

GBP,USD M15 1.4506 1.00 1.4508 SL/TP



Day trading



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



بازنشر:

خرید و فروش روزانه

- به هنر خرید و فروش یک دارایی مالی در طول یک روز یا یک جلسه معاملاتی و کسب سود از کوچکترین نوسانات قیمت، **day trading** گفته می شود.
- البته که این کار می تواند بسیار خطرناک برای افراد نا آشنا و غیر حرفه ای باشد.
- در ادامه نگاهی می اندازیم به اصلی ترین الزامات **day trading**



دانش قدرت است.

- نه فقط دانش پایه برای معاملات بلکه نیاز به داشتن آخرین اخبار و اطلاعات برای انجام خرید و فروش روزانه لازم و ضروری است.
- اطلاع از آخرین اخبار شرکت ها، آخرین اخبار بانک مرکزی و تصمیمات آنها، آخرین داده های اقتصادی و ... اهمیت بالایی در این کار دارد.
- لیستی از سهامی که قصد معامله روی آنها دارید را تهیه کنید، اطلاعاتتان را در مورد این شرکت ها و البته کلیت بازار بالا ببرید، روزنامه ها را بخوانید و سایت های معتبر را زیر نظر داشته باشید.



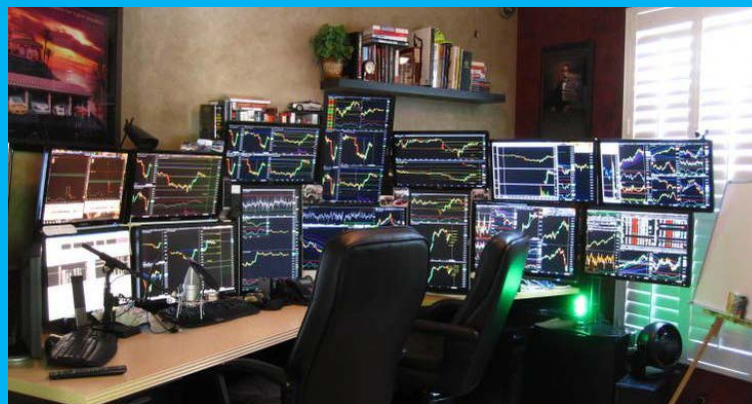
بخشی از سرمایه را کنار بگذارید.

- تعیین کنید که چه میزان از دارایی شما در معرض ریسک در هر معامله قرار خواهد گرفت.
- (اغلب day trader های حرفه ای ۱ تا ۲ درصد برای این موضوع در نظر می گیرند.)
- بخشی از پولتان را برای این کار کنار بگذارید که آمادگی پذیرش زیان در مورد آن را دارید (البته شاید هم زیان نکنید) ولی پول لازم برای گذراندن زندگی و پرداخت هزینه ها را هم داشته باشید.



بخشی از زمان را هم کنار بگذارید.

- خرید و فروش روزانه نیاز به زمان زیادی دارد. تقریباً اکثر زمان روزانه شما را.
- این کار نیاز دارد شما تمام زمان بازار را زیر نظر داشته باشید تا بتوانید فرصت های مناسب را شکار کنید.
- این اتفاق در هر زمان از بازار ممکن است رخ دهد و سرعت عمل اولین حرف را می زند.
- پس اگر زمان برای این کار را ندارید به فکر day trading نباشید.



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



بازنشر:

کوچک شروع کنید

- به عنوان یک مبتدی به شما توصیه می شود که روی یک یا نهایت دو نماد در هر جلسه معاملاتی متمرکز شوید.
- با تعداد سهام کم، پیدا کردن فرصت های سودآور بسیار آسان تر است.
- رصد کردن تعداد زیادی سهم و دنبال کردن اخبار و نمودار و تغییرات قیمت آنها کار دشواریست و باعث می شود فرصت های زیادی از دست برود.



از سهام بی ارزش بر حذر باشید

- البته که شما دنبال یک معامله خوب در قیمت های پایین هستید ولی مراقب سهام بی ارزش باشید.
- در بازار ما می توان بازار پایه را مصداقی برای این گونه سهام در نظر گرفت. ریسک این شرکت ها بسیار بالاست و سفته بازان زیادی روی آنها فعال هستند.
- سرمایه گذاری روی این سهام بسیار بی فایده است و شانس پیروزی در مقابل بازیگران (سفته بازان) آن بسیار اندک است.



زمان انجام معاملات مهم

- بسیاری از سفارشات خرید و فروش که توسط معامله گران در ماشین ثبت می شوند در ابتدای شروع بازار ثبت می شوند و نوسانات قیمت را تعیین می کنند.
- یک معامله گر حرفه ای می تواند خیلی سریع الگوها را تشخیص داده و کسب سود کند اما یک تازه وارد بهتر است ۱۵ تا ۲۰ دقیقه اول را فقط تماشا کرده و اقدام به معامله نکند. ساعت های میانی نوسانات کمتری دارد و ریسک پایین تری دارد. ساعت های پایانی نیز معمولاً حرکات شدیدی صورت می گیرد که تا حدودی تعیین کننده وضعیت فردا هستند. البته در ساعتهای اولیه هم نوسانات قیمتی شدید هستند.



زیان ها را با سفارشات محدود، محدود کنید.

- انتخاب کنید که با چه نوع سفارشی قصد ورود و خروج به سهم دارید. سفارش بازار یا سفارش محدود؟ وقتی سفارش بازار انتخاب کنید سفارش شما به بهترین قیمت موجود اجرا می شود و هیچ تضمینی بر قیمت وجود ندارد.
- سفارش محدود به نوعی تضمین کننده قیمت است اما لزوماً آن را اجرا نمی کند.



abcBourse.ir



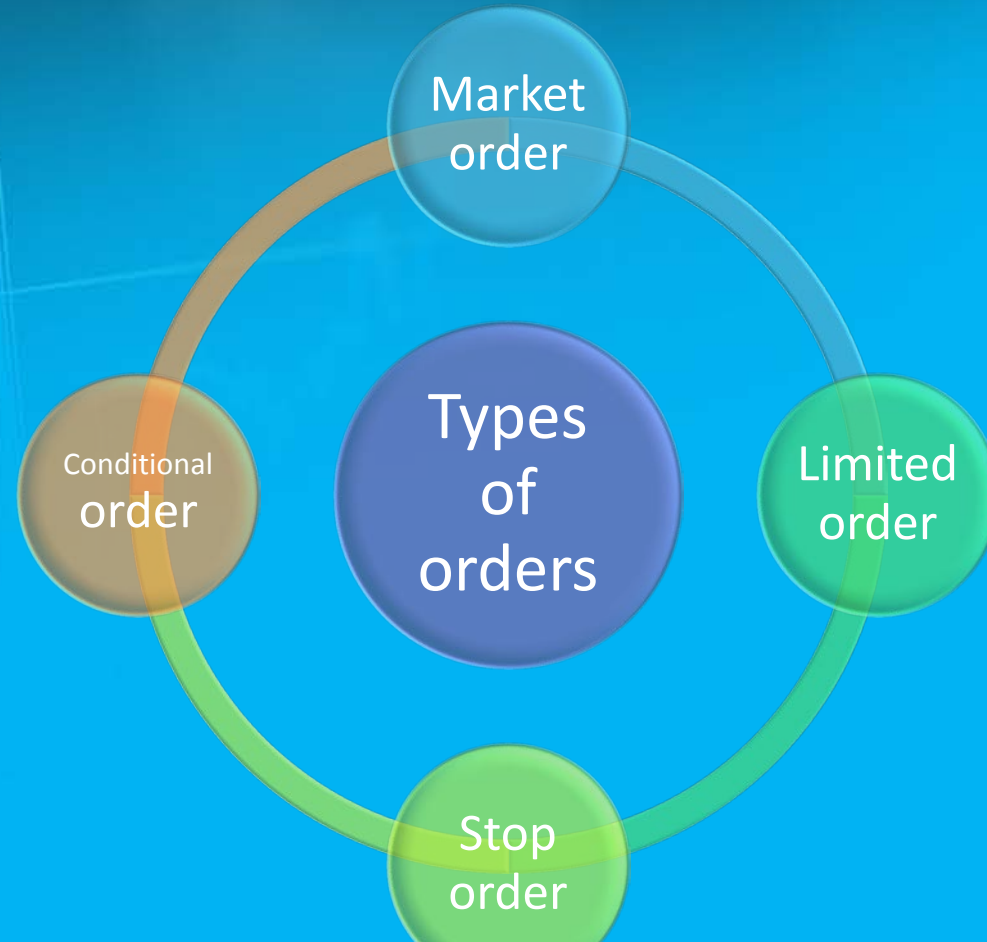
@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



بازنشر:

انواع سفارشات



Conditional order

- سفارشی که در صورت وقوع یک شرط خاص انجام می شود. به این نوع سفارش One-Cancels-Other Order – OCO نیز گفته میشود.
- از معروفترین این سفارش ها می توان به bracket order اشاره کرد.
- این سفارش به طور همزمان یک سفارش محدود و یک سفارش توقف زیان را ارسال می کند. در صورتی که هر یک از این سفارش ها انجام گرفت، سفارش دیگر به طور خودکار کنسل می شود.
- سفارش محدود به منظور شناسایی سود و رسیدن قیمت به هدف است و سفارش دوم برای جلوگیری از ضرر در صورت حرکت بازار در خلاف جهت مورد انتظار.



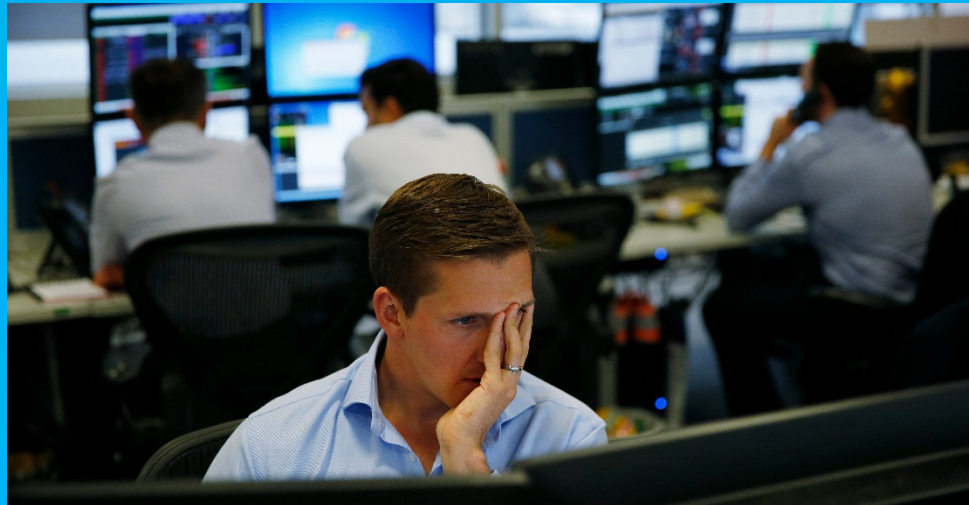
در مورد سود ها واقع بین باشید.

- یک استراتژی لزوما نباید در تمامی موارد برنده باشد تا به عنوان یک استراتژی موفق شناخته شود. بسیاری از معامله گران موفق تنها در ۵۰ یا ۶۰ درصد معاملاتشان موفق هستند.
- نکته اینجاست که آنها در بردهایشان سودهای بیشتری می کنند تا زیانشان در باخت ها.
- اطمینان حاصل کنید که زیان شما محدود به درصدی مشخص از حساب شما باشد و نحوه خروج از معامله مشخص و قابل اجرا باشد.



خون سرد باشید

- در بازار زمان هایی وجود دارد که میزان استرس شما را می سنجد.
- به عنوان یک day trader نیاز دارید که ترس، طمع و امید را مدیریت کرده و معقول تصمیم بگیرید.
- تصمیمات شما باید بر اساس قواعد باشند نه بر اساس احساسات.



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



بازنشر:

به برنامه خود پایبند باشید.

- معامله گران حرفه ای نیاز دارند که سریع عمل کنند اما نیاز ندارند که سریع فکر کنند. زیرا آنها استراتژی های خود را از پیش تعیین کرده اند و با نظم به آن پایبند هستند.
- در حقیقت شما باید به دقت استراتژی و فرمول خود را دنبال کنید به جای دنبال کردن سود.
- “plan your trades, then trade your plan.”

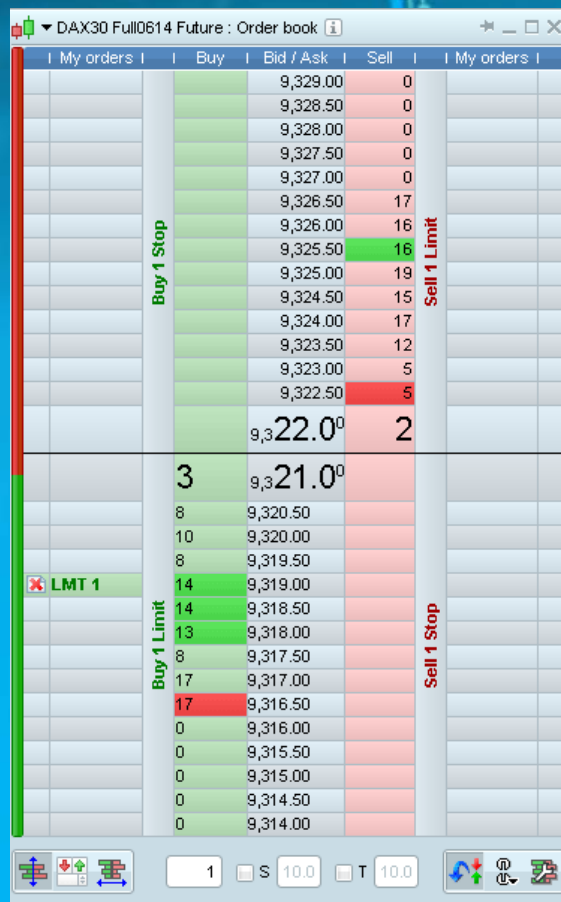


چه بخریم؟

- Day trader ها دنبال کسب سود با دنبال کردن قیمت های دقیقه ای و تغییرات در هر دارایی از جمله سهام، جفت ارز، فیوچر ها و آپشن ها و ... هستند. معمولا آنها از اهرم نیز بهره می گیرند تا با پول های کم سود های کلان کسب کنند.
- در مورد اینکه روی چه سهمی متمرکز شوید حرفه ای ها سه فاکتور رایج دارند:
- نقد شوندگی، نوسانات و حجم معامله



نقد شونگی



- نقد شونگی به شما اجازه می دهد تا به راحتی به یک سهم وارد یا از آن خارج شوید.
- نقد شونگی به معنی low spread (فاصله بین قیمت خریدار و فروشنده) و low slippage (فاصله بین قیمت انتظاری برای معامله و قیمت واقعی) می باشد.

حجم معامله

- حجم معامله به این معناست که چه میزان یک سهم در طول یک روز معاملاتی خرید و فروش شده است که این آیتم با شاخصی به نام ADTV یا متوسط حجم معامله روزانه اندازه گیری می شود.



نوسان

- نوسان به معنی اندازه تغییرات قیمت یک دارایی در طول روز معاملاتی است. نوسان بالاتر به معنی فرصت های کسب سود و میزان سود یا زیان بیشتر است.
- معمولاً افزایش در حجم معامله یک نشانه برای جهش قیمتی است. جهش می تواند رو به بالا یا پایین باشد.



انتخاب نقطه ورود

- یکی از با اهمیت ترین نکات پس از انتخاب سهم، انتخاب نقطه ورود است. به طور معمول سه روش برای شناسایی نقطه ورود استفاده می شود:
- Real-time news services (سرویس های اخبار لحظه ای)
- ECN/level2 quotes
- Intraday candlestick charts



چه زمانی بفروشیم؟

- قبل از اینکه وارد بازار شوید باید برنامه مشخصی برای خروج از آن داشته باشید.
- شناسایی نقطه خروج هدف قیمتی یا **price target** گفته می شود.
- در ادامه برخی از رایج ترین استراتژی ها برای شناسایی هدف قیمتی را معرفی خواهیم کرد.



شناسایی هدف قیمتی

استراتژی	شرح
Scalping	یکی از رایج ترین استراتژی ها- هر موقع که توی سود هستی خارج شو. هدف قیمتی همان نقطه ای است که تو در یک معامله سود کردی.
Fading	محو شدن شامل فروش سهام پس از یک حرکت سریع است. این استراتژی بر مبنای فرض (۱) این سهام اشباع خرید شده است (۲) خریداران اول آماده شناسایی سود هستند، (۳) خریداران فعلی ممکن است بترسند و فرار کنند. در این استراتژی هدف قیمتی زمانی است که خریداران مجدد شروع به خرید می کنند.



شناسایی هدف قیمتی

استراتژی	شرح
Daily pivots	این استراتژی بر مبنای سود کردن از نوسان یک روز است. تلاش برای خرید در پایین قیمت یک روز و فروش در بالاترین قیمت آن.
Momentum	این استراتژی بر مبنای اخبار منتشر شده یا پیدا کردن روند های قوی با حجم بالاست. یک نمونه از این معامله بدین صورت است که با انتشار یک خبر خرید انجام می شود و تا زمان نشانه های برگشتی نگهداری می شود. مدل دیگر این است که نقطه خروج زمانیست که حجم کاهش یابد.



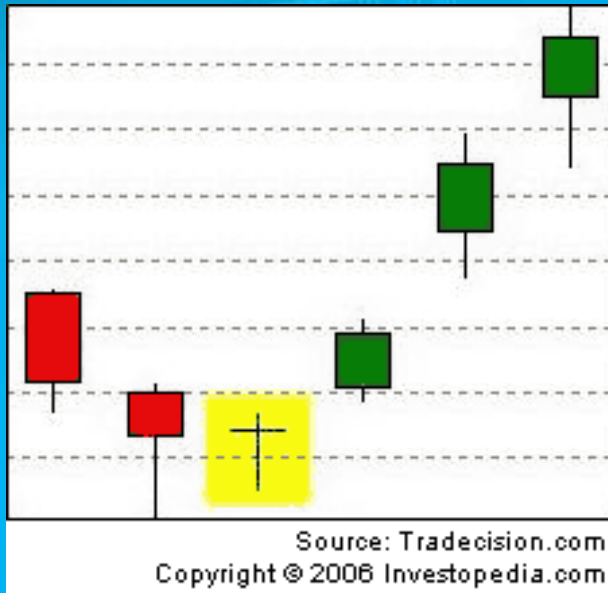
نمودارها و الگوها

- یکی از ابزارهای اصلی، استفاده از الگوهای شمعی و نمودارها بود. در این بحث روی سه موضوع تمرکز خواهیم داشت:
 - الگوهای شمعی (شامل engulfing و doji)
 - تحلیل تکنیکال (شامل خط روند ها و مثلث ها)
 - حجم (افزایش ها و کاهش ها)
- الگوهای فراوانی وجود دارند اما اگر بتوان از دوجی ها به درستی استفاده کرد یکی از کارآمدترین ابزارها خواهد بود.



Doji

- الگوهای فراوانی وجود دارند اما اگر بتوان از دوجی ها به درستی استفاده کرد یکی از کارآمدترین ابزارها خواهد بود.



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



بازنشر:

نمودار های بین روزی

- Day trader ها از نمودار هایی با تایم فریم کوتاه تر از یک روز استفاده می کنند. رایج ترین تایم فریم ها عبارتند از :
 - H4,H1,M30,M15,M1



حد ضرر داشته باشید

- Day trader ها معمولا با استفاده از منابع کارگزار خود معامله می کنند. در این حالت شمادر برابر نوسانات تند قیمت بسیار آسیب پذیر خواهید بود . بنابراین برای کنترل ضرر خود باید حد ضرر تعیین کنید وگرنه چندین برابر کل داراییتان ضرر خواهید کرد.
- Stop loss یا حد ضرر در زمان خرید می تواند زیرآخرین کف قیمت باشد و برای موقعیت فروش می تواند بالای آخرین قله قرار گیرد.



حد ضرر داشته باشید

- یک استراتژی وجود دارد که می گوید دو حد ضرر داشته باشید:
- **یک حد ضرر فیزیکی** که سفارشی مشخص در یک قیمت مشخص است و ریسک شما را محدود می کند. این به معنی بیشترین ضرریست که ممکن است شما متحمل شوید.
- **یک حد ضرر روانی** که زمانیست که معیار خرید شما نقض می شود. به این معنی که اگر اتفاق غیر قابل پیش بینی در معامله شما رخ داد شما سریعاً از آن معامله خارج شوید.



Day trading در ایران

- در بازار ایران day trading به علت هزینه معاملاتی بالا کار نسبتاً دشوار است. هر معامله خرید و فروش در بازار سهام ایران در حدود ۱.۵ درصد کارمزد و مالیات دارد. یعنی نوسان یک معامله باید شامل بیش از ۱.۵ درصد باشد تا سود آور باشد.
- در بازار سهام ایران چون امکان معامله در دو جهت وجود ندارد بسیاری از فرصت های day trading از بین می رود.



Day trading در ایران

- در بازار آتی سکه در ایران فرصت های خوبی برای day trade وجود دارد. اولاً امکان خرید و فروش در هر دو جهت وجود دارد. دوماً امکان استفاده از اهرم معاملاتی و کسب سود بالا وجود دارد و کارمزد معاملات نیز مبلغ ثابت ۳۰۰۰ تومان است که در مقایسه با ارزش یک معامله به عنوان مثال در سررسید شهریور (۱۰*۱۶۰۰،۰۰۰=۱۶،۰۰۰،۰۰۰ تومان) رقم ناچیزی می شود.





با تشکر از توجه شما

پر سود باشید



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



بازنشر: