

## Соотношение риска к прибыли и управление капиталом в торговле

**Это может стать самой важной статьей о Форексе для вас. Звучит как смелое заявление, но на самом деле вы должны учитывать, что правильное управление капиталом является наиболее важным компонентом успешной торговли на рынке Форекс.**

Управление капиталом на рынке Форекс это термин, описывающий различные аспекты управления риском и прибылью в каждой вашей сделке. Если вы в полной мере не понимаете смысл управления капиталом а также не понимаете как реализовать методы управления капиталом, у вас очень мало шансов стать трейдером постоянно зарабатывающим деньги.

Я собираюсь объяснить самые важные аспекты управления капиталом в этой статье; соотношение риска к прибыли, выбор размер позиции, фиксированной прибыли или риск в процентах. Итак, берите чашку своего любимого напитка и вникайте в то, что я собираюсь помочь вам понять некоторые критические понятия в вашей прибыльной карьере в торговле на Форексе.

### Соотношение риска к прибыли

Соотношение риска к прибыли один из важнейших аспектов по управлению вашими деньгами на рынке. Многие трейдеры не могут полностью понять, как в полной мере воспользоваться силой соотношения риска к прибыли. Каждый трейдер на рынке желает увеличить свою прибыль и минимизировать свои риски. Это базовый строительный элемент становления постоянно получающего прибыль трейдера. Соответствующие знания и внедрение соотношения риска к прибыли дают трейдерам практическую основу для этого.

Многие трейдеры не в полной мере используют силу соотношения риска к прибыли, потому что им не хватает терпения последовательно выполнить достаточно большую серию сделок, чтобы понять, что может дать на самом деле соотношение риска к прибыли. Соотношение риска к прибыли не означает просто расчет риска и прибыли для сделки, это означает понимание того, что добившись 2 или 3 риска или больше во всех своих прибыльных сделках, вы будете в состоянии делать деньги в серии сделок, даже если потеряете в большинстве из них. Когда мы объединим последовательное выполнение риск/прибыль 1:2 или больше вместе со стратегией с высокой вероятностью, например прайс экшн, у нас будет рецепт очень мощной торговой стратегии.

Давайте посмотрим на 4-х часовой график золота, чтобы увидеть, как рассчитать соотношение риска к прибыли на сетапе пин бара. Видим на графике ниже очевидный пин бар сформированный от поддержки на растущем рынке, в этом случае надежный сигнал. Следующий шаг, мы должны рассчитать риск, в нашем случае стоп-лосс установим ниже минимума пин бара, теперь мы можем посчитать какой размер лота мы можем торговать в этой сделке с таким стоп-лосом. Давайте возьмем гипотетический риск в 100\$, например. Видим, что данный сетап вырос до размеров 3-х рисков, в нашем случае 300\$.



Итак, имея прибыль в размере 3-х рисков, сколько сделок мы можем потерять из серии 25 сделок и ВСЕ ЕЩЕ быть прибыльными? Ответ: 18 сделок или 72%. Все верно, вы можете терять до 72% сделок при соотношении риска к прибыли 1:3 или лучше, и ВСЕ ЕЩЕ делать деньги... в серии сделок.

Вот быстрый расчет:

18 убыточных сделок по 100\$ = -1800\$, 7 прибыльных сделок с соотношением 1:3 = 2100\$. Итак после 25 сделок вы заработали 300\$, но вы должны были терпеть 18 убыточных сделок.... И дело в том, что вы никогда не знаете когда придут убыточные сделки. Вы можете получить 18 сделок подряд, прежде чем сделаете 7 прибыльных, что маловероятно, но возможно.

Таким образом, в соотношении риска к прибыли все сводится к одному, вы должны иметь мужество открыть и забыть ваши сделки на достаточно большой серии экзекуций, чтобы в полной мере реализовать силу риск/прибыль. Теперь очевидно, если вы используете стратегию с высокой вероятностью как прайс экшн, вы скорее всего не будете терять в 72% сделок. Теперь представьте себе, что вы можете сделать, если правильно и последовательно будете осуществлять риск/прибыль вместе с торговой стратегией, как прайс экшн.

К сожалению, большинство трейдеров эмоциональны, недисциплинированны чтобы применить риск/прибыль правильно, или не знают как этим воспользоваться. Вмешательство в ваши сделки, такие как передвигание стопов ближе к входу, или не закрытие сделок при достижении 2 или 3 размеров риска представляют две самые большие ошибки, которые делают трейдеры. Также они склонны забирать прибыль в размере одного риска или даже меньше, но это только означает, что вы должны забирать большее соотношение, чтобы иметь прибыль в длинном периоде. Помните, что трейдинг это марафон, а не спринт, и чтобы выиграть марафон нужно последовательно применять соотношение риска к прибыли в сочетании с мастерством по-настоящему эффективной стратегии.

## Расчет размера позиции

Расчет размера позиции это процесс настройки количества лотов которым вы будете торговать в сделке, чтобы удовлетворить заранее определенный размер риска и расстояние до стоп-лоса. Это немного перегруженное предложение для новичков. Итак, давайте разберем его по частям. Вот как надо рассчитывать размер позиции в каждой торгуемой сделке:

- 1) Сначала вам необходимо определить при какой сумме в долларах (или любой другой вашей национальной валюте) вы чувствуете себя КОМФОРТНО ПРИ ИХ ПОТЕРЕ. Вы должны на самом деле чувствовать себя нормально при убытках в любой сделке. Потому что, как мы обсудили в предыдущем разделе, можно действительно потерять в любой сделке, вы никогда не знаете, какая сделка будет прибыльной, а какая убыточной.
- 2) Найдите наиболее логичное место размещения стоп-лоса. Если вы торгуете сетап пин бара, то обычно стоп-лос размещается под/над минимумом/максимумом носа пина бара. Кроме того, другие сетапы которых я учу, как правило имеют «идеальное» место размещения стоп-лоса. Основная идея в том, чтобы разместить стоп-лос в том месте, где сетап будет аннулирован, если цена дойдет до него, или спрятать стоп-лос за уровнем поддержки/сопротивления; это все логичные места для размещения стоп-лоса. Что вы НИКОГДА НЕ ДОЛЖНЫ ДЕЛАТЬ, это размещать ваш стоп-лос ближе к вашему входу только потому, что вы хотите торговать большим лотом, это ЖАДНОСТЬ, и это будет для вас ударом, более сильным, чем вы можете себе представить.
- 3) Далее вам необходимо вычислить количество лотов или мини-лотов которые дадут вам необходимый размер риска в долларах при определенной вами дистанции до логичного стоп-лоса. Один мини-лот как правило составляет 1\$ на пункт, поэтому если вы определили размер риска в 100\$ и ваше расстояние до стоп-лоса 50 пунктов, вы можете торговать 2 мини-лотами;  $2\$ \text{ на пункт} \times 50 \text{ пунктов стоп-лоса} = 100\$ \text{ риска}$ .

Три шага описанных выше описывают, как правильно использовать размер лота. Самое важное помнить, НИКОГДА не настраивайте ваш стоп-лос для удовлетворения размера позиции; вместо того вы должны ВСЕГДА настраивать размер позиции для удовлетворения вашего риска и размещаемого стоп-лоса. Это ОЧЕНЬ ВАЖНО, и прочитайте еще раз.

Следующий важный аспект установки размера позиции, который вам необходимо понимать, в том, чтобы торговать всегда одной и той же суммой риска в каждой сделке. Например, только из-за того что вы должны иметь больший размер стопа в сделке не означает, что нужно рисковать большей суммой, также если у вас короткий стоп, это не означает что вы можете рисковать меньшей суммой. Вы регулируете размер своей позиции, чтобы соответствовать определенной сумме риска, не зависимо от того какой большой или маленький ваш стоп. Много начинающих трейдеров путаются в этом, и думают, что рискуют больше с большим стопом или меньше с маленьким стопом, это не обязательно так.

Давайте посмотрим на дневной график EURUSD ниже. Видим два разных сетапа прайс экш: пин бар сетап, и сетап внутренний бар. Эти сетапы требуют разных дистанций до стоп-лоса, но как видно на графике мы по-прежнему рискуем одной суммой, благодаря размеру позиции.



### Фиксированная сумма риска или риск в процентах

В предыдущей статье об управлении деньгами, я утверждал что использование фиксированной суммы риска превосходит использование процента от счета. Основной аргумент по этому поводу в том, что хотя при расчете риска в процентах, ваш счет будет расти быстрее при серии прибыльных сделок, он будет замедлять свой рост при серии неудачных сделок, и его становится тяжелее вернуть на предыдущий уровень. Это потому, что при использовании модели процента от счета вы торгуете меньше лотов когда ваш счет уменьшается, а это может быть хорошо для ограничения убытков, но также ставит вас в колею, с которой вам будет тяжело выбраться. Все что необходимо, это совершенствование в одной торговой стратегии и фиксированный риск с которым вы чувствуете себя нормально в убыточных сделках. Когда вы объедините эти два фактора с последовательным выполнением соотношения риска к прибыли, у вас будут отличные шансы в получении прибыли в долгосрочном периоде.

Много профессиональных трейдеров используют метод фиксированной суммы риска потому что знают, что в совершенстве освоили свою стратегию, они не переторговывают, не злоупотребляют плечами, поэтому они могут спокойно рисковать определенной суммой и чувствуют себя нормально в каждой сделке. Обратной стороной этого является то, что профессиональные трейдеры на самом деле выводят прибыль со счетов каждый месяц, после чего их счет возвращается на исходную позицию. Метод расчета риска в процентах от счета приводит к тому, что после серии неудачных сделок они попадают в ловушку, торгуя меньшим количеством лотов (меньшей суммой) и это может привести к тому, что они никогда не вернутся на начальный размер своего счета.

Давайте посмотрим на гипотетический пример 25 сделок. Сравним фиксированный в долларах риск и модель риска 2% от торгового счета. Совершенно очевидно из приведенного примера, что модель фиксированного риска является лучшей. Конечно, вы можете быстрее уменьшить торговый счет серией убыточных сделок при фиксированном риске, но обратная сторона данной модели в том, что вы намного быстрее восстановите свой счет после серии прибыльных сделок.

Начальный размер счета = 2000\$	Прибыль/убыток	Фиксированный риск 100\$	Риск 2% от счета
Все прибыли равны 3 рискам	прибыль	\$2 300	\$2 120
	прибыль	\$2 600	\$2 247
	убыток	\$2 500	\$2 202
	убыток	\$2 400	\$2 158
	убыток	\$2 300	\$2 115
	убыток	\$2 200	\$2 073
	убыток	\$2 100	\$2 031
	убыток	\$2 000	\$1 991
	прибыль	\$2 300	\$2 110
	прибыль	\$2 600	\$2 237
	прибыль	\$2 900	\$2 371
	прибыль	\$3 200	\$2 513
	убыток	\$3 100	\$2 463
	убыток	\$3 000	\$2 414
	убыток	\$2 900	\$2 365
	убыток	\$2 800	\$2 318
	убыток	\$2 700	\$2 272
	убыток	\$2 600	\$2 226
	убыток	\$2 500	\$2 182
	убыток	\$2 400	\$2 138
	убыток	\$2 300	\$2 095
	убыток	\$2 200	\$2 053
8 прибыльных 17 убыточных	убыток	\$2 100	\$2 012
Прибыльных = 32%	прибыль	\$2 400	\$2 133
Убыточных = 68%	прибыль	<b>\$2 700</b>	<b>\$2 261</b>

Пример немного экстремальный, если вы торгуете по стратегии прайс экшн и действительно мастерски ее овладели, вы не будете терять в 68% сделок, скорее всего процент выигрыша будет составлять 50%. Если у вас будет 50% прибыльных сделок, после 25 сделок с фиксированным риском 100\$ ваш счет 2000\$ увеличится до 4500\$. При 50% прибыльных сделок но с риском 2% от счета после 25 сделок ваш счет составит всего лишь чуть более 3300\$.

Итак, вывод из этой статьи заключается в следующем. Чтобы добиться успеха в торговле на рынке Форекс, вы должны не только хорошо понимать соотношение риска к прибыли, расчета размера позиции, и риска в одной сделке, вам также необходимо последовательно выполнять каждый из этих аспектов управления деньгами в сочетании с высокоэффективной и простой в понимании торговой стратегии, как прайс экшн.