

تریلینگ استاپ چیست؟

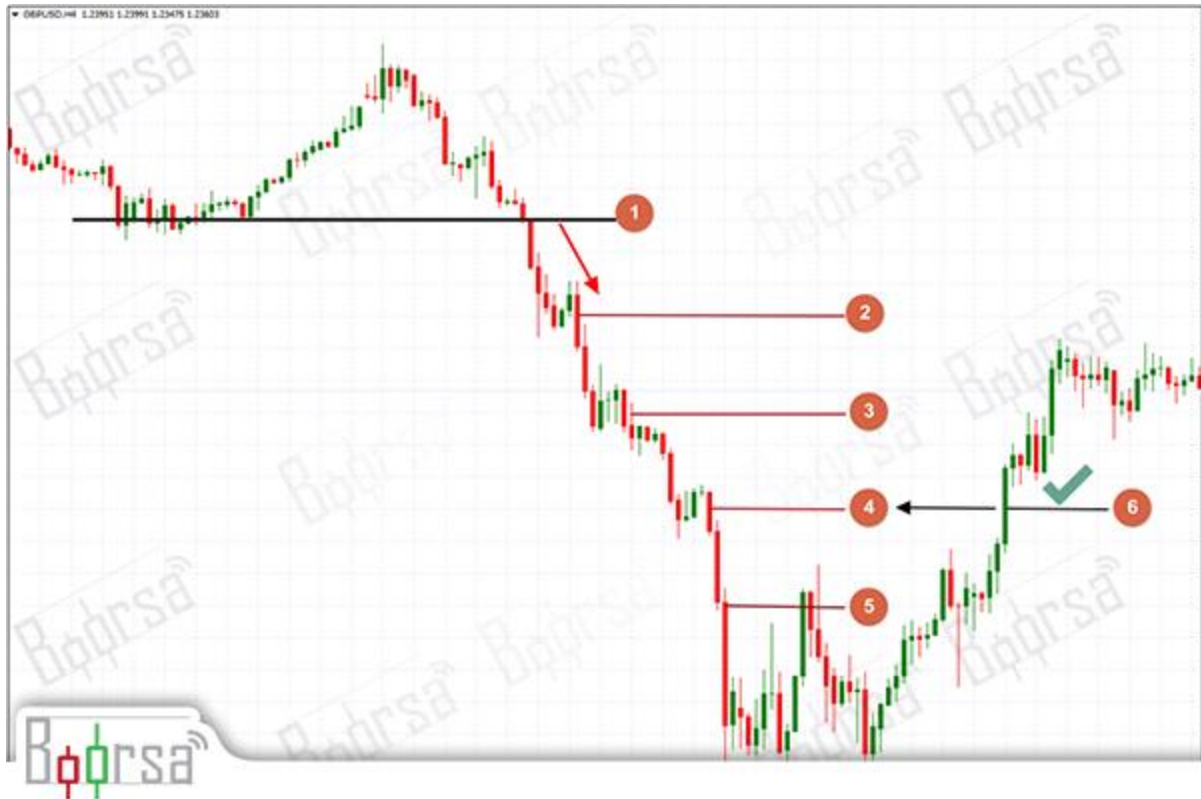
تریلینگ استاپ اصلی از یک دستور مد ضرر معمولی است که می تواند با درصد یا مقدار دلاری تعریف شده به دور از قیمت فعلی بازار تنظیم شود. برای یک پوزیشن خرید، یک سرمایه گذار یک تریلینگ استاپ را زیر قیمت فعلی بازار قرار می دهد. برای یک پوزیشن فروش، یک سرمایه گذار تریلینگ استاپ را بالاتر از قیمت فعلی بازار قرار می دهد.

Trailing Stop برای محافظت از سود طراحی شده است، و معامله را باز نگه می دارد تا زمانی که قیمت به نفع سرمایه گذار حرکت می کند سود را ذخیره کند. در صورتی که جهت قیمت با درصد یا مقدار دلار مشخصی تغییر کند، این معامله بسته می شود.

تریلینگ استاپ معمولاً همزمان با انجام معامله اولیه قرار می گیرد، اگرچه ممکن است پس از باز شدن معامله تعیین شود.

درک Trailing Stop

Trailing Stop ها فقط در یک جهت حرکت می کنند زیرا برای قفل کردن سود یا محدود کردن ضرر طراحی شده اند. اگر توقف ضرر 10 درصدی به یک پوزیشن خرید اضافه شود، اگر قیمت پس از خرید 10 درصد از قیمت اوج خود کاهش یابد، معامله فروش صادر می شود. تریلینگ استاپ تنها زمانی به سمت بالا حرکت می کند که یک قله جدید ایجاد شود. هنگامی که تریلینگ استاپ به سمت بالا حرکت کرد، دیگر نمی تواند به سمت پایین حرکت کند.



تریلینگ استاپ نسبت به دستور مد ضرر ثابت انعطاف پذیرتر است، زیرا به صورت خودکار جهت قیمت دارایی را دنبال می‌کند و نیازی به تنظیم مجدد دستی مانند توقف ضرر ثابت ندارد.

سرمایه گذاران می‌توانند از Trailing Stop ها در هر طبقه دارایی استفاده کنند، با این فرض که کارگزار آن نوع سفارش را برای بازار مورد معامله ارائه می‌دهد. همچنین تریلینگ استاپ را می‌توان به عنوان سفارشات لیمیت یا سفارشات بازار تنظیم کرد.

معامله با دستورات تریلینگ استاپ

کلید استفاده موفقیت آمیز از تریلینگ استاپ این است که آن را در سطحی تنظیم کنید که نه خیلی نزدیک و نه خیلی دور باشد. قرار دادن تریلینگ استاپی که بیش از حد نزدیک است می‌تواند به این معنی باشد که تریلینگ استاپ با حرکت عادی بازار روزانه آغاز می‌شود و بنابراین معامله جایی برای حرکت در جهت معامله‌گر ندارد. مد ضرری که خیلی نزدیک است معمولاً منجر به یک معامله زیان‌ده می‌شود. توقفی که خیلی زیاد است، توسط حرکات عادی بازار ایجاد نمی‌شود، اما به این معنی است که معامله‌گر ریسک زیان‌های غیرضروری بزرگ را می‌پذیرد، یا سود بیشتری از آنچه که نیاز دارد را از دست می‌دهد.

در حالی که تریلینگ استاپ ها سود و ضرر را محدود می کنند، ایجاد فاصله توقف ایده آل در انتهای مسیر دشوار است. هیچ فاصله ایده آلی وجود ندارد زیرا بازارها و نحوه حرکتشان همیشه در حال تغییر هستند. با وجود این، تریلینگ استاپ ها ابزار موثری هستند. هر روش فروج مزایا و معایب خود را دارد.

استاپ ضرر ایده آل تریلینگ در طول زمان تغییر خواهد کرد. در طول دوره های پرنوسان تر، یک تریلینگ استاپ دورتر شرایط بهتری را فراهم می کند. در زمان های آرام تر بازار که بازار در نوساناتش ثبات دارد، توقف ضرر نزدیک تر ممکن است موثر باشد. گفته می شود، هنگامی که تریلینگ استاپ یک معامله مشخص می شود، باید همانطور که هست نگه داشته شود. یک اشتباه رایج در معاملات این است که برای جلوگیری از ضرر، یک بار ریسک را در یک معامله افزایش دهید. به این حالت زیان گریزی (اثر انصرافی در زمینه بازارها) می گویند و می تواند مساب معاملاتی را به سرعت فلج کند.

نمونه ای از تریلینگ استاپ ها

فرض کنید Alphabet Inc. (GOOG) را با قیمت 100 دلار خریداری کرده اید. با نگاهی به پیشرفت های قبلی در سهام، می بینید که قیمت اغلب قبل از اینکه دوباره به سمت بالاتر حرکت کند، پولبک 5 تا 8 درصدی را تجربه می کند. این حرکت قبلی می تواند به تعیین سطح درصدی برای استفاده برای تریلینگ استاپ کمک کند.

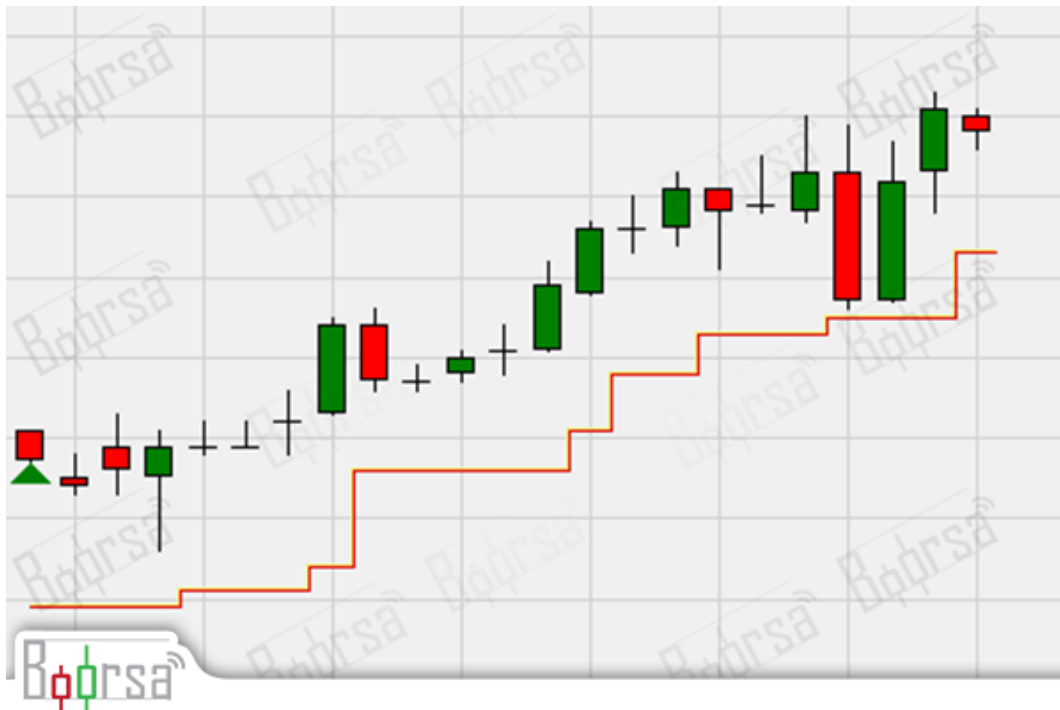
انتخاب 3% یا 5% ممکن است خیلی سخت باشد. متی پولبک های جزئی نیز تمایل به حرکت بیشتر از این دارند، که به این معنی است که معامله احتمالاً قبل از اینکه قیمت فرصتی برای حرکت بالاتر پیدا کند، با تریلینگ استاپ متوقف می شود.

انتخاب یک تریلینگ استاپ 20 درصدی می تواند بسیار افراطی باشد. بر اساس روندهای اخیر، میانگین پولبک حدود 6 درصد است و موارد بزرگتر نزدیک به 8 درصد است.

بهترین انتخاب برای تریلینگ استاپ بین 10 تا 12 درصد خواهد بود. این به معامله فضایی برای حرکت می دهد، اما در صورت کاهش بیش از 12 درصدی قیمت، معامله گر را به سرعت خارج می کند. افت 10 تا 12 درصدی بزرگتر از یک پولبک معمولی است که به این معنی است که اتفاق مهم تری می تواند در جریان باشد - عمدتاً، این می تواند به جای صرفاً پولبک، یک تغییر روند باشد.

با استفاده از تریلینگ استاپ 10 درصدی، اگر قیمت 10 درصد کمتر از قیمت فرید شما باشد، کارگزار شما دستور فروش را اجرا می کند. این 90 دلار است. اگر پس از فرید، قیمت هرگز از 100 دلار بالاتر نرود، تریلینگ استاپ شما

در 90 دلار باقی فواید ماند. اگر قیمت به 101 دلار برسد، استاپ ضرر شما به 90.90 دلار می رسد که 10 درصد زیر 101 دلار است. اگر سهام به 125 دلار برسد، کارگزار شما دستور تریلینگ استاپ را در صورت کاهش قیمت به 112.50 دلار اجرا می کند. اگر قیمت از 125 دلار شروع به کاهش کند و دوباره بالا نرود، سفارش تریلینگ استاپ شما در 112.50 دلار باقی می ماند و اگر قیمت به آن قیمت کاهش یابد، کارگزار از طرف شما دستور فروش را وارد می کند.



چرا باید از تریلینگ استاپ استفاده کنم؟

معامله گران و سرمایه گذاران می توانند کارایی توقف ضرر را با جفت کردن آن با توقف پایانی افزایش دهند، که یک دستور معامله است که در آن قیمت توقف ضرر در یک مقدار مطلق دلار ثابت نیست، بلکه در یک مقدار مشخص تعیین می شود. درصد یا مقدار دلار کمتر از قیمت فعلی بازار است که به طور مداوم با بالا رفتن بازار (برای یک موقعیت خرید) تجدید نظر می شود. توقف های انتهایی ممکن است برای بورس های سهام، اختیار معامله و آتی که از سفارش های توقف ضرر سنتی پشتیبانی می کنند استفاده شود.

چگونه روانشناسی بازار می تواند به من در تعیین تریلینگ استاپ کمک کند؟

در طول افت لطفه ای قیمت، بسیار مهم است که در مقابل انگیزه بازنشانی تریلینگ خود مقاومت کنید، در غیر این صورت ممکن است مد ضرر موثر شما کمتر از مد انتظار باشد. به همین ترتیب، زمانی که می بینید که حرکت در نمودارها به اوج خود می رسد، به ویژه زمانی که قیمت به بالاترین مد خود می رسد، مهار تریلینگ استاپ توصیه می شود. تصمیم گیری در مورد چگونگی تعیین نقاط خروج از موقعیت های خود به میزان محافظه کار بودن شما به عنوان یک معامله گر بستگی دارد.

تریلینگ استاپ در فارکس چیست؟

تریلینگ استاپ سفارش پویا در فارکس است که با حرکت بازار به نفع معامله گر، سطح مد ضرر را تنظیم می کند و به صورت خودکار فاصله مشخصی را برای تضمین سود و محدود کردن ضرر مفض می کند.

چگونه می توان فاصله تریلینگ استاپ بهینه را تعیین کرد؟

معامله گران تامل ریسک، نوسانات بازار را در نظر می گیرند و از تحلیل تکنیکال یا ابزارهایی مانند اندیکاتور میانگین برد واقعی (ATR) برای تعیین فاصله مدضرر مناسب با هدف متعادل کردن انعطاف پذیری معاملات و کنترل ریسک استفاده می کنند.

مزایا و معایب توقف های انتهایی چیست؟

مزایا

مدیریت ریسک، کنترل امساعات، ذخیره سود.

معایب:

مستعد برای بسته شدن زود هنگام معامله، پیچیدگی در قرار دادن، در زمان گپ های بازار به سرعت بسته می شود

Börssa