

ФЬЮЧЕРСЫ ОТ А ДО Я

Дмитрий Ткачёв



ФЬЮЧЕРСЫ

Что же это такое и как этим пользоваться ?

В данном курсе „Фьючерсы от А до Я Дмитрия Ткачева“

Мы разберём все понятия и наглядно покажем и расскажем как открывать, закрывать, выставлять ордера, стоп-лимиты, а главное как правильно фиксировать прибыль и **ЗАРАБАТЫВАТЬ.**

Начнём с момента на чем мы будем зарабатывать ➔

–Во фьючерсной торговле, вы можете участвовать в движениях рынка и получать прибыль, открывая Лонг или Шорт позицию по фьючерсному контракту.

–Открывая Лонг позицию, трейдер покупает фьючерсный контракт, ожидая, что в будущем он вырастет в цене.

И наоборот, трейдер продает фьючерсный контракт, чтобы открыть Шорт позицию, тем самым делая ставку на снижение цен в будущем.

ИТАК, ПОГРУЗИМСЯ В МИР ФЬЮЧЕРСОВ

Что же такое фьючерс ?

Фьючерс – это договор о том, что в будущем одна сторона продаст или купит что-то у другой стороны. Чаще всего это касается драгметаллов, сельскохозяйственной продукции и энергоресурсов: угля, нефти, газа.

Разберём на ещё более понятном примере ➔ Андрей обратиться к поставщику моркови в декабре и договорился, что через полгода он получит всю морковь по нынешней цене! допустим, 100\$ за ящик. Неважно, сколько морковь будет стоить через полгода – 100\$ или 1000\$– он получит морковь в полном объеме и за ту цену, которую заплатил.

!Важно понимать, что фьючерсы —это почти всегда про спекуляции, игру на стоимости и рыночные ожидания. Например, вы оформляете фьючерсную сделку на покупку Bitcoin, ожидая, что его цена в будущем вырастет, и затем продаёте свой фьючерс, когда посчитаете нужным зафиксировать прибыль. Стоит учесть, что покупая фьючерс, вы не становитесь обладателем той или иной монеты на которой торгуете. Фьючерс на Bitcoin —не то же самое, что Bitcoin лежащий на вашем кошельке будет это горячий или же холодный.

Рассмотрим где происходят собственно торговля фьючерсами.

Мы рекомендуем и сами будем наглядно показывать процесс торговли на бирже Binance. *Если вы проживаете в государстве "Беларусь",то вам советуем биржу Bybit*

!Binance Futures (Бинанс Фьючерсы) – это раздел биржи Binance, представляющий собой площадку для торговли фьючерсами. При этом трейдеры не покупают и не продают криптовалюту напрямую, а происходит расчет нереализованных прибылей и убытков.

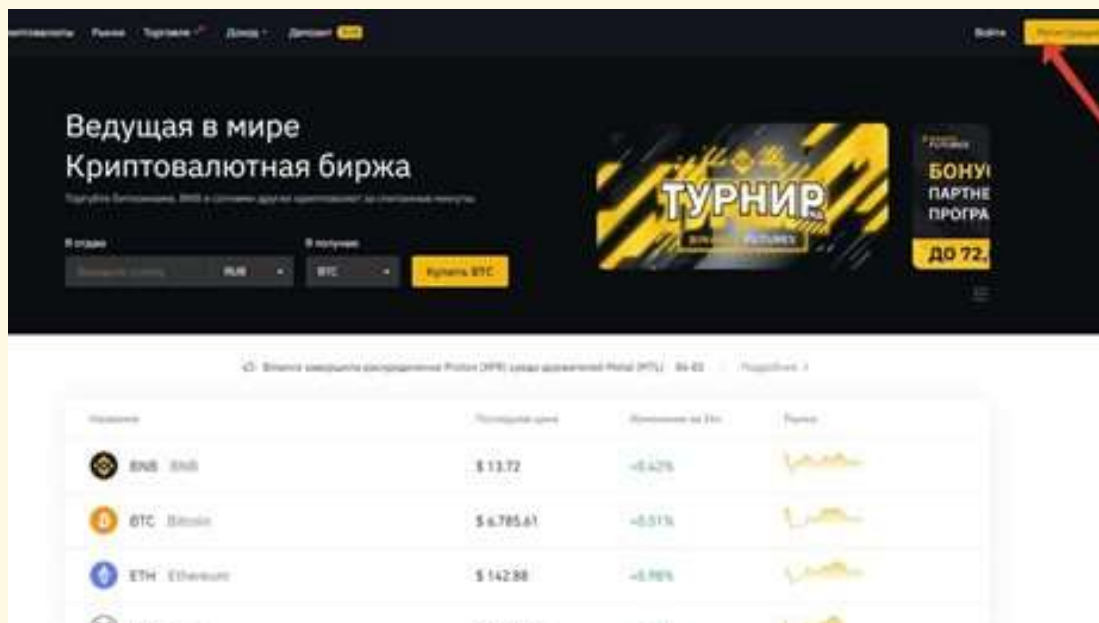
Так же проводить торговые операции по отношению фьючерсов можно и на других биржа, таких как: FTX, Bitmex, Bybit, Currency, Huobi, BaseFex, PrimeXBT, StormGain и другие менее известные биржи.

□Цены на фьючерсы отличаются от курсов спотового рынка, поскольку включают в себя дополнительные расходы (на хранение и доходности). На Бинанс используется система ставок финансирования, с помощью которой обеспечивается сближение цен между спотом и фьючерсами в долгосрочной перспективе. При этом в краткосрочной перспективе может наблюдаться существенная разница стоимости.

Мы узнали, что такое фьючерсы и как они работают, выбрали биржу, преступим к регистрации фьючерсного аккаунта.

Рассмотри на примере биржи Бинанс !

Для начала торговли на Binance Futures нам сначала нужно создать аккаунт на сайте <https://www.binance.com/ru/futures/ref/maksrom2282> биржи Binance, если он еще не создан. Для этого нажмите кнопку «Регистрация» на главной странице.

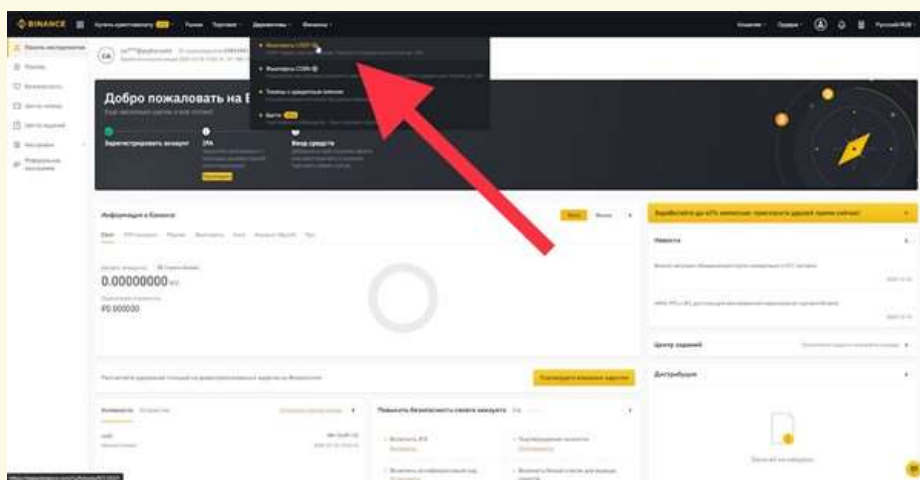


И заполните требуемые поля. В поле Futures Referral ID укажите **maksrom2282** чтобы получить скидку **10 %** на торговые комиссии.

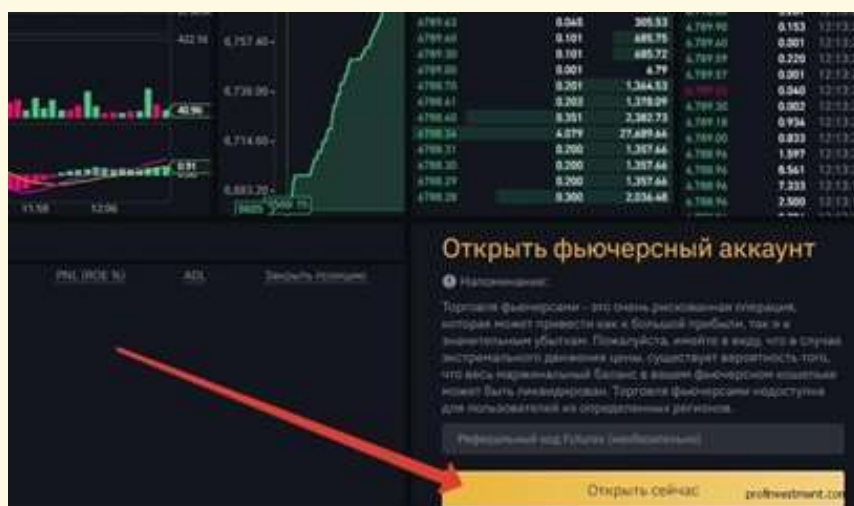
Затем подтвердите адрес электронной почты.

!Верификация аккаунта для торговли фьючерсами на Бинанс не требуется. Но обратите внимание, что необходимо подключить в настройках двухфакторную аутентификацию перед тем, как создавать фьючерсный счет.

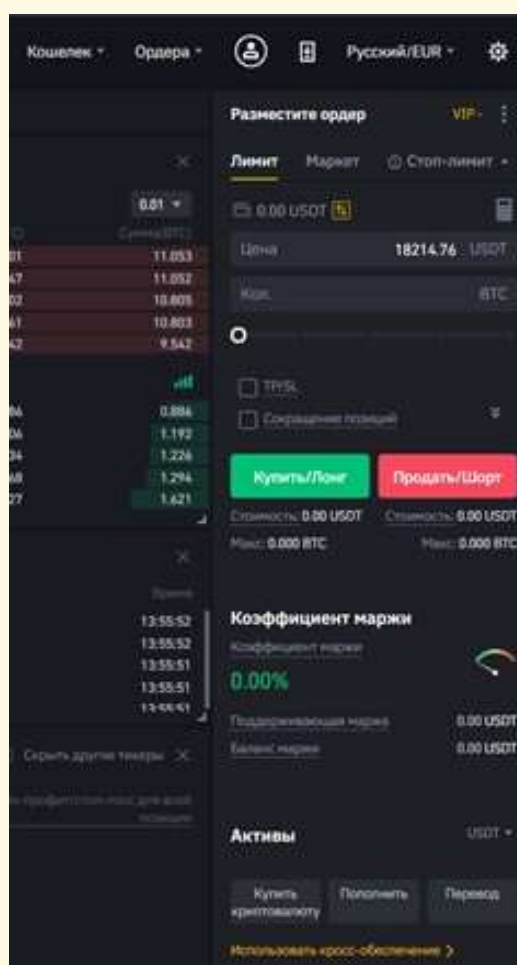
Далее, авторизовавшись в своей учетной записи, зайдите на страницу Фьючерсы и нажмите «Открыть сейчас» в правом нижнем углу.



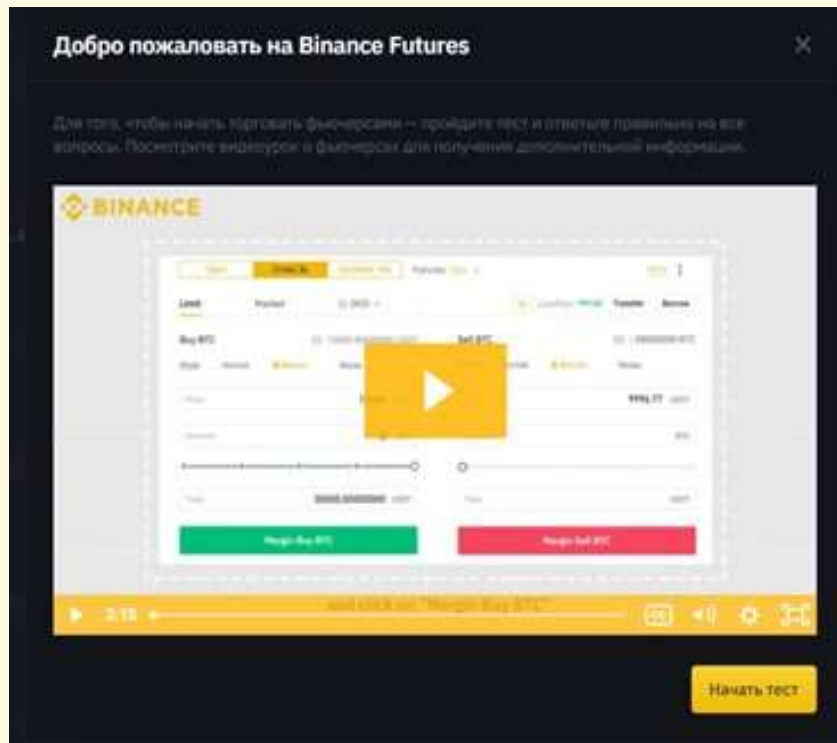
Все эти манипуляции нужны для активации фьючерсного аккаунта на бирже Binance.



После открытия меню фьючерсной торговли нажмите на одну из кнопок – Купить/Лонг или Продать/Шорт в меню справа.



В появившемся окне с обучающим видео необходимо нажать на кнопку Начать тест.



Для активации доступа к фьючерсной торговле требуется правильно ответить на 14 вопросов:

- 1.Каков максимальный размер убытка при торговле фьючерсными контрактами?

Весь баланс фьючерсного кошелька

Половина баланса моего фьючерсного кошелька

Я не потеряю деньги
- 2.Какая цена используется при ликвидации баланса фьючерсов?

Последняя цена

Цена за последний час

Цена маркировки
- 3.Знаете ли вы, что после принудительной ликвидации баланса фьючерсов, помимо потери позиции, взимается комиссия за ликвидацию обеспечения (= номинальная стоимость позиции * ставка комиссии за ликвидацию), в связи с чем баланс вашего фьючерсного кошелька может упасть до нуля?

Нет, я не знаю о том, как рассчитывается комиссия за ликвидацию обеспечения.

Да, я знаю, что существует комиссия за ликвидацию обеспечения и как она рассчитывается, и я осознаю риски, которые могут привести к обнулению баланса.

Нет, я не знаю, что ликвидация может привести к потере всех активов на моем фьючерсном кошельке.

4. Для каждого фьючерсного контракта существует максимальное количество ордеров. Как вы будете действовать, когда лимит ордеров будет достигнут? Как только будет достигнуто максимальное количество, ордер не сможет быть размещен. Вы получите сообщение об ошибке. Мне нужно попытаться разместить ордер еще раз с тем же количеством и сообщить Binance об ошибке работы платформы.

Как только будет достигнуто максимальное количество, ордер не сможет быть размещен, и появится сообщение об ошибке. Но я уверен(а), что ордер будет размещен в случае, если я предприму ряд дополнительных попыток.

Как только будет достигнуто максимальное количество, ордер не сможет быть размещен, и появится сообщение об ошибке. Мне нужно разделить ордер на ордера с меньшим количеством.

5. Какое из следующих утверждений о рыночных стоп-ордерах является верным?

Цена сделки должна быть равна цене активации.

После срабатывания тейк-профит и стоп-лосс сделка сразу исполняется по рыночной цене. Цена сделки может не совпадать с ценой активации.

Цена сделки должна быть больше цены активации.

6. Какое из следующих утверждений о лимитных стоп-ордерах является верным?

После срабатывания тейк-профит и стоп-лосс ордер мгновенно будет выставлен по лимитной цене. Однако, возможно, лимитный ордер не будет исполнен, если цена резко двинется в противоположном направлении.

Лимитный ордер будет исполнен после его размещения.

Лимитный ордер не будет исполнен после его размещения.

7. Какого поведения следует избегать при торговле фьючерсами?

Строгая дисциплина, правильный стоп-лосс, разумные прибыль и убыток, включая выигрыш или проигрыш на мой страх и риск.

Изучение основ торговли фьючерсами и соответствующих статей на сайте Binance.

Высокий уровень спекуляций, торговая зависимость, постоянные убытки и обвинение других.

8. Чтобы продолжить торговлю фьючерсами, я:

пока не до конца понимаю правила и риски, связанные с торговлей фьючерсами, и еще не совсем готов(а) торговать ими. Мне стоит получить больше базовых знаний о торговле фьючерсами.

понимаю все правила и риски и соглашаюсь с тем, что я лично несу ответственность за любые убытки, которые могут возникнуть при торговле фьючерсами, и платформа не несет за них ответственности.

пока не до конца понимаю правила и риски, связанные с торговлей фьючерсами, и еще не совсем готов(а) торговать ими, но я точно смогу получить прибыль, если буду

9.Сетевые задержки, системные сбои и другие факторы могут вызвать перебои или отклонения в работе сервисов Binance Futures. Binance приложит разумные усилия, чтобы система Binance Futures работала эффективно, но не гарантирует этого. Binance не несет ответственности за любой ущерб или убытки, понесенные в связи с вышеуказанными факторами.

Да, всё верно.

Нет, это не так.

10.Прибыли и убытки (PnL) на Binance Futures рассчитываются следующим образом:

Торговля фьючерсами принесет только прибыль без каких-либо убытков.

Нереализованные прибыли и убытки, прибыли и убытки по моим ордерам.

После закрытия позиции фактическая прибыль или убыток рассчитываются на основе цены открытия и цены закрытия.

11.Если вы продолжаете совершать ошибки при торговле, вам необходимо:

Попробуйте повторить операцию еще раз.

Проверьте сеть и сохраните необходимую информацию для службы поддержки.

Будете следовать советам пользователей в интернете или группе.

12.Комиссия по фьючерсным контрактам рассчитывается следующим образом:

Как и на спотовом рынке, взимается только комиссия за транзакцию.

Помимо комиссии за сам ордер, добавляются инвестиционные расходы и расходы на ликвидацию.

Как и при P2P-торговле, взимается только комиссия за транзакцию.

13.Какая валюта может использоваться в качестве маржи при торговле фьючерсами COIN-Margin?

Валюта USDT-margined кошелька.

Валюта соответствующего фьючерса.

Валюта Coin-margined кошелька.

14.Если обслуживание Binance Futures прерывается по каким-либо причинам, вы можете использовать функцию «Закрыть все позиции», чтобы отменить все ордера и закрыть все открытые позиции. Из-за разного рода факторов, которые нельзя спрогнозировать, результат использования этой функции может не соответствовать вашим ожиданиям. Binance не несет ответственности за любой ущерб или убытки, понесенные в связи с вышеуказанными факторами.

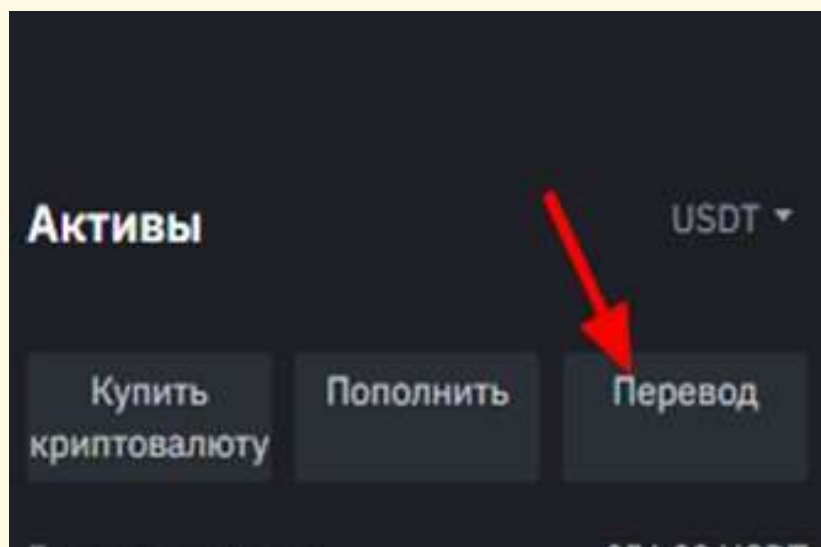
Да, всё верно.

Нет, это не так.

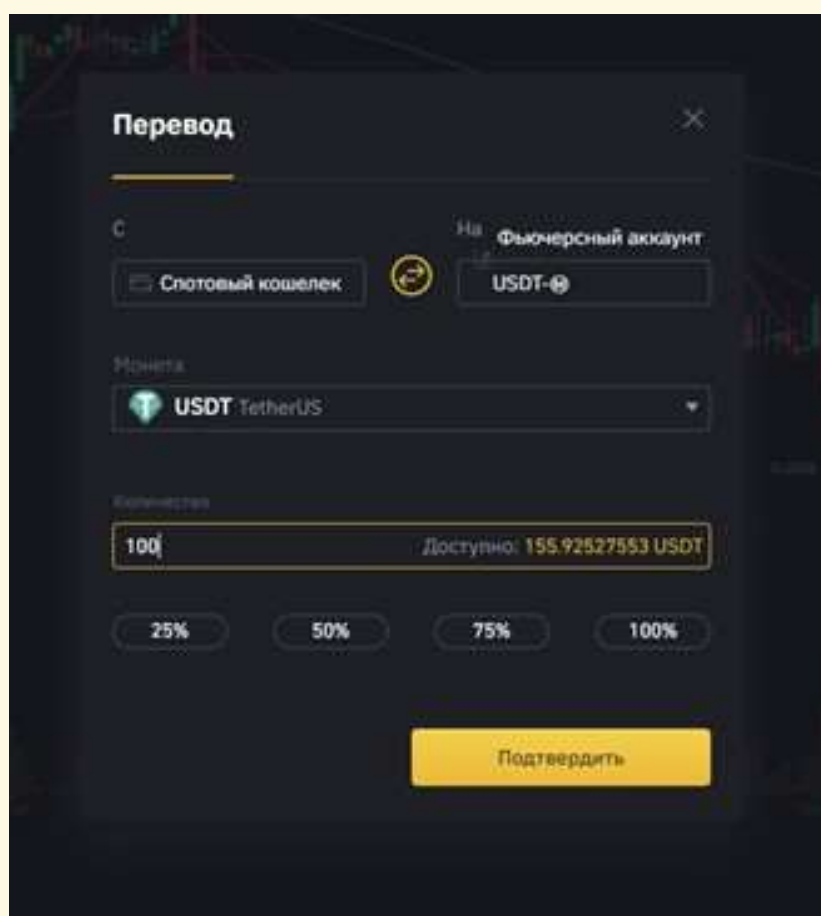
После ответов на вопросы нажмите на кнопку Trade Futures. Если вы ответили на все вопросы верно, интерфейс фьючерсной торговли будет активирован.

Приступим к пополнению фьючерсного счета:

Для начала торговли фьючерсами необходимо перевести желаемую сумму USDT со своего спот-аккаунта на фьючерсный. За переводы USDT между этими счетами комиссия биржей Binance не взимается ! Для этого нажмите кнопку Перевод в меню справа.



В открывшемся окне перевода активов между счетами введите желаемую сумму и нажмите "Подтвердить".



Если все сделали верно, то можем приступать к торговле.
Наглядно о торговле вы увидите в видео уроках. А сейчас поговорим об основных понятиях по фьючерсами.

И так разберём, что такое открыть позицию !

Открыть позицию – означает приобрести фьючерс на повышение или понижение цены определенного объема актива.

Закрыть позицию –соответственно реализовать фьючерс, получив прибыль или убыток.

Обратимся к фьючерсному калькулятору Binance, выставив соответствующие параметры: тип позиции (шорт или лонг), цена входа (цена при открытии позиции), цена выхода (при закрытии), 1х – плечо. Интересующий нас результат – PNL (она же прибыль и же убыток).

The screenshot shows the Binance futures calculator interface. The 'Long' tab is selected. The 'Leverage' is set to 1x. The 'Entry Price' is 10000 USDT, and the 'Exit Price' is 12000 USDT. The 'Quantity' is 1 BTC. The 'Calculate' button is highlighted in yellow. The 'Result' section shows: Initial Margin: 10,000.00 USDT, PNL: 2,000.00 USDT, and ROE: 20.00 %.

PNL	Целевая цена	Цена ликвидации	Макс. открытие	Цена открыт	
Long					
1x	25x	50x	75x	100x	125x
Цена входа	10000 USDT				
Цена выхода	12000 USDT				
Количество	1 BTC				
Рассчитать					
Результат					
Начальная маржа		10,000.00 USDT			
PNL		2,000.00 USDT			
ROE		20.00 %			

!Расчет прибыли для позиции лонг

The screenshot shows the Binance futures calculator interface. The 'Short' tab is selected. The 'Leverage' is set to 1x. The 'Entry Price' is 10000 USDT, and the 'Exit Price' is 8000 USDT. The 'Quantity' is 1 BTC. The 'Calculate' button is highlighted in yellow. The 'Result' section shows: Initial Margin: 10,000.00 USDT, PNL: 2,000.00 USDT, and ROE: 20.00 %.

PNL	Целевая цена	Цена ликвидации	Макс. открытие	Цена открыт	
Long					Short
1x	25x	50x	75x	100x	125x
Цена входа	10000 USDT				
Цена выхода	8000 USDT				
Количество	1 BTC				
Рассчитать					
Результат					
Начальная маржа		10,000.00 USDT			
PNL		2,000.00 USDT			
ROE		20.00 %			

!Расчет прибыли для позиции шорт

П Л Е Ч О

Плечо, или лeverадж (англ. leverage) –увеличение размера позиции за счет заемных средств, предоставляемых биржей трейдеру под проценты. Плечо обозначается множителем, например, 10х означает, что размер используемых при открытии средств может быть в 10 раз больше, чем имеющихся у трейдера. То есть, к используемым \$100 будет добавлено еще \$900 кредитных, чтобы итоговый объем составил $\$100 \times 10 = \1000 . Эта формула проста и не требует калькулятора Binance, хотя возможность расчета в нем имеется. Поскольку позиция открывается по активу, трейдеру может быть необходимо рассчитать ее размер в активе, по текущей или не круглой цене, типа \$11.256. Пример расчета объема позиции 20х с \$500 баланса:

Скриншот интерфейса Binance, иллюстрирующий расчет позиции с плечом 20х. Визуально представлены следующие элементы:

- Выбор валютной пары: BTC/USDT.
- Выбор направления: Лонг (Long).
- Выбор плеча: 20x.
- Введенная цена входа: 10000 USDT.
- Текущий баланс: 500 USDT.
- Результат расчета: Макс. открытие (BTC) – 1, Макс. открытие (USDT) – 10000.00.
- Примечание: * Открытый убыток не будет применяться во внимание при расчете максимальной суммы открытия.

!Расчет открытия с плечом 20х :

Основным достоинством торговли с плечом является конечно же возможность торговать за счет небольшого баланса, получая при этом прибыль, многократно увеличенную с помощью заемного рычага (плеча).

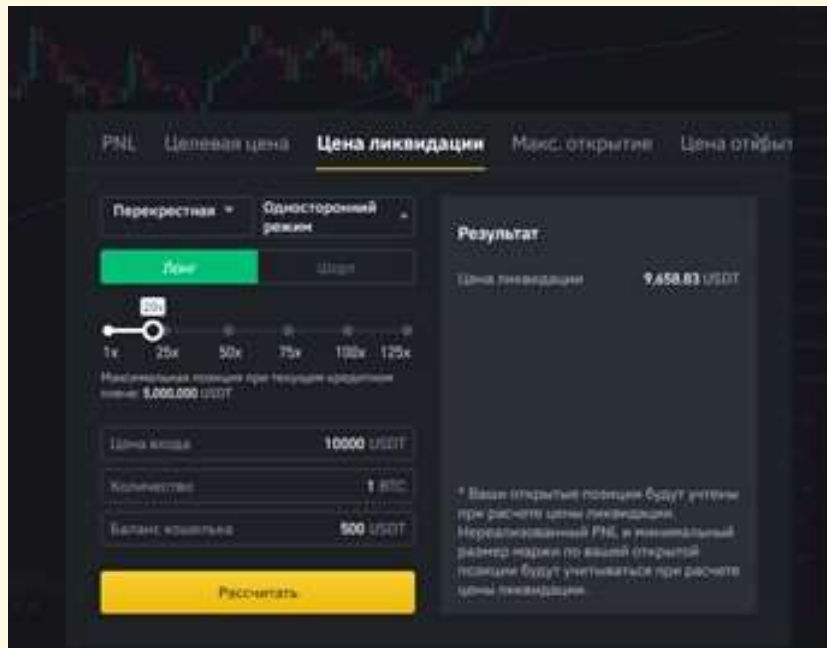
Цена ликвидации

Пожалуй один из важнейших аспектов, именно из-за него сделки ликвидируются и мы теряем наши средства, поэтому все внимание !!!

Цена ликвидации –уровень цены, при достижении которого позиция трейдера автоматически ликвидируется и он теряет свои средства. Ликвидация происходит, если цена начинает двигаться в противоположном ожидаемому направлению относительно цены входа, то есть вниз при позиции лонг и вверх при позиции шорт.

Механизм ликвидации работает автоматически, защищая кредитные средства биржи, предоставленные для плеча, как только собственные средства трейдера становятся недостаточными для покрытия убытка из-за движения цены в обратном направлении.

Чем больше плечо, тем ближе цена ликвидации к входной цене. Рассмотрим снова фьючерсный калькулятор Binance, рассчитав цену ликвидации для позиции лонг 1 BTC 20x при использовании минимально необходимых для открытия позиции \$500:



!Расчет цены ликвидации на калькуляторе Binance Futures

Как видим, при отклонении цены всего лишь до \$9.658 (менее чем на -5%) произойдет ликвидация позиции и все \$500 будут потеряны. С учетом большой волатильности, такая ситуация весьма вероятна.

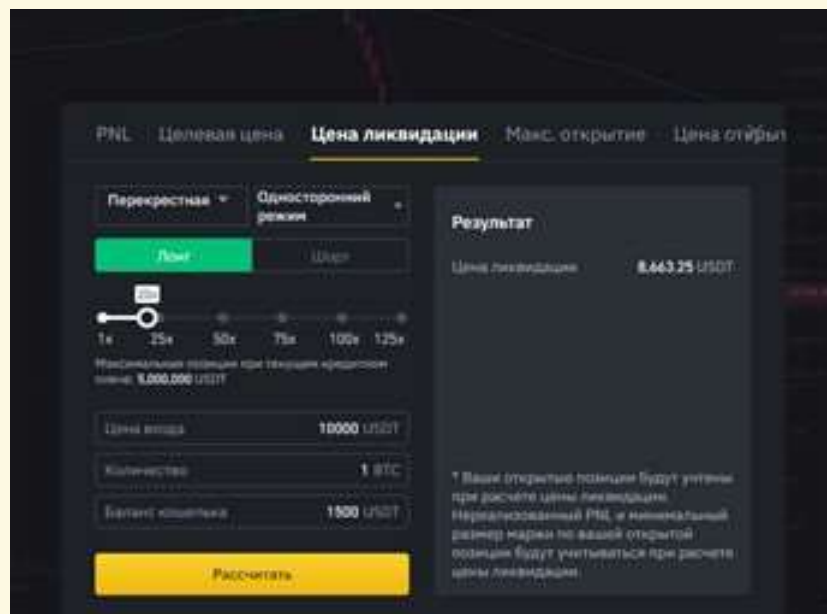
Маржа

Итак мы подошли к марже.

Маржа - этот термин обозначает не прибыль, как может подумать неискушенный в терминах читатель, а маржинальное обеспечение (Margin) фьючерсной торговли.

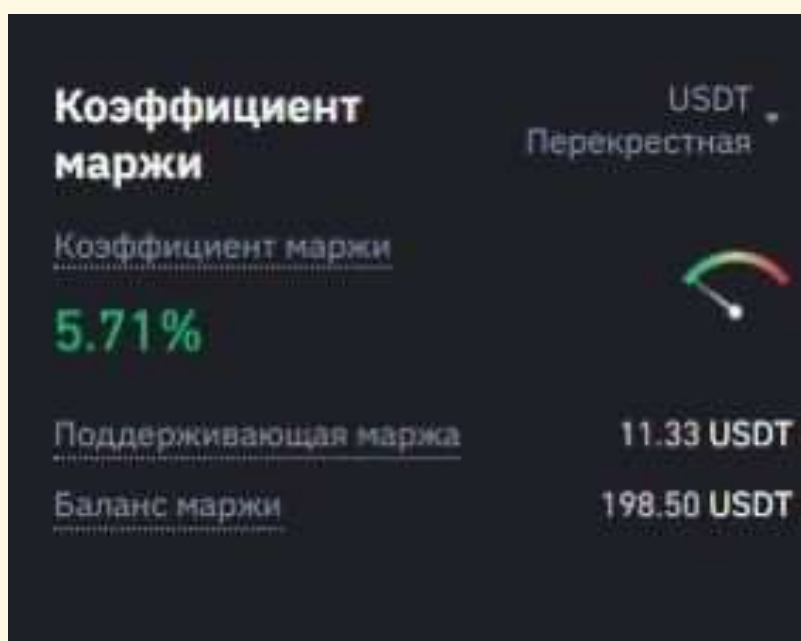
Главное назначение маржи - обеспечить функционирование позиции при смещении цены в "неправильном" направлении и не допустить ликвидации. Наблюдение за маржей - важная задача трейдера, имеющего открытую позицию.

Рассмотрим предыдущий пример - позиция лонг 1 BTC 20x использует \$500 долларов для открытия на цене 10.000, но при этом у трейдера имеется запас средств и используется объем кошелька в размере \$1500 в качестве маржинального обеспечения:



Цена ликвидации составляет теперь \$8.663, в то время как при балансе \$500 она составляла всего лишь \$9.658. Такое резкое падение цены возможно с гораздо меньшей вероятностью и имеет запас для разворота цены в правильном направлении.

Перекрестная (Cross) маржа - это маржа, которая предполагает "совместное" использование фьючерсного кошелька для поддержания всех открытых позиций. Кросс-маржа распределяется по позициям с использованием полной суммы средств в доступном балансе, что снижает риск ликвидации убыточной позиции. Трейдер имеет меньше контроля за ее распределением по позициям, но с другой стороны, любая доступная прибыль из "удачной" позиции автоматически пополняет маржу для "неудачной", производя тем самым определенное хеджирование. Текущее состояние маржи отслеживается по состоянию двух показателей - "Поддерживающая маржа" и "Баланс маржи":



Поддерживающая маржа - минимальная сумма маржи на балансе для сохранения текущей позиции или позиций (в режиме кросс-маржи).

Изолированная маржа (Isolated) - это маржа, которая отводится трейдером индивидуально для каждой позиции. Таким образом, этот режим маржи имеет более высокий риск ликвидации, но и максимальный убыток ограничен фиксированной суммой обеспечения для конкретной позиции, а не всем кошельком.

Торговля криптовалютой и как можно зарабатывать от 100\$ в день!

Торговля криптовалютами – один из ответов на вопрос, как зарабатывать деньги с помощью криптовалюты. Хотя среднесуточный объем сделок с криптовалютами составляет всего 1% от валютного рынка, на крипторынке наблюдается большая волатильность. Таким образом, есть потенциал для краткосрочных сделок.

Часто задаваемые вопросы о торговле криптовалютами
Ниже приведены некоторые часто задаваемые вопросы о торговле криптовалютой, которые могут оказаться полезными.

Какая криптовалюта лучше всего подходит для торговли?

Очень волатильная и изменчивая природа криптовалют означает, что любые общие заявления о "лучшем" и "худшем", вероятно, устареют в течение нескольких месяцев.

Однако простой способ решить, является ли данная криптовалюта хорошим кандидатом для торговли, – это выяснить, обладает ли она высокой ликвидностью (с ней связано много фиатной валюты, часто выражаемой как "рыночная капитализация) и высоким объемом торгов (ею торгует много людей).

Как правило, эти цифры должны быть в районе нескольких сотен миллионов долларов США или более.

Какова ставка налога на торговлю криптовалютами?

Правительства по всему миру пытаются создать нормативно– правовую базу для криптовалют. В Соединенных Штатах юридическая классификация криптовалюты как ценных бумаг, товаров, валюты или имущества остается несколько неоднозначной. Тем не менее, Налоговое управление США (IRS) уже признает увеличение стоимости криптовалюты налогооблагаемой. Посетите их веб–сайт [здесь](#) или свяжитесь с агентством напрямую для получения дополнительной информации.

Каковы недостатки торговли криптовалютой?

Многие состояния были сделаны в криптовалюте, но важно всегда помнить, что многие, многие другие были потеряны. Обратной стороной беспрецедентных скачков цен на несколько сотен процентов является внезапное падение. Очень высокая волатильность цен на криптовалюту – палка о двух концах, и вы должны иметь это в виду. Получение убытков – это вопрос того, когда, а не если. Хорошая стратегия определит, является ли эта потеря разорительной или просто неудачной.

В дополнение к ценовым рискам, пространство криптовалют также представляет некоторые уникальные риски безопасности, которых нет на традиционных финансовых рынках. Нарушения безопасности на централизованных биржах криптовалют – это риски, которые вы должны понимать.

Наконец, торговые сборы могут быть довольно высокими, особенно для стратегий, в которых используется очень высокая частота транзакций. Важно понимать затраты на фактическое использование торговой платформы, прежде чем инвестировать в нее.

Перейдем к примерам торговли используя некоторые стратегии

Торговля от уровней поддержки и сопротивления

Уровни поддержки и сопротивления могут сигнализировать о том, куда движется цена актива, соответственно подсказывая трейдерам, открывать или закрывать позицию по конкретным активам.

Уровень поддержки – это цена актива, ниже которой он исторически не опускается. Могут быть краткосрочные уровни поддержки, а также исторические уровни поддержки, которые сохраняются годами. С другой стороны, уровень сопротивления – это цена бумаги, которую она исторически не может пробить. Позиционные трейдеры используют долгосрочные уровни сопротивления для закрытия позиций, если цена актива готова упасть после достижения этой точки.

Точно так же они могут закупиться на исторических уровнях поддержки, если ожидают, что в этой точке начинается долгосрочный тренд.

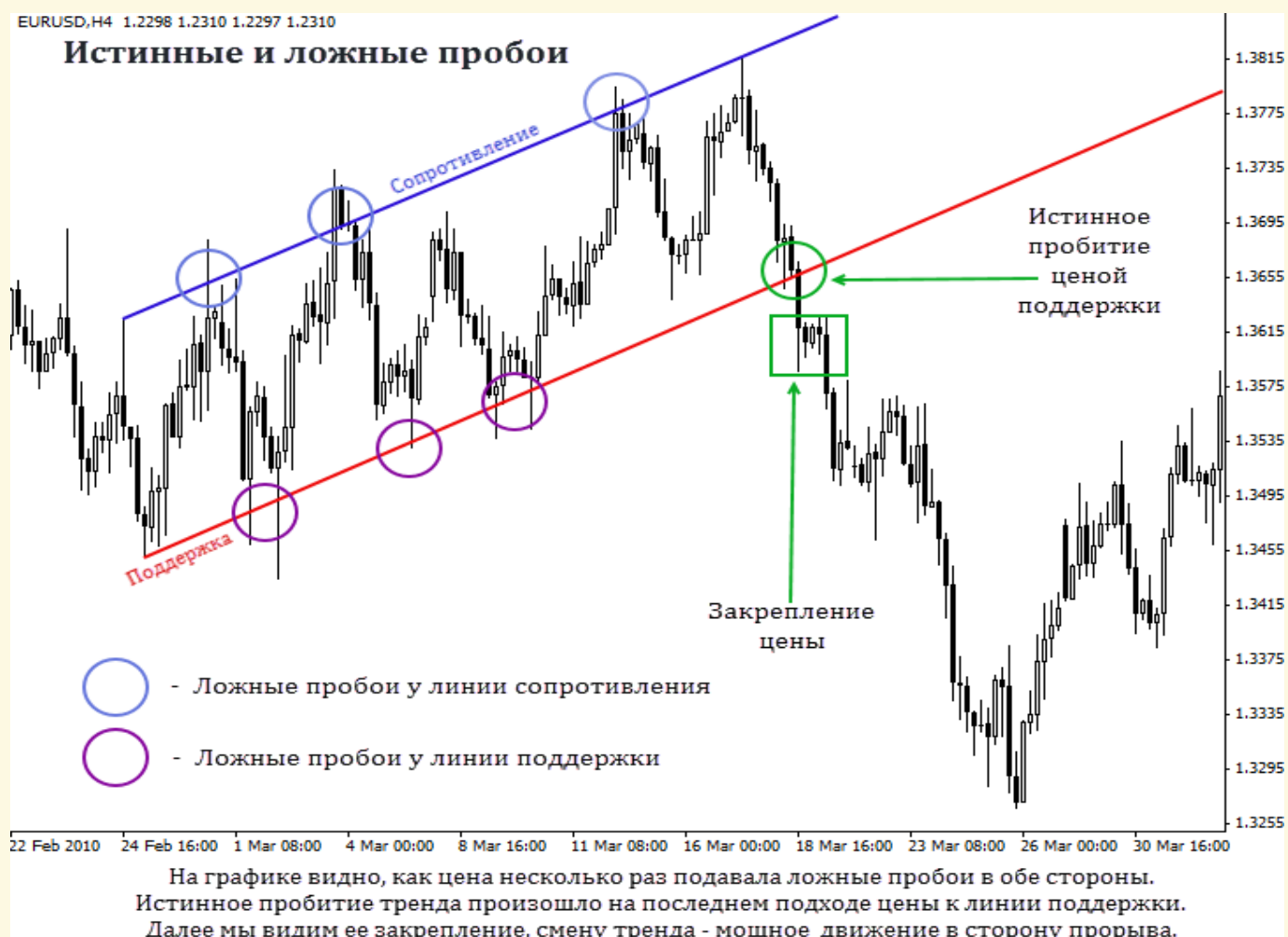


Как найти уровни поддержки и сопротивления
 Следует помнить, что уровни поддержки и сопротивления не являются точными числами.
 Часто вы видите уровень поддержки или сопротивления, который кажется пробитым, но вскоре понимаете, что рынок просто тестировал его.



Обратите внимание, как тени свечей протестировали сопротивление 15 тыс., которое ранее выступало в качестве поддержки.
 В те времена казалось, что цена “пробивает” поддержку. Оглядываясь назад, мы увидим, что цена просто тестировала этот уровень.

Если уровень поддержки – это цена, ниже которой актив не опускается, то уровень сопротивления – это ценовая точка, при которой акции не могут расти. Думайте об уровне поддержки как о полу, а об уровне сопротивления как о потолке.



Ложные прорывы – отличные торговые возможности. Одна из стратегий заключается в том, чтобы на самом деле дожидаться ложного прорыва и войти в рынок только после того, как он произойдет. Например, если тренд восходящий, а цена откатывается к поддержке, позвольте цене пробиться ниже уровня поддержки, а затем покупайте, когда она начнет подниматься выше уровня поддержки.

Аналогично, если тренд нисходящий, а цена отступает к сопротивлению, позвольте цене пробиться выше сопротивления, а затем открывайте короткие позиции, когда цена начнет опускаться ниже сопротивления.

Ценовой канал

Один из паттернов та, свидетельствующий о продолжении тренда. если наклон ценового канала направлен вниз, то он считается нисходящим (медвежьим), если же вверх — восходящим (бычьим).

Построение ценового канала

Чтобы построить восходящий торговый канал, нужно определить, где начинается трендовое движение. А затем по двум локальным последовательно повышающимся точкам минимума провести линию тренда. Такие точки будут называться опорными, а нарисованная линия — основной.

Следующий шаг — параллельно построенной линии спроецировать ещё одну линию тренда. Она должна проходить через локальный максимум — самую верхнюю точку, расположенную между двумя опорными.

Частным случаем ценового канала является паттерн «Прямоугольник», верхняя и нижняя линии которого горизонтальны.



У ценового канала есть основная линия тренда и линия самого канала. Первая строится по двум (как минимум) точкам, задающим угол наклона. При восходящем тренде основная линия по ценовым минимумам и служит цене поддержкой. При нисходящем тренде основная линия строится по последовательным максимумам, играя роль сопротивления.

С основной теорией мы разобрались, теперь как же можно зарабатывать от 100\$ в день?

Вот пример торговли уровней поддержки и сопротивления



Часто вы увидите сильную свечу, которая переходит на другую сторону вашего канала, что означает его потенциальный конец. И чем дольше длится канал, тем выше вероятность потенциального прорыва. Итак, как вы торгуете по стратегии прорыва канала?

При торговле по этой стратегии первое, на что следует обратить внимание, – это свеча прорыва. Если вы агрессивный трейдер, это четкий сигнал к торговле на прорыве. Вы покупаете или продаете при закрытии свечи прорыва.



Давайте подведем итоги и соберем то, что написано выше в конкретный алгоритм действий.

Сначала смотрим, движется ли цена на данный момент в рамках торгового канала.

- Определяем направление тренда/канала и обрисовываем его границы.
- Ждем, когда цена дойдет до одной из границ канала.
- Ждем пробоя или отбоя от уровня.
- Выставляем ордера.