

Леонид Шафт

**Прогнозирование трендов
на финансовых рынках для
инвесторов и трейдеров**



ЛитРес: Самиздат
Москва

УДК 338.24
ББК 65.26
ШЗО

Шафт Л.

Прогнозирование трендов на финансовых рынках для инвесторов и трейдеров / Шафт Л. — Москва: ЛитРес: Самиздат, 2020. — 110 с.

ISBN 978-5-532-03229-3

Книга содержит описание метода прогнозирования ценовых движений для поиска инвестиционных возможностей на фондовом и валютном рынках. Автор успешно использует эту методику уже более десяти лет. Метод позволяет быстро определить привлекательность актива и потенциал его роста, узнать, в какой фазе тренда находится рынок, и рассчитать ближайшие ценовые уровни, на которых возможен его «разворот». Трейдер сможет полностью отказаться от совершения сделок с необоснованно высоким риском, а инвестор получит прекрасный инструмент для прогнозирования точек "разворота" среднесрочных и долгосрочных трендов.

Содержание

Предисловие	5
Часть 1. Тренды на фондовом рынке	6
Глава 1.1. Риск и прибыль	7
Торговля от «стопа»	7
Торговля от «тейка»	8
Инвестировать в тренды	9
Глава 1.2. Где рынок хранит деньги	11
Расчет целей тренда	11
ПАО ГАЗПРОМ	11
СБЕРБАНК	15
ЛУКОЙЛ	17
ГМК Норильский никель	19
YANDEX	20
НОВАТЭК	21
Роснефть	22
Полюс	23
Магнит	24
Алроса	25
Место метода в инвестиционной стратегии	27
Часть 2. Тренды на валютном рынке	29
Глава 2.1. Особенности валютного рынка	30
Модель валютного рынка	32
Отличия рынка валют от других рынков	37
Две основные ошибки трейдеров	48
Глава 2.2. Технические инструменты	50
Таймфреймы	51
Ценовые уровни и границы диапазонов	53
Тренды и коррекции	55
USDJPY	60
AUDUSD	62

EURUSD	79
XAUUSD	85
Уровни Фибоначчи	93
Глава 2.3. Выбор опорных точек	99
Условия применения метода	99
Когда нельзя применять метод	100
Продолжительность фаз тренда и коррекции	103
Двойное дно – зарождение нового тренда	105
«Проклятье» трейдера	106
Формула метода	107
Глава 2.4. Метод в торговой системе трейдера	109
Эпилог	110

Предисловие

Любой человек начинает интересоваться торговлей на финансовых рынках, в надежде научиться зарабатывать на ценовых колебаниях. Очень скоро он понимает, что учебника успешной торговли нет, а собственный опыт достается ему слишком дорого.

За время существования рынков, человечество сумело накопить огромный «склад» экономических теорий и торговых методов, технических платформ и инструментов. Пытаясь отыскать в этой «куче» хоть что-то, что поможет ему приблизиться к успеху, трейдер хватается за все подряд, каждый раз убеждаясь, что снова ошибся в выборе. Вспоминая то время, когда я сам находился в такой ситуации, я понимаю – дело было вовсе не в выборе инструмента, а в том, что я плохо представлял себе, что именно я собираюсь им делать.

Работая над этой книгой, я внезапно понял, что возможно, для многих читателей наиболее ценным и полезным, будет даже не сам метод прогнозирования (который, на мой взгляд – чертовски хорош), а четкое понимание его места в системе принятия инвестиционных решений.

Чем раньше к трейдеру придет понимание, что ВСЕ его действия на рынке должны выполняться в рамках торговой системы или инвестиционной стратегии, каждый элемент которой был им заранее просчитан, тем короче будет его путь к успеху.

В этой книге, детально описан всего один из элементов моей торговой системы, но зато он самый интересный, потому что умеет отвечать на вопрос: «Где лежат деньги?»

Часть 1. Тренды на фондовом рынке

В первой части книги, демонстрируется метод прогнозирования тренда для инвесторов, на примере ценовых движений «голубых фишек» российского фондового рынка. Показаны реальные возможности и преимущества применения метода.

* Несмотря на то, что автор использует данный метод в трейдинге и часто обращается к читателю – «трейдер», наилучшие результаты этот метод показал именно в инвестициях и долгосрочных сделках.

Глава 1.1. Риск и прибыль

Это ключевые понятия для торговли на рынках. Именно реализация рынком их предварительной оценки и генерирует доход инвестору. Как правило, трейдер не в состоянии существенно повысить процент «выигрышных» сделок – начать чаще «угадывать» рынок. Но зато он может изменить соотношение риска и прибыли, что не менее важно, чем соотношение выигрышей и проигрышей. Можно выигрывать всего одну сделку из четырех и при этом вести прибыльную торговлю на протяжении многих лет! Все зависит от соотношения величины среднего убытка и среднего выигрыша сделок.

Торговля от «стопа»

Большинство трейдеров предпочитают торговать, выбирая время на рынке, когда появляется возможность открыть позицию с «коротким стопом». Потенциальную прибыль такой сделки, они оценивают приблизительно, предпочитая верить, что смогут избавиться от риска полностью или хотя бы существенно снизить его и дожждаться момента, когда цена «выстрелит» в нужную сторону. Такой подход на рынках является нормой уже много лет и за это время успел обрести различными исследованиями и даже пословицами.

Поиск «надежного» ценового уровня, который бы цена не смогла преодолеть, заставляет трейдеров использовать различные инструменты. Как правило, опытные трейдеры используют очень небольшое количество признаков, на основании которых они принимают торговые решения. В какие-то периоды времени такой подход отлично работает, но меняется фаза рынка и такие сделки начинают давать сбои. Цена, раз за разом, «продавливает» вроде такую похожую свечную формацию (столько раз позволявшую успешно входить в рынок), вынуждая трейдера фиксировать очередной убыток. Зная такую особенность, после серии сплошных неудач, многие прекращают торговать вообще, выжидая в стороне, когда рынок изменится и, отработанная схема снова начнет срабатывать.

Привычка искать «надежный» уровень для входа в рынок с годами формирует в сознании трейдера безусловный приоритет ограничения риска над размером потенциальной прибыли. Психологически ему очень комфортна ситуация, когда он рискует небольшой суммой и может рассчитывать получить с рынка неограниченную прибыль. Девиз такого подхода к торговле: «Режь убытки – дай прибыли расти!».

При кажущейся простоте данного подхода, достичь успеха, используя его, совсем непросто. Колоссальное значение приобретает многолетний опыт трейдера, его интуиция, сила воли и дисциплинированность. Даже угаданное будущее движение рынка может не принести прибыли, если вовремя не закрыть позицию. Когда и где ее надо было закрывать? Есть разные варианты:

«Ну, главное зайти удачно в рынок, а там-то видно будет. Поглядим – разберемся!»

«Если сигнал возникнет в другом направлении, то я закрою позицию»

«А я стоп в «безубыток» переставлю и уже не проиграю!»

«Посмотрю несколько дней/недель/месяцев/кварталов, если движение прекратится – закроюсь»

Такие ответы нередко можно услышать на вопрос – где планирует закрыть свою прибыльную позицию трейдер. Объединяет эти ответы одно – люди рассчитали вероятность выигрыша, тщательно отмерили свою ставку, но, так и не узнав размер ответной ставки, сели играть с рынком на деньги.

Торговля от «тейка»

В корне отличается от торговли от «стопа». Инвестор ищет на графике не те участки, на которых цена может «застрять», а участки, которые цена может быстро преодолеть и достигнуть новых экстремумов. Участки, на которых будет хозяйничать тренд, «загоняя» цену на новые уровни. В такие моменты рынок ускоряется, и технические факторы уже не способны оказывать на него длительное воздействие, препятствующее движению цены.

Цели таких движений намного легче прогнозировать. Величину трендовых движений можно использовать для расчета риска в своих сделках. Зная заранее точку возможного разворота цены, трейдер сможет закрывать свои позиции по лучшим ценам на рынке за длительное время, а инвестор сумеет вовремя избавиться от актива, который на долгое время утратит способность роста. Такой подход дает возможность, зная вероятность «выигрышей» своей торговой системы, заключать только «выгодные» сделки. Только те, в которых соотношение риск-прибыль будет ниже общей «выигрышности» системы.

Иными словами, зная процент своих выигрышных сделок и размер ожидаемой прибыли, трейдер сможет легко определить, что очередная планируемая им сделка – слишком рискованная для него и, тем самым, сумеет ее избежать.

Используя торговлю от «тейка» в стратегическом планировании, а торговлю от «стопа» в тактическом – трейдер сможет существенно повысить общую прибыльность своей торговой системы.

Инвестировать в тренды

Предлагаемый здесь метод в большей мере будет полезен инвестору, т.к. может быть применен им сразу, в то время, как трейдеру еще предстоит понять, как можно будет интегрировать его в свою торговую систему.

Действительно, метод наиболее надежен для долгосрочных трендов, которые продолжаются месяцами и годами. Инвестор способен «пересидеть» в активе существенные краткосрочные просадки, что дает ему большое преимущество перед трейдером, который никогда не сможет себе этого позволить. Инвестор способен дожидаться реализации цели движения и взять с рынка всю прибыль, даже если тренд продолжался много лет.

Знание возможных «разворотных» точек может сильно помочь ему при принятии решений о приобретении актива или его продаже. Более того, инвестор сможет сравнивать потенциал роста различных активов, используя, хоть и вероятностные, но зато достаточно точные количественные оценки.

Также применение метода заставляет инвестора искать рынки либо находящиеся в тренде, либо способные в это состояние перейти. Какой еще другой навык будет настолько полезен человеку, решившему заняться инвестированием?