

# **Мой подход к трейдингу**

**Валеев Ренат**

**Конференция smart-lab 21.04.2018**

# О себе:

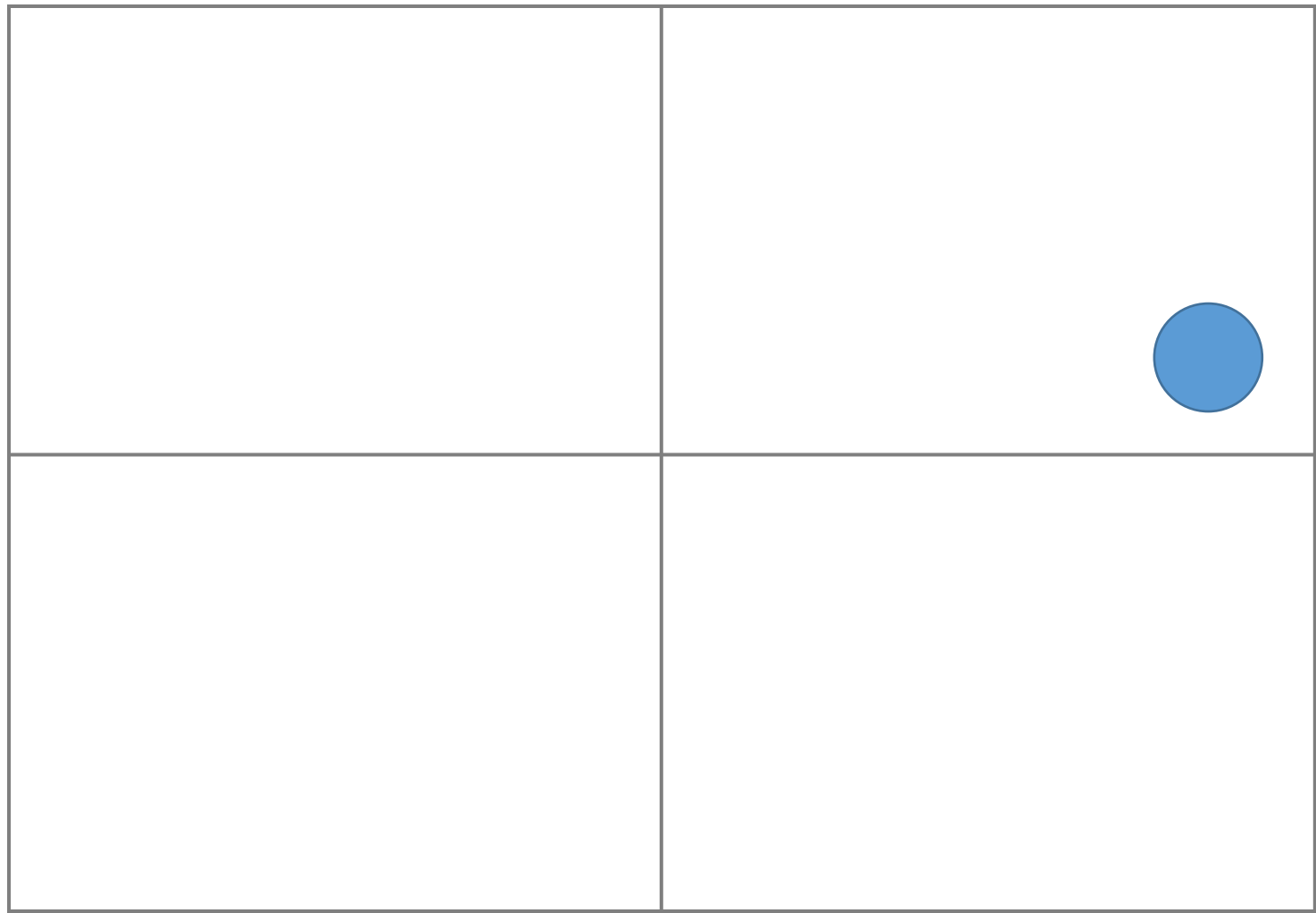
- Опыт торговли > 10 лет
- Акции, фьючерсы, опционы, Forex
- 2010 – аттестат ФСФР 1.0
- 2015 – CFA charter holder
- 2011-2016 – трейдер в ЦБРФ
- 2016 - ... - свой бизнес,

книга «Искусство трейдинга»



**Дискреционн  
ый**

**Системн  
ый**

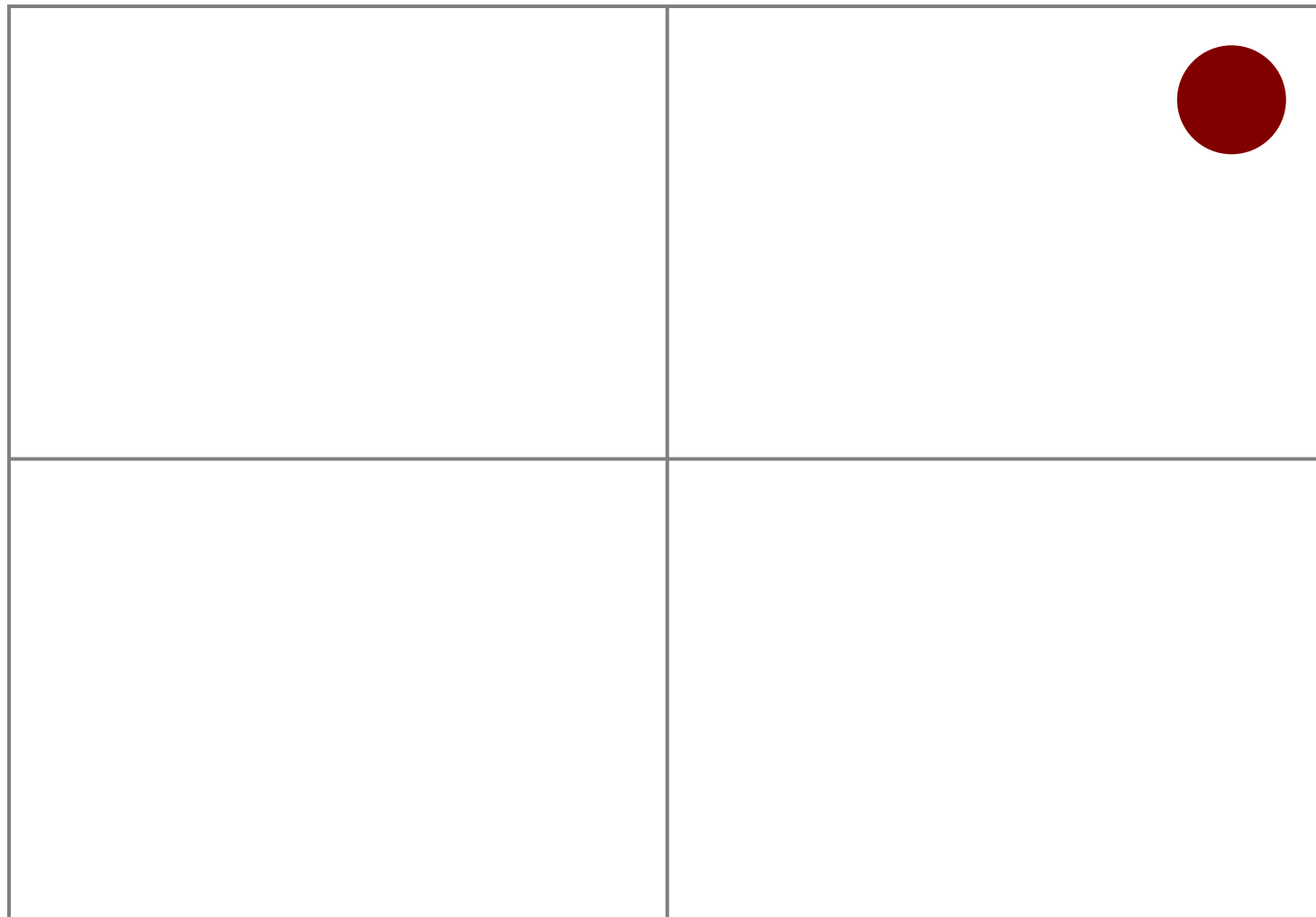


**Фундаментальн  
ый**

**Техническ  
ий**

**Агрессивн  
ый**

**Осторожн  
ый**



**Контртрендов  
ый**

**Трендов  
ый**

**Истина  
посередине**



**quantitative trading**

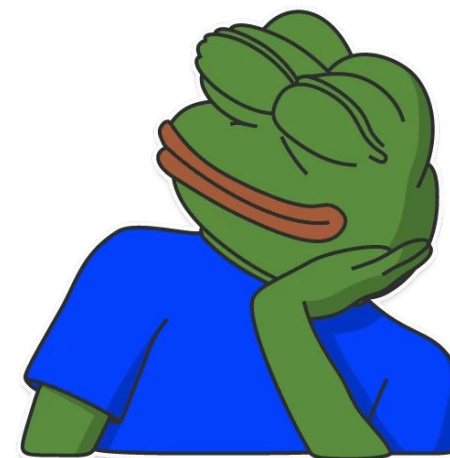
**Дискреционны  
й  
(интуитивный)  
трейдинг**

Т. Мартынов:

«Цель - последовательно в течение длительного периода времени генерировать максимальную прибыль при минимальных допустимых рисках»

Р. Валеев:

«Цель – заработать состояние»



# Как?

- а) имея капитал небольшой
- б) не привлекая чужие средства





# Есть два пути...

- blasstar\_no\_1:

$$\text{Profit} = \bar{P}_+ Q_+ - \bar{P}_- Q_-$$

Путь  
первый  
**Мой**  
**выбор!**

Путь  
второй

Задача – совершать редкие огромные по  
прибыли сделки:



- брать большое плечо
- сидеть в позиции долго

Результат: **потеря**  
**капитала**



**Цель – сделать состояние**



**Задача №1 – обеспечить  
сохранность капитала**

**Задача №2 –  
фантастическая  
доходность**

**=> pyramiding**



**capital = 10 000 \$**  
**stop-loss = 0.0040**

**take-profit**



+32 (64)

+16 (32)

+8 (16)

+4 (8)

+2 (4)

+1 (2)

buy +1 (1)

**+ 50 800 \$ net profit**  
**капитал увеличен в 6 раз**

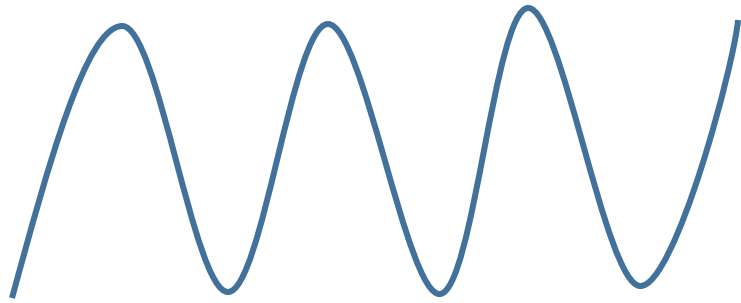
При ограниченном  
риске!

# Пирамидились:

- Джесси Ливермор
- Николас Дарвас  
(How I made \$ 2 000 000 in the Stock Market)
- Bull

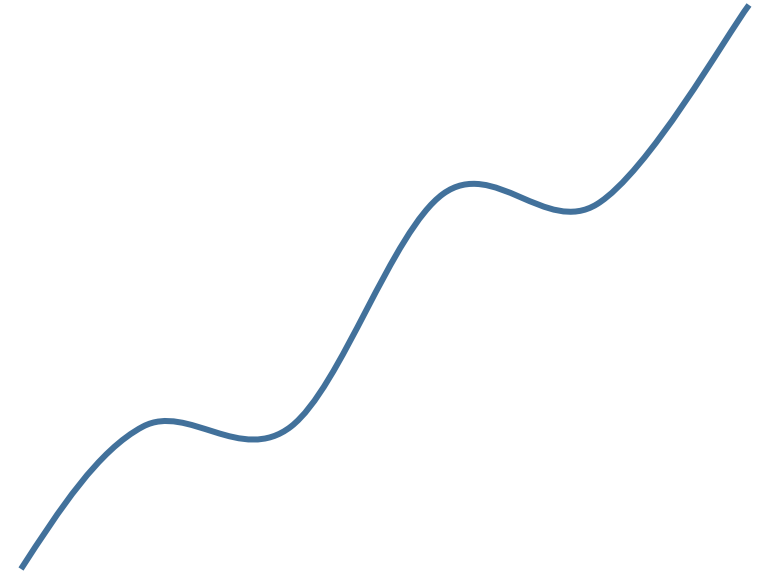


# Стратегия работает только на трендовом рынке



Я: -\$\$\$

Трейдер N: +\$ или  
-\$



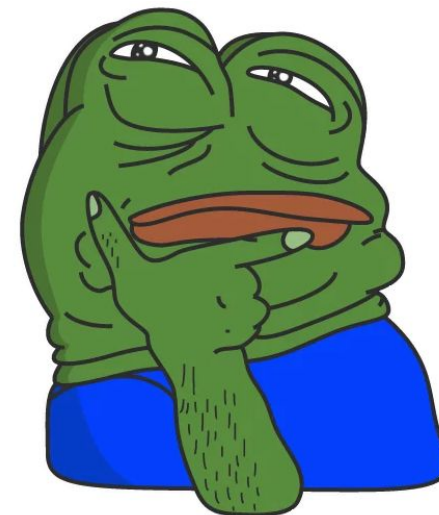
Я: +\$\$\$\$\$

Трейдер N: +\$\$

Задача – поймать сильный тренд

**Как  
?**

Обратимся к  
истории...









**Присоединение Крыма**

**Ввод санкций**

**Сбивают самолёт над Украиной.**

# Как поймать сильный тренд

Способ №1 – кардинальная смена фундаментальной обстановки:

- Решения центральных банков
- Геополитический «шок»

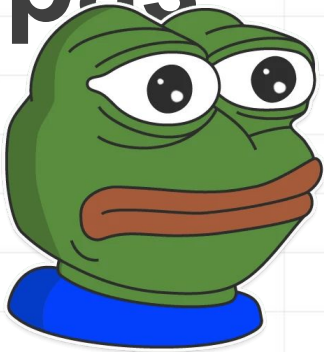
**2003 – 2018:**

**рост в 153 раза**

**CAGR = около 40%**



# 2016 – 2017: Рост почти в 50 раз



# Как поймать сильный тренд

**Способ №2 – расширять список инструментов:**

- «Модные» технологичные акции (APPLE, Google)
- Рождение новых финансовых инструментов (Bitcoin)

# Как поймать сильный тренд

## Способ №3 – технический:

Каждое движение на рынке происходит в результате

- а) открытия новых позиций
- б) закрытия старых позиций
- в) того и другого**

**Если а) и б) протекают  
одновременно  
в сжатый период времени**

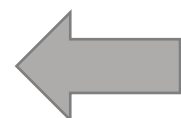
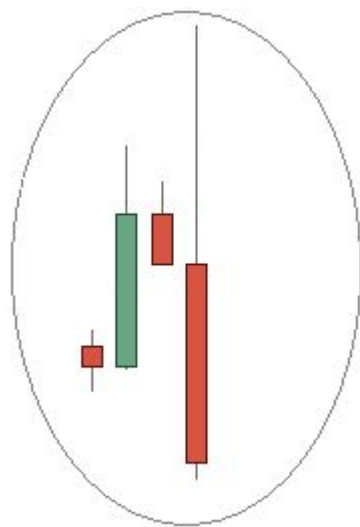


**сильное  
движение**



# Как поймать сильный тренд

Мощнейшие движения происходят в результате «контратак»



**одновременно**  
закрывают старые позиции  
и открывают новые!





ROUND 01





↑ Trump wins

↑  
Свеча в  
зоне  
поддержки

# GBPUSD 4H timeframe



До 1.4350...  
(8 фигур!)

В зоне поддержки!



**Классический  
тех. анализ**  
(тренды, уровни)

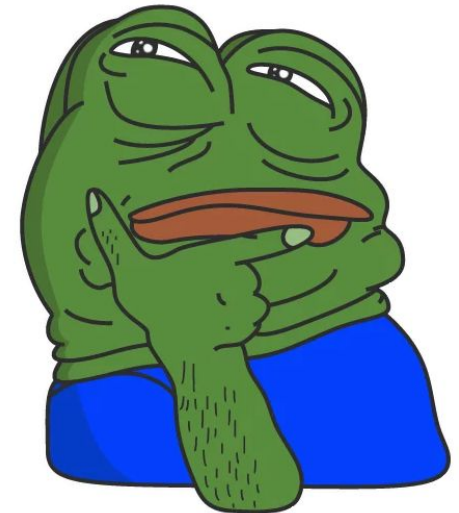
**TRADE** **Японские свечи**  
**HERE** (pin-bar, свечи поглощения,  
momentum candles)

~~Компьютерные  
индикаторы~~

# Управление рисками

Господствующая парадигма трейдинга:

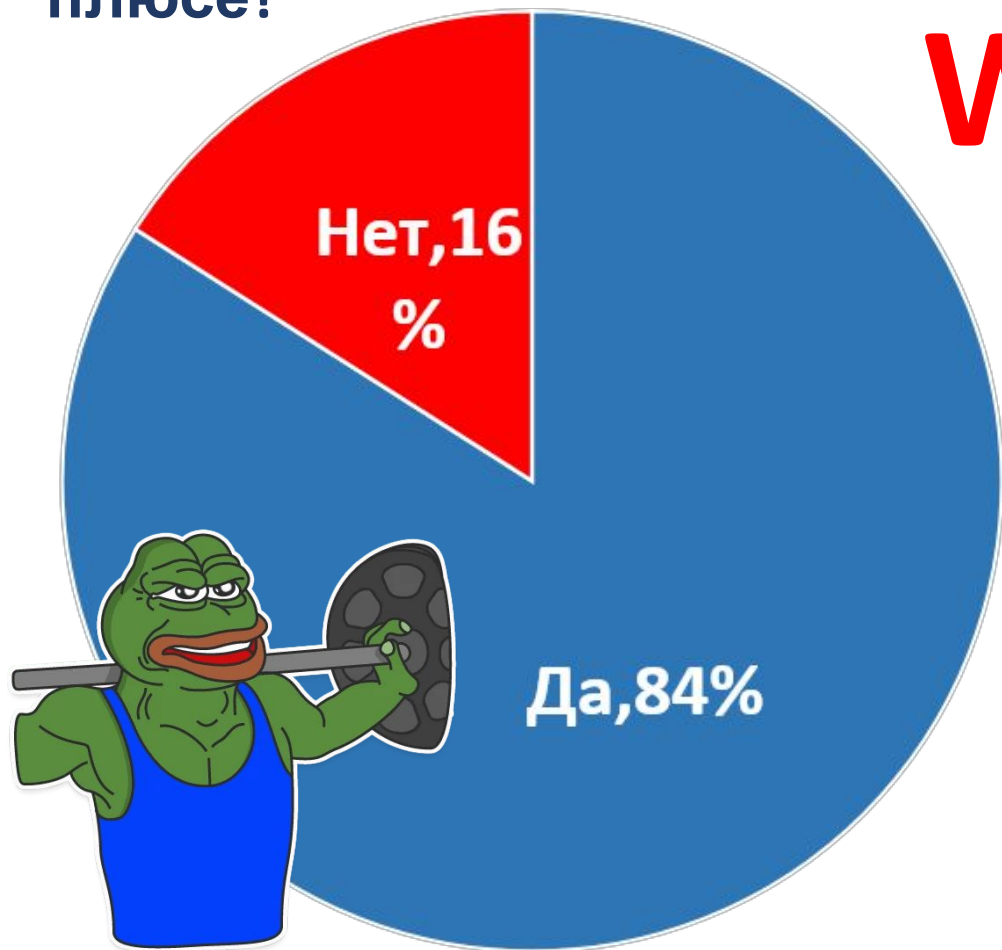
«Контролируй себя путем четкого следования торговой системе, соблюдай правила управления рисками, и прибыль придёт»



# Ожидания vs. реальность

Можете ли Вы ежемесячно быть в плюсе?

WNYU?



По факту



## Overconfidence:

систематическая переоценка собственных способностей,

«Я не такой как все!»

**Правда в том, что контролировать себя невозможно! Это иллюзия**

**Вопрос лишь в том, сколько денег  
Вы успеете вывести с рынка**



**Цикл** – период с начала пополнения торгового счёта до

а) потери средств

б) вывода средств

в) длительного перерыва

Жизнь – это тоже цикл. Рано или поздно наступит конец!

**=> Держите на рынке ограниченную сумму**

**=> Вкладывайте прибыль в материальные активы**

# Подводя итог

## **Основная задача трейдера:**

1. Поймать тренд (есть 3 способа...)
2. Запирамидиться
3. Вывести прибыль с рынка до потери контроля
4. Вложить деньги в материальный актив

Повторить пункты 1-4

Берегите здоровье и не забывайте  
ЖИТЬ!

Спасиб

nick (smart-lab): Neonmouse

