

فکر می کنید در معامله بدشانس هستید؟

توسط : مدیر

7-8 minutes

فکر میکنید در معامله بدشانسید؟ ممکن است این 5 کار را اشتباه انجام می دهید

تقریباً همه معامله گران روزی با «چالش های همه گیر معامله گری» مواجه بوده اند. این چالشه ای فراگیر حالتی است که در آن مرتباً سودها از دست می روند، یا زیان ها افزایش میابند. این دوره های زیان یا فعالیت های بی ثمر (فراچارت : یعنی وضعیتی که معاملات زیانده، سود معاملات دیگر را از بین میبرد) میتوانند در هر زمانی برای هر کسی رخ دهند. گاهی ممکن است به سبب تغییر جهت (فراچارت: روند) بازار این مشکل رخ دهد؛ گاهی نیز، ممکن است به این علت باشد که معامله گر استراتژی اش را تغییر داده است یا دیگر به پلن مشخصی پایبند نیست. فارغ از علت، معامله گر می تواند 5 سؤال از خود بپرسد تا مشکل را شناسایی و بررسی کند؛ بدین ترتیب، او میتواند تغییرات را آغاز کند و امیدوارانه به روند سودآوری بازگردد.

پرسشها

پرسشهای زیر باید تا حد ممکن صادقانه و کامل پاسخ داده شوند. هرکدام از آنها شرایط جاری بازار و استراتژی شخصی معامله گر را بررسی میکند. معامله گران باید بدانند که معاملات زیانده برای هر کسی رخ میدهد و حتی برای بهترین سیستم های معامله گری نیز ممکن است زنجیره ای از زیانها پیش آید. بنابراین، نباید با هر زیان، قوانین و استراتژیهای معاملاتی را بازبینی کرد. این پرسشها زمانی باید استفاده شوند که معامله گر روی گردونه (دور) زیان افتاده است. این پرسشها باید معاملهگر را مدام در مسیر نگه دارد و کمک کند از آغاز در دام آن «چالشهای فراگیر» نیفتد.

بر اساس روش هایم، آیا معامله من در جهت ایجاد سود حرکت میکند؟

پوسته پایین و بالا میروند، از حالت بدون روند خارج شده، روند دار میگردند و دوباره به شرایط بی روند بر میگردند. بنابراین آنچه در شرایطی



خاص به کار می‌آید، ممکن است در شرایط دیگر کاربردی نداشته باشد. طرح معاملاتی ممکن است بدون نقص اجرا شود، اما اگر در جای نامناسب به کار گرفته شود، به شکست منجر خواهد شد.

بنابراین، معامله‌گران باید نقاط ورود، حد زیانها، و حد سودها و استراتژی‌های مدیریت سرمایه‌شان را با شرایط بازار تعیین کنند. در غیر این صورت، باید تا وقوع شرایط مناسب، از باز کردن معامله اجتناب کنند یا استراتژی‌های جایگزین برای چنین شرایطی ایجاد کنند.

معامله‌ام در جهت روند است یا خلاف آن؟

بسیاری از معامله‌گران استراتژی‌هایی را توسعه می‌دهند که بتوانند با آنها از روند کسب سود کنند. روندها در تایم فریم‌های گوناگون شکل می‌گیرند و معامله‌گر باید توجه کند که کدام روندها برای معامله مناسب‌ترند.

معامله در جهت روند، میتواند بر اساس دید معامله‌گر متفاوت باشد: ممکن است روند کوتاه مدت به سمتی برود، اما روند بلندمدت در همان زمان خلاف آن جهت باشد. بنابراین تشخیص روند در تایم فریم‌های مختلف و انتخاب یکی از آنها برای معامله، فاکتوری تعیین‌کننده در موفقیت معامله است.



اگر استفاده از استراتژی دنباله روی روند همچنان معاملات زیانده باشند، باید بررسی کند که آیا اصلاً بازار روند دارد یا خیر. اگر بازار روند دار باشد، احتمالاً نقطه ورود بسیار در (فراخات: نزدیک نقطه اصلاح) تعیین شده



است یا حد زیان بسیار نزدیک قیمت است. اگر استراتژی به نظر سودآور باشد (اما در عمل اینطور نباشد)، باید بررسی کرد که آیا قوانین استراتژی کاملاً رعایت میشوند. ممکن است مشکل در استراتژی نباشد، بلکه تریدر با نداشتن نظم باعث به وجود آمدن آن شده باشد (فراچارت: غالباً هم، اینطور است).

آیا من قواعدی برای ورود و خروج دارم و آیا کاملاً آنها را رعایت میکنم؟

هنگامی «چالش های همه گیر معامله گری» رخ میدهد که تریدر طرح کاملی (فراچارت: با ذکر جزئیات) برای نحوه ورود به معاملات و خروج از آنها ندارد. آیا قوانین ورود و خروج با جزئیات نوشته شده اند؟ جزئیات باید شامل نحوه و زمان ورود و خروج باشد.

معامله گران حتی باید کوچکترین تغییرات در طرح معاملاتی را بررسی کنند. برای مثال، آیا به محض صدور سیگنال، معامله باز کنند یا صبر کنند قیمت بسته شود، و برعکس. چنین تغییراتی میتواند پویایی استراتژی را تغییر دهد. همچنین، معامله گر باید از خود بپرسد: آیا قواعد خرید و فروش من آزموده شده اند؟ و **فرضهای پنهان** این قواعد چیست؟ برای تست کارایی هر استراتژی میتوان از بررسی گذشته قیمت، معاملات مجازی یا حسابهای دمو استفاده کرد.

آیا با همه سیگنال های استراتژی معامله میکنم یا فقط تعداد خاصی را انتخاب میکنم؟

زمانی که سیستمی ایجاد میشود، به خصوص زمانی که بر اساس تست گذشته ایجاد شده، فرض می شود که تریدر همه سیگنالها را معامله خواهد کرد. اگر معامله گران خاص بعضی سیگنالها را فیلتر می کنند، در معاملات واقعی نیز باید آنها را نادیده بگیرند. بنابراین معامله گر باید از خود بپرسد آیا دقیقاً منطبق بر استراتژی معامله میکنم یا تعداد معاملات را بسیار زیاد یا بسیار کم میکنم؛ اگر معاملات بیشتری باز میشود، باید بررسی کند که کدامیک بخشی از طرح معامله نبوده اند. نباید طرح معاملاتی را مقصر دانست. معامله گر باید تا زمانی که معاملات با سیستمی سودده به ثمر بنشینند، از این معاملات اضافه دست بردارد. اگر همه سیگنالها معامله نمیشوند، فرض سودآوری استراتژی میتواند به شدت مخدوش شود. معامله گران باید بررسی کنند معاملاتی که از آنها صرفنظر کرده اند سودده بود هاند یا خیر. اگر چنین بوده، ازاین پس، همه سیگنالها را معامله کنند.

آیا قواعد مدیریت سرمایه دارم و آنها را رعایت میکنم؟

همترین نکات معامله گری مدیریت سرمایه است. در هر معامله، ریسک در باید به مقدار ناچیزی محدود شود، در حالت ایده آل کمتر از 1 درصد

Aa



اصل سرمایه. بنابراین معامله گر باید از خود بپرسد: اگر قواعد مدیریت سرمایه مناسب هستند، آیا من آنها را رعایت میکنم؟



ممکن است قواعد مناسب باشند، اما آیا در معاملات واقعی زیانها بیشتر از حد پذیرفته شده می شوند یا خیر. اسلیپیج (فراچارت: Slippage): در معنای لغوی به معنای سر خوردن میباشد و به تغییر قیمت از زمان صدور فرمان معامله از سوی مشتری تا زمان اجرای آن توسط کارگزار گفته می شود، و کارمزدها، می-توانند زیانها را بیش از حد پیشبینی شده کنند و یک استراتژی سود ده را خراب کنند.

البته اگر درست و حسابی به ریسک پرداخته نشده باشد. اگر زیانها پیوسته بسیار بیش از حد پیشبینی شده هستند، حجم معاملات را کاهش دهید، یا به کارگزاری مراجعه کنید که کارمزدش کمتر باشد، و یا به کلی در این بازار معامله نکنید؛ زیرا ممکن است اسلیپیج آن به قدری زیاد باشد که نتوان به درستی ریسک را کنترل کرد.

سخن پایانی

زیانهای پیاپی برای هر کسی پیش می آید، مخصوصاً زمانی که فرد به اندازه کافی ترید کرده باشد. منشأ «چالشهای همه گیر» یا بازار است یا معامله گر (فراچارت: تغییر جهت بازار یا چگونگی اجرای قواعد معامله). معامله گران با بررسی دقیق سیستم معاملاتی شان می توانند رشته زیانها را پاره کرده، امیدوارانه به سود برسند.

پایش مداوم بازارها و بررسی کارایی سیستم نیز از دیگر راههای رسیدن به این منظور هستند. معامله گر همچنین باید بررسی کند که معاملاتش در جهت روند هستند یا خلاف آن. آیا قواعد کارآمد ورود، خروج و مدیریت سرمایه دارد؛ آیا همه سیگنالها معامله میشوند، یا مهمتر از آن، همه قواعد رعایت میشوند؟ با آزمون بازار و بررسی دقیق طرح معاملاتی (و چگونگی اجرای آن) ریشه را میتوان یافت و با اقدامات مناسب وضعیت را اصلاح کرد.

Aa

انتشار: فراچارت



ترجمه: امیر مصطفی‌زاده و سعید جنتی‌زاده

مدیر



لطفا هنگام برداشت از مطالب با ذکر منبع به رشد و شکوفایی ما کمک کنید.
استفاده از حاصل زحمات و دسترنج دیگران بدون اجازه و بدون ذکر منبع در
نهایت باعث ترویج بی اعتمادی و ایجاد محیط ناسالم برای رقابت خواهد شد.

Aa



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



باز نشر :