

استراتژی معاملاتی

ایچی موکو

مترجم: مهندس جواد فلاحیان

سخن مترجم

امروز با پیشرفت تحلیل تکنیکال در کشورهای مختلف به خصوص کشور ما بیشتر معامله گران بازارهای مالی به روش تحلیل تکنیکال گرایش پیدا کرده اند تمام اهداف معاله گران این است که پس از مدتی بتوانند سیستم معاملاتی خود را طراحی کرده و با آن اقدام به معامله کنند در بسیار از مواقع معامله گران و علاقه مندان به تحلیل تکنیکال قادر خواهند بود سیستم شخص خود را طراحی نمایند در بسیاری از مواقع هم موفق نخواهند شد سیستم های معاملاتی متعددی وجود دارد که معامله گران از آن استفاده می کنند و بعضا مشاهده می شود به موفقیت های زیادی دست پیدا کرده اند یکی از این روش های سیستم معاملاتی ایچی موکو می باشد که طرفداران زیادی در بین معامله گران دارد در این مقاله سعی شده به بررسی این سیستم معاملاتی پرداخته و ابتدا به بررسی 5 جزء تشکیل دهنده آن و پس از آن به معرفی استراتژی های معاملاتی از سه دیدگاه قوی ، متوسط و ضعیف می پردازیم هر چند ممکن است این مقاله به صورت کامل نتواند قدرت و توانایی این سیستم معاملاتی و تمامی سیگنال های این روش را معرفی کند ولی می تواند یک دید کلی به شخص معامله گر بدهد و در درک و استفاده از این روش به او کمک شایانی کند

امیدوارم برای همه علاقمندان به بازارهای مالی این مقاله مفید باشد

ارادتمند جواد فلاحیان

ایچی موکو کینکو هیو

توصیف مختصر:

ایچی موکو کینکو هیو یک سیستم معاملاتی موفق می باشد که در تمامی بازار ها می توان از آن استفاده کرد و سیستمی بسیار منحصر به فرد می باشد قدرت اولیه این سیستم اطلاعات متعددی که به شخص معامله گر می دهد و معامله گر می تواند از آن استفاده نماید این سیستم بیشتر توجه دارد به واکنش های قیمت و این دید را عمیق تر می سازد در واقع ایچی موکو یک سیستم معاملاتی عمومی و قابل درک برای همه می باشد و معامله گر را به راحتی قادر می سازد ((در یک نگاه)) که احتمالات بیشتر را از احتمالات کمتر در نمودار تشخیص دهد و در مسیر درست معامله نماید

تاریخچه:

سیستم معاملاتی ایچی موکو توسط یک روزنامه نگار ژاپنی طراحی شد این شخص Goichi Hosoda نام داشت او بررسی بر روی این سیستم را از قبل از جنگ جهانی دوم آغاز کرد و در این راه از بسیاری از دانش آموزان خود کمک گرفت با بهره گیری از فرمول ها و سناریو های مختلف و مشابه سازی آن در کامپیوتر و تست متعدد روزانه ، نهایتاً در سال 1968 این سیستم را طراحی کرد بعد از حدود 20 سال تست و استفاده از این سیستم آقای Hosoda کتاب خودش در خصوص این سیستم ویرایش کرد و نسخه نهایی آن را منتشر نمود

سیستم و روش معاملاتی ایچی موکو در تالار های معاملاتی شرق آسیا به صورت فوق العاده گسترده مورد استفاده قرار گرفت در ادامه آقای Hosoda کتاب جدید خود در خصوص استفاده از این سیستم معاملاتی در بازارهای ارز ، کلا ، آتی و سهام را منتشر کرد که در آسیا از محبوبیت بسیار بالایی برخوردار شد

سیستم معاملاتی ایچی موکو به ظاهر تا سال 1990 به دلیل عدم ترجمه آن به زبان انگلیسی در غرب مورد استفاده قرار نمی گرفته است اما پس از آن و با توجه به وجود منابع ترجمه شده آن و درک این سیستم معاملاتی در بین معامله گران غربی هم مورد توجه قرار گرفت و از محبوبیت بالایی برخوردار شد و صورت عمومیت به خود گرفت و امروزه بسیاری از افراد از این سیستم معاملاتی پر قدرت استفاده می نمایند

تعادل در یک نگاه

ایچی موکو کینکو هیو به معنای نمودار تعادل در یک نگاه می باشد که به راستی درست می باشد توصیف این سیستم و چگونگی استفاده از آن در زیر آمده است

• با توجه به اینکه سیستم ایچی موکو از 5 خط و بخش جداگانه تشکیل شده است ، ولی این بخش ها به صورت جداگانه مورد استفاده قرار نمی گیرند در واقع زمانی که تصمیم به معامله گرفته می شود هر 5 بخش آن باید به صورت یکپارچه مورد بررسی قرار گیرد ((کل 5 بخش)) و تصویر واکنش قیمت را به نمایش می گذارد ((در یک نگاه)) بدین ترتیب با یک نگاه ساده به سیستم ایچی موکو ، این سیستم به عنوان یک متخصص با درک فوری از نمودار قیمت برای شما تشخیص رویدادهای و روند های قدرتمند را فراهم می سازد

• Hosoda شدیداً معتقد بود که بازار بازتاب مستقیم رفتار یک گروه از انسان ها می باشد او معتقد است که رفتار انسان ها می تواند یک حرکت تعادلی در زندگی و و تمایلات آن ها ایجاد نماید . هریک از این پنج جزء سیستم ایچی موکو بازتابی از این رفتار تعادلی و توازن انسان ها می باشد

سیستم معاملاتی ایچی موکو از پنج اندیکاتور جداگانه تشکیل شده است . کار با این پنج اندیکاتور سیستم معاملاتی ایچی موکو را تکمیل می نماید گزارشی از هریک از این پنج جزء و نحوه محاسبه آن در زیر آماده است

Tenkan Sen (خط تبدیل)

((بالاترین قیمت + پایین ترین قیمت)/2) برای 9 روز گذشته

Kijun Sen (خط استاندارد)

(بالاترین قیمت + پایین ترین قیمت) / 2 برای 26 روز گذشته

Chikou Span (خط عقب مانده)

نمودار خطی و شیفته آن به 26 روز عقب

Senkou Span A (خط پیشرو 1)

(Tenkan Sen + Kijun Sen) / 2 و شیفته آن به 26 روز جلوتر

Senkou Span B (خط پیشرو 2)

(بالاترین قیمت + پایین ترین قیمت) / 2 برای 52 روز گذشته و شیفته آن به 26 روز جلوتر

سنکو اسپن A و سنکو اسپن B از اهمیت بیشتری برخوردار می باشند که با هم تشکیل Kumo یا ابر را می دهند که به صورت کامل درباره آن صحبت خواهیم کرد در نمودار زیر هریک از این پنج بخش نمایش داده شده است



تنظیمات ایچی موکو

در نمودار بالا شما تنظیمات پیش فرض سیستم ایچی موکو را مشاهده می نمایید هر کدام از این خطوط می تواند تنظیمات ویژه ایی داشته باشد آقای Hosoda پس از تحقیقات فراوان در اعداد و تنظیمات مختلف و تست آن ها سر انجام به اعداد 9، 26 و 52 رسید و آن را در تنظیمات این سیستم قرار دارد عدد 26 بدلیل تعداد روزهای کاری در ژاپن که تنها یک روز تعطیلی داشته ، عدد 9 به معنای یک هفته و نیم و عدد 52 هم برای 2 ماه کاری در نظر گرفته شده است

تنظیمات استاندارد برای ایچی موکو 9، 26 و 52 می باشد

بحث هایی در این خصوص وجود دارد که آیا این تنظیمات برای کشورهای غربی که دو روز تعطیلی دارند و با بازار های فارکس که به صورت 24 ساعته می باشد آیا کاربرد دارد یا نه و آیا نیاز به تغییر تنظیمات می باشد یا خیر ؟ بسیار از معامله گران حرفه ایی که به سبک ایچی موکو کار می کنند معتقدند که این تنظیمات 9، 26 و 52 بسیار خوب و عالی می باشد و نیازی برای تغییر آن ها وجود ندارد بررسی نشان داده که تنظیمات ایچی موکو از یک تعادل و همبستگی برخوردار می باشد که تغییر در تنظیمات آن می تواند آن را از تعادل خارج نماید و سیگنال های نامعتبری را صادر نماید که سبب خطا و ضرر خواهد شد

بنابراین برای توصیف سیستم ایچی موکو بنا را بر تنظیمات پیش فرض آن قرار می دهیم

Tenkan Sen

همانطور که در بخش مقدماتی مطرح شد به صورت زیر محاسبه می گردد.

Tenkan Sen (خط تبدیل)

(بالا ترین قیمت + پایین ترین قیمت) / 2 برای 9 روز گذشته

در بسیاری از مواقع تنکان سن را با مووینگ ساده 9 روزه مقایسه می کنند و لی در تنکان سن بالاترین قیمت و پایین ترین قیمت در نظر گرفته شده است و با قیمت بسته شدن ارتباطی ندارد این نوع محاسبه در تنکان سن سبب شده است که به تعادل نزدیکتر شود و این محاسبه ما را با جنبه های تعادل بهتر آشنا می نماید

نمودار شکل زیر را در نظر بگیرید



همانطور که در شکل بالا مشاهده می نمایید تنکان سن در بخش هایی حالت مسطح به خود می گیرد که در مووینگ 9 روزه این اتفاق نمی افتد این به این دلیل است که در محاسبه تنکان سن از متوسط بالاترین و پایین

ترین قیمت استفاده شده است نه قیمت بسته شدن ، بنابراین در مواقعی تنکان سن حالت تخت و مسطح به خود می گیرد

در واقع زمانی که تنکان سن حالت تخت به خود می گیرد نشان دهنده یک روند کوتاه مدت در بالای 9 روز گذشته می باشد

در نمودار بالا همچنین می توانید مشاهده کنید دقت تنکان سن را در نشان دادن نقاط حمایتی نسبت به مووینگ 9 روزه را ، واکنش قیمت بالای تنکان سن را در سه نقطه های لایت شده در نمودار بالا می توانید مشاهده نمایید در زمانی که قیمت مووینگ 9 روزه را می شکند این مربوط به شیوه محافظه کارانه محاسبه تنکان سن می باشد که باعث می شود بروی حرکات کوچک قیمت کمتر واکنش نشان دهد . در نمودار های نزولی قیمت تنکان سن حکم مقاومت را داشته و می توان به عنوان مقاومت قیمت استفاده نمود

از زاویه دیگر از تنکان سن می توان به عنوان یک مومنتوم نسبی در تشخیص حرکت قیمت در 9 روز گذشته استفاده کرد در صورتی که تنکان سن یک زاویه تند داشته باشد رشد قیمت با سرعت بالا در کوتاه مدت را تایید خواهد کرد و در صورتی که زاویه کند داشته باشد یا تخت باشد ممکن است قیمت با سرعت پایین یا حتی حرکتی نداشته باشد. موارد فوق در خصوص روند صعودی ذکر شده و به طبع در روند نزولی برعکس خواهد بود.

تنکان سن و کیجون سن در روندهای کوتاه مدت را مورد بررسی قرار می دهند بدیهی است که تنکان سن نسبت به کیجون سن تند تر بوده زیرا در تنکان سن 9 روز گذشته اندازه گیری شده و در کیجون سن 26 روز گذشته بنابراین با توجه به ماهیت کوتاه مدتی تنکان سن ، زیاد قابل اعتماد نمی باشد ولی یک بخش بسیار مهم از سیستم معاملاتی ایچی موکو می باشد هر چند واکنش های قیمت برروی تنکان سن می تواند نشانه هایی از بازگشت یا ادامه روند برای ما باشد ولی در این سیستم می بایست تمام اجزای ایچی موکو را مورد بررسی قرار داد و سیگنال ها را دریافت نمود

یکی از روش های مهم استفاده از تنکان سن ارتباط آن با کیجون سن می باشد چنانچه تنکان سن بالای کیجون سن باشد روند صعودی و چنانچه تنکان سن زیر کیجون سن باشد روند نزولی می باشد و کراس این دو باهم در واقع سیگنال معاملاتی می باشد که در بخش های بعد در این خصوص صحبت خواهیم کرد

Kijun Sen

کیجون سن به صورت زیر محاسبه می شود

Kijun Sen (خط استاندارد)

(بالاترین قیمت + پایین ترین قیمت) / 2 برای 26 روز گذشته

کیجون سن یکی از بخش های بسیار مهم ایچی موکو می باشد که کاربرد بسیار زیادی دارد که آن را برادر تنکان سن می نامند نحوه محاسبه هر دو مانند هم می باشد با این تفاوت که یکی برای 9 روز گذشته و دیگری برای 26 روز گذشته می باشد کیجون سن تمام ویژگی های تنکان را دارد با این تفاوت که اطلاعات را برای یک دوره زمانی بلندتر برای ما فراهم می نماید.

با توجه به اینکه در محاسبه کیجون سن دوره زمانی بلندتر در نظر گرفته می شود قابل اعتمادتر از تنکان سن می باشد اگر قیمت در حال رنج یا در جا باشد کیجون سن با حالت تخت یا مسطح آن را منعکس می نماید . یکی دیگر از عواملی که صعود یا نزول قیمت را در ایچی موکو مشخص خواهد کرد کیجون سن می باشد که زوایای کیجون سن مانند تنکان سن می تواند قدرت و حرکت روند را در کوتاه مدت مشخص کند

با توجه به اینکه واکنش قیمت بر روی کیجون سن دقیق تر از تنکان سن می باشد می تواند آن را به عنوان یک سطح حمایتی یا مقاومتی بسیار با اهمیت در نظر گرفت



قیمت همواره تمایل به حرکت دور از کیجون سن را دارد یا به صورت دوره ایی برخورد با آن و بازگشت بنابراین زمانی که قیمت تمایل به حرکت با سرعت بالا را دارد کیجون سن تمایل به جذب قیمت به سمت خود و برخورد با خود را دارد و در حالتی سکون قیمت تمایل به دور شدن از خود را دارد که در واقع خواستار یک نوع تعادل در حرکت قیمت می باشد که در شکل بالا مشخص است این پدیده مخصوصا زمانی که کیجون سن تخت یا مسطح است به شدت مشهود است که در شکل زیر می توانید مشاهده کنید



با توجه به پویایی کیجون سن معامله گر می تواند سطح کیجون سن را نقطه ورود مطمئن و کم خطر در نظر بگیرد که در بخش استراتژی های معامله با ایچی موکو در خصوص بیشتر صحبت خواهیم کرد

Chikou Span

چیکو اسپن به صورت زیر محاسبه می شود

Chikou Span (خط عقب مانده)

نمودار خطی و شیفیت آن به 26 روز عقب

دهانه چیکو اسپن یکی از ویژگی های منحصر به فرد ایچی موکو می باشد که می تواند یک دیدگاه روشن از عکس العمل قیمت در زمان های خاص به ما بدهد . منطق شیفیت دادن قیمت بسته شدن یا همان نمودار خطی به 26 روز قبل ممکن است در ابتدا بسیار گیج کننده باشد اما این امر با سرعت به ما نشان می دهد واکنش های قیمت در زمان حال را نسب به 26 روز گذشته که در تعیین جهت روند می تواند به ما کمک شایانی نماید اگر قیمت کنونی پایین تر قیمت 26 روز گذشته باشد (دهانه چیکو اسپن در نمودار شکل زیر) یعنی تمایل جهت روند نزولی بیشتر می باشد و چنانچه قیمت کنونی از دهانه چیکو اسپن بالاتر باشد تمایل جهت روند صعودی در نمودار قیمت بیشتر می باشد

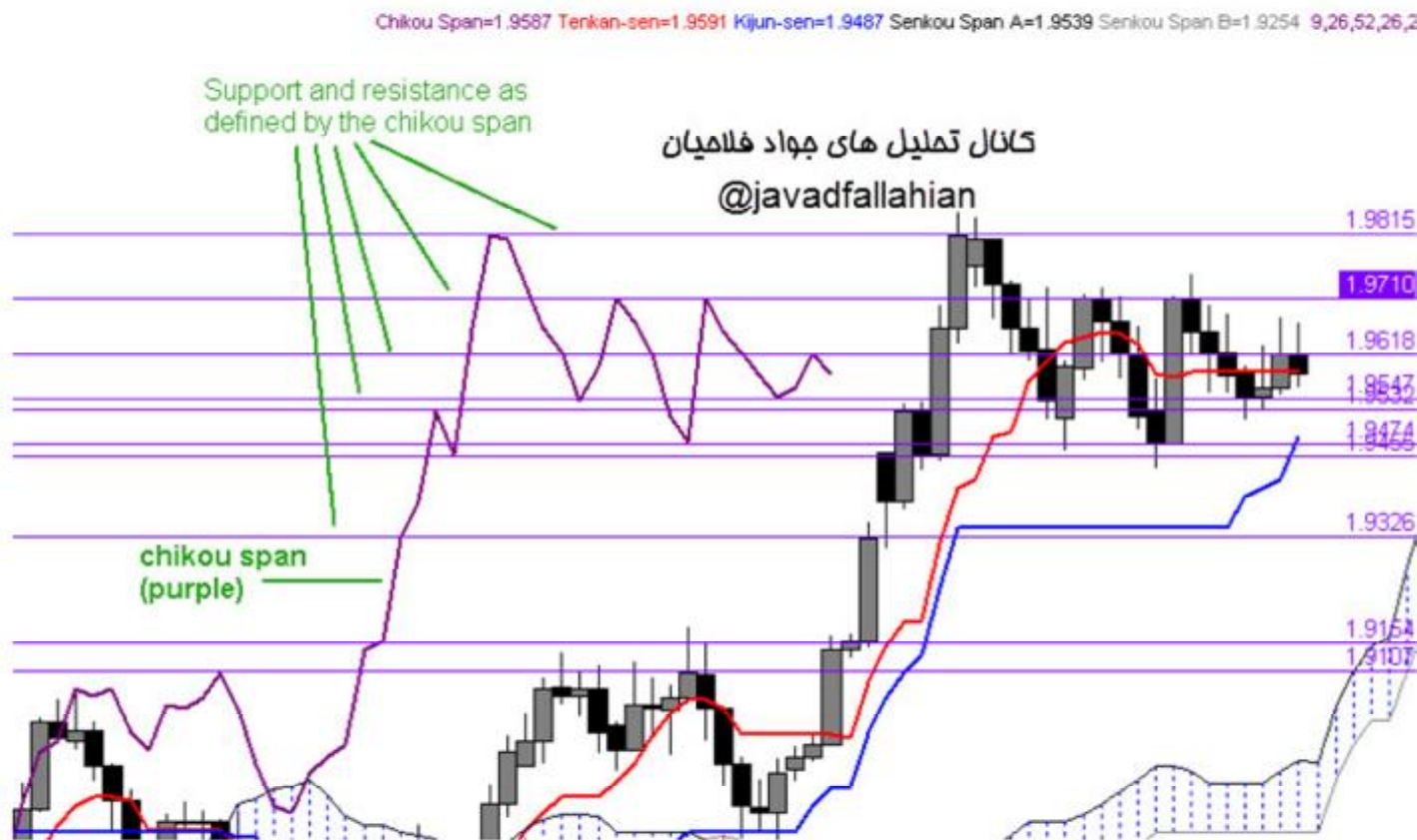


در نمودار بالا مشخص است که تمایل جهت روند صعودی بسیار زیاد می باشد



در نمودار بالا مشخص است که تمایل جهت روند نزولی بسیار زیاد می باشد

یکی دیگر از مواردی که می توان از چیکو اسپن استفاده کرد تعیین سطوح حمایت و مقاومت بر اساس قیمت بسته شدن می باشد که کمک شایانی در این امر به ما می کند در شکل زیر شما این سطوح را می توانید مشاهده نمایید



سنکو اسپن A به صورت زیر محاسبه می شود

Senkou Span A (خط پیشرو 1)

$\frac{2}{(Tenkan\ Sen + Kijun\ Sen)}$ و شیفیت آن به 26 روز جلوتر

سنکو اسپن A شناخته شده ترین بخش سیستم ایچی موکو می باشد که به همراه سنکو اسپن B، کومو یا ابر را تشکیل داده که پایه و اساس سیستم ایچی موکو می باشد. سنکو اسپن A یکی دیگر از خطوط انتقال زمان است که سیستم ایچی موکو را منحصر به فرد می سازد ویژگی سنکو اسپن A این است که 26 روز به جلوتر منتقل می شود آقای Hosoda به خوبی می دانست که قیمت تمایل به واکنش در سطوح حمایت و مقاومت

دارد بنابراین با جلو بردن این خط به میزان 26 روز خواست با سرعت و در یک نگاه حمایت و مقاومت در 26 روز را نسبت به قیمت حال مشاهده نماید

شاید به توان از سنکو اسپن A و سنکو اسپن B به تنهایی در معامله استفاده کرد ولی با ترکیب این دو، قدرت شگفت انگیز آن ها مشخص خواهد شد

Senkou Span B

سنکو اسپن B به صورت زیر محاسبه می شود

Senkou Span B (خط پیشرو 2)

(بالاترین قیمت + پایین ترین قیمت) / 2 برای 52 روز گذشته و شیفیت آن به 26 روز جلوتر

سنکو اسپن B شناخته شده ترین بخش سیستم ایچی موکو می باشد که به همراه سنکو اسپن A، کومو با ابر را تشکیل داده که پایه و اساس سیستم ایچی موکو می باشد

کومو

اصول اولیه

کومو قلب و روح سیستم معاملاتی ایچی موکو می باشد . کومو نیز یکی از جنبه های منحصر به فرد سیستم معاملاتی ایچی موکو می باشد که دیدگاه دیگری نسبت به تشخیص حمایت ها و مقاومت ها می دهد بر خلاف اینکه همواره یک سطح را به عنوان حمایت بررسی می کنیم در کومو نواحی حمایتی و مقاومتی مشخص می شود . کومو خود از دو خط سنکو اسپن A و سنکو اسپن B تشکیل شده است که این محدوده کومو خود می تواند به عنوان نواحی حمایتی و مقاومت محسوب شود

انجام معامله در کومو به هیچ عنوان توصیه نمی شود در زیر به توضیح در این خصوص می پردازیم

معیار های بهتری از حمایت و مقاومت

همانطور که قبلا هم گفته شد یکی از جنبه های منحصر به فرد سیستم ایچی موکو ، کومو می باشد که می تواند دیدگاه های قابل اعتماد تری نسبت به حمایت ها و مقاومت ها به ما بدهد به جای نمایش یک سطح حمایتی و مقاومتی محدوده های حمایتی و مقاومت را به ما نشان می دهد برای مثال در نمودار زیر در پنج نوبت جداگانه واکنش قیمت در مرزهای کومو را در مدت 30 روز مشاهده می نمایید



قدرت کومو زمانی آشکار می شود که آن را با سطوح حمایت و مقاومت کلاسیک مورد بررسی قرار دهیم

در نمودار زیر یک خط روند نزولی A به صورت کلاسیک و یک سطح مقاومت کلاسیک B نمایش داده شده است. در نقطه C به نظر قیمت قادر به شکست خط روند نزولی شده است ولی یک معامله گر زیرک و تیز بین مشاهده می نماید که این سطح دقیقا در لبه کومو قرار دارد و می داند ورود در این نقطه بسیار خطرناک می باشد و دقیقا قیمت پس از آن ریزش زیادی داشته است

در ادامه قیمت قادر بوده که مقاومت کلاسیک B را در نقطه D بشکند باز هم معامله گر ایچی موکو می داند که این نقطه در درون کومو قرار دارد نزدیک به سنکو اسپن B که سطح مقاومتی مهم می باشد و هیچ چیزی در این محدوده مشخص نمی باشد و به دنبال فرصت ورود مناسب تری می گردد و همانطور که مشخص است قیمت در نقطه E بازگشت قدرتمندی داشته است. مثال زیر نمایش چند بعدی از حمایت ها و مقاومت ها در سیستم ایچی موکو و مقایسه آن با معامله گران کلاسیک می باشد که با سطوح حمایت و مقاومت به بررسی نمودار می پردازند تحلیل گر ایچی موکو از موقعیت های مشکوک و نامشخص آگاهی می یابد و در موقعیت های مطمئن اقدام به خرید یا فروش می نماید



در اغلب تفاسیر عمومی زمانی که قیمت در بالای ابر کومو قرار دارد نشان از روند صعودی می باشد و به طبع

زمانی که قیمت در زیر ابر ابر کومو قرار دارد تمایل بر روند نزولی می باشد اگر قیمت درون ابر کومو باشد مبنی بر از بین رفتن روند می باشد معامله گر به سبک ایچی موکو در نگاه اول تمایل قیمت در جهت صعود و نزول را تشخیص می دهد و از دیدگاه چارتیستی اگر قیمت درون ابر کومو قرار داشت صبر پیشه می کند تا قیمت در بالا یا پایین ابر کومو قرار گیرد و روندی را مشخص نماید

عمق یا ضخامت کومو

در زمان مشاهده کومو ممکن است عمق یا ضخامت کومو متفاوت باشد ضخامت کومو نشانه ایی از نوسانات بازار می باشد کومو ضخیم نشان می دهد نوسانات تاریخی بزرگ و کومو نازک نوسانات کوچک را نشان می دهد برای درک بهتر این موضوع باید محاسبات دو خط تشکیل دهنده کومو یعنی سنکو اسپن A و سنکو اسپن B را به خاطر داشته باشیم سنکو اسپن A متوسط تنکان سن و کیجون سن می باشد از سوی دیگر سنکو اسپن B بالاترین و پایین ترین قیمت در 52 روز گذشته می باشد بنابراین سنکو اسپن A در کوتاه مدت تندتر و سریع تر از سنکو اسپن B می باشد در نمودار زیر قیمت از 52 روز گذشته ریزش داشته است و دهانه های حال سنکو اسپن B رو به پایین است به دلیل کند بودن آن ولی از 26 روز گذشته قیمت رشدی داشته و دهانه سنکو اسپن A رو به بالا می باشد و ضخامت ابر کومو در حال نازکتر شدن می باشد به عبارت دیگر سنکو اسپن A از کوتاه مدت تاثیر می گیرد و دهانه سنکو اسپن B در بلند مدت چنانچه قیمت افزایش یابد و سنکو اسپن A بالای سنکو اسپن B قرار گیرد به اصلاح گفته می شود پیچ و تاب عبور کومو



باز و بسته شدن دهانه های کومو ناشی از نوسانات بازار می باشد چنانچه نوسانات در بازار زیاد باشد سنکو اسپن A سریعتر واکنش نشان می دهد و با منحنی قیمت هم جهت خواهد شد در حالی که سنکو اسپن B دیرتر واکنش نشان خواهد داد و این امر سبب ضخیم تر شدن کومو می شود و زمانی که نوسانات کمتر باشد کومو نازک خواهد بود

عمق و ضخامت کومو تابعی از نوسانات قیمت خواهد بود

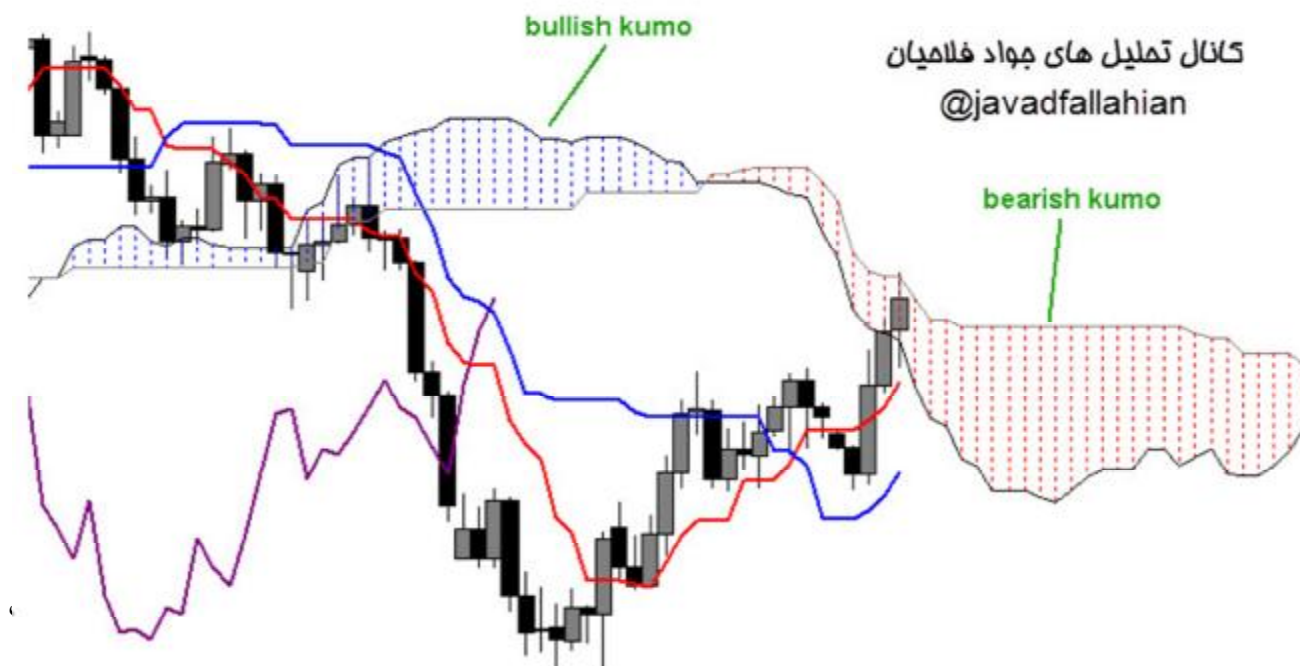
از دیدگاه معامله گری کومو ضخیم تر مقاومت و حمایت قدرتمندی خواهد بود این اطلاعات برای معامله گر به سبک ایچی موکو می تواند در مدیریت ریسک و استراتژی ورود به معامله کمک شایانی نماید برای مثال چنانچه قیمتا در حال نزدیک شدن به کومو نازک می باشد می تواند شانس شکست کومو را بالا بداند ولی در

صورتی که قیمت در حال نزدیک شدن به کومو ضخیم و قدرتمند باشد می تواند استراتژی سیو سود و یا کاهش میزان حساب معاملاتی خود و در صورت نداشتن معامله باز ورود در زمان دیگر را انتخاب نماید به طور کلی ضخیم تر بودن کومو حمایت و مقاومت معتبر تری را فراهم خواهد کرد

تمایلات کومو

کومو مانند اشخاص دارای تمایلاتی می باشد از آنجایی که کومو از دو میانگین متحرک تشکیل شده است چنانچه سنکو اسپن A بالای سنکو اسپن B قرار بگیرد تمایلات صعودی بیشتر می باشد و چنانچه سنکو اسپن B بالای سنکو اسپن A قرار گیرد تمایلات نزولی بیشتر است در شکل زیر این موضوع نمایش داده شده است

Chikou Span=1.2362 Tenkan-sen=1.2253 Kijun-sen=1.2136 Senkou Span A=1.2195 Senkou Span B= USD/CHF O=1.2321 H=1.2394 L=1.2271 C=1.236



تمایلات کومو را زیر نظر دارند . کراس دهانه های سنکو اسپن و وقوع این پیچ و تاب می تواند یک سیگنال ورود و تایید روند باشد که در بخش استراتژی ها بیشتر در این خصوص صحبت خواهیم کرد

کومو بالا ، پایین و تخت

حالت های بالا ، پایین و تخت که در دهانه های کومو مشاهده می شود در واقع حالت های تعادلی کومو می باشد مانند کیجون سن که در حالت تخت می تواند حمایت بسیار مهمی باشد سنکو اسپن B هم در حالت تخت حمایت بسیار مهمی می باشد به دلیل اینکه در مدت 52 روزه محاسبه شد است از آنجایی که قیمت همواره تمایل به حرکت به صورت درجا یا رنج را دارد دهانه سنکو اسپن B در زمانی که به صورت تخت می باشد می تواند این موضوع را نشان دهد در روند صعودی چنانچه سنکو اسپن B به صورت تخت باشد می تواند نشانه ایی از تغییر روند در قیمت باشد و در روند نزولی هم به همین صورت در مثال زیر زمانی که در نمودار قیمت در انتها سنکو اسپن B تخت شده است احتمال تغییر روند در آن زیاد شده است و این موضوع در گذشته هم که روند از حالت صعودی به نزولی تبدیل شده است بسیار مشهود می باشد قسمت های لایت شده در نمودار زیر این موضوع را به خوبی بیان می کند



تعریف : معامله کردن در مسیر روند یک استراتژی سرمایه گذاری است برای زمان بلند مدت در بازارهای مختلف ، معامله گرانی که به این روش ترید می کنند با مشخص کردن مووینگ اوریج ها و شکست ها در مسیر اصلی روند بازار سیگنال های ورود یا خروج را پیدا می نمایند معامله گرانی که به روش دنبال کردن

روند معامله می کنند مسیر قیمت را پیش بینی و یا پیش گویی نمی کنند فقط در قیمتی از روند اصلی بر آن سوار می شوند و روند را دنبال می کنند

معامله در مسیر روند در سیستم ایچی موکو کینکو هیو

هر شخصی که به معامله به روش ایچی موکو تمایل دارد در ابتدا می بایست این سیستم را به خوبی درک کند همین موضوع است که معامله گران به روش ایچی موکو تمایل دارند درک عمیقی از این سیستم داشته باشند تا در دراز مدت بتوانند از این روش سود کسب نمایند توجه داشته باشید یکی از عوامل موفقیت عوامل روانی و خود شناختی معامله گر می باشد که این مهم به خود معامله گر بستگی دارد و باعث بسیاری از موفقیت ها و شکست ها می باشد

معامله گران روند

- هرگز پیش بینی نکنید که بازار به کجا خواهد رفت
- هرگز بالا یا پایین حرکات قیمت را جست و جو نکنید و ذهن خود را درگیر آن نکنید
- همواره به روند اصلی احترام گذاشته و در مسیر آن معامله کنید
- اجازه دهید که بازار بگوید که روند به پایان رسیده
- عبور قیمت از بعضی از نقاط شرایط الزامی جهت تایید شروع یا پایان روند می باشد پس با صبر و تحمل اجازه دهید تا قیمت از این نقاط عبور کند تا شروع یا پایان روند تایید شود
- حرکات قیمت را با دید بلند مدت نگاه کنید تا نوسانات و حرکات کوچک بر روی شما تاثیر نگذارد
- درک این موضوع که همانطور که معامله در مسیر روند می تواند سبب موفقیت های بزرگی شود ممکن است موجب ضرر به همان میزان نیز شود
- درک این موضوع که می توان در هر تایم فریمی معامله کرد

استراتژی معاملاتی ایچی موکو

1- کراس تنکان و کیجون سن

کراس تنکان سن و کیجون سن یک از متداول ترین استراتژی ها در سیستم ایچی موکو کینکو هیو می باشد. این سیگنال زمانی صادر می شود تنکان سن از کیجون سن عبور نماید چنانچه تنکان سن پس از عبور در بالای کیجون سن قرار گیرد سیگنال روند صعودی و چنانچه تنکان سن پس از عبور زیر کیجون سن قرار گیرد سیگنال روند نزولی صادر خواهد شد مانند تمام استراتژی های درون ایچی موکو کراس تنکان و کیجون سن نیاز به یک شرط بزرگتری باید داشته باشد که بتواند با آن به موفقیت های بیشتری دست پیدا کرد به طور کلی کراس تنکان سن و کیجون در سه دسته قوی ، متوسط و ضعیف دسته بندی می شوند

ü سیگنال قوی کراس تنکان سن و کیجون سن

سیگنال قوی خرید کراس تنکان سن و کیجون سن زمانی که ، کراس صعودی در بالای ابر کومو باشد صادر می شود

سیگنال قوی فروش کراس تنکان سن و کیجون سن زمانی که ، کراس نزولی در زیر ابر کومو باشد صادر می شود

ü سیگنال متوسط کراس تنکان سن و کیجون سن

سیگنال متوسط خرید کراس تنکان سن و کیجون سن زمانی که ، کراس صعودی در درون ابر کومو باشد صادر می شود

سیگنال متوسط فروش کراس تنکان سن و کیجون سن زمانی که ، کراس نزولی در درون ابر کومو باشد صادر می شود

ü سیگنال ضعیف کراس تنکان سن و کیجون سن

سیگنال ضعیف خرید کراس تنکان سن و کیجون سن زمانی که ، کراس صعودی در زیر ابر کومو باشد صادر می شود

سیگنال ضعیف فروش کراس تنکان سن و کیجون سن زمانی که ، کراس نزولی در بالای ابر کومو باشد صادر می شود

در شکل زیر می توانید مثال هایی از سیگنال های قوی ، متوسط و ضعیف را مشاهده نمایید



اما صبر کنید !! آیا چیکو اسپن را در نظر داشته اید؟

با این سه دسته سیگنال قوی ، ضعیف و متوسط که در ذهن داریم شما باید چیز دیگری را نیز اضافه کنید و آن چیکو اسپن است که مانند یک داور نهایی رفتار می کند هر یک از سه دسته بندی بالا که ذکر شد می تواند به دسته بندی های بیشتری با توجه به چیکو اسپن و موقعیت آن با منحنی قیمت تقسیم شود اگر سیگنال خرید صادر شده باشد و چیکو اسپن بالای منحنی قیمت باشد این سیگنال قویتر خواهد بود به همین ترتیب اگر سیگنال فروش صادر شده باشد و چیکو اسپن زیر منحنی قیمت باشد سیگنال قوی تر خواهد شد در صورتی که وضعیت چیکو اسپن با منحنی قیمت مخالف سیگنال صادر شده باشد ، سیگنال صادره تضعیف خواهد شد

ورود

ورود در کراس تنکان سن و کیجون سن بسیار ساده است قرار دارد یک سفارش در مسیر کراس به همین راحتی، ولی با وجود سیستم معاملاتی خوب ایچی موکو یک معامله گر باید تمامی حمایت ها و مقاومت های کلاسیک پیش روی قیمت را در نظر داشته باشد و با عبور قیمت از آن ها سفارش خود را وارد نماید

خروج

خروج در روش کراس تنکان سن و کیجون سن کمی متفاوت خواهد بود، سیگنال خروج سنتی، عبور تنکان سن از کیجون سن در مسیر خلاف معامله شما می باشد ولی نگرانی هایی در خصوص دیر صادر شدن این سیگنال وجود دارد که ممکن است ریسک معامله را بالا ببرد پس پیشنهاد می شود از دیگر روشهای خروج خارج از روش ایچی موکو استفاده شود

قرار دادن حد ضرر

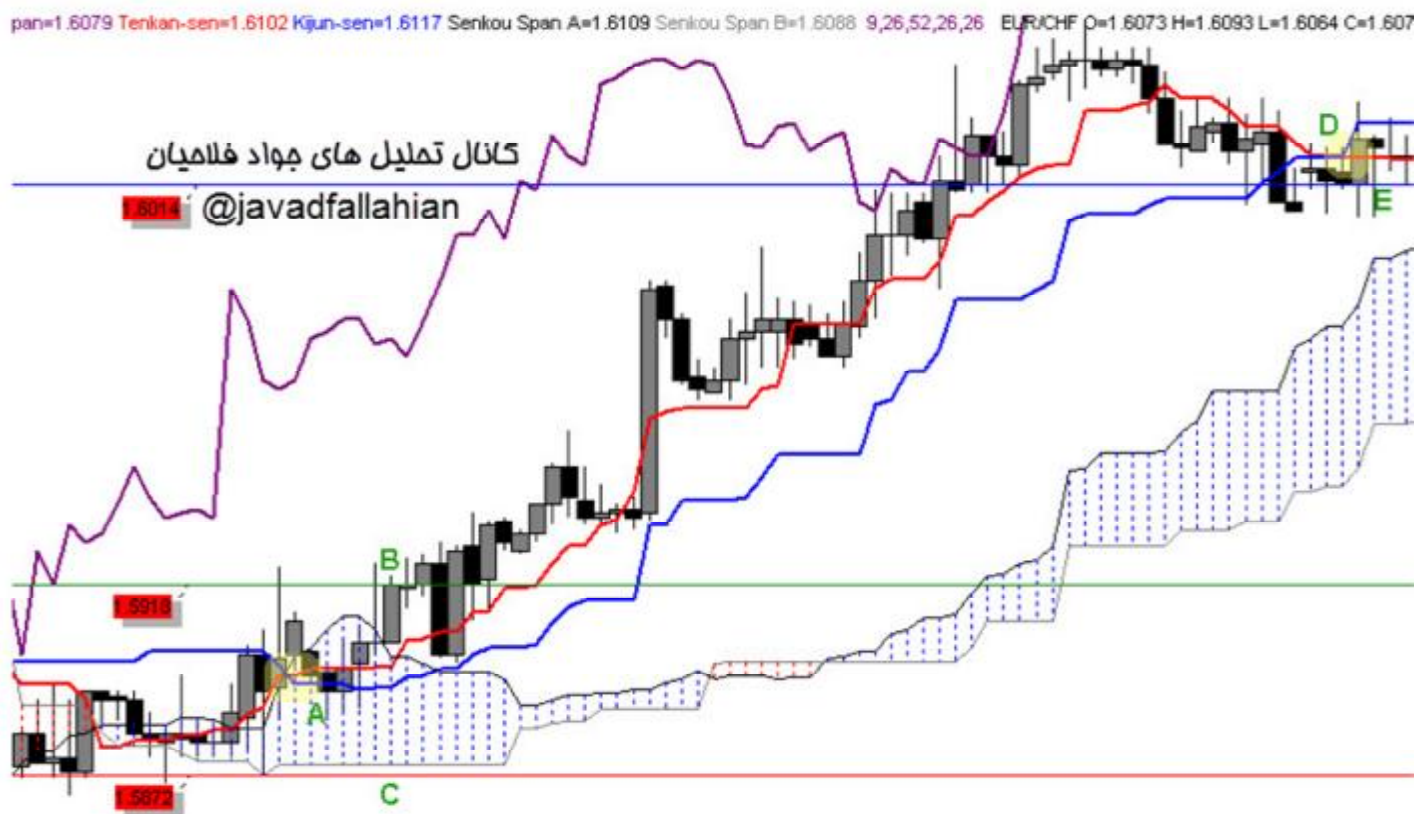
حد ضرر در استراتژی کراس تنکان سن و کیجون سن ساختار مشخصی ندارد و معامله گر می بایست بر اساس رعایت ریسک و مدیریت سرمایه اقدام به قرار دادن حد ضرر کند

حد سود

حد سود در استراتژی کراس تنکان سن و کیجون سن را می توان به 2 روش تعیین کرد در روش اول رسیدن قیمت به سطوح حساس که در واقع حمایت حمایت ها و مقاومت ها می باشد و در روش دیگر با کراس تنکان سن و کیجون سن در خلاف روند اصلی

مثال:

در نمودار زیر سیگنال خرید با قدرت متوسط در نقطه A صادر شده است و با توجه به اینکه چیکو اسپن در بالای منحنی قیمت قرار دارد بر قدرت آن افزوده شده است نقطه B می تواند برای ورود مناسب باشد در این مثال حد ضرر در زیر ابر کومو و در نقطه C قرار گرفته شده است و حد سود پس از کراس تنکان سن و کیجون سن در خلاف روند اصلی یعنی نقاط D و E تعیین شدن است نقاط های لایت شده در نمودار این موضوع را به خوبی نشان می دهد



در این مثال می توان با بالا رفتن قیمت حد ضرر را هم قیمت به قیمت بالا برد و در زیر کیجون سن قرار داد

2- کراس کیجون سن

کراس کیجون یکی از قدرتمند ترین و قابل اعتمادترین استراتژی ها در روش ایچی موکو می باشد
این روش را در تمام تایم فریم ها می توان استفاده کرد که البته هر چه تایم فریم بزرگتر باشد اعتبار
بیشتری خواهد داشت معمولا در تایم های کوچک کمتر قابل اعتماد خواهد بود این سیگنال زمانی
که قیمت از کیجون سن عبور نماید صادر خواهد شد اگر پس از عبور قیمت ، کیجون سن زیر
قیمت قرار گیرد سیگنال خرید صادر می شود و جنانچه بعد از عبور قیمت ، کیجون سن بالای
قیمت قرار گیرد سیگنال فروش صادر خواهد شد

به طور کلی کراس کیجون سن در سه دسته قوی ، متوسط و ضعیف دسته بندی می شوند

ü سیگنال قوی کراس کیجون سن

سیگنال قوی خرید کراس کیجون سن زمانی که ، کراس صعودی در بالای ابر کومو باشد صادر
می شود

سیگنال قوی فروش کراس کیجون سن زمانی که ، کراس نزولی در پایین ابر کومو باشد صادر می
شود

ü سیگنال متوسط کراس کیجون سن

سیگنال متوسط خرید کراس کیجون سن زمانی که ، کراس صعودی در درون ابر کومو باشد صادر
می شود

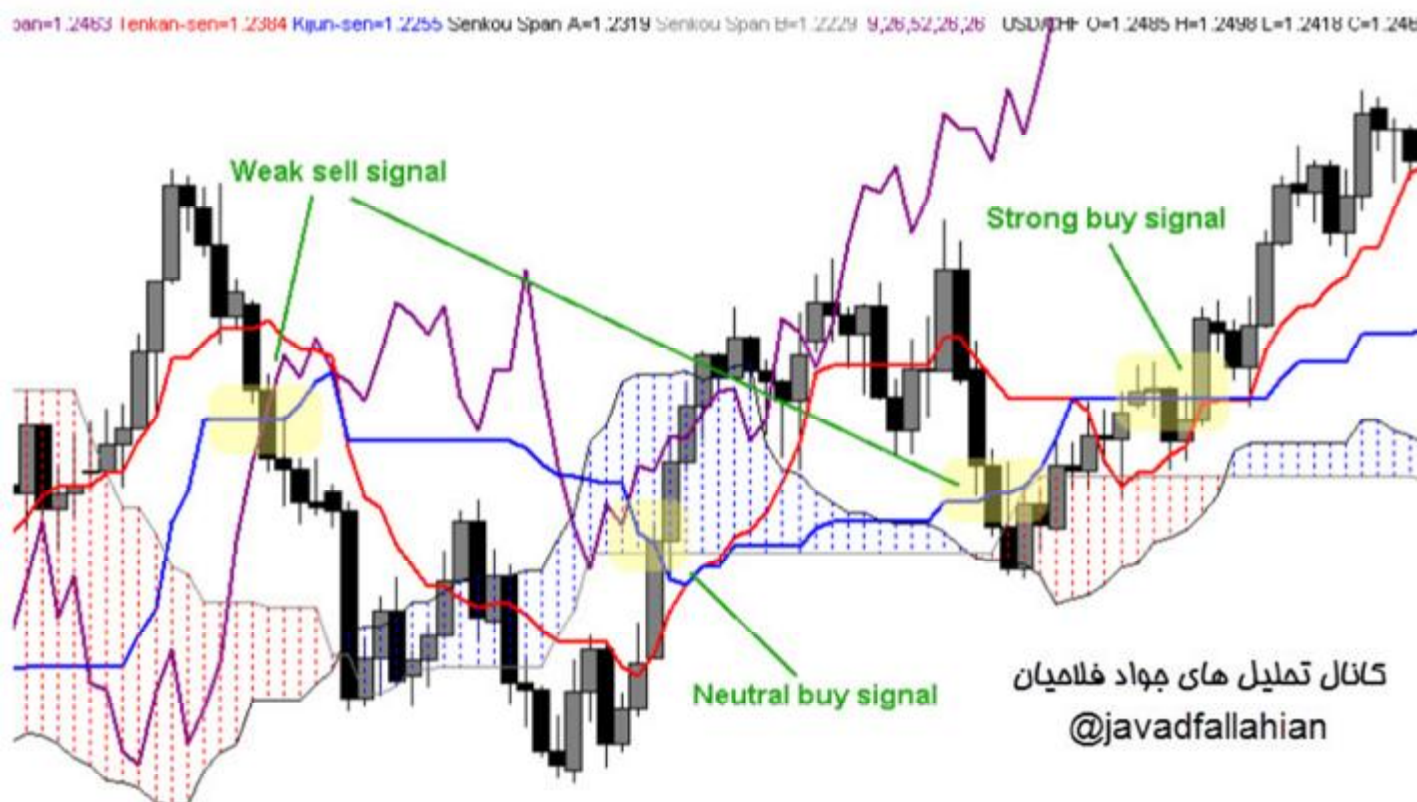
سیگنال متوسط فروش کراس کیجون سن زمانی که ، کراس نزولی در درون ابر کومو باشد صادر
می شود

ü سیگنال ضعیف کراس کیجون سن

سیگنال ضعیف خرید کراس کیجون سن زمانی که ، کراس صعودی در زیر ابر کومو باشد صادر
می شود

سیگنال ضعیف فروش کراس کیجون سن زمانی که ، کراس نزولی در بالای ابر کومو باشد صادر می شود

در نمودار زیر سیگنال های قوی ، متوسط و ضعیف کراس کیجون سن در نقاط های لایت شده نمایش داده شده است



مانند کراس تنکان سن و کیجون سن که معامله گر باهوش و دانا نظر به چیکواسپن دارد در کراس کیجون سن هم به همین صورت می باشد چنانچه در سیگنال خرید کراس کیجون سن چیکواسپن در بالای منحنی قیمت قرار داشته باشد بر قدرت و اعتبار آن می افزاید و چنانچه در سیگنال فروش کراس کیجون سن ، چیکواسپن در زیر منحنی قیمت قرار داشته باشد اعتبار و قدرت آن بیشتر می شود

ورود

ورود در کراس کیجون سن بسیار ساده است قرار دارد یک سفارش در مسیر کراس به همین راحتی ولی با وجود سیستم معاملاتی خوب ایچی موکو یک معامله گر باید تمامی حمایت ها و مقاومت های کلاسیک پیش روی قیمت را در نظر داشته باشد و با عبور قیمت از آن ها سفارش خود را وارد نماید

خروج

خروج در روش کراس کیجون سن بدین صورت است که در صورتی که کراس بر خلاف جهت اصلی روند اتفاق بیافتد سیگنال خروج صادر خواهد شد

قرار دارد حد ضرر

قرار دادن استاپ بستگی به نوع ریسک و مدیریت سرمایه معامله گر دارد ولی چنانچه در روند صعودی قیمت به زیر کیجون سن بیاید و در روند نزولی قیمت به بالای کیجون سن برود می تواند گفت حد ضرر زده شده است

تعیین حد سود

حد سود در استراتژی کراس کیجون سن را می توان به 2 روش تعیین کرد در روش اول رسیدن قیمت به سطوح حساس که در واقع حمایت حمایت ها و مقاومت ها می باشد و در روش دیگر با کراس کیجون سن و منحنی قیمت در خلاف روند اصلی

در مثال زیر می توانید نقاط کراس و ورود و حد ضرر و حد سود را مشاهده کنید همانطور که مشاهده می کنید کراس کیجون سن با منحنی قیمت در نقطه A رخ داده است و سیگنال خرید صادر شده است و نقطه B جهت ورود مناسب می باشد همانطور که مشاهده می کنید حد ضرر در زیر کیجون سن در نقطه C قرار گرفته است قیمت رشد داشته و پس از کراس کیجون سن با منحنی قیمت در خلاف جهت روند در نقطه D سیگنال خروج یا حد سود صادر شده است



3- شکست کومو (شکست ابر)

شکست کومو یک استراتژی معاملاتی می باشد که در تمامی تایم فریم ها کاربرد دارد هرچند که در تایم فریم های بالاتر مانند روزانه ، هفتگی و ماهیانه از قدرت و اعتبار بالاتری برخوردار است معامله به روش شکست کومو از ناب ترین استراتژی ها در سیستم ایچی مو کو می باشد زمانی که قیمت از کومو عبور کند و در بالای کومو بسته شود سیگنال خرید صادر می شود و میتوان انتظار داشت که مدتی روند صعودی خواهد بود و چنانچه قیمت در زیر کومو بسته شود سیگنال فروش صادر خواهد شد و می تواند مدتی انتظار روند نزولی را داشته باشیم

مثال زیر سیگنال خرید شکست کومو را نشان می دهد



ورود

ورود در استراتژی ابر کومو ساده است. زمانی که قیمت در بالا یا پایین ابر کومو بسته می شود می توان در مسیر شکست کومو وارد معامله شد البته باید مراقب بود که در بعضی از مواقع این شکست ها ممکن جعلی باشد بخصوص زمانی که شکست ها اچه از بالا و چه از پایین از قسمت تخت کومو صورت گیرد پس همواره توصیه می شود نگاهی به دیگر ساختارهای سیستم ایچی مو کو در صدور سیگنال داشته باشید مانند موقعیت چیکو اسپن در هنگام شکست و یا وجود مقاومت ها و حمایت های کلاسیک در مسیر قیمت

معامله گران شکست کومو می توانند استفاده خوبی از کومو آینده (26 روز جلوتر) داشته باشند اگر کومو آینده نزولی باشد شکست کومو هم باید نزولی باشد این یک نشانه بسیار خوب برای ورود به معامله می باشد و بالعکس چنانچه کومو آینده صعودی بود شکست کومو هم باید صعودی باشد چنانچه کومو آیند بر خلاف شکست کومو بود معامله گر زیرک باید منتظر بماند و صبر و بردباری را پیشه کند

خروج

خروج آسانترین بخش شکست کومو می باشد معامله گر منتظر می ماند تا قیمت ، کومو را بر خلاف جهت روند بشکند. هر چند ممکن است که بسیاری از معامله گران برای کسب سود حداکثری نقطه خروج خود را بالا ببرند و یا به اصلاح دیگر تریلینگ کنند

تعیین حد ضرر

بهترین نقطه قرار دادن حد ضرر در زیر کومو می باشد

حد سود

اهداف کلاسیک (مقاومت ها و حمایت ها) می تواند در تعیین حد سود برای شکست کومو استفاده شود اما شکست بالا / پایین کومو می تواند نیز حد سود محسوب شود

در مثال زیر با شکست ابر کومو در نقطه A سیگنال فروش صادر شده است نقطه B برای ورود مناسب می باشد و همانطور که مشاهده می کنید در نقطه C یعنی بالای ابر کومو حد ضرر قرار گرفته شده است پس از ریزش قیمت در نقطه D شکست کومو در خلاف روند اصلی رخ داده است و به عبارت دیگر حد سود ما می باشد



4- کراس سنکو اسپن

کراس سنکو اسپن یکی از استراتژی های کمتر شناخته شده در سیستم ایچی موکو می باشد این کراس می تواند یک ترکیب اضافی با دیگر استراتژی های معاملاتی باشد که می تواند قطعا مورد استفاده قرار گیرد

استراتژی کراس سنکو اسپن مانند شکست ابر کومو در تایم فریم های روزانه ، هفتگی و ماهیانه از قدرت و اعتبار بالاتری برخوردار است چنانچه سنکو اسپن A سنکو اسپن B را از پایین به بالا کراس کند سیگنال صعودی و چنانچه سنکو اسپن A سنکو اسپن B را از بالا به پایین کراس کند سیگنال نزولی صادر خواهد شد به طور کلی کراس سنکو اسپن در سه دسته قوی ، متوسط و ضعیف دسته بندی می شوند

ü سیگنال قوی کراس سنکو اسپن

سیگنال قوی کراس سنکو اسپن زمانی صادر میشود که کراس در جهتی رخ دهد که منحنی قیمت تمایل به حرکت در همان مسیر را داشته باشد

ü سیگنال متوسط کراس سنکو اسپن

سیگنال متوسط کراس سنکو اسپن زمانی صادر میشود که در هنگام کراس قیمت درون کومو قرار داشته باشد

ü سیگنال ضعیف کراس سنکو اسپن

سیگنال ضعیف کراس سنکو اسپن زمانی صادر میشود که کراس در جهتی رخ دهد که منحنی قیمت تمایل به حرکت در خلاف آن مسیر را داشته باشد

مثال: در نمودار زیر سیگنال های قوی و متوسط کراس سنکو اسپن نمایش داده شده است



ورود

ورود در سیگنال کراس سنک اسپن بسیار ساده است . بهتر است که سیگنال های ورود در این استراتژی در تایم فریم های بالا مورد بررسی قرار گیرد بهتر است پس از کراس سنکو اسپن در مسیر کراس و روند اصلی ورود صورت پذیرد البته مانند دیگر نمونه های ورود استراتژی ایچی موکو بهتر است مقاومت ها و حمایت های کلاسیک و همچنین دیگر اجزاء سیستم ایچی موکو نیز مد نظر قرار گرفته شود

خروج

سیگنال خروج در سیستم کراس سنکو اسپن زمانی اتفاق می افتد که کراس سنکو اسپن در خلاف جهت روند کلی اتفاق بیافتد

تعیین حد ضرر

حد ضرر در کراس صعودی سنکو اسپن در زیر نقطه کراس و در کراس نزولی سنکو اسپن در بالای نقطه کراس قرار می گیرد که البته تعیین حد ضرر به میزان ریسک و مدیریت سرمایه بستگی دارد

حد سود

اهداف کلاسیک (مقاومت ها و حمایت ها) می تواند در تعیین حد سود برای کراس سنکو اسپن استفاده شود اما کراس سنکو اسپن در خلاف مسیر ورود نیز می توان به عنوان حد سود تعیین نمود

در مثال زیر در نقطه A کراس نزولی اتفاق افتاده است در این لحظه قیمت در نقطه B قرار داشته و نقطه D جهت ورود مناسب می باشد حد ضرر در بالای نقطه کراس و در مکان D تعیین شده است قیمت پس از ریزش در نقطه E کراس بر خلاف روند ورود اتفاق افتاده است و در نقطه F نقطه خروج یا حد سود می باشد که در زمان کراس سنکو اسپن ، قیمت در نقطه F قرار داشته است



5- کراس چیکو اسپن

برای معامله گران دانا و باهوشی که از سیستم ایچی موکو استفاده می کنند تمایلات چیکو اسپن می تواند اعلامی قبل از ورود به معامله را برای آن ها صادر نماید که این علام یا سیگنال تایید می تواند از عبور چیکو اسپن از منحنی قیمت صادر می شود در صورت عبور چیکو اسپن از منحنی قیمت از پایین به بالا سیگنال صعودی و در صورت عبور از منحنی قیمت از بالا به پایی سیگنال نزولی صادر خواهد شد

تا اینجا دانستیم که کراس چیکو اسپن در استراتژی ایچی موکو می تواند به عنوان سیگنال تایید باشد ولی در مواقعی نیز می تواند خود به صورت مستقل سیگنال صادر کند

مانند دیگر سیگنال ها و استراتژی های سیستم ایچی موکو سیگنال کراس چیکو اسپن هم در سه دسته قوی ، متوسط و ضعیف دسته بندی می شود

ü سیگنال قوی کراس چیکو اسپن

سیگنال قوی کراس چیکو اسپن صعودی زمانی اتفاق می افتد که در زمان کراس قیمت در بالای کومو قرار داشته باشد

سیگنال قوی کراس چیکو اسپن نزولی زمانی اتفاق می افتد که در زمان کراس قیمت در پایین کومو قرار داشته باشد

ü سیگنال متوسط کراس چیکو اسپن

سیگنال متوسط کراس چیکو اسپن صعودی زمانی اتفاق می افتد که در زمان کراس قیمت درون کومو قرار داشته باشد

سیگنال متوسط کراس چیکو اسپن نزولی زمانی اتفاق می افتد که در زمان کراس قیمت درون کومو قرار داشته باشد

ü سیگنال ضعیف کراس چیکو اسپن

سیگنال ضعیف کراس چیکو اسپن صعودی زمانی اتفاق می افتد که در زمان کراس قیمت پایین کومو قرار داشته باشد

سیگنال ضعیف کراس چیکو اسپن نزولی زمانی اتفاق می افتد که در زمان کراس قیمت بالای کومو قرار داشته باشد

در مثال زیر سیگنال های قوی و ضعیف کراس چیکو اسپن نمایش داده شده است توجه داشته باشید با توجه به این چیکو اسپن 26 روز عقب تر می باشد ، چیکو می بایست قیمت را کراس نماید . در نقطه A1 چیکو منحنی قیمت را از بالا به پایین کراس کرده است (کراس نزولی) و همزمان قیمت در نقطه A2 قرار دارد با توجه به این که قیمت در بالای کومو قرار دارد سیگنال ضعیف فروش صادر شده است

Jan=1.2961 Tenkan-sen=1.2970 Kijun-sen=1.3081 Senkou Span A=1.3025 Senkou Span B=1.3102 9,26,52,26,26 EUR/USD O=1.3015 H=1.3064 L=1.2951 C=1.296

کانال تحلیل های جواد فلامیان
@javadfallahian



در نقطه B1 چیکو اسپن منحنی قیمت را از پایین به بالا کراس کرده است (کراس صعودی) و همزمان در نقطه B2 قیمت بالای کومو بسته شده است بنابراین سیگنال قوی خرید صادر شده است در ادامه در نقطه C1 چیکو اسپن منحنی قیمت را به سمت پایین کراس کرده است (کراس نزولی) و همزمان قیمت در بالای کومو قرار دارد بنابراین سیگنال ضعیف فروش صادر شده است

ورود

ورود در کراس چیکو اسپن نیز بسیار ساده است . معامله گر می تواند پس از شناسایی قدرت کراس و دیگر سیگنال های صادر شده در مسیر کراس وارد معامله شود

خروج

سیگنال خروج کراس چیکو اسپن بر خلاف جهت روند ورود می باشد هر چند به میزان ریسک معامله گر و همچنین مدیریت سرمایه بستگی دارد

تعیین حد ضرر

در روش کراس چیکو اسپن روش خاصی جهت تعیین حد ضرر وجود ندارد و مانند هر استراتژی می بایست میزان ریسک و مدیریت سرمایه در نظر گرفته شود

حد سود

اهداف کلاسیک (مقاومت ها و حمایت ها) می تواند در تعیین حد سود برای کراس چیکو اسپن استفاده شود اما کراس چیکو اسپن در خلاف مسیر ورود نیز می توان به عنوان حد سود تعیین نمود

در مثال زیر در نقطه A چیکو اسپن منحنی قیمت را از پایین به بالا کراس کرده است و در زمان حال قیمت در بالای کومو قرار دارد بنابراین سیگنال قوی صادر شده است نقطه B1 تایید کراس می باشد و در واقع نقطه B2 نقطه ورود ما به معامله می باشد پس از رشد قیمت در نقطه C1 چیکو اسپن منحنی قیمت را از بالا به پایین کراس کرده است و در واقع نقطه خروج یا حد سود ما نقطه C2 می باشد



موفق و موید باشد

جواد فلاحیان