

FOR TRADER.RU

2017  
сентябрь

120

выпуск

08

ЖУРНАЛ О БИРЖАХ

# ПРАКТИЧЕСКИЙ ТРЕЙДИНГ

Голая экономика. Разоблачение

«Здравствуйтесь! Вас интересует  
пассивный доход?». О мошенниках

Форекс на выходных.

Где посмотреть котировки выходного дня?

Советник Money Cross – внутридневная  
торговля с низкой просадкой

ФОРЕКС —

НЕ ТОЛЬКО СТРАТЕГИЯ

аналитический журнал для финансовых трейдеров  
[www.fortrader.org](http://www.fortrader.org)

# СОДЕРЖАНИЕ НОМЕРА

- 1. ФОРЕКС – НЕ ТОЛЬКО СТРАТЕГИЯ**  
Слово главного редактора журнала Юлии Апель. [3 стр.]
- 2. METATRADER 4 — СЕКРЕТЫ ПОПУЛЯРНОСТИ**  
Самый популярный торговый терминал и его альтернативы с Романом Кравченко. [4 стр.]
- 3. СОВЕТНИК MONEY CROSS – ВНУТРИДНЕВНАЯ ТОРГОВЛЯ С НИЗКОЙ ПРОСАДКОЙ**  
Тестирование торговых роботов. [8 стр.]
- 4. ГОЛАЯ ЭКОНОМИКА. РАЗОБЛАЧЕНИЕ УНЫЛОЙ НАУКИ**  
Что почитать трейдеру. [18 стр.]
- 5. ФОРЕКС НА ВЫХОДНЫХ. ГДЕ ПОСМОТРЕТЬ КОТИРОВКИ ВЫХОДНОГО ДНЯ?**  
Секреты прибыльного трейдинга. [21 стр.]
- 6. КОГНИТИВНО-ПОВЕДЕНЧЕСКАЯ ТЕРАПИЯ И ТРЕЙДИНГ. ЧАСТЬ 2**  
Психологическая подготовка трейдера с Алексеем Хмелевым. [23 стр.]
- 7. ЛУЧШИЙ ВАРИАНТ ЛОКИРОВАНИЯ. 3 МНЕНИЯ О ЗАМКАХ НА ФОРЕКС**  
Практический трейдинг на Форекс. [29 стр.]
- 8. ОБЗОР VWAP (VOLUME WEIGHTED AVERAGE PRICE). НЕПРОСТАЯ СКОЛЬЗЯЩАЯ СРЕДНЯЯ**  
Пополняем свой набор технических индикаторов. [33 стр.]
- 9. «ЗДРАВСТВУЙТЕ! ВАС ИНТЕРЕСУЕТ ПАССИВНЫЙ ДОХОД?» КАК НЕ ПОПАСТЬ К ФОРЕКС МОШЕННИКАМ**  
О безопасности трейдера и финансовых мошенниках с Александром Смагиным. [40 стр.]
- 10. ФОРЕКС СТРАТЕГИЯ FAKEY PATTERN TRADING SYSTEM НА ОСНОВЕ ПАТТЕРНОВ PRICE ACTION**  
Торговая стратегия месяца. [44 стр.]

# Форекс – не только стратегия

(Слово главного редактора)



В сентябре мне бы хотелось обсудить с читателями журнала вот такой вопрос. Форекс – это только хорошая торговая стратегия? Или есть что-то еще, что мы часто упускаем из вида? Даже не так, не просто упускаем, а принимаем как должное? Второй подряд номер я бы хотела обсудить выбор компании, с которой мы работаем.

Так получилось, что в течение сентября на мой личный номер телефона 5 (!) раз звонили разные представители разных компаний, которые предлагали пассивный доход. Якобы я где-то оставила свой номер и очень просила их мне звонить и предлагать заработок, если будет возможность. Где, конечно, мне никто не сказал, прикрывшись словом «Интернет». На мои 3 вежливых «нет, мне не интересно» звучал ответ «Вам что, не нужны деньги???» Конечно нужны, поэтому вам я их никогда не передам!

Только одна статья нашего номера посвящена этой проблеме, остальные говорят о практике трейдинга. Но я считаю ее самой важной. Почему в России так много было офер и так много жалоб на форекс брокеров? Потому что люди сами желают быстрых денег, а на спрос, как говорится, всегда найдется предложение. Будьте внимательны и заботливы к своим инвестициям. Торговая стратегия – не самое главное. Главное – голова на плечах.

Всем успешного торгового месяца!

Оставайтесь с нами.

С уважением, Юлия Апель

# Metatrader 4 — секреты популярности

Несмотря на кажущееся обилие торговых терминалов, платформа MetaTrader 4 по-прежнему остается самой популярной. Как показывает статистика, ей отдают предпочтение более 90% трейдеров на Форекс.

Неужели МТ4 – самое лучшее решение для торговли на Форекс или за его популярностью кроется что-то другое? Итак, сегодня разбираемся с терминалом MetaTrader 4 и возможными альтернативами.



## Недостатки и слабые места MetaTrader 4

На самом деле, несмотря на такую популярность, качественные характеристики терминала МТ4 не всегда полностью удовлетворяют пользователя.

Настройки терминала могут назвать гибкими только оптимисты. Свечи имеют фиксированную длину, временные интервалы (таймфреймы) только стандартные – для создания нестандартного таймфрейма придется потрудиться. И так далее.

Отдельно стоит упомянуть штатную сетку на графиках. В альтернативных торговых терминалах для построения сетки используются круглые уровни.

Терминал МТ4 в этом плане «радует» трейдера сеткой, построенной принципу, смысловая нагрузка которого осталась для нас неразгаданной.



Рис. 1. Сетка цен в терминале MetaTrader 4.

И это недостатки, которые видны практически при первом взгляде. При создании программных продуктов разработчики сталкиваются с более глобальными проблемами. По сути, терминал MetaTrader 4 на данный момент не полностью соответствует современным реалиям и запросам. Да, компания MetaQuotes (это разработчики терминалов MetaTrader 4 и 5) регулярно выпускает обновления для МТ4. Однако, помощь от этих обновлений не всегда очевиден. Чего только стоят «сломанные» индикаторы, не работающие в новых билдах.

## В чем же секрет популярности МТ4?

Так почему же подавляющее большинство трейдеров до сих пор пользуется MetaTrader 4, тем более, при наличии более функционального МТ5?

Вполне возможно, что выше мы несколько сгустили краски, и терминал МТ4 не так уж и плох. По крайней мере, он прост в использовании, что, само по себе, уже не мало, особенно, для непрофессиональных трейдеров.

На самом деле, причина популярности МТ4 кроется в его распространении брокерами и

дилингвыми центрами. И не потому, что нет других альтернатив. Наоборот, они есть, но мы считаем, что здесь дело больше в технической части вопроса.

Наверняка, интеграция серверной части MetaTrader 4 с базой данных брокера и прочим функционалом технически достаточно сложна. Как следствие, переход к использованию в системе брокера нового терминала сопряжен с масштабными техническими работами, а также финансовыми расходами. По всей видимости, срабатывает известный принцип всех программистов: «Программа работает? Ничего в ней больше не трогай». К этому можно отнести с пониманием.

Есть и другая причина, по которой MT4 так распространен. Это

инструменты, которыми пользуется практически каждый трейдер – технические индикаторы, торговые роботы, скрипты. За многие годы распространения терминала, программных продуктов к нему скопилось великое множество на самый взыскательный вкус. Достаточно взглянуть на наш форум, чтобы убедиться в этом. К сожалению, другие терминалы, включая MT5, увы, не способны работать с ними (а было бы здорово!), а это значит, трейдеры сталкиваются с новыми затратами по переработке любимых советников для новой платформы. Не всегда такая возможность есть, потому MT4 в фаворитах.

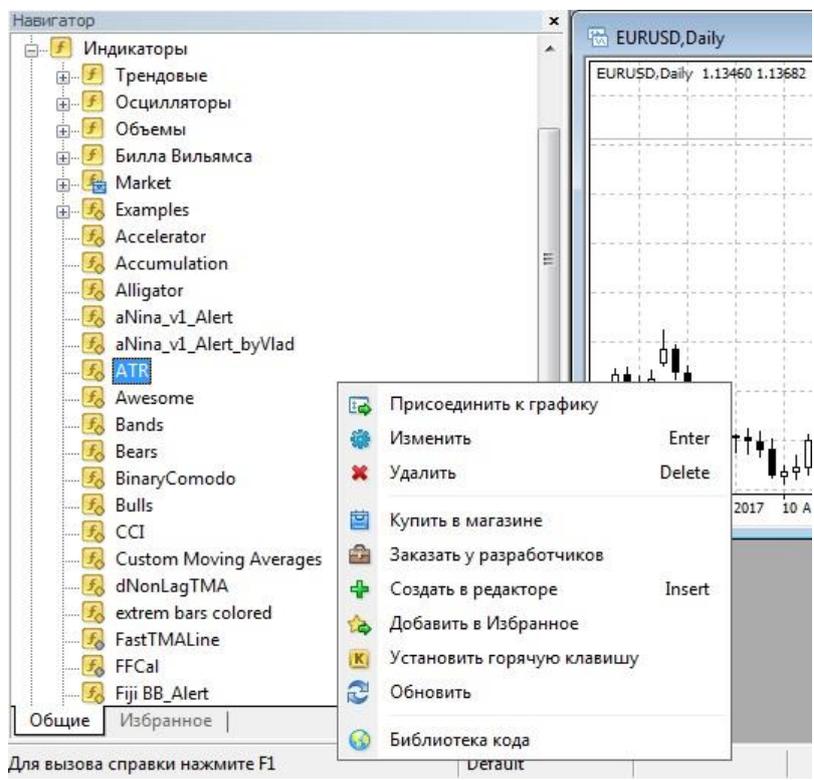


Рис. 2. Количество индикаторов терминала MT4 обширно, даже предустановочных.

Дело в том, что для разработки автоматических торговых систем, в силу ряда причин, MT5 не годится. Поэтому тут остается не так уж и много вариантов — либо использовать MT4, который все же, худо- бедно, более пригодный для этих целей, чем его старший собрат, либо писать свою платформу для тестирования и оптимизации. Безусловно, существуют индикаторы и для MT5, однако, о какой-то сопоставимости масштабов речи не идет.

В итоге, получается замкнутый круг. Брокеры распространяют терминал MetaTrader 4, потому что его использует большинство трейдеров, а трейдеры «юзают» MT4, потому что его распространяют все брокеры.

## **Альтернативные терминалы.**

### **Веб-платформы**

Многие профессиональные трейдеры скептически ухмыляются при виде терминала MetaTrader 4 и используют другие торговые платформы. Их, на самом деле, существует достаточно приличное количество, и о них мы сегодня говорить не будем.

Для MetaTrader 4, кроме других торговых платформ, существует еще одна альтернатива – это веб-терминалы. Мобильный трейдинг с каждым годом становится все популярнее. Намного удобнее открыть торговый терминал непосредственно в браузере или смартфоне, чем скачивать и

устанавливать какое-то программное обеспечение.

На данный момент сфера веб-терминалов еще достаточно молода и только развивается. При этом, развитие браузерных торговых терминалов пошло по двум направлениям.

Первое направление – адаптация уже имеющихся торговых терминалов под веб. Недостатком такого терминала является значительно урезанный функционал, по сравнению с оригинальной версией.

Второе – это создание веб-терминалов на базе отдельного брокера. Это дает брокеру ряд преимуществ: нет зависимости от сторонних разработчиков, реализация уникальных решений и т.д. Вопрос с пользовательскими индикаторами и другими инструментами в этом направлении остается открытым.

### **Выводы**

По всей видимости, торговый терминал MetaTrader 4, несмотря на все свои недостатки, еще долго не потеряет своей популярности. Однако, темпы современной жизни настолько быстры, что никто не гарантирует, что в ближайшее время на Форекс не произойдет какая-нибудь «техническая революция», в результате которой большинство трейдеров перейдут к торговле в веб-терминалах.

**FT#**

# Советник Money Cross – внутридневная торговля с низкой просадкой

Советник Money Cross представляет собой трендовую систему, работающую в полном автоматическом режиме, основанную на скользящих средних, с фильтром MACD. Торговый алгоритм реализован как внутридневной с рабочим таймфреймом, начиная от M15, заканчивая H1. Это платная разработка с бесплатным демо-вариантом. Стоимость совсем небольшая, порядка 12\$. Хотя стратегия настолько понятна, что создать подобную версию специалистам не составит большого труда. Итак, посмотрим.



Рис. 1. Работа советника Money Cross.

## **Входные параметры**

Советник работает с валютными парами EUR/USD, USD/CHF, GBP/USD (с осторожностью), USD/CAD, AUD/USD, USD/JPY. Перед использованием на остальных инструментах требуются тщательные тесты.

Ценовые разрывы на графике актива (гэпы) приводят к росту числа ложных сигналов.

Период макроэкономических новостей, вызывающий всплеск цен (класса – «очень важно» в экономическом календаре), по воздействию на советник приравнивается к гэпам. Поэтому с осторожностью работаем в понедельник и перед важными событиями.

## **Торговая стратегия Money Cross**

Система советника Money Cross собрана на двух простых скользящих средних (МА) с параметрами периода 8 и 35, построенными по ценам закрытия, определяющих направление тренда.

Сигнал, поступающий при пересечении «быстрой» скользящей с периодом 8 и медленной, фильтруется индикатором MACD с классическими параметрами 9, 12, 26.

Проблема запаздывания сигнала скользящих средних решена методом подбора оптимального значения периода.

Чтобы отфильтровать ошибку подобной «подгонки» фильтр MACD всегда используется с классическими параметрами, подтверждая вход по скользящим факторам перехода столбиков гистограммы через нулевую линию.

## **Сигналы на покупку, продажу и закрытие сделки**

Советник Money Cross продает на пересечении «быстрой» скользящей с периодом 8, медленной (период 35) сверху вниз, если при этом гистограмма MACD перешла с положительной в отрицательную область.



Рис. 2. Пример сделки на продажу.

Сигналы считаются по закрытию свечи – при определении валидности условий сделка происходит по цене открытия следующего таймфрейма.

Сделка на покупку открывается, когда «быстрая» скользящая средняя оказывается выше «медленной», а столбик гистограммы MACD переходит в положительную область:



Рис. 3. Пример сделки на покупку.

Как видно из рисунка, приведенного выше, гистограмма MACD «опередила» скользящие – столбики приняли положительное значение до пересечения, поэтому как только восьмипериодная МА оказалась выше «медленной», по закрытию свечи Money Cross, проверив условия, открыл сделку на первом тике цены нового таймфрейма.

Закрытие сделки происходит по тейкпрофиту (выставляется пользователем в настройках) или при возникновении обратного сигнала. В этом случае система совершает реверсную двойную сделку, одновременно фиксируя убыток и открывая новую позицию. Старая позиция закрывается полностью.



Рис. 4. Закрытие позиции советником Money Cross.

### Управление капиталом стратегии Money Cross – манименеджмент

В советнике реализована тактика ограничения сделок по времени: «рабочий отрезок» начинается за три часа до сессии Лондонской биржи LSE, «отыгрывает» всю европейскую сессию и заканчивается на моменте открытия бирж Северной Америки. Переход через американскую сессию осуществляется при наличии ранее открытой сделки.

Тейкпрофит определен в 300 пунктов для часового графика, при торговле на пятнадцатиминутных свечах трейдеры ограничивают этот размер до 100 пунктов.

## Настройки советника Money Cross

Окно настроек индикатора включает в себя возможность изменения:

- параметров всех индикаторов, входящих в систему (МА и MACD);
- промежутка времени работы Советника Money Cross;
- размера тейкпрофита;
- условий работы со стоп-лоссом (ограничение убытков) или реверсные методики входов.

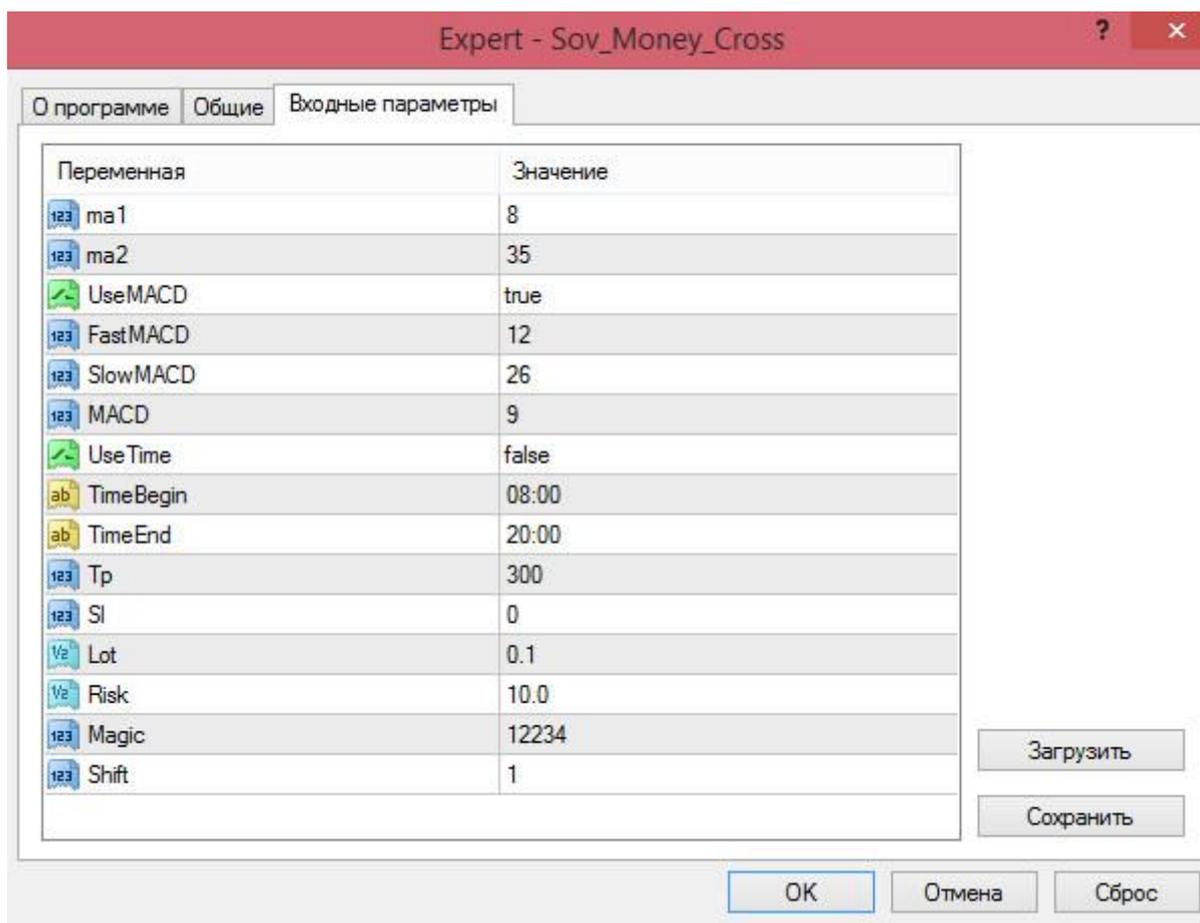


Рис. 5. Параметры настройки советника Money Cross.

Если в графе SL стоит цифра ноль, Money Cross переворачивается по противоположному сигналу, любая другая цифра – размер в пунктах, отстоящего от цены открытия, не передвигаемого стопа.

Размер лота настраивается пользователем от дробных до целых значений (соответствует разрядности ордеров терминала Metatrader).

Параметр Risk предназначен для «разгона» капитала, увеличивая (или уменьшая) на число процентов (по умолчанию 10) размер капитала в ордере по условию: если предшествующее закрытие в плюс – сделка увеличивается, в минус – уменьшается.

t/p	4	0.97	1.08357
sell	5	1.00	1.06572
modify	5	1.00	1.06572
close	5	1.00	1.06779
buy	6	0.98	1.06778
modify	6	0.98	1.06778
close	6	0.98	1.06454

*Рис. 6. Пример работы параметра Risk.*

Параметр Shift дает возможность сдвинуть скользящие средние, увеличив запаздывание сигнала.

В условиях постоянства параметров MACD этот эффект используют для быстрой настройки скользящих, подгоняя их под «запаздывающие» сигналы первого индикатора.

Трейдерам, использующим Money Cross одновременно на нескольких открытых инструментах, следует использовать идентификатор сигналов magic.

## **Установка советника Money Cross на платформу MetaTrader**

В открытом терминале Metatrader в верхнем главном меню «Файл» выберете опцию «Открыть каталог данных»:

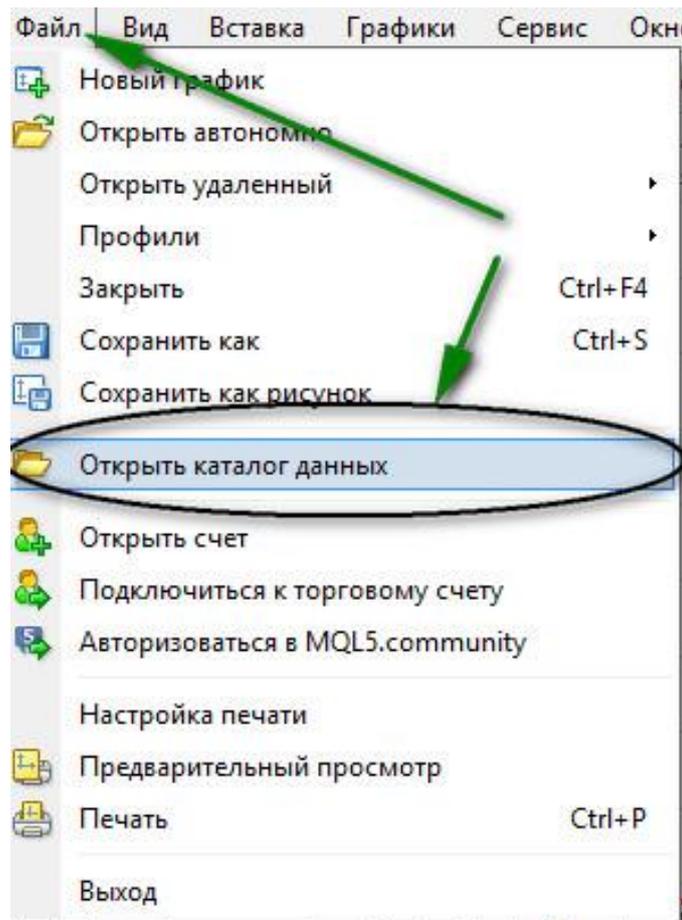


Рис. 7. Установка советника.

В появившемся окне откройте папку MQL4 и поместите советник в папку Experts:

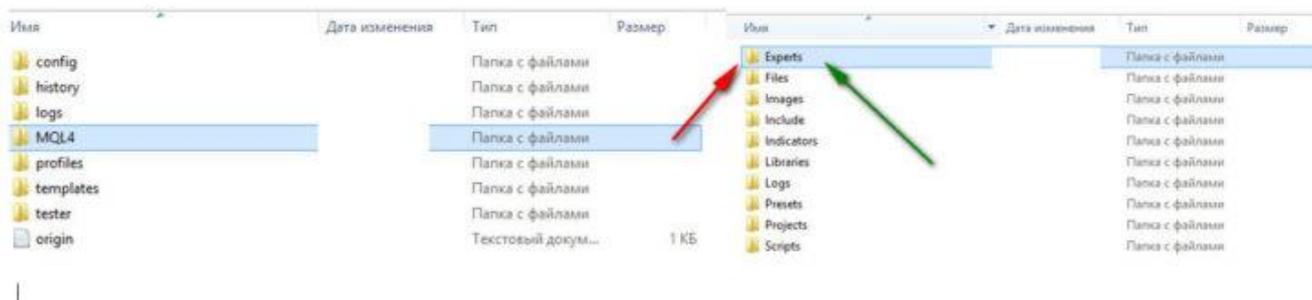


Рис. 8. Установка советника.

Перезагрузите терминал Metatrader, и советник появится в окне Навигатора. Захватив мышью и перетащив робота на график, пользователь сможет приступить к настройкам и запуску Money Cross.

## Тестирование советника Money Cross

Посмотрим, как работает советник Money Cross.

Для теста используем пару EUR/USD:

- таймфрейм – H1,
- спред 1 пункт,
- метод — все тики.

Используем параметры по умолчанию.



Неплохие результаты для 100\$ с учетом процента прибыльности и абсолютной просадки. 50% за год – не много, но для одной пары вполне достаточно.

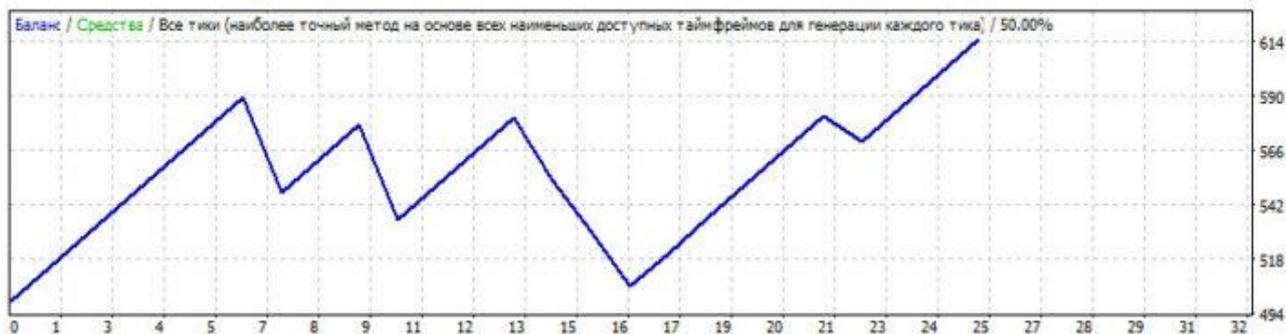
Следующий тест Money Cross: пара GBP/USD, таймфрейм – H1, метод — все тики.

### Strategy Tester Report

#### Sov\_Money\_Cross

LiteForex-Demo.com (Build 1090)

Символ	GBPUSD (Great Britan vs US Dollar)		
Период	1 Час (H1) 2016.12.29 00:00 - 2017.03.15 23:00 (2016.12.29 - 2017.03.16)		
Модель	Все тики (наиболее точный метод на основе всех наименьших доступных таймфреймов)		
Параметры	ma1=8; ma2=35; UseMACD=true; FastMACD=12; SlowMACD=26; MACD=9; UseTime=false; TimeBegin="08:00"; TimeEnd="20:00"; Tp=300; Sl=0; Lot=0.1; Risk=10; Magic=12234; Shift=1;		
Баров в истории	2058	Смоделировано тиков	4555631
Ошибки рассогласования графиков	0	Качество моделирования	50.00%
Начальный депозит	500.00	Сред	Текущий (18)
Чистая прибыль	114.89	Общая прибыль	284.16
Прибыльность	1.68	Общий убыток	-169.27
Прибыльность	1.68	Матожидание выигрыша	4.60
Абсолютная просадка	20.40	Максимальная просадка	93.65 (15.77%)
		Относительная просадка	15.77% (93.65)
Всего сделок	25	Короткие позиции (% выигравших)	14 (71.43%)
		Длинные позиции (% выигравших)	11 (81.82%)
		Прибыльные сделки (% от всех)	19 (76.00%)
		Убыточные сделки (% от всех)	6 (24.00%)
	Самая большая прибыльная сделка	15.05	убыточная сделка
	Средняя прибыльная сделка	14.96	убыточная сделка
	Максимальное количество непрерывных выигрышей (прибыль)	6 (89.38)	непрерывных проигрышей (убыток)
	Макс. непрерывная прибыль (число выигрышей)	89.38 (6)	непрерывный убыток (число проигрышей)
	Средний непрерывный выигрыш	4	непрерывный проигрыш



Не так симпатично, как в паре с евро. Параметры для этой пары явно стоит доработать.

Тест Money Cross пара USD/JPY. Тот же таймфрейм и метод.

## Strategy Tester Report

### Sov\_Money\_Cross

LiteForex-Demo.com (Build 1090)

Символ	USDJPY (US Dollar vs Japanese Yen)		
Период	1 Час (H1) 2017.04.20 00:00 - 2017.07.07 23:00 (2017.04.20 - 2017.07.10)		
Модель	Все тики (наиболее точный метод на основе всех наименьших доступных таймфреймов)		
Параметры	ma1=8; ma2=35; UseMACD=true; FastMACD=12; SlowMACD=26; MACD=9; UseTime=false; TimeBegin="08:00"; TimeEnd="20:00"; Tp=300; Sl=0; Lot=0.1; Risk=10; Magic=12234; Shift=1;		
Баров в истории	2039	Смоделировано тиков	4989374
Ошибки рассогласования графиков	0	Качество моделирования	88.65%
Начальный депозит	1000.00	Сред	Текущий (20)
Чистая прибыль	309.08	Общая прибыль	548.07
Прибыльность	2.29	Общий убыток	-238.99
Прибыльность	2.29	Матожидание выигрыша	12.36
Абсолютная просадка	66.50	Максимальная просадка	108.89 (8.97%)
		Относительная просадка	8.97% (108.89)
Всего сделок	25	Короткие позиции (% выигравших)	11 (72.73%)
		Длинные позиции (% выигравших)	14 (78.57%)
		Прибыльные сделки (% от всех)	19 (76.00%)
		Убыточные сделки (% от всех)	6 (24.00%)
		Самая большая прибыльная сделка	32.18
		Средняя прибыльная сделка	28.85
		Максимальное количество непрерывных выигрышей (прибыль)	5 (154.90)
		Макс. непрерывная прибыль (число выигрышей)	154.90 (5)
		Средний непрерывный выигрыш	3
		Самая большая убыточная сделка	-95.53
		Средняя убыточная сделка	-39.83
		Максимальное количество непрерывных проигрышей (убыток)	2 (-44.59)
		Макс. непрерывный убыток (число проигрышей)	-95.53 (1)
		Средний непрерывный проигрыш	1



30% прибыли и довольно мало сделок за год. Советнику явно требуется больше активов для торговли, которые надо постоянно отслеживать. Но потенциал у робота есть, поэтому его вполне можно продолжать дорабатывать. Особенно тем трейдерам, которые предпочитают торговать стабильно с небольшим риском.

➤ [Скачать файл советника](#)

➤ [Обсуждение советника](#)

FT#

# Голая экономика. Разоблачение унылой науки

**Оригинальное название:** Naked Economics. Undressing the Dismal Science (Fully Revised and Updated)

**Автор:** Чарльз Уилан / Charles Wheelan

Издательство: Манн, Иванов и Фербер, 2017 г

ISBN 978-5-00100-797-5

Страниц: 280 стр.

Формат: 170×240 мм (средний формат)

Вес: 760 г

Переплет: Твердый переплет

➤ [Купить книгу](#)

## Читать книгу

➤ [Содержание. Предисловие. Глава 1. Мощь рынков: Кто кормит Париж?](#)

### Читать книгу о простоте экономики

Интересная, веселая, умная и понятная книга по экономике. Чарльз Уилан, автор бестселлера «Голая статистика» — мастер в том, чтобы превращать скучное и непонятное в интересное и доступное. В этой книге он проделал такой трюк с экономикой, обойдясь без заумных графиков и уравнений.

Увы, у экономики неидеальная репутация: если вы учили ее в



университете, то на занятиях и экзаменах вы скорее обсуждали модели, диаграммы и уравнения, чем то, почему базовые экономические законы предрекали неизбежность распада СССР (распределение ресурсов при отсутствии системы ценообразования в долгосрочной перспективе оказалось поистине непосильной задачей), какие экономические выгоды обеспечивают курильщики некурящим людям (они раньше умирают, и остальные могут рассчитывать на большие социальные и пенсионные выплаты), или почему более

щедрые пособия по уходу за новорожденным в реальности вредны для женщин (из-за них работодатели нередко дискриминируют молодых соискательниц вакансий).

Вас когда-нибудь мучил вопрос, нет ли рационального зерна в протестах антиглобалистов и не правы ли они в том, что народы развитых или развивающихся стран, возможно, выиграли бы от менее мощной экономической интеграции? Уилан предельно полно и на удивление доходчиво расскажет и об этом.

Вам интересно, почему Бена Бернанке часто называют вторым по влиятельности человеком в США? Уилан раскроет тайну эффекта, оказываемого денежно-кредитной политикой на экономическую активность.

Читая в газетах о жарких дебатах по текущим экономическим проблемам, не приходилось ли вам недоумевать и поражаться жуткой какофонии мнений и аргументов, высказываемых спорщиками? Уилан проведет детальный разбор специальных терминов, разложит по полочкам политические аспекты доводов и доберется до самой сути каждой из этих проблем.

### 3 причины прочитать эту книгу

- Книга входит в список 100 лучших бизнес-книг всех времен и народов.
- Вы сможете познакомиться с основами экономики, наслаждаясь интересным чтением.
- Книга написана автором лучшей нон-фикшн книги («Голая статистика») 2016 года (по версии «Афиши»).

### Цитаты

Экономисты и дискриминация. Подумайте: есть ли основания утверждать, что в прошлом симфонические оркестры всего мира дискриминировали женщин? Экономисты выяснили, что в 1950-х годах американские оркестры начали использовать «слепые» прослушивания. После этого шансы женщин на прохождение первого раунда увеличились примерно на 50 процентов.

Долгосрочные выгоды. Coca-Cola быстро закрепились на рынке Восточной Германии, бесплатно поставляя напиток торговцам. В краткосрочной перспективе это было, безусловно, экономически невыгодное предприятие; восточногерманская валюта еще ничего не стоила. Но бизнес-решение в

долгосрочной перспективе было поистине блестящее.

Рациональность человека. Каждый человек неявно взвешивает издержки и выгоды всего, что делает. Экономист сказал бы, что мы стараемся максимизировать полезность конкретных ресурсов, имеющих в нашем распоряжении; мой папа сказал бы, что мы стараемся получить как можно больше за каждый кровный бакс.

Ценовая дискриминация. Во время президентской кампании 2000 года Альберт Гор пожаловался, что его мать и его собака принимают одно и то же лекарство от артрита, только мать платит за него намного дороже. Его пример все равно идеально иллюстрирует это явление: одно и то же лекарство продается в обычных и ветеринарных аптеках по разным ценам.

Неправильные оценки. Как и следовало ожидать, многие люди были не в восторге от неудобств нововведения. И они отреагировали на него так, как аналитики вполне могли бы предсказать, но не предсказали. Семьи, которые могли позволить себе вторую машину, приобретали ее. В итоге выбросы загрязняющих веществ в окружающую среду только увеличились.

Правильные стимулы. Удачная политика предпринимает разные меры воздействия, чтобы направить поведение людей в сторону получения желаемого результата. Неудачная политика либо игнорирует подобные методы, либо оказывается не в состоянии предвидеть, как рациональные люди могут изменить свое поведение, чтобы избежать наказания.

### **Автор книги**

Чарльз Уилан — автор бестселлера «Голая экономика», вошедшего в список 100 лучших бизнес-книг всех времен и народов по версии 8-800-CEO-READ и переведенного на 13 языков. Профессор, преподаватель экономики и политики в Чикагском университете и Дартмутском колледже с многолетним стажем.

С 1997 по 2002 год Уилэн работал корреспондентом журнала The Economist. Кроме того, он работал внештатным автором таких изданий, как Chicago Tribune, The New York Times и Wall Street Journal. Колумнист Yahoo! Finance.

Уилан проживает в Чикаго с женой и тремя детьми.

**FT#**

# Форекс на выходных. Где посмотреть котировки выходного дня?

Каждую торговую неделю котировки валютных пар в нашем терминале «замирают» в пятницу в 23:59:59 и снова начинают движение в понедельник в 00:00:01. Торги в субботу и воскресенье не проводятся по причине отсутствия цен, поэтому многие трейдеры считают, что в выходные дни валютный рынок не работает. Вы удивитесь, но они ошибаются. Проговорим, зачем нужно знать о котировках в выходные дни.

GBP/USD	82%	1.54260	14:15	🕒 04:23
EUR/JPY	82%	135.365	14:15	🕒 04:23
GBP/JPY	81%	183.543	14:15	🕒 04:23
USD/JPY	73%	118.983	14:15	🕒 04:23
USD/CAD	79%	1.25174	14:15	🕒 04:23
USD/CHF	73%	0.94890	14:15	🕒 04:23
EUR/GBP	78%	0.73751	14:15	🕒 04:23

## Что происходит с котировками в выходные дни?

Форекс продолжает работать и в выходные дни – на межбанковском уровне продолжают происходить операции по обмену валюты, которые инициируют маркетмейкеры.

За субботу и воскресенье накапливаются торговые объемы и в первую секунду понедельника они вступают в силу. Если происходит существенный перевес в сторону покупок или продаж, цена открытия понедельника будет очень сильно отличаться от цены закрытия пятницы, образуя гэп.

## Зачем нужны котировки выходного дня?

Безусловно, если ваша торговая стратегия подразумевает закрытие всех

сделок в конце торговой недели, следить за котировками в выходные дни нет никакой необходимости. Однако есть ряд причин, из-за которых это делать все-таки стоит:

➤ **Заработать на гэпе.** На основании анализа этих данных можно получить информацию о предпосылках возникновения гэпа и спрогнозировать его направление.

➤ **Составить торговый план.** Если перевес в заявках отсутствует или является несущественным, можно провести технический анализ торгуемой валютной пары, определить ближайшие поддержки и сопротивления и составить торговый план на следующую неделю.

➤ **Отработать сделку.** Если трейдер ушел на выходные, имея открытую сделку, то мониторинг котировок позволит ему заранее спланировать свои

действия на открытии торгов. Это может быть частичная или полная фиксация прибыли, коррекция ордера и т.д.

### Где можно увидеть котировки валютной пары в выходные дни?

Как вы знаете, самые распространенные торговые терминалы MetaTrader 4 и 5 информации по котировкам Форекс в выходные дни не предоставляют. Тем не менее, можно воспользоваться другими простыми и удобными источниками котировок. Самыми распространенными из них мы с вами и поделимся:

**OANDA** – маркетмейкер с доступом к всемирной базе данных. Значения котировок обновляются каждые 5 секунд. Для удобства использования, вся таблица поделена на категории: основные пары, пары с евро, другие пары, металлы.

**QUESTRADE** – канадский брокер, сотрудничающий с институтом Morningstar, Inc. За счет этого максимальная задержка по котировкам составляет не более 15 минут. Представленная таблица обладает удобным фильтром, позволяющим одновременно работать с 8 инструментами.

**XE** – котировки от этой компании обладают высокой надежностью, поскольку собираются из 100 различных источников. Данные на странице

обновляются автоматически каждые 10 секунд. На свое усмотрение пользователь может воспользоваться общей или специальной таблицей. Первая позволяет просматривать сведения только относительно популярных активов, а с помощью второй можно проверить данные любой пары.

**TRADINGCHARTS** – эта платформа обладает удобной системой фильтров, позволяющей разделить все активы по категориям. Обновления происходят автоматически, однако для ускорения процесса трейдер может выполнить обновление данных самостоятельно с помощью специальной кнопки.

### Когда лучше всего смотреть котировки валютных пар на выходных?

В выходные дни, как правило, поступление заявок и накопление торговых объемов происходит неравномерно. Чтобы увидеть максимально объективную картину, котировки выходного дня лучше всего смотреть в воскресенье за 4-6 часов до начала торгов.

Теперь вы с легкостью можете узнать онлайн котировки нужной вам валютной пары Форекс в выходной день, и эта информация поможет вам четче видеть торговую ситуацию и принимать правильные решения, ведущие к прибыли.

FT#

# Когнитивно-поведенческая терапия и трейдинг. Часть 2

В предыдущей части о когнитивно-поведенческой терапии и её применении в трейдинге говорилось о том, что, рассмотрев и оценив свои сильные и слабые стороны, трейдер при помощи когнитивно-поведенческой терапии (КПТ) может перенести акцент на позитивные психологические установки вместо негативных. В частности, обсуждались конкретные примеры, когда вместо деструктивных мыслей о своей торговле человек мог разработать новую, гораздо более продуктивную поведенческую модель, и реализовать её на практике, изменив таким образом своё поведение и, как следствие, улучшить результаты торговли.



Коротко напомним, что когнитивно-поведенческая терапия (КПТ) – это довольно эффективная методика, которая обычно применяется психологами для оказания помощи людям, страдающим различными формами расстройств, такими как

излишняя тревожность, и даже в случаях игровой зависимости (гемблинга, англ. gambling), которая довольно часто встречается в трейдерской среде, а также при многих других психологических проблемах.

Однако для того, чтобы использовать на практике методики КПТ, совершенно не обязательно иметь какие-либо расстройства. Достаточно чётко понимать, какие именно аспекты своего мышления и поведения вы хотите изменить.

**Такие формы поведения могут включать:**

- Непоследовательность в торговле;
- Нарушение правил собственной торговой системы;
- Ненадлежащее управление торговым счётом;
- Плохая торговая дисциплина;
- Эмоциональная или импульсивная торговля;
- Нечестность с собой или с другими людьми;
- Систематическое переторговывание.

### **Основные принципы когнитивно-поведенческой терапии кратко**

Ваши мысли, поведение и чувства взаимосвязаны и влияют друг на друга. Изменяя хотя бы один из этих трёх элементов, вы неизбежно изменяете и остальные.

Методика КПТ акцентирована на настоящем и на том, что конкретно вы в состоянии изменить непосредственно сейчас, в настоящее время, вместо того, чтобы беспокоиться о прошлом или будущем.

В предыдущей статье приводились конкретные примеры того, как можно изменить “мыслительный” элемент треугольника КПТ, проанализировав свои убеждения и выявив деструктивные мысли и психологические установки, которые на самом деле не имеют никакого подтверждения в реальности. После такого анализа убеждений с последующей заменой их на позитивные и реалистичные вам будет легче изменить и ваше поведение, о чём мы как раз и поговорим в этой статье. Но прежде чем вы продолжите чтение, я настоятельно рекомендую вам прочитать первую часть.

### **7 основных деструктивных привычек трейдера**

Итак, определение деструктивного торгового поведения.

Прежде чем вы сможете начать работать над изменением своего негативного торгового поведения, вы должны проанализировать собственные привычки. Важно понимать, что многие, на первый взгляд, “плохие” торговые установки не нужно полностью исключать из практики. Очень часто бывает так, что их достаточно слегка откорректировать, изменив к ним свой подход, чтобы обратить негатив в позитив. Что касается поведенческих шаблонов, то у каждого трейдера, что называется, “свой скелет в шкафу”, и ситуации у всех разные, всегда требующие индивидуального подхода.

Предположим, вы твёрдо настроены на борьбу с трудностями в трейдинге. Вы уже переосмыслили и проанализировали

свои торговые установки и полны решимости серьёзно взяться за их коррекцию. Вот приблизительный возможный список того, с чем чаще всего в своей работе сталкивается начинающий трейдер, и что он хотел бы изменить в своём поведении:

- Я пытаюсь немедленно вернуть потери или увеличить прибыль.

- Я оправдываю нарушение правил моей системы, говоря себе, что просто использовал в данной сделке “дискреционный метод торговли”.

- Я не могу выносить бездействия и в результате переторговываю.

- Я слишком нетерпелив и сразу перехожу к торговле на реальном счете вместо того, чтобы уделить необходимое время изучению торговой системы и её тестированию.

- Иногда я вхожу в сделку большим объёмом средств, чем это допускают мои правила управления капиталом.

- Я не могу просыпаться рано утром для того, чтобы торговать в наиболее активные и продуктивные для торговли часы.

- Часто, когда я планирую решить какую-то задачу, я в последний момент нарушаю свои планы и переключаюсь на другое занятие.

Теперь, когда вы более-менее разобрались со списком того, что хотелось бы откорректировать, можно приступить непосредственно к работе над самими изменениями. В идеале, в таком списке задачи должны быть

расставлены в порядке приоритетности, и вначале идут наиболее важные и сложные. Более общие поведенческие проблемы могут сместиться в нижнюю часть списка. Применительно к данному примеру, основная проблема человека, составившего такой список, если бы он существовал на самом деле, это проблемы с дисциплиной.

### **Изменение негативных торговых установок при помощи КПТ**

Основной смысл когнитивно-поведенческой терапии заключается в действии. Работая над изменением своих негативных убеждений, которые управляют поведением человека, он также может начать параллельно изменять непосредственно само поведение. Это потребует определённых усилий и волевого напряжения, но изменения всегда даются с трудом, особенно если эти изменения касаются наших собственных установок.

Вы можете вдруг почувствовать, что трейдинг – это пустая трата времени, и что быть дисциплинированным попросту невозможно, или что если не торговать активно, то в таком случае, можно вообще ничего не заработать, и если не вернуть сразу же всё потерянное, то невозможно сохранить депозит. Планомерная работа с этими и подобными установками даёт возможность освободиться от них.

Наши убеждения преимущественно формируются на основе полученного в результате действий опыта. Неоднократно совершённые ошибки постепенно создают у трейдера

искаженное представление о его собственной торговле, что и способствует возникновению внутренних чувств, которые побуждают его продолжать делать ошибки. Формируется замкнутый круг. Путем изменения своего поведения, даже если на первый взгляд это кажется сложным, человек начинает создавать новый, более позитивный опыт. Этот опыт поможет ему получить новые переживания, в конечном итоге приводящие к изменению всей модели поведения в будущем.

Начинать лучше с чего-то более простого, постепенно усложняя задачу.

Возвращаясь к примеру списка, и учитывая, что он написан по принципу “от простого к сложному”, то можно подниматься по нему, как по лестнице, снизу вверх, начав с простого. Это позволит постепенно переходить к более сложным задачам, не сталкиваясь сразу с серьезными трудностями. К тому же, небольшие, но уверенные успехи в начале пути будут создавать мотивационную базу для продолжения движения.

Вы начинаете с планомерного укрепления дисциплины, взяв на себя задачу, которую можете выполнить, и таким образом убеждаете себя в том, что

позитивные перемены более чем реальны.

### Посмотрим на примерах

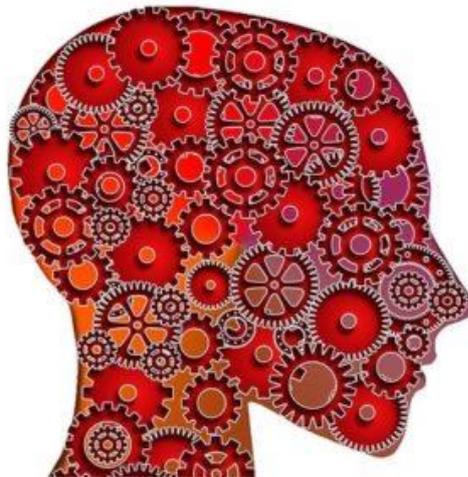
*“Часто, когда я планирую решить какую-то задачу, я в последний момент нарушаю свои планы и переключаюсь на другое занятие”.*

И здесь очень хорошо, что постепенный путь к изменениям не начинается сразу с проблем, связанных с трейдингом. Изменения в других областях жизни могут пойти легче. Это может быть что-то максимально простое: составить с вечера список дел на следующий день и попытаться его придерживаться, не опоздать на назначенную встречу и т.д.

Казалось бы, как всё просто! Но именно такие простые и повседневные мелочи приводят в результате к более

дисциплинированной торговле. Постепенно формируется автоматическое выполнение принятых решений, это становится привычкой, а именно на формирование у человека такой привычки и направлены методики когнитивно-поведенческой терапии.

*“Я не могу заставить себя рано вставать, чтобы торговать в наиболее активные часы”.*



Это отличный пример, потому что в данном случае изменения включают простые конкретные решения на каждый день, а методик существует огромное количество и перечислять их здесь нет необходимости. Вместо того, чтобы просыпаться рано только по торговым дням (что может вообще убить всякое желание торговать), можно выработать у себя привычку вставать рано ежедневно.

Научится рано вставать само по себе уже очень хорошо, независимо от торговли. Сколько уже написано на тему раннего подъёма и, как следствие, увеличения продуктивности! Это касается абсолютно всех аспектов жизни, и конечно, трейдинг – не исключение.

Изменения в чём-то одном создадут положительные изменения во всей системе.

Используя лучшее и наиболее активное время для торговли, трейдер будет проводить больше успешных сделок, таким образом закрепляя положительный результат. Торговые возможности, которые раньше упускались, теперь можно реализовывать в полном объёме.

Теперь, когда количество прибыльных сделок увеличилось, уже нет ощущения их дефицита. Это позволяет перейти к решению более сложных задач в списке.

### **Привычки посложнее**

*“Я не могу выносить бездействия и в результате переторговываю”.*

Это ещё один пункт из списка для коррекции поведения. Он тесно связан с тем, где говорится о нарушении правил торговой системы под оправданием “дискреционной” торговли. Оба пункта предполагают сделки при отсутствии реальных возможностей для торговли. Работать над изменением этого поведения можно как с привлечением третьих лиц, так и с установлением некоторых правил для неукоснительного соблюдения.

Например, вместо того, чтобы входить в сделку немедленно, при первом же импульсивном желании, можно поставить себе условие её обязательной проверки на соответствие правилам торговой системы.

Для этого составляется краткий список критериев оценки, обычно от четырёх до шести, в зависимости от применяемой трейдером системы и тактики торговли, и потенциальная сделка сверяется с каждым пунктом.

Таким образом, за время анализа стихает первое эмоциональное, импульсивное желание и на первый план выходит рациональная оценка ситуации, чего и требовалось добиться. Трейдер должен понимать каждую свою сделку и быть в состоянии логично и лаконично объяснить свои действия в любой момент. В противном случае могут возникнуть серьёзные проблемы.

### **Измени жизнь – измени трейдинг**

Эта практика хороша тем, что в процессе освоения новых форм поведения у человека неизбежно

начинают формироваться новые, положительные психологические установки, и далеко не только имеющие отношение непосредственно к трейдингу. В нашей жизни всё переплетено намного теснее, чем подчас кажется.

Человек – это своего рода система сообщающихся сосудов, и, развивая дисциплину в одном, он неизбежно становится более дисциплинирован и собран во всех областях. Так же и в трейдинге, положительное изменение в одном влечёт улучшение результатов торговли в целом.

Что является идеальным результатом? Это когда человек

изменяет свои мысли и действия, он начнет видеть реальные результаты. Личная трансформация – это очень сложная вещь, но она же приносит человеку самые существенные и значимые результаты в процессе не только профессионального становления, но в самых разных аспектах жизни.

Единственный путь для достижения всего того положительного, что может дать работа трейдера, – это непрерывная и кропотливая работа над самим собой.

Надеюсь, эти две статьи помогут вам победить ваши собственные внутренние препятствия и двигаться вперед в вашей карьере трейдера, ибо всё только в ваших руках!

FT#



## Лучший вариант локирования. 3 мнения о замках на Форекс

Практически все трейдеры на Форекс слышали о локировании позиций. Однако имеющих об этой технике четкое представление в разы меньше. И в этом нет ничего удивительного, поскольку локирование позиций или выставление замков – настолько неоднозначная техника, что мнения даже опытных трейдеров относительно нее очень сильно разнятся.

В этой статье не будет готовых правил по установке и раскрытию замков. Мы обобщим три самых распространенных мнения о замках на Форекс, а делать выводы предоставим нашим читателям.



### **Мнение первое. Локирование – психологический прием, который может избавить от убытка**

Замки при торговле на Форекс используются при открытии позиций без стоп-лоссов. Вместо того, чтобы

зафиксировать убыток, трейдер открывает позицию равного (возможно большего или меньшего) объема в противоположном направлении.

#### **Зачем это делается?**

➤ Во-первых, некоторое снятие психологического напряжения, трейдер

получает время, необходимое на принятие решения.

➤ Во-вторых, убыток больше не растёт.

➤ В-третьих, при удачном стечении обстоятельств и строгом расчёте, возможно получение дохода от применения замка.

Теперь об этом подробнее. Чаще всего замки используют трейдеры, которые торгуют по методу Мартингейла. Выглядит это, примерно, следующим образом. Был последовательно открыт ряд ордеров. Отката, дающего возможность закрыть сделки хотя бы в ноль, не было. Цена продолжает идти против трейдера, и он ставит замок на весь объём ордеров. И снова вопрос – зачем это делать? Как правило, это единственная возможность спасти депозит от полного слива. Кроме того, получаем дополнительное время, которое можно использовать для более глубокого анализа рынка, доливки средств на депозит и т.д.

Установка замка помогает психологически. Это даёт возможность трейдеру «остыть», прийти в себя и собраться с мыслями. Вполне возможно, что на следующий день трейдер «увидит» рынок совсем по-другому, чем в тот момент, когда «все пошло не так». Не стоит недооценивать важность этого момента. В покере есть такой сленговый термин – «тилт». Им характеризуется психологическое состояние игрока, который в порыве отчаяния начинает делать бездумные и глупые ставки.

Форекс трейдеры часто впадают в такой же «тилт», сами этого не замечая. Локирование позиций даст трейдеру отсрочку в принятии решения о закрытии убыточной позиции или же добавления денег на депозит, если в спину дышит Маржин Колл. Это и есть основные причины установки замков.

Стоит ли вообще локировать позиции и как это делать правильно? Все зависит от возникшей ситуации и практического опыта трейдера. Обязательно нужно понимать, что 100%-но работающей стратегии по раскрытию замков на Форекс попросту не существует.

Основная проблема при раскрытии замка состоит в том, что у трейдера, как и сапера, есть только одна попытка. Если она не удалась – депозит будет слит.

Если вы собираетесь применять локирование позиций, то необходимо тренироваться на демо или центовых счетах. Например, строить пирамиду ордеров против тренда и пытаться вывести ее в ноль. Со временем вы начнете понимать, как это работает, и приобретете необходимый опыт.

### **Мнение второе. Лучше не устанавливать никаких замков**

Говорить о том, что локирование позиций – это какая-то единая техника или торговая стратегия бессмысленно. Ведь мы же не говорим о технике или стратегии с использованием, например, стоп-лоссов. Кто-то их использует, а кто-то нет. Точно также и с замками. Кто-то использует локи, кто-то нет. И те, кто это

делает, делают это по-разному, с разными целями и, естественно, с разным успехом.

Именно поэтому говорить о локировании позиций необходимо применительно к конкретной ситуации. Например, возьмем сеточный мартингейл. Открыта большая пирамида ордеров против тренда, цена уверенно движется против позиций, коррекции нет, просадка увеличивается со сверхзвуковой скоростью. Можно выставить замок. То есть, открыть позицию в противоположном направлении и объемом, не меньше чем суммарный объем открытых до этого сделок, взяв паузу и отправившись отдохнуть и прийти в себя. Но стоит ли так поступать?

Ставить замок просто потому, что не знаешь, как поступить дальше, – так стоит поступать только если следующим шагом будет закрытие всех сделок и фиксация убытка.

Основное и самое главное правило локирования – установка замка должно быть взвешенным и четко рассчитанным торговым решением.

Как и любое другое торговое решение, оно должно основываться на анализе рынка и прогнозировании дальнейшей ситуации. Если вы все рассчитали и спрогнозировали верно – от такого решения будет польза. Если ваши расчеты оказались неверны или, более того, вы установили лок только для того, чтобы остановить рост убытка – такое решение сделает ситуацию только хуже.

Если вы не можете трезво оценить ситуацию, четко проанализировать состояние рынка и сделать точный прогноз – то лучше не ставить никаких форекс замков. Очень часто оказывается так, что ничего не делать – не самое плохое решение.

### **Мнение третье. Лучший замок – это замок на прибыльную сделку**

Многие форекс трейдеры, имеющие многолетний опыт торговли на валютном рынке, используют локи крайне редко. Это последствия негативного опыта их использования и сливов депозитов.

Для того чтобы раскрыть замок, одного анализа рынка и четкого прогноза по валютной паре мало. Необходимо, чтобы у вашего форекс брокера были подходящие для этого условия. Например, у некоторых компаний отсутствует возможность частичного закрытия встречной позиции, что сильно затрудняет открытие замка, особенно, если используется равномерный лок.

Очень часто встречается ошибка, когда трейдер открывает локирующий ордер большего объема, чем первоначальные позиции, для того, чтобы уменьшать убыток при движении цены против начальных ордеров. Такой замок крайне опасен. Если направление цены изменится, ситуация моментально ухудшится, а убыток будет расти быстрее.

Также многие трейдеры допускают психологическую ошибку. Как только

какая-то сделка замка показывает прибыль, и есть вероятность, что цена дальше не пойдет, у большинства трейдеров не выдерживают нервы, и они быстро закрывают прибыльную позицию лока.

Как показывает анализ рынка, безоткатное (или с незначительными коррекциями) движение цены в одном направлении более 500 пунктов встречаются всего 1-2 раза в год. Для установки замка на этом уровне, просадка на счету должна быть не более 45%, иначе для открытия встречного ордера не будет хватать свободных средств.

Статистически же, вероятность отката на этом уровне в несколько раз выше. Именно поэтому лучше такие моменты «пересидеть», чем устанавливать замок.

Безусловно, можно установить замок, не дожидаясь безоткатного тренда в 500 пунктов. Но в этом случае вы будете постоянно находиться в подвешенном состоянии и иметь дело с локами. В большинстве случаев, когда вы будете морально готовы установить замок, цена будет на грани разворота.

Целесообразность использования локирования позиций на Форекс

отсутствует, как таковая. Какой бы ни была ситуация с валютной парой, альтернативой замка всегда будет стоп-лосс или же обычное «пересидивание» убытков с усреднением на важных уровнях.

Кроме того, не стоит забывать и о свобах. Если свопы отрицательные, то такой замок будет только наращивать убыток, а ведь на некоторых валютных парах размер свопа очень и очень существенный. Да, один из свопов может



быть положительным, но даже в этом случае размер отрицательного свопа будет больше, и убыток все равно будет увеличиваться.

Единственный приемлемый для разумного трейдера вариант использования замка – это его установка не на убыточную, а на прибыльную сделку. Когда открытая позиция дает хорошую прибыль, но близка коррекция, можно вместо закрытия сделки поставить лок, тем самым зафиксировав прибыль. В момент, когда цена возобновит движение в вашу сторону, встречный ордер закрывается, прибыль по открытой ранее сделке продолжает расти. С таким замком психологически работать намного легче, чем с убыточным.

FT#

# Обзор VWAP (Volume Weighted Average Price). Непростая скользящая средняя

VWAP — это внутридневной расчет, используемый в основном HFT алгоритмами и институциональными трейдерами для оценки того, где акции торгуются относительно среднего значения объема за день. Внутридневные трейдеры также используют VWAP для оценки направления рынка и фильтрации торговых сигналов. Перед использованием VWAP необходимо понять, как он рассчитывается, как его интерпретировать и использовать, а также какие недостатки у этого инструмента.

## Как рассчитывается VWAP?

VWAP (Volume Weighted Average Price) — это аббревиатура от средневзвешенной цены по объему. На первый взгляд вы можете думать, что VWAP – это всего лишь индикатор средней цены. Но VWAP – это нечто большее.

Индикатор скользящей средней чаще всего основан только на одной цене (закрытия) актива, и он никогда не даст вам точной информации об истинной средней цене. Чтобы определить истинную среднюю цену акции (или другого актива), вам необходимо фактическое количество транзакций по целому ряду цен. Это то, что может делать VWAP.

Расчет VWAP для любого торгового инструмента осуществляется по следующей формуле:

$$VWAP = \frac{\sum(\text{Volume} \times \text{Price})}{\sum \text{Volume}}$$

Классический расчет VWAP состоит из пяти простых шагов:

- На основе данных о ценах (OHLC) рассчитывается Typical Price  $[(H + L + C) / 3]$ . Также вы можете выбрать другие расчетные цены (см. Настройки на платформе PTMC).
- Рассчитывается произведение объема на Typical Price
- Рассчитывается кумулятивный объем торговли (это знаменатель в формуле VWAP)
- Рассчитывается совокупный показатель произведения Typical Price на объем (это числитель в формуле VWAP)
- Вычисляется значение VWAP (делится 4 шаг на 3 шаг)

Date	Time	High	Low	Close	Typical Price (TP)	Volume (V)	V*TP	Σ (V*TP)	Σ V	VWAP
11.08.2017	06:00:00.000	5 094,77	5 085,97	5 090,47	5 090,40	116 650,00	593 795 442,87	593 795 442,87	116 650,00	5090,40
11.08.2017	06:15:00.000	5 093,77	5 088,47	5 092,77	5 091,67	132 960,00	676 988 398,37	1 270 783 841,24	249 610,00	5091,08
11.08.2017	06:30:00.000	5 092,77	5 084,77	5 085,97	5 087,84	117 310,00	596 854 075,18	1 867 637 916,42	366 920,00	5090,04
11.08.2017	06:45:00.000	5 091,27	5 084,77	5 086,27	5 087,44	201 890,00	1 027 102 387,25	2 894 740 303,67	568 810,00	5089,12
11.08.2017	07:00:00.000	5 085,47	5 066,47	5 078,47	5 076,80	985 432,00	5 002 844 456,28	7 897 584 759,95	1 554 242,00	5081,31
11.08.2017	07:15:00.000	5 086,27	5 076,27	5 082,97	5 081,84	608 490,00	3 092 246 569,13	10 989 831 329,08	2 162 732,00	5081,46
11.08.2017	07:30:00.000	5 084,47	5 075,47	5 076,77	5 078,90	297 800,00	1 512 497 210,58	12 502 328 539,66	2 460 532,00	5081,15
11.08.2017	07:45:00.000	5 085,27	5 071,47	5 071,97	5 076,24	221 100,00	1 122 355 769,96	13 624 684 309,61	2 681 631,99	5080,74
11.08.2017	08:00:00.000	5 074,97	5 059,77	5 061,77	5 065,50	211 478,00	1 071 242 300,93	14 695 926 610,54	2 893 109,99	5079,63
11.08.2017	08:15:00.000	5 067,27	5 051,77	5 054,27	5 057,77	440 719,99	2 229 060 218,66	16 924 986 829,21	3 333 829,99	5076,74
11.08.2017	08:30:00.000	5 059,73	5 046,97	5 056,77	5 054,49	522 430,00	2 640 616 862,41	19 565 603 691,62	3 856 259,99	5073,73
11.08.2017	08:45:00.000	5 058,47	5 049,77	5 055,97	5 054,74	242 180,00	1 224 155 954,88	20 789 759 646,49	4 098 439,99	5072,60
11.08.2017	09:00:00.000	5 056,47	5 047,77	5 052,97	5 052,40	297 750,00	1 504 352 905,12	22 294 112 551,61	4 396 189,99	5071,24
11.08.2017	09:15:00.000	5 055,77	5 049,77	5 054,77	5 053,44	285 300,00	1 441 745 293,33	23 735 857 844,94	4 681 489,99	5070,15
11.08.2017	09:30:00.000	5 068,77	5 054,27	5 067,77	5 063,60	296 990,00	1 503 839 347,37	25 239 697 192,30	4 978 479,99	5069,76
11.08.2017	09:45:00.000	5 069,77	5 055,27	5 057,27	5 060,77	243 150,00	1 230 526 150,52	26 470 223 342,82	5 221 629,99	5069,34
11.08.2017	10:00:00.000	5 065,27	5 056,97	5 064,27	5 062,17	190 440,00	964 039 597,39	27 434 262 940,22	5 412 069,99	5069,09

Рис. 1. Пример расчета VWAP для индекса CAC40 (France) для 15 мин периода.

В платформе PTMC можно выбрать для расчета VWAP не только по цене Open, High, Low, Close но и другие типы:

- Typical price — это средняя цена  $[(H + L + C) / 3]$ .
- Median price — это средняя цена  $[(H + L) / 2]$ ,
- Weighted price — это средняя цена  $[(O + H + L + C) / 4]$ .

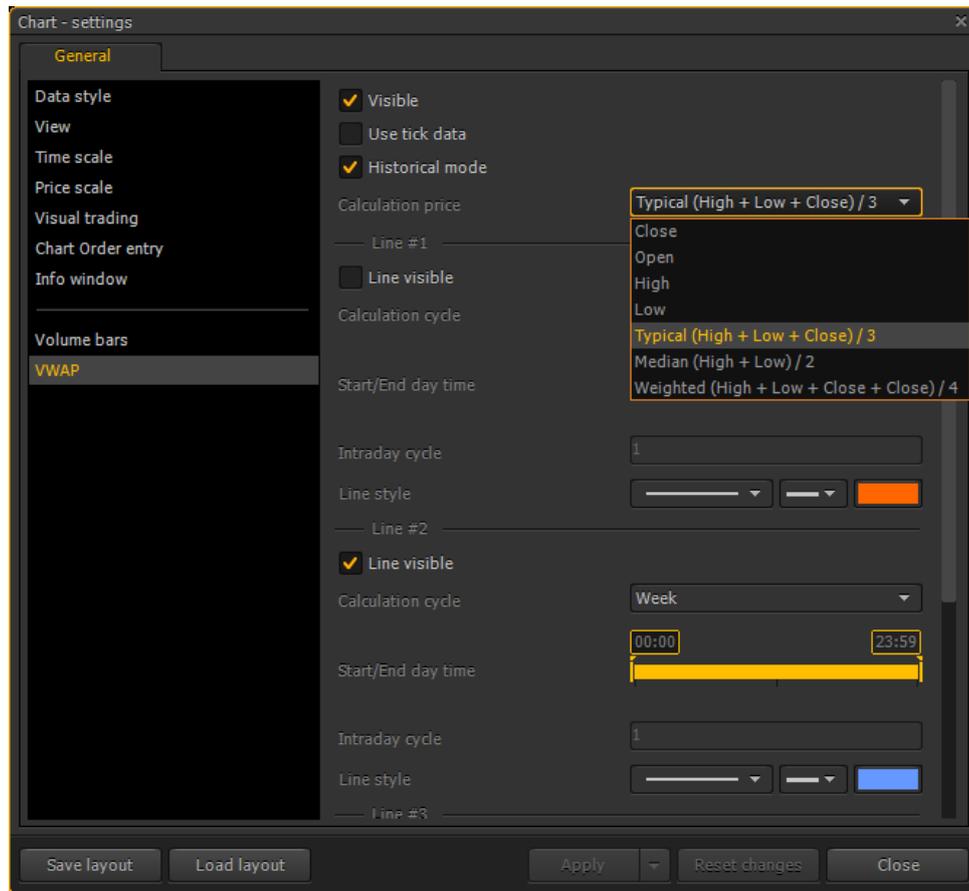


Рис. 2а. Типы цен для расчета VWAP в платформе PTMC

Традиционно институциональные трейдеры рассчитывают VWAP на базе тиковых данных для всего торгового дня. Но также допускается расчет для различных таймфреймов (1, 5, 10, 15, 30 или 60 минут, а также неделя, месяц). Все эти настройки можно задать в платформе PTMC.

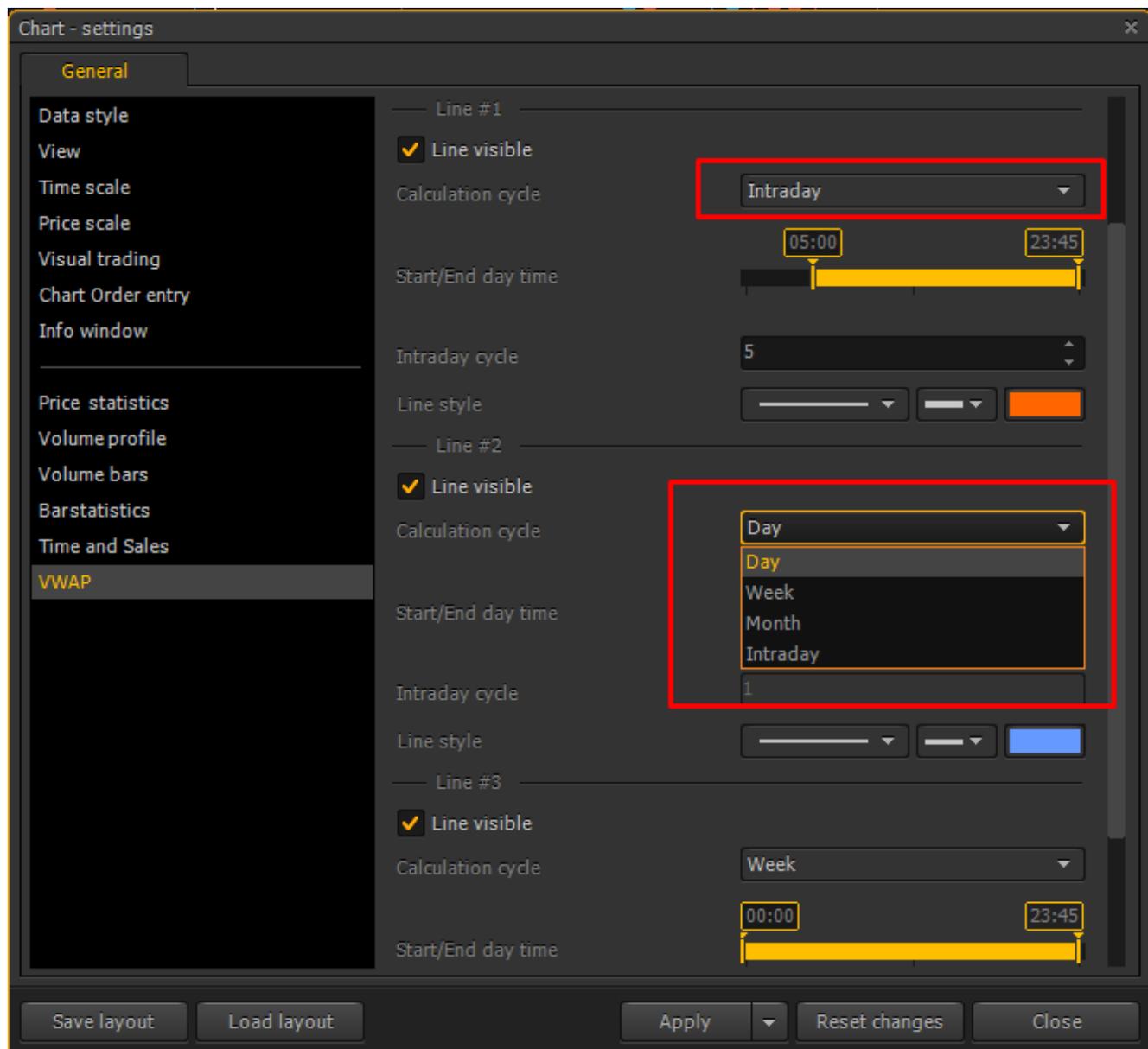


Рис. 2b. Расчетные циклы VWAP в платформе PTMC

## Торговля с помощью VWAP

Расчет VWAP при использовании дневного цикла начинается с цены открытия торгового дня (также можно задать время расчета для отдельной торговой сессии), и поначалу VWAP будет очень чувствителен к изменению цены. Но по мере торговли в течение дня он станет более стабильным.

Когда вы используете VWAP, вы должны иметь в виду, когда цена выше линии, значит, преобладает восходящий тренд. И напротив, если цена ниже VWAP, значит преобладает нисходящий тренд.

Наверное, вам интересно, каково поведение этого индикатора при использовании на боковом рынке. В этом случае VWAP будет просто проецироваться посередине ценового диапазона.

Глядя на направление VWAP, вы можете понять, следует ли использовать трендовую или возвратную стратегию.

На следующих рисунках показано, как выглядит VWAP на примере графика TSLA (Tesla company) соответственно для бычьего рынка (рис. 3а), медвежьего рынка (рис. 3б) и бокового рынка (рис. 3с).



Рис. 3а. VWAP на бычьем рынке

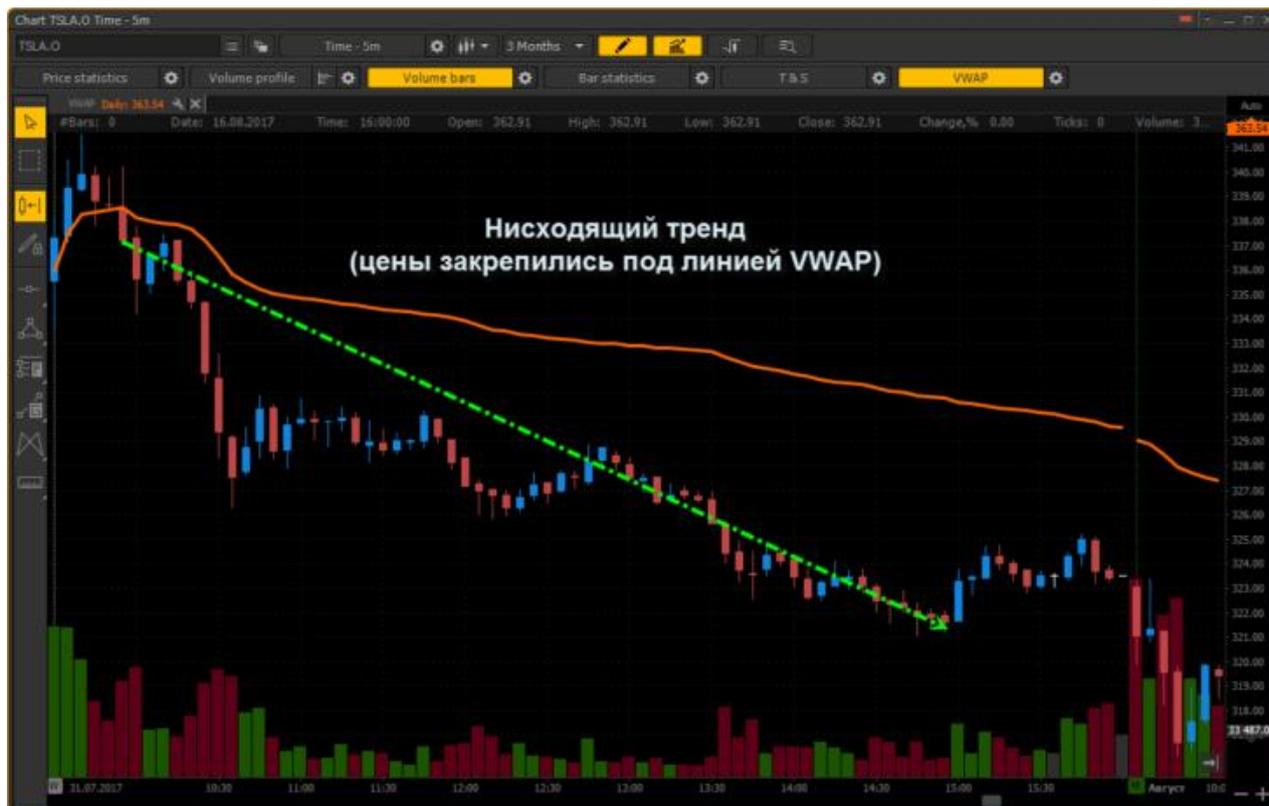


Рис. 3b. VWAP на медвежьем рынке



Рис. 3c. VWAP на флетовом рынке

## Как профессиональные трейдеры используют VWAP?

- покупают, когда цена ниже VWAP, потому что они могут накапливать позицию по цене, которая лучше, чем средняя рыночная цена.
- закрывают длинные позиции и открывают короткие, когда цена выше VWAP.

VWAP используется HFT трейдерами для покупки / продажи в точке, которая не вызвала бы внезапного движения цен на акции. Это не обязательно дает торговые сигналы, но помогает покупать низкие и высокие продажи. При использовании с другими торговыми индикаторами он определенно может помочь в повышении точности вашей торговой стратегии. Вы должны понимать, что это только один показатель из тысячи, который учитывается при размещении большого объема ордеров.

## Стратегия розничных трейдеров, которые используют VWAP

Розничные торговцы хотят часто торговать на импульсных движениях. Когда цена пересекает линию VWAP, то можно рассматривать это как сигнал восходящего тренда. И затем вы можете искать возможности для покупки. Напротив, можно рассматривать сигналы на продажу, если цена ниже линии VWAP.

Когда вы выбираете эту стратегию, вы должны знать, что:

- Сильное давление на покупку выше VWAP показывает, что цена заставляет участников рынка достичь нового максимума.
- Сильное давление на продажу ниже VWAP является признаком того, что цена подталкивается вниз, чтобы достичь нового минимума.
- График ниже (рисунок 4) показывает взаимодействие линии VWAP и цены. Часто VWAP является поддержкой или сопротивлением. Это означает, что вы можете использовать VWAP в своей стратегии, для определения динамических уровней поддержки и сопротивления.



Рис. 4. VWAP как динамический уровень поддержки / сопротивления

## Недостатки VWAP

Нет сомнений в том, что VWAP – отличный индикатор, который вы можете использовать для входа в прибыльные позиции. Но это не святой грааль, который сделает вас успешным без каких-либо усилий с вашей стороны. Основным недостатком индикатора VWAP (как и любой MA) заключается в том, что он запаздывает. Это связано с его кумулятивной формулой.

Давайте проясним это на примере: если вы используете 5-минутный график, после 4 часов торговли VWAP будет рассчитан для 48 периодов. Задержка, связанная с этим, будет похожа на 48 периодов скользящей средней (рис. 5). По мере того, как в течение дня накапливается объем, это отставание будет увеличиваться, и в конце дня оно достигнет самого высокого значения. Это связано с тем, что в расчете уже учитывается столько данных, что новые данные имеют крайне малое влияние.

Поэтому VWAP имеет большую ценность в начале дня для розничных торговцев, потому что он более чувствителен к ценовым движениям.



Рис. 5. Расхождение между VWAP и SMA (48)

С другой стороны, в конце дня VWAP будет сглажен и окажется мало полезен для розничного трейдера. Значения VWAP на конец дня более важны для институционального трейдера, поскольку стоимость индикатора дает ориентир, с помощью которого они могут сравнить свои накопленные позиции относительно средней цены на рынке.

FT#

# «Здравствуйтесь! Вас интересует пассивный доход?»

## Как не попасть к форекс мошенникам

*Пассивный доход – это доход, который не зависит от ежедневной деятельности. Наверняка, нет такого человека, который бы не хотел периодически получать какие-нибудь проценты на вклады, арендные платежи или дивиденды.*

*Сегодня мы коснемся темы пассивных доходов, но не будем предлагать 10 самых распространенных способов получения пассивного дохода. О чем же тогда пойдет речь? Заинтригованы?*

### **Вы еще не приготовили мешки для денег? Тогда мы идем к вам!**

Телефонный звонок. Незнакомый номер. Приятный женский голос.

— Здравствуйте. Вас интересует пассивный доход?

И далее, все тем же приятным голосом девушка делает мне заманчивое предложение – возможность получения пассивного дохода от 30% в месяц. А заманчивость предложения заключается в том, что мне ничего, собственно, делать и не нужно. Просто нужно принести деньги в компанию «АБВ капитал», а дальше ими займутся сотрудники компании – профессиональные аналитики и трейдеры с трехсотлетним стажем работы на всевозможных финансовых рынках. Мне же останется только получать ежемесячную прибыль.



«Так это же прекрасно!» – скажете вы. И я соглашусь с этим, но напомним читателям свою любимую поговорку: «Дьявол кроется в деталях». Именно детали мне (а теперь, надеюсь, и вам) уж очень интересны.

Набираю название компании в Гугле и вижу, что компания является инвестиционным банком, входящим в группу компаний АБВ. Но и мы не лыком, так сказать, шиты. Мой вопрос «А какая организация регулирует деятельность вашей компании?» озадачивает девушку. После поисков ответа, которое у нее заняло некоторое время, она приглашает к телефону старшего менеджера, который ответит мне на все мои вопросы.

Старший менеджер уверенным голосом отвечает, что их регулирует Российская Федерация. Любопытно...

Точно таким же уверенным голосом я говорю старшему менеджеру, что никакого своего согласия на рекламные звонки я никому не давал, а поэтому, на каком, собственно, основании мне звонят? Получаю невнятный ответ, что у них есть общедоступная информация о том, что я трейдер и все в таком роде.

После еще нескольких моих вопросов энтузиазм старшего менеджера несколько увял. Поняв, что для их компании я – клиент бесперспективный, разговор был закончен.

А теперь, уважаемые знатоки, вопрос – а кто же звонил?

### **Волки в овечьей шкуре**

Честно говоря, это не первый звонок такого типа. Я их получаю периодически. Наверняка, многие из трейдеров с ними тоже сталкивались. Опытные трейдеры понимают, кто и зачем им звонит уже с первого слова.

А для тех, кто еще не в курсе, знайте – это самые настоящие мошенники, пытающиеся завладеть вашими деньгами под видом инвестиций или трейдинга.

Схема их работы проста: вам предлагают внести деньги на торговый счет в их компании, после чего вы можете попробовать торговать на нем сами или же доверить управление своими деньгами «супертрейдерам и аналитикам», которых опасается весь Уолл-стрит. Дальше события развиваются следующим образом:

Если вы пытаетесь торговать самостоятельно, то рано или поздно

сливаете счет и остаетесь в положении «сам дурак».

Если же ваш счет под «надежным» управлением, то опять же, рано или поздно, вам звонят из компании и сообщают, что «на рынке возникли форс-мажорные обстоятельства. Наши аналитики и трейдеры вообще впервые видят такую ситуацию. К сожалению, на вашем счете получен убыток, который превышает сумму ваших средств». В общем, вы еще остаетесь компании должны.

Как альтернатива, вас могут попросить внести на счет «незначительную сумму», поскольку ситуация вот-вот должна вырасти и убыток будет покрыт с прибылью 1000%.

И если раньше названия таких компаний ничего не говорили даже сведущему человеку, то сейчас эти мошенники умело маскируются под реальные достаточно крупные и известные компании.

### **Инсайд от «старшего менеджера»**

Однажды на приятельских посиделках я столкнулся с одним из «старших менеджеров» подобной компании. В личном общении за «рюмкой чая» он оказался неплохим парнем, хотя то, чем он занимается, мне претит.

Так вот, по его словам, один менеджер за месяц обзванивает около 5 тысяч человек, при этом, на такое заманчивое предложение соглашаются где-то человек 10-15.

Новоиспеченного будущего миллионера подготавливают около

месяца. На его счету рисуют красивые цифры прибыли, после чего предлагают внести еще денег. Ну а чего нет? Смотрите, дела у вас идут просто замечательно. Если вы добавите на свой счет еще хотя бы 10 тысяч долларов, вы будете получать минимум 3 тысячи долларов в месяц.

Не жизнь, а сказка, не правда ли? И при упоминании суммы обязательно скажут «хотя бы», подчеркивая, что 10 тысяч долларов для их компании – это просто какая-то карманная мелочь на фоне их о-го-го каких прибылей.

В таких компаниях существует понятие «закреть клиента». То есть, ваш счет намеренно сливают. Ну а почему бы и не слить? Никто ничем реально не торговал, а нарисовать хоть отчет с прибылью, хоть с убытком – дело нехитрое. После такого «слива» клиенту

предлагают еще пополнить счет. Если у клиента в голове все-таки что-то зашевелится, и он откажется или, более того, начнет предъявлять компании какие-то претензии, то такой человек попросту игнорируется. Все, клиент закрыт.

### Откуда у них мой номер телефона?

Вполне логичный вопрос. А теперь припомните, начиная свое знакомство с фореком трейдингом, сколько раз и на каких торговых площадках вы оставляли свой номер телефона. Припоминаете? Вот и я нет. А данные ведь никуда не делись.

Вот вам для примера скриншот из поисковой системы Гугл:



купить базу клиентов ф

купить базу клиентов фореком

**куплю** базу клиентов фореком

**продам** базу клиентов фореком

Поиск в Google

Мне повезёт!

То есть, в принципе, любой желающий может купить базу номеров эдак тысяч на 200 всего за несколько сотен долларов.

### Как правильно разговаривать со «старшим менеджером»?

Если вам позвонили с таким или подобным предложением, в первую очередь. Вы должны отнестись к каждому слову с большой долей скептицизма, если вы не положили трубку в самом начале разговора.

Если вы поняли, что вас просто «разводят» на деньги, можно просто, как говорит молодежь, поприкалываться и получить удовольствие, изображая

наивного простака. Если для этого нет времени или желания, то забудьте о всякой толерантности. Очень часто такие люди играют на вашей безотказности и вежливости. Потребуйте вам больше не звонить. И да, в выражениях можно не стесняться – это только пойдет на пользу. В противном случае, если вы вежливым тоном попытаетесь вывести их на чистую воду, как в случае, который я привел выше, с вами будут разговаривать так, как будто вы им что-то должны.

Отвечая на очередной такой звонок, вспомните эту статью. Надеюсь, она убережет многих начинающих трейдеров и инвесторов от необдуманных шагов и крупных финансовых потерь.

FT#

Копируя его сделки в реальном времени с помощью сервиса **Share4you**.

# Форекс стратегия Fakey Pattern Trading System на основе паттернов Price Action

Форекс стратегия Fakey Pattern Trading System основана на так называемом паттерне Fakey, который состоит из паттерна Price Action «Внутренний бар» и его ложного прорыва.

Торговая стратегия Fakey Pattern Trading System имеет трендовый характер. Сигналы паттерна Fakey фильтруются с помощью двух скользящих средних, с помощью которых определяется направление тренда.

## Входные параметры

- Валютные пары: EUR/USD, GBP/USD, USD/JPY, USD/CHF, GBP/JPY, EUR/NZD, AUD/USD, EUR/GBP, EUR/JPY
- Таймфрейм: М5 и выше
- Время торгов: любое
- Риск-менеджмент: после расчета стоп-лосса выбирайте такой объем лота, чтобы риск был не более 2-5% от депозита на одну сделку.

## Используемые индикаторы

- EMA (100, close);
- EMA (200, close);
- Fakey Pattern indicator.
- НАСТРОЙКА ЦЕНОВОГО ГРАФИКА
- Распаковываем архив
- Шаблон копируем в папку templates
- Индикаторы копируем в папку MQL4 -> indicators
- Перезапускаем терминал
- Открываем график нужной валютной пары
- Устанавливаем шаблон с именем Fakey Pattern Trading System

График должен выглядеть так:



Рис. 1. Шаблон торговой стратегии Fakey Pattern Trading System

### Сигналы, указывающие на открытие длинной позиции (покупки)

- ЕМА 100 находится выше ЕМА 200;
- Появилась стрелка вверх голубого цвета.

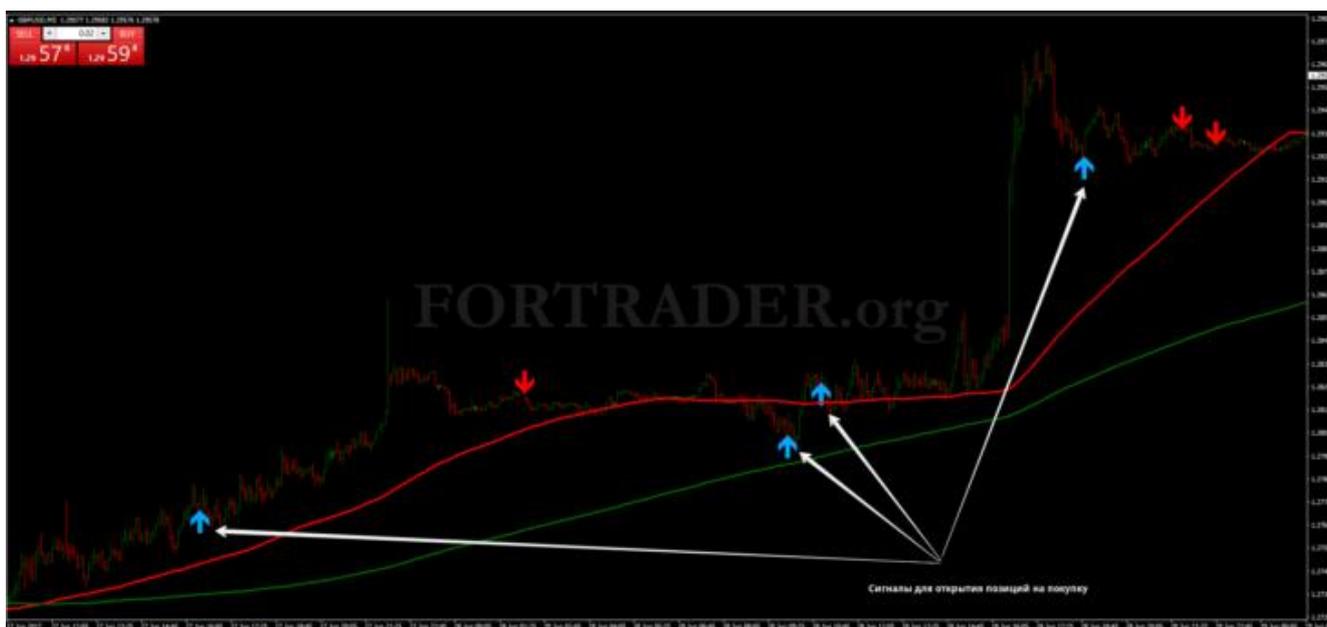


Рис. 2. Примеры длинных сделок

## Сигналы, указывающие на открытие короткой позиции (продажи)

- ЕМА 100 находится ниже ЕМА 200;
- Появилась стрелка вниз красного цвета.



Рис. 3. Примеры коротких сделок

## Установка ордеров стоп-лосс и тейк-профит

Так как форекс стратегия Fakey Pattern Trading System носит трендовый характер, то в ней используются классические методы установки ордеров стоп-лосс и тейк-профит:

- Стоп-лосс устанавливается выше/ниже предыдущего локального максимума/минимума
- Выход из позиции осуществляется при появлении противоположного сигнала или по тейк-профит, установленному около следующего уровня поддержки или сопротивления.

Правила торговой стратегии Fakey Pattern Trading System просты и понятны, поэтому даже у начинающих трейдеров она вряд ли вызовет какие-нибудь затруднения.

Обратите внимание, что использование в стратегии скользящих средних подразумевает некоторое запаздывание. Вполне возможен вход в позицию до смены расположения скользящих средних, однако, для этого следует использовать дополнительные индикаторы, графические построения или ориентироваться на отработку разворотных фигур технического анализа.

Перед использованием торговой стратегии Fakey Pattern Trading System на реальном депозите, мы настоятельно рекомендуем протестировать ее на демо-счете.

- **Скачать шаблон и индикаторы стратегии Fakey Pattern Trading System**

#FT