

در دنیا پرهیجان و غیرقابلیتی‌بینی بازارهای مالی، اکثر ترازوواران به دنبال یادگیری انواع سبکهای تحلیل تکنیکال برای تبدیل شدن به یک معامله‌گر سودده هستند. اما اگر بادقت به مسیر تریدرهای سودده با صندوقهای سرمایه‌گذاری نگاه نماید، درمی‌باید که رمز موقیت در سیکهای متعدد تحلیل تکنیکال یا وین ریت بالا نیست، بلکه در نحوه مدیریت سرمایه و کنترل ریسک در معامله‌گری است، مدیریت سرمایه به زبان ساده فلسفه بفاست یعنی: چطور معامله کنید تا حد توقیت ضرر می‌کنید، باز هم دوام بیاورید و توان مالی و ذهنی برای شروع مجدد داشته باشید، هر معامله‌گر سودده نر در دنیا، قیل از اینکه روی سود تمرکز کند، اول بدین فکر می‌کند. زیرا در بازاری که همیشه در حال تغییر است، بقا مساوی موقیت است، بدون یک سیستم مدیریت سرمایه، حتی هفتگین تحلیلها و معاملات هم در بلندمدت باقی‌ماند. **مدیریت سرمایه**، **Profit Factor**، همراه با مثال‌های عددی، اشتباختات متداول و روش‌های مدیریت سرمایه پس اگر به دنبال آموزش رایگان مدیریت سرمایه هستید در ادامه همراه ما باشید.

مفهوم مدیریت سرمایه

بعنی شما یعنیون یک تریدر باید پاد بگیرید در هر شرایطی، ابتدا از سرمایه‌تان محافظت کنید و بعد دنبال سود پاشید، اگر استراتژی شما ۷۰٪ موقع بود: اینکه ای پدریزی ۵ درصدی کل حساب را ناید نکن، در واقعه بالندجای.

اما اگر فقط ۴۰٪ موقع بوده باشید: ولی هر بار ریسک خود را کنترل کنید و اجازه ندهید هیچ ضرری از ۲٪ موجودی حساب پیشتر شود، در بلندمدت سودآور خواهد بود.

مدیریت سرمایه به صورت ابتدایی یعنی تنظیم بیوزشن سایز بر اساس حد ضرر و درصد ریسک مجاز از کل حساب، و هدف اصلی آن کاهش اثر ضررها و پایدار نگذاشتن محتنی رشد سرمایه است.

چرا باید حد ضرر تعیین کنیم؟

حد ضرر (Stop Loss) یکی از ابزارهای حیاتی مدیریت سرمایه و ریسک است که به اهمیت آن در ادامه در آموزش رایگان مدیریت سرمایه خواهیم پرداخت واقعی، بدون حد ضرر، شما در حال قمار کردن هستید نه معامله‌گری.

حد ضرر نقطه‌ای است که قبل از ورود به معامله مشخص می‌کنید؛ یعنی اگر بازار برخلاف پیش‌بینی شما حرکت کرد، معامله بسته شود تا از ضرر بیشتر جلوگیری شود.

فرض کنید سرمایه شما ۱۰۰ دلار است و تصمیم دارید در هر معامله فقط ۷٪ سرمایه را ریسک کنید. یعنی حد ضرر حدودی ۲۰ دلار ضرر کنید.

اگر حد ضرر شما ۵ پیپ پایین‌تر از نقطه ورود باشد، کافی است حجم معامله را طوی تنظیم کنید که هر ۵ پیپ مساوی ۲۰ دلار ضرر باشد، در این حالت، حتی اگر حد ضرر شما ۱۰٪ از دست بدیده است، هنوز ۸٪ سرمایه‌تان حفظ شده است.

در حالی که اگر حد ضرر بار ۱٪ ریسک می‌گردید، بعد از همان ده معامله کل حسابتان ناید می‌شود.

درصد ضرر و دشواری جیران آن

در مدیریت سرمایه، یکی از واقعیت‌های تاخ اما مهم این است که جیران ضرر بسیار دشوار از خود ضرر است مثلاً:

- اگر ۱٪ ضرر کنید، باید ۱۱٪ سود کنید تا به نقطه اول بگردید.

• اگر ۵٪ ضرر کنید، باید ۱۱۰٪ سود کنید.

• اگر ۷۵٪ ضرر کنید، باید ۳۰۰٪ سود کنید.

این اعداد نشان می‌دهد چرا ضررها باید ممتوح باشد و در معامله‌گری از حد ضرر و بیوزشن سایز مناسب استفاده شود، وقتی بیش از ۲۵٪ از سرمایه از بین بود، جیران آن از نظر ذهنی و ریاضی دشوار است، معامله‌گر خیلی هیچ‌گاه اجازه نمی‌دهد ضررهاش از کنترل خارج شوند، زیرا می‌داند که بقای شرط اصلی ادامه بازی است.

ساختار ذهنی مدیریت سرمایه

در نگاه اول کنندگان معمولی سرمایه‌گری از معمولی خواهند داشت، معمولی سرمایه‌گری این است که دهنده بیوزشن سایز را باید می‌خواهیم بروزگاری می‌گردید معامله‌گرها که دهنده‌شان تسلط ندارند، معمولاً در معاملات‌شان حجمها را به صورت تصادفی تغییر می‌دهند، بعد از یک ضرر، دوباره حجم وارد بازار می‌شوند که پس از اینکه اینکه می‌گردیدند، معمولی سرمایه‌گری این است که باید می‌خواهیم بروزگاری می‌گردیدند.

قاعده کلی:

- اگر چند معامله ضرر کردی، حجم را کاهش دهید.

• اگر در سری معاملات سودده باشی، حجم را بهترین افزایش (اما با حدوده مجاز) دهید (اما باز هم در محدوده مجاز).

این نکته رو فراموش نکنید که معامله‌گران موفق نه با امید، بلکه با احتمالات تصمیم گیرند.

شخص‌های کلیدی مدیریت سرمایه

برای اندادگیری عملکرد استراتژی مدیریت سرمایه، باید از شخص‌های کمی استفاده کنید.

این شخص‌ها کمک می‌کنند بهفهمید آیا سیستم شما در بلندمدت سودآور است یا نه.

شناسن شخص اصلی مدیریت سرمایه عبارت‌اند از:

1. درصد معاملات بزنده (Win Rate)

2. درصد معاملات بازنده (Loss Rate)

3. نسبت سود به ضرر (Risk to Reward Ratio)

4. نسبت بازگشت مالی (Payoff Ratio)

5. شاخص سودآوری (Profit Factor)

6. امید ریاضی (Expectancy)

7. افت سرمایه (Drawdown)

در ادامه در آموزش رایگان مدیریت سرمایه هر کدام را به صورت تخصصی بررسی می‌کنیم:

درصد معاملات بزنده (Win Rate)

وین ریت یعنی چه درصدی از کل معاملات شما با سود بسته باشند.

فرمول:

$$\text{وین ریت} = (\text{تعداد معاملات سودده} \div \text{کل معاملات}) \times 100$$

من اگر در ۱۰۰ معامله، ۵۰٪ مورد سودده باشد، وین ریت شما ۵۰٪ است.

اما توجه کنید که معاملات سرمایه‌گری باید ممتوح باشد و در معامله‌گری از حد ضرر و بیوزشن سایز مناسب استفاده شود، وقتی بیش از ۲۵٪

زیان از سرمایه از بین بود، جیران آن از نظر ذهنی و ریاضی دشوار است، معامله‌گر خیلی هیچ‌گاه اجازه نمی‌دهد ضررهاش از کنترل خارج شوند، زیرا

می‌داند که بقای شرط اصلی ادامه بازی است.

نسبت سود به ضرر (Risk to Reward Ratio)

رسیک که ریواد یا پراختصار R را یعنی نسبت سود به ضرر می‌گیرد، بعد از همان ده معامله کل حسابتان ناید می‌شود.

فرمول:

$$\text{زیان} = (\text{نیزد} \times \text{ضرر}) \div (\text{زیان} + \text{ضرر})$$

وین ریت یعنی چه درصدی از کل معاملات شما با سود بسته باشند.

فرمول:

$$\text{زیان} = \text{زیان} \times \text{ضرر} \div (\text{زیان} + \text{ضرر})$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (زیان + ضرر)

فرمول:

$$\text{زیان} = \text{زیان} \times \text{ضرر} \div (\text{زیان} + \text{ضرر})$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (زیان + ضرر)

فرمول:

$$\text{زیان} = \text{زیان} \times \text{ضرر} \div (\text{زیان} + \text{ضرر})$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (زیان + ضرر)

نسبت بازگشت مالی (Payoff Ratio)

در ادامه در آموزش رایگان مدیریت سرمایه هر کدام را به صورت تخصصی بررسی می‌کنیم:

درصد معاملات بازنده (Loss Rate)

وین ریت یعنی چه درصدی از کل معاملات شما با خسارت بسته باشند.

فرمول:

$$\text{خسارت} = (\text{نیزد} + \text{ضرر}) \div (\text{زیان} + \text{ضرر})$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (زیان + ضرر)

فرمول:

$$\text{خسارت} = \text{خسارت} \div (\text{زیان} + \text{ضرر})$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (زیان + ضرر)

نسبت بازگشت مالی (Expectancy)

امید ریاضی یا ریاضی انتظاری (Expectancy) یعنی انتظاری که از معامله می‌گیریم.

فرمول:

$$\text{امید ریاضی} = \text{زیان} \times \text{نیزد} + \text{خسارت} \times \text{ضرر}$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (زیان + خسارت + ضرر)

فرمول:

$$\text{امید ریاضی} = \text{زیان} \times \text{نیزد} + \text{خسارت} \times \text{ضرر} + \text{خسارت} \times \text{ضرر}$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (زیان + خسارت + ضرر)

نسبت بازگشت مالی (Drawdown)

در ادامه در آموزش رایگان مدیریت سرمایه هر کدام را به صورت تخصصی بررسی می‌کنیم:

نسبت بازگشت مالی (Payoff Ratio)

نسبت بازگشت مالی میانگین سودوتان ۱۲ دلار و میانگین ضرورتان ۶ دلار باشد:

$$\text{Payoff Ratio} = 120 \div 60 = 2$$

یعنی در این استراتژی معاملات سودده باشید، وین ریت ۲ دلار سود می‌سازد.

فرمول:

$$\text{زیان} = (\text{نیزد} \times \text{نیزد}) \div (\text{زیان} + \text{ضرر})$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (زیان + ضرر)

نسبت بازگشت مالی (Risk to Reward Ratio)

در ادامه در آموزش رایگان مدیریت سرمایه هر کدام را به صورت تخصصی بررسی می‌کنیم:

نسبت بازگشت مالی (Win Rate)

نسبت بازگشت مالی میانگین سود معاملات سودده \div کل معاملات

$$\text{نسبت بازگشت مالی} = (\text{نیزد} \times \text{نیزد}) \div (\text{نیزد} + \text{ضرر})$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (نیزد + ضرر)

نسبت بازگشت مالی (Profit Factor)

نسبت بازگشت مالی میانگین سود معاملات سودده \div میانگین ضرر

$$\text{نسبت بازگشت مالی} = (\text{نیزد} \times \text{نیزد}) \div (\text{نیزد} + \text{ضرر})$$

وین ریت = (نیزد + ضرر) \div (نیزد + ضرر)

نسبت بازگشت مالی (Drawdown)

در ادامه در آموزش رایگان مدیریت سرمایه هر کدام را به صورت تخصصی بررسی می‌کنیم:

نسبت بازگشت مالی (Risk to Reward Ratio)

نسبت بازگشت مالی میانگین سود معاملات سودده \div میانگین خسارت

$$\text{نسبت بازگشت مالی} = (\$$