

بنام خالق هستی

ایچیموکو کینکو هایو:

روش ایچیموکو کینکو هایو ، طی سالیان ، به طرز موفقیت آمیزی در ژاپن استفاده می شود ، ولی در دنیای غرب آنچنان مورد توجه قرار نگرفته است . اگر یک معامله گر ، شمع های ژاپنی را با ایچیموکو ترکیب نماید ، ابزار قدرتمندی را برای خود فراهم خواهد آورد .

در ابتدا سعی خواهیم نمود تا شما رو با اجزای نوسان نمای ایچیموکو کینکو هایو آشنا نمایم :

ایچیموکو سیستمی هست که از پنج خط اصلی تشکیل شده است :

Five Lines in One System

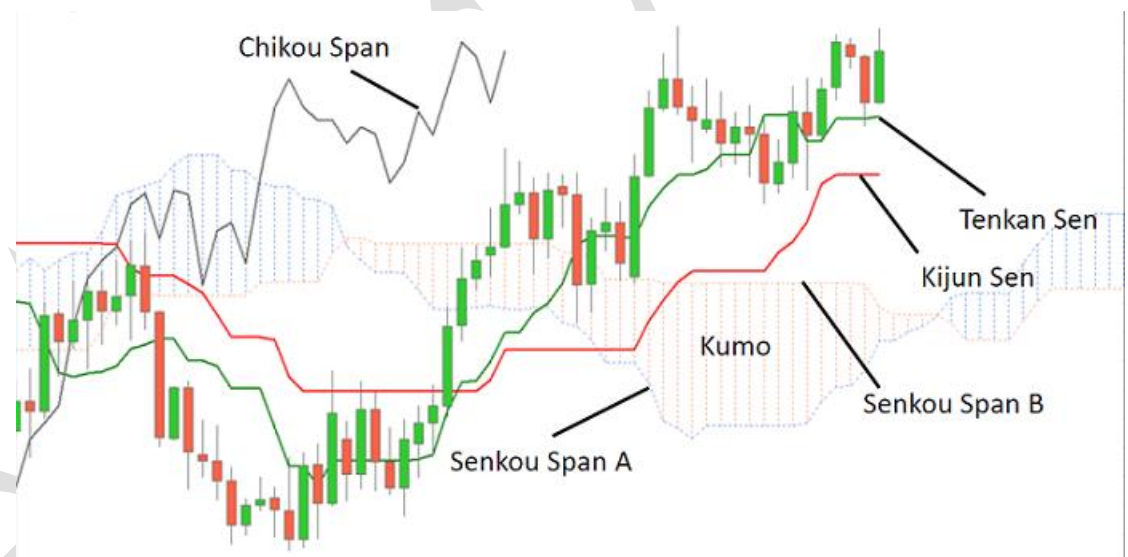
۱- تنکانسن (tenken sen)

۲- کیجونسن (kijun sen)

۳- چیکواسپین (chikou span)

۴- سنکواسپین a

۵- سنکواسپین b



توضیح :

در نرم افزارهای مختلف رنگ هر یک از اجزاء متفاوت هست که در نرم افزار متاتریدر به طور پیش فرض تنکانسن به رنگ قرمز ، کیجونسن به رنگ آبی و چیکواسپین به رنگ سبز می باشد

که در استراتژی های معاملاتی رنگ این اجزاء متفاوت خواهد بود جهت یادگیری با تنوع رنگ

تنکانسن :

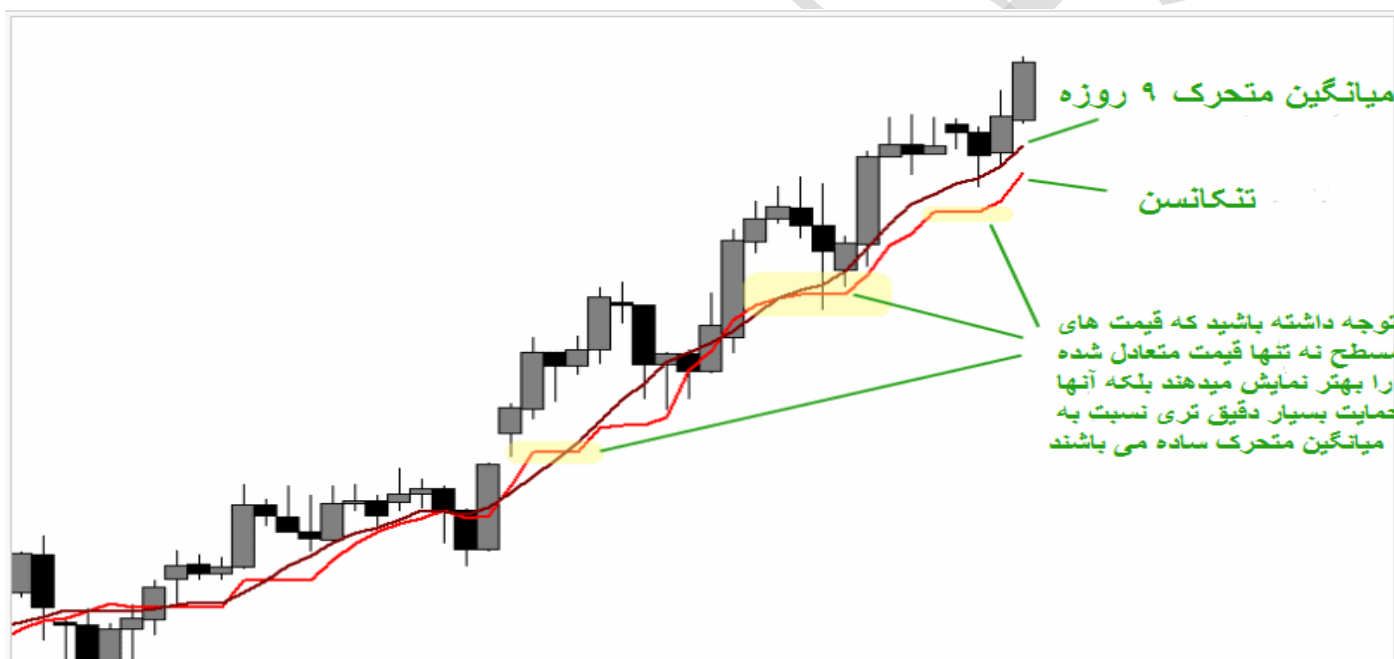
اولین نوسان نمایی که مورد بحث قرار خواهیم داد ، تنکانسن خواهد بود ، این نوسان نما نمایانگر حرکات کوتاه مدت بازار می باشد. رابطه نوسان نمای تنکانسن به صورت زیر می باشد :

$$\text{برای } 9 \text{ روز} \quad 2 \div (\text{بالترین قیمت} + \text{پایین ترین قیمت})$$

تنکانسن برای محاسبه میانگین متحرک ، به جای قیمت پایانی از میانگین بالاترین قیمت و پایین ترین قیمت استفاده می کند ، با این کار فراریت میان روزی در نظر گرفته می شود .

توجه : کلمه متحرک به این نکته اشاره دارد که فقط به میانگین n روز آخر را در محاسبات لحاظ کنیم

در شکل پایین تنکانسن و میانگین متحرک 9 روزه ساده نمایش داده شده است . همانطور که مشاهده می نمایید تنکانسن با استفاده از میانگین بالاترین و پایینترین قیمت به جای قیمت پایانی ، حرکات کوتاه مدت بازار را بهتر از میانگین متحرک ساده نمایش میدهد .



در رابطه با تنکانسن، باید به موارد زیر توجه نمایید :

تمایلات :

اگر قیمت بالای تنکانسن بسته شود صعودی می باشد و بالعکس اگر قیمت پایین تنکانسن بسته شود نزولی هست

تنکانسن باید در جهت روند ، حرکت نماید هر چه شیب آن بیشتر باشد با روند قوی تری مواجه هستیم ، اگر تنکانسن جهت خاصی را دنبال نکند ، بازار دچار بی تصمیمی شده است . معامله در این

شرایط احتیاط بیشتری می طلبد ، زیرا ممکن است روند کوتاه مدت به پایان خود نزدیک شده باشد .
 در شکل زیر نمودار فولاد مبارکه را مشاهده می نمایید:



تنکانسن در واقع نوعی مقاومت/حمایت کوتاه مدت است . عبور قیمت از تنکانسن اتفاق مهمی است ،
 چرا که بازار یکی از مهمترین مقاومت های/حمایت های کوتاه مدتش را پشت سر گذاشته است .
 تصویر پایین مربوط به سهم کشرق می باشد که با عبور قیمت از تنکانسن سهم با رشد قیمت مواجه
 شده است :



تنکانسن باید به قیمت نزدیک باشد. از نزدیکی قیمت و تنکانسن می توان دریافت که با روندی مواجه هستیم که با سرعتی آهسته و فراریتی کم ، در حال حرکت است . اگر قیمت از تنکانسن دور شود ، احتمال بسیار زیادی وجود دارد که مجدداً به آن باز گردد زیرا بیش از اندازه از تعادل خارج شده است .

کیجونسن (Kijun sen):

نوسان نمای بعدی مورد بحث کیجون سن خواهد بود که در نرم افزار متاتریدر به رنگ آبی می باشد که در تصاویر نیز به همین رنگ انتخاب شده است .

این نوسان نما نشا نگر حرکات میان مدت بازار می باشد. بنابراین اغلب معامله گران می توانند از این نوسان نما استفاده نمایند

رابطه کیجون سن به صورت زیر می باشد :

برای ۲۶ روز $\div 2$ (بالاترین قیمت + پایین ترین قیمت)

کیجونسن شباهت بسیار زیادی با میانگین متحرک ساده ۳۰ روزه دارد که توسط معامله گران خرده مورد استفاده قرار می گیرد

مانند تنکانسن ، کیجونسن نیز بر اساس میانگین بالاترین و پایین ترین قیمت محاسبه میشود ، با این تفاوت که تنکانسن بالاترین و پایین ترین قیمت را برای ۹ روز در نظر میگیرد ولی کیجونسن برای ۲۶ روز .

کیجونسن یکی از نوسان نماهای کلیدی برای روش ایچیموکو می باشد . اغلب روش های معاملاتی ایچیموکو حول محور این نوسان نما گردش می کنند . موارد زیر نکاتی است که باید در مورد کیجونسن در نظر بگیرید :

وقتی قیمت بالای کیجونسن بسته شود صعودی می باشد و بالعکس زمانی که قیمت پایین کیجون سن بسته شود نشانه نزول می باشد

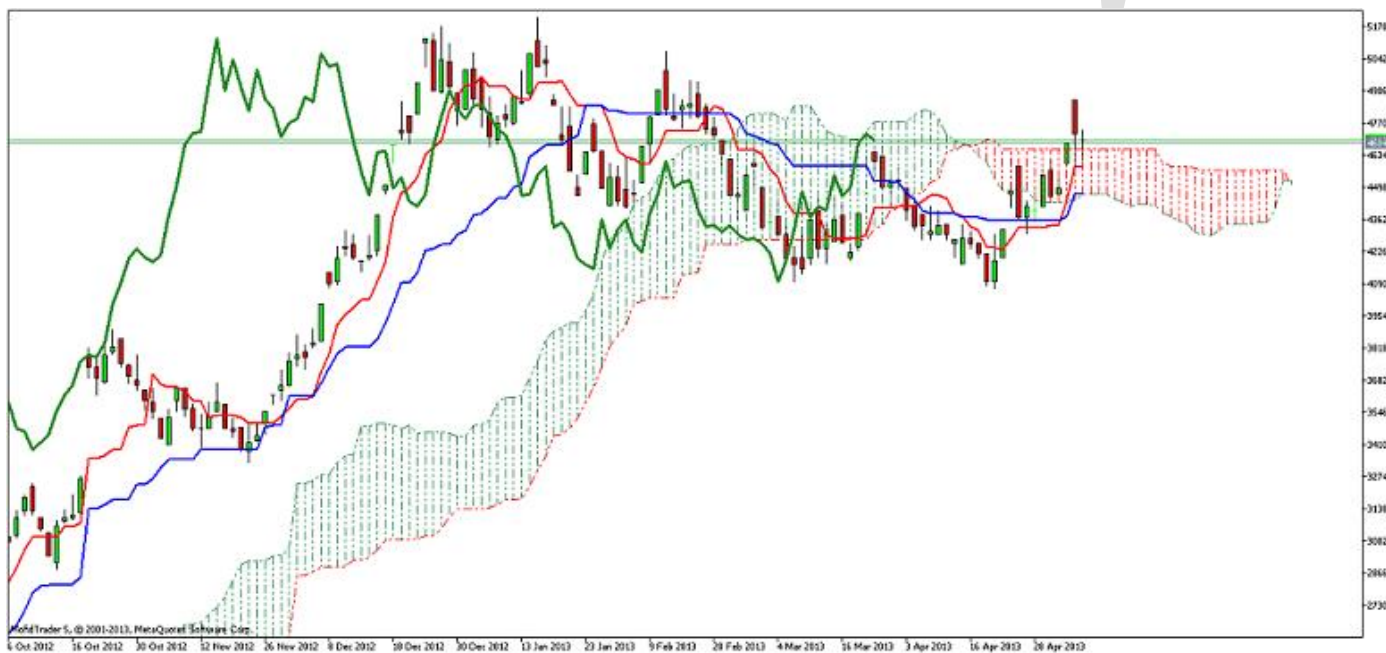
کیجونسن باید هم جهت با روند حرکت نماید . هر چه شیب حرکتی کیجونسن بیشتر باشد با روند قوی تری مواجه هستیم ، کیجونسن زمانی حرکت صعودی خواهد داشت که قیمت از میانگین بالاترین و پایینترین قیمت بازار طی ۲۶ روز گذشته ، بزرگتر باشد. برخلاف تنکانسن ، حرکات قیمت تاثیر کمتری بر کیجون سن می گذارد . کیجونسن در تشخیص روند به ۲۶ روز زمان نیاز دارد

حال یک سوال مطرح میشود (از این سوالهایی که در معاملات روزانه مطرح میشود نیست!!!!)

آیا نقطه آغاز روند را از دست می دهیم؟

جواب به این پرسش مثبت است ، مطمئنا آغاز روند را از دست میدهیم زیرا باید آنقدر منتظر بمانیم تا روند خود را کاملا آشکار سازد .

کیجونسن به عنوان حمایت/مقاومت نیز عمل می نماید ، بازار با شکست کیجونسن یکی از مهمترین مقاومت ها و حمایت های بازار را پشت سر گذاشته است .



وقتی بازار کیجونسن را قطع می نماید احتمال بازگشت در روند وجود دارد . لحاظ این احتمال جهت آمادگی برای عقب نشینی اصلی یا بازگشت روند ، حیاتی به نظر میرسد به هر حال این احتمال نیز وجود دارد که هیچکدام از این دو نیز به وقوع نپیوندد.

توجه : برای چارچوب زمانی روزانه کیجونسن تقریبا اطلاعات یک ماه رو نشون میدهد در حالی که تکناسن بدون در نظر گرفتن آخر هفته ها نمایانگر تقریبا یک هفته و نیم میباشد .

مهم : کیجونسن در برخی موارد و حتی بیشتر به عنوان حمایت و مقاومت در نمودار عمل میکند

زمانی که کیجونسن مسطح است ، قیمت در برخورد به آن ، بستگی به این دارد که از کدام جهت به سمتش نزدیک میشود که به عنوان مقاومت یا حمایت عمل میکند . کیجونسن باید همیشه نزدیک قیمت حرکت کند و وقتی قیمت از کیجون سن فاصله میگیرد نشانگر این هست که با سرعت بیشتری در حال تغییر هست ، یک روند خوب روندی هست که قیمت و کیجونسن با آهنگ ثابت و نزدیک به هم حرکت میکنند .

چیکواسپین (chikou span) :

نوسان نمای سومی که مورد بررسی قرار خواهیم داد چیکواسپین می باشد ، این نوسان نما نمایانگر مومنتوم بازار است . به عبارت دیگر احتمال وقوع روند را تشخیص می دهد. به یاد دارید که :

روند به حالتی از بازار تلقی میشود که برای مدت زمان طولانی در یک جهت حرکت کند .

من جهت آموزش با استفاده از نرم افزار متاتریدر از رنگ سبز استفاده نموده ام که ممکن است رنگ این ابزار در نرم افزار ها متفاوت باشد .

چیکو اسپن چیزی نیست جز نمودار فعلی قیمت که ۲۶ روز به عقب منتقل شده است .

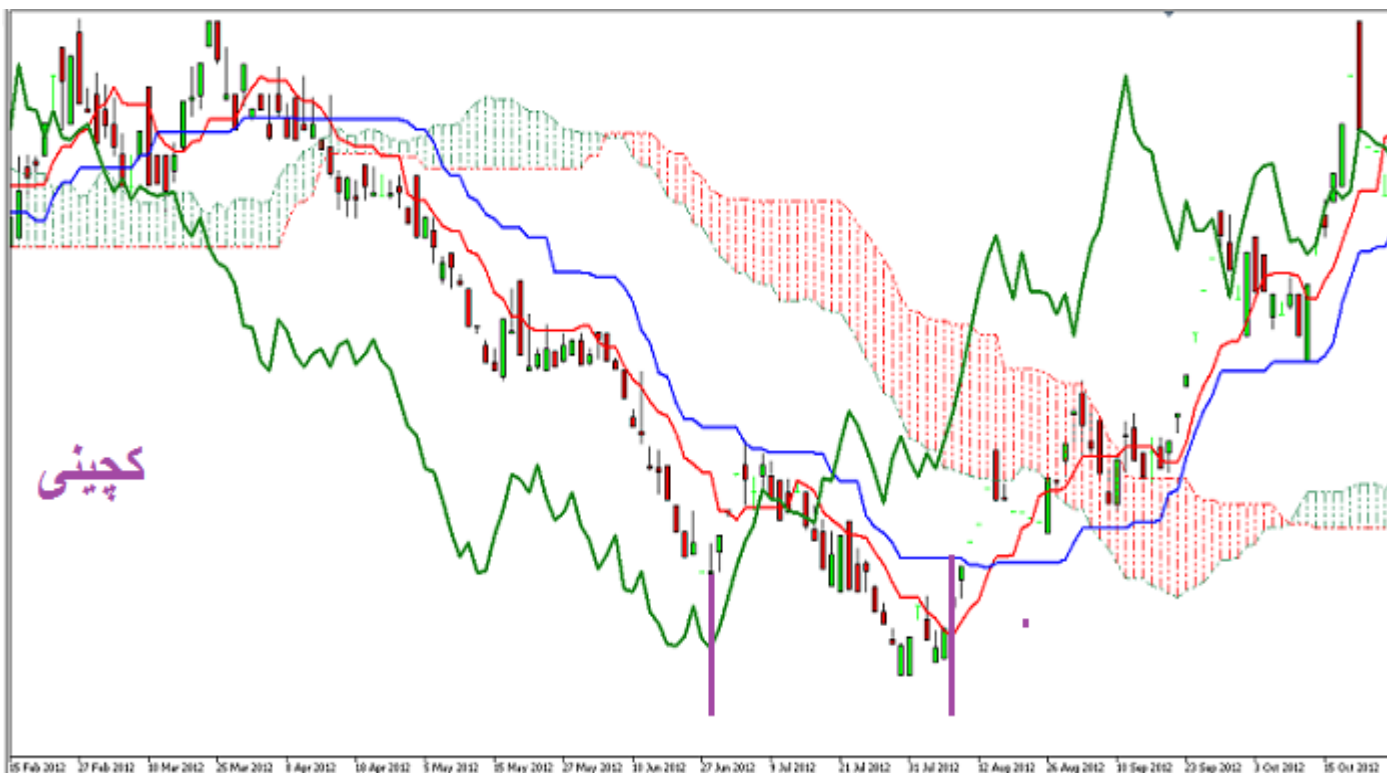
چیکو اسپن علیرغم سادگی ، نوسان نمایی است که اکثر معامله گران قادر به درک آن نیستند و البته ، یکی از نوسان نماهای محبوب به شمار میرود

همانطور که گفته شد این نوسان نما اصولاً همان نمودار قیمت امروز است که به ۲۶ روز قبل منتقل شده است .



در رابطه با چیکواسپین به نکات زیر توجه نمایید :

اگر چیکواسپین بالای نمودار قیمت در ۲۶ روز گذشته باشد ، یعنی با رسم یک خط عمودی تا قیمت ، اگر چیکو اسپن بالای قیمت باشد تمایلات سهم صعودی است و اگر با رسم یک خط عمودی تا قیمت ، نوسان نما در پایین قیمت باشد تمایلات نزولی می باشد و اگر چیکواسپین به قیمت طی ۲۶ روز گذشته بسیار نزدیک باشد نشانه بی تصمیمی می باشد.



با توجه به آموزش تا این حد سعی میکنیم تا تصویر بالا که مربوط به کچینی می باشد را مورد بررسی قرار دهیم ، قیمت در یک روند نزولی قرار دارد و زیر هر دو نوسان نمای تنکانسن و کیجونسن قرار دارد و تنکانسن به عنوان مقاومت مهم سهم به شمار می رود چیکواسپن هم در پایین قیمت قرار دارد با توجه به خط عمودی که رسم کردیم پس سهم شدیداً در روند نزولی قرار دارد .

توجه :

به مانند تصویر بالا ، اگر چیکواسپن در فضای باز به سر برد ، در روند پایدار قرار داریم ، زیرا قیمت امروز به مقاومت /حمایت ۲۶ روز بعد وارد نشده است.

قله ها و دره های چیکواسپن ، نواحی مهم حمایت و مقاومت به شمار می روند ، اگر خطی افقی از یکی از قله ها و یا دره های چیکواسپن رسم نمایید ، نشانگر ناحیه حمایتی/مقاومتی می باشد . اگر دره ها و قله های بسیاری بودند که به این خط افقی برخورد می کردند ، این ناحیه را یک ناحیه مقاومت . حمایت اصلی در نظر میگیریم. اگر دو یا بیشتر قله یا دره با این خط برخورد داشته باشد ، عموماً این نقطه یکی از نسبت های فیبوناچی خواهد بود .

اجزای ابر کومو :

دو نوسان نمای باقیمانده ، سنکو اسپن A و سنکو اسپن B می باشند. این دو نوسان نما را به صورت متفاوتی به نسبت نوسان نمایهای دیگر مورد بررسی قرار می دهیم، زیرا این دو اطلاعات زیادی به همراه تشکیل ابر کومو به همراه دارند. ابر کومو همان فضای بین سنکو اسپن A و سنکو اسپن B می باشد که به دو صورت رنگ آمیزی میشود:

اگر سنکو اسپن A از سنکو اسپن B بالاتر باشد ، ابر به رنگ سبز در می آید (صعودی)

و اگر سنکو اسپن A از سنکو اسپن B پایینتر باشد ، ابر به رنگ قرمز در می آید که در نرم افزار متاتریدر شما می توانید این رنگ ها را به دلخواه خود تغییر دهید. رنگ هایی که من برای خودم انتخاب کرده ام سبز و قرمز می باشند .



سنکواسپن A :

نوسان نمای چهارمی که مورد بحث قرار میدهم و نیمی از ابر کومو را تشکیل میدهد ، رنگ این نوسان نما سبز می باشد و از رابطه زیر تشکیل میشود :

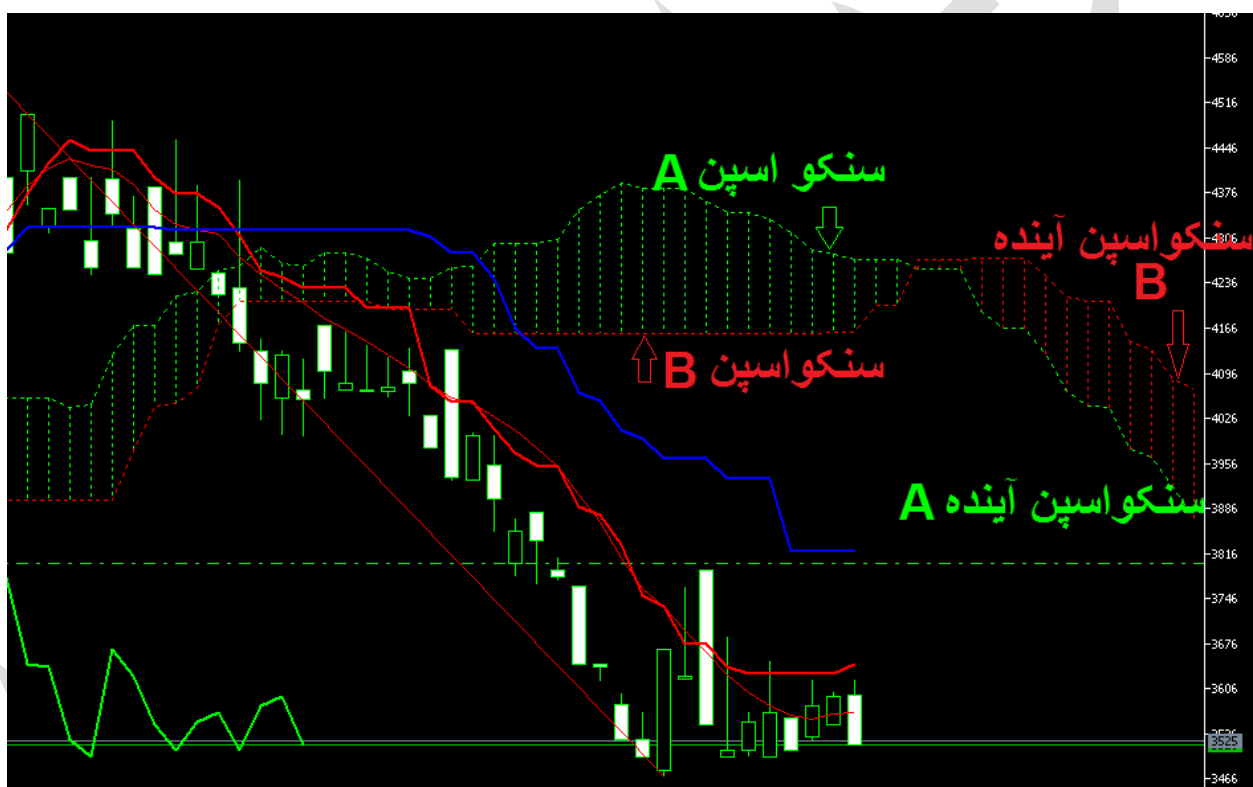
$$2 = (\text{تنکاسن} + \text{کیجونسن}) \text{ و انتقال به } 26 \text{ روز بعد}$$

سنکو اسپن B:

نوسان نمای پنجم مورد بحث سنکو اسپن B می باشد که به رنگ قرمز می باشد و از رابطه زیر به دست می آید :

برای ۵۲ روز $\div 2$ (بالاترین قیمت + پایین ترین قیمت) و سپس ۲۶ روز انتقال به جلو این نوسان نما بیشترین دوره را در بین نوسان نما های دیگر ایچیموکو دارد

این نکته را نیز مورد توجه قرار دهید که دو سنکو اسپن ، دو نوع میباشند که سنکو اسپن های فعلی + سنکو اسپن های آینده



سنکو اسپن B سطح نمایانگر یکی از مهمترین نواحی مقاومت و حمایت بازار است ، هر چه یکنواختی سنکو اسپن B بیشتر به طول بیانجامد ناحیه مقاومت و حمایت قوی تری ایجاد می کند در شکل بالا که مربوط به نمودار روزانه کچینی می باشد مشاهده می نمایید که سنکو اسپن B سطح شده و قیمت از آن عبور نموده است که نشانه ریزش شدید قیمتی می باشد .

حال ، در اینجا میخواهیم به این نکته اشاره کنیم که در نمودار ما دو ابر کومو داریم که از دید برخی از تحلیلگران به دور هست ،

ابر کوموی فعلی : ابر بالا یا پایین نمودار قیمت فعلی هست

ابر کوموی آینده : ابری که ۲۶ روز از نمودار فعلی قیمت **جلوتر** است

که سعی خواهیم کرد در استراتژی های معاملاتی به نکته بسیار مهمی در این موضوع اشاره کنیم.

بعد از معرفی اجزاء ابرهای ایچیموکو ، قصد داریم تا استراتژی های معاملاتی ایچیموکو را نیز معرفی نماییم :

در زیر استراتژیهای ایچیموکو عنوان شده اند که هر یک با تصاویر بسیار جالبی توضیح داده خواهند شد

البته باید توجه نمایید که رنگ این ابزار در این تصاویر متفاوت با متاتریدر می باشد که صرفاً جهت آشنایی و درک موضوع شما می باشد

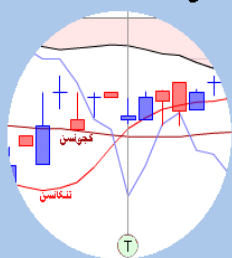
استراتژی تقاطع کیجونسن و تنکانسن :

اصول ورود به معامله خرید برای استراتژی تقاطع کیجونسن و تنکانسن به صورت زیر می باشد :

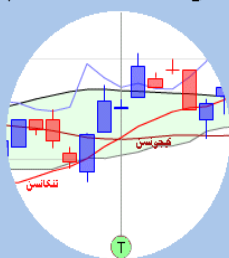
تقاطع تنکانسن (Tenkan Sen) و کیجون سن (Kijun Sen)

استراتژی تقاطع تنکان سن و کیجون سن

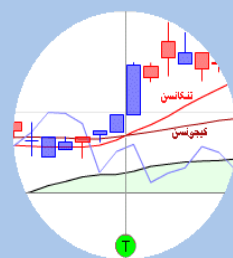
سیگنال صعودی : سیگنال صعودی زمانی اتفاق می افتد که تنکانسن از پایین کیجونسن را به طرف بالا قطع نماید



سیگنال ضعیف صعودی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع زیر ابر کومو باشد

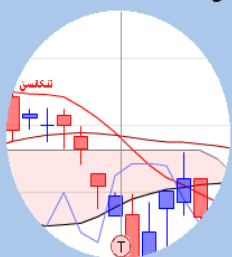


سیگنال صعودی خنثی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع درون ابر کومو باشد

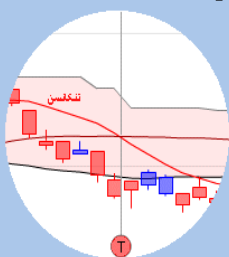


سیگنال صعودی قوی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع بالای ابر کومو باشد

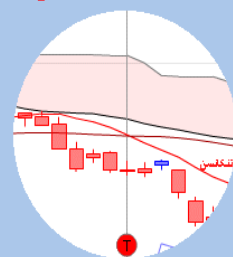
سیگنال نزولی : سیگنال نزولی زمانی اتفاق می افتد که تنکانسن از بالا کیجونسن را به طرف پایین قطع نماید



سیگنال نزولی ضعیف زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع بالای ابر کومو باشد



سیگنال نزولی خنثی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع درون ابر کومو باشد



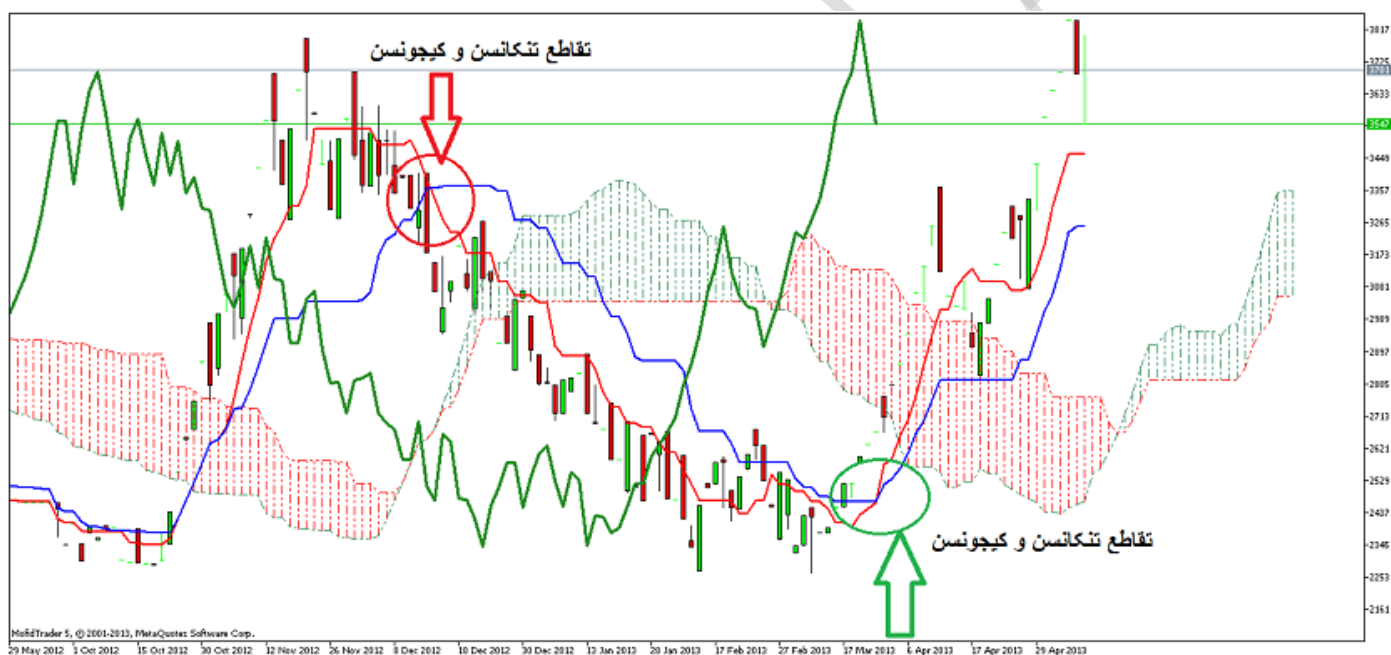
سیگنال نزولی ضعیف زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع پایین ابر کومو باشد

قیمت بالای ابر کومو باشد و یا فاصله قابل قبولی از ابر کوموی غیر ضخیم داشته باشد و تنکانسن ، کیجونسن را به سمت بالا قطع نماید و چیکو اسپن در فضای باز باشد و همچنین قیمت ، تنکانسن و کیجونسن و چیکواسپن نباید در ابر کومو واقع شده باشند

اصول ورود به معامله فروش :

قیمت پایین ابر کومو باشد و یا فاصله قابل قبولی از ابر کوموی غیر ضخیم داشته باشد و تنکانسن ، کیجونسن را به سمت پایین قطع نماید و همینطور چیکو اسپن در فضای باز باشد و همه ابزار ها در داخل ابر کومو واقع نشده باشد .

نمودار روزانه فنوال:

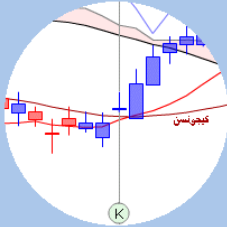


استراتژی قطع کیجونسن :

استراتژی تقاطع کیجونسن

سیگنال تقاطع کیجونسن زمانی اتفاق می افتد که قیمت کیجونسن را قطع نماید

سیگنال صعودی : سیگنال صعودی زمانی اتفاق می افتد که قیمت از پایین به بالا کیجونسن را قطع نماید



سیگنال ضعیف صعودی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع پایین ابر کومو باشد



سیگنال خنثی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع درون ابر کومو باشد

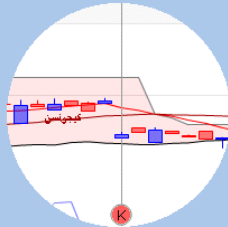


سیگنال قوی صعودی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع بالای ابر کومو باشد

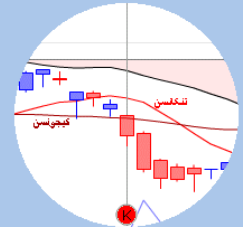
سیگنال نزولی : سیگنال نزولی زمانی اتفاق می افتد که قیمت از بالا به پایین کیجونسن را قطع نماید



سیگنال نزولی ضعیف زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع بالای ابر کومو باشد



سیگنال خنثی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع درون ابر کومو باشد



سیگنال قوی نزولی زمانی اتفاق می افتد که :
تقاطع پایین ابر کومو باشد

این استراتژی ، یک استراتژی معامله روزانه (کوتاه مدت) می باشد

اصول استراتژی ورود به معامله خرید به صورت زیر می باشد :

قیمت از کیجونسن عبور نماید و اگر تنکانسن از کیجونسن پایینتر باشد ، در زمان مسطح بودن کیجونسن ، تنکانسن باید جهت رو به بالا داشته باشد و بهتر است تنکانسن از کیجونسن بالاتر باشد و همچنین چیکو اسپن در فضای باز باشد و در پایان سنکواسپن B آینده باید مسطح یا رو به بالا باشد .

اصول استراتژی ورود به معامله فروش :

قیمت پایین ابر کومو بسته شود و اگر تنکانسن از کیجونسن بالاتر است ، بنابراین در زمان مسطح بودن کیجون سن ، تنکانسن باید جهت رو به پایین داشته باشد ، سنکو B آینده باید مسطح یا رو به پایین باشد ، قیمت و تنکانسن و کیجونسن و چیکواسپن در داخل ابر کومو نباشند و قیمت از تنکانسن و کیجونسن فاصله زیادی نداشته باشد

استراتژی تقاطع سنکو اسپن ها :

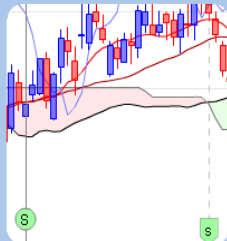
استراتژی تقاطع سنکو اسپن ها

سیگنال تقاطع سنکو اسپن ها زمانی اتفاق می افتد که سنکو اسپن A سنکو اسپن B را قطع نماید

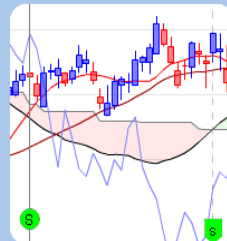
سیگنال صعودی : زمانی اتفاق می افتد که سنکو اسپن A از پایین به بالا سنکو اسپن B را قطع نماید



سیگنال ضعیف صعودی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت پایین ایر کومو باشد

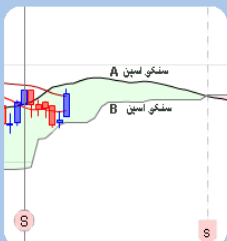


سیگنال خنثی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت درون ایر کومو باشد

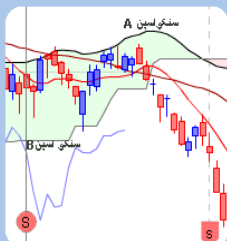


سیگنال قوی صعودی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت بالای ایر کومو باشد

سیگنال نزولی : زمانی اتفاق می افتد که سنکو اسپن A از بالا به پایین سنکو اسپن B را قطع نماید



سیگنال ضعیف نزولی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت بالای ایر کومو باشد

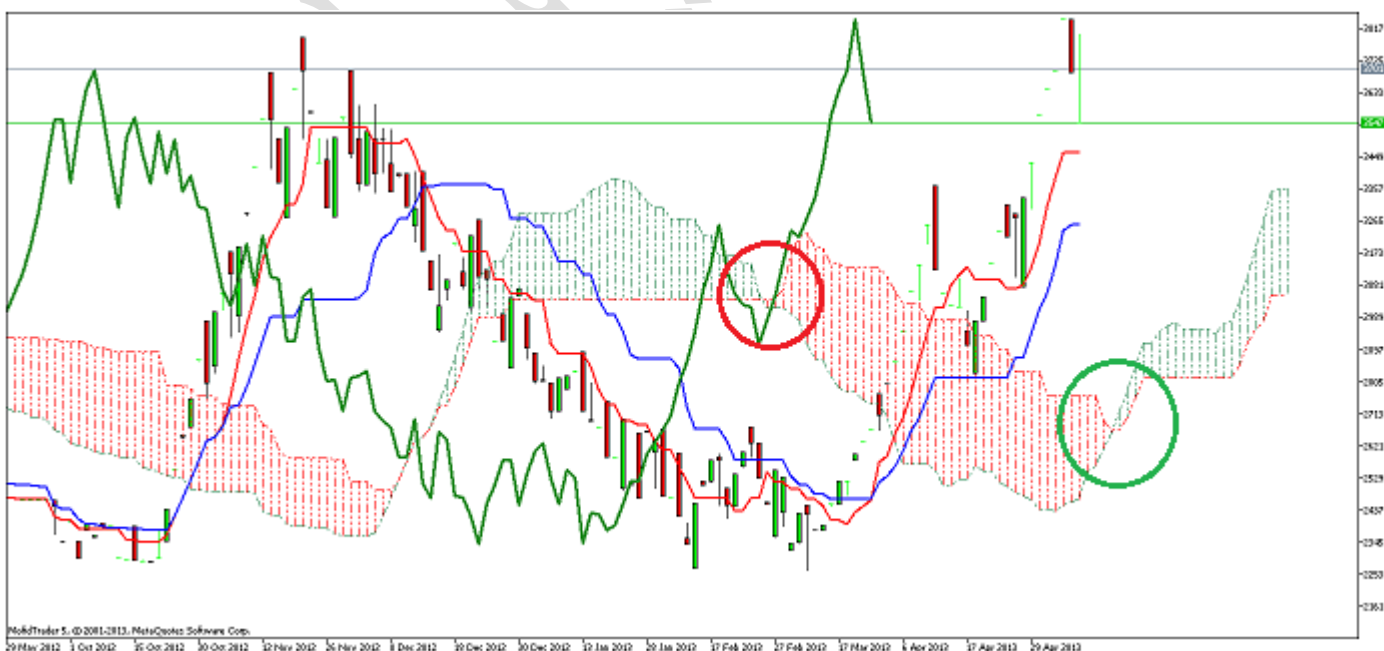


سیگنال خنثی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت درون ایر کومو باشد



سیگنال قوی نزولی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت پایین ایر کومو باشد

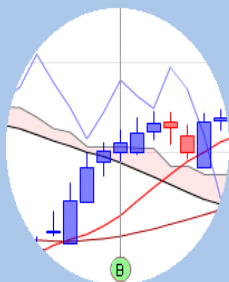
این استراتژی بسیار جالب است . در نقطه ای که سنکو A از سنکو B عبور می نماید می توانید یک خط عمودی رسم کنید . این ناحیه یک ناحیه بالقوه برای تغییر روند یا ادامه آن است به اعتقاد من این استراتژی بهتئهایی پاسخگو نیست ، باید با روش های دیگر ترکیب شود تا به استراتژی قدرتمندی تبدیل گردد .



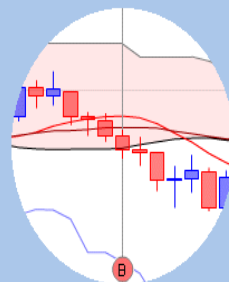
استراتژی خروج از ابر کومو :

خروج از ابر کومو

استراتژی خروج از ابر کومو : سیگنال خروج از ابر کومو زمانی اتفاق می افتد که قیمت کومو را قطع و یا از آن عبور نماید.



سیگنال صعودی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت به سمت بالای ابر کومو حرکت می کند



سیگنال نزولی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت رو به پایین به سمت پایین ابر کومو حرکت میکند



این استراتژی تقریبا کمترین محبوبیت رو دارد چرا که وقتی قیمت از ابر کومو خارج میشود وارد معامله میشویم و قیمت ممکن است بارها و بارها از ابر کومو خارج شده و دوباره به آن بازگردد. یعنی مرتبا به اشتباه فکر میکنیم قیمت از ناحیه مقاومتی یا حمایتی اش خارج شده است.

اما خروج از کومو نیز استراتژی خاص خود را می طلبد بدین نحو که :

بهترین حالت و زمان عبور قیمت از کومو زمانی هست که کومو نازک تر شده و قیمت براحتی میتواند از آن عبور نماید که البته در ادامه وارد جزئیات بیشتری خواهیم شد

همانطور که در تصویر میبینید قیمت توان عبور از کوموی ضخیم را ندارد و البته هنوز شرایط برای عبور مهیا نشده هست.



چرخش کومویی : twist kumo

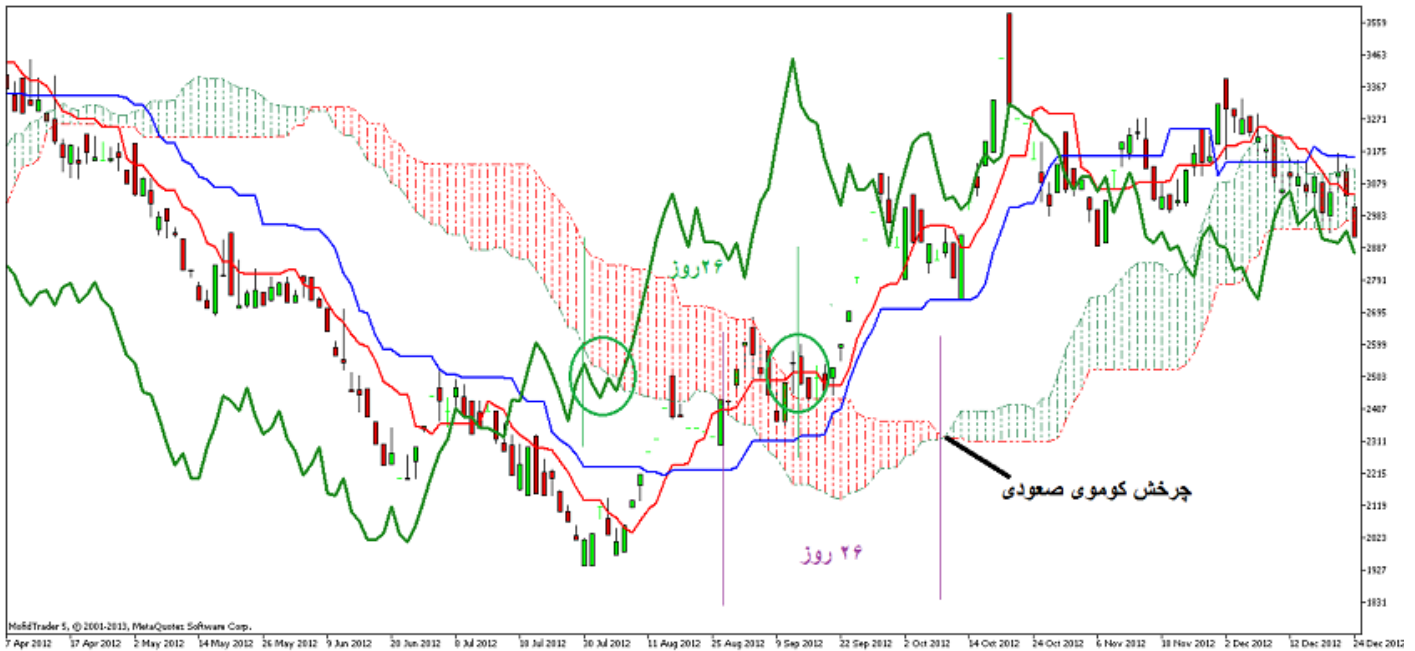
اگر دقت کنید در بالا اشاره داشتیم که چه زمانی تشخیص بدهیم که قیمت توان عبور از کومو را دارد همانطور که قبلا به آن اشاره داشتیم زمانی که سنکو **a** سنکو **b** را به سمت بالا قطع نماید شاهد تشکیل و تغییر کومو خواهیم بود که به نقطه تقاطع چرخش کومویی گفته میشود و قبلا نیز گفتیم که ما در نمودار دو نوع کومو داریم که ابر کوموی آینده ، ابری که ۲۶ روز از نمودار فعلی قیمت **جلوتر** است

حالا به نمودار با دقت نگاه کنید :



کوموی آینده صعودی شده و کوموی فعلی نازک و تمام شرایط برای عبور قیمت مهیا شده است

در ادامه نمودار کچینی رو بررسی میکنیم :



در نمودار کچینی مشاهده میکنید که قیمت بعد از یک روند نزولی شدیدی که تجربه نمود یک نقطه بسیار حساس چرخش کومویی یک سیگنال مهمی برای صعود رو بهمون هشدار داد ، برگردیم به کمی عقبتر ، قیمت برای اولین بار توانست از کیجونسن عبور نماید که قبلا گفتیم عبور قیمت از کیجونسن هشدار بسیار مهمی برای قیمت هست بعد کراس یا تقاطع تنکانسن و کیجونسن روی میدهد و قیمت وارد کومو با تاییدیه گرفتن از چرخش کوموی سعودی به سمت شکست کومو حرکت می نماید ، در ادامه خواهیم دید که با توجه به اینکه قیمت از کومو هم عبور کرد کمی در جا زد ،

و علت انرا باید در چیکو اسپن بگردیم

چیکو اسپن ۲۶ روز قبل قیمت کنونی را نمایش میدهد ولی هنوز از کومو خارج نشده و به محض خروج چیکو اسپن از کومو قیمت نیز به روند خود ادامه میدهد .

استراتژی تقاطع چیکواسپین :

تقاطع چیکواسپین

سیگنال تقاطع چیکواسپین زمانی است که ، چیکواسپین بالای قیمت و پایین قیمت حرکت کند

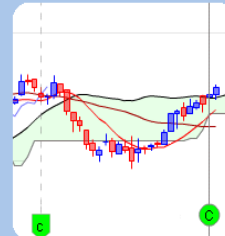
سیگنال صعودی : زمانی اتفاق می افتد که چیکواسپین بلند شود از پایین به بالای قیمت



سیگنال ضعیف صعودی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت پایین ابر کومو باشد

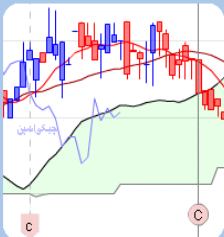


سیگنال خنثی زمانی هست که :
قیمت درون ابر کومو قرار دارد



سیگنال قوی صعودی زمانی هست که :
قیمت بالای ابر کومو قرار دارد

سیگنال نزولی : زمانی اتفاق می افتد که چیکواسپین از بالا به پایین قیمت می افتد



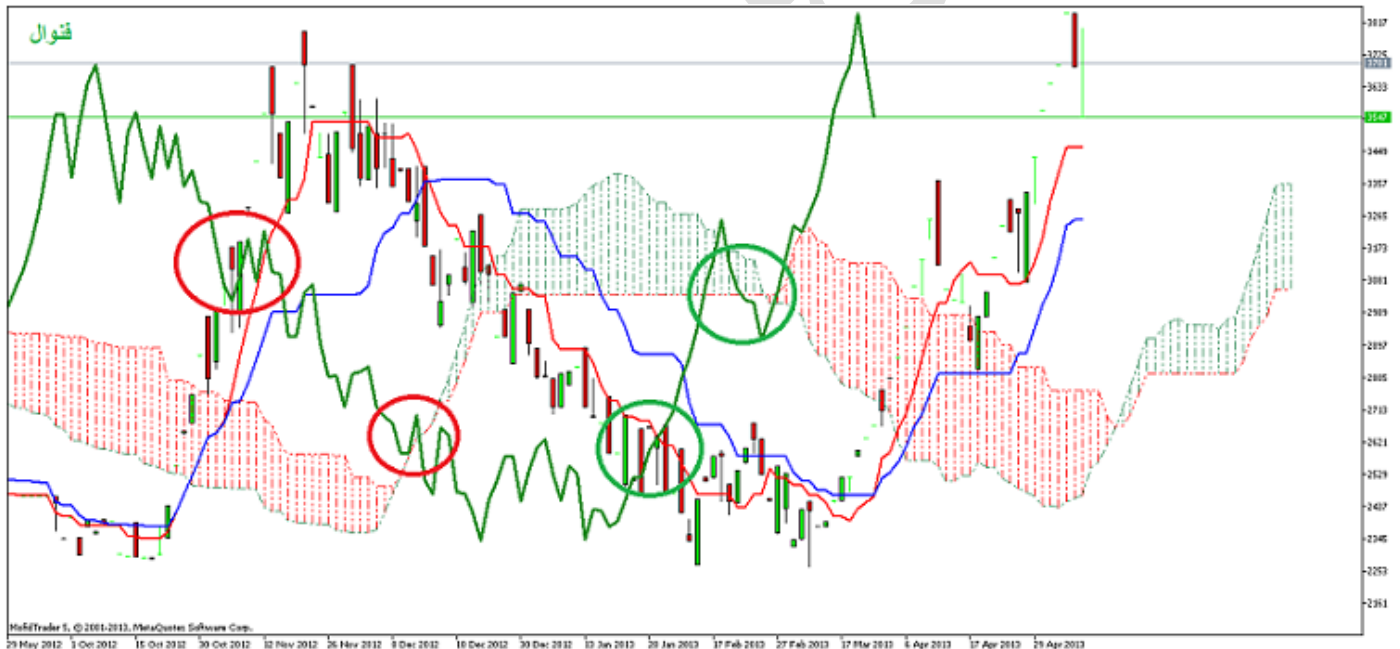
سیگنال ضعیف نزولی زمانی هست که :
قیمت بالای ابر کومو قرار دارد



سیگنال خنثی زمانی هست که :
قیمت درون ابر کومو قرار دارد



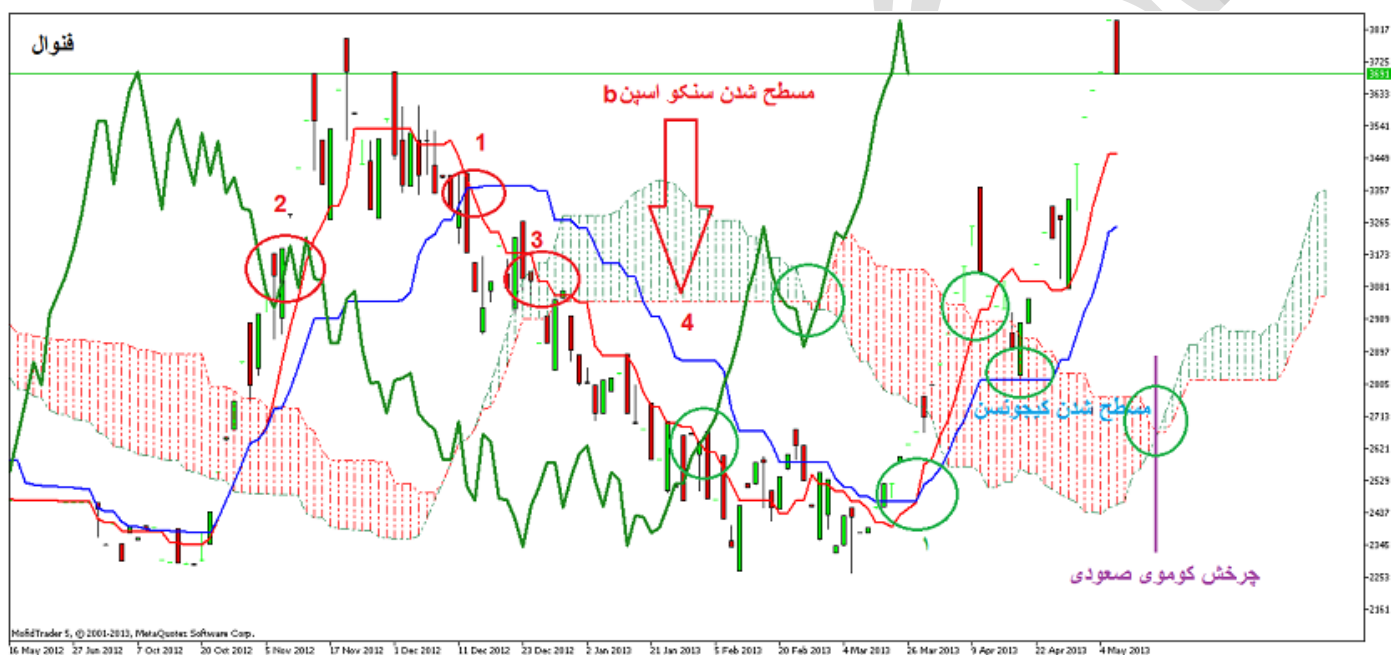
سیگنال نزولی قوی زمانی اتفاق می افتد که :
قیمت پایین ابر کومو قرار دارد



استراتژی مسطح شدن سنکو اسپن b:

سنکو b مسطح نمایانگر یکی از مهمترین نواحی مقاومت و حمایت بازار محسوب میشود ، هر چه یکنواختی سنکو اسپن b بیشتر به طول بینجامد ناحیه مقاومت و حمایت قوی تری ایجاد میشود ، مقاومت و حمایت هایی که مانع اصلی برای روند های جاری و آینده خواهند بود

در ادامه سعی میکنیم تا نمودار فنوال رو به صورت دقیق تری با مطالعه مطالب گذشته بررسی کنیم :



همونطور که قبلا گفتیم ایچیموکو ابتدای روند رو بخوبی تشخیص نمیده و مابایستی یک ابزار کمکی به ایچیموکو اضافه کنیم و آنهم مکد میباشد .

در بسیاری از وبلاگ ها و فروم هایی که سر میزنم ، بیشتر دوستان فقط اشاره مختصری به مکد دارند و صرفا فقط به واگرایی ها اشاره دارند

ابتدا سعی میکنیم تا مکد رو به صورت کامل بشناسیم :

MACD

Moving Average Convergence-Divergence

میانگین متحرک همگرایی - واگرایی

این اندیکاتور برای اولین بار بوسیله گرانپول معرفی شد

عاملی که باعث مفید بودن این اندیکاتور میشود عبور یک میانگین متحرک دوگانه می باشد که بر روی صفحه کامپیوتر دو خط دیده میشه که در واقع در محاسبات از **سه لاین** استفاده شده است

MACD Line: (12-day EMA - 26-day EMA)

Signal Line: 9-day EMA of MACD Line

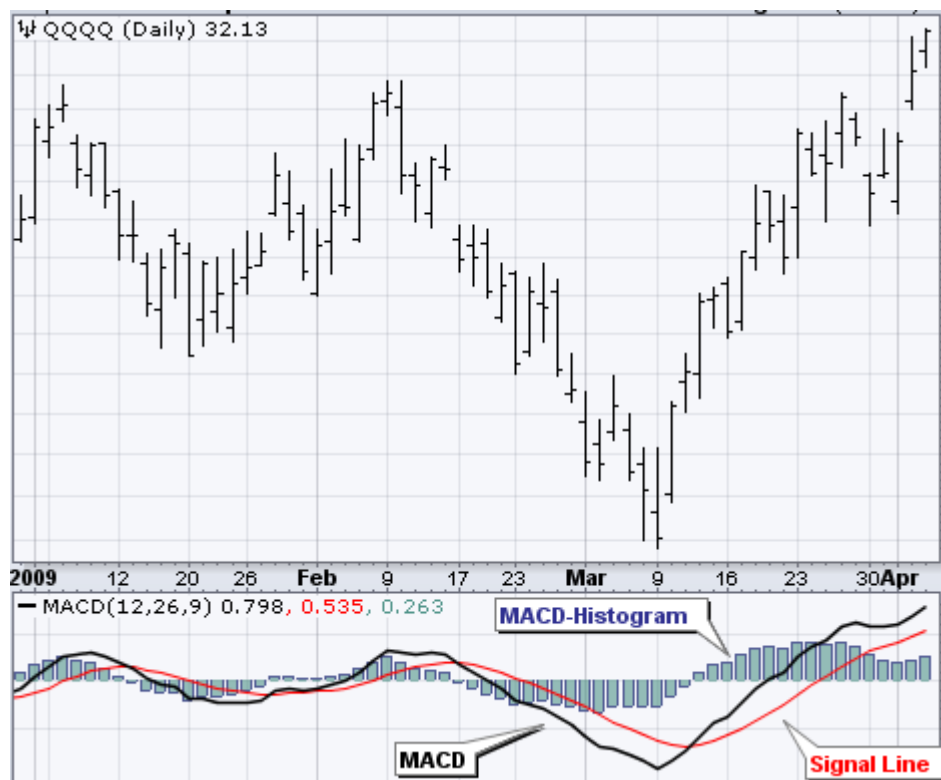
MACD Histogram: MACD Line - Signal Line

خط سریعتر (که خط مکد مکد نامیده میشود) اختلاف بین دو میانگین متحرک نمایی صاف

حاصل از قیمت های پایانی است که معمولا ۱۲ روزه و ۲۶ روزه میباشد

خط کندتر که سیگنال لاین یا خط اخطار نیز نامیده میشود معمولا یک میانگین صاف شده

اغلب معامله گران به طور کلی از اعداد ۱۲ و ۲۶ و ۹ استفاده میکنند که میتواند روز و هفته باشد .



اخطارهای خرید و فروش واقعی در زمان تقاطع دو خط صادر میشود. عبور روبه بالای خط مکد از خط سیگنال اخطار خرید تلقی میشود. عبور رو به پایین خط مکد از خط سیگنال اخطار فروش محسوب میشود .

در واقع مقادیر مکد به صورت سیستم میانگین متحرک دوگانه عبوری عمل میکند و با توجه به اینکه مقادیر مکد در بالا و پایین خط صفر نوسان میکند اینجاست که همانند یک اسیلاتور عمل میکند .

اما بایستی به نکته بسیار مهمی در مكد توجه داشته باشید

در بسیاری از مواقع وقتی سهمی در یک روند صعودی پر قدرت میباشد مكد و سیگنال لاین میتواند

اخطارهای خرید و فروش نادرستی صادر کند و ما رو به اشتباه بیندازد

به یک نمونه به دقت نگاه کنید

پتروشیمی کرمانشاه :



همانطور که میبینید ما دوخط تشکیل دهنده مكد رو وارد نمودار کردیم

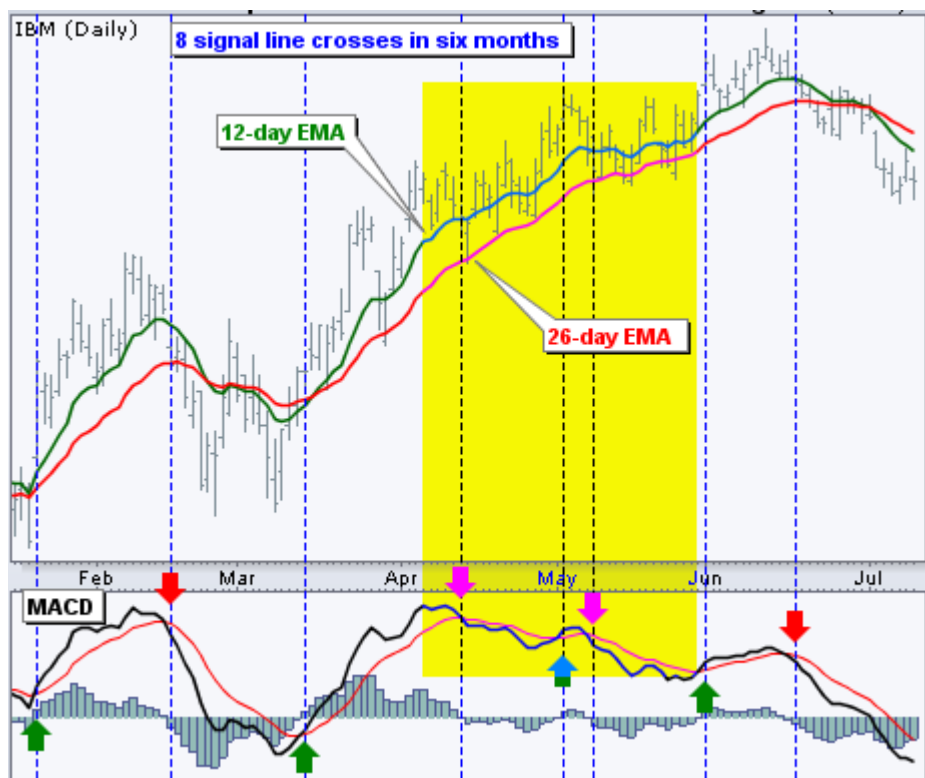
میانگین متحرک نمایی ۱۲ روزه و میانگین متحرک نمایی ۲۶ روزه که در واقع فیلتری هست برای

سیگنال های اشتباه مكد

به نمودار دوباره با دقت نگاه کنید زمانی که میانگین متحرک نمایی ۱۲ روزه روبه بالا میانگین

متحرک نمایی ۲۶ روزه را قطع مینماید دقیقا مكد خط صفر را رو به بالا قطع مینماید .

یک مثال دیگر که سعی شده سیگنال های اشتباه رو به صورت دقیق برای شما نشون بده :



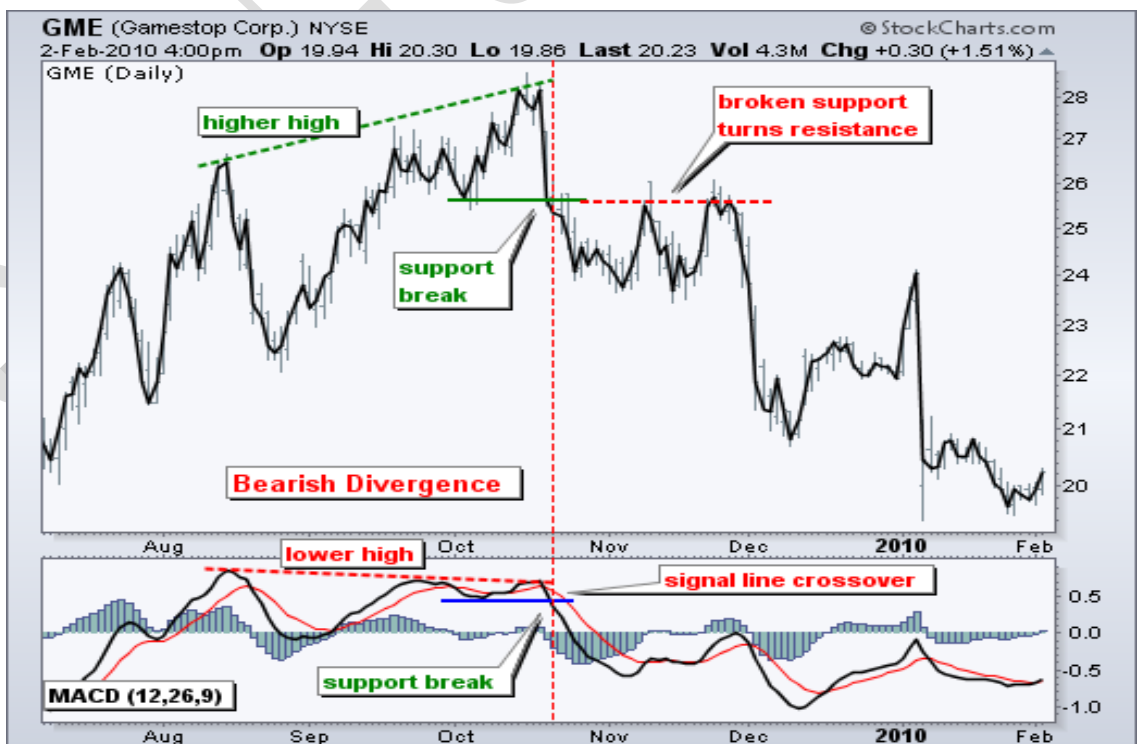
همانطور که در تصویر مشاهده میکنید در مکد ۸ سیگنال در ۶ ماه صادر شده که ۴ مورد صعودی و ۴ مورد نزولی بوده که به وسیله دو میانگین متحرک نمایی فیلتر شده اند
قبلا اشاره کردیم که مکد در بالا و پایین خط صفر نوسان میکند ، عبور مکد از فاز منفی و عبور از خط صفر سیگنال خرید قوی به شمار میرود و همچنین زمانی که مکد از فاز مثبت با قطع خط صفر وارد فاز منفی میشود سیگنال فروش محسوب میشود .

در تصویر پایین مکد با تغییر فاز بخوبی سیگنال های خرید و فروش صادر نموده است .



با توجه به اینکه می‌خواهیم نقطه ورود مناسب بر اساس اچیموکو را بخوبی شناسایی کنیم بایستی به **واگرایی‌ها** DIVERGENCE شناخت داشته باشیم .
 واگرایی بین روندخطوط MACD و خط قیمت پدید می‌آید
واگرایی منفی :

زمانی است که خطوط مکد کاملاً در **بالای خط صفر** قرار دارد (خریده‌جانی) و زمانی که قیمت به روند افزایشی ادامه می‌دهد شروع به کاهش می‌کند



واگرایی مثبت :

زمانی است که خطوط مکد **کاملاً در پایین خط صفر** قرار دارد (فروش هیجانی) و زودتر از قیمت شروع به افزایش میکند در بیشتر مواقع این اخطار به موقعی برای وقوع کف قیمتی هست .

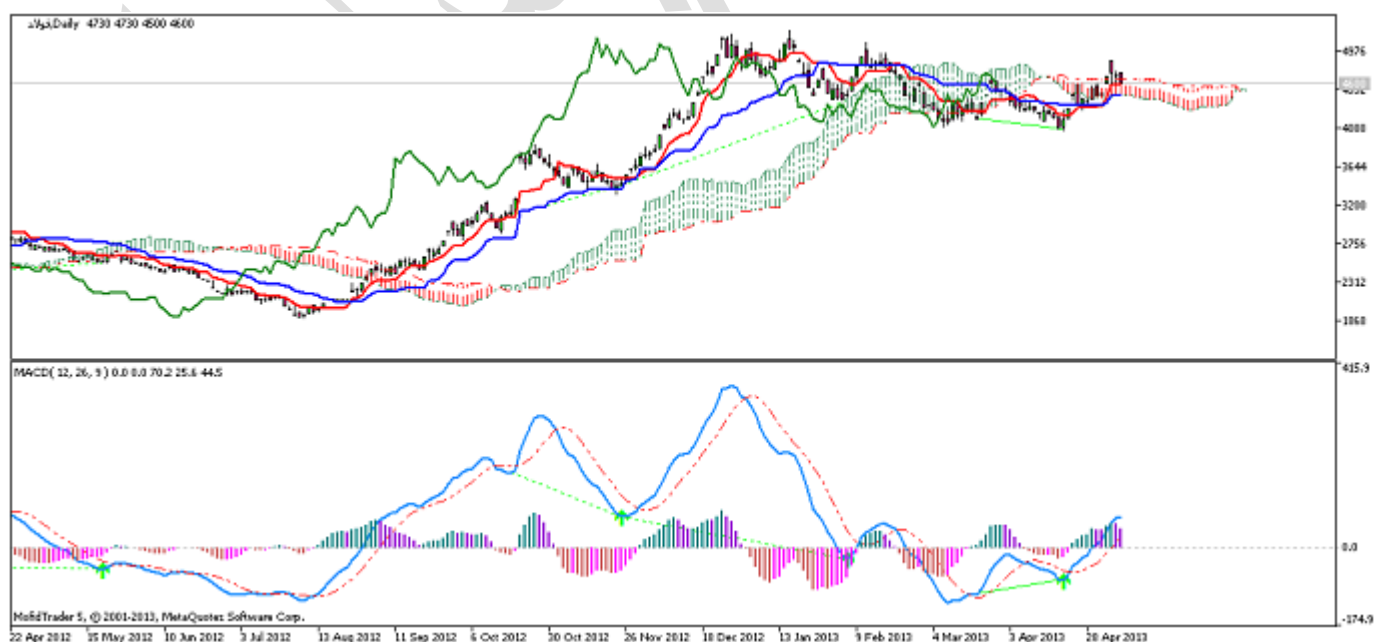


واگرایی مخفی : HIDDEN DIVERGENCE

واگرایی مخفی صعودی :

این واگرایی در یک روند صعودی پر قدرت شکل میگیرد که حاکی از قدرتمند بودن تداوم روند جاری میباشد

در این واگرایی اندیکاتور کف قبلی خورد را شکسته در حالی که قیمت در حال تشکیل یک کف بالاتر میباشد



واگرایی مخفی نزولی :

این واگرایی در روندهای نزولی شکل میگیرد

در این واگرایی قیمت واندیکاتور همزمان دو قله ایجاد میکنند ، پس از اندک حرکت اصلاحی اندیکاتور از سقف قله قبلی بالاتر رفته و قله جدیدی دیگری ایجاد میکند اما قیمت در ایجاد قله بالاتر ناموفق بوده و قله دوم اندکی پایینتر تشکیل میشود به عبارت دیگر اندیکاتورها برخلاف قیمت توانسته اند سقف قبلی خود را بشکنند این وضعیت را واگرایی مخفی نزولی گویند

همانطور که اشاره کردیم چنین وضعیتی معمولاً در میانه یک روند نزولی پدیدار میشود که حاکی از قدرتمند بودن تداوم روند جاری بازار است

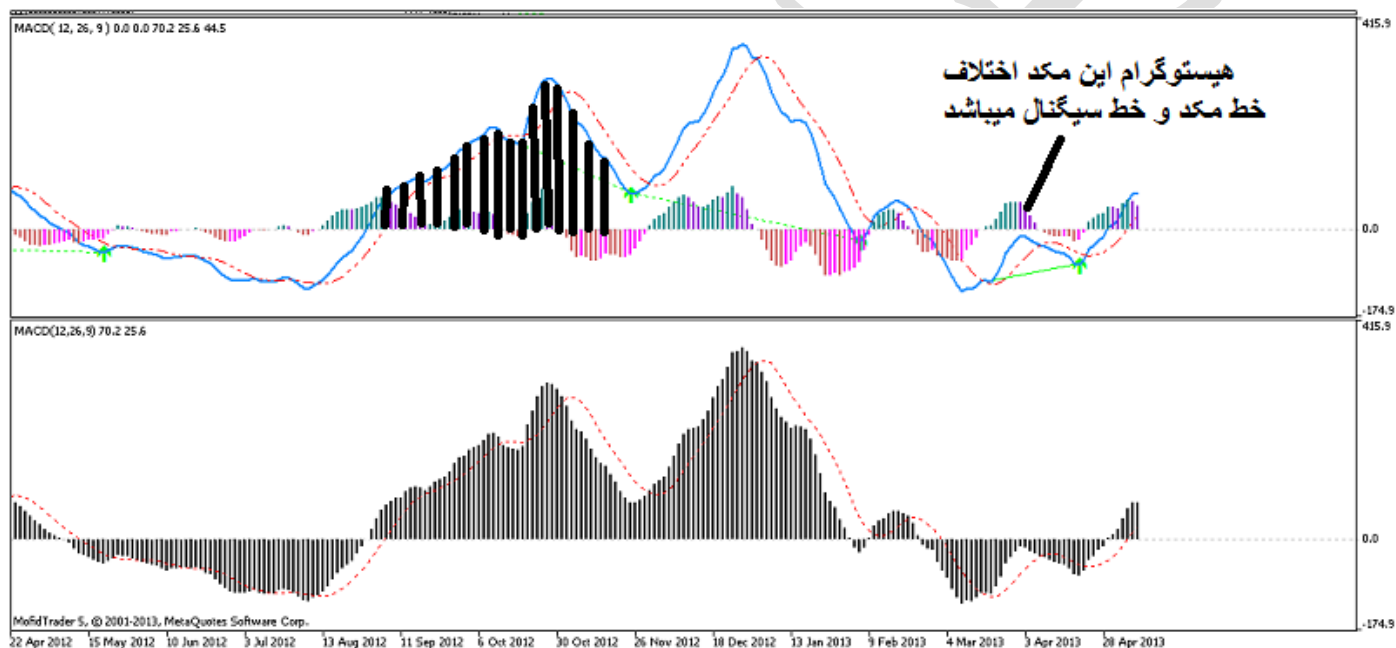


هیستوگرام مکد :

خیلی از دوستان در برخی از موارد به اشتباه می افتند که کدوم مکد درست میباشد چرا که در شکل با هم تفاوت دارند ولی در اصل یکی هستند ،

هیستوگرام شامل میله های عمودی هست که از اختلاف بین خطوط مکد به دست می آید . هیستوگرام خط صفر مخصوص به خود را دارد زمانی که خطوط مکد در تراز مثبت هستند هیستوگرام بالای خط صفر قرار میگیرد . عبور هیستوگرام از بالا یا پایین خط صفر همزمان با سیگنال های خرید و فروش منتج از عبور مکد رخ میدهد .

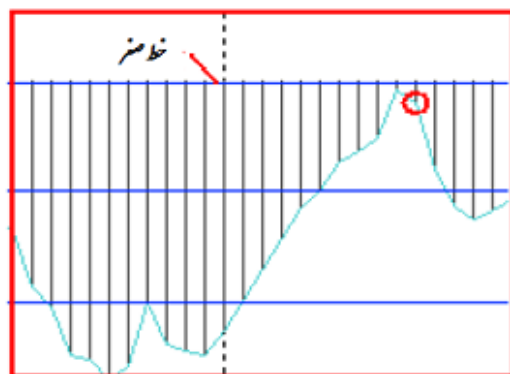
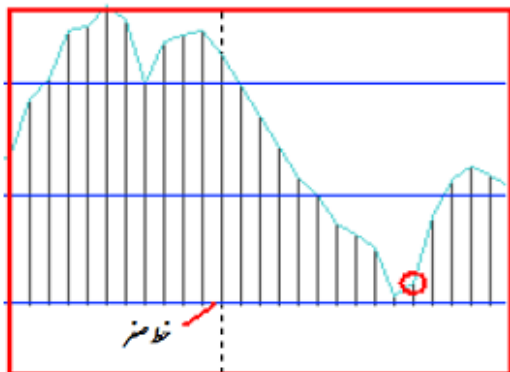
برای اینکه تفاوت رو دقیقتر احساس نمایید هر دو مدل مکد رو با هم مقایسه کنیم :



در انتها می‌خواهیم یکسری از الگوهای شکل گرفته در مکد رو معرفی کنیم :

اولین الگو

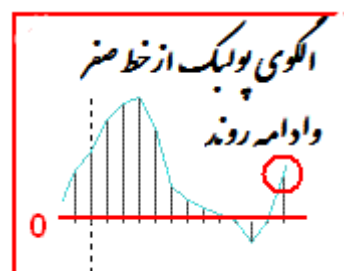
الگوی ادامه دهنده :

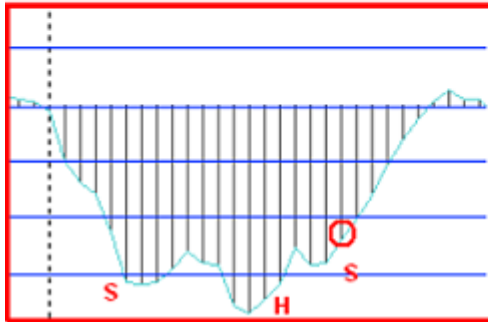
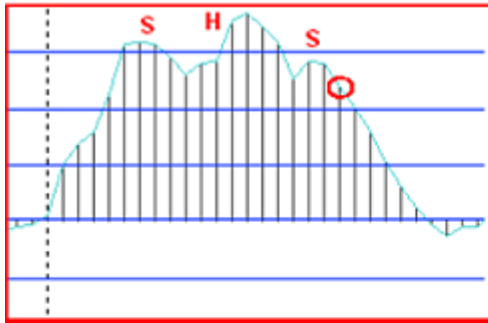


الگوهای مکدی:

زمانی که مکد به سمت خط صفر حرکت می‌کند، فرقی ندارد چه از بالا به طرف پایین و چه از طرف پایین به طرف خط صفر، چنانچه، دوباره به همان سمت قبلی برگشت نماید نشانه‌دهنده ادامه روند قبلی است

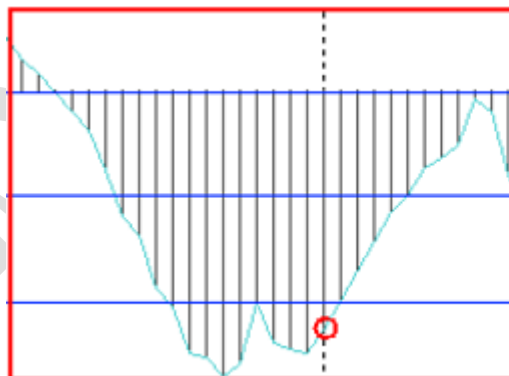
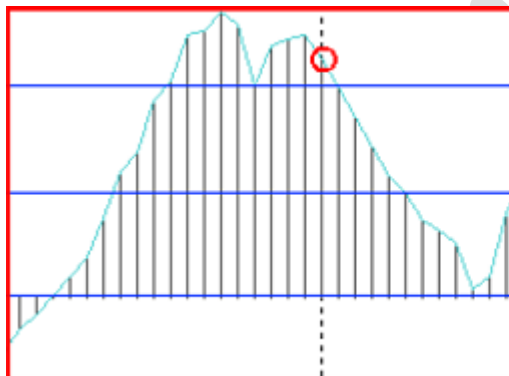
الگوی پولبک از خط صفر :





الگوی سر و شانه سقف و کف

الگوی دو قلو سقف و دو قلو کف :



الگوی دو قلو سقف

الگوی دو قلو کف

برسیم به بحث اصلی

چرا ما ایچیموکو رو با مکد معرفی کردیم

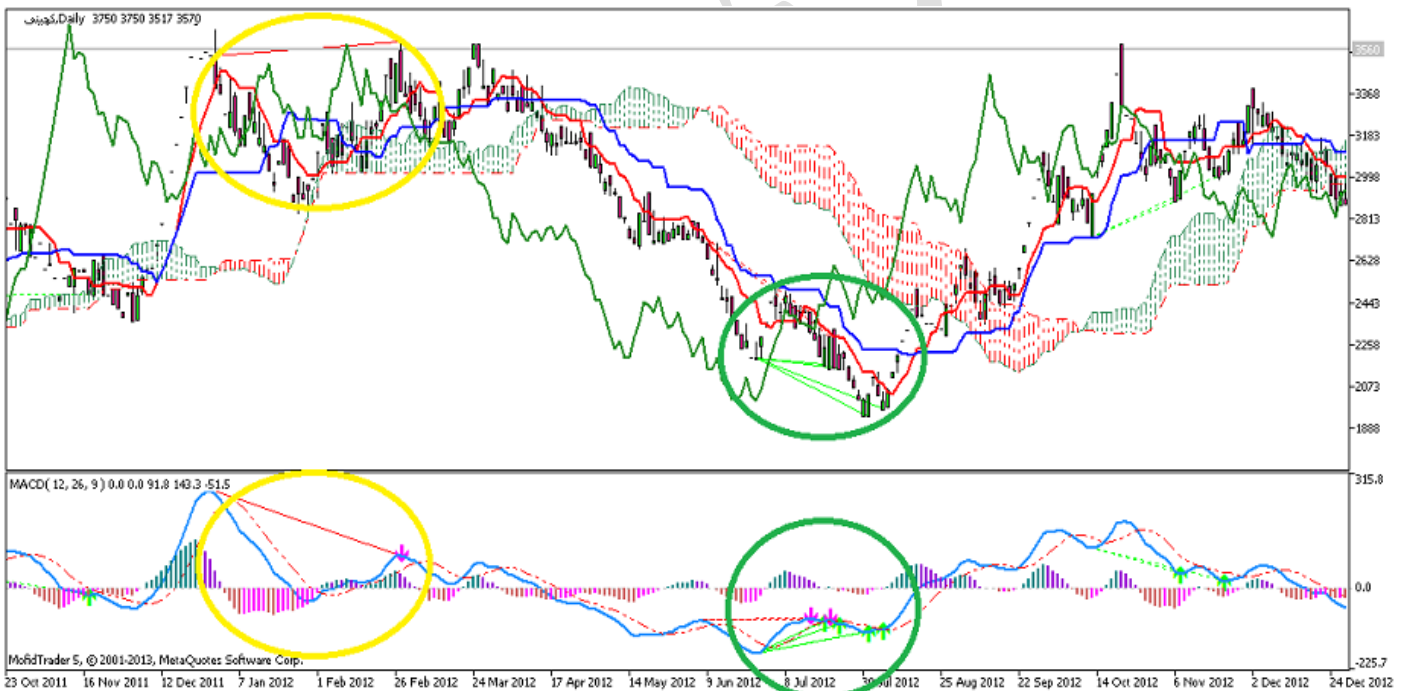
به یک نکته دقیقا دقت کنید

اگر خاطرتون باشه به شما گفتیم که شروع روند در ایچیموکو کمی تاخیر دارد و ما به کمک مکد میتونیم به وسیله واگرایی هایی که در کف تشکیل میشود را با ایچیموکو ادغام کنیم و با بهره جستن از سیگنال های هر دو بتوانیم نقطه های ورود و خروج رو دقیقا شناسایی بکنیم

اگر در ایچیموکو دقت کرده باشید با عدد ۲۶ زیاد سر و کار داشتیم و تقریبا همیشه با دستکاری قیمتی این دو سیستم رو با هم ادغام کنیم

اگر خاطرتون باشه بهترین زمان خروج قیمت از ابر کومو با یکسری سیگنال ها صورت می گرفت که در بالا اشاره کردیم

اما در بیشتر موارد در مناطقی که قیمت توان عبور از کومو رو دارد یک واگرایی به طور حتم خواهیم داشت



بهزاد

Godbeest کارگزاری پاسارگاد اردیبهشت سال ۹۲