

The logo for ICEFX, featuring the word "ICE" in a white serif font and "FX" in a white sans-serif font. A small blue diagonal line is positioned above the "X".

ICEFX

Решения для торговли

# Риск-менеджмент

Внешний контроль трейдеров

# Проблематика

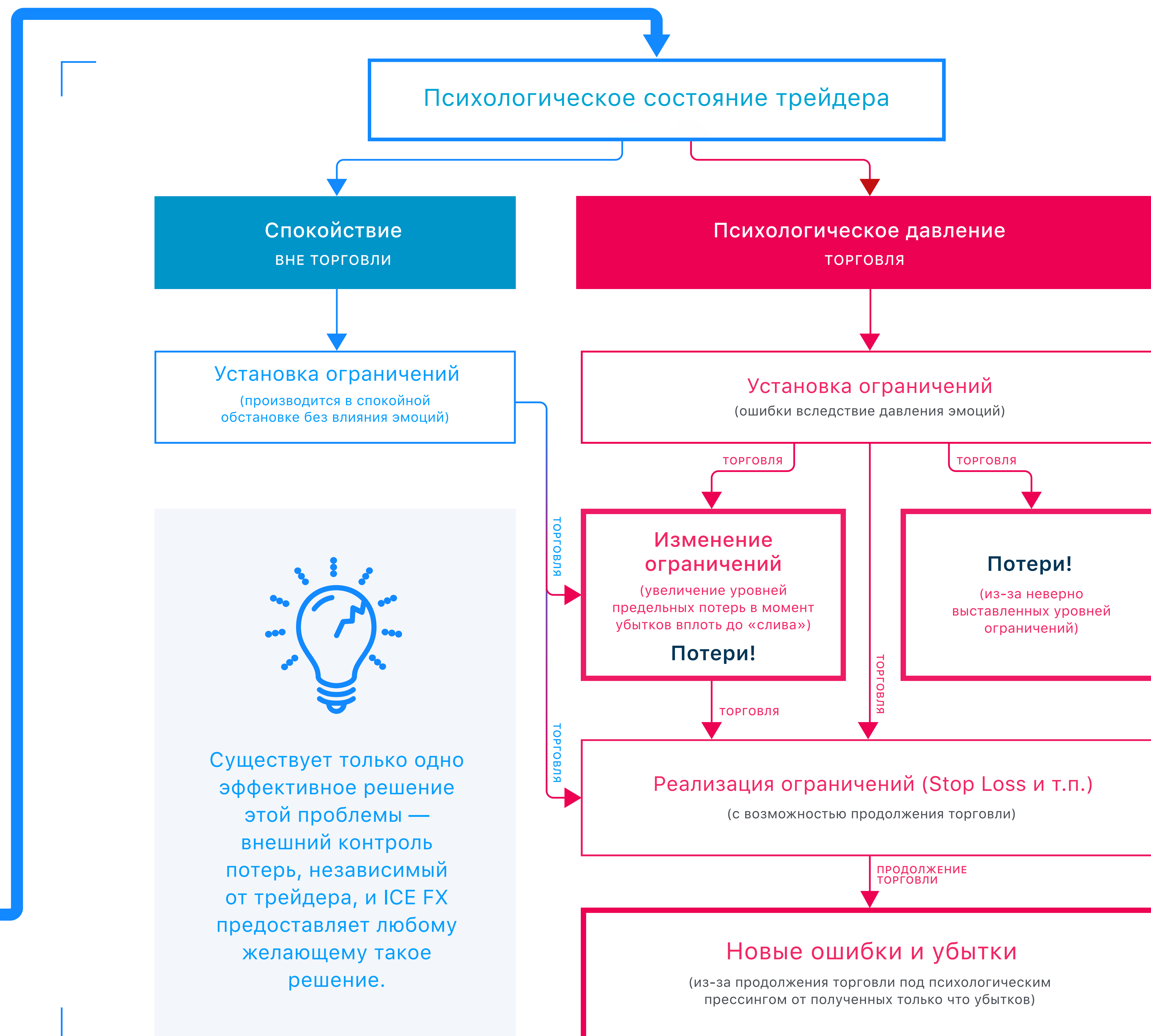
## Описание проблемы

Все мы знаем, что психология является «краеугольным камнем» в торговле. Любая, сколь угодно прибыльная торговая система не обеспечит трейдеру заработок, в случае, если он периодически совершает ошибки под воздействием эмоций.

Согласно статистике, порядка 70% всех потерь на рынках вызваны именно психологическими причинами.

Трейдер может установить в терминале уровни Stop Loss, Take Profit, и установить себе мысленно любые формы ограничений. Но все это «не работает», поскольку в состоянии сильных эмоций («тильт») человек может совершать необдуманные действия (сдвигать Stop Loss, отменять их, открывать лишние сделки и т. д.)

Справа представлена схема работы существующих систем ограничений с привязкой к психологическому состоянию трейдера.



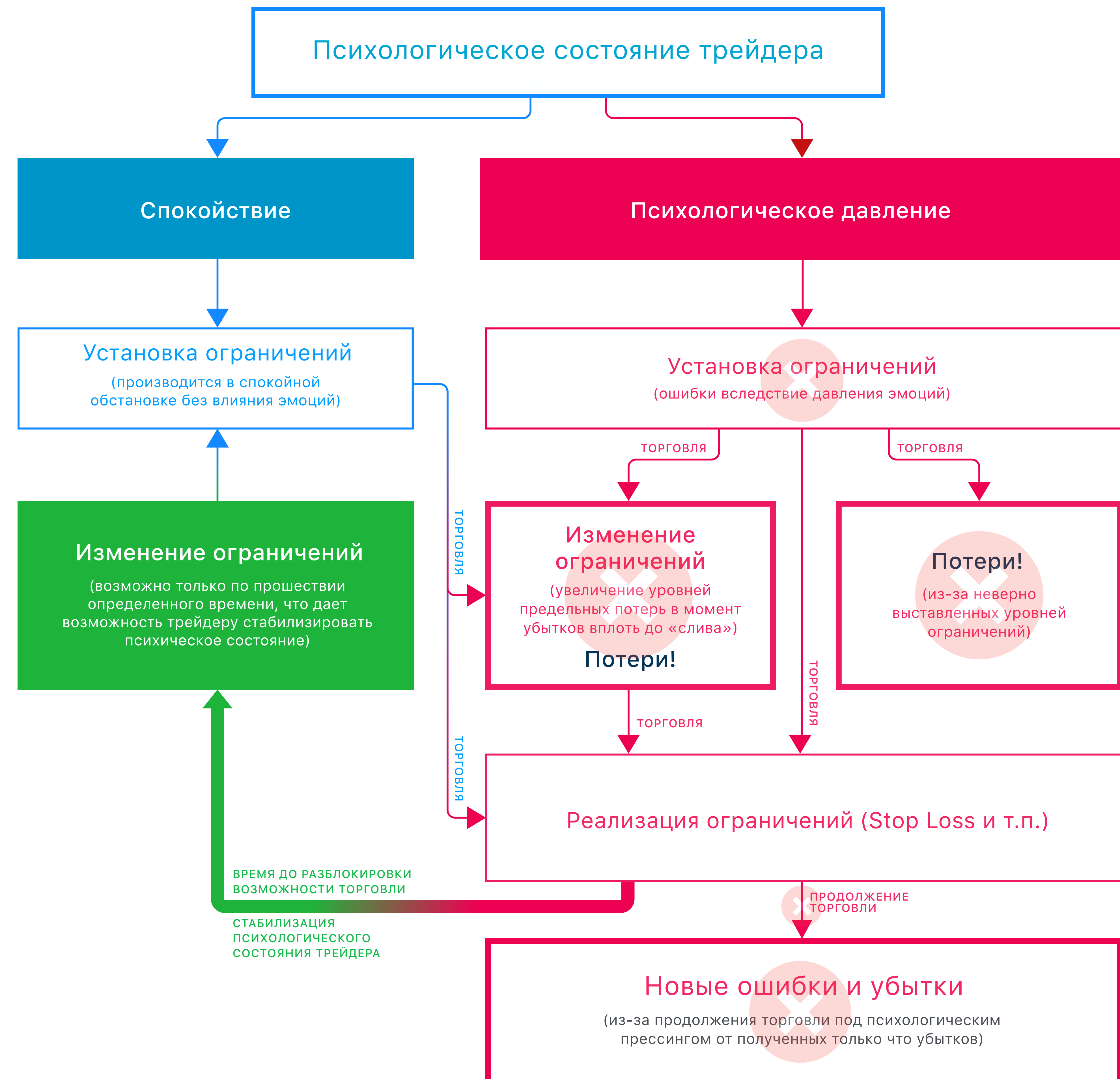


# Решение

## Система контроля

компанией разработана система внешнего контроля за торговлей трейдеров, доступная каждому желающему. Трейдер может установить ряд ограничений, при реализации одного из которых сделки автоматически закроются и возможность торговли заблокируется на определенный период времени.

Также, невозможно любое моментальное изменение уровня ограничений, поэтому трейдер не может увеличивать свои потери сверх изначально определенных ограничений в момент нарастания убытка.

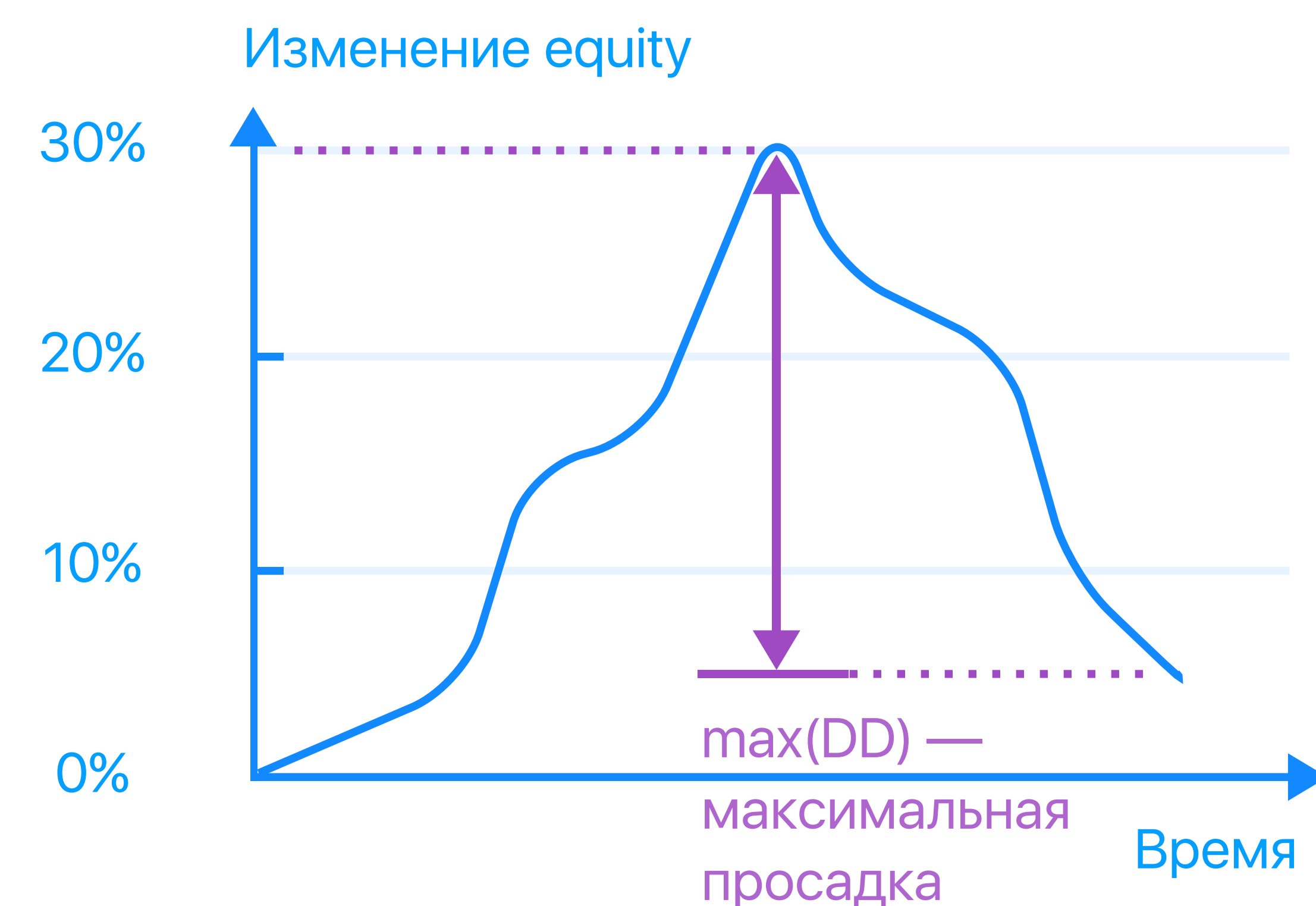


# Виды ограничений

Трейдера предоставляется возможность задать любые из 5 предложенных видов ограничений:

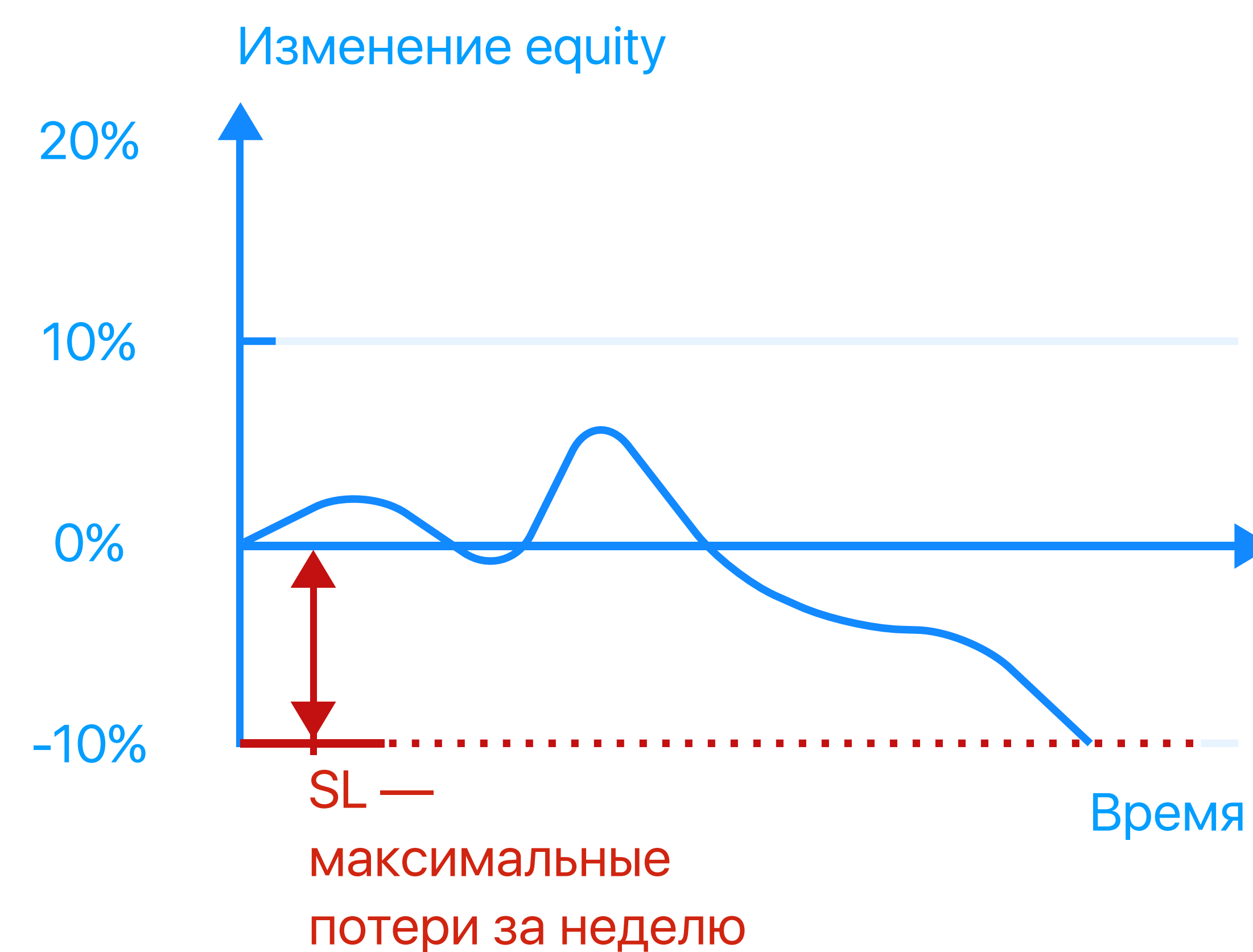
## Максимальная просадка

Расчет ведется от пика максимального значения equity счета, зафиксированного после установки данного ограничения. Если, спустя некоторое время, максимальное equity счета опустится на уровень установленной максимальной просадки, сработает данный ограничитель (аналогия Trailing Stop в терминале MT4). **Выражается в процентах от депозита.**



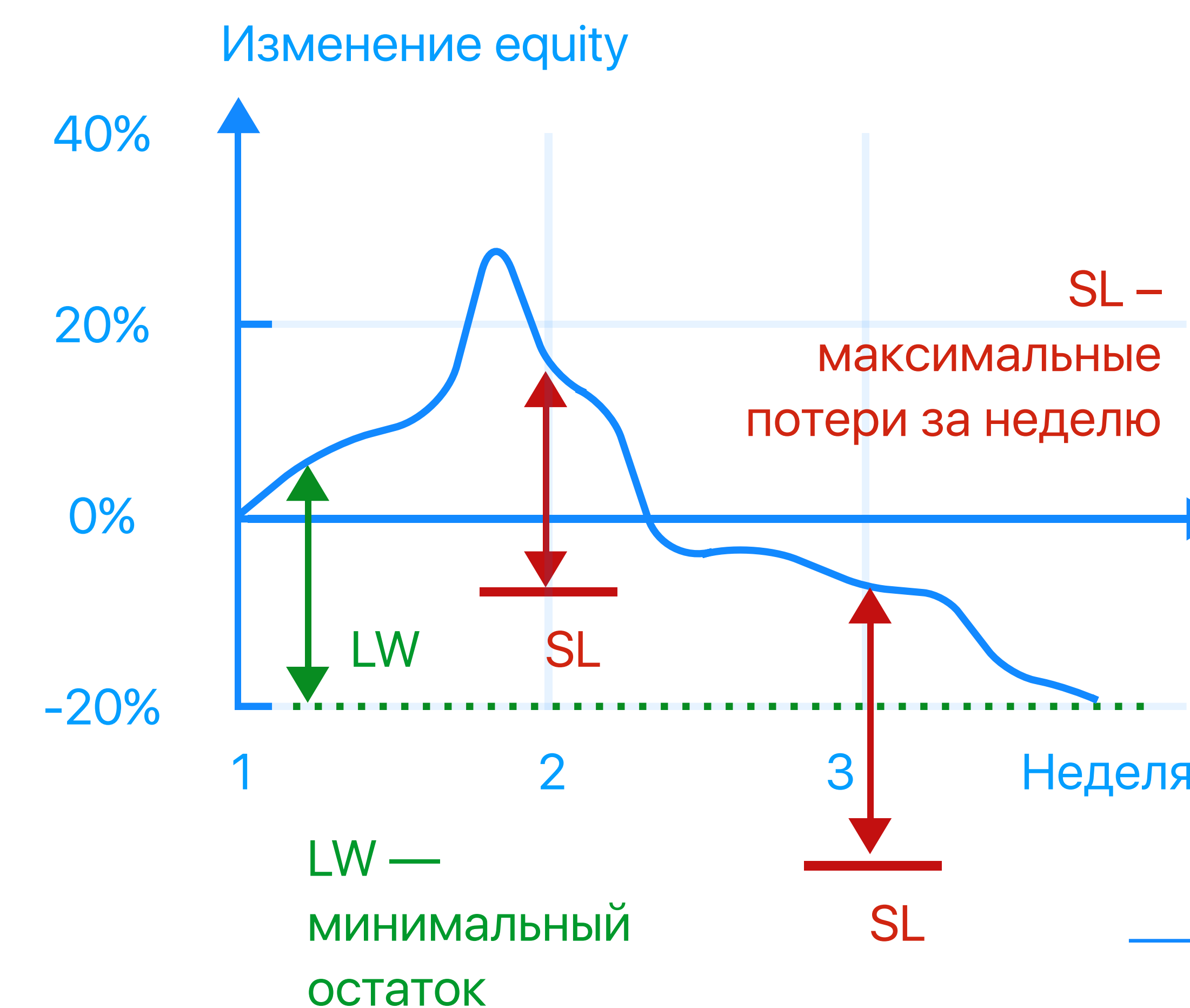
## Максимальные потери за неделю

Ограничивает максимальные потери за неделю, исчисляемые от значения equity на начало недели, вне зависимости от того, насколько возрастает equity счета за этот период. (В отличие от ограничения «Максимальная просадка», значение которого исчисляется от максимального значения equity после установки). **Выражается в процентах от депозита.**



## Минимальный остаток

Указывается денежное значение минимальной суммы, по достижении которой произойдет реализация ограничения, и торговля на счете остановится. **Выражается в валюте депозита.**



## Виды ограничений

### Ограничение максимального кредитного плеча

Возможность ограничить значение максимального кредитного плеча.

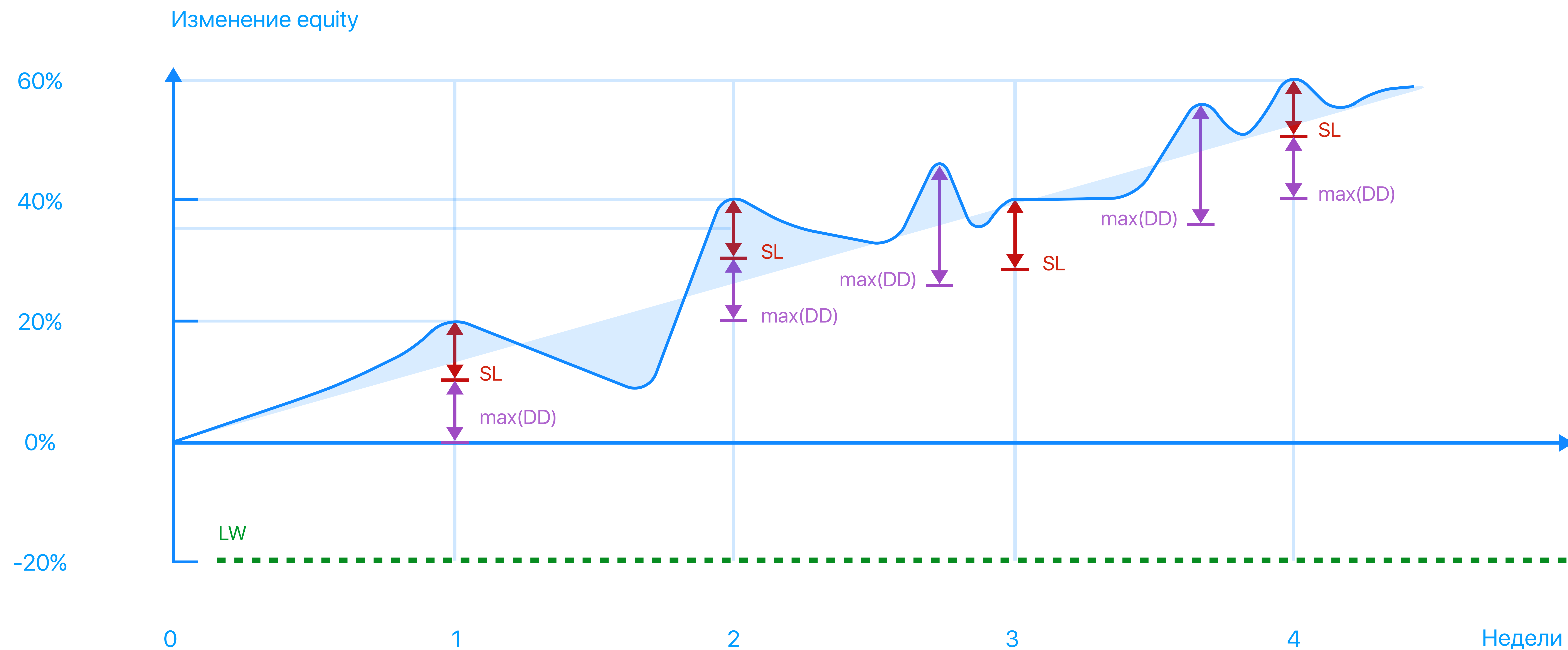
### Максимальные потери за сутки

Является аналогом ограничения «Максимальные потери за неделю». Ограничивает максимальные потери за сутки, исчисляемые от значения equity на начало торговых суток, вне зависимости от того, насколько возрастает equity счета за этот период. (В отличие от ограничения «Максимальная просадка», значение которого исчисляется от максимального значения equity после установки). Выражается в процентах от депозита.

В случае реализации любого из ограничений, сделки немедленно будут закрыты по текущим рыночным котировкам, и возможность торговли заблокируется до определенного момента (указано в таблице «Особенности функционирования ограничений»).



## Схематическое пояснение работы риск-менеджмента ICE FX



**\$1 000**

Equity

**SL (10%)**

максимальные потери за неделю

**max(DD) (20%)**

максимальная просадка

**LW (800 USD)**

минимальный остаток

# Особенности функционирования ограничений

Вид ограничения <sup>1</sup>	Точка отсчета <sup>2</sup>	Условие реализации ограничения	Возможность продолжения торговли (не ранее)	Вступление изменений в силу <sup>3</sup>
Ограничение потерь за неделю	Значение equity счета на 00:05 (EET) понедельника текущей недели	Снижение значения equity счета (в %) на размер заданного ограничения	00:05 (EET) понедельника следующей недели	00:05 (EET) понедельника следующей недели
Ограничение потерь за сутки	Значение equity счета на 00:05 (EET) текущего торгового дня	Снижение значения equity счета (в %) на размер заданного ограничения	00:05 (EET) следующего торгового дня	00:05 (EET) следующего торгового дня
Ограничение максимальной просадки (бессрочное)	Максимальное значение equity счета после установления/изменения уровня ограничения	Снижение значения equity счета (в %) на размер заданного ограничения	00:05 (EET) понедельника следующей недели	00:05 (EET) понедельника следующей недели
Ограничение минимального остатка (бессрочное)	—	Снижение значения equity счета (в валюте счета) до заданного значения	00:05 (EET) понедельника следующей недели	00:05 (EET) понедельника следующей недели
Ограничение максимального кредитного плеча	—	—	—	00:05 (EET) понедельника следующей недели

Примечания:

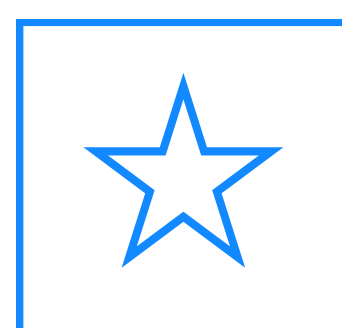
<sup>1</sup> Ни одно из ограничений не является обязательным для самостоятельной торговли.

<sup>2</sup> Момент времени, в который фиксируется начальное значение параметра, используемое в дальнейших расчетах.

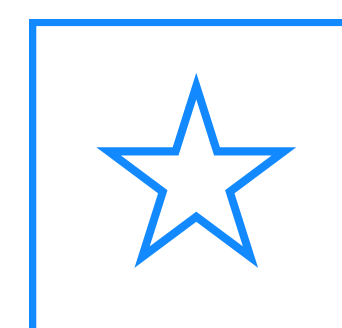
<sup>3</sup> В случае подачи запроса Клиентом на изменение.



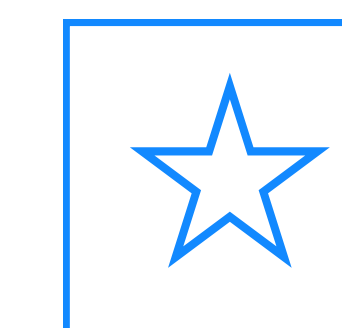
## Преимущества



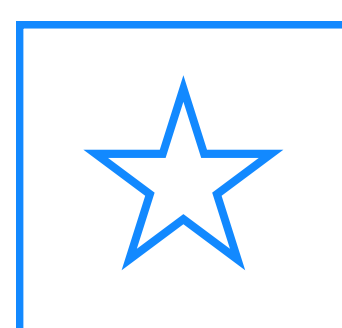
Отсутствие возможности со стороны трейдера изменить уровни ограничений моментально: подача на изменение уровня ограничения исполняется не ранее начала следующей торговой недели. Таким образом, трейдер не может увеличить уровень потерь в состоянии психологического давления.



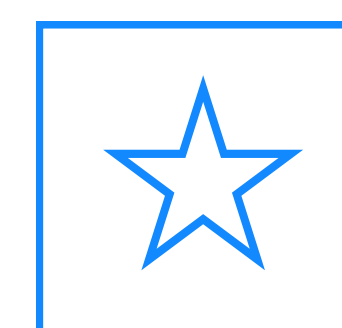
Невозможность продолжения торговли после реализации одного из ограничений некоторое время (как правило, до начала следующей торговой недели). Это исключает торговлю в состоянии психологического давления (у трейдера есть время успокоиться и пересмотреть свои ошибки до следующей недели).



Снятие с трейдера психологической нагрузки ввиду понимания того, что заданные уровни ограничений потерь невозможно изменить в ходе торговли.



Защита от «выбросов» / «черных лебедей» и т.п. Не во всех случаях трейдер может моментально среагировать на резкие непредвиденные движения на рынке, за счет чего может быть получен убыток значительно больше предполагаемого. Система внешнего риск-менеджмента работает круглосуточно и реагирует моментально, что может помочь минимизировать потери (примечание: стоит иметь в виду, что система риск-менеджмента не может обойти такие рыночные атрибуты, как «проскальзывания», «реквоты» и т. п.).



Защита от ошибочных действий трейдера, совершаемых под воздействием сильных эмоций.

The logo for ICEFX, featuring the word "ICE" in a white sans-serif font and "FX" in a white italicized sans-serif font, with a small blue diagonal line above the "X".

ICEFX

2017

[www.ice-fx.com](http://www.ice-fx.com)

Почта для связи

[support@ice-fx.com](mailto:support@ice-fx.com)