

بسم الله الرحمن الرحيم

شکار جریان نقدینگی در بازار



مترجم

آرشی سرابی

ارائه شده در:

کانال تریگر - ها

https://telegram.me/TRIGGER_Ha



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



باز نشر:

چرا الگوهای کندل استیکی بدرستی کار نمی کنند:



الگوهای کندل استیکی و بازو بسته شدن کندل ها روی سطح لول ها در تایم فریم های مختلف از یکساعت تا چهار ساعت به طور گسترده توسط تحلیل گران تکنیکال استفاده میشه ولی اینکه انتظار داشته باشیم این الگوها در این تایم فریم ها یک رفتار مشخص را داشته باشه به خاطر اینکه در یک زمان خاصی از روز در یک موقعیت خاص بودند یک توهم بیشتر نیست. باز و بسته شدن کندل ها روی لول ها وابسته به زمان است ولی این تایم فریمها به قدری کوچک هستند که فرصت ورود و استاپ و تیک گذاشتن از دست می رود به هرحال یکی از مهمترین مسایلی که تحلیل گران تکنیکال در رابطه با کندل ها توجه می کنند صعودی و نزولی بودن ان و جهت حرکت بازار و سایه و بدنه کندل است.

شکل بالا:

غالباً می بینید خریداران یا فروشندگان در پایین یا بالای چارت وارد نمی شوند بلکه در وسط چارت یک حجم بزرگ و شتابداری از خریداران یا فروشندگان وارد بازار می شوند که این سطوح در تجزیه و تحلیل چارت و تعیین حرکت آینده ان نقش بسیار مهمی را ایفا می کنند.

یک جنگ دائمی بین احساسات توده تریدرها و بانک ها وجود دارد. احساسات بازار غالباً در خلاف جهت لیکوئیدیتی یا نقدینگی بازار است. بانک ها مدام در حال تغییر جهت دادن به سرمایه ها برای رساندن سرمایه توده مردم به سطوح خود و سپس ورود سرمایه بانک ها میباشد و نتیجه این جنگ زدن استاپ تریدرها و حرکت بازار در جهت حرکت بانک ها می باشد.

زمان بسته شدن یک تایم فریم بزرگ (روزانه یا هفتگی یا ماهیانه) نقدینگی در کمترین میزان خود قرار دارد. در موقعی که نقدینگی بازار کم است (مثلاً در شب که تایم فریم روزانه بسته می شود) بانک ها به بستن پوزیشن های خود اقدام می کنند. بنابراین در زمان بسته شدن کندل روزانه یا هفتگی یا ماهیانه به راحتی می توانید چگونگی دستکاری قیمت و دستکاری سطوح را در طی روز یا هفته یا ماه ببینید

(مترجم: منظور این است که اگر به تایم فریم های پایینتر بروید می بینید که به طور مثال بازار در ادامه روند قبل حرکت کرده ولی بسیاری از تریدرها که در جهت روند ترید کرده بودند فریب حرکات بانکها را خورده اند و بجای اینکه سود کنند ضرر کرده اند شاید بارها با خود گفته اید که اگر پوزیشن خود را نمی بستم سود فراوانی می کردم زود بستن پوزیشن شما ناشی از جنگ روانی است که بانک ها به راه می اندازند شما طوری در بازار حرکت می کنید که آنها می خواهند . منظور از دستکاری سطوح این است که بارها دیده اید نمودار قبل از رسیدن به یک سطح مهم بر می گردد یا حتی یک سطح مهم را به صورت صحیح می شکند ولی شکست ادامه پیدا نمی کند و نمودار بر میگردد).

اما جنگ روانی که بانک ها به راه می اندازند غالباً توسط اخبار فندامنتال است من همیشه به پیش بینی بانک های بزرگ درباره ارزها و فلزات گوش می دهم و زمان اعلام این خبرها را در نظر می گیرم. بطور مثال بلومبرگ در زمان اخرفته دو مقاله منتشر می کند راجع به اینکه دلار بسیار ضعیف شده است در برابر ارزهای کالایی (یون و فرانک و ین) و همچنین اگر نمودار یورو را ببینیم یک روند صعودی را میبینیم که تقویت یورو و ضعف دلار را نشان می دهد از طرفی تحلیل هایی که بلومبرگ و بانک ها ارائه میدهند بر ادامه روند تقویت یورو و تضعیف دلار دلالت دارد. اما چه اتفاقی می افتد؟ در هفته بعد بر خلاف تحلیل آنها یک کندل نزولی در یورو شکل می گیرد و دلار تقویت می شود .

اما بانک ها و بنگاههای خبری چه زمانی اخبار دروغ منتشر می کنند ؟ و چرا باید اینکار را بکنند ؟ دلیل ان واضح است بطور مثال در یورو روند صعودی بوده و نقدینگی لازم برای حرکت صعودی وجود نداشته . و ادامه روند صعودی ممکن نبوده و از لحاظ تکنیکالی در سقف و اشباع بودیم و از طرفی سفارشات خرید کم بوده پس بانک ها به این نتیجه رسیدند که ادامه حرکت صعودی ممکن نیست . پس باید اقدام به فروش بکنند برای اینکه بانک ها سفارش فروش بگذارند احتیاج به خریدار به اندازه کافی دارند که به دلایلی که بالا گفتم (در سقف و اشباع بودن و نبود سفارشات کافی) خریدار نیست پس با انتشار اخبار غیر واقع خریداران را به سمت بازار جلب می کنند . اما این کار همیشه انجام نمی شود و در مواقع کمبود نقدینگی انجام می شود. کمبود نقدینگی در انتهای کندل دیلی و هفتگی رخ می دهد.



بازی نقدینگی و ایجاد نقدینگی را می توانید قبل از FOMC و NFP مشاهده کنید . هنگامی که در روند صعودی در نمودار روزانه کمبود نقدینگی مشاهده می شود درست در نقطه اوج و حد سود یک کندل نزولیزده می شود و تا سه روز قیمت نمی تواند بالای لول اصلی بسته شود تا تریدرها فکر کنند روند برگشته و وارد پوزیشن فروش شوند و نقدینگی لازم جهت صعود بعد از اعلام خبر FOMC بوجود بیاید و یک جهش صعودی بعد از خبر FOMC بوجود میاید و نمودار به سمت سقف مهمی حرکت می کند.



حال به نمودار هفتگی نگاه ببندازید و این صعود را انجا بهتر ببینید . البته بعد از این صعود دوباره جریان سازی شروع شده و یک کندل نزولی شکل گرفته است



حال به دو شکل زیر در تایم فریم یکساعته و چهارساعته توجه کنید درست در زمان ریزش بازار زمانی که نقدینگی جهت ریزش کم است چند کندل صعودی زده می شود تا خریداران جذب بازار شوند و نقدینگی جهت ریزش ایجاد شود



Figure 3.0.

EUR/USD Quarterly time frame.

اساسی ترین نکته این است که در بررسی جریان نقدینگی همیشه به یک تایم فریم بالاتر رجوع کنید تا در دام کندل های برگشتی جعلی نیافتید.

حال متوجه شدید چرا یک الگوی کندلی کار نمی کند؟ شما یک پین بار روی یک لول اصلی میبینید و انتظار برگشت بازار را از روی ان لول دارید و حتی 2 یا 3 کندل هم تایید کننده برگشت هستند اما روند بر نمیگردد و به حرکت خود ادامه می دهد تا استاپ شما را بزند دلیل ان این است که بانک ها برای جذب نقدینگی شما را در دام انداخته اند . چند روز مانده به اخبار اصلی از انجایی که بانک ها به اخبار دسترسی دارند چنین سناریو سازی ای را انجام می دهند پس یکی از موافعی که نباید بر اساس کندل ها معامله کنید و سیگنال بگیرید همین زمان است.

ترند لاین و مووینگ اوریج:

خط روند و مووینگ بصورت گسترده ای توسط تکنیکال کارها مورد استفاده قرار می گیرد. در اکثر تحلیل ها که میبینید خط روند و مووینگ اوریج وجود دارد اینها خطوطی هستند که به صورت گسترده توسط بانک ها مورد استفاده قرار می گیرند **(برای استاپ زدن نه ترید بر اساس انها)**. نادیده گرفتن این خطوط در تکنیکال بسیار کار اشتباهی است **(این به معنی ترید بر اساس انها نیست)**. منافع مشتریان بانک ها و تریدرها در تضاد با منافع بانک ها قرار دارد و انها سعی در ایجاد ذهنیت مثبت در تریدرها راجع به خط روند و مووینگ ها دارند تا سود کنند پس انها مدام در 50 درصد موارد سعی دارند به تریدرهایی که بر این اساس ترید می کنند ضرر بزنند و استاپ انها را بزنند. اکثرا بانک ها را میبینید که با اسپایک به خطوط روند اصلی و مووینگ های بزرگ حمله کرده اند و استاپ افرادی که انجا پوزیشن قرار داده اند را زده اند. در بعضی موارد هم میبینید که حرکت به گونه ای بوده که به خط روند یا مووینگ احترام گذاشته در اینگونه موارد انها قصد بازار سازی و هدایت جریان سرمایه در مسیر دلخواه خود دارند.

روش جمع کردن نقدینگی:

شما ممکن است در چارت حرکات نمودار را ببینید که به طور نا منظم اتفاق میافتد و شما می توانید دو یا سه خط روند خوب در چارت پیدا کنید. اما چیزی که در واقعیت در حال اتفاق افتادن است این است که بانک ها در حال فشرده کردن قیمت بوسیله گذاشتن سفارش های متعدد در یک فاصله قیمتی کم هستند (CP).

میتوانم یک مثال بزنم:

بانکها قصد گذاشتن یک سفارش خرید بزرگ یک بلیون دلاری را دارند و انها به قیمت یک حرکت سریع 10 پیپی می دهند و روی قیمت یک حرکت نزولی ده پیپی می گذارند و همگان فکر می کنند ریزش بزرگی با حرکت پر شتاب آغاز شده و شروع به گذاشتن سفارش های فروش به مقدار نیم بلیون می کنند بانک ها مجدد وارد می شوند و با یک سفارش خرید یک و نیم بلیون دلاری نمودار را به نقطه شروع بر می گردانند یعنی با این کار حجم پوزیشن خود را افزایش داده اند بدون اینکه قیمت مسافت طولانی از محل دلخواهشان فاصله گرفته باشد. اما پرایس اکشن کاران خبره با دیدن سفارش فروش اول دقیقا حرکت در خلاف جهت را پیش بینی میکنند.

بانک ها بر اساس خط روند یا مووینگ ترید نمی کنند انها بر اساس احتمالات و جریان نقدینگی ترید می کنند. انها به دنبال حمایت و مقاومت های ضعیف می گردند که پشت انها جریان نقدینگی برای رسیدن به اهدافشان وجود دارد و در ان اطراف می توانند بازار سازی کنند.

به شکل زیر توجه کنید میبینید که یکسری بار اول قیمت به مووینگ 100 برخورد داشته و برگشته ولی برای بار دوم ان را به صورت جعلی شکسته و استاپ تریدرها را زده و نمودار بر گشته





شما می توانید در یک روند خوب وارد ترید شود و بعد از نقطه برخورد و چرخش بازار پوزیشن بگیرید. شما می توانید یک بازار خوب پیدا کنید که به ازای هر قله یک دره داشته باشیم و به ازای هر HH یک LL سپس با استفاده از فیبوناچی نسبت های 50 یا هر نسبت دیگری که در آن جفت ارز خوب جواب می دهد را پیدا کنید و هنگامی که نمودار زیر آن نسبت رفت وارد ترید شوید و هر وقت علامت های برگشت در HH یا LL دیدید از بازار خارج شوید. یا در یک بازار رنج در سقف بفروشید یا در کف بخرید یا منطقه رنج را به چهار قسمت تقسیم کنید و ترید کنید (یعنی بازار رنج را شبیه یک اندیکاتور نوسان نما کنید و بر آن اساس ترید کنید). آن چیزی که شما برای سود کردن بیشتر از هر چیزی احتیاج دارید مدیریت سرمایه است.

ممکن است قیمت سریع حرکت کند و از مووینگ یا خط روند عقب بماند انگاه انقدر قیمت درجا میزند که مووینگ یا خط روند به آن برسد.

در روندها یا میانگین متحرک ها کجا حد ضرر یا حد سود قرار دهیم؟ گذاشتن حد سود و حد ضرر یک چیز کاملا شخصی و ذهنی است. اما سوال اساسی این است که قیمت چقدر از سطح یک لول ممکن است فراتر می رود و نقطه برگشت نمودار کجاست. اینکه تیک پروفیت و یا استاپ لاس خود را نزدیک مووینگ یا خط روند بگذارید تا حد بسیار زیادی به تجربه شما بستگی دارد. اما چرا از پرایس اکشن و تجزیه تحلیل پرایس برای گذاشتن تیک پرافیت و استاپ لاس استفاده نکنیم.

یکی از مهمترین کارهایی که باید در رسم خطوط روند انجام داد این است که با دقت ببینیم که کجا بیشترین برخورد به خط انجام شده و در چه نقطه ای ورود به پوزیشن زیاد انجام شده است و در آن نقطه خط روند رسم کنیم و در تایم فریم پایینتر همان خط روند را دقیقتر ترسیم کنیم مهمترین نکته در رسم خط روند این است که بدنه کندل ها نباید از آن عبور کرده باشد.



خط روندی که برای بار اول بعد از تشکیل خط روند به آن برخورد انجام می شود می شود و یا مووینگی که مدت های زیادی به آن برخورد انجام نشده احتمال بسیار زیادی بعد از برخورد نمودار به آن برگشت اتفاق می افتد و این ستاپی است که من زیاد استفاده می کنم.

(یک خط روند در نمودار دیلی یا ویکیلی یا چهارساعته که دوبار و فقط دوبار قیمت به آن برخورد داشته پیدا کنید و با رسیدن قیمت به یک لول قوی افقی دیدن کندل برگشتی و تایید کندل منتظر رسیدن نمودار به خط روند و برخورد سوم باشید مترجم)

اگر قیمت خط روند را بشکند و 20 تا 40 پیپ از آن فاصله بگیرد و برگشت را انجام دهد باید دوباره خط روند را بر اساس شرایط جدید رسم کرد. در پنجاه درصد موارد قیمت از خط روند ترسیمی قبلی بر میگردد بنابراین می توانید موقعی که قیمت نزدیک خط روند شد پوزیشن خود را ببندید یا قسمتی از سود خود را

ببندید خوب به خط روند و شکست ان دقت کنید که ایا شکست جعلی است و بعد از بیست تا 40 پیپ دوباره قیمت بر می گردد یا شکست واقعی است. نکته ای که نباید فراموش شود این است که نقاطی که روی خط روند رسم می شود و انتظار برگشت یا شکست از ان نقاط را داریم باید دقیقا منطبق بر خطوط حمایت و مقاومت افقی باشد واگر نه هیچ ارزشی ندارد.



استاپ هانتینگ یا شکار استاپ در فارکسی:

در این چند روز بازخوردهای زیاد و خوبی در وبلاگ در مورد اینکه چرا برخی از بانک ها یا بروکرها اقدام به استاپ هانتینگ می کنند و چطور می توانیم با استاپ هانتینگ آنها ما سود کنیم دریافت کردم

بسیاری از تازه واردان که دنبال مقصر می گردند تا ضرر های خود را گردن آنها بیندازند یا حتی تریدرهای قدیمی تر موقعی که ضرر می کنند این مساله را عنوان می کنند که بروکر استاپ ما را زده است اما آیا این مساله واقعیت دارد؟ اگر بطور خلاصه بخواهم جواب بدهم باید بگویم خیر.

زدن استاپ لاس برای بروکر بسیار پرریسک است چون با حرکت به سمت استاپ ممکن است همزمان نمودار حرکاتی را انجام دهد که رهایی از این مرحله برای بروکر بسیار سخت باشد و ثانیاً اینکار برای بروکر عواقب قانونی سنگینی دارد که هر دو اینها برای بروکر بسیار ناخوشایند است. بنابراین بروکرها اینکار را انجام نمی دهند.

به هر حال اگر بروکری بخواهد استاپ هانتینگ کند با یکی از دو سناریو زیر انجام می دهد:

سناریو اول آن است که قیمت را با چند کندل به جایی میبرد که بیشترین استاپ ها در آن جا قرار دارد و بعد از زدن استاپ بعضی از مشتریان خود نمودار برمی گرداند و روال طبیعی خود را از سر می گیرد که به راحتی تریدرها می توانند با مقایسه نمودار بروکر خود با سایر نمودار بروکرها متوجه این تناقض شوند.

سناریو دوم آن است که برای تمام مشتریان خود داده سازی کند و کندل های اشتباه برای زدن استاپ بفرستد که در موقعیت بدی ممکن است بروکر قرار گیرد.

استاپ هانتینگ چیست؟

1- اول آنکه تصادفی است و واقعیت ندارد.

2- دوم آنکه اتفاقی است و واقعیت ندارد .

3- ونهایتاً برای بار سوم آن را حرکتی توسط بروکر بدانید.

شما بارها میبینید که نمودار استاپ شما را میزند و سپس در جهت پیش بینی شما حرکت می کند و این را ممکن است دسیسه و یا دستکاری بروکر بدانید . یا افراد تازه کار را ببینید آنها دقیقاً مطابق آنچه در کتابها خوانده اند عمل می کنند و استاپ خود را پشت آخرین سویینگ میگذارند . شکل زیر را ببینید. یک قانون ساده در تجارت وجود دارد **یک نفر باید ضرر کند تا طرف دیگر سود کند**. بانک های بزرگ مدام دنبال جریان سفارشات در چارت ها میگردند کاری که باید شما انجام دهید و دنبال جریان سفارش در چارت باشید و گرنه مدام با خوردن استاپ مواجه خواهید شد نه بدلیل استاپ هانتینگ توسط بروکرها بلکه بدلیل اینکه بانکها دنبال سفارشات انباشته شده پشت سطوح هستند.



بهرتر است بجای اینکه تمرکز کنید روی بروکر و مقصر بروکر را بدانید تمرکز خود را روی این بگذارید که استاپ خود را کجا بگذارید که توسط بانک ها شکار نشود.

چند بار تا بحال اتفاق زیر برای شما افتاده است؟ مسلما بارها و بارها

مثال :

شما وارد پوزیشن سل در پوند روی عدد 1.55 می شوید و با نسبت ریسک به ریوارد 1 به 3 استاپ خود را پشت یک مقاومت روی عدد 1.53 می گذارید به محض اینکه دکمه سل را فشار می دهید بازار به سمت استاپ شما حرکت می کند و استاپ شما را میزند و بعد از آن به سمت تیک پرافیتی که شما گذاشته اید حرکت می کند. و شما فقط نظاره گر خوردن استاپ خود و ضرر کردن خود هستید و دیدن اینکه با وجود اینکه پیش بینی و تحلیل شما درست بوده است ضرر کرده اید.

استاپ هانتر توسط چه کسانی انجام می شود؟

بانک ها یا موسسات مالی بزرگ که توانایی حرکت دادن چارت را به سمتی که دلخواه آن موسسه یا بانک است دارد تا در قیمت خوب و پایین بخرد و در قیمت بالاتر بفروشد و از این راه کسب سود به خاطر داشته باشید که بانک هایی که استاپ هانتر می کنند در جهت معکوس برای دستیابی به نقدینگی پوزیشن می گیرند .

به یاد داشته باشید برای هر خریداری باید یک فروشنده وجود داشته باشد و باید قانون عرضه و تقاضا دقیقا رعایت شود اگر به ازای هر خریدار یک فروشنده نباشد نمودار به سمت بالا حرکت می کند تا یک فروشنده در آن جا پیدا کند و سفارش خرید را با آن سر به سر کند و دلیل حرکت بازار به سمت بالا یا پایین هم همین است

وقتی اکثر معامله گران در بازار (صعودی یا نزولی) پوزیشن هاشون در یک جا قرار گرفته باشد یا بطور مایل چیده شده باشد کار برای افرادی که استاپ هانتر می کنند راحتتر می شود. موقعی که تمایلات شدید خرید و فروش در بازار وجود دارد و بازار احساسی عمل می کند مکانی که اکثر تریدرها استاپ خود را می گذارند مشخص می شود.

(مثلا فرض کنید قیمت به یک لول بزرگ خورده و ان را شکسته با قدرت زیاد اکثریت بازار با دیدن شکست قوی سطح وارد پوزیشن خرید می شوند و استاپ خود را پشت ان سطح می گذارند خوب شناخت این روند احتیاج به مشاهده حجم ندارد و با اندکی تجربه مشخص می شود. شخصا منتظر برگشت یا شکست سطوح می مانم و بعد از استاپ هانتر وارد ترید می شوم و اگر استاپ هانتر را نبینم وارد هیچ تریدی نمی شوم چون بدون اینکه استاپ هانتر دیدن وارد ترید شدن را قمار می دانم؛ مترجم).

استاپ هانتر طور دیگری هم می تواند اتفاق بیافتد که ما بعنوان اینگلف می شناسیم یعنی یک حرکت سریع که به صورت شادو دیده می شود به یک سطح انجام شود و سفارشات واقع در ان سطح پاک شود سپس نمودار در همان جهت بدون وجود سفارشات مخالف جهت راحتتر حرکت کند



نمودار یورو در چارت یکساعت یک استاپ هانت کلاسیک





نمودار کد در تایم یکساعته همانطور که می بینید در دوطرف ساپورت و رزیستنس استاپ هانت انجام شده



نمودار یورو پوند در تایم یکساعت و استاپ هانت زیر خط ساپورت

همانطور که در شکل های بالا میبینید دلیل استاپ هانت شدن این است که اکثر تریدرها استاپ خود را در جایی قرار داده اند که قابل پیش بینی است . با دانستن موضوعات بالا می توانید استراتژی ترید خود را قویتر کنید

ارائه شده در:

کانال تریدرها

https://telegram.me/TRIGGER_Ha