

Урок: Психология в трейдинге. Риск-менеджмент и Мани-менеджмент



Bitcoin / TetherUS · 1Д · BINANCE ОТКР40862.46 МАКС41199.99 МИН39853.86 ЗАКР40546.43 -316.03 (-0.77%)

40550.54 0.01 40550.55

Объем 29.77K



Как использовать психологию толпы в своем трейдинге

- 1. На шаг впереди толпы.** Лучше всего заходить в рынок перед самым началом импульсного роста. Для этого, во время этапа накопления, нужно отследить момент, когда диапазон цен будет достаточно узким.
- 2. Вместе с толпой.** Пока цена только начинает разгонное движение, не упускайте возможность открыть сделки в общем направлении.
- 3. Не гнаться за толпой.** Если цена уже ушла далеко вверх, а Вы остались вне позиции, не спешите входить в рынок, дождитесь отката и снижения. Рынок еще даст вам заработать.

Что такое ФОМО?

ФОМО (Fear of missing out) - синдром упущенной выгоды, проще говоря, это навязчивая боязнь, пропустить хорошую возможность получить прибыль. Также, оно проявляется, как чувство сожаления, когда была упущена возможность открыть выгодную сделку. ФОМО, как правило, приводит к принятию нерациональных решений, таких как покупка актива на пике цены, когда рынок уже готовится к развороту.

Признаки ФОМО:

- Постоянная боязнь пропустить важные события на рынке
- Желание открыть сделку при каждом резком движении цены
- Сильное сожаление о каждой упущенной возможности заработать
- Убеждение, что “всем везет, кроме меня”
- Чувство сильного дискомфорта, когда нет доступа к бирже

Риск-менеджмент (PM, управление рисками) - это процесс принятия и выполнения важных решений, направленных на снижение вероятности возникновения негативных событий и минимизацию возможных потерь, из-за них.

Включает:

- определение размера позиции
- уровней фиксации прибыли
- установку уровней стоп-ордеров

Почему трейдеры часто игнорируют риск-менеджмент?

- Многие считают что способны перехитрить рынок.
- Психологически людям сложно смириться с потерями и они предпочитают не фиксировать их.
- Игра на бирже, как в казино, при отсутствии понимания работы рынка.

Мани-менеджмент. Как управлять своим капиталом?

Мани-менеджмент - это финансовая стратегия по управлению капиталом трейдера, для его сохранения и приумножения.

Включает:

- определение размера торгового депозита
- размера позиции
- способов хеджирования рисков

Как рассчитать размер позиции

Никогда не торгуйте на весь депозит! Опасность торговли при бесконтрольном использовании капитала заключается в том, что если убытки увеличиваются в арифметической прогрессии, то сумма прибыли, которая нужна для их покрытия, растит в геометрической прогрессии. Например, при сливе 50% депозита нужно заработать 100% прибыли от оставшейся суммы депозита, чтобы **выйти в ноль**. Следует торговать суммой не больше, чем 25% от депозита.

Как правильно определить уровень Stop-loss

Осторожный - при этом подходе, процент риска по одной сделке не должен превышать 1% от размера позиции.

Стандартный - самый популярный подход, при котором процент риска по одной сделке не должен превышать 2% от размера позиции.

Агрессивный - этот высокорисковый подход используется, как правило в долгосрочной торговле, или в тех редких случаях, когда есть условия для наиболее точного прогноза движения цены. В этом случае, процент риска по одной сделке может быть повышен до 5-10% от размера позиции.

Ошибки новичков при работе со Стоп-ордерами:

- Слишком короткий, или наоборот, слишком длинный Стоп
- Установка Стопа не по стратегии риск-менеджмента
- Не учитывание при расположении Стопа важных ценовых уровней, таких как уровни поддержки и сопротивления, трендовые линии и т.д.

Расчет уровня Stop-loss:

Когда нам уже известен размер допустимого риска, мы можем определить уровень на котором будет установлен Stop-loss на графике. Он рассчитывается по следующей формуле:

Цена входа * (Размер позиции - Размер риска) / Размер позиции

Например, при условиях:

Цена входа - 38264

Размер депозита - \$1000

Процент риска - 2%

Наша формула будет выглядеть так:

$$38264 * (1000 - 20) / 1000 = 37498,72$$

В итоге, мы должны установить Стоп-лосс на уровне - 37498,72.

Как правильно определять уровни фиксации прибыли

Пример фиксации прибыли частями:

1. По достижению ценой уровня Тейк-профит 1, фиксируем 25% прибыли.
2. По достижению ценой уровня Тейк-профит 2, фиксируем 50% прибыли.
3. По достижению ценой уровня Тейк-профит 3, фиксируем оставшуюся прибыль.

Что такое хеджирование рисков?

Хеджирование - страхование рисков изменения цены в сторону противоположную открытой позиции. Для этого используется открытие позиций противоположных позиций на одном рынке или открытие на одном из рынков позиции в противоположном направлении с целью компенсации потенциальных рисков по позиции на другом рынке.

Способы хеджирования рисков:

1. Открытие разнонаправленных позиций по одному и тому же активу по одной цене
2. Открытие разнонаправленных позиций по одному и тому же активу по разным ценам.



Обратная сторона хеджирования:

1. Хеджирование это не гарантия сохранения средств. Это лишь инструмент, способствующий сокращению рисков, но ликвидировать их на 100% с помощью хеджирования невозможно. Поэтому нужно не забывать о традиционных способах минимизации убытков, таких как Стоп-лосс и Усреднение позиций.

2. Процесс хеджирования требует заморозки большего объема средств, ведь трейдер удерживает две позиции, соответственно и расходы на них вдвое больше. Поэтому хеджирование также должно находиться в рамках мани-менеджмента.

3. При частом и удачном использовании хеджирования у трейдера формируется психологическая ловушка, которая заключается в ложном ощущении безопасности и беспроеигрышности позиций.

4. Техники хеджирования рисков требуют наличия большого опыта в биржевой торговле.