

استراتژی خرید خورجینی (Straddle Trading)

نویسنده: مهدی طهماسب

ارتباط: @SimpleChart_admin

تاریخ نگارش: 95/4/3

مقالات اینجانب را در این کانال دنبال کنید: <https://telegram.me/SimpleChart>

این استراتژی در بازارهای رنج (Consolidation) بکار میرود. در اینگونه بازارها، معامله گران در یک حالت بلا تکلیفی و انتظار بسر می برند و معمولاً منتظر اعلام خبر مهمی می باشند. در واقع خبر مهمی در راه است که تاثیر چشمگیری بر حرکت قیمت خواهد گذاشت و می دانیم، عنقریب است که حرکت مهمی (یا به سمت بالا و یا به سمت پایین) انجام شود. **مشخصه مهم ناحیه رنج، کندلها با بدنه و سایه کوچک می باشند.**

لذا در اینگونه موارد از آنجائیکه نمی دانیم حرکت آتی قیمت به سمت بالا و یا پایین خواهد بود، از دستورات شرطی BuyStop و SellStop برای همراه شدن با حرکت قیمت استفاده می شود. بدینگونه که در بالاترین High ناحیه رنج یک BuyStop و در پایین ترین Low ناحیه رنج یک SellStop قرار میدهیم. اگر بنای قیمت به صعود باشد، دستور شرطی BuyStop فعال شده و با فعال شدن آن دستور شرطی دیگر (SellStop) را حذف می کنیم. و بر عکس اگر بنای قیمت به نزول باشد، دستور شرطی SellStop فعال شده و با فعال شدن آن دستور شرطی دیگر (BuyStop) را حذف می کنیم.



میزان فاصله اردرهای شرطی از حد اقل و حداکثر قیمت در داخل ناحیه رنج بستگی به تایم فریم و جفت ارز مورد معامله دارد. هر چه تایم فریم بالاتر باشد این میزان نیز باید بیشتر باشد. از نظر تئوریک، دستورات شرطی می بایست در جایی قرار گیرند که به احتمال زیاد با رسیدن قیمت به آن، ناحیه رنج شکسته شده و Breakout اتفاق افتاده باشد.

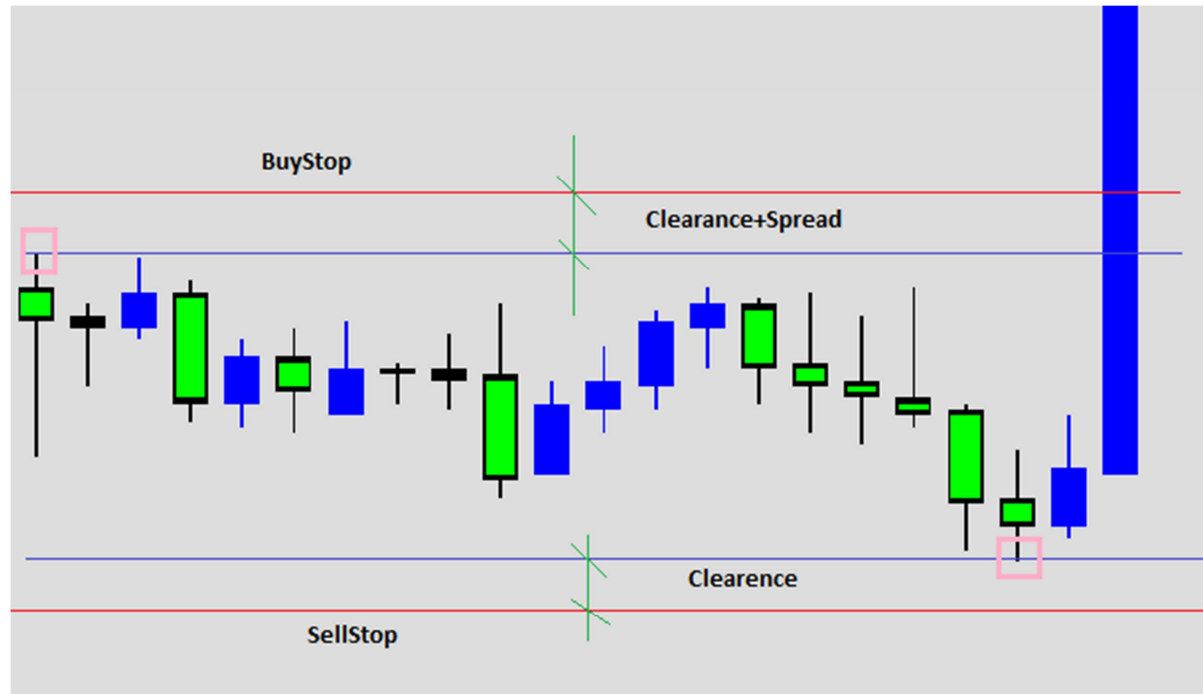
حد ضرر (Stop Loss)

طبق تعریف، حد ضرر باید در محلی قرار گیرد که با رسیدن قیمت به آن، تحلیل ما را Fail کند. بر این اساس اگر دستور BuyStop فعال شود، در صورت رسیدن قیمت به سطح SellStop نشاندهنده آنست که فرض ما مبنی بر بالا رفتن قیمت اشتباه بوده و لذا حد ضرر را در محل SellStop قرار می دهیم. و با استدلالی مشابه، برای دستور SellStop حد ضرر را در محل BuyStop قرار می دهیم. اگر ارتفاع ناحیه رنج خیلی زیاد بود (مخصوصاً در تایم فریمهای بالا)، میتوانیم 50٪ این ارتفاع را بعنوان حد ضرر در نظر بگیریم.

شکست های قلابی (Feak Breakout)

در بسیاری مواقع قیمت با رسیدن به دستورات شرطی آنها را فعال کرده اما بجای ادامه حرکت، مجدداً به داخل ناحیه رنج بر میگردد. در واقع شکستی که اتفاق افتاده بود، یک شکست Feak یا قلابی بوده است. شما اصلاً از این بابت نگران نباشید. حتی اگر با فعال کردن دستورات شرطی شما مجدداً به داخل ناحیه رنج برگردید، و استاپ شما را تاج شود، باکی نیست. فقط کافیست یکبار شکست واقعی اتفاق بیفتد که در اینصورت علاوه بر جبران تمام ضررهای قبلی، سود قابل توجهی را برای شما خواهد داشت.

محل قرار گرفتن دستورات شرطی



همانگونه که قبلاً هم گفته شد، میزان خلاصی (Clearance) به تایم فریم مورد ترید و جفت ارز مورد معامله بستگی دارد که بصورت تجربی می بایست آنرا بدست آورید ولی برای تایم فریم H4 حدوداً 20-15 پیپ در نظر گرفته میشود.

کاربرد مهم استراتژی خورجینی در ترید هنگام اخبار

یکی از کاربردهای مهم این استراتژی معامله هنگام اعلام اخبار میباشد. فرض کنید خبر مهمی در مورد دلار مانند nfp قرار است اعلام شود. پنج دقیقه قبل از اعلام خبر یکی از چارت های دلار را در تایم یک دقیقه باز کنید. (مثلا EURUSD) و دستورات شرط را به گونه ای قرار دهید که با قیمت جاری حدود 10 پیپ فاصله داشته باشد. در نتیجه استاپ هر کدام 20 پیپ خواهد شد. هنگام اعلام خبر و فعال شدن یکی از اردرها، بلافاصله اردر دیگر را حذف کنید. سپس مانند شکل زیر همراه با حرکت قیمت و تشکیل کندل های جدید استاپ خود تریل کنید.



در شکل مقابل با شروع تشکیل هر کندل جدید استاپ به زیر کندل قبلی یا فاصله مناسب از آن (Clearance) منتقل میشود تا اینکه در نهایت در SL7 استاپ زده میشود.

ترید بر روی جفت ارز، نه ارز:

اخبار و شاخصهای اقتصادی بر روی یک ارز اعلام میشود. اما ما در فارکس بر روی جفت ارز ترید میکنیم. بعنوان مثال خبر nfp برای دلار آمریکا اعلام میشود، اما اینکه چارت دلار نسبت به چه جفت ارزی برای ترید، باز شود مهم است. ممکن است بیشترین تاثیر بر روی EURUSD و یا USDJPY و یا ... اتفاق بیفتد. به عبارت دیگر انتخاب ارز دوم هم بسیار مهم است. که براساس نوع خبر و شرایط فاندمنتال بازار متفاوت خواهد بود

نکته مهم

ما پیشگو نیستیم و به هیچ وجه نمیدانیم قیمت، ناحیه رنج را به سمت بالا میشکند و یا به سمت پایین. بر این اساس دستورات شرطی را در بالا و پایین ناحیه رنج قرار میدهیم تا با شکستش شده این ناحیه از هر طرف، با قیمت همراه شویم. اما دو چیز را میدانیم و آن اینکه زمانیکه قیمت، در این ناحیه قرار دارد، یعنی بازار دچار بی تصمیمی شده و دیر یا زود از یک طرف شکسته خواهد شد. نکته دیگری که میدانیم آنست که هر چه مدت زمان بیشتری در این ناحیه قرار داشته باشیم، شکست این ناحیه سهمگین تر خواهد بود.

موفق و پر سود باشید