

توقف زیان متحرک در فارکس (Trail Stop Loss)

old.forexyar.com/trail-stop-loss-in-forex

۸ خرداد ۱۳۹۸

سلام بر معامله گران عزیز؛ مقاله امروز ما بر موضوع **توقف زیان متحرک** به عنوان یکی از روش های مدیریت معاملات تمرکز دارد. آیا **توقف زیان متحرک** برای شما منطقی و معنی دار است؟

یا بهتر است از **حد سود take profit** و رعایت **نسبت سود به ریسک (R:R)** استفاده کنیم؟ در این مقاله پرسش های مطرح شده و موارد دیگری بحث خواهد شد، اما این موضوع مسلماً یک بحث باز است که توصیه می کنم تجربیات خود را درباره آن به اشتراک بگذارید و در قسمت پایین در بخش نظرات، بازخورد ارائه کنید.

آیا از **توقف زیان متحرک [تریلینگ استاپ]** استفاده می کنید؟

آیا قبل از استفاده از **توقف زیان متحرک**، کارآیی آن را امتحان کرده اید؟

اگر از آن استفاده نمی کنید، دلیل شما چیست و به نظر شما چه ابزاری بهتر است؟

گزینه های توقف زیان متحرک (تریلینگ استاپ)

روش های مختلفی برای اجرای **توقف زیان متحرک** وجود دارد. در اینجا فهرستی ارائه می شود:

- (۱) **توقف زیان متحرک فوری** در همان بازه زمانی.
- (۲) **توقف زیان متحرک فوری** در بازه زمانی بزرگتر.
- (۳) **توقف زیان متحرک** پس از رسیدن به هدف.
- (۴) ترکیبی از **حد سود آشکار** و **توقف زیان متحرک**.
- (۵) **توقف زیان** با **تحرك** روبه کاهش در سطوح بالاتر نسبت سود به ریسک R:R
- (۶) **اختیاری** (نسبت به تصمیم بعدی باز باشد: نه حد سود و نه **توقف زیان متحرک**)

روش های مختلفی برای استفاده از توقف زیان متحرک وجود دارد:

- (۱) میانگین متحرک
- (۲) باند بولینگر
- (۳) فراکتال
- (۴) نوسان گیری (سوئینگ) بالا، نوسان گیری (سوئینگ) پایین
- (۵) حمایت و مقاومت
- (۵) **توقف منحنی سهمی (پارابولیک)**

به نظر شما کدام گزینه بهتر است؟ کدام روش های دیگر را به فهرست بالا اضافه می کنید؟

میزان موجودی توقف زیان متحرک

مزیت توقف زیان متحرک این است که به معامله گر فارکس اجازه می دهد برخی از سرمایه گذاری های سودآور آنها اجرا شود و برخی از زیان های خود را قطع می کنند. این موضوع یکی از مفاهیم نیرومند معاملات فارکس است، که در آن افزایش متوسط سود R:R در مقابل متوسط زیان R:R یکی از بخش های مؤثر و محوری سودآور شدن است.

برخی نکات مهمی که شایسته توجه است:

(۱) هرگونه توقف زیان متحرک باید قبل از پیاده سازی از لحاظ کار آبی و سودآوری آزمایش شود.

معامله گر فارکس باید برای میزان قابل قبولی از معاملات (به میزان حداقل دویست معامله) چگونگی عملکرد توقف زیان های متحرک مختلف در مقایسه با استراتژی خود را امتحان و بررسی کند تا برای تشخیص اینکه آیا روش توقف زیان متحرک در مقایسه با حد سود آشکار می تواند بهبود ایجاد کند یا خیر و در صورت پاسخ مثبت میزان بهبود ایجاد شده بینش لازم را کسب کند.

آنچه اهمیت دارد مرور داده های طولانی مدت از قبیل سود آوری، حداکثر افت سرمایه، متوسط تعداد سود، متوسط تعداد زیان، تعداد حداکثر زیان ها، تعداد سودهای بیش از حداکثر زیان در مقایسه با کل سودها، است. این اطلاعات درباره اینکه کدام سیستم بهترین موجودی حساب را دارد جزئیاتی فراهم می کند.

(۲) از تجزیه و تحلیل بیش از حد موضوع بپرهیزید.

درست است، این بخش از معاملات فارکس شایسته توجه و صرف زمان است، اما هر توقف زیان متحرک و هر حد سود آشکار مزایا و معایب معینی دارد.

معامله گر ان فارکس باید ببیند که یک روش بخصوص هرگز نمی تواند کافی و کامل باشد. همواره مثال هایی وجود خواهد داشت از مواردی که ۱ توقف زیان متحرک بهتر از دیگری عمل می کند. برای موفقیت باید این واقعیت را بپذیریم.

روانشناسی معاملات

هر یک از شیوه های مدیریت معاملات انتخاب شده همیشه باید با روانشناسی معاملات هماهنگ و همگام باشد. دقیقاً مانند هر موضوع دیگری، وجود هماهنگی بین استراتژی، مدیریت ریسک، مدیریت پول هر معامله گر و روانشناسی او حیاتی است.

مزایا و معایب

هر دو ابزار توقف زیان متحرک و سطوح حد سود دارای مزایای و معایب معینی هستند.

مزایای توقف زیان متحرک:

الف) توقف زیان متحرک اجازه می دهد به جای اینکه فارکس برای بازار تصمیم بگیرد، بازار درباره اینکه تا چه حد می خواهد یا نمی خواهد پیش برود تصمیم بگیرد. به این ترتیب معامله گر فارکس «بر موج سوار است» و «و همراه جریان غالب پیش می رود».

ب) هنگامی که از توقف زیان متحرک استفاده می شود معامله گر ان فارکس نگرانی کمتری برای سود «دادن» دارند.

توقف زیان متحرک بر اساس این واقعیت صریح که معامله گر فارکس توقف زیان های متحرک خود را تا سطحی حرکت می دهند که به ورودی نزدیک تر باشد، و به این ترتیب زیان یا سود کمتری را «حبس می کنند»، به محافظت از سرمایه معاملات کمک می کند.

از مزیت های روانشناختی این آگاهی این است که معامله گر می داند معاملات او از وضعیت جلو بودن با $R:R$ ، $2:1$ به زیان کامل افت نمی کند. تصور افت معامله از وضعیت مثبت می تواند مشکلات جدی ایجاد کند، مثلاً معامله گر فارکس ممکن است معامله ای را زودتر از آنچه برنامه ریزی شده است، معاملات را ترک کند.

(ج) گهگاه- توقف زیان متحرک امکان سود انبوه را فراهم می کند. چنین سودهای انبوهی می تواند موجب جهش منحنی ارزش دارایی به سطح کاملاً جدید شود.

مزایای حد سود:

(الف) حد سود منحنی ارزش دارایی را هموار می کند. توقف زیان متحرک از توانایی بالقوه ایجاد سودهای کوچک، زیان های کوچکتر، و گهگاه سودهای بزرگتر برخوردار است، که باعث می شود منحنی ارزش دارایی نوسان بیشتری داشته باشد. حد سود در مقایسه با توقف زیان متحرک منحنی ارزش دارایی هموارتری دارد زیرا پاسخ همیشه ساده است: یا سود یا زیان.

(ب) محاسبه نسبت سود به ریسک برای حد سود آسان تر است زیرا سود بالقوه تعیین شده است.

(ج) حد سود مستلزم زمان مدیریت معامله کمتری است. هنگامی که معامله گر فارکس می خواهد با سطوح واضح زیان یا سود بازار را ترک کند، ایجاد ذهنیت «تنظیم کن و فراموش کن» آسان تر خواهد بود. توقف زیان متحرک نیازمند توجه است.

انتخاب استراتژی

در نهایت، بسیار مهم است که استراتژی خود را بشناسید و درباره اینکه کدام رویکرد می تواند مناسب تر باشد تأمل کنید.

معامله گر روزانه ممکن است که نخواهد از توقف زیان متحرک استفاده کند زیرا قصد دارد موضع معاملاتی خود را قبل از بسته شدن روز معاملات ببندد و/یا می تواند از سود بسیار زیادی در مقایسه با محدوده روزانه مورد انتظار صرف نظر کند.

اگر چه معامله گران نوسانی (سوئینگ) چنین محدودیت زمانی را ندارند. با این حال آنها نیز لازم است توقف زیان متحرک را به نوعی ایجاد کنند که از لحاظ زمانی قابل اجرا باشد، زیرا معامله گران فارکس نمی توانند بازار را ۲۴ ساعته و در تمام ۵ روز هفته پایش کنند.

این امر می تواند به معنای ایجاد توقف زیان متحرک باشد که می تواند با یک یا دو بار بررسی نمودارها در طول روز پایش شود یا به وسیله معامله در گروهی از معامله گران باشد که موضع های معاملاتی را بر مبنای ثابتی بررسی می کنند.

البته، مسلماً این پرسش نیز مطرح است که معامله گر می خواهد چه نوع استراتژی را پیاده سازی کند؟

یک استراتژی فیبوناچی از سطوح فیبوناچی به عنوان سطوح حد سود استفاده می کند. در عین حال یک استراتژی بیرون شکست خیری، می تواند برای توقف زیان متحرک بسیار مناسب باشد. با این حال برای استراتژی معامله در کانال یا دامنه، سطوح حد سود می تواند استراتژی مفیدتری باشد. یک معامله برگشتی ممکن است بخواهد توقف زیان متحرک را بعد از رسیدن به حد معینی سود در استراتژی خود بگنجانند، در حالی که تنظیمات معامله روندی می تواند به طور جدی با افزایش قیمت در یک جهت از توقف زیان متحرک بهره مند شود.