

KADEMELİ HAREKETLİ KAR STOP LOSS NASIL ÇALIŞIR

Sistem Düzenleme
×

Sistem Adı

▢ Kar Realizasyonu

Taşınan Pozisyonlara uygula Açık Pozisyonlara uygula Kar Hedefi Yüzde Puan

▢ Zararı Durdur

Taşınan Pozisyonlara uygula Açık Pozisyonlara uygula Max. Zarar Yüzde Puan

▢ Süre Sınırı

Taşınan Pozisyonlara uygula Açık Pozisyonlara uygula Bar

▢ Hareketli STOP LOSS

Taşınan Pozisyonlara uygula Açık Pozisyonlara uygula Stop Seviyesi Yüzde Puan

▢ Kademeli Hareketli KAR STOP LOSS

Taşınan Pozisyonlara uygula Açık Pozisyonlara uygula Yüzde Puan

* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır.

AL SAT Açığa Sat Açık Poz. Kapat Değişkenler

STOP NOT

Kademeli Hareketli Kar Stop Loss (KHKSL) uygulaması bize KAR'ın alınması konusunda esneklik sağlar. Bu uygulama Sistem Tester modülünün STOP sekmesinde yer alır. Yukarıdaki resimde görebileceğiniz gibi alt alta üç satır ve her satırda 2 hücre vardır.

Satırlar kademe belirlemek için kullanılır.

İlk sütunda bulunan hücrelerde tanımlayacağınız veriler KAR miktarlarıdır.

Alım (veya açığa satış) yaptığınız ana göre fiyatın ulaşmış olduğu kazanç seviyesini belirlersiniz. (Yüzdeler oran veya puan olarak seçim yapabilirsiniz.)

Yüzdeler oran seçtiğiniz takdirde uygulama şöyle olmalıdır:

Mesela ilk hücreye 1 yazarsanız, %1 kar seviyesine ulaşıldığı ve geçildiği seviyeler kast edilmektedir. Hücrenin sol tarafındaki >= işareti bu sebeple vardır.

Belirlediğiniz seviye ve üstü için yapılacak uygulama sağ taraftaki hücrede belirleyeceğimiz orana göre yapılacaktır.

Sağ taraftaki hücrede, ulaşılan kar seviyesinden ne oranda geriye dönülür ise stop uygulanacağını tanımlarsınız. Buraya da gene doğrudan yüzde oranı yazılmalıdır. Yalnız bu sefer yazacağınız oran kar seviyesinin içindeki değişimin oranıdır.

Mesela 50 yazdığınızda sistemin yapacağı şudur. Ulaştığı kar seviyesinin (% 1.2 olduğunu varsayalım) % 50 sini kaybettiği takdirde (Yani toplam üzerinde % 0.6 geriye gidiş olduğunda) stop uygulanacaktır.

3 Ayrı kademe sunulmasının önemi / bize sağlayacağı fayda ise şöyledir:

İlk kademede 1 ve 30 seçtiğinizi ikinci kademde ise 2 ve 50 seçtiğinizi düşünelim.

Kar seviyeniz % 1 i aştıktan sonra bunun % 30 u kadar yani takriben % 0.3 geri gidişte stop çalışacaktır. Karınız %2 ye ulaşana kadar bu durum geçerlidir. Tabii ki üst seviyede, %2'nin hemen altından gerçekleşecek bir dönüşte, bu yükselişin %30 u olan yaklaşık %0.6 geriye gidiş için çalışacaktır.

Kar seviyeniz % 2 ye ulaştığı andan itibaren, stop seviyesi Kardan % 50 geriye gidiş olacaktır. Bu durumda %1 lik geriye gidişe kadar stop çalışmayacaktır.

Bu bize ne sağlar. VIOP çok hareketli olduğu için zaman zaman stopu az daha uzağa koysaydım diye düşündüğümüz durumlar yaşarız.

KHKSL sayesinde kar seviyemiz arttıkça stopu uzağa çekebiliriz.

İpucu: Karşı bakış açısı ile şunu da uygulayabilirsiniz. Kar seviyesi düşük iken stop geri dönüşünü yüksek tutarsınız. Kar seviyesi arttıkça stop geri dönüş oranını azaltabilirsiniz. Böylece düşük kar seviyelerinde daha esnek davranmış olursunuz. Belli bir seviyenin üzerinde bir kar rakamına ulaştığınız durumda ise, karınızı fazla eksiltmeden alma şansını yakalayabilirsiniz.

Örnek:

- Hareketli STOP LOSS			
<input type="checkbox"/>	Taşınan Pozisyonlara uygula	Stop Seviyesi	0
<input type="checkbox"/>	Açık Pozisyonlara uygula		
		<input checked="" type="radio"/>	Yüzde
		<input type="radio"/>	Puan
- Kademeli Hareketli KAR STOP LOSS			
<input checked="" type="checkbox"/>	Taşınan Pozisyonlara uygula	>=	1
<input checked="" type="checkbox"/>	Açık Pozisyonlara uygula	>=	2
			30
			50
			70
* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır.			
			Varsayılan Olarak Kaydet

Yukarıdaki seçimlerle elde edeceğimiz sonuç şudur:

Alım yaptığınız seviyeye göre:

Kar oranı %1 in altında kaldığı sürece KHKSL devreye girmez. Var ise diğer stoplarınız çalışabilir.

Kar seviyesi % 1 in üstüne çıktığı andan itibaren ilk kademe devreye girer. Kar seviyesi % 2 ye çıkmadığı sürece 2. Kademe devreye girmez. Ve bu arada ulaşılan maksimum kar miktarının % 30 kadar bir geri gidiş durumunda stop çalışır.

Kar seviyesi % 2 nin üstüne çıktığı anda Kademe 2 devreye girer. Burada geri dönüş oranı artık % 50 dir. Yani ulaşılan maksimum kar miktarının yarısı (% 50 si) kaybedildiği takdirde stop çalışır.

Kar seviyesi % 3 ün üstüne çıktığı anda Kademe 3 devreye girer. Burada geri dönüş oranı artık % 70 olarak çalışmaktadır. Yani ulaşılan maksimum kar miktarının % 70 i kaybedildiği takdirde stop çalışır.

Burada hedeflenen kar miktarı arttıkça stop seviyesini uzağa çekerek istenmeyen stoplardan kurtulmaktır. Tabii bunun için, kazanç yükseldikçe elde edilen kazancın daha fazlası riske atılmaktadır.

Dilerseniz bu oranları daha farklı uygulayabilirsiniz. Mesela belli bir seviyenin üstünde çok az bir geri dönüşte bile karı cebinize koyacak şekilde hareket edebilirsiniz. Bunun için kademe 3 te geri dönüş oranının düşürmeniz yeterlidir.

Yukarıdaki örnekte 70 yerine 20 yazarsanız; kar seviyeniz % 3 ün üstüne çıktıktan sonra, karın sadece % de 20 sini kaybettiğiniz anda stop çalışacaktır.

Puan seçimi yaptığınız takdirde hafif bir değişiklik söz konusudur.

- Kademeli Hareketli KAR STOP LOSS			
<input checked="" type="checkbox"/>	Taşınan Pozisyonlara uygula	>=	0.4
<input checked="" type="checkbox"/>	Açık Pozisyonlara uygula	>=	0.7
			0.1
			0.2
			0.4
* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır.			
			Varsayılan Olarak Kaydet

Bu durumda ilk sütuna yazacağınız rakamlar puan olarak görülecektir. Tabii bu durumda puan seviyelerini sembolün fiyatına göre belirlemeniz gerekecektir. VİOP için 0.1 = 100 puan anlamına gelir, unutmayınız. İkinci sütuna yazacağınız rakamlar gene puan olarak alınacaktır.

Bu durumda yukarıdaki örnek rakamların bize vereceği sonuç şu olacaktır (VİOP için belirlenmiştir):
Kar seviyesi 400 puanın altında kaldığı sürece KHK stop devreye girmez. Var ise diğer stoplarınız çalışabilir.
Kar seviyesi 400 puanın üstüne çıktığı andan itibaren, fiyattaki 100 puanlık bir geri gidiş KHK stopunun çalışmasını sağlar.

Kar seviyesi 700 puanın üstüne çıktıktan sonra, fiyattaki 200 puanlık bir geri gidiş KHK stopunun çalışmasını sağlar.

Benzer şekilde, son kademedeki belirlenen seviye 1000 puandır. Kar seviyesi bunun üzerine çıktığı andan itibaren 400 puanlık bir geri gidiş olması halinde bu stop devreye girecektir.

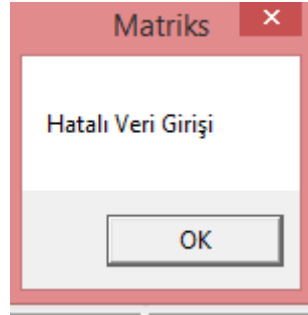
Dikkat: İlk sütunda bulunan hücrelerde belirleyeceğiniz oranlar artarak gitmelidir. Yani:

Kademeli Hareketli KAR STOP LOSS			
<input type="checkbox"/> Taşınan Pozisyonlara uygula	>=	1	30
<input type="checkbox"/> Açık Pozisyonlara uygula	>=	3	50
* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır	>=	2	70

Yüzde
 Puan

[Varsayılan Olarak Kaydet](#)

Yukarıda olduğu gibi, 1-3-2 sıralaması yapamazsınız. Artarak gitmelidir. Seçimin puan olması durumunda da bu kural geçerlidir. Bu şekilde yazarsanız şöyle bir uyarı gelir:



2. sütunda belirleyeceğiniz oranlar için sıralı olarak artma veya azalma mecburiyeti söz konusu değildir.

DİKKAT: Geçmişin testinde STOP'larla ilgili önemli bir detay vardır: Kar Al ve Zarar Durdur stop seviyelerinin yerleri nettir. Geçmiş testindeki veriler gerçek hayatla örtüşür.

Bununla beraber Hareketli Stop'lar için geçmiş testinde durum belirsizdir.

Sistem bar içindeki fiyat hareketlerinin sürecini bilemeyeceği için yüksekler ve kapanışlara bakarak STOP üretir.

AL işleminin gerçekleştiği Bar'ın kapanışı alış fiyatınızdır. İlk anda bu değer stop seviyesi için baz alınır.

Sonraki bardan itibaren fiyat daha 'Yüksek' bir seviye görürse (ki normal şartlar altında görecekler) stop seviyesini buna göre revize eder. Ve bu bardın kapanışı ile stop seviyesini karşılaştırır, kapanış daha aşağıda ise 'STOP' verir. (Yani, aynı bar içindeki yüksek ve kapanış farkı dolayısı ile stop verebilir.)

Değilse bir sonraki barda aynı kontrolleri yaparak devam eder. Daha yüksek bir seviye görülür ise stop seviyesi buna göre tekrar revize edilir. Fiyat stop seviyesine görmüş ise de 'STOP' verir. İlk işlemin 'Açığa Sat' olması durumunda, yukarıda bahsedilen işlem ters yönde uygulanır. Testin getirisi bu stop seviyesine göre hesaplanır.

Seans esnasında ise, gerçekleşen son fiyat STOP koşulunu gerektirdiği anda STOP oluşur. Stop seviyesine o bar içinde yüksek görülmeden önce ulaşılmış olabilir.

Bu yüzden STOP uygulaması olan sistemlerin geçmiş testlerinde sonuçlar gerçek süreçle tam örtüşmeyebilir. Hatta düşük miktarda stoplarda oldukça ciddi biçimde ayrışır. Bu sebeple hareketli stop kullanıyorsanız, geçmiş testlerine ihtiyatlı yaklaşmanız önemlidir.

Bu konuda sorularınız olur ise lütfen telefonla veya yazılı olarak irtibata geçiniz.

Tel: 0212 354 54 54

E-posta: egitim@matriksdata.com