

कोड बेस अल्लो ट्रेडिंग बॅक निफ्टी ट्रेड फॉलोविंग स्टॅटजी

1. **अल्लो ट्रेडिंगचा उद्देश :-** नियमित पणे फायदा (फ्रॉफीट) मिळविण्यासाठी कोणत्याही सेजमेंट मध्ये ट्रेडिंग करण्यासाठी
 1. **मनी मॅनेजमेंट** - फ्रॉफीट / लॉस किती प्रमाणात घेणार हे अगोदरच ठरविणे आवश्यक आहे.
 2. **रूल :-** ट्रेड खरेदी करणे किंवा विकणे हे कशाच्या अधारावर करणार, एका दिवसात किती ट्रेड घेणार, लॉस झाला तर काय करायचे हे ठरविणे, स्वताच्या स्टॅटजी व विश्वास ठेवत तिला किमान एक महीना वापरणे. आवश्यक आहे
 3. **सायकोलॉजी :-** कोणत्याही परीस्थिती मध्ये मनी मॅनेजमेंट व रूल नुसारच काम करणार त्याच बरोबर लॉस झाला तरी पॅनीक होवुन स्वताचे रूल व मनी मॅनेजमेंट यांचेशी कॉम्प्रमाईज करणार नाही. यावर कायम ठाम राहणे.
 4. **अॅक्टिव राहणे :-** नेहमी मार्केट बदल सर्व गोष्टी जाणुन घेणे, स्वताचे ज्ञान वाढवत राहणे, मार्केटच्या प्रत्येक हालचालीवर लक्ष ठेवुन त्यानुसार नविन नियम तयार करणे स्टॅटजी मध्ये बदल करणे. निर्णय घेणे आवश्यक आहे.

परंतु सामान्य माणुस ज्याच्या कडे त्याचे दैनंदिन काम करुन मार्केट मध्ये फ्रॉफीट मिळविण्यासाठी वरील सर्व गोष्टी करण्यासाठी पुरेसा वेळ नाही. त्याच बरोबर ज्ञानाची कमतरता असणे त्यामुळे तो नेहमी मार्केट मध्ये तोटा सहन करतो. त्यावर उपाय म्हणुन अल्लो ट्रेडिंग च्या माध्यमामातुन मनी मॅनेजमेंट, रूल, सायकोलॉजी यावर नियंत्रण ठेवता येवु शकते.

2. **अंडरलाईन सेजमेंट :- बॅक निफ्टी** :- बॅकनिफ्टी हि इंडेक्स सर्व इंडेक्स पेक्षा जास्त वोलाटाईल असल्याने आपण सर्व प्रथम या अंडलाईन अॅसेटची (सेजमेंटची) निवड केली आहे.
3. **ट्रेडिंग सेजमेंट :- बॅकनिफ्टी ऑपशन्स बायींग** :- बॅकनिफ्टी आपशन्स मध्ये ऑपशन्स बायींग आणि सेलींग असे दोन प्रकार आहेत त्या पैकी ऑपशन्स सेलींग साठी जास्त प्रमाणात कॅपीटलची आवश्यकता असते त्या तुलनेत ऑपशन्स बायींग मध्ये फक्त प्रिमीयम इतक्याच कॅपीटलची आवश्यकता असल्याने ट्रेडिंग साठी ऑपशन्स बायींग सेजमेंट ची निवड केली आहे.
4. **सेजमेंट ड्रॉबॅक :-** ऑपशन्स सेलींग या प्रकारात फ्रॉफीट मिळण्याची प्रोबॅलीटी 70% तर ऑपशन्स बायींग या प्रकारात फ्रॉफीट मिळण्याची प्रोबॅलीटी 30% आहे. ऑपशन्स सेलर मार्केट वोलाटाईल किंवा साईडवे असेल तर फ्रॉफीट मिळवु शकतो. ऑपशन्स बायर फक्त वोलाटाईल मार्केट मध्येच फ्रॉफीट मिळवु शकतो.

5. ट्रेडिंग स्टॅटजी :-

1. **इंट्राडे ट्रेडिंग :-** आपण इंट्राडे ट्रेडिंग करणार आहोत. बॅक निफ्टी हि इंडेक्स शक्यतो दररोज गॅप डाउन किंवा गॅप अप ओपन होत असते. त्याचा परीणाम ऑपशन्सच्या प्रिमीयमवर दिसुन येतो. इंडेक्स गॅप अप ओपन झाली तर कॉल ऑपशन्सचे प्रिमीयम मध्ये अचानक वाढ होते तर पुट ऑपशन्सच्या प्रिमीयम मध्ये अचानक मोठ्या प्रमाणात घट होते. त्याच बरोबर इंडेक्स गॅप डाउन ओपन झाली तर कॉल ऑपशन्सचे प्रिमीयम मध्ये अचानक मोठ्या प्रमाणात घट व पुट

ऑपशन्सच्या प्रिमीयम मध्ये अचानक मोठया प्रमाणात वाढ होते. अशा परीस्थीती मध्ये आपण आपला ट्रेड पुढच्या दिवसात कॅरीफारवर्ड केला तर अनपेक्षीत नुकसान होण्याची शक्यता जास्त आहे. त्यामुळे प्रत्येक दिवसाचा ट्रेड हा त्याच दिवशी आपल्याला पुर्ण करायचा आहे. त्याच बरोबर ऑपशन्स मध्ये थिटा या गिक्स मुळे कॉन्ट्रॉक्ट चा कालावधी पुर्ण होत येतो त्या प्रमाणे ऑपशन्स प्रिमीयम मध्ये घट होण्यास सुरवात होते. परीणामी अपेक्षीत प्रॉफीट पेक्षा लॉस होण्याची शक्यता वाढते.

2. वेळेची मर्यादा :- मार्केटची वेळ सकाळी 9.15 ते 3.30 वाजे पावेतो असते. आमच्या अभ्यासाप्रमाणे मार्केट सुरु होताच 9.15 ते 9.30/9.45 या वेळेत मार्केटची दिशा समजणे अवघड असते. या वेळेत घाईमध्ये कोणाताही ट्रेड नुकसानकारक ठरू शकतो. त्यामुळे आपण ट्रेड साधारण 9.45 नंतरच घेणार आहोत. त्याच बरोबर मार्केट दुपारी 3.30 वाजता क्लोज होते. त्याचे किमान 15 मिनीट आपला ट्रेड क्लोज करणे आवश्यक असल्याने आपण सकाळी 9.45 ते दुपारी 3.15 या वेळेतच ट्रेडींग करण्याचे नियोजन केले आहे.

3. ट्रेड कसा घेणार :-

अ) टाईम फ्रेम :- ट्रेडींगसाठी आपण 5 मिनीट कॅन्डलस्टिक पॅटर्न वापरणार आहोत. आपल्या स्टॅटर्जी प्रमाणे बॅक टेस्ट साठी इतर टाईम फ्रेम चा वापर करुन पाहिला परंतु त्या सर्वात चांगला रिझल्ट 5 मिनिट पॅटर्न मध्ये मिळाल्याने आपण या टाईफ्रेमची निवड केली आहे.

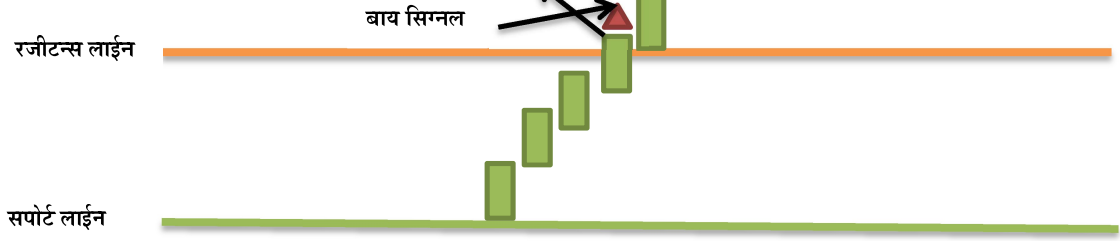
ब) सपोर्ट रज्जिटन्स झोन :- सकाळी 9.15 ते 9.45 या वेळे मधील हाय व्हॅल्यु आपला रज्जिटन्स पॉइंट असणार आहे. तर सर्वात लो व्हॅल्यु आपला सपोर्ट पॉइंट असणार आहे. सकाळी 9.45 वाजे नंतर मार्केट ने रज्जिटन्सस पॉइंटला ब्रेक केले तर आपण कॉल बाय करणार आहोत. त्याच प्रमाणे रज्जिटन्स पॉइंटला ब्रेक केले तर आपण पुट बाय करणार आहोत (हाय व लो व्हॅल्यु पासुन 10 पॉइंट बफर घेणार आहोत)

पहिला ट्रेड :- बॅक निफ्टी या अंडरलाईन अॅसेटवर आपला कोड रन होणार, बॅक निफ्टीची चार्ट वर असा सेल किंवा बाय सिग्नल जनरेट झाल्यावर आपण सिग्नल जनरेट झालेल्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्युचे जवळ पास असणारे स्ट्राईक प्राईसचा (अॅट द मनी) पुट / कॉल ऑपशन बाय करणार आहोत.

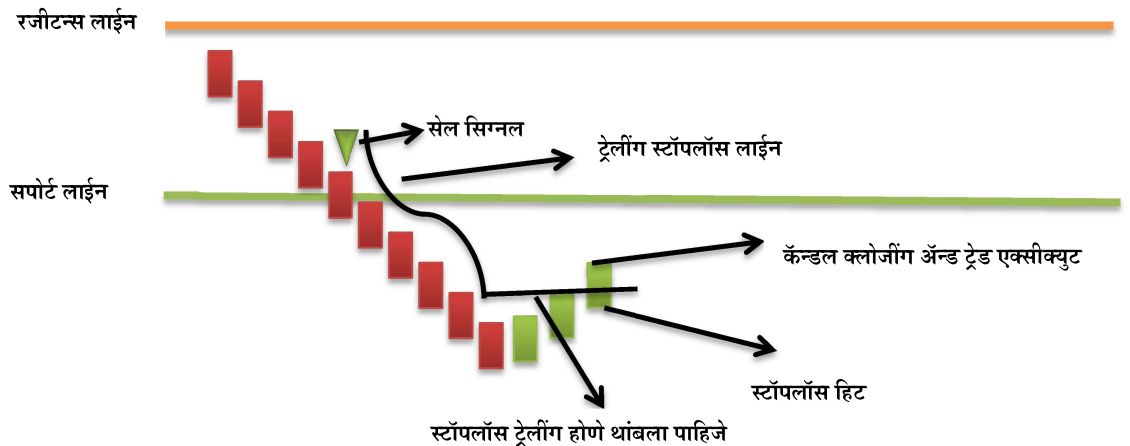


सेल सिग्नल हा कॅन्डल क्लोज झाले नंतरच तयार होत असल्याने आपण पुट ऑपशन बायची पोजीशन कॅन्डल चे क्लोजींग व्हॅल्युवर घेणार आहोत

बाय सिग्नल हा कॅन्डल क्लोज झाले नंतरच तयार होत असल्याने आपण कॉल ऑपशन बायची पोजीशन कॅन्डल चे क्लोजींग व्हॅल्युवर घेणार आहोत

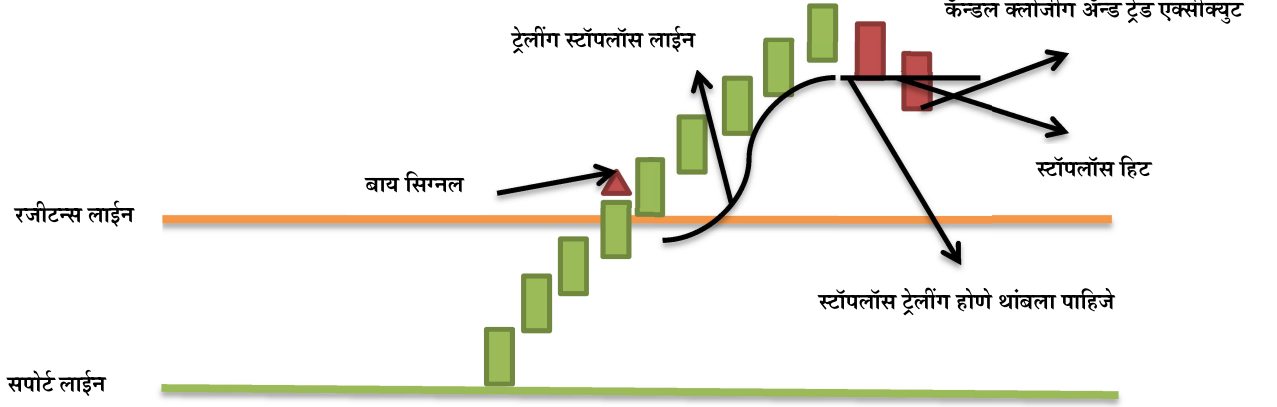


क) ट्रेलींग स्टॉप लॉस :- सेल पोजीशन :- बँक निफ्टीचे चार्ट वर ज्या कॅन्डलला सेल सिग्नल मिळाला आहे. त्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु पासून सर्वात जवळचे स्ट्राईक प्राईसचा पुट ऑपशनस आपण बाय करणार आहोत. त्याच बरोबर सिग्नल जनरेट झालेल्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु मध्ये 25 पॉइंट अँड करुन जी व्हॅल्यु मिळेल ती आपली स्टॉप लॉसची व्हॅल्यु असणार आहे. पोजीशन घेतल्यानंतर पुढील प्रत्येक कॅन्डलचे क्लोजींग प्राईज हि तिचे मागचे कॅन्डलच्या क्लोजींग व्हॅल्यु पेक्षा कमी असेल तेव्हा त्या कॅन्डलच्या क्लोजींग व्हॅल्यु मध्ये पुन्हा 25 पॉइंट अँड करुन स्टॉप लॉस व्हॅल्यु पेक्षा कमी यणारे कॅन्डचे क्लोजींग व्हॅल्यु पर्यंत ट्रेल होणार परंतु मागचे कॅन्डलचे क्लोजींग पॉइंट पासून पुढचे कॅन्डलची क्लोजींग व्हॅल्यु जास्त असेल अशा वेळी स्टॉप लॉस ट्रेल होणार नाही. तो आहे त्याच ठिकाणी स्टॉप राहील. अशी सायकल कन्ट्युन्यु चालु राहील. जेव्हा स्टॉप लॉस चे व्हॅल्यु पेक्षा ज्या कॅन्डलची क्लोजींग व्हॅल्यु जास्त राहील तेव्हा त्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्युला आपला स्टॉपलॉस हिट होवुन आपली ऑर्डर एक्सीक्युट होईल.



बाय पोजीशन :- बँक निफ्टीचे चार्ट वर ज्या कॅन्डलला बाय सिग्नल मिळाला आहे. त्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु पासून सर्वात जवळचे स्ट्राईक प्राईसचा कॉल ऑपशनस आपण बाय करणार आहोत. त्याच बरोबर सिग्नल जनरेट झालेल्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु मध्ये 25 पॉइंट मायनस करुन जी व्हॅल्यु मिळेल ती आपली स्टॉप लॉसची व्हॅल्यु असणार आहे. पोजीशन घेतल्यानंतर

पुढील प्रत्येक कॅन्डलचे क्लोजींग प्राईज हि तिचे मागचे कॅन्डलच्या क्लोजींग व्हॅल्यु पेक्षा जास्त असेल तेव्हा त्या त्या कॅन्डलच्या क्लोजींग व्हॅल्यु मध्ये पुन्हा 25 पॉइंट मायनस करुन स्टॉप लॉस व्हॅल्यु पेक्षा **जास्त** यणारे कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु पर्यंत ट्रेल होणार परंतु मागचे कॅन्डलचे क्लोजींग पॉइंट पासुन **पुढचे कॅन्डलची क्लोजींग व्हॅल्यु कमी** असेल अशा वेळी **स्टॉप लॉस ट्रेल होणार नाही**. तो आहे त्याच ठिकाणी **स्टॉप** राहील. अशी सायकल कन्ट्युन्यु चालु राहील. जेव्हा स्टॉप लॉस चे व्हॅल्यु पेक्षा ज्या कॅन्डलची क्लोजींग व्हॅल्यु **कमी** राहील तेव्हा त्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्युला आपला **स्टॉपलॉस हिट** होवुन आपली **ऑर्डर एक्सीक्युट** होईल.

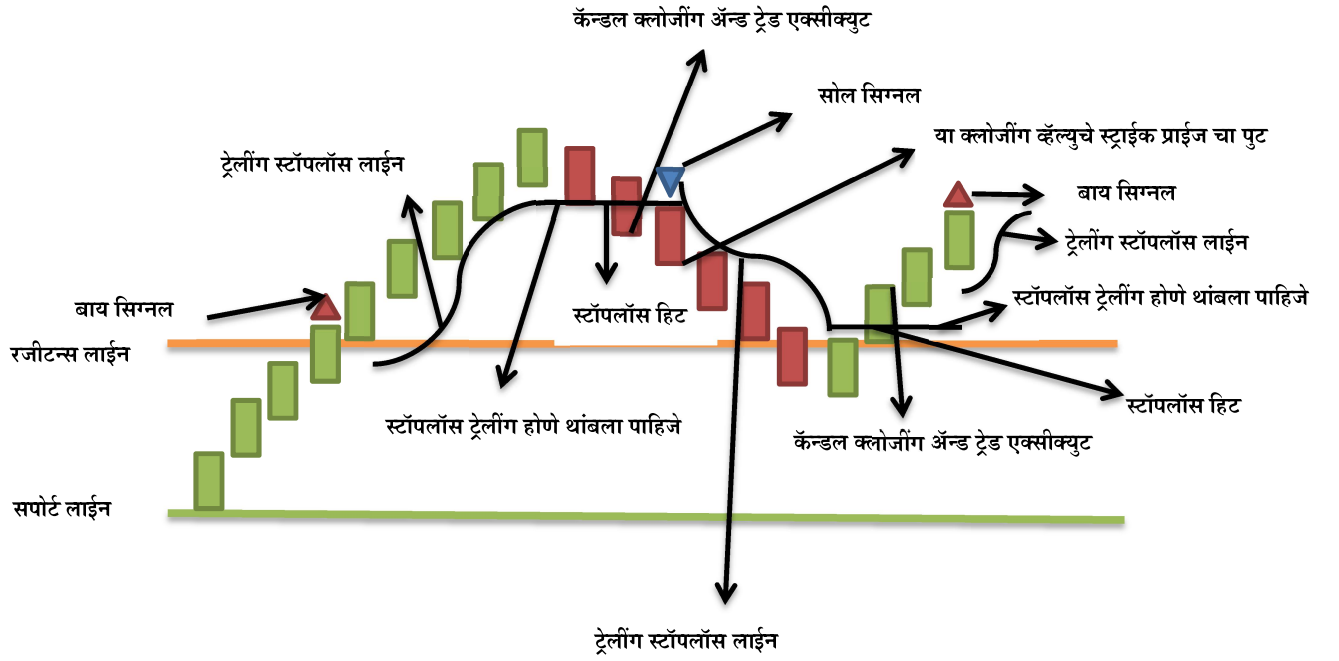


दुसरा ट्रेड :- ज्या वेळेस पहिला ट्रेड स्टॉप लॉस हिट होवुन ज्या कॅन्डलच्या क्लोजींग व्हॅल्युवर एक्सीक्युट होईल त्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु पासुन कोणत्याही पुढील कॅन्डलची क्लोजींग व्हॅल्यु 25 पॉइंट पेक्षा जास्त असेल तेव्हा पुन्हा बॅक निफ्टीचे कॅन्डल स्टिक पॅटर्न वर बाय सिग्नल जनरेट होवुन ज्या कॅन्डलचे क्लोजींग वर बाय सिग्नल जनरेट झाला आहे त्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु पासुन सर्वात जवळचे स्ट्राईक प्राईसचा कॉल ऑप्शन्स बाय करणार आहोत.

किंवा

ज्या वेळेस पहिला ट्रेड स्टॉप लॉस हिट होवुन ज्या कॅन्डलच्या क्लोजींग व्हॅल्युवर एक्सीक्युट होईल त्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु पासुन कोणत्याही पुढील कॅन्डलची क्लोजींग व्हॅल्यु 25 पॉइंट पेक्षा कमी असेल तेव्हा पुन्हा बॅक निफ्टीचे कॅन्डल स्टिक पॅटर्न वर सेल सिग्नल जनरेट होवुन ज्या कॅन्डलचे क्लोजींग वर सेल सिग्नल जनरेट झाला आहे त्या कॅन्डलचे क्लोजींग व्हॅल्यु पासुन सर्वात जवळचे स्ट्राईक प्राईसचा पुट ऑप्शन्स बाय करणार आहोत.

कॉल बाय किंवा पुट बाय झाल्यानंतर पुन्हा वरील प्रमाणे स्टॉपलॉस सुरु होईल. व स्टॉप लॉस हिट झाले नंतर याच प्रमाणे पुढील ट्रेड घेणार आहोत.



या पध्दतीने ट्रेडिंगची सायकल सकाळी 9:45 ते दुपारी 3:15 पर्यंत चालू राहणार आहे. ज्यावेळी दुपारी 3:15 पर्यंत आपण घेतलेल्या एखाद्या ट्रेड चा स्टॉप लॉस हिट होवुन पोजीशन एक्सीक्युट होणार नाही अशा वेळी दुपारी 3.15 वाजेच्या कॅन्डललचे क्लोजिंगला आपला ट्रेड एक्सीक्युट झाला पाहिजे.

आपण घेतलेली प्रत्येक पोजीशन हि स्टॉपलॉस हिट होवुनच एक्सीक्युट होणार आहे. यात आपण फ्रॉफीटचा कोणाताही रेशो लावणार नाही. एक्सीक्युट पोजीशन साठी आपण फक्त कॅन्डलची क्लोजिंग प्राईज गृहीत धरणार आहोत. (कॅन्डलची हाय किंवा लो व्हॅल्यु गृहीत धरायची नाही. कारण बरेच वेळा हाय किंवा लो व्हॅल्यु ही स्टॉपलॉस व्हॅल्युला क्रॉस करणारी राहणार आहे.)

स्ट्राईक प्राईज :- प्रत्येक ट्रेड ला स्ट्राईक प्राईज हि अंट द मनी स्ट्राईक प्राईज घेणार आहोत कारण ATM स्ट्राईक प्राईज चा प्रिमीयम हा मिडीयम असतो. त्याचा डेल्टा ग्रीक्स हा कमीत कमी 0.50% असतो व मार्केटचे मुव्हमेंट प्रमाणे तो वाढत जावुन फ्रॉफीट रेशो वाढत जातो.

ऑपशन्स कॉन्ट्रॉक्ट :- या ट्रेडिंग मध्ये आपण करंट विकली ऑपशन्स कॉन्ट्रॉक्टचीच निवड करणार आहोत कारण करंट कॉन्ट्रॉक्ट मधील प्रिमीय मध्ये अँडरलाईन अॅसेट प्रमाणेचे मुव्हमेंट होत असते.

स्टॅडर्डीचे ड्रॉबॅक :- 1. ट्रेड मध्ये कॅन्डल स्टिकचे पॅटर्न मध्ये प्रत्येक कॅन्डलचे ओपन - क्लोज व हाय - लो व्हॅल्युवर डिपेंड रहावे लागेल. प्रत्येक कॅन्डलचा हा डेटा आपल्याला कॅन्डलच्या टाईमफ्रेमचे डायुरेशन पुर्ण झाल्यावरच मिळतो म्हणजे पाच मिनीट उशीरा. त्यामुळे प्रत्येक ऑर्डर मार्केटच्या मुव्हमेंट नंतर पाच मिनिट उशीरा होणार आहे.

2. मार्केट मध्ये साईडवे मुव्हमेंट असल्यास थिटा या ग्रिक्स मुळे कॉन्ट्रॅक्टचे डायुरेशन कमी झाल्यामुळे प्रिमीयम मधील टाईम व्हॅल्यू कमी होवुन ऑप्शन्स चा प्रिमीयम कमी होतो त्यामुळे काणार फ्रॉफीट कमी अथवा लॉस होण्याची शक्यत वाढते.
3. हि स्टॅटजी ट्रेडींग मार्केट मध्येच चांगला फ्रॉफीट देवु शकते. साईड वे मार्केट मध्ये कमी फ्रॉफीट किंवा लॉस होण्याची शक्याता आहे.
4. ट्रेड ची संख्या दिवसाला किमान 2 ते 3 व जास्तीत जास्त 3 ते 4 होणार असल्याने ब्रोकरेज चार्जेस जास्त पे करावे लागतील

स्टॅडजीचे चांगले परीणाम :- 1. हि ट्रेड फॉलोविंग स्टॅटजी असल्यामुळे मार्केट मधील प्रत्येक मुव्हमेंटला कॅच करुन जास्तीत जास्त फ्रॉफीट मिळु शकतो.

2. ट्रेलींग स्टॉप लॉस मुळे मार्केटची पुर्ण मुव्हमेंट कव्हर होवुन जास्तीत जास्त फ्रॉफीट मिळता येणार आहे. त्याच बरोबर होणारा लॉस कंट्रोल करता येणार आहे.
3. स्टॉप लॉस हिट होवुन पहील पोजीशन कट होणार आहे. त्याच बरोबर नेक्सट मुव्हमेंट कव्हर होवुन दुसरी पोजीशन मिळुन त्या मुव्हमेंट मधील फ्रॉफीट कव्हर करता येणार आहे. त्या मुळे ट्रेडची संख्या जरी वाढली तरी ब्रोकरेजच्या तुलनेत फ्रॉफीट हा जास्त राहणार आहे.

नोट :- या प्रमाणे कोड डेव्हलोप करुन त्याची किमान एक वर्षाचे डेटावर बॅकटेस्ट करणे गरजेचे आहे. बॅक टेस्ट दरम्यान स्टॉप लॉस व नेक्सट पोजीशन साठी निवड केलेल्या 25 पॉईंट पेक्षा जास्त किंवा कमी पॉईंट घेवुन बॅक टेस्ट मध्ये फ्रॉफीट रेशो चेक करुन जो जास्त फ्रॉफीटेबल रेशो असेल तो स्टॉपलॉस व नेक्सट पोजीशन साठीचा क्राईट एरीया ठरवायचा आहे. स्टॅटजी टेस्ट करतांना पुर्ण एक महिन्याचा फ्रॉफीट काउंट करुन प्रत्येक महिन्याला किती फ्रॉफीट मिळु शकतो यांचा अंदाज लावता येईल.