

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

Оценка рисков: расчет минимальной просадки

Диверсификация активов и управление ими

Кросс маржа или изолированная маржа

Разбор успешных и неуспешных сделок

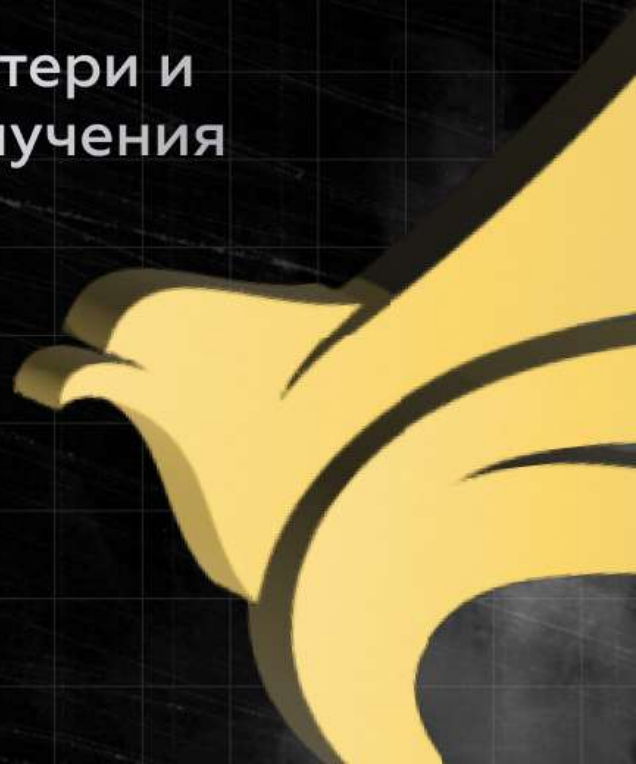
Выводы и рекомендации



ЧТО ТАКОЕ ОЦЕНКА РИСКОВ В ТОРГОВЛЕ?

Оценка рисков, по простому - до каких крайних значений цена может добраться, дабы мы не потеряли свой депозит (не получили ликвидацию всего субаккаунта).

Цель: Минимизировать потери и повысить вероятность получения прибыли.





ФАКТОРЫ, ВЛИЯЮЩИЕ НА РИСКИ ПРИ ТОРГОВЛЕ С БОТОМ

Настройки бота: Плечо, количество денег в поддержке, сетка перекрытия, выбор монеты, сетка ордеров.

Рыночная волатильность:
Непредсказуемые колебания цен.

Внешние факторы: Новости, события, изменения регуляций.



КАК ОЦЕНИТЬ РИСКИ?

Анализ монеты, ее фундаментала и графика перед настройкой

Бэктестирование: Проверка стратегии на исторических данных.

Анализ чувствительности: Изучение, как изменения в настройках бота влияют на результаты.

Расчет максимальной просадки: Определение максимального возможного снижения депозита.

РАСЧЕТ ТОЧКИ ЛИКВИДАЦИИ, ЧЕРЕЗ ТАБЛИЦУ:

Цель: отодвинуть ее как можно дальше за круглые значения (1-2-5-10\$), и желательно между нашей точкой входа и точкой ликвидации, должны присутствовать несколько уровней поддержки или сопротивления (в зависимости от того, лонгуем мы или шортим).



ИНСТРУМЕНТЫ ДЛЯ ОЦЕНКИ РИСКОВ

Таблицы: Для расчета различных показателей, например, максимальной просадки.

Графики: Для визуализации исторических данных и определения трендов.

Калькуляторы: Для автоматизации расчетов и анализа.



ДИВЕРСИФИКАЦИЯ АКТИВОВ: НЕ КЛАДИТЕ ВСЕ ЯЙЦА В ОДНУ КОРЗИНУ

На скриншоте отличный пример что может произойти, выбери мы лишь один не лучший актив для торговли, "Закотлетив" в него.





ПОЧЕМУ ДИВЕРСИФИКАЦИЯ ВАЖНА?

Снижение рисков: Распределение капитала между несколькими активами позволяет снизить влияние просадки одного актива на весь портфель.

Повышение стабильности:

Диверсификация делает портфель более устойчивым к рыночным колебаниям.

Увеличение потенциала прибыли:

Инвестируя в разные активы, мы можем захватить больше возможностей для роста.



КАК ПРАВИЛЬНО ДИВЕРСИФИЦИРОВАТЬ ПОРТФЕЛЬ?

Выбор активов: Выбирайте активы с различной корреляцией.

Оптимальное количество активов: Обычно рекомендуется выбирать 3-5 активов.

Баланс между риском и доходностью: Составляйте портфель таким образом, чтобы он соответствовал вашей толерантности к риску.



УПРАВЛЕНИЕ ДИВЕРСИФИЦИРОВАННЫМ ПОРТФЕЛЕМ

Мониторинг портфеля: Регулярно отслеживайте состояние своих инвестиций.

- ↘ Где ваша точка входа
- ↘ Где ваша точка ликвидации
- ↘ Влияние фандинга на вашу открытую позицию
- ↘ Если есть навык в трейдинге - важные уровни от которых может дать реакцию цена (FVG\OB\Зона поддержки\Сопротивления\Ликвидность)

Ребалансировка: Периодически корректируйте доли активов в портфеле, ребалансируя их в другие менее насыщенные \$ направления. Часть в ботов (для сложного процента, часть в другие направления - СПОТ к примеру)

Анализ эффективности: Оценивайте результаты своей инвестиционной деятельности. Опыт позволит со временем улучшить торговые результаты значительно.

ИЗОЛИРОВАННАЯ МАРЖА

- ↓ По разному работает ликвидация
- ↓ Ликвидация на перекрестной марже - ликвидирует все деньги на счету
- ↓ В изолированной марже - ликвидирует лишь то, что выделено у нас на позицию
- ↓ Ликвидация зависит от плеча (с 10 плечом мы не можем сделать сетку перекрытия 20%, нас просто ликвидирует раньше)
- ↓ Подгонять сетку меньше чем плечо (8% если 10 плечо, например) чем меньше сетка тем безопаснее
- ↓ За счет изолированной маржи, трейдер может контролировать сколько средств он хочет выделить на конкретную сделку. И не потерять лишнего со счета.

КРОСС МАРЖА

- ↙ Система на бирже, которая позволяет трейдерам использовать весь баланс своего кошелька, включая все нереализованные прибыли и убытки открытых позиций в качестве маржи.

Если по простому, все наши средства на конкретном субакаунте будут задействованы в открытых сделках полностью, и в случае ликвидации мы их так же теряем полностью. Но только на этом конкретном субакаунте.

В свою очередь за счет кросс-маржи, мы и удерживаем позиции открытыми находясь в большей безопасности, используя наши USDT как поддержку.

- ↙ Биржа по умолчанию всегда работает на Кросс-Марже.