

Phương pháp giao dịch

Lê Công Tráng

2025-04-06

1. Giao dịch tùy ý hay giao dịch cơ học (Discretionary or Mechanical Trading)

Có hai cách tiếp cận chính: **tùy ý** và **cơ học**. Trader tùy ý đưa ra quyết định dựa trên kinh nghiệm và cảm nhận. Trader cơ học tuân theo bộ quy tắc chặt chẽ, không có chỗ cho cảm xúc.

Hình thức lai giữa hai loại này là **bán cơ học**, nơi hệ thống đưa ra tín hiệu, nhưng trader chọn lọc lệnh.

Người mới nên bắt đầu bằng hệ thống **cơ học đơn giản** để rèn kỷ luật.

2. Tạo ra một phương pháp giao dịch (Creating a Methodology)

Một hệ thống giao dịch hiệu quả cần có:

- **Tín hiệu (Setup)** – Nhận biết cơ hội.
- **Entry** – Quy tắc vào lệnh.
- **Stop loss** – Giới hạn thua lỗ.
- **Exit** – Quy tắc thoát lệnh lời và lỗ.
- **Position sizing** – Khối lượng lệnh.
- **Quản lý rủi ro** – Giới hạn tổng rủi ro tài khoản.

Phương pháp tốt = Đơn giản + Khách quan + Kiểm thử được

3. Giao dịch theo xu hướng (Trend Trading)

Chiến lược dễ tiếp cận nhất là **trend trading**:

- Không đoán đỉnh/đáy.
- Theo sau lực chính của thị trường.
- Dễ kiểm chứng và duy trì tâm lý ổn định.

Hai phong cách

- **Breakout**: Giao dịch khi giá phá vỡ đỉnh/đáy.
- **Pullback**: Giao dịch khi giá hồi về vùng hỗ trợ/kháng cự trong xu hướng chính.

4. Không phải chỉ báo nào cũng vô dụng (Not All Indicators Are Bad)

Chỉ báo là công cụ – hữu ích nếu:

- Dùng đúng mục đích (xác nhận).
- Không lạm dụng.
- Hiểu rõ cơ chế hoạt động.

Chỉ báo không dự đoán – chỉ hỗ trợ góc nhìn.

5. Nhưng thị trường có thay đổi không? (But Don't Markets Change?)

Thị trường thay đổi về **hành vi ngắn hạn**, nhưng **các nguyên lý nền tảng** (cung cầu, tâm lý, hành vi giá) thì **không đổi**.

Hệ thống nên:

- Dựa trên nguyên lý bền vững
 - Tinh chỉnh, không thay đổi toàn bộ
-

6. Có nên có nhiều phương pháp? (Multiple Methodologies)

Không có hệ thống nào phù hợp với **mọi điều kiện thị trường**.

Khi mới bắt đầu: dùng **1 hệ thống duy nhất**

Khi có kinh nghiệm: có thể phát triển thêm hệ thống bổ trợ

7. Các đặc điểm của hệ thống giao dịch chiến thắng (Basic Attributes)

- Có Stop rõ ràng
- Cho phép lợi nhuận chạy
- Giảm thiểu cảm xúc
- Dễ kiểm thử
- Đơn giản, rõ ràng
- Dùng được nhiều thị trường

- Không cần dự đoán – chỉ phản ứng
-

8. Ví dụ: Chiến lược Turtle Trading

Một hệ thống trend-following đơn giản:

- Mua khi giá vượt đỉnh 20 ngày
- Dừng lỗ nếu thủng đáy 10 ngày
- Vào lệnh theo từng unit
- Quản lý vốn bằng ATR

Thành công thực sự đến từ **tuân thủ tuyệt đối hệ thống**.

9. Ví dụ về công cụ xu hướng khách quan (Objective Trend Tool)

Swing Chart – phân tích hành vi giá bằng đỉnh đáy:

- $HH - HL =$ xu hướng tăng
- $LH - LL =$ xu hướng giảm
- Sideway nếu không rõ xu hướng

Công cụ trực quan, đơn giản, loại bỏ nhiều cảm xúc.

10. Fibonacci: Sự thật hay huyền hoặc? (Fibonacci: Fact or Fiction)

- Không nên dùng làm công cụ chính.
- Có thể hữu ích khi kết hợp cấu trúc giá và xác nhận.
- Phải biết **kéo đúng điểm A–B**, nếu không sẽ gây ảo giác.

Dùng như la bàn phụ – không phải bánh lái.

11. Trader “Placebo” – tưởng mình có hệ thống (Placebo Traders)

- Tin vào hệ thống nhưng chưa kiểm thử
- Thay đổi liên tục vì cảm xúc
- Không có sổ liệu, không có nhật ký

Tin vào cảm giác = tự đưa mình vào bẫy

12. Tóm tắt (In Summary)

Bạn không cần hệ thống thần thánh.

Bạn cần:

- Một phương pháp rõ ràng
- Kỷ luật thực thi
- Khả năng kiểm soát cảm xúc

Thành công = Hệ thống đơn giản + Kỷ luật sắt đá