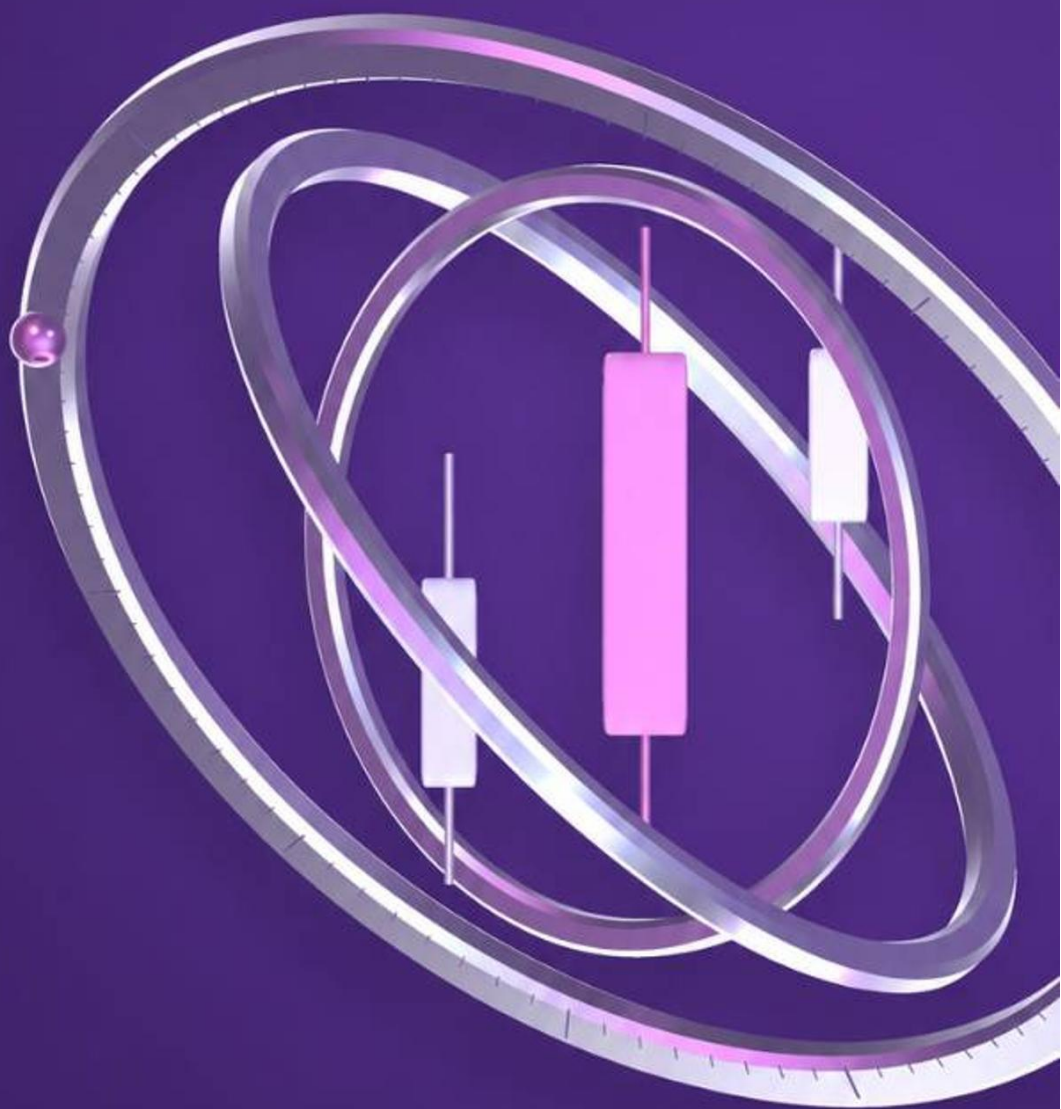


Smart Forex

ВИКТОР КРОСС



**Практическое
руководство**

от основ MetaTrader 4
до стратегии и психологии
трейдера

Виктор Кросс

**Smart Forex. Практическое
руководство от основ
MetaTrader 4 до стратегии
и психологии трейдера**

«Автор»

2026

Кросс В.

Smart Forex. Практическое руководство от основ MetaTrader 4 до стратегии и психологии трейдера / В. Кросс — «Автор», 2026

Хватит учиться Forex по роликам, где прибыль появляется быстрее, чем объяснение риска. Smart Forex заставляет открыть MetaTrader 4 и делать руками: считать пункты и размер позиции, ставить стоп-лосс, читать график на нескольких таймфреймах, строить торговый план, вести дневник и переживать серию убытков без мести рынку. Далее идут технический анализ, макроэкономика, центральные банки, управление капиталом и психология. В приложениях: чек-листы, 90-дневный и годовой планы, реальные сделки с комментариями, сценарии, дневники и упражнения. Это не книга, которую читают и ставят на полку. Это тренажёр, который превращает хаотичного новичка в человека с процедурой, правилами и статистикой. Если вы собираетесь рисковать реальными деньгами, сначала научитесь не рисковать вслепую. При редакционной подготовке текста использовался Gemini.

© Кросс В., 2026

© Автор, 2026

Содержание

1. Предисловие автора	6
2. Введение: как использовать эту книгу в сочетании с MetaTrader 4	7
2.1. Добро пожаловать в Smart Forex	7
2.2. Обязательное условие: на компьютере должна быть установлена пробная версия МТ4	8
2.3. ПК против смартфона: почему ПК практически незаменим	9
2.4. Пошаговое руководство: как установить MetaTrader 4 на компьютер с Windows	11
2.5. Установка на Mac	12
2.6. Установка на смартфон (в качестве дополнения)	13
2.7. Три действия, которые вам нужно выполнить в течение первых 30 дней использования демо-платформы МТ4	14
2.8. Интерфейс MetaTrader 4: 4 основных панели	15
2.9. Структура книги: 6 последовательных уровней	16
2.10. Цветные вставки: как организовано содержание	17
2.11. 5 правил эффективного использования этой книги	19
Правило 2.12 — Читайте по порядку	20
Правило 2.13 — Все упражнения необходимо выполнять в МТ4	21
Правило 2.14 — Распечатайте контрольные списки	22
Правило 2.15 — Держите окно МТ4 открытым во время чтения	23
Правило 2.16 — читайте медленно и регулярно	24
2.17. Необходимые вещи для начала: полный список	25
Уровень 3 — Основы Форекс	26
3.1. Валютный рынок: чем вы на самом деле занимаетесь	27
3.2. Кто на самом деле управляет рынком	28
3.3. Четыре рыночных сеанса и время работы итальянских трейдеров	29
3.4. График — 4 рыночных торговых сессии перекрываются в течение более 24 часов (по центрально-итальянскому времени)	30
3.5. Валютные пары: как выбирать и почему	32
3.6. Полный глоссарий и примеры	35
3.7. Пип: единица измерения	36
3.8. Дополнительные знаки после запятой: «пипетка»	37
3.9. Лот: размер позиции	38
3.10. Спред: ваши торговые издержки	40
3.12. Собственный капитал, доступная маржа, уровень маржи	42
3.13. Маржа и принудительное закрытие позиций: два сигнала опасности	43
3.14. Стоп-лосс и тейк-профит: «ремень безопасности»	45
3.15. Установка стоп-лосса: три метода	46
3.16. Как установить уровень тейк-профита: принцип R:R	47
3.17. MetaTrader 4: профессиональная пошаговая настройка	49
3.18. Шаг 1: Настройка списка наблюдения	50
3.19. Шаг 2: Установите правильный временной интервал	51
3.20. Шаг 3: Добавьте ключевые индикаторы (и только их)	52
3.21. Шаг 4: Сохранение шаблона	53

3.22. Управление капиталом: навыки, которые спасут ваш счет	54
3.23. Правило 2%	55
3.24. Ежедневные и еженедельные лимиты	57
Уровень 4 — Технический анализ	59
4.1. Структура японских свечей	60
4.2. Временной интервал: как выбрать?	63
4.3. 5 моделей свечей, которые вам нужно знать	64
4.4. Рисунок 1: «Молоток»	65
4.5. Фигура 2: «Метеор»	66
4.6. Фигура 3: бычий поглощающий бар	67
4.7. Фигура 4: Медвежья фигура «поглощения» (медвежья фигура «поглощения»)	68
4.8. Фигура 5: Крест	69
4.9. Уровни поддержки и сопротивления: как их рисовать и использовать	70
4.10. Как рисовать уровни поддержки и сопротивления	73
4.11. Психологические уровни: целые числа	74
4.13. Структура тренда: HH/HL и LL/LH	75
4.14. Объективное определение нисходящего тренда	76
4.15. Важность прорыва структуры	77
4.16. RSI и скользящие средние: подтверждение сигнала, а не сам сигнал	78
4.17. Скользящие средние: EMA 21 и SMA 200	79
4.18. Индекс относительной силы (RSI): осциллятор импульса	80
4.19. Расхождение RSI: качественный сигнал	81
Конец ознакомительного фрагмента.	82

Виктор Кросс

Smart Forex. Практическое руководство от основ MetaTrader 4 до стратегии и психологии трейдера

1. Предисловие автора

Если вы читаете эту книгу, то, вероятно, уже столкнулись с суровой реальностью торговли на Форекс: видео на YouTube обещают удвоить ваш счет за неделю, онлайн-курсы стоимостью в тысячи евро в конечном итоге оказываются мошенничеством, а «гуру» в социальных сетях хвастаются Ferrari и Rolex, но никогда не раскрывают информацию о своих реальных счетах. Вы растеряны, а порой даже чувствуете, что над вами посмеялись, и в голове у вас постоянно крутится один и тот же вопрос: «Можно ли действительно серьезно научиться торговать?»

Ответ — да. Но для этого нужен подход, кардинально отличающийся от тех методов, которые вам навязывают. Нужен честный, систематический и — что самое главное — практичный подход. Не теория из учебников, не воодушевляющие лозунги и не какие-то секреты. Нужна настоящая практика: работать в платформе MetaTrader, самостоятельно делать расчёты на калькуляторе, выполнять упражнения и каждый вечер вести торговый дневник.

Эта книга — плод моего многолетнего практического опыта: знакомства с рынком, собственных ошибок и ценных выводов, сделанных благодаря ежедневному упорному изучению графиков. Это не академический труд и не сборник чужих теорий, а опыт торговли на Форекс на реальные деньги, который позволил мне выяснить, какие методы работают, а какие — нет. Я постарался изложить ключевые концепции, разобрать ошибки, которые совершали я сам и другие, и ответить на вопросы, которые возникают только на практике. В результате получилось руководство не на один день: оно будет сопровождать вас в течение нескольких месяцев.

Важнейшая особенность этого руководства — работа с ним предполагает использование платформы MetaTrader 4. Все упражнения, примеры и расчёты основаны на том, что вы можете в режиме реального времени просматривать графики, измерять пункты и тестировать ордера. Читать эту книгу, не запустив MetaTrader 4, — всё равно что учиться плавать, только читая инструкцию, но никогда не входя в воду: вы усвоите теорию, но никогда не научитесь плавать.

Прежде всего, я прошу вас взять на себя конкретное обязательство: скачать MetaTrader 4 с сайта smart-forex.net (полная инструкция приведена ниже в разделе «Введение»), открыть демо-счёт с виртуальным капиталом не менее 10 000 евро и начать использовать эту книгу в качестве практического руководства по освоению данного программного обеспечения. Только так прочитанное превратится в настоящие профессиональные знания.

Желаю вам приятного путешествия. До встречи на страницах книги.

2. Введение: как использовать эту книгу в сочетании с MetaTrader 4

2.1. Добро пожаловать в Smart Forex

Добро пожаловать. Это не та книга, которую прочитают и отложат на полку. Это практическое руководство, которое станет вашим верным помощником в первые месяцы (а то и годы) вашей торговой карьеры и будет всегда лежать рядом с экраном компьютера. Вы будете пользоваться ею так же, как руководством по ремонту: не читать за один присест, а обращаться к ней по мере необходимости, выделять важные моменты, делать заметки и, самое главное, применять полученные знания на практике.

Эта книга появилась благодаря простому, но важному наблюдению: большинство книг по трейдингу либо слишком теоретичны, либо слишком поверхностны. В них объясняют, что такое пункт, но не дают возможности рассчитать его стоимость на вашем счете. В них говорят: «Используйте стоп-лосс», но не объясняют, как его устанавливать в десяти различных ситуациях. В них обсуждают психологию, но не предлагают плана действий на случай, если вы потерпите пять убыточных сделок подряд.

Эта книга, напротив, уделяет особое внимание практической стороне дела. Каждая концепция сопровождается реальными данными, конкретными примерами, упражнениями и списками для распечатки. Кроме того — и в этом заключается главное отличие этой книги от почти всех других руководств — она специально разработана для использования в сочетании с платформой MetaTrader 4, запущенной на компьютере.

2.2. Обязательное условие: на компьютере должна быть установлена пробная версия МТ4

Золотое правило: единственное непреложное условие

Прежде чем продолжить чтение, вам необходимо скачать MetaTrader 4 с сайта smart-forex.net на свой компьютер и открыть демо-счёт с виртуальным капиталом не менее 10 000 евро. В противном случае ценность этой книги снизится на 70%.

Под «демо-счетом» понимается полностью бесплатный виртуальный счет, средства на котором являются виртуальными, но с реальными рыночными ценами, реальными спредами и механизмом торговли, полностью идентичным реальной торговле. Это своего рода тренажер для трейдеров. Демо-счёт, который я предоставляю на сайте smart-forex.net, настроен специально для учебных целей данного руководства: он использует те же параметры (кредитное плечо, минимальный размер лота), что и в наших упражнениях.

Если вы хотите читать эту книгу, не запуская МТ4, лучше отложите её сейчас, чтобы не тратить время зря. Так не получится. Каждое упражнение, каждый пример и каждый расчёт в этой книге предполагают, что вы можете в любой момент просматривать графики, измерять пункты и тестировать ордера.

2.3. ПК против смартфона: почему ПК практически незаменим

Вы можете установить MetaTrader 4 на компьютер (Windows или Mac) или на смартфон (Android или iPhone). Обе версии бесплатны и обладают полным набором функций. Однако между ними существует огромная разница, особенно с точки зрения освоения программы.

На компьютере у вас есть большой экран, позволяющий одновременно просматривать несколько таймфреймов, точно прокладывать линии поддержки и сопротивления, удобно использовать такие индикаторы, как RSI и скользящие средние, а также открывать торговый журнал в Excel рядом с графиком. Одним словом, на компьютере вы можете работать как профессионал. На смартфоне вы можете отслеживать открытые позиции, находясь вдали от дома, или закрывать позиции в экстренных ситуациях, но вы не сможете учиться, проводить тщательный технический анализ или эффективно выполнять упражнения, приведенные в этой книге.

Устройства ПК (Windows/Mac) Смартфон

Технический анализ на нескольких таймфреймах

Идеально

Очень сложно

Определение уровней поддержки и сопротивления

Точно

Неточно

Просмотр нескольких графиков одновременно

(4–6 графиков)

(по одному за раз)

Далее — управление дневником в Excel.

Удобно

Невозможно

Тестирование стратегий с помощью тестера стратегий

Пока нет

Срочный заказ

Идеально подходит

для отслеживания местоположения за пределами вашего дома

Идеально

для выполнения упражнений из этой книги.

Необходимо

Неэффективно

Совет: Идеальная конфигурация

Идеальная конфигурация: использовать МТ4 на компьютере в качестве основного инструмента для обучения и торговли, а также установить МТ4 на смартфон и подключить его к тому же демо-счету, чтобы вы могли контролировать свои позиции, даже когда не находитесь за компьютером. Один и тот же счет (демо-счет или реальный счет) можно использовать одновременно на компьютере и смартфоне: ваши позиции будут полностью совпадать и синхронизироваться в режиме реального времени.

Если у вас есть только смартфон (например, если вы — студент, часто находящийся в разъездах, или человек, которому приходится длительно находиться в командировках), вы всё равно можете начать знакомиться с интерфейсом. Но лучше сначала установить МТ4 на первый попавшийся компьютер, а затем заново приступить к выполнению упражнений из книги.

2.4. Пошаговое руководство: как установить MetaTrader 4 на компьютер с Windows

Весь процесс займет менее десяти минут и не требует никаких специальных технических навыков. Пожалуйста, выполняйте следующие шаги в указанном порядке.

Упражнение: Упражнение 0 — Установка МТ4 на компьютер (обязательно, 10 минут)

Сразу же выполните следующие шаги, а затем продолжайте чтение. Это первое упражнение книги, его необходимо выполнить.

Шаг 1: Откройте браузер на компьютере и перейдите по адресу www.smart-forex.net. На главной странице вы найдёте раздел, специально предназначенный для загрузки демо-версии MetaTrader 4: это версия, подготовленная мной для читателей данного руководства и настроенная специально для учебных целей.

Шаг 2: Нажмите на сайте кнопку «Скачать пробную версию МТ4». Размер файла.exe (для Windows) или.dmg (для Mac) составляет примерно 1–2 МБ, и загрузка займет всего несколько секунд. Загрузка бесплатна и не требует регистрации.

Шаг 3: Дважды щелкните по скачанному файлу, чтобы начать установку. Примите условия использования, подтвердите папку установки по умолчанию и подождите. Процесс установки займет 1–2 минуты и не требует каких-либо специальных настроек.

Шаг 4: При первом запуске МТ4 откроется окно «Открыть счет». На странице загрузки программного обеспечения на сайте smart-forex.net вы найдете подробную инструкцию по первоначальному подключению, включая номер демо-счета, пароль и название сервера. Следуя инструкциям, вы сможете завершить настройку и начать работу всего за 2 минуты.

Пятый шаг: выберите виртуальный капитал в размере 10 000 евро для тренировки в режиме симуляции (не превышайте эту сумму: тренировка с 100 000 евро заставит вас недооценить важность управления рисками). Настройки кредитного плеча соответствуют требованиям Европейского управления по ценным бумагам и рынкам (ESMA): коэффициент кредитного плеча для основных акций составляет 1:30. Не изменяйте эту настройку.

В правом нижнем углу платформы вы увидите зелёный статус «Подключено», а цифры будут обновляться в режиме реального времени. Поздравляем — вы успешно запустили платформу и готовы к работе.

Шаг 7: Теперь слева вы видите рыночные котировки (список валютных пар и их цен), в центре — график, а внизу — терминал, отображающий ваш виртуальный баланс в размере 10 000. В разделе 1.7 этой книги мы вместе рассмотрим настройки интерфейса, включая шаблоны графиков, индикаторы и т. д.

Если у вас возникли проблемы: на странице загрузки smart-forex.net вы найдете раздел «Устранение неполадок», в котором перечислены наиболее распространённые проблемы (ошибки подключения, сервер не найден, сертификат не принимается). Если проблема осталась, обратитесь по адресу info@smart-forex.net или в Telegram-группу @SmartForexIT.

2.5. Установка на Mac

Если вы используете Mac: MetaTrader 4 — это программное обеспечение, разработанное для Windows, но на сайте smart-forex.net вы также можете найти версию для Mac (предоставляется через официальный пакетировщик). Скачайте её из того же раздела загрузок и следуйте тем же инструкциям: она полностью идентична версии для Windows. В качестве альтернативы вы можете скачать MT4 Web прямо из браузера: её функционал немного уступает версии для Windows, но вполне достаточен для начинающих.

2.6. Установка на смартфон (в качестве дополнения)

Если вы уже установили MT4 на компьютер и хотите добавить смартфон, чтобы просматривать свои позиции, когда вы находитесь вдали от компьютера, то сделать это очень просто:

1. Откройте Play Store (Android) или App Store (Apple)
2. Найдите приложение «MetaTrader 4» (разработчик: MetaQuotes)
3. Установите приложение (бесплатно)
4. При первом запуске выберите «Войти в существующий аккаунт»
5. Введите адрес сервера, имя пользователя и пароль демо-счёта, полученные на странице загрузки smart-forex.net (те же данные, что и на компьютере).
6. Вы подключены. Ваш компьютер и смартфон синхронизированы для использования одного и того же счёта.

2.7. Три действия, которые вам нужно выполнить в течение первых 30 дней использования демо-платформы МТ4

В течение первых 30 дней использования данного руководства вы будете выполнять следующие три конкретных действия на демо-счете МТ4:

1. Наблюдайте за парой EUR/USD: уделите как минимум две недели наблюдению за графиком EUR/USD. Не совершайте сделок. Изучите его динамику, поведение на разных временных интервалах, когда возникают сильные колебания, а когда — боковое движение. Такое упражнение по «интерпретации рынка» часто недооценивают, но оно имеет решающее значение.

2. Выполняйте упражнения: все упражнения из этой книги необходимо выполнять на демонстрационной платформе МТ4. Каждое упражнение должно быть выполнено. Всего около 20 практических упражнений. Не пропускайте ни одного. Каждое пропущенное упражнение означает, что вы не освоили какой-то навык.

3. Торгуйте на демо-счете: после прочтения первого и второго уровней вы можете начать торговать на демо-счете. Совершайте не более одной-двух сделок в день и записывайте их все в свой торговый дневник. Цель первых 30 дней — не заработать деньги, а на 100 % выполнить торговый план.

2.8. Интерфейс MetaTrader 4: 4 основных панели

Прежде чем углубляться в детали работы на первом уровне, давайте посмотрим на схематическое изображение интерфейса МТ4. Когда вы впервые откроете платформу, вас может ошеломить огромный объем информации. На самом деле всё не так сложно, как кажется: МТ4 разделена на четыре основных панели, и, как только вы разберётесь в их назначении, пользоваться остальными функциями станет гораздо проще.

LA STRUTTURA DI METATRADER 4 (MT4) — I 4 Pannelli Principali

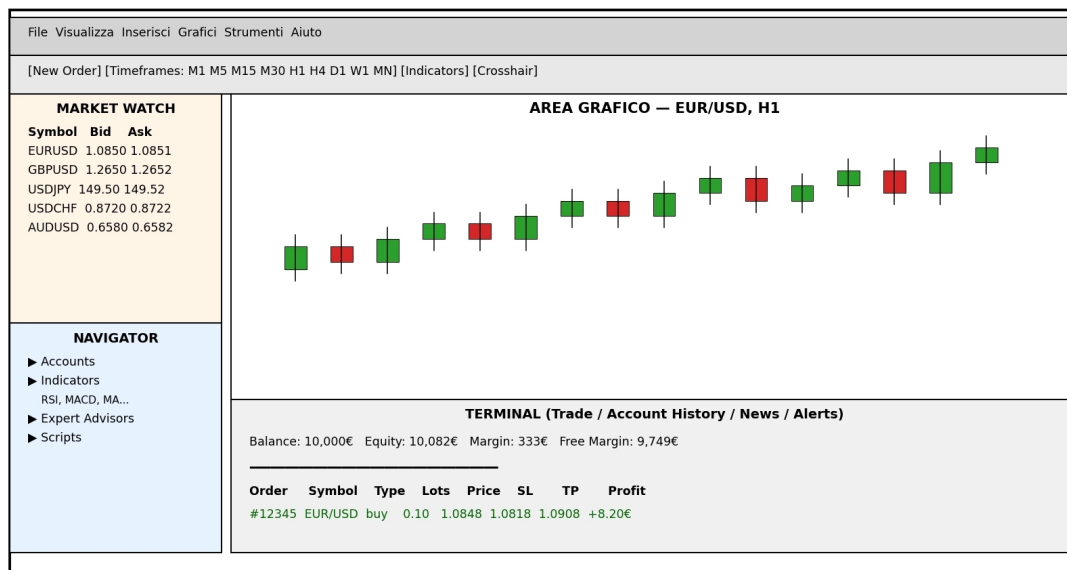


Рис. — Схема интерфейса MetaTrader 4, включающая 4 основных панели

Эти 4 панели:

- **Список котировок (вверху слева):** список валютных пар с отображением текущих цен покупки (аск) и продажи (бид). Разница между ценой покупки и ценой продажи называется спредом. Отсюда вы можете перетаскивать валютные пары на график.
- **Панель навигации (в левом нижнем углу):** содержит список ваших счетов, доступных индикаторов (RSI, скользящие средние, MACD и т. д.), торговых роботов и скриптов. Здесь вы можете перетаскивать индикаторы на график.
- **Область графиков (самая большая область в центре):** здесь отображаются графики валютных пар. Вы можете одновременно открывать несколько графиков, менять временные периоды (M1, M5, M15, H1, H4, D1 и т. д.), применять индикаторы, а также рисовать линии поддержки и сопротивления.
- **Терминал (внизу):** панель управления. Здесь отображаются ваш баланс, чистая стоимость (баланс + прибыль/убыток по открытым позициям), использованная маржа и доступная маржа. Вкладки включают: Торговля (открытые позиции), История счета, Новости и Уведомления.

В разделе 1.7 курса первого уровня вы шаг за шагом научитесь профессионально настраивать эти панели. А пока просто ознакомьтесь с их внешним видом.

2.9. Структура книги: 6 последовательных уровней

Шесть уровней, пошаговое обучение. Каждый уровень строится на основе предыдущего. Если пропустить какой-либо уровень, всё последующее будет так же неустойчиво, как дом, построенный на песке. Обязательно проходите курсы по порядку и не торопитесь.

1. Основы Форекс (первый уровень) — основы: как работает рынок, терминология и конкретные примеры, пошаговая настройка MetaTrader 4, а также базовые знания по управлению капиталом. Без этих основ всё остальное будет подобно дому, построенному на песке.

2. Технический анализ (уровень 2) — язык графиков: японские свечные графики (с комментариями к 5 полным сделкам), уровни поддержки и сопротивления, RSI, скользящие средние, а также метод работы с несколькими таймфреймами, используемый профессионалами.

3. Продвинутые стратегии (уровень 3) — три готовые к использованию стратегии (следование за трендом, тестирование прорыва, отскок от уровней поддержки/сопротивления), а также шаблоны торговых планов и форматы торговых дневников с заполненными примерами.

4. Макроэкономика (уровень 4) — как экономические данные влияют на валюты, в сочетании с примерами из реальной жизни (данные по занятости в несельскохозяйственном секторе, решения ЕЦБ, индекс потребительских цен), экономический календарь и корреляции между валютными парами.

5. Управление капиталом и средствами (Уровень 5) — сколько капитала действительно нужно, а также средства, необходимые для ведения бизнеса как разумный выбор, математическое ожидание и итальянский налог на торговые операции.

6. Психология трейдинга (уровень 6) — 5 внутренних врагов, полный распорядок дня, соглашение о серии проигрышей и тест из 100 сделок.

2.10. Цветные вставки: как организовано содержание

Каждая концепция в книге сопровождается цветной рамкой. Каждый цвет соответствует определенному типу содержания, что позволяет интуитивно ориентироваться в книге и быстро находить нужную информацию.

Практические примеры: зелёные рамки — практические примеры

Зеленые рамки содержат полные пошаговые инструкции по совершению сделок с подробными комментариями и реальными данными, охватывающими весь процесс от входа до выхода, включая управление эмоциями. Эти рамки — самая важная часть книги: они показывают, как эти концепции применяются в реальной торговле. Внимательно читайте их, делайте заметки и, если возможно, воспроизводите эти сделки на демо-версии платформы МТ4.

Расчеты: фиолетовые рамки — расчеты

В фиолетовых рамках приведены формулы с примерами для 2–3 различных уровней капитала. Необходимо повторять эти вычисления с помощью калькулятора до тех пор, пока вы не освоите их в совершенстве. Эти упражнения, хотя и требуют много времени, имеют решающее значение: владение методами расчета пунктов, маржи и размера позиции — это ключевой фактор, отличающий трейдеров-любителей от профессионалов.

Контрольный список: оранжевая рамка – контрольный список

В оранжевых рамках приведены практические чек-листы, которые можно распечатать и использовать ежедневно. Когда эмоции влияют на ваше суждение, они действуют как «автопилот». Все ключевые чек-листы также собраны в приложении В в формате для печати, чтобы вы могли разместить их рядом с монитором.

Распространенные ошибки: красная рамка – Распространенные ошибки

В красных рамках перечислены ошибки, которые чаще всего допускают новички, с подробным анализом причин и конкретными способами их устранения. Всего я собрал 12 самых распространённых ошибок. Вы почти наверняка допустите как минимум половину из них. В этом нет ничего страшного: главное — уметь сразу распознавать эти ошибки, понимать их и не повторять их в будущем.

«Если... что бы вы сделали»: бирюзовые рамки — сценарии «Если... что бы вы сделали»

Эти сине-зелёные рамки содержат реальные ситуации, с которыми сталкивается каждый трейдер, а также объяснения правильных стратегий реагирования и их обоснования. Они помогут вам разработать набор сценариев действий, благодаря чему, когда такие ситуации возникнут (а они обязательно возникнут), вы сразу будете знать, что делать, и не придётся импровизировать.

Упражнения: темно-синие рамки — практические задания

Темно-синие рамки содержат практические задания, которые необходимо выполнить в демо-версии МТ4, и, по возможности, предоставляют ответы с автоматической проверкой. Эти упражнения составляют основу книги. Просто читать книгу, не выполняя упражнения, — все равно что смотреть видеоуроки по плаванию, но никогда не заходить в воду. Я вам гарантирую.

Золотое правило: желтая рамка — «Золотое правило»

В желтых рамках перечислены непреложные правила торговли. Это не рекомендации, а строгие требования. Нарушение «золотых правил» подобно движению по встречной полосе: возможно, на время это принесет выгоду, но рано или поздно придется заплатить за это дорогой ценой. Обязательно запомните это.

Подсказки: светло-зелёные рамки — подсказки

В светло-зелёных рамках приведены практические советы, лайфхаки и приёмы, которые я выработал за долгие годы торгового опыта. Они не являются обязательными, но помогут вам сделать ваш путь в трейдинге более гладким. Относитесь к ним как к советам опытного друга, а не как к знаниям, которые учитель навязывает вам в жёсткой форме.

2.11. 5 правил эффективного использования этой книги

Чтобы извлечь максимальную пользу из этого руководства, следуйте следующим 5 простым правилам. Они имеют решающее значение.

Правило 2.12 — Читайте по порядку

Не переходите к третьему уровню, пока не выполните упражнения первого и второго уровней. Каждая концепция строится на основе предыдущей. Поспешность — главный враг трейдера, и это касается и читателя. Частая ошибка новичков — поспешное изучение «стратегий заработка». Но без освоения базовых знаний — таких как понятие пункта, принцип работы кредитного плеча и расчёт размера позиции — любая стратегия будет похожа на то, как слепой щупает слона. Даже если вначале вам покажется, что темп чтения слишком медленный, читайте по порядку.

Правило 2.13 – Все упражнения необходимо выполнять в МТ4

Каждый темно-синий квадрат содержит одно упражнение. Остановитесь, откройте МТ4 и сразу же приступайте к выполнению упражнения. Не откладывайте на «потом» и не говорите «завтра». Сделайте это прямо сейчас! Только упражнения из этой книги принесут результат. Держите темп: в среднем на каждое упражнение уходит 5–10 минут. Всего в книге 20 упражнений, на их выполнение потребуется примерно 3–4 часа. Это самое разумное вложение средств в ваше обучение.

Правило 2.14 – Распечатайте контрольные списки

В оранжевых квадратах содержатся списки, которые вам пригодятся каждый день. Распечатайте их и положите рядом с монитором. Когда эмоции будут влиять на ваше суждение (а это обязательно произойдет), эти списки будут служить вам в качестве автоматического навигатора. В Приложении В вы найдете чёткие версии всех списков, готовые к печати, с заранее настроенным форматом, чтобы вам было удобно их вырезать и повесить на стену.

Правило 2.15 – Держите окно MT4 открытым во время чтения

В идеале на левом экране должна быть открыта эта книга (или электронная книга на планшете), а на правом экране (или в соседнем окне) — система моделирования торговли MT4. Всякий раз, когда в книге упоминаются визуальные концепции — например, фигуры свечей, уровни поддержки/сопротивления, откаты ЕМА — ищите соответствующие концепции на графике EUR/USD в MT4. Такой подход — «увидел в книге, нашел в MT4» — позволяет учиться в три раза быстрее, чем при простом чтении.

Правило 2.16 — читайте медленно и регулярно

Не спешите прочитать эту книгу за неделю. Идеальный темп — изучать по одному уровню в неделю, тогда вы прочитаете книгу примерно за шесть недель. Например, при изучении второго уровня (технический анализ) вам следует попрактиковаться в применении материала каждого раздела в течение нескольких дней, прежде чем переходить к следующему. После прочтения всего содержания обязательно вернитесь к повторению: раздел по психологии (шестой уровень) нужно перечитывать регулярно, особенно после первых нескольких серий поражений.

2.17. Необходимые вещи для начала: полный список

Чтобы прочитать эту книгу, вам понадобится всего 5 вещей. Все они — ничто необычное и не дорогостоящее. 99 % того, что вам нужно, доступно бесплатно.

1. Компьютер или ноутбук (с ОС Windows или Mac) с стабильным подключением к Интернету. Желательно, чтобы объем оперативной памяти составлял не менее 8 ГБ, чтобы избежать замедления работы.

2. Установленная платформа MetaTrader 4 (бесплатно, с сайта smart-forex.net). Время установки: 10 минут.

3. Демо-счёт с виртуальным капиталом не менее 10 000 евро (бесплатно, можно скачать в разделе загрузок на сайте smart-forex.net). Время открытия счёта: 5 минут.

4. Калькулятор. Подойдет даже калькулятор на мобильном телефоне. Он нужен для расчета пунктов, маржи и размера позиции.

5. Торговый дневник. Это может быть как бумажный блокнот, так и таблица в Excel или Google Sheets. Полный шаблон см. в Приложении С.

Вам не нужны реальные деньги. Всё, чему вы здесь научитесь, необходимо сначала отработать на демо-счёте в течение как минимум трёх месяцев, совершив не менее 100 сделок. Переход на реальный счёт — это последний шаг, а не первый. 90 % тех, кто пропускает этап работы с демо-счётом и сразу начинает торговать на реальные деньги, терпят убытки в течение шести месяцев. Не становитесь одним из этих 90 %.

Золотое правило: обещание читателю

Я прошу вас дать обещание. Каждый раз, когда вы встретите упражнение (в темно-синей рамке), останавливайтесь и выполняйте его. Не продолжайте чтение, пока не выполните упражнение. Именно эта привычка сделает ваше знакомство с этой книгой совершенно иным по сравнению с другими руководствами по трейдингу, которые вы читали или будете читать.

Обещаете?

Если ответ «да», пожалуйста, поставьте свою подпись ниже. Серьёзно, возьмите ручку и подпишитесь в книге (или в электронной версии с помощью приложения для заметок). Это небольшой, но очень значимый шаг: ещё до того, как вы начнёте читать, вы уже дадите себе обещание. Статистика показывает, что такое письменное обещание повышает вероятность дочитать книгу до конца на 40–60 %.

Подпись читателя: _____ Дата: ____ / ____ / _____

Хорошо. Если вы уже зарегистрировались (и установили МТ4), мы можем приступать. Уроки первого уровня начинаются на следующей странице.

Уровень 3 — Основы Форекс

Прежде чем совершать какие-либо сделки, вы должны четко понимать, какой первый шаг вы делаете. Эта глава — самая длинная в книге, и это вполне оправданно: неукрепленный фундамент приведет к обрушению любого здания, даже самого великолепного. Не торопитесь. Все начинается именно здесь.

Во всех разделах этого уровня предполагается, что на вашем компьютере установлена демо-версия MetaTrader 4 и она подключена к вашему счету. Если вы еще не выполнили упражнение 0 из вводной части, сделайте паузу, а затем вернитесь и выполните его. Только если у вас будет возможность одновременно открыть МТ4 и эту книгу, вы сможете понять остальную часть этой главы.

3.1. Валютный рынок: чем вы на самом деле занимаетесь

Валютный рынок (Forex) — это рынок, на котором осуществляется торговля валютами по всему миру. По данным Банка международных расчетов за 2025 год, его ежедневный оборот превышает 7 триллионов долларов США, что делает его крупнейшим и наиболее ликвидным рынком в мире. У валютного рынка нет фиксированного физического места, он функционирует непрерывно 24 часа в сутки, 5 дней в неделю, через глобальную сеть, состоящую из центральных банков, коммерческих банков, хедж-фондов, финансовых учреждений и частных трейдеров.

При торговле на валютном рынке вы одновременно покупаете одну валюту и продаете другую. Цена, отображаемая на графике — например, EUR/USD = 1,0850 — означает: «1 евро равен 1,0850 доллара США». Если вы покупаете EUR/USD, вы делаете ставку на укрепление евро по отношению к доллару США. Если вы продаете EUR/USD, вы делаете ставку на ослабление евро по отношению к доллару США.

Что делать, если...: применение валютного рынка в повседневной жизни

Представьте, что вы отправляетесь в Нью-Йорк. Вы пошли в банк и обменяли 1000 евро по курсу 1,0850 евро за доллар. Вы получили 1085 долларов.

Ситуация А: Через неделю курс вырос до 1,1000 (евро укрепился). Если вы снова обменяете деньги: $1,085 / 1,1000 = 986,36$ евро. Вы потеряли 13,64 евро из-за изменения курса.

Ситуация В: курс упал до 1,0700 (евро ослаб). Повторный обмен: $1,085 / 1,0700 = 1\,014,02$ евро. Вы получили прибыль в размере 14,02 евро.

В торговле на валютном рынке вы вполне можете добиться этого, причём вам достаточно просто сидеть за компьютером и использовать кредитное плечо для увеличения объёма ваших операций, чтобы получать прибыль как при росте цены (открытие длинной позиции), так и при её падении (открытие короткой позиции). А самое замечательное: вам даже не нужно садиться в самолёт.

Фундаментальное отличие между обменом валюты в банкомате (для туристов) и торговлей на Форекс заключается в двух моментах: (1) при торговле на Форекс используется кредитное плечо, что позволяет вам контролировать позиции, значительно превышающие размер вашего депозита; (2) при торговле на Форекс не требуется физическая поставка валюты — это всего лишь спекуляция на динамике цен, а для закрытия позиции достаточно совершить сделку в обратном направлении и обменять разницу на наличные.

3.2. Кто на самом деле управляет рынком

Часто задаваемый вопрос: «Если я ежедневно торгую парой евро/доллар, кто является моим контрагентом?» Состав валютного рынка в целом выглядит следующим образом:

Типы участников

Предполагаемая доля

Роль

Центральные банки (ФРС, ЕЦБ, Банк Японии и др.)

Около 5 %

Они влияют на рынок посредством процентных ставок и политики.

Межбанковский рынок и коммерческие банки

около 45 %

Основные источники ликвидности, маркет-мейкеры

Хедж-фонды и крупные институциональные инвесторы

около 15 %

Масштабные спекулятивные операции

Транснациональные компании

около 15 %

Хеджирование валютных рисков при импорте и экспорте

Розничные брокеры (частные трейдеры)

около 5–8 %

Вы и другие трейдеры, подобные вам

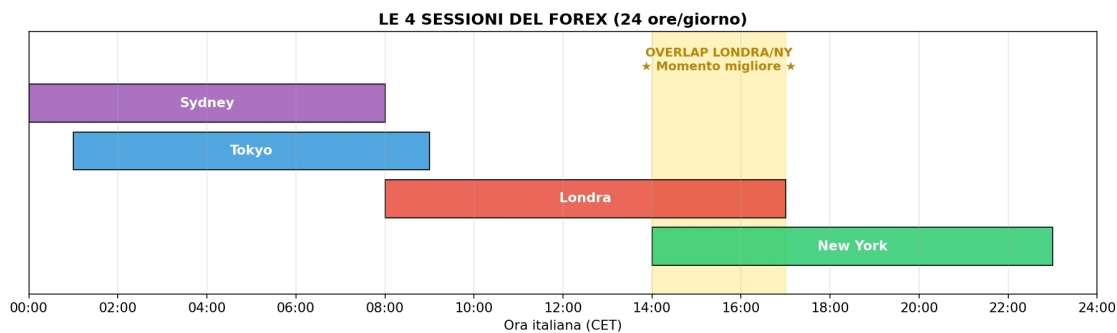
Прочие (например, центральные банки развивающихся стран)

около 12–15 %

Взаимодополняющие сети

Доля розничных трейдеров в 5–8 % может показаться небольшой, но на рынке с дневным объемом торгов в 7 трлн долларов США это соответствует нескольким сотням миллиардов долларов. Этого достаточно для обеспечения достаточной ликвидности по любой основной валютной паре.

3.3. Четыре рыночных сеанса и время работы итальянских трейдеров



3.4. График — 4 рыночных торговых сессии перекрываются в течение более 24 часов (по центрально-итальянскому времени)

Валютный рынок открыт круглосуточно — с утра понедельника (открытие в Сиднее) до вечера пятницы (заккрытие в Нью-Йорке). Однако не все периоды одинаковы: иногда на рынке наблюдается высокая волатильность (в это время торговля приносит прибыль), а иногда — недостаточная ликвидность (в это время лучше воздержаться от торговли). Эти 24 часа делятся на четыре основных торговых сессии в соответствии с графиком работы основных мировых финансовых центров.

Время

Время (центральноевропейское время)

Волатильность

Оптимальные пары

Рекомендации

Сидней

00:00–08:00

Низкий

Австралийский доллар/доллар США, новозеландский доллар/доллар США

Только ночные колебания

Токио

01:00–09:00

Низкий – средний

Доллар США/иена, евро/иена

Подходит для ранних пташек

Лондон

08:00–17:00

Высокая

Евро к доллару США, фунт стерлингов к доллару США, евро/фунт стерлингов

Важнейшие заседания

Нью-Йорк

с 14:00 до 23:00

Высокая

Евро к доллару США, доллар США к канадскому доллару, фунт стерлингов к доллару

США

Макроэкономические данные США будут опубликованы в 14:30

Перекрытие LON-NY

14:00 — 17:00

Максимальный

Все профессиональные

Лучшее время

Совет: идеальное время для итальянских трейдеров

Если вы работаете днем и можете уделить торговле только 2–3 часа: тогда торгуйте с 9:00 до 12:00 (начало лондонской торговой сессии). Этот период является самым «чистым» в течение дня.

Если у вас больше гибкости: добавьте период с 14:30 до 17:00 (перекрытие лондонской и нью-йоркской сессий, пик волатильности).

Если вы можете торговать только вечером: занимайтесь скальпингом, проводите вечерний анализ (с 20:00 до 21:00) и размещайте отложенные ордера, которые сработают на следующий день.

Категорически избегайте: торговли с 22:00 до 6:00. Ликвидность крайне низкая, спред увеличивается на 200–400%, а ценовые колебания становятся резкими. В этот период наиболее высок риск убытков.

Распространённая ошибка № 1: ночная торговля (с 22:00 до 6:00)

В эти часы ликвидность крайне низкая, спред расширяется на 200–300%, а ценовые колебания становятся резкими и труднопредсказуемыми. Сделка, спред по которой днем составляет 0,8 пункта, ночью может достигать 3–5 пунктов. Вы платите в 4–5 раз больше, но получаете результат, который в 4–5 раз хуже.

Решение: если вы работаете днём, попробуйте заняться скальпингом. Вечером анализируйте графики (дневные и четырёхчасовые), устанавливайте предварительные ордера стоп-лосс и тейк-профит, чтобы рынок работал на вас днём. Таким образом, вы сможете торговать на дневных графиках, отфильтровав ночные колебания, и вам не придётся постоянно следить за экраном компьютера.

Что делать, если...: три типа трейдеров и их время торговли

- «Полноценные» дневные трейдеры (профессионалы или полупрофессионалы): торгуют 5–8 часов в день, в основном с 9:00 до 17:00. Совершают 1–3 сделки в день. Зарабатывают на жизнь торговлей или рассматривают её как вторую профессию.

- «Узкосессионные» (неполноценные) дневные трейдеры: торгуют всего 2–3 часа в день, обычно в период перекрытия сессий с 14:30 до 17:00 или в «золотой» период с 9:00 до 10:00. Совершают 3–8 сделок в неделю. Имеют другую работу.

- Трейдеры, торгующие в диапазоне (подходит большинству): торгуют в основном вечером (с 20:00 до 22:00), размещая ордера на основе анализа дневных и четырёхчасовых графиков. Ежедневно совершают 2–5 сделок. Сроки удержания позиций обычно составляют несколько дней. Имеют полную занятость, семью и другие приоритеты.

Большинство читателей этой книги — трейдеры, торгующие в диапазоне: этот стиль торговли наиболее соответствует реальности.

3.5. Валютные пары: как выбирать и почему

Валютные пары делятся на три категории: основные валютные пары (с наибольшим объемом торгов, всегда привязанные к доллару США), второстепенные или кросс-пары (между двумя основными валютами, но без участия доллара США) и экзотические пары (одна основная валюта и одна валюта развивающегося рынка). Для 99 % читателей этой книги ответ прост: торгуйте только основными валютными парами, а в первые три месяца — исключительно парой евро/доллар.

Супруги

Тип

Типичное распределение

Ежедневная волатильность

Отзывы новичков

Евро к доллару США

Основные

0,6–1,0 пункта

60–80 пунктов

Идеальный вариант. Небольшой диапазон спреда, предсказуемое поведение.

Фунт стерлингов/доллар США

Основные

0,9–1,5 пункта

80–120 пунктов

Второй вариант. Более высокая волатильность, значительные колебания цен.

Доллар США/иена

Основные

0,8–1,2 пункта

50–70 пунктов

Эта пара хорошо подходит для тех, кто работает по утрам в Азии

Доллар США/швейцарский франк

Основные

1,0–1,5 пункта

40–60 пунктов

Низкая волатильность, подходит для спокойного стиля торговли

Австралийский доллар/доллар США

Основные

1,0–1,5 пункта

50–70 пунктов

Чувствителен к ценам на сырье

Доллар США/Канадский доллар

Основные

1,0–1,5 пункта

60–80 пунктов

Чувствительность к ценам на нефть

Евро/фунт стерлингов

Вторичный

1,5–2,5 пункта

30–50 пунктов

Низкая волатильность, отлично подходит для тренировок

Евро/иена

Вторичный

1,2–2,0 пункта

80–120 пунктов

Высокая волатильность, подходит для опытных трейдеров

Фунт стерлингов/иена

Вторичный

2,0–3,5 пункта

120–200 пунктов

Очень высокая волатильность, новичкам не рекомендуется.

Доллар США/турецкая лира

Экзотическая пара

30–80 пунктов

200–500 пунктов

Обязательно избегайте. Широкий диапазон колебаний, полная неразбериха.

Доллар США/Южноафриканский ранд

Экзотическая пара

20–50 пунктов

150–400 пунктов

Избегайте: непредсказуемое поведение.

Золотое правило: правило «первой пары»

В течение первых трех месяцев вы можете торговать только парой евро/доллар. И только.

Причины: (1) это валютная пара с самым низким спредом в мире (наименьшие торговые издержки); (2) у неё умеренная волатильность — ни слишком стабильная, ни слишком резкая; (3) её поведение наиболее тщательно изучено и задокументировано во всех торговых материалах; (4) она «логично» реагирует на ключевые макроэкономические данные (ФРС и ЕЦБ); (5) она демонстрирует хорошие результаты (5).

После того как вы совершите 100 сделок по паре евро/доллар и получите положительную прибыль на демо-счете в течение 3 месяцев, вы можете добавить вторую валютную пару (рекомендуется: фунт стерлингов/доллар). Не две, не три, а только одну.

Упражнение: Упражнение 1 — Изучите свою валютную пару (платформа МТ4, 15 минут)

Запустите платформу МТ4. В окне «Рыночные котировки» перетащите пару евро/доллар на центральный график. Установите таймфрейм «Дневной» (нажмите «D1» вверх). Ответьте в письменной форме:

1. Каков текущий курс евро/доллар США? _____

2. Каков текущий спред? (Посмотрите цены «Купить» и «Продать» в окне «Рыночные котировки»: спред = цена «Продать» – цена «Купить», умноженная на 10 000) _____ пунктов

3. На сколько изменилась цена за последние 24 часа? (Наведите курсор на последнюю свечу дневного графика: МТ4 отобразит максимальную и минимальную цены. Вычтите минимальную цену из максимальной; результат выражается в пунктах.) _____ пунктов

4. Текущая цена выше или ниже средней цены за последние 20 свечей D1 (примерно один месяц)?

5. Оглянитесь на последние шесть месяцев: сможете ли вы найти как минимум два ценовых уровня, на которых цена неоднократно отскакивала? _____

Цель: начать знакомиться с валютной парой евро/доллар. Вам не нужно давать идеальные ответы; вам просто нужно ежедневно наблюдать за динамикой курса евро/доллар. В течение первой недели повторяйте это упражнение каждый день. К концу недели вы обретете более глубокое понимание динамики курса евро/доллар, которое не даст вам ни одна книга.

3.6. Полный глоссарий и примеры

Прежде чем продолжить, нам нужно согласовать терминологию. Это термины, которые вы будете использовать каждый день. Прочитайте их внимательно; если забудете какой-то термин, можете вернуться и посмотреть его значение. Терминология Форекс, хотя и сложна, но не бесконечна: как только вы освоите 15–20 ключевых терминов, вы сможете понять 95 % жаргона.

3.7. Пип: единица измерения

Пункт (пип) — стандартная единица изменения цены. Для большинства валютных пар 1 пункт = 0,0001. Для пар с японской иеной (USD/JPY, EUR/JPY, GBP/JPY) 1 пункт = 0,01.

Конкретный пример измерения пунктов:

- Курс евро к доллару США колебался от 1,0850 до 1,0873, амплитуда колебаний составила 23 пункта.

- Курс евро к доллару США упал с 1,0850 до 1,0845, что соответствует падению на 5 пунктов.

- Курс доллара США к иене вырос с 149,50 до 150,10, амплитуда колебаний составила 60 пунктов.

- Курс британского фунта стерлингов к доллару США колебался от 1,2650 до 1,2800, амплитуда колебаний составила 150 пунктов.

3.8. Дополнительные знаки после запятой: «пипетка»

Многие брокеры отображают дополнительные знаки после запятой: например, EUR/USD = 1,08505 (5 знаков после запятой вместо 4). Пятая цифра называется «пипеткой» (pipette) или «десятой долей пункта» и представляет собой одну десятую пункта. Это позволяет отображать котировки с большей точностью, однако при расчете прибыли и убытка по-прежнему используются целые пункты. Например, если спред составляет 9 пипеток, это равно 0,9 пункта.

3.9. Лот: размер позиции

«Лот» — это стандартная единица измерения размера позиции в торговле на валютном рынке.

Тип участка	Размеры	Значение в МТ4
Стандартная партия (партия)	100 000 единиц базовой валюты	1,00
Мини-лот	10 000 единиц	0,10
Микропартии	1 000 единиц	0,01
Nano Lotto (некоторые брокеры)	100 единиц	0,001

Начинающим трейдерам с балансом счета от 3 000 до 5 000 евро рекомендуется использовать микро-лоты (от 0,01 до 0,05 лота). Мини-лоты (от 0,10 до 0,30 лота) подходят для пользователей с балансом счета от 10 000 евро и выше. Стандартные лоты (1,00 лот и выше) подходят для пользователей с балансом счета от 100 000 евро и выше, например, для инвесторов в недвижимость. Компании.

Расчет: сколько стоит 1 пункт (полная таблица)

Курс евро к доллару США составляет 1,0850:

- 0,01 лота (мини): 1 пункт = 0,10 доллара США $\approx$ 0,09 евро
- 0,10 лота (мини): 1 пункт = 1,00 долл. США $\approx$ 0,92 евро
- 1,00 лот (стандартный): 1 пункт = 10,00 долларов США $\approx$ 9,22 евро

Курс фунта стерлингов к доллару США составляет 1,2650:

- 0,01 лота: 1 пункт = 0,10 доллара США $\approx$ 0,08 евро
- 0,10 лота: 1 пункт = 1,00 долл. США $\approx$ 0,79 евро
- 1,00 лот: 1 пункт = 10,00 долларов США $\approx$ 7,91 евро

Курс USD/JPY 149,50:

- 0,01 лота: 1 пункт = 0,067 доллара США $\approx$ 0,06 евро
- 0,10 лота: 1 пункт = 0,669 доллара США $\approx$ 0,53 евро
- 1,00 лот: 1 пункт = 6,69 доллара США $\approx$ 5,29 евро

Примечание: стоимость пункта ежедневно незначительно колеблется в зависимости от курса валют. Для удобства и быстрого расчета: на примере пары евро/доллар США 1 мини-лот $\approx$ 1 доллар США/пункт $\approx$ 0,92 евро/пункт. Запомните это ориентировочное значение, чтобы избавиться от необходимости каждый раз производить точные расчеты.

Упражнение: Упражнение 2 — Расчет стоимости пункта (обязательное, 10 минут)

Воспользуйтесь бумагой, ручкой и калькулятором, чтобы рассчитать стоимость 1 пункта в следующих ситуациях:

1. Курс евро к доллару США — 1,0900, 5 микро-лотов (0,05)
2. Фунт стерлингов к доллару США, 1,2700, 2 мини-лота (0,20)
3. Доллар США/иена, цена 150,00, 3 микро-контракта (0,03)
4. Курс евро к доллару США составляет 1,0850, торговля 8 микро-лотами (0,08)
5. Курс австралийского доллара к доллару США — 0,6580, 1 мини-контракт (0,10)

Ответ:

1. $0,0001 \times 5,000 = 0,50$ доллара США за пункт $\approx 0,46$ евро
2. $0,0001 \times 20,000 = 2,00$ доллара США/пункт $\approx 1,57$ евро
3. $0,01 \times 3,000 / 150,00 = 0,20$ доллара США за пункт $\approx 0,16$ евро
4. $0,0001 \times 8,000 = 0,80$ доллара США за пункт $\approx 0,74$ евро
5. $0,0001 \times 10,000 = 1,00$ долл. США/пункт $\approx 0,92$ евро

Если ответ совпадает с результатом ваших вычислений, продолжайте. В противном случае перечитайте формулу и повторите вычисления. Умение быстро производить такие вычисления крайне важно: при торговле на реальном счёте вам необходимо за считанные секунды оценить стоимость каждого пункта колебания курса.

3.10. Спред: ваши торговые издержки

Спред — это разница между ценой покупки (ценой продажи) и ценой продажи (ценой покупки). Это скрытые издержки каждой сделки, представляющие собой комиссию, взимаемую брокером за предоставление вам доступа к рынку. Типичный спред по паре евро/доллар составляет 0,6–1,0 пункта. По другим валютным парам с более низкой ликвидностью спред может возрастать до 2–5 пунктов. В валютной торговле спред легко превышает 30 пунктов.

Спред — это мгновенные издержки: если вы купили пару евро/доллар по цене 1,0851 (цена продажи) и сразу же закрыли позицию, цена закрытия составит 1,0850 (цена покупки), что означает убыток в 1 пункт. Это означает, что каждая ваша позиция изначально несет небольшой убыток, и для получения прибыли сначала необходимо «покрыть спред».

Совет: как спред влияет на вашу стратегию

Спред по паре евро/доллар составляет 1 пункт, а целевая прибыль — 10 пунктов, что означает, что один только спред поглощает 10 % потенциальной прибыли. Поэтому для розничных инвесторов краткосрочная торговля (с диапазоном колебаний 5–15 пунктов) чрезвычайно сложна: затраты на спред постепенно съедают прибыль.

При торговле в диапазоне (колебания в пределах 50–200 пунктов) спред не имеет существенного значения: из 100 пунктов целевой цены колебание на 1 пункт составляет всего 1%, что является приемлемыми затратами.

Именно это является одной из причин, по которой, судя по статистике, краткосрочные трейдеры выживают дольше, чем розничные краткосрочные трейдеры.

3.11. Кредитное плечо, маржа и дополнительная маржа:

Понимание этих понятий — залог выживания

Эта часть является самой важной в курсе первого уровня. Если вы неправильно понимаете концепцию кредитного плеча, вы упустите отличные возможности. Если же вы действительно понимаете, как работает кредитное плечо, то вы уже опередили те 70% начинающих трейдеров, которые открывают реальные счета.

Кредитное плечо позволяет вам контролировать позиции, размер которых значительно превышает ваш собственный капитал. Кредитное плечо 1:30 (максимальное кредитное плечо у ведущих европейских брокеров, установленное Европейским управлением по ценным бумагам и рынкам (ESMA) с целью защиты розничных инвесторов) означает, что на каждый 1 евро, вложенный вами в качестве «маржи» (залога), вы можете контролировать позицию на сумму 30 евро.

Расчет: требуемая маржа — формула и пример

Формула: Маржа = Размер позиции в базовой валюте / Кредитное плечо

Пример 1: Вы хотите открыть 1 лот (10 000 евро) по контракту евро/доллар США с коэффициентом кредитного плеча 1:30.

Прибыль = $10\,000 / 30 = 333,33$ евро

Пример 2: Вы хотите открыть 3 микро-лота (3 000 евро) по контракту евро/доллар с кредитным плечом 1:30.

Прибыль = $3\,000 / 30 = 100,00$ евро

Пример 3: Вы хотите открыть 1 мини-лот (позиция на 10 000 евро) по паре евро/фунт стерлингов (второстепенная валютная пара) с кредитным плечом 1:20.

Прибыль = $10\,000 / 20 = 500,00$ евро

Примечание: в течение периода удержания позиции маржа будет заблокирована. После закрытия позиции маржа будет разблокирована и включена в вашу реализованную прибыль или убыток.

3.12. Собственный капитал, доступная маржа, уровень маржи

В МТ4 от в терминале (на нижней панели) вы увидите несколько терминов, которые необходимо понимать:

Срок
Значение
Формула

Баланс
Остаток на счете по закрытым позициям
Фиксированное значение, изменяющееся только в зависимости от фактической прибыли или убытка

Справедливая стоимость
Текущая стоимость счета
Остаток + прибыль/убыток по открытым позициям

Прибыль
Средства, заняты открытыми позициями
Сумма маржи по каждой позиции

Свободная маржа
Остаются средства, доступные для новых сделок.
Собственный капитал – маржа

Норма прибыли
Состояние счета
 $(\text{Собственный капитал} / \text{Маржа}) \times 100$

Уровень маржи является ключевым показателем состояния счета. Когда на счете открыт счет, но нет открытых позиций, уровень маржи равен бесконечности (не используется никакая маржа). Как только открывается позиция, уровень маржи снижается. Если уровень маржи снижается слишком сильно, возникают проблемы.

3.13. Маржа и принудительное закрытие позиций: два сигнала опасности

Когда открытые позиции приносят убытки, чистая стоимость ваших средств снижается (поскольку нереализованные убытки уменьшают ваш баланс). Если чистая стоимость ваших средств снизится слишком сильно и превысит ваш максимальный уровень маржи, брокер вмешается:

- Уведомление о необходимости пополнения маржи (обычно при достижении уровня маржи 100%): брокер направит вам уведомление по электронной почте или в системе с предупреждением: «Вы приближаетесь к пределу пополнения маржи, пожалуйста, пополните счет или закройте позиции». Это предупреждение, и у вас ещё есть возможность принять меры.
- Принудительное закрытие позиций (обычно срабатывает при достижении уровня маржи 50%): брокер автоматически закроет все ваши позиции, начиная с тех, которые приносят наибольший убыток, до тех пор, пока уровень маржи не восстановится до значения выше 50%. Эта операция необратима. Вы уже зафиксировали убыток, который невозможно возместить.

Что делать, если...: два трейдера — осторожный и агрессивный

Оба располагают капиталом в размере 3000 евро и решили купить евро по отношению к доллару по цене 1,0850. Однако размеры их позиций совершенно разные.

АННА (осторожная): 2 микро-лота ($0,02 =$ позиция на 2 000 евро).

Требуемая маржа: 67 евро ($2,2\%$ от остатка на счете).

«Запас прочности» до залога: огромный.

Если цена упадет на 100 пунктов: вы потеряете $100 \times 0,092 \times 2 = 18,40$ евро ($0,6\%$ от суммы на вашем счете).

Счет выдержит обратное колебание более чем на 1 500 пунктов без требования дополнительной маржи.

LUCA (агрессивный тип): 8 мини-лотов (позиция $0,80 = 80\,000$ евро).

Требуемая маржа: 2 667 евро (89% от остатка на счете).

Запас прочности: нулевой.

Если цена упадет на 4 пункта (!), вы потеряете $4 \times 0,92 \times 8 = 29,44$ евро.

Колебание в обратную сторону всего на 40 пунктов вызовет уведомление о необходимости пополнения маржи. 40 пунктов по паре евро/доллар соответствуют 1–2 часам лондонской торговой сессии.

Результат через шесть месяцев: Анна по-прежнему будет здесь, совершив уже 200 сделок и многому научившись. А Лука, возможно, уже на первый или второй день перестанет считать, сколько сделок он совершил, и, вероятно, трижды придётся начинать с нуля. Эти два случая вообще нельзя сравнивать.

Золотое правило: золотое правило кредитного плеча

Ни в коем случае общая сумма маржи по всем открытым позициям не должна превышать 3–5 % от вашего общего капитала.

Капитал в размере 3 000 евро = маржа не более 90–150 евро = одновременное открытие 1–3 микро-лотов.

Капитал в 5 000 евро = маржа не более 150–250 евро = 1–3 мини-лота.

При капитале в 10 000 евро максимальная сумма маржи составляет 300–500 евро.

Эти суммы кажутся небольшими, но для трейдера это вопрос жизни и смерти. Ни один профессиональный трейдер не будет использовать полное кредитное плечо. Полное кредитное плечо — это коммерческий трюк брокера, а не инструмент серьёзного трейдера.

3.14. Стоп-лосс и тейк-профит: «ремень безопасности»

Стоп-лосс (SL) — это автоматический ордер, при достижении которым система автоматически закрывает позицию. Тейк-профит (TP) — это автоматический ордер, при достижении которого система автоматически закрывает позицию.

Стоп-лосс и тейк-профит следует устанавливать до открытия позиции, а не после. Это два самых важных ордера во всей торговой операции, гораздо более важных, чем кнопки «Купить» и «Продать». Открытие позиции без стоп-лосса — это как езда на автомобиле без ремня безопасности: «ничего не происходит», пока не случится авария, и тогда будет уже слишком поздно.

Что делать, если...: со стоп-лоссом и без стоп-лосса — одна и та же ситуация, два разных исхода

Вы покупаете EUR/USD по цене 1,0850 с объемом 2 мини-лота (спред: 1,84 евро).

Вариант без стоп-лосса (реальная ситуация):

В 23:00 вы ложитесь спать. Цена составляет 1,0840 (-10 пунктов, -18,40 евро). Вы думаете: «Завтра цена обязательно вырастет; я вижу на графике уровень поддержки 1,0820». Вы не установили стоп-лосс, решив «дать рынку больше пространства для маневра».

В 3 часа ночи ФРС опубликовала неожиданное заявление. Цена резко упала до 1,0720.

В 7:00 утра вы просыпаетесь: вы потеряли 130 пунктов, то есть -239,20 евро (4,8 % от остатка на счете). Всего одна сделка, за одну ночь, пока вы спали.

Вариант со стоп-лоссом на уровне 30 пунктов (1,0820):

В 23:00 цена упала до 1,0820: сделка была автоматически закрыта. Убыток: -55,20 евро (1,1% от баланса счета). Контролируемый. Управляемый. Нормальный.

Вы просыпаетесь, обнаруживаете, что стоп-лосс сработал, анализируете, извлекаете уроки и завтра продолжаете работу.

Разница: -55,20 евро против -239,20 евро. Без стоп-лосса убыток увеличился бы в 4,3 раза. И это лишь «спокойный» пример: в случае серьезных новостных событий (война, банкротство банка и т. д.) соотношение может легко достичь 20:1 или даже 50:1.

3.15. Установка стоп-лосса: три метода

Уровень стоп-лосса не следует устанавливать произвольно (например, всегда на 30 пунктов). Его нужно размещать в разумном месте, и когда цена достигнет этой отметки, это будет означать, что ваш анализ не оправдался. Три основных метода:

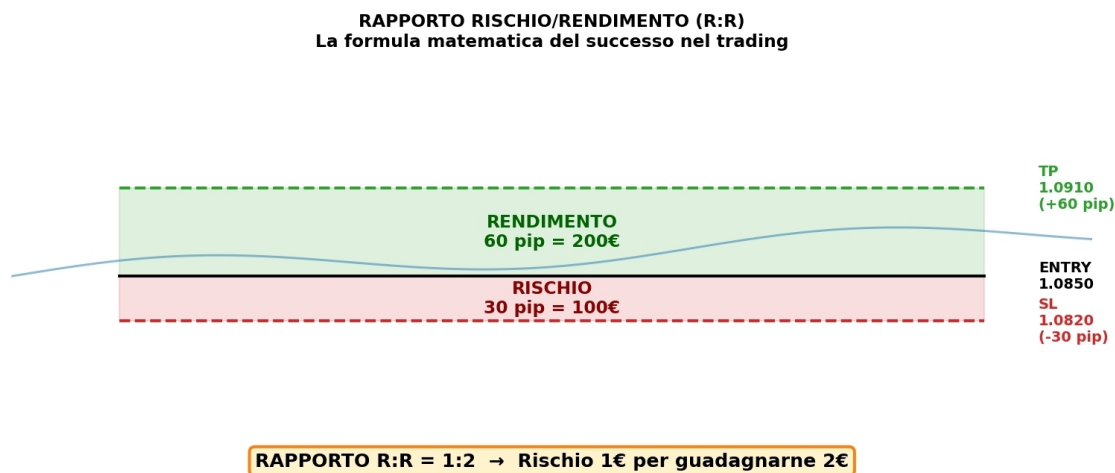
1. Технический стоп-лосс (рекомендуется): чуть ниже уровня поддержки (при открытии длинной позиции) или чуть выше уровня сопротивления (при открытии короткой позиции). Если цена пробивает уровень поддержки, это означает, что ваша торговая стратегия не сработала.

2. Стоп-лосс на основе ATR (для опытных трейдеров): основан на средней волатильности валютной пары. Стоп-лосс = $1,5 \times \text{ATR}(14)$. Этот метод автоматически адаптируется к валютным парам с высокой или низкой волатильностью.

3. SL FIXED AX PIP (подходит для начинающих): стоп-лосс при внутридневной торговле евро к доллару США — 30 пунктов, при скальпинге — 50–80 пунктов. Это не самый оптимальный метод, но его преимущество заключается в простоте и удобстве.

3.16. Как установить уровень тейк-профита: принцип R:R

Уровень тейк-профита следует устанавливать так, чтобы соотношение расстояния до тейк-профита (прибыль) к расстоянию до стоп-лосса (риск) составляло не менее 1:2 — то есть вы должны получить прибыль, как минимум, в два раза превышающую риск. Это правило является математическим залогом долгосрочной прибыльности.



Графическая структура сделки с соотношением прибыли к риску 1:2 (стоп-лосс 30 пунктов, тейк-профит 60 пунктов)

Расчёт: почему соотношение R:R 1:2 является основой

Предположим, что у трейдера процент выигрышных сделок составляет 50% (он выигрывает половину всех сделок). Мы совершаем 100 сделок с соотношением прибыли к риску 1:2 (риск на каждую сделку — 50 евро, прибыль — 100 евро).

50 прибыльных сделок × 100 евро = +5000 евро

50 убыточных сделок × 50 евро = -2500 евро

Результат: +2 500 евро

Теперь представьте, что у того же трейдера соотношение риска к прибыли составляет 1:1 (риск 50 евро, прибыль 50 евро):

50 прибыльных сделок × 50 евро = +2 500 евро

50 убыточных сделок × 50 евро = -2 500 евро

Результат: 0 евро (безубыточность). Вы зря потратили время.

А теперь представьте, что соотношение риска и прибыли составляет 2:1 (риск 50 евро, можно заработать только 25 евро — это типичная ошибка новичков):

50 × 25 евро = +1 250 евро против 50 × 50 евро = -2 500 евро

Результат: -1250 евро. Убыток сократился вдвое.

Примечание: минимальное соотношение риска к прибыли 1:2 является математическим выводом, а не личным мнением. При соотношении ниже 1:2 вы будете в убытке со статистической точки зрения, даже если ваша вероятность выигрыша достигнет 50%.

Упражнение: Упражнение 3 — Установите свой первый стоп-лосс и стоп-профит на демо-счете MT4 (20 минут)

Запустите платформу MT4. В окне «Рыночные котировки» щелкните правой кнопкой мыши по валютной паре EUR/USD > «Новый ордер». Откроется окно ордера.

Выполните следующие действия:

1. Количество: введите 0,01 (1 микролот)
2. Стоп-лосс: установите стоп-лосс на 30 пунктов ниже текущей цены (если курс евро к доллару составляет 1,0850, то стоп-лосс должен быть установлен на уровне 1,0820).
3. Тейк-профит: откройте позицию на 60 пунктов выше текущей цены (1,0910).
4. Тип: Немедленное исполнение → Покупка
5. Нажмите «Купить». Сделка открыта.

Перейдите в терминал (нижняя панель). Просмотрите свою позицию. Примечание: рядом с текущей ценой вы увидите установленные уровни стоп-лосса (SL) и тейк-профита (TP).

Наблюдайте в течение 10–30 минут: цена колеблется. Иногда она приближается к уровню стоп-лосса, иногда — к уровню тейк-профита. Что вы чувствуете? Тревогу, скуку или волнение?

После того как вы освоили методику, вручную закройте позицию (щелкните правой кнопкой мыши > «Закрыть позицию»). Запомните: вы уже разместили свой первый ордер с установленными стоп-лосом и стоп-профитом. С этого момента вы должны настраивать их для каждой сделки. Впредь нельзя будет торговать без установки стоп-лоса.

3.17. MetaTrader 4: профессиональная пошаговая настройка

Теперь, когда вы ознакомились с основными терминами, необходимо настроить МТ4 как профессиональную рабочую станцию. Лаконичный интерфейс снижает визуальное напряжение, ускоряет принятие решений и позволяет с первого взгляда увидеть важную информацию.

3.18. Шаг 1: Настройка списка наблюдения

По умолчанию в МТ4 в разделе «Рыночные котировки» отображаются десятки валютных пар. Оставьте только основные и несколько второстепенных валютных пар. Щелкните правой кнопкой мыши «Рыночные котировки» > «Торговые инструменты» > отключите все валютные пары, кроме следующих: EURUSD, GBPUSD, USDJPY, USDCHF, AUDUSD, USDCAD, NZDUSD, EURGBP, EURJPY. Все необычные валютные пары: удалены.

3.19. Шаг 2: Установите правильный временной интервал

В верхней части панели инструментов отображаются временные периоды: M1, M5, M15, M30, H1, H4, D1, W1 и MN. Для начинающих трейдеров, занимающихся скальпингом или внутридневной торговлей, рекомендуется использовать следующие временные периоды:

- D1 (дневной график) используется для анализа общего тренда
- H4 (4 часа) — определение зоны входа
- H1 (1 час) — для точного хронометража

Забудьте про M1, M5 и M15: для новичков они только добавляют шума и стресса. Использовать их могут только опытные спекулянты.

3.20. Шаг 3: Добавьте ключевые индикаторы (и только их)

90 % трейдеров используют слишком много индикаторов, что затрудняет интерпретацию графиков. В течение первых шести месяцев вам достаточно использовать три индикатора:

1. ЕМА 21 (21-периодное экспоненциальное скользящее среднее) — для определения среднесрочного тренда

2. Простая скользящая средняя с периодом 200 (SMA 200) — для определения долгосрочного тренда

3. Индикатор RSI с периодом 14 — для определения зон перекупленности/перепроданности

Способ добавления: добавьте в меню «Навигатор» > «Индикаторы» > «Тенденции» > «Скользящие средние». «Средние» > щелкните и перетащите на график. Установите для ЕМА период 21 и цвет оранжевый. Повторите эту операцию, установив для SMA период 200 и цвет синий. Для RSI: «Навигатор» > «Осцилляторы» > «RSI» > период 14, установите уровни 30 и 70.

3.21. Шаг 4: Сохранение шаблона

Щелкните правой кнопкой мыши по графику > Шаблоны > Сохранить шаблон > Назовите его «MioSetup». С этого момента каждый новый график, который вы откроете, будет автоматически загружать эту конфигурацию: щелкните правой кнопкой мыши > Шаблоны > Загрузить > MioSetup.

Практическое задание: Задание 4 — Настройка MT4 Pro (25 минут)

Строго следуйте приведенным выше инструкциям. В результате на графике EUR/USD H1 вы должны увидеть:

- Цена (свечной график)
- ЕМА 21 (оранжевая линия, следующая за динамикой цены)
- 200-дневная скользящая средняя (более медленная синяя линия)
- Снижение индикатора RSI (осциллятор, значения которого находятся в диапазоне от 0 до 100, с пороговыми значениями 30 и 70)

Затем откройте три графика той же валютной пары «евро/доллар» на таймфреймах D1, H4 и H1 и расположите их в виде сетки (щелкните правой кнопкой мыши по нижней панели вкладок > «Расположить окна в виде сетки»).

Сохраните шаблон. Закройте MT4. Запустите программу заново. Графики должны выглядеть так же, как и перед тем, как вы вышли из программы. Теперь у вас есть профессиональная настройка.

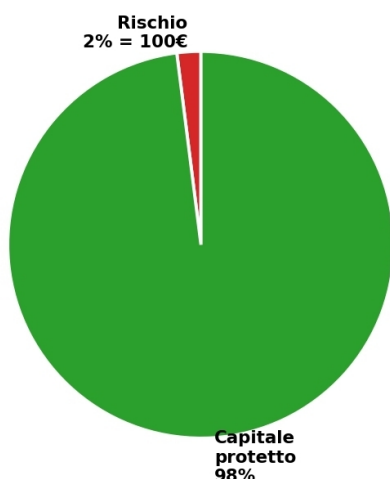
3.22. Управление капиталом: навыки, которые спасут ваш счет

Управление капиталом (ММ) — это искусство, которое определяет допустимый уровень риска для каждой сделки, общий допустимый уровень риска и момент установки стоп-лосса. Это не раздел, который можно пропустить, перейдя сразу к главе «Стратегии», — это основа, на которой строится любая стратегия. Без тщательного управления капиталом даже самая лучшая в мире стратегия приведет вас к полному разорению.

3.23. Правило 2%

Золотое правило управления капиталом для розничных трейдеров: риск по одной сделке ни в коем случае не должен превышать 2% от общего капитала. Для счета на 5000 евро максимально допустимый убыток по одной сделке составляет 100 евро.

TRADER PRUDENTE (2% per trade)
Capitale 5.000€



TRADER AGGRESSIVO (15% per trade)
Capitale 5.000€ — PERICOLO!

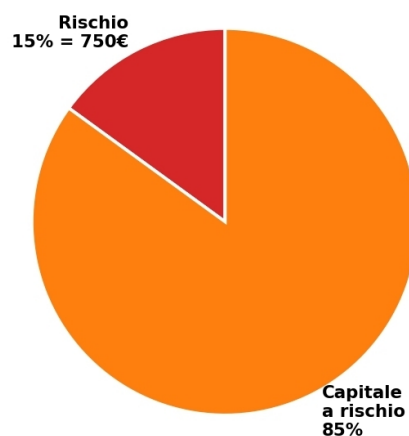


График — наглядное сравнение: риск 2% и 15% на одну сделку (при одинаковом начальном капитале)

Расчёт: формула определения размера позиции

Формула (запомните):

Размер позиции (лоты) = Риск (евро) / (количество пунктов стоп-лосса (пункты) × стоимость пункта в лоте)

Пример 1: начальный капитал 5 000 евро, риск 2 % = 100 евро. Стоп-лосс по паре евро/доллар — 30 пунктов.

Количество лотов = $100 / (30 \times 0,92) = 100 / 27,6 = 3,62$ микролота → округляется в меньшую сторону до 3 микролотов (0,03)

Пример 2: Основной капитал 10 000 евро, риск 1,5 % = 150 евро. Стоп-лосс по паре фунт стерлингов/доллар США — 40 пунктов.

Количество = $150 / (40 \times 0,79) = 150 / 31,6 = 4,75$ микро-лота → 4 микро-лота (0,04)

Пример 3: Основной капитал 3 000 евро, риск 2 % = 60 евро. Стоп-лосс по паре евро/доллар — 25 пунктов.

Количество = $60 / (25 \times 0,92) = 60 / 23 = 2,61$ микролота → 2 микролота (0,02)

Важное замечание: обязательно округляйте в меньшую сторону. Лучше взять на себя риск в 1,8%, чем в 2,1%. Управление рисками — это асимметричная защита: лучше перестраховаться.

Упражнение: Упражнение 5 — Расчет размера позиции для 5 сценариев (15 минут)

Не заглядывая в ответы, рассчитайте размер позиции (в микролотах) для следующих 5 ситуаций:

1. Капитал 4 000 евро, риск 2%, стоп-лосс по паре евро/доллар 35 пунктов → ?

2. Капитал 7 500 евро, риск 1,5 %, стоп-лосс по паре фунт стерлингов/доллар США 50 пунктов → ?

3. Стартовый капитал 2 500 евро, риск 2%, стоп-лосс по паре евро/доллар 20 пунктов → ?

4. Стартовый капитал 10 000 евро, риск 1 %, стоп-лосс по паре евро/иена 60 пунктов → ?

5. Стартовый капитал 6 000 евро, риск 2 %, стоп-лосс по паре евро/доллар 45 пунктов → ?

Ответ:

1. $80 / (35 \times 0,92) = 2,48 \rightarrow 2$ микро (0,02)

2. $112,5 / (50 \times 0,79) = 2,85 \rightarrow 2$ микро (0,02)

3. $50 / (20 \times 0,92) = 2,72 \rightarrow 2$ микро (0,02)

4. $100 / (60 \times 0,60) = 2,78 \rightarrow 2$ микро (0,02) [Примечание: стоимость пункта по паре EUR/JPY составляет примерно 0,60 евро за микро]

5. $120 / (45 \times 0,92) = 2,90 \rightarrow 2$ микро (0,02)

Обратите внимание: во всех этих случаях ответ равен 2. Микро-лоты. Видите? При небольшом балансе счёта фактический объём торговли всегда будет небольшим. Это нормальное явление, а не программная ошибка.

3.24. Ежедневные и еженедельные лимиты

Помимо риска по отдельной сделке, вам также необходимо установить совокупные лимиты. Эти лимиты защитят вас от убыточных дней и серий неудач.

Ограничения

Рекомендуемые значения

Что делать при достижении этого порога

Максимальный убыток по одной сделке

1–2 % от капитала

Автоматическое закрытие позиции и установка стоп-лосса

Максимальный дневной объём торгов

3 (подсказка: 2)

Прекратите торговлю. Закройте МТ4. Завтра будет новый день.

Максимальный дневной убыток

4% от капитала.

Остаток дня — без торговли

Максимальное количество убыточных сделок подряд

2 проигрыша

Не торгуйте до конца дня. Пересмотрите свой план.

Максимальный убыток за неделю

6–8 % от капитала

Прекратите торговлю до конца недели.

Максимальный общий просадка

15 % от пикового значения.

Прекратить торговлю на неделю. Провести тщательную реорганизацию.

Контрольный список перед торговлей (распечатать и приклеить к монитору)

Перед совершением любой сделки обязательно ответьте «да» на все следующие вопросы:

Соответствует ли эта настройка условиям моего плана?

Нашел ли я логичный (технически обоснованный, а не случайный) уровень стоп-лосса (SL)?

Правильно ли рассчитан размер позиции по формуле?

Соотношение R:R составляет не менее 1:2?

Не предвидится ли публикация макроэкономических данных в течение ближайших двух часов?

Разве я уже не исчерпал дневной лимит сделок?

Достигло ли моё эмоциональное состояние уровня не менее 710 (ясно мыслю, хорошо отдохнул, не нервничаю)?

Сейчас ведь пятница днём (есть риск провала на выходных)?

Не превышает ли амплитуда ценовых колебаний нормальный уровень (не в 2–3 раза выше обычного)?

Я уже определил для себя TP1 и TP2?

Если хотя бы на один из вопросов ответ «нет», не входите в сделку. Дождитесь следующей возможности. Рынок открыт 250 дней в году, так что возможности для торговли всегда найдутся. Ваши средства ограничены, и как только они иссякнут, все закончится.

Совет: быстрый способ корректировки размера позиции: «волшебное число»

Чтобы ускорить расчет, самостоятельно рассчитайте «магическое число». Для курса евро/доллар и вашего стандартного уровня риска магическое число составляет:

«Магическое число» = риск (евро) / 0,92

После завершения расчёта достаточно разделить полученное число на стоп-лосс в пунктах, чтобы получить размер позиции (в микро-лотах).

Например: начальный капитал 5 000 евро, риск 2 % = 100 евро. «Магическое число» = $100 / 0,92 \approx 109$.

Стоп-лосс 30 пунктов $\rightarrow 109/30 = 3,6 \rightarrow 3$ микро-лота

Стоп-лосс 50 пунктов $\rightarrow 109/50 = 2,2 \rightarrow 2$ микро-лота

Стоп-лосс 80 пунктов $\rightarrow 109/80 = 1,4 \rightarrow 1$ микро-лот

Запомните свои счастливые цифры: это сэкономит 20 секунд на каждой сделке, что снизит вероятность ошибок, связанных с поспешностью.

Мы завершили изучение базовых знаний первого уровня. Если вы выполнили все упражнения, то теперь должны понимать, что такое торговля на Форекс, как работают торговые сессии и валютные пары, знакомы со всеми терминами (пункт, лот, спред, кредитное плечо, маржа), умеете устанавливать стоп-лосс и тейк-профит, настраивать платформу МТ4, а также рассчитывать правильный размер позиции. Это составляет 40 % от общего объема знаний, необходимых трейдеру. Курс второго уровня будет посвящён «пониманию графиков»: настоящему техническому анализу, то есть техническому анализу на операционном уровне.

Уровень 4 — Технический анализ

Технический анализ — это язык графиков. Это искусство, заключающееся в наблюдении за историческими ценами и прогнозировании вероятности будущих ценовых движений на их основе. Это не точная наука — как и любая наука на рынке — но это самый мощный инструмент в руках розничного трейдера. В этой главе вы научитесь интерпретировать графики как профессионал: свечные графики, фигуры, уровни поддержки, уровни сопротивления, линии тренда, скользящие средние, индекс относительной силы (RSI), а также различные временные рамки.

Как и в курсе первого уровня, всё, что вы прочитаете здесь, следует немедленно применять на демо-счёте MT4. Прочитав главу, откройте MT4 и найдите на графике EUR/USD то, о чём вы только что прочитали. Такие упражнения по принципу «что в книге, то на графике» позволяют преобразовать теорию в практический опыт.

4.1. Структура японских свечей

Свечной график — это наиболее широко используемый в мире способ отображения цен. Каждая свеча представляет собой определенный период времени (1 минуту, 1 час, 1 день — в зависимости от выбранного таймфрейма) и отображает четыре ключевых показателя: цену открытия, цену закрытия, максимальную цену и минимальную цену. Сокращение от этих четырех показателей — OHLC.

CANDELA RIALZISTA (Bullish) Chiusura > Apertura

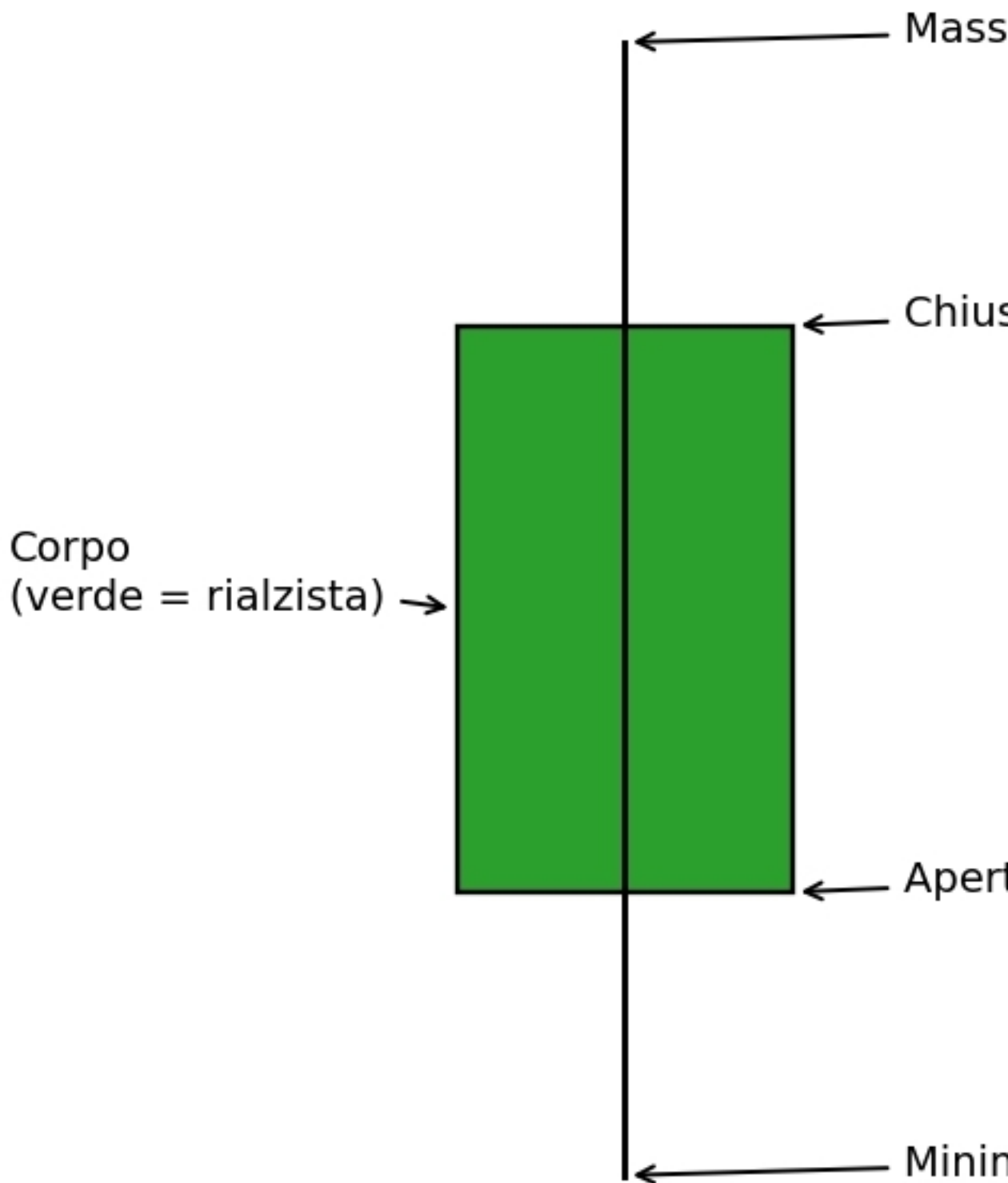


Рис. — Структура «белой» свечи (слева) и «черной» свечи (справа)

Как интерпретировать «пламя» свечи:

- Если цена закрытия выше цены открытия, то свеча является «положительной». В МТ4 по умолчанию она отображается белым или зелёным цветом. Тело свечи равно разнице между ценой закрытия и ценой открытия.
- Если цена закрытия ниже цены открытия, то свеча является «медвежьей». В МТ4 по умолчанию она отображается черным или красным цветом.
- Тени (или «фитили») — это тонкие линии над и под телом свечи: они обозначают максимальную и минимальную цены, достигнутые за данный период.
- Более крупные фигуры указывают на чётко выраженное направление. Мелкие фигуры с длинными тенями свидетельствуют о нерешительности или противоречиях между покупателями и продавцами.

Совет: почему свечные графики превосходят линейные

Линейный график отображает только цену закрытия. А свечной график за каждый период показывает четыре показателя: цену открытия, цену закрытия, максимальную и минимальную цену. Это похоже на разницу между фотографией и видео: видео демонстрирует динамику цен, а не только итоговую цену сделки.

Кроме того, формы свечных графиков, которые вы скоро увидите, являются результатом более чем 300-летних наблюдений — они были изобретены японскими торговцами рисом в XVIII веке — и систематизируют психологическое поведение покупателей и продавцов в узнаваемой форме.

4.2. Временной интервал: как выбрать?

В МТ4 каждый временной интервал отображается в виде свечного графика, представляющего различные периоды:

Общий период

Свечной график = 1 период:

Типичное применение

M1

1 минута

Продвинутая краткосрочная торговля (не рекомендуется новичкам)

M5/M15

5/15 минут

Быстрая скальпинг-торговля / внутридневная торговля

M30 / H1

30 минут/1 час

Внутридневная торговля (основной режим торговли)

H4

4 часа

Скальпинг (зона входа)

D1

1 день

Анализ общего тренда

W1

1 неделя

Долгосрочная торговля

Миннесота

1 месяц

Макроанализ

Для начинающих читателей этой книги мы сосредоточимся в основном на 3-х таймфреймах: D1 (для наблюдения за общим трендом), H4 (для определения зон входа), H1 (для определения точного момента входа).

4.3. 5 моделей свечей, которые вам нужно знать

В литературе описаны десятки моделей свечей, 90 % из которых являются «шумом». Пять приведенных ниже моделей демонстрируют наилучшую эффективность, подкреплены статистическими данными и широко используются профессиональными трейдерами. Внимательно изучите эти пять моделей и на время забудьте об остальных.

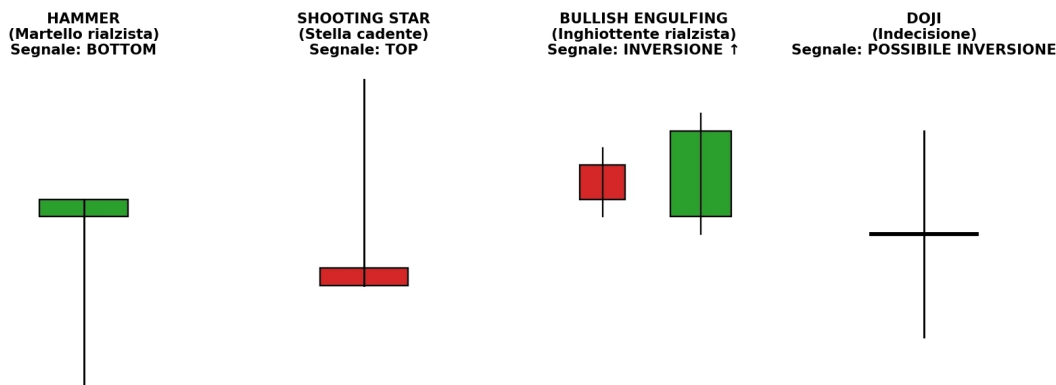


Рисунок — Пять основных фигур из, часть 4: «Молоток», «Метеор», «Бычий поглощающий бар», «Крест»

4.4. Рисунок 1: «Молоток»

Свеча, характеризующаяся коротким верхним телом и длинным нижним телом (по крайней мере, в два раза длиннее верхнего тела), при этом верхнее тело очень короткое или отсутствует вовсе. Появление такой свечи после нисходящего тренда предвещает возможное восходящее разворотное движение. Более длинный нижний тень означает отказ от цены: продавцы на время снизили цену, но затем покупатели продемонстрировали сильный отскок, подняв цену вверх.

Практический пример: торговля по свече «Молоток» — полная настройка

Евро к доллару США: после 5 дней непрерывного падения цена достигла отметки 1,0800, которая является историческим уровнем поддержки.

На таймфрейме H4 сформировалась свеча «молот»: цена открытия 1,0820, минимум 1,0795, цена закрытия 1,0821, максимум 1,0823.

Дополнительные подтверждения: RSI (14) на H4 = 29 (перепроданность), SMA 200 на D1 = 1,0810 (зона поддержки подтверждена).

Настройки сделки:

Точка входа: дождаться закрытия свечи «молот» на уровне 1,0821, открыть длинную позицию на уровне 1,0822.

Стоп-лосс: на 5 пунктов ниже минимума свечи «молот» → 1,0790 (стоп-лосс 32 пункта).

Тейк-профит: 1,0885 (следующий уровень сопротивления, 63 пункта = соотношение риска к прибыли 1:1,97).

Количество лотов (капитал 5 000 евро, риск 2%): $100 / (32 \times 0,92) = 3,4 \rightarrow 3$ микро (0,03).

Типичный результат: в 60–70 % случаев цель по прибыли достигается в течение 2–3 дней. Если его прогноз окажется неверным, стоп-лосс закроет сделку с убытком примерно в -94 евро. Если его прогноз окажется верным, прибыль составит примерно +174 евро. Ожидаемая доходность положительная.

4.5. Фигура 2: «Метеор»

Это формация «перевернутый молот». Нижнее тело небольшое, верхняя тень длинная, нижняя тень короткая или отсутствует. Она появляется после восходящего тренда и предвещает возможное нисходящее разворотное движение. Длинная верхняя тень означает, что цена столкнулась с сопротивлением на восходе: покупатели подталкивают цену вверх, но продавцы активно вмешиваются и оттягивают цену обратно вниз.

Реальный пример: торговля по модели «Метеор» — полная настройка

Фунт стерлингов к доллару США: после 4-дневного роста цена достигла отметки 1,2900, которая является ключевым уровнем сопротивления.

На 4-часовом таймфрейме (H4) сформировалась свеча «Метеор»: цена открытия 1,2880, максимальная цена 1,2915, цена закрытия 1,2878, минимальная цена 1,2876.

Подтверждение: RSI H4 = 73 (перекупленность), цена остановилась ровно на уровне сопротивления D1.

Настройки:

Вход (продажа): 1,2873, после подтверждения следующей красной свечи.

На 5 пунктов выше максимума «Метеорита» → 1,2920 (47 пунктов).

ТР: 1,2790 (83 пункта, соотношение риска к прибыли 1:1,77).

Лот (5 000 евро, 2%): $100 / (47 \times 0,79) = 2,69 \rightarrow 2$ микро (0,02).

4.6. Фигура 3: бычий поглощающий бар

Две последовательные свечи: первая — «медвежья» (меньшего размера), вторая — очень большая «бычья» свеча, полностью «поглощающая» тело предыдущей свечи. Появляется после нисходящего тренда и является сильным сигналом бычьего разворота. Фигура «поглощение» считается одной из самых надежных.

4.7. Фигура 4: Медвежья фигура «поглощения» (медвежья фигура «поглощения»)

Обратная ситуация: первая свеча — небольшая «юньская», вторая — большая «иньская», полностью поглощающая тело первой свечи. Возникает медвежья разворотная сигнализация после восходящего тренда.

4.8. Фигура 5: Крест

«Крест» — это свеча, у которой практически отсутствует тело (цена открытия равна цене закрытия или почти равна ей), а верхняя и нижняя тени хорошо заметны. Она символизирует нерешительность: силы покупателей и продавцов уравновешены. Сама по себе «крестовая звезда» является слабым сигналом; она приобретает значение только в следующих случаях: (а) при появлении на важных уровнях поддержки или сопротивления; (б) после продолжительного тренда (исчерпание тренда); или (с) если за ней следует свеча, подтверждающая направление движения.

Золотое правило: правило подтверждения

Ни одна формация свечей не должна служить основанием для открытия сделки в одиночку. Обязательно дождитесь как минимум одного дополнительного подтверждающего сигнала.

Три наиболее убедительных способа подтверждения:

1. Контекст: данная формация появляется на уровнях поддержки/сопротивления на более высоких таймфреймах (H4 или D1).

2. RSI: данная формация появляется, когда RSI находится в экстремальной зоне (для открытия длинной позиции — ниже 30, для открытия короткой позиции — выше 70).

3. Следующая свеча: свеча, следующая за фигурой, подтверждает направление (например, после свечи «молот» следующая свеча зелёная).

Одна фигура плюс два подтверждающих сигнала = надёжная сделка. Одна фигура без подтверждающих сигналов = чистая надежда, а не сделка.

Упражнение: Упражнение 6 — Поиск паттернов в MT4 (30 минут)

Откройте платформу MT4, выберите 4-часовой график EUR/USD и просмотрите данные за последние 3–6 месяцев.

Найдите и отметьте (с помощью инструмента «Текстовая метка» в MT4: панель инструментов > «Объекты» > «Текстовая метка»):

- как минимум 3 «молотка» на уровне поддержки
- не менее 3 «метеоров» на уровне сопротивления
- не менее 2-х моделей поглощения (бычьих или медвежьих)
- не менее 2 «крестиков» на важных уровнях.

Запишите на бумаге каждый обнаруженный вами паттерн:

- а) даты свечей
- б) цена закрытия данной фигуры
- с) Что произошло в следующих 5–10 свечах (сработала ли эта модель?)

Цель: научиться распознавать паттерны в реальных ситуациях, а не только на иллюстрациях в книгах. После 30 минут практики ваша способность распознавать графические паттерны повысится на 50%.

4.9. Уровни поддержки и сопротивления: как их рисовать и использовать

Уровень поддержки — это цена, ниже которой цене трудно опуститься; когда цена достигает этого уровня, она встречает сопротивление и отскакивает вверх. Уровень сопротивления — это обратное: цена, выше которой цене трудно подняться. Уровни поддержки и сопротивления являются основой технического анализа: 70 % высококачественных торговых установок строятся вокруг этих уровней.

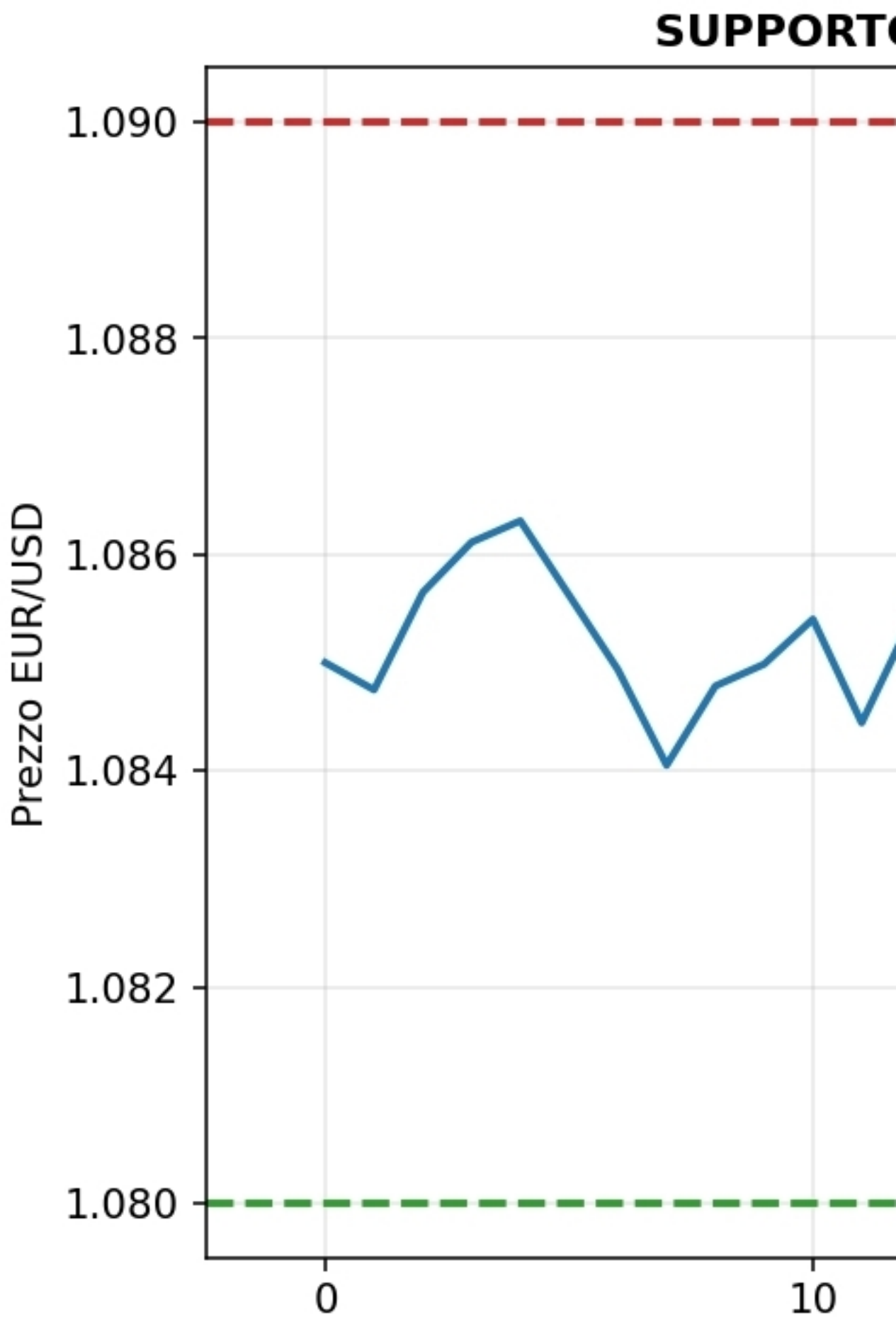


Иллюстрация — колебания цены между уровнем поддержки (зелёный) и уровнем сопротивления (красный)

4.10. Как рисовать уровни поддержки и сопротивления

Наилучшими уровнями являются те, которые неоднократно достигались в прошлом. Чем чаще цена отскакивает от определенного уровня, тем более устойчивым и надежным он будет в будущем.

1. Откройте дневной график пары евро/доллар
2. Уменьшите масштаб: просмотрите данные как минимум за 6 месяцев
3. Определите «относительные максимумы» и «относительные минимумы»: точки, в которых цена меняет направление движения
4. Проведите горизонтальные линии между максимальной точкой (уровень сопротивления) и минимальной точкой (уровень поддержки). Используйте инструмент «Горизонтальная линия» в МТ4.
5. Соедините. Наилучшие уровни — это те, которые соединяют три или более точек. Соединение двух точек считается приемлемым. Соединение одной точки не является уровнем.

Подсказка: уровни поддержки и сопротивления представляют собой зоны, а не точные линии.

Частая ошибка новичков заключается, например, в том, что они проводят точную линию на уровне 1,0823, а затем ожидают, что цена остановится именно там. Это неправильно.

Эти ценовые уровни представляют собой зоны шириной 10–20 пунктов. Если уровень поддержки находится «около 1,0820», то реальной зоной поддержки следует считать диапазон 1,0815–1,0825.

Ожидая отскока, не рассчитывайте на точность до одного пункта. Дождитесь, пока цена войдет в целевой диапазон и сформирует фигуру сопротивления (свеча «молот», «игла»), и только тогда открывайте позицию. Попытки разместить ордер «с точностью до одного пункта» обречены на провал.

4.11. Психологические уровни: целые числа

Целые уровни (например, курс евро к доллару вблизи 1,1000, 1,0800 и 1,0500) часто выступают в качестве уровней поддержки и сопротивления, даже если эти цены никогда не достигались на практике. Причина кроется в психологических факторах: крупные институциональные инвесторы размещают ордера на этих уровнях, что вызывает реакцию рынка. Это не какая-то таинственная сила, а коллективное поведение тысяч трейдеров.

4.12. Разворот: когда уровень поддержки превращается в уровень сопротивления (и наоборот)

Одно из самых практичных понятий заключается в том, что когда цена пробивает уровень поддержки, этот уровень становится новым уровнем сопротивления (и наоборот). Это явление «разворота» подтверждено многовековым опытом торговли и является одним из самых надежных правил технического анализа.

Практический пример: движение разворота

Курс евро к доллару имеет поддержку в районе 1,0800, которая за последние два месяца тестировалась четыре раза.

Во вторник утром цена решительно пробила уровень 1,0800 и опустилась до 1,0750.

Через три дня цена вернулась к отметке 1,0800 (повторно протестировав этот уровень снизу).

Ситуация такова: в семи случаях из десяти цена пробивает уровень 1,0800 сверху и начинает откатываться. Прежняя линия поддержки превращается в линию сопротивления. Это возможность открытия короткой позиции с высокой вероятностью успеха.

Упражнение: Упражнение 7 — построение горизонтальных линий на графике евро/доллар (30 минут)

Откройте график EUR/USD на дневном таймфрейме и сохраните исторические данные как минимум за один год.

С помощью инструмента «Горизонтальная линия» (панель инструментов > «Вставка» > «Линия») нарисуйте:

- 3 прозрачных линии сопротивления (каждая с минимум 3 точками соприкосновения)
- 3 чёткие линии поддержки (каждая с минимум 3 точками соприкосновения)
- Целые значения, наиболее близкие к текущей цене

Используйте разные цвета: сопротивления — красный, поддержки — зеленый, целое число — синий.

Сохраните шаблон с указанными ценовыми уровнями. Каждое утро на следующей неделе проверяйте: приближается ли цена к одному из этих уровней? Если да, запишите: «В ближайшие дни может появиться торговая возможность».

Самое «профессиональное» упражнение в этой книге заключается в следующем: именно это каждый вечер делает опытный трейдер.

4.13. Структура тренда: HH/HL и LL/LH

«Тенденция — ваш друг». Эта фраза верна: вероятность успеха при торговле по тренду в два раза выше, чем при торговле против тренда. Но чтобы «идти по течению», вы сначала должны уметь объективно распознавать тренд, а не судить «на глаз».



Рисунок — Три типа рыночных структур: восходящий тренд, нисходящий тренд, боковое движение.

4.14. Объективное определение нисходящего тренда

Восходящий тренд — это последовательность более высоких максимумов (НН) и более высоких минимумов (НЛ). Каждый новый максимум выше предыдущего, а при каждом откате достигается минимум, выше предыдущего.

Нисходящий тренд — это обратное: более низкие максимумы (ЛН) и более низкие минимумы (ЛЛ).

Боковые колебания (колебания в диапазоне) означают отсутствие как новых максимумов, так и новых минимумов: цена колеблется между горизонтальными уровнями поддержки и сопротивления.

Золотое правило: правило определения тренда за 10 секунд

Посмотрите на график D1, отображающий исторические данные за 3–6 месяцев. Ответьте на следующие два вопроса:

1. Находится ли цена в данный момент выше или ниже 200-дневной скользящей средней?
2. 200-дневная скользящая средняя находится в восходящем или нисходящем тренде?

Если оба ответа «выше» и «вверх»: подтверждение восходящего тренда. Ищите возможности для открытия длинных позиций.

Если оба ответа «ниже» и «вниз»: нисходящий тренд. Ищите возможности для открытия коротких позиций.

Если ответы не совпадают или 200-дневная скользящая средняя находится в горизонтальном положении: боковой тренд. Вступайте в сделку только в том случае, если знаете, как торговать в условиях бокового тренда; в противном случае придерживайтесь выжидательной позиции.

4.15. Важность прорыва структуры

Тенденция меняется только при прорыве структуры. В восходящем тренде тенденция сохраняется до тех пор, пока цена продолжает формировать более высокие максимумы (НН) и более высокие минимумы (НЛ). Однако если цена сначала формирует минимум (НЛ), затем — более низкий минимум (ЛН) и, наконец, пробивает последний минимум вниз, это является первым явным сигналом смены тренда. До этого момента прогнозирование разворота тренда является чисто спекулятивным.

Распространенная ошибка № 2: торговля против тренда «потому что цена слишком высока»

«Курс евро к доллару вырос на 300 базисных пунктов за две недели, он обязательно упадет, я открою короткую позицию». Это одна из самых распространенных ошибок новичков.

Сильный тренд обычно продолжается 1000–3000 пунктов. Рост на 300 пунктов не считается «слишком большим». Открывать короткую позицию только потому, что «цена сильно выросла», — это так же опасно, как прыгнуть под мчащийся поезд.

Разъяснение: Прежде чем рассматривать возможность открытия короткой позиции, необходимо дождаться объективных сигналов разворота (прорыв структуры + разворотная фигура + расхождение RSI). До этого момента: либо продолжайте открывать длинные позиции, либо сохраняйте выжидательную позицию.

4.16. RSI и скользящие средние: подтверждение сигнала, а не сам сигнал

Индикаторы — это инструменты, основанные на ценовом движении. Они не могут ни предсказывать будущее, ни генерировать волшебные сигналы. Их роль заключается в подтверждении информации, которую вы уже наблюдали на графике свечей и в формациях поддержки/сопротивления. Если вы будете использовать индикаторы в качестве «основного источника» сигналов, ваша стратегия станет уязвимой. Если же вы будете использовать их в качестве подтверждающих сигналов, качество ваших точек входа улучшится вдвое.

4.17. Скользящие средние: EMA 21 и SMA 200

Скользящая средняя — это среднее арифметическое (или средневзвешенное) значение цены за последние N периодов. Она позволяет отфильтровать шум и отобразить потенциальную динамику цены. Мы будем использовать следующие два вида скользящих средних:

- EMA 21 (экспоненциальная скользящая средняя за 21 период): экспоненциальная скользящая средняя, которая быстрее реагирует на недавние ценовые изменения. Отлично подходит для определения среднесрочных трендов и в качестве зоны «коррекции».

- SMA 200 (простая скользящая средняя) 200-периодическая простая скользящая средняя (SMA): бычья простая скользящая средняя. Нахождение цены ниже или выше 200-периодической SMA позволяет различать бычий и медвежий рынки.

Совет: 21-периодическая скользящая средняя как зона динамической поддержки/сопротивления

В условиях четкого восходящего тренда цена часто «замирает», периодически касаясь 21-дневной скользящей средней, а затем продолжает рост. Такие откаты к 21-дневной скользящей средней называются «коррекциями» и являются оптимальными точками входа для трейдеров, следующих за трендом.

Например: пара евро/доллар находится в восходящем тренде, цена составляет 1,0900. На 4-часовом графике 21-периодное скользящее среднее находится на уровне 1,0860. Цена опускается до 1,0865, касается 21-периодного скользящего среднего и формирует бычий «молот». Это классическая схема для открытия длинной позиции: вход на уровне 1,0866, краткосрочная цель — ниже минимума «молота», а следующий максимум — следующая цель.

На графике, используя шаблон, настроенный в упражнении 4, вы увидите, как такая ситуация повторяется десятки раз. Научитесь её распознавать.

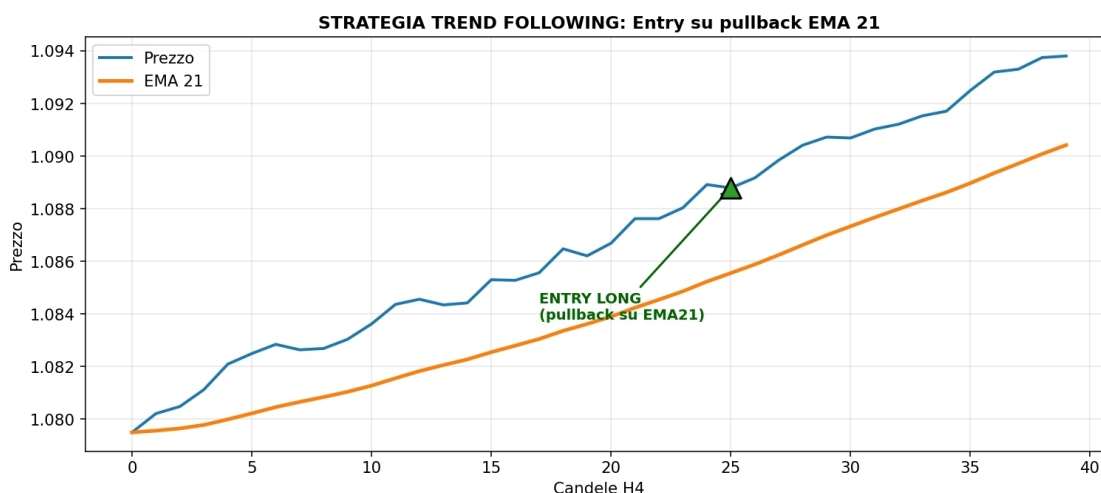


Иллюстрация — Пример отскока от 21-дневной скользящей средней: точка входа в длинную позицию в восходящем тренде

4.18. Индекс относительной силы (RSI): осциллятор импульса

Измеряет силу тренда, диапазон значений — от 0 до 100. Основные факторы:

- $RSI > 70$: означает «перекупленность». Цена значительно и быстро выросла. Примечание: в условиях сильного восходящего тренда RSI может оставаться выше 70 в течение нескольких недель подряд. Это не означает «немедленно открывать короткую позицию», а означает «перекупленность = нахождение в сильном восходящем тренде».
- $RSI < 30$: перепроданность. Цена резко и быстро упала. Это предвещает возможное отскок, особенно если точка отскока совпадает с уровнем поддержки.
- $RSI = 50$: нейтральная зона. В восходящем тренде обычно играет роль «динамической поддержки» (RSI никогда не опускается ниже 50).

4.19. Расхождение RSI: качественный сигнал

Расхождение RSI — один из самых надёжных сигналов разворота. Расхождение RSI возникает в следующих случаях:

- Цена достигает нового максимума на линии верхнего уровня, но RSI достигает более низкого максимума на линии нижнего уровня. → Медвежья дивергенция: ослабление импульса, восходящий тренд теряет силу.
- Цена достигает нового минимума LL, но индикатор RSI формирует более высокий минимум HL. → Бычья дивергенция: медвежья динамика ослабевает, возможно ралли.

Практический пример: торговля с использованием бычьего расхождения RSI

Курс евро к доллару США находится в нисходящем тренде уже три недели подряд. Цена продолжает снижаться, сформировав два минимума: 1,0780 (первый минимум) и 1,0740 (второй минимум, более низкий).

Однако RSI на H4 показывает: RSI на первом минимуме = 25, RSI на втором минимуме = 32. Расхождение: цена падает, а RSI растёт.

На втором минимуме (1,0740) сформировалась бычья модель поглощения на графике H4.

Увеличение временного интервала:
поглощение с сужением)

Стоп-лосс: 1,0725 (на 5 пунктов ниже минимума, 30 пунктов)

Тейк-профит: 1,0820 (следующий уровень сопротивления, 65 пунктов, соотношение риска к прибыли 1:2,17)

Конец ознакомительного фрагмента.

Текст предоставлен ООО «Литрес».

Прочитайте эту книгу целиком, [купив полную легальную версию](#) на Литрес.

Безопасно оплатить книгу можно банковской картой Visa, MasterCard, Maestro, со счета мобильного телефона, с платежного терминала, в салоне МТС или Связной, через PayPal, WebMoney, Яндекс.Деньги, QIWI Кошелек, бонусными картами или другим удобным Вам способом.