

СОДЕРЖАНИЕ

БЛАГОДАРНОСТИ	10
ВВЕДЕНИЕ	11
Как пользоваться этой книгой?	17
Структура книги	19
Опорные тезисы	20
Цели книги	20
1. ПРОФЕССИЯ ТРЕЙДЕР	25
1.1 Проблематика профессии	26
1.2 Эффект Карго	30
1.3 Статистика профессии	31
1.3.1 ЛЧИ	31
1.3.2 Comon.ru	31
1.3.3 Брокеры	33
1.3.4 «Форекс»	33
1.3.5 Другое	34
1.4 Мечты и реальность	35
1.5 Мифы о трейдинге	37
1.6 Плюсы трейдинга	37
1.7 Эволюция трейдера	38
1.8 Вершина успеха в трейдинге	39
1.9 Частные и профессиональные трейдеры	40
1.10 Реальные истории трейдеров	41
1.11 Профессия трейдер: выводы	42
2. ТРЕЙДИНГ И СЧАСТЬЕ	43
2.1 Счастье и Деньги	43
2.2 Кривая вашего настроения	44
2.3 Социальное сравнение	49
2.4 Социальный фактор	50
2.5 Трейдинг и счастье: выводы	51
3. КТО Я?	52
3.1 Проблема самоидентификации	54
3.2 Проблема одиночки	58
3.3 Две группы вопросов к себе	61
3.4 Сбитый ориентир	64

4. МЕХАНИЗМ	68
4.1 Алгоритм успеха	68
1.2 Как Механизм будет раскрыт в этой книге?	72
4.3 Мой собственный путь и Механизм	73
4.4 Механизм: выводы	78
5. ЦЕЛЬ	79
5.1 Долгосрочная цель. Мечта	80
5.2 Почему важна мечта?	81
5.3 Почему важна цель трейдинга?	82
5.4 Цель трейдинга	84
5.5 Определить мечту	86
5.6 Составьте детальный план	88
5.7 Фиксация цели	91
5.8 Как правильно ставить цели?	93
5.9 Цель: выводы	94
6. ИСТОЧНИКИ ИНФОРМАЦИИ	96
6.1 Первичная информация: время, цена и прочее	98
Фактор времени	101
6.2 Вторичная информация: волатильность, ликвидность, издержки	103
Лирическое отступление по теме	118
6.3 Информация: размер позиции	123
6.4 Информация об информации	127
6.5 Другие источники информации	128
6.5.1 Новости	130
Закономерности	131
6.5.2 Книги по трейдингу	135
6.5.3 Гуру рынка, обучение трейдингу	137
6.5.4 Аналитики	139
6.5.5 Интернет-ресурсы	139
6.6 Информация о самих себе	139
6.6.1 Состояние	140
6.6.2 Возраст	142
6.6.3 Образование	142
6.6.4 Темперамент	142
6.7 Информация о доверительном управлении	143
Почему инвестор отдает деньги в ДУ?	143
Как работает бизнес-модель?	144
Советы потенциальному инвестору	148

Репутация	148
Единый стейтмент	149
Диверсификация. Портфель управляющих	150
7. ОБРАБОТКА ИНФОРМАЦИИ.....	151
7.1 Лучший способ начать торговать на бирже	154
7.2 Основные принципы трейдинга	155
7.2.1 Альфа и Бета	155
7.2.2 Что мы контролируем?	156
7.2.3 Конкуренция и деньги	158
7.2.4 Источники альфы	161
7.3 Подход «Снизу вверх». Виды неэффективностей	162
7.3.1 Тренд	163
Почему работает тренд?	164
Фундамент долгосрочного тренда	166
Проблематика	166
Тренды на разных таймфреймах	167
Определение трендов	168
7.3.2 Контртренд. Схождение к среднему	176
7.3.3 Уровни	184
7.3.4 Пробои уровней	189
7.3.5 Привязка к круглым числам	191
7.3.6 Краткосрочные ошибки ценообразования	191
7.3.7 Срабатывание стоп-лоссов	193
7.3.8 Выброс цен	195
7.3.9 Гэпы	198
7.3.10 Разность скоростей	202
7.3.11 Инерционность и запаздывание	204
7.3.12 Большие приказы и фронтраннинг	204
7.3.13 Сезонность, тайминг	206
7.3.14 Послеторговый аукцион, имбэлэнсы	207
7.3.15 Манипулирование рынком	207
7.3.16 Технологические неэффективности	208
7.3.17 Неэффективности на опционах	209
7.3.18 Game-changers, новости, которые все меняют	211
7.3.19 Государственные интервенции	212
7.3.20 Финансовый пузырь	213
7.3.21 Стрессовые активы	214
7.3.22 Ошибка оценки активов	215
7.3.23 Корпоративные действия эмитентов	216

7.3.24	Дивидендные неэффективности	217
7.3.25	Инсайдерская информация	217
7.4	«Снизу вверх»: выводы	218
7.5	Подход «Сверху вниз». Статистика и датамайнинг	220
7.5.1	Как искать закономерности?	222
7.5.2	Статистика	224
7.5.3	Паттерны	225
7.5.4	Технический анализ	226
7.5.5	Перебор параметров	230
7.5.6	Поиск закономерностей в режиме реального времени.	232
7.5.7	«Сверху вниз»: выводы	233
8. ПЛАН	235
8.1	Почему нужен план?	236
8.2	План управления собой	238
8.3	Торговая система.	240
8.3.1	Правила входа в сделку и выхода из сделки.	242
8.3.2	Входы в сделку	244
8.3.3	Примеры систем входа в рынок	247
8.3.4	Выход из сделки	249
8.3.5	Технические характеристики выходов	253
8.3.6	Бессистемная торговля по плану	255
8.4	Управление капиталом и контроль риска	258
8.4.1	Как построить риск-менеджмент?	261
8.4.2	Стоп-лоссы	266
8.4.3	Практика стоп-лоссов	268
8.4.4	Торговля от стоп-лосса	269
8.4.5	Пример простого расчета риска и размера позиции	271
8.4.6	Риск-менеджмент черепах-трейдеров	272
8.4.7	Форс-мажор	273
8.4.8	Системный риск-менеджмент	273
8.4.9	Кредитное плечо	285
8.4.10	Стоп счет	288
8.4.11	Усреднение на убыток (мартингейл)	289
8.4.12	Усреднение на прибыль	290
8.4.13	Диверсификация	291
8.4.14	Как потерять деньги на бирже?	293
8.5	План: выводы	294
	Создайте план.	294

Всегда следуйте своему плану	294
8.6 От Плана к Исполнению.....	296
9. МЕХАНИЗМ. ИСПОЛНЕНИЕ	298
9.1 Корни психологических проблем в трейдинге.....	299
9.2 Природа человека и его поступков.....	304
9.3 Система принятия решений человека.....	308
9.4 Система принятия решений и трейдинг.....	311
9.5 Коротко о психологии трейдинга.....	321
9.6. Ключевые психологические ловушки в трейдинге.....	322
9.7 Другие ловушки	338
9.8 Психологические ловушки – выводы	339
9.9 Правильное мышление трейдера	340
9.10 Влияние сделок на человека с точки зрения «кривой счастья» ..	341
9.11 Медитация.....	348
9.12 Психология – выводы	350
10. ОЦЕНКА РЕЗУЛЬТАТОВ	356
10.1 Почему необходимо тестировать план?	358
10.2 Как тестировать систему?	358
10.3 Критерии оценки	360
10.4 Критерии оценки систем: выводы	371
10.5 Оптимизация торговой системы	372
10.6 Оценка бессистемной торговли	374
11. РАБОТА НАД ОШИБКАМИ И КОРРЕКТИРОВКИ	377
11.1 Работа над ошибками торговой системы	381
11.2 Фиксация ошибок	383
11.3 Ошибки в трейдинге.....	384
11.4 Журнал сделок	385
11.5 Временная карта	389
11.6 Мои ошибки в трейдинге	391
12. ЧТО ВАМ НУЖНО СДЕЛАТЬ?	393
13. ВСЯ КНИГА НА ОДНОЙ СТРАНИЦЕ	395
14. КАК ОТКРЫТЬ ТОРГОВЫЙ СЧЕТ И НАЧАТЬ ТОРГОВАТЬ?..	397
Библиография.....	400
Примечания.....	402