

اصطلاحات فارکس

Currency pair جفت ارز

جفت ارزها از مهمترین اصطلاحات بازار فارکس محسوب میشوند. این اصطلاح پایه و اساس بازار فارکس اشاره میکند. در واقع بازار فارکس به گونهای طراحی شده است که هر ارز با ارز دیگر معامله میشود. جفت ارز جز مفاهیم پایه در بازار فارکس محسوب میشود.

اصلیترین جفت ارزها عبارتاند از:

یورو در مقابل دلار EUR/USD

پوند در مقابل دلار GBP/USD

دلار در مقابل فرانک سوئیس USD/CHF

دلار در مقابل ین ژاپن USD/JPY

Lot لات

به واحد اندازهگیری مقدار معامله لات گفته میشود که با استفاده از آن میتوان حجم پوزیشنی را اندازهگیری کرد. بهطورکلی در فارکس یک لات برابر ۱۰۰,۰۰۰ دلار است.

Spread اسپرد

تفاوت بین نرخ خرید و نرخ فروش یک ارز - تفاوت بین نرخ های پیشنهاد فروش و قیمت خرید.

Pip پیپ

پیپ یا پوینت به واحد اندازه گیری حرکات و نوسانات قیمت در بازار ارز گفته می شود. مثلا اگر ۱۴۸۰۷ برسد ۶۸,۶ پیپ جا به جا شده ۱۴۱۲۱ / به عدد / ۱ از عدد EUR/USD ۱ جفت ارز

Pipet پیپت

به کوچکترین واحد نوسانات قیمت در بازار ارز گفته می شود که معمولا چون خیلی ناچیز است استفاده از آن معمول نیست و از همان اصطلاح پیپ معامله گران استفاده می کنند. (اگر پیپ را به ده قسمت تقسیم کنیم پیپت یک قسمت یا یک دهم آن می باشد) مثلا اگر جفت ۶ پیپ جا به ۱ / برسد در حقیقت ۶۸۶ پیپت یا ۱۴۱۲۱ / ۶۸ به عدد / ۱۴۸۰۷ از عدد EUR/USD ۱ ارز جا شده.

Commission کمیسیون

کارمزد و مبلغی که یک کارگزار به عنوان حق الزحمه می گیرد تا به نیابت از مشتری معامله ای را انجام دهد.

Trailing Stop دنبال کردن حد ضرر

ابزاری تکنیکال می باشد که برای ادامه روند سود دهی در بازار از آن استفاده می شود. سطحی متغیر که در روند صعودی بازار قیمت را بالاتر می برد و در روند نزولی آن را پایین تر می آورد. توسط نرم افزار بالاتر برده می شود و در پوزیشن (loss stop) در پوزیشن خرید با صعود بازار دستور فروش با نزول بازار این دستور توسط نرم افزار پایین تر آورده می شود.

Pending order دستور شرطی

به مجموع دستوراتی که برای باز کردن معاملات شما شرطی قرار می دهند دستورات شرطی می هم گفته می شود (Orders Limit). گویند چهار دستورات شرطی داریم که در زیر به آن اشاره شده

Buy stop بای استاپ

یعنی معامله گر آغاز روند صعودی را بالاتر از قیمت فعلی بازار می بیند و صبر می کند سطح مورد نظر او شکسته شود و بعد وارد معامله خرید میشود.

(دستور خریدی بالقوه که با افزایش قیمت و رسیدن به قیمت مورد نظر اجرا می شود) بخر به شرط (گذاشتن سفارش خرید بالاتر از قیمت جاری)

Buy limit بای لیمیت

یعنی معامله گر آغاز روند صعودی را پایین تر از از قیمت فعلی بازار می بیند و اعتقاد دارد بازار به پایین میزنه بعد میره بالا (دستور خریدی بالقوه که با کاهش قیمت و رسیدن به قیمت مورد نظر اجرا می شود) بخر به شرط (گذاشتن سفارش خرید پایین تر از قیمت جاری)

Sell stop سل استاپ

یعنی معامله گر آغاز روند نزولی را پایین تر از از قیمت فعلی بازار می بیند و صبر می کند سطح مورد نظر او به پایین بشکند و بعد وارد معامله فروش میشود.

(دستور فروشی بالقوه که با کاهش قیمت و رسیدن به قیمت مورد نظر اجرا می شود) بفروش به شرط (گذاشتن سفارش فروش پایین تر از قیمت جاری).

Sell limit سل لیمیت

یعنی معامله گر آغاز روند نزولی را بالاتر از از قیمت فعلی بازار می بیند و اعتقاد دارد بازار به بالا میزنه بعد میریزه (دستور فروشی بالقوه که با افزایش قیمت و رسیدن به قیمت مورد نظر اجرا می شود) بفروش به شرط (گذاشتن سفارش فروش بالاتر از قیمت جاری)

winrate وین ریت

یا درصد موفقیت، به معامله گر نشان می دهد که چند درصد از معاملات او (Win Rate) وین ریت منجر به سود شده است.

به طور مثال، فرض کنید وین ریت یک استراتژی معاملاتی، ۷۰ درصد است؛ این یعنی به طور میانگین از هر ۱۰۰ معاملهای که با این استراتژی انجام میشود، ۷۰ مورد از آنها منجر به سود و

۳۰ مورد از آنها منجر به ضرر است.

Broker کارگزار

در یک جمله می توان گفت کارگزار واسط بین سرمایه گذاران و بازارهای مالی (مثلا بورس) هستند و کار خرید و فروش سهام و اوراق بهادار به نمایندگی از طرف مشتریان توسط کارگزاران انجام می شود.

Long term معامله گر بلند مدتی

این معامله گران از نمودارهای هفتگی برای دریافت دورنمای حرکت بازار و از نمودارهای روزانه برای قرار دادن نقاط ورود به معامله استفاده می کنند و معاملات آنها چندین هفته و ماه ممکن است باز باشد.

Short trem معامله گر کوتاه مدتی

این معامله گران از تایم فریمهای ساعتی استفاده می کنند و معاملات خود را برای چند ساعت یا یک هفته باز نگه می دارند.

Scalper اسکالپر

به معامله گران خیلی کوتاه مدتی گفته می شود. این معامله گران برای تحلیل بازار از تایم فریمهای یک تا پنج دقیقه استفاده می کنند، معاملات خود را در طول روز انجام داده و با بسته شدن بازار از آنها خارج می شوند. اسکالپ در لغت به معنای نوک زدن به معاملات می باشد که معمولا با حجم بالا و حد ضرر و حد سود های کوچک انجام می شود.

Mechanical Trading System استراتژی مکانیکی

سیستم مکانیکی یعنی استراتژی هایی که نقاط ورود و خروج را بر اساس روال ها و الگوریتم های مشخصی که منطبق بر اندیکاتور ها هستند صادر می کند.

trading edge لبه معاملاتی

در لغت به معنای لبه و دستگیره می باشد و در ترجمه عمومی به معنای امکان وقوع Edge اج بیشتر یک پیشامد نسبت به دیگر پیشامد است. و در معاملات به شرایطی گفته می شود که با رخ دادن آنها احتمال موفقیت یک معامله بیشتر از شکست آن است.

یعنی امکان وقوع بیشتر یک مسیر برای قیمت نسبت به مسیر دیگر (ریوارد به ریسک بالا) به زبان ساده تر همان استراتژی و روش معاملاتی شماست که احتمال مناسبی در به سود نشستن معاملات شما دارد.

Break even بریک ایون

در ادبیات اقتصادی به معنی سربرسر شدن هزینه و درآمد هست (بدون ریسک). یعنی سود و زیان صفر. در اصطلاح بازار سرمایه وقتی نقطه استاپ به نقطه ورود منتقل میشود.

در نتیجه اگر پوزیشن استاپ هم بخورد شما بدون ضرر از پوزیشن خارج میشوید.(انتقال استاپ به نقطه ورود)

Risk free ریسک فیری

را دارد .یعنی وقتی نقطه استاپ به نقطه ورود even break در اصطلاح بازار سرمایه همان مفهوم منتقل میشود.

Draw Down درادان

کاهش موجودی حساب در نتیجه یک یا چند معامله پی در پی ناموفق

Fill or kill فیل اور کیل

دستور خرید یا فروش داده شده به کارگزار که یا باید فوراً به طور کامل اجرا شود. یا اگر چنین امکانی فراهم نیست به طور کامل لغو گردد(.عامیانه یعنی یا انجام بده کامل یا بی خیال سفارش شو)

Sideways یا **range** یا **Flat** بازار رنج

اصطلاحاً به زمانی اطلاق می شود که نوسان های بازار جهت خاصی نداشته و فراز و فرود واضحی در بازار مشاهده نمی شود.

فورکست

پیشبینی کردن، پیشبینی بازار و شاخصهای اقتصادی توسط کارشناسان

Spike اسپایک

به پرش های شدید و ناگهانی قیمت گفته می شود.

Hedging هج

داشتن یک یا چند موقعیت معاملاتی در بازار آتی یا اختیاری برخلاف موقعیت معامله در بازار نقدی است و هدف این نوع معاملات کاهش یا محدود کردن ریسک هایی است که ناشی از تغییرات قیمت به وجود می آید.

Order دستور

دستور مشتری برای خرید یا فروش

Platform سکوی معاملات

در بازار های بین المللی امروزی که از اینترنت و وسائل مخابراتی مدرن بهره می جوید سکوی معامله یک مکان فیزیکی نیست که در آن خریداران و فروشندگان برای انجام معامله با یکدیگر گرد هم آیند.

بلکه مکانی مجازی در شبکه اینترنت است که کلیه اطلاعات و امکانات لازم برای خرید و فروش را در اختیار معامله گران قرار می دهد.

Session جلسه

از اصطلاحات بورس است و به مدت زمان کار بازار گفته می شود یعنی از زمانی که بازار باز می شود تا زمانی که تعطیل می گردد.

Settlement Price قیمت ستل

آخرین قیمت معامله شده یک محصول تجاری در طول روز گذشته

Swing trader سوئینگ تریدر

به معامله گرانی گفته میشود که معاملات آنها از یک روز تا چند روز باز می ماند یا به بیان دیگر به معامله گران کوتاه مدت اطلاق میشود.

Overlap همپوشانی

به معنای همپوشانی یا روی هم افتادگی معنی می دهد.

Correction اصلاحی

به حرکت قیمت در جهت خلاف روند فعلی به منظور استراحت و کسب قدرت برای ادامه حرکت خود. مثلا اگر روند صعودی هست به کاهش قیمت به منظور نفس گیری و بعد مجدد ادامه روند صعودی

impulse ایمپالس

در معنای لغتی به معنای انگیزشی و جنبشی می باشد و در اصطلاح الیوتی به موجهای قوی نزولی یا صعودی گفته میشود.

Open position معامله باز

وقتی در کارگزار معامله ای دارید که هنوز نبسته اید به آن معامله باز گفته می شود مثلا سهام یا کالایی را خریده اید و هنوز آنرا نگه داشته اید.

Leverage لوریج

اهرم یا لوریج ابزاری است که کارگزاران در اختیار معامله گران قرار می دهد که معامله گران بتوانند بیش از سرمایه اولیه خود معامله کنند. برای مثال، وقتی که حساب شما دارای لوریج (۱:۱۰۰) یک به صد) باشد، شما می توانید صد دلار را با پرداخت یک دلار معامله کنید. بنابراین برای معامله یک لاتی (صد هزار واحد) دلار تنها نیاز است که ۱۰۰۰ دلار بپردازید یعنی می توان گفت قدرت پول شما صد برابر می شود.

توجه داشته باشید لوریج یک شمشیر دولبه هست که هم می تواند باعث ایجاد سودهای هنگفت و همچنین ضرر های سنگین برای شما بشود. چون عملا به شما این امکان را می دهد که بیش از سرمایه خود معامله کنید.

Balance بالانس

زمانی که شما هیچ معامله بازی نداشته باشید؛ بالانس حساب شما، مقدار پولی است که در حسابتان دارید. مثلاً اگر در حساب خود ۱۰۰۰ دلار داشته باشید و هیچ معامله بازی هم نداشته باشید بالانس حساب شما ۱۰۰۰ دلار است.

Equity اکوئیتی

از لحاظ لغتی به معنای معادل می باشد. وقتی از بالانس شما میزان سود یا ضرر معاملات باز شما اضافه یا کسر می شود عددی بدست می آید که خالص دارای شماست. مثلاً بالانس شما ۱۰۰۰ دلار است و مجموع معاملات باز شما ۱۵۰ دلار در ضرر است در این صورت ایکوئیتی شما برابر است با ۸۵۰ دلار و اگر معاملات خود را ببندید بالانس شما از ۱۰۰۰ دلار به عدد قطعی ۸۵۰ دلار کاهش می یابد. (به بیان ساده موجودی حساب شما بعد از بستن همه معاملات باز).

Margin مارجین

وقتی معامله جدیدی باز میکنید کارگزار با توجه به حجم و نوع کالای مورد معامله شما بخشی از سرمایه اولیه شما را به عنوان ضمانت (وجه الضمان) نزد خود مسدود و بلوکه میکند.

Free margin فیری مارجین

Equity به میزان وجه آزاد حساب شما گفته می شود که می توانید با آن معامله کنید. وقتی از معاملات کم می شود عددی بدست می آید که به آن فیری مارجین گفته می Margin حساب میزان شود.

$$\text{Free Margin} = \text{Equity} - \text{Margin}$$

Margin level مارجین لول

یکی از اصطلاحات اساسی است که تعاریف دیگری نیز از آن استخراج میشود لذا دانستن آن خیلی اهمیت دارد.

شما (Margin) بر مارجین (Equity) مارجین لول سطحی است که از تقسیم خالص دارایی شما بدست می آید و به درصد بیان می شود که نشان می دهد خالص دارایی های شما چه درصدی از مارجین اشغال شده توسط معاملات باز شماست و دانستن این درصد به شما در مدیریت سرمایه کمک می کند.

$$\text{Margin level} = (\text{equity}/\text{margin}) * 100$$

نکته: ۱ اگر مارجین لول حساب شما به صد درصد برسد یعنی خالص دارایی های شما با مارجین حساب برابر شده لذا بروکر به شما اجازه نمی دهد که پوزیشن جدیدی باز کنید.

تعریف می شوند level Margin. بر اساس level out Stop و Call Margin نکته: ۲ دو اصطلاح

Margin Call مارجین کال

شما از درصد مشخصی کمتر شود بروکر شروع به اختطار دادن به شما می کند **level margin** وقتی که باید حساب خود را شارژ کنید تا بروکر اقدام به بستن معاملات باز شما نکند. در این حالت کادر قرمز رنگی در متاتریدر در زیر معاملات شما ایجاد میشود. این عدد معمولاً ۵۰ درصد است.

نکته: کال مارجین به معنای اختطار بروکر به شما است که از صفر شدن حساب شما جلوگیری کند ولی بصورت عامیانه این لفظ در بین تریدرها به معنای صفر شدن حساب کاربرد پیدا کرده.

Stop out Level سطح استاپ اوت

شما به سطح بحرانی برسد که در بروکرها معمولاً ۱۰ یا ۲۰ درصد است **level margin** وقتی متاتریدر به طور اتوماتی در این درصد شروع به بستن معاملات شما می کند. و این کار را با بستن معامله ای که بیشترین ضرر را داشته است، شروع می کند تا حساب شما از منطقه بحرانی دور شود.

stop level ستاپ لول

وقتی معامله ای را انجام می دهید و قصد تعیین حد ضرر و حد سود را دارید این مفهوم استفاده می شود.

و میزان فاصله ای است که می بایست بین قیمت مد نظر معامله گر (جهت قرار دادن حد سود، حد ضرر یا دستورهای پندینگ) و قیمت جاری وجود داشته باشد تا بروکر به معامله گر اجازه ثبت آن را بدهد.

ضمناً دقت نمایید که این عدد یک میزان ثابت نیست و بروکر می تواند بنا به شرایط و دلایل مختلف را در سیمبل های معاملاتی مختلف تغییر دهد **stops level**. عدد برای معامله گرانی که اسکالپی هستند و معاملات سریعی دارند و قصد **stops level** نکته: فاکتور دارند حد ضرر یا حد سود را در فاصله کمی از قیمت ست کنند اهمیت زیاد دارد لذا برای انتخاب بروکر باید به این موضوع توجه کنند.

contract size کانترکت سایز

اندازه حجم قرارداد یک معامله در بازار مبادلات به ازای یک لات استاندارد می باشد که در بروکرهای مختلف تفاوت هایی دارد. مثلاً کانترکت سایز نماد داوجونز اگر در بروکری اگر ده باشد یعنی یک لات معامله داوجونز شامل ده قرارداد است.

یا مثلاً اگر کانترکت سایز طلا در بروکری اگر ۱۰۰ باشد یعنی یک لات طلا ۱۰۰ اونس است. یا اگر کانترکت سایز نفت در بروکری ۱۰۰ باشد یعنی یک لات نفت ۱۰۰ بشکه نفت است یا اگر کانترکت سایز بیت کوین در بروکری یک باشد یعنی هر لات آن یک بیت کوین است.

Requote ریکوت

ریکوت به معنای لفظی قیمت گذاری مجدد می باشد و منظور آن است که زمانی که شما سفارش خرید یا فروش می دهید به هر دلیل کارگزاری نتواند در قیمت مورد نظر شما خرید یا فروش را انجام دهد.

و به شما فرصت انتخاب قیمت جدید را بدهد. به معنای عامیانه یعنی مظنه گیری مجدد. هر چه ریکوت های قیمتی یک کارگزاری کمتر باشد کار با آن کارگزاری راحت تر و اعتبار بیشتری برای او محسوب می شود.

Slippage اسلیپیج

اسلیپیج در لغت به معنای لغزش و لیز خوردن می باشد و در اصطلاح معامله گری به معنی اختلاف بین قیمتی است که شما سفارش میگذارید با قیمتی که سفارش شما با آن مچ و اجرا میشود.

دارای اهمیت بالایی میباشد و می تواند پوزیشن های لحظه ای و حد ضرر ها و حد **Slippage** سودها های شما را دستخوش تغییرات کند و آنها را با قیمت های دیگری اجرا کند. زمانی که با زار بر اساس اخبار یا گپ های قیمتی دچار تلاطم می شود معنی پیدا می کند به اینصورت که قیمت پرش ناگهانی می کند.

و چون در قیمت شما یا حد سود یا حد ضرر شما تقاضا و قیمتی وجود ندارد که با آن مچ شود لذا اسلیپیج باعث لیز خوردن قیمت جاری و اجرا و مچ شدن پوزیشن شما در اولین قیمتی است که در دسترس است و تقاضا برای آن وجود دارد.

نکته: ۱ اسلیپیج روی حد ضرر شما تاثیر بد و روی حد سودها تاثیر خوبی دارد.

نکته: ۲ اسلیپیج با ریکوت تفاوت دارد.

Back test بک تست

در لغت به معنای آزمون در گذشته می باشد. و در بازارهای مالی به معنای تست و بررسی یک استراتژی و روش در گذشته چارت می باشد تا بتوان میزان موفقیت و نقاط ضعف و قوت یک استراتژی را مورد بررسی قرار داد.

Liquidity لیکوئیدیتی

به میزان نقد شوندگی و شناوری یک بازار گفته می شود. هر چه یک بازار نقد شونده تر باشد راحت

می توانید سهام یا کالا یا ارز خود را نقد و تبدیل به پول کنید چون در چنین بازارهایی عرضه و تقاضا

بالاست و به قول معروف کمتر صف خرید و فروش می شوند.

Volatility والاتیلیتی

گریز گری یا فراریت در علم شیمی و فیزیک به تمایل یک ماده برای تبدیل شدن به فاز بخار گفته می شود و در اصلاح بازارهای مالی شاخصی است که میزان نوسان هر جفت ارز را در بازه زمانی خاصی اندازه گیری می کند.

به عنوان مثال جفت ارز پوند به ین فراریت بالایی دارد و در طول روز نوسانات زیادی انجام میدهد.
Correlation کورلیشن

به میزان همگام بودن و هم حرکت بودن دو یا چند ارز یا کالا گفته میشود که بصورت درصد بیان % میشود از % ۱۰۰ - تا ۱۰۰ +

