

جزوه آموزشی پترن های هارمونیک

بهزاد بهزادی



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس 

باز نشر :

دوره آموزشی پترن های هارمونیک :

کتاب های مورد استفاده در این دوره عبارتند از:

Fibonacci Trading by Carolyn Boroden

در کتاب فوق که در سال 2008 به چاپ رسیده است، سه استراتژی مورد بررسی قرار می گیرد.

Fibonacci for Active Trader by Derrik S. Hobbs

این کتاب نیز شامل ده استراتژی می باشد که به طور کامل مورد بررسی قرار خواهد گرفت.

The Harmonic Trader by Scott Carney

این کتاب مهمترین کتاب در مورد پترن های هارمونیک می باشد که شامل دو جلد است و در این دوره مورد بررسی قرار می گیرد.

سبک خانم کارولین برودن:

ابتدا سبک کارولین برودن را در این دوره مورد بررسی قرار خواهیم داد. خانم برودن معتقد هستند که شمارش الیوتی نوعی تحلیل ذهنی افراد می باشد و به همین دلیل آنچه در سبک خانم برودن اهمیت دارد سویینگ های واضح بازار می باشد و اصطلاحا آنچه اتفاق افتاده و کاملا ملموس است. بنابراین ایشان اعتقاد چندانی به شمارش الیوتی ندارند و اصل بازار را همین کف ها و سقف هایی می دانند که شکل گرفته است. این روش نکات مثبت و منفی دارد که در آینده به آن اشاره خواهیم نمود. اما آنچه مسلم است ترکیب این روش با سبک الیوت رابرت ماینر، روشی قدرتمند را در اختیار یک تریدر قرار می دهد.

خلاصه کلام: در این روش تکنیک های فیبوناچی را روی سویینگ ها و سقف ها و کف های اصلی پیاده می کنیم بدون اینکه شمارشی از لحاظ الیوتی انجام داده باشیم.

تکنیک های زمانی استفاده شده توسط خانم برودن همان فیبوناچی تایم هایی هستند که در سبک الیوت ماینر مورد استفاده قرار می گیرد. تنها نکته قابل توجه در این خصوص این است که در زمان استفاده از DTP پس از کشیدن و اصلاح سویینگ های اصلی در نرم افزار داینامیک تریدینگ برای شناسایی کلاستر های زمانی به جای انتخاب نوع موج گزینه Default را انتخاب می نماییم، چون در اینجا عملا شمارش امواج صورت نمی گیرد.

خانم برودن به طور کلی سه سبک دارد که در این دوره این سبک ها مورد بررسی قرار می گیرد. این سبک ها عبارتند از:

استراتژی اول: استراتژی کلاسترها

این استراتژی که برای بر روی تمامی تایم فریم ها قابل پیاده سازی می باشد، شناسایی سویینگ های مختلف و پیاده نمودن تکنیک های مختلف فیبوناچی بر روی سویینگ های اصلی جهت شناسایی نواحی و کلاستر ها می باشد.

استراتژی دوم: استراتژی سیمتری یا تقارن

در این استراتژی بر اساس تکنیک پروجکشن صد فیبوناچی یک استراتژی بسیار قدرتمند معرفی شده است که به تفصیل آنرا در این دوره توضیح خواهیم داد.

نکته: روش های خانم برودن، به خصوص در مواقعی که شمارش الیوتی چندان واضحی نداشته باشیم بسیار کارآمد می باشد. این روش ها برای تمامی تایم فریم ها قابل استفاده می باشد و در صورت ترکیب با الیوت روشی قدرتمند می شوند.

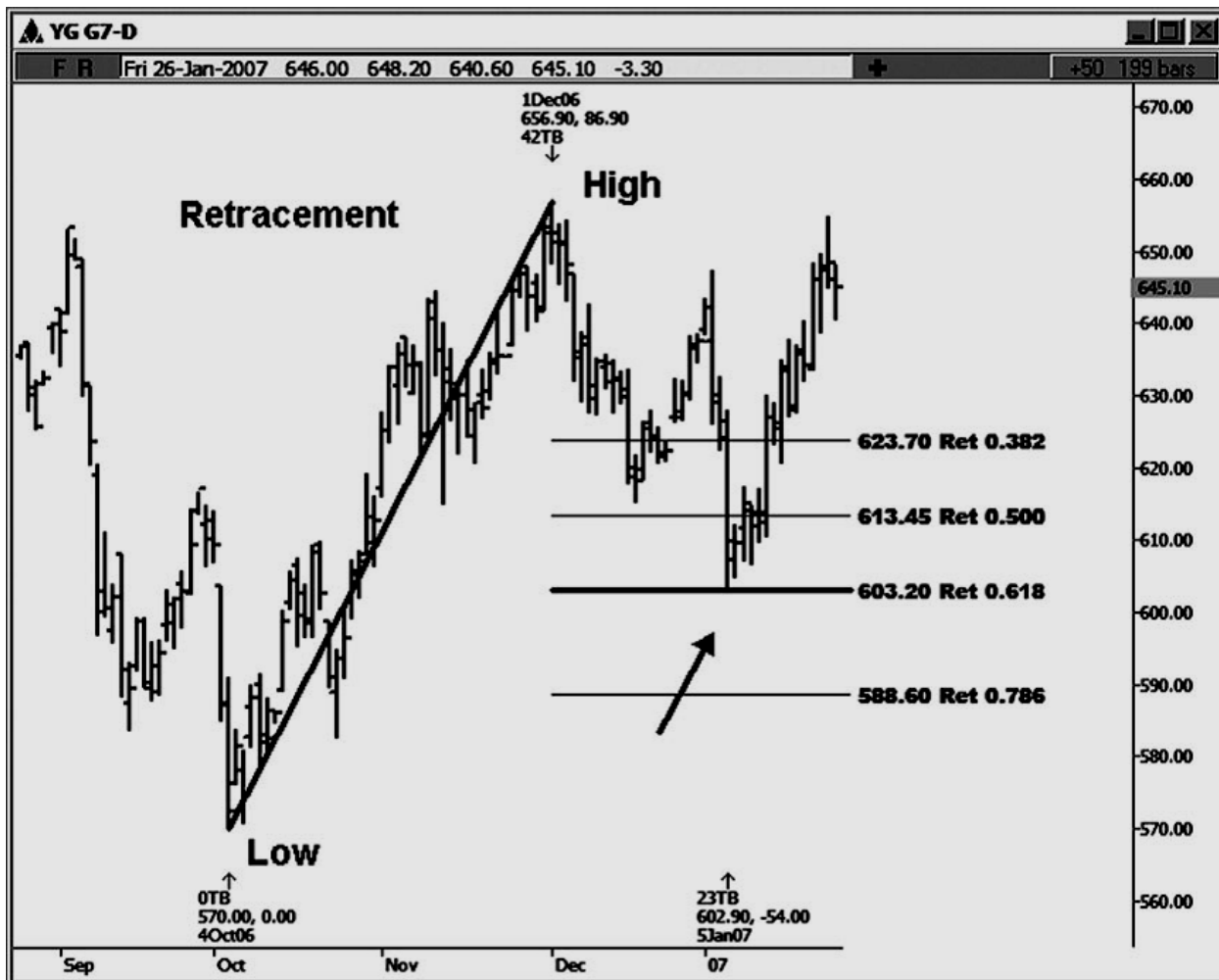
استراتژی سوم: پترن های دو مرحله ای یا Two Step Pattern

این پترن ها در یک حالت خاص شبیه پترن گارتلی و مشابه موج چهار الیوت می شوند و در تمامی تایم فریم ها قابل استفاده هستند.

علاوه بر سه استراتژی فوق یک **استراتژی چهارم** هم داریم که در واقع همان استراتژی دوم می باشد که در تایم فریم های کوچک مانند سه دقیقه و پنج دقیقه قابل استفاده می باشد، با این تفاوت که به دلیل کوچک بودن تایم فریم در اینجا از تعدادی فیلتر و تریگر مخصوص خانم برودن استفاده می نماییم.

پس از اعمال این چهار استراتژی در نهایت فیبوناچی تایم نیز روی چارت ها پیاده می شود تا کلاستر های دقیق تری داشته باشیم.

نکته: داشتن پلان کار برای یک تریدر بسیار ضروری و مهم می باشد. یک نمونه از پلان کار توسط استاد امیری در سایت قرار داده می شود. تمام تریدر های بزرگ دنیا پلان کاری دارند که به صورت مدام آنرا آپدیت می نمایند.

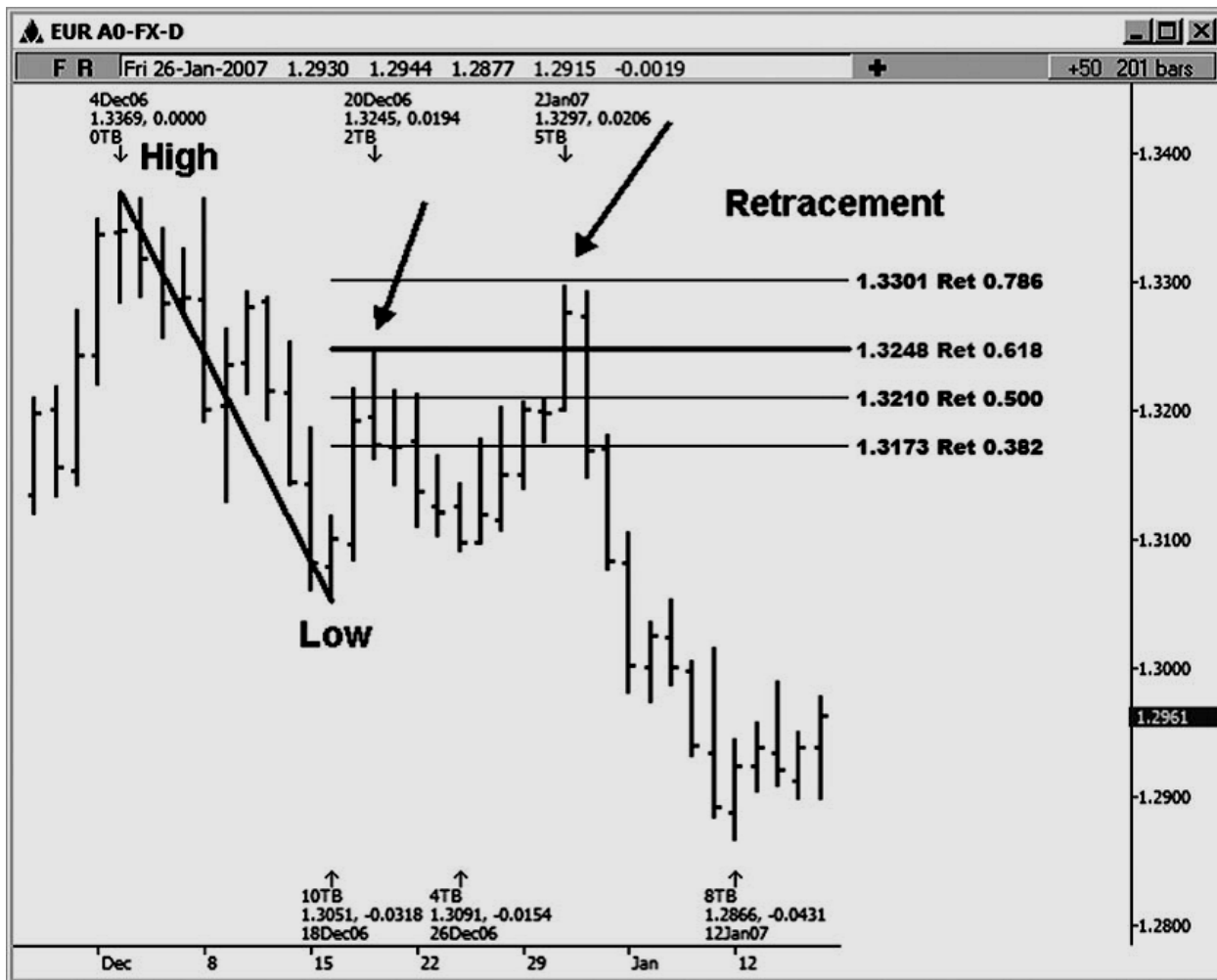


این اسلاید مروری بر تکنیک های فیبوناچی ریتریسمنت می باشد.

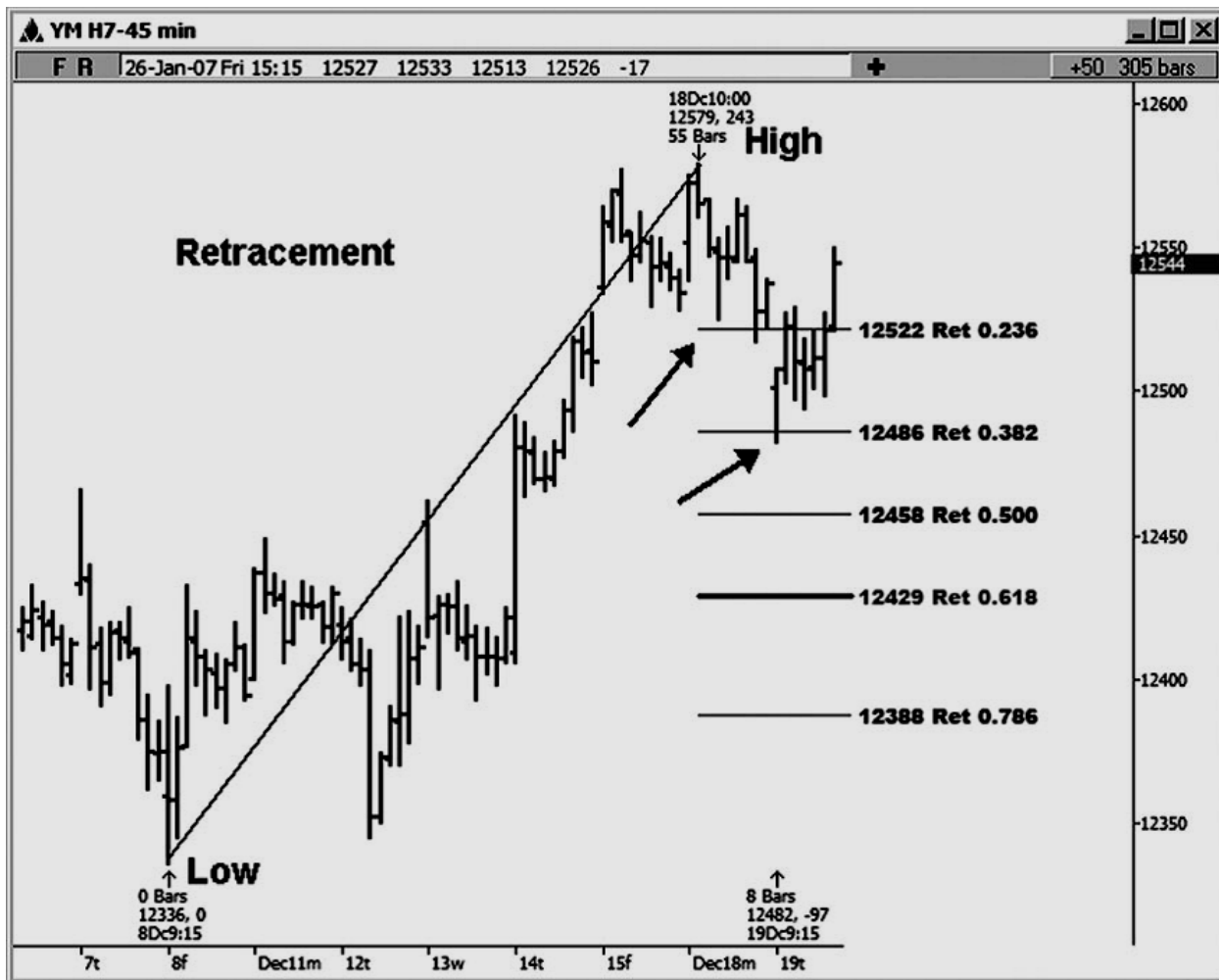
کاربرد فیبوناچی ریتریسمنت: از این تکنیک جهت شناسایی انتهای کارکشن ها یا انتهای حرکات مقطعی بازار که خلاف جهت روند اصلی بازار هستند، استفاده می شود. و با شناسایی انتهای این حرکات مقطعی نسبت به گرفتن سیگنال هم جهت روند اصلی اقدام می کنیم. (صفحه 11)

نکته: در بین نسبت های فیبوناچی ریتریسمنت، نسبت های 62 و 79 اهمیت کلیدی تری دارند. در بعضی از ارز ها مانند پوند نسبت 79 اهمیت بیشتری از نسبت 62 دارد.

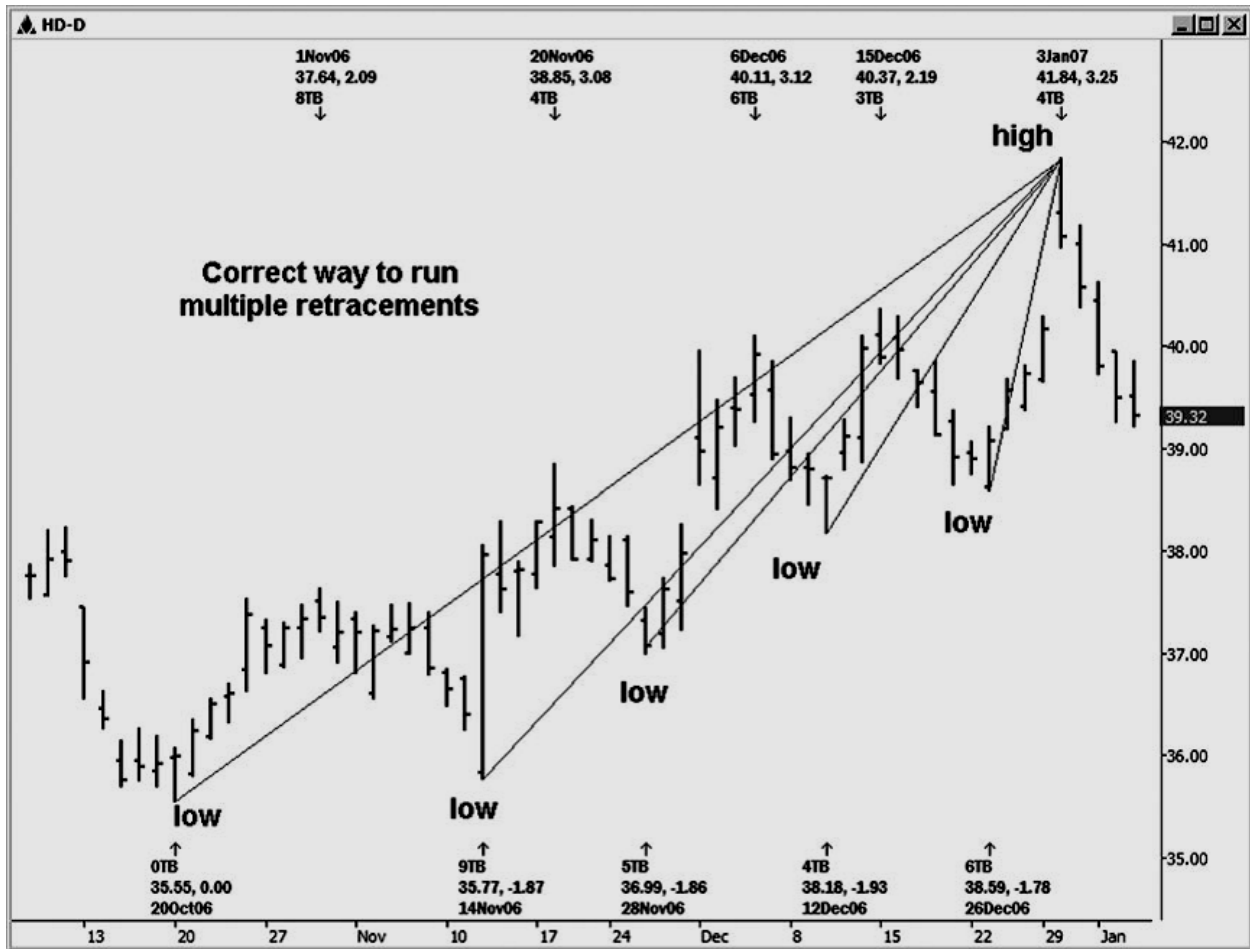
سایت خانم برودن: www.fibonacciqueen.com



این اسلاید مثال دیگری از بکارگیری تکنیک فیبوناچی ریتریسمنت می باشد. همانطور که مشاهده می شود نسبت های 62 و 79 نسبت های پر اهمیتی می باشند. (صفحه 12)



در این اسلاید بازگشت قیمت از روی نسبت 38 درصد فیبوناچی ریتریسمنت اتفاق افتاده است. (صفحه 14)

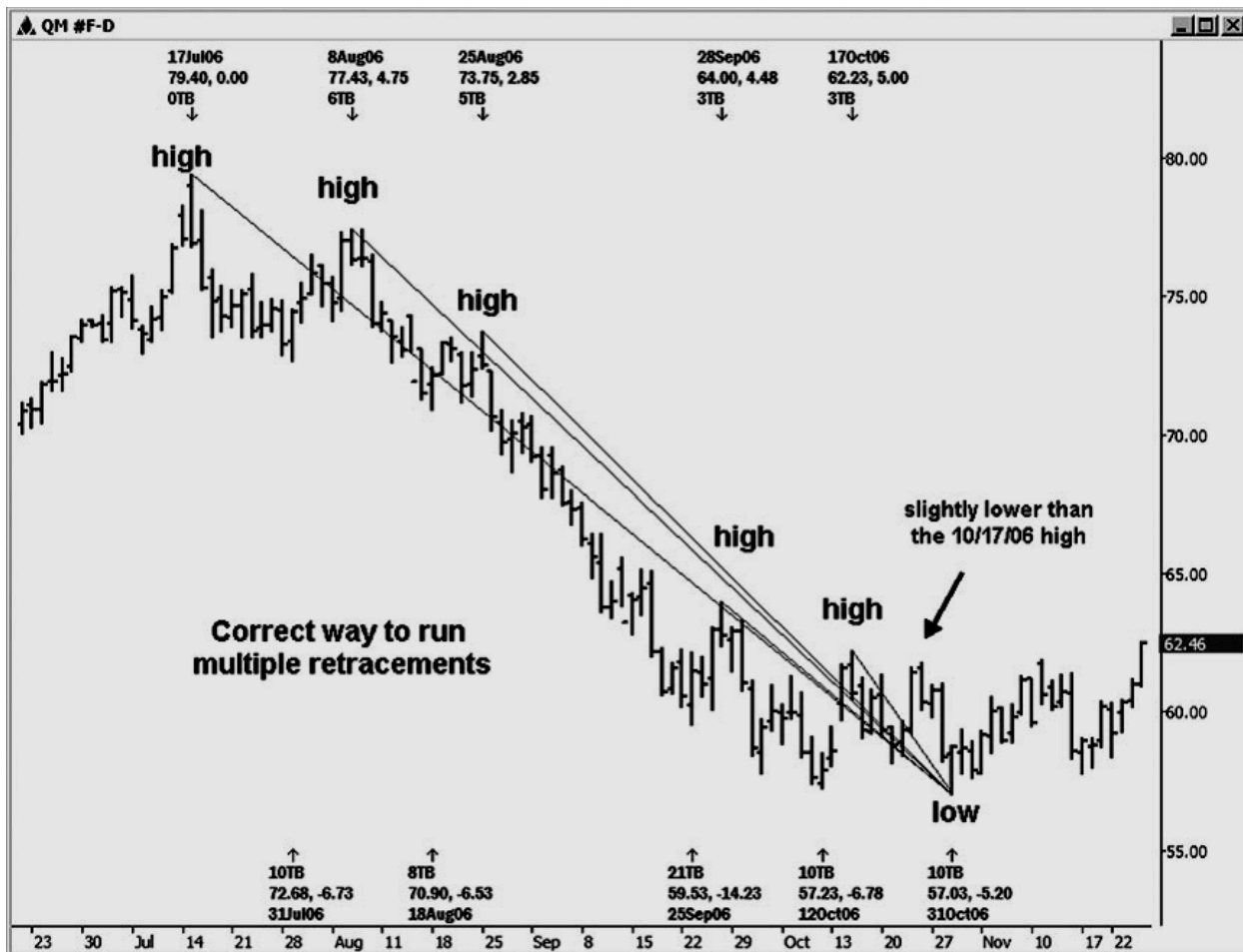


نحوه ترسیم صحیح ریتریسمنت های مختلف:

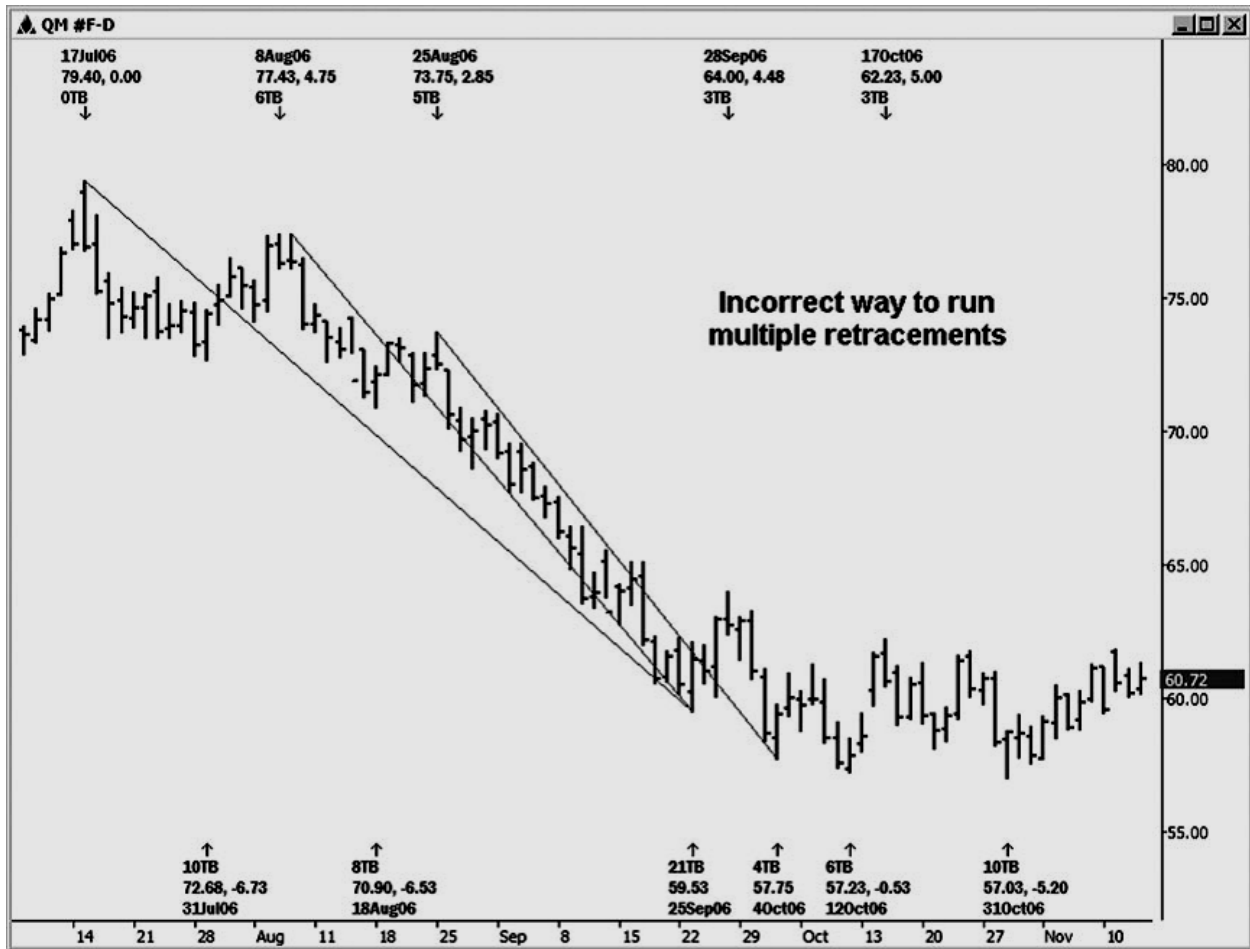
در یک روند صعودی برای شناسایی کلاسترهای معتبر از تکنیک فیبوناچی ریتریسمنت بر روی سویینگ های واضح استفاده می کنیم. همانطور که می بینید در یک روند صعودی کف ها متغیر هستند اما سقف واحد و بالاترین سویینگ موجود می باشد. در یک روند نزولی سقف ها متغیر هستند و کف واحد می باشد. در شکل فوق نحوه صحیح ترسیم این تکنیک بر روی سویینگ های واضح در یک روند صعودی به نمایش گذاشته شده است. (صفحه 23)



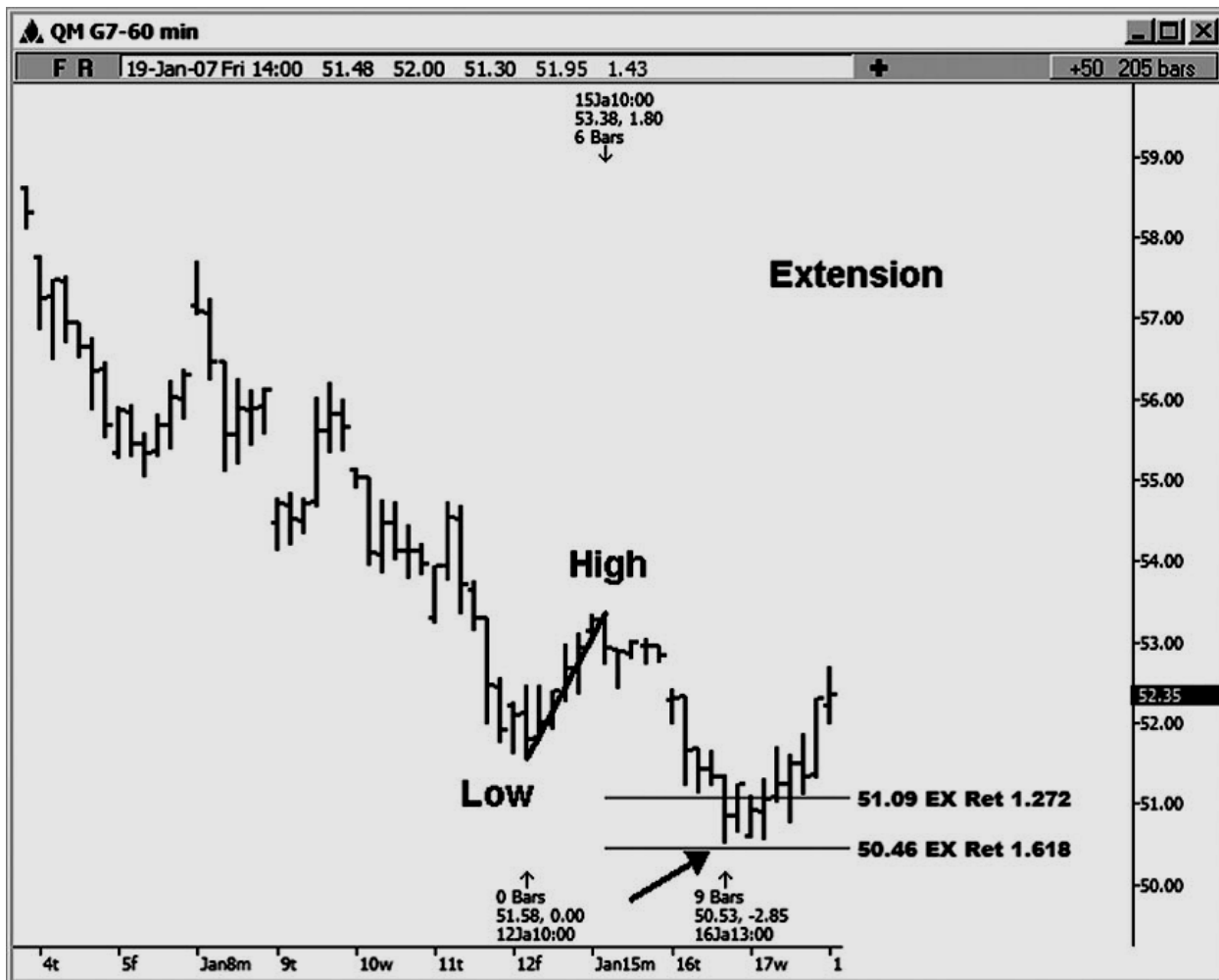
این ترسیم نادرست می باشد چرا که سقف ریتریسمنت در یک روند صعودی به اشتباه گرفته شده است، در نتیجه کلاسترهای بدست آمده با ترسیم ریتریسمنت های مورد نظر بی ارزش می باشد. در ترسیم تکنیک فیبوناچی در یک روند صعودی باید High اصلی در نظر گرفته شود. (صفحه 24)



این اسلاید نحوه ترسیم تکنیک های فیبوناچی را در یک روند نزولی نمایش می دهد. (صفحه 26)



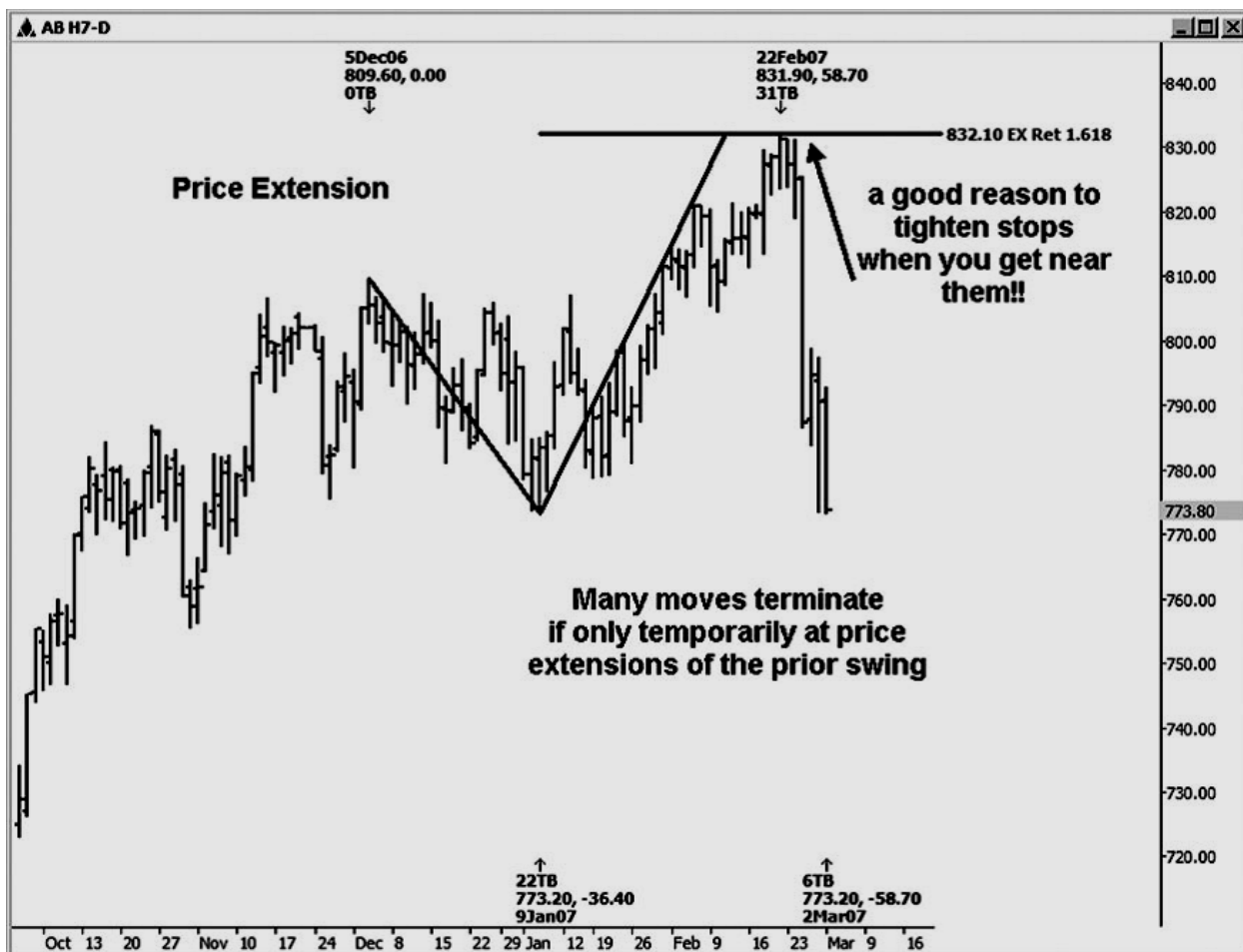
ترسیم اشتباه در تکنیک های فیبوناچی در یک روند نزولی. کف باید کف اصلی و واحد باشد. (صفحه 27)



این اسلاید مروری بر تکنیک های فیبوناچی اکستنشن می باشد.

کاربرد فیبوناچی اکستنشن: از این تکنیک در سطح وسیعی می توان برای شناسایی انتهای روندها استفاده نمود. (صفحه 31)

نکته: در بین نسبت های فیبوناچی اکستنشن نسبت های 127 و 162 اهمیت بسیاری دارند. در بازار فارکس مهمترین نسبت، نسبت 162 می باشد.



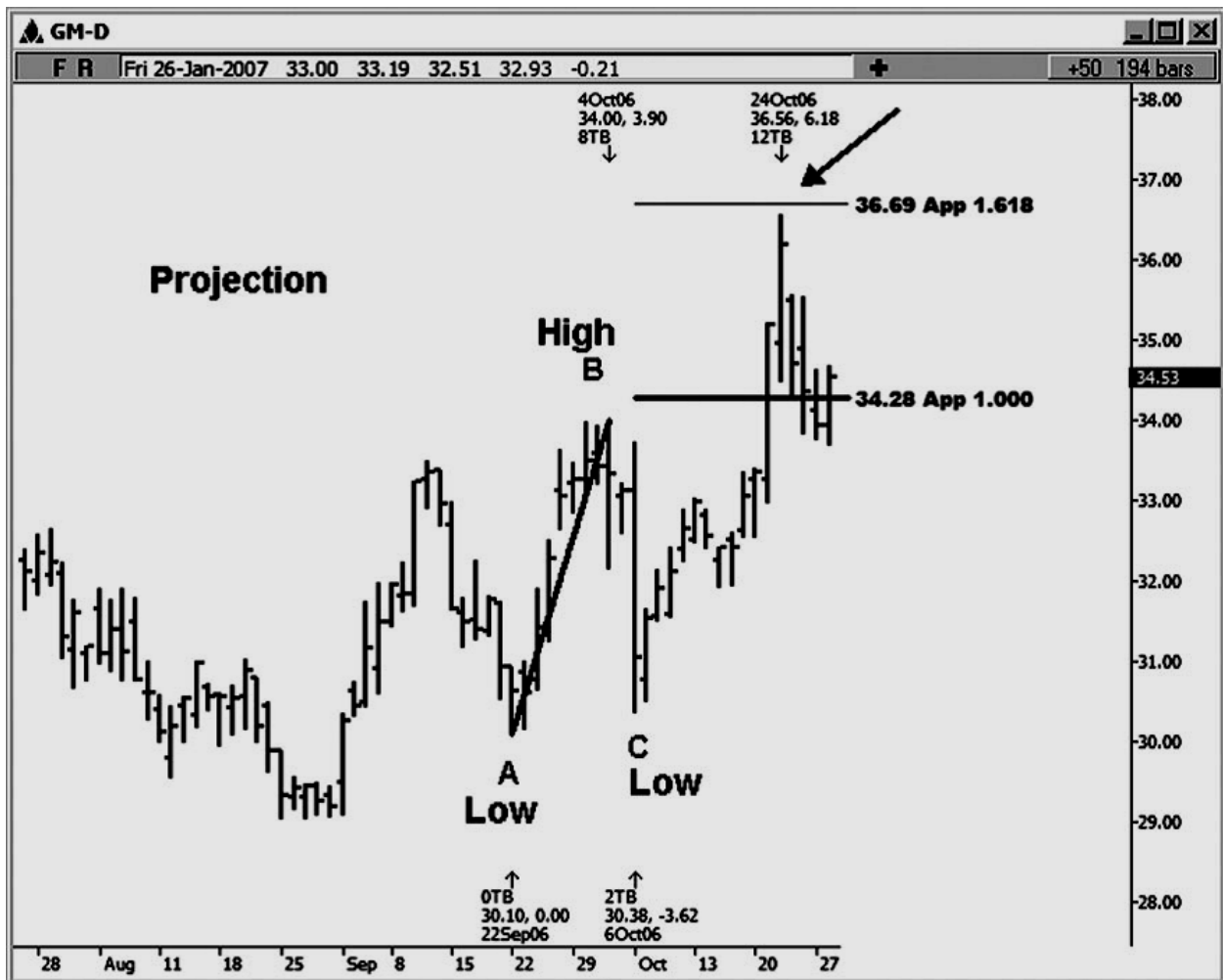
در این تصویر اهمیت نسبت 162 اکستنشن به نمایش گذاشته شده است. (صفحه 35)

نکته کلیدی: اگر یک پوزیشن باز داشتید و قیمت به این نسبت رسید، از این مرحله به بعد شروع به تریلینگ استاپ به روش کندلی (یک پیپ پایینتر از LOW کندل ما قبل آخر یا آخرین کندل تثبیت شده) کنید. پس کاربرد دیگر تکنیک اکستنشن شناسایی اهداف تارگتی و نقطه خروج می باشد.

نقطه خروج:

معمولا ترکیب تکنیک های اکستنشن و پروجکشن به ما کلاستری می دهد که نقطه خروج و تارگت مناسب را معرفی می کند. ضمن اینکه همین کلاستر ها نقطه ورود مناسب جهت پوزیشن معکوس جدید را فراهم می سازند.

نکته کلیدی: از تکنیک اکستنشن به دو صورت می توان استفاده مفید نمود. اول تعیین نقطه خروج مناسب با اهداف قیمتی و دوم شناسایی پتانسیل های ترید جدید با شناسایی انتهای حرکات قبلی.



این تصویر چگونگی استفاده از تکنیک سه نقطه ای پروجکشن را نمایش می دهد. (صفحه 47)

کاربرد فیبوناچی پروجکشن: در این تکنیک نسبت های 62، 100 و 162 اهمیت خاصی دارند. مهمترین نسبت این تکنیک نسبت 100 می باشد که عمده ترین کاربرد آن در تعیین نقاط دقیق خروج از بازار و یا به عبارتی دیگر تعیین اهداف قیمتی است.

نکته کلیدی: خرید سی دی ویدیوی آموزشی 7 ساعته شاگرد رابرت ماینر به نام جیمی جانسون بسیار پیشنهاد می گردد. این آموزش به سبک ماینر مخصوص بازار فارکس تهیه شده است.



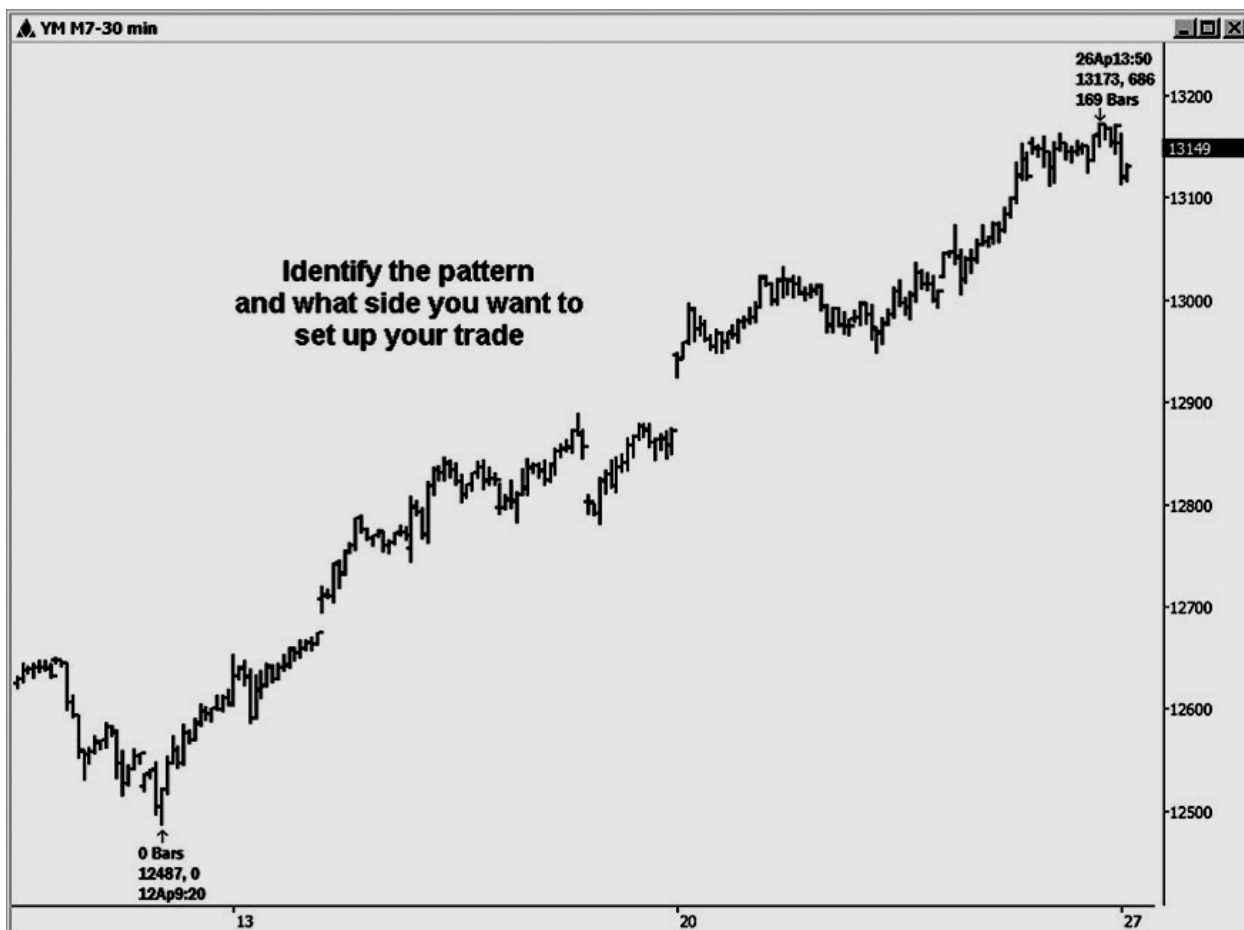
تصویر فوق مثالی دیگر از تکنیک سه نقطه ای فیبوناچی پروجکشن می باشد. (صفحه 50)

در اینجا بر خلاف تصویر قبلی بازوی دوم بزرگتر از بازوی اول می باشد. در روش الیوت از این نوع پروجکشن در شناسایی انتهای موج چهار استفاده می کردیم بدین ترتیب که موج دو را از انتهای موج سوم پروجکت می کردیم تا انتهای احتمالی موج چهار شناسایی گردد.



یکی از کاربرد های اصلی تکنیک پروجکشن شناسایی انتهای پترن های ABC می باشد. (صفحه 54)

نکته کلیدی: در صورتی که در یک پترن ABC قیمت نسبت صد پروجکشن رو با قاطعیت شکست به احتمال قوی می توان نسبت 162 پروجکشن رو انتهای آن روند دانست و در این نسبت باید در انتظار بازگشت روند باشیم.



این تصویر شروع مباحث مربوط به استراتژی های خانم کارولین برودن می باشد. (صفحه 66)

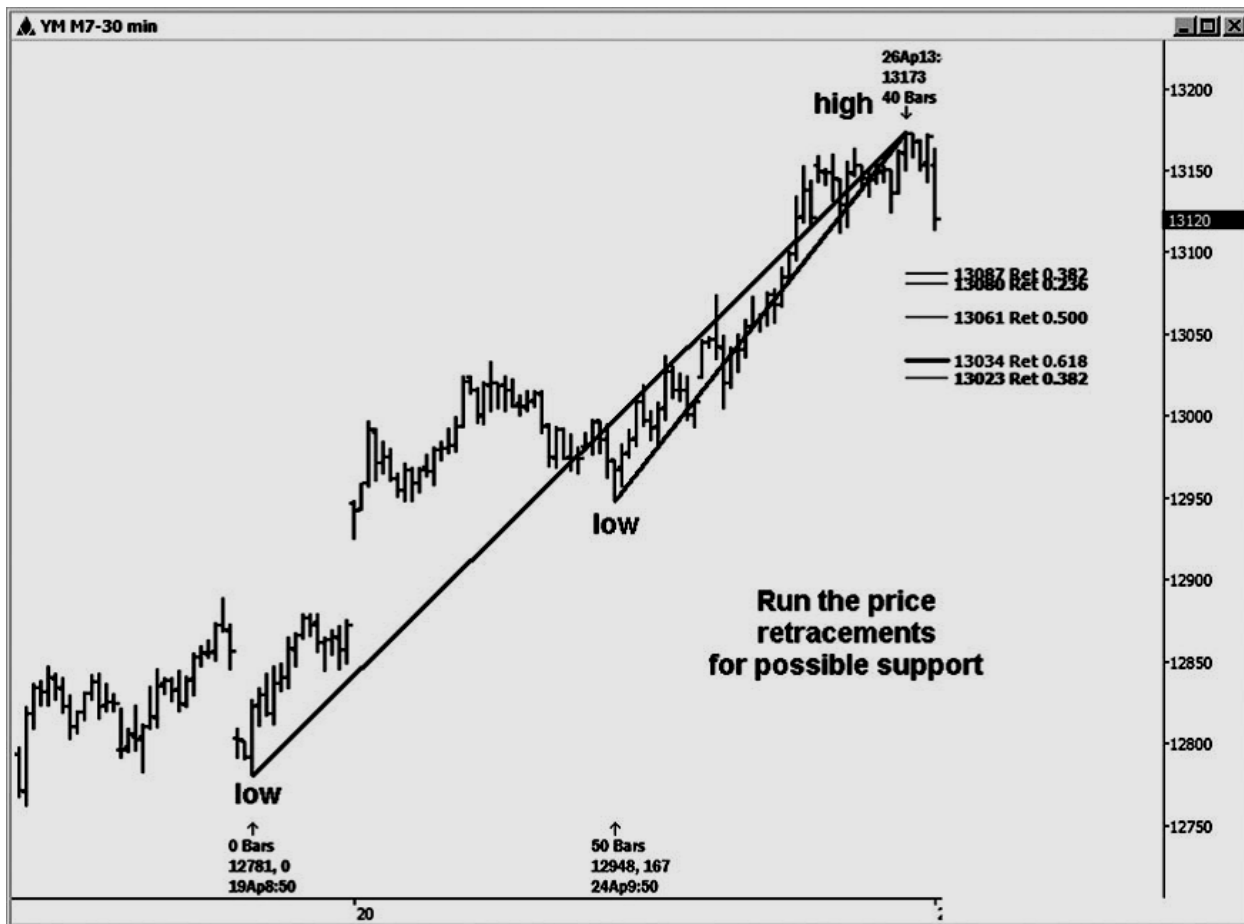
استراتژی اول برودن یا استراتژی کلاستریابی:

این استراتژی روش کلاستریابی می باشد. کلیت روش به این صورت است که بوسیله پیاده سازی تکنیک های فیوناچی بر روی سوبینگ های واضح چارت شروع به کلاستریابی می نمایم.

نکته کلیدی: خانم برودن برعکس رابرت ماینر و درک هابز از تکنیک فیوناچی اکسپنشن استفاده نمی کنند.

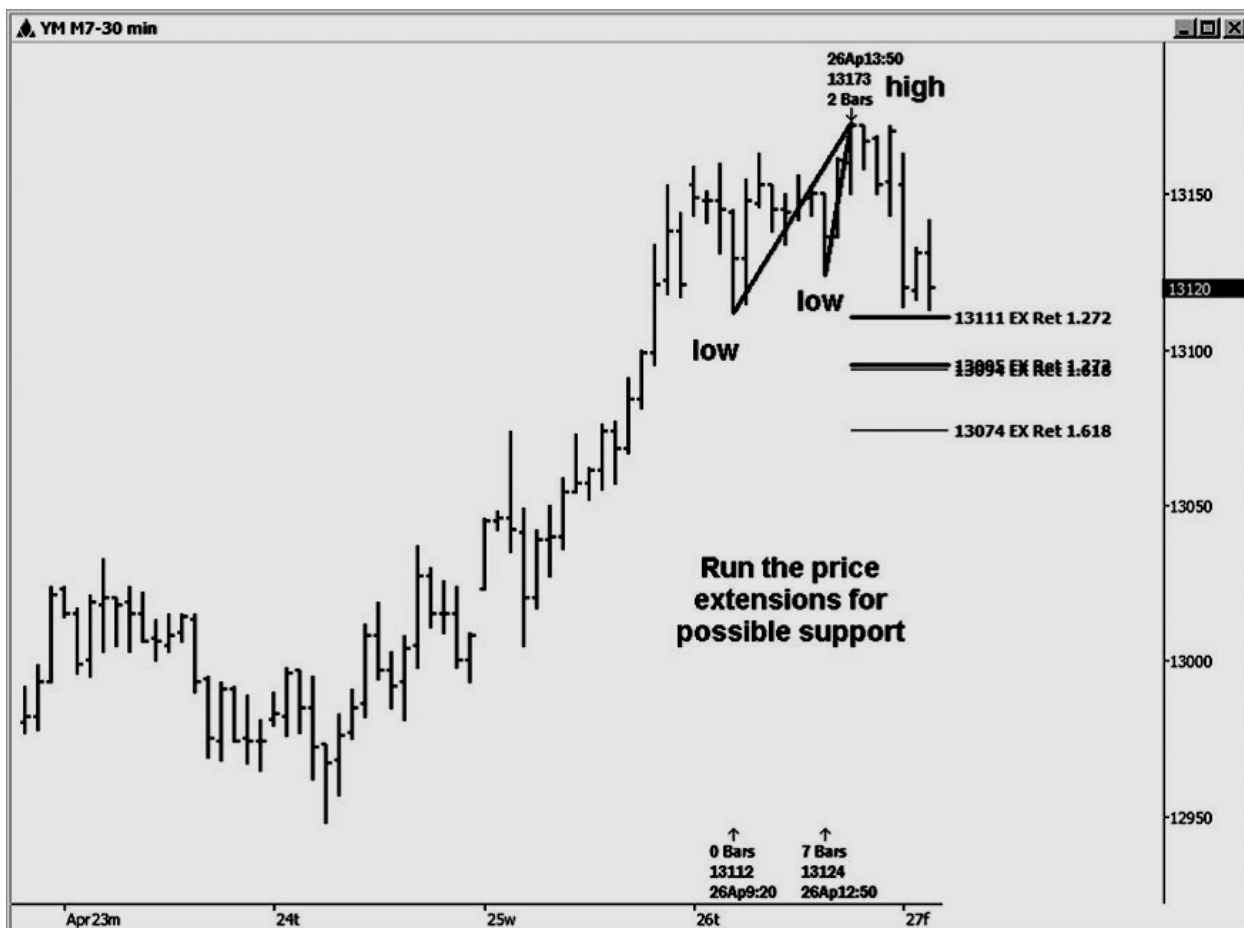
اولین گام روش کلاستریابی:

ابتدا باید جهت روند را تشخیص دهیم چرا که می خواهیم هم جهت با روند ترید انجام دهیم. خانم برودن جهت روند را به صورت چشمی از چارت تشخیص می دهند. اما قاعده کلی برای شناسایی جهت روند این است که ما در یک روند صعودی شاهد بروز Higher High و Higher Low هستیم و در یک روند نزولی شرایط کاملاً بر عکس می باشد. به طور مثال در تصویر فوق کاملاً مشهود است که جهت روند صعودی می باشد.



دومین گام روش کلاستریابی:

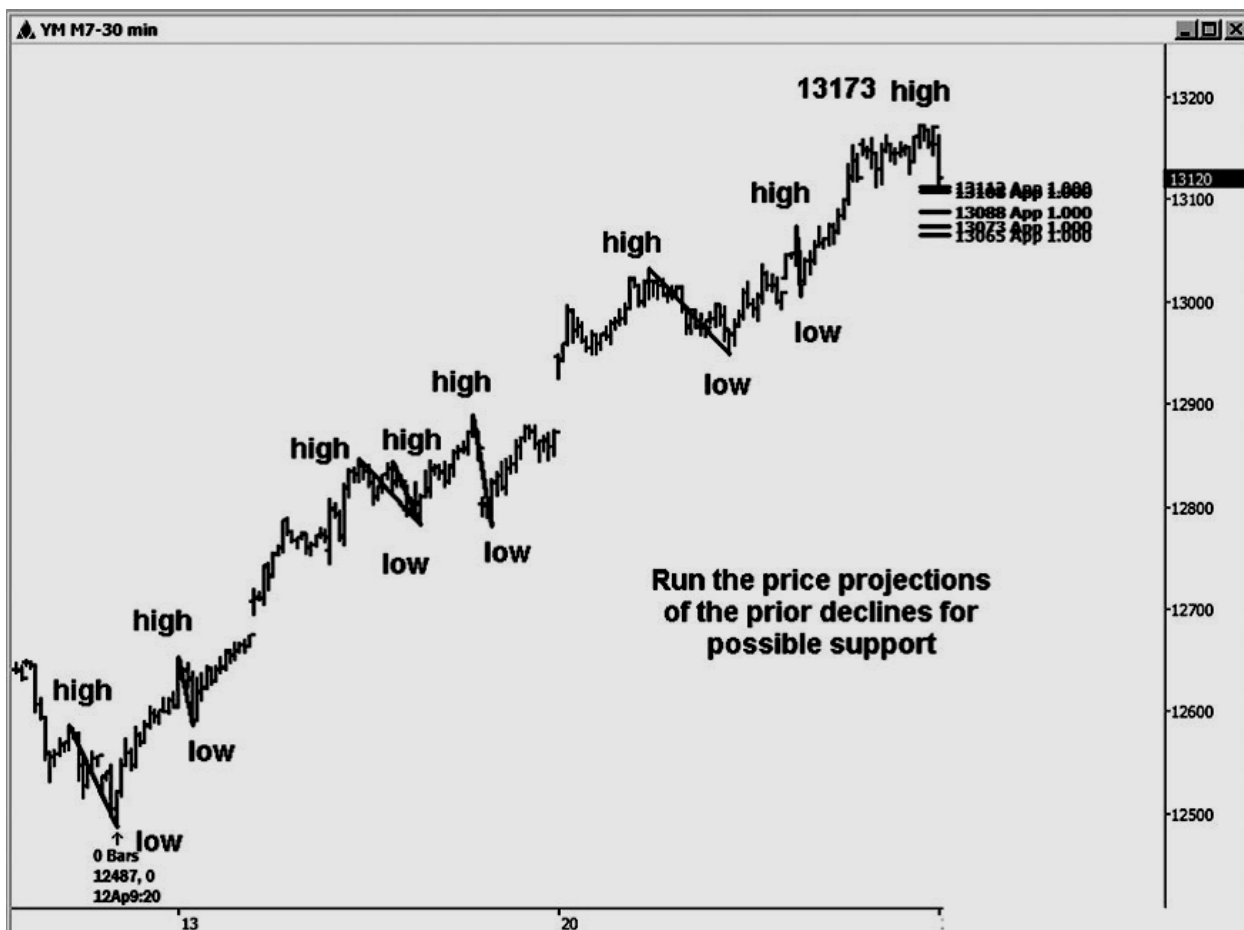
حال شروع به شناسایی سویینگ های اصلی چارت می کنیم . در اولین مرحله از این گام شروع به ترسیم تکنیک های فیبوناچی ریتریسمنت می نماییم. روش صحیح ترسیم را در گذشته آموخته اید، توجه کنید که سقف همه ریتریس ها در یک روند صعودی ثابت و سقف چارت موجود است. (صفحه 67)



در مرحله بعدی شروع به استفاده از تکنیک فیبوناچی ریتریسمنت و ترسیم آن مشابه تکنیک فیبوناچی ریتریسمنت می کنیم. (صفحه 68)

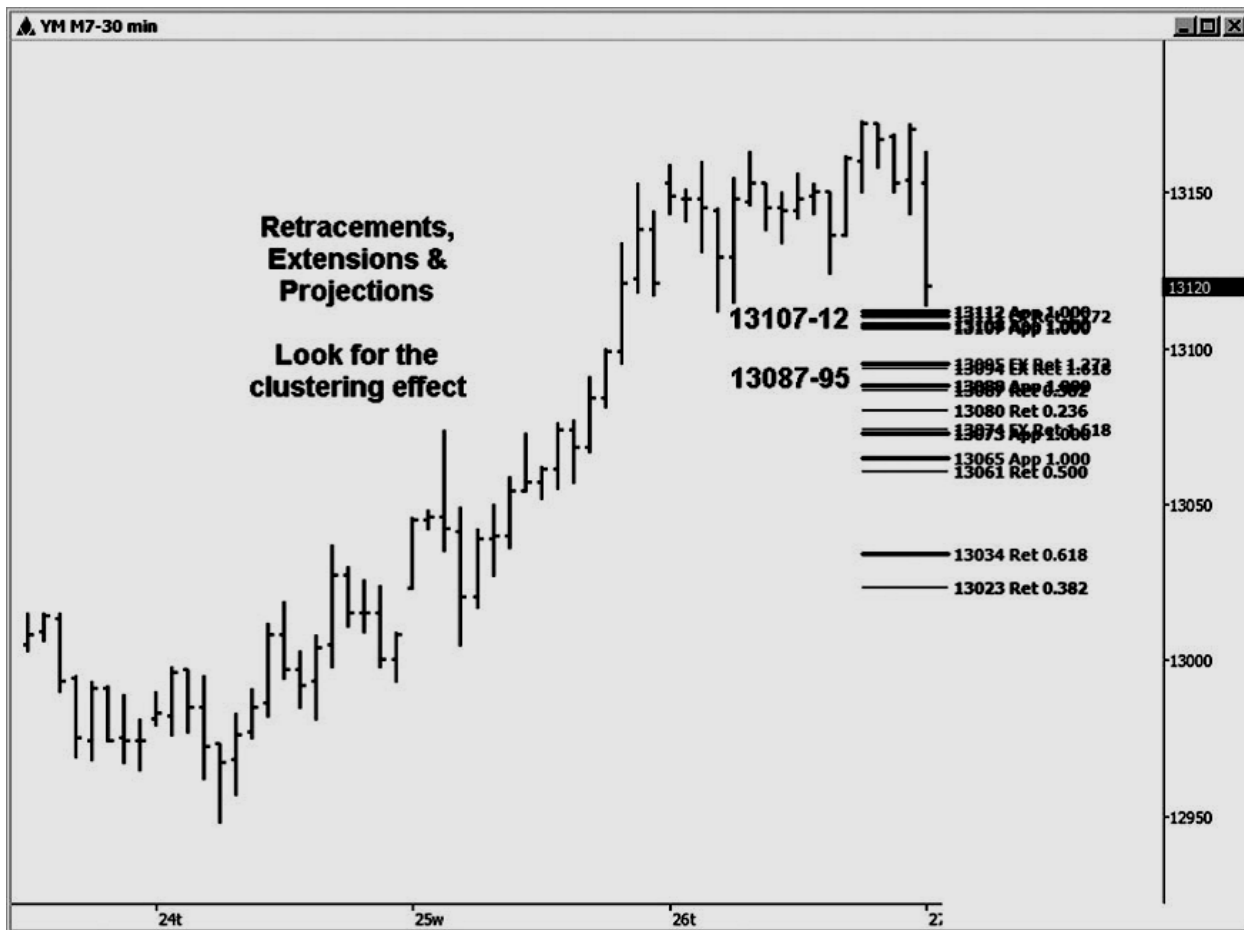
نکته کلیدی: در تکنیک اکستنشن معمولاً تا به حال آنرا خلاف جهت یک روند ترسیم می کردیم تا انتهای محتمل یک روند شناسایی گردد. برای مثال در یک روند صعودی، یک کارکشن نزولی مانند موج چهار را در نظر گرفته و از سقف به کف اقدام به ترسیم فیبوناچی اکستنشن برای شناسایی انتهای موج پنج می کردیم. ولی در سبک برودن ما هم جهت با وند هم اکستنشن ها رو ترسیم می کنیم. در حقیقت این اکستنشن ها همان ریتریسمنت های با نسبت بالای 100 هستند که فقط آنرا بر روی دو سویینگ آخر روند پیاده می کنیم.

نکته کلیدی: نسبت های 127 و 161 نسبت های مهمی در اکستنشن محسوب می شوند.



در مرحله بعدی، سومین تکنیک از تکنیک های فیبوناچی یعنی پروجکشن را بر روی چارت پیاده می کنیم. در این تکنیک سه نقطه ای نقطه سوم جهت ترسیم پروجکشن ها ثابت بوده و در یک روند صعودی همان سقف چارت می باشد. (صفحه 69)

نکته کلیدی: در روش اول برودن، برای ترسیم پروجکشن ها فقط از نسبت 100 این تکنیک استفاده می نمایم که دلیل آن جلوگیری از شلوغی بیش از حد چارت می باشد.



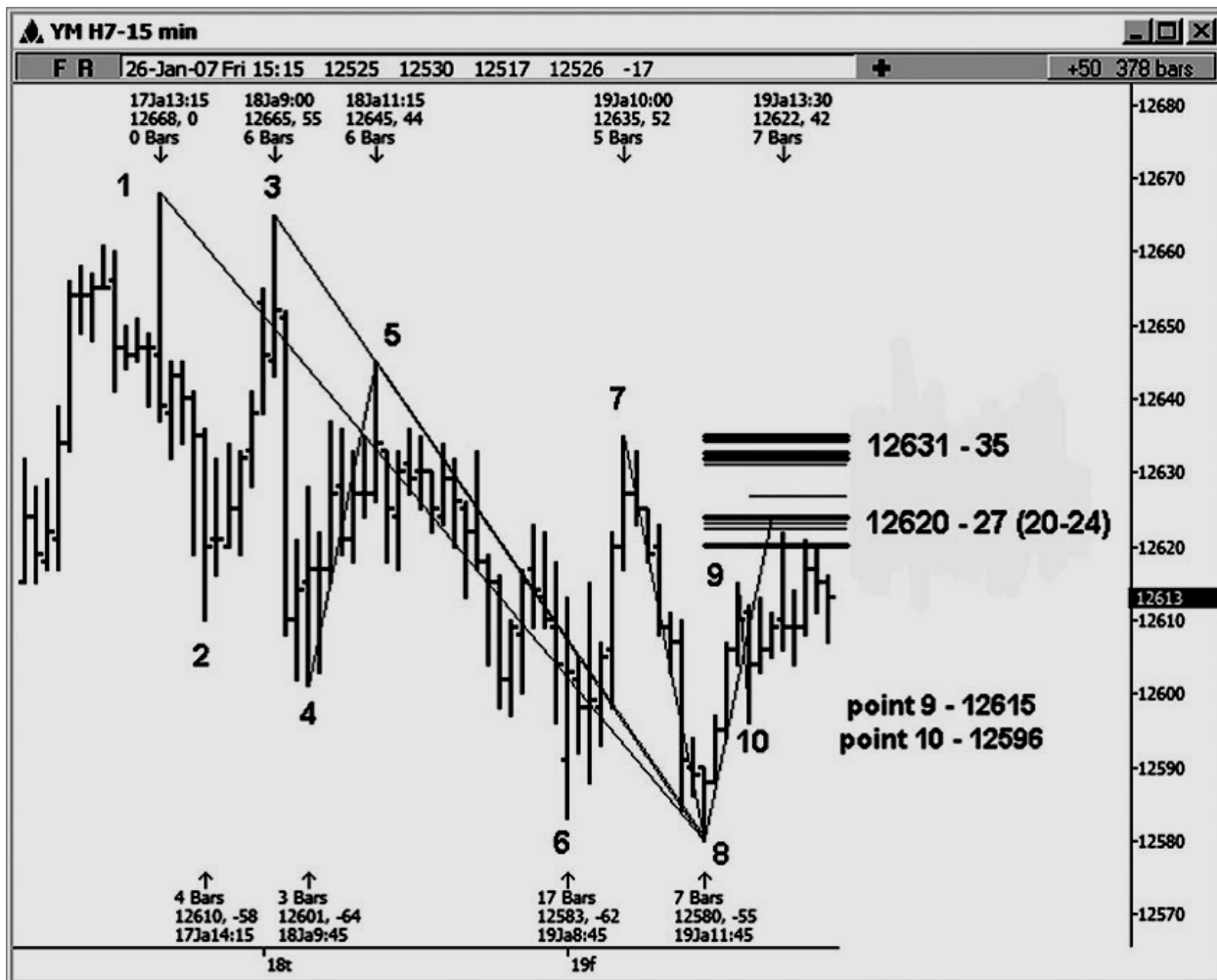
حال تمامی تکنیک های پیاده شده را، بر روی یک چارت مشاهده می نمایید تا بدینوسیله نسبت به شناسایی یک یا چند کلاستر معتبر اقدام گردد. (صفحه 70)



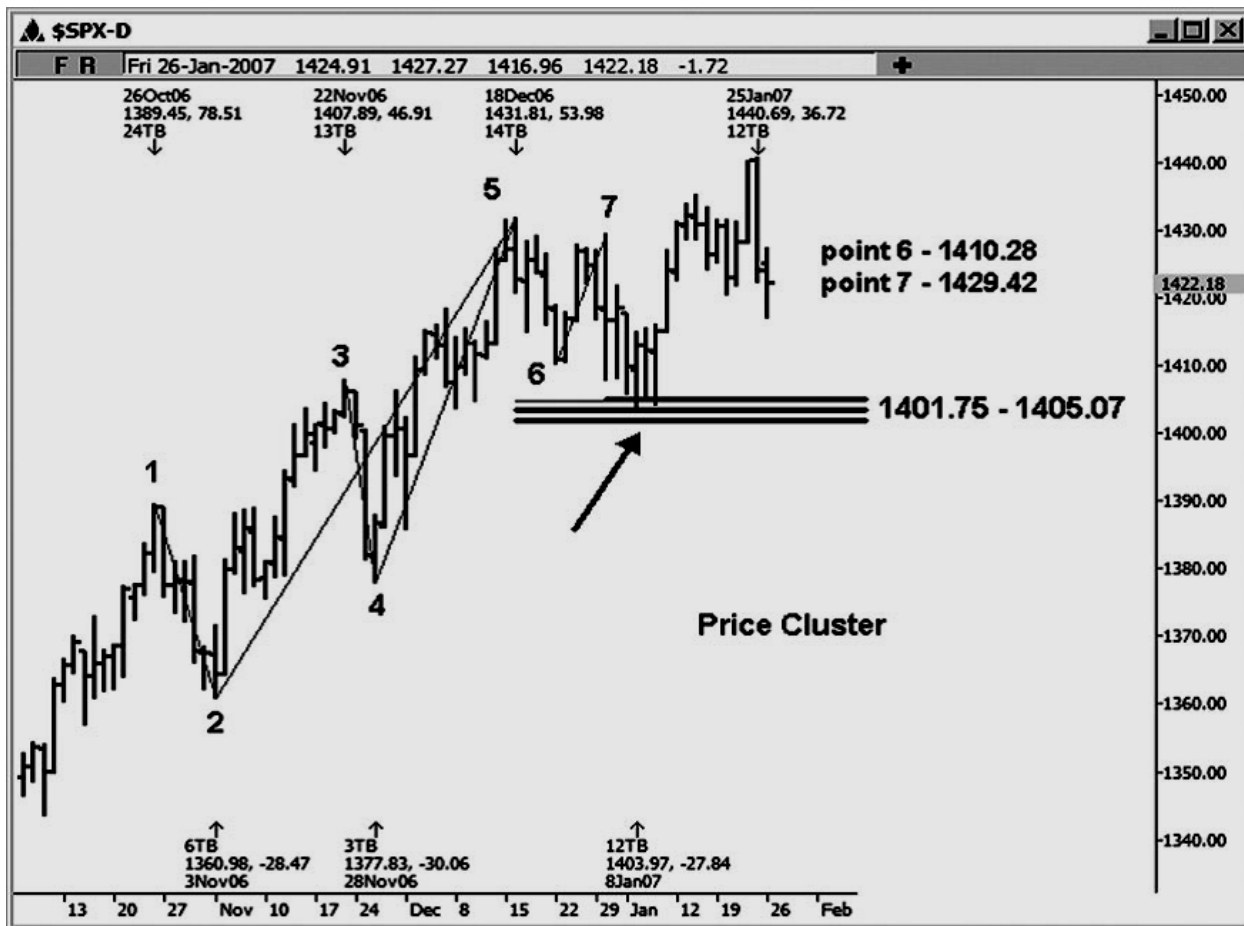
این تصویر آینده چارت قبلی را نشان می دهد. همانطور که می بینید روند قیمت پس از برخورد با یکی از کلاسترهای اصلی چارت قبل تغییر جهت داده است. (صفحه 71)

نکته کلیدی: پس از تشخیص کلاسترهای اصلی با مشاهده رسیدن قیمت روند به آنها باید منتظر تریگر (مانند کندل برگشتی) برای ورود به بازار باشیم و هرگز بدون داشتن تریگر اقدام به گرفتن پوزیشن نخواهیم کرد. ترجیحا در تایم فریم های پایین باید از فیلترهایی نیز به صورت مکمل استفاده نماییم.

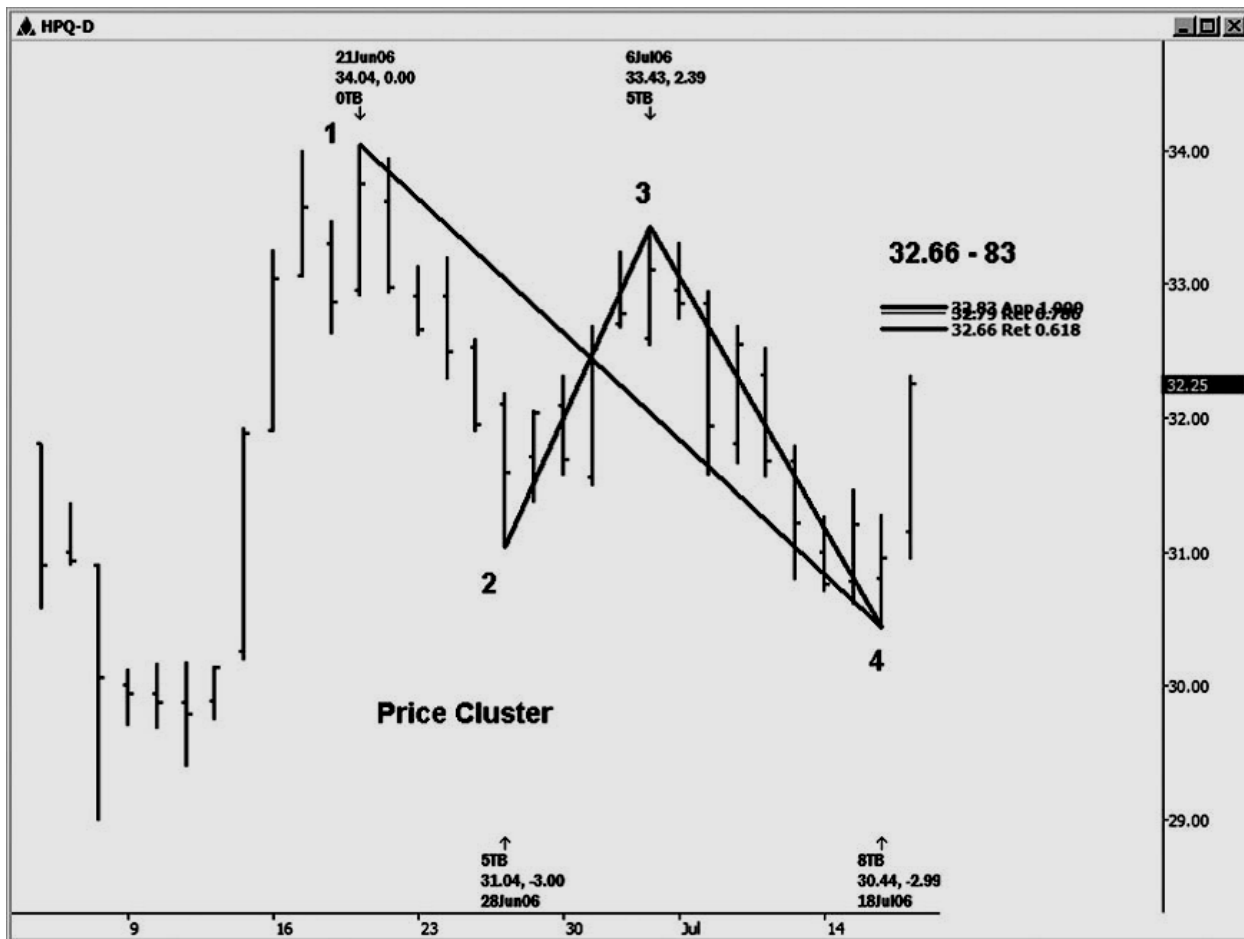
نکته کلیدی: مهمترین رمز موفقیت در بازار فارکس، مدیریت سرمایه و ریسک کم در هر ترید می باشد. شک نکنید!



این تصویر نمونه ای از پیاده سازی روش کلاستریابی کارولین برودن و این بار برای یک روند نزولی می باشد. (صفحه 75)



این تصویر نمونه ای دیگر از همان روش برای یک روند صعودی می باشد. (صفحه 79)



ترکیبی از پیاده سازی سه تکنیک فیبوناچی را در روش کلاستر یابی خانم برودن ملاحظه می کنید. (صفحه 83)

تکنیک ریتریسمنت: از یک به چهار وصل می کنیم. (دو نقطه ای)

تکنیک اکستنشن: از سه به چهار وصل می کنیم. (دو نقطه ای)

تکنیک پروجکشن: از دو به سه و سپس چهار وصل می کنیم. (سه نقطه ای)



همانطور که می بینید تحلیل علی رغم پیاده سازی روش اول برودن Fail شده است. (صفحه 85)

نکته کلیدی: همواره به یاد داشته باشید که هیچ روش تحلیل صد در صدی وجود ندارد.

نکته کلیدی: به دلیل احتمال شکست در هر تحلیل هرچند هم آن تحلیل دقیق باشد، یک راهکار این است که با دو پوزیشن با دو تارگت اولیه و ثانویه وارد شویم و بعد از اینکه پوزیشن ها تا حدی در سود رفتند آنها را ریسک فری بنماییم.

نکته کلیدی: اگر درصد ریسک پایین باشد Fail شدن یک تحلیل لطمه ای به حساب ما وارد نمی کند.

استراتژی دوم برودن یا استراتژی سیمتری:

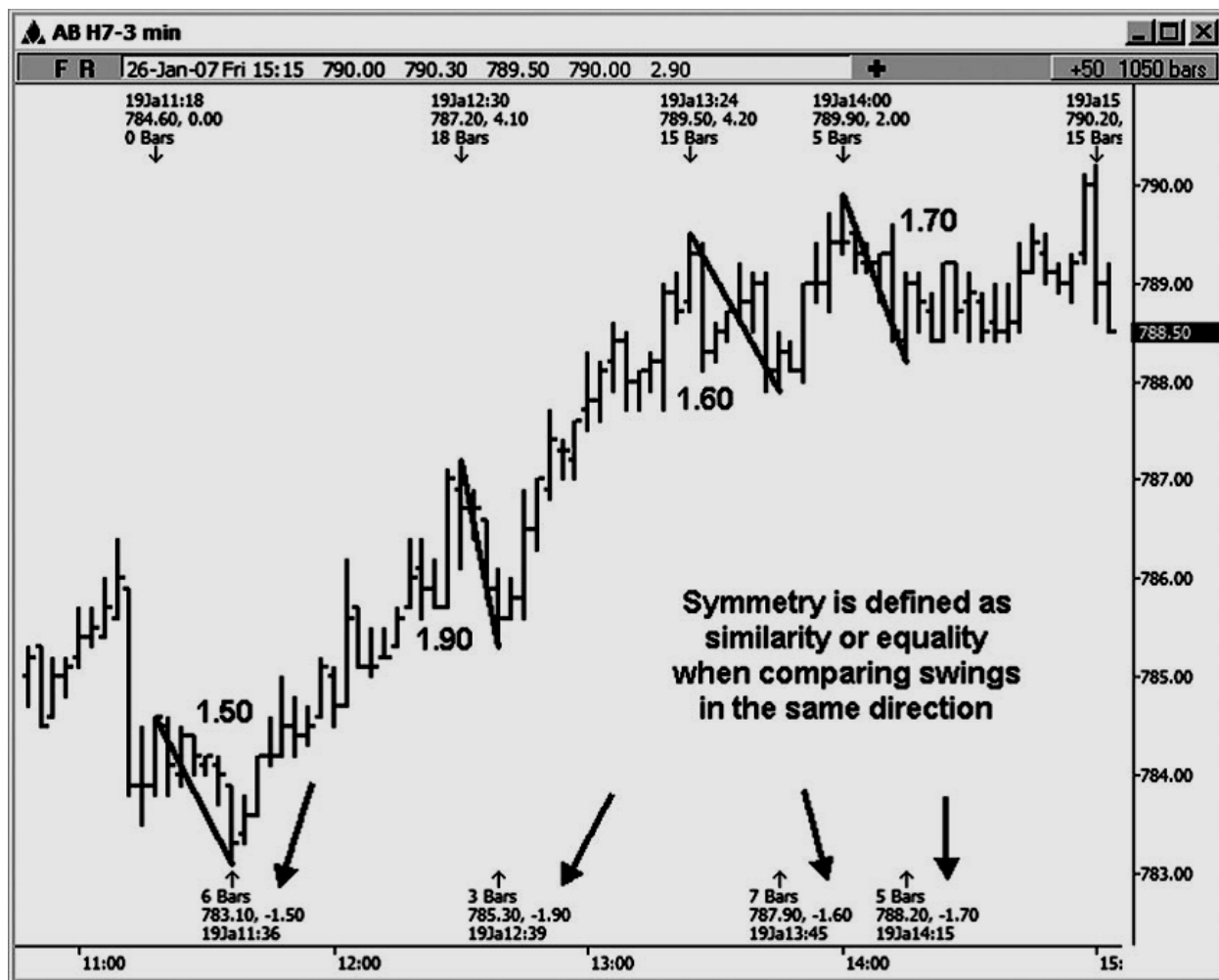
این استراتژی به استراتژی سیمتری یا Symmetry به معنی تقارن و برابری شهرت دارد. همانطور که می دانید در بازار فارکس نسبت 100 پروجکشن دارای این خاصیت می باشد و به همین دلیل در این استراتژی تنها از نسبت 100 تکنیک فیبوناچی پروجکشن استفاده می شود.

مراحل پنجگانه استفاده از این روش به طور اختصار عبارتند از:

- 1- تشخیص جهت روند و اینکه بدانیم که آیا روند صعودی است یا نزولی. تشخیص جهت روند از طریق شناسایی هایرهای و هایر لو ها (HH و HL) برای یک روند صعودی و لور لو و لور های ها (LH و LL) برای یک روند نزولی میسر می باشد.
- 2- حال باید نسبت به شناسایی کارکشن های واضح روند اقدام نماییم.
- 3- بر روی حرکات مقطعی خلاف جهت روند (کارکشن ها) تکنیک فیبوناچی پروجکشن با نسبت 100 را پیاده می کنیم.
- 4- کلاستر حاصله از اعمال این پروجکشن ها شانس بسیار بالایی برای موفقیت تحلیل دارد.
- 5- در استراتژی چهارم خانم کارولین برودن، ایشان برای تایم فریم های کوچک تر فیلتری را معرفی کرده اند که به آن خواهیم پرداخت. برای تایم فریم های بزرگتر برودن فیلتری ارائه نکرده است و در این فریم ها از فیلتر ارائه شده توسط درک هابز استفاده می کنیم.

نکته کلیدی: شناسایی جهت روند به صورت چشمی نیز امکان پذیر می باشد.

نکته کلیدی: برای ترید بر اساس استراتژی سیمتری به جهت قدرت بسیار بالای این روش تحلیلی (در عین سادگی) کلاستر به دست آمده از پیاده سازی حتی یک پروجکشن 100 هم کفایت می کند، اما تشکیل کلاستر های با تعداد خطوط بیشتر شانس موفقیت بالاتری به همراه خواهد داشت.



تصویر فوق نمونه ای از پیاده سازی استراتژی سیمتری می باشد. توجه نمایید که نقطه سوم در ترسیم پروجکشن ها ثابت و بالاترین سقف موجود تا آن لحظه می باشد. (صفحه 99)

این سیستم ترید که خاص خانم کارولین برودن می باشد، یک سیستم در جهت روند یا دنباله رو روند می باشد که به آنها اصطلاحاً Trend Following گفته می شود.

نکته کلیدی: پس در انتهای پروجکشن ها در صورت داشتن تریگر مناسب وارد پوزیشن هم جهت ترند فعلی می شویم.

نکته کلیدی: هدف کلیه این دوره ها اینست که تریدر های حرفه ای تربیت شوند که در طول هفته حداکثر یک یا دو ترید انجام دهند. کم ترید کردن راز بسیار مهمی در موفقیت در بازار فارکس می باشد.

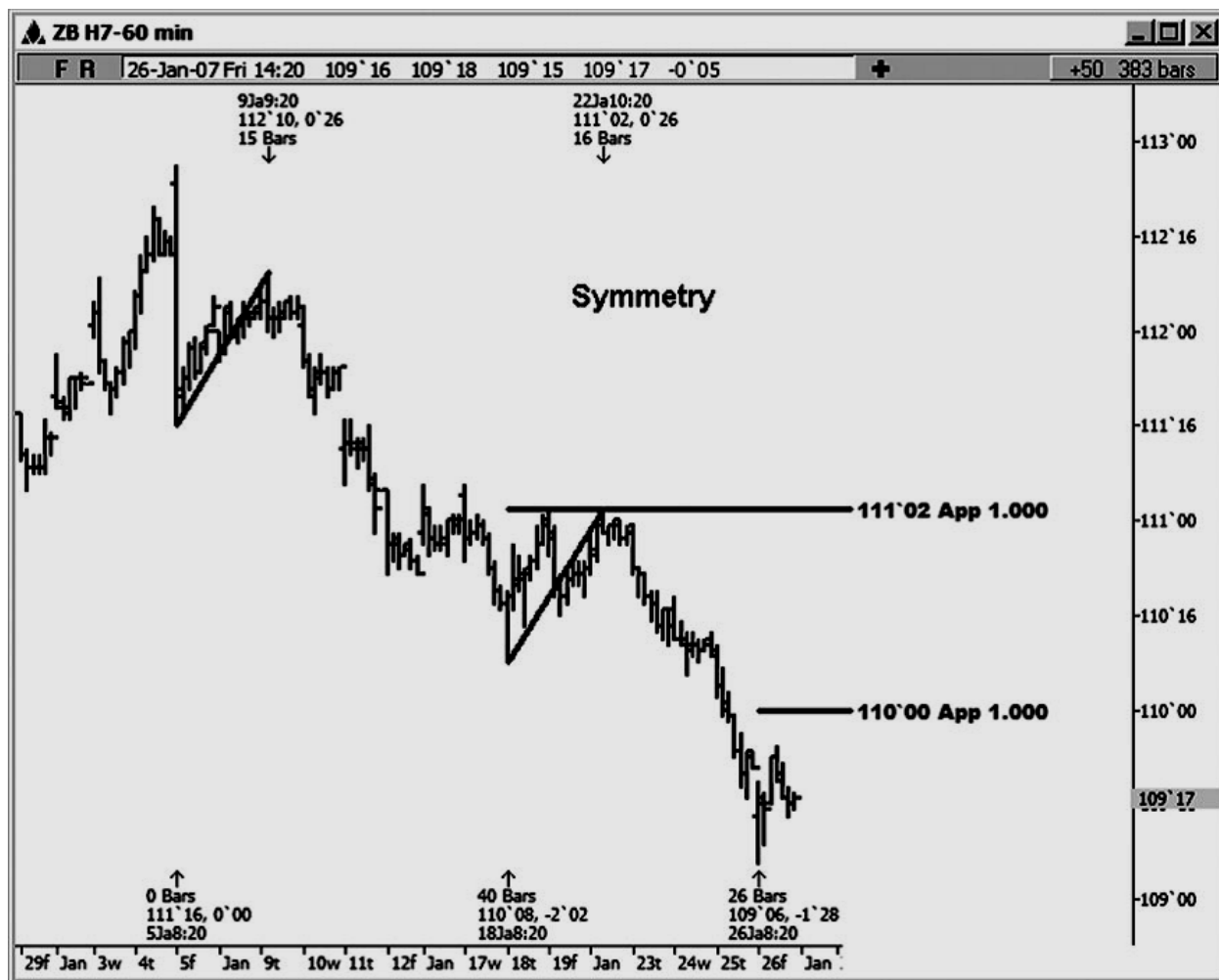
در تصویر صفحه قبل نکته ای در مورد پیاده سازی پروجکشن بر روی آخرین سویینگ قبل از ترند وجود دارد که به توضیح آن خواهیم پرداخت.

نکته کلیدی: در سبک تحلیلی ماینر گاهی اوقات ترند ها بسیار اکستند می شوند و باعث شکسته شدن کلاستر های استاندارد انتهای موج می شوند و پیدا کردن انتهای ترند با ساختار شناسی دشوار می گردد. اگر به یاد داشته باشید در اینگونه موارد برای پیدا کردن انتهای احتمالی روند، از تکنیک ترسیم فیبوناچی اکستنشن بر روی سویینگ آخر ما قبل ترند استفاده می کردیم که نسبت 424 این تکنیک در بسیاری از موارد انتهای آن روند می باشد.

در سبک تحلیلی خانم برودن نیز روشی مشابه وجود دارد و مجددا بر روی آخرین سویینگ ما قبل ترند (در صورت وجود داشتن) برای ترسیم فیبوناچی پروجکشن 100 در روش سیمتری استفاده می کنیم با این تفاوت که این بار از پروجکشن به جای اکستنشن استفاده می شود. بدین ترتیب با انتخاب سقف و کف این سویینگ آخر ما قبل ترند آنرا از انتهای روند جاری پروجکت یا منعکس می کنیم.

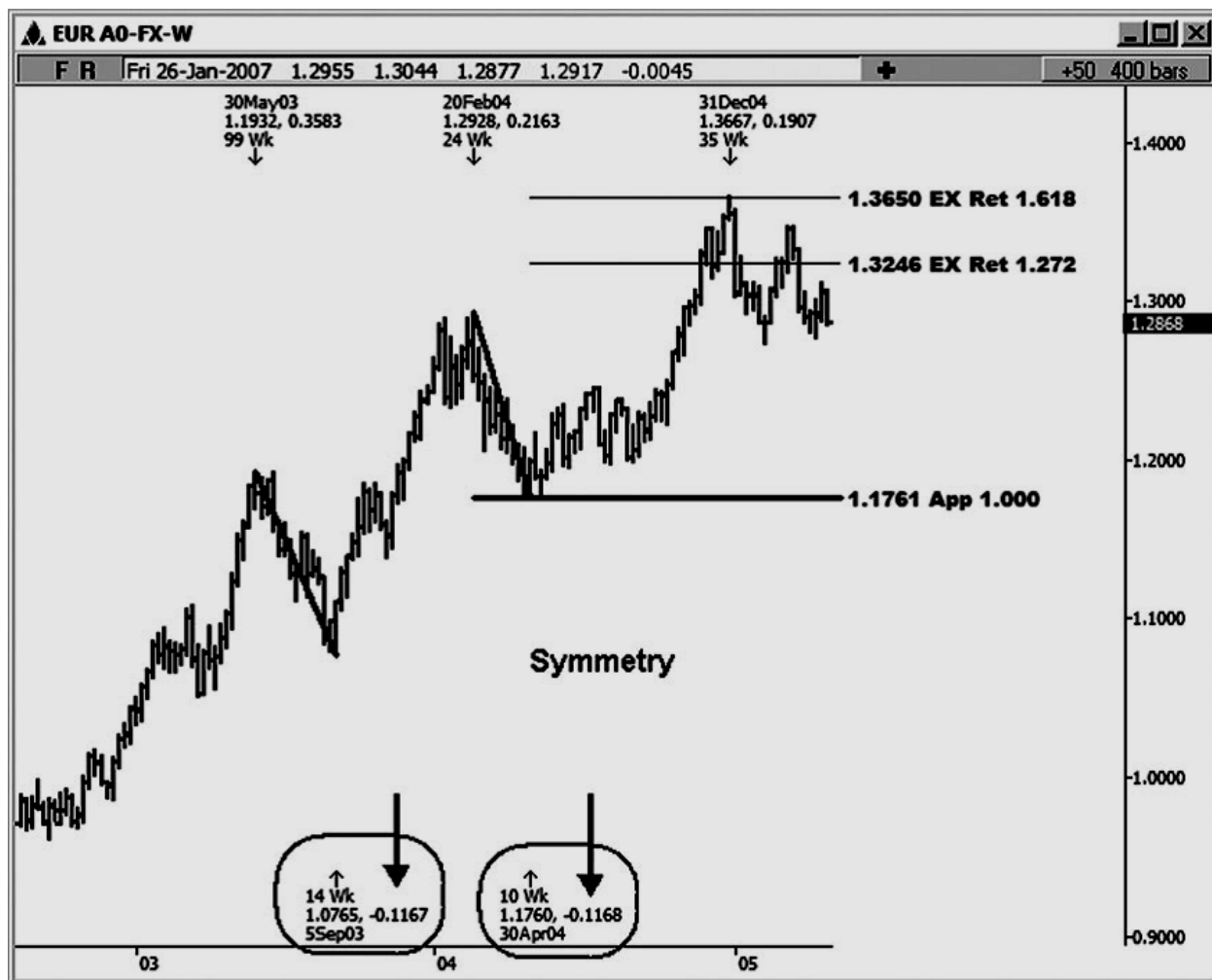
نکته کلیدی: استفاده از تایم فریم های بالاتر برای یک تریدر مزیت های زیادی دارد از جمله موارد زیر:

- 1- استرس کمتری به تریدر وارد می شود.
 - 2- زمان کمتری برای نشستن پای چارت صرف می گردد. به یاد داشته باشید که فاصله گرفتن از چارت رمز موفقیت شما در بازار فارکس است.
 - 3- تحلیل های تکنیکال دارای قدرت احتمالی بیشتری نسبت به تایم فریم های کوچکتر دارند.
- تایم فریم پیشنهادی برای تریدر ها با سرمایه متوسط چهار شاعته و با سرمایه بالا روزانه پیشنهاد می گردد.



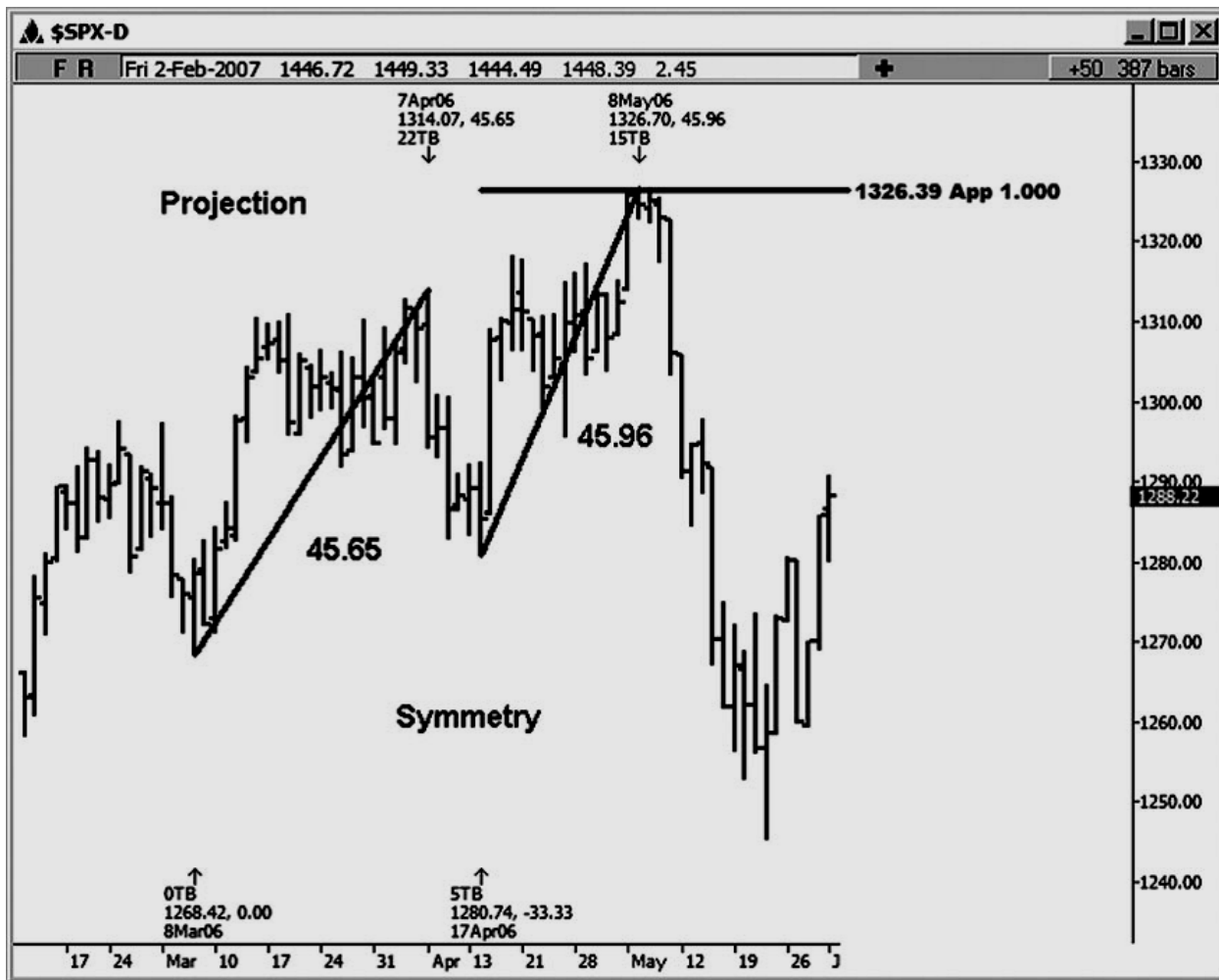
این تصویر مثالی دیگر از پیاده سازی تکنیک سیمتری می باشد. (صفحه 101)

نکته کلیدی: در این روش بر روی هر کارکشنی پروجکشن های 100 را ترسیم می کنیم. اگر ریتریس قیمت به کلاستر پروجکشنی رسید و در آنجا تریگر داد و در عین حال فیلترها نیز تایید نمودند وارد پوزیشن می شویم. اگر قیمت به این کلاستر نرسید که اصلا موقعیت تردی شکل نگرفته است. پس از قبل نمی دانیم که کدام یک از کارکشن ها به این سیستم جواب خواهند داد.



این تصویر بکارگیری روش سیمتری را در یک روند صعودی نشان می دهد. (صفحه 104)

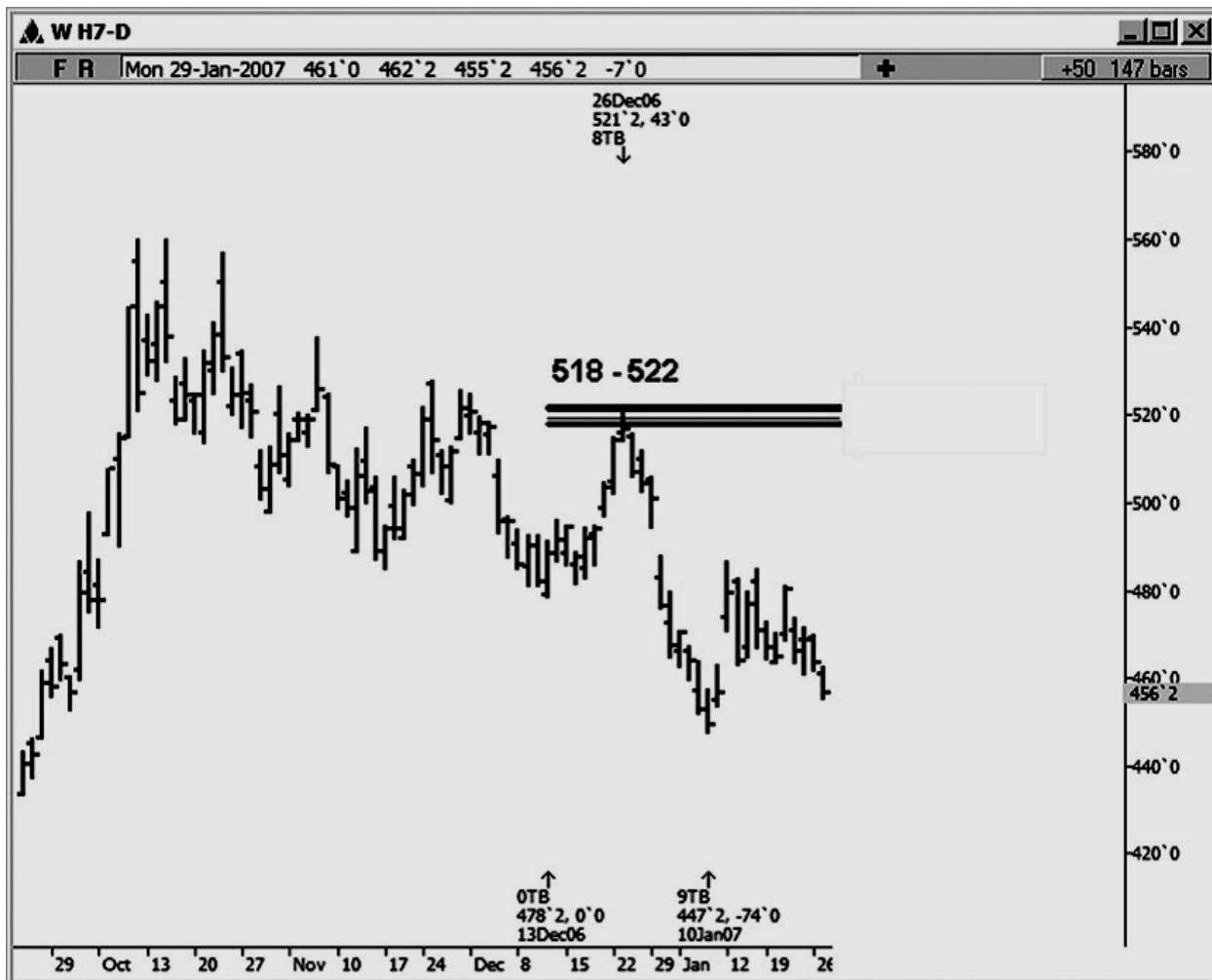
نکته کلیدی: تارگت این روش دو مرحله ای می باشد. نسبت های اکستنشن 127 و 162 به ترتیب تارگت های ایده آل اول و دوم هستند. بهتر است به جای بستن پوزیشن در تارگت، پس از رسیدن به تارگت شروع به تریلینگ استاپ کندلی بنماییم. (یک پیپ زیر آخرین کندل تثبیت شده)



استراتژی سیمتری، یک استراتژی مناسب برای افزایش حجم معامله بر روی سویینگ ها می باشد، بدین معنی که وقتی یک روند اصلی شناسایی گردد مدام با افزایش لات بر روی سویینگ ها می توان حجم معامله و در نتیجه سود حاصله از شکار این روند را افزایش داد. منتها باید توجه نمود که ترجیحا ترید های قبلی ریسک فری شده باشند.

نکته کلیدی: یک راه حل مناسب این است که یک پوزیشن بلند مدت برای گرفتن کل روند داشته باشیم و سپس بر روی هر سویینگ از پوزیشن های هم جهت کوتاه مدت با تارگت های کوچک تر استفاده کنیم.

در تصویر فوق می بینید که از این روش می توان برای گرفتن پوزیشن در خلاف جهت روند نیز استفاده نمود (در انتهای یک ایمپالس). این حالت بسیار مشابه بخش هایی از روش الیوت می باشد. در واقع در روش سیمتری در هر دو جهت می توان پوزیشن گرفت اما ترجیحا از روش خانم برودن برای گرفتن پوزیشن های هم جهت استفاده نمایید. (صفحه 106)



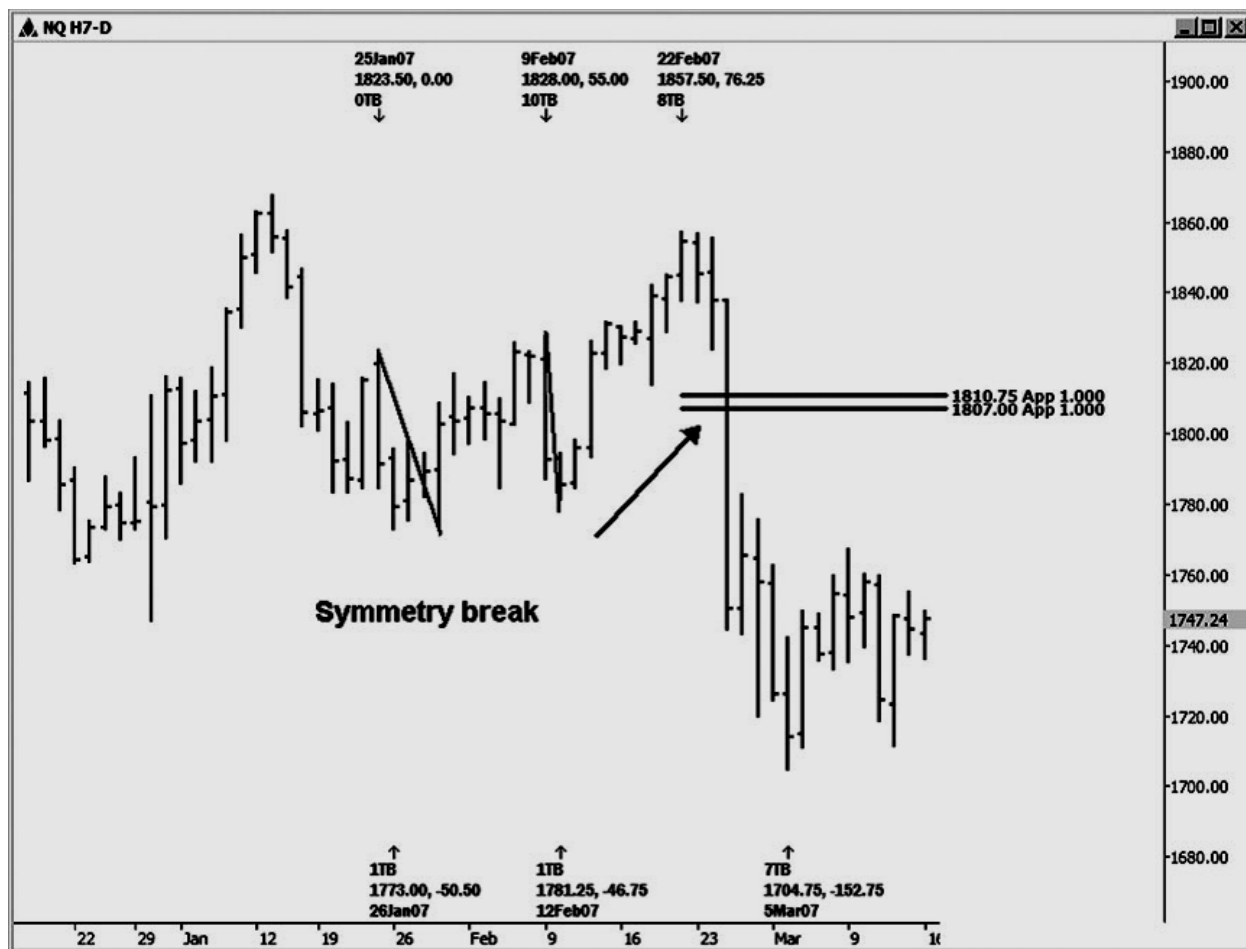
در تصویر فوق با یک کلاستر سیمتری روبرو هستیم. زمانی که تجمع فیبوناچی پروجکشن های 100 را در یک منطقه محدود داشته باشیم این کلاستر به مراتب قدرتمند تر می گردد. اما همانطوری که قبلا نیز به آن اشاره شد با یک نسبت 100 پروجکشن هم می توان از این استراتژی استفاده نمود. با این حال شکی نیست که کلاستر با خطوط بیشتر قدرت بیشتری دارد. (صفحه 111)



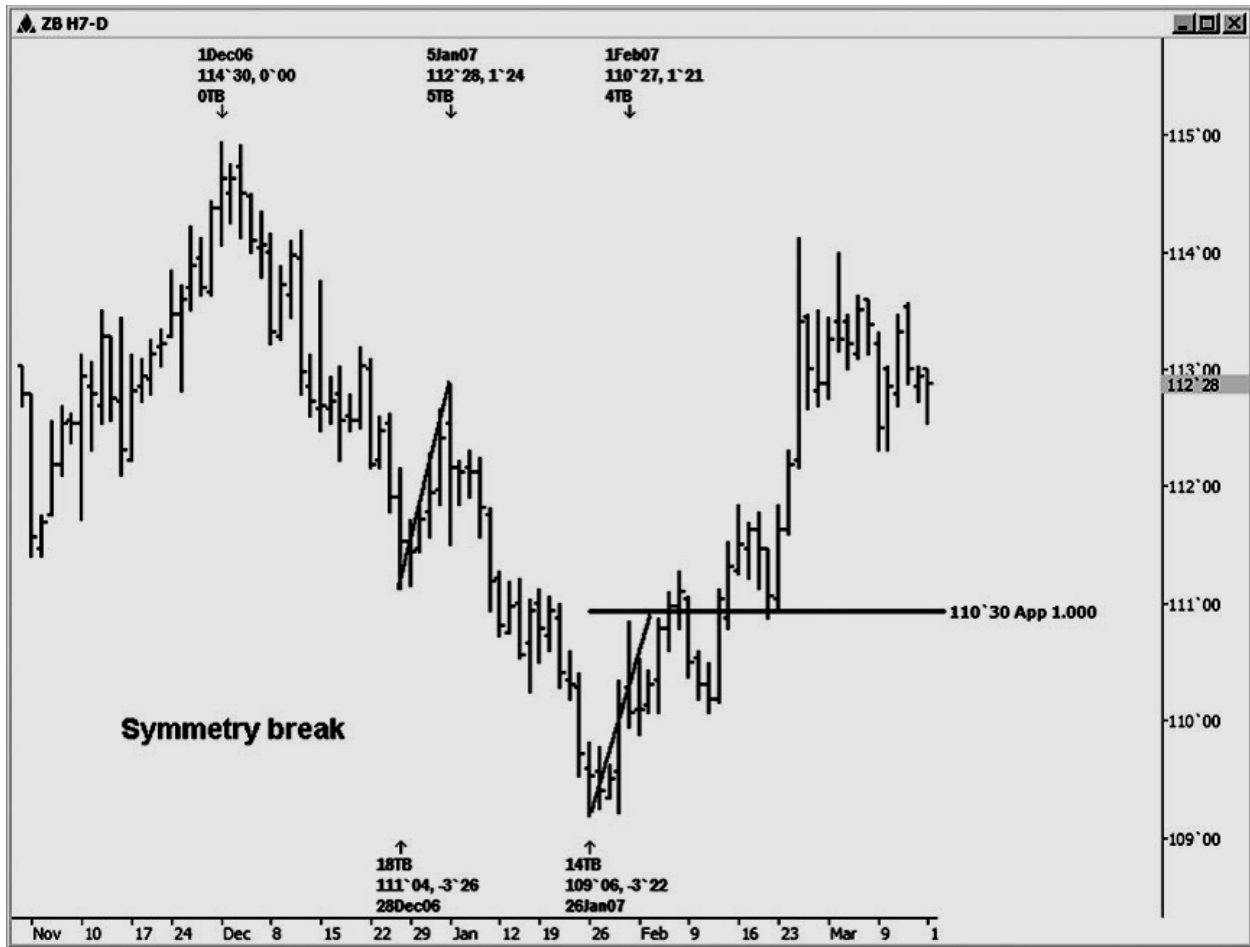
اگر کلاستر سیمتری با قدرت شکسته شود و روند باز نگردد، نشان دهنده آن است که یک عامل قدرتمند پشت قضیه هست. معمولاً شکستن قاطع این کلاستر نشانه‌ای از شروع تغییر جهت روند می باشد. (صفحه 114)

نکته کلیدی: تکنیک سیمتری ابزار قدرتمندی برای ترید محسوب می شود خصوصاً اگر به جای استفاده از یک پروجکشن، یک کلاستر پروجکشنی داشته باشیم. اما در پاره‌ای موارد این کلاسترهای قدرتمند شکسته می شوند و این بدان معنی است که عامل سومی در بازار نقش پیدا کرده است که بسیار قدرتمند می باشد. بنابراین شکستگی قاطع سیمتری (به طور مثال با کندلی قدرتمند) بیانگر آنست که این شکستگی مقطعی نخواهد بود و غالباً در اینگونه موارد شاهد روندی پر قدرت هستیم. در نتیجه می توان اینگونه بیان کرد که شکستگی قاطع کلاستر روش سیمتری، سیگنال مطمینی برای گرفتن پوزیشن در جهت روند جدید و در خلاف جهت روند فعلی محسوب می گردد.

نکته کلیدی: برای شناسایی انتهای روند ها ابزار زیادی وجود دارد، اما یکی از ساده ترین ابزار، ترسیم تکنیک سیمتری و توجه به کلاستر حاصله از پیاده سازی این تکنیک است. شکستگی این کلاستر هشدار می دهد برای اتمام روند قبلی و شروع روندی جدید است.



در این تصویر نمونه ای از شکستگی کلاستر سیمتری و تغییر روند را شاهد هستید. (صفحه 122)



نمونه ای دیگر از شکسته شدن کلاستر سیمتری و تغییر جهت روند. (صفحه 123)

استراتژی سوم برودن یا استراتژی الگوهای دو مرحله ای:

استراتژی سوم کارولین برودن به استراتژی دو مرحله ای یا Two Step Pattern مشهور است.

نکته کلیدی: مزیت سبک های خانم برودن این است که بعضا اگر شمارش الیوتی واضح نباشد با سبک های ایشان می توان بدون توجه به ساختار الیوتی استراتژی های چهارگانه را بر روی سویینگ ها پیاده نمود. در نتیجه ترکیب سبک الیوت ماینر با سبک های خانم برودن تحلیل ها را دو چندان قوی می کند.

(تصویر صفحه 128 بعدا اضافه شود)

این پترن که بر اساس نسبت های فیبوناچی شکل می گیرد و به همین دلیل پترن هایی قدرتمند هستند، به طور خلاصه از دو بخش تشکیل شده است. یک پترن ABC و یک بازوی حرکتی قبل از این پترن.

قدرت این پترن از این حیث است که چون پترن ABC به خودی خود پترنی قدرتمند می باشد، در صورتیکه با بازوی پیش از خود بر روی نسبت های خاص فیبوناچی ریتریسمنت قرار گیرد، کلاستری بسیار قدرتمند را تشکیل می دهد و قدرت این پترن را چند برابر می کند.

علت دیگر قدرت این پترن این است که جهت روند (یا همان بازوی حرکتی قبل از پترن ABC) قبلا تعیین شده است و در نتیجه مشاهده تریگر در کلاستر قدرتمند این پترن (کلاستر های ریتریسمنتی) شانس ترید موفق را هم جهت با روند اصلی به ما ارائه می دهد. این استراتژی نیز، به ما فرصت ترید هم جهت با روند اصلی را می دهد و به همین دلیل نتایج آن بسیار قوی می باشد.

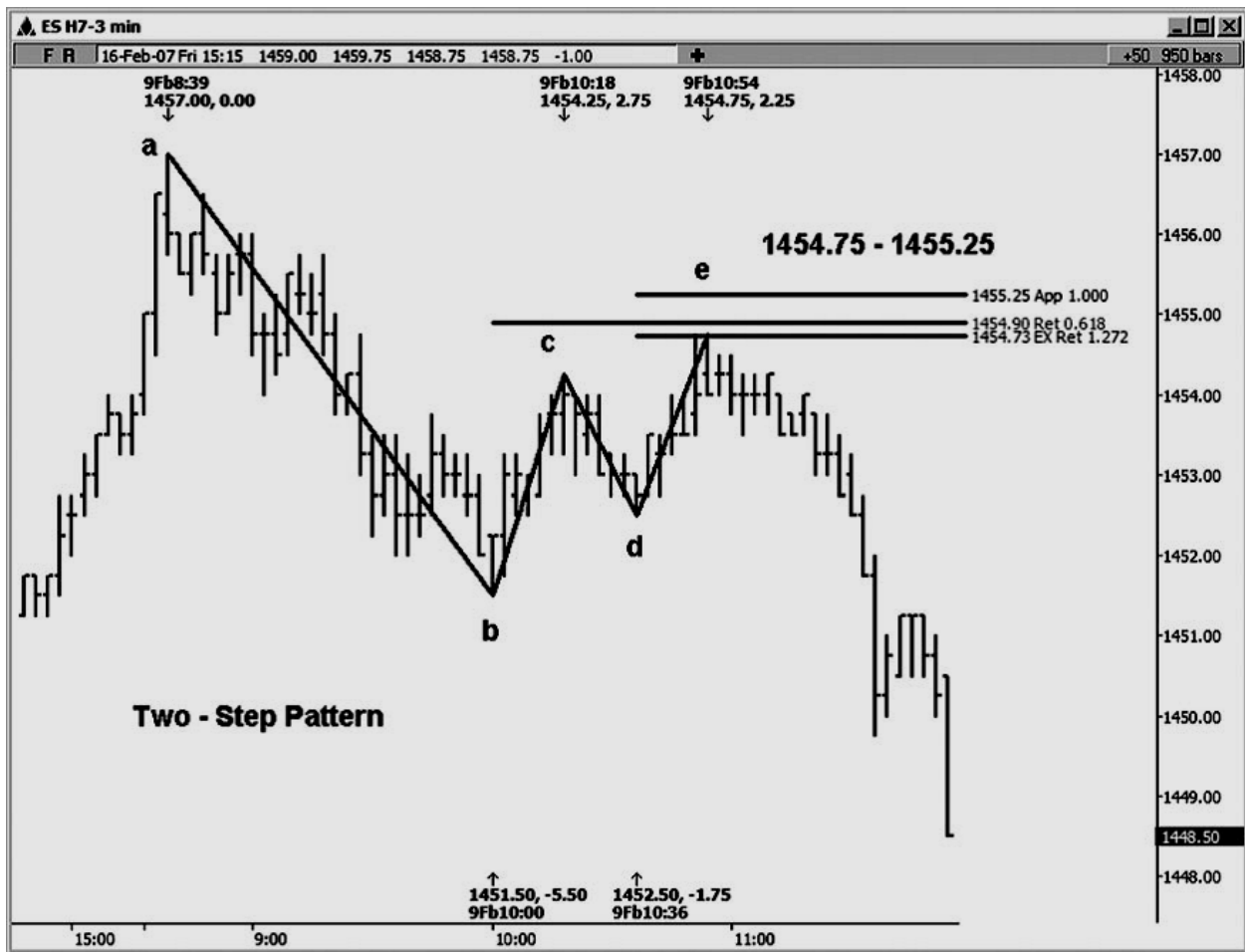
نکته کلیدی: این ساختار در واقع شکل اولیه پترن گارتلی می باشد که در آینده به طور مفصل به آن خواهیم پرداخت.

نکته کلیدی: در این روش انتهای پترن ABC می بایست بر روی یکی از نسبت های 38، 50، 62 و یا 79 بازوی حرکتی قبل از پترن قرار گیرد.

نکته کلیدی: از دیدگاه الیوتی زمانی که انتهای پترن ABC در فاصله نسبت های 38 تا 50 درصد قرار داشته باشد احتمالا در موج چهار و زمانی که انتهای این پترن در فاصله نسبت های 62 تا 79 درصد قرار گیرد احتمالا در موج دو قرار گرفته ایم. اما نباید این پترن را به موج دو یا چهار الیوت محدود کرد چرا که در موج بی و یا ساختار های داخلی و ریزموج ها نیز شکل می گیرد. با این حال دانستن و شناسایی موج های 2،4 و B فیلتر الیوتی مهمی برای شناسایی بهینه الگوها و مرحله ای برودن می باشد.

نکته کلیدی: شکل کامل شده این پترن ها در دوره اسکات کارنی بطور مفصل مورد بررسی قرار خواهد گرفت.

نکته کلیدی: همیشه می توان از سبک های مختلف ترید مانند ماینر، هابز، برودن، کارنی و ... به عنوان تایید بر روی همدیگر استفاده نمود که این موضوع بسیار مهم می باشد.

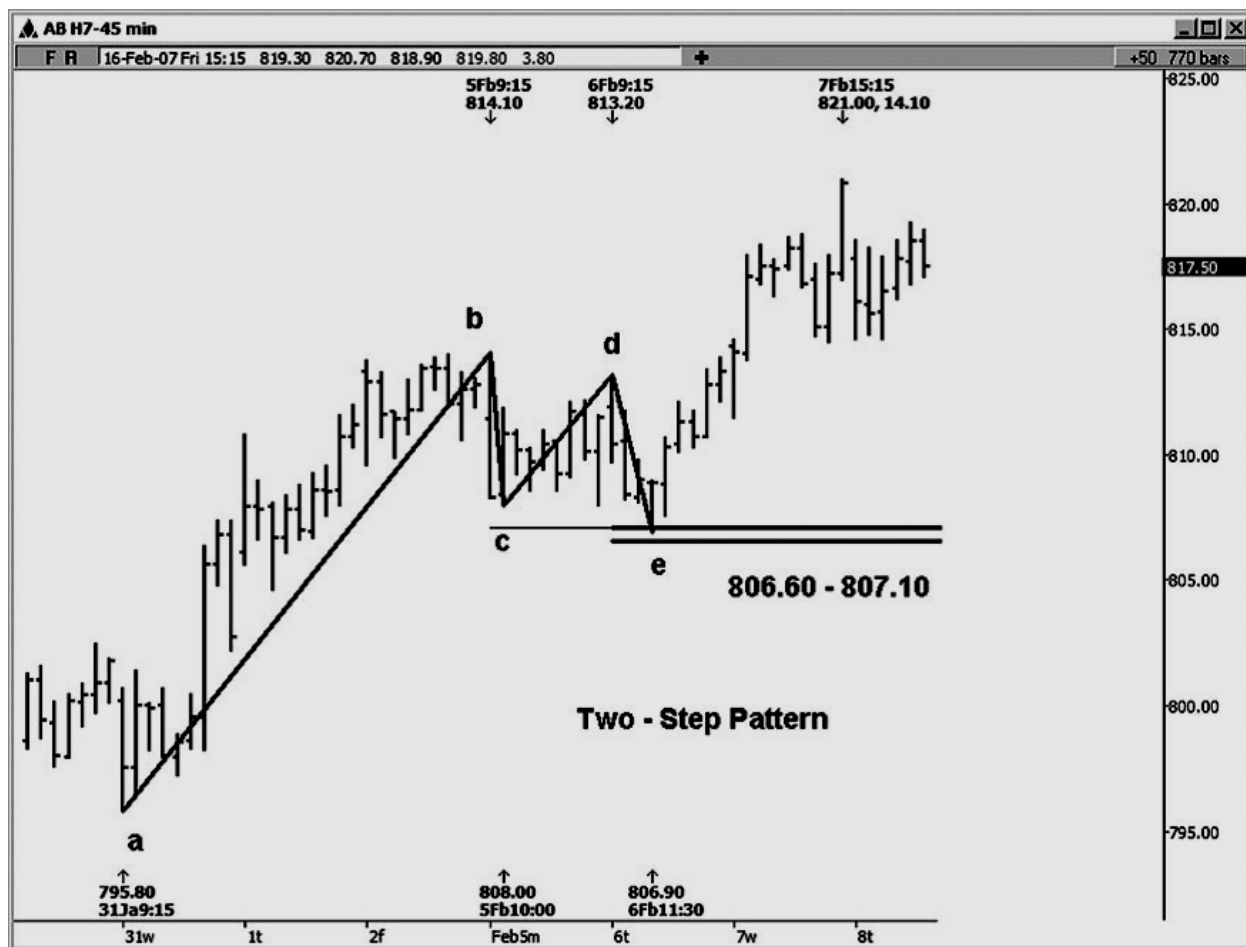


همانطور که در تصویر بالا مشاهده می کنید در الگوهای دو مرحله ای، از تکنیک های سه گانه ریتریسمنت، اکستنشن و پروجکشن به طور همزمان برای ایجاد کلاستری قدرتمند استفاده شده است. (صفحه 131)

نکته کلیدی: در پترن های ABC به سبک اسکات کارنی، اگر این پترن ها بعد از یک ترند قوی شکل گرفته باشد قدرت تحلیلی آنها دو چندان می گردد. به عبارتی دیگر اگر چه پترن های ABC به خودی خود پترن هایی قدرتمند هستند اما وجود یک ترند قوی قبل از این پترن ها، باعث قوی تر شدن کلاستر حاصله در انتهای موج سی این پترن ها می شود. در سبک الیوت نیز شاهد هستیم که پترن های زیگزاگ معمولاً در موج چهار و بعد از یک موج سه که موجی قدرتمند است شکل می گیرند. مقایسه سبک پترن های دو مرحله ای خانم برودن (یک بازوی قوی و یک پترن ABC بعد از آن) با این دو روش، نشان می دهد که هر سه نفر عملاً یک روش را به زبان های گوناگون بیان نموده اند که می تواند تاییدی بر یکدیگر و اهمیت این روش باشند.

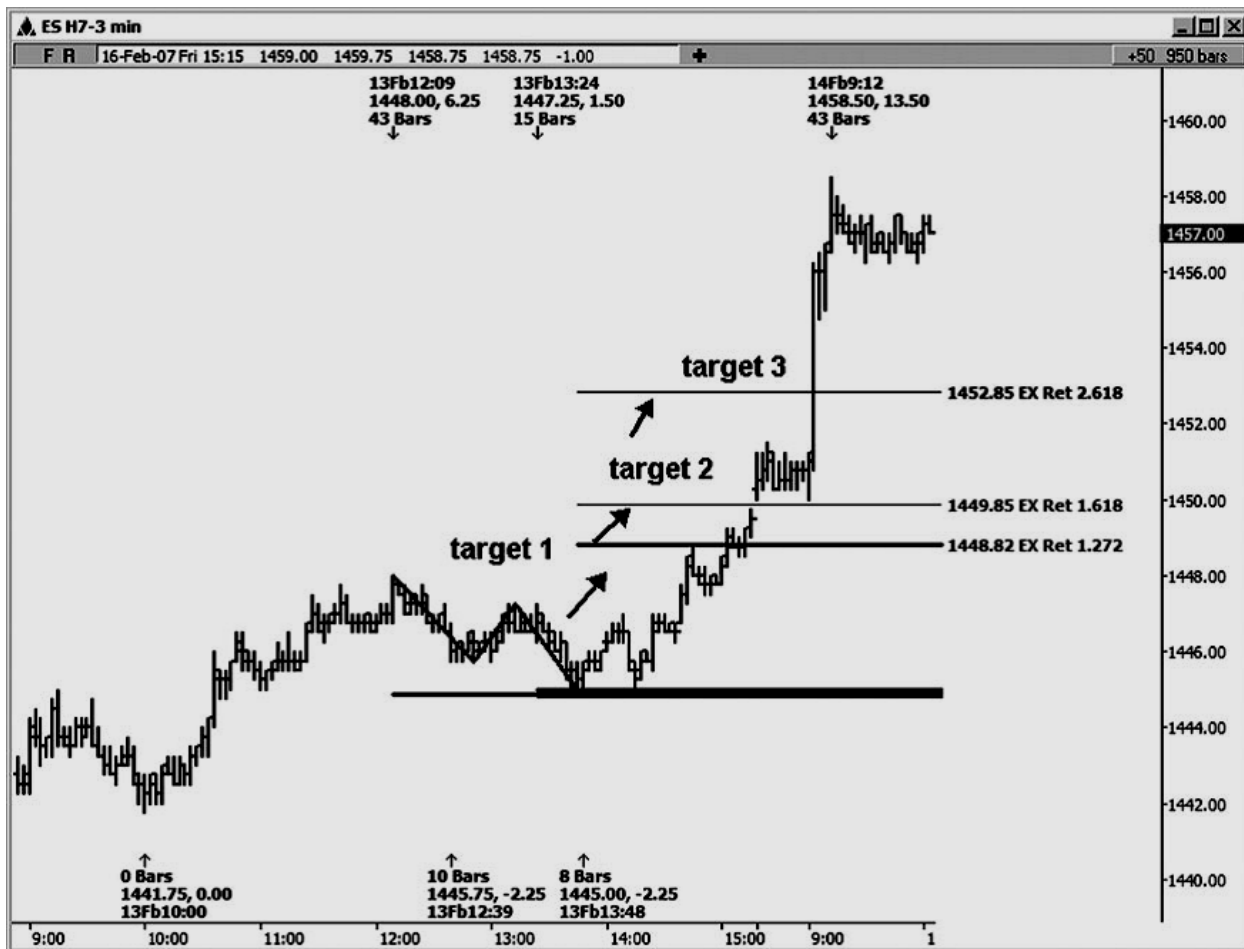
نکته کلیدی: در تصویر فوق از بین اکستنشن 127 و پروجکشن 100 پترن ABC هر کدام به نسبت های اصلی ریتریسمنت موج بزرگتر نزدیک تر باشد مهم تر بوده و به همراه این ریتریسمنت کلاستر محتمل تری را تشکیل می دهد.

نکته کلیدی: تصویر فوق از دید الیوتی بسیار مشابه انتهای یک موج چهار بوده است. پس در این مثال، دو روش الیوت به سبک ماینر و پترن های دو مرحله ای برودن هم زمان تایید کننده سیگنال فروش در انتهای موج سی بوده اند.



تصویر فوق نمونه ای دیگر از پیاده سازی استراتژی الگوهای دو مرحله ای می باشد که در اینجا با ترسیم ریتریسمنت 38 درصد بازوی اول و پروجکشن 100 و اکستنشن 127 از پترن ABC یک کلاستر قدرتمند شکل گرفته است. (صفحه 133)

نکته کلیدی: در بعضی از ارزها مانند دلارین ریتریسمنت های 38 درصدی (ریتریسمنت های نسبتا کوچک) زیاد اتفاق می افتد.



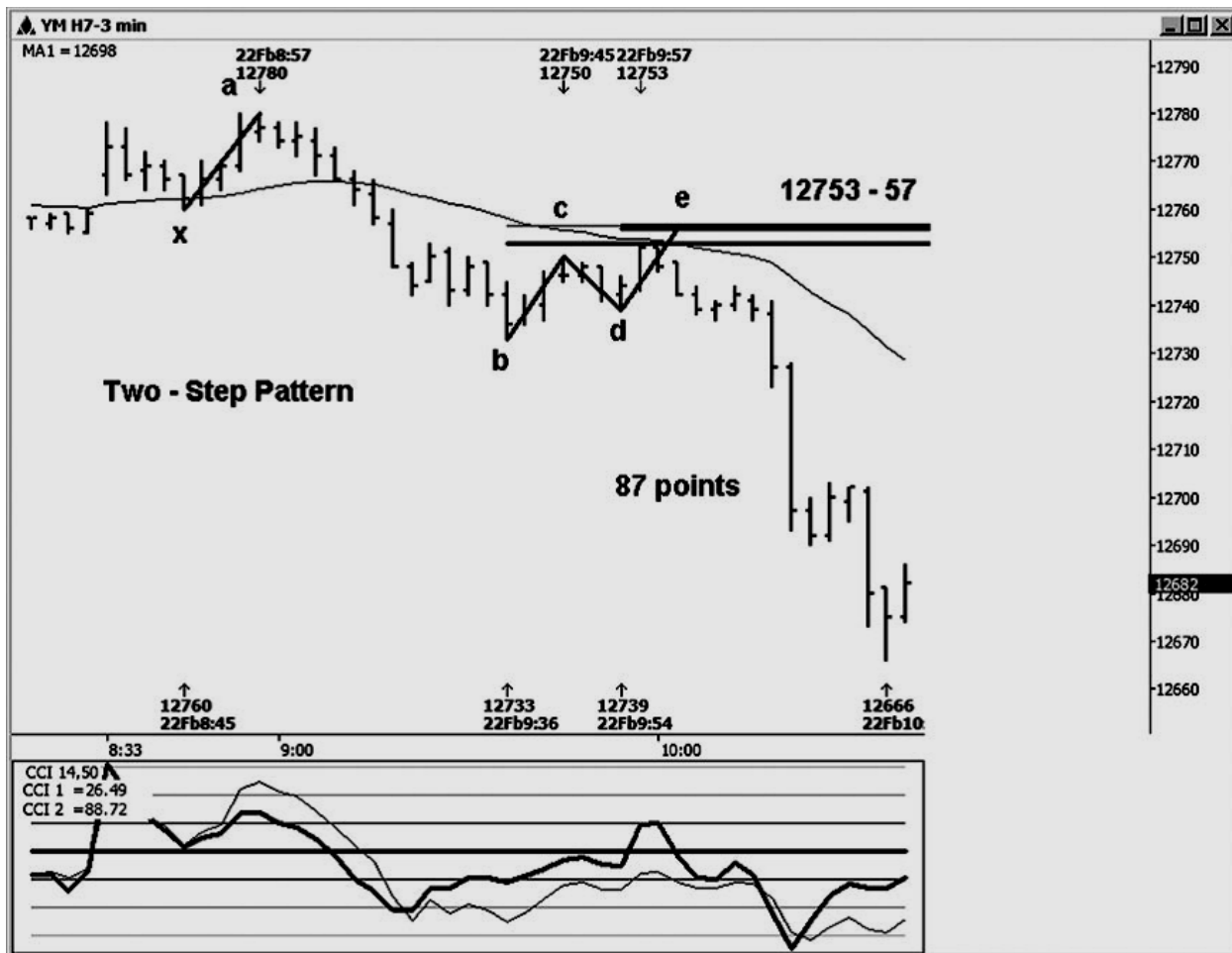
حال این سوال پیش می آید که تارگت مورد نظر در این پترن ها کجا می باشد. (صفحه 136)

در حالت کلی همیشه به یاد داشته باشید که اگر شما یک الیوت کار هستید معمولا تارگت های شما بر اساس کلاسترهای انتهایی موج سه و یا انتهایی موج پنج بدست می آید. اما در اینجا فرض بر این است که شمارش الیوتی نداریم. در این صورت سه مرحله کلی بر اساس نسبت های 127، 162 و 261 فیبوناچی به عنوان تارگت خروج از پوزیشن خواهیم داشت.

نکته کلیدی: عملا نسبت های 127 و 162 اهمیت کلیدی تری دارند.

نکته کلیدی: بهتر است زمانی که به این تارگت ها رسیدیم به جای خروج از پوزیشن شروع به تریلینگ استاپ به روش کندلی کنیم. این موضوع باعث می گردد تا اگر با یک ترند قوی طرف باشیم بتوانیم سود بیشتری از آن ترند بگیریم. در این روش پس از عبور از تارگت با بسته شدن و تثبیت هر کندل استاپ لس به یک پیپ پایین تر یا بالاتر از آن منتقل می گردد.

نکته کلیدی: هر یک لات معامله بر روی طلا معادل یک دلار می باشد، منتها مشکل این است که به جای سه درصد ریسک معامله عملا سی درصد مارجین اکانت را درگیر می کند. با این حال خوبی معامله بر روی طلا در صورتی که تکنیکال باشد این است که در مدت زمانی کوتاه، تارگت یا استاپ لس را زده و تکلیف پوزیشن را سریعاً مشخص می کند.



در تصویر فوق همانگونه که مشاهده می کنید از ترکیب روش پترن های دو مرحله ای و روش سیمتری به طور همزمان استفاده شده است. این ترکیب و تایید چندگانه با استفاده از روش های گوناگون، عملاً اطمینان بیشتری را به تریدر برای انجام تریدی موفق خواهد داد. (صفحه 137)



نمونه ای دیگر از ترکیب روش های پترن های دو مرحله ای و سیمتری را مشاهده می کنید. (صفحه 142)

استراتژی چهارم برودن یا استراتژی سیمتری برای تایم فریم های کوچک:

این استراتژی در واقع همان استراتژی سیمتری برای تایم های کوچک می باشد. این استراتژی از نظر برودن، قوی ترین و کاربردی ترین استراتژی کتاب او و همچنین استراتژی محبوب او به شمار می آید. ایشان در تالار سیگنال های لایو روزانه خود بارها سیگنال های دریافتی از پیاده سازی این استراتژی را ارایه می دهند.

نکته کلیدی: روش سیمتری ارایه شده توسط کارولین برودن در حالت استاندارد (تایم فریم های بزرگ تر از یک ساعت) فیلتری ندارد و در تایم های بالا از فیلتری که هابز بوسیله اندیکاتور ADX ارایه می دهد و بسیار موثر می باشد استفاده می کنیم که در جای خود به شرح آن خواهیم پرداخت.

نکته کلیدی: در فریم های کوچک تر (مانند سه، پنج، پانزده و سی دقیقه) به دلیل نوسانات زیادی که بازار دارد خانم برودن دو فیلتر ارایه کرده اند که در صورتی که پتانسیل های شکل گرفته شده تاییدیه این دو فیلتر را نیز داشته باشند، در صورت شکل گیری تریگر وارد معامله خواهیم شد. این دو فیلتر عبارتند از:

- 1- میانگین حرکت یا مووینگ اوریج 34 EMA
- 2- اندیکاتور CCI با پارامتر های خاص (50 و 14)

نکته کلیدی: در تایم فریم های زیر 15 دقیقه، کارولین برودن از تکنیک های زمانی استفاده نمی کند.

نکته کلیدی: زمان هایی که بازار برای مدتی رنج می شود یک راه حل این است که برای انجام ترید و تحلیل به تایم فریم های کوچکتر برویم. در اینگونه مواقع از استراتژی های متناسب با این فریم ها، همانند استراتژی کارولین برودن می توان استفاده نمود.

نکته کلیدی: بهتر است همیشه زمانی از تحلیل های سبک خانم کارولین برودن استفاده نماییم که هم جهت با تحلیل الیئتی ما باشد. تحلیل الیوتی به سبک ماینر به عنوان مرجع اصلی باید همیشه مد نظر یک تریدر باشد.

نکته کلیدی: سایت آقای Kenwood را برای اندیکاتور CCI بررسی و مطالعه نمایید.

www.woodiescciclub.com

مراحل چهارگانه استراتژی چهارم خانم برودن یا Ideal Setup (ستاپ ایده آل):

مراحل چهار گانه این استراتژی به ترتیب به شرح زیر می باشد:

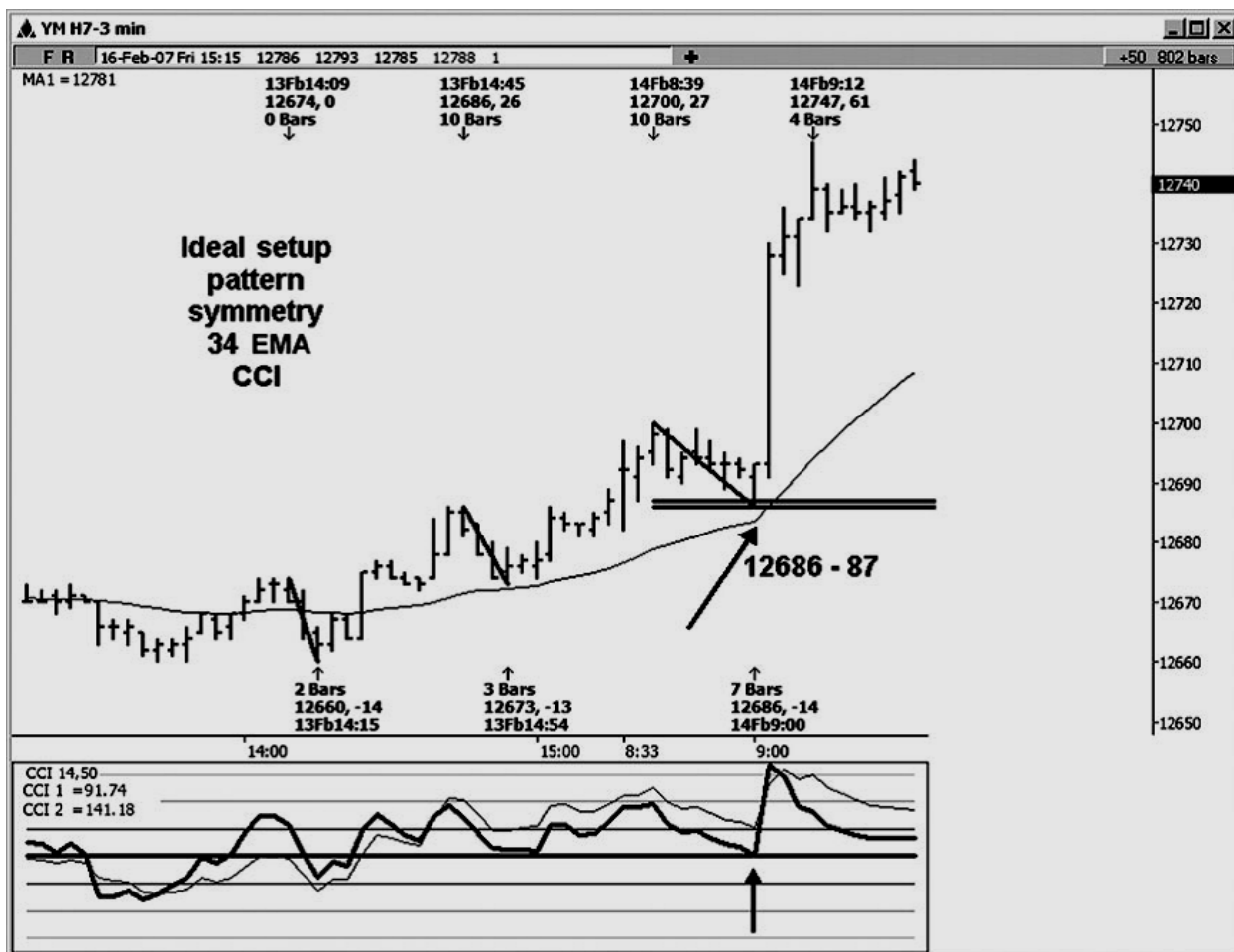
- 1- ابتدا در تایم فریم کوچک مانند تایم فریم 5 دقیقه جهت روند را تشخیص می دهیم. قبلا نحوه تشخیص جهت روند آموزش داده شده است. برای روند های صعودی باید شاهد HH و HL باشیم و در روند های نزولی باید شاهد LL و LH باشیم. در صورتی که روند، جهت مشخصی نداشته باشد و بازار اصطلاحا سایید باشد کلا تریدی انجام نمی دهیم.
- 2- استراتژی سیمتری را که قبلا توضیح داده شده است بر روی چارت پیاده می کنیم. به عبارتی دیگر بعد از تشخیص روند یک یا چند کارکشن اصلی را شناسایی می کنیم و سپس در صورت مشاهده بازگشت روند، پروجکشن آنرا بر روی ترند پیاده می سازیم. همانطور که می دانیم در روش سیمتری نسبت 100 پروجکشن، نسبت اصلی و مهم است.
- 3- زمانی که روند قیمت به کلاستر انتهای پروجکشن کشیده شده رسید، وضعیت میانگین متحرک 34EMA را مورد بررسی قرار می دهیم. برای یک روند صعودی (حالت خرید یا بای) مووینگ اوریج مذکور باید زیر روند قیمت قرار داشته باشد. همچنین برای یک روند نزولی (حالت فروش یا سل) مووینگ اوریج 34EMA باید بالای روند قیمت قرار داشته باشد.
- 4- در صورتی که هر سه شرط فوق محقق گردید حال وضعیت اندیکاتور CCI را بررسی خواهیم نمود. از این اندیکاتور با پارامتر های 14 و 50 استفاده می نماییم. در یک روند صعودی (پتانسیل خرید) و در زمانی که شاهد یک تریگر کندلی در کلاستر مربوطه با رعایت بند 3 هستیم هر دو پارامتر 14 و 50 این اندیکاتور باید بالای خط صفر یا مرکزی این اندیکاتور باشند و در حالت فروش هر دو پارامتر باید زیر خط مرکزی اندیکاتور باشد.

نکته کلیدی: برودن معتقد است اگر تنها به همین روش به خوبی مسلط شوید، به تنهایی با همین سیستم سود بسیار خوبی را در بازار بدست خواهید آورد.

نکته کلیدی: در بازار فارکس به دلیل نوساناتی که دارد از این استراتژی در تایم فریم های 15 و 30 دقیقه نیز قابل استفاده می باشد. بالاتر از آن با استفاده از این فیلترها توصیه نمی گردد.

- 5- یک مرحله اضافی پنجم نیز داریم. در صورتی که جهت روند کلی تایم فریم مورد نظر با تایم فریم بالاتر همسو باشد قدرت این روش دو چندان می گردد و شانس موفقیت ترید افزون می گردد. مثلا اگر در تایم فریم 15 دقیقه سیگنال خرید داشته باشیم و در فریم یک ساعته روند نزولی باشد این احتمال وجود دارد که این سیگنال یک حرکت کارکشن مقطعی باشد و در نتیجه ریسک این ترید افزایش می یابد. پس حالت بهینه و شرایط ایده آل در شرایطی رخ می دهد که علاوه بر هر چهار مرحله اول، جهت ترید نیز هم سو با جهت بازار در یک یا دو تایم فریم بالاتر باشد.

نکته کلیدی: بهتر است این روش را برای مدتی در بازار فارکس تست نمایید تا از نتایج آن اطمینان بیشتری پیدا کنید.

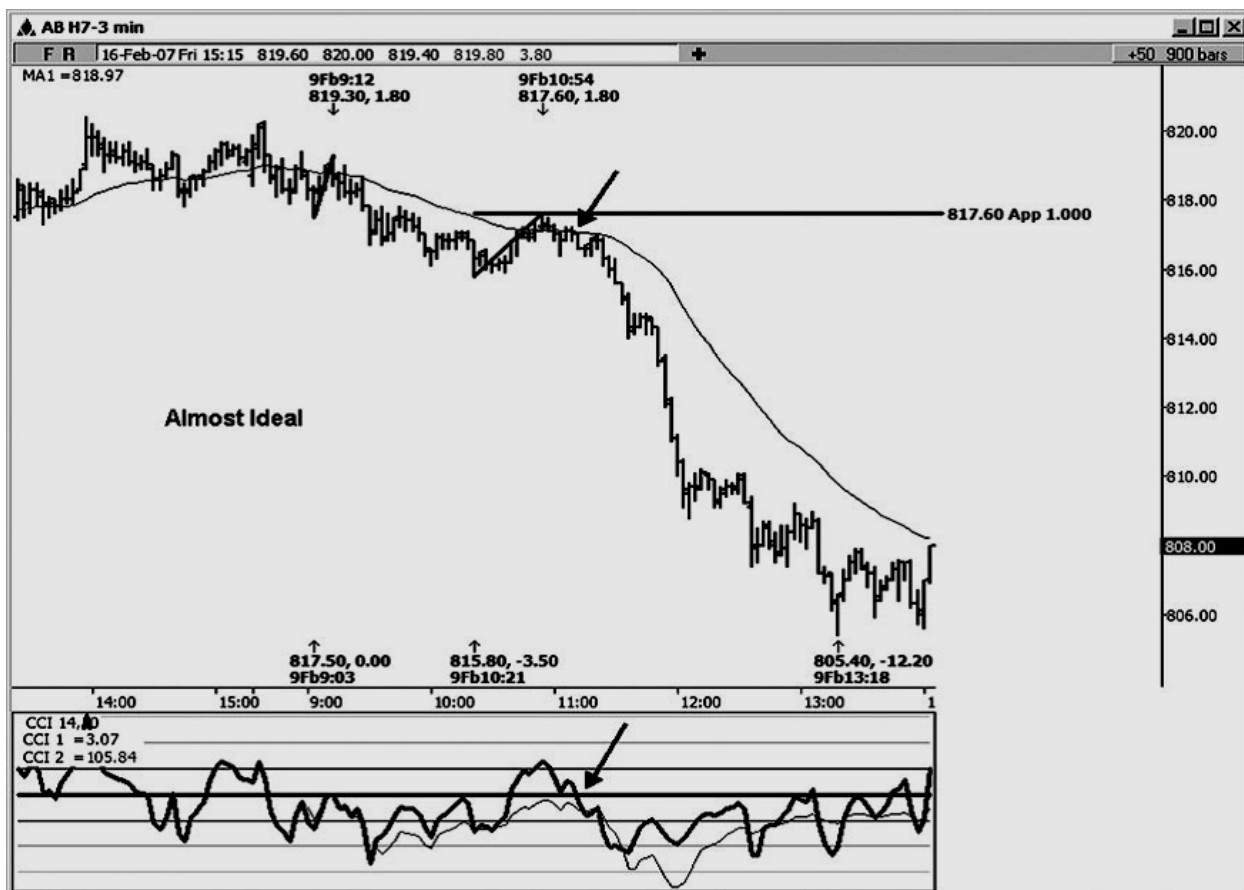


تصویر فوق مثالی از سیستم استراتژی ستاپ ایده آل خانم برودن می باشد. (صفحه 250)

همانطور که می بینید هر چهار شرط اصلی در اینجا به شرح زیر محقق گشته است:

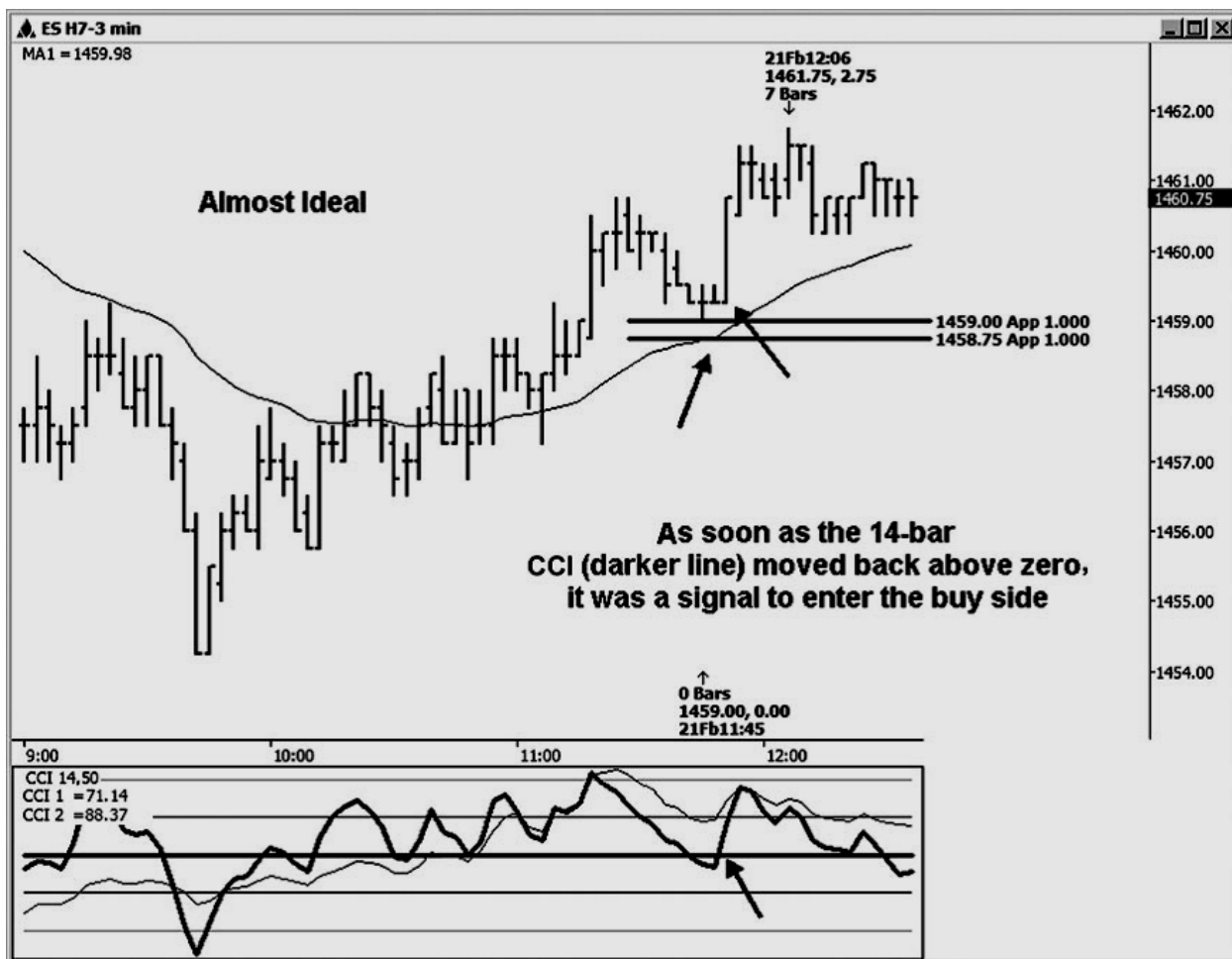
- 1- شناسایی جهت روند که صعودی بودن بازار را نشان می دهد.
- 2- تکنیک های استراتژی سیمتری بر روی چارت پیاده شده است که در اینجا کلاستر سیمتری داریم. به خاطر دارید که به دلیل اهمیت این روش حتی یک نسبت پروجکشن 100 به تنهایی نیز می تواند پاسخگو باشد که البته با داشتن کلاستر شرایط به مراتب مطلوب تری، مهیا می گردد.
- 3- مووینگ اوریج 34EMA در زیر خط قیمت قرار دارد. (وضعیت مناسب جهت خرید در بازار صعودی)
- 4- دو خط 14 و 50 اندیکاتور CCI بالای خط مرکزی، قرار گرفته اند. (وضعیت مناسب جهت خرید در بازار صعودی)

نکته کلیدی: در وضعیت های مشابه که چند سیمتری ایده آل شکل گرفته باشد، آن موردی ارجح تر است که در اندیکاتور CCI پارامتر 14 (همان خط ضخیم تر و تیره تر) خط صفر را در لحظه تریگر لمس کرده باشد و به آن نزدیک باشد همانند آنچه در همین مثال اتفاق افتاده است که شرایط را بسیار ایده آل نموده است.



تصویر فوق مثالی دیگر از همین روش در یک بازار نزولی می باشد(صفحه 253)

نکته کلیدی: همانطور که می بینیم در زمانی که پروجکشن به کلاستر رسیده است و تریگر کندلی نیز شکل گرفته است، شرایط مناسبی در مویینگ اوریج 34EMA و همچنین خطوط 14 و 50 اندیکاتور CCI وجود نداشته است. در این شرایط نباید عجله نمود و ابتدا باید صبر کرد تا خط مویینگ اوریج به وضوح بالای خط قیمت قرار گیرد. همچنین باید منتظر بود تا خط 50 و به خصوص 14 اندیکاتور CCI خط مرکزی را به سمت پایین کراس کند و در منطقه مطلوب برای سل قرار گیرد. پس از ایجاد این شرایط و با تثبیت کندل می توان یک پیپ زیر آن یک پندینگ اردر سل جهت فروش جفت ارز مورد نظر قرار داد.



مجددا مثالی دیگر از سیستم چهارم کارولین برودن می باشد که در این مثال شرط چهارم مهیا نبوده است و باید منتظر شویم تا کراس خط مرکزی یا خط صفر اندیکاتور CCI توسط خط 14 صورت پذیرد و بعد از آن وارد پوزیشن شویم (صفحه 259)



abcBourse.ir

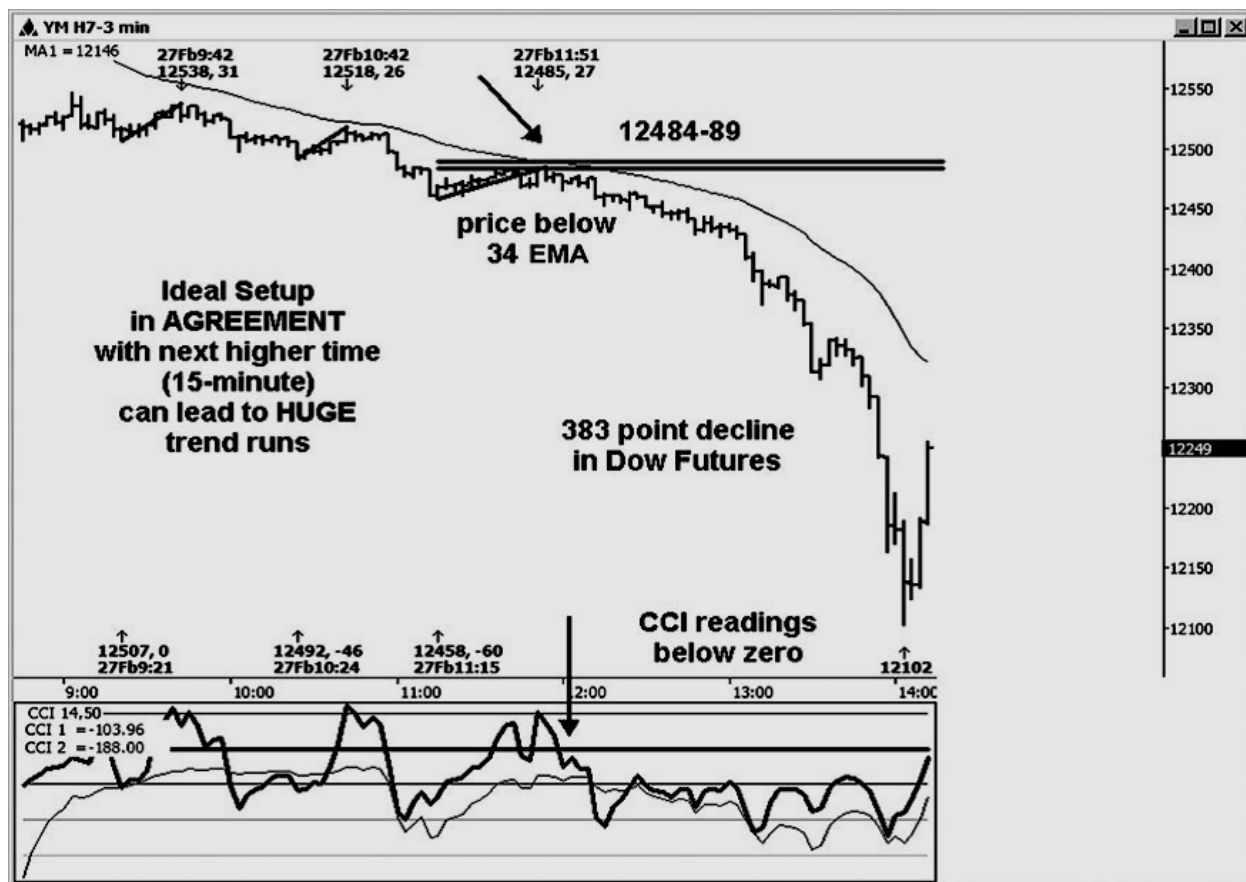


@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس

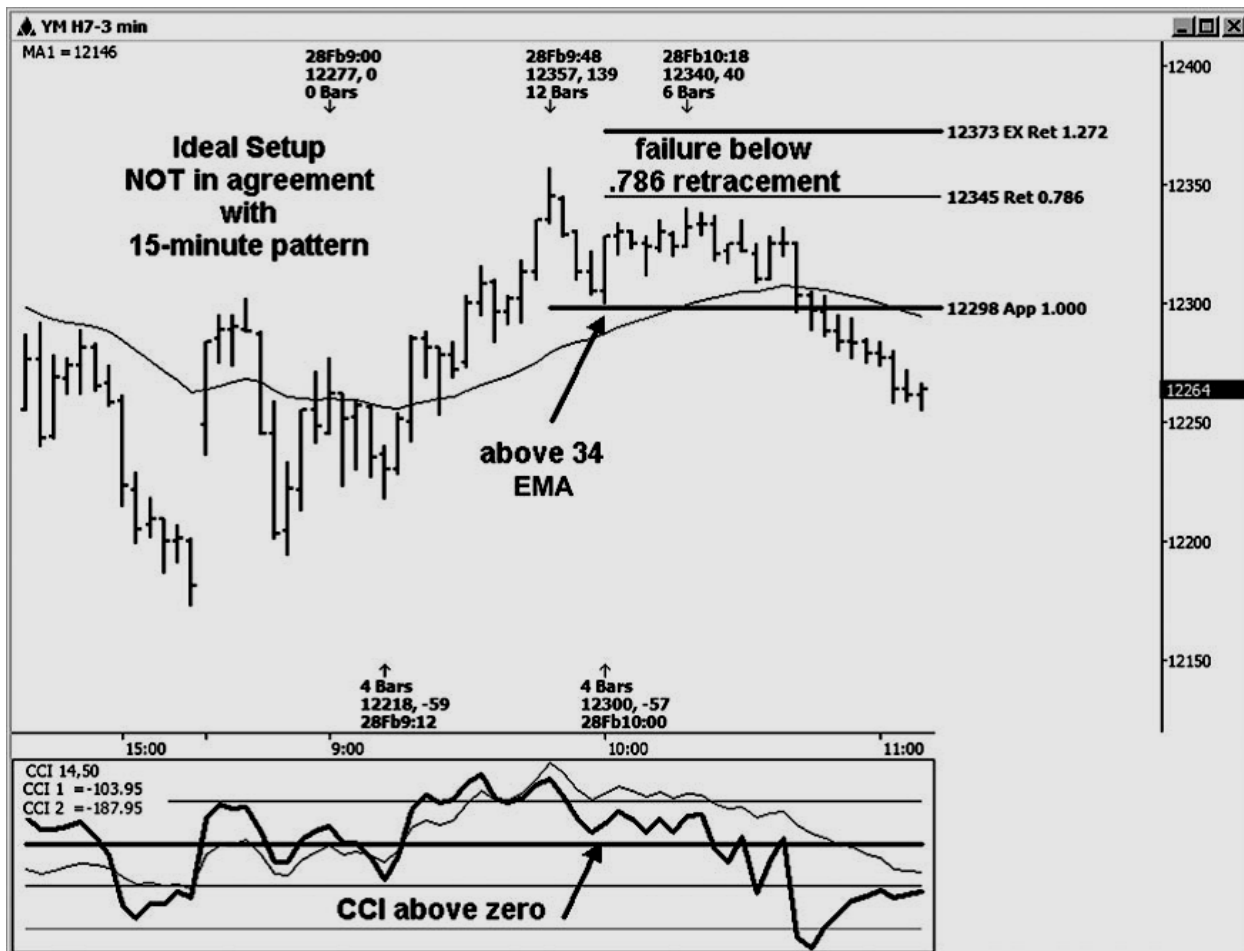


بازنشر:



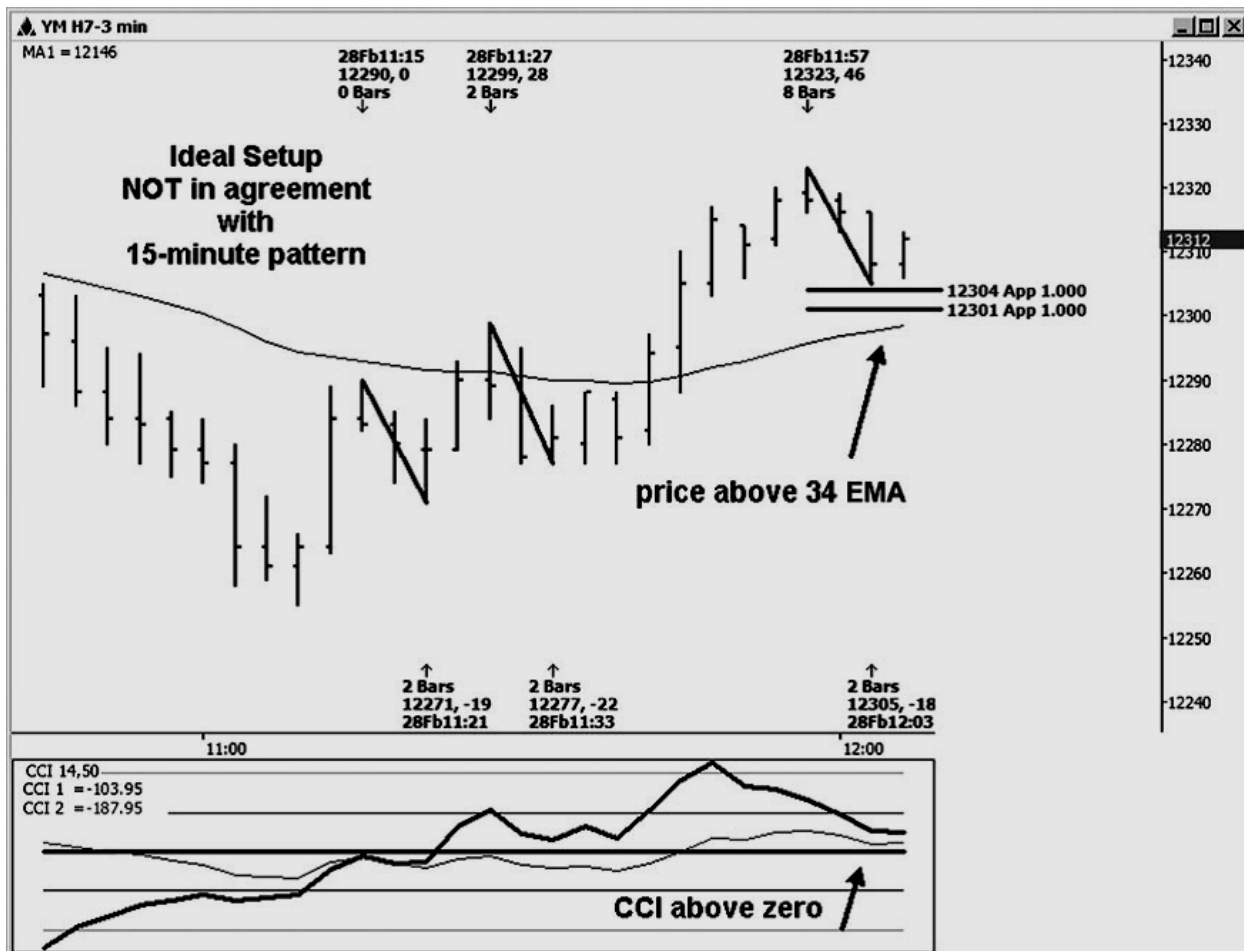
در تصویر فوق هر چهار شرط مورد نیاز مهیا بوده است و به همین دلیل شاهد ریزش خوبی بوده ایم. (صفحه 263)

نکته کلیدی: یک روش مطمئن و مناسب برای تریدینگ استاپ، تریدینگ بر اساس مووینگ قمرز رنگ الیگیتور می باشد بدین معنی که با بسته شدن و تثبیت هر کندل، استاپ لس را به یک پیپ زیر یا بالای مووینگ قمرز رنگ منتقل می نمایم.

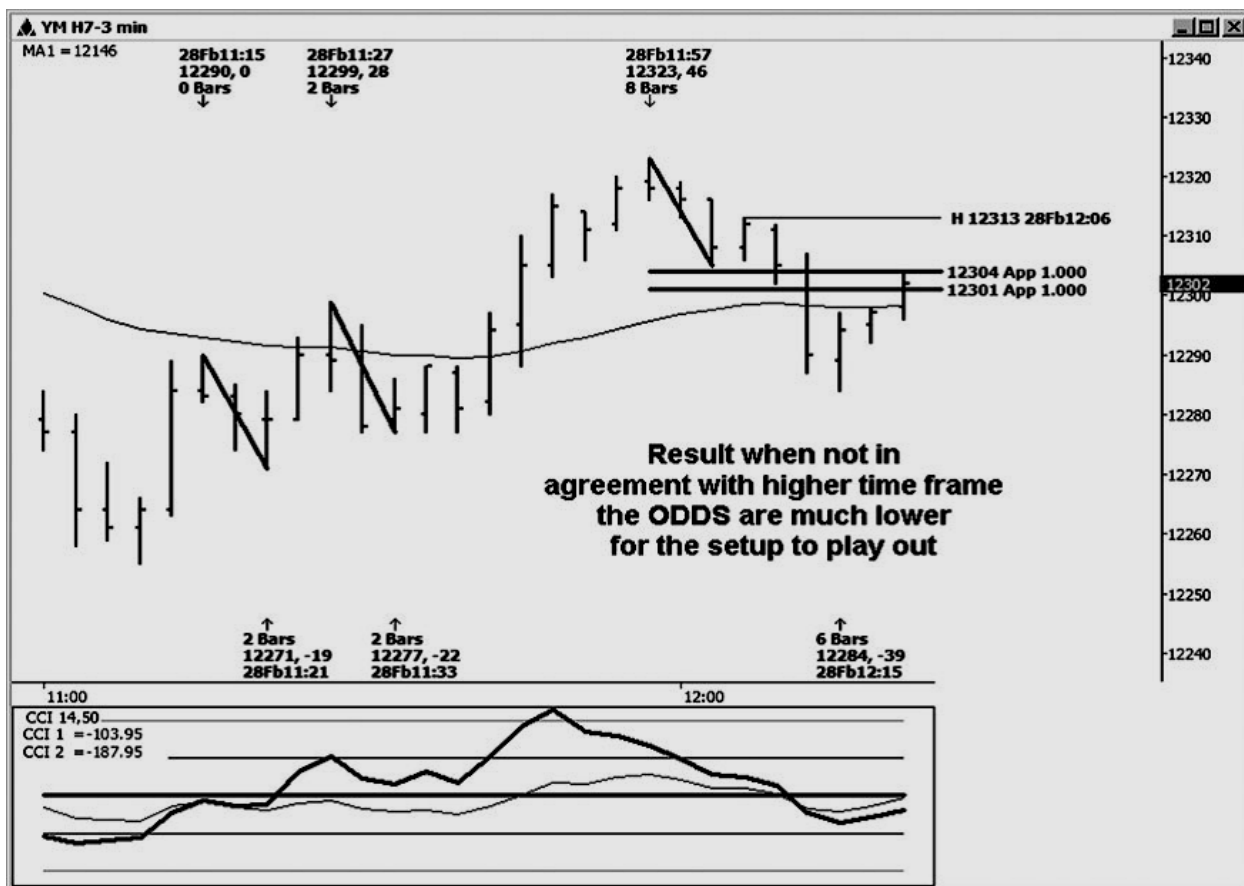


در تصویر فوق با وجودی که هر چهار شرط تاییدی بر خرید در بازار بوده است، با این حال تحلیل Fail شده است که دلیل عمده آن عدم تحقق همان شرط اضافی پنجم و هم جهت نبودن پوزیشن با روند تایم فریم بالاتر بوده است (صفحه 264)

نکته کلیدی: حتی در صورت تحقق هر چهار شرط اصلی خانم برودن برای ستاپ ایده آل، ترجیحا هم جهت با روند در تایم فریم های بالاتر ترید نمایید تا نتایج بهتری را کسب کنید.



در تصویر فوق همانطوری که می بینیم هر چهار شرط لازم برای یک پوزیشن خرید وجود داشته است. ضمن اینکه به دلیل هم جهت بودن پوزیشن با روند در تایم های بالاتر شرط پنجم نیز ورود به پوزیشن را تایید می کرده است که در اسلاید بعد نتیجه غیر منتظره آنرا ملاحظه می کنید. (صفحه 267)



همانطور که ملاحظه می کنید علیرغم مهیا بودن هر پنج شرط سیستم چهارم خانم برودن، بازار ریزش نموده است اما توجه داشته باشید که اصلا تریگر کندلی ما فعال نشده است و ما وارد مارکت نشده ایم (صفحه 268)

نکته کلیدی: حتما با تریگر کندلی همانند وایز من یا سایر تریگر های کندلی و از طریق پندینگ اردر (بای استاپ و سل استاپ) وارد بازار شوید.

نکته کلیدی: به یاد داشته باشید که فیلتر های خانم برودن برای تایم فریم های 5، 15 و 30 دقیقه در بازار فارکس کارایی داشته و ترجیحا در تایم فریم های بالاتر از آن از این نوع فیلتر استفاده نکنیم.