

به نام خدا

استراتژی‌های معامله

برای انجام معاملات در فارکس، بدخواه از استراتژی‌های گوناگونی می‌توان استفاده کرد. هدف از این مقاله و طبقه‌بندی ارائه شده، معرفی و تأکید بر تفاوت‌های میان این استراتژی‌ها می‌باشد.

۱. استراتژی‌های معامله در جهت روند قیمت

در استراتژی معامله در جهت روند قیمت، معامله‌گر با شناسایی جهت حرکت نوسانات قیمت، معامله خود را در مسیر روند باز کرده و سپس در انتظار ادامه مسیر در جهت روند شناسایی شده می‌نشیند. نکته مهم در بکارگیری این استراتژی اطمینان یافتن از آغاز حرکت روند در مسیر شناسایی شده است. بنابراین؛ معامله‌گر تا شناسایی کامل نشانه‌های آغاز روند، و اطمینان از وقوع آنها، هیچگاه نباید به خرید در حداقل یا فروش در حداکثر اقدام نماید. به همین دلیل، ممکن است تا زمان حصول اطمینان از حرکت روند و باز کردن معامله، حرکات اولیه و در نتیجه بخشی از سود را از دست بدهد. مسئله حائز اهمیت در انتخاب استراتژی معامله در جهت روند؛ تنظیم حساسیت آن است. استراتژی‌هایی با حساسیت بالا نسبت به تغییرات روند، شاید در روندهای قوی سودمندتر باشند اما در کنار آن احتمال خطای بیشتری نیز در شناسایی علائم دارند. در مقابل، سیستم‌های با حساسیت کمتر عکس این ویژگی‌ها را دارا می‌باشند.

بسیاری از معامله‌گران تمایل دارند در هر حرکت بازار معامله‌ای باز کرده و از آن سود ببرند. همین امر موجب می‌شود تا هر مرتبه از سیستم‌های سریع و سریع‌تری برای ردیابی روند استفاده کنند. با این حال باید توجه داشت؛ به رغم آن که سیستم‌های سریع نسبت به سیستم‌های کند در برخی بازارها سودمندتر هستند، در بیشتر آنها وضعیت به گونه دیگری است. به بیان دیگر سیستم‌های کندتر دارای سوددهی بیشتری هستند زیرا در این سیستم‌ها بر عکس سیستم‌های سریع، تعداد معاملات کم اما اکثراً موفق بوده علاوه بر اینکه حق کمیسیون کمتری هم پرداخت می‌شود. به همین دلیل، تلاش برای یافتن سیستم‌های با حساسیت هرچه بالاتر نسبت به تغییرات حرکت بازار، چندان توصیه نمی‌شود بلکه اعتقاد براین است؛ انتخاب سیستم سریع یا کند از میان استراتژی‌های بسیار گوناگون در جهت روند باید تنها براساس میزان تجربه معامله‌گر و خلیات وی باشد.

در ادامه استراتژی‌های مهم و اصلی معامله در جهت روند را برای شما آورده‌ایم:

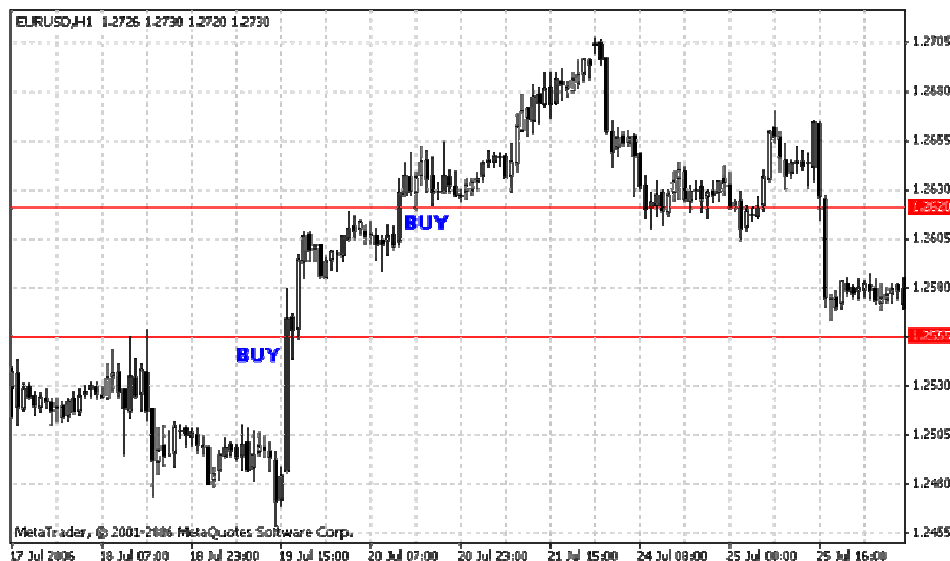
• استراتژی‌های بر مبنای میانگین متحرک

در صورت تغییر جهت روند صعودی به روند نزولی، قیمت باید میانگین متحرک را از بالا به پایین قطع کند و در مقابل؛ با تغییر جهت روند نزولی به روند صعودی، قیمت باید میانگین متحرک را از پایین به بالا قطع نماید. در بیشتر سیستم‌هایی که براساس میانگین متحرک عمل می‌کنند، این نقاط تقاطع به عنوان علائم معاملاتی محسوب می‌شوند.



• استراتژی شکست به بیرون

این استراتژی از مفهوم زیربنایی نسبتاً ساده‌ای برخوردار است: با رسیدن قیمت به نقطه حداکثر یا حداقل جدید و عبور از آن (شکست خطوط حمایت و مقاومت)، قیمت به مسیر فعلی خود ادامه خواهد داد.



۲. استراتژی‌های معامله در خلاف جهت روند

در استراتژی‌های معامله در خلاف جهت روند، معامله‌گر معامله خود را در محلی خلاف جهت روند باز کرده و پیش‌بینی می‌کند روند بازار در جهت روند پیش‌بینی شده او تغییر مسیر خواهد داد. اینگونه استراتژی‌ها عموماً برای افرادی که تمایل به خرید در حداقل قیمت و فروش در حداکثر قیمت دارند، بسیار جذاب و قابل توجه هستند. البته از آنجایی که پیش‌بینی مسیر جدید روند پیش از تأیید قطعی علائم آن بسیار پیچیده بوده و به سختی می‌توان آن را حل نمود، متأسفانه این امر از جذابیت این روش‌ها می‌کاهد. در همین راستا، مهمترین تفاوتی که می‌توان میان سیستم‌های معامله در جهت روند و سیستم‌های معامله در خلاف جهت روند قائل شد این است که سیستم‌های معامله در جهت روند خود اصلاحگر هستند اما در سیستم‌های معامله در خلاف جهت روند امکان اشتباه و ضررهای بی‌شمار بسیار زیاد است. به همین دلیل در اینگونه سیستم‌ها، استفاده از نقاط توقف ضرر^۲ (Stop-Loss) الزامی است. در غیر این صورت مجبور می‌شوید یک معامله

خرید را در تمام مدت یک روند نزولی و یا یک معامله فروش را در تمام مدت یک روند صعودی حفظ کنید. که (ممکن است بسیار خطرناک نیز باشد).

مزیت اصلی بکارگیری همزمان سیستم‌های معامله در جهت و خلاف جهت روند، این است که فرصت‌های معاملاتی متعددی در اختیار معامله‌گر قرار می‌دهد. از این رو، استفاده از این سیستم‌ها حتی با وجود کمی ضرر توصیه می‌شود. چرا که معامله به هردو روش ریسک‌های کمتری نسبت به معامله با تنها یکی از روش‌ها به دنبال خواهد داشت. از این امر می‌توان چنین نتیجه گرفت که بکارگیری هردو سیستم نسبت به بکارگیری سیستم خلاف جهت روند به تنهایی، باوجود درجه ریسک یکسان، سود بیشتری به دنبال دارد.



۳. شناسایی الگوی رفتار قیمت

همه سیستم‌های معاملاتی را از جهاتی می‌توان در گروه سیستم‌های شناسایی الگو قرار داد. حتی اگر چنین هم نباشد، حداقل موقعیت‌هایی که در آنها بر مبنای یک علامت، معامله در جهت یا خلاف جهت روند باز می‌شود، را می‌توان به نوعی در گروه الگوهای قیمت جای داد. البته؛ این الگوها آنگونه که در سیستم‌های معامله در جهت و خلاف جهت روند مرسوم است، اساساً بر مبنای نوسانات قیمت در یک مسیر خاص نیستند.

سیستم‌های الگوی رفتار قیمت را گاهی می‌توان در تصمیم‌گیری‌های معاملاتی به عنوان الگوی احتمالی به کار برد. به این منظور تلاش می‌شود تا الگوهای شناسایی شوند که به نظر می‌رسند ادامه افزایش یا کاهش قیمت را نشان می‌دهند. در واقع از چنین الگوهای به عنوان راهی برای ارزیابی رشد یا سقوط قیمت استفاده می‌شود.

در اینجا لازم به ذکر است که کلیه استراتژی‌های گفته شده همیشه به طور مشخص از یکدیگر جدا و متمایز نبوده، و با کمی تغییر می‌توان هریک را از گروهی به گروه دیگر انتقال داد.



۴. معامله در کانال

معامله در کانال بیانگر انجام معاملات در کانال تولید شده میان سطوح مقاومت یا حمایت است، به گونه‌ای که این سطوح خطوط مرزی کانال محسوب شوند. این روش‌ها برای انجام معاملات در روندهای خنثی کاربرد داشته و در روندهای صعودی یا نزولی عملاً به کار نمی‌روند. در شکل زیر؛ نمونه‌ای از معامله در کانال نشان داده شده است:



برای انجام این نوع معاملات از قوانین زیر باید پیروی نمود:

- سطوح حمایت و مقاومت باید به دقت تعیین شوند. محاسبه دقیق محل آنها به مشخص شدن واضح مرزهای کانالی که نوسانات بازار در آن انجام می‌شود، کمک می‌کند.
- با رسیدن قیمت به سطح حمایت و بازگشت آن در خلاف جهت اولیه، باید معامله خرید و با رسیدن آن به سطح مقاومت معامله فروش، باز نمود.

- معامله باز شده را باید به محض رسیدن قیمت به سطح یا همان مرز مقابل (که می تواند بنا به شرایط سطح مقاومت یا حمایت باشد)، بست. نکته حائز اهمیت در این مرحله این است که از آنجائی که بازگشت قیمت ممکن است پیش از رسیدن آن به مرزهای کانال اتفاق بیفتد، در نتیجه معامله را نیز در واقع بهتر است پیش از رسیدن کامل قیمت به سطوح مقاومت یا حمایت خاتمه داد.

مزیت چنین روش هایی افزایش حداکثر ممکن سود حاصل از باز و بسته شدن مکرر معامله در صورت ادامه مسیر روند خنثی است. در مقابل، ویژگی منفی آنها در این است که چنانچه قیمت سطوح حمایت و مقاومت را شکسته و از آنها بگذرد ضررهای پیش بینی نشده قابل توجهی را به همراه خواهد داشت. در این راستا به منظور پیشگیری از وقوع چنین ضررهایی لازم است نقطه توقف ضرر را به دقت تعیین نمود تا معامله در صورت ادامه روند در جهت خلاف پیش بینی، به موقع بسته شود.

موفق باشید

تیم ترجمه و تالیف فارکس پرسین