

KADEMELİ HAREKETLİ KAR STOP UYGULAMASI HAREKETLİ STOPLARDA DİKKAT EDİLMESİ GEREKEN DETAYLAR

Hareketli STOP LOSS

Taşınan Pozisyonlara uygula Stop Seviyesi Yüzde
 Açık Pozisyonlara uygula Puan

Kademeli Hareketli KAR STOP

Taşınan Pozisyonlara uygula >= Yüzde
 Açık Pozisyonlara uygula >= Puan

* Seviye bilgileri artan şekilde >=
sıralı olmalıdır.

Kar Hedefi ile SAT/KAPAT ENGELLE

Taşınan Pozisyonlara uygula Kar Hedefi Yüzde
 Açık Pozisyonlara uygula Puan

Engelleme stopu Satış ve Poz. Kapatma işlemlerini kar hedefi doğrultusunda ENGELLEYECEĞİ için dikkatli kullanılmalıdır !

AL SAT Açığa Sat Açık Poz. Kapat Değişkenler **STOP** NOT

Kademeli Hareketli Kar Stop (KHKS) 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. (Yüzdelik oran veya puan olarak seçim yapabilirsiniz.)

Yüzdelik 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 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 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. VİOP çok hareketli olduğu için, zaman zaman stopu az daha uzağa koysaydım diye düşündüğümüz durumlar yaşarız.

KHKS 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
* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır.	>= 3	70	
Varsayılan Olarak Kaydet			

Yukarıdaki seçimlerle elde edeceğimiz sonuç şudur:

Alım yaptığınız seviyeye göre:

Kar oranı %1 in altında kaldığı sürece KHKS 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	0.1
<input checked="" type="checkbox"/> Açık Pozisyonlara uygula	>=	0.7	0.2
* Seviye bilgileri artan şekilde sıralı olmalıdır.	>=	1	0.4

Yüzde
 Puan

Varsayılan Olarak Kaydet

Bu durumda ilk sütuna yazacağınız rakamlar puan olarak görülecektir. Tabii bu durumda puan seviyelerini sembolün fiyatına göre belirlemeniz gerekecektir.

İkinci sütuna yazacağınız rakamlar gene puan olarak alınacaktır.

Bu durumda, yukarıdaki örnek rakamların bize vereceği sonuç şu olacaktır:

Kar seviyesi 0.40 TL (puan) altında kaldığı sürece KHK stop devreye girmez. Var ise diğer stoplarınız çalışabilir.

Kar seviyesi 0.40 TL'nin üstüne çıktığı andan itibaren, fiyattaki 0.10 TL tutarında bir geri gidiş KHK stopunun çalışmasını sağlar.

Kar seviyesi 0.70 TL'nin üstüne çıktıktan sonra, fiyattaki 0.20 TL'lik bir geri gidiş KHK stopunun çalışmasını sağlar.

Benzer şekilde, son kademede belirlenen seviye 1 TL'dir. Kar seviyesi bunun üzerine çıktığı andan itibaren 0.40 TL tutarında bir geri gidiş olması halinde bu stop devreye girecektir.

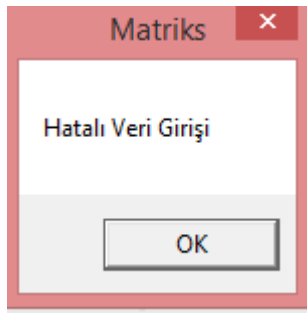
Dikkat: İlk sütunda bulunan hücrelerde belirleyeceğiniz oranlar artarak gitmelidir. Yani:

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 Stoplarla 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 yükselere 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 görecektir) stop seviyesini buna göre revize eder. Ve bu barın 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.

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. Esas detay budur. Ve farkı bu detay oluşturur.

Bu yüzden STOP uygulaması olan sistemlerin geçmiş testlerindeki sonuçlar, gerçek süreçle tam örtüşmeyecektir.

Dikkat: Hatta düşük miktarda stoplarda oldukça ciddi biçimde ayrışır. Bu sebeple hareketli stoplardan birisini kullanıyorsanız, geçmiş testlerine ihtiyatlı yaklaşmanız önemlidir.

Bunu, bir örnek ile test edelim.

Bazı kullanıcılarımız şunu yapmaktadır:

Yüzdeler seçiminde 2. Sütuna 1 yazmak.

Yani:

Seviye	Yüzdeler
1	1

Bu şu demektir:

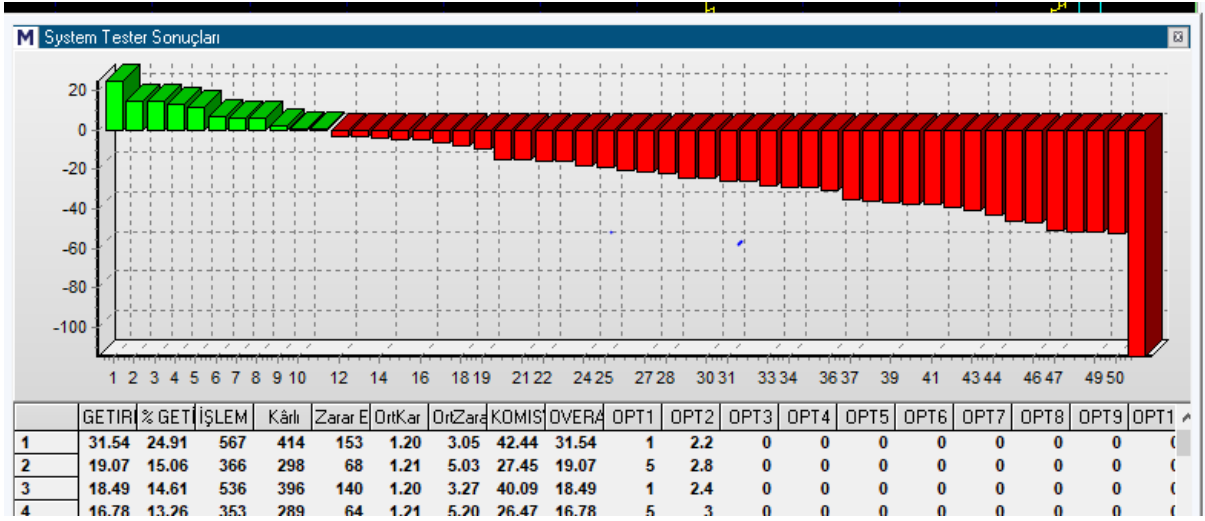
Kar seviyesi yüzde 1'i geçtiği anda, karımın sadece yüzde 1'i bile gitse stopla (Kar olarak stopla).

Dikkat ediniz: Bu onbinde 1'e denk gelir. Yani, kar yüzde 1'i geçtiği anda fiyat 1 kademe bile geri gelse stoplanır.

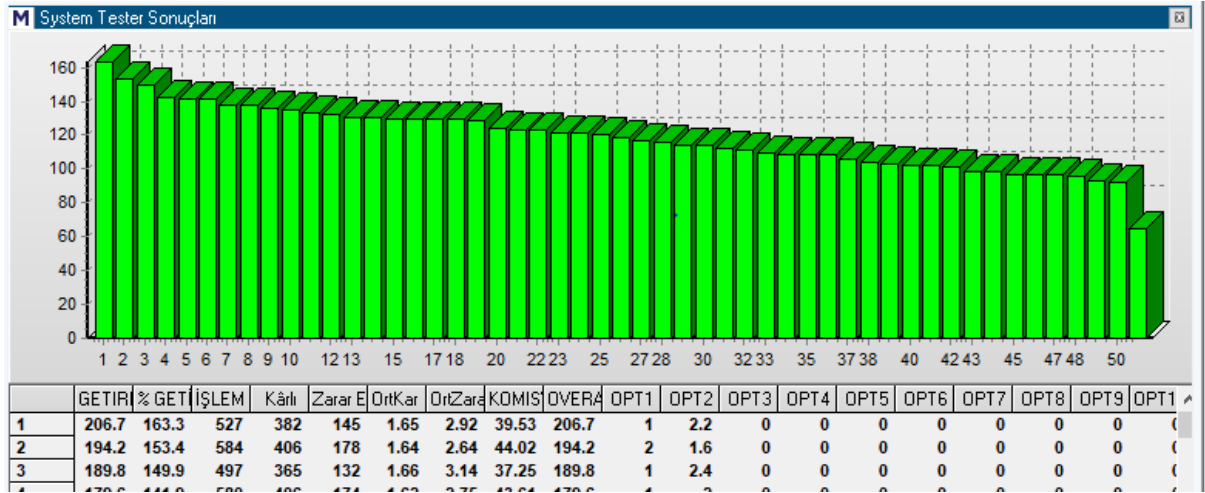
Bu da eşittir %1 kar al stopudur aslına.

Ama geçmiş testinde bu seçim farklı sonuçlar verir. Çünkü, sistem bar içindeki hareketleri bilemez. Yüksek / Düşük ve Kapanış rakamlarına bakar. Vereceği sonuçta en yüksek / düşükten geriye gelişe bakmak zorunda olduğu için yanıltıcı olur.

Temel bir sistemi (Most) önce % 1 kar ile çalıştırıyorum. Elde ettiğim sonuçlar:



Sonra da, hareketli kar al ile, yüzdeler olarak 1 ve 1 seçimi yaparak çalıştırıyorum.



Aradaki farka dikkat ediniz!

Ek Bilgi: Farkın bu derece yüksek olması, esasen yanlış kullanımdan kaynaklanır. Bununla beraber, doğru kullanıldığında dahi, back test ile gerçek hayattaki kullanım arasında, daima pozitif yönde bir hesaplama farkı oluşacaktır.

Oluşacak farkı tahmin etmeye çalışmayınız. Periyoda ve oranlara ve gerçekte yaşanan fiyat hareketlerinin dalgalanma boyutuna göre değişkenlik gösterecektir.

Seans esnasında izleyip sonuçlar aldıkça, fikriniz oluşacaktır.

Hareketli stop veya Kademeli hareketli stop kullanma fikri size, yakın geliyor ise, kullanınız.

Sadece, geçmiş testlerinde getiri artıyor diye kullanmayınız lütfen.

Hareketli stopları, canlı izleyerek incelemeli / kullanma kararınızı buna göre vermelisiniz.

Puan testi ile bir deneme yaparsanız, ve bir müddet izlerseniz, hareketli stopun doğru çalıştığını rahatça görebilirsiniz.

Önemli bir başka detay:

Sistem tester içinde,

Emir bağladığınız bir grafikte, hareketli stoplar olduğunu düşünelim.

Bu grafikte, Simulasyonu yeniden hesapla demek, Geçmiş sil ve back test sonuçlarını getir demektir.

Geçici sinyal kullanan kullanıcılarımız, bunun ne demek olduğunu bilir. Geçici sinyalde emir gönderildi ise ve bu sinyal kalıcıya dönüşmedi ise, simulasyonu yeniden hesapla yaptığınızda, geçici sinyaller kaybolur.

Hareketli stoplar, seansı canlı izlerken, fiyatın bar içindeki hareketlerine göre çalışır ve Stop sağlarlar.

Eğer daha sonra, simulasyonu yeniden hesapla yaparsanız, sistem canlı seans esnasındaki stop yerlerini unuttur. Bilemez.

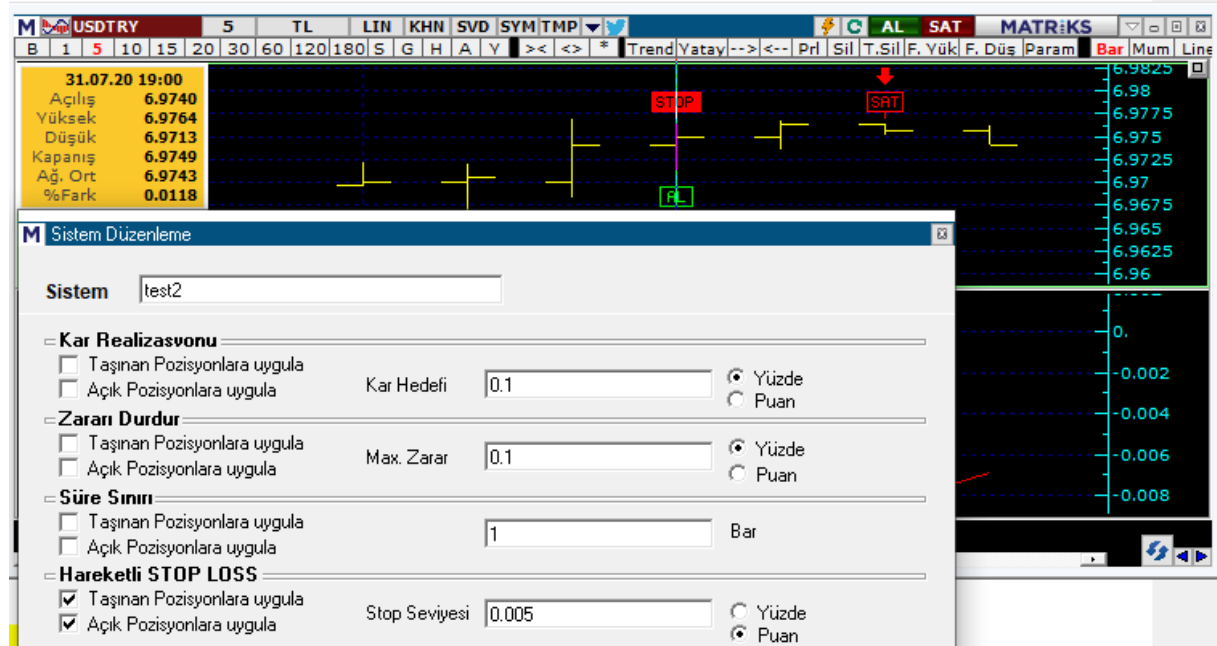
Canlı seans esnasındaki stoplar kalkar. Back test yapmanız halinde oluşacak stoplar gelir.

Bunu da bir örnekle inceleyelim:

Konunun daha net anlatılması / anlaşılması için düz hareketli stop üzerinden yapacağım örneği.

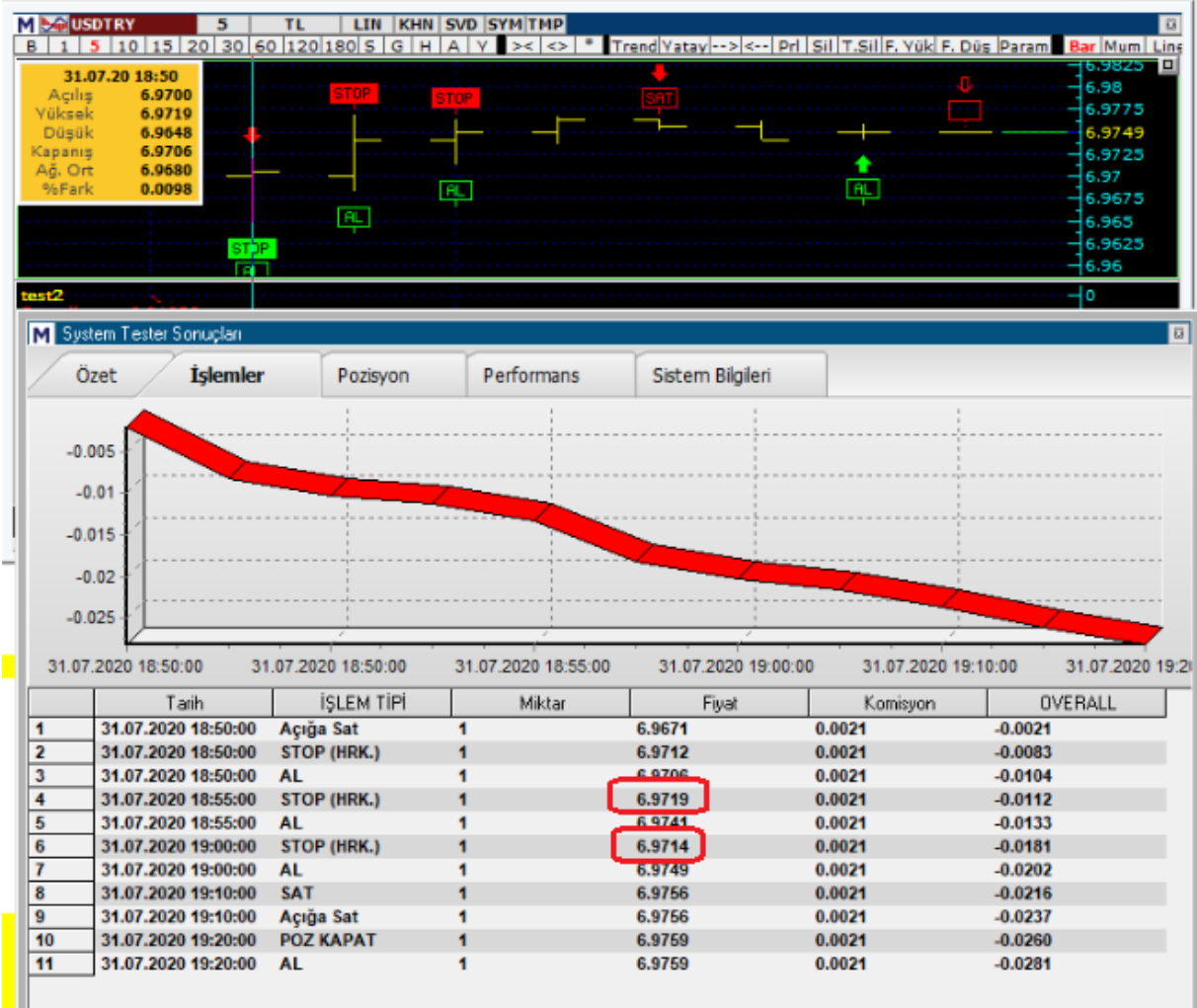
Görmek istediğimiz, seans esnasında oluşan stop ile, back testteki stopun fark edeceği.

Rakamlar üzerinden nasıl olduğunu anlamak. Ve, simulasyonu yeniden hesapla yapınca, stopların, back test durumunda nasıl sonuç verecek ise, o duruma dönecek olması .



USDTRY grafiği üzerinde, 0.005 seviyelik, puan hareketli stopu koyuyor ve izliyorum.

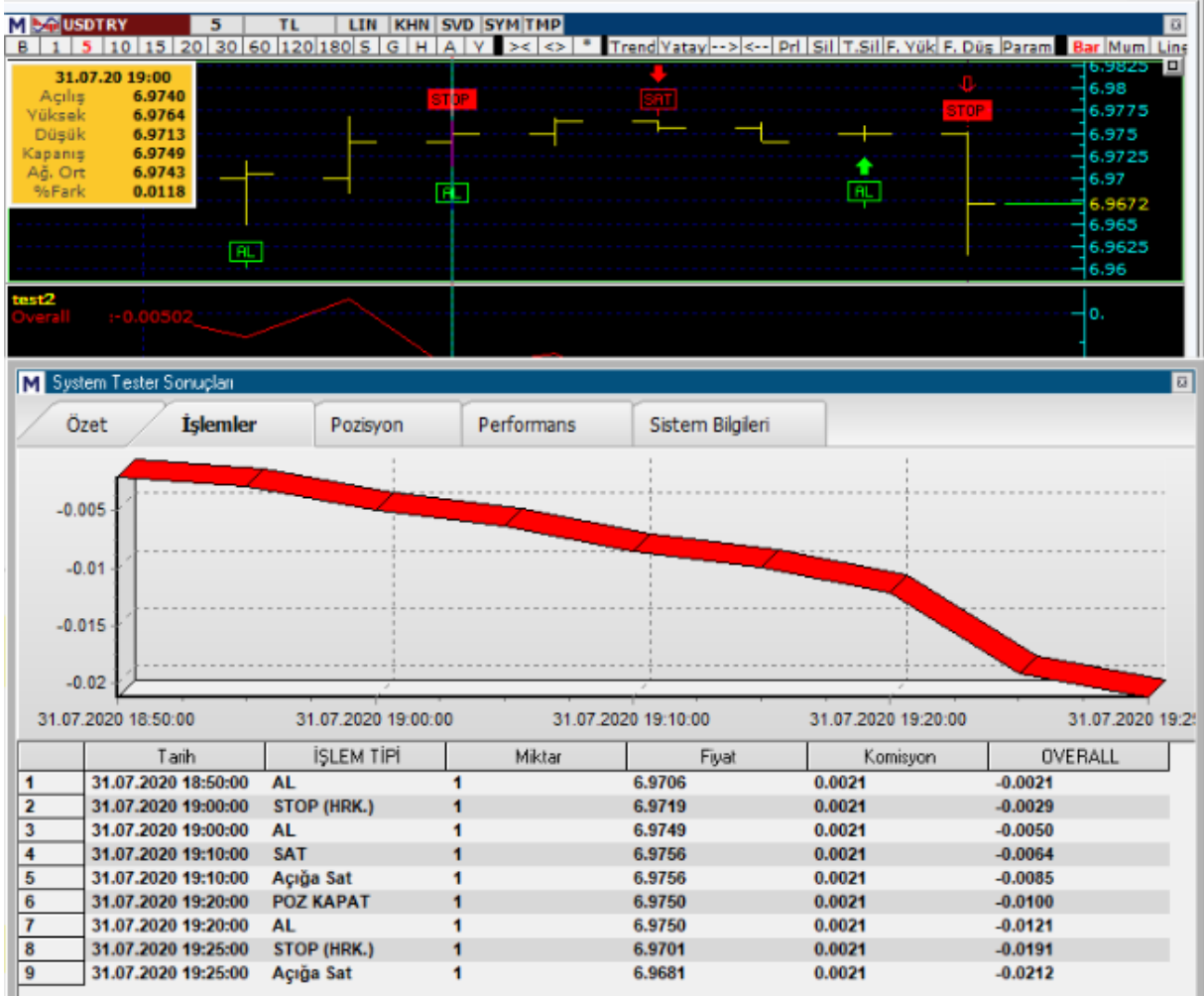
İlk görüntü şöyle



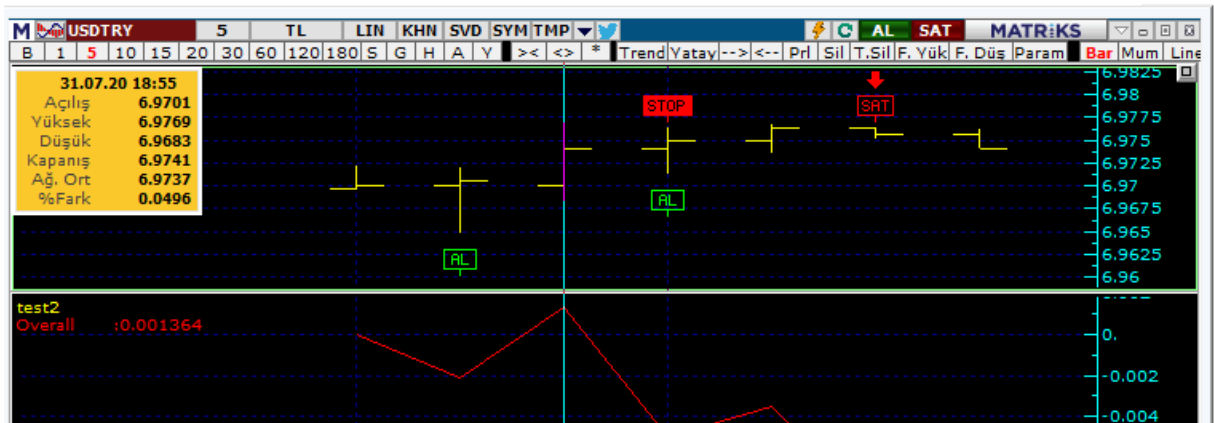
Dikkat ediniz. 18:50 de, 18:55 de ve 19:00 da hareketli stop var. Bunlar canlı seans anında oluşan stoplar.

18:55 ve 19:00 barlarındaki stopları özellikle işaretledim. Az sonra, neden olduğunu anlayacağız.

Şimdi simuasyonu yeniden hesapla yapıyorum. Karşımıza gelen görüntü:

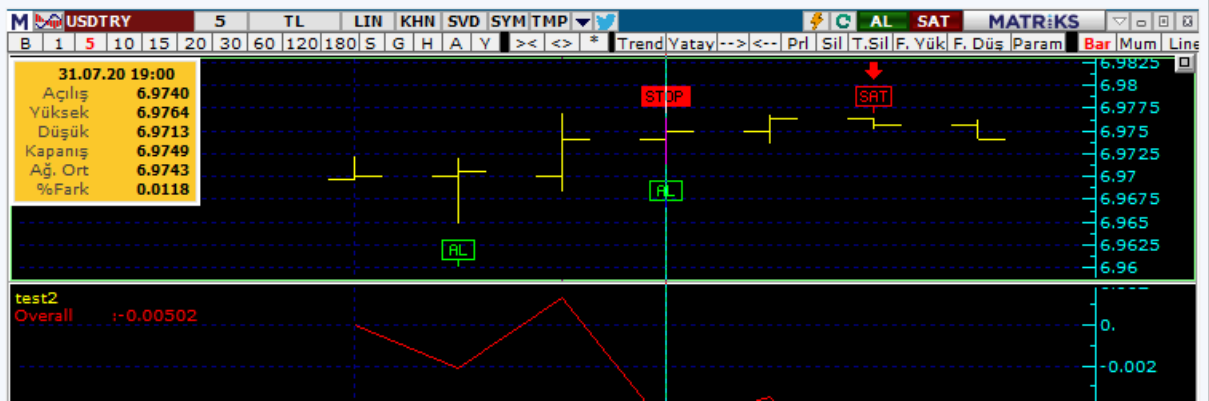


Dikkat: 18:50 ve 18:55'deki stoplar yok oldu. 19:00 daki stopun da, değeri değişti!
18:55 barına odaklanırsak, kolayca anlayacağız.

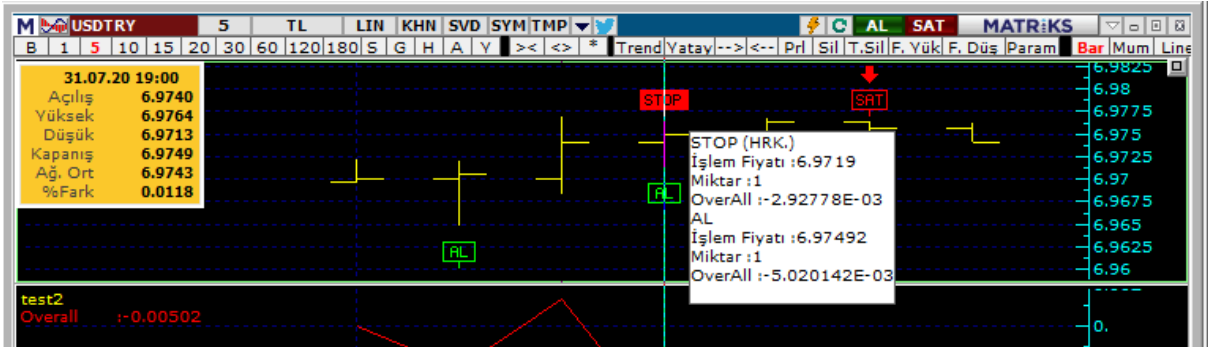


18:55 barı bilgileri yukarıda. 18:50 bar kapanışında AL var.
18:55 barında görülen en yüksek seviye, 6.9769
Kapanış ise: 6.9741 Aradaki fark hareketli stop seviyemiz olan 0.005'ten az.
Bu AL sonrası ilk bar olduğu için, düşük seviyesine bakmıyor. Hangisinin önce olduğunu bilemez...

19:00 barına geçiyoruz.

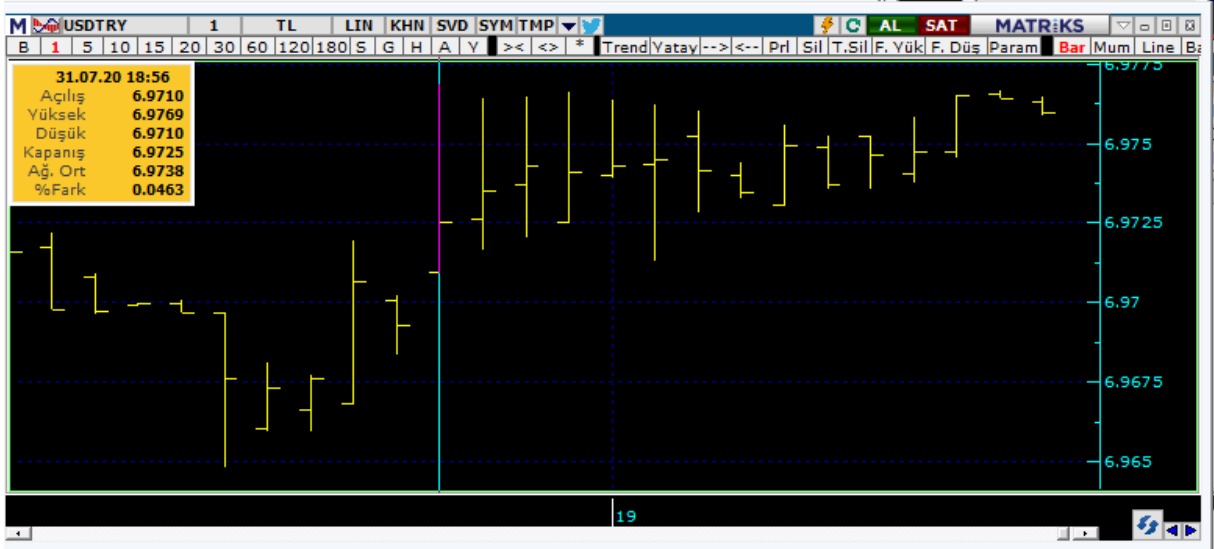


En yüksek, 6.9764. Bir önceki barın yüksekinden daha aşağıda. Hareketli stop tanımına göre baz alınması gereken rakam hangisi. Daha yüksek olan. Yani, 6.9769
Peki, bu barda görülen diğer seviyeler. Kapanış 6.9749 Stop şartını karşılamıyor ama, artık en yüksek seviyeye göre yeni bir bara geçtik. Bu sebeple, bu barda kapanışa değil, en düşüğe bakmalıyız. Yani, 6.9713 seviyesine bakacağız.
Ve, $6.9769 - 6.9713 = 0.0056$ Yani, hareketli stop seviyesinin üstünde bir rakam.
O zaman sistem ne yapıyor. Gördüğü en yüksek seviyenin 0.005 puan altına STOP'u koyuyor. Bu da 6.9719 seviyesidir.



Şuna dikkat ediniz. Yukarıdaki resimlerde var. Seans esnasında oluşan stoplara (Sonradan kaybolan stoplar) baktığımızda, 18:55 barında gerçekleşmiş olan STOP seviyesinin de, 6.9719 olduğunu görebiliriz.

Bu da aslında, canlı seans esnasında, STOP'un doğru çalıştığının bir göstergesidir. O bar içinde, önce en yüksek seviye görülmüştür. Sonra STOP olmayı gerektirecek kadar düşük bir seviyeye erişilmiştir. Bu arada STOP gerçekleşmiştir. Bunu görmek için 1 dk.lık grafiklere bakabiliriz.



1 dk.lık grafiklerde 18:56 ve 18:57 barlarına baktığımızda, neden o periyotta (5 dklık grafik 18:55 barı) stop oluşması gerektiğini gösteriyor. Önce en yüksek seviye görülüyor, sonrada, stop olmayı gerektirecek kadar düşük bir seviye görülüyor.

Bunu ancak, 5 dakikalık periyodun alt periyodlarına bakarak görebiliyoruz. Maalesef, sistem bar içindeki hareketleri bilemediği için, back testte bunları görme şansı olamıyor.

Bunu bir örnek olarak görünüz. Stop geç de olsa, aynı fiyatta olmuş demeyiniz.

19:00 barında fiyat çok daha yüksek bir seviyeyi görebilirdi. Ve, back test açısından stop çok daha yukarılara taşınabilirdi. Bu da fark oluştururdu. Lütfen bunu unutmayınız.

Özet olarak:

Hareketli stoplar, seans esnasında doğru çalışırlar. Backtest esnasında yanıltıcı sonuçlar verebilirler. Bu detayı bilerek hareket etmelisiniz.

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

Tel: 0212 354 54 54

E-posta: egitim@matriksdata.com

Hayırlı kazançlar dileklerimizle...

Temmuz 2020