

«Как торговать на валютном рынке»

Вводный курс.

**Урок №10 «Зачем нужна торговая система?
Пример торговой системы»**

Содержание вводных уроков:

Урок 1. Не бойся быть богатым!

Урок 2. Что такое FOREX?

Урок 3. Маржинальная торговля

Урок 4. Сделки на FOREX

Урок 5. Ордера и некоторые особенности совершения сделок

Урок 6. Основные понятия технического анализа

Урок 7. Что такое «Индикаторы»?

Урок 8. Что такое «Фундаментальный анализ»?

Урок 9. Психология трейдинга

Урок 10. Зачем нужна торговая система? Пример торговой системы

Урок 10. Зачем нужна торговая система? Пример торговой системы

Чтобы снизить влияние психологического фактора и систематизировать свою торговлю на валютном рынке, трейдеры используют торговые системы. Роль торговых систем заключается в предварительном планировании сделок подобно тому, как бизнес-план регулирует развитие предприятия. Что же представляет из себя торговая система?

Торговая система – это набор правил, определяющих, при каких условиях и в каком порядке осуществляются открытие позиций и их закрытие. Правила торговой системы должны быть четко определены, чтобы не допускать двоякого рассмотрения ситуации. Именно жесткое определение критериев и условий для входа в рынок и выхода из рынка служит основным инструментом снижения психологического давления на трейдера в момент принятия им важного решения о совершении сделки.

Торговая система должна быть сформулирована трейдером до того, как он приступает к торгам, а проводимые затем сделки должны строго соответствовать правилам системы.

Различные торговые системы обладают разным набором правил для определения момента входа в рынок и выхода из него. Сложные торговые системы накладывают массу условий для получения сигнала, и при этом очень часто сложные системы не облегчают, а усложняют жизнь трейдера. Поэтому важно соблюдать баланс между необходимостью в дополнительной информации и ее достаточностью.

Для начинающего трейдера хорошая торговая система, изученная и протестированная им лично на исторических данных, является спасительным кругом в водовороте ценовых движений, сопровождаемых взрывами в момент выхода важных новостей.

Торговые системы определяют детальный план работы трейдера на том временном фрейме, для которого разработана данная система. Можно говорить о торговой системе, разработанной для торговли на дневных свечах, на часовых или даже 10-минутных. Какая из систем больше подходит – решать Вам, тут многое зависит и от свободного времени, и от Ваших денежных ресурсов, но, прежде всего, это зависит от цели, которую Вы ставите для себя, придя на валютный рынок.

В процессе построения торговой системы трейдер должен решить, для каких участков рынка он готовит систему – для длительных тенденций или для боковых коридоров. Конечно, система может иметь и разные свойства, быть комбинированной, но все же нужно учесть такой момент: классические трендовые системы могут плохо работать в коридоре, и, наоборот, системы для работы в боковом рынке – не лучший выбор для работы в тренде. Поэтому чрезвычайно значимой задачей для трейдера является понимание того, для каких рыночных участков он строит свою систему, на каких участках имеющаяся система будет работать и как такие потенциально выгодные участки определять, находясь на правом краю графика, за которым – неизвестное нам будущее.

Достаточно важную роль при построении торговой системы играет величина торгуемого лота (сумма сделки). Эта величина может быть неизменной, а может меняться по результатам предыдущих сделок (это называется управлением капиталом или money management). Каждый из подходов обладает своими преимуществами и недостатками, и основной шкалой оценки служит соотношение риска к возможной прибыли. Чем выше доходность, тем, как правило, выше принимаемый риск, чем ниже риск, тем ниже доходность по сделкам.

Для определения моментов входа в рынок торговые системы дают сигналы с помощью различных инструментов графического и математического анализов. Применяются уровни, линии, графические фигуры, свечные конфигурации, технические индикаторы. В одной системе более важными могут быть индикаторы, в другой – фигуры или уровни; все зависит от предпочтений трейдера.

Тема разработки торговых систем обширна, ее следует обсуждать более подробно, причем после того, как новичок изучил более широкий спектр инструментов принятия решений, узнал о нюансах. Здесь же мы приведем пример простейшей торговой системы.

Пример простейшей торговой системы

- Внимание! Этот пример системы – всего лишь пример, а не рекомендация торговать по приведенным правилам. Если Вы поторопитесь воспользоваться этими правилами, не оценив целесообразности их применения, т.е. доходность системы, то вся ответственность за возможные потери ляжет на Вас лично. Forex Club ответственности за совершаемые Вами сделки и за возможные убытки не несет

Валютная пара: EUR/USD.

- Рабочий временной интервал: 1 час.
- Система будет трендовой. Основную тенденцию определяем по положению цены относительно простой скользящей средней с периодом 24.
- Открывать позицию будем не тогда, когда цена пересекает среднюю вверх или вниз, а тогда, когда индикатор Stochastic (стохастик) покажет нам, что закончился откат цены против тренда и возобновилось движение в направлении тренда. Сигналом индикатора Stochastic пусть будет: для продажи – выход быстрой линии индикатора сверху вниз из зоны перекупленности в центральную зону (пересекает линию 70%); для покупки – выход быстрой линии снизу вверх из зоны перепроданности в центральную зону (пересекает линию 30%).
- Позицию будем закрывать по ордерам. Stop Loss = 0.0040; Take Profit = 0.0080. Отсчет уровней ордеров производится от уровня фактического открытия.
- Для страховки незафиксированной прибыли ордер Stop Loss переносим на уровень безубыточности, если цена пройдет 40 пунктов.



Рис. 1. EUR, простейшая торговая система, сигнал на открытие длинной позиции 21.09.2006

На рисунке 1 отражен ход одной сделки на 21.09.2006, время 01:00. Цена находится выше скользящей средней. Stochastic вышел из зоны перепроданности вверх (был равен 29%, стал 52%), показав, что движение в сторону тренда возобновилось. Открылись с рынка (вручную) по цене $1.2709+0.0005=1.2714$ (на графике отражается цена Bid 1.2709, а покупка совершается по Ask, которая на 5 пунктов выше в связи со спредом). Позиция закрыта с прибылью на уровне 1.2794 в тот же день, 21.09.2006 в 20:00. Итог сделки 80 пунктов, что при лоте \$10 000 (0,01) равно 80 долларам, а при лоте \$30 000 (0,03) – 240 долларам.

Конец примера

Когда система создана, то перед началом торговли ее надо как-то оценить: если она окажется хорошей – примем к исполнению на ближайшее время, а если плохой – откажемся или будем что-то в ней менять. Разумеется, наиболее важным параметром любой торговой системы является доход, выражаемый в процентах от депозита. Выбирая торговую систему, необходимо знать, сколько сигналов она выдает на определенном временном промежутке, сколько среди них прибыльных, сколько убыточных, каковы средняя положительная и средняя отрицательная сделки. Например, если система за год выдает 150 сигналов, из них 110 сигналов прибыльных, а 40 убыточных, мы скажем, что это хорошая система. Однако, обратившись к средней прибыльной и к средней убыточной сделке, мы обнаружим, что прибыльная в среднем составляла 7,3 пункта, что практически сопоставимо со спредом, а средняя убыточная составляла 35 пунктов. Существенный диссонанс между потенциальной прибылью и возможным убытком будет для нас основанием для отказа от данной системы, поскольку он ведет к превышению общих убытков над общей прибылью. Использование торговой системы является необходимым условием устойчивой и прибыльной работы на валютном рынке, облегчающим торговлю как начинающим трейдерам, так и опытным специалистам:

- Вы сможете работать спокойнее, т.к. у Вас будет четкий план.
- Результаты торговли будут определяться качеством системы, а не выдержкой.

- Ваша главная задача будет состоять в том, чтобы сотрудничать с Ее Величеством Статистикой. До начала совершения сделок требуется создать такие правила для своей системы, чтобы было видно: есть устойчивый доход на продолжительном периоде, пусть даже и возникают убытки в отдельных сделках.
- Важно, чтобы прибыль росла быстрее убытков – этот принцип и лежит в основе роста любого капитала.

Домашнее задание

В этом уроке мы рассмотрели простейшую систему. На том же рисунке виден хороший момент для открытия позиции вниз. Найдите его и рассчитайте доход от сделки. Проверьте, работала ли эта система на протяжении 2008 года? Какие были удачные сделки, какие неудачные? Попробуйте составить другую торговую систему, определяющую тренд с помощью двух скользящих средних. Правила для момента открытия позиции и правила закрытия позиций придумайте сами. В правилах системы должны быть ответы на следующие вопросы:

- На каких временных интервалах должна работать система?
- На каких валютных парах собираетесь использовать торговую систему?
- На основании чего Вы открываете длинную или короткую позицию?
- Каким лотом Вы планируете открывать позиции?
- Что является основанием для закрытия позиции – Stop Loss, Take Profit или какой-то другой способ закрытия позиции?
- Насколько долго собираетесь держать позицию открытой?

Заключение

Мы с Вами рассмотрели несколько примеров инструментов, применяемых трейдерами при принятии решений о совершении сделок. Мы показали Вам и простой пример того, как создаются торговые системы, позволяющие снизить психологическое напряжение, полагаясь на статистику, в которой проявляется психология толпы.

Торговля на финансовых рынках одновременно простой и трудный бизнес. Простой, потому что принцип осуществления сделок не является сложным, для торговли не нужно трудно приобретаемых знаний, высокого интеллектуального потенциала или сложного технического оборудования. Тем более нет необходимости прибывать на биржу, как на работу. Но это и непростой процесс, потому что необходимо постоянно бороться с сильнейшим конкурентом – со своей психологией, которая постоянно оказывает давление на нашу способность хладнокровно принимать правильные решения и искажает реальность в нашем восприятии.

На финансовых рынках много историй о том, как трейдеры с небольшой стартовой суммой сделали многомиллионные состояния. Много историй и о том, как другие теряли все. Объективная действительность такова: очень многое зависит от самого трейдера, от его отношения к деньгам и к риску. И если отношение трейдера к деньгам бережное и трейдер чувствует соответствие риска возможным результатам, то успешность такого трейдера – лишь вопрос времени и приложенных к обучению сил.

Forex Club искренне и от всего сердца желает Вам успехов в торговле!