

انواع حد ضرر

۱.

حد ضرر ثابت:

این روش خیلی ساده ای هست که در این روش معامله گر مقدار مشخصی به عنوان حد ضرر در نظر میگیره که میتونه به دو روش باشه:

الف - مقدار ثابت عددی، مثلا معامله گر حد ضرر ۲۰ تومن رو برای هر سهم برای خودش قرار میده و میگه هر زمان از نقطه ورود ۲۰ تومن افت کنه از معامله خارج میشه.

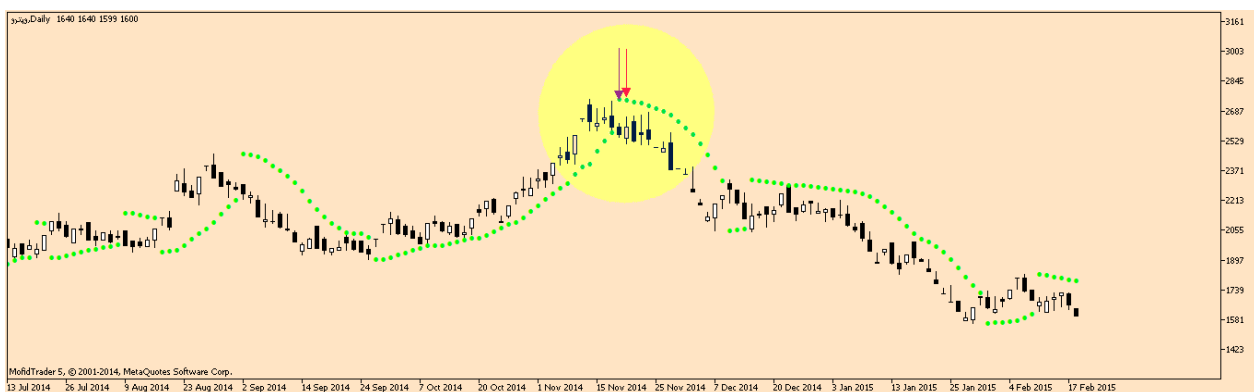
ب- درصد ثابت، مثلا معامله گر با خودش درصد ثابتی مثل ۵ درصد یا ۱۰٪ رو برای حد ضرر انتخاب میکنه و مثلا سهمی رو اگر ۵۰۰ تومن بخره با رسیدن به ۴۵۰ تومن از معامله خارج خواهد شد.

به هرحال شاید محدوده‌ای پنج الی ۱۰ درصدی نسبت به قیمت خرید ما برای تعیین حد ضرر مناسب باشد. البته محال است یک محدوده ضرر کاملا یکسان برای یک سهم توسط همگان ارایه شود. خصوصا این که سهم مورد نظر می تواند سابقه نوسانی زیادی داشته باشد و بنابراین شاید این ارقام ما افزایش (یا کاهش) یابد.

حد ضرر مکانیکال، این روش نیز سادست و در این مورد معامله گر از اندیکاتورها استفاده میکنه که تعدادی از روشهای اون رو خدمتون مثال میزنم:

الف - استفاده از پارابولیک سار (Parabolic SAR)، یکی از مواردی که در خیلی از استراتژیها برای حد ضرر استفاده میشه پارابولیک هست به این شکل که ما در پارابولیک تعدادی نقاط داریم که توسط نرم افزار رسم میشه، در روند صعودی این نقاط در زیر نمودار قرار داره، اولین نقطه ایی که در بالای نمودار ظاهر بشه میتونه برای ما دلالت بر اتمام روند صعودی کنه و حد ضرر باشه (در بعضی استراتژیها دومین نقطه)

به عنوان مثال در نمودار روزانه وپترو در کندلی که با رنگ بنفش مشخص شده است اولین نقطه پارابولیک ظاهر شده و در کندل بعدی که با پیکان قرمز مشخص شده است دومین نقطه پارابولیک نمایان شده است، لذا بر اساس این استراتژی حد ضرر با بسته شدن کندل با پیکان قرمز فعال شده است.



ب- استفاده از میانگین متحرک، در استراتژیهای مختلف از مووینگ اوریجهای ۲۰ یا ۵۰ به عنوان حد ضرر استفاده میشه و زمانه که مووینگ نمودار رو به سمت بالا قطع کنه و نمودار در زیر اون تثبیت بشه ما باید از سهم خارج بشیم (یک روش استاندارد استفاده از مووینگ نمایی ۲۰ هست که باید بعد از قطع یک کندل کامل زیر اون بسته بشه و در ابتدای کندل دوم میتونیم خارج بشیم).

نمودار سهام وپترو است: به بخشی که در کادر قرمز هست دقت کنیم، میبینیم که حد ضرر در یک کندل کامل زیر موینگ ۲۰ فعال شده است. (توجه: باید یک کندل کامل زیر (بدنه و سایه ها) زیر خط آبی تشکیل میشد.)



ج- میتوان از اندیکاتورهای دیگر یا ترکیب دو یا چند مورد در استراتژیهای مختلف استفاده نمود اما اساس کار همگی یکیست و بر مبنای تقاطع یا عبور از مقداری مشخص نباشد به عبارتی اطلاعات تکنیکال زیادی لازم ندارد و بر طبق عددی که توسط اندیکاتور بواسطه نرم افزار مشخص میشود باید اقدام کرد

۳- روشهای تکنیکال یا ترسیمی، در این دسته روشها کار مقداری سختتر میباشد اما در عوض دقیقتر است و برخلاف دسته دوم در خیلی از موارد از ابتدا حد ضرر برای ما مشخص است.

الف- خط روند به عنوان استاپ لاس: زمانی که خط روند شکسته شود، بعضی ها فقط با بسته شدن دو کندل زیر آن اقدام میکنند، اما بعضی دیگر حتما اجازه میدهند یک فراکتال نزولی در زیر خط روند تشکیل شود و بعد از شکسته شدن فراکتال نزولی خارج میشوند. در مثال زیر گروه اول دو کندل بعد از شکست خط قرمز رنگ از سهم خارج شده اند، اما گروه دوم صبر میکنند تا سهم زیر خط چین سورمه ای رنگ بیاید و چون این اتفاق نمیوفتد میتوانند با سهم باقی بمانند و صعود بعدی را نیز تصاحب کنند، البته طبیعیت است اگر قیمت زیر خط چین میامد گروه دوم ضرر بیشتری متحمل میشدند. در مثال زیر (نمودار هفتگی وساخت) گروه اول دو کندل بعد از شکست خط قرمز رنگ از سهم خارج شده اند، اما گروه دوم صبر میکنند تا سهم زیر خط آبی رنگ بیاید و چون این اتفاق نمی افتد میتوانند با سهم باقی بمانند و صعود بعدی را نیز تصاحب کنند، البته بدیهی است اگر قیمت زیر خط آبی می آمد گروه دوم ضرر بیشتری متحمل میشدند.



ب- درصدهای فیببوناچی به عنوان استاپ ،علاوه بر روش فوق عده ای از خطوط کاماریلا (با استراتژی خاص خود) یا خطوط پیوت استفاده میکنند ،در مورد استاپ لاس و فیبو ،میتوان فیبو ریتریسمنت را رسم کرد و بر مبنای استراتژی یک یا دو فیبو زیر محل ورود را بعنوان ناحیه استاپ لاس در نظر گرفت.

ج- استفاده از ایوت برای استاپ لاس،در این روش باید بر شمارش امواج تسلط کافی داشته باشیم و از قوانین ایوت برای این کار استفاده کنیم ،عموما وقتی هدف گرفتن موج سه میباشد و در انتهای موج دوم وارد میشویم استاپ لاس را زیر شروع موج اول قرار میدهند که نقض آن شمارش ما را باطل مینماید .
اما وقتی هدف گرفتن موج ۵ میباشد استاپ لاس را انتهای موج یک قرار میدهیم چون ورود موج ۴ به حوزه موج یک باعث ابطال شمارش خواهد شد و اصولا این اتفاق نباید حادث شود مگر ما در شمارش ایراد داشته باشیم .
برای گرفتن موج C نیز استاپ را انتهای موج b قرار میدهند در اینجا عبور از استاپ شمارش را نقض نمینماید ولی بیانگر اشتباه ما در فرض اتمام موج b یا در حالت بدتر اشتباه در کل موج شمارست .

د- استفاده از پترنها در استاپ لاس ،

اگر ما ورود را بر مبنای کف دو قلو انجام داده باشیم استاپ لاس زیر کفها قرار میگیرد ،
اگر بر مبنای سرو شونه کف وارد شده باشیم استاپ لاس ابتدا در زیر سر قرار میگیرد و سپس به زیر شانه راست منتقل میشود (روش استاندارد)

اگر بر مبنای پترن یک دو سه وارد شده باشیم استاپ لاس ابتدا زیر نقطه شروع و سپس زیر فراکتال سمت راست قرار میگیرد .

اگر بر مبنای مثلث وارد شده ایم ،استاپ لاس زیر نقطه سی قرار میگیرد و کلا بر مبنای هر پترنی که وارد شدیم استاپ لاس ما بر مبنای اون پترن تعیین میشه .



معاملات بازنده خود را سریع ببندید و به معاملات برنده اجازه رشد دهید، اگر این شیوه را پیش گیرید و مدیریت سرمایه را همراه آن کنید حتی اگر معاملات شما تصادفی باشند باز هم براینده شما مثبت خواهد بود..