



پلن معامله گری

Trading Plan



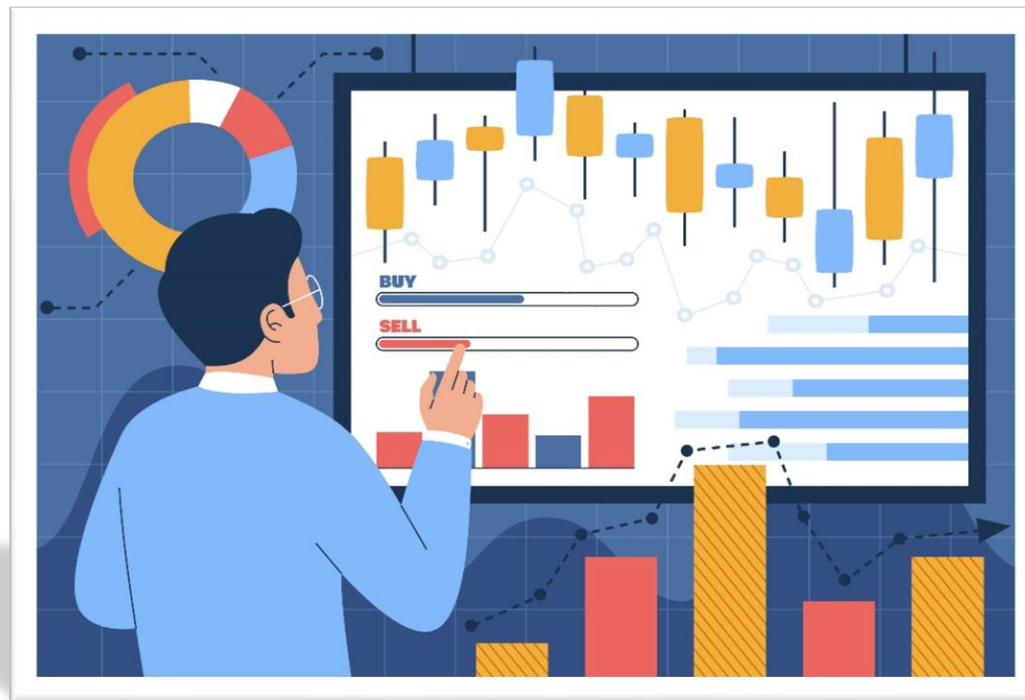
برنامه - Plan



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

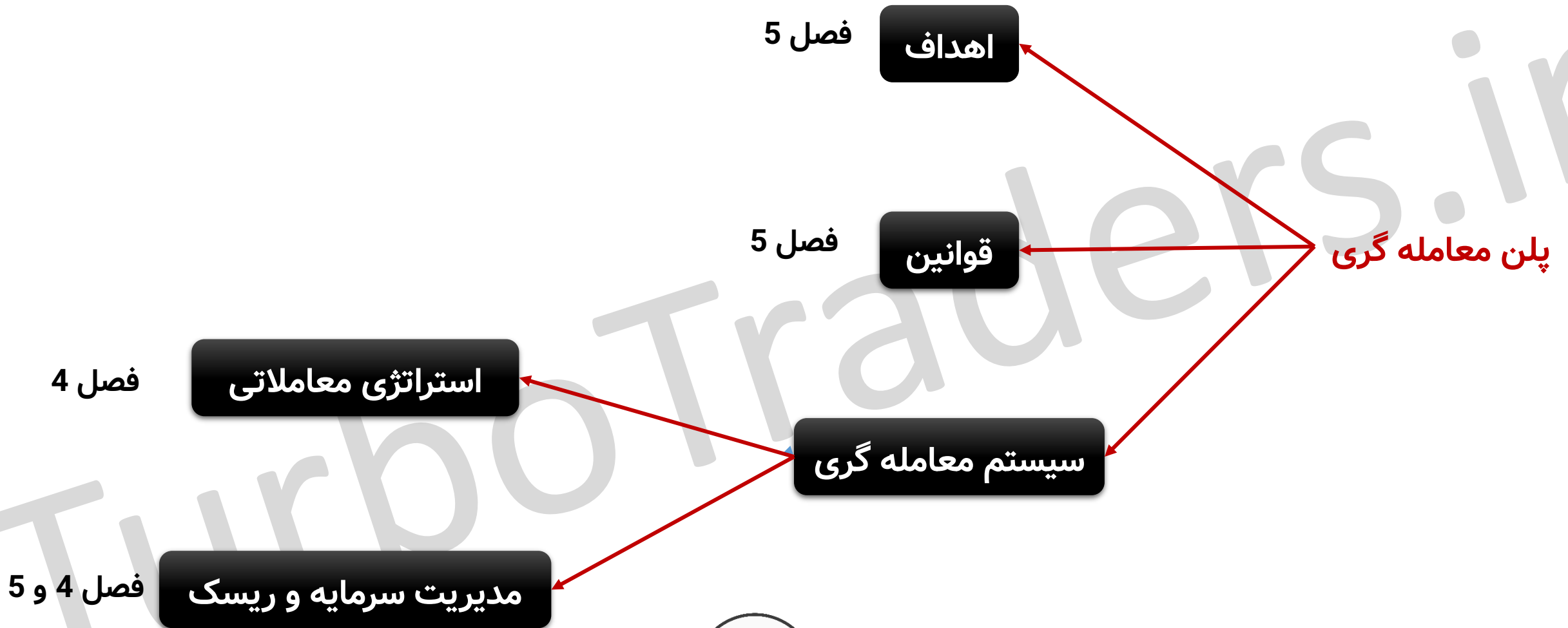


پلن معامله گری عبارت است از :

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.



هر استراتژی معاملاتی چه سوالاتی را باید پاسخ دهد؟

نوع معامله یا پوزیشن – Long or Short / Buy or Sell

1

نقطه ورود - Entry Price

2

حد سود – Take Profit

3

حد ضرر – Stop Loss

4

در تمامی موارد فوق ، باید دلیل هر مورد در استراتژی ذکر شود.



ویژگی های استراتژی - مدون بودن استراتژی



اولین ویژگی استراتژی مدون بودن آن است به معنی اینکه یکجا و جمع آوری شده باشد. از آنجایی که مطالب آموزشی در بازارهای مالی بسیار زیاد است. تصمیم گیری درباره یک معامله نیاز به انسجام و نظم ذهنی دارد. مدون بودن استراتژی، به ساختار آن نظم بخشیده و هرچه این ویژگی با حوصله، نظم و دقت بیشتری انجام گیرد میتواند در ذهن انسان بیشتر بماند. به عنوان مثال ایجاد فهرست یا مرحله ای کردن استراتژی میتواند کمک بزرگی به منظم کردن آن بکند.



ویژگی های استراتژی - مکتوب کردن استراتژی

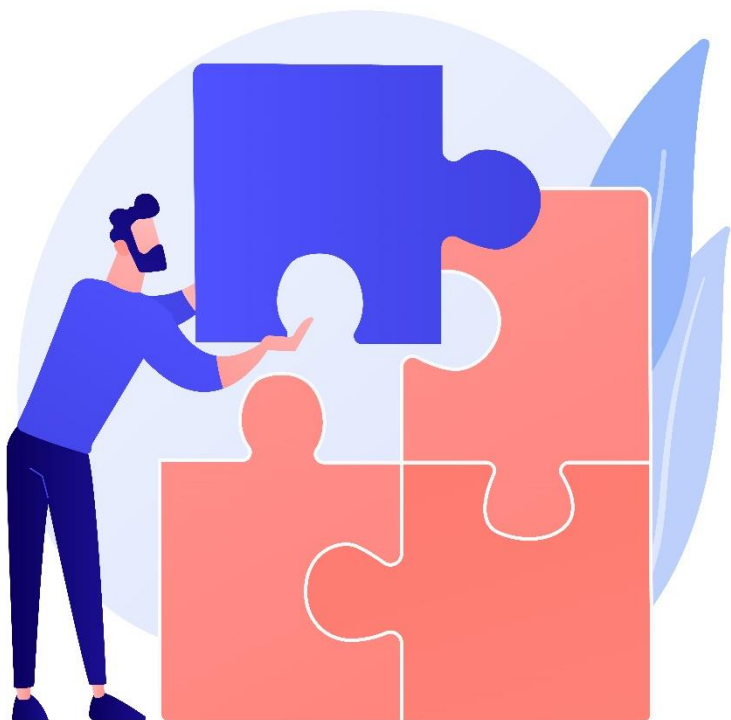
به سه دلیل مهم استراتژی باید مکتوب شود :

- راحت سپردن آن به ذهن
- افزایش قدرت پایبندی به آن
- ایجاد قابلیت ارزیابی

با توجه به پیچیدگی مطالب آموزشی در بازار های مالی پایبندی به استراتژی و سپردن جزئیات آن به ذهن بدون مکتوب کردن آن کار بسیار سختی می باشد . علاوه بر آن به دلیل این فرار بودن مطالب ، امکان ارزیابی صحیح و دقیق استراتژی دشوار می شود ، بنابر این مکتوب کردن استراتژی امری ضروری و مهم به شمار می رود.



ویژگی های استراتژی - شفاف بودن استراتژی

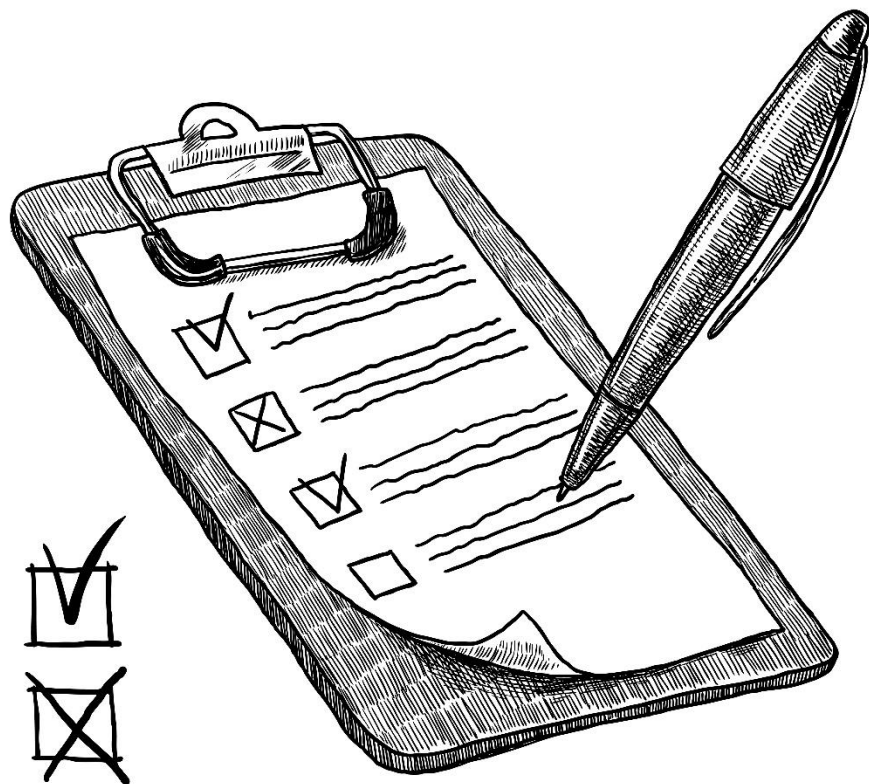


وقتی استراتژی مکتوب میشود برای هر تصمیمی در هر شرایط ،
دلیل مشخصی باید وجود داشته باشد و پاسخ به هر سوال باید
مشخص و شفاف باشد و ابهام برانگیز نباشد در غیر این صورت باید
استراتژی ویرایش شده و دلیل موردنظر قید شود.
حتی اگر در شرایط خاص اقدامی صورت نمیگیرد باید دلیل آن
روشن و شفاف در استراتژی مکتوب گردد.
اگر در تصمیم برای باز کردن یک معامله خود از عبارت "نمیدانم"
استفاده کردید باید رویکرد شما در این شرایط ، در متن استراتژی
قید شود.

- معامله در این نقطه مجاز است : چرا ؟
- معامله در این نقطه مجاز نیست : چرا ؟



ویژگی های استراتژی - قابل ارزیابی و تست کردن



- استراتژی باید قابلیت ارزیابی داشته باشد ، به عبارتی دیگر بتوانیم بفهمیم در صورت صحیح اجرا کردن آن سودآور می باشد یا خیر ؟
 - اگر استراتژی در شرایط مشابه ، دو دستور مخالف برای معامله را بدهد امکان ارزیابی در آن وجود ندارد .
 - اگر استراتژی مبهم باشد ، امکان ارزیابی آن وجود ندارد .
- ما به کمک ژورنال نویسی و انجام فرآیند بک تست و فوروارد تست در ژورنال معاملاتی ، علاوه بر تست میزان سودآوری و صحت عملکرد استراتژی ، با ابعاد و چالش های آن نیز آشنا خواهیم شد.
- درباره ژورنال نویسی و انجام فرآیند تست در اسلاید های آینده مفصل صحبت خواهیم کرد.**



اهمیت استراتژی معاملاتی با یک مثال

فرض کنید در یک کارخانه یک دستگاه تولیدی کفش وجود دارد.

این دستگاه شامل قطعات مختلفی می باشد که با نظم و آرایش خاصی در کنار هم به وظیفه خود عمل میکند . اگر بخواهیم استراتژی معاملاتی را به این دستگاه تشبیه کنیم میتوان اجزای آن را به شکل زیر شباهت داد :

- اجزای تشکیل دهنده دستگاه (مثلاً چرخ دنده ، پیچ ، تسمه و ...) :
- آموزش های علمی بازارهای مالی
- مواد اولیه یا خام : پول و سرمایه وارد شده به بازار
- کفش های تولید شده : سودآوری دستگاه یا استراتژی
- تست اولیه دستگاه قبل ورود مواد خام با حجم قابل توجه :
- ارزیابی استراتژی قبل از استفاده اصلی



اهمیت تست استراتژی معاملاتی با یک مثال

مشابه مثال روبرو ، گاهی اوقات استراتژی معاملاتی در فرآیند تست ، نه تنها به سودآوری منجر نمی شود بلکه ضرر های پی در پی را به دنبال دارد. در این شرایط باید از ورود مواد اولیه (پول) به دستگاه جلوگیری کرد و دستگاه را خاموش کرد و مجدداً درستی عملکرد آن را بررسی نمود.

apararat.com/sanayepress.com



مدرس : مهندس سعید گلوی



نسبت ریسک به ریوارد

Risk / Reward Ratio



Risk

Reward

نسبت ضرر به پاداش (Risk/Reward Ratio) یا نسبت ریسک به پاداش ، یک محاسبه ریاضی است که توسط سرمایه گذاران ، برای اندازه گیری نسبت میزان ریسک یا ضرر احتمالی یک معامله ، به سود پیش بینی شده ی آن ، استفاده می شود. در واقع نسبت ریسک به ریوارد، به صورت تقسیم کردن میزان ریسک قابل قبول بر مقدار سود احتمالی ، محاسبه می شود. معنای ریسک و ریوارد در این محاسبه ریاضی به صورت روبرو در نظر گرفته می شود:



نسبت ریسک به پاداش یا Risk / Reward یا R/R



- **ریسک** : حداکثر پول یا درصدی که حاضریم در یک معامله و یا سرمایه گذاری خاص، از دست بدهیم.

- **ریوارد یا پاداش** : مقدار پولی یا درصدی که پیش بینی می کنیم که در یک معامله یا سرمایه گذاری به خصوص ، حاصل شود.



نسبت ریسک به پاداش یا Risk / Reward یا R/R

Risk Reward Ratio Chart



معمولاً معامله‌گران نسبت ریسک به ریوارد را به صورت Risk:Reward نشان می‌دهند. برای مثال، اگر نسبت ریسک به ریوارد در یک معامله ۱:۵ باشد، به این معنی است، که سرمایه‌گذار در این معامله، نهایتاً می‌پذیرد که ۱ دلار ضرر کند و در مقابل توقع دارد که در صورت موفقیت معامله، ۵ دلار سود کسب کرده باشد.



نسبت ریسک به پاداش یا Risk / Reward یا R/R

Risk Reward Ratio Chart



یا برای مثال تصور کنید ، که یک ارز دیجیتال را در قیمت ۱۰۰۰ دلار بخرید. از طرفی توقع داشته باشید ، که سرمایه گذاری شما با ۹۰ دلار سود همراه باشد ؛ و در مقابل ، تنها حاضر باشید که ۳۰ دلار ضرر کنید . در این صورت با تقسیم کردن ۳۰ دلار بر ۹۰ دلار ، به نسبت ریسک به ریوارد ۱:۳ می رسید ، که یک نسبت تقریباً خوب برای انجام یک معامله محسوب می شود



نسبت ریسک به پاداش یا Risk / Reward یا R/R

$$\frac{R}{R} = 1:2 \text{ یا } \frac{R}{R} = 2$$

در اغلب موارد، معامله‌گران حرفه‌ای و سرمایه‌گذاران باتجربه، میزان نسبت ریسک به ریوارد را تقریباً بین ۱:۲ و ۱:۳ در نظر می‌گیرند. یعنی توقع دارند که به ازای هر ۳ واحد سود، نهایتاً ۱ واحد ضرر کنند. معمولاً این معامله‌گران، میزان این نسبت را با استفاده از ابزار روبر، در معامله‌ی خودشان علامت‌گذاری می‌کنند:



نسبت ریسک به پاداش یا Risk / Reward یا R/R



نسبت ریسک به ریوارد به ما می‌گوید که آیا معامله ارزش انجام دادن را دارد یا نه. معمولاً معامله‌گران به معاملاتی با نسبت ریسک به ریوارد بیشتر از ۱:۲ وارد نمی‌شوند. این مسئله باعث کنترل میزان ریسک معاملات شما می‌شود. همان‌طور که بنجامین گراهام (Benjamin Graham)، نویسنده و اقتصاددان آمریکایی، می‌گوید: «هدف یک سرمایه‌گذار نباید تحمل ریسک بالا، برای کسب سود باشد. من فکر می‌کنم که یک سرمایه‌گذار باهوش، باید فرصت‌های سرمایه‌گذاری‌ای را پیدا کند که احتمال کسب سود در آن‌ها بیش از دوبرابر میزان ریسک باشد.»



$$\frac{win}{Loss} \times 100$$

درصد موفقیت یا برد

Win Rate



درصد موفقیت یا برد



درصد موفقیت یا وین ریت به ما نشان می‌دهد که چند درصد از معاملات ما ، به حد سود برخورد می‌کند یا به عبارتی برنده میشود . مثلاً زمانی که گفته می‌شود وین ریت فلان استراتژی برابر با ۶۰ درصد است ، یعنی به طور میانگین ، از هر ۱۰۰ معامله‌ای که با این استراتژی انجام می‌شود ، ۶۰ تای آن به سفارش حد سود خورده و ۴۰ تای آن به سفارش حد ضرر خورده است.



$$\frac{1}{winRate} \propto \frac{R}{R}$$

به طور کلی رابطه ای که بین این دو مفهوم وجود دارد ، به این شکل است که افزایش هر کدام از آن ها ، میتواند دیگری را کاهش دهد . به عبارت دیگر معمولا و در صورتی که وین ریت معامله گری بالاتر باشد ، نسبت ریسک به ریوارد آن فرد کاهش پیدا میکند . همچنین اگر R/R معامله ها بیشتر باشد ، میزان وین ریت هم کاهش می یابد.



نکته مهم : وین ریت با چه ریسک به ریواری ؟

وین ریت

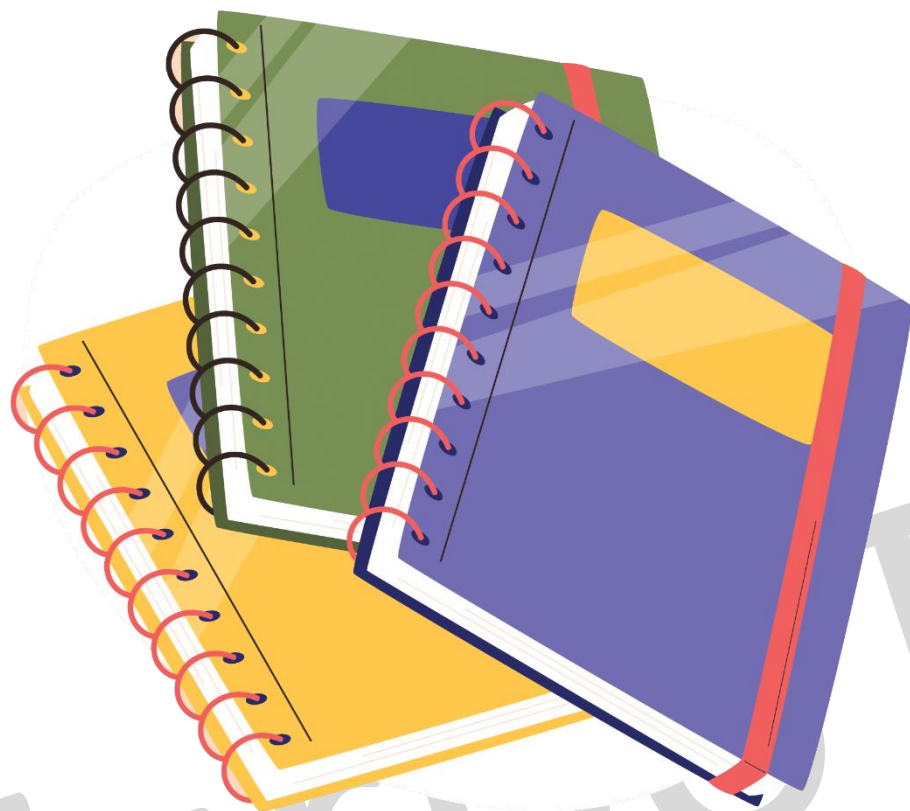
با چه R/R ری ؟

به یاد داشته باشید :

وقتی صحبت از درصد موفقیت یا وین ریت برای یک استراتژی یا معاملات خود میکنید باید به دنبال آن R/R معاملات خود را نیز با این درصد موفقیت ذکر کنید ، در غیر این صورت درصد موفقیت ابهام بر انگیز است .

به عنوان مثال استراتژی ایکس ، وین ریت ۵۰ درصد با $R/R=2$ دارد . (نسبت ریسک به ریوارد بعد از وین ریت قید شود)





ژورنال معاملاتی

Trading Journal



ژورنال معاملاتی – Trading Journal



ژورنال معاملاتی به مجموعه ای مکتوب بر روی یک دفترچه یادداشت گفته میشود که در آن یک تریدر معاملات گذشته خود را یادداشت میکند. یادداشت کردن اطلاعات با اهداف زیر می باشد:

- تست عملکرد استراتژی و سودآوری آن
- تحلیل میزان سودآوری استراتژی
- یادگیری و تمرین استراتژی
- کنترل احساسات معامله گری و مشکلات روانشناسی
- پیدا کردن نقاط ضعف و قوت استراتژی و جلوگیری از اشتباهات تکراری



کاربرد ژورنال معاملاتی

نوشتن ژورنال معاملاتی زمان زیادی می‌برد، اما استفاده درست از آن می‌تواند ارزش دارایی شما را چند برابر کند. شاید در نگاه اول، نوشتن یک ژورنال معاملاتی برای تریدرها کار بی‌فایده و خسته‌کننده‌ای به نظر برسد، اما در طولانی مدت، یک تریدر معمولی را به یک معامله‌گر حرفه‌ای و موفق تبدیل می‌کند. با ثبت جزئیات معاملات می‌توانید از معاملات موفق و حتی ناموفق درس بگیرید و فعالیت‌های معاملاتی خود را بهبود ببخشید. ثبت جزئیات در معاملات فارکس به تریدر کمک می‌کند تا نتیجه استفاده از استراتژی‌های معاملاتی خود را مورد تجزیه و تحلیل قرار داده و از موفق‌ترین آن‌ها در معاملات آینده خود استفاده کند

ایجاد چارچوب برای
استراتژی‌های معاملاتی تریدر



جلوگیری از انجام
معاملات احساسی



شناسایی نقاط
قوت و ضعف تریدر



جلوگیری از انجام
معاملات پرریسک



انواع معاملات در ژورنال

معاملات در ژورنال معاملاتی از نظر زمان بررسی استراتژی روی آنها به دو دسته تقسیم میشوند :

تست برگشت - Back Test : روشی است که برای بررسی یک استراتژی معاملاتی به کمک داده‌های گذشته استفاده می‌شود. به عبارت دیگر بک تست با استفاده از داده‌های گذشته، یک استراتژی معاملاتی را می‌سنجد

تست پیشروی - Forward Test : در ازای آزمایش استراتژی واحد روی گذشته قیمت ، آن را در معاملات زنده و کنونی آزمایش می‌کنیم که باعث خطای کمتر و قابلیت آزمایشی متناسب‌تر با شرایط مارکت می‌شود. تست پیشروی ، راهی برای شبیه‌سازی معاملات واقعی است و شامل پیروی از منطق سیستم در بازار زنده خواهد شد.

