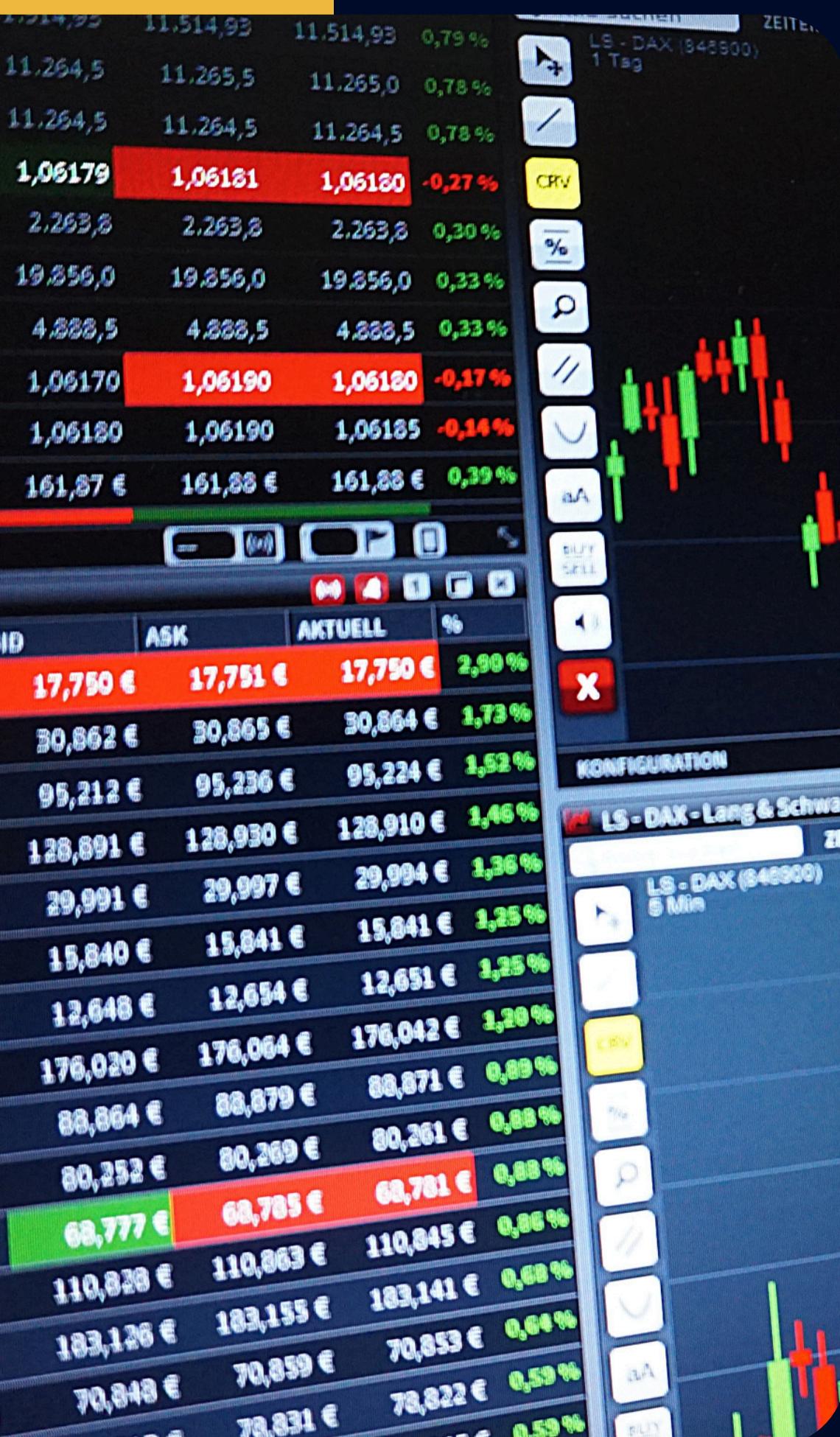


# ГАЙД ПО РМ/ММ для GRID БОТОВ

Кто управляет риском –  
управляет прибылью

**ИЗУЧИТЬ**



# Введение

Добро пожаловать в гайд по **риск-менеджменту (РМ)** и **мани-менеджменту (ММ)** для трейдинга с использованием грид-ботов! Если вы новичок в криптовалютном трейдинге, этот гайд поможет вам понять, как защитить свой капитал и грамотно управлять рисками при торговле с грид-ботами. Даже если у вас есть опыт, вы найдёте полезные советы по настройке стратегий для минимизации потерь и увеличения шансов на стабильную прибыль.

- **Риск-менеджмент (РМ)** — это правила, которые помогают ограничить возможные убытки, чтобы ваш депозит не был потерян даже в самых неблагоприятных рыночных условиях.
- **Мани-менеджмент (ММ)** — это правила управления капиталом, которые определяют, сколько средств вы вкладываете в каждую сделку, чтобы сбалансировать риск и потенциальную прибыль.

Почему РМ и ММ самое важное при торговле с плечом? Потому что рынок криптовалют очень волатилен: цены могут расти или падать на 10–30% за день. Без чётких правил вы рискуете потерять весь депозит. Грид-боты, которые автоматически покупают и продают активы на заданных уровнях цен, требуют особенно строгого РМ и ММ, так как они могут быстро накапливать позиции при сильных движениях рынка. Поэтому ваш РМ и ММ, кроме соблюдения, должен соответствовать вашему риск-профилю.

## В этом гайде разберём:

1. Основные понятия грид-ботов, маржи и плеча.
2. Разницу между перекрёстной и изолированной маржой.
3. Три подхода к РМ и ММ: консервативный, умеренный, агрессивный.
4. Примеры расчётов на XRP для обоих типов маржи.
5. Рекомендации, как выбрать подходящий подход.

# 1. Основные понятия

## Что такое грид-бот?

- **Грид-бот** — это автоматизированный торговый инструмент, который размещает ордера на покупку и продажу актива на заранее заданных уровнях цен. Представьте сетку, где ордера располагаются с определённым шагом (например, каждые 1–2% изменения цены). Когда цена движется, Long бот покупает при падении и продаёт при росте, зарабатывая на волатильности актива. А short бот покупает при росте и продает при падении цены актива.

## Что такое ликвидация?

- **Маржа** — это ваши собственные средства, которые вы выделяете на сделку.
- **Плечо** — это заёмные средства, которые увеличивают объём вашей позиции. Плечо увеличивает как потенциальную прибыль, так и риск убытков.

## Какие бывают типы маржи?

- **Перекрёстная маржа:** Все ваши средства на счёте используются для покрытия убытков любой позиции. Это снижает риск ликвидации, но если убытки накапливаются, вы можете потерять весь депозит.
- **Изолированная маржа:** Каждая позиция использует только выделенную маржу. Убытки ограничены этой маржей, но ликвидация может наступить быстрее, так как другие средства не задействуются.



## 2. Перекрёстная vs изолированная маржа: плюсы, минусы, кому подходит

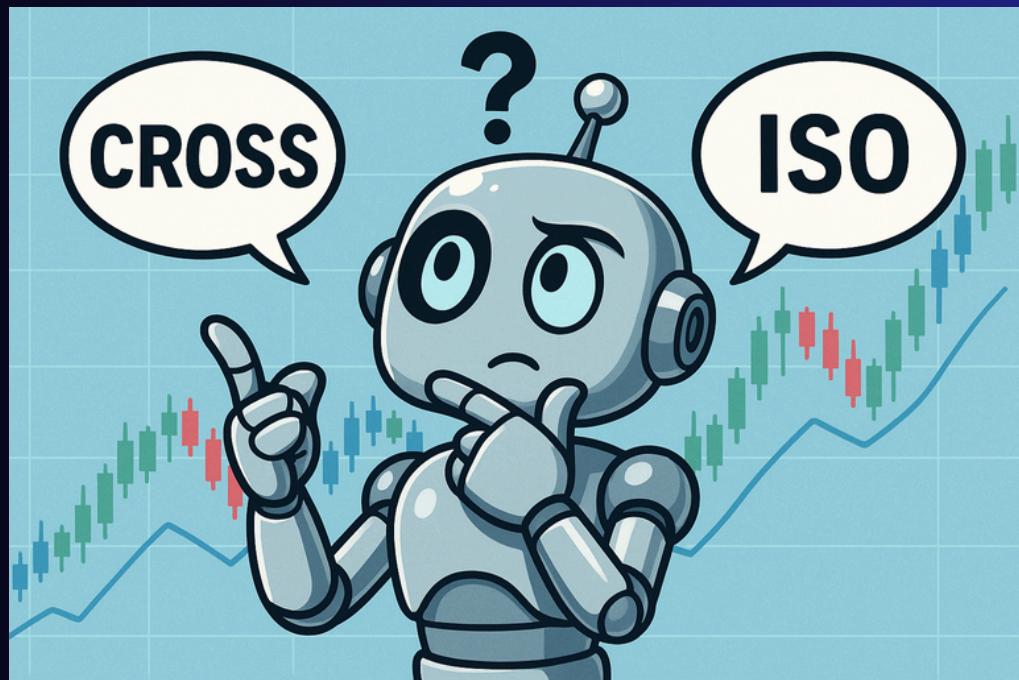
В трейдинге с грид-ботами выбор между перекрёстной и изолированной маржой критически важен, так как он влияет на то, как долго ваши позиции могут выдерживать неблагоприятные движения рынка.

### Как работает перекрёстная маржа?

При перекрёстной марже все ваши средства на счёте используются для покрытия убытков любой открытой позиции. Если у вас есть несколько ботов, убытки одного бота могут компенсироваться свободными средствами или прибылью другого. Это увеличивает устойчивость позиций, так как ликвидация наступает только при исчерпании всего депозита.

### Пример:

У вас депозит \$1000, вы открываете лонг-бот на XRP с 2% от депозита на одного бота (\$20) и плечом 10x (объём позиции \$200). Если цена XRP падает, убытки покрываются из оставшихся \$980. Это позволяет позиции выдерживать большие движения цены (например, падение на 90%+), прежде чем наступит ликвидация.



## **Плюсы**

- Меньший риск ликвидации: Благодаря использованию всего депозита позиции могут выдерживать сильные движения рынка.
- Гибкость: Свободные средства можно использовать для усреднения (добавления ордеров при падении или росте цены) или открытия новых позиций.
- Подходит для опытных: Грид-боты накапливают позиции постепенно, и перекрёстная маржа даёт больше пространства для манёвров, особенно при волатильных активах.

## **Минусы**

- Риск потери всего депозита: Если рынок движется против всех ваших позиций (например, все боты в убытке), вы можете потерять весь счёт.
- Сложность управления: Нужно строго следить за общими убытками, чтобы не исчерпать депозит.
- Психологическое давление: Новичкам может быть сложно видеть, как весь депозит используется для покрытия убытков.

## **Кому подходит?**

- Подготовленным трейдерам, которые понимают, как управлять несколькими позициями и контролировать общий риск.
- Тем, кто использует грид-боты с узкими или умеренными сетками (2–10%).
- Трейдерам с средним или высоким риск-профилем, готовым рисковать всем депозитом ради большей устойчивости отдельных позиций.

## **Когда использовать?**

- Риск потери всего депозита: Если рынок движется против всех ваших позиций (например, все боты в убытке), вы можете потерять весь счёт.
- Сложность управления: Нужно строго следить за общими убытками, чтобы не исчерпать депозит.
- Психологическое давление: Новичкам может быть сложно видеть, как весь депозит используется для покрытия убытков.

## Как работает изолированная маржа?

При изолированной марже каждая позиция ограничена выделенными средствами (например, \$20 на бота). Убытки не затрагивают другие средства на счёте, и ликвидация наступает, когда убытки превышают эти средства. Это защищает остальной депозит, но делает позиции более уязвимыми.

### Пример:

С депозитом \$1000 вы открываете лонг-бот на XRP с 2% от депозита на одного бота (\$20) и плечом 3х (объём \$60). Если цена XRP падает на 33%, убытки составят \$20 ( $\$60 \times 0.33$ ), и позиция ликвидируется. Остальные \$980 на счёте остаются нетронутыми.

### Плюсы

- Защита депозита: Убытки ограничены выделенными средствами, защищая остальной капитал.
- Простота управления: Легче отслеживать риски, так как каждая позиция независима.
- Подходит для новичков и опытных: Меньше риска потерять весь депозит, что снижает психологическое давление.

### Минусы

- Быстрая ликвидация: Позиции закрываются при меньших движениях цены, особенно с узкими сетками.
- Ограниченнная гибкость: Нельзя использовать свободные средства для усреднения или спасения позиции.
- Меньшая устойчивость: Грид-боты с узкими сетками могут быстро исчерпать маржу при сильной волатильности.

## **Кому подходит?**

- Новичкам и опытным: Тем, кто хочет ограничить потери и заниматься трейдингом без риска потерять весь депозит.
- Трейдерам с низким и средним риск-профилем: Если вы предпочитаете чётко знать максимальную сумму возможного убытка.
- Тем, кто торгует с умеренными и широкими сетками (10–30%).

## **Когда использовать?**

- Когда вы тестируете новую стратегию или грид-бота и хотите ограничить риск.
- Когда торгуете высоковолатильные активы и боитесь больших просадок.
- Когда у вас мало опыта в управлении несколькими позициями.

## **Выберите перекрёстную маржу, если:**

- Вы уверены в своих навыках и чётко соблюдаете РМ и ММ.
- Торгуете с большим депозитом и несколькими ботами.
- Используете узкие и средние сетки (2–10%) и готовы к длительным просадкам.
- Хотите максимизировать устойчивость позиций.

## **Выберите изолированную маржу, если:**

- Вы новичок или хотите минимизировать потери.
- Торгуете с небольшим депозитом и не хотите рисковать всем.
- Используете средние и широкие сетки (10–30%) или тестируете стратегию.
- Предпочитаете чёткие лимиты убытков.

## **Пример для XRP:**

С депозитом \$1000 и ценой XRP \$3.15 вы открываете лонг-бот с 2% от депозита на одного бота (\$20) и плечом 10x (перекрёстная маржа). При падении цены на 90% позиция всё ещё не ликвидируется, так как убытки покрываются остатком \$980. С изолированной маржой и плечом 3x та же позиция (объём \$60) ликвидируется при падении на ~33%, но остальные \$980 остаются в безопасности.

### **3. Подходы к РМ и ММ: консервативный, умеренный, агрессивный**

Основной принцип риск-менеджмента и мани-менеджмента для грид-ботов — ограничение рисков на каждую позицию и общий депозит.

- **До 5% депозита на одного бота:** Например, при депозите \$1000 это \$50 на одного бота.
- **Контроль количества ботов:** До 20% от всего депозита используется для торговли.
- **Резерв:** Остальные средства (80%) держатся в резерве. Часть резерва доступна для усреднений — добавления ордеров в позицию при сильных движениях цены для снижения средней цены входа. Остальная часть резерва неприкосновенна и защищает от экстремальных ситуаций.

Этот подход минимизирует риск потери депозита, сохраняя гибкость для манёвров, и подходит для новичков, работающих с волатильными активами.

#### **Консервативный подход**

В консервативном подходе общий объём позиций с учётом плеча не превышает ваш собственный депозит (\$1000). Например, с плечом 10x и 9% от депозита на все боты объём позиций — \$900. Это обеспечивает максимальную защиту капитала, но ограничивает прибыль. Подходит для тех, кто хочет минимальный риск.

#### **Умеренный подход**

В умеренном подходе общий объём позиций с учётом плеча равен: ваш депозит ( $\$1000 \times 2$ ). Например: настраиваете 2 бота с плечом 10x и 10% от депозита на одного бота (\$100), объём одной позиции — \$1000, а двух ботов — \$2000 с учётом плеча. Это баланс между риском и доходностью, подходящий для трейдеров, готовых к умеренным просадкам.

#### **Агрессивный подход**

В агрессивном подходе общий объём позиций с учётом плеча равен: ваш депозит ( $\$1000 \times 3$ ). Например, с плечом 10x и 15% от депозита на одного бота (\$150), объём одной позиции — \$1500, а двух ботов — \$3000. Это максимизирует прибыль, но увеличивает риск ликвидации. Подходит для опытных трейдеров, готовых к высоким рискам.

## 4. Примеры расчётов:

### 1. Умеренный подход с перекрёстной маржой (плечо 10x)

- Депозит: \$1000
- Позиции: 2 бота (лонг и шорт )
- Маржа на бота: \$100 (10% депозита)
- Объём позиции:  $\$100 \times 10 = \$1000$
- Общий объём:  $\$1000 \times 2 = \$2000$
- Остаток: \$800

**Уровни ликвидации:** После того как бот соберёт всю вашу сетку страховочных ордеров, цена XRP должна упасть безоткатно от вашей средней цены, чтобы сработала ликвидация:

- Для лонг-бота: ~90.35%
- Для шорт-бота: ~116.61%

### 2. Умеренный подход с изолированной маржой (плечо 3x)

- Депозит: \$1000
- Позиции: 2 бота (лонг и шорт на XRP)
- Маржа на бота: \$100 (10% депозита)
- Объём позиции:  $\$100 \times 3 = \$300$
- Общий объём:  $\$300 \times 2 = \$600$
- Остаток: \$800
- Риск контролируется выделенными средствами на бота

**Уровни ликвидации:** После того как бот соберёт всю вашу сетку страховочных ордеров, цена XRP должна упасть безоткатно от вашей средней цены, чтобы сработала ликвидация:

- Для лонг-бота: ~35.67%
- Для шорт-бота: ~51.98%

### Почему для изолированной маржи не рекомендуется плечо выше 3x?

Изолированная маржа ограничивает убытки только выделенными средствами. Высокое плечо (например, 10x) приводит к ликвидации при движении цены всего на ~10%. Плечо 3x даёт запас в ~35% движения цены, что лучше подходит для волатильных активов.

## 5. Рекомендации по выбору подхода

### Выберите перекрёстную маржу, если;

- Вы уверены в своих навыках и чётко соблюдаете РМ и ММ.
- Торгуете с большим депозитом и несколькими ботами.
- Используете узкие и средние сетки (2–10%) и готовы к длительным просадкам.
- Хотите максимизировать устойчивость позиций.

### Выберите изолированную маржу, если:

- Вы новичок или хотите минимизировать потери.
- Торгуете с небольшим депозитом и не хотите рисковать всем.
- Используете средние и широкие сетки (10–30%) или тестируете стратегию.
- Предпочитаете чёткие лимиты убытков.

### Рекомендации по опыту:

*Новичкам стоит начинать с:*

- Консервативного подхода.
- Изолированной маржи с плечом до 3х.
- Выделения до 5% депозита на одного бота.
- Использования консервативных сеток (10–20%) для замедления сбора позиции и минимизации риска ликвидации.

*Трейдерам с опытом подойдёт:*

- Умеренный подход.
- Перекрёстная маржа с плечом до 10х.
- Выделение 10% депозита на одного бота.
- Хеджирование через лонг- и шорт-боты с умеренными или агрессивными сетками (20–40%) для баланса доходности и устойчивости.



## Комбинированный подход:

Рассмотрите комбинированный подход, сочетая:

- Изолированную маржу для строгого контроля риска.
- Перекрёстную маржу для большей устойчивости.

## Управление резервом

Всегда держите 80% депозита в резерве:

- 50% для усреднений при движении цены.
- 50% — неприкосновенный резерв для защиты от экстремальных ситуаций.

## Дополнительные рекомендации

- Проверяйте волатильность и тренды перед запуском ботов.
- Регулярно мониторьте свои позиции.
- Не забывайте про психологический аспект — торгуйте только теми суммами, потеря которых не повлияет на вашу жизнь.

*Помните: успешный трейдинг с ботами требует дисциплины, обучения и строгого соблюдения правил риск-менеджмента. Начинайте с малого, изучайте рынок и постепенно увеличивайте свою позицию по мере накопления опыта.*

