

## مهم ترین مراحل در سیستم معاملاتی شخصی

توسط : مدیر

5-7 minutes

یکی از الزامات معامله گری در بازار سرمایه اینه که شخص معامله گر دارای یک سیستم معاملاتی مدون و مکتوب در بازار باشه و بر اساس اون سیستم معاملاتی معاملاتش رو تنظیم کنه. نداشتن یه سیستم معاملاتی در بازار شبیه اینه که بدون اینکه شنا بلد باشید برید در یه جای عمیق شنا کنید. در این حالت احتمال از بین رفتن تقریبا 100% هست.

در بازار های مالی هم سرمایه گذار بدون داشتن یک سیستم معاملاتی قادر به حفظ سرمایهش تو بازار نیست و هیجان بازار هم طوریه که ممکنه کل سرمایهش رو به راحتی از دست بده. سیستم معاملاتی میتونه به کار سرمایه گذار نظم بده و جلوی هر عامل منفی اثرگذار در روحیه سرمایه گذار رو بگیره و به همین جهت معامله گر میتونه بدون استرس و هیجان تو بازار معامله کنه و در واقع با پیش آمدن هر وضعیتی بدونی که قدم بعدی چیه و باید چیکار کنه. طراحی و ساخت یک سیستم معاملاتی از مراحل زیر تشکیل میشه:

Aa





### مرحله اول: بازه زمانی خاص خود را انتخاب کنید.

اولین مرحله در طراحی یک سیستم معاملاتی انتخاب بازه زمانی برای معامله است. بازه زمانی به کار رفته در نرم افزار های تحلیل تکنیکال بین 15 دقیقه تا 1 ماه هست و هر معامله گری هم میتونه بستگی به تجربه ای که تو بازار داره و یا جنس معاملاتش (اینکه معامله گر ترجیح نمیده کوتاه مدت، میان مدت و یا بلند مدت معامله کنه)، یکی از بازه های زمانی رو به دلخواه انتخاب کنه. به عنوان مثال تحلیلگری که رو نمودارهای هفتگی کار میکنه نمیتونه طول مدت سرمایه گذاریش رو یک ماهه در نظر بگیره و کوتاه مدت معامله کنه و به همین دلیل هم نیاز نیست که هر روز بره سایت های بورسی رو چک کنه و ببینه قیمت سهمش چنده و بازار در مورد اون سهم چی میگه. پس اولین قدم اینه که شخص بازه زمانی سرمایه گذاری رو تعیین کنه.

Aa





## مرحله دوم: روند رو تشخیص دهید و از آن تایید بگیرید.

به نظر من تشخیص شروع یک روند کار نسبتاً سختیه و صرفاً با ابزارهایی که برای تحلیل تکنیکال استفاده میشه همیشه شروع روند رو حدس زد. البته در بحث امواج الیوت و شمارش موج ها همیشه انتهای موج 5 رو همراه با مشاهده واگرایی ها تشخیص داد ولی ممکنه خطاهایی هم داشته باشه و از طرفی زمان زیادی هم برای شروع روند صرف بشه.

پس بهتره که با همون شرایط رایجی که در خصوص تشکیل روند در بازار وجود داره (در روند صعودی: سقف ها بالاتر و کف ها بالاتر و در روند نزولی: سقف ها پایین تر و کف ها پایین تر) شروع روند رو حدس بزنیم. بزارید یه نکته رو در خصوص روند بگم. در کل دیدگاه معامله گرا مبنی بر اینکه یه روند غالب در بازار وجود داره موجب ایجاد نظم در معاملات میشه و همین هم موجب معاملات موفقتری در بازار می شه و در نهایت هم از معاملات هیجانی و استرس زا هم دوریم. البته در تشخیص شروع روند ممکنه قیمت ها بالاتر بره ولی روند تایید میشه و آدم با خیال راحت تری میتونه سهم رو بخره چون یک روند شروع کار هست و بعد از اون باید قدم های بعدی برداشته

Aa





### مرحله سوم: نسبت ریسک و ریوارد خود را تعیین کنید:

در بحث طراحی سیستم های معاملاتی باید میزان ریسک معامله ای که قراره توش بریم رو تعیین کنیم. حالا این میزان ریسک میتونه درصدی از حجم پول سرمایه گذاری باشه (دیدگاه عامیانه در بین سرمایه گذاران در خصوص تعیین میزان ریسک) و یا بر مبنای تحلیل تکنیکال و تعیین نسبت R/R باشه. به عبارت دیگه سرمایه گذار باید بدونه که با رسیدن به حد ضرر، قراره چه تصمیمی برای سرمایه گذاری بگیره و این موضوع رو از قبل به صورت مکتوب داشته باشه.

Aa



abcBourse.ir



@abcBourse\_ir

مرجع آموزش بورس



باز نشر :



**مرحله چهارم: مقدار سرمایه ای که قصد ورود به سهم را دارید تعیین کنید:**

در این مرحله لازمه تعیین کنیم که چه میزان سرمایه ای رو باید وارد سهم کنیم و از خودمون بپرسیم که قراره خرید رو یکباره انجام بدیم و یا برای اون هم برنامه ریزی داشته باشیم. یعنی خرید پله ای با معیارهای موجود داشته باشیم و یا از روش های دیگه ای استفاده کنیم. یه نکته رو در این خصوص بهتون یادآور میشم که در خرید پله ای حتما پتانسل های سهم رو هم مد نظر داشته باشید و بعد از اون میانگین قیمت خرید خودتون رو کاهش بدید. چون حس زیان گریزی موجب میشه که چون دوست ندارید زیان شناسایی کنید دست به خرید های مجدد میزنید در صورتی که اون سهم اصلا سهم خوبی نیست و حساسیت بی مورد رو اون سهم دارید.

Aa



abcBourse.ir



@abcBourse\_ir

مرجع آموزش بورس



باز نشر :



### مرحله پنجم: نقاط ورود و خروجتان را مشخص کنید.

بعد از اینکه چهار مرحله اول رو با موفقیت پشت سر گذاشتید باید قادر به تشخیص محدوده مناسب برای ورود به سهم باشین. عموماً افرادی که درگیر بازارند نقاط ورود به سهم رو با اندیکاتورها تعیین میکنن هر کسی هم به نوع خودش از یه ابزاری استفاده میکنه و به همین دلیل هم عموماً فصل مشترکی بین همه سرمایه گذارا در تعیین نقطه ورود مناسب وجود نداره.

به نظر من تعیین یه نقطه مناسب برای خرید سهم نباید صرفاً با این روش صورت باشه و معامله گر در کنار این ابزارها باید روند حرکتی سهم و رفتار خریدار و فروشنده ها رو هم در نظر گرفته و سپس تاییدی برای خرید سهم بگیره. اینجاست که همیشه یک نقطه بهینه برای خرید سهم رو تشخیص داد. برای تعیین قیمت فروش هم میتونیم از مقاومت های استاتیک و داینامیک تو بازار استفاده کنیم.

یعنی هر زمانی با یه مقاومت رو به رو هستیم ببینیم شرایط عرضه سهم توسط تریدرگان به چه صورت هست و سپس تصمیم درست رو بگیریم. عده ای هم همیشه در این شرایط خروج پله ای رو در نظر میگیرند تا بتونن حداکثر سود

Aa



رو ببرند و از طرفی ریسک خودشون رو هم کاهش بدن و عده ای هم از تریل کردن استفاده میکنند.



مرحله ششم: از سیستم‌تان استفاده کنید و با آزمون و خطا کارایی آن را افزایش دهید.

مرحله آخر تست سیستم می باشد. در این مرحله عملیات سیستم رو مکتوب کنید و طبق اصول و ضوابطی که تعیین کردید جلو برید و هیچ وقت سعی نکنید اصول رو زیر پا بگذارید. سیستم معاملاتی که طراحی کردین رو چند بار تست کنید و هر بار سعی کنید که اون رو بهینه کرده و کارایی رو بالا ببرین. برای تست سریع تر هم میتونید از دیتاهای چند ماه گذشته استفاده کنید و فکر کنید که به صورت واقعی دارید معامله انجام میدین. به همین ترتیب قادرید سیستمی که طراحی کردید رو جلوتر تست بگیرید و مشکلاتی که داره رو تشخیص بدین و سیستم معاملاتیون رو تقویت کنید.

تهیه و تنظیم: مهدی افضلیان / انتشار: سایت فراچارت

Aa



abcBourse.ir



@abcBourse\_ir

مرجع آموزش بورس



باز نشر:



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 :