

# Tại Sao 90% Trader Thất Bại Với Giao Dịch Theo Xu Hướng?

Lê Công Tráng

2025-04-06

## Một Sự Thật Trớ Trêu

Giao dịch theo xu hướng là phương pháp được:

- Các quỹ lớn sử dụng
- Nhiều nghiên cứu chứng minh có hiệu quả lâu dài
- Cộng đồng trader phổ biến rộng rãi

**Nhưng có một nghịch lý:**

> Hầu hết trader thất bại thảm hại khi áp dụng trend trading.

> Không phải vì chiến lược sai, mà vì cách họ hiểu – và vận dụng nó – đã sai ngay từ đầu.

---

## 1. Hiểu Sai Về Bản Chất Của Trend Trading

Nhiều người tưởng:

- Trend trading giúp **lướt sóng** đều đặn
- Mỗi lệnh lời phải “chốt nhanh” để bảo toàn
- Vẽ MA, RSI, MACD là đủ để “bắt trend”

**Sự thật:**

- Trend trading là **nghệ thuật để lệnh chạy càng lâu càng tốt**
- **Tỷ lệ thắng thấp (30–40%)** là bình thường
- Chỉ một vài lệnh “big winner” gánh cả danh mục

Nhưng phần lớn trader không chịu nổi việc:

- 5–7 lệnh đầu tiên đều lỗ nhỏ
- Không biết lúc nào “trend thật” sẽ xuất hiện
- Lệnh đang lời thì chốt non vì sợ thị trường quay đầu

Và họ bỏ cuộc đúng lúc chiến lược sắp “nở hoa”.

---

## 2. Tư Duy Muốn “Chính Xác” – Thay Vì “Xác Suất”

Trend trading là cuộc chơi **kỳ vọng dương** (positive expectancy), không phải độ chính xác cao.

Ví dụ:

- Bạn thắng 3/10 lệnh
- Mỗi lệnh thắng lời 3R, mỗi lệnh thua lỗ 1R
- Kỳ vọng:  $(3 \times 3R - 7 \times 1R) = 2R$  sau 10 lệnh  $\rightarrow$  Lợi nhuận

Nhưng vấn đề là:

- Phần lớn trader bị **ám ảnh bởi việc “đúng”**
- Họ cảm thấy thất bại sau mỗi lệnh lỗ
- Họ nghi ngờ hệ thống sau chuỗi thua 5–10 lệnh

Đây chính là cái bẫy khiến họ **không bao giờ cho hệ thống đủ thời gian để sinh lời**.

---

## 3. Lạm Dụng Indicator – Và Tối Ưu Đến Mức Phá Hoại

Sai lầm thường gặp:

Lỗi thường thấy	Tác hại
Dùng RSI để vào lệnh theo trend	RSI chỉ báo đảo chiều – dễ bị nhiễu khi giá trending
Thay đổi thông số MA, MACD liên tục	Mất tính ổn định, không nhất quán
Chọn “con số đẹp nhất” trong backtest	Dính overfitting, không dùng được ở thị trường thực

Kết quả: Hệ thống nhìn đẹp trong quá khứ, nhưng **sụp đổ khi trade thật**.

Một chiến lược tốt không cần “đẹp” trong backtest – mà cần **ổn định, đơn giản và có logic rõ ràng**.

---

## 4. Không Biết Quản Lý Rủi Ro – Và Bị Thổi Bay Tài Khoản

Trend trading đòi hỏi:

- **Nhiều lệnh lỗ nhỏ**
- **Một vài lệnh siêu lời**
- Cần **kiểm soát vốn cực kỳ chặt chẽ**

Nhưng nhiều trader:

- Không đặt stop-loss (tin rằng “nó sẽ quay lại”)
- Dùng đòn bẩy quá lớn

- Gồng lệnh thua, cắt non lệnh lời

Hệ quả:

- Chỉ 1–2 lệnh sai là “bay màu”
- Thua không phải vì hệ thống – mà vì **cách vào lệnh quá tham lam**

Gợi ý:

- Rủi ro mỗi lệnh 1–2% tổng vốn
- Cắt lỗ máy móc, không thương tiếc
- Lãi lớn đến đâu cũng không “gồng lời” vô định → nên dùng trailing stop hoặc target rõ ràng

## 5. Không Chuẩn Bị Tâm Lý Cho Drawdown

Trend trading có thể khiến bạn:

- Lỗ 10 lệnh liên tiếp mà vẫn “đúng hệ thống”
- Trải qua drawdown vài tháng liên tục
- Cảm giác “mình đang ngu ngốc” dù vẫn theo đúng quy tắc

Nhưng đó là **phần không thể tách rời của phương pháp**.

Trader thành công là người:

- Biết điều này từ trước
- Lên kế hoạch sẵn: cả về tâm lý và tài chính
- **Không phá hệ thống giữa chừng**

Xu hướng thường đến bất ngờ – nếu bạn không còn ở đó để đón nó, thì bạn mất hết.

## Vậy Làm Sao Để Tránh Thất Bại?

Hành động	Lý do
Hiểu rằng tỷ lệ thắng thấp là bản chất của trend trading	Đừng kỳ vọng thắng đều
Kiểm tra hệ thống trên nhiều thị trường, nhiều điều kiện	Tránh tối ưu quá mức
Giữ nguyên thông số đơn giản, logic rõ ràng	Để tăng tính ổn định
Đặt stop-loss nghiêm túc	Bảo vệ vốn là ưu tiên số 1
Quản lý vốn bảo thủ	Bạn cần tồn tại trước khi kiếm lời
Ghi nhật ký & đánh giá tâm lý mỗi tuần	Giúp nhận diện sai lệch hành vi

## Tổng Kết

Trend trading không khó về mặt kỹ thuật. Nhưng nó là **một bài test tâm lý toàn diện**:

- Bạn phải chấp nhận lỗ nhiều mà không dao động
- Bạn phải chờ đợi dài hạn mà không nôn nóng
- Bạn phải tin vào hệ thống dù chẳng ai công nhận

Và phần lớn trader **không vượt qua được bài test đó**.

Nếu bạn đủ kiên nhẫn để sống sót, thì thị trường sẽ trả công bạn một cách xứng đáng.

---