

TRADING NASTAWIONY NA WYNIK

Lista **top 6** opłacalnych strategii



Spis treści:

Wprowadzenie.....	2
Handel wg. trendu.....	4
Scalping.....	12
Prognozowanie przy pomocy świec japońskich.....	16
Wskaźnik EMA.....	28
Praca w oparciu o wiadomości.....	35
Strategie zarządzania ryzykiem.....	42
Podsumowanie.....	49

Wprowadzenie

Dyscyplina jest niezbędnym składnikiem skutecznego handlu. Statystyki pokazują, że traderzy, którzy przestrzegają zasad, osiągają sukces na giełdzie o wiele szybciej.

Dlaczego? Ponieważ strategia jest jednym ze sposobów przestrzegania ustalonego planu. Dzięki niej trader lepiej koncentruje się na celu i szybciej osiąga pożądany wynik.

Którą strategię wybrać? Nie istnieje jednoznacznej odpowiedzi na to pytanie.

Każdy wybiera to, co mu odpowiada, ze względu na swój temperament,

stosunek do ryzyka czy ilość wolnego czasu. Dobra strategia dla jednego brokera może wcale nie być odpowiednią dla drugiego.

Tylko przetestowanie różnych strategii pomoże zrozumieć, który model zachowania pozwala handlować pewniej i osiągać lepsze wyniki.

W tej książce przedstawimy sześć znanych i sprawdzonych strategii..

Dowiesz się, czym różnią się od siebie i jak zarabiać z ich pomocą na prawdziwym rynku.

Handel wg. trendu



Prostota to podstawowa cecha wszystkich skutecznych metod. Do osiągnięcia regularnych przychodów na rynku Forex, wystarczy przestrzegać klasycznej zasady analizy technicznej – handlować według trendu.

W tym celu trader musi monitorować

wykres i otwierać pozycje w określonych punktach. Oczywiście istnieją techniki, które polegają na handlu wielokierunkowym lub nawet wbrew trendowi. Skupimy się jednak na tych, które zapewniają stabilny dochód i oszczędzają pieniądze.

Co to jest handel według trendu i jak znaleźć punkty wejścia na rynek?

Przyjrzyjmy się bliżej.

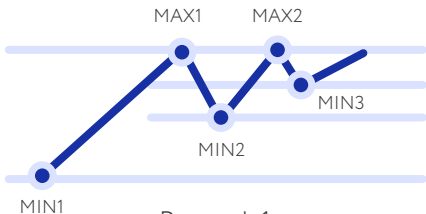
Przed otwarciem transakcji traderzy starają się określić aktualny trend dla wybranej pary walutowej.

Trendem nazywa się stabilny ruch ceny w określonym kierunku.

Istnieją dwa rodzaje trendów: wzrostowy (lub hossa) i spadkowy (lub

bessa). W przypadku hossy cena rośnie, a w przypadku bessy – spada.

Uwaga: prawidłowe określenie trendu wymaga spełnienia kilku warunków. Zobacz rysunek 1.



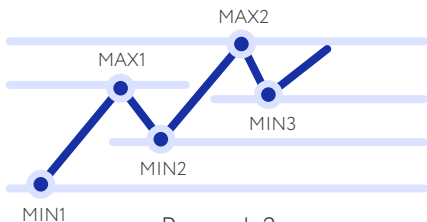
Rysunek 1

Każde kolejne maksimum i minimum ceny musi być wyżej lub niżej od poprzedniego, w zależności od typu trendu.

W takim przypadku będzie można

Twymnaczyć technicznie uzasadniony punkt wejścia na rynek.

Na przykład wykres na rysunku 1 nie jest trendem. Na nim MAX2 nie przekracza MAX1, co oznacza, że otwarcie transakcji kupna w punkcie MIN3 byłoby błędem.

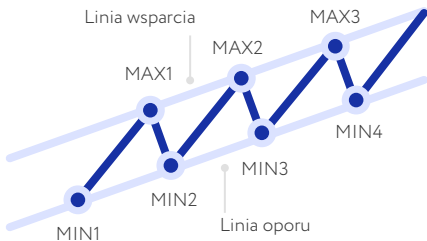


Rysunek 2

Rysunek 2 przedstawia klasyczny wzór trendu wzrostowego, w którym wszystkie kolejne wartości MAX i MIN znajdują się powyżej poprzednich wartości.

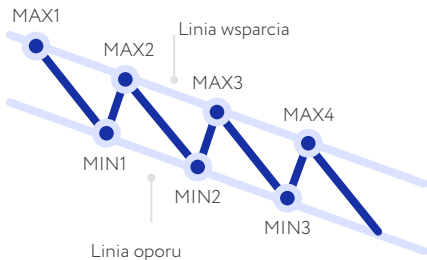
W takim przypadku zaleca się otwarcie pozycji kupna w punkcie MIN3.

Trend wzrostowy



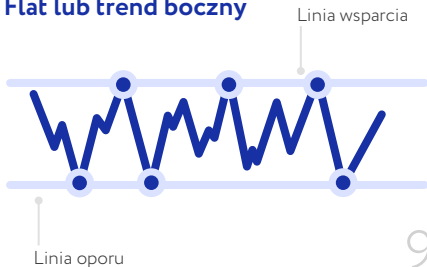
Ten typ ruchu cen charakteryzuje się tym, że każde kolejne maksimum i minimum ceny jest wyższe niż poprzednie, co jest klasyczną definicją trendu wzrostowego.

Trend spadkowy



Ten wykres przedstawia schematyczny przykład trendu spadkowego, kiedy każde kolejne maksimum i minimum ceny jest niższe niż poprzednie.

Flat lub trend boczny



W tym przypadku ciężko wyznaczyć wyraźny trend. Jeżeli masz trudności z określeniem trendu, najprawdopodobniej masz do czynienia z trendem bocznym. Lub, jak go często nazywano, okresem konsolidacji cen. Flat może wskazywać na gotowość rynku do zmiany kierunku. Ale najczęściej jest to krótka przerwa w dotychczasowej tendencji. Po pewnym czasie trend zostaje kontynuowany.

W trendzie wzrostowym dokonuje się tylko zakupów, a w spadkowym tylko sprzedaży.

Handel zgodnie z trendem to jedna z najbardziej dochodowych strategii. Nawet transakcja zostanie otwarta nieco przedwcześnie, trend prędzej czy później wyciągnie Twoją pozycję na plus.

Scalping



Scalping to styl handlu dziennego, który charakteryzuje się dokonaniem wielu transakcji. Przy skalpowaniu czas utrzymywania transakcji jest krótki, a same transakcje są duże.

Celem skalpingu jest zdobycie kilku punktów w kierunkowym ruchu wykresu.

Minimum dla skalpera jest spełnienie wszystkich warunków dokonania transakcji i zdobycie 2-4 pkt.

Zaletą tej strategii jest możliwość handlu preferowanymi aktywami. Skalpowanie polega na bardzo prostych zasadach, co pozwala powierzyć proces handlowy doradcom.

Z reguły do skalpowania nadają się bardzo zmienne aktywa, ponieważ większe ruchy na giełdzie przynoszą większe zyski.

Jednak w okresach skrajnej

aktywności zaleca się zaprzestanie handlu lub całkowite wycofanie się z transakcji. Przykładem takiej sytuacji jest publikacja danych makroekonomicznych.



Okresy niskiej i wysokiej zmienności

Na wykresie okresy o niskiej zmienności zaznaczono na zielono, a te o dużej na czerwono.

W przypadku handlu dziennego rozsądny limit wynosi 20-30 proc. (20-30 pkt) dziennego ruchu. Przy wystarczającej zmienności pozycja może być utrzymywana od dwóch do czterech godzin.

Prognozowanie na podstawie świec japońskich



Wykres świecowy od dawna jest niezbędnym narzędziem traderów do analizy rynku.

Opanowanie tej metody jest konieczne zarówno dla początkujących, jak i profesjonalistów.

Japońskie świece to najwygodniejszy i najłatwiejszy sposób prezentowania informacji o transakcjach rynkowych.

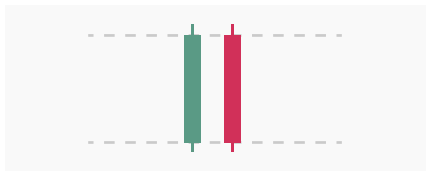
Ten rodzaj analizy wizualnej pozwala zrozumieć psychologię aktualnego stanu rynku. Podobnie jak sto lat temu uczestnicy kierują się emocjami – strachem i chciwością. Te emocje są dobrze widoczne na wykresach świecowych.

Jedna świeca przedstawia od razu cztery wartości ceny – cenę otwarcia, zamknięcia, maksimum i minimum. Wartości te są aktualne dla okresu czasowego, w trakcie którego powstała świeca.

Świece dzienne cieszą się największym zainteresowaniem, ale warto pamiętać, że analiza świecowa może być stosowana w każdym zakresie czasowym.

Tradycyjnie świece zwyżkujące są prezentowane na zielono lub na biało, a zniżkujące na czerwono lub czarno.

Na wykresach najczęściej można spotkać takie świece:



Długi dzień – świeca o długim korpusie i krótkim ogonie.

Jej rozmiar zależy od średniej wielkości świec na wykresie.

Znaczenie. Te świece wskazują na kierunkowy i pewny ruch cen. Pojawiają się, gdy na rynku panuje stabilny trend.



Krótki dzień — krótka świeca o małym cieniu.

Podobnie jak „długi dzień” zależy od średniej wielkości świec na wykresie.

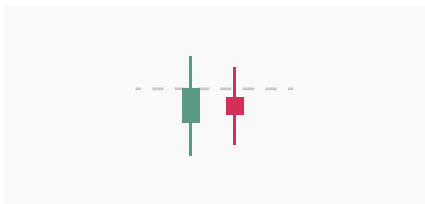
Znaczenie. Takie świece powstają w wąskim kanale cenowym i wskazują na niepewność rynku lub oczekiwanie ważnego wydarzenia.



Marubozu – świeca, w której cena otwarcia i / lub zamknięcia jest ekstremalna.

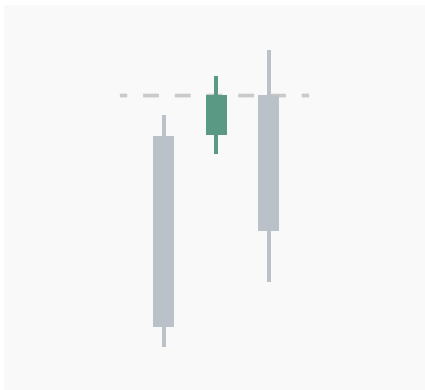
Charakteryzuje się brakiem ogona z jednej lub z obu stron.

Znaczenie. Zielona marubozu zapowiada kierunkowy ruch cen od momentu jej otwarcia. Czerwona marubozu lub marubozu zamknięcia świadczy o tym, że na zamknięciu osiągnięto ekstremalną cenę. Ta świeca ma większą wagę w analizie niż marubozu otwarcia.



Szpułki – świeca o małym korpusie i długich cieniach po obu stronach.

Znaczenie. Podobnie jak „krótka dzień” wskazuje na niepewność rynku. Kolor świecy i długość cieni nie mają znaczenia.



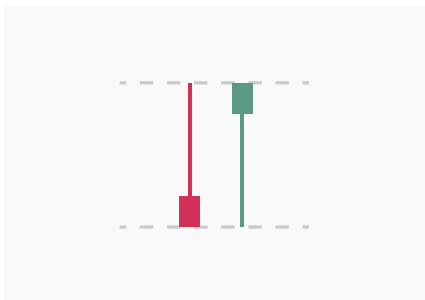
Gwiazda – krótka świeca na samym dole lub górze wykresu cenowego, która tworzy się po długiej świecy.

Znaczenie. Pojawienie się krótkiej świecy po ruchu kierunkowym wskazuje na niepewność lub niezdolność rynku do kontynuowania dotychczasowego trendu.



Doji – w tłumaczeniu z japońskiego oznacza „zamieszanie”, co bardzo dobrze odzwierciedla jej naturę. Świeca nie ma lub praktycznie nie ma korpusu, co oznacza, że cena otwarcia i zamknięcia jest prawie taka sama.

Znaczenie. Wskazuje na niepewność rynku lub przerwę w trendzie. Sąsiednie świece również muszą być brane pod uwagę.



Papierowy parasol – świeca o małym korpusie i długim ogonie po jednej stronie. Warto zwracać uwagę na miejsce, w którym się znajduje – na górze czy na dole wykresu, a także, po której stronie ma cień.

Każda konfiguracja ma unikalną nazwę, co pozwala jednoznacznie jej identyfikować.

Znaczenie. Być może najsilniejszy sygnał odwrócenia trendu. Pojawienie się tej świecy wskazuje na konflikt interesów między uczestnikami rynku.

Każda świeca dostarcza pewnych informacji o nastrojach rynku. Badając różne kombinacje i wiedząc, jak te nastroje zmieniają się w czasie, będziemy w stanie lepiej przewidzieć zachowanie cen w najbliższej przyszłości

W analizie świecowej szczególną uwagę zwraca się na cenę zamknięcia świecy. Wynika to z faktu, że na początku świece wykorzystywano do budowy wykresów dziennych.

Dlatego zmiany w ciągu dnia nie były brane pod uwagę. Najważniejsze było zakończenie dnia handlowego wygraną i rozpoczęcie kolejnej sesji handlowej z przewagą.

Wydaje się to całkiem logiczne, ponieważ cena zamknięcia jest nam bliższa niż cena otwarcia, a nadchodzące wydarzenia mają większą wagę niż te przeszłe.

Współczesne rynki nie bardzo się zmieniły. Szybkość przekazywania informacji, w tym cytatów, dzisiaj jest liczona w ułamkach sekund. To z kolei zmieniło stosunek traderów do zmiany cen w ciągu dnia.

A ponieważ rynek jest fraktalny – taki, którego części są podobne do całości – analiza świecowa ma zastosowanie w każdej skali czasowej. Teraz traderzy monitorują zmiany aktywów w różnych zakresach czasowych, żeby znaleźć lepsze punkty wejściowe i lepiej zrozumieć aktualny stan rynku.

Wskaźnik EMA



Nie zaleca się zaśmiecać wykresu wieloma wskaźnikami naraz. Zwiększa to prawdopodobieństwo błędnych decyzji handlowych.

Cena sama w sobie zawiera wszystkie niezbędne informacje, a świece i ich kombinacje dostarczają tylko dodatkowych wskazówek. Jednak czasami wskaźniki mogą okazać się bardzo przydatne.

Z reguły doświadczeni traderzy używają nie więcej niż 2-3 wskaźników. Przyjrzyjmy się bliżej jednemu instrumentowi. Jest to najczęściej stosowany, a w dodatku bardzo prosty wskaźnik trendowy. Porozmawiamy o średnich kroczących, a mianowicie o wykładniczej średniej kroczącej (exponential moving average lub EMA).

EMA to wskaźnik, który wskazuje kierunek trendu w danym momencie.

Średnie kroczące działają podobnie do linii wsparcia i oporu. Ta ich cecha staje się szczególnie widoczna w przypadku wyraźnych trendów. Dlatego zalecamy używać średnich kroczących jako linii trendu. Nie należy jednak spodziewać się, że takie podejście zadziała w każdej sytuacji. Przecież dobrze wiemy, że prędzej czy później trend się skończy.

Warto o tym pamiętać, ponieważ wskaźnik ten mimo całej stabilności sygnałów może w pewnym momencie zawieść.

Jednak analiza statystyczna sugeruje, że przy wyraźnych trendach sygnały średniej kroczącej są wiarygodne i poprawne. W ujęciu procentowym liczba poprawnych sygnałów znacznie przewyższa liczbę fałszywych.

Hossa na podstawie średnich koczających



Na rysunku linie EMA są skierowane w górę i prawie równoległe do siebie, a cena jest powyżej tych poziomów. Zakupu się dokonuje przy kolejnym zbliżaniu się wykresu cenowego do średniej koczającej, czyli czekamy, aż wykres cenowy dotknie wskaźnika.

Bessa na podstawie średnich koczujących



W tym przypadku linie EMA są skierowane w dół i też równoległe, a cena znajduje się niżej poziomów EMA. Sprzedajemy przy kolejnym dotknięciu wykresu cenowego średniej koczującej..

TW ten sposób sygnały otrzymane ze średnich koczujących pomagają znaleźć najlepszy punkt wejściowy.

Czasami cena nie dotyka zbudowanej przez nas linii wsparcia lub oporu. W przypadku stosowania średnich kroczących zwiększamy liczbę wejść na rynek, ponieważ otrzymujemy dokładniejsze sygnały.

Praca w oparciu o wiadomości



Na dynamikę cen wpływają następujące czynniki:

Czynniki gospodarcze:

- polityka banków centralnych;
- przemówienia szefów banków centralnych, szefów rządów;
- publikacja wskaźników ekonomicznych (statystyki makro);

- spotkania G7, innych związków gospodarczych lub zawodowych;
- relacje między rynkami / sąsiednie rynki.

Czynniki polityczne:

- zmiany w polityce światowej;
- wybory prezydenckie;
- zmiana kursu politycznego kraju.

Czynniki psychologiczne:

„Kupuj pogłoski, sprzedawaj fakty” – znane powiedzenie handlowe. Kupowanie oczekiwań jest zrozumiałe i łatwe do wyjaśnienia, ponieważ u jego podstaw leży czynnik emocjonalny. Często uczestnicy rynku zaczynają reagować

na zdarzenie z wyprzedzeniem, a w momencie, gdy następuje faktycznie, starają się pobrać zysk.

Siła wyższa:

W tej grupie znajdują się zdarzenia, których nie da się przewidzieć, ale które poważnie wpływają na rynek:

- klęski żywiołowe;
- katastrofy itp.



Ten wykres pokazuje spadek pary walutowej GBP / USD o ponad 600 pkt po referendum BREXIT w Wielkiej Brytanii w 2016 roku. Niepewność co do przyszłości Wielkiej Brytanii i jej relacji z UE doprowadziła do ucieczki inwestorów od ryzykownej waluty brytyjskiej do bezpieczniejszych aktywów (USD, złoto).

Warto zwrócić szczególną uwagę na moment, w którym rynek „przetwarza” wiadomość.

Wiadomości można podzielić na dwa typy:

Losowe – głównie wiadomości o charakterze politycznym lub przyrodniczym, rzadziej o charakterze gospodarczym;

Planowane – wiadomości ekonomiczne, rzadziej polityczne (publikacja danych makroekonomicznych, przemówienia szefów banków centralnych, sprawozdawczość finansowa itp.). Na takie wiadomości traderzy przygotowują się z wyprzedzeniem.

Ludność ma pewne oczekiwania co do większości planowanych wydarzeń. Na podstawie tych oczekiwań traderzy planują swoje pozycje rynkowe, obliczają ryzyko, zyski i dalszy rozwój sytuacji.

W czasie publikacji danych makroekonomicznych, uczestnicy rynku ściśle monitorują przeszłe wartości wskaźników, prognozowane i wartość w momencie publikacji.

W przypadku transakcji krótkoterminowych po publikacji poddają się ocenie wartości rzeczywiste i oczekiwane. Jeśli rzeczywista wartość okazała się lepsza od przewidywań, uczestnicy rynku otwierają długie pozycje i odwrotnie – jeśli prognozy były lepsze, składnik aktywów straci na wartości.

W przypadku pozycji średnioterminowych i długoterminowych sytuacja wygląda nieco inaczej. Tutaj oceniana jest ogólna dynamika określonego aktywa, dlatego do analizy zostają wykorzystane wartości rzeczywiste i przeszłe. Na podstawie dynamiki wskaźników w perspektywie średnioterminowej można ocenić ogólną dynamikę gospodarki, co z kolei będzie przydatne w budowaniu strategii handlowej.

Strategie zarządzania ryzykiem



Zyski i straty na rynku zależą bezpośrednio od gotowości do podejmowania ryzyka przez tradera. Im większe ryzyko, tym większe zarobki.

Ale dokładnie to samo dotyczy strat.

Naszym zadaniem jest obliczenie ryzyka w taki sposób, by zapewnić bezpieczeństwo lokaty w przypadku spadków i jednocześnie zarobić.

Uważa się, że 1-2 proc. depozytu to optymalna wielkość dla kapitału ryzyka, maksymalna z kolei to 5 proc. Zdefiniujmy to jako dzienny limit strat, a limit na transakcję będzie wynosić 1/10 dziennego limitu.

Przy depozycie w wysokości 1000 USD, limit strat dziennie wyniesie 10-20 USD, a ryzyko dla jednej transakcji – 1-2 USD. Poniższa tabela pokazuje, że minimalna wartość 1 pkt to 10 centów przy wolumenie 0,01 lota.

Używając limitu strat w wysokości 2 USD dla jednej transakcji, maksymalny możliwy Stop Loss wyniesie 20 pkt, z uwzględnieniem spreadu. Przy ryzyku w 1 USD maksymalny Stop Loss wyniesie 10 pkt. Ta tabela wartości pipsów jest aktualna dla wszystkich walut kwotowanych w dolarach: EUR / USD, AUD / USD ... XXX / USD.

Wolumen transakcji,lot	Koszt 1 pkt, USD
10	100
1	10
0.1	1
0.01	0.1

Optymalne strategie zarządzania ryzykiem:

● «„Trzy strzały” – bardzo prosta, a jednocześnie bardzo wydajna strategia zarządzania kapitałem handlowym, która chroni pieniądze przed utratą. Zalecamy rozpoczynać właśnie od niej.

Istota strategii: jeżeli w trakcie sesji handlowej trzy transakcje zostają zamknięte przez Stop Loss, czyli ze stratą, trader natychmiast przestaje handlować.

Jak to wygląda w praktyce:

- Jeżeli trzy transakcje zostały zamknięte przez Stop Loss, uważamy, że limit strat został osiągnięty i przestajemy handlować;
- jeżeli limit strat zostaje osiągnięty każdego dnia przez trzy dni z rzędu – nie handlujemy w następnym dniu.

- Dywersyfikacja –
Innymi słowy – dystrybucja kapitału
ryzyka.

Istota strategii: Dokonuje się nie
jednego, tylko kilku wejść na rynek
przy niepełnym wolumenie.

Przy takim podejściu zmniejsza się
obciążenie ryzykiem, co powoduje
wzrost rentowności transakcji. Na
przykład ustawiamy Stop Loss na 15
pkt (łącznie ze spreadem), Take Profit
na 30 pkt, wolumen – 1 lot, czyli
kapitał ryzyka w tym przypadku
będzie 150 USD.

eraz są dwie opcje: pierwsza –
wprowadzamy cały kapitał ryzyka w
transakcje,

druga – dywersyfikujemy, czyli zamiast jednej dużej dokonamy 10 mniejszych transakcji.

Lot	Open	Stop loss	Take profit	Loss	Target
1	1,1200	1,1215	1,1970	(\$150)	\$300

Распределение риска

0,1	0,1200	0,1215	1,1970	(15\$)	\$30
-----	--------	--------	--------	--------	------

0,1	0,1201	0,1215	1,1970	(14\$)	\$31
-----	--------	--------	--------	--------	------

0,1	0,1202	0,1215	1,1970	(13\$)	\$32
-----	--------	--------	--------	--------	------

0,1	0,1203	0,1215	1,1970	(12\$)	\$33
-----	--------	--------	--------	--------	------

0,1	0,1204	0,1215	1,1970	(11\$)	\$34
-----	--------	--------	--------	--------	------

0,1	0,1205	0,1215	1,1970	(10\$)	\$35
-----	--------	--------	--------	--------	------

0,1	0,1206	0,1215	1,1970	(9\$)	\$36
-----	--------	--------	--------	-------	------

0,1	0,1207	0,1215	1,1970	(8\$)	\$37
-----	--------	--------	--------	-------	------

0,1	0,1208	0,1215	1,1970	(7\$)	\$38
-----	--------	--------	--------	-------	------

0,1	0,1209	0,1215	1,1970	(6\$)	\$39
-----	--------	--------	--------	-------	------

				(\$105)	\$345
--	--	--	--	---------	-------

W ten sposób ryzyko zostaje
zmniejszone do 105 USD.
Zaoszczędziliśmy 45 USD,
co stanowi 30 proc. pierwotnego
kapitału ryzyka, i zwiększyliśmy
rentowność o 45 USD.

Podsumowanie

By skutecznie pokonać wszystkie przeszkody, początkujący trader musi być przygotowany. Nie próbuj zarobić milion na samym początku!

Lepiej zdobądź wystarczająco wiedzy i ćwicz powoli. Okazje do zysku będą zawsze. Przecież nic nie tracisz, inwestując swój czas w edukację i szkolenia. Wkraczaj na rynek stopniowo, testując różne strategie w praktyce. Po jakimś czasie stworzysz własny system handlu i nauczysz się czerpać maksymalne korzyści z każdej transakcji!