

مجموعه مقالات و آموزش های معامله گری

تخمین ریسک های نزولی به کمک اندیکاتور AI



ایران بورس آنلاین

IranBourseOnline.co

.....
برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس
وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline

تخمین ریسک های نزولی به کمک اندیکاتور ال

دراوداون (Drawdown) نشانگر بزرگ‌ترین افت سرمایه در معاملات است. معمولاً برای ارزیابی عملکرد استراتژی معاملاتی از مفهوم Drawdown استفاده می‌شود تا میزان ریسک معاملات را به طور کلی ارزیابی کرد. در این میان روشی ساده وجود دارد که می‌تواند به معامله‌گران کمک کند تا قبل از انجام معامله، میزان دراوداون را پیش‌بینی کنند. در این روش از اندیکاتور ال استفاده می‌شود. این اندیکاتور حداکثر ریسک موجود در معاملات خرید را نشان می‌دهد. یعنی اگر می‌خواهید در نماد خاصی معامله خرید انجام دهید، به کمک شاخص Ulcer می‌توانید پیش‌بینی کنید که حداکثر ریسک پیش روی معامله شما چقدر است؟

فهرست مطالب

- شاخص السری یا Ulcer Index چیست؟

برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline

شاخص السریا Ulcer Index چیست؟

شاخص السریا Ulcer Index یک نوع اندیکاتور تکنیکال است که میزان ریسک‌های نزولی را ارزیابی می‌کند. این اندیکاتور به کمک عمق و طول دوره حرکات نزولی میزان ریسک‌های نزولی را محاسبه می‌کند. وقتی که قیمت از اوج‌های اخیر خود فاصله می‌گیرد و سقوط می‌کند، مقدار عددی اندیکاتور ال هم افزایش می‌یابد. یعنی ریسک افزایش یافته است. زمانی که قیمت به اوج‌های جدیدی صعود می‌کند، اندیکاتور ال هم پایین می‌آید. معمولاً این اندیکاتور برای دوره زمانی ۱۴ روز استفاده می‌شود. اعدادی که اندیکاتور ال نشان می‌دهند، در واقع همان درصد دراو داون (Drawdown) است که معامله‌گر باید در آن دوره زمانی از بازار انتظار داشته باشد.

هر چقدر عدد اندیکاتور ال بزرگ‌تر باشد، برای بازگشت بازار به اوج قبلی به زمان بیشتری نیاز خواهد بود. این اندیکاتور فقط نوسانات سمت نزولی بازار را اندازه‌گیری می‌کند.

اندیکاتور Ulcer در سال ۱۹۸۷ توسط Byron McCann برای تحلیل صندوق‌های سرمایه‌گذاری طراحی شد و برای اولین بار هم در سال ۱۹۸۹ معرفی شد. این اندیکاتور تنها ریسک‌های نزولی بازار را بررسی می‌کند و بیشتر به درد خریداران بازار می‌خورد تا فروشندگان.

به طور کلی می‌توان گفت که اگر اندیکاتور ال اعداد کوچک‌تری را نشان دهد، به این معنی است که ریسک دراو داون نماد معاملاتی مربوطه پایین است. اگر به این اندیکاتور، میانگین متحرک اضافه کنید، می‌توانید نوسانات کلی بازار را هم به دست آورید. اگر اندیکاتور با جهش‌های شدید و سریعی مواجه شود، به این معنی است که بازار در دوره‌هایی متحمل ریسک‌های نزولی شدیدی شده است و بهتر است که خریداران از چنین بازارهای دور بمانند و یا با احتیاط کار کنند.

برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه‌های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

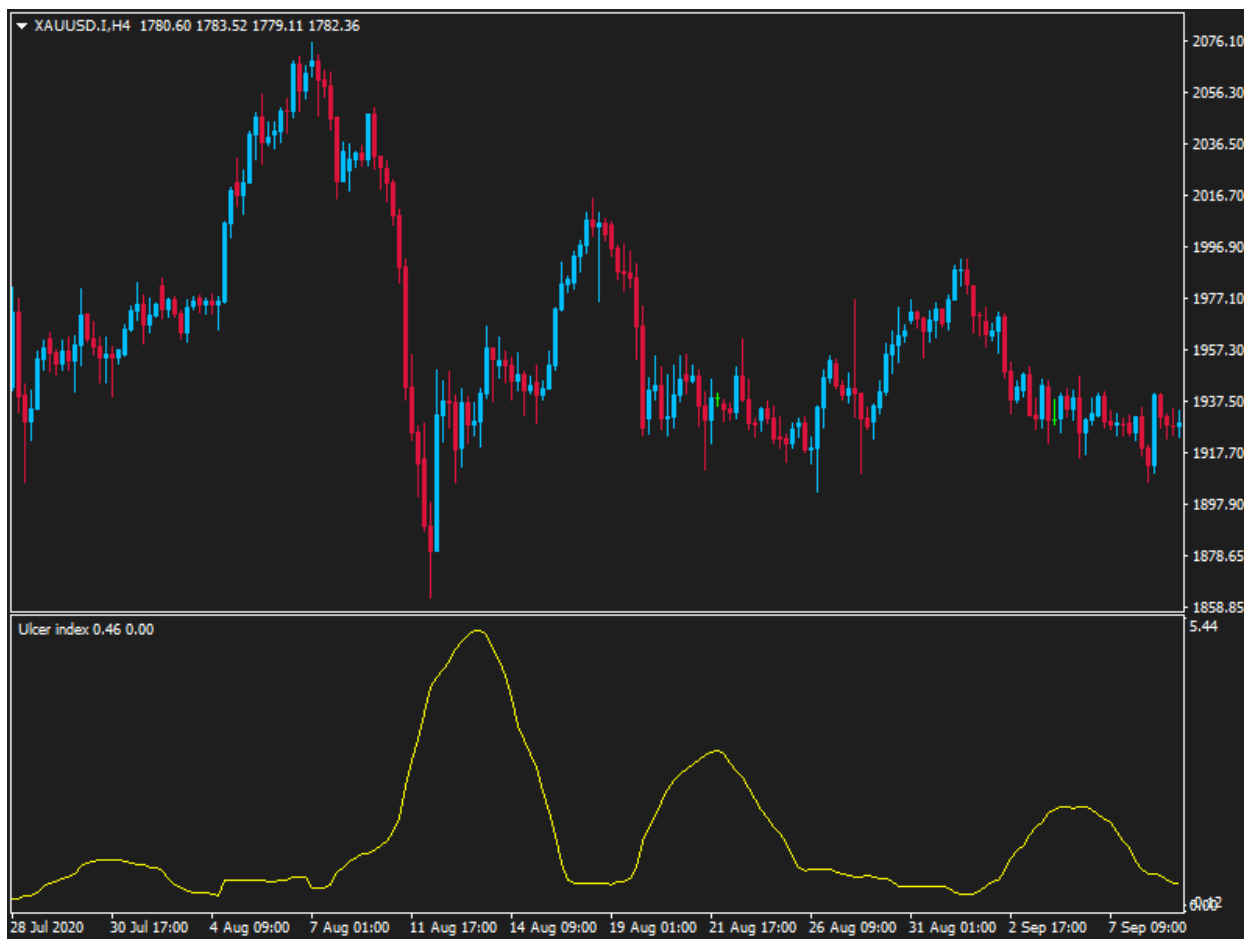
وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline



وقتی که اندیکاتور UL جهش غیر منتظره ای را ثبت می کند، باید چنین تصور کرد که بازار به مدت زمان بیشتری برای جبران سقوط اخیر نیاز دارد. همچنین این جهش نشان می دهد که ریسک افت سرمایه در معاملات خرید هم بالاست.

IranBourseOnline.co

برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline