

مجموعه مقالات

تولد یک اکسپرت

تحلیل گر بازار سرمایه

طراح و برنامه نویس سیستم های معاملاتی

مهندس فرهاد سلطانی



اکسپرت چیست؟

اکسپرت در لغت به معنی "متخصص و کارشناس" است. هرگاه استراتژی مالی Financial Strategy خود را در محیط پلت فرم معاملاتی برنامه نویسی کرده و اجازه دهیم تا کامپیوتر جای ما عملیات خرید یا فروش را انجام دهد اکسپرت گویند.

در دسته بندی انواع روشهای تحلیل سه روش وجود دارد:

۱-تحلیلگر فاندامنتال Fundamental analyst

۲-تحلیلگر تکنیکال Technical Analyst

۳- ترکیبی از دو حالت قبل که تکنو فاندامنتال گویند.

تحلیگران تکنیکال از یکسری نمودار Chart و یکسری ابزارهای گرافیکی که به آن اندیکاتور Indicator می گویند استفاده می کنند مانند Moving, Atr, Sar, ... و برای اینکه نماد رو خرید Buy کنند بعضا از ترکیب این اندیکاتورها و یکسری ابزارها و روشهای دیگر استفاده می کنند که از ترکیب این ابزارها قواعدی ساخته میشود که به آن استراتژی گویند. برای مثال:

مثلا یه استراتژی ساده :

۱. دو اندیکاتور موینگ اوریج Moving Average با پریودهای زیر

Moving Average 1: Period=11 , Price close , Shift=0

Moving Average 2: Period=21 , Price close , Shift=0

۲. یک اندیکاتور Rsi

Rsi Period=11, Price=Close

قواعد استراتژی :

۱. هرگاه $Ma\ fast > Ma\ Slow$ که به اصطلاح می گویم کراس Cross کرد و شیب به سمت بالا باشد می گویم محیط Buy شده و

هرگاه $Ma\ Fast < Ma\ Slow$ شد می گویم محیط فروش یا Sell شده

۲. مرحله بعد چک می کنیم آیا Rsi در محدوده زیر ۵۰ برای Buy خرید و بالای ۵۰ برای فروش هست

۳. مقدار Buy sl : کوچک ترین Low پنج تا کندل قبل از ورود

۴. مقدار Sell Sl : بزرگترین High پنج تا کندل قبل از ورود

۵. مقدار $Tp=0$ چون روندی است

۶. سیستم تریل من هم از Parabolic Sar

۷. میزان لات = 3% از کل سرمایه در هر پوزیشن

فرض قواعد بالا استراتژی من باشد و حالا این قواعد را فرضا در بازار سهام می خواهم مورد بررسی قرار دهم. باید تک تک سهامها نمودارش را باز کنیم و ببینیم آیا شرایط بالا را دارد تا خرید کنیم!!! خوب حالا کل نمادهای بورس ۲۴۰۰ (فعال و غیر فعال) و حدود ۵۰۰ تا ۶۰۰ نماد هم بطور متوسط باز هستن زمان زیادی خواهد برد و یه کار کسل کننده است اینجاست که با داشتن اکسپرت همه این مشکلات حل خواهد و ظرف چند دقیقه همه اینها بررسی میشن.

پس به دلایل بالا و خیلی دلایل دیگر ضرورت داشتن اکسپرت Expert اهمیت پیدا می کنند.

پس اکسپرت یک برنامه کامپیوتری است که استراتژی ما تبدیل به برنامه شده و جای ما رفتار می کند. پس برای نوشتن اینچنین برنامه ای باید به یک برنامه نویس کامپیوتر که هم برنامه نویسی بلد باشه + بورس و سهام و آتی سکه و.. بدونه چیه و تجربه اینکار رو داشته باشه باید مراجعه کرد تا بتونم با سفارش اکسپرت به برنامه نویس اکسپرتم خودم رو سفارشی بسازم.

حالا برنامه نویس چیکار می کنه:

برنامه نویس میاد از یک پلت فرم معاملاتی که توش بشه برنامه نویسی کرد مثل برنامه معروف متا تریدر MetaTradr که برای سهام ایران نرم افزار پارس رسا (متا ورژن ۴) و مفیدر تریدر (متا ورژن ۵) استفاده می کنه و در این پلت فرم در بخش برنامه نویسی اش که در متا تریدر MetaEditor هست برنامه نویسی می کنه و پس از تست و اتمام کار اون فایل رو به من میده تا بتونم روی حسابم چک کنم استفاده می کنم.

برنامه MetaTrader ماله یه شرکت روسی به نام Meta Quotes متاکویتز که انصافا هم خوب دارن کار میکنه و بخش پشتیبانی اونها هم قوی کار میکنن.

راههای داشتن یک اکسپرت:

۱. از اینترنت دانلود کنیم
 ۲. از دوستی بگیریم
 ۳. از کتابی بخونیم
 ۴. یه شخصی داشته باشه و اون رو روی حساب ما ران کنه و بخشی از سود ما رو بگیره
 ۵. بهترین حالت اینکه خودم بسازم.
- یه نکته خیلی مهم اکسپرت خوب **مرغ تخم طلاست** و هر ادم عاقلی مرغ تخم طلاشو که نمی فروشه پس باید احتیاط کرد .
راههای داشتن استراتژی خوب:

۱. از اینترنت دانلود کنم مثل سایت [فراچارت](#) یا سایت [استراتژی](#)
۲. با تجربه خودم بدست بیارم
۳. دوستی به من بده
۴. از کتاب بخونم

بازم مسئله **مرغ تخم طلا** مطرح میشه!!! ولی یه نکته داره استراتژیهای عمومی کامل نیستن اما غلط هم نیستن پس بهتره تا میتونم استراتژی بخونم و مزایا و معایب هر کدوم رو در بیارم بعد پیام بر اساس تجمیع تفکر استراتژیهای که مطالعه کردم استراتژی خودم رو بسازم. تو این مرحله هر چقدر وقت بذاریم ارزش داره.

حالا استراتژی رو هم ساختم چطور اکسپرت کنم:

۱. سفارش اکسپرت رو بدم یه برنامه نویسی متا تریدر که واسم اکسپرت رو بسازه Expert
۲. خودم کد بنویسم

بهترین حالتش حالت دومه منتها یه مسئله اینکه کدنویس+طراح استراتژی بهتره یکی نباشن چونکه خطا بالا میره و دلیل دیگه اینکه برنامه نویسی یه کار تخصصی و تا من به اونجا برسم زمان میبره پس بهتره با یه برنامه نویسی MQL صحبت کنم و در شروع اون بهم کمک کنه بعد از اینکه به یه استراتژی خوب رسیدم مطمئنم استراتژیهای دیگه رو بسازم پس از اونجا به بعد خودم به موازات کارای دیگم میرم برنامه نویسی MQL رو یاد میگیرم و خیالم راحت یک استراتژی دارم و درآمد ماهانه درآمد و هزینه کردن کلاس آموزشی برام توجیه پیدا می کنه.
یه نکته دیگه اینکه برای ساخت یک اکسپرت خوب باید تستهای خوبی روش بشه که اینجا به نظرم از یه شخص دیگه استفاده شه که به آمار مسلط باشه و بتونم با استفاده از روشهای آماری خطای سیستم رو بگه. خوبیش اینکه یکی استراتژی رو طراحی میکنه یکی کد می نویسه یکی هم خطا رو درمیاره و امکان نداره جواب نگیرین فقط اصل تمرکز فراموش نشه.