

RRR, или соотношение прибыль/убыток (risk/reward ratio)

Считается, что при планировании сделки, соотношение планируемого риска к планируемому вознаграждению должно составлять $1/2 - 1/3$. При этом торговля будет прибыльной, даже если трейдер прав всего лишь в 50-40% сделок. Замечательно: получать три доллара прибыли на доллар риска. Будь прав в 40% сделок и можно выбирать яхту!

В учебниках так и рекомендуют, но что делать в реальности, если открытая сделка перешла в положительную сторону по отношению к намеченной цели и мы достигли уровня прибыли в $2R$? Есть ли смысл придерживаться первоначального плана, чтобы получить $3R$ с риском потерять то, что удалось достигнуть или ещё хуже, позволить прибыли превратиться в убыток?

Ведь второй важнейшей задачей, кроме продуманного торгового плана, является управление сделкой в процессе торговли. Если не снизить риск, то трейдер обращает соотношение RRR против себя. Не передвинув стоп-лосс и достигнув прибыльного уровня в $2R$, разница между достигнутым уровнем и стоп-лоссом насчитывает уже $3R$. Если при этом вы склонны придерживаться прежней цели, то соотношение переворачивается с ног на голову, вы рискуете тремя R , рассчитывая получить $1R$.

Скорее всего, в центре внимания во время развития сделки должны быть характеристики сделки и то, как ведет себя при этом выбранный вами рынок, а не предварительно назначенное соотношение прибыль/убыток. Трейдер должен быть готов проехаться на движении и более трех R , если сделка ведет себя так, как предполагалось и капитализировать случаи, когда рынок готов отдать вам и 4 и 5 R .