

Ed Seykota, çok başarılı bir öğrenciydi ve dünyanın en iyi mühendislik fakültelerini bünyesinde barındıran MIT'den elektrik mühendisi olarak 1969'da mezun oldu. Sermaye piyasalarına, özellikle de emtia piyasalarına oldukça meraklıydı.

1969'da mezun olduktan sonra 1970 yılında Donchian Kanallarının mucidi Richard Donchian'ın yazdığı bir makaleyi okudu. Bu makalede mekanik bir trend takip edici sistemin piyasaları alt edebileceğinden bahsediliyordu. Bu makaleden cesaret alan Ed Seykota, trading'i matematiksel göstergelerle beslenerek, disiplinli bir şekilde duygusallıktan arınarak yapma arayışına başladı. İlk olarak bu kurumları sınamak ve kendi stratejilerini oluşturmak için bilgisayar programları yazmaya başladı. Daha sonra Wall Street'te bir aracı kurumda analist olarak görev aldı. Kısa süre içinde daha büyük bir aracı kuruma transfer oldu. Ed Seykota burada futures piyasalarındaki müşterilerinin fonları için ilk ticari bilgisayar destekli trading sistemini tasarlayıp geliştirdi. Sistemi oldukça kâr getirecek bir şekilde çalışmasına karşın şirket yönetiminin kararları onun yüksek performansını sınırlamaya başladı. Bu deneyim de açıkçası Ed Seykota'yı bağımsız çalışmaya yöneltti.

İzleyen yıllarda trading için sistem haline getirdiği yaklaşımını hem kendi hesabına hem de müşterilerinin hesaplarına uygulamaya başladı. Bu süreç boyunca, Ed Seykota'nın yönettiği hesaplar şaşırtıcı kârlar gördü. 12 yıllık zaman diliminde kendi gerçek müşteri hesabı olan model hesabındaki 5.000\$, 15.000.000\$'a yükseldi. Ed'i eşsiz kılan özelliği, sürekli olarak kendini gözden geçirmesi ve tradingin psikolojik bileşenleri üzerine yoğunlaşmaya olan bağlılığı oldu. Ed'in trading işlemleri aslında ertesi güne dair sinyaller veren bilgisayar programını bir kaç dakika çalıştırmaktan ibaretti. Ed, dünyanın farklı ülkelerinden 60 kişilik bir trading grubunu çalıştırmaya devam etmektedir.

Yatırım Tavsiyeleri

- Pozisyon alırken aldığım riski bilirim ve aldığım pozisyonun bu riske değecek bir pozisyon olduğunu düşünürüm.
- Teknik analiz sörf yapmak gibidir. Dalgaların fiziksel yapısı, rezonans ya da sıvı dinamiği hakkında çok bir şey bilmemize gerek olmasa da dalgaların ne zaman olacağını sezmemiz ve doğru zamanda harekete geçmemiz gerektiğini söyler. Aslında bu sözü, çoğu insan para kazanmak yerine piyasayı anlamaya çalışır, "trendler kırılana kadar dostumuzdur" demesi ile de örtüşüyor.
- İşlem yaparken kaybetmek can sıkıcıdır. Ancak paniğe kapılmak insanı mahveder.
- Küçük zararları kaldıramayanlar eninde sonunda çok ciddi zararlar karşılar.
- Asla kaldıramabileceğimizden fazlasını riske atmamalısınız, ancak aynı zamanda kazanınca değecek kadarını riske atmalısınız.

Bunlar basit gibi gözükse de üzerine düşünülmesi gereken tavsiyeler diyebiliriz.

Teknik Stratejileri

Şimdi teknik stratejilerine geçelim ve trendler ile başlayalım.

Uzun vadeli trendlerin haftalık ve aylık periyotta çizildiğini ve trend çizilirken kapanışların birleştirildiğini ifade ediyor.

Haftalık periyotlu grafikte Ed Seykota'nın çizdiği şekilde trend çizgisi gösterimi.

Trend göstergesi için ADX'i (ortalama yönsel endeksi) kullandığını, ADX'in 20'nin üzerine fırlamasının yeni trende işaret edebileceğini,

Akabinde ise trendin hareketli ortalamalarla takip edilmesi gerektiğini söylemektedir.

Düşen ve düz ADX ise trendsiz piyasayı göstermekte ve 20'nin altında volatilité düşmektedir.

Hareketli ortalamalardan devam edecek olursak; hisselerin yükseliş trendine başlamadan önce hareketli ortalamalarına indiğini, alım için 50 günlük/10 haftalık ortalamasının üzerinde kapanış izlediğini ifade ediyor.

Günlük periyotta, EMA 80'nin EMA 140'i yukarı kırdığında pozisyonun uzun vadeli taşımaya başlanması gerektiğini, burada stop noktasının ise 4Xatr seviyesi altında kapanış olması gerektiğini söylüyor. Bu sayede pozisyonu hiç ummadığın kadar taşıyabileceksin der. Zaten mesele de trade değil taşımaktır.

Stokastik Rsi-Macd stratejilerine değinmemiz gerekirse;

Stokastikin Rsi'dan daha erken ancak daha emniyetsiz sinyaller verdiği,

Ancak ikisinin de güçlü boğa piyasasında kullanışsız olduğunu, MACD'in haftalıklarda çok güzel trend takipçisi olduğunu ve en iyi al'ın sıfırın altında yukarı kesişme olduğunu, en iyi sinyaller için ise her ikisinin aşırı alı ya da aşırı satışı bölgesinde olmasını kendinize şart koşabileceğinizi söyler. (nadiren de olsa)

Ayrıca stokastiğin, RSI'den daha hızlı aşırı-al/sat bölgesine ulaşacağını ve daha fazla uyumsuzluk vereceğini vurgular. Koşan piyasada ise stokastik'in 80 üzerinde uzun kaldığını, herkes satarken kendisinin taşıdığını belirtir.

İşlem hacmi ve formasyonlar konusunda ise; işlem hacminin tepelerde ve üçgen formasyonlarında azaldığını, formasyonun ne kadar uzun zamanda oluşmuşsa o kadar kıymetli olduğunu, işlem hacmi analizinde OBV (On Balance Volume) kullanılması gerektiğini söyler. Bunu değerlendirirken yukarı yönlü olmasının düşen günlerde işlem hacminin az, çıkan günlerde işlem hacminin fazla olduğunu gösterdiğini, yatay piyasada OBV'nin önceden kırılım yaparak yol gösterebildiğini hatırlatır.

Ed Seykota'nın yatırım tavsiyeleri ve stratejilerine ayrıntılı olarak aşağıdaki videodan ulaşabilirsiniz.

<https://www.youtube.com/watch?v=rvDJ93psTwU&t=300s>