ChartZenFX

ДНЕВНИК ТРЕЙДЕРА

Система решений и ошибок

- Журнал сделок
- Разбор решений
- Классификация ошибок
- Проверка своих правил

18 глав · 72 задания · учебный кейс

ChartZenFX

Дневник трейдера

«Автор»

2026

ChartZenFX

Дневник трейдера / ChartZenFX — «Автор», 2026

Торговый журнал — не просто список прибылей и убытков. Его задача — показать, какие решения соответствовали плану, где правила нарушались и как это отражалось на результате.Эта книга объясняет, как записывать сделки до входа, считать результат в R, классифицировать ошибки, разбирать день, неделю и месяц и превращать наблюдения в проверяемые правила.Внутри — 18 глав, 72 задания, шаблоны для собственного журнала и сквозной учебный кейс на 50 синтетических сделках.Книга не содержит торговых сигналов и не обещает прибыль.

© ChartZenFX, 2026
© Автор, 2026

Содержание

Содержание 7
Введение 8
Журнал, который хранит, и журнал, который учит 8
Четыре звена системы 9
Три величины, которые нельзя смешивать 10
Что понадобится 11
Как устроены задания 12
Об учебных данных 13
Как читать 14
Часть I. Что записывать 15
1.1. Одна сделка ничего не говорит о решении 16
1.2. Матрица «решение × исход» 17
1.3. Как оценить решение, не зная исхода 18
1.4. Решение оценивают по сделке, результат — по серии 19
1.5. Три величины одной сделки 20
1.6. Что из этого следует для журнала 21
Задания к главе 1 22
Глава 2. Анатомия записи 24
2.1. Три момента записи 25
2.2. До входа: план сделки 26
2.3. В сделке: журнал действий 27
2.4. После выхода: итог и оценка 28
2.5. Лишние поля 30
2.6. Минимальная запись 31
2.7. Признаки записи задним числом 32
2.8. Тетрадь или таблица 33
Задания к главе 2 34
Глава 3. Единица измерения — R 35
3.1. Что такое R 36
3.2. Размер позиции от риска 37
3.3. Результат в R 38
3.4. Плановое соотношение и результат 39
3.5. Когда единица R меняется 40
3.6. Когда результат больше 1R по модулю 41
3.7. Что записывать 42
Задания к главе 3 43
Глава 4. Правила, по которым можно себя проверить 44
4.1. Проверка двумя наблюдателями 45
4.2. Пять частей описания сетапа 46
4.3. Три примера переписывания 47
4.4. Правила режима 49
4.5. Решения на усмотрение 50
4.6. Торговый план на одной странице 51
Задания к главе 4 52
Глава 5. Контекст и состояние как данные 53
5.1. Контекст рынка 54

5.2. Состояние трейдера 55
5.3. Шкала, которая не плывёт 56
5.4. Три ловушки 57
Конец ознакомительного фрагмента. 58

ChartZenFX
Дневник трейдера

Дневник трейдера
Система решений и ошибок
ChartZenFX

© ChartZenFX, 2026. Все права защищены.

Книга носит образовательный характер. Она не содержит торговых сигналов и индивидуальных инвестиционных рекомендаций и не обещает доходности. Торговля на финансовых рынках связана с риском потери средств. Решения о сделках читатель принимает самостоятельно и на свой риск.

Все сделки в книге учебные, цены условные. Данные сквозного кейса (часть V и приложение Д) синтетические: они сгенерированы программой по заданным правилам. Это не история реальной торговли.

Содержание

Введение
Часть I. Что записывать
Глава 1. Решение и результат — не одно и то же
Глава 2. Анатомия записи
Глава 3. Единица измерения — R
Глава 4. Правила, по которым можно себя проверить
Глава 5. Контекст и состояние как данные
Часть II. Классификация ошибок
Глава 6. Что считать ошибкой
Глава 7. Каталог ошибок с кодами
Глава 8. Условная стоимость ошибки в R
Глава 9. Пропущенные сделки
Часть III. Разбор
Глава 10. Ежедневный разбор
Глава 11. Недельный разбор
Глава 12. Месячный разбор и базовые метрики
Глава 13. Ловушки разбора
Часть IV. От разбора к правилам
Глава 14. Личный свод правил
Глава 15. Предохранители
Глава 16. Изменили правило — сравните честно
Глава 17. Журнал на длинной дистанции
Часть V. Сквозной кейс
Глава 18. Месяц одного трейдера
Приложения
А. Шаблоны · Б. Формулы с примерами · В. Ответы к заданиям · Г. Словарь терминов · Д. Учебный журнал: таблица и как получены данные
Об авторе

Введение

Журнал, который хранит, и журнал, который учит

Почти каждый трейдер хотя бы раз начинал вести журнал сделок. Обычно это таблица: дата, инструмент, вход, выход, прибыль или убыток. Строк в ней становится всё больше, а открывают её всё реже. Записи есть, а пользы нет: таблица хранит историю, но ничего не говорит о том, что делать иначе.

Причина в устройстве такого журнала: он собирает результаты, а учиться можно только на решениях. Строка «−150 $» не отвечает на вопросы о качестве решения. Была ли сделка по плану? Был ли план вообще? Это обычный убыток, который случается при любой системе, или следствие того, что стоп передвинули в надежде на разворот? Пока журнал не различает эти случаи, разбор превращается в перечитывание собственных неудач.

Эта книга — о другом типе журнала: системе, которая помогает менять поведение на основе записей. В книге слова «дневник» и «журнал» означают одно и то же; дальше используется слово «журнал».

Четыре звена системы

Работающий журнал состоит из четырёх звеньев:

Запись. До входа фиксируется план сделки, в сделке — каждое действие, после выхода — итог.

Классификация. Каждое отклонение от плана получает код из каталога. Отклонение — это не убыток, а расхождение действий с собственными правилами.

Разбор. Ежедневно, еженедельно и ежемесячно записи сводятся в таблицы. Так видно, какие нарушения повторяются, в каких условиях и насколько меняют результат в R.

Правило. На основе повторяющегося нарушения формулируют одно новое правило. Его испытывают заранее заданный срок и оставляют или отменяют по данным.

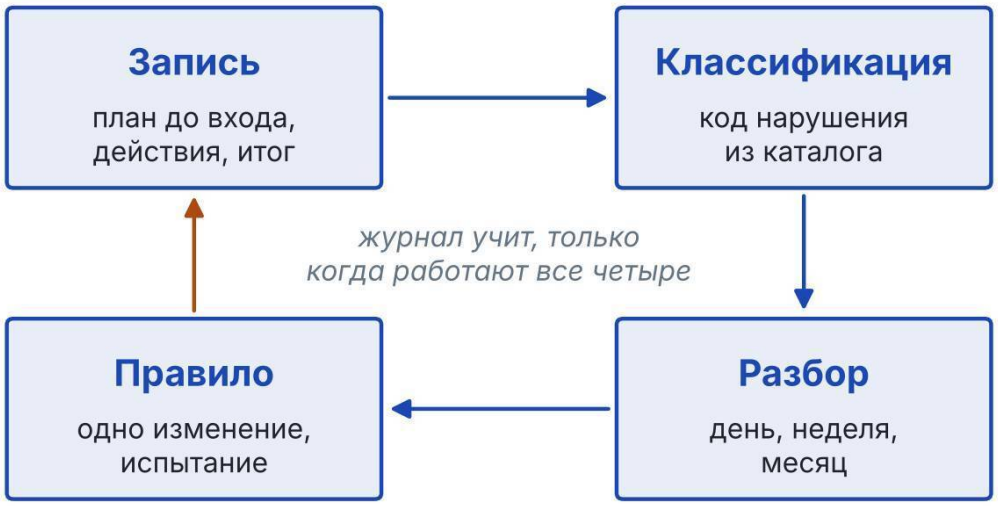


Схема. Четыре звена системы журнала

Если выпадает любое звено, система перестаёт работать. Без записи нечего классифицировать. Без классификации разбор сводится к впечатлениям. Без разбора коды остаются ярлыками. Без правил разбор ничего не меняет.

Три величины, которые нельзя смешивать

Вся книга держится на одном различии. У каждой сделки есть три разные величины, и путать их нельзя.

- **Нарушение**

— факт процесса: вы сделали не то, что записали в плане. Нарушение либо было, либо нет, независимо от того, чем кончилась сделка.

- **Результат**

— финансовый итог сделки. В этой книге он всегда измеряется в R, то есть в единицах заранее принятого риска (глава 3).

- **Условная стоимость нарушения**

— оценка того, насколько нарушение изменило результат. Это разность между фактическим результатом и тем, что дал бы план. Оценка именно условная, и считается она только в R (глава 8).

Сделка может быть прибыльной и при этом содержать грубое нарушение. Может быть убыточной и при этом безупречной. Журнал, который различает эти случаи, учит. Журнал, который видит только итоговую сумму, учит обратному: закрепляет нарушения, которым повезло.

Что понадобится

• Тетрадь или любая программа электронных таблиц. Специальные программы, платформы и индикаторы не нужны. Все шаблоны книги даны в двух видах — для тетради и как набор столбцов таблицы с формулами (приложение А).

• Ваш торговый план: хотя бы набросок того, как вы входите, где ставите стоп и когда выходите. Если плана нет, глава 4 поможет его записать. Без плана нельзя определить нарушение, поэтому с него придётся начать.

• Около десяти минут после каждого торгового дня и около часа в конце недели.

Книга не учит торговой стратегии и не оценивает качество вашей стратегии. Она подходит для любого рынка и стиля: криптовалюты, валюты, акции, фьючерсы; внутри дня и на несколько дней. Примеры взяты из разных рынков, чтобы показать, что приёмы не зависят от инструмента.

Как устроены задания

В книге есть задания четырёх типов:

Тип
Что нужно сделать
Ответ

разбор
по описанию сделки найти нарушение, присвоить код, отличить от невезения
в приложении B

счёт
посчитать R, размер позиции, результат, условную стоимость, метрики
в приложении B, с ходом решения

переформулировка
переписать расплывчатое правило или запись так, чтобы её можно было проверить
в приложении B: образец и критерии

личное
применить приём к собственному журналу
без ответа; дан способ проверить себя

Личные задания выстроены по порядку. Если выполнять их по ходу чтения, к последней главе у вас будет работающий журнал, каталог ваших нарушений и первый свод правил.

Об учебных данных

Все сделки в книге учебные, цены условные и округлены. В части V разобран месяц вымышленного трейдера — 50 сделок. **Эти данные синтетические.** Они сгенерированы программой по заданным правилам, чтобы показать все приёмы книги на одном наборе данных. Это не история реальной торговли и не результат какой-либо стратегии. Закономерности, которые читатель найдёт в этом журнале, заложены в модель намеренно. Как именно, описано в приложении Д.

Полная таблица всех 50 сделок приведена в приложении Д. Каждое число в главах о разборе можно пересчитать по ней самостоятельно.

Как читать

Части идут в порядке построения системы:

- **Часть I**
  — что и как записывать.
- **Часть II**
  — как классифицировать нарушения и оценивать их условную стоимость.
- **Часть III**
  — как разбирать журнал за день, неделю и месяц.
- **Часть IV**
  — как превращать выводы в правила и проверять их.
- **Часть V**
  — вся система на одном месяце учебного трейдера.

Если хотите начать сегодня. Возьмите минимальную запись из приложения A.2 и заведите её до следующей сделки: план до входа, действия в сделке, итог после выхода. Вечером проведите ежедневный разбор по пяти вопросам главы 10 — это около десяти минут. Остальное книга добавит по ходу чтения.

Главы ссылаются друг на друга, и пропускать части не стоит. Главу 3 о единице R стоит прочитать и тем, кто уже ведёт учёт в R: в этой книге R считается от нормы риска счёта, а не от риска отдельной сделки.

Важно. Книга носит образовательный характер. Она не содержит торговых сигналов и индивидуальных инвестиционных рекомендаций и не обещает доходности. Торговля на финансовых рынках связана с риском потери средств. Журнал не делает торговлю прибыльной. Он показывает, что именно происходит с вашими решениями.

Часть I. Что записывать

Глава 1. Решение и результат — не одно и то же

Первый навык журнала — отделять качество решения от исхода сделки. Без этого все остальные приёмы теряют смысл: разбор сведётся к простому правилу «прибыль — хорошо, убыток — плохо», а оно в торговле чаще вводит в заблуждение, чем помогает.

1.1. Одна сделка ничего не говорит о решении

Исход отдельной сделки складывается из двух частей: из ваших действий и последующего движения рынка. Своими действиями вы управляете: выбираете сетап, точку входа, размер позиции, стоп и выход по правилам. Движением рынка — нет. Даже хорошо описанный сетап в части случаев приводит к стопу, а случайный вход иногда приносит прибыль.

Пример 1.1. Два трейдера торгуют по одинаковым правилам: вход по сетапу, стоп на 1R, цель на 2R, стоп не переносится.

Трейдер А покупает EUR/USD по сетапу. Цена идёт против позиции и задевает стоп. Результат: −1,0R.

Трейдер Б покупает BTC/USDT по такому же сетапу. Цена тоже идёт к стопу. За несколько пунктов до него трейдер Б переносит стоп ниже: «сейчас развернётся». Цена проходит исходный уровень стопа, затем действительно разворачивается. Трейдер Б закрывает позицию вручную на +1,8R.

Если судить по результату, Б торговал лучше. Если судить по решениям, наоборот. А выполнил план полностью. Б нарушил главное правило своей системы — ограничение убытка — и в этот раз ему повезло. В следующий раз цена может не вернуться, и убыток, который должен был остаться в пределах 1R, ничем не будет ограничен.

1.2. Матрица «решение × исход»

Каждую сделку можно отнести к одной из четырёх клеток. Строки — качество решения: по плану или с нарушением. Столбцы — знак результата.

Решение	**Прибыль**	**Убыток**
по плану	заслуженный результат	нормальная цена системы
с нарушением	опасная удача	наказанное нарушение

Заслуженный результат. План выполнен, сделка прибыльна. Менять ничего не нужно: по одной сделке правила не меняют. Важно не приписать себе больше, чем было: план сработал в этот раз, но одна прибыльная сделка не подтверждает, что он работает вообще.

Нормальная цена системы. План выполнен, сделка убыточна. Любая система с ограниченным риском регулярно даёт такие убытки, это плата за участие в рынке. Убыток по плану — не повод менять правила. Его записывают и идут дальше. Если таких убытков подозрительно много, это вопрос о самой системе. Отвечают на него по серии сделок, а не по одной.

Опасная удача. Нарушение принесло прибыль. Это самая опасная клетка: деньги подкрепляют то поведение, которое при следующем повторении может стоить дорого. Сделки из этой клетки разбирают так же строго, как убыточные. В журнале, который смотрит только на итоговую сумму, они выглядят как успехи.

Наказанное нарушение. Нарушение и убыток. Эта клетка заметнее остальных, поэтому на неё легко отреагировать эмоционально: «больше никогда». Пользы от такой реакции мало. Пользу даёт запись: какое именно нарушение, в каких условиях, сколько раз уже повторялось.

Сделки с нулевым результатом в столбцы не попадают, но строку для них определить всё равно нужно. По плану или с нарушением — для журнала это главный вопрос, знак результата вторичен.

1.3. Как оценить решение, не зная исхода

Решение оценивается по той информации, которая была вам доступна в момент решения, даже если вы ею не воспользовались. Назовём её **информационным срезом**: что показывал график, что стояло в календаре событий, что было записано в плане, в каком вы были состоянии. Всё, что стало известно после входа, к оценке решения отношения не имеет.

Проверочный вопрос звучит так: **«Принял бы я то же решение снова, если бы располагал ровно той информацией, которая была доступна тогда?»** Если решение соответствовало плану и учитывало всё, что было известно, оно качественное, даже если исход плохой. Если правила нарушены, решение некачественное, даже если исход хороший.

Сохранить информационный срез можно только одним способом — записать план до входа. Когда исход уже известен, память переписывает прошлое. Убыточная сделка вспоминается как «я же видел, что не надо», прибыльная — как «я всё рассчитал». Запись, сделанная до входа, защищает от этого лучше любой дисциплины. Поэтому следующая глава начинается с того, что нужно записать до сделки.

Отдельный вопрос — хорош ли сам план. Решение может полностью соответствовать правилам, а правила могут быть неполными или неудачными. Эту ситуацию журнал тоже различает: в главе 6 она названа недостатком системы и отделена от нарушения. Есть ли у системы преимущество в принципе, журнал по нескольким десяткам сделок не докажет. Это задача отдельной проверки на данных, и в этой книге она не решается.

1.4. Решение оценивают по сделке, результат — по серии

Даже исправный план даёт длинные серии убытков. Если план приносит прибыль в 40% сделок, а исходы сделок не зависят друг от друга, то в отрезке из 50 сделок хотя бы одна серия из пяти и более убытков подряд встречается с вероятностью около 0,84: из десяти таких отрезков — больше чем в восьми. Серия из шести и более — с вероятностью около 0,63. Как это посчитать, показано в приложении Б. Это свойство случайности, а не признак того, что система сломалась.

Отсюда простое разделение:

- **Качество решения**
  проверяется в каждой сделке. Ответ «по плану или нет» известен сразу после выхода.
- **Качество результата**
  оценивается только по серии. По одной сделке, по одному дню и даже по одной неделе о нём ничего сказать нельзя.

Журнал, построенный по этой книге, ведёт эти две линии раздельно: соблюдение плана считается по каждой сделке, результат — по периодам (часть III).

1.5. Три величины одной сделки

Вернёмся к примеру 1.1 и укажем три величины для каждой сделки.

Величина
Сделка А
Сделка Б

нарушение
нет
перенос стопа дальше от цены; затем выход вручную до цели

результат
−1,0R
+1,8R

результат по плану
−1,0R
−1,0R

условная стоимость нарушения
—
+2,8R

Нарушение — факт процесса. В сделке Б он есть, в сделке А нет. От результата этот факт не зависит. Ручной выход до цели — второе нарушение той же сделки; условная стоимость относится к первому по времени — переносу стопа (глава 8).

Результат — фактический итог в R. Что такое R и как его считать, разобрано в главе 3.

Результат по плану — итог, который дал бы план, если бы его выполнили. В сделке Б цена дошла до исходного стопа, значит, по плану сделка закрылась бы на −1,0R.

Условная стоимость нарушения — разность между фактическим результатом и результатом по плану: +1,8R − (−1,0R) = +2,8R. Положительная стоимость означает, что в этот раз нарушение улучшило итог. Это не делает его правильным. Сделка Б попадает в клетку «опасная удача», потому что она прибыльна и содержит нарушение. Положительная условная стоимость здесь совпала с прибылью, но это разные признаки: прибыльная сделка с нарушением остаётся опасной удачей и при отрицательной стоимости (задание 1.1, пункт д).

Стоимость называется условной, потому что результат по плану восстанавливают задним числом, по графику и правилам. Предполагается, что стоп сработал бы ровно на своём уровне, без проскальзывания. Это оценка, а не точная величина, и считается она только в R, никогда в деньгах. Как определять результат по плану в разных случаях и что делать, когда его определить нельзя, разобрано в главе 8.

1.6. Что из этого следует для журнала

Если решение и результат — разные вещи, журнал должен фиксировать их раздельно:

•

до входа

— план и информационный срез, чтобы потом было с чем сравнивать;

•

в сделке

— каждое действие и его причину: по правилу или нет;

•

после выхода

— результат в R, нарушения и оценку решения отдельно от результата.

Как сделать это кратко и без лишних полей, разобрано в главе 2.

Коротко.

• Исход одной сделки смешивает качество решения и случайность.

• Матрица «решение × исход» делит сделки на четыре клетки; самая опасная — «опасная удача».

• Решение оценивают по информационному срезу — тому, что было известно или доступно до входа.

• Качество решения видно в каждой сделке, качество результата — только по серии.

• У каждой сделки три величины: нарушение, результат и условная стоимость нарушения в R.

Задания к главе 1

Задание 1.1 (разбор). Правила трейдера: план сделки записывается до входа, вход только по сетапам из торгового плана, стоп ставится при входе и не переносится, риск 1R, выход по цели, по стопу или по времени. Отнесите каждую сделку к клетке матрицы «решение × исход».

а) Вход по сетапу из плана, стоп на месте, цена дошла до цели: +2,0R.

б) Вход по сетапу из плана, сработал стоп: −1,0R.

в) Вход сразу после публикации новости, без записанного плана; цена пошла в нужную сторону, выход вручную: +1,2R.

г) Вход по сетапу из плана, но с риском вдвое больше нормы; сработал стоп: −2,0R.

д) Вход по сетапу из плана, цель +2,0R; позиция закрыта вручную «на всякий случай» на +0,6R. Через час цена дошла до цели.

е) Вход по сетапу из плана; ни цель, ни стоп не достигнуты, выход по правилу времени: 0,0R.

Задание 1.2 (разбор). Трейдер купил золото и получил −1,0R. Ниже — всё, что известно об этой сделке. Отметьте, какие факты входят в информационный срез и могут использоваться для оценки решения. Затем ответьте: было ли решение качественным?

В плане есть правило: не входить за 30 минут до важных новостей.

В календаре событий на момент входа стояла публикация важной статистики через 20 минут.

Стоп стоял за минимумом дня, как требует сетап.

Через 25 минут после входа цена резко упала на публикации.

Вечером стало известно, что данные сильно разошлись с прогнозом.

Задание 1.3 (переформулировка). Перепишите записи так, чтобы в них отдельно были видны решения и результат.

а) «Ужасный день, −3R, опять всё слил».

б) «Отличная неделя, +6R, наконец-то поймал рынок».

в) «Сделка по нефти — красавица, +2,5R».

К записям известно следующее.

•

К записи а.

Было три сделки. Две по плану, обе закрылись по стопу. Третья открыта сразу после второго убытка без сетапа, тоже закрылась по стопу.

•

К записи б.

Семь сделок, все по плану: четыре прибыльных, три убыточных.

•

К записи в.

Вход по плану, но риск увеличен в 2,5 раза; цена дошла до цели в 1R.

Задание 1.4 (счёт). Для каждой сделки укажите результат, результат по плану и условную стоимость нарушения.

а) План: цель +2,0R, стоп −1,0R. Трейдер закрыл позицию вручную на +0,4R, после этого цена дошла до цели.

б) План: цель +1,5R, стоп −1,0R. Трейдер перенёс стоп дальше от цены. Цена прошла исходный стоп и задела новый: −1,7R.

в) План: цель +2,0R, стоп −1,0R. Трейдер закрыл позицию вручную на −0,3R, после этого цена дошла до исходного стопа.

Задание 1.5 (личное). Возьмите десять своих последних сделок и отнесите каждую к клетке матрицы. Посчитайте, сколько сделок попало в «опасную удачу».

Проверка себя: если для какой-то сделки вы не можете уверенно выбрать строку «по плану / с нарушением», значит, план не был записан до входа или его правила нельзя проверить. Это первая находка вашего журнала. Отметьте такие сделки отдельно: к ним вернутся главы 2 и 4.

Глава 2. Анатомия записи

Запись в журнале — не отчёт о сделке, а три короткие части, которые заполняют в разные моменты. Каждая отвечает на свой вопрос. Если смешать их в одну запись после выхода, теряется главное: сравнивать действия с планом будет не с чем.

2.1. Три момента записи

Момент	**Вопрос**	**Когда заполняется**
до входа	что я собираюсь сделать и почему	до отправки заявки
в сделке	что я изменил и по какому правилу	в момент каждого действия
после выхода	чем кончилось и совпало ли с планом	после закрытия, в тот же день

Разделение нужно, потому что после исхода память переписывает прошлое (глава 1). План, записанный до входа, — единственное, что знание исхода не может исказить. Сигналы, по которым вход не сделан, записываются отдельно — в журнал пропусков (глава 9).

2.2. До входа: план сделки

Обязательные поля:

Время записи. Нужно, чтобы потом убедиться, что план записан до входа, а не после.

Инструмент и направление — покупка или продажа.

Сетап — название из вашего списка сетапов и версия торгового плана: «откат, план v3» (глава 4). Если сетапа нет в списке, это сразу заметно.

Условие и точка входа — при каком событии и по какой цене вы входите: «касание 1,0850 лимитной заявкой», «закрытие часовой свечи выше 3 100, вход по рынку».

Стоп — уровень и одна фраза о том, почему он стоит именно там.

Цель или условие выхода, включая выход по времени, если он есть в правилах.

Условие отмены — что должно произойти до входа, чтобы сделка отменялась: «если цена уйдёт выше 1,0890, не дойдя до точки входа, — заявку снять». Если правила требуют закрыть уже открытую позицию при похожем условии, оно записывается здесь же; такой выход — выход по правилу отмены.

Риск и размер позиции — сколько R вы рискуете (обычно 1R) и какой размер позиции из этого получается. Расчёт — в главе 3.

Контекст — одна строка о рынке (глава 5).

Состояние — сон и усталость по шкале (глава 5).

Причина входа — сигнал плана или нет; если нет — причина одним словом: «отыграть», «не упустить». Слово «нет» здесь — честная запись, а не провал: она экономит время на разборе.

Ориентир — две-три минуты на запись. Если регулярно уходит дольше, скорее всего, в форме лишние поля или слишком много текста (раздел 2.5).

2.3. В сделке: журнал действий

Пока позиция открыта, записываются только действия с ней. Для каждого действия три поля: время, что сделано, по правилу или нет. Первая строка — сам вход: время, фактическая цена исполнения и стоп, выставленный при входе. По ней на разборе проверяют, записан ли план до входа (раздел 2.7) и не был ли вход раньше сигнала или по цене хуже допустимой (глава 7).

- «11:20 — стоп перенесён в безубыток, по правилу: цена прошла 1R».
- «12:05 — стоп перенесён с 59 400 на 59 100, не по правилу».
- «12:40 — закрыта половина позиции, по правилу частичного выхода».

Если с позицией ничего не делали, после строки входа достаточно записи «без изменений». Мысли, сомнения и комментарии к движению цены сюда не пишут. Действие либо было, либо нет, и для разбора важно только это.

2.4. После выхода: итог и оценка

Время и цена выхода.

Причина выхода — одно из шести: цель, стоп, правило времени, правило отмены, другое правило выхода из плана (назвать какое), вручную без правила.

Результат в R — после комиссий и сборов (глава 3).

Нарушения — коды из каталога (глава 7). Если их несколько, первым пишется первичное — первое по времени торговое нарушение (раздел 6.4).

Результат по плану и условная стоимость — заполняются, только если было нарушение (глава 8).

Оценка решения — одно слово: «по плану» или «с нарушением». Заполняется отдельно от результата и не зависит от него.

Вывод — одна строка, по желанию.

Поля 4–6 можно заполнить вечером, во время ежедневного разбора. Поля 1–3 — сразу после выхода, пока точные данные под рукой.

Пример 2.1. Полная запись сделки. Цены условные.

До входа

Поле
Значение

время записи
14:05

инструмент
EUR/USD, покупка

сетап
откат к средней в восходящем тренде; план v3

вход
лимитная заявка 1,0850, у средней

стоп
1,0820 — ниже минимума отката

цель
1,0910 (2R); если до 20:00 ни цели, ни стопа — закрыть по рынку

отмена
если до входа цена уйдёт выше 1,0890 — снять заявку

риск, размер
1R = 100 $; стоп 30 пунктов; 0,33 лота, фактический риск 99 $

контекст
на дневном графике рост; важных новостей до 18:00 нет

состояние
сон 7,5 ч; усталость 2 из 5

причина входа
сигнал плана

В сделке

Время
Действие
По правилу

14:32
вход: заявка исполнена по 1,0850, стоп 1,0820 выставлен
по правилу

15:40
без изменений
—

После выхода

Поле
Значение

выход
19:10, 1,0910 — цель

результат
+198 $ − 2,3 $ комиссии = +195,7 $ = +1,96R

нарушения
нет

оценка решения
по плану

Пример 2.2. Та же сделка, записанная по памяти вечером: «EUR/USD, купил на откате, вышел на цели, +196 $, отлично».

Из такой записи нельзя узнать:

• был ли план до входа и в какое время его записали;
• где стоял стоп, какой был риск и сколько это в R;
• было ли условие отмены и выполнялось ли оно;
• в каком состоянии была принята сделка;
• соответствовала ли сделка плану.

Через месяц сотня таких записей даст только сумму. Сотня записей из примера 2.1 покажет, где именно теряется результат.

2.5. Лишние поля

Заполнение каждого поля журнала требует времени, а чем длиннее форма, тем легче бросить журнал. Проверка для любого поля одна: **«Буду ли я когда-нибудь считать, сортировать или фильтровать записи по этому полю или сверять по нему, выполнен ли план?»** Если нет — поле лишнее.

В первую очередь проверьте такие поля:

- **длинные описания чувств и рассуждений.**

Состояние фиксируется шкалой (глава 5). Рассуждения о рынке занимают не больше одной строки контекста.

- **значения индикаторов, которых нет в правилах.**

Если индикатор не участвует в решении, его значение не объясняет решение.

- **снимки графика на каждом шаге.**

Полезны два снимка — при входе и при выходе, и только если вы действительно открываете их на разборе. Достаточно имени файла в поле записи.

- **оценки вроде «уверенность от 1 до 10»,**

если вы не собираетесь сравнивать результаты по уровням уверенности. Если собираетесь — поле нужно, но тогда шкалу надо описать так же строго, как шкалу усталости.

Поле, которое не прошло проверку, лучше убрать сразу. Поле, которое заполняется через раз, вредит ещё больше: оно создаёт видимость данных, которых нет.

2.6. Минимальная запись

Бывают дни, когда полную запись сделать некогда. Для них есть минимальная запись — шесть полей:

время записи;

инструмент и направление;

сетап;

точка входа, уровни стопа и цели;

риск в R;

после выхода — время и цена входа по истории сделок; менялись ли в сделке стоп, цель или объём — и как; результат в R; «по плану: да / нет».

Важно. Минимальная запись допустима, отсутствие записи — нет. Поля «до входа» заполняются только до входа. Если после закрытия сделки дописать в план стоп или цель, получится ровно то, от чего журнал должен защищать: план, подогнанный под исход. Поля «после выхода» можно дополнить в тот же день, на ежедневном разборе.

2.7. Признаки записи задним числом

Даже при намерении вести журнал честно часть записей появляется уже после событий. Опознать их помогают четыре признака:

- **время записи плана позже времени входа;**
- **цель совпадает с ценой ручного выхода**

или с крайней точкой, до которой дошла цена. Совпадение цели с ценой выхода по цели — норма. Совпадение с ценой выхода вручную — повод насторожиться;

- **стоп стоит ровно на экстремуме,**

которого цена достигла уже после входа;

- **причина входа ссылается на то, что стало известно позже:**

«ожидал падения на новости» о новости, которой во время входа ещё не было в календаре.

Защита простая. План записывается до отправки заявки. В таблице время записи ставится в отдельный столбец. Поля плана после входа не исправляются: если что-то нужно уточнить, добавляется новая строка с пометкой времени. В каталоге ошибок (глава 7) запись плана после входа и исправление записи после исхода — отдельные нарушения с кодами A1 и A3.

2.8. Тетрадь или таблица

Оба способа пригодны, но у каждого есть слабая сторона.

•

Тетрадь

удобна до входа: её не нужно открывать, она лежит рядом, запись занимает минуту. Слабость — считать по ней трудно. Месячный разбор превращается в пересчёт вручную.

•

Таблица

удобна после выхода: сортировка, фильтры, формулы. Слабость — её проще заполнить позже, «когда будет время», и тогда записи становятся записями задним числом.

Распространённое решение — совмещать. План записывают в тетрадь до входа и указывают время записи. Вечером, на ежедневном разборе, записи переносятся в таблицу, и время записи плана переносится вместе с ними. Шаблоны для обоих способов — в приложении А.

Коротко.

• Запись состоит из трёх фиксаций: до входа, в сделке, после выхода.

• План записывается до заявки и после входа не исправляется.

• В сделке фиксируются только действия: время, что сделано, по правилу или нет.

• Каждое поле проходит проверку: «буду ли я по нему считать или сверять план».

• Минимальная запись лучше отсутствия записи, но поля плана задним числом не заполняются.

Задания к главе 2

Задание 2.1 (разбор). Перечислите обязательные поля плана (раздел 2.2), которых нет в записи. Объясните, какое из отсутствующих полей делает запись непригодной для расчёта в R.

09:40. BTC/USDT, продажа. Сетап: пробой диапазона вниз. Вход по рынку 61 200. Цель 59 400. Риск 1R. Сон 6 ч.

Задание 2.2 (разбор). В каких записях план, скорее всего, записан или исправлен задним числом? Назовите признак.

а) План записан в 10:12, вход в 10:15. Стоп 1,2710, цель 1,2830. Выход по цели на 1,2830.

б) План записан в 16:40, вход в 16:05.

в) План записан в 09:58, вход в 10:02. В плане стоп указан ровно на уровне минимума, до которого цена дошла через два часа после входа. Причина входа: «ожидал разворот после решения по ставке». Решение по ставке опубликовали в 11:30, а в календаре событий его утром не было.

г) План записан в 13:20, вход в 13:24. Цель 3 150. Выход вручную на 3 150, «почувствовал, что дальше не пойдёт».

Задание 2.3 (переформулировка). Разложите заметку по полям записи: до входа, в сделке, после выхода. Отметьте поля, которые нельзя заполнить честно, и посчитайте результат в R, приняв вход 3 050 и стоп 3 020 и считая это расстояние равным 1R.

Утром увидел, что эфир пробил вчерашний максимум, долго сомневался, но вошёл в покупку примерно на 3 050, стоп поставил где-то под 3 020, хотел взять 3 110. Не выспался, голова тяжёлая. Через пару часов закрыл на 3 080 — надоело ждать.

Задание 2.4 (личное). Составьте свой шаблон записи для трёх моментов. Заполните его для одной из прошлых сделок и засеките время.

Проверка себя: поля плана заполняются не дольше трёх минут; каждое поле проходит проверку «буду ли я по нему считать или сверять план». Поля, которые вы не смогли заполнить для прошлой сделки по памяти, — те, без которых ваш прежний журнал не позволял ничего проверить.

Глава 3. Единица измерения — R

В журнале сравнивают сделки между собой: разные дни, инструменты, размеры счёта. Для этого нужна общая единица. В деньгах сделки сравнивать трудно: убыток в 150 $ при счёте в 3 000 $ и при счёте в 30 000 $ — разные события. В этой книге всё измеряется в R.

3.1. Что такое R

1R — это сумма, которую вы заранее согласились потерять в одной сделке, если сработает стоп. Обычно её задают долей счёта: 0,5%, 1%, 2%.

В этой книге R — **постоянная единица для счёта на период,** например на месяц. Все результаты за период выражаются в одних и тех же R, поэтому их можно складывать, усреднять и сравнивать.

Это отличается от распространённого способа, при котором результат делят на первоначальный риск самой сделки. При том способе убыток по стопу равен −1R даже при риске вдвое выше нормы. Здесь такая сделка даёт −2R, и превышение риска видно прямо в результате.

Пример 3.1. Счёт 10 000 $, риск на сделку 1%. Значит, 1R = 100 $.

• Сделка закрылась по стопу с убытком 100 $ — результат −1,0R.

• Прибыль 250 $ — +2,5R.

• Убыток 140 $ — −1,4R. Это больше одного R, и такой результат требует объяснения (раздел 3.6).

Почему не деньги и не проценты? Деньги зависят от размера счёта: после роста или просадки одни и те же решения дают разные суммы. Проценты от счёта лучше, но и они не связаны с решением о риске: убыток в 1% счёта может быть и полным стопом, и его десятой частью. R привязан к тому, что вы сами решили до входа, — к допустимому убытку. Результат +2R понятен сразу: сделка принесла вдвое больше, чем вы были готовы потерять.

3.2. Размер позиции от риска

Если 1R задан, размер позиции не выбирается — он рассчитывается:

размер позиции = 1R ÷ (расстояние до стопа × стоимость единицы движения цены)

Расстояние до стопа — разница между ценой входа и ценой стопа. Стоимость единицы движения зависит от инструмента: для криптовалюты на споте и в линейных контрактах с ценой в долларах или USDT — 1 $ на одну монету (у инверсных контрактов расчёт другой, он есть в спецификации), для валютной пары — стоимость пункта, для золота — стоимость движения цены на 1 $ для одного лота.

Размер округляют **вниз** до шага, который допускает инструмент. Округление вверх незаметно делает риск больше 1R. Если после округления размер меньше минимального объёма, сделку с таким стопом при риске 1R открыть нельзя: минимальный объём сделает риск больше нормы.

Рассчитанный размер проверяют ещё по двум условиям. Первое — хватает ли средств: свободных денег при покупке без плеча или маржи при торговле с плечом. Второе, для позиций с плечом, — цена ликвидации должна быть дальше от входа, чем стоп, с запасом: иначе позицию закроет площадка, и убыток окажется больше 1R. Требования к марже и порядок ликвидации зависят от площадки и указаны в спецификации инструмента. Если хотя бы одно условие не выполняется, размер уменьшают или от сделки отказываются. В примерах 3.3 и 3.4 позиции больше счёта: такие сделки открывают с плечом.

Пример 3.2. BTC/USDT, покупка. Вход 60 000, стоп 59 400, 1R = 100 $. Цены условные.

• Расстояние до стопа: 60 000 − 59 400 = 600 $ на 1 BTC.

• Размер: 100 ÷ 600 = 0,1667 BTC. Шаг объёма 0,001 BTC, округляем вниз:

0,166 BTC.

• Фактический риск: 0,166 × 600 = 99,6 $, то есть 0,996R.

• Цель на 2R по расстоянию — 61 200. Прибыль на цели: 0,166 × 1 200 = 199,2 $.

Пример 3.3. EUR/USD, покупка. Вход 1,0850, стоп 1,0820, 1R = 100 $.

• Расстояние до стопа — 30 пунктов (пункт — 0,0001).

• Для счёта в долларах один пункт на 1 стандартный лот (100 000 единиц валюты) EUR/USD стоит 10 $. Риск на лот: 30 × 10 = 300 $.

• Размер: 100 ÷ 300 = 0,333 лота. Шаг 0,01 лота, округляем вниз:

0,33 лота,

риск 99 $.

Это та самая сделка из примера 2.1.

Пример 3.4. XAU/USD (золото), покупка. Вход 3 200, стоп 3 192, 1R = 100 $.

• Расстояние до стопа — 8 $ на унцию.

• Размер контракта у многих брокеров — 100 унций на лот. Тогда движение на 1 $ стоит 100 $ на лот, а риск на лот равен 8 × 100 = 800 $.

• Размер: 100 ÷ 800 = 0,125 лота. Округляем вниз:

0,12 лота,

риск 96 $.

Важно. Размер контракта, стоимость пункта и шаг объёма зависят от брокера, типа счёта и валюты котировки. 10 $ за пункт на лот верно для пар, где доллар — вторая валюта, как в EUR/USD. У USD/JPY (пункт — 0,01) или EUR/GBP стоимость пункта другая и меняется с курсом. Перед первым расчётом проверьте эти величины в спецификации инструмента. Ошибка в стоимости пункта искажает все результаты в R. В примерах книги 1 USDT принят равным 1 $.

3.3. Результат в R

результат в R = (прибыль или убыток после комиссий) ÷ 1R

В результат включают комиссии, спред и плату за перенос позиции. Они реальны, и при близком стопе их доля в R бывает заметной.

Пример 3.5. Сделка из примера 3.2 (0,166 BTC, вход 60 000) закрыта вручную на 60 450. Комиссия биржи — 0,05% от объёма при входе и при выходе.

• Прибыль до комиссий: 0,166 × 450 = 74,7 $.

• Комиссии: (0,166 × 60 000 + 0,166 × 60 450) × 0,0005 ≈ 10,0 $.

• Результат: 74,7 − 10,0 = 64,7 $, то есть

+0,65R.

Комиссии здесь — около 0,1R за сделку. Если стоп в два раза ближе, а размер в два раза больше, комиссии вырастут примерно до 0,2R. Это ещё одна причина считать результат в R, а не в пунктах цены: в пунктах этих потерь не видно.

Частичный выход. Если позиция закрывается частями, общий результат получают сложением результатов каждой части с учётом её доли.

Пример 3.6. Половина позиции закрыта на +1,0R, вторая половина — по цели на +2,0R. Результат: 0,5 × 1,0 + 0,5 × 2,0 = **+1,5R.** Если вторая половина закрыта в безубытке: 0,5 × 1,0 + 0,5 × 0 = **+0,5R.**

3.4. Плановое соотношение и результат

Важно не путать два числа:

- **плановое соотношение прибыли и риска** — отношение расстояния до цели к расстоянию до стопа. Известно до входа: «цель на 2R»;
- **результат в R** — то, чем сделка закончилась фактически.

Если цель на 2R, а результат +0,6R, такую сделку нельзя записывать как «сделку 2R». Это сделка, закрытая раньше цели. В журнале оба числа хранятся раздельно: первое в плане, второе после выхода.

3.5. Когда единица R меняется

R держат постоянным в течение периода — недели, месяца — и пересчитывают в его начале по размеру счёта.

Пример 3.7. К началу следующего месяца счёт вырос до 10 500 $. При риске 1% новый 1R = 105 $. Результаты прошлого месяца остаются в старых R. Сделка, открытая в одном периоде и закрытая в следующем, считается в R того периода, в котором открыта: риск по ней был принят в прежних единицах. Сравнивать периоды по R можно: +5R в обоих месяцах означают одинаковый результат в единицах принятого риска, хотя в деньгах суммы разные.

Если внутри периода вы осознанно меняете риск на сделку, например снижаете его после серии убытков, правильнее начать новый период. Иначе 1R периода перестанет совпадать с риском сделки: убыток по стопу будет записываться, например, как −0,5R, и проверка раздела 3.6 перестанет работать. Новый период начинается с даты смены риска и нового значения 1R; сравнивать его с прошлыми по R можно, как и любые периоды.

3.6. Когда результат больше 1R по модулю

При соблюдении плана убыток по стопу равен −1R с поправкой на комиссии и проскальзывание: например, −1,02R или −1,05R, а при комиссии от объёма и стопе порядка 1% цены — около −1,1R. Так закрылась бы по стопу сделка из примеров 3.2 и 3.5: 99,6 $ убытка и 9,9 $ комиссий — −1,10R. Если в журнале встречаются убытки −1,4R, −2,0R, −2,3R, причин две группы, и какая из них сработала, показывает только разбор сделки. Первая — одно из трёх нарушений:

Стоп перенесли дальше от цены. Это нарушение управления (глава 7).

Риск был больше нормы. Размер позиции рассчитан не от 1R или округлён вверх.

Стопа не было. Убыток ничем не ограничивался и остановился там, где вы решили выйти.

Вторая — **разрыв цены и сбой исполнения.** Цена может открыться за стопом после выходных или ночного перерыва либо проскочить его на публикации, и тогда стоп исполняется хуже своего уровня; при техническом сбое он может не исполниться вовсе. Это не нарушение (глава 6), но такие сделки отмечают в выводе: стоп-заявка исполняется по первой доступной цене и не гарантирует убыток ровно в 1R.

Отсюда простая и сильная проверка журнала: **средний убыток, заметно превышающий 1R, — повод разобрать убыточные сделки по одной.** Сначала отделите то, что объясняют комиссии, проскальзывание, разрывы цены и сбои исполнения. Если превышение остаётся, ищите нарушения: перенос стопа, риск больше нормы, вход без стопа. При исправном исполнении средний убыток не больше 1R с поправкой на комиссии, а если часть сделок закрывается по времени или в безубытке, — заметно меньше.

Сделка без стопа требует отдельного пояснения. Её результат в R счёта посчитать можно: убыток 230 $ при 1R = 100 $ — это −2,3R. Но риск самой сделки не был определён до входа. Размер позиции выбирался без расчёта, и ограничения убытка не было. Поэтому стоп — не просто правило безопасности, а условие измерения: без него план сделки нельзя записать в R.

3.7. Что записывать

В плане сделки:

• 1R в деньгах на текущий период;

• расстояние до стопа;

• размер позиции и фактический риск после округления;

• плановое соотношение: «цель на 2R».

После выхода:

• прибыль или убыток после комиссий в деньгах;

• результат в R с двумя знаками после запятой, на разборе — с одним.

Коротко.

• 1R — заранее принятый убыток на сделку; в книге это постоянная единица счёта на период.

• Размер позиции рассчитывается от 1R и округляется вниз.

• Результат в R считается после комиссий.

• Плановое соотношение и фактический результат — разные числа.

• Убыток заметно больше 1R — повод проверить сделку: причиной может быть перенос стопа, превышение риска или отсутствие стопа, а может — разрыв цены через стоп или сбой исполнения.

Задания к главе 3

Задание 3.1 (счёт). Счёт 25 000 $, риск на сделку 0,5%. Чему равен 1R?

Задание 3.2 (счёт). ETH/USDT, покупка, 1R из задания 3.1. Вход 3 000, стоп 2 940, цель 3 150. Шаг объёма 0,01 ETH. Найдите размер позиции, фактический риск в долларах и плановое соотношение прибыли и риска.

Задание 3.3 (счёт). EUR/USD, 1R из задания 3.1. Стоп — 25 пунктов от входа, стоимость пункта — 10 $ на лот, шаг 0,01 лота. Найдите размер позиции.

Задание 3.4 (счёт). XAU/USD, продажа, 1R из задания 3.1. Вход 3 210, стоп 3 222. Размер контракта 100 унций на лот, шаг 0,01 лота. Найдите размер позиции и фактический риск.

Задание 3.5 (счёт). Прибыль по сделке до комиссий — 312 $, комиссии — 12 $, 1R = 125 $. Каков результат в R?

Задание 3.6 (счёт). Позиция закрыта в два приёма. Найдите результат в R.

а) Треть позиции закрыта на +1,5R, остаток — по стопу, перенесённому в безубыток.

б) Треть позиции закрыта на +1,5R, остаток — по цели на +3,0R.

Задание 3.7 (разбор). 1R = 100 $. Что не так с каждой записью и каким будет результат в R?

а) Стоп не выставлен, позиция 0,5 BTC, сделка закрыта вручную с убытком 230 $.

б) EUR/USD, размер 0,3 лота, стоп 50 пунктов, стоимость пункта 10 $ на лот. Сработал стоп.

Задание 3.8 (личное). Запишите для своего счёта:

• 1R на текущий месяц;

• шаг объёма и стоимость единицы движения цены для трёх инструментов, которыми вы торгуете;

• размер комиссий.

Рассчитайте размер позиции для типичного расстояния до стопа по каждому инструменту.

Проверка себя: фактический риск после округления не больше 1R; комиссия за полную сделку выражена в R. Если она больше 0,1R, учитывайте её при выборе расстояния до стопа.

Глава 4. Правила, по которым можно себя проверить

Нарушение — это расхождение действий с правилами. Значит, журнал может найти ровно столько нарушений, сколько позволяют найти правила. Если правило звучит как «вхожу, когда вижу силу покупателей», под него подходит любой вход, и нарушений не будет никогда. Это не означает безупречной торговли. Это означает, что журнал ослеп.

Эта глава — о том, как записать свою систему так, чтобы по ней можно было проверить каждое решение. Глава не учит, по каким сетапам торговать: она учит записывать любой сетап в проверяемом виде.

4.1. Проверка двумя наблюдателями

Правило проверяемо, если два человека, прочитав его и глядя на один и тот же график, примут одинаковое решение. На практике эту проверку можно провести так: каждое условие правила должно иметь ответ «да» или «нет» в конкретный момент времени.

• «Цена у сильного уровня» — ответа нет: что такое сильный уровень и насколько «у»?

• «Цена в пределах 0,2% от максимума последних 20 закрытых дневных свечей» — ответ есть.

Расплывчатые формулировки опасны не только тем, что их нельзя проверить. Они ещё и меняют смысл задним числом. Если вход оказался удачным, уровень «был сильным». Если неудачным — «был слабым, надо было видеть». Проверяемое правило не даёт так переписать решение после исхода.

4.2. Пять частей описания сетапа

Полное описание сетапа отвечает на пять вопросов:

Условие — какое наблюдаемое состояние рынка делает сетап возможным. Обязательно указывается таймфрейм.

Сигнал и точка входа — какое событие запускает вход и по какой цене или каким типом заявки.

Стоп — где он стоит и почему: за каким элементом графика и с каким отступом.

Выход — цель в R или по уровню, правило выхода по времени. Если в системе есть частичный выход или перенос стопа в безубыток, их условия тоже описываются здесь.

Отмена — что должно произойти до входа, чтобы сетап перестал действовать, и, если правила это предусматривают, после входа — чтобы позиция закрывалась.

К этому добавляются фильтры, общие для всех сетапов: инструменты, время торговли, правило о новостях. Они описаны в разделе 4.4.

4.3. Три примера переписывания

Ниже три сетапа разных типов. Каждый сначала дан в расплывчатой форме, потом в проверяемой.

Важно. Это примеры формы записи, а не рекомендации торговать по этим правилам. Приносят ли они прибыль — отдельный вопрос, и книга его не решает.

Пример 4.1. Пробой диапазона.

Расплывчато: «Покупаю пробой, когда рынок готов к росту».

Проверяемо:

•

Условие:

таймфрейм 1 час. Диапазон — максимум и минимум 12 закрытых свечей перед сигнальной. Его ширина не больше двух средних высот свечи за эти 12 часов.

•

Сигнал:

свеча закрылась выше максимума диапазона. Вход по рынку на открытии следующей свечи.

•

Стоп:

на 0,1% ниже минимума сигнальной свечи.

•

Выход:

цель 2R. Если через 8 часов не достигнуты ни цель, ни стоп — закрыть по рынку.

•

Отмена:

если цена входа выше максимума диапазона больше чем на половину расстояния до стопа — не входить.

Пример 4.2. Откат к средней в тренде.

Расплывчато: «Покупаю на откате в тренде».

Проверяемо:

•

Условие:

таймфрейм 4 часа. 50-периодная простая скользящая средняя цен закрытия выше своего значения 10 свечей назад, цена закрытия выше средней.

•

Сигнал:

минимум свечи касается средней или проходит ниже неё, а закрытие остаётся выше. Вход по рынку на открытии следующей свечи.

•

Стоп:

на 0,1% ниже минимума сигнальной свечи.

•

Выход:

цель 2,5R; если за 6 свечей ни цели, ни стопа — закрыть.

•

Отмена:

если свеча закрылась ниже средней, сетапа нет до нового закрытия выше неё.

Пример 4.3. Отбой от границы диапазона.

Расплывчато: «Продаю у верха боковика».

Проверяемо:

•

Условие:

таймфрейм 1 час. Верхняя граница — максимум 24 закрытых свечей перед сигнальной, нижняя — их минимум. Каждой границы цена касалась не меньше двух раз (касание — максимум или минимум свечи в пределах 0,1% от границы), и последняя свеча закрылась внутри диапазона.

•

Сигнал:

свеча коснулась верхней границы и закрылась ниже неё. Вход по рынку на открытии следующей свечи.

•

Стоп:

на 0,1% выше максимума сигнальной свечи.

•

Выход:

цель 1,5R; если за 6 свечей ни цели, ни стопа — закрыть.

•

Отмена:

если свеча закрылась выше верхней границы, диапазон считается сломанным.

Во всех трёх проверяемых версиях на каждое условие можно ответить «да» или «нет» по закрытой свече. Именно это позволяет в главе 7 отличить, например, вход до сигнала (код B1) от входа по сигналу.

4.4. Правила режима

Кроме сетапов, в торговом плане есть правила, которые касаются не отдельной сделки, а торговли в целом:

- **список сетапов**
  — торгуются только они;
- **инструменты**
  — с чем вы работаете;
- **время торговли**
  — окна, в которые вы входите, и часы, когда не входите;
- **граница дня**
  — час и часовой пояс, с которых начинается торговый день. На рынках без перерыва их выбирают заранее и не меняют задним числом. Результат сделки относится к тому дню, в который она закрыта, лимит числа сделок — ко дню открытия. Дневной лимит убытка считают по уже закрытым сделкам дня. Позиция, перенесённая через границу дня, остаётся под теми же правилами сопровождения;
- **новости**
  — за сколько минут до важных публикаций и после них вы не входите;
- **риск на сделку**
  — 1R, и как он считается;
- **ограничения дня**
  — например, сколько сделок и какой убыток за день допустимы. Как выбрать такие ограничения, разобрано в главе 15;
- **состояние**
  — при каком состоянии вы не торгуете, если такое правило есть (глава 5).

Правила режима — источник целой группы нарушений. Торговля сетапом не из списка, вход перед новостью, сделка после дневного лимита — всё это нарушения только в том случае, если соответствующее правило записано. Пока его нет, такая сделка в журнале выглядит как обычная.

4.5. Решения на усмотрение

Не всё в торговле сводится к жёстким правилам, и это нормально. Важно, чтобы усмотрение тоже было записано:

- **где именно**
  правила оставляют выбор: «цель — 2R или ближайший максимум дня, на усмотрение»;
- **в каких границах:**
  «но не меньше 1,5R»;
- **что выбрано в сделке**
  — одним словом в записи.

Выбор внутри записанных границ — не нарушение. Выбор за их пределами — нарушение. Если же правило вообще не задаёт границ, это не ошибка трейдера, а недостаток самой системы: правило надо дописать. Это различие подробно разобрано в главе 6.

Записанное усмотрение даёт ещё одну возможность. Через месяц можно сравнить результаты сделок, в которых выбирали ближнюю цель, с результатами сделок, в которых выбирали дальнюю.

4.6. Торговый план на одной странице

Ориентир — все правила помещаются на одну страницу. Если не помещаются, их, возможно, слишком много для повседневного соблюдения.

Версия и дата: «План v3, с 1 марта».

Риск: 1R = 1% счёта; пересчёт в начале месяца.

Инструменты, время торговли и граница дня.

Сетапы — каждый в пяти частях (раздел 4.2).

Правило о новостях.

Ограничения дня, если есть.

Правило о состоянии, если есть.

Решения на усмотрение и их границы.

Номер версии нужен для разбора. Если план меняется, записи должны показывать, по какой версии принято решение. Иначе результаты месяца, в середине которого изменились правила, трудно сопоставить с результатами предыдущего и следующего месяцев. Как вносить изменения в план, разобрано в главе 14. Здесь достаточно одного правила: план не меняют в середине торгового дня и под впечатлением от одной сделки.

Коротко.

• Журнал может найти столько нарушений, сколько позволяют правила.

• Правило проверяемо, если на каждое условие есть ответ «да» или «нет» в конкретный момент.

• Сетап описывается в пяти частях: условие, сигнал и вход, стоп, выход, отмена.

• Правила режима — список сетапов, время, новости, риск, ограничения — тоже должны быть записаны.

• Усмотрение допустимо, если записаны его границы.

Задания к главе 4

Задание 4.1 (разбор). Какие правила проверяемы? Для непроверяемых объясните, чего не хватает.

а) «Вход, когда рынок перепродан».

б) «Стоп — за ближайшим уровнем».

в) «Стоп — на 0,1% ниже минимума сигнальной свечи».

г) «Выход, если сделка не идёт».

д) «Если через 6 часов после входа не достигнуты ни цель, ни стоп — закрыть по рынку».

е) «Не торгую в плохом настроении».

Задание 4.2 (переформулировка). Перепишите правила в проверяемом виде. Числа выберите сами — важна форма.

а) «Покупаю, когда цена отбивается от поддержки».

б) «Фиксирую прибыль, когда вижу слабость».

в) «Не торгую перед важными новостями».

Задание 4.3 (разбор). Было ли нарушение? Если нет, что это?

а) Правило: «вход после закрытия часовой свечи выше максимума диапазона». Трейдер купил, когда цена была выше максимума, за 20 минут до закрытия свечи. Свеча закрылась выше максимума.

б) Правило: «цель — ближайший уровень сопротивления». Трейдер поставил цель на уровне, который счёл ближайшим. На разборе выяснилось, что был уровень ближе, и цена от него развернулась.

в) Правило: «цель 2R или максимум дня, на усмотрение, но не меньше 1,5R». Трейдер выбрал максимум дня, который был на расстоянии 1,2R.

Задание 4.4 (личное). Запишите свой торговый план на одной странице по схеме раздела 4.6. Каждый сетап — в пяти частях.

Проверка себя: отложите план на день и перечитайте, как чужой. Для каждого условия спросите: «Можно ли ответить „да“ или „нет“ по закрытой свече?» Каждое условие, на которое ответить нельзя, — место, где журнал не сможет найти нарушение.

Глава 5. Контекст и состояние как данные

Нарушения не обязательно распределены равномерно: одни могут повторяться в часы высокой волатильности, другие — после бессонной ночи, третьи — во второй половине дня. Чтобы найти такие связи на разборе, условия нужно записывать до исхода. Задним числом их не восстановить: ни состояние рынка, ни собственное самочувствие по памяти точно не вспомнить.

Эта глава о двух группах полей: контексте рынка и состоянии трейдера. Обе записываются как данные — коротко, по шкалам. Это не дневник переживаний.

5.1. Контекст рынка

Контекст — одна строка в плане сделки. Обычно хватает трёх-четырёх полей, и каждое определяется вашим собственным правилом.

- **Волатильность.**

Три уровня — низкая, обычная, высокая — по простому правилу. Например, высота вчерашней дневной свечи относительно средней высоты за 14 дней: меньше 0,7 — низкая, от 0,7 до 1,3 — обычная, больше 1,3 — высокая.

- **Новости.**

Есть ли важные публикации в ближайшие два часа: «да, 16:30» или «нет».

- **Время.**

Окно торговли по вашему часовому поясу: утро, день, вечер — или торговая сессия, если вы делите сутки по сессиям.

- **Режим рынка**

— тренд или диапазон. Это поле нужно, только если ваши правила дают этим словам точное определение (глава 4).

Записывать стоит только те поля, по которым вы собираетесь делать разрезы на разборе. Остальные отнимают время и разбору не помогают: условие, которое ни с чем не сравнивают, не объясняет нарушения.

5.2. Состояние трейдера

Для состояния тоже хватает трёх полей:

- **Сон**
  — сколько часов вы спали прошлой ночью, числом.
- **Усталость**
  — по шкале от 1 до 5 (раздел 5.3).
- **Причина входа**
  — «сигнал плана» или одно слово другой причины: «скука», «догнать», «отыграть». Это мотив решения, а не самочувствие, но записывают его здесь же: «скука» и «отыграть» тоже говорят о состоянии. Поле заполняется честно именно потому, что заполняется до исхода.

Иногда добавляют четвёртое поле — **отвлечения**: «да», если в момент решения вы одновременно делали что-то ещё, или балл по шкале (задание 5.1). Оно полезно тем, кто торгует параллельно с другой работой.

5.3. Шкала, которая не плывёт

Число на шкале имеет смысл, только если «4» в марте означает то же, что «4» в январе. Поэтому у каждой ступени шкалы должно быть словесное описание. Пример для усталости:

Балл
Описание

1
свеж, полностью сосредоточен

2
внимание держится, лёгкая усталость, ошибок нет

3
заметная усталость, иногда отвлекаюсь

4
сильная усталость, трудно удерживать внимание

5
клюю носом, перечитываю одно и то же, ошибаюсь в цифрах

Правила устойчивой шкалы:

- **ступени описаны наблюдаемыми признаками,**
а не словами «плохо» и «хорошо»;
- **оценка ставится до входа,**
вместе с планом;
- **смысл ступеней не меняется.**

Если описание шкалы пришлось изменить, начинается новый период, и старые оценки с новыми не сравниваются.

5.4. Три ловушки

Оценка после исхода. После убытка кажется, что вы «были уставшим», после прибыли — что «были в форме». Если поле состояния заполняется после выхода, через месяц в журнале окажется ровно эта связь: высокая усталость рядом с убытками. Эту связь создаст не усталость, а оценка задним числом, и настоящее влияние усталости в таких данных уже не отличить. Признак такой ловушки — время записи состояния позже времени выхода.

Исповедь вместо данных. Длинное описание эмоций нельзя посчитать. Если информации больше, чем позволяет передать шкала, добавьте одну строку в вывод после выхода. Поля состояния при этом остаются числами.

Состояние как оправдание. «Перенёс стоп, но очень устал, так что это не считается». Считается. Состояние объясняет нарушение, но не отменяет его. Нарушение получает код как обычно, а состояние записывается рядом. Если через месяц окажется, что нарушения собираются в дни высокой усталости, это будет основанием для правила о состоянии. Если убрать код, эта связь останется незамеченной.

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.