

قسمت سوم : برنامه های تریدینگ

بازار توسط برنامه های معاملاتی کنترل میشود و شما تنها در حالتی میتوانید سود آور باشید که همسو با برنامه ها معامله کنید، اگر قدرت در دست برنامه های صعودی باشد بازار رشد خواهد کرد و اگر بخرید سود می کنید ، اگر قدرت در دست برنامه های نزولی است پس باید بفروشید.

برنامه نویسان چگونه الگوریتم ها را ایجاد می کنند؟ تمام ایده های شما را برنامه نویسان تست کرده اند ، حتی وقتی بازار در دامنه معاملاتی قرار دارد حجم زیاد است و برنامه ها در حال اسکالپ کردن یک یا دو تیک هستند. وقتی قرارداد آتی ایمنی برای یک یا دو ساعت در دامنه معاملاتی قرار میگیرد و فاصله سقف و کف دامنه فقط ۲ واحد است آنگاه وقتی بازار به زیر نقطه میانی میرود ، شرکتهای معاملات فرکانس بالا میخرند و وقتی یک یا دو تیک پایین تر میرود بیشتر میخرند و وقتی به وسط دامنه برمیگردد آنها میفروشند ، در معامله اول سر به سر می شوند و در معامله دوم و سوم یک یا دو تیک سود می کنند و وقتی بالاتر از نقطه میانی میرود آن ها می فروشند یک یا دو تیک بالاتر میرود بیشتر میفروشند و وقتی به وسط دامنه میرسد که نقطه ورود نیز میباشد آنها سر به سر خارج می شود و از معاملات بعدی خود سود کرده اند. اگر تلویزیون را ببینید به نظر میرسد که گلدمن ساکس در حال کنترل کردن بازار است در حالی که اینطور نیست در هر لحظه هزاران شرکت در حال معامله هستند و گلدمن ساکس فقط بخش کوچکی از آنها است و بازار در حالت عمومی در تعادل است، پس تقریبا در اکثر اوقات تعداد خریداران و فروشندگان با هم برابر است.

برنامه های صعودی در تلاش هستند تا شکست صعودی ایجاد کنند و برنامه های نزولی هم به معاملات خود می افزایند تا شکست نزولی ایجاد شود در نهایت یکی از این دو برنده میشود برای مثال اگر خریداران موفق شوند و یک شکست صعودی قوی ایجاد کنند آنگاه فروشندگانی که فروختند مجدد می خرن بدین صورت تعداد خریداران زیاد می شود و بازار بیشتر رشد می کند و فروشندگان دیگر تمایل ندارند بفروشند پس خرس ها نمی فروشند و این یعنی بازار باید بالاتر برود تا به قیمتی برسد که آنها تمایل به فروش داشته باشند پس در شکست بازار میتوانند یک طرفه شود.

بازار توسط برنامه ها کنترل می شود و آنها نمی توانند کار خود را پنهان کنند پرایس اکشن به همه نشان میدهد که چه اتفاقی دارد میوفتد پس اگر شمع ها یکی پس از دیگری بالاتر قرار بگیرند یعنی خریداران در حال بردن و فروشندگان در حال باختن هستند و وقتی شما هم می بینید که خریداران در حال بردن هستند باید بخرید یا به دنبال خرید باشید ، آنها نمی توانند این را پنهان کنند یعنی وقتی ۵۰ شرکت در حال خرید هستند و بازار در حال رشد است و آنها به ما نشان می دهند که دارند چه کار میکنند یعنی وقتی بازار در حال رشد است ما میدانیم که دلارهای بیشتری داره صرف خرید میشه تا فروش پس باید به فکر خرید باشیم.

شما نمی توانید بازار را تکان بدهید بعضی ها فکر می کنند اگر در اینجا بخرند بازار را بالا می کشند یا اگر در اینجا بفروشند بازار را پایین می کشند یا اگر خرید کرده باشم ، بازار ایست ضرر من را می بیند و پایین می آید تا حد ضرر من را بزند این طرز فکر کاملا غلط است بازار فقط در حالتی بالاتر یا پایین تر از قیمت جاری میرود که یکی از موسسات بخواهند بالاتر یا پایینتر از این قیمت معامله کند برای هر قیمت باید خریدار و فروشنده ای وجود داشته باشد حتما باید موسسات بفروشند و اینکه شما یا دوستتون بخواهید در ایست ضرر بفروشید و یا در بالای سوییگ های خرید تاثیری در رشد بازار ندارد و بازار وقتی بالاتر از یک سقف می رود که موسسات بخواهند در بالای آن سقف خرید کنند پس بازار تمام حرکات شما را نادیده میگیرد. ممکنه بگوئید من در چارت ایمنی دیدم که بعد از معامله ۳ قرارداد شکست ایجاد شد درسته گاهی اوقات این اتفاق می افتد گاهی اوقات موسسات تنها با ۳ سفارش میتوانند بازار را تکان بدهند اما شما با سه تا معامله نمی توانید این کار را بکنید پس اگر بازار به واسطه سه معامله بالاتر از یک قیمت قرار میگیرد نباید تصور کنید که شما این کار را کرده اید بلکه موسسات این کار را کرده اند نه اینکه کسی در منزل این کار را کرده باشد. و اینکه موسسات این کار را می کنند دلیلی دارد موسسات ممکن است بخواهند بازار پایین برود اما میخواهند که معامله گران فکر کنند که بازار در حال رشد است و به محض اینکه معامله گران ۳ تا قرارداد موسسات را خریدند بازار مثلا یک تیک پایین می آید و بعد به اندازه ۲۰۰ تا کاهش میابد.

پس اگر میخواهید در قیمتی بفروشید برای اینکه سود کنید ، یا برای اینکه از یک معامله بد خارج بشوید مطمئن باشید که بازار فقط در حالتی می تواند به قیمت مورد نظر شما برسد که موسسات

بخواهند در آن قیمت بفروشند ، یعنی فرقی ندارد که معامله شما در چه حجمی باشد بازار به خاطر شما به قیمت مورد نظرتان نمی رسد و وقتی به آن قیمت میرسد که موسسات هم میخواهند در آن قیمت بفروشند.

شرکتهای با معاملات فرکانس بالا اخیرا شهرت زیادی پیدا کرده اند که یک نوع برنامه معاملاتی است که همیشه بیشتر حجم معاملاتی را ایجاد می کند در بازارهای بزرگ میتواند ۵۰ درصد تا ۷۵ درصد حجم معاملاتی ایجاد کنند و برای سود های کوچک اسکالپ میکنند. سود کوچیک چیست؟ گاهی اوقات یک پنی و شاید کمتر از آن و آنها تعداد بسیار زیادی معامله انجام میدهند در نهایت آنها تأثیر چشمگیری روی جهت بازار ندارند و به دنبال چند پنی بالاتر و پایین تر هستند و تأثیر زیادی بر جهت حرکت بازار ندارند.

یک شرکت معمولی ممکنه ۱۰ الی ۵۰ میلیون معامله در روز انجام بدهد و معاملات کوچک هستند مثلا ۱۰۰ تا قرارداد یا ۳۰۰ تا سهام اما اگر ۵۰ میلیون سهام را برای ۱ پنی معامله کنید و ۵۵ درصد مواقع هم درست بگیرید آنگاه روز سودآوری خواهید داشت پس معاملات فرکانس بالا ۷۰ درصد حجم را ایجاد میکنند ، سایر موسسات ۲۵ درصد از حجم را شکل می دهند من و شما هم در یک روز خوب ۵ درصد از حجم را تشکیل می دهیم.

موسسات فرکانس بالا بر روی فاصله زمانی بین انجام معامله و پایان معامله حساس هستند. آنها کامپیوترهای خیلی سریع دارند تا این فاصله زمانی را کم کنند آنها معمولا معاملات خود را برای چند ثانیه نگه می دارند و گاهی اوقات هم چند ساعت اما اکثرا برای زمان کوتاهی نگه می دارند و به دنبال سود اندکی هستند.

در جلسات بعد در مورد اسکالپ کردن صحبت خواهیم کرد ، اسکالپ کردن یعنی معاملات فرکانس بالا را به صورت دستی انجام می دهیم برای مثال ایمنی در یک روز معاملاتی ۸۱ شمع دارد و در یک روز معمولی حدودا ۴۰ اسکالپ وجود دارد پس شما اسکالپر هستید و در طی روز به دنبال اسکالپ هستید پس شما یک معامله گر فرکانس بالا هستید اما به جای اینکه از کامپیوتر استفاده کنید این کار را دستی انجام میدهید.

برمیگردیم به بحث قبل که موسسات ۹۵ درصد از معاملات را انجام می دهند ، این موسسات به دنبال پول شما نیستند پول شما آنقدر کم هست که آنها را راضی نمیکند، به خاطر داشته باشید که ۹۵ درصد از دلارها متعلق به موسسات است پس این ۹۵ درصد به دنبال این نیست که ۵ درصد را منبع درآمد خود قرار دهد تمام موسساتی که جز این ۹۵ درصد هستند منبع درآمد خود را سایر موسساتی قرار میدهند که جز این ۹۵ درصد هستند پس هیچ کدام از این موسسات به ما اهمیت نمیدهند مثلاً گلدمن ساکس سعی نمیکند پول شما را به دست بیاورند آنها به دنبال پول گرفتن از بانک جی پی مورگان ، کردیت سوییس ، مورگان استنلی و تمام صندوقهای پوشش ریسک هستند چون تمام پول ها در این موسسات است پس منبع درآمدشان اینجاست هر چند به نظر میرسد که آنها سعی دارند افراد کوچک را از بین ببرند ، اما آنها اهمیتی نمی دهد که شما وجود دارید شما پول کافی ندارید ، تمام افراد حقیقی را کنار هم بگذاریم پول کافی ندارند که بتواند نظر موسسات را جلب کنند ، پس موسسات هیچ وقت به دنبال شما نیستند.

شرکتهای معاملات فرکانس بالا چقدر سود میکنند؟ برای مثال شرکتی که روزانه ۱۰ میلیون معامله انجام می دهد را بررسی می کنیم و هر معامله به اندازه ۱۰۰ سهم است ۵۵ درصد از مواقع سود می کنند ، یعنی در ۵.۵ میلیون معامله یک پنی سود می کنند و در ۴.۵ میلیون معامله یک پنی ضرر می کنند این فرضی است ، در آخر آنها ۵.۵ میلیون یک پنی سود کرده اند که می شود ۵.۵ میلیون دلار و ۴.۵ میلیون هم یک پنی ضرر کرده اند که میشود ۴.۵ میلیون دلار ضرر ، پس امروز سود خالص آنها می شود ۱ میلیون دلار سود خالص در سال می شود ۲۰۰ میلیون دلار.

موسسات معاملات فرکانس بالا دقیقاً مثل من و شما هستند آنها به دنبال ثروتمندان هستند و می دانند که یک سود بالقوه وجود دارد و این سود بالقوه منجر به شکل گیری موسسات زیادی میشود که به دنبال این سود هستند اما یک باور غلط وجود دارد که همه فکر می کنند این شرکت ها پول های خیلی زیادی در میارند اما واقعیت این نیست خیلی از آنها ضرر میکنند و فقط موسسات خیلی خوب طبق مثالی که گفتم سود میکنند.

شرکت های معاملات فرکانس بالا تحت الشعاع اخبار هستند و رسانه ها اینگونه جلوه می کند که به خاطر این شرکت هاست که شما نمی توانید به اندازه کافی پول در بیاورید ، شرکتهای معاملات فرکانس بالا علت پول در نیاوردن شما نیستند بلکه مشکل خود شما هستید ، همه میخواهند بخاطر ضرر هاشون بقیه را مقصر بدانند اما اگر ضرر می کنید این یعنی اینکه هنوز به اندازه کافی خوب نیستید همه میدوند که دلار ها اینجا به خاطر همین همه ما اینجا هستیم ما بخشی زیادی از دلارها را میخواهیم اما شما دارید با افراد حرفه ای و متخصص رقابت می کنید پس اگر میخواهید دلارها را از دستان معامله گران حرفه ای در بیاورید باید اول معامله گری را یاد بگیرید.

@SalarFakhr