

بسمه تعالی

## آموزش اندیکاتورهای ماینر

ترجمه و تنظیم:

علیرضا سالکی (علی فارکس)



توجه

این ترجمه صرفاً جهت آموزش رایگان هموطنان و کمک به پیشرفت ایوت کاران عزیز و به منظور ادای دین اینجانب به سایت

پربار

[www.gheymatha.com](http://www.gheymatha.com)



تهیه شده است.

اشتراک گذاری این فایل با همین شمایل و مشخصه ها در هر سایت یا آموزشگاهی بلامانع میباشد. در غیر این صورت قلاً نسبت به مسئولین سایت یا آموزشگاه مذکور دلگیر خواهم شد.

آدرس تاپیک مربوطه:

<http://www.gheymatha.com/showthread.php?t=1775>

توجه کنید که اندیکاتور *StoRSI* در آموزه های ماینر هم اکنون با نام *DTOSC* در نرم افزار *DT4* و *DT5* موجود است.

## درس اول

استراتژیهای گفته شده در این بخش در هر تایم فریم و هر بازاری قابل استفاده است. در این سری فقط روی اندیکاتور STORSI صحبت میکنیم. ماینر خود بیشتر از این اندیکاتور استفاده میکند زیرا معتقد است این اندیکاتور دارای سیگنالهای False کمتری نسبت به بقیه اندیکاتورها میباشد. اندیکاتورهایی که با دیدگاه داینامیک تریدینگ مورد استفاده قرار میگیرد در موقعیت ورود-خروج و تریلینگ پوزیشن میتواند مورد استفاده قرار گیرد.

در شکل زیر در اواسط مارچ و آوریل 2 بار اندیکاتور ابتدا در منطقه آور بات به سمت پایین میچرخد و سپس خط 75٪ را به سمت پایین کراس میکند (از آن عبور میکند) شما در کدام نقطه میخواهید وارد شوید؟ جایی که اندیکاتور به سمت پایین میچرخد؟ یا جایی که خط 75٪ را کراس میکند؟

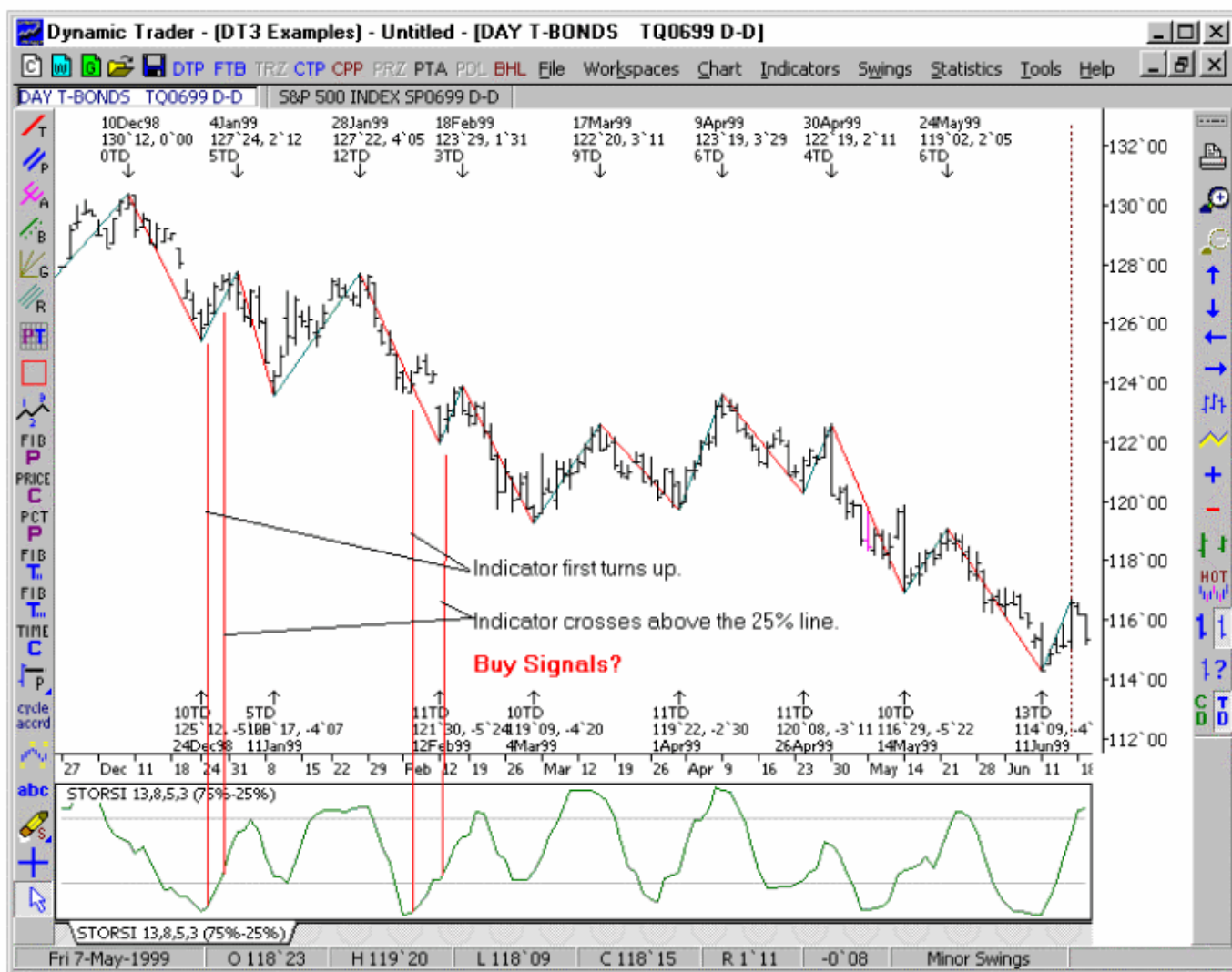
در این موقعیت که با 2-3 میله بعد از سیگنال یک low تشکیل شده است ممکن است رفتن به sell برای ما هزینه بردار شود اما به هر حال برای هر 2 حالت گفته شده اندیکاتور در سطوح over قرار دارد در صورتیکه ترند یک bull ترند است.

شکل شماره 1



بیشتر اندیکاتورها روی تغییرات نرخ متمرکز هستند تا اینکه روی high و low متمرکز باشند. ممکن است اندیکاتوری قبل از اینکه یک top کامل شود به خاطر افت در تغییرات نرخ به سمت به ما **over bought** نشان دهد و یا بر عکس برای **oversold**. گاهی اندیکاتورها خیلی زود و گاهی خیلی دیر سیگنال میدهند.

شکل شماره 2



نتیجه ای که از مباحث گفته شده بالا گرفته میشود این است که نمیتوان تنها به سیگنال یک اندیکاتور برای ورود به بازار اتکا کرد. بلکه باید فاکتورهای تاییدی دیگری نیز برای اینکار داشته باشیم که در ادامه بیشتر در مورد آنها صحبت خواهیم کرد.

سوال: در اولین مرحله چه چیزی باعث بهبود در عملکرد استفاده از یک استراتژی با مبنای اندیکاتور میشود؟  
جواب: فقط گرفتن سیگنالهایی که در جهت ترند باشند.

در مورد مثال S&P در بالا ترند حالت Sideway به سمت up را داشت. بنابراین تنها سیگنالهای خرید از اندیکاتور میتوانست مورد بررسی قرار گیرد و در مجموع باعث تریدهای سود آوری شود.

حال سوال جدیدی مطرح میشود و آن اینکه:

مسیر ترند به کدامین سمت است؟

شما ممکنه از فیلتری مثل dynamic trend filter استفاده کنید یا از moving average ها یا حتی ممکنه از روش دینامیک تریدینگ و شمارش امواج و ... برای تشخیص جهت ترند بهره بگیرید.

به هر حال ما باید روشی را پیدا کنیم که از جهت ترند مطلع شویم .

استفاده تنها از اندیکاتور میتواند باعث بروز مشکلاتی در ترید شود. شما دیر وارد میشوید و زود خارج میشوید.

باید از خودمان بپرسیم که این چه پارامتری از اندیکاتور است که میتواند در تصمیمات ترید ما برای ورود - خروج و استاپ گذاری پوزیشن مفید باشد؟

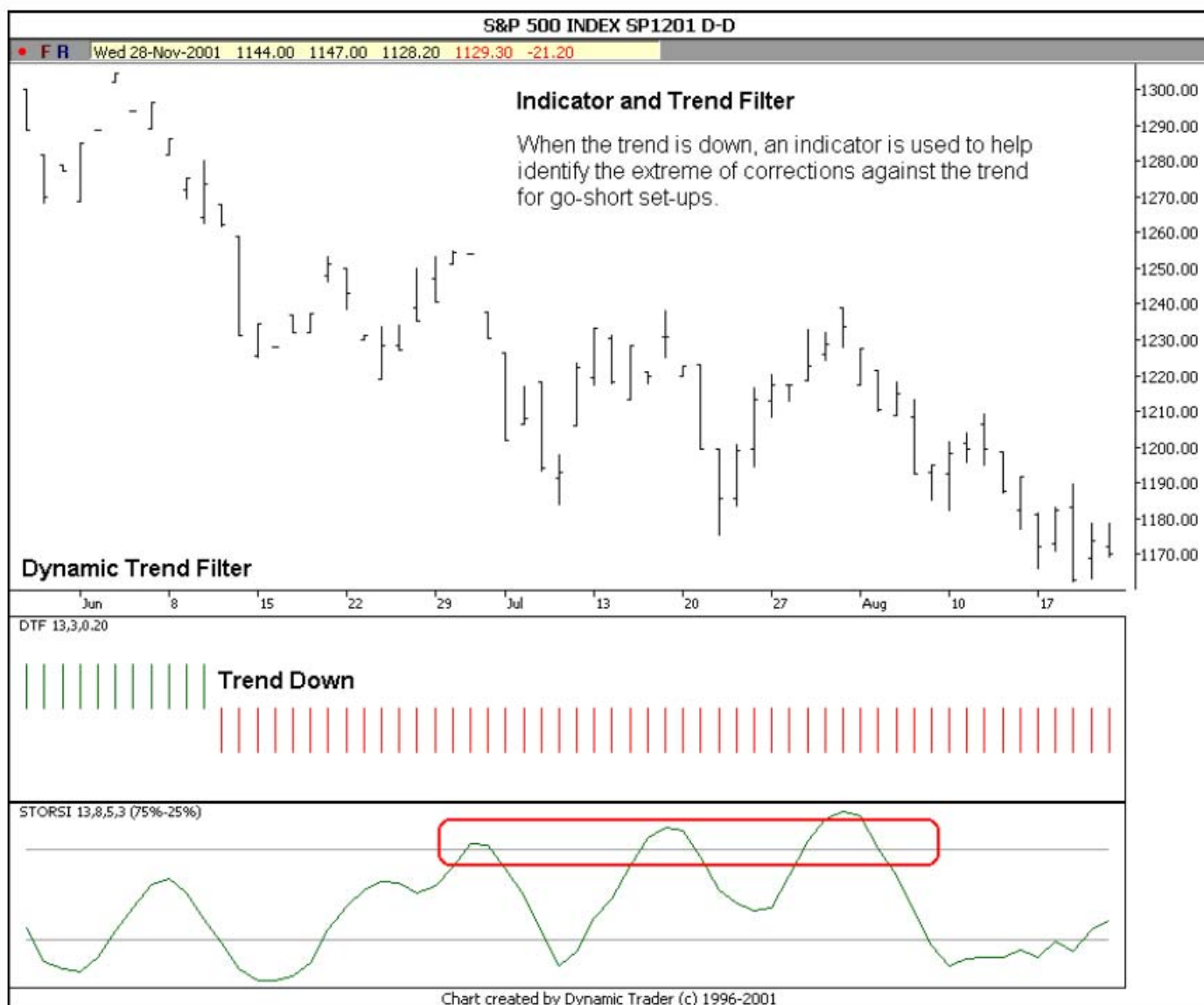
جواب این است که

اندیکاتور میتواند در مواقعی که کارکنهای minor در مقابل ترند در حال شکل گیری هستند به کمک ما بیاید تا به عنوان یک سیگنال در جهت ترند وارد شویم .

برای نمونه به شکل زیر نگاه کنید.

DTF جهت ترند را نزولی نشان میدهد. بنابراین تنها آن دسته از سیگنالهایی از STORSI معتبر هستند که در جهت sell باشند.

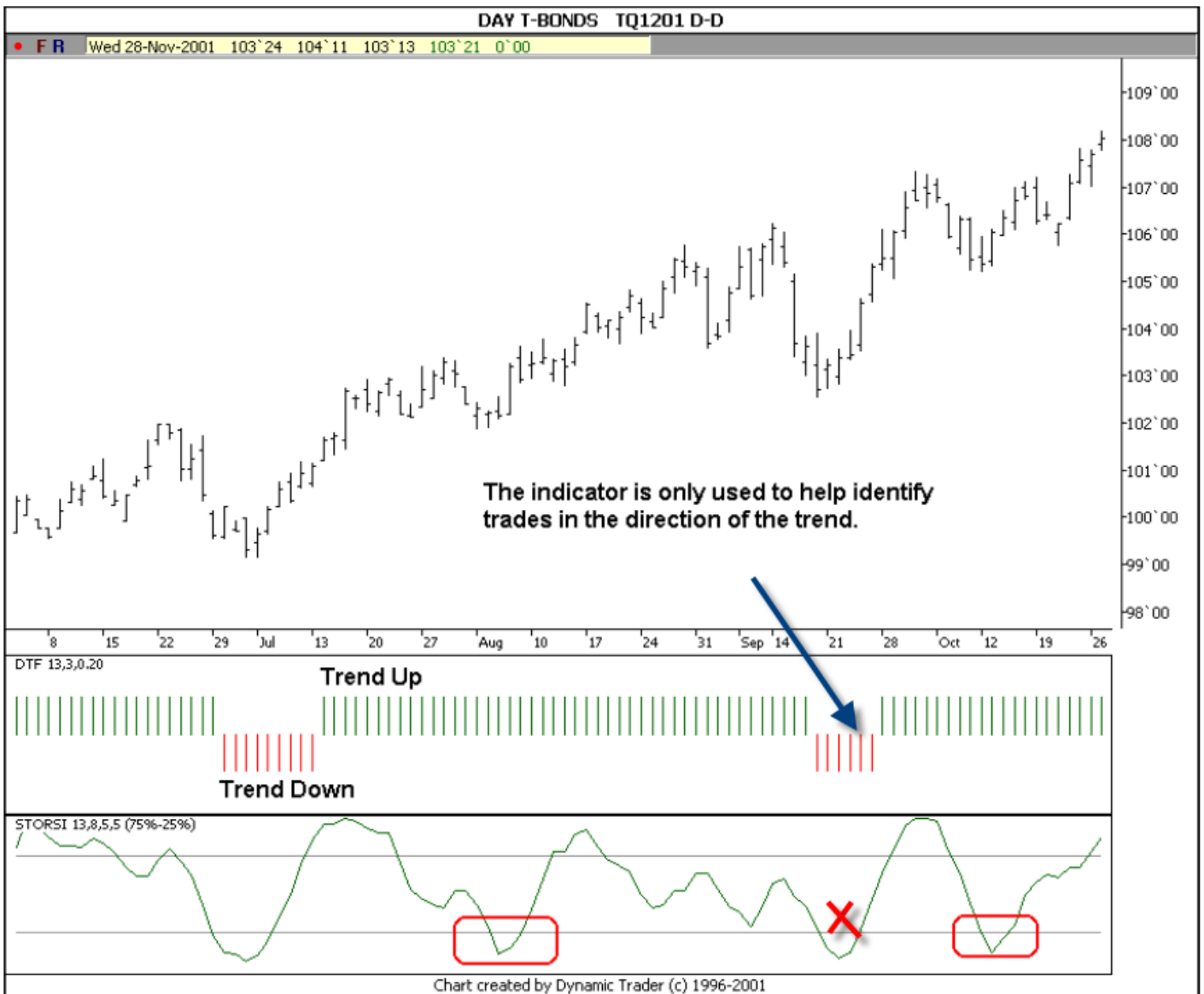
شکل شماره 3



در شکل زیر در اواخر **June** برای بار دوم اندیکاتور **sto** سیگنال **buy** میدهد اما به خاطر اینکه ترند (اندیکاتور **trend filter**) میگوید ترند عوض شده است بنابراین ما اجازه نداریم تا به خرید فکر کنیم. پس از این سیگنال صرف نظر میکنیم.

**trend filter** متاثر از چند کندل آخر بازار است و از پررود کوچکی بهره میگیرد.

شکل شماره 4



نمونه ای دیگر....

در این مثال بر روی تنظیمات اندکی دستکاری انجام گرفته که در ادامه این سری آموزشی نحوه تغییر در این تنظیمات گفته خواهد شد.

کسانی که از دیدگاه **dynamic trading** به بازار نگاه میکنند حتما بحث الگو، زمان و قیمت را به مباحثی که در بالا گفته شد اضافه میکنند و صرفاً به **trend filter** برای تشخیص جهت ترند بسنده نمیکنند.

شکل شماره 5



## درس دوم

### ((نواحی خرید و فروش))

در درس یک در مورد اینکه نواحی over در چه شرایطی مهم تلقی میشوند صحبت کردیم و فهمیدیم که بهترین استفاده از اندیکاتور ها در نواحی هست که انتهای یک کارکشن باشیم.

در ادامه به نواحی خرید و فروش میپردازیم.

در شکل زیر میتوان دید که ترند sideways به سمت up هست. هر گاه که اندیکاتور به سمت پایین (buy zone) بیاید میتوان احتمال تکمیل کارکشنی minor را در نظر گرفت .

در واقع ما از اندیکاتور برای تشخیص انتهای کارکشن در روندهای صعودی و نزولی (دنبال low و high به ترتیب) هستیم. باز هم تاکید میکنیم که :

اندیکاتور برای کمک به تشخیص انتهای کارکشن به منظور ورود به یک ترند major مورد استفاده قرار میگیرد و لا غیر!!!!

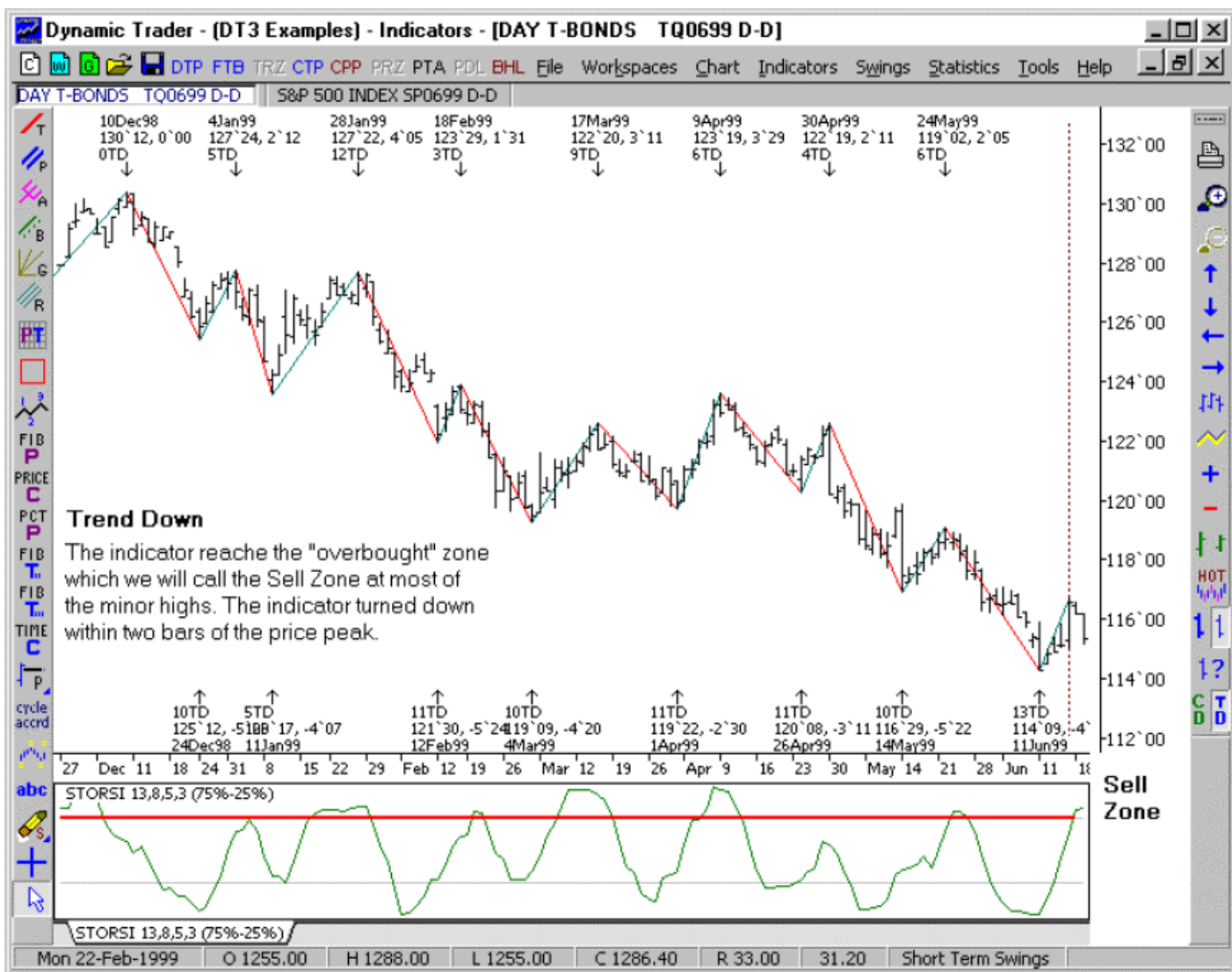
شکل شماره 6





در شکل زیر روند از دیدگاه دینامیک به روند نزولی است و ما به دنبال sell zone در مناطق over bought از اندیکاتور هستیم. در بین موقعیتهایی که روی اندیکاتور وجود داشته تنها 2 مورد بوده که اندیکاتور زودتر از قیمت شروع به ریزش کرده و از ناحیه اوور خارج شده است که در جای خود جای تامل دارد.

شکل شماره 7



باید حتما در نظر داشته باشید که در جهت ترند ترید کنید. هر گاه اندیکاتور به منطقه buy zone یا sell zone رسید و شرایط تایم، قیمت و الگو برای انتهای کارکشن محیا بود بالای کندل مربوطه 1 اوردر قرار دهید و استاپ آنرا 1 پیپ زیر low یا high قرار دهید. در چنین شرایطی هیچ دلیلی ندارد که استاپ را بیشتر از این مقدار قرار دهیم.

به عبارتی باید همواره به نکات زیر دقت داشته باشیم که :

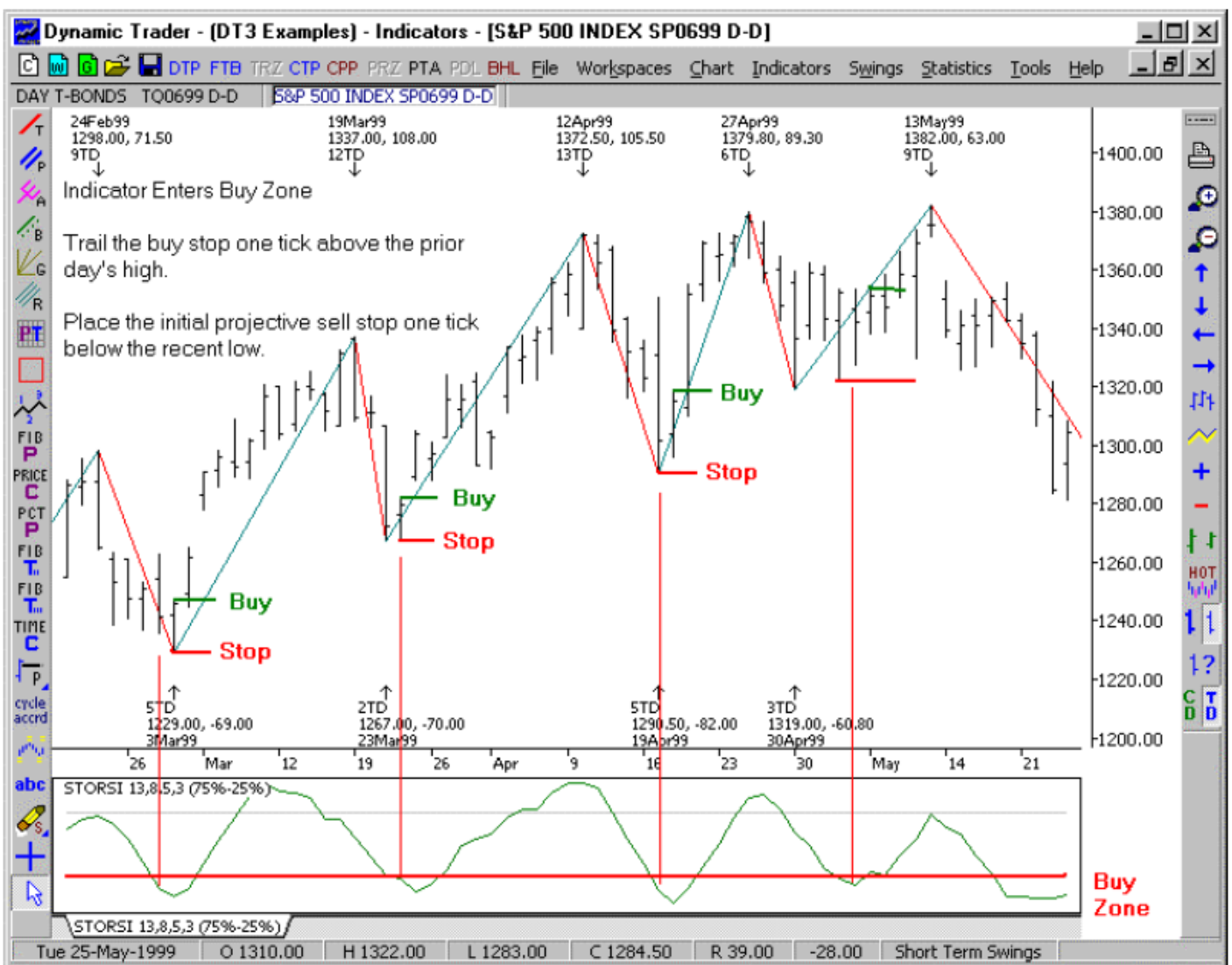
1- تنها سیگنالهایی مورد اهمیت هستند که در جهت ترند باشند.

2- اگر مثلاً ترند جهت صعودی داشت بعد از تاچ شدن منطقه **buy zone** باید اگر پوزیشن باز دارید استاپ آنرا یک پیپ بالای **high** کندل اخیر قرار دهید و اگر میخواهید ورود به پوزیشن داشته باشید یک پیپ بالای آن کندل **buy stop** قرار دهید.

3- فراموش نکنید که کلاً ورود به ترید تنها در شرایطی حادث میشود که ما از نظر تایم، قیمت و الگو به این مطلب که اینجا انتهای احتمالی کارکشن است رسیده باشیم و گرنه نباید وارد ترید شد.

به شکل دقت کنید

شکل شماره 8



مثال اول:

نقطه 1- اولین ترید سل هست که استاپ اوت میشود و بعد از آن بازار باز هم جهت تکمیل کارکشن پیش میرود اما از آنجایی که بازار همچنان در منطقه سل زون قرار دارد ما همچنان سیاست سل استاپ گذاری با فاصله 1 پیپ زیر low آخرین کندل پیش میرویم.

نقطه 2- 2 روز بعد سیگنال سل جدید فعال میشود و بازار در جهت ترند اصلی که همانا ترند نزولی بوده حرکت میکند(اینکه جهت ترند چی هست قبلا در موردش صحبت شد که میتونه با اندیکاتور تعیین بشه یا اینکه میتونه از طریق تحلیل داینامیک بازار انجام بشه)

نقطه 3 - سیگنال فروشی دیگر

نقطه 4-سیگنال سل دیگری که استاپ اوت میشود.بعد از آن ما با توجه به اینکه اندیکاتور همچنان در ناحیه فروش قرار دارد و ما نیز جهت ترند را با داینامیک نزولی تشخیص داده ایم لذا با قرار دادن سل استاپ 1 پیپ زیر کندلها یکی یکی با کندلها جلو میرویم که به خاطر عبور از سطح استاپ اوردرها همه اوردرها تا نقطه 5 بطور اتومات حذف میشوند.

نقطه 5 -سیگنال فروشی دیگر

نقطه 6- سیگنال فروشی دیگر

شکل شماره 9



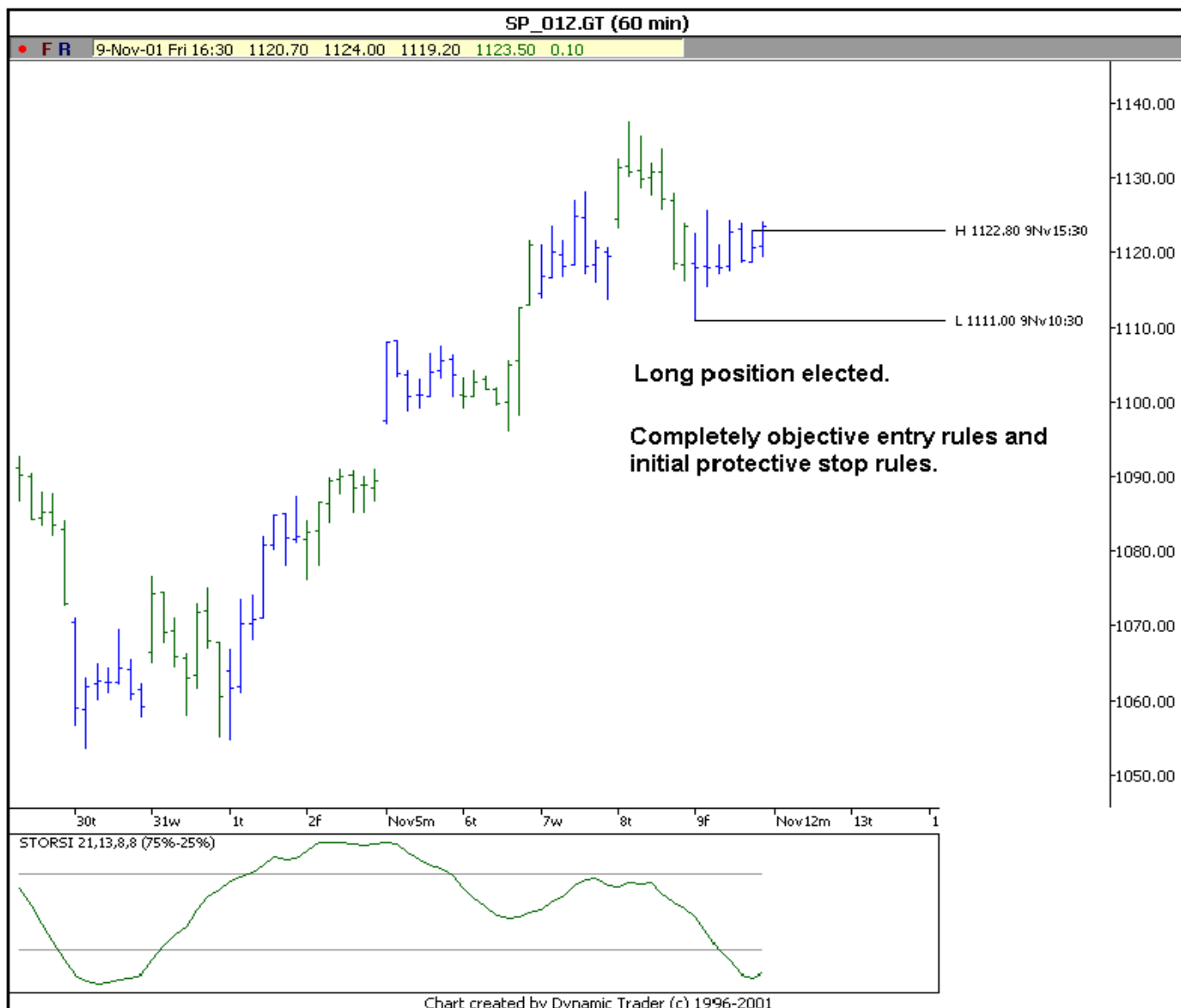
مثالی دیگر

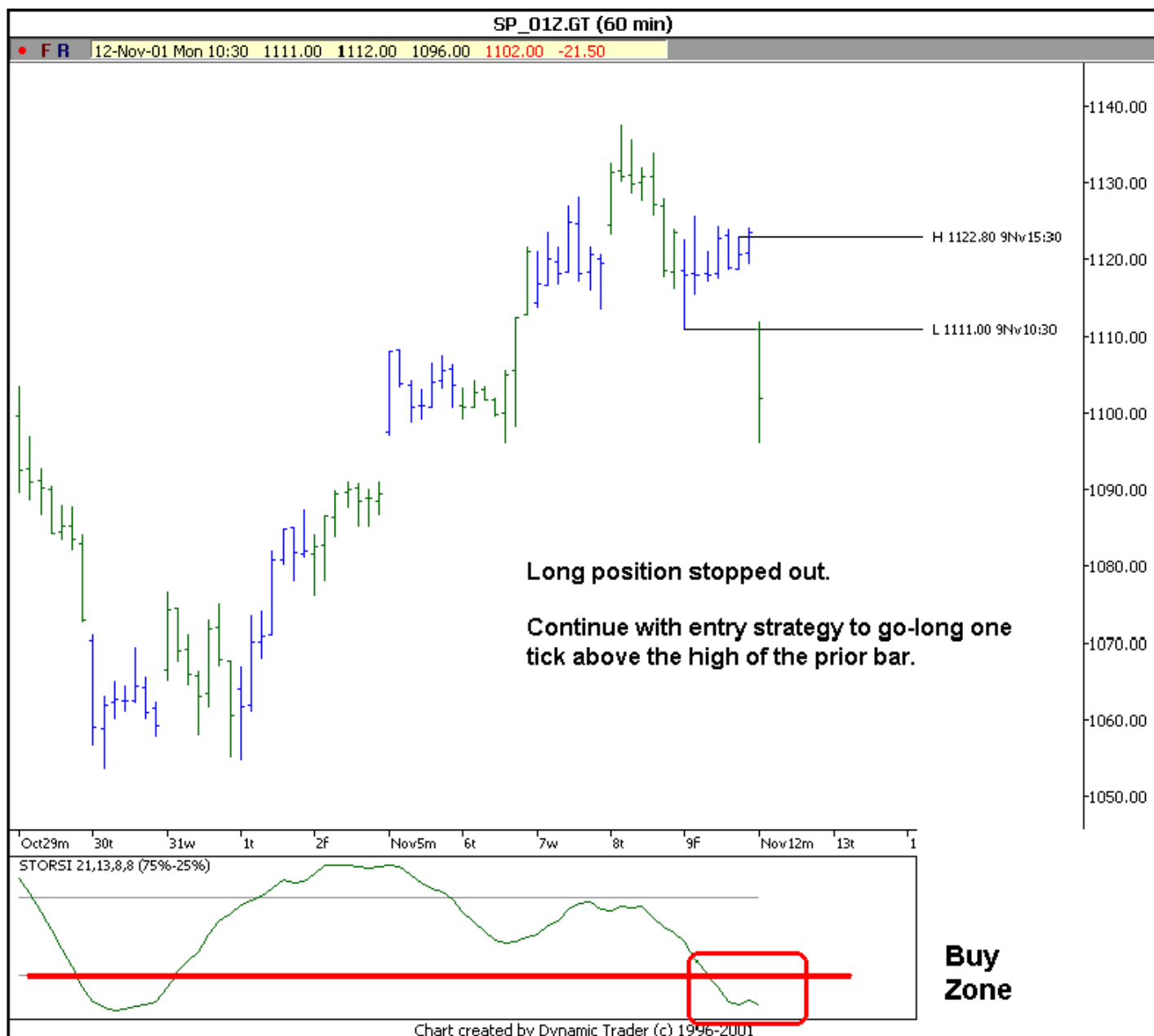
در شکل شماره 10 بازار در یک ترند صعودی قرار گرفته است. با ورود اندیکاتور به منطقه buy zone اوردر buy stop قرار داده میشود.

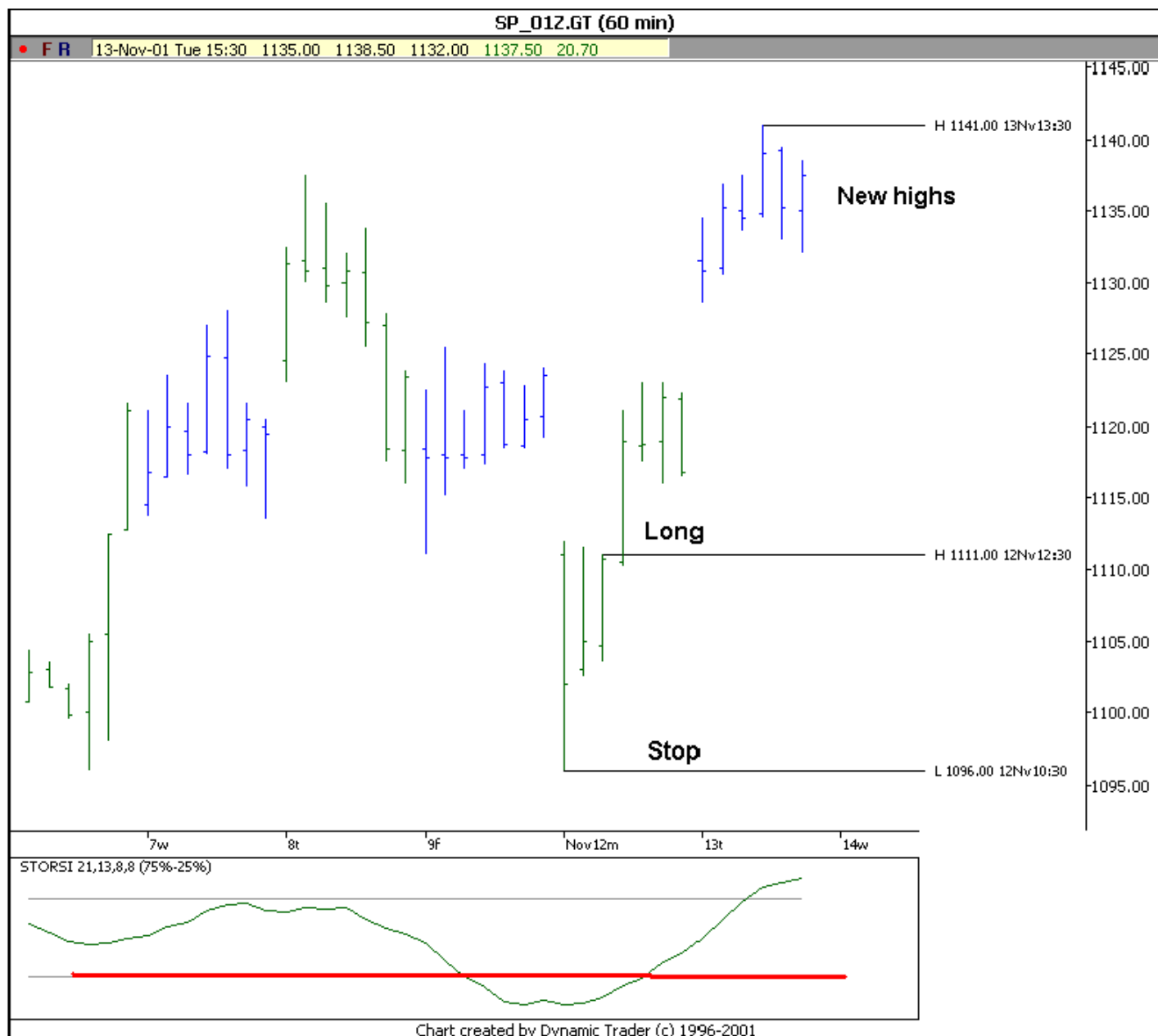
در شکل شماره 11 بعد از 3 میله قیمت اوردر ما فعال میشود و استاپ آنرا زیر آخرین low در شکل شماره 12 بازار در خلاف جهت پوزیشن ما گپ میزند و مارا استاپ اوت میکند. اما از آنجا که از نظر ما بازار همچنان صعودی است و با توجه به تایید این مطلب توسط اندیکاتور اوردر buy stop را مطابق شکل 13 قرار میدهیم. بعد از 3 میله ای بعد از گپ و قراردادن اوردر به اندازه 1 تیک بالای قیمت نهایتا در میله شماره 4 اوردر خرید ما فعال شده و وارد بازار میشویم.

شکل شماره 10









چند روز بعد مجددا فرصت دیگری بر روی sp درست شد که اقدام به اوردر گذاری کردیم و .... نکته: در صورتی که احساس کنیم در نقطه ای که سیگنال ورود حادث شده اصولا اقدام به خرید غیر معتبر است و به عبارتی انتظار داریم که ترند در حال تکمیل باشد اینجاست که دیگر برای ورود به خرید اقدام نمیکنیم و سیگنالهای خرید ما غیر معتبر میشوند.





## درس چهارم اندیکاتورها و تریلینگ کردن استاپ

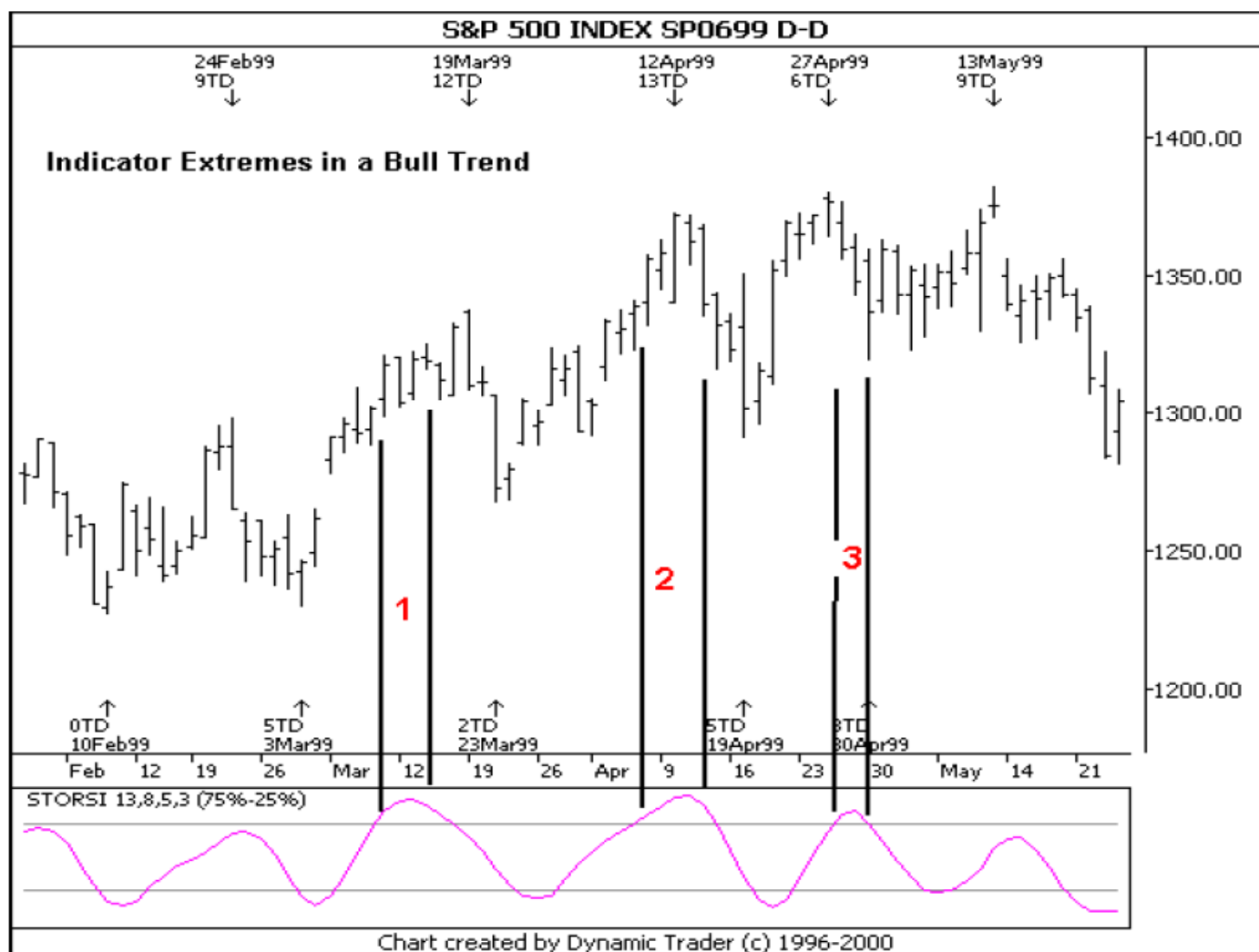
در این درس یاد خواهیم گرفت که چطور از اندیکاتور و ناحیه استاپ (stop zone) برای مدیریت پوزیشن استفاده کنیم. در شکل زیر موقعیت اندیکاتور را در حالتی که ترند صعودی است و اندیکاتور در ناحیه بالای 75٪ تشکیل قله داده و به سمت پایین میچرخد مشاهده میکنید که در هر 3 وضعیت lable گذاری شده است.

در مورد شماره 1 - اندیکاتور پس از رسیدن به ناحیه 75٪ به سمت پایین چرخش میکند (طی چند میله) قبل از اینکه کارکشن تکمیل شود. کارکشن 2 میله بعد از چرخش تمام میشود.

شماره 2- اندیکاتور بالای 75٪ میرسد و به اندازه چندین میله بالای خط 75٪ میماند و به سمت پایین چرخش نمیکند تا اینکه طی 2 میله به سمت پایین میچرخد.

شماره 3: اندیکاتور به سمت 75٪ میرود و بلافاصله با اولین کندل به سمت پایین سرازیر میشود.

شکل شماره 15



در شکل زیر میبینید که بازار یک بازار صعودی است و در مواقعی که اندیکاتور وارد منطقه sell zone شده تنها افت ناچیزی در قیمت داشته ایم و آن مناطق هرگز نمیتوانند به عنوان سیگنال ظاهر شوند. حال ما تا اینجای درس آماده شدیم که چطور در مواقعی که بازار در حالت ترند است با استفاده از اندیکاتور نقاط احتمالی پایان ریتریسهای موقت را پیدا کرده و وارد بازار شویم.

حالا یک سوال:

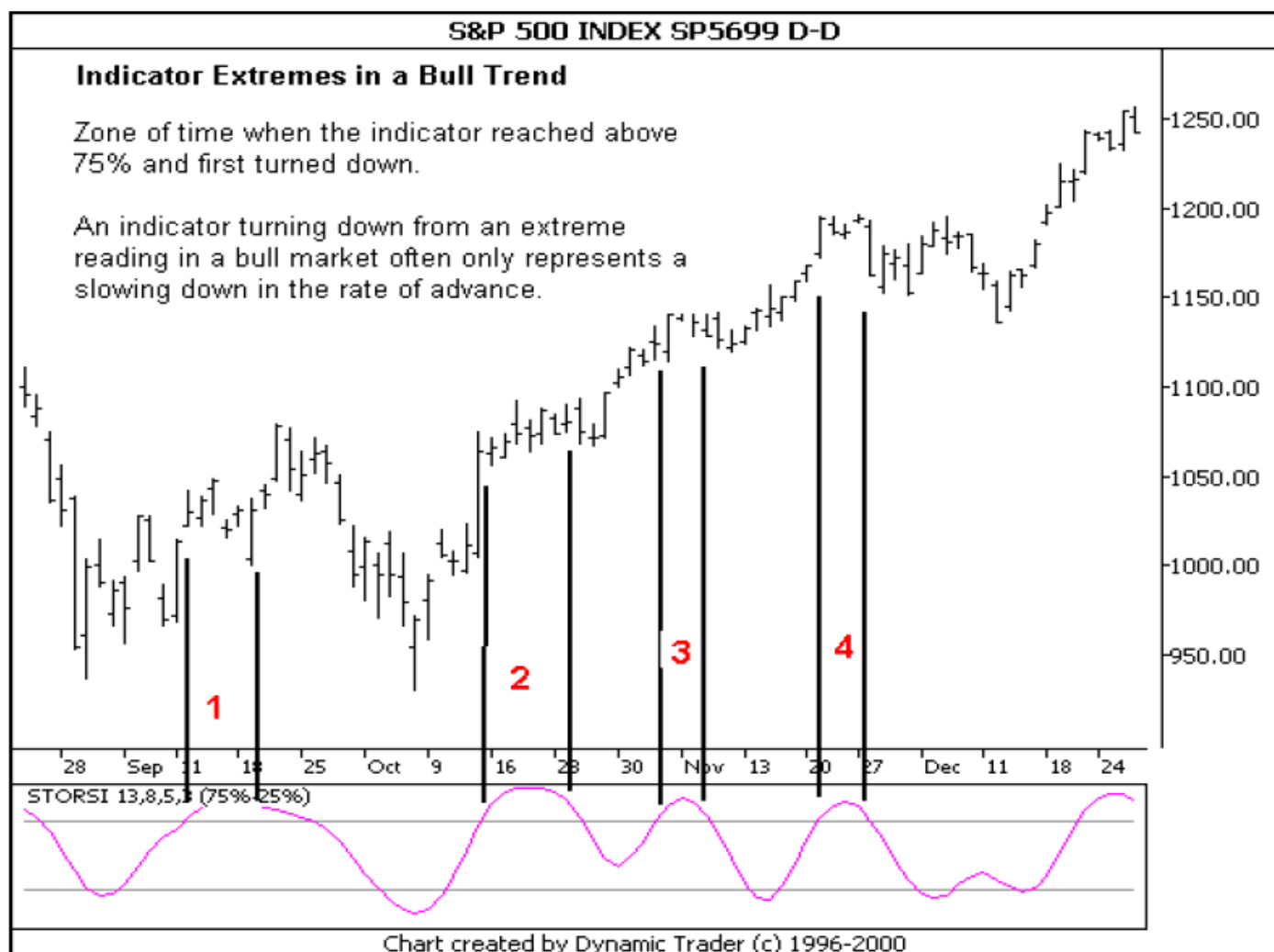
آیا ما میتوانیم از اندیکاتورها در زمانی که در جهت ترند وارد ناحیه هیجانی خود میشوند استفاده کنیم؟ (مثلا در ترند صعودی اندیکاتور وارد منطقه sell zone شود)

جواب:

خیر. اما ما میتوانیم از اندیکاتورها در چنین مواقعی برای تریل کردن پوزیشنهای بازمان بهره بگیریم. در این قسمت فرض ما بر این است که مثلا برای یک ترند صعودی تقریبا همیشه قبل از ایجاد یک تاپ کوتاه مدت اندیکاتور وارد منطقه فروش هیجانی میشود (sell zone)

در ادامه شرایطی را که میتوان با استفاده از این اندیکاتور به تریلینگ پوزیشن پرداخت عنوان میکنیم.

شکل شماره 16



: stop zone

برای ترند صعودی همان ناحیه sell zone و برای ترند نزولی بر عکس.

قوانین تریلینگ :

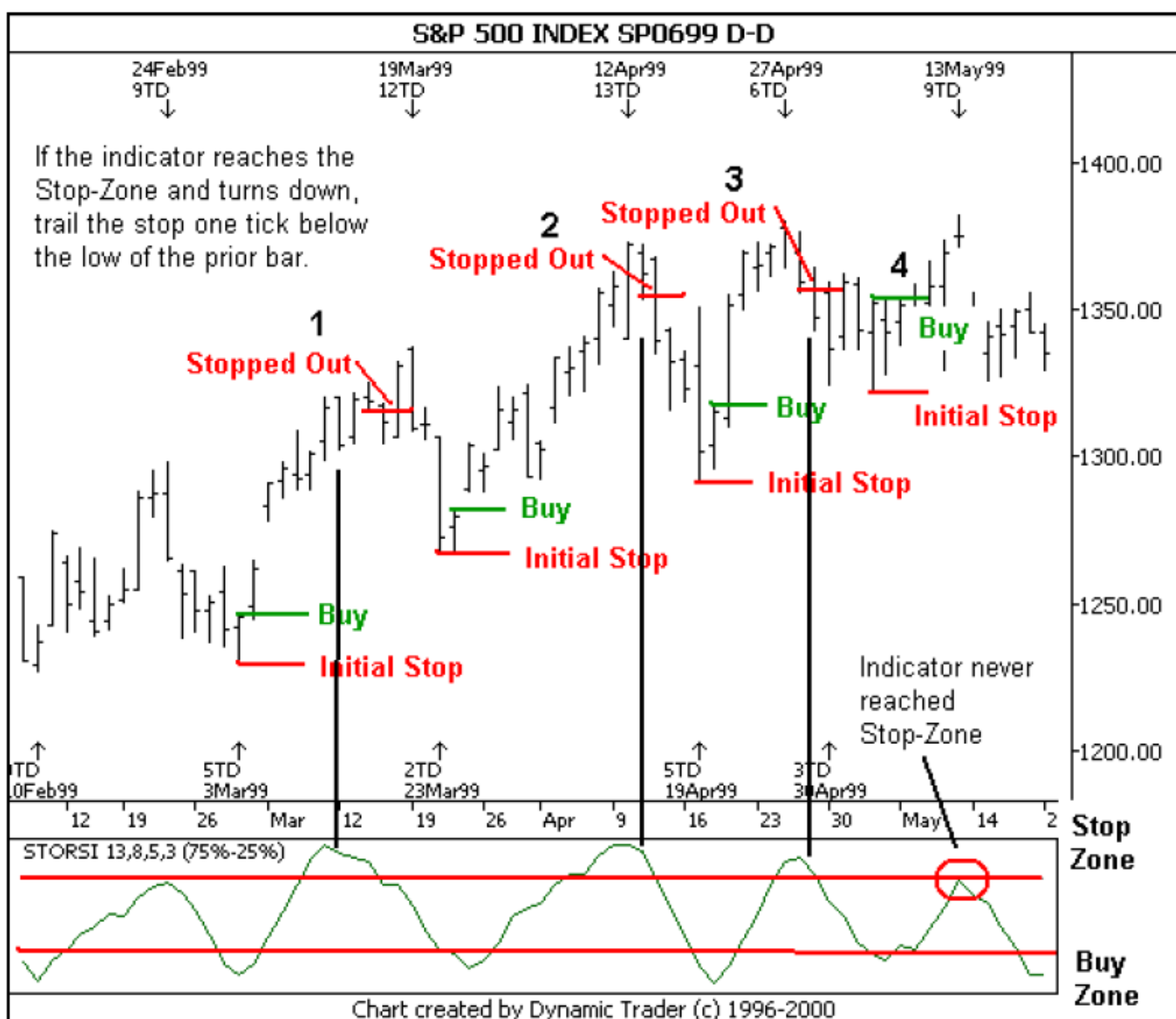
(1) اندیکاتور به منطقه stop zone رسیده و به سمت پایین چرخش کند (turn down)

(2) استاپ را به اندازه 1 پیپ زیر low میله قبلی قرار دهیم.

در شکل زیر دقت کنید که در ترید شماره 4 اندیکاتور به هیچ وجه وارد منطقه stop zone نمیشود و لذا ما به هیچ عنوان از

استراتژی تریلینگ برای آن استفاده نخواهیم کرد.

شکل شماره 17



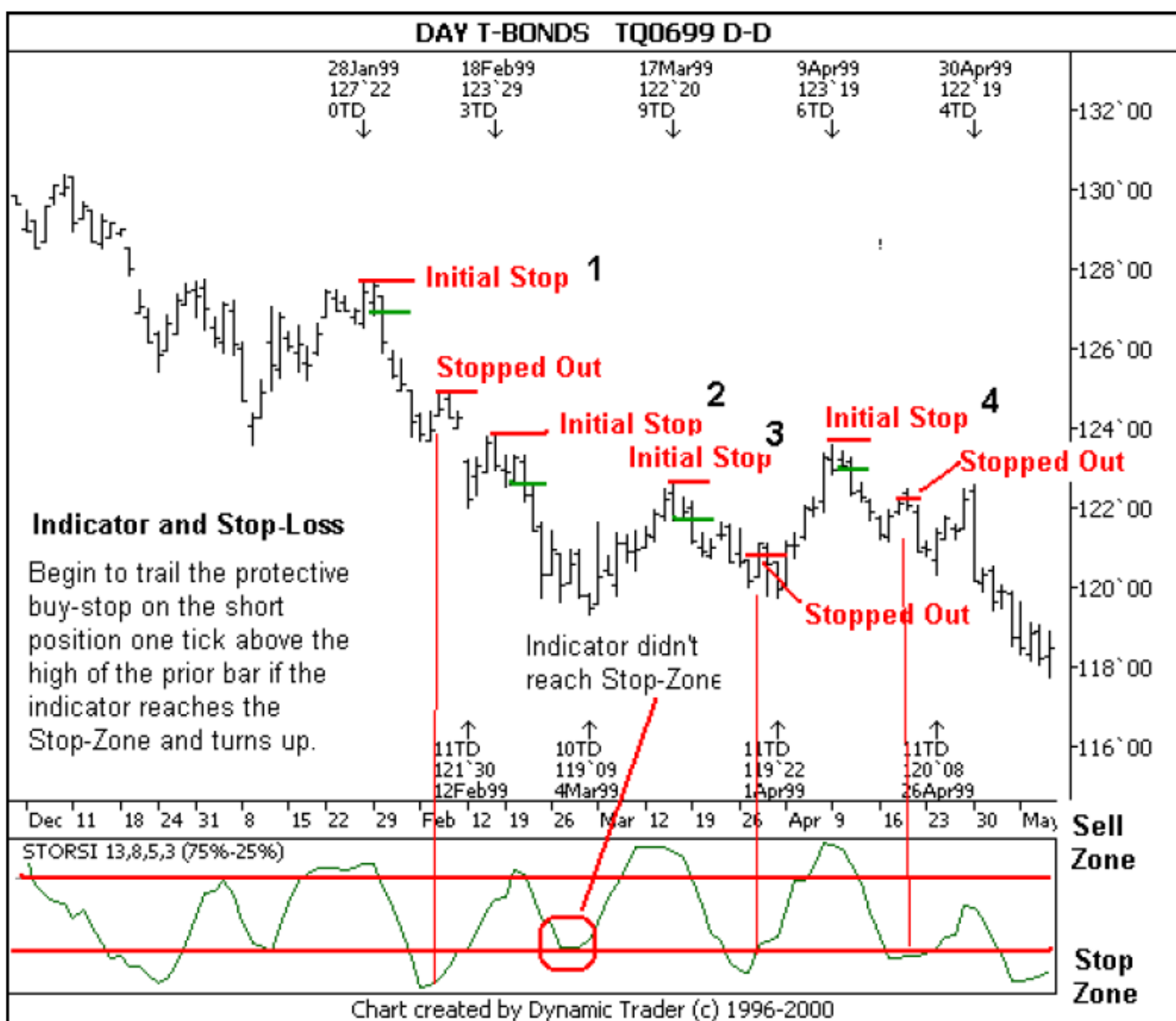
شکل دیگر مثالی دیگر است .

توجه کنید که ترید شماره 2 به خاطر عدم برخورد اندیکاتور به stop zone لاجرم آنرا تریل نمیکنیم تا اینکه در نهایت stop out میشود.

توجه:

استراتژی استفاده از روش تریلینگ با استفاده از این اندیکاتور تنها برای تریدهای کوتاه مدت استفاده میشود چرا که اگر پوزیشن ها برای تریدهای بلند مدت باشند با اصلاح های minor میان راه خود بخود stop out میشوند.

شکل شماره 18















### درس پنجم:

## چطور بهترین تنظیمات را برای اندیکاتور برگزینیم؟

سوال:

آیا فقط یک تنظیم خاص برای کلیه حالات بازار کفایت میکند؟

جواب:

خیر. اگر چه که تشخیص اینکه چه تنظیمی برای بازار بهتر است کار سختی نیست.

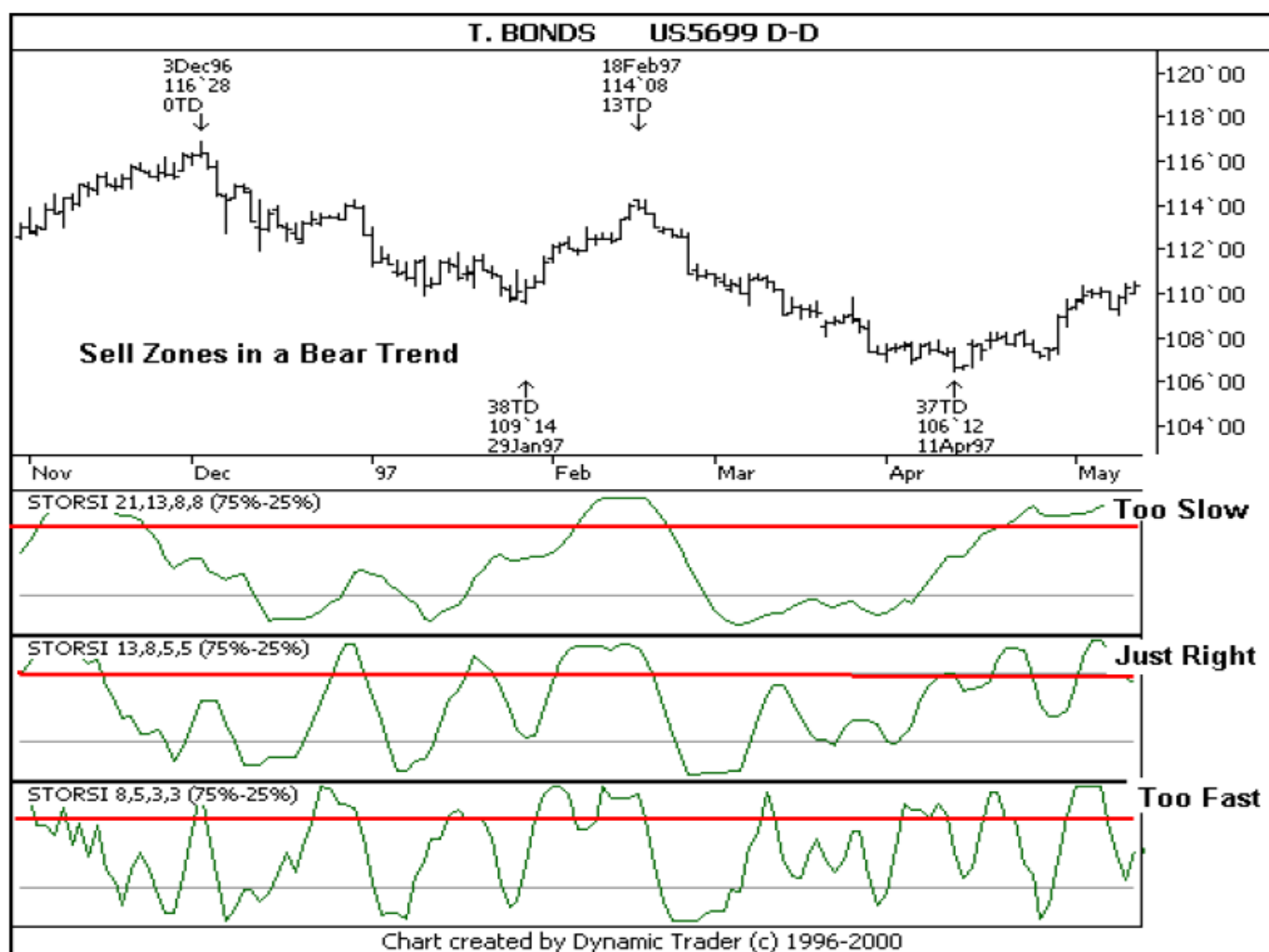
در ادامه در این خصوص صحبت خواهیم کرد.

دیدگاهی مشابه آنچه در ادامه خواهد آمد برای سایر اندیکاتورها نیز صادق است.

در ضمن در خود نرم افزار چندین ستینگ برای کاربران موجود است و میتوانند از آنها استفاده کنند.

در چارت زیر دقت کنید.

عکس شماره 24



یک بازار نزولی داریم.

پنجره ها اندیکاتور با 3 نوع تنظیم مختلف برای MA-1 را نشان میدهند که با خط سبز نشان داده شده اند. ما باید اینطور فکر کنیم که برای یک ترند نزولی و برای بدست آوردن یک ناحیه درست sell zone که ناحیه احتمالی اتمام یک کارکشن را به ما بدهد باید چه تنظیماتی داشته باشیم؟

ستینگ 21 روزه تنها 1 بار در 6 ماه گذشته به محدوده بالایی میرسد و انتهای کارکشن اصلی را به ما نشان میدهد. اگر شما یک تریدر بلند مدت (long term) هستید این تنظیم برای شما مناسب است که اکثر تریدرها تمایل دارند تعداد تریدهای بیشتری در طول 1 ماه داشته باشند.

ستینگ بعدی که در پایین همه قرار دارد دارای پریود 8 روزه است که چندین بار در طول این ترند نزولی منطقه sell zone را بخود دیده است و سیگنالهای خطایی هم از خود صادر کرده است.

ستینگ وسطی که همان پریود 13 روزه است برای مشخص کردن انتهای کارکشنهای مینور وارد منطقه sell zone شده.

در صورتیکه ما توقع ریزش بیشتری از بازار داریم ورود مجدد اندیکاتور وسطی در منطقه sell zone میتواند گزینه مناسبی برای ورود به ترید در جهت sell باشد. (با تنظیمات 13,8,5,5)

به عکس شماره 25 نگاه کنید.

MA1: خط سبز رنگ است .

MA2: در حقیقت موینگ اوریج MA1 میباشد که اصطلاحاً به آن "Double Smoothed" گفته میشود.

در ادامه در مورد نحوه استفاده از کراس 2 موینگ اوریج در تریدها و استراتژیها صحبت خواهیم کرد.

## تنظیمات پیشنهادی StoRSI در چارت روزانه:

باندها : UPPER:70-80% و LOWER:20-30%

تنظیمات :

5-5-8-13

3-3-5-8

برای رسیدن به بهترین تنظیمات کافی است چارت را آورده و تنظیمات پیشنهادی را طبق نکته ای که در بالاتر گفته شد تست نمایید.

دقت کنید که

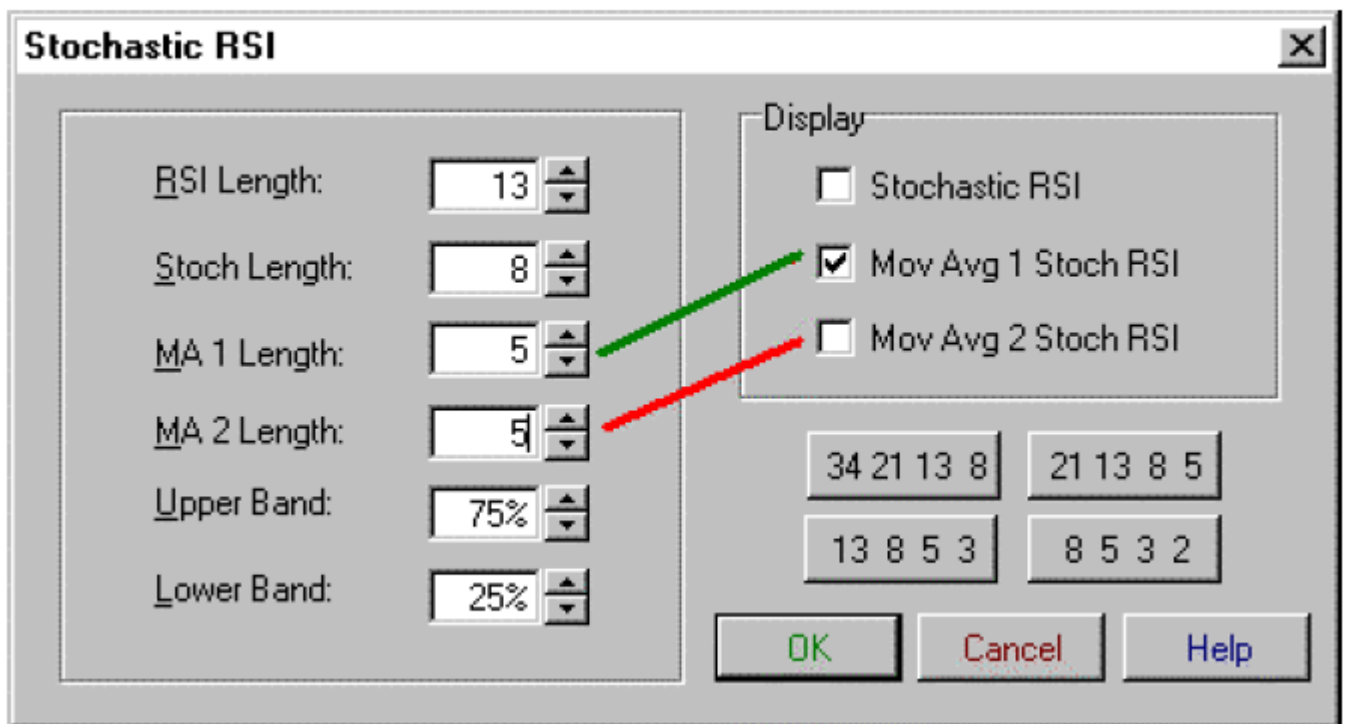
نکته مهم این است که تعداد سیگنالها کم باشد اما از درجه اعتبار بالایی برخوردار باشند بطوریکه با سودهای بالاتر و ضررهای کوچکتر روبرو باشیم.

پس اون تنظیماتی که این مشخصات رو داشت بهترین تنظیم هست .

4 تنظیم برتر بصورت دیفالت در تنظیمات اندیکاتور موجود است.

عکس شماره 25

## StoRSI Settings Menu

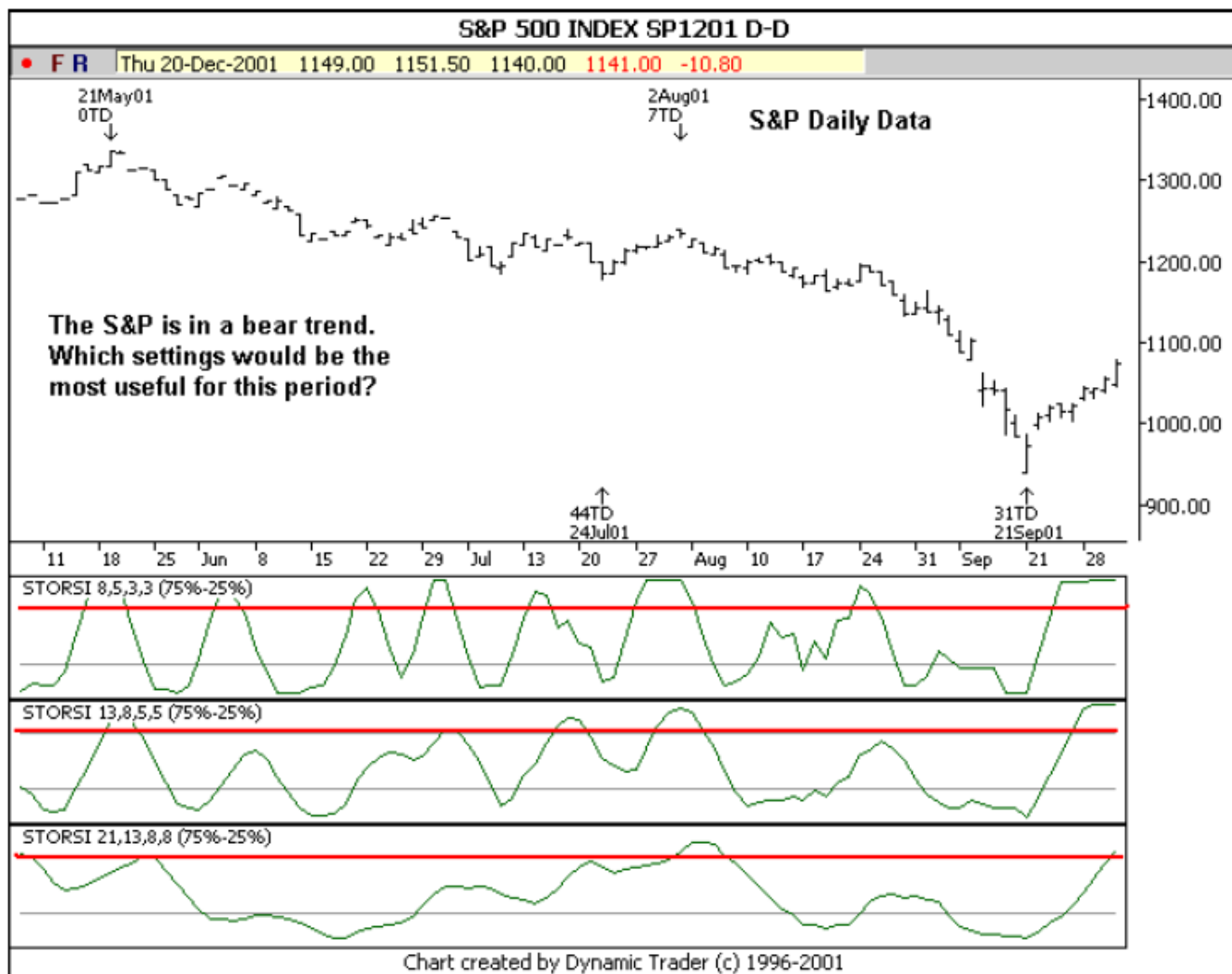


خوب حالا اجازه بدید روی چند تا چارت تنظیمات مختلف را قرار داده و بهترین تنظیم را بدست آوریم.

در چارت اول که s&p میباشد شاهد روند نزولی در این پریود هستیم .

کدامیک از تنظیمات بهتر است و نقاط high انتهای کارکشن را بهتر تشخیص داده است؟

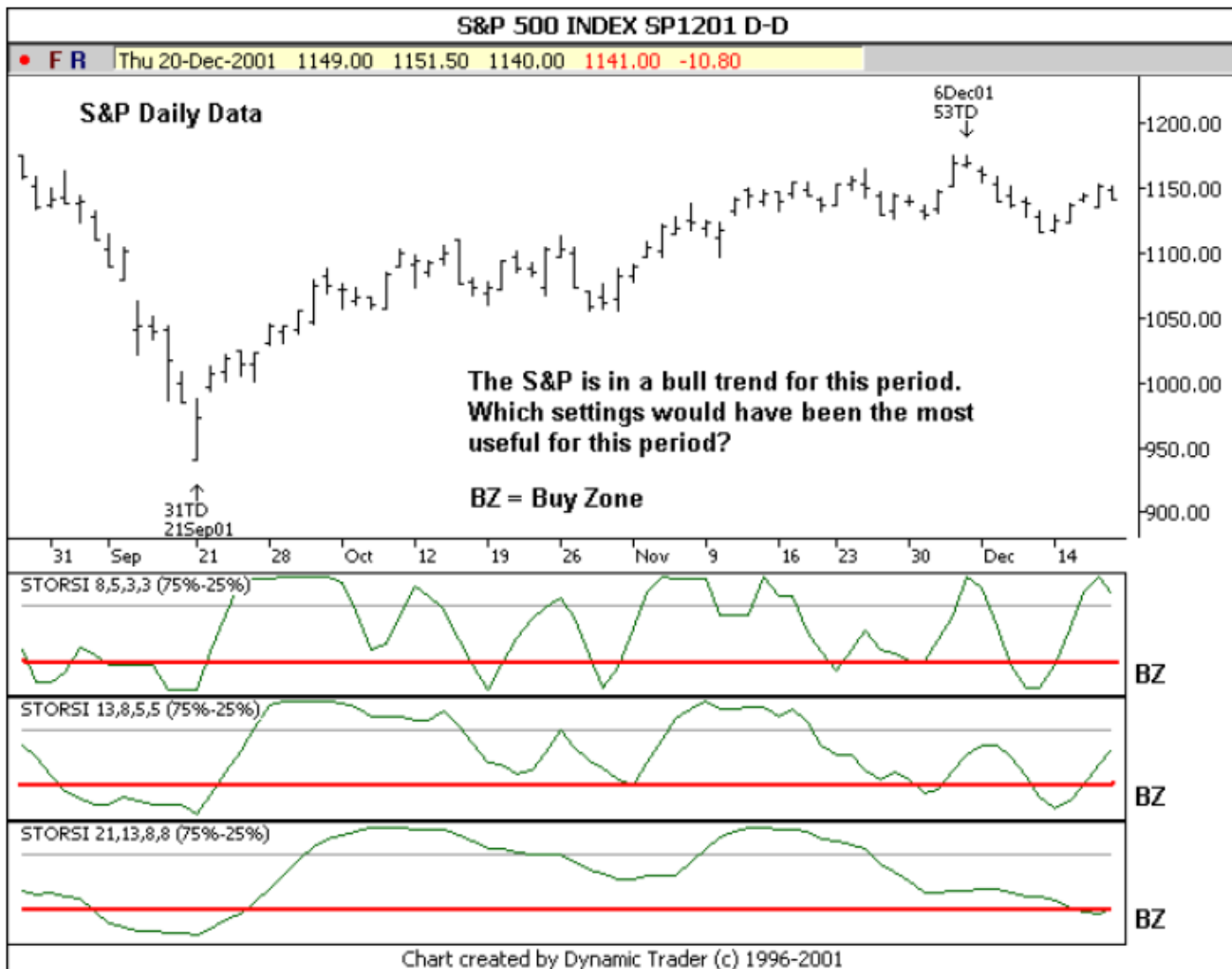
شکل 26



پریود 8 روزه بهتر از بقیه عمل کرده است.

چارت بعدی چارت روزانه s&p هست که دارای یک روند صعودی است.  
بهترین تنظیم کدام است؟

عکس شماره 27



پریود 13 روزه بهتر از بقیه عمل کرده است.

چارت بعدی چارت روزانه Bond هست که دارای یک روند صعودی است.  
بهترین تنظیم کدام است؟

شکل 29



در چارت بالایی (34 روزه) کارکنشهایی مشخص شده اند که عمدتاً طولی بین 3-7 روز دارند و این اندیکاتور low نسبتاً خوبی به ما میدهد.

اندیکاتور پایینی (13 روزه) low های کوتاه مدت را برای ما مشخص میکند.

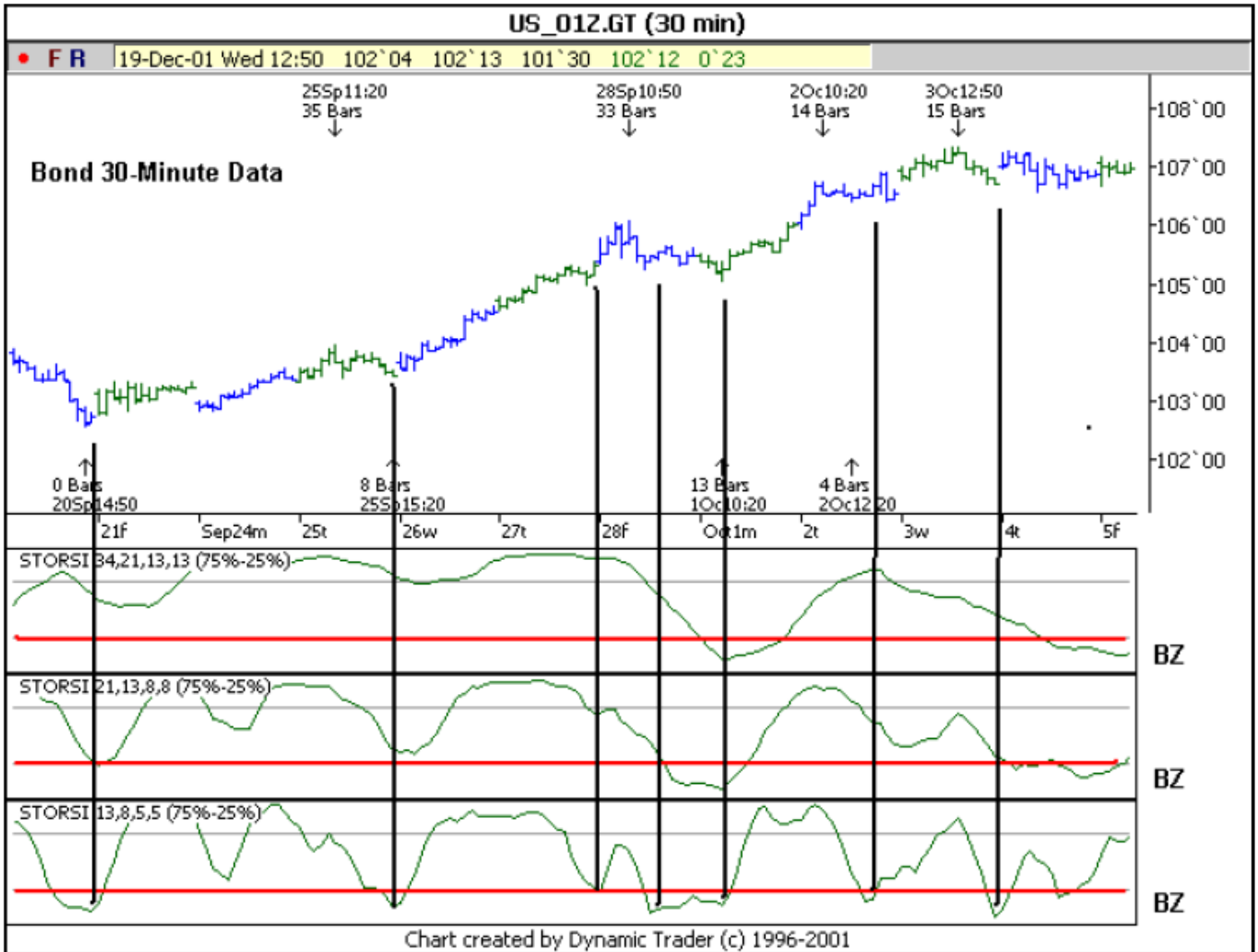
شما کدام حالت را برای ترید بر میگزینید؟

از نظر من (ماینر) 2 تای بالایی نقاط بهتری برای ترید به ما میدهند و سیگنالهای فالس کمتری دارند و اگر من بخواهم تریدهای کوچکی انجام دهم (در حد 2-3 روز) میتوانم از اندیکاتور پایینی استفاده کنم.

چارت بعدی چارت 30 دقیقه ای از BOND هست که دارای یک روند صعودی است.  
بهترین تنظیم کدام است؟

در این چارت انتهای کارکشن ها که باید در مناطق buy zone مورد توجه باشند با خطوط عمودی نشان داده شده اند.

شکل 30



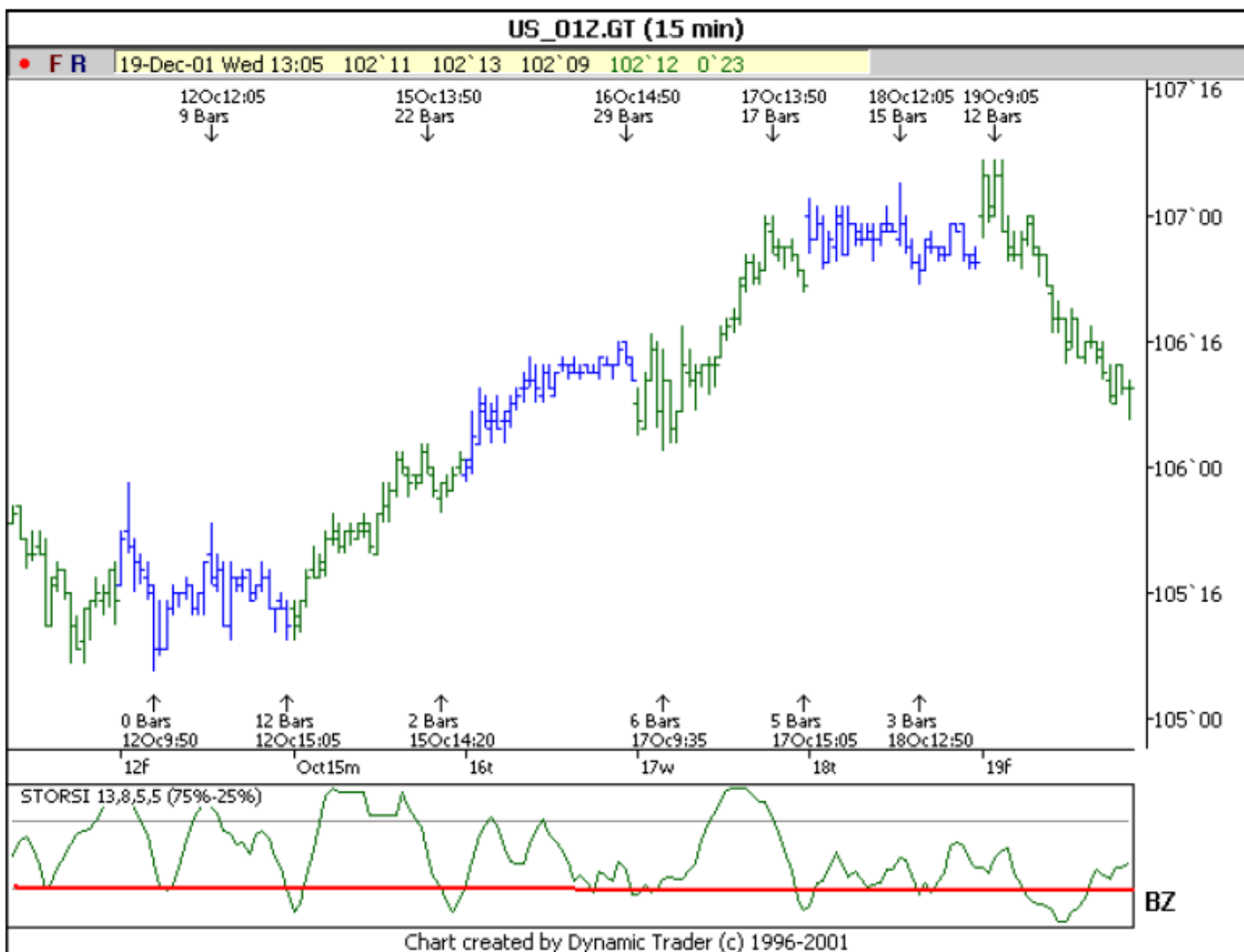
در این شکل اندیکاتور پایینی که همان پریود 13 باشد انتهای کارکشن ها را بهتر پیدا کرده است.



اجازه بدید به تایم فریمهای پایینتر برویم (15 دقیقه)

اندیکاتور 13 روزه در این تایم فریم low های بهتری را برای ورود در جهت ترند افزایشی پیدا میکند.

شکل 31



توجه داشته باشید که

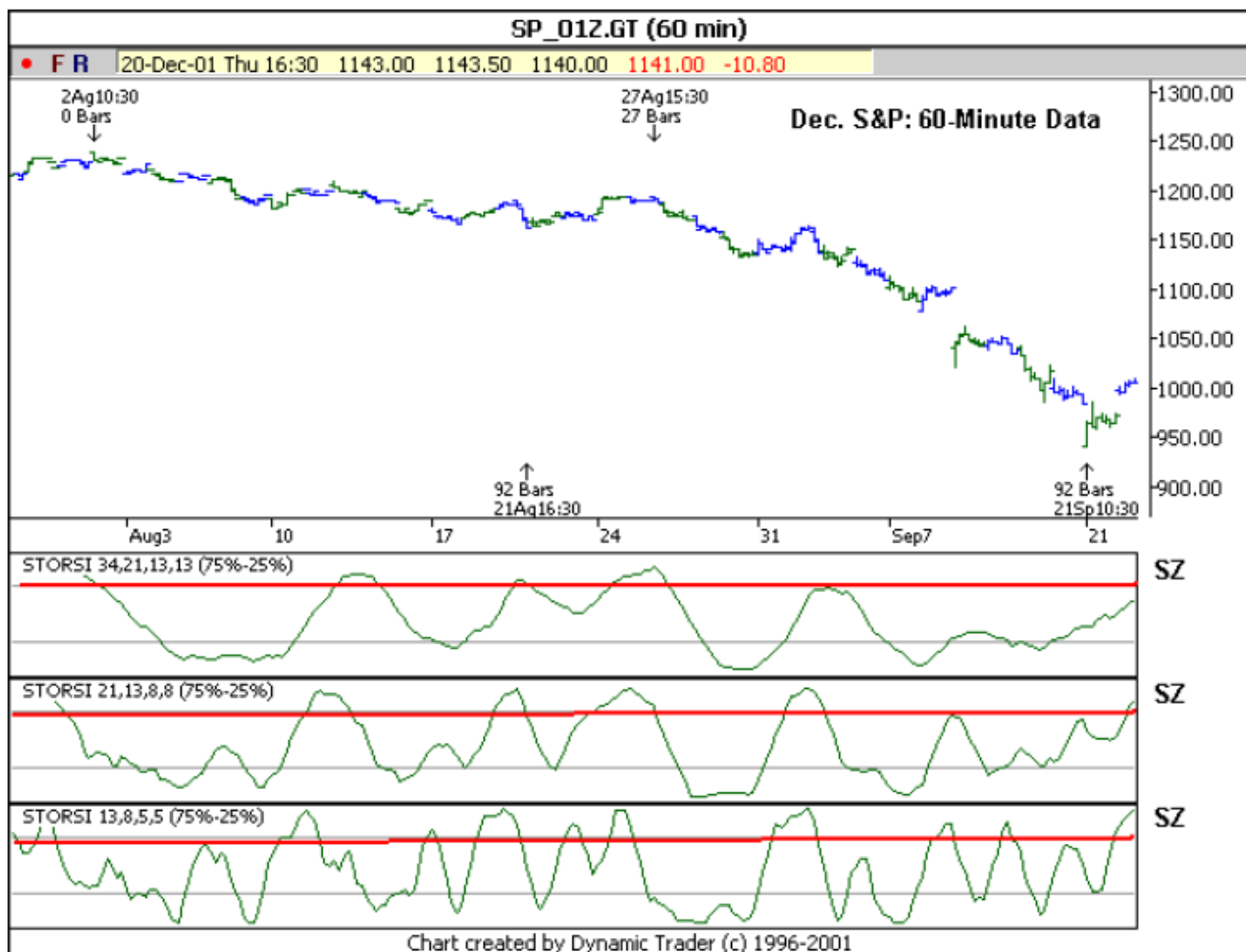
در تمامی این مثالها

هدف استفاده از اندیکاتور کمک به پیدا کردن انتهای کارکشنها جهت ورود در جهت ترند است.

در ادامه 2 مثال از 60 دقیقه چارت S&P در یک ترند افزایشی و کاهشی با ستینگهای مختلف اندیکاتور داریم.  
 کدام تنظیم بهتر از بقیه است؟

شکل شماره 32





بازدها :

پایینی 20% تا 30%

بالایی 70% تا 80%

تنظیمات:

8-8-13-21

5-5-8-13

**چند نکته:**

1- سعی نکنید یک اندیکاتور را به چارت بخورانید. اگر ببینید وضعیت اندیکاتور وضعیت جالبی ندارد به تایم فریمهای پایینتر بروید تا شرایط مطلوب حاصل شود.

2- باز هم تکرار میکنیم که هدف اصلی در استفاده از اندیکاتور پیدا کردن نقاط صحیح برای انتهای کارکشن جهت ورود در جهت ترند است. بنابراین توقع بیشتری از آنها نداشته باشید.

در درس آینده طریقه استفاده از کراس اندیکاتور Double Smoothed و نحوه سیگنال گیری از آن صحبت خواهیم کرد.

## درس ششم

استفاده از کراس در اندیکاتور برای تشخیص ریتریس های ترند و ترندهای در جهت روند

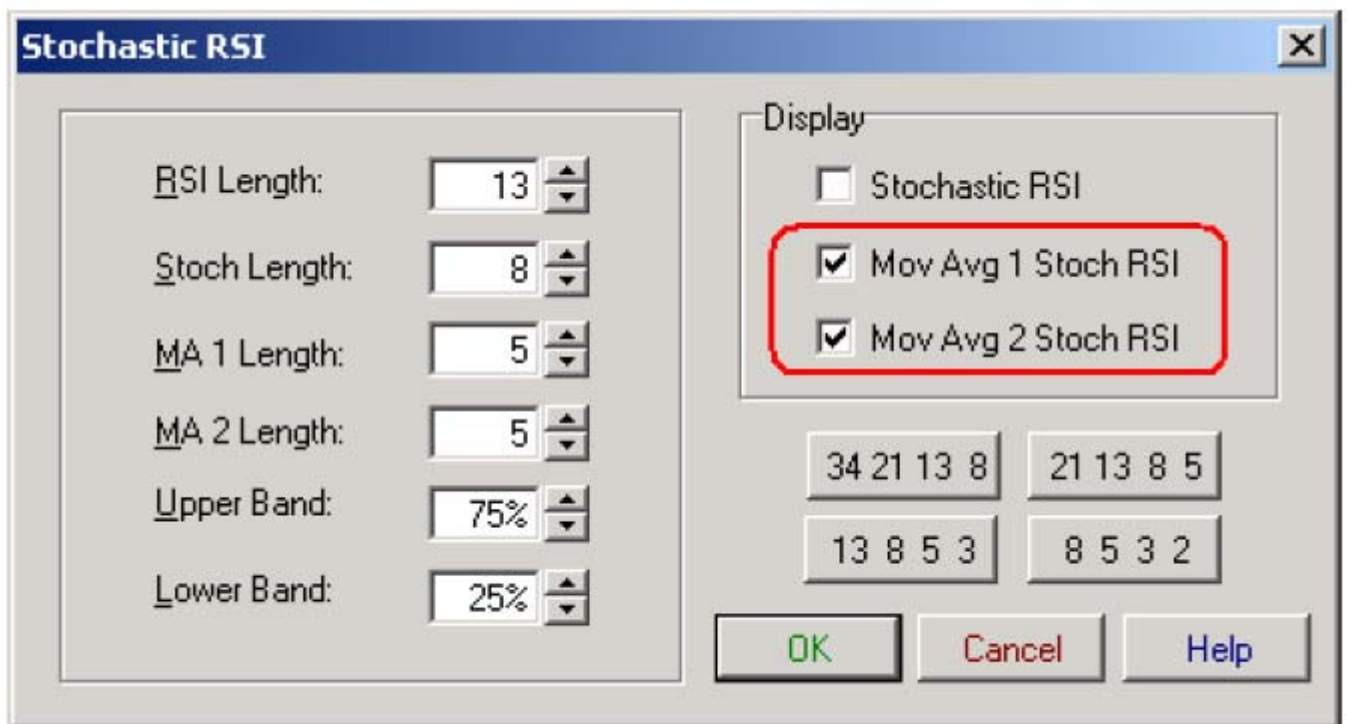
در گذشته تنها از MA1 استفاده میکردیم.

حال از کراس MA1 و MA2 جهت تنظیم اوردردر در ورود به پوزیشن و تنظیم استاپ استفاده خواهیم کرد.

در نرم افزار داینامیک تریدر MA1 سبز رنگ (البته الان شده آبی تیره) و MA2 صورتی رنگ است.

از آنجایی که (همانطور که قبلا گفتیم!) MA2 موینگ اوریج MA1 است بنابراین نسبت به MA1 کندتر عمل میکند.

شکل 34



قوانین استراژی ورود و خروج با استفاده از کراس:

قوانین ورود

=====

- 1- فقط اجازه داریم در جهت ترند وارد شویم. (در اینجا روند را صعودی فرض میکنیم)
- 2- MA1 (سبز رنگ) باید ابتدا به منطقه buy zone برسد. (مقال برای روند صعودی است)
- 3- MA1 به سمت بالا و به سمت MA2 بچرخد. (ارزش MA1 از MA2 بیشتر است)
- 4- شروع به اوردر گذاری اولیه buy stop یک پوینت بالای high میله اول (BH1)
- 5- اگر در حال ترید قرار گرفتیم استاپ اولیه 1 پوینت زیر آخرین low قرار میگیرد.

قوانین خروج

=====

- 1- MA1 به سمت منطقه stop zone حرکت کند.
- 2- MA1-2 به سمت زیر MA2 بچرخد.
- 3- شروع به تریلینگ استاپ 1 واحد زیر آخرین low میکنیم.

عکس همین قوانین برای حالتی است که روند نزولی باشد.

## S&P MINI چارت 15 دقیقه :

در این مثالها ما از داده های کوتاه مدت برای تریدهای کوتاه مدت که ممکنه از چند ساعت تا چند روز بطول بیانجامند . این استراتژی میتواند در هر بازار و هر تایم فریمی مورد استفاده باشد.

در چارت زیر S&P تا محدوده 78.6% بازگشت کرده. اجازه بدید این ناحیه را یک ناحیه ساپورتی مهم فرض کنیم. جایی که احتمال دارد حداقل بازار به اندازه 50% از آنجا بازگشت کند. از آنجا که جهت ترند نزولی است توقع حرکتی 10-30 پوینتی به سمت بالا را داریم. بخاطر داشته باشید که ترند مرتبط با تایم فریم است. هدف ما در اینجا اقدام به خرید در یک کارکشن برای گرفتن 10 پوینت یا بیشتر سود است. شکل شماره 35



در شکل بالا

- 1- ابتدا موینگ اوریج 1 (سبز رنگ) وارد منطقه buy zone میشود و سپس MA2 (صورتی) را به سمت بالا کراس میکند. در این وضعیت ما یک اوردر buy stop یک پیپ بالاتر از high کندل مذکور قرار میدهیم.
- 2- حداقل هدف ما بازگشت قیمت به سمت 50% تا نهایتاً 78.6% است که این ترند کوچک نزولی است.
- 3- اگر پوزیشن فعال شد استاپ اولیه 1 پیپ زیر آخرین LOW میباشد.

حال یک سوال اساسی در مورد مثال قبلی:

آیا بعد از ورود اندیکاتور به منطقه buy zone باید در جهت ترند نزولی (که ترند اصلی ما است) وارد پوزیشن شویم؟  
به عبارتی دیگر آیا آن منطقه منطقه ای است که به ما میگوید کارکشن به پایان رسیده و باید وارد پوزیشن سل شویم؟؟

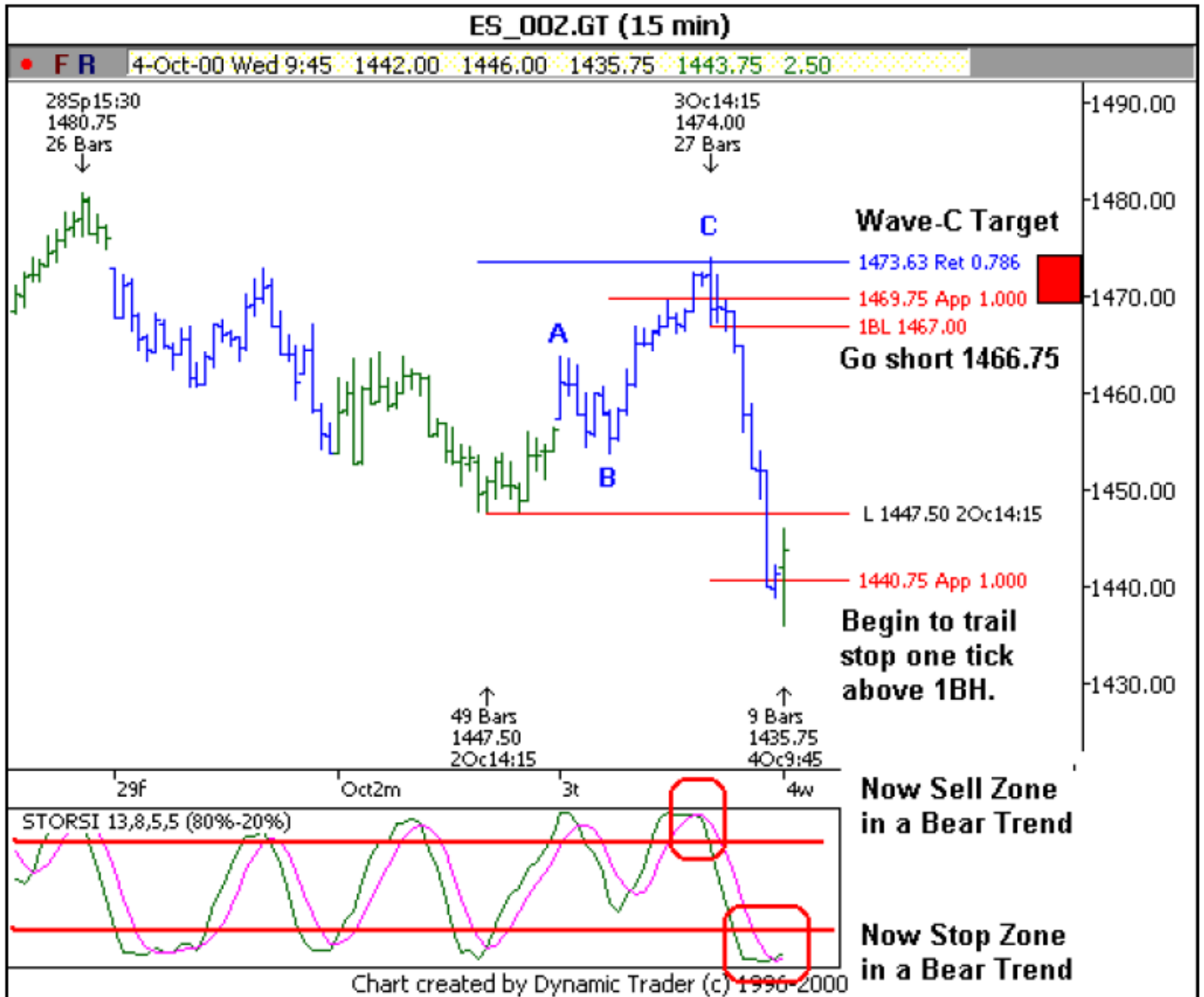
جواب:

در صورتی که با توجه به روابطی که بلدیم به این نتیجه رسیدیم که کارکشن در high در 3 اکتبر به پایان رسیده میتوانیم در جهت ترند وارد سل شویم.

باز هم تاکید میکنیم فراموش نشود که ما به کارکشن وارد میشویم تنها تا زمانی که به مناطق هدف انتهایی کارکشن برسیم و هرگز نباید جهت ترند را فراموش کنیم.

در ادامه همانطور که در شکل زیر میبینید بعد از نقطه A دارای 3 تیک مخالف هستیم. در این مرحله بخاطر اینکه به نواحی انتهایی موج 4 نرسیده ایم (چه از بعد تایم و چه از بعد قیمت) به هیچ عنوان نباید وارد پوزیشن sell شویم. در ادامه و بعد از نقطه B قیمت در نقطه C به ناحیه انتهایی موج C میرسد و ما باید آماده ورود به پوزیشن در جهت sell شویم. از آنجا که اندیکاتور نیز در منطقه sell zone قرار گرفته میتوانیم با استفاده از کراس اوردر گذاری کنیم.

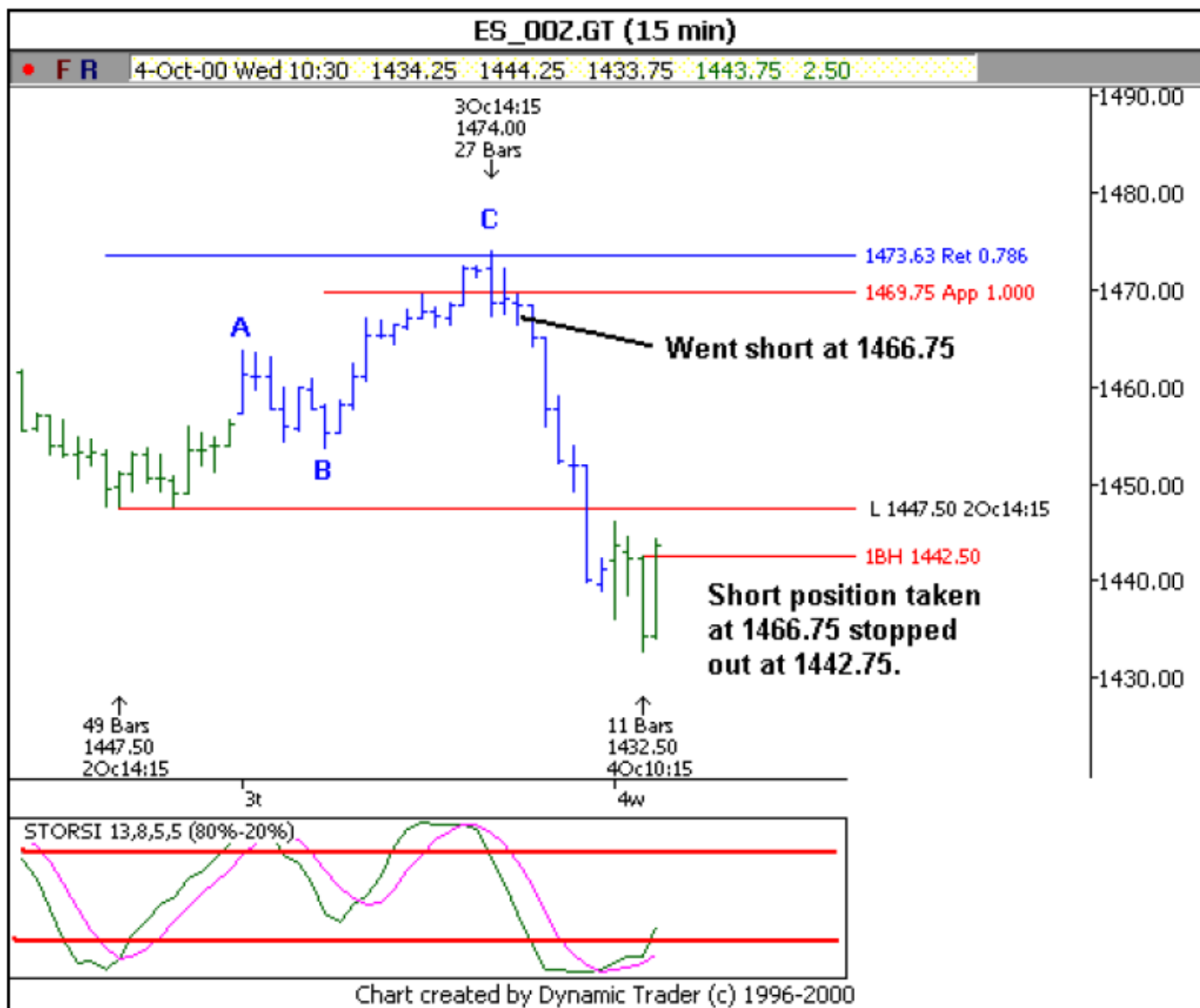




دقت کنید که در این مثال آنچه که باعث ایجاد stop zone در ترند نزولی برای ما شد تنها و تنها اعتقاد ما به این بود که اینجا انتهای کارکشن است و ترند در حال حاضر نزولی است.

در نهایت با رسیدن قیمت به ناحیه stop zone طبق روشی که قبلا گفتیم استاپ را به اولین high کندل آخر میبریم و تریل را ادامه میدهم تا استاپ اوت شویم یا ....

شکل 39



سوال: آیا حالا که استاپ اوت شدیم زمان زمان خرید است؟

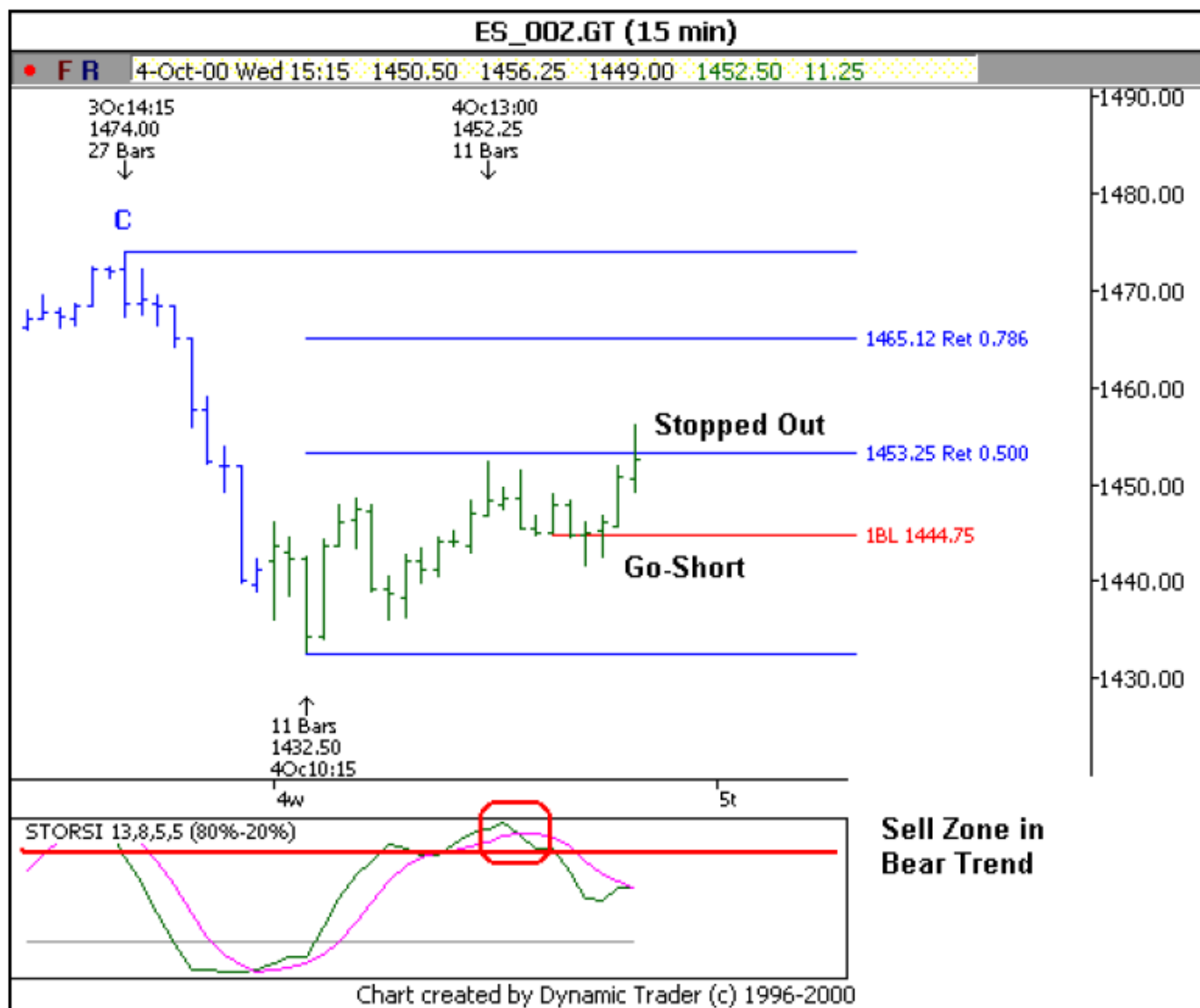
جواب: خیر به خاطر اینکه هنوز به نواحی انتهایی موج فعلی (نزولی) نرسیده ایم بنابراین اصلا به buy فکر نمیکنیم و فعلا همچنان دنبال سیگنال sell هستیم.

- 1- در این شکل (شکل 40) میبینید که در اواسط روز 4 اکتبر S&P تا یک نقطه زیر ریتتریس 50% فیبوناچی می آید و در ناحیه sell zone خط MA2 توسط MA1 از بالا کراس میشود.
- 2- اوردر sell stop را 1 تیک زیر BL1 یعنی low اولین کندل قرار میدهیم.
- 3- بعد از چند میله ترید کوتاه مدت فعال میشود. (در 1444.50)
- 4- استاپ اولیه برابر با 1452.50 در یک تیک بالای آخرین high قرار دارد.
- 5- این ترید کوتاه مدت با ضرر کوچکی بسته میشو زیرا یک new high در حال شکل گیری است.

سوال: آیا ما همچنان به دنبال sell هستیم؟

جواب: البته. تا وقتی که ترندنزولی است و ما در یک اصلاح choppy قرار گرفته ایم و نه یک ABC ساده. تا زمانی که با توجه به مباحث time و price اعتقاد به ریزش داریم و هنوز قیمتی در بالای سطح 78.6% قرار نگرفته است ما باید هر زمانی که موقعیت برای تنظیم sell stop بود از دست ندهیم.

شکل 40

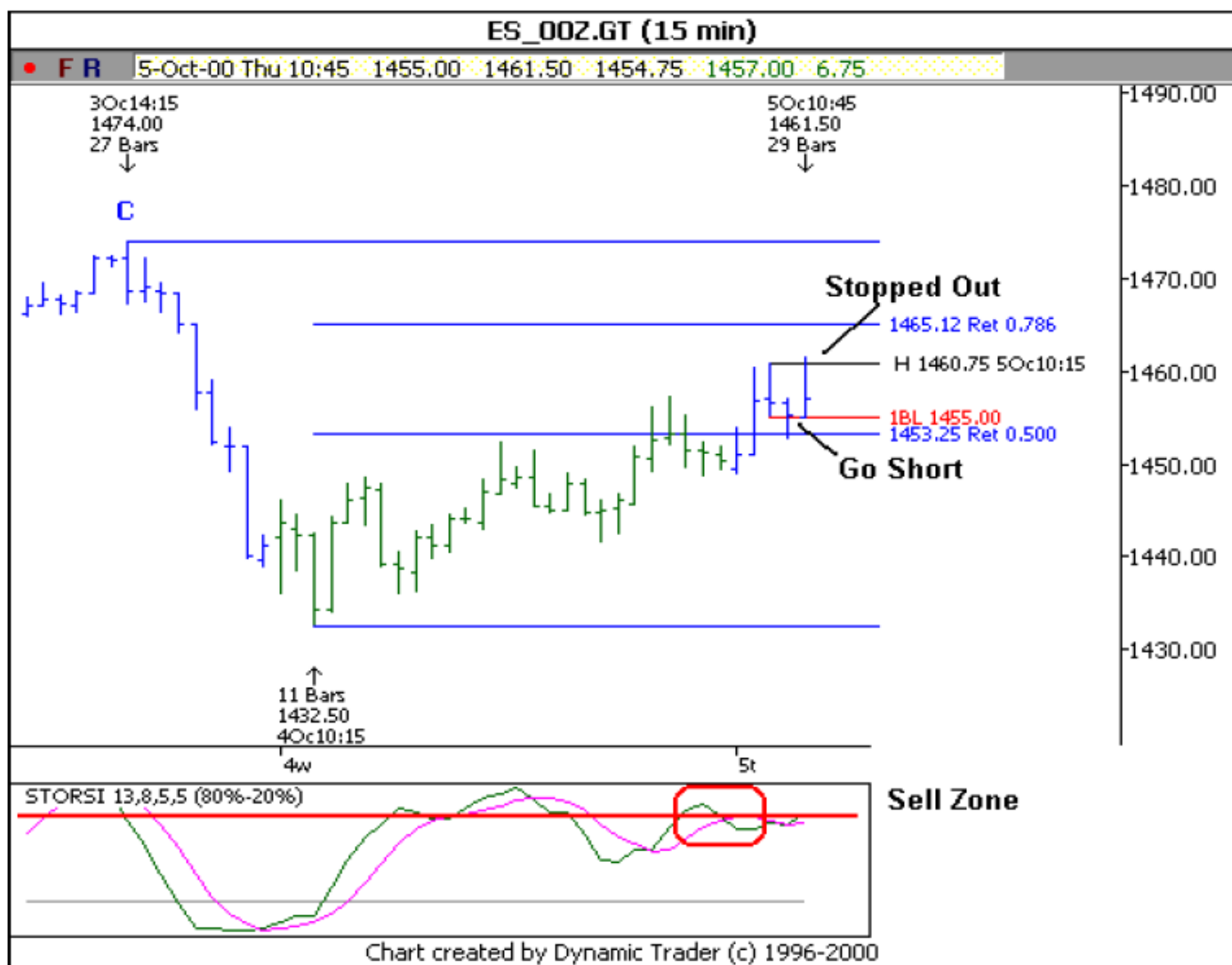


- 1- در صبح 5 اکتبر همچنان این رالی صعودی به بالای 78.6% نرسیده است.
- 2- MA1 به منطقه sell zone میرسد و به سمت زیر MA2 کراس میکند. توجه کنید که MA2 در بالای منطقه sell zone قرار ندارد! (اجباری ندارد که اینگونه باشد اما MA1 حتما باید به منطقه بالای sell zone رسیده باشد)
- 3- در این مرحله sell stop دیگری را برای ورود به short قرار میدهیم که بصورت BL1 تریل میشود. (تا اینکه به اون کندلی که زیرش اوردر گذاشته شده میرسیم)
- 4- مجددا در ناحیه 1454.75 اوردر سل فعال میشود و استاپ اولیه در ناحیه 1461.75 یعنی 1 تیک بالاتر از آخرین low قرار میگیرد.
- 5- مجددا در میله بعدی استاپ اوت میشویم. (در قیمت 1461.75)

سوال: بعد از خوردن 2 بار استاپ پشت سر هم آیا همچنان برای اوردر گذاری سل اقدام میکنیم؟

جواب: بله. تا زمانی که بازار در تایم روزانه بالای سطح 78.6 بسته نشود این به معنی آن است که ما همچنان به ترند نزولی اعتقاد داریم.

شکل 41



1- MA1 مجددا جهش کوچکی به سمت بالا و منطقه sell zone می‌کند و MA2 را به سمت پایین کراس می‌کند.

2- مجددا یک اوردر سل استاپ 1 واحد زیر BL1 قرار می‌دهیم.

3- اوردر در قیمت 1451.50 فعل می‌شود.

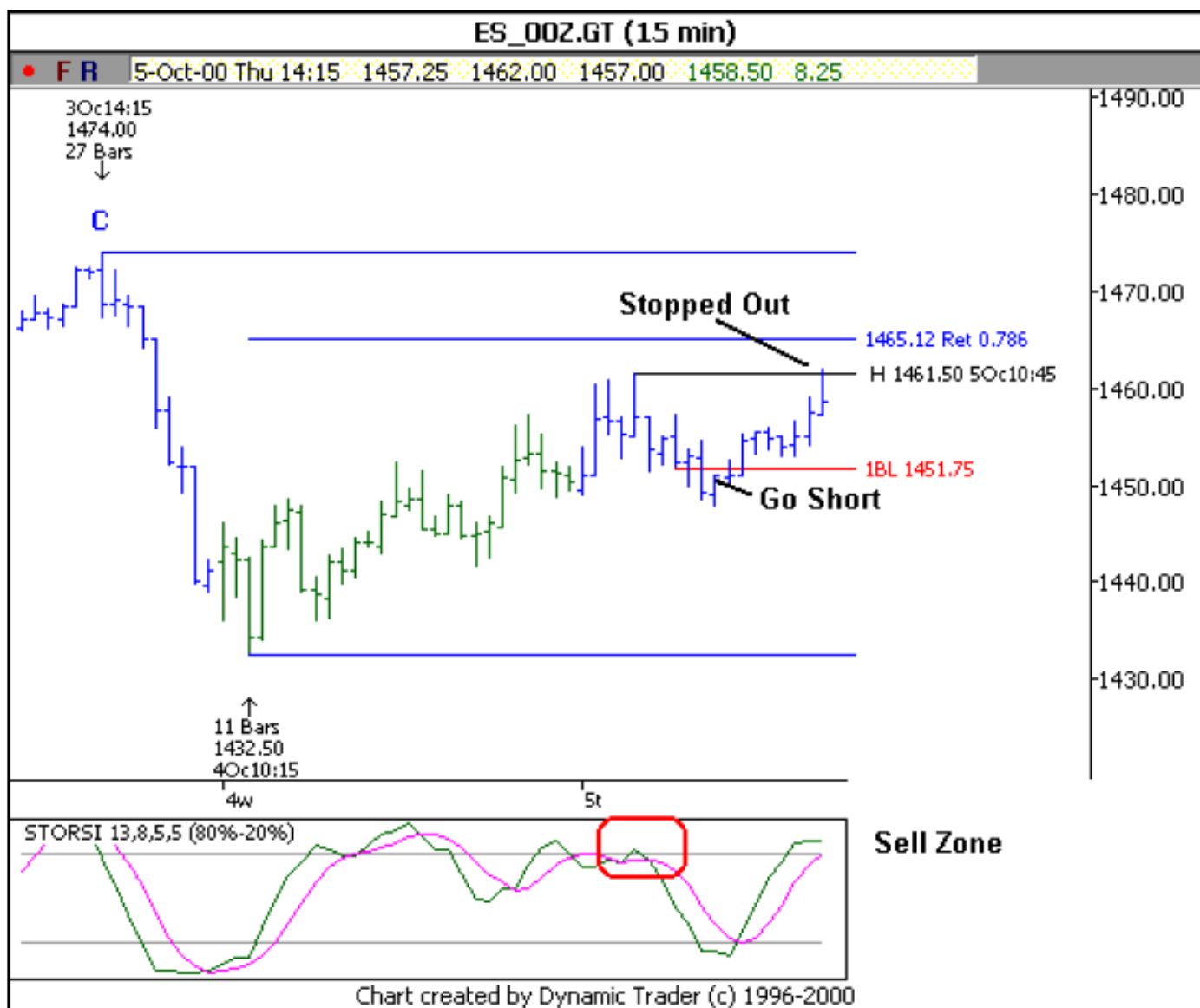
4- سپس این بار در قیمت 1461.75 و یک تیک بالای آخرین high استاپ اوت می‌شویم.

سوال: هم اکنون ما 3 بار پشت سر هم استاپ خورده ایم. آیا باز هم اوردر sell تنظیم می‌کنیم؟

جواب: البته. تا زمانی که S&P بالای سطح 78.6 بسته نشود این کار را ادامه می‌دهیم. هم اکنون پترن هم به خوبی نشان می‌دهد

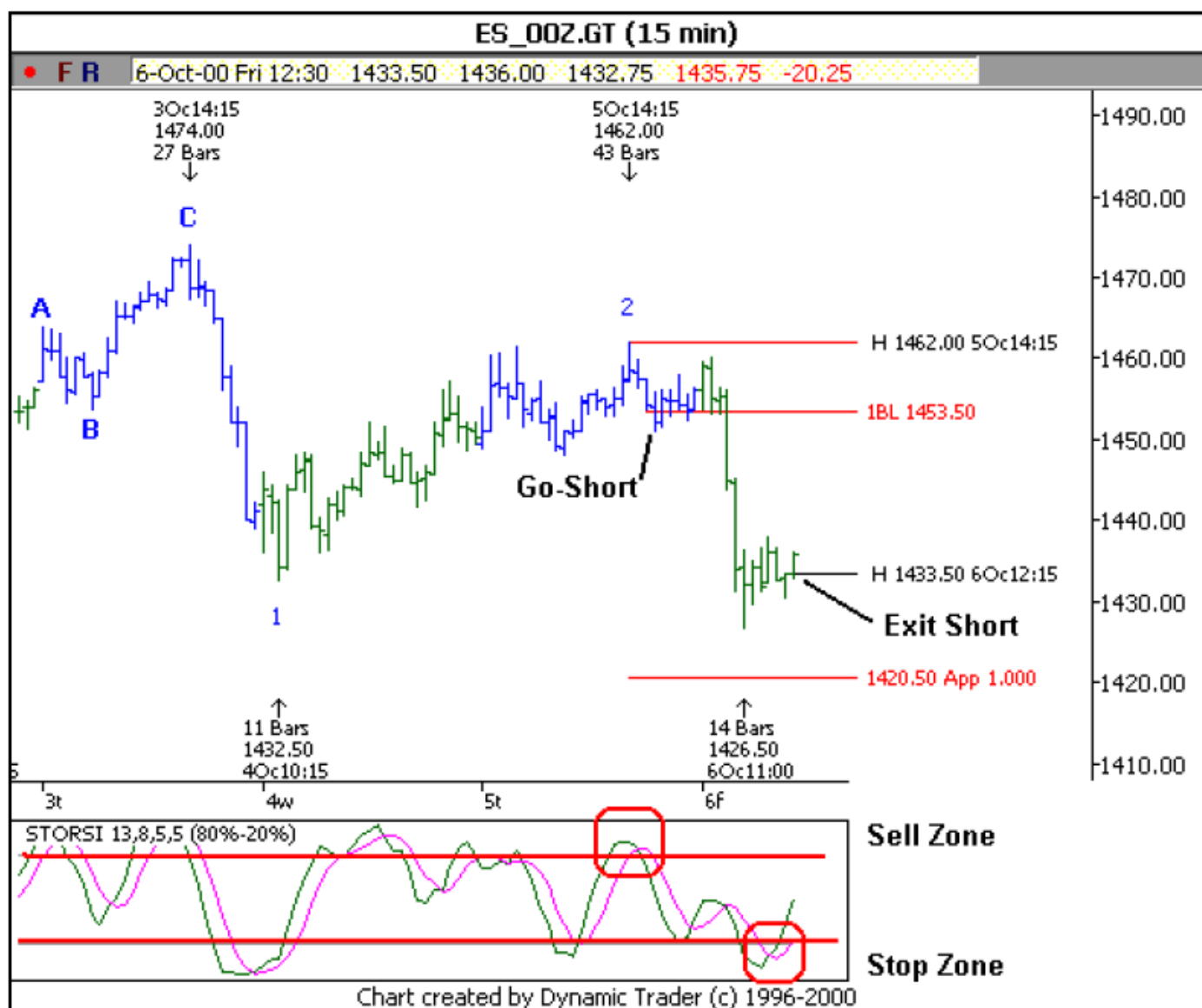
که یک کارکشن واضح شکل گرفته است. S&P هم اکنون فقط چند پیپ در زیر تارگت نهایی کارکشن خود قرار دارد.

شکل 42



- 1- چند میله بعد از استاپ اوت شدن مجددا MA1 وارد منطقه sell zone شده و با MA2 کراس میکند. مجددا اوردر sell را تیک زبر BL1 قرار میدهم و تریل میکنیم.
- 2- sell در قیمت 1453.25 فعال میشود. در این هنگام s&p با سرعت و شیب زیادی (sharp) تشکیل new low میدهد.
- 3- در ناحیه sell stop موینگ 1 با MA2 به سمت بالا کراس میکند.
- 4- شروع به تریل استاپ یک تیک بالای high میکنیم.
- 5- سرانجام در قیمت 1433.75 از بازار استاپ اوت میشویم.

شکل 43



در مثالهای بالا چنین مثالی از s&p را انتخاب کردیم چون در حالتی بود که در کارکشن choppy گیر کرده بودیم. (که باعث 3 بار استاپ خوردن ما شد)

نکته مهم این است که همیشه چشمتون به توپ باشه. توپ چیه؟ جهت ترند! در مقایسه با سایر استراتژیهای ادامه دهنده روند این استراتژی تقریباً بی نقص عمل میکند. چرا که کلید آن محدود کردن ضرر در دوره های choppy یا اصطلاحاً رنج بازار به جند استاپ کوچک پشت سر هم و سپس گرفتن ترند اصلی است. (البته بنده خودم هیچ تجربه و تمایلی به این سبک چند بار استاپ خوردن برای گرفتن ترند ندارم چون بار روانی سنگینی به تریدر وارد میکند.)

ناحیه stop zone و تریلینگ کردن استاپ:

ما در مثالهای بالا با اولین کراس اندیکاتورها در منطقه stop zone بلافاصله استاپ را 1 پیپ زیر high یا low آخرین کندل قرار میدادیم. در بعضی مواقع با استفاده از تحلیلهای تایم و پرایس ما از بازار توقع رسیدن به اهداف خاصی در جهت ترند را داریم (به جای اینکه با اولین کراس اقدام به تریلینگ کنیم)

1- در شکل زیر در بعد از ظهر 5 اکتبر اوردر سل فعال میشود.

2- سپس در 6 اکتبر در منطقه stop zone کراس اتفاق می افتد. آیا اینجا باید استاپ را به یک پیپ بالای BH1 منتقل کنیم؟

3- اگر در آنالیز زمان 5 اکتبر را انتهای موج 2 شماره گذاری کنیم typical target برای موج 3 برابر با 161.8% APP موج 2 میشود که در نزدیکی 1394.75 یعنی تقریباً حدود 40 پیپ پایینتر خواهد بود.

4- این غیر منطقی است که حداقل تا رسیدن قیمت به منطقه typical target استاپ را به 1 تیک بالای BH1 منتقل کنیم.

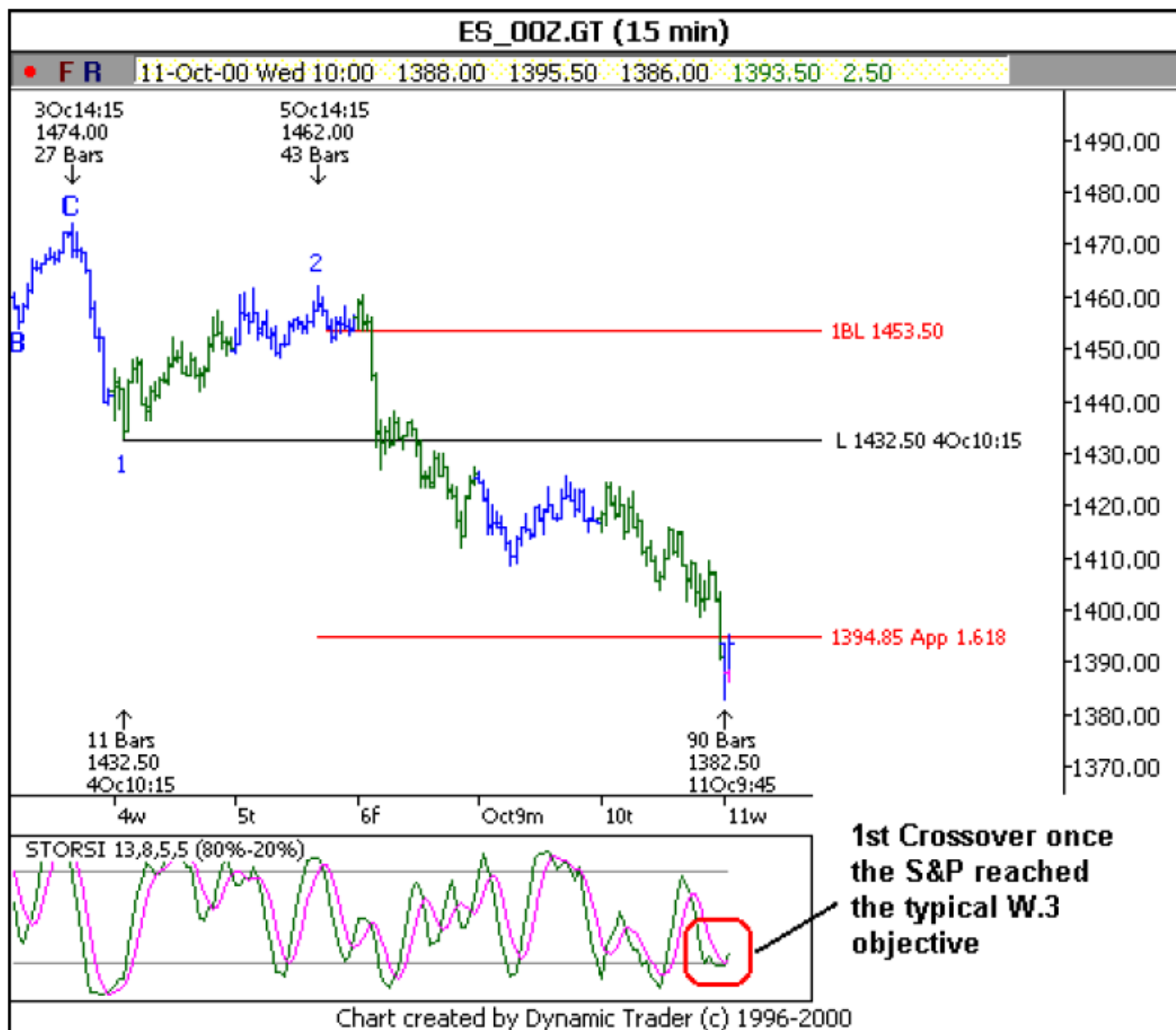
شکل 44





1- S&P تا قبل از رسیدن به ناحیه typical target سه بار در ناحیه stop zone کراس می‌کند.  
 2- در صبح 11 اکتبر بازار به ناحیه APP %162 میرسد و در منطقه stop zone نیز یک کراس دیگر اتفاق می‌افتد.  
 اکنون منطق حکم می‌کند که استاپ را به 1 پیپ بالای BH1 منتقل کنیم.

شکل 45

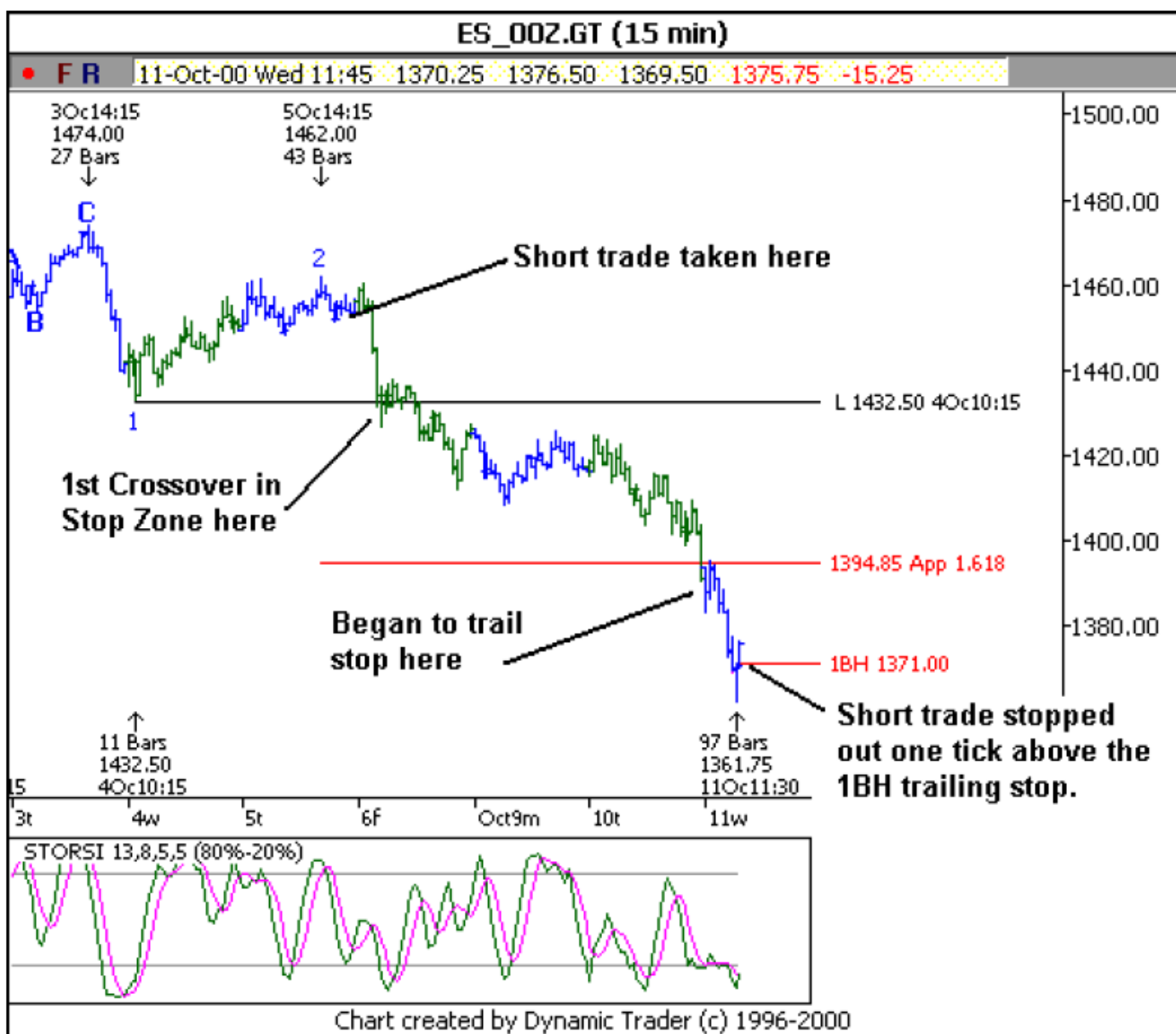


1- مارکت باز هم میریزد و ما نیز کندل به کندل و با توجه به lower high تریلینگ را انجام میدهم تا اینکه سر انجام در قیمت 1371.25 از بازار استاپ اوت میشویم.

2- با اضافه کردن اهداف جدید قیمتی به چارت سود خالص ما از حدود 20 پیپ در کراس اول به بالای 80 پیپ در اولین کراس بعد از رسیدن به اهداف اولیه قیمت رسید. (ببینید چه اختلاف قابل توجهی!؟)

در اینجا هدف ما این است که تا حد امکان جلوی از دست رفتن بخشی از سودمان را بگیریم.

شکل 46



درس هفتم: چند مثال بصورت step by step (مرحله به مرحله)

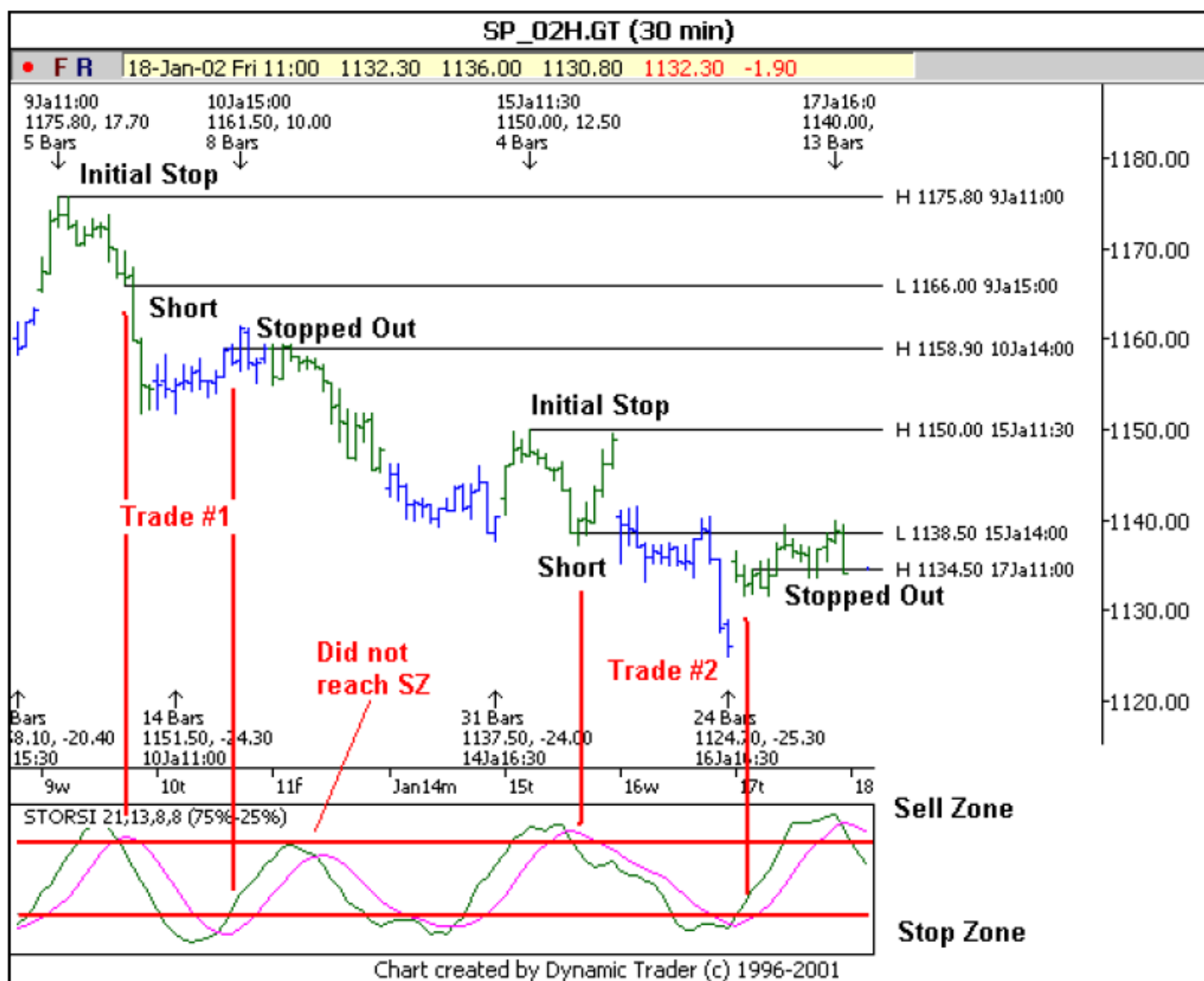
همه چیز در عکس مشخص است و اگر قسمتهای گذشته را خوب متوجه شده باشیم توضیحا روی عکس کفایت میکند.

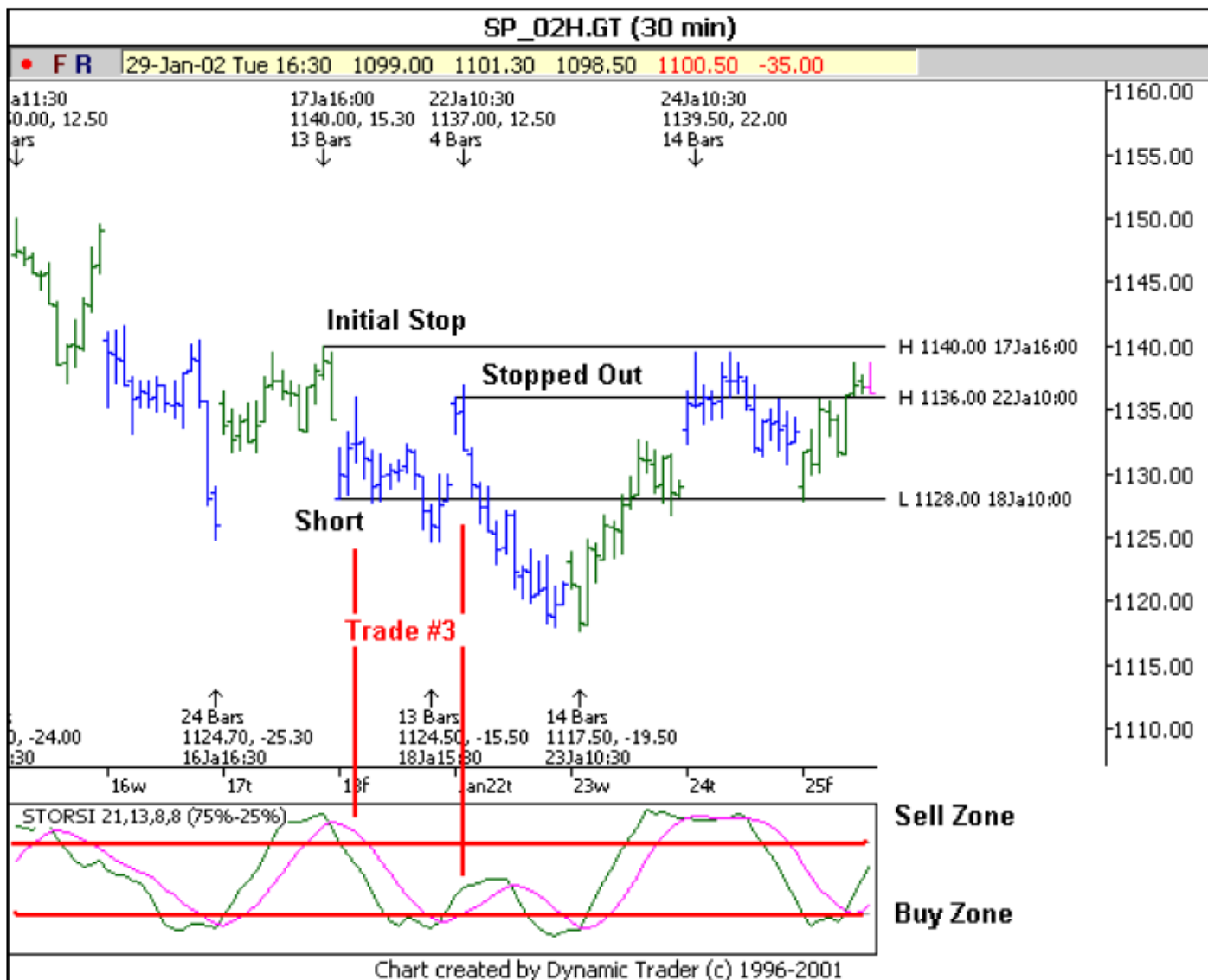
عکسها به ترتیب

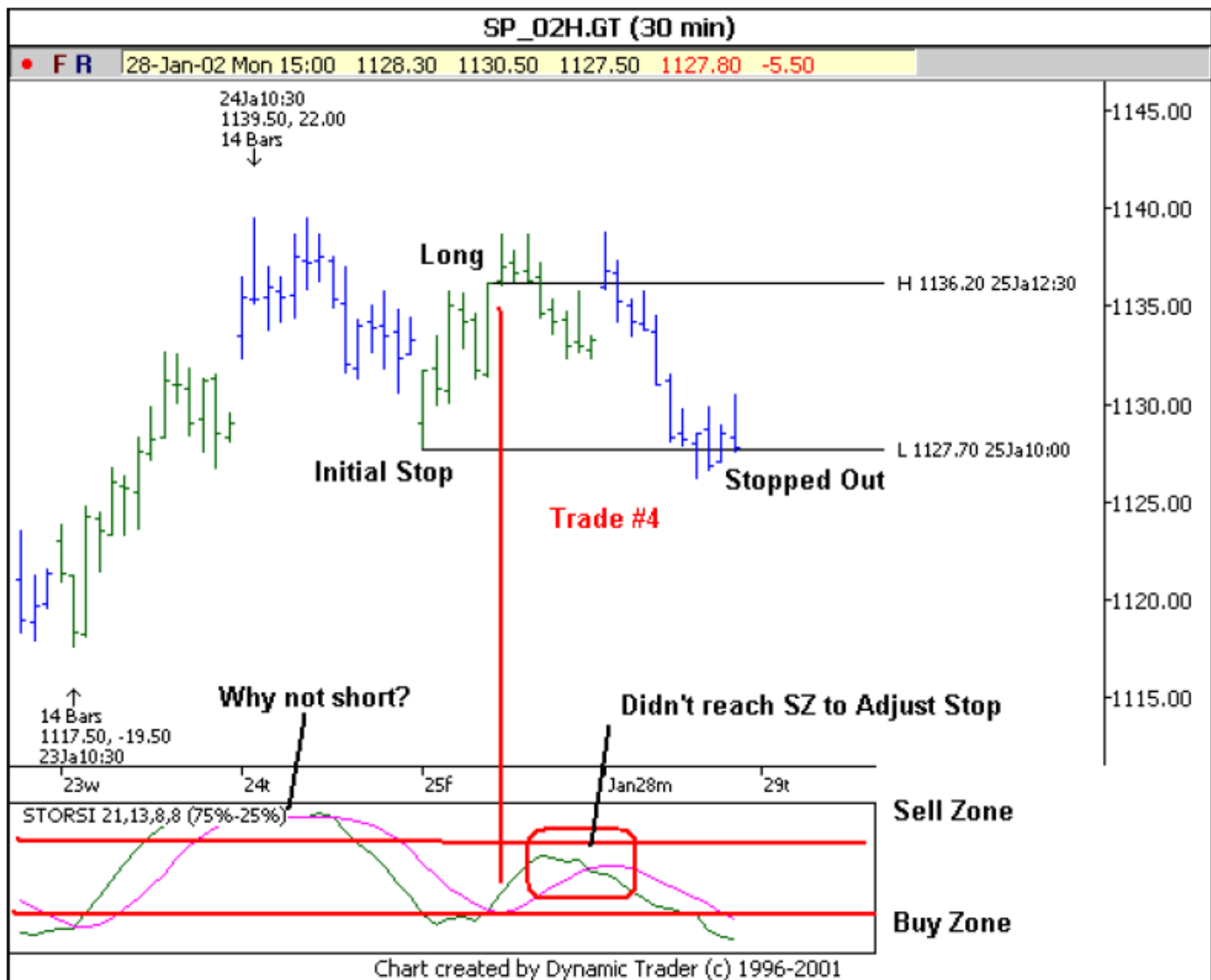
47

48

49







اکنون میدانیم که چطور باید از اندیکاتور در استراتژی خود استفاده کنیم. حالا شما همه مبانی را میدانید.

حال سعی کنید با پیگیری گزارشات ریل تایم در ادامه روند آموزشی خود یاد بگیرید که

1- چطور از اندیکاتور جهت تایید پوزیشنهای خود استفاده کنید.

2- چگونه بین تایم فریمها جابجا شوید

3- چطور تنظیمات اندیکاتور را متناسب با تایم فریم انجام دهید.

دوستان مطالب ارائه شده در بالا ترجمه ای بود از یکی از PDF های ماینر (که حدوداً 80 صفحه است). کمی و کاستی رو به بزرگی خودتون ببخشید.

اگر مطالب بالا برای شما الیوت کاران عزیز مفید بود لطفاً آگه زحمتی نیست یک فاتحه بخونید و نثار مادر بزرگ مرحوم بنده کنید. شاد و مسرور باشید.

پایان