

## Close strategy

2025

Ali Gholami

این استراتژی بر مبنای این بنا شده که صاحب اصلی بازار جهانی آمریکا هست و قیمت بر اساس تصمیمات اونها تغییر میکنه حالا کمی به چرایی ساده این ماجرا میپردازیم:

از قدیم الایام ماهیت بازار همواره اینگونه عمل میکرد که مثلا بازاری ها میپرسیدن که قیمت شکر یا برنج دیروز رو چقدر بوده؟ بیشترینش چقدر بوده؟ کمترینش چقدر بوده؟ و با همین چندین معیار ساده تصمیم گیری میکردن برای معاملات روز فعلی خودشون.

قیمت کلوز شدن و کمترین و بیشترین قیمت همواره برای تصمیم گیری همگان تاثیرگذار بوده و کلوز مهمترین قیمت برای تصمیم گیری لحاظ میشد چرا که به تصمیم معامله گران و کامپیوترهای تریدینگ این قیمت به عنوان قیمت منصفانه برای انتهای روز لحاظ شده.

(قیمت منصفانه یا fair price به سطحی گفته میشود که در آن تعادل بین خریداران و فروشندگان وجود دارد به عبارتی قیمتی که بازار در آن تعادل نسبی رسیده و حجم معاملات بین عرضه و تقاضا متوازن است.)

\*تلاش بازار در هر لحظه برای یافتن قیمت منصفانه هست و اگر بازار به این نتیجه برسد که قیمت پایین است یا بالا است سریعاً دچار نوسان صعودی یا نزولی میشود و حمایت ها و مقاومت ها نقاطی برای یافتن قیمت منصفانه محسوب میشوند.

\*اگر بازار به این نتیجه برسد که قیمت فعلی مساوی است تعادلی بین خریداران و فروشندگان اتفاق می افتد که به اصطلاح میگوییم بازار در حال رنج زدن یا سایدوی هست.

خلاصه مباحث در ارتباط با اهمیت کلوز:

کلوز بازار امریکا بعنوان سطح حمایتی یا مقاومتی مهمی عمل میکند به علت اینکه در نهایت تصمیم گیرندگان امریکایی در انتهای روز بعنوان قیمت منصفانه پایانی اون قیمت رو مناسب دونستن و برای ترید کردن نیاز به سطوح حمایت و مقاومت داریم.

در چه بازاری؟

همانطور که قبل تر اشاره کردم آمریکا صاحب اصلی بازار جهانی هست و هر نمادی که یک طرف آن به دلار امریکا مربوط باشد این استراتژی برای تصمیم گیری اهمیت پیدا میکند.

اما انتخاب نماد Dowjones بعنوان نماینده ۳۰ شرکت برتر امریکایی و نمادی کاملاً امریکایی میتونه اهمیت تصمیم گیری امریکایی ها در تصمیم گیری برای قیمت رو بیشتر کنه و به همین علت در این نماد این استراتژی را تست میکنیم.

معایب مکانیکی کار کردن با استراتژی کلوز:

در بازار همواره پارامتر های مختلفی بطور همزمان روی تصمیم گیری برای معامله تاثیرگذار هست و مکانیکی کردن استراتژی ها با دخیل کردن سیستم های کوچکتر میتونه باعث بیشتر ضرر کردن سیستمی بشود.

مثلا وقتی در سطح کلوز میرسیم با استفاده از دانش پرایس اکشن به اینکه ایا اینجا جای مناسبی برای معامله هست یا نه و اگر هست چه حد سودی و چه حد ضرری مناسب هست میپردازیم اما در حالت مکانیکی یکسری از ابعاد گسترده ای حذف میشوند و صرفا به دخیل کردن چند پارامتر ساده میپردازیم.

## Close strategy system:

۱. این سیستم در ساعات بازار نیویورک کار میکند.
  ۲. با توجه به کلوز بازار در روز گذشته میباشد.
  ۳. با رسیدن بازار به سطح کلوز بلافاصله معامله در جهت معکوس فعال میشود با حد ضرر معین (۳۰ واحد). (این ناحیه به عنوان ناحیه حمایتی / مقاومتی میباشد).
  ۴. حد سود و تارگت معین تعیین میشود (۵۰ واحد)
  ۵. اگر حد ضرر معامله فعال شد معامله در جهت عکس معامله اول فعال میشود.
  ۶. حد ضرر و حد سود معامله دوم مانند معامله اول تعیین شود.
- در حال حاضر حد ضرر بهینه برای حالت مکانیکی ۳۰ پیپ و حد سود ۵۰ پیپ  
لحاظ شده اما با ازمون خطا میشه به اعداد بهتری رسید.

## Backtest examples:

در فایل ضمیمه یک PDF شامل تعدادی بکتست دستی و نمونه هایی از واکنش بازار به سطح کلوز بررسی میشود.