

Инструкция инвестора в период экстремальной волатильности.

1. Тщательный учет и расчет имеющихся активов (деньги, ценные бумаги) и пассивов (долговые обязательства и необходимые выплаты)
2. На основании пункта 1. определение размера свободных денежных средств для работы на рынке акций;
3. На основании пункта 1. анализ состояния имеющегося портфеля ценных бумаг и принятие решений по статусу каждой из имеющихся позиций в 3-х возможных вариантах:
 - закрытие или сокращение с целью высвобождения денежных средств;
 - удержание без использования дополнительного ресурса с целью усиления;
 - удержание и усиление с использованием имеющегося свободного ресурса;
4. На основании пунктов 2. и 3. планирование и распределение капитала для формирования новых позиций;
5. На основании используемой торговой стратегии определение конкретных инструментов, которые будут включены в портфель;
6. На основании используемой торговой стратегии выстраивание процесса формирования новых позиций;
7. Учет наличия многообразия возможных сценариев развития рыночной ситуации и выработка алгоритма действий для каждого из них.
8. Если торговая стратегия предполагает использование стоп-лоссов, неукоснительное выставление для этих целей соответствующих стоп-заявок с учетом фактора экстремальной волатильности.
В частности, существенное расширение размера защитного спреда, а также необходимо предусматривать возможность открытия новой торговой сессии с существенным гэпом;
9. Сведение к минимуму использования заемного ресурса или полный отказ от него. Для любых позиций с использованием заемного ресурса выставление стоп-лоссов обязательно.
10. Не фиксировать внимание на промежуточных финансовых результатах (результатах дня, недели), т.к. в период экстремальной волатильности оценка состояния брокерского счета может меняться на несколько % за торговую сессию.
11. Выдержка и спокойствие. Не поддаваться панике. Наоборот, использовать биржевую панику в своих интересах.