SF EDUCATION

Риск менеджмент

СПИКЕР: Александр Рябинин



Что такое риск менеджмент

Риск менеджмент является важной составляющей в вашей торговой системе.

По сути, это статистический набор цифр, отображающий вашу торговую систему. По нему можно ориентироваться, приносит ваша торговая система прибыль или вводит в убытки. Конечно же, его необходимо дополнить процентом прибыльных сделок (мат. ожидание).

То есть сначала мы рассчитываем риск к премии. Торгуем по торговой системе и смотрим, какой процент положительных сделок у нас имеется. Дальше сверяемся с показателем риск/премия. И отсюда уже понимаем, мы генерируем прибыль или убытки. А также видим слабые места.

Например:
Риск/премия - 1/10
А процент положительных сделок 20%
Это значит, что мы получаем 4 убыточных сделки и одну прибыльную. В то время как одна прибыльная приносит 100% дохода, а 4 убыточных в совокупности, наносят ущерб в 40%.
Значит наша система работает. Если улучшим процент прибыльных сделок, то вообще прекрасно.

Классический идеальный риск менеджмент

Как и везде, в риск менеджменте есть свой золотой стандарт.

Им является риск/премия равная 1/3. При этом статистика прибыльных сделок должна быть равна или превышать 50%.

Таким образом, мы одной прибыльной сделкой можем перекрыть три убыточных. Или потерпеть поражение в 2 сделках из 3, но выйти в прибыль.

Это считается золотым стандартом как в России, так и за рубежом.

Если достигнуть данных показателей, то можно с легкостью зарабатывать на трейдинге самостоятельно или пойти работать в инвестиционный фонд трейдером.

Единственное, у вас должна быть устойчивая статистика за 3 года, чтобы вас взяли в фонд. Некоторые, конечно, дают поблажки и могут посмотреть статистику всего за год. А начинающие фонды и вовсе могут поверить на слово и проверить ваши навыки на демо счете. И если вы оправдаете ожидания, то вас с радостью примут в свою команду.

Риск менеджмент который использую я

Я уже нашел свою торговую систему, которая укладывается под мой характер. Точнее их 2, но носят они довольно близкий смысл.

В предыдущем слайде я рассказал как можно попасть в фонд. Таким образом, начинал свою работу в фонде и я. Предоставил статистику за несколько лет и меня взяли. Но я не стал останавливаться на достигнутом. Трейдинг это про личность, а личность требует постоянного развития.

Так я и начал улучшать и разрабатывать свои «идеальные» торговые системы.
Пришел я к следующему риск менеджменту. Путем долгих и мучительных проб и ошибок. Даже в тот период потерял себя и хотел «спрятаться в домик».

В итоге получил следующее:
Риск/премия - 1/10-1/40 (зависит о рынка на котором я работаю)
Процент положительных сделок - 30%.
Хоть у меня по проценту положительных сделок предыдущая система и была выше, а именно порядка 80%, но новые системы начали давать мне большую прибыль за счет риск/премии, а так же замечательно уложились в мой характер. Стоит этому уделить внимание.

Риск менеджмент на споте

Разговор выше был про фьючерсный рынок.

А вот на споте 1/3 очень хороший показатель. Так как это больше про инвестиционную часть.

Но так как мы говорим про рынок криптовалют, то здесь все довольно творчески. Так как волатильность заставляет пощекотать нервишки.

Здесь встает вопрос - при какой просадке выходить и выходить ли, а также при какой прибыли выходить и выходить ли.

Нужно понимать, что мы говорим больше про инвестиционный инструмент, нежели спекулятивный. Отсюда нужно и ставить грамотно рамки. А главное четко.

Например:
Я выхожу из сделки, когда мой убыток превысит 30%.
А фиксирую я сделку, когда моя прибыль будет равна 90%.
При этом, мы цифры так же не берем из головы. А анализируем активы, которые могут нам дать необходимые сочетания риска к прибыли.

Плюсы и минусы риск менеджмента

Говорить о плюсах и минусах возможно бессмысленно, так как преимущества использования риск менеджмента проверены временем. Но считаю необходимым вас подготовить к тому, что с вами будет происходить и во имя чего вы все это терпите.

Минусы:

- Вас будет ломать, закрываться в убыток с непривычки болезненно
- Порой вас будет захватывать FOMO
- Возможно, вы разочаруетесь в себе, как и я когда-то (это главное пройти)
- Для хаотичных и эмоциональных людей это будет пытка.

Плюсы:

- Вы станете системным
- Сможете прогнозировать свою прибыль/убыток в следующем периоде
- Будет четкая картина что в вашей торговле хромает
- Со временем, сможете закрывать убытки, а не наращивать их
- Будет намного меньше шанс потери денег.

Контакты

Сайт:

sf.education

По всем вопросам:

info@sflearning.org

https://t.me/sf_education

https://vk.com/sfeducation

sf_education

https://www.facebook.com/sfeducationru

https://seekingalpha.com/author/societe-financiers

https://www.youtube.com/c/SFEducationnew