

ТОРГОВЫЙ ПЛАН

Основные пункты торгового плана

1. Цена входа, время входа
2. Цена выхода с прибылью, техническое обоснование, время выхода
3. Цена выхода с убытком, техническое обоснование, время выхода
4. Ориентировочное время удержания открытой позиции - выход по текущей цене рынка, если так и не были достигнуты прогнозируемые уровни прибыли/убытка

Иллюстрация

Обозначения: красный цвет – продажа, синий цвет – покупка; в соответствии с цветом: стрелки – открытие позиции, галочки – цели, крестики – стопы,

План



Результат



Новый план



Правила открытия позиций:

- а)** открывать позицию только при наличии одного основного и не менее одного дополнительного сигналов
- б)** при открытии обязательно заранее сформулировать и записать на бумаге:
 - цену входа в рынок
 - цену, по которой планируется закрыть прибыльную позицию
 - цену, по которой четко будут фиксироваться убытки, если прогноз не оправдается
 - расчетное время «жизни» открытой позиции/отложенного ордера
- в)** открываться против тренда - осторожно и на короткое время, лучше вообще не открываться
- г)** открываться в диапазоне - осторожно и на короткое время

Правила поддержания позиций и частичного закрытия до расчетного времени:

- а)** удерживать позиции только, если анализ и поведение рынка подтверждает сделанные ранее предположения
- б)** частично закрывать позиции:
 - при получении убытков, превышающих расчетные
 - если цена достигла расчетной отметки для получения прибыли
- в)** ожидать:
 - при появлении убытков, ниже расчетных
 - если цена остается на уровне входа в рынок
 - если цена не достигла расчетной отметки взятия прибыли

Правила закрытия позиций:

- по истечении расчетного времени
- при получении расчетной прибыли
- при получении расчетных убытков
- при достижении максимума прибыли

Подробный пример реального торгового плана

Для примера, давайте разберем реальный конкретный простой пример прогнозирования и торговли в канале по USDJPY на протяжении с начала апреля по начало мая 2003 г.



Как мы видим, 1-2 апреля курс достиг уровня 117.85 йен за доллар, и потом за неделю резко поднялся вверх до уровня 120.90 (7 апреля). Ещё на начало марта курс установил среднесрочный минимум на уровне 116.35 йен за доллар, поэтому мы используем эту точку для проведения линии поддержки «А» через нижние экстремумы курса (не вошли в рисунок). Можно сказать, что: во-первых, есть вероятность отскока от этой вверх линии при приближении к ней сверху; во-вторых, при прорыве этой линии вниз, скорее всего, можно ожидать дальнейшее снижение курса доллара к йене.

Откладываем уровни Фибоначчи между курсами 120.90 и 117.85, отметим их значения: 23.6% = 120.15, 38.2% = 119.70, 50% = 119.35, 61.8% = 118.90. Но пока у нас нет общей картины, чтобы принимать какие-то решения. Но уже за следующие три дня на 11 апреля мы можем с некой уверенностью определить следующее:

1. Курс пары может сформировать боковой канал с верхним уровнем границы на 120.90 и нижним на 119.40 (50% Фибо).
2. Уровни 38.2% и 50% Фибо уже показали себя как хорошие уровни поддержки.
3. При прорыве 118.90 или 61.8% Фибо есть большая вероятность возврата курса на 117.85 или 100.0% отката.

Торговый план:

1. Исходя из вышеизложенного, можно принимать такие торговые решения в канале (см. на рисунке отмеченные овалом курсовые значения):
 - покупаем при курсе 119.70 йен за доллар (38.2% Фибо); прибыль 120.70 (0% Фибо минус 20 пунктов); убыток на 118.80 (61.8% Фибо минус 10 пунктов, чтобы не было соотношение потерь к прибылям 1 к 1, а так 1:0.9)
 - продаем при курсе 120.70 (0% Фибо минус 20 пунктов); прибыль 119.70 (38.2% Фибо); убыток 121.20 (120.70 плюс 50 пунктов).
2. Если будут прорывы уровней, совершаем следующие действия:
 - покупаем на 121.30 при прорыве верхнего уровня 120.90 (т.е прибавляем 40 пунктов на случай возможных рыночных «шумов»)
 - продаем на 118.50 - при прорыве 118.90 (61.8% Фибо); первая прибыль на 117.90.
 - срочно (!) продаем при прорыве линии "А"; первый профит на 117.90.

Если бы трейдер безукоризненно выполнял торговый план с 14 апреля (день начала 3 торговой недели в апреле), то получился бы такой результат:

1. Торговля в канале (пустые квадратики на рисунке со стрелочками):
 - 14.04.03-16.04.03 – +100 пунктов с продажи
 - 17.04.03-22.04.03 – +100 пунктов с покупки
 - 22.04.03-22.04.03 – +100 пунктов с продажи
 - 22.04.03-25.04.03 – +100 пунктов с покупки
 - 25.04.03-29.04.03 – +100 пунктов с продажи
 - 29.04.03-29.04.03 – +100 пунктов с покупки
 - 29.04.03-30.04.03 – +100 пунктов с продажи
 - 30.04.03-30.04.03 – –90 пунктов с покупки
2. Торговля на прорывах: 30.04.03 – прорыв линии "А" на уровне 119.25. Продаем по этому курсу. Получаем +135 пунктов на закрытии данной позиции 06.05.03 на уровне 117.90.

Общий результат:

+725 пунктов по работе с йеной за 3 недели торгов. А это прибыль в размере более чем 6100 долларов при работе 1 (одним) лотом на стандартном форексе (или 610 долларов на мини).

Дневник трейдинга



Дневник должен быть организован таким образом, чтобы хорошо просматривались все плюсы и минусы торговли. Обычно в дневнике отражаются следующие моменты:

1. Торговая сделка:

- дата и время
- данные о входе в позицию (длинная или короткая позиция, цена)
- тип (скальпирование, долгосрочный или дневной)
- причина сделки - логика и стратегия, стоящие за ним
- стоп - время и уровень выставления стоп-лосса
- предельная цена, при которой вы готовы выйти из позиции
- плюсы - позитивные аспекты торговли
- минусы - потенциальные проблемы

2. Результат:

- update (через некоторое время обновите информацию о сделке - текущие прибыли или убытки, выставленные стопы и т.п.)
- выход - цена, дата и время
- причина выхода - цена достигла цели или уровня стопа и т.п.
- прибыль/убыток - абсолютные и относительные величины (доллары и проценты)
- выводы (чему научила Вас эта конкретная операция, что вы сделали правильно, а что нет?).

Преимущества ведения дневника:

- выявление логики совершения сделок и процессов, которыми вы руководствуетесь во время их проведения;
- отслеживание событий, сигналов рынка и их влияние на совершение сделок;
- помощь в управлении стрессами и эмоциями.

В дневнике имеет смысл вести:

- график, на котором отмечаются точки входа и выхода.
- психологическое состояние (нервозность, уверенность, эмоциональность и т.д.).
- уровень детализации заносимой информации ограничивается лишь вашим воображением и временем - чем подробнее будет дневник, тем лучше. При грамотно построенном графике, сравнивая максимально возможную прибыль с полученной, можно понять, почему выход из рынка был слишком ранним, или слишком поздним.
- из дневника становится ясен тип проведенной торговой операции, рыночные условия, при которых она была совершена, время и цена исполнения. В случае убыточности операции полученная информация должна дать ответ на главный вопрос: потери являются результатом случайной ошибки или неверности применяемой стратегии?

Контрольные вопросы

1. Что такое торговый план, для чего он нужен?
2. Преимущества ведения дневника совершения торговых операций
3. По достижению каких условий трейдер закрывает открытую ранее сделку?