

PROP TRADER SECRETS

How Successful Prop Traders
Pass Any Challenge



Секреты проп-трейдеров

Данная книга – результат анализа статистики более 17 000 клиентов одной проп-фирмы, который был проведен с целью выявить тенденции в торговле тех, кто входит в топ-5%. Файл оригинала прикреплен к этому сообщению.

Секрет №1: Максимальный убыток vs средняя прибыль

В чем заключается самый важный секрет трейдинга?

В этой главе вы узнаете самый важный секрет трейдинга. Как нам кажется, это – самый быстрый способ «выйти из грязи в князи». Секрет звучит следующим образом:

Чтобы стать прибыльным проп-трейдером, вы должны торговать так, чтобы ваша средняя прибыль превышала ваш максимальный убыток.

Прежде чем говорить о соотношении максимального убытка к средней прибыли, давайте разберемся в этих понятиях по отдельности.

Максимальный убыток: «Наибольший убыток, полученный по одной конкретной позиции за конкретный период времени».

Скажем, вы провели в сентябре по EURUSD 30 сделок. Из этих 30 сделок 6 оказались убыточными. Предположим, что в худшей сделке вы потеряли \$500. В этом случае ваш максимальный убыток будет равняться **-\$500**.

Обратите внимание, что максимальный убыток – это убыток именно по одной сделке, а не по нескольким.

Средняя прибыль: «То, сколько в среднем приносят вам ваши прибыльные сделки».

Здесь все очень просто. Средняя прибыль – это среднее арифметическое ваших прибылей за определенный период времени.

Как и раньше, предположим, что вы провели в сентябре **30** сделок, из которых **24** оказались прибыльными.

Если вы сделали в этих сделках **\$24 000**, ваша средняя прибыль будет равняться **(\$24 000 / 24) = \$1 000**. Это означает, что в тех случаях, когда вы получаете прибыльную сделку, в среднем вы зарабатываете **\$1 000**.

МУ vs СП представляет собой соотношение максимального убытка к средней прибыли.

МУ vs СП = Максимальный убыток / Средняя прибыль

В нашем примере МУ vs СП = **500 / 1 000 = 0,5**. Это означает, что ваш максимальный убыток за определенный период времени оказался в два раза меньше того, сколько вы в среднем зарабатывали в своих прибыльных сделках.

Теперь, когда вы поняли концепты «максимального убытка» и «средней прибыли», давайте поговорим о МУ vs СП.

Почему это важно?

Трейдерам, соотношение МУ/СП которых ниже 1, получают около 52% выплат.

Проанализировав около **4 000** счетов успешных проп-трейдеров, мы обнаружили в их торговле четкий паттерн, касающийся соотношения МУ/СП:

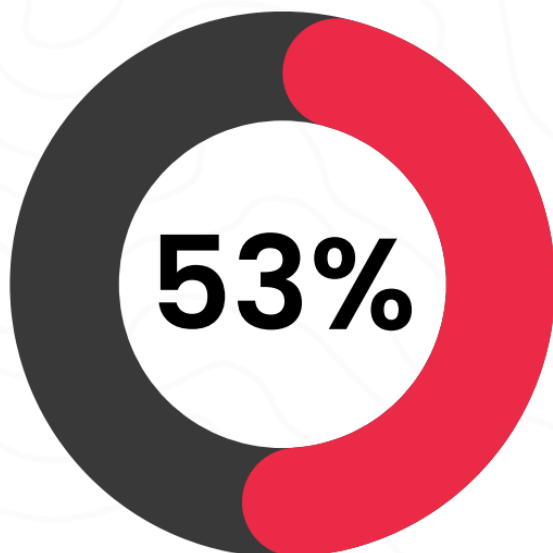
- Как правило, их средняя прибыль больше, чем их самый большой убыток.
- Их убытки никогда значительно не превышают их средние прибыли.

Давайте посмотрим на данные. Взгляните сами:

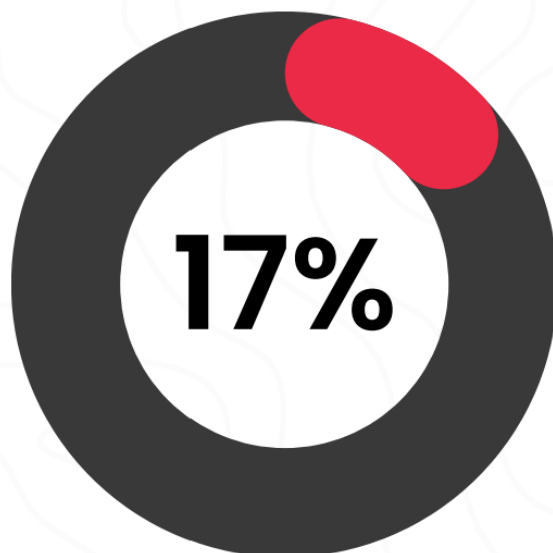
Соотношение МУ/СП	Количество трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
0.00 to 0.50	256	6.41%	30.10%
0.50 to 1.00	457	11.44%	22.99%
1.00 to 1.50	513	12.84%	16.21%
1.50 to 2.00	648	16.22%	12.84%
2.00 to 2.50	919	23.00%	11.44%
2.50 to 3.00	1203	30.11%	6.42%

- Самые успешные трейдеры – трейдеры с минимальным соотношением МУ/СП.
- Менее **7%** трейдеров удается поддерживать значение **МУ/СП ниже 0,5**.
- **Трейдерам, которым удается поддерживать значение МУ/СП ниже 1, получают около 52% выплат.**
- Как правило, их средняя прибыль **больше**, чем их самый большой убыток.
- Их убытки **никогда** значительно не превышают их средние прибыли.

Что это означает? Если вы сможете торговать так, чтобы величина вашего максимального убытка составляла менее половины того, сколько в среднем приносят вам ваши прибыльные сделки, вы попадете в топ-7% успешных проп-трейдеров.



**Трейдера с соотношением
МУ/СП выше 2**



Выплат

- Около **53%** трейдеров торгуют с соотношением МУ/СП **выше 2**. Это означает, что их максимальный убыток в 2 раза превышает их среднюю прибыль. Но они получают всего лишь около **17%** выплат.
- Трейдеры, которым удастся поддерживать соотношение МУ/СП **ниже 0,5**, получают в **4 раза** больше, чем трейдеры, соотношение МУ/СП которых находится в диапазоне **1.0-1.5**.

Спросите себя, когда вы в последний раз уделяли внимание показателю своего максимального убытка?

Этот важный показатель «спрятан на самом видном месте». Когда вы теряете в своей убыточной сделке больше, чем в среднем получаете в своих прибыльных сделках, это наносит урон не только вашему счету, но и вашей психологии.

Все сводится именно к соотношению МУ/СП. Есть ли другие секреты?

Да! В следующей главе мы узнаем еще один.

Упражнение

Предположим, что вы провели в сентябре 40 сделок, 34 из которых оказались прибыльными. Вы заработали в них \$34 000. 6 оказались убыточными. Самый большой убыток составил \$600. **Вычислите свое соотношение МУ/СП.**

Секрет №2: Профит-фактор

Замечали ли вы, что боль от потери \$1 000 ощущается гораздо сильнее, чем радость от получения прибыли того же размера?

Что, если бы у вас была возможность выяснить, что привело к убытку в \$1 000, и применить статистический подход для управления рисками?

В этой главе мы поговорим о том, что имеет к этим вопросам непосредственное отношение – о профит-факторе.

У успешных проп-трейдеров профит-фактор больше обычного.

Профит-фактор: общая прибыль от всех прибыльных сделок / общий убыток от всех убыточных сделок

Что такое профит-фактор?

Чтобы вычислить этот параметр, нужно разделить сумму всех своих прибылей на сумму всех своих убытков.

Скажем, вы исполнили в ноябре **100** сделок. **57** из них были закрыты с прибылью, что принесло вам **\$5 700**. **43** были закрыты с убытком, из-за чего вы потеряли **\$2 000**. В этом случае ваш профит-фактор будет равняться $5\,700 / 2\,000 = 2,85$.

Это означает, что **общая сумма ваших прибылей в 2,85 раза превышает общую сумму ваших убытков**.

Если вы хотите стать успешным проп-трейдером, ваш профит-фактор должен быть больше 1.

Как успешные трейдеры мы всегда старались ограничивать убытки и давать своим прибылям расти. Но до этого момента мы не знали причину, лежащую в основе этого принципа.

Нижеприведенные данные мы получили, проанализировав статистику **более 4 000** успешных проп-трейдеров. Поверьте, мы получили благодаря этому ценную информацию. Ключевые выводы:

Профит-фактор	Количество трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
1.00 to 1.25	1362	34.06%	6.37%
1.25 to 1.50	958	23.96%	7.88%
1.50 to 1.75	754	18.85%	8.88%
1.75 to 2.00	355	8.88%	18.85%
2.00 to 2.25	315	7.88%	23.96%
2.25 to 2.50	255	6.38%	34.05%

• Для прибыльного проп-трейдинга ваш **профит-фактор должен быть больше 1**.

• Как мы видим из **первых 3 рядов, 76,86%** трейдеров из этих 4 000 поддерживали свой профит-фактор в диапазоне 1-1,75. Это означает, что более 76% трейдеров торговали с профит-фактором менее **1,75**. Получается, если вы сможете поднять свой профит-фактор выше этой отметки, вы войдете в топ-**22%** трейдеров.

• Как видно из этой таблицы, трейдеры с профит-фактором 1-1,75 получили только 23% выплат. **Проп-трейдеры с профит-фактором более 1,75 получили почти 77% выплат.**

Если вы сможете торговать так, чтобы общая сумма ваших прибылей **в 2 раза** превышала общую сумму ваших убытков, **вы сможете увеличить свои выплаты вплоть до 5,6х.**

• Как мы видим, проп-трейдеры с профит-фактором 1-1,25 получили 6,37% от всех выплат. Трейдеры с профит-фактором 2,25-2,50 получили 34,05% выплат. **$34,05 / 6,37 = 5,6x$.**

• Менее 7% трейдеров поддерживали профит-фактор в диапазоне 2,25-2,50.

Это – еще один статистический показатель, «спрятанный на самом видном месте». Данный секрет несет в себе жизненно необходимое знание, которому «гуру» вас никогда не научат. Почему? Ответ прост.

Большинство «гуру» *сами этого не знают.*

Упражнение

Наше уравнение выглядит так:

Профит-фактор = общая сумма всех прибылей / общая сумма всех убытков

Предположим, что вы заработали за месяц \$7 496, а потеряли \$5 433.

Чему равняется ваш профит-фактор?

Секрет №3: Время удержания прибылей vs время удержания убытков

Не замечали ли вы, что даете своим убыточным сделкам больше времени и шансов, чем прибыльным?

Случалось ли с вами такое? А может, вы даже не смотрели на время удержания своих сделок?

Пора это сделать!

В этой главе мы поговорим о том, сколько профессиональные проп-трейдеры удерживают свои сделки, и о том, как вы можете извлечь из этого выгоду.

Один из самых важных аспектов торговли – время удержания сделок. Если вы не являетесь гиперактивным скальпером (что немного сложновато и достаточно рискованно), вы должны давать своим сделкам время на отработку.

Что такое время удержания прибылей и время удержания убытков?

Чем больше ваше время удержания прибыльных сделок по отношению ко времени удержания убыточных сделок, тем большей прибыльности вы добьетесь в проп-трейдинге.

Время удержания прибылей: время, в течение которого вы удерживали свои прибыльные позиции.

Скажем, у вас открыто 3 сделки. Одна из них – позиция по золоту, прибыль по которой составляет **150+ пунктов**. В 13:00 вы эту сделку открыли, а в 15:00 – закрыли. **Время удержания прибыли** составило 120 минут.

Время удержания убытков: время, в течение которого вы удерживали свои убыточные позиции.

Предположим, одна из этих 3 сделок – сделка по EURUSD, которая вошла в просадку на **120 пунктов**. Вы открыли ее в 12:30 и закрыли в 15:00. Время удержания убытка составило 150 минут.

Время удержания прибыли vs время удержания убытка = общее время удержания ваших прибыльных сделок / общее время удержания ваших убыточных сделок

Скажем, вы провели в сентябре 50 сделок. Из этих 50 сделок 39 принесли вам прибыль, а 11 – убыток. Совокупное время удержания 39 прибыльных сделок составило 80 часов, а 11 убыточных сделок – 40 часов. Время удержания прибылей vs время удержания убытков равняется $80 \text{ часов} / 40 \text{ часов} = 2$.

Данное соотношение показывает, что вы удерживали свои прибыльные сделки в 2 раза дольше, чем убыточные. **Чем больше будет этот показатель, тем больше будет ваша прибыльность.**

Как и все хорошее в этом мире, ваши хорошие сделки требуют времени.

Как дать своим хорошим сделкам достаточно времени?..

Ответ прост: забирайте время у своих плохих сделок. Хотя то, что хорошим сделкам нужно давать больше времени, чем плохим, кажется очевидным, давайте все же подкрепим эту идею статистическими данными.

Проанализировав более 4 000 счетов успешных трейдеров, мы обнаружили в их торговле четкий паттерн, касающийся соотношения ВУП/ВУУ.

Вот что стоит учитывать:

Соотношение ВУП/ВУУ	Количество трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
0.10 to 0.50	1403	35.08%	6.75%
0.50 to 1.00	947	23.68%	9.53%
1.00 to 1.50	523	13.08%	11.90%
1.50 to 2.00	476	11.90%	13.07%
2.00 to 2.50	381	9.53%	23.66%
2.50 to 3.00	270	6.75%	35.08%

- Как мы видим, **по мере увеличения соотношения времени удержания прибылей ко времени удержания убытков процент выплат растет, а количество трейдеров снижается.**
- Самые **прибыльные** проп-трейдеры за выбранный период – проп-трейдеры с **самым большим** соотношением времени удержания прибылей ко времени удержания убытков.
- Также наблюдается очевидное снижение количества трейдеров по мере повышения этого соотношения. 1 ряд: 1 403 трейдера поддерживали соотношение ВУП/ВУУ в диапазоне 0,1-0,5. Во 2 ряду (диапазон 0,5-1) трейдеров оказалось меньше (947), а в 3 (диапазон 1-1,5) – еще меньше (523).
- Менее 7% трейдеров удалось поддерживать свое соотношение ВУП/ВУУ выше 2,5. Эти трейдеры получили около 35% всех выплат. **Это означает, что топ-7% удерживали свои прибыли более чем в 2 раза дольше, чем убытки.**
- По первым 2 рядам мы видим, что большинство трейдеров (около 58%) удерживали свои убыточные сделки дольше, чем прибыльные.

Чтобы долго удерживать прибыльные сделки, требуется дисциплинированность и хорошо развитая психология. Причина того, что количество трейдеров в каждом последующем ряду снижается, заключается в том, что **у большинства трейдеров нет тенденции к долгому удерживанию прибылей.**

Упражнение

Скажем, вы провели в сентябре 48 сделок. Из этих 48 сделок 37 оказались прибыльными, а 11 – убыточными. Совокупное время удержания 37 прибыльных сделок составило 70 часов, а совокупное время удержания 11 убыточных сделок – 30 часов.

Чему равняется ваше соотношение ВУП/ВУУ?

Секрет №4: Качество важнее количества

Что, если 1 сделка принесет вам столько прибыли, сколько обычно приносят 10?

У всех великих трейдеров есть одна общая черта. Когда они совершают ошибку, они это понимают. Даже в том случае, если ошибка принесла им краткосрочную выгоду.

Прибыльные трейдеры торгуют не ради острых ощущений. Они торгуют, чтобы получать прибыли.

В этой главе вы увидите, как смещение акцента с количества сделок на их качество может улучшить вашу долгосрочную прибыльность в проп-трейдинге.

Итак, с чего начать?

Вы должны понимать, сколько убытков можете получить за один день.

Случалось ли такое, что вы получали убыток – и сразу же после этого видели, что рынок вот-вот восстановится?

Но как только вы входили в направлении восстановления, рынок сразу же разворачивался, вы получали двойной убыток и лишались своих предыдущих прибылей.

Представьте: что бы случилось, если бы вы, получив убыток, заканчивали свой торговый день? Сколько бы вы благодаря этому сэкономили?

Проанализировав данные около 4 000 успешных проп-трейдеров, нам удалось выявить несколько интересных паттернов. Вот некоторые из них:

- Чем выше частота исполнения сделок, тем ниже прибыльность.
- Исполнение большего количества сделок может **снизить** количество получаемых выплат.

Взгляните на следующую таблицу:

Количество сделок за период	Количество трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
3 to 5	96	2.43%	34.45%
5 to 10	373	9.45%	25.44%
10 to 15	473	11.99%	17.60%
15 to 20	704	17.84%	10.78%
20 to 25	922	23.37%	9.33%
25+	1378	34.92%	2.41%

Из нее можно сделать следующие выводы:

- По мере увеличения количества сделок в цикле количество выплат и их средний размер снижаются, а число трейдеров растет.
- Трейдеры, исполнившие за торговый цикл от 3 до 5 сделок, имели наивысший «средний размер выплат».
- Размер средней выплаты трейдеров, которые исполнили за цикл (период длиной в 1 месяц) более 25 сделок, оказался равен всего лишь \$186.
- Около 58% трейдеров исполнили более 20 сделок. Но они получили всего лишь 12% выплат.
- Только 23,8% трейдеров удалось открыть за цикл менее 15 сделок. Они получили около 78% всех выплат.

Почему нужно стремиться к качеству, а не к количеству?

- Вам будет проще поддерживать сосредоточенность.
- Вы будете совершать меньше ошибок, связанных с исполнением сделок (неправильный лот, полное закрытие вместо частичного и так далее).
- Ваши выплаты, вероятно, вырастут.
- Риск слива счета или достижения лимита по просадке уменьшится.

Упражнение

Начните вести следующую статистику: сколько сделок вы проводите в месяц? Наблюдается ли между этой переменной и вашей прибыльностью корреляция?

Определите, когда ваш винрейт максимален, а когда – минимален.

Секрет №5: Следуйте за трендом

Вот вам гарантии!

Если то, что будет написано ниже, не соответствует вашим торговым результатам, дайте нам знать. Если это действительно так, мы предоставим вам торговый счет бесплатно.

Мы гарантируем: если вы проанализируете циклы своей торговой истории, то обнаружите, что в большинстве циклов большую часть прибылей вам приносило какое-то одно направление торговли (либо покупки, либо продажи).

Как понимать фразу «следуйте за трендом»? Значит ли это, что нужно покупать, когда рынок выстреливает вверх, и продавать, когда он падает? Вовсе не обязательно.

Вы следуете за трендом, когда торгуете в направлении перевеса на старшем таймфрейме.

Предположим, что вы торгуете EURUSD, и последние 5 недельных свечей этой пары были медвежьими. Это показывает, что тренд на EURUSD сейчас нисходящий. Если вы подстроитесь к нему и начнете торговать только сделки на продажу, вы будете следовать за трендом.

Для вычисления того, как часто трейдер извлекает выгоду из следования за трендом, мы ввели термин «процент прибылей от перевеса».

Процент прибылей от перевеса – та часть ваших прибылей, которую вы получили, торгуя в направлении конкретного перевеса.

Предположим, вы получили в ноябре прибыль в \$1 000. Если \$750 из них были сделаны благодаря вашим позициям на покупку, это означает, что 75% ваших прибылей были получены благодаря перевесу.

Вы можете повысить вероятность получения прибыли, если будете подстраивать направление торговли к текущей структуре рынка.

Мы проанализировали 4 000 успешных проп-трейдеров и попытались вычислить их процент прибылей от перевеса.

Также мы попытались найти взаимосвязь между этим показателем и размерами их выплат.

Хотите увидеть немножко магии?

Топ-5-6% трейдеров получили 90-100% своих прибылей благодаря перевесу.

Процент прибылей от перевеса	Количество трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
70 to 75	1325	33.13%	4.95%
75 to 80	919	22.98%	9.33%
80 to 85	726	18.15%	11.46%
85 to 90	459	11.48%	18.14%
90 to 95	373	9.33%	22.98%
95 to 100	198	4.95%	33.14%

▪ Как видно по первому ряду, за используемый период 1 325 трейдеров получили 70-75% своих прибылей, торгуя в направлении перевеса. Это означает, что всего 25-30% их прибылей были получены тогда, когда конкретного перевеса у них не было.

▪ Если мы взглянем на 2 последних ряда, то увидим, что топ-15% трейдеров получили 90-100% прибылей, торгуя в направлении перевеса.

▪ По мере того, как процент прибылей от перевеса растет, растут и размеры выплат, а количество трейдеров снижается.

▪ Менее 30% прибылей были сделаны, когда перевеса у трейдеров не было (трейдеры занимались хеджированием, рынок находился в консолидации).

▪ Топ-трейдеры почти не пытались зарабатывать на хеджинговых позициях.

Как трейдеру вам стоит стремиться к простоте восприятия рынка. Цена может идти только в двух направлениях: либо вверх, либо вниз. Вам нужно находить четкие тренды. Потому что:

Большинство убыточных сделок случаются в ходе консолидации.

У вас нет ни необходимости, ни способности ловить каждое движение рынка. Когда вы придерживаетесь перевеса, вы торгуете более уверенно. Получать прибыли проще, когда вы следуете четкому тренду.

Не забывайте о гарантиях, которые мы дали вам в начале этой главы.

Важно понимать, какие тренды торговать стоит, а какие – нет. То же самое можно сказать и про валюты.

В следующей главе мы поделимся с вами секретом о том, как выбрать для себя правильные пары и как на них сосредоточиться.

Упражнение

Начните отслеживать следующую статистику: сколько сделок вы проводите во время тренда? Как часто входите против него?

Определите, как часто вы получаете прибыли, а как часто – убытки, торгуя в направлении тренда. Также определите, какие позиции приносят вам больше прибыли – покупки или продажи.

Секрет №6: Сосредоточьтесь на ограниченном количестве торговых пар

Как выбрать для себя пары/торговые инструменты?

Трейдеры тратят много времени и денег, пытаясь разобраться, КАК торговать, но при этом почти не уделяют внимания вопросу о том, ЧТО торговать. Представьте, что вы знаете про каждую пару следующее:

- Самые активные торговые часы и дни
- В какое время наиболее вероятно формирование устойчивого тренда
- Как далеко цена может пройти в тренде
- Какую часть от этого тренда вы можете забрать

Пытаться торговать все паттерны на всех парах – не лучшее решение.

Наши трейдеры торгуют 53 форекс-пары, 16 индексов, 3 металла и 5 товарных рынков. Сможете ли вы отслеживать паттерны на всех этих рынках? Очевидно, нет.

Успешные проп-трейдеры сосредотачиваются на конкретных парах.

Пытаться торговать паттерны на всех парах – не лучшее решение. Проанализировав данные 4 000+ прибыльных трейдеров, мы обнаружили, что самые успешные из них предпочитают сосредоточиться на конкретных парах. Судя по нашим анализам,

чем меньше пар торгует проп-трейдер, тем он успешнее.

Давайте посмотрим, какие данные мы получили:

Количество выбранных пар	Количество трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
Только 1 символ	239	5.98%	43.31%
2-3 символа	717	17.93%	32.79%
Мажорные пары/ Индексы США/ Европейские индексы	1311	32.78%	17.93%
Множество символов из разных групп	1733	43.33%	5.98%

- Топ-**6%** трейдеров торгуют только один конкретный символ.
- Менее 25% трейдеров торгуют от 1 до 3 символов.

• Как мы видим по последнему ряду, 43,33% трейдеров предпочитают не сосредотачиваться на конкретных парах.

• Проп-трейдеры, которые сосредотачиваются только на 1 паре, в среднем получают в 52 РАЗА БОЛЬШЕ выплат, чем проп-трейдеры, торгующие разные символы из разных групп.

Проп-трейдеры, которые сосредотачиваются на конкретных группах инструментов, например, на кроссах с долларом, на индексах США (Nasdaq, US100, US500) или на европейских индексах (DE40, UK100), получили в 13 раз меньше выплат, чем трейдеры, которые торговали только 1 пару.

Очевидно, чем меньше пар трейдер торгует, тем выше его прибыльность.

Упражнение

Начните отслеживать, какие пары вы торгуете.

Найдите пару, которая является для вас самой прибыльной, и пару, которая является для вас самой убыточной.

Секрет №7: Прибыльные сделки – только в прибыльные дни

Сможете ли вы стать прибыльным проп-трейдером, торгуя всего 1 раз в неделю – то есть всего 4 раза в месяц?

Треjder, который торгует только в конкретный день недели, может получить примерно в 13 раз больше выплат, чем трейдер, который торгует 4-5 дней в неделю.

Вопрос не в том, сможете ли вы стать прибыльным трейдером, торгуя 1 раз в неделю. Вопрос в том, удастся ли вам воздержаться от торговли во все остальные дни.

Определите, в какие дни недели вы обычно получаете больше всего прибылей.

Представим ради примера, что в течение последних 12 недель вы получали больше всего прибылей по четвергам. Это означает, что вам стоит торговать конкретные пары, которые являются для вас наиболее прибыльными, именно по четвергам.

Более 45% выплат получают те трейдеры, которые торгуют только в конкретные дни недели.

Но не верьте нам на слово. Давайте посмотрим на результаты анализа торговли 4 000 успешных проп-трейдеров.

Количество торговых дней в неделе	Кол-во трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
Один конкретный день	295	8.59%	45.24%
2-3 конкретных дня	1330	38.72%	33.25%
4-5 дней	1810	52.69%	21.51%

- Менее 9% трейдеров торговали только один конкретный день недели.
- Эти трейдеры получили более 45% выплат.
- Трейдеры, которые торговали 4-5 дней в неделю, получили менее 22% выплат.
- Трейдеры, которые торговали только в конкретный день недели, получили примерно в 13 раз больше выплат, чем трейдеры, которые торговали 4-5 дней в неделю.

Упражнение

Определите свой самый прибыльный день недели за последние 3 месяца.

Секрет №8: Винрейт

Что важнее? Винрейт или соотношение риска к прибыли?

Если вы хотите добиться успеха в торговле сделок с соотношением риск/прибыль 1:10 и вас совершенно не волнует, каким при этом окажется ваш винрейт – эта глава не для вас.

Потому что в данной главе мы обсудим, как вычислить свой винрейт и как его можно эффективно увеличить.

Винрейт = количество прибыльных сделок / общее количество сделок

Предположим, что вы исполнили в октябре 100 сделок. Из этих 100 сделок 67 вам удалось закрыть с прибылью. Получается, ваш винрейт равняется $(67/100) * 100\% = 67\%$.

Мы проанализировали винрейт 4 000 успешных проп-трейдеров и получили поразительные результаты – поразительные не в плане винрейта, а в плане того, как сильно от него зависела их успешность. Вы в это не поверите.

Трейдеры, винрейт которых находился в диапазоне 60-70%, получили в 10 раз больше выплат, чем трейдеры, винрейт которых равнялся 50-60%.

Винрейт	Количество трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
50-60%	1569	39.23%	1.83%
60-70%	1076	26.90%	12.45%
70-80%	784	19.60%	19.60%
80-90%	498	12.45%	26.90%
90-100%	73	1.83%	39.22%

Какие выводы можно сделать из этой таблицы?

- Если вы хотите добиться успеха в проп-трейдинге, ваш винрейт должен быть выше 50%.
- Трейдеры с винрейтом в диапазоне 60-70% получили почти в 10 раз больше выплат, чем трейдеры с винрейтом в 50-60%.
- Менее 2% трейдеров смогли поддерживать свой винрейт выше отметки в 90%.
- Менее 15% трейдеров смогли поддерживать свой винрейт выше отметки в 80%.
- Более 66% выплат получили трейдеры с винрейтом более 80%.

Многие проп-трейдеры считают, что винрейт не так уж важен. Некоторые даже думают, что ключ к успеху – это хорошее соотношение риск/прибыль. Однако **хорошего соотношения риск/прибыль можно добиться с помощью риск-менеджмента. Винрейт же зависит от качества ваших сигналов.**

Как можно увеличить свой винрейт?

- Ведите торговый журнал.
- Вычислите свой текущий винрейт.
- Определите, какие пары являются для вас наиболее прибыльными.
- Определите, какие дни являются для вас наиболее прибыльными.
- Торгуйте только лучшие пары в лучшие дни.
- Каждый торговый день придерживайтесь конкретного количества сделок.

Упражнение

Уравнение винрейта выглядит следующим образом:

Винрейт = количество прибыльных сделок / общее количество сделок

Скажем, вы провели за месяц 47 сделок, 29 из которых оказались прибыльными.

Чему равняется ваш винрейт?

Мы открыли вам 8 секретов успешных проп-трейдеров.

Советуем вам пройти по ним еще раз, прежде чем мы перейдем к последнему.

Окей, пришло время для последнего секрета!

Секрет №9: Торговля без стресса

Задумывались ли вы когда-нибудь о том, как стабильно прибыльным трейдерам удается торговать, никогда не испытывая стресса?

Чтобы понять, как контролировать стресс, сначала нужно разобраться, что его вызывает. Итак,

Что вызывает у вас стресс?

- Сделки в просадке?
- Вынос стоп-лосса?
- Когда рынок выносит вас по безубытку и уходит в нужную сторону?

Что, если бы вы точно знали, что произойдет в будущем? Испытывали бы вы тогда такой же уровень стресса? Вероятно, нет, не так ли?

Главная причина стресса – неизвестность.

Если вы хотите мыслить так, как мыслят лучшие проп-трейдеры, вам нужно научиться полностью принимать риски и действовать соответственно.

Как поддерживать дисциплинированность, сосредоточенность и уверенность перед лицом неизвестности? Это – фундаментальный парадокс трейдинга. Тем не менее, это возможно, если вы освоите манеру мышления прибыльных проп-трейдеров. Но трейдеры, как правило, не уделяют этому достаточно внимания и даже не предпринимают попыток это сделать.

Спросите себя: если вы освоите навык принятия риска, сможет ли рынок дать вам такую информацию, которая вызовет у вас стресс?

Если рыночная информация лишится потенциала для вызова стресса, вам будет нечего избегать. Рыночные данные будут нести в себе только возможности.

Полностью избавиться от неизвестности в трейдинге нереально. Но что, если вы сможете ее уменьшить?

Проанализировав статистику более 4 000 успешных проп-трейдеров, мы выявили паттерн, который помогает им ограничивать стресс.

И он очень прост.

Успешные проп-трейдеры ограничивают количество убытков, которые они могут получить за день.

Количество убыточных сделок в день	Количество трейдеров	Процент трейдеров	Процент выплат
1	253	6.01%	41.33%
2-3	333	7.91%	31.24%
4-5	725	17.22%	18.12%
6-7	1250	29.68%	8.32%
8-9	1650	39.18%	0.99%

Трейдеры, получившие менее 4 убытков в день, получили 72% выплат.

- Самыми прибыльными оказались трейдеры с наименьшим количеством убытков в день.
- Менее 14% трейдеров удалось торговать так, чтобы получить не больше 3 убытков в день. Они получили 72% всех выплат.
- Около 39% трейдеров иногда получали до 8-9 убытков в день. Доля их выплат составила менее 1%.
- Трейдеры, которые получали по 4-5 убытков в день, получили в 5 раз меньше выплат, чем трейдеры, которые получали менее 4 убытков в день.

Теперь, когда мы ознакомились со статистикой, давайте разберемся, как убыточные сделки связаны со стрессом. Взглянем на ситуацию объективно.

Если ваша ментальная модель ограничивает количество убытков, которые вы можете получить в течение дня, происходит волшебство. Например:

- Вместо того, чтобы работать в условиях потенциально многочисленных стрессовых исходов, вы ограничиваете степень неизвестности. Как следствие – вы лучше контролируете свой стресс.
- Вы перестаете чувствовать необходимость отыграться в день получения убытка.
- Вы не поддаетесь овертрейдингу.
- Вам не приходится заниматься торговлей в плохом настроении.

К сожалению, иногда у вас все равно будет возникать чувство, будто рынок имеет что-то против вас лично.

Холодная и жестокая реальность трейдинга заключается в том, что исход каждой сделки непредсказуем. Если вы не научитесь полностью принимать вероятность неизвестного исхода,

вы будете стараться избегать (осознанно или неосознанно) любых возможностей, вызывающих стресс.

Что приведет к дорогостоящим ошибкам.

Упражнение

Определите, сколько убытков (в среднем) вы получаете в день.

Какие действия вы предпримете для того, чтобы снизить их количество? Ответ запишите.

Резюме

- У каждого успешного проп-трейдера **средняя прибыль превышает максимальный убыток**. Это означает, что если он в среднем делает в своих прибыльных сделках по \$1 000, его максимальный убыток не превышает той же \$1 000.
- Успешные проп-трейдеры имеют **профит-фактор больше обычного**. Это означает, что сумма всех их прибылей превышает сумму всех их убытков.
- **Время удержания прибылей у успешных проп-трейдеров больше, чем время удержания убытков**. Это означает, что они удерживают свои прибыльные сделки дольше, чем убыточные.
- Успешные проп-трейдеры **исполняют сравнительно мало сделок**.
- Успешные проп-трейдеры **следуют за рыночным трендом и не торгуют, когда рынок пребывает в консолидации**. Чтобы следовать за трендом, они отслеживают перевес на старшем таймфрейме.
- Успешные проп-трейдеры **торгуют свои самые прибыльные пары в свои самые прибыльные дни недели**. Более 45% выплат уходит тем трейдерам, которые торгуют в конкретный день недели.
- Успешные трейдеры обладают **высоким винрейтом**. Трейдеры с винрейтом в 60-70% получают почти в 10 раз больше, чем трейдеры с винрейтом в 50-60%.
- Успешные проп-трейдеры **ограничивают количество убытков**, которые могут получить **в течение дня**. Трейдеры, которые получали менее 4 убытков в день, получили около **72% выплат**.

Правда о проп-трейдинге

Вы ведь технический аналитик, верно?

В отличие от фундаментального анализа, технический анализ дает бесчисленное количество сетапов для торговли, что в теории должно помочь трейдеру закрыть разрыв между желаемым и действительным.

Действительно, технический анализ позволяет выявить поведенческие паттерны, которые появляются на всех таймфреймах, что открывает для трейдеров источник бесконечных возможностей.

Но я хочу задать вам один вопрос.

Если технический анализ так хорошо работает, зачем вы скачали эту книгу? И почему большинство успешных трейдеров работают над своим мышлением, а не над своей торговой стратегией?

Ответ прост.

В техническом анализе тоже присутствует разрыв между желаемым и действительным – разрыв между тем, что представляется вам источником бесконечных возможностей для получения финансовой выгоды, и тем, какие прибыли вы получаете на самом деле.

Как можно сократить этот разрыв?

С помощью дисциплинированного образа мышления.

Вспомните свои самые дорогостоящие ошибки, связанные с исполнением сделок. Входит ли в их число что-нибудь из нижеприведенного?

- Попытка уговорить себя торговать посредственный сетап.
- Колебания в момент открытия сделки.
- Преждевременные выходы.
- Погоня за рыночными движениями.
- Преждевременное подтягивание стопа.
- Отодвигание тейк-профита.
- Попытка отговорить себя от правильной сделки.

Вот 5 столпов дисциплинированного образа мышления: подготовка, исполнение, контроль эмоций, трейд-менеджмент и риск-менеджмент.

Спросите себя, в чем причина этих проблем? В вашей стратегии? Или в вашем образе мышления? Ответ – «в образе мышления».

Если правильный образ мышления и дисциплинированная торговля вызывают у вас трудности, следующие главы вам помогут. Давайте посмотрим, что нужно делать, чтобы мыслить как топ-5% трейдеров.

Психологический столп №1: Подготовка

*«Те, кто проливают на тренировках больше пота, в бою проливают меньше крови»,
– Джордж Смит Паттон-младший.*

Вы должны готовить себя к возможностям. Это критически важно. И речь не только о подготовке к прохождению испытания проп-фирмы. Вы должны постоянно развивать свои навыки и понимание рынка. Держите глаза открытыми, продолжайте учиться, продолжайте расти. Когда возможность появится, вы должны быть готовы ей воспользоваться.

Ведение торгового журнала

Торговый журнал – самый важный инструмент для любого трейдера. Но большинство из нас пренебрегают его ведением или ведут его спустя рукава.

Журнал позволяет непредвзято оценить свои результаты, взглянув на них без лишних эмоций. Также с его помощью можно выявить риски и возможности.

Существует огромное количество шаблонов для торговых журналов. Оптимальные включают в себя следующие переменные сделок:

- Время и цена входа
- Время и цена выхода
- Размер позиции
- Тейк-профит (цена или значение индикатора)
- Стоп-лосс (цена или значение индикатора)

Выберите стиль проп-трейдинга, который подходит вашей повседневной жизни

Совмещать дейтрейдинг с работой на полную ставку очень нелегко. Вряд ли вы сможете добиться в этом стиле долгосрочного успеха, если регулярные рабочие встречи мешают вам проверять телефон. Ваш подход к трейдингу должен хорошо вписываться в ваш образ жизни. Определите, сколько времени вы можете посвящать торговле – в день, в неделю, в месяц. После этого создайте такую стратегию и такой торговый план, которые будут это учитывать.

Отслеживайте экономические новости

Публикация экономических данных может повлиять (и влияет) и на валюты, и на индексы. Каждый проп-трейдер должен учитывать дату и время запланированных экономических новостей и заблаговременно к ним готовиться. В такие моменты волатильность нередко подскакивает. Это несет в себе как риски, так и возможности.

Психологический столп №2: Исполнение

Всегда тестируйте новые идеи на демо-счете

Если у вас нет доказательств прибыльности новой стратегии, неразумно сразу пускать ее в ход на проп-счете.

Всегда сначала тестируйте свои новые стратегии на демо.

«Идея не сделает тебя богатым. А вот правильная реализация идеи – сделает», – Феликс Деннис.

Регулярно проводите анализ своей торговли

Ведение торгового журнала – это прекрасно. Но толк он не будет только в том случае, если вы будете регулярно проводить анализ полученных с его помощью данных. Он служит нескольким целям:

- Анализ торгового журнала помогает трейдеру поддерживать сосредоточенность на своей торговой стратегии.
- С его помощью можно оценить корректность субъективных мнений и ощущений.
- Он позволяет выявить проблемы и возможности.

Вы должны проводить оценку своей торговли настолько организованно, насколько это возможно. Каждая аналитическая сессия должна нести максимум пользы и затрагивать все основные темы.

Избегайте чрезмерного мышления

У каждой исполненной вами сделки может быть только 2 исхода – прибыльный или убыточный. В раздумьях, а уж тем более – чрезмерных, нет нужды, если вы ограничиваете размер своих убытков и правильно контролируете риски. Просто исполняйте – отслеживайте – записывайте!

Психологический столп №3: Контроль эмоций

Регулярно проводите аудит своих эмоций

Мы упоминали, что самый полезный инструмент проп-трейдера – его торговый журнал. Почему? Потому что самая главная сложность трейдинга – это эмоции.

Эмоции заставляют проп-трейдеров отступать от намеченного плана, поддаваться овертрейдингу, идти на лишние риски и применять непроверенные тактики. Все это приводит к ужасным последствиям. Эмоции нам неподвластны, но мы можем снизить силу их влияния. И первый к этому шаг – правильная оценка эмоций.

Возможно, вам помогут следующие вопросы:

- Как я себя чувствую?
- О чем я в данный момент беспокоюсь? На что я надеюсь?
- Не случилось ли какого-то важного события, которое может повлиять на мою работу?

Если вы считаете, что испытываемые вами в данный момент эмоции могут повлиять на вашу торговлю – прекратите ее. Вам вовсе не обязательно торговать каждый день. Возможности никуда от вас не денутся. Займитесь вместо торговли причиной, вызвавшей сильные эмоции. Если у вас не получится с ней разобраться, создайте стратегию, которая поможет вам минимизировать количество решений, которые вам приходится быстро принимать в течение дня.

«Если вы научитесь создавать состояние ума, на которое не влияет поведение рынка, трудности просто перестанут для вас существовать», – Марк Дуглас.

Проигрывать – это нормально

Каким бы прекрасным трейдером вы ни были, рано или поздно вы обязательно проиграете. Невозможно торговать, никогда не получая убытков. Иногда череда неудач просто случается.

Это – неотъемлемая часть торговли. Каждому трейдеру нужно понимать это и быть к этому готовым. Убытки должны вызывать опасения только в том случае, если они случаются чаще обычного – в масштабах значительного количества сделок.

Если вы поймете, что проигрыши – это часть игры, вы сможете смириться с этими небольшими неудачами.

Устраивайте перерывы от рынков

Как ни увлекателен трейдинг, это – дело непростое. Торговля – занятие сложное, но вознаграждающее.

Любому успешному бизнесу требуются периодические отпуска... Как и нам. Уйти в рынки с головой очень просто. Поэтому трейдерам стоит регулярно устраивать себе заранее запланированные паузы, чтобы ненадолго отключиться от рынков.

Просто проводить свои вечера вдали от экранов недостаточно. Нужно устраивать полноценные перерывы, которые помогут бы вам перезагрузиться и восстановить внутреннее равновесие. Это особенно полезно, когда у трейдера начинает проявляться нежелательное поведение.

Вот несколько признаков того, что вам нужно сделать перерыв от торговли:

- Вы замечаете, что начали поддаваться овертрейдингу и торговать посредственные и даже плохие сетапы.
- Вы получили за последнее время несколько по-настоящему крупных убытков.
- Когда вы не торгуете, вы занимаетесь тем, что прокручиваете в своей памяти сделки, особенно – убыточные.
- Вы становитесь раздражительным, и у вас появляются проблемы со сном.

Психологический столп №4: Трейд-менеджмент

«Цель успешного трейдера – проводить наилучшие сделки. Деньги вторичны», – Александр Элдер.

Начните с маленького проп-счета

За редкими исключениями, не существует прибыльных методов, которые работали бы на счете в \$500 000, но не подошли бы для счета в \$5 000. Трейдеры-новички особенно уязвимы для сливов. Можно даже сказать, что это – своеобразный обряд посвящения.

Следовательно, начинать нужно с малого. Не концентрируйтесь на общих прибылях. Сосредотачивайтесь на процентах. Ваша уверенность в себе будет расти по мере получения положительных результатов.

Сосредотачивайтесь на решениях, а не на результатах

«Поле его мечты» – фильм, который стоит посмотреть и трейдерам. Прибыли – следствие мудрых решений. Так что включайте голову! Способности к рекурсивному обучению и использованию обратной связи для внесения изменений заложены во всех людях.

Трейдинг похож на покер. Вы можете проиграть даже с лучшими картами. Топовых трейдеров и игроков в покер не волнует, каким окажется исход конкретной раздачи или конкретного дня.

Вместо этого они просто стараются принимать наилучшие решения. Они знают, что результаты придут сами. Не забывайте: даже самые надежные и проверенные тактики иногда подводят.

Если мы сосредоточимся на принятии правильных решений, исключить фактор удачи из стратегии окажется гораздо проще.

Вы всегда должны продумывать вход, цель, стоп и размер позиции до открытия сделки

Трейдеры-новички часто забывают, что риск-менеджмент зависит от того, знаете ли вы свой вход, цель, стоп и размер позиции до открытия сделки.

Если вы этого не знаете, вы подвергаете себя риску, который может оказаться катастрофическим.

Никогда не изменяйте свой стоп-лосс

К сожалению, практика отодвигания стоп-лосса среди проп-трейдеров очень распространена.

Исход сделки должен предопределяться в момент ее открытия. Отодвигание стоп-лосса, как правило, является верным способом потерять деньги. Мы используем стоп-лоссы для ограничения убытков. Не стоит в них вмешиваться – этим мы подвергаем себя потенциально катастрофической опасности.

Учитывайте взаимосвязи между парами

Перед исполнением сделки проверьте корреляцию рынков.

Психологический столп №5: Риск-менеджмент

Установите ограничение на убытки

У всех трейдеров время от времени случаются сложные периоды. Иногда это происходит и с нами.

Ваша цель – не позволить череде убытков навредить вашему проп-счету. Никогда не забывайте: череда убытков, чем бы она ни была вызвана (рынком, эмоциями или изъяном в стратегии), не станет серьезной угрозой для вашей карьеры, если вы практикуете использование дневных и недельных ограничений на убытки.

«Не бойтесь рисков. Понимайте их, контролируйте их, минимизируйте их до приемлемых уровней», – Навед Абдали.

Контролируйте свои позиции и свой портфель

Никогда не используйте случайные размеры позиций. Аккуратно взвешивайте каждую свою сделку. Прежде чем проводить транзакцию, оцените, как она может повлиять на ваш проп-счет – с учетом всех остальных позиций.

Никогда не отрывайте взгляда от сделки

Отвлекающих факторов не избежать, где бы вы ни торговали. Ответить на телефонный звонок и случайно отвлечься от происходящего на рынке – это так просто! Хуже того, некоторые проп-трейдеры уходят от своих девайсов и сделок в условиях повышенной рыночной волатильности. Никогда так не поступайте. Всегдаставляйте стоп-лоссы и цели, даже если вы планируете выходить вручную – просто на всякий случай.

Ваш лучший убыток – первый

Эта ценная поговорка основывается на огромном количестве сделок. Она будет всегда актуальна.

Проще говоря, фиксируйте небольшие убытки – пока они не выросли в более крупные.

Бывает, что проп-трейдеры цепляются за свои позиции, потому что не хотят ошибаться. Старайтесь держать свое эго в узде. Не пытайтесь компенсировать убытки в день их получения.

Не рискуйте тем, что не можете позволить себе потерять

Не забывайте три основных принципа:

- Не берите деньги в долг, чтобы оплатить испытание проп-фирмы.
- Не используйте сбережения, отложенные для других целей.
- Не тратьте на испытание деньги на оплату счетов.

Конец



TLAP.COM