

تمپلیت برنامه ریزی معاملاتی (TRADING PLAN TEMPLATE)

ترجمه

وحید مطلبی زاده

همکاری

دکتر رضا اناری

سلب مسئولیت

در تهیه این متن تمامی تلاش و اقدامات منطقی انجام شده است. بااینحال ممکن است این متن شامل نظریاتی باشد که برای روش معاملاتی شما مناسب نبوده؛ بنابراین توصیه می شود که شخصا تحقیق کرده و خود به یک نتیجه گیری شخصی دست یابید. این متن به تنهایی عملکرد معاملاتی شما را بهبود نخواهد بخشید و جلوی ضررهای شما را نخواهد گرفت. مسئولیت هر ضرر تنها به عهده شخص معامله گر هست. بنابراین تحت هیچ شرایطی trade2win مسئولیت ضرر را نمی پذیرد.



فهرست مطالب

معرفی

کلیات برنامه ریزی معاملاتی

- ۱- برنامه ریزی معاملاتی چیست؟
- ۲- چه کسی به برنامه ریزی معاملاتی نیاز دارد؟
- ۳- برنامه ریزی معاملاتی چه کاری انجام می دهد؟
- ۴- قبل از شروع...

تمهیت برنامه معاملاتی

- ۶- خودتان را بشناسید، هدفتان را بشناسید
- ۷- اهداف معاملاتی
- ۸- بازارها، ابزارها و تایم فریم ها
- ۹- ابزارهای معامله
- ۱۰- قبل از باز شدن بازار
- ۱۱- مدیریت ریسک و پول
- ۱۲- استراتژی خروج
- ۱۳- استراتژی های معامله، ستاپ ها و ورودها
- ۱۴- بعد از بسته شدن بازار
- ۱۵- انضباط
- ۱۶- قوانین طلایی معاملاتی



معرفی

نزدیک به انتهای سال ۲۰۰۴ میلادی، یک خط فکری تحت عنوان " برنامه معاملاتی- که باید یکی از آن را داشته باشید" در فوروم " معامله کردن برای گذران زندگی " در سایت www.trade2win.com (T2W) آغاز شد.

هدف این خط فکری تهیه یک تمپلیت بود به گونه ای که تمامی معامله گران بتوانند یک برنامه معاملاتی حرفه ای را خلق کنند (فارغ از میزان تجربه معامله گران، ابزارهایی که معامله می کنند، تایم فریم ها و کارگزاری ها و ...). این متن نتیجه آن خط فکری ای بود که در آن سال آغاز کرده بودیم؛ که شامل دو بخش اصلی همراه با یک بخش سومی است که در زمانش امیدواریم شامل مثالهایی از برنامه های واقعی خلق شده ای باشد که از این تمپلیت استفاده کرده اند.

کلیات برنامه معاملاتی

این بخش مربوط به سوالات بنیادینی که مربوط به موضوع هستند می شود؛ و با یک تعریف ساده آغاز می شود. سپس به بحث درباره اینکه اصلا چرا معامله گران به یک برنامه نیاز دارند می پردازد و اینکه برنامه برای آنها دقیقا چه کاری را انجام می دهد. آن دسته از معامله گرانی که به ضرورت داشتن یک برنامه معاملاتی پی برده اند می توانند از این بخش ها بگذرند.

تمپلیت برنامه معاملاتی

این بخش، قسمت اصلی این مقاله را تشکیل می دهد؛ که شامل ده قسمت کلیدی همراه با یک سری سوالاتی است که در مجموع به ۵۰ سوال می رسند. جمع بندی این بخش ها را در قسمت پایانی مقاله تحت عنوان " قوانین طلایی معاملاتی " آورده ایم. امید ما این است که هر معامله گری بتواند از این تمپلیت استفاده کرده و یک برنامه معاملاتی خاص خودش را خلق کند. اشتباه نکنید، انجام این کار نیازمند صرف وقت و انرژی است. اما به محض اتمام آن خواهید فهمید که جزو کدام دسته از معامله گران هستید و شما را قادر می سازد که بر روی آن گونه از معامله گری که می خواهید باشید تمرکز کنید؛ و این حداقل دستاورد این مقاله است. برای تمامی سوالات این بخش توضیحات بیشتر همراه با مثالهایی از پاسخ های ممکن آورده شده است. در صورت نیاز به راهنمایی می توانید از اعضای T2W کمک بخواهید. کافی است سوال خود را در بخش مربوطه به آدرس زیر پست کنید:

<http://www.trade2win.com/boards/showthread.php?t=12585>

طبیعی است که بخش هایی را که فکر می کنید در این مقاله آورده نشده است در برنامه خود بگنجانید و در مقابل قسمت هایی از تمپلیت را که در برنامه شما کارایی نخواهند داشت را حذف کنید. در صورت تمایل می توانید این اصلاحات را به آدرس بالا پست کنید تا سایر معامله گران نیز بتوانند از آن منفعت ببرند.

مثال های برنامه معاملاتی

در حال حاضر در این بخش مثالی گنجانده نشده است. در حالت ایده آل حداقل سه برنامه معاملاتی وجود دارد: یک برنامه مختص معامله گران شاخص ها، یک برنامه برای معامله گران بازار فارکس و یک برنامه معاملاتی برای معامله گران بازار سهام. برای جزئیات بیشتر برنامه می تواند تایم فریم معاملاتی

را نیز پوشش دهد: معامله گر روزانه (day trader) ، معامله گر نوسان گیر (swing trader)، معامله گر موقعیتی (position trader).

کلیات برنامه معاملاتی

۱- برنامه معاملاتی چیست؟

۱-۱ برنامه معاملاتی یک سری کامل از قوانینی است که تمامی جنبه های زندگی معاملاتی شما را در بر میگیرد. بسیاری از متخصصان به لزوم داشتن یک "مرز" که بتواند احتمال موفقیت شما را در جهت دلخواهتان فراهم کند اشاره می کنند. برنامه معاملاتی به تنهایی این "مرز" نیست، اما در طول زمان معامله گری که برنامه معاملاتی دارد به مراتب بهتر از معامله گری که برنامه ندارد عمل خواهد کرد. بسیاری از معامله گران آماتور هیچ برنامه معاملاتی که بر طبق آن معامله کنند را ندارند و بدون توجه به نسبت سود به ضرر وارد معامله می شوند. لازم به ذکر است که استراتژی مدیریت ریسک و پول جامع در قلب تمامی برنامه های معاملاتی خوب قرار دارد.

۱-۲ معامله گرانی که برنامه معاملاتی دارند امکان زیر نظر داشتن عملکرد خود را خواهند داشت. آنها می توانند پیشرفت خود را پیوسته و روز به روز ارزیابی کنند به گونه ای که در مسیری هدفمند و درست پیش بروند. داشتن برنامه معاملاتی به آنها کمک می کند که معاملاتی بدون احساسات و با حداقل استرس را داشته باشند. معامله گر بدون برنامه امکان انجام هیچ یک از این موارد را ندارد و در معاملاتش تمایل به ترید بر اساس احساسات دارد. برای این دسته از معامله گران معامله کردن همراه با استرس بسیار و در نهایت از دست دادن پول است.

۱-۳ واضح است که برنامه معاملاتی موفقیت را تضمین نمی کند. با اینحال داشتن یک برنامه خوب با پایبندی به قوانین آن می تواند ضررها را به حداقل رسانده و به شما اجازه می دهد که نسبت به معامله گران بدون برنامه مدت طولانی تری را در بازی دوام آورید. آلپس . بی . پاتل در کتابش با نام "معاملات آنلاین" می نویسد: "در حالی که برنامه معاملاتی نمی تواند آینده را پیشگویی کند اما می تواند کمک کند که چطور به نتایج احتمالی واکنش نشان دهید. به همین دلیل است که داشتن برنامه معاملاتی ضروری است. برنامه معاملاتی ایستی از پاسخ های استراتژیک به اتفاقاتی است که خارج از کنترل شماست. شما تنها یک چیز را می توانید کنترل کنید کنترل می کنید و آن خود شما هستید."

۱-۴ یک سردرگمی در تفاوت بین برنامه معاملاتی (یا سیستم معاملاتی) با استراتژی معاملاتی وجود دارد. همان گونه که در بالا بیان شد، برنامه معاملاتی یک سری از قوانین جامعی است که تمامی جنبه های زندگی معاملاتی شما کنترل می کند. برنامه معاملاتی وارد جزئیات زیادی می شود که به عنوان مثال می تواند به مقدار زمانی که برای خواندن مثلا سایت T2W اختصاص می دهید نیز بپردازد.

عبارت "استراتژی معاملاتی" برای توصیف معیارهای ورود و خروج شما به معاملات می پردازد. با اینحال این ها تنها اجزایی از یک برنامه معاملاتی کلی هستند. یک برنامه معاملاتی کلی می تواند شامل دو یا چند استراتژی معاملاتی نیز باشد.

۲- چه کسانی به برنامه معاملاتی نیاز دارند؟

۲-۱ برخی برنامه معاملاتی را مانند یک نقشه راه توصیف می کنند. یعنی مسیری که شما را از جایی که اکنون هستید به جایی که می خواهید بروید یعنی سودآوری پیوسته راهنمایی خواهد کرد. همان گونه که مسافرت با ماشین بدون داشتن نقشه راه غیر عاقلانه و نهایتاً باعث گم شدن شما خواهد شد. معامله کردن بدون داشتن یک ایده روشن از این که به کجا می خواهید بروید و اینکه چطور می خواهید به آنجا برسید قطعاً باعث افزایش استرس شما و شب های بدون خواب و ضررهای مالی و یا هر سه خواهد بود. سوالی که باید از خود پرسید این است که اگر شما حاضر نیستید بدون داشتن نقشه راه به مسیری ناشناخته بروید پس چرا بدون داشتن یک برنامه معاملاتی واضح و با جزئیات دقیق حاضر به معامله کردن می شوید؟

۳- برنامه معاملاتی چه کاری انجام می دهد؟

۳-۱ با داشتن برنامه معاملاتی انجام معاملات برای شما راحت تر می شود نسبت به زمانی که از برنامه معاملاتی استفاده نمی کنید. احتمال انجام معاملات بد را محدود می کند و از ریشه دار شدن بسیاری از مشکلات روحی و روانی جلوگیری می کند. به شما در رسیدن به این موارد کمک می کند چراکه در هر کجا از مسیر معاملاتیتان که هستید نه تنها به عنوان یک نقشه راه عمل می کند بلکه موقعیت شما را نیز نشان می دهد. مهم تر از همه اینکه اگر معاملات شما بد پیش رفت شما خواهید فهمید که دلیل آن تنها یکی از این دو احتمال بوده است. یا یک بخش در برنامه خوب کار نمی کند و یا شما چندان به برنامه خود پایبند نبوده اید. اگر برنامه شما خوب است و از آن back test و forward test (البته با سرمایه اندک) گرفتید و نتایج خوب بودند پس اشکال احتمالاً مربوط به عدم رعایت قوانین برنامه توسط شما بوده است. اما در صورت نداشتن برنامه معاملاتی و ضرر کردن تقریباً فهمیدن اینکه چه کاری را درست انجام میدادید و چه کاری را اشتباه تقریباً غیر ممکن است. شما هیچ راهی برای ارزیابی نتایج معاملاتتان ندارید. بنابراین امکان رفع اشکال برای شما وجود ندارد. برنامه معاملاتی مانند یک GPS شخصی است که موقعیت فعلی شما را نشان می دهد و اگر مسیر را اشتباه رفتید به شما هشدار می دهد و شما را مجهز به ابزاری برای تشخیص محل اشتباه و راه درست برای برگشت به مسیر اصلی می سازد. شما راقدر می سازد که بتوانید پیوسته نتایج معاملاتتان را ارزیابی کنید و از همه مهمتر در ارزیابی انضباط شخصی شما به گونه ای هدفمند و جامع یاری می رساند. بدون برنامه معاملاتی انجام این کار بسیار مشکل است.

۳-۲ یک برنامه معاملاتی بایستی بار بسیاری از تصمیم گیری ها را در زمان انجام معاملات به دوش بکشد. مسائل احساسی زمانی که بحث پول واقعی به میان می آید بسیار قدرتمند می شود و باعث می شود که تصمیمات غیر منطقی بگیرید. در یک برنامه معاملاتی درست، تمامی رفتارهای درست باید دیده شده باشد تا در اوج معاملات مجبور به گرفتن هیچ تصمیمی نباشید و تنها آنچه را که در برنامه آمده است را دنبال کنید.

۳-۳ بسیار خوب امیدوارم که در مورد ضرورت داشتن یک برنامه معاملاتی واضح و با جزئیات قانع شده باشید. در زیر خلاصه ای از مزایای اصلی داشتن برنامه معاملاتی آمده است.

- انجام معاملاتی بدون استرس و با آرامش که بسیار راحت تر از زمانی است که برنامه معاملاتی نداریم

- توانایی بررسی عملکرد، رفع خطاها و به دنبال آن اصلاح برنامه معاملاتی

- به کمک برنامه از ریشه دار شدن بسیاری از مشکلات روحی پیشگیری می شود
- با پایبندی به برنامه معاملاتی می توان تعداد معاملات بد را کاهش داد
- برنامه معاملاتی مانع از گرفتن تصمیمات غیر منطقی در اوج معاملات می شود
- به کمک برنامه می توانید تنها موردی که امکان کنترلش را دارید کنترل کنید و آن خود شما هستید
- معامله گران حرفه ای بسیار منضبط هستند. برنامه معاملاتی به تدریج انضباط را به معاملات شما وارد می کند. قماربازها نه برنامه و نه انضباط دارند
- به کمک برنامه می توانید خارج از حد آرامش خود نیز معامله کنید. چند بار در معاملات خود به ضررها اجازه پیشروی دادید و جلوی ادامه رشد معاملات سودده خود را گرفته اید؟ برنامه ای همراه با انضباط انجام شود از روی دادن چنین مواردی جلوگیری می کند.
- برنامه نقشه راه شماست که شما را از جایی که اکنون هستید به جایی که می خواهید بروید می رساند یعنی سودآوری پیوسته.
- تمپلیت (و به طور ضمنی برنامه شما) به گونه ای طراحی شده که اگر در جایی از مسیر حرکت اشتباه کردید به سرعت شما را آگاه کند و این شانس را داشته باشید که قبل از خارج شدن چرخه ضررها از کنترل آن ر اصلاح کنید.

۴- قبل از اینکه شروع کنید...

۴-۱ قبل از اینکه شروع به خلق برنامه معاملاتی خود با استفاده از این تمپلیت کنید در اینجا نکاتی را متذکر می شویم که به کمک آنها بتوانید بهترین برنامه ممکن را برای خود بسازید. تمپلیت به ده بخش تقسیم شده است. هدف این است که در نهایت به برنامه ای برسید که با شخصیت، توانایی و منابع شما همخوانی داشت باشد. به هیچ عنوان سعی نکنید از بعضی از بخش ها بگذرید و مراحل را به همان ترتیبی که در این متن آمده است دنبال کنید. این ترتیب مطالب به دلایل مشخصی به این گونه در نظر گرفته شده اند که در طول دوره متوجه آن خواهید شد. به این یازده بخش همانند حلقه های یک زنجیر نگاه کنید و یا بازیکنان یک تیم فوتبال؛ هر کدام به اندازه دیگری مهم هستند. برای کسانی که از قیاس کردن لذت می برند و می خواهند بدانند که کدامیک از این یازده بخش در نقش دروازه بان هست باید بگوییم که بخش دهم بخش مدیریت ریسک و پول .

۴-۲ بعضی از بخش ها به نظر ساده می آیند. اگرچه تمپلیت به گونه ای طراحی شده است که تا حد امکان ساده باشد اما به تمامی جواب های خود تا حد امکان دقت لازم را مبزول داشته باشید. به عنوان مثال در اولین بخش سوال چرا می خواهید معامله گر باشید؟ پرسیده شده است، جواب "پول درآوردن" یک جواب کلی است که برای تمام معامله گران قابل کاربرد است. اما این جواب نمی تواند شخصی باشد بنابراین نمی تواند کمکی به برنامه شما بکند. جواب "معامله گری یک تجارت است درست مانند همه تجارت های دیگر" نیز یک پاسخ کلیشه ای است که اغلب گفته می شود و بنابراین به راحتی فراموش می شود.

تمپلیت برنامه ریزی معاملاتی

۵- خودتان را بشناسید ، هدفتان را بشناسید

۱-۵ تقریباً تمامی معامله گران حرفه ای به شما خواهند گفت که کلید موفقیت در بازار در فهم و شناخت روحیه خودتان است (درک و شناخت روحیات یک معامله گر، که از آن به طور کلی با عنوان احساسات نیز یاد می شود؛ ابزار بسیار ارزشمندی است). بسیاری از معامله گران کم تجربه در بدو شروع کارشان به عنوان یک تریدر به هیچ عنوان آمادگی مقابله در برابر یورش هایی که در فکر و احساساتشان ایجاد می شود را ندارند. چراکه در هنگام کسب سود دچار طمع و در زمان باخت دچار ترس می شوند. اما در مقابل، معامله گران حرفه ای در زمان سود و زیان خونسردی خود را حفظ می کنند. شما برای رسیدن به این مرحله باید خودتان را بشناسید و باید بدانید که عکس العمل تان در زمان سود و ضرر چگونه است. به محض این که به این اطلاعات دسترسی یافتید پلان معاملاتی شما می تواند برخی جنبه های مثبت از ساختار روانشناختی شما را به کار گیرد و بعضی از جنبه های منفی اش را از پلان معاملاتی حذف کند.

۲-۵ در کنار تلاش برای درک روحیه و رسیدن به یک شناخت از شخصیتتان ؛ دانستن این که چرا شما می خواهید که یک تریدر شوید نیز مهم است.

- هدف شما چیست - موفقیت به عنوان یک معامله گر برای شما به چه معناست؟

- تصمیم بگیرید که می خواهید چه چیزی را به دست آورید و از خود بپرسید که چرا و چطور معامله کردن می تواند به آن جامه عمل بیوشاند؟

- چقدر ناراحت کننده خواهد بود اگر بعد از یکسال و یا بیشتر و بعد از صدها و هزاران دلار سرمایه گذاری، متوجه شوید که معامله گری به درد شما نمی خورد و این که شما نردبان موفقیت خود را به یک دیوار اشتباه تکیه داده بودید.

بسیار خوب پلان معاملاتی شما از همین الان آغاز می شود..

۳-۵ چرا می خواهید که یک معامله گر شوید؟

انگیزه های حقیقی خود را مورد پرسش قرار دهید.

من می خواهم که یک تریدر باشم به دلیل اینکه..... (مثال؛ انجام این چالش یعنی موفقیت به کمک داشتن نظم، که کار بسیار سختی است، در جایی که ۹۰ درصد شرکت کنندگان آن می بازند مرا به وجد می آورد.)

هدف اصلی من برای این که می خواهم یک تریدر شوم این است که(مثال؛ درآمد سالانه و کافی ... دلار را برای تامین خانواده ام به دست آورم.)

هدف دوم من از تریدر شدن این است که (مثال؛ زمان بیشتری را با خانواده ام بگذرانم و از امکان ترید کردن از هر کجای جهان لذت ببرم)

این اهداف برای من مهم هستند چراکه (آنها هدف و مسیر را در زندگی من مشخص می کنند و به من امکان ایجاد توازن بیشتر را می دهند.)

من باور دارم که به این اهداف می رسم چراکه(نام من است و دیگر هیچ).

۴-۵ شما از کدام دسته از تریدرها هستید؟

آیا شما یک تریدر محتاط هستید و یا یک تریدر ماشینی؟

آیا شما معامله گر بلند مدت (مثلا ماهانه) یا میان مدت (هفتگی) و یا کوتاه مدت (روزانه و یا حتی زیر روزانه) هستید؟

انتخاب این که شما معامله گر موقعیتی هستید position trader و یا یک swing trader نوسان گیر و یا یک معامله گر روزانه هستید به مقدار زیادی بستگی به این دارد که شما حاضرید چه میزان از زمان خود را به این تجارت اختصاص دهید.

به طور کلی معامله گر روزانه به صفحه مانیتور خود در طول مدت پوزیشن چسبیده اند در حالی که معامله گر موقعیتی کمتر از یک ساعت در هفته را به بازار اختصاص می دهند.

سبک معاملاتی خود را تعریف کنید و باورهای خود را درباره بازار بیازمایید

مثال : من یک معامله گر محافظه کار هستم و سبک معاملاتی من بسیار (محتاطانه هست که باعث می شود من برای swing trading در انتهای روز مناسب باشم و یا برعکس سبک معاملاتی من بسیار تهاجمی است به گونه ای که من را برای scalping در تایم فریم زیر روزانه مناسب می سازد)

من متوجه شدم که نمی توانم آینده را پیش بینی کنم و پذیرفتم که نمی توانم بازار را کنترل کنم با اینحال می توانم خودم را کنترل کنم که این کار رابه کمک(پابندگی به برنامه معاملاتی ام که با جزئیات بسیار و دقیق طراحی شده و از آن تست گرفته ام و سود ده هست انجام می دهم)

۵-۵ نقاط ضعف و قدرت شما در چیست؟

لیستی از نقاط ضعف و قدرت هر یک از معاملات خود را تهیه کنید و سپس مشخص کنید که چطور می خواهید سود های پیشین خود را افزایش و ضررها را کاهش دهید. انجام این کار برای دیگران اغلب راحت تر است تا اینکه برای خودتان انجامش دهید. پیشینه معاملاتی شما شاید برخی از سرنخ ها را برای شما فراهم کند.

فرض کنید که شما یک خلبان هواپیمای جنگنده بازنشسته اید که عادت به کار در محیطی بسیار با نظم و انضباط داشته اید و به دستورات بسیار سختگیرانه پایبند بوده اید. (نقطه قوت بالقوه)

با اینحال روی دیگر سکه این است که شاید شما عادت به تفریح یا عادت به ترشح بالای آدرنالین در خونتان و یا عادت هیجانی که باعث خوردن ناخن هایتان می شود و یا حتی میل به تجربه ترس دارید. (نقاط ضعف بالقوه)

اگر پاسخ به این سوالات برای شما سخت هست، یک حساب دمو باز کنید و هر یک از معاملاتتان را امتحان کنید و یادداشت کنید که چه کارهایی را اشتباه و چه کارهایی را درست انجام داده اید. این کار را تا آنجا انجام دهید که الگو شروع به پدیدار شدن کند تا بتوانید بدین ترتیب نقاط قوت و ضعف خود را بیابید.

اولین نقطه قدرت من این است که (به سودهایم اجازه رشد می دهم و پوزیشن هایم را تنها زمانی که استراتژی خروج به من اجازه می دهد می بندم. این به من کمک می کند که در راستای هدفم که کسب سودهای پیوسته از بازار هست حرکت کنم)

دومین نقطه قدرت من

اولین نقطه ضعف من (دلم می خواهد که ضررم را به سرعت جبران کنم مسئله ای که اغلب به ایجاد ضررهای بیشتر منجر می شود) **البته بخش هایی از برنامه معاملاتی من به کنترل این نقطه ضعف کمک می کند و مانع رشد ضررها می شود.....** (مثلا من یک حد ضرر روزانه دارم که اگر به آن حد رسید از انجام معامله در ادامه آن روز منع می شوم)

نقطه ضعف دوم من

۵-۶ آیا شما در شرایط فکری مناسبی برای ترید هستید؟

شرایط فکری شما یک مانع کلیدی است که بین شما و موفقیت در بازار قرار می گیرد.

آیا شما به اندازه کافی خوابیده اید؟

آیا شما در سلامتی و تندرستی و هوشیاری ذهنی هستید؟

آیا شما آرام و خونسرد هستید و یا اینکه خسته اید و از بابت مسئله ای پریشان خاطرید؟

من تنها در روزهایی معامله می کنم که (به اندازه کافی استراحت کرده ام؛ آرام هستم و از بابت مسئله ای در محیط کار یا خانه یا فکرم مشغول نیست. در این صورت بر طبق برنامه معاملاتی ام عمل خواهم کرد و با جدیت به آن پایبند خواهم ماند. این مسئله به من کمک می کند که از انجام معاملاتی که به خوبی درک و اجرا نمی شوند بپرهیزم)

من معامله نمی کنم در روزهایی که (احساس کسالت می کنم و یا روزهایی که خسته هستم و یا از نظر شرایط ذهنی و روحی پریشانم)

۷-۵ اهداف درآمدی شما چیست ؟

دلایل بیشماری برای معامله گر شدن وجود دارد. پول درآوردن یک دلیلی است که همگی ما بر آن اتفاق نظر داریم. بسیار مهم هست که بدانید اهداف اقتصادی و درآمدی شما چیست و بتوانید آن ها را به بازه های روزانه و هفتگی خرد کنید. این گفته که رسیدن به اهداف کوچکتر به مراتب آسانتر از اهداف بزرگتر هست کاملاً درباره معامله گری نیز صدق می کند. اگر استراتژی شما کسب بازدهی ۵ درصد در ماه باشد این به مراتب نسبت به داشتن هدف کسب بازدهی ۱ درصد در روز عملی تر است.

اهداف شما نباید فانتزی های ایده آل گرایانه باشند بلکه آنها باید کاملاً بر اساس نتایج back test و forward test شما بنا شده باشند. (این موضوع به تفصیل در بخش های ۷-۱۰ و ۸-۱۰ در قسمت مربوط به sharpe ratio & success ratio توضیح داده می شود.)

اهداف درآمدی من (به دست آوردن بازگشت سرمایه ای در حدود X درصد در سال که این برابر است با مبلغی معادل دلار، بدون اینکه drawdown حساب من از Y درصد فراتر رود. بنابراین میانگین درآمد ماهانه من معادل دلار؛ میانگین درآمد هفتگی معادل ... دلار؛ میانگین درآمد روزانه ... دلار می شود. بنابراین هدف درآمدی روزانه من Z درصد از کل موجودی حسابم خواهد بود.)

۶- اهداف معاملاتی

۶-۱ داشتن اهداف، بخش ضروری از برنامه معاملاتی شما هستند. آنها مثل چراغ راهنما و به شما امکان پیگیری پیشرفتتان را می دهند و انگیزه لازم برای اینکه از پس این کار برآید را در اختیارتان قرار می دهند. سعی کنید اهداف خود را در غالب پیشرفتتان در تریدر شدن تعریف کنید و نه صرفاً تعریف اهداف مالی. چراکه تمرکز بر روی تبدیل شدن به یک معامله گر حرفه ای قطعاً به دنبال سودهای زیادی را برای شما به ارمغان خواهد آورد. سپس تصمیم بگیرید که چطور می خواهید به این اهداف برسید و چطور می خواهید بعد از رسیدن به این اهداف به خود پاداش دهید. پاداش باید متناسب با مقیاس و اندازه موفقیتتان باشد ولی به همان اندازه هم باید برای شما حس و معنی پاداش را بدهد. به عنوان مثال پاداشی مثل یک شب بیرون رفتن و خوش گذراندن با کسانی که دوست دارید با آنها باشید.

۶-۲ اهداف معاملاتی سالانه شما چه هستند؟

این یک تصویر بزرگ است. به این مقوله به این صورت فکر کنید که چه مهارت ها و اطلاعاتی را می خواهید در طی این یک سال به دست آورید.

هدف معاملاتی سالانه من (به عنوان مثال؛ توسعه مهارت معامله گری ام به مرزی که مورد دلخواه من هست. و در حال حاضر، این سه بخش مجزا را شامل می شود که عبارت است از ...

۱. من دسترسی به آموزه های یک مربی با نام..... را دارم که یکی از بهترین ها در رابطه با به کارگیری استراتژی هاست ؛

۲. من از یکی از بهترین مدل های تمرین معامله گری استفاده می کنم که شامل یک برنامه معاملاتی است که به روشنی برنامه ریزی شده و به صورت مکتوب است؛

۳. استراتژی های من به خوبی توسعه یافته اند، تست شده اند و به طور جامع بررسی شده اند تا این اطمینان را بدهند که در تمامی شرایط قابلیت معامله کردن و سوددهی را خواهند داشت.

من انتظار دارم که به این اهداف برسم به این دلیل که (علاوه بر داشتن مربی، مجله ... را نیز می خوانم و از سخنان حکیمانه افراد باتجربه تر در را نیز مطالعه می کنم).

زمانی که به هدف برسم پاداش من (دو هفته مسافرت خانوادگی به خواهد بود)

۳-۶ اهداف معاملاتی ماهانه شما چه هستند؟

اکنون اهداف معاملاتی ماهانه خود را تعریف کنید. دوباره مانند دفعه گذشته از تعیین اهداف مالی تا حد امکان بپرهیزید. اینکه چطور شما به این اهداف می رسید و چطور در زمان رسیدن به این اهداف به خود پاداش می دهید.

اهداف معاملاتی ماهانه من (رسیدن به سوددهی پیوسته در هر ماه است با $success\ ratio$ معادل ۲ به ۱ و $sharp\ ratio$ معادل ۱/۵ به ۱ و یا بیشتر)

من انتظار دارم که به این اهداف برسم چراکه (من عملکرد خودم را براساس اصول روزانه/هفتگی/ماهانه مرور می کنم و به این ترتیب هر مشکلی که پیش آمده باشد را مشخص می کنم)

زمانی که به این هدف می رسم پاداش من (صرف شام بیرون از منزل همراه با خانواده و یا همکار در رستوران خواهد بود)

۴-۶ اهداف معاملاتی هفتگی شما چه هستند؟

در اینجا نیز اهداف معاملاتی هفتگی خود را تعیین کنید. چطور به آنها خواهید رسید و چطور در زمان دست یافتن به آنها به خود پاداش خواهید داد.

هدف معاملاتی هفتگی من (این است که در هر روز هفته معامله انجام دهم. معاملاتی که متناسب با برنامه معاملاتی من باشد. و این نیز شامل در نظر گرفتن استاپ لاس، پایبند ماندن به استراتژی مدیریت پول و ریسک؛ و دنبال کردن معیارهای خروج از معاملاتم و اختصاص دادن بیشتر وقتم برای جستجوی موقعیت های معاملاتی جدید و تنها انتخاب آن دسته از موقعیت هایی که بهترین ستاپ را دارند.)

زمانیکه به این هدف رسیدم پاداش من (خرید آلبوم موسیقی.... خواهد بود)

۵-۶ اهداف معاملاتی روزانه من چه خواهد بود؟

در نهایت تعیین اهداف معاملاتی روزانه هست. برنامه روزانه شما برای انجام معاملات چیست. و چطور پیشرفت خود را می سنجید و چطور به خود پاداش می دهید.



هدف معاملاتی روزانه من..... (معامله براساس برنامه هست. امروز من به برنامه معاملاتی خود پایبند خواهم ماند چراکه با جزئیات دقیق و مشخص و آزمایش شده و سوده هست. من اطمینان دارم که از چنان نظمی برخوردارم که می توانم به این برنامه پایبند بمانم و در ازای آن برنامه این اطمینان را به من می دهد که اهداف هفتگی و ماهانه و سالانه من نیز برآورده خواهد شد.)

با فرض پایبندی به برنامه..... (پاداش من یک دسر مورد علاقه ام قبل از خواب خواهد بود.)

۷ بازارها ، ابزارها ، تایم فریم ها

۱-۷ چه بازارهایی را شما معامله می کنید؟

درباره بازاری که دوست دارید معامله کنید تصمیم بگیرید؛ ابزارهایی که در آن بازار در دسترس هستند و دلایل شما برای انتخابتان. در یک حساب سرانگشتی، معامله گران حرفه ای تمایل به منحصر کردن تمرکزشان به تعداد محدودی از بازارها و ابزارها دارند. اما در مقابل معامله گران مبتدی هر روز در یک بازار کار می کنند .

ابزار معاملاتی من..... (معامله سهام بازار امریکا در شب هنگام بعد از ساعت کاری ام است؛ چراکه فرصت های معاملاتی خوبی در بین ساعت ۷ تا ۹ بعدازظهر در این بازار وجود دارد. به خصوص که در این بازه بازار از نقدینگی و نوسان خوب و اسپرد کم و *fast fill* و کمیسیون کم و بدون مالیات (*stamp duty*) برخوردار است.

۲-۷ چه ابزارهایی را معامله می کنید؟

آیا شما خود را به سبدهی از سهام محدود می کنید و یا اینکه هر چیزی را از هر کجا معامله خواهید کرد. اگر شما بازار آتی را معامله می کنید چه بازارهای متفاوتی از آن را ترید می کنید و چرا. اگر معامله گر بازار فارکس هستید چند جفت ارز را معامله می کنید و چرا.

تعداد سهام/ قراردادهای بازار آتی/ جفت ارزها که من معامله خواهم کرد..... (بیشتر از X تعداد نخواهد شد و براساس میزان نقدشوندگی و حجم معاملات حداقل ۲ میلیون برگه سهم و براساس نوساناتشان و حداقل نوسان ۱/۵ دلار در روز انتخاب می شوند.)

۳-۷ چه تایم فریمی را معامله می کنید؟

قبل از این قسمت شما تعیین کردید که چه نوع معامله گری هستید؛ معامله گر میان روزی ، نوسان گیر و یا موقعیتی (*intraday, swing or position trader*). اکنون باید بر روی تایم فریم متناسب با انتخاب نوع معامله گری خود تمرکز کنید. درباره تعداد تایم فریم هایی که از آنها استفاده می کنید و نیز در مورد

دلیل استفاده آنها دقیق و روشن باشید. به عنوان مثال یک معامله گر روزانه ممکن است از تایم فریم ۱ دقیقه برای ورود به معامله و از تایم فریم ۵ دقیقه برای خروج و از تایم فریم ۱۵ دقیقه برای تصمیم گیری درباره تعیین نوع روند در طول بازه ی معاملاتی اش استفاده کند.

به عنوان یک معامله گر نوسان گیر من استفاده می کنم از (نمودارهای روزانه برای تعیین روند؛ از نمودار 10 دقیقه برای ورود و خروج از معامله و از نمودار 60 دقیقه برای دنبال کردن پوزیشن های بازم)

۸ ابزارهای معامله

۸-۱ از کدام ابزارهای مالی در معامله استفاده می کنید؟

از هر ابزار مالی که در معاملات استفاده می کنید: , Shares, Spread Betting, Contracts for Difference (CFD) مزایا و معایب در رابطه با انتخابتان را کاملا درک کنید. به خصوص درباره Spread Betting. بدون هیچ پرسشی این یکی از ابزارهای معاملاتی محبوب هست به خصوص که برای معامله گران مبتدی ایده آل است اما این ابزار اشکالاتی هم دارد به عنوان مثال اغلب غیر ممکن است که یک معامله روزانه سودده با استفاده از این ابزار معاملاتی داشته باشید

ابزار معاملاتی انتخابی من (Spread betting هست چراکه من می توانم یک حساب با فقط ۱۰۰ یورو باز کنم و فقط ۱ پیپ در هر پوینت معامله کنم و سودها هم فعلا معاف از مالیات هستند. با اینحال من محدودیت های این ابزار را می دانم و اینکه این ابزار بیشتر برای نوسانگیر ها مناسب است)

۸-۲ از کدام کارگزاری و پلتفرم معاملاتی برای ترید استفاده می کنید؟

کارگزاری و پلتفرم معاملاتی شما در نحوه اجرای شما بسیار حیاتی هستند درست همان طور که راکت تنیس راجر فدرر و یا کفش های راگی جانی ویلکینسون برای کار آنها حیاتی هست. هر دوی این ورزشکاران با هر وسیله و ابزار کهنه ای می توانند خیلی خوب بازی کنند اما انتخاب این ابزارهای اولیه با دقت زیاد به آنها کمک می کند تا یک عملکرد ورزشی پیوسته فوق العاده داشته باشند. به عنوان شروع در تصمیم گیری برای انتخاب کارگزاری این ۶ مورد دخیل هستند:

۱- ابزارهایی که شما می خواهید از آنها برای ترید استفاده کنید. اگر به عنوان مثال شما تمایل به ترید بر روی سهام امریکا را دارید کدام کارگزاری بیشترین تعداد شرکت را در اختیارتان قرار می دهد و کارمزد و کمسیون آن نسبت به کارگزاری های دیگر چقدر است؟

۲- ابزار مالی مورد استفاده شما برای معامله ی بازار مورد انتخاب شما. , C.F.Ds., Spread betting, options, futures, forex or direct access

3- اندازه حساب شما. اگر شما مبلغ محدودی برای سرمایه گذاری در معاملات دارید، شما قادر نخواهید بود حساب Patten Day trader (P.D.T.) با دسترسی مستقیم به کارگزاری افتتاح کنید. بنابراین انتخاب شما از کارگزاری هایی که پیشنهاد C.F.D را نیز می دهند محدود می شود. Spread betting می تواند تنها گزینه مناسب برای شما باشد و جایی است که اکثر تریدر های تازه کار از آنجا شروع می کنند.

4- پلتفرم مورد استفاده شما برای معامله. این معمولاً بخشی است که توسط کارگزار در اختیار شما قرار می گیرد. این پلتفرم پیشنهادی باید دارای بخش های مورد نیاز شما باشد و کار کردن با آن برای شما راحت باشد.

5- سطح پشتیبانی و خدمات مشتری که کارگزاری ارائه می دهد.

6- سطح تجربه شما. بسیاری از حرفه ای های بازار، تریدر های تازه کار را از باز کردن یک حساب با کارگزاری فیوچرز برحذر می دارند. و پیشنهاد می کنند که از معامله e-mini S&P شروع کنند.

انتخاب من از کارگزاری. کارگزاری .. است چراکه آنها طیف وسیعی از سهام را ارائه می دهند همراه با اسپردهای خوب؛ آنها جوایز بسیاری در زمینه سرعت بالای پلتفرم معاملاتی از آن خود کرده اند و خدمات مشتری آنان خوب است.

۳-۸ از چه نرم افزار و منبع دیتا برای معامله کردن استفاده می کنید؟

اگر تصمیم شما برای معامله بر مبنای تحلیل های تکنیکال هست مطمئن شوید که منبع تامین دیتای قیمتی شما و پلت فرم نمودار قیمت شما موارد مورد نیاز شما برای تحلیل را داشته باشد.

انتخاب من از منبع تامین دیتا (.... است چراکه دیتا را برای ابزارهایی که من برای ترید لازم دارم تامین می کند و در عین حال گزینه ای برای به روز کردن دارد و به من امکان دسترسی به دیتای لحظه ای سایر بازارها می دهد)

۹- قبل از باز شدن بازار

۹-۱ انجام یک سری کارها، قبل از بازگشایی بازار، برای اطمینان از آمادگی کامل شما برای روز معاملاتی پیش رو ضروری است. اگر غیر از این باشد مانند مسافرتی است بدون چک کردن میزان سوخت ماشین؛

۹-۲ عادات های روزانه شما قبل از بازگشایی بازار چی هست؟

همان طور که از سوال مشخص هست؛ منظور کارهایی هستند که شما هر روز انجام می دهید تا مطمئن شوید که زمانی که موقعیت معامله فراهم می شود نتایج مورد نظر شما را فراهم می کند.

عادات های روزانه من قبل از بازگشایی بازار شامل پنج مورد کلیدی می شود.....(۱-معاملات روز گذشته را بررسی می کنم. ۲-پوزیشن های باز را مرور کرده و هدف ها را به روز می کنم. ۳- وضعیت بازار امروز را ارزیابی کرده و مطابق آن برنامه ریزی می کنم. ۴- برنامه روز پیش رو را ساعت به ساعت برنامه ریزی می کنم. ۵- یک انتخاب اولیه از سهام یا جفت ارز احتمالی برای معامله را انجام می دهم.)

۹-۳ آیا معاملات دیروز را تحلیل کرده اید؟

آیا شما تحلیل معاملات دیروز خود را کامل کرده اید و دفترچه گزارشات معامله خود را به روز کرده اید؟ آیا به برنامه خود پایبند بوده اید؟ اگر نه این موضوع چه تاثیری بر روی فعالیت معاملاتی امروز شما خواهد داشت؟ به عبارت دیگر، توانایی شما(یا عدم توانایی شما) در پایبندی به برنامه معاملاتی دیروز باید در فعالیت معاملاتی امروز شما تعریف شده باشد.

هر روز اطمینان حاصل می کنم که معاملات دیروز من.....(تحلیل و ثبت شده اند و دفترچه ثبت معاملاتم به روز است. علاوه بر آن مطمئن می شوم که به تمام بخش های برنامه معاملاتی ام پایبند بوده ام.)
در صورت عدم پایبندی به برنامه معاملاتی ام.....(فعالیت معاملاتی امروز را مطابق با دستورالعمل انضباطی و تادیبی که در بخش ۳-۱۴ به تفصیل آمده اصلاح خواهم کرد.)

۹-۴ آیا هیچ پوزیشن باز دارید؟

اگر در برنامه شما به وضوح درباره باز نگه داشتن پوزیشن در طول شب توضیحی داده نشده پس پوزیشن خود را باز نگه ندارید. با اینحال اگر شما swing trader و یا position trader هستید احتمالا پوزیشن های باز داشته باشید.

اگر من پوزیشن باز داشته باشم.....(اهداف قیمتی و حد ضررها را به روز می کنم و مطمئن می شوم که دلایل اولیه ی ورودم به معامله هنوز اعتبار دارند.)

۹-۵ وضعیت عمومی بازار چگونه است؟

آیا هیچ اخبار مهمی که بر روی بازار تاثیر بگذارد وجود دارد؟ شاخص بازار فیوچرز چگونه است؟ آیا هیچ گزارش اقتصادی مهمی برای انتشار وجود دارد و اگر هست در چه ساعتی منتشر می شود.....؟

قبل از معاملات (۱ - شاخص بازار فیوجرز را چک می‌کنم تا روند آن مشخص کنم ؛ صعودی ، نزولی و یا خنثی ؛ این یک سیگنال مثبت/ منفی است چراکه)

۲ - چک می‌کنم که آیا هیچ گزارش‌های اقتصادی مهم برای انتشار وجود دارد و اگر هست در ساعتی منتشر می‌شود.

۳ - چک می‌کنم که آیا هیچ شخصیت مهمی سخنرانی دارد و اگر اینطور هست در چه ساعتی

هدف من معامله در زمان عکس العمل بازار به این گزارش‌ها و اخبار هست. بنابراین من ترید نمی‌کنم برای مدت (۱۵ دقیقه اول بعد از انتشار گزارش و یا متن سخنرانی تا متوجه شوم که عکس العمل بازار به آن چه هست. این کمک می‌کند که من مطمئن باشم که آنچه را که می‌بینم معامله کنم نه آنچه را که فکر می‌کنم)

۶-۹ امروز را چگونه خواهید گذراند؟ ساعت به ساعت

اگر شما برای هر ساعت از روز خود برنامه نداشته باشید سرعت شما کم می‌شود و این باعث از دست رفتن فرصت‌ها و یا بدتر از آن خروج از برنامه و باز کردن معاملات خسته‌کننده می‌شود. ساختاری را فراهم کنید تا نظم روزانه شما را تامین کند و تمرکز شما را حفظ کند و این اطمینان را بدهد که ساعات کاری شما تا حد اکثر ممکن به بهترین نحو استفاده می‌شود. البته ساعات به خصوصی را برای خوردن و زمان استراحتی را برای بلند شدن از پشت کامپیوتر نیز در نظر بگیرید.

به عنوان یک تریدر روزانه سهام امریکا ، برنامه روزانه ای دارم که (ساعت به ساعت بازار را پوشش می‌دهد. قبل از ساعت ۱۲ ظهر به وقت گرینویچ وقت آزاد من برای استراحت و چک کردن سایت است. ساعت ۱۲ ظهر زمان خوردن ناهار. ساعت ۱ ظهر آن قسمت از برنامه که در بخش ۲-۹ تا ۵-۹ آورده ام را انجام می‌دهم. ساعت ۲ ظهر برای باز شدن بازار آماده می‌شوم و به دنبال گپ‌های بازگشایی و آلارم‌ها هستم. ساعت ۲/۳۰ لحظه باز شدن را ترید می‌کنم. ساعت ۲/۴۵ به دنبال برگشت‌های ساعت ۳ هستم. و به همین ترتیب تا انتهای روز.....)

۷-۹ چه سهم‌ها یا جفت‌ارزهایی در واچ لیست شما هستند؟

در نهایت شما برای جستجوی فرصت‌های معاملاتی امروز آماده‌اید. تمام جفت‌ارزهای مورد نظر خود را چک کرده و آنهایی را که با استراتژی شما مطابقت دارد جدا کنید. مثلا اگر شما یک معامله‌گر روزانه هستید ممکن است یک استراتژی اصلاحی برای معامله کردن لحظه بازگشایی بازار داشته باشید ؛ و به دنبال آن استراتژی شکست بعد از نیم ساعت اول بازگشایی بازار و در نهایت استراتژی بازگشتی برای جلسه معاملاتی شب.

من تمامی جفت‌ارزهای مورد نظرم را چک می‌کنم به منظور (انتخاب گزینه‌هایی که با استراتژی من هماهنگی دارند. و یک زنگ هشدار صوتی و یا تصویری برای سیگنال ورود و خروج تنظیم می‌کنم.)

من نمودارهای تمامی جفت ارزهایی که در واچ لیست من هستند به روز می‌کنم تا بتوانم(سطوح حمایت و مقاومت مهم و اصلی و قیمت باز و بسته شدن بالاترین و پایین ترین قیمت دیروز ورا ببینم)

۱۰ - مدیریت سرمایه و ریسک

۱-۱۰ این بخش دشوارترین قسمت از کل این مطلب هست. شکست در بکارگیری قوانین مدیریت سرمایه و ریسک به طور قطع باعث ورشکستگی مالی خواهد شد. اول از همه بگذارید تفاوت مابین مدیریت ریسک و مدیریت سرمایه را توضیح دهم.

مدیریت ریسک بر روی مراحل تمرکز می‌کند که برای کاهش ضررها ضرورت دارد و این کار را توسط تعیین شرایط بازار، نسبت ریسک به سود R/R، احتمالات و استفاده از دستور توقف ضرر یا استاپ لاس و... انجام می‌دهد.

از طرف دیگر مدیریت سرمایه، بر روی مراحل تمرکز دارد که برای افزایش سود ضرورت دارند و این کار را توسط استفاده از تریل کردن استاپ لاس و تنظیم حجم معاملات و... انجام می‌دهند.

و تمامی اینها در این اصل بزرگ معامله‌گری خلاصه شده است: ضررهایت را کوچک کن (مدیریت ریسک) و به سودهایت اجازه رشد بده (مدیریت سرمایه).

مدیریت ریسک کلی

۲-۱۰ نگرش شما در رابطه با ریسک چیست؟

این سوال عجیبی به نظر می‌رسد، اما این نقطه شروع خوبی است تا مطمئن شوید که آیا احساس شما در رابطه با ریسک با روش معاملاتی شما همخوانی دارد یا نه.

دیوید اس. ناسار در کتابش با نام "How to Get Started in Electronic Day Trading" پیشنهادی در رابطه با این موضوع می‌کند: "به این بازار همانند یک راکتور هسته ای بیاندیشید - هر چه بیشتر در معرض تشعشعات آن باشید احتمال سوختن شما بیشتر است. ریسک بازار با مقدار زمانی که شما در بازار هستید سنجیده می‌شود. که می‌تواند ثانیه ها، دقیقه ها، ساعت ها، روزها و یا هفته ها باشد. هر چه مدت زمان حضور شما در بازار بیشتر باشد احتمال اینکه چیزی اشتباه پیش آید بیشتر می‌شود. بنابراین روش معاملاتی ای که باعث شود شما مدت زمان طولانی تری در بازار حضور داشته باشید می‌تواند بیشترین ریسک را برای شما داشته باشد." بسیاری از معامله گر ها با این موضوع کاملا مخالفت خواهند کرد و خواهند گفت که اگر پوزیشن های میان مدت تا بلند مدت تری داشته باشند شب ها راحت تر خواهند خوابید و احساس بهتری خواهند داشت. بنابراین به عنوان مثال برای این معامله گر ها معامله کردن در بازار پر نوسان (Nasdaq) در بازه ی زیر روزانه به مراتب پر ریسک تر است.

نگرشم را درباره ریسک می‌توانم این طور جمع بندی کنم که..... (من کلا ریسک گریز هستم و تا جایی که امکان دارد سعی می‌کنم ریسک را به حداقل برسانم. و با تنوع بخشی و پایبندی به اصول مدیریت ریسک که در این بخش از برنامه معاملاتی ام تعریف کرده ام سعی در کاهش ریسک معاملاتم دارم.)

۳-۱۰ ریسک کلی بازار چیست؟

اکنون به حداکثر مبلغی از داراییتان که هر زمان حاضرید در معرض ریسک قرار دهید فکر کنید. برای بدترین ها آماده شوید. در وقایعی مانند ریزش سال ۸۷ بازار یا حمله تروریستی ۱۱ سپتامبر، اگر مبلغ زیادی از سرمایه تان را به بازار اختصاص داده بودید دچار ضرر فاجعه باری می شدید. بسیاری از معامله گرها در هر معامله بیشتر از ۱ درصد سرمایه شان را در معرض ریسک قرار نمی دهند که این مبلغ در تمام پوزیشن های بازشان بیشتر از ۵ درصد نمی شود. به عبارت دیگر اگر تمام پوزیشن های باز شما باعث شود که در یک لحظه ۵ درصد از سرمایه شما در معرض ریسک باشد پوزیشن ها همزمان بسته خواهند شد. این باعث می شود که افت حساب شما (Drawdown) بیشتر از ۵ درصد نشود. درست است که این موضوع نامطبوع هست اما حداقل فاجعه بار نیست.

حداکثر سرمایه در معرض ریسک من..... (از ۵ درصد مجموع پوزیشن های باز من در هر لحظه فراتر نمی رود)

۴-۱۰ ریسک بخشی (sector risk) چیست؟

هرکس که سریال تخیلی " مردی که بریتانیا را در هم کوبید" را دیده باشد به یاد خواهد آورد که برای آن معامله گر شهرنشین چه اتفاقی افتاد؛ کسی که روی نفت معامله ی سنگینی کرده بود. او و بانکی که از طرف آن معامله را انجام داده بود خوب عمل کرده بودند تا اینکه تروریست ها بزرگترین پالایشگاه نفت جهان را منفجر کردند. او نه تنها هیچ پاداشی دریافت نکرد بلکه کارش را نیز از دست داد. یک راه برای محدود کردن ریسک بخشی این است که تعداد پوزیشن های خود را در هر بخش یا هر بازار محدود کنید.

حداکثر ریسک من در هر بازار..... (از ۳ درصد مجموع کل سرمایه من در هر زمان فراتر نمی رود).

۵-۱۰ ریسک کارگزاری و سخت افزاری چیست؟

تصور کنید که کارگزاری شما از دسترس خارج شود و شما هم هیچ راهی برای بستن پوزیشن های خود نداشته باشید. شما در چنین موقعیتی چه می کنید. به طور مشابه، زمانی که کامپیوتر شما دچار مشکل شده و هیچ دسترسی دیگر برای بستن پوزیشن خود نداشته باشید.

کارگزاری اصلی من..... (..... است و کارگزاری پشتیبان من است. در شرایط خاص زمانی که کارگزاری اصلی من از دسترس خارج می شود من این امکان را دارم که پوزیشن های خود را توسط کارگزاری پشتیبانم هج (hedge) کنم).

و در موقعیتی که کامپیوترم از کار بیفتد..... (من یک کامپیوتر دیگر دارم با امکان اتصال به اینترنت و تمامی اطلاعاتم را روزانه بر روی یک سی دی back up می گیرم. علاوه بر آن من همیشه موبایلم روشن است و همیشه در زمان ترید کاملاً شارژ است با شماره های تماس هر دو کارگزاری ها که در صورت لزوم با آنها تماس بگیرم).

۶-۱۰ ریسک استراتژی چیست؟

بازارها پیوسته در حال تغییر هستند و یک استراتژی که برای ماه گذشته و یا سال گذشته سودده بوده ممکن است برای سال آینده و یا ماه آینده دیگر سودده نباشد. راه هایی برای بررسی این موضوع وجود دارد که در بخش ۱۳ درباره آن بحث شده است. بخش " بعد از بسته شدن بازار... "

با اینحال با داشتن یک حد ضرر بزرگ برای یک ریسک بالا نیز آماده باشید موضوعی که احتمالاً دیر یا زود اتفاق می افتد. استراتژی معاملاتی فوق العاده و بسیار سودده شما دیگر کار نمی کند. برای کنترل کردن این مسئله حداکثر drawdown را که برای استراتژی خود در نظر گرفته اید را در عدد ۱/۵ تا ۲ ضرب کنید. اگر drawdown معامله شما از این مقدار بیشتر شد انجام معامله براساس این استراتژی را به سرعت متوقف کنید.

من به دقت drawdown معاملات خود را بررسی می کنم. در شرایطی که این مقدار از (X درصد فراتر رفت به سرعت معامله براساس این استراتژی را متوقف می کنم و یک بررسی کلی را انجام خواهم داد.)

مدیریت ریسک خاص

۷-۱۰ احتمالات یک ترید موفق چه هستند؟

زمانی که به ارزیابی ریسک مربوط به یک معامله می رسیم بسیاری از معامله گران تنها بر روی نسبت ریسک به سود تمرکز می کنند. متأسفانه این موضوع تاحدی بی معنی است مگر این که احتمال موفقیت نیز به این معادله افزوده شود. دلیل آن را با مثال توضیح می دهیم: در نظر بگیرید که شخصی تصمیم به معامله با نسبت ریسک به سود ۱ به ۴ دارد؛ که برابر با سودی معادل ۸۰ پیپ در ازاء ریسک ۲۰ پیپی خواهد بود. به تنهایی این نسبت به نظر فوق العاده می رسد. با اینحال اگر احتمال موفقیت این استراتژی تنها ۲۰ درصد باشد این بدان معناست که احتمال ۲۰ پیپی ضرر ۸۰ درصد است؛ در این شرایط استراتژی پیشنهادی دیگر چندان جذاب به نظر نمی رسد.

برای ارزیابی احتمال موفقیت یک استراتژی معاملاتی بایستی کار را با تعریف ستاپ معاملاتی شروع کنیم. بررسی این موضوع باید بسیار دقیق و بدون ابهام و شفاف باشد. این موضوع برای اجرای این ستاپ در حساب واقعی و معامله با یک پول واقعی بسیار حیاتی است. زمانی که ستاپ تعریف شد، باید از آن back test و forward test گرفت تا مشخص شود که احتمال موفقیت آن از احتمال شکست بیشتر است یا نه. برای پیچیده تر کردن مسئله مسائل متنوع زیادی وجود دارد که بر روی نتیجه کار تاثیر می گذارد. سعی کنید این مسائل متنوع را در مرحله back test حذف کنید. به عنوان مثال ستاپ شما احتمال موفقیت بالای دارد اگر فقط در محدوده اعداد رند (در پوزیشن های خرید) اتفاق بیفتد و در محدوده مابین این اعداد رند یک چنین احتمال موفقیتی وجود ندارد. زمانی که ستاپ را تعریف می کنید و سپس آن را تست می کنید سعی کنید این قضیه را ساده نگه دارید؛ در جزئیات ترید گرفتار نشوید (جزئیاتی مثل تریگر ورود، محل حد ضرر، و استراتژی خروج ...). در نهایت زمانی که تعریف ستاپ به اندازه کافی دقیق بود و تست ستاپ به اندازه کافی سختگیرانه بود در این صورت ارزیابی تعداد معاملات موفق نسبت به

تعداد معاملات ناموفق امکان پذیر است. این نسبت را اغلب با نام نسبت موفقیت می شناسند (success ratio) و این نسبت را می توان به صورت درصد بیان کرد که از تقسیم کل معاملات سودده به کل معاملات انجام شده (چه سودده و چه زیان ده) ضربدر صد بدست می آید.

ستاپ یا ستاپ های معاملاتی من (به وضوح در بخش ۳-۱۲ از برنامه ی من تعریف شده و من به خوبی با آن آشنایی دارم به گونه ای که می توانم آن را در هر لحظه ای به سرعت انجام دهم. تست های گسترده *back test* و *forward test* که روی حساب دمو با این ستاپ انجام شده نشان می دهد که احتمال موفقیت \times درصد را داراست (success ratio).

۸-۱۰ نسبت ریسک به ریوارد چیست؟

برای تعریف نسبت ریسک به ریوارد ما نیاز داریم که نسبت موفقیت یا (success ratio or probability ratio) را که در بخش قبل توضیح داده شد و نیز نسبت sharp ratio را بدانیم.

نسبت sharp ratio رابطه بین مقدار پول (مثلا مقدار دلاری) بدست آمده در معاملات سودده با مقدار پول از دست رفته در معاملات زیان ده را بیان می کند. برای بیان این نسبت به صورت درصد ، میانگین مقدار پول به دست آمده در پوزیشن های سودده را تقسیم بر مجموع میانگین پول به دست آمده با میانگین پول از دست رفته کرده و ضربدر ۱۰۰ می کنیم.

برای توضیح این مطلب ، فرض کنید که نسبت $success\ ratio = 2:1$ هست یعنی احتمال موفقیت ۶۶ درصد است. به علاوه این که نسبت $sharp\ ratio = 1.5:1$ هست. این بدان معناست که ما در پوزیشن های سودده به ازای ۴۰ دلار ریسک ۶۰ دلار سود کسب می کنیم. نسبت $success\ ratio$ به ما می گوید که ما از هر سه معامله انجام شده دو معامله را با سود می بندیم و نسبت $sharp\ ratio$ به ما می گوید که از هر دو معامله برنده ما $2 * 60 = 120$ دلار به دست می آوریم. و از هر سه پوزیشن تنها یک پوزیشن با ضرر بسته می شود و بنابراین تنها ۴۰ دلار به حساب ضرر وارد می کند. و در تمام این سه پوزیشن گرفته شده ما تنها ۴۰ دلار ریسک می کنیم و در نهایت سود خالص معادل ۸۰ دلار به دست آورده ایم. بنابراین اگر ما مقدار سود خالص را بر مقداری که ریسک می کنیم تقسیم کنیم به نسبت ریسک به ریوارد ۲:۱ خواهیم رسید.

نکته ای که باید به آن توجه داشته باشیم این است که ما تنها زمانی معامله می کنیم که شرایط معامله بر اساس ستاپ ما وجود داشته باشد و این ستاپ باید به خوبی تست شده باشد تا بتوان میزان موفقیت آن را به خوبی تعریف کرد.

من از استراتژی معاملاتی ام یک *forward test* بر روی حساب دمو گرفته ام و نیز با مقدار اندکی سرمایه آن را بر روی حساب واقعی نیز تست کرده ام. نتیجه این ها همه به من کمک کرده تا بتوانم (یک $success\ ratio = 2:1$ یا حتی بهتر و یک $sharp\ ratio = 1.5:1$ و یا حتی بهتر را تعریف کنم. بنابراین نسبت ریسک به ریوارد من ۲:۱ و یا بهتر خواهد بود.)

۹-۱۰ ریسک شما در هر معامله چقدر است؟

حقیقت این است که توانایی برای تشخیص جهت حرکت بازار در ۹۹ درصد مواقع بی فایده است اگر شما ۱۰۰ درصد از سرمایه خود در هر ترید ریسک کنید. شما می توانید پیش بینی کنید اما در نهایت شما همه چیز را از دست خواهید داد. بسیاری از تریدرها بیشتر از ۱ درصد از کل سرمایه خود را در هر ترید ریسک نمی کنند مگر اینکه اندازه حساب بسیار کوچک باشد- که در اینصورت درصد این ریسک به ۳ درصد افزایش می یابد.

برای هر پوزیشنی که وارد می شوم من بیشتر از.... (۲ درصد کل سرمایه ام را ریسک نمی کنم. برای هر معامله یک حد ضرر ایده آل را تعریف می کنم و تعداد سهام و یا قرارداد را به گونه ای تغییر می دهم که مطمئن شوم ریسک معامله من بیشتر از ۲ درصد نمی شود.)

۱۰-۱۰ حد ضرر خود را در کجا قرار می دهید؟

هر معامله ای را که انجام می دهید باید حد ضرر داشته باشد. مگر اینکه شما یک تریدر حرفه ای باشید. با اینحال اطمینان حاصل کنید که یک حد ضرر مشخص و عینی در بازار را معین کرده اید نه یک حد ضرر ذهنی. این باعث می شود که مطمئن شوید که ضررها کاهش می یابد. همچنین اگر امکان دارد اجازه دهید که این حد ضرر براساس موقعیت بازار تعریف شود نه براساس یک درصد مشخص مثلا ۲ درصد از کل حساب؛ به عنوان مثال اگر شما پولبک ها را معامله می کنید و استراتژی شما به شما می گوید که حد ضرر خود را دقیقا در زیر سوینگ پایینی پولبک قرار دهید بنابراین این دقیقا همان جایی است که حد ضرر شما باید باشد. سپس تعداد سهام را به گونه ای تغییر دهید که ریسک آن معامله شما بین مقداری باشد که در قسمت قبلی آن را تعریف کرده اید.

برای مواقعی که معامله در خلاف جهت پوزیشن من حرکت کرد ، در هر معامله ای که به آن وارد می شوم در ابتدا تصمیم می گیرم که حد ضرر خود را در کجا قرار دهم و موقعیت این حد ضرر براساس (نوع معامله من انتخاب می شود؛ یعنی یک حد ضرر تنگ برای معاملات براساس استراتژی اسکالپ و یک حد ضرر باز برای معاملات براساس استراتژی swing trade انتخاب می شود)

۱۱-۱۰ چه زمان دست از ترید کردن می کشید؟

دانستن اینکه چه زمان دست از ترید کردن می کشید هم به لحاظ نظم و انضباط و هم به لحاظ مدیریت ریسک خوب است. علاوه بر آن این موضوع به شما کمک می کند که در روزهای ضررده از دنبال کردن ضررها دست بردارید و در روزهای سودده از طمع کردن شما جلوگیری می کند. هر روز معاملاتی شما باید با یکی از سه دلیل زیر پایان بگیرد:

۱ - در روزهای سودده شما قانون ساده ای دارید با رسیدن به هدف روزانه خود باید دست از معامله کردن بکشید.

- ۲ - در روزهای ضررده با رسیدن به حد ضرر روزانه باید دست از معامله کردن بکشید
- ۳- در برخی روزها نیز هیچ موقعیت معاملاتی وجود ندارد بنابراین در این روزها اصلا ترید نکنید
- ۱- به محض رسیدن به هدف روزانه ام معامله کردن را متوقف می‌کنم..... (بعد از اولین معامله ضررده)
- ۲- قبل از رسیدن به هدف روزانه ام معامله کردن را متوقف می‌کنم..... (بعد از دو معامله ضررده).
برای اینکه مطمئن شوم که ضررهایم در حداقل ممکن باقی خواهند ماند من..... (حداکثر حدضرر روزانه ای معادل ۳ درصد کل حسابم را در نظر می‌گیرم)
- ۳- من اصلا معامله نمی‌کنم در روزهایی که..... (هیچ ستاپ یا تریگر ورودی براساس برنامه معاملاتی ام نمی‌یابم)

مدیریت سرمایه کلی

۱۰-۱۲ سودها و ضررهای (Drawdown) بزرگ- در این شرایط چه می‌کنید؟

سرمایه شما برای معامله باید پولی باشد که شما تحمل از دست دادن آن را داشته باشید و این پول برای تامین مخارج روزانه شما کنار گذاشته نشده باشد. اگر شما مقدار زیادی از این پول را از دست دادید این مسئله نباید بر روی شرایط عادی زندگی شما تاثیری بگذارد. در برنامه خود به وضوح شرایطی را تشریح کنید که در صورت یک ضرر بزرگ چطور حساب خود را شارژ می‌کنید و در صورت یک سود بزرگ چطور سود را از حساب خود برداشت می‌کنید.

در صورت از دست دادن مبلغ زیادی از سرمایه..... (حساب را تنها از پولی شارژ می‌کنم که مربوط به پول های مازاد من باشد و توانایی از دست دادن آن را داشته باشم. من دوباره شروع به معامله نمی‌کنم تا زمانی که علت این ضرر بزرگ را دریابم و استراتژی خودم را دوباره تست کنم تا مطمئن شوم که استراتژی توانایی کسب اهداف مالی من را دارد.)

زمانی که حساب معاملاتی من از مقدار پولی که برای معامله براساس استراتژی خودم نظر گرفته بودم فراتر رفت..... (مازاد آن را برداشت می‌کنم و به مصرف کار... اختصاص می‌دهم)

۱۰-۱۳ از چه روش های مدیریت سرمایه ای استفاده می‌کنید؟

اگر شما با یک حساب کوچک مثلا ۵۰۰ پوند و یا کمتر شروع کرده اید - اهداف شما چیست؟ اگر به عنوان مثال می‌خواهید که یک معامله گر pattern day trader باشید شما باید تا حدود ۳۵۰ درصد رشد کند تا بتواند به حداقل مبلغ ۲۵ هزار دلار برای باز کردن حساب P.D.T برسد. زمانی که حساب شما رشد می‌کند آیا شما ریسک هر معامله را افزایش می‌دهید و یا تنوع استراتژی های معاملاتی خود را افزایش می‌دهید و یا از روش های کاملا متفاوتی استفاده خواهید کرد.

همچنان که حساب معاملاتی من رشد می کند من (من اندازه معاملاتم را تا X تعداد سهام و یا قرارداد افزایش می دهم البته تا جایی که در محدوده استراتژی مدیریت ریسک من قرار داشته باشد.)

مدیریت سرمایه خاص

۱۰-۱۴ آیا پوزیشن های خود را در سود قفل می کنید؟

استفاده از trailing stop برای قفل کردن سودها در زمانی که معامله در جهت پوزیشن شما حرکت می کند تا رسیدن نقطه سر به سر دو فایده اصلی دارد. ۱- در بدترین حالت معامله شما سر به سر بسته خواهد شد و بدون هیچ ضرری ۲- در بهترین حالت این کار به سودهای شما اجازه حرکت می دهد که بتوانید مقدار قابل توجهی از سود حرکت مورد نظر را برداشت کنید.

من از trailing stop استفاده می کنم تا پوزیشن خودم را (X پیپ به زیر پایین ترین قله در روند صعودی و X پیپ بالاتر از بالاترین کف در روند نزولی قرار دهم.)

۱۰-۱۵ درباره اندازه پوزیشن خود چطور تصمیم می گیرید؟

اندازه پوزیشن شما هرگز نباید از پارامترهای تعریف شده در قوانین مدیریت ریسک شما فراتر رود. با اینحال گزینه های زیادی در دسترس هستند. برخی از استراتژی ها شاید احتمال پیروزی بالایی داشته باشند (به عنوان مثال استراتژی های دنباله روی روند) به شما اجازه می دهند پوزیشن های با حجم بالاتری در زمان ورود بگیرید. برخی استراتژی ها احتمال پیروزی کمتری دارند (به عنوان مثال استراتژی هایی که بازگشتها را معامله می کنند) و معیارهای مدیریت ریسک شما حجم معاملاتی محافظه کارانه تری را در نقطه ورود به شما دیکته می کند. با اینحال زمانی که معامله انجام شد و روند جدید شکل گرفت اضافه کردن به حجم معامله در قسمت هایی که سیگنال ادامه روند صادر می شود می تواند مزایایی داشته باشد. به صورت بالقوه این موضوع اجازه ی انباشته شدن معامله ای با حجم بالا را می دهد در حالیکه در تمام مدت نگهداری پوزیشن ریسک کمی متوجه آن است.

من یک اسکالپر هستم بنابراین این روش چندان به درد من نمی خورد.

من یک سوینگ تریدر هستم و من معامله خود را بر اساس (اضافه کردن x تعداد سهم در الگوی ادامه دهنده ABC بعدی برپا خواهم کرد. بعد از آن بدین صورت به حجم معاملاتم اضافه خواهم کرد....)

۱۱ استراتژی خروج

۱۱-۱ انجام درست استراتژی های خروج به مراتب سخت تر از استراتژی های ورود هست. و البته اهمیتشان به مراتب بیشتر از استراتژی های ورود است چراکه به وضوح کنترل سود و ضرر ما را در دست دارند. اگر شما بیشتر از یک استراتژی معاملاتی دارید باید به سوالات این بخش برای هر یک

استراتژی های مورد استفاده تان پاسخ دهید چراکه سیگنال هایی که منجر به خروج شما از معامله می شود می توانند متنوع باشند. مسلماً برای معامله گران محتاط بهترین استراتژی خروج آن است که دینامیک باشد و توسط بازار کنترل شود، برخلاف استراتژی ای که مکانیکی و غیر منعطف است و بدون توجه به وضعیت بازار به معامله تمایل می شود. تفاوت بین این دو را با مثال بهتر می توان درک کرد. تصور کنید که یک استراتژی مکانیکی دارید که براساس ریسک به ریوارد ۳:۱ هست. بنابراین اگر شما ۳۰ دلار ریسک کنید به محض شناسایی ۳۰ دلار ضرر و یا ۹۰ دلار سود از پوزیشن خارج می شوید هر کدام که زودتر محقق شود. به همین سادگی. در این شرایط زمانی حساب شما رشد خواهد کرد (البته نه زیاد) که نسبت success ratio معاملات شما برابر با ۲۶ درصد یا بیشتر باشد. اما در استراتژی های خروج دینامیک این شانس وجود دارد که در شرایط معاملات ضررده، قبل از فعال شدن حد ضرر پوزیشن در سود خوبی رفته باشد. به علاوه پوزیشن های سودده نیز سودهایی به مراتب بیشتر از آن ۹۰ دلاری که با بسته شدن پوزیشن براساس استراتژی خروج مکانیکی بدست می آمد به شما خواهند داد. با استفاده از استراتژی خروج دینامیک به معامله باز خود اجازه حرکت بیشتری در جهت بازار خواهید داد. یک استراتژی خروج دینامیک که توسط وضعیت بازار کنترل می شود به شما امکان می دهد که حتی از معاملات بازنده ی احتمالی نیز سود بدست آورید و با اجازه دادن به ادامه حرکت در معاملات برنده امکان شناسایی سودهای به مراتب بیشتری را خواهید داشت.

۲-۱۱ معاملات بازنده- آیا شما قبل از رسیدن به حد ضرر پوزیشن خود را می بندید؟

در برخی استراتژی ها، معاملات همیشه با برخورد به حد ضرر بسته می شوند نه قبل از آن. فایده ی این روش در این است که به پوزیشن اجازه نوسان بیشتر را می دهد که شاید در نهایت پوزیشن باز شده به یک معامله برنده تبدیل شود. در مقابل جنبه منفی ماجرا این است که پوزیشن های بازنده شما با حداکثر ضرری که توسط استراتژی شما تعیین شده بسته می شود.

اگر بازار در خلاف جهت پوزیشن من حرکت کرد استراتژی خروج من اجازه (بستن معامله را می دهد تنها در شرایطی که وضعیتی که در قسمت بعدی توضیح داده شده است پیش بیاید).

۳-۱۱ در معاملات بازنده، دیدن چه سیگنال هایی باعث خروج زودتر از موعد شما از معامله می شود؟

اگر شما پذیرفته اید که پوزیشن خود را قبل از برخورد قیمت به حد ضررتان ببندید چه سیگنال های دقیقی به شما اجازه این خروج زودتر از موعد را می دهند؟

اگر بازار در خلاف جهت پوزیشن من حرکت کرد من قبل از برخورد قیمت به حد ضررم از معامله خارج می شوم..... (اگر قیمت به اندازه X پیپ در جهت مورد نظر من حرکت نکرد، با بسته شدن کندل بعدی بعد از کندل ورودیه معامله از پوزیشن خارج می شوم).

۴-۱۱ معاملات برنده - با دیدن چه سیگنال هایی به طور کامل از پوزیشن خارج می شوید؟

زمان هایی وجود دارد که بهتر است از معامله خارج شوید - آن هم به سرعت. برای یک چنین موقعیت هایی آماده باشید و بدانید که برای چنین مواقعی دنبال چه نوع سیگنالی باید باشید.

من تمام پوزیشنم را به طور کامل و به سرعت خواهم بست.... (اگر قیمت به بالای میانگین متحرک.... برود)

۵-۱۱ معاملات برنده - با دیدن چه سیگنال هایی تنها نیمی از حجم معامله خود را می بندید؟

یک روش محبوب این است که نیمی از حجم پوزیشن خود را با رسیدن به اولین هدف و یا اولین نشانه از ضعف ببندید و اجازه دهید که نیمه دیگر به حرکت ادامه دهد.

من نیمی از حجم پوزیشنم را خواهم بست.... (اگر بالای x درصد از حجم معاملات نسبت به کندل قبلی کمتر یا بیشتر شود)

۶-۱۱ معاملات برنده- با دیدن چه سیگنال هایی مابقی حجم معامله خود را می بندید؟

حتی اگر استراتژی خروج شما بسیار خوب برنامه ریزی شده باشد، هنوز موفقیت کل استراتژی شما منوط به چگونگی خروج نیمه دوم حجم از یک معامله سودده هست.

من نیمه دوم حجم معاملاتی ام را می بندم.... (چراکه در انتهای روز، براساس این تجربه و تحقیق دریافتم که در روزهای رونددار، ابزارهایی که من معامله می کنم به اندازه x درصد از قیمت بالایی روز H.O.D (high of the day) بسته می شوند.)

۱۲ استراتژی های معاملاتی ، ستاپ ها و ورودها

استراتژی ها متناسب با شرایط بازار متنوع هستند، اینکه چه زمانی از روز مورد استفاده قرار می گیرند و اینکه در چه تایم فریمی معامله می شود. مسلماً تمام استراتژی ها در یکی از این سه گروه قرار می گیرند: شکسته ها ، اصلاحی ها و بازگشتی ها.

۲-۱۲ با چه استراتژی هایی شما معامله می کنید؟

بسیاری از تریدرهای حرفه ای پیشنهاد می کنند که حداقل دو استراتژی معاملاتی متفاوت داشته باشید یکی برای بازارهای رونددار و دیگری برای بازارهای بدون روند. به علاوه آنها پیشنهاد می کنند که ابتدا یکی



از این استراتژی ها را پیدا کرده و با آن کار کنید (یعنی یک استراتژی که تست شده و سوددهد است) سپس به دنبال استراتژی دیگر بروید.

استراتژی معاملاتی اولیه من برای بازار بدون روند طراحی شده است. این استراتژی (استراتژی اصلاحی هاست و مربوط به معامله گپ های روبه بالا و یا پایین در زمان بازگشایی بازار سهام می باشد. فرض بر این است که بازار به اخبار عکس العمل شدید نشان می دهد چه خوب و چه بد و باعث می شود که قیمت بیش از حد جابه جا شود. متعاقبا قیمت به یک سطح متعادل تر باز می گردد و گپ ها اصولا پر می شوند.)

استراتژی دوم من برای بازار رونددار است. این استراتژی (استراتژی شکست هاست، که هدفش سوار شدن در جهت روند قدرتمند است.)

۳-۱۲ ستاپ های شما چه هستند؟

ستاپ، یک سری از ویژگی هایی است که شما را قادر می سازد که بالاترین احتمال معامله را تشخیص دهید که این کار را زودتر از اینکه تریگر ورود شما بخورد انجام می شود. سعی کنید که اجزای ستاپ خود را ساده نگه دارید برای اینکه بتوانید در لحظه به سرعت آنها را شناسایی کنید و بتوانید پتانسیل های آنها را به سرعت ارزیابی کنید. بنابراین ضروری است که ستاپ شما به وضوح تعریف شده باشد و عمیقا قبل از استفاده در معامله با پول واقعی تست شده باشند تا از احتمال موفقیت آن ها مطمئن شده باشید. شکست در تعریف و تست ستاپ ها به طور گسترده ای برنامه معاملاتی شما را بی اعتبار می کند و تمام کارهایی را که تا به الان انجام داده اید را بلااستفاده می سازد. این یکی از ویژگی هایی است که باعث تفاوت بین یک معامله گر حرفه ای و یک قمار باز می شود.

ستاپ استراتژی اول من شامل موارد زیر است..... (۱. گپ زمان بازگشایی که بین ۱ تا ۳ درصد است. ۲. میانگین متحرک ۵۰ بایستی به وضوح در جهت معامله باشد. ۳. گپ ایجاد شده باید در محدوده حمایت/مقاومت باشد نه اینکه در این محدوده رخنه کرده باشد. ۴. شواهدی مبنی بر حجم قوی در زمان پیش گشایش وجود داشته باشد.)

ستاپ برای استراتژی دوم من شامل بخش های زیر است..... (۱. قیمت بایستی به وضوح یک روند صعودی و یا نزولی منطبق بر تعریف من از روند را داشته باشد. ۲. قیمت بایستی قیمت بالا/پایین روز قبل خود را شکسته باشد تا بتواند یک قیمت بالا/پایین جدید را ثبت کند. ۳. قیمت به قیمت بالا/پایین روز قبل خود پولبک بزنند نه اینکه به آن نفوذ کند.)

۴-۱۲ چطور می توانید ستاپ های خود را پیدا کنید؟

اگر معاملات شما به یک یا دو ابزار محدود می شود، کار راحت است. اما اگر شما تمام سهام لیست شده در NYSE یا Nasdaq را معامله می کنید؛ احتمالا به اسکن سهام این لیست نیاز دارید تا ستاپ های مورد نظر خود را در بین آنها بیابید.

من ستاپ هایی را که برای معامله نیاز دارم....(با استفاده از نرم افزار اسکن سهام در سایت پیدا می کنم . معیار برای هر اسکن براساس ویژگی های هر یک از ستاپ های استراتژی معاملاتی ام تعریف شده است.)

۵-۱۲ چه سیگنال هایی تریگر شما برای ورود خواهد بود؟

عبارات شفاف ، دقیق و موجز ویژگی های یک برنامه معاملاتی خوب هستند. در جواب به این سوال ، ضرورت دارد که هیچ قسمتی به صورت نامفهوم وجود نداشته باشد. به بیانی دیگر ، اگر صد معامله گر جواب های شما به این سوال را بخوانند آیا همه آنها سعی خواهند کرد پوزیشن شما را و با قیمت ورود شما معامله کنند؟ این هدف مشکلی برای دست یافتن است اما با این وجود برای رسیدن به آن تلاش کنید.

تریگر ورود من براساس استراتژی اولی....

تریگر ورود من براساس استراتژی دوم.....

۳-۱۳ بعد از بسته شدن بازار....

۱-۱۳ زمانی که شما از معامله برای آن روز دست کشیدید، ممکن است بخواهید جشن گرفته و یا در اندوه فرو روید. برنامه معاملاتی ممکن است برای این کارها به شما اجازه بدهد و یا اجازه ندهد. در هر صورت برنامه باید شامل ارزیابی هر دوی معاملات برنده و بازنده باشد. ضروری است که بدانید چه کاری را درست انجام داده اید و مهم تر از همه در کجا اشتباه کردید.

۲-۱۳ آیا معاملات امروز خود را ثبت کرده اید؟

ثبت تمام معاملات یک ضرورت کاری است که تمامی معامله گران حرفه ای به صورت روزمره و کامل انجام می دهند. جزئیات نوشتاری این گزارش شامل: نقاط ورود، خروج، حد ضرر، حد سود، ترازهای مقاومت و حمایت، قیمت باز شدن/ بسته شدن ، و بالاترین /پایین ترین قیمت روز ، مدت زمان باز بودن پوزیشن، و نکات کلیدی که از این معامله فرا گرفته اید، می شود.

بعد از بسته شدن بازار....(۱ . هر معامله را بررسی می کنم و جزئیات بالا را یادداشت می کنم.)

۲ . بر روی نمودار توضیحاتی بنویسم برای امکان رجوع در آینده و همان را روی سی دی نیز ذخیره کنم.)

۳-۱۳ آیا معاملات را طبق برنامه معاملاتی انجام داده اید؟

اگر به طور معمول معاملاتتان را طبق برنامه انجام نمی دهید، یا شما مشکلی جدی با انضباط شخصی دارید و یا برنامه شما در جایی اشکال دارد. در هر صورت شما یک مشکل جدی و بزرگ دارید و باید به سرعت به آن رسیدگی کنید.

در زمان ثبت گزارش معاملاتم ، چک می کنم که.....(تمامی معاملات بر طبق برنامه معاملاتی انجام شده باشند. اگر اینطور نبود

بررسی می کنم که آیا اشکال مربوط به خود برنامه بوده و یا مشکلی در انضباط خود من بوده است و اقدام لازم را انجام می دهم.)

۴-۱۳ آیا گزارش معاملات خود را کامل کرده اید؟

معامله کردن و احساسات مانند روغن و آب هستند. یا حداقل باید اینطور باشند. برنامه معاملاتی شما برای این طراحی شده که این اطمینان را بدهد که شما بدون احساسات معامله می کنید. اگر شما با این مسئله مشکل دارید پس معامله با یک اکسپرت را در نظر بگیرید. گزارش معاملاتی شما جایی است که می توانید خود را تخلیه کرده و احساسات خود را بیان کنید.

من به طور مرتب گزارش معاملات خود را به روز می کنم.....(با توضیح تفکرات و احساساتم درباره هر معامله و با نوشتن نتایجی که در آن روز به آنها رسیده ام.)

۱۴ انضباط

۱-۱۴ داشتن یک برنامه معاملاتی جامع با معیارهای دقیق ورود و خروج و یک دستورالعمل فوق العاده مدیریت ریسک و سرمایه ، این همه بدون داشتن انضباط در اجرا هیچ خواهند بود. این بخش به منظور اطمینان از پایبندی به تعهدهایی است که در نه قسمت قبلی به خود داده اید. پایبندی به برنامه در دوره ای که سود می کنید کار ساده است. اما امتحان واقعی زمانی است که معاملات شما چندان خوب پیش نمی روند.

۲-۱۴ Back Test یا Forward Test ؟

قبل از شروع معامله با پول واقعی، مهم است که استراتژی خود را تست کرده باشید. اگر شما معامله گری هستید که با اکسپرت کار می کنید انجام این تست با استفاده از برنامه هایی مثل TradeStation و حتی MS Excel امکان پذیر است. اگر شما معامله گر محتاطی هستید به صورت دستی از استراتژی back test بگیرید و سپس با حساب مجازی نیز forward test بگیرید. اگرچه معاملات با حساب مجازی نمی تواند بازتاب چگونگی معامله شما با حساب واقعی باشد اما می تواند نشان دهنده این باشد که استراتژی پایه ای شما ضررده هست و یا برعکس یک معدن طلاي بالقوه است.

قبل از شروع معامله با حساب و پول واقعی من (یک *back test* و یا *forward test* از استراتژی های خودم می گیرم تا مطمئن شوم که آنها قابل ترید هستند و اهداف سودی که مدنظرم هستند را برآورده می کنند یا نه ؛ البته با در نظر گرفتن پارامترهای مدیریت سرمایه و ریسک).

۳-۱۴ قول های شما به خودتان چه هستند؟

در اینجا قول هایی باید طراحی شوند تا باعث ایجاد انضباط شخصی شوند. چه تحریم هایی را در صورت شکستن یکی از قوانین برنامه معاملاتی تان برای خود در نظر می گیرید؟ و بدتر از آن در صورت شکستن دو قانون چه انجام می دهید؟

اگر من یکی از قوانین برنامه معاملاتی ام را زیر پا بگذارم..... (برای تمام روز ترید نخواهم کرد و بر روی دلایل این مسئله که چرا قوانینم را رعایت نکرده ام تمرکز خواهم کرد).

اگر دو تا از قوانین برنامه معاملاتی ام را شکستم..... (برای دو روز دست از معامله خواهم کشید و بر روی دلایل این مسئله که چرا قوانینم را رعایت نکرده ام تمرکز خواهم کرد).

اگر دو تا از قوانین برنامه معاملاتی ام را شکستم..... (به سرعت معامله را متوقف خواهم کرد تا دلیل انضباط ضعیف خود را بررسی کنم و اگر لازم بود برنامه معاملاتی را اصلاح کنم).

۴-۱۴ بعد از معاملات سودده چه سوالاتی از خود می پرسید؟

بعد از انجام معامله سودده، به برخی از سوالات، قبل از انجام معامله بعدی باید پاسخ دهید. آیا همه کارها را درست انجام دادید؟ آیا معامله درست برنامه ریزی و اجرا شده بود؟ اگرچه معامله سودده بود، اما آیا می توانستید با پایبندی به استراتژی خروج خود سود بیشتری به دست آورید؟ معامله بعدی شما می تواند خراب شود: آیا شما به اندازه کافی آرامش برای ادامه دادن معاملات را دارید و یا نیاز به استراحت دارید؟

بعد از یک معامله برنده..... (۱. دچار اعتماد به نفس بیش از اندازه نمی شوم و مطمئن می شوم که نگرش من پایدار باقی می ماند. ۲. بررسی می کنم که هر آنچه را که در توانم بوده انجام داده ام. ۳. به خودم یادآوری می کنم که اجرای معامله مطابق با برنامه معاملاتی ام به مراتب مهم تر از نتیجه معامله است).

۵-۱۴ بعد از یک معامله ضررده چه سوالاتی را از خود می پرسید؟

مراحل بالا را نیز بعد از یک معامله ضررده نیز انجام دهید. اینکه به یک معامله ضررده به اندازه یک معامله موفق توجه کنید هم قابل قبول و هم مطلوب است (و این یک اگر بزرگ است) شما به برنامه خود پایبند باشید. خودتان می دانید که در بین معاملات برخی ضررده خواهند بود؛ و تمام معامله گران همین طورند. هیچ دلیلی وجود ندارد که اعتماد به نفس خود را از دست دهید تا زمانی که ضررها را

مدیریت کنید و آنها را در مقدار کم نگاه دارید. آیا شما آرامش لازم برای ادامه معاملات را دارید و یا ناخودآگاه به دنبال انتقام هستید؟

بعد از یک معامله ضررده... (۱. بررسی می‌کنم که چه درسی را از این معامله می‌توانم بیاموزم. ۲. و چک می‌کنم که آیا تمام جوانب معامله را طبق برنامه معاملاتی ام انجام داده‌ام. ۳. و اینکه آیا آرامش ذهنی لازم برای انجام معاملات بعدی با نگرشی غیر احساسی و حرفه‌ای را دارم؟)

۵-۱۴ چه اقداماتی برای یادگیری بیشتر درباره معامله کردن انجام می‌دهید؟

تجربه عملی البته که ضروری است. با اینحال عاقلانه این است که آن را با یادگیری و مطالعه کامل کنید. در اینجا نکته این است که برنامه یک دوره مطالعاتی را برای خود داشته باشید تا مطمئن شوید که زمان باارزش شما صرف افزایش دانش شما در سریع‌ترین زمان ممکن می‌شود. معامله کردن از آن دسته از کارهاست که ناگزیر از مطالعه کردن و گوش دادن به اطلاعات در دسترس خواهید بود. اما مسئله حیاتی این است که زمان حیاتی خود را صرف تمرکز بر موضوعات درست بنمایید.

X ساعت از زمان را در هفته به معامله کردن اختصاص می‌دهم و... (Y ساعت را به مطالعه کردن صرف خواهم کرد. و از این مقدار A ساعت آن را به خواندن کتاب و B ساعت آن را به مطالعه سایت‌ها و C ساعت آن را به... اختصاص خواهم داد.)

۵-۱۵ قوانین طلایی ترید

۱-۱۵ ده قانون طلایی اول معاملاتی شما چه هستند؟

قوانین شما باید آنهایی باشند که برای شما معنی دار و مناسب شما باشند. در اینجا لیستی از قوانین آمده است که می‌توانید درباره آنها فکر کنید. برخی از قوانین شما ممکن است در اینجا آمده باشد و برخی نه. به عنوان مثال قانونی که در اینجا حذف شده ولی در بسیاری از لیست‌های دیگر ممکن است باشد این است که: در صورت وجود روند معامله شود، اگر روندی نیست معامله‌ای هم در کار نیست. این قانون فوق‌العاده‌ای است، مگر اینکه استراتژی اصلی شما این باشد که به دنبال ضعف در روندهای زیر روزهانه باشید و یا اصلاحی‌های بلند مدت تر را معامله کنید.

قانون شماره ۱- از سرمایه خود محافظت کنید

معامله‌گران کم تجربه بر روی میزان پولی که می‌توانند به دست آورند تمرکز می‌کنند. معامله‌گران حرفه‌ای دقیقاً برعکس عمل می‌کنند؛ یعنی بر روی مقدار پولی که می‌توانند از دست دهند تمرکز می‌کنند و اینکه چطور می‌توانند ضررها را در حداقل ممکن نگاه دارند. این گفته حرفه‌ای‌ها را دنبال کنید: سرمایه خود را محافظت کنید."

قانون شماره ۲ - همیشه حد ضرر را در معاملات قرار دهید. همیشه.

یک راه برای اینکه بتوانید قانون شماره ۱ را رعایت کنید این است که از حد ضرر در معاملات استفاده کنید. در صورت امکان قبل از باز کردن یک معامله جدید حد ضرر را بگذارید. هرگز بر روی حد ضررهای ذهنی اتکا نکنید. این تنها راه حفظ گونه کمیابی از معامله گران هست: معامله گرانی که بسیار باتجربه و پیوسته سودده هستند. حد ضرر در قلب تمامی استراتژی های مدیریت ریسک قرار دارد و برای اطمینان از اینکه ضررهای شما در حداقل ممکن باقی می ماند قطعاً حیاتی است. پس بدون هیچ بحثی: همیشه حد ضرر را در معاملات قرار دهید.

قانون شماره ۳ - ضررها را کم کنید. به سودها اجازه رشد دهید

کم کردن ضررها تنها با کمک استفاده از حد ضرر امکان پذیر است. به علاوه مرتب از خود این سوال را بپرسید که: آیا من اصلاً باید وارد این معامله می شدم و اینکه آیا می خواهم معامله خود را باز نگه دارم؟ اگر جواب شما منفی است پس به سرعت از معامله خارج شوید. شما مجبور نیستید که با فعال شدن حد ضرر از معامله خارج شوید. اجازه دادن به رشد سود بستگی به مدیریت ریسک و یک استراتژی خروج فوق العاده دارد. بر روی این بخش های برنامه خود خوب کار کنید تا بتوانید ضررها را کم و سودها را افزایش دهید.

قانون شماره ۴ - آنچه را که می بینید معامله کنید - نه آنچه را که فکر می کنید

نفس و معامله کردن با هم مخلوط نمی شوند. صدایی که در درون سر شما به شما می گوید بازار چه حرکتی را انجام خواهد داد باید در زمان معامله کردن ساکت شود. زمانی که به این صدا گوش می دهید نمی توانید به آنچه که بازار برای شما آشکار می کند توجه کنید. نمی توانید به نمودارها و به اندیکاتورها (اگر از آنها استفاده می کنید) و به حرکات قیمت توجه کنید. به این اطلاعات نگاه کنید و آنچه را که می بینید معامله کنید و نه آنچه را که فکر می کنید.

قانون شماره ۵ - هرگز در صدد انتقام از بازار در زمان ضرر نباشید هرگز

بعد از یک معامله ضررده ضروری است که احساسات خود را آرام نگه دارید. البته این می تواند کار دشوار باشد به خصوص اگر ضرر در نتیجه یک اشتباه احمقانه بوده باشد. زمانی که شما دوباره وارد بازار می شوید شما احتمالاً برای انتقام معامله خواهید کرد. اگر شما ترید انتقام جویانه انجام دهید و مصمم باشید که ضرر را پوشش دهید، نتایج احتمالاً فاجعه بار خواهد بود. تقریباً این کار باعث ایجاد ضررهای بیشتر و درگیر شدن احساسات بیشتر و ... خواهد شد. پس هیچ وقت معامله انتقام جویانه انجام ندهید هیچ وقت.

قانون شماره ۶ - هیچگاه میانگین قیمت خرید را کم نکنید هیچ وقت

این قانون به دنبال قانون شماره ۵ می آید. انجام این دو "گناه" باعث می شود که حساب شما در معرض ریسک بالای از بین رفتن قرار گیرد. مولف این متن تصمیم گرفت این تئوری را آزمایش کند؛ ۷۰ درصد از حساب تنها در یک معامله که ۲۴ ساعت طول کشید از دست رفت. میانگین کم کردن یک تاکتیکی است که توسط سرمایه گذاران بلند مدتی به کار برده می شود و هرگز نباید توسط معامله گران امتحان شود. اگر بازار بر خلاف جهت معامله شما حرکت کرد به سرعت از بازار خارج شوید. هرگز میانگین کم نکنید.

قانون شماره ۷- گزارش معاملات خود را کامل ثبت کنید

به دلایل استراتژیک، ضروری است که گزارش تمامی معاملات خود را ثبت کنید. علاوه بر ثبت سود ها و ضررها بایستی دلایل اینکه چرا این کار را انجام دادید و اینکه چه کاری انجام دادید و چه زمانی این کار را انجام دادید را نیز ثبت کنید. در عین حال بسیاری از معامله گران گزارشی از وضعیت روحی و روانی خود در هر ترید را نیز ثبت می کنند. این گزارش ها مانند یک GPS شخصی عمل می کنند و این امکان را برای شما فراهم می کند که بفهمید چه میزان به برنامه خود پایبند بوده اید.

قانون شماره ۸ - حفظ انضباط

ثبت دقیق گزارش عملکرد این امکان را نیز برای شما فراهم می کند که در یک نگاه متوجه شوید که در معاملات خود چقدر منضبط بوده اید. شکست در ارزیابی مسئله انضباط شخصی به طور قطع در عملکرد معاملاتی شما بازتاب خواهد داشت. اگر شما در انجام این کار به طور پیوسته کوتاهی کنید، دو گزینه خواهید داشت: ۱- معاملات را به دست کامپیوتر بسپارید و از اکسپرت استفاده کنید؛ هیچ شکی در رعایت انضباط در ثبت گزارشها توسط کامپیوتر وجود ندارد. ۲- معامله کردن را رها کنید- این کار برای شما نیست.

قانون شماره ۹ - استراتژی را ساده نگه دارید

بسیاری از معامله گران حرفه ای از استراتژی های بسیار ساده با حداقل اندیکاتور ممکن استفاده می کنند. تمرکز آنها بر روی حفظ انضباط شخصی و معامله کردن بر طبق برنامه است. شما نیز آن را برای خود آسان بگیرید و تا حد امکان همه چیز را در حد ساده نگه دارید.

قانون شماره ۱۰- برای معامله برنامه ریزی کنید - طبق برنامه معامله کنید

معامله کردن قمار کردن نیست؛ یک تجارت است. با این حال معامله گری که بدون یک برنامه معاملاتی کاملاً تست شده و با جزئیات دقیق وارد بازار می شود فرقی با یک قمارباز ندارد.

۲-۱۵ نتیجه گیری

اگر شما تا بدین جا را خواند اید و به سوالات پاسخ داده اید - به شما تبریک می گویم. شما اکنون در جمع قلیل معامله گرانی هستید که یک برنامه تست شده و با جزئیات دقیق دارد. موفقیت آتی شما به عنوان یک تریدر تضمین شده است، با کامل کردن این سوالات یک برنامه معاملاتی خاص خودتان را خواهید داشت.

موفق باشید و معاملات خوبی داشته باشید