – и через год я миллионер! А уж я-то умею его прогнозировать – зря, что ли, я столько умных книг по анализу прочитал!» Конечно, я получал и на демосчете убытки, но отмахивался от них, как от назойливых мух, списывая их на то, что сегодня я просто был невнимателен, просто устал, просто не повезло... Вот уж на реале-то я буду трижды внимательным, вдвое более энергичным, а уж о везенье-то и говорить не стоит – Господь не допустит, чтобы я обанкротился. Кто угодно, только не я!

Затем, когда я начал торговать на реальные деньги, я стал потихоньку понимать, что ММ – не выдумка недоучек, а, скорее, опыт людей умных. Дальше-больше: я все яснее осознавал, что это понятие – правила управления капиталом (Money Management) является ключевым на рынке, а недоучка – это, скорее, я. Потом, спустя пару лет, уже после полного осознания этого, я где-то вычитал рассказ старого трейдера. Так вот, у него был ученик, который после окончания одной из торговых сессий вышел из дилингового зала и, встретив своего учителя, произнес: «Я понял, что такое трейдинг! Трейдинг - это не управление рынком. Трейдинг – это управление капиталом!». Я снимаю шляпу перед этим трейдером! И, садясь за монитор, прежде чем открыть позицию, мысленно повторяю эти его слова. Не то, чтобы я не понимал этого раньше, когда я наткнулся на этот рассказ, я уже, как сказал выше, знал это. Просто эта **АБСОЛЮТНАЯ ИСТИНА** сформулирована им гениально! А в том, что эта истина **АБСОЛЮТНА**, нет ни малейшего сомнения! У десятка трейдеров может быть десяток разных профитных стратегий и, применяя свою, каждый из них будет прав – здесь у каждого своя правда. Они могут использовать в терминале разные индикаторы, считая именно свои лучшими, и в этом у каждого будет своя правда. Каждый из них может предпочитать свою пару валют – и здесь тоже своя правда!

И только ММ – это **ОДНА ПРАВДА НА ВСЕХ!** Тот, кто этого не поймет, недолго продержится на рынке! Я шел к пониманию этого сам, теряя деньги и душевное равновесие, веру в себя и веру в рынок. Я потерял много денег и времени потому, что я не поверил людям, которые дарили мне знание этой правды. Не надо повторять мой путь. Если Вы решили научиться торговать на этом рынке, начните изучение трейдинга с изучения правил управления капиталом – это намного сократит Ваш путь от новичка до Мастера!

Я могу себе позволить открыться двумя лотами только в том случае, если рынок, закрыв мою торговлю по стопу, понизит мой депозит не более чем на 10%. Если же я взял убыток на предыдущих торгах, и на балансе денег меньше, чем может обеспечить стоп-лосс, не увеличивая уровень риска, я перейду на входы одним лотом. Если денег еще меньше, и риск на торгах и одним лотом превысит допустимый уровень, то придется пополнить счет, прежде чем входить в рынок.

Во время торгов может быть добавлено сколь угодно много позиций, но при последовательном открытии каждой из них, риск должен распространяться только на прибыль от предыдущих, и никоим образом не на основной капитал!

Таким образом, при любой ситуации на рынке, я не стану рисковать более чем 10% депозита! О принципе безубыточности я уже писал – нет надобности повторяться.

Но это я сейчас такой умный! Начинать я, после чтения по трейдингу всего (кроме материалов по Money Management), что попадалось под руку, и недолгой тренировки на демосчете, с 3 полновесных зеленых тысяч (мой первый депозит) – слил. Ушел опять на демо – долго тренировался с виртуальных \$3000, временами пытаюсь торговать на мини - успех был весьма переменным. Затем, когда потихоньку нарисовались собственные стратегии, когда трейд на демо стал профитным не из-за шальных удач, а из-за правильной методы – опять перешел на реал, но уже с \$4000. На демо с \$3000 уходил в отрыв легко и просто, а на реале с \$4000... ☹. Дважды пополнял. Из-за нарушения правил – на реале очень трудно соблюдать даже то, что сам и разработал. Эмоции, однако!... Потом выкарабкался, все-таки. Но ломать себя пришлось.

Вот такая история. В том числе и об ММ – Money Management...

5. Ждем-с...

Одним из требований Форекса к трейдеру, является наличие у трейдера такого качества, как терпение. Умение ждать на рынке Форекс – это качество, которое невозможно переоценить. Почему-то многие трейдеры, открыв терминал, сразу начинают искать возможности для входа в рынок. При этом, ситуация на рынке может быть и неопределенной, и носить признаки перемены тренда, рынок может находиться в коррекции после длительного движения... А может быть и попросту непонятно, что происходит в данный момент на рынке. Если не переждать, очень даже можно получить совсем необязательные убытки! Спешка на рынке Форекс – смертельно опасная штука для вашего депозита!

Есть и другая ситуация, требующая даже большего терпения: держать позицию, которая приносит прибыль. «Дать прибыли расти» - этот постулат теоретически не оспаривается ни одним трейдером, но на практике часто можно наблюдать, как в своей торговле трейдер руководствуется совершенно противоположным принципом – «лучше синица в руках, чем журавль в небе».

Эти две стороны одной медали приводят к довольно плачевным результатам: получив прибыль, меньшую, чем позволял рынок и закрыв торговлю по принципу «синицы», трейдер затем, не переждав неопределенности, входит в рынок и получает лосс. От ранее заработанной прибыли остаются крохи, два неверных входа подряд – депозит несет потери... А если эти действия повторяются многократно, то, в конце концов, депозит разрушается окончательно. Причина одна – не хватает терпения: в одном случае – терпеливо ждать роста прибыли, в другом – терпеливо ждать торговой ситуации на рынке, не входя в торги. Терпение – это качество для трейдера столь же необходимое, как для стрелка – зрение, или для музыканта – слух.

Трейдеру нужно с первых дней занятий трейдингом определиться, чего он хочет от рынка – постоянно находиться «в игре», или зарабатывать деньги. Игра дает адреналин, но деньги требуют к себе другого – бережного и уважительного отношения. Ведь никому не придет в голову начать жарить цыпленка табака к обеду, если нет в наличии самого цыпленка, подходящей сковороды, соли, перца, чеснока... Почему же человек должен пытаться получить деньги там, где нет в наличии предпосылок к этому? Работа на рынке – это не только (и даже не столько) совершение транзакций, это, в гораздо большей степени, определение лучшего времени и лучшей конъюнктуры рынка для начала транзакций, Кликнуть компьютерной мышкой может и обезьяна, а вот правильно выбрать ситуацию, время и направление, может только человек. А именно это и является основной работой трейдера. После входа в торги, работы у трейдера нет, она - до... Преувеличение, конечно – позициями тоже надо управлять - но смысл, думаю, ясен.

6. Кое-что об индикаторах и теханализе

➤ Общие соображения

Сколько написано литературы, сколько сломано копий, сколько рухнувших надежд! Каждый вновь прибывший на эту Голгофу - Forex, считает, что стоит только найти нужный индикатор, и миллионы в кармане! А если в природе нет такого индикатора, его надо изобрести и написать самому.

Давайте подумаем, что же делает индикатор на нашем мониторе? Он обсчитывает то, что произошло с ценой за энный период времени и, тем или иным образом, сообщает нам об этом. Конечно, график цены нам расскажет то же самое, но слишком долго его рассматривать, искать ситуации, похожие на текущую, затем смотреть, что чаще всего вытекает из этой ситуации... Индикатор это делает автоматом и практически мгновенно, что намного удобнее. И если мы согласны принять такое толкование, то невольно возникает желание поразмышлять: если все индикаторы следят за ценой, все реагируют на один и тот же параметр - изменение цены в каждый момент времени (а других параметров у цены просто нет!), то и сигналы их, в сущности, говорят об одном и том же! Разными способами, но всегда об одном и том же! Если сравнить индикаторы с обычными средствами коммуникации, то, скажем, команду "покупай!" можно довести до трейдера по телефону, заказным письмом, по телеграфу, световым семафором, флажковым семафором, по радиосвязи, сигнальной ракетой, с помощью тамтама, пионерского горна, посыльным, по мэйлу, дымовым сигналом... На ближайшем заборе написать, в конце концов! Выбирай, какой способ нравится больше, но любой из них скажет "покупай!".

В общем случае теханализ сводится к одному: понять, что нам говорят цена и индикаторы. На ценовом графике мы строим разные линии, внимательно рассматриваем индикаторы, если нас обманул один, мы его заменяем другим... Но ведь они все показывают одно и то же! Да и набор команд, которые может послать нам любой индикатор, убог до примитива - их всего-то три:

1. "Купи!";
2. "Продай!";
3. "Жди!".

Все! Других команд, по большому счету, и нет! Поэтому и требовать (или ждать) от индикатора чего-то сверхъестественного не стоит. Дело-то простое: не индикатор управляет ценой - цена управляет индикатором! Цена идет, куда ей вздумается, а индикатор, как теленок на поводке, тащится за ней. Индикатор, каким бы гением он ни был написан, не сможет помешать цене развернуться в любой момент времени, и просвистеть пару фигур в течение какого-то получаса.

И вот тут возникают вопросы:

1. Что мы ждем от индикатора?
2. Чем же один индикатор отличается от другого?
3. Из каких критериев исходить при выборе индикаторов?
4. Можно ли построить на индикаторах прибыльную МТС?

Вот мои ответы - можете их оспорить, если хотите:

1. Я жду от индикатора прогноза ВОЗМОЖНОГО развития событий - он накопил в себе какую-то статистику о поведении цены за энный период, и показывает мне в графическом виде, что с ценой МОЖЕТ произойти, если БОЛЬШЕ НИЧЕГО НЕ ПРОИЗОЙДЕТ;

2. Только способом предоставления информации и чувствительностью (настраиваемый параметр у большинства, известных мне, индикаторов. Измени период обсчета - изменится и чувствительность). Правда, с появлением фильтров, возможно, меняется и качество? Пока не возьмусь судить однозначно...

3. Только из личных предпочтений. Тот из них, который больше нравится (сигналы которого Вы изучили лучше всего), тот и Ваш.

4. Этого я не знаю, и не стремлюсь узнать. На мой взгляд, рынок в комплекте с возможностями терминала представляет собой уже готовую МТС - и незачем велосипед изобретать!

Может показаться, что я вообще противник всяческих индикаторов. Впрочем, не я один: когда я впервые опубликовал в Интернете свои стратегии, и один из трейдеров решил протестировать их, он написал в дискуссионном листе: "Такое впечатление, что индикаторы только мешают!".

Нет, я не противник индикаторов. Но каждый трейдер просто обязан изучить их поведение не только по книжкам, но и на практике. Огромную роль в этом играет наблюдательность. Например, в поведении некоторых индикаторов я заметил закономерности, которые в описаниях мне не встречались. Например, стохастик: в классике он считается нетрендовым индикатором. Многие трейдеры в тренде им не пользуются вообще. Однако, по моим наблюдениям, он довольно неплохо говорит о том, почему развернулся рынок - коррекция это текущего тренда, или нечто более серьезное. Понаблюдайте за ним в тренде - если цена развернулась, и прошла в обратном направлении небольшую часть предыдущего сильного движения, а стохастик за это же время проскочил расстояние большее, чем он шел по тренду, это явный сигнал коррекции. (См. рис. 1).

Рисунок 1. Стоило ли волноваться, когда образовалась белая длинная свеча в конце периода коррекции, и закрывать прибыльную короткую позицию?

Стохастик говорит - нет! И он прав, однако... Умница мой... ☺



Я называю это (для себя, Вы можете найти другое определение) "обратной дивергенцией". Т. е., в литературе рекомендуется на даун-тренде отслеживать расхождение (дивергенцию, по-нашему, по-простому... по-русски ☺) низов, я же отслеживаю (столь же внимательно!) еще и расхождение верхов. Стохастик при коррекции как бы запасается необходимым простором для дальнейшего длительного движения по тренду. И в этом качестве стохастику при работе в тренде цены нет!

То же и с другими индикаторами - наверняка многие из них имеют "недокументированные" свойства. Все зависит от внимательности трейдера и его способности отойти от только формальной трактовки показаний индикатора.

У меня есть три моих постоянных индикатора: OsMa, RSI, Стохастик. Тестировал я десятки, если не сотни индикаторов. Остановился на этих трех. Почему? Да потому, что эта тройка помогает мне получать деньги с мистера Форекса, и делает это ничуть не хуже своих, в том числе, и платных, конкурентов. А других назначений у индикаторов и нет. Ну, скажите, зачем мне изучать еще массу разных индикаторов? Блеснуть эрудицией в разговоре с коллегами? Но у меня другая цель прихода на этот рынок...

Хотя, приврал чуток... Сейчас, все-таки, на демо присматриваюсь к фильтрам. Новый подход, знаете ли... ☺

➤ Индикатор объема

Я столкнулся в сообществе трейдеров с каким-то необъяснимым пренебрежением к этому важнейшему, на мой взгляд, индикатору. Когда я попытался понять, в чем тут дело, выяснилось, что оказывается, трейдеры просто не знают, как трактовать его показания. В переписке с коллегами я столкнулся с приблизительно одинаковой оценкой: раз этот индикатор не показывает количества денег, пришедших на рынок или ушедших с него, то это и вообще не объемы, и он попросту врет, и он не показывает корректно ничего важного – все очень субъективно, ненадежно, расплывчато! Мне пытались объяснить, что, раз это тиковый объем, то и говорить нечего – какая, дескать, разница, сколько там тиков в единицу времени... И оценить силу быков или медведей на этом рынке, с помощью объемов нельзя!

Я решил выделить описание этого индикатора в отдельную главу, хотя это по объему и очень маленькая глава, чтобы подчеркнуть важность этого индикатора.

Действительно, это индикатор тикового объема. Но что он нам показывает? Если мы посмотрим на график любой валюты, мы увидим, что далеко не всегда максимальному объему соответствует самый большой торговый рэндж – бывает и так: нарисовалась маленькая свечка «волчок», или даже «дожи», хотя индикатор объема показывает значительный по размеру столбик. Как это понимать? А это значит, что цена действительно совершила множество движений (тиков), но в очень узком диапазоне – она никуда не шла, просто дергалась почти на одном месте. Но сдвинуть цену могут только деньги игроков, причем только быков или только медведей. Делаем вывод из увиденного: сейчас на рынке совершается много сделок (объемы значительны – цена постоянно дергается) но в обе стороны – деньги идут как от быков, так и от медведей. Ситуация на рынке неопределенная и нам лучше воздержаться от входа в торги.

Другая картина: объемы не очень велики, но на них образовалась ап-свеча, которая по размеру превосходит то, что принято считать волчком – следовательно, за то небольшое количество тиков, которое показывает нам индикатор, цена сдвинулась от предыдущего значения (уровень открытия), движение приобрело направление. Это говорит о том, что деньги идут, в основном, от быков. А если следующая ап-свеча образовалась на фоне растущего объема и сама имеет большую длину, то можно с уверенностью заключить, что к быкам присоединяются еще быки, и они сейчас значительно сильнее медведей. Если же, несмотря на растущий объем, свеча имеет размер, хоть и не больше предыдущей, но ту же направленность, то можно заключить, что медведи еще сопротивляются, но, все-таки, у быков сил больше – от них поступает больше денег – движение цены, как мы уже говорили, вообще может быть инициировано только деньгами.

К сказанному можно добавить, что индикатор объемов может действительно корректно отобразить картину рынка на таймфреймах от 4 часов и выше, на меньших таймфреймах значение показаний снижается из-за того, что в силу вступают такие факторы, как внутрисуточная «сезонность» - рынок меняет регионы, переходя из одной страны в другую, в течение рабочего времени меняется активность крупных игроков, и т. д. Временами могут «пошалить» брокеры на местах – мы это видим на графиках как «выбросы» - это и охота за нашими стопами, и, видимо, создание более выгодных условий для входа в собственную торговлю... Поэтому, безоговорочно доверять этому индикатору на, скажем, М5 не стоит. А вот посмотреть объемы после окончания торгового дня на дневных графиках – святое дело каждого трейдера! Для меня, во всяком случае, это обязательная процедура!

7. Кое-что об МТС

Давайте разберемся, что должна делать МТС? Ждать такого изменения в поведении цены, чтобы показания одного или нескольких индикаторов сконфигурировались определенным образом

и, после этого, сгенерировать и послать сигнал брокеру. Так? И поскольку индикаторы не управляют ценой, то цена, по-прежнему, вольна сама выбирать направление, темп и диапазон, и менять их. Так?

Не слишком ли сложно? Программист должен написать МТС, трейдер должен настроить и протестировать систему, установить ее в терминал. А потом? Цена должна воздействовать на индикаторы, индикаторы должны воздействовать на МТС, МТС должна воздействовать на брокера... Сам черт ногу сломит! А заправляет-то всем - ЦЕНА! Она первична, остальные только посредники между ней и брокером. Ну, грамотные, конечно, посредники, математику знают, но руководит-то всем цена! И только она! А исходя из этого, нельзя ли попроще: цена воздействует непосредственно на брокера? Как? Например, так: мы знаем из опыта уже не одного поколения трейдеров, что часто цена, после длительного болтания в узеньком коридорчике (флэт), прорывая какую-нибудь из его границ, начинает стремительное движение в сторону прорыва. Иногда это является смертью старого и зарождением нового кратко-, средне- или долгосрочного тренда. Иногда началом «строительства» нового канала. Таким образом, продуманно расставленные ордера GTC и сама цена и явятся системой, при которой, цена, коснувшись уровня GTC, сама сгенерирует приказ на проведение транзакции. А для инициализации выхода, другая система: цена + StopLoss. И опять: цена сама принимает решение о прекращении или продолжении трейда. Но, что архиважно, предварительно согласовав условия с трейдером, т. к. уровни-то (и GTC, и StopLoss) определяет он!

Чем не готовая система?

Вот в некоторых платформах существуют т. н. эксперты. Этот эксперт, наблюдая за каким-то индикатором, генерирует сигнал, скажем, на продажу. Когда этот сигнал выйдет, цена уже должна пройти в даун-направлении, ибо это она тянет за собой индикатор (любой!). Ну, а войти в торги эксперт сможет, если цена за минуту пролетает сотню пунктов, как мы это неоднократно наблюдали? Проблематично... А GTC - сможет.

Вот и все соображения на этот счет...

Впрочем, я никого не собираюсь убеждать, что МТС - это безнадежно. Честь и хвала ребятам, которые работают в этом направлении, за их труд.

И скромненько, курсивом, шепотом: *Сизифов, имхо...*

8. Пример механического входа в торги

Ну что ж, давайте поговорим о технологии входа в торги.

Вообще-то, этот элемент трейдинга является самым ответственным. От того, как и когда мы открыли позицию, зависит и успех торговой сессии вообще, и величина стоп-лосса, и нервы трейдера, в конце концов!

В этой главе я хочу рассказать о методе входа, который я называю механическим потому, что инициирует торговлю не трейдер маркет-ордером, а сам рынок. Задача трейдера сводится к поиску рынка, находящегося во флэте, и расстановке GTC-ордеров в обе стороны. Рынок сам выберет, когда и какой ордер ему запустить (см. рис. 1). Стоп-лоссы ставим на противоположной стороне канала консолидации, или, если канал для нас слишком широк, то на расстоянии, приемлемом для трейдера (читай - депозита). Лучшим индикатором для определения подходящего рынка и точек размещения ордеров, на мой взгляд, являются Полосы Болинджера (Bollinger Bands). Если канал консолидации имеет хоть небольшой наклон, полосы расходятся, если, после движения, рынок упокаивается, полосы сходятся. Идеальным случаем для входа будет ситуация, когда полосы параллельны (см. рис. 2). Впрочем, если Вы прокрутите график с этим индикатором назад, в историю, Вы без труда распознаете все участки, пригодные для входов. Внимательно и не спеша рассмотрите несколько валют, потратьте на это целый день, если понадобится, и Вы научитесь определять такие каналы на глаз. Здесь есть один нюанс - на этом рисунке вырезка из M15. Но такие спокойные участки бывают, все-таки, нечасто - даже во флэте рынок немножко штормит. В

этом случае, перейдите на соседний старший таймфрейм - главное не период графика, а именно параллельность полос.

Рисунок 2. Работа индикатора Bollinger Bands для определения точек входа

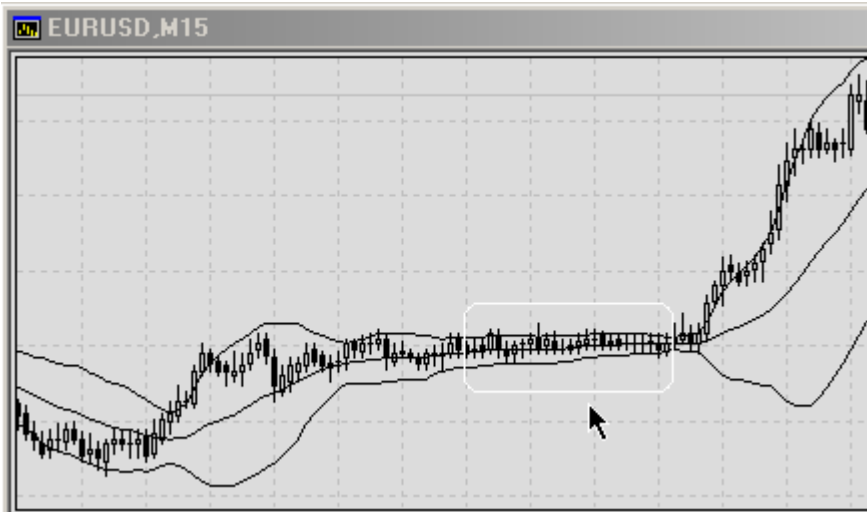
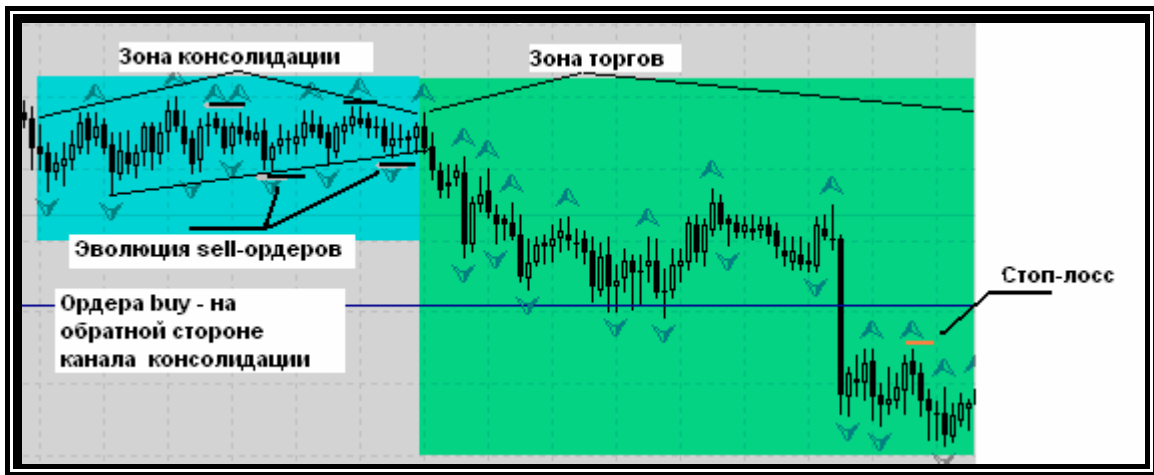


Рисунок 2-1. Принцип входа в рынок из флэта.



Кроме того, при таком способе входа и при небольшом депозите, следует сдвигать стоп на цену открытия сразу, как только позволит рынок. Очень часто случаются ложные пробой флэтового канала, что показано на рис. 3.

Рисунок 3. Рынок позволяет поставить безубыток - этим надо воспользоваться. Повторный вход в рынок в обратном направлении может быть запущен со старого ордера, но можно и передвинуть на следующий фрактал справа. О такой возможности сигнализирует повторный флэт, который начался после пробоя - он отмечен рамочкой.



На приведенном рисунке видно, что, вообще-то, произошло два ложных пробоя: после первого флэта выброс вверх, и после второго такой же выброс вверх. Но это нас мало волнует: на самом деле для нас произошел только один ложный пробой - после первого мы встали в безубыток, так что последствия этого пробоя не грозят нашему депозиту. Со вторым (если мы уже поставили на добавление вверх) придется смириться, прочитав главу об убытках, но вознаграждение следует незамедлительно - посмотрите на рисунок.

Я уже говорил и повторяю: на этом рынке мы, никогда и ни при каких обстоятельствах, не можем что-то утверждать. Мы можем только предполагать. Ну, в самом деле: мы строим линии сопротивления и поддержки, настраиваем кучу индикаторов, анализируем свечи, занимаемся еще черт знает чем... А в это время злой Бен Ладен "...ползет на берег, точит свой кинжал", Гринспен плетет свои козни... Для того чтобы точно утверждать, что рынок пойдет туда-то, нам придется позвонить Главному Террористу и справиться о его планах, позвонить Бушу и справиться о его здоровье, позвонить Трише... позвонить Гринспену... Господи, да так весь день на телефоне просидишь! А спекулировать когда?!

А если всех не обзовишь, откроешься по своему анализу, придут на рынок янки и слопают твой депозит...

Господи, как страшно жить!

Но мы тоже не лыком шиты: у нас есть программки с теханализом, и мы теперь открыли секрет американцев! Давайте посмотрим на 4-часовой график, особое внимание обратив на индикатор объема (см. рис. 4)! Когда на рынок приходят самые большие деньги? Именно с началом американской торговой сессии - на графике это соответствует 16:00 мск. И когда рисуются самые длинные свечки? В это же время! Вот он, страшный секрет американского рынка! Именно американцы вливают в рынок самые большие деньги! Именно их деньги способны сдвинуть рынок!

Они развернут рынок, куда захотят, в любую минуту! У нас нет столько денег... Нам с ними не справиться... Это как с паровозом бодаться... Нет, нам с ними не по пути...

Ой, ли?

Нам с ними, действительно, не справиться, да нам и не надо! Но нам с ними именно по пути! Мы просто обязаны идти вместе с ними – иначе смерть депозиту! И нам надо всего лишь научиться эксплуатировать этого страшного эксплуататора. Помните, в Кавказской пленнице? - "Тот, кто нам мешает, тот нам и поможет".

Идея проста и заключается в том, что мы должны сесть в ту же лодку, на которой собирается плыть этот американский Мальчиш-Плохиш - и пусть плывет куда хочет! Куда он, туда и мы! Он тянет вверх - и мы тут, он вниз - а где ж нам еще быть?!

А реализовать это очень просто: отложенный ордер.

Вот конкретная и простая, но краткая инструкция:

В 15:50 - 16:00 (приблизительно, конечно) мы начинаем анализ. Если рынок находится в консолидации, ставим отложенные ордера в обе стороны на прорыв канала консолидации (см. рис. 1).

Стопы на противоположной стороне канала.
End.

Рисунок 4. Иллюстрация к вопросу об использовании американской сессии. Вырезка из 4-часовки EURUSD.



Все то же самое, что сказано и в начале главы, только с уточнением времени!

Если рынок активен - меняем валюту. Столько раз, сколько потребуется, чтобы найти спокойный рынок. После того, как нашли, выполняем п.п. 1, 2, 3.

Все! Мы в лодке американского рынка. Теперь, куда бы он ни направился (посмотрите, как реагируют свечи на приход больших денег!), ему от нас не сбежать! Мы эксплуатируем ЕГО триллионы для получения СВОЕЙ ПРИБЫЛИ.

И кстати: время начала хорошего движения зачастую можно предсказать, посмотрев на расписание выхода важных новостей. Именно перед выходом таких новостей, рынок частенько и замирает в ожидании. И сразу же после их выхода начинается бешеная скачка, которая и откроет нашу позицию! В каком бы направлении эта скачка не началась! Если на день нашей торговли запланирован выход новостей по Америке, то установку ордеров надо произвести перед самым их выходом – ну, минут за 5 – 10.

Смотрите, что получается:

мы заставили эти бешеные деньги запустить нашу торговлю - это мы эксплуатируем их, а не они нас;

мы находимся на стороне очень больших денег, т.е. на правильной стороне рынка - мы идем в ногу с ним;

и нам не надо было гадать "любит-не-любит" (в смысле, "вверх или вниз?").

И теперь наша задача заключается только в одном: как только рынок позволит, сдвинуть стоп на цену открытия - можно даже трейлингом в 15 пунктов, но, чтобы трейлинг в дальнейшем не испортил нам торговлю, а вместе с ней и праздника души, его, после получения уровня безубытка, желательно сразу же удалить (см. правила), и перейти на «ручное управление». Иначе малейший рыночный шум, захлопнет преждевременно нашу торговлю и там, где мы могли бы взять 300 пунктов, придется ограничиться 30... В крайнем случае, изменить значение трейлинга на 50 - 60 пунктов.

В дальнейшем мы, в процессе управления данной торговой сессией, сдвигаем стоп-лосс согласно правилам (по встречным фракталам), и, если рынок позволяет, агрессивно добавляемся, сохраняя принцип безубыточности.

Мы здесь поговорили об Америке, но должен сказать, что никакой Америки я не открыл. Идея этой технологии входов в рынок принадлежит незабвенному Биллу Вильямсу - у него Вы можете прочитать подробности. Я только немного подкорректировал ее, исходя из личного опыта, под Форекс - это касается наиболее безопасного времени размещения ордеров. На столь коротком отрезке времени, минимальна вероятность запуска торгов шумовым дерганьем цены. Но она есть. Просто защищаемся стопами, и, если получаем убыток, читаем главу, посвященную убыткам.

И в качестве еще одного аргумента в пользу входа в торги с помощью GTC: если Вы ждете выхода важных новостей для открытия позиции, а еще неизвестно, в какую сторону двинут рынок эти новости, то сразу после опубликования их, начинается настолько стремительное движение рынка, что ни у одного брокера Вы не сможете открыться с маркета! Раз за разом Вы будете отдавать команду "Купить!... Купить!..." и раз за разом получать в ответ "Цена изменилась!... Цена изменилась!...". Иногда в течение одной минуты рынок проскакивает сотню пунктов, и Вы не сможете войти в торги, пока эта скачка не приостановится. А тогда уже и поздно, нам уже и не надо... ☹ И не очень, дескать, хотелось...

GTC же откроет Вашу торговлю, и позволит взять большую часть этого движения, остаться в торгах в безубытке на следующие скачки, продолжать агрессивную торговлю в тренде так долго, как долго будет существовать этот тренд.

Вот такие резоны.

9. Торговые стратегии

➤ Общие соображения

Вообще говоря, на белом свете есть очень много вполне работоспособных стратегий. Трейдеру есть из чего выбирать. Но почему-то очень часто, вполне, казалось бы, работоспособная стратегия приводит к потере депозита. В чем тут причина?

Скорее всего в том, что трейдер плохо усвоил правила торговли по выбранной стратегии, или считает, что ситуация вот именно сейчас требует каких-то других действий, а не тех, что записаны в этих правилах. Особенно сильно это явление проявляется после парочки убыточных торгов. Очень часто на трейдера движение цены действует завораживающе, я бы даже сказал, гипнотически. Если на глазах трейдера вдруг начинает шустро расти свечка, а у него нет открытых позиций, сам черт подталкивает руку к мышке, а мышку к кнопке... И в этот момент забываются слова автора стратегии о том, когда и как следует входить в рынок, что является сигналом, что подтверждением... И повторяется это раз за разом! Вот тогда-то и переходит трейдер из категории профитных трейдеров, в категорию убыточных. Именно с этого момента и начинается смерть трейдера и рождение банкрота.

Понимая свою назойливость в этом вопросе, я все-таки повторю: только безусловное соблюдение правил может привести трейдера к долгосрочной успешной работе на Форексе. Независимо от того, какую стратегию он избрал.

Теперь о стратегиях, которые я опишу в этой главе: они построены на механических действиях трейдера за монитором. Я использую принцип: пусть рынок делает что хочет, только пусть при этом не забудет и про меня. Если рынок не делает то, что я от него жду, то и я останусь вне рынка. Когда же он созреет для движения, то захватит и меня с собой. Такой подход представляется мне наиболее рациональным с точки зрения получения стабильных профитов и наиболее безопасным с точки зрения получения фатального лосса. Постараюсь объяснить, почему я так думаю: все мы время от времени читаем материалы разных-всяких аналитиков. Чаще всего в них мы знакомимся с общей картиной рынка, которая никогда не дает ответа на главный для трейдера-практика вопрос: КОГДА И КУДА ОТКРЫВАТЬСЯ? Мы наблюдали самые разные разрисовки самых разных стратегий, попытки самых разных предсказаний и прогнозов - увы, ни одна из них никогда не давала ответа на этот вопрос. Чаще всего лейтмотивом всех этих анализов в

разной форме является: «возможны два варианта... Или сначала отскок, или сначала сходит к уровню... Или, если пробьет, или, если не пробьет...». А что это дает действующему трейдеру в практическом плане? Ну, вот прочитал (или сам нарисовал) я такой анализ или прогноз, открыл терминал, и что? Что делать-то? Продавать? Покупать? Или туда-или сюда? КОГДА И КУДА ОТКРЫВАТЬСЯ-ТО?

Еще одно: зададимся вопросом - при анализе рынка возможны ошибки? Ну, там, ошибочное определение точек, или ошибочная разрисовка, или еще что-то ошибочное? Возможны.

И последнее: точно, безошибочно выполненный прогноз, самый тщательный анализ, самая грамотная разрисовка... И что? Рынок обязан оправдать правильный анализ? Ничего подобного! Рынок будет делать то, что посчитает нужным!

Вот такие соображения... Соглашаться или нет - добровольное дело каждого трейдера.

Сначала я хотел бы представить канальную стратегию, так как этот метод может быть использован как один из способов входа в тренд, затем мою любимую стратегию торговли по тренду.

Но прежде я хочу сказать, что учитывая то, что эта книга адресована, главным образом, начинающим, а они, как правило - внутривнедневные трейдеры, то я и рекомендации по той, или иной стратегии даю "внутривнедневные". Но считаю своим долгом предупредить: в большинстве случаев средне- и долгосрочный трейдинг является более прибыльным, менее рискованным, и, как это не покажется странным, менее стрессовым. Вот, посмотрите рисунок 5, иллюстрирующий это. Верхняя картинка - это 15-минутка на нисходящем тренде. Посмотрите, сколько фракталов, на которые, следуя правилам, мы должны сдвинуть стоп-лосс. Сколько раз наша торговля может быть остановлена преждевременно? Я пометил эти моменты красными стрелками. То-то и оно...

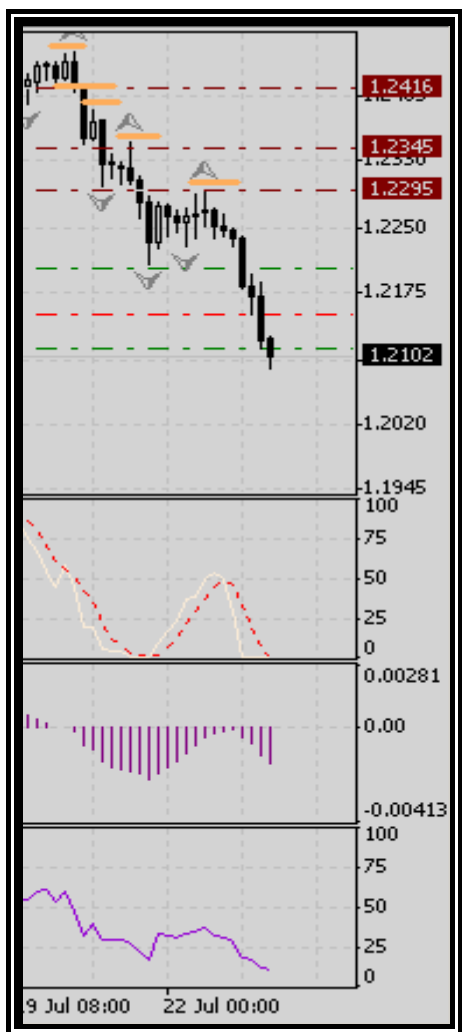
Теперь посмотрим нижний рисунок.

Рисунок 5.



Слава Господи, что все нужное Ты сделал простым, а все сложное ненужным!

Рисунок 5-1. Здесь тот же временной отрезок, но на 4-часовом таймфрейме. Если безоговорочно следовать правилам, то мы все еще в торгах и прибыль растет. Но это уже НЕ ВНУТРИДНЕВНЫЙ трейдинг!



На обоих рисунках красным штрихом показана эволюция стоп-лоссов, а черным штрих-пунктиром - эволюция добавлений

Если Вы работаете внутридневно, то выхода два:

следовать правилам неукоснительно, и ограничиваться той прибылью, которую позволит взять рынок;

следовать правилам неукоснительно, но использовать для управления сессией больший таймфрейм, который, с одной стороны, позволит держать позицию столько, сколько посчитает нужным сам трейдер, а, с другой стороны, приведет к пониманию, что прибыли надо дать расти. Хоть день, хоть неделю.

Впрочем, по моему глубокому убеждению, трейдер не должен себя жестко причислять к категории внутридневных, или внутринедельных, или еще каких-то трейдеров. Пусть длительность торгов определяет рынок. Если Ваша позиция закрылась в день открытия, прекрасно : сегодня Вы - внутридневный трейдер. Если она простояла, принося прибыль три недели, еще лучше, Вы - внутримесячный. А для того, кто согласен с такой постановкой вопроса, я дам следующие рекомендации по управлению торговой сессией:

при работе в тренде, избежать преждевременного закрытия позиции, и не пропустить при этом возможностей для агрессивного добавления, возможно при соблюдении следующего правила: управление торгами мы производим на меньших таймфреймах (скажем на M15), на которых ищем возможности для размещения ордеров добавления (соблюдая принцип безубыточности!). А стоп-лоссы переносим только после полного завершения отката. Полным завершением считаем

пересечение фрактала, на котором выставлен GTC на добавление, и запуск добавляемой позиции. В этом случае, стоп-лосс переносится выше (ниже) самого верхнего (нижнего) фрактала, который образовался на коррекции на этом же таймфрейме, но это не будет БЛИЖАЙШИЙ встречный фрактал на этом таймфрейме. Это может быть и второй, и пятый встречный фрактал.

➤ Канал

Вход:

Строим канал (на часовке и (или) 4-х часовке) по двум минимумам и одному максимуму, или по двум максимумам и одному минимуму (как только таковые прорисуются на графике).

Торгуем не внутри канала, а от его границ внутрь.

Входим в торговлю при достижении ценой одной из границ и появлении НА ИНДИКАТОРАХ сигнала разворота.

До начала разворота цены ставим отложенный ордер в противоположном направлении, если не уверены в безусловном развороте цены. При выходе цены за границу канала, ордер все равно ставим ТОЛЬКО ВНУТРИ КАНАЛА. Если цена после пробоя границы возвращается в канал, ордер открывается внутрь канала в предположении, что пробой был ложный.

3. При открытии позиции стоп-лосс ставим за пределами канала, но не ближе! 50 пунктов от цены открытия.

Трейд

Управление торговой сессией проводим на меньших экранах Элдера, если Вы внутриденный трейдер. Таймфрейм выбирается в зависимости от волатильности рынка и личных предпочтений трейдера. Схема управления приведена на рис. 6.

Рисунок 6. Зелеными метками обозначены направления и точки размещения ордеров на открытие позиций, красные метки - эволюция стоп-лоссов в процессе торговой сессии.



Правила трейда.

Игнорируем все дерганья цены внутри канала.

Если ширина канала позволяет, применяем агрессивный метод добавления по стохастику на 5-ти или 15-минутке. Следим, чтобы при развороте цены, основная + добавленная позиция, закрываясь по стопам были безубыточными, т. е. чтобы в случае разворота против торговли или появлении выброса, лосс добавленной перекрывался профитом основной.

До завершения 1-го отката не меняем уровень стопа, после получения 1-го встречного фрактала ставим безубыток, если фрактал позволяет. Ориентиром является НЕ ФРАКТАЛ ± 1 пункт, а ЦЕНА ОТКРЫТИЯ ± 1 пункт!!!

При приближении цены к границе канала в направлении торговли, последовательно сдвигаем стоп-лосс и прекращаем ставить ордера на добавление (см. рис.6).

Если канал восходящий - НЕ ставим ордера на пробой вверх, если нисходящий - то вниз.

Рисунок 7. Объясняет, почему нельзя ставить на пробой вверх в восходящем канале. После каждого срабатывания Buy Stop-ордера, цена идет к нижней границе канала, принося убытки. Зеркальная картина, если канал нисходящий.



Очень часто восходящий или нисходящий (да и горизонтальный тоже!) канал является фигурой продолжения (флаг) текущего даун или ап-тренда соответственно, на более высоком таймфрейме. Например, восходящий канал на 4-часовом графике может быть флагом для даун-тренда на дневном графике. Поэтому не возбраняется ставить ордера на пробой восходящего канала вниз, но трейдеру следует помнить, что случаются и ложные пробои! Поэтому совет в такой ситуации может быть следующим: поскольку у нас уже открыта торговля вниз от верхней границы, воздержаться от добавления до образования ниже (выше) границы канала попутного фрактала, и поставить ордер по нему. На рис. 6 показан пример размещения ордера для пробоя горизонтального канала вверх, на рис. 7 - восходящего вниз (стрелка, помеченная кружком). Важно только учитывать, что часто после прорыва канала (не ложного), цена очень стремительно уходит пунктов на 100 (особенно на американской сессии, после выхода важных новостей), поэтому и ловить эти фракталы следует на меньших экранах (начиная от M30, и вплоть до M5, а то и M1).

Меня часто спрашивают начинающие трейдеры: как увидеть конец тренда и начало строительства канала? Здесь можно дать рекомендацию такого рода: при движении рынка по тренду, попутные фракталы, образующие точки для агрессивного добавления, как правило пробиваются единожды трендовым движением. Например, при даун-тренде рынок пробивает их сверху вниз, и, затем, идет дальше. При коррекции же, рынок чаще всего не доходит до пробитого последнего фрактала. Когда текущий тренд начинает слабеть, то, во-первых, замедляется движение по тренду, что можно заметить по более коротким свечам, соответствующего тренду цвета, и во-вторых, рынок пробивает последний трендовый фрактал дважды – первый раз движением по тренду, второй раз – встречным движением коррекции. Как правило, в этом случае последняя добавленная позиция становится убыточной. Вот в момент вторичного пробоя фрактала, мы и можем предполагать начало строительства нового канала.

Если же это явление наблюдается при достижения значимого уровня сопротивления (поддержки), то надежность прогноза значительно повышается.

➤ Ошибки

Вход в торги «вдогонку» внутри канала. Ждать достижения границы канала.

Стоп слишком близко. Возможен выброс от границы канала.

Слишком ранний перенос стопа в безубыток. Ждать встречного фрактала, т. к. возможен возврат к границе канала. Если после возврата первый встречный фрактал в убыточной зоне, то стоп переносить по фракталу, а не по безубытку. Но!...

Иногда предпочтительнее ставить стоп в безубыток СРАЗУ, КАК ТОЛЬКО РЫНОК ПРЕДОСТАВИТ ТАКУЮ ВОЗМОЖНОСТЬ. Это относится, например, к случаю, когда размер депозита особенно не позволяет принимать убытки: для него - депозита - предпочтительнее не получить никакой прибыли в данной сессии, чем получить убыток, в случае срабатывания стоп-лосса. Или при входе в торги на длительном флэте, когда риск ложного выхода цены из флэтового коридора достаточно высок (см. рис. 3)

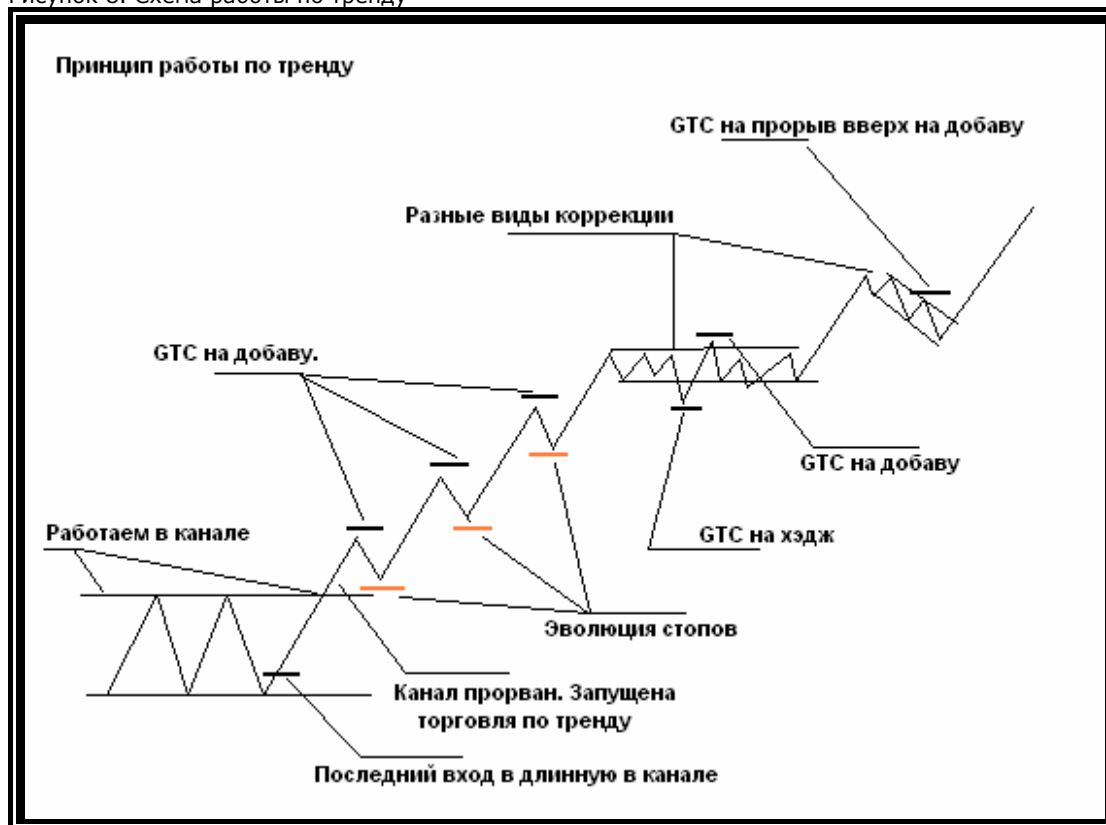
Преждевременное закрытие позиции. Терпение!

Ручное закрытие позиции. Только близким стопом! И только при приближении к границе! Иначе мы будем выбиты из очень выгодных торгов, в случае истинного пробоя канала.

➤ По тренду

Торговля возникает после прорыва канала. В идеале, когда пробивается граница канала, мы уже держим открытые позиции - те, что инициировали в канале, от противоположной его границы. Таким образом, мы уже находимся в тренде, и нам не надо ломать голову, когда входить в торги (см. рис. 8)

Рисунок 8. Схема работы по тренду



Но это в идеале! А как быть, если мы не имеем позиций? А тогда искать возможности для входа. Ордера GTC на прорыв можно ставить: в восходящем канале - только StopSell, в нисходящем - только StopBuy! В обе стороны можно ставить на прорыв, когда цена находится в ГОРИЗОНТАЛЬНОМ КАНАЛЕ, ИЛИ ТРЕУГОЛЬНИКЕ! (См. рис. 6 и 7).

Идеальная ситуация для входа - длительный флэт в очень узком канале (хорошо индицируют, как я уже говорил выше, полосы Боллинджера). Ставить отложенные ордера в обе стороны в этом

случае лучше с началом американской сессии (около 16 часов мск.). Впрочем, этому уже посвящен целый параграф - не будем повторяться. (См. рис. 2).

Стопы - на обратных сторонах канала. Следить постоянно, ибо может быть ложный прорыв, т. е. выброс. Возможен вход на коррекции. Следует дождаться сигналов окончания коррекции на 30-минутке и даже (в неявных случаях) на часовке, и выставить отложенный ордер в сторону тренда. Если разворот носит явный характер (фигуры "на горку", или "с горки", например), можно открыться и вручную.

Так же вручную можно открыться, если Стохастик показал окончание коррекции (См. главу об индикаторах).

При флэте **НЕ ПЫТАТЬСЯ ПРЕДСКАЗЫВАТЬ НАПРАВЛЕНИЕ ПРОБОЯ И ПОСЛЕДУЮЩЕГО ДВИЖЕНИЯ - ПРОСТО СТАВИТЬ ОРДЕРА!!!**

СЛЕДИТЬ ЗА УРОВНЯМИ СОПРОТИВЛЕНИЯ и ПОДДЕРЖКИ! Если торговля проходит рядом с важным уровнем, не ставить отложенных ордеров в его сторону - возможен ложный пробой уровня и отворот от него в другую сторону! В случае пробоя уровня - следить за поведением цены. Если вернется к уровню и начнет отворачивать (раскаяние трейдеров - по Элдери, по-моему...) - поставить отложенный ордер по фракталу (см. рис 9).

Рисунок 9. Раскаяние трейдеров: пробой нижней границы, затем возврат к ней, затем, после некоторого раздумья - ралли в сторону пробоя. Если бы мы, исходя из предположения, что пробой ложный, поставили GTC на покупку внутри канала, ордер не сработал бы, и не принес убытков. А ордер на продажу, поставленный после пробоя по фракталу в отмеченной зоне, добавил к текущей прибыльной позиции еще одну, так же прибыльную.

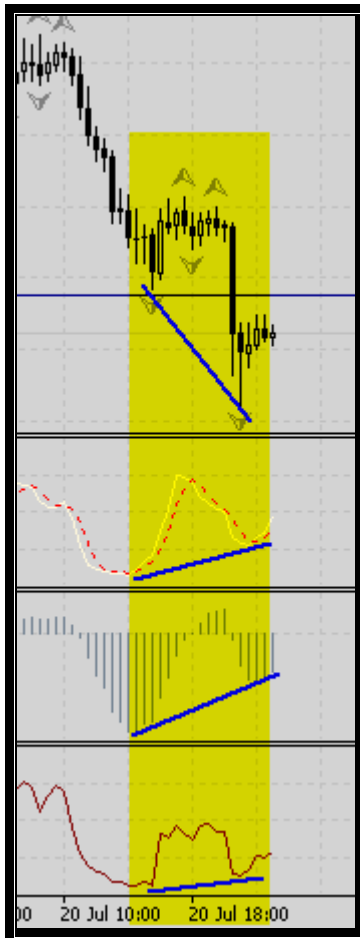


ДОБАВЛЕНИЕ ТОЛЬКО ПРИ ВЫПОЛНЕНИИ УСЛОВИЙ БЕЗУБЫТОЧНОСТИ!

Готовиться к закрытию по подтвержденным всеми индикаторами дивергенциям на 4-х часовой, или по двойной дивергенции на часовой и ниже. Выходы только по стоп-лоссам - дивергенциям нельзя доверять на 100%. Но ДОБАВЛЯТЬСЯ ПРЕКРАЩАЕМ, т. к. может быть выброс, который запустит позицию и приведет её к стопу с убытком. Стопы всегда по фракталу последней коррекции. Последнюю добавленную позицию хэджирем встречной позицией с количеством лотов равным, или на единицу меньше, чем содержит последняя добавленная.

Слава Господи, что все нужное Ты сделал простым, а все сложное ненужным!

Рисунок 10. К вопросу о хеджировании. Дивергенции на M30 (вверху) и 5-минутке (внизу), подтвержденные всеми тремя индикаторами (подсвеченная область). Внизу ценового графика на M5 образовался дожи (помечен овалом) с длинной нижней тенью - дополнительное подтверждение. Стоит открыть встречную хеджирующую позицию.

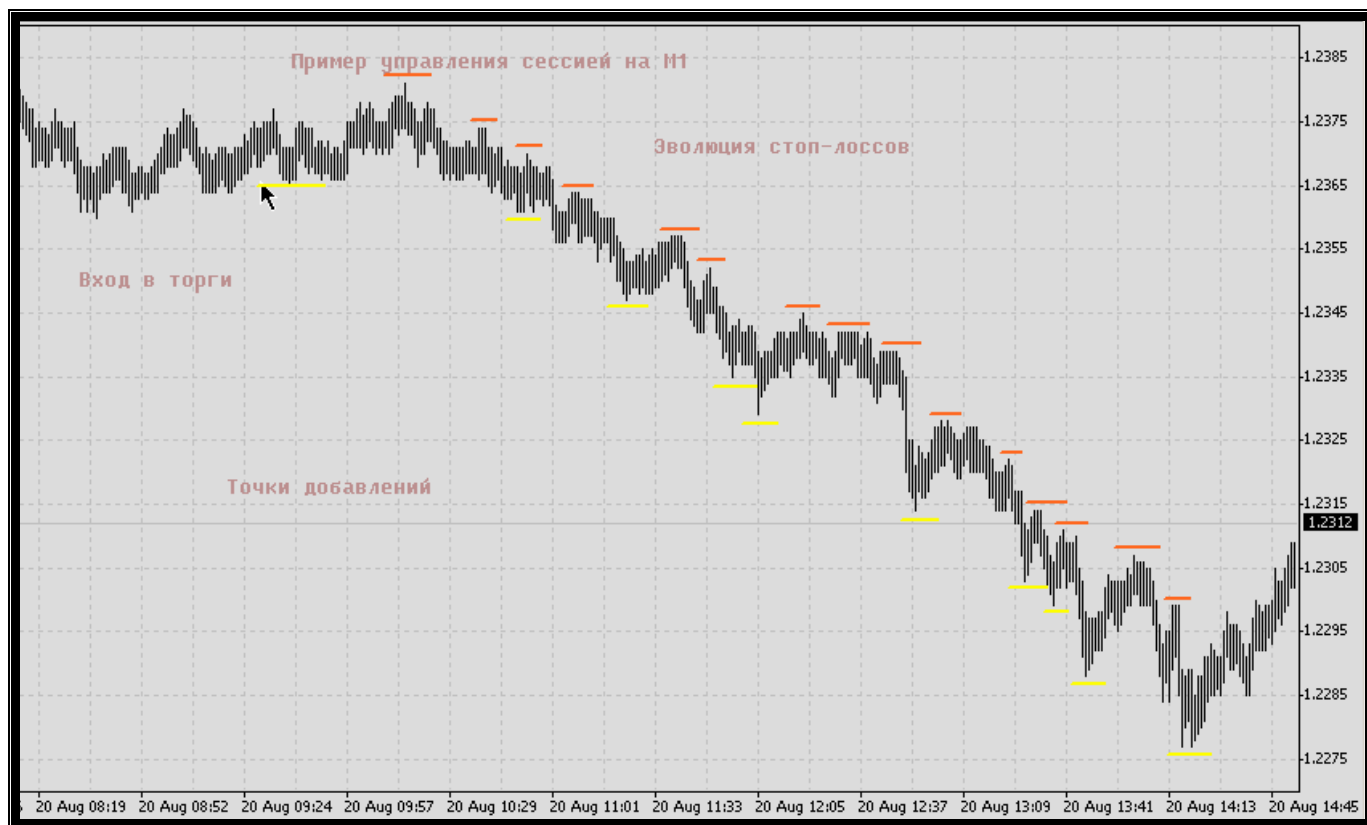




➤ **«Быстрая» торговая сессия**

Эта стратегия (по тренду) может быть очень эффективной при использовании для управления сессией таймфрейма М1. При этом, ее можно с успехом использовать как для агрессивного входа в долгосрочную торговлю, так и в качестве самостоятельной внутридневной торговли (см. рис. 11)

Рис. 11 Управление сессией на М1. Желтыми метками показаны точки возможных агрессивных добавлений, красными – эволюция стоп-лоссов.



На этом рисунке видно, что вся торговля, начавшись из флэтового канала, проходила всего с 10:28 до 14:30. При этом рынок предлагал менее 100 пунктов, но, используя стратегию «по тренду» с агрессивными добавлениями, взять у него можно было более 400 пунктов прибыли.

Но это что касается внутридневной торговли. А есть еще один вариант использования этого метода – агрессивный вход в торги.

➤ Агрессивный вход в торги

Эта метода изобретена не мной, я ее не применяю, но коль скоро она используется в практическом трейдинге, то я считаю своим долгом познакомить с ней и читателей. Автором ее является один мой приятель, который, являясь человеком, в общем-то, здравомыслящим и самокритичным, говорит о себе: «Я патологически жаден на рынке! Я не могу позволить себе видеть, как хоть одна из прибыльных позиций становится убыточной – я закроюсь, несмотря на все хэджи и все расчеты по безубыточности!»

Вот для борьбы с этой жадностью, он и изобрел эту методику, которая заключается в следующем: сразу же, после срабатывания запускающего ордера, он начинает добавляться, используя именно М1. На первых 35-50 пунктах он уже имеет 2-3-4 позиции. После этого все добавки прекращаются! Он просто ждет окончания движения, перенес стоп-лосс на цену открытия последней. Как правило, рынок в конце серьезного движения начинает свои «канальные игры». Так вот, Саша, как зовут моего приятеля, работает в канале так, как будто у него нет открытых позиций. Коррекция на сильном тренде редко вернет рынок в первую четверть своего движения, поэтому эти его позиции мало рискуют. А по тренду, как и обычно стоит ордер на добавку на пробой канала + торговля от нижней границы канала. Если этот ордер на пробой срабатывает, картина повторяется – открываются еще 3-4 позиции в самом начале движения, опять переносится стоп-лосс в безубыток последней из них, и опять ожидание, но уже имея в торгах 6-8 позиций! И

при этом он исключает для себя муки видеть убытки на мониторе. И даже, если его торговля в канале принесет какой-то лосс, то этот лосс ляжет на прибыль, а не на депозит.

Здесь следует оговориться, что применяется им эта тактика - для входа в долгосрочную торговлю, когда определенлся тренд и ему не хочется закрываться по принципу «синицы», т. е., «схватить и убежать» (См. рис. 12).

Рис. 12 Принцип агрессивного входа в долгосрочные торги, позволяющий ослабить давление рынка на психику трейдера.



➤ Хэджирование рисков

Впрочем, хэджирование – это такая тонкая штука, что когда я впервые в дискуссионном листе заикнулся о нем, на меня яростно обрушились сразу несколько человек – противников этого вида защиты и увеличения прибыли в текущей сессии! Как только не называли мои высказывания: и бредом, и вредными, и инструкцией для лохов. А когда я просто открыл демосчет и продемонстрировал сообществу хэдж в действии, назвали это просто ловким трюком, ни больше, ни меньше! Правда, нашлись и мои сторонники – именно благодаря их поддержке, я и отваживаюсь писать этот раздел.

А рассказываю я это потому, что противников хэджирования своей торговли встречной позицией, действительно, много. Кое в чем они, может, и правы, но высказывания типа: «Хэджирование только дарит брокеру спрэд, делая дороже нашу торговлю и ничего не давая

взамен», у меня вызывает только улыбку. При этом я не настаиваю на обязательном применении хэджирования всеми, если кто-то не видит в этом приеме пользы – ради Бога!

Но однажды меня спросили: «а почему нельзя сохранить прибыль на основной позиции, закрыв ее, а по завершению отката, вновь открыться в этом же направлении, сэкономив таким образом на спреде?» Да можно, конечно! Только для того, чтобы поступить именно так, надо быть абсолютно уверенным, что это не разворот рынка, а именно коррекция. Если же это, все-таки, смена текущего тренда, хотя мы и уверены в обратном, то, когда основная (или основные) позиция закроется по стоп-лоссу, имея хэджирующую позицию мы останемся в торгах, причем открытых по самой выгодной для нас цене.

А что касается «экономии на спреде», то я, помню, ответил тогда, что самая большая экономия будет, если вообще не открывать позиций. Никаких и никогда! А хэдж, кроме того, часто приносит и прибыль, если своевременно перенести стоп-лосс в прибыльную зону, или закрыть его вручную, когда появятся сигналы возврата рынка на текущий тренд.

Но даже если хэджирующая позиция закроется по стоп-лоссу с убытком, это не повредит нашему депозиту, т. к. нарастающий убыток от хэджа, при движении рынка в сторону его стопа, будет перекрываться нарастающим профитом основной.

И есть еще одно немаловажное значение у хэджа – психологическая разгрузка трейдера. Когда после хорошего движения, рынок останавливается и начинает непонятную пляску, защитив свою торговлю хэджем, трейдер может спокойно переждать «трудные времена», и, после того, как рынок определится в направлении, принять решение о дальнейших действиях. При этом переждать трейдер будет вполне комфортно, зная, что его прибыль уже у него в кармане, депозиту ничто не угрожает, он в безопасности. И зная, что у него есть шанс сохранить прибыльную позицию с тем, чтобы дать прибыли расти.

Очень часто начинающие трейдеры задают вопрос: когда следует открывать встречную позицию? Что является сигналом к ее открытию?

У каждого трейдера в терминале стоит свой определенный набор индикаторов – исходить будем из этого. Так вот: общий анализ рынка мы проводим на 4-х часовом таймфрейме, а управление торгами на меньшем экране - том, который трейдер выбрал для себя, исходя из личных предпочтений. Допустим, что наша торговля находится в ап-тренде, основная позиция уже получила какую-то прибыль. Наблюдая за индикаторами на том экране, где мы управляем торгами, мы обнаружили сигналы разворота рынка. На моих индикаторах это будут, например, дивергенции, причем для меня важно, чтобы эти дивергенции были подтверждены всеми тремя индикаторами (см. рис 10). У других трейдеров это могут быть другие индикаторы и, соответственно, другие сигналы: пересечение скользящей средней, например, или пробой границы облака в Ишимоку... Словом, трейдер должен знать свои индикаторы и их сигналы.

Получив такие сигналы, мы должны просто поставить GTC-ордер в обратном направлении. Если цена не оправдает ожиданий и не сменит направление, то и ордер не сработает, и убыточной позиции не будет.

Второй способ: тот же ап-тренд, но после длительного хорошего движения, рынок вошел во флэт (так часто бывает). Здесь все еще проще: мы поставим ордера по правилам входа (в обе стороны), и получим либо добавление к текущей позиции, либо хэдж – рынок сам решит, что нам нужнее ☺.

Вообще-то, следует учитывать такую закономерность в поведении рынка, как обязательная коррекция после особенно сильных движений. Если, скажем, после выхода какой-то важной фундаментальной новости по США, рынок делает стремительный скачок пунктов на 120-150, то трейдер просто обязан быть готовым к последующему встречному движению. В этом случае хэджирующую позицию можно открывать просто при развороте индикаторов в обратном направлении. Вероятность ошибки в этом случае, минимальна.

➤ Ошибки:

Вход маркет-ордером на резком подъеме (падении). Даже если брокер позволит открыть позицию, скорее всего последует коррекция и она будет глубже, чем выставлен стоп.

Ранний сдвиг стоп-лосса после входа в торги. Он должен располагаться по БЛИЖАЙШЕМУ ВСТРЕЧНОМУ ФРАКТАЛУ! Если размер депозита не диктует встать в безубыток сразу же, как только рынок позволит.

Преждевременное хэджирование. После получения сигнала о развороте (дивергенция), обычно цена еще немало проскочит в том же направлении до окончательного разворота. Ждать! или хэджировать ордером ГТС.

10. Нестандартные ситуации на рынке Forex

Вообще-то, честно говоря, я не знаю, что называть стандартным, а что нестандартным на этом рынке. Все, что может произойти с ценой, уже когда-то происходило и еще будет происходить, что-то, что не укладывается в рамки логического объяснения, на рынке встречается на каждом шагу, совершенно неожиданные пируэты цена совершает в самые неподходящие моменты... Объяснить все выкрутасы рынка вам не сможет никто и никогда. А вот ждать этих выкрутасов нужно всегда и всегда быть готовым принять их. В первую очередь это относится к ограничению возможных убытков. Во вторую, к защите прибыли. И, наконец, к выбору времени входа в торги. Давайте условимся, что нестандартной мы будем называть ситуацию, когда на рынке невозможно применить ни одно из правил описанных стратегий – рынок не обеспечивает необходимых условий.

➤ Гэп

Давайте рассмотрим одну из ситуаций, которая требует особых действий именно при входе в торги – гэп.

Постараемся понять, откуда берется разрыв, иногда значительный, между двумя торговыми сессиями. Здесь вряд ли можно что-то утверждать уверенно, но предположить можно: допустим, мы в пятницу «проводили» рынок по цене закрытия «Х», а в понедельник «встретили» по цене открытия «У». Причем разрыв между ними составляет 20-30 пунктов, а то и более...

Этот разрыв может быть обусловлен несколькими причинами, первая из которых - какие-то события, происшедшие в мире за выходные. Мы бросаемся изучать новости, и, если ничего экстраординарного не произошло, то встает вопрос: откуда?

Можно гадать, конечно, что это: хитрость брокеров на местах, чтобы получить более выгодную торговлю для себя, попытка развернуть рынок (обычно в месте разрыва формируется уровень сопротивления или поддержки), попытка срубить наши стопы... Но что бы это ни было, остается вопрос: что в такой ситуации делать? Ответ один: ждать! Если разрыв произошел на даун-тренде вниз и рынок движется вверх, нельзя открывать торговлю, пока гэп не будет закрыт полностью. Только после этого можно искать возможность для входа по тренду. Если же рынок идет в сторону разрыва, т. е. вниз, то можно предположить, что уровень сопротивления, образовавшийся на гэпе, достаточно силен, и рынок может сохранить направление, или начать строительство канала. Вообще, эта ситуация должна быть охарактеризована как неопределенная. А на неопределенном рынке торговать не рекомендуется.

➤ «Пьяный кенгуру»

Еще одна ситуация, которую иллюстрирует рис. 13 – поведение рынка, когда он попросту не знает, чего хочет.

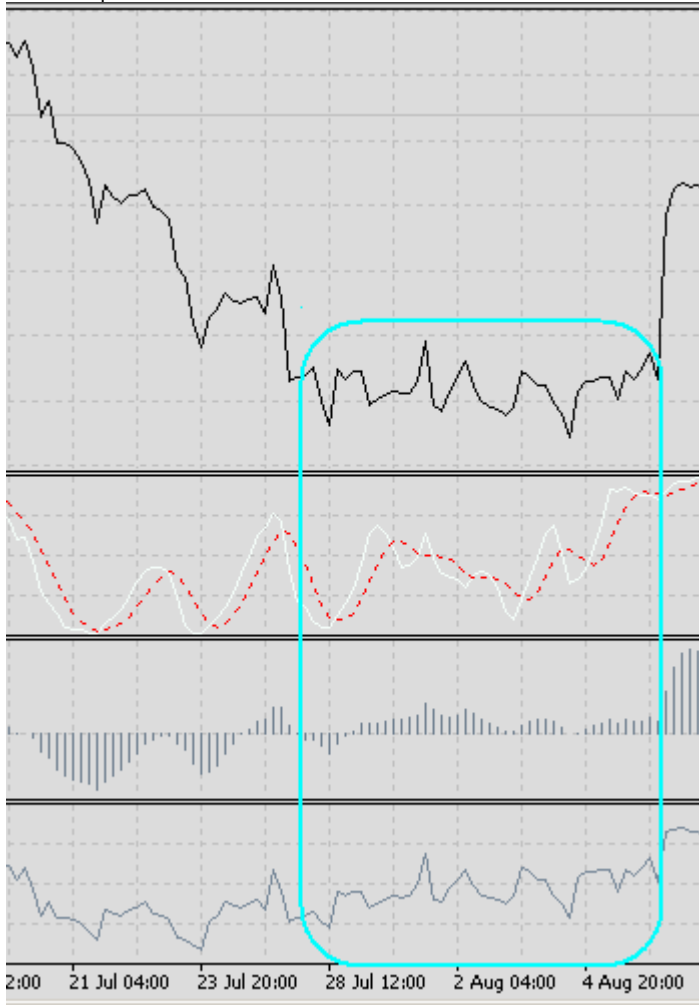
Рис. 13 «Смутные времена» на рынке. Обратите внимание на поведение индикаторов.



Взгляните на график: в выделенной рамкой области рынок ведет себя «никак» - нет трендового движения, нет «правильного» канала, нет флэта... Пьяный кенгуру, да и только... И это продолжается довольно долго – с 27 июля по 5 августа! Какая-то пляска святого Витта!

Правда, здесь более или менее ясно, что происходит, хотя совсем неясно, как торговать. Видно, что рынок пришел в эту зону сверху. Столь резкое торможение свидетельствует о том, что цена натолкнулась на мощную линию поддержки. Если посмотреть линейный график (рис. 14), то явно видны попытки пробить этот уровень. Но все они раз за разом проваливались. Отсюда, с большой долей вероятности, можно сделать предположение, что мы наблюдаем завершение даун-тренда.

Рис. 14 Окончание даун-тренда и рождение ап-тренда. Переходный период неблагоприятен для торговли, лучше находиться вне рынка.



Только вот как торговать в этот период, совершенно неясно! Посмотрите на индикаторы – как трактовать их показания? По-моему, трактовать их нужно совершенно однозначно – рынок непредсказуем, входить в торги опасно, стоим в стороне, но в голове держим сценарий рождения ап-тренда. Только вот когда это произойдет? Сейчас, постфактум, знаем, что вечером 5-го августа, но это сейчас! А еще утром 5-го, этого не знал никто. Только выход новостей по США разрешил эту загадку и подтвердил наши предположения. А они, эти предположения, позволили нам не пропустить хорошую торговлю. Но, повторю, это уже потом. А до образования этой длинной белой свечи, которая видна справа на рисунке 13, рынок был в неопределенном состоянии. А на неопределенном рынке торговать не рекомендуется. В это время можно почитать главу «Ждем-с...»

А как вообще определить, можно, или нельзя вот сейчас торговать? Ведь все эти уже нарисованные рынком картинки легко объясняют прошлое, а как понять сиюминутную ситуацию? Что должно служить критерием определения «неправильного» поведения рынка?

У меня нет на это однозначного теоретического ответа. Боюсь, что его нет ни у кого. А вот практически можно считать, что сейчас на рынке скачет пьяный кенгуру (или, если угодно, бешеный кузнечик), если Вы, СОБЛЮДАЯ ПРАВИЛА дважды входили в торговлю и дважды подряд получили убыточные торги, т. е. рынок дважды повел себя нестандартно. Не следует испытывать судьбу, лучше, облокотившись на посох, постоять в сторонке мудрым созерцателем.

11. В заключение

Я понимаю, что очень многие трейдеры могут сказать: только вторая часть книги и содержит что-то интересное. Остальное – чушь, вода, флейм, бред сивой кобылы!

Я абсолютно уверен, что это не так! Вторая часть содержит только описания стратегий – а этого добра в литературе хоть отбавляй!

Именно первая часть данной книги не выдумана, не вычитана, а выстрадана! Автор прошел тот путь, в начале которого сейчас стоят многие из вас, коллеги. Автор искренне хотел бы помочь вам всем уберечься от тех ошибок, которые неизменно совершает подавляющее большинство трейдеров в начале своей карьеры, и которых он сам нагородил в свое время предостаточное количество!

Я понимаю так же, что в данной книге невозможно охватить ВСЕ аспекты такого огромного и сложного механизма, каковым является Форекс. Но если попытаться описать этот механизм подробно, то понадобится писать огромный многотомный труд – автор не ставил перед собой столь амбициозной цели. Именно поэтому все материалы по практическому трейдингу носят несколько схематичный характер – каждый трейдер, поняв принципы, заложенные в этих материалах, сможет без труда приспособить их под себя. Я позволю себе привести два высказывания практического трейдера, которое он выдал в двух своих постах в моем мастерклассе – при этом я привожу их в оригинальном виде, не редактируя:

*«Дождался касание верхней границы канала у фунту, потом бы дивер на Стохастике...
Вообщем пока вниз идем... + там еще был маленький канал, идем к нижней границе...»*

На евро за последнюю 2 недели на демо с 1400 по стратегии до 4000 вытянул, работает кто же сомневался...

*На реале с 117 у.е. до 300 у.е. ... с грубыми нарушениями, как говорил Станислав **если все строго соблюдать***

утонуть практически не возможно, но конечно надо кое-какой опыт...

И он меня просто заставил думать о том, что не важно куда и что идет и не важно кто что там говорит и анализирует, не НАДО гадать... ПРОСТО иди за рынком...

В качестве важности этих слов, можно почитать Трампа, Черепах...»

«Цит: На евро за последнюю 2 недели на демо с 1400 по стратегии до 4000 вытянул, работает кто же сомневался... Конец цит.

Но... это загадочное но...

***До этого с 3000 удачно было слито в попытках как то сделать лучше,
и когда остался шаг до пропости - решил работать как написано... и О... полетел!!»***

Я только выделил слова, которые мне кажутся важными. И еще: две недели, о которых говорится в этих постах, были не очень благоприятными для торговли – рынок, по своему поведению, приближался к «пьяному кенгуру», работать можно было преимущественно только внутри дня.

Ну и совсем в заключение: мы, трейдеры, не являемся конкурентами. Сколь успешными спекулянтами ни станете Вы, сколько миллионов долларов ни заработаете на этом рынке, МОИХ денег Вы с рынка не заберете! Мои деньги останутся моими, при любом вашем успехе. Поэтому мне нет смысла обманывать вас или скрывать какие-то секреты. Все, что я говорю – проверено, проверено, и еще сто раз проверено. И вам отдаю на проверку – тестируйте, улучшайте, приспособливайте под себя и ЗАРАБАТЫВАЙТЕ!!!

И попутного вам тренда!

С уважением

Ваш

S. Grebenshikov.

gretys@mail.ru

12. Благодарности

Я выражаю искреннюю благодарность моим коллегам – трейдерам, которым я доверил оценить этот мой скромный труд, и написать свои рецензии по книге. Эти люди внесли неоценимый вклад в её написание, делая замечания, предлагая вопросы, ответы на которые они хотели бы видеть на её страницах, высказывая критические замечания, и указывая на ошибки. Особая благодарность за их моральную поддержку - без неё эта книга вряд ли состоялась бы. Всех их я считаю своими друзьями!

Среди них:

- Владимир Николаевич Тимофеев, г. Отрадный Самарской области;
- Александр Мочалов, г. Днепропетровск;
- Михаил Борисович Сироткин, г. Выборг, Ленинградской обл;
- Владимир Баянов, г. Волгодонск;
- Владимир Богомолов, г. Владивосток;
- Елена Реутова, г. Москва;
- Ваграм Саядов, г. Рига;
- Артем Слоболинский, г.Днепропетровск;
- Георгий Пичугин [Dr.Scalper], г. Мирный.