



**پلن معامله گری**

**Trading Plan**



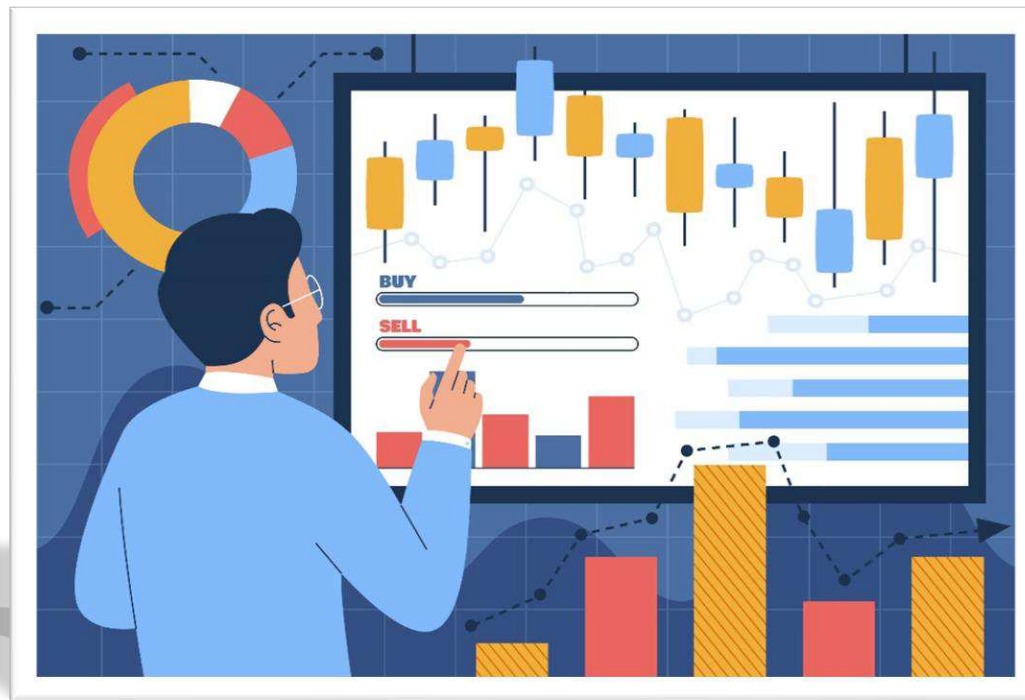
## برنامه - Plan



پلن یعنی برنامه ریزی و طرح ریزی برای انجام یک کار .  
در برنامه ریزی ها جوانب کار را سنجیده ، اهداف را تعیین  
کرده سپس محدودیتها را بررسی ریسکها و پاداشهای  
احتمالی را نیز حساب کرده و یک نقشه ی راه برای هفته  
ها و ماههای آتی ترسیم می کنیم.



## پلن معامله گری – Trading Plan

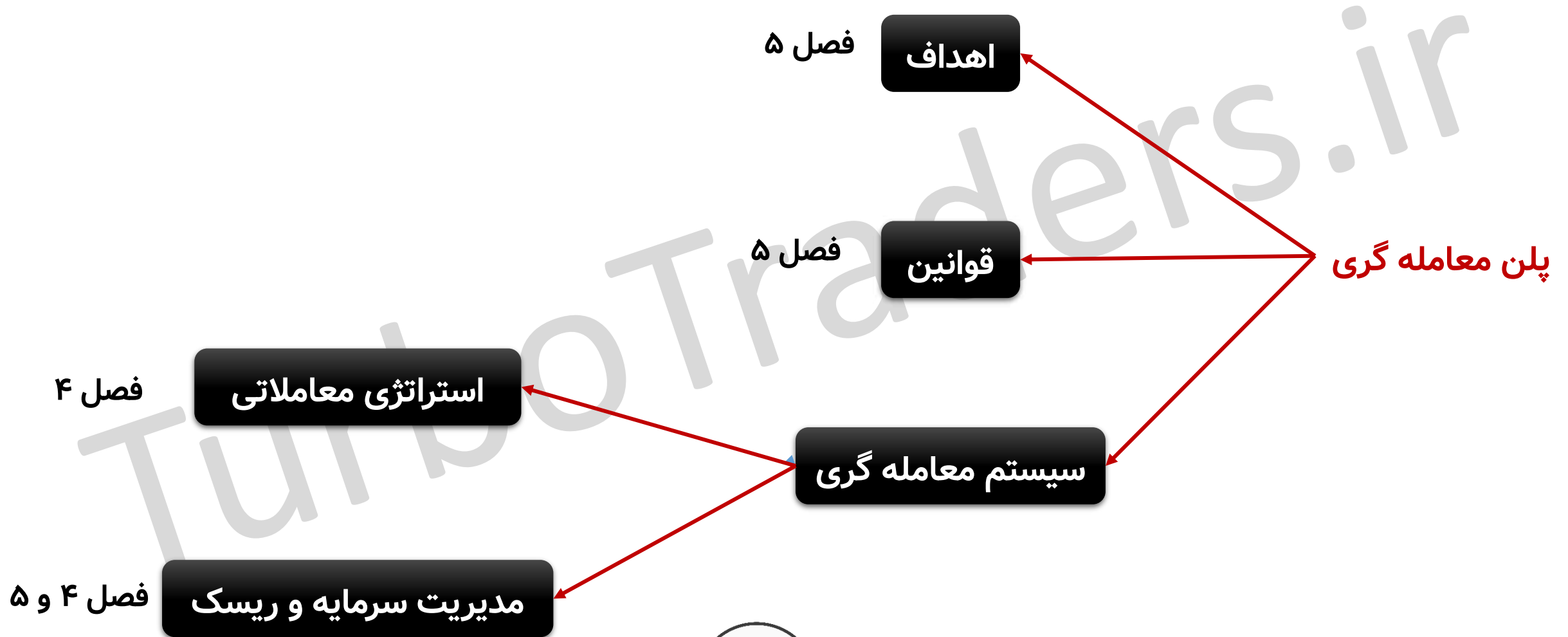


**پلن معامله گری عبارت است از :**

**یک برنامه راهبردی مدون برای کنترل عوامل تاثیر گذار کنترل پذیر در روند معاملات.**



## پلن معامله گری : نقشه راه تریدر شدن



## استراتژی معاملاتی – Trading Strategy



به مجموعه قوانین مدون ، مکتوب ، شفاف ، قابل ارزیابی که به بر مبنای آموزش های علمی در بازار جهت ، نقطه ورود و خروج یک معامله را تعیین میکند . **استراتژی معاملاتی** یا **Trading Strategy** گفته میشود. استراتژی معاملاتی مهم ترین بخش پلن معامله گری میباشد که تا حد قابل توجهی باعث کنترل عوامل تاثیر گذار کنترل پذیر در روند معاملات میشود.



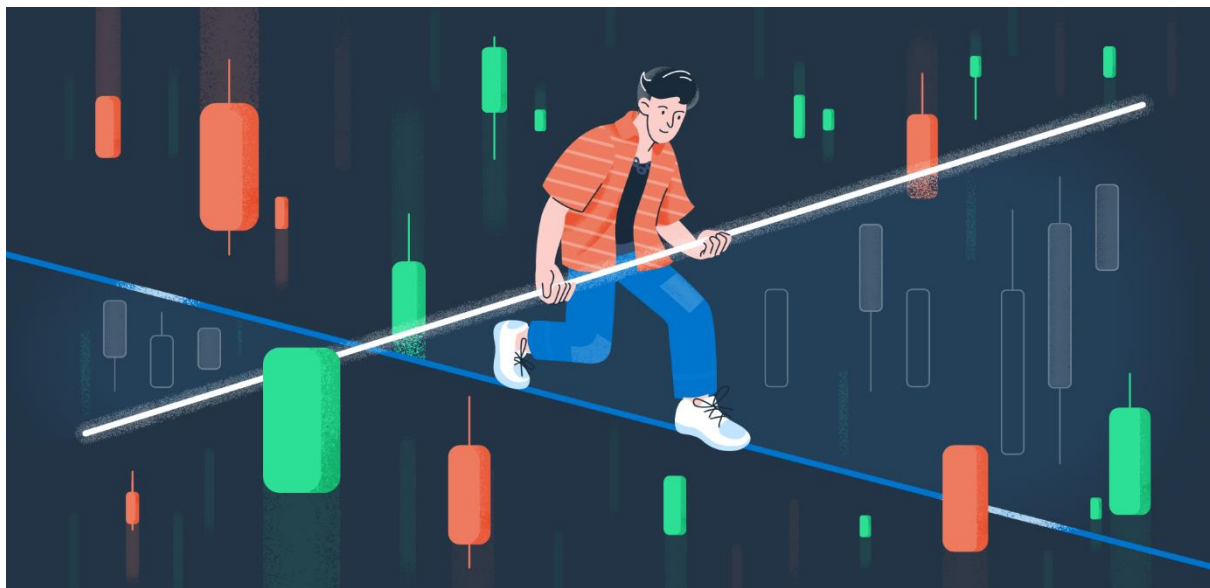


## پلن مدیریت سرمایه و ریسک

Risk and Money Management Plan



## پلن مدیریت سرمایه و ریسک – Risk and Money Management Plan



به مجموعه قوانین مرتبط با هر استراتژی معامله گری ،  
که برای مدیریت و کاهش ریسک های آن ، بعد از  
تصمیم به گرفتن یک معامله ، بررسی میشود . پلن  
مدیریت سرمایه و ریسک گفته میشود . هدف اصلی این  
پلن ، کاهش میزان ریسک و مدیریت سرمایه می باشد.



## اهداف پلن ریسک



سه هدف مهم پلن ریسک :

- افزایش میزان سود ها نسبت به ضرر ها به کمک قوانین پلن ریسک با تأثیر بر متغیرهای آن ، حتی در حالتی که درصد برد استراتژی (Win Rate) زیر پنجاه درصد باشد ( تعداد باخت ها از برد ها بیشتر باشد ).
- کاهش تعداد معاملات با افزایش میزان سود
- کاهش درگیری های روانشناسی معاملاتی ترس ، طمع ، غرور ، انتقال از بازار ( Over Trade ) ، ترس از جاباندن (Fomo)



## شعار پلن ریسک – Risk and Money Management Plan

**بقا در بازار حتی در بدترین شرایط ،  
سود بعداً میاد ، اول باید زنده بمونی!**



## اجزای پلن ریسک – Risk Plan Ingredients



- متغیرهای پلن ریسک : اهرم و مارجین پوزیشن
- قوانین مدیریت سرمایه و ریسک : به مجموع قوانینی که متناسب با قوانین استراتژی معاملاتی ، برای تعیین اهرم و مارجین مناسب تعیین میشود ، قوانین مدیریت سرمایه و ریسک گفته میشود که بر دو نوع است : کمی ، کیفی



## Leverage & Margin

**اهرم (Leverage):** ضریب وجه ضمانت در یک معامله که باعث تعیین ارزش قرارداد و چند برابر شدن سود یا ضرر میشود.

**وجه ضمانت (Margin):** مقدار سرمایه ای که در یک پوزیشن معاملاتی توسط معامله گر تا زمان بسته شدن پوزیشن قفل میشود و بعد از تسویه ، اصل وجه ضمانت با احتساب سود و ضرر معامله به حساب فیوچرز برمیگردد.



## انواع پلن های ریسک – Risk Plans Types

سه نوع پلن ریسک براساس ثبات متغیر های آن

مارجین :

اهرم :

ثابت

متغیر

متغیر

ثابت

متغیر

متغیر

# Leverage & Margin



# Elementary Risk Plan

**پلن ریسک استراتژی المنتری**

Elementary Risk Plan



## اهرم مبنا - Basic Leverage



به حداکثر اهرمی که با در نظر **نگرفتن** قوانین پلن ریسک معامله گری ، کمترین ریسک را داشته باشد. اهرم مبنا یا اهرم حداکثری گفته میشود. اهرم مبنا طبق فرمول زیر محاسبه میشود .

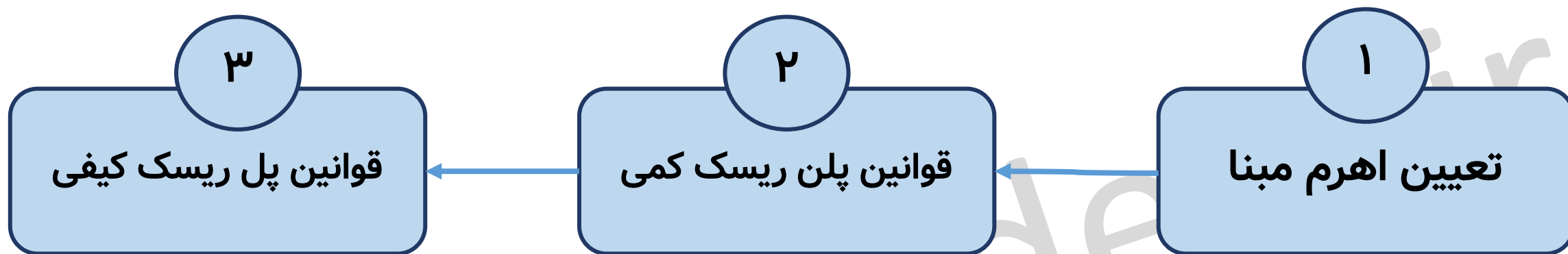
$$SL (\%) = (100 / \text{Maximum Leverage}) \times 0.55$$

بنابر این اهرم مجاز در یک پوزیشن ، با اعمال قوانین پلن ریسک باید در فرمول زیر برقرار باشد :

$$SL (\%) \geq (100 / \text{Leverage}) \times 0.55$$



## نحوه اعمال قوانین پلن ریسک المنتری



نحوه اعمال قوانین پلن ریسک بر روی استراتژی المنتری :

۱ - ابتدا اهرم مبنا را پیدا میکنیم. ( به کمک ژورنال یا فرمول اسلاید قبل )

۲ - براساس قوانین پلن ریسک کمی ( اسلاید های بعد ) اهرم را کاهش یا افزایش میدهم به طوری که شرط زیر برقرار باشد و در صورتی که اهرم مجاز از ۲۵ بالاتر بود ، به قوانین کیفی مراجعه میکنیم.

$$1 \leq \text{Leverage} \leq \text{Basic Leverage} \leq 50$$



## انواع قوانین پلن ریسک المنتری

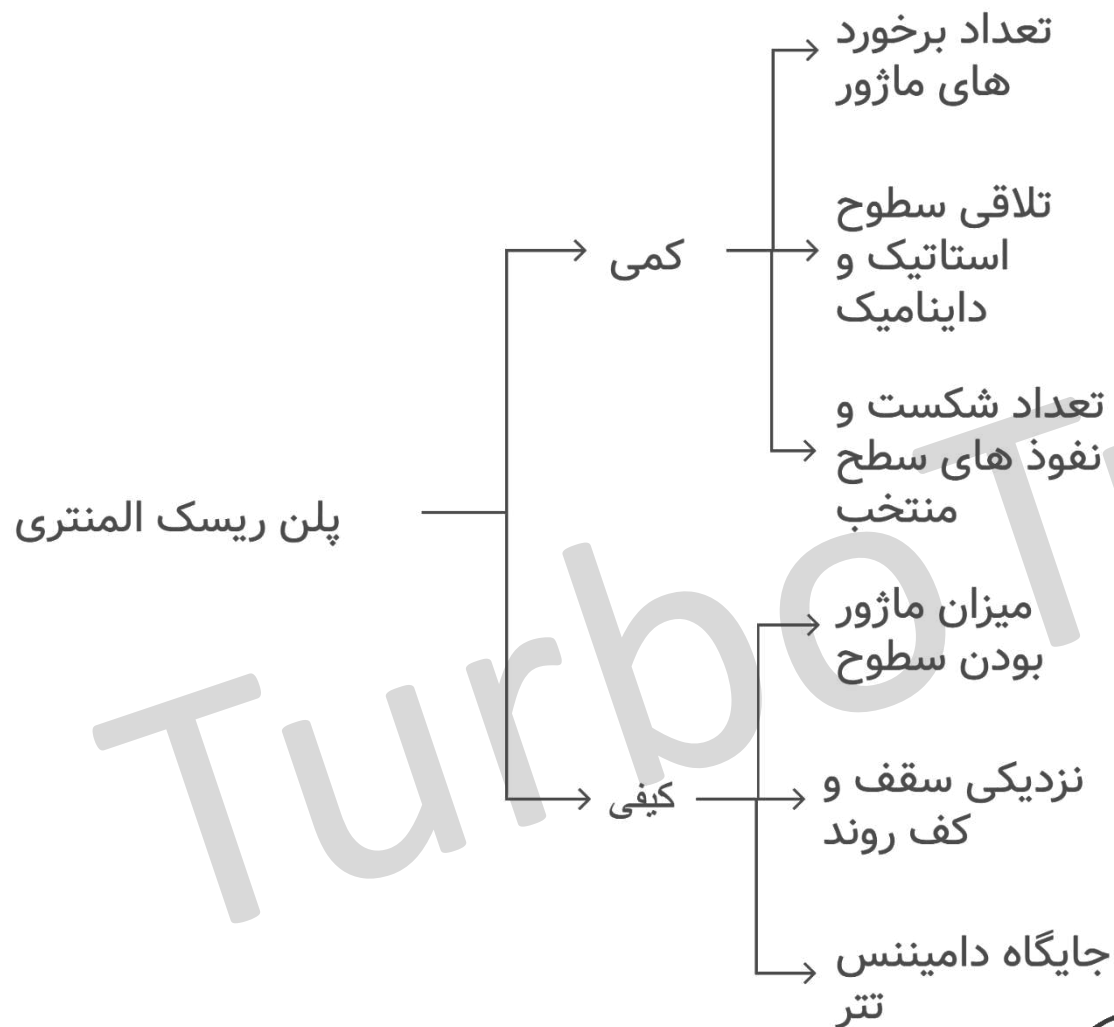
- ۱ - قوانین کمی : به قوانینی گفته میشود که براساس پارامتر های واضح و بدون ابهام ، اعمال میشوند.
- ۲ - قوانین کیفی : به قوانینی گفته میشود که براساس پارامتر های تخمینی و با لحاظ مقداری خطا ، اعمال میشوند.

**مثلا :**

کمی : تعداد برخوردهای قبل و بعد شکست ( چون به راحتی قابل شمارش هستند واضح و بدون ابهام است )  
کیفی : میزان مازور بودن پیوت ها ( نسبی است و به راحتی قابل اندازه گیری نیست پس با لحاظ مقداری خطا اعمال میشود )



## قوانین پلن ریسک المنتری



کمی :

- تعداد برخورد های مازور به سطح منتخب و خط روند
- تلاقی سطوح استاتیک و دینامیک
- تعداد شکست ها و نفوذ های سطح منتخب

کیفی :

- میزان مازور بودن سطوح
- میزان نزدیک بودن سقف و کف روند به حالت شماتیک ( استاندارد )
- جایگاه Dominance تتر (USDT.D)



## قوانین کمی - Quantitative rules

بر اساس قوانین زیر ، اهرم مبنا را کاهش یا افزایش می‌دهیم . به طوری که  $1 \leq \text{Leverage} \leq \text{Basic Leverage} \leq 50$

بر خورد اول بعد شکست : تغییری در اهرم ایجاد نمی‌کنیم.

بر خورد دوم بعد شکست : ۲ - واحد ( در صورتی که در پوزیشن باز نباشیم یعنی بر خورد اول را نگرفته باشیم )

بر خورد اول به بعد قبل شکست : به ازای هر بر خورد : ۱ + واحد

به ازای هر تلاقی هم راستا برای سطوح استاتیک و داینامیک : ۲ + واحد

به ازای هر تلاقی معکوس برای سطوح استاتیک و داینامیک : ۲ - واحد

بر خورد سوم به بعد برای خط روند : به ازای هر بر خورد : ۱ - واحد

شکست یا نفوذ اول به بعد برای سطح منتخب : برای شکست ( ۲ - واحد ) برای نفوذ ( ۱ - واحد )



## نکات تکمیلی

براساس قوانین زیر ، اهرم مبنا را کاهش یا افزایش میدهیم . به طوری که  $1 \leq \text{Leverage} \leq \text{Basic Leverage} \leq 50$

نکته : در صورتی نفوذ شمارش میشود که تا نصف فاصله تا سطح مقابل قیمت پیشروی کرده باشد.

برای شمارش شکست ها و نفوذ ها چه مقدار به عقب برگردیم ؟ به اندازه مقیاس افقی کافیت اما اگر منشا سطح منتخب ، در مقیاس افقی قبلی باشد . به مقیاس افقی قبل برمیگردیم و شمارش میکنیم.

- تلاقی هم راستا یعنی تلاقی یک سطح حمایت استاتیک با یک سطح حمایت داینامیک ( همچنین برای مقاومت )
- تلاقی معکوس یعنی تلاقی یک سطح حمایت استاتیک با یک سطح مقاومت داینامیک و بالعکس
- تنها در صورتی که بعد از اعمال قوانین کمی ، اهرم بدست آمده **بالاتر از ۲۵ بود** ، به **قوانین کیفی** مراجعه میکنیم ، در غیر این صورت نیاز به مراجعه به قوانین کیفی نیست .



## قوانین کیفی ( فقط برای کاهش اهرم مبنا ) - Quality rules

بر اساس قوانین زیر ، اهرم مبنا را فقط کاهش می‌دهیم . به طوری که  $50 \geq \text{Basic Leverage} \geq \text{Leverage} \geq 1$

- در صورت داشتن ویژگی های مثبت اهرم مبنا را تغییری نمی‌دهیم.
- **میزان مازور بودن سطوح :** پیوت های مازوری که به سطح منتخب برخورد کرده بررسی میکنیم ، هرچقدر طول رفت و برگشت پیوت طولانی تر باشد ، پیوت مازور تر است ( طول ۷ و ۸ ) . میتوان برای اینکار از اندیکاتور MACD کمک گرفت.
- اگر میزان مازور بودن پیوت ها نسبت به سایر پیوت ها کم بود ، اهرم مبنا را کاهش می‌دهیم.
- **میزان نزدیک بودن سقف و کف روند به حالت شماتیک ( استاندارد ) :** شکل ساختاری روند به حالت شماتیک ، نزدیک تر باشد و تشخیص آن راحت تر باشد . اگر به حالت استاندارد نزدیک نبود ، اهرم را کاهش می‌دهیم.
- **جایگاه Dominance تتر (USDT.D) :** دامیننس تتر را در تایم فریم روزانه ، تحلیل ۵ مرحله میکنیم ، بررسی میکنیم که تحلیل دامیننس تتر خلاف پوزیشن ما سیگنال ندهد . اگر دامیننس خلاف پوزیشن ما سیگنال داد ، اهرم را کاهش می‌دهیم.

