Частая торговля против редкой торговли

Многие трейдеры на Форексе думают, что открывая сделки более часто, они дают себе больше возможностей и это даст им заработать больше денег. Это не верно, на самом деле, более частая торговля приводит к большему стрессу, разочарованию, и открытию сделок с малой вероятностью позитивного исхода. Дело в том, что если вы знаете, что торгуете и вы на 100% уверенны как и когда это торговать, вы обнаружите, что действительно нет необходимости торговать чаще. Существует неоспоримое доказательство, что дейтрейдеры и скальперы делают в среднем меньше денег, чем трейдеры торгующие реже. Давайте обсудим это и многое другое в этой статье, итак начнем…

Примечание: речь будет идти об обычных «розничных» трейдерах, а не о специализированных коммерческих торговых компьютерных программах количество сделок которых достигает тысячи и десятки тысяч в день.

Самый быстрый способ улучшить вашу торговлю это…

…Прекратите так много торговать! Это просто особенность человеческой натуры, чем больше мы торчим перед монитором, тем больше мы готовы нажать на кнопку и войти в сделку. Тот факт, что мы тяжело работали над деньгами, находящимися на нашем торговом счете, кажется, вылетает из головы после просмотра 5-ти минутного графика некоторое время. Мы также склонны переоценивать свои возможности прогнозировать движения рынка и игнорируем реальный потенциал потери деньги, которыми рискуем.

Больше сделок означает больше затраченного времени и больше стресса. Лично я верю в трейдинг на дневных графиках и редкие сделки, это означает, что я на самом деле открываю на много меньше сделок чем большинство трейдеров. При этом мы все знаем, что большинство трейдеров теряют деньги… большинство трейдеров также часто торгуют, поэтому здравый смысл говорит нам, что просто торгуя реже (поступая не так как большинство трейдеров) мы улучшим наши показатели в долгосрочной перспективе.

Зная свою торговую стратегию, и будучи на 100% уверенным в том когда и как торговать, вы обнаружите что намного легче игнорировать рынок когда на рынке нет ваших сетапов. Когда вы торгуете реже, вы также можете рискнуть чуть больше в отдельной сделке, если вам с такой суммой комфортно. Подумайте об этом, один трейдер торгует 30 раз в месяц, а другой трейдер открывает 3 сделки в месяц, очевидно, что первый парень не может торговать таким большим размером как второй. Не говоря уже о том, что частая торговля занимает у него много драгоценного времени, часто в стрессе и разочаровании. Я предпочитают тратить меньше времени на рынке, также иметь меньше стресса, поэтому я больше придерживаюсь дневных графиков, и я торгую относительно редко по сравнению с большинством трейдеров.

Дело вот в чем: когда вы повышаете качество ваших сделок, вы также увеличите соотношение риска к прибыли, и вместо борьбы на рынке вы просто будете терпеливыми и действуете только тогда, когда рынок показывает ваши сетапы. Это будет работать на увеличение вашей прибыли, в тоже время вы будете меньше времени проводить на рынках. Такой пример выглядит нелогично, так как в большинстве профессий больше времени = больше денег, в трейдинге это не так, на самом деле большинство трейдеров начинают работать лучше, проводя меньше времени на рынках. Таким образом, вы должны бороться с желанием чрезмерно анализировать, часто торговать, или торговать на малых таймфреймах.

Высокая частота против низкой частоты. Пример.

Вы хотите увеличить ваш общий R-фактор при одновременном снижении стресса и эмоций на рынке? R-фактор означает ваш фактор прибыли, это сколько прибыли вы делаете на рынке в течении определенного периода времени по отношению к вашему риску (R) в каждой сделке. Значит, если вы рискуете 100$ в каждой сделке, ваш фактор R составляет 100$, если вы заработали 500$ в месяц, значит ваш возврат 5R. Вот так вы должны думать о риске и вознаграждении, а не в процентном выражении. Проценты на самом деле не имеют значения, потому что прибыль 50% может означать что вы заработали 50 долларов или 50 000 долларов… как вы видите проценты относятся к размеру вашего счета, а нам важно соотношение долларов риска к долларов прибыли. Если вы собираетесь создать хороший прибыльный послужной список, чтобы найти инвестора, который даст деньги в управление, то главное на что они обращают внимание, это соотношение вашей прибыли к сумме которой вы рискуете.

Чтобы показать, что торговля с высокой частотой не означает более высокой прибыли, давайте рассмотрим гипотетический пример трейдера торговавшего на 4-х часовом графике в течении одного месяца в сравнении с трейдером торговавшим редко на дневных графиках в том же месяце. Главное из этого примера в том, что оба трейдера закончили период с прибылью 3R, при этом первый трейдер торговал в три раза больше, открыв 15 сделок в мае по сравнению с 4 сделками другого трейдера.

Вы можете себе представить, на сколько меньше эмоций, разочарования и стресса было у трейдера открывшего 4 сделки, а также на сколько больше времени и здравого ума по сравнению с терйдером вошедшим 15 раз на 4-х часовом графике и завершившего месяц с тем же результатом. На самом деле это относительно мягкий пример, я знаю много трейдеров торгующих на графиках намного ниже 15-ти минутных и продолжающих терять деньги, некоторые из вас так делают сейчас. Итак… почему бы не попробовать что-то другое? Торговать меньше:

Гипотетический пример 15 сделок на 4-х часовом графике

Дата входа	Пара	Вход	Стоп	Цель	Выход	Риск/прибыль
May 2nd	EURUSD	1.3200	1.3300	1.3100	1.3100	1R Прибыль
May 4th	GBPUSD	1.6190	1.6290	1.5990	1.5990	2R Прибыль
May 4th	AUDUSD	1.0200	1.0100	1.0400	1.0100	1R Убыток
May 7th	EURJPY	104.00	103.00	106.00	103.00	1R Убыток
May 8th	EURUSD	1.3000	1.3100	1.2700	1.2700	3 R Прибыль
May 8th	EURJPY	103.60	102.60	105.60	102.60	1 R Убыток
May 9th	GBPJPY	128.40	127.40	130.40	127.40	1 R Убыток
May 11th	AUDUSD	1.0050	1.0150	0.9850	0.9850	2 R Прибыль
May 14th	USDCHF	0.9300	0.9400	0.9100	0.9400	1R Убыток
May 15th	USDCAD	1.0050	1.0150	0.9850	1.0150	1R Убыток
May 17th	GBPUSD	1.5800	1.5700	1.6000	1.5700	1R Убыток
May 22nd	XAUUSD	1590.00	1610.00	1550.00	1550.00	2 R Прибыль
May 24th	EURUSD	1.2600	1.2700	1.2400	1.2400	2 R Прибыль
May 25th	EURJPY	100.00	99.00	102.00	99.00	1 R Убыток
May 28th	GBPUSD	1.5700	1.5600	1.5900	1.5600	1R Убыток
Всего сделок = 15						Profit = + 3R

Гипотетический пример 4 сделок на дневных графиках

Дата входа	Пара		Стоп	Цель	Выход	Риск/прибыль
May 4th	GBPUSD	1.6150	1.6250	1.5950	1.5950	2R Прибыль
May 7th	GBPJPY	129.35	128.35	131.35	128.35	1R Убыток
May 8th	EURUSD	1.3000	1.3100	1.2700	1.2700	3R Прибыль
May 16th	AUDUSD	0.9920	0.9820	1.0120	0.9820	1R Убыток
Всего сделок = 4						Profit = + 3R

(Примечание: это были не реальные сделки, все они взяты ради примера)

Итак, как видно из приведенного примера, более частая торговля не означает большей прибыли. Очевидно, что это не реальный опыт, но суть понятна, когда вы открываете больше сделок у вас естественно будет больше убыточных сделок, которые необходимо компенсировать большим количеством прибыльных сделок, только ради того, чтобы получить тот же результат. Также обратите внимание на то, что у трейдера торгующего на дневных графиках было 50% прибыльных сделок, а у трейдера торгующего на 4-х часовом графике только 40% прибыльных сделок.

Рассматривайте рынок как сад

Может помочь думать о рынке как о саде. Каждый месяц в саду вырастает ограниченное количество овощей, но также и много сорняков. Чем больше овощей вы собираете каждый месяц, тем больше шансов вытянуть сорняк в следующий раз. В торговле каждый месяц существует определенное количество сетапов с выской вероятностью, поэтому если у вас нет терпения чтобы торговать только эти очевидные сетапы, вы в конечном счете будете брать больше убыточных сделок (сорняков) чем прибыльных (овощей).

Наука о том, почему люди торгуют слишком много

Существует множество причин, почем люди торгуют слишком много, но главная из них это чрезмерная уверенность в себе. Это особенно актуально после успешной сделки, или серии из успешных сделок. Трейдеры имеют склонность становиться более уверенными в себе после закрытия хорошей сделки или нескольких сделок и особенно если не следуют торговому плану и просто торгуют полагаясь на интуицию. Существует серьезное научное исследование, подкрепляющее утверждение, что большинство трейдеров торгует слишком часто именно из-за чрезмерной уверенности в себе. Большинство людей переторговывает в связи с «переприбыльностью» своих сделок, об этом пишут Терренс Одеан и его коллеги в своем исследовании под названием «Дейтрейдеры знают о своих способностях?»

«Однако, когда они оказываются успешными, эти инвесторы иррационально приписывают успех непропорционально своим способностям, а не просто удаче, ведущие инвесторы переоценивают свои способности и торгуют слишком агрессивно, и даже инвесторы с прошлыми большими потерями чем успехами, могут стать самоуверенными превышая важность своих успехов»

Одеан и его компания начали обсуждение почему «совокупная производительность дейтрейдеров отрицательна». Их исследование подчеркивает тот факт, что **торговля на малых таймфреймах а также торговля с высокой частотой вызывает привыкание и затягивает**. Торговая

наркомания является единственным объяснением того что «более половины трейдеров можно отнести к опытным и с историей убытков», указывается в исследовании. **По каким еще причинам «опытные трейдеры с историей убытков» продолжают торговать внутри дня, если бы не их зависимость от этого?**

Главное, что нужно из этого понять, это то, что вы должны избегать преувеличения ваших торговых достижений… это не означает, что вы не должны изучать их… скорее вы должны рассматривать их как еще одно подтверждение вашей стратегии. Запомните, что даже если вы трейдер с 70% прибыльных сделок, вы никогда не можете знать какая ваша сделка попадет в эти 70% или окажется в других 30%, таким образом, вы никогда не должны принимать слишком большой риск на ваш торговый счет или переторговывать… просто торгуйте когда видите ваши сетапы, и с течением времени вы будете получать стабильную прибыль.

Мужчины против женщин

Я знаю, что большинство моих читателей мужчины, но дело в том что сейчас мы должны убрать свою гордость и взять немного полезного из того как торгуют женщины.

В недавней статье на сайте Нью-Йорк Таймс сообщается о том, что мужчины имеют склонность торговать намного чаще чем женщины, и это увеличивает их затраты и уменьшает общий результат, смотрите:

«Это увеличение торговли приводит к повышению затрат мужчин и уменьшает их результаты. Экономисты определили, что в то время как оба пола сокращали чистые доходы посредством торговли, мужчины делали это на 0.94 процента больше в год. В телефонном интервью профессор Барбер сказал «В общем, самонадеянные инвесторы собираются интерпретировать то, что происходит вокруг них и думают, что они в состоянии принять решения которое совершенно не подкреплено смыслом». Краткосрочные финансовые новости часто относятся к бессмысленному шуму, говорит он. Мужчины, намного чаще чем женщины, пытаются извлечь смысл из этого шума, и напрасно.»

Итак, вот несколько важных уроков :

1) Мужчины склонны думать, что они «знают» о том, что рынок собирается сделать, тогда как женщины скорее принимают факт, что они не «знают» наверняка, что рынок будет делать. Суть в том, что женщины правы, никто никогда не «знает» что рынок будет делать, за исключением инсайдеров с незаконной информацией. Итак, чем раньше вы поймете, что трейдинг это игра вероятностей где результат любого сигнала не «бесспорный», тем раньше вы прекратите брать маловероятные сделки только потому что *чувствуете*, что вы «знаете» куда пойдет рынок.
2) Женщины менее вероятно будут одержимы финансовыми новостями и пытаться «выяснить, что же это все означает». Мужчины должны также так поступать, если вы не понимаете почему, прочтите мою недавнюю статью о новостях и фундаменте на Форексе.
3) Лично я полагаю, что у женщин меньше потребность быть «правыми» чем у мужчин, и это делает их лучшими трейдерами. Рынок безразличен к вам, и к вашим чувствам, поэтому быть правым или нет, эгоистично относиться к трейдингу, это все полностью не соответствует тому, чтобы получать результат. Оставьте свое эго за дверьми, когда входите в свою торговую комнату, потому что это не поможет вам принимать лучшие торговые решения. Вы можете думать, что вы правы, но на самом деле рынку все равно правы вы или нет, он будет делать то, что считает нужным, потому что рынок всегда прав, а не вы.

Поэтому научитесь торговать осознавая этот факт, научившись читать движения цены создаваемые рынком для нас, и торговать только когда присутствует наш сетап с высокой вероятностью.

Заключительные мысли…

Возможно, главная мысль из этого урока состоит в том, что вы не должны придавать слишком большого значения каждой сделке. Это означает, не начинать переторговывать став самоуверенным после нескольких удачных сделок. Помните, вы можете достигнуть такого же результата R за тот же период времени, просто торгуя реже. *Вы можете это сделать фокусируясь на качестве сделок а не на количестве*. Я торгую «низкочастотную» стратегию прайс экшн на дневных графиках, и моя философия основывается на торговле только высококачественных торговых сетапов прайс экшн, что означает меньше сделок и меньше стресса!