راهنمای مدیریت سرمایه

26 — BacktestLab سیستم فعال — ساخته‌شده در 2026/08/06 - 18:02
این راهنما مستقیماً از روی کد برنامه ساخته شده است.

مفاهیم پایه

R یعنی چه؟

هر معامله به یک عدد ساده تبدیل می‌شود: نتیجه تقسیم بر ریسکی که کرده بودی. ۱۰۰ دلار ریسک و ۲۵۰ دلار سود یعنی R برابر ۲٫۵؛ همان ۱۰۰ دلار باخت یعنی R برابر منفی ۱. پس تاریخچه‌ی تو یک زنجیره‌ی ثابت از R هاست و سیستم مدیریت سرمایه فقط تصمیم می‌گیرد پای هر کدام چند دلار گذاشته شود. خودِ R ها هرگز عوض نمی‌شوند، فقط وزنشان.

قانون طلایی جبران

ضریب لازم برای جبران پله‌های قبلی برابر است با ۱ + ۱÷R. یعنی با R:R برابر ۲، ضریب ۱٫۵ کافی است و نه ۲. اکثر آدم‌ها کورکورانه ۲ می‌گذارند و همین یک اشتباه عمر حسابشان را نصف می‌کند.

کدام عدد را نگاه کنم؟

سرمایه‌ی نهایی مهم‌ترین نیست. «بیشترین افت» می‌گوید چقدر درد کشیده‌ای، «بزرگ‌ترین ریسک تک‌معامله» می‌گوید در بدترین لحظه چند درصد حساب روی یک معامله بوده، و «وضعیت پایانی» می‌گوید اصلاً زنده مانده‌ای یا نه. سیستمی با بازده ۳۰۰ درصد و ریسک لحظه‌ای ۴۰ درصد، از سیستمی با بازده ۸۰ درصد و ریسک ۳ درصد بدتر است، نه بهتر.

هشدار مهم

این شبیه‌سازی روی همان یک ترتیب واقعی معاملات اجرا می‌شود. اگر همان معاملات با ترتیب دیگری رخ می‌دادند، رتبه‌بندی جدول می‌توانست کاملاً عوض شود. ممکن است مارتینگل در جدول تو بالا بیفتد فقط به این دلیل که تصادفاً زنجیره‌ی شش‌تایی باخت نداشته‌ای. این شانس است، نه برتری.

پایه‌های سالم

استانداردهای جاافتاده. اگر آخرِ کار به یکی از این‌ها برگشتی، تعجب نکن.

1. درصد ثابت از سرمایه

درصد ثابتی از موجودی لحظه‌ای ریسک می‌شود؛ استاندارد طلایی و مبنای مقایسه.
این سیستم پارامتر تنظیمی ندارد؛ رفتارش کاملاً از پیش تعیین‌شده است.

2. حجم ثابت (مبلغ ثابت)

همیشه یک مبلغ ثابت از سرمایه‌ی اولیه ریسک می‌شود؛ ساده‌ترین و بی‌خطرترین مبنا.
این سیستم پارامتر تنظیمی ندارد؛ رفتارش کاملاً از پیش تعیین‌شده است.

3. نسبت ثابت (رایان جونز)

حجم فقط وقتی یک پله بالا می‌رود که سود انباشته به اندازه‌ی دلتا رشد کند.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
100,000	50	**1,000**	دلتا (مبلغ هر پله)

کازینویی‌های مهارشده

پیشرفت حجم دارند، ولی بدترین حالتشان از پیش معلوم و قفل‌شده است. ستاره‌دارها طراحی اختصاصی همین برنامه‌اند.

4. جبران بودجه‌دار ★

اول تصمیم می‌گیری در یک چرخه‌ی بد چند درصد حساب را حاضری بدهی، بعد کل نردبان جبران دقیقاً داخل همان بودجه چیده می‌شود. برعکس مارتینگل که اول ضریب را می‌بندد و بعد می‌فهمد چقدر ضرر می‌دهد.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
15.00	0.50	**4.00**	بودجه‌ی هر چرخه (٪ حساب)
8	2	**4**	تعداد پله‌ی چرخه

3.00	1.10	**1.50**	ضریب پله

5. نردبان پول خانه ★

فقط با سودی که همین رگه‌ی برد ساخته قمار می‌کنی. اگر رگه بشکند، حداکثر همان چیزی را پس می‌دهی که خودِ رگه به تو داده بود؛ سرمایه‌ی اصلی دست‌نخورده می‌ماند.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
1.00	0.10	**0.50**	سهم سود رگه در ریسک بعدی
10.0	1.5	**4.0**	سقف واحد

6. مارتینگل ریشه‌ای ★

به‌جای رشد نمایی، ریسک با ریشه‌ی شماره‌ی پله بالا می‌رود: پله‌ی نهم در مارتینگل ۲۵۶ برابر پایه است، اینجا حدود ۳ برابر. زنجیره‌ی باخت را از فاجعه به یک خراش تبدیل می‌کند، در ازای جبران کندتر.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
1.50	0.30	**0.50**	توان رشد
15	2	**6**	حداکثر پله
10.0	1.5	**3.0**	سقف واحد

7. دو جیب ★

حساب به دو جیب تقسیم می‌شود: جیب اصلی که هرگز دست نمی‌خورد و جیب ماجراجو که کل نردبان داخلش جا شده. سودش به جیب اصلی منتقل می‌شود و اگر خالی شد، برنامه تا آخر با ریسک ثابت ادامه می‌دهد.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
50.0	2.0	**15.0**	سهم جیب ماجراجو (٪ سرمایه)
8	2	**5**	تعداد پله‌ی نردبان
3.00	1.20	**2.00**	ضریب پله

8. آنتی‌مارتینگل با فیوز ★

روی بردها بزرگ می‌شود، ولی با چند باخت پیاپی یک فیوز می‌پرد و برای چند معامله با ریسک نصف ادامه می‌دهی. همان قانونی که خیلی‌ها می‌خواهند رعایت کنند و نمی‌توانند، اینجا خودکار است.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
3.00	1.10	**1.60**	ضریب رشد بعد از برد
8	1	**3**	حداکثر پله
8	2	**3**	چند باخت پیاپی فیوز را بزند
30	1	**6**	طول دوره‌ی خنک‌سازی
100	10	**50**	ریسک دوره‌ی خنک‌سازی (٪ پایه)

9. پارولی (نردبان کوتاه برد)

بعد از هر برد یک پله بالا می‌روی و در انتهای نردبان، چه ببری چه ببازی، به پایه برمی‌گردی. چون نردبان روی بردهای قبلی ساخته شده، بدترین حالتش سودِ رگه را می‌خورد نه سرمایه را.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
6	2	**3**	طول نردبان
3.00	1.20	**2.00**	ضریب هر پله

10. دنباله‌ی ۱-۳-۲-۶

چهار پله روی بردهای پیاپی. پله‌ی سوم عمداً از دومی کوچک‌تر است تا سود قفل شود؛ از آن پله به بعد چرخه حتی با باخت هم سودده تمام

می‌شود.
این سیستم پارامتر تنظیمی ندارد؛ رفتارش کاملاً از پیش تعیین‌شده است.

11. فیبوناچی معکوس

همان دنباله‌ی فیبوناچی، ولی روی بردها جلو می‌رود و با اولین باخت مستقیم به خانه‌ی اول برمی‌گردد.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
7	2	**4**	حداکثر گام

12. لابوشر معکوس

خط اعداد با هر برد بلندتر و با هر باخت کوتاه‌تر می‌شود؛ یعنی رگه‌ی بد خودش شرط‌ها را کوچک می‌کند — دقیقاً برعکس نسخه‌ی خطرناکِ اصلی.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
10	2	**4**	طول خط اولیه
40	2	**12**	سقف واحد

13. سیستم ۳۱ (بودجه‌ی بسته)

دنباله‌ی کلاسیک ۱-۱-۱-۲-۲-۴-۴-۸-۸ که مجموعش دقیقاً ۳۱ واحد است. کل چرخه داخل یک بودجه‌ی درصدی جا داده شده، پس بدترین حالت ممکن همان بودجه است و نه یک ریال بیشتر.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
20.00	1.00	**6.00**	بودجه‌ی هر چرخه (٪ حساب)

ریاضی و آماری

ریسک را از روی آمار واقعی معاملات خودت حساب می‌کنند.

14. کِلی کسری

ریسک را از روی درصد برد و R واقعیِ گذشته حساب می‌کند؛ نصف یا یک‌چهارم کِلی عاقلانه است.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
1.00	0.10	**0.50**	کسر کِلی
200	10	**40**	پنجره‌ی محاسبه

15. اپتیمال f (جست‌وجوی عددی)

با آزمون‌وخطا کسری را پیدا می‌کند که رشد هندسی گذشته را بیشینه کند.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
1.00	0.10	**0.50**	ضریب احتیاط
300	20	**60**	پنجره‌ی محاسبه

ساختاری و رفتاری

به‌جای فرمول حجم، قاعده‌ی رفتاری می‌گذارند: کِی معامله نکن، کِی برداشت کن.

16. فیلتر منحنی سرمایه

وقتی منحنی سرمایه زیر میانگین متحرکش برود، معامله را رد می‌کند تا رگه‌ی بد تمام شود.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر

60	3	**10**	دوره‌ی میانگین

17. نردبانی (پله‌های رشد)

هر بار سرمایه یک پله رشد کند، درصد ریسک کمی بالا می‌رود و در افت پایین می‌آید.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
100	5	**25**	هر چند درصد رشد
2.00	0.10	**0.50**	افزایش ریسک هر پله (٪)

18. ریسک روی سود انباشته

روی سرمایه‌ی اولیه محافظه‌کار می‌ماند و فقط بخشی از سودِ به‌دست‌آمده را جسورانه ریسک می‌کند.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
3.00	0.10	**1.00**	سهم سود در ریسک

19. برداشت پله‌ای سود

با هر پله رشد، بخشی از سود از حساب خارج و بی‌خطر می‌شود؛ کندتر ولی خواب‌راحت‌تر.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
100	5	**20**	هر چند درصد رشد
90	10	**50**	چند درصد سود برداشته شود

خطرناک‌ها (برای عبرت)

این‌ها از کازینو آمده‌اند نه از بازار. نگهشان داشته‌ایم تا شکستشان را روی داده‌ی خودت ببینی، نه اینکه استفاده‌شان کنی.

20. مارتینگل (افزایش بعد از باخت)

بعد از هر باخت ریسک ضرب می‌شود؛ منحنی صاف می‌سازد تا روزی که نمی‌سازد.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
5.00	1.10	**2.00**	ضریب افزایش
12	1	**5**	حداکثر پله

21. آنتی‌مارتینگل (افزایش بعد از برد)

بعد از هر برد ریسک بیشتر و بعد از باخت به پایه برمی‌گردد؛ سوارِ رگه‌های خوب می‌شوی.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
4.00	1.10	**1.50**	ضریب افزایش
10	1	**3**	حداکثر پله

22. دالامبر (پله‌ای ملایم)

بعد از باخت یک واحد اضافه و بعد از برد یک واحد کم می‌شود؛ نسخه‌ی رام‌شده‌ی مارتینگل.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
20	2	**8**	حداکثر واحد

23. دالامبر معکوس

بعد از برد یک واحد اضافه و بعد از باخت یک واحد کم می‌شود.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر

20	2	**8**	حداکثر واحد

24. فیبوناچی

بعد از باخت یک گام جلو و بعد از برد دو گام عقب در دنباله‌ی فیبوناچی.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
15	2	**8**	حداکثر گام

25. لابوشر (خط اعداد)

یک دنباله‌ی هدف می‌سازد و با هر برد دو سرش را حذف می‌کند تا خط تمام شود.

بیشینه	کمینه	پیش‌فرض	پارامتر
10	2	**4**	طول خط اولیه
40	2	**15**	حداکثر واحد

26. اسکار گراینده

هدفش سود یک واحدی در هر چرخه است؛ بعد از برد یک پله بالا، بعد از باخت ثابت.
این سیستم پارامتر تنظیمی ندارد؛ رفتارش کاملاً از پیش تعیین‌شده است.

جدول مرجع سریع

#	سیستم	گروه	تعداد تنظیمات	کلید داخلی
1	درصد ثابت از سرمایه	پایه‌های سالم	0	fixed_fractional
2	حجم ثابت (مبلغ ثابت)	پایه‌های سالم	0	fixed_amount
3	نسبت ثابت (رایان جونز)	پایه‌های سالم	1	fixed_ratio
4	جبران بودجه‌دار ★	کازینویی‌های مهارشده	3	budget_recovery
5	نردبان پول خانه ★	کازینویی‌های مهارشده	2	house_money
6	مارتینگل ریشه‌ای ★	کازینویی‌های مهارشده	3	sqrt_martingale
7	دو جیب ★	کازینویی‌های مهارشده	3	two_pocket
8	آنتی‌مارتینگل با فیوز ★	کازینویی‌های مهارشده	5	circuit_anti
9	پارولی (نردبان کوتاه برد)	کازینویی‌های مهارشده	2	paroli
10	دنباله‌ی ۱-۳-۲-۶	کازینویی‌های مهارشده	0	seq_1326
11	فیبوناچی معکوس	کازینویی‌های مهارشده	1	anti_fibonacci
12	لابوشر معکوس	کازینویی‌های مهارشده	2	reverse_labouchere
13	سیستم ۳۱ (بودجه‌ی بسته)	کازینویی‌های مهارشده	1	system31
14	کِلی کسری	ریاضی و آماری	2	kelly
15	اپتیمال f (جست‌وجوی عددی)	ریاضی و آماری	2	optimal_f
16	فیلتر منحنی سرمایه	ساختاری و رفتاری	1	equity_filter
17	نردبانی (پله‌های رشد)	ساختاری و رفتاری	2	milestone
18	ریسک روی سود انباشته	ساختاری و رفتاری	1	ratchet
19	برداشت پله‌ای سود	ساختاری و رفتاری	2	withdraw

martingale	2	خطرناک‌ها (برای عبرت)	**مارتینگل (افزایش بعد از باخت)**	20
anti_martingale	2	خطرناک‌ها (برای عبرت)	**آنتی‌مارتینگل (افزایش بعد از برد)**	21
dalembert	1	خطرناک‌ها (برای عبرت)	**دالامبر (پله‌ای ملایم)**	22
anti_dalembert	1	خطرناک‌ها (برای عبرت)	**دالامبر معکوس**	23
fibonacci	1	خطرناک‌ها (برای عبرت)	**فیبوناچی**	24
labouchere	2	خطرناک‌ها (برای عبرت)	**لابوشر (خط اعداد)**	25
oscar	0	خطرناک‌ها (برای عبرت)	**اسکار گرایند**	26

پیشنهاد عملی: هر سیستم را با پارامترهای مختلف اجرا کن و به‌جای «کدام بیشترین سود را داد؟» بپرس «کدام در بدترین حالت هنوز زنده بود؟». اگر بعداً همین موتور را به صفحه‌ی مونت‌کارلو وصل کنی و هزار ترتیب تصادفی بگیری، به «احتمال ورشکستگی» می‌رسی که تنها معیار واقعاً معتبر برای مقایسه‌ی این سیستم‌هاست.

این سند خودکار ساخته شده است. برای به‌روزرسانی دوباره اجرا کن: python make_guide.py