

KADEMELİ HAREKETLİ KAR STOP LOSS NASIL KULLANILIR

m
Sistem Düzenleme
X

Sistem Adı

Kar Realizasyonu

 Taşınan Pozisyonlara uygula Kar Hedefi Yüzde
 Açık Pozisyonlara uygula Puan

Zararı Durdur

 Taşınan Pozisyonlara uygula Max. Zarar Yüzde
 Açık Pozisyonlara uygula Puan

Süre Sınırı

 Taşınan Pozisyonlara uygula Bar
 Açık Pozisyonlara uygula

Hareketli STOP LOSS

 Taşınan Pozisyonlara uygula Stop Seviyesi Yüzde
 Açık Pozisyonlara uygula Puan

Kademeli Hareketli KAR STOP LOSS

 Taşınan Pozisyonlara uygula >= Yüzde
 Açık Pozisyonlara uygula >= Puan
 Seviye bilgileri artan >=

* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır.

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 ulaştığı 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 ulaştığı ve geçildiği seviyeler kast edilmektedir. Hücrenin sol tarafındaki >= işareti bu sebeple vardır.

Belirlediğiniz seviye ve üstü için yapılacak uygulama sağ taraftaki hücrede belirleyeceğiniz 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 kademede 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. VİOP 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 checked="" type="radio"/> Yüzde	
<input type="checkbox"/> Açık Pozisyonlara uygula		<input type="radio"/> Puan	
- Kademeli Hareketli KAR STOP LOSS			
<input checked="" type="checkbox"/> Taşınan Pozisyonlara uygula	>= 1	30	<input checked="" type="radio"/> Yüzde
<input checked="" type="checkbox"/> Açık Pozisyonlara uygula	>= 2	50	<input type="radio"/> Puan
	>= 3	70	
* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır.			<input type="button" value="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 % 2 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	0.1	<input type="radio"/> Yüzde
<input checked="" type="checkbox"/> Açık Pozisyonlara uygula	>= 0.7	0.2	<input checked="" type="radio"/> Puan
	>= 1	0.4	
* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır.			<input type="button" value="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 kademede belirlenen seviye 1000 puandır. Kar seviyesi bunun üzerine çıktığı andan itibaren 400 puanlık bir geri gidiş olması halinde bu stop devreye girecektir.

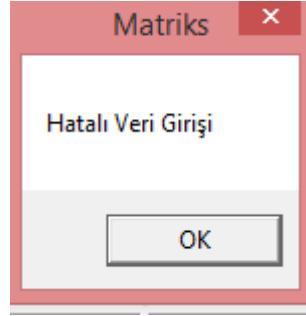
Dikkat: İlk sütunda bulunan hücrelerde belirleyeceğiniz oranlar artarak gitmelidir. Yani:

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.

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

Tel: 0212 354 54 54

E-posta: egitim@matriksdata.com