

## Система накопленных рисков

Виталий Гоголин, Daytrader, Киев, 2012

Система разработана как полностью механизированный свод правил для контроля рисков трейдеров, торгующих на деньги компании. Несмотря на то, что она разрабатывалась для внутрисуточной торговли, эта же система с более глубоким уровнем подсчета применима для любого торгового горизонта.

1. Поставить месячную цель. Пример: **\$600**
2. Рассчитать месячный риск, разделив прибыль на 3. Пример:  $\$600/3=\$200$
3. Рассчитать дневной риск, разделив месячный на 20. Пример:  $\$200/20=\$10$
4. Использовать таблицу для ведения рисков:

Риск на текущий день (Risk):			
Цель на текущий день (Target):			
Убыточные позиции (Loss)		Прибыльные позиции (Profit)	
1		2	
3		4	
5		6	
7		8	
...		...	
N		N+1	
Итого за день (Day):			

5. Риск на день рассчитывается по формуле: дневной риск + накопленный, который остался неиспользованным с предыдущего дня. Расчет накопленного риска:
  - Если прошлый день закрыт в целевом диапазоне, накопленный риск равен риску прошлого дня;
  - Если прошлый день закрыт в плюс, но не достиг цели, накопленный риск равен накопленному риску предыдущего дня;
  - Если прошлый день закрыт в минус, накопленный риск рассчитывается по формуле: риск прошлого дня минус сумма убыточных позиций за прошлый день.
6. Цель на день лежит в диапазоне [Риск – Риск\*3]. Основная цель – закрыть день в плюс. Если получается уверенно контролировать дневной риск, двигаться к большей границе. Если есть какая-либо неуверенность или сомнения – закрывать день у минимальной цели.

При расчете риска в течение дня, все цифры считаются нэтом. При невозможности указания точной цифры из-за заранее неизвестного размера комиссии или биржевых сборов, следует указать приближенное завышенное значение.

### Примеры:

День 1				День 2				День 3				День 4			
R: \$10 T: \$10-\$30				R: \$10 T: \$10-\$30				R: \$20 T: \$20-\$60				R: \$20 T: \$20-\$60			
Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit	
1	-4			1	-5	2	+28	1	-4	2	+22	1	-5		
2	-5			3	-5			3	-6			2	-5		
								4	-5			3	-6		
Day: -9				Day: +18				Day: +7				Day: -16			
День 5				День 6				День 7				День 8			
R: \$14 T: \$14-\$42				R: \$24 T: \$24-\$72				R: \$34 T: \$34-\$102				R: \$12 T: \$12-\$36			
Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit	
		1	+15	1	-6	3	+20	1	-4					1	+6
				2	-8	5	+25	2	-5					2	+16
				4	-5			3	-5						
								4	-4						
								5	-8						
								6	-6						
Day: +15				Day: +26				Day: -32				Day: +22			
День 9				День 10				День 11				День 12			
R: \$22 T: \$22-\$66				R: \$32 T: \$32-\$96				R: \$30 T: \$30-\$90				R: \$40 T: \$40-\$120			
Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit	
1	-12	2	+48	1	-12			1	-16	3	+54	2	-14	1	+102
								2	-8			3	-12		
Day: +36				Day: -12				Day: +30				Day: +66			
День 13				День 14				День 15				День 16			
R: \$50 T: \$50-\$150				R: \$50 T: \$50-\$150				R: \$60 T: \$60-\$180				R: \$70 T: \$70-\$210			
Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit	
1	-12	3	+44	3	-24	1	+35			1	+60	1	-24	3	+38
2	-28			4	-26	2	+110					2	-24		
Day: +4				Day: +95				Day: +60				Day: -10			
День 17				День 18				День 19				День 20			
R: \$60 T: \$60-\$180				R: \$70 T: \$70-\$210				R: \$0 T: \$0				R: \$0 T: \$0			
Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit		Loss		Profit	
1	-24	2	+98	1	-24	3	+38								
		3	+106	2	-24	4	+55								
				9	-10	5	+6								
						6	+45								
						7	+14								
						8	+20								
Day: +180				Day: +120				Day: 0				Day: 0			

В примере последние два дня нет торговли, поскольку достигнута месячная цель.

## Реальность целей в примере

**Второй день:** для того, чтобы получить +28, достаточно взять 28 центов на 100 акций или 14 центов на 200.

**Третий день:** чтобы получить +22, достаточно взять 11 центов на 200 акций или 22 цента на 100.

**Пятый день:** показан пример, что не обязательно выторговывать весь день. Если первая позиция дает цель, можно остановиться.

**Шестой день:** +20 можно получить десятью центами на 200 акций со стопом 3 цента. +25 получается единственно возможным вариантом – 25 центов на 100 акций. После четвертой позиции в новой сделке нельзя было ставить риск более \$5.

**Восьмой день:** пример одновременного закрытия позиций по общему достижению цели.

**Девятый день:** +48 – это 16 центов на 300 акций, 24 цента на 200 акций или 48 на 100.

**Двенадцатый день:** +102 – это 25-27 центов на 400 акций или 51 цент на 200. Вариант 102 на 100 акций не рассматривается, поскольку цели более 60 центов можно брать только частичными объемами.

**Тринадцатый день:** +44 можно получить только двумя способами: 44 на 100 или 22 на 200. На момент входа в третью позицию, риска оставалось всего \$10.

**Четырнадцатый день:** показывает, что независимо от того, сколько за день заработали, отведенный на день риск превышать нельзя. Для +110 достаточно взять ~20 центов на 600 акций.

**Пятнадцатый день:** позволяет открыть позицию объемом в 1000 акций, с риском 4 цента. Этого делать не рекомендуется, диверсификация по корзине более стабильна, но возможность такого входа есть.

**Шестнадцатый день:** если нет хороших входов и рынок выносит из позиций, достаточно уйти с любым плюсом, чтобы сохранить накопленный риск.

**Семнадцатый день:** +100 – это 20 центов на 500 акций, 50 центов на 200 акций и все варианты между ними. Примером может быть день, когда 2 позиции были открыты в одну сторону, а третья в противоположную. За движением рынка первые две подтянулись, а третью выбило по стопу.

**Восемнадцатый день:** После второй позиции на день оставалось всего \$22 риска. Серия из 7 позиций по 100 акций возможна, когда по первым позициям исчезает риск закрытия в убытке. К примеру, из 4 открытых позиций с риском 5 центов 3 были перенесены в безубыток. Подход высвобождает риск и позволяет открыть большее число позиций, чтобы добраться до верхнего целевого диапазона. Позиции 3-9 были закрыты все вместе по совместному достижению цели.

Важно: Ко всем целям необходимо добавлять комиссию. Все риски считать только нэтом.

## Принципы торговли по системе накопленных рисков:

1. **Динамичность.** Отсутствует постоянный риск для отдельного дня и отдельной позиции. Объем позиции и торговых целей в позиции сводится к интуитивно-расчетному.
2. **Комфортность.** Система снижает психологическое давление на трейдера и сводит процесс торговли к игровому расчету, как в шахматной партии.
3. **Креативность.** Система предполагает творческий подход к торговле и нелинейное поведение при совершении сделок.

## Система накопленных рисков решает проблемы:

1. **Переход на объем.** Творческий подход и выигрышные серии динамически переводят трейдинг на большее количество бумаг и с той же легкостью возвращают назад после убыточных дней.
2. **Большие стопы.** При расчете путей достижения цели, элементарные математические рассуждения подскажут более рациональные варианты, чем постановка увеличенных стопов.
3. **Пересиживание прибыли.** Независимо от заработанной прибыли за день, остановка риска происходит по достижению лимита по убыточным позициям.
4. **Туманность целей.** В системе правила сводятся к двум состояниям в течении дня: голодный и сытый. В зависимости от текущего состояния, нужно или забирать со стола то, чего хватает, чтобы стать сытым (попасть в прибыльный диапазон) или добавляется вальяжность и небрежность в отношении позиций с целью выжать максимальный результат.
5. **Психология.** Есть четкие цели на день. Психология заменяется математикой. Нахождение в конце дня в победном диапазоне означает выполненную задачу и отсекает ненужные мысли и вопросы из серии «мог взять больше».

## Контакты:

Skype: vgogolin

Tel: +38067-656-1466

Site: [www.daytrader.ua](http://www.daytrader.ua)

День 1		День 2		День 3		День 4	
R:	T:	R:	T:	R:	T:	R:	T:
Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit
Day:		Day:		Day:		Day:	
День 5		День 6		День 7		День 8	
R:	T:	R:	T:	R:	T:	R:	T:
Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit
Day:		Day:		Day:		Day:	
День 9		День 10		День 11		День 12	
R:	T:	R:	T:	R:	T:	R:	T:
Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit
Day:		Day:		Day:		Day:	
День 13		День 14		День 15		День 16	
R:	T:	R:	T:	R:	T:	R:	T:
Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit
Day:		Day:		Day:		Day:	
День 17		День 18		День 19		День 20	
R:	T:	R:	T:	R:	T:	R:	T:
Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit	Loss	Profit
Day:		Day:		Day:		Day:	