

آموزش تحلیل تکنیکال مقدماتی و پیشرفته مدرس: فرهاد سلطانی

<http://mql.blogfa.com/>



1395

تحليل تکنیکال مقدماتی



Farhad Soltani

<http://mql.blogfa.com/>

1395

مقدمه

در سالهای گذشته به علت اولویت بندی اهدافم، علاقه ای به پر رنک شدن در بازار بورس و ... نداشتم و طبیعتاً هم تهیه جزوه و فعالیت در گروهها و... زمانی تعریف نشده بود و نتیجتاً فعالیتی هم نداشتم. چون بیشتر انرژی بنده در زمینه مطالعه و تحقیق بوده است. اما این شرایط زمانی، برای بنده فراهم شده تا تجربیات و مطالعات خودم را بین علاقمندان به حوزه تحلیل تکنیکال در میان بگذارم. این جزوه حاصل سالها مطالعه، تحقیق، تدریس و جمع آوری از منابع مختلف است. و این اولین جزوه رسمی بنده بوده و این نوشتار را به عنوان شروع این رسالت فرهنگی بنده در نظر بگیرید. باشد که در این مسیر با پیشنهادات و انتقادات خودتان، راهنمایی بفرمایید.

باتشکر

فرهاد سلطانی-پاییز ۹۵

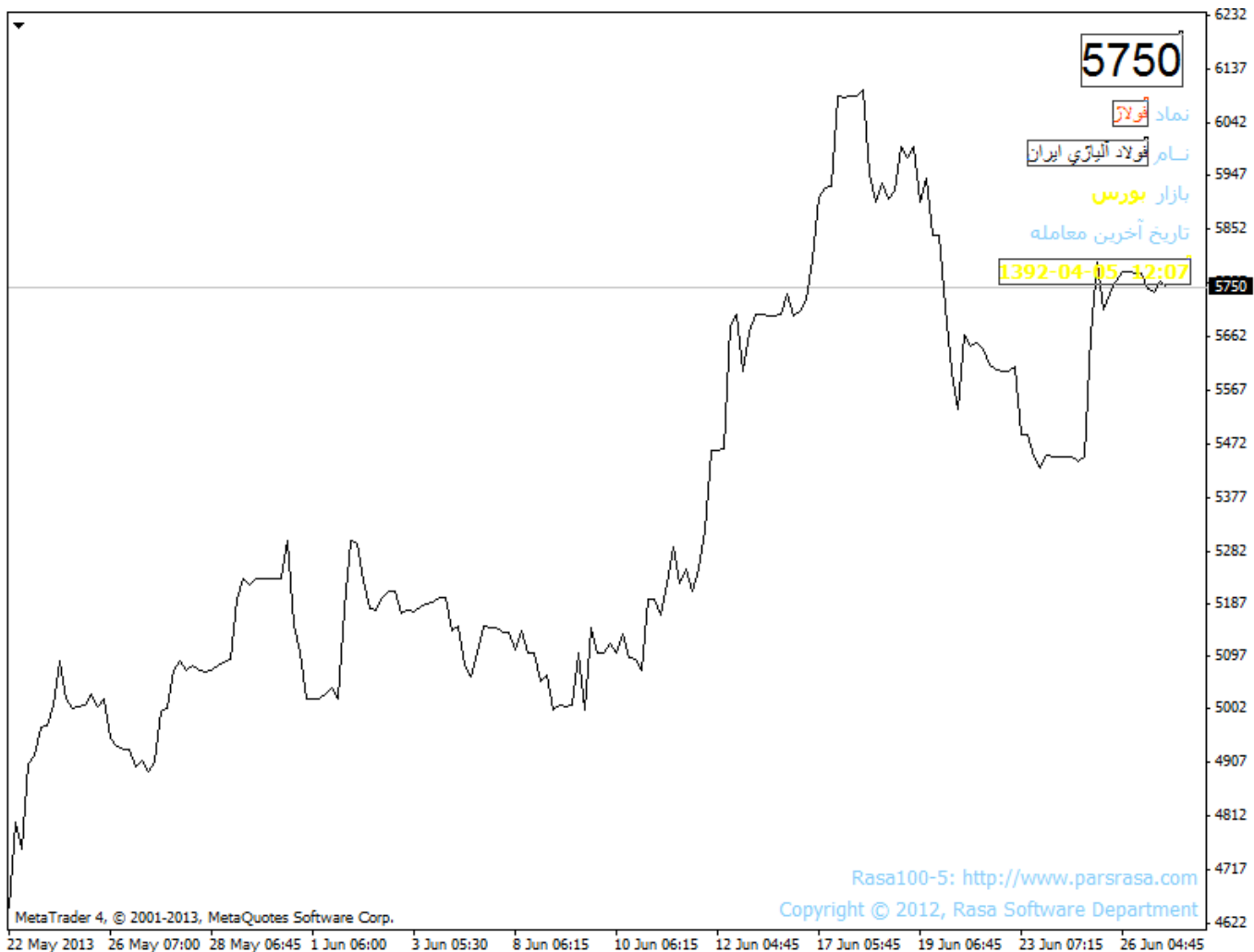
۰۹۱۰ ۹۲۹ ۱۳۷۳

iran_analyst_stock@yahoo.com

<http://mql.blogfa.com>

تعریف تحلیل تکنیکال

مطالعه رفتار و حرکات قیمت سهام در گذشته با هدف پیش بینی روند قیمت ، در آینده. که برای هر نوع کالا یا شاخص یا سهام قابل استفاده است.



آیا گذشته می تواند برای پیش بینی آینده مورد استفاده قرار بگیرد؟

- روش های پیش بینی ، از پیش بینی وضع هوا گرفته تا تحلیل های بنیادی ، کاملاً مبتنی بر اطلاعات گذشته می باشد.
- علم احتمالات بر اساس پیش بینی بنا نهاده شده است.
- بیشتر اعمال ما بر اساس تجربیات گذشته ما از آن عمل قابل پیش بینی است.

- نمودار قیمت‌ها تجلی افکار عمومی است که بر اساس اصول روانشناسی عمومی که قابل پیش بینی است بنا نهاده شده است.

رفتارهای بازار شامل سه اصل اولیه دارد: قیمت، زمان، حجم

فلسفه تحلیل تکنیکال

۱. همه چیز در قیمت لحاظ شده است: یعنی همه عوامل سیاسی اقتصادی و... در قیمت لحاظ شده است. تغییرات قیمت تابعی از عرضه و تقاضاست. اگر تقاضا بیشتر از عرضه باشد قیمت صعودی می شود و اگر عرضه بر تقاضا پیشی گیرد قیمت کاهش می یابد. این تغییرات، اساس تمام پیش بینی های اقتصادی و بنیادی است.
۲. قیمت ها بر اساس روند حرکت می کند: هدف از ترسیم نمودار قیمت ، شناسایی روند و پیش بینی جهت حرکت این روند است.
۳. تاریخ تکرار می شود. آینده چیزی نیست جز گذشته.

تفاوت تحلیل گر تکنیکال و فاندامنتال

- تحلیل گر تکنیکال عقیده دارد که تغییرات قیمت تنها چیزی است که او نیاز دارد بداند و دانستن علتها و دلایل این تغییرات لازم نیست و در مقابل تحلیلگر فاندامنتال همواره به علتها و دلایل تغییر قیمت می پردازد.
- تحلیل گر تکنیکال تاثیر عوامل فاندامنتال بر روی چارت را بررسی می کند و چون همیشه تاثیر عوامل فاندامنتال در روی قیمت لحاظ می شود بنابراین بررسی فاندامنتال در درجه دوم است.
- چارتیست به راحتی می تواند هر نوع بازاری را که تمایل داشته باشد مورد مطالعه قرار دهد حتی اگر دانش فاندامنتال نداشته باشد در حالی که اغلب تحلیلگران فاندامنتال به علت اینکه همواره مقادیر زیادی اطلاعات و صورتهای مالی را باید بررسی کنند ، چندان نمی توانند از جایی که هستند دور شوند.

ما با تحلیل موج به دنبال پیدا کردن سه نکته هستیم:

۱. زمان تغییر وضعیت .
۲. میزان تغییرات قیمت .
۳. تعیین جهت حرکت .



تاریخچه تحلیل تکنیکال

چارلز داو

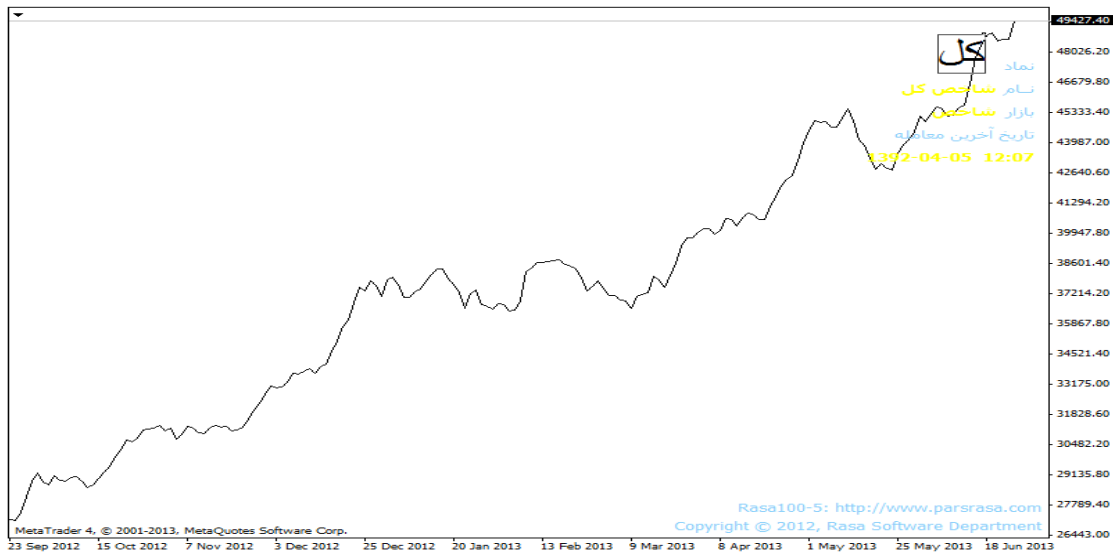
نظریات داو از ۲۵۵ سرمقاله ای که برای وال استریت ژورنال نوشته استخراج شده است. چارلز داو، موسس وال استریت ژورنال و بنیانگذار داوجونز است. پس از مرگ او ، با جمع آوری مقالاتش نظریه داو شکل گرفت. نظریه داو ۶ اصل اساسی دارد که توسط نلسن ،رابرت، رها و همیلتون آن را به صورت امروزی اصلاح کردند .

داو دریافته بود که میانگین قیمت پایانی سهام می تواند مبنای خوبی برای تشخیص وضعیت اقتصادی کشور باشد. در سوم ژوئن ۱۸۸۴ نخستین میانگین یا شاخص بازار سرمایه که از میانگین قیمت نهایی ۱۱ شرکت بدست آمده بود توسط داو منتشر شد.

نظریات داو تقریبا به عنوان اصول پایه ای تحلیل تکنیکال استفاده میشود.

اصل اساسی نظریه داو

۱. همه چیز در میانگین ها(شاخص ها) لحاظ می شود.



تعریف روند

روند جهت حرکت قیمت را در بازار نشان می دهد.

بازار هرگز بصورت یک خط راست حرکت نمی کند و تغییرات بازار به صورت یکسری از حرکات زیگزاگ مشخص می شود. این زیگزاک ها همانند یکسری موج های پی در پی می باشند که شامل موجهای صعودی و موج های نزولی می باشند.

برآیند حرکات این موج های صعودی و نزولی روند بازار را تشکیل می دهد که شامل روند های صعودی و نزولی و خنثی می باشد.

۲. بازار سه نوع روند دارد:

۱. روند صعودی: کف موج بعدی از کف موج قبلی بالاتر باشد.



۲. روند نزولی: سقف موج قبلی از سقف موج جدید بالاتر باشد



۳. خنثی یا side یا range: سقف و کف موجها در یک محدوده مشترک باشند



از نظر داو یک روند خود مشتمل بر سه روند دیگر است:

۱. روند اولیه یا اصلی یا بزرگ یا جریان : نشان دهنده جریان حاکم بر کل روند است. روند بزرگ یا بلند مدت که ممکن است از یک تا چند سال به طول بیانجامد. اگر بازار پی در پی سقف های بزرگتر و کف های بزرگتر بسازد افزایشی است.

۲. روندهای ثانویه یا میان مدت یا امواج: در حقیقت امواجی هستند که جریان یا روند اولیه را تکمیل می کنند. از ۱ تا ۳ ماه به طول می انجامد و تا حدود یک سوم تا دو سوم روند دوم پیش از خود بازگشت انجام می دهد. (عموماً ۳۳ تا ۶۶ درصد از حرکت اصلی قیمت را اصلاح می کند).
۳. روند کوچک یا کوتاه یا سطح ناهموار دریا: از ۱ روز تا ۳ هفته به طول می انجامد و کم اهمیت و گمراه کننده هستند.

اگر هر موج نسبت به موج قبلی نفوذ بیشتری در ساحل داشته باشد جریان جاکم می شود. هرگاه بالاترین نقطه ای که امواج متوالی در ساحل به آن می رسند کاهش داشته باشد جریان رو به بازگشت و نابودی است.

روند های اصلی یا بزرگ سه فاز دارند:

- فاز تجمیع یا تراکم: زمانی است که خبرگان بازار بر خلاف نظر بازار شروع به خرید می کنند. در این فاز قیمت سهام خیلی تغییر نمی کند زیرا این سرمایه گذاران در اقلیتند.
- فاز مشارکت عمومی: با شروع رشد قیمت مشارکت عمومی همراه می شود و قیمت به سرعت رشد می کند. این فاز تا زمانی اتفاق می افتد که سفته بازی بسیار زیاد می شود.
- فاز توزیع: در این نقطه، سرمایه گذاران زیرک شروع به توزیع سهام می کنند.

۳. شاخص ها باید یکدیگر را تایید کنند.

در زمان داو، اولین شاخص او شاخص صنعتی بود و دیگری شاخص شرکت های راه آهن. برای داو، بازار صعودی برای شاخص صنعتی تا هنگامی که شاخص راه آهن نیز صعود نمی کرد تایید نمی شد. از نظر او زمانی که مابین این دو شاخص واگرایی بود یک هشدار جهت تغییر اوضاع وجود داشت.

۴. حجم معاملات باید روند را تایید کند.

اصولاً نظریه داو بر رفتار نرخ تاکید دارد و حجم تنها برای تعیین موقعیت های نامعلوم بکار می رود. حجم باید در جهت روند اصلی گسترش یابد. با رشد قیمت، حجم معامله نیز می بایست رشد کند

۵. روندها تا زمانی که اخطارهای قطعی جهت پایان آنها وجود نداشته باشد معتبرند

از نظر داو ، روندها با وجود نویزهای بازار (نوسانات بازار) همچنان پابرجا می مانند. ممکن است قیمت به صورت موقت در خلاف جهت روند حرکت کند اما به سرعت مجدداً به حرکت در جهت اصلی ادامه خواهد داد. تشخیص اخطار قاطع بازگشتی کار ساده ای نیست. ابزارهای تحلیل تکنیکی برای شناسایی این هشدارهای بازگشتی بسیار مفیدند اما توسط تحلیلگران مختلف به صورت های متفاوت تفسیر می شوند.

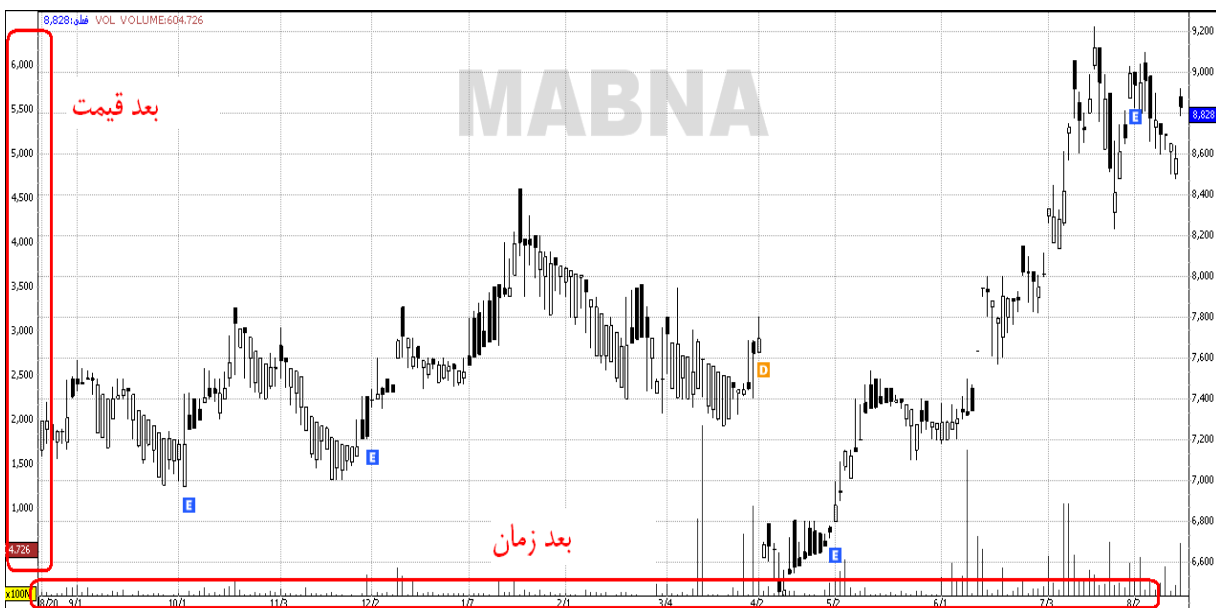
انتقاد به نظریه داو

- بطور متوسط ۲۰ تا ۲۵ درصد از تحرکات بازار پیش از بوجود آمدن اخطار خرید و فروش توسط نظریه داو به خاطر خاصیت ریاضی میانگین قابل پیش بینی نیست.

اجزای نمودار

- بعد قیمت و زمان:

نمودارها از دو بعد قیمت و زمان تشکیل شده اند . خط افقی نشان دهنده بعد زمان و خط عمودی نشاندهنده بعد قیمت است.



- تغییرات قیمت در بازه زمانی:

M1 M5 M15 M30 H1 H4 **D1** W1 MN

اگر بازه زمانی را یک روزه فرض کنیم در هر روز چهار قیمت اهمیت ویژه دارد.

Open	قیمت اولین معامله در طول یک دوره زمانی مشخص است .
High	بالاترین قیمتی است که سهم در طول یک دوره زمانی مشخص معامله می شود .
Low	پایین ترین قیمتی است که در طول یک دوره زمانی مشخص معامله می شود.
Close	آخرین قیمتی است که ورق بهاداری در طول یک دوره زمانی مشخص معامله می شود . قیمت نهایی بدلیل نشان دادن آخرین وضعیت ،بیشترین مورد استفاده را در تحلیل دارد .

ساختار نمودار

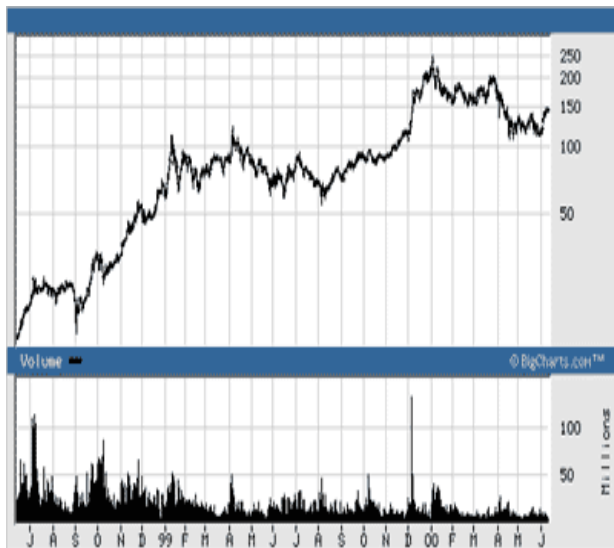
نمودارهای قیمت به طور معمول بصورت قیمت و زمان نشان داده می شود. زمان به صورت افقی نشان داده می شود ، که تاریخ ها در پایین نمودار از چپ به راست حرکت می کنند. مقیاس قیمت به صورت عمودی نمایان می شود، از قیمت های پایین تا قیمت های بالاتر.

دو روش برای نشان دادن قیمت ها وجود دارد. رایجترین راه با استفاده مقیاس خطی یا حسابی است. در نمودار مقیاس خطی برای مثال، هر افزایش قیمت به صورت یکسان رسم شده است. برای مثال صعود از ۱۰ به ۲۰ همانند صعود از ۵۰ به ۶۰ نمایش داده می شود، در هر دو مورد ۱۰ واحد صعود شکل گرفته که در مقیاس عمودی یکسان نشان داده می شود. این مقیاس خطی رایجتر است.

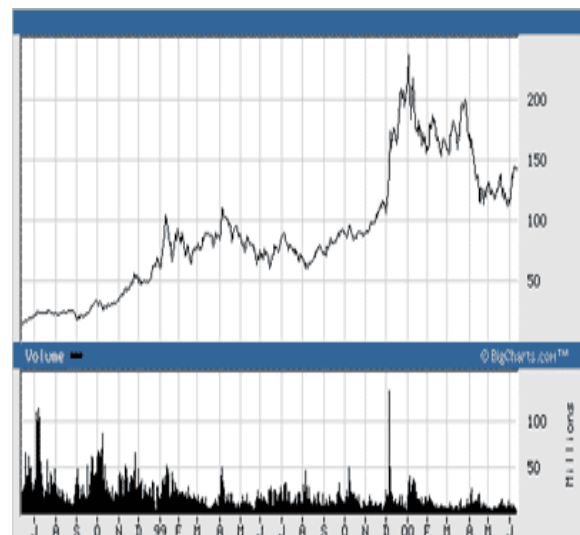
نوع دیگر از مقیاس ها، مقیاس لگاریتمی است. در نمودارهای لگاریتمی تغییرات قیمت به صورت درصدی اندازه گیری می شود. به بیان دیگر، حرکت قیمت از ۱۰ تا ۲۰ بسیار بزرگتر از حرکت قیمت از ۵۰ تا ۶۰ نشان داده می شود. دلیلش این است که از لحاظ درصدی، صعود از ۵۰ تا ۶۰

معادل ۲۰ درصد رشد است اما صعود از ۱۰ تا ۲۰ معادل ۱۰۰ درصد صعود است. نمودارهای لگاریتمی بر اساس صعود درصدی ایجاد شده اند و صعود از ۱۰ تا ۲۰ را معادل صعود از ۵۰ تا ۱۰۰ نمایش می دهد.

به صورت عمومی، تفاوت مابین دو مقیاس برای دوره های زمانی کوتاه مدت خیلی اهمیتی ندارد. بیشتر تحلیلگران همچنان از مقیاس حسابی برای تحلیل هایشان استفاده می کنند. اما تفاوت در نمودارهای بلند مدت تر اهمیت بیشتری دارد. در یک نمودار لگاریتمی، صعود متوالی قیمت در مقایسه با حرکتهای ابتدایی قیمت کوچکتر نمایان می شود. در نتیجه، خطوط روند در نمودارهای لگاریتمی بسیار سریعتر شکسته می شوند. **هیچ جواب قطعی وجود ندارد که نشان دهد کدام تکنیک برتر است.**



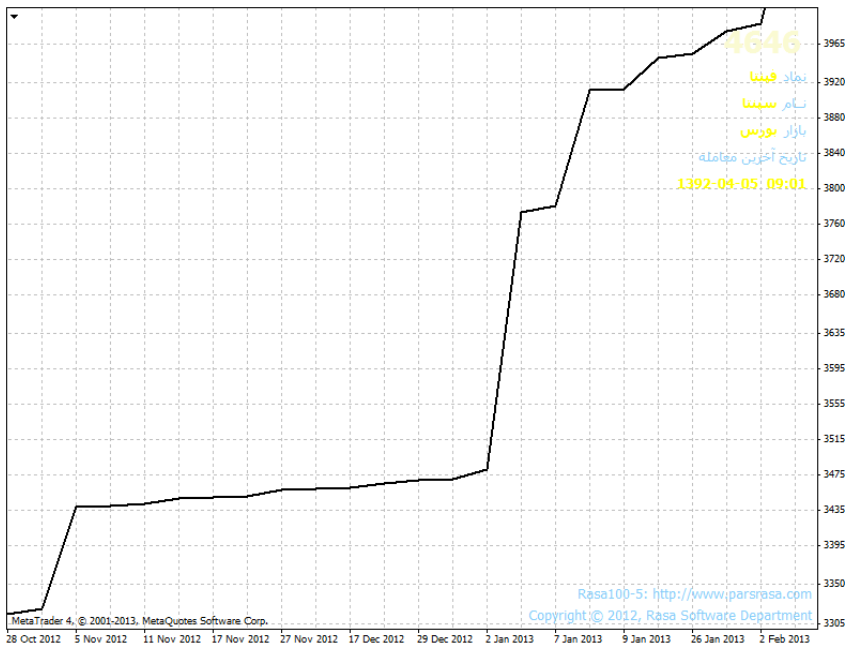
نمودار با مقیاس لگاریتمی



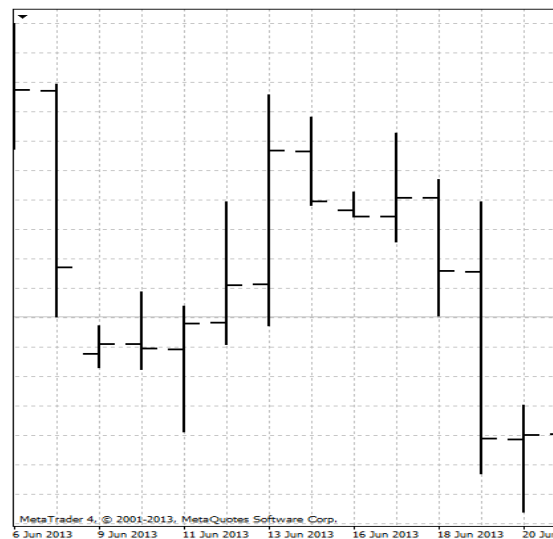
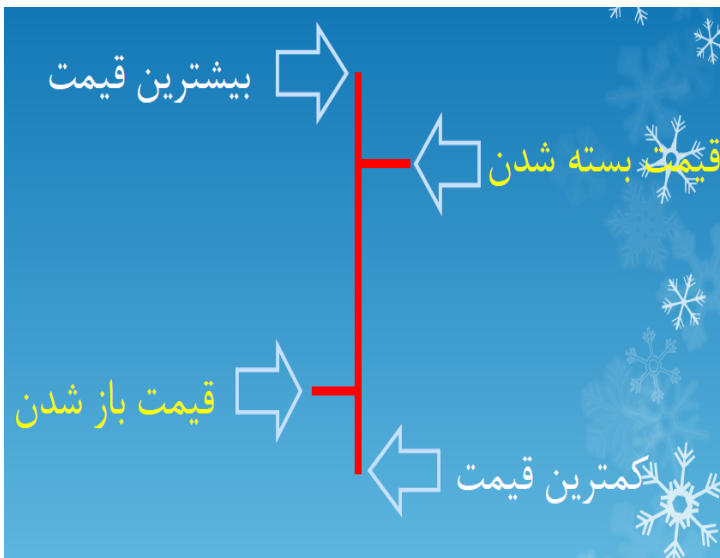
نمودار با مقیاس حسابی یا خطی

انواع نمودار

۱. نمودار خطی Line Chart: از بهم پیوستن قیمت بسته شدن یک سهم در روزهای متوالی. ضعف: جزئیات کمتری از احساسات بازار را نمایش می دهد مثلاً کمترین و بیشترین قیمت را نشان نمی دهد.

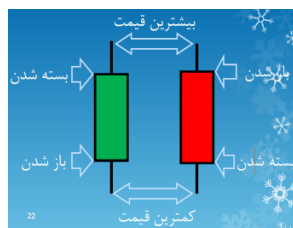


۲. نمودار میله ای Bar chart: نشاندهنده چهار قیمت close & open & high & low



۳. نمودار شمع Candel stick نشاندهنده چهار قیمت close & open & high & low بصورت

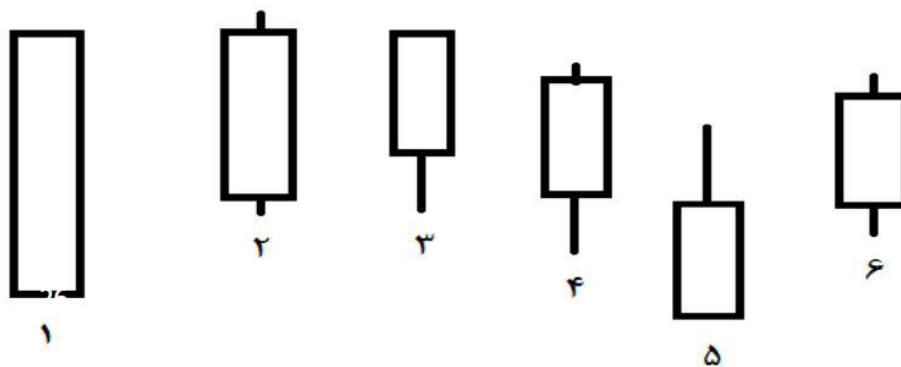
گرافیکی



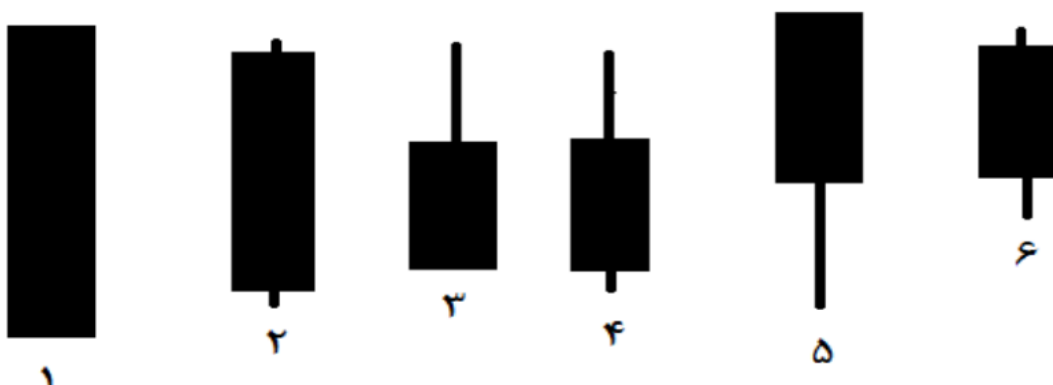
نمودارهای شمعی سفید تو خالی

شماره	نام	تفسیر
۱	شمع بلند سفید - بدون سایه	افزایشی زیاد
۲	شمع سفید بلند	افزایشی زیاد
۳	شمع با سایه پایین تر	افزایشی
۴	شمع سفید بلند - سایه پایین تر	افزایشی
۵	شمع سفید بلند - سایه بالاتر	افزایشی ملایم
۶	شمع سفید کوتاه	افزایشی با ثبات

نمودار زیر انواع شمع های سفید افزایشی را نشان می دهد:

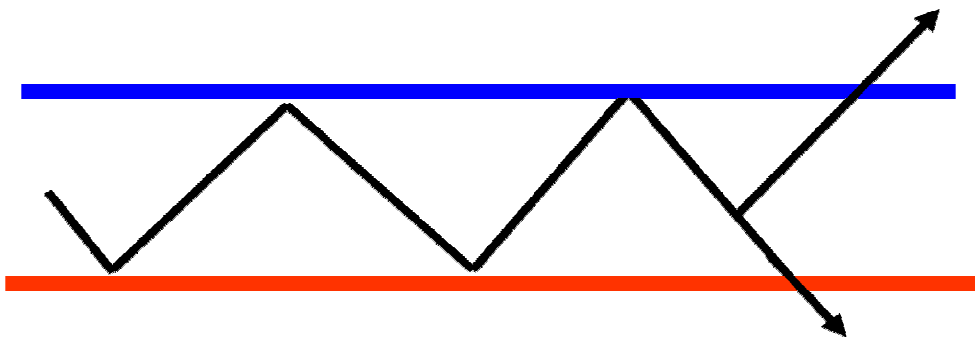


شماره	نام	تفسیر
۱	شمع سیاه بلند - بدون سایه	کاهشی زیاد
۲	شمع سیاه بلند	کاهشی زیاد
۳	شمع سیاه بلند - با سایه بالایی بلند تر	کاهشی
۴	شمع سیاه با سایه بالایی بلند	کاهشی
۵	شمع سیاه با سایه پایین تر بلند	کاهشی ملایم
۶	شمع سفید کوتاه	کاهشی با ثبات



خطوط حمایت و مقاومت & Support line & Resistance line

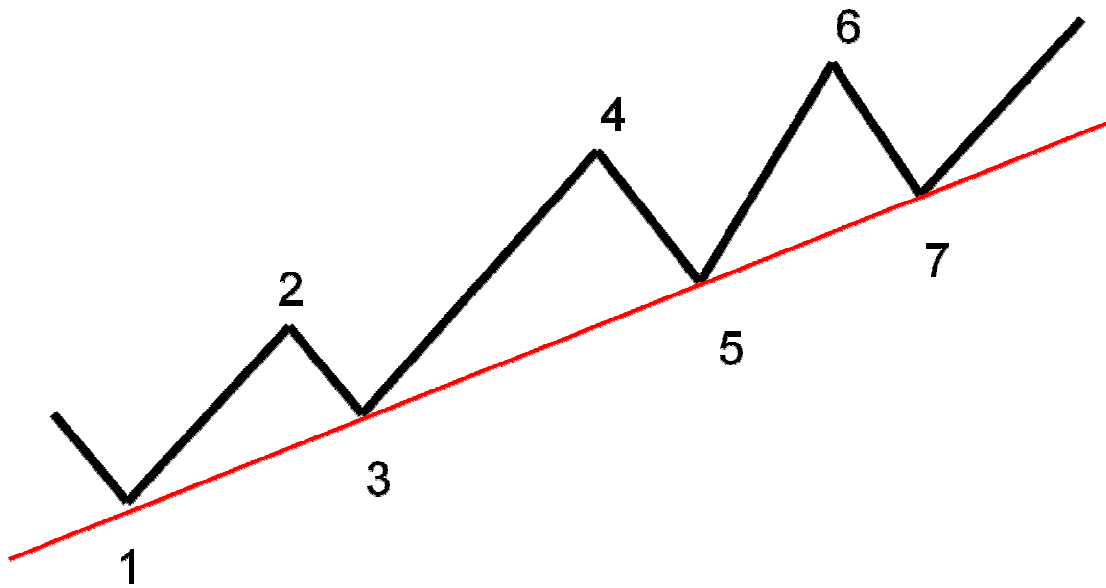
- خط مقاومت خطی است که در مقابل افزایش قیمت از خود مقاومت نشان می دهد و شکست آن نویدی جهت افزایش بیشتر قیمت است.
- خط حمایت خطی است که از قیمت ، جهت جلوگیری از کاهش بیشتر حمایت می کند و شکست آن نشاندهنده کاهش بیشتر قیمت است.



- نکته ۱: خط حمایت و مقاومت با حداقل دو نقطه تایید می شود.
- نکته ۲: پس از شکست خط مقاومت ، این خط تبدیل به خط حمایت می گردد و بالعکس پس از شکست خط حمایت این خط تبدیل به خط مقاومت می گردد.

خط روند صعودی

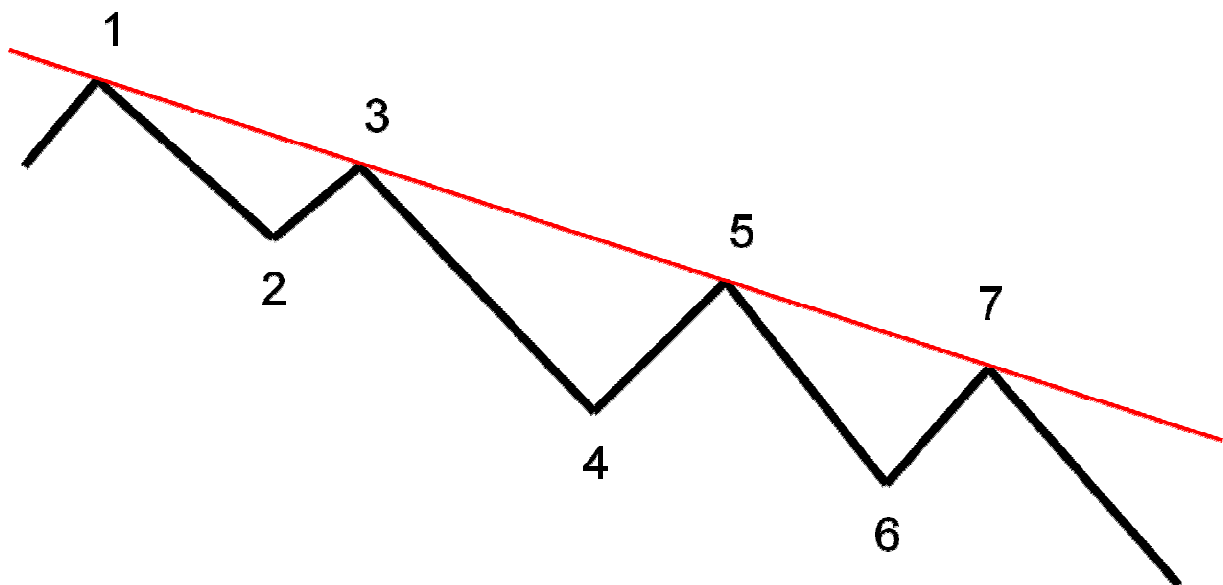
خط روند صعودی خط صافی است که انتهای موج های نزولی را به یکدیگر متصل می کند.



خطوط روند با دو نقطه رسم و با نقطه سوم تایید می شوند.

در اغلب موارد شکسته شدن خط روند یکی از بهترین و سریع ترین اخبارهای برگشت است.

خطوط روند نزولی



- معیار اعتبار خط روند طولانی بودن زمانی که خط روند صحت خود را حفظ کرده و تعداد دفعاتی که در برخورد با قیمت ایستادگی کرده می باشد.
- نفوذ بیشتر از ۳٪ قیمت پایانی آنطرف خط روند و بسته شدن قیمت دو کندل آنطرف آن می تواند تاییدی بر شکست خط روند باشد.

الگوهای شمعی ژاپنی

از تکنیک های نمودارهای شمعی می توان در نوسان گیری و سرمایه گذاریهای کوتاه مدت استفاده کرد. از ادغام و درهم افزایی شمع های ژاپنی و سایر ابزار تکنیکی می توانیم تکنیک های پر توانی را خلق کنیم.

اعتبار الگوهای شمعی امری ذهنی است و به تفکر و بررسی نیاز دارد.

تحلیل تکنیکی بیشتر نوعی هنر است تا علم. شما نباید برای اکثر شکل های تحلیل تکنیکی انتظار قوانین سفت و سخت داشته باشید، فقط می توانید انتظار راهنمایی داشته باشید.

محدودیت ها












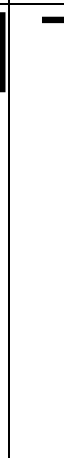



برای رسم یک شمع به قیمت پایانی نیاز داریم. بنابراین برای دریافت اخطار معتبر، منتظر قیمت پایانی بمانید. به این ترتیب تنظیم دستور خرید یا فروش به قیمت پایانی احتیاج دارد و لازم است چند دقیقه قبل از پایان شمع، قیمت پایانی را پیش بینی کنید و دستور خود را قرار دهید یا شاید ترجیح دهید برای تنظیم دستور خود تا باز شدن شمع بعدی منتظر بمانید.

نمودارهای شمعی، **اخطارهای بسیار مفیدی را مهیا می کنند اما قیمت هدف را مشخص نمی کنند.** روش های دیگری برای محاسبه قیمت وجود دارد مانند سطوح حمایت و

مقاومت ، سطوح فیبوناچی ، هدف های نوسان سازی و غیره. برخی از تحلیلگران نمودارهای شمعی با اخطار خرید وارد معامله می شوند و تا زمانیکه اخطار فروش دریافت نکنند با آن معامله باقی می مانند. در الگوهای شمعی همواره باید به حرکات قبلی قیمت و همچنین ارتباط آن با دیگر ابزارهای تکنیکی نیز توجه کرد.

ساختار نمودارهای شمعی

برای ژاپنی ها **مهمترین** قسمت یک شمع **بدنه اصلی** است. سایه ها به عنوان یک فاکتور فرعی در نوسانات قیمت لحاظ می شوند.

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
														
کاهشی	افزایشی					فرقره بی تصمیمی بازار				طول سایه در دوجی می تواند هر اندازه باشد و نشانه بازگشتند				
		ته صاف	سر صاف	ته صاف	سر صاف	فرقره - بدنه باید کوچک باشد طول سایه اهمیتی				دوجی	دوجی	دوجی	دوجی	
به بدبینانه شدت	به خوشبینانه شدت	بدبینانه	بدبینانه	خوشبینانه	خوشبینانه	خنثی	خنثی	نزولی = خ صعودی = بد	نزولی = خ صعودی = بد	تغییر روند	تغییر روند	پایان صعودی روند	تغییر روند	تغییر احتمالی روند

شمع بلند سیاهی که در آن قیمت ابتدایی نزدیک به قیمت بالایی و قیمت پایانی نزدیک به قیمت پایانی بوده است و در کل **بیانگر نزول در قیمت** است.

دلالت بر **افزایشی** بودن دارد.

دوجی یا بلند

طول سایه ها در دوجی می تواند هر اندازه ای باشد. و **نشانه بازگشت** هستند **دو** شمعدان دوجی پشت سرهم نشان یک حرکت **پر قدرت** پس از شکست وضعیت

قیمت ابتدایی و پایانی

تحلیگران ژاپنی اهمیت وافری برای قیمت ابتدایی و پایانی قایل هستند. زیرا این دو نقطه نماد هیجن انگیز ترین زمانهای یک روز کاری هستند.

اولین ساعت صبح سکان تمام روز است.

قیمت ابتدایی ، نخستین راهنما برای تعیین جهت روز است. قیمت ابتدایی تجلی تمام شایعات و اخباری است که شب قبل طرح و بررسی شده اند.

قیمت محوری دیگر، قیمت پایانی یا بسته شدن است. اگر خرید یا فروش عمده ای در زمان نزدیک شدن بازار در پایان ساعات با هدف تاثیر گذاری در قیمت نهایی انجام شود، ژاپنی ها آن را **حمله شبانه** می نامند. قیمت پایانی برای بسیاری از تکنسین ها، محوری و اساسی است. ممکن است آنها برای تایید اعتبار یک الگو تا دریافت قیمت پایانی منتظر بمانند. بسیاری از سیستم های رایانه ای (برای مثال Moving average) بر مبنای قیمت های پایانی، طراحی شده اند.

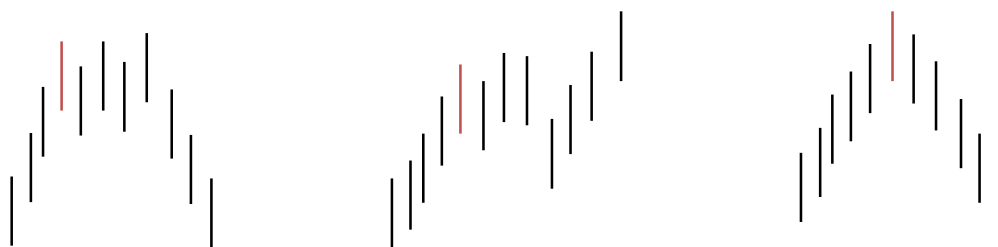
۱. الگوهای بازگشتی و افزایشی

تاریکی یک گام جلوتر به کمین نشسته است.

الگوهای بازگشتی ما را از امکان **تغییر جهت روند مطلع** می سازد. الگوهای بازگشتی غربی شامل سقف ها و کف های دو قلو، روزهای بازگشتی، سر و شانه ها و جزیره های سقف و کف هستند. وقوع این الگوها به این معناست که **جو روانی بازار در حال تغییر** است. شما باید روش معامله خود را با شرایط جدید بازار هماهنگ کنید.

اخطار بازگشت روند، صرفاً بیان می کند که روند قبلی مایل به تغییر است ولی به این **معنا نیست** که الزاماً تغییر جهت می دهد و بازگشت می کند.

سه حالت ممکن برای یک روند سقف بازگشتی: نزولی، صعودی و خنثی



تشخیص پدید آمدن الگوهای بازگشتی، یک مهارت ارزشمند به حساب می آید. معامله موفق مستلزم این است که هم روند و هم احتمالات ممکن به نفع شما رخ دهد.

یک قاعده مهم برای ورود به معامله جدید (بر اساس اخطارهای بازگشت) این است که اگر اخطار در جهت کلی روند بازار بود، وارد معامله شوید.

برای مثال اگر در بازار افزایشی الگوی بازگشتی سقفی بوجود آمد این اخطار تنها می تواند مجوزی برای فروش خریدهای قبلی باشد. اما اگر روند کلی بازار نزولی بود، همان الگوی بازگشتی سقف می تواند مجوزی برای فروش باشد.

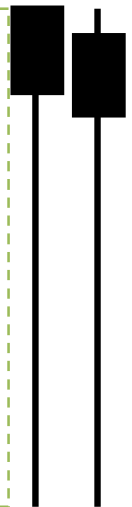
اکثر الگوهای نمودارهای شمعی؛ الگوهای بازگشتی هستند.

دار آویز Hanging Man

شمع هایی با سایه پایینی بلند و بدنه اصلی کوچک را نمایش می دهد.

قدرت زیاد، بازگشتی و در روندهای صعودی ظاهر می شود.

شرایط تایید: طول سایه پایینی دو برابر بدنه باشد

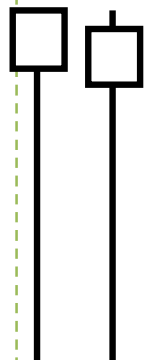


چکش تاکوری Hammer

شمع هایی با سایه پایینی بلند و بدنه اصلی کوچک را نمایش می دهد.

قدرت زیاد، بازگشتی و در روندهای نزولی ظاهر می شود.

تاکوری: تلاش برای مشخص کردن عمق آب، بوسیله لمس کردن کف است





الگوی نافذیا سوزنی Piercing line

دلالت بر **افزایشی** بودن دارد.

پوشش ابر سیاه

دلالت بر **کاهشی** بودن دارد.

اگر بدنه شمع دوم پایین تر از میانه بدنه شمعان پیشین باشد **نیرومندتر** خواهد بود.

شمعدان های پوشاننده افزایشی

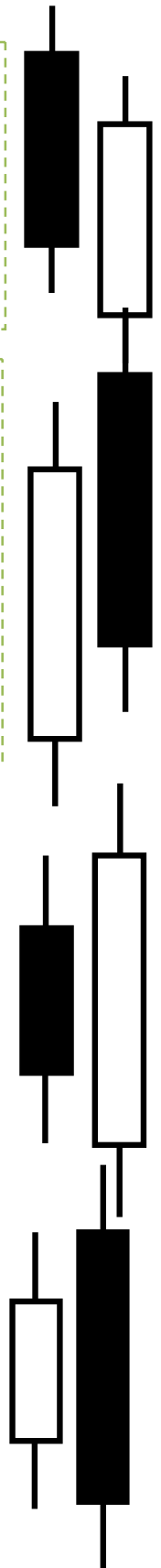
اگر پس از یک روند کاهشی بزرگ رخ دهد بسیار **افزایشی** خواهد بود.

شرایط تایید: بدنه شمع (پوشش دهد) مهم است و طول سایه اهمیت ندارد.

شمعدان های پوشاننده کاهشی

اگر پس از یک روند افزایشی رخ دهد **کاهشی** خواهد بود.

این الگو زمانی رخ می دهد که یک شمع دان بزرگ کاهشی یک شمعدان کوچک افزایشی را بپوشاند.



ستاره بامداد

یک الگوی **افزایشی** است که یک کف احتمالی را نشان می دهد. ستاره احتمال بازگشت و شمعدان افزایشی تایید می کند ستاره می تواند خالی یا تو پر باشد

ستاره بامداد یا صبحگاهی Morning Star

یک الگوی **افزایشی** است که یک کف احتمالی را نشان می دهد. ستاره احتمال بازگشت و شمعدان افزایشی تایید می کند ستاره می تواند خالی یا تو پر باشد

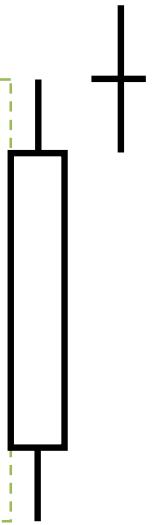
ستاره دوجی افزایشی

ستاره نشان **بازگشت** است اما دوجی نشان دهنده **تردید و دودلی** است. پس معمولاً نشان بازگشت است. باید صبر کنید تا الگوی جهت تایید شود. یعنی **کندل سوم** تشکیل شود مانند ستاره بامداد سه تایید شود.



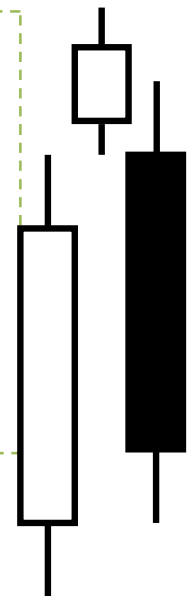
ستاره دوجی افزایشی

ستاره نشان بازگشت است اما داجی نشان دهنده **تردید و دودلی** است. پس معمولاً نشان بازگشت است. باید صبر کنید تا الگوی جهت تایید شود. یعنی **کندل سوم** تشکیل شود مانند ستاره بامداد سه تایید شود.



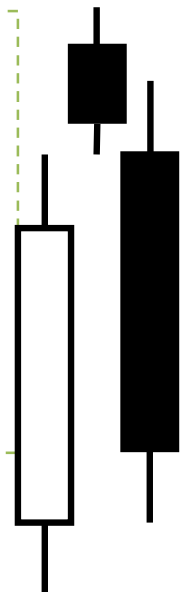
ستاره شامگاهی

یک الگوی **کاهشی** است که یک سقف احتمالی را نشان می دهد. ستاره احتمال بازگشت و شمعدان کاهشی آنرا تایید می کند ستاره می تواند خالی یا تو پر باشد



ستاره شامگاهی

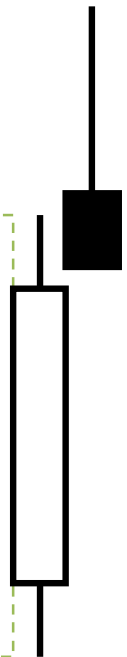
یک الگوی **کاهشی** است که یک سقف احتمالی را نشان می دهد. ستاره احتمال بازگشت و شمعدان کاهشی آنرا تایید می کند ستاره می تواند خالی یا تو پر باشد





ستاره دنباله دار

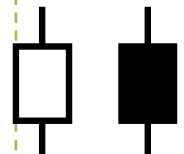
پس از یک روند افزایشی رخ می دهد و یک **بازگشت جزئی** را نشان می دهد. بدنه ستاره باید نزدیک نرخ کمینه باشد و شمعدان باید سایه بالایی بلندی داشته باشد.



۲. الگوهای خنثی

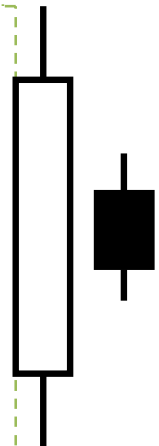
الگوی نخ ریسی

این الگو **خنثی** است. فاصله میان بیشینه و کمینه و فاصله میان نقطه باز شدن و بسته شدن کم است.



هارمی یا آبستن Harami

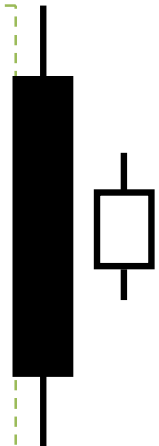
این الگو **کاهش جنبش** است. هنگامی رخ می دهد که یک شمعدان که بدنه کوچکی دارد وسط یک شمعدان که بدنه بزرگتری دارد قرار گیرد



در این الگو سفید یا سیاه بودن شمعهها مهم نیست که در طی روند

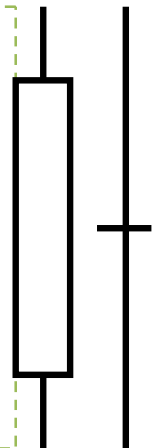
هارمی یا آبستن Bullish Harami

این الگو کاهش جنبش است و روند تغییر عمومی قیمت مشخص است..هنگامی رخ می دهد که یک شمعدان که بدنه کوچکی دارد وسط یک شمعدان که بدنه بزرگتری دارد قرار گیرد در این الگو سفید یا سیاه بودن شمعهها مهم نیست که در طی روند



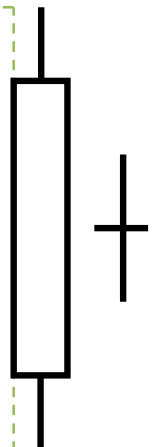
هارمی یا گذر

این الگو کاهش جنبش است و نشان تردید است(دوجی)



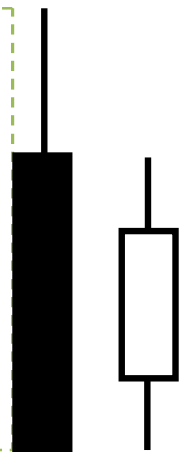
هارمی صلیبی Bullish Harami Cross

این الگو کاهش جنبش است و نشان تردید است(دوجی)



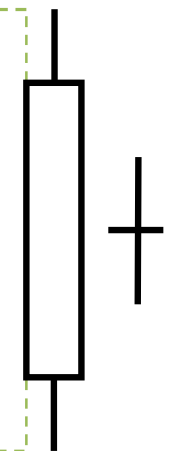
دو شمع دارای کف یکسان Tweezer bottom

هیچ توجهی به بدنه سیاه و سفید، طول سایه ها و... نمی شود. تنها چیزی که مهم است یکسان بودن کف طی دو روز



هارمی صلیبی Bullish Harami Cross

این الگو **کاهش جنبش** است. و نشان تردید است (دوجی)



اندیکاتور Indicator

تعریف اندیکاتور

اندیکاتورها توابع ریاضی هستند که بر اساس فرمول های خاص در جهت تحلیل بازار بوسیله ابزارهای گرافیکی ترسیم و مورد استفاده قرار می گیرند. داده های ورودی در اندیکاتورها بر اساس تعدادی از بازه های قبلی تغییرات قیمت وارد می شود. در هر بازه زمانی اطلاعات قیمت آغاز (Open)، پایان (Close)، سقف (High)، کف (Low) و یا تعدادی از مجموع این اطلاعات مورد استفاده قرار می گیرد.



استفاده از اندیکاتورها

برای استفاده از اندیکاتورها در بازارهای مالی بر اساس تغییرات گذشته قیمت، سه استفاده کلی میشود.

۱. اندیکاتورها در زمان های خاص بر اساس شرایط شکل گرفته روی آنها، قبل از تغییر روند یا همزمان با چرخش روند، در بازار علائم بازگشت روند را نشان می دهند. از این رو یکی از مهم ترین استفاده ها از اندیکاتورها برای **تعیین هشدارهای مناسب تغییر روند و جهت حرکت** قیمت است.
۲. **پیش بینی**: یکی از استفاده های اندیکاتورها برای **پیش بینی قیمت** ورودی مناسب است. معمولا اندیکاتورهای **کمی** هستند که برای پیش بینی قیمت ورودی و در عین حال جهت درست، مناسب معامله گری باشند.
۳. **تایید**: از مهمترین استفاده هایی که از اندیکاتورها می شود برای تایید گرفتن تشخیص درست روند یا جهت است. این روش استفاده از اندیکاتورها معمولا زمانی مورد استفاده قرار می گیرد که تحلیل گر بر اساس داده های تکنیکی یا بنیادی جهت و قیمت ورودی مناسب در بازار را پیش بینی کرده است و از اندیکاتور برای تایید گرفتن استفاده می کند.

اندیکاتورها از لحاظ نوع حرکت و رفتار به دو دسته :

۱. **Leading Indicators**: اندیکاتورهای پیشرو معمولا همراه با نوسانات قیمت هشدار و پیش بینی را اعلام می کنند. اندیکاتورهای پیشرو، اغلب موارد سیگنال های بیشتری نسبت به اندیکاتورهای تاخیری ایجاد می کنند و به همین جهت احتمال خطا در آنها بیشتر است.
۲. **Lagging Indicators**: اندیکاتورهای تاخیری معمولا با تاخیر پس از حرکت قیمت و جابجایی بازار هشدار و پیش بینی لازم را ارائه می دهند. اندیکاتورهای تاخیری با اینکه سیگنال های کمتری ایجاد می کنند اما به خاطر اینکه قیمت حرکت اصلی خود را در بازار انجام داده و سپس این اندیکاتورها سیگنال می دهند معمولا تاخیر آنها باعث از دست رفتن موقعیت مناسب ورود می شود. ایراد دیگر اندیکاتورهای تاخیری سیگنال های اشتباه آنها در روندهای رو به جلو است. این دسته از اندیکاتورها معمولا برای بازارها رونددار کاربرد دارند.

انواع اندیکاتورها

در تقسیم بندی ها اندیکاتورها به ۴ خانواده اصلی بر اساس نوع نمایش یا مدل محاسباتی تقسیم بندی می شوند که مهمترین این تقسیم بندی ها شامل:

۱. Trend: ابزارهایی برای شناسایی روند
۲. Oscillators: اسیلاتورها ابزارهایی برای تشخیص روند جاری و محدوده بیش خرید و بیش فروش هستند. اسیلاتورها خود به دو دسته Banded و Centered تقسیم بندی می شوند.
۳. Volumes: برای تشخیص حجم معاملات و استفاده از برآیند تعداد پوینت های نوسانات استفاده می شود. این دسته از اندیکاتورها در بازار تبادلات ارزی کاربرد چندانی به واسطه اهمیت نداشتن حجم ندارند.
۴. Bill Williams: برای تشخیص جابجایی سطوح قیمتی روند مورد استفاده قرار می گیرند.

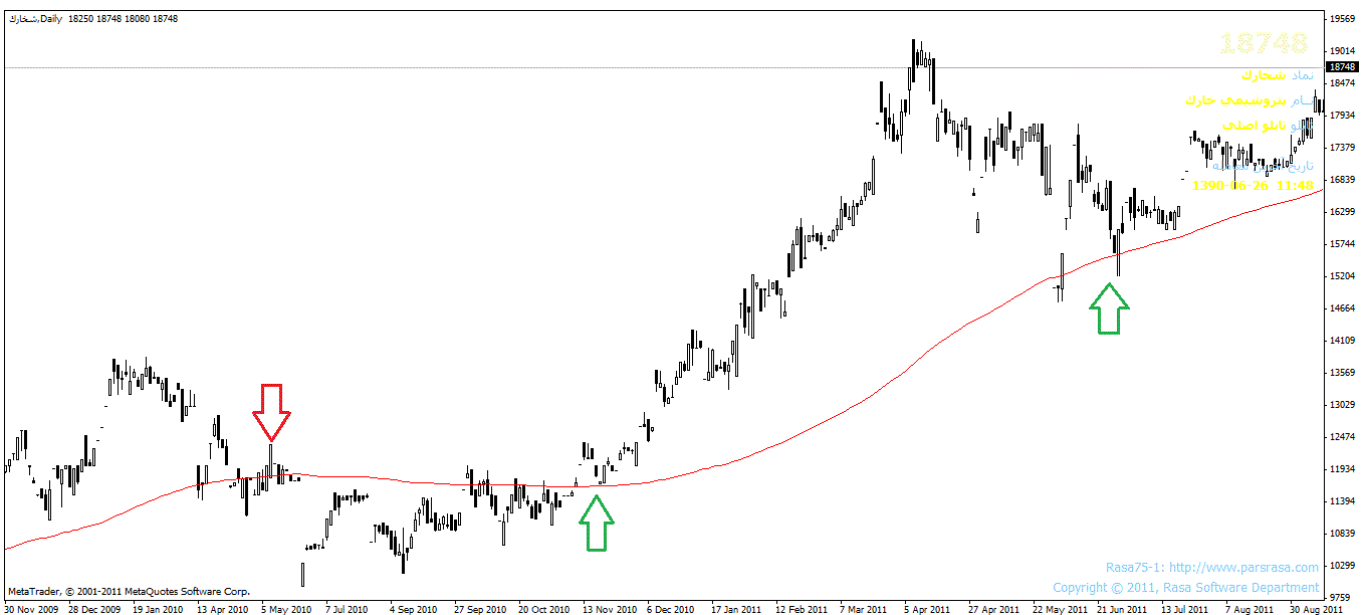
اندیکاتور میانگین متحرک Moving Average

اندیکاتوری است از نوع Lagging Indicators تاخیری و Trend روندی. میانگینی از قیمت هاست (اغلب قیمت بسته شدن) که در بازه زمانی خاصی محاسبه می گردد. عامل حساس در میانگین متحرک، تعداد دوره های زمانی است که در محاسبه میانگین مورد استفاده قرار می گیرد. با تجربه و با امتحان دوره های مختلف، می توان دوره ای را انتخاب نمود که سودآور باشد. کلید این کار یافتن میانگین متحرکی است که دارای سیگنال های درست و سودآور باشد.

میانگین متحرک	روند (روز)
M15	34,55,144
H1	8,34,55,89,144
H4	8,34,55,89,144
D1	8,13,21,55,89
W1	8,13,21

انواع میانگین متحرک:

۱. میانگین متحرک ساده simple: وزنی مساوی به قیمت‌های سری داده‌ها
۲. میانگین متحرک نمایی Exponential: برای داده‌های جدید وزن بیشتر
۳. میانگین متحرک وزنی Weighted: برای داده‌های جدید وزن



Simple Moving Average Calculation

Daily Closing Prices: 11,12,13,14,15,16,17

First day of 5-day SMA: $(11 + 12 + 13 + 14 + 15) / 5 = 13$

Second day of 5-day SMA: $(12 + 13 + 14 + 15 + 16) / 5 = 14$

Third day of 5-day SMA: $(13 + 14 + 15 + 16 + 17) / 5 = 15$

Exponential Moving Average Calculation

SMA: 10 period sum / 10

Multiplier: $(2 / (\text{Time periods} + 1)) = (2 / (10 + 1)) = 0.1818$ (18.18%)

EMA: $\{\text{Close} - \text{EMA}(\text{previous day})\} \times \text{multiplier} + \text{EMA}(\text{previous day})$.

نحوه تحلیل: هرگاه قیمت خط میانگین متحرک را از پایین قطع و به سمت قیمت های بالاتر ادامه مسیر دهد علامتی برای **خرید** و در صورتیکه از بالا قطع و به سمت قیمت پایین تر ادامه مسیر دهد علامتی برای **فروش** محسوب می گردد.

همچنین در انتخاب دوره زمانی برای میانگین متحرک باید به موارد زیر توجه کنید .

هر چقدر دوره زمانی طولانی تر انتخاب شود حساسیت میانگین متحرک نسبت به تغییرات قیمت کمتر می شود . تا آنجا که یک میانگین متحرک خیلی بزرگ کاملاً از بازار عقب می افتد .

هر چقدر دوره زمانی کوتاه تر انتخاب شود سیگنال های اشتباه بیشتری به دلیل افزایش حساسیت میانگین متحرک دریافت می شود . به عنوان مثال یک میانگین متحرک کوتاه مدت بارها و بارها توسط قیمت شکسته می شود در حالی که روند حرکت موج تغییری نخواهد کرد.

از آنجا که میانگین متحرک یک شاخص روند محسوب می شود نباید از آن در محدوده های معاملاتی استفاده کرد . محدوده های معاملاتی نواحی هستند که قیمت در این نواحی بین یک کف و سقف مستحکم در رفت و برگشت است .

استثناء: در بازارهای خنثی که سقف و کف مستحکمی در رفت و برگشت استفاده نشود.

بهترین حالت استفاده از میانگین متحرک در بازارهایی است که دارای **روند** هستند

Moving Average Convergence Divergence:MACD

اندیکاتور میانگین متحرک همگرایی/واگرایی بوسیله گرانداپل معرفی شد. چیزی که باعث مفید بودن این اندیکاتور می شود ترکیب برخی از اصول اسیلاتورهاست. بر روی صفحه دو خط دیده می شود در حالیکه در حقیقت در محاسبات از سه خط استفاده میشود.

این شاخص که معمولاً به صورت دوره های ۹ و ۱۲ و ۲۶ روزه بررسی می شود.

اخطارهای خرید و فروش واقعی در زمان تقاطع دو خط صادر می شود.

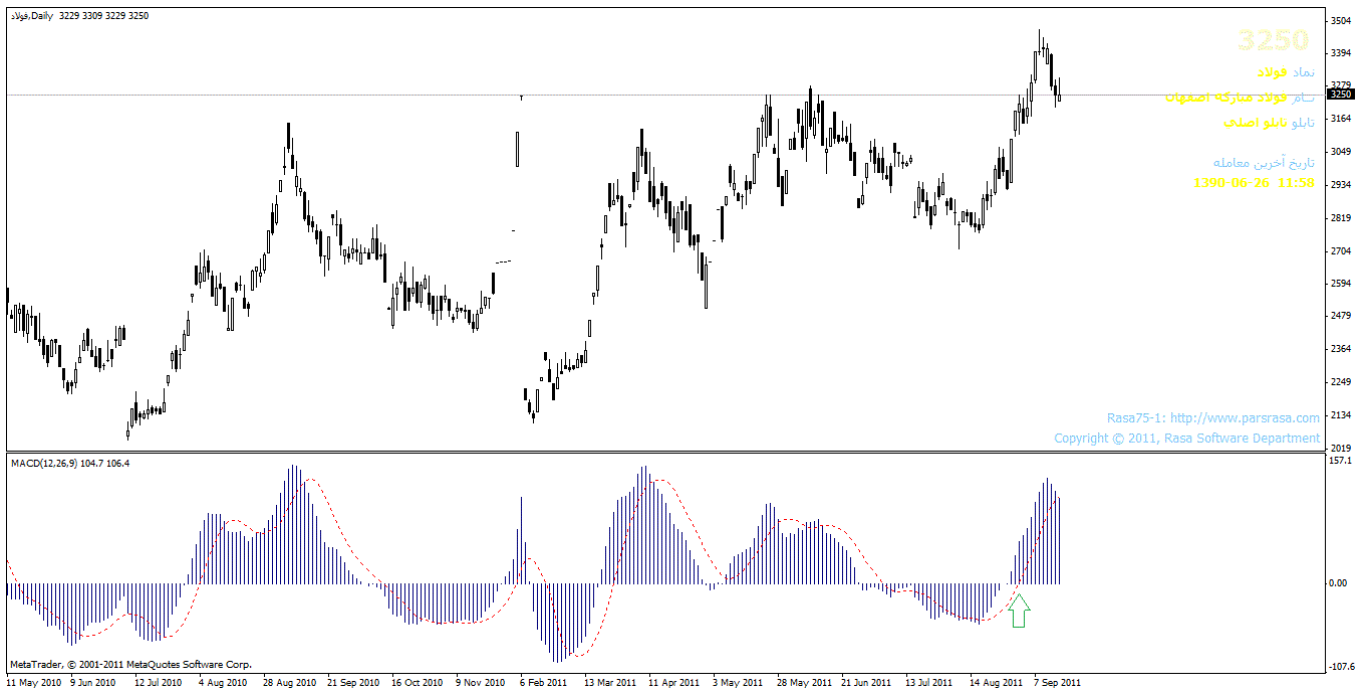
خرید: عبور رو به بالای خط MACD سریعتر از خط کندتر اخطار خرید تلقی می شود.

فروش: عبور رو به پایین خط سریعتر از خط کندتر اخطار فروش محسوب میشود.

خط صفر: نقش اسیلاتور را دارد. زمانی که این خطوط تا حد زیادی در بالای خط صفر فاصله می گیرند شرایط خرید هیجانی و برعکس آن فروش هیجانی.

بهترین اخطار خرید زمانی است که قیمت ها کاملاً در زیر خط صفر قرار می گیرند (فروش هیجانی)

زمانی که مانند مثال پایین، نماگر MACD در جهتی مخالف قیمت سهم در حال حرکت است، باید منتظر برگشت روند حرکت قیمت سهم (در این مثال به سمت پایین) باشیم. با توجه به این که میانگین متحرک ۱۲ روزه در حال عبور از روی میانگین متحرک ۲۴ روزه از قسمت پایین است، پیغام خرید ضعیفی در روزهای آتی می تواند پیغامی از سوی این شرکت باشد.



گرچه بر اساس این اطلاعات نمی توان برای خرید یا فروش نتیجه گیری قطعی کرد، اما می توان اطلاعات خود را برای تعیین مسیر آتی سهم و در نتیجه احتمال موفقیت خود را افزایش داد. نوع استاندارد میانگین متحرک همگرا واگرا (۹، ۱۲، ۲۶) MACD است.

در یک نمودار MACD معمولاً سه عدد می بینید که برای تنظیمات آن استفاده شده اند.

۱. اولین عدد، دوره های زمانی است که میانگین متحرک سریعتر را محاسبه می کند.
۲. دومین عدد، دوره های زمانی است که میانگین متحرک کندتر را محاسبه می کند.
۳. و سومین عدد، تعداد میله هایی است که یک میانگین متحرک، بین میانگین متحرک سریعتر و کندتر محاسبه می کند.

این اندیکاتور از دو خط تشکیل شده است. MACD اختلاف بین دو میانگین متحرک نمایی با یک خط سیگنال که خود یک میانگین متحرک نمایی است می باشد. اگر MACD (خط آبی) و خط سیگنال (خط قرمز) با هم برخورد کنند، این امکان وجود دارد که روند تغییر کند.

همچنین خط سیگنال خطی است در نمودار MACD. اگر MACD بالای خط سیگنال باشد علامت خرید و اگر MACD پایین خط سیگنال باشد علامت فروش می باشد. این نمودار در واقع

تفاوت بین میانگین متحرک سریع و کند را رسم می کند. اگر به نمودار بالا نگاه کنید می بینید که هرچه میانگین ها از هم دورتر شوند نمودار بزرگتر می شود. به این واگرایی می گویند. چرا که میانگین متحرک سریع از میانگین متحرک کند دور می شود. هر چقدر میانگین های متحرک به هم نزدیکتر شوند، نمودار کوچکتر می شود. به این همگرایی می گویند چرا که میانگین متحرک سریع به میانگین متحرک کند نزدیک می شود و بدین ترتیب منشأ نام واگرایی همگرایی میانگین متحرک مشخص می شود.

اندیکاتور Parabolic SAR=Parabolic Stop And Reverse

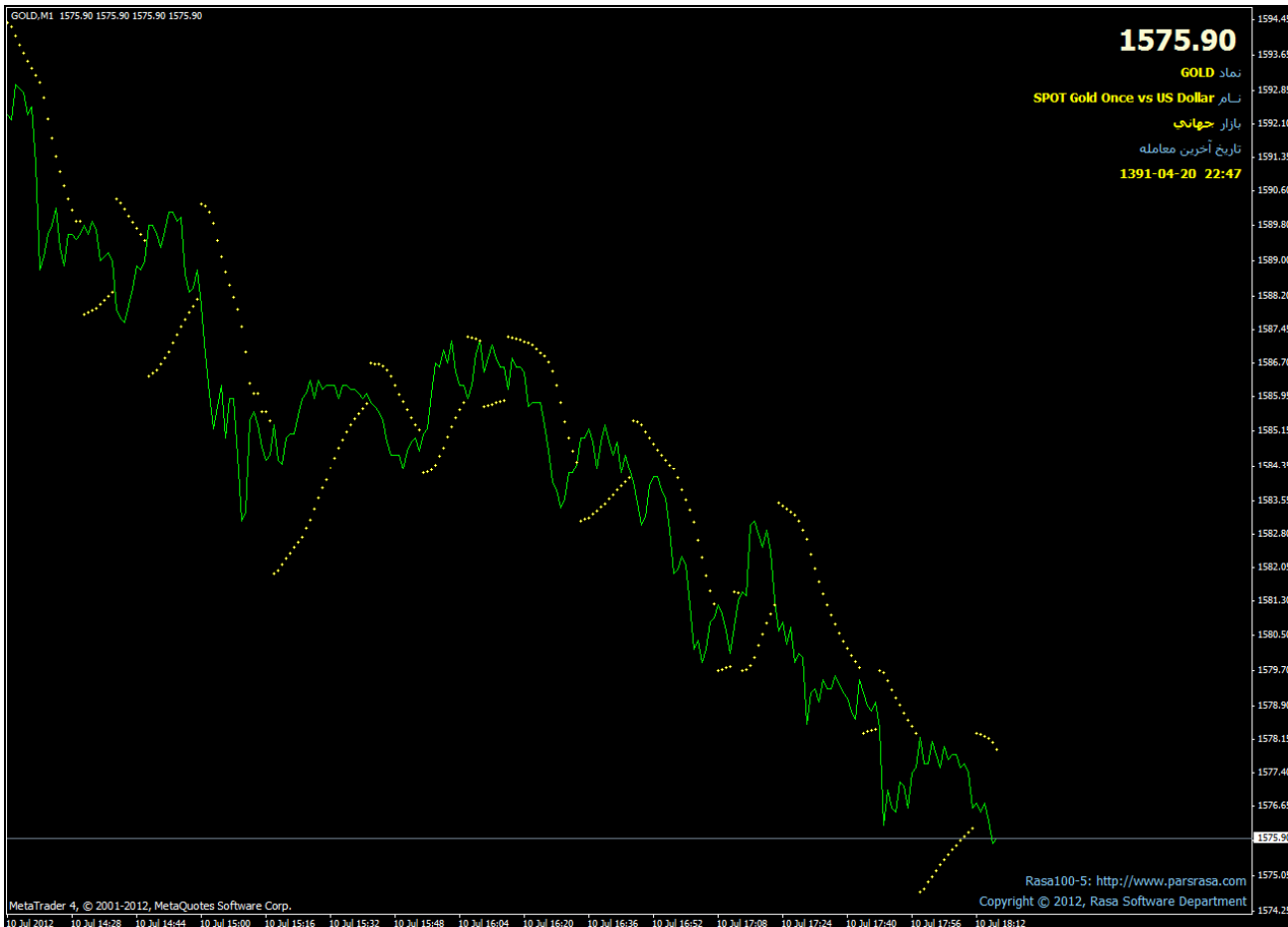
یک سیستم بازگشتی قیمت / زمان می باشد. در ابتدا SAR کند است زمانیکه روند پایدار می شود شتاب می گیرد. و در بازارهای **رونددار** کاربرد دارد.

اندیکاتوری برای تشخیص روند و بدست آوردن **نقاط کلیدی اتمام یک روند** است.

مادامی که نقطه های این اندیکاتور **روی** هر شمع باشد روند **نزولی** است.

مادامی که نقطه های این اندیکاتور **زیر** هر شمع باشد روند **صعودی** است.

در عین حال هر نقطه سبز رنگ این اندیکاتور می تواند حکم یک حمایت یا مقاومت را در بازار داشته باشد. عبور قیمت هر شمع از نقطه سبز رنگ اندیکاتور به معنی پایان روند جاری و آغاز یک روند خلاف جهت است. این اندیکاتور معمولاً برای بازارها یا دوره های رو به جلو کاربرد چندانی ندارد.

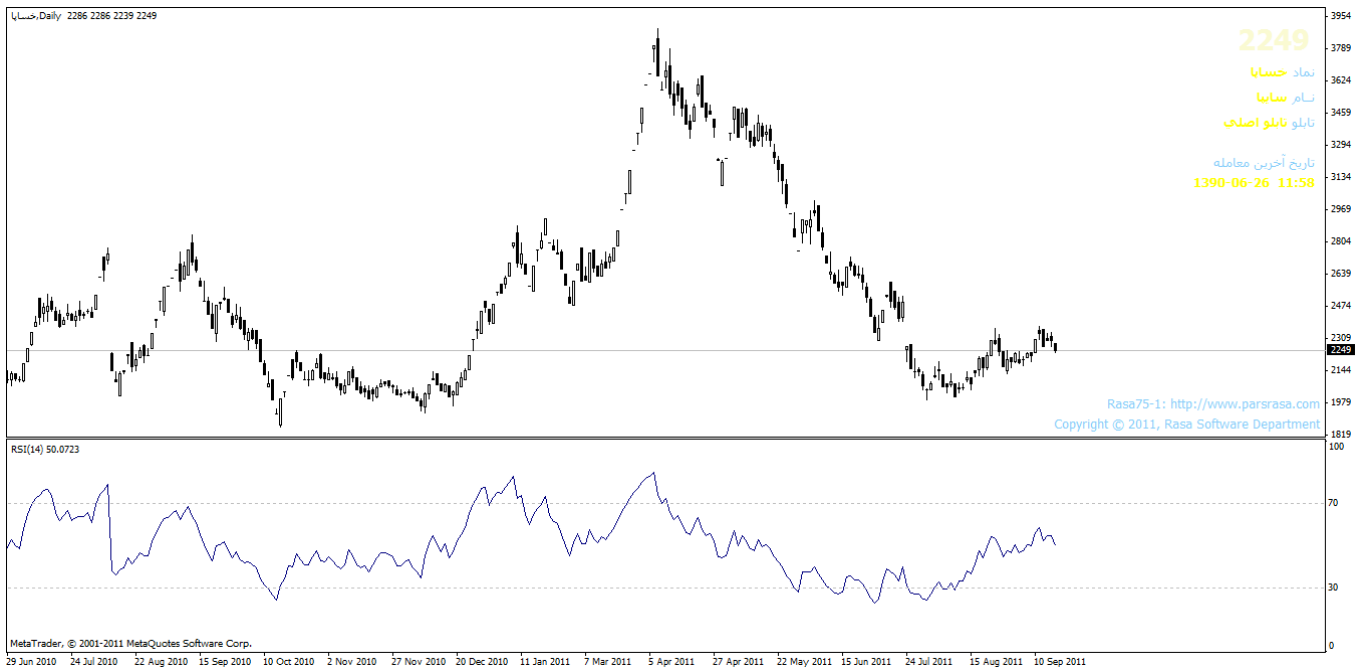


اندیکاتور RSI شاخص قدرت نسبی: Relative Strength Index

این شاخص تکنیکی در سال ۱۹۷۸ توسط J.Welles معرفی شده و از محبوبترین اندیکاتورهای تکنیکی در بین اکثر تحلیلگران است. از این رو شاخص قدرت نسبی نام گرفته که قدرت تغییرات قیمتهای اخیر بسته شدن را با مقادیر پیشینی از دوره های قبلی اندازه گرفته و آن را تبدیل به عددی میکند که همواره بین ۰ و ۱۰۰ است. اندیکاتور RSI نسبت حرکات صعودی و نزولی را اندازه گیری می کند و مقدار بدست آمده را طوری تعیین می کند که عددی مابین ۰ تا ۱۰۰ خواهد بود. اگر اندیکاتور RSI عدد ۷۰ یا بزرگتر از آن را نشان دهد، بیان کننده آن است که قیمت در وضعیت حد اشباع خرید قرار گرفته است (در واقع قیمت بیش تر از حد انتظار بازار افزایش یافته است) و اگر RSI عدد ۳۰ و یا کمتر از آن را نشان دهد به این معنی است که قیمت

در محدوده اشباع فروش قرار دارد (در این وضعیت قیمت بیشتر از حد انتظار بازار سقوط کرده است).

عدد ۳۰ به معنی در کف بودن سهم و عدد ۷۰ به معنی در سقف بودن سهم است.



سیگنال های خرید

۱. اگر عدد زیر ۳۰ باشد و تشکیل کف دوگانه (ناقص) بدهد
۲. اگر نمودار قیمت تشکیل کف دهد ولی اندیکاتور نتواند این الگو را تشکیل دهد
۳. اگر خطوط روند در نمودار قیمت و اندیکاتور رو به بالا شکسته شود
۴. حرکت اندیکاتور به بالای خط ۵۰ اخطار تاییدی برای خرید می باشد
۵. واگرایی صعودی سیگنال خرید می باشد (مهمترین سیگنال)
۶. در زمان بازار بدون روند بهترین زمان خرید حرکت از زیر عدد ۳۰ به بالا می باشد (از منطقه اشباع فروش خارج شود)

سیگنال های فروش

۱. اگر عدد بالای ۷۰ باشد وتشکیل سقف دوگانه (ناقص) بدهد
۲. اگر نمودار قیمت تشکیل سقف دهد ولی اندیکاتور نتواند این الگو را تشکیل دهد
۳. اگر خطوط روند در نمودار قیمت واندیکاتور رو به پایین شکسته شود
۴. حرکت اندیکاتور به زیر خط ۵۰ اخطار تاییدی برای فروش می باشد
۵. واگرایی نزولی سیگنال فروش می باشد (مهمترین سیگنال)
۶. در زمان بازار بدون روند بهترین زمان فروش حرکت از بالای عدد ۷۰ به پایین
۷. می باشد(از منطقه اشباع خرید خارج شود)

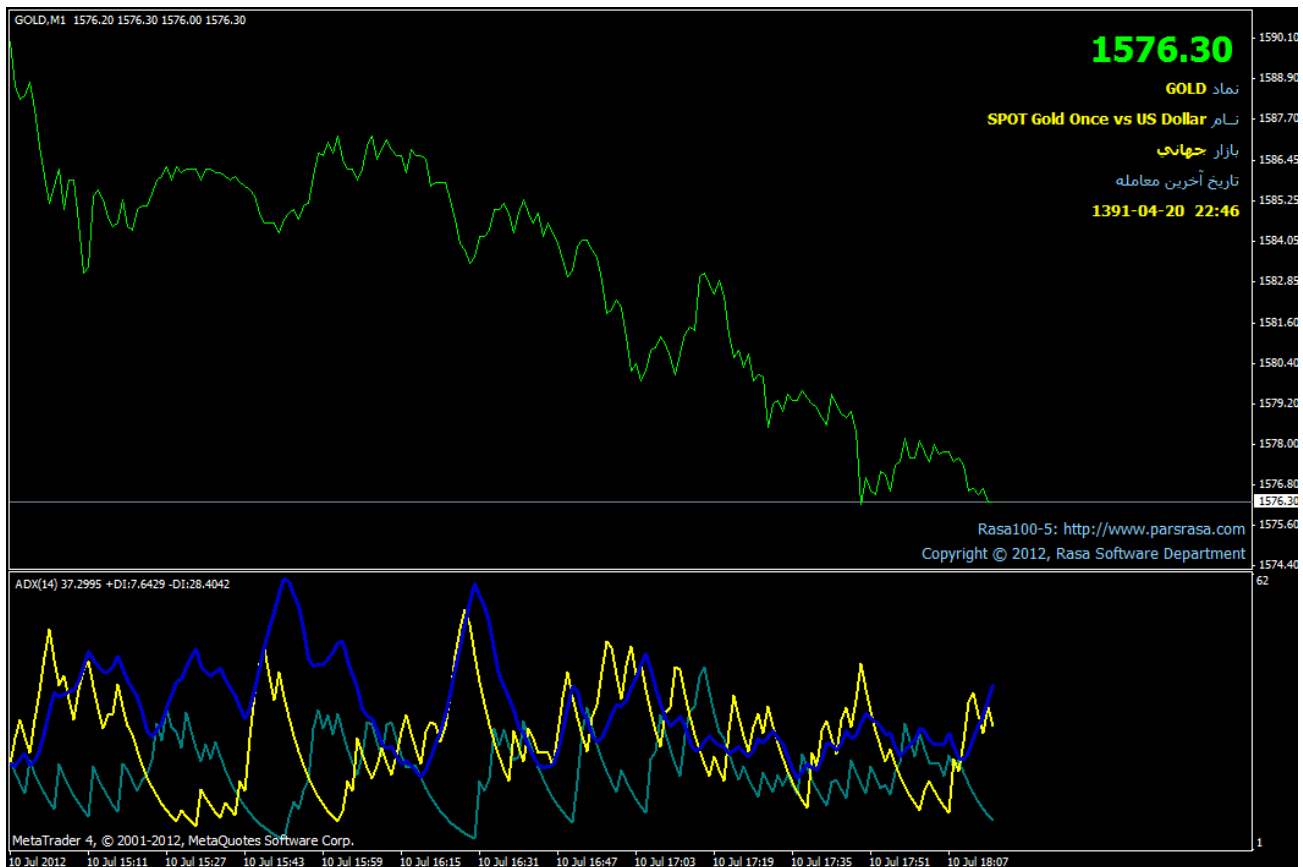
اندیکاتور Average Directional Movement Index: ADX

این اندیکاتور یک ابزار تشخیص اینکه بازار روندار هست یا نه؟

بر اساس این اندیکاتور ابتدا مشخص می کنیم که **روند نزولی** یا **صعودی** و یا **رو به جلو** است.

نشانگر ADX شامل دو جهت مخالف **+DI** و **-DI** و خط **ADX** است. که **+DI** و **-DI** در خلاف جهت یکدیگر حرکت می کنند و **ADX** نیز تفاوت این دو را نشان می دهد. هر چقدر **+DI** و **-DI** واگرایی بیشتری داشته باشند مقدار **ADX** نیز بزرگتر است.

نقطه عبور **+DI** و **-DI** را از روی یکدیگر می توان مکان ارائه سیگنال در نظر گرفت.



خرید یا فروش	روند	-DI	+DI	ADX
-	ضعیف	تقریباً خنثی		خیلی ضعیف یا زیر سطح ۲۰
-	در حال تضعیف	همگرایی		کاهشی
خرید	در حال تقویت	کاهشی	افزایشی	افزایش
فروش		افزایشی	کاهشی	
خرید	تشکیل روند جدید	کاهشی	افزایشی	به شکل کف مدور
فروش		افزایشی	کاهشی	
بستن معامله سوده	بازگشت با احتمال زیاد	-	-	خیلی قوی
-	اشباع از خرید یا فروش	-	-	به شکل سقف مدور

اندیکاتور Bollinger Bands

نوارهای بولینگر دامنه انتظارات معامله گران را نمایش می دهند و چنانچه قیمتها از این نوارها خارج شوند تمایل دارند به درون آنها باز گردند.

همانطور که قبلا هم اشاره شد قیمتها بین دو محدوده خریدهها و فروشهای افراطی در نوسان هستند. نقاط بالائی و پائینی فقط در لحظاتی کوتاه پدید خواهند شد و ما نمی توانیم در آن نقاط معامله ای انجام دهیم. اما محدوده هایی وجود دارد که نزدیک ترین نقاط به قله یا قعر قیمتی است. این محدوده بیرون از نوارهای بولینگر شکل می گیرد.

نوارهای بولینگر برای اندازه گیری فراریت بازار استفاده می شوند. اساسا این ابزار به ما می گوید که چه زمانی بازار بی حرکت است و چه زمانی دارای حرکت است. زمانیکه بازار بی حرکت است نوارها به هم نزدیک می شوند و هنگامیکه بازار دارای حرکت است نوارها از هم دور می شوند. به شکل زیر نگاه کنید. زمانیکه قیمتها بی حرکت است نوارها به هم نزدیک می شوند و زمانیکه قیمتها بالا می روند، نوارها از هم دور می شوند.

نحوه محاسبه:

باندهای بولینگر سه تا هستند که همانطور که ذکر شد خط وسط، میانگین متحرک n دوره ای سهم میباشد. یعنی:

$$\frac{\sum_{j=1}^n Close_j}{n} = \text{باند وسط}$$

باند بالایی همان باند پایینی است که به اندازه انحراف معیار (یا ضریبی از آن) به بالا منتقل شده است. یعنی:

$$\left[D + \sqrt{\frac{\sum_{j=1}^n (\text{Close}_j - \text{Middle Band})^2}{n}} \right] \quad \text{باند بالایی = باند وسط} +$$

که D همان ضریبی است که بعضی مواقع در انحراف معیار (قبل از جمع با باند وسط) ضرب میگردد. این ضریب میتواند ۱ یا ۲ باشد.

فرمول مشابهی نیز برای باند پایینی بولینگر وجود دارد. یعنی پس از ضرب کردن D در انحراف معیار باند وسط را به اندازه این مقدار به پایین منتقل میکنیم.

$$\left[D + \sqrt{\frac{\sum_{j=1}^n (\text{Close}_j - \text{Middle Band})^2}{n}} \right] \quad \text{باند پایینی = باند وسط} -$$

آقای بولینگر عدد ۲۰ را بعنوان تعداد بازه مناسب برای رسم میانگین متحرک معرفی میکند. {یعنی میانگین متحرک ۲۰ روزه} و نوع میانگین متحرک پیشنهادی ایشان ساده (Simple Moving Average) میباشد. آقای بولینگر ضریب $D=2$ را پیشنهاد کرده است. از دیگر یافته های آقای بولینگر این است که میانگین متحرک های زیر ۱۰ روزه کارکرد خوبی برای رسم باندهای بولینگر ندارند.

خروج قیمتها از نوارها بیانگر پیشی گرفتن انتظارات معامله گران از جریان اطلاعات است که در محاوره به آن یک کلاغ چهل کلاغ می گوئیم. این حرکات تند قیمتی همواره یک دوره تصحیح را به دنبال خواهد داشت.

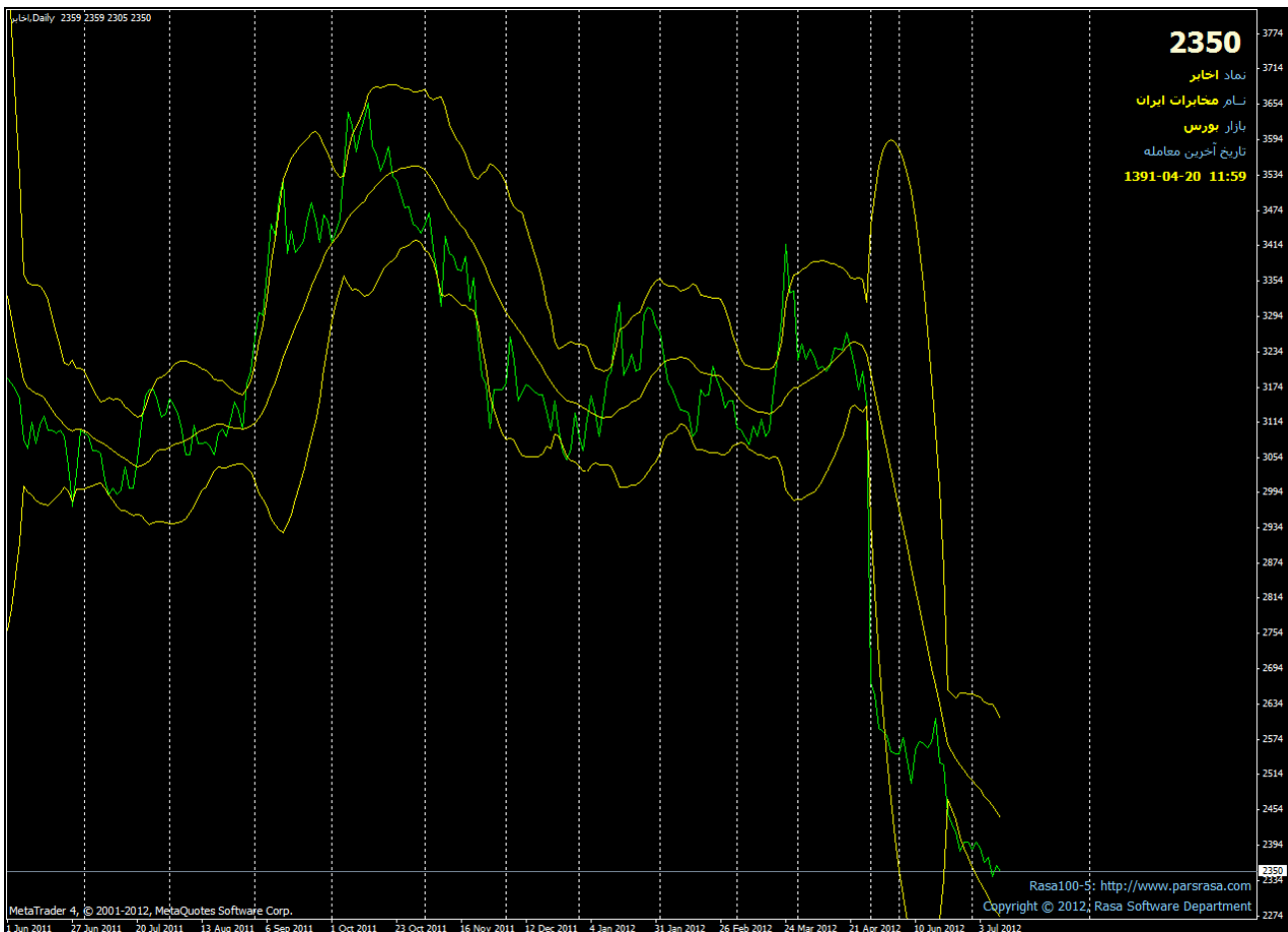
دوره ای که بازار مجدداً به اطلاعات شرکت رجوع می کند و آنها را بازنگری می کند. در این شرائط دهانه نوارهای بولینگر بهم نزدیک می خواهد شد و چنانچه به جریان مثبت اطلاعات آتی امیدوار شود مجدداً تلاش خریداران منجر به ادامه روند افزایشی خواهد شد. این مسیر تا خروج مجدد قیمتها از نوار بولینگر ادامه خواهد داشت.



کاربرد باندهای بولینگر

۱. بخش عمده نوسانات قیمت (۹۵٪) در فاصله بین دو باند است
۲. فاصله نوارها در موقعیت های بازار پر نوسان بیشتر می شود
۳. میانگین متحرک ۱۰ روزه برای کوتاه مدت و ۲۰ روزه برای میان مدت استفاده می شود
۴. هنگامی که فاصله دو نوار زیاد شود پایان روند جاری و وقتی که فاصله کم شود علامت آغاز روند جدید است.
۵. اگر قیمت به نوار بالایی/پایینی حرکت کند و باند وسطی را قطع کند نوار پایینی / بالایی هدف قیمت است.

آقای بولینگر عدد ۲۰ را برای دوره های میانگین متحرک پیشنهاد داده است.



اندیکاتور Commodity Channel Index

اندیکاتور شاخص کانال کالا یا CCI اندیکاتوری برای تشخیص روند و میزان قدرت روند می باشد. بر خلاف اندیکاتورهای خانواده اسیلاتورها این اندیکاتور فاقد محدوده بیش خرید و بیش فروش است.

طریقه استفاده از این اندیکاتور بدین ترتیب است که در صورت عبور شاخص CCI از روی عدد ۱۰۰ مثبت دیدگاه جهت و روند، صعودی در نظر گرفته می شود و در صورت عبور شاخص CCI به زیر عدد منفی ۱۰۰ دیدگاه جهت و روند، نزولی در نظر گرفته می شود. هرچه شاخص CCI از

اعداد ۱۰۰ مثبت یا ۱۰۰ منفی بیشتر فاصله بگیرد روند در آن جهت قدرت بیشتری خواهد داشت.

در این اندیکاتور واگرایی به مانند اندیکاتورهای خانواده اسیلاتور مورد استفاده قرار می گیرد. در عین حال اندیکاتور CCI از جمله اندیکاتورهای شناخته می شود که همراه و همزمان با تغییرات قیمت سیگنال ارائه می دهد و پس از جایابی قیمت تصحیح انجام نمی دهد.



میانگین متحرک

میانگین متحرک (ma) میانگینی از قیمت هاست (اغلب قیمت بسته شدن) که در بازه زمانی خاصی محاسبه می گردد. این شاخص ارتباط ملایمی بین قیمت و زمان پدید می آورد و این هموارسازی تا به این حد است که گاهی از آن به عنوان نرم کننده قیمت نیز یاد می شود. مقدار این هموارسازی از طریق پارامتر دوره زمانی (تعداد شمع هایی که باید از آنها میانگین تهیه کرد) معین می شود. به عنوان مثال یک میانگین متحرک

دوره ۵ منحنی از به هم پیوستن نقاطی است که هر یک میانگینی از قیمت بسته شدن ۵ شمع است و این روند از جایی که اطلاعات موجود است تا آخرین شمع تشکیل یافته در بازار ادامه دارد.

جهت انتخاب دوره زمانی میانگین متحرک می توانید از تنظیمات پیشنهادی در جدول ۱-۱ استفاده کنید.

اندیکاتور Commodity Channel Index

یکی دیگر از نماگرهای تکنیکی که بسیار قابل اطمینان و با اهمیت هستند نوارهای بولینگر هستند. نوارهای بولینگر شبیه پوشش های میانگین متحرک هستند. نوارهای بولینگر دامنه انتظارات معامله گران را نمایش می دهند و چنانچه قیمتها از این نوارها خارج شوند تمایل دارند به درون آنها باز گردند.

تفاوت بین نوارهای بولینگر و پوشش ها که این پوشش برحسب درصدی ثابت در بالا و پایین میانگین متحرک ترسیم شده است در حالیکه نوارهای بولینگر با انحراف استاندارد در بالا و پایین میانگین متحرک کشیده می شوند.

همانطو که قبلا هم اشاره شد قیمتها بین دو محدوده خریده ها و فروشهای افراطی در نوسان هستند. نقاط بالائی و پائینی فقط در لحظاتی کوتاه پدید خواهند شد و ما نمی توانیم در آن نقاط معامله ای انجام دهیم. اما محدوده هایی وجود دارد که نزدیک ترین نقاط به قله یا قعر قیمتی است. این محدوده بیرون از نوارهای بولینگر شکل می گیرد.

نوارهای بولینگر برای اندازه گیری فراریت بازار استفاده می شوند. اساسا این ابزار به ما می گوید که چه زمانی بازار بی حرکت است و چه زمانی دارای حرکت است. زمانیکه بازار بی حرکت است نوارها به هم نزدیک می شوند و هنگامیکه بازار دارای حرکت است نوارها از هم دور می شوند. به شکل زیر نگاه کنید. زمانیکه قیمتها بی حرکت است نوارها به هم نزدیک می شوند و زمانیکه قیمتها بالا می روند، نوارها از هم دور می شوند.

نحوه محاسبه:

باندهای بولینگر سه تا هستند که همانطور که ذکر شد خط وسط، میانگین متحرک n دوره ای سهم میباشد.

یعنی:

$$\frac{\sum_{j=1}^n Close_j}{n} = \text{باند وسط}$$

باند بالایی همان باند پایینی است که به اندازه انحراف معیار (یا ضریبی از آن) به بالا منتقل شده است. یعنی:

$$\left[D + \sqrt{\frac{\sum_{j=1}^n (Close_j - Middle Band)^2}{n}} \right] \quad \text{باند بالایی} = \text{باند وسط} +$$

که D همان ضریبی است که بعضی مواقع در انحراف معیار (قبل از جمع با باند وسط) ضرب می‌گردد. این ضریب میتواند ۱ یا ۲ باشد. فرمول مشابهی نیز برای باند پایینی بولینگر وجود دارد. یعنی پس از ضرب کردن D در انحراف معیار باند وسط را به اندازه این مقدار به پایین منتقل می‌کنیم.

$$\left[D - \sqrt{\frac{\sum_{j=1}^n (Close_j - Middle Band)^2}{n}} \right] \quad \text{باند پایین} = \text{باند وسط} -$$

آقای بولینگر عدد ۲۰ را بعنوان تعداد بازه مناسب برای رسم میانگین متحرک معرفی می‌کند. {یعنی میانگین متحرک ۲۰ روزه} و نوع میانگین متحرک پیشنهادی ایشان ساده (Simple Moving Average) میباشد. آقای بولینگر ضریب $D=2$ را پیشنهاد کرده است. از دیگر یافته های آقای بولینگر این است که میانگین متحرک های زیر ۱۰ روزه کارکرد خوبی برای رسم باندهای بولینگر ندارند.

خروج قیمتها از نوارها بیانگر پیشی گرفتن انتظارات معامله گران از جریان اطلاعات است که در محاوره به آن یک کلاغ چهل کلاغ می گوئیم. این حرکات تند قیمتی همواره یک دوره تصحیح را به دنبال خواهد داشت.

دوره ای که بازار مجدداً به اطلاعات شرکت رجوع می کندو آنها را بازنگری می کند. در این شرائط دهانه نوارهای بولینگر بهم نزدیک می خواهد شد و چنانچه به جریان مثبت اطلاعات آتی امیدوار شود مجدداً تلاش خریداران منجر به ادامه روند افزایشی خواهد شد. این مسیر تا خروج مجدد قیمتها از نوار بولینگر ادامه خواهد داشت.



کاربرد باندهای بولینگر

۱- بخش عمده نوسانات قیمت (۹۵٪) در فاصله بین دو باند است

۲- فاصله نوارها در موقعیت های بازار پر نوسان بیشتر می شود

۳- میانگین متحرک ۱۰ روزه برای کوتاه مدت و ۲۰ روزه برای میان مدت استفاده می شود

۴- هنگامی که فاصله دو نوار زیاد شود پایان روند جاری و وقتی که فاصله کم شود علامت آغاز روند جدید است.

۶- اگر قیمت به نوار بالایی/پایینی حرکت کند و باند وسطی را قطع کند نوار پایینی / بالایی هدف قیمت است.

آقای بولینگر عدد ۲۰ را برای دوره های میانگین متحرک پیشنهاد داده است.

اندیکاتور STOCHASTIC

۱- این اندیکاتور بر پایه این نظریه بنا شده است که قیمت های پایانی در حالت افزایشی تمایل دارند به سمت بالاترین قیمت دور بروند (و بلعکس)

۲- اکثر اخطار های خرید و فروش را خط $D\%$ صادر می کند.

۳- رایج ترین عدد برای این شاخص عدد ۱۴ است.

$D\%$ خط :

مهمترین اخطار قابل رویت حالت واگرایی بین این خط و خط قیمت در حالتی که خط وارد مرز های خرید و فروش هیجانی شده است (۲۰-۸۰) می باشد

واگرایی کاهشی زمانی است که این خط بالاتر از عدد ۸۰ باشد و دو قله بسازد که قله دوم مقدار کمتری نسبت به قله اول داشته باشد در حالی که قیمت کماکان صعودی باشد

واگرایی افزایشی زمانی است که این خط کمتر از عدد ۲۰ باشد و دو کف بسازد که کف دوم مقدار بیشتری نسبت به کف اول داشته باشد در حالی که قیمت کماکان نزولی باشد

۵- از استوکاستیک هفتگی برای تشخیص جهت بازار در هفته پیش رو و از استوکاستیک روزانه برای خرید و فروش استفاده می شود

۶- ترکیب اندیکاتور قدرت نسبی (ار اس ای) و استوکاستیک ۱۴ هفته ای : بهترین اخطار زمانی است که هر دو اسیلاتور اخطار خروج از بازار و خرید و فروش هیجانی را صادر کنند

۷- اگر سقف ها کم عرض و کم ارتفاع باشد نیروی صعودی ضعیف و حرکت نزولی بعدی قوی می باشد

۸- اگر کف ها کم عرض و کم ارتفاع باشد نیروی نزولی ضعیف و حرکت صعودی بعدی قوی می باشد

سیگنال خرید

۱) را قطع کند سیگنال خرید است $D\%$ از پایین به بالا K اگر

۲) واگرایی صعودی سیگنال خرید است

سیگنال فروش

۱) را قطع کند سیگنال فروش است $D\%$ از بالا به پایین K اگر

۲) واگرایی نزولی سیگنال فروش است

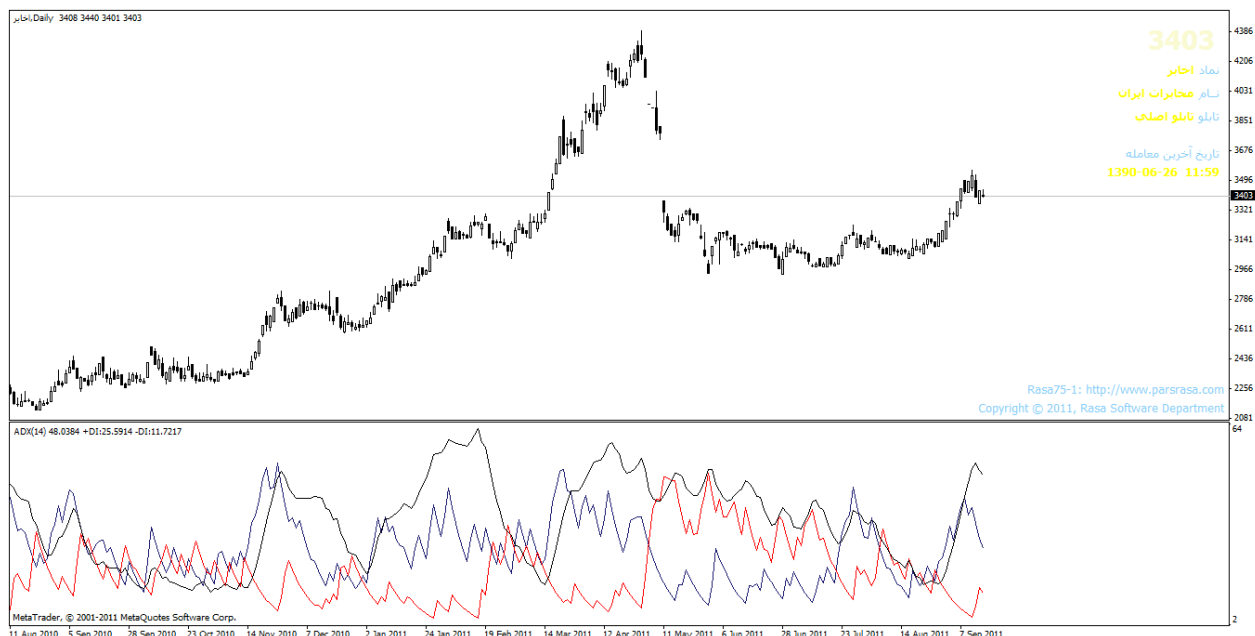
اندیکاتور Directional Movement

اندیکاتوری است که برای تشخیص قدرت بازار به کار می‌رود شاخص ADX نمی‌تواند جهت چارت را به ما بگوید. سه نماگر مختلف هستند که هر سه در سیستم تعیین روند سهم به نام سیستم > حرکت جهت دار (Directional Movement) مورد استفاده قرار می‌گیرند. ADX نیز عددی بین صفر تا صد است که هر چه بالاتر باشد قدرت سهم را برای تداوم روند فعلی (صعودی یا نزولی) نشان می‌دهد.

علاوه بر ADX دو شاخص دیگر به صورت نقطه‌چین نشان می‌دهد که یکی از آنها +DI و دیگری -DI می‌باشد. شاخص ADX بین ۰ تا ۱۰۰ متغیر است (۰ ~ +۱۰۰) تقسیم‌بندی آن بین ۰ و ۲۰ و ۴۰ و ۶۰ و ۱۰۰ می‌باشد.

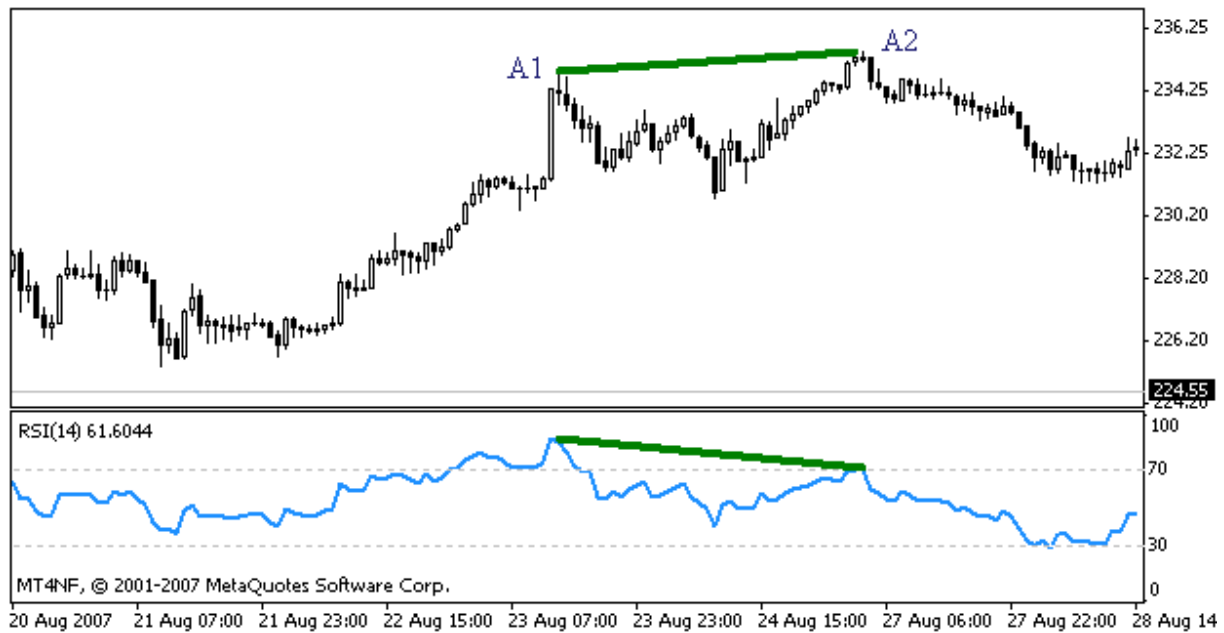
۱- هرگاه شاخص ADX به سمت بالا حرکت کند نتیجه می‌گیریم که قدرت بازار در حال افزایش می‌باشد (شروع یا تقویت روند جاری)

۲- هرگاه شاخص ADX به سمت پائین نزول کند ضعف روند جاری و یا ورود به نواحی روند خنثی می‌باشد. ولس ویلدر تدوین کننده این شاخص پیشنهاد داده است که وقتی +DI بالاتر از -DI بود امکان رشد قیمت سهم وجود دارد و برعکس وقتی که +DI پایین تر از -DI بود احتمال کاهش قیمت سهم وجود دارد.



واگرایی در اسیلاتورها

به شکل زیر توجه کنید:

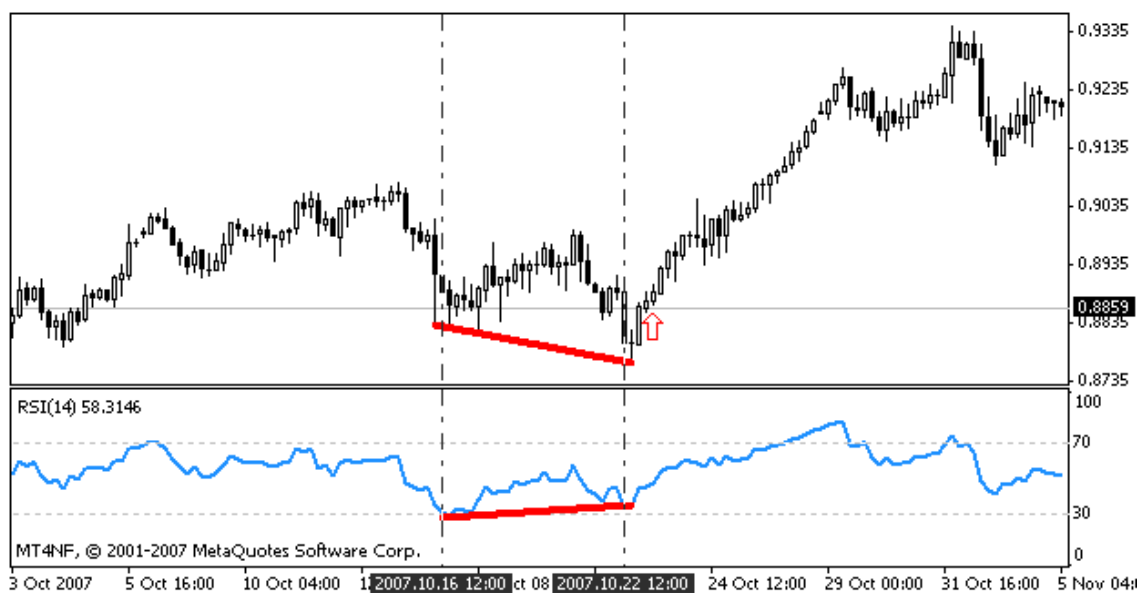


همانطور که ملاحظه میکنید خط واصل از A1 به A2 صعودی است اما در اسیلاتور (RSI) روند خط واصل دونقطه متناظر با A1 و A2 کاملاً نزولی دیده میشود. در این شرایط **واگرایی منفی یا نزولی** بوجود آمده است. با توجه به روند بازار واگرایی ممکن است به دو صورت مثبت و منفی ایجاد شود. واگرایی مثبت در انتهای روند نزولی اتفاق می افتد و برعکس.

در واگرایی مثبت دو نقطه Low که نقطه دوم پایین تر از نقطه اول است تشکیل میشود. در صورتی که اسیلاتور بطور صحیح تنظیم شده باشد متناظر با هر کدام از نقاط Low در نمودار قیمت یک نقطه Low در نمودار اسیلاتور دیده میشود. اگر نقطه Low دوم در نمودار اسیلاتور بالا تر از نقطه Low اول باشد (برخلاف قیمت) واگرایی مثبت اتفاق افتاده است.



واگرایی مثبت نشانه قدرتمندی برای پایان روند نزولی میباشد و در صورت تایید با سایر ابزارها میتوان اقدام به خرید کرد. همانطور که میدانید برای رسم ترند لاین در روند صعودی نقاط Low و در روند نزولی نقاط High به هم متصل میشوند. برای تعیین واگرایی شرایط کاملاً متفاوت است. بطوریکه در تعیین واگرایی مثبت (در روند نزولی) نقاط Low را به هم وصل میکنیم در تعیین واگرایی منفی (در روند صعودی) باید نقاط High را به هم وصل کنیم. دقت داشته باشید که برای تشکیل یک واگرایی نیاز با ۲ نقطه اکستریم (۲ نقطه ماکزیموم یا دو نقطه مینیموم) در قیمت و دو نقطه اکستریم در اسیلاتور داریم. در شکل زیر به خطوط قرمز رنگ توجه کنید. نقاط اکستریم در نمودار قیمت و اسیلاتور در زمانهای مشابه اتفاق افتاده است به عبارتی این نقاط در نمودار قیمت و اسیلاتور با یکدیگر متناظر میباشند.



علامت قرمز رنگ نقطه ورود مناسب را نشان میدهد. ملاحظه میکنید که در نمودار قیمت یک کندل صعودی شکل گرفته و نقطه مینیموم کامل شده است. یکی از مزیت های سیگنال های واگرائی بالا بودن نسبت سود به زیان است. مزیت دیگر این روش اخطار سریع پایان روند می باشد. واگرائی ها بسیار سریع تر از سایر ابزار های تکنیکال پایان یک روند قدرتمند را به معامله گر اخطار می دهند. واگرائی منفی در انتهای یک روند صعودی و واگرائی مثبت در انتهای یک روند نزولی شکل می گیرد. بنابراین وجود یک روند نسبتاً قوی اولین شرط تشکیل واگرائی می باشد.

حجم معاملات

اکثر تحلیل گران تکنیکال در بازارهای مالی با دنبال کردن دو عامل قیمت و حجم معاملات از روشهای چند بعدی برای تحلیل بازار استفاده می کنند. تمام مباحث مربوط به نمودار بر این نکته تاکید دارند که بیشتر توجه و تمرکز باید معطوف به حرکات قیمت باشد و البته تا حدی نیز باید به حجم معاملات دقت کرد. حجم تنها شاخصی است که از قیمت ناشی نشده است، و به شما عقیده ای ثانویه از بازار ارائه می دهد. با ترکیب حجم با شاخص های بازار، شما حس خوبی نسبت به کسی که بازار را کنترل می کند پیدا می کنید. شاید قیمت راننده (محرک) باشد، اما حجم، سوخت است که بازار را از یک نقطه به نقطه دیگر می برد. در نهایت، هرچند حجم می تواند یک شاخص مهم باشد، اما شاخص کاملی نیست. برای مثال، مشکل اینست که همیشه نمی دانیم که مسئول افزایش حجم، خریدارها هستند یا فروشندگان آنها.

حجم معاملات به عنوان یک شاخص ثانویه

حجم معاملات به میزان معاملات انجام شده در دوره ای از زمان گفته می شود. تایم فریم مناسب حجم می تواند روزانه یا هفتگی باشد و به ندرت از تایم فریم ماهانه برای حجم معاملات استفاده می شود. در روند صعودی حجم معاملات باید همزمان با صعود قیمت بیشتر شود و در هنگام پدید آمدن حفره ها باید کاهش یابد. تا هنگامیکه که الگو ادامه دارد حجم معاملات باید روند قیمت را تایید کند. چارتیست ها همچنین به دنبال یافتن واگرایی هستند. واگرایی هنگامی رخ می دهد که نفوذ به بالاتر از نقطه بالایی در یک روند صعودی همراه با کاهش حجم معاملات باشد. این وضعیت هشدار می دهد به معامله گران در مورد کاهش فشار خرید است.

یک قانون کلی در تمام نقاط شکست اگر اخطار شکست واقعیت داشته باشد باید شاهد حجم معاملات سنگینی باشیم.

حجم معاملات جلوتر از قیمت

با مطالعه همزمان قیمت و حجم معاملات بطور همزمان یک موضع یعنی فشار را اندازه گیری می کنیم. از نظر تحلیلگران تکنیکی حجم معاملات جلوتر از قیمت است به این معنی که کاهش شدت صعود در روند صعودی یا افت شدت نزول در روند نزول قبل از آشکار شدن در روندهای برگشتی قیمت، ابتدا در حجم معاملات ظاهر می شود. اصول کلی در استفاده از نشانگرهای حجم:

وضعیت بازار	حجم معاملات	قیمت
خوشبینانه	افزایشی	روند افزایشی
بدبینانه	کاهشی	روند افزایشی
خوشبینانه	افزایشی	روند کاهشی
بدبینانه	کاهشی	روند کاهشی

رابطه بین حجم معاملات و قیمت در بازار بصورت زیر است: حجم معاملات به عنوان مقیاسی برای تشخیص قدرت و ضعف وضعیت عمومی بازار در نظر گرفته می شود.

حجم معاملات در صورتی روند صعودی را تأیید می کند که همزمان با صعود قیمت بیشتر شود و در روندهای اصلاحی یک روند صعودی با کاهش قیمت کاهش یابد. این الگو تا هنگامی با قدرت ادامه می یابد که حجم معاملات روند قیمت را تأیید کند.

حجم معاملات در صورتی روند نزولی را تأیید می کند که همزمان با نزول قیمت بیشتر شود و در روندهای اصلاحی یک روند نزولی با افزایش قیمت کاهش یابد. این الگو تا هنگامی با قدرت ادامه می یابد که حجم معاملات روند قیمت را تأیید کند.

واگرایی هنگامی رخ میدهد که در یک روند صعودی نفوذ به بالاتر از نقطه بالایی همراه با کاهش حجم باشد. این وضعیت هشدار است به معامله گران در مورد کاهش فشار خرید همچنین اگر حجم معاملات تمایل به افزایش در حفره ها در این روند داشته باشد روند صعودی دچار اشکال شده است.

در یک روند نزولی نیز واگرایی هنگامی رخ میدهد که نفوذ به پایینتر از نقطه پایینی همراه با کاهش حجم باشد. این وضعیت هشدار می‌دهد که معامله‌گران در مورد کاهش فشار روند نزولی همچنین اگر حجم معاملات تمایل به افزایش در روندهای اصلاحی در این روند داشته باشد روند نزولی دچار اشکال شده است.

چارتیست‌ها همواره دنبال یافتن علامت واگرایی در یک روند می‌باشند.

رشد حسابی و تب فروش / Blowoffs & Selling Climaxes

در زمانی که قیمت سهام در اوج یا کف می‌باشد اتفاق می‌افتد.

رشد حسابی زمانی که بازار در اوج قرار دارد روی می‌دهد. معمولاً پس از افزایش پیوسته قیمت‌ها طی یک مدت زمانی نسبتاً طولانی، در اواخر این دوره، قیمت‌ها با سرعت زیادی صعود کرده و حجم معاملات افزایش می‌یابد. در این حالت اکثر افرادی که قصد خرید را داشته‌اند، سهام مورد نظر را خریده و سود مناسب را بدست آورده بنابراین شروع به فروش سهام می‌کنند و در نتیجه معمولاً قیمت‌ها بصورت ناگهانی روند کاهشی خود را آغاز می‌کند.

تب فروش حالت عکس وضعیت فوق است. این حالت در نزدیکی کف قیمت روی می‌دهد. زمانی که قیمت‌ها برای مدت طولانی روند نزولی را طی می‌کند، یک موج نهایی فروش با حجم بالا قیمت را به شدت کاهش می‌دهد. کسانی که دنبال خرید سهام در قیمت‌های شکسته شده هستند در این زمان اقدام به خرید سهام می‌کنند. پس از این نقطه روند تغییر قیمت وارون می‌شود و قیمت شروع به افزایش می‌کند.

اندیکاتورهای حجم:

۱. اندیکاتور حجم متوازن OBV on balance volume

۲. اندیکاتور جریان سرمایه MFI

۳. اندیکاتور تراکم/توزیع accumulation/distribution

۴. اندیکاتور حجم volumes

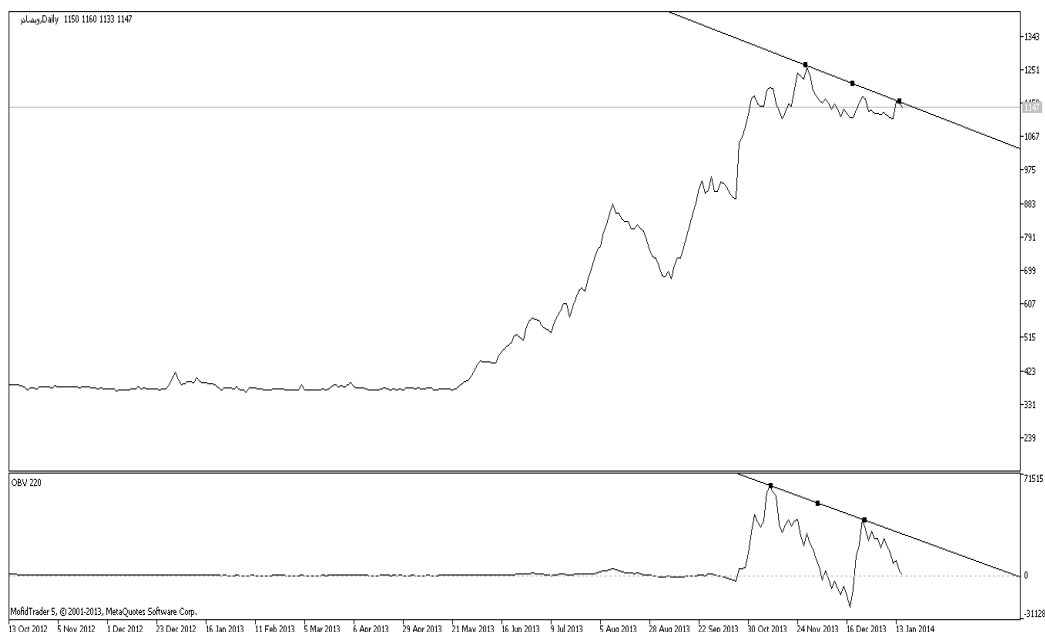
اندیکاتور حجم تعادلی On Balance Volume=OBV

نوع: قیمت / حجم - پیشرو - مناسب اهداف کوتاه مدت

کاربرد:

ساده ترین و معروفترین اندیکاتور حجم می باشد که بوسیله جوزف گرانویل در سال ۱۹۶۳ در کتابش (استراتژی جدید زمان بندی بازارهای سهام روزانه جهت بدست آوردن حداکثر سود) معرفی شد. این شاخص از طریق مقایسه حجم معاملات و حرکتهای قیمت سعی در تعیین سطوح تجمع یا تقاضا و توزیع یا عرضه دارد. در تفسیر این شاخص شیب و جهت اهمیت دارد نه مقادیر

عددی.



مشاهده می کنید تعقیب کردن روند با OBV آسانتر است.

فرمول ساخت:

اگر قیمت بسته شدن امروز از قیمت بسته شدن روز قبل بیشتر باشد علامت مثبت

$$OBV(I)=OBV(I-1)+VOLUME(I)$$

اگر قیمت بسته شدن امروز از قیمت بسته شدن روز قبل پایین تر باشد علامت منفی

$$OBV(I)=OBV(I-1)+VOLUME(I)$$

اگر قیمت بسته شدن امروز از قیمت بسته شدن روز قبل برابر باشد

$$OBV(I)=OBV(I-1)$$

Date	Close	Up-Down	Volume*	Positive Negative	OBV
27-Oct-10	53.26				
28-Oct-10	53.30	+1	8,200	+8,200	8200
29-Oct-10	53.32	+1	8,100	+8,100	16300
01-Nov-10	53.72	+1	8,300	+8,300	24600
02-Nov-10	54.19	+1	8,900	+8,900	33500
03-Nov-10	53.92	-1	9,200	-9,200	24300
04-Nov-10	54.65	+1	13,300	+13,300	37600
05-Nov-10	54.60	-1	10,300	-10,300	27300
08-Nov-10	54.21	-1	9,900	-9,900	17400
09-Nov-10	54.53	+1	10,100	+10,100	27500
10-Nov-10	53.79	-1	11,300	-11,300	16200
11-Nov-10	53.66	-1	12,600	-12,600	3600
12-Nov-10	53.56	-1	10,700	-10,700	-7100
15-Nov-10	53.57	+1	11,500	+11,500	4400
16-Nov-10	53.94	+1	23,800	+23,800	28200
17-Nov-10	53.27	-1	14,600	-14,600	13600
18-Nov-10	53.60	+1	11,700	+11,700	25300
19-Nov-10	53.65	+1	10,400	+10,400	35700
22-Nov-10	53.62	-1	9,500	-9,500	26200
23-Nov-10	53.27	-1	13,900	-13,900	12300
24-Nov-10	53.44	+1	10,400	+10,400	22700
26-Nov-10	53.28	-1	4,200	-4,200	18500
29-Nov-10	53.14	-1	10,900	-10,900	7600
30-Nov-10	53.31	+1	17,600	+17,600	25200
01-Dec-10	54.09	+1	17,900	+17,900	43100
02-Dec-10	54.08	-1	15,800	-15,800	27300
03-Dec-10	54.01	-1	10,200	-10,200	17100
06-Dec-10	54.17	+1	8,700	+8,700	25800
07-Dec-10	54.24	+1	16,000	+16,000	41800
08-Dec-10	54.45	+1	12,500	+12,500	54300

* Volume rounded and shown in 1000s.

فرض اساسی، در مورد تحلیل حجم همه جانبه، این است که تغییرات OBV قبل از تغییرات قیمت ایجاد میشود. اگر حرکت قیمت سهام جلوتر از حرکت OBV باشد، یک "عدم تصدیق" روی داده است. وضعیتهای عدم تصدیق میتواند در سقفهای بازار گاوی (وقتی که سهام بدون، یا قبل از OBV صعود میکنند) یا در کفهای بازار خرسی (وقتی که سهام بدون، یا قبل از اندیکاتور تکنیکی OBV نزول میکنند) روی دهند.

OBV در یک روند صعودی است زمانی که هر قله جدید بالاتر از قله قبلی باشد و هر دره جدید بالاتر از دره قبل از خودش باشد. به همین ترتیب OBV در یک روند نزولی است زمانی که هر قله متوالی پایین تر از قله قبلی باشد و هر دره متوالی بالاتر از دره قبل از خودش باشد. وقتی که OBV در یک روند خنثی قرار گرفته باشد و بالاها و پایین های متوالی تشکیل نمیدهد، در یک روند مشکوک قرار گرفته است.

همینکه یک روند پایرجا شد، تا زمانی که شکسته نشده باشد نیرومند باقی می ماند. دو راه وجود دارد که در آن روند اندیکاتور OBV میتواند شکسته شود. اولین آنها زمانی روی میدهد که روند از روند صعودی به یک روند نزولی، یا از یک روند نزولی به یک روند صعودی تغییر کند.

دومین راهی که روند OBV میتواند شکسته شود این است که روند به یک روند مردد تغییر کند و بمدت بیش از ۳ روز در همان حالت مردد بماند. بنابراین، اگر سهام از یک روند صعودی به یک روند مردد تغییر کند و بمدت فقط دو روز پیش از تغییر برگشتی به روند صعودی مردد بماند، OBV را چنان در نظر میگیرند که گویا همیشه در یک روند صعودی بوده است. وقتی که OBV به یک روند صعودی یا روند نزولی تغییر میکند، یک "شکست" روند روی داده است. چون معمولاً شکستهای OBV پیش از شکستهای قیمت روی میدهند، سرمایه گذاران باید معامله خرید را در نقاط شکست فوقانی انجام دهند. به همین ترتیب سرمایه گذاران باید وقتی که OBV یک نقطه شکست تحتانی ایجاد میکند معامله فروش بکنند. پوزیشنها را باید تا ایجاد تغییر در روند باز نگه داشت. حجم تعادلی ممکن است صعودی یا نزولی باشد. در صورت صعودی بودن یعنی حجم

صعودی بیشتر از حجم نزول است و این تاییدی بر صعودی بودن روند است. حجم تعادلی نزولی معمولاً علامت فروش است. جهت حجم متوازن باید در جهت روند حرکت قیمت باشد. هنگامیکه حجم معامله نتواند در جهت روند قیمت حرکت کند واگرایی ایجاد شده است و هشدار می‌دهد برای برگشت روند قیمت.

تحلیل به کمک OBV

- اگر یک افزایش قیمت توسط افزایش اندیکاتور تایید شود، به معنای تقویت روند صعودی است.
- اگر یک کاهش قیمت توسط کاهش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند نزولی است.
- واگرایی صعودی و واگرایی نزولی به ترتیب بیانگر ضعف در روند صعودی و نزولی است.
- شکست خط روند رسم شده در اندیکاتور OBV اختطاری مبنی بر وقوع شکست در خط روند نمودار قیمت، در زمانی نه چندان دور خواهد بود.

ایراد OBV

ایراد OBV اینست که حجم معاملات کلی روز را بصورت ارقام + یا - مشخص می‌کن فرض کنید که قیمت پایانی در یک روز به مقدار بسیار کمی نسبت به روز قبل رشد داشته است آیا می‌بایست کل معاملات آن روز را + فرض کنیم؟

برای حل این مشکل به روزهای که روند قوی تری دارند وزن بیشتری دهیم. به عنوان مثال در روزیکه قیمت رشد داشته حجم معامله را در میزان رشد قیمت ضرب کنیم. برای همین منظور اندیکاتور MFI طراحی گردید.

اندیکاتور شاخص جریان نقدی Money Flow Index=MFI

کاربرد:

این شاخص جریان نقدی ورودی یا خروجی برای خرید یا فروش سهم را نشان می دهد. اگر این شاخص بالای ۸۰ باشد در واقع سهم در منطقه اشباع خرید قرار دارد و زمانی که شاخص کمتر از ۲۰ است، سهم در منطقه اشباع فروش واقع است. شاخص جریان پول، شاخص لحظه‌ای است که قدرت جریان ورود و خروج پول به اوراق بهادار را اندازه می‌گیرد. این شاخص با شاخص قدرت نسبی (Relative Strength Index) در ارتباط است، با این تفاوت که RSI سقف قیمتها را شامل میشود، ولی شاخص جریان پول، حجم را به حساب می‌آورد.



فرمول ساخت:

برای محاسبه این شاخص باید ابتدا مقادیر قیمت واقعی، جریان پول و نسبت پول را به شکل زیر محاسبه کنیم:

$$\text{Typical Price} = (\text{High} + \text{Low} + \text{Close})/3$$

$$\text{Raw Money Flow} = \text{Typical Price} \times \text{Volume}$$

$$\text{Money Flow Ratio} = (\text{14-period Positive Money Flow}) / (\text{14-period Negative Money Flow})$$

$$\text{Money Flow Index} = 100 - 100 / (1 + \text{Money Flow Ratio})$$

	Date	Typical Price	Up or Down	Volume*	Raw Money Flow	1-period Positive Money Flow	1-period Negative Money Flow	14-period Positive Money Flow	14-period Negative Money Flow	14-period Money Flow Ratio	14-period Money Flow Index
1	3-Dec-10	24.63		18,730							
2	6-Dec-10	24.69	1	12,272	302,976	302,976	-				
3	7-Dec-10	24.99	1	24,691	617,060	617,060	-				
4	8-Dec-10	25.36	1	18,358	465,534	465,534	-				
5	9-Dec-10	25.19	-1	22,964	578,388	-	578,388				
6	10-Dec-10	25.17	-1	15,919	400,628	-	400,628				
7	13-Dec-10	25.01	-1	16,067	401,796	-	401,796				
8	14-Dec-10	24.96	-1	16,568	413,516	-	413,516				
9	15-Dec-10	25.08	1	16,019	401,810	401,810	-				
10	16-Dec-10	25.25	1	9,774	246,780	246,780	-				
11	17-Dec-10	25.21	-1	22,573	569,130	-	569,130				
12	20-Dec-10	25.37	1	12,987	329,483	329,483	-				
13	21-Dec-10	25.61	1	10,907	279,371	279,371	-				
14	22-Dec-10	25.58	-1	5,799	148,335	-	148,335				
15	23-Dec-10	25.46	-1	7,395	188,250	-	188,250	2,643,012	2,700,043	0.98	49.47
16	27-Dec-10	25.33	-1	5,818	147,351	-	147,351	2,340,037	2,847,394	0.82	45.11
17	28-Dec-10	25.09	-1	7,165	179,766	-	179,766	1,722,977	3,027,160	0.57	36.27
18	29-Dec-10	25.03	-1	5,673	141,978	-	141,978	1,257,443	3,169,137	0.40	28.41
19	30-Dec-10	24.91	-1	5,625	140,138	-	140,138	1,257,443	2,730,887	0.46	31.53
20	31-Dec-10	24.89	-1	5,023	125,057	-	125,057	1,257,443	2,455,317	0.51	33.87
21	3-Jan-11	25.13	1	7,457	187,374	187,374	-	1,444,817	2,053,521	0.70	41.30
22	4-Jan-11	24.64	-1	11,798	290,653	-	290,653	1,444,817	1,930,658	0.75	42.80
23	5-Jan-11	24.51	-1	12,366	303,090	-	303,090	1,043,007	2,233,748	0.47	31.83
24	6-Jan-11	24.15	-1	13,295	321,133	-	321,133	796,227	2,554,881	0.31	23.76
25	7-Jan-11	23.98	-1	9,257	221,953	-	221,953	796,227	2,207,703	0.36	26.51
26	10-Jan-11	24.07	1	9,691	233,205	233,205	-	699,949	2,207,703	0.32	24.07
27	11-Jan-11	24.36	1	8,870	216,084	216,084	-	636,663	2,207,703	0.29	22.38
28	12-Jan-11	24.35	-1	7,169	174,567	-	174,567	636,663	2,233,936	0.28	22.18
29	13-Jan-11	24.14	-1	11,356	274,191	-	274,191	636,663	2,319,877	0.27	21.53
30	14-Jan-11	24.81	1	13,379	331,942	331,942	-	968,605	2,172,526	0.45	30.84

* Volume shown in 1000s

اگر قیمت واقعی امروز از قیمت واقعی دیروز بیشتر باشد، این امر جریان پول مثبت و چنانچه قیمت امروز کمتر از قیمت دیروز باشد، جریان پول منفی در نظر گرفته میشود. جریان پولی مثبت، مجموع پولهای مثبت در طول تعداد دورههای مشخص است، و جریان پول منفی مجموع پولهای منفی در طول تعداد دورههای مشخص میباشد.

تحلیل به کمک MFI

- اگر یک افزایش قیمت توسط افزایش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند صعودی است
- اگر یک کاهش قیمت توسط کاهش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند نزولی است
- واگرایی صعودی و واگرایی نزولی به ترتیب بیانگر ضعف در روند صعودی و نزولی است.

اندیکاتور شاخص تجمع و توزیع Accumulation Distribution

رابطه بین قیمت و حجم را نشان می دهد ، شاخصی پیشرو و توسط مارک چیکین ساخته شده است .از بیشتر جنبه ها شبیه OBV است ولی پیچیده تر از آن و عملکردی بهتر دارد

فرمول ساخت:

1. Money Flow Multiplier = $[(\text{Close} - \text{Low}) - (\text{High} - \text{Close})] / (\text{High} - \text{Low})$
2. Money Flow Volume = Money Flow Multiplier x Volume for the Period
3. AD = Previous AD + Current Period's Money Flow Volume

Date	High	Low	Close	MF Multiplier	Volume*	MF Volume	Accu-Dist Line
10-Dec-10	62.34	61.37	62.15	+61	7,849	+4,774	4774
13-Dec-10	62.05	60.69	60.81	-.82	11,692	-9,629	-4855
14-Dec-10	62.27	60.10	60.45	-.68	10,575	-7,164	-12019
15-Dec-10	60.79	58.61	59.18	-.48	13,059	-6,230	-18249
16-Dec-10	59.93	58.71	59.24	-.13	20,734	-2,758	-21006
17-Dec-10	61.75	59.86	60.20	-.64	29,630	-18,970	-39976
20-Dec-10	60.00	57.97	58.48	-.50	17,705	-8,809	-48785
21-Dec-10	59.00	58.02	58.24	-.55	7,259	-4,000	-52785
22-Dec-10	59.07	57.48	58.69	+52	10,475	+5,468	-47317
23-Dec-10	59.22	58.30	58.65	-.24	5,204	-1,244	-48561
27-Dec-10	58.75	57.83	58.47	+39	3,423	+1,345	-47216
28-Dec-10	58.65	57.86	58.02	-.59	3,962	-2,357	-49574
29-Dec-10	58.47	57.91	58.17	-.07	4,096	-293	-49866
30-Dec-10	58.25	57.83	58.07	+14	3,766	+512	-49354
31-Dec-10	58.35	57.53	58.13	+46	4,239	+1,965	-47389
03-Jan-11	59.86	58.58	58.94	-.44	8,040	-3,517	-50907
04-Jan-11	59.53	58.30	59.10	+30	6,957	+2,093	-48813
05-Jan-11	62.10	58.53	61.92	+90	18,172	+16,339	-32474
06-Jan-11	62.16	59.80	61.37	+33	22,226	+7,346	-25128
07-Jan-11	62.67	60.93	61.68	-.14	14,614	-2,016	-27144
10-Jan-11	62.38	60.15	62.09	+74	12,320	+9,116	-18028
11-Jan-11	63.73	62.26	62.89	-.14	15,008	-2,165	-20193
12-Jan-11	63.85	63.00	63.53	+25	8,880	+2,194	-18000
13-Jan-11	66.15	63.58	64.01	-.67	22,694	-15,100	-33099
14-Jan-11	65.34	64.07	64.77	+10	10,192	+1,043	-32056
18-Jan-11	66.48	65.20	65.22	-.97	10,074	-9,759	-41816
19-Jan-11	65.23	63.21	63.28	-.93	9,412	-8,759	-50575
20-Jan-11	63.40	61.88	62.40	-.32	10,392	-3,282	-53856
21-Jan-11	63.18	61.11	61.55	-.57	8,927	-5,132	-58988
24-Jan-11	62.70	61.25	62.69	+99	7,460	+7,357	-51631

* Volume rounded and shown in 1000s.

تحلیل به کمک AD

- واگرایی: واگرایی صعودی سیگنال خرید و واگرایی نزولی سیگنال فروش است.
- اگر یک افزایش قیمت توسط افزایش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند صعودی است
- اگر یک کاهش قیمت توسط کاهش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند نزولی است

- شکست خط روند رسم شده در نشانگر خطاری مبنی بر وقوع شکست در خط روند نمودار قیمت در زمانی نه چندان دور است.

ایراد A/D

- این شاخص شکافها را در نظر نمی گیرد.
- از آنجاکه این شاخص بسیار به حرکات قیمت مخصوصا قیمت بسته شدن وابسته است اغلب همراه آن حرکت می کند و واگرایی های کمی نشان می دهد.
- گاه ردیابی تغییرات ظریف و نامحسوس در جریانهای حجم دشوار است. نرخ تغییر حجم ر یک روند نزولی ممکن است در حال کاهش باشد ولی تا زمانیکه این شاخص به سمت بالا بازگشت نکند قابل تشخیص نیست. این مشکل در اسیلاتور چیکن یا جریان پول چیکن حل شده است.

شاخص کانال کالا Commodity Channel Index

این شاخص انحراف قیمت از میانگین را به عنوان یک متغیر آماری محاسبه می کند. محدوده تغییرات این شاخص معمولاً بین +۱۰۰ تا -۱۰۰ است. زمانی که این شاخص از پایین +۱۰۰ را به سمت بالا قطع می کند، علامت خرید و هرگاه از بالا -۱۰۰ را به سمت پایین قطع کند، علامت فروش است.



۱- بیشتر چارتیست ها از این شاخص فقط به عنوان شناسایی نقاط خرید و فروش هیجانی استفاده می کند

۲- یک میانگین متحرک ۲۰ روزه به عنوان یک مبنای محاسبه استفاده می شود

۳- اگر بازار روند دار بود از سیگنال مناطق اشباع خرید و فروش استفاده نشود

۴- اگر شیب میانگین متحرک کم و نزدیک به صفر بود بازار بدون روند است

سیگنال خرید

- (۱) بهترین زمان خرید هنگامی است که نمودار شاخص با شیب صعودی و مثبت از منطقه اشباع فروش خارج شود یعنی شاخص با شیب صعودی خط $+100$ را قطع کند و بالاتر از آن قرار گیرد
- (۲) زمانی یک واگرایی صعودی مثبت میان نمودار و شاخص پدیدار گردد (روند دار)

سیگنال فروش

- (۱) بهترین زمان فروش هنگامی است که نمودار شاخص با شیب نزولی و منفی از منطقه اشباع خرید خارج شود یعنی شاخص با شیب نزولی خط $+100$ را قطع کند و پایین تر از آن قرار گیرد
- (۲) زمانی یک واگرایی نزولی منفی میان نمودار و شاخص پدیدار گردد (روند دار)

آرایش یا الگوها

زمانی نیز وجود دارد که بازار بصورت مستقیم یا خنثی حرکت می کند. این بخش از نمودارها یعنی بخشی که بازار را کد می باشد و در حقیقت قیمت فعالیت چندانی انجام نمی دهد بخش مهمی از نمودارهاست. نکته بسیار مهم این است که تغییرات اصلی در روندها احتیاج به یک دوره انتقال دارند مطالعه این دوره های زمانی انتقال و پیش بینی آنها ما را به سمت مبحثی به نام الگوهای قیمت هدایت می کنند. الگوهای قیمت به دو گروه عمده تقسیم می شوند:

۱. الگوهای برگشتی قیمت

۲. الگوهای ادامه دهنده

حجم معامله نقش بسیار مهمی را در تایید الگوها بازی می کند.

نکات اساسی مشترک در الگوهای برگشتی

۱. لازمه شروع هر الگوی برگشتی وجود یک روند اولیه می باشد.
۲. اولین **اخطار** برای ایجاد برگشت روند اکثراً زمانی ساطع می شود که یکی از خطوط روند شکسته شود.
۳. بزرگ بودن الگو نشانه بزرگ بودن (ارتفاع و پهنا) تحرکات بعد از آن می باشد.
۴. الگوهای سقف معمولاً دوره زمانی کوتاه تر و نوسان بلندتری نسبت به الگوهای کف دارند. به همین دلیل است که خرید در کف به مراتب ساده تر از فروختن در سقف می باشد.
۵. کف ها معمولاً تغییرات قیمت کمتری دارند و زمان بیشتری برای تشکیل شدن صرف می کنند
۶. حجم معمولاً در نقاط سقف اهمیت فوق العاده ای دارند



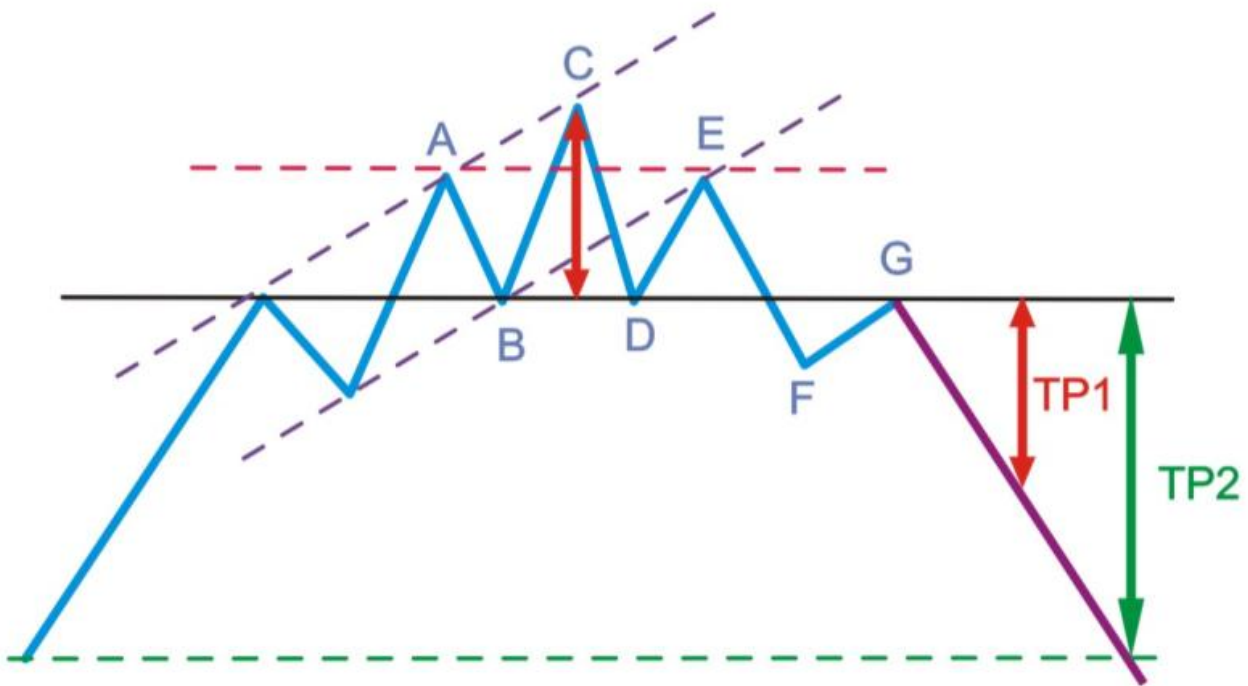
الگوهای برگشتی روند آرایش های برگشتی از تنوع زیادی برخوردارند. اما رایج ترین آنها عبارتند از :

۱. آرایش سروشانه
۲. آرایش سروشانه معکوس
۳. آرایش دو قله (سقف دو قلو)
۴. آرایش دو دوره (دو کف)
۵. آرایش سه قله (سقف سه قلو)
۶. آرایش سه دره (کف سه قلو)
۷. آرایش وی
۸. آرایش قوسی پایین و بالا

الگوهای ادامه روند

۱. آرایش پرچم
۲. آرایشهای مثلثی
۳. آرایش کنج
۴. آرایش مستطیل

الگوی برگشتی سر و شانه - Head and Shoulder



الگوی سر و شانه یکی از قابل اعتمادترین الگوهای نموداری است. این الگو در انتهای یک روند رخ می دهد و روند صعودی را به نزولی و روند نزولی را به صعودی تبدیل می کند. نمونه ای از الگوی سر و شانه در نمودار نشان داده شده است.

همانطور که در نمودار می بینید اولین نشانه ایجاد این الگو با شکسته شدن خط روند صعودی به وجود می آید. قیمتها در یک روند به سمت بالا از سطح مقاومت گذشته است. قیمتها در خط گردن به سطح مقاومت نفوذ کرده و به سمت بالا رفته است. این سطح در مرحله بعدی تبدیل به حمایت شده است. شانه چپ هنگامی که قیمتها به در نقطه B به سطح حمایت برخورد می کند شکل می گیرد. پس از به وجود آمدن یک قله قیمتها خط روند را در کانال صعودی شکسته و در شرایط عادی سطح قیمتها به حمایت قبلی خود باز میگردند. در این حالت وقتی که قیمتها افت می کنند شکست سطح حمایت تایید می شود.

الگوی سر و شانه مشتمل بر سه موج پشت سر هم می باشد. موج اول و سوم که شانه ها را شکل می دهد ، تقریباً بلندی یکسانی دارند. سر در این الگو توسط موج میانی ایجاد می گردد و بلند تر از شانه ها می باشد. در این الگو هر سه موج از خط حمایتی پیروی می کنند که این سطح به عنوان خط گردن معروف شده است. در آرایش سر و شانه معکوس این سه موج از یک خط مقاومت تبعیت می کنند.

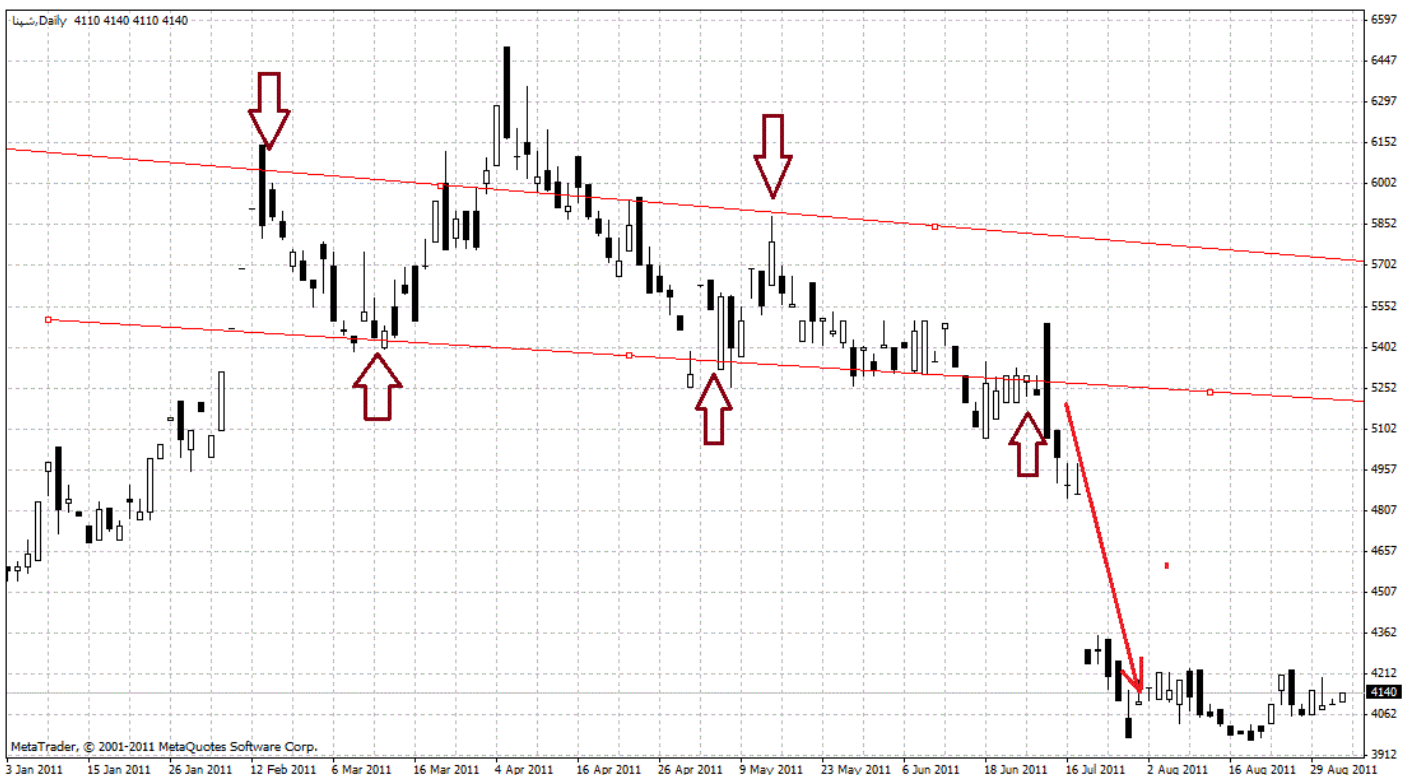


علائم ساخته شده توسط الگوی سر و شانه

۱. خط حمایت با توجه به نقطه B و D قابل شناسایی است. این سطح خط گردن را به نمایش می گذارد.
۲. خط مقاومتی که فشار خرید را کنترل می کند. معمولاً بازار پس از شکست سطح حمایت ، خط گردن را دوباره آزمایش می کند.
۳. جهت روند و قیمت‌ها توسط این الگو مشخص می شود. اگر خط گردن فشار خرید را در نقطه برخورد دوباره متوقف سازد ، آنگاه الگوی سر و شانه اطلاعاتی راجع به جهت قیمت فراهم می کند.

۴. هدف قیمت از بدست آوردن فاصله سر تا خط گردن قابل محاسبه است (به صورت خط چین و فلش در نمودار بالا). به عنوان تایید این الگو نیاز است که قیمت‌ها تحت حجم معاملات بالا به خط گردن نفوذ نمایند.

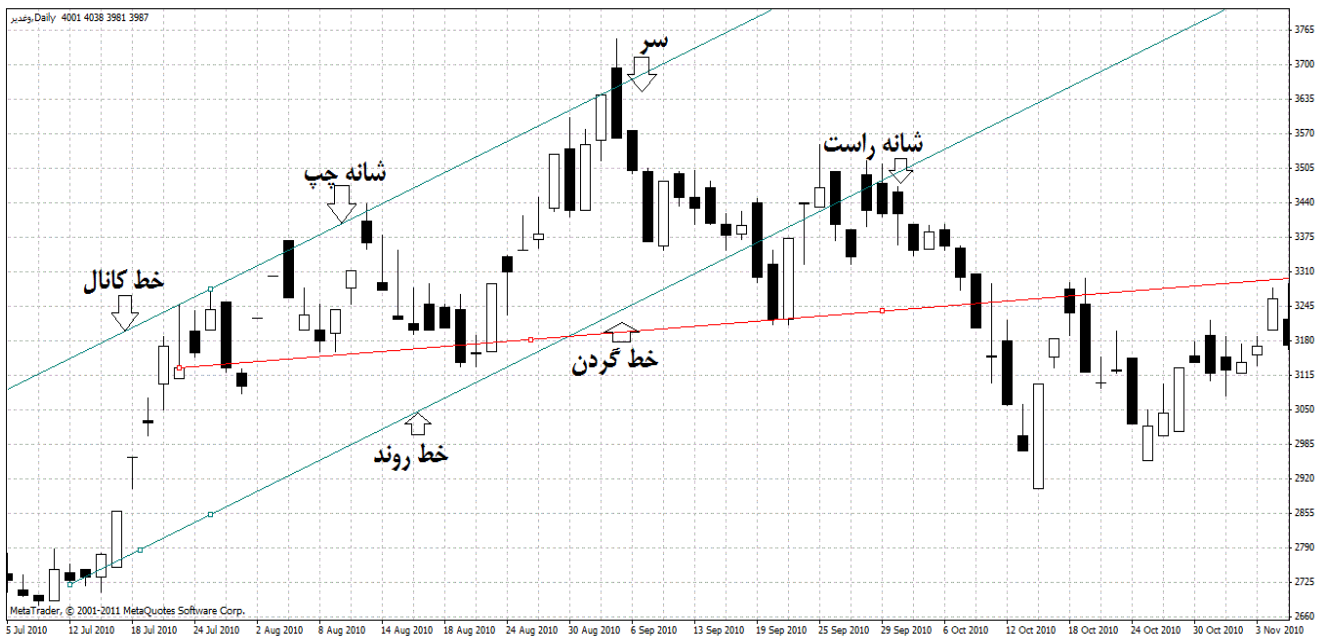
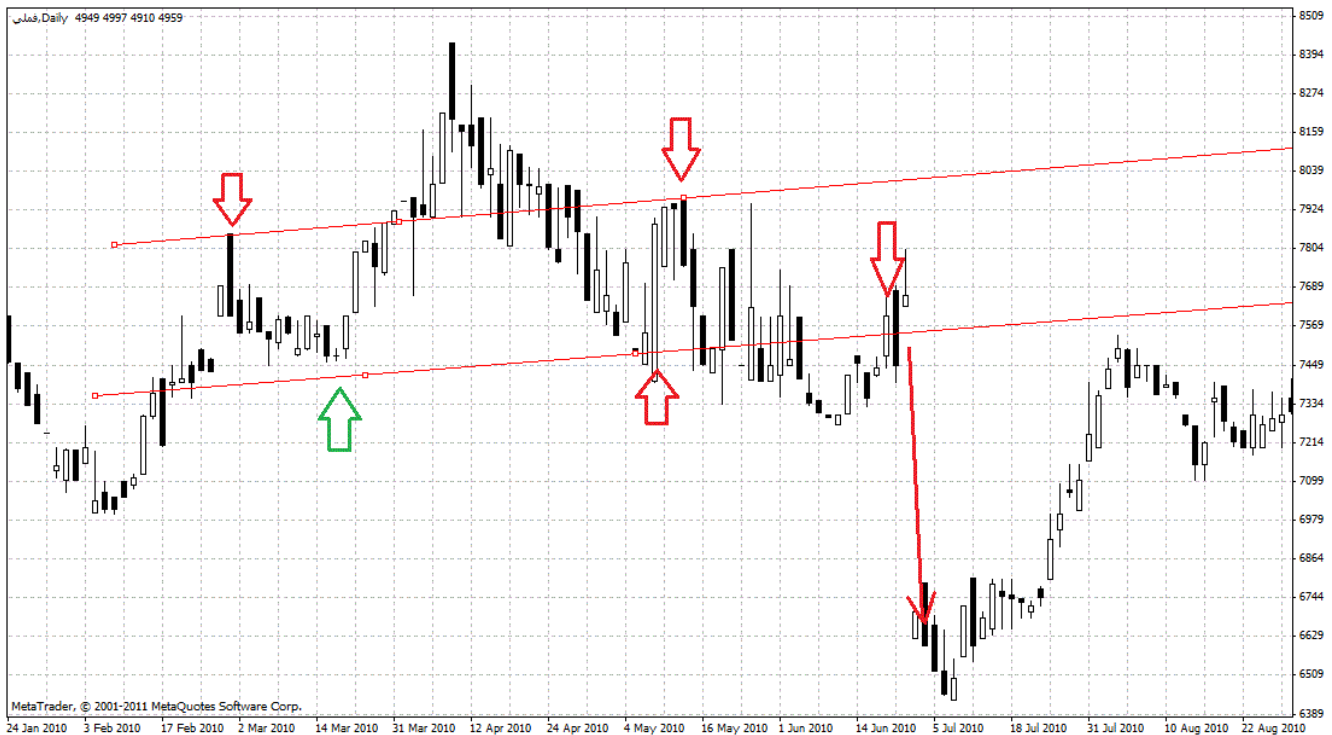
بنابراین فروض اصلی در توسعه این الگو این است که در هنگام شکست خط گردن حجم معاملات بسیار زیاد است و فروشهای زیادی انجام می‌گیرد.



دوره زمانی در آرایش سر و شانه

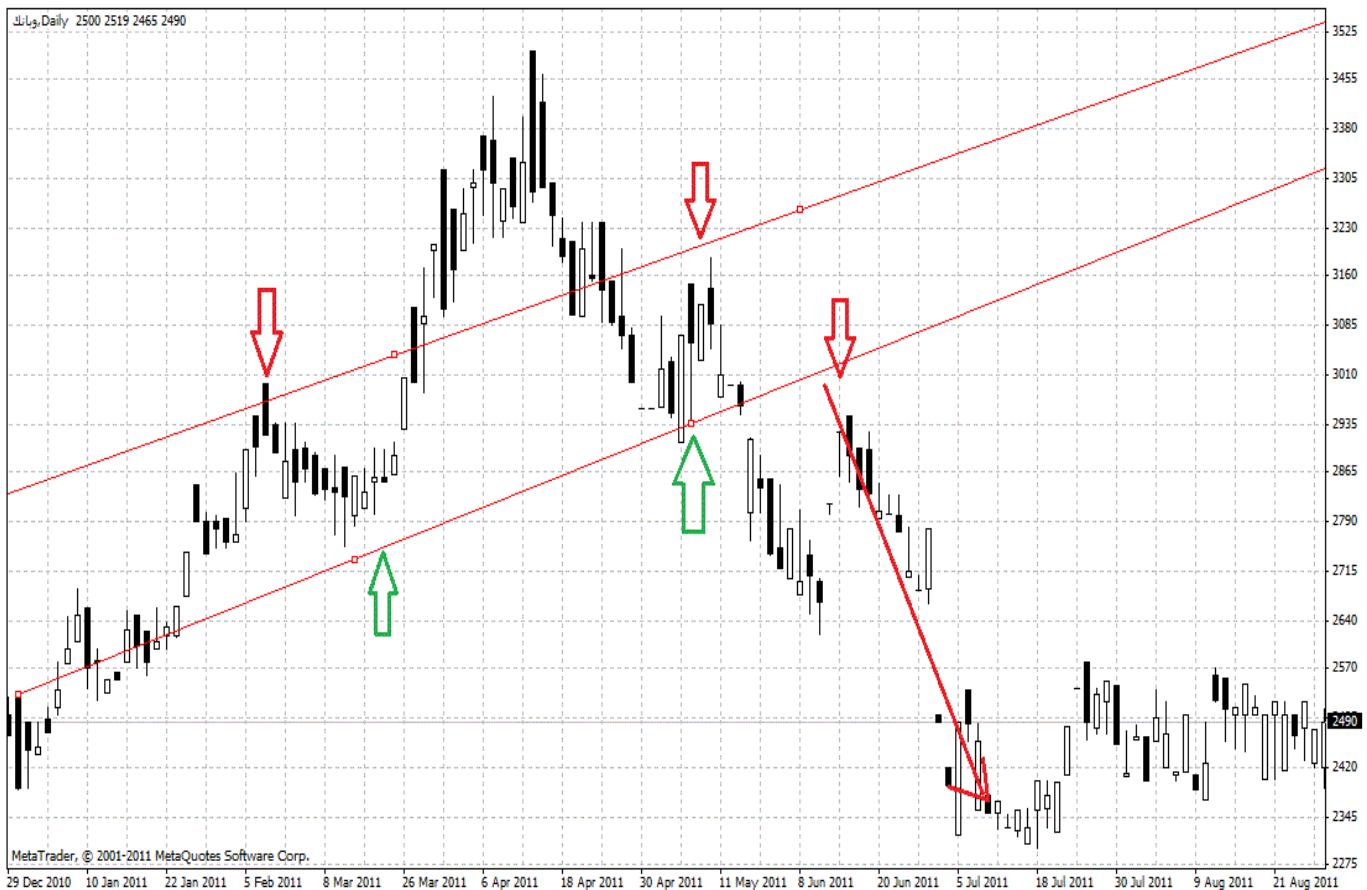
چارچوب زمانی الگوی سرو شانه می‌تواند از چند هفته تا چند ماه را پوشش دهد. هر چه زمان این الگو طولانی‌تر باشد این الگو دقیق‌تر است. اما هدف قیمتی به احتمال زیاد در کوتاه مدت بدست نمی‌آید. موقعی که برای رسیدن به هدف زمانی با مشکل مواجه می‌شویم، اجماع عمومی بر این است که طول مدت گسترش یافتن این الگو با دوره زمانی آن ارتباط خواهد داشت. بایستی تاکید کرد که اندازه گیری هدف از نقطه ای که خط گردن شکسته می‌شود بسیار مهم است.

بسیاری از الگوهای سروشانه ظاهر متفاوتی با نمودار بالا دارند. حالت واقعی قیمت ها به اندازه کافی نرمال و متقارن نیستند و آرایش سر و شانه گاهی اوقات وضوح نخواهد داشت. همین طور توجه داشته باشید خط گردن به ندرت افقی خواهد بود. نمونه واقعی این الگو در بازار بورس اوراق بهادار در تغییرات قیمت سهام شرکت سرمایه گذاری غدیر قابل مشاهده است.



شناسایی آرایش سر و شانه

۱. اندازه شانه ها بایستی تقریباً مساوی باشند و از این مهمتر شانه ها نبایستی فراتر از گردن باشند.
۲. لازم است نقاط خط حمایت همگی مماس با خط گردن باشند که اگر این شرط برقرار نباشد ، نمیتوان این آرایش را به الگوی سر و شانه نسبت داد.
۳. الگوی سر و شانه تنها در هنگامی که سه موج به صورت امواج برگشتی با سطح حمایت (خط گردن) برخورد نمایند و سپس آنرا قطع کنند کامل و تایید می شود. چنانچه قیمت نتواند خط گردن را قطع کند ، الگو اعتبار خود را از دست می دهد.



نقطه نظرات داد و ستد

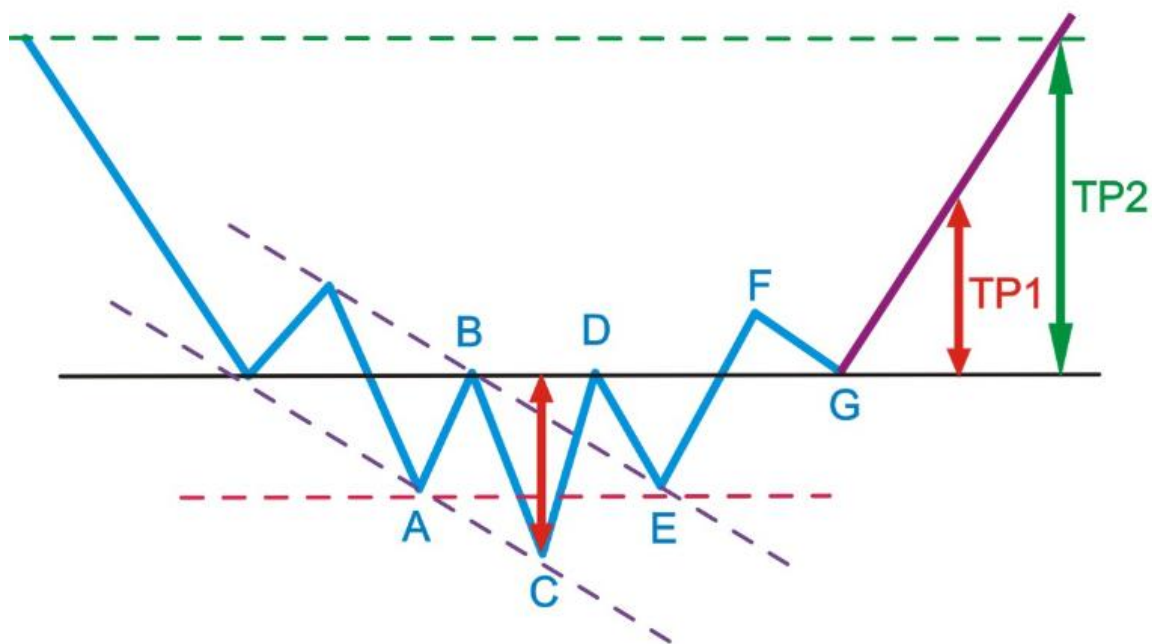
اصولا معامله گران از انواع مختلف نمودارها براساس چارچوب زمانی متفاوت استفاده می کنند. لازم است تاکید کنیم که برای تایید الگو قیمت پایانی بایستی نقاطی خارج از گردن را بوجود آورند. پیشنهاد می شود که در این صورت از نمودار شمعی یا میله ای استفاده شود.

در آرایش سر و شانه بسیاری از معامله گران مترصد عبور قیمتها از خط گردن خواهند بود ، اما گزارشات قیمتی معمولا بسیار گسترده اند و هر وقفه در آن امکان بازگشت دوباره قیمتها را مشکل می کند ، و در این شرایط امکان دارد بازار خط گردن را آزمون کند.

در معدودی از بازارها که در آن معامله گران ریسک بالایی را می پذیرند خرید یا فروش قبل از تلاقی خط گردن با قیمت انجام می شود و در نتیجه اگر بازار در خط گردن نفوذ کند سود بسیار بالایی خواهند برد. اگر بازار نتواند از خط گردن عبور کند آنگاه باید هر چه زودتر از بازار خارج شویم تا از زیان بیشتر جلوگیری شود. اگر چه گردش پول بالا و نقدینگی پایین وضعیتی را به وجود می آورد که امکان انجام معامله را از معامله گران سلب می کند. الگوی سر و شانه همواره به صورت یک آرایش منظم و متقارن شکل نمیگیرد.

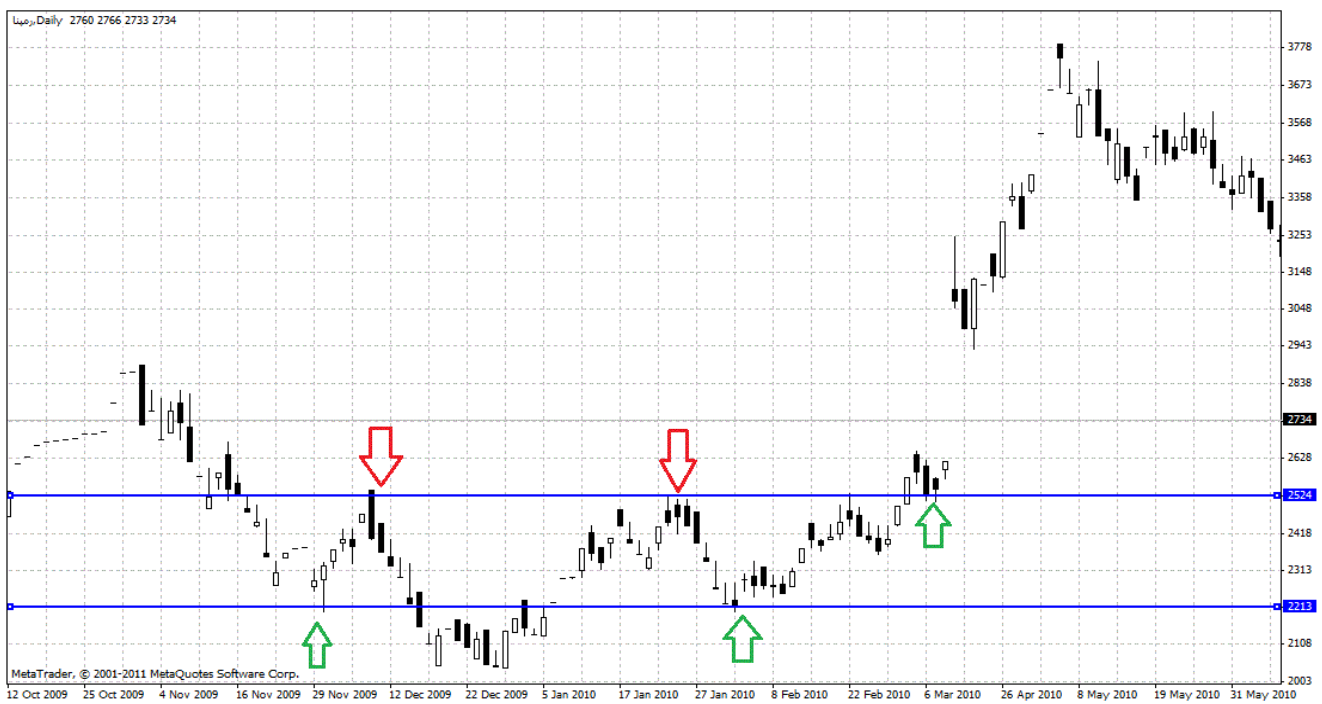
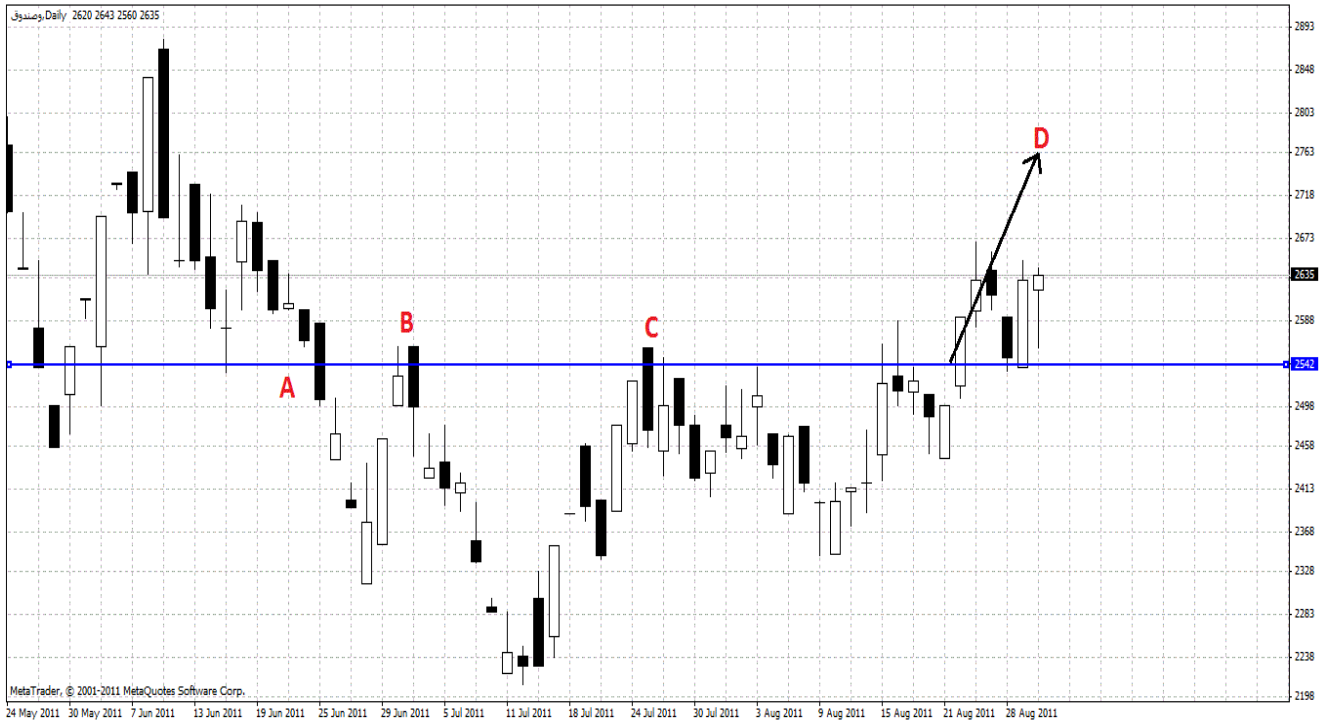


آرایش سر و شانه معکوس

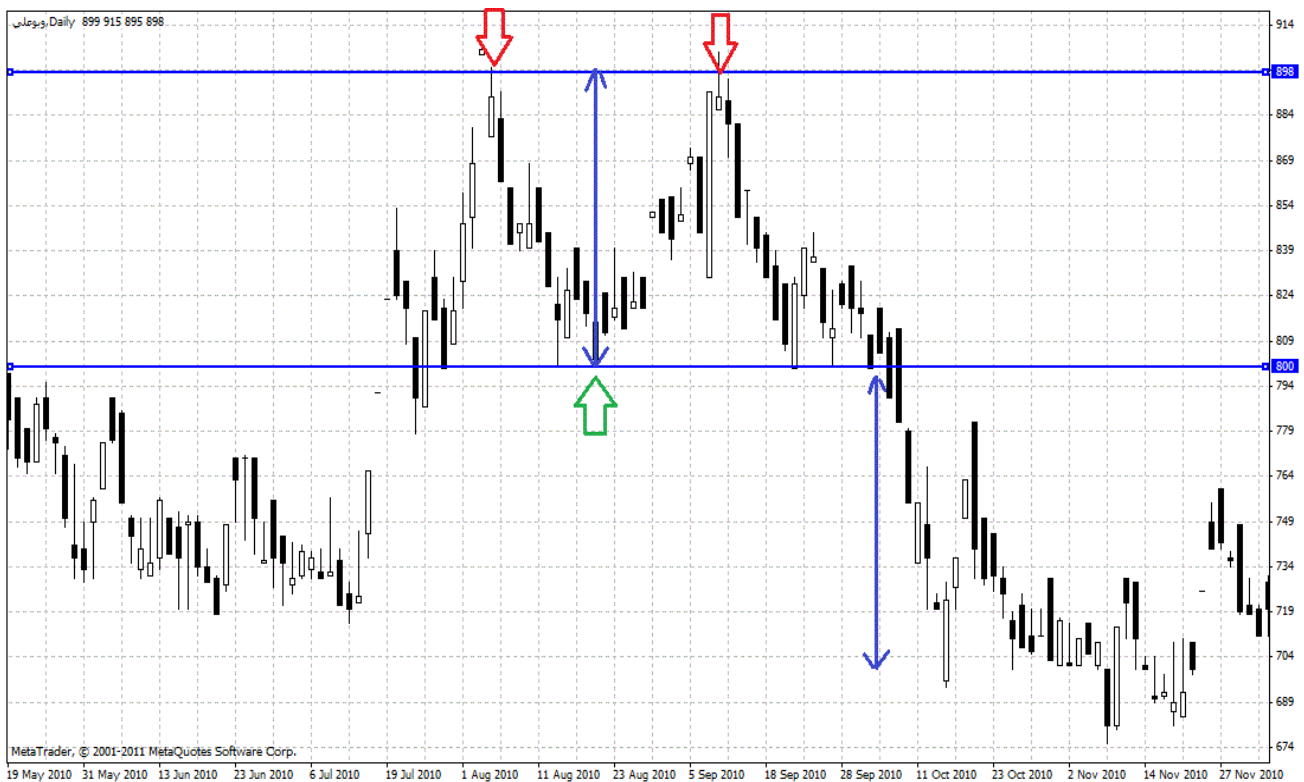
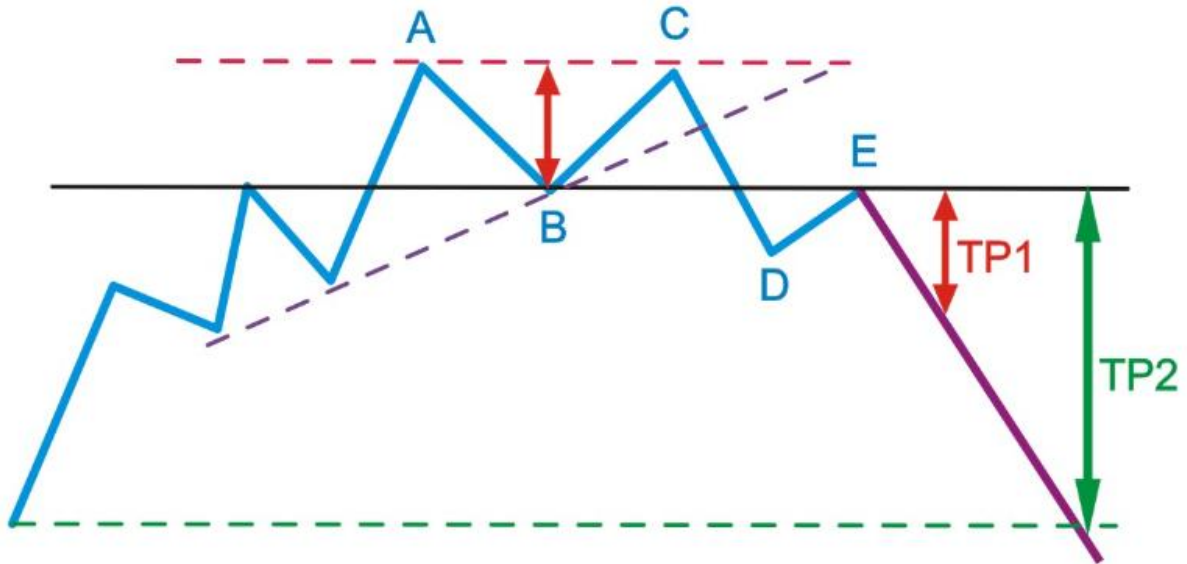


آرایش سر و شانه معکوس یک تصویر درون آینه از الگوی پیشین است. به نمودار بالا توجه کنید. پیش از آنکه قیمتها از نقطه A عبور کند، سطح حمایت در برابر قیمتها خود نمایی می کند. زمانی که این سطح شکسته شود، آن خط به یک خط مقاومت مهم و قوی تبدیل می شود. اما در طول زمان قیمت دوباره به سوی خط مقاومت پرش می کند. سطح حمایت پیشین و سطح مقاومت جدید به عنوان خط گردن در اینجا مطرح می شود. قیمتها دوباره نقاط B و C به سوی خط گردن هجوم می آورند، اما حرکت آنها با برخورد با این سطح متوقف می شود. در نتیجه با تلاش خریداران خط گردن شکسته شده و این بار قیمتها با حجم معاملات بالا از سطح مقاومت عبور می کند. پس از عبور قیمت از خط گردن، اکنون این سطح نقش سطح حمایت را ایفا می کند. اگر خط حمایت در برابر فشار فروشندگی و آزمون بازار دوام آورد، انتظار می رود که قیمتها در نهایت به نقطه D بالا بروند که هدف قیمتی آرایش سر و شانه به شما می آید. هدف

قیمتی احتمالا با فاصله بین بالای سر و خط گردن است و از نقطه شکسته شدن خط گردن در نقطه مقاومت محاسبه می شود.



آرایش دو قلو (سقف دو قلو)



الگوی سقف دوقلو نیز در انتهای روند صعودی یا روند نزولی تشکیل می شود. دو قله آرایش برگشتی دیگری است که بسیار معمول و معتبر است. همانطور که نام این الگو به طور مختصر و واضح بیان می کند ؛ این آرایش از دو قله یا بلندی تشکیل شده است که احتمالاً می تواند دارای بلندی برابری باشد.

در این آرایش خطی موازی رو به روی سطح مقاومت کشیده می شود که دو قله را به عم وصل می کند. این جهت شناسایی خط گردن در نظر گرفته می شود.

دوباره سعی می کنیم پدید آمدن این آرایش را مرور کنیم. پیش از آنکه قیمتها از نقطه A عبور کنند ، سطح حمایت در برابر قیمتها بوجود آمده و زمانی که این خط شکسته می شود به یک خط مقاومت مهم و قوی تبدیل خواهد شد. قیمتها در برخورد با نقطه B به سطح حمایت برگشت می کنند. این سطح اکنون به عنوان خط گردن مطرح است. امید خریداران به برگشت قیمتها دوام زیادی پیدا نمی کند ، چرا که بار دیگر قیمتها در نقطه بوسیله عرضه هایی بازمی گردد. حرکت قیمتها طوری است که سطح حمایت شکسته می شود ، اما احتمال دارد با تلاش خریداران قیمت به سوی خط گردن متمایل شود. این حالت خط گردن توسط بازار آزموده شده و می تواند نقش بازدرانده از رشد را بازی کند. اگر خط مقاومت در برابر فشار خریداران دوام بیاورد انتظار می رود قیمت سقوط کند. هدف قیمتی احتمالاً برابر فاصله بین بالای قله ها و خط گردن است و از نقطه شکسته شدن خط روند به سمت پایین محاسبه می شود.



آرایش دو قله اطلاعاتی را در زمینه های زیر فراهم می کند:

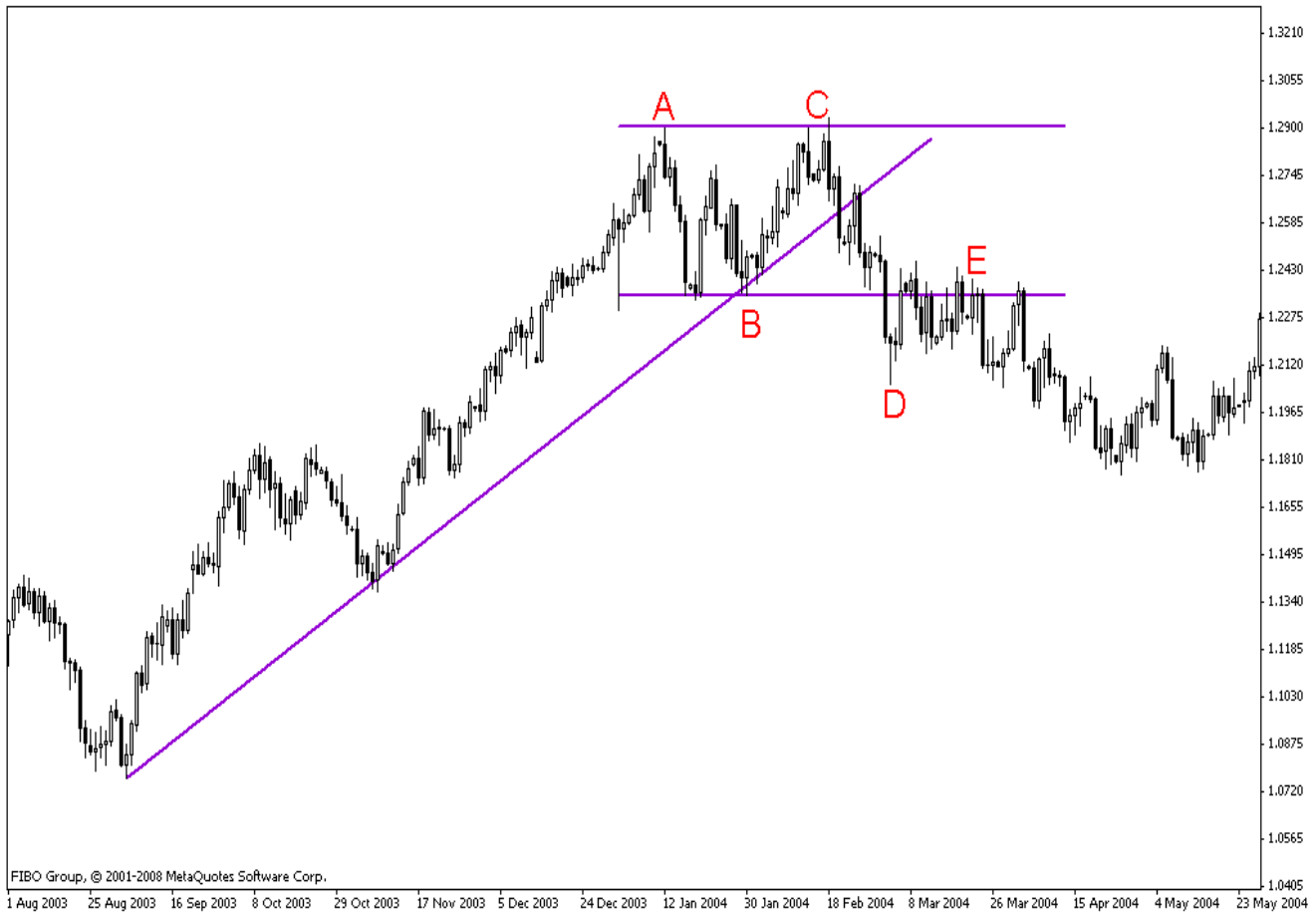
۱. خط حمایت بین نقاط A ، C ، E ایجاد می شود.

۲. خط مقاومت بین نقاط B ، D ایجاد می شود

۳. جهت قیمتی : اگر خط گردن فشار خریداری را کنترل نماید ، آرایش اطلاعاتی راجع به جهت قیمتی فراهم می کند. حرکت قیمتها کاهشی و درست برخلاف قله ها خواهد بود.

۴. هدف قیمتی : بوسیله تایید و تصدیق آرایش فراهم می شود. در این حالت خط گردن بوسیله حجم معاملات زیاد شکسته می شود.

همچنین خاطر نشان می گردد چارچوب زمانی برای تکمیل الگو دو قله ممکن است چندین هفته یا چندین ماه به طول بینجامد و هر چه این زمان طولانی تر باشد الگو از اعتبار بیشتری برخوردار است.



شناسایی آرایش

۱. بلندی قله ها بایستی برابر باشد.
۲. خیلی مهم است که نقاط معین و مهم همگی با خط گردن مماس شوند. کوتاهی در این شرط ویژگی های آرایش را کم اعتبار می کند.
۳. آرایش دو قله تنها زمانی تایید می شود که به طور کامل دو موج به سطح مقاومتی برخورد نموده و در برگشت قیمتتها نفوذی به خط گردن ایجاد گردد. در این حالات قیمت بسته شدن خارج از خط گردن خواهد بود. چنانچه قیمت نتواند خط گردن را قطع کند الگو اعتبار خود را از دست می دهد.

دیدگاه معامله گر

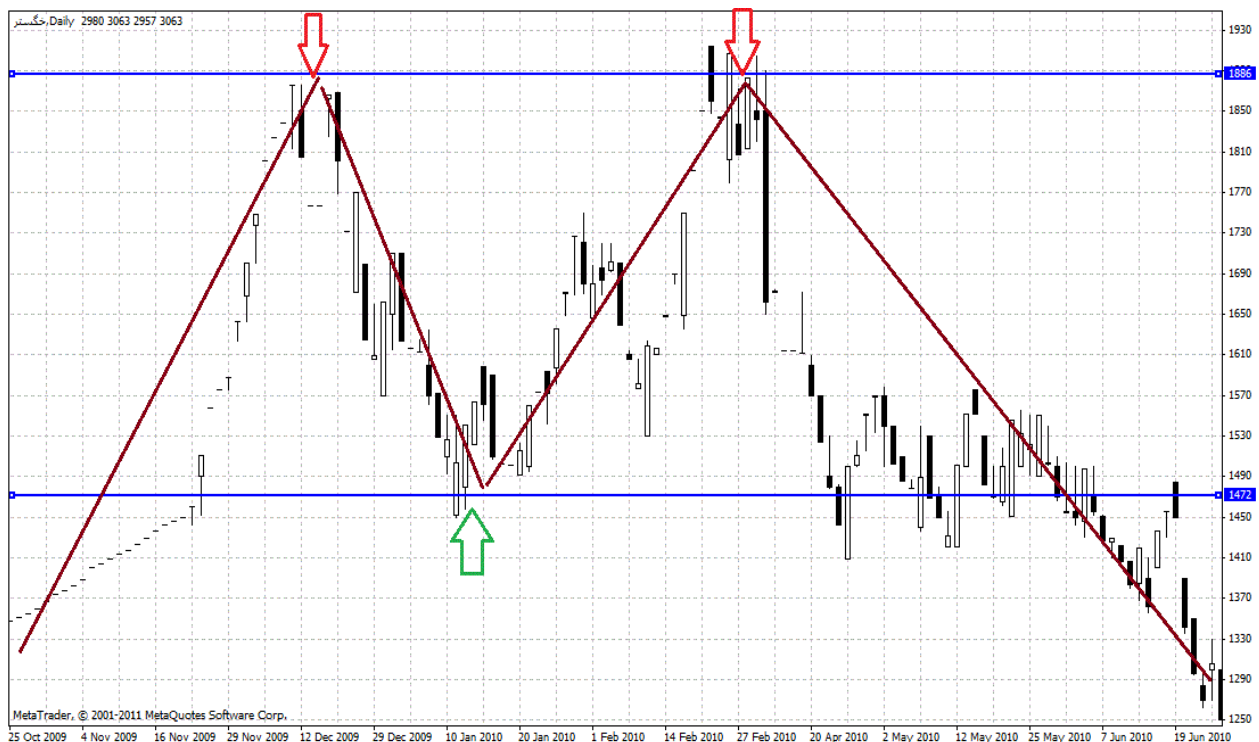
۱. مهم است به خاطر داشته باشیم که تایید شکست خط گردن شامل قیمت بسته شدن سهم بیرون خط گردن است.

۲. اکثریت معامله گران بازار منتظر تایید نفوذ در خط گردن می مانند در حالیه تلاش نمی کنند تا از قافله عقب بمانند. در آرایش دو قله بسیاری از معامله گران مترصد عبور قیمتها از خط گردن خواهند بود؛ اما گزارشات قیمتی معمولاً بسیار گسترده اند و هر وقفه در آن امکان بازگشت دوباره قیمتها را مشکل می کند و در این شرایط امکان دارد بازار خط گردن را آزمون کند.

۳. افراد با ریسک پذیری بالا، در موقع شکسته شدن خط گردن از بازار خارج می شوند. زیرا آنها انتظار بازگشت قیمتها را ندارند. در واقع اگر قیمت به خط گردن نفوذ نماید، آنها از زیان جلوگیری کرده اند. اگر قیمت نتواند از خط گردن عبور نماید، آنگاه باید هر چه زودتر از بازار خارج شویم تا از زیان بیشتر جلوگیری کنیم.

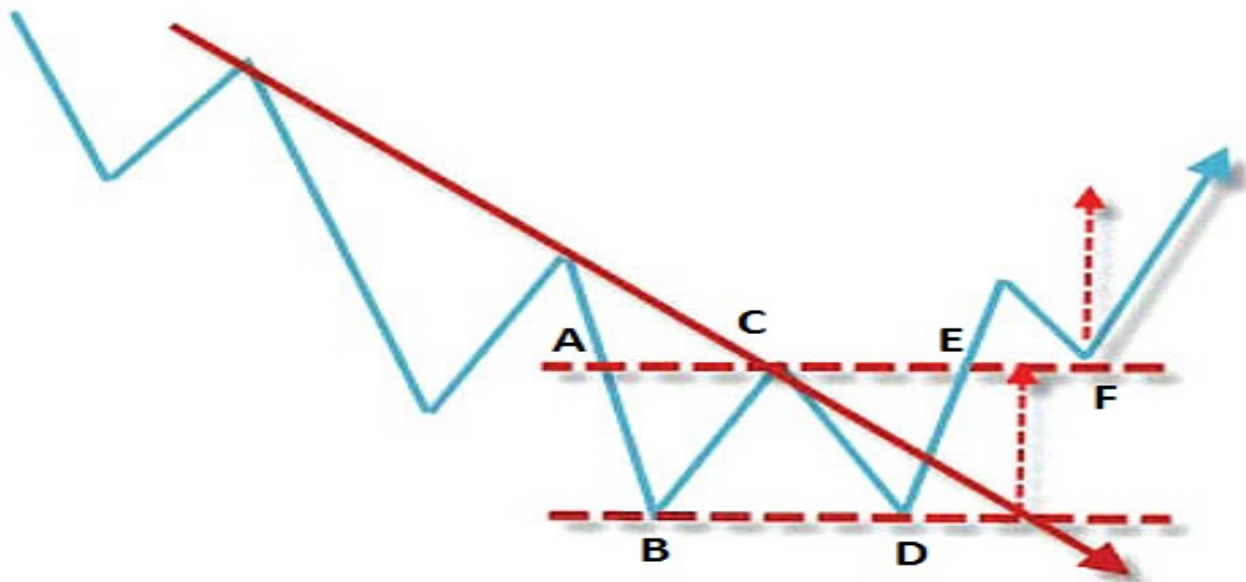
۴. به خاطر انتظار بازار برای تکمیل زودهنگام این آرایش، احتمال دارد که وضعیتهایی وجود داشته باشد که برگشتهای سریع را بدنیال داشته باشیم.

۵. قیمت به طور تصادفی ممکن است در قیمت هدف متوقف شود. عموماً ممکن است قیمت مقداری پایین تر یا بالاتر قرار گیرد. معامله گران بایستی با اطلاعات اضافی خود را برای سازگار نمودن با شرایط بعدی آماده کنند.



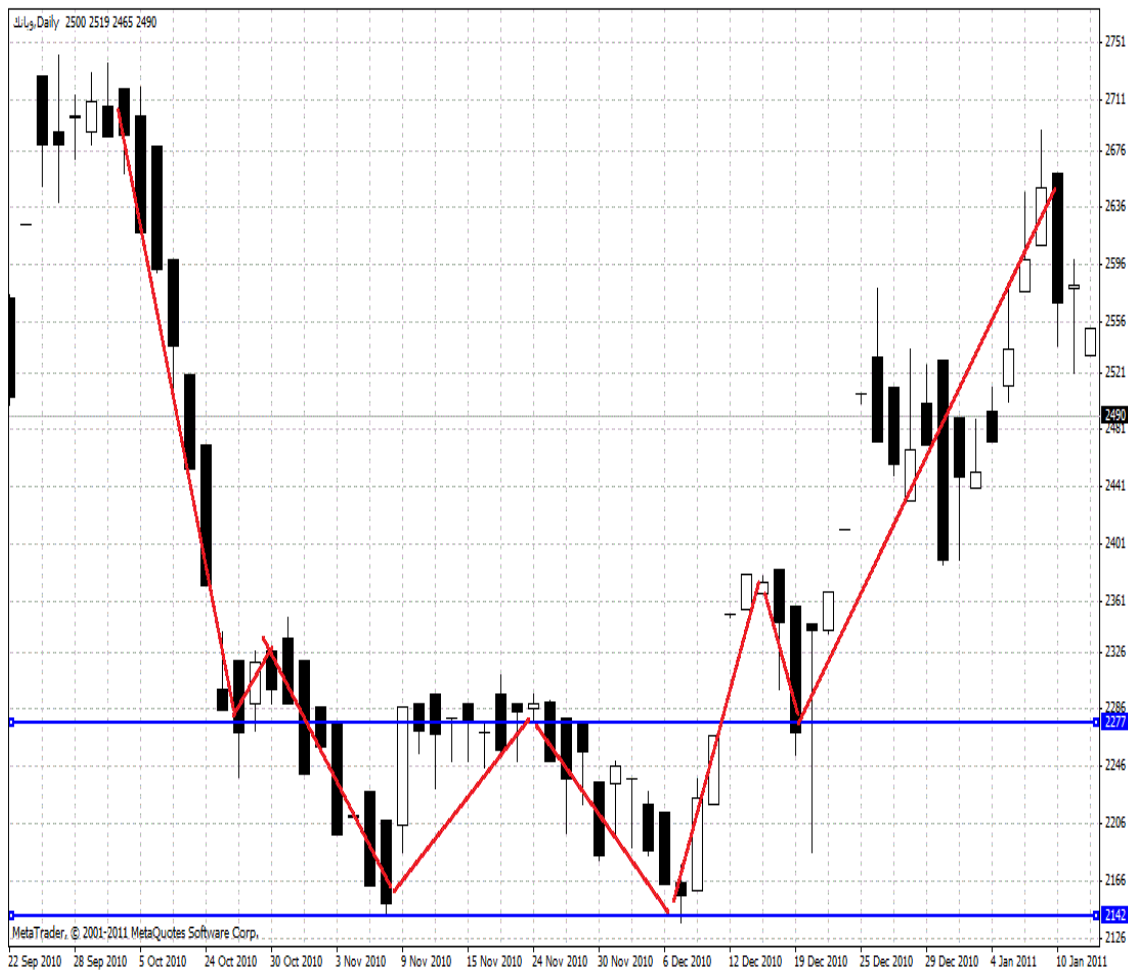
در آرایش دو قله بهترین کار آن است که **در اولین علامت فروش از بازار خارج** شد. خیلی بد است که منتظر دومین افزایش باشیم ، چون ممکن است هرگز اتفاق نیفتد. به هر حال حرکت به طرف دومین روند افزایش ، موقعیت دیگری برای سهامدارانی که به علائم بی اعتنا بودند بوجود می آورد تا از این سهم خارج شوند.

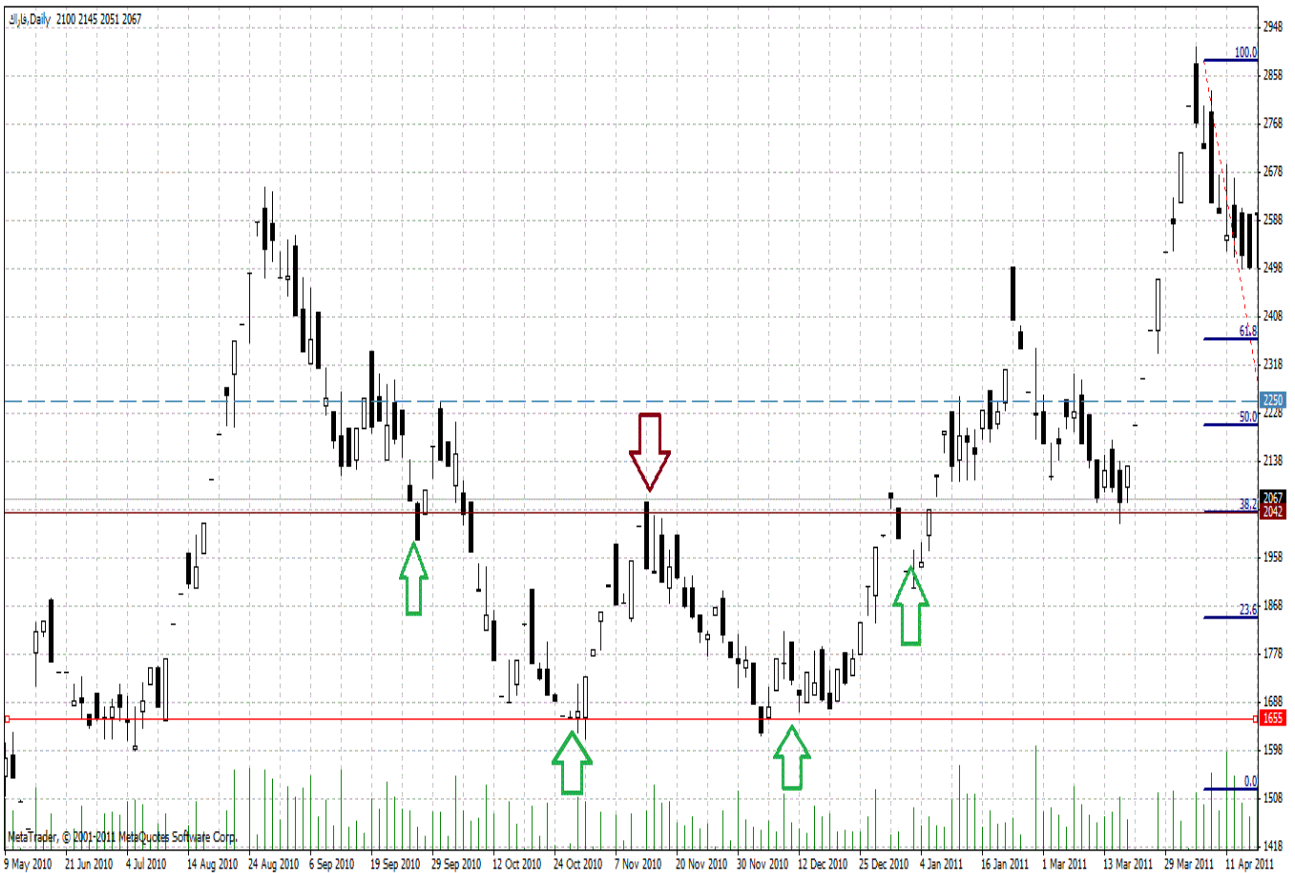
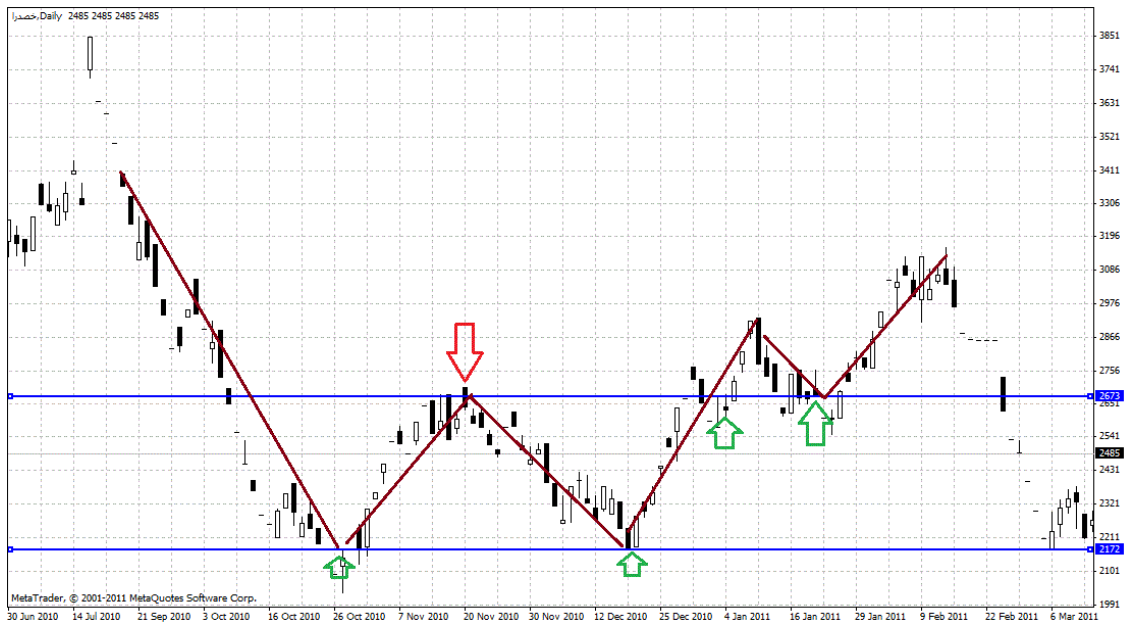
آرایش دو دره (کف دو قلو)



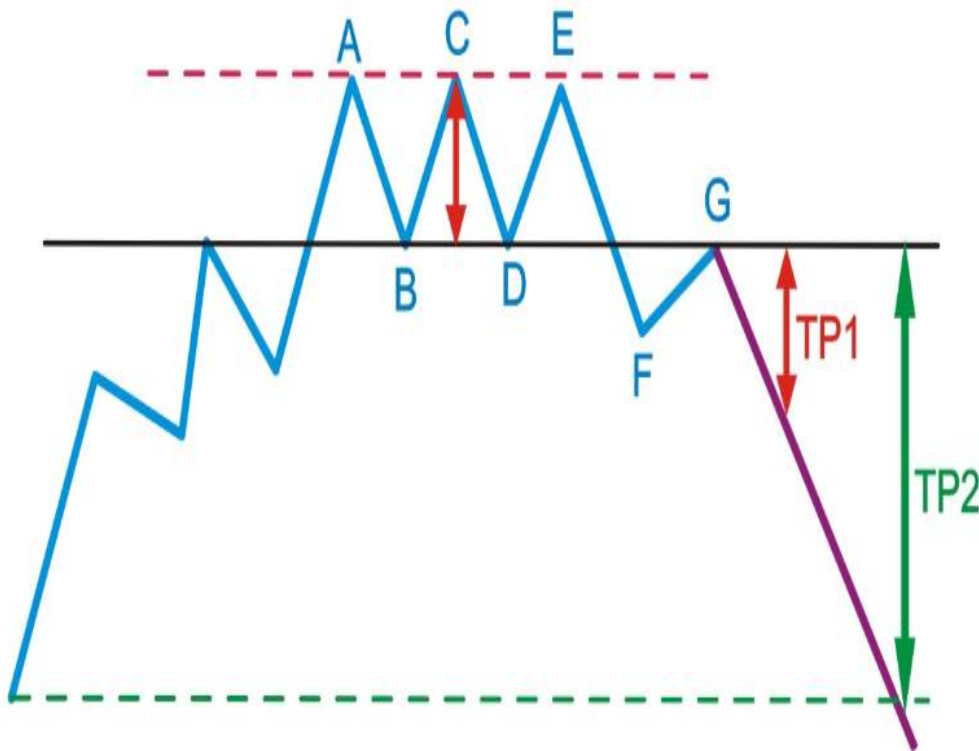
آرایش دو دره ، یک تصویر درون آینه از الگوی پیشین است. بنابراین ویژگی ها ، مسائل بالقوه ، علامتها ، نقطه نظرات معامله گران که در الگوی دو قله ارائه شد را به طور مشابه در این الگو به کار گیرید. دو کف تقریباً دامنه نوسان مشابهی دارند. خطی موازی خط گردن در مقابل خطی که دو کف را به هم وصل می کند کشیده می شود. دوباره ایجاد آرایش را بررسی می کنیم. پیش از آنکه قیمتها از نقطه A عبور کنند ، قیمتها با سطح حمایتی روبرو بوده اند. زمانی که این خط شکسته می شود ، این خط به یک سطح مقاومت قوی تبدیل می شود. با حرکت قیمتها در طول زمان دوباره برگشته و پرشهایی را به سطح مقاومت خواهیم داشت. سطح حمایت پیشین و سطح مقاومت کنونی به عنوان خط گردن در اینجا مطرح می شود. قیمتها دوباره در نقاط D و C به سوی خط گردن هجوم می آوردند ، اما حرکت آنها با برخورد با کف متوقف می

شود. در این حالت در کف شکل نخستین خود را به وجود می آورد. در نهایت با تلاش موفقیت آمیز خریداران خط گردن در نقطه E شکسته می شود و این بار قیمتها با حجم معاملات زیاد از سطح مقاومت عبور می کند. زمانی که خط مقاومت قوی شکسته شود یک برگشت دوباره قیمت را انتظار خواهیم داشت نقطه F. در این شرایط خط گردن توسط بازار آزموده می شود و نقش سطح حمایت را ایفا می کند. اگر خط حمایت در برابر فروشندگان دوام بیاورد انتظار داریم قیمتها به اندازه فاصله سر تا خط گردن افزایش یابد.





آرایش سه قله (سقف سه قلو)



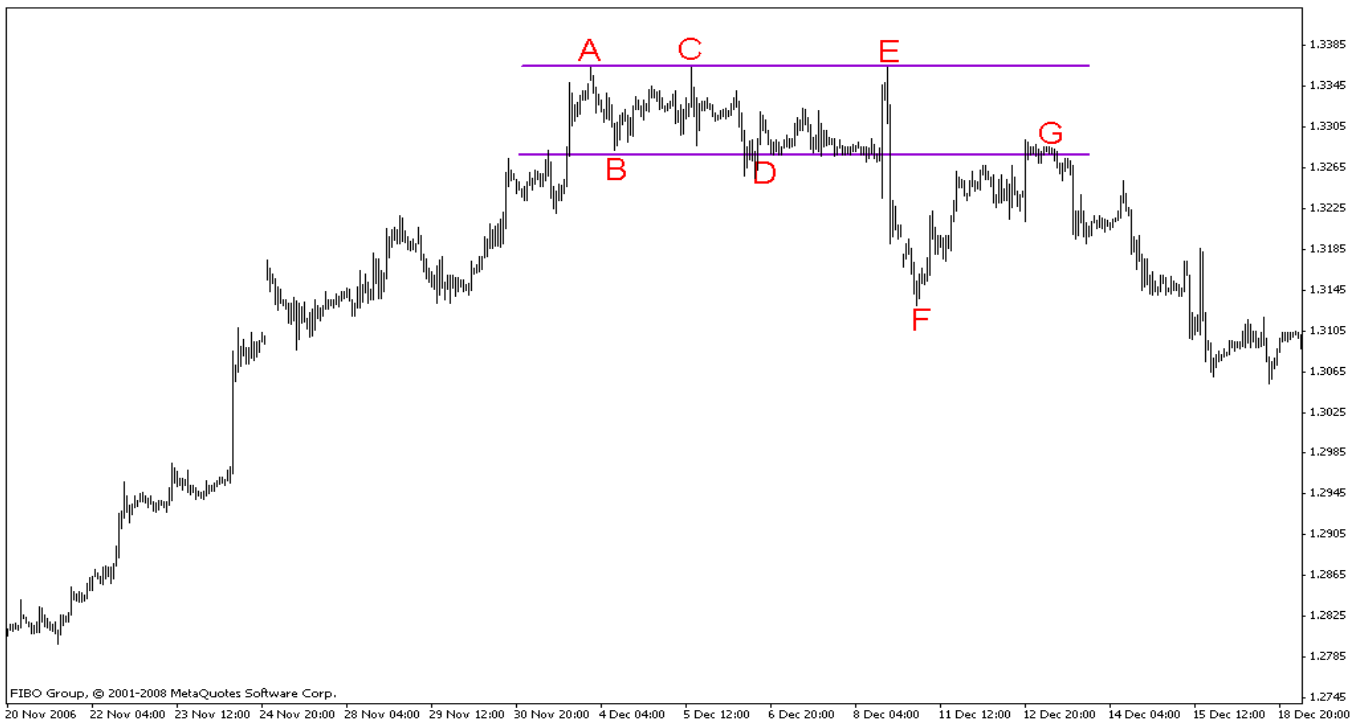
سقف سه قلو ترکیبی از آرایش های برگشتی سر و شانه و دو قلو است. بر عکس ، کف سه قلو ترکیبی از سر و شانه معکوس و کف دو قلو است. ثمر نتیجه آنها در ویژگی ها ، مسائل بالقوه ، علامتها و نقطه نظرات معامله گران ، به ترتیب با سقف دو قلو و کف دو قلو مشابه هستند.

همانطور که در نمودار مشاهده میکنید ، در آرایش سقفهای سه قلو (سه قله) ، عموماً بلندی ها و قله ها تقریباً ارتفاع مشابهی دارند. یک خط موازی موسوم به خط گردن در مقابل خطی که سه بلندی A ، C ، E را بهم وصل می کند کشیده می شود. هرگاه به عنوان یک خط مقاومت ، خط شکسته شود ، در این صورت نقش خط گردن تغییر کرده و به یک حمایت قوی در نقاط B و D تبدیل می شود. اما در نهایت این سطح حمایت شکسته می شود و باز سطح حمایت به یک سطح مقاومت قوی تبدیل می شود که برگشت قیمت را

در نقطه G متوقف می کند. هدف قیمتی در سطح TP2 است که میانگین ارتفاع بلندی سه قله است و از نقطه C تا خط گردن محاسبه می شود.

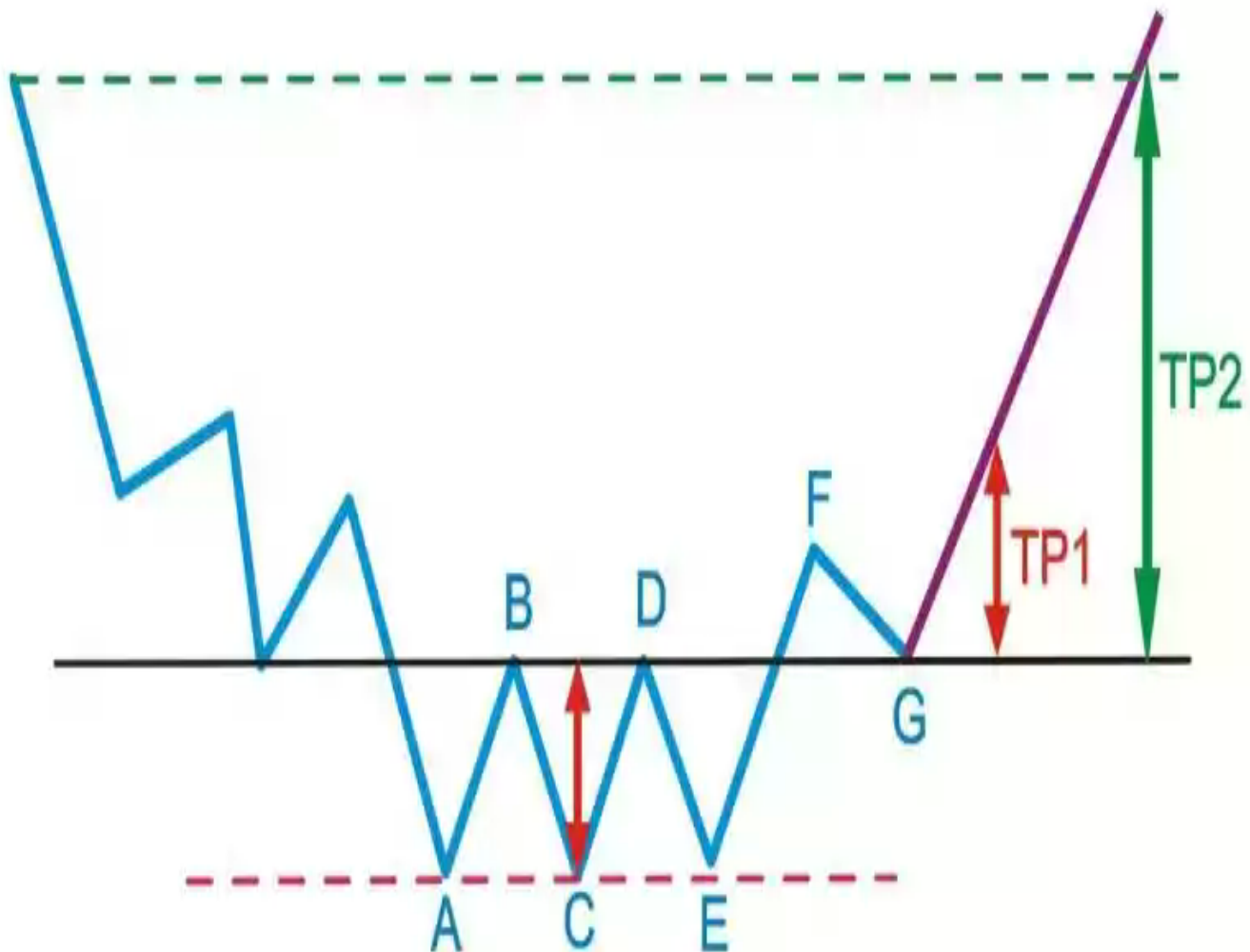
در آرایش سقف های سه قلو (سه قله) ، اگر آرایش در نقطه D نتواند از خط گردن عبور نماید قیمتتها به تندی به سمت نقطه E حرکت می کنند. خط مقاومت یکبار دیگر این موج را نگه می دارد و قیمتتها به تندی دوباره به سمت خط گردن پایین می افتند. در این سطح فشار بازار قادر است که در خط حمایت نفوذ نماید. بعد از اینکه دوباره خط گردن را تست کرد ، قیمت بار دیگر پایین می آید که سرانجام به قیمت هدف دست می یابد.

الگوی سه سقف و الگوی سه کف تشابه بسیاری با الگوی سقف های دوقلو و کف های دوقلو دارد با این تفاوت که به جای دو قله یا دو دره سه قله و سه دره ایجاد شده است. این الگو نیز در انتهای روند ایجاد می شود و شاهد سه سقف یا سه کف در نقاط A، C و E هستیم. دو دره در بین این سقف ها وجود دارد و با شکسته شدن دره ها (نقاط B و D) می توان انتظار داشت بازار از حالت صعودی به نزولی تبدیل شود.



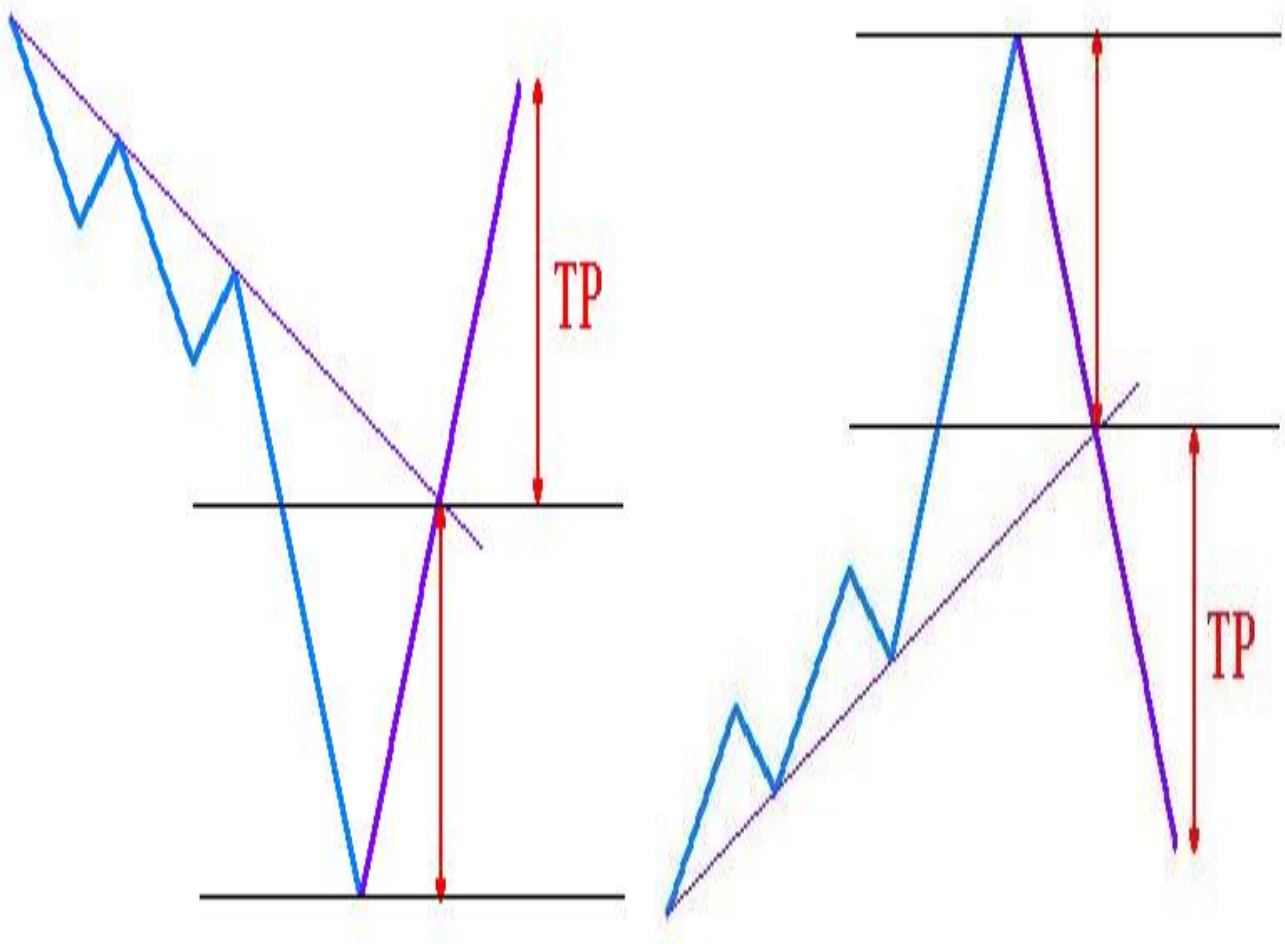
آرایش آرایش سه دره (کف سه قلو)

برعکس الگوی قبلی، این الگو ترتیبی از ساختارهای سر و شانه های معکوس و کف دو قلو است. در این مورد هم همان ویژگیها، مشکلات احتمالی، نشانه ها و نکات معاملاتی سقف دو قلو به کار برده می شود. همانطو که در شکل زیر نشان داده شده است، در یک ساختار کف سه قلو، کف ها تقریباً یکسانند. یک خط (خط پایه) به موازات خطی که سه کف (A و C و E) را بهم وصل می کند، رسم شده است.



سطح حمایت به عنوان یک خط حامی قطع شده است و به یک خط مقاوم برای سطوح نرخ B و D تبدیل شده است. اما نهایتاً در نقطه F قطع می شود. خط مقاوم به یک خط حامی تبدیل می شود که در نقطه G، بازار را به خط پایه برمی گرداند. نرخ مورد نظر در سطح TP2 است که میانگین ارتفاع سه کف اندازه گیری شده از نقطه C است.

آرایش وی V

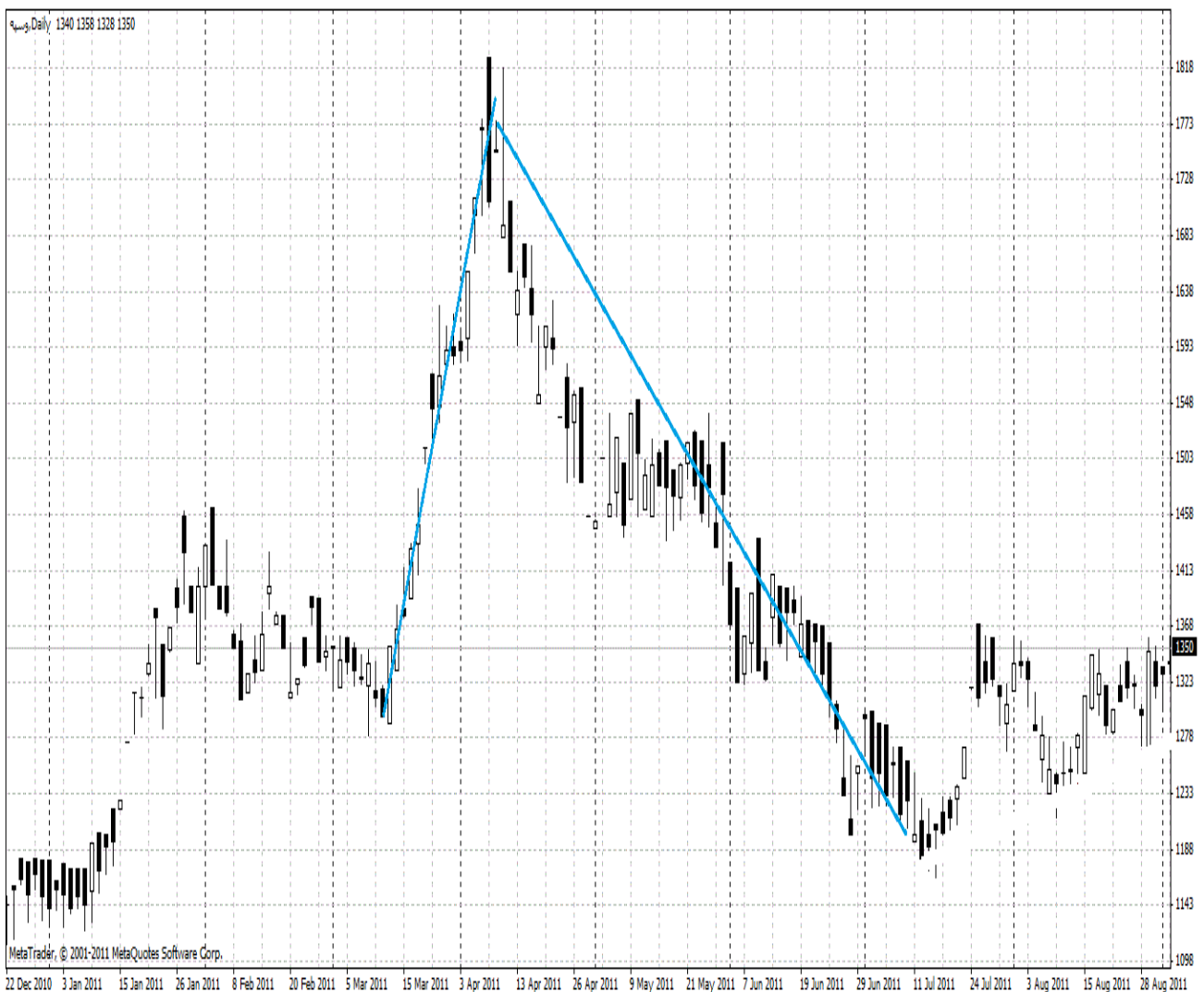


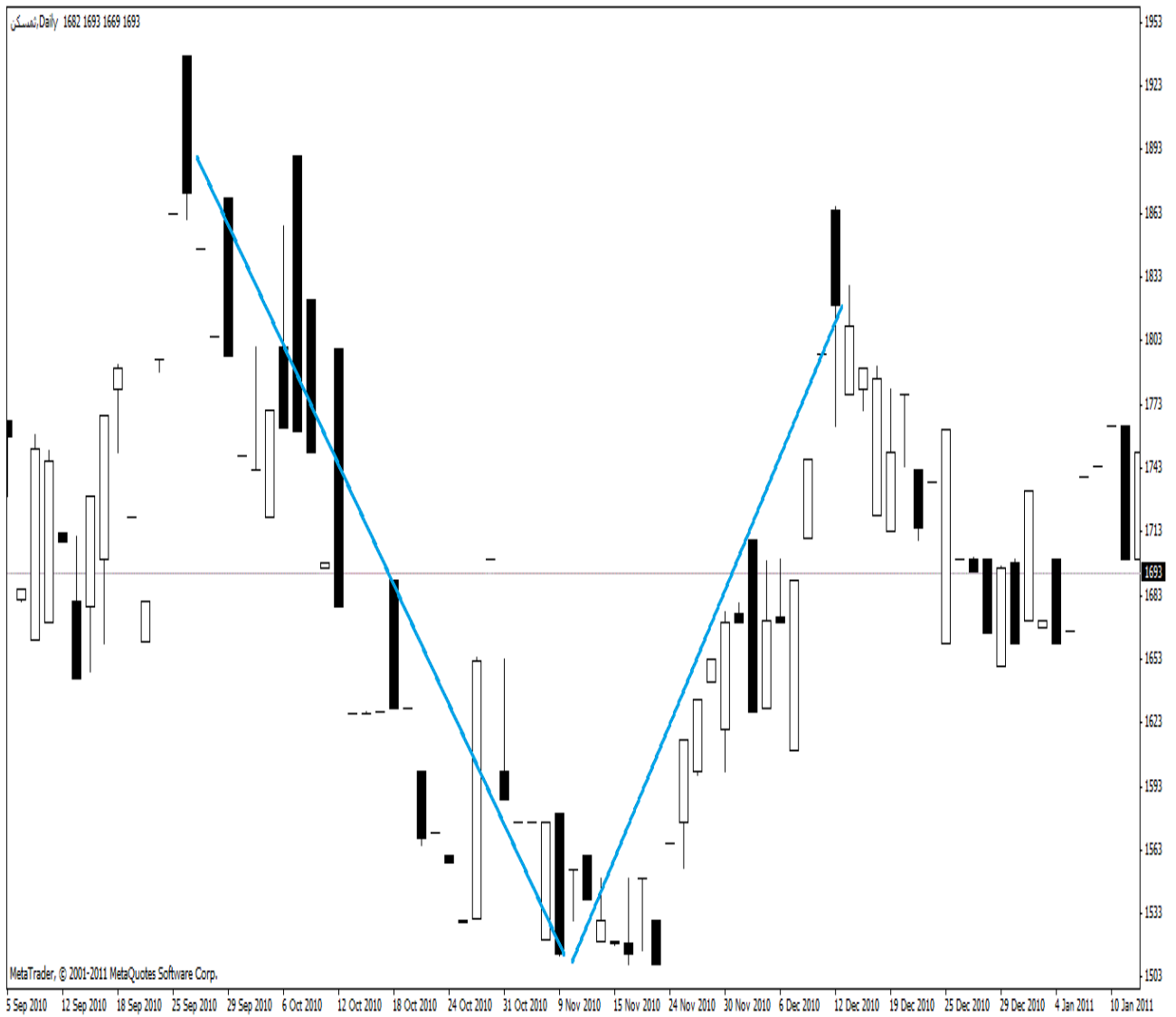
ساختارهای V یا اسپایک (spike)، نوع نادری از ساختار معکوس هستند. در تمامی الگوهای دیگر که در این فصل راجع به آنها بحث شد، بازار سعی دارد که بعد از یک شکست نرخ، قیمت‌ها را دوباره به روند اصلی

برگرداند. اما معکوسهای اسپایک فاقد این خصوصیت هستند. آنها بسادگی و **بدون هیچ هشدار**ی، از یک روند به روند متقابلش تغییر موقعیت می دهند و در طی این تغییر موقعیت و یا بعد از آن، حجم زیادی از معاملات را در بر می گیرند زیرا در طی زمانی که روند اصلی باید نقدی و یا معکوس شود، موقعیت های فوق العاده ای به وجود می آیند.

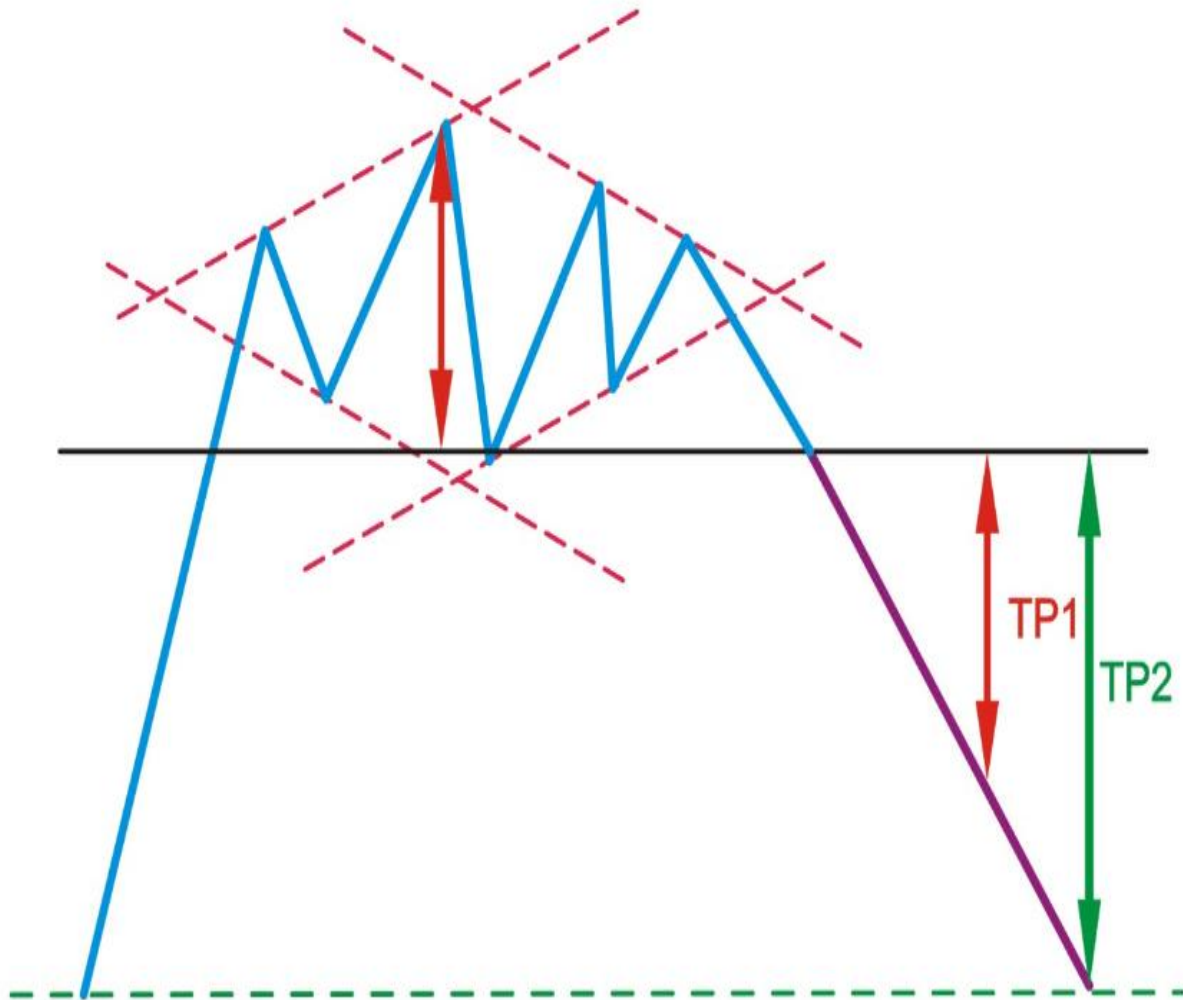
الگوی "وی" **V** با **شکسته شدن خط روند** تکمیل می شود و میتوان وارد معامله شد. شاخصه اصلی این الگو بازگشت ناگهانی قیمت می باشد و بازگشت های داخل الگو بسیار کوتاه و موقت است. مشخصه دیگر الگوی **V** **شیب زیاد موج آخر حرکت روند قبلی** می باشد و **بازگشت ها معمولاً با همان زاویه ای بر می گردد که بازار با آن شیب حرکت اصلی را آغاز کرده است.**

شکل زیر، چگونگی ساختار کف **V** را نشان می دهد. خطی که در پائین نمودار رسم شده و مینیمم نرخ روند نزولی را نشان می دهد، می تواند از دیگر خطهای قبلی و بعدی، منحصر باشد. شدید بودن هر دو روند، نشانه قطعیت بازار در مسیر قیمت است.



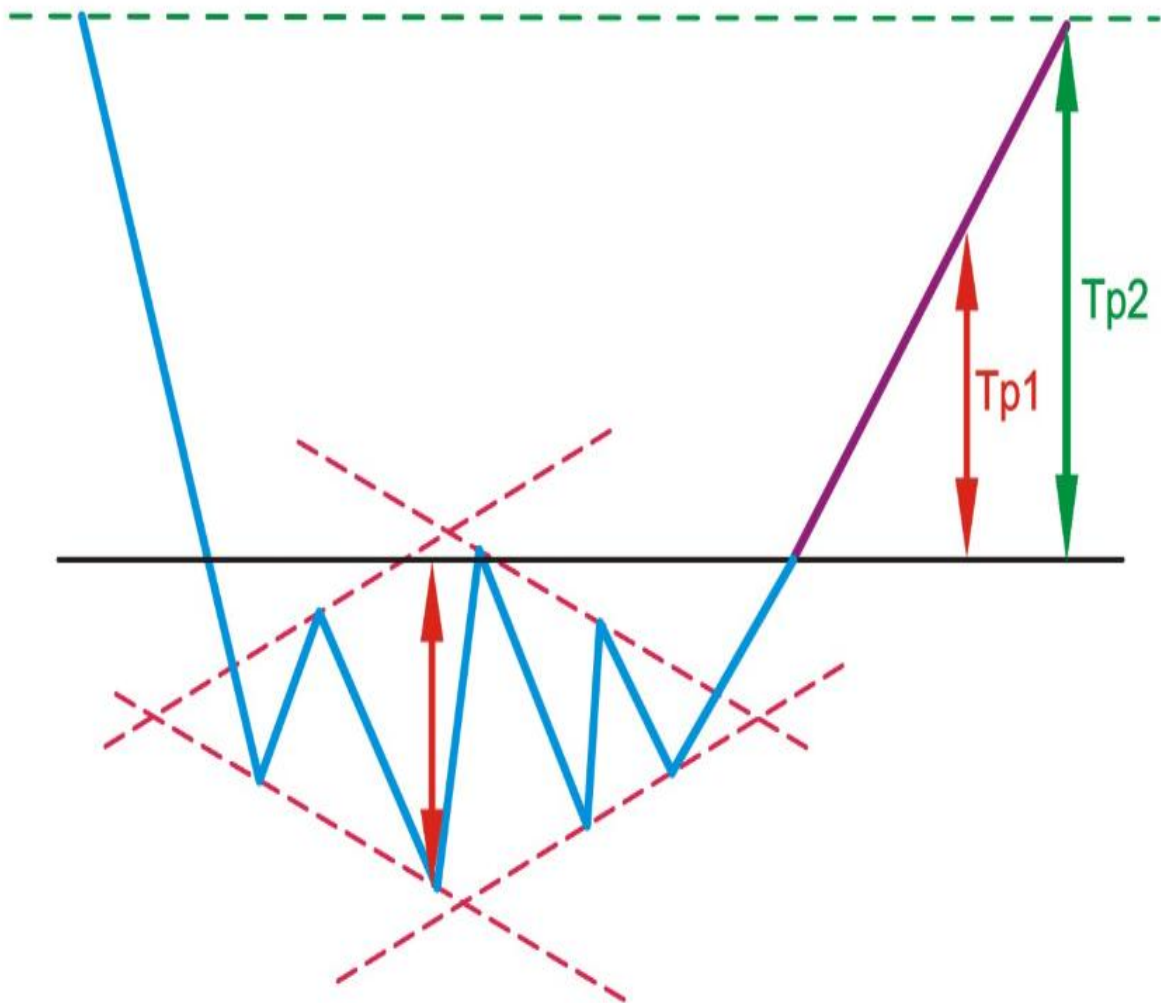


الگوی لوزی

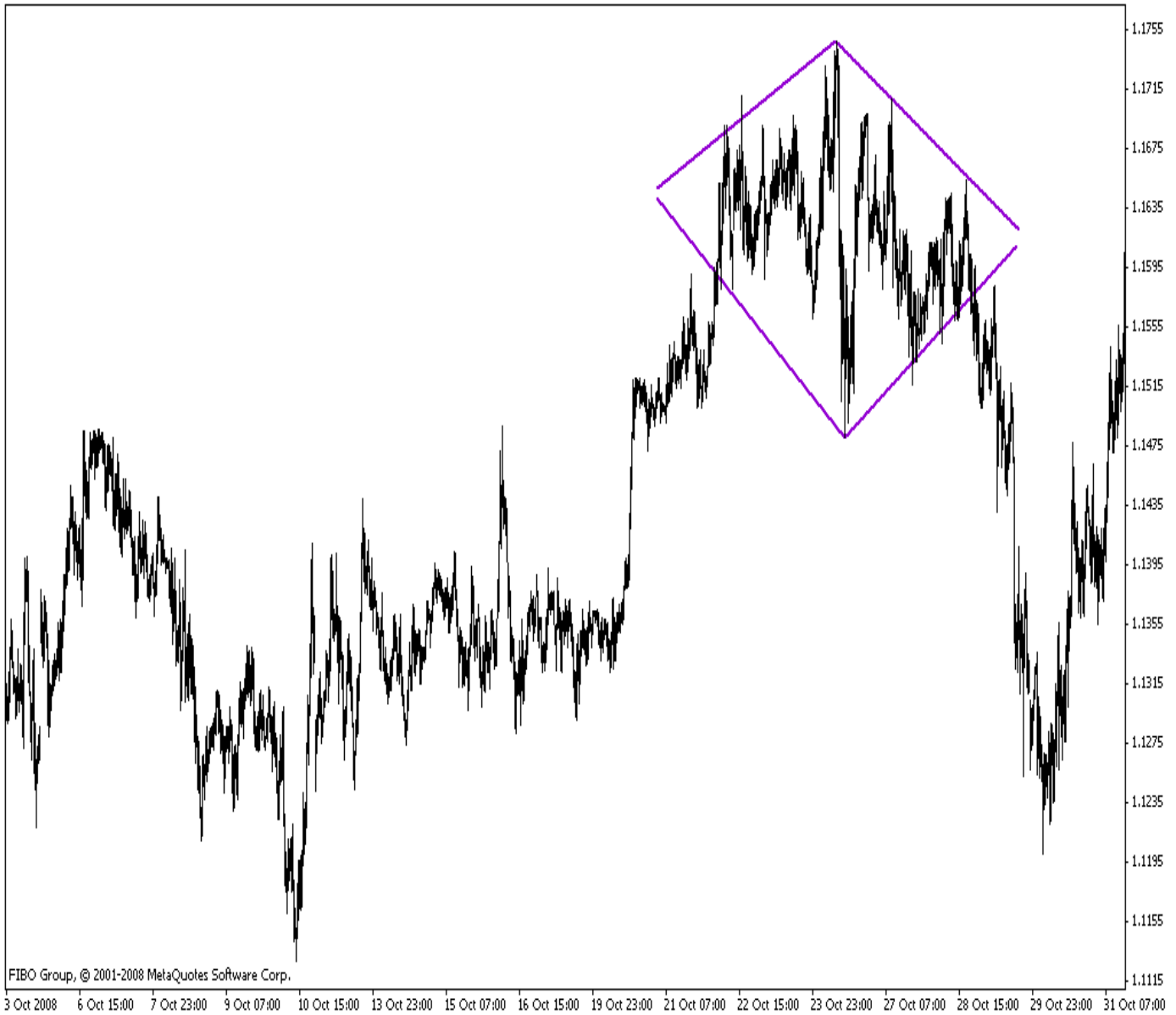


الگو لوزی نیز در انتهای روند به وجود می آید. بعد از یک روند صعودی یا نزولی در ابتدا شاهد سقف و کف های کوچک هستیم. به مرور دامنه حرکت سقف و کف ها بزرگتر می شود دوباره در اواخر الگوی اندازه سقف و کف ها بزرگتر می شود. با شکسته شدن سقف یا کف الگو وارد معامله می شویم. حد ضرر معامله ورودی از طریق این الگو با لحاظ مقداری فاصله از بالاترین سقف در حالت صعودی و با لحاظ مقداری از پایین ترین کف در حالت نزولی قرار می گیرد. حد سود اول به اندازه فاصله بزرگترین سقف و کف داخل الگو

می باشد و حد سود دوم محدوده آغاز روند است.



نمونه الگوی الماس در بازار سرمایه غالباً کم پیدا می شود با این حال می توانید نمونه ای را در نمودار زیر ببینید که با شکسته شدن امتداد خط گردن عمیقترین دره بازار به هدف قیمتی حد سود اول رسیده است



الگوی سقف و کف مدور

الگوهای سقف و کف های مدور که الگوهای نعلبکی هم نامیده می شوند، جزء روندهای معکوس نادر هستند. این الگوها یک تغییر تدریجی در جهت روند و تزلزلش در پایان روند را نشان می دهند. آیا روند اصلی ادامه پیدا می کند و یا به بالاترین یا پائین ترین حد خود می رسد؟ از آنجائیکه افزایش و کاهش قیمت ها، روند را به دو جهت مختلف می کشند، معامله کند می شود. تشخیص اینکه ساختار حقیقتاً چه زمانی کامل می شود، غیر ممکن است و شما هیچ عاملی برای رونق دوباره ندارید. این خصوصیات باعث شده که این روند معکوس در بین معامله گران محبوب نباشد. همانند هر الگوی دیگری، هرچه کامل شدن سقف و یا کف مدور بیشتر طول بکشد، تمایل نرخ برای حرکت در یک جهت جدید بیشتر می شود. شکل زیر ساختار یک الگوی کف مدور را نشان داده و شکل ۱۶-۲ نمونه های بازار از ساختار معکوس را نشان می دهد.

الگوهای ادامه دهنده

تحلیل گران تکنیکی ، علاوه بر الگوهای روندهای معکوس اصلی ، الگوهای ادامه دهنده را هم معرفی کرده اند. این الگوها باعث تقویت روندها می شوند و شکست مورد نیاز بازار در طی یک روند شدید را منعکس می کنند. از طریق این ساختارها ، بعضی از معامله گران می توانند کل و یا قسمتی از سود خود را برداشت کنند در صورتی که دیگران در درستی جهت روند شک دارند. به طور کلی این فعالیت ها ، باعث ایجاد تثبیت قیمت می شوند که گاهی به عنوان حرکات خنثی اتفاق می افتند ، اما معمولاً در جهت مخالف روند اصلی عمل می کنند. این دوره تثبیت کاملاً کوتاه هستند. شکست ها باید به طور طبیعی در جهت روند اصلی اتفاق بیفتند.

مهمترین الگوهای ادامه دهنده عبارتند از:

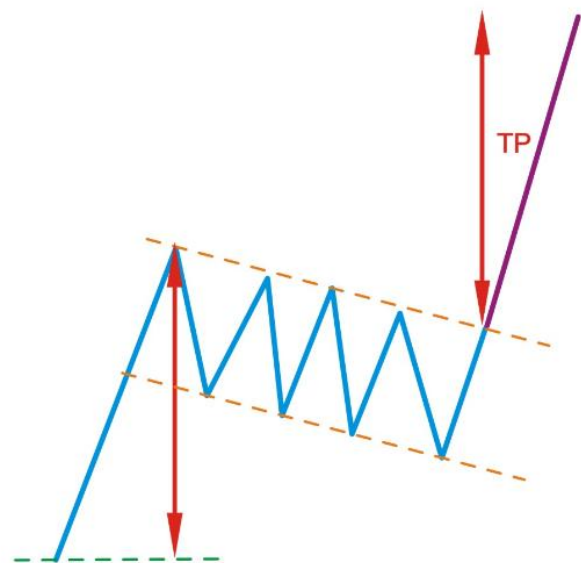
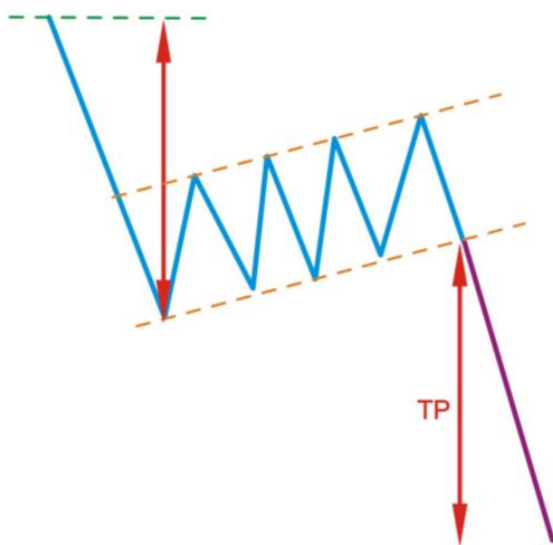
- ۱- پرچم
- ۲- پرچم سه گوش
- ۳- مثلث
- ۴- سه گوش
- ۵- مستطیل ادامه دهنده

الگوی پرچم

پرچم، یک الگوی روند ادامه دهنده معتبر است که نشانه های مهمی بدست می دهد: جهت و نرخ مورد نظر. این ساختار شامل یک دوره ثبات کوتاه مدت در یک روند شیب دار صعودی و یا نزولی است. شیب ثبات یا درخلاف جهت شیب روند اصلی است ، و یا مسطح است. این ثبات بین یک خط حامی و یک خط مقاومت محصور شده است که این دو خط یا با هم موازی هستند(مثل یک متوازی الاضلاع) و یا به سمت هم مایل هستند که باعث می شوند الگو شبیه یک پرچم شود. روند اصلی ، میله پرچم است. هنگامی که قیمت با

شکست ثبات ، دوباره وارد روند شود ، هدف قیمت طول کلی میله پرچم است که از سطح شکست نرخ اندازه گیری می شود.

لگوی پرچم از امتداد اتصال محدوده ای از تغییرات قیمت در میانه یک روند به وجود می آید که شیبی کم و خلاف جهت روند قبل از خود دارد. این الگو معمولاً مدت زمان زیادی پایدار نمی ماند و خیلی زود شکسته می شود. با شکسته شدن امتداد خطوط الگو بازار به اندازه ابتدای روند قبلی تا نقطه آغاز اولین موج الگوی پرچم پیش روی دارد.

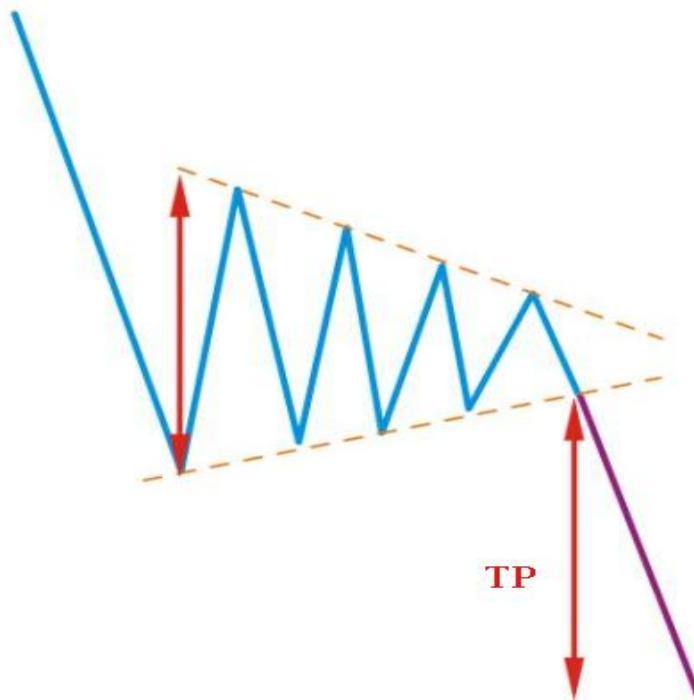
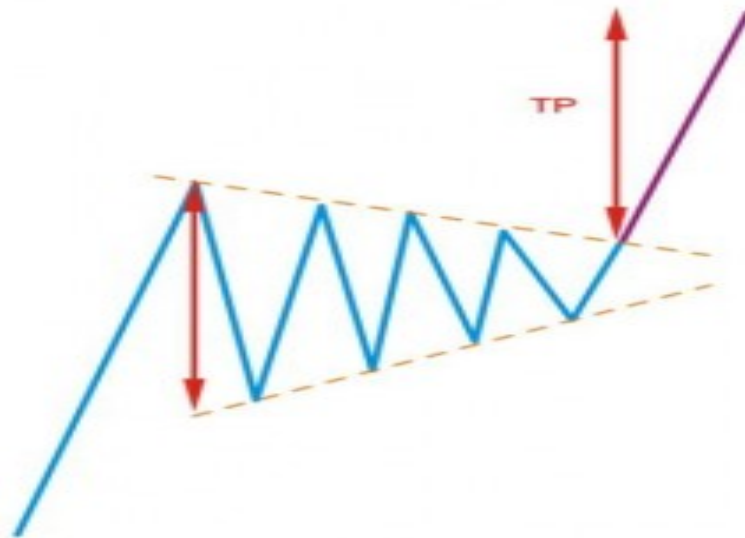


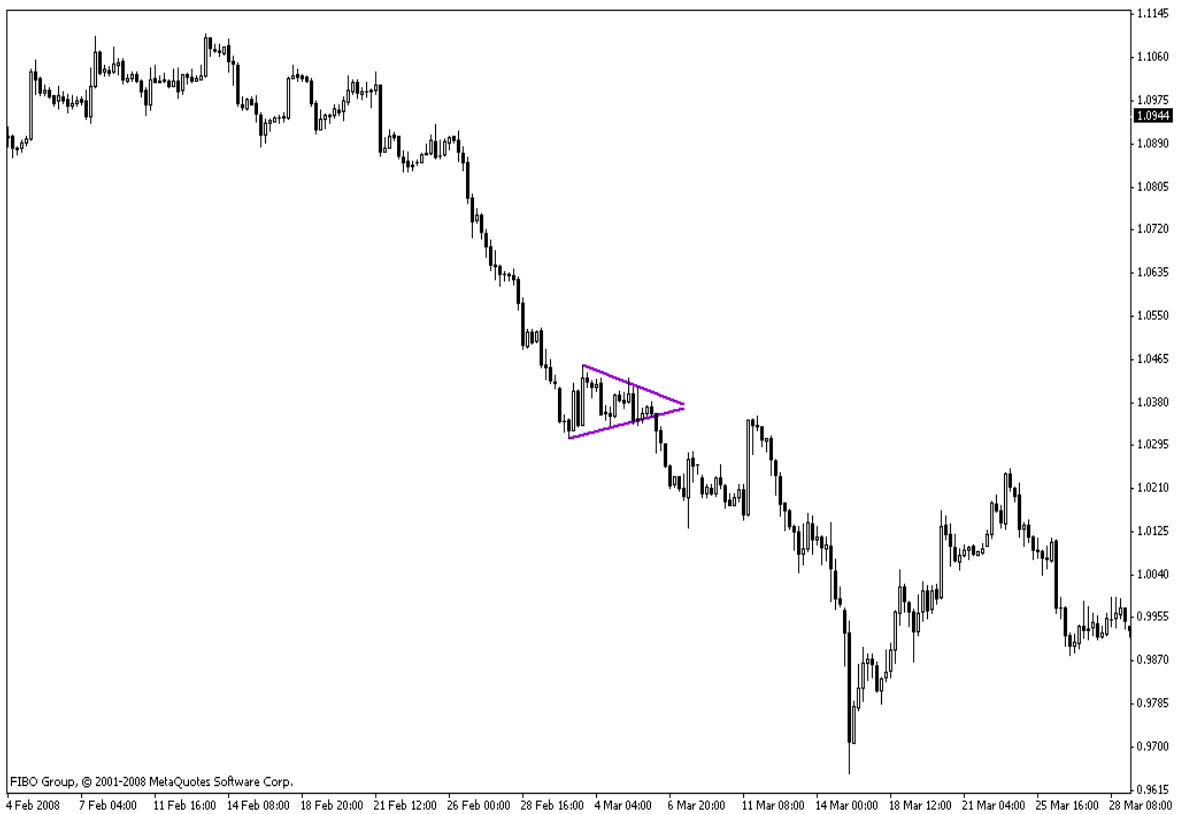


الگوی پرچم سه گوش

الگوی پرچم سه گوش مانند الگوی پرچم در میانه یک روند تشکیل می شود با این تفاوت که اتصال خطوط پیشینه و کمینه در داخل الگو موازی نبوده و متقارن می باشند. شیب اتصال خطوط پیشینه و کمینه در این الگو حتما باید زیاد باشد و قبل از آن حتما روند با شیب زیاد داشته باشیم در غیر این صورت یک الگوی مثلث افزایشی را تشخیص داده ایم. در این الگو دو هدف قیمتی داریم، هدف اول مانند شکل اندازه قاعده اولین حرکت تصحیحی داخل الگو می باشد و حد سود دوم به اندازه فاصله آغاز روند صعودی قبلی تا نقطه

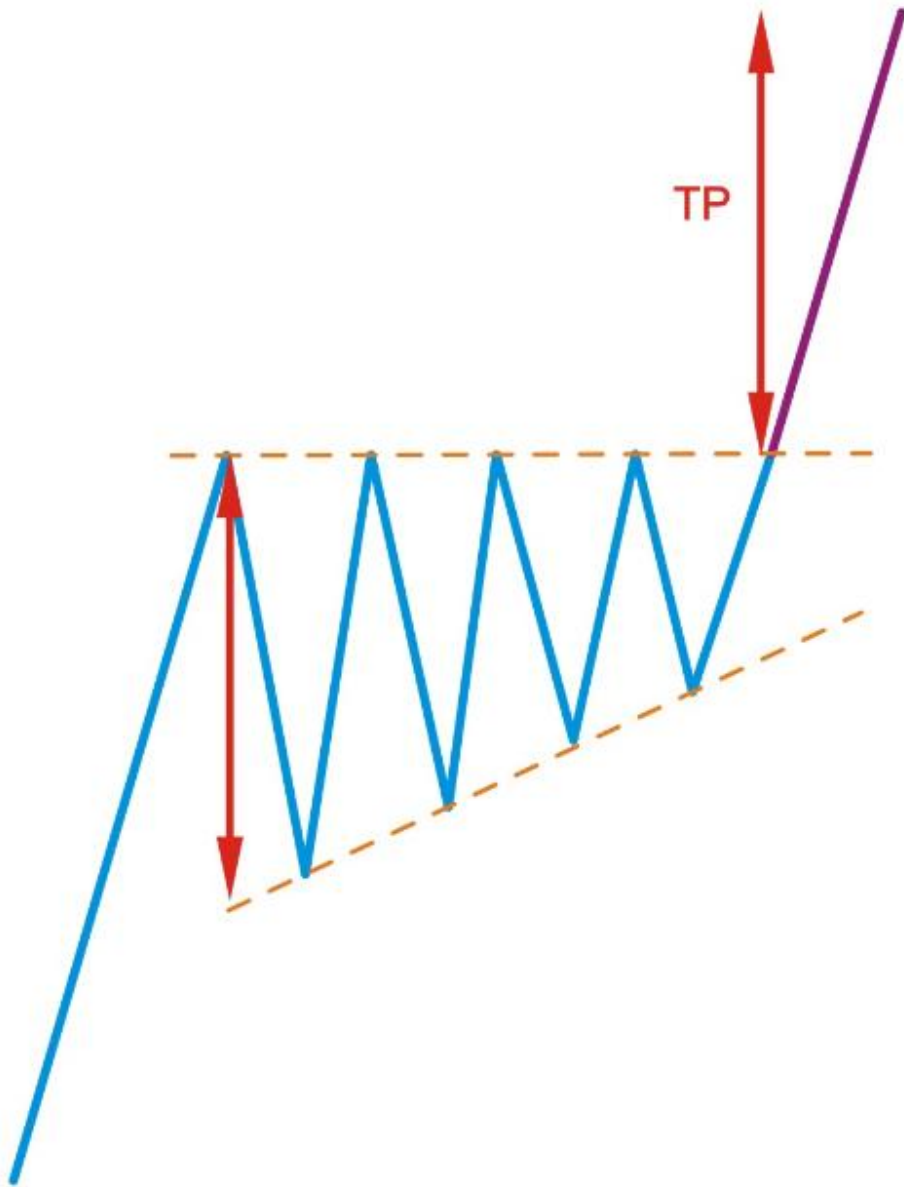
تشکیل الگو می باشد که با شکسته شدن یکی از خطوط بالایی و پایینی الگو انتظار داریم قیمت پیش روی کند.





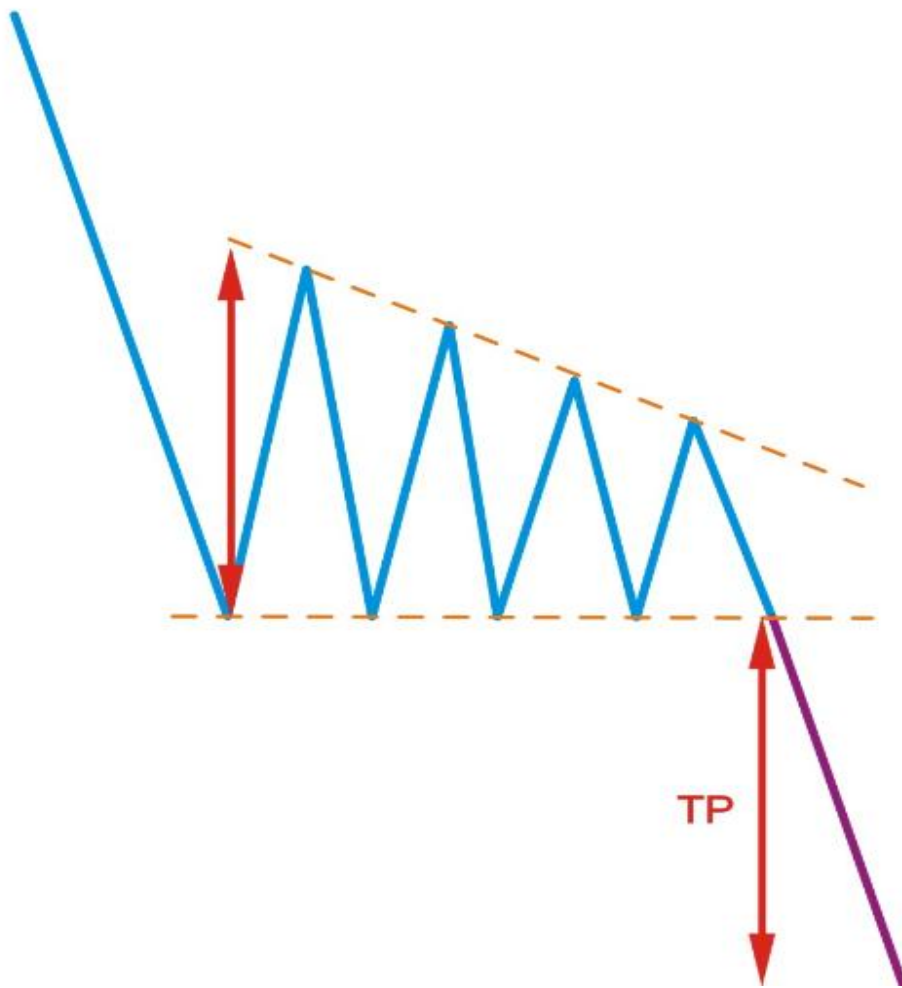
الگوی مثلث

الگوی مثلث افزایشی حالتی از تغییرات قیمت است که قیمت هر بار در صعودهایش در محدوده ای از مقاومت متوقف می شود در حالی که پس از بازگشت از این محدوده مقاومت هر بار به دره یا کمینه قبل از خود نمی رسد. امتداد خطوط پایینی در اتصال به مقاومت بالایی، الگویی می سازد که نشان دهنده آغاز یک حرکت قوی بازار می باشد. تغییرات قیمت معمولاً خط مقاومت در این الگو را می شکند و می توان انتظار داشت که به اندازه قاعده اولین حرکت داخل مثلث افزایشی بازار در جهت بالایی افزایش داشته باشد. این الگو معمولاً بعد از یک روند افزایشی به وجود می آید با اینکه هیچ الزامی به این روند افزایشی نمی باشد.





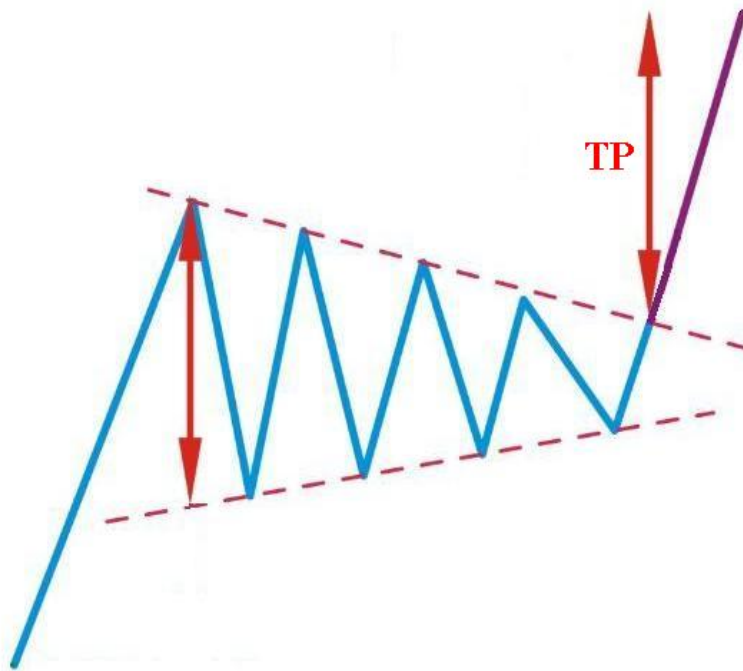
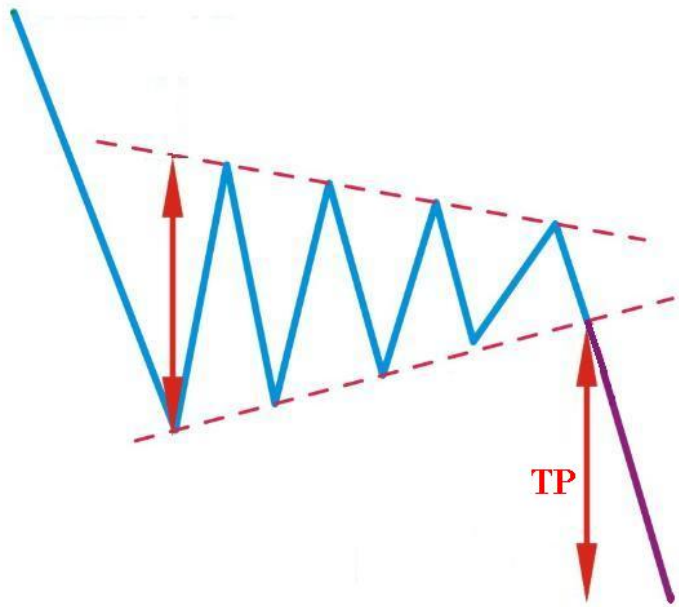
الگوی مثلث کاهشی حالتی از تغییرات قیمت است که قیمت هر بار در نزول هایش در محدوده ای از حمایت متوقف می شود در حالی که پس از بازگشت از این محدوده حمایت هر بار به قله یا بیشینه قبل از خود نمی رسد. امتداد خطوط بالایی در اتصال به مقاومت پایینی، الگویی می سازد که نشان دهنده آغاز یک حرکت قوی بازار می باشد. تغییرات قیمت معمولاً خط حمایت در این الگو را می شکند و می توان انتظار داشت که به اندازه قاعده اولین حرکت داخل مثلث کاهشی بازار در جهت پایینی کاهش داشته باشد. این الگو معمولاً بعد از یک روند کاهشی به وجود می آید با اینکه هیچ الزامی به این روند کاهشی نمی باشد.





الگوی مثلث متقارن Symmetrical Triangles

مثلث متقارن یا همسان‌الگویی دیگر از خانواده مثلث‌ها می‌باشد که معمولاً بعد از یک روند کاهشی یا افزایشی به وجود می‌آید گرچه هیچ الزامی برای این مورد وجود ندارد. در این الگو حرکات صعودی و نزولی داخل الگو به حمایت‌ها یا مقاومت‌های قبل از خود نمی‌رسند به همین جهت امتداد این خطوط مثلثی متقارن را ایجاد می‌کند. با شکسته شدن امتداد نقاط به هم متصل شده بالایی و پایینی در الگو می‌توان انتظار داشت موج جدید به اندازه فاصله اولین قاعده درونی مثلث پیش روی داشته باشد.

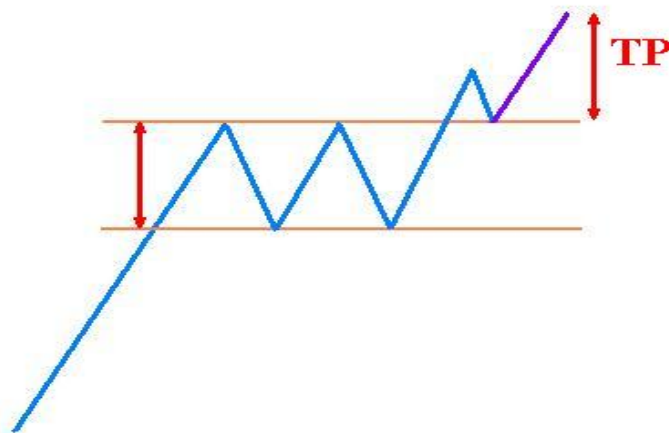
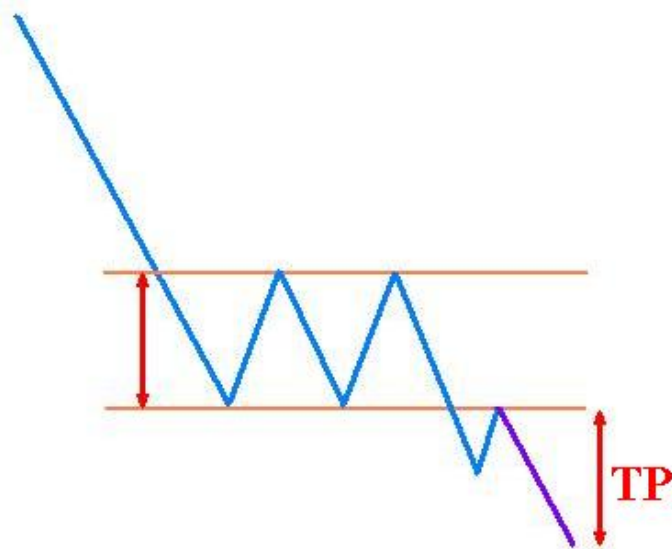




الگوی مستطیل

الگوی مستطیل بعد از یک روند کاهشی یا افزایشی تشکیل می شود که امتداد خطوط بیشینه و کمینه درون آن موازی- افقی بوده و تشکیل یک مستطیل فرضی را می دهد. حداقل دو بار قیمت ها باید به امتداد خطوط بالایی و پایینی در این الگو برخورد کرده باشد. برای حد سود انتظار داریم بعد از شکسته شدن خط

بالایی در روند افزایشی و خط پایینی در روند کاهشی هدف قیمتی جدید به اندازه فاصله درونی دو خط موازی درون الگو پیش روی نماید.







منابع

- کتاب تحلیل تکنیکال جان مورفی ، مترجم : کامیار فراهانی
-

1395

تکنیکال پیشرفته



مهندس فرهاد سلطانی

<http://mql.blogfa.com/>

1395

مقدمه

در سالهای گذشته به علت اولویت بندی اهدافم، علاقه ای به پر رنگ شدن در بازار بورس و ... نداشتم و طبیعتاً هم تهیه جزوه و فعالیت در گروهها و... زمانی تعریف نشده بود و نتیجتاً فعالیتی هم نداشتم. چون بیشتر انرژی بنده در زمینه مطالعه و تحقیق بوده است. اما این شرایط زمانی، برای بنده فراهم شده تا تجربیات و مطالعات خودم را بین علاقمندان به حوزه تحلیل تکنیکال در میان بگذارم. این جزوه حاصل سالها مطالعه، تحقیق، تدریس و جمع آوری از منابع مختلف است. و این اولین جزوه رسمی بنده بوده و این نوشتار را به عنوان شروع این رسالت فرهنگی بنده در نظر بگیرید. باشد که در این مسیر با پیشنهادات و انتقادات خودتان، راهنمایی بفرمایید.

باتشکر

فرهاد سلطانی- پاییز ۹۵

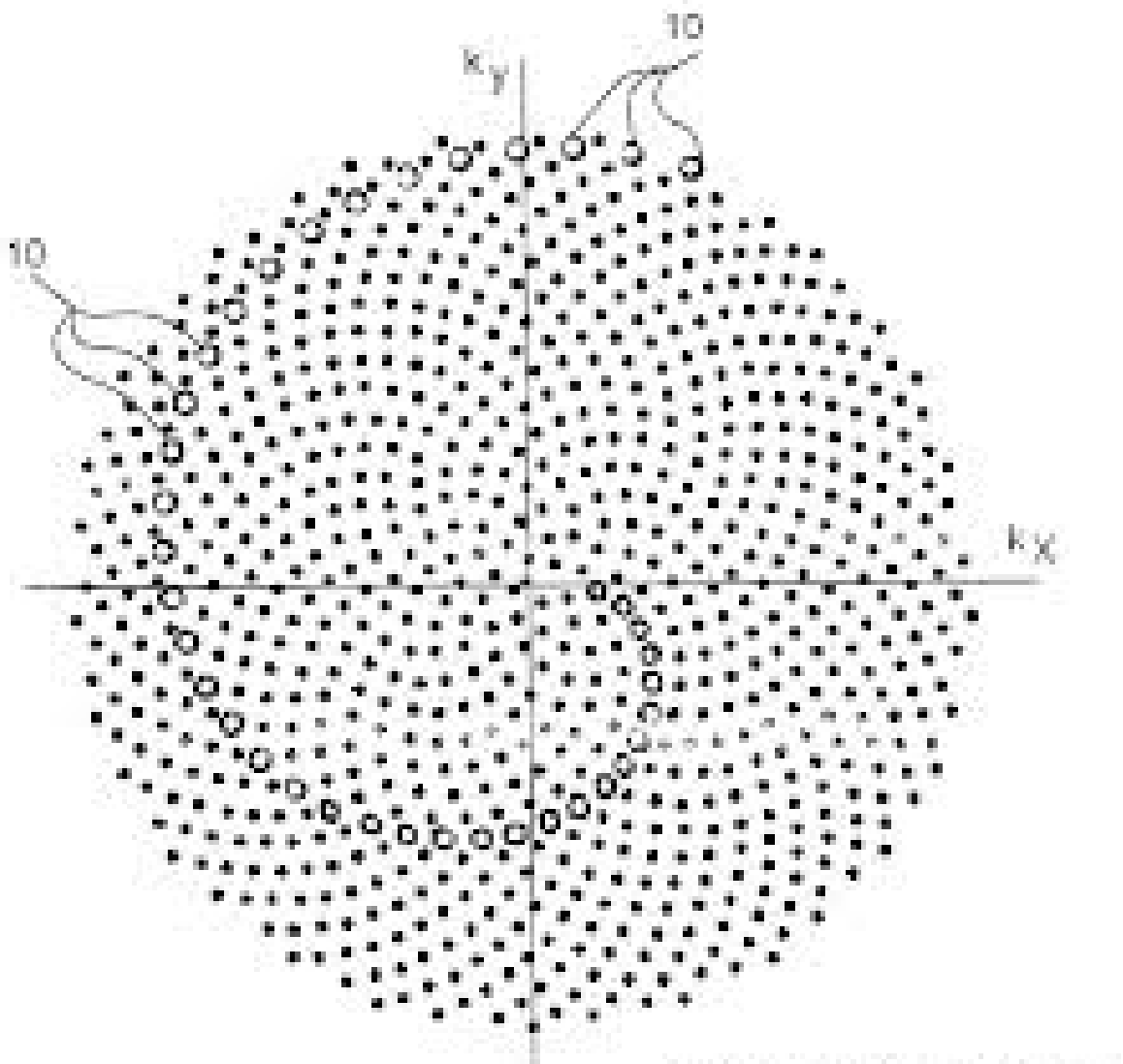
۰۹۱۰ ۹۲۹ ۱۳۷۳

iran_analyst_stock@yahoo.com

<http://mql.blogfa.com>



Fibonacci



Fibonacci

فیبوناچی

لئوناردو فیبوناتچی نخستین ریاضیدان بزرگ اروپا در قرن سیزدهم است. از آنجایی که زادگاه او شهر پیزا در ایتالیا بوده به لئوناردو دا پیزا نیز معروف است. بیشتر کارهای وی مأخوذ از آثار ریاضیدانهای مسلمان به خصوص خوارزمی، کرجی و ابوکامل می باشد.

دنباله فیبوناچی

در دوران حیات فیبوناچی مسابقات ریاضی در اروپا بسیار مرسوم بود، در یکی از همین مسابقات که در سال ۱۲۲۵ در شهر پیزا توسط امپراتور فردریک دوم برگزار شده بود مسئله زیر مطرح شد:

فرض کنیم خرگوش‌هایی وجود دارند که هر جفت (یک نر و یک ماده) از آنها که به سن ۱ ماهگی رسیده باشند به ازاء هر ماه که از زندگی‌شان سپری شود یک جفت خرگوش متولد می کنند که آنها هم از همین قاعده پیروی می کنند حال اگر فرض کنیم این خرگوشها هرگز نمی میرند و در آغاز یک جفت از این نوع خرگوش در اختیار داشته باشیم که به تازگی متولد شده اند حساب کنید پس از n ماه چند جفت از این نوع خرگوش خواهیم داشت؟

0,1,1,2,3,5,8,13,21,34,55,89,144,233,377,610,987,1597,...

خواص اعداد فیبوناچی

۱. هر عدد از مجموع دو عدد قبلی بدست می آید.
۲. نسبت هر عدد به عدد بعدی خود به ۰.۶۱۸ میل می کند
۳. نسبت هر عدد به عدد قبلی خود به ۱.۶۱۸ میل می کند.
۴. نسبت هر عدد به دو عدد بعدی خود به ۰.۳۸۲ میل می کند.
۵. نسبت هر عدد به دو عدد قبلی خود به ۲.۶۱۸ میل می کند.
۶. نسبت هر عدد به سه عدد بعدی خود به ۰.۲۳۶ میل می کند.
۷. تقسیم عدد اول به دوم $1/1=1$ می گردد.
۸. تقسیم عدد دوم به عدد سوم $0.5=1/2$ می گردد.
۹. ریشه دوم یا جذر ۰.۶۱۸ برابر ۰.۷۸۶ و ریشه دوم یا جذر ۱.۶۱۸ برابر ۱.۲۷۲ می گردد.
۱۰. معمولا اعداد را بصورت درصد نمایش می دهند که عبارتند از :

23.6% - 38.2% - 50% - 61.8% - 78.6% - 100 %

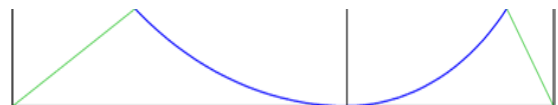
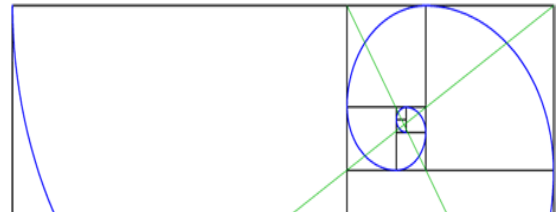
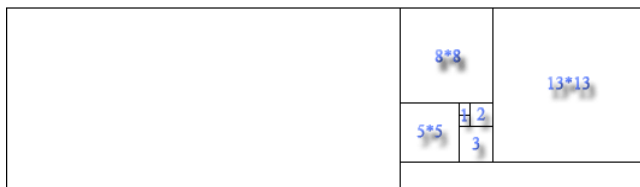
127.2% - 161.8% - 200% - 261.8% - 300% - 323.6% - 423.6%

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L
	1	2	3	5	8	13	21	34	55	89	144
1	1.0000	2.0000	3.0000	5.0000	8.0000	13.0000	21.0000	34.0000	55.0000	89.0000	144.0000
2	0.5000	1.0000	1.5000	2.5000	4.0000	6.5000	10.5000	17.0000	27.5000	44.5000	72.0000
3	0.3333	0.6667	1.0000	1.6667	2.6667	4.3333	7.0000	11.3333	18.3333	29.6667	48.0000
5	0.2000	0.4000	0.6000	1.0000	1.6000	2.6000	4.2000	6.8000	11.0000	17.8000	28.8000
8	0.1250	0.2500	0.3750	0.6250	1.0000	1.6250	2.6250	4.2500	6.8750	11.1250	18.0000
13	0.0769	0.1538	0.2308	0.3846	0.6154	1.0000	1.6154	2.6154	4.2308	6.8462	11.0769
21	0.0476	0.0952	0.1429	0.2381	0.3810	0.6190	1.0000	1.6190	2.6190	4.2381	6.8571
34	0.0294	0.0588	0.0882	0.1471	0.2353	0.3824	0.6176	1.0000	1.6176	2.6176	4.2353
55	0.0182	0.0364	0.0545	0.0909	0.1455	0.2364	0.3818	0.6182	1.0000	1.6182	2.6182
89	0.0112	0.0225	0.0337	0.0562	0.0899	0.1461	0.2360	0.3820	0.6180	1.0000	1.6180
144	0.0069	0.0139	0.0208	0.0347	0.0556	0.0903	0.1458	0.2361	0.3819	0.6181	1.0000

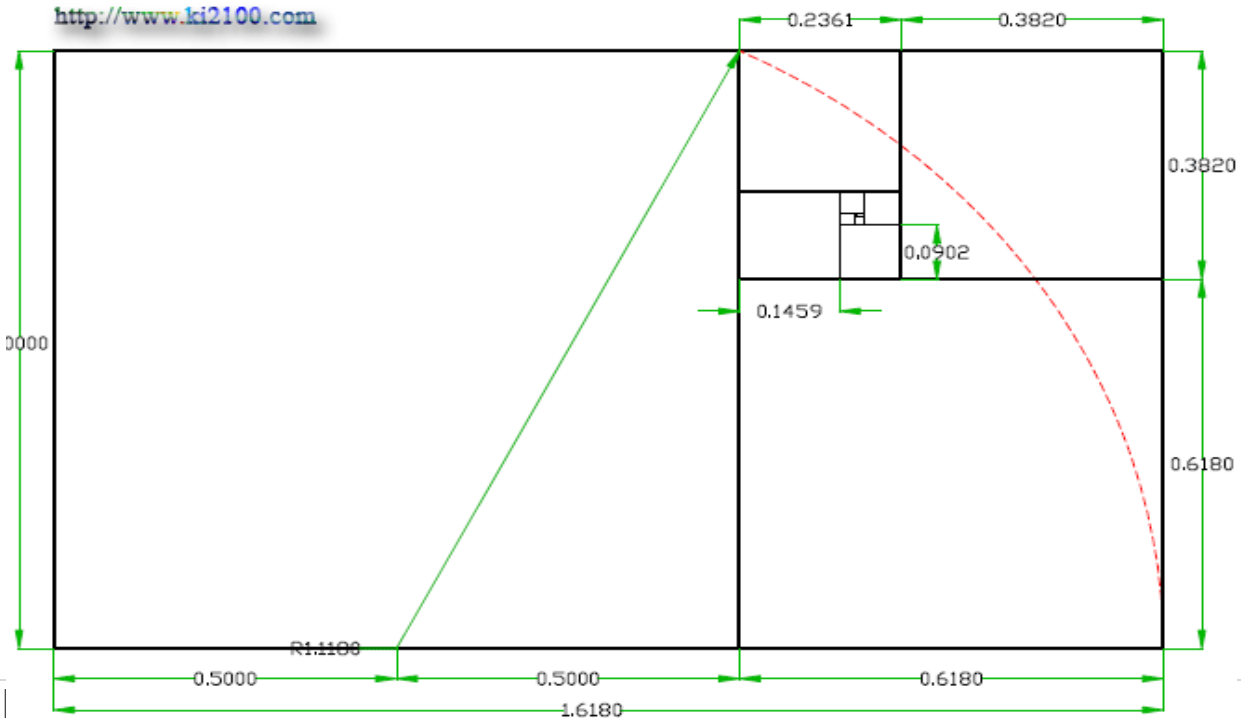
نسبت طلایی

به نظر می رسد که این رشته به عدد طلایی نزدیک می شود. اگر نسبت عدد چهارم این رشته را به عدد قبلی حساب کنیم به عدد ۱.۶۱۸ می رسیم که با تقریب ۱۴ رقم اعشار نسبت طلایی را نشان می دهد. نسبت جملات متوالی به عدد طلایی میل می کند. که یونانیان آنرا با حرف فی Φ نمایش می دهند.

توسعه هندسی دنباله فیبوناچی یا سری از اعداد



<http://www.ki2100.com>



کاربردهای عدد طلایی

از زمانی که هنرمندان و معماران به عمد شروع به استفاده از نسبت طلایی کردند ، نشان داده شد که مخاطبان شیفتگی و شیدایی بیشتری نسبت به کارهای آنها از خود نشان دادند . مستطیل‌های طلایی ، مانند نسبت طلایی فوق‌العاده ارزشمند هستند . در بین مثال‌های بی‌شمار از وجود این نسبت و یکی از برجسته‌ترین آنها مارپیچ‌های DNA است . این دو مارپیچ فاصله دقیقی را با هم براساس نسبت طلایی حفظ می‌کنند و دور یکدیگر می‌تابند.

در حالی که نسبت طلایی و مستطیل طلایی جلوه‌های زیبایی را از طبیعت و ساخته‌های دست انسان به نمایش می‌گذارد ، جلوه دیگری از این شکوه وجود دارد که زیبایی‌های تحرک را به نمایش می‌گذارد . یکی از بزرگ‌ترین نمادهایی که می‌تواند رشد و حرکات کاینات را نشان دهد ، اسپیرال طلایی است . اسپیرال طلایی که به آن اسپیرال لگاریتمی و اسپیرال متساوی‌الزاویه نیز می‌گویند هیچ حدی ندارد و شکل ثابتی است . روی هر نقطه از اسپیرال می‌توان به هر یک از دو سو تا بی‌نهایت حرکت کرد . از یک سو هرگز به مرکز نمی‌رسیم و از سوی خارجی نیز هرگز به انتها نمی‌رسیم . هسته اسپیرال لگاریتمی وقتی با میکروسکوپ مشاهده می‌شود همان منظره‌ای را دارد که وقتی به اندازه هزاران سال نوری به جلو می‌رویم . دیوید برگامینی در کتاب ریاضیاتش خاطر نشان می‌کند که منحنی ستاره‌های دنباله‌دار از خورشید کاملاً شبیه به اسپیرال لگاریتمی است . عنکبوت شبکه تارهای خود را به صورت اسپیرال لگاریتمی می‌بافد . رشد باکتری‌ها دقیقاً براساس رشد منحنی اسپیرال است . هنگامی که سنگ‌های آسمانی با سطح زمین برخورد می‌کنند ، مسیری مانند اسپیرال لگاریتمی را طی می‌کنند . عدد فی Φ عددی مربوط به خلقت پروردگار یکتا است . اسب‌های آبی ، صدف حلزون‌ها ، صدف نرم‌تنان ، موج‌های اقیانوس‌ها ، سرخس‌ها ، شاخ‌های جانوران و نحوه قرار گرفتن گلبرگ‌های گل آفتاب‌گردان و چیدمان گل مروارید ، همه به صورت اسپیرال لگاریتمی است . گردباد و منظومه‌ها از نگاه بیرون کاملاً در

مسیری به صورت اسپیرال حرکت می‌کنند. طرح مطالب در این زمینه بسیار زیاد است که در آینده به آن خواهیم پرداخت. امروزه در طراحی مانیتورهای LCD پهن (wide) از این تناسب بهره می‌جویند یعنی دقت 1050×1680 یعنی 1.6 . 1050×1680 برای اینکه داشتن نما و دید در این تناسب برای طراحان، گرافیک‌ها و ضروری است. موضوعی که در گذشته به آن اهمیت داده نمی‌شد ولی صنعت سینما و آن را لازم دانست.

کاربرد سری فیبوناچی در بورس

بازار سهام مجموع نوساناتی به هم پیوسته است که از امواجی از درجه کوچک به بزرگ شکل گرفته میتوان گفت ای بازار مشابه ضرب المثلی است که میگوید زندگی فرایندی است دو قدم به جلو و یک قدم به عقب. بازار هم بعد از هر کاهش یا افزایشی موج قبلی خود را اصلاح (بازگشت) کرده و مجدداً روند قبلیش را از سر میگیرد این امواج در بازار توسط خطوط فیبو قابل تفکیک میباشند. در صورتی که بپذیریم نوسانات بازار توسط میلیون ها خطوط حمایت و مقاومت موضعی شکل گرفته بعد از آن میشود نقاط اصلاحی (بازگشت) روند قبل را توسط خطوط فیبوناچی تخمین زد.

ابزارهای فیبوناچی

۱. خطوط تصحیح فیبوناچی داخلی Retracement
۲. ابزار تصویرگر Projection
۳. ابزار توسعه Extension
۴. ابزار کمانی Arc
۵. ابزار بادبزن Fan
۶. فیبو ناچی Time

Retracement

خطوط تصحیح فیبوناچی داخلی

در یک روند صعودی زمانهای نزول هم وجود دارد که به آنها اصلاح Correction گفته می شود. عمده تلاش تحلیل تکنیکال یافتن جهت روند و معامله در انتهای یک اصلاح می باشد. خطوط تصحیحی فیبوناچی داخلی نسبت های کوچکتر از ۱۰۰٪ هستند زیرا پایان یک اصلاح کوچکتر از حرکت قبل از آن است.

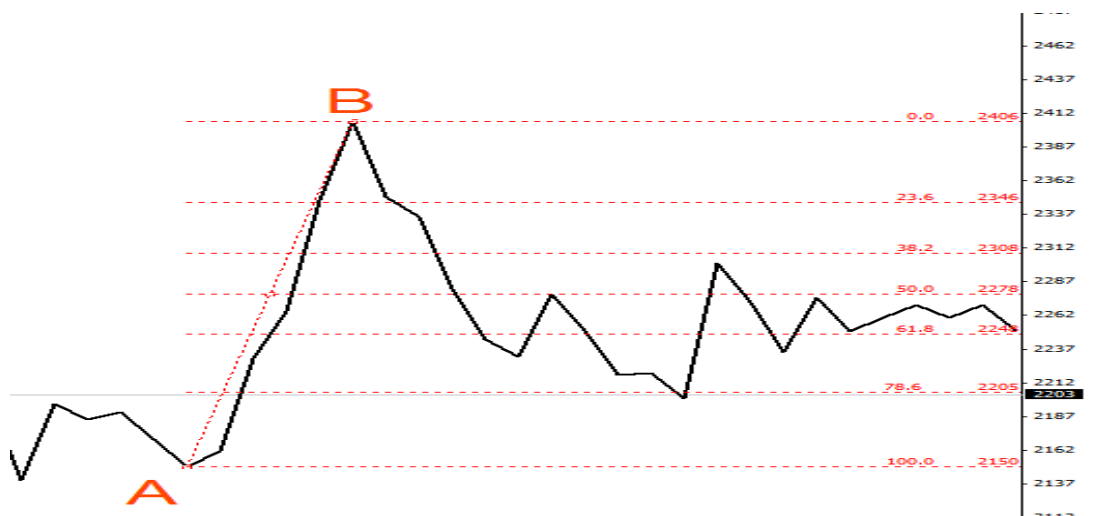


سطوح تصحیح فیبو داخلی مهم: ۶۱.۸، ۷۸.۶، ۵۰، ۳۸.۲٪

سوال اینست که از روی کدام سطوح فیبو برگشت قیمت صورت می گیرد؟ باید منتظر تریگر روی سطوح فیبو بمانیم.

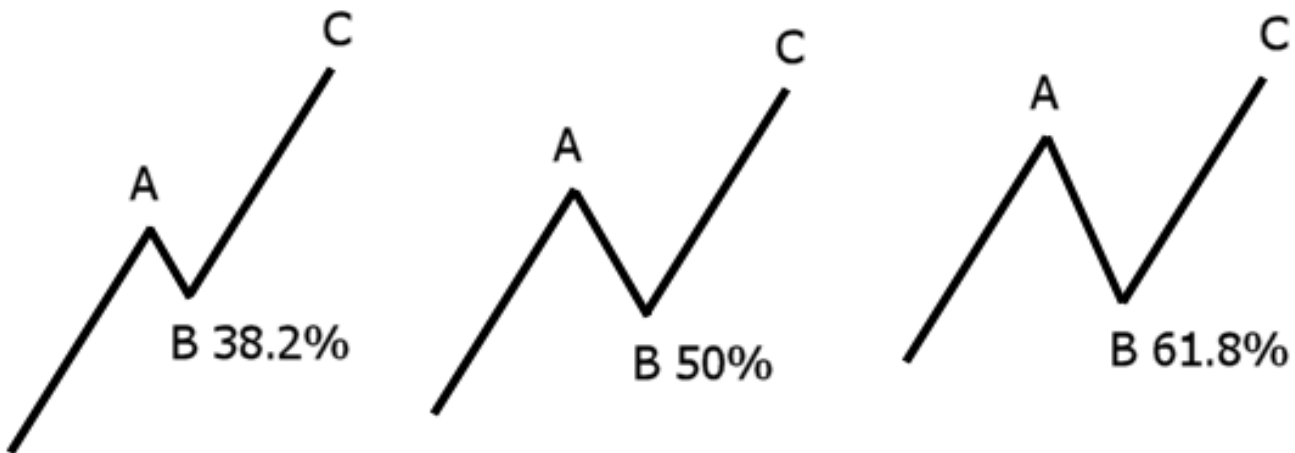
نحوه رسم فیبو Ret

فیبو ret یک ابزار دو نقطه ای می باشد برای رسم آن باید روی دو نقطه از چارت کلیک کنیم. ابتدا نقطه A و سپس نقطه B را انتخاب می کنیم.



قدرت برگشت

هرچه سطح با درصد کمتری برخورد نماید قدرت برگشت آن بیشتر است.



اگر نقطه ورود C روی فیبو 38.2 RET باشد، نقطه خروج D روی فیبو 261.8 EXT خواهد بود.

اگر نقطه ورود C روی فیبو 50 RET باشد، نقطه خروج D روی فیبو 200 EXT خواهد بود.

اگر نقطه ورود C روی فیبو 61.8 RET باشد، نقطه خروج D روی فیبو 161.8 EXT خواهد بود.

اگر نقطه ورود C روی فیبو 78.6 RET باشد، نقطه خروج D روی فیبو 127.2 EXT خواهد بود.

Fibonacci projection

خطوط تصویرگر

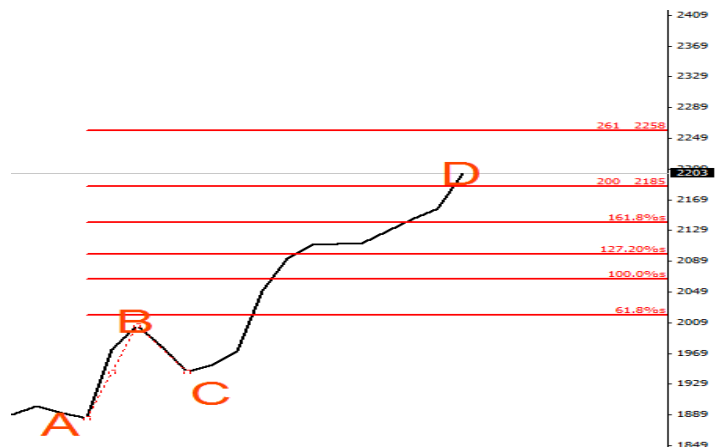
سطوح خارجی مهم: ۴۲۳.۶، ۲۶۱.۸، ۱۶۱.۸، ۱۲۷.۲٪

فیبوناچی Projection ابزاری مانند فیبوناچی اکستنشن می باشد و نقاط بازگشت بیش از ۱۰۰ درصد بازگشت هر موج را نمایش می دهد با این تفاوت که میزان بازگشت تصحیح قیمت در یک موج برای بدست آوردن نقاط بالای ۱۰۰ درصد آن روند اهمیت دارد. متاسفانه ابزار فیبوناچی پروجکشن در متاتریدر به اشتباه Fibonacci Expansion نامگذاری شده است. در حالیکه به لحاظ تعریف علمی این ابزار کاربرد فیبوناچی پروجکشن را نمایش می دهد. برای استفاده از فیبوناچی پروجکشن ابزار فیبوناچی اکسپنشن متاتریدر را انتخاب می کنیم سپس از یک بیشینه قیمت (در شکل زیر نقطه A) به کمترین

قیمت آن روند (نقطه B) خط رسم می کنیم. نقطه سوم که میزان تصحیح قیمت در این روند نزولی می باشد را در نقطه C تعیین می کنیم. بعد از رسم صحیح فیبوناچی پروجکشن انتظار خواهیم داشت قیمت از درصدهای ۶۱.۸-۱۰۰-۱۶۱.۸ و حتی ۲۶۱.۸ به روند نزولی خاتمه دهد و روند صعودی پیدا کند. به بیان دیگر این درصدها می تواند ساپورت هایی برای بازگشت قیمت باشند. درصدهای ۶۱.۸-۱۰۰-۱۶۱.۸ و ۲۶۱.۸ میزان ادامه روند نزولی می باشند که نقطه آغازین محاسبه آخرین نقطه تصحیح روند (نقطه C) می باشد. در شکل زیر دیده می شود بازار نسبت به نقاطی که با فلش مشخص شده (۱۶۱.۸ درصد و ۲۶۱ درصد) عکس العمل نشان داده است. شایان ذکر است در یک روند صعودی این نقاط بصورت معکوس مورد استفاده قرار میگیرند تا نقاط رزیستنس انتهایی یک روند صعودی محاسبه گردد.

نحوه رسم فیبو Pro

ابتدا نقطه AB انتخاب سپس نقطه BC انتخاب می کنیم.



Fibonacci Expansion

فیبوناچی اکسپنشن شباهت بسیار زیادی به فیبوناچی پروجکشن دارد و ادامه یک روند نزولی یا صعودی را تا نقطه پایانش محاسبه می کند. تنها تفاوت آن با فیبوناچی پروجکشن استفاده از دو نقطه به جای سه نقطه است. در یک روند نزولی فیبوناچی پروجکشن درصدهای ۶۱.۸ - ۱۰۰ - ۱۶۱.۸ و ۲۶۱ نقاط A تا B را از نقطه آغازین C مورد محاسبه قرار می دادیم تا نقاط D و E بدست بیاید اما در اینجا تنها به درصدهای نقاط A تا B نیاز داریم و با استفاده از درصدهایی که برای فیبوناچی اکسپنشن ذکر کردیم انتظار داریم بازار ۱۶۱.۸٪ - ۲۶۱.۸٪ - ۴۲۳.۶٪ از نقطه آغازین حرکت داشته باشد. از همین رو فیبوناچی اکسپنشن را تلفیقی از فیبوناچی اکسپنشن و فیبوناچی پروجکشن می دانند. برای رسم فیبوناچی اکسپنشن ابزار خاصی در متاتریدر تعریف نشده است اما میتوان با استفاده از فیبوناچی ریتریسمنت درصدهای بیش از ۱۰۰ واحد موج اولیه، نقاط بازگشت فیبوناچی اکسپنشن را بدست آورد.

اصول کار با فیبوناچی Arcs و نحوه رسم

فیبوناچی Arcs ابزاری از گروه فیبوناچی ها می باشد که درصد های تصحیح و بازگشت یک روند را بصورت کمانی نمایش نشان می دهد درصدهای عمومی مورد استفاده در این ابزار ۳۸.۲ - ۵۰ و ۶۱.۸ درصد می باشند که کمان های برگشت قیمت را نسبت به یک روند صعودی یا نزولی نمایش می دهند.



شکل بالا نمونه استفاده از ابزار فیبوناچی آرک را نمایش می دهد درصدهای ۵۰ و ۶۱.۸ در شکل بالا برای روند تصحیح نزولی حکم رزیستنس را ایفا کرده و باعث روند نزولی قیمت شده اند.

اصول کار با فیبوناچی Fan و نحوه رسم

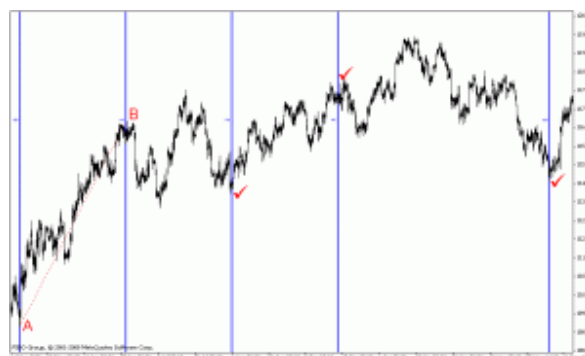
فیبوناچی Fan ابزاری دیگر از گروه ابزارهای فیبوناچی می باشد که بر اساس زاویه روند غالب نقاط بازگشت را از برخورد خط های بادبزنی (فن) با قیمت بدست می آورد. در این ابزار نیز درجه های (درصدهای) $۳۸.۲ - ۵۰$ و ۶۱.۸ از اهمیت بیشتری برخوردار هستند.



رسم و استفاده از این ابزار در متاتریدر به علت نقص در رسم درجه های قیمت و نشان ندادن درجه های قیمت روند صعودی کاربرد چندانی ندارد. اما میتوان برای رسم درجه های یک روند صعودی از قسمت **Properties** و **Fibo Levels** با منفی وارد کردن درصدهای **Description** زاویه های مخالف را برای روند صعودی ترسیم کرد.

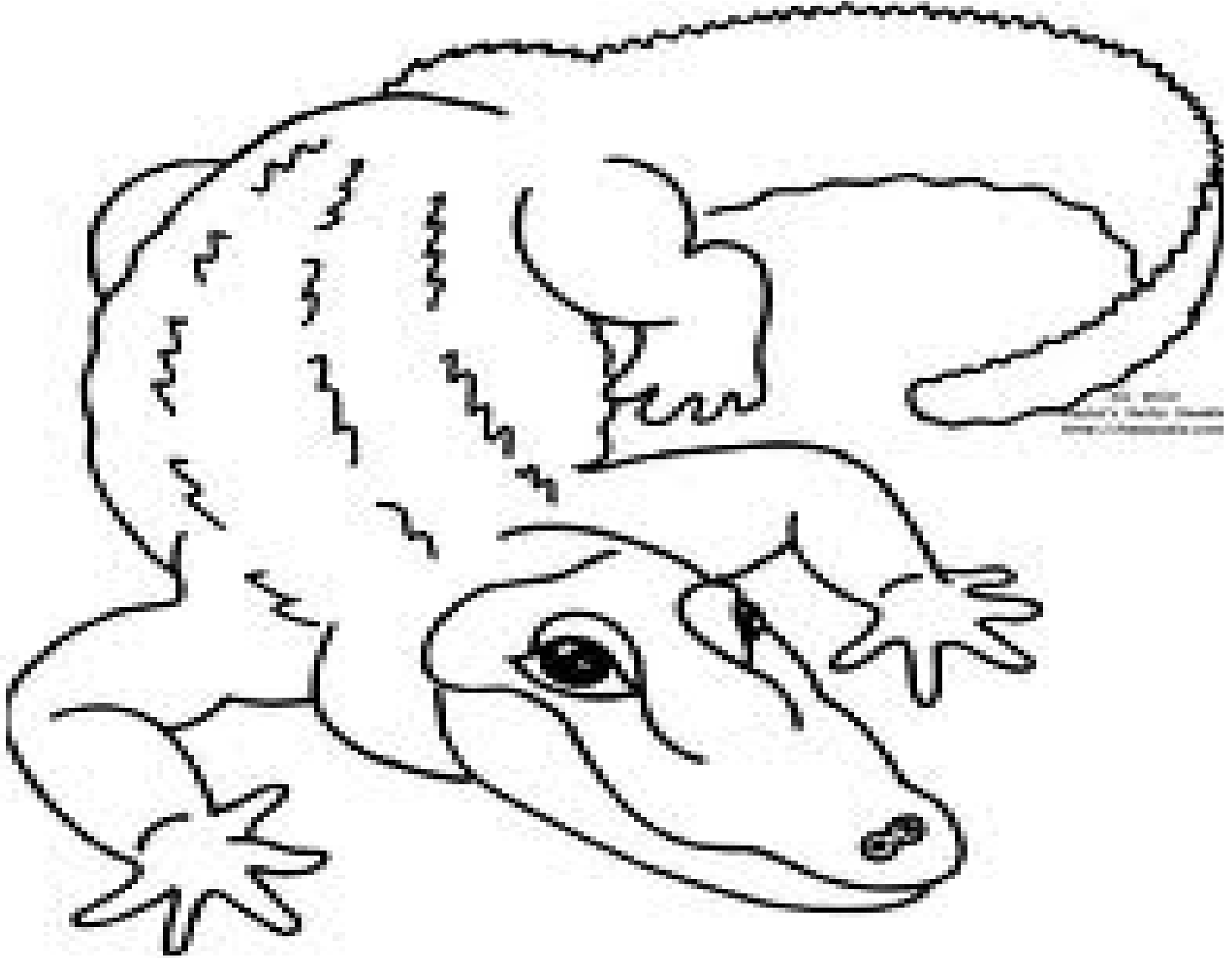
اصول کار با فیبوناچی Time و نحوه رسم

فیبوناچی تایم یا فیبوناچی زمانی ابزاری است که نقاط بازگشت قیمت را بر اساس زمان تعیین می کند از این ابزار به دو روش استفاده می کنند. در روش اول فاصله زمانی دو قله را به عنوان صفر و یک محاسبه میکنند و در نقاطی که زمان به خطوط عمودی $۱-۲-۳-۵-۸$ و الی آخر می رسد انتظار ریزش دوباره قیمت را دارند.



در روش دوم مانند مثال بالا، فاصله زمانی پایین ترین قیمت (Low) تا بالاترین قیمت (High) یک موج محاسبه می شود. سپس انتظار می رود در بازه های زمانی ۱-۲-۳-۵-۸ و الی آخر قیمت تغییر جهت بدهد و موج های جدید تشکیل شود.

Bill Williams Chaos Theory



تئوری بی نظمی بیل ویلیامز

بیل ویلیامز توانست از تلفیق جنبه های روانی بازار و تئوری بی نظمی روش جدیدی را برای تحلیل ابداع کند. او چنین عنوان کرد که نتایج مورد انتظار یک فرد از معامله یا سرمایه گذاری بوسیله عوامل روانی فرد تعیین می شود. از اینرو کسی می تواند یک معاملگر خوب باشد و بطور مداوم به سود خود بیفزاید که بتواند به نظم نهفته در حرکات اتفاقی و به ظاهر غیر قابل پیش بینی بازار پی ببرد.

در نتیجه دو جنبه مهم در هر معامله خودآگاهی و دوم شناخت ساختار بازار می باشد. و از نظر او اگر ساختار بازار خوب درک شود بدست آوردن سود آسان است. بدین منظور باید از حقایق درونی بازار که به ان ابعاد بازار گفته می شود آگاه شویم. با کنار هم قرار دادن ابعاد این وجوه بدست می آید:

۱. چرخش Fractal یا فاز تغییرات که از طریق اندیکاتور fractal

۲. جنبش Momentum یا فاز انرژی از طریق اندیکاتور awesome

۳. شتاب یا کندی acceleratin/deceleration

۴. نواحی تجارت zone

۵. خط تعادل معاملات balance line

Alligator

اندیکاتور تمساح یا جهت یاب

تمساح، اندیکاتوری است که برای نشان دادن فقدان، جهت یا شکل گیری یک روند طراحی شده است. "بیل ویلیامز" به رفتار تمساح به عنوان یک تمثیل برای رفتار بازار نگاه می کرد. به این صورت که به محض بیدار شدن تمساح، زمان ساکت به زمان شکار قیمت تبدیل می شود و پس از پایان تغذیه برای خوابیدن برمی گردد. تمساح هرچه بیشتر بخوابد، گرسنه تر می شود و حرکت بازار، قوی تر خواهد بود.

کاربرد

این شاخص به سه خط میانگین حرکتی هموار شده در دوره های زمانی ۱۳، ۸ و ۵ تقسیم بندی می شود که به ترتیب توسط نوارهای ۸، ۵ و ۳ به آینده انتقال پیدا می کنند و با رنگ های آبی، قرمز و سبز مشخص می شوند که نمایانگر آواره، دندان و لب های تمساح هستند.

هنگامیکه این سه خط میانگین در هم می پیچند و در یک خط افقی باریک حرکت می کنند، به معنای خواب بودن تمساح است. هرچه بیشتر این سه خط از هم فاصله بگیرند، حرکت قیمت زودتر به وقوع خواهد پیوست. ادامه حرکت صعودی این خطوط (حرکت خط سبز به دنبال خطوط آبی و قرمز) خبر از شکل گیری یک روند صعودی را می دهد که ما آن را به عنوان یک سیگنال قلمداد می کنیم. اگر خطوط میانگین یکدیگر را در یک حرکت اصلاحی نزولی همراهی کنند، سیگنالی قوی از وقوع یک روند نزولی خواهد بود؛ به همین دلیل، فروش در این نقطه مناسبتر خواهد بود.



محاسبه

قیمت متوسط = (بالا + پایین) / ۲

آرواره تمساح (SMMA) = قیمت متوسط، ۱۳، ۸ jaw

دندان های تمساح (SMMA) = قیمت متوسط، ۸، ۵ Teeth

لب های تمساح (SMMA) = قیمت متوسط، ۵، ۳ Lips

Gator Osilator

نوسانگر تمساح

نوسانگر تمساح (Gator Oscillator) مکمل اندیکاتور تمساح است و در کنار آن استفاده می شود تا درجه کاملی از همگرایی/واگرایی سه خط میانگین حرکتی اندیکاتور تمساح را نشان دهد که اشاره دارند به دوره های خواب و بیداری تمساح (یعنی مراحل که بازار در روند به سر می برد یا نمی برد)

کاربرد

نوسانگر تمساح (Gator Oscillator) ، به عنوان یک نوسانگر متشکل از دوگونه آرایش نمودار ستونی در بالا و پایین خط صفر، اختلاف کامل بین دندان و آرواره تمساح (خطوط قرمز و آبی) در محوطه مثبت و اختلاف کامل بین لب ها و دندانهای تمساح (خطوط سبز و قرمز) در محوطه منفی را ترسیم می کند. اگر حجم میله ای از میله ای قبلی اش در این نمودار ستونی بیشتر شود، رنگ آن سبز می شود و اگر کمتر شود، رنگ آن قرمز می شود.

میله های با طول بسیار زیاد در ارتباط با نیروهای روند قدرتمند هستند.

دوره فعالیت تمساح به چهار بخش تقسیم می شود:

۱. تمساح بیدار می شود - میله های در دو طرف خط صفر، دو رنگ متفاوت دارند.
۲. تمساح تغذیه می کند - میله ها در دو طرف خط صفر، سبز رنگ هستند.
۳. تمساح کاملاً سیر می شود - یک میله تکی قرمز رنگ در مرحله تغذیه.
۴. تمساح می خوابد - میله ها در هر دو سمت خط صفر، قرمز رنگ هستند.



Fractals

چرخش‌ها

بیل عنوان کرد بهتر است پیش از وقوع اولین چرخش معامله نکنید.

شاخصی است برای مشخص کردن اوج‌ها و فرودهای نمودار در مواقعی که حرکت قیمت متوقف و یا وارونه شده است. این نقاط برگشتی به ترتیب اوج‌ها و فرودها نامیده می‌شود.

کاربرد

چرخش‌ها از یک گروه حدود پنج میله‌ای تشکیل می‌شود که دو تای اولی آنها بطور موفق صعود کرده (یا سقوط) کرده‌اند و دو تای آخری پایین آمده‌اند (یا صعود کرده‌اند) و یکی در وسط بیشترین صعود (یا سقوط) را دارد که در مجموع یک گروه را تشکیل می‌دهند.

- چرخشها خرید، یک پیکان رو به بالا است.
- چرخشها فروش، یک پیکان رو به پایین است.





Awesome Oscillator

اسیلاتور مرموز

نوسان گر مرموز جنبش بازار را تعیین می کند (Awesome Oscillator) یک اندیکاتور شتاب حرکت است که تغییرات دقیق در نیروی محرک بازار را بازتاب می دهد و به تشخیص قدرت روند برای رسیدن به حداکثر نقاط شکل یافتن یا اصلاح کمک می کند.

کاربرد

سه سیگنال اصلی قابل رویت وجود دارند:

۱. بشقاب. از سه ستون پشت سر هم بالای خط صفر، دو ستون اول باید قرمز رنگ باشند (ستون دوم باید کوتاه تر از ستون اول باشد) و ستون سوم باید سبز رنگ بوده و بالاتر از ستون قبلی اش (ستون دومی) باشد. چنین آرایشی یک سیگنال واضح خرید است و اگر همین الگو بطور برعکس در ستون های زیر خط صفر شکل بگیرد، به عنوان سیگنال خرید در نظر گرفته می شود.
۲. قطع کردن خط صفر. اگر ستونی خط صفر را بطور صعودی قطع کند و از آن عبور کند، ارزش خود را از حالت منفی به مثبت تغییر می دهد. ما به چنین حالتی، یک سیگنال خرید می گوییم. اگر حرکت نمودار ستونی در جهت عکس رخ دهد، سیگنال فروش ایجاد می شود.
۳. دو نوک. اگر ستون ها در زیر خط صفر، پشت سر هم دو نوک، شبیه به دو قلۀ واژگون شده را تشکیل دهند بطوریکه نوک دومی از نوک اولی به خط صفر نزدیک تر باشد، یک سیگنال خرید شکل گرفته است. سیگنال فروش هم هنگامی خواهد بود که آرایشی مشابه در بالای خط صفر شکل بگیرد.



Acceleration/Decelration

شاخص افزایش یا کاهش شتاب

شاخص تحلیل تکنیکی Acceleration/Deceleration نشان دهنده شتاب مثبت و شتاب منفی نیروی پیش برنده کنونی بازار است. قاعده عملکردی این اندیکاتور بر اساس فرضیه سازنده آن، "بیل ویلیامز"، است که طبق آن پیش از تغییر جهت حرکت قیمت، از نیروی حرکتی آن کاسته می شود.

کاربرد

بگیرد، تغییر می کند؛ به همین دلیل، از آن برای دریافت زودترین هشدارها در مورد احتمال تغییر جهت روند استفاده می شود.

تغییرات رنگ اندیکاتور به تنهایی می تواند خیلی مهم باشد چراکه خط سبز رنگ کنونی (مستقل از رقمی که نشان می دهد) در مورد پوزیشن های خرید هشدار می دهد و به همین ترتیب خط قرمز رنگ در مورد فروش هشدار می دهد.

اگر معامله گر می خواهد همراه با نیروی پیش برنده بازار، وارد بازار شود باید به رنگ و رقم اندیکاتور توجه داشته باشد. دو ستون متوالی سبز رنگ بالای سطح صفر به شما پیشنهاد می دهد که با یک پوزیشن خرید وارد بازار شوید در حالیکه حداقل دو ستون قرمز رنگ زیر سطح صفر ممکن است به عنوان توصیه ای برای فروش قلمداد شوند.

معمولاً در زمانبندی های کمتر از ۴ ساعته، سیگنال های غیرواقعی و اشتباه بیشتر هستند.

**MFI****شاخص تسهیل بازار**

شاخص تسهیل بازار برای این منظور طراحی شده است که نشان دهد چه مقدار تمایل برای حرکت در بازار وجود دارد. ارزش های ذاتی شاخص برخلاف متحرکهایش در ارتباط با متحرک های حجم، به تنهایی هیچ سینگال معاملاتی ای ارائه نمی دهند.

کاربرد

ارزش های ذاتی شاخص توسط میله های نمودار ستونی نشان داده می شوند که در عین حال، سنجش شاخص و حجم متحرکها با رنگ های مختلف ارائه داده می شوند که به نوبه خود برای قرائت علائم شاخص حیاتی هستند.

۱. ستون سبز رنگ - شاخص تسهیل بازار و حجم، هر دو بالا هستند. افزایش فعالیت معامله به معنای شدت گرفتن حرکت بازار است. در این حالت ممکن است به روند ملحق شویم.

۲. ستون آبی رنگ - شاخص تسهیل بازار، بالا و حجم پایین است. علی رغم افت حجم، حرکت ادامه دارد. روند به زودی وارونه خواهد شد.

۳. ستون صورتی رنگ - شاخص تسهیل بازار پایین و حجم بالا است. حرکت نزولی علی رغم افزایش حجم احتمالاً نشانگر شکستن ۱۸۰ درجه ای به شکل U است.

۴. ستون قهوه ای رنگ - شاخص تسهیل بازار و حجم، هر دو پایین هستند. بازار دیگر تمایلی به جهت کنونی ندارد و به دنبال علائمی از یک گسترش در آینده است.



Elliott Wave Theory

3-PART SONG: (Sonata No. 1) [1-181] (Mozart, Op. 2, K. 10)

Adagio

1st Part, First Antecedent

Full Cadence on II

2nd part

2nd part repeat and completion. Leading on D

Full cadence on the Dominant (with some freedom of the antecedent)

Full Cadence on I

نظریه موج الیوت

۱۹۳۸ کتاب اصول موج به عنوان اولین مرجع برای مبحثی که امروزه به نام نظریه موج الیوت شناخته می شود منتشر شد.

۱۹۶۴ الیوت دو سال قبل از مرگش در سال کتاب راز هستی تلاش و کارهای خود را نوشت.

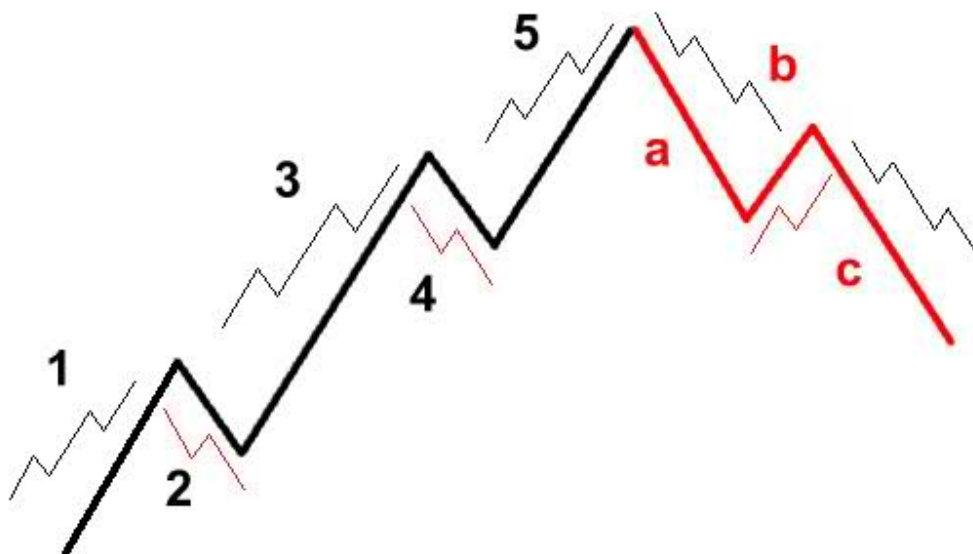
۱۹۷۸ فروست و رابرت پرچتر در با همکاری هم کتاب نظریه موج الیوت را منتشر کردند.

۱۹۸۰ پرچتر در کتاب تلاش های بزرگ الیوت اثری ماندگار باقی گذاشت.

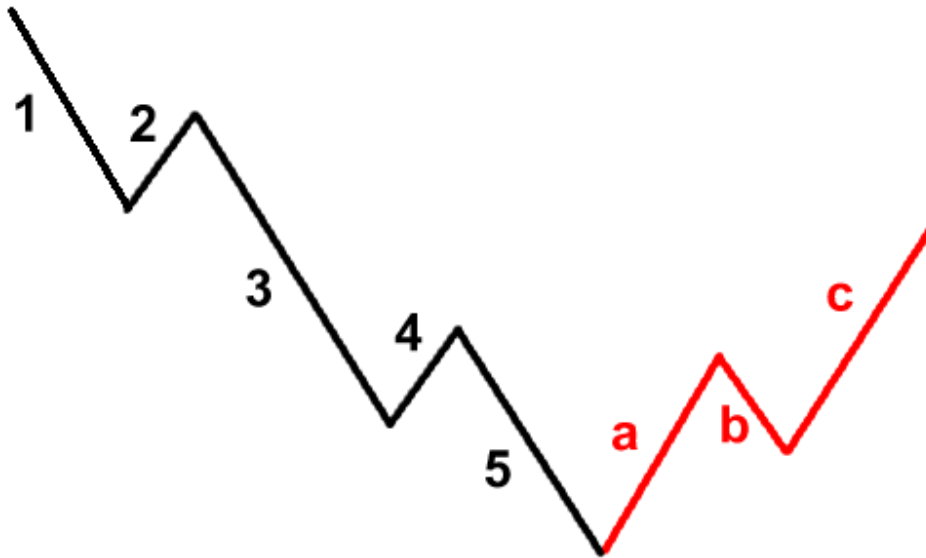
اصول اولیه موج

سه جنبه مهم در نظریه موج وجود دارد: الگو، نسبت، زمان

- الگو در نظریه موج به الگوهای موج و اشکال آن اشاره دارد که مهمترین جزء نظریه است.
 - تحلیل نسبت ها برای تعیین نقاط صحیح و قیمت های هدف از طریق اندازه گیری ارتباط بین موج های مختلف کاربرد دارد.
 - روابط زمان برای تایید کردن الگوهای موج و نسبت ها بکار می رود.
- نظریه موج الیوت اصولاً برای میانگین های بزرگ بازار سرمایه بکار می رود مخصوصاً برای میانگین صنایع داو جونز.
- ابتدایی ترین تعریف این نظریه: بازار سرمایه براساس یک آهنگ یا ریتم مکرر شامل ۵ موج افزایشی حرکت می کند که در ادامه با ۳ موج کاهشی همراه می شود.



موج های ۱-۳-۵ موج های صعودی و موج های ۲-۴ (موج های تصحیح) برخلاف روند صعودی حرکت می کند. بعد از اینکه ۵ موج پیش رونده کامل شد سه موج تصحیح کننده شروع می شوند که با a-b-c مشخص شده اند.

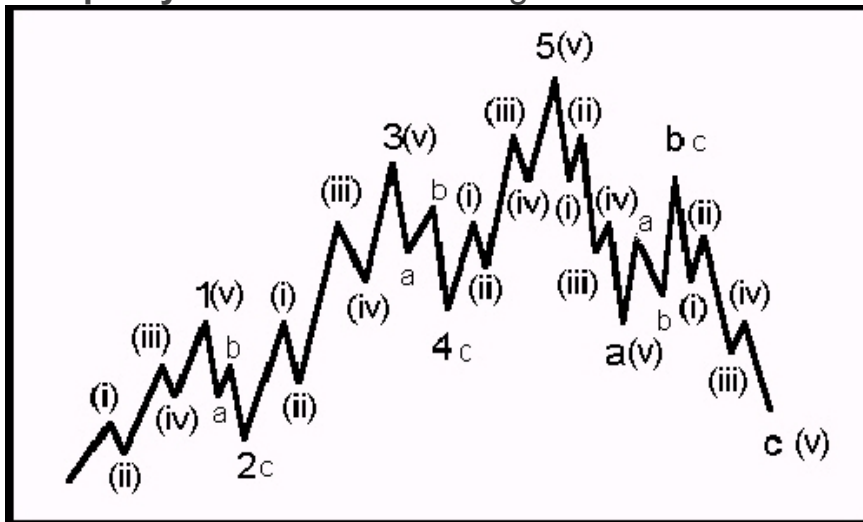


با وجود فرم ثابت امواج، درجات مختلفی از اهمیت آن وجود دارد. روندها درجات بسیار مختلفی دارند. الیوت روند را به ۹ درجه مختلف از لحاظ اهمیت یا بزرگی طبقه بندی کرد که از دوره های عظیم ۲۰۰ ساله تا دوره های چند ساعته را شامل می شود. این نکته را در نظر داشته باشیم که ۸ موج مقدماتی به اینکه در کدام درجه از روند قرار دارد ارتباطی ندارد.

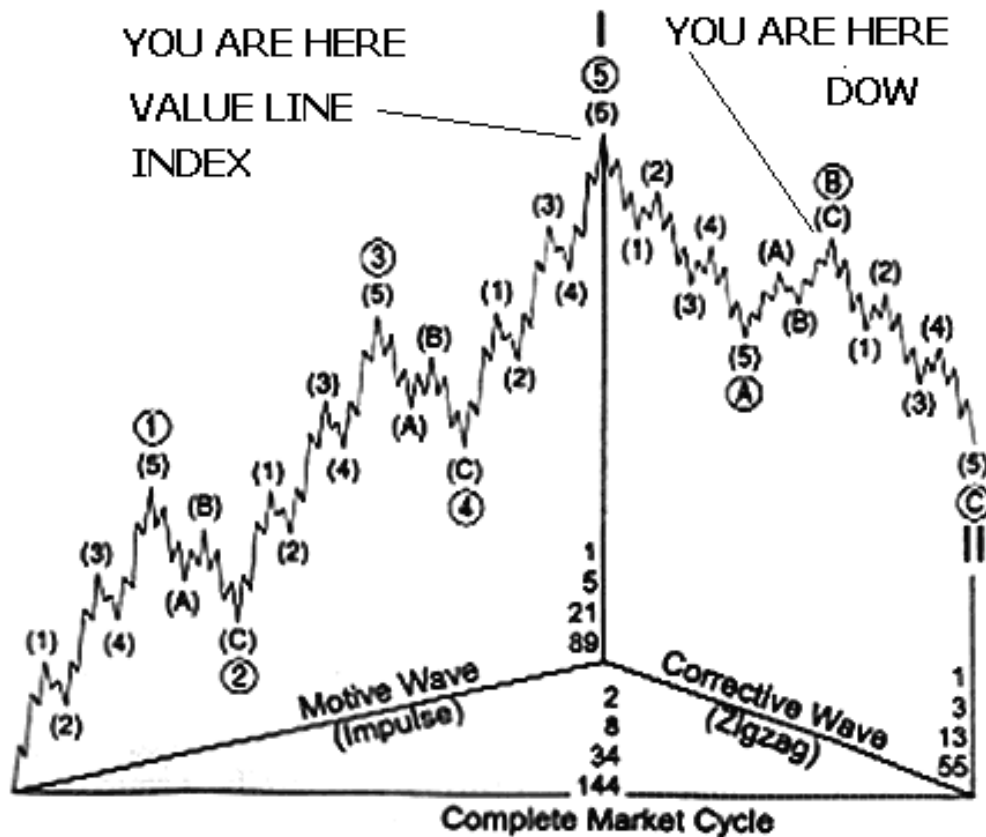
Wave Degree	5s With the Trend					3s Against the Trend		
Grand Supercycle	⓪	Ⓛ	Ⓜ	Ⓝ	Ⓟ	ⓐ	ⓑ	ⓒ
Supercycle	(I)	(II)	(III)	(IV)	(V)	(a)	(b)	(c)
Cycle	I	II	III	IV	V	a	b	c
Primary	Ⓛ	Ⓜ	Ⓝ	Ⓞ	Ⓟ	Ⓐ	Ⓑ	Ⓒ
Intermediate	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(A)	(B)	(C)
Minor	1	2	3	4	5	A	B	C
Minute	⓪	Ⓛ	Ⓜ	Ⓝ	Ⓟ	ⓐ	ⓑ	ⓒ
Minuette	(i)	(ii)	(iii)	(iv)	(v)	(a)	(b)	(c)
Subminuette	i	ii	iii	iv	v	a	b	c

هر موج به موج هایی با درجات کوچکتر تقسیم می شوند. در این حالت هر موج قسمتی از موج بزرگتر و با درجه بیشتر است.

Submicro – minutes to hours	دقیقه به ساعت
Micro - hours to days	ساعت به روز
Subminuette - days to weeks	روز به هفته
Minuette - days to months	روز به ماه
Minute - weeks to months	هفته به ماه
Minor - weeks to quarters	یک چهارم هفته
Intermediate - months to quarters	یک چهارم ماه
Primary - months to years	ماه به سال
Cycle - quarters to years	۱/۴ سال (سه ماه)
Supercycle – years	سالانه
Grand Supercycle – decades or longer	طولانی تر



که در این تقسیم بندی به شماره موجهای ۱-۲-۳-۵-۸-۱۳-۲۱-۳۴-۵۵-۸۹-۱۴۴... می رسیم که این شماره موجها همان سری اعداد فیبوناچی می باشد که پایه و اساس ریاضیات نظریه موج ایوت می باشد.



توانایی مشخص کردن ۳ یا ۵ موج در به کاربردن این نظریه آشکارا اهمیت زیادی دارد. این اطلاعات به تحلیلگر می گوید در آینده منتظر چه چیزی می باشد.

به عنوان مثال حرکت کامل ۵ موج به این معنی است که این فقط قسمتی از حرکت موج بزرگتر کامل شده و این موج بزرگ ادامه دارد (اگر ۵ موج آخر از موج بزرگ نباشد). یک نکته مهم باید به خاطر داشته باشیم که مرحله تصحیح (a-b-c) هرگز در این ۵ موج اتفاق نمی افتد.

اگر در بازار افزایشی ۵ موج نزولی مشاهده شد بیانگر اینست که احتمالاً این اولین موج از ۳ موج کاهشی a-b-c می باشد و احتمالاً شاهد نزول بیشتر روند خواهیم بود.

در بازار کاهشی ۳ موج صعودی باید کاملاً در ادامه روند نزولی باشد و اگر ۵ موج صعودی دیده شد می تواند اخطار واقعی برای شروع حرکت صعودی تلقی شود و احتمالاً ممکن است این اولین موج روند صعودی باشد.

قوانین تحلیلی الیوت

الیوت سه اصل برای تفسیر قانون خود بیان کرد:

۱. موج ۲ هیچ وقت به اندازه صد درصد موج ۱ بازگشت نمی کند.
۲. موج ۳ هیچ وقت کوتاه ترین موج نیست.
۳. موج ۴ هیچ وقت وارد دامنه موج ۱ نمی شود.

ویژگی های موج ها

۱. موج ۱: پیدا کردن این موج کار مشکلی است زیرا این موج اغلب به نظر یک موج اصلاحی می رسد. این موج کوتاه ترین موج در میان موج های حرکتی است.
۲. موج ۲: پیدا کردن این موج بدلیل ساختار سه موجی آن کار آسان تری است. این موج در حدود ۰.۶۱۸ درصد از موج یک ادامه می یابد. معمولاً زیگزاگ ها (یکی از موج های اصلاحی) در این موج ظاهر می شوند.
۳. موج ۳: این موج معمولاً بلند ترین موج در میان موج های حرکتی است و معمولاً امتداد ها (Extensions) در این موج رخ می دهند در هر حال کوتاه ترین موج نیست. در این موج معمولاً حجم معاملات بازار بالاست و اخبار فاندامنتال از این موج حمایت می کنند.
۴. موج ۴: بر اساس قانون تناوب الیوت اگر موج دوم پیچیده باشد موج چهار پیچیده گی کمتری دارد و برعکس. توجه اینکه این موج هیچ وقت وارد حریم موج یک نمی شود.
۵. موج ۵: این موج آخرین موج حرکتی محسوب می گردد و معمولاً بایستی فراتر از اوج نقطه موج سوم پیش روند و اما گاهی این اتفاق نمی افتد و اصلاحاً " شکست " و یا " کوتاه شدگی " (Truncation) رخ می دهد.
۶. موج A: پیدا کردن موج A کار چندان آسانی نیست. بهترین راه برای این کار پیدا کردن موجی با ۵ موج فرعی است.
۷. موج B: موج B ممکن است با تنوعات و پیچیدگی های فراوانی همراه باشد زیرا که در زمان تشکیل این موج آخرین خریداران تلاش دارند که آخرین سودهای خود را از بازاری که صعودی بوده است

کسب کنند و فروشندگان تلاش دارند که وضعیت را امتحان کنند و در صورت امکان دست به فروش بزنند.

۸. موج C: موج C پایان روند را نشان می دهد این موج که بعد از یک بازار صعودی به وجود آمده است با رسیدن به نرخی پایین تر از نرخ حداقل موج A به اتمام می رسد.

موج های تصحیح گر

موج های اصلاحی نسبت به موج های حرکتی از پیچیدگی بیشتری برخوردارند معمولا تا تکمیل نشوند نمی توان آنها را تشخیص داد. برای موج های اصلاحی فقط یک قانون وجود دارد و آن اینکه این موج ها فقط شامل ۵ موج نمی شوند (موج های تصحیح گر هرگز با ۵ موج اتفاق نمی افتد. موج های تصحیح گر ۳ تاهستند) به استثنایی مثلث ها).

(یعنی اینکه چنانچه در یک بازار افزایشی ۵ موج نزولی دیدید این هرگز پایان اصلاح نیست بلکه بخشی از آن است و الگو هنوز کامل نشده است. انواع این موج ها به شرح ذیل می باشند:

۱. زیگزاگ

الگوی ۳ موج تصحیح گر هستند که برخلاف روند بزرگتر حرکت می کنند. ساختار این موج ها بصورت ۵-۳-۵ (از چپ به راست بخوانید). زیگزاگ ها خود شامل سه دسته تنها، دوقلو و سه قلو ظاهر می باشند.

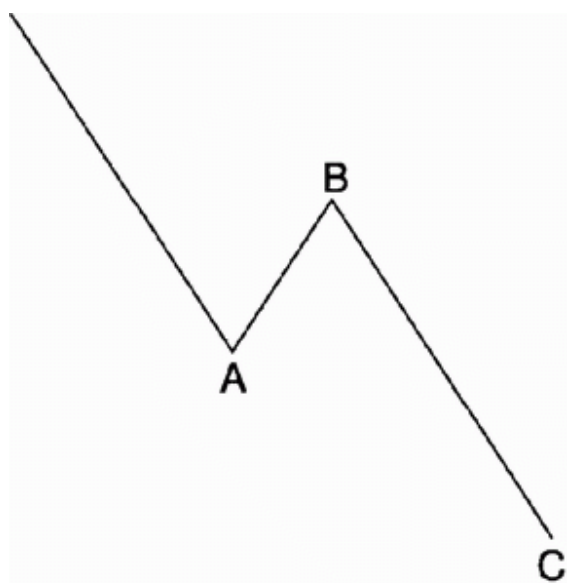


Figure 1-22

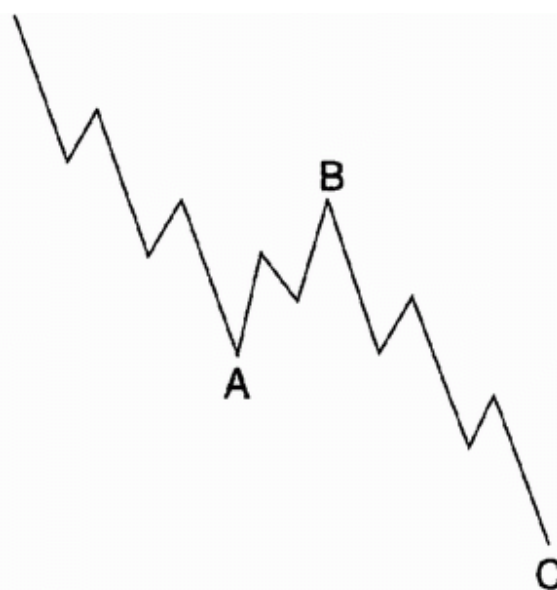


Figure 1-23

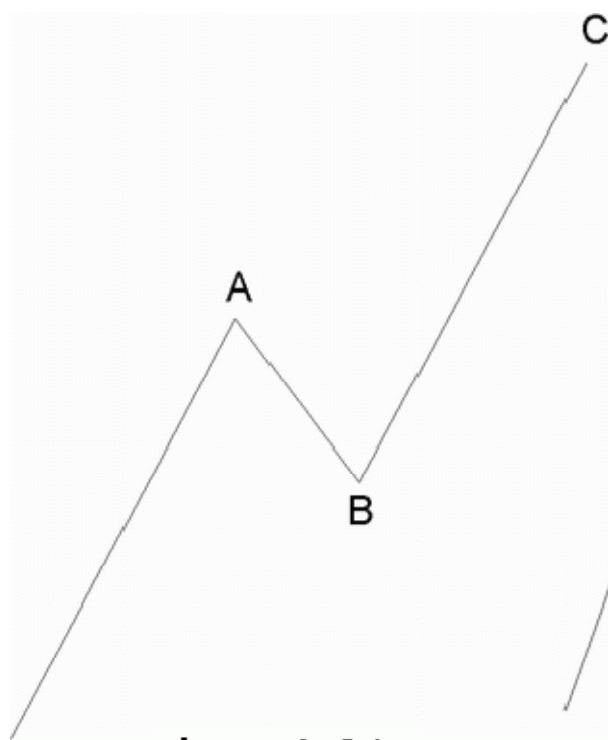


Figure 1-24

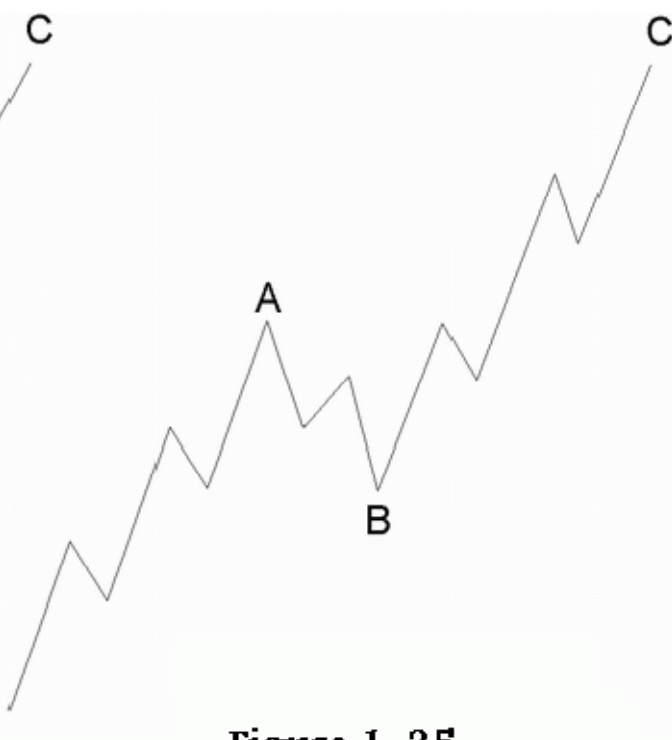
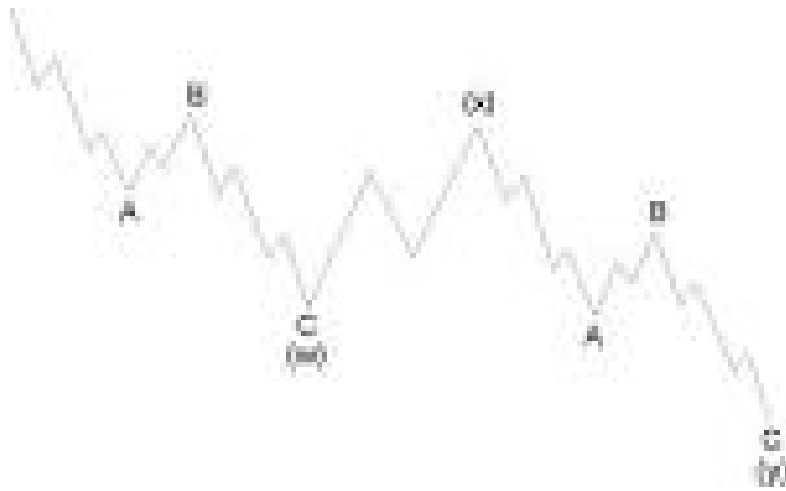


Figure 1-25

می بینید که موج وسط یعنی موج B مقدار کمی به سمت موج A باز می گردد ولی موج C کاملاً از انتهای موج A فراتر رفته است.

زیگزاگ ها بوسیله سری های سه تایی از هم جدا می شوند مانند موج X در شکل فوق.

نکته : هر موجی مانند X نشانگر این است که زیگزاگی دیگر در راه است. از ویژه گی های زیگزاگ ها باید گفت که این موج معمولا در موج دوم از موج های اصلی ظاهر میشود و بندرت در موج چهارم دیده شده است. یکی از انواع زیگزاگ ها که کمتر مشاهده می شود زیگزاگ دابل نام دارد. اغلب در الگوهای بزرگ تصحیحی اتفاق می افتد. این نوع متفاوتی از الگوی زیگزاگ 5-3-5 مرتبط با الگوی a-b-c میانی است.

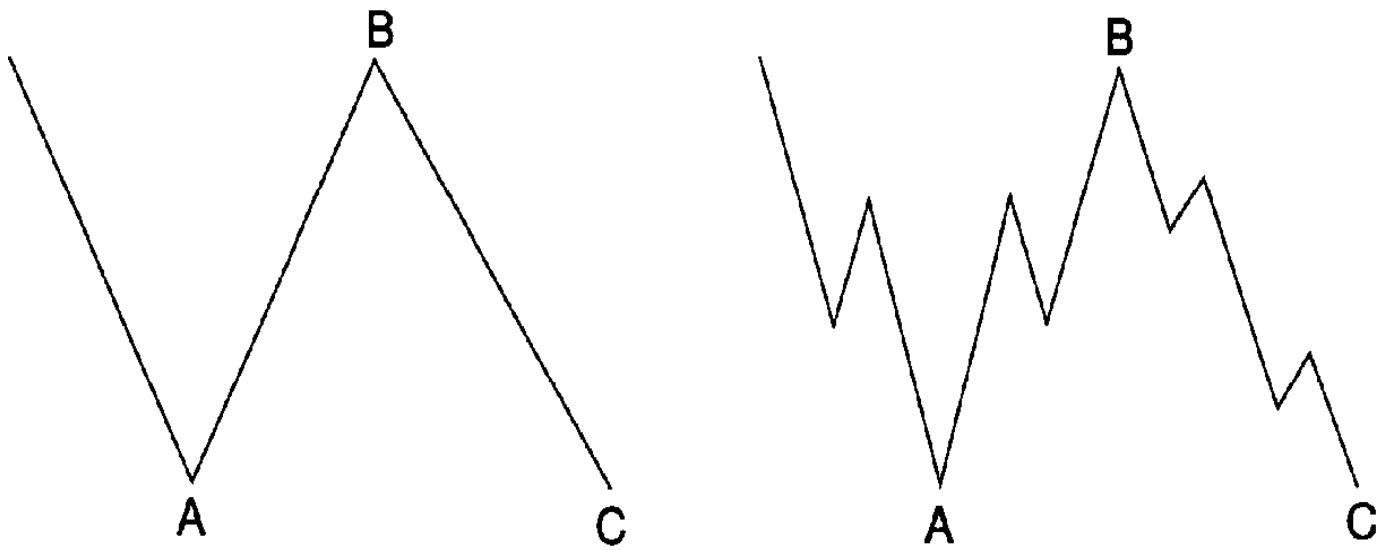


۲. پهنه ها

تمایز بین پهنه ها و زیگزاگ این است که پهنه ها از الگوی ۳-۳-۵ پیروی می کند.

پهنه ها بیشتر علامت تقویت بازار افزایشی هستند و بیشتر الگوی تحکیمی بشمار می آیند تا الگوی تصحیحی.

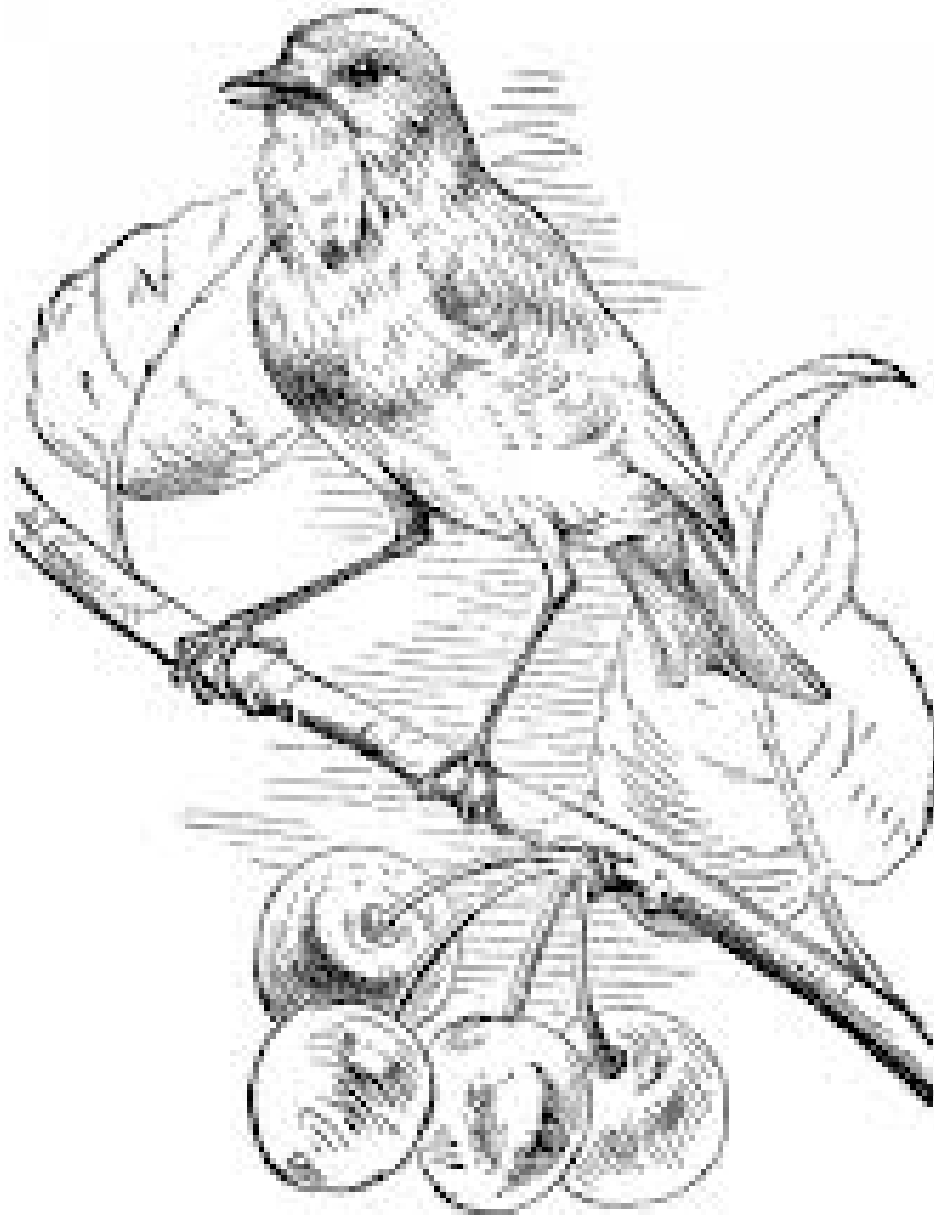
برای مثال در یک بازار افزایشی تا نقطه اولیه موج A صعود می کند که این نشان از قدرت مضاعف روند بزرگ حاکم دارد. موج C نیز به حوالی انتهای موج A باز می گردد برخلاف زیگزاگها که موج C کاملا در پایین انتهای موج A قرار می گیرد.



دو نوع غیر عادی پهنه تصحیحی نیز وجود دارد:

۱. نوع پهن شونده یا منبسط آن به شکل زیر می باشد که موج B فراتر از نقطه شروع موج A بالاتر رفته و انتهای موج C نیز پایین تر از موج A می رود.
۲. نوع دیگری آن: موج B به بالای موج A می رسد ولی موج C نمی تواند به انتهای موج A برسد که این حالت در بازار افزایشی، نشانگر قوی بودن بازار است. که بنام پهنه دونده شناخته شده

Advanced GET



نرم افزار Advanced GET و امواج الیوت

در این نرم افزار امواج به صورت اتوماتیک و با تشخیص خود نرم افزار با شماره های ۱ تا ۵ شماره گذاری می شوند. ما فعلا فقط با اعدادی که با دایره های آبی رنگ مشخص هستند کار می کنیم. دقت داشته باشید که شماره موج در انتهای موج نوشته می شود.

همچنین نظریه الیوت بیان می دارد که در انتهای یک حرکت صعودی یا نزولی ۵ موجی الیوت، یک حرکت شدید در خلاف جهت خواهیم داشت که البته خود ممکن است شامل زیر موج و یا امواج اصلاحی دیگر باشد که در نرم افزار با دایره های قرمز رنگ A – B – C نشان داده می شوند .

قوانین امواج الیوت که همیشه باید آنها را در نظر داشته باشید:

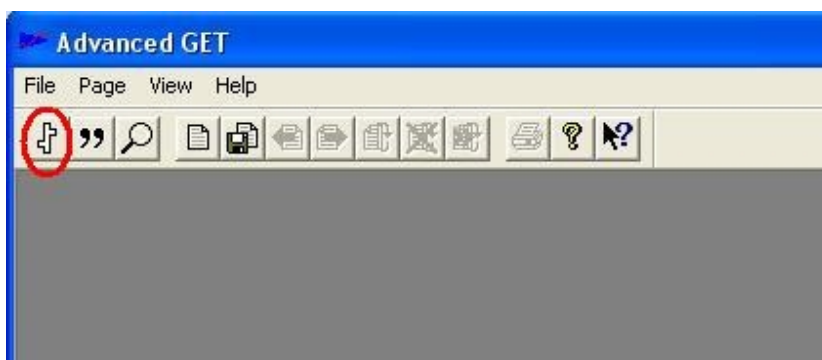
- موج ۳ نباید کوتاهترین موج باشد .یعنی موج ۳ حداقل از یکی از دو موج دیگر (۱ یا ۲) بلندتر می باشد. در بازارهای مالی مانند بورس موج ۳ یا از موج ۵ بزرگتر و یا با آن برابر است.
- موج ۴ نباید با موج ۱ همپوشانی داشته باشد .معنی این جمله اینست که پایان موج ۴ نباید زیر High موج اول باشد (در امواج صعودی) و یا اینکه نباید بالای Low موج ۱ باشد (در امواج نزولی)

راه اندازی و تنظیمات اولیه در Mofid Trader:

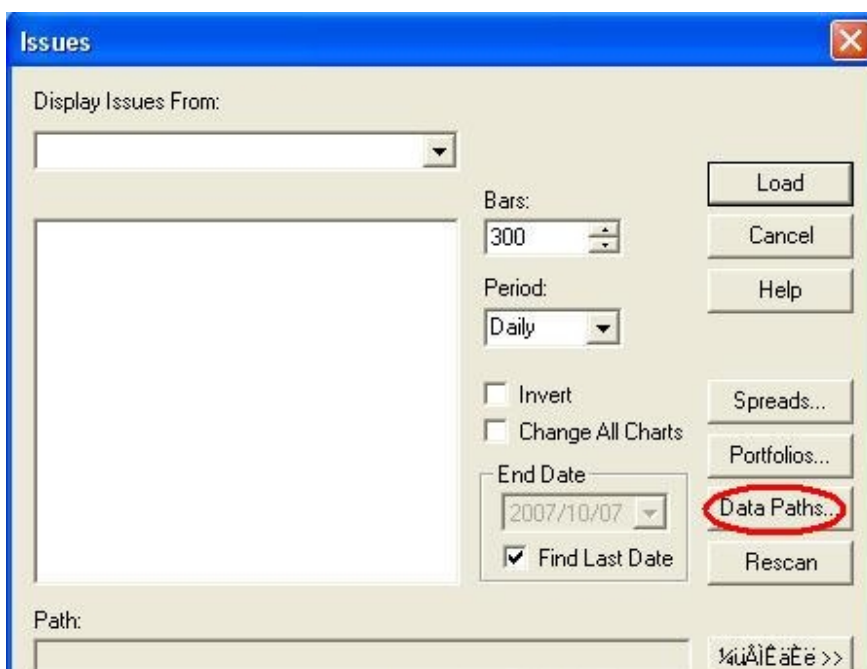
ابتدا اندیکاتور IndSendDataForMofidTrader.mq5 را در پوشه MQL5\Indicators شاخه متاتریدر خود کپی کنید. متاتریدر را اجرا کنید و اندیکاتور را روی چارت مربوطه اضافه کنید. اگر این اندیکاتور را همیشه روی چارت خود داشته باشید با دیدن تایم فریم های مختلف برای هر کدام یک فایل با پسوند PRN در شاخه MQL5/files ایجاد می شود که بعدا آن را توسط Advanced GET باز خواهیم کرد.

راه اندازی و تنظیمات اولیه در Advanced GET:

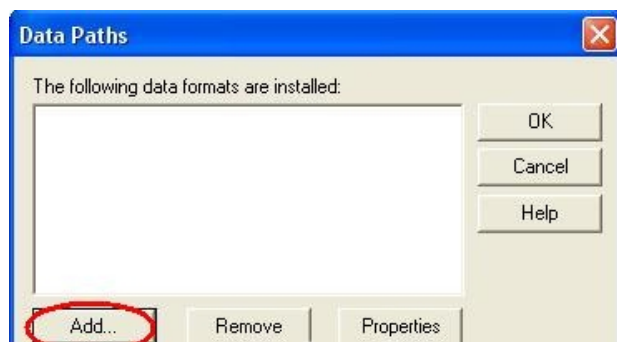
۱. وارد نرم افزار Advanced GET شده که برای انجام تنظیمات بر روی دکمه New Chart کلیک می کنیم:



۲. سپس دکمه: Data Paths:



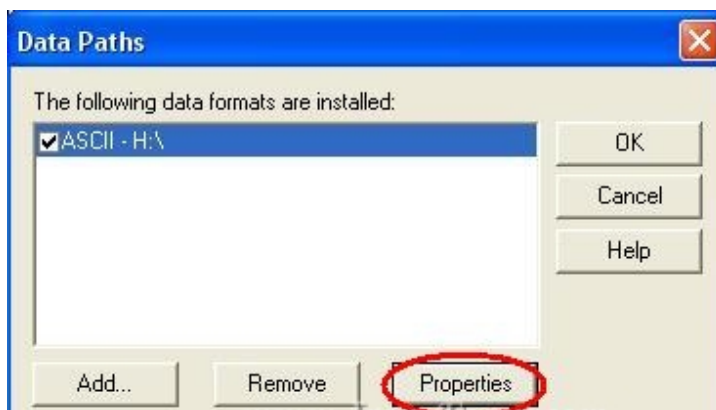
۳. دکمه: Add:



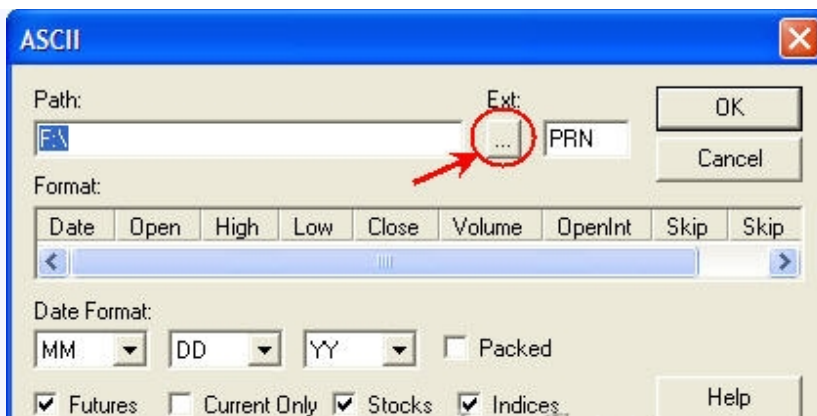
۴. مراحل زیر:



۵. دکمه Properties:



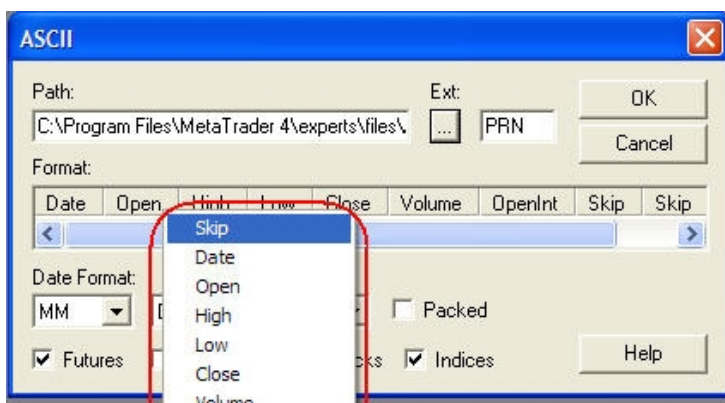
۶. دکمه Ext:



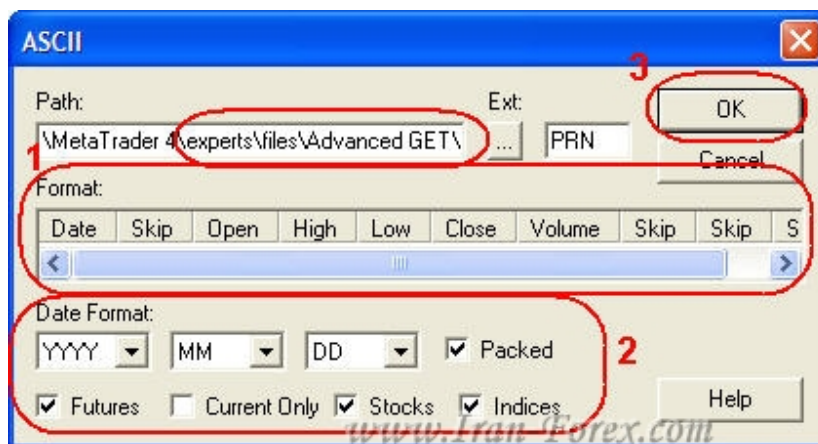
۱. مراحل زیر: (در این مرحله باید مسیر `Mql5/files` رو از شاخه متاتریدر خود تعیین کنید)



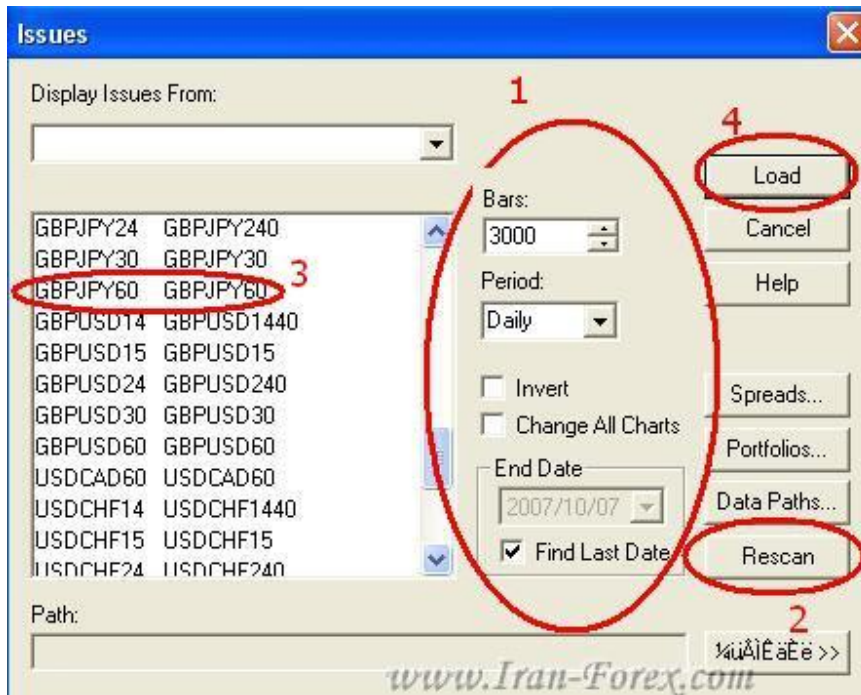
۲. با کلیک راست بر روی قسمت وسط پنجره می توان گزینه مورد نظر را انتخاب نمود مانند زیر:



۳. تنظیمات پنجره را به این صورت انجام دهید:

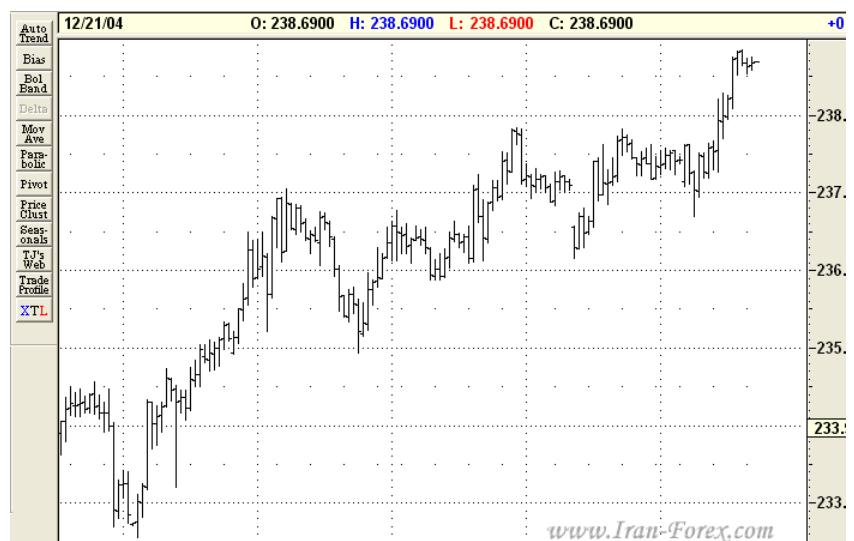


۴. و در نهایت تنظیمات زیر و دکمه Load دقت داشته باشید که چارت دلخواهی را می توانید از سمت چپ انتخاب کنید این چارت ها همان فایل های PRN هستند که ساخته شده اند



چند نکته مهم:

• بعد از زدن دکمه Load چارتی مانند زیر به نمایش درمی آید:



دقت داشته باشید هر بار که بوسیله دکمه **New Chart** چارت جدیدی را لود می کنید قبل از انتخاب چارت و دکمه **Load** حتما دکمه **Rescan** را بزنید تا اطلاعات بروز رسانی شوند البته قبل از آن هم باید در متاتریدر خود نیز چارت و تایم فریم مربوطه را نمایش دهید تا اطلاعات آن هم بروز شده و با دکمه **Rescan** ذکر شده در پنجره **New Chart** اطلاعات به **Advanced GET** منتقل شوند.

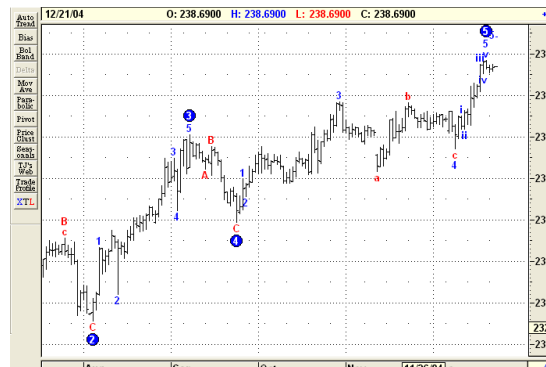
- اگر نخواهید که چارت ها را ببندید برای بروز شدن اطلاعات در نرم افزار بعد از بروز کردن آنها در متاتریدر باید از **Advanced GET** خارج شده و مجدداً آن را اجرا نمایید.
- به تاریخچهایی که نرم افزار بر روی چارت نشان می دهد توجه نکنید. نمودار و قیمت برای ما مهم است.
- این نرم افزار چارت های زیر روزانه را هم با نام **Daily** می شناسد و نمایش می دهد که شما با نام آن کاری ندارید قبل از نام **Daily** تایم فریم اصلی نوشته می شود و اطلاعات نیز به صورت صحیح نمایش داده می شوند. در حقیقت شما با این کار این نرم افزار را دور زده اید!

تا اینجا کار چارت ما آماده شده است مراحل زیر را بر روی چارت انجام می دهیم تا به الگوی مورد نظر برسیم: راست کلیک بر روی چارت و انتخاب گزینه: **Elliott Waves**

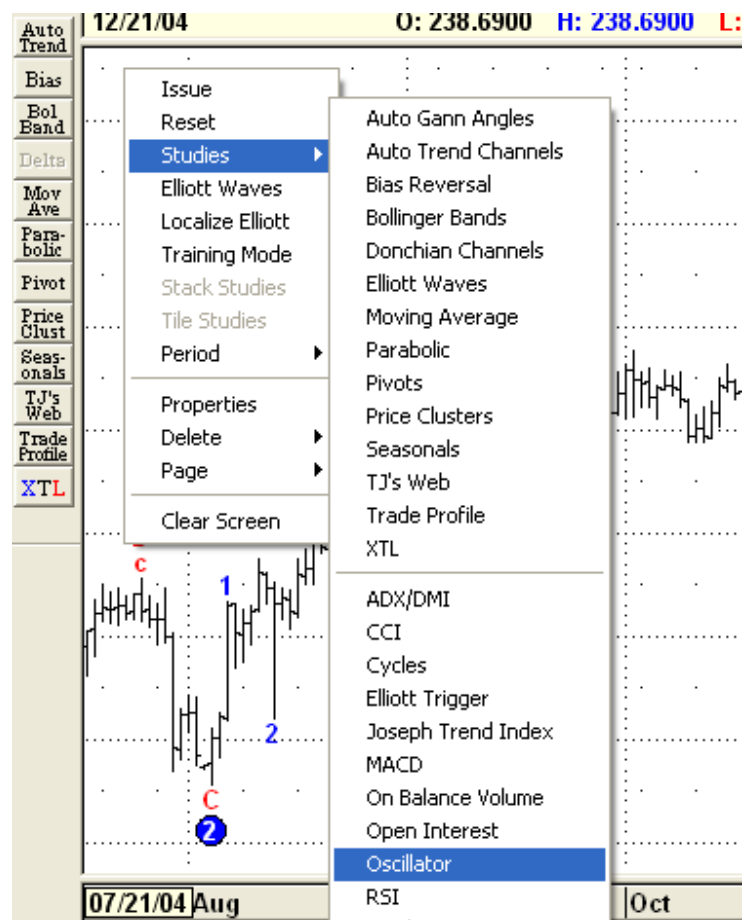


در پنجره باز شده تنظیمات پیش فرض را پذیرفته و **OK** می کنیم در نهایت چارت ما تقریباً به شکل زیر در می آید:

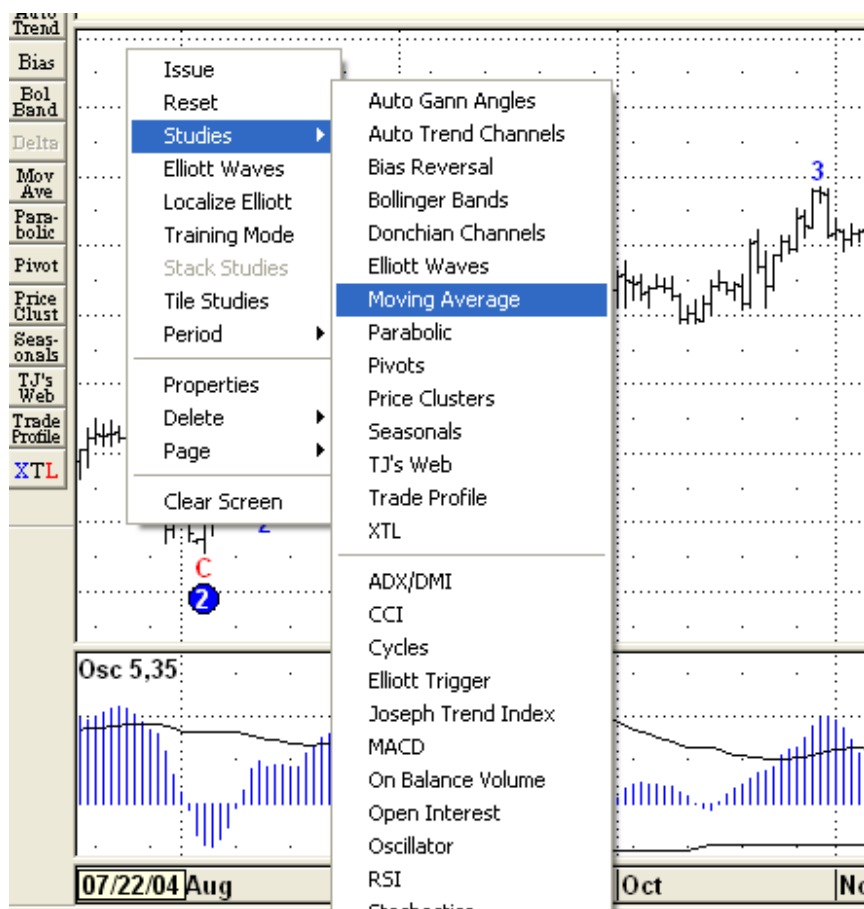
نکته: ممکن است پارامترهای اضافه دیگری نیز ببینید که در مورد آنها توضیح خواهیم داد.



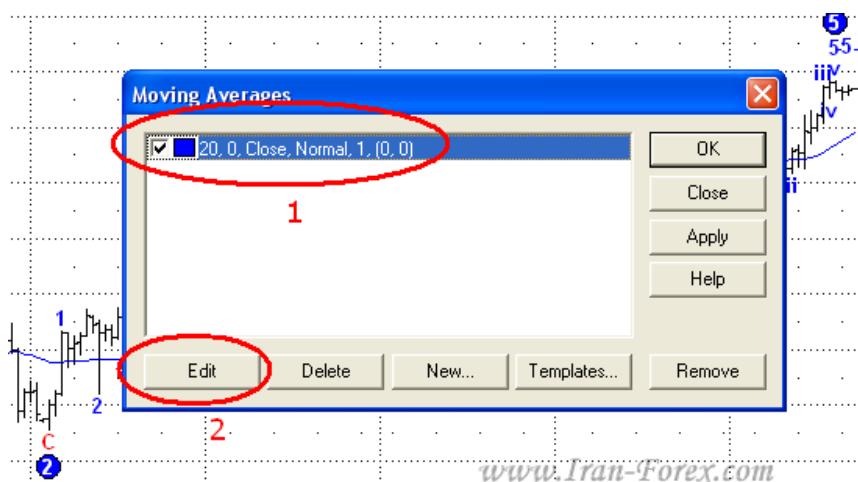
سپس طبق روش زیر اندیکاتور Oscillator را به چارت اضافه می کنیم:

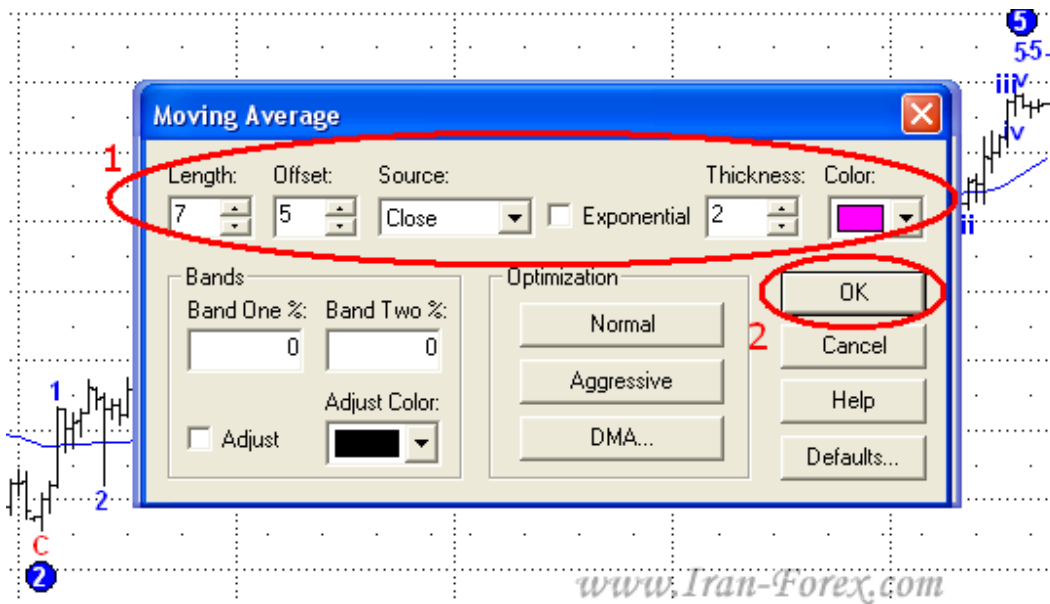


حالا با روش زیر یک Moving Average به چارت اضافه کرده و در پنجره ظاهر شده تنظیمات شکل بعد را می دهیم:

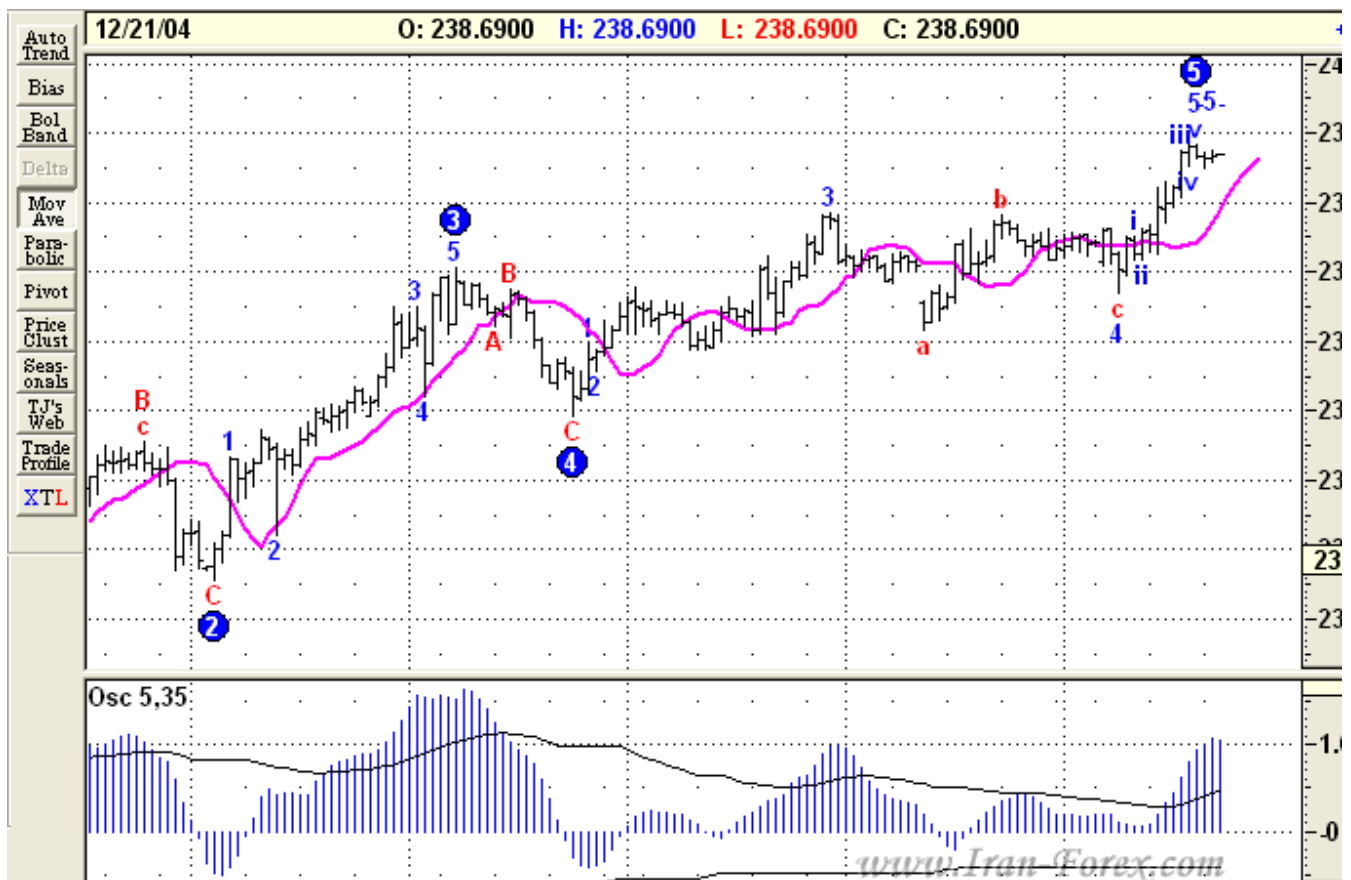


تنظیمات: Moving Average



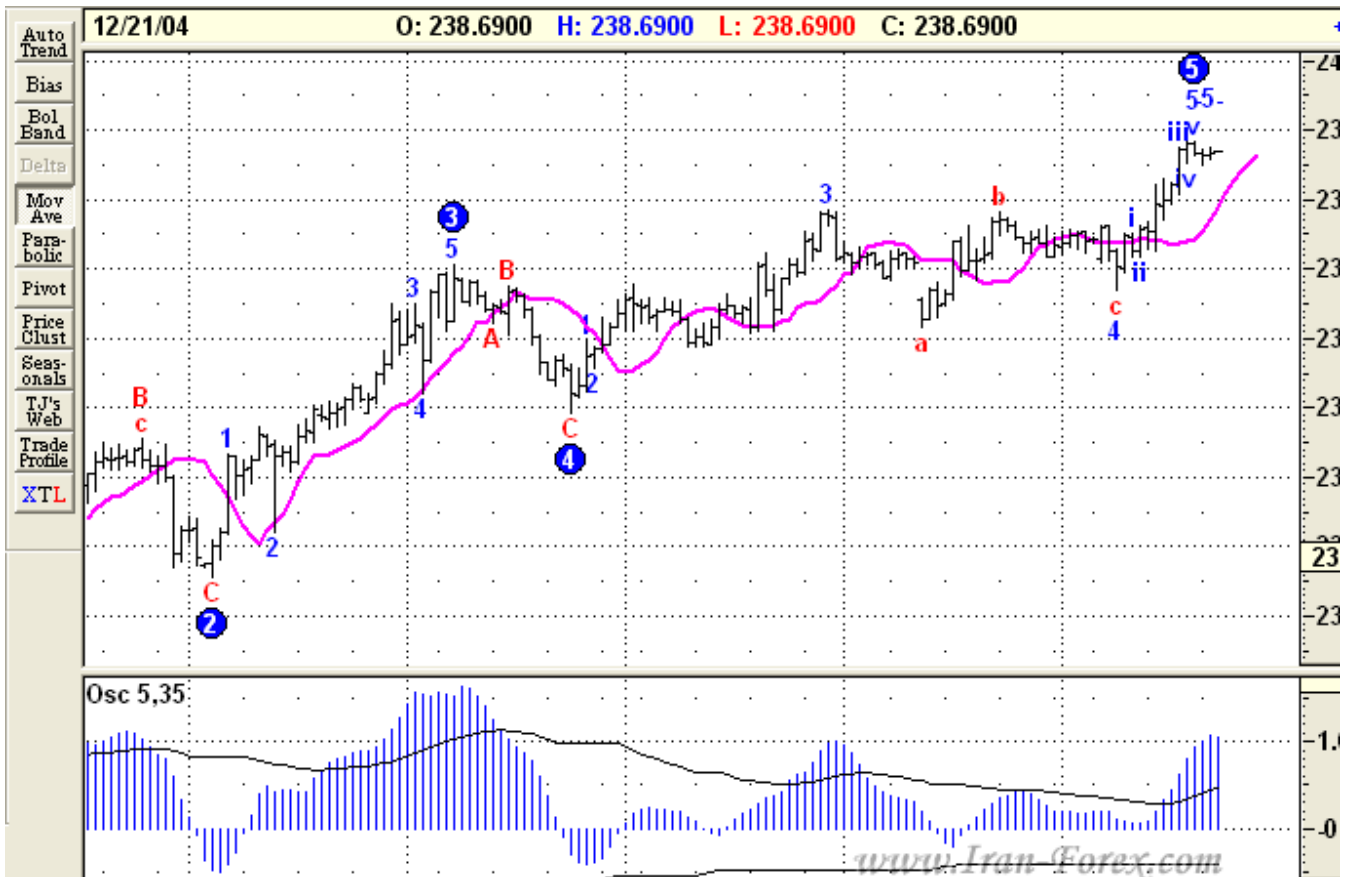


در نهایت الگوی زیر را بر روی چارت خواهیم داشت:



اندیکاتور DMA

همانطور که در شکل پایین می بینید یک Moving Average به رنگ صورتی با پریود ۷ و جابجایی راست ۵ ایجاد کردیم:

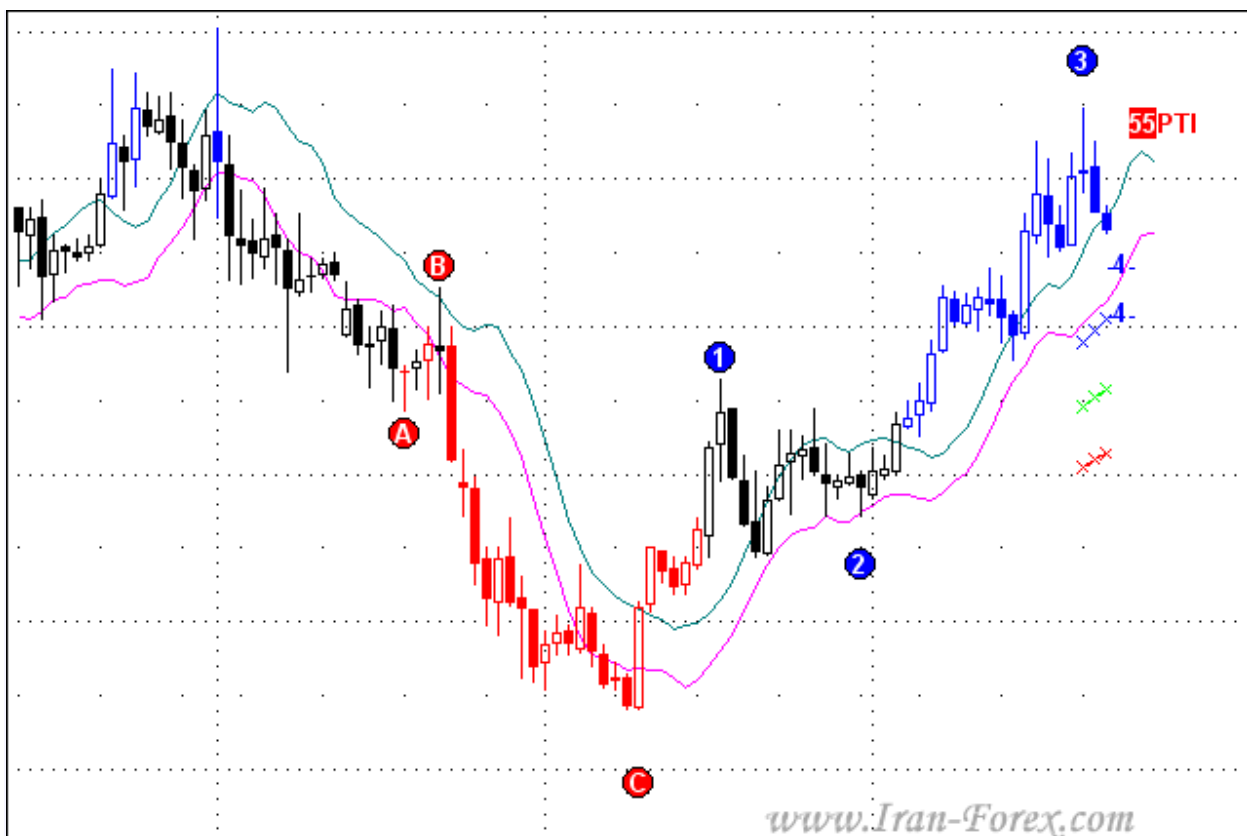
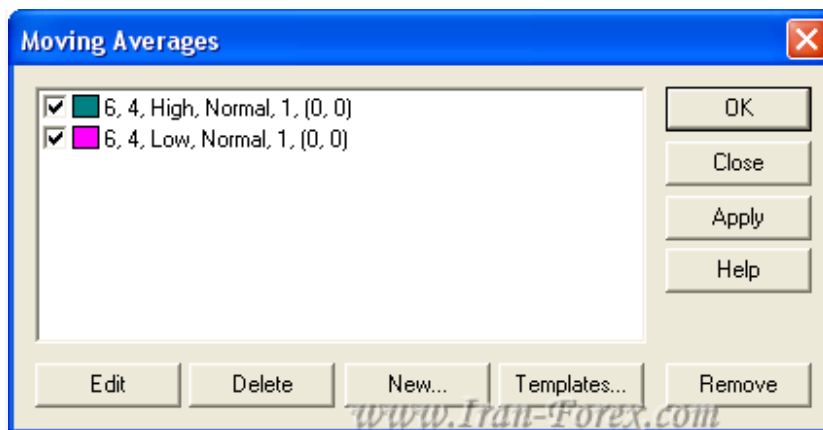


نام آن (Displaced Moving Average میانگین متحرک جابجا شده) یا DMA است. طبق گفته سازندگان این نرم افزار هدف استفاده از این میانگین متحرک ساده اجازه دادن به بازار برای ادامه مومنتوم است. زمانی که بازار توالی ۵ موج الیوت را تکمیل می کند DMA را قطع خواهد کرد و یک حرکت شدید در خلاف جهت خواهد داشت. در پایان موج پنجم از DMA برای ورود به پوزیشن استفاده خواهیم کرد.

نکته مهم:

DMA فقط برای ورود به پوزیشن در انتهای موج پنجم و در الگوهای مطمئن در پایان موج چهارم طراحی شده است. در مناطق دیگر به هیچ وجه از آن برای ورود استفاده نکنید.

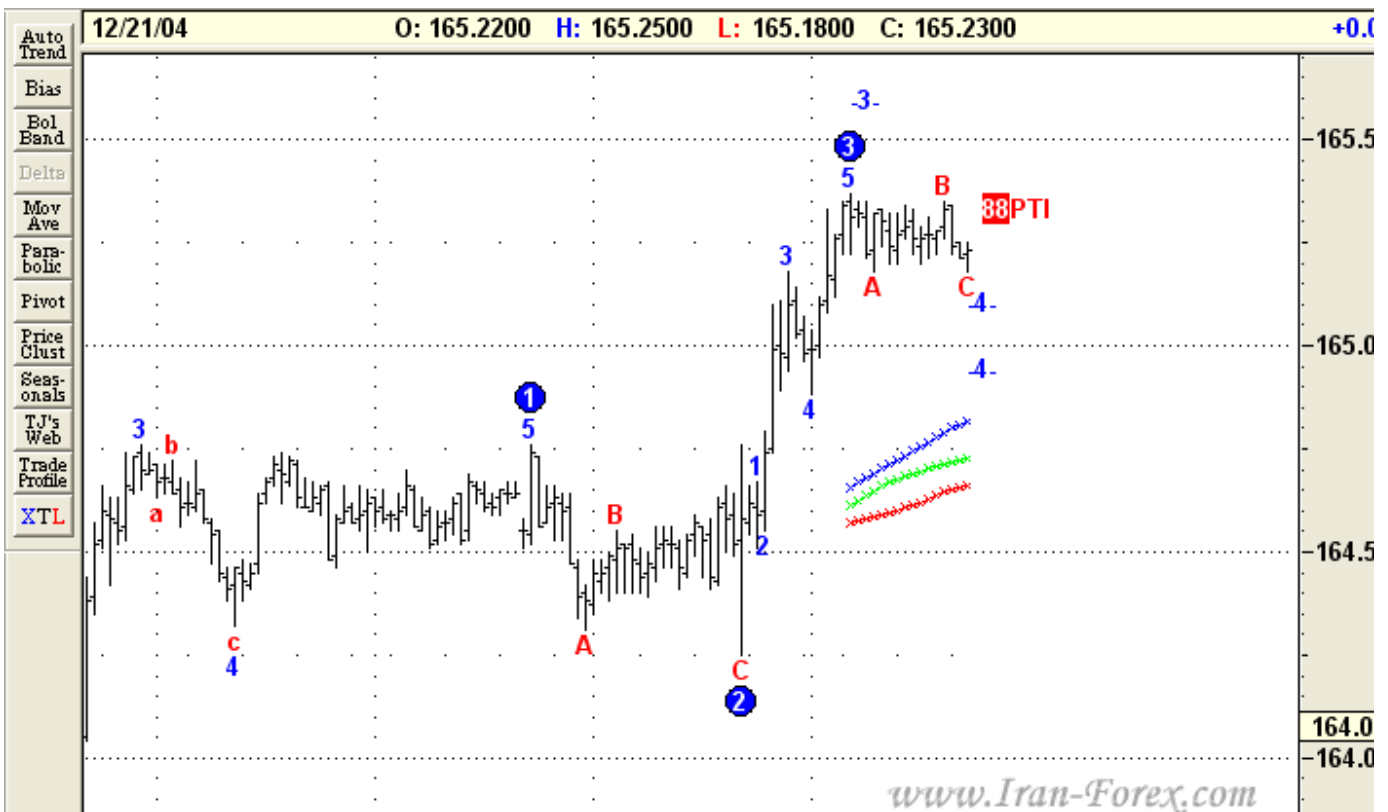
به جای DMA معرفی شده در پست های قبلی از دو DMA با مشخصات زیر استفاده کنید:



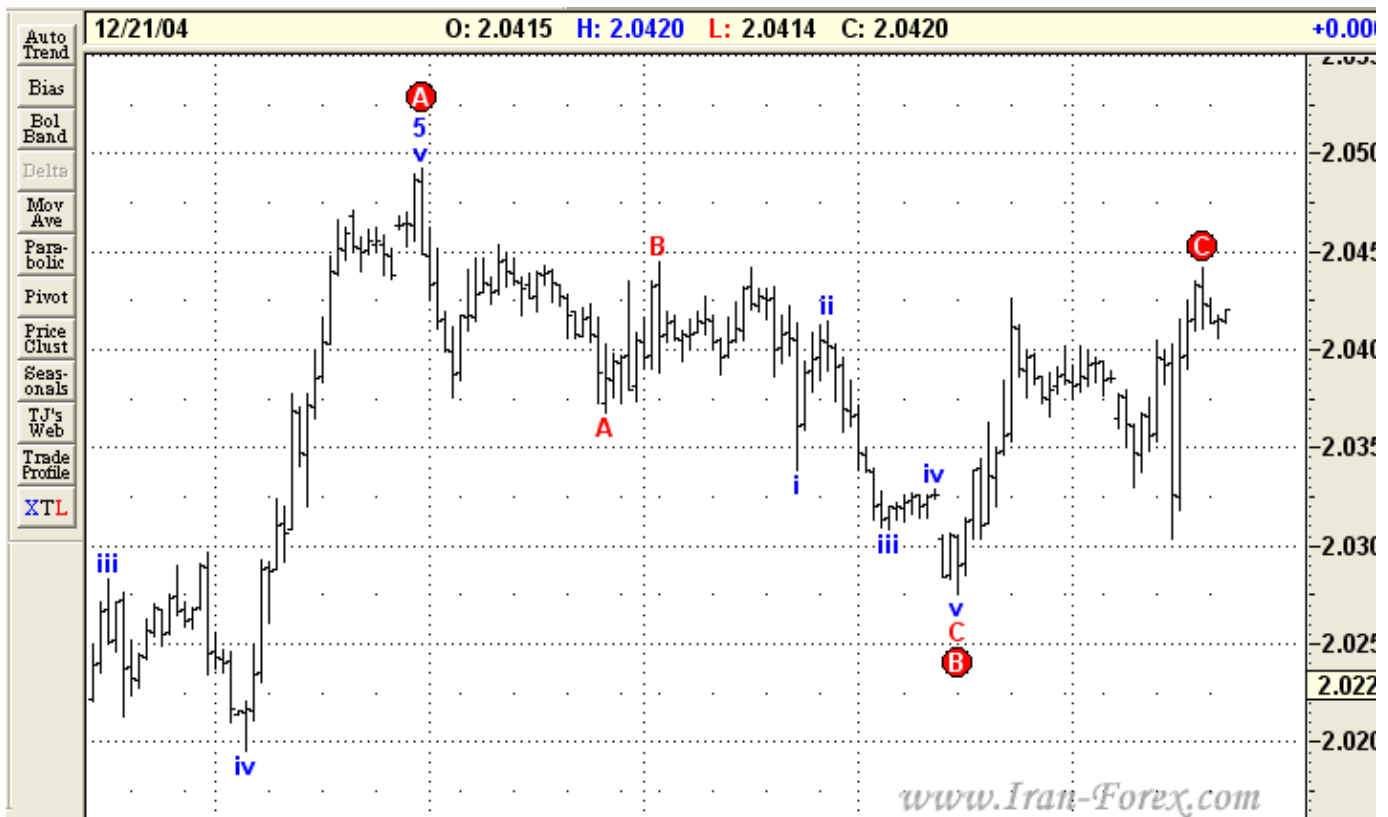
از شکست هر دو DMA جهت تأیید در تریدهای خود بهره بگیرید.

لازم است در اینجا نکته ای را یادآور شوم:

ممکن است بعد از اضافه کردن ابزار امواج الیوت - **Elliot Waves** - پارامترهای دیگری را نیز همراه آنها ببینید مانند شکل زیر که شامل یک سری خطوط به رنگ های آبی، سبز و قرمز و یک عدد شاخص به نام **PTI** است که در چارت نشان داده می شوند. در مورد آنها صحبت خواهیم کرد:

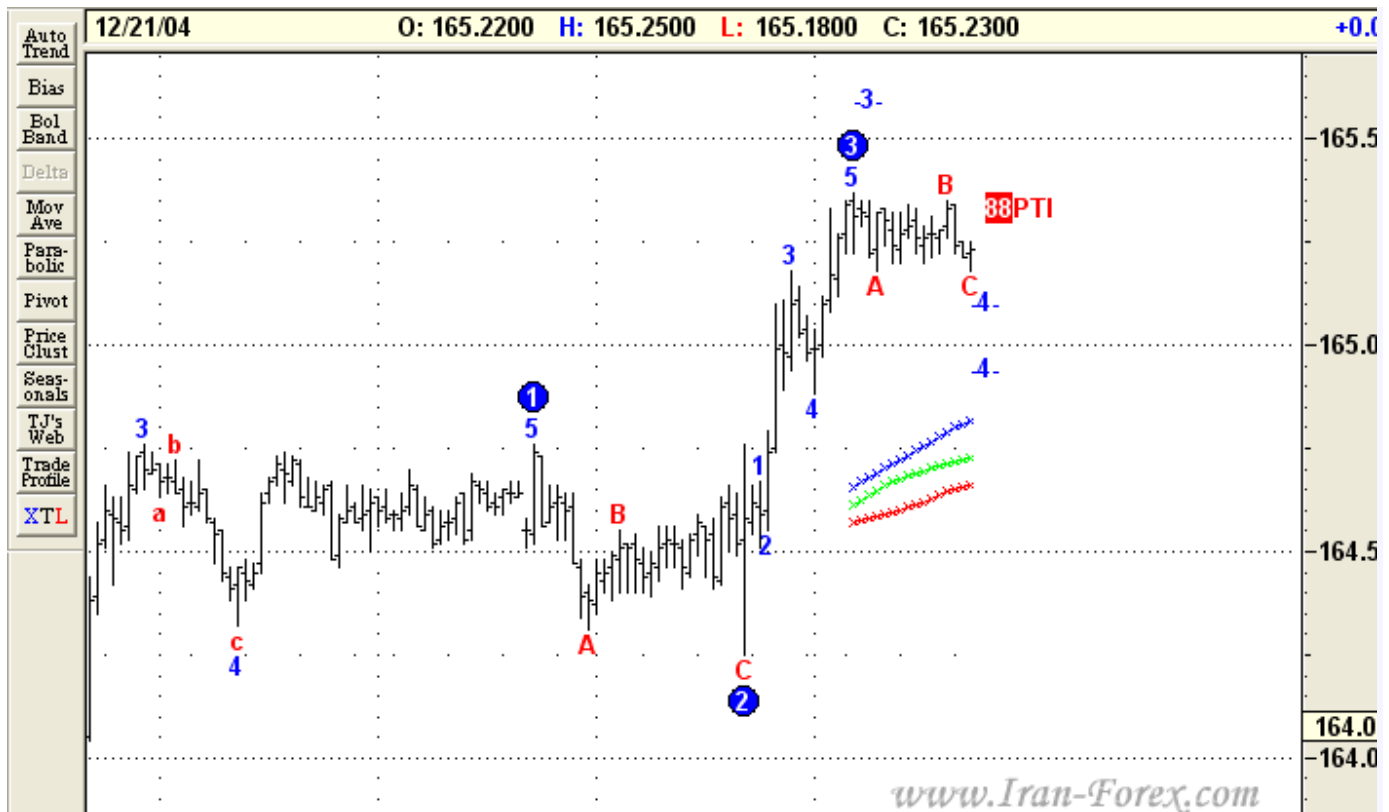


یا مانند شکل زیر به جای عدد، حروف A - B - C با دایره های قرمز رنگ دیده شوند که در مورد آنها نیز صحبت خواهیم کرد:



PTI و کاربرد آن

زمانی که موج سوم ایجاد می شود بر اساس تئوری امواج الیوت باید به دنبال موج چهارم اصلاحی باشیم که به دنبال آن موج پنجم ایجاد می گردد. به شکل زیر دقت کنید:



دیده می شود که نرم افزار تا موج سوم را شماره گذاری کرده و بازار در حال ساخت موج چهارم است. در این زمان پارامتری با رنگ قرمز به نام PTI دیده می شود که مقدار آن در اینجا برابر ۸۸ است. PTI مخفف Profit Taking Index می باشد (شاخص حد سود PTI). (مومنتوم Buy ها و Sell های موج سوم را با موج چهارم مقایسه می کند سپس این مقایسه به الگوریتمی داده می شود که عدد PTI را محاسبه می کند. به طور آماری **اگر عدد PTI بزرگتر از ۳۵ (سی و پنج) باشد بازار تمایل شدیدی دارد که موج پنجم را بسازد**. در این شکل دیده می شود که عدد بدست آمده برابر ۸۸ است که پتانسیل خوبی را برای تشکیل موج پنجم نشان می دهد.

اما در شکل خطوطی نیز به رنگهای آبی، سبز و قرمز دیده می شوند. ما این خطوط را "کانال های موج چهارم" می نامیم.

در یک روند صعودی: اگر موج چهارم اصلاحی بالای "کانال های موج چهارم" باشد انتظار برای تشکیل موج پنجم زیاد است.

در یک روند نزولی: اگر موج چهارم اصلاحی پایین "کانال های موج چهارم" باشد انتظار برای تشکیل موج پنجم زیاد است.

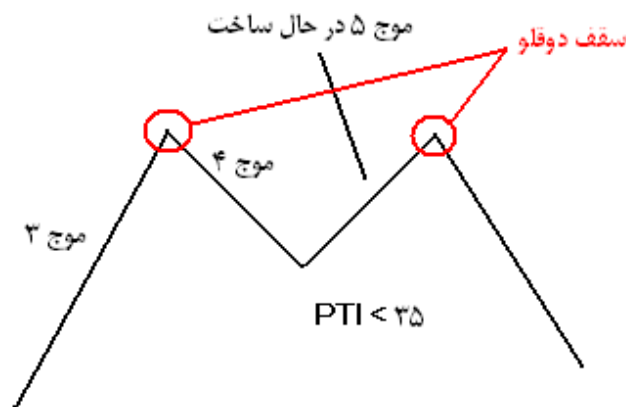
سقف دو قلو - کف دو قلو

تا اینجا با دو نوع اصلی ترید در این نرم افزار آشنا شدیم. حال می خواهیم ۲ موقعیت دیگر را که می توان از آنها نیز برای ورود به پوزیشن استفاده کرد بیان کنیم.

(Double Top)

الگوی سقف دو قلو

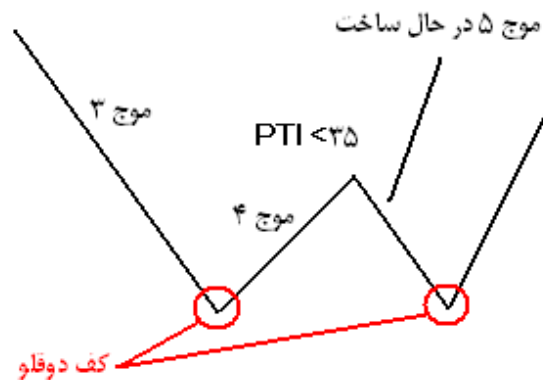
هنگامی که موج چهارم توسط نرم افزار شماره گذاری شده و PTI کمتر از ۳۵ است دیده می شود که بازار در حال ساخت موج پنجم است. این مقدار برای PTI بدین معنی است که قیمت به هدف اصلی موج پنجم نخواهد رسید. در این حالت احتمال تشکیل سقف دو قلو بسیار زیاد است. هنگامی که قیمت به سقف رسید از شکست DMA برای ورود به یک پوزیشن Sell استفاده کنید.



الگوی کف دو قلو (Double Bottom)

هنگامی که موج چهارم توسط نرم افزار شماره گذاری شده و PTI کمتر از ۳۵ است دیده می شود که بازار در حال ساخت موج پنجم است. این مقدار برای PTI بدین معنی است که قیمت به هدف اصلی موج پنجم

نخواهد رسید. در این حالت احتمال تشکیل کف دو قلو بسیار زیاد است. هنگامی که قیمت به کف رسید از شکست DMA برای ورود به یک پوزیشن Buy استفاده کنید



پوزیشن گیری یا انواع ترید:

- ترید نوع اول - (Type 1) ورود در انتهای موج چهارم اصلاحی
- ترید نوع دوم - (Type 2) ورود در انتهای موج پنجم.

ترید نوع اول - ورود در انتهای موج ۴ اصلاحی

از نمودار **یک ساعته** جهت ورود استفاده خواهیم کرد که به گفته سازندگان این نرم افزار بهترین تایم فریم برای تشخیص الگوی الیوت است. به مرور زمان از چهار ساعته نیز برای تأیید استفاده می کنیم. از دوستان عزیزم نیز خواهشی دارم و آن اینکه اگر مایل بودند و تصمیم داشتند با شرایطی که از ابتدا بیان می شود همراه بنده پوزیشن بگیرند **حتما از حساب دمو استفاده کنند**. کار ما هنوز تمام نشده است و به تدریج تکمیل خواهد شد و همه نکات یک جا گفته نمی شود. در آخر نیز حتما به جمع بندی خواهیم رسید.

شرایط خرید:

- موج شماره ۳ توسط نرم افزار شماره گذاری شده است.

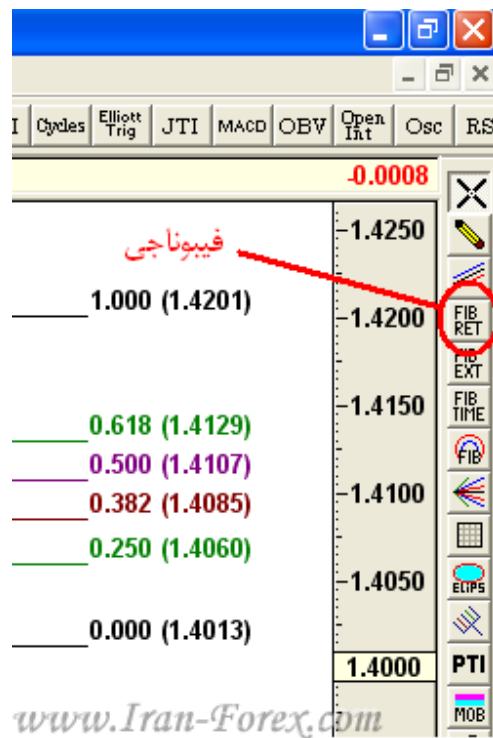
- **Oscillator** به سمت صفر برگشته است. (نکاتی راجع به این اندیکاتور وجود دارد که در حین کار توضیح داده می شود)
- **PTI** بزرگتر از ۳۵ است.
- موج چهارم اصلاحی **بالای** "کانال های موج چهارم" است.

حد سود:

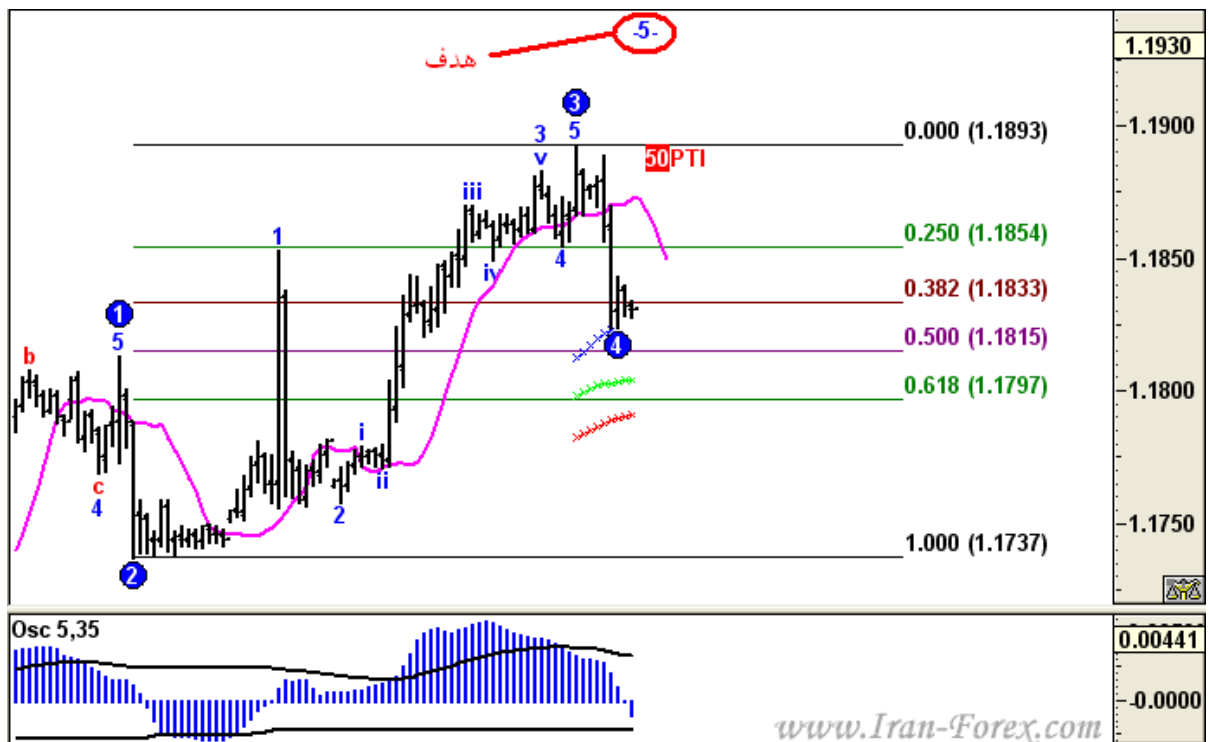
توسط نرم افزار در بالای موج سوم به صورت -۵- شماره گذاری شده است. اگر آن را نمی بینید با موس چارت را جابجا کنید.

حد ضرر:

بوسیله ابزار فیبوناچی که در شکل زیر می بینید سطوح فیبوناچی را از ابتدای موج سوم (پایین ترین نقطه در انتهای موج دوم) تا انتهای موج سوم رسم می کنیم. میزان استاپ لاس دو سطح فیبوناچی پایین تر از نقطه ورود است با کمی فاصله اطمینان. یعنی اگر در سطح ۳۸٪ (۰.۳۸۲) وارد شدید میزان استاپ لاس کمی پایین تر از سطح ۶۲٪ (۰.۶۱۸) می باشد. از منوی **Tools** و انتخاب گزینه **Fibonacci Retracement** نیز می توانید خطوط فیبوناچی را رسم نمایید:



مثال:



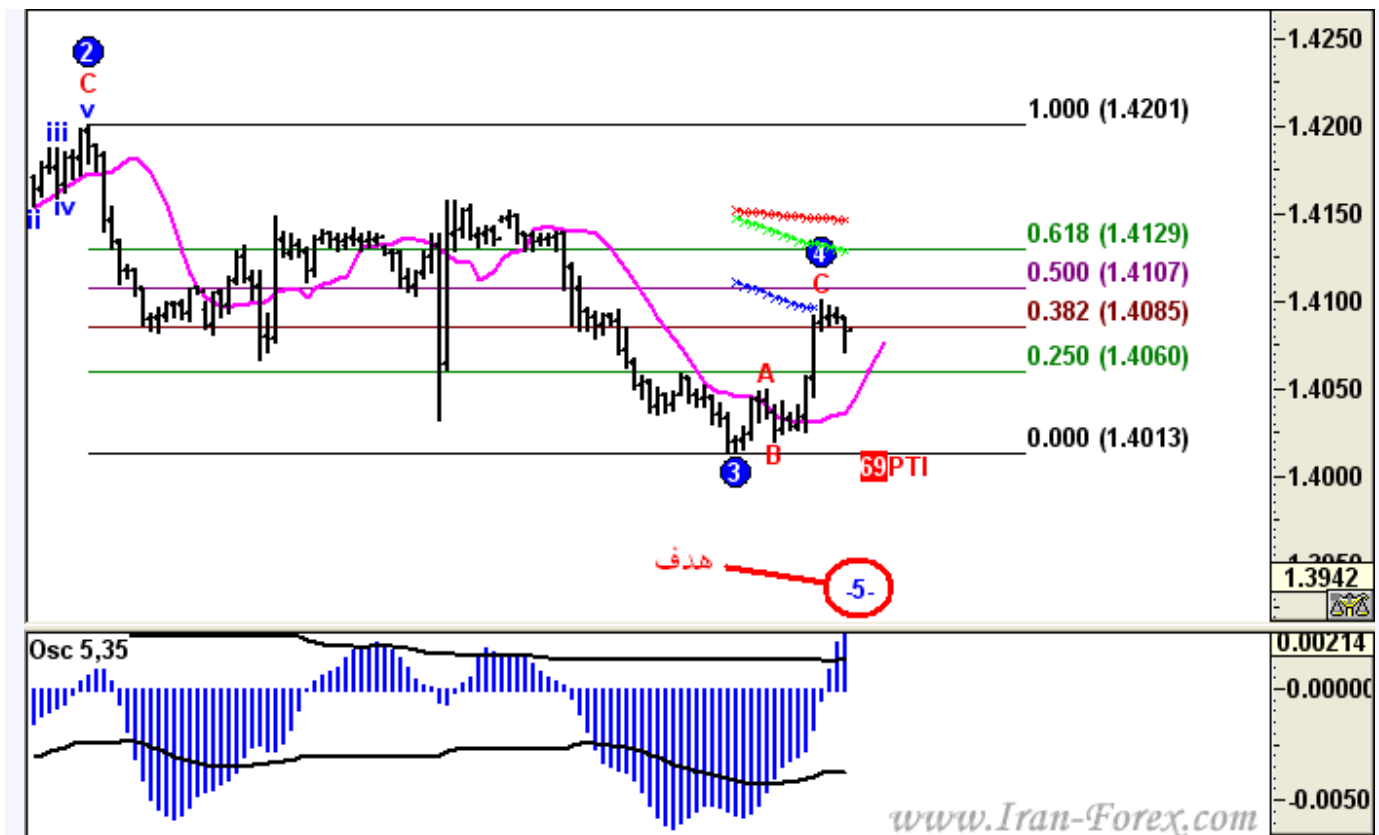
همانطور که در شکل بالا دیده می شود شرایط برای Buy مهیاست. نقطه ورود ۱.۱۸۳۳ می باشد. میزان استاپ لاس را ۱.۱۷۹۰ تعیین می کنیم.

شرایط فروش:

همان شرایط تنها با یک تفاوت:

موج چهارم اصلاحی **پایین** "کانال های موج چهارم" است.

مثال:



همانطور که در شکل بالا دیده می شود شرایط برای **Sell** مهیاست. نقطه ورود 1.4090 می باشد. میزان استاپ لاس را 1.4135 تعیین می کنیم.

نسبت های فیبوناچی موج چهارم

کم کم خود را برای پوزیشن گیری در شرایط زنده بازار آماده می کنیم. در اینجا نکته ای خدمت شما دوستان عزیز عرض می کنم که می تواند دید نسبتا مناسبی را در تعیین دقیقتر نقطه ورود و استاپ لاس ترید نوع اول (ترید در انتهای موج چهارم اصلاحی) به ما ارائه دهد:

اگر خطوط فیبوناچی را از انتهای موج دوم (اکستریم کندلی که با دایره آبی رنگ شماره ۲ مشخص شده است) تا انتهای موج سوم (اکستریم کندلی که با دایره آبی رنگ شماره ۳ مشخص شده است) رسم کنیم، به لحاظ آماری:

- در ۱۵ درصد مواقع، موج چهارم تا بین ۲۴٪ - ۳۰٪ خطوط فیبو بازگشت می کند.
- در ۶۰ درصد مواقع، موج چهارم تا بین ۳۰٪ - ۵۰٪ خطوط فیبو بازگشت می کند.
- در ۱۵ درصد مواقع، موج چهارم تا بین ۵۰٪ - ۶۲٪ خطوط فیبو بازگشت می کند.
- در ۱۰ درصد مواقع، موج چهارم از ۶۲٪ فیبو رد می کند.

تصویر پایین آخرین وضعیت جفت ارز EURJPY در تایم فریم یک ساعته را در پایان بازار هفته گذشته نشان می دهد. همانطور که می بینید موج چهارم تا چند پیپ بالاتر از خط ۵۰٪ فیبو بازگشت کرده است. همچنین:

- موج سوم توسط نرم افزار شماره گذاری شده است.
- Oscillator به سمت صفر برگشته و مقداری نیز در جهت منفی پیشروی کرده است.
- PTI بزرگتر از ۳۵ است.
- موج چهارم بالای "کانال های موج چهارم" است که البته این مورد به اندازه موارد قبلی حیاتی نیست.

با باز شدن بازار می توان با تأیید تایم فریم چهارساعته وارد یک پوزیشن Buy گردید:



بنده به علت اینکه در هفته گذشته زودتر از این شرایط برقرار شده بود این پوزیشن را گرفته ام که نتیجه را تا بدین جا مشاهده می کنید:

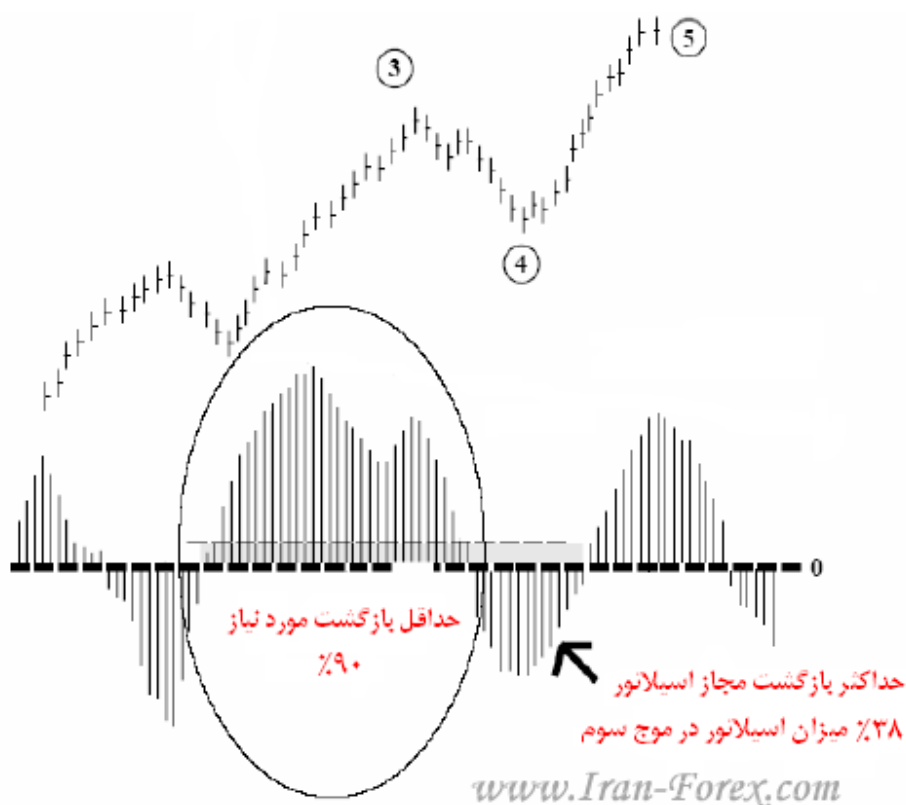
Order	Time	Type	Size	Symbol	Price	S / L	T / P	Price	Swap	Profit
492...	2007.10.12 11:34	buy	0.10	eurjpy	166.36	165.50	167.50	166.73	1.02	31.46

استاپ لاس را هم می توان نقطه ۱۶۵.۹۰ یعنی چند پیپ پایین تر از خط ۵۰٪ درصد فیبو تعیین کرد که خودم برای اطمینان بیشتر زیر خط ۶۲٪ درصد گذاشته ام. حد سود را هم یک هدف کوتاه مدت تعیین کرده ام، یعنی چند پیپ پایین تر از انتهای موج سوم. البته بنده پوزیشن دیگری را نیز با حد سود تعیین شده بوسیله نرم افزار برای موج پنجم باز کرده ام (با چند پیپ پایین تر به عنوان فاصله اطمینان) که صد البته این کار بر روی حساب ریل یا واقعی باید با مدیریت سرمایه انجام شود. در صورت تمایل به گرفتن پوزیشن تا اطمینان کامل لطفاً از حساب دمو استفاده کنید.

حداقل بازگشت مورد نیاز و حداکثر بازگشت مجاز برای اسیلاتور در موج چهارم

حداقل بازگشت مورد نیاز و حداکثر بازگشت مجاز برای اسیلاتور در موج چهارم:

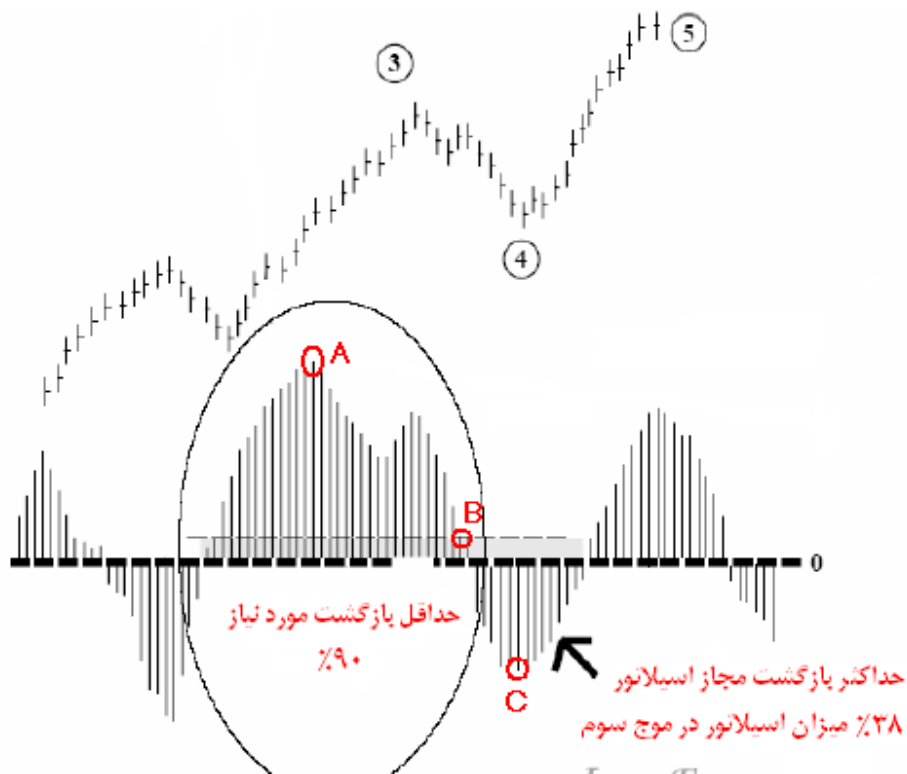
حدود ۹۵ درصد موج های چهارم که قادر به ساخت موج پنجم هستند با استفاده از Oscillator قابل شناسایی می باشند. همانطور که گفته شد در ترید نوع اول میزان Oscillator تقریباً باید در نزدیکی های صفر باشد. اگر بخواهیم عمیق تر شویم، Oscillator در این موج ها حداقل به اندازه ۹۰ درصد مقدار اکستریم (اکستریم Oscillator) ماکزیمم برای روند صعودی یا مینیمم برای روند نزولی (در موج سوم را بازگشت می کند. از آن طرف، مسأله بسیار مهم دیگر این است که Oscillator نباید بیش از ۳۸ درصد میزان اکستریم Oscillator در موج سوم را از سمت دیگر خط صفر رد کند:



این مطلب را به بیان دیگر شرح می دهیم:

شکل زیر را در نظر بگیرید:

- نقطه A نقطه ماکزیمم اسیلاتور تا خط صفر برای موج سوم است.
- طول نقطه B تا خط صفر برابر ۱۰ درصد طول نقطه A تا خط صفر است.
- طول نقطه C تا خط صفر برابر ۳۸ درصد طول نقطه A تا خط صفر است.



اگر به یاد داشته باشید یکی از شروطی که برای ترید نوع اول (ورود در انتهای موج چهارم اصلاحی) باید برقرار باشد اینست که اسیلاتور (Oscillator) به صفر رسیده باشد. در اینجا میزان بازگشت آن را دقیقتر بیان کردیم یعنی گفتیم حداقل مقداری که اسیلاتور لازم است برگردد تا بتوانیم روی آن حساب کنیم برابر با ۹۰ درصد طول نقطه A تا خط صفر است یعنی باید حداقل تا نقطه B پایین بیاید. این از یک طرف. از طرف دیگر گفتیم که نباید بیش از ۳۸ درصد طول نقطه A تا خط صفر در جهت منفی پیش رود. یعنی در شکل، اسیلاتور حداکثر می تواند تا نقطه C پایین بیاید اگر پایینتر آمد دیگر نمی توان روی موج چهارم آن حساب باز کرد.

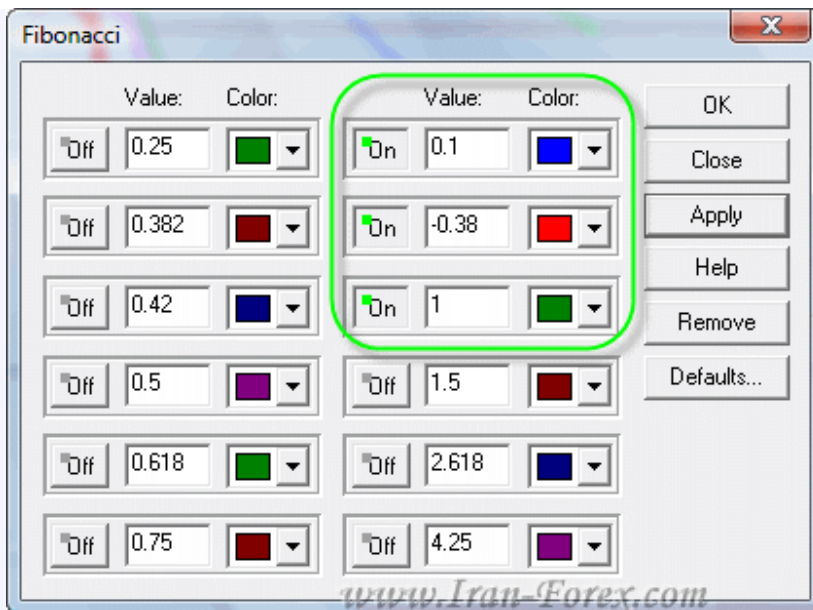
تعیین میزان بازگشت اسیلاتور در موج ۴ با کمک ابزار FIB EXT

با استفاده از ابزار Fibo Extension موجود در نرم افزار میتوان میزان بازگشت اسیلاتور در موج ۴ را تعیین کرد. حداقل میزان بازگشت اسیلاتور در ترید نوع اول ۹۰٪ (عدد ۰.۱ مشخص شده در تصویر) از موج ۳ و حداکثر میزان بازگشت مجاز اسیلاتور ۳۸٪ (عدد ۰.۳۸- مشخص شده در تصویر) از میزان نوسان نمای موج ۳ می باشد. مراحل زیر را انجام دهید:



www.Iran-Forex.com

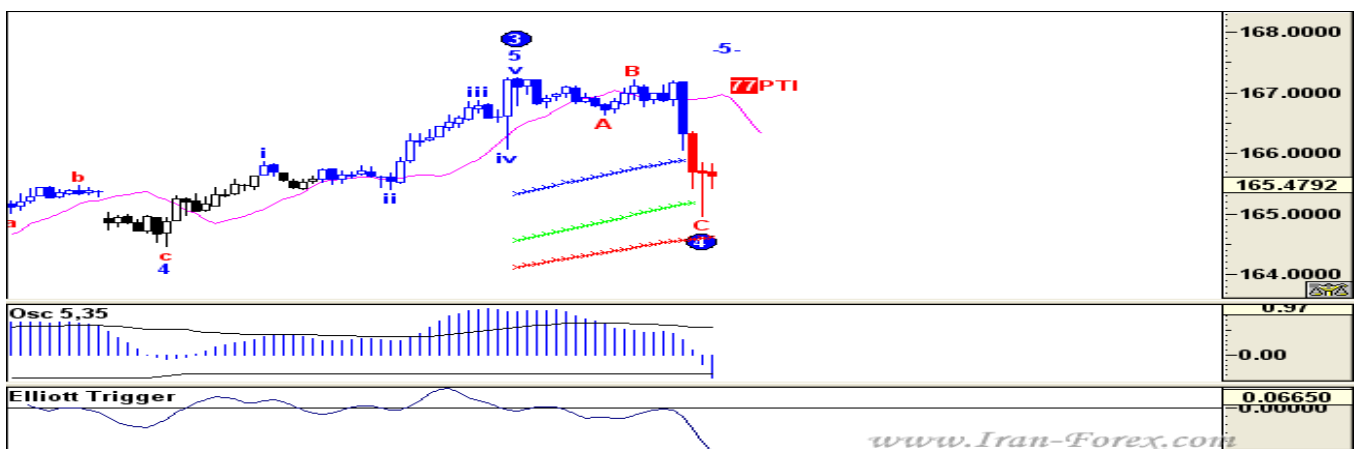
بر روی یکی از خطوط رایت کلیک کرده و درصدها را مطابق شکل زیر تعیین کنید تا حداقل و حداکثر میزان مجاز نشان داده شوند:



مفهوم کانال های موج چهارم

از لحاظ آماری:

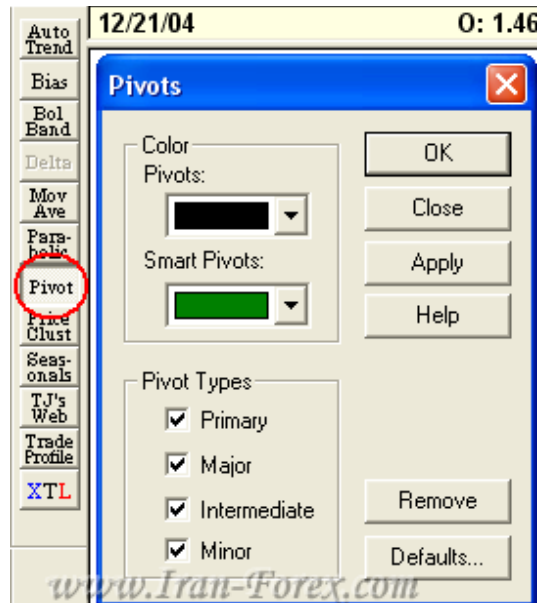
- اگر موج چهارم، بالای کانال اول (با رنگ آبی) باشد احتمال اصابت به هدف موج پنجم ۸۰ درصد است.
- اگر موج چهارم، بالای کانال دوم (با رنگ سبز) باشد احتمال اصابت به هدف موج پنجم ۶۰ درصد است.
- اگر موج چهارم، کانال سوم (با رنگ قرمز) را بشکند احتمال اصابت به هدف موج پنجم بسیار پایین است.



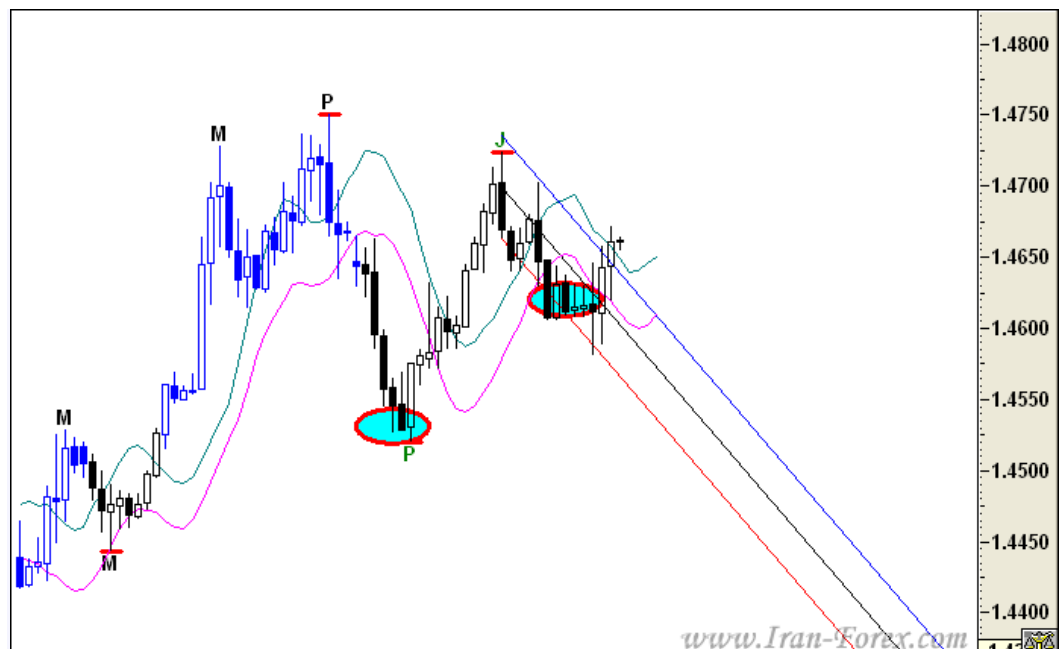
هنگامی که مورد سوم دیده می شود، با توجه به برقرار بودن شرایطی دیگر که توضیح خواهیم داد از آلترناتیو ها به عنوان یک ایده دوم استفاده می کنیم. در جاهای دیگر نیز از آلترناتیو ها استفاده می شود که در مورد آنها در پست بعد صحبت خواهیم کرد.

Pivot

بر روی ابزار Pivot کلیک و پنجره ظاهر شده را مطابق شکل زیر تنظیم کنید:

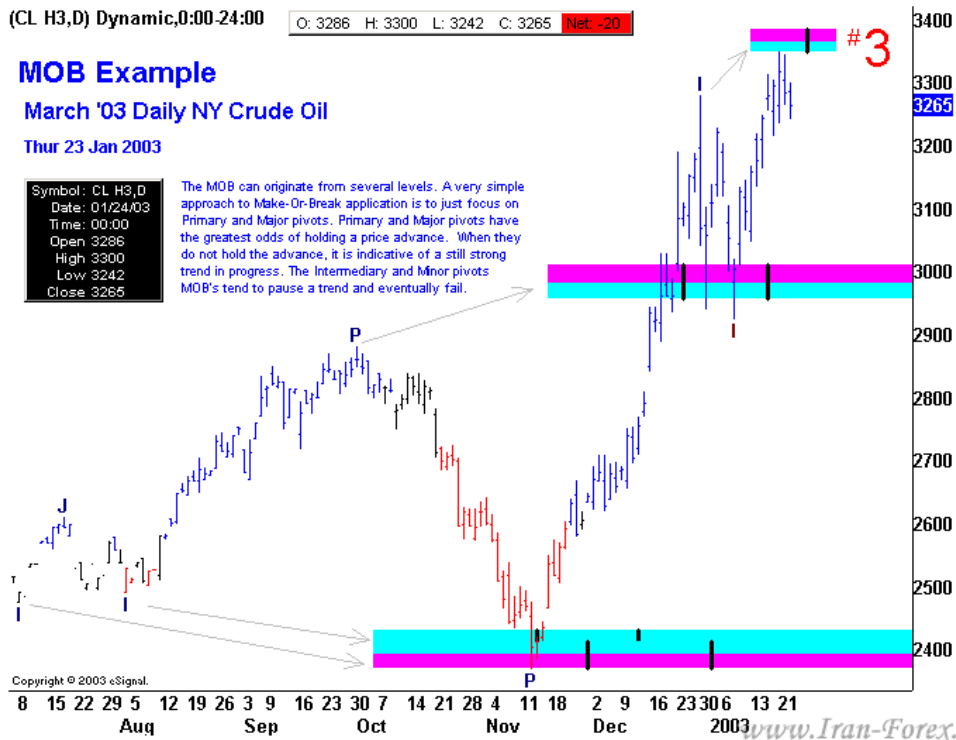
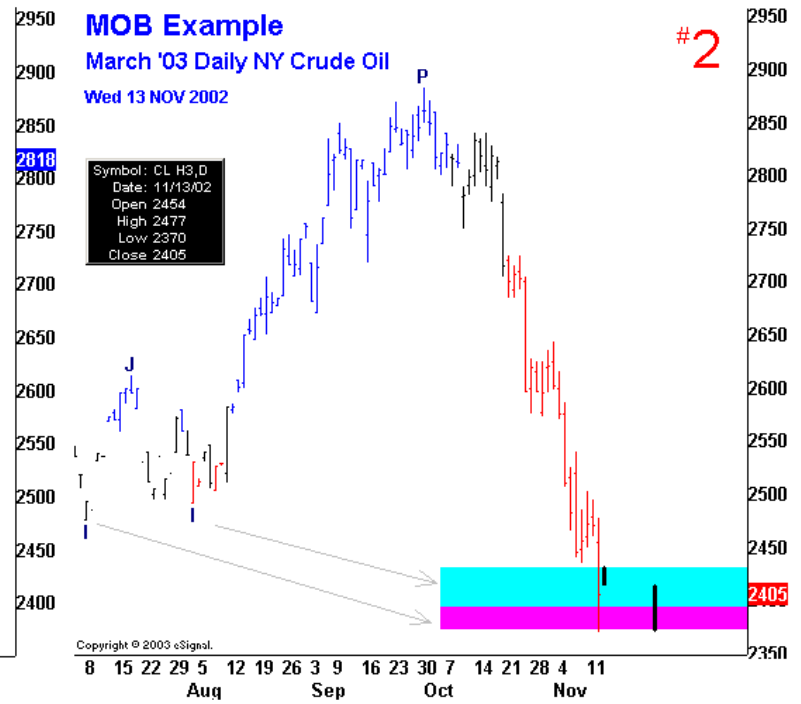
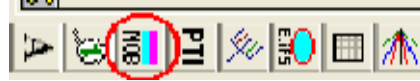


بعد از OK حروفی بر روی کندل ها ظاهر می شوند:



از نزدیکترین High و Low که توسط نرم افزار با این حروف نشان داده می شود برای رسم TJ's Ellipse استفاده کنید. با تمرین و آزمون و خطا خودتان می توانید بهترین نقاط را پیدا کنید.

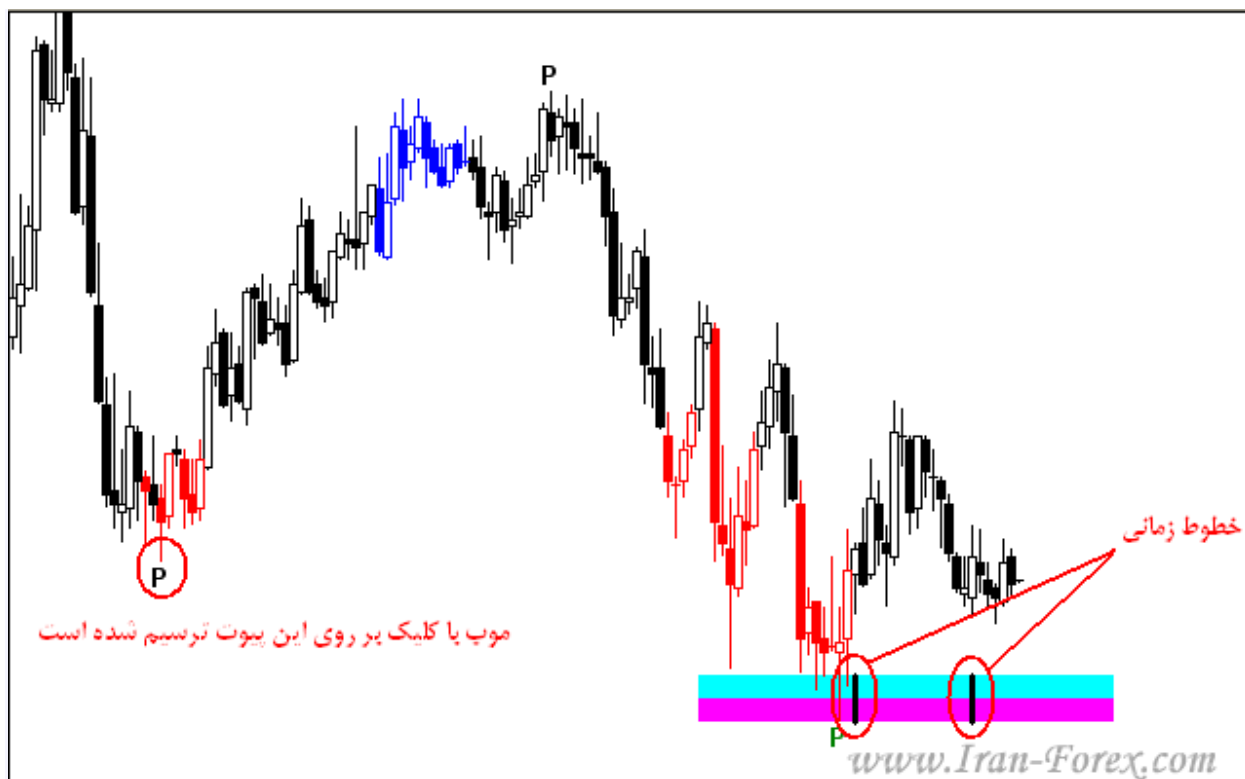
MOB=Make or Break برگشت یا شکست



MOB

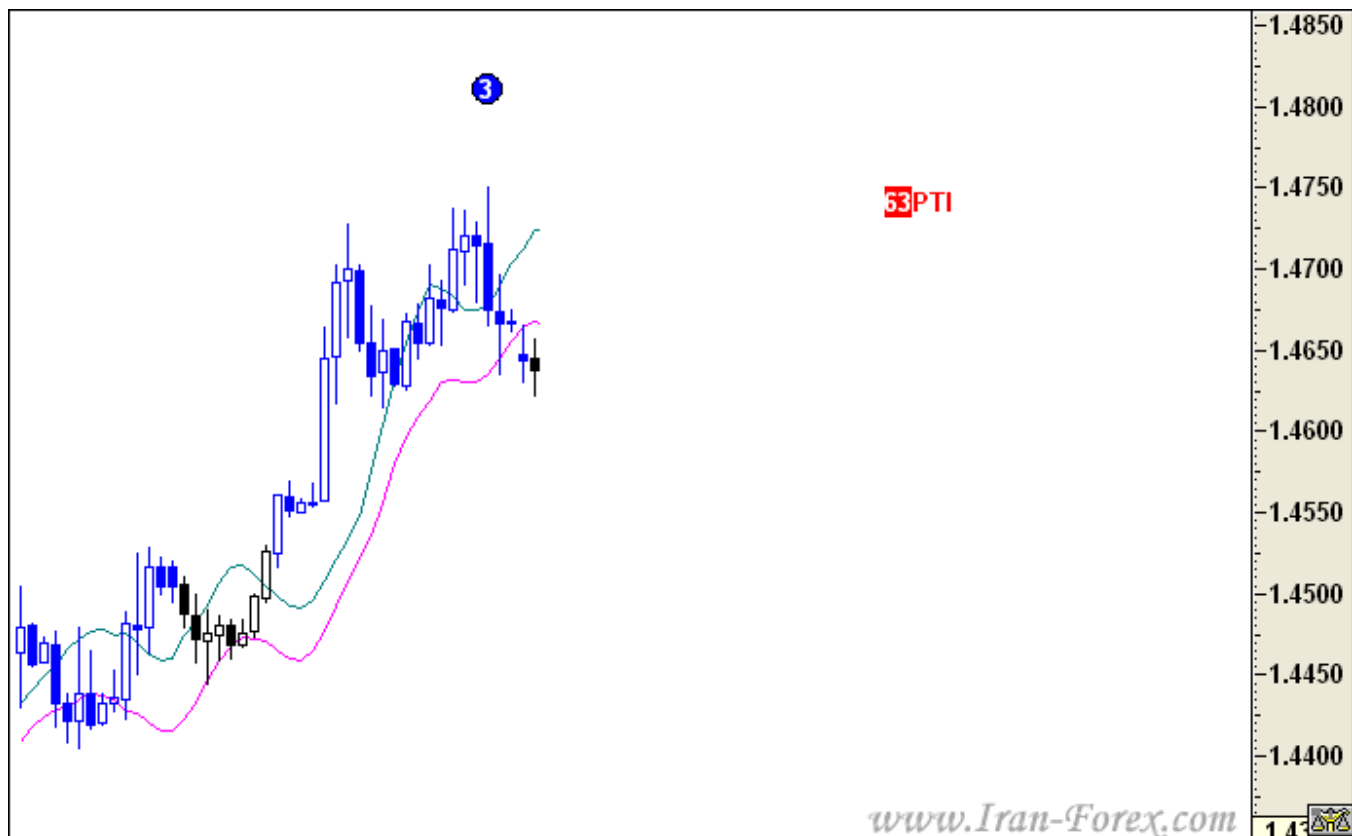
توضیحاتی در مورد ابزار

از ابزار موب برای تعیین سطوح حمایت و مقاومت، و همچنین جهت مشخص کردن تارگت در تریدهای خود استفاده نمایید. قیمت با رسیدن به این سطوح یا برمی گردد و یا با شکست قدرتمند آن به مسیر خود در جهت ترند قبلی ادامه می دهد. به همین دلیل است که آن را شکست یا برگشت می نامند. خطوط سیاه رنگ عمودی که در موب دیده می شود مشخص کننده زمانی است که به احتمال قوی در آن هنگام قیمت به موب خواهد رسید:

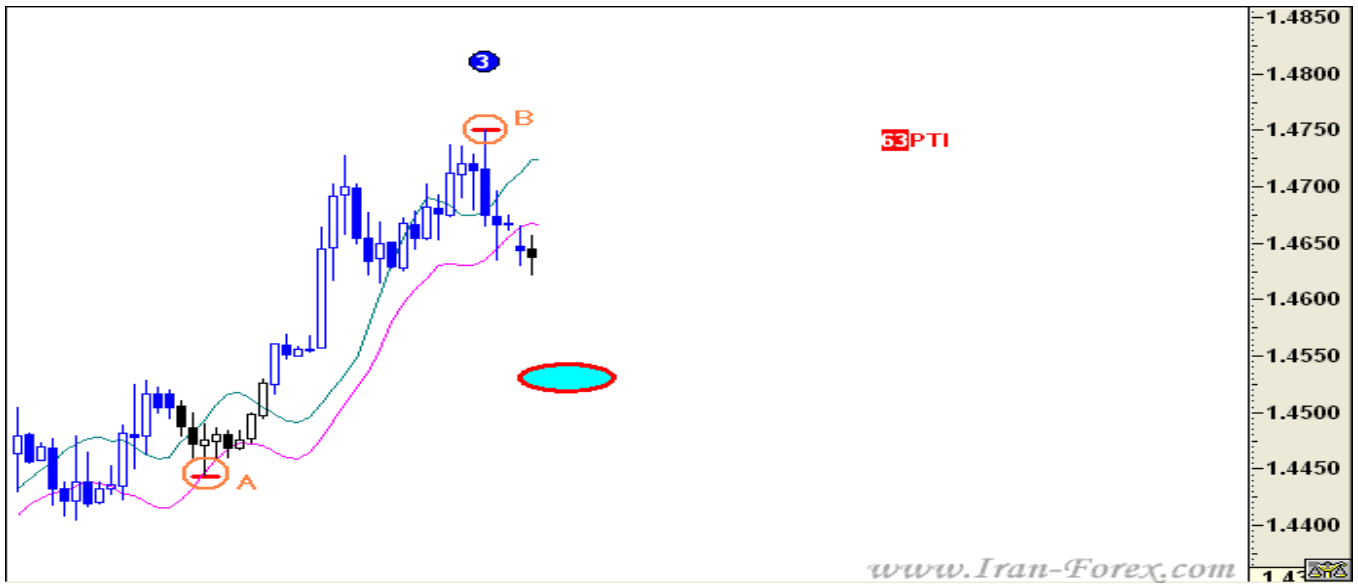


تعیین میزان بازگشت موج چهارم با کمک ابزار TJ's Ellipse

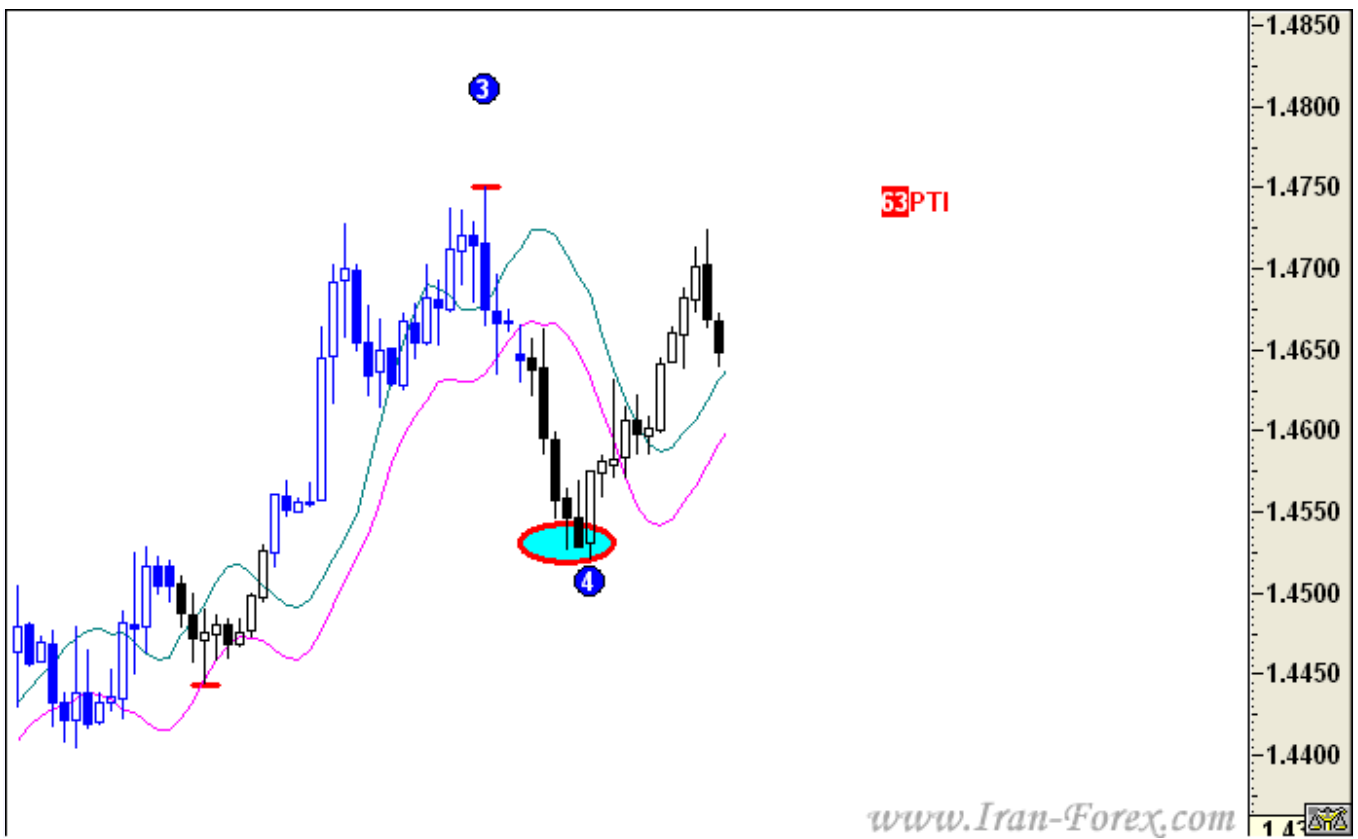
- EURUSD چهار ساعته:



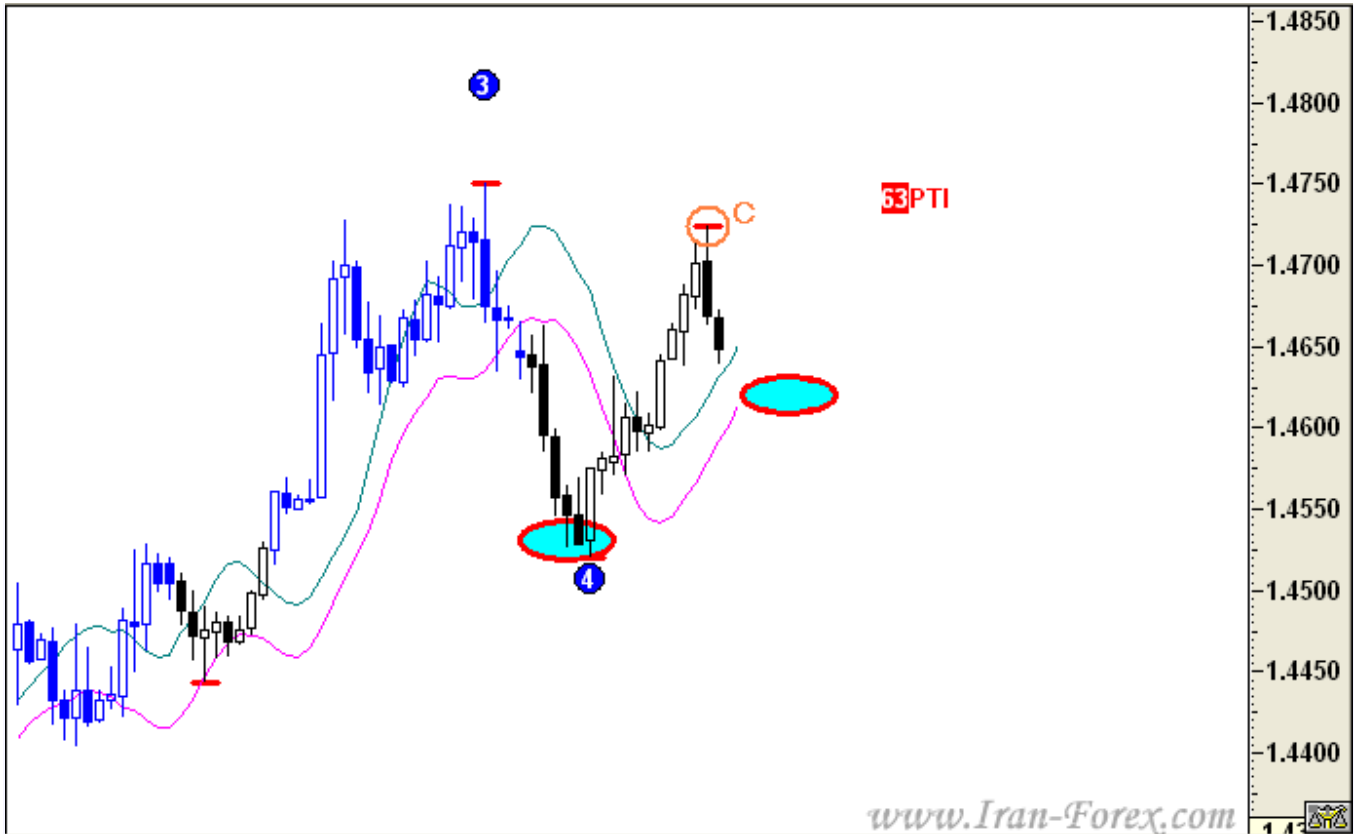
به نظر می رسد موج چهارم آغاز شده است. احتمال می دهید تا کجا پایین بیاید؟ یک راه رسم خطوط فیبوناچی است. ولی احتمال برگشت تا کدام خط بیشتر است؟ قبلاً به صورت کلی در مورد نسبت های فیبوناچی موج چهارم صحبت شده اما موج جاری جزء کدام دسته خواهد بود؟ بوسیله TJ's Ellipse از منوی Tools یا از نوار ابزار که با بیضی فیروزه ای رنگ مشخص است ابتدا بر روی نقطه A و پس از آن بر روی نقطه B کلیک می کنیم تا بیضی به شکل زیر ظاهر گردد:



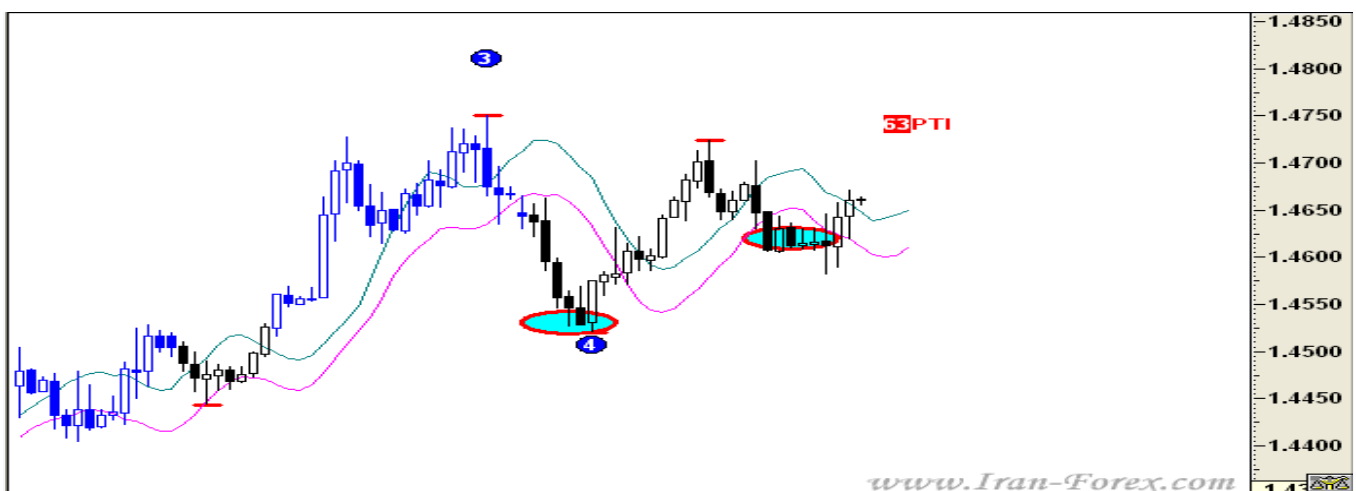
پس از چند ساعت:



دیده می شود که موج دوباره در حالت اصلاح قرار گرفته است. مجدداً با TJ's Ellipse ابتدا در انتهای موج چهارم و سپس در نقطه C کلیک می کنیم تا بیضی دیگری ظاهر گردد:



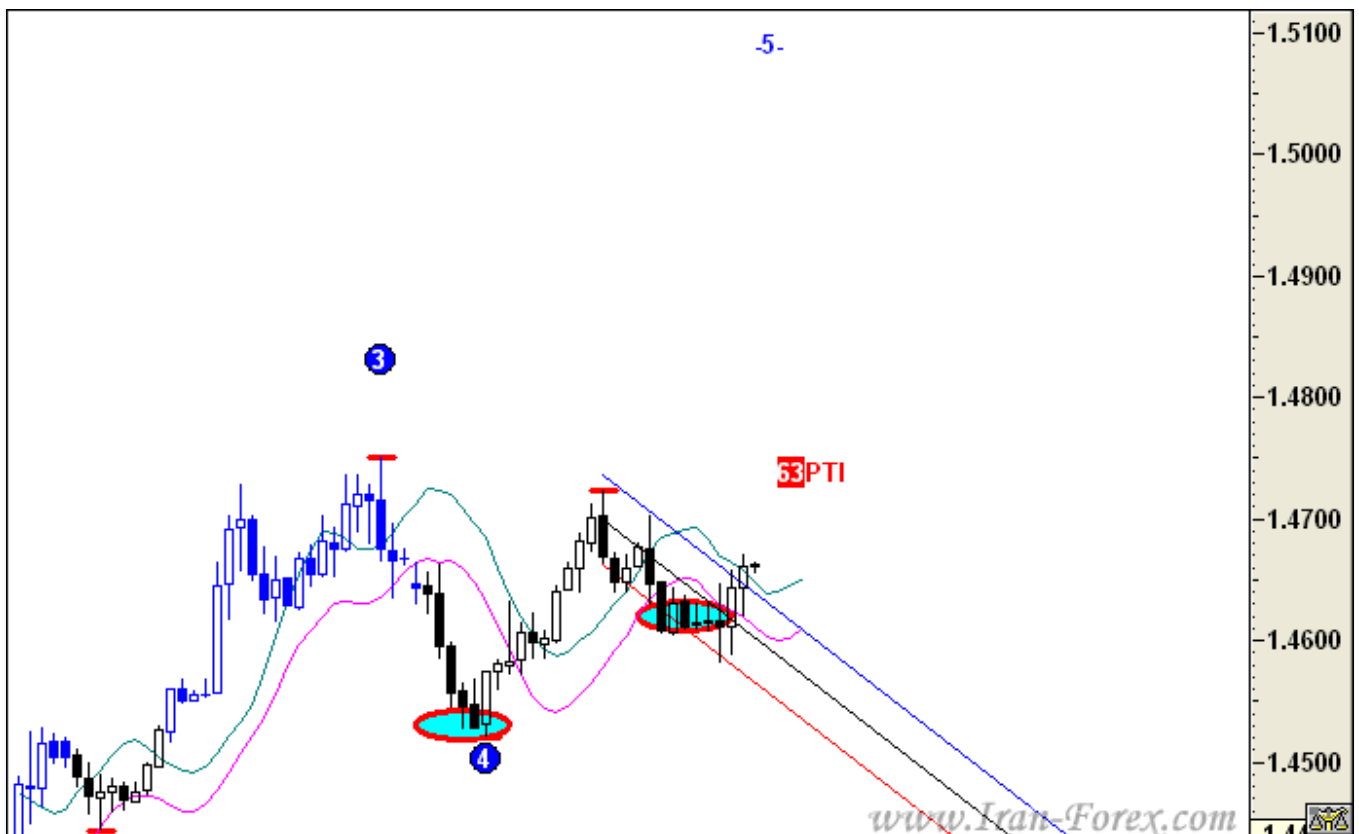
پس از چند ساعت:



ظاهراً موج چهارم که یک موج اصلاحی ترکیبی بوده خاتمه یافته و موج پنجم آغاز شده است.

نکته: ابزار Pivot می تواند شما را در پیدا کردن نقاطی مانند A ، B و C که در تصاویر بالا دیدید کمک نماید. در پست بعد راجع به Pivot صحبت خواهیم کرد.

در این هفته بر روی این ارز فقط به BUY فکر کنید:



پیشنهاد:

ORDER BUY STOP EURUSD @ 1.4670 TP=400 SL=170

در مورد بیضی نکته ای وجود دارد که در تصاویر داده شده به خوبی رعایت نشده است. در ابتدا که بیضی را رسم می کنید ممکن است محل آن با هدف اصلی تفاوت داشته باشد (در تصویر داده شده پایینتر باشد). اما با حرکت قیمت به سمت پایین، بیضی نیز به سمت بالا حرکت می کند تا در محلی همدیگر را ملاقات نمایند. آن محل، مکانی است که به احتمال قوی تغییر مسیر قیمت در آن رخ خواهد داد. این بیضی بوسیله یک سری

نسبت ها و محاسبات فیبوناچی بین دو پیوت قبلی محاسبه و رسم شده. همچنین خطوط و زوایای گن نیز در ترسیم آن دخالت داشته است.

TJ's Ellipse

نسبتهای فیبوناچی استفاده شده در

نسبتهای فیبوناچی استفاده شده در حلقه های الیپس

Short : %38.2

Normal : %50

Long: %61.8

استفاده از Elliott Trigger برای انتخاب دقیقتر نقطه ی ورود در ترید نوع ۱

نقطه ی ورود کجاست؟ حتماً این سوال در ذهن شماست که در ترید نوع دوم نقطه ورود کاملاً مشخص است اما در ترید نوع اول چه باید کرد؟ بهترین نقطه ورود کجاست؟ اندیکاتور Elliott Trigger بعد از مهیا شدن تمام شرایط ترید نوع اول، نقطه دقیق ورود را تعیین و خیال ما را آسوده می کند. به شکل زیر توجه کنید: نمودار - EURUSD یک ساعته - آخرین وضعیت در ساعات پایانی بازار در هفته گذشته:



تمام شرایط برای یک پوزیشن Buy فراهم شده است:

موج سوم شماره گذاری شده است.

اسیلاتور به صفر رسیده و کمی نیز در جهت منفی حرکت کرده است.

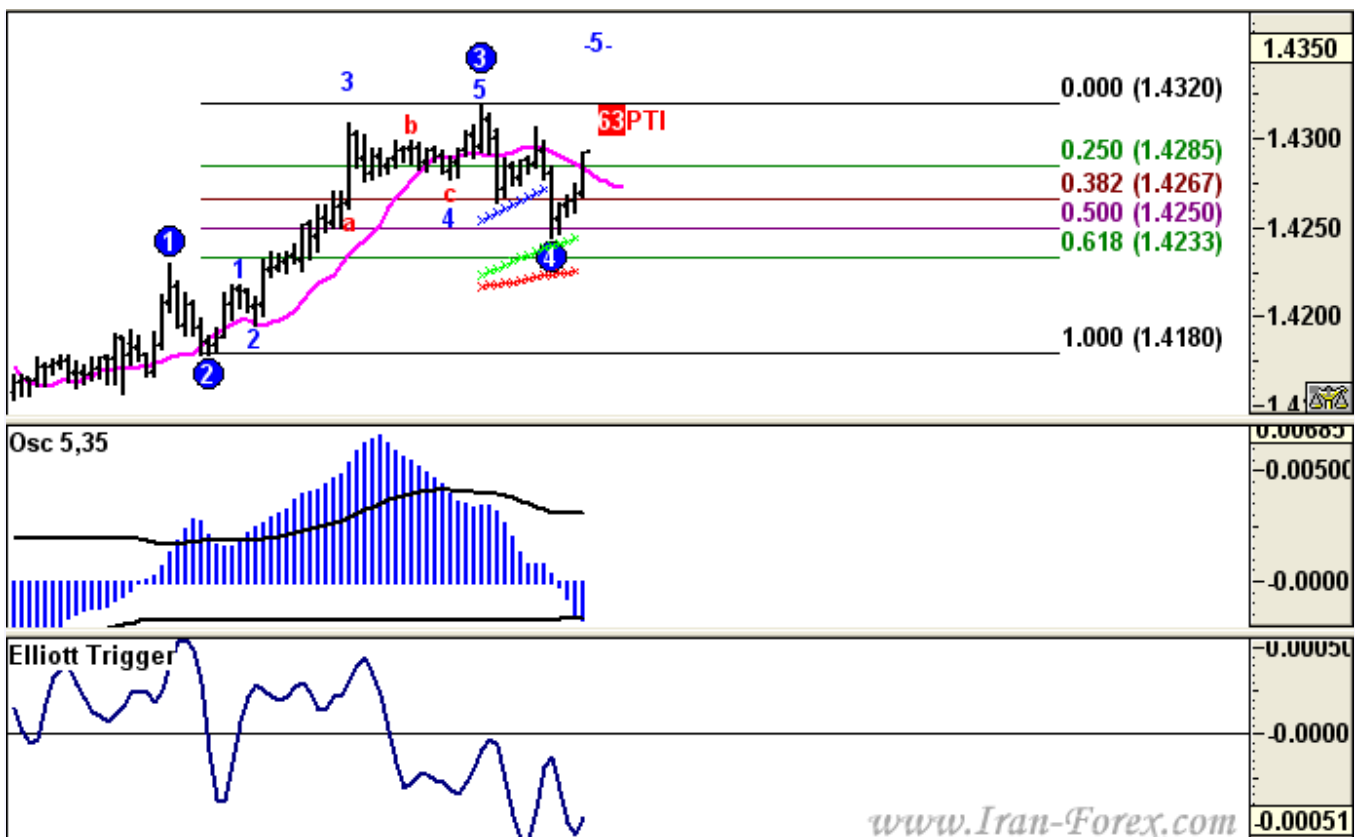
PTI بزرگتر از ۳۵ است.

موج چهارم بالای "کانال های موج چهارم" است.

تایم فریم چهارساعته نیز در حال تشکیل موج پنجم می باشد و صعودی است.

از منوی Chart زیرمنوی Studies و از منوی آن گزینه Elliott Trigger را انتخاب کنید (با راست کلیک بر روی نمودار هم می توانید).

شکل زیر را خواهید داشت:

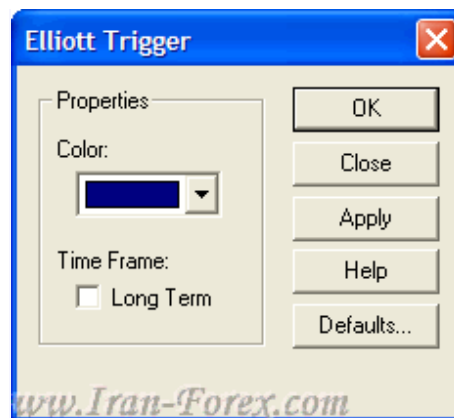


با خیال آسوده صبر کنید تا اندیکاتور Elliott Trigger که هم اکنون زیر صفر است به خط صفر رسیده و آن را به سمت بالا قطع کند. به محض قطع شدن خط صفر در Open کندل بعد وارد می شویم. بدیهی است که برای روند نزولی، این اندیکاتور باید خط صفر را از بالا به سمت پایین قطع کند.

همانطور که قبلاً گفته شده از ابزار الیوت تریگر برای اطمینان از اتمام موج ۴ استفاده می کنیم .

توضیحات مربوط به تنظیمات این ابزار:

بر روی الیوت تریگر رایت کلیک کنید و به بخش Properties بروید.



با استفاده از **Color** می‌توانید رنگ مربوط به اندیکاتور را تغییر دهید.

*از گزینه **Long Term** فقط زمانی استفاده کنید که از شمارش **Alternative3** آلترناتیو ۳ و اسیلاتور ۱۰،۷۰ استفاده می کنید. دو نمونه از موارد استفاده از الیوت تریگر بصورت انیمیشن:

NZDUSD240-Type 1 Buy

GBPUSD240-Alt3-Type 1 Buy

ترید نوع دوم - (Type 2) ورود در انتهای موج پنجم:

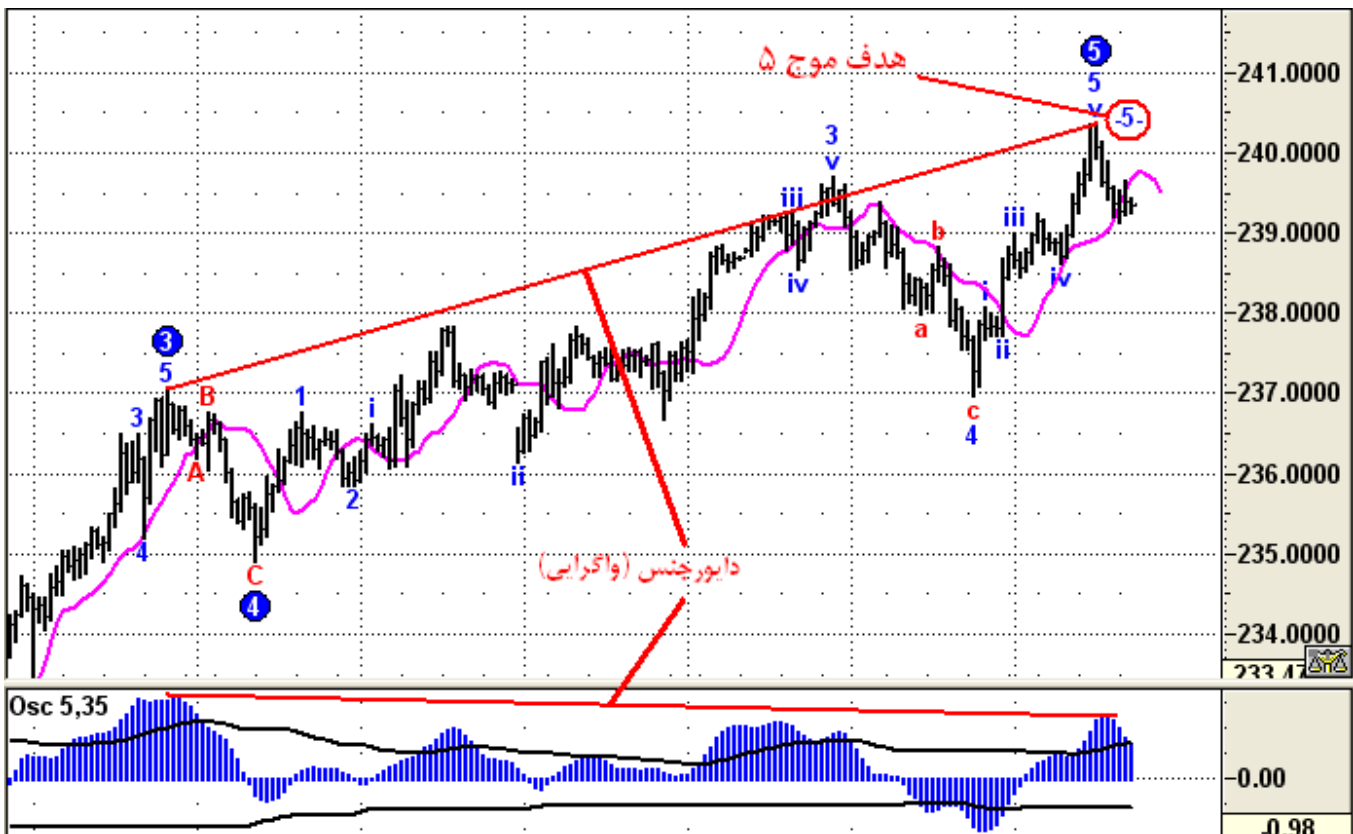
شرایط فروش:

قیمت در نزدیکی هدف موج پنجم است (هدف پیش بینی شده توسط نرم افزار).
Oscillator 2-High بین موج سوم و High موج پنجم یک دایورجنس را نشان می دهد و به سمت صفر در حال حرکت است.
 به محض شکست DMA در Open کندل بعد وارد می شویم.

حد سود:

اولین هدف انتهای موج چهارم (یعنی جایی که دایره آبی رنگ شماره ۴ را می بینید) می باشد. از خطوط فیبوناچی که بین انتهای موج چهارم و انتهای موج پنجم رسم می کنید نیز می توانید به عنوان اهداف کوتاه مدت استفاده کنید. پیشنهاد بنده خطوط فیبوناچی است.

حد ضرر High: موج پنجم با چند پیپ فاصله اطمینان (۱۰ پیپ فاصله ایده آل است. مثال):



سایر ابزارها

باز و بستن اتوماتیک AdvancedGet با AGET Auto-Open/Close

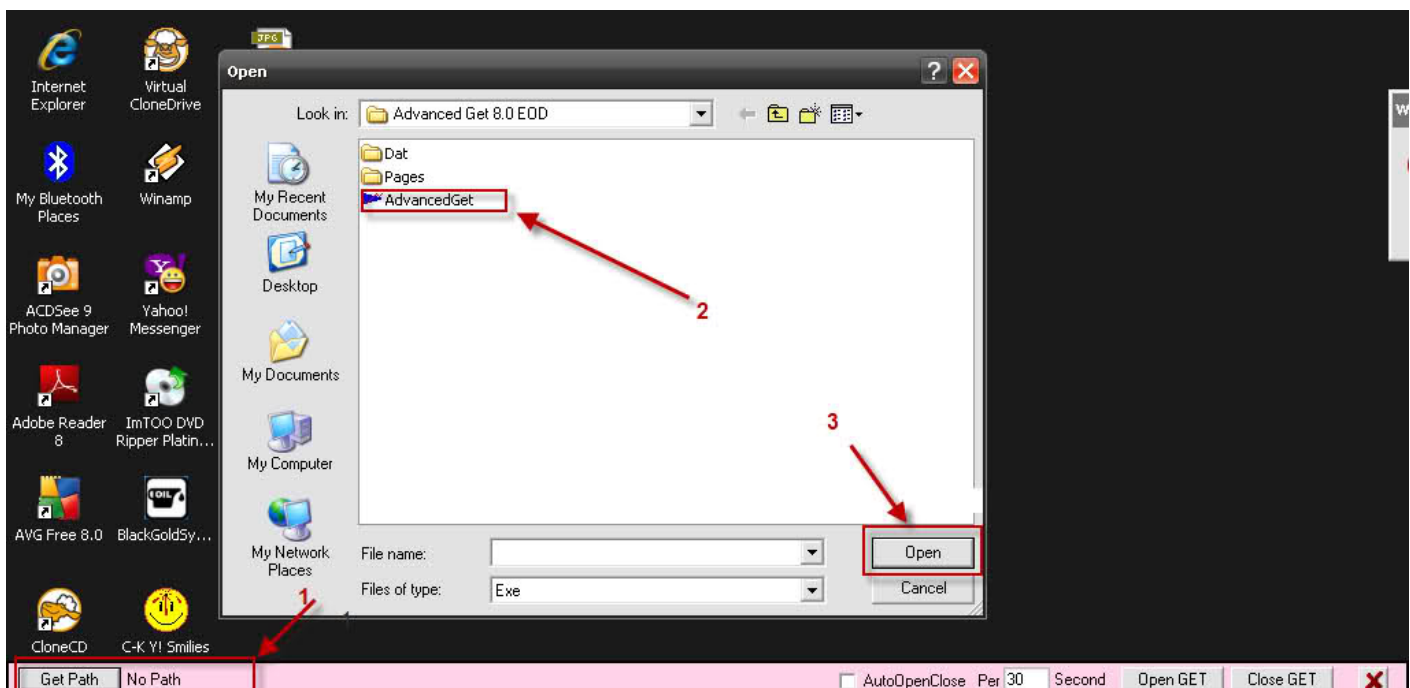
برنامه ای برای راحتی همه دوستانی که در تایم فریمهای پایین در AGET کار میکنند و دیگه لازم نیست AGET را مدام باز و بسته کنید.

این برنامه به صورت خودکار برنامه AGET را باز و بسته میکند. کافیست تایم مورد نظر برای بازبسته شدن AGET را به این نرم افزار بدهید.

پس از دانلود و Extract ، برنامه را اجرا کنید:

بعد از اجرای نرم افزار برروی Get Path کلیک کنید و آدرس فایل اجرایی AGET را به آن بدهید. توجه داشته باشید که برای باز و بسته شدن اتوماتیک AGET ، نام فایل اجرایی نرم افزار ادونسدگت باید AdvancedGet.exe باشد. اگر اینطور نیست فایل را Rename کرده و به AdvancedGet.exe تغییر دهید.

مراحل زیر به ترتیب انجام دهید:



بعد از انتخاب **AdvancedGet.exe** آدرس آن را مشاهده خواهید کرد: در نهایت مدت زمانی را که میخواهید **AGET** بعد ابه صورت اتوماتیک باز بسته شود برحسب ثانیه وارد کرده و بعد گزینه **AutoOpenClose** را فعال کنید. پس از کلیک بر روی **Open GET** نرم افزار **AGET** باز میشود. در صورتی که نایم فایل را به درستی به **AdvancedGet.exe** تغییر داده باشید با کلیک بر روی **Close GET** نرم افزار **AGET** بسته میشود.

کانال رگرسیون ترند

ابزارهای ساده دیگری در **Advanced GET** وجود دارند که بنا به تشخیص خود می توانید از آنها برای تأیید استفاده کنید. یکی از آنها کانال رگرسیون ترند می باشد که با ابزار **AutoTrend** در نرم افزار به طور اتوماتیک رسم می شود و به طور اتوماتیک نیز خود را اصلاح می کند. هنگامی که یک روند در یک جهت خاص شروع می شود قیمت تمایل دارد که در این کانال بماند و بین خطوط بالایی و پایینی آن نوسان کند. شکسته شدن کانال نشان دهنده پایان روند است. در موارد زیر می توانیم از این ابزار استفاده کنیم:

- مشخص کردن پایان موج دوم و ورود در ابتدای موج سوم.
 - خروج از معامله در موج سوم به محض شکسته شدن کانال.
 - جهت تأیید برای ورود در انتهای موج چهارم (ترید نوع اول). (خروج از معامله موج پنجم در صورت شکسته شدن کانال و تأییدی برای ورود به معامله در جهت مخالف (ترید نوع دوم).
- با کلیک بر روی دکمه نشان داده شده و زدن **OK** در پنجره ظاهر شده کانال رگرسیون ترند به طور اتوماتیک رسم می شوند:

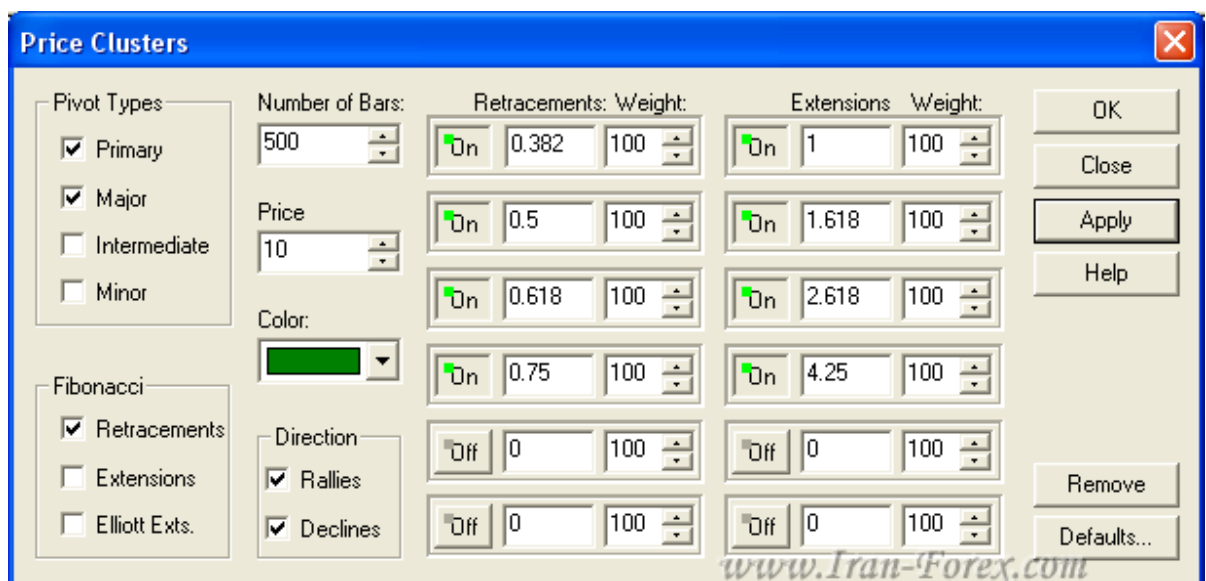


Price Clusters

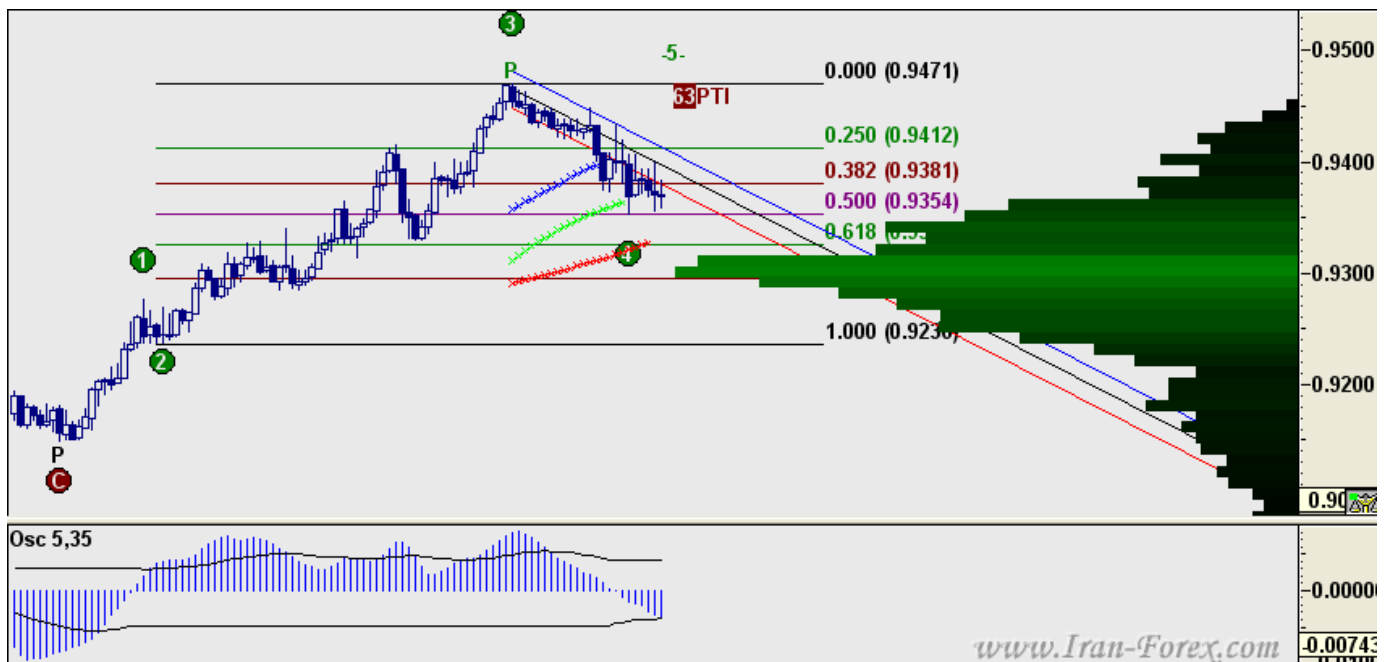
تا به حال با روش های مختلفی برای اطمینان از پایان موج چهارم آشنا شده ایم. یکی دیگر از این روش ها استفاده از ابزار Price Clusters است که قبلا در تاپیک سیگنالها با نمونه ای از آن در نمودار GBPUSD آشنا شدید. از این ابزار جهت تأیید در سایر استراتژی های خود نیز می توانید بهره بگیرید. چارت زیر نمودار یک ساعته AUDUSD را در موقعیت خرید نوع اول نشان می دهد:



با کلیک بر روی ابزار پرایس کلاستر پنجره ای باز می شود که در آن تنظیمات گوناگونی وجود دارد. در صورتی که بخواهید تنها مقاومت های قیمت را ببینید در قسمت Fibonacci فقط عبارت Retracements را تیک بزنید:



بعد از کلیک دکمه OK نمودار به شکل زیر در می آید:



بلندترین نوار سبز رنگ یا کمی پایینتر از آن قویترین مقاومت (خط حمایت) را برای موج چهارم نشان می دهد. از ترکیب این نوار با خطوط فیبوناچی می توانید به نتایج بهتری در تعیین نقطه احتمالی بازگشت قیمت دست پیدا کنید.

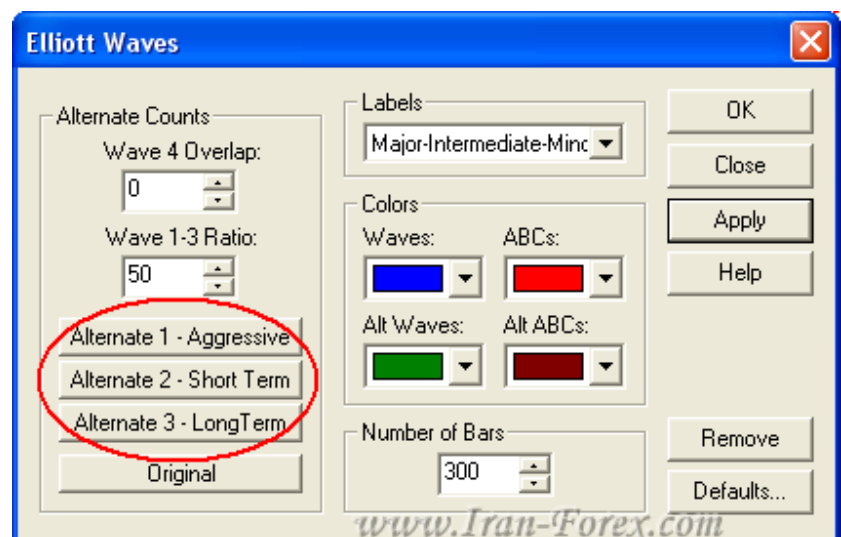
Trade Profile

یکی دیگر از امکانات نرم افزار قابلیت تشخیص سطوح خرید یا فروش در گذشته با توجه به میزان حجم معاملاتی صورت گرفته یا Volume می باشد. این سطوح بوسیله نوارهای آبی رنگ (Buy Zone) و قرمز رنگ (Sell Zone) نشان داده می شوند. انتظار می رود که قیمت با رسیدن به این سطوح عکس العمل نشان داده و مطابق با رنگ نوار عمل نماید بدین معنی که با رسیدن به نوار آبی به سمت بالا و با رسیدن به نوار قرمز به سمت پایین حرکت کند. هر مقدار که این نوارها ضخیم تر و بلندتر باشند قدرت بیشتر آنها را نشان می دهد. با استفاده از این ابزار می توانید برای تعیین نقطه ورود به یک پوزیشن یا تعیین استاپ لاس تأیید بیشتری بگیرید. به گفته طراحان، این قابلیت جدای از به کارگیری در استراتژی های نرم افزار در ۶۰ درصد موارد جوابگوست.



آلترناتیوها

با کلیک راست بر روی چارت و انتخاب Elliott Waves پنجره ای به شکل زیر ظاهر می شود:



در قسمتی که با دایره قرمز رنگ می بینید سه دکمه وجود دارد:

1- Alternate 1 – Aggressive : هنگامی که در موج چهارم هستید بعضی مواقع اسیلاتور مدت زیادی را در زیر صفر (برای روند صعودی) یا بالای صفر (برای روند نزولی) می ماند که گاهی با شکسته شدن کانال قرمز رنگ، افت شدید PTI و رد شدن اسیلاتور از ۳۸ درصد اکستریم اسیلاتور در موج سوم همراه است. در این گونه موارد از این آلترناتیو به عنوان یک ایده دوم برای شماره گذاری امواج استفاده کرده و بر اساس آن ترید کنید.

2- Alternate 2 – Short Term : آلترناتیو شماره دو – کوتاه مدت : برای تشخیص ریز موج ها در یک موج بزرگتر به کار می رود. به عنوان مثال این امر در شکار موج سوم ما را یاری می کند.

3- Alternate 3 – Long Term : آلترناتیو شماره سه – بلند مدت : هنگامی که رالی ۵ موجی الیوت تکمیل می شود ممکن است برای برگشت قیمت حرکات اصلاحی بوجود آید. در این گونه موارد دایره های قرمز رنگ A ، B و C دیده می شوند. در این شرایط از این آلترناتیو به عنوان ایده دوم استفاده نمایید.

دکمه آخر هم **Original** و یا حالت اصلی و پیش فرض نرم افزار برای شماره گذاری است که با دایره های آبی رنگ در چارت نمایش داده می شوند. شماره گذاری آلترناتیو ها با مربع های سبز رنگ دیده می شوند.

Training Mode

از منوی Chart گزینه Training Mode را انتخاب کنید. نوار ابزاری به شکل زیر به نمایش در می آید:

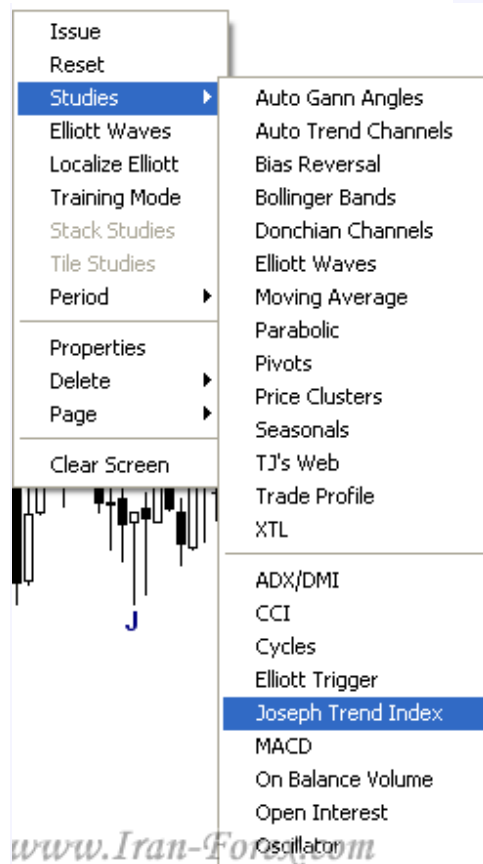


اکنون می توانید به گذشته باز گردید!

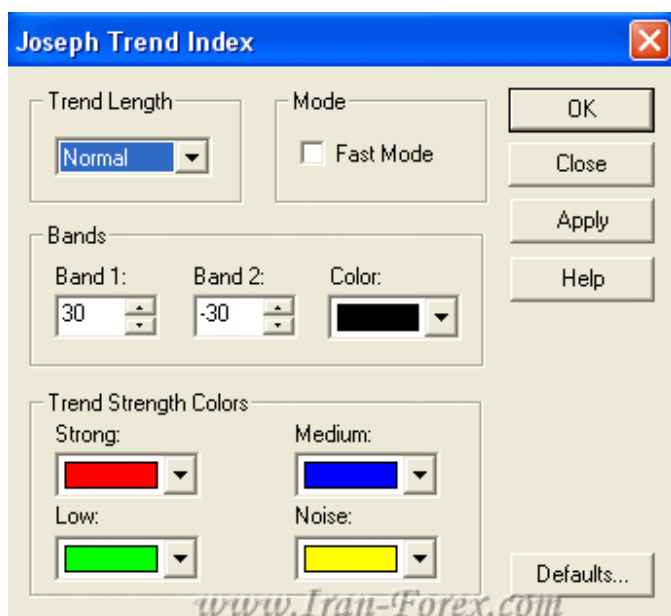
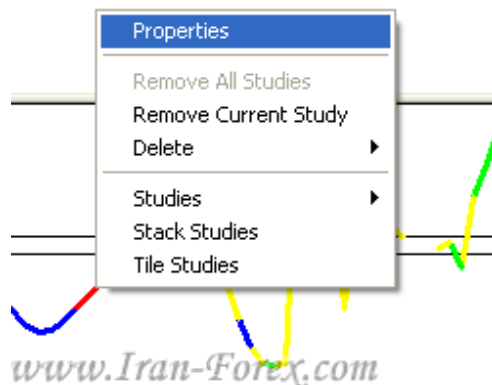
ابزاری جهت شناسایی ترند موجود در بازار است. قدرت بازار توسط این ابزار طبقه بندی می شود، طبقه بندی ها به قرار زیر است:

1. قرمز: بسیار قوی
2. آبی: قدرت متوسط
3. سبز: قدرت ضعیف
4. زرد: نویزهای بازار

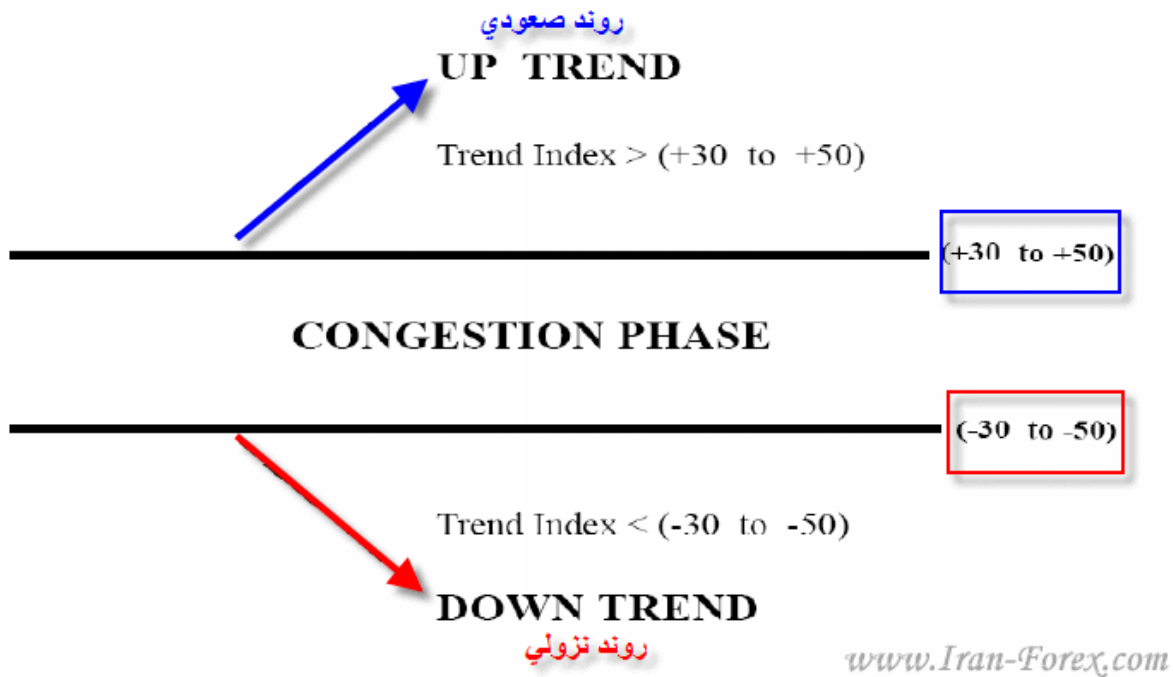
طبق تصویرهای زیر ابزار را فعال کنید.



برای تنظیمات بر روی ابزار راست کلیک کنید. بهتر است تنظیمات را بر روی حالت پیش فرض ثابت بگذارید.

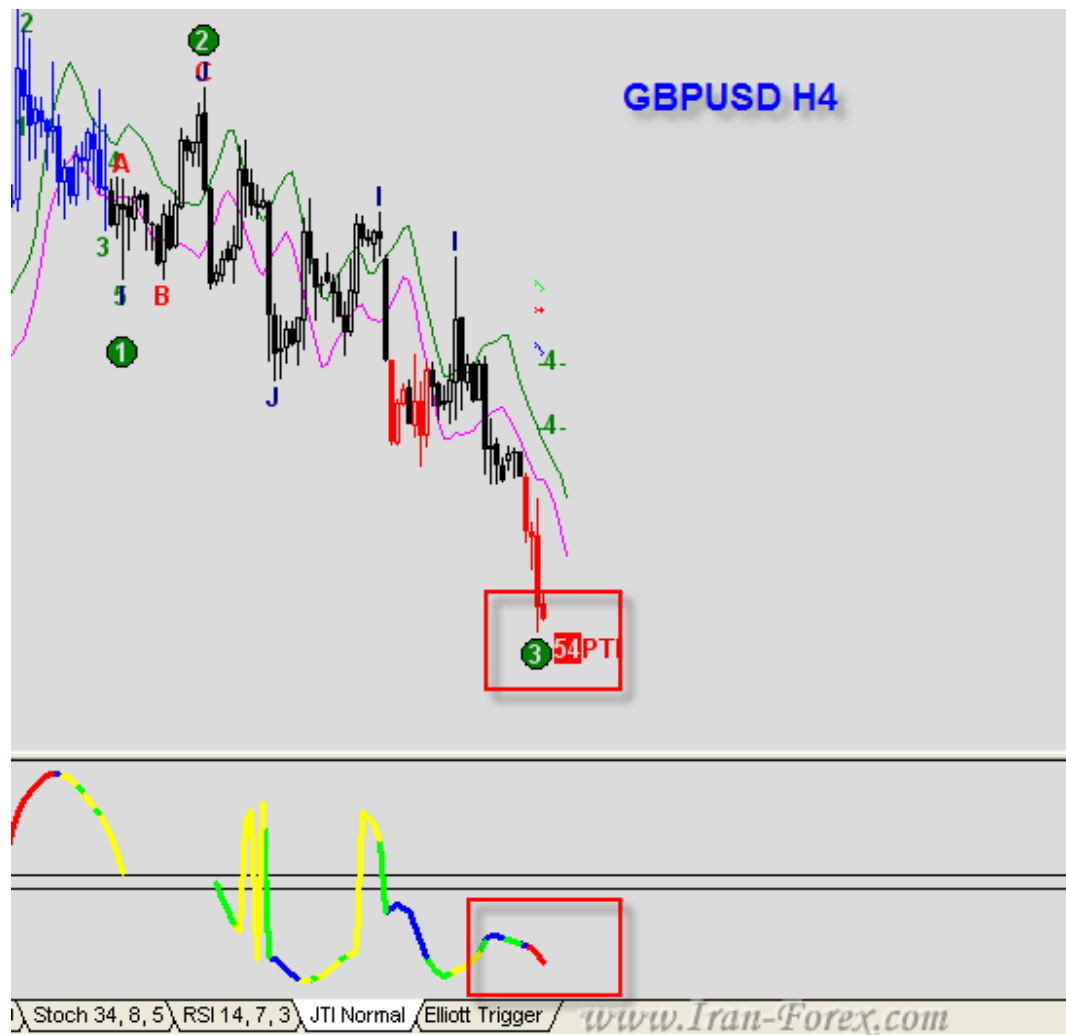


دو باند موجود تعیین کننده ی روند صعودی یا نزولی هستند.



در موج های سه و پنج رنگ این ابزار قرمز می شود و تاییدی برای قدرت موج است.

مثال:



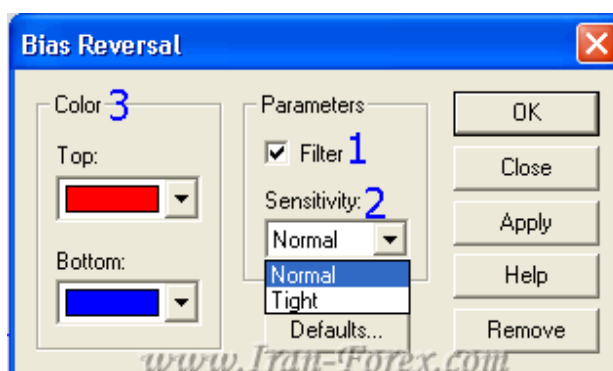
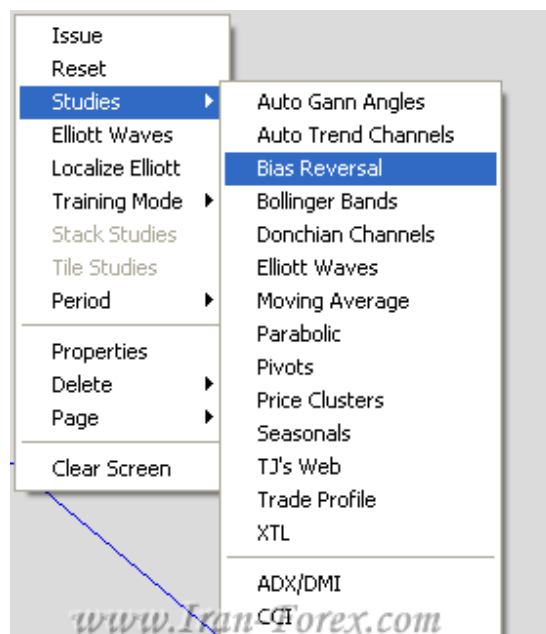
Bias Reversal

تعیین نقاط برگشت قیمت با ابزار

ابزار بایاس ریورسال Bias Reversal تعیین کننده ی زمانی مناسب برای اتمام روند است. این ابزار به تنهایی قابل اعتماد نیست و باید با ابزارهای دیگر هم چون کانال رگرسیون مورد استفاده قرار بگیرد.

به این دلیل گفتم سیگنال قطعی نیست چون باید منتظر چند کندل بعد باشید تا علامت بایاس در چارت ثابت شود.

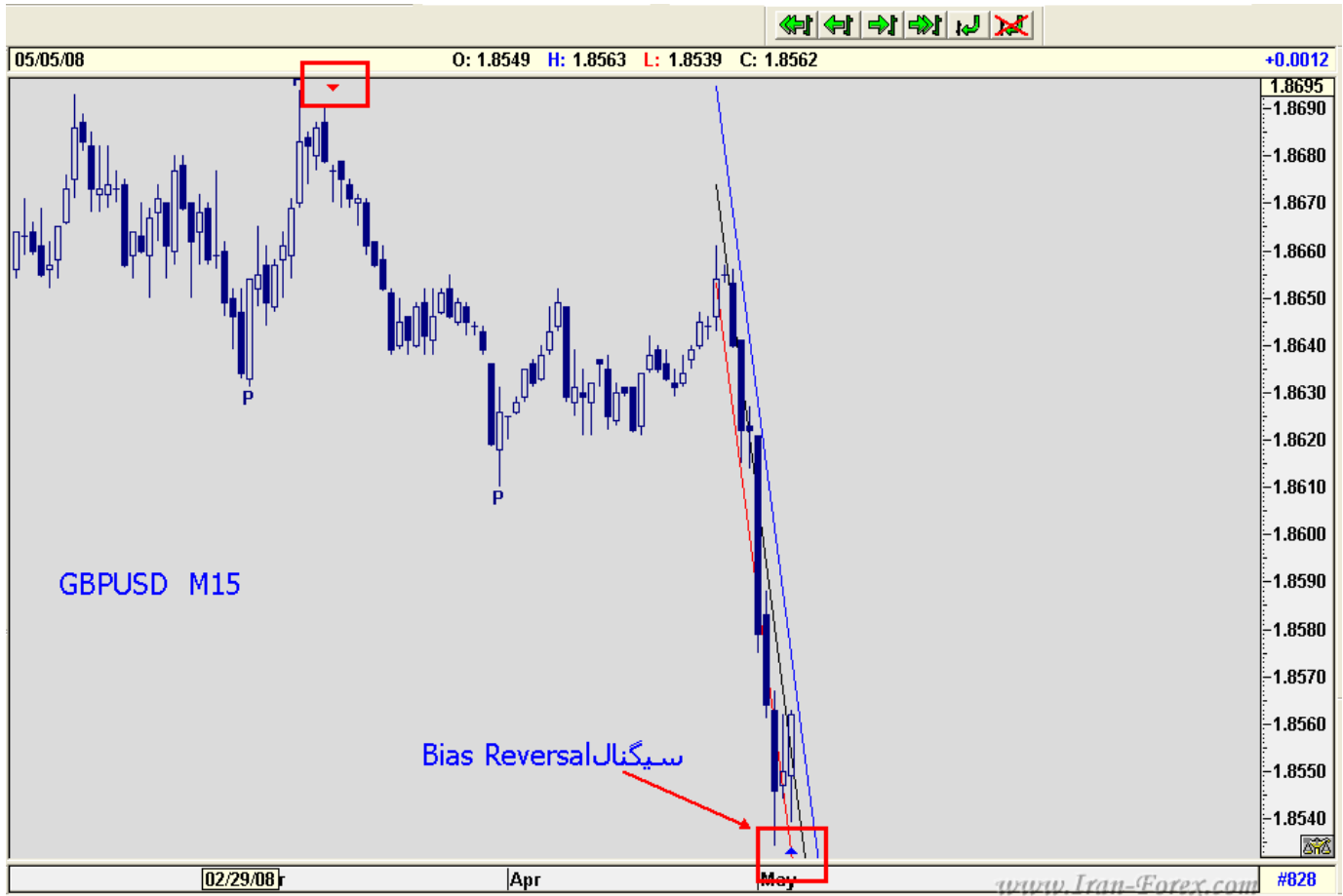
بر روی چارت دکمه ی سمت راست موس را بزنید و مانند شکل زیر گزینه ی بایاس را انتخاب کنید.



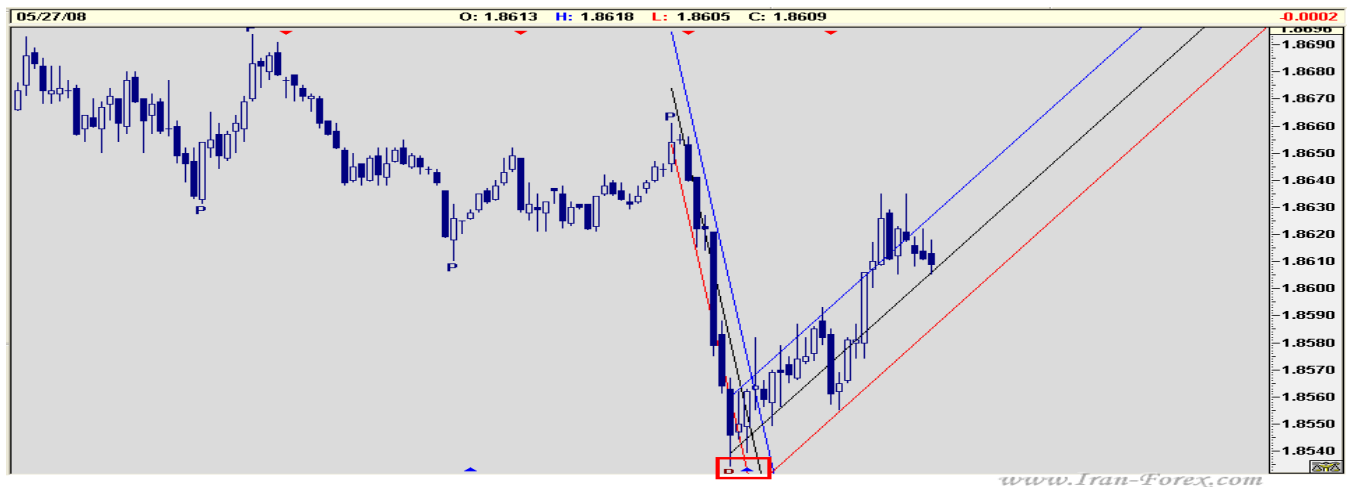
Filter: اگر این گزینه را انتخاب کنید مثلث های کوچکی که به عنوان سیگنال برگشتی در چارت ظاهر می شد اگر سیگنال خطا باشند به شکل خودکار از روی چارت حذف می شوند اما اگر این گزینه انتخاب نشود بر روی سیگنال های خطا، خطی رسم می شود.

حساسیت **Sensitivity** دو نوع حساسیت تعریف شده است. یکی **Normal** و **Tight** سختگیرانه **Color** : انتخاب رنگ برای مثلث های تعیین کننده ی برگشت می باشد.

مثال: بایاس در این شکل حساسیت سختگیرانه دارد.



بایاس در این شکل حساسیت نرمال دارد در انتظار تثبیت سیگنال و خروج از کانال رگرسیون می مانیم.



خطوط گن

با استفاده از ابزار Gann Box در نرم افزار می توانید مکان های هندسی احتمالی برای پایان موج های ۳، ۴ و ۵ را تعیین کنید.

نقاط احتمالی پایان موج ۳ و ۵:

بر روی Gann Box کلیک و سپس بر روی نقطه پیوت قبل از آغاز ۵ موج کلیک کنید. معمولاً و نه همیشه این نقطه پیوت در روند صعودی از High موج اول بالاتر و در روند نزولی از Low موج اول پایینتر است. با حرکت موس به سمت قیمت جاری، جعبه گن ترسیم می گردد. با کمی ممارست می توانید از نقاط پیوت قبلی دیگر یا حتی High یا Low خود موج یک که روند را در ترسیم گن بهتر نشان می دهند نیز استفاده کنید.

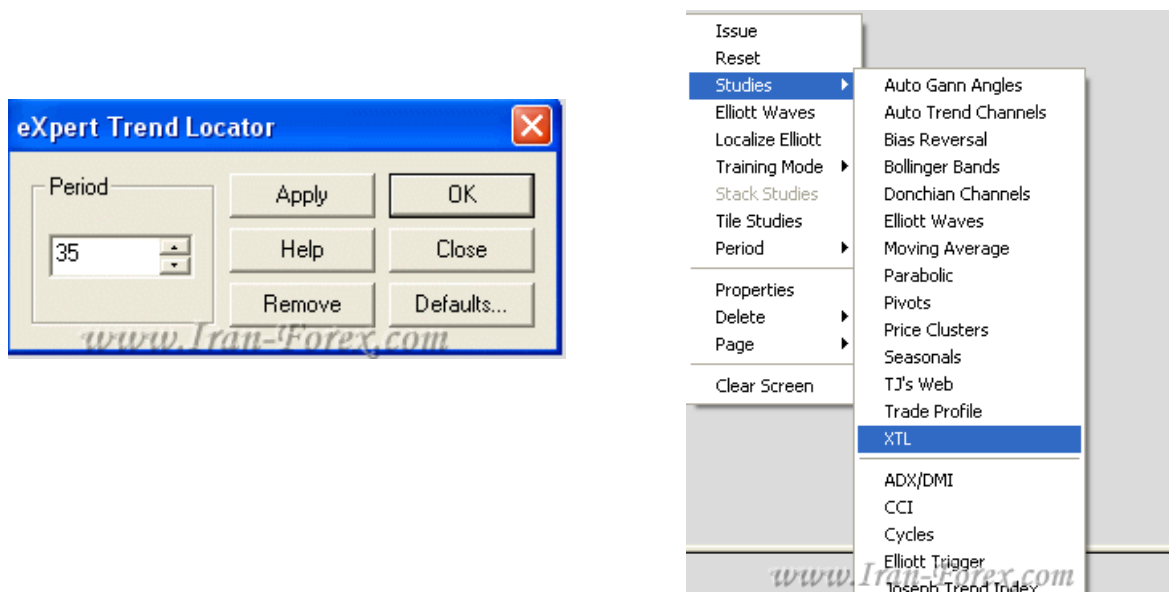
نقاط احتمالی پایان موج ۴:

بر روی Gann Box کلیک و سپس بر روی نقطه پیوت قبل از آغاز ۵ موج کلیک کنید. معمولاً این نقطه پیوت در روند صعودی Low ترین نقطه قبل از آغاز ۵ موج و در روند نزولی High ترین نقطه قبل از آغاز ۵ موج است. با حرکت موس به سمت قیمت جاری، جعبه گن ترسیم می گردد. گاهی اوقات نیز می توان انتهای موج دوم را به عنوان نقطه پیوت در نظر گرفت.

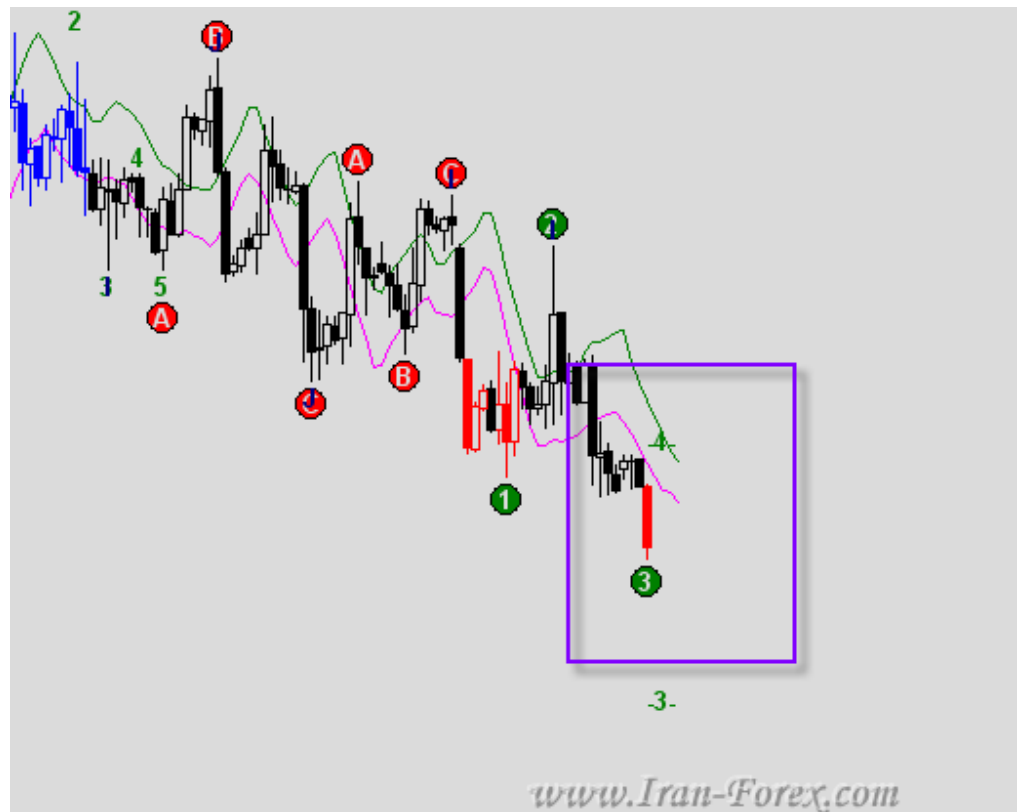
تئوری گن: حرکات قیمت که ناشی از رفتارهای فرکتالی معامله گران (ترس، طمع و ...) است، مکان های هندسی روند داری را تشکیل می دهد که قیمت در طول روند با رسیدن به آنها تغییر مسیر می دهد. خطوط گن در بسیاری از موارد این مکان های هندسی را به زیبایی نشان می دهد.

ابزار - XTL مشخص کننده روند - آبی ترند بالا رو و قرمز ترند پایین رو. از آن برای تأیید در ترندهای خود استفاده کنید. شکسته شدن کانال رگرسیون می تواند علامتی بر پایان ترند باشد. تنظیمات پیش فرض را انتخاب کنید ابزاری بسیار قوی در تعیین ترند موجود در بازار است. از این ابزار می توان برای شکار موج ۳ و ۵ در ادونسد گت استفاده کرد.

توصیه می کنم این ابزار را حتما در ابزارهای تحلیل خودتون قرار بدید (XTL is miracle) روش استفاده از XTL را توضیح می دهم امیدوارم سودهای خوبی ازش بگیرید. ابتدا XTL را بر روی چارت فعال کنید و تنظیمات آن را بر روی عدد ۳۵ ثابت بگذارید. این عدد بهترین عدد سیگنالده برای جفت ارزهاست. خطای بسیار کمتری داره. می توانید از اعداد ۲۱ و ۱۳ نیز استفاده کنید.

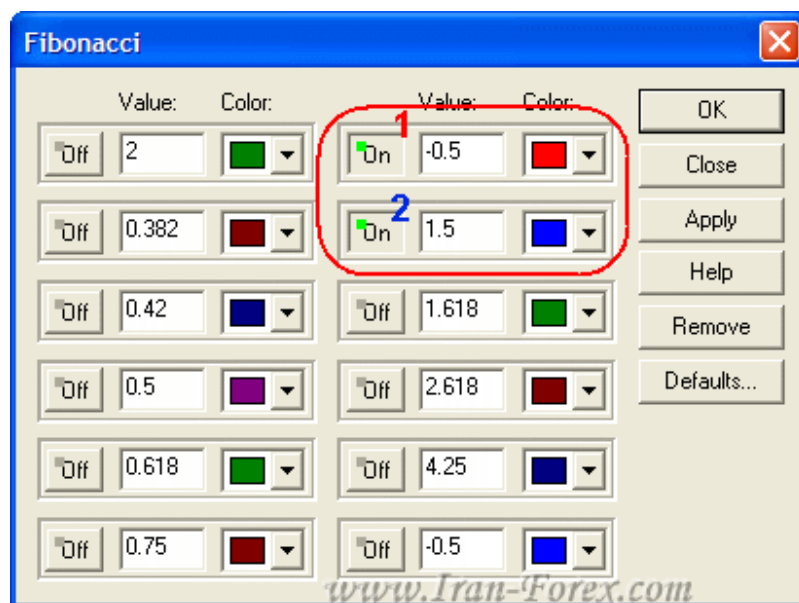


کندلهای قرمز رنگ نشان دهنده ی روند نزولی و کندلهای آبی رنگ نشان دهنده ی روند صعودی است. اولین بار قرمز رنگ یا آبی رنگ ما را برای اردر گذاری فرامی خواند.



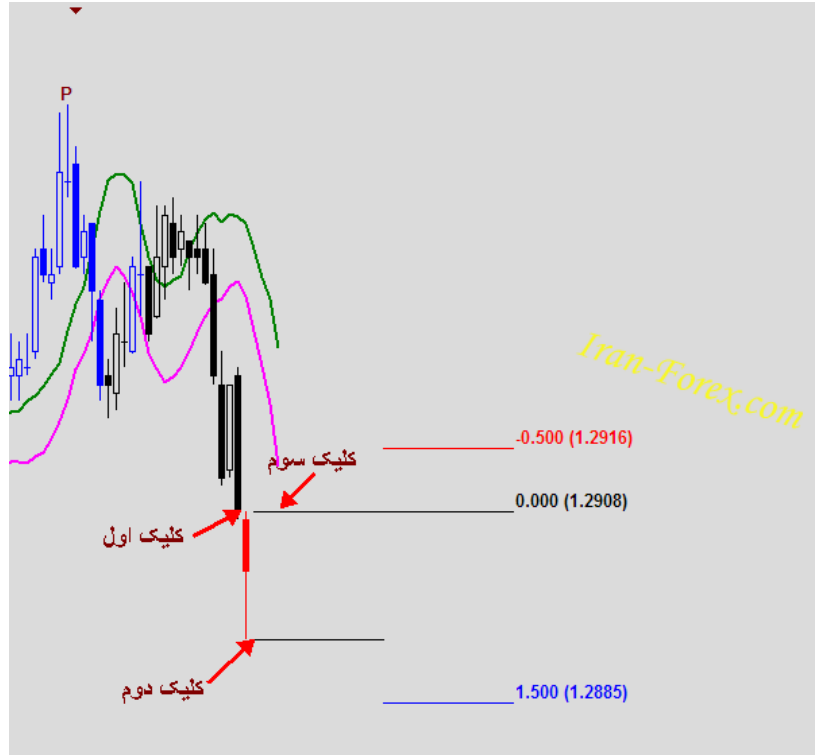
بر روی ابزار فیبو اکستنشن Fibo Extension کلیک کنید و تنظیمات را انجام دهید. باید اردری به اندازه ی نیم برابر کندل رنگی پایین تر (بالا تر) از این کندل قرار دهید.

نکته: باید تا بسته شدن اولین کندل آبی یا قرمز منتظر بمانید و سپس خطوط فیبو را رسم کنید.

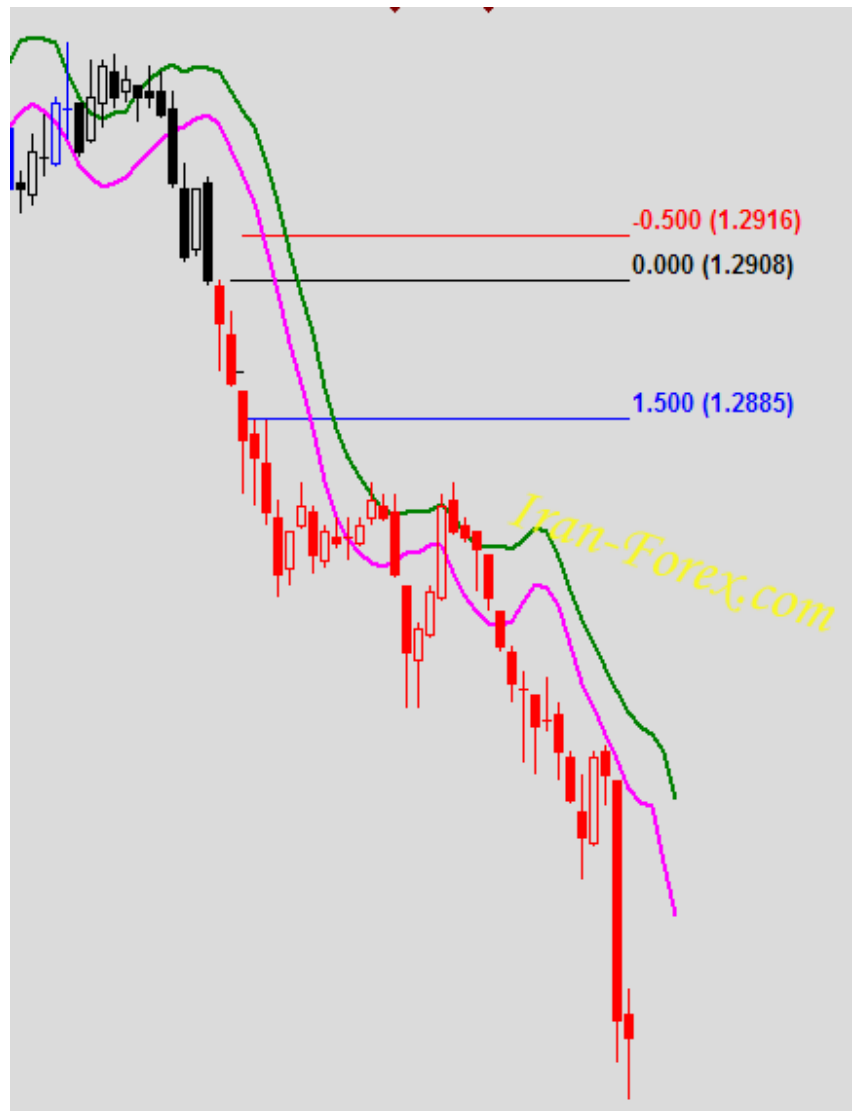


عدد ۱ نقطه ی استاپ و ۲ نقطه ی ورود است

طبق روش زیر ، بر روی اولین کندل رنگی خطوط فیبو را رسم کنید تا نقطه ی ورود و استاپ را بدست آورید.



نتیجه ی این سیگنال:



ابتدا بر روی High کندل قرمز و بعد Low و دوباره High کلیک کنید تا نیم برابر کندل برای تعیین نقطه ی ورود به همراه استاپ مشخص شود.

قوانین روش:

قانون اول: اگر قبل از فعال شدن Order ، قیمت به نقطه ی استاپ رسید باید Order را حذف کنید.
 قانون دوم : اگر قبل از فعال شدن Order ، رنگ کندل ها سیاه شد، Order را پاک نکنید.
 قانون سوم: اگر قبل از فعال شدن Order ، تغییر رنگ از آبی به قرمز یا برعکس را داشتید، هر دو Order را آماده بگذارید و هر کدام که فعال شد دیگری را حذف کنید .

نکته ی بعدی این است که چه موقع از پوزیشن خارج شویم:

۱- بعد از ادامه ی روند و رفتن پوزیشن در سود مناسب با تغییر رنگ کندل ها از رنگی به سیاه می توانید از بازار خارج شوید.

۲- از بایاس ریورسال (سخت گیرانه) بعلاوه ی اندیس جوزف ترند و کانال رگرسیون می توانید استفاده کنید.
امیدوارم سودهای خوبی از این روش کسب کنید.

شمارش مجدد امواج - نوشته ی مایکل کریدلر

ماهیت پویای Advanced GET یکی از مواردیست که این نرم افزار را از سایر برنامه های آنالیز تکنیکال متمایز نموده است. AGET به بازار واکنش نشان میدهد و خود را با شرایط کنونی آن وفق میدهد که به معامله گر امکان یافتن موقعیت هایی را که قبلاً وجود نداشتند، می دهد. این همان ذات پویاست، هرچند که برخی از کاربران را نگران می کند. آنها (کاربران) این حقیقت را می بینند که AGET امواج را دوباره شماره گذاری می کند که بنوعی اثبات می کند شمارش امواج سطحی و غیر قابل اطمینان است. حقیقت مطلب اینست که بسیاری از کاربران بیش از حد، روی شمارش الیوت تمرکز می کنند. نتیجه ی اساسی این است که "وقتی یک موقعیت معامله پیش می آید شمارش الیوت دیگر چیست؟!!" اگر موقعیت معامله فراهم است، شمارش مجدد امواج، معامله ی شما را تغییر نخواهد داد. همچنین اگر شمارش مجدد امواج پیش از موقعیت معامله رخ دهد، پس به دنبال موقعیت بعدی باشید. هدف این نوشتار اینست که به شما بینشی در مورد شرایط اندکی که در آنها شمارش مجدد امواج متعارف است، داده و دلایل آن را ارائه دهد. الگوریتم الیوتی که ما برای AGET توسعه داده ایم پیچیده است، به حدی پیچیده که نیازمند یک کامپیوتر برای ثبت تمام متغیرها می باشد و این نوشتار در صدد بحث فراگیر در مورد تمامی متغیرها در همه ی شرایط نیست، بلکه در پی فراهم آوردن اصول بسیار اولیه و اساسی راهنمایی برای شماست.

جستجوی موج شماره ی ۳

شما مکرراً با شمارش مجدد امواج بعد از اتمام موج ۵ و شروع مراحل بعدی مواجه خواهید شد. نرم افزار در این مواقع به دنبال بهترین شمارش ممکن است و هر بار (کندل) جدید می تواند باعث پدیدار شدن شمارش جدیدی شود.

سوال: در چه نقطه ای موج ۳ نشان داده شده قابل اطمینان است؟

پاسخ: زمانیکه یک برگشت قوی از باند گسترش یافته بوجود آید. باند گسترش یافته ، خط پر پیچ و خمی است که شما در نوسانگر خواهید یافت. بعضی فکر می کنند که آن ، میانگین متحرک نوسانگر است ولی اینگونه نیست . چگونگی محاسبه ی باند مهم نیست ، آنچه مهم است نحوه ی استفاده از آن است. تنها هدف آن تصدیق موجهای ۳ است. وقتی حرکتی پر قدرت بالای این باند (در روند صعودی) یا در پایین این باند (در روند نزولی) ایجاد می شود و با یک موج شماره ی ۵ پیگیری می شود، شما می توانید اطمینان بسیاری به شمارش الیوت داشته باشید .

همپوشانی موج ۴

شرایط متعارف دیگری که در آن شمارش مجدد رخ می دهد ، همپوشانی موج ۴ با موج ۱ است. در اینجا دو قانون با اندکی تفاوت بکار برده می شود. نرم افزار همپوشانی موج ۴ با موج ۱ را به اندازه ی ۱۷٪ برای بازار کالا اجازه می دهد ، اما برای Stock و Index این اجازه ۰٪ است. وقتی شما گسترش موج ۴ را می بینید که به موج شماره ی ۱ قبلی نزدیک میشود ، باید انتظار شمارش مجدد امواج را داشته باشید.

قدرت موج ۵

علت وقوع مکرر شمارش مجدد ، قدرت موج پنجم است. اگر موج ۵ قدرتی بیش از حد معمول داشته باشد ، نرم افزار بطور طبیعی آن را موج ۳ نامگذاری خواهد نمود. به یاد داشته باشید که موج ۵ معمولاً به اندازه ی ۶۲ تا ۱۰۰ درصد موج سوم قبلی گسترش می یابد. همچنین نوسانگر موج پنجم ضعیفتر از موج سوم قبلی است. اگر شما مشاهده کردید که حرکت قیمت بیش از ۱۰۰٪ تراز گسترش نرمال است ، به نوسانگر دقت

کنید. اگر دیگر واگرایی (دایورجنس) وجود ندارد و مخصوصاً موج ۵ از موج ۳ قویتر است، منتظر شمارش مجدد باشید.

باز هم تکرار می شود که اینها قواعد ساده ای برای راهنماییست. شمارش الیوت یک ابزار برای شما در AGET می باشد. هدف اصلی آن پیدا نمودن موقعیتهای معامله برای زمانیست که امواج الیوت معقول هستند یعنی زمانی که همه چیز صحیح است. بعضی از معامله گران از همه ی موارد فقط به شمارش امواج دقت می کنند و سردرگم (دیوانه) می شوند و می خواهند در هر صورت منفرد شمارش الیوت را درک کنند.

اصلاحی بودن یا نبودن، مسأله این است! چه میزان می توان به شماره گذاری نرم افزار اعتماد کرد؟
چه میزان می توان به شماره گذاری نرم افزار اعتماد کرد؟

موج سوم:

در صورتی که این موج توسط نرم افزار شماره گذاری شد به اسیلاتور نگاه کنید. اگر اسیلاتور خطوط نوسانگر خود را قطع کرده است (به سمت بالا برای روند صعودی - به سمت پایین برای روند نزولی) و روند تایم فریم جاری با تایم فریم بالاتر همخوانی دارد می توانید به آن اعتماد کنید. البته همانطور که می دانید به هیچ موردی نمی توان اعتماد مطلق کرد و همیشه احتمال خطا وجود دارد.

موج چهارم:

قبلاً راجع به پارامترهایی که بوسیله آنها می توان به اتمام موج چهارم و شماره گذاری آن توسط نرم افزار اطمینان حاصل کرد صحبت شده است مانند: رسیدن اسیلاتور به صفر، کانال های موج چهارم، قطع کانال رگرسیون و قطع هر دو DMA.

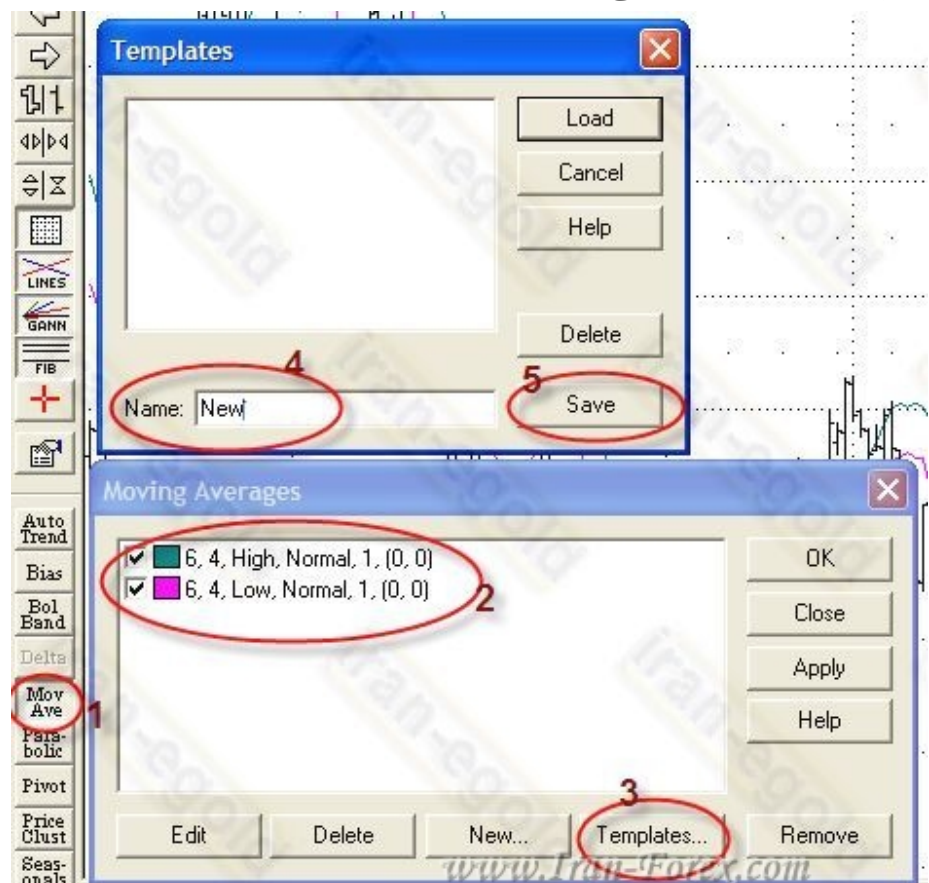
موج پنجم:

به محض اینکه قیمت از High موج سوم در روند صعودی بالاتر برود و یا از Low موج سوم در روند نزولی پایینتر، موج پنجم شماره گذاری خواهد شد. حال چگونه می توان به اتمام آن اطمینان حاصل کرد؟ پارامترهای نزدیک بودن قیمت به هدف موج پنجم، مشاهده شدن واگرایی (دایورجنس) یا همگرایی (

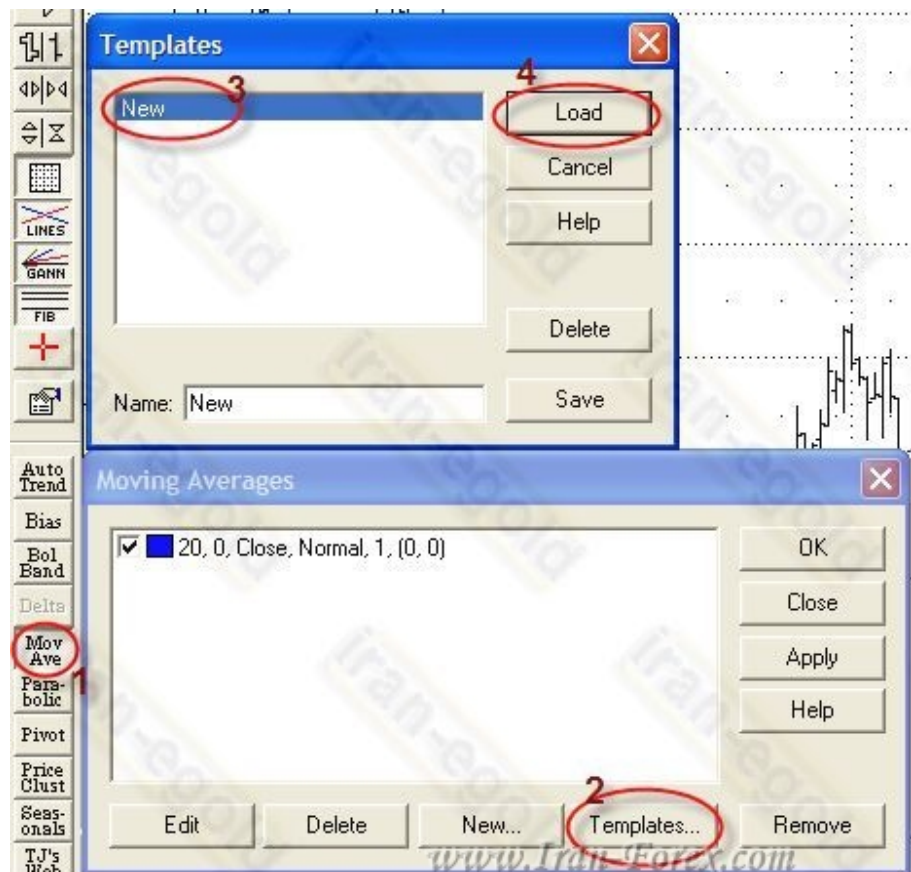
کانورجنس (در اسیلاتور و قطع هر دو DMA توسط قیمت می تواند در این مورد به ما کمک کنند) ترید نوع دوم).

تنظیمات: Moving Average

ابتدا همانند آموزشهای صفحه ی اول چارتی را Load کنید.
در نوار ابزار برروی Mov Ave کلیک کنید تا پنجره ی تنظیمات باز شود.
طبق آخرین آموزشها دو مووینگ را اضافه کنید.
برروی Templates کلیک کنید.
در پنجره ی باز شده نامی را برای این Template وارد کرده و برروی Save کلیک کنید.



فرض میکنیم چارت دیگری را باز کرده اید. برای اینکه مووینگها را به چارت جدید اضافه کنید کافیست:



بر روی **Mov Ave** و سپس در پنجره باز شده **Templates** را کلیک کنید **New** را انتخاب کرده و بر روی **Load** کلیک کنید. دو مووینگ با مشخصاتی که از قبل ذخیره کرده اید، نمایش داده میشوند. در نهایت بر روی **OK** کلیک کرده تا مووینگها به چارت اضافه شوند.

نکته: برای حذف مووینگها از روی چارت ابتدا پنجره **Moving Averages** را با کمک نوار ابزار باز کنید. بر روی **Remove** کلیک کرده و **Ok** کنید.

AdvancedGet تنظیمات خصوصیات چارت

در حالت پیش فرض چارتهای جدیدی که **Load** میکنید به صورت **Bar Chart** به نمایش در می آیند. از آنجاییکه ممکنه دوستان به نمودارهای کندل استیک (**Candle Stick**) علاقه داشته باشند، تنظیمات پیش فرض برنامه را به حالت نمودارهای شمعی تغییر میدهیم تا همیشه پس از باز کردن چارت جدید، نمودارهای کندلی داشته باشیم. برای ایجاد این تغییرات مراحل زیر را دنبال کنید:

- از نوار ابزار همانند شکل برروی **Properties** کلیک کنید. (این گزینه با رایت کلیک برروی چارت و یا از منوی **Chart** و سپس **Properties** نیز در دسترس است
- **Bar Type** را به **Candle Stick** تغییر دهید.
- مقدار **Spacing** را نیز از ۴ به ۶ تغییر دهید.
- برروی **Defaults** کلیک کنید تا پنجره ی مربوط باز شود.
- برروی **Save Current Settings As Default** کلیک کنید.
- برای اعمال تنظیمات **OK** کنید.

به این ترتیب هر گاه چارت جدیدی را **Load** کردید بدون نیاز به انجام تنظیمات به صورت کندل استیک نشان داده خواهد شد.

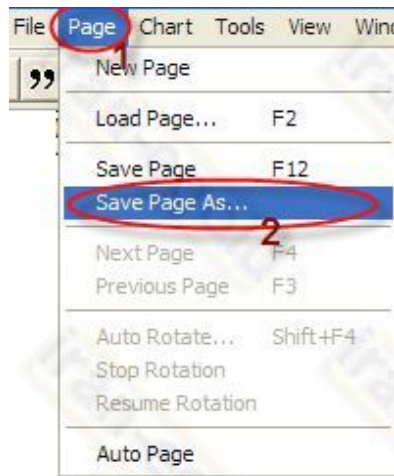
نکته: اگر قصد باز گرداندن تنظیمات برنامه به حالت پیشفرض (**Bar Chart**) را داشتید در صفحه ی **Defaults** برروی **Original Settings** و سپس برروی **Save Current Settings As Default** کلیک کنید. تنظیمات برای چارتهای جدید به حالت پیشفرض (**Original**) باز خواهد گشت. نکته: اگر در پنجره ی **Properties** و در بخش **Display** گزینه ی **Crosshairs** را انتخاب کرده و تنظیمات را **Save** کنید، در چارتهای جدیدی که باز میکنید **Crosshair** فعال خواهد بود.

تنظیمات سریع در **AdvancedGet** - ذخیره و **Load** کردن چارتهای

موارد دیگری که باید به چارت اضافه شوند، امواج الیوت، اسیلاتور، الیوت تریگر، اتوترند، **Xtl** و ... میباشند که اکثراً در نوار ابزار موجود هستند و نیازی به توضیح ندارد. پس از اینکه تمامی تنظیمات را برروی یک چارت انجام دادید، میتوانید آن را **Save** کرده و در صورت نیاز دوباره **Load** کنید.

- دقت داشته باشید قبل از ذخیره ی چارت، فقط چارت مورد نظر باز باشد و بقیه ی چارتهای را ببندید. با این روش دیگر نیاز به باز نگه داشتن بیش از یک چارت و قرار دادن آنها به صورت **Minimize** ندارید.

- چارت مورد نظر فعال باشد. از منوی Page بر روی Save Page As کلیک کنید.



در پنجره ی Save As بر روی Auto Title کلیک کنید تا نامی متناسب با چارت موجود قرار بگیرد. (میتوانید انتهای متن را تغییر دهید مثلاً GBPUSD60 D را همانند شکل به GBPUSD H1 تغییر نام دهید). همچنین شماره ی چارت را نیز بررسی کنید. در حالت عادی نرم افزار اتوماتیک به شماره ها می افزاید.



در سمت چپ در حال حاضر فولدر اصلی یا همان Pages انتخاب شده. شما میتوانید برای هر جفت ارز با کلیک بر روی علامت New Folder ، پوشه ی جدیدی ایجاد کنید.

حال قصد اضافه کردن چارت های دیگر را داریم.

ابتدا چارت H1 را که ذخیره کردیم، می بندیم.

چارت H4 از همین ارز یا H1 از ارز دیگر را نیز باز کرده و پس از انجام تنظیمات ، همانند قبل مراحل ۱ و ۲ را انجام میدهیم. پس از ذخیره ی تایم H4 ، این نمودار را نیز Close میکنیم. نکته: در پنجره ی Save Page با کلیک بر روی Sort ، نرم افزار به صورت اتوماتیک چارتهای را براساس حروف مرتب خواهد کرد.

مرحله ی بعدی Load کردن چارتهای ذخیره شده میباشد.

از منوی Page ، بر روی Load Page کلیک کنید تا پنجره ی Load Page ظاهر شود. برای دسترسی آسانتر روی کیبورد کلید F2 را فشار دهید.

پنجره ی Load Page به صورت زیر خواهد بود:

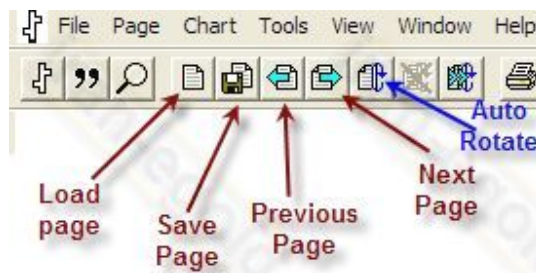


چارت مورد نظر را انتخاب کنید و بر روی Load کلیک کنید.

نکته: با کمک کلید F4 بر روی کیبورد (یا از منوی Page و انتخاب Next Page میتوانید به چارت ذخیره شده ی بعدی بروید). (با کمک F3 به چارت قبلی برگردید)

نکته: اگر بر روی چارتی که **Load** شده تغییراتی ایجاد کردید، باید تنظیمات جدید را ذخیره کنید. برای این کار پس از اعمال تغییرات از منوی **Page** ، بر روی **Save Page** کلیک کنید. (ویا فشردن کلید **F12** بر روی کیبورد) اگر قصد دارید تغییرات جدید ذخیره نشوند، بدون ذخیره کردن یکبار **F3** و سپس **F4** را بر روی کیبورد بزنید.

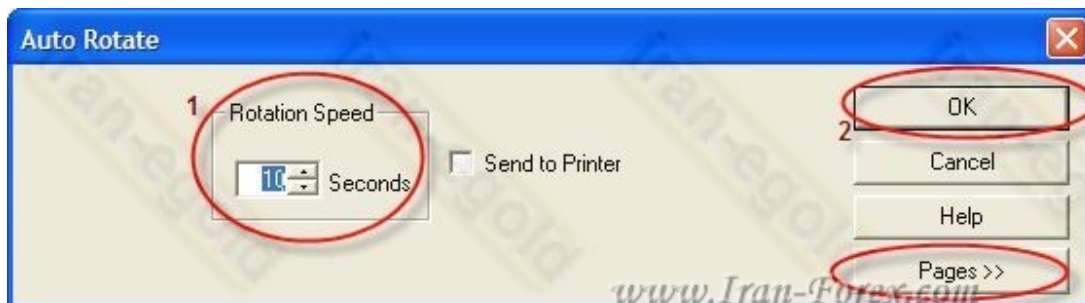
تمامی موارد فوق به راحتی از نوار ابزار در دسترس خواهند بود:



چگونگی چینش چارتهای در هنگام ذخیره کردن و مرتب کردن آنها سلیقه ایست. میتوانید تایم یکساعته ی چندین جفت ارز را در فولدر اصلی **Pages** ذخیره کنید و یا برای هر ارز فولدر جداگانه ای ایجاد کرده و تایمهای مختلفی مانند **H1** ، **H4** ، **D1** و ... را ذخیره کنید.

اگر طبق روش پیشنهادی اول عمل کردید و تایم **H1** از چندین جفت ارز را در پوشه ی اصلی و یا در پوشه ای خاص پشت سر هم ردیف کردید ، میتوانید از قابلیت **Auto Rotate** استفاده کنید.

بر روی **Auto Rotate** در نوار ابزار کلیک کنید. (از منوی **page** نیز در دسترس خواهد بود) (یا کلید **Shift+F4** بر روی کیبورد)



در پنجره ی باز شده تایم را به میزان دلخواه (برحسب ثانیه) تغییر دهید. (میتوانید بر روی **Page** کلیک کرده و چارتهایی را که میخواهید نرم افزار اتوماتیک برای شما نشان دهد مشخص کنید).

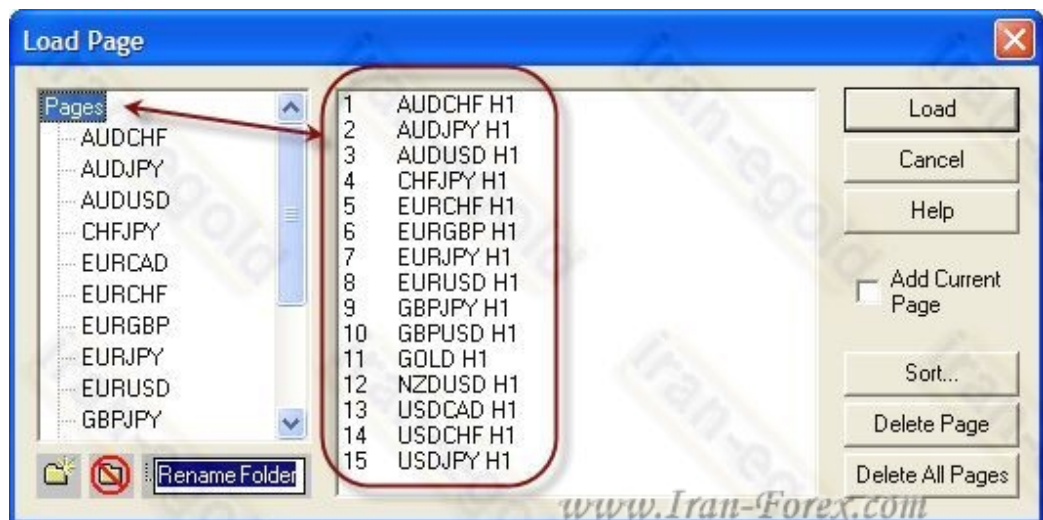
برروی OK کلیک کنید. چارتهایی که در پوشه ی مشخص شده قرار دارند با توجه به تایم مشخص شده برای شما به نمایش در می آیند. در اینصورت گزینه های **Resume Rotation** و **Stop Rotation** نیز از منوی **Page** یا نوار ابزار در دسترس خواهند بود.

نکته: اگر نحوه ی قرار گرفتن آیکنها در نوار ابزار به هم ریخت ، از منوی **View** و انتخاب **Dock All Toolbars** برای بازگرداندن نوارابزارها به حالت پیشفرض استفاده کنید.

نکته: اگر چارت جدیدی را با کمک **New Chart** باز کردید به هیچ عنوان برروی **Save chart** کلیک نکنید. در غیر اینصورت آخرین چرات **Load** شده به اشتباه تغییر خواهد کرد. همیشه برای ذخیره ی چارتهای جدید از **Save Chart As** استفاده کنید.

نکته: برای اینکه چارتهای ذخیره شده در هنگام **Load** آپدیت شوند، باید یکبار برنامه را بسته و دوباره باز کنید.

همانطور که می بینید با کمک **Sort** نرم افزار ، جفت ارزها را براساس حروف الفبا (**alphabet**) مرتب کرده است.

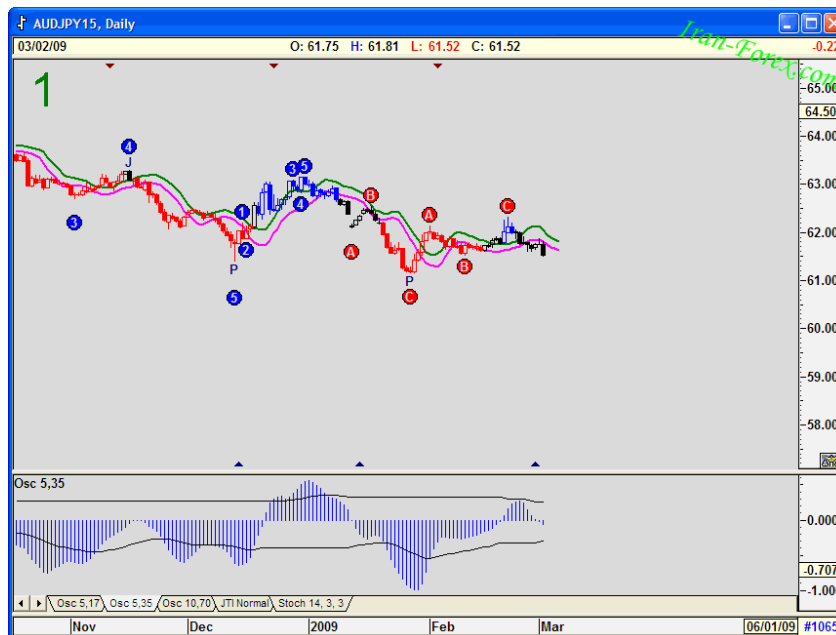


Quick Load جایگزینی برای AGET در Template

با توجه به اینکه در نگارشهای ک-ر-ک شده ی AGET امکان استفاده از Template وجود ندارد و تنظیم تعداد زیادی چارت و تایمهای مختلف وقت گیر می باشد. برای حل این مشکل از قابلیت Quick Load در ادونسدگت استفاده می کنیم.

ابتدا از منوی File/New Chart ، چارتی را به دلخواه باز کرده و تنظیمات مورد نظر را بر روی چارت انجام دهید.

حالا همانطوری که چارت با تنظیمات در حال نمایش است ، روی کیبورد ارز مورد نظر و تایم مربوط را وارد کنید مثلاً قصد داریم چارت ۱۵ دقیقه ای جفت ارز پوند-دلار را با تنظیمات چارت فعلی اجرا کنیم. عبارت GBPUSD15 را تایپ کرده و کلید Enter را فشار دهید. چارت ۱۵ دقیقه ای این ارز باز خواهد شد. حال از منوی Page بر روی Save Page As کلیک کرده و چارت را ذخیره کنید. مجدداً در حالتی که چارت ۱۵ دقیقه ای پوند-دلار باز است روی کیبورد عبارت GBPUSD30 را تایپ کرده و اینتر کنید. تایم ۳۰ دقیقه ای اجرا می شود. این چارت را نیز ذخیره کنید. مراحل را تا تایمهای بالاتر ادامه دهید. در انیمیشن زیر ابتدا چارت AUDJPY15 اجرا و تنظیمات اعمال شده ، سپس چارت ۱۵ دقیقه ای پوند-دلار با همین تنظیمات Load شده است:



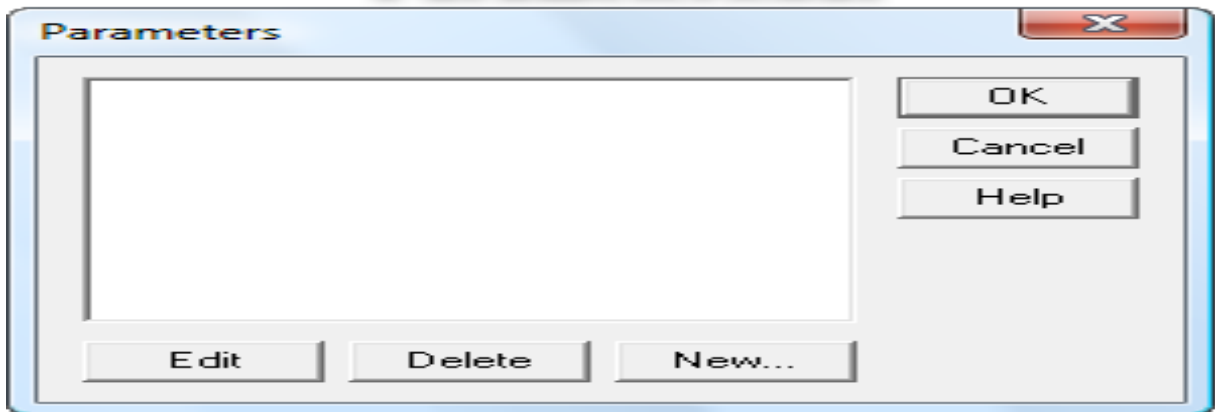
فایل آماده ی چک لیست برای پوزیشنهای نوع ۱ و ۲
نرم افزار GET Advanced را ببندید.

فایل ضمیمه زیر را دانلود و Extract کنید. فایل Parameters.dat را به فولدري که نرم افزار در آن
قرار دارد و در فولدر dat کپی کرده و جایگزین فایل قبلی (Replace) کنید.
فرض میکنیم نرم افزار را در درایو C و Program Files نصب کرده اید. فایل را باید به پوشه ی کد:

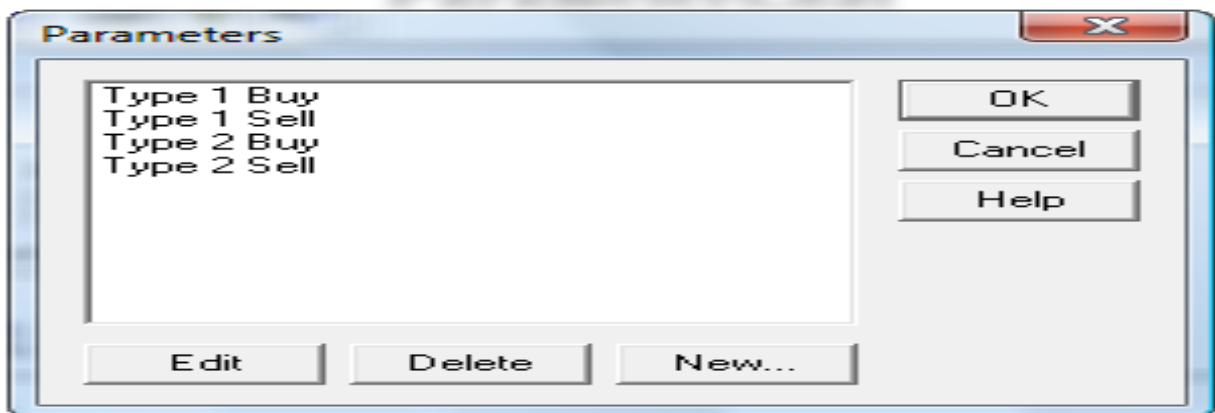
C:\Program Files\GET\dat

کپی و جایگزین کنید GET Advanced را اجرا کنید.

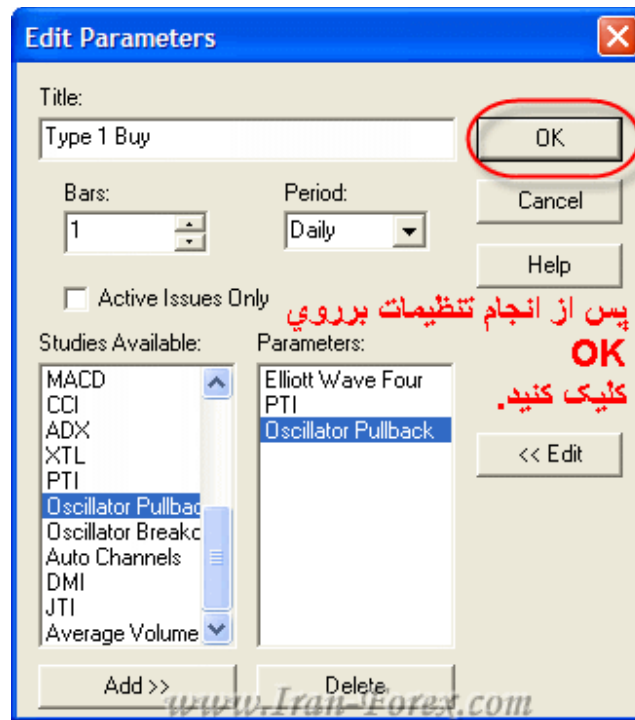
قبل از جایگزین کردن فایل
Parameters.dat



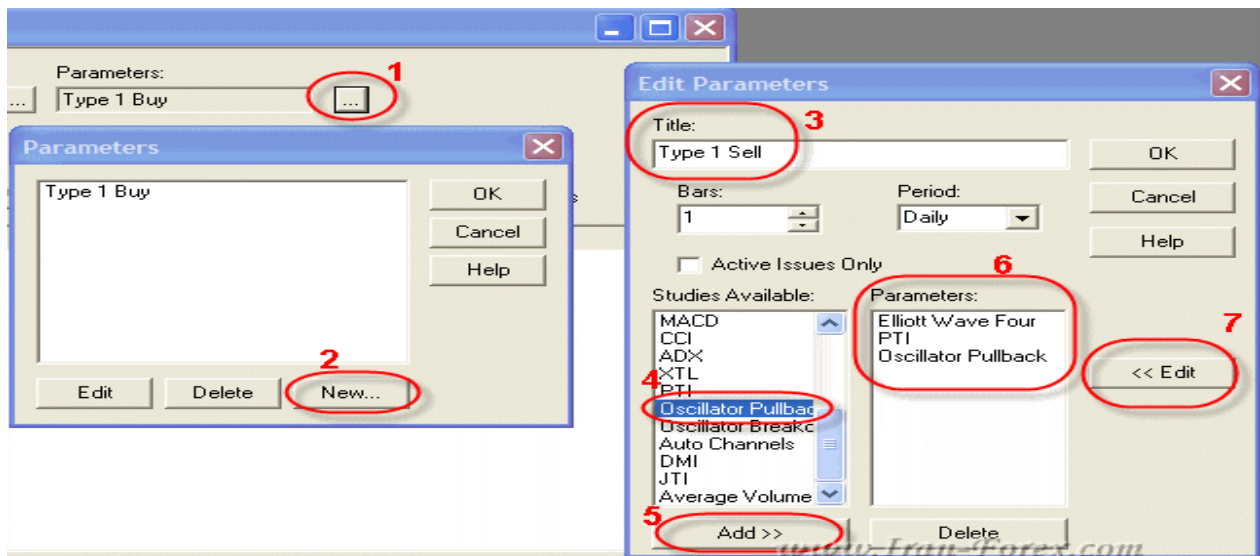
بعد از جایگزین کردن فایل
Parameters.dat

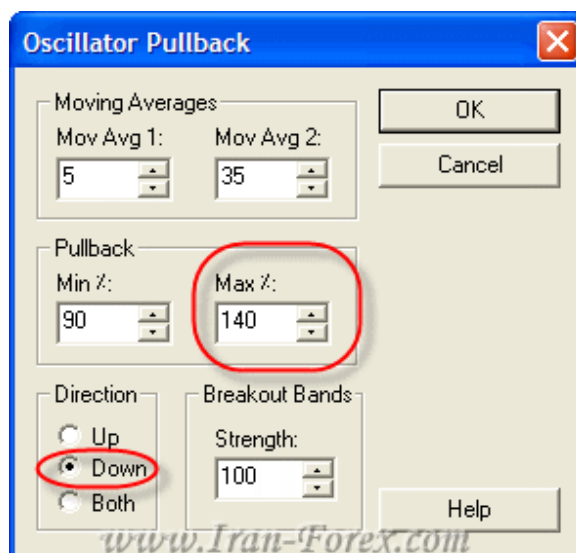
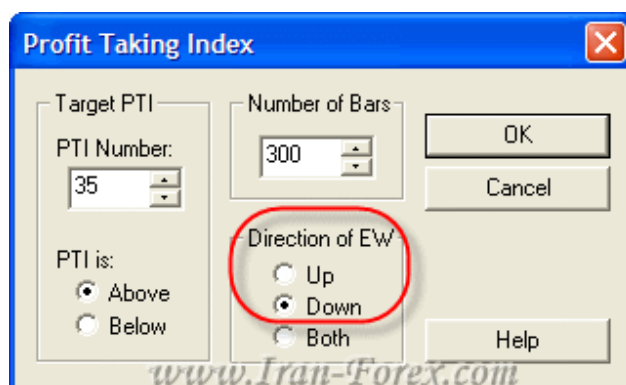
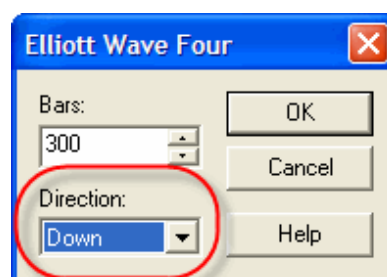


ایجاد چک لیست برای پوزیشن نوع اول (Type 1 Buy)



ایجاد چک لیست برای پوزیشن نوع اول (Type 1 Sell)





Portfolio: <Issue List 11/26/2007> Parameters: Type one Sell

Status: Ready Found: 25 Of 116 21%

Change All Charts Independent Of Pages

Any Parameter	EW4	PTI	OPB
#DD60	X	X	
#ENQZ760		X	
#EPZ760		X	
#GM60	X	X	
#HPQ60	X		
#IBM60	X		
#JPM60	X	X	
#NGF860	X	X	
AUDNZD60	X	X	
AUDUSD!60			X
AUDUSD60			X
EURHKD60	X		
EURJPY!60	X		
EURJPY60	X		
EURNZD60		X	
EURSEK60		X	
EURUSD!60	X		
EURUSD60	X	X	
GBPNZD60		X	
GBPSEK60	X	X	
GOLD60	X		
USDCHF!60	X		
USDCHF60	X		
USDHRK60	X	X	
USDSGD60	X	X	

دیگر برای چک کردن زمان را از دست نمی دهید.

با کلیک بر روی علامت play لیستی تهیه می شود که در آن ها موقعیت چند مورد انتخابی ظاهر می شود. هرگاه هر سه گزینه علامت داشت نشانه ی ورود است. البته چارت را چک کنید اگر موج ۴ از خط قرمز رد کرده بود دیگر اعتبار ندارد.

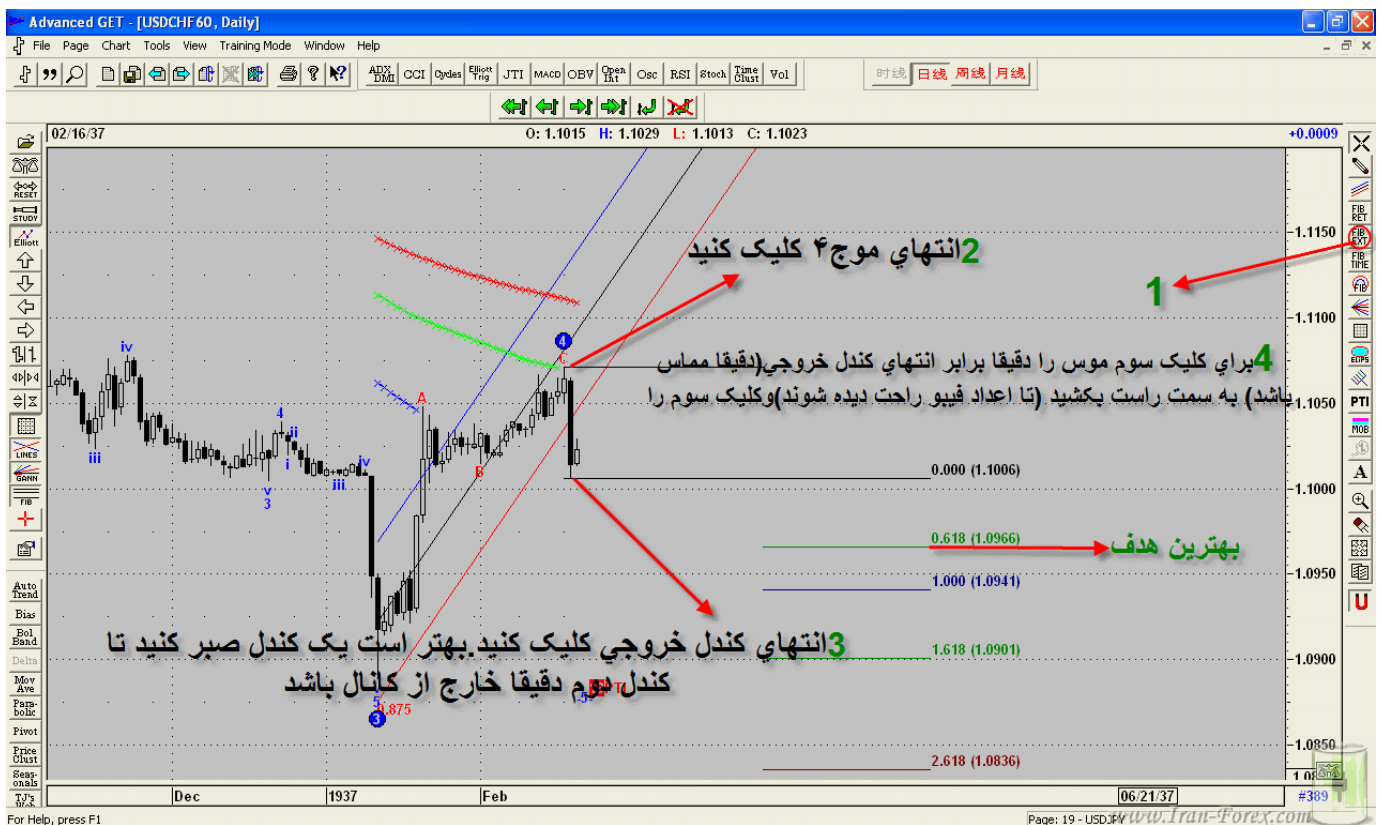
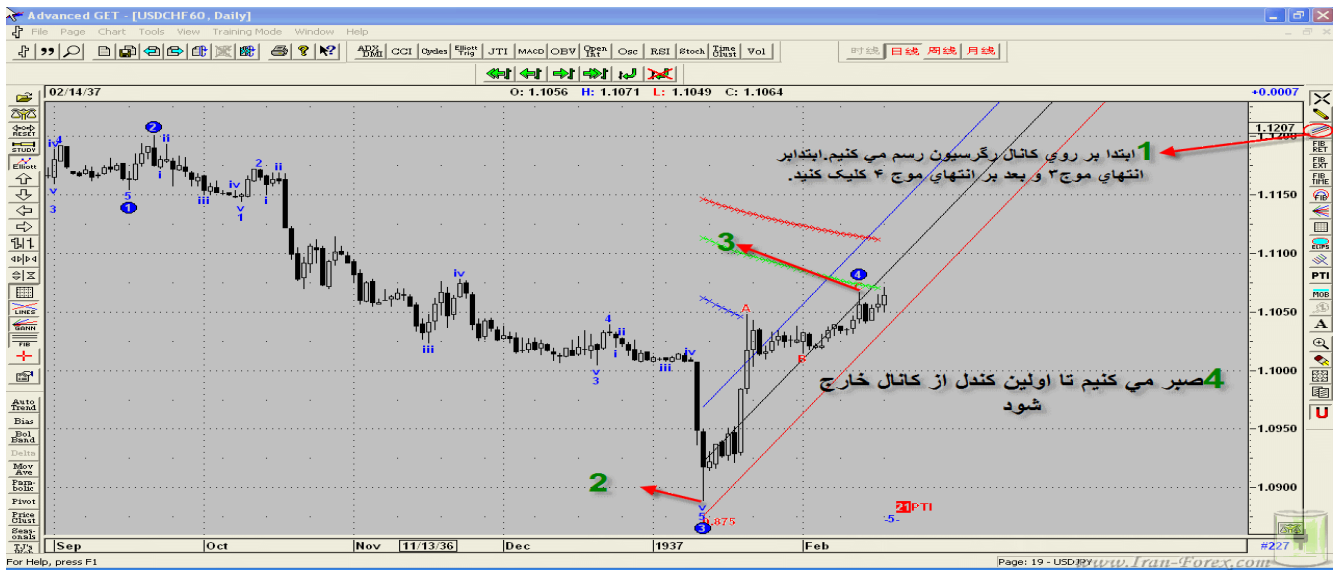
www.Iran-Forex.com

خطوط FIBO

طریقه ی رسم خطوط فیبو EXT برای تعیین نقطه خروج برای موج ۵



طریقه ی رسم خطوط فیبو EXT برای تعیین نقطه خروج بدون شماره گذاری موج ۵

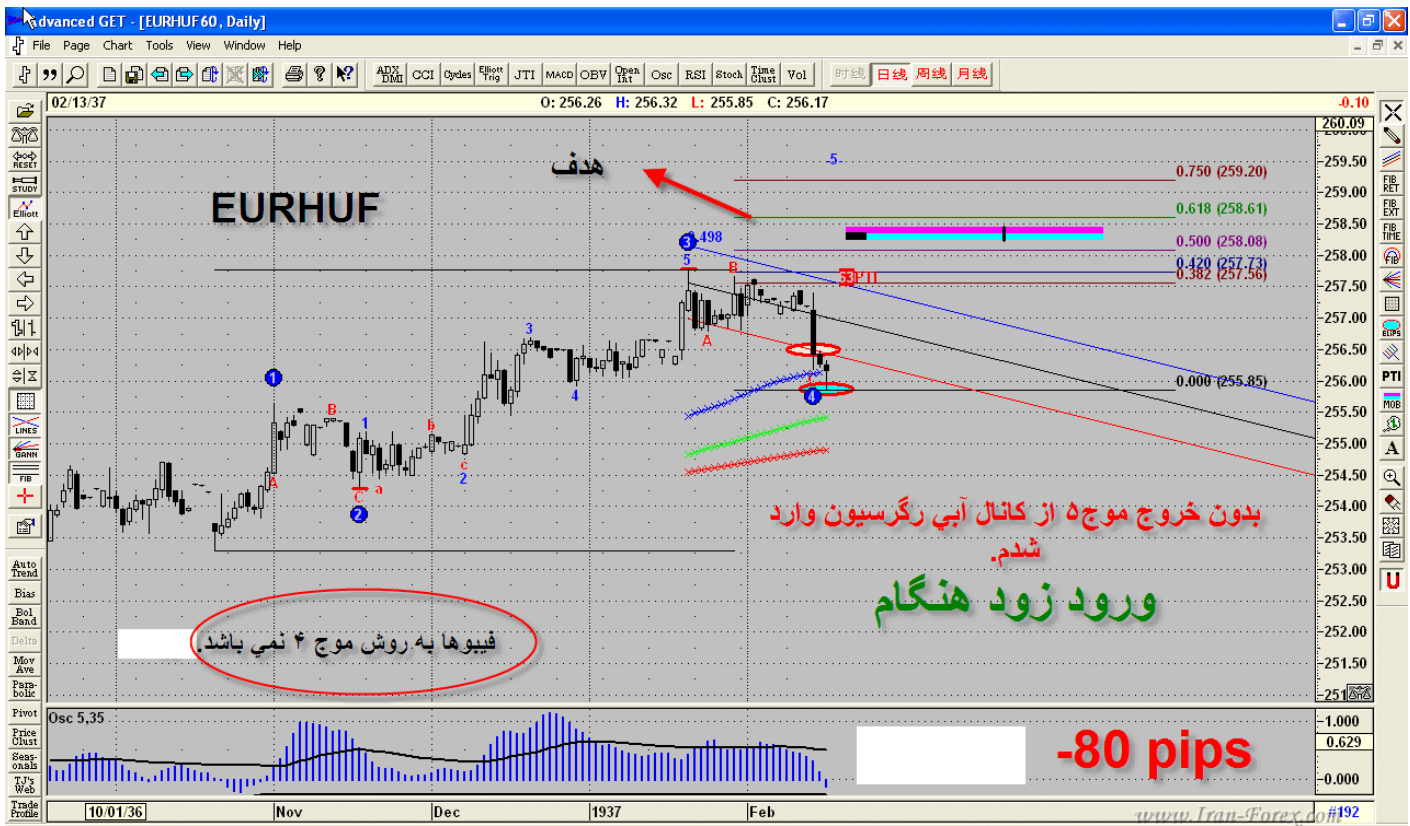


چند مثال از چگونگی استفاده از خطوط فیبو

نتیجه زیاد مطمئن نیست چون pti کمتر از ۳۵ است. تنها جنبه ی آموزشی داشت.



گفتم شاید لازم باشه چند تا مثال واقعی در مورد موارد بالا را اضافه کنم. دلایل شکست ۱. بدون خروج موج ۵ از کانال های آبی، وارد شدم. ۲. استفاده ی نا بجا از انواع فیبو زدن

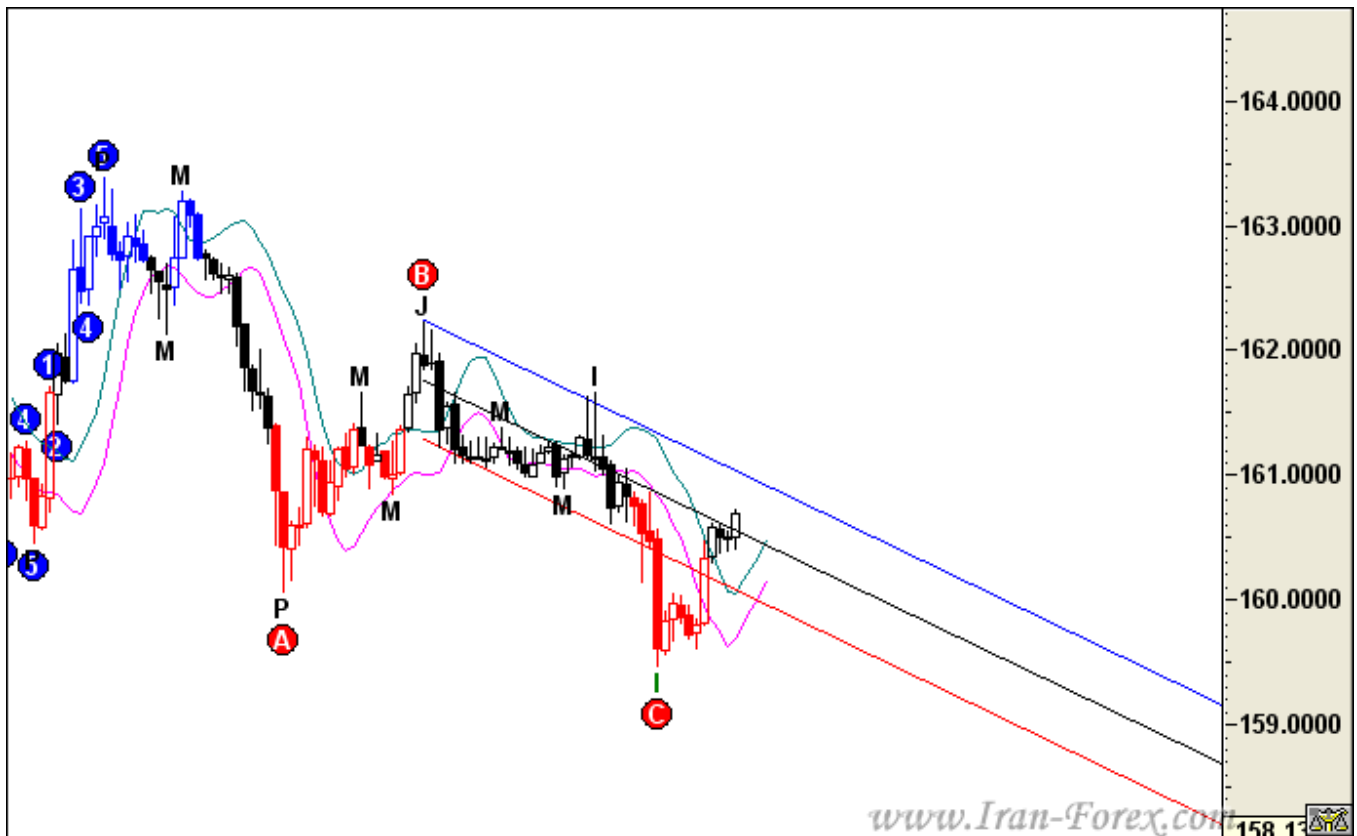


تستی در مورد رابطه طمع و ضرر 61.8% فیبوناچی بهتر است یا ۷۵% از نظر سود ۷۵% ولی از نظر طمینان ۶۱.۸% .

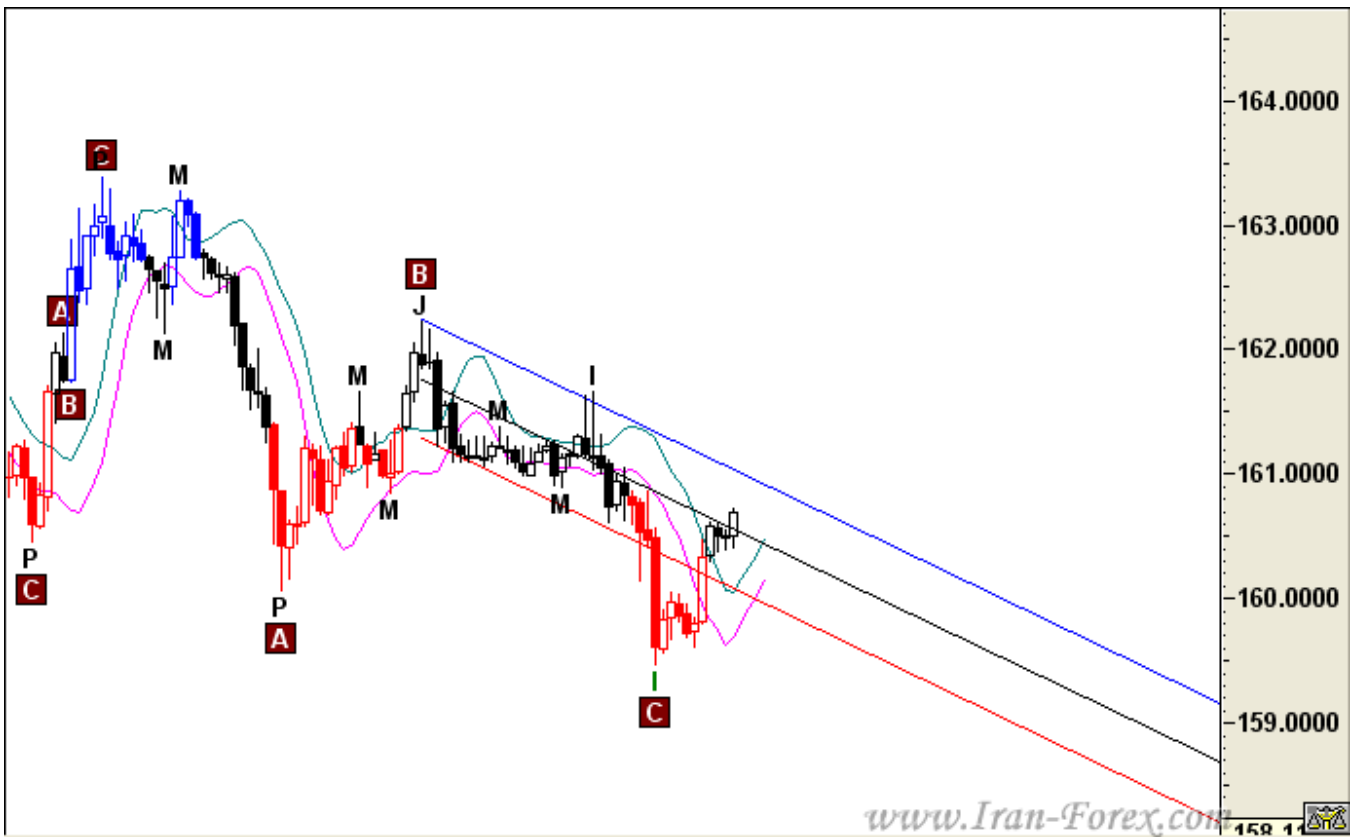


اسیلاتور

اسیلاتور GET Advanced با خطوط نوسانگر برای متاتریدر) فایل ضمیمه ی پست شده) نقل قول:



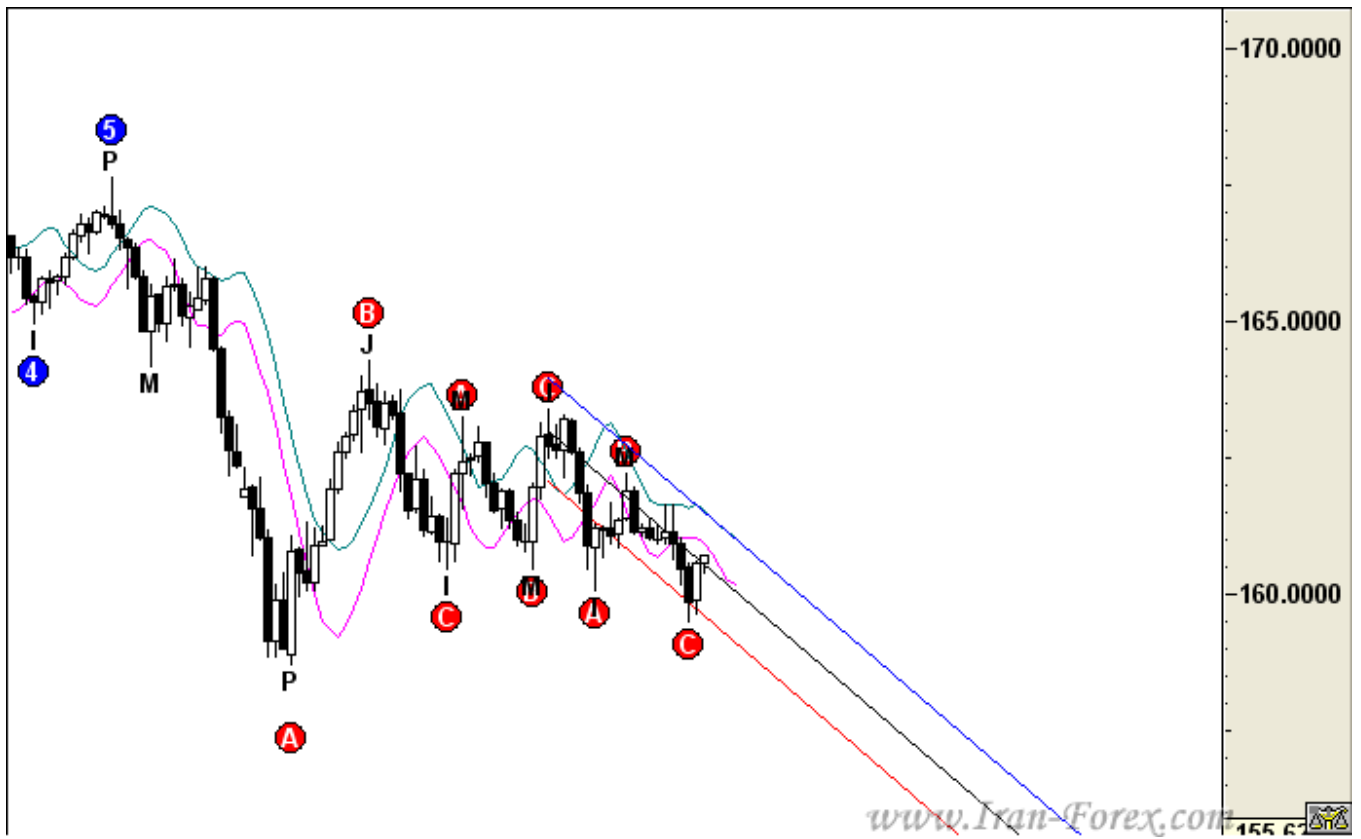
هر دو DMA و خط میانی کانال شکسته شده اند. اگر قیمت در آن سمت خط بالایی کانال بسته شود به احتمال زیاد صعودی در کار است. هنگامی که نرم افزار امواج اصلاحی را نشان می دهد از پنجره Elliott Waves آلترناتیو شماره سه را انتخاب می کنیم:

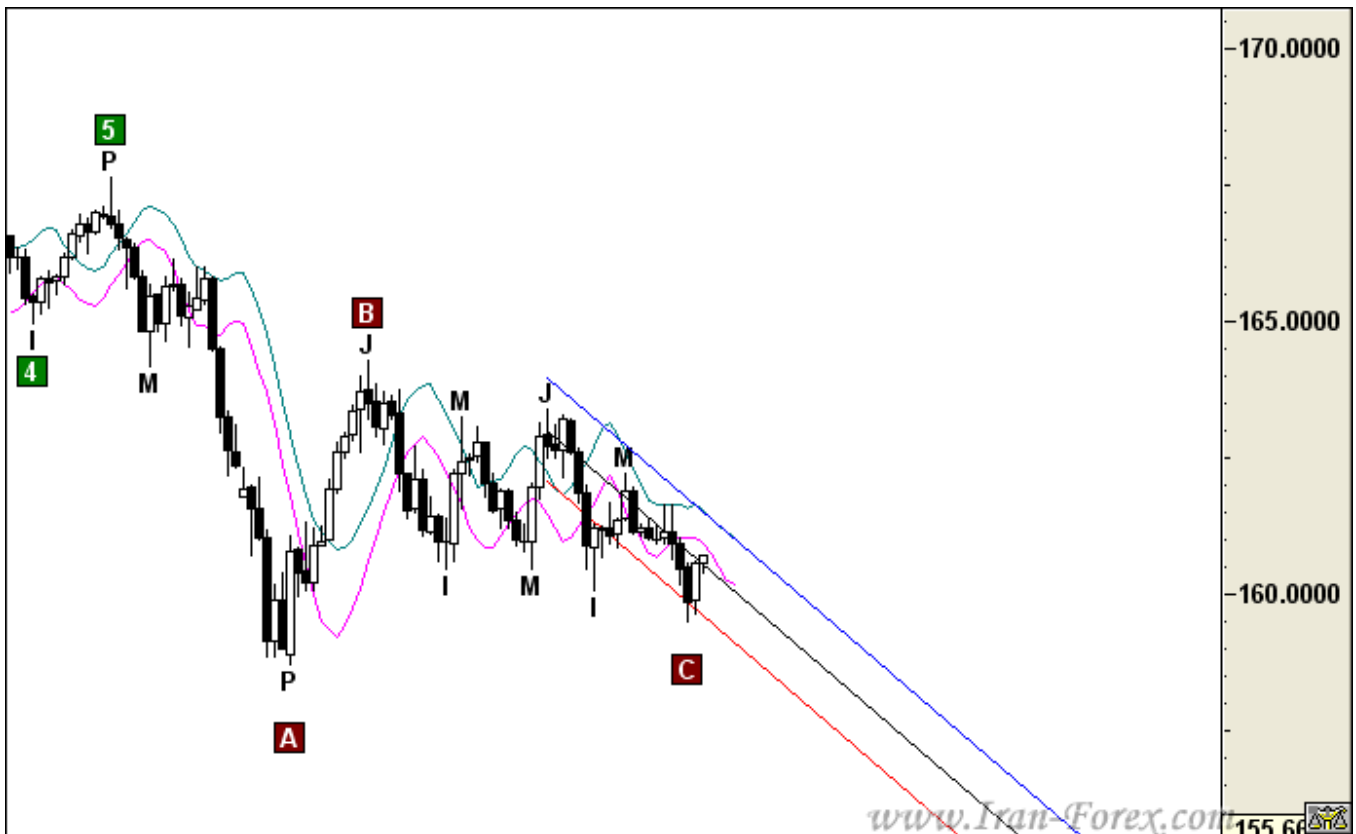


آلترناتیو سه نیز امواج را اصلاحی نشان می دهد. به تایم چهارساعته می رویم:

این بار هم اصلاحی است. قیمت خط میانی کانال را شکسته اما هنوز موفق به قطع هر دو DMA نشده است.

آلترناتیو سه:



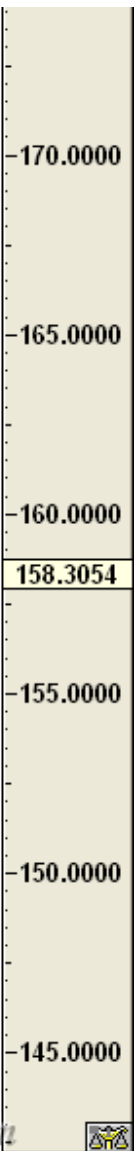
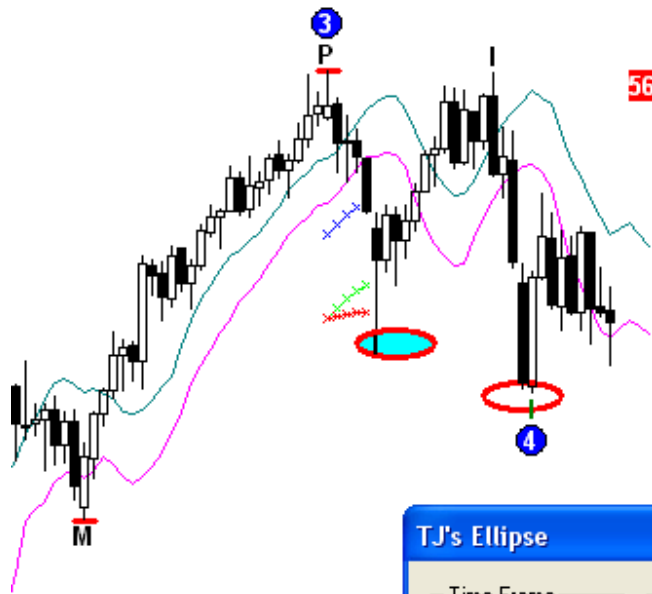


و باز هم اصلاحی. حال به تایم روزانه می رویم:

روند صعودی است و به نظر می رسد موج چهارم به اتمام رسیده است. همانطور که در شکل نشان داده شده از پیوت M تا پیوت P (انتهای موج سوم) بیضی را رسم کنید و در پنجره آن دکمه Long را در حالت On قرار دهید. مشاهده می کنید که قیمت با رسیدن به دو بیضی نرمال و بلند مدت عکس العمل نشان داده است و این مسأله ما را به اتمام موج چهارم مطمئن تر می سازد. می توان صبر کرد تا DMA دیگر نیز شکسته شود اما اگر تایم فریم های پایین تر صعود را نشان دادند می توان زودتر از موعد اقدام به خرید کرد و تمام موج پنجم در تایم روزانه را شکار نمود.



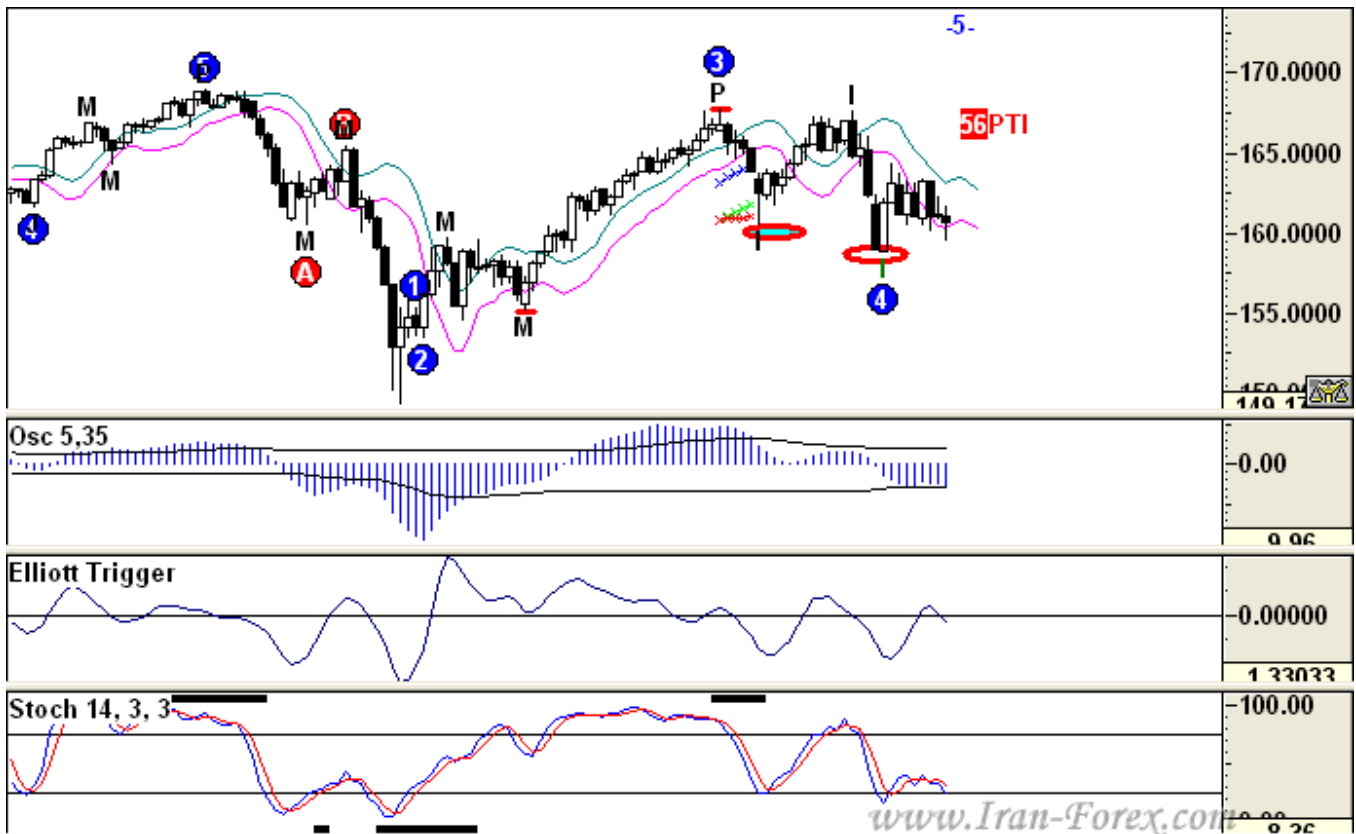
-5-



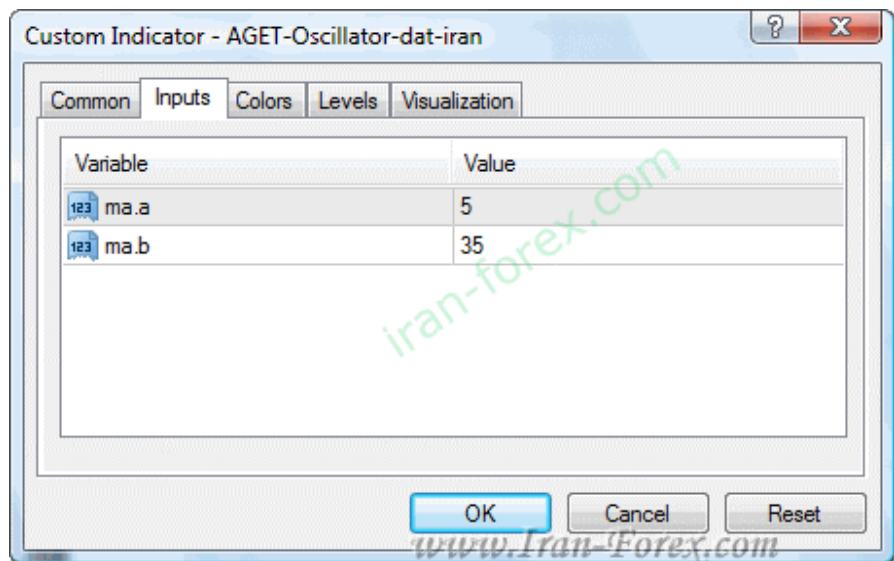
TJ's Ellipse [Close]

Time Frame	Color	Line Width	OK
<input type="checkbox"/> Short	<input type="color" value="red"/>	3	Close
<input checked="" type="checkbox"/> Normal	Markers	<input checked="" type="checkbox"/> Shadows	Apply
<input checked="" type="checkbox"/> Long	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	Help
			Remove
			Defaults...

www.Iran-Forex.com



اسیلاتور Advanced GET با خطوط نوسانگر برای متاتریدر با قابلیت تغییر دوره ها
 سیلاتور Advanced GET با خطوط نوسانگر برای متاتریدر)
 ندیکاتوری که استاد (آقا بنیامین) زحمت آپلودش را کشیدن ، فقط دوره ی ۵,۳۵ را بر روی متاتریدر نشان
 میدهد و امکان تغییر این اعداد همانند محیط نرم افزار وجود ندارد.
 در صورتیکه از اسیلاتور برای شمارش آلترناتیوها استفاده میکنید ، می توانید اندیکاتور زیر را دانلود کرده و
 اعداد مربوط را در متاتریدر هم تغییر دهید.



بالا بردن درصد موفقیت

در اینجا نکاتی جهت بالا بردن درصد موفقیت بیان می شود: اول: از تایم فریم چهارساعته برای تأیید استفاده کنید. اگر وضعیت مناسب داشت و ساز مخالف نمی زد ترید کنید.

دوم: در ترید نوع اول هنگامی که **Oscillator** به صفر می رسد بهتر است کمی صبر کنید تا **Oscillator** تغییر روند دهد. دقت کنید منظور مثبت یا منفی شدن **Oscillator** نیست. مثلاً اگر از سمت مثبت به صفر رسیده است کمی صبر کنید تا روند آن رو به بالا شود حالا چه مقدار آن مثبت باشد چه منفی. در این زمان می توانید استاپ لاس را کمی پایین تر از **Low** انتهای موج چهارم در روند صعودی و یا کمی بالاتر از **High** انتهای موج چهارم در روند نزولی قرار دهید. البته اگر تحمل استاپ لاس بیشتر را دارید می توانید در همان لحظه ای که **Oscillator** به صفر می رسد در **Open** کندل بعد وارد شوید که در اینجا از خطوط فیبوناچی برای تعیین استاپ لاس استفاده می شود و مطمئن تر است.

سوم: هنگامی که پوزیشن شما در سود نشست استاپ لاس را تنگ تر کنید که البته در این مورد هر کس لستراتژی مخصوص به خود را دارد.

چهارم: اگر به سود کمتر قانع هستید می توانید از اردر گذاری استفاده کنید. بدین روش که در ترید نوع اول:

- در روند صعودی یک اردر **Buy Stop** به فاصله چند پیپ بالای انتهای موج سوم قرار دهید.
- در روند نزولی یک اردر **Sell Stop** به فاصله چند پیپ پایین انتهای موج سوم قرار دهید.

هدف انتهای موج پنجم - شماره گذاری شده توسط نرم افزار - می باشد. در اینجا استاپ لاس کمی قضاوتی میشود و بستگی به میزان تحمل ضرر و مدیریت سرمایه شما و وضعیت قیمت و ارز دارد. بین ۳۰ تا ۵۰ پیپ قرار دهید. البته اینجانب از روش اردر گذاری کمتر استفاده می کنم ولی اگر هم استفاده کنم برای **GBPJPY** بیشتر از ۵۰ و برای سایر ارزها بیشتر از ۳۵ پیپ قرار نمی دهم. در این مورد خود شما باید تجربه کنید و به تنظیمات مناسب برسید.

پنجم: حتما می دانید که لحظه خروج از معامله بسیار مهم است. چه زمانی پوزیشن را دستی ببندیم؟ مثالی می زنم:

در ساعتی خاص مثلا ۷ صبح با برقرار بودن شرایط و تأیید تایم چهارساعته وارد معامله در یک جفت ارز خاص می شویم. ساعت مثلا ۱۲ دوباره شرایط را بررسی می کنیم و می بینیم که همان پوزیشن هنوز باز است ولی شرایط در جهت معکوس برقرار شده است. چهار ساعتی نیز تأیید می کند. دو راه دارید:

- پوزیشن را دستی در سود یا ضرر ببندید و پوزیشنی در جهت مخالف باز کنید.

- اجازه دهید پوزیشن قبلی باز بماند و پوزیشنی جدید در جهت مخالف باز کنید.

تصمیم گیری با شماست که با رعایت مدیریت سرمایه می توانید انتخاب کنید. در زمینه مدیریت سرمایه نیز به خواست خدا در آینده مطالبی عرض خواهد شد.

دکمه های تایم فریم

در اینجا لازم است نکته ای را به دكمه های تایم فریم نوار ابزار عرض کنم. معنای این دکمه ها که با مکس کردن موس بر روی آنها نشان داده می شود شما را به اشتباه نیاندازد:

۱- دکمه اول یا **Daily Data** برای نمایش چارت یک ساعته.

۱- دکمه دوم یا Weekly Data : برای نمایش چارت چهار ساعته.

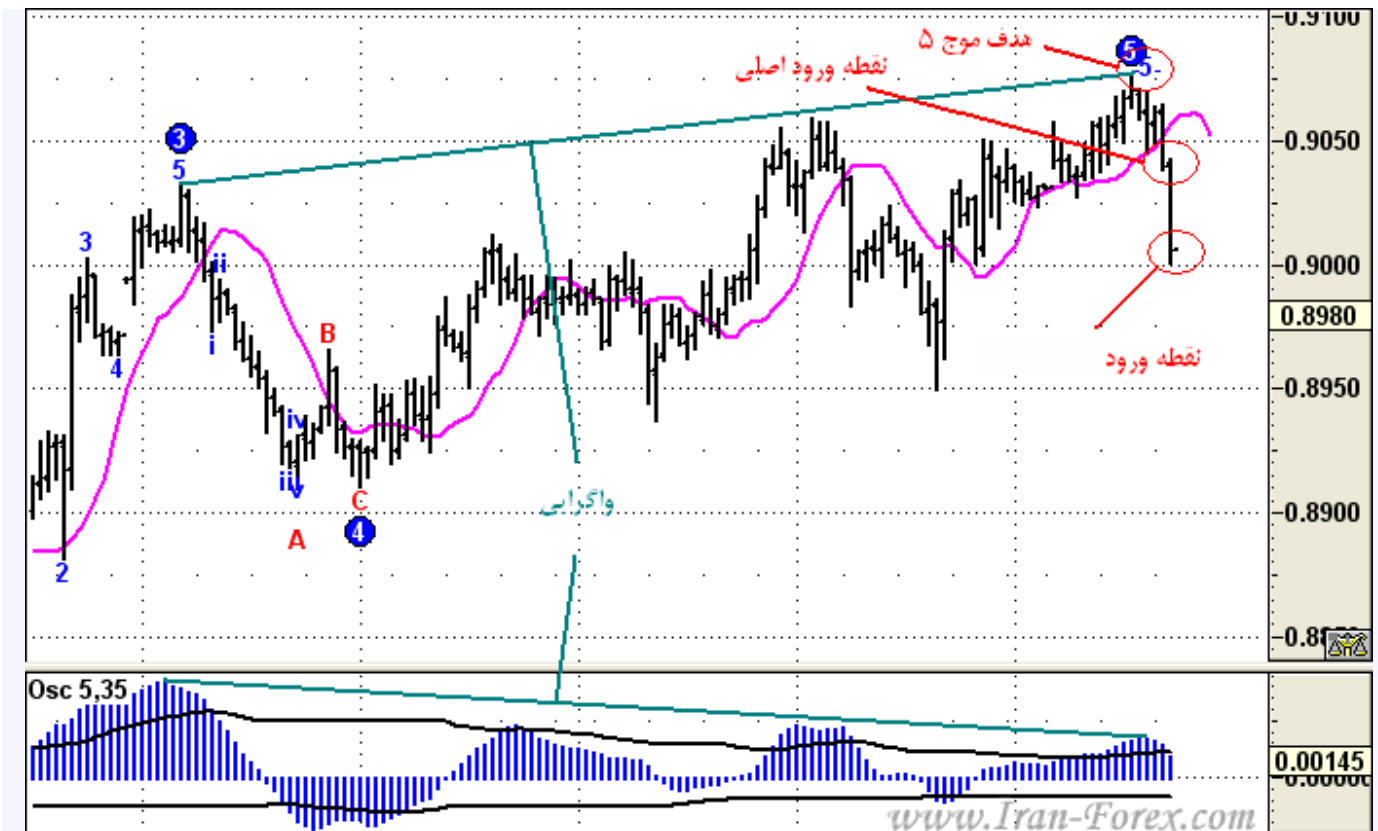
۲- دکمه سوم یا Monthly Data : برای نمایش چارت روزانه.

برای گرفتن تأیید از تایم فریم چهار ساعته کافیست با کلیک دکمه مربوطه، آن را در همان پنجره مشاهده کنید و نیازی به لود کردن آن از پنجره New Chart نیست.

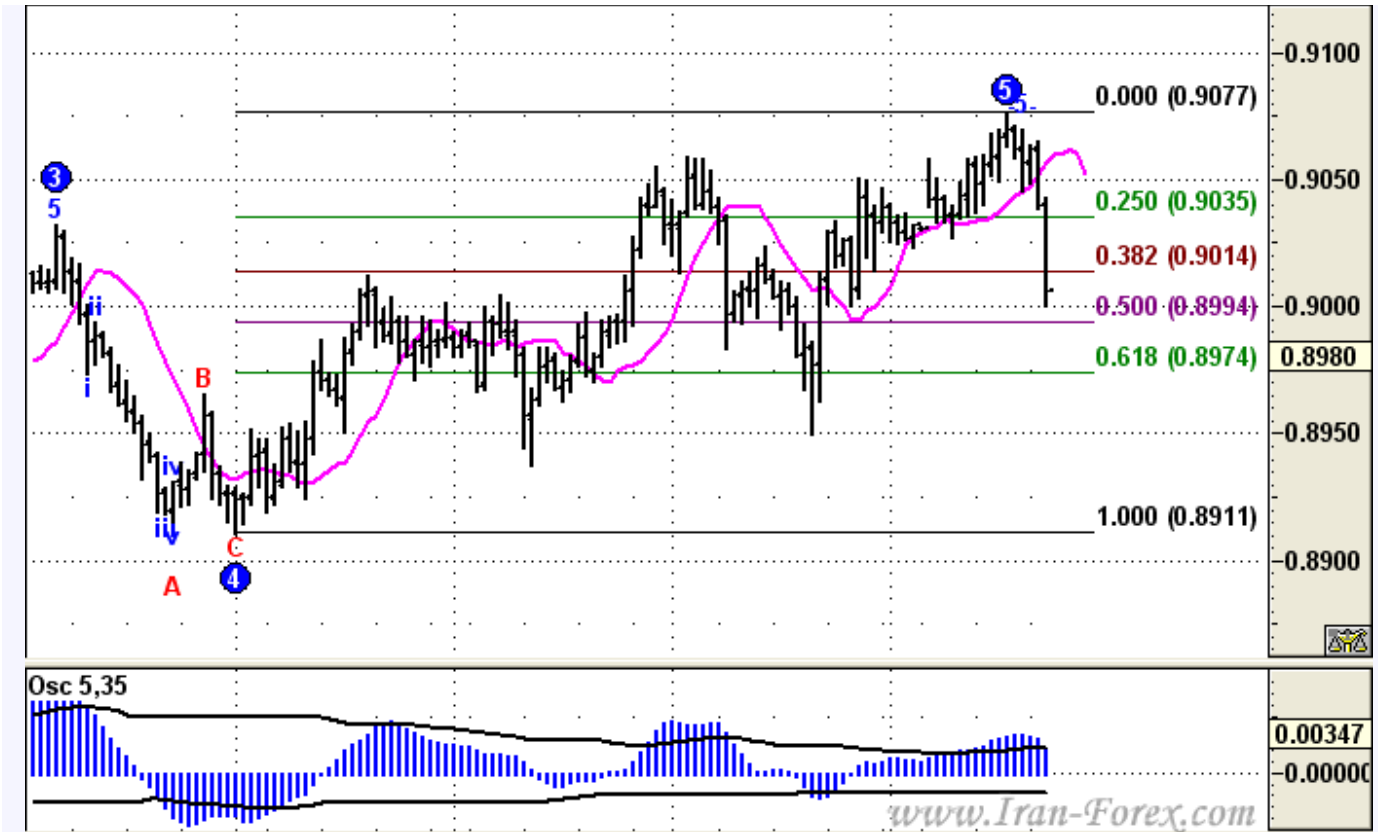


یک مثال - نمونه ای دیگر از نتایج 1 و 2

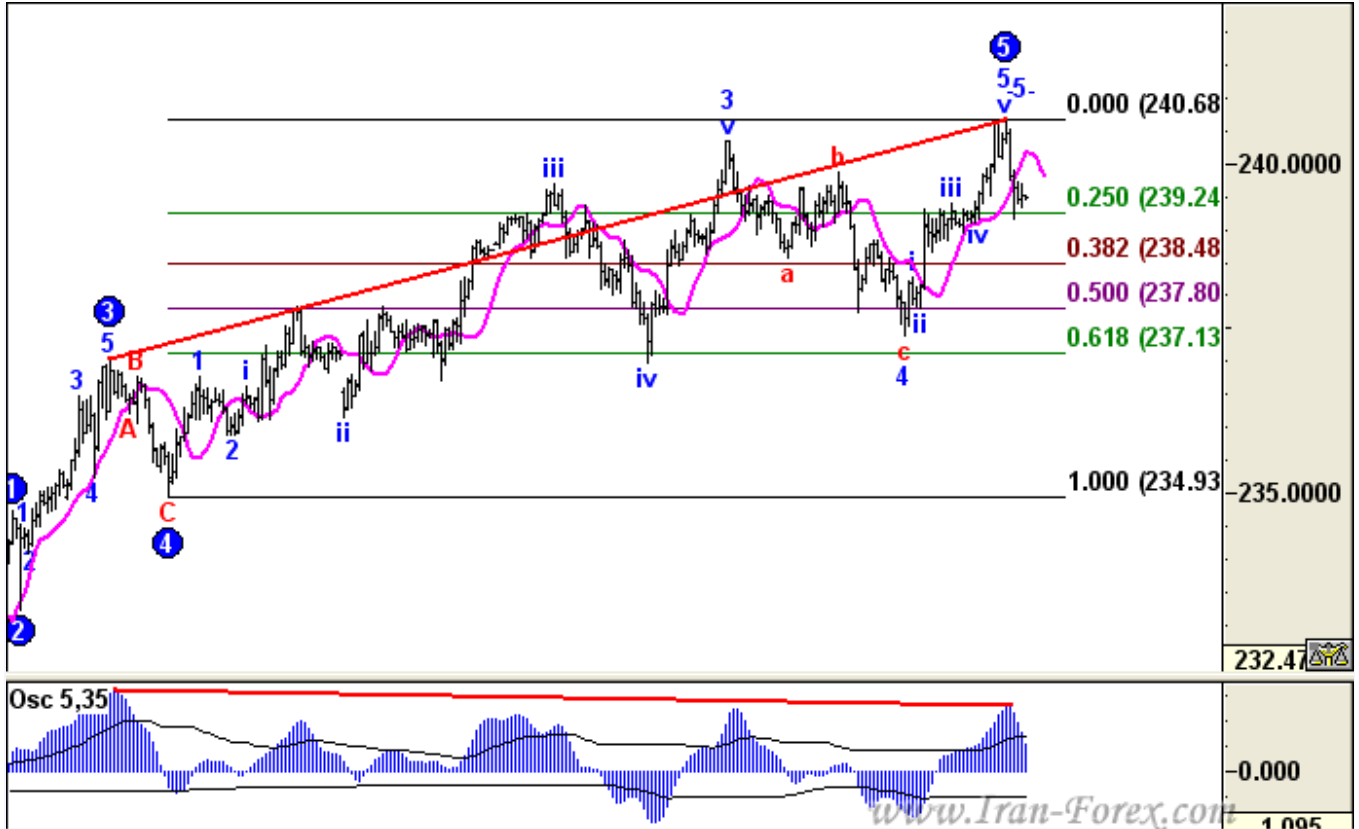
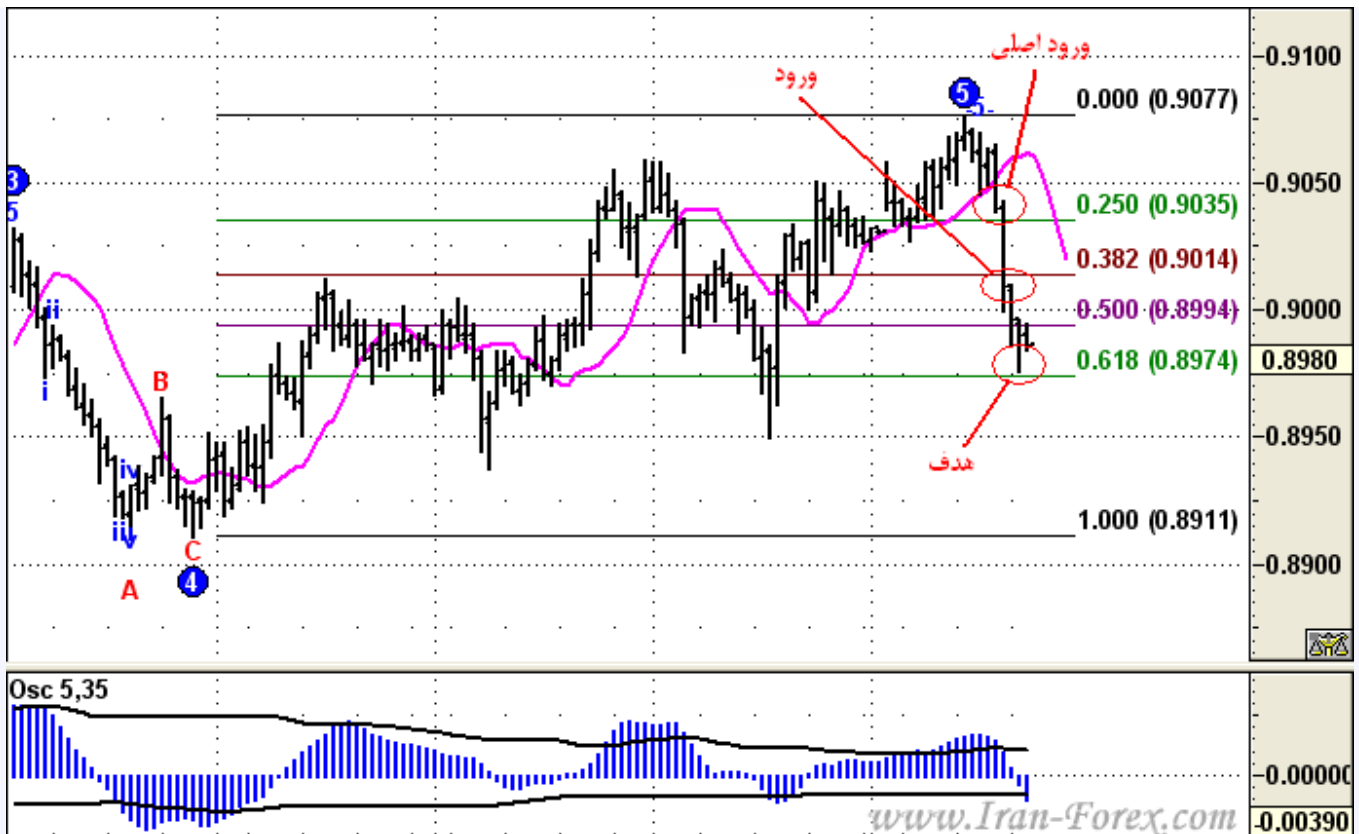
موقعیت امروز برای AUDUSD که بنده به دلیل عدم حضور با تأخیر وارد شدم: (سل نوع دوم)



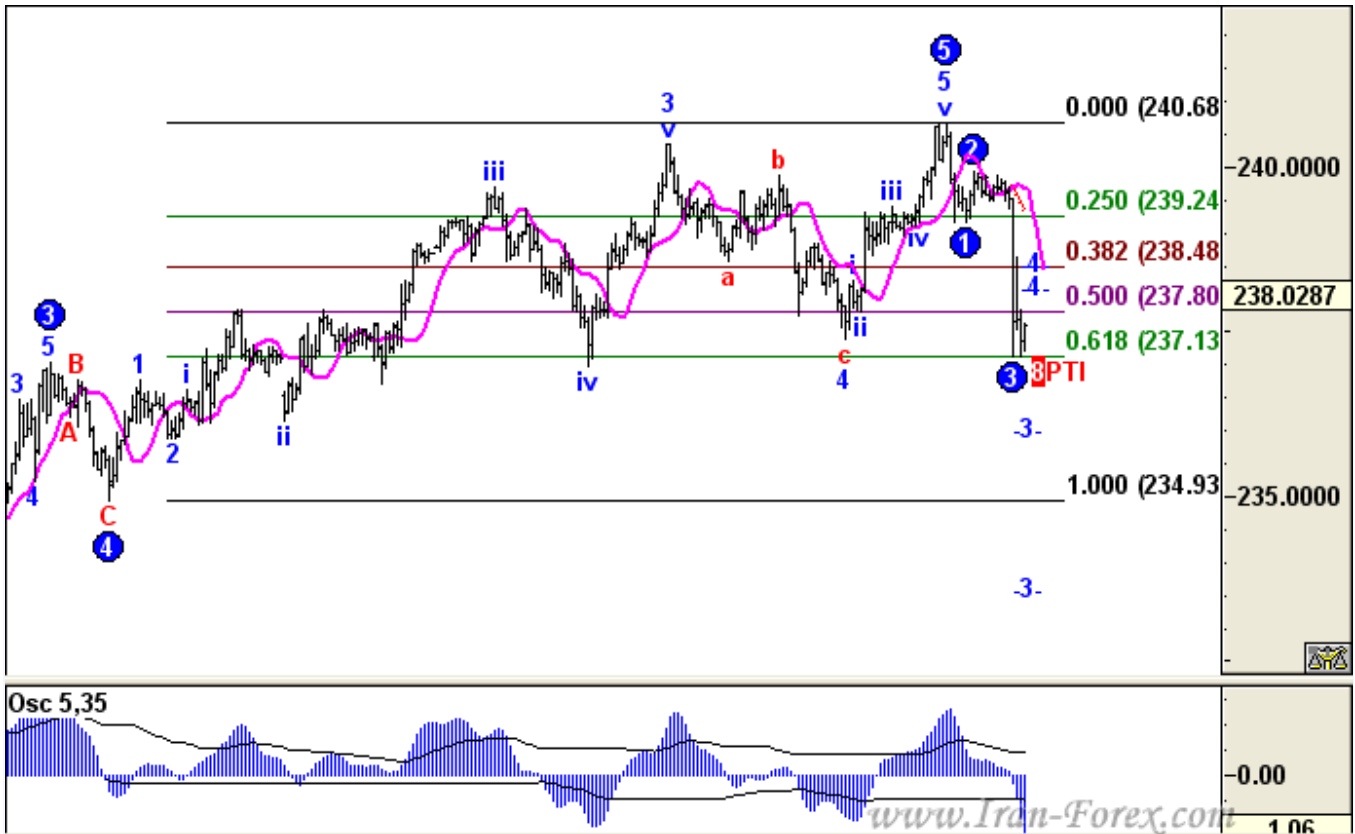
رسم فیبوناچی برای تعیین هدف کوتاه مدت:
 نقطه ۰.۸۹۸۰ کمی بالاتر از ۶۲٪ تارگت مناسبی است



اصابت به هدف:



دو تارگت تعیین شد: چند پیپ بالای خطوط ۳۸٪ و ۵۰٪ که امروز به هر دو اصابت کرد و تا ۶۲٪ نیز پایین آمد:





در مورد آلترناتیو توضیح خواهم داد.



دو نکته (سریعتر لود شدن چارت ها - استفاده از تایم چهارساعته در ترید نوع دوم

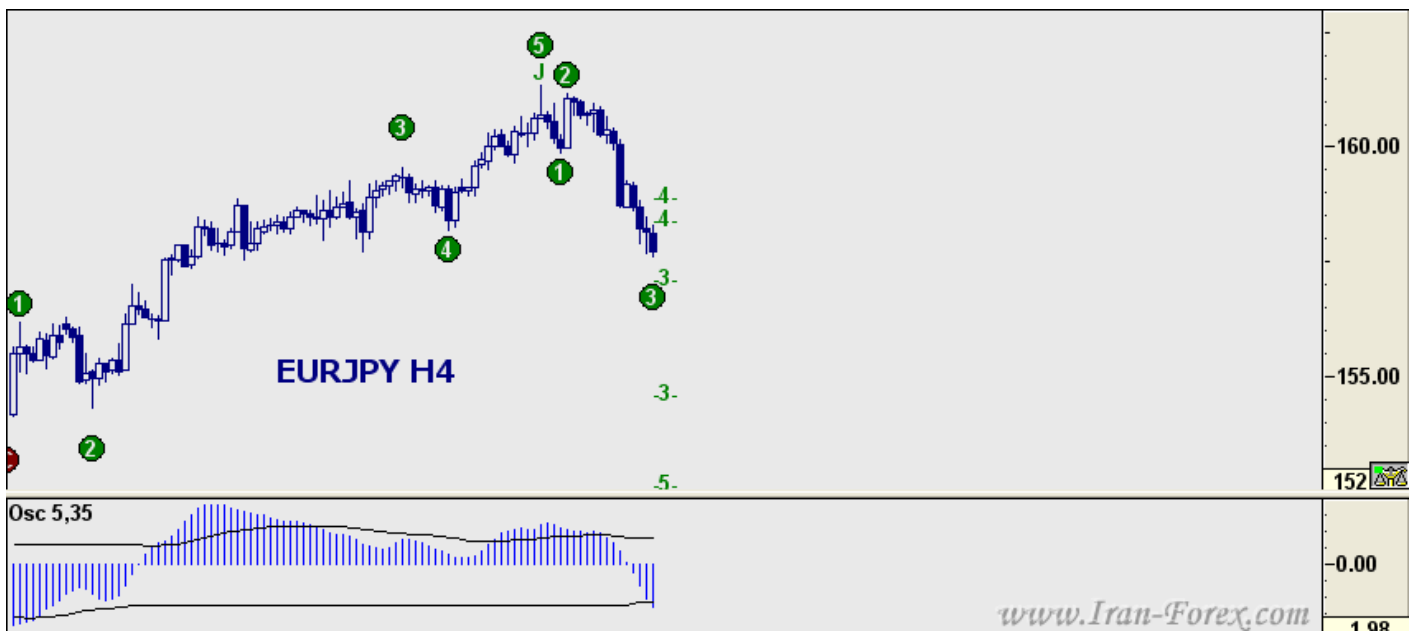
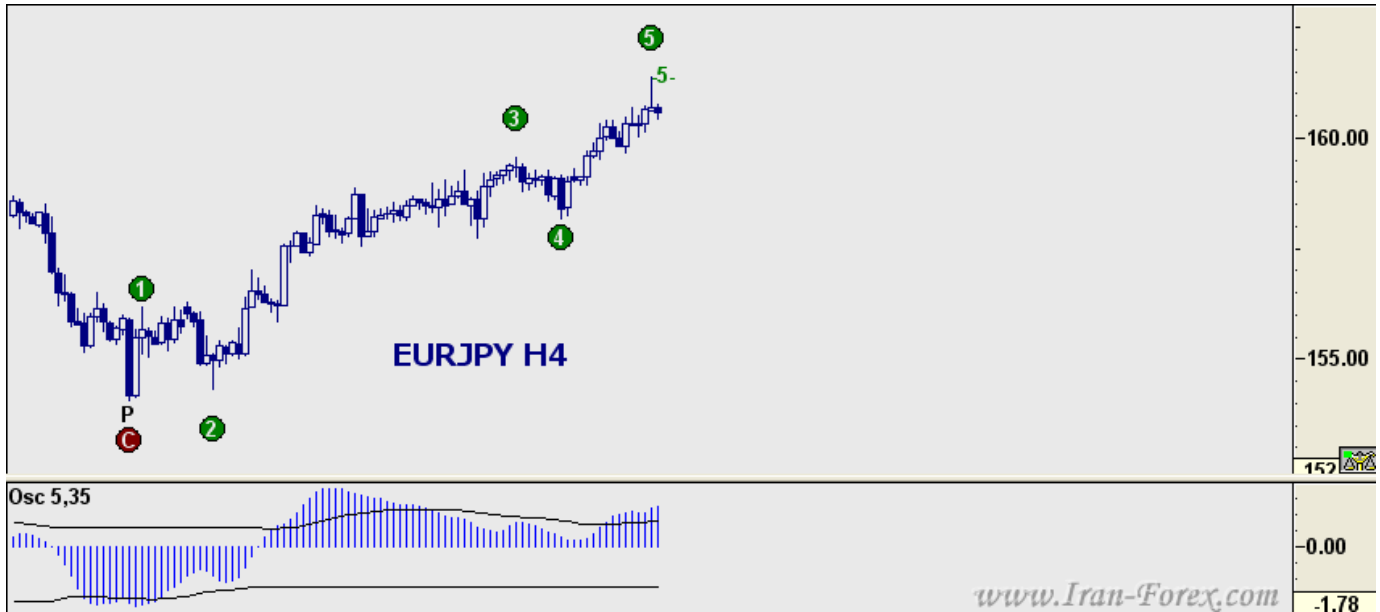
نکته اول:

برای سریعتر لود شدن چارت ها در متاتریدر که به دلیل اندیکاتور ادونسد گت ممکن است کند شده باشد، در متاتریدر خود به منوی Tools بروید و گزینه Options را انتخاب و در پنجره ظاهر شده به زبانه Charts رفته و از قسمت پایین آن تعداد بارهای History و Chart را روی ۲۰۰۰ یا ۳۰۰۰ تنظیم نمایید. متاتریدر را بسته و تمام فایل های PRN ایجاد شده در پوشه Experts/Files را پاک کرده و دوباره متاتریدر را اجرا و چارت های مورد نظر را لود کنید. برای لود کردن چارت ها در نرم افزار نیز از تعداد بارهای ۱۰۰۰ استفاده نمایید.

نکته دوم:

برای ترید نوع دوم سعی کنید از نمودار چهار ساعته استفاده کنید. تصویر زیر نمودار جفت ارز EURJPY را

در تایم چهارساعته نشان می دهد. به کندل ستاره ایجاد شده (نشانه تغییر روند) که شاخ آن با هدف موج پنجم برخورد داشته توجه کنید، یک چنین نزدیکی به هدف موج پنجم در ترید نوع دوم مد نظر است:



اندیکاتور اصلاح شده

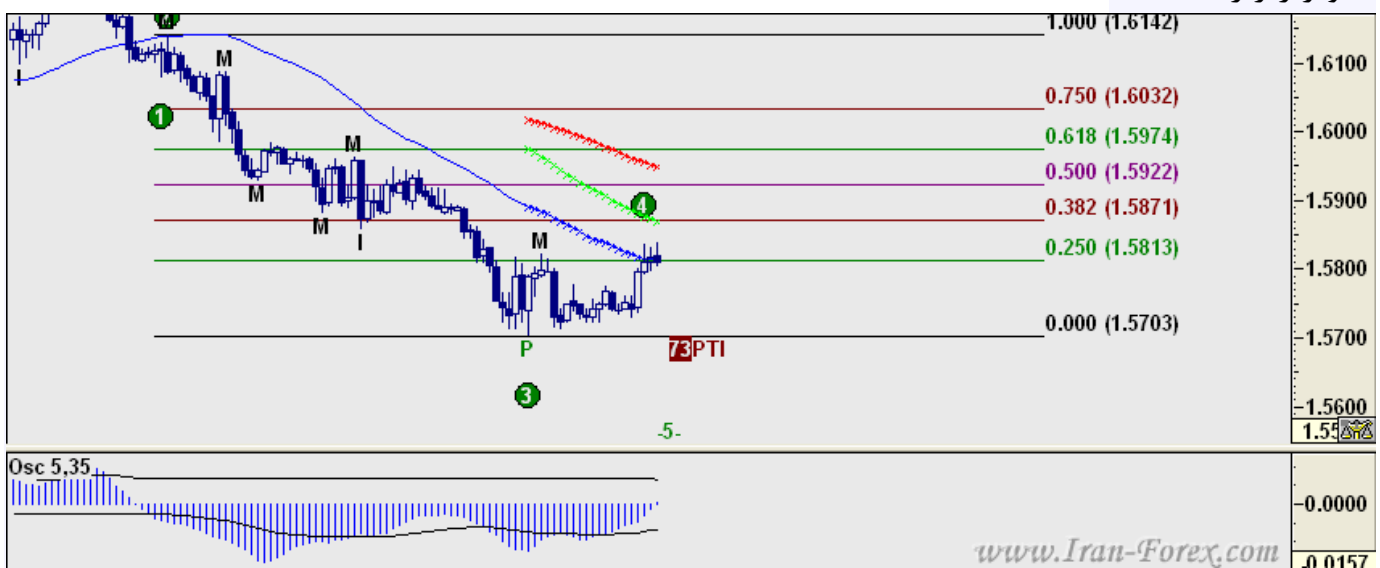
اندیکاتور **Aget - Elliot Confirm V003**؛ ورژن بعدی آن میباشد که هم این و قبلی توسط همکاران عزیزمان در **fxpars** تهیه شده؛ در این ورژن جدید تر به علت تکرار حلقه برنامه آن برای میله ها به مقدار ۱۷۰۰۰ کمی سرعت اجرای برنامه متا تریدر را در صورت نصب چند نمودار پائین می آورد. و البته این اندیکاتور جدیدتری یعنی **Aget - Elliot Confirm V003** کارا تر میباشد آن هم در صورتی که بخواهیم نمودار با میله های مورد علاقه و مد نظر خودمان داشته باشیم بدین صورت که مثلا در نمودار یک ساعته چنانچه ضریب آن را به روی ۲ قرار دهیم نمودار حاصله در **Advanced Get** یک نمودار ۲ ساعته باشمارش الیوت مخصوص آن خواهید داشت که با هر باز و بسته شدن برنامه به راحتی آپدیت میشود قبلا برای تنظیم یک همچین حالتی ما مجبور بودیم که از اندیکاتور **Period_Converter_Opt** استفاده کنیم آن هم به صورت آفلاین و بدون قدرت آپدیت مداوم که با عنایت همکاران عزیز این مشکل حل شد. اگر دوستان نمیخواهند که دائم نمودار با تنظیم ساعتی مورد نظرشان را داشته باشند و از همین تایفرم ها استفاده میکنند، توصیه بنده این است که برای سرعت در کارهایشان از این اندیکاتور قبلی که ایرادات بسیار کوچکش رفع شده استفاده کنند.

ترید نوع سوم

همانطور که می دانید نرم افزار ادونسد گت دارای دو استراتژی می باشد. یکی از آنها ترید در انتهای موج چهارم برای شکار موج پنجم است که ترید نوع اول نام دارد و دیگری ترید در انتهای موج پنجم برای شکار حرکت به سوی انتهای موج چهارم که ترید نوع دوم نامگذاری شده. طی دو سه ماه اخیر که با دقت بیشتری نرم افزار را بررسی کردیم توانستیم روشی را که البته نیاز به تست بیشتری دارد ابداع کنیم و آن ترید در انتهای موج سوم برای شکار موج چهارم است که ما آن را ترید نوع سوم می نامیم. البته این نوع ترید دارای ریسک نسبتا بالایی است زیرا هنگامی که قیمت

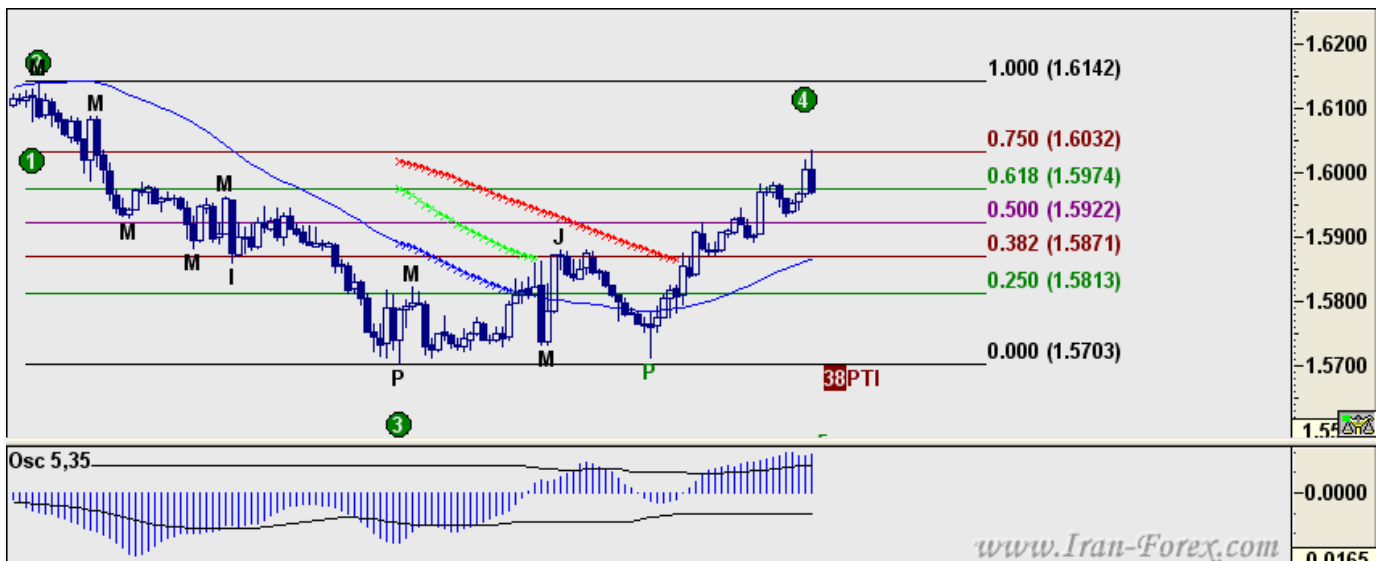
در موج چهارم حرکت می کند با نوسانات بسیار زیادی دیده می شود. در چنین شرایطی نیز هست که سیستم ها و استراتژی های کاملا مکانیکالی از قبیل **Power Break** و ... ضررده می شوند. بنابراین ما آن را در همه موارد توصیه نمی کنیم. توجه فرمایید که این نوع ترید هیچ گونه ارتباطی با استراتژی های نرم افزار ندارد و فقط به عنوان یک ایده ابتکاری در این تایپک مطرح شده است.

تصویر زیر را ببینید:



هنگامی که قیمت در پایان موج سوم به سمت اصلاح خود حرکت می کند و قصد دارد که موج چهارم را بسازد سه کانال رنگی که قبلا در مورد آنها صحبت شده است ظاهر می گردند ما در اینجا فقط به کانال آبی رنگ یعنی همان کانالی که به قیمت نزدیکتر است توجه می کنیم. این کانال مانند بقیه کانالها یک میانگین متحرک است که دوره یا پریود آن را می توانید با آزمون و خطا بیابید. در تصویر بالا کانال آبی یک میانگین متحرک با پریود ۴۴ است که قیمت تقریبا آن را قطع کرده. بررسی ها و تجارب نشان داده که با قطع این کانال می توانید به آغاز موج چهارم با احتمال بالایی مطمئن شوید، پس از قطع کانال معمولا یک برگشت اتفاق می افتد، قیمت در این برگشت نخواهد توانست که از اکستریم موج سوم رد کند (در اینجا از **LOW** موج سوم)، بعد از آن مجددا به سمت تکمیل موج چهارم پیش رفته و در یکی از نسبت های فیبوناچی بازگشت می کند. در این نوع ترید نقطه ورود می تواند **Open** کندل بعد از تقاطع قیمت با کانال آبی باشد یا

اینکه در حرکت بازگشتی که پس از تقاطع معمولاً اتفاق می افتد در نظر گرفته شود. اگر این تقاطع در نسبت های بالا مانند بیش از ۳۸ درصد یا ۵۰ درصد اتفاق بیافتد دیگر آن ترید مقرون به صرفه نخواهد بود. تارگت معمولاً می تواند ۵۰ درصد فیبوناچی باشد اما مواردی نیز هست که موج چهارم به شکل زیگزاگی شده و در نسبت پایینی همچون ۳۸ درصد شروع به ساختن موج پنجم می کند. استاپ هم در این نوع ترید LOW موج سوم (در اینجا) با ۲۰ یا ۳۰ پیپ فاصله اطمینان است.



یک نکته برای تریدهای بلند مدت ترید های کوتاه مدتی که انجام می دهیم معمولاً با بررسی تایم های یک، چهار و روزانه است. اگر مایل به تریدهای بلند مدت تر هستید می توانید از تایم های چهارساعته، روزانه و تأیید از هفتگی استفاده کنید که به نظرم نتیجه آن می تواند به مراتب بهتر باشد.



منابع

- آموزش Advanced Get از سایت iran-forex.com