

سیستم معاملاتی یا TRADING SYSTEM

بازار جهانی با رشدی شگفت انگیز در حجم مبادلات، تبدیل به پر حجم ترین بازار مالی جهان شده است به طوری که حجم معاملات روزانه بازار ارز آن در برخی روزها به ۱۰۰۰ میلیارد دلار می رسد. ورود و خروج این حجم پول به این بازار باعث گردیده که این بازار پر ریسک ترین و نقدشونده ترین بازار جهانی شود و به همان نسبت برای نوسانگیری در آن نیاز به برنامه ریزی و دیسپلین یا انضباط کاریست.

اگر به بازار کسب و کار دقت کنیم، همواره کارفرمایان و کار آفرینانی موفق هستند که در هر مرحله از بیزنس خود میدانند به دنبال چه هستند و این هدفمندی به قبل از شروع کار یا بیزنسنشان برمیگردد. در طرح کسب و کار یا بیزنس پلنی که قبل از شروع داشته اند و بر اساس آن برنامه ریزی نموده اند.

در بازار جهانی نیز هدفمندی قبل معاملات، از عوامل اصلی و ماندگاری ست. تریدینگ سیستم ابزاری ست که منجر به برنامه ریزی یا نوشتن تریدینگ پلن میگردد که همان بیزنس پلن بازار جهانی می باشد.

تریدینگ سیستم مجموع قوانینی ست که نقاط ورود و خروج به هر معامله ای را تعیین میکنند. تریدینگ سیستم یک سیستم شخصی ست و بر اساس شخصیت های متفاوت معامله گری و درصد میزان ریسک پذیری معامله گر می تواند قوانین متفاوتی داشته باشد.

تریدینگ سیستم را می توانیم بر اساس پارامترهای تحلیل تکنیکال قانون بندی کنیم یا بر اساس میزان سرمایه و همانطور که گفته شد این بستگی به شخصیت های متفاوت دارد.

این قوانین باید بتواند نقطه ورود، خروج و مدیریت ریسک هر معامله ای را به معامله گر بگوید و قالبی بسازد به نام تریدینگ پلن که شامل نقطه ورود، خروج و مدیریت ریسک می باشد. در واقع تریدینگ پلن خلاصه ای از تریدینگ سیستم است.

وقتی به ۱۰% برندگان بازارهای سرمایه و مالی میکنیم و دنبال عامل موفقیت شان میگردیم، یکی از عوامل داشتن تریدینگ پلنی ست که بر اساس تریدینگ سیستم شخصی نوشته شده و در هر معامله رعایت میشود. در واقع یکی از عوامل اصلی داشتن تریدینگ پلن و انضباط رعایت آن است.

تریدینگ سیستم تکنیکال

معمولا چارتریست ها با توجه به آنچه در مورد تکنیکال آموخته اند و می پسندند قوانین تکنیکالی را برای خود وضع میکنند و بر اساس آنها نقاط ورود و خروج خود را تعیین میکنند و آنرا به شکل یک تریدینگ پلن در آورده و معامله میکنند.

یک تریدینگ سیستم ساده تکنیکالی می تواند بر اساس خطوط ساپورت و رزیستنس (حمایت و مقاومت) و فیبوناچی باشد.

قوانین تریدینگ سیستم خطوط چه می گوید؟

۱. ساپورت خطی ست که با برخورد حداقل ۲ قیمت کف و در حالت بهتر ۳ قیمت تشکیل میشود و تنها پس تشکیل خط ساپورت و برخورد دوباره قیمت و برگشت از خط، می توانیم وارد معامله خرید شویم.
۲. رزیستنس خطی ست که با برخورد ۲ قیمت سقف و در حالت بهتر ۳ قیمت تشکیل میشود و تنها پس از تشکیل خط و برخورد دوباره قیمت به خط و برگشت آن وارد معامله فروش میشویم.
۳. خطوط فیبوناچی از بالاترین تا پایین ترین قیمت روند کشیده میشوند و در تایم فریم ۱ ساعت به پایین تنها به عنوان نقطه خروج استفاده میگردند.

این قوانین به ما می گوید زمانی که ساپورت تشکیل شد و قیمت دوباره به آن برخورد کرد و نتوانست آنرا بشکند، می توانیم وارد معامله خرید بشویم. معمولا معامله خرید ۵ الی ۱۰ پیپ بالاتر از ساپورت بهتر است که انجام شود. نقطه ی حد ضرر می تواند کمی پایین تر از کف قیمتی خط ساپورت تعریف گردد و حد سود اولین درصد فیبوناچی تعریف شود که از بالاترین قیمت تا پایین ترین قیمت کشیده شده است. آنچه بسیار اهمیت دارد حجم معامله است که معمولا بهترین حجم ۱۰٪ دارایی برای معاملات است. بطور مثال برای هر ۱۰۰۰ دلار دارایی، بهتر است حجم معامله ۱۰۰ تعریف شود. این تریدینگ سیستم بسیار ساده، اجازه ورود در هر زمانی را به ما نخواهد داد و همین قوانین باعث میشود مقدار زیادی از استرس معامله گر بکاهد و دیدگاهی تکنیکالی و سیستمی به او بدهد.

معامله فروش نیز برعکس این معامله تعریف میشود.

تریدینگ سیستمهای دیگری نیز بر اساس سایر ابزار و پارامترهای تکنیکال ساخته میشوند. پارامترهایی مانند:

- میانگین های حرکتی

- استاتستیک ها

- اوسیلاتورها

RSI -

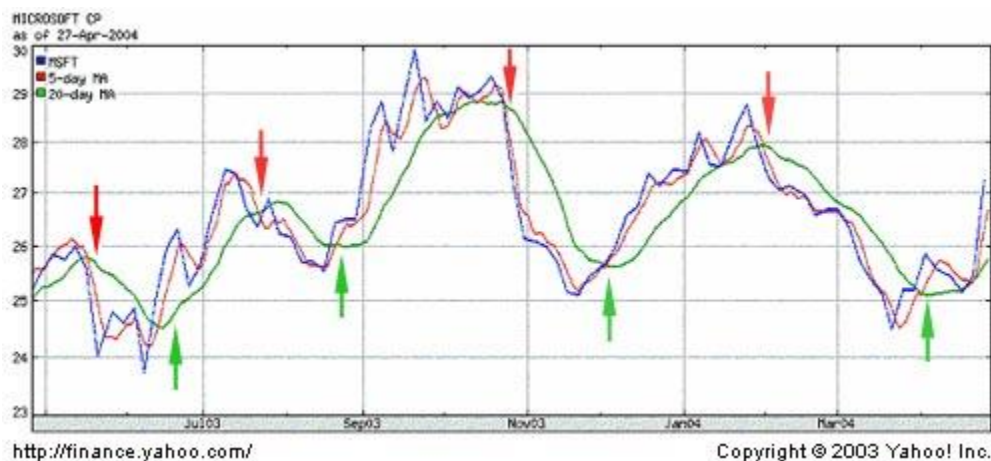
- بولینگرها

- و غیره

اغلب اوقات دو یا چند فرم از اندیکاتورها در ساخت یک قانون نقش دارند و معمولا ترکیبی از چند اندیکاتور در تصمیم بهتر کمک بیشتری میکنند.

برای مثال سیستم کراس میانگین های حرکتی که جزو سیستم های محبوب تریدرها یا معامله گران استفت ترکیبی از میانگین های بلند مدت و کوتاه مدت است.

این سیستم میگوید وقتی میانگین کوتاه مدت بالای میانگین بلندمدت کراس کرد، زمان خرید است و برعکس آن زمان فروش.



یک نوع سیستم RSI فقط از یک اندیکاتور و آن هم RSI استفاده میکند و تنها یک قانون دارد که می گوید تنها زمانی که قیمت بالای یک خط خاص بود می توانید وارد معامله خرید شوید.

تجربه نشان میدهد که تریدینگ سیستم هایی که از ترکیب چند اندیکاتور ساخته میشوند کارایی بهتری در طول زمان دارند و موفقیت آن بستگی به این دارد که تا چه اندازه قوانینش کارآمد باشند. بنابراین معامله گرانی که درصدد ویرایش قوانین سیستم خود هستند، در طول زمان نتیجه ی بهتری و سود بیشتری میگیرند. تریدینگ سیستم مانند هر سیستم دیگری در طول زمان نیاز به بازبینی و ویرایش دارد و شاید لازم باشد پارامترهای هر قانونی در طی معاملات و در طول زمان ویرایش یا عوض گردد.

تریدینگ سیستم بر اساس مقدار سرمایه

نوع دیگر تریدینگ سیستم که می تواند بسیار ساده باشد براساس مقدار سرمایه است. مثلا معامله گری براساس ریسک پذیری اش یا مقدار سرمایه اش، در کف قیمتی که در نظر دارد وارد معامله خرید میشود و حد ضرر خود را ۳% سرمایه اش میگذارد و حد سود خود را ۵% سرمایه ی کل .

معامله گر دیگری همین پوزیشن یا معامله را تقسیم بر سه و در ۳ معامله متفاوت میگذارد تا سبب معاملات خود را متنوع کند. هر معامله گری با توجه به سرمایه و ریسک پذیری و دانشی که از بازار دارد، میتواند یک سیستم شخصی طراحی کند و در طول زمان با کسب تجربه و شناخت بیشتر از بازار می تواند این سیستم را ویرایش بنماید.

خاطره نیکویی

تیر ماه ۱۳۹۵