

مجموعه مقالات و آموزش های معامله گری

# آیا استراتژی معاملاتی به صرفه است؟



# 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

## آیا استراتژی معاملاتی به صرفه است؟

در حرفه معامله‌گری همیشه باید به ارتقا و توسعه سیستم معاملاتی توجه کرد. این امر بدون ارتقا دانش فنی معامله‌گر امکان‌پذیر نیست. در این مقاله می‌خواهیم با مبحث جدیدی آشنا شویم که به معامله‌گر در درک عملکرد برنامه معاملاتی کمک می‌کند. دو فرمول محاسباتی ساده به ما کمک می‌کنند تا با چشمی باز استراتژی معاملاتی را انتخاب و آن را ارتقا دهیم.

این مقاله به شما کمک می‌کند تا خیلی سریع مشخص کنید که آیا سیستم معاملاتی جدید به صرفه است یا خیر؟ علاوه بر این متوجه خواهید شد که چه پارامترهایی در موفقیت کلی شما تأثیر دارند؟ آیا امکان دارد معامله‌گری در ۶۰ درصد مواقع اشتباه کند، اما باز هم سرمایه خود را چند برابر کند؟

### فهرست مطالب

- سود انتظاری معاملات
- معامله‌گری در ۶۰ درصد مواقع به حد ضرر می‌خورد، چگونه سرمایه او ۱۲۰ درصد افزایش یافته است؟

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](#)

## سود انتظاری معاملات

کار را با ارائه مثال ساده‌ای شروع می‌کنیم. این مثال کمک می‌کند تا قوانین مدیریت ریسک را بهتر درک کنید و آن‌ها را در معاملات پیاده کنید. همچنین سعی می‌کنیم با ارائه این مثال به شما کمک کنیم تا به سؤالات ابتدای مقاله پاسخ دهید.

فرض کنید که هر معامله‌ای که انجام می‌دهید ۱۰ دلار ریسک و ۱۰ دلار سود دارد. آیا انجام چنین معامله‌ای به صرفه است؟

برای پاسخ به این سؤال باید شانس یا احتمال معاملات سود ده و زیان ده را بدانیم. اما مشکل اساسی که در معاملات و استراتژی‌های معاملاتی وجود دارد، این است که تا وقتی که معامله‌ای انجام نشده، نمی‌توان آمار و احتمالات استراتژی معاملاتی را محاسبه کرد. یعنی شما تنها زمانی می‌توانید داده‌های تاریخی را بررسی کنید که ریسک کرده باشید. به همین دلیل است که همیشه از حساب‌های آزمایشی برای تست استراتژی استفاده می‌کنند. چون که اگر معامله‌ای انجام نشود، شانس سود و زیان استراتژی هم مبهم باقی خواهد ماند.

از دید فرمول ریاضی، عملکرد یک سیستم معاملاتی را می‌توان از فرمول زیر محاسبه کرد:

نتیجه معاملات برابر است با (تعداد معاملات) ضرب در (متوسط سود یا زیان هر معامله)

---

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](http://IranBourseOnline)

وب سایت: [iranbourseonline.co](http://iranbourseonline.co)

کانال آپارات: [IranBourseOnline](http://IranBourseOnline)

کانال تلگرام: [IBOChannel](http://IBOChannel)

اینستاگرام: [iran\\_bourse\\_online](http://iran_bourse_online)

پشتیبانی تلگرام: [IranBourseOnline](http://IranBourseOnline)

در فرمول بالا می‌توان متوسط سود یا زیان هر معامله را از فرمول پایینی پیدا کرد:

بازده انتظاری برابر است با: (زیان هر معامله ناموفق \* شانس معاملات زیان ده) -  
(سود هر معامله موفق \* شانس معاملات سود ده)

فرض کنید که شانس موفقیت معاملات سود ده ۵۰ درصد باشد. اگر در هر معامله ۱۰ دلار سود کنید و ریسک هر معامله هم ۱۰ دلار باشد، آنگاه متوسط سود انتظاری از سیستم معاملاتی برابر صفر خواهد بود:

$$(10 * 0.5) - (10 * 0.5) = \text{صفر دلار}$$

یعنی اگر بازدهی انتظاری از معاملات صفر دلار باشد، معامله کردن در بازار توجیهی نخواهد داشت. حتی اگر ۱۰۰۰ معامله هم انجام شود، باز هم بازدهی انتظاری معامله صفر دلار خواهد بود. چنین معاملاتی بیشتر به نفع کارگزار خواهد بود تا خود معامله‌گر! اگر در مثال بالا شانس معاملات ناموفق تنها ۱ درصد افزایش یابد، بازدهی انتظاری هم منفی خواهد شد:

$$(10 * 0.51) - (10 * 0.49) = 0.20$$

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](http://IranBourseOnline)

وب سایت: [iranbourseonline.co](http://iranbourseonline.co)

کانال آپارات: [IranBourseOnline](http://IranBourseOnline)

کانال تلگرام: [IBOChannel](http://IBOChannel)

اینستاگرام: [iran\\_bourse\\_online](http://iran_bourse_online)

پشتیبانی تلگرام: [IranBourseOnline](http://IranBourseOnline)

این یعنی متوسط بازدهی انتظاری از هر معامله‌ای منفی ۲۰ سنت خواهد بود. یعنی در بلندمدت، حساب معامله‌گر پاک خواهد شد.

- پس می‌توان گفت که اگر بازدهی انتظاری هر معامله صفر یا کمتر از صفر باشد، معامله توجیهی ندارد و با انجام معاملات بیشتر هم تغییری در بازدهی انتظاری صورت نخواهد گرفت و حساب معاملاتی خالی خواهد شد.
- نکته دیگری که از بازدهی انتظاری می‌توان یاد گرفت این است که اگر متوسط سود به دست آمده از هر معامله مساوی یا کمتر از ریسک (زیان) هر معامله باشد، معامله‌گر باید تعداد معاملات موفق بیشتری داشته باشد تا بتواند با برآیند مثبت از بازار خارج شود.

## معامله‌گری در ۶۰ درصد مواقع به حد ضرر می‌خورد، چگونه سرمایه او ۱۲۰ درصد افزایش یافته است؟

فرض کنید که حساب معاملاتی با موجودی ۱۰ هزار دلار داریم. ریسک یا زیان هر معامله‌ای حداکثر ۲۰۰ دلار است. نسبت ریسک به ریوارد معاملات هم یک به دو است. یعنی حد سود حداقل دو برابر حد ضرر است. پس سود هر معامله موفق به طور متوسط ۴۰۰ دلار خواهد بود.

.....  
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](https://www.IranBourseOnline.com)

وب سایت: [iranbourseonline.co](https://www.IranBourseOnline.com)

کانال آپارات: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

کانال تلگرام: [IBOChannel](https://www.IBOChannel.com)

اینستاگرام: [iran\\_bourse\\_online](https://www.IranBourseOnline.com)

پشتیبانی تلگرام: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

حال فرض کنید که معامله‌گری در طول سه ماه ۳۰۰ معامله انجام داده است. این معامله‌گر در ۱۸۰ معامله اشتباه کرده و معامله در حد ضرر بسته شده است. یعنی شانس معاملات زیان ده او ۶۰ درصد است. مابقی معاملات یا همان ۱۲۰ معامله (۴۰ درصد) هم به حد سود رسیده‌اند. اجازه دهید بازدهی انتظاری هر معامله را محاسبه کنیم:

بازدهی انتظاری هر معامله برابر است با:

(زیان هر معامله ناموفق \* شانس معاملات زیان ده) - (سود هر معامله موفق \* شانس معاملات سود ده)

$$= 40 = (0.40 * 400) - (0.60 * 200)$$

اگر اعداد را در فرمول بالایی بگذاریم، بازدهی انتظاری از هر معامله برابر ۴۰ دلار خواهد بود. حال برای محاسبه عملکرد کلی معاملات کافی است که بازدهی انتظاری از هر معامله را در کل تعداد معاملات انجام شده ضرب کنیم: یعنی

۴۰ دلار \* تعداد کل معاملات (۳۰۰) که برابر است با ۱۲ هزار دلار

.....  
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](http://IranBourseOnline)

وب سایت: [iranbourseonline.co](http://iranbourseonline.co)

کانال آپارات: [IranBourseOnline](http://IranBourseOnline)

کانال تلگرام: [IBOChannel](https://t.me/IBOChannel)

اینستاگرام: [iran\\_bourse\\_online](https://www.instagram.com/iran_bourse_online)

پشتیبانی تلگرام: [IranBourseOnline](http://IranBourseOnline)

این یعنی با این که معامله گر در ۶۰ درصد مواقع اشتباه می کند، اما سرمایه او بعد از ۳۰۰ معامله به اندازه ۱۲ هزار دلار یا ۱۲۰ درصد رشد می کند! این مثال ساده نشان می دهد که مدیریت ریسک چه تأثیری بر عملکرد معاملات دارد.

در واقع اگر حد سود معاملات حداقل دو برابر حد ضرر باشند، معامله گر این فرصت را دارد که با وجود درصد خطای بالا، باز هم سود قابل توجهی کسب کند!

**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](#)