



2 in 1



با چه میزان سرمایه باید به کار معامله گری در بازار ارز پرداخت؟



https://telegram.me/TRIGGER_Ha



http://www.aparat.com/trigger_ha

نویسنده: Jeremy Wagner

مترجم: محمد رضا حسینی (عضو گروه مترجمین تریگرها)

ویراستار: طاها صادقی

تریگر پرایس اکشن 



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس 

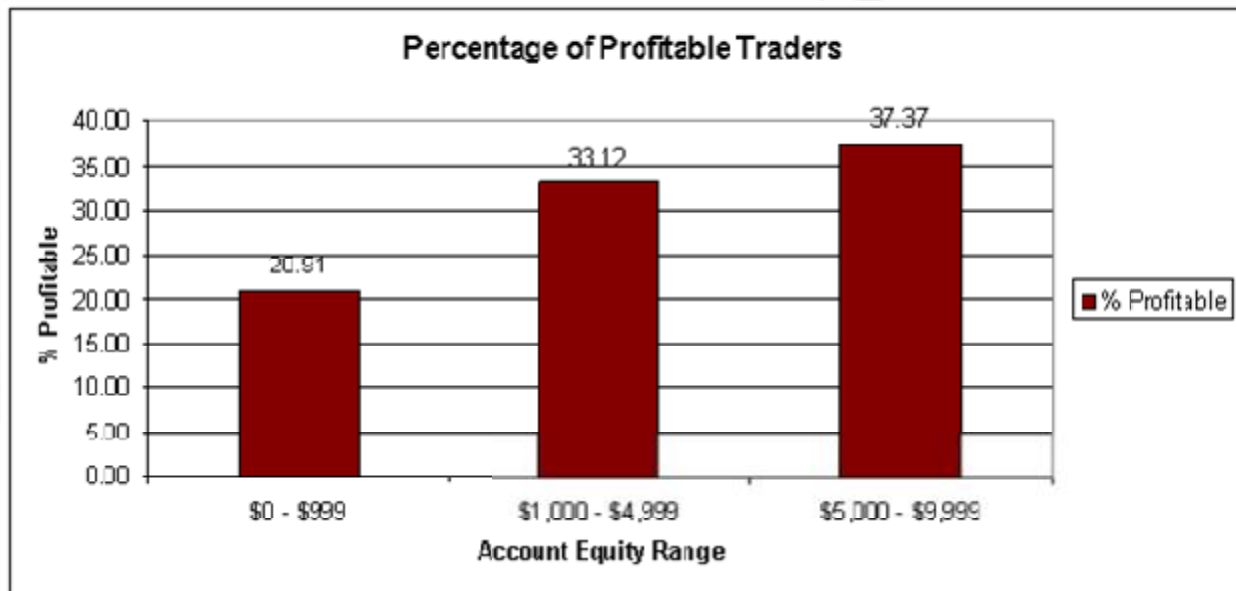
بازنشر:



تحقیقات نشان میدهد میزان سرمایه شما میتواند بر روی سودآوری شما تاثیر داشته باشد. معامله گرانی با حداقل 5000 دلار تمایل به استفاده بیشتری از لوریج محتاطانه دارند. معامله گران بهتر تمایل به استفاده از یک اهرم مالی موثر یک به ده یا حتی کمتر از آن دارند.

با نگاهی به عملکرد ده ها هزار مشتری از یک بروکر معتبر و همچنین صحبت با معامله گران از طریق وبینارهای زنده، تویتر و ایمیل اینطور به نظر میرسد که معامله گران با تمایل محافظت کردن از سرمایه در معرض ریسکشان در برابر ضررهای احتمالی وارد بازار بازار ارز میشوند. بنابراین بسیاری از معامله گران تازه کار با سرمایه پایه کوچکی شروع به معامله در بازار ارزی می کنند.

آنچه که ما از طریق تحلیل هزاران حساب معامله گری به دست آورده ایم نشان میدهد که معامله گران با موجودی حساب های بزرگتر گرایش به سودآوری در درصد بیشتری از معاملات دارند. ما احساس میکنیم که این نتیجه استفاده از اهرم مالی موثر در حساب معاملاتی میباشد.



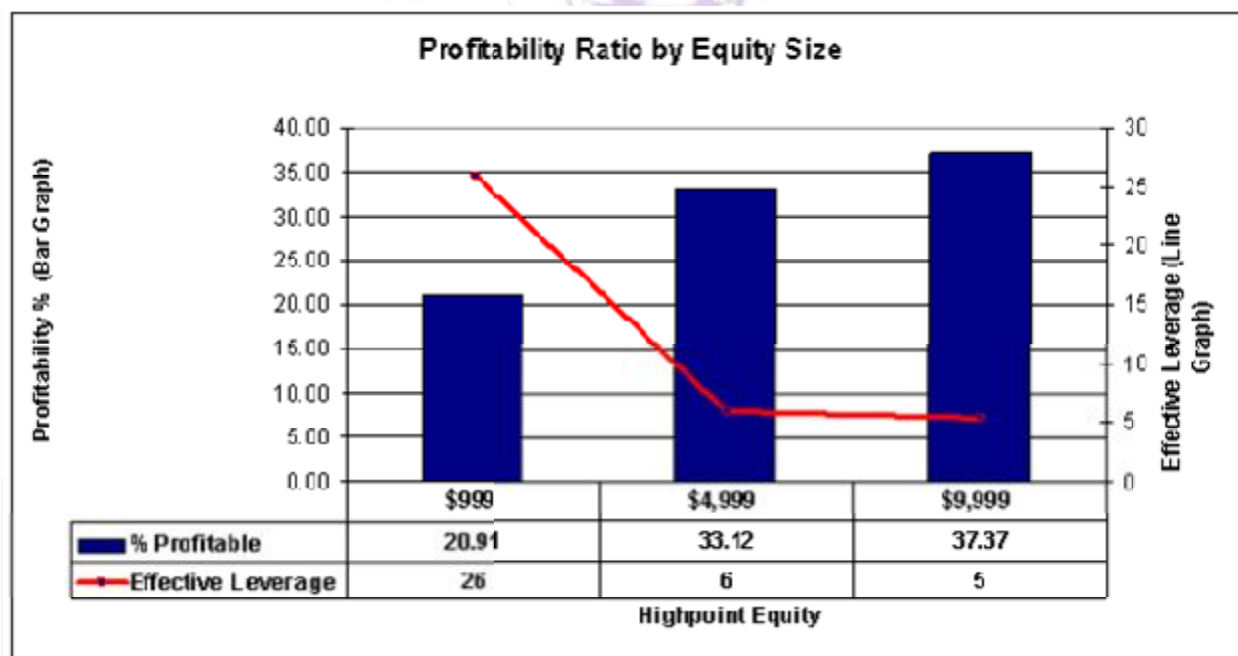
شکل 1

از آنجاییکه بسیاری از معامله گران خرده پا در معامله گری بازار ارزی تجربه هستند تمایل به این دارند که حساب خود را در معرض سطوح بسیار بالایی از لوریج قرار دهند. (لوریج زیاد). در نتیجه، این میزان افزایش در لوریج می



تواند پتانسیل ضرر را در حسابهایشان بالا ببرد. با معامله گرانی که از احساسات ایجاد شده از ضررهای سنگین به ستوه آمده اند، یا از این کار دست میکشند یا این کار را با لوریج نسبتا بالایی ادامه می دهند. این روال به سیکلی باطل تبدیل شده و به اشتیاقی که آنها را جذب بازار ارزی نمود آسیب وارد می کند.

اهمیتی ندارد استراتژی معاملاتی شما چقدر خوب یا بد باشد، تصمیم شما (یا بی تصمیمی شما، هر موردی که ممکن است باشد) در بارها هم موثر مالی تاثیرات مستقیم و قدرتمندی روی بازدهی معاملاتی شما دارد. تحقیقی انجام شده است که بازدهی یک استراتژی یکسان ولی با لوریج های متفاوت را نشان میدهد.



شکل 2

در شکل 2 ما دو عنصر نمودار شکل یک را اصلاح کرده ایم. اولین اصلاح این بود ما هر ستون را دوباره نام گذاری کرده ایم تا معرف بالاترین میزان مبلغ واجد شرایط برای آن ستون باشد. برای مثال محدوده موجودی 0 تا \$999 دلار را در دسته \$999 معرف کرده ایم و به همین ترتیب محدوده موجودی \$999 تا \$4999 دلار را در دسته \$4999 و از \$5000 تا \$9999 را در دسته \$9999 معرف کردیم.



دومین تغییر ایجاد شده این بود که ما میانگین حجم معاملاتی هر گروه را محاسبه و بر حداکثر میزان ممکن یک حساب معاملاتی برای آن گروه تقسیم کردیم. در اصل، این کار مقداری برای اهرم (لوریج) موثر کاهش یافته محافظه کارانه را در اختیار ما قرار می دهد. (هر چه حساب بزرگتر باشد میزان لوریج را کاهش می دهد، بنابراین خط قرمز کمترین و محافظه کارترین محاسبه چارت را نشان میدهد. مثلا میانگین حجم معامله برای گروه \$999 دلار تقریبا برابر با 0.26 لات (26000 واحد) بوده است. چنانچه ما متوسط حجم معامله را برداریم و بر موجودی حساب تقسیم کنیم، میزان متوسط اهرم موثر استفاده شده در هر یک از گروه ها را بدست میاوریم.

از آنجاییکه که لوریج موثر استفاده شده بطور چشمگیری از گروه \$999 به گروه \$4999 کاهش می یابد (خط قرمز)، میزان سود آوری حسابها بصورت چشمگیری در حدود 12 واحد افزایش میابد (ستونهای آبی). در ادامه وقتی با افزایش موجودی، حساب به گروه 9999 دلاری جابجا می شود، کاهش اهرم موثر و به تدریج ادامه یافته و نسبت سود آوری را تا 37% بالا می برد.

نقشه بازی: بهتر است از چه میزان اهرم (لوریج) موثر استفاده کنیم؟

ما به شما پیشنهاد استفاده از لوریج 10 به 1 و حتی کمتر را میدهیم. ما نمی دانیم که شرایط بازار چه زمانی تغییر خواهد کرد و این تغییر باعث خواهد شد که استراتژی ما زیان ندهد. بنابراین، همیشه لوریج خود را در سطوح محتاطانه ای حفظ کرده ضمن اینکه در تمامی معاملاتتان از حد ضرر استفاده کنید. یک محاسبه ساده برای اینکه در تعیین حجم معامله مورد نظر بر اساس موجودی حسابتان به شما کمک کنیم.

محاسبات لوریج 1:10

موجودی حساب	حجم معامله
5000\$	50000\$
10000\$	100000\$
25000\$	250000\$
100000\$	1000000\$
1000000\$	10000000\$



شکل 3

شکل بالا نشان می‌دهد حساب یک معامله گر حداکثر حجم معامله بر پایه لوریج 1:10 را نشان می‌دهد. که معنای آن این است که وقتی شما 10000 دلار داخل حساب دارید و از لوریج 10 استفاده میکنید هرگز نباید بیشتر از 100000 دلار معامله باز داشته باشید.

مقدار دقیق لوریج مورد استفاده باید توسط خود معامله گر محاسبه شود. شما شاید حتی احساس راحتی با لوریج های موثر کمتری مثل 1 به 5 یا حتی 1 به 3 داشته باشید.

بسیاری از تریدرهای حرفه ای به جای تمرکز بر مقدار سودی که به دست خواهند آورد، با تمرکز بر میزان سرمایه ای که تحمل از دست دادن آن را دارند وارد معامله میشوند. هیچکس از حرکات آینده قیمت خبر ندارد بنابراین تریدر حرفه ای با اطمینان به رویکرد و سیستم معاملاتی خود و البته استفاده از اهرم مالی محتاطانه و موثر خود به معامله میپردازد.

تنظیم اهرم مالی موثر متناسب با میزان تحمل ریسک شما

تحقیقات ما نشان می‌دهد که حسابهای با کوچکترین میزان سرمایه (دسته \$999) مینگین حجم معاملاتی 26000 (0.26 لات) برای هر معامله دارند و لوریج موثر آنها 26 است که بطور قابل توجهی بالاتر از لوریج 10 می باشد که بالاتر درباره اش صحبت شد. این تریدرها اگر میخواهند از لوریج بالاتر از این استفاده نکنند، دو راه حل زیر را پیش رو دارند:

اولا بالا بردن میزان سرمایه موجود در حساب تا مقداری که لوریج موثر را تا کمتر از 1:10 کاهش دهد. در نتیجه تریدری که میخواهد بطور متوسط حجم معاملاتش 26000 واحد یا 0.26 لات است، باید حداقل یک حساب 2600 دلاری داشته باشد تا بتواند 26000 واحد یا 0.26 لات را با لوریج موثر 1:10 را معامله کند. دوما پایین آوردن حجم معامله متناسب با همان لوریج 1:10. از محاسبات شکل 3 و نمودار فوق استفاده کنید.

تریگر پرایس اکشن TRIGGER



abcBourse.ir

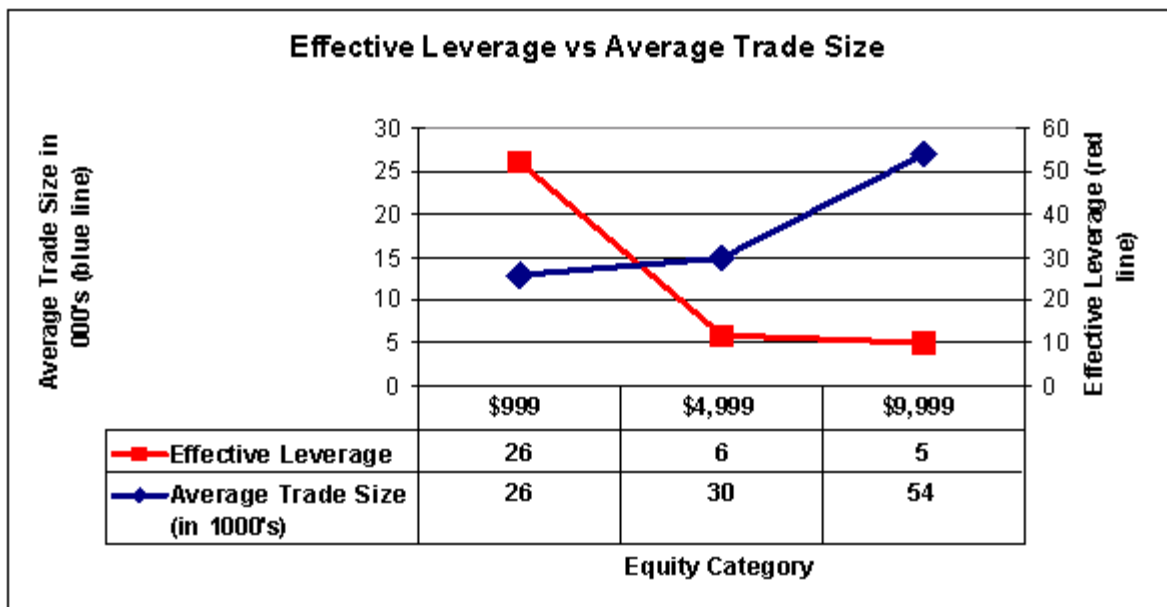


@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



باز نشر:



شکل 4

در شکل بالا توجه کنید که حجم معامله در زمان افزایش موجودی حساب از گروه \$999 به گروه \$4999 نسبتاً ثابت می‌ماند. در اصل، این نشان می‌دهد که بطور میانگین تریدرها به دنبال حداقل 2.6 دلار به ازای هر پیپ (اگر حجم معامله 26000 واحد 0.26 لات باشد که تقریباً ارزش هر پیپ در اکثر جفت ارزها با این میزان حجم معامله همان 2.6 دلار است.) می‌باشند.

ممکن است دلایل زیادی باشد که چرا معامله گران بطور میانگین به دنبال حجم 0.26 لات یا 26000 واحد هستند. شاید می‌خواهند حجم معامله ای که می‌خواهند انجام دهند باندازه کافی بزرگ باشد تا ارزش وقتی که برای این کار گذاشته اند را داشته باشد. عبارت دیگر، ممکن است معامله گران بدنال ارزش پیپد ازای قیمت باشند و \$2.60 حداقل آستانه بطور میانگین باشد. اگر این معامله گران قرار بود لوریج موثری بیشتر از 10:1 نداشته باشند باید حداقل \$2600 موجودیدر حساب داشته باشند تا بتوانند ارزش \$2.60 در ازای هر پیپ را داشته باشند.



یک دلیل دیگه هم میتونه عدم درک درست از قدرت اهرم مالی توسط معامله گران آماتور باشه و اینکه چطور یک ضرر سنگین میتواند کل سودهایتانرا از بین ببرد. استفاده از لوریج محافظه کارانه باعث میشه وقتیکه شما بصورت متوالی ضرر دادید بتوانید نرخ یا سرعت کاهش موجودی حساب خود را کم کنید. و وقتی شرایط برگشت همچنان سرمایه خوبی برای ادامه مسیر داشته باشید. اصل اول حفظ سرمایه است. مثل سربازی که تفنگ دارد ولی فشنگ ندارد نباشید. تفنگ شما همان قدرت تحلیلتان است و فشنگتان سرمایه حسابتان. تفنگ بی فشنگ ارزش زیادی ندارد.

صرفنظر از دلایل ارایه شده، در مجموع هدف ما از این نوشتار این بود که از اهرم مالی محافظه کارانه استفاده کنید. اگر شما میزان سرمایه قابل ریسکتان را بدانید از محاسبات شکل 3 استفاده کنید تا حجم معامله را متناسب با سایز حسابتان محاسبه کرده است.

اگر شما یک هدف بر مبنای ارزش "هر پیپ" دارید باید از محاسبات دیگری استفاده کنید تا حداقل میزان سرمایه برای پشتیبانی از حجم معامله را تعیین کنید. افزایش موجودی سرمایه دلیل بر سود آوری بیشتر شما نخواهد بود. بلکه این بدان معنا است که چنانچه معامله بر خلاف جهت شما حرکت کند، قدرت تحمل بیشتری خواهید داشت. بطور میانگین معامله گرانی که ترکیبی از میزان مناسب سرمایه (حداقل 5000 دلار) و اهرم مالی مناسب (10 یا کمتر) استفاده میکنند درصد موفقیت بیشتری خواهند داشت.





چطور اهرم مالی موثر و مناسبی را مشخص کنیم؟



https://telegram.me/TRIGGER_Ha



http://www.aparat.com/trigger_ha

نویسنده: Jeremy Wagner

مترجم: محمد رضا حسینی (عضو گروه مترجمین تریگرها)

ویراستار: طاها صادقی

تریگر پرایس اکشن 



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



بازنشر:



سوال مشترک تریدرها این هست که از چه میزان لوریج باید استفاده کنیم؟ ما معمولاً درباره استفاده از اهرم موثر کمتر از 10 صحبت میکنیم.

برای شروع بیایید ببینیم لوریج چیست و چرا بهتر است بجای لوریج بیشتر از لوریج کمتر استفاده کنیم. سپس محاسبات ساده مورد نیاز برای تعیین لوریج موثر در حساب معاملاتیتان را تشریح میکنیم.

لوریج چیست؟

لوریج یعنی استفاده از مقدار کمی از یک چیز برای کنترل کردن مقادیر بزرگتر از چیزی دیگر. بعنوان یک فرد، ما در بخشی از زندگی روزمره مانا درجه ای از لوریج استفاده می کنیم.

به عنوان مثال وقتی شما خانه ای بصورت اعتباری (با وام) میخرید، در حقیقت شما از لوریج استفاده کرده اید. بگذارید به شما بگویم که مثلاً آرزوی خرید یک خانه 200000 دلاری در سر دارید ولی این میزان پول نقد ندارید. پس میاید مثلاً با 20 درصد که میشه 40000 دلار آن خانه رو میخرید و شروع میکنید به دادن قسطهای منظم به بانک. در این مثال شما با مقدار کمی پول نقد (40000) موفق به خرید و کنترل مقدار بیشتری (200000) شده اید.

در بازار سهام در بسیاری از حسابهای اعتباری شما میتونید میزان خریدتان را تا دو برابر بالا ببرید. یعنی مثلاً با 50000 دلار سرمایه تا 100000 دلار اجازه دارید خرید کنید (لوریج 2).

لوریج موثر چگونه محاسبه میشود؟

برای محاسبه خیلی راحت میتونید داراییهشترا بر دارایی کمتر تقسیم کنید. در مثال خرید خانه که در بالا آمد با تقسیم 200 هزار دلار بر 40 هزار عدد 5 به دست می آید که این همان عدد لوریج شماست.

$$200000 / 40000 = 5 \text{ اهرم}$$

در مثال بازار سهام هم عدد 2 بدست آمد.

$$100000 / 50000 = 2 \text{ اهرم}$$

فرمول ساده ای برای تعیین لوریج موثر حسابتان وجود دارد. این فرمول بصورت زیر است:

کل حجم معامله / موجودی حساب = اهرم موثر (Effective Leverage = Total Position Size / Account Equity)



حالا بیایید فرض کنیم یک تریدر در بازار فارکس چطور میتواند لوریج خود را حساب کند.

فرض کنید تریدری با موجودی حساب 10000 دلار 3 تا پوزیشن باز به ترتیب ذیل دارد:

فروش 0.2 لات (20000 دلار) EURUSD

خرید 0.4 لات (40000 دلار) USDCAD

خرید 0.2 لات (10000 دلار) AUDJPY

مجموع معاملات بالا رقمی در حدود 70000 دلار یا 0.7 لات میباشد.

(70000 دلار (0.7 لات) حجم معاملات باز / 10000 دلار موجودی حساب = 7 برابر لوریج)

پس این تریدر با فرمول محاسبه ذکر شده لوریجی در حدود 7 را استفاده میکند.

از کجا بدانیم از چه مقدار لوریج استفاده کنیم؟

رابطه ای بین میزان لوریج و تاثیر آن بر حساب معاملاتی تان در بازار ارزی وجود دارد. به این صورت که هر چه از لوریج بزرگتری استفاده کنید میزان نوسانات حسابتان بیشتر میشود (چه در سود و چه در ضرر). عکس این مساله در هنگام استفاده از لوریج کمتر صادق است یعنی نوسانات کمتری را متحمل میشوید به همین دلیل است که ما معمولا درباره استفاده از لوریج کمتر از 10 صحبت میکنیم. فقط به این دلیل که به مقادیر بالایی از لوریج را دسترسی دارید به این معنی نیست که شما لزوما بخواهید از تمام یا بخشی از آن استفاده کنید. مثلا شما فرض کنید اتومبیل یا موتورسیکلتی که میتواند با سرعت 360 کیلومتر/ساعت حرکت کند به این معنی نیست که ضرورتا نیاز به رانندگی در این سرعت دارید. خودتان بهتر میدانید هر چه سرعت بالاتر میرود امکان تصادف هم افزایش میابد. پس استفاده از لوریج بالا هم ریسک زیادی به حساب شما وارد میکند همانطور که سرعت بالا ممکن است به شما آسیبهای جسمی زیادی وارد کند.

چرا ما مشوقی برای لوریج پایین تر هستیم؟

وقتی از لوریج بیش از اندازه استفاده میکنید تعداد کمی از معاملات ضررده بسیاری از معاملات سودده شما را از بین میبرد. برای اینکه بوضوح ببینید چطور این اتفاق شدنی است، مثال زیر را در نظر بگیرید.
معامله گرالف 5 لات و معامله گرب 0.5 لات AUDUSD می خرد.

تریگر پرایس اکشن TRIGGER





سوال: وقتی 100 AUDUSD پیپ بر خلاف جهت معامله آنها ریزش می کند، برای موجودی حساب معامله گر الف و ب چه اتفاقی می افتد؟

پاسخ: معامله گر الف 50% و معامله گر ب 5.0% موجودی حسابش را از دست می دهد.

مثال:

معامله گر الف	معامله گر ب	
موجودی حساب	موجودی حساب	10000 دلار
حجم معامله معقول	حجم معامله معقول	500000 دلار (دارای قدرت خرید 50 لات 10000 دلاری)
اهرم بکار رفته	اهرم بکار رفته	50:1 (50 برابر)
100 پیپ ضرر به دلار	100 پیپ ضرر به دلار	5000 دلار ضرر
% ضرر از موجودی	% ضرر از موجودی	50.0%
% باقیمانده از موجودی	% باقیمانده از موجودی	50.0%
		5 لات 10000 دلاری (دارای قدرت خرید 5 لات 10000 دلاری)
		5:1 (5 برابر)
		500 دلار ضرر
		5%
		95.0%

با بکار بردن اهرم کمتر، معامله گر ب کاهش موجودی بر اثر ریزش 100 پیپی را به شدت کاهش می دهد

به این دلایل هست که من در حسابم بسیار محتاط عمل میکنم و معمولاً از لوریج کمتر از 10 برابر استفاده میکنم. لوریج مورد استفاده برای شما بستگی به میزان ریسک پذیریتان دارد. معامله گران ریسک پذیر تر اهرم موثر نزدیک به 10 به 1 و معامله گران محتاط تر مقادیر کمتری برابر با 3 به 1 یا کمتر را برای حساب خود انتخاب می کنند.

TRIGGER