Один факт о трейдинге, который вы должны знать

Наиболее важным аспектом торговли на Форексе, о котором многие трейдеры не подозревают, является то, что они не должны ожидать от каждой отдельной сделки, что она будет прибыльной или убыточной. Все верно, хотя звучит немного странно, но это факт. Понимаете, даже если у вас есть торговая стратегия, и вы знаете какой процент прибыльных сделок она дает, вы все еще не знаете, какая сделка закончится прибылью или убытком. Подумайте, если у вас 60% прибыльных сделок за год, вы же не знаете, какая сделка попадет в колонку прибыльных 60%, а какая попадет в колонку убыточных 40% . Нет, не знаете. Вы не знаете, и никогда не можете знать, а знаете почему? Потому что в трейдинге, случайное распределение прибыльных и убыточных сделок, не зависимо от вашей торговой стратегии.

Может показаться, что вы это уже знаете, но факт в том, что большинство трейдеров не торгуют так как будто они понимают, или хотя бы переживают из-за того, что их прибыльные и убыточные сделки распределяются случайно. Если вам все еще не очень понятно, что я понимаю под «распределяются случайным образом», так это просто означает, что вы никогда не знаете, когда ваша сделка закроется с прибылью, а когда с убытком, ДАЖЕ ЕСЛИ вы следуете своей высокоэффективной стратегии. Таким образом, результаты ваших сделок будут распределены случайным образом, но если вы следуете прибыльной стратегии, все время, в общем, вы будете прибыльны. Ключевая фраза здесь «все время», и это как раз та часть, о которой многие трейдеры забывают или имеют с ней проблемы. У них попросту нет дисциплины и/или терпения следовать своей торговой стратегии и управлению капиталом сквозь большое количество сделок, чтобы стать прибыльным.

Вот пример того как случайное распределение прибыльных и убыточных сделок может выглядеть. Обратите внимание, что кривая активов в длительном периоде растет, а это означает, что используется эффективная и прибыльная стратегия на протяжении длительного времени. Последствия этого глубоки:

Последствия случайного распределения результатов торговли

Возможно, самое главное, что вам необходимо понимать о том факте, что ваши торговые результаты распределены случайным образом, в том что если вы действительно это понимаете и принимаете этот факт, вы никогда не будете рисковать в каждой сделке большей суммой чем при потере которой вы будете себя комфортно чувствовать. Трейдеры, которые это действительно понимают, никогда не знают прибыльная или убыточная сделка выпадет, и никогда не будут вести себя так, как будто знают что будет.

Трейдеры, рискующие в сделке суммой больше чем с которой им комфортно терять, ведут себя так как будто знают что точно получат прибыль в этой сделке. Такое отношение и вера толкают трейдеров в большие неприятности. Если вы торгуете с учетом того, что ваши торговые результаты случайно распределены, тогда вы будете всегда осознавать какой суммой вы рискуете, и всегда будете взвешивать потенциальное соотношение риска к прибыли в сделке перед тем как ее открыть, в отличие от того чтобы постоянно думать о прибыли.

Как ваши ожидания убивают ваш счет

Возможно, что вы много раз не открывали сделки ожидая убытков в них; на самом деле, вы возможно ожидаете получить прибыль в каждой открываемой сделке. Такова человеческая натура, желать прибыли в каждой открываемой сделке; в конце концов, в нас существует врожденная потребность быть правыми и держать все под контролем. Это причина, по которой многие больше боятся летать чем ездить автомобилем, хотя статистика показывает, что летать значительно безопаснее; людям нравится чувствовать, что у них все под контролем.

Проблема с трейдингом в том, что вы должны отбросить все ваши ожидания о прибылях в каждой сделке, а для большинства трейдеров это невозможно. Когда сделка закрывается в убыток, происходят две вещи: 1) вы теряете деньги, и 2) вы ошиблись с направлением рынка.

Мы должны понимать, что обе вещи, и потеря денег, и ошибка в определении направления, все это часть игры. Вы должны помнить, что трейдинг это бизнес, но затраты здесь отличаются от других видов бизнеса. Ваши затраты прямые и на лицо: убыток и ошибка в направлении говорят, что вы не правы в этой сделке. Вы должны научиться игнорировать эти вещи, чтобы они не сделали вас эмоциональными.

Ожидания убивают большинство трейдеров. Вы должны научиться избавляться от ожиданий в отдельной сделке, вместо этого у вас должны быть долгосрочные ожидания. Например, правильно ожидать быть прибыльным по результатам года, если вы торгуете в соответствии со своим планом, терпеливо и дисциплинировано. В тоже время, неправильно ожидать прибыли в следующей сделке, которую вы откроете. Причина, почему это неправильно, в том, что на самом деле не имеет значения, что будет с вашей следующей сделкой, какая разница, если вы дисциплинированы и торгуете только свои сетапы и всегда контролируете свой риск. Если вы будете делать эти вещи постоянно, вы можете ожидать получить прибыль в серии сделок. Но большинство трейдеров становятся эмоциональными, начинают переторговывать и сливают свои счета, потому что думают, что каждая их сделка будет прибыльной. Когда вы ожидаете прибыли в каждой сделке, вы как товарный поезд эмоций летящий в кирпичную стену реальности. Смысл в том, что когда наши ожидания не совпадают с реальностью, мы становимся эмоциональными, а когда мы становимся эмоциональными, мы теряем деньги.

Реальные примеры случайного распределения торговых результатов

Достаточно теории, перейдем к практике. Хочу пройтись несколькими графиками с недавними реальными примерами торговых сетапов прайс экшн. Прежде всего отмечу, что эти примеры взяты для демонстрации случайного распределения, и чтобы доказать, что мы никогда не знаем чем закончится сделка. Я не утверждаю, что все эти сделки были в реальности открыты.

Золото

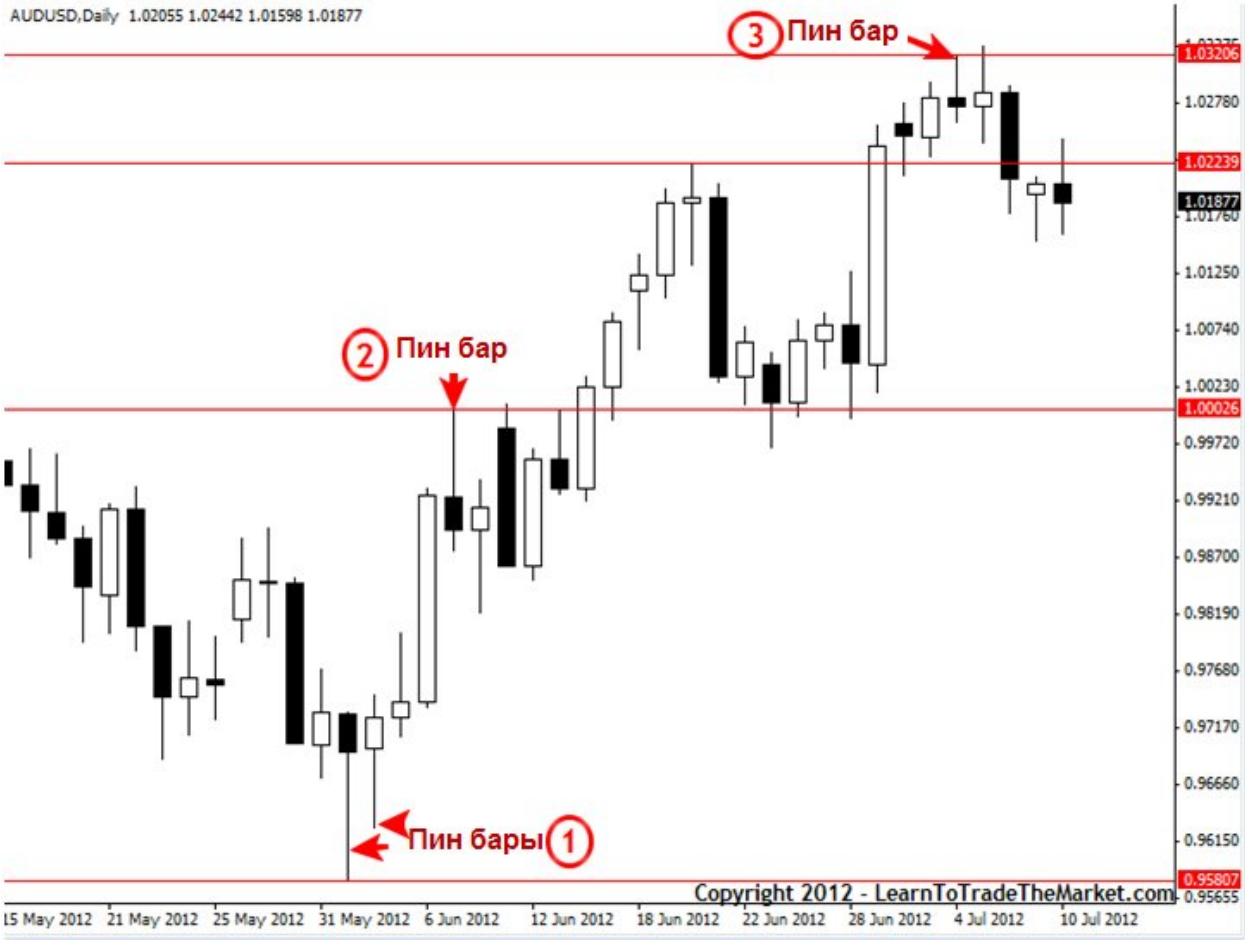
Ниже приведен дневной график рынка золота. Видим пример трех разных сетапов прайс экшн, недавно возникших на рынке. Давайте пройдемся по ним, соответственно номерам.

1) Большой пин бар сформированный от ключевого уровня поддержки. Даже при том что он против тренда сетап все равно действительный и очевидный, таким образом это хорошее представление нашей торговой стратегии прайс экшн. Данный пин бар возможно завершился убытками для многих трейдеров, так как видим цена сразу после пробоя максимума развернулась и дошла до минимума пин бара. При этом цена сформировала еще один пин бар от той же поддержки. Таким образом, даже при том, что сетап был очевидным и действительным сделка закончилась убытками; урок здесь в том, что вы должны освободиться от своих ожиданий прибылей в каждой сделке.
2) Второй пин бар сформированный от той же зоны поддержки в районе $1530.00. Это также большой пин бар от ключевой поддержки, таким образом это другой действительный сетап нашей торговой стратегии. После короткого отката цены к уровню 50% пин бара, рынок рванул вверх предоставив нам прибыльную сделку. Опять, нет необходимости ожидать, что это должна быть прибыльная сделка, это только частичный случай победы нашей торговой стратегии прайс экшн.
3) Дальше мы видим четкий сигнал ложного пробоя, сформированный вместе с пин баром. Очень хорошо сформированный сетап от ключевого уровня сопротивления, поэтому конечно это был хорошо действительный и очевидный сетап нашей торговой стратегии

прайс экшн. Видим как цена резко упала, предоставив нам хорошую прибыль, особенно если входить на уровне около 50% пин бара. Все эти сетапы представляют действительные примеры моей торговой стратегии прайс экшн, два из них оказались прибыльными, один убыточный, но нет никакого способа каким бы мы могли узнать наверняка, какой из сетапов будет убыточным, а какой прибыльным.

AUDUSD

Ниже показан дневной график пары AUDUSD. Видим пример трех разных торговых сетапов прайс экшн, появившихся недавно. Давайте пройдемся по ним, соответственно номерам.

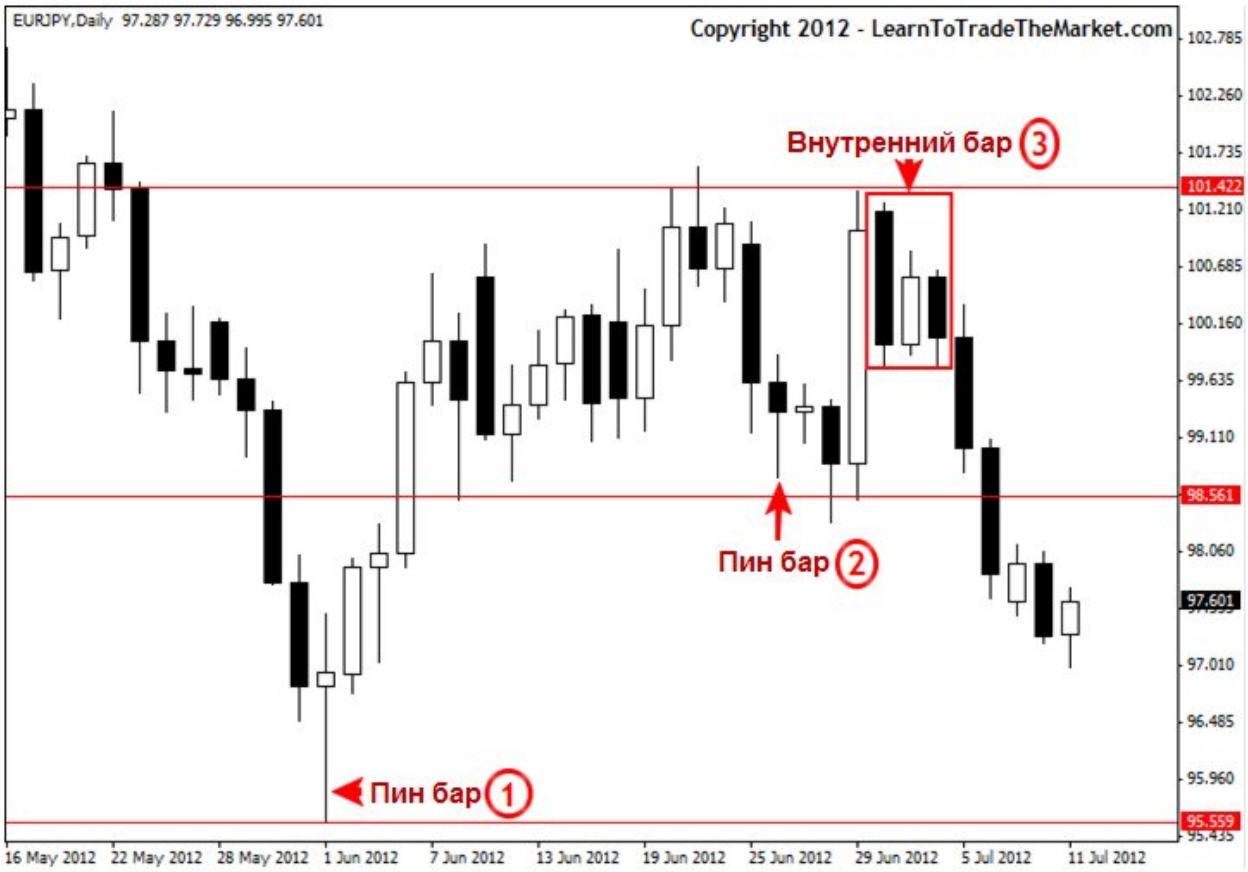


1) Первый сетап это пин бар, фактически два хороших пин бара, последовательно сформированных, так что даже если вы пропустили первый пин бар, вы могли входить на втором, так как оба показывают отказ цены одти ниже от ключевой долгосрочной поддержки. Видим, что можно было получить достаточно большую прибыль от этих пин баров, в зависимости от постановки стопа можно было получить соотношение риска к прибыли 1:3 или 1:4 или даже больше. Опять, возможно многие ожидали потерь от такого сетапа, так как он против тренда. Но на самом деле мы имели действительный противотрендовый сетап, поэтому мы должны были разместить наши ордеры и позволить рынку сделать свою работу. Не ожидайте от каждой сделки прибылей или убытков, просто неукоснительно следуйте своей торговой стратегии и торговому плану и помните, что если будете так поступать то останетесь прибыльными в длительных отрезках времени.

2) Хорошо сформированный медвежий пин бар, который для многих кто входил на нем, стал убыточным. Даже после того, как эта сделка стала убыточной, мы не должны становиться эмоциональными или расстроенными, потому что мы знаем, что наши прибыли и убытки распределяются случайным образом, поэтому у нас нет никаких ожиданий относительно наших сделок.
3) Это был маленький пин бар, но он четко показал отказ от твердого уровня сопротивления, и после длительного сильного роста вверх это был сигнал прайс экшн на продажу, и многие трейдеры входили на нем. Мы можем видеть, что цена пошла вниз от сопротивления, но прежде откатила вверх чтобы повторно тестировать сопротивление, что для многих трейдеров обернулось убытками. Итак, на данном графике мы видим одну хорошую сделку, принесшую нам прибыль в размере 3R или 4R, а затем две убыточные сделки по 1R каждая. Как видно мы все еще остаемся в прибыли, даже при том что у нас не было никаких ожиданий относительно того будут сделки прибыльными или нет.

EURJPY

Ниже приведен дневной график EURJPY. Видим пример трех разных сетапов, возникших недавно на этом рынке. Давайте пройдемся по ним, соответственно номерам.



1) Это сетап пин бара с длинным носом, четко показавший отказ цены идти ниже долгосрочной ключевой поддержки в районе 97.00 - 96.00. Обратите внимание, как цена значительно выросла после пин бара, предоставив хорошее соотношение риска к прибыли.
2) Данный сетап пин бара обернулся убыточной сделкой, если входили после закрытия свечи, или на 50% от пин бара. Это действительный пин бар, так как сформировался очень

близко к ключевой поддержке 98.70 – 98.50 и очевидно сформированный. Однако, нет никаких причин ожидать что эта сделка могла быть прибыльной или убыточной, так как мы знаем, что наши торговые результаты распределены случайно. Необходимо просто следовать своему плану и когда формируются действительные сетапы, вы открываете сделки и предоставляете рынку решить исход.

3) Далее видим сетап внутренний бар, сформированный сразу под сопротивлением около 101.40, когда рынок находился в торговом диапазоне. Обратите внимание, как цена агрессивно опустилась от данного сетапа, и если разместить стоп около 50% материнского бара, можно было получить очень хорошее соотношение риска к прибыли, и пока я пишу эту статью рынок продолжает снижаться от этого сетапа.

Перестаньте ожидать прибыль в каждой сделке, и вы станете прибыльным трейдером

Причины, по которой для многих проблема постоянно зарабатывать прибыль, могут быть сведены в один факт, что они слишком многого ожидают. Большинство трейдеров очень настойчиво пытаются контролировать все аспекты своей торговли, не зависимо от того осознают они это или нет. В действительности, мы не можем контролировать рынок, все что мы можем, это контролировать себя. Но, намного труднее контролировать свои действия и мысли, чем переторговывать и рисковать слишком многим в одной сделке, когда вы убедили себя что эта сделка будет прибыльной. Люди убеждают себя, что они правы относительно своих сделок, они чувствуют себя хорошо когда думают, что они правы. Действительно, многие трейдеры становятся зависимыми от чувства необходимости войти в сделку, даже при том, что у них длинная череда потерь на рынке.

Вы должны научиться смотреть на себя как на корень всех торговых проблем. Это не ошибка вашего брокера, это не ошибка рынка, это ваша ошибка, что вы потеряли деньги. И скорее всего вы потеряли деньги потому что ожидали прибылей в каждой сделке, значит вы игнорируете риск связанный с торговлей. Люди склонны слишком много фокусироваться на потенциальных прибылях, и не достаточно на риске потерь. Тем не менее, как мы обсудили выше, потенциал получить прибыль или убыток в каждой сделке равен. Это потому, что ваши прибыли и убытки распределяются случайным образом, вы должны об этом помнить. Вы можете определить процент прибыльных сделок вашей торговой стратегии на длительном периоде времени, но вы не можете определить процент прибыли для каждого отдельного проявления сетапов вашей торговой стратегии, это тяжелое понятие для понимания, но очень важное. Вы должны понять, то о чем я рассказал в этой лекции, и торговать соответственно, не становясь эмоционально зависимыми от каждой сделки, и понимать что вы можете быть прибыльным трейдером в длительной серии сделок следуя вашей торговой стратегии, торгуя дисциплинировано.