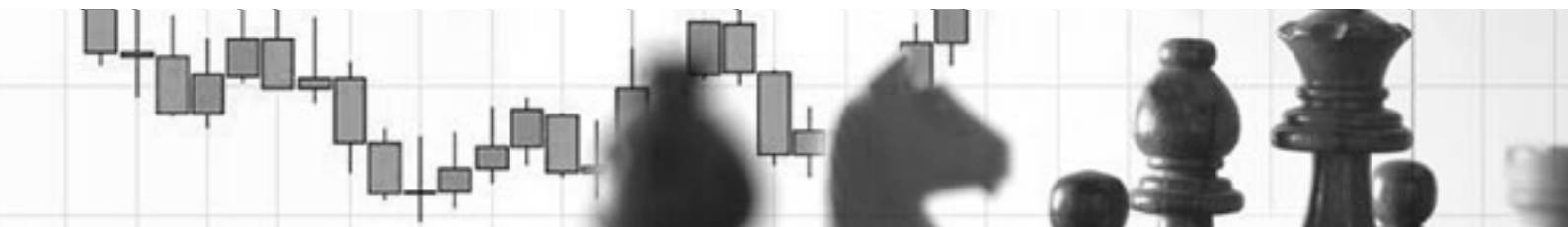


# Торговые Стратегии



# Форекс





Общее представление о различных торговых стратегиях Forex и использование их в наиболее подходящие моменты позволяет максимально повысить шансы получить прибыль. К сожалению, для результативной торговли недостаточно знать одну единственную стратегию. Каждый трейдер должен уметь реагировать на разнообразные сигналы рынка, что это непросто, так как требует тщательного изучения и глубокого понимания экономических процессов.

Для обучения эффективной торговле компания **IFC Markets** предоставляет Вам качественные учебные материалы и дает возможность детально ознакомиться с самыми популярными торговыми стратегиями, которые используют успешные трейдеры.

Системы торговли, о которых пойдет речь, подойдут как для начинающих, так и для тех, кто хочет совершенствовать свои навыки. Все стратегии описаны и разделены по классам для удобства восприятия материала. Каждый трейдер может самостоятельно выбрать наилучший метод применения стратегий.



## Торговые Стратегии по Анализу Форекс

5

### Торговые Стратегии на Основе Технического Анализа

6

Стратегия Торговли по Тренду

7

Торговля от Уровней Поддержки и Сопротивления

8

Стратегия Торговли во Флете

9

Стратегии Форекс на Индикаторах

10

Торговая Стратегия на Основе Графического Анализа

11

Стратегия Торговли по Объемам

12

Стратегия по Мультитаймфреймовому Анализу

13

### Стратегия на Основе Фундаментального Анализа

14

### Торговая Стратегия на Основе Настроения Рынка

15

## Форекс Стратегии на Основе Торгового Стиля

16

### Внутридневные Стратегии (Дейтрейдинг)

17

Скальпинг Стратегия

18

Торговая Стратегия Фейдинг (Fading)

19

Стратегия Дневной Пивот (Daily Pivot)

20

Торговая Стратегия Моментум (Momentum)

21

### Стратегия Керри Трейд (Carry Trade)

22

### Стратегия Хеджирования | Валютное Хеджирование

23

### Стратегия Портфельной Торговли

24

### Стратегия Купить и Держать (Buy and Hold)

25

### Стратегия Спредовой/Парной Торговли

26

### Стратегия Свинг Трейдинга

27

## Стратегии на Основе Торговых Ордеров

28

## Автоматические Торговые Стратегии

29





# Торговые Стратегии по Аналізу Форекс

Большинство торговых стратегий базируется на общепринятых принципах анализа рынка Forex. С их помощью можно найти закономерности в динамике цен активов. Эти принципы включают в себя технический и фундаментальный анализ, а также оценку настроения рынка.

Каждый из упомянутых методов позволяет определить текущий тренд и сделать рациональный прогноз, как поведет себя рынок в будущем. Если технический анализ имеет дело в основном с графиками и математической статистикой, то фундаментальный анализ обращает внимание на макроэкономические и политические факторы, которые могут оказать существенное влияние на международные курсы обмена валют. Совершенно другой подход использует стратегия оценки настроений, которая основывается на мнении трейдеров о текущем положении дел на рынке. Ниже Вы найдете детальную информацию о каждом из популярных методов анализа.

## Торговые Стратегии на Основе Технического Анализа

Технический анализ Forex — это попытка изучения рынка с помощью графиков истории цен с целью спрогнозировать будущий тренд. Трейдеры могут разработать свою собственную торговую систему, используя разнообразные инструменты технического анализа и принимая во внимание направление тренда, наличие бокового движения, уровни поддержки и сопротивления, графические фигуры и сигналы индикаторов. При желании можно прибегнуть к методу параллельного анализа различных таймфреймов.

Метод теханализа — это мощный инструмент для оценки активов посредством изучения истории цен с учетом статистических данных. Первоочередная задача приверженцев этого метода — с помощью графиков и инструментов технического анализа обнаружить систему закономерностей, которая прогнозирует направление рынка. Технические аналитики твердо уверены в том, что история цен способна подсказать курс их движения в будущем.



## Стратегия Торговли по Тренду

Тренд является основополагающим понятием теории технического анализа. Все инструменты теханализа служат одной единственной цели — понять, в каком тренде сейчас находится рынок. Определение тренда на Forex почти ничем не отличается от общепринятого определения термина «тренд» — это направление, в котором движется рынок. Ни для кого не секрет, что рынок обмена валют не может следовать по прямой. Его траектория — это серия напоминающих волны колебаний с вершиной и дном, или, как чаще говорят трейдеры, с максимумами и минимумами.



Как мы уже упоминали выше, форекс тенденция состоит из ряда максимумов и минимумов, и в зависимости от движения этих пиков и впадинов можно понять тип тренда на рынке.



Большинство людей уверены, что рынок может идти только в двух направлениях: либо вверх, либо вниз, однако существует не два, а три типа тренда:

- Восходящий
- Нисходящий
- Боковой



Трейдеры могут принять три решения: открыть длинную позицию, то есть, встать в покупку; открыть короткую позицию, то есть, встать в продажу; наконец, не входить в рынок и не

*Покупать лучше всего в тот момент, когда рынок движется вверх, а продавать — когда движется вниз. В случае бокового тренда остаться в стороне может быть разумным решением.*

## Торговля от Уровней Поддержки и Сопротивления

Уровни поддержки и сопротивления занимают ключевое место в техническом анализе. По своей сути, это горизонтальные линии, которые показывают, где рынок препятствует выходу цены из тренда. Линия поддержки строится по минимальным значениям цены актива, а линия сопротивления — по максимальным. На уровне поддержки влияние участников рынка, стоящих в покупку, является особенно сильным. Оно будет противостоять давлению инвесторов, продающих активы. В случае с линией сопротивления ситуация обратная - продавцы активов (медведи) пересиливают покупателей (быков). На графике истории цен линии поддержки и сопротивления можно сформировать, прочертив прямую либо по пикам ценовых значений, либо по точкам наибольшего падения.



*Для того чтобы разработать стратегию, основанную на линиях поддержки и сопротивления, необходимо понимать, как эти линии характеризуют тренд. Например, у восходящего тренда каждый новый уровень поддержки выше предыдущего и каждый новый уровень сопротивления — также выше предыдущего.*

Если же новый уровень поддержки оказывается ниже предыдущего минимума, это может свидетельствовать о том, что восходящий тренд подошел к концу или о том, что он постепенно переходит в боковик. Есть вероятность, что тренд сменит направление на обратное. С нисходящим трендом происходит обратная ситуация, если новый уровень поддержки сформировался не ниже, а выше предыдущего, это может служить сигналом к изменению курса движения.

*Суть торговли по линиям поддержки и сопротивления остается такой же — покупать, когда мы предполагаем, что актив вырастет в цене, и продавать, когда ожидается, что он подешевеет. Это значит, что, когда котировки достигают уровня поддержки, трейдеры приобретают актив, создавая спрос и подстегивая цены. Если же котировки приближаются к уровню сопротивления, трейдеры распродают активы, двигая цены вниз.*



## Стратегия Торговли во Флете

Торговля в боковом тренде или, другими словами, торговля внутри канала обычно ассоциируется с ситуацией, когда у рынка нет четкого направления, а ярко выраженный тренд отсутствует. Торговля в боковике предполагает, что цена движется в пределах определенных границ, и основная задача — обнаружить эти границы. Это можно осуществить, соединив линиями максимальные и минимальные ценовые значения боковика. Иначе говоря, нужно построить уровни поддержки и сопротивления: пространство между ними будет называться «торговым диапазоном».



*Внутри этого диапазона очень легко найти точки, подходящие для открытия коротких и длинных позиций. Можно покупать у линии поддержки и продавать у линии сопротивления, пока котировки актива не вышли за эти пределы. Если это произошло, Вы рискуете получить большой убыток.*

Торговля в канале эффективна именно при таком уровне волатильности, при котором цена колеблется внутри канала, но не выходит за его границы. Если котировка пробила один из уровней, позицию рекомендуется закрыть. Для того чтобы оградить себя от подобных рисков, трейдеры часто выставляют ограничение убытков и используют лимитные ордера. Если они полагают, что цена сменит направление с восходящего на нисходящее, то устанавливают ордер типа sell limit рядом с уровнем сопротивления и ставят take profit около уровня поддержки. Если же ожидается коррекция вверх, они устанавливают ордер buy limit близ уровня поддержки, а take profit - под линией сопротивления. На случай пробоя выставляется ограничение убытков (stop loss) за пределами сопротивления и поддержки.

## Стратегии Форекс на Индикаторах

Технический индикатор - это функция, построенная на статистических значениях цены и объема актива. Он используется для того, чтобы подтвердить тренд и оценить весомость сформировавшихся фигур технического анализа. С его помощью трейдеры определяют наиболее подходящие моменты для открытия позиции на покупку или продажу. Индикаторы можно использовать по отдельности, вместе, а также в сочетании с графическими объектами.

*Индикаторы формируют сигналы на продажу и покупку, демонстрируя, например, для скользящих средних пересечение или дивергенцию. В случае пересечения цена проходит скользящую среднюю насквозь или перекрещиваются две скользящих средних. Дивергенция — это поведение графика, при котором индикатор и цена движутся в противоположных направлениях, что означает, что текущий тренд ослабевает.*

Существует огромное количество индикаторов, и каждый наилучшим образом подходит в определенной ситуации. Однако большинство аналитиков в повседневной работе использует только самые популярные из них:

- ▶ Скользящая средняя
- ▶ Полосы Боллинджера
- ▶ Индекс относительной силы (RSI)
- ▶ Осциллятор Стохастик (Stochastic)
- ▶ Схождение/расхождение скользящих средних (MACD)
- ▶ ADX
- ▶ Моментум (Momentum)

Вы с легкостью можете освоить эти индикаторы и разработать собственную [стратегию торговли на индикаторах](#).

## Торговая Стратегия на Основе Графического Анализа

В техническом анализе рынка Forex график — это визуальное представление движения цены за определенный промежуток времени. Он показывает, как изменялась стоимость актива на протяжении минуты или дня, месяца или года. В зависимости от того, какие данные интересуют трейдера на графике, он может быть линейным или иметь вид свечей, баров, а также крестиков-ноликов.

Можно также попытаться наложить на график актива известные фигуры технического анализа:

- ▶ Треугольник
- ▶ Флаг
- ▶ Вымпел
- ▶ Клин
- ▶ Прямоугольник
- ▶ Голова и плечи
- ▶ Двойное дно и двойная вершина
- ▶ Тройное дно и тройная вершина

Вы с легкостью можете научиться применять эти фигуры и создать собственную [стратегию торговли на фигурах](#).

## Стратегия Торговли по Объемам

Объем показывает, какое количество активов покупается или продается за определенный промежуток времени. Чем больше объем торгов, тем интенсивнее совершаются сделки и тем сильнее напряженность рынка. При проведении технического анализа графика цены трейдеры никогда не оставляют этот показатель неучтенным. Чтобы определить, растет ли или уменьшается объем транзакций, инвестор обращается к индикаторам объема, (гистограмма этих индикаторов обычно располагается под графиком инструмента). Любое сильное движение цены будет сопровождаться соответствующим изменением объема.

*Для оценки напряженности рынка трейдеры одновременно учитывают направление тренда и объемы сделок. Если котировки актива растут, очевидно, что влияние покупателей больше, чем влияние продавцов. Если во время восходящего тренда объем сделок начинает уменьшаться, это может означать, что движение подходит к концу.*

Как однажды сказал форекс-аналитик Хузефа Хамид, «объем — это топливо в баке финансового механизма». В то время как большинство трейдеров обращает внимание исключительно на технические индикаторы, объем заставляет рынок двигаться. Однако стоит учитывать, что только существенное изменение объема транзакций способно дать сильный толчок котировкам инструмента.



## Стратегия по Мультитаймфреймовому Анализу

*Под параллельным анализом таймфреймов понимается мониторинг цены актива на графиках, соответствующих разным временным интервалам.*

Так как цена ведет себя по-разному в рамках различных таймфреймов, переключение между ними помогает выявить так называемый «торговый цикл» актива. Параллельный анализ таймфреймов позволяет определить направление движения цены как в маленьком, так и в большом временных масштабах и обнаружить основной тренд рынка. Смысл стратегии заключается в том, чтобы последовательно проанализировать график, начиная с самых коротких интервалов (минуты, часы), заканчивая самыми длинными (день, неделя и т. д.).

Профессиональный трейдер Кори Розенблум считает, что такой подход к анализу должен помочь определить момент, в котором тренды на различных таймфреймах совпадают. Это дает наиболее полное представление о движении цены и повышает вероятность открытия прибыльной позиции. Однако так происходит не всегда. Иногда тренды на различных временных интервалах ведут себя по-разному. Согласно господину Розенблуму, короткие таймфреймы в таких случаях более информативны.



## Стратегия на Основе Фундаментального Анализа

В то время как технический анализ изучает поведение рынка на исторических данных, фундаментальный анализ ориентируется на фундаментальные факторы, оказывающие влияние на движение цены.

Приверженцы фундаментального подхода утверждают, что такие макроэкономические показатели, как темпы роста экономики, учетная ставка центробанка, уровень безработицы, а также политическая обстановка воздействуют на финансовые рынки и, следовательно, могут

*Последователи технического анализа не интересуются причиной изменения тренда, а фундаментальные аналитики задаются вопросом, почему это произошло. Они изучают макроэкономические данные по одной стране или нескольким, чтобы предсказать поведение местной валюты в ближайшем будущем. Основываясь на оценке определенного события они покупают валюту в расчете, что она подорожает или, наоборот, продают ее, чтобы потом купить по более выгодной цене.*

Как правило, фундаментальные аналитики работают на более длинных временных интервалах, так как информация, на основе которой они принимают решения, накапливается значительно медленнее, чем данные, используемые техническими аналитиками.

## Торговая Стратегия на Основе Настроения Рынка

Настроение рынка определяется отношением людей к ситуации на финансовых площадках или к поведению определенного актива. Оно зависит от того, что люди думают и какой линии поведения придерживаются, совершая сделки.

Очень часто специалисты недооценивают, насколько важным бывает мнение группы людей по отношению к тому или иному вопросу. Анализ настроения рынка стремится проникнуть в суть причин и взаимосвязей и позволяет принять правильное решение об открытии позиции.

У каждого трейдера свое собственное мнение о движении цены, которое напрямую отражается на транзакциях и определяет общее настроение рынка.

Рынок представляет собой очень сложную систему, а позиции каждого из его участников в сумме задают направление тренда. Однако обычный трейдер не способен заставить рынок двигаться в выбранном им направлении. Только крупнейшие игроки, такие как международные корпорации или центробанки стран могут в одиночку создать движение, так как объемы их сделок исчисляются миллиардами долларов.

*Настроение рынка можно считать бычьим, если инвесторы ожидают начало восходящего движения цены. Если ожидается спад, говорят, что настроение рынка медвежье. Стратегия, анализирующая настроение рынка, особенно популярна среди трейдеров, стремящихся торговать против тренда. В случае если превалируют бычьи тенденции, такие инвесторы будут стоять в продажу.*



# Форекс Стратегии на Основе Торгового Стиля

Стратегия Форекс может базироваться на популярных стилях торговли, среди которых можно назвать внутридневную торговлю, carrytrade (заработок на разнице процентных ставок), хеджирование, buyandhold (купить и держать), портфельное инвестирование, торговля парами или спред-трейдинг, свинг-трейдинг, торговля по типу ордеров, а также алгоритмическая торговля.

Для того чтобы разработать эффективную торговую стратегию, нужно прежде всего определить собственные сильные стороны и слабости и подобрать именно такой стиль, который наилучшим образом соответствует Вашим индивидуальным особенностям. Не существует универсального способа торговать, стиль работы другого трейдера может совершенно Вам не подходить. Ниже приведены наиболее популярные техники торговли; Вы можете выбрать из них наиболее подходящий лично Вам.





## Внутридневные Стратегии (Дейтрейдинг)

*Внутридневная торговля подразумевает открытие и закрытие трейдером позиции в рамках одной торговой сессии. На следующий день сделка не переносится.*

Внутридневная стратегия включает в себя скальпинг, фейдинг (торговлю против рынка), торговлю на импульсе, а также торговлю на уровнях Pivot (dailypivot). Ограничений по количеству сделок не существует, однако каждая позиция должна быть закрыта до окончания торговой сессии.

При использовании внутридневной стратегии необходимо помнить, что чем дольше позиция будет держаться в рынке, тем больше будет вероятность получить убыток. В зависимости от стиля торговли уровень цен, до достижения которого трейдер будет держать позицию, может быть разным. Ниже представлена более подробная информация о перечисленных техниках торговли.



## Скальпинг Стратегия

Скальпинг на Форекс – это внутридневная торговая стратегия, цель которой - извлечь прибыль из краткосрочного изменения цены. Скальперы могут в течение дня открыть до нескольких сотен сделок, руководствуясь соображениями, что краткосрочное движение предсказать намного проще, чем долгосрочное.

*Смысл стратегии заключается в том, чтобы купить или продать большой объем активов и очень быстро совершить обратную сделку по более выгодной цене.*



Существует несколько важных факторов, на которые стоит обратить внимание при применении стратегии скальпирования на рынке Форекс: это ликвидность, волатильность, временной интервал и управление рисками. Многие скальперы предпочитают торговать на высоколиквидном рынке, что позволяет им быстро открывать и закрывать позиции значительного объема. Другие выбирают более спокойный рынок с более широкими спредами между ценами Бид и Аск.

Что касается волатильности, скальперы считают самыми удобными стабильные активы - с ними снижается риск неожиданного изменения цены. Если она меняется равномерно, то скальперы могут открывать тысячи сделок по одним и тем же Бидам и Аскам. Для торговли используется небольшой таймфрейм, и иногда трейдеры получают прибыль на движении актива, которое подчас тяжело заметить даже на минутном графике.

Из-за значительного количества открываемых позиций сотня прибыльных ордеров будут соседствовать с сотней убыточных, поэтому управление рисками является неотъемлемой частью грамотного скальпинга.

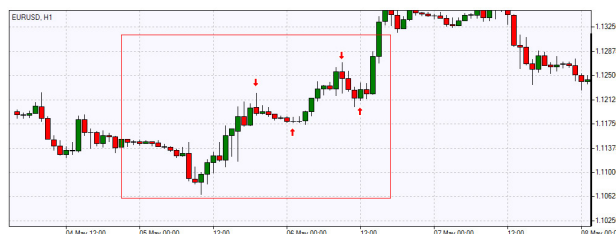
## Торговая Стратегия Фейдинг (Fading)

Стратегия фейдинг означает торговлю против тренда. Если наблюдается восходящее движение, приверженцы этого стиля будут продавать, если существует медвежий импульс, они будут открывать позиции на покупку.

Внутридневная торговая стратегия фейдинг идет против рынка и превалирующего на нем тренда, в то время как при использовании других стратегий трейдеры стремятся попасть в движение.

Фейдинг может применяться в трех случаях:

- ▶ Securities are overbought
- ▶ Early buyers are ready to take profits
- ▶ Current buyers may appear at risk



Торговля против тренда может быть очень рискованной, а трейдер, применяющий ее, должен быть готов к крупным потерям. Но в то же время, такая техника может принести неожиданно большую прибыль. Основной принцип торговли против тренда — выставить два лимитных ордера: buy limit - ниже текущей цены, и sell limit – выше нее.

Несмотря на риски, сопровождающие торговлю против основного рыночного тренда, трейдер может получить хорошую прибыль в случае разворота цены, так как предполагается, что сильное восходящее или нисходящее движение зарегистрирует несколько таких разворотов.

## Стратегия Дневной Пивот (Daily Pivot)

Стратегия торговли на уровнях Pivot стремится извлечь прибыль из внутридневного изменения волатильности. Уровень Pivot может быть определен как точка разворота. Он является своего рода техническим индикатором, который рассчитывается как среднее трех цен: максимальной, минимальной и цены закрытия валютной пары.

*Смысл этой стратегии заключается в том, чтобы купить по самой низкой цене внутри дня и продать по самой высокой.*

В середине девяностых профессиональный трейдер и аналитик Томас Эспрей опубликовал для своих институциональных клиентов уровни Pivot, появляющиеся на рынке обмена валют Forex. По его словам, программы технического анализа того времени не поддерживали функцию определения уровней Pivot, а формула их расчета была не очень распространена.

Тем не менее, в своей книге «Полное руководство по системам технического анализа: как получать прибыль, анализируя свечи и используя уровни Pivot и другие индикаторы» известный трейдер Джон Персон утверждает, что к тому времени эта схема использовалась уже на протяжении 20-ти лет. А несколько лет назад, опять же благодаря Джону Персону, сообщество трейдеров познакомилось со стратегией квартальных уровней Pivot.

Сейчас формулой уровней Pivot пользуются многие трейдеры, к тому же автоматический калькулятор для их расчета можно с легкостью найти в сети.

$$P = (H + L + C) / 3$$

**Уровень Pivot = (Предыдущий High + Предыдущий Low + предыдущий Close) / 3**

Дневные уровни Pivot помогают определить линии поддержки и сопротивления, а также точки входа в рынок и выхода из него. Они рассчитываются по следующим формулам:

$$\begin{aligned} R1 &= (P \times 2) - L \\ S1 &= (P \times 2) - H \\ R2 &= P + (H - L) = P + (R1 - S1) \\ S2 &= P - (H - L) = P - (R1 - S1) \end{aligned}$$

где:

P - Уровень Pivot

L - Предыдущий Low

H - Предыдущий High

R1 - Уровень сопротивления 1

S1 - Уровень поддержки 1

R2 - Уровень сопротивления 2

S2 - Уровень поддержки 2

## Торговая Стратегия Моментум (Momentum)

Стратегия торговли по импульсу основывается на поиске актива, который показывает сильное движение и который, скорее всего, вырастет. Стратегия рассчитывает на продолжение тренда, а не на разворот.

Трейдер, который придерживается такой тактики, будет покупать в случае восходящего движения и продавать в случае нисходящего. В отличие от трейдеров, работающих на дневных уровнях *Pivot*, которые покупают актив по низкой цене и продают по высокой, инвесторы, применяющие стратегию торговли по импульсу покупают дорого, чтобы продать еще дороже.

Приверженцы системы торговли по импульсу используют такие технические индикаторы, как MACD, RSI и осциллятор Momentum, чтобы определить в какую сторону движется цена и когда следует открыть позицию. Они также обращают внимание на новости и учитывают объемы транзакций.

По словам широко известного финансового аналитика Ларри Лайта, торговля по импульсу дает возможность обыгрывать рынок и избегать потерь до тех пор, пока инвесторы следуют тренду и сосредотачиваются только на тех акциях, которые показывают рост.



## Стратегия Керри Трейд (Carry Trade)

*Стратегия Carry trade подразумевает взятие в долг валюты страны с низкой процентной ставкой и ее обмен на валюту страны с высокой процентной ставкой. Полученные средства инвестируются в высокодоходные облигации этой страны. Инвесторы, использующие эту стратегию, занимают деньги под низкий процент, чтобы инвестировать их в активы, приносящие хорошую прибыль.*

Стратегия Carrytrade подходит для стабильного низковолатильного рынка, так как инвесторов прежде всего интересует разница процентных ставок. Все очень просто: чем больше эта разница, тем выше прибыль. Чтобы решить, в какую валютную пару инвестировать, необходимо сначала узнать, как могут меняться процентные ставки в ближайшем будущем.

*Далее нужно просто купить валюту страны, центробанк которой, вероятно, повысит учетную ставку, и продать валюту страны, в которой процентная ставка понизится.*

Тем не менее, это не значит, что можно полностью сбрасывать со счетов изменение обменного курса валют. Вы можете купить валюту в расчете на повышение учетной ставки, но если она подешевеет, убыток по сделке может превысить прибыль, полученную на разнице ставок. Таким образом, представленная стратегия работает только для тех валют, которые торгуются в боковике, и значительного восходящего или нисходящего движения в ближайшее время не предвидится.



## Стратегия Хеджирования | Валютное Хеджирование

Хеджирование — это стратегия защиты инвестиций от возможных потерь, причиной которых являются определенные события, происходящие на рынке.

Стратегия хеджирования подразумевает покупку одной валюты и продажу другой в расчете на то, что прибыль, полученная от одной сделки, компенсирует потери по другой сделке. Особенно эффективно такая стратегия работает, если между двумя валютами наблюдается отрицательная корреляция.

*Предполагается, что после покупки одного актива Вы приобретете второй, который будет его хеджировать. В отличие от большинства упомянутых торговых стратегий хеджирование рассчитано не столько на получение прибыли, сколько на защиту от потенциальных рисков.*

Для примера можно взять несколько валютных пар. Предположим, на определенном таймфрейме у американского доллара крепкие позиции, а валютные пары, в которые входит доллар, показывают разный убыток: GBP/USD подешевел на 0.60%, JPY/USD - на 0.75%, а EUR/USD - на 0.30%. Для открытия сделки представляется разумным выбрать евродоллар. За указанный интервал времени эта пара опустилась меньше остальных, поэтому в случае разворота тренда она подорожает сильнее прочих.

После покупки EUR/USD необходимо выбрать пару, которой можно захеджироваться. Мы сравниваем валюты и выбираем ту, которая показала наибольший спад, в нашем примере это была йена. Чтобы захеджировать нашу сделку на покупку EUR/USD мы открываем позицию на продажу EUR/JPY.

Однако стоит упомянуть еще один важный момент: хеджирование и контроль рисков всегда означают уменьшение прибыли. Поэтому, как уже было сказано, эта стратегия скорее предназначена для защиты от потери средств или сокращения потенциальных убытков.

## Стратегия Портфельной Торговли

Стратегия инвестиционного портфеля или инвестиционной корзины предполагает комбинирование различных активов, принадлежащим к разным сегментам рынка (валюты Forex, акции, фьючерсы и так далее).

В основе портфельного инвестирования лежит диверсификация — одно из наиболее популярных средств сократить риски. Грамотно распределив активы внутри инвестиционной корзины, трейдер защищает себя от непредвиденного изменения волатильности и уменьшает потенциальные убытки.

Перед составлением портфеля необходимо прежде всего определить, какие цели Вы преследуете при вложении средств.

*Одна из рекомендаций — включить в портфель такие активы (валюты, акции, товарные фьючерсы, индексы), которые не имеют сильной положительной корреляции. Это будет означать, что прибыль по этим активам не будет изменяться синхронно. Выбирая активы, которые, как правило, движутся в противоположных направлениях, Вы сможете сбалансировать портфель и значительно уменьшить риски.*

Компания IFCMarkets предоставляет технологию создания и торговли Персональных композитных инструментов PCI, созданных по методу GeWorko, которая значительно упрощает портфельное инвестирование и дает возможность получить максимальную прибыль. Используя эту технологию, Вы сможете составить портфель как из одного актива, так и из нескольких десятков инструментов, включить в него как длинные, так и короткие позиции, а также оценить доходность на основе исторических данных (причем период анализа может достигать 40-ка лет). Технология позволяет создать свой собственный Персональный композитный инструмент (PCI), применить полный набор инструментов технического анализа, опробовать разнообразные торговые стратегии и сбалансировать инвестиционный портфель. Другими словами, метод GeWorko — это решение, с помощью которого Вы можете использовать стратегию, которая лучше всего соответствует Вашим предпочтениям.



## Стратегия Купить и Держать (Buy and Hold)

*Стратегия Buy and Hold предусматривает, что трейдер приобретает актив и держит его на протяжении долгого времени.*

Инвестор, который применяет стратегию buyandhold, не принимает во внимание краткосрочное изменение цены и не использует технические индикаторы на небольших временных интервалах. Как правило, эта система популярна среди биржевых трейдеров. Однако ее используют и участники рынка валют, но скорее в качестве средства пассивного инвестирования, полагаясь прежде всего на фундаментальный анализ.



Пассивный инвестор будет принимать во внимание такие фундаментальные факторы, как уровень инфляции и безработицы в стране, валюту которой он приобрел. Если он купил акции той или иной компании, его будут интересовать стратегия развития предприятия, качество выпускаемой продукции и другие показатели.

Активный инвестор будет в первую очередь руководствоваться техническим анализом, чтобы, исходя из математической статистики, открыть позицию на продажу или покупку.

## Стратегия Спредовой/Парной Торговли

*Торговля парами или спред-трейдинг — это одновременная покупка или продажа двух связанных друг с другом активов. От разницы изменения цены на эти инструменты и будет зависеть, какую прибыль или какой убыток получит трейдер.*

Среди видов спред-трейдинга нужно выделить внутрирыночный спред и межтоварный спред. В первом случае инвестор открывает длинную и короткую позиции по инструментам, основанным на одном и том же активе, но торгуемых в разных формах (например, спот и фьючерс) и на разных биржевых площадках. Во втором случае совершаются сделка по продаже и покупке связанных друг с другом активов: например, золото и серебро.

При торговле парами важно не столько предсказать направление рынка, сколько определить закономерности, с которыми активы соотносятся друг с другом. Важно обнаружить такую пару активов, между ценами которых был заметный разрыв, чтобы было легче контролировать соотношение прибыли и убытка.



## Стратегия Свинг Трейдинга

Стратегия свинг-трейдинг — это открытие позиции на срок от одного до нескольких дней в расчете получить прибыль на циклических колебаниях цены, которые часто обозначаются словом swing.

Позиция, характерная для свинг-трейдинга, имеет больший срок жизни, чем позиция, открытая в рамках внутрисуточной торговли но меньший, чем сделка, совершенная по «купить и держать», (последняя может оставаться в рынке даже на протяжении нескольких лет).

Инвесторы, прибегающие к стратегии свинг-трейдинга, применяют математический анализ, для того чтобы исключить влияние эмоций на принятые решения. Для определения точек входа в рынок и выхода из него они могут также комбинировать методы фундаментального и технического анализа. Рыночный тренд играет для этой стратегии решающую роль.



Приверженцы техники свинг-трейдинга придерживаются установки, которая гласит: «Тренд — Ваш друг». Если тренд восходящий, они покупают или, другими словами, открывают длинную позицию. Если движение нисходящее, продают или открывают короткую позицию. В том случае если нельзя с точностью определить, какой тренд главенствует на рынке: медвежий или бычий, и актив торгуется в боковике, трейдеры обращают особое внимание на канал цены. Они стараются вставать в покупку в случае приближения цены к уровню поддержки, а в продажу — если котировки подходят к линии сопротивления.

# Стратегии на Основе Торговых Ордеров

Торговля на ордерах помогает открыть или закрыть позицию в наиболее благоприятный момент; для этого используются ордера различных типов: рыночные, отложенные, лимитные, стоп и стоп лосс ордера и так называемые ордера ОСО (один отменяет другой).

Представленные на рынке современные торговые платформы позволяют выставлять целый ряд ордеров, каждый из которых наилучшим образом подходит для определенной торговой стратегии. Чтобы разработать эффективную торговую систему, важно понимать, какой из типов ордеров рекомендуется применять в том или ином случае.

Среди торговых ордеров используемых трейдерами Forex, можно выделить следующие типы:

- ▶ Рыночный ордер - это приказ открыть позицию на покупку или продажу по существующей на данный момент на рынке цене. Интерфейс открытия такого ордера обычно для простоты использования содержит только кнопки «продать» и «купить».
- ▶ Отложенный ордер – это ордер, позволяющий открыть позицию на продажу или покупку по заданной заранее цене. Существует 6 видов таких ордеров: buy limit, sell limit, buy stop, sell stop, buy stop limit и sell stop limit.
- ▶ Лимитный ордер - разновидность отложенного ордера. Он точно так же дает команду на открытие позиции по определенной заранее цене. Buy limit дает указание покупать по указанной цене или цене ниже. Sell limit дает команду продавать по указанной цене или цене выше.
- ▶ Стоп ордер - разновидность отложенного ордера. Срабатывает, когда цена достигает указанного значения (уровня стопа). Buy stop ставится выше рынка, sell stop – ниже рынка.
- ▶ Ордер стоп лосс - ордер, позволяющий ограничить торговые риски. Он устанавливается на уровне, до достижения которого трейдер готов терпеть убытки. Если позиция длинная, то стоп лосс ставится ниже цены ее открытия. Если позиция короткая, стоп лосс ставится выше.
- ▶ Ордер ОСО (один отменяет другой) – комбинация двух отложенных ордеров. В случае если один из них активируется, второй удаляется.

# Автоматические Торговые Стратегии

Автоматическая торговля на Forex – это совершение операций при помощи автоматического советника, который запрограммирован в определенных ситуациях покупать или продавать валютную пару. Руководствуясь системой технического анализа, такой советник реагирует на сигналы рынка, а задача пользователя — научить его распознавать и интерпретировать эти сигналы.

Многие современные платформы, такие как NetTradeX и MetaTrader 4, поддерживают функцию автоматической торговли и позволяют разработать собственного торгового робота.

На платформе NetTradeX эта функция реализована при помощи дополнительного терминала NetTradeX Advisors. В нем можно создавать собственных советников на языке программирования NTL+ (NetTradeX Language). В ручном режиме этот терминал также позволяет осуществлять основные рыночные операции (открытие, закрытие позиций, установка ордеров) и применять инструменты технического анализа.

MetaTrader 4 дает возможность пользоваться функцией автоматической торговли посредством встроенного языка программирования MQL4. Трейдер может создавать торговых роботов (советников), а также свои собственные индикаторы технического анализа. Программирование, компиляция, оптимизация и тестирование советника проходят в среде MT4 Meta-Editor.

Автоматическая торговля на Forex популярна прежде всего благодаря тому, что она помогает исключить эмоциональную составляющую, ведь очень часто психология мешает трейдеру принимать взвешенные решения, что отрицательно сказывается на результатах.



Follow us:

