



Основные правила прибыльной торговли

РОМАН АНДРЕЕВ

ГЛАВНЫЙ ВРАГ ТРЕЙДЕРА – ОН САМ. ОСНОВНЫЕ ПСИХОЛОГИЧЕСКИЕ ОШИБКИ ИГРОКА

- Основная ошибка всех игроков – надежда на быстрое обогащение и как следствие – выбор самой активной модели торговли – интрадей.
- «Пересиживание» убытков и ограничение прибыли
- Отсутствие стопов
- Попытки догнать рынок
- Попытки отбить рано закрытые трендовые позиции контртрендом
- Эмоциональный трейдинг
- Постоянное желание торговать
- Неприятие убытков и попытки сразу отыгаться

ПОДГОТОВКА К ТОРГОВЛЕ. СОСТАВЛЯЕМ ТОРГОВЫЙ ПЛАН.

- Намечайте уровни, по которым будете входить в сделку и выходить из нее до открытия рынка и взятия позиции. Как правило в это время Вы видите рынок наиболее непредвзято.
- Когда входите в позицию, все дальнейшие движения рынка видятся вам сквозь призму вашей позиции и отличаются от реальности
- Характер движения к уровню может заставить вас изменить свою тактику хотя утром Вы железно планировали заходить по нему.

АНАЛИЗИРУЕМ СВОИ СДЕЛКИ

Разобрав свои сделки за день и сопоставив их с торговым планом, вы (с высокой вероятностью) поймете:

- что большинство убыточных сделок было вне торгового плана;
- что вы не вошли в потенциально прибыльные и запланированные сделки, потому что было страшно, хотя именно тогда сделки получаются самыми прибыльными.

Запоминайте эти моменты и на следующий день постарайтесь совершить меньше незапланированных сделок и больше запланированных

Не пересиживайте убыток. Выходите по стопу. Всегда проще зайти заново, если рынок развернулся в Вашу сторону, и поставить новый стоп. Если выбьет и его – значит уровень выбран неверно.

ДИВЕРСИФИЦИРУЕМ ТОРГОВЛЮ ПО СТРУКТУРЕ АКТИВОВ И ВРЕМЕНИ УДЕРЖАНИЯ ПОЗИЦИИ

- два типа позиций: среднесрок и интрадей
- для интрадея больше подходят фьючерсы
- для среднесрока – облигации, компании роста и дивидендные истории
- для каждого из видов торговли лучше выделить отдельный счет (субсчет)
- анализируйте свою деятельность по обоим счетам увеличивая долю в портфеле того счета, что показывает лучшую динамику

ПОЧЕМУ ТОРГОВАТЬ «СРЕДНЕСРОК» ЛУЧШЕ, ЧЕМ «КРАТКОСРОК»

- рынок более трендовый
- меньше рыночного шума (не слишком высокая волатильность)
- возможность взять большое движение при сравнительно небольшом стопе
- меньше нервов и отвлечения на рынок от основной работы
- по статистике долгосрочный инвестор почти всегда более выигрышен
- дивиденды как дополнительный плюс

ПОЧЕМУ ТОРГОВАТЬ «СРЕДНЕСРОК» ЛУЧШЕ, ЧЕМ «КРАТКОСРОК»

Минусы:

- трудно высидеть цели
- тяжело мириться с большими откатами (надо уметь с этим бороться)
- можно войти в рынок в начале цикла падения.
- можно нарваться на форсмажор

- Не торгуйте с плечами
- Всегда имейте лимит на каждый инструмент
- ведите статистику сделок по инструменту
- меняйте лимиты на инструмент согласно его статистике
- не «вбухивайте» в 1 инструмент более 50% депо
- Не торгуйте кучей инструментов - растет энтропия

РИСК И ТАЙММЕНЕДЖМЕНТ

- Всегда ставьте стопы.

Стопы выбивает у тех, кто не правильно их ставит.

Отсутствие стопов может сделать из спекулянта долгосрочного инвестора.

Присутствие стопов учит человека понимать рынок лучше, чем любая книжка.

Не ставьте стопы заранее, старайтесь закрыть сделку руками.

Соотношение риск-прибыль годится только для системы с МО близком к нулю

PANIC BUY И PANIC SELL, ИЛИ ТОРГОВЛЯ ДЛЯ ЛЕНИВЫХ

Как правило, все крупные тренды начинаются/заканчиваются паническими распродажами.

Основные признаки:

- пробой сильного дневного\недельного фрактала;
- падение на пике снижения от 4 до 10%;
- большинство игроков даже не думают о покупках, кажется, что все пропало и падение будет только продолжаться;
- соответствующий новостной фон и комментарии аналитиков;
- в конце дня (на следующий день) рынок отыгрывает большую часть снижения;
- высокие объемы торгов.

PANIC BUY И PANIC SELL, ИЛИ ТОРГОВЛЯ ДЛЯ ЛЕНИВЫХ

Даже если вы не нашли в себе сил зайти в рынок на черной свечке, разворот почти всегда идет «неудавшимся размахом», т.е. после излета импульса роста обычно идет сильный откат вниз, на котором можно заходить.

PANIC SELL

Published on Investing.com, 3/Mar/2016 - 9:52:51 GMT, Powered by TradingView.

ММВБ, Россия, Москва:МСХ, D



PANIC SELL

Published on Investing.com, 3/Mar/2016 - 9:58:28 GMT, Powered by TradingView.

ММВБ, Россия, Москва:МСХ, D



PANIC BUY

ПАНИКБАЙ почти на всех рынках явление редкое (исключение – пара доллар\рубли)

Свечка в последний день роста тоже может быть больше обычных, но, как правило, все аптренды заканчиваются двойной-тройной вершиной или ГиП

Лучший способ идентифицировать излет тренда – это резкое увеличение угла роста за несколько предыдущих дней, выход за верхнюю границу канала, невозможность построить верхнюю границу нового канала, которая во времени будет уходить в бесконечность.

В принципе, для среднесрочной торговли подобных моментов достаточно, чтобы минимизировать свои входы и получить качественную прибыль.

НЕДОСТАТКИ:

- вырастает размер стопов
- раз в 5-10 лет происходят обвалы рынков, для которых правила паникселла не действуют.

Пример – 2008 год.

PANIC BUY

Published on Investing.com, 3/Mar/2016 - 10:10:45 GMT, Powered by TradingView.

ММВБ, Россия, Москва:МСХ, D



Основные правила спокойной торговли:

- всегда анализируйте рынок начиная с больших ТФ, там видно то, чего не видит интрадейщик
- каналы отлично работают на всех периодах, надо просто уметь их строить
- инвестируйте прежде всего в дивидендные истории
- покупайте то, что плохо падает и хорошо отскакивает, шортите то, что делает наоборот
- не торгуйте логику новости и вообще новости – все есть на графике
- умейте ждать свои цели
- всегда имейте план «В» на случай, если что-то пойдет не так.

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!