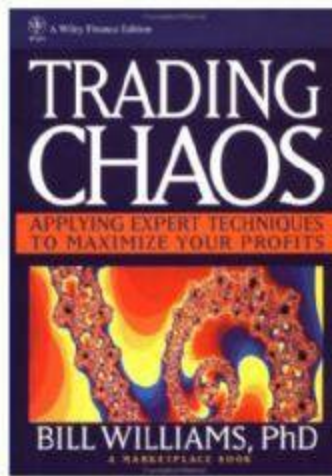


ترجمه کتاب تریدینگ کی اس



به نام خدا

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس نوشته بیل ویلیامز



مترجم

مترجم

به قلم توانای : دانیال ارجمند

مطرح شده در سایت :

Fxtraders



abcBourse.ir

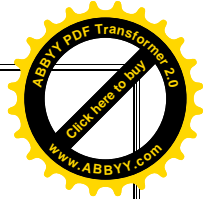
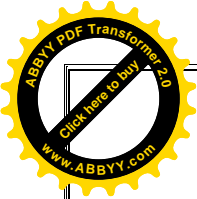


@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



باز نشر :



فصل اول

مارکت مشکل شما نیست، مشکل شما اینست که مارکت را بعنوان مشکل می بینید. سود دهی مارکت توسط اندیکیتورها و روش های مختلف میسر نیست. چون از ابزار پارامتریک برای دنیای غیر پارامتریک (مارکت) استفاده می کند. تردید خوب از سر، سرچشمه نمی گیرد. بلکه از روده و قلب می آید. شما نیاز به بینش و حساسیت به نیازهایتان و نیاز مارکت و بنای محکمی از حس های معمول دارید. تردید موفق بر اساس دانش شما از ساختار زیربنایی مارکت و خودتان است. نحوه کارکرد مغزتان شما را برنده یا بازنده می کند. پند قدیمی می گوید: اول خودت را بشناس و سپس مارکت را. زمانی که من تردید را شروع کردم، بیش از \$6000 صرف کتاب ها و مجلات کردم. چون باور داشتم که این ها کار می کند. سپس من متوجه شدم نویسندگان این مجلات با توصیه های خودشان تردید نمی کنند. تردید مشکل نیست، و می تواند خیلی سود ده باشد. یاد بگیرید به خودتان متکی باشید. اگر از کسانی که موفق نبودند سؤال کنید چرا تردید را کنار گذاشتند، جواب خواهند داد چون نتوانستند مارکت را پیشگویی کنند. هیچ کس نمی توان، اگر شما فکر می کنید که می توانید یاد بگیرید، خودتان را جزو 90٪ افراد غیر موفق قرار می دهید. من در عرض 35 سال تردید یاد گرفتم که آینده مثل گذشته نیست.

رمز موفقیت چیست؟

بهترین پلن های تردید معمولاً اشتباه هستند. اکثر تردیدها هرگز این را کشف نمی کنند. تردیدهای ناموفق دنبال سیستمی هستند که مطمئن و قابل اعتماد باشد و به آنها بگوید چه بکنند. و هر چه کمتر می یابند بیشتر دنبالش می گردند. همه از تحلیل تکنیکال و فاندامنتال استفاده می کنند، اما ما نه. چون تمام تحلیل های تکنیکال بر اساس این منطق اشتباه که آینده مثل گذشته است پایه ریزی شدند.

برخی حقایق غیر معمول: یک سناریوی تپیک:

اکثر تردیدها شروع های متوالی دارند که به پایان شاد منتهی نمی شود. آنها مطمئن هستند که موفقیت درست در کنارشان هست.

شما به مارکت نگاه می کنید با این فکر که سریعاً پول زیادی بدست خواهید آورد بدون اینکه روی آن کار کنید. و این از گزارش های دوستان و بروکر و ... از سودهای کلان ناشی می شود و شما از ضرر هیچ نمی شنوید. بالاخره شما طاقت ندارید. تشنه این موفقیت هستید. تردید اول شما سود کمی می دهد. با تردید دوم فکر می کنید در عرض شش هفته پولتان دو برابر یا حتی بیشتر می شود. و رؤیای شما به زندگی تان وارد می شود و شاید با کانزاس تماس بگیرید برای کاتولوگ هواپیما. تردید بعدی ضرر می کنید و تردیدهای دیگر هم همینطور. از دوستتان سؤال می کنید که چه شده. او می گوید که کسادی مختصری است، گاه گاهی اتفاق می افتد. متأسفانه ضرر ادامه پیدا می کند و بالاخره شما شکست را قبول می کنید. دوست شما خیره است و موفق است. حالا حتی اگر شما متحمل ضرر هم شده باشید، مزه موفقیت را هم چشیدید. شما می دانید سود کلان ممکن است اما آسان نیست.

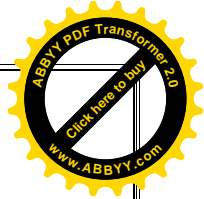
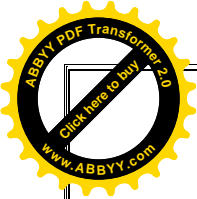
سپس شما مجلات، گزارش ها را می خوانید و برنامه های فینانسیال تلوزیون را نگاه می کنید. تمام زندگی تان درباره تردید است حتی زمانی که به چیز دیگری فکر می کنید. شما از امکانات، بد را انتخاب کردید. با اتکا بخودتان تردید کنید و به دوستتان نگوئید و با دانستن این نکته که مطالب زیادی هست که باید یاد بگیرید. سپس برنامه سمیناری بدستتان می رسد که تمام سوالات شما را پاسخ می دهد و از شما یک تردید می سازد. و توصیه های زیادی برای ثبت نام دریافت می کنید. شما ثبت نام می کنید. سخنرانان از سودهای خود برایتان می گویند و اینکه شما نیاز دارید در نشریات آنها ثبت نام کنید، خط فاکس آنها را بگیرید. اینها همه هزینه کمی برای شما دارد و سود زیادی برای شما دارد.

کار کردن با متخصص خوب است، کسانی مثل The Wall Street Journal و Futures magazine. اینها تردیدهای واقعی هستند.

شما نشریات را می خرید و آنها می گویند این را بخر و آنرا بفروش، برخی را شما نمی فهمید. به هر حال نمی خواهید ضرر کنید و می خواهید در سود بمانید. اکثر تردیدها خوب کار می کند و شما مطمئن به نشریات سمینار می شوید. سپس روز بزرگ فرا می رسد. خط فاکس فریاد می زند:

این است آن! یک فرصت بزرگ!

این آخرین شانس ما هست. این مثل خریدن طلا در \$35 یا Stock در \$800 است. بزغاله های تان را بفروشید و مزرعتان را گرو بگذارید. و هر چه دارید سرمایه گذاری کنید. شما دست پاچه هستید، اما شما باید سود کلان بکنید. تمام سرمایه تان را وارد مارکت می کنید و تا دیر نشده خرید می کنید، اما قیمت کاهش می یابد. با معلم تردیدتان تماس می گیرید، او می گوید درست همان است که انتظارش را داشتیم، فرصت خوبی برای خرید است. قیمت همچنان پائین می آید. دپرس می شوید. فکر می کنید توصیه ها را اشتباه فهمیدید، او متخصص است، او می داند چکار می کند. نشریات همچنان به اینکه چطور ثروتمند شوید ادامه می دهند. با خود فکر می کنید، احتمال دارد زود خرید کردم و نیاز دارم به توصیه های اساسی. شما نا آرام تر از آن هستید که در استراتژی بمانید.



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

بالا و پائین رفتن:

الان شما خیلی محتاط شدید، تنها مشکل شما این است که بطور مداوم سود نمی‌کنید. تصمیم می‌گیرید وارد Trading Pool شوید، جایی که بنظر می‌رسد ریسک کمتری دارد. یکی را که سابقه موفق دارد انتخاب می‌کنید. متأسفانه اقتصاد ضعیف می‌شود و Pool ضرر می‌دهد. این اولین سال ضرر در 10 سال گذشته است.

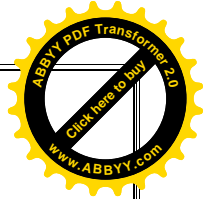
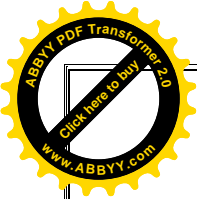
دنیای ترید

به دنیای شگفت‌انگیز فیوچر خوش آمدید. جایی که قابل پیش‌بینی نیست. وقتی که شما امیدتان را به توصیه‌ها، سیستم‌ها و ... از دست دادید، بالاخره شروع می‌کنید به کنترل ترید خودتان. و متوجه می‌شوید که کسی در مارکت ترید نمی‌کند، ما همه سیستم‌های اعتقادی شخصی خودمان را ترید می‌کنیم. ترید یک بازی سایکولوژیک است. استراتژی‌های اکونومیک، فاندمنتال، مکانیکال، یا تکنیکال اکثراً کار نمی‌کنند. مارکت کامپیوتر نیست و توسط کامپیوتر فهمیده نمی‌شود. در کل، نیاز به استراتژی و تاکتیکی است که با آن خودمان و مارکت را بفهمیم. ما یاد گرفتیم که ساختار زیربنایی مارکت بازتابی از ساختار زیربنایی هر تریدر است. همه تلاش‌ها، برای هماهنگ کردن ساختار زیربنایی خودمان که معمولاً قابل دیدن نیست با مارکت است. بطور خلاصه بگوئیم، آنچه که مارکت می‌خواهد، می‌خواهم. تمام ناامیدی‌های ما یک منشأ دارد، انتظارات ما برآورده نمی‌شوند. وقتی که خواسته ما خواسته مارکت است، و خودمان را با مارکت وفق دهیم. ما ناامید نمی‌شویم. با این روش استرس پائین است. و ما وارد ساختار سایکولوژیک No Risk و مفرح می‌شویم. اگر ترید مفرح نباشد، اشتباه می‌کنیم و تنها معلم ما که مارکت است، همیشه به ما می‌گوید چه چیز اشتباه است و خطای ما کجا است.

یافتن استعداد ترید خودتان

در این کتاب من به شما نشان خواهم داد که چگونه در این دنیای نامطمئن ترید، مطمئن سود کنید، بدون اضطراب، و بدون نیاز به پیش‌بینی‌ها، سیستم‌ها، نگاه کردن به FNN، یا خوردن ژورنال وال استریت برای صبحانه. من نمی‌توانم گارانتی کنم که با روش من سود کنید یا حتی از این ایده‌ها نتیجه بگیرید. من اعتقاد دارم که می‌توانم به شما کمک کنم که حداکثر استفاده را از استعدادتان، بلندپروازی‌تان و علاقه‌تان به ترید ببرید. چون مارکت قابل پیش‌بینی نیست، ما باید از روشی برای ترید استفاده کنیم که نیازی به پیش‌گویی نداشته باشد. مشخصه مارکت انرژی است. و انرژی همیشه مسیری را که مقاومت کمتری دارد طی می‌کند. تصور کنید رودخانه از کوه پائین می‌آید. آب در بستر رودخانه حرکت می‌کند چون مقاومت کمتر است. مسیر حرکت آب بستگی به بستر رودخانه دارد. اکثر روش‌های ترید سعی در تعیین مسیر جریان آب دارند بجای همراه شدن با بستر. ساختار زیربنایی مارکت فیوچر، فرکتال است. و با استفاده از علم بی‌نظمی (Chaos)، بهتر شناخته می‌شود. شما کتاب‌های بیشتری را می‌خوانید، مثل Market Wizards و Wizards The New Market. داستان‌های زیادی می‌گویند که تریدرهائی که ضرر می‌کنند، سیستم ترید ندارند. و از یک روش بروش دیگر می‌روند

دنیای ترید



فصل دوم (درک مارکت)

درک مارکت

اگر شما در هر وضعیتی که هستید، آنچه را که دیگران می بینند، ببینید می توانید بگوئید شما نماینده فرهنگ تان و قربانی آن هستید.

هدف: درک اینکه مارکت فیوچر واقعاً چگونه کار می کند و چرا اکثریت تردرها ضرر می کنند.
در هندوستان شاگردی بود که می خواست هدایت شود. او خانواده اش را ترک کرد تا معلم مناسب را برای راهنمایی اش پیدا کند. او در جایگاه یک معلم توقف کرد و از او روش هدایت شدن را سؤال کرد. معلم گفت، هدایت شدن واقعاً ساده است. تمام آنچه که نیاز دارید اینست که به خانه رفته، جلوی آئینه برای 30 دقیقه نشسته و از خودت بارها و بارها پرس من کیستم؟ شاگرد پاسخ داد آن نمی تواند اینقدر ساده باشد. معلم جواب داد اوه بله ساده است. اما اگر شما راه دیگری را می خواهید چندین معلم در این خیابان است. شاگرد تشکر کرده و براهش ادامه می دهد. و به معلم دوم می رسد با همان سؤال. معلم جواب می دهد اوه، کاملاً مشکل است و وقت زیادی می خواهد. باید به افرادی با این ذهنیت در اشرام (Ashram) بپیوندی و ساوا (Sava) انجام دهی. ساوا یعنی عاری از نفس پرستی. بنابراین شما بدون مزد کار می کنید.

شاگرد همچنان زده شد. این معلم با ذهنیت شاگرد از هدایت شدن بیشتر سازگار بود. او همیشه شنیده بود که آن مشکل است. معلم به شاگرد گفت که تنها شغل باز در اشرام، تمیز کردن اسطبل گاوها است. اگر شاگرد واقعاً برای هدایت شدن جدی است، معلم اجازه می دهد که مدفوع حیوانات را جمع کند و مسئول تمیز نگه داشتن اسطبل گاوها باشد. شاگرد قبول کرد و احساس اطمینان می کرد که باید در مسیر درست قرار گرفته باشد. بعد از 5 سال شاگرد در باره هدایت شدن بی تاب شد و نزد معلم آمد و گفت من 5 سال بدون شکایت و تأخیر کارم را انجام دادم، آیا فکر می کنید زمان آن رسیده که من هدایت شوم؟ معلم جواب داد، بله من اعتقاد دارم شما آماده هستید. به خانه بروید و هر شب در آئینه خودت را نگاه کرده و برای 30 دقیقه از خودت پرس من کیستم. شاگرد شگفت زده گفت این را معلم دیگری 5 سال قبل به من گفت. معلم گفت او راست گفته. این داستان در مورد تردید نیز صادق است. سود کردن در تردید کاملاً ساده است. توجه کنید نگفتم آسان است. یک دنیا تفاوت بین مفهوم ساده و آسان است. نگاه کردن در آئینه بمدت 30 دقیقه کار ساده ای است، اما پرسیدن یک سؤال بارها و بارها و یافتن پاسخ آسان نیست. بعنوان سایکولوژیست اعتقاد دارم انسان ها دو تمایل فطری دارند:

1. ما تمایل داریم که هر چیز را که می بینیم بیش از حد پیچیده اش کنیم.
 2. ما بدیهیات را نمی توانیم ببینیم.
- برای اکثر تردرها مارکت یک حیوان وحشی خطرناک است. و منطق آنها چنین است که "آن را بگیر قبل از اینکه آن تو را بگیرد." آنها مارکت را بصورت دنیائی که اگر نخوری می خورنت می بینند.

ساده بودن تمام مارکت ها

هر بازار کالا توسط مردمی ایجاد می شود که توافق در قیمت و عدم توافق در ارزش کالا دارند.
بالانس مطلق بین قدرت آنها که می خواهند بخرند و بفروشند وجود دارد. بازارهای کالا جایی است که خیلی سریع بالانس می شود. قبل از اینکه شما و من و تردرها متوجه عدم بالانس شویم. اگر سناریوی بالا درست باشد، ما به این نتیجه گیری ساده و مهم می رسیم که ما اطلاعاتی که از طریق مارکت می رسد را بدون سؤال قبول می کنیم. اولین چیزی که باید از جعبه ابزارمان دور بریزیم Bullish و Bearish است. اگر مارکت کارش را خوب انجام دهد پس چیزی تحت عنوان Bullish و Bearish نمی تواند وجود داشته باشد. آنهایی که اطلاعات Bull - Bear را می فروشند، آنها را از تردرها بدست آوردند. برای مثال اگر 75% صعود گزارش کنند، این به این معنی است که تمام Bear ها را در نظر نگرفتند. مارکت قبل از افزایش قیمت نمی تواند حتی 50.01 درصد هم Bulish داشته باشد.

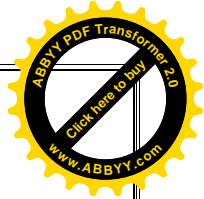
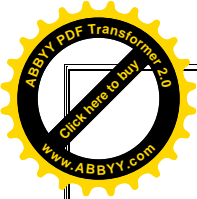
اگر Bullish و Bearish وجود ندارد، به این معناست که چیزی بعنوان خرید هیجانی و فروش هیجانی هم وجود ندارد. اجازه

بدهید دو مفهوم متناقض را بررسی کنیم:

1. خرید در کف و فروش در سقف
 2. برای سود کردن در جهت ترند تردید کنید.
- این دو جمله بطور مطلق غیرقابل انطباق است.

جاده خطرناک رسیدن به استقلال مادی

تریدرهایی که به بروکرها، عناوین روزنامه ها، ژورنال، Street Wall و منابع مشابه توجه نمی کنند خیلی موفق ترند. در تردید ریسک وجود دارد، و مثل رانندگی می ماند. شما هر روز رانندگی می کنید و از خطر در امان می مانید. چون آگاهی و تجربه بدست آوردید. اگر شما مارکت را بفهمید و تجربه داشته باشید، تردید خطرناک تر از رانندگی روز یکشنبه نیست.



فصل سوم

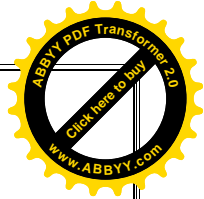
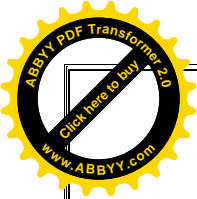
تئوری Chaos: یک مدل تازه برای ترید
 قلب شما خیلی منظم کار می‌کند و اگر نه شما می‌میرید. اما مغز شما خیلی بی‌قائده است و اگر نه تشنج می‌کنید. این نشان می‌دهد که بی‌نظمی، Chaos منجر به سیستم پیچیده می‌شود. مغز انتخاب کرده که ناپایدار باشد.

هدف: فهم بهتر Chaos و هندسه فرکتال
 پارادایگم ریشه یونانی دارد و به معنی مدل یا پترن است. از پارادایگم ما دنیا را می‌فهمیم. آن مثل آب است برای ماهی. پارادایگم دنیا را به ما توضیح می‌دهد و کمک می‌کند رفتار را پیش‌گویی کنیم. پارادایگم فیلتری است که از طریق آن دنیا را می‌بینیم. آن درک ما از واقعیت است. و چون واقعیت ما را تشکیل می‌دهد، ندرتاً به آن توجه می‌کنیم و سؤال می‌کنیم. ما هرگز دنیا را مستقیماً نمی‌بینیم، ما همیشه از طریق فیلتر پارادایگم می‌بینیم. کل را نمی‌بینیم، فقط تکه‌ای را می‌بینیم. همه اینها برای مارکت هم درست است. مارکت مثل غار است اگر فریاد بزنی "انالیز تکنیکال"، آکو بازگشتی بطرف شما "انالیز تکنیکال" خواهد بود. وقتی ما در وسط یک مدل هستیم، تصور مدل‌های دیگر مشکل است. برای مثال تصور کنید سال 1968 است و شما Leader جهانی ساعت‌سازی را در سال 1980 پیش‌گویی می‌کنید. شما می‌گوئید سوئیس. چون چندین سال است که در مارکت ساعت، از همه پیشی گرفته است. اما عوض شدن مدل از ساعت‌های مکانیکی به الکترونیک اتفاق می‌افتد. زاین مدل جدید را تشخیص داده و از اکثر بازارهای جهانی ساعت جلو می‌زند. سوئیس با ماندن در مدل قدیمی، سهم خودش را از بازار در سال 1968 که بیش از 90٪ بوده از دست داده و به زیر 10٪ طی سال 1980 رسید. با تغییر مدل تمام قوانین تغییر می‌کند. و با مدل اشتباه حتی عمل‌های صحیح کار نمی‌کنند. مدل شخصی ما روشی که ما اطلاعات را تجزیه تحلیل کرده و پاسخ می‌دهیم را کنترل می‌کند. احساس و نگاه شما به مارکت بعد از 10 بار متوالی ضرر با نگاهتان بعد از 10 بار سود متوالی خیلی متفاوت خواهد بود.
 علم Chaos یک مدل تازه و خیلی مناسب‌تری از دنیا، مارکت، و رفتار شخصی خودمان می‌دهد.

CHAOS و دنیای شخصی ما
 ما انسان‌ها عادت داریم مفاهیم و ابزارهای خیلی مهم را اشتباه نام‌گذاری کنیم. برای مثال ما ذهن (نیمکره چپ) را هوشیار می‌نامیم، در حالیکه آن تنها قسمتی از مغز ما است که ناهوشیار می‌شود یا می‌خوابد. قسمت دیگر مغز ما بطور مداوم کار می‌کند. مشابهاً فیزیک این علم جدید را Chaos نامید که اساساً اشتباه است.
 Chaos به اتفاقی بودن اشاره نمی‌کند، دقیقاً برعکس آن درست است. Chaos درجه بالایی از نظم است. که اتفاقی بودن و Stimuli اصول تشکیل‌دهنده آن هستند تا علت و اثر در مدل نیوتن و اقلیدس. چون طبیعت و مغز انسان هر دو Chaotic هستند، پس مارکت نیز بعنوان قسمتی از طبیعت و انعکاسی از انسان Chaotic است. منحنی توزیع نرمال، یکی از عمومی‌ترین علوم طبیعی است، و می‌توان بعنوان ابزار ترید در مارکت استفاده کرد. قیمت‌های بازار کالا بسادگی در مدل زنگ شکل (Bell Shape) قرار نمی‌گیرد. با وجود این شبیه به خط ساحل یا بستر رود است. هر تغییر قیمت اتفاقی و غیر قابل پیش‌بینی است. اما توالی تغییرها مستقل از مقیاس است: منحنی روزانه و ماهانه تغییرات قیمت کاملاً مطابق است. ما محصول chaos هستیم. حتی مغز ما، یک قسمت (نیمکره چپ) در جستجوی پایداری و قسمت دیگر (نیمکره راست) دنبالش است. ما (خودمان، بدن، شخصیت، و همه) نتیجه تداخل مدبرانه پایداری و Chaos هستیم. Chaos بستر تلاقی بین Yin / Yang، سفید \ سیاه، اینجا \ آنجا، حالا \ بعداً، یا ایجاد ما است. در مارکت، Chaos، متغیر در مقابل ترند است. در رفتار تریدر، یعنی سود بردن و ضرر کردن. یعنی خوابیدن و راه رفتن، یعنی کشت و برداشت.
 مغز ما هم رفتار متفاوت بسته به جریان انرژی نشان می‌دهد. گاهی پایدار است، مثل جریان رود آرام. وقتی ترید می‌کنید، مغز اغلب آشفته است، مثل جریان رود متلاطم. بر طبق نقشه منطقی خطی معمول ما، حقیقت در پایداری است. به این معنی که دانش هرگز تغییر نمی‌کند. بنابراین سود کمی از استراتژی‌هایی که برای معاملات از Chaos استفاده می‌کنند عاید می‌شود.

در منطق غیر خطی موقت بودن پایداری، امری بدیهی است. و Chaos برای همیشه است. تحقیقات ما نشان داده که chaos ذهن ما، در مارکت منعکس می‌شود. هر دو مخلوط استانداردهایی از Chaos و پایداری است. Prigoging نوشته است: مغز مخلوق Chaos است.
 پایداری و chaos همچنین بصورت فعالیت خطی و غیر خطی تعریف می‌شود، فعالیت شامل رشد، تولید، و حتی فکر کردن است. اگر ما دنیا را از دید نیمکره چپ می‌ساختیم، رندهای مستقیم، ابرهای گرد، و کوه‌های مخروطی داشتیم. طبیعت از منبع غیر خطی سرچشمه می‌گیرد. فراورده‌های ساخت بشر مثل زبان، از نیمکره چپ ناشی می‌شود و بنابراین دیجیتال و خطی است. ما سیستم تردمان را به همان روشی که زبان را ایجاد کردیم، ساختیم و درست همچنانکه زبان در شرح طبیعت موفق نیست، سیستم ترید خطی نیز در شرح و سود گرفتن از مارکت موفق نیست. بخاطر داشته باشید Chaos ما را به اینجا رسانده و ما را به جایی که می‌خواهیم برویم، خواهد رساند.

هندسه فرکتال
 علم Chaos بطور قابل توجهی بیشتر از یک تکنیک تازه ترید است. آن یک راه جدید دیدن دنیایمان است. تئوری Chaos اولین روشی است که در مدل‌سازی اشکال پیچیده (زنده و غیر زنده) و جریان‌های متلاطم با متدولوژی حسابی موفق بوده است. هندسه فرکتال یکی از ابزارهای علم Chaos است که برای مطالعه پدیده‌هایی است که فقط از نظر هندسه اقلیدسی و



ترجمه کتاب تردینگ کی اس

حساب خطی بی‌نظم است. غیر خطی بودن زمانی مشخص می‌شود که قدرت نتیجه، چندین برابر قدرت علت است. از دنیای نیوتن و اقلیدس حساب خطی شامل آمار ایجاد شده که بصورت منحنی توزیع نرمال تعریف می‌شود. این فهم ما را از طریق دور ریختن اجزائی که ما فکر می‌کنیم غیر ضروری برای سیستم است، آسان می‌کند. کلمه کلیدی غیرضروری است. در دنیای واقعی این غیر ضروری‌های دور ریخته شده مشخصه اساسی این سیستم‌ها هستند.

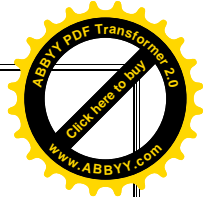
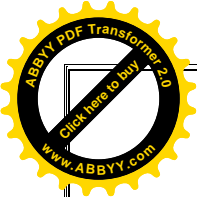
چرا اغلب هندسه بصورت سرد و خشک شرح داده می‌شود. یک علت آن است که قادر به شرح شکل ابر، کوه، خط ساحلی و درخت نیست. طول خط ساحل را با هندسه اقلیدسی نمی‌توان اندازه گرفت. چون طول نامحدودی در یک فضای محدود دارد. برای اندازه‌گیری اجسام طبیعی که بی‌قائده هستند، از فرکتال یا عبارتی بهتر از بعد کسری (Fractional Dimension) استفاده می‌شود. بعد کسری، درجه ناهمواری یا نامنظمی سیستم را نشان می‌دهد. مندلبروت متوجه شد که بعد کسری یک جسم نامنظم با هر درجه‌ای از بزرگنمایی ثابت است. عبارتی نظمی در همه بی‌تظمی‌ها وجود دارد. زمانی که ما به پدیده تصادفی بودن اشاره می‌کنیم، یعنی ما ساختار آن پدیده را نمی‌فهمیم. در زبان مارکت این به این معنی است که یک پترن یکسان بایستی در چارچوب‌های زمانی مختلف تشکیل شود. چارت یک دقیقه حاوی همان پترن فرکتال است که چارت ماهانه دارد. این "Self - Similarity" که در چارت دیده می‌شود، نشان می‌دهد که عمل مارکت خیلی نزدیک به مدل رفتار نچرال است تا رفتار اکونومیک، فاندمنتال، مکانیکال، یا تکنیکال.

مندلبروت همچنین متوجه شد که تشابه نزدیکی بین اعداد فرکتال، رود می‌سی‌سی‌پی و قیمت کتان در تمام طول مدت مطالعه که شامل جنگ‌های جهانی، سیل، خشکسالی و حوادث بد مشابه می‌شد وجود دارد. عمق این مشاهده که نمی‌تواند اغراق باشد. این به این معنی است که مارکت یک فونکسیون غیر خطی نچرال است نه یک فونکسیون خطی فیزیک کلاسیک، و این توضیحی است برای دلیل شکست 90٪ تریدرهائی که از آنالیز تکنیکال برای تردید استفاده می‌کنند. آنالیز تکنیکال نه تنها براساس این فهم اشتباه که آینده مثل گذشته است بنا شده، بلکه از تکنیک خطی غیرمناسب برای آنالیز استفاده می‌کند. مارکت توسط مجموع فعالیت‌های توربولانت ایجاد شده و یک پدیده غیر خطی است. هر تریدر با کمی تجربه یاد می‌گیرد که مارکت نتیجه مکانیکی و ساده عرضه و تقاضا نیست.

فرکتال با استفاده از فرایندی به نام تکرار توسط کامپیوتر تولید شد. بهم پیوستگی یک تکرار غیر سیستماتیک است. اضافه کردن چیزهائی به چیزهای دیگر و این چیز بزرگتر را به چیزهای دیگر اضافه کردن است. ساده‌ترین مدل Iteration (تکرار) مجموع توالی‌ها است که اعداد فیبوناچی گفته می‌شود. توالی با صفر شروع می‌شود و اولین دو ترمی که اضافه می‌شود "یک" و "یک" است. یک را به صفر اضافه کنید جواب یک است. یک دوم را اضافه کنید جواب دو است. از این به بعد دو تا عدد آخر را با هم جمع کنید. دو و سه می‌شود پنج. پنج و سه می‌شود هشت. توالی به همین ترتیب ادامه پیدا می‌کند. خاصیت این تکرار این است که هر عدد دقیقاً ششصد و هجده هزارم، برابر عدد بعدی است. دنیا پر از رابطه‌های ششصد و هجده هزارم، می‌باشد. پترن‌های تخریری گل‌ها اعداد فیبوناچی است. انقباض عضله قلب دقیقاً ششصد و هجده هزارم، برابر مدت استراحت است. یک مثال شخصی ناف انسان است که درست در ششصد و هجده هزارم، طول شخص قرار دارد.

هندسه فرکتال و مارکت

فرکتال همانطوری‌که گفته شد به معنی بُعد کسری است. تصور کنید شما به یک توپ نخی 3 اینچی از فاصله 200 یاردی نگاه می‌کنید. بصورت یک نقطه دیده می‌شود، که بعدی ندارد. وقتی نزدیکتر می‌شوید متوجه می‌شوید که توپ نخی است و سه بعد دارد. وقتی خیلی نزدیک می‌شوید، می‌بینید از یک نخ دراز تشکیل شده که فقط یک بعد دارد. با استفاده از عدسی و نگاه دقیق‌تر می‌بینید که نخ سه بعدی است. بنابراین بسته به دیدتان، صفر بعدی، سه بعدی، یک و سپس سه بعدی می‌بینید. آنچه را که در مارکت می‌بینید کاملاً بستگی به دید یا مدل شما دارد. در حقیقت دید رایج شما مدل شماست. اگر شما دید خطی داشته باشید شما هرگز مارکت واقعی را نمی‌بینید. فرکتال همچنین بی‌تظمی را اندازه می‌گیرد. هرچه مارکت بی‌تظم‌تر و متلاطم‌تر باشد، اعداد فرکتال بزرگتر خواهد بود. اعداد فرکتال قسمتی از حرکت، همیشه در نقطه برگشت حداکثر خواهد بود. بنابراین تمام تغییرات تردید مارکت همراه با اعداد فرکتال بزرگتر از Bars است که منجر به تغییر تردید می‌شود. درخت فرکتال نقطه‌ای را که هندسه فرکتال تغییر را اندازه‌گیری می‌کند، نشان می‌دهد. هر شاخه شدن درخت، هر انحراف در رود، هر تغییر جهت در مارکت یک نقطه تصمیم است. این نظریه، فاکتور قاطع کشف فرکتال موج الیوت است.



فصل چهار

تعریف ساختار زمینه‌ای شما و اینکه این ساختار چطور بر سود و ضرر شما تاثیر می‌گذارد.

تئوری ذن از تغییر وجودی: من تغییر می‌کنم نه با سعی برای چیز دیگر شدن از آنچه که هستم، من تغییر می‌کنم با آگاه شدن کامل از آنچه که من هستم.

هدف:

فهمیدن انرژی مارکت، ساختار ساخت، و دو نوع ساختار زیربنایی همچنانکه گفته شد، chaos براساس پدیده‌های طبیعی است. یکی از یافته‌های مندلبروت این است که بعد کسری (Fractal Dimension) رودخانه شبیه مارکت است. این نشان می‌دهد که مارکت بیشتر فونکسیون از طبیعت است تا اینکه فرایند طراحی شده توسط نیمکره چپ باشد.

اصول مطالعه انرژی مارکت

1. انرژی همیشه مسیری را که کمترین مقاومت را دارد طی می‌کند. مارکت شبیه رودخانه است. همچنانکه از هر دقیقه از تردید عبور می‌کند، کمترین مقاومت را انتخاب می‌کند. در مارکت، شما از تردیدی که در ضرر است زمانی خارج می‌شوید که درد از دست دادن یک دلار بیشتر قویتر از درد گفتن این نکته باشد که شما اشتباه تردید کردید. مسیر با مقاومت کمتر دوباره پیروز است.

2. مسیر با کمترین مقاومت همیشه با ساختار زمینه‌ای و معمولاً ناپیدا تعیین می‌شود. رفتار رود بستگی به ساختار زمینه‌ای بستر رود دارد. اگر بستر رود عمیق و پهن باشد، رود به آرامی پائین می‌آید. اگر بستر رود کم‌عمق و باریک باشد، رود سریع حرکت می‌کند. رفتار رود را می‌توان با بررسی دقیق بستر رود پیش‌بینی کرد. فرض کنید حالا می‌خواهید به حمام بروید. شما احتمالاً از یک یا چند اتاق یا در می‌گذرید. چرا بطور مستقیم از طریق دیوارها عبور نمی‌کنید؟ چون شما یاد گرفتید که در آن صورت آسیب می‌بینید. در طی مسیر به حمام، شما احتمالاً از این مطلب آگاهی ندارید که رفتار شما را آرشیتکتی که مکان اتاق‌ها و درها را طراحی کرده تعیین می‌کند. اتاق‌ها، ساختار زمینه‌ای شما هستند. به همین صورت ساختار زمینه‌ای زندگی شما روش تردیدتان را مشخص می‌کند. صرفنظر از آگاه بودن یا نبودن شما از این ساختار، آن رفتار و واکنش شما را نسبت به حرکت مارکت تعیین می‌کند. (فصل 9).
تریدرهائی که بطور مرتب ضرر می‌دهند، بایستی ساختار زمینه‌ای‌شان را تغییر دهند. اگر شما فقط تغییرات سطحی ایجاد کنید، چیزی واقعاً تغییر نکرده است. تغییرات دائمی فقط زمانی ایجاد می‌شود که ساختار زمینه‌ای تغییر کند. فصل 6 تا 10 ساختار زمینه‌ای مارکت را ارزیابی می‌کند و به شما نشان می‌دهد چطور هر تغییر در این ساختار را تشخیص دهید. فصل 11 و 12 کمک‌تان می‌کند، ساختار شخصی خودتان را بشناسید. زمانی که ساختار شخصی شما با مارکت هم‌تراز باشد، شما در مسیر با کمترین مقاومت قرار دارید و برنده‌اید. بعنوان یک تردیدر همیشه بدانید کی سعی می‌کنید برعلیه مسیر کم مقاومت باشید. تنش بلافاصله در ذهن و بدن‌تان ایجاد می‌شود. اگر شما در باره تردید تنش داشته باشید، نمی‌توانید در مسیر رود شنا کنید. وقتی یاد بگیرید که ساختار زمینه‌ای مارکت را تعیین کنید، با رفتار مارکت آرامش خواهید داشت و بسادگی مثل یک پروانه شناور شوید.

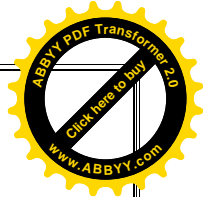
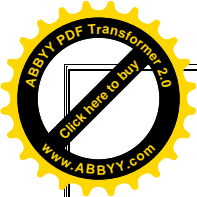
3. این ساختار زمینه‌ای و معمولاً ناپیدای همیشگی را می‌توان کشف و تغییر داد. اکثر تردیدرها سعی می‌کنند مارکت را با استفاده از Bucket Bailing تغییر دهند. این کار غیر ممکن است. با وجود این با رفتن به بالا تا منبع رود، ممکن است با حرکت دادن چند صخره مسیر جریان آب را تغییر داد. گاهی تغییر جزئی در علت سبب تغییرات بزرگ در رفتار می‌شود. شما می‌توانید جریان زندگی و تردیدتان را تغییر دهید. برای اینکه این تغییر بسادگی صورت گیرد و دائمی باشد، شما باید روی ساختار زمینه‌ای‌تان کار کنید، نه رفتاری که از این ساختار نتیجه شده. هر زمان که یک ساختار متفاوت و تازه را برای تردید بکار ببرید، کل نیروی تردید شما مثل جریان رود، جنبش را می‌سازد و کمک می‌کند که نتایج دلخواه‌تان را بدست آورید.
مفاهیم اساسی که از این سه اصول نتیجه می‌شود عبارتند از: شما می‌توانید یاد بگیرید که ساختاری که تردیدتان را پیش می‌برد را تشخیص دهید و تغییر دهید. و آنچه را که واقعاً از مارکت می‌خواهید بدست بیاورید.

ساختار چیست؟

هر ساختار چهار جز دارد:

1. قسمت اصلی
2. طرح
3. منبع قدرت
4. هدف

تمام ساختارها حاوی حرکت و تمایل به سمت حرکت هستند. این، به این معنی است که آنها تمایل دارند تغییر حالت دهند. برخی ساختارها تمایل بیشتری به حرکت دارند. در یک ساختار ایستا اجزا تمایل دارند که از یکدیگر جلوگیری کنند. در یک ساختار کمتر ایستا اجزا تمایل دارند که حرکت آسان‌تر را اجازه می‌دهند. صندلی چرخدار تمایل بیشتری برای حرکت دارد تا



ترجمه کتاب تردینگ کی اس

صندلی راحتی، و صندلی راحتی تمایل بیشتری به حرکت دارد تا نیمکت. یک نیمکت تمایل بیشتری به حرکت دارد تا یک ساختمان. در هر مورد ساختار زمینه‌ای تمایل به حرکت را تعیین می‌کند. این ساختار که معمولاً دیده نمی‌شود در همه جای زندگی ما وجود دارد و بویژه در هر تغییر واکنش ما به تغییر مارکت، قوی عمل می‌کند. فکر کردن به اجزا جداگانه، فهمیدن و سپس ارتباط دادن آنها به هم. "فهمیدن، ساختار است" شناسایی قالب یعنی برقراری ارتباط بین حوادث، ساختار رفتار را تعیین می‌کند. ساختار تعیین می‌کند که هر چیز چگونه رفتار کند. ساختار هر میدان مبارزه رفتار هر تریدر را در مبارزه تعیین می‌کند. ساختاری که بیشترین تأثیر را در نتایج ترید شما دارد، ترکیبی است از خواسته‌ها، باورها، فرضیات، آرزوها، و بیشتر از همه فهم شما از ساختار مارکت و خودتان.

مطالعه ساختار مستقل و کاملاً متفاوت از مطالعه سایکولوژی است. با وجود این یک رابطه قوی وجود دارد. برای بکار بردن درک ساختار و این اصول در ترید دو بینش لازم است:

بینش اول: اکثر ما تمایل داریم که طبیعت را ندیده بگیریم و بطور ساده آنرا بعنوان صحنه‌ای برای فعالیت‌های مهم‌ترمان در نظر بگیریم. تریدرها بر طبق ساختار زمینه‌ای عمل می‌کنند که کل زندگی آنها برآن اساس است. "زمان معلم بزرگی است، اما متأسفانه تمام شاگردانش را می‌کشد".

بینش دوم: برخی ساختارها نتایج بیشتر و متفاوت‌تری ایجاد می‌کنند. ساختار فاقد شخصیت هست. برخی ساختارها منجر به درد می‌شود، صرف‌نظر از اینکه چه کسی در این ساختار است، اکثر تریدرها کوشش می‌کنند که رفتارشان را تغییر دهند بجای اینکه ساختار زندگی‌شان را تغییر دهند. "شما نمی‌توانید ساختار را گول بزنید". برخی ساختارها سرنوشت نهائی را تعیین می‌کنند و برخی دیگر بسادگی نوسان می‌کنند.

ساختار نوع اول

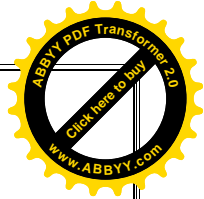
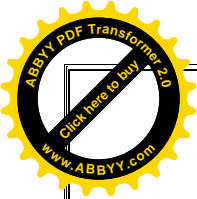
ساختار نوع اول ایجاد رفتار عمل ۱ عکس العمل، عقب و جلو، 8 شکل می‌کند. یک رفتار دلخواه باعث یک رفتار غیر دلخواه متضاد می‌شود. یک مثال ساده پاندول است. اکثر تریدرها در ساختار نوع اول گیر افتاده و ترید می‌کنند. برای مثال فرض کنید در ترید هستید و می‌خواهید محافظه‌کارانه با استاپ کم عمل کنید. به خودتان می‌گوئید که نیاز به یک استاپ کم دارید بنابراین اگر ترید شما اشتباه باشد، خیلی ضرر نمی‌کنید. مارکت رتریس نرمال دارد که استاپ، شما را از ترید خارج می‌کند و سپس در جهت ترید شما حرکت می‌کند. شما ضررتان را آنالیز می‌کنید و به این نتیجه می‌رسید که استاپ شما خیلی نزدیک بوده. شما باید به مارکت منطقه‌ای را برای حرکت در نظر بگیرید، در ترید بعدی استاپ را بطور غیر معمول دورتر از نقطه ورود قرار می‌دهید. مارکت عقب‌نشینی می‌کند و شما ضرر خیلی بزرگی می‌کنید. شما تحمل این ضرر بزرگ را ندارید. دوباره در آنالیزتان تصمیم می‌گیرید که استاپ کم بگذارید.

اکثریت تریدرهای متضرر در این استراتژی عقب و جلو گیر افتاده‌اند. ساختار نوع اول ما را مردد می‌کند و درست مثل پاندول عمل می‌کنیم. هر زمانی که شما نتایج یکسان را بارها و بارها بدست آورید، شما در این ساختار گیر افتاده‌اید. اگر شما سیگار را ترک کردید و هنوز می‌خواهید، اگر نوشیدن را ترک کردید و هنوز می‌خواهید، یا می‌خواهید سود کنید و ضرر می‌کنید، شما در ساختار نوع اول هستید.

ساختار نوع دوم

به نظم ذاتی چیزها توجه کنید. بجای مقابله، با آن کار کنید. سعی برای تغییر آنچه که هست، فقط باعث مقاومت می‌شود. اساس ساختار نوع اول در نیمکره چپ مغز است. ساختار نوع دوم در قسمت خلاق مغز قرار دارد. ساختار نوع اول کوشش می‌کند مسأله (جلوگیری از ضرر) را حل کند. اما ساختار نوع دوم امکانات تازه‌ای را فراهم می‌کند. بجای حل مسأله، نتایج را بوجود می‌آورد. وقتی شما در حل مسأله موفق هستید، به این معنی است که مسأله‌ای ندارید. و هنوز ممکن است به نتیجه دلخواه‌تان (سود کردن بطور مداوم) نرسیده باشید. کلید کار اینجا است. در روش حل مشکل، مسیر با کمترین مقاومت باعث حرکت از بد به بهتر و دوباره به بد است.

بزرگترین و مهمترین مسأله زندگی اساساً غیر قابل حل است. اما فقط فرع هستند مثل گوشت اضافه. اینها را نمی‌شود حل کرد اما در مواجه با یک انگیزه زندگی تازه و قویتر، کم‌رنگتر می‌شوند. ساختار نوع دوم، دنیای دیگری است که همه‌چیز بطور اتوماتیک برای رسیدن به اهداف‌تان کار می‌کند



فصل پنجم

ماهیت مارکت: نیاز برای نقشه خوب
هدف: مطالعه مراحل کلی از مبتدی تا پیشرفته و بکار بردن آنها برای تریدر موفق شدن.

راه سود بردن:
یکی از مشکلات یادگیری ترید این است که توالی منظمی وجود ندارد که تریدر مبتدی را از نادانی به دانش و از ضرر به سود پایدار برساند. برنامه‌هایی که در حال حاضر در دسترس هستند، الفبای ترید را یاد می‌دهند و شامل ایندیکتورها هستند. هیچ‌کدام از اینها تریدرهای پایدار خوب ایجاد نمی‌کند. با وجود این یک برنامه 5 مرحله‌ای از مبتدی تا پیشرفته وجود دارد. برای نواختن پیانو، علائم نت‌ها را یاد می‌گیرید. و برای ترید، خواندن زبان مارکت را یاد می‌گیرید.

سطح مبتدی

هدف: ضرر نکردن در حالیکه تجربه کسب می‌کنید.

ابزار: windows and air bag OHLC,volum, (market faciliation index) MFI, profitunity

در علوم مشخصه این سطح اعداد هستند. در موسیقی نوشتن نت، در کامپیوتر ارقام دوتائی. در فیزیولوژی کلید نیم‌کره چپ مغز است. و بالاخره اینکه هر چیزی در این دنیا مجزا از هم بوده و قابل شمارش و طبقه‌بندی است. در این سطح، زبان مارکت را یاد می‌گیرید. چطور وارد ترید شویم، مارجین چیست و الی‌آخر. ما به مارکت کندل به کندل نگاه می‌کنیم. ما فقط روی دو کندل آخر تمرکز می‌کنیم. دید اول ما فهمیدن رفتار مارکت است. ما یاد می‌گیریم چطور تعیین کنیم که چه کسی مارکت را پیش می‌برد. و یاد می‌گیریم ترند را تشخیص دهیم. اکثر تریدرهای مبتدی بدنیاال سیستم مکانیکی هستند که آنها را ثروتمند کند. اگر شما بفهمید که واقعاً مارکت چگونه کار می‌کند، می‌فهمید که مارکت برای تخریب هر سیستم مکانیکال موفق کار می‌کند. تمام سیستم‌های مکانیکی می‌میرند. آنها ابزارهای خطی هستند و نمی‌توانند بطور دقیق و کافی مارکت غیر خطی را شرح دهند. نقشه‌ای که مبتدی‌ها استفاده می‌کنند عموماً قیمت‌ها را مقایسه می‌کند. و چون قیمت اثر است نه علت، پس این ابزار محکوم به شکست است. برای مدتی سیگنال خوب ایجاد می‌کنند، اما سود دهی پایدار ندارند. اینها ابزارهای خطی هستند و نمی‌توانند بطور دقیق مارکت غیر خطی را توصیف کنند. اکثر مبتدی‌ها مقدار زیادی انرژی صرف می‌کنند و متعاقب این شادی معمولاً افسردگی است.

ترید واقعاً یک شغل حقه‌بازی است نسبت به آنچه که پیش‌بینی می‌کردم. هر زمان که یک قدم جلو می‌گذارید، به نظر می‌رسد آن یک قدم عقب می‌گذارد. به همین علت اکثر تریدرهای مبتدی، ترید را ترک می‌کنند. همچنانکه شما مطالعه میکروسکوپی (دیدن فقط دو کندل مجاور) رفتار مارکت را ادامه می‌دهید، به این واقعیت می‌رسید که مارکت چگونه کار می‌کند. و به این نتیجه می‌رسید که مارکت محصول طبیعت است نه اکونومی، فاندمنتال، و یا تکنیکال. مثل مهارت در دوچرخه‌سواری است تا بقدر کافی زمین نخورید، اصول بالانس داخلی را یاد نمی‌گیرید. در سطح مبتدی شما بالانس مارکت را یاد می‌گیرید.

سطح دو: مبتدی پیشرفته

هدف: بدست آوردن پول بطور مداوم براساس یک قرارداد.

موج الیوت و فرکتال

در مارکت مثال‌های نقشه‌های سطح 2، فرکتال و موج الیوت است. از مقایسه دو کندل مجاور هم به دید وسیع‌تر 140 کندل یا بیشتر رسیدیم.

در این نقطه تمام تریدرها به یک وضع بغرنج می‌رسند. آیا انگیزه ترید بقدر کافی قوی است تا بر ناامیدی موقتی تجربیات یادگیری مارکت غلبه کند؟ درست مثل جاذبه که باعث افتادنتان از دوچرخه شده و کمک می‌کند بالانس را یاد بگیرید، با ضرر در مارکت در باره خودتان و نقطه بالانس مارکت یاد می‌گیرید.

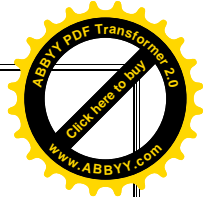
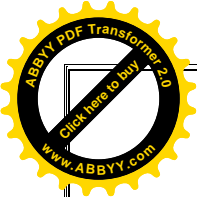
فرکتال و موج الیوت ساختار زمینه‌ای مارکت را نشان می‌دهند. موج الیوت کتاب راهنمای حرکت رو به بالا و پائین مارکت است. ترید مثل شروع ساختن یک چیز تازه است. اولین چیزی که شما می‌خواهید تولید یک محصول با کیفیت است. اگر شما تولید را افزایش دهید قبل از اینکه کیفیت داشته باشید، مشتری‌های خود را از دست می‌دهید. زمان افزایش تولید فقط بعد از داشتن کیفیت است. در مارکت کیفیت سود کردن بطور مداوم براساس یک روش است. مبتدی‌های پیشرفته به این سوددهی رسیدند. حرکت بعدی به سطح بالاتر رسیدن است، جایی که براساس چند اصول ترید می‌کنند. و مهارت‌های یادگرفته شده در سطح 1 و 2 اتوماتیک می‌شود. در این سطح، تریدر به افزایش سود از طریق سرمایه‌گذاری (ROI) تمرکز می‌کند بجای سود بردن به ازای هر معامله.

سطح 3: تریدر شایسته

هدف: به حداکثر رساندن ROI کل توسط ترید با سرمایه متعدد، Spread، و نوشتن فرصت‌ها

ابزار: Trading Profitunity Trading Partner And Profitunity Planned

در این سطح دانشجوی پیانو دقیقاً نت نوشته شده را می‌زنند. در ترید ماهر شدن به معنی افزایش ROI کل است. شما متن مارکت را دقیقاً می‌خوانید. وقتی مارکت می‌گوید خرید، خرید می‌کنید؛ وقتی فروش گفت، فروش می‌کنید؛ و وقتی گفت ترید نکن، نمی‌کنید. شما بخور نمیر زندگی می‌کنید. به عبارتی شما از ابزاری که برایتان سود ایجاد می‌کند استفاده نمی‌کنید. سطح سه دنیای دیگری را به روی شما باز می‌کند. مشخصه این در تاریخ، انقلاب صنعتی است، وقتی که فرصت‌های شغلی



ترجمه کتاب تردینگ کی اس

جدیدی بخاطر درک جدیدی از تولید و اکونومی باز شد. در ریاضیات این سطح با جبر که حل مسائل با مقادیر نامعلوم را امکان پذیر می‌سازد، مشخص می‌شود. این ابتدای شروع فهم Chaos است. سطح سه آنچه را که اکثر مردم "علت" می‌نامند بجای اثر، مونیتور می‌کند.

ابزار تردید در این سطح شامل طرح تردید سودده که حداکثر انعطاف و سود را با بررسی ساختار زمینه‌ای و ناپیدای مارکت بدست می‌دهد، می‌باشد. در این سطح وارد ریتم شده و رقص را شروع می‌کنید با آهنگی که مارکت بطور رایج می‌نوازد. همچنین این امکان را می‌دهد که بفهمیم آیا آنالیز اشتباه یا دور از دسترس است. اگر اشتباه است، استراتژی مناسب توقف و برگشت است. اگر دور از دسترس است، بهترین استراتژی خارج شدن است.

هدف تردید طرح‌ریزی شده بر سود، به حداکثر رساندن سود برای یک حرکت ویژه و اجازه دادن به مارکت (بجای سیستم قراردادی) برای تعیین استراتژی مناسب می‌باشد.

ابزار اولیه دیگر در این سطح Profitunity Trading Partner است. هدف از این ابزار در نظر گرفتن اولویت‌ها و اضافه کردن مناسب‌ترین اندازه‌گیری‌ها برای محافظت از معامله تردید است. مهارت در استفاده از این ابزار امکان آنالیز کامل را در هر چارت امکان‌پذیر می‌سازد و در 10 ثانیه یا کمتر می‌دانید در هر کندل چه باید بکنید: خرید، فروش، اضافه کنید، توقف، و برگشت یا خارج شوید. در سطح سه، شما یاد می‌گیرید قادر شوید ارزیابی درست و فوری از هر مارکت داشته باشید.

ساعات زیادی برای آنالیز مارکت صرف نمی‌کنید. در این سطح همیشه از ساختار زمینه‌ای مارکت آگاهی دارید. علت فروش کاست‌های موسیقی و ایجاد سود این است که خواننده دقیقاً آنچه را که نوشته شده نمی‌خواند، او احساسش را اضافه می‌کند. بزرگترین جهش در کل پنج مرحله پیشرفت از مبتدی تا پیشرفته بین سطح سه و چهار است. در سطح چهار درک مستقیم یادگرفته شده و با احساس باطنی در باره مارکت دارید که معمولاً خیلی دقیق است. شما ساختار خودتان را دستکاری می‌کنید تا با ساختار مارکت هماهنگ باشد. در سطح چهار سود کردن، مسیر با حداقل مقاومت می‌شود.

سطح چهار: تردید ماهر

هدف: تردید با سیستم اعتقادی خودتان

ابزار: نیمکره چپ، مرکز (Core)، نیمکره راست (سیم‌کشی مغز)

در این سطح موسیقیدان قادر به ارتباط احساس با زبان موسیقی است. احساس از طریق انگشتان نوازنده به کلیدهای پیانو، که امواج صدا را ایجاد می‌کند ترجمه می‌شود و هیجانات شنونده را برمی‌انگیزد. در تردید، شما سیستم اعتقادی خودتان را تردید می‌کنید (ساختار شما با ساختار مارکت در یک ردیف قرار می‌گیرد) و لذت شما نه تنها از سود، بلکه از رضایت احساسی شما از همگام بودن با مارکت ایجاد می‌شود. در این سطح به این واقعیت می‌رسید که هیچ‌کس مارکت را تردید نمی‌کند و هرکس سیستم اعتقادی فردی خود را تردید می‌کند. در این سطح یاد می‌گیریم و کار می‌کنیم با بدن شخصی و ساختار مغزی خودمان.

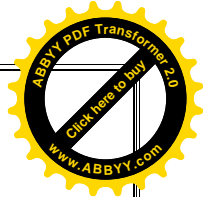
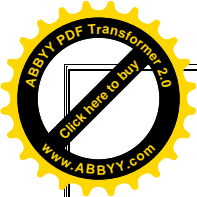
سطح پنج: تردید کارشناس

هدف: تردید کردن حالات ذهنی

ابزار: حالات متفاوت ذهنتان (نرم‌افزار بیولوژیکی)

در این نقطه ما به این درک میرسیم که تا حالا فقط در رویا بودیم. در سطح پنج، هر چیزی اساساً اطلاعات است. و هدف ما در هماهنگی با این اطلاعات پیدا کردن اینکه ما کیستیم، می‌باشد. در این سطح تردید "بازی" است، هر چیزی مهم و تعلیم دهنده است. ما خودمان و مارکت را می‌فهمیم و این فهم باعث کنترل بیشتری از هردو می‌شود. در سطح پنج، ما عمیقاً وارد دنیای Chaos می‌شویم. در ورزش Zone نامیده می‌شود. Chaos درجه بالائی از نظم است، اتفاقی بودن وجود ندارد. آنچه که ما در سطح یک تا سه اتفاقی بودن می‌نامیم، ناشی از عدم آگاهی و فهم ماست. برای دسترسی سریع به هر سطح، به طریق زیر جدول‌بندی می‌شود.





ترجمه کتاب تردینگ کی اس

Level	Objective	Tools
1. Novice	To not lose money while gaining experience	OHLC, volume, MFI, Profitunity windows and air bag
2. Advanced beginner	To make money consistently on a one-contract basis	Elliott wave and fractals
3. Competent	To maximize the total ROI	Profitunity Trading Partner and Profitunity Planned Trading
4. Proficient	To trade your own belief systems	Left hemisphere, core, right hemisphere (brain wiring)
5. Expert	To trade your states of mind	Your own various states of mind (biological software)

فصل ششم

سطح یک: تردیر مبتدی
راه طبیعت ساده و آسان است، اما انسان ترجیح می‌دهد پیچیده و مصنوعی کند. «Tzu Lao»

هدف: شروع خواندن خود مارکت، بجای خواندن نظر مردم در باره مارکت در این فصل، ما به فاندamental نگاه می‌کنیم که برای شروع فهم مارکت و تردیر ضروری است. بهترین راه اینست که هر نکته و هر تصمیم را بعنوان تجربه یادگیری در نظر بگیریم. همچنانکه گفته شد، هیجان زیادی در شروع ماجرای تازه وجود دارد. ما انرژی را یا (Germination Energy) می‌نامیم. ماجرای مارکت شما متفاوت از دیگران خواهد بود. من در سمینارهایم می‌گویم که تردیر کردن عادی‌ترین سایکوتراپی در دنیا است. تردیر کالا نه تنها پول به حساب‌تان می‌آورد، بلکه هیجان، سرگرمی، و درک را به زندگی‌تان می‌آورد.

تریدرهای مبتدی وقتی وارد پوزیشن می‌شوند بطور تیبیک اطلاعات بیشتری از آنچه که در دسترس دارند، می‌خواهند. اگر شما تمام اندیکتورها و اطلاعات دنیا را در اختیار داشته باشید، بطور مطلق 100 درصد دمدمی (Ambivalent) هستید. خصوصیات مارکت بطور برابر تقسیم می‌شود بین فشار خرید و فشار فروش. بنابراین اطلاعات بیشتر پاسخ نیست. پاسخ اطلاعات درست بشکل صحیح است.

در این فصل شما یاد خواهید گرفت چه کسی این نمایش را که مارکت نامیده می‌شود پیش می‌برد. چه کسانی سود می‌برند و مهمتر اینکه آنها چه می‌کنند. همچنین یاد خواهید گرفت که چطور تعیین کنید، راهی را که مارکت می‌رود. اولین چیزی که ما باید دور بریزیم برای تردیر سودده، این عقیده است که ما می‌توانیم بر مارکت تأثیر بگذاریم. تنها انتخاب ما دنبال کردن است و ما می‌خواهیم مطمئن شویم که پیش‌برنده‌های مارکت را دنبال می‌کنیم. وقتی من می‌گویم شما یاد خواهید گرفت چه کسی مارکت را پیش می‌برد، به تردیرهایی اشاره دارم که بزرگترین معامله را دارند. دانستن نام آنها مهم نیست، اما دانستن اینکه آنها چه کار می‌کنند، خرید و فروش در حجم‌های زیاد اهمیت زیادی دارد و فهمیدن انتخاب‌ها و عملکردشان، آنطور که اکثر تردیرها فکر می‌کنند مشکل نیست.

اجازه بدهید با واحد اصلی تردیر شروع کنیم، یک کندل در چارت. اطلاعاتی که مارکت به ما می‌دهد، OHLC، حجم معاملات، و زمان است. کلید فهمیدن رابطه بین قیمت باز و بسته شدن در مقایسه با قیمت H و L است.

Open قیمت باز شدن به ما می‌گوید نقطه بالانس بین خرید ارها و فروشنده‌ها در نقطه باز شدن پررود است علی‌رغم تایم فریم مورد استفاده.



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

High به ما می‌گوید بالاترین نقطه‌ای که Bull قیمت را بالا می‌برد. Bull می‌خواهد که قیمت بالاتر از قله کندل حرکت کند و سود بیشتری را ایجاد کند. همیشه نقطه مقابل بالانس وجود دارد که Bull از جریان خارج می‌شود و یا Bear آنقدر قوی می‌شود که پیشرفت را متوقف می‌کند. این خواسته فروشنده‌ها است چون با هر تیک افزایش مارکت ضرر می‌کنند.

LOW به ما می‌گوید قیمت دقیقی که فروشنده‌ها خارج می‌شوند و خریداران حرکت رو به پائین را پس می‌گیرند.

Close به ما می‌گوید تمام نقاط بالانس اساسی در انتهای پیروید کجا قرار دارد. اگر تایم فریم درازمدت باشد (روز، هفته، ماه)، قیمت بسته شدن همچنین به ما می‌گوید جایی که جمعیت تریدکننده‌ها به بالانس می‌رسند و قیمت را ترک می‌کنند.

چهار قیمت فوق به ما اطلاعات حیاتی زیادی می‌دهند، اما مهمتر حرکت نقطه بالانس است. من پی بردم که راحت‌ترین، ساده‌ترین، و پرسودترین روش تقسیم کندل به سه قسمت مساوی است. سپس ما یک روش ساده می‌خواهیم تا آنچه را که در یک پیروید زمانی مشخص اتفاق می‌افتد، تعیین کند. بطور قراردادی عدد اول برای قیمت باز شدن و عدد دوم برای قیمت بسته شدن در نظر می‌گیریم. این اعداد بسته به اینکه قیمت باز و بسته شدن در کدام قسمت از کندل اتفاق می‌افتد، تعیین می‌شود. برای مثال اگر قیمت باز شدن و بسته شدن در یک سوم فوقانی کندل باشد، کندل 1 - 3 گفته می‌شود. اگر هردو در یک سوم تحتانی باشد، کندل 3 - 3 گفته می‌شود. هرچا شما 1 - 1 یا 3 - 3 دیدید، در 85% موارد جهت مارکت در 1 تا 5 کندل بعدی عوض خواهد شد. این دانش به تنهایی نتیجه تریدتان را می‌تواند تغییر دهد. این بینهایت برای ترید اینترادای (Intraday) مفید است.

از نظر سایکولوژی دو کندل 1 - 1 و 3 - 3 رفتار نوع (نزدیک شدن - دور شدن) است. آنها باز می‌شوند، در یک جهت حرکت می‌کنند و دوباره به نزدیکی جایی که شروع کرده بود برمی‌گردند. نتیجه حرکت کمتر جهت‌دار است. همچنین اطلاعات ارزش تری را می‌توان از این کندل بدست آورد. دقیقاً می‌گوید چه کسی سود می‌برد و در طی قسمت‌های مختلف این پیروید زمانی چکار می‌کنند. برای مثال در کندل 1 - 1 در قسمت اول فروشنده‌ها در سود هستند و در طی قسمت بعدی خریدارها در سود هستند. ما همچنین می‌دانیم که در انتهای پیروید چه کسی سود می‌کند. خریدارها سود می‌کنند. چرا؟ چون کندل در یک سوم انتهایی بسته شد. برعکس اینها برای کندل 3 - 3 صحیح است.

کندل 2 - 2 برخلاف کندل‌های قبلی به ما نمی‌گوید چه کسی در زمان بسته شدن کندل در سود است. این کندل اطلاعات کمی می‌دهد و ما آن را خنثی می‌نامیم. که اصطلاحاً Spinning Top یا دوجی نامیده می‌شود. این کندل نشان می‌دهد که نه خریدارها و نه فروشنده‌ها در این پیروید کنترل ندارند.

کندل صعودی بصورت 1 - 3، 1 - 2 و 2 - 3 دیده می‌شود. شکل 5 - 6. کندل 1 - 3 بیشترین اطلاعات را به ما می‌دهد. آن به ما می‌گوید که خریدارها در کل پیروید کنترل دارند. و این می‌تواند روز ترنددار باشد. کندل 2 - 3 حداقل اطلاعات را می‌دهد. خریدارها توانستند قیمت را بیشتر از باز شدن ببندند، اما فروشنده‌ها قیمت را به زیر قیمت حداکثر رساندند. و ما نمی‌توانیم مطمئن باشیم در پایان پیروید چه کسی سود برده است.

کندل نزولی بصورت 2 - 1، 3 - 2 و 3 - 1 دیده می‌شود. شکل 6 - 6. بیشترین اطلاعات را کندل 3 - 1 می‌دهد که فروشنده‌ها در سراسر پیروید در سود هستند. کندل 2 - 3 اطلاعات کمتری می‌دهد و فروشنده‌ها در سود هستند. کندل 1 - 2 حداقل اطلاعات را می‌دهد و ما نمی‌دانیم در پایان پیروید خریدارها یا فروشنده‌ها در سود هستند.

نقطه مهمی که از این بررسی‌ها درک می‌شود این است که هر کندل بطور واضح عکس‌العمل خریدارها و فروشنده‌ها را که باعث حرکت نقطه بالانس در طی پیروید می‌شود نشان می‌دهد.

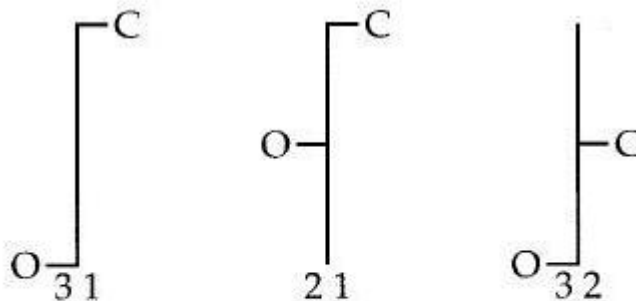


Figure 6-5 Climbers: 3-1, 2-1, and 3-2.

حرکت درازمدت

ما نیاز به اطلاعات ثانوی داریم تا ارزیابی ما را از عمل مارکت محدود بکنند: ترند فوری کدام است؟ از فوری منظور من مقایسه کندل قبلی در همان پیروید است. برای مثال در پیروید پنج دقیقه، ما در کل ده دقیقه صحبت می‌کنیم. اگر نقطه وسط کندل فعلی بالای قله کندل قبلی باشد، ترند صعودی است و با علامت مثبت (+) نشان می‌دهیم. اگر نقطه وسط داخل کندل قبلی باشد، "0" نشان می‌دهیم و همپوشانی می‌نامیم بدون ترند واضح. و اگر نقطه وسط زیر کندل قبلی باشد، ما با (-) نشان

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

داده و نماینده ترند نزولی است. شکل 7 - 6. حالا ما می‌دانیم چه کسانی سود می‌کنند و چکار می‌کنند. و حالا با دانستن اینکه ترند فوری چی است، ترند طولانی‌تر را بفهمیم.

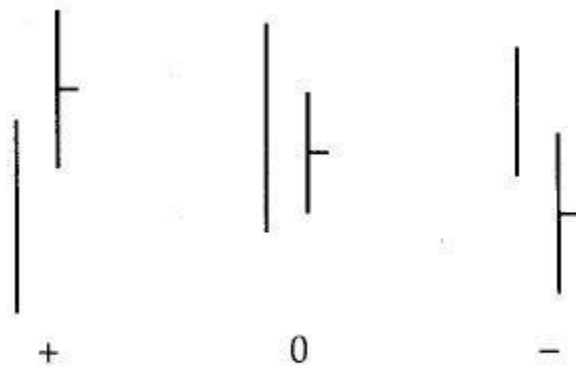


Figure 6-7 Determining the immediate trend.

ترند ایده‌آل آن است که در ابتدای شروع ترند صعودی خرید کنید. برای این منظور لازم است به چگونگی تشکیل ترند نگاه کنیم، در واقعیت ترند در خارج از فلور (Floor) تشکیل می‌شود بجای اینکه مثل گذشته در فلور تشکیل شود. کلید حجم است. تنها اطلاعات ما از مارکت Tick Volum، زمان، و قیمت است. حجم تیک، تعداد دفعات تغییر قیمت در یک پیروید مشخص است. آن تعداد سرمایه‌ای که ترید می‌شود نیست. مطالعات نشان داده که تفاوت عمده‌ای بین رابطه حجم واقعی و حجم تیک وجود ندارد. ما از حجم تیک استفاده می‌کنیم و می‌توانیم فرض کنیم که آن نماینده حجم واقعی است.

در این مبارزه دو ویژگی اساسی وجود دارد: بروکرهای فلور و لوکال. بروکرهای فلور کسانی هستند که سفارشات را می‌پذیرند. آنها حقوق، کمیسیون و یا ترکیبی از این دو را می‌گیرند، که عموماً آنها پول خود را وارد مارکت نکردند.

بروکرهای لوکال با پول خودشان ترید می‌کند. اگر آنها قیمت خوب بدست نیاورند، پول خود را از دست می‌دهند. بنابراین بروکرهای لوکال باید تریدر بهتری از فلور باشند. لوکال‌ها باید خودشان تصمیم بگیرند ولی فلورها تصمیمات دیگران را دنبال می‌کنند. کار لوکال‌ها ساختن مارکت با گرفتن طرف دیگر ترید است. آنها معمولاً با پوزیشن‌های درازمدت میانه‌ای ندارند. ما در آموزش خصوصی خودمان چندین لوکال داریم که برای بعضی از آنها 10 دقیقه درازمدت است. بخاطر داشته باشید که ترند در نتیجه عمل فلورها است تا لوکال‌ها. چون وظیفه اصلی لوکال‌ها گرفتن سمت دیگر بیرون آردها است، آنها هیچ Future در ترید با یکدیگر ندارند. آنها بعد از پول شما هستند. دوباره کلید ما به فهم عمل در مبارزه (Pit) حجم تیک است. لوکال‌ها مقادیر مهمی از ترید را با دیگر لوکال‌ها ندارند و ترند با Outside Paper تشکیل می‌شود. بنابراین ما باید بدانیم که کی و به چه مقدار Outside Paper به فلور می‌آید. این توسط تغییر در حجم تیک مشخص می‌شود. اگر حجم کندل فعلی بیشتر از کندل قبلی باشد، یعنی اوردرهای بیشتری از بیرون به فلور آمده. قبل از اینکه ترند شروع شود، باید حجم زیادی به فلور بیاید. همیشه افزایش در حجم مقدم بر افزایش در مومنتوم، و تغییر مومنتوم قبل از تغییر ترند است. قبل از اینکه هر کدام از اینها شروع شود، صدها یا حتی هزاران تصمیم باید توسط تریدرهای بیرون گرفته شود، کسانی که فکرشان را درباره مارکت تغییر می‌دهند. اولین تغییرات، تصمیم‌هایی هستند که در ذهن تریدرهای خارج از فلور است. سپس تصمیم آنها در تغییر در حجم تیک منعکس می‌شود. بعد از آن تغییر در مومنتوم و نهایتاً ترند ایجاد می‌شود. هدف ما گرفتن در اولین 10% هر تغییر در ترند، و خارج شدن در 10% آخر ترند است. اگر شما بتوانید اینکار را بکنید شما ثروتمند می‌شوید. دوباره برای تأکید، اولین کلید تغییر در حجم تیک است.

قانون پرکتیکال در ترید داخل روز به این صورت است: تفاوت یک تیک کافی است. اگر ما با چارت روزانه ترید می‌کنیم، + 10 - درصد تفاوت مهمی در حجم است. در چارت روزانه، ما باید 110% حجم روز قبل را (+)، حجم 90% یا کمتر (-) و بین 91 و 109% را حجم برابر در نظر بگیریم. تنها زمانی که مارکت صحبت می‌کند عبارت است از تیک، حجم، و زمان.

ایندکس تسهیل کننده مارکت زمانی که حجم تیک بالا رفت ما Paper Outside بیشتری داریم و زمانی که پائین می‌آید، ما می‌دانیم که Paper Outside کمتر که فلور می‌آید. هدف ما ارزیابی دقیق اثرات این تغییر در حجم بر مارکت است. دانستن اینکه چقدر تغییر کرده کافی نیست، بلکه بیشتر مهم است که بدانیم چطور مارکت به تغییرات حجم واکنش می‌دهد. حجم سنگین‌تر همیشه به این معنی نیست که مارکت حرکت خواهد کرد. وظیفه اصلی مارکت یافتن نقطه بالانس است. نقطه بالانس تنها زمانی حرکت خواهد کرد که در آردهای آمده تمایل به یکطرف (Bias) وجود داشته باشد. بنابراین ما به یک پیداکنده نیاز داریم. پیداکنده‌های بیاز هم در مارکت ترنددار و هم در رنج کار می‌کنند. سود کردن در ترند نسبتاً ساده است. مسأله نگاه داشتن سود در زمان رنج است. در زمان رنج ترید مثل گیر کردن در گل است. و در زمان ترند، مثل راندن در شنزار. بنابراین ما از این اندیکتور بنام فاکتور گل یاد می‌کنیم؛ هرچه گل بیشتر باشد مارکت آهسته‌تر حرکت خواهد کرد. سپس Tic Mileage نامیدیم، چون ما تغییر قیمت

ترجمه کتاب تردینگ کی اس

به ازای هر تیک را اندازه می‌گیریم. و بالاخره بنام ایندکس تسهیل‌کننده مارکت (MFI) نامیدیم. در حال حاضر این ایندکس استفاده جهانی دارد و بعنوان اندیکاتور استاندارد در چندین سیستم آنالیز تکنیکال استفاده می‌شود.

این ایندکس خیلی ساده است. عکس اول از سمت راست.

با شکستن فرمول بصورت زیر می‌توانید ببینید که MFI اندازه‌گیری تغییر قیمت به ازای هر تیک است. عکس دوم از سمت راست.

با مقایسه این فرمول با فرمول انیشتین $E=mc^2$ می‌توانیم ثابت c^2 را حساب کنیم؛ عکس سوم از سمت راست. در ترد جرم برابر است با حجم، انرژی برابر است با حرکت قیمت. آیا انیشتین موافق است؟ من نظری ندارم، اما بکار بردن آن در ترد طنز آمیز است.

ما تغییرات مؤثر را در قیمت به ازای هر تیک می‌سنجیم. این اعداد هیچ ارزش مطلق ندارند. ارزش آنها در مقایسه این اعداد با MFI قبلی است. برای مثال اگر MFI کندل جاری 0.541 باشد، قابل مقایسه با کندل چارت دیروز با همان ارزش نیست. ما MFI را در رابطه با عمل بلافاصله قبلی مارکت در نظر می‌گیریم. ما می‌خواهیم بدانیم که آیا تسهیل حرکت قیمت مارکت کمتر یا بیشتر است. MFI تمایل بازار را به حرکت قیمت اندازه می‌گیرد. من نمی‌توانم بر ارزش این اندیکاتور تأکید بیشتری بکنم. نسبت به استوکاستیک، RSI یا هر اندیکاتور مومنتوم دیگر عمل مارکت را صحیح‌تر اندازه می‌گیرد.

اندازه‌گیری MFI از اینکه مارکت به ازای هر تیک چه مقدار حرکت می‌کند، توصیف بی‌نهایت دقیقی از کارایی مارکت در طی این کندل بخصوص دارد. اگر MFI جاری بزرگتر از قبلی باشد، حرکت قیمت به ازای هر تیک بیشتر است و تسهیل حرکت قیمت در طی زمان بزرگتر است. ما فقط MFI کندل جاری را با کندل قبلی مقایسه می‌کنیم. این به ما این اجازه را می‌دهد که تعیین کنیم این پررود زمانی فرصت ترد کمتر یا بیشتر را فراهم می‌کند.

مزیت بزرگ روش سودده این است که هیچ چیز ایده‌آل نیست. MFI بطور مداوم بر یک مبنای نسبی در ولایتی جاری مارکت تغییر می‌کند. بنابراین همچنانکه شخصیت مارکت در طول زمان تغییر می‌کند، MFI و وابستگی‌های مختلف آن هم تغییر می‌کند.

اجازه بدهید آنچه را که یاد گرفتیم جمع‌بندی بکنیم:

1. چه کسی مارکت را پیش می‌برد (خریدارها یا فروشنده‌ها)
 2. مارکت به چه سمتی حرکت می‌کند.
 3. مارکت برای تسهیل حرکت قیمت در طی زمان (MFI) چه کار می‌کند.
- تمام این اطلاعات با یک ثابتی با یکدیگر در تداخل هستند. و حالات مختلف مارکت و فرصت‌های مختلف ترد را نشان می‌دهند. سپس ما می‌توانیم فاکتورهای بالا را برای افزایش قدرت فهم و آنالیز ما از عمل مارکت با هم ترکیب کنیم.

ترکیب MFI با حجم

تغییر حجم ما را قبل از شروع ترند آگاه می‌کند، و MFI نشان می‌دهد که مارکت چگونه به این افزایش یا کاهش حجم واکنش نشان می‌دهد. با ترکیب این دو فاکتور باهم، ما می‌توانیم تصویر واضح و دقیقی از عمل مارکت بدست بیاوریم. ما از حجم دوبار استفاده خواهیم کرد، اما به دو روش:

1. ما از حجم خام که با حجم تیک مشخص می‌شود استفاده می‌کنیم.
2. ما از حجم در محاسبه MFI استفاده می‌کنیم.

دریچه‌ای برای سود

دریچه‌ای برای سود بیشتر از فقط یک فرصت است. با ترکیب دو فاکتور حجم و MFI در کل چهار امکان ترکیب، امکان موفقیت شما خیلی بهتر می‌شود و ما آن را سود بردن می‌نامیم بجای فرصت. من اندیکاتوری را برای هر یک از ترکیب‌ها طراحی کردم که دقیقاً آنچه را که در مارکت Broad اتفاق می‌افتد و واکنش‌ها در Pit را شرح می‌دهد. ما یک به یک به آنها نگاه می‌کنیم. عکس چهارم از سمت راست.

$$MFI = \frac{\text{Range (High - Low)}}{\text{Volume}}$$

$$\frac{\text{Range}}{\text{Volume}} = \frac{\Delta \text{ Price}}{\text{Tick}}$$

$$c^2 = \frac{E}{m} = \frac{\text{Range}}{\text{Volume}}$$

Tick Volume/MFI Combinations	Indicator
1. + Tick volume and + MFI	Green (+ +)
2. - Tick volume and - MFI	Fade (- -)
3. - Tick volume and + MFI	Fake (- +)
4. + Tick volume and - MFI	Squat (+ -)

سبز (افزایش حجم تیک و افزایش MFI)

ما این کندل را سبز می‌نامیم، چون چراغ سبزی برای حرکت مارکت است. حرکت قبلاً اتفاق افتاده است. تصور کنید شما در ساحل شرقی هستید و بدنبال کشتی هستید که بطرف غرب می‌رود. دو راه متفاوت برای پیدا کردن کشتی مناسب دارید. اول، شما بدنبال کشتی‌هایی هستید که مسیرش به سمت غرب است، با این فرض مسلم که آن بالاخره به سمت غرب خواهد رفت. وقتی شما یکی را یافید، در ماشین زیبا و راحتان می‌نشینید و منتظر رفتن می‌شوید. انتخاب دوم شما ممکن است این باشد که در انتهای غرب محوطه بایستید و بداخل اولین کشتی که از محوطه خارج می‌شود بپرید. انتخاب دوم می‌تواند "سبز" باشد. کشتی قبلاً شروع به حرکت کرده است. سبز ممکن است خطرناک باشد. شما مطمئناً نمی‌خواهید در مقابل آن بایستید، که دقیقاً مثل آن است که مخالف جهت کندل سبز ترید کنید.

سبز سیگنال Breakout است و بهترین استراتژی فوری شما رفتن با جهتی که مارکت می‌رود است. سبز سه چیز را مشخص می‌سازد:

1. تریدرهای (Players) زیادی وارد مارکت شده‌اند (افزایش حجم)
2. رسیدن تریدرها در سمت حرکت مارکت Biased هستند
3. (افزایش MFI) The price movement is picking up speed as it goes

Fade (کاهش حجم تیک و کاهش MFI)

زمانی دیده می‌شود که مارکت نفس می‌کشد یا علاقه‌اش را از دست می‌دهد. محو متضاد سبز است؛ هر دو حجم و MFI (حرکت قیمت) کم است. مارکت فیوچر یک مارکت مزایده است، و کسانی که پیشنهاد می‌دهند علاقه‌شان را از دست می‌دهند. اگر من این کامپیوتر را به مزایده بگذارم، اکثر مردم بلافاصله \$100 پیشنهاد می‌دهند. با این نوع جواب، من قیمت را بالا می‌برم. بطور قابل توجهی تعداد کمتری \$1000 پیشنهاد می‌دهند، و من مطمئن هستم هیچ کس \$5000 نمی‌دهد. همچنانکه قیمت بالا و بالاتر می‌رود، شرکت کنندگان بیشتر و بیشتری علاقه خود را از دست می‌دهند. اغلب قله اولین موج در موج الیوت، قله موج (Fade) دارد؛ عمل‌ها زیاد نیست، و شور مارکت کم کم تحلیل می‌رود. خیلی مهم است که مناطق محورا مشخص کنیم، چون شروع حرکت بزرگ هستند. بنابراین در اکثر مواقع که مارکت بیشترین Boring (لانه کردن) را دارد، دقیقاً زمانی است که تریدرهای خوب گوش بزرگ هر علامتی از ایجاد مومنتوم هستند.

Fake (کاهش حجم تیک و افزایش MFI)

ما وضعیتی داریم که MFI افزایش می‌یابد، به این معنی که مارکت خودش را با حرکت قیمت در طی زمان تسهیل می‌کند اما توسط افزایش حجم از خارج از Pit حمایت نمی‌شود. بنابراین تسهیل کمتر قوی است، که با کاهش حجم خام مشخص می‌شود. به هر دلیل مارکت حجم کمتری را نسبت به کندل قبلی کسب کند. Fake گاهی یک مکث، در عمل مارکت قبل از Takeoff مارکت هست. تا اینکه این وضعیت بلافاصله با افزایش حجم دنبال شود. Fake ممکن است احتمالاً توسط لوکال‌ها دستکاری شود. لوکال‌ها کنترل موقتی دارند. چون حجم عمده‌ای از Outside Paper به داخل Pit نمی‌آید. Fake علامتی از دستکاری Pit است و بایستی با درجه بالایی از شک بررسی شود. لوکال‌ها حس می‌کنند که حرکت در طی سکون در عمل Pit ختمی است. این تنها زمانی است که لوکال‌ها قدرت کافی برای زدن استاپ شما دارند. آنها اگر ممکن باشند مارکت را در خلاف جهت حرکت مورد انتظار می‌گیرند برای بدست آوردن موجودی و گرفتن سمت دیگر اوردرهایی که پیش‌بینی می‌شود به Pit بیاید. آنها موجودی خود را می‌سازند و بنابراین می‌توانند در رالی بعدی بفروشند یا در نزول بعدی خرید کنند.

Squat (افزایش حجم تیک و کاهش MFI)

"Squat" قویترین پتانسیل ساختن پول از چهار پنجره سودده هستند. حقیقتاً تمام حرکت‌ها با Squat بعنوان کندل Low & High بعلاوه یا منهای یک کندل در همان پرپود پایان می‌یابد. عبارتی تمام ترندهای مهم با یک Squat در یکی از سه کندل قله یا ته پایان می‌یابد. این آنالیز یک روش بالقوه مؤثر را برای گرفتن شروع ترند فراهم می‌سازد. در حالیکه تمام ترندها در یک Squat پایان می‌یابند، تمام اسکوات‌ها پایان ترند نیستند. اسکوات غالباً در وسط موج سه الیوت و در رتریس فیبوناچی و خطوط کان دیده می‌شود. (فصل 7). چنانچه اگر ترند اخیر را پایان ندهد، یک "Measuring Squat" (شبیبه Measuring Gap) می‌شود و

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

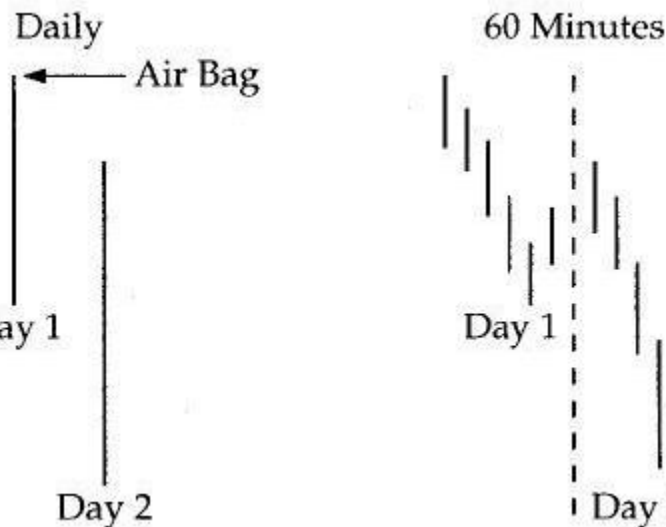
اینکه حرکت جاری چقدر ادامه خواهد یافت. این به ما یک منطقه تارگت را می‌دهد، جایی که ما می‌توانیم بدنال اسکوات دیگر باشیم که ممکن است پایان ترند باشد.

اسکوات‌ها معمولاً با حجم تیک بزرگتر و MFI کمتر و اما نه همیشه با رنج کمتری نسبت به کندل قبلی مشخص می‌شوند. اگر شما در چارت کوتاه‌مدت ترید می‌کنید (اینترادی)، یک دید خلاصه برای اسکوات رنج یکسان یا کوچکتر با یک حجم تیک بیشتر (در مقایسه با کندل قبلی) خواهد بود.

اسکوات آخرین مبارزه Bulls and Bears ، با لات‌های خرید و فروش با حداقل حرکت قیمت است. تقریباً تقسیم مساوی بین تعداد و جدیت Bull و Bear وجود دارد. یک جنگ واقعی اتفاق می‌افتد و مبارزه برابری در Pit است. من این را اسکوات می‌نامم. چون بنظر می‌رسد مارکت چمباتمه زده و آماده است که به یک سمت که اغلب در جهت عکس ترند جاری است برود. مارکت حجم قابل توجهی را به بالا یا پایین حرکت کرده، و حالا سیلی از خریداران یا فروشندگان در مارکت هستند. حجم افزایش می‌یابد، ترند متوقف می‌شود و حرکت قیمت حقیقتاً متوقف می‌شود. کلید اینجا است که حرکت قیمت در حجم بالاتری متوقف می‌شود. یکی از دو نیروی متضاد (خریداران در مقابل فروشندگان) برنده خواهد شد، و معمولاً شیوع اسکوات این امکان را به شما می‌دهد که بفهمید این اسکوات ادامه ترند یا یک اسکوات برگشت ترند است.

کیسه هوا: محافظت در برابر حوادث بد

من 45 سال است که رانندگی می‌کنم و هرگز اتفاق نیفتاده که خودم باعث تصادف شوم. با این توصیف شما ممکن است نتیجه بگیرید که من راننده دقیقی هستم و حداقل محافظ را در رانندگی لازم دارم. در طی این 45 سال دو بار سرم به شیشه جلو اتومبیل برخورد کرده که در هر دو مورد در صندلی مسافر در سمت راست نشسته بودم و راننده در مسیر مناسب و با سرعت کمتر از حد می‌راند. هر دو تصادف توسط راننده مست که در جهت مخالف و در مسیر غلط می‌آمد اتفاق افتاد. از این تجربه من هرگز ماشینی نمی‌خرم که کیسه هوا دوتایی نداشته باشد. گاهی اوقات مارکت مثل راننده مست عمل می‌کند، و شما کیسه هوای محافظ را لازم دارید. اگر شما ترید خودتان را بطور دقیق محافظت کنید، شما ممکن است یک ردیف طولانی از ضرر را داشته باشید بدون اینکه مجبور باشید ترید را ترک کنید. خوشبختانه مارکت یک تکنیک عالی می‌دهد. مارکت می‌تواند به پنج پرپود زمانی متفاوت که رابطه ثابت و مشابهی را با هم دارند بشکند. ما با پرپود ماهانه شروع می‌کنیم. هر ماه شامل 4.3 هفته، هر هفته شامل پنج روز، هر روز شامل پنج الی شش ساعت ترید، هر ساعت ترید شامل چهار (پانزده دقیقه) یا شش (ده دقیقه) کندل می‌باشد. هر پرپود زمانی تقریباً یک پنجم پرپود بالاتر و تقریباً پنج برابر پرپود پایین‌تر از خود است. ما کیسه هوا را یک تیک بالا یا پائین High / Low دومین کندل قبلی در یک پرپود زمانی خیلی بالاتر (یا کندلی قبلی‌تر که هر دو Higher High یا High ، Lower High یا Lower Low دارد قرار می‌دهیم. به تصویر توجه نمائید. اگر کیسه هوا شما بالا است، یعنی اینکه در صورت رسیدن مارکت به آن شما تمایلی برای فروش ندارید. اگر کیسه هوای شما پائین است، یعنی اینکه در صورت رسیدن مارکت به آن شما تمایلی برای خرید ندارید. اکثر مواقع شما قبل از اینکه مارکت به کیسه هوای‌تان برسد، سیگنال برگشتی یا ورود بدست می‌آورید.



گذشتن همه چیز باهم در سطح یک

ما حالا ابزاری در دست داریم که می‌تواند ما را از صفر و ضرر به سمت سود پایدار سطح یک برساند. وقتی شما این فصل را بفهمید، اطلاعات زیادی را نسبت به 90% تریدرها درباره ساختن سود از مارکت دارید. شما خواهید فهمید که حجم، حرکت مارکت را کنترل می‌کند و ترند از فلور می‌آید.

شما ابزار اساسی در اختیار دارید که عمل مارکت و مقادیر اطلاعات زیادی را که مارکت هر دقیقه به ما می‌دهد را بصورت قابل فهم و آسان ترجمه می‌کند شما همچنین می‌دانید چطور حجم ورودی را آنالیز کنید و چطور از ارزیابی خیلی دقیق واکنش مارکت به حجم، MFI استفاده کنید. شما می‌دانید که با ترکیب حجم تیک خام و MFI، ابزار بهتری برای فهمیدن عمل مارکت و احتمال حرکت بعدی در اختیار دارید. برای مثال اگر کندلی که بررسی می‌کنید در یک سوم فوقانی باز و در یک سوم تحتانی بسته شود، مارکت به طرف پائین حرکت کرده است. اگر نقطه وسط کندل جاری بالای رنج کندل قبلی باشد، ترند فوری را بصورت منها (-) نشان می‌دهیم. اگر حجم تیک در مقایسه با کندل قبلی افزایش یابد، حجم (+) و MFI کمتر از کندل قبلی باشد، MFI (-) و در کل به این فرم نشان می‌دهیم: (- + -) از این طرح ما می‌فهمیم که ترند نزولی است. فروشندگان در سراسر این پرپود زمانی در سود هستند، و تا پایان پرپود در سود خواهند بود و پنجره سودده اسکوات است. بطور ایده‌آل ما بایستی آماده برگشت و رفتن به خرید باشیم. تصویر پیوست را مشاهده نمائید.

ترجمه کتاب تردینگ کی اس

ترند صعودی (+)، کندل فعلی در یک سوم تختانی باز و در یک سوم فوقانی بسته شده (31)، و افزایش حجم داریم (+) و MFI بیشتر از کندل قبلی (+). شرح ما از این کندل به این صورت است: (+31++) تصویر پیوست شده در کامنت قبلی مشاهده نمایید. تفاوت مهم این و مثال قبلی این است که خریدارها در سراسر این کندل در سود هستند و پنجره سودده سبز است. بطور ایده آل ما بایستی قبلاً در صحنه در طرف خرید باشیم، بویژه زمانی که ما یک کندل اسکوات پنج کندل قبل تر از کندل سبز جاری داشتیم. این کندل "Go With" است و ما می‌خواهیم با آن بمانیم تا زمانی که مارکت چیز دیگری بگوید.

سؤالات زیر برای مرور است. قبل از رفتن به سطح دو شما باید قادر باشید به آسانی به آنها پاسخ دهید.

1. چطور شما می‌توانید بگوئید چه کسی در یک پرپود زمانی مشخص در سود است؟
2. در کد کندل کدام عدد باز و یا بسته شدن را نشان می‌دهد؟
3. دو کندل نهائی کدامها هستند و چه اطلاعاتی را در مورد ادامه ترند به ما می‌دهند؟
4. کندل خنثی چه اطلاعاتی را به ما می‌دهد؟
5. کدامیک از کندل‌های صعودی بیشترین و کدامیک کمترین اطلاعات را به ما می‌دهد؟
6. کدامیک از کندل‌های نزولی بیشترین و کدامیک کمترین اطلاعات را به ما می‌دهد؟
7. ترند در کجا تشکیل می‌شود و چگونه تشخیص می‌دهید؟
8. بطور واضح توضیح دهید چرا MFI برای سود بردن خیلی با ارزش است.
9. چهار پنجره سودده را تعیین و شرح دهید.
10. کدام پنجره‌ها همراه با افزایش حجم است؟
11. کدامیک از چهار پنجره سودده بیشترین ارزش را برای شما بعنوان تریدر دارد؟ چرا؟ این نوع از پنجره کجا دیده می‌شود؟

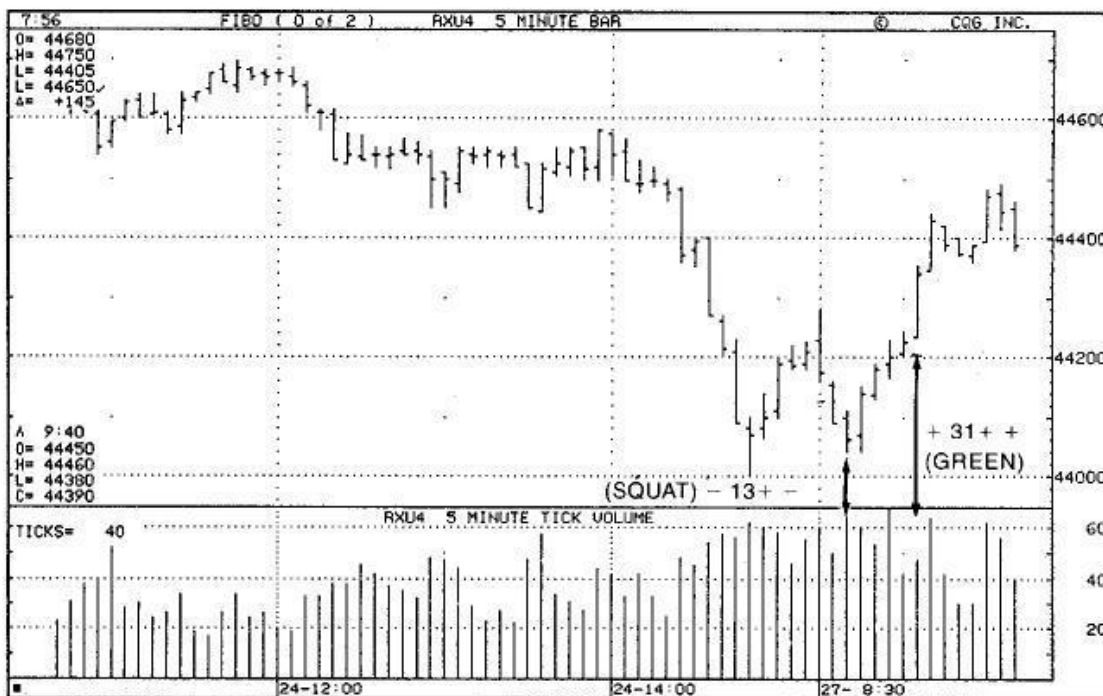
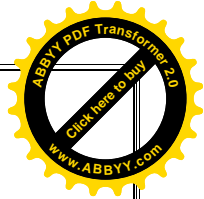
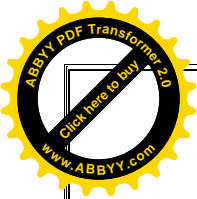


Figure 6-10 A + 13 + - squat bar and a + 31 + + green bar.



فصل 7

سطح دو: مبتدی پیشرفته
اهداف:

1. فهمیدن ارتباط بین MFI و شمارش موج الیوت.
2. استفاده از MACD سودمند برای خارج شدن از ابهام شمارش موج الیوت.

قبلاً گفتیم که انرژی‌ها یا همیشه منجر به ورود به تجربه تازه می‌شود. وقتی آنها متوجه می‌شوند که بیشتر از آنچه فکر می‌کردند درگیر شدند، اکثر تریدرهای تازه‌کار دلسرد می‌شوند و هرگز به آنچه که باید برسند نمی‌رسند. در سطح دو شما به این ارتباط بحرانی می‌رسید. آیا شما دلسرد شدید و به این نتیجه رسیدید که کسی از مارکت پول بدست نمی‌آورد؟ یا جسیپید به مارکت و سود بردید؟ در این سفر از سطح 1 به سطح 5 با برخی ابزارهای قدرتمند آشنا می‌شویم.

در سطح یک، هدف ما ماندن در مارکت و از دست ندادن پول در حین کسب تجربه است. در سطح دو، بایستی بطور پایدار از مارکت پول بدست بیاوریم. در سطح دو دیدمان را وسیع می‌کنیم. درحالی‌که برای آنالیز موج الیوت، حداقل باید 100 کندل و حداکثر 140 کندل را در نظر بگیریم. زمانی که از ترید براساس طرح سودده استفاده می‌کنیم، می‌توانیم هر تعداد کندل را بررسی کنیم.

اول، موج الیوت را بررسی می‌کنیم. سپس به آنالیز مارکت می‌رسیم و به ساختار زمینه‌ای موج الیوت نگاه می‌کنیم. این ساختار از علم جدید Chaos و بویژه از فرکتال موج الیوت می‌آید. بعد از نگاه کردن به موج الیوت، ترید را در دنیای واقعی ساده خواهیم کرد. شما احتمالاً شنیده باشید که اگر دو الیوت کار را باهم در یک اتاق با یک چارت بگذارید، آنها با نه شمارش مختلف بیرون خواهند آمد. این برای شما با روش سودده اتفاق نمی‌افتد. تقریباً هر مجله‌ای این تیتر که موج الیوت آنقدر ذهنی است که ارزش ترید ندارد، را چاپ می‌کند. فکر آشغال! من سعی می‌کنم هر تریدری را به اتاق تریدم بیاورم و با من یک روز ترید کند. آن تریدر اعتقاداتش را از دست می‌دهد. مشکل اساسی این است که تعداد کمی از تریدرها درک می‌کنند و می‌دانند چطور جایی را که ما در شمارش هستیم، تست کنند. هر الیوت کاری یک شمارش خوب بعد از مشخص شدن واقعیت می‌دهد. تریدرها نیاز به شمارش موج جاری دارند که قابل اطمینان و دقیق باشد. این ابزار دقیق در سطح دو در دسترس است. بعد از توضیح تئوریک ساده با مثال‌های واقعی کار خواهیم کرد.

یکی از چیزهایی که تمام تریدرها با آن موافق هستند، لزوم زمان مناسب برای ترید سودده است. در بیش از 35 سال ترید فعال، من روشی را ندیدم که صحت تعیین زمان تکنیک من را زیر سؤال ببرد. با ترکیب شمارش دقیق موج الیوت و فهمیدن آنچه واقعاً در مارکت اتفاق می‌افتد (بنجره سودده) و با آنالیز فرکتال خودم، تریدر می‌تواند در "On Top" هر دقیقه به دقیقه (یا روز به روز، در تایم فریم ارجح خودش) باشد. روش سودده در آنالیز موج یک اندازه‌گیری کمی و کیفی از خطر هر ترید فراهم می‌کند. دانستن اینکه کجای موج الیوت قرار دارید، دانشی به شما می‌دهد که خرافات، حدسیات، آگهی‌ها و افسانه‌ها را کنار می‌گذارید و اساس اینکه مارکت چگونه خودش را آشکار می‌کند بدست می‌آورد. برخی تریدرها حتی با این دانش، فاقد بالانس هیجانی - منطقی لازم برای ترید موفق هستند. برای اکثر تریدرها مدیریت هیجانی مشکل‌ترین مانع برای ترید سودآور می‌باشد. (فصل 10 و 11).

هدف ما در این فصل ساختن شبکه‌ای است که نشان بدهد چرا و چگونه مارکت کار می‌کند. یاد گرفتن موج سواری مارکت شبیه موج سواری دریا است. هر چه موجی که سوار بر آن هستید بزرگتر باشد، شانس بیشتری دارید که خشک بمانید. گاهی غوطه خوردن در آب قیمتی است که برای این ورزش پرداخت می‌کنید. تمام موج سوارها می‌دانند که اغلب اوقات به دریا می‌افتند و "هیولا" را می‌بینند. و بیشتر یاد می‌گیرند که رفتار هر موج را بخوانند. هر چه بیشتر درک کنید چگونه انرژی را که در هر ترید "هیولا" وجود دارد، استفاده و پراکنده کنید، اطمینان بیشتری در موقعیت‌های غیر منتظره خواهید داشت.

موج الیوت

دلیل اولی که در فهم موج الیوت جالب است، اینست که بهترین اندیکتوری است که جای شما را در حرکت مارکت نشان

ترجمه کتاب تردینگ کی اس

می‌دهد. خواندن مارکت مثل اینست که سعی کنید بفهمید شهر نیویورک چطور عمل می‌کند. شما می‌توانید یک روز با هر یک از پنج پرزیدنت هر ایالت وقت صرف کنید، تا عمق آنچه را که در هر ایالت در هر زمان اتفاق می‌افتد را بفهمید. روش دیگر گرفتن هلیکوپتر و دیدن کل شهر از بالای مرکز تردید جهانی است. روش سودده قابل مقایسه با مصاحبه عمقی است: ما آنچه را که در "زندگی" هر بازار کالا در زمان حاضر اتفاق می‌افتد را می‌فهمیم. موج الیوت ما را به ارتفاع بالاتر می‌برد و دید وسیع‌تری از چگونگی عمل مارکت نشان می‌دهد. موج الیوت ساختار زمینه‌ای مارکت است و فرکتال ساختار زمینه‌ای موج الیوت است. موج الیوت انتخاب قله و ته است. بطور طبیعی، این برای سلامتی مالی‌تان خطرناک است.

ریتم‌های اساسی موج الیوت

توالی موج شامل یک ریتم اساسی از "5" تصحیح شده با "3" می‌باشد. این توالی ثابت می‌ماند و مهم نیست چه درجه‌ای از موج آنالیز می‌شود. این ریتم موج تا زمانی که حداقل مقدار حجم تردید وجود داشته باشد، قابل مشاهده است. به عنوان یک قانون سرانگشتی ما از حداقل متوسط 20 تیک به ازای هر پریود زمانی استفاده می‌کنیم. اگرچه توالی الیوت می‌تواند اغلب در پریود کوتاه‌تر با حجم خیلی کمتر برای مثال در چارت 1 دقیقه نیز دیده شود. فرم پترن خیلی مهمتر از تایم‌فریم است. موج ممکن است منبسط یا فشرده (از نظر زمان و قیمت) شود، اما فرم زمینه ثابت می‌ماند. حرکت خودش را در جهت اولیه در یک سری از 5 موج که 1 تا 5 نام‌گذاری می‌شوند، آشکار می‌کند. حرکت 5 موج بطور نرمال با حرکت 3 موج در جهت مخالف تصحیح می‌شود. الیوت، شماره‌های 1 تا 5 "را موج‌های کاردینال" نامید. Frost و Prechter اصطلاح "Impulse Waves" را برای موج 1، 3، و 5 عمومی کرد. موج‌های اصلاحی با حروف کوچک مشخص می‌شوند. چنانچه در شکل اول از سمت راست می‌بینید، موج اول با موج 2، و موج 3 با موج 4 تصحیح می‌شود. سپس موج 5 با توالی 3 موج تصحیح می‌شود که A - B - C نامیده می‌شود. بعد از اینکه توالی 5 موج کامل شد، معمولاً یک موج با "درجه بزرگتر" یا بخشی از موج بزرگتر می‌شود. حرکت کامل موج از 1 تا 5 توالی موج بلندتر بعدی را کامل می‌کند. بنابراین حرکت از موج 1 تا 5، موج 1، 3، و 5 را کامل می‌کند و توالی A - B - C، موج 2 و 4 را کامل می‌کند. شکل دوم از سمت راست.

مشخصات موج‌های مختلف

قواعد اصلی تئوری موج ساده است، اما کاربرد این قوانین اکثر دانش‌آموزان این تئوری را می‌ترساند. با استفاده از اندیکاتورهای سودده که در فصل قبل توضیح داده شد، این کار ساده، مختصر، و دقیق خواهد بود. یکی از بزرگترین لذت‌های من در تردید نگاه کردن به شمارش موج شما که درست آنچه را که پیش‌بینی می‌کنید را نشان می‌دهد، می‌باشد. اکثر رابطه‌هایی که اکثر الیوت‌کاران توضیح می‌دهند، در واقع تمایلات بوده و نه دائمی و نه دقیق هستند. بعلاوه این رابطه‌ها در طول زمان تغییر می‌کنند. درست زمانی که شما شروع به شمارش می‌کنید، آنها تغییر می‌کنند که ما این مشکل را حل کردیم. قبل از توضیح راه حل، اجازه بدهید موج‌های مختلف و روابط بین آنها را بررسی کنیم. دوباره من باید تأکید کنم که برخی مفاهیم آنالیز موج الیوت که به ما دقیق‌تر نشان می‌دهد اعتماد ما به اندیکاتورهای سودده است که تداخلات مارکت را در همان لحظه نشان می‌دهد.

موج 1

موج اول همیشه یک حرکت تغییر ترند است. تردیدهای اول که وارد ترند جدید می‌شوند همیشه برنامه سایکولوژیکی "Have Fun" که در فصل 12 شرح داده شده، اجرا می‌کنند. شروع موج 1 (که پایان موج 5 یا پایان موج C یا E است که از سمت متضاد می‌آید) همراه با دایورجنس در اوسیلاتور MFI خواهد بود. وقتی ما تمام اندیکاتورها را با هم داشته باشیم، انتظار حرکت شارپ را از ته (قله) داریم. این ممکن است نقطه صفر (تکنیک PPT در سطح 3، فصل 9) باشد که به ما امکان تردید و سود بیشتر را می‌دهد. بهترین راه برای پیش‌بینی و هدف‌گذاری موج 1 بررسی ساختار داخلی و موج‌های با درجه کوچکتر است. به تایم‌فریم کوچکتر نگاه کنید؛ برای مثال، به توالی 5 موج داخل موج 1 در حال تشکیل نگاه کنید. شکل سوم از سمت راست.

سپس چک کنید:

1. دایورجنس
2. منطقه تارگت
3. فرکتال
4. اسکوات

5. تغییر اندیکاتور مومنتوم

ما اینها را پنج گلوله بزرگ می‌نامیم چون تقریباً همیشه ترند جاری را می‌کشد.

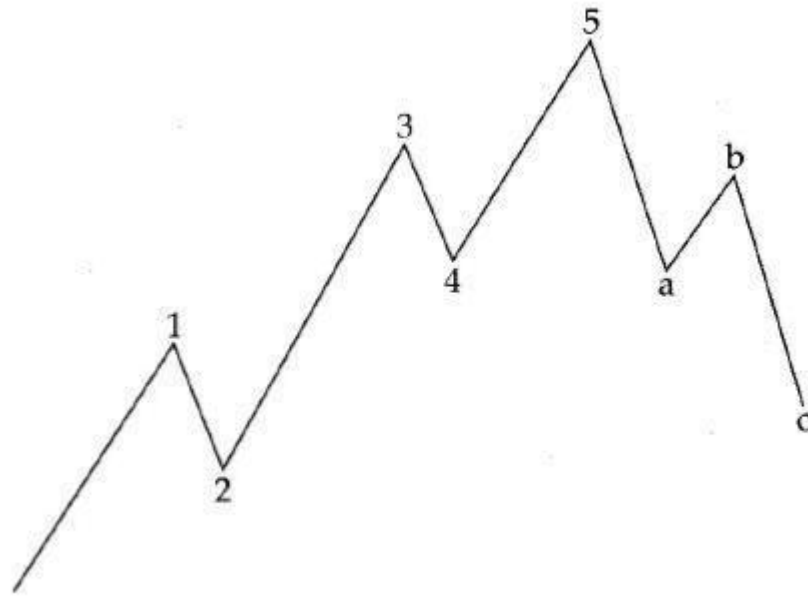


Figure 7-1 Diagram of waves 1-5 with an a-b-c correction.

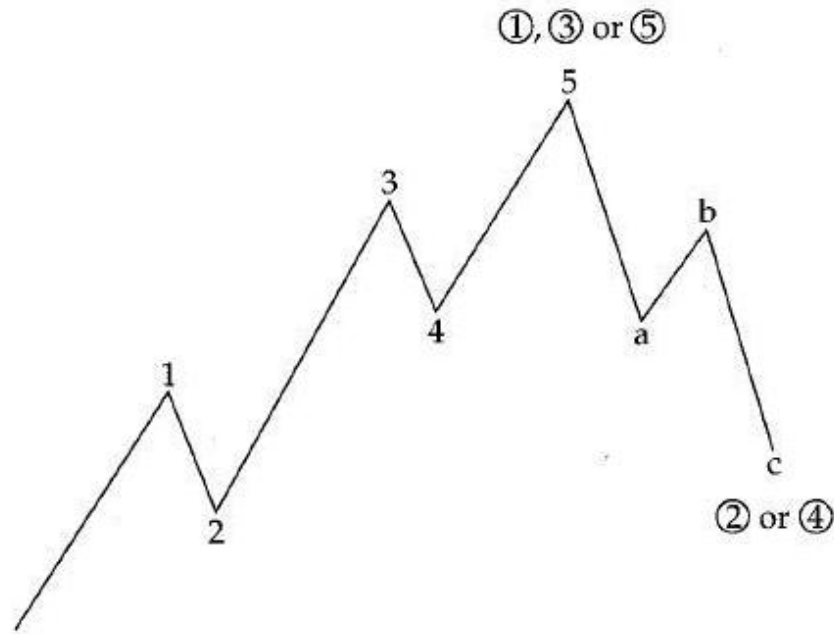


Figure 7-2 A 5-wave sequence with a 3-wave correction can be part of another wave of larger degree.

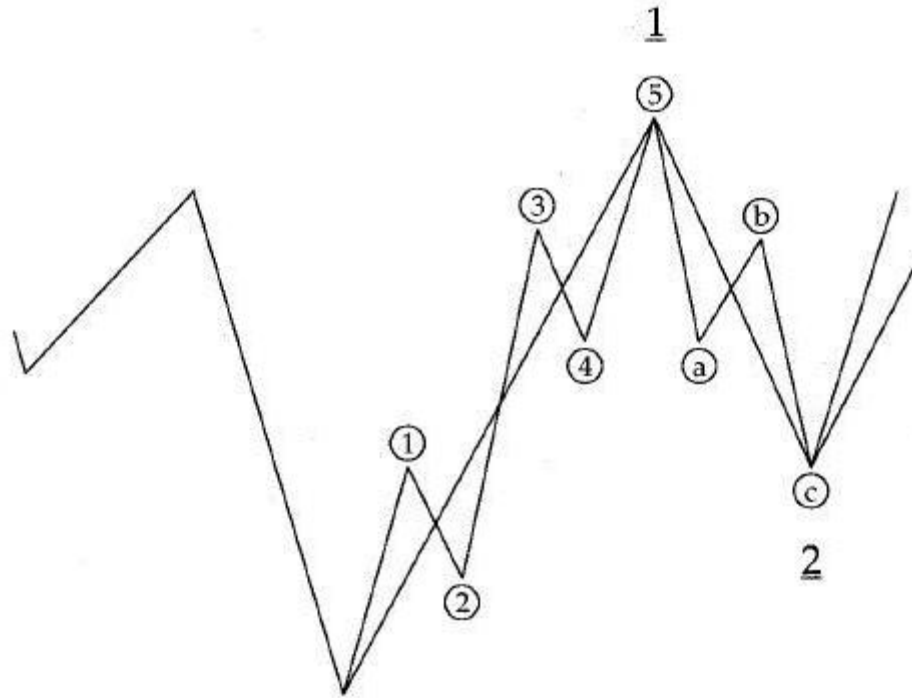


Figure 7-3 Characteristics of wave 1.

موج 2 زمانی که موج اول پایان می‌یابد، ما در انتظار دومین موج در جهت عکس هستیم. موج دوم توسط فروش (خرید) تازه ایجاد می‌شود، برخلاف موج چهارم که توسط سود کردن (خروج از خرید یا فروش) ایجاد می‌گردد. تارگت موج 2 توسط روابط فیبوناچی و شمارش داخلی موج تعیین می‌شود. معمولاً تارگت برای پایان موج 2 بین 38.2 و 61.8 درصد موج 1 است. (شکل اول از سمت راست) در حدود سه چهارم موارد موج 2 در این ناحیه پایان می‌یابد و فقط در یک ششم موارد بیش از 61.8 درصد رتریس می‌کند. اگر موج 2 در کمتر از 38.2 درصد تصحیح پایان یابد، معمولاً تصحیح بی‌قاعده داشته است. (شکل دوم از سمت راست) پس موج 2 با فروش تازه در یک ترند صعودی (یا خرید در ترند نزولی) توسط تریدرهائی که در مارکت نیستند و تشخیص نمی‌دهند که این حرکت رو به بالا موج 1 در جهت تازه است ایجاد می‌شود. (فصل 9 یافتن نقطه صفر) این تریدرها فکر می‌کنند که موج 1 تصحیح دیگری در حرکت نزولی است بنابراین آنها در قله موج 1 اقدام به فروش می‌کنند. این دلیل رفتار متفاوت موج 2 از موج 4 است که یک موج سود گرفتن می‌باشد. تریدرهائی که با سود در مارکت هستند برای خارج شدن از مارکت زمان بیشتری صرف می‌کنند تا تریدرهائی که تازه وارد شدند. این بی‌نهایت برای تعیین دقیق پایان موج 2 مهم است. بزرگترین فرصت سود بردن به ازای واحد زمان در موج 3 اتفاق می‌افتد، که عموماً سریع‌تر حرکت و مسافت بزرگتری را طی می‌کند.

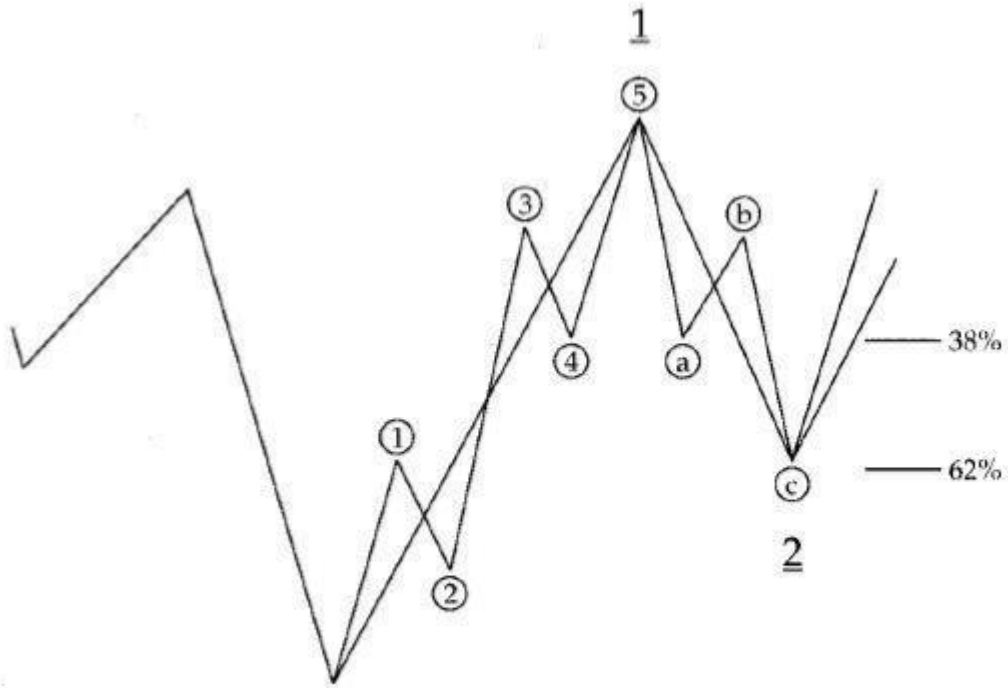
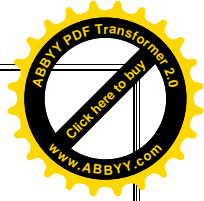
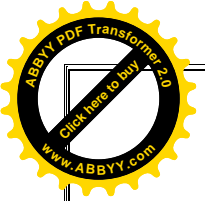


Figure 7-4 The most common retracement of wave 2.

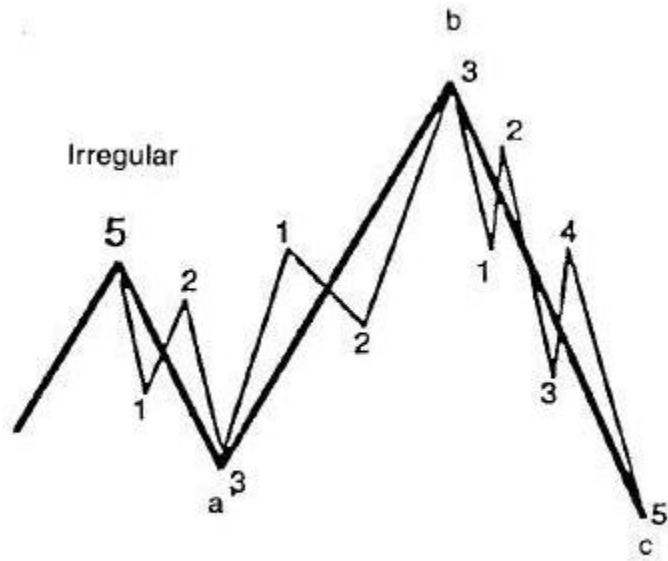


Figure 7-11 Irregular correction.



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

موج 3
 Robert Prechter موج 3 را عجایب دیدنی نامید. موج 3 امکان سود زیادی را می‌دهد. وقتی ما به سطح 5 (فصل 12) برسیم، ویژگی‌های سایکولوژیک موج 3 را آنالیز خواهیم کرد. یک روش برای شناسایی موج 3، شیب آن است. که عموماً نسبت به موج 1 تندتر (از تغییر قیمت تندتر می‌گذرد) است. گاهی موج 3 تقریباً عمودی دیده می‌شود. (شکل 1) و می‌تواند با موج 5 (Sell - Off) Blow - Off اشتباه شود. موج 3 عموماً حجم زیادی دارد. اگر حرکت سریع و قوی حجم کمتری داشت، معمولاً Blow - Off (Sell - Off) است. در طی موج 3، زمینه اکونومیک از حرکت حمایت می‌کند (برای موج 1 این موضوع صادق نیست). دلایل فاندامنتال شروع می‌کنند اندیکاتورهای تکنیکال را Pileatop کردن. اینها زمان‌های بی‌اندازه سودده برای بودن در مارکت هستند و پر کردن واگن در این موج‌ها امری ضروری است. بهترین تارگت اولیه برای طول موج 3 بین 1 و 1.62 برابر طول موج 1 است. ندرتاً موج 3 کوتاهتر از موج 1 است. و اغلب طولانی‌تر از 1.62 برابر طول موج 1 خواهد بود. بهترین راه برای تعیین کردن پایان موج 3 رفتن به تایم فریم کوچکتر و استفاده از تلافی 5 گلوله بزرگ برای پیدا کردن پایان موج 5 از اندیکاتور موج 3 می‌باشد. این 5 گلوله بزرگ عبارتند از:

1. دایورجنس در اوسیلاتور MFI
2. فرار گرفتن داخل منطقه تارگت
3. تشکیل فرکتال در قله (ته)
4. یک اسکوات در یکی از سه کندل بالاترین (پائین‌ترین)
5. تغییر در جهت مومنتوم در روی

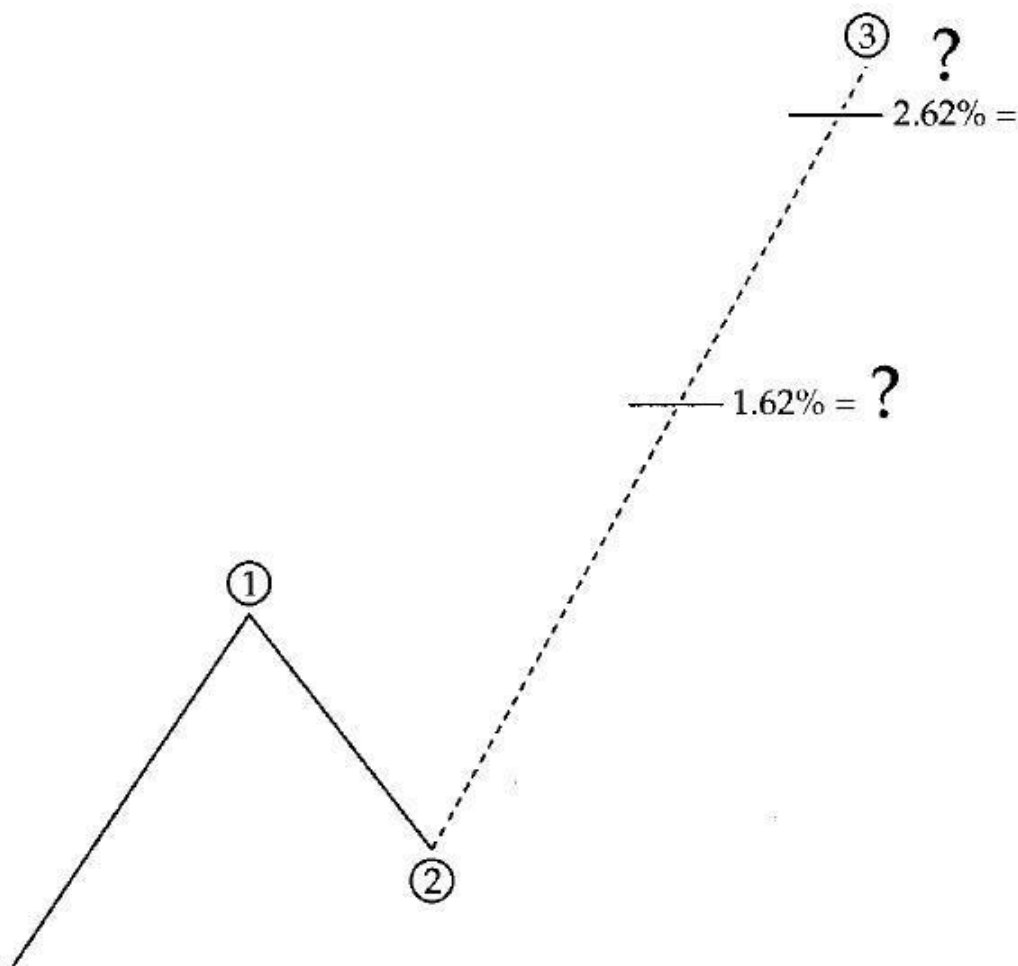


Figure 7-5 Characteristics of wave 3.

موج 4
 وقتی موج 3 قوی تمام شد، تریدرها سودشان را وصول می‌کنند. اکثر تریدرها ماهر، قبلاً در ترند بودند، و بنابراین سود فراوانی برده‌اند. مشخصه موج 4 کاملاً متفاوت از موج 2 است. الیوت این تفاوت را قانون تناوب نامید؛ اگر موج 2 ساده است،

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

موج 4 پیچیده خواهد بود، و برعکس. یک تصحیح ساده معمولاً بصورت زیگزاگ است. اگر موج 2 ساده باشد، موج 4 تصحیح پیچیده از یک طرف دارد (مسطح، نامنظم، سه گوش، درخت دوتایی یا سه تایی). تحقیقات نشان داده که 85% تمام Whiplashes در موج 4 دیده می شود. اگر شما به آسانی نتوانید بفهمید در کدام شماره از موج هستید، خیلی احتمال دارد که در موج 4 باشید. اگر شما بیدار شدید و دیدید در موج 4 هستید، بهترین استراتژی اینست که دوباره به رختخواب برگردید. با وجود این چندین بازار کالا است که در چارت ماهانه برای سالها در موج 4 است. من نمی خواهم بمدت طولانی در بستر بمانید. بعلاوه اگر بتوانیم پایان موج 4 را تعیین کنیم، ما فرصت بزرگی برای سود در موج 5 خواهیم داشت. درصد رتریس در موج 4 کاملاً با موج 2 متفاوت است. (تصویر پیوست) عموماً تصحیح موج 4 خیلی طول می کشد، اغلب تا 70% کل توالی موج 5 از نظر زمانی. عموماً موج 4 به اندازه (از نظر قیمت) موج 2 رتریس نمی کند. دوباره، این موج توسط وصول سود ایجاد می شود نه توسط ورودهای تازه به مارکت. عموماً شما شاهد افت شدید در حجم، ولایتی، Option Premiums، و اندیکاتور مومنتوم هستید. فقط در حدود یک ششم موارد موج 4 کمتر از 38% موج 3 رتریس می کند. محتمل ترین تارگت بین 38.2 و 50 درصد است. در نگاه به موج 4 یادآور می شوم که قانونی که شکسته نمی شود اینست که موج 4 هرگز به زیر قله موج 1 نمی رود. در ترید واقعی، شما خواهید دید که در برخی از موارد قانون درست نیست.

در آنالیز موج 4 برای بدست آوردن منطقه خوب برای ترید موج 5، از روابط فیبوناچی استفاده کنید و بدنال 5 گلوله بزرگ در تایم فریم کوچکتر داخل موج C از موج 4 باشید. مطمئن باشید که شما بین کندل 100 و 140 در موج C موج 4 هستید. شما می توانید تعداد را از دستکاری تایم فریم در چارت بدست آورید. بار دیگر، پنج گلوله بزرگ عبارتند از:

1. دایورجنس MFI
2. قرار گرفتن در منطقه تارگت
3. فرکنال
4. اسکوات
5. تغییر مومنتوم در MACD

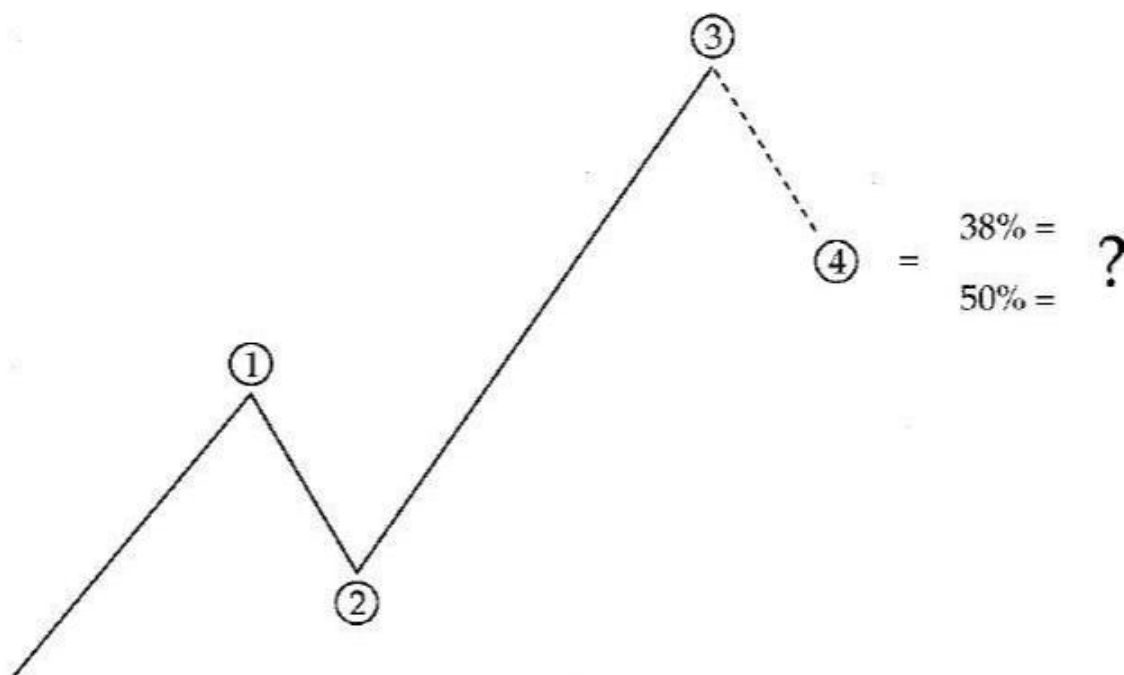


Figure 7-6 Wave 4 retracements.

موج 5 که در شکل سمت راست می بینید، آخرین تقلای تریدرها برای ایجاد High و یا Low قیمت است. این به اندازه موج 3 خوشایند و جذاب نیست. عموماً شیب خط قیمت کمتر از موج 3 است. تریدرهای ماهر از این قیمت جدید برای بدست آوردن سود استفاده می کنند در حالیکه غیر ماهرها هنوز در ترند هستند. پایان موج 5 با متدهای مختلفی که قبلاً گفته شد، محاسبه می شود. وقتی متدهای مختلف تارگت را در یک منطقه محدود تعیین کردند، اعتبار بالا می رود و ما می توانیم نقطه ترمینال موج 5 را پیش بینی کنیم. طول موج 5 از 4 تا 5 اندازه گرفته می شود، بنابراین تارگت نهائی را نمی توان تا پایان موج 4 تعیین کرد. (فصل بعدی، ترکیب اسپلاتور MFI با موج ایوت نیاز به موج 4 را به حداقل می رساند.)

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

یکی از دقیق‌ترین تعیین کننده‌های پایان موج 5 منطقه تارگت است. این متد بی‌نهایت مفید و سودده است. تفاوت قیمت بین شروع موج 1 و پایان موج 3 را اندازه بگیرید. سپس این مقدار را به ته موج 4 اضافه کنید. 61.8 درصد طول تفاوت را بدست آورده و به ته موج 4 اضافه کنید. در اکثر مواقع موج 5 بین دو عدد پایان می‌یابد. می‌توانید دقت را با استفاده از همان روش داخل موج پنجم از موج 5 افزایش دهید. این به شما حتی منطقه تارگت کوچکتر را می‌دهد. بطور نرمال منطقه کوچکتر از موج 5 داخل موج 5 بزرگتر، داخل منطقه تارگت بزرگتر از موج با درجه بزرگتر قرار می‌گیرد. سپس با اضافه کردن اندیکاتور سودمند فرکتال و اسکوات، بعلاوه دایورجنس بین موج 3 و موج 5، شما می‌توانید نقطه وصول سود و نقطه ورود خیلی دقیق را بدست بیاورید. حرکت کامل موج 1 تا 5 معمولاً ردیف‌های بالاتر خسته شدن توالی موج را کامل می‌کند. بنابراین حرکت از موج 1 تا موج 5، موج 1، موج 3، و موج 5، و توالی C - A - B - C با موج 4 را کامل می‌کند. (شکل سمت چپ)

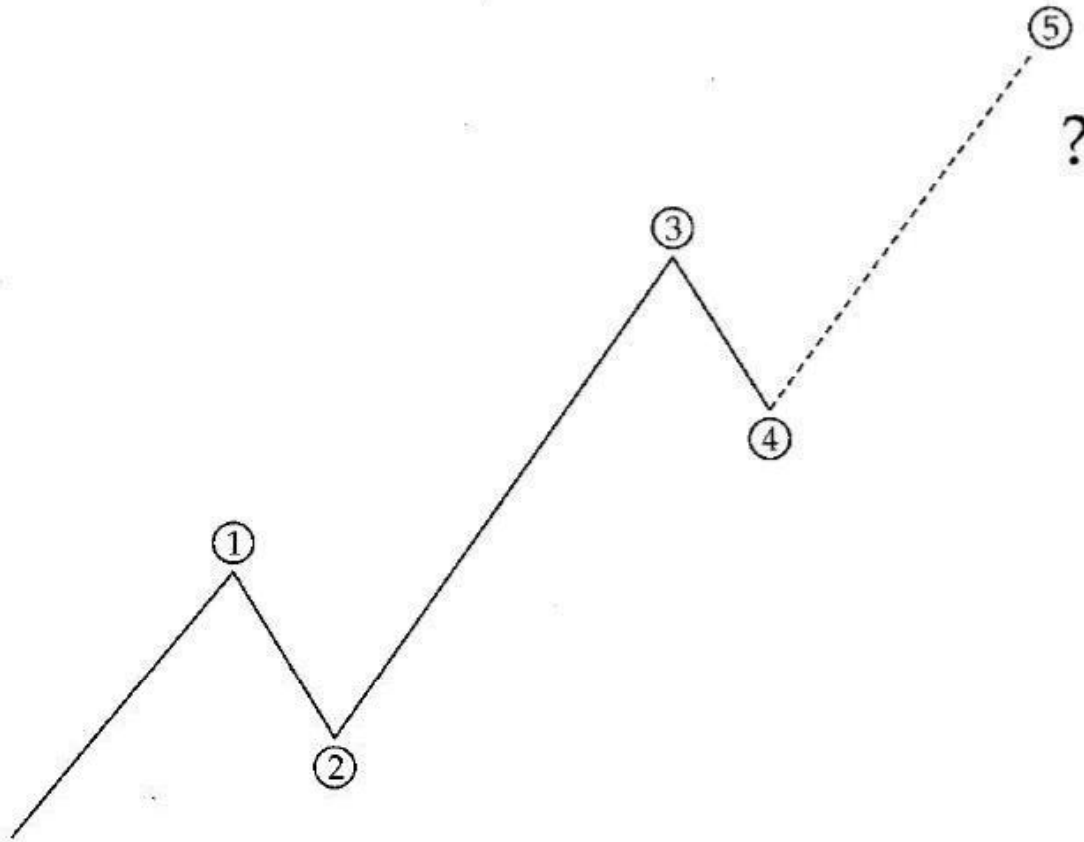


Figure 7-7 Characteristics of wave 5.

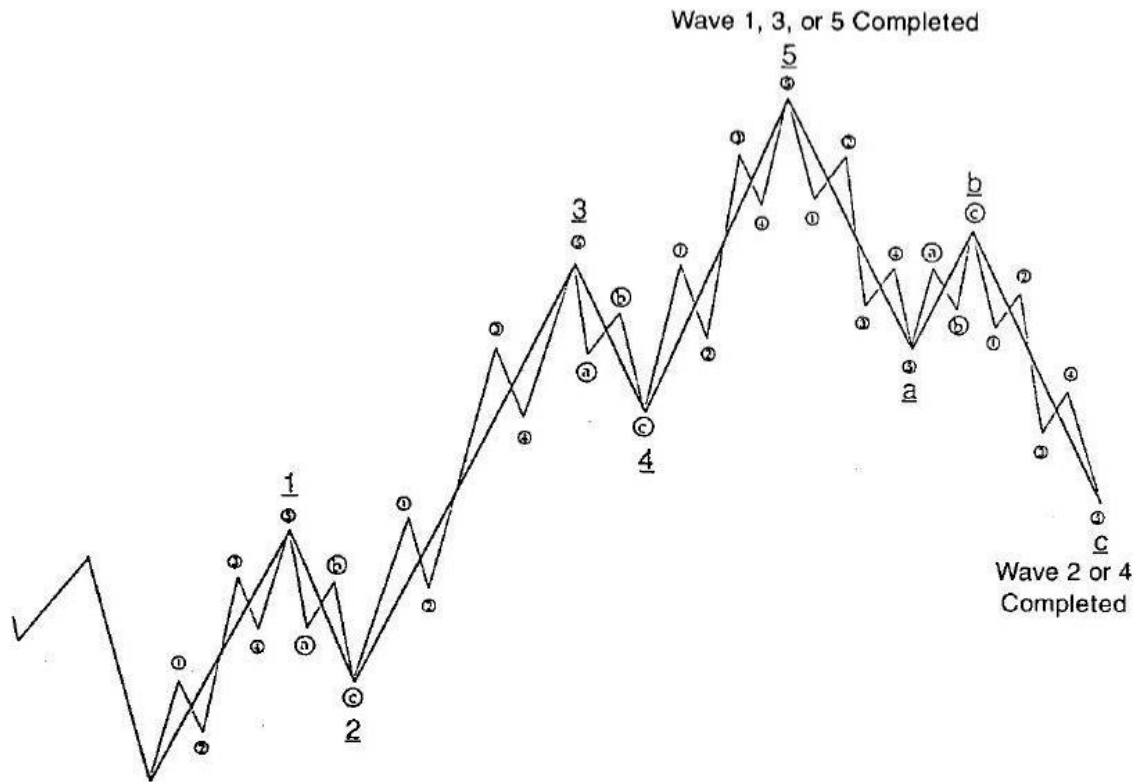


Figure 7-8 Impulse and corrective waves of various degrees.

تصحیح بطور نرمال بصورت ساده و پیچیده طبقه‌بندی می‌شود. ساده به تصحیح زیگ‌زاگ، و پیچیده به هر چیز دیگر گفته می‌شود. در سه موج اصلاحی A - B - C صرف‌نظر از اینکه ساده یا پیچیده باشد، موج B همیشه حاوی سه موج است، و موج C همیشه حاوی پنج موج است. موج A ممکن است حاوی سه یا پنج موج باشد. اگر شامل 5 موج باشد، یعنی تصحیح از نوع زیگ‌زاگ خواهد بود و اگر شامل سه موج باشد، خیلی محتمل است که صاف، نامنظم، یا مثلث باشد.

تصحیح ساده (زیگ‌زاگ) وقتی پنج موج از موج A تمام شد، موج B بطور نرمال بیشتر از 61.8 درصد طول موج A رتریس نمی‌کند. (شکل اول از سمت راست) در موارد نادر ممکن است تا 75 درصد تصحیح شود. چون موج C مشخصات موج سه را دارد، می‌تواند یک فرصت ترید بوده باشد. اگر موج B بین 50 و 61.8 درصد موج A پایان یابد، به فرکتال و اسکوات نگاه کنید برای تأیید ورود برای ترید موج C. سپس موج C را درست مثل دیگر توالی‌های پنج موجی ترید کنید. از پنج گلوله بزرگ برای وصول سود در پایان موج C از موج 4 استفاده کنید و برگردید برای ترید موج 5 در جهت مخالف.

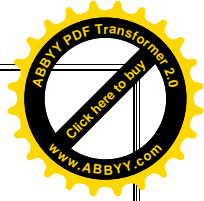
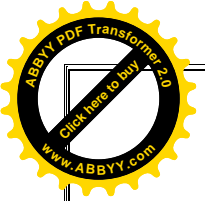
تصحیح پیچیده

سه نوع تصحیح پیچیده وجود دارد:

1. تصحیح صاف (شکل دوم از سمت راست)
2. تصحیح نامنظم (شکل سوم از سمت راست)
3. تصحیح مثلث (شکل چهارم و پنجم از سمت راست)

در تصحیح صاف، هر موج تقریباً یکسان (برابر) است. اگر موج B از قله موج Impulse آخر فراتر رود، شما می‌توانید مظنون به تصحیح نامنظم باشید. تصحیح مثلث، پترن پنج موجی دارد که A - B - C - D - E نام‌گذاری می‌شود. آنها معمولاً در توالی بعد از آخرین توالی موج 4 یا موج B اتفاق می‌افتند. وقتی مثلث در موج 4 دیده شود، قیمت تمایل دارد در جهت موج ایمپالس 3 که در حال تصحیح است، بپرد. (شکل دوم از سمت چپ) وقتی مثلث در موج B، دیده شود، قیمت تمایل دارد در جهت موج تصحیح که در حال تصحیح است بپرد. (شکل سمت چپ)

ما مشخصات و شکل تیبیک موج‌های ایمپالس و تصحیحی را بررسی کردیم. بعداً احتیاج به تکنیک ساده و سودده برای ورود به ترید داریم تا پیش‌بینی آنالیز دقیق ساختار موج را به حداکثر برساند.



Wave a of a zigzag pattern is always five waves.

Therefore, if five waves can be identified in wave a, expect a tradable zigzag pattern to materialize.

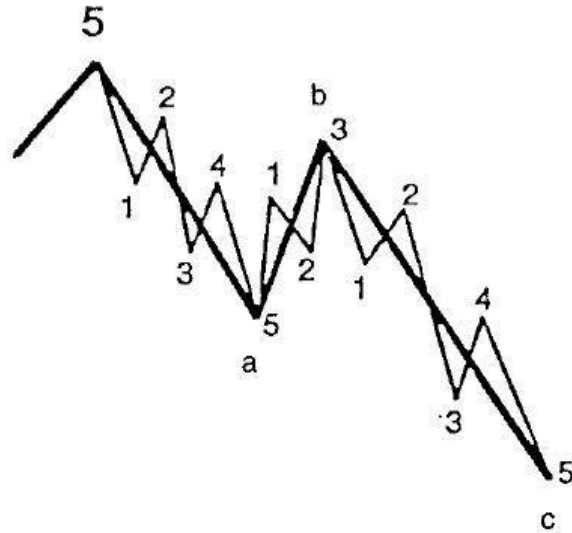
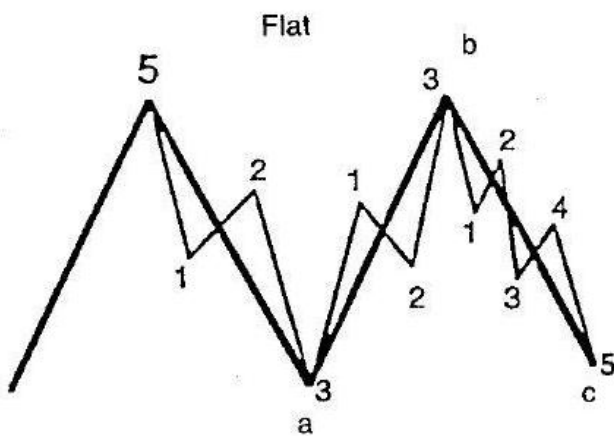


Figure 7-9 Simple (zigzag) correction.



Wave a in other types of corrections is three waves.

Figure 7-10 Flat correction.



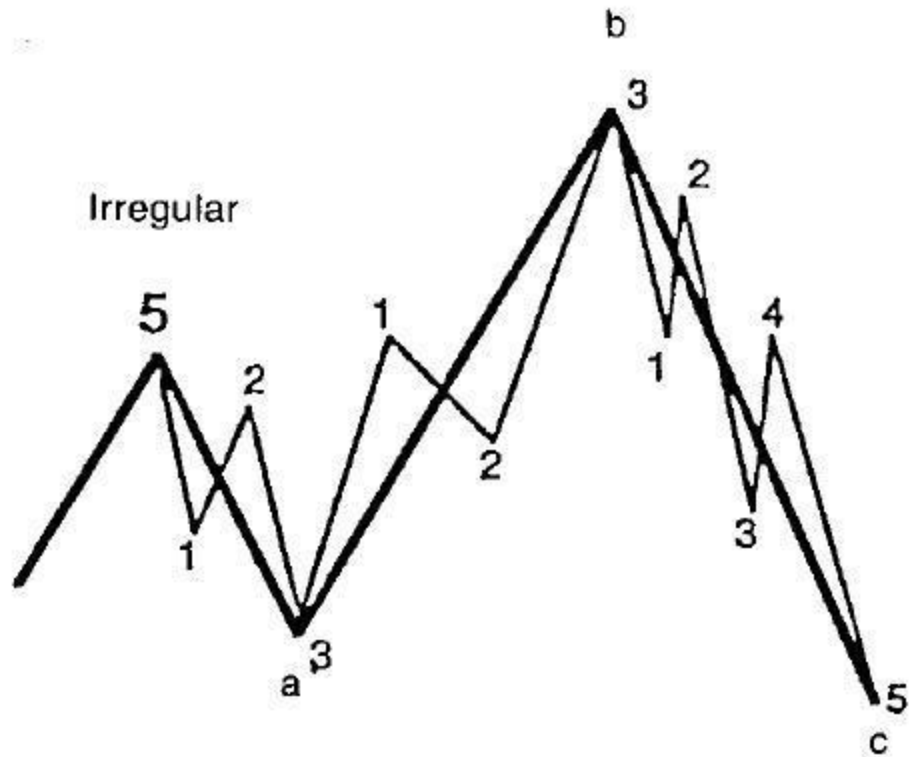
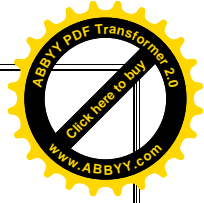
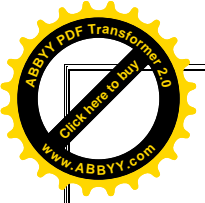


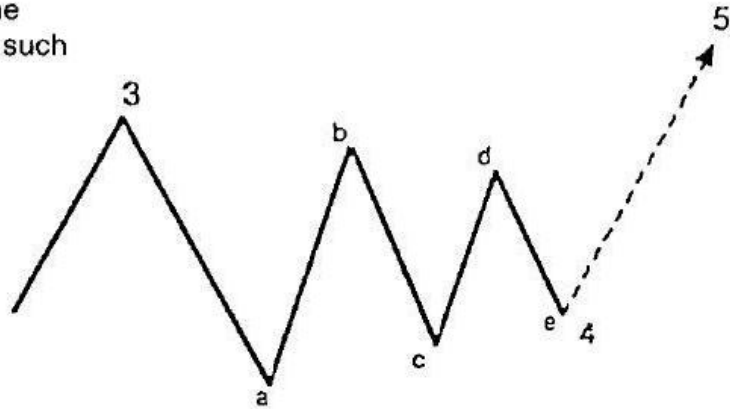
Figure 7-11 Irregular correction.

بازار جمند



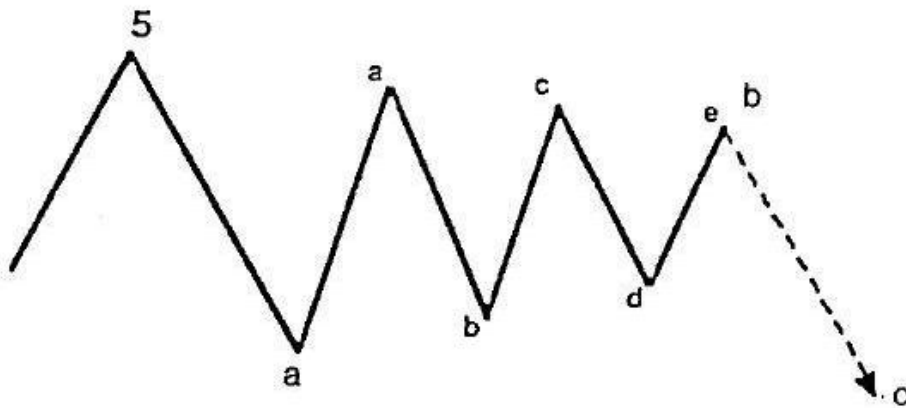
Triangle corrections are five wave patterns labeled a-b-c-d-e.

Triangles usually occur in the next to last wave sequence, such as wave 4 or wave b.



When triangles occur in wave 4, prices tend to shoot out in the direction of the impulse wave 3 being corrected.

Figure 7-12 Wave 4 triangle correction.



When triangles occur in wave b, prices tend to shoot out in the direction of the correction wave a being corrected.

Figure 7-13 Wave b triangle.

خارج شدن از ابهام موج الیوت
من ناتوانی در شمارش موج‌های الیوت را به فقدان دانش یا تجربه نسبت می‌دهم. چندین چیز درباره موج الیوت مرا ناراحت

ترجمه کتاب تردینگ کی اس

می‌کند. اول، الیوت‌کاران خودشان بطور دقیق شمارش نمی‌کنند؛ آنها تغییر قیمت را که موج را پوشش می‌دهد، شمارش می‌کنند. در مثالی که در شکل 1 از سمت راست نشان داده شده، موجی که دو واحد ارتفاع و دو واحد طول (بعد زمان) دارد همانند موجی که دو واحد ارتفاع دارد و ده واحد طول دارد شمارش می‌شود. یک چیز قطعی است؛ درحالی‌که هر دو بصورت دو واحد ارتفاع شمارش می‌شوند، یک نوع مارکت نیستند. ارتفاع موج همیشه در محور عمودی شمارش می‌شود، و فاکتور زمان در نظر گرفته نمی‌شود. وقتی فاکتور زمان شمارش می‌شود، هر موج یک زاویه قائمه تشکیل می‌دهد. (شکل 2 از سمت راست) با مطالعه این موضوع، من متوجه شدم که رابطه‌ای بین منطقه ایجاد شده توسط تغییر قیمت و زمان هر موج وجود دارد. این مطالعه در اوایل سال 1980 انجام گرفت و از ماشین حساب دستی برای محاسبه این مناطق استفاده می‌کردم. من فهمیدم، اگر منطقه زیر موج 1 را به منطقه موج 2 اضافه کنید. پاسخ شما رابطه فیبوناچی (معمولاً 61.8 درصد) به منطقه موج 3 دارد. پس با کم کردن منطقه موج 4 از منطقه موج 3، شما به انتهای منطقه موج یا رابطه فیبوناچی می‌رسید. (صفحه 120 کتاب)

با این آگاهی من از نرم‌افزار کامپیوتری برای محاسبه و پیش‌بینی پایان موج بعدی استفاده می‌کنم. وقتی قیمت شروع و پایانی موج 1 و تعداد کندل در تایم‌فریمی که تردید می‌کنیم (معمولاً کندل یک ساعته) را وارد می‌کنیم، کامپیوتر سه تارگت زمان - قیمت را برای پایان موج 2 محاسبه می‌کند. همچنین براساس احتمالات به ترتیب ردیف می‌کند.

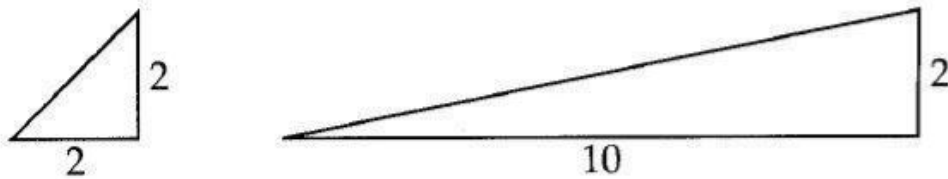


Figure 7-14 Two units high vs. two units wide (left), and two units high vs. ten units wide (right).

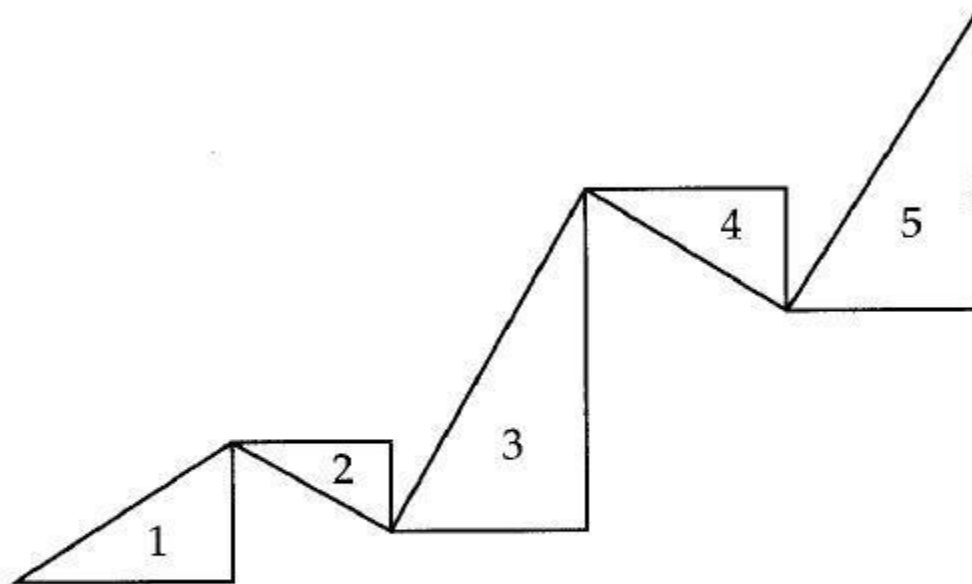
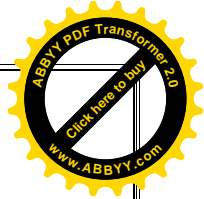
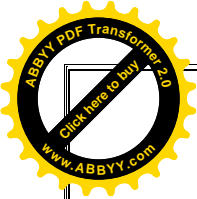


Figure 7-15 Areas beneath the Elliott Waves.



ترجمه کتاب تردینگ کی اس

ترکیب MFI با موج الیوت همانطور که قبلاً گفته شد، یکی از اندیکاتورهای کلیدی که ما برای تردید سودده استفاده می‌کنیم MFI است. این اندازه‌گیری اساسی چگونگی مؤثر بودن حجم تردید جاری در حرکت قیمت در طی زمان است. این اندیکاتور تیک شمار است. هر چه MFI بالاتر باشد، تغییر قیمت برای هر واحد حجم بیشتر است. ما می‌خواهیم پولمان را وقتی وارد مارکت بکنیم که قیمت سریعترین حرکت را داشته باشد، تا حداکثر سود را بکنیم. MFI همانطور که در فصل ششم توضیح داده شد، رنج تقسیم بر حجم است. و پاسخ با پرپود زمانی قبلی مقایسه می‌شود. بعد از اینکه سال‌ها با این اندیکاتور کار کردم، متوجه شدم رنج‌های متفاوت در هر موج الیوت وجود دارد.

اکثر تردیدها حتی الیوت‌کاران حرفه‌ای، گاهی از شمارش موج‌ها در چارت قیمت باز می‌مانند. من راحت‌تر، دقیق‌تر، و کمتر ذهنی‌تر موج‌ها را پیدا و شمارش می‌کنم. فکر بعدی من محاسبه MFI در هر موج، با میانگین گرفتن کندل‌های MFI و سپس مقایسه میانگین‌های مختلف برای موج‌های مختلف می‌باشد. من دقیقاً آنچه را که انتظار داشتیم، پیدا کردم. میانگین MFI در موج 3 بالاترین است. در موج 1 و موج 5 این میانگین کمتر است. واضح است که بین قیمت در انتهای موج 5 و میانگین MFI برای موج 5 دایورجنس وجود دارد. اگرچه قیمت در پایان موج 5 بالاتر از پایان موج 3 است، میانگین MFI برای موج 5 کمتر بوده و ایجاد دایورجنس می‌کند. (تصویر پیوست) این دایورجنس یک اندیکاتور پیشرفته‌ای برای پایان این سری از ایمپالس‌ها است و تغییر ترند را پیشگویی می‌کند. با داشتن مجموعه‌ای از پارامترها، ما قادر به تردید با آنها یا ساختن اندیکاتور برای تعیین تفاوت بین MFI در هر موج خواهیم بود. این با MFI بطور موفق انجام می‌شود. MFI یک اندیکاتور مومنتوم واقعی در زمان حال است.

اکثر اندیکاتورهای "Off The Shelf" مثل استوک‌هاستیک، RSI، و امثال آن، مومنتوم را مقایسه نمی‌کنند. آنها قیمت را با قیمت X کندل قبل مقایسه می‌کنند. آنها میزان عمل قیمت در داخل موج 5 را که داخل موج 3 است، مقایسه نمی‌کنند. بنابراین اندیکاتورهای خیلی قدیمی که امروزه توسط تردیدها استفاده می‌شود بطور ثابتی پایان ترند را نشان نمی‌دهند، که قاطع‌ترین اطلاعات در تردید است.

Tom Joseph، محقق عالی در تکنیک‌های تردید، یک اندیکاتور مومنتوم خیلی مؤثر را ایجاد کرده است. او مووینگ اوریج 35 را از مووینگ اوریج 5 کم می‌کند. این اسیلاتور را ایجاد می‌کند که قابل برنامه‌ریزی روی اکثر ماشین‌های Quote است. SMA 5 قدرت جاری مارکت و مووینگ اوریج 35 قدرت مومنتوم را در پرپود طولانی‌تر نشان می‌دهد. اگر اعداد را به اسیلاتور 34/5 تغییر دهیم، ما بی‌نهایت به تفاوتی که در MFI برای هر موج پیدا می‌کنیم نزدیک خواهیم شد. برای مثال، در نظر بگیرید شما الان در موج 3 هستید. مووینگ اوریج 5 میزان حرکت در داخل موج 3 را نشان می‌دهد. این میزان تغییر، مثل MFI، تندتر از هر زمان دیگر در توالی موج الیوت حرکت می‌کند. مووینگ اوریج 35 میزان حرکت یا MFI داخل موج 1 و 2 را نشان می‌دهد. این میزان از تغییر خیلی آهسته‌تر از میزان پرپود 5 است و تفاوت بزرگی را بین دو مووینگ اوریج ایجاد می‌کند. موج 3 بالاترین پیک را در اسیلاتور 34/5 ایجاد می‌کند. در طول سال‌ها، ما با این اسیلاتور به چند روش کار کردیم.

www.abcBourse.ir

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

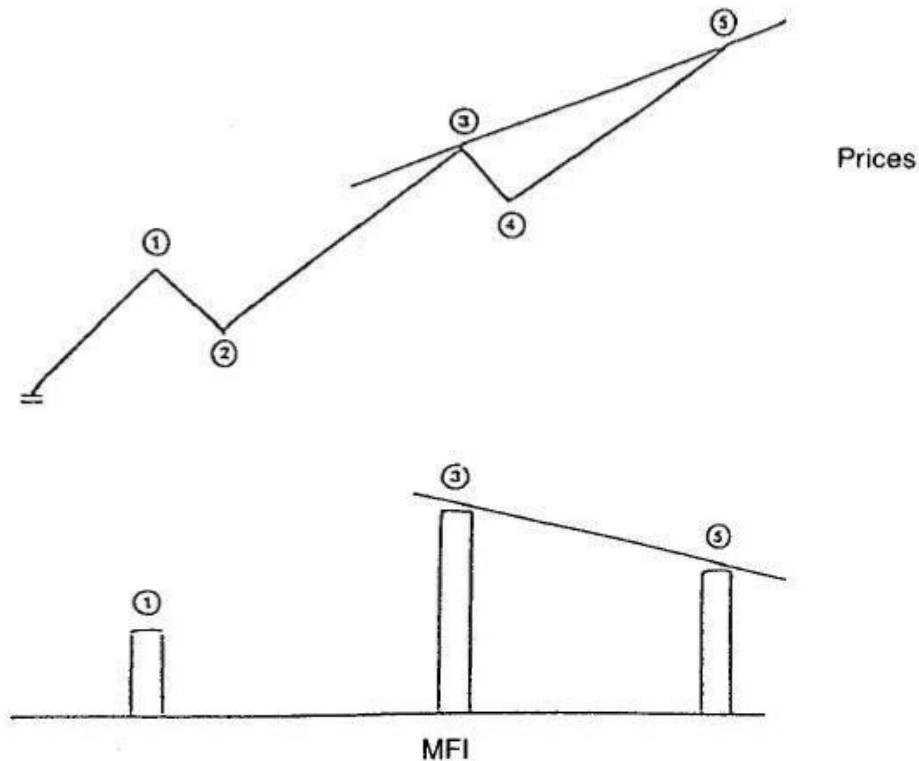


Figure 7-16 Average MFI divergence between wave 3 and wave 5.

ما فهمیدیم که با اضافه کردن مووینگ اوریج با پریود 5 به اسیلاتور الیوت، اسیلاتور به Macd تغییر می‌کند. این مووینگ اوریج "خط سیگنال" یا اندیکاتور ریتم مارکت خواهد بود. (فصل نهم) و به ما تأیید بیشتری را برای ترید می‌دهد. آن یک اندیکاتور رهبر است و دقیقاً جایی که مارکت شروع به تمام کردن جریان می‌کند را نشان می‌دهد. این سیگنال قبل از اینکه تغییر جهت (مومنتوم) در قیمت قابل مشاهده باشد اتفاق می‌افتد. Macd 5/34/5 سودده بطور ثابتی به ما می‌گوید که بایستی در کدام طرف مارکت باشیم.

چهار استفاده اولیه برای Macd 5/34/5 سودده وجود دارد:

1. تعیین قله موج 3
2. تعیین پایان موج 4، یا نزدیک‌ترین نقطه به پایان موج
3. جستجوی پایان ترند و قله موج 5
4. سیگنال فوری جهت مومنتوم جاری، یا جهتی از مارکت که تریدرها می‌خواهند ترید کنند.

تعیین قله موج 3 در توالی 5 موج، هر دو میانگین Mfi و Macd 5/34/5 در قله موج 3 به پیک می‌رسند. (تصویر پیوست) اگر ما اسیلاتور 34/5 را بشکل هیستوگرام در چارت قرار بدهیم، به آسانی کندلی که در آن پیک اتفاق می‌افتد را می‌توانیم تعیین کنیم. چون تمام اسیلاتورها اندیکاتور تأخیری هستند، پیک موج 3 بالاترین (پائین‌ترین) قیمتی خواهد بود که 1 تا 5 کندل قبل از پیک اسیلاتور اتفاق می‌افتد. بلافاصله بعد از پیک، هیستوگرام زیر خط سیگنال حرکت می‌کند. خط سیگنال مووینگ اوریج 5 از خود اسیلاتور هست. در این صورت، در گرفتن هر پوزیشن بای دقت کنید: مومنتوم جریان را تمام کرده است. اگر در بای هستید، شما ممکن است که در موج 4 بمانید یا سودتان را وصول کنید و منتظر باشید تا این اسیلاتور حداقل نیاز به تلاقی موج 4 را نشان دهد.

ترجمه کتاب تردینگ کی اس

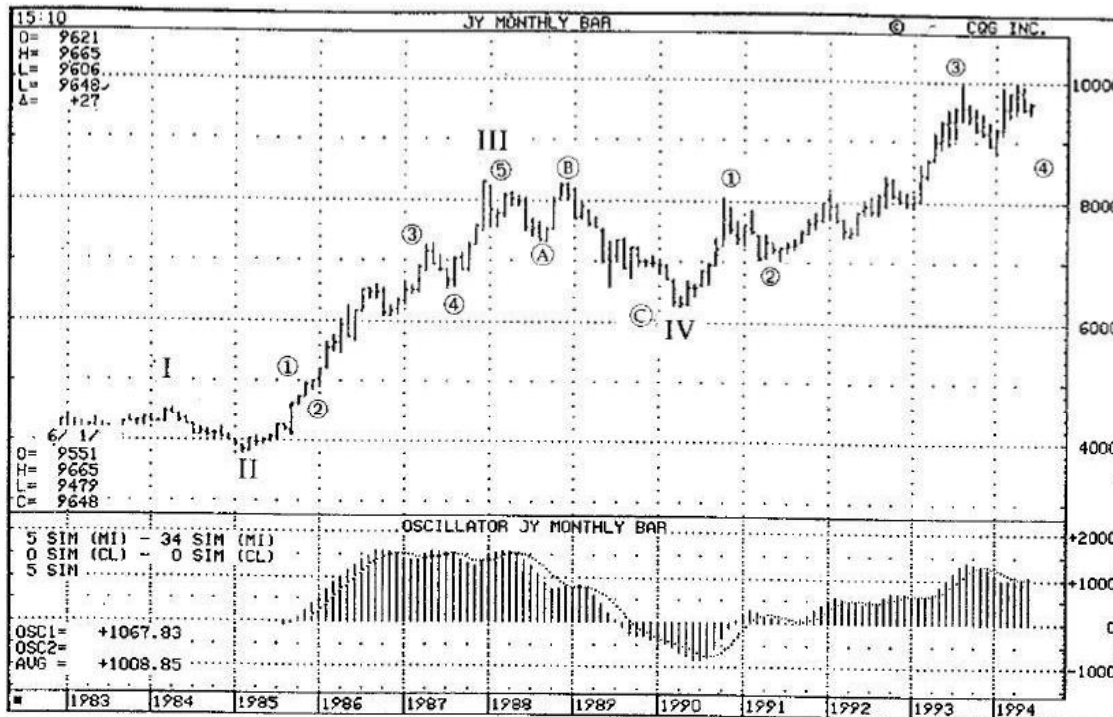


Figure 7-17 The 5/34/5 profitunity MACD peaking on wave 3.

تعیین پایان موج 4 بعد از پایان موج 3، اسیلاتور با رتریس موج 4 برمی‌گردد. هیستوگرام به زیر خط سیگنال می‌افتد، این به ما می‌گوید که اینجا منطقه خوبی برای ورود به پوزیشن بای نیست. با وجود این، ما باید یکی از مهمترین مطالب را اینجا بیاوریم. MACD 5/34/5 اندیکاتور خیلی دقیقی برای موج الیوت است، که به فهم چگونگی کار این اندیکاتور کمک می‌کند. و همیشه موج الیوت را اندازه می‌گیرد. سؤال اینجا است: کدام درجه از موج الیوت؟ تحقیقات ما نشان داده که برای دقیقترین اندازه‌گیری، موج تحت بررسی پایبندی از 100 تا 140 کندل تشکیل شده باشد. اگر ما به توالی موج با کمتر از 100 کندل نگاه کنیم، MACD موج الیوت با درجه بالاتر را اندازه می‌گیرد. و اگر تعداد کندلها بیشتر از 140 باشد، MACD موج الیوت با درجه کوچکتر را اندازه می‌گیرد. بعنوان مثال، تصویر سمت راست چارت یک ساعته این نشان می‌دهد، در بررسی حرکت از نقطه X به Y، ما به ترد سودده بعدی نگاه می‌کنیم. در نظر بگیرید شما برای لحظه‌ای در مارکت نبودید. بنظر می‌رسد در 6 روز اخیر موج 5 رو به بالا حرکت کرده است.

اولین سوال اینست: آیا مطمئن هستید که موج 4 تمام شده؟ اگر تعداد مناسب کندل (100-140) را در نظر بگیرید، MACD جواب قطعی را به شما می‌دهد. از نقطه X به نقطه Y، فقط 33 کندل وجود دارد. توجه کنید، MACD در نقطه A به پیک می‌رسد اما خط صفر را در نقطه B قطع نمی‌کند. چون ما فقط 33 کندل در چارت یک ساعته داریم و باید حداقل چهار برابر چارت را کوچکتر کنیم به چارت 15 دقیقه (تصویر سمت چپ) تا جواب دقیقتری بگیریم. این تصویر همان ارز را در 15 دقیقه نشان می‌دهد که شامل 102 کندل بین نقطه X و Y است. دو نکته مهم در بررسی این چارت وجود دارد:

1. MACD خط صفر را در نقطه R قطع می‌کند، یعنی حداقل لزوم برای تلاقی موج 4. بنابراین، در اوایل روز در نهم ژوئن، ما بدنبال منطقه خوب برای ورود به بای هستیم.
2. این چارت اطلاعات حیاتی در مورد آنچه که در بین نقطه P و Q اتفاق افتاده، می‌دهد. دایورجنس وجود دارد، اما اسیلاتور به صفر نرفته است. این نشان‌دهنده آنست که نقطه P موج 3 از موج 3، و نقطه Q موج 5 از موج 3 است. این دانش شما را از شایع‌ترین اشتباه الیوت‌کاران: یعنی شمردن موج 3 داخل موج 3 بعنوان پایان موج سوم، و سپس شمردن موج 5 از موج 3 بعنوان درجه بزرگتری از موج 5 محافظت می‌کند. وقتی این اتفاق می‌افتد، الیوت‌کاران در نقطه 4 سل می‌کنند. مارکت موج 4 را تمام می‌کند و بخاطر اشتباه در شمارش "Creamed" می‌شود.

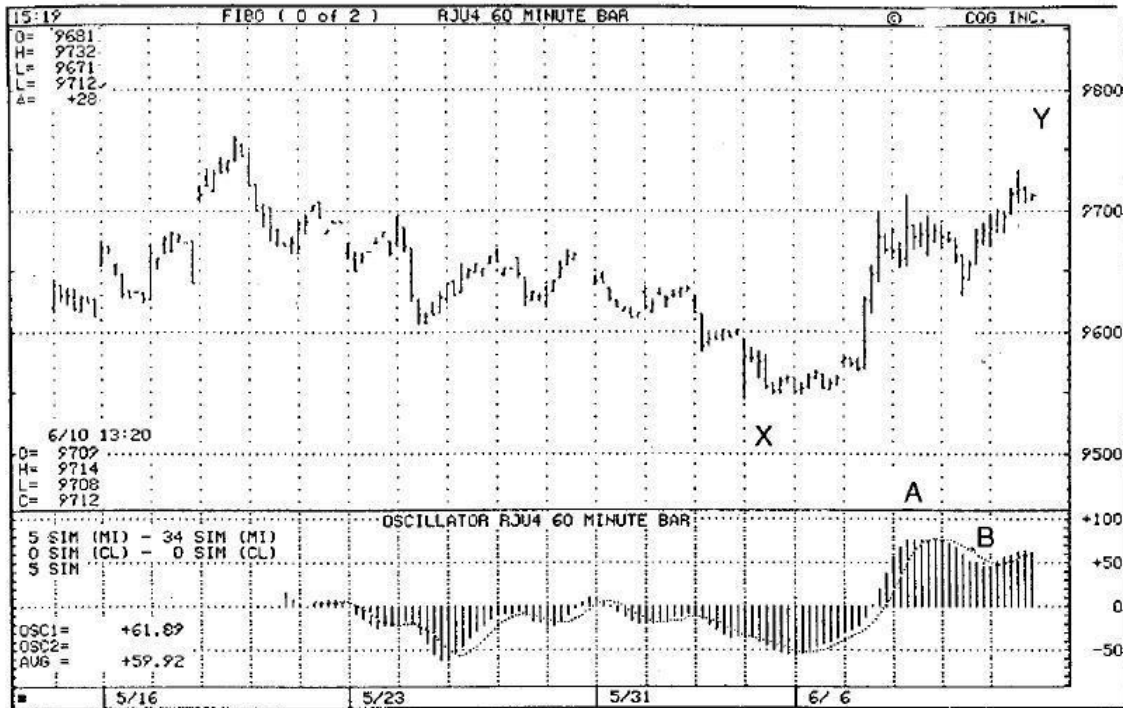


Figure 7-18 Japanese yen, hourly chart.

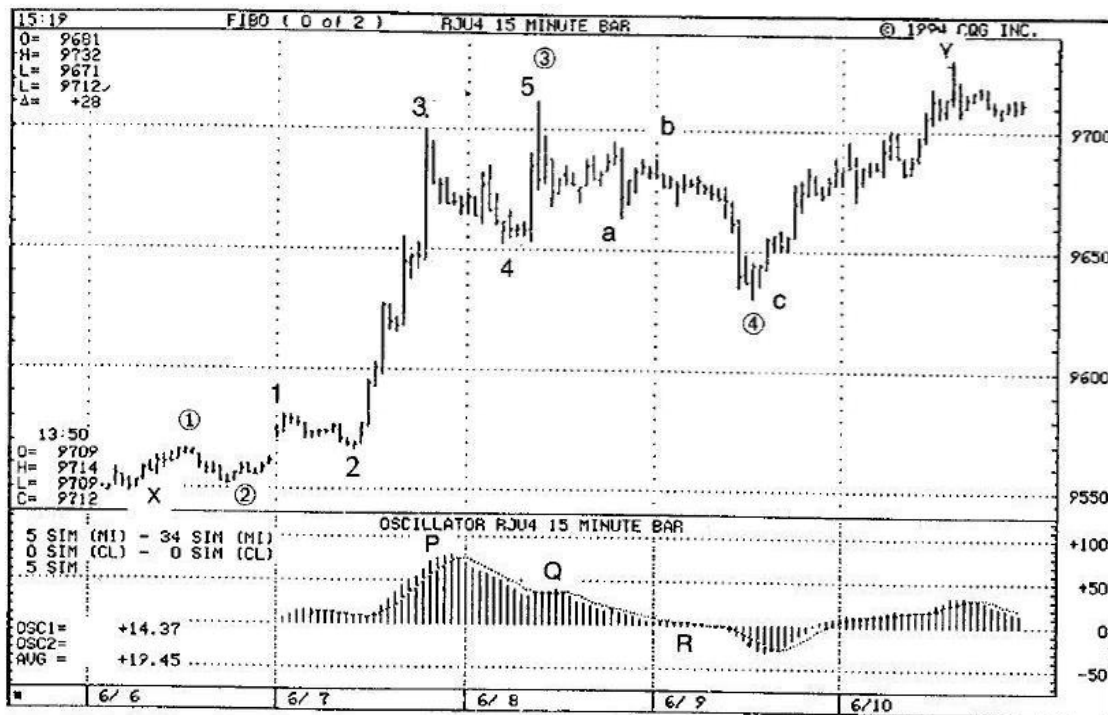


Figure 7-19 Japanese yen, 15-minute chart.

با در نظر گرفتن اینها شما منطقه خوب را براساس قطع خط صفر پیدا می‌کنید و تعداد کندل مناسبی را برای شمارش دارید، و آماده هستید که وصول سودتان را برنامه‌ریزی کنید. برای شمارش دقیقتر موج‌ها بین نقطه 4 و 5، ما باید از چارت 5 دقیقه

ترجمه کتاب تردینگ کی اس

استفاده کنیم تا تعداد کافی کندل برای شمارش موج 5 از موج 5 داشته باشیم. در تصویر سمت راست می‌توانیم ببینیم که در توجه کنید، و Macd چهارمین موج از موج 5 هستیم. ما کمترین نیاز را برای موج 4 از موج 5 داریم (به قطع خط صفر توسط می‌توانیم منطقه تارگت برای پایان موج 5 از موج 5 را تخمین بزنیم. این سه چارت (تصاویر کامنت قبلی و تصویر سمت راست) ارزش مطالعه دقیق را دارند. اگر شما این مطالب را کامل بفهمید، می‌توانید سودتان را به حداکثر و ریسک‌تان را به حداقل برسانید. ورود و خروج شما اعتمادی در شما ایجاد می‌کند که می‌توانید به سطوح بالاتر ترید کنید.

بخاطر داشته باشید، وقتی شما توالی موج را در تعداد مناسبی (100-140) کندل برای شمارش در نظر بگیرید، می‌توانید زمانی را که حداقل نیاز برای تلاقی موج 4 است را تعیین کنید، یعنی وقتی که اسیلاتور خط صفر را قطع کند. یک نکته مهم در اینجا اینست: قطع خط صفر توسط اسیلاتور بعد از پیک موج 3 نشان‌دهنده حداقل نیاز به تلاقی موج 4 است. این به این معنی نیست که موج 4 تمام شده، و برای ترید تا بعد از اینکه اندیکاتور خط صفر را قطع کند، زود خواهد بود. برای افزایش دقت ورود اگر در مثلث است) برای پنج گلوله بزرگ E یا c نگاه کنید. داخل موج آخر (C - B - A) به ترید در پایان موج 4، به تصحیح مثلث یا داخل موج کوچکتر نگاه کنید.

روش دیگر برای پیش‌بینی پایان موج 4 نگاه کردن به زمان فیوناچی است. ابتدا فاصله زمانی بین پیک موج 1 و 3 را اندازه بگیرید. سپس این فاصله را در دو نسبت فیوناچی ضرب کنید. اکثر موج‌های 4 در پرپود زمانی بین 38.1 و 161.8 برابر طول موج 1 تا موج 3، وقتی از ته موج 2 اندازه گرفته شوند، تمام می‌شوند. گذاشتن تمام اینها با هم منطقه تارگت عالی هم از نظر زمان و هم از نظر قیمت، برای پایان یافتن موج 4 فراهم می‌کند. (تصویر دوم)

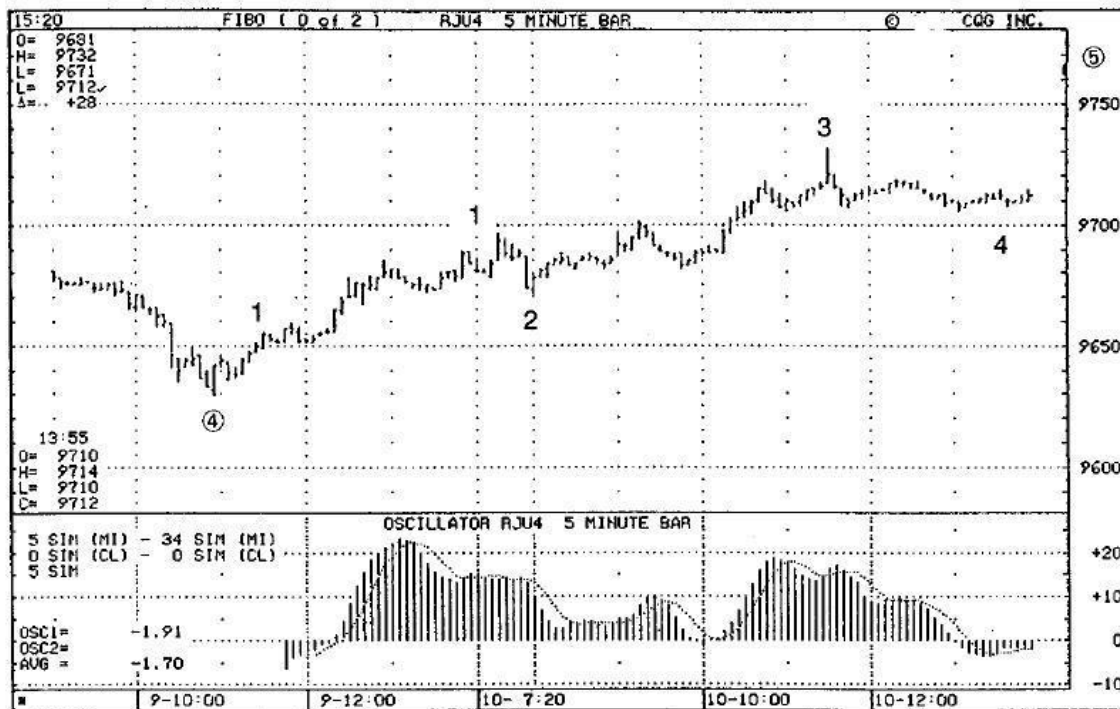


Figure 7-20 Japanese yen, 5-minute chart.

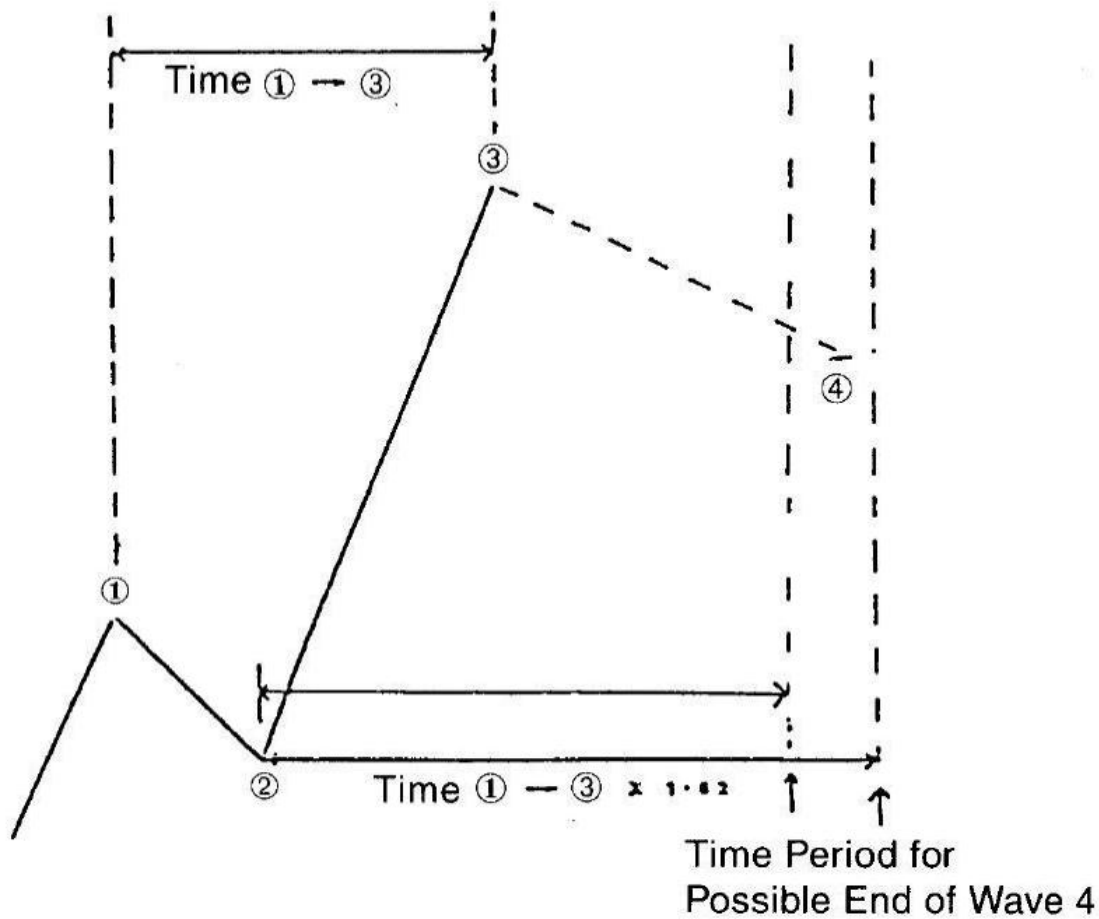


Figure 7-21 A timing model for estimating the end of wave 4.

یافتن پایان ترند و قله موج 5
بعد از پایان یافتن موج 4 و شروع موج 5، می‌توانیم تارگت پایان این توالی 5 موج را تخمین بزنیم.
اول، فاصله قیمت را از شروع موج 1 تا پایان موج 3 اندازه بگیرید. این اعداد را به پایان موج 4 اضافه کنید. سپس 62 درصد این فاصله را علامت بزنید. بین این دو عدد (62 درصد و 100 درصد فاصله قیمت از شروع موج 1 تا پایان موج 3، که به شروع موج 4 اضافه شده است) بهترین تارگت برای پایان موج 5 است.
بعداً، 5 موج را داخل موج 5 شمارش کنید. اندازه‌گیرهای بالا را برای هر 5 موج داخل موج 5 تکرار کنید. این منطقه تارگت کوچکتر را برای کامل شدن موج 5 و موج 5 از موج 5 می‌دهد (شکل 1).
بخاطر داشته باشید که تمام ترندها در دایورجنس بین high قیمت و high اوسیلاتور در پایان موج 5 تمام می‌شوند

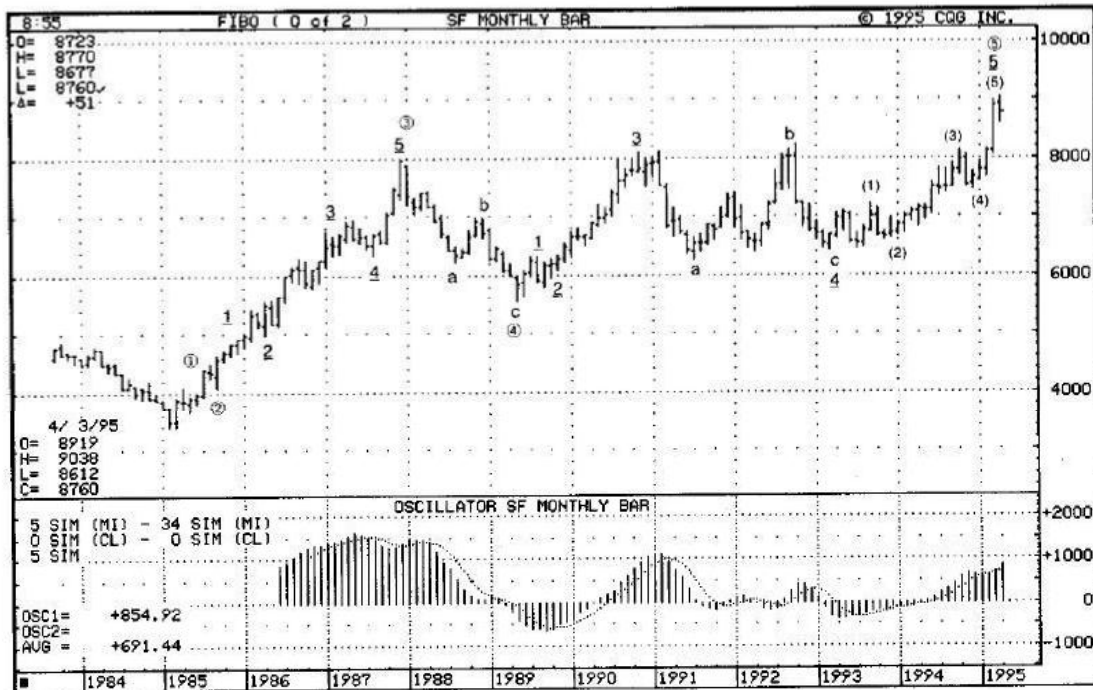


Figure 7-22 The end of wave (5) of wave 5 of wave 5.

تعیین فوری جهت مومنتوم جاری اینجا ما باید ابتدا موقعیت نسبی بین هیستوگرام 34/5 اوسیلاتور و خط سیگنال (خط سیگنال میانگین متحرک ساده با پریود 5 از اوسیلاتور 34/5 است) را تعیین کنیم و سپس فقط در جهت مومنتوم جاری ترید کنیم. (شکل 1). این تکنیک حساس ترین و دقیق ترین فیلتر برای اندازه گیری تغییر مومنتوم است. اگر هیستوگرام زیر خط سیگنال باشد، ما فقط سل می گیریم. اگر هیستوگرام بالای خط سیگنال باشد، ما فقط بای می گیریم. برای افزایش دقت در شمارش موج به جزئیات بیشتری نیاز داریم. وقتی تعداد کندل (100-140) صحیح باشد و دایورجنس بینیم که به خط صفر نرفته است، آنچه که ما می بینیم پیک موج 3 داخل موج 3 بزرگتر است. Macd رتریس خواهد کرد (اما نه به خط صفر)، سپس برگشته و ایجاد دایورجنس می کند، به این معنی که آن موج 5 از موج 3 است و بنابراین پیک موج 3 بزرگتر در آن نقطه است. مکرراً، شایع ترین اشتباه الیوت کاران این است که پیک موج 5 داخل موج 3 بزرگتر را پایان موج 5 می دانند. براساس این خطا، آنها پوزیشن تازه ای را در خلاف جهت می گیرند و تکمیل شدن موج 5 واقعی را ناتمام گذاشته و متوقف می کنند. بعد از اتمام موج 5 داخل موج 3 بزرگتر، Macd به خط صفر برمی گردد برای نشان دادن اینکه حداقل نیاز برای دیدن موج 4 بزرگتر است. موج 4 اغلب نزدیک پایان موج 4 داخل موج 3 بزرگتر تمام می شود. اگر این نقطه نزدیک رتریس معمول فیبوناچی باشد، ارزش بیشتری به این تارگت می دهد. با کسب مهارت در ترید با Macd، می توانید استوک هاستیک، Rsi، اندیکتور مومنتوم و ابزارهای مشابه را کنار بگذارید. این پترن دایورجنس بارها هر روز در بازارهای کالا اتفاق می افتد.

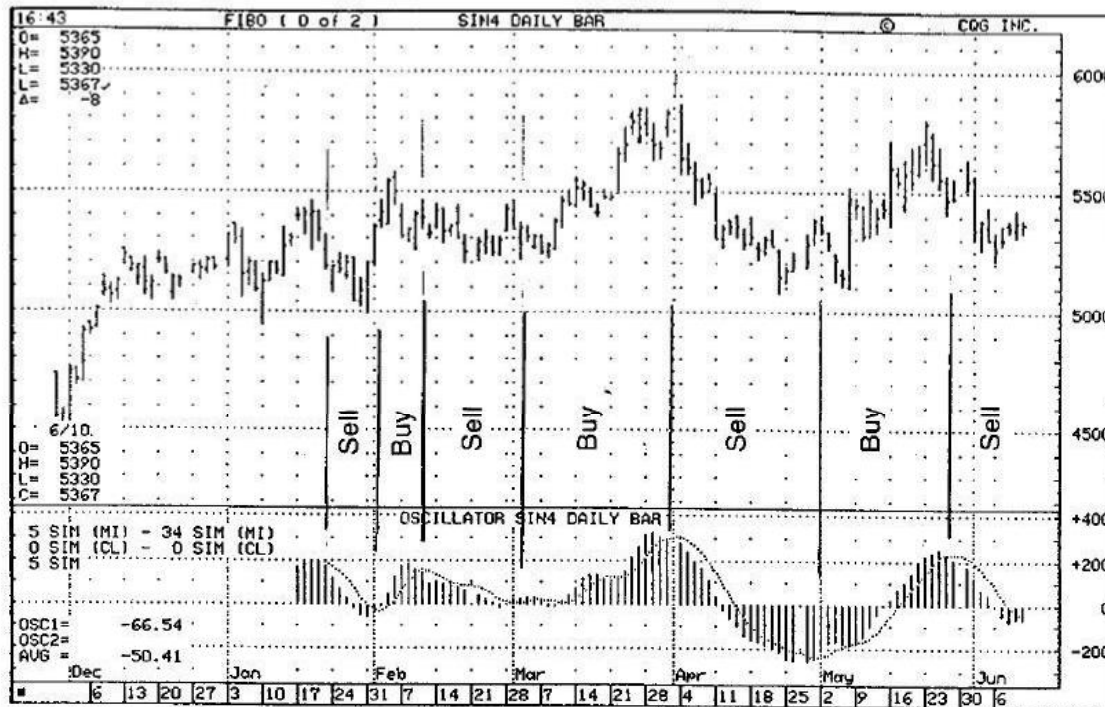


Figure 7-23 Determining the immediate market momentum.

خلاصه

در این فصل ما موج الیوت را بر اساس ریتم اساسی جریان مارکت بررسی کردیم. سپس مشخصات هر موج را به تنهایی آنالیز کردیم و ابزاری را برای خارج شدن از ابهام در شمارش موج در اختیار گذاشتیم. ما بر چهار استفاده Macd 5/34/5 تمرکز کردیم و چارتهایی را برای نشان دادن قابلیت‌های آن نشان دادیم. در فصل بعدی، ساختار زمینه‌ای موج الیوت، که فرکتال است را بررسی خواهیم کرد. ما یاد خواهیم گرفت چطور موج الیوت را ترید کنیم، حتی اگر ندانیم دقیقاً در کدام شماره هستیم

مرو

1. سه قانون شکست ناپذیر آنالیز موج الیوت کدامند؟ کدامیک اغلب شکسته می‌شود؟
2. کدامیک از سه موج تصحیحی بایستی حاوی سه موج باشد؟ کدامیک بایستی حاوی پنج موج باشد؟ کدامیک حاوی سه یا پنج موج است؟ اگر آن پنج موج داشته باشد، نوع تصحیح چگونه خواهد بود؟
3. شایعترین (بنابراین قابل انتظارترین) نسبت فیوناچی در موج c از تصحیح (a) زیگ‌زاگ، (b) صاف، و (c) نامنظم کدام است؟
4. بهترین راه ترید در تصحیح مثلث کدام است؟
5. مشخصات موج‌های 1، 2، 3، 4، و 5 را شرح دهید.
6. کدام اوسیلاتور بیشترین هماهنگی را با MFI دارد؟
7. کدام مزیت MFI امکان استفاده بیشتری از MFI نسبت به یک اوسیلاتور می‌دهد؟
8. کدام اطلاعات حیاتی را خط سیگنال در MACD 5/34/5 می‌دهد؟
9. چهار اطلاعات مهم که MACD برای تریدهای دراز مدت و کوتاه مدت می‌دهد، کدامند؟
10. در چه تعداد از دایورجنس‌ها اکثر ترندها تمام می‌شوند؟

استفاده از فرکتال و لوریج

او گفت: "بیا لبه پرتگاه"

آنها گفتند: "ما می‌ترسیم"

او گفت: "بیا لبه پرتگاه"

آنها گفتند: "ما می‌ترسیم"

او گفت: "بیا لبه پرتگاه"

آنها آمدند

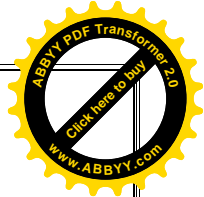
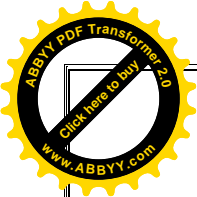
او هل داد

آنها پرواز کردند.

"Guillaume Appolinaire"

اهداف:

1. فهمیدن و تشخیص و ترید کردن پترن‌های شروع کننده و حساس فرکتال



ترجمه کتاب تردینگ کی اس

2. فهمیدن اینکه چگونه لوریج سیگنال تردید می‌دهد یا تردید بالقوه را کنسل می‌کند. تردیدهای بازار کالا و فروشندگان سیستم، مهارت بدست آوردن و بکار بردن هر سیستم تازه را برای تردید دارند. اکثر اوقات، این پیشرفت‌ها سودده نیستند و یک سرگرمی گذرا هستند. در گذشته مارکت از فرمهای مختلف اندیکتورهای تکنیکال گذر کرده که یا از بین رفتند یا استفاده نمی‌شوند، چون سودده نیستند.

مارکت یا فرکتال رفتاری، تغییر رفتاری بارز را نشان می‌دهد. وقتی شما تصمیم می‌گیرید از تردیدی که درضرر است خارج شوید، جایی که شما خارج می‌شوید کاملاً قابل پیش‌بینی است. شما زمانی خارج خواهید شد که درد از دست دادن یک دلار بیشتر، شدیدتر از درد گفتن اینکه اشتباه کردید باشد. آن نقطه فرکتال رفتاری است. فرکتال همچنین زمانی که شما تلفن را برمی‌دارید و به بروکر می‌گوئید او در بگذارد دیده می‌شود. فرکتال رفتاری زمانی که تصمیم می‌گیرید این کتاب را بخوانید تا اینکه کارهای دیگری انجام دهید اتفاق می‌افتد. تصمیم برای تردید همیشه یک فرکتال رفتاری است. برای تردید سودده ما نیاز داریم که فرکتال رفتاری توده تردیدها را تشخیص داده و تغییرات مشرف را در تمایل مارکت بفهمیم. سپس ما می‌توانیم او در خود را قبل یا در اوایل شروع ترند تازه قرار دهیم. ما می‌توانیم فرکتال سایکولوژیکی خودمان را در تمایل شخصی بررسی کنیم، و فرکتال جامعه‌شناسی مارکت را از روی چارت آنالیز کنیم.

پترن شروع کننده فرکتال
پترن فرکتال در چارت (در هر تایم فریم) شامل حداقل پنج کندل متوالی است. کندل وسط باید higher high (یا lower low) نسبت به دو کندل قبلی و بعدی باشد. شکل 1 از سمت راست.

توجه به محدودیت‌های ذیل مهم است:
1. اگر قله کندل برابر وسط یا قله (ته) کندل باشد، بعنوان یکی از 5 کندل شمرده نمی‌شود. چون (higher low) lower high نسبت به کندل وسط ندارد.

2. دو فرکتال مجاور ممکن است در کندل سهیم باشند.
در شکل 1 به پترن A توجه کنید، این فرکتال بالا است و با \wedge نشان داده می‌شود. پترن B هم فرکتال بالا است، اما همچنین فرکتال پائین است. به این علت که دو کندل قبلی و بعدی کندل "inside" هستند. در پترن C هر دو فرکتال بالا و پائین را داریم که در کندل‌ها سهیم هستند. پترن D برای تشکیل فرکتال بالا به شش کندل نیاز دارد. چون کندل پنجم قله برابر با قله قبلی دارد.

در فرکتال بالا، ما فقط به قله کندل نگاه می‌کنیم. در فرکتال پائین، ما فقط به ته کندل توجه می‌کنیم. وقتی که مارکت حرکت صعودی به طرف بالا دارد، قله تشکیل می‌دهد و سپس نزول می‌کند با دو کندل که قله پائینتری دارند، این مارکت تصمیم فرکتال دارد. شکل 2 از سمت راست. مارکت به نقطه A صعود می‌کند و به هر دلیل برمی‌گردد پائین. پایستی مارکت دوباره بطرف بالا حرکت کند و سپس از نقطه A بگذرد، پترن نشان می‌دهد که مارکت نظرش را عوض کرده و تصمیم گرفته از تصمیم قبلی‌اش که توقف در نقطه A بود دست بردارد. یک تیک بالای نقطه A محل خرید است. هر توالی پنج کندل که در آن کندل وسط بلندتر از (یا پائین‌تر) دو کندل قبل و بعد باشد، فرکتال تشکیل می‌دهد، و وقتی فرکتال تشکیل شد، فرکتال باقی می‌ماند. در طی عمرش، این فرکتال چندین رل بازی می‌کند. از زمانی به زمان دیگر می‌تواند فرکتال استارت، سیگنال، یا استاپ باشد. رلی که فرکتال بازی می‌کند بستگی به محلی که در توالی حرکت رو به بالا یا پائین مارکت قرار می‌گیرد دارد.

پایان ترجمه

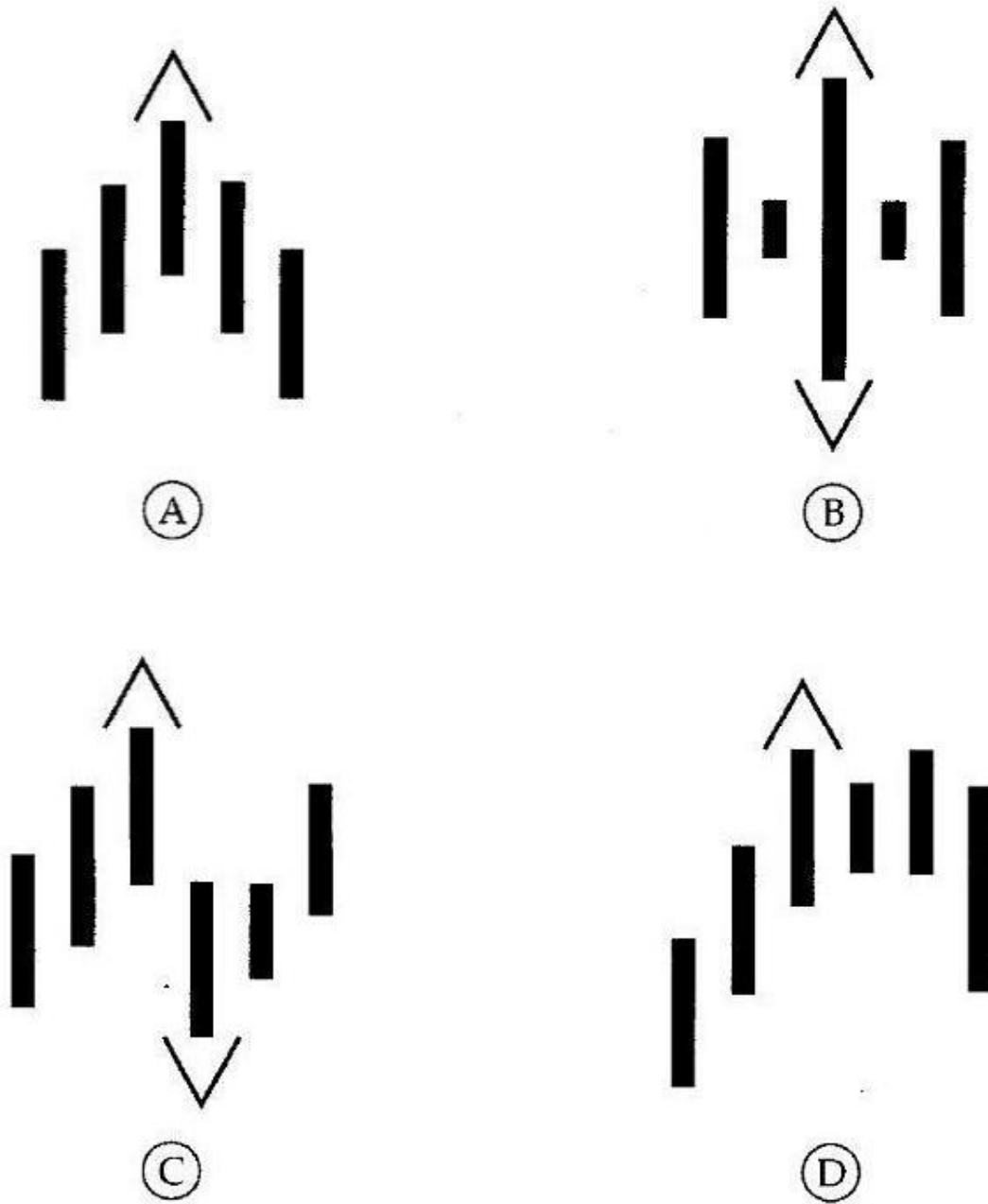


Figure 8-1 Examples of initiating fractals.