

جزوه تکمیلی آنالیز تکنیکال

ترجمه: حامد بهاری

Email: Dr.H.Bahari@Gmail.com



abcBourse.ir



@abcBourse_ir



باز نشر:

با تشکر از:

سروران گرامی آقایان: غلامحسین جمیلی

وهاب قهرمانی

مهرداد فراهانی

رضا حسینی

فرزاد سروقدی

WWW.FXPARS.COM



abcBourse.ir



@abcBourse_ir

مرجع آموزش بورس



باز نشر:

۶	تکنیک موج الیوت
۶	الگوهای حرکت
۱۰	اندیکاتور برای شمارش موج الیوت
۱۲	نوسان نمای الیوت: کاربرد مرحله به مرحله
۱۷	حداقل بازگشت مورد نیاز
۱۸	حداکثر بازگشت مجاز
۱۹	استفاده از نوسان نمای الیوت در موج سوم
۲۰	استفاده از نوسان نمای الیوت در موج چهارم
۲۱	استفاده از نوسان نمای الیوت در موج پنجم
۲۱	نوارهای قطع کننده (Breakout) نوسان نما
۲۳	PTI (اندکس حد سود)
۲۵	اضافه کردن کانال های موج چهارم
۲۶	PTI و کانال های موج چهارم
۲۷	اضافه کردن میانگین متحرک جابه جا شده
۲۸	راهنما و قوانین موج الیوت
۲۹	اصلاح های موج الیوت
۳۳	قوانین فرعی
۳۳	نسبت ها و اندازه گیری موج
۳۵	نسبت های موج سوم
۳۵	نسبت های موج چهارم
۳۶	نسبت های موج پنجم
۳۷	کانال های الیوت برای شناسایی Top موج ۵
۳۸	آنالیز آماری نسبت های موج دوم
۳۸	آنالیز آماری نسبت های موج سوم
۳۹	آنالیز آماری نسبت های موج چهارم
۴۱	نسبت های فیبوناچی /الیوت
۴۱	نسبت های فیبوناچی الیوت برای موج ۵

۴۳	قواعد: ترید نوع ۱
۴۵	قواعد: ترید نوع ۲
۴۶	مثال‌های تریدهای نوع یک و دو
۴۶	بررسی Buy نوع اول
۴۷	Buy نوع دوم
۴۸	بررسی سل نوع دوم
۴۹	پیش‌بینی عدم تشکیل موج ۵ام یا تشکیل سقف دوقلو
۴۹	بررسی عدم تشکیل موج ۵
۶۴	قدرت نمودارهای ۱ ساعته
۷۹	ارجاع به اطلاعات هفتگی
۸۳	آلترناتیوهای آنالیزور موج الیوت
۸۳	شمارش منطقه‌ای موج الیوت
۸۴	شمارش آلترناتیو
۸۴	آلترناتیو ۳ (بلند مدت)
۸۶	آلترناتیو ۲ (کوتاه مدت)
۸۷	آلترناتیو ۱ (تهاجمی)
۹۱	تکنیک‌های گان
۹۲	خطوط و زوایای گان
۹۶	استفاده از زوایای گان با امواج الیوت
۹۸	خطوط گان بهینه شده
۹۸	آنالیزور GANN BOX
۱۰۶	کانال‌های رگرسیون ترند
۱۰۸	T.J.'s Web سطوح
۱۱۱	نسبت‌های زمانی گسترش فیبوناچی
۱۱۶	خوشه‌های گسترش فیبوناچی قیمت
۱۱۸	خوشه‌های اصلاح فیبوناچی قیمت



۱۲۱	خطوط میانه اندروز
۱۲۴	خطوط موازی گسترش یافته
۱۲۷	ترکیب خطوط میانه با موج ۳
۱۳۰	کانال‌های رگرسیون ترند اتوماتیک
۱۳۴	اکسپرت مشخص کننده ترند (XTL)
۱۳۸	طراحی برای استفاده از XTL
۱۳۸	تنظیمات XTL
۱۴۲	حد سود
۱۴۳	ادامه ترید (ماندن در ترید)
۱۴۴	راهنما جهت ادامه ترند:
۱۴۵	استفاده از تنظیمات متفاوت برای XTL
۱۴۹	مطالعه MOB (شکست یا برگشت)
۱۶۰	حرکت برگشتی (Bias Reversal)
۱۶۲	Elliot Wave Trigger
۱۶۴	T.J.'s Ellipse
۱۶۷	مسیر بیضی (سایه)
۱۷۱	اندکسی جوزف ترند (JTI)
۱۷۶	چگونگی استفاده از JTI
۱۷۷	چرخه‌ها
۱۸۰	Trade Profile

تکنیک موج الیوت

نگرش عملی- در ترکیب با GET

موج الیوت ترکیبی از تکنیک‌های مختلف است. نزدیک به ۶۰ درصد از این تکنیک‌ها ساده و روشن هستند و فقط ۴۰ درصد از آن‌ها بخصوص برای افراد مبتدی مشکل می‌باشند.

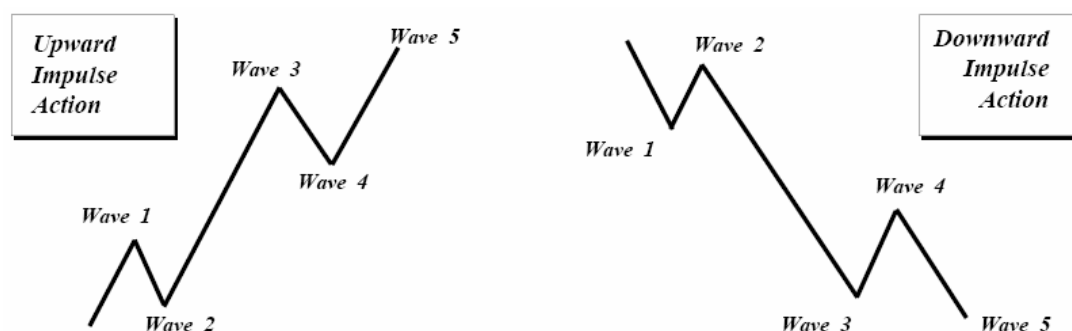
زمانی که آنالیز روشن و واضح نمی‌باشد چرا نباید بدنبال بازار دیگری باشیم که با الگوی موج الیوت تطابق داشته و ساده‌تر می‌باشد.

برای مدت‌های زیاد این مساله وجود داشت و من بدنبال این نگرش برای استفاده عملی از موج الیوت در تریدهایم بودم.

همه تئوری موج الیوت به دو بخش تقسیم‌بندی می‌شود که شامل الگوی حرکت (Impulse) و الگوی اصلاح (Corrective) می‌باشد. در این مبحث ما در مورد موج حرکت بحث می‌کنیم و چگونگی شناسایی موج فوق را بوسیله نوسان نمای الیوت (Elliot Oscillator) توضیح می‌دهیم.

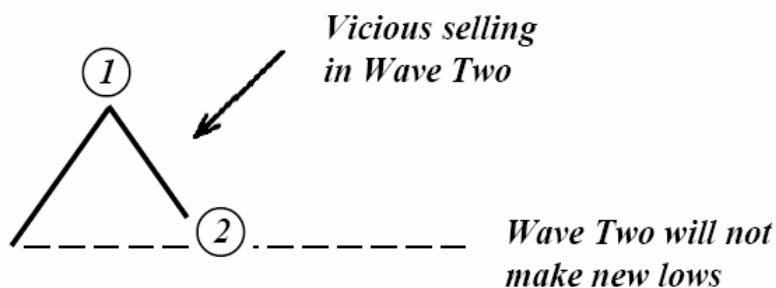
الگوهای حرکت

الگوی حرکت از ۵ موج تشکیل شده است. این ۵ موج می‌تواند دارای حرکت صعودی یا نزولی باشند. تعدادی مثال در زیر نشان داده شده است.

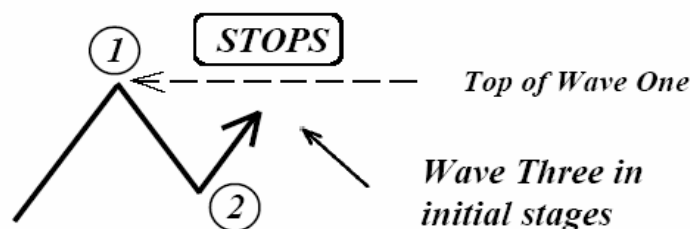


موج اول دارای رالی ضعیفی بوده و درصد کمی از تریدرها در این موج دست به ترید می‌زنند. بعد از اتمام موج اول، موج دوم آغاز می‌شود که Sell در یک ۵ موج صعودی کار

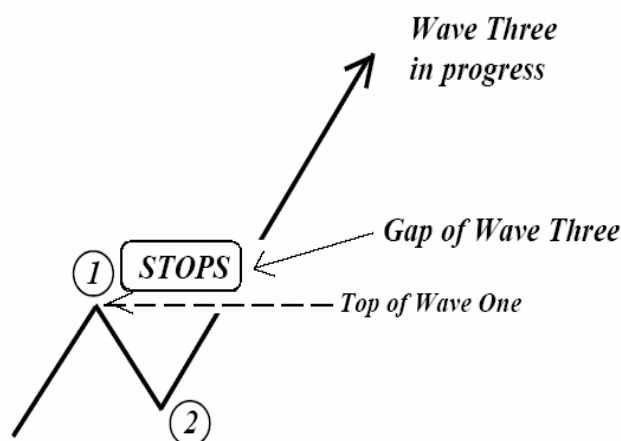
خطرناکی می باشد. موج دوم بدون آن که قیمت Low جدیدی بسازد، به اتمام می رسد و بازار از حول و حوش همان نقطه آماده رالی دیگری می شود.



مراحل اولیه موج ۳ آهسته بوده و در نهایت به نقطه Top رالی موج قبلی می رسد (بالاترین قسمت موج ۱). در این زمان Stop های زیادی بالای این قسمت وجود دارد.

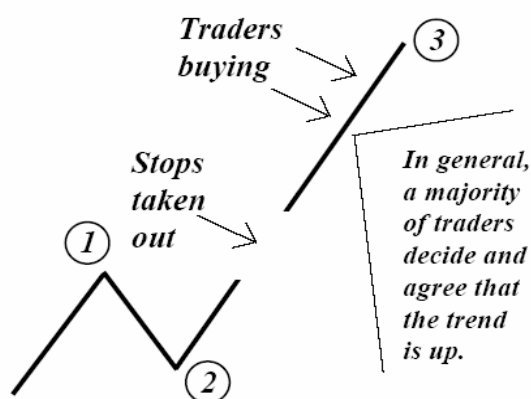


تریدرها از ادامه این رالی مطمئن نبوده و آن را کوتاه مدت در نظر می گیرند. برای اینکه این آنالیز صحیح باشد بازار نباید از بالای موج قبلی بالاتر برود. بنابراین بالای موج ۱ Stop های زیادی وجود خواهد داشت. رالی موج ۳ Top موج اول را رد می کند. در این زمان بازار از Top موج اول رد شده و Stop های زیادی عمل خواهد کرد. براساس میزان Stop ها گپ ایجاد خواهد شد. گپ علامت خوبی دال بر در جریان بودن موج سوم است.



اتفاقات زیر بدنبال هم رخ خواهد داد: تریدرهایی که زودتر و در پایین تر Buy کرده بودند خوشحال خواهند بود. آن‌ها ممکن است تصمیم بگیرند که پوزیشن‌های خود را افزایش دهند.

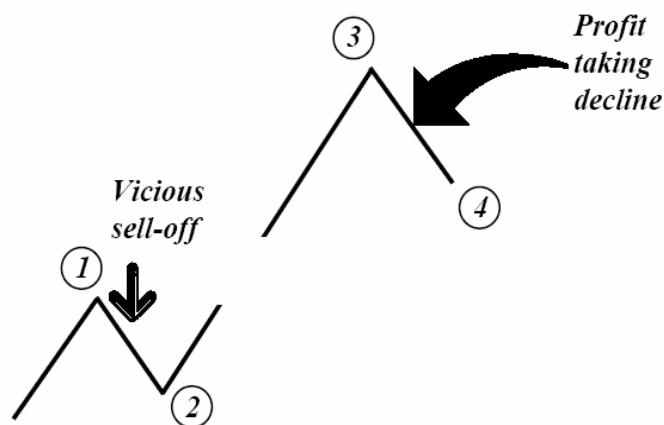
تریدرهایی که Stop آن‌ها عمل کرده است متقاعد می‌شوند که ترند صعودی بوده و تصمیم به انجام Buy در رالی صعودی می‌گیرند. تمام این اتفاقات جالب در رالی موج سوم رخ می‌دهد.



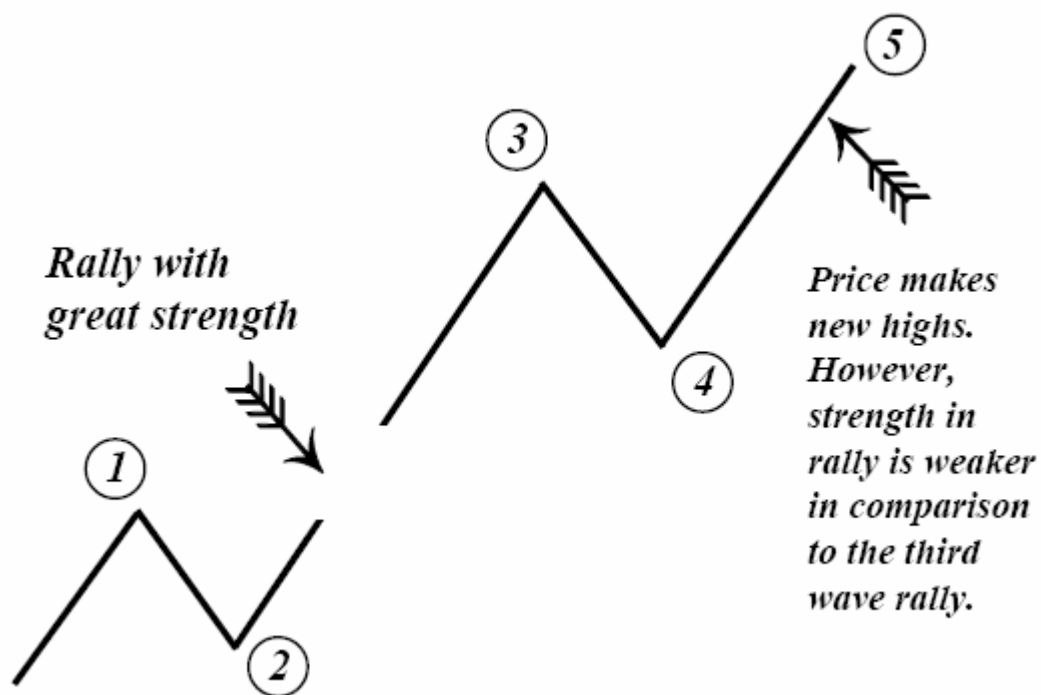
این زمان، زمانی است که اکثر تریدرها معتقدند که ترند بازار صعودی می‌باشد. در نهایت نیز همه التهاب‌های ناشی از Buy خاموش خواهند شد و موج سوم متوقف می‌شود. در این زمان تریدرهایی که به طولانی بودن حرکت صعودی اعتقاد داشتند تصمیم به حصول سود خود می‌گیرند. آن‌ها ترید خوبی داشته‌اند و تصمیم می‌گیرند که سود خود را دریافت کنند.

به این دلیل قیمت افت می‌کند و موج ۴ ساخته می‌شود. موج ۲ محل Sell های خطرناک و موج ۴ محل عمل کردن Take Profit می‌باشد.

زمانی که Take Profit فوق عمل می‌کند عده زیادی از تریدرها معتقدند که روند صعودی همچنان ادامه دارد. این افراد یا دیر وارد بازار شده‌اند یا در قسمت Side وارد بازار شده‌اند. این افراد باور دارند که این Take Profit فرصت عالی برای Buy فراهم آورده است. در پایان موج چهارم بیشتر Buy ها قرار داده شده و بازار شروع به حرکت می‌کند.

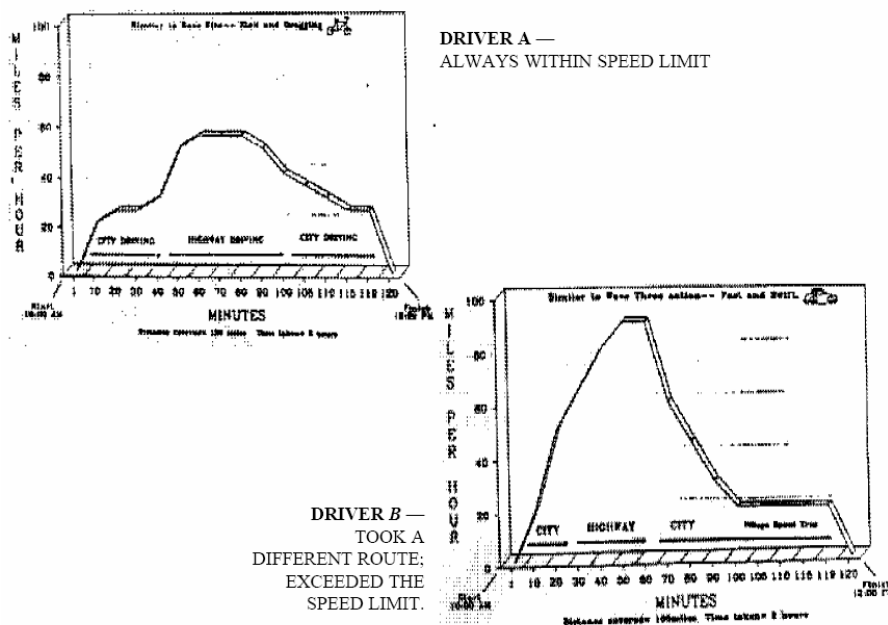


موج ۵ در مقایسه با موج ۳ از قدرت و تدام لازم برخوردار نیست. توسعه موج ۵ به خاطر گروه کوچکی از تریدرها می باشد. زمانی که موج ۵ High بالاتری از موج ۳ می سازد برای توسعه یافتن از قدرت و تداوم لازم در مقایسه با موج ۳ برخوردار نیست. در نهایت زمانی که این آخرین Buyها نیز خاتمه یافت نقاط پایانی بازار خاتمه یافته و وارد فاز جدیدی می شویم.



اندیکاتوری برای شمارش موج الیوت

مثال‌هایی که از ۵ موج حرکت در صفحات قبلی نشان داده شدند بسیار روشن و قطعی بودند. به هر حال بازار همیشه ساده نبوده است. در بعضی مواقع فقط به تنهایی با نگاه کردن به نمودار قیمت تقریباً غیر ممکن است که موج ۳ و ۵ را از هم تشخیص داد. نمودار قیمت‌ها قادر نیست که قدرت‌های متفاوت موج‌ها را نشان دهد. ابزارهایی که در ادامه توضیح داده می‌شوند جهت بحث در این زمینه استفاده می‌شوند. دو راننده را در نظر بگیرید که در یک زمان از یک نقطه ولی با دو وسیله نقلیه متفاوت شروع به حرکت می‌کنند. راننده A با سرعت ثابتی تمام مسیر را طی می‌کند در حالی که راننده B با سرعت بیشتری طی مسیر می‌کند.



به هر حال دو راننده استراتژی متفاوتی را جهت رسیدن به مقصد خود استفاده می‌کنند. در حالی که راننده A با سرعت معمولی حرکت می‌کند راننده B با سرعت متغییری مانند bat-out-of-Hades مسیر قادر نخواهد بود که بین الگوی رانندگی دو راننده تفاوت را تشخیص دهد. برای یک بیننده بی‌توجه هر دو راننده در یک زمان حرکت کرده‌اند و در زمان برابری به یک نقطه رسیده‌اند. این مساله مشابه مشکل ما، زمانی که سعی می‌کنیم موج ۳ را از ۵ افتراق دهیم می‌باشد. موج ۵ High جدیدی می‌سازد؛ یک تریدر به نمودار نگاه می‌کند و قادر نیست که موج ۳ را از ۵ افتراق دهد. به هر حال الگوی سازنده موج ۳ در مقایسه با موج ۵

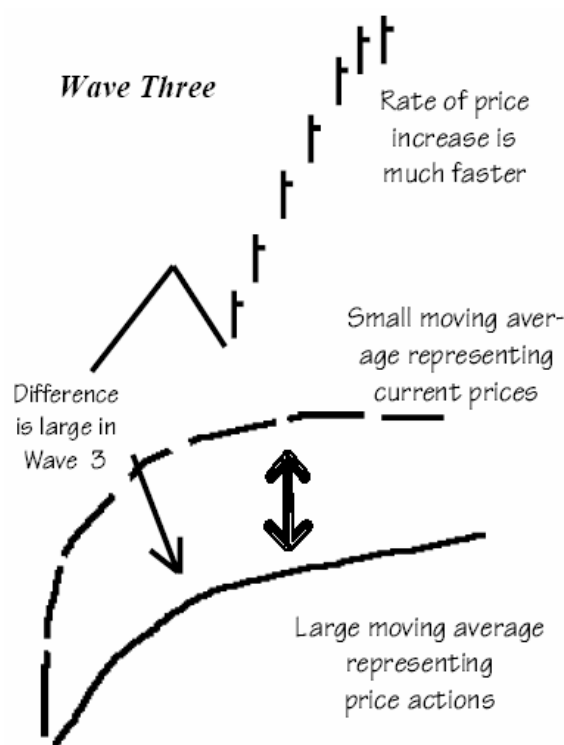
بسیار بزرگتر است. بنابراین ما نیازمند استفاده از یک اندیکاتور اندازه‌گیری قدرت موج سازنده می‌باشیم تا تفاوت را بیان کند.

جهت شناسایی امواج الیوت ما نیازمند اندیکاتوری هستیم که نسبت تغییرات قیمت را در یک موج در مقابل موج دیگر اندازه‌گیری کند. اندیکاتورهای رایج قادر به اجرای این مقایسه نیستند. آن‌ها صرفاً قیمت را در مقابل قیمت مقایسه می‌کنند و قادر به مقایسه نسبت تغییرات قیمت نیستند. بعد از سال‌ها تحقیق نوسان نمای الیوت بدست آمد. ایده نوسان نما در زیر شرح داده شده است.

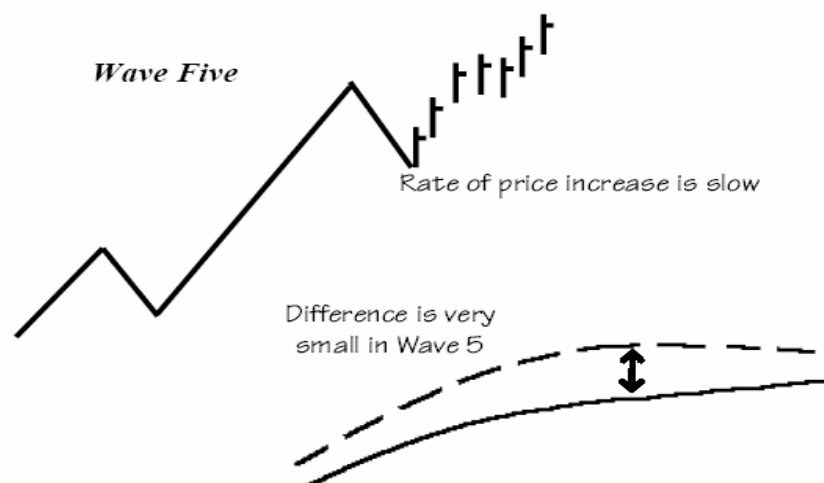
یک نوسان نمای الیوت به طور اولیه و پایه‌ای از تفاوت بین دو میانگین متحرک محاسبه می‌شود. اگر ما یک میانگین متحرک کوتاه مدت را با یک میانگین متحرک بلند مدت به کار ببریم تفاوت بین این دو، میزان افزایش در قیمت را نشان می‌دهد.

میانگین متحرک کوتاه مدت نشان دهنده تغییرات قیمت فعلی می‌باشد در حالی که میانگین متحرک بلند مدت تر نشان دهنده تغییرات کلی قیمت است.

زمانی که قیمت موج ۳ را می‌سازد قیمت جاری سریعتر حرکت می‌کند و تفاوت بین میانگین متحرک کوتاه مدت و بلند مدت زیاد می‌شود و یک میزان نوسان نمای بزرگ را ایجاد می‌کند.



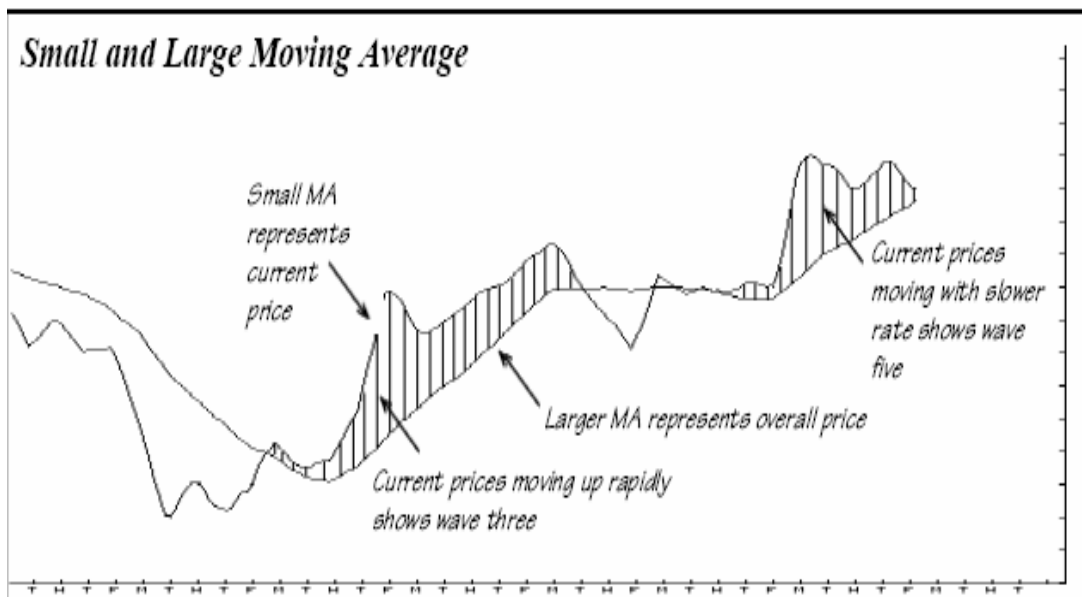
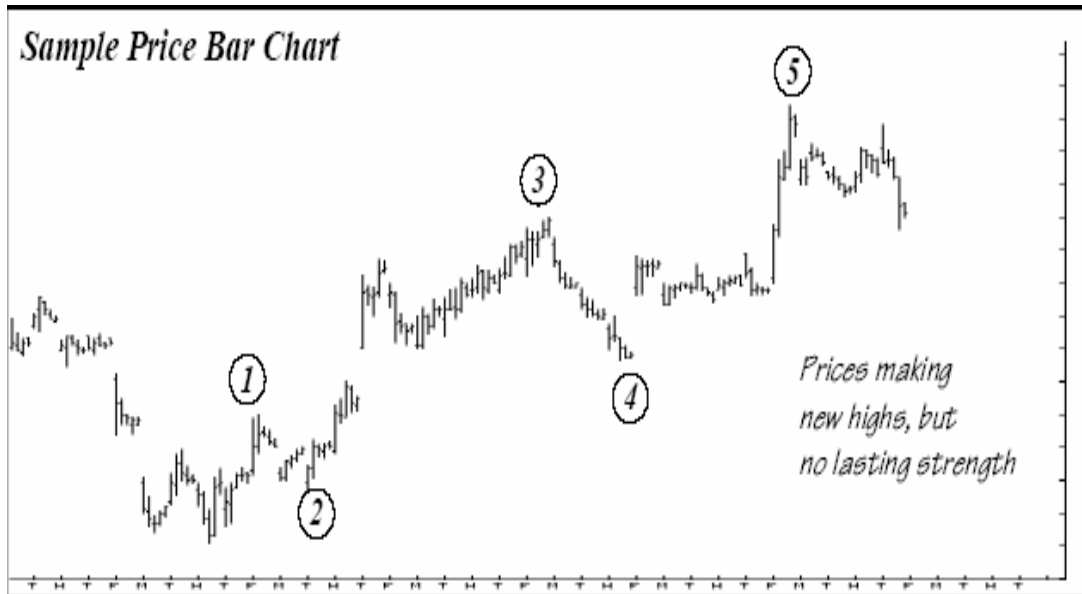
در موج ۵ قیمت جاری حرکتی به میزان سرعت قبلی دارد و بنابراین تفاوت بین میانگین متحرک کوتاه مدت و بلند مدت کم است. این موضوع میزان کوچکی از نوسان نما را ایجاد می‌کند.



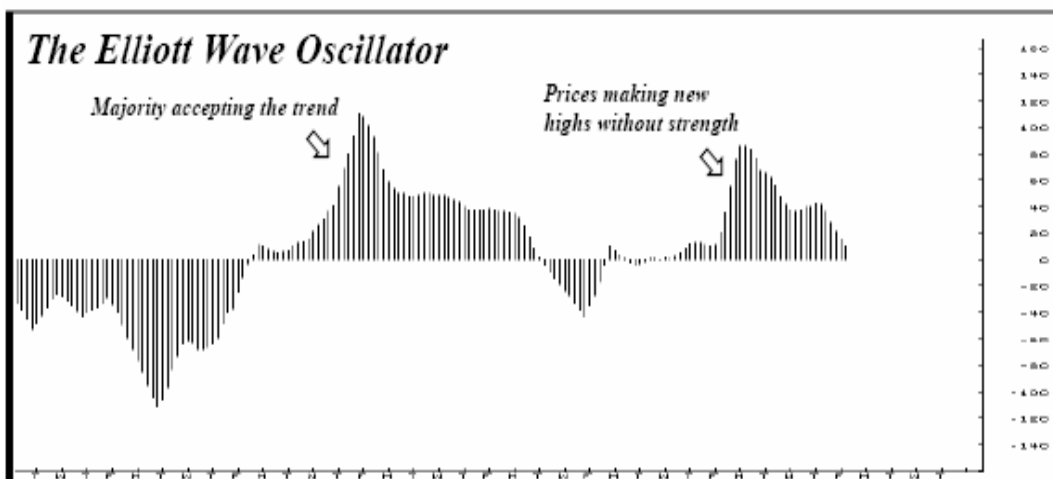
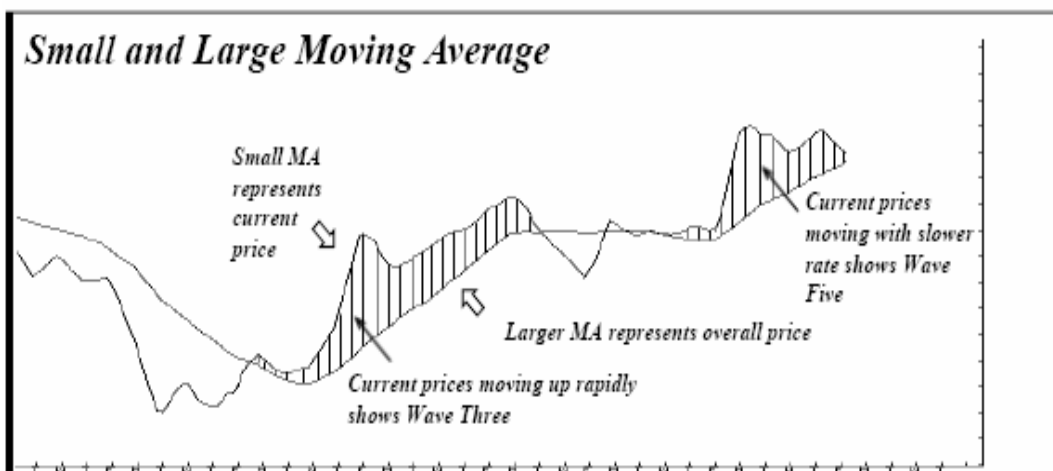
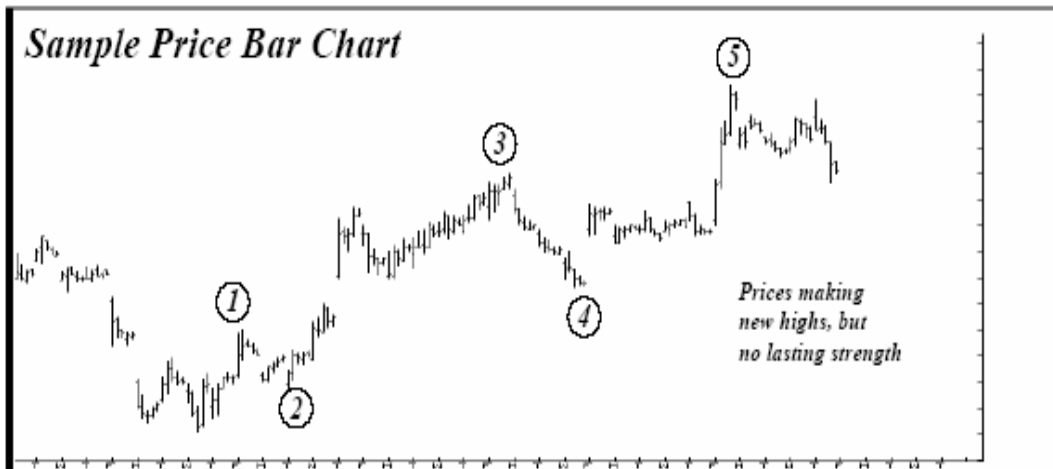
علت شناسی این مساله مشابه دو راننده می‌باشد. موج ۳ مانند راننده B می‌باشد که سرعتش افزایش می‌یابد و سرعت بالاتری دارد در حالی که موج ۵ آهسته بوده و آهسته شدن تغییرات قیمت را نشان می‌دهد.

نوسان نمای الیوت: کاربرد مرحله به مرحله

ما نمودار یکسانی را برای نشان دادن استفاده می‌کنیم. زمانی که قیمت به **Top** موج ۱ گسترش می‌یابد نوسان نمای الیوت **High** جدیدی ایجاد می‌کند. همچنین باید به **Gap**ها توجه کنید. این حرکت جدید موج ۳ نام گذاری می‌شود. در نهایت **Buy**ها در موج ۳ متوقف می‌شوند. تریدرها شروع به دریافت سود می‌کنند. در این زمان عموم مردم مشتاقانه منتظر یک منطقه جهت خرید در آن هستند. زمانی که نوسان نمای الیوت به سمت سطح صفر برمی‌گردد یا به آرامی به زیر آن می‌رود بازار به منطقه مورد نظر (**Neutral Area**) می‌رسد.

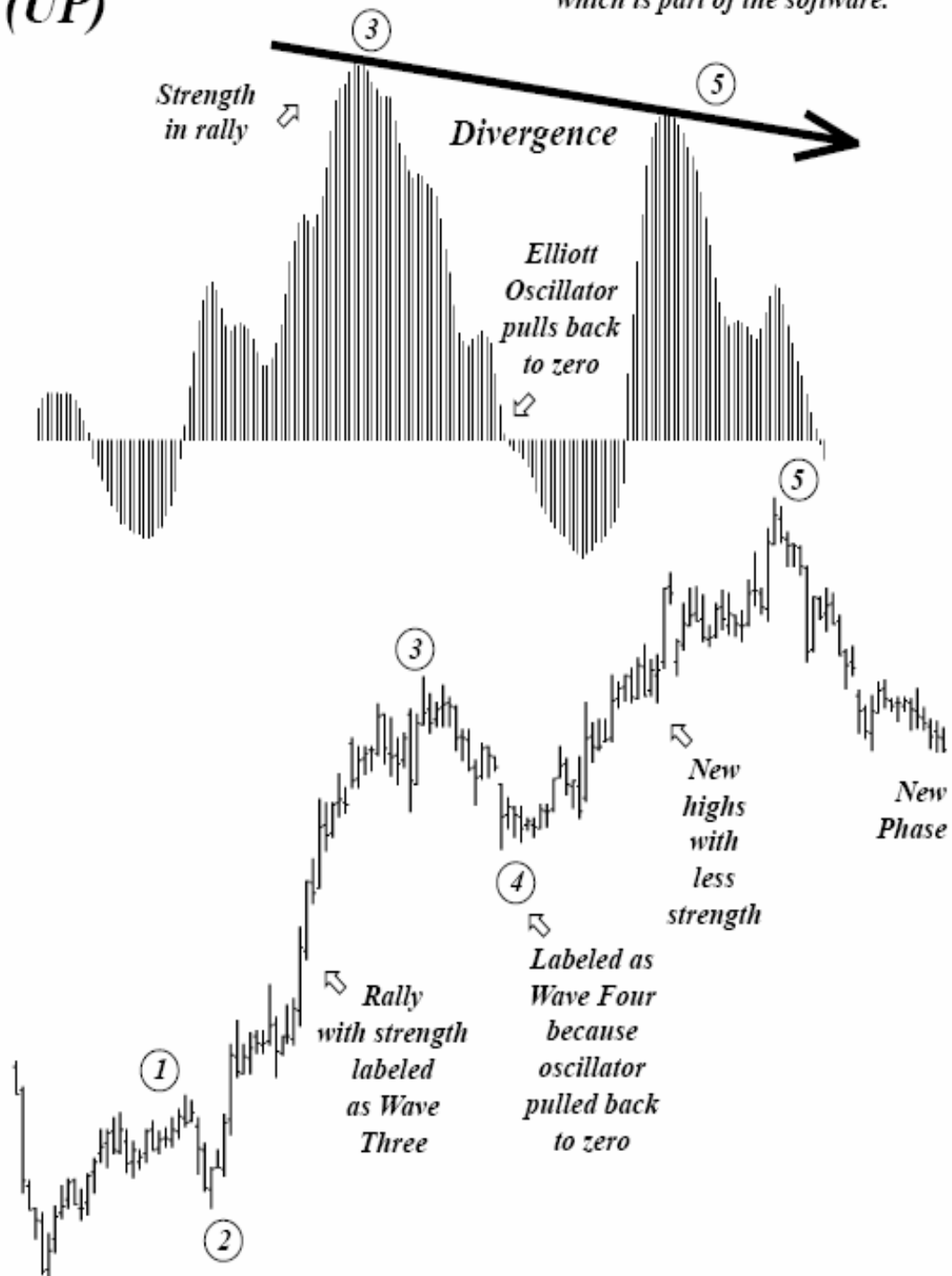


زمانی که موج ۴ پایان یافت، **Buy** توسط خریدرهایی انجام می شود که در رالی موج ۳ سهمیم نبوده اند. در این زمان قیمت **High** جدیدی می سازد. نسبت افزایش قیمت در این رالی به اندازه موج ۳ نیست. این تفاوت در میزان حرکت قیمت بوسیله نوسان نما نشان داده می شود و به راحتی مشخص می شود. نتیجه (MORAL OF THE STORY): همیشه اجازه دهیم نوسان نمای الیوت شمارش موج الیوت را همراهی کند.



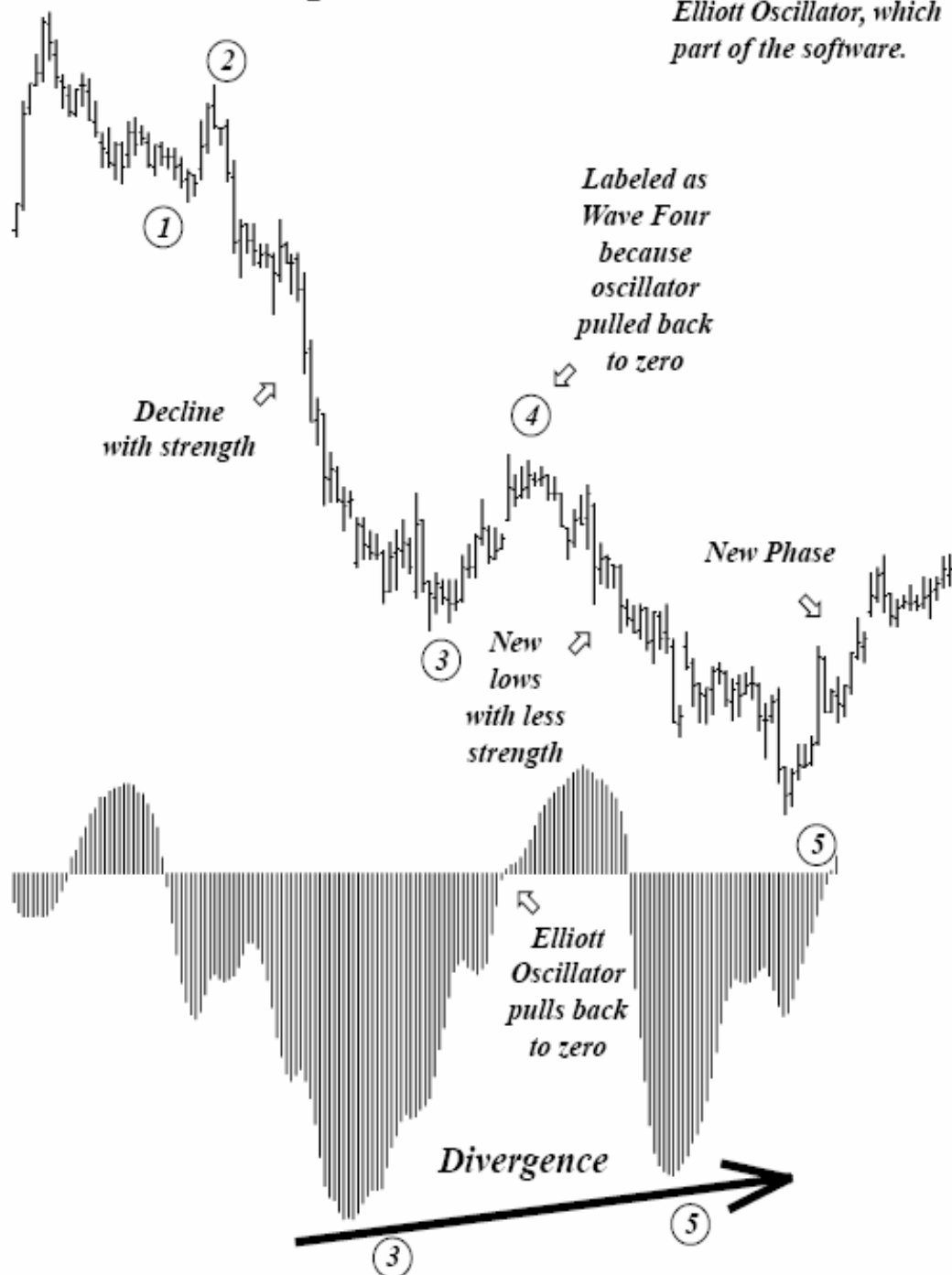
Five Wave Impulse (UP)

Identifying a five wave impulse (up) using the Elliott Oscillator, which is part of the software.



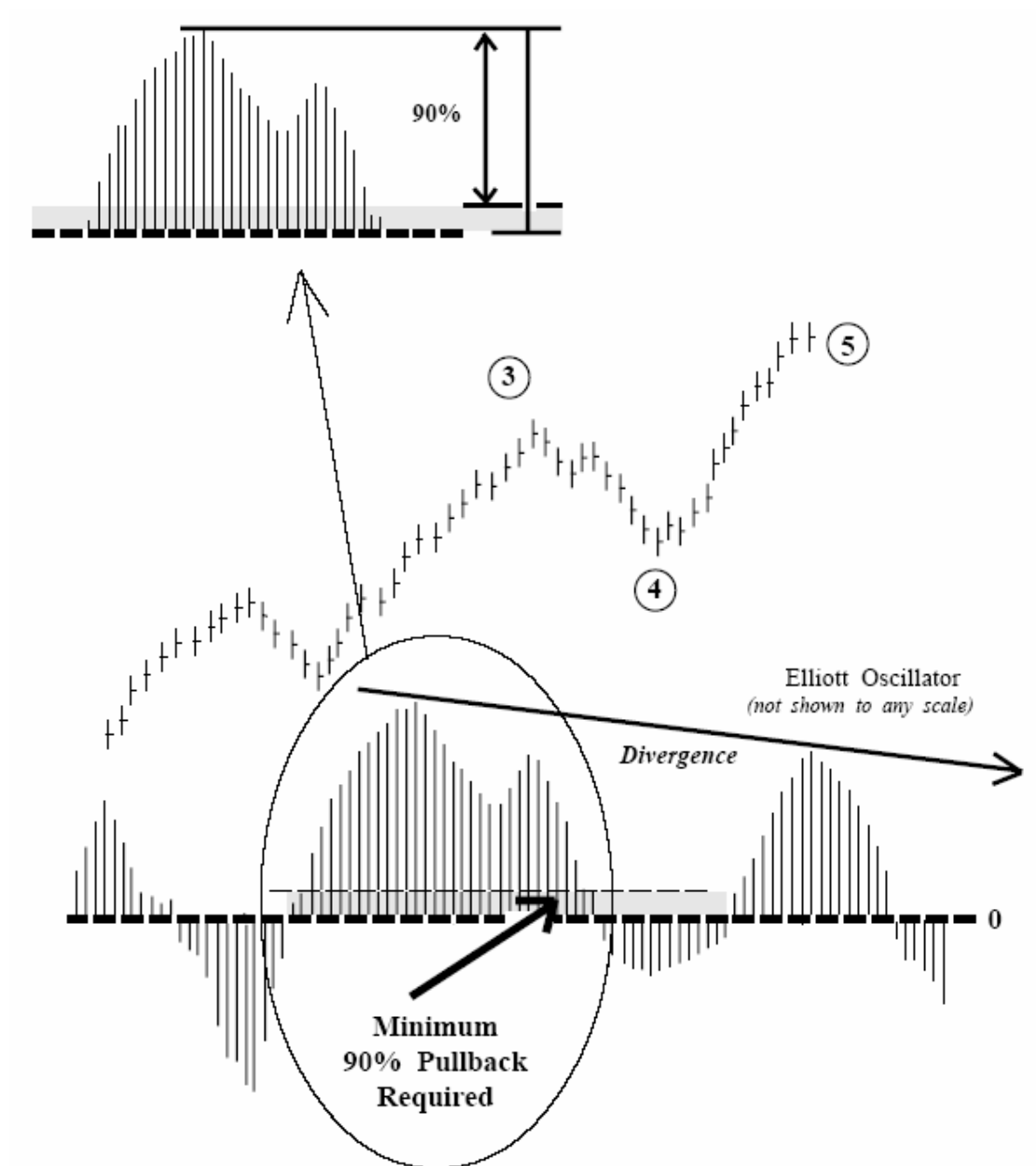
Five Wave Impulse (DOWN)

Identifying a five wave impulse (down) using the Elliott Oscillator, which is part of the software.



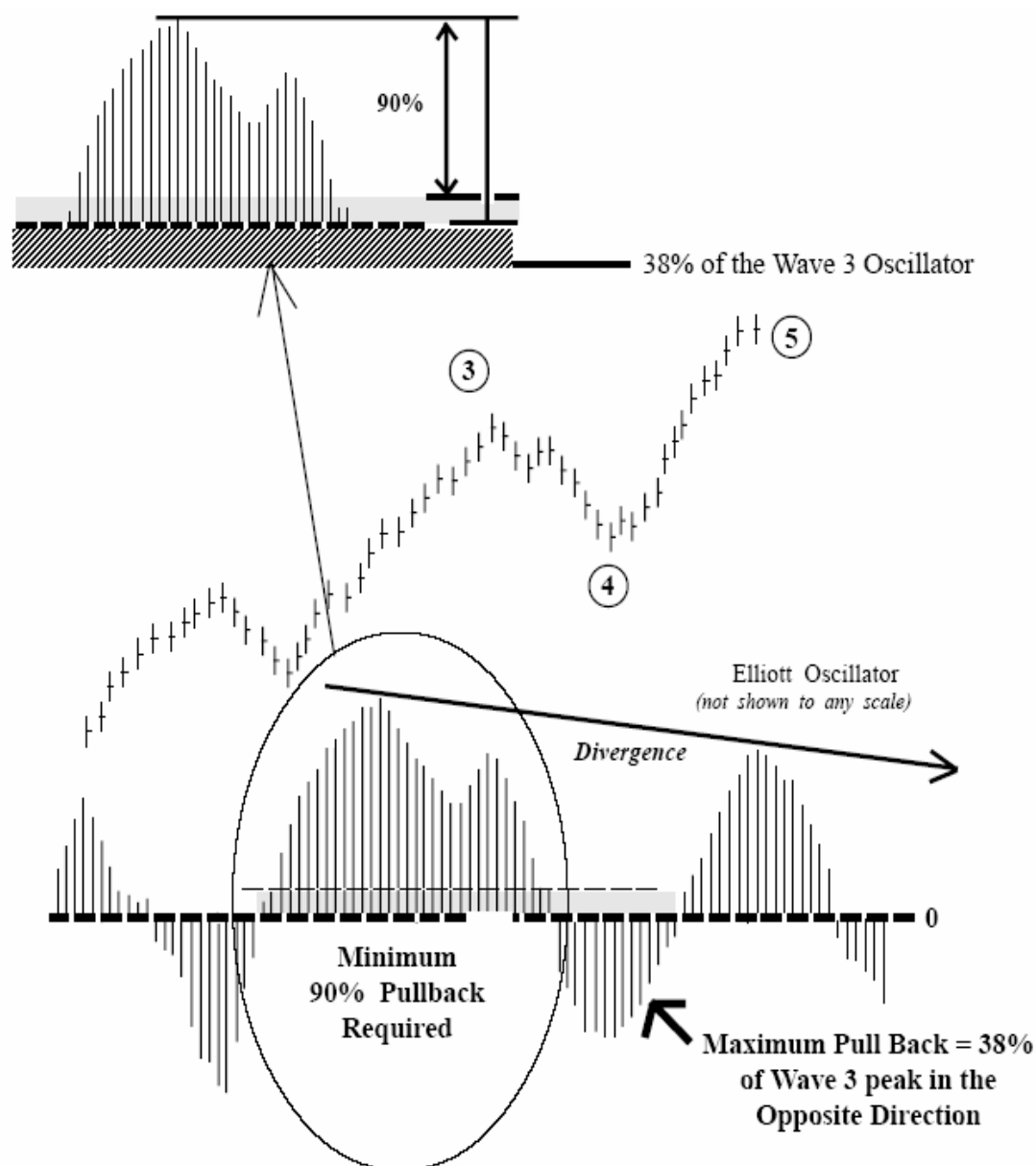
حداقل بازگشت مورد نیاز

اصولا ۹۴٪ همه موج‌های ۴ که به یک موج پنجم دارای High یا Low جدید ختم می‌شوند در آن‌ها نوسان نمای الیوت حداقل ۹۰٪ از موج سوم را بازگشت می‌کند.



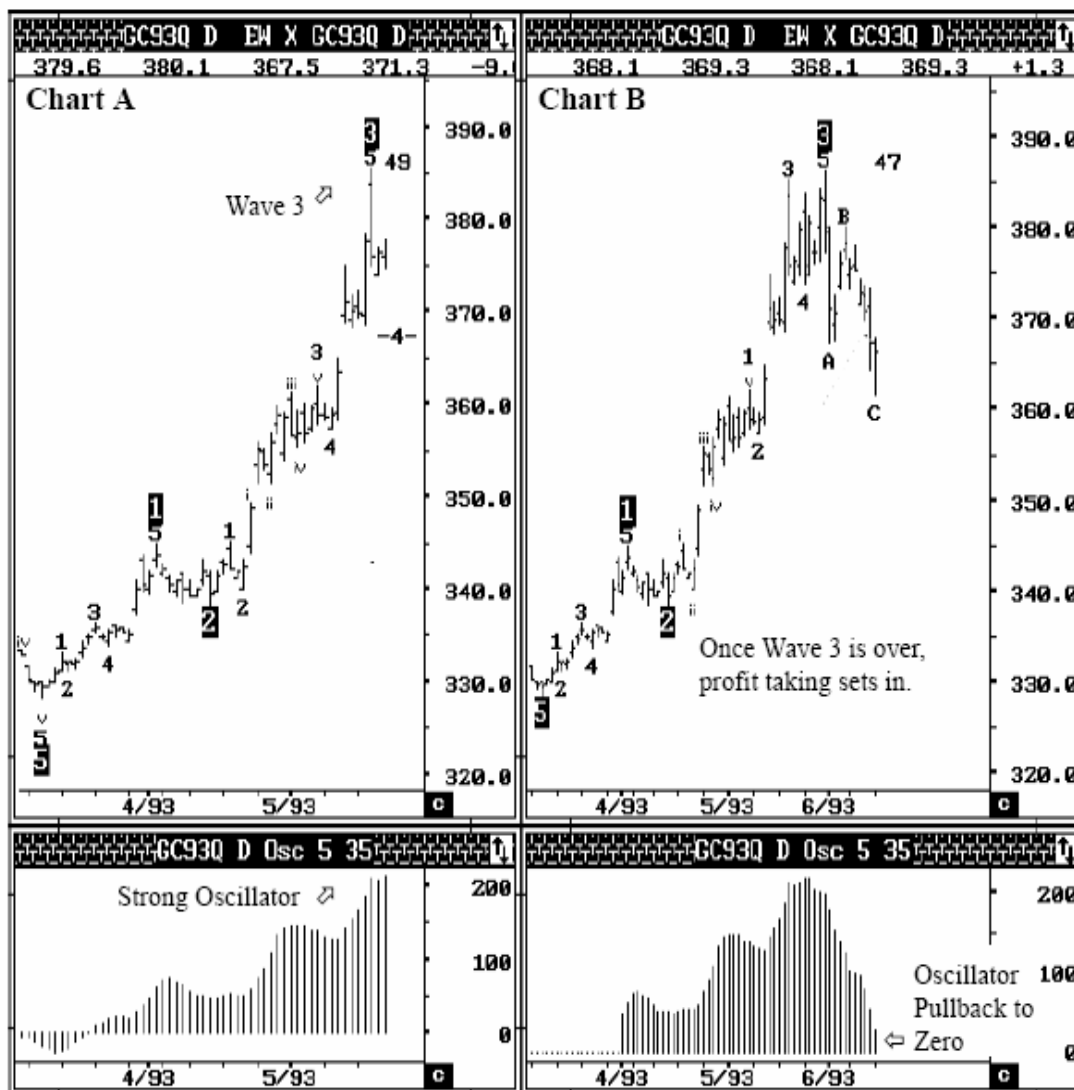
حداکثر بازگشت مجاز

همان طور که بازگشت نوسان نما به خط صفر مساله مهمی است (یا حداقل ۹۰٪ نوسان نماي موج ۳ که در صفحه قبلي توضیح داده شد) این مساله که نوسان نما نباید بیش از ۳۸٪ از نوسان نماي موج ۳ را از سمت دیگر خط صفر رد کند نیز مساله بسیار مهمی می باشد.



استفاده از نوسان نمای ایوت در موج سوم

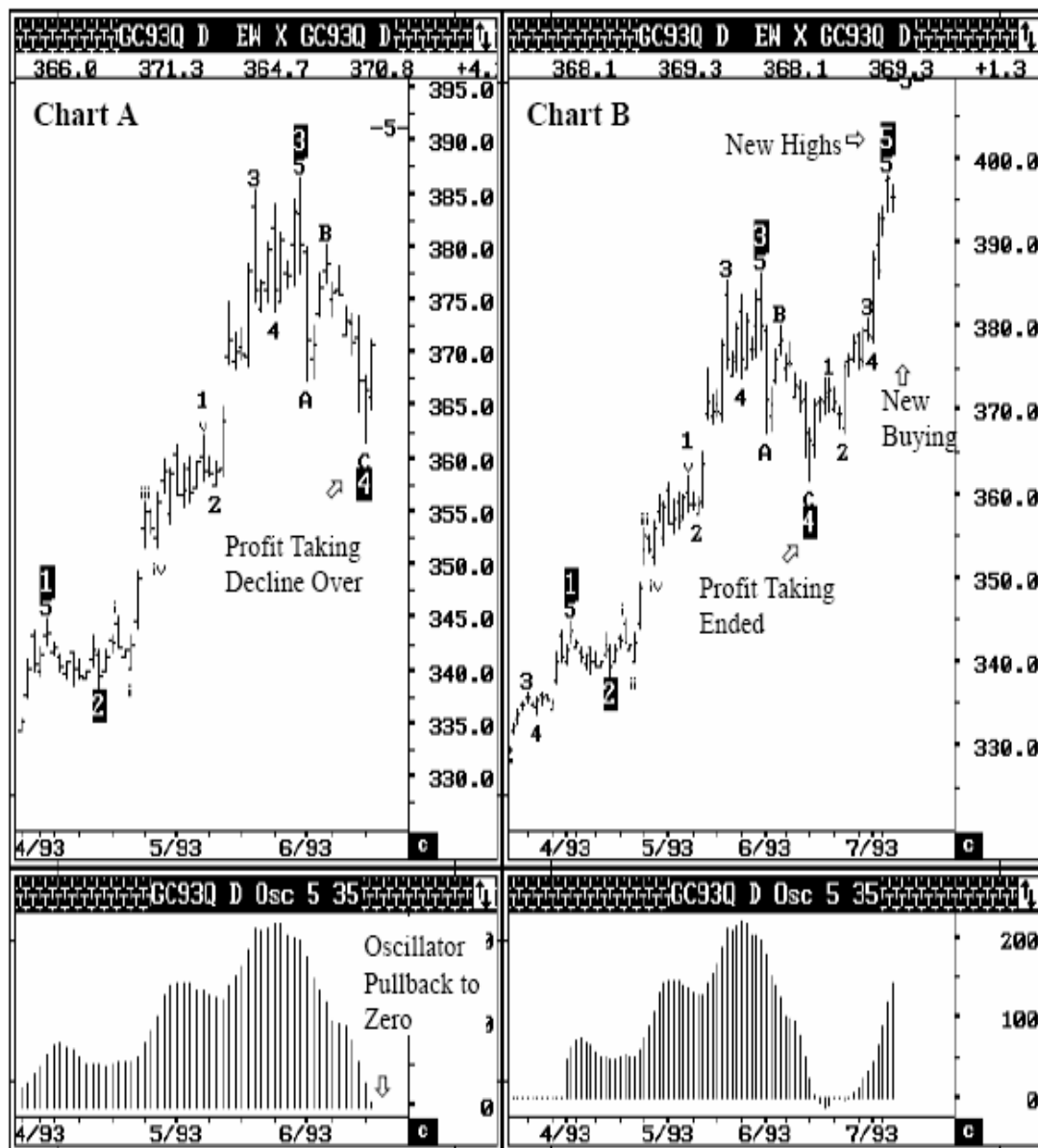
مانند نمودار A زمانی که بازار در یک رالی با نوسان نمای ایوت قوی همراهی شود این رالی تحت عنوان موج سوم نام گذاری می شود.



زمانی که موج سوم به پایان می رسد بازار جهت حصول سود نزول می کند. در این زمان نوسان نمای ایوت باید به سمت خط صفر برگردد (همان طور که در نمودار B نشان داده شده است).

استفاده از نوسان نمای ایوت در موج چهارم

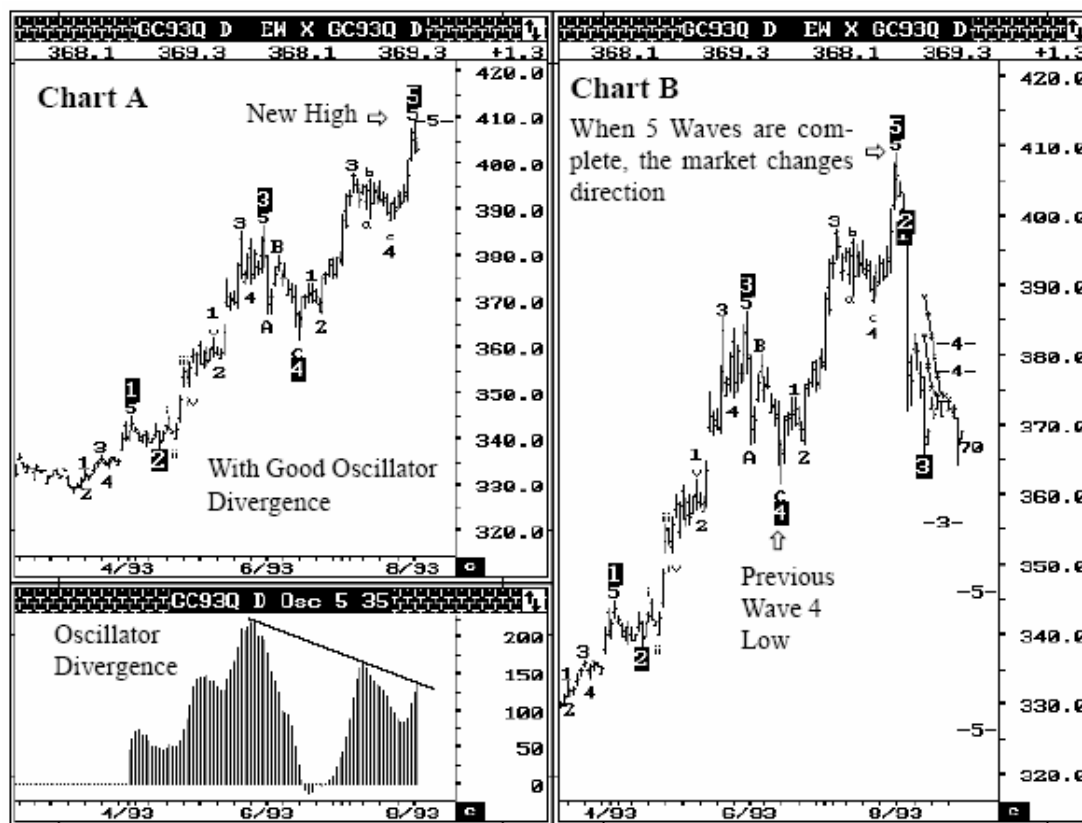
زمانی که نوسان نمای ایوت به سمت خط صفر برمی گردد این مساله علامتی است جهت پایان یافتن نیروی موج چهارم نزولی که در نمودار A نشان داده شده است.



Buyهای جدید شروع شده و بازار Highهای جدیدی ایجاد می کند (در نمودار B نشان داده شده است)

استفاده از نوسان نمای الیوت در موج پنجم

بازار High جدیدی می‌سازد که قدرت نوسان نمای کمتری دارد و در نمودار A نشان داده شده است.



این مساله نشان می‌دهد که رالی فعلی یک موج ۵ می‌باشد و زمانی که موج ۵ به اتمام برسد بازار جهت خود را تغییر خواهد داد.

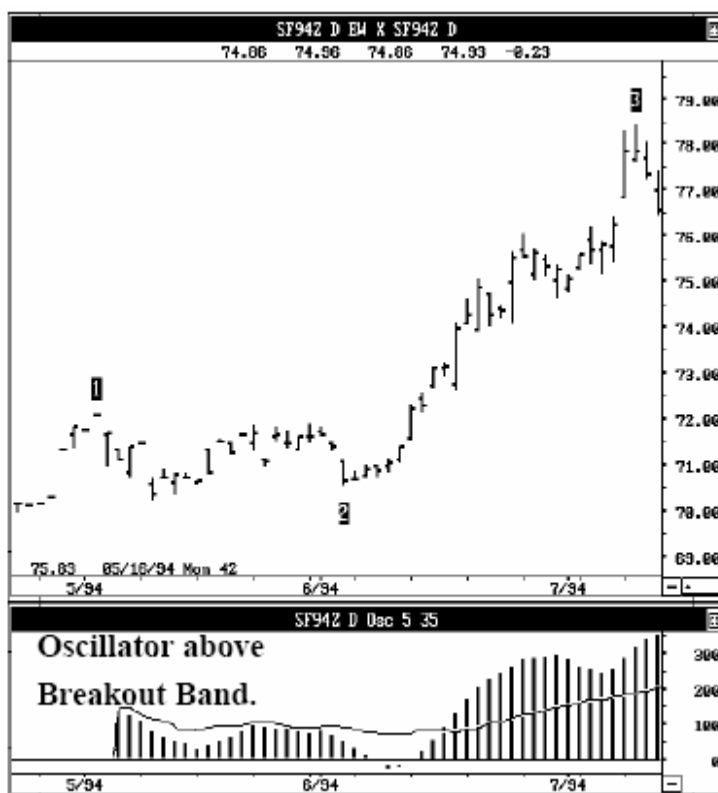
زمانی که بازار بعد از اتمام ۵ موج جهت خود را عوض کند موج چهارم قبلی اولین هدف خواهد بود. در نمودار B بازار مسیر خود را تغییر داده و در تلاش است تا به موج ۴ قبلی که نزدیک ۳۶۳۰ است برسد.

نوارهای قطع کننده (Breakout) نوسان نما

یک پرسش مهم در مورد بکارگیری آنالیزور موج الیوت شناسایی ترکیب موج ۳ با یک نوسان نمای قوی می‌باشد. ما در گذشته این کار را با مشاهده اندازه نوسان نمای قیمت با آن چه که در گذشته بوده است انجام می‌دادیم. این نوسان نما یک نوار بالایی و یک نوار

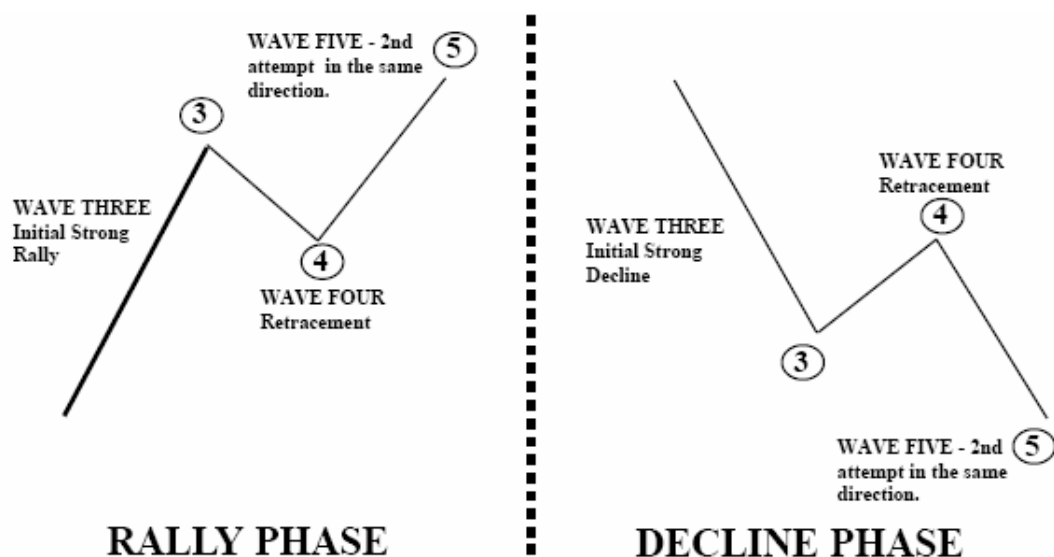
پایینی دارد. هر زمان که نرم افزار موج ۳ را نام گذاری کرد لازم است که نوسان نما نیز به بالای نوارهای فوق برود. پیشنهادات ما معمولا ۸۰٪ موارد براساس این نوارها می باشد. نموداری که در پایین قرار داده شده است نمودار روزانه فرانک سوئیس از دسامبر ۹۴ می باشد. در اینجا زمانی که نرم افزار موج ۳ را نامگذاری کرده است این رالی با یک نوسان نمای قوی ترکیب شده است به طوری که باندها را به سمت بالا قطع کرده است.

بنابراین شمارش این موج در این زمان و در این بازار صحیح است. مثال دیگر نیز در زیر نمایش داده شده است. زمانی که نوسان نما بالای نوار بوده و با یک آنالیزور موج الیوت نیز تایید شده است.

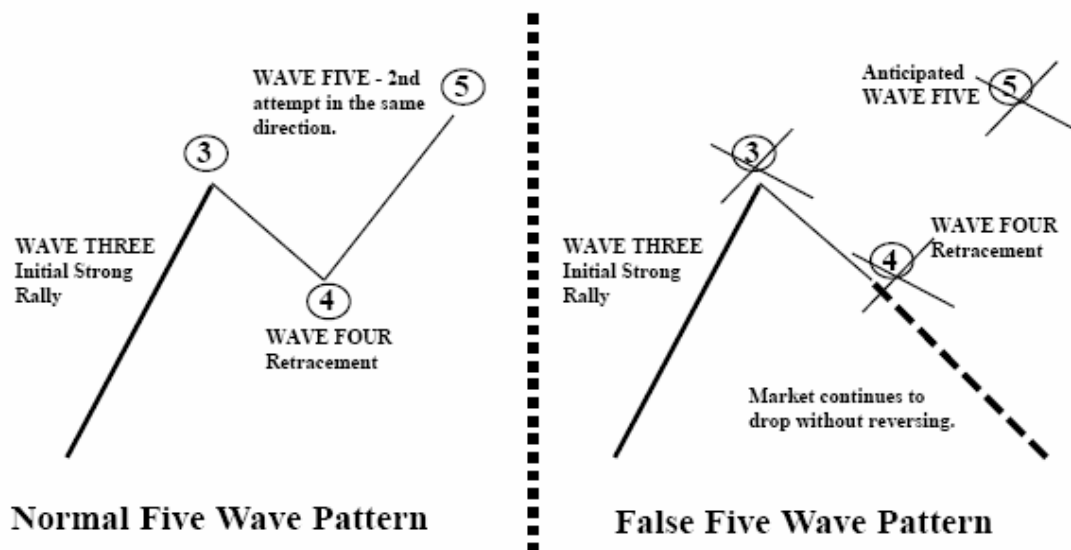


PTI (اندکس حد سود)

با استفاده از آنالیزور موج الیوت بسیاری از رالی‌ها و نزول‌ها تحت عنوان موج ۳ طبقه‌بندی خواهند شد. زمانی که موج ۳ ایجاد می‌شود براساس تئوری موج الیوت باید بدنال موج ۴ اصلاحی (Retracement) باشیم که بدنال آن حرکت دوم در مسیر ترند بازار ایجاد شود که این فاز موج ۵ نام دارد.

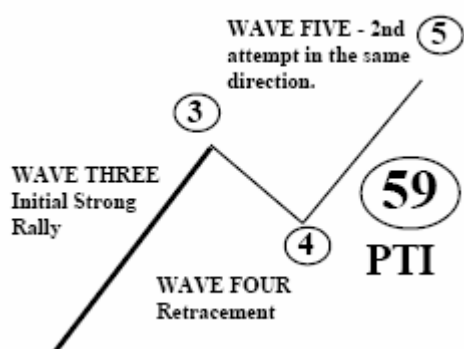


الگوهای بالا توالی ۵ موج را تکمیل کردند و از میزان مورد انتظار نیز فراتر رفته‌اند. به هر حال زمانی که الگوها در حال تکمیل‌اند تریدر با مساله مشکلی در پایان موج ۴ اصلاحی مواجه است که این مساله به این علت است که در موارد زیادی این حرکت دوم به وقوع نمی‌پیوندد.



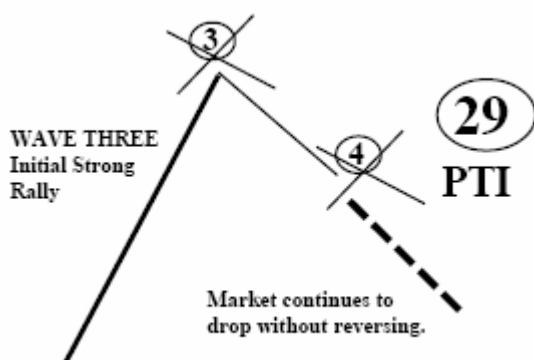
تحقیقات در این سال‌ها ادامه یافت و ما موفق به طراحی PTI (Profit Taking Index) شدیم. ابزار PTI مومنتوم Buyها و Sellهای موج ۳ را با موج ۴ مقایسه می‌کند. سپس این مقایسه به الگوریتمی داده می‌شود که عدد PTI را محاسبه می‌کند.

مثال ۱: الگوی ۵ موج صحیح



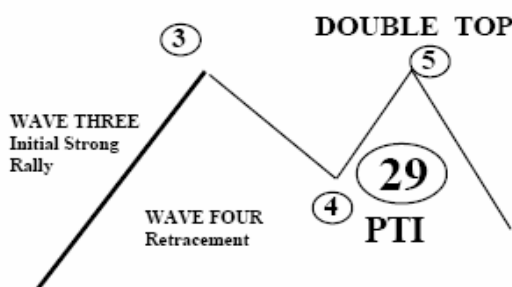
به طور آماری اگر PTI بالاتر از ۳۵ باشد بازار تمایل شدیدی دارد که موج ۵ یا دومین موج حرکت را بسازد.

مثال ۲: الگوی ۵ موج نادرست



به طور آماری اگر PTI کمتر از ۳۵ باشد بازار به طور معمول قادر نخواهد بود که موج ۵ یا دومین موج فاز حرکت را ایجاد کند.

مثال ۳: الگوی موج پنجم ناقص: سقف دوقلو



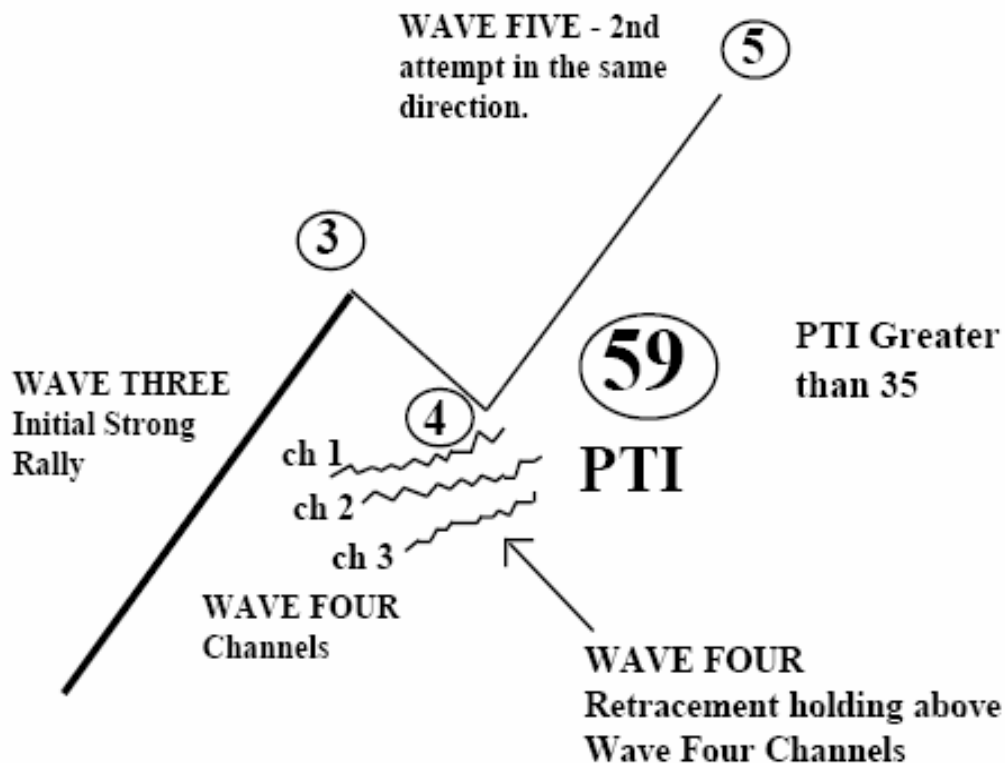
اگر PTI کمتر از ۳۵ بود و بازار در حال ساخت موج ۵ بود احتمال تشکیل سقف دوقلو بسیار زیاد است.

اضافه کردن کانال‌های موج چهارم

کانال‌های موج چهارم ویژگی دیگری است که همراه PTI می‌باشد. ابزار PTI اساساً از طریق مومنتوم بای‌ها و سل‌ها در مقاطع متفاوت بدست می‌آید. کانال‌های موج چهارم از طریق زمان بدست می‌آیند. بعد از یک رالی بزرگ فاز اصلاح (Retracement) اجازه می‌دهد که میزان مشخصی از زمان بگذرد تا دومین فاز حرکت (موج ۵) آغاز شود. مطالعات آماری نشان می‌دهد که اگر فاز اصلاح (Retracement) زمان زیادی را به طول انجامد دومین موج حرکت از اثرات اصلی‌اش کاسته می‌شود. کانال‌های موج چهارم سه خط براساس قیمت و زمان هستند.

اگر موج چهارم اصلاحی (Retracement) بالای کانال‌های موج چهارم باشد انتظار برای یک موج حرکت دوم قوی زیاد است.

اگر موج چهارم اصلاحی (Retracement) زیر کانال‌های موج چهارم باشند انتظار برای موج حرکت دوم قوی خیلی کم خواهد بود.



مفهوم کانال‌های موج چهارم:

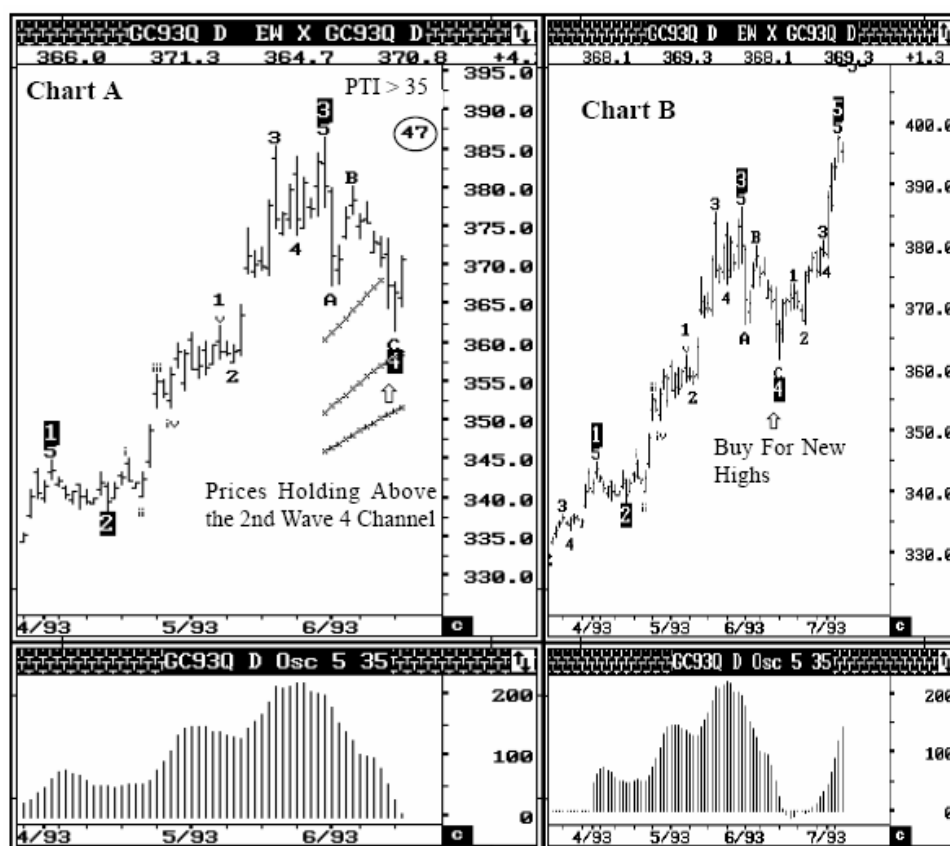
۱) اگر موج چهارم بالای کانال اول باشد (با رنگ آبی مشخص است) از نظر آماری بالای ۸۰٪ انتظار برای یک رالی موج ۵ قوی می‌باشد.

۲) اگر موج چهارم بالای کانال دوم باشد (با رنگ سبز مشخص است) از نظر آماری ۶۰٪ انتظار برای یک رالی موج ۵ قوی می‌باشد.

۳) کانال سوم نقطه توقف نهایی می‌باشد (با رنگ قرمز مشخص است). زیرا زمانی که این کانال شکسته شود انتظار برای ایجاد یک High جدید در موج ۵ بسیار پایین است. در موارد خیلی کم بعد از شکسته شدن کانال قرمز موج ۵ تشکیل می‌شود و رالی آن بسیار کسالت‌آور و کند بوده و روندی را شکل می‌دهد که بی‌اقرار صبر و حوصله را از بین برده و بی‌نتیجه است.

PTI و کانال‌های موج چهارم

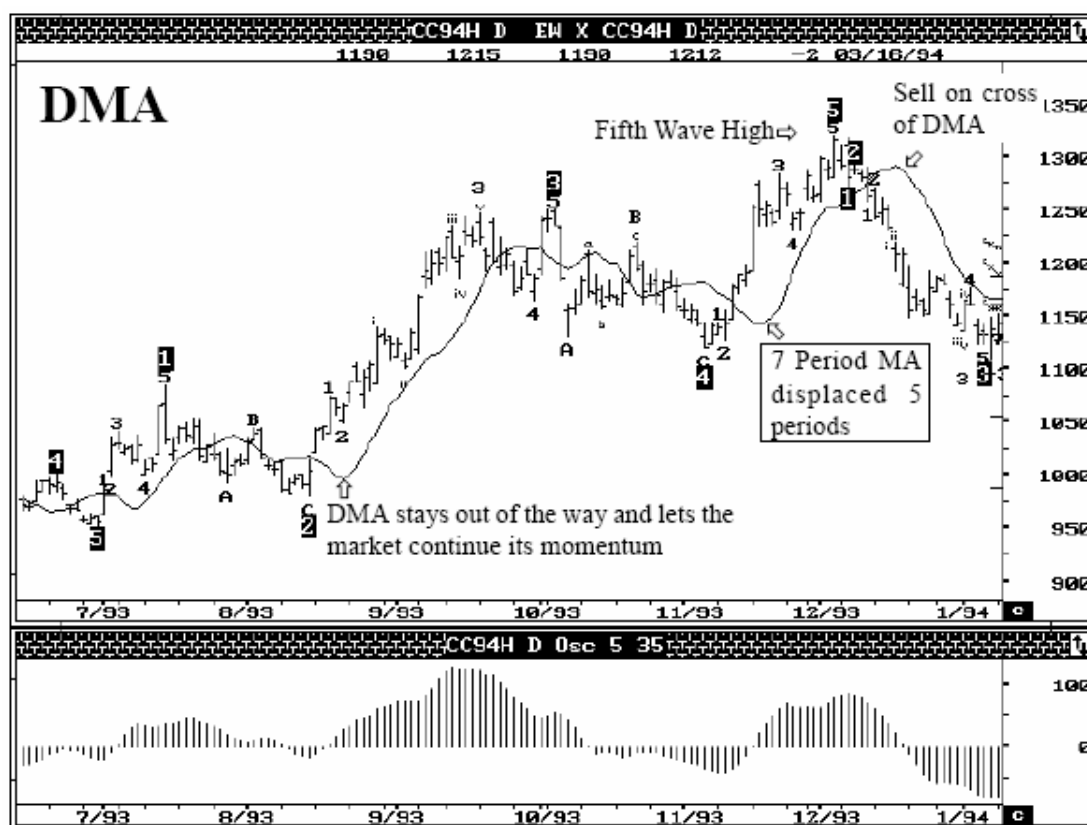
* در چارت A زمانی که نوسان نمای الیوت به سمت صفر برمی‌گردد PTI از ۳۵ بیشتر می‌شود. در این مورد PTI در محدوده ۴۷ می‌باشد که دلالت بر PTI مناسبی در موج چهارم نزولی می‌باشد.



* بعلاوه قیمت باید بالای کانال های موج چهارم باشد که مدت زمان مناسبی را برای PTI ایجاد می کند. در نمودار A قیمت بالای کانال های موج چهارم می باشد.
* همه چیز در اینجا برای Buy مناسب است.

اضافه کردن میانگین متحرک جابه جا شده (Displaced Moving Average)

* ما نظریه DMA را در سال ۱۹۸۳ ابداع کردیم. ابزار DMA یک میانگین متحرک ساده می باشد که به سمت راست منتقل شده است. هدف از استفاده DMA اجازه دادن به بازار برای ادامه مومنتوم آن می باشد.
* زمانی که در نهایت بازار توالی ۵ موج را تکمیل می کند قیمت DMA را قطع خواهد کرد.



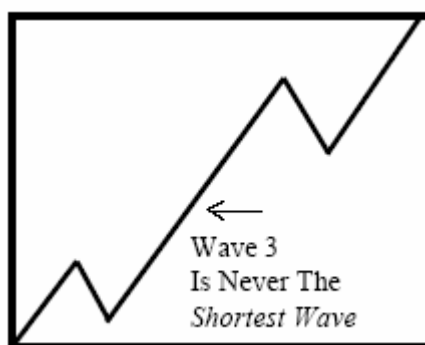
* در پایان موج ۵ از DMA برای ورود به خرید استفاده کنید. ما پیشنهاد می کنیم که از یک میانگین متحرک ۷ روزه که به سمت راست جابه جا شده با دوره های ۵ استفاده شود.

* **هشدار:** DMA برای ورود به پوزیشن در انتهای موج ۵ و در الگوهای مطمئن در پایان موج چهارم طراحی شده است. نباید DMA را به عنوان ابزاری جهت **Buy** یا **Sell** کردن در مناطق دیگر استفاده کرد. دقت DMA بعنوان یک ابزار کمتر از ۲۱٪ می باشد.

راهنما و قوانین موج الیوت

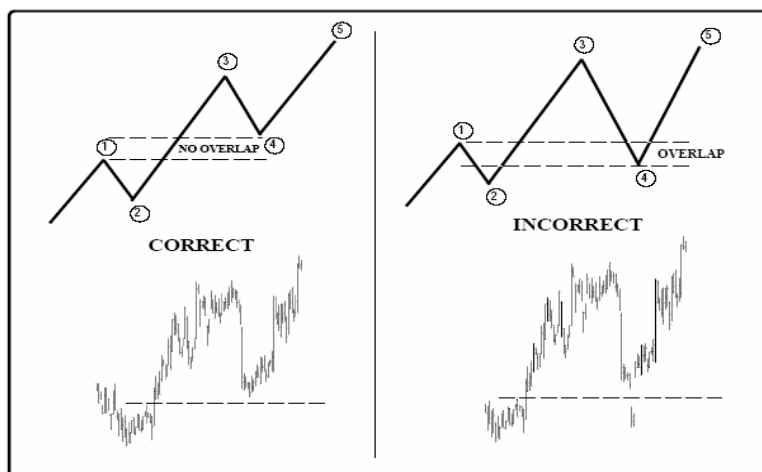
(۱) موج سوم نباید کوتاهترین موج باشد (قانون)

معنی جمله فوق این است که موج سوم همیشه حداقل از یکی از دو موج دیگر (۱ یا ۲) بلندتر می باشد. معمولاً موج سوم بلندتر از هر دو موج می باشد. شما نباید هیچ وقت بدنبال موج سومی باشید که از دو موج دیگر کوتاه تر باشد. در بعضی مواقع موج سوم در نقاط برابری پایان می یابد ولی هیچ گاه کوتاه تر نیست. برای این قانون هیچ استثنایی وجود ندارد.



(۲) موج چهارم نباید با موج اول هم پوشانی داشته باشد (قانون و راهنما)

معنی این جمله این است که پایان موج ۴ نباید زیر بالاترین نقطه موج ۱ باشد. این قانون در بازارهای با نقدشوندگی بالا نقض نمی شود. در بازارهای کالا هم پوشانی ۱۵-۱۰٪ قابل قبول است. به هر حال داشتن هم پوشانی به عنوان پایان کار است.

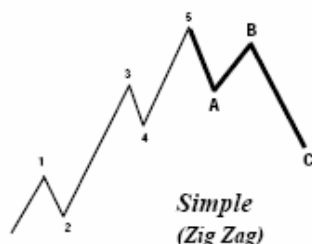


اصلاح‌های موج الیوت

غلبه بر اصلاح‌ها کار بسیار دشواری می‌باشد. اغلب تریدرهای الیوت در حین الگوی حرکت پول بدست می‌آورند و سپس آن را در طی فاز اصلاح از دست می‌دهند. الگوی حرکت شامل ۵ موج است. الگوی اصلاح شامل ۳ موج است و حالت بخصوصی از یک مثلث است. معمولاً بدنبال یک الگوی حرکت الگوی اصلاح ایجاد می‌شود. الگوی اصلاح به دو دسته متفاوت تقسیم می‌شود که شامل اصلاح ساده و اصلاح ترکیبی می‌باشد.

اصلاح ساده

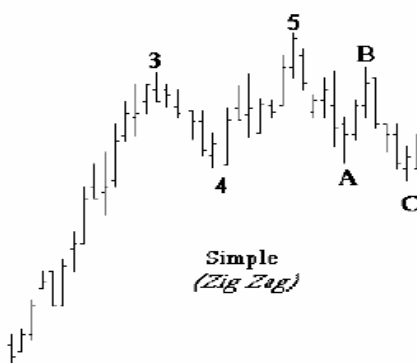
در اصلاح ساده فقط یک الگو وجود دارد. این الگو اصلاح زیگزاگ نامیده می‌شود. یک الگوی اصلاح زیگزاگ شامل الگوی ۳ موجی می‌باشد که موج B نمی‌تواند بیش از ۷۵٪ از موج A را اصلاح نماید. موج C یک Low جدید را زیر موج A ایجاد می‌کند. معمولاً موج A از یک اصلاح زیگزاگ، الگوی ۵ موجی دارد. در دو مورد دیگر اصلاح (مسطح و نامنظم) موج A الگوی ۳ موجی دارد. بنابراین اگر شما بتوانید در موج A پنج موج را شناسایی کنید شما می‌توانید انتظار داشته باشید که اصلاح، با الگوی زیگزاگ پایان یابد.



نسبت‌های فیبوناچی در داخل اصلاح زیگزاگ

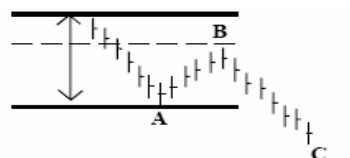
Wave B = usually 50% of Wave A.
Wave B should not exceed 75% of Wave A.

Wave C = either 1 x Wave A
or 1.62 x Wave A
or 2.62 x Wave A



A simple correction is commonly called a Zig-Zag correction.

You typically see divergence with the Oscillator in a simple correction.



Be alert for angle divergence

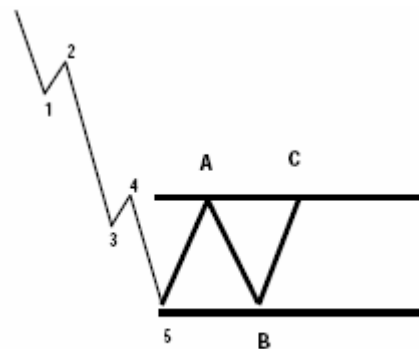
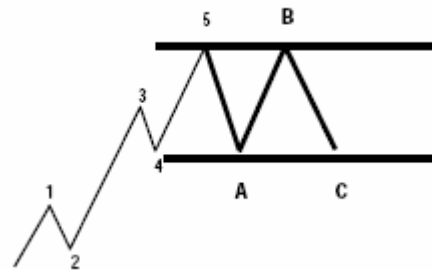
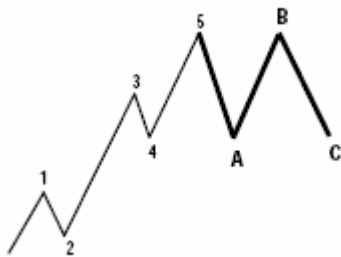
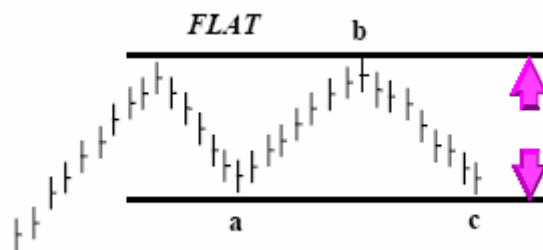


اصلاح ترکیبی - مسطح، منظم، مثلث

گروه اصلاح ترکیبی شامل سه قسمت است: (۱) مسطح (۲) نامنظم (۳) مثلث

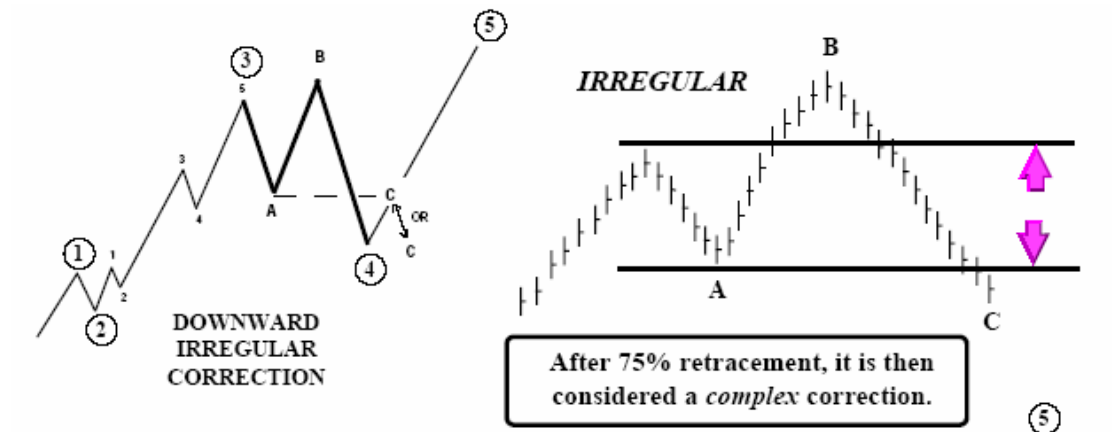
اصلاح مسطح

در یک اصلاح مسطح طول موج‌ها با یکدیگر یکسان است. بعد از یک الگوی حرکت ۵ موجی بازار به موج A می‌رسد. سپس موج B که تشکیل شد به نقطه High موج A قبلی می‌رسد. در نهایت نیز بازار در موج C به Low قبلی خود در A می‌رسد.



اصلاح نامنظم

در این نوع از اصلاح موج B یک High جدید ایجاد می‌کند. در نهایت نیز موج C می‌تواند به نقطه شروع A یا پایین‌تر از آن برسد.

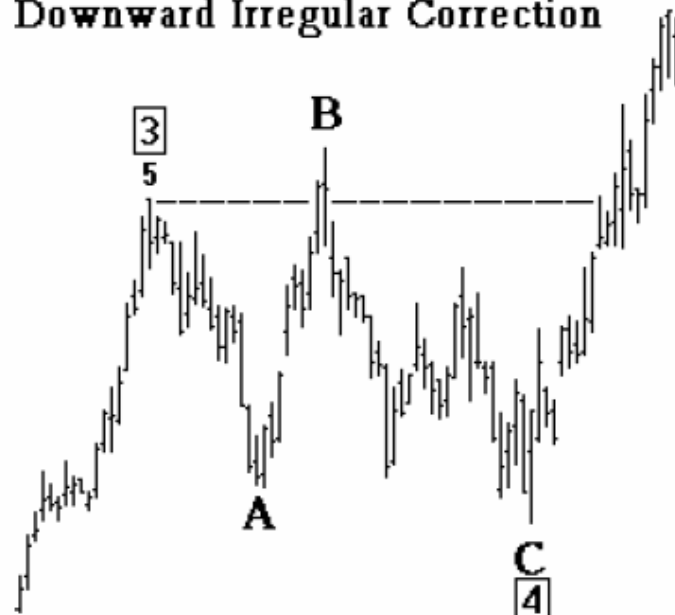


نسبت‌های فیبوناچی در موج نامنظم

Wave B = either 1.15 x Wave A
or 1.25 x Wave A

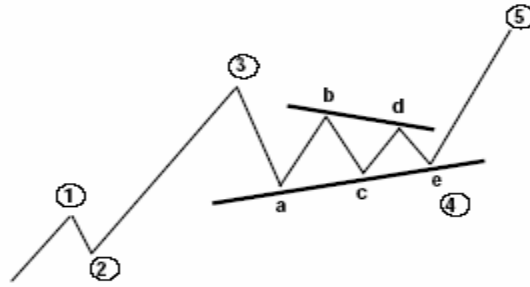
Wave C = either 1.62 x Wave A
or 2.62 x Wave A

Downward Irregular Correction



اصلاح‌های مثلث

الگوهای اصلاحی دیگری وجود دارد که الگوی مثلث نامیده می‌شوند. بررسی مثلث امواج ایبوت بسیار متفاوت از دیگر انواع مثلث‌ها می‌باشد. مثلث ایبوت یک الگوی ۵ موجی می‌باشد که همه موج‌ها دیگر موج‌ها را در بر می‌گیرد. این ۵ زیر موج از یک مثلث تحت نام A, B, C, D و E نامگذاری می‌شوند.



مثلث‌ها در بیشتر مواقع بعنوان موج چهارم هستند. بعضی مواقع می‌توانیم یک مثلث را در موج B از یک سه موج اصلاحی ببینیم. مثلث‌ها بسیار بزرگ و گیج کننده هستند. این الگوها باید قبلاً به دقت مطالعه شوند تا بتوان آن‌ها را تشخیص داد. قیمت تمایل دارد تا شکل مثلث را با سرعت رها کند که **Thrust** نام دارد.



زمانی که مثلث‌ها در موج چهارم رخ دادند بازار به سمت مسیر موج ۳ به خارج از مثلث پرتاب می‌شوند. زمانی که مثلث‌ها در موج B رخ می‌دهند بازار به سمت مسیر موج A از مثلث به خارج پرتاب می‌شوند.



قوانین فرعی

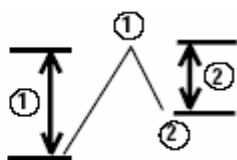
* اگر موج دوم یک اصلاح از نوع ساده باشد انتظار داریم که موج چهارم یک اصلاح ترکیبی باشد.

* اگر موج دوم یک اصلاح از نوع ترکیبی باشد انتظار داریم که موج چهارم یک اصلاح ساده باشد.

نسبت‌ها و اندازه‌گیری موج

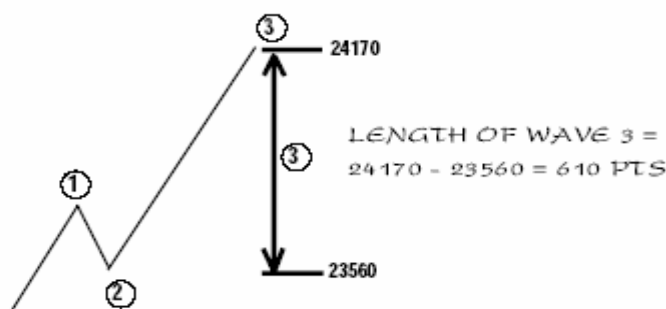
طول هر موج از طریق اندازه‌گیری فاصله عمودی شروع موج تا پایان آن محاسبه می‌شود. طول براساس یک نقطه از قیمت بیان می‌شود.

Length of Wave One

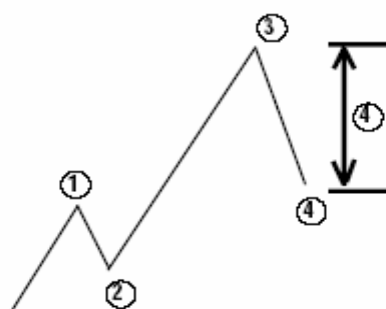


Length of Wave Two

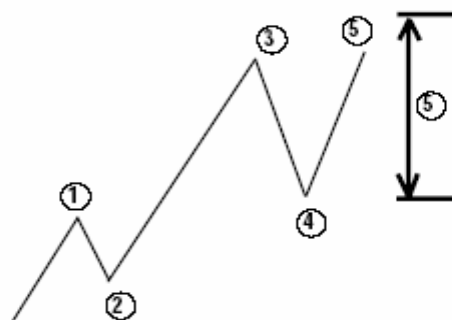
Length of Wave Three



Length of Wave Four



Length of Wave Five



نسبت‌های فیبوناچی امواج

اولین موج از توالی الیوت موج ۱ نام دارد. اندازه‌گیری موج ۱ جهت یافتن نسبت‌های سایر امواج است. این نسبت‌ها بعنوان یک قانون نیستند ولی راهنمایی برای تخمین موج‌های مختلف می‌باشند. قبل از بیان نسبت‌های امواج ما باید در مورد فیبوناچی بحث کنیم.

توضیحاتی در مورد نسبت‌های فیبوناچی

نسبت‌های فیبوناچی نسبت‌های ریاضی هستند که از دنباله فیبوناچی بدست آمده‌اند. دنباله فیبوناچی توسط لئوناردو فیبوناچی در سال ۱۱۸۰ بعد از میلاد مورد استفاده قرار گرفت. دنباله فیبوناچی در موارد زیادی به کار می‌رود که شامل مهندسی، مطالعات فضایی، فعالیت‌های بازار سهام و بسیاری از امور دیگر می‌شود. از این همه یکی از استفاده‌های مهم از نسبت‌های فیبوناچی در پیش‌بینی معاملات می‌باشد. بیشترین نسبت‌های مورد استفاده در بازار سهام شامل موارد زیر است:

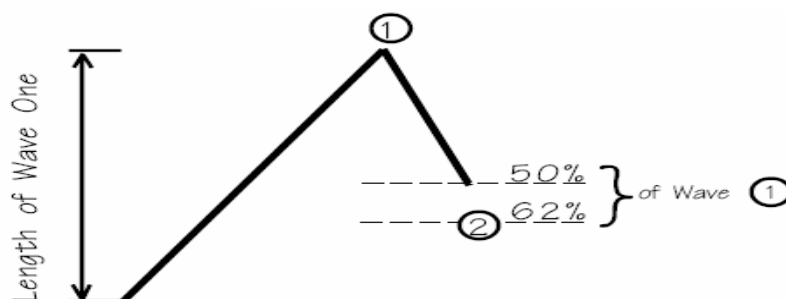
1 - 1.618 - 2.618 - 4.23 - 6.85 (multiples)
0.14 - 0.25 - 0.38 - 0.5 & 0.618 (ratios)

که سطر اول نشان‌دهنده ضرایب و سطر دوم نسبت‌ها می‌باشد. نسبت‌هایی که در این مباحث مورد استفاده قرار گرفته‌اند از نسبت‌های استاندارد فیبوناچی بدست آمده‌اند و در زیر لیست شده است. این نسبت‌ها بهترین نقاط را برای الگوهای امواج کوتاه مدت نشان می‌دهند.

نسبت‌های موج دوم

قوانین فیبوناچی برای موج دوم در زیر آمده است. معمولاً موج دوم متناسب با موج اول است. نسبت‌های رایج برای موج دوم شامل موارد زیر است:

Wave 2 = either, 50% of Wave 1
or, 62% of Wave 1

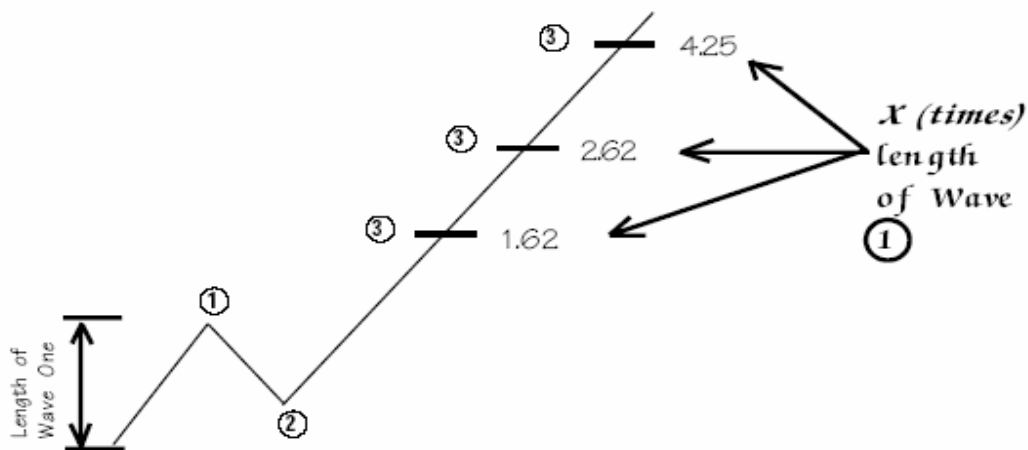


نسبت‌های موج سوم

موج سوم با یکی از ضرایب زیر با موج ۱ متناسب است:

Wave 3 = either 1.62 x length of Wave 1
or 2.62 x length of Wave 1
or 4.25 x length of Wave 1

ضرایب متداول ۱/۶۲ و ۲/۶۲ می‌باشند. به هر حال اگر موج سوم موج گسترش یافته باشد در این زمان ضرایب ۲/۶۲ و ۴/۲۵ مورد استفاده قرار می‌گیرند.

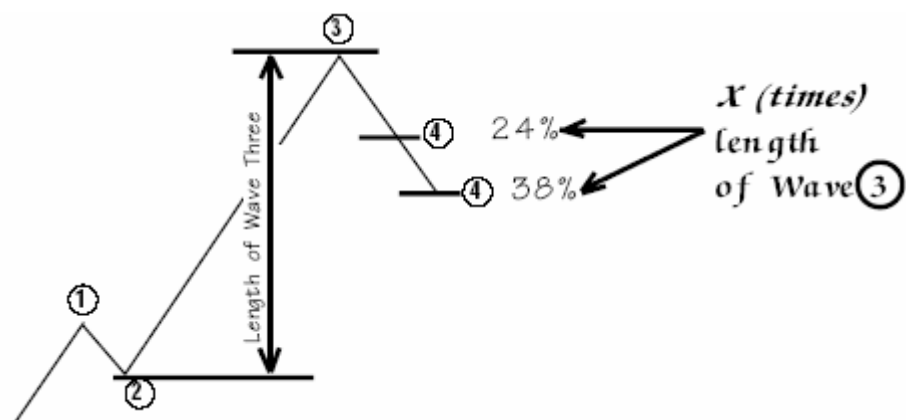


نسبت‌های موج چهارم

موج چهارم با یکی از نسبت‌های زیر با موج سوم متناسب است:

WAVE 4 = either, 24% of Wave 3
or, 38% of Wave 3
or, 50% of Wave 3

۲۴٪ و ۳۸٪ متداول‌ترین نسبت‌ها برای موج ۴ می‌باشند.

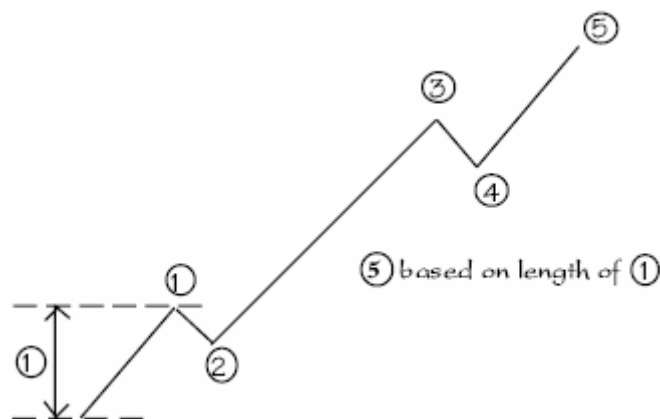


نسبت‌های موج پنجم

موج پنجم دارای دو تفاوت عمده می‌باشد که هر دو در زیر اشاره شده‌اند.

۱) اگر موج سوم بیش از $1/62$ بوده یا گسترش یافته، باشد در این هنگام نسبت‌های موج ۵ بر این اساس است:

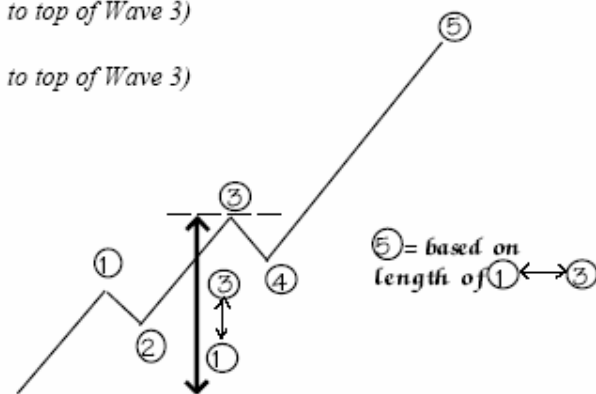
Wave 5 either = Wave 1
or = 1.62 x Wave 1
or = 2.62 x Wave 1



۲) اگر موج سوم کمتر از $1/62$ بود نسبت‌های موج پنجم بر اساس زیر است:

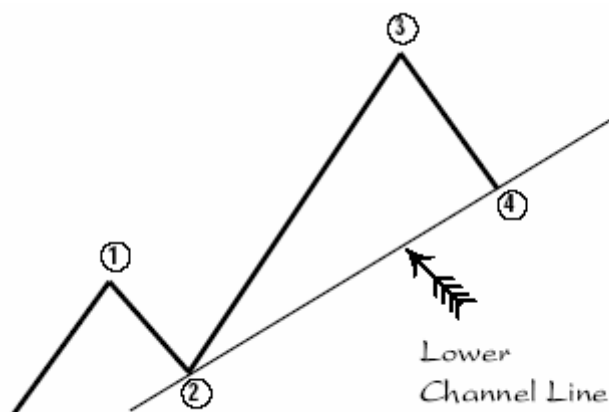
زمانی که موج سوم کمتر از $1/62$ باشد موج گسترش بسیار بیشتری می‌یابد. در بررسی‌ها مشخص شده نسبت موج پنجم بر پایه طولی است که اندازه آن از شروع موج اول تا پایان موج سوم می‌باشد:

Extended Wave 5 = either 0.62 x length of
(beginning of Wave 1 to top of Wave 3)
or = length of
(beginning of Wave 1 to top of Wave 3)
or = 1.62 x length of
(beginning of Wave 1 to top of Wave 3)

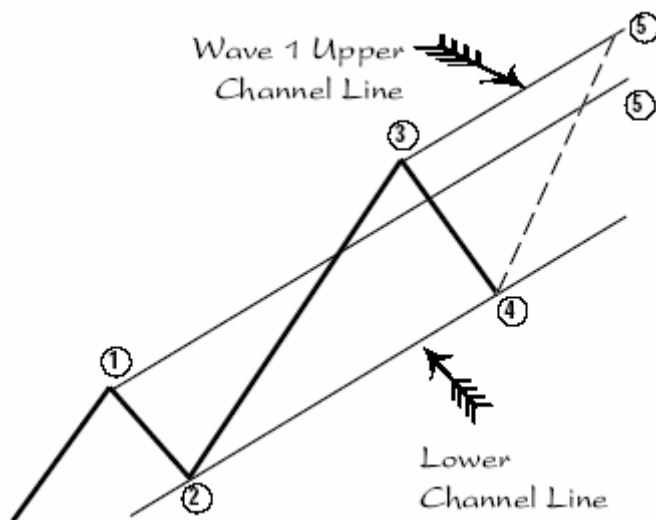


کانال‌های ایوت برای شناسایی Top موج ۵

زمانی که موج پنجم آغاز می‌شود تکنیک کانال موج ایوت می‌تواند انتهای موج پنجم را پیش‌بینی کند. وقتی که موج چهارم کامل شد خطی مستقیم بین موج ۲ و ۴ رسم کنید.

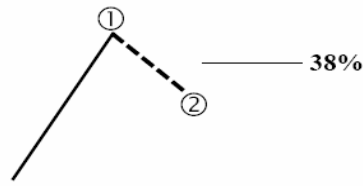


حالا دو خط موازی با خط پایینی از نقاط Top موج‌های ۱ و ۳ رسم کنید.

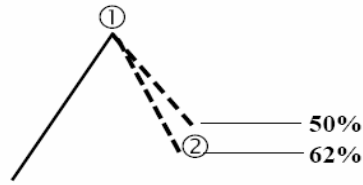


انتظار داریم که موج ۵ در دو کانال بالایی به اتمام برسد. معمولاً اگر موج سوم یک موج معمولی باشد موج ۵ تمایل دارد که تا کانالی که از Top موج ۳ رسم شده ادامه یابد. اگر موج سوم گسترش یافته باشد موج ۵ تمایل دارد که تا کانالی که از Top موج ۱ رسم شده ادامه یابد.

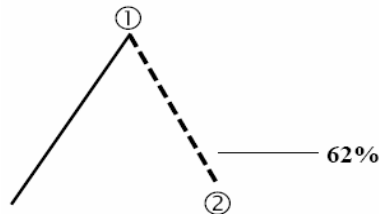
آنالیز آماری نسبت‌های موج دوم



Only 12% held within a 38% retracement of Wave One

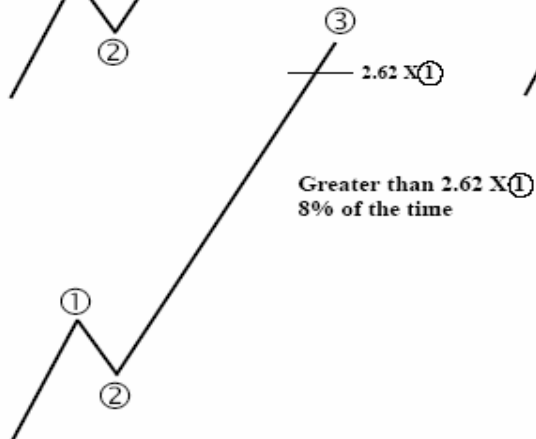
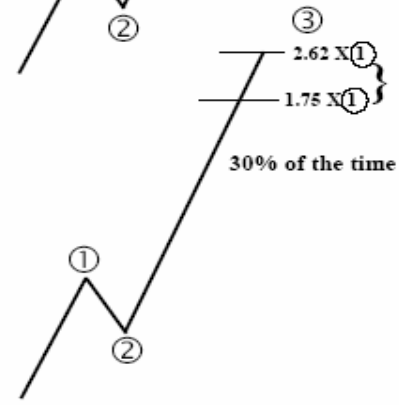
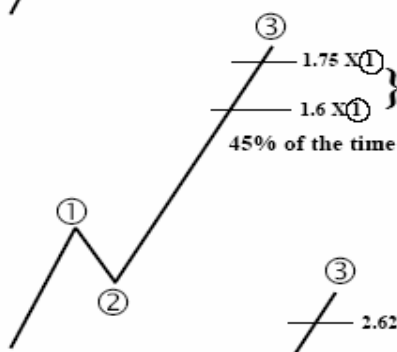
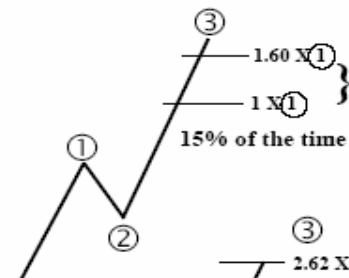
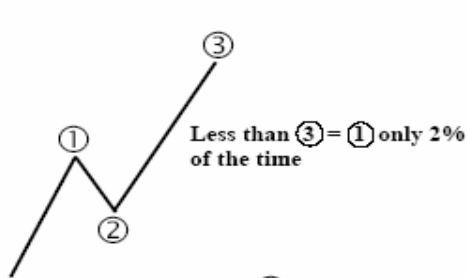


73% Retraced between 50% and 60%

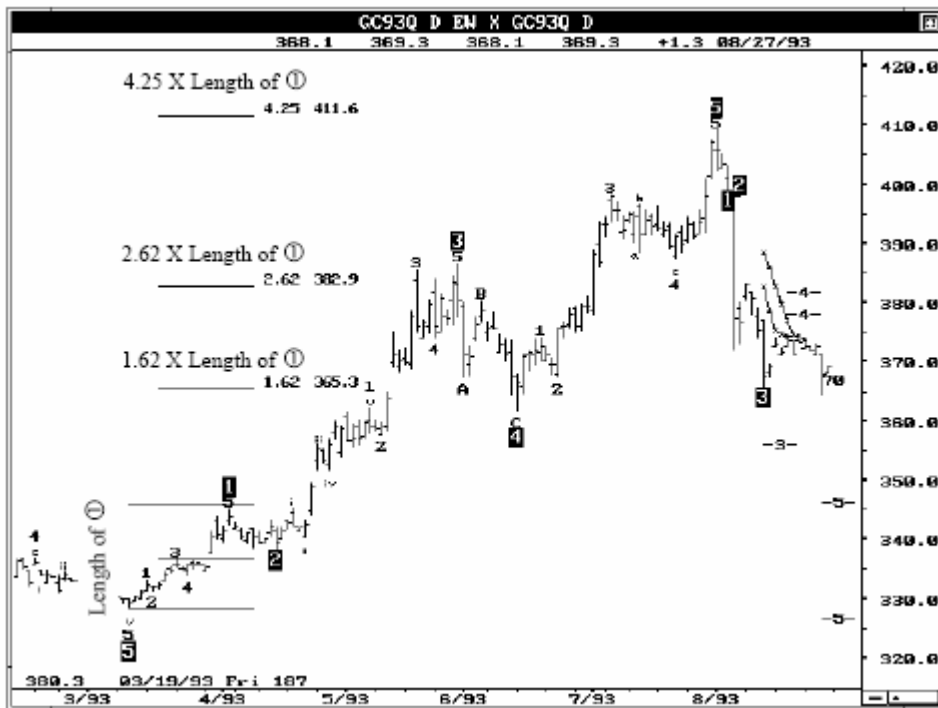


15% Retraced below the 62% level

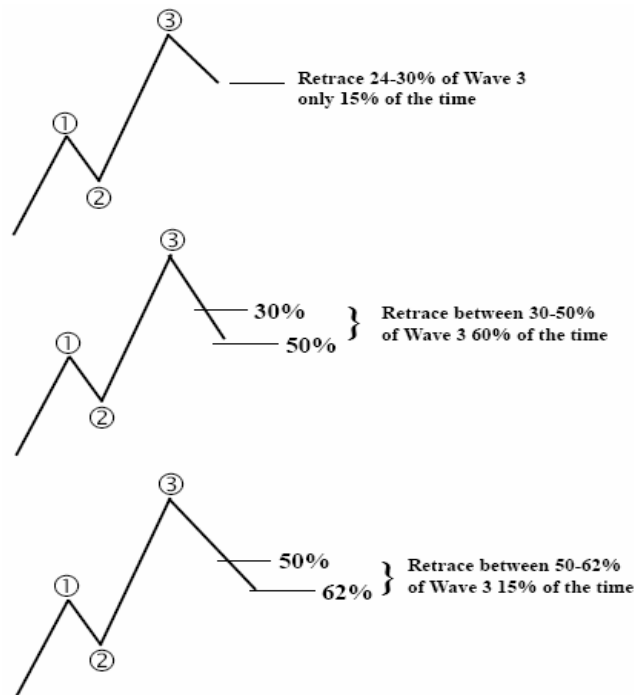
آنالیز آماری نسبت‌های موج سوم



نسبت‌های موج سوم



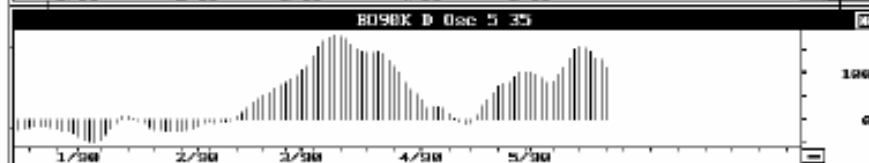
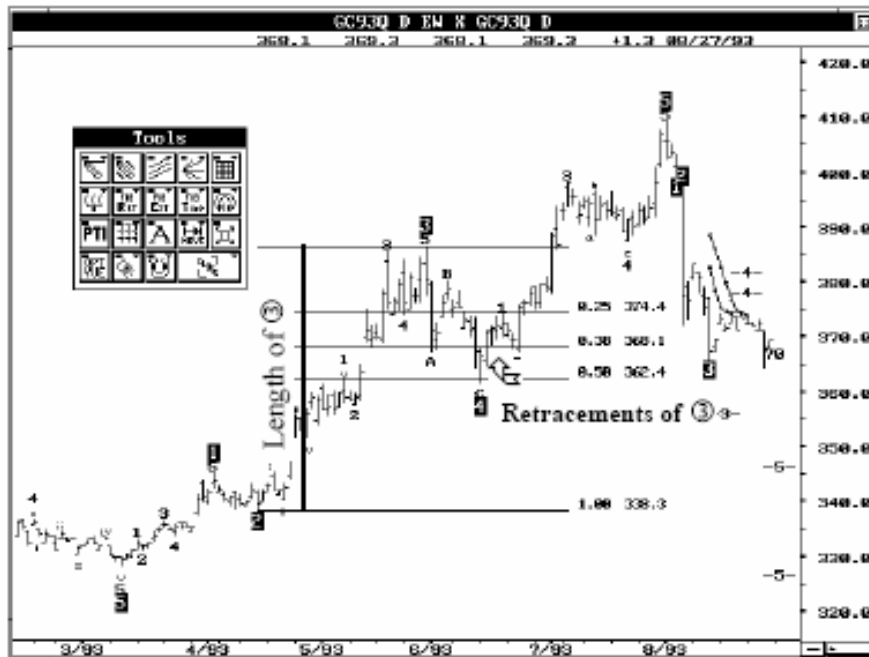
آنالیز آماری نسبت‌های موج چهارم



Under 62% retracement of Wave 3 = 10% of the time



نسبت‌های موج چهارم

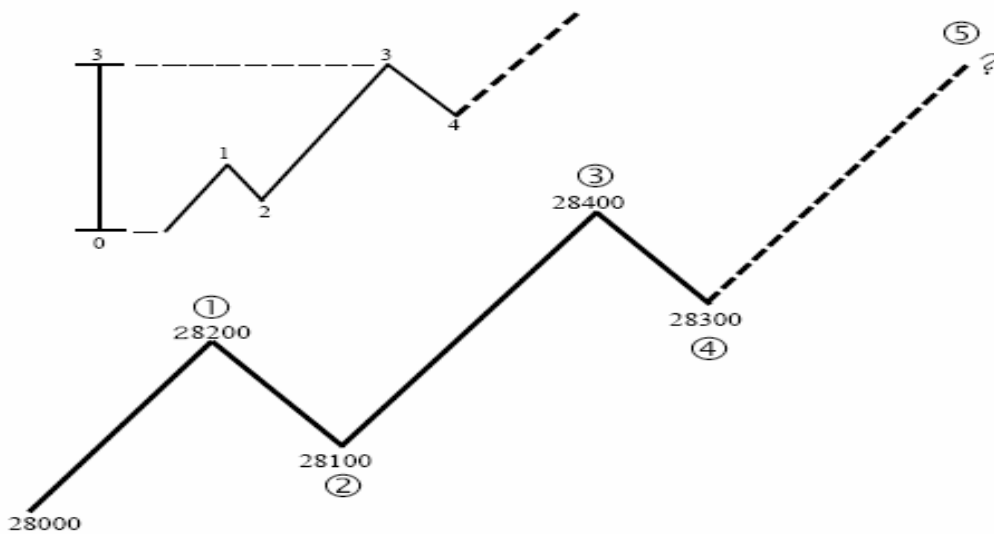


نسبت‌های فیوناچی/الیوت

موج پنجم

(در صورتی که موج سوم کمتر از $1/62$ برابر موج اول باشد گسترش می‌یابد):

- ⑤ = $.62 \times$ Length of 0 to 3
- ⑤ = $1 \times$ Length of 0 to 3
- ⑤ = $1.62 \times$ Length of 0 to 3



نسبت‌های فیوناچی الیوت برای موج ۵



تحقیقات ما نشان داده زمانی که موج سوم گسترش یافته باشد توالی پنج موج اغلب در نسبتی از فاصله نقطه صفر تا پایان موج سوم می باشد. این مساله شروع کننده یک توالی ۵ موج جدید می باشد. طول ۳-۰ از انتهای موج چهارم گسترش می یابد. معمولاً پایان موج ۵ در ۶۲٪ از طول ۳-۰ یا مساوی طول آن می باشد.



قواعد: خرید نوع ۱

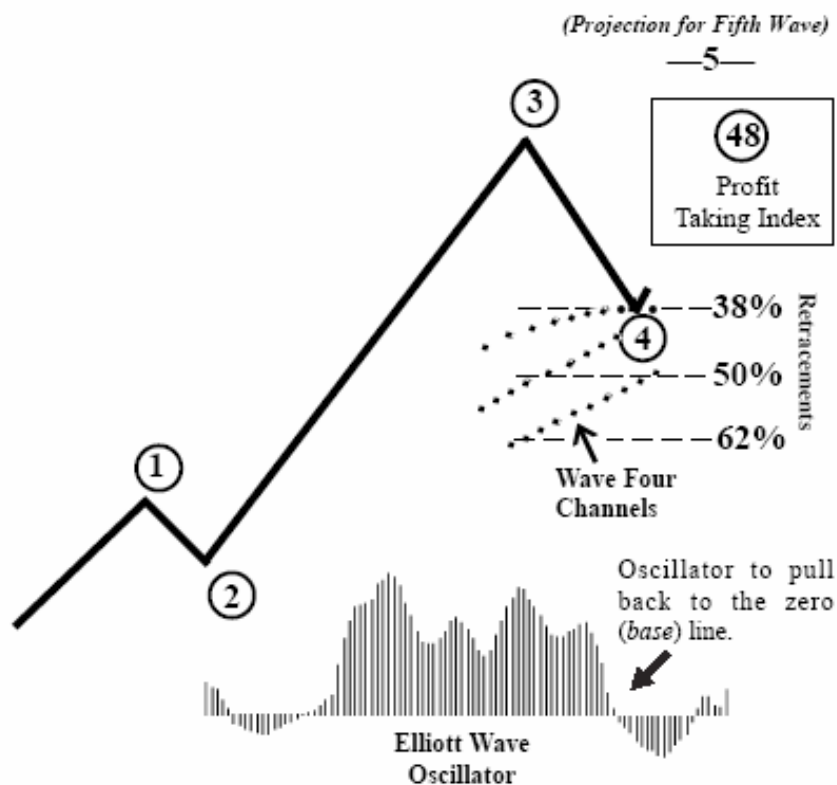
(Buy در انتهای یک موج چهارم اصلاحی)

زمانی که نرم افزار وجود یک رالی موج سوم را قطعی کرد بدنبال شرایط زیر باشید:

(۱) به نوسان نمای الیوت نگاه کنید که به سمت خط صفر برگشته است.

(۲) زمانی که نوسان نما به سمت صفر بازگشته است این مساله را بررسی کنید که موج سوم حداقل ۳۸٪ را اصلاح (Retrasement) کرده است.

(۳) در این زمان PTI بایستی بالای ۳۵ باشد. ابزار PTI به خوبی اشاره بر این دارد که احتمال وجود موج پنجم زیاد است. زمانی که PTI به زیر ۳۵ سقوط کند از نظر آماری احتمال ایجاد موج ۵ کاهش می یابد. بعلاوه احتمال تشکیل نشدن موج ۵ افزایش می یابد.



۴) اصلاح‌ها بایستی بالای کانال‌های موج چهارم باشند. کانال‌های موج پنجم کانال‌های مناسبی می‌باشند که اجزای زمانی لازم برای آنالیزور موج الیوت را فراهم می‌کنند. یک موج چهارم ایده‌آل باید بالای این کانال‌ها کامل شود. محدود ماندن سطوح اصلاحی بالای دو کانال از کانال‌های فوق احتمال تشکیل موج ۵ را افزایش می‌برد. این مرحله به اندازه PTI در مرحله شماره ۳ حیاتی نیست.

۵) نقاط Stop را براساس دو سطح فیبوناچی زیر نقطه ورود محاسبه کنید. برای مثال اگر نقطه ورود شما در سطح ۳۸٪ می‌باشد Stop باید در جایی باشد که دو سطح پایین‌تر است (در جایی زیر خط اصلاحی ۶۲٪).

۶) نقطه هدف موج ۵ را که نرم افزار به شما می‌دهد را نگاه کنید. نسبت سود به ضرر را محاسبه کنید. اگر این نسبت بالاتر از ۱/۵ بود این ترید قابل قبول است.

محتوس همه این مراحل را برای یک موج ۵ نزولی در نظر بگیرید.

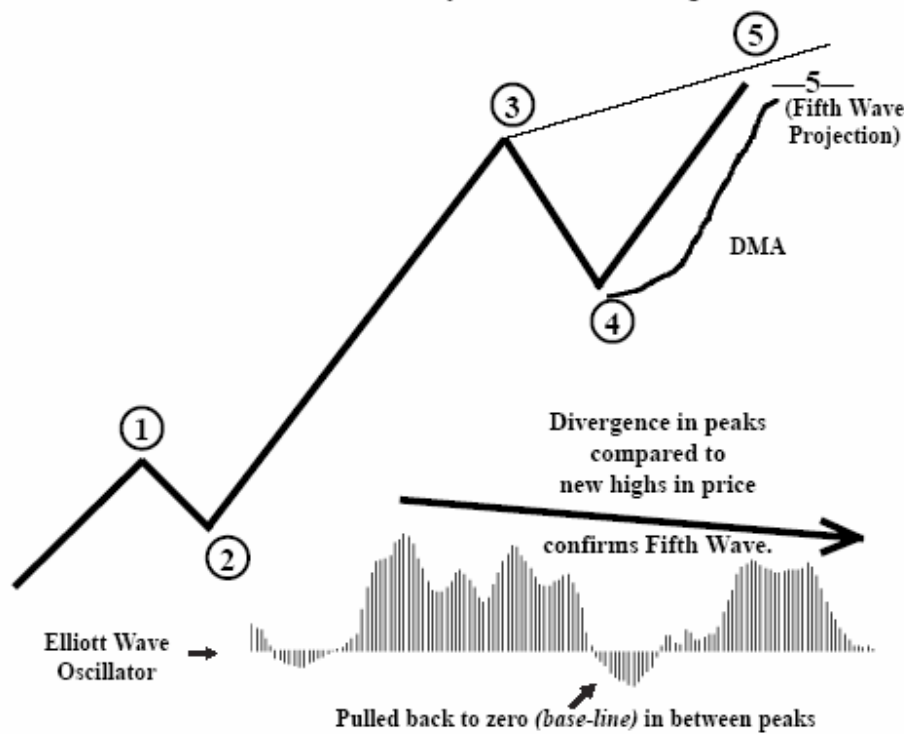


قواعد: ترید نوع ۲

(Sell در انتهای رالی موج پنجم)

زمانی که نرم افزار وجود رالی موج پنجم را قطعی کرد بدنبال شرایط زیر باشید:

- ۱) توجه کنید که قیمت در نزدیکی موج پنجم مورد نظر باشد.
- ۲) اطمینان حاصل کنید که نوسان نمای الیوت یک موج پنجم را با یک دایورجنس روشن و برگشت به سمت صفر قطعی کرده است.

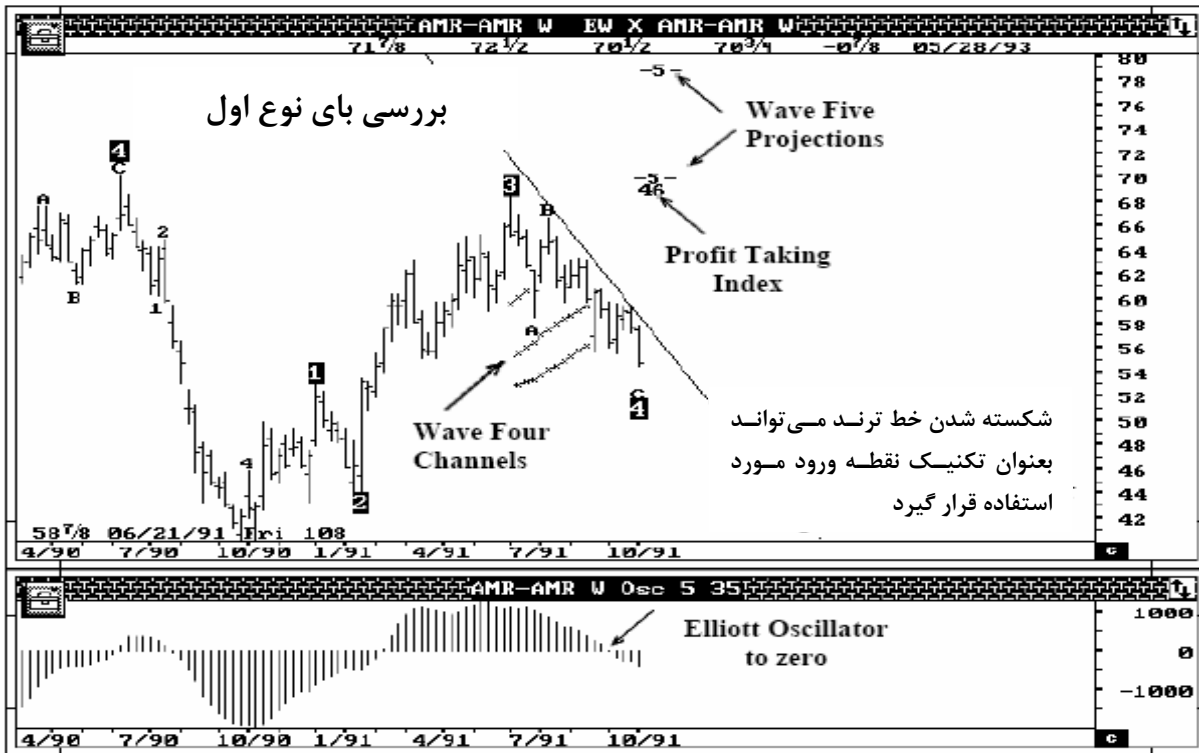


- ۳) از DMA برای گرفتن Sell در سمت دیگر استفاده کنید. در DMA یک میانگین متحرک ساده به سمت راست جابه جا شده است. زمانی که مومنتوم در بازار ادامه دارد DMA خارج از مسیر قرار دارد. زمانی که قیمت در موج پنجم از نقطه Top خود برگشت می کند این نقطه شکست DMA می باشد. این مساله نقطه ورود را قطعی می کند. همچنین یک Stop قطعی بالای این نقطه High ایجاد می کند.
- ۴) یک Stop بالای High قبلی قرار دهید.

معکوس همه این مراحل را برای یک موج ۵ نزولی در نظر بگیرید.



مثال‌های تریدهای نوع یک و دو



بررسی Buy نوع اول

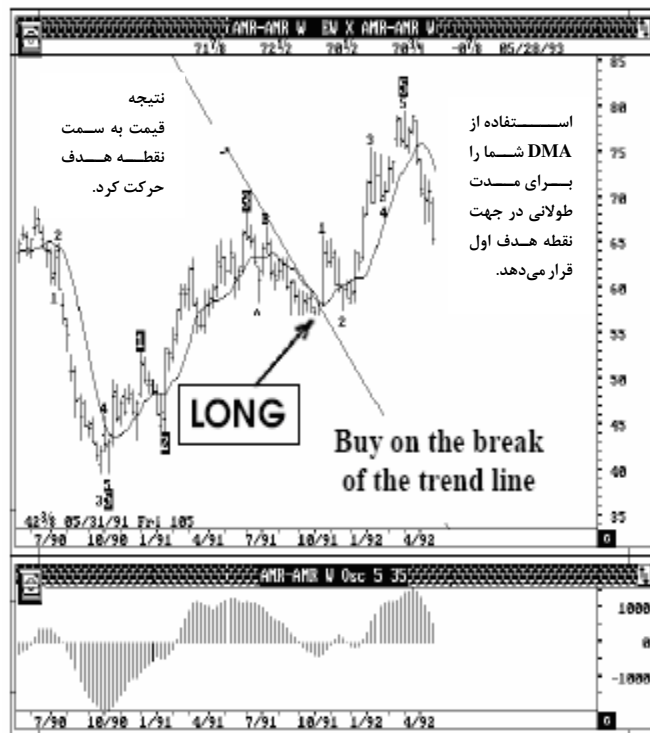
مرحله A: نوسان نمای الیوت به خط صفر برگشته است.

مرحله B: خط ترند را بعنوان نقطه ورود تکنیکال در نظر بگیرید. این تکنیک برای این بکار می‌رود که در صورت شکسته شدن خط ترند نقطه ورود به پوزیشن ایجاد می‌شود.

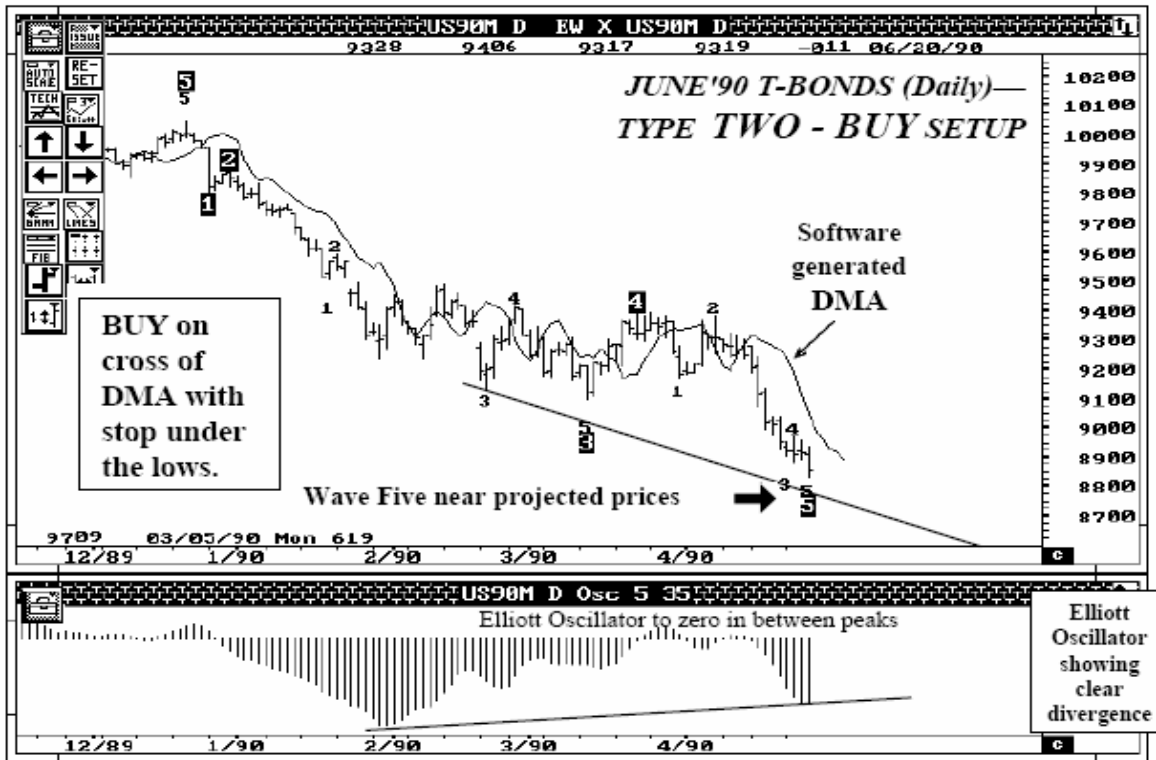
مرحله C: PTI دارای عدد ۴۶ است که از میزان ۳۵ مورد نیاز بالاتر است.

مرحله D: حرکت اصلاح، کانال‌های موج چهارم را شکسته است. کانال‌های موج چهارم به اندازه PTI دارای اهمیت نمی‌باشد.

مرحله E: دو نقطه قابل پیش‌بینی در ۷۰ و ۷۹ وجود دارد.



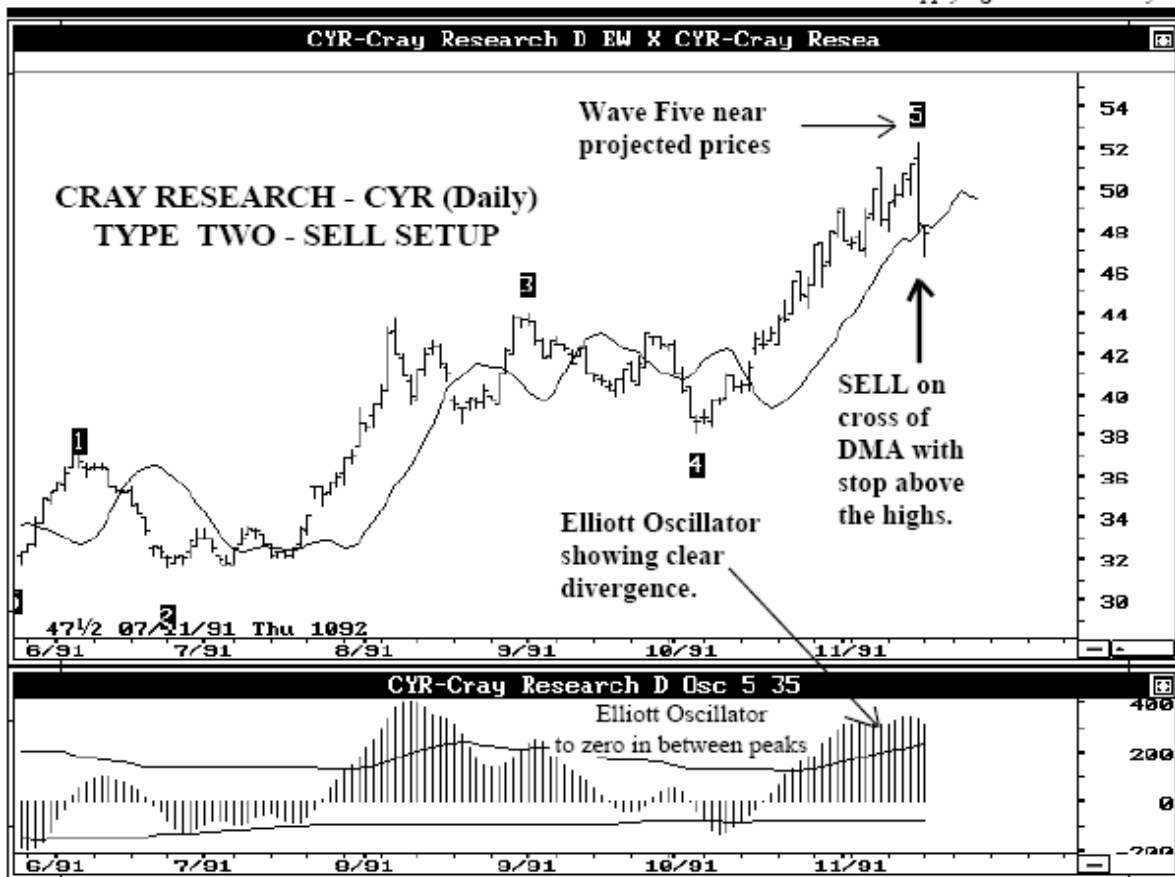
Buy نوع دوم



بررسی Buy نوع دوم

- مرحله A:** قیمت نزدیک موج ۵ پیش‌بینی شده می‌باشد.
- مرحله B:** نوسان نمای الیوت دایورجنس واضحی را نشان می‌دهد. همچنین نوسان نمای الیوت در بین دو قله به سمت صفر بازگشته است.
- مرحله C:** از تقاطع DMA برای ورود به یک پوزیشن Buy استفاده کنید.
- مرحله D:** Stop مورد نظر را در زیر Low قرار دهید.
- مرحله E:** زمانی که فاز بعدی شروع می‌شود با استفاده از DMA سود خود را محافظت نمایید. حالا خود را آماده بررسی یک پوزیشن نوع یک کنید.





بررسی سل نوع دوم

مرحله A: قیمت نزدیک موج پنجم مورد انتظار است.

مرحله B: نوسان نمای الیوت یک موج ۵ را با دایورجنس واضح نشان می‌دهد... نوسان نمای الیوت در بین دو قله به خط صفر بازگشته است.

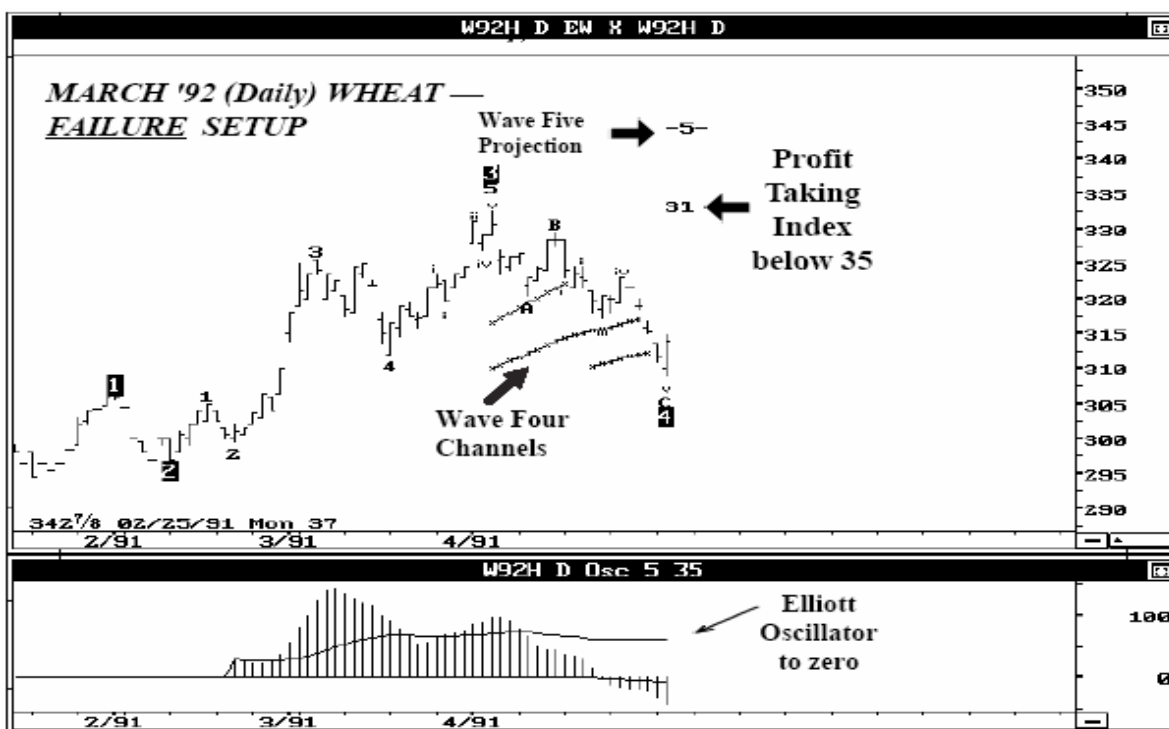
مرحله C: از تقاطع DMA برای یک خرید Buy استفاده کنید.

مرحله D: Stop را در بالای High قرار دهید.

مرحله E: زمانی که فاز بعدی در حال شکل‌گیری است. سود خود را با استفاده از DMA محافظت کنید. حالا منتظر بررسی یک پوزیشن نوع اول باشید.



پیش بینی عدم تشکیل موج ۵ یا تشکیل سقف دوقلو



بررسی عدم تشکیل موج ۵

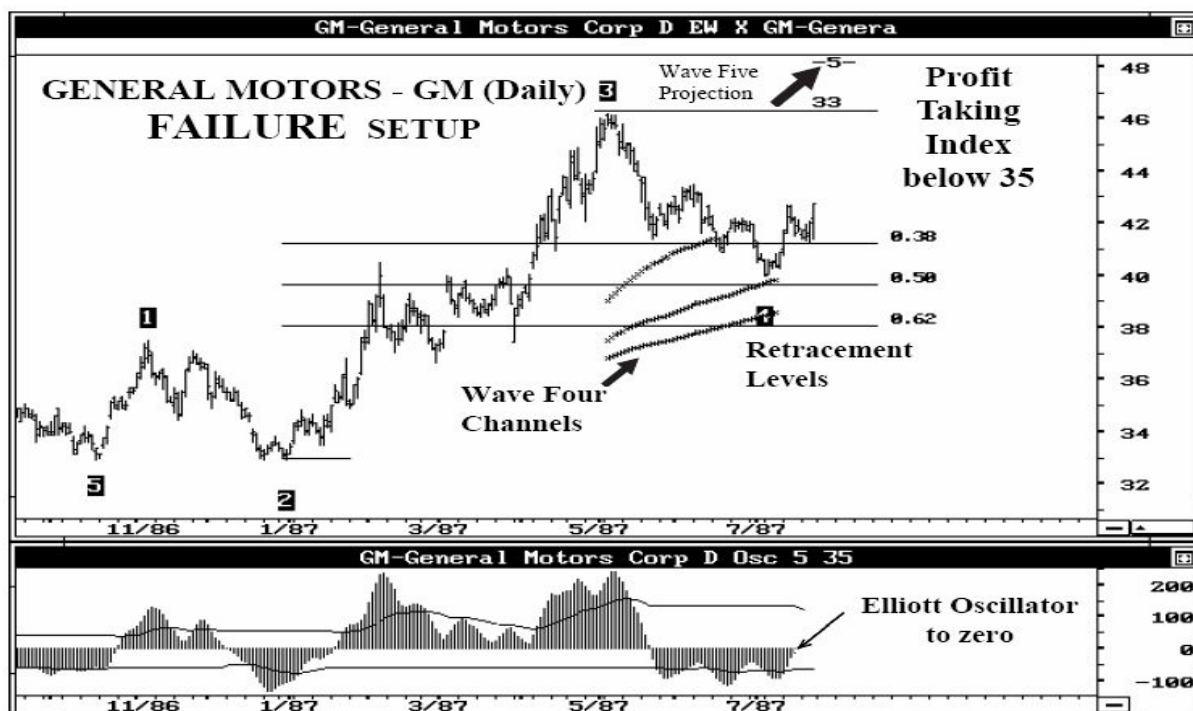
عدد **PTI کمتر از ۳۵ شده است**. به طور آماری این حالت دلالت بر این نکته دارد که احتمال تشکیل موج ۵ به شدت کاهش یافته است و یا یک سقف دوقلو تشکیل خواهد شد.

یک راه مل محافظه کارانه این است که از این ترید Buy صرف نظر کنیم.

اگر این ترید (حالت تهاجمی) صورت گیرد به احتمال زیاد با **Stop** بسته خواهد شد.



پیش بینی عدم تشکیل موج ۵ یا تشکیل سقف دوقلو

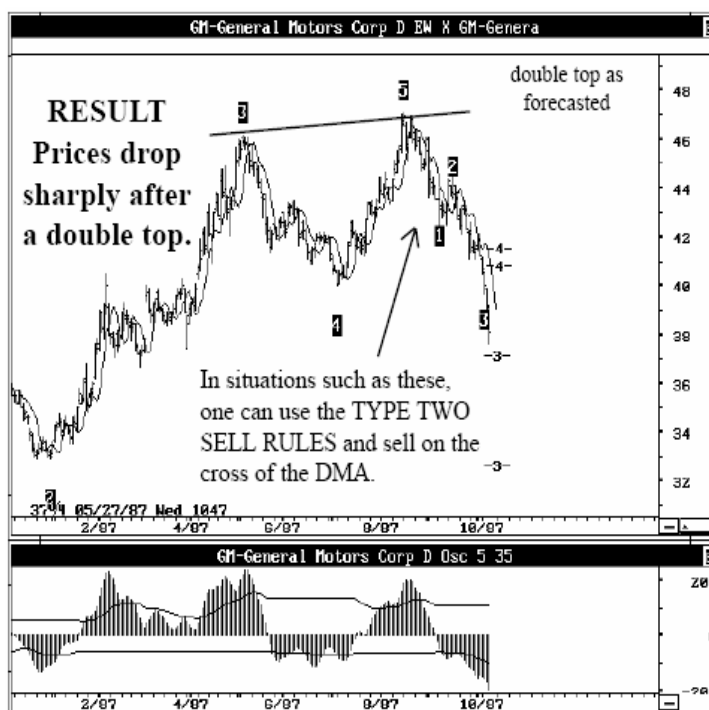


بررسی عدم تشکیل موج ۵

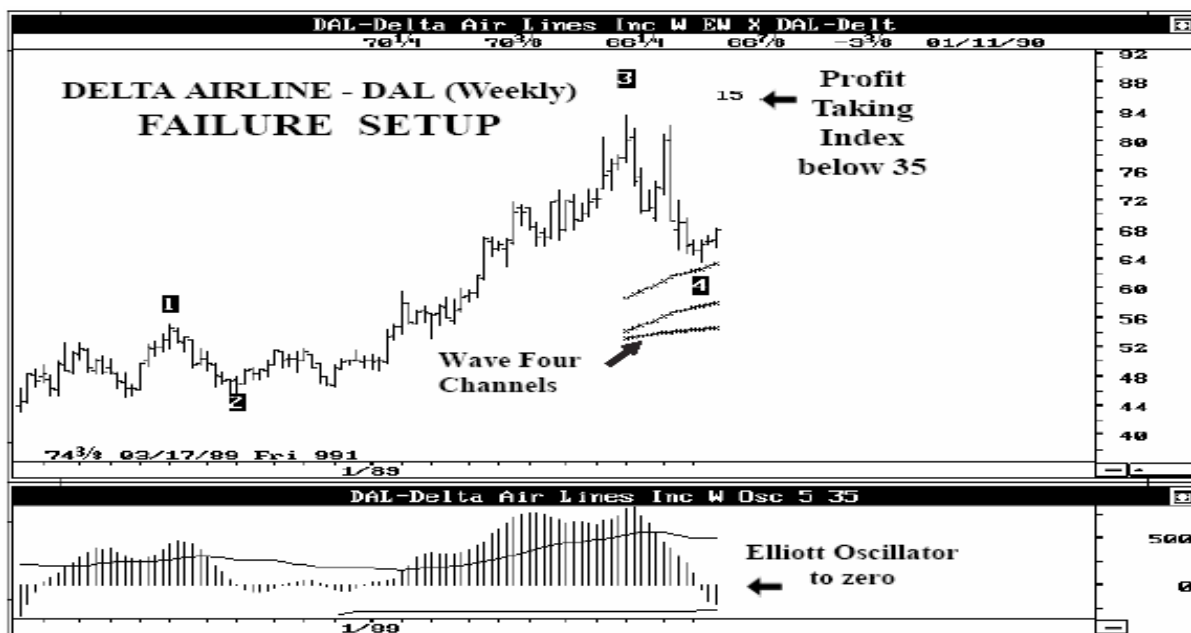
عدد PTI کمتر از ۳۵ شده است. به طور آماری این حالت دلالت بر این نکته دارد که احتمال تشکیل موج ۵ به شدت کاهش یافته است و یا یک سقف دوقلو تشکیل خواهد شد.

یک راه مل محافظه کارانه این است که از این خرید Buy صرف نظر کنیم.

اگر این خرید (حالت تهاجمی) صورت گیرد به احتمال زیاد با Stop بسته خواهد شد.

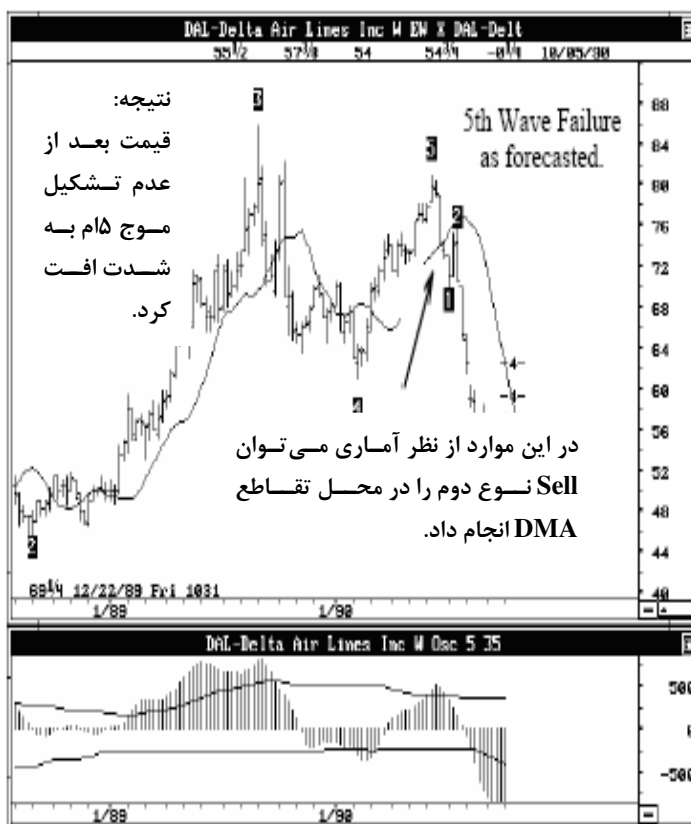


پیش بینی عدم تشکیل موج ۵ یا تشکیل سقف دوقلو



بررسی عدم تشکیل موج ۵

عدد PTI کمتر از ۳۵ شده است. به طور آماری این حالت دلالت بر این نکته دارد که احتمال تشکیل موج ۵ به شدت کاهش یافته است و یا یک سقف دوقلو تشکیل خواهد شد. یک راه حل محافظه کارانه این است که از این خرید Buy صرف نظر کنیم. در صورتی که توجه کنید می بینید که عدد PTI (۱۵) بسیار پایین است. پایین بودن بیش از حد PTI به شدت تاکید می کند که موج ۵ تشکیل نمی شود.

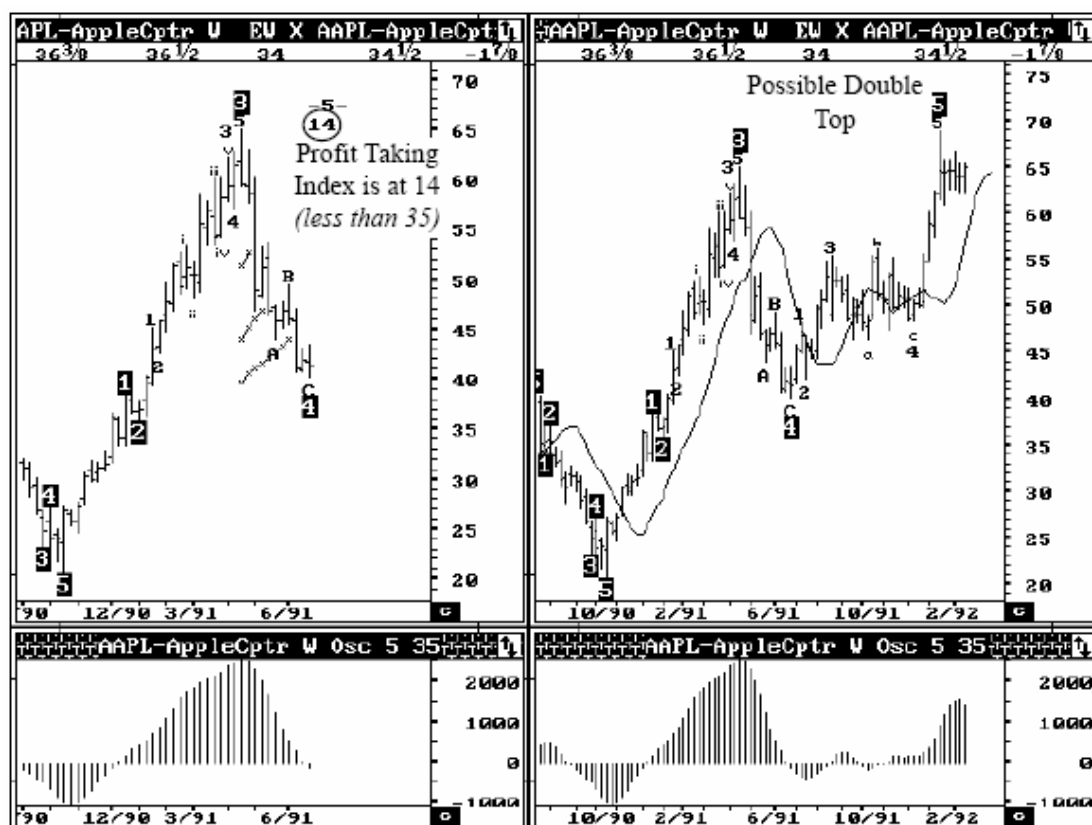


در این موارد از نظر آماری می توان Sell نوع دوم را در محل تقاطع DMA انجام داد.



تشخیص عدم تشکیل موج ۱۵ (سقف دوقلو)

نمودار هفتگی Apple Computer با نرم افزار نشان داده شده است که شمارش موج الیوت را نیز انجام داده است. توجه کنید که PTI دارای عدد ۱۴ می باشد (زیر ۳۵). این مساله به اطمینان زیاد دلالت بر عدم تشکیل موج ۵ دارد و همچنین احتمال تشکیل سقف دوقلو وجود دارد.

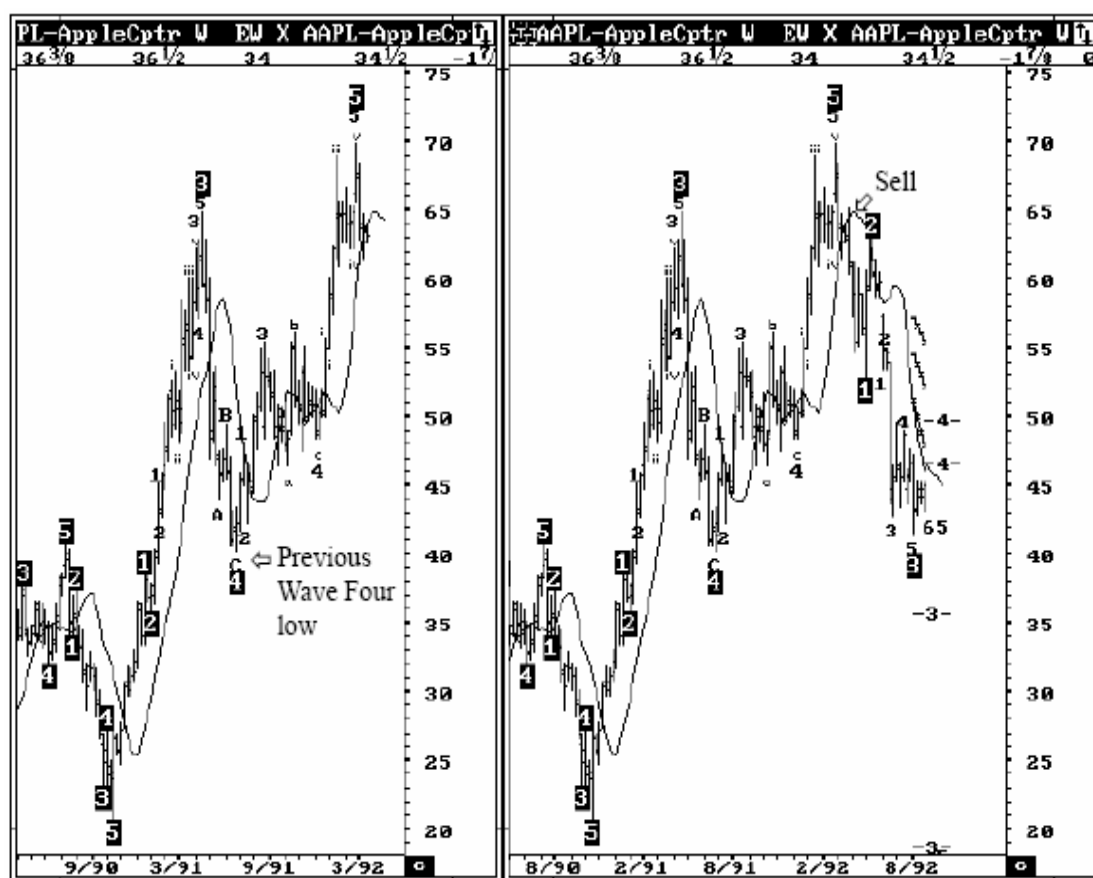


* زمانی که PTI کمتر از ۳۵ باشد حد سود بالاتر از حد مورد نظر در موج ۴ام دیده خواهد شد. این امر منجر به عدم تشکیل موج ۵ام و تشکیل سقف دوقلو خواهد شد (به صفحه بعد نگاه کنید).

سقف دوقلو (عدم تشکیل موج ۵ام)

Apple Computer (هفتگی)

* زمانی که بازار به High قبلی می‌رسد (با PTI کمتر از ۳۵ که در صفحه قبل نشان داده شد) این امر مطرح کننده این موضوع است که احتمال تشکیل سقف دوقلو و عدم تشکیل موج ۵ام بیشتر می‌باشد.

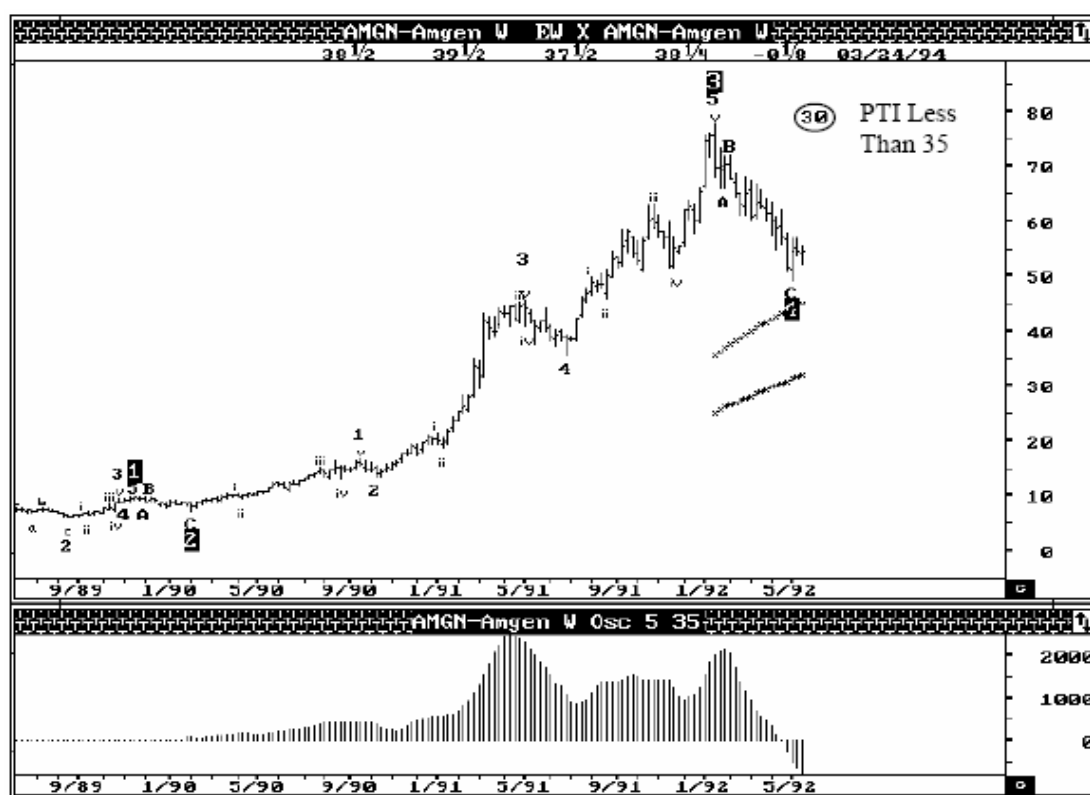


* از DMA برای ورود به یک پوزیشن Sell استفاده کنید و Stop را بالای High قرار دهید.

* در اینجا نیز هدف اول Low موج ۴ام قبلی نزدیک ۴۳ می‌باشد.

سقف دوقلو (عدم تشکیل موج ۵ام)

نمودار هفتگی AMGEN در زیر با شمارش موج الیوت نشان داده شده است. موج چهارم نزولی اخیر دارای PTI ۳۰ (که کمتر از ۳۵ مورد نظر است) می باشد. این مساله دلالت بر این مورد دارد که حد سود مورد انتظار بیشتر از حد معمولی بوده و در همین حدود می باشد.



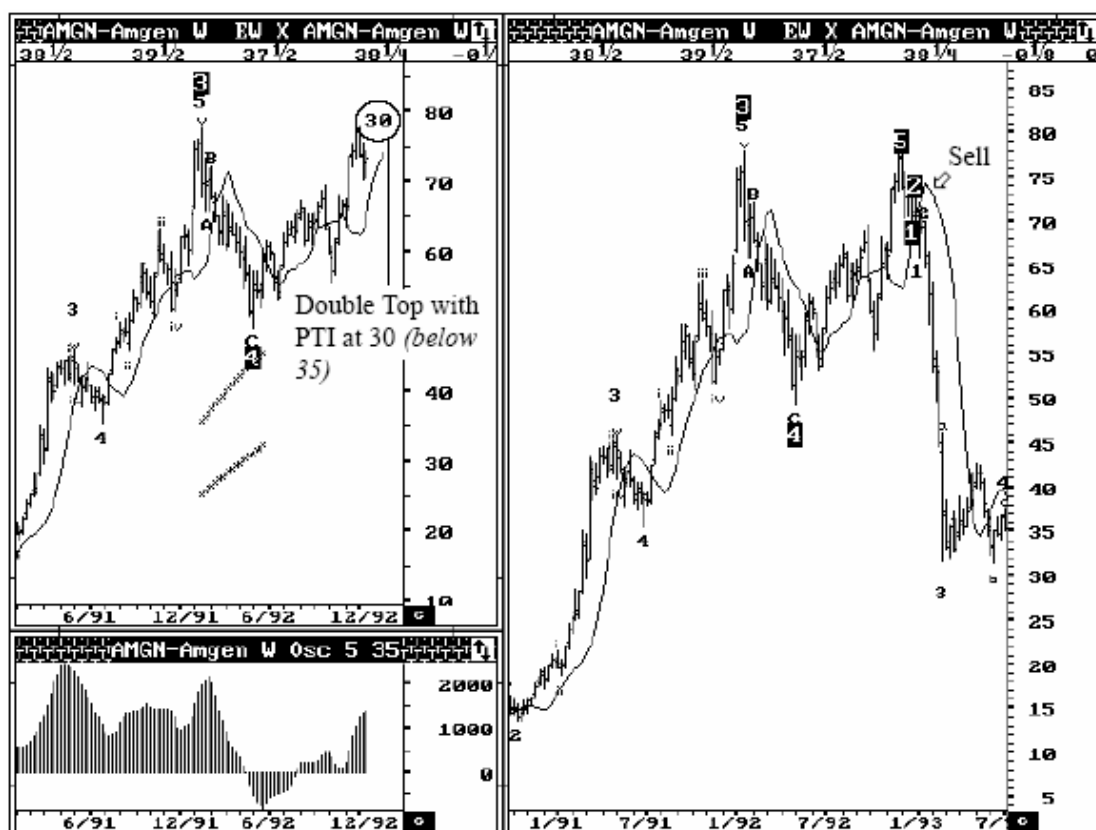
* این مساله باعث می شود که سقف دوقلو تشکیل شده یا High موج ۵ام تشکیل نشود (به صفحه بعد نگاه کنید).



سقف دوقلو (عدم تشکیل High موج ۵ام)

نمودار هفتگی AMGEN

* زمانی که PTI در حد ۳۰ بود و توجه بازار به High موج سوم باشد احتمال عدم تشکیل موج ۵ام یا تشکیل سقف دوقلو زیاد است.



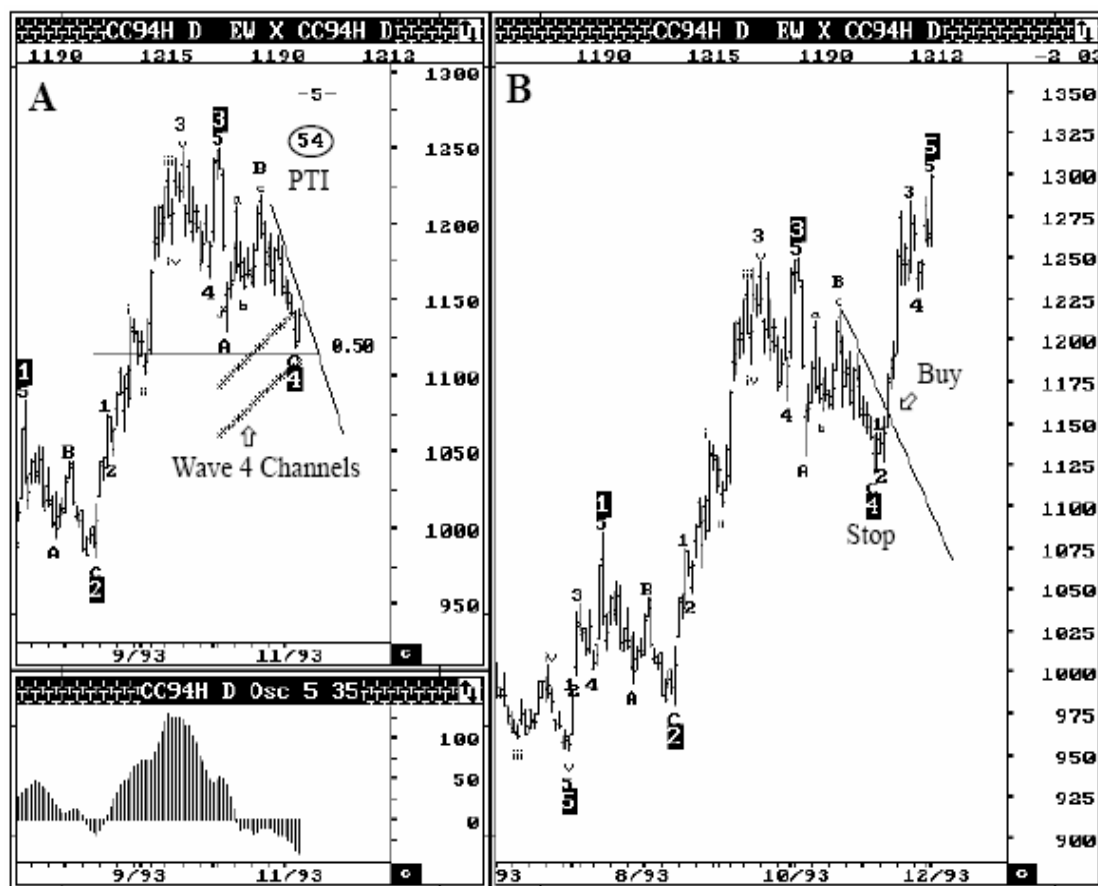
* از DMA برای ورود به پوزیشن Sell استفاده کنید و Stop را بالای High قرار دهید.

* Low موج ۴ام که نزدیک ۵۰ می باشد اولین هدف است. در این زمان می توان Stop مورد نظر را کوچکتر کرد و یا منتظر ماند تا نرم افزار شمارش جدید برای موج ۳ام را در همان مسیر انجام دهد.



بای نوع اول در مارس ۹۴ برای Cocoa

* نمودار A پایان موج نزولی چهارم را نشان می‌دهد. نوسان نمای الیوت نیز به سمت صفر برگشت نموده است و این امر را محتمل تر می‌سازد.
* در اینجا نیز PTI بالاتر از ۳۵ بوده (۵۴) که نشان دهنده پتانسیل خوبی برای ایجاد یک رالی که High جدیدی خواهد ساخت می‌باشد.



* کانال‌های موج چهارم نیز این پتانسیل خوب را برای تشکیل رالی جدید را نشان می‌دهد.

* Buy در محل تقاطع خط ترند با DMA انجام می‌شود و Stop نیز در زیر Low موج ۴ قرار داده می‌شود. هدف اول نیز بالای ۱۲۵۰ می‌باشد. پیش‌بینی نرم افزار به صورت -۵- نشان داده شده است (با خط‌هایی در دو طرف آن).

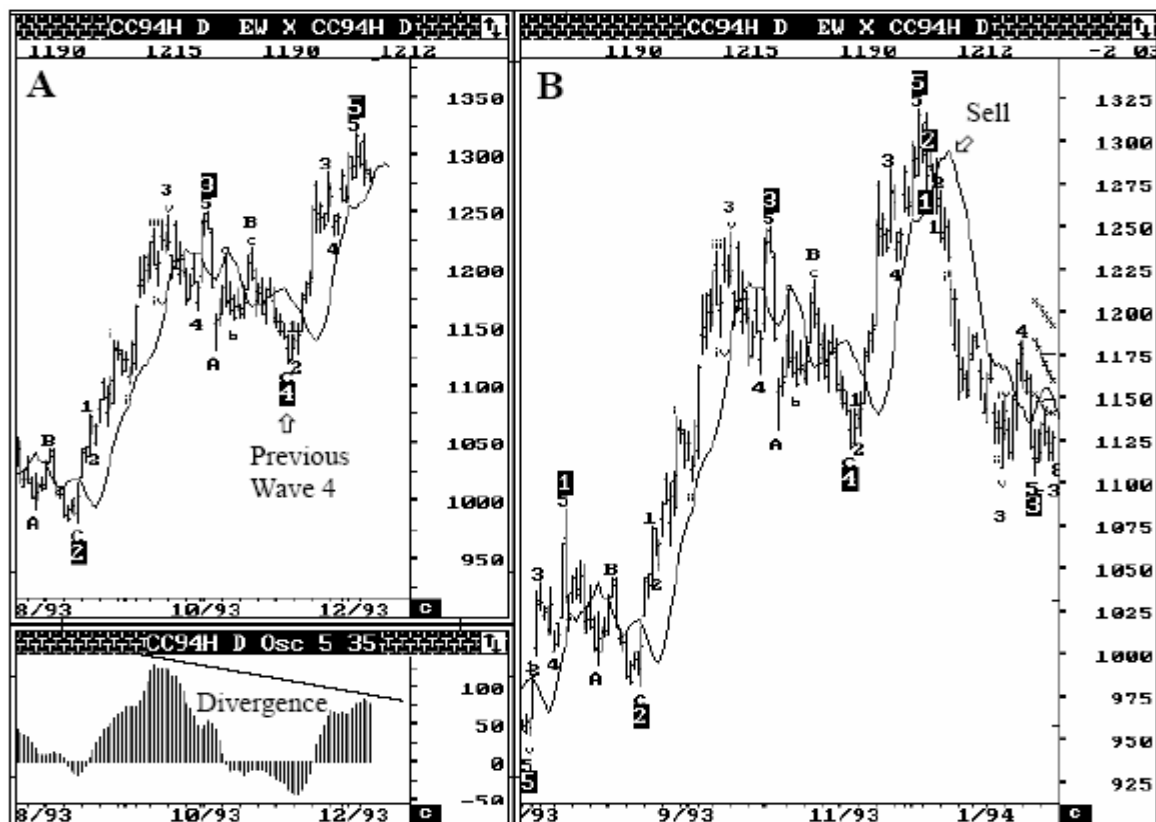
* همچنین Sell نوع دوم نیز آماده اجرا می‌شود (صفحه بعد را ببینید).



سل نوع دوم در مارس ۹۴ برای Cocoa

* نمودار A پایان رالی موج ۵ام را نشان می‌دهد.

* نوسان نمای الیوت نیز دایورجنس واضحی را نشان می‌دهد.



* سل در محل تقاطع خط ترند یا DMA انجام شود و Stop بالای High قرار داده شود.

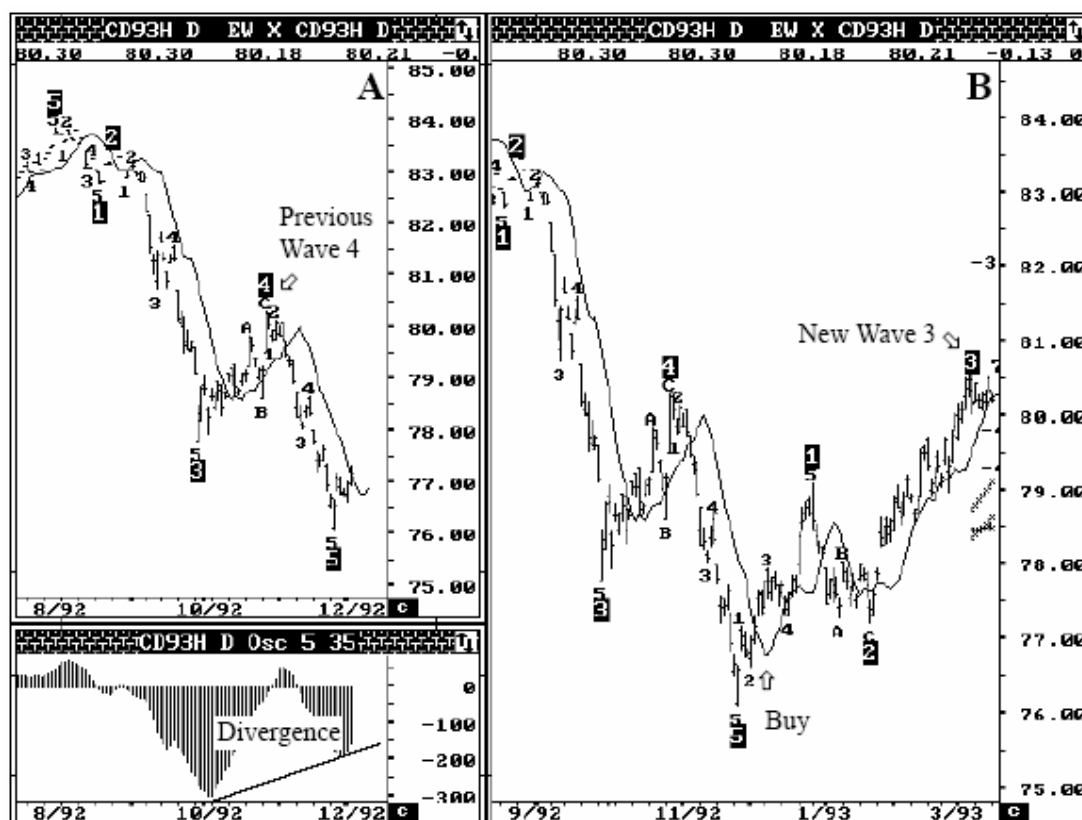
* اولین هدف در نزدیکی موج ۴ام حدود ۱۱۱۰ می‌باشد.

* نمودار B نقطه سل را در ادامه نشان می‌دهد.

بای نوع دوم در مارس ۹۳ برای دلار کانادا

* در نمودار A در مارس ۹۳ موج چهارم برای دلار کانادا پایان یافته است.

* نوسان نمای الیوت نیز دایورجنس واضحی را نشان می دهد.



* بای در محل تقاطع خط ترند یا DMA انجام شود و Stop زیر Low قرار داده شود.

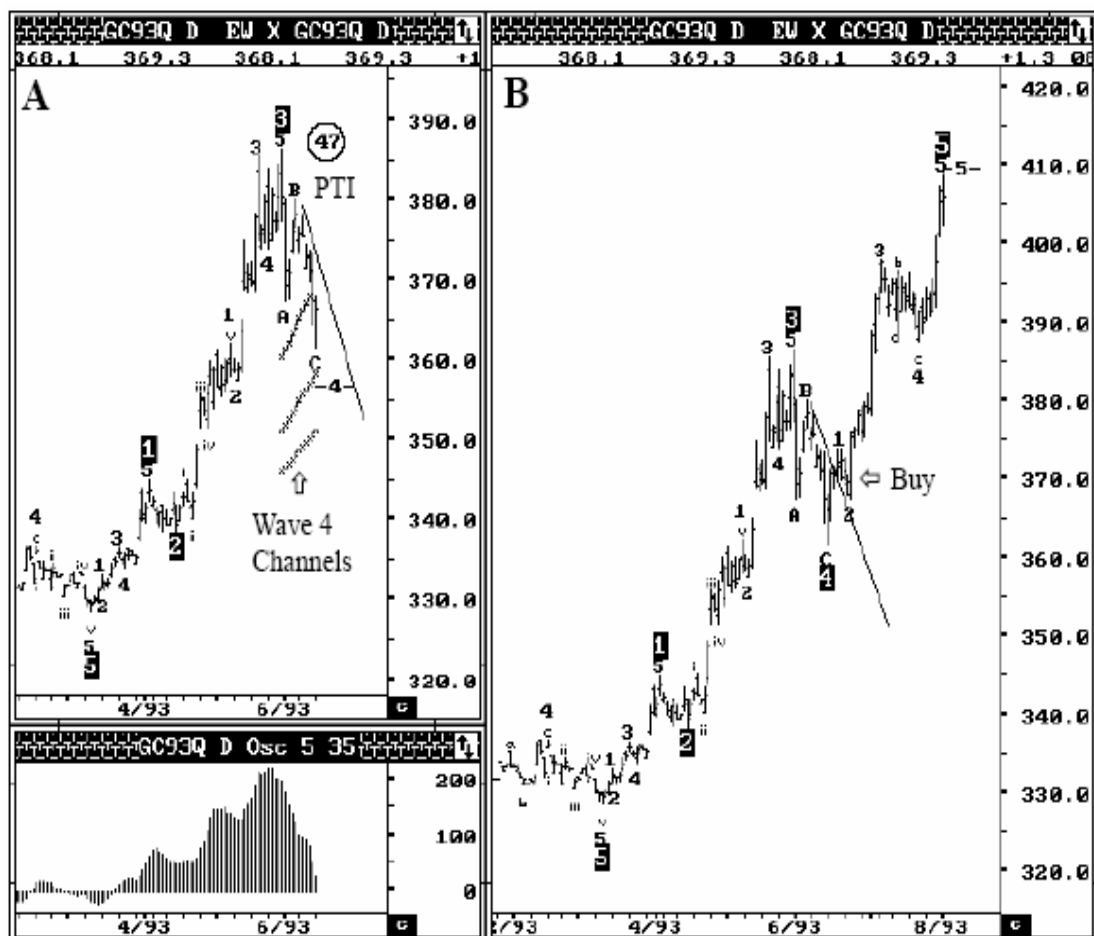
* اولین هدف در نزدیکی موج ۴ام قبلی حدود ۱۱۱۰ می باشد.

* زمانی که قیمت به هدف اول رسید می توان Stop مورد نظر را کوچکتر کرد و منتظر ماند تا نرم افزار شمارش جدید برای موج ۳ام را در همان مسیر انجام دهد.

بای نوع اول در آگوست ۹۳ برای طلا

* نمودار A تکمیل موج ۴م را نشان می‌دهد. نوسان نمای الیوت نیز این امر را تایید می‌کند.

* در اینجا PTI بالاتر از ۳۵ (۴۷) می‌باشد که دلالت بر پتانسیل قوی برای رالی که بتواند High جدیدی بسازد می‌باشد.



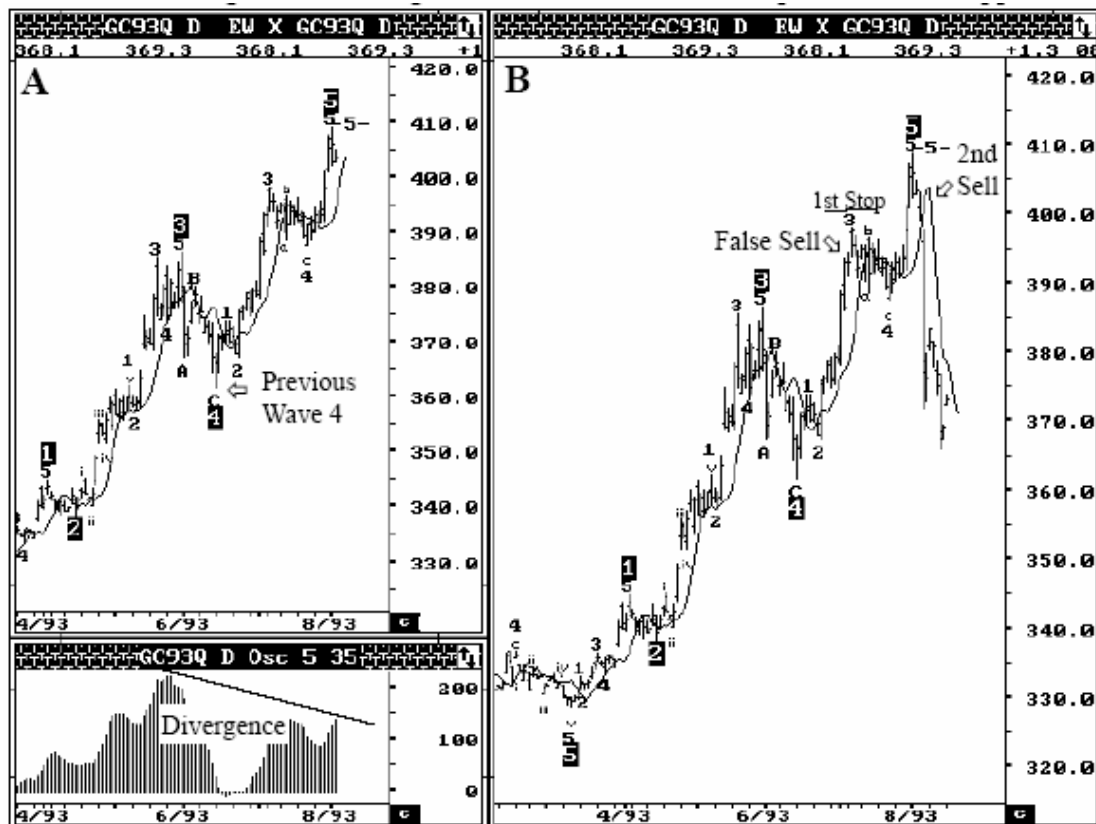
* کانال‌های موج چهارم قیمت‌ها را در این سطح نگه داشته و حمایتی برای رالی بالقوه آن در آینده می‌باشند.

* Buy در محل تقاطع خط ترند با DMA انجام شود و Stop زیر Low موج چهارم قرار داده شود. اولین هدف در بالای سطح ۳۹۰ می‌باشد.

* این موارد معمولا Sell نوع دوم را نیز به همراه دارند (به صفحه بعدی نگاه کنید).

سل نوع دوم در آگوست ۹۳ برای طلا (با یک سیگنال خطا)

* نمودار A تکمیل موج ۴م را نشان می‌دهد که نوسان نمای الیوت نیز دایورجنس واضحی را نشان می‌دهد.
* Buy در محل تقاطع خط ترند با DMA انجام شود و Stop بالای High موج چهارم قرار داده شود. اولین سیگنال خطا بوده و پوزیشن فوق Stop خورده است.



* سیگنال Sell دوم ما را وارد یک روند نزولی کرد. هدف اول در Low موج چهارم در نزدیکی ۳۶۰ می‌باشد.
* سیگنال Sell اول سیگنال خطا بود. این مساله بعلت یک تقسیم کوچک یا گسترش موج ۵ام بود.
* به صفحه بعد نگاه کنید تا نشان دهد چگونه سیگنال خطایی که بعلت تقسیم موج ۵ام ایجاد شده کنترل شود.

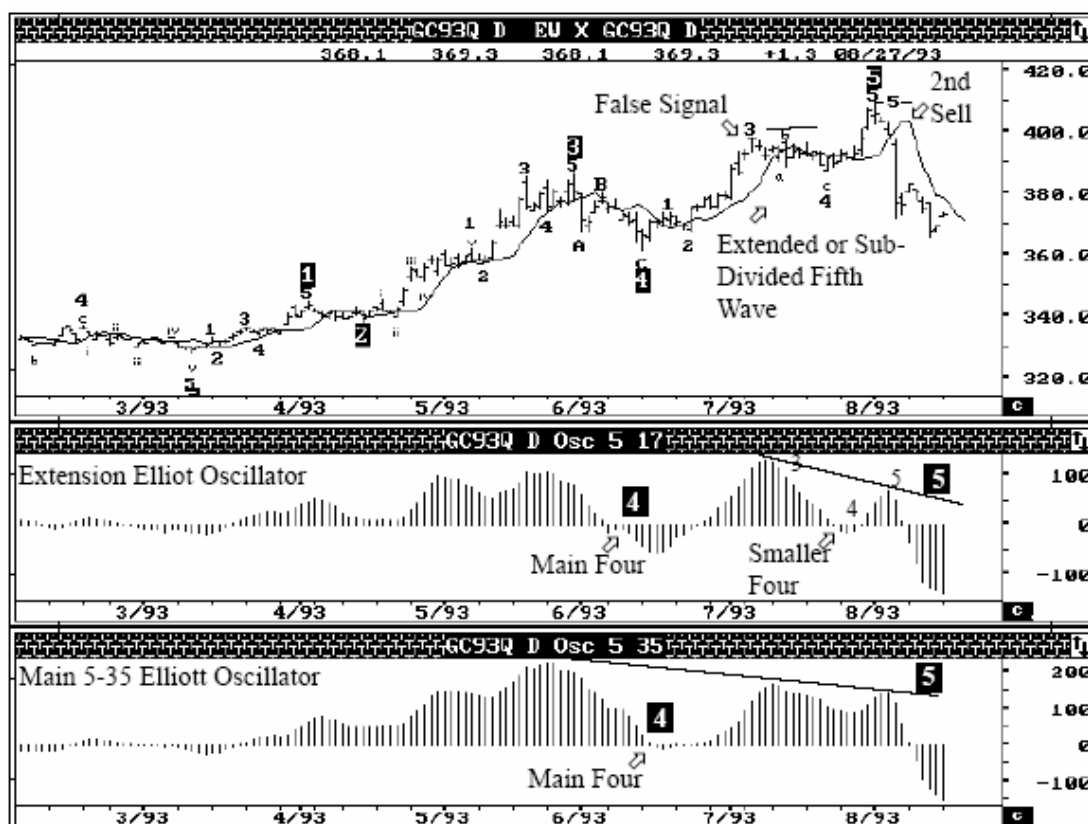


کنترل سیگنال خطای نوع دوم

(که بعلت یک تقسیم کوچک یا گسترش موج ۵ام ایجاد شده است.)

* نوسان نمای الیوت معمولی یا اصلی (Tom's ۵-۳۵) درجه بالاتر از موج ۵ام را نشان می دهد.

* زمانی که موج ۵ام گسترش می یابد یا به زیر موج هایی تقسیم می شود، سیگنال خطای سل اول ایجاد می شود.



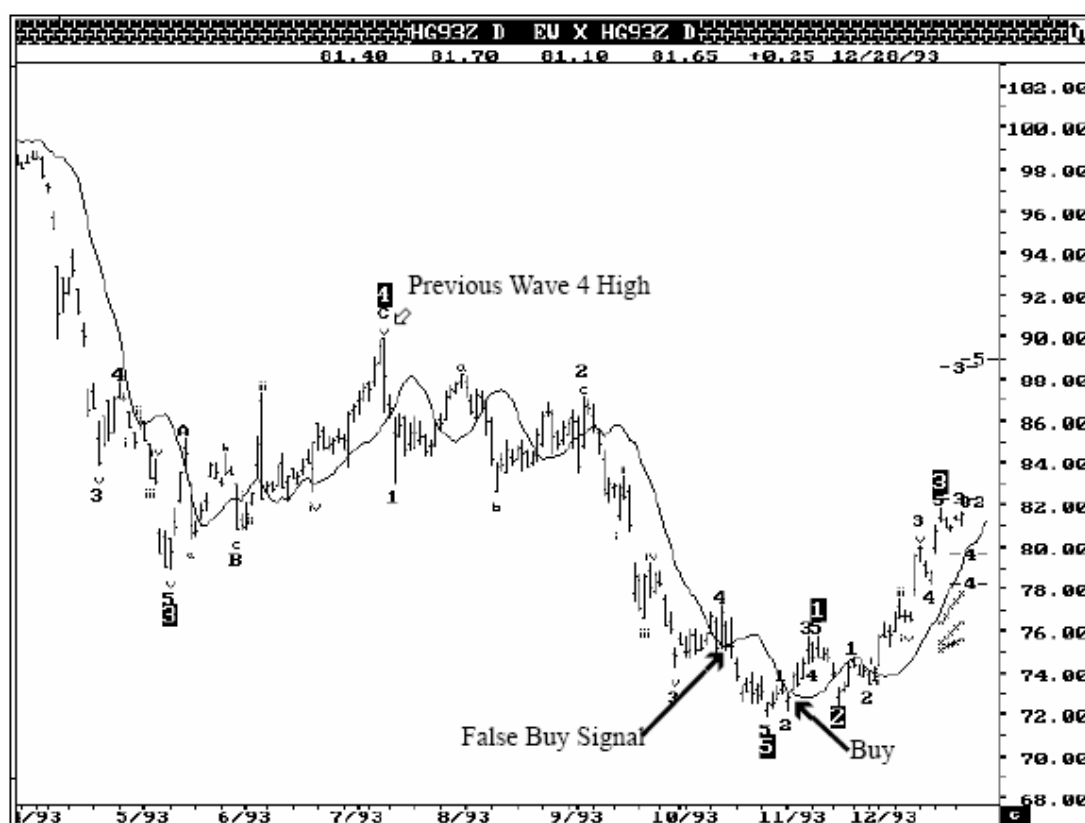
* زمانی که شما به سیگنال خطایی که بعلت گسترش یا تقسیم موج ۵ام به زیر موج ها ایجاد می شود بر می خورید از نوسان نمای الیوت گسترش یافته (نوسان نمای گسترش یافته Tom's ۵-۱۷) برای دیدن دایورجنس در زیر موج های آن استفاده کنید.

* راه دیگر این است که قبل از گرفتن پوزیشن مجدد منتظر بمانید تا نرم افزار این محل را نشان دهد. این محل به صورت -۵- (یک عدد با دو خط در دو طرف) نشان داده می شود.

بای نوع دوم در دسامبر ۹۳ برای مس

(با سیگنال خط بعلت گسترش یا تقسیم موج ۵ام به زیر موج‌ها)

* نرم افزار نشان می‌دهد که توالی ۵ موج مس در دسامبر ۹۳ تمام شده است.
* Buy در محل تقاطع خط ترند با DMA انجام شود و Stop زیر Low موج چهارم قرار داده شود.



* اولین سیگنال خطا بود و پوزیشن فوق Stop خورد.
* سیگنال Buy دوم رالی را ایجاد کرد. حال به High موج ۴ام بعنوان هدف اول توجه کنید.
* اولین سیگنال خطا بود. علت این امر گسترش یا تقسیم موج ۵ام به زیر موج‌ها بود.
* به صفحه بعد نگاه کنید تا نشان دهد چگونه سیگنال خطایی که بعلت تقسیم موج ۵ام ایجاد شده کنترل شود.

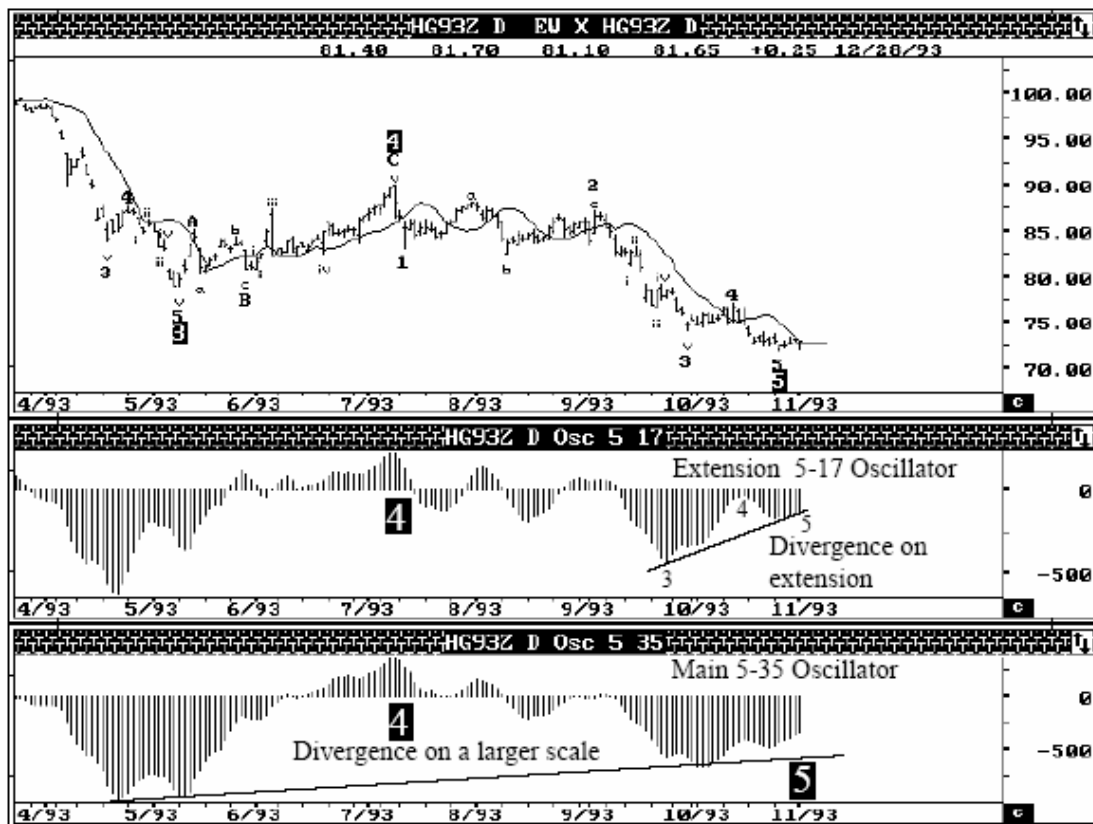


کنترل سیگنال خطای نوع دوم

(که بعلت یک تقسیم کوچک یا گسترش موج ۵ام ایجاد شده است.)

* نوسان نمای الیوت معمولی یا اصلی (Tom's ۵-۳۵) درجه بالاتر از موج ۵ام را نشان می دهد.

* زمانی که موج ۵ام گسترش می یابد یا به زیر موج هایی تقسیم می شود، سیگنال خطای Sell اول ایجاد می شود.



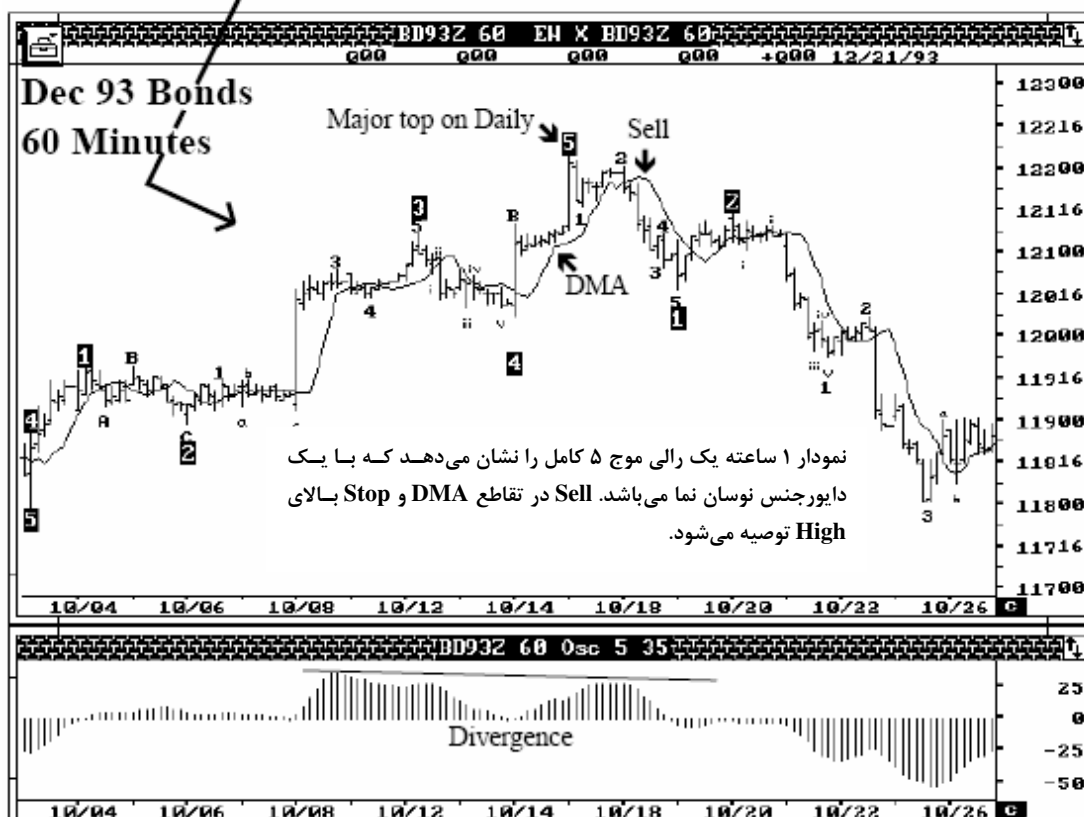
* زمانی که شما به سیگنال خطایی که بعلت گسترش یا تقسیم موج ۵ام به زیر موج ها ایجاد می شود بر می خورید از نوسان نمای الیوت گسترش یافته (نوسان نمای گسترش یافته Tom's ۵-۱۷) برای دیدن دایورجنس در زیر موج های آن استفاده کنید.

* نوسان نمای گسترش یافته (۵-۱۷) به کاربر امکان می دهد که گسترش یا تقسیم موج ۵ام به زیر موج ها را کنترل کند.

قدرت نمودارهای ۱ ساعته

نمودار روزانه Bonds در دسامبر ۹۳ یک Top اصلی را در حوالی ۱۲۲/۱۰ تکمیل کرده است. نمودار ۱ ساعته همان روز را در زیر نشان داده است.

از نمودار ۱ ساعته استفاده کنید. همان طور که می بینید یک نقطه ورود برای پوزیشن سل در حوالی ۱۲۱/۲۴ در همه زمان ها وجود دارد. زمانی که شماره گذاری امواج الیوت در نمودار روزانه مشخص نیست، نمودار ۱ ساعته نتایج بهتری را ارائه می کند و نقاط ورود و خروج عالی را نشان می دهد.

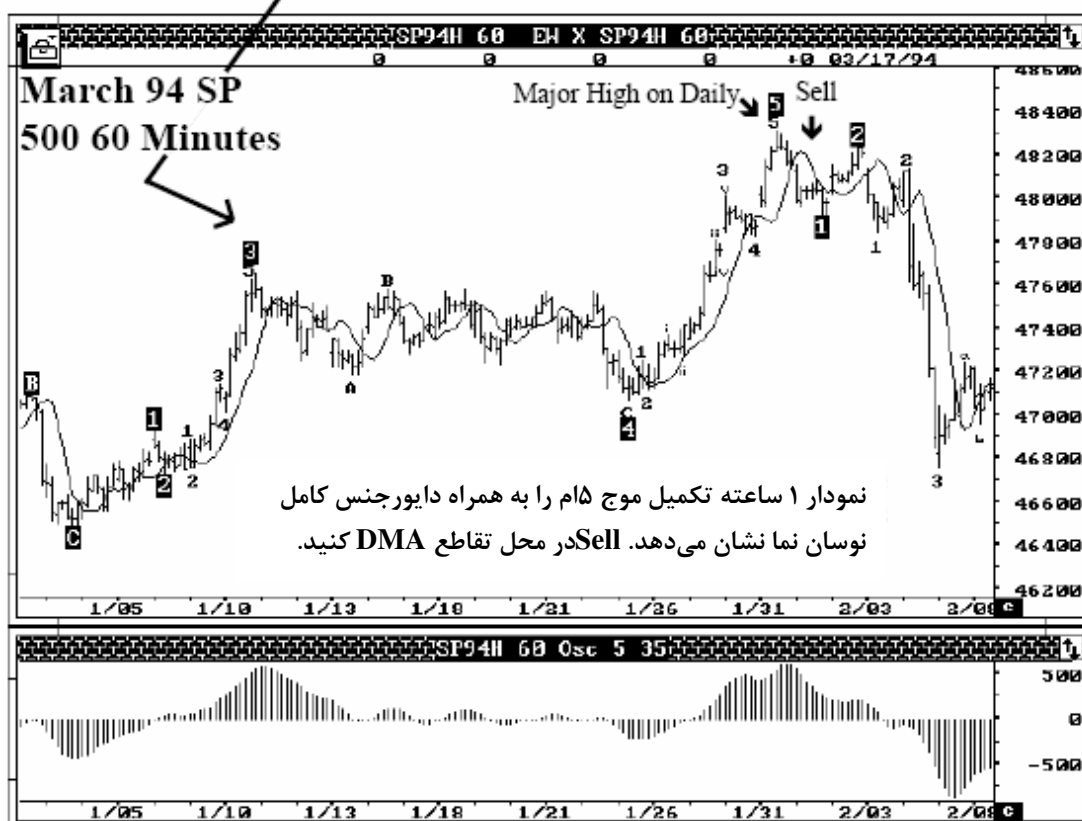


مارس ۹۴ برای SP ۵۰۰

در نمودار روزانه SP ۵۰۰ نشان داده شده است که High موج ۵ام کامل شده است.
نمودار ۱ ساعته یک موج ۵ام را نشان می‌دهد که کامل شده است.



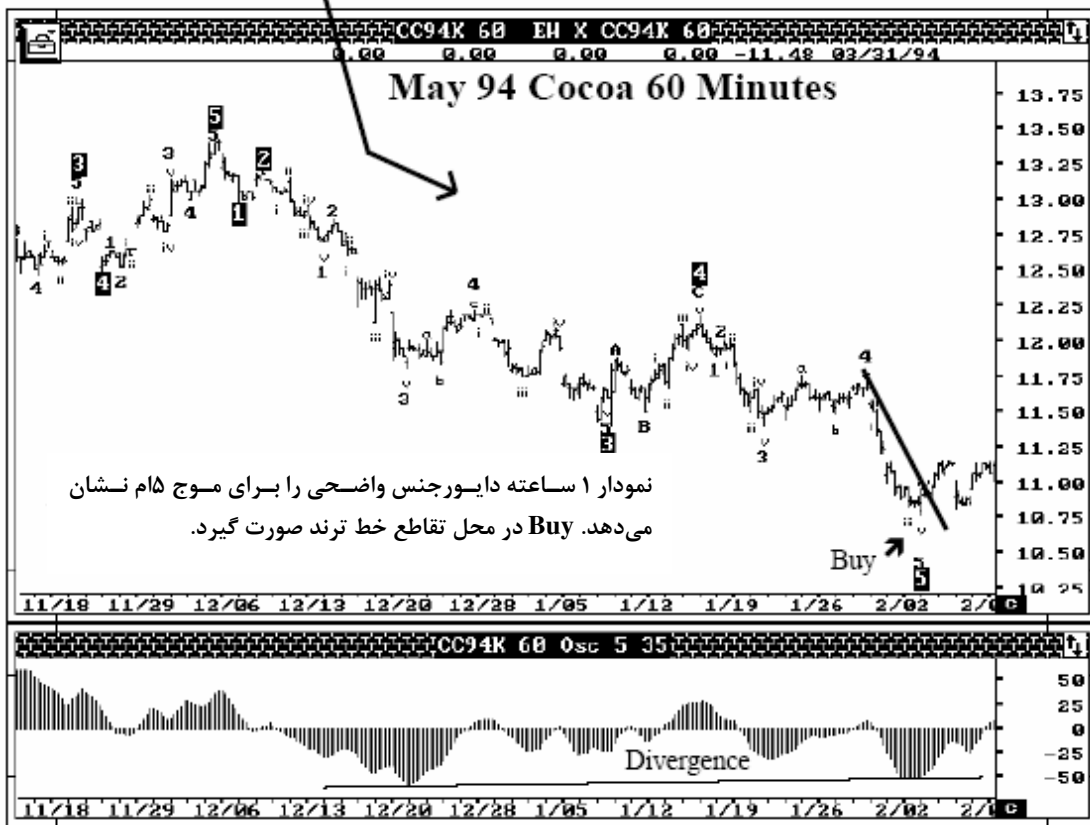
می‌توان وارد یک پوزیشن Sell در نقطه ۴۸۰۸۰ شد و این کار فقط کمی بعد از اتمام آن در زمان‌های دیگر صورت می‌گیرد (مترجم: زمان‌های بالاتر از ۱ ساعته)



مارس ۹۴ برای Cocoa - قدرت نمودارهای ۱ ساعته



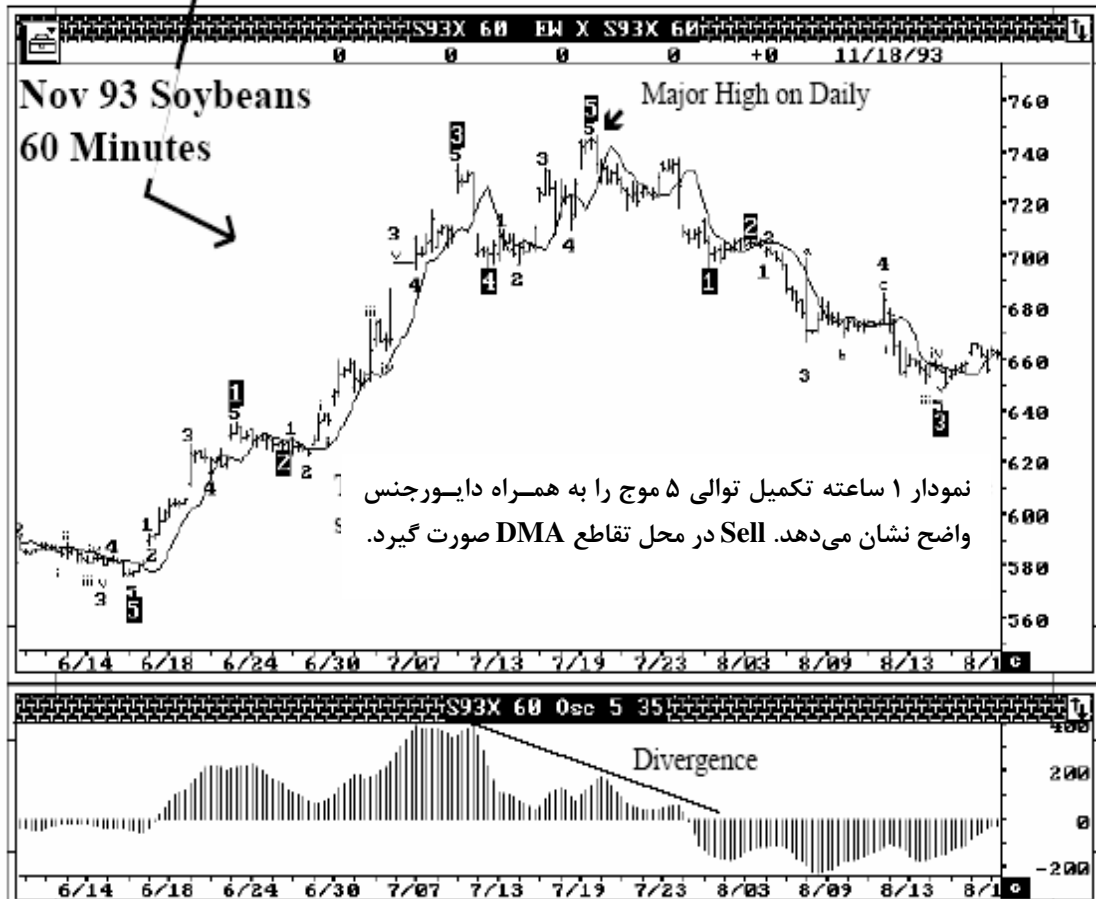
نمودار ۱ ساعته تکمیل توالی ۵ موج را نشان می‌دهد. نمودار روزانه خیلی واضح نیست. نمودار ۱ ساعته می‌تواند ورود به یک پوزیشن Buy را چند میله بعد از اتمام Low نشان دهد.



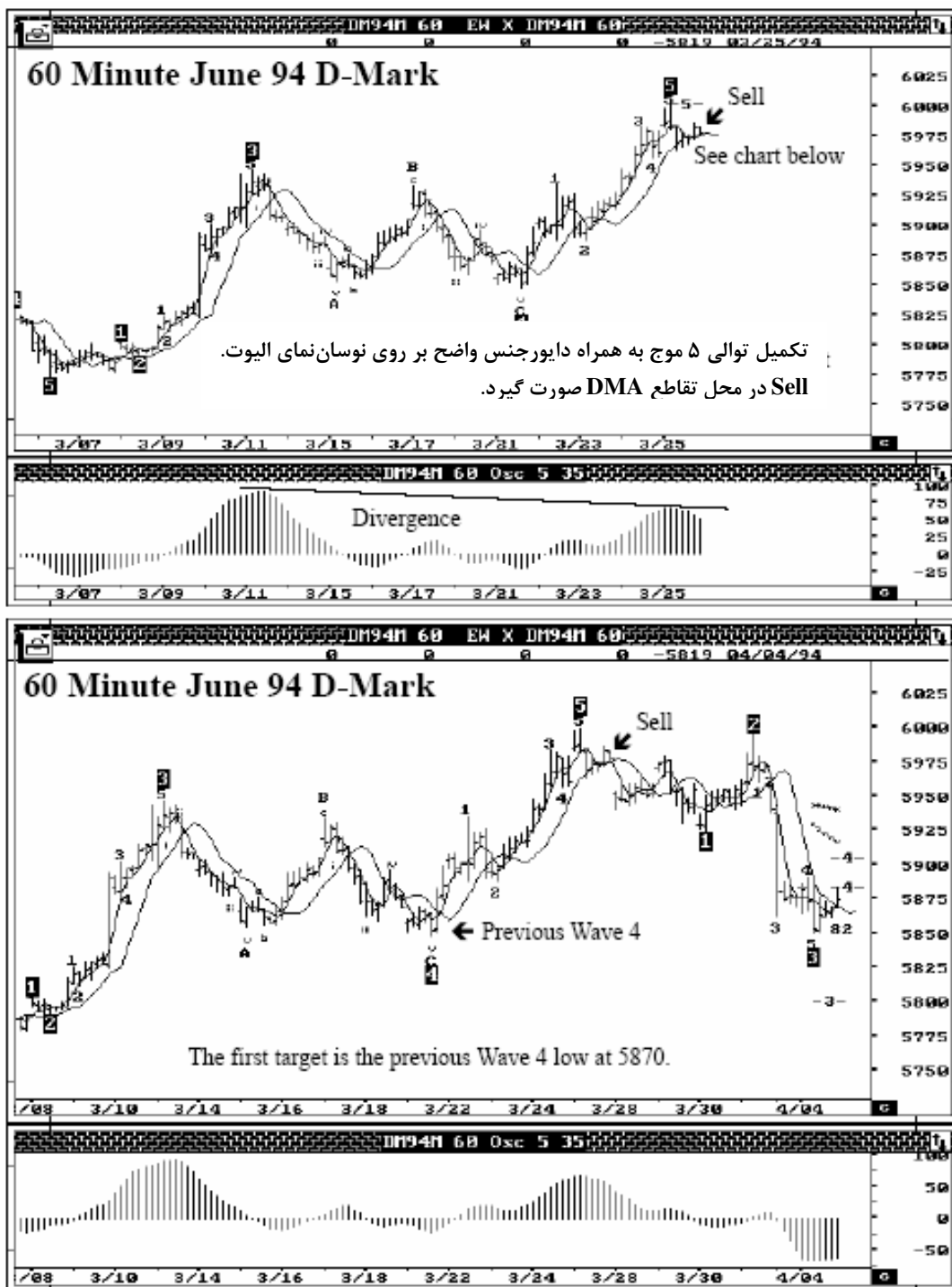
نمودار Soybeans در نوامبر ۹۳



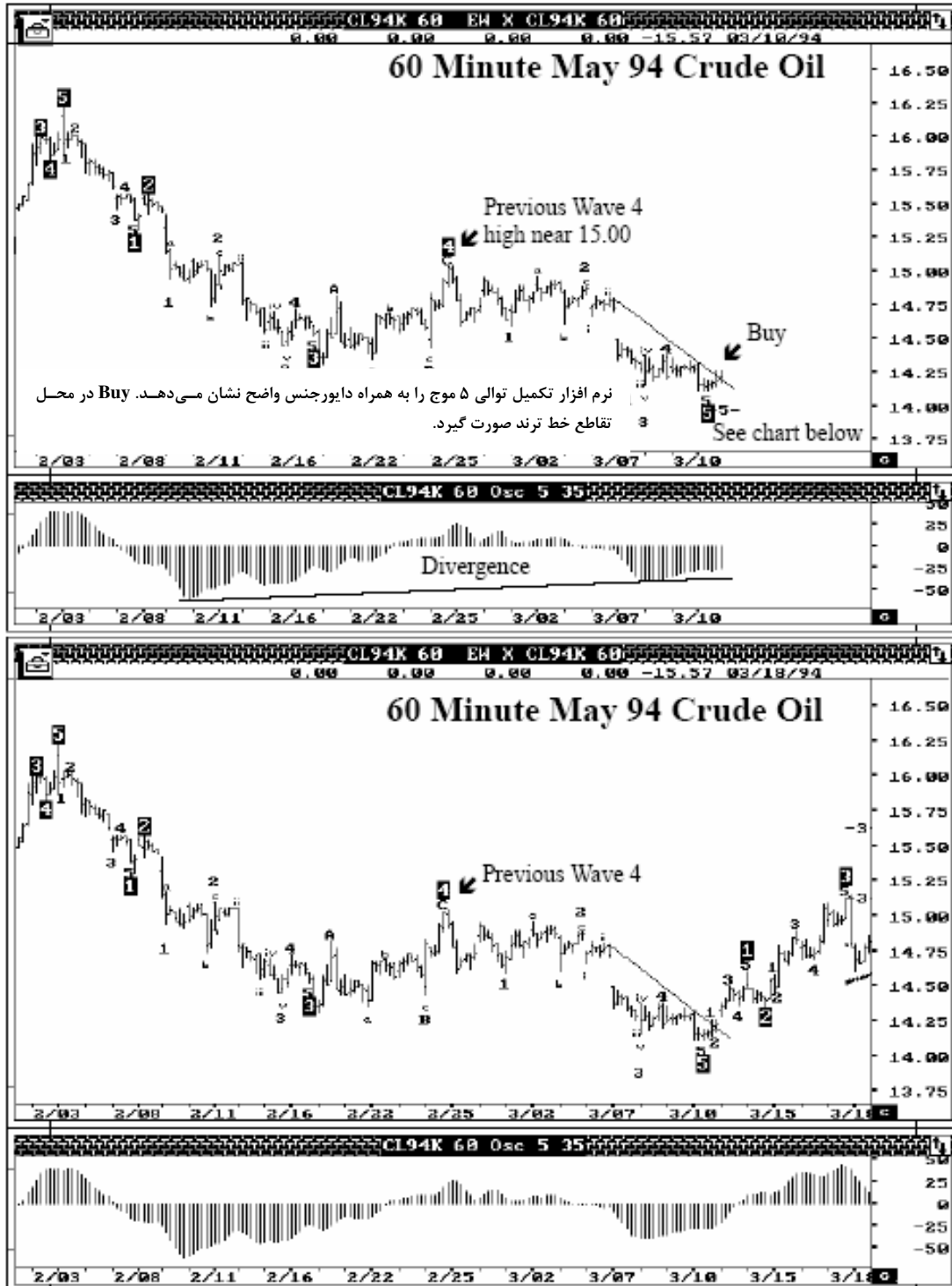
در نمودار روزانه یک High اصلی ایجاد شده است. در نمودار ۱ ساعته توالی ۵ موج کامل شده است. می توان وارد یک پوزیشن Sell در ۷۳۰ شد که چند سنت پایین تر از High اصلی است.



نوع دوم ژوئن ۹۴ برای DM – نمودار ۱ ساعته



نوع دوم می ۹۴ برای Crude Oil - نمودار ۱ ساعته



نمودارهای ۱ ساعته برای Cocoa مارس ۹۴

* نمودار تکمیل توالی ۵ موج را برای Cocoa در می ۹۴ نشان می دهد.

*نوسان نمای الیوت نیز دایورجنس واضحی را بین High موج سوم و پنجم نشان می دهد.



* Sell در محل تقاطع خط ترند انجام شود و Stop بالای High قرار گیرد.

* Low موج ۴م قبلی به عنوان هدف اول می باشد (۱۱/۵۰).

* زمانی که قیمت به این هدف می رسد Stop را کوچک کرده و منتظر می مانیم تا نرم افزار موج ۳ جدید را در مسیر نام گذاری کند.

نمودار ۱ ساعته طلا در ژوئن ۹۴

- * نرم افزار High جدیدی را در موج ۵ام شماره گذاری کرده است.
- * نوسان نمای الیوت دایورجنس واضحی را بین موج ۳ام و ۵ام نشان می دهد.



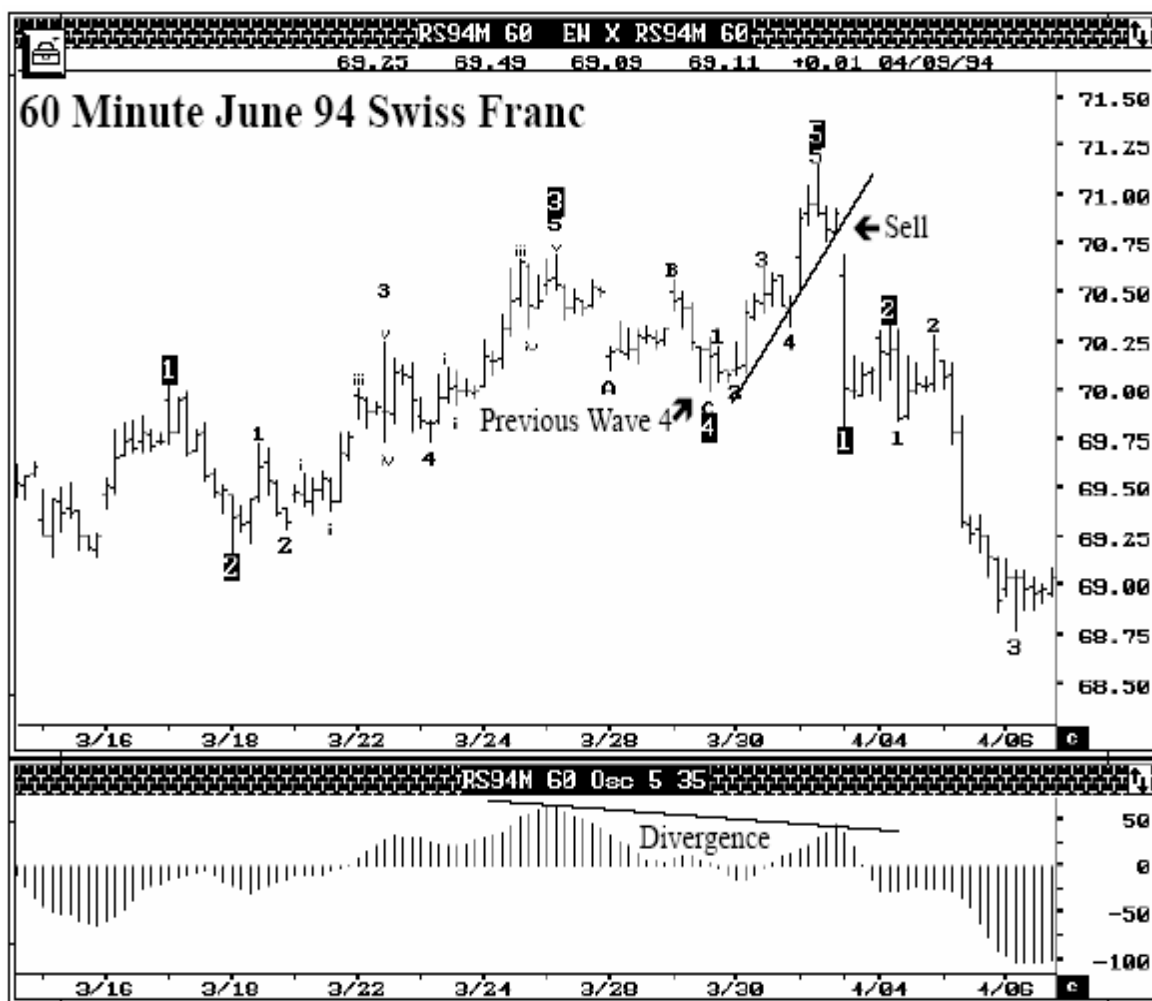
* در محل تقاطع خط ترند Sell کنید و Stop را بالای High قرار دهید.

* حالا به Low موج ۴ قبلی توجه کنید که اولین هدف می باشد که نزدیک ۳۸۶۰ است.

نمودار ۱ ساعته فرانک سوئیس در ژوئن ۹۴

* نرم افزار نشان می دهد که در نمودار ۱ ساعته ۵ موج کامل شده است.

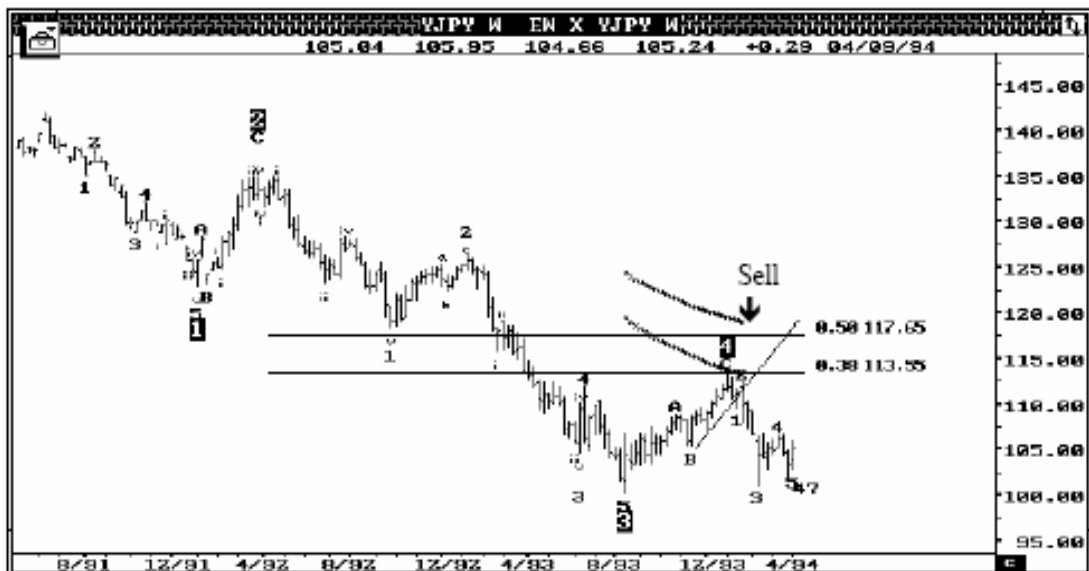
* نوسان نمای الیوت دایورجنس واضحی را بین موج ۳ام و ۵ام نشان می دهد.



* در محل تقاطع خط ترند Sell کنید و Stop را بالای High قرار دهید.

* حالا به Low موج ۴ قبلی توجه کنید که اولین هدف می باشد که نزدیک ۶۹۹۰ است.

شمارش امواج ایوت در نمودار هفتگی بین



نمودار هفتگی فرانک سوئیس - سقف دوقلو

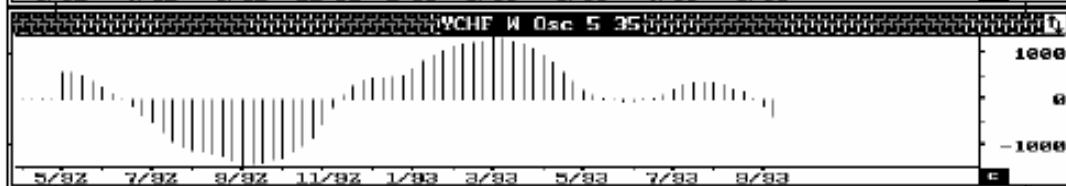
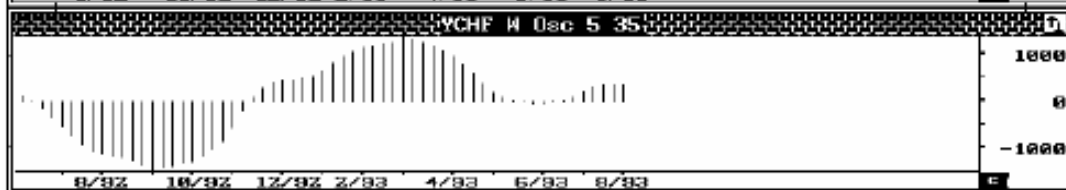
ما نگاه دقیقی به موج ۴ خواهیم داشت و انتظار PTI را داریم. زمانی که PTI زیر ۳۵ باشد احتمال تشکیل سقف دوقلو افزایش می‌یابد.



در اینجا PTI دلالت بر وجود پتانسیل برای تشکیل سقف دوقلو می‌باشد. بازار همچنین کانال‌های موج ۴ را شکسته‌اند.

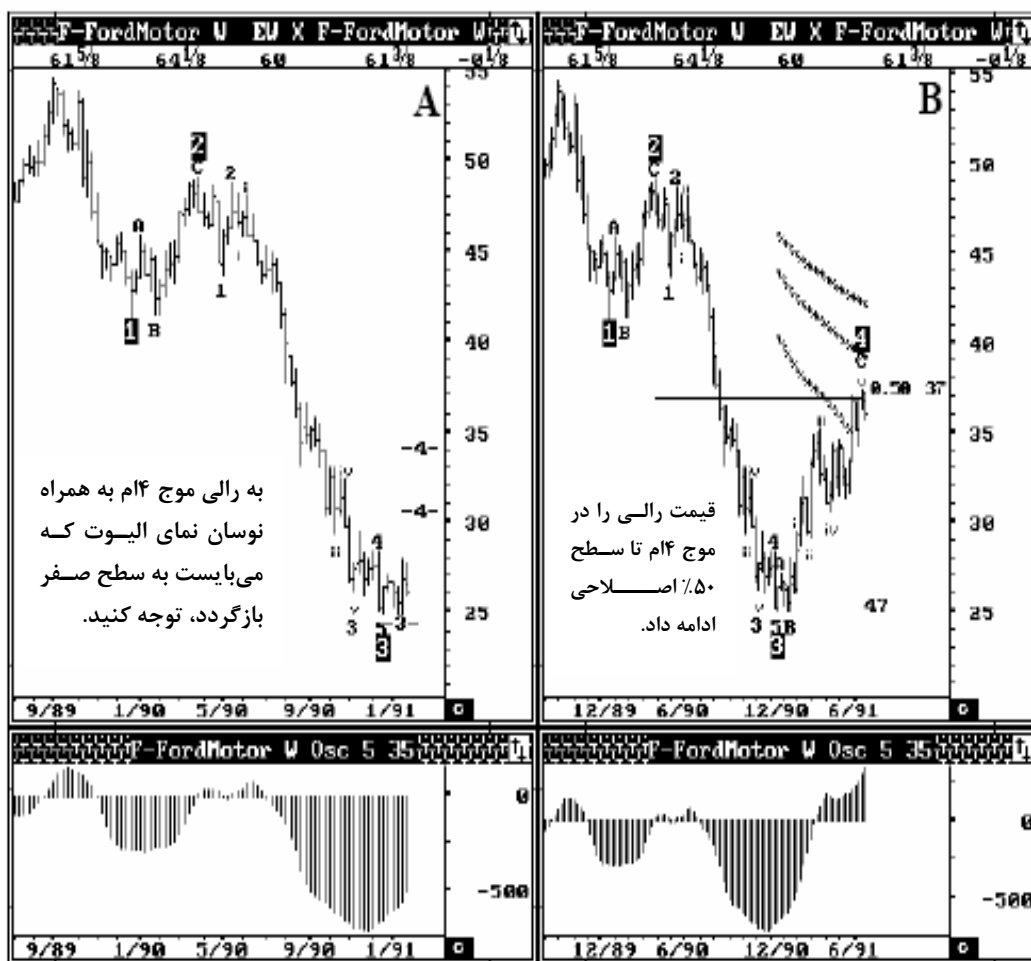
به صفحه بعد برای ادامه روند نگاه کنید.

نمودار هفتگی فرانک سوئیس - سقف دوقلو



بررسی سل نوع اول بر روی نمودار هفتگی Ford Motor

* نمودار A نمودار هفتگی Ford Motor را نشان می‌دهد که موج نزولی ۳ام کامل شده است. فاز بعدی رالی موج ۴ام می‌باشد که با برگشت نوسان نمای الیوت به خط صفر همراه است.

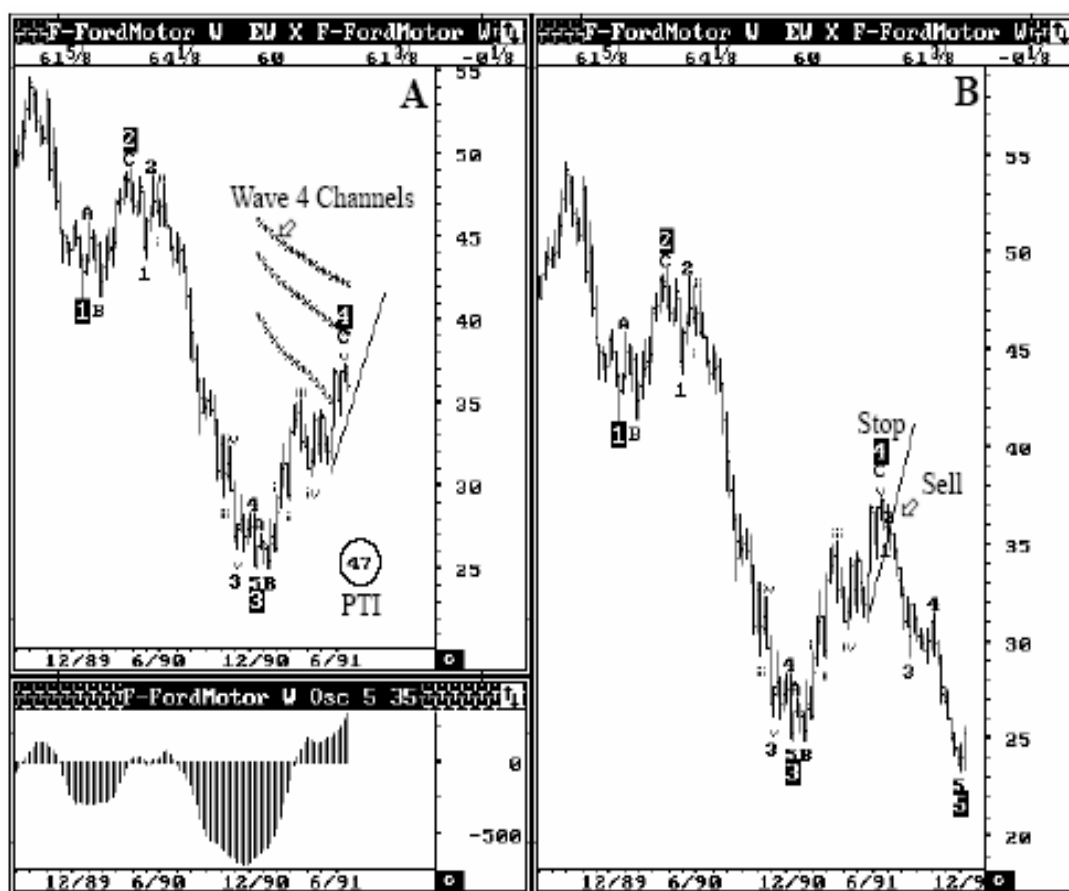


* در نمودار B رالی قیمت به سطوح ۵۰٪ فیبوناچی اصلاحی (Retracement) رسیده است. رسیدن نوسان نمای الیوت به سطح صفر دلالت بر رهایی از شرایط بیش فروش می‌باشد. به صفحه بعدی برای Sell نوع اول توجه کنید.

سل نوع اول بر روی نمودار هفتگی Ford Motor

* نمودار A تکمیل شدن موج ۴ام را نشان داده است. در اینجا PTI از حداقل مورد نیاز که ۳۵ می باشد (۴۷) بیشتر است. این مساله نشان می دهد که موج ۵ جدید در راه است.

* کانال های موج چهارم نشان می دهد که پتانسیل مناسبی برای یک موج چهارم نزولی سریع وجود دارد.



* در محل تقاطع خط ترند Sell کنید و Stop را بالای High موج ۴ام قرار دهید. هدف اولین Low در زیر ۲۵ می باشد.

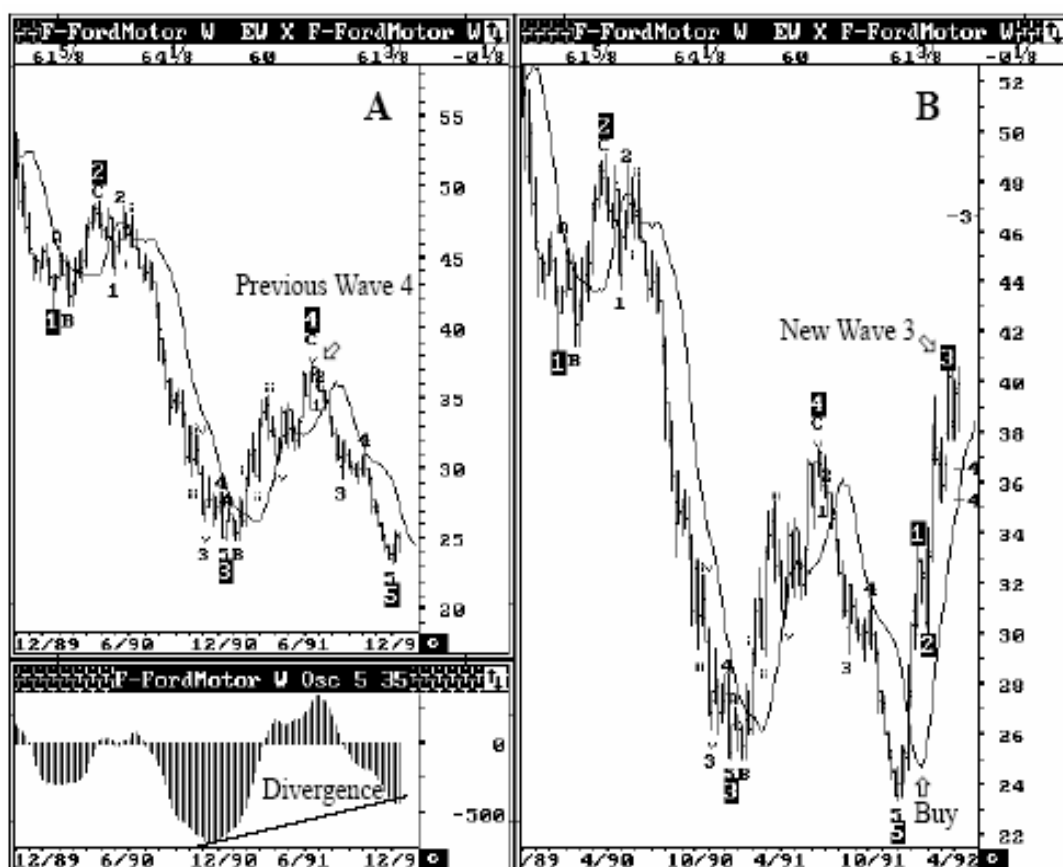
* نمودار B محل Sell را در موج ۵ام نشان می دهد.

* این حالت معمولا به یک Buy نوع دوم ختم می شود. به صفحه بعد برای دیدن ادامه روند نگاه کنید.

بای نوع دوم بر روی نمودار هفتگی Ford Motor

* نمودار A شمارش امواج را که بوسیله نرم افزار شماره گذاری شده است را نشان می دهد. توالی ۵ موج به همراه دایورجنس مناسب در نوسان نمای الیوت نشان داده شده است.

* در محل تقاطع DMA می توان Buy انجام داد و Stop آن را زیر Low آن قرار داد.



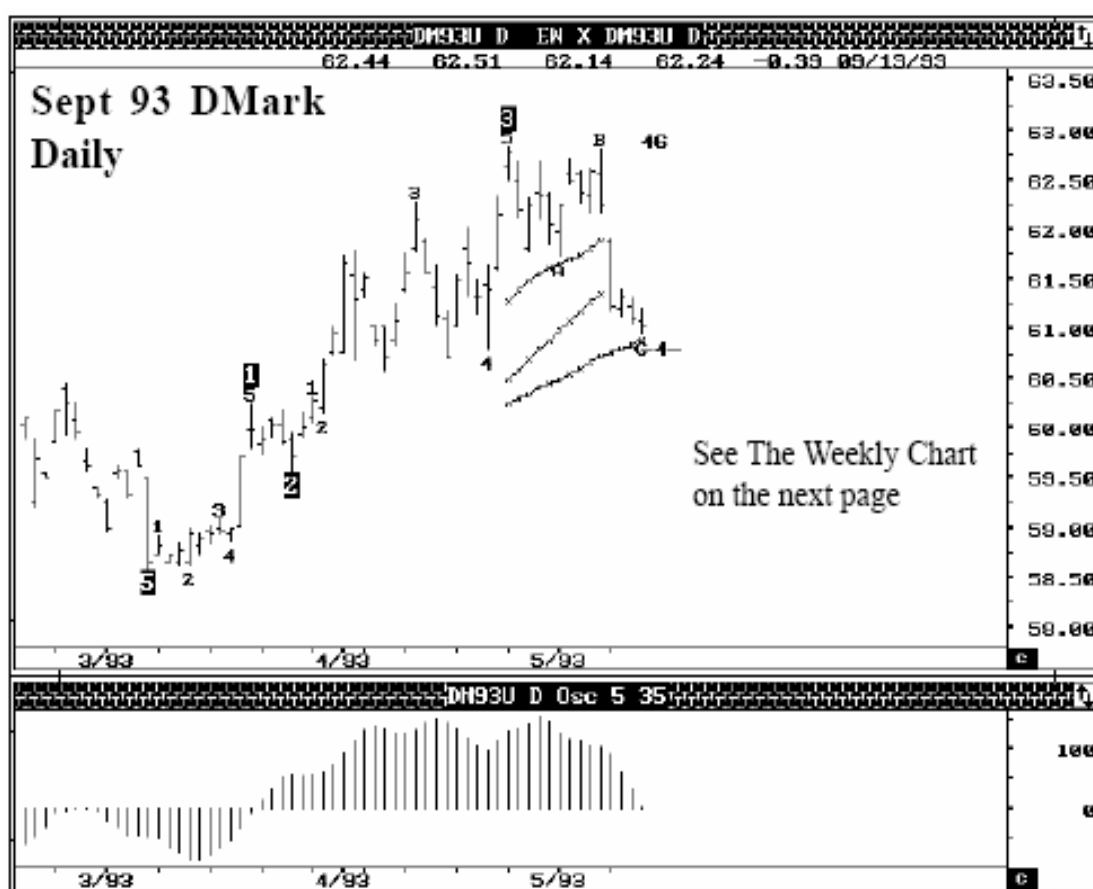
* اولین هدف در High موج ۴م نزدیک ۳۷ می باشد.

* زمانی که قیمت به هدف اول رسید می توان Stop را کوچک کرد و منتظر ماند تا نرم افزار شمارش جدید امواج را انجام دهد و موج سوم را در همان مسیر نام گذاری کند.

ارجاع به اطلاعات هفتگی

* نمودارهایی که در ادامه آمده است نشان دهنده کامل شدن موج ۴ام نزولی برای Dmark در سپتامبر ۹۳ می باشد.

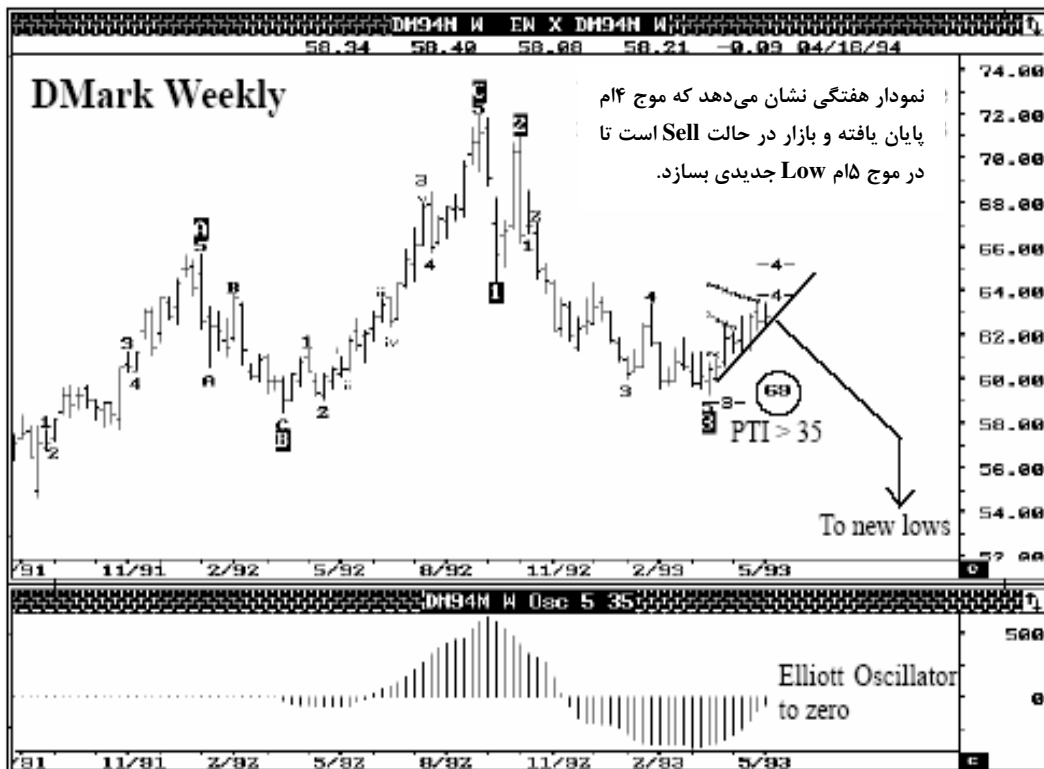
* نوسان نمای الیوت به خط صفر برگشته است و PTI از ۳۵ بزرگتر است (۴۶).



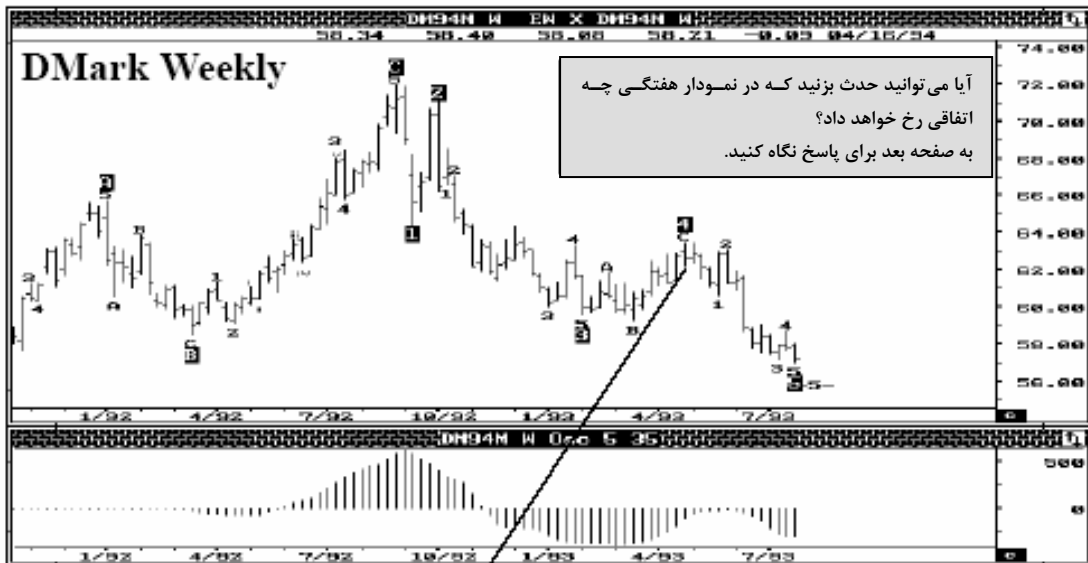
کانال های موج چهارم نیز این مساله را تایید می کنند.
* همه این ها نشان دهنده رالی برای تشکیل یک High جدید است.

* اکنون به نمودار هفتگی در صفحه بعد نگاه کنید.

ارجاع به اطلاعات هفتگی از روزانه



نتیجه ارجاع



توالی حرکت برای Dmark در نمودار هفتگی



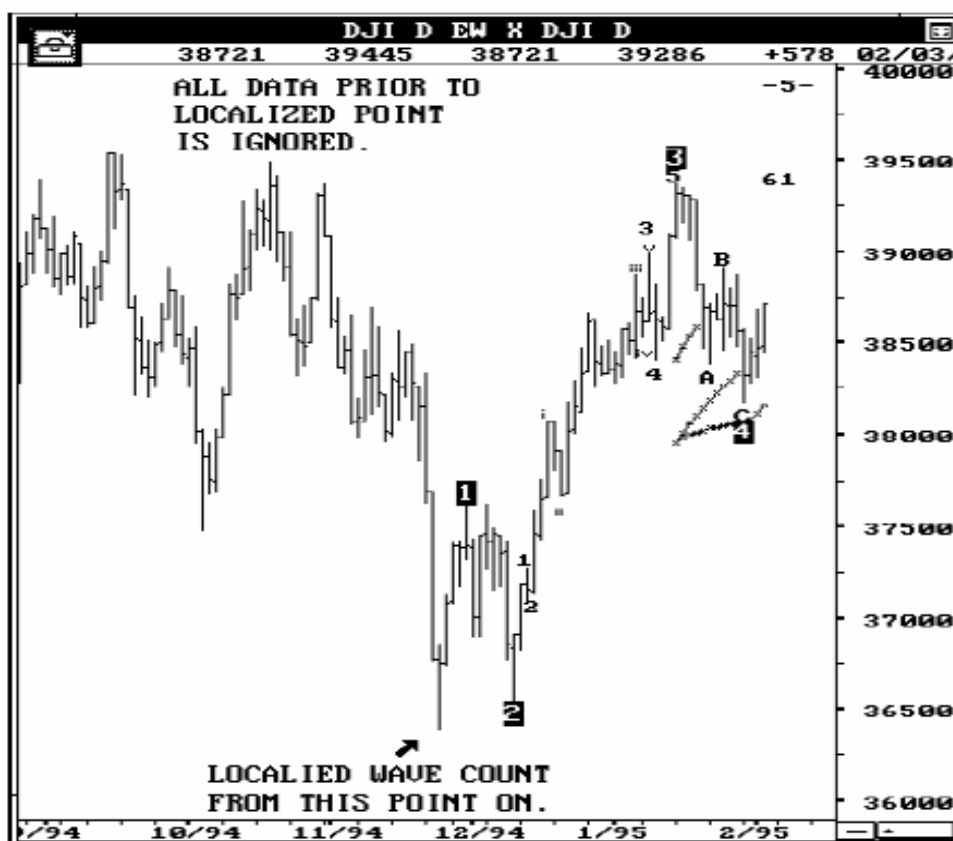
زمانی که توالی ۵ موج کامل شد بازار جهت خود را عوض می کند و به نقطه موج ۴ قبلی می رسد.

آلترناتیوهای آنالیز موج الیوت

شمارش منطقه‌ای موج الیوت

این گزینه به کاربر اجازه می‌دهد که نرم افزار را به گونه‌ای تنظیم کند که شمارش امواج را از نقطه‌ای مشخص روی نمودار آغاز کند. در موارد مطمئن بازار تمایل دارد که Low ایجاد کند و رالی با مومنتوم بالایی این Low را پایان می‌دهد. به هر حال زمانی که نرم افزار اطلاعات ورودی را جهت مشخص کردن شمارش موج به کار می‌برد ممکن است در حالی باشد که منطق نرم افزار حرکت اخیر بازار را در شمارش موج لحاظ نکرده باشد.

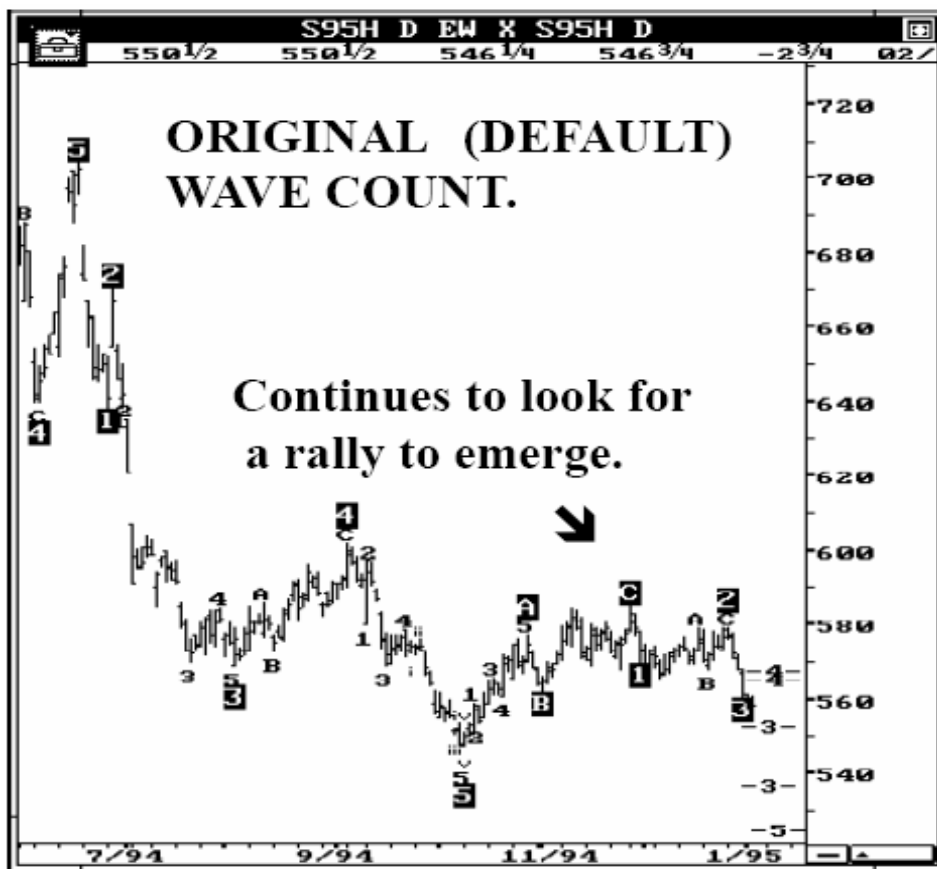
با منطقه‌ای کردن شمارش موج الیوت، نرم افزار می‌تواند اطلاعات گذشته را در نظر نگیرد و فقط اطلاعات را از نقطه‌ای که کاربر مشخص کرده در نظر گرفته و شمارش موج الیوت را انجام دهد.



شمارش آلترناتیو

شمارش موج الیوت از طریق آلترناتیو به کاربر این اجازه را می‌دهد که شمارش موج آلترناتیو را به چند صورت داشته باشد. سه نوع متفاوت شمارش امواج آلترناتیو وجود دارد. در اینجا ما درباره شمارش موج های آلترناتیو مختلف بحث خواهیم کرد. هدف اصلی شمارش امواج آلترناتیو تدارک دیدن این امکان برای کاربر است که در مواقع بحرانی و سخت ایده دومی نیز داشته باشد.

آلترناتیو ۳ (بلند مدت)



زمانی که آنالیزور اصلی امواج توالی یک ۵ موج را شناسایی می‌کند این آنالیزور یک رالی در جهت مخالف را جستجو خواهد کرد که موج چهارم قبلی کمترین هدف قیمتی خواهد بود. حتی اگر رالی فوق قادر نباشد به هدف فوق برسد تا Low موج پنجم اول به پایان برسد نرم افزار بدنبال این الگو خواهد بود. مثالی که در ادامه آمده است نمودار ماه مارس در سال ۹۵ Soyben را با شمارش اصلی موج نشان می‌دهد.



از Low موج ۵ نرم افزار به دنبال یک رالی در جهت مخالف خواهد بود که هدفی در نزدیکی ۶۱۰ (موج چهارم قبلی) خواهد داشت. اگر رالی فوق با قدرت به هدف خود برسد نرم افزار یک رالی موج سوم جدید را خواهد ساخت. تنها راهی که نرم افزار این مسیر را رها خواهد کرد زمانی است که قیمت به طور واقعی یک Low جدید بسازد. سپس این Low جدید یک موج ۵ جدید می‌شود.



آلترناتیو ۳

به طور عادی شمارش بلند مدت تری تدارک می‌بیند که در سمت راست نشان داده شده است.

نموداری که در زیر آمده نشان می‌دهد بازار یک Low جدید ساخته است که توسط آلترناتیوها پیش‌بینی شده بود. در زیر لیست مواردی آمده است که پیشنهاد می‌شود در آن زمان‌ها از شمارش موج بلند مدت ALT۳ استفاده شود.



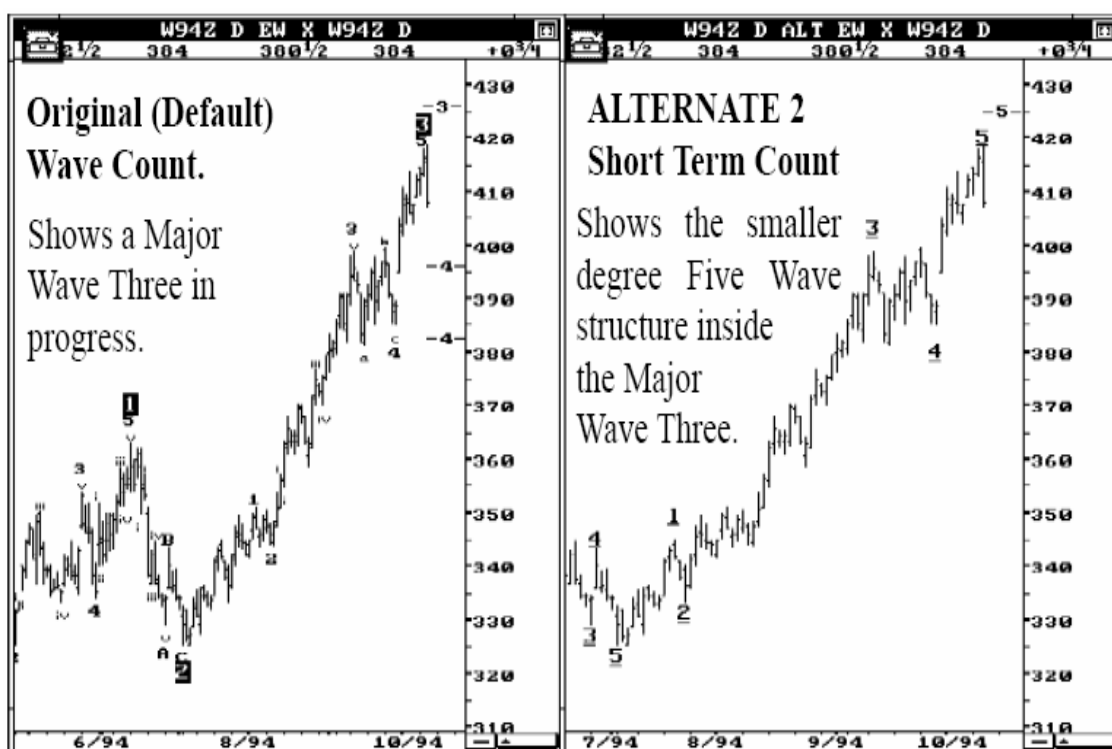
(A) اگر رالی که از توالی یک ۵ موج آغاز می‌شود، قادر نباشد تا یک ۳ موج را در جهت مخالف ایجاد کند ما توصیه می‌کنیم از شمارش موج ۳ ALT استفاده کنید.

(B) اگر مومنتوم بازار به پارامترهای ۳ ATL برسد سپس نرم افزار شمارش موج آلترناتیوی را ایجاد می‌کند که دارای یک نمای بلند مدت است. زمانی که شمارش آلترناتیو اجرا می‌شود کاربر باید با دقت و هوشیاری منتظر یک Low بالقوه جدید باشد.

(C) موارد زیادی وجود دارد که پارامترها به نقطه مورد نظر نمی‌رسند و شمارش امواج ۳ ALT مشابه شمارش امواج از قبل تعیین شده می‌باشد. در این موارد کاربر باید از شمارش اصلی موج استفاده کند.

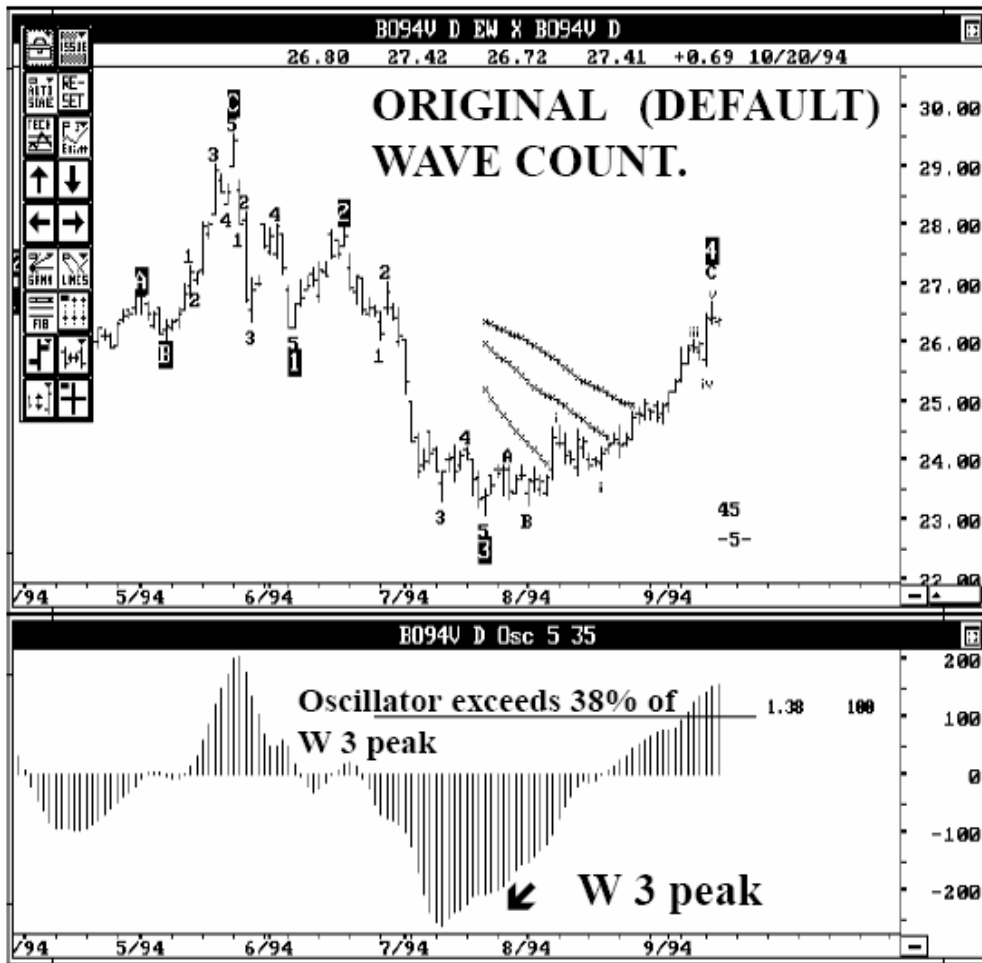
آلترناتیو ۲ (کوتاه مدت)

این آلترناتیو یک نمای کوتاه مدت از شمارش اصلی را نشان می‌دهد. برای مثال زمانی که یک رالی موج اصلی در شمارش اصلی وجود دارد ۲ ALT می‌تواند ۵ موج را در داخل موج سوم اصلی را نشان دهد. این امر برای کسب سود در پایان موج ۳ اصلی به کار می‌رود.



آلترناتیو ۱ (تهاجمی)

تا زمانی آنالیزور اصلی موج ها در موج چهارم باقی می ماند که موج چهارم با موج اول ۱۷٪ در مورد بازار کالاها هم پوشانی داشته باشد. (در ایندکس و سهام ۵٪) در موارد زیادی حتی زمانی که PTI به حد بسیار پایین افت می کند و بیش از ۳۸٪ از موج سوم نوسان نما اصلاح می یابد نرم افزار هنوز بر مبنای شماره گذاری قبلی باقی می ماند.



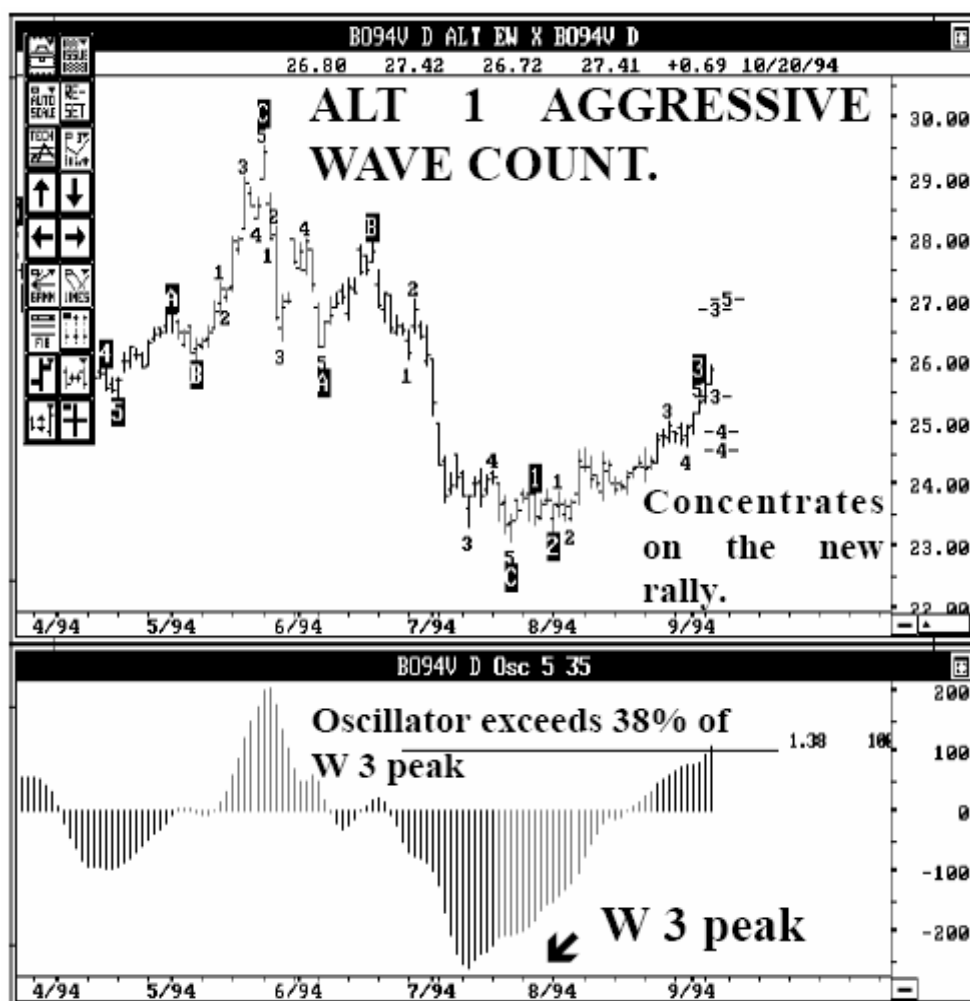
نمودار بالا مربوط به ماه اکتبر Beanoil با شماره گذاری موج اصلی است. همان طور که می بینید کانال های موج چهارم شکسته شده اند و رالی موج اول را گرفته است و از همه مهمتر اینکه نوسان نما بیش از ۳۸٪ در جهت مخالف اصلاح یافته است.
ولی هنوز نرم افزار شماره گذاری قبلی را ادامه می دهد. که متأسفانه این مساله قابل قبول نیست.

آلترناتیو ۱ برای پایان دادن به این موج چهارم طول کشیده طراحی شده است و این موج را تبدیل به یک موج سوم در خلاف جهت می‌کند. **استفاده از ALT۱ در موارد زیر توصیه می‌شود.**

(A) در بعضی رالی‌ها که موج چهارم بوسیله شمارش موج اصلی نام گذاری شده است و این شماره گذاری به دلایل زیر دچار تردید می‌شود که شامل زمانی است که این موج توسط کانال‌های موج چهارم شکسته شده و نوسان‌ناپذیر از ۳۸٪ در جهت مخالف بیک موج سوم حرکت کرده است.

(B) همچنین این شرایط در ۶۵٪ از موارد با یک PTI زیر ۳۵ همراه می‌شود. **در این گونه شرایط ما توصیه می‌کنیم از ALT۱ به عنوان آلترناتیو یا یک ایده دوم استفاده کنید. صفحه بعد مثال‌ها را نشان می‌دهد.**

آلترناتیو ۱ (تهاجمی)



نموداری که در زیر آمده نشان دهنده شمارش امواج آلترناتیو ۱ در مورد نمودار اکتبر Bean Oil است. **در اینجا نرم افزار موج نزولی را تمت عنوان ABC میدهد** شماره گذاری کرده است. **منطق نرم افزار ایده ۵ موج نزولی را باطل کرده و به جای آن مرحله رالی جدیدی را قرار داد.**

لطفاً این مساله را در ذهن داشته باشید که شمارش (ALT) فقط زمانی مورد استفاده قرار می گیرد که بازگشت نوسان نما بیش از ۳۸٪ پیک موج سوم اصلی را در جهت مخالف داشته باشد. در این مثال، پیک نوسان نما موج سوم ۲۶۲ بوده است و ۳۸٪ آن در جهت مخالف ۹۹ می شود.

این سطح ۳۸٪ که بیش از آن در نوسان نما مورد نظر است بوسیله ابزار بازگشتی که در ابزار کشیدن قرار داده شده است قابل ترسیم است.

درصد هم پوشانی

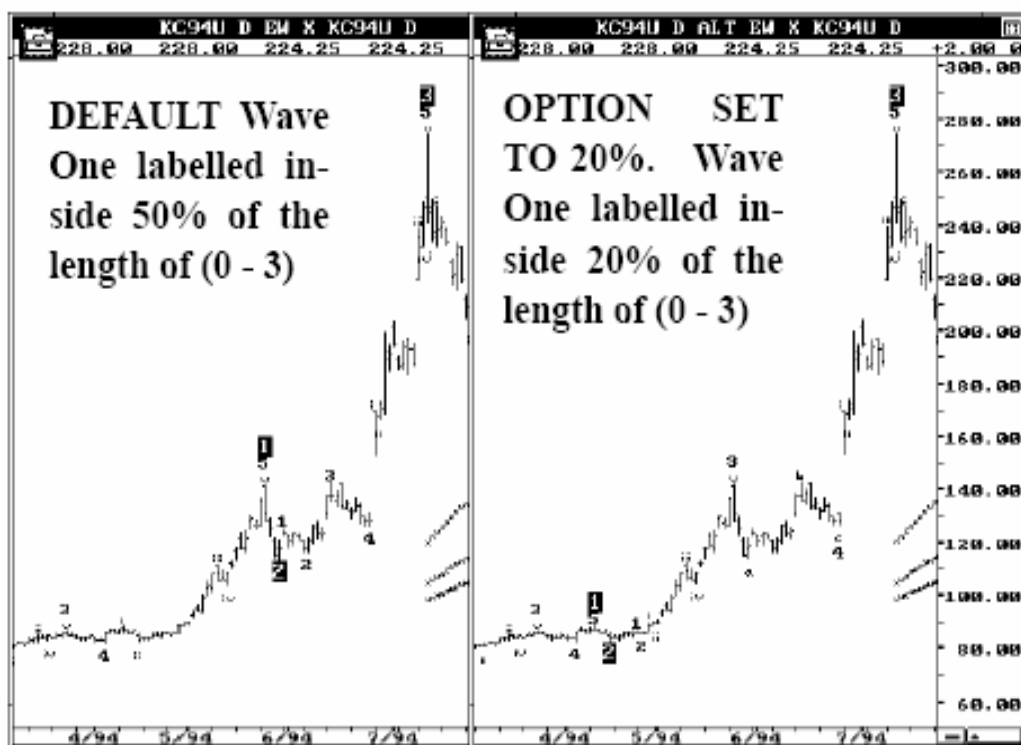
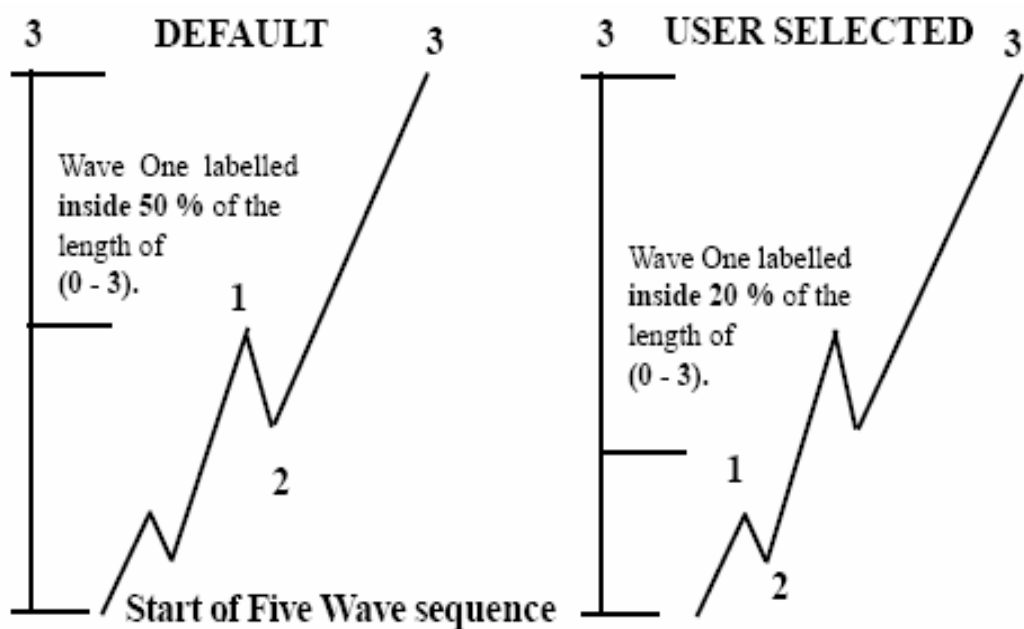
به صورت از پیش تنظیم شده نرم افزار به صورت اتوماتیک اجازه می دهد که در مورد کالاها ۱۷٪ از هم پوشانی بین موج ۱ و ۴ وجود داشته باشد که در مورد بازار سهام و اندیکس ها به ۰٪ رسیده است.

قوانین الیوت اجازه این هم پوشانی را در همه موارد نمی دهند. **به هر حال براساس تمقیقات، ما پی برده ایم که بسیاری از کالاها تمایل دارند که بین موج ۱ و ۴ هم پوشانی وجود داشته باشد و در ادامه یک توالی ۵ موج کاملاً روشن را تشکیل دهند.** به هر حال شما می توانید درصد این هم پوشانی را تغییر دهید که براساس نظر شما خواهد بود. زمانی که شما این هم پوشانی را تغییر دهید GET شمارش امواج الیوت را براساس شمارش آلترناتیو خواهد داشت.

شمارش براساس امواج آلترناتیو با رنگ سبز نمایش داده می شود و برای نمایش آن براساس شمارش از پیش تعریف شده براساس رنگ آبی است.

درصد هم پوشانی موج ۱ و ۳ (Option) : زمانی که شماره گذاری امواج الیوت انجام شد شمارش از پیش تعیین شده به نرم افزار اجازه می دهد که موج اول را در هر کجایی بین شروع توالی پنج موج و ۵۰٪ ارتفاع ۳-۰ شماره گذاری کند. در بعضی موارد نرم افزار نقطه پیوتی را انتخاب می کند که این نقطه در بالاترین محدوده قرار دارد و موج اول به خوبی

در داخل موج سوم شماره گذاری می شود. کاربر می تواند این حالت از پیش تعیین شده را باطل کند و محدود کند به اینکه موج اول در کجا شماره گذاری شود.



تکنیک‌های گان

W. D. Gann

بنا بر بعضی از دلایل و مسایل دیگر هر چیزی در ارتباط با گان به نظر اسرار آمیز و گنگ به نظر می‌رسد. مقالات بسیاری از این رویکرد استفاده می‌کنند و در توضیحات آن، روش سختی را برای یادگیری به کار برده‌اند. به منظور فهمیدن کامل این تکنیک و به منظور باور آن باید ابتدا تابوی گیج کننده آن از بین برود و باور داشت که کار با آن در واقع مجموعه‌ای از تکنیک‌ها می‌باشد ما سعی می‌کنیم مطالب را ساده و قابل فهم بیان کنیم.

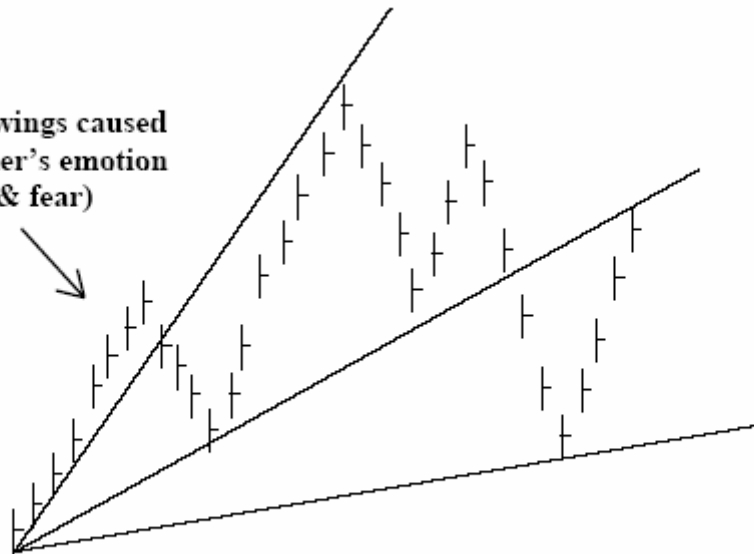
آقای *W. D. Gann* مجموعه‌ای از تکنیک‌ها را به کار می‌برد. در این کارگاه ما می‌خواهیم این بحث را ادامه دهیم: دلیل اینکه گان در پیش‌بینی‌های خود بسیار دقیق بود نه به خاطر وجود یک تکنیک واحد بلکه به دلیل استفاده درست از ابزار در زمان‌های صحیح بود. او در این کار استاد بود. وی یک ریاضیدان عالی بوده و دارای یک حافظه کارا و سریع بوده است. برای مثال او می‌توانسته حالت بیش خرید در بازار را بدون استفاده از هیچ گونه اندیکاتوری محاسبه کند. استوکاستیک فرمولی است که بر پایه علم ریاضیات بنا شده تا حالات بیش فروش و بیش خرید را نشان دهد. شاید گان می‌توانسته است این اندیکاتورها را در ذهن خود با نگاه کردن به قیمت محاسبه کند.

دیدگاه GET استفاده ساده و کاربردی از تکنیک‌های گان و بهبود آن می‌باشد. به همین خاطر اطلاعات خود را به آن اضافه کرده تا محاسبات کامپیوتری پیچیدگی آن را کاهش دهد. زمانی که معادلات کامپیوتری ساختار بندی شد و با قدرت پاسخ داد شما همچنین می‌توانید به صورت عملی آن را اضافه کرده و از آن سود ببرید.

خطوط زوایای گان

ما با خطوط ترند به خوبی آشنا هستیم. اشکال اصلی خطوط ترند این است که نیاز به حداقل ۲ نقطه قیمت داریم تا بتوانیم خطی رسم کنیم. دیدگاه خطوط و زوایای گان فقط نیازمند یک نقطه قیمت پیوت است که خطوط مختلفی از این نقطه قابل رسم است. نظرات در مورد زوایای گان در زیر تشریح شده است.

Price swings caused
by trader's emotion
(greed & fear)



Appropriate angles contain their price swings

خطوط و زوایای گان

زمانی که رالی قیمت به یک Low خاتمه می‌دهد می‌زانی که است که نوسانات و رالی‌های بازار بوسیله ترس و طمع تریدرهایی که در بازار هستند کنترل می‌شود. ترس و طمع باعث نوسانات (Swing) بازار است. این رفتار افراد از یک Extreme تا Extreme دیگر در سیکل‌های با درجات متفاوت در حال حرکت است. این سیکل‌های متفاوت می‌توانند با پارامترهای زوایای اصلی دقیق با استفاده از قیمت Low مشخص شوند. کار اصلی یافتن تنظیم مناسبی از زوایاست که می‌تواند سیکل‌های متفاوتی را که از باز خورد طمع و ترس تریدرهای دارای نظرات شخصی ایجاد شده است رابایابد.



Incorrect Approach



Same geometric angle failed
to contain prices when the
scale is altered.



زوایای مناسب یک شبه بدست نمی آیند. نمودار بالا گان چندین سال را نشان می دهد. بوسیله کمک از کامپیوتر و دریافت صحیح ما قادر خواهیم بود تا زوایای بسیاری از کالاهایی که در ایالات متحده ترید می شوند و بعضی از بازارهای دیگر را محاسبه کنیم. زوایای ما براساس اطلاعات ۱۰-۵ سال قبل استوار است زاویه مرکزی برای هر بازار ثابت است و در طول زمان تغییر نمی کند. حساسیت و اهمیت به آهستگی تغییر می کند اما زاویه مرکزی یکسان باقی می ماند.

دیدگاه GET براساس یافتن زوایایی برای هر بازار است که بتواند نوسانات مخصوص آن بازار را که به علت احساسات ترس و طمع می باشد بیابد. این موضوع در صفحه بعد شرح داده شده است.

A Real-Time Example



سیکل های ترس و طمع

پیش‌بینی ترس و طمع تردیدرها بسیار مشکل می‌باشد. به هر حال ما موفق شدیم با مشکلات زیاد به راه حلی برسیم.

زمانی که بازار یک **Low** یا **Bottom** اصلی می‌سازد که خود نتیجه یک نوسان قیمت خیلی بزرگ می‌باشد، این مساله معقول به نظر می‌رسد که احساسات عمومی به نقطه انتهایی خود رسیده است. به عبارت دیگر در یک **Top** اصلی طمع تردیدرها افت کرده است و توالی‌های سقوط بازار بعلت ترس تردیدرها می‌باشد. با روشن شدن این مساله‌ها می‌توانیم به مرحله بعدی برویم و مراحل زیر را دنبال کنیم. زمانی که یک **Top** اصلی بوجود می‌آید احساسات تریدهای زیادی (در این مورد طمع) برای یک حرکت در این زمان با هم در یک راستا قرار می‌گیرد. بنابراین زوایای گان در این قبیل **Top** های اصلی نشات گرفته از جزئی از فاز سیکل‌های احساس بعدی تردیدرها می‌باشد. زوایای گان که از یک **Top** اصلی ترسیم می‌شوند می‌توانند بهتر سیکل‌های احساسی بزرگ را نسبت به زوایای گان که از **Top** های فرعی ترسیم می‌شوند نشان دهند.

به عبارت ساده‌تر: زوایای گان که از نوسان بزرگ قیمت تولید می‌شوند و جهت روشن کردن نوسان قیمت بعدی به کار می‌روند بسیار مفیدتر از زوایای گانی می‌باشند که از نوسانات فرعی قیمت تولید می‌شوند. نرم افزار **GET** نقاط بسیار مهم برای کشیدن زوایای گان اصلی را فراهم می‌کند.

تشفیص نوسانات قیمت

این مساله ما را جهت روشن کردن نوسانات اصلی قیمت راهنمایی می‌کند. این مساله ساده‌ای است که به نمودار قیمت نگاه کنیم و بگوییم این نقطه **High** می‌باشد یا این نقطه **Low** می‌باشد. ما این کار را به کامپیوتر سپرده‌ایم.



نرم افزار GET بوسیله اندازه گیری درصد نوسان قیمت از هر low و High، نقاط پیوتی را مشخص می کند که تحت نام p= اولیه، J= اصلی، I= بنیابینی و M= فرعی (که در بالا نشان داده شده اند) نام گذاری می کند.

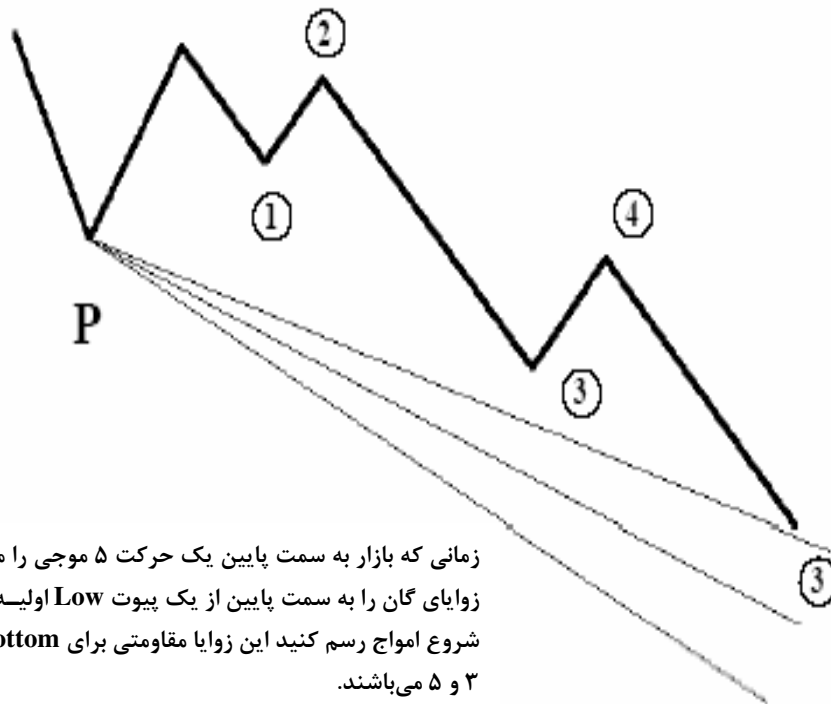
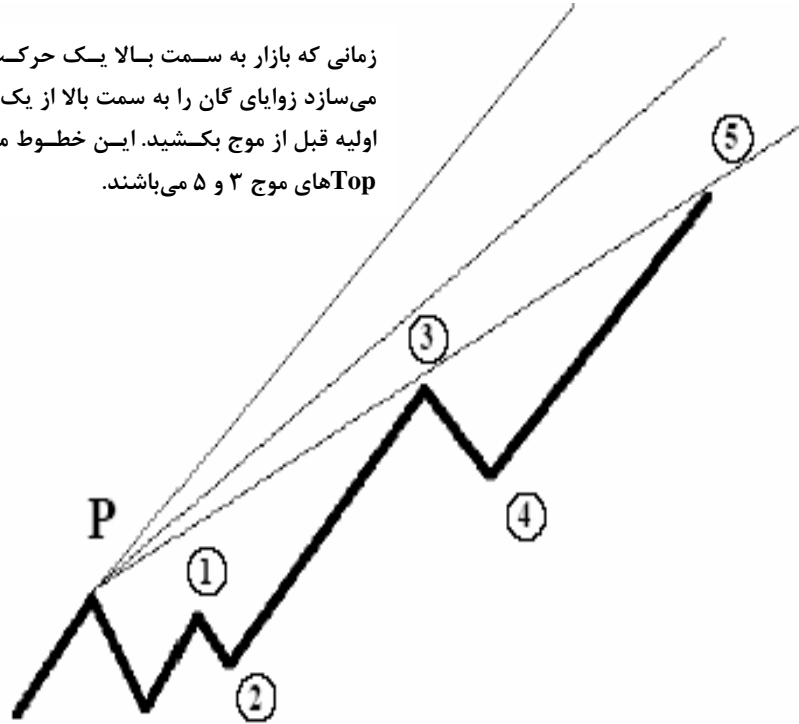
زوایای گان که از Low/High اولیه ترسیم می شوند ارزش بسیار بیشتری در تشخیص مسیر بعدی سیکل های احساسی تردیدرها دارند. توالی آن ها براساس اهمیت به ترتیب اصلی، بینابینی و فرعی می باشد.

به صورت کلی همه زوایای گان می توانند یک حمایت یا مقاومت برای نوسان قیمت ترسیم کنند. به هر حال زوایایی که نشان دهنده راه های فوق هستند مثل زوایایی که از نقاط اصلی رسم می شوند خطوط حمایت و مقاومت قوی و محکمی را نشان خواهند داد.



استفاده از زوایای گان با امواج ایوت (برای موج ۵، ۳)

زمانی که بازار به سمت بالا یک حرکت ۵ موجی را می‌سازد زوایای گان را به سمت بالا از یک پیوت **High** اولیه قبل از موج بکشید. این خطوط مقاومت برای **Top** های موج ۳ و ۵ می‌باشند.

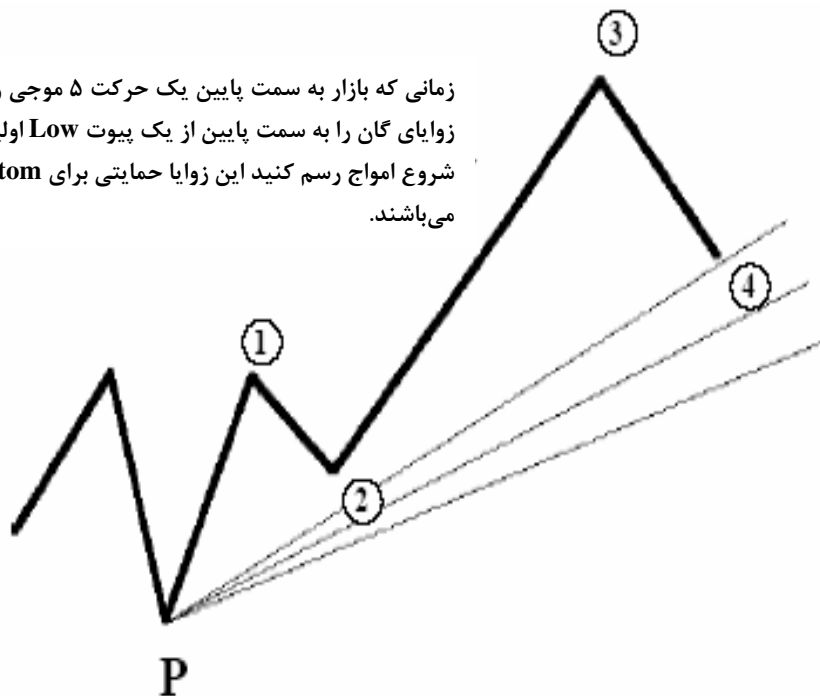


زمانی که بازار به سمت پایین یک حرکت ۵ موجی را می‌سازد زوایای گان را به سمت پایین از یک پیوت **Low** اولیه قبل از شروع امواج رسم کنید این زوایا مقاومتی برای **Bottom** موج ۳ و ۵ می‌باشند.

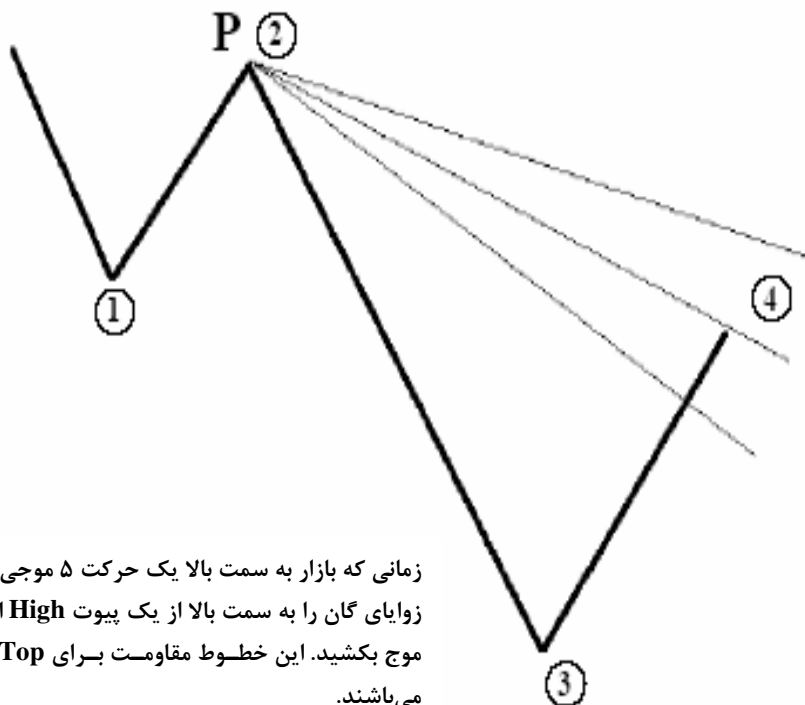


استفاده از خطوط گان با امواج الیوت (برای موج ۴)

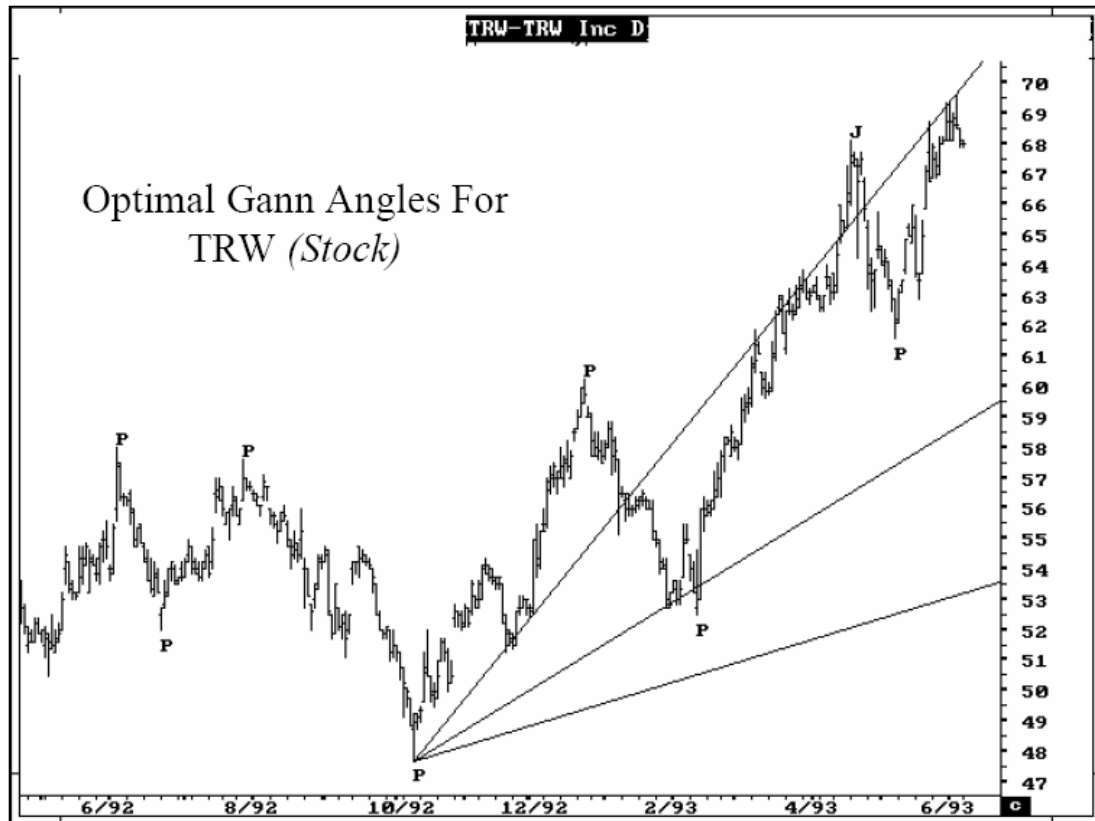
زمانی که بازار به سمت پایین یک حرکت ۵ موجی را می‌سازد
زوایای گان را به سمت پایین از یک پیوت **Low** اولیه قبل از
شروع امواج رسم کنید این زوایا حمایتی برای **Bottom** موج ۴
می‌باشند.



زمانی که بازار به سمت بالا یک حرکت ۵ موجی را می‌سازد
زوایای گان را به سمت بالا از یک پیوت **High** اولیه قبل از
موج بکشید. این خطوط مقاومت برای **Top** های موج ۴
می‌باشند.



خطوط گان بهینه شده



در ورژن‌های قبلی ما یک مقیاس از پیش طراحی شده برای خطوط گان فقط برای کالاهای US تدارک دیده بودیم. این طراحی دارای ۲ اشکال بود.

۱- این مقیاس قابلیت تغییر را به همراه تغییر بازار از یک روز به روز دیگر را نداشت.

۲- خطوط گان فقط برای بازارهای خاصی قابل دسترس بود.

در حال حاضر ما این ویژگی را جزو موارد روتین در آورده‌ایم که به کاربر اجازه می‌دهد تا خطوط بهینه را برای همه بازارهایی که قابل Load شدن هستند بیابد که شامل سهام، Spread, Cross Rate, Foreign Issue و Volatility Adjustments می‌شوند. مقیاس بهینه شده بر روی نمودار قرار می‌گیرد و برای موارد بعدی قابل استفاده است.

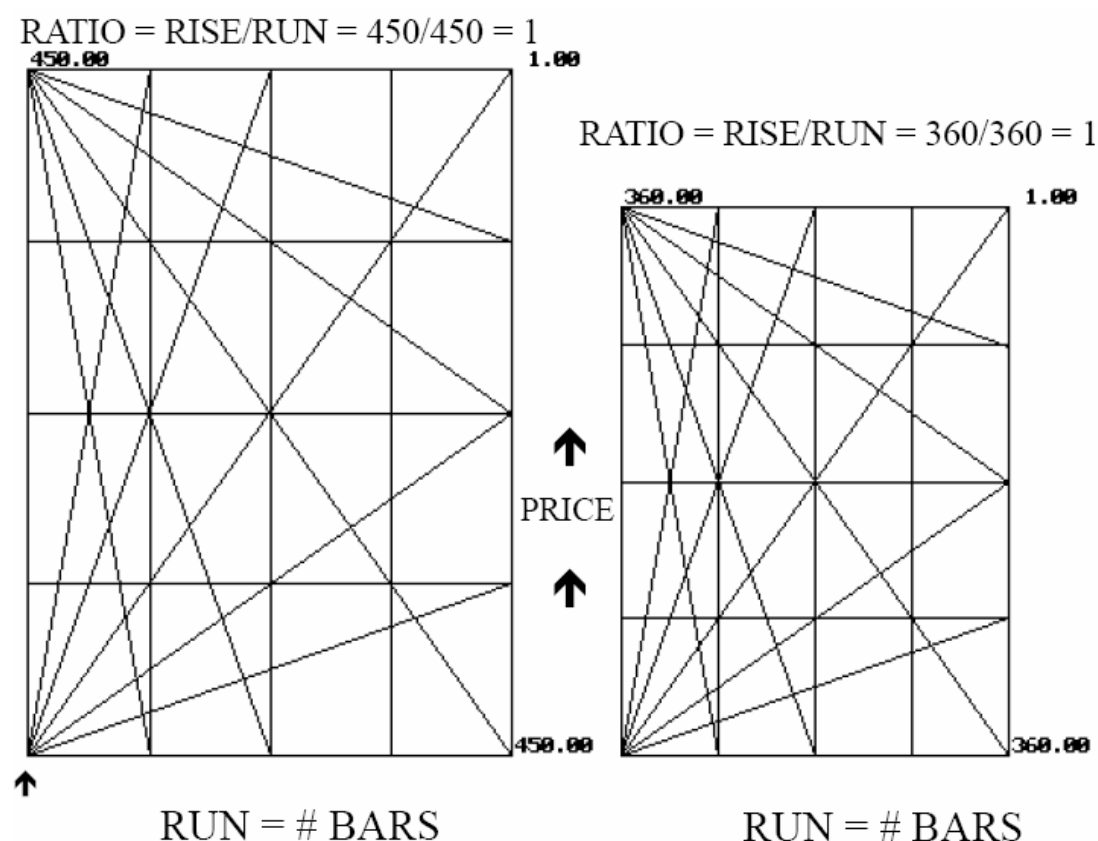
آنالیزور GANN BOX

یکی از اشکالات در بسیاری از برنامه‌ها فقدان مطالعات زمانی کافی می‌باشد. ما تلاش کردیم تا به این خواسته بوسیله مطالعات خاصی مانند خوشه‌های زمانی و آنالیزور GANN BOX برسیم. واژه گان به سادگی تعداد زیادی از تریدرها را می‌ترساند که این



امر به علت پیچیدگی و روشن نبودن طریقه استفاده از آن می‌باشد. در دو سال گذشته ما در این زمینه با دقت بسیاری تحقیق کرده‌ایم و راه‌های ساده‌ای برای بکارگیری گان GANN BOX یافته‌ایم. نرم افزار به شما اجازه می‌دهد که GANN BOX را در اشکال متفاوت رسم کنید. زمانی که کاربر متدهای اضافی گان را دنبال می‌کند می‌تواند از آن به مانند یک مقاله ترجمه شده استفاده کند. به هر حال ما نتایج تمقیقات خود را استفاده کرده‌ایم و Pre-Fixed GANN BOX را اضافه کرده‌ایم.

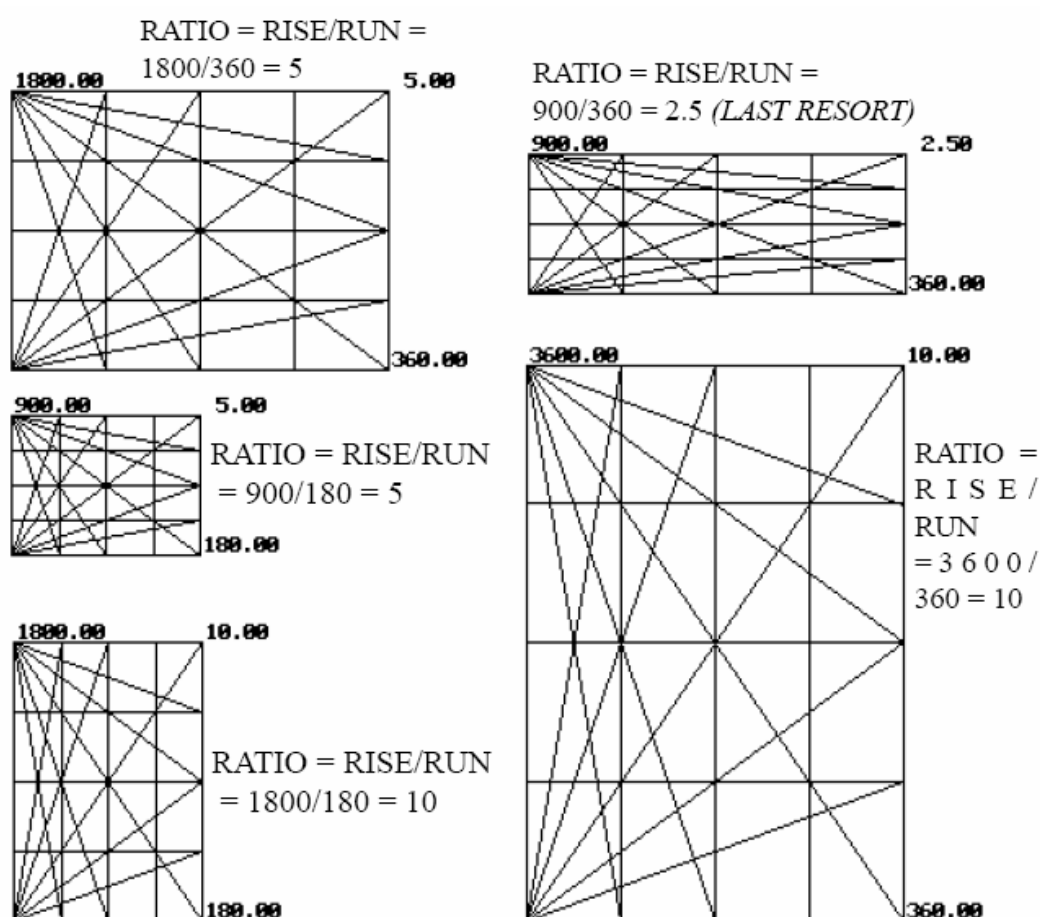
ویژگی اصلی که ما در این تحقیق یافتیم این است که نسبت Rise/Run جعبه باید ۱ یا مضاربی از قبیل ۱۰ و ۲۰ و غیره باشد. جعبه‌های گان از High یا Low های اصلی (major) رسم می‌شوند. فاصله قیمت از نقطه مورد نظر Rise و تعداد ستون‌ها از نقطه فوق Run نامیده می‌شود. جعبه‌ای که در زیر نشان داده شده از ۴۵۰ بار (Run) و ۴۵۰ قیمت از نقطه Low که Rise نامیده می‌شود رسم شده است. نسبت $Rise/Run = 450/450 = 1$ است.



نسبت توصیه شده (توصیه بسیار مهم) شامل موارد زیر است ۱، ۲، ۵، ۱۰، ۲۰، ۴۰ و (۵/۲) بعنوان آخرین مورد)

تحقیقات ما بر روی همه بازارها و همه بازه‌های زمانی نشان داده که اگر شما نسبت‌های گفته شده (موارد بسیار مهم) ۱، ۲، ۵، ۱۰، ۲۰، ۴۰ و ۲/۵ (بعنوان آخرین مورد) را به کار ببرید و جعبه گان را از Low یا High اصلی (Major) رسم کنید خطوط رسم شده سطوح حمایت و مقاومتی را ترسیم می‌کنند که بازار در آینده در آن‌ها حرکت می‌کند. همچنین این تکنیک علاوه بر این نسبت‌ها برای شما بازه‌های زمانی ثابت ۴۵ و ۹۰ و ۱۸۰ و ۳۶۰ روزه و مانند آن را فراهم می‌کند. **جعبه‌هایی که در ادامه آمده‌اند بعضی نسبت‌های دیگر را نشان می‌دهند که می‌توان از آن‌ها استفاده کرد.**

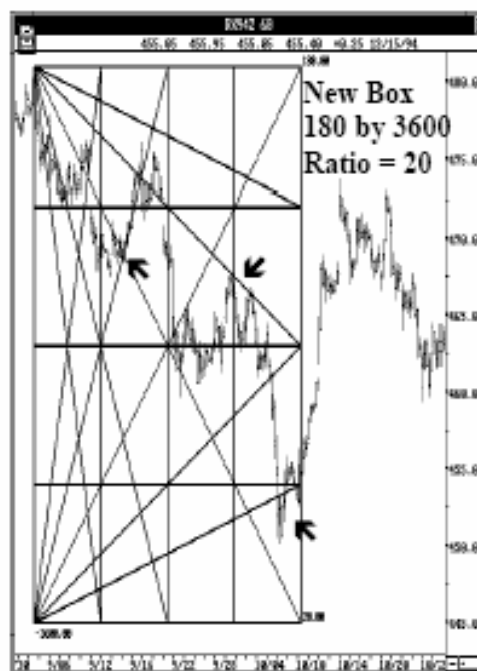
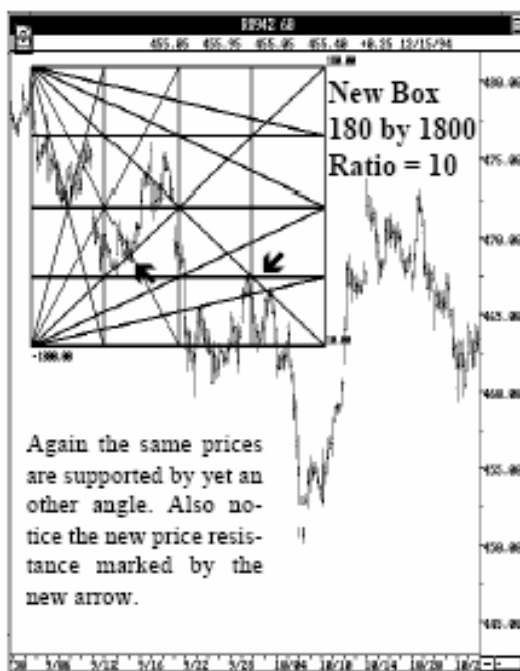
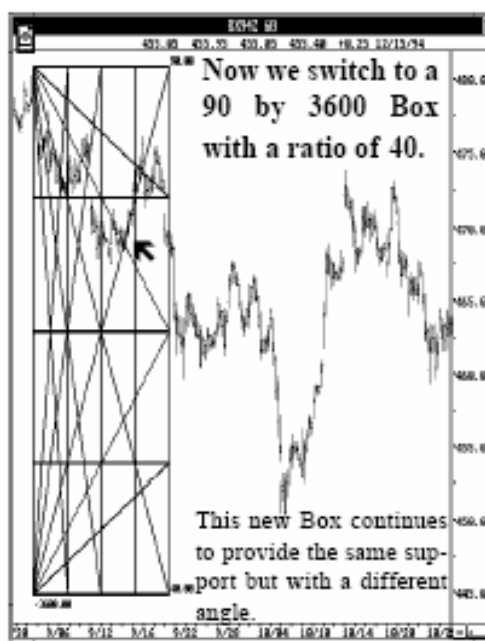
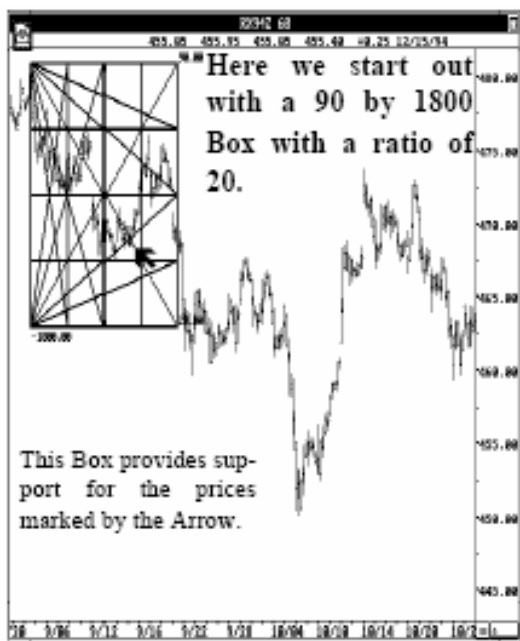
(جعبه‌های گان که با نسبت‌های دیگر رسم شده‌اند)



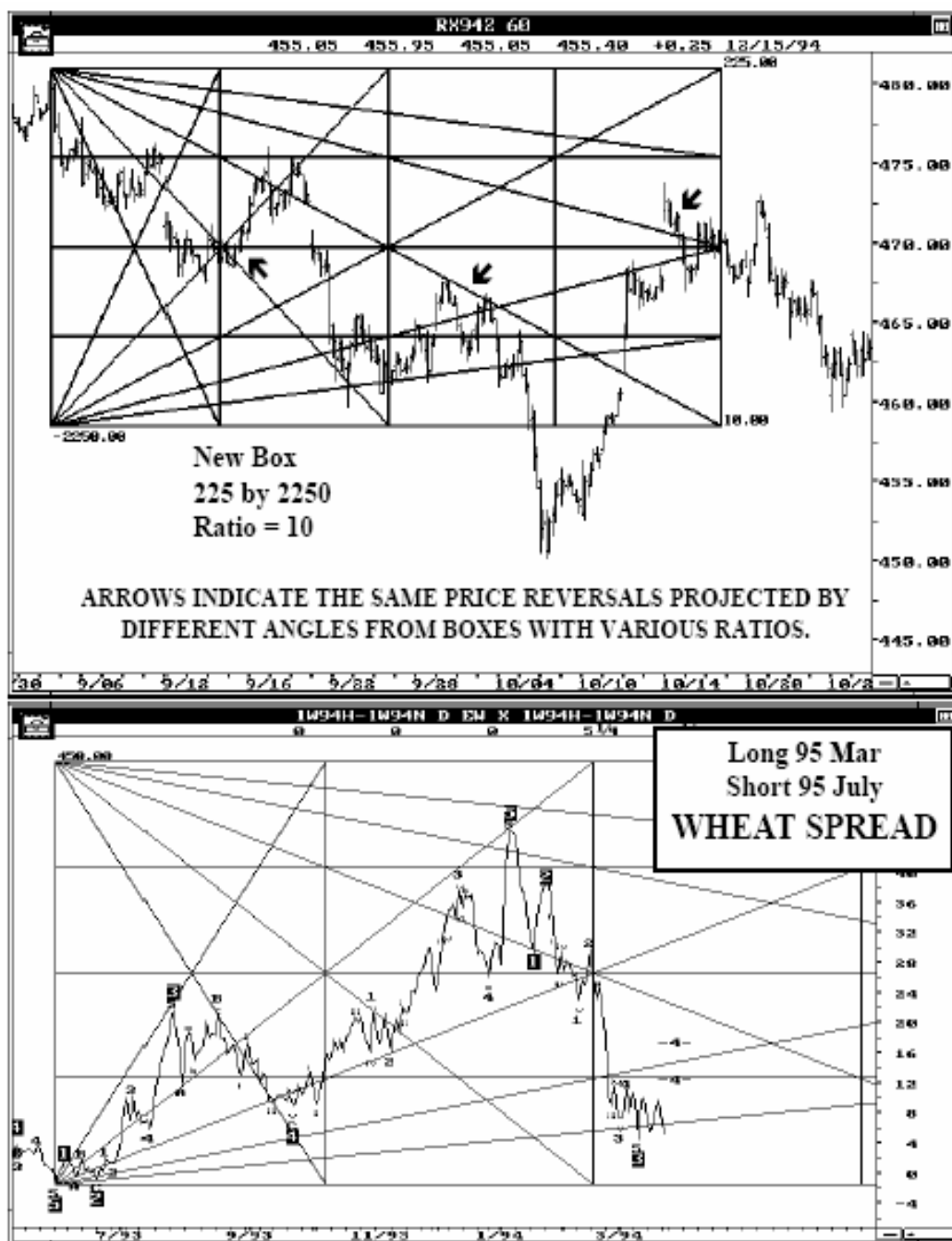
زمانی که جعبه‌ها رسم می‌شوند آن‌ها یک مسیر یا نقشه راهی برای بازار تدارک فراهم می‌کنند. ترکیب *Pre-Fixed Rate* و *Fixed Time Intervals* نتایج نهایی قابل توجهی ارائه می‌دهد.

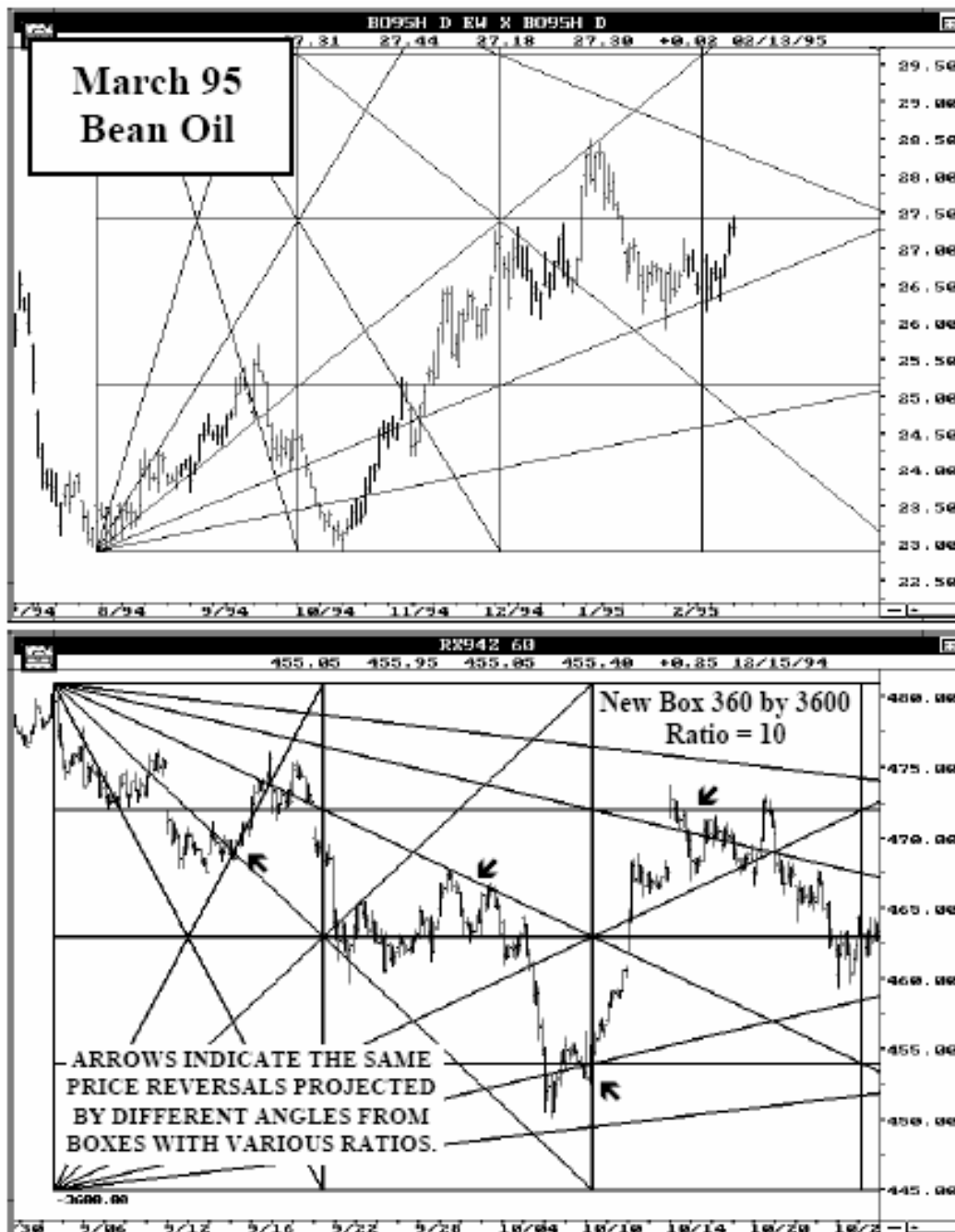


همانطور که در صفحه قبل توضیح داده شد ما از Pre-Fixed Time با اعداد ۹۰، ۱۸۰، ۲۲۵، ۳۶۰، ۴۵۰ و غیره برای استفاده در طول و همراه با Pre-Fixed Price به منظور تهیه نسبت جعبه ۱، ۲، ۵، ۱۰، ۲۰، ۴۰ و ۲،۵ استفاده کردیم. با استفاده از نسبت‌های Pre-Fixed که با استفاده از محاسبات ریاضی می‌باشند با وجودی که سایز باکس‌ها متفاوت است همه موارد یکسان باقی می‌مانند. در مثال‌های زیر ما از باکس‌های متفاوت برای حرکت بازار استفاده کرده‌ایم.



زمانی که محدوده قیمت گسترش می‌یابد کاربر به راحتی یک جعبه بزرگتر را رسم می‌کند که نسبت‌های Pre-Fixed در آن تثبیت شده است. زمانی که بازار حرکت می‌کند با استفاده از محاسبات ریاضی نمودار خود را با تغییر دادن فصول گان تنظیم می‌کند ولی هنوز فصول حمایت و مقاومت یکسانی رسم می‌کند.





جعبه‌های گان با این نسبت‌ها برای همه کالاها، سهام و Spreadها در نمودارهای ۱ ساعته، روزانه و هفتگی قابل استفاده است. جعبه گان همچنین با آنالیزور موج ایوت به خوبی کار می‌کند.

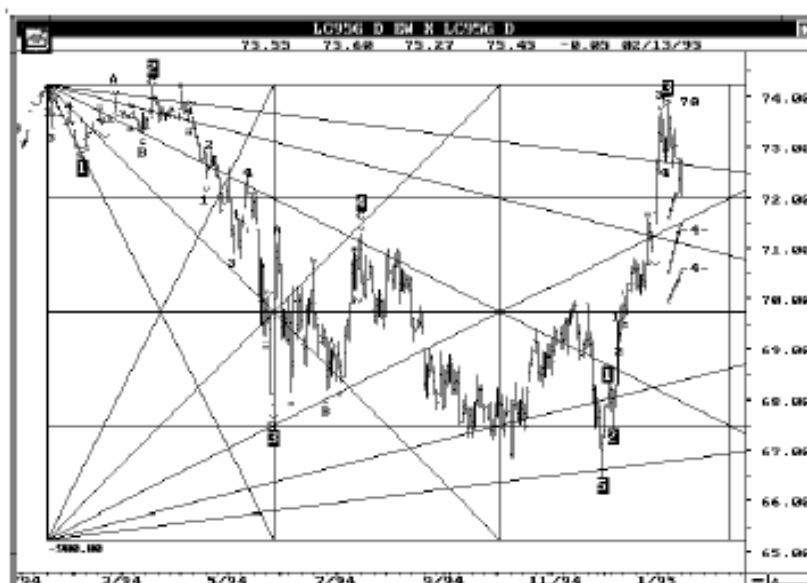




استفاده از مجبه گان Pre-Fixed با امواج الیوت

مجبه گان Pre-Fixed می تواند به همراه آنالیزور موج الیوت استفاده شود. توضیح زیادی در مورد چگونگی این ترکیب وجود ندارد. صحبت های public service announcement را به یاد بیاورید. که می گفت " Here is your Brain, here is your Brain on drugs, Any questions? به همان صورت در اینجا دو نمودار وجود دارد که در هر دو آنالیزور الیوت و مجبه گان Pre-Fixed وجود دارد. سوالی مطرح است؟

FEB 95
Live Cattle

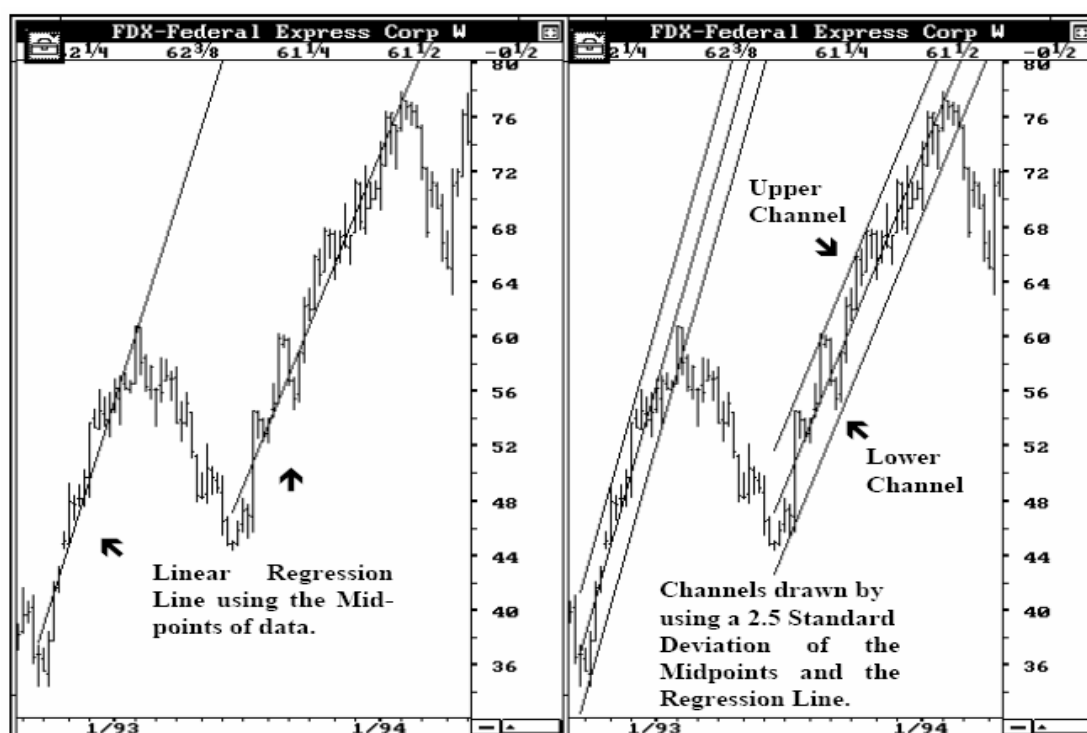


MAR 95
SUGAR



کانال‌های رگرسیون ترند

این موضوعی ساده ولی بسیار کاربردی می‌باشد. ترسیم این کانال‌ها به این صورت است که یک کانال بالایی و یک کانال پایینی با استفاده از SD قیمت کشیده می‌شود. این خطوط بسیار مشابه باندهای بولینگر می‌باشند که در آن خطوط با استفاده از SD میانگین متحرک رسم می‌شود. به هر حال توصیه می‌کنیم که شما به جای استفاده از میانگین متحرک از خطوط رگرسیون خطی برای شناسایی نوسانات قیمت استفاده کنید.



نمودار سمت چپ دو نوسان قیمت را از Low تا High نشان می‌دهد. خطی که از وسط کشیده شده است خط رگرسیون استاندارد می‌باشد که از نقاط وسط نوسانات قیمت استفاده کرده است. نمودار سمت راست کانال‌های بالایی و پایینی را که با فاصله $2.5SD$ از خطوط رگرسیون و نقاط میانی رسم شده‌اند را نشان می‌دهد. منوی کانال رگرسیون به کاربر اجازه می‌دهد که خطوط ترند یا رگرسیون را بوسیله نقاط میانی بالایی یا پایینی و غیره محاسبه کند. همچنین به کاربر اجازه می‌دهد که میزان SD برای کانال‌های بالایی و پایینی را تنظیم کند.

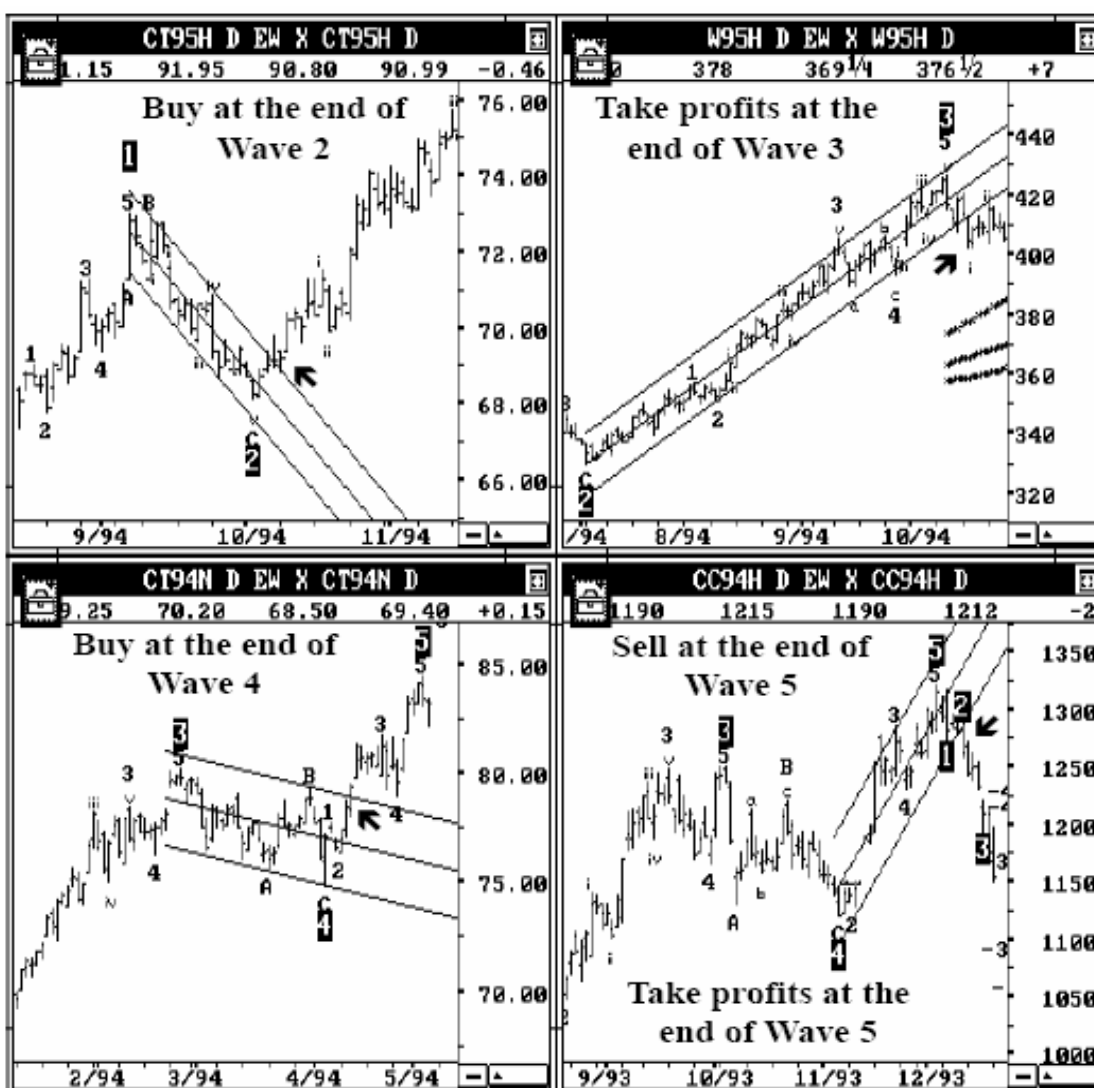
به علاوه R پیرسون که به این مجموعه اضافه شده است چگونگی ارتباط مناسب رگرسیون خطی را با اطلاعات نشان می‌دهد.

استفاده از کانال‌های رگرسیون ترند

زمانی که بازار ترند دار می‌شود و یا حرکت در یک جهت خاص جریان می‌یابد کانال‌های رگرسیون ترند می‌توانند جهت تشخیص مرزهای بالایی و پایینی بازار مورد استفاده قرار گیرند. زمانی که مومنتوم در جهت یکسانی قرار دارد بازار تمایل دارد که در داخل کانال بماند و به محض اینکه جهت حرکت بازار تغییر کند قیمت کانال را قطع می‌کند و علامتی دال بر پایان حرکت می‌باشد.

عملکرد اولیه کانال‌های رگرسیون ترند شامل موارد زیر است:

- (۱) مشخص کردن پایان موج دوم برای خرید در موج سوم
- (۲) مشخص کردن حد سود در داخل موج سوم
- (۳) ورود در پایان موج چهارم برای شرکت در موج پنجم
- (۴) مشخص کردن حد سود در داخل موج پنجم و ورود به خرید در جهت مخالف در پایان موج پنجم. مثال‌هایی که در ادامه آمده است بسیار روشن است.



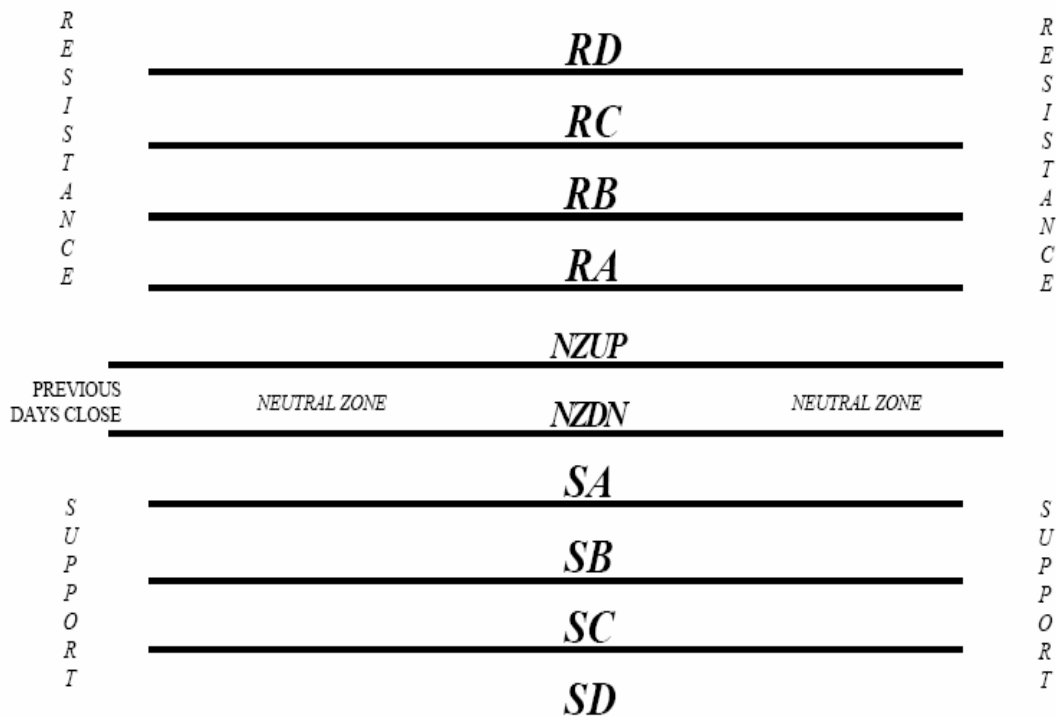
سطوح T.J.'s Web

سطوح T.J.'s Web توالی قیمت‌های ویژه‌ای می‌باشند که براساس ارتباط فیبوناچی با فعالیت‌های هفته قبلی در بازار سهام بدست می‌آیند. سه منطقه برای روز بعدی محاسبه می‌شود. منطقه خنثی، منطقه مقاومت و منطقه حمایت

منطقه خنثی: معمولاً این منطقه باریک بوده و چند نقطه پایین‌تر و بالاتر از قیمت‌های بسته شدن هفته قبل می‌باشد. زمانی که قیمت‌ها بالای منطقه فوق باشند سهام تمایل دارند قوی‌تر و **Versa-Vice** حرکت کنند.

منطقه مقاومت: در بالای منطقه خنثی چهار سطح مقاومت وجود دارد که **RC, RB, RA** و **RD** نامیده می‌شوند. این‌ها سطوح مقاومت فیبوناچی هستند که بر پایه فعالیت‌های قیمت سهام در هفته قبلی بنا شده‌اند.

منطقه حمایت: در زیر منطقه خنثی چهار سطح حمایت وجود دارد که تحت نام **SA, SB, SC** و **SD** نام گذاری شده‌اند. این‌ها خطوط حمایت فیبوناچی هستند که بر پایه فعالیت‌های قیمت سهام در هفته قبل بنا شده‌اند.



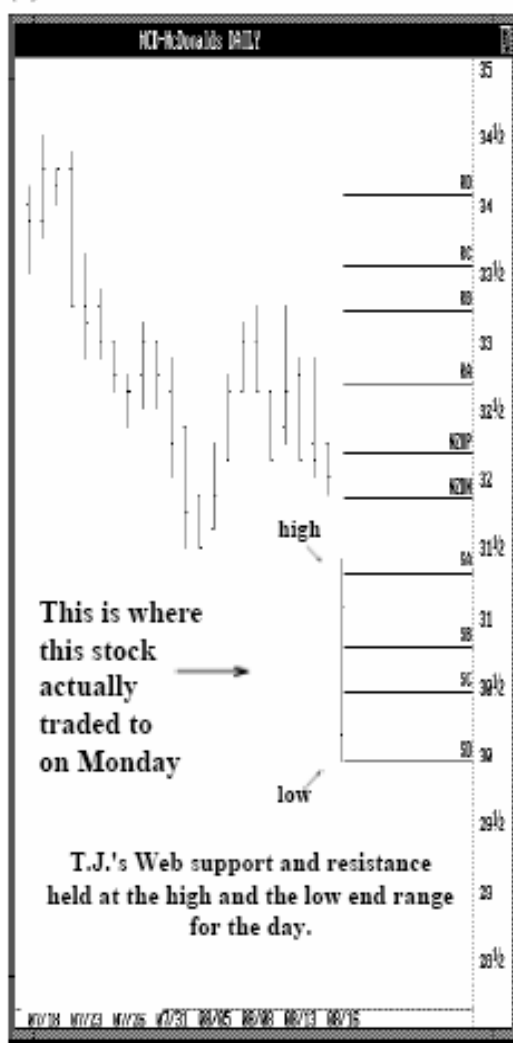
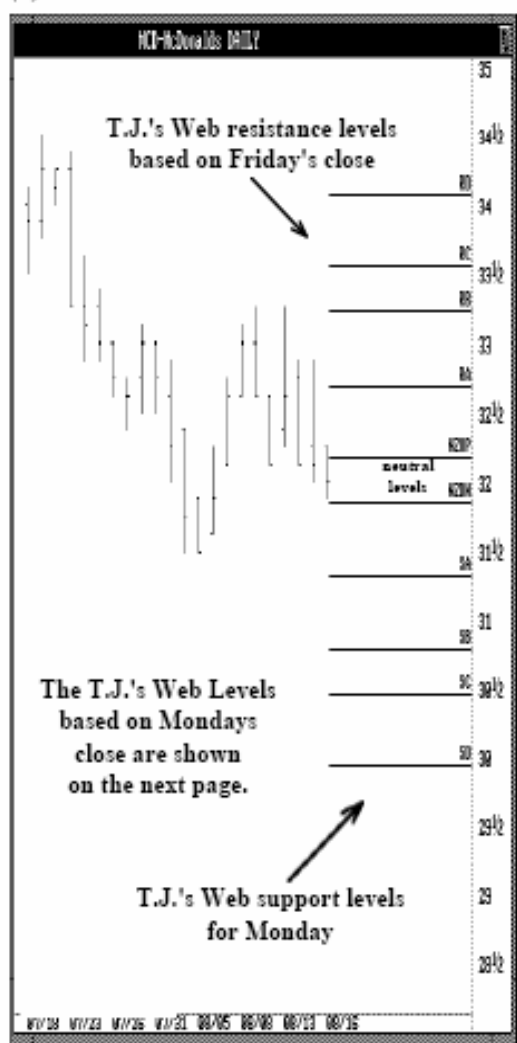
در صفحه بعد چگونگی به کار بردن این ابزار گفته شده است. این سطوح برای سهام مک دونالد با توجه به قیمت بسته شدن جمعه نشان داده شده است.

سطوح Web حمایت و مقاومتی را برای ترید روز بعدی نشان می دهند. اگر قیمت سهام در روز دوشنبه رالی داشته باشد آخرین سطح مقاومت RD مطرح کننده این موضوع است که سهام فوق نباید قبل از سطوح ۳۴ ترید شود و به طور مشابه آخرین سطح حمایت دلالت بر این دارد که سهم فوق نباید قبل از سطوح ۳۰ ترید شود. در روز دوشنبه سهام مک دونالد در سطح بالایی ۳۱/۸-۳۱ و پایینی ۳۰ معامله شد و حرکت این سهم در محدوده SA, SD سطوح Web بود. این مثال، اصولی را در مورد T.J.'s Web برای ما روشن می کند. شما نباید انتظار داشته باشید که این خطوط همیشه درست کار کنند. اما اگر آنها را به طور متناوب و پیوسته به کار ببرید آنها می توانند سطوح مقاومت و حمایت های خوبی را به ما نشان دهند.

will consistently provide good support and resistance

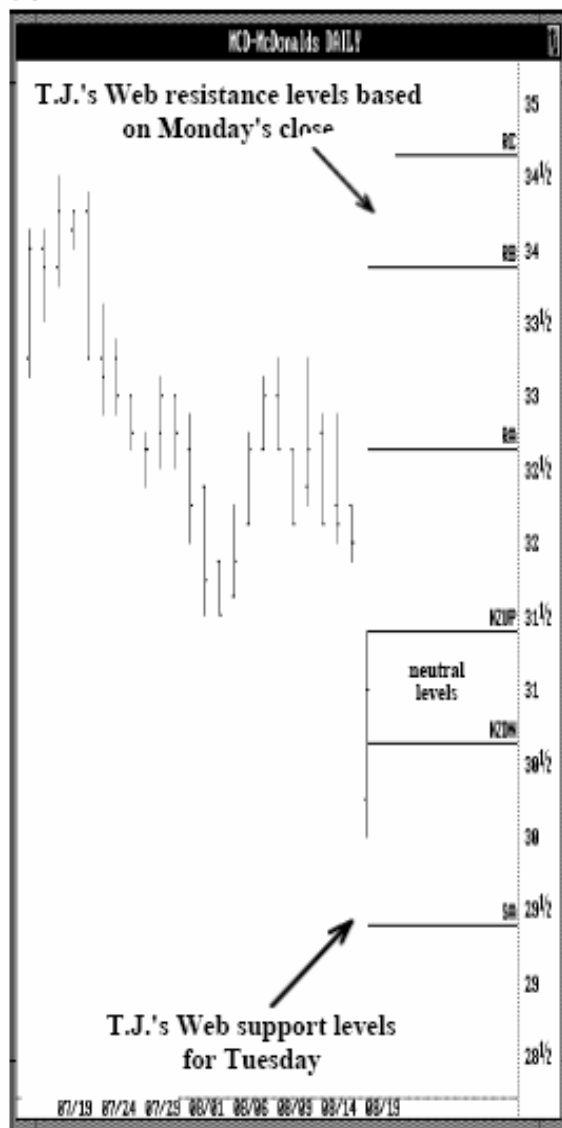
(1) FRIDAY'S CLOSE

(2) TRADING ACTION FOR MONDAY

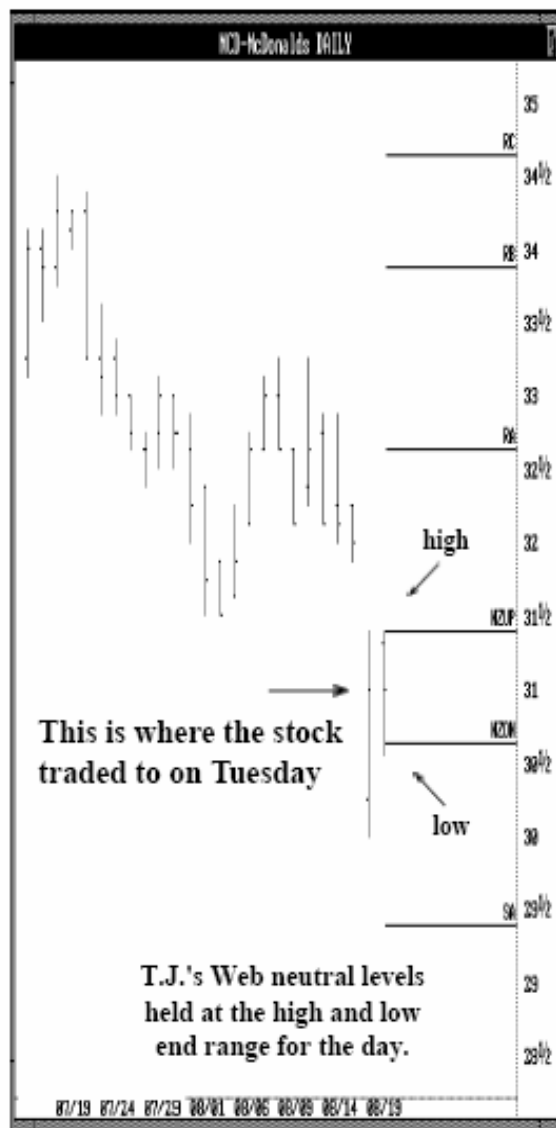


سطوح T.J.'s Web می‌توانند با اندیکاتورهای روزانه مثل استوکاستیک آهسته ۲۱ و نوسان نمای الیوت در روی نمودار ۵ دقیقه‌ای استفاده شوند. زمانی که نوسان نمای الیوت یک دایورجنس صحیح را نشان داد؛ که قبلاً این موضوع توضیح داده شده و استوکاستیک بالای ۸۰ بود یک سیگنال کوچک در حال شکل‌گیری بوده و از سطح T.J.'s Web بعدی به عنوان پایان معامله استفاده کنید. سیگنال Buy دقیقاً بر عکس مطلب گفته شده می‌باشد.

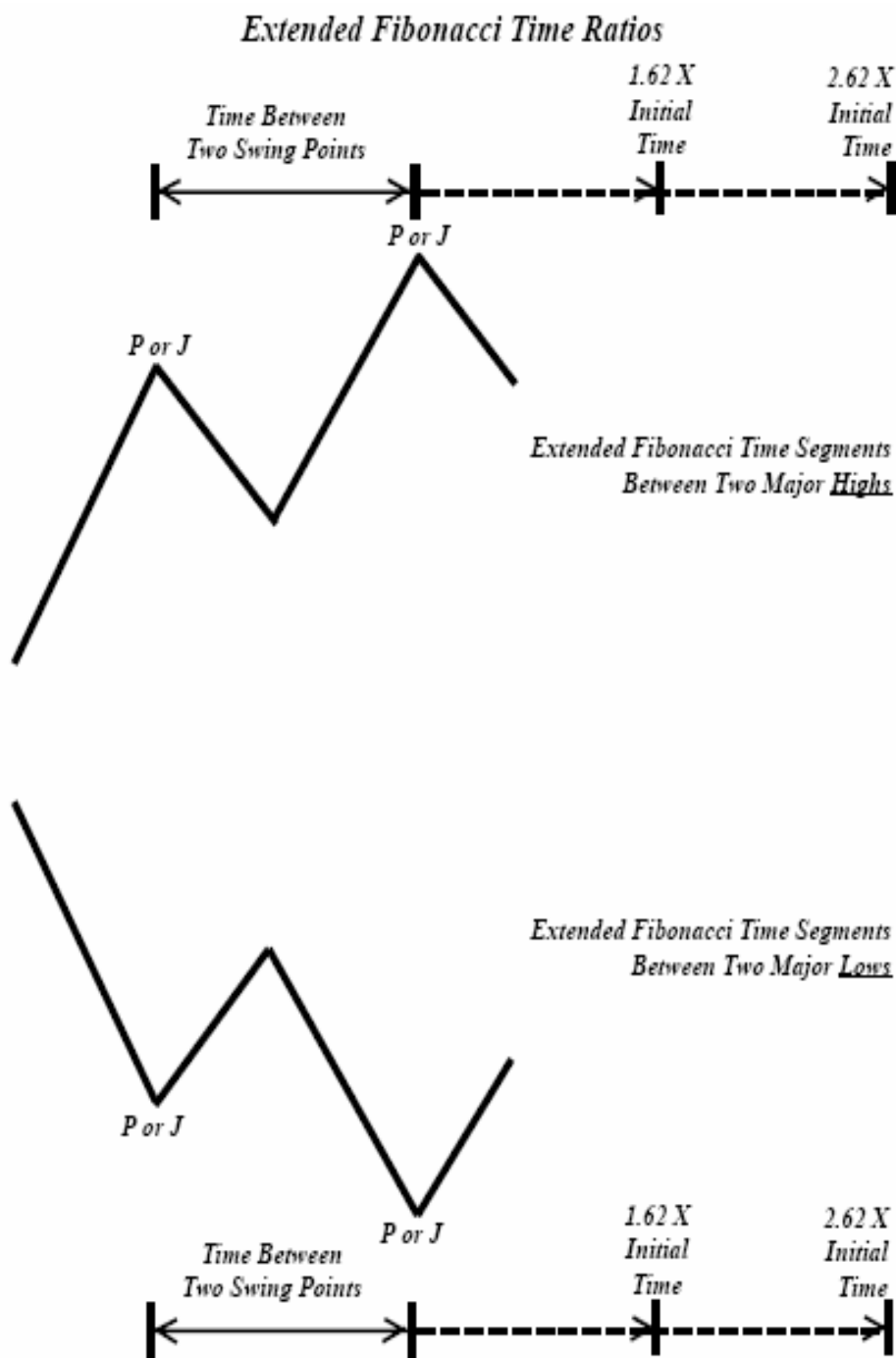
(3) MONDAY'S CLOSE

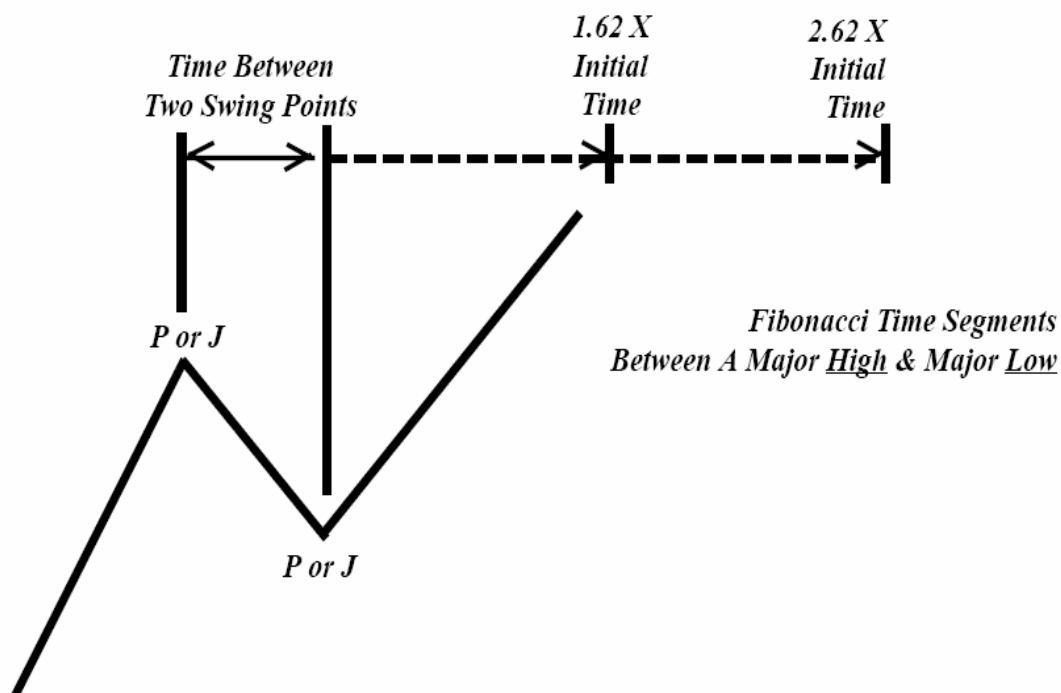


(4) TRADING ACTION FOR TUESDAY



نسبت های زمانی گسترش فیبوناچی





در ابتدا باید یک زمان اولیه بین دو پیوت اولیه یا اصلی به کار برد. این پیوت‌ها می‌توانند بوسیله کاربر یا بوسیله شماره‌گذاری که توسط نرم افزار از طریق منوی پیوت انجام می‌شود صورت پذیرد.

این بازه زمانی اولیه برای پیش‌بینی، با استفاده از نسبت‌های فیبوناچی متفاوت برای انجام پیش‌بینی، گسترش می‌یابند. ما پیشنهاد می‌کنیم که از نسبت‌های $1/62$, $2/62$ استفاده کنید. بر هر حال شما باید ترکیبات متفاوتی را به کار ببرید. اگر شما نسبت‌های حاضر را که ما اضافه کرده‌ایم نمی‌پسندید خودتان می‌توانید اعداد خود را مثل $3/79$, $2/94$ وارد کنید.

این نظریه به منظور جستجو برای تغییرات بالقوه در ترند در این دوره‌های زمانی گسترش یافته می‌باشد.

نوشته‌های زمانی فیبوناچی

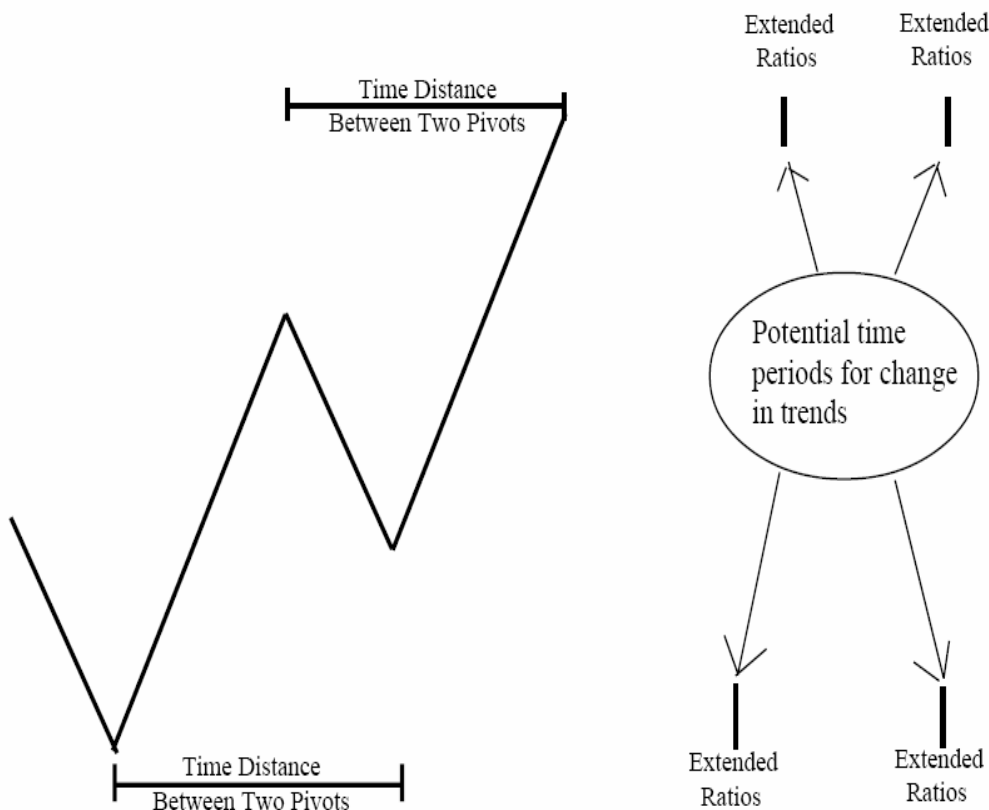
از فاصله زمانی (تعداد ستون‌ها) بین دو پیوت و نسبت‌های گسترش یافته این فاصله زمانی، به منظور نشان دادن آینده استفاده کنید. شما باید توجه داشته باشید که بسیاری از پیوت‌هایی که در آینده خواهند آمد (نقاط تغییر ترند) در این دوره‌های زمانی گسترش یافته رخ می‌دهند.

سوال:

ما از چه نسبت‌هایی باید استفاده کنیم؟ آیا باید از همه پیوت‌ها استفاده کرد یا فقط از اصلی و اولیه باید استفاده کرد؟ آیا باید از نقاط High به High یا low به low استفاده کرد؟

جواب:

تعداد زیادی از تریدرها از این روش استفاده می‌کنند. به هر حال هر تریدر از نسبت‌های متفاوت، پیوت‌های متفاوت و انواع متفاوتی از نوسانات استفاده می‌کند. شما باید ابتدا ترکیب‌های زیادی را بکار ببرید و موردی را که دقت خوبی در بیشتر زمان‌ها دارد بیابید. در تحقیقات ما نتوانستیم ترکیبی را که در همه زمان‌ها به خوبی کار کند بیابیم.



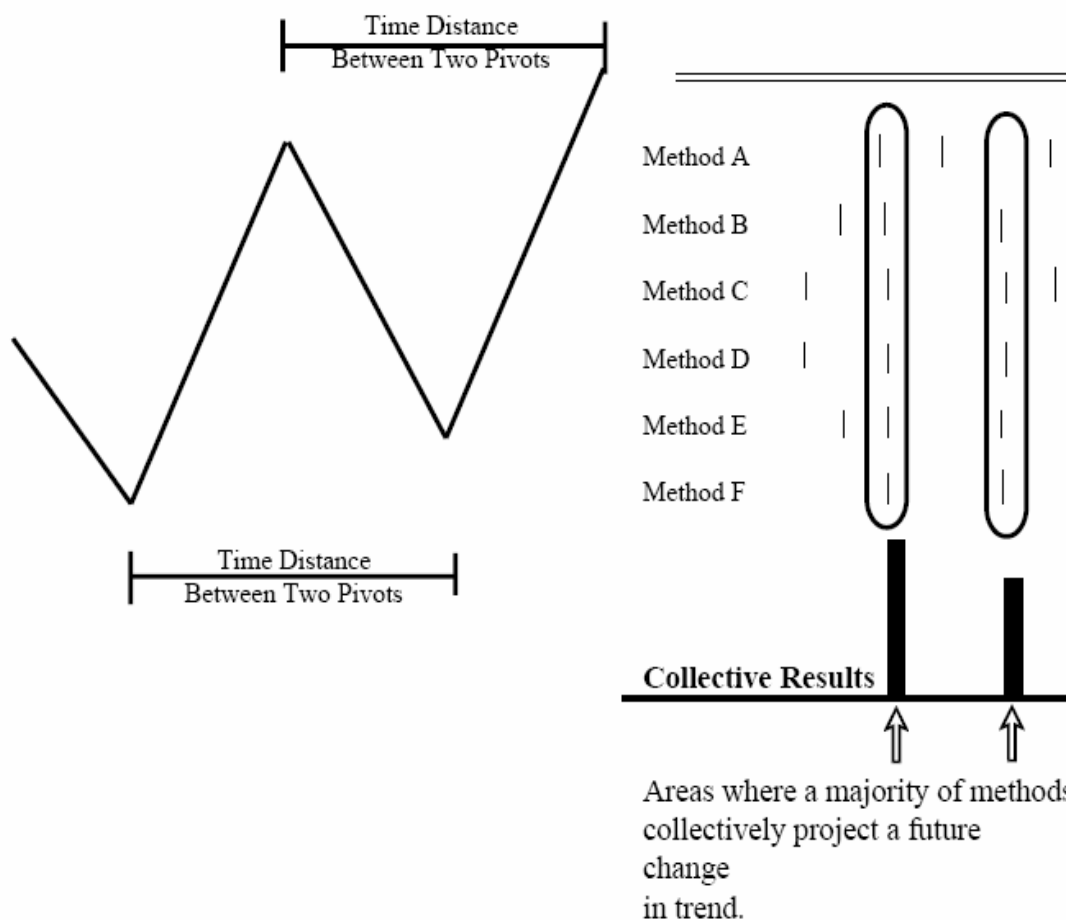
سوال؟

حال چگونه می توان از این ابزار استفاده کرد؟

جواب:

تمام ترکیب‌های قابل دسترس را بکار ببرید و گروهی از خوشه‌ها را بیابید. اجازه دهید بگوییم که تعدادی از تریدرها از این مطالعه استفاده می‌کنند که هر کدام نسبت‌ها و پیوت‌های متفاوتی را به کار می‌برند. جدا از اینکه کدام یک از این ترکیبات مورد استفاده قرار می‌گیرند پیش‌بینی‌های انتخاب شده همه تریدرها منتج به منطقه‌ای خواهد شد که در آن همه تریدرها معتقد به تغییر ترند می‌باشند. بنابراین مناطقی که بوسیله گروهی از خوشه‌ها مشخص می‌شوند تحت نام سطوح پیش‌بینی کننده انتخابی نامگذاری می‌شوند.

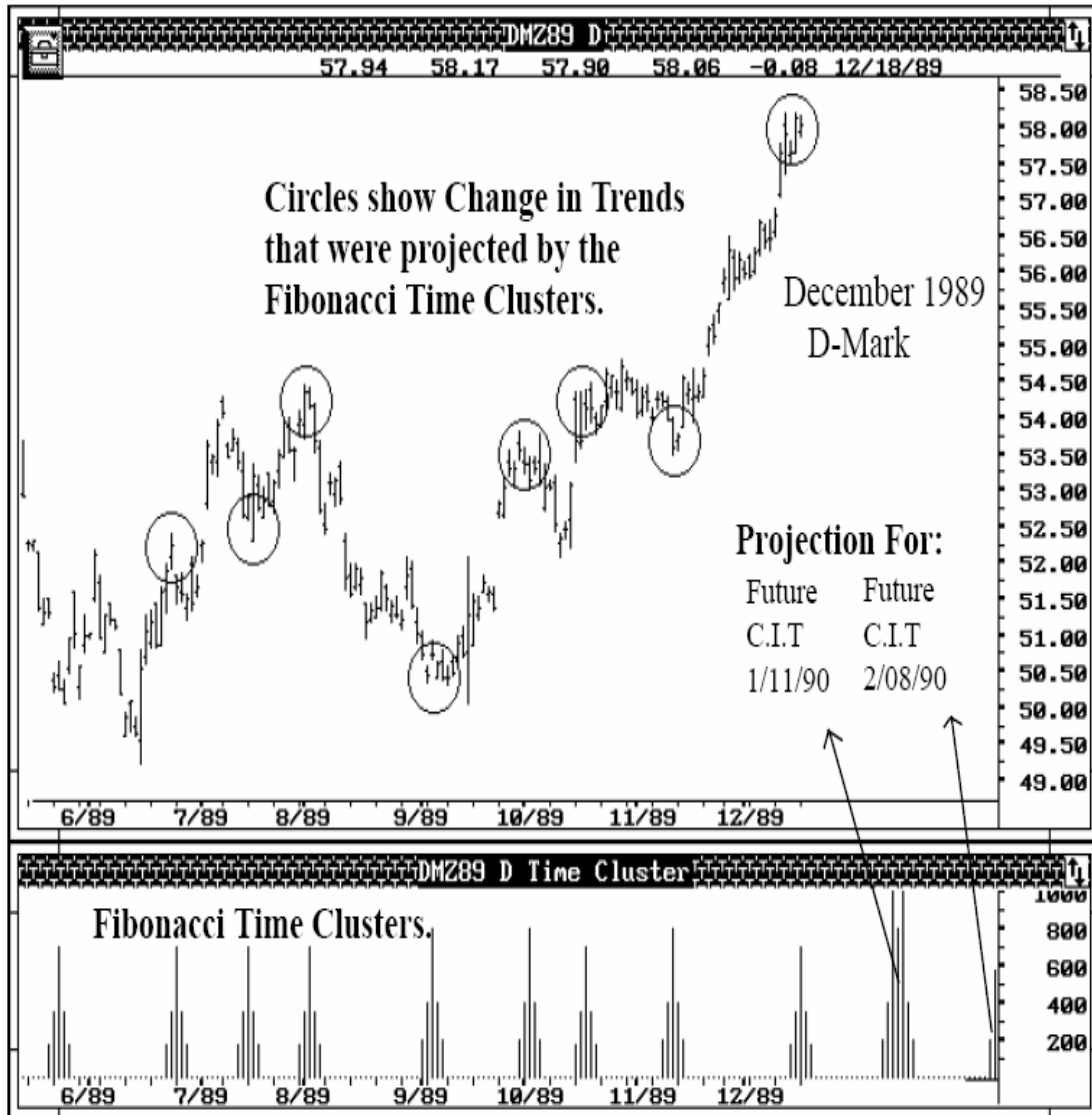
Future Projection Using Various Methods



مثال: خوشه‌های زمانی فیبوناچی

نمودار نشان داده شده در زیر نمودار سهام روزانه D-Mark در سال ۱۹۸۸ در ماه دسامبر می‌باشد. خوشه‌های زمانی با استفاده از موارد زیر بدست آمده‌اند.

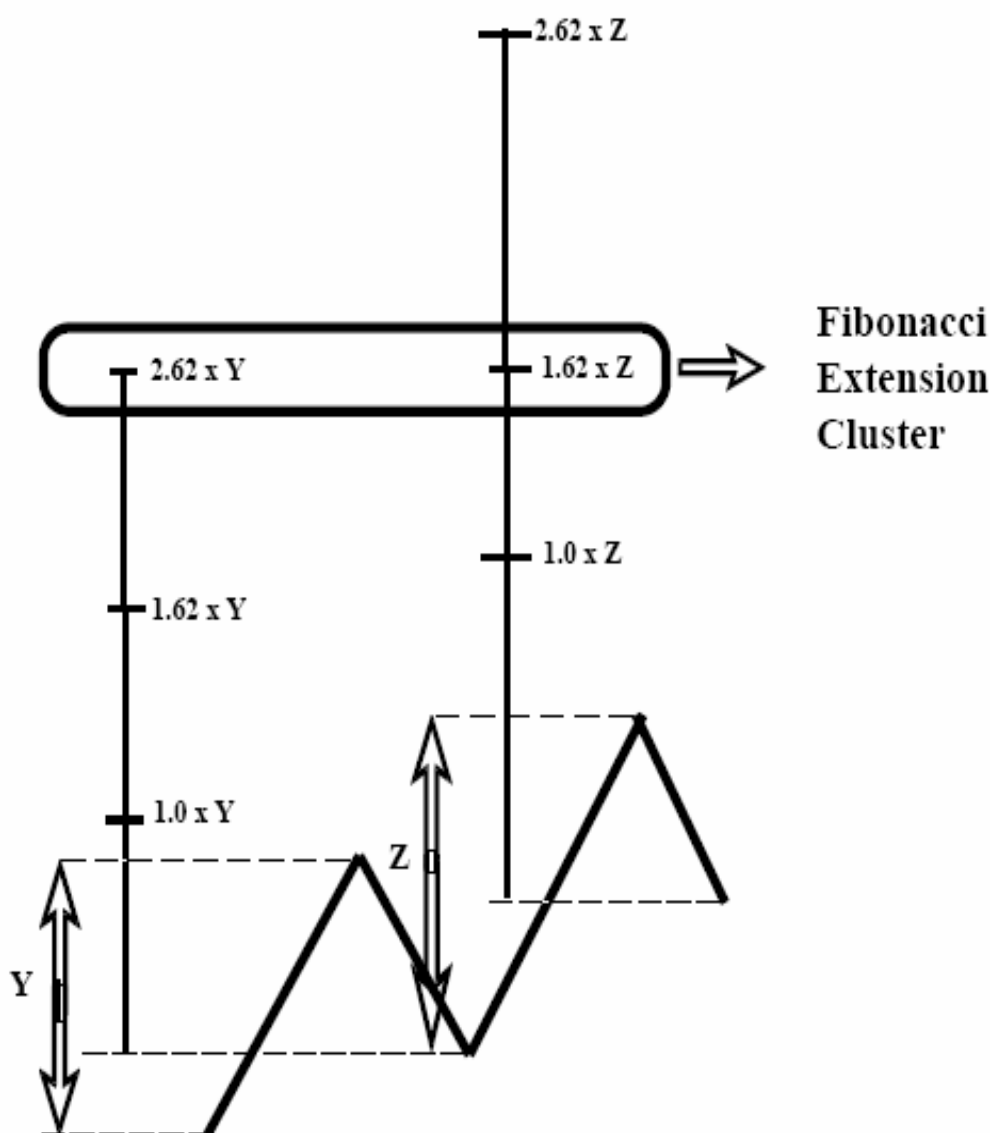
- همه پیوت‌های اولیه و اصلی
 - درصدهای ۱/۶۲ و ۲/۶۲ گسترش فیبوناچی زمانی با پوشش ۱۰۰٪
 - استفاده از نوسان High به High و Low به Low
 - حداقل وجود ۱۰ میله بین پیوت‌ها
 - حداکثر وجود ۱۰۰ میله در بین پیوت‌ها
- برای دیدن جزئیات بیشتر مطالب بالا صفحه بعدی را ببینید.



خوشه‌های گسترش فیبوناچی قیمت

سطوح اصلاحی و گسترش فیبوناچی تقریباً توسط همه تریدرها مورد استفاده قرار می‌گیرند. مطمئن باشید که همه افراد روش منحصر به فردی برای استفاده از آن‌ها دارند یا از آن طریق نسبت‌های فیبوناچی را بدست می‌آورند.

جدا از تنوع روش‌های مورد استفاده پیش‌بینی‌های انتخاب شده همه تریدرها منتج به سطوح قیمتی می‌شوند که در آن تعداد زیادی از تریدرها پیش‌بینی یکسانی از نقاط حمایت و مقاومت دارند نرم‌افزار می‌تواند این سطوح انتخابی را بوسیله راه‌های خوشه‌ای شناسایی کند.

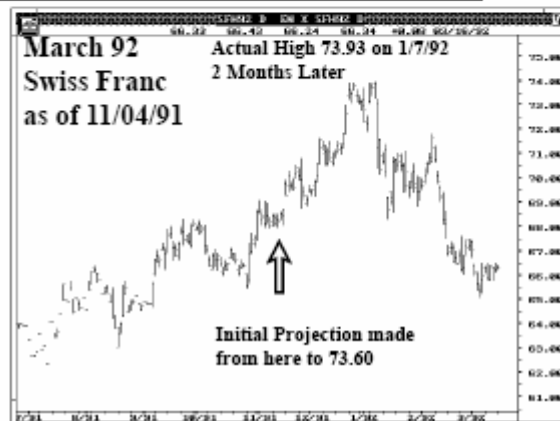
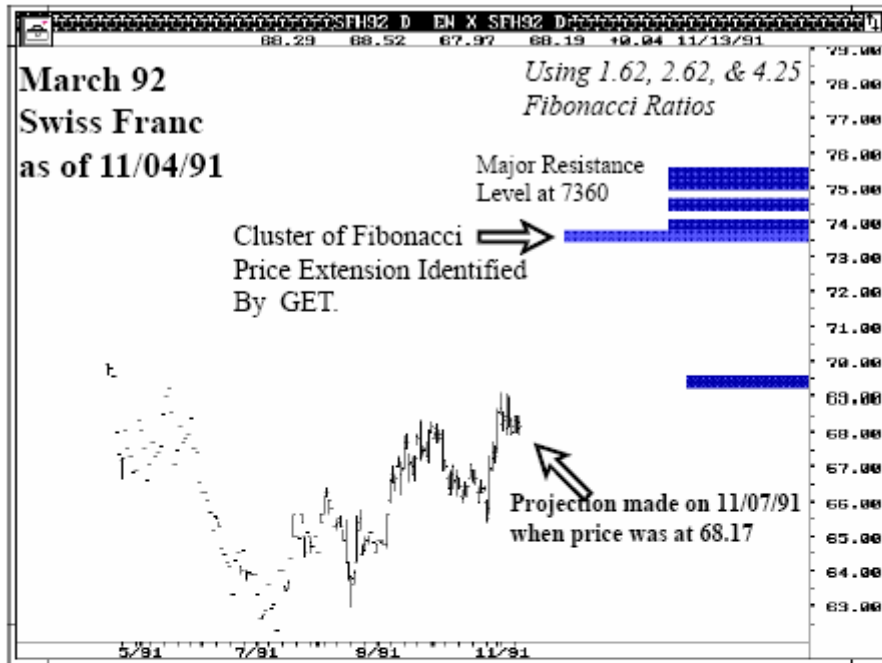


مثال: فوشه‌های گسترش فیبوناچی قیمت

نمودار نشان داده شده در زیر نمودار روزانه ماه مارس در سال ۱۹۹۲ مربوط به فرانک سوئیس است. گسترش فیبوناچی قیمت با استفاده از موارد زیر بدست آمده است:

* همه پیوت‌های اصلی و اولیه

* گسترش فیبوناچی قیمت با ۱/۶۲ و ۲/۶۲ و ۴/۲۳ با پوشش ۱۰۰٪ و با استفاده از رالی‌ها



پیش بینی:

خوشه اولیه در ۷۳۶۰ توسط نرم افزار در ۷ نوامبر ۱۹۹۷ رسم شد.

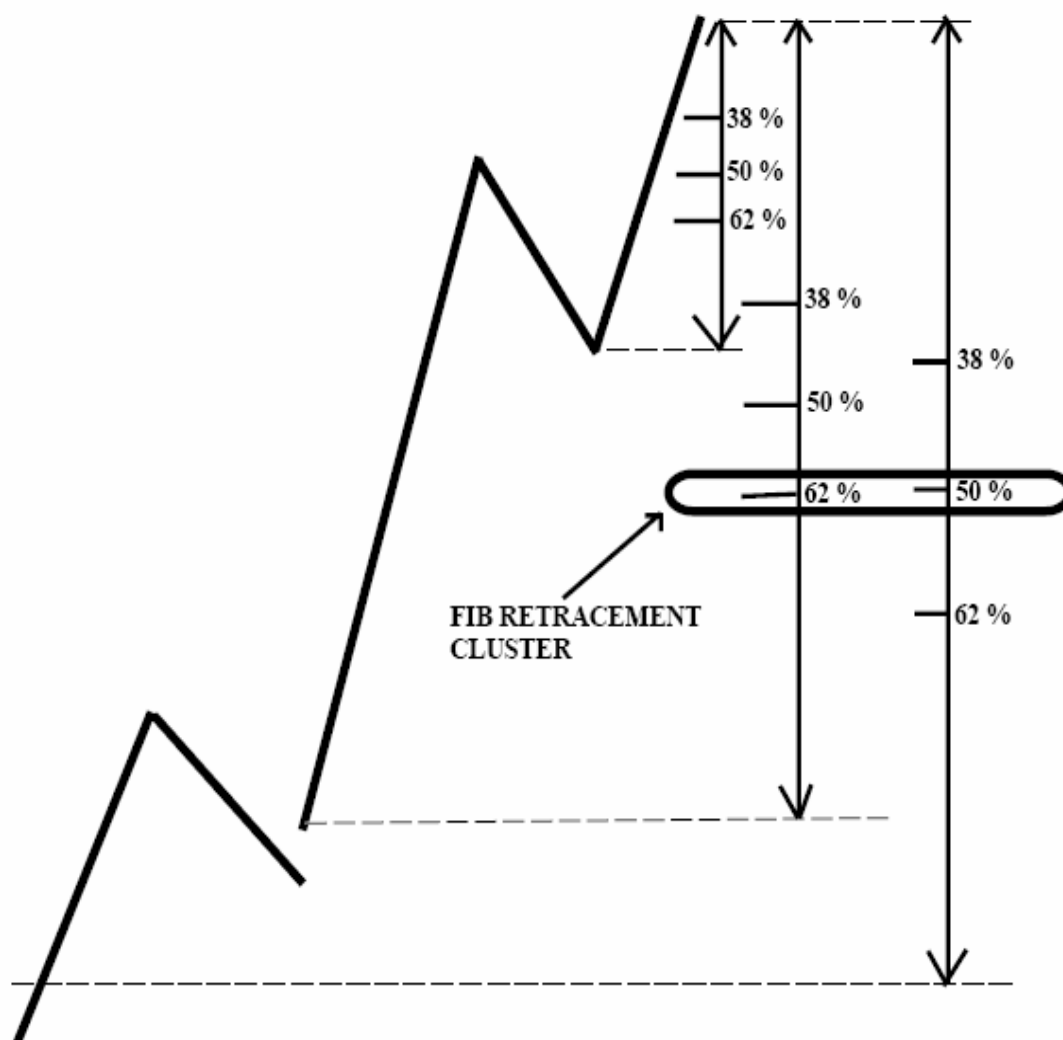
نتیجه:

دو ماه بعد در ماه مارس فرانک سوئیس در ۷۳/۹۳ به نقطه اوج خود رسید.



خوشه‌های اصلاح فیبوناچی قیمت

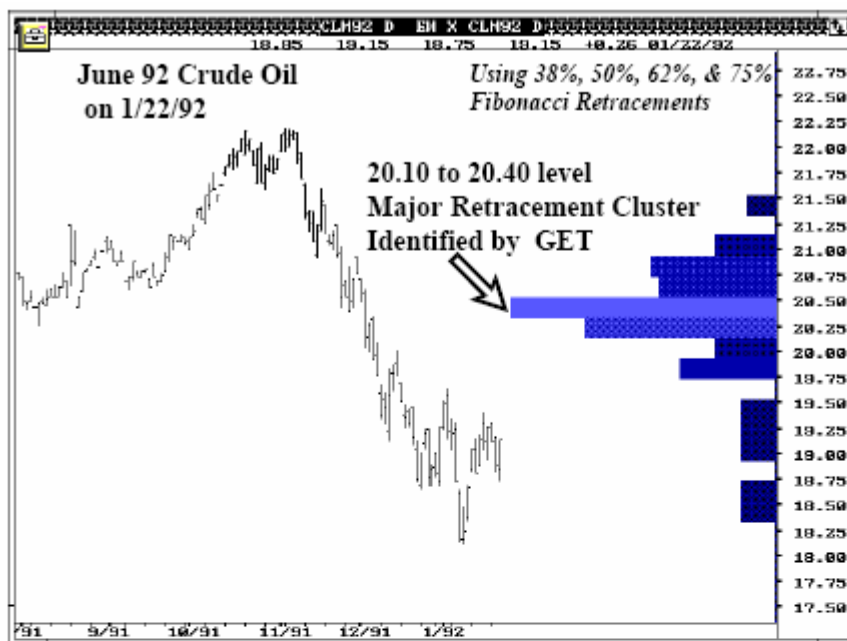
درست مانند گسترش‌ها همه تریدرها در سرتاسر دنیا از سطوح اصلاحی فیبوناچی قیمت برای تعیین خطوط حمایت و مقاومت استفاده می‌کنند. تریدرها از سطوح اصلاح متفاوتی استفاده کرده و همچنین از سطوح نوسان متفاوتی این محاسبه را انجام می‌دهند. بدون توجه به تعداد روش‌های مورد استفاده پیش‌بینی همه تریدرها منتج به سطوح قیمتی می‌شوند که در آن تعداد زیادی از تریدرها قائل به سطوح حمایت و مقاومت یکسانی هستند. نرم افزار قادر است این سطوح را بوسیله راه‌های خوشه‌ای شناسایی کند.



مثال، فوشه های اصلاح فیبوناچی قیمت

نمودار نشان داده شده در زیر نمودار روزانه ماه ژوئن در سال ۹۲ می باشد. اصلاح فیبوناچی قیمت با استفاده از موارد زیر بدست آمده است:

- همه پیوت های اصلی و اولیه. اصلاح فیبوناچی قیمت در سطوح ۰.۳۲٪، ۰.۵۰٪، ۰.۷۵٪ با استفاده از ۱۰۰٪ حرکت نزولی



پیش بینی:

اولین خوشه در ۲۰۴۰-۲۰۱۰ قرار گرفته است.

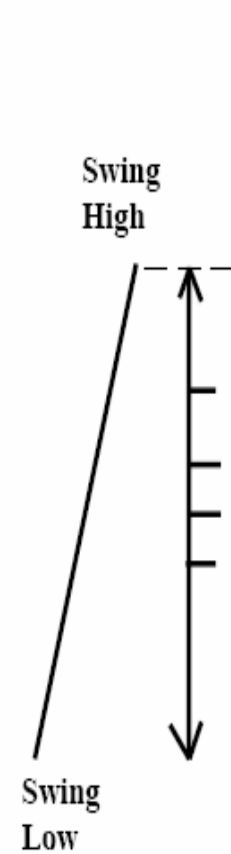
نتیجه:

یک High واقعی در نمودار ژوئن سال ۹۲ این سهم در ۲۰,۰۰۰ بوجود آمده است.

"قرار دادن اصلاح‌ها و گسترش‌ها و گسترش یک الیوت"

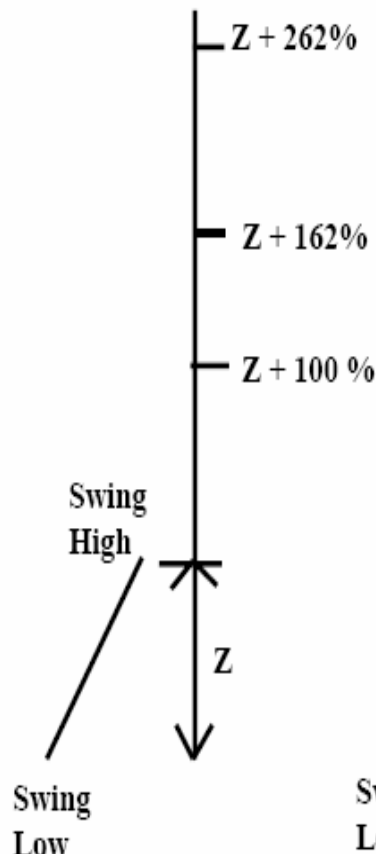
سه نوع متفاوت از خوشه‌های قیمت قابل محاسبه است. آن‌ها در زیر نمایش داده شده‌اند.

Retracements



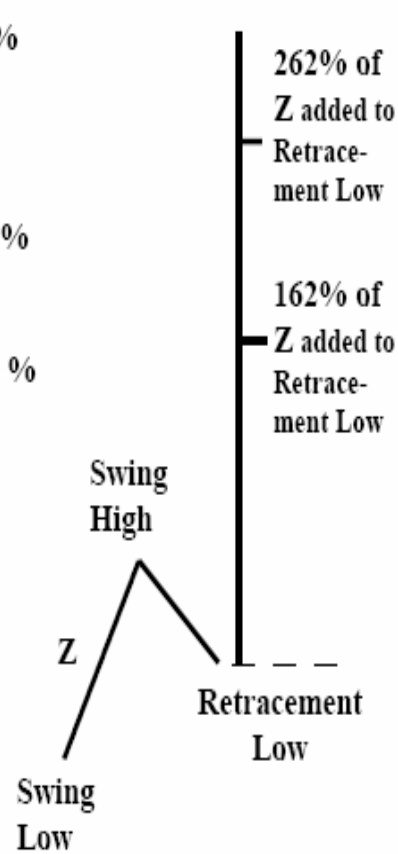
Retracement of Swing Range

Extensions



Fibonacci Extension added on to the end of the Swing

Elliott Extensions



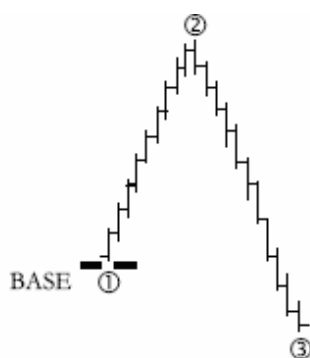
Fibonacci Extensions added to the end of a Retracement. These are normal Elliott Wave type extensions as used in Waves 1,2,3, etc.



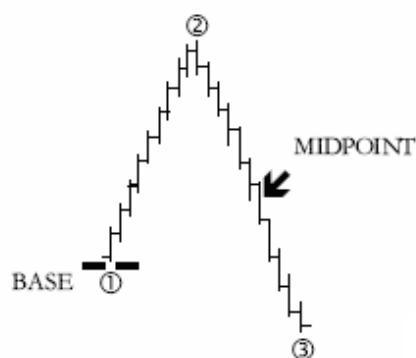
خطوط میانه اندروز

دکتر آلن اندروز تکنیکی را گسترش داد که خطوط میانه نامیده می شود. روش فوق به عنوان یک ابزار ترید مکمل بوسیله بسیاری از تریدرها مورد استفاده قرار می گیرد. در چند صفحه بعد ما در مورد جزئیات خطوط میانه و در ترکیب با آنالیزور موج الیوت بحث خواهیم کرد.

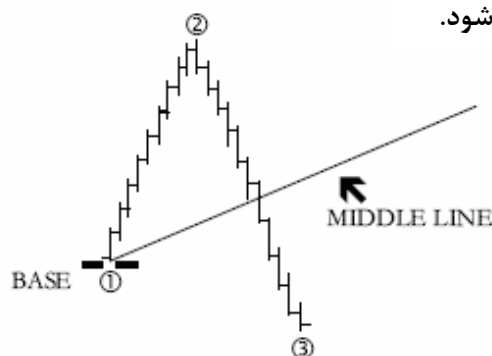
برای رسم خطوط میانه ما نیاز به ۳ نقطه داریم. زمانی که ۳ نقطه در بازار شناسایی شد شما آماده خواهید شد تا از خطوط فوق استفاده کنید. نقطه اول نقطه پایه (Base) نامیده می شود.



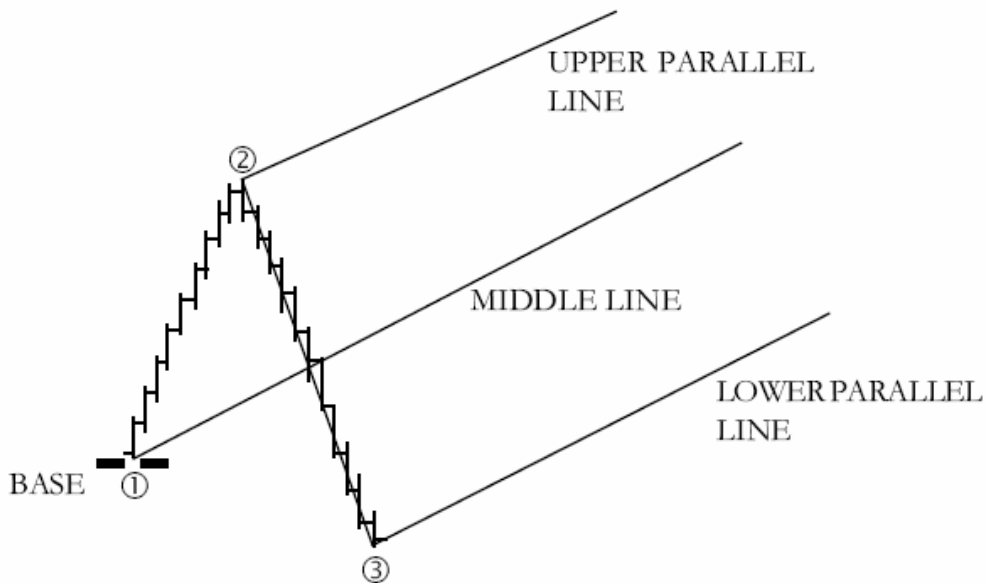
یک خط از نقطه ۲ به ۳ رسم می کنیم.



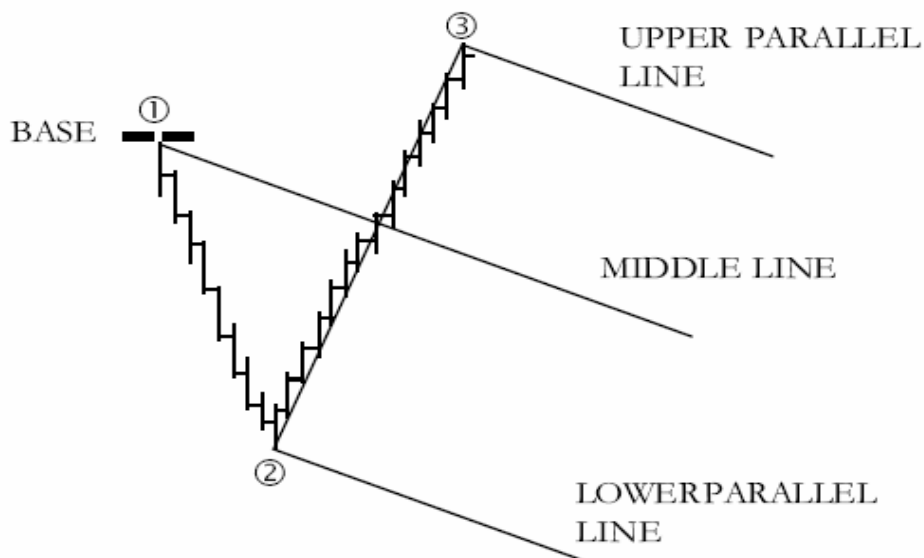
خطی از نقطه پایه به نقطه میانی ۲ ، ۳ وصل می کنیم. این خط میانه نامیده می شود.



خطوطی از نقاط ۲ و ۳ که موازی با خط میانه باشد رسم می‌کنیم این خطوط موازی بالایی و پایانی نامیده می‌شوند.



خط میانه رو به پایین دقیقاً برعکس خط میانه رو به بالا باشد. در ابتدا دوباره باید ۳ نقطه پیدا شود. نقطه اول نقطه پایه نامیده می‌شود. نقطه‌ای در حد فاصل نقاط ۲ و ۳ را پیدا کرده و از نقطه پایه به نقطه میانه وصل می‌کنیم. این خط میانه نام دارد. سپس خطوطی از نقاط ۲ و ۳ موازی خط میانه رسم کنید. به همین منوال این خطوط موازی بالایی و پایینی نامگذاری می‌شوند.



در قوانین دکتر اندروز قیمت یکی از دو حالت زیر را در برخورد با خط میانه خواهد داشت.
 (۱) قیمت در خط میانه برگشت خواهد داشت و یا
 (۲) قیمت از خط میانه خواهد گذشت و با خط موازی بالایی برخورد خواهد کرد. مثال‌هایی
 در هر دو مورد در ادامه آمده است:

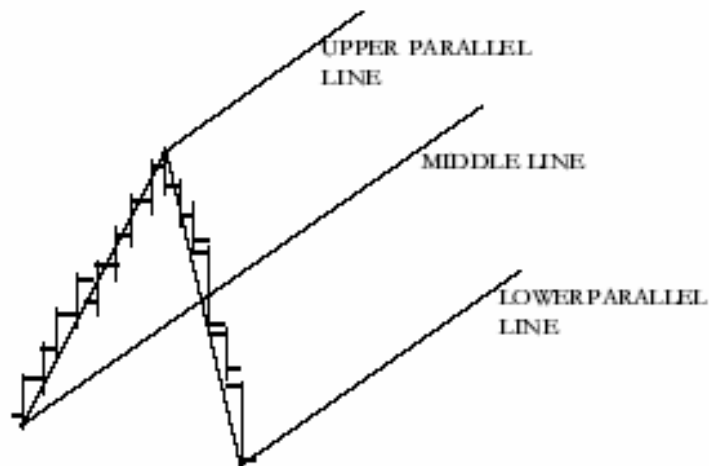




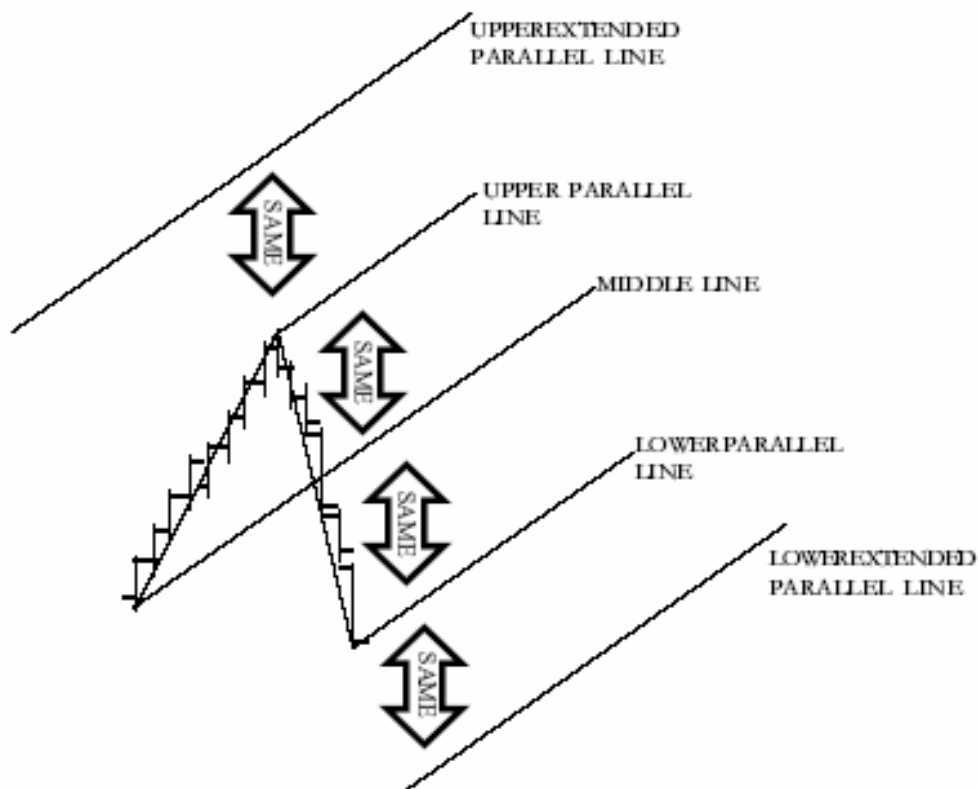
خطوط موازی گسترش یافته

در بعضی موارد خطوط موازی استاندارد گسترش می‌یابند. این حالت برای زمانی که بازار حرکت تندی دارد لازم است. مجدداً زمانی که خط میانی استاندارد رسم شد. کانال‌های موازی بالایی و پایینی رسم می‌شوند. سپس شما آماده‌اید که خطوط موازی معمولی را گسترش دهید فاصله بین خط میانه و خط موازی بالایی را رسم کنید. از همین فاصله استفاده کنید و یک خط موازی با خط موازی بالایی رسم کنید. همین کار را برای خط موازی پایینی نیز انجام دهید. اگر شما از ابزار Pitchfork در Global ToolBox استفاده کنید می‌توانید به راحتی این کار را انجام دهید. بصورت اتوماتیک فاصله بین خطوط موازی بالایی و پایینی را محاسبه می‌کند و خطوط موازی گسترش یافته هر دو خط موازی بالایی و پایینی را رسم می‌کند.



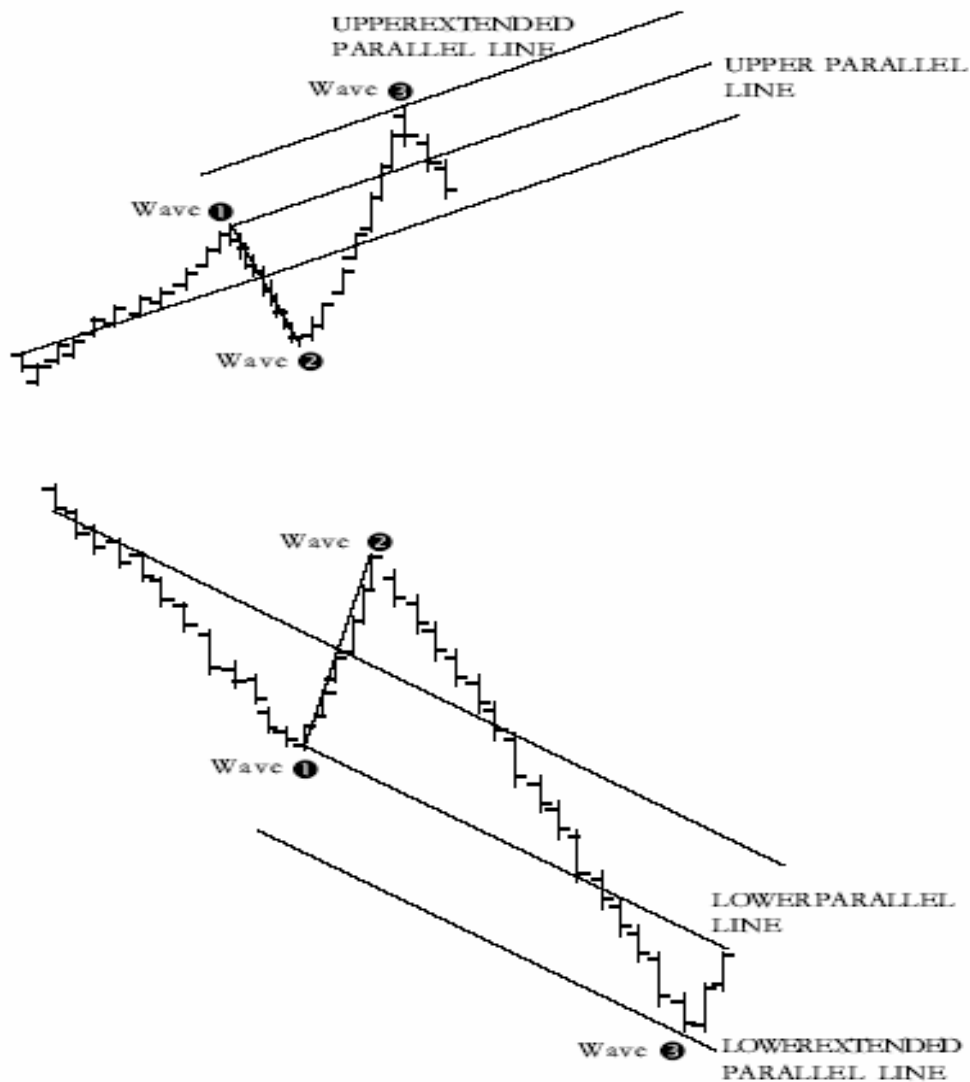


Extended Parallel Lines



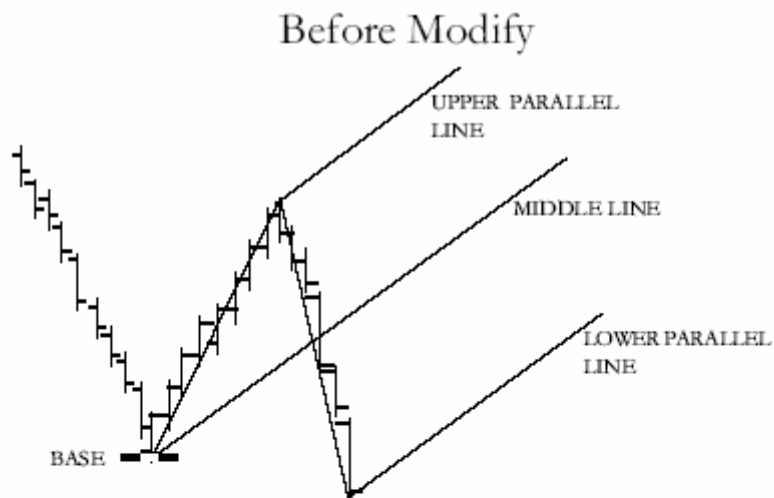
کشیدن خطوط موازی گسترش یافته جهت یافتن بالای موج ۳ ضروری است. این امر در زمانی که حرکت بازار در خلال یک حرکت قوی موج ۳ فاصله ایجاد می کند ضرورت می یابد.





زمان‌هایی وجود دارد که در آن موج ۲ حرکت اصلاحی ما شیب تندی دارد. این زمانی است که شما باید **Modify** را در جعبه ابزار **Pitchfork** استفاده کنید. با تغییر این دکمه به روی حالت **On** خود **Pitchfork** بصورت اتوماتیک حالت مستقیم را تغییر داده و فاصله‌ها را مطابق با اصلاح موج ۲ تغییر می‌دهد. شما باید نقطه پایه را پیدا کرد و سپس **GET** خودش آنها را برای شما **Modify** می‌کند.

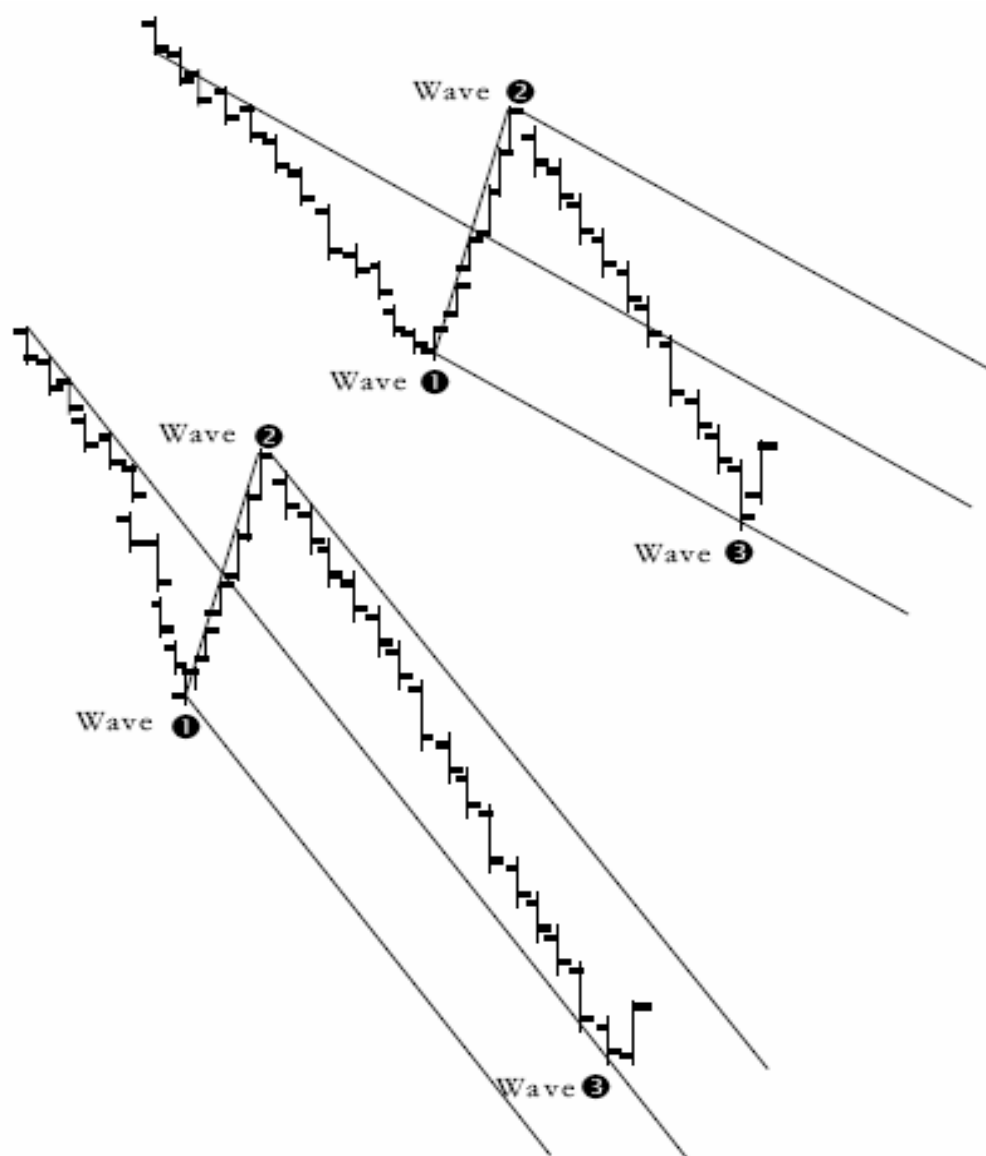




ترکیب خطوط میانه با موج ۳

زمانی که خط میانه بر روی موج ۱ و ۲ رسم شود شما می‌توانید تکنیک خط میانه را برای پیش‌بینی اوج موج ۳ بکار ببرید.

معمولا موج ۳ در خط میانه یا خط موازی بالایی یا پایینی پایان می‌یابد.

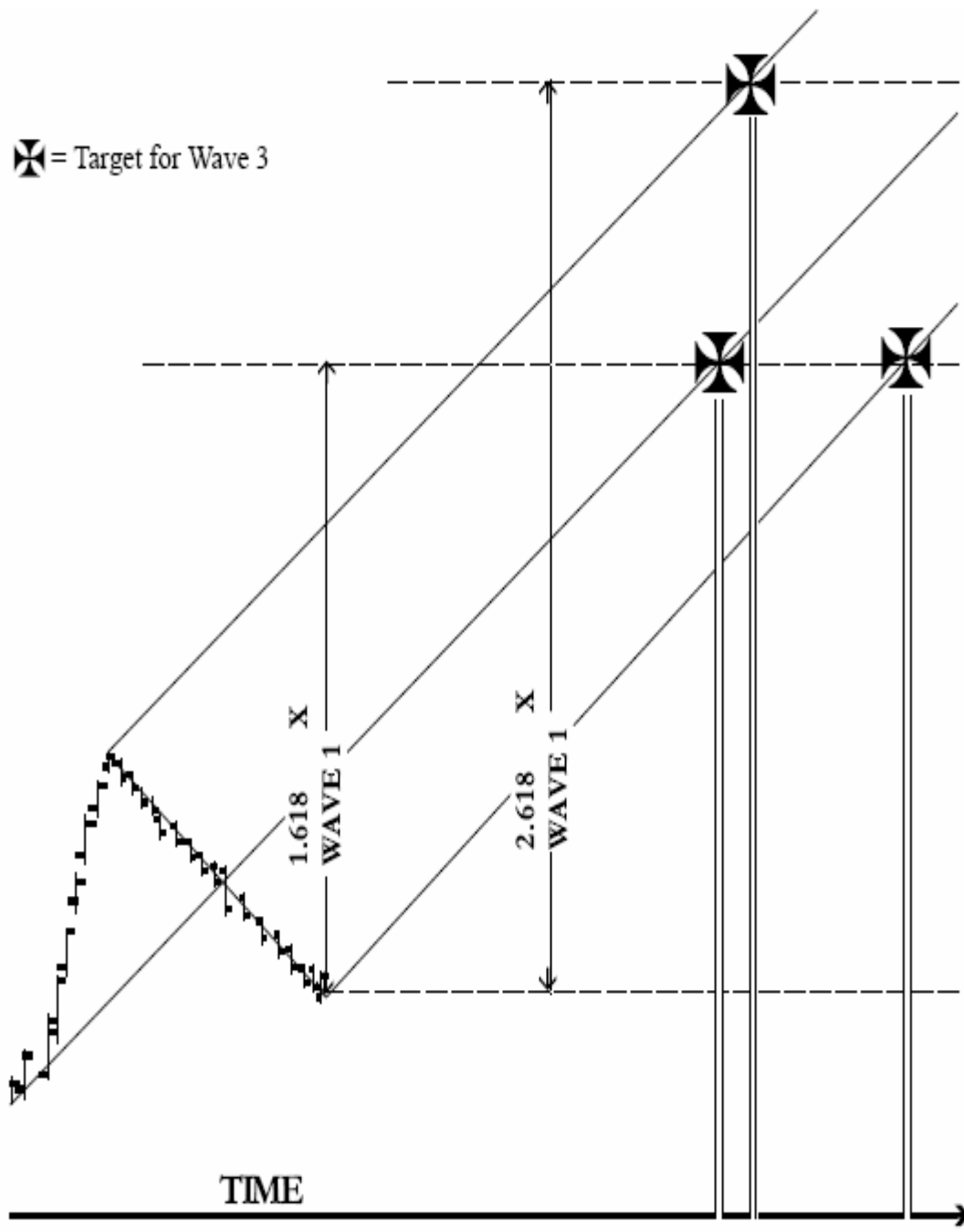


موج ۳ ارتباط فیبوناچی با موج ۱ دارد. ما می‌توانیم این مساله را در مورد پیشرفته محاسبه کنیم.

روش خط میانه تمایل دارد که اوج موج ۳ را بیابد. با ترکیب این دو تکنیک این امر امکان‌پذیر است که دوره‌های زمانی که موج ۳ پایان می‌یابد پیش‌بینی شود. زمانی که موج ۱ و ۲ پایان یافت یک خط میانه از نقطه پایه موج ۱ به میانه موج ۲ رسم کنید سپس خطوط موازی بالایی و پایینی را مثل قبل رسم کنید.

حالا پیش‌بینی فیبوناچی را نیز رسم کنید. این خطوط فیبوناچی خطوط میانه را قطع خواهد کرد. هر یک از این تقاطع‌ها نقطه بالقوه‌ای برای پایان اوج (Top) موج ۳ می‌باشد.





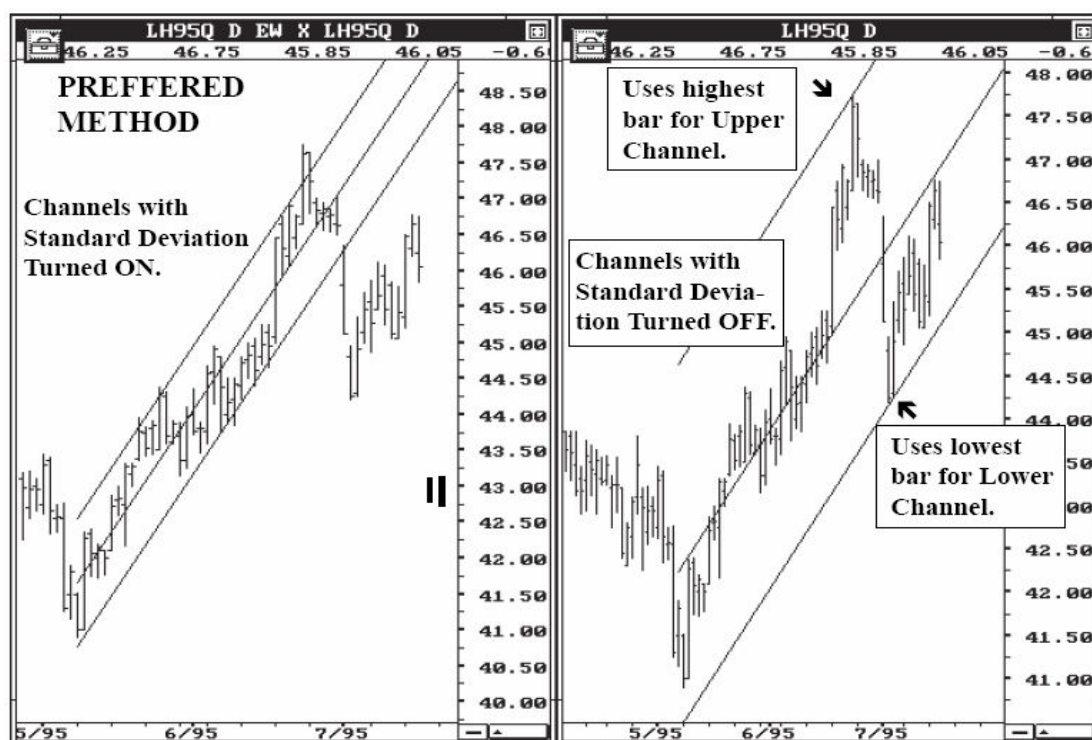
کانال‌های رگرسیون ترند اتوماتیک

چگونه از آن استفاده و با آن ترید کنیم

کانال‌های رگرسیون ترند ابزار بسیار مفیدی در تشخیص و تعقیب ترند بازار می‌باشند. زمانی که قیمت‌ها کانال ترند را به خوبی بشکنند معمولاً ترند بازار تغییر می‌کند. به هر حال کشیدن این کانال‌ها کار خسته کننده‌ای می‌باشد. بنابراین ما تصمیم گرفتیم این کار را به صورت اتوماتیک انجام دهیم. ابتدا اجازه دهید در مورد مشکل بعضی از تریدرها در برخورد با کانال رگرسیون صحبت کنیم.

مشکل موجود

در منوی رگرسیون ترند چراغ سبز در جعبه SD باید On باشد. زمانی که حالت On باشد نرم افزار SD را برای کانال‌های بالایی و پایینی محاسبه خواهد کرد. اگر SD در حالت Off باشد (چراغ سبز نباشد) سپس نرم افزار به سادگی بالاترین و پایین‌ترین نقطه را خواهد یافت و با استفاده از این پیک قیمت‌ها کانال‌های پایینی و بالایی رسم می‌شود. به منظور استفاده از کانال‌های رگرسیون ترند که در اینجا بحث می‌شود شما باید SD را روی On قرار دهید (چراغ سبز روشن باشد).

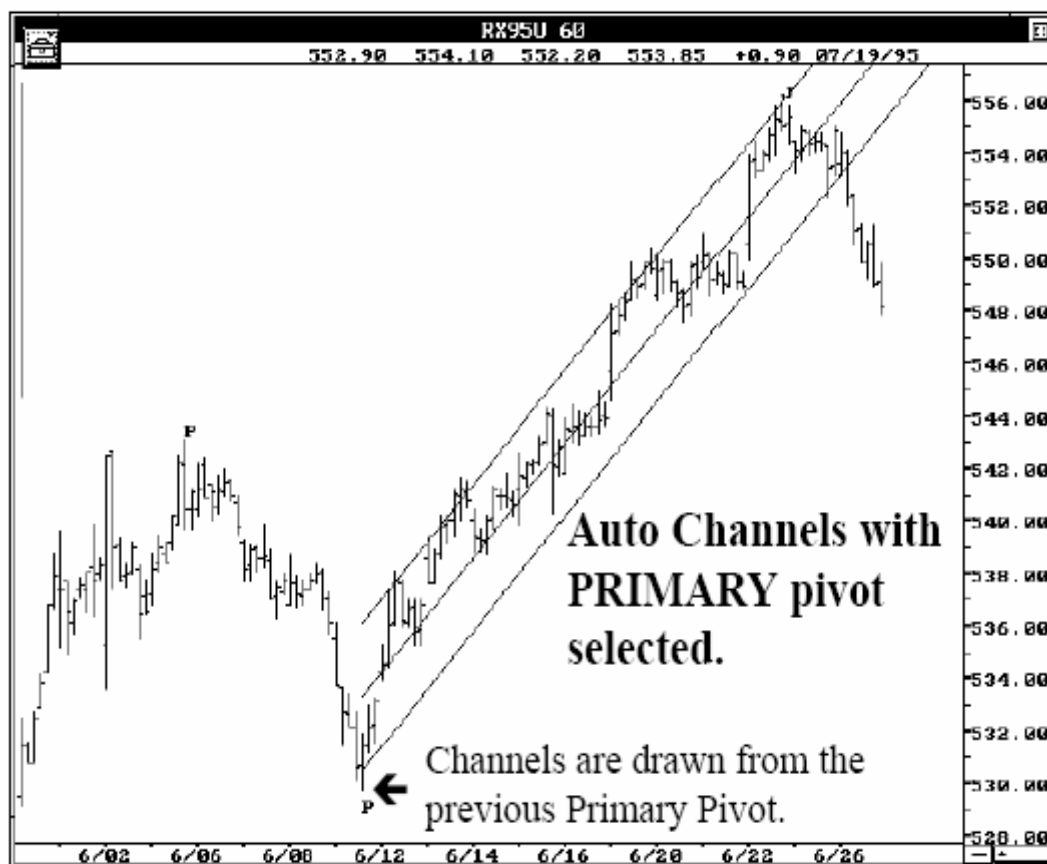


Min Pivot Select برای کانال اتوماتیک

ما چندین روش را آزمایش کردیم و در ادامه توضیح دادیم. کاربر یک پیوت قبلی را که نرم افزار بعد از آن کانال را رسم کرده است می یابد. برای ترند بلند مدت از حالت اصلی یا اولیه استفاده کنید. برای ترندهای کوتاه مدت از حالت مینور یا بینابینی استفاده کنید. ما توصیه می کنیم این مطالعه بوسیله پیوت اصلی یا اولیه انتخاب شود. در غیر اینصورت کانال های اتوماتیک بصورت مداوم در هر زمان که رسم می شوند از یک پیوت مینور استفاده می شوند. این تغییر مداوم می تواند این کانال های اتوماتیک را بلااستفاده کند. مثال هایی که در ادامه می آید می تواند انتخاب پیوت را روشن کند.

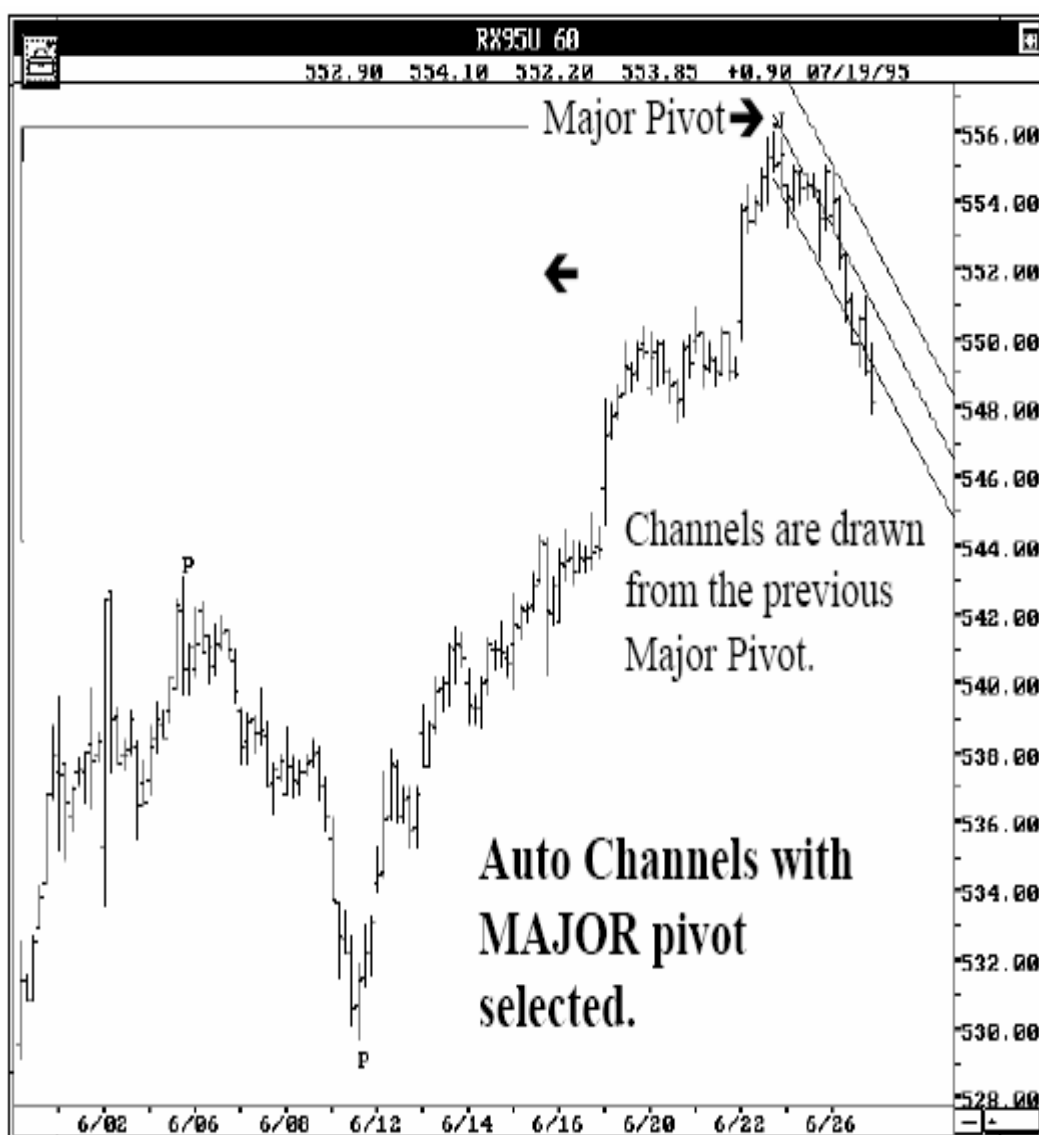
پیوت اولیه

بوسیله انتخاب پیوت اولیه به عنوان پیوت مینیموم نرم افزار بدنبال پیوت اولیه قبلی می گردد و کانال رگرسیون ترند را از این پیوت رسم خواهد کرد. زمانی که یک پیوت اولیه شماره گذاری شد کانال ها به صورت اتوماتیک از پیوت جدید رسم می شوند.



پیوت اصلی

بوسیله انتخاب پیوت اصلی به عنوان پیوت مینیموم نرم افزار بدنبال پیوت اصلی قبلی می گردد و کانال رگرسیون ترند را از این پیوت رسم خواهد کرد. زمانی که یک پیوت اصلی جدید شماره گذاری می شود کانالها به صورت اتوماتیک مجدداً از این پیوت جدید رسم می شوند.



مثال واقعی استفاده از کانال‌های اتوماتیک

تریدی که در ادامه می‌آید در مورد دلار کانادا در ماه سپتامبر با استفاده از آنالیز موج ایوت و کانال‌های رگرسیون ترند اتوماتیک و نوسان نمای ایوت است.

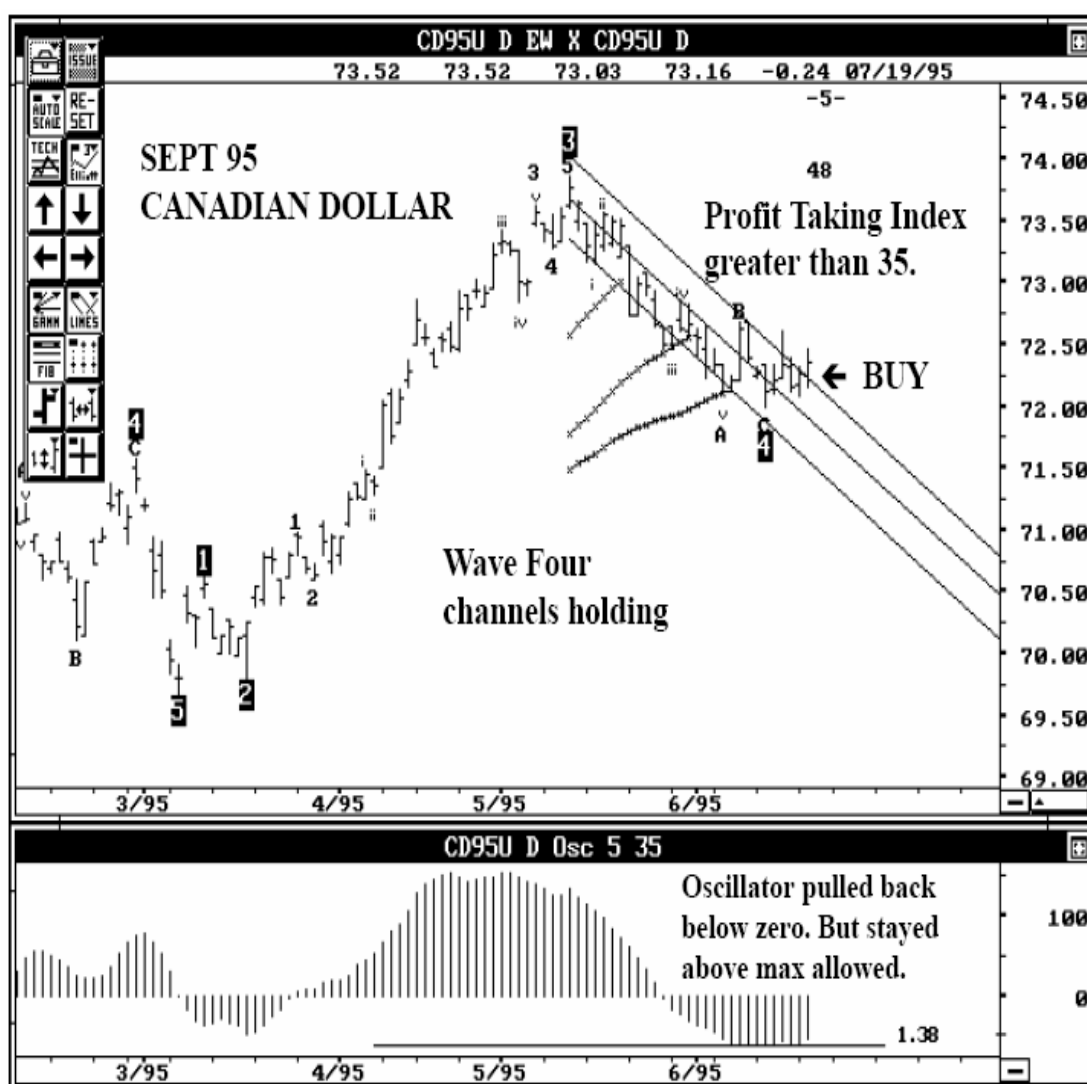
مواردی که باید رعایت شوند:

* نوسان‌نما به سمت صفر برگردد و بالای مقداری که بیشتر از آن مجاز نیست نماند.

* PTI در عدد ۴۸ است (بیشتر از ۳۵). معنی آن این است که حالت خوبی برای شروع

رالی ۵ وجود دارد. Buy برای دلار کانادا در ماه سپتامبر در محل شکسته شدن کانال

ترند وجود دارد.



اکسپرت مشخص کننده ترند (XTL)

نیاز برای XTL:

GET پیشرفته دارای ویژگی عالی در شناسایی شمارش موج الیوت می باشد. زمانی که با مطالعاتی از قبیل PTI، کانال های موج ۴، کانال های ترند و مشابه آن ترکیب می شود یک مکانیسم مؤثر ترید کردن در دسترس کاربران GET قرار می گیرد. مکانیسم این استراتژی بر موارد زیر متمرکز است:

الف) ترید بر روی حرکت از موج ۴ به ۵ در ترید نوع اول

ب) ترید در پایان موج ۵ در ترید نوع دوم

این مساله می توانست بسیار پر بار تر شود در صورتی که می توانسیم با مکانیسم فوق در بعضی از موج های سوم گسترش یافته که در بازار ایجاد می شوند شرکت کنیم. به همین دلیل این کار با ماندن در ترید های نوع دوم که در انتهای موج ۵ صورت می گیرد قابل انجام است که در این حالت باید منتظر موج سوم که تولید خواهد شد ماند. در بعضی اوقات تعدادی از کاربران ما درخواست کردند که ما تکنیکی ارائه دهیم که اجازه دهد زودتر به نوسان موج سوم وارد شوند.

بعد از تحقیقات زیاد، ما ژوزف ترند اندکس را در سال ۱۹۹۵ بدست آوردیم. این JTI طراحی شده بود به منظور این که نوسان موج سوم را زمانی که نوسان رخ می دهد تشخیص دهد. این کار بوسیله ایجاد یک منحنی لگاریتمی در نوسان موج سوم بدست می آمد. به هر حال در بعضی موارد این تشخیص برای کاربری که می خواست به طور کامل به نوسان موج سوم وارد شود به خصوص در مواردی که نقطه ورود زودتری داشت کمی دیر انجام می شد.

ابزار

بعد از آخرین نرم افزار GET پیشرفته که در ماه مارس ۱۹۹۵ منتشر شد، ما تحقیقات را ادامه دادیم تا راه حل قابل قبولی را برای شناسایی نوسان موج سوم در مراحل اولیه بدست آوریم. نتیجه این کار XTL (اکسپرت مشخص کننده ترند) می باشد.

تئوری XTL:

اگر ما با دقت به نمودارها نگاه کنیم شما بازه‌های زمانی را خواهید یافت که در آنجا بازار تمایل دارد که از ترند قبلی خود برگردد و نیرویی بدون جهت مشخص و نوسانات واضح داشته باشد که به صورت پشت سر هم و تصادفی رخ می‌دهد. به خاطر می‌آوریم که بسیاری از این نوسانات تحت عنوان Noise طبقه‌بندی می‌شوند. مثال‌های که در صفحات بعدی می‌آیند نشان دهنده نمودار طلا مربوط به فوریه ۹۶ می‌باشد که بازار حالت سایید و بدون ترند مشخص می‌باشد.

برای بمت در مورد این مساله باید گفت که بازاری است که در آن ترید کردن در یک روش تصادفی است. در صورتی که شما در این بازار با استفاده از ترندی که این سیستم به شما می‌دهد ترید انجام دهید، شما باید Buy در نقاط High انجام داده Sell در Low انجام دهید. ترندی که براساس مدل گفته شده ایجاد می‌شود معمولاً در بازارهای سایید به خوبی کار نمی‌کند. به هر حال ترید کردن بوسیله اندیکاتورهایی که حالت‌های بیش فروش و بیش خرید را نشان می‌دهند در این بازه‌های زمان بهتر کار می‌کنند.



به هر حال شما باید در بازه‌های زمانی از استراتژی که در حالت بیش خرید و فروش ترید می‌کند به حالت‌هایی که بازار ترند داراست تغییر وضعیت دهید. به نظر نمی‌رسد این چرخه هیچگاه تغییر کند و *literally make a grown man cry*. زمانی که بازار به سمت حالت ترند دار حرکت می‌کند قیمت در یک جهت با مومنتوم قوی و بعنوان یک مومنتوم ادامه دار ترید می‌شود که این نوسان تحت عنوان ترند ماژور طبقه‌بندی می‌شود. در واژه‌های امواج الیوت این نوسان به نام موج سوم نام گذاری می‌شود.



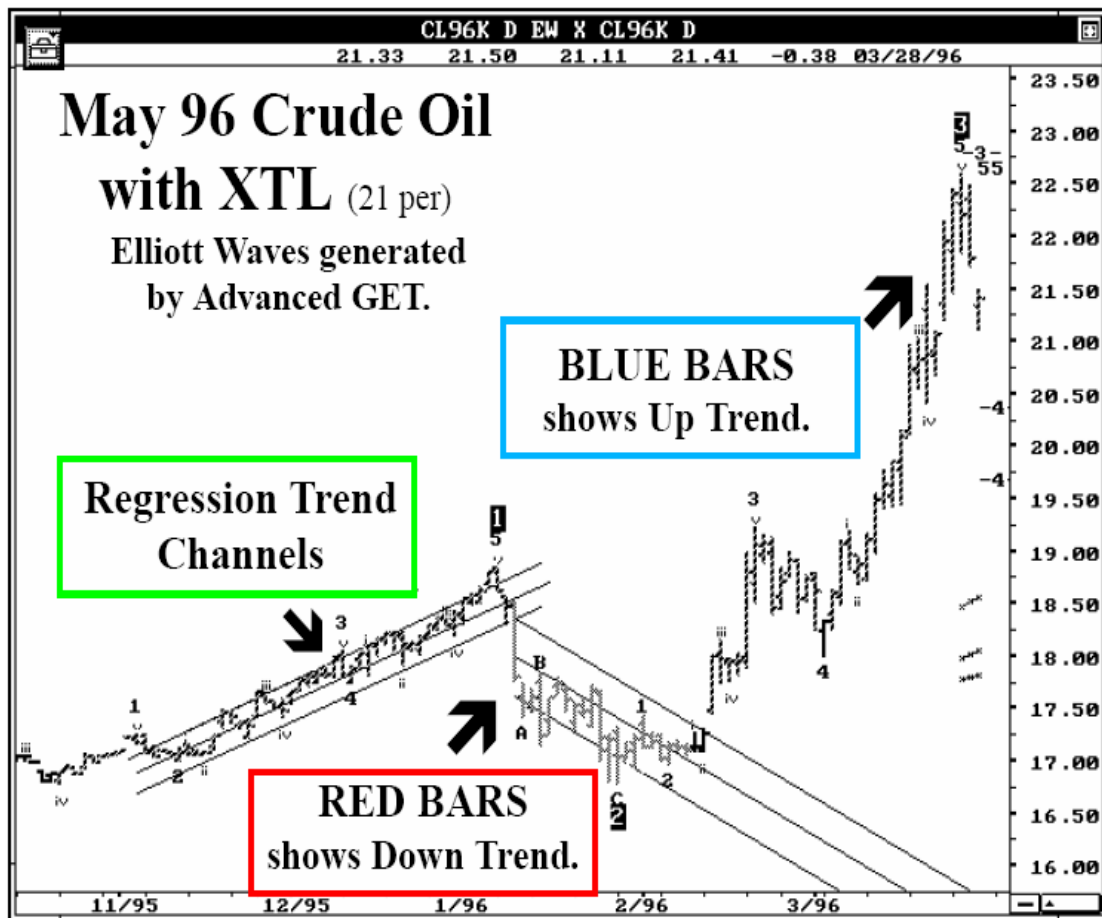


هدف تشخیص این مساله است که چه زمانی بازار در حالت تصادفی است (random Fashion) و چه زمانی در حالت ترند ماژور است. این مساله نیاز به دو چیز دیگر دارد.

- (۱) حالت ترند اصلی باید در مراحل اولیه شناسایی شود تا کسی بتواند روی آن ترید کند.
- (۲) سیگنال‌های خطای آن کم باشد.

ما یک مدل آماری را ایجاد کردیم که به صورت تصادفی اطلاعات داده شده را بررسی می‌کند. مدل مشابه یک تست برای موارد تصادفی می‌باشد (در کتاب‌های آماری پیشرفته بیابید). مدل آماری ما ارزشی معادل ۰ و ۱ برای اطلاعات داده شده محاسبه می‌کند. (۰ به طور کامل تصادفی است و ۱ کاملاً biased) به علاوه ما همچنین راهی برای اندازه‌گیری سطوح آستانه یافتیم. اگر آزمایش ما برای اطلاعات داده شد تصادفی شده از این آستانه بالاتر بود ما انتظار فواید داشت که بازار به صورت بالقوه حرکت کند یا تریدی همراه با یک bias در مراحل اولیه یک ترند ماژور صورت فواید پذیرفت.

زمانی که یک bias رو به پایین یا ترند رو به پایین یافت می‌شود ستون‌ها به رنگ قرمز می‌شوند و زمانی که bias رو به بالا یا ترند رو به بالا یافت می‌شود ستون‌ها به رنگ آبی می‌شوند. اگر ترند نه به سمت بالا و نه به سمت پایین باشد ستون‌ها به رنگ سیاه دیده می‌شوند.



قابلیت جابه‌جایی

این مطالعه فقط در صورتی قابل اعتماد است که قابلیت استفاده در بازارهای دیگر را داشته باشد. مدل آماری که ما برای XTL یافته‌ایم این خاصیت را دارد. این مدل در همه بازارها (کالا و سهام) و برای همه زمان‌ها بدون هیچ محدودیتی کار می‌کند.

سازگاری با آنالیز موج الیوت:

تقریباً همه نوسانات موج سوم که ایجاد می‌شوند قوی هستند و مومنتوم زیادی برای ایجاد یک ترند مازور دارند. در بسیاری از موارد XTL می‌تواند ترند مازور را در مراحل اولیه موج سوم بیابد. بعلاوه اینکه XTL یک مدل آماری است و از امواج الیوت استفاده نمی‌کند می‌تواند نقاط مطمئن و مستقلی را ارائه دهد و ابزار ورودی زود هنگامی برای نوسان موج سوم می‌باشد.

طراحی برای استفاده از XTL:

شاید مهمترین ارزش استفاده از XTL شناسایی مراحل اولیه موج سوم صعودی یا نزولی می‌باشد. آنالیزور اموج الیوت به کاربر هشدار می‌دهد که احتمال بالقوه تغییر در ترند وجود دارد. ابزار XTL می‌تواند این تغییر در ترند را شناسایی یا کشف کند. بنابراین ترکیب آنالیزور موج الیوت و XTL می‌تواند حالت فوبی را در جهت پیش‌بینی و اثبات ترند بوهود آورد.

در چندین صفحه بعدی ما بحث خواهیم کرد که چگونه از XTL استفاده کنیم و بعضی از قوانین ترید توصیه شده شرح داده خواهد شد ما پیشنهاد می‌کنیم که شما از این حالت استفاده کنید و ایده‌های خود را در بازه‌های متفاوت آزمایش کنید. سپس حالتی را شکل دهید که منطبق با استیل ترید کردن شما باشد.

تنظیمات XTL:

فقط یک تنظیم (input) برای کاربر قرار داده شده است که ابزار XTL برای آن محاسبه انجام می‌دهد. این ورودی تعداد میله‌هایی می‌باشد که برای آزمایش به کار برده می‌شود. تنظیم از پیش تعیین شده دوره ۳۵ را به کار برده است و ما به شدت توصیه می‌کنیم که آن را به کار ببرید. استفاده از دوره ۳۵ باعث کاهش تعداد سیگنال‌های خطای شکسته شدن می‌شود. به هر حال استفاده از تنظیم با دوره ۲۱ روزه به XTL این اجازه را می‌دهد که ترند مازور را در مراحل خیلی ابتدایی تر شناسایی کند.

بنابراین با وجودی که XTL با دوره ۳۵ سیگنال‌های خطای کمتری ایجاد می‌کند، XTL با دوره ۲۱ ترند مازور را یک یا دو میله زودتر شناسایی می‌کند.

استفاده از هر کدام از تنظیمات (دوره ۳۵ یا ۲۱) بستگی به سلیقه شخصی شما دارد. بهترین راه برای تصمیم‌گیری برای بهترین تنظیم استفاده آزمایشی و گرفتن تست بر روی اطلاعات گذشته و یافتن تنظیمی که با اصول ترید شما متناسب باشد، است. همچنین ما مثال‌هایی را پیوست کرده‌ایم که از هر دو تنظیم استفاده شده تا نتایج و اشکال آن‌ها را با هم توضیح دهد.

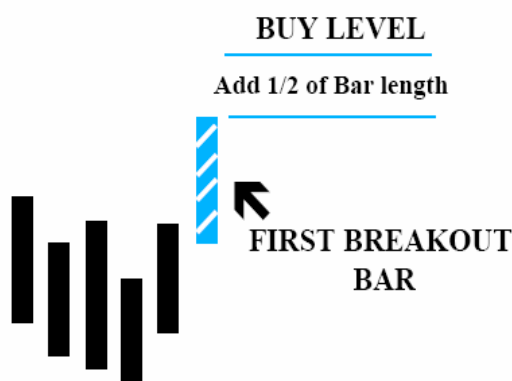
چگونگی استفاده از XTL:

بعلت این که XTL ابزاری است که ترند ماژور را تشخیص می‌دهد، شما باید از آن بعنوان روشی جهت بهبود ترید خود استفاده کنید. براساس آزمایشات ما روش‌هایی که در ادامه می‌آیند بسیار قابل اعتماد هستند. زمانی که ترند ماژور وجود دارد میله‌ها طرح‌دار و سیاه هستند. زمانی که ترندی یافت می‌شود، رنگ میله قرمز (ترند نزولی) یا آبی (ترند صعودی) می‌شود.

اولین میله که رنگش تغییر می‌کند

اولین میله شکست نامیده می‌شود.

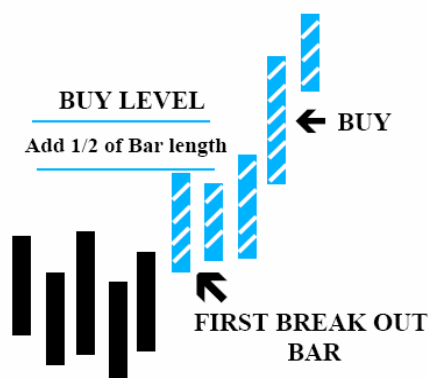
نصف ارتفاع این ستون شکست را برای بدست آوردن سطح Buy بکار ببرید.



زمانی که بازار به سطح Buy نفوذ کند و در صورت شرایط زیر Buy اعمال می‌شود:

الف) XTL نباید یک میله، با رنگ مخالف ترند داشته باشد. در مورد بالا Buy با یک سیگنال ترند بالایی ایجاد شده است. بنابراین شما نباید میله قرمز رنگی را قبل از نفوذ به سطح Buy ببینید. میله‌های سیاه (Neutral) مشکل ندارند و استراتژی را مفدوش نمی‌کنند.

ب) بعد از اینکه رنگ میله تغییر کرد قیمت نباید به سطح استاپ مورد نظر برسد (Taken out). (به صفحه بعدی برای بحث در مورد استاپ‌ها نگاه کنید).



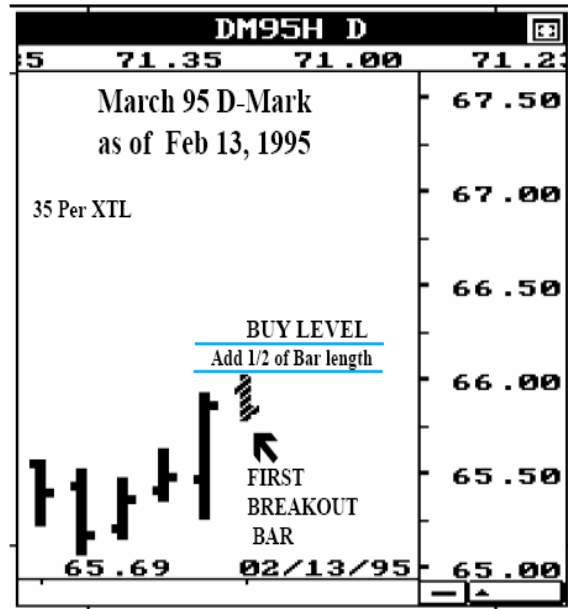
ما پیشنهاد می‌کنیم که نصف طول میله قطع کننده را اضافه کنید. لطفا با آزادی کامل یک بک تست در حالت آزمایشی بگیرید و بهترین طولی را که برای شما مناسب‌تر است بیابید.

برای ورودهای خطرناک شما باید سطح Buy را بالای High میله قطع کننده قرار دهید.

شما با یک Buy Stop در این مناطق انتخاب شده به بازار وارد می‌شوید.

در مثال بعدی (تا زمانی که شرایط تغییر می‌نکند) ما از دوره زمانی ۳۵ برای مناسبه XTL استفاده کردیم. همچنین ما نصف ارتفاع میله قطع کننده را نیز مناسبه کردیم.

شکل بالا نمودار مربوطه به مارس ۹۵ در مورد D-Mark می‌باشد. که از ۱۳ فوریه می‌باشد. ابزار XTL یک حالت بالقوه در بازار را نشان می‌دهد. این میله با رنگ آبی نشان دهنده ترنر رو به بالا می‌باشد همچنین این میله به عنوان اولین میله قطع کننده نامیده می‌شود. اکنون نصف ارتفاع این میله قطع کننده را جهت بدست آوردن سطح Buy محاسبه می‌کنیم.

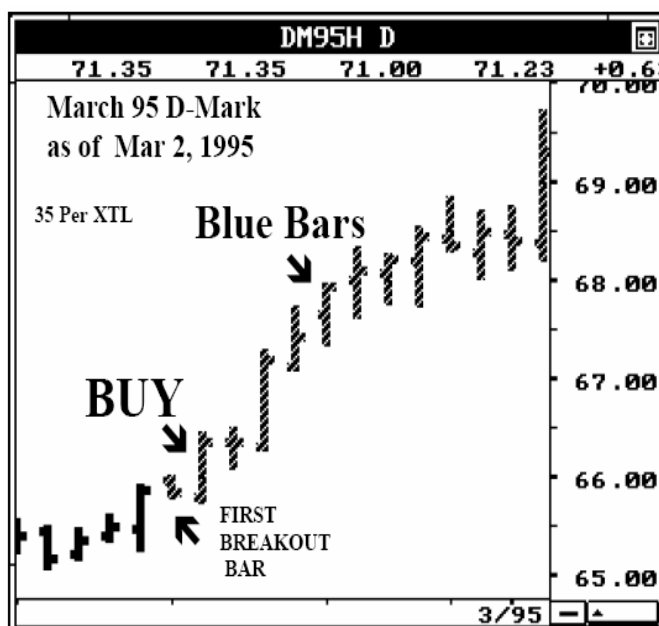


در زمان اولین میله قطع کننده، XTL نباید:

(۱) موردی بر خلاف ترند را داشته باشد.

(۲) استاپ نباید Taken Out شده باشد.

بنابراین یک پوزیشن Buy زمانی که بازار از سطح Buy می‌گذرد قابل ارزیابی است.



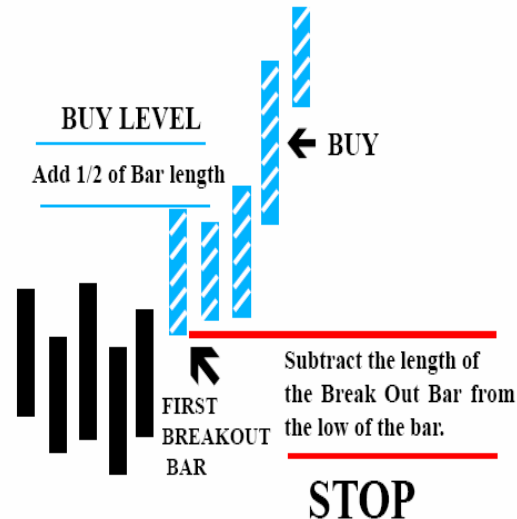
تعدادی راه ورود وجود دارد. ایده‌های زیادی برای ورود به یک Buy در سطح Buy وجود دارد.

نکته: قبل از حرکت بازار به سمت سطح Buy ممکن است میله‌های سیاه دیده شود. میله‌های سیاه استراتژی را مفدوش نمی‌کنند.

استفاده از استاپ:

اگر چه راه‌های زیادی جهت گذاشتن استاپ وجود دارد راهی که در اینجا ما یافته‌ایم مفید است. یک استاپ به اندازه میله قطع کننده زیر Low میله قطع کننده قرار دهید.

ما پیشنهاد می‌کنیم که آزمایش کنید و یک روش استاپ که با استراتژی و استیل شما هماهنگ است بیابید. اگر احساس می‌کنید که استاپ بسیار کوچک است می‌توانید از ۲ برابر طول میله قطع کننده استفاده کنید. در مقابل اگر احساس می‌کنید که استاپ خیلی بزرگ است در آن زمان می‌توانید از نصف طول میله قطع کننده استفاده کنید.



برای مثال: میله قطع کننده در محدوده $High=7650$ و $Low=7630$ قرار دارد. بنابراین طول میله قطع کننده $20=(7650-7630)$ می‌باشد.

سیگنال بای ترند روبه بالا

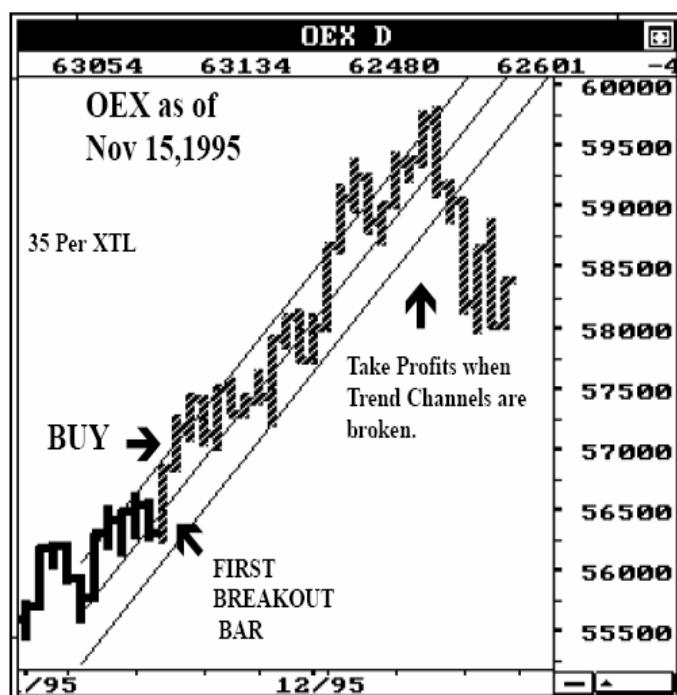
برای بدست آوردن سطح Buy شما باید $1/2$ طول میله قطع کننده را بیابید. در این مورد $1/2$ ارتفاع میله قطع کننده $= (20 * 0.5) = 10$ می‌باشد. این عدد را به High میله قطع کننده اضافه کنید تا سطح Buy بدست آید $7660=(7650+10)$
برای بدست آوردن سطح استاپ شما باید طول میله قطع کننده را از Low آن کم کنید $7610=(7630-20)$ که این عدد استاپ پیشنهادی ما می‌باشد.

سیگنال‌های سل ترند رو به پایین

برای سیگنال‌های ترند رو به پایین شما باید درست برعکس عمل کنید. از مثال بالا استفاده کنید، $1/2$ طول میله قطع کننده 10 پوینت می‌باشد. این عدد را از Low میله قطع کننده کسر کنید تا سطح Sell بدست آید $7620=(7630-10)$
برای بدست آوردن استاپ پیشنهادی ما شما باید طول میله قطع کننده را با High آن جمع کنید $7670=(7650+20)$ این نقطه استاپ پیشنهادی ما است.

حد سود

حد سود جایی است که از یک تریدر به تریدر دیگر متفاوت است. به هر حال زمانی که تصمیم می‌گیرید که در مورد سود فکر کنید ما پیشنهاد می‌کنیم که از ابزار GET پیشرفته در کانال رگرسیون ترند استفاده کنید. شما می‌توانید از آن براساس حالت ثابت و اتوماتیک یا از پیوت قبلی استفاده کنید. این کانال‌ها برای ماندن با ترند بازار بسیار عالی است.

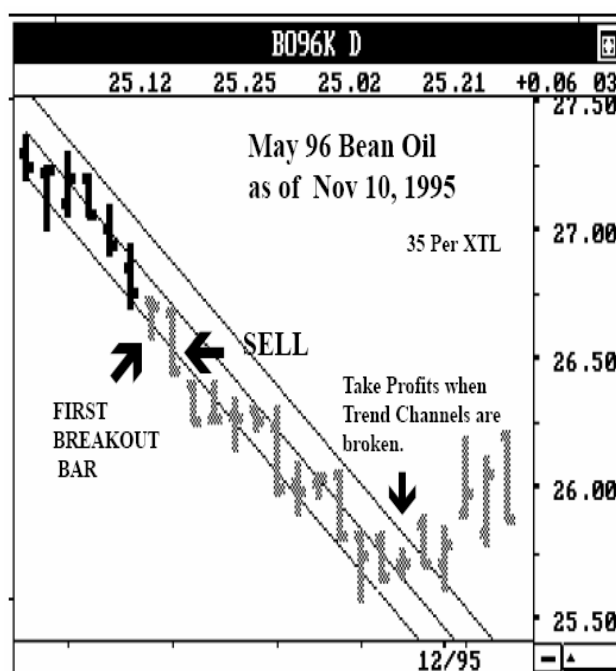


یکی از قدرت‌های بالای این کانال رگرسیون ترند کمک به ماندن با ترند بازار است. زمانی که ترند بازار کانال‌ها را قطع می‌کند معمولاً علامتی دال بر پایان ترند است.

با این فکر ما پیشنهاد می‌کنیم که مد سود زمانی است که کانال توسط قیمت شکسته می‌شود.

ابزار XTL همچنین می‌تواند برای شناسایی ترند رو به پایین ماژور مورد استفاده قرار گیرد. مثال نشان داده شده مربوط به Bean Oil می‌باشد.

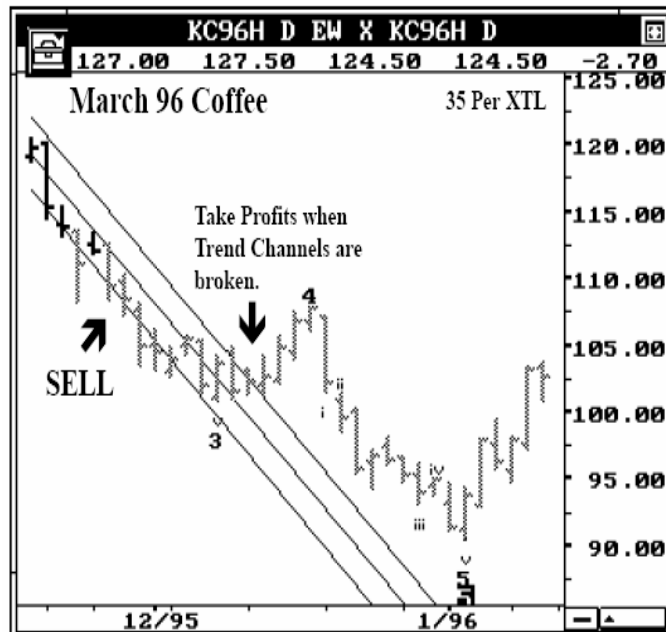
در همین زمان نیز ما پیشنهاد می‌کنیم که سود باید در زمانی که قیمت کانال رگرسیون ترند را قطع می‌کند حاصل شود.



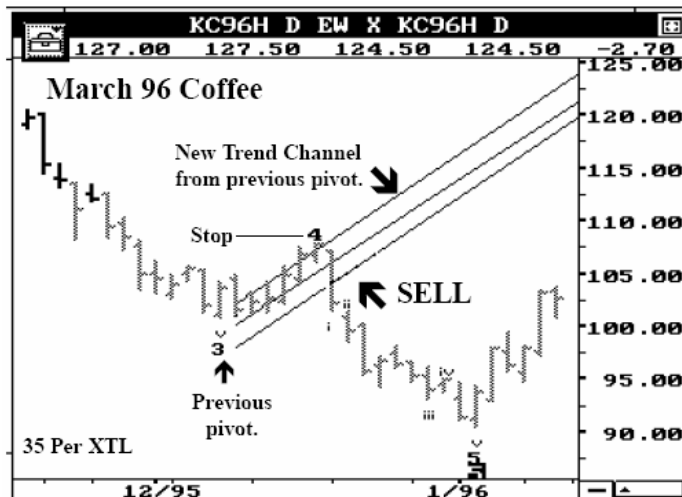
ادامه ترید (ماندن در ترید):

زمانی که کانال‌های رگرسیون ترند را برای حفاظت از سود بکار می‌برید به منظور بودن در بازار در جهت ترند ترید اولیه، شما باید از یک زمان به زمانی دیگر از بازار **Stop out** (خروج موقت) کنید. زمانی که قیمت کانال‌های ترند را شکست معمولاً علامتی دال بر پایان ترند یا حداقل یک تغییر موقت در مسیر (bias) است.

پیش‌بینی این مساله که یک شکست در کانال ترند یک تغییر واقعی در ترند است یا فقط یک تغییر موقت است بسیار مشکل است. ما توصیه می‌کنیم که در این شرایط سود را کسب کنید. اگر ترند اولیه ادامه یافت شما می‌توانید مانند زیر دوباره وارد بازار شوید.



زمانی که ترند اصلی که بوسیله نرم‌افزار بدست آمده تغییر نکرد {در این مورد میله‌ها از رنگ قرمز (ترند نزولی) به رنگ آبی (ترند صعودی) تغییر کرد} شما می‌توانید در مسیر اولیه زمانی که قیمت کانال‌های ترند جدید را قطع کرد دوباره به بازار برگردید. میله‌های سیاه مشکلی ایجاد نمی‌کند و استراتژی را مخدوش نمی‌کنند. کانال‌های ترند جدید از پیوت قبلی رسم می‌شوند.



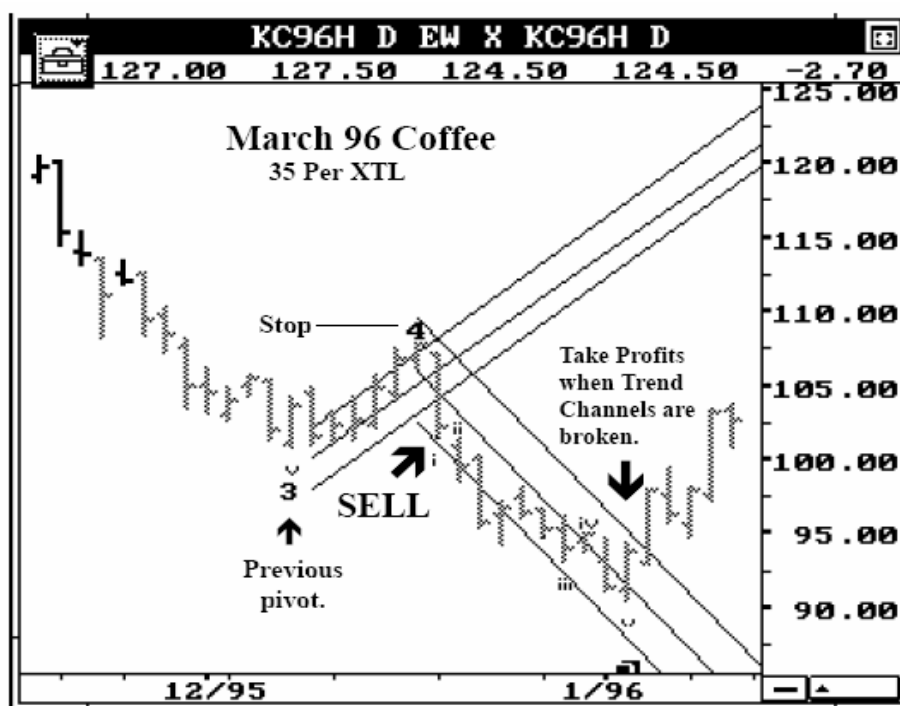
نقطه ورود محل شکسته شدن کانال ترند می‌باشد.

راهنما جهت ادامه ترند:

۱) ترند اصلی که بوسیله GET بدست می آید نباید تغییر کند. مثال: در بازار با ترند رو به پایین رنگ ستون‌ها نباید قرمز (dawn) یا سیاه (neutral) باشد و نباید به رنگ آبی (Up) تغییر کند که می تواند دلالت بر امکان تغییر به bias (ترند رو به بالا) باشد. خلاف این مساله برای فاز رالی قابل تعمیم است.

۲) زمانی که یک پیوت تخمین زده شد، کانال ترند را از این پیوت که در شکل صفحه قبل آمده رسم کنید. شما همچنین باید از کانال‌های اتوماتیک در GET استفاده کنید (لطفاً توجه کنید که کانال‌های اتوماتیک پیوت‌های جدید را که توسط کاربر انتخاب شده مثل اصلی و اولیه و غیره را فاموش می‌کند. شما باید این تنظیمات را برای بدست آوردن نتایج بهتر تغییر دهید.)

۳) زمانی که قیمت‌ها این کانال ترند جدید را در جهت مسیر اولیه قطع کرد یک خرید جدید با یک استاپ، بالا/پایین پیوت قبلی (در زیر نشان داده شده) قابل انجام است.



خرید جدید:

زمانی که دوباره به بازار وارد شدید فکر کنید که وارد یک پوزیشن جدید شده‌اید زمانی که خرید به سود نشست از کانال رگرسیون ترند برای محافظت از سود استفاده کنید.

استفاده از تنظیمات متفاوت برای XTL

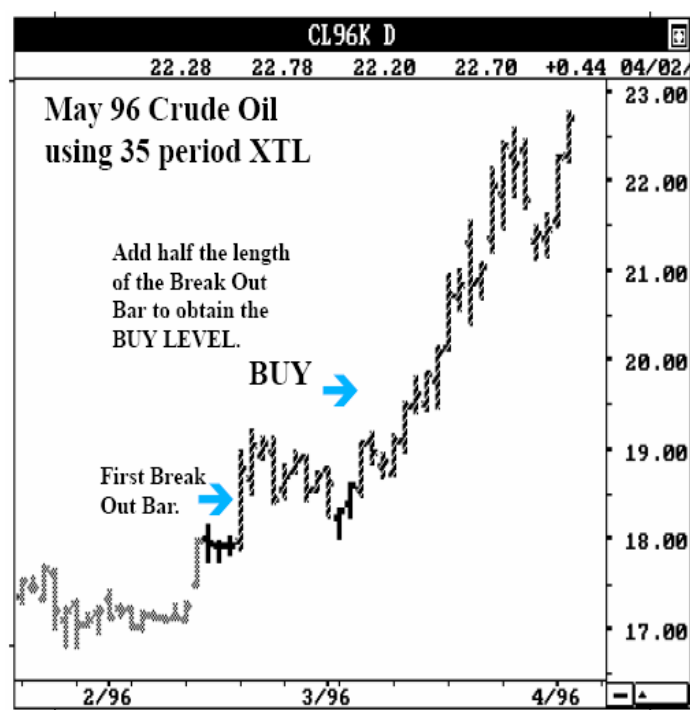
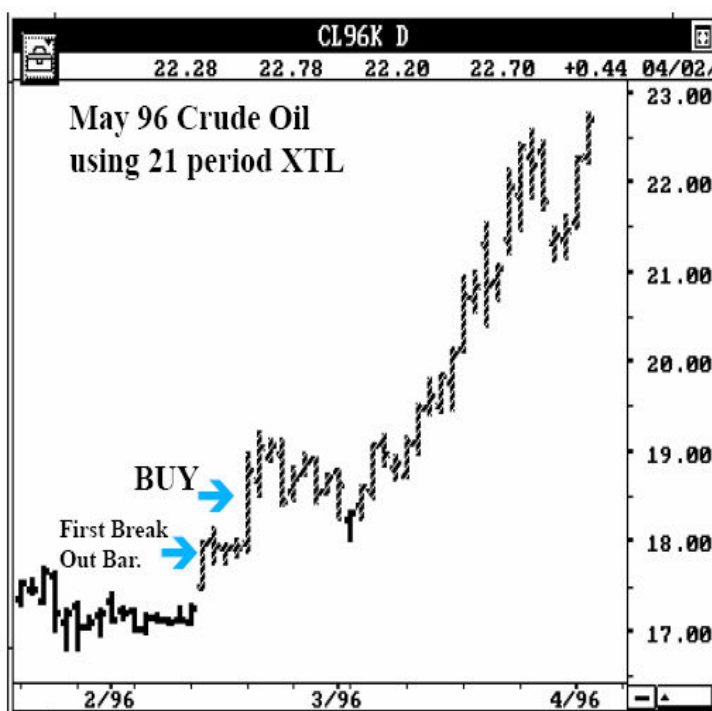
در این صفحه ما تفاوت استفاده از دوره‌های ۲۱ در XTL با دوره‌های ۳۵ آن را نشان خواهیم داد. از XTL با دوره‌های ۲۱ برای ورود زودتر در بازار استفاده می‌شود. به هر حال اشکال اساسی در استفاده از تنظیمات دوره ۲۱ تعدادی سیگنال خطا است، که در صفحه بعد نشان داده شده است.

استفاده از XTL با

دوره ۲۱:

معمولاً اولین میله قطع کننده در استفاده از دوره‌های ۲۱ XTL زودتر ایجاد می‌شود.

این حالت می‌تواند همچنین تعدادی سیگنال خطا که در صفحه بعد نشان داده شده را ایجاد کند.



استفاده از XTL با دوره

۳۵:

زمانی که از GET با دوره ۳۵ استفاده می‌شود سیگنال خطا به کمترین حد ممکن می‌رسد.

معمولاً اولین میله قطع کننده زمانی که با تنظیمات XTL با دوره ۲۱ مقایسه شود کمی دیرتر ایجاد می‌شود (با یک یا دو ستون تاخیر).

استفاده از تنظیمات متفاوت برای XTL

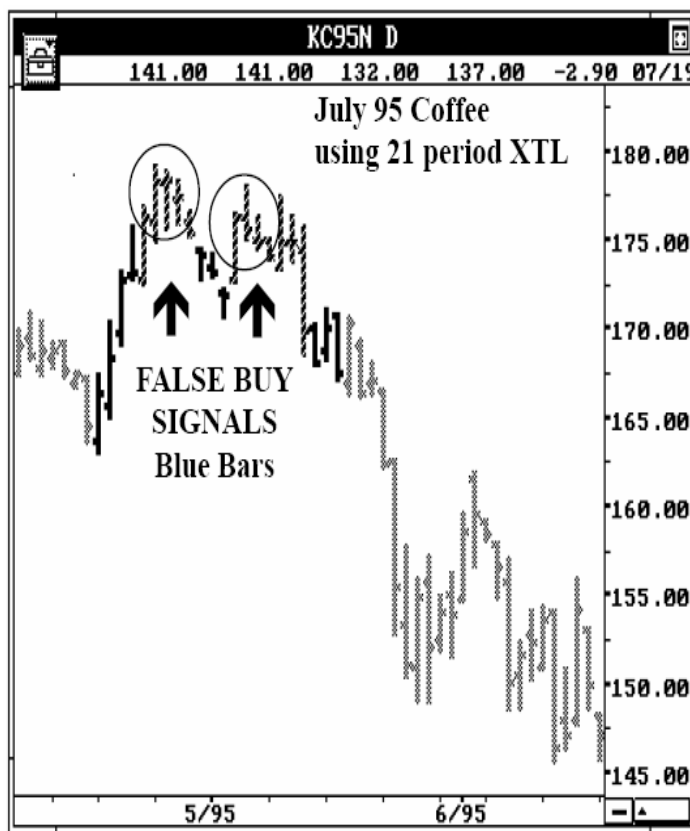
استفاده از XTL با دوره

۲۱:

در این مثال نمودار جولای ۹۵ در مورد Coffee نشان داده شده که در یک ترند نزولی اصلی قرار دارد.

ابزار XTL با دوره ۲۱ دو سطح Buy متفاوت ایجاد می‌کند که می‌توانند سیگنال‌های خطا باشند.

اشکال اساسی در استفاده XTL با دوره ۲۱ پتنا نسایل بالقوه برای سیگنال‌های خطا می‌باشد.

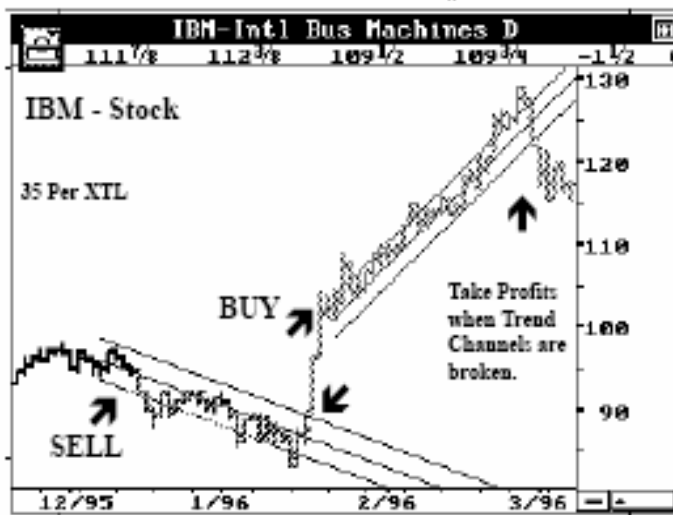
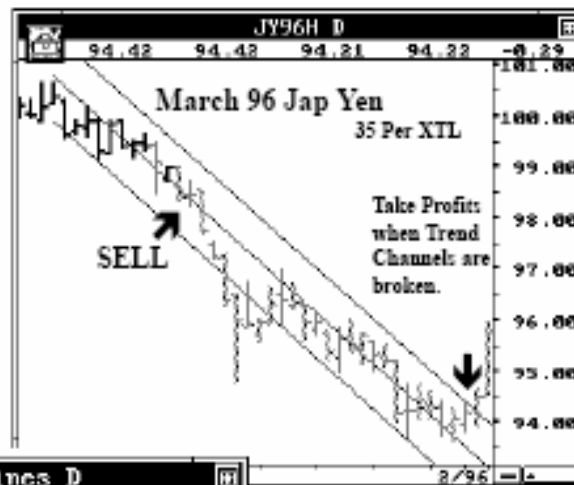


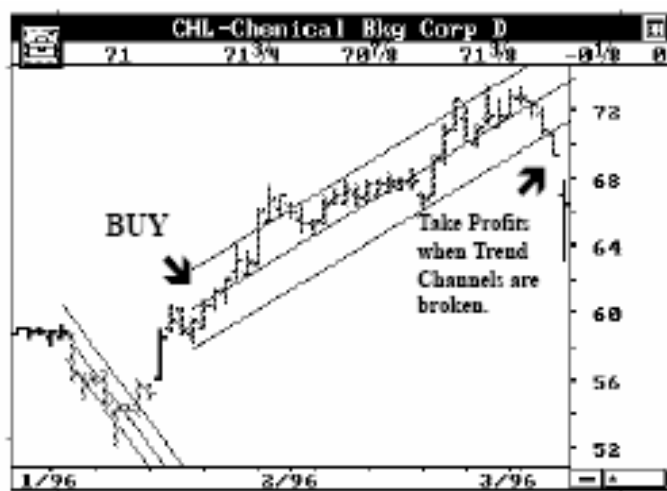
استفاده از XTL با دوره‌های ۳۵:

استفاده از XTL با دوره‌های ۳۵ مانع از سیگنال‌های خطا می‌شود. این مساله مهمترین فایده در استفاده از XTL با دوره ۳۵ می‌باشد.

با استفاده از این مثال ما فواید و مضرات استفاده از XTL با دوره ۲۱ در مقابل ۳۵ را نشان دادیم. شما به عنوان کاربر باید تصمیم بگیرید که کدام یک را در الگوی خرید کردن فود بکار ببرید.

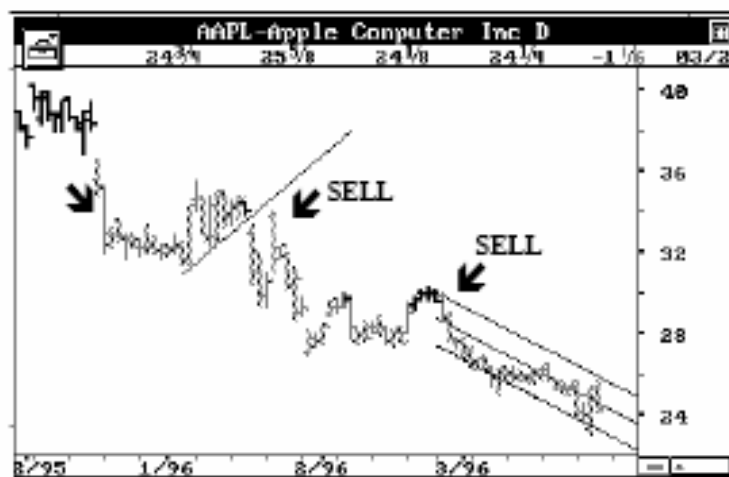
Examples on using XTL





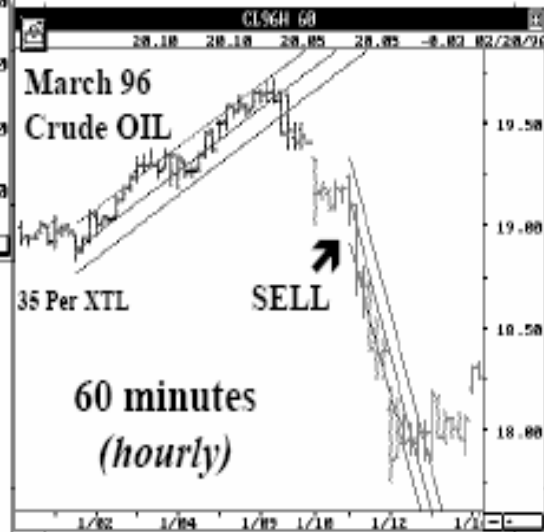
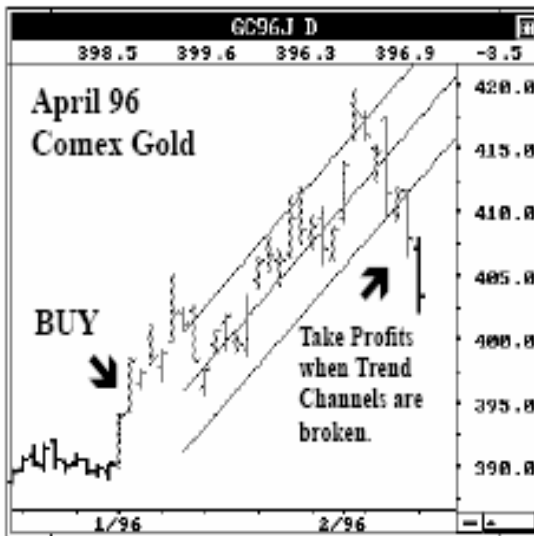
Chemical Bank-Stock
35 Period XTL

Apple Computer
35 Period XTL



March 96
German Bunds
35 Period XTL

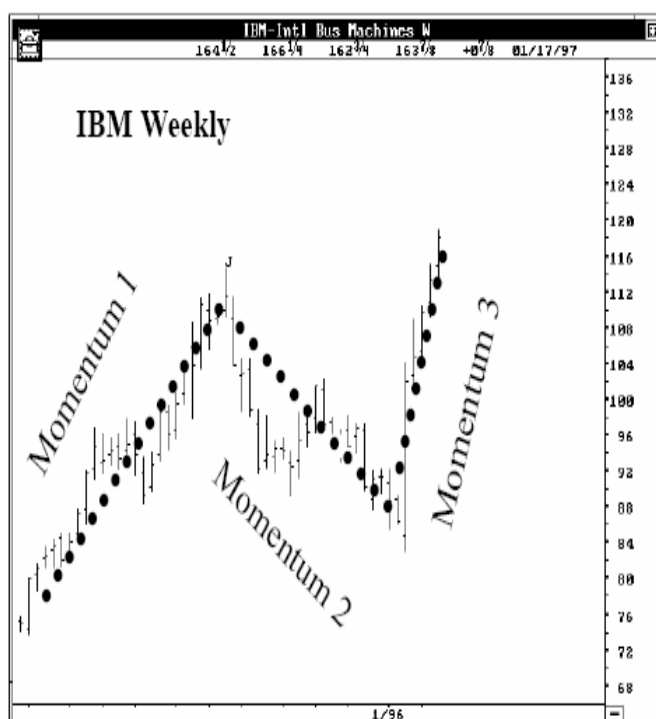




مطالعه MOB (شکست یا برگشت) با بازه‌های زمانی بازار

دیگر مطالعات جدید و MOB زمانی که به درستی استفاده شوند بسیار مفید خواهند بود. تمام تلاش برای این است که آنها را در این قسمت تکنیکال شرح دهیم. به هر حال ما به شدت توصیه می‌کنیم که شما به ویدئو سمینار ۱۹۷۶ نگاه کنید. در سمینار این مطالعه با جزئیات و مطالعات انجام شده یا در موارد ترکیبی آن بحث شده است. این مساله که ویدئو سمینار در این بحث تکنیکال مطرح شوند امکان پذیر نیست. (تعدادی مثال آماده شده بود تا چگونگی استفاده آن را چه به تنهایی و چه در ترکیب با موارد دیگر نشان دهد. همچنین این کار امکان پذیر نمی باشد که با استفاده از تلفن به هر کدام از مشتری ها توضیح داده شود. Bottom Line: اگر شما وقت کافی برای دیدن این ویدئو سمینار ندارید شما نباید انتظار داشته باشید که چگونه استفاده از این مطالعه جدید را به بدانید. And that would be your loss.

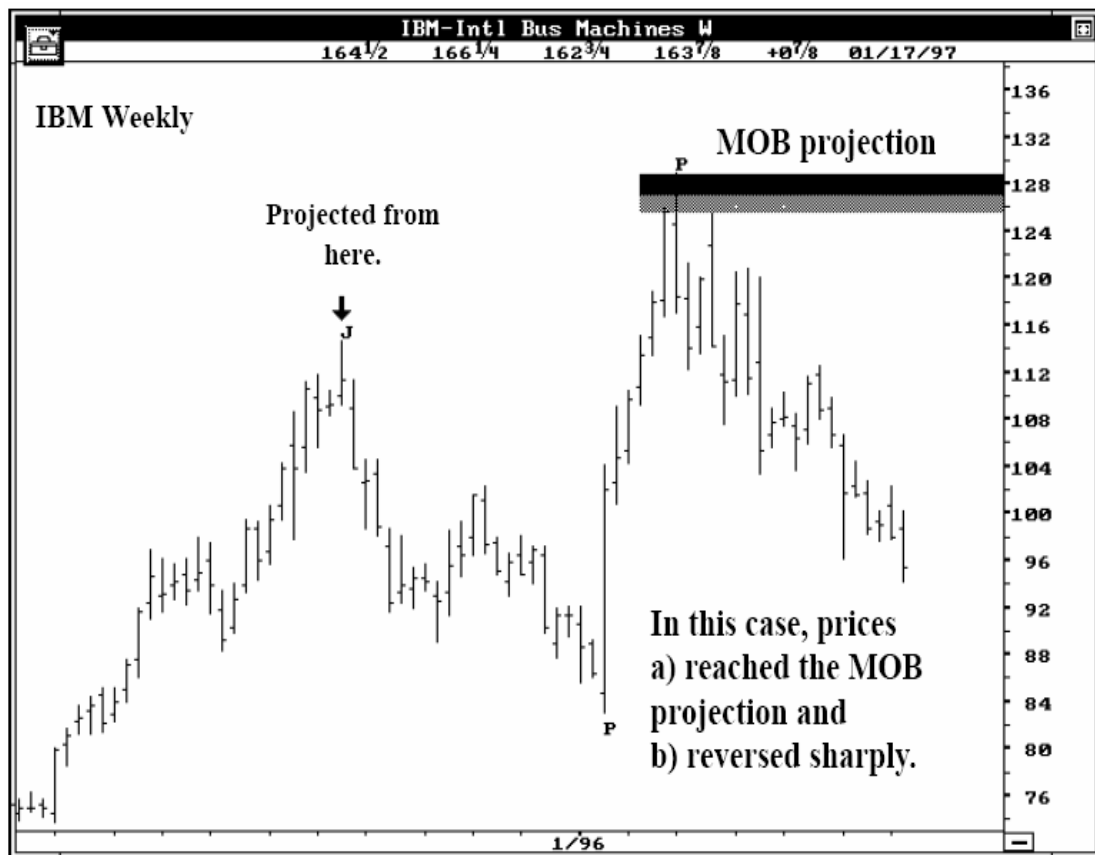
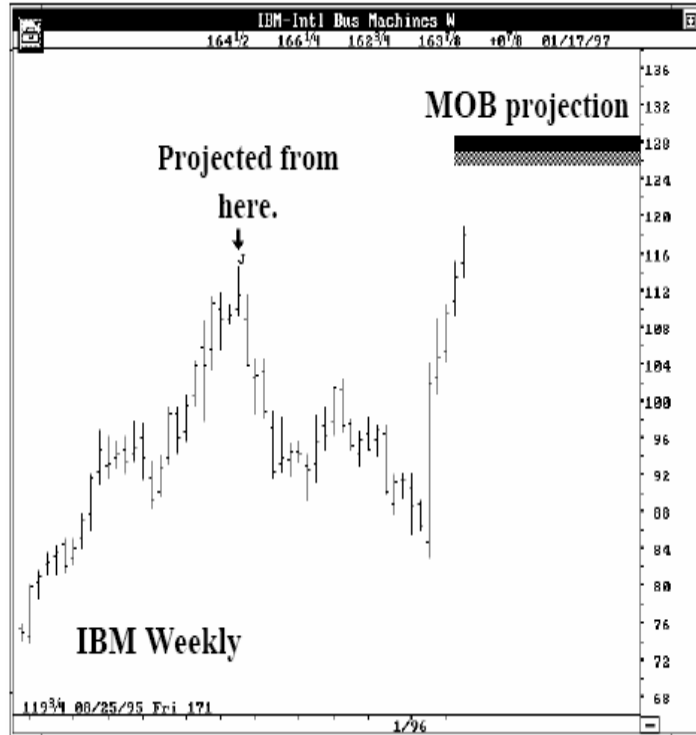
مطالعه MOB مومنتوم و شتاب و دیگر مدل‌های نسبتی را برای تشخیص یک منطقه پیش بینی قیمت به کار می‌برد.



نمودار هفتگی IBM در سمت چپ نشان داده شده است. نوسانات متفاوت براساس ارزش‌های مومنتوم مجزا تحت عنوان مومنتوم ۱ و ۲ و ۳ چیده شده‌اند. با به کار بردن نسبت این مومنتوم‌های متفاوت GET پیشرفته یک منطقه پیش‌بینی قیمت را محاسبه می‌کند. پیش‌بینی قیمت می‌تواند یک مقاومت اصلی برای رالی قیمت بوجود آورد.



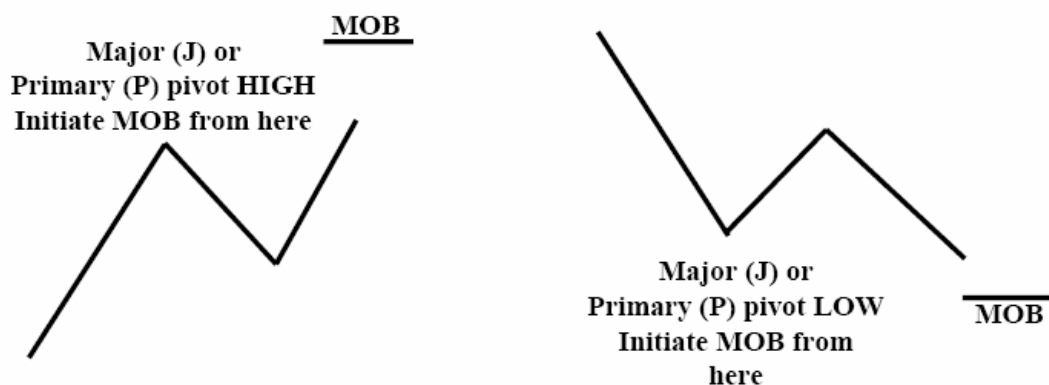
(۱) قیمت می تواند به سمت MOB پیش بینی شده رالی داشته باشد.
 (۲) تقریباً ۷۰٪ از زمان ها قیمت به سمت MOB پیش بینی شده حرکت می کند و بر می گردد.
 (۳) در زمان استراحت، قیمت ها به قیمت MOB پیش بینی شده می رسند و ترید با یک مومنتوم قوی ادامه می یابد. از این رو به آن **Make** یا **Break** می گویند. قیمت ها یا بر می گردند یا با افزایش مومنتوم ادامه می یابند.



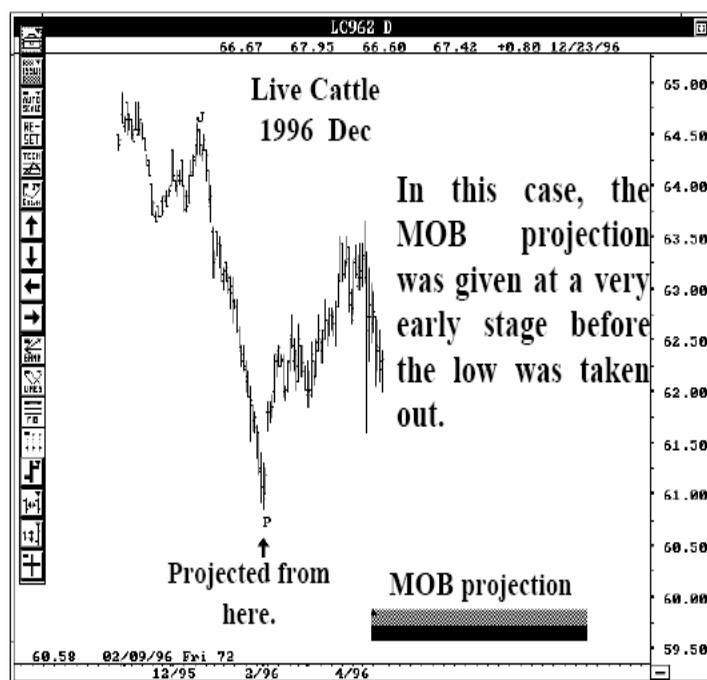
منطقه پیش بینی قیمت بر اساس مومنتوم نوسان جدید و دو نوسان قبلی مشخص می شود.

کجا باید محاسبه MOB را قرار داد: ساده ترین راه این است که محاسبه MOB از یک پیوت قبلی (اولیه یا ماژور) شروع شود. در مثال بالا در مورد نمودار هفتگی IBM سطوح MOB از یک پیوت ماژور شروع شده است. پیوت ها می توانند بوسیله نرم افزار و انتخاب ابزار پیوت محاسبه شده و اجرا شوند.

ابزار MOB می تواند از چندین سطح شروع شود. برای مثال زمانی که موج پنجم کامل می شود، می توان شروع MOB را از پیوت موج سوم قبلی انجام داد. به طور کلی هر زمان شما یک پیوت اولیه یا اصلی داشته باشید سطوح قیمت MOB می تواند شروع شود. در زمان های متفاوت نیز حتی پیوت های کوچک از قبیل بینابینی یا مینور می توانند برای پیش بینی بکار روند.

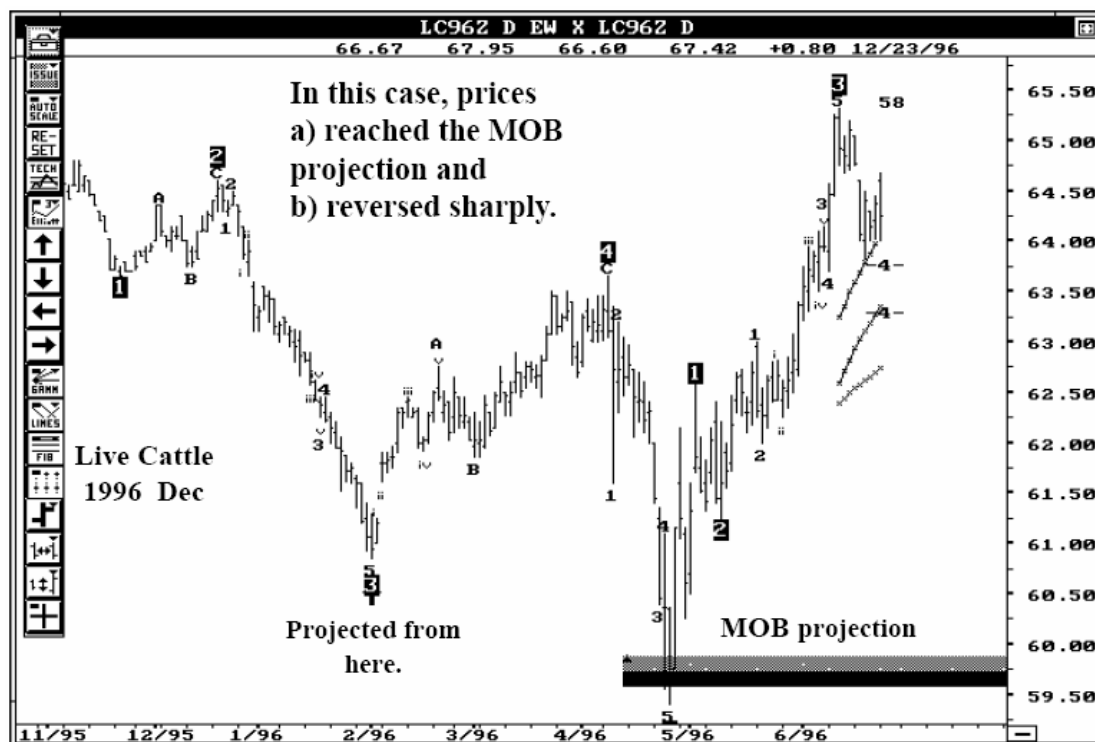


مثال MOB با امواج الیوت

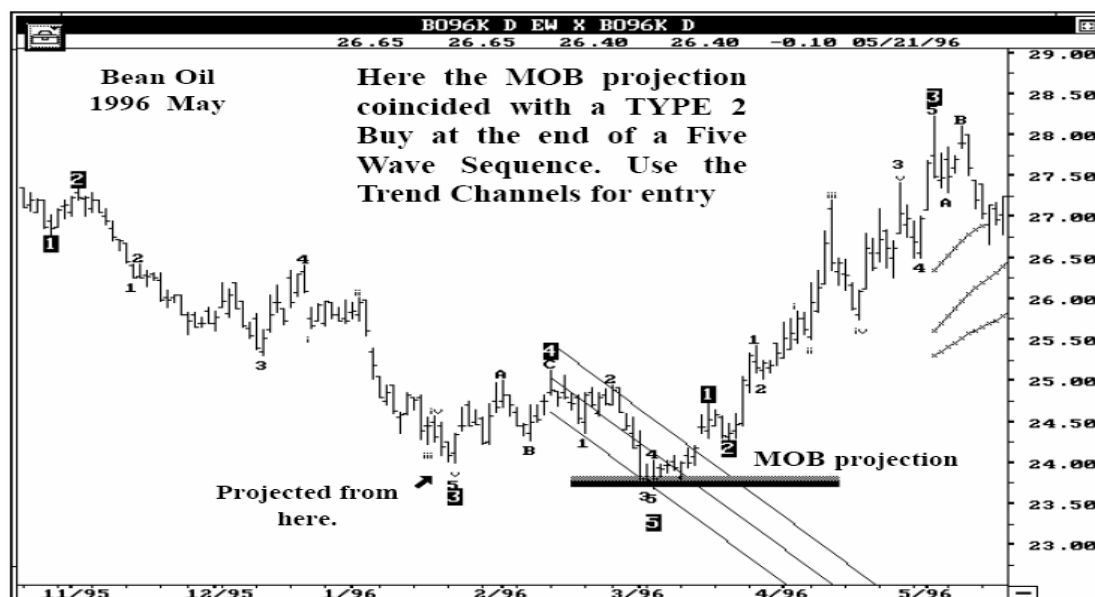


نمودار روزانه Live Cattle برای ماه دسامبر ۹۶ در شکل سمت چپ نشان داده شده است. ابزار MOB از پیوت Low قبلی شروع شده است. با استفاده از نسبت این مومنتوم های متفاوت GET پیشرفته منطقه پیش بینی قیمت را محاسبه می کند. قیمت پیش بینی شده یک حمایت قوی برای این روند نزولی می باشد.

منطقه پیش‌بینی MOB معمولاً نقطه پایانی را برای توالی پنج موج الیوت آماده می‌کند؛ در این مورد پیوت Low قبلی Low موج سوم می‌باشد. پیش‌بینی MOB از این پیوت Low یک حمایت (منطقه پیش‌بینی MOB) برای پایان موج پنجم می‌باشد. همچنین توجه کنید که چگونه این پیش‌بینی به زودی به حقیقت می‌پیوندد.



مثال MOB با کانال‌های ترند و امواج الیوت



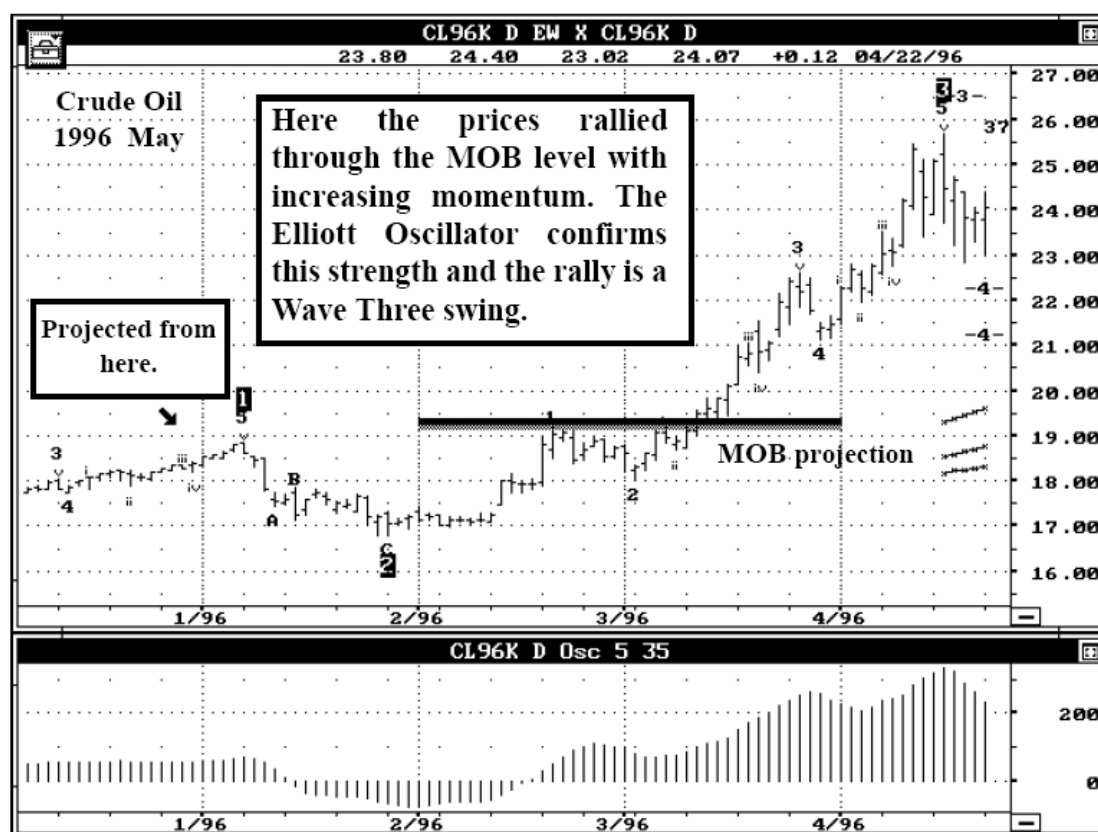
نمودار نشان داده شده در اینجا نیاز به توضیح بیشتری ندارد. نمودار Bean Oil در ماه می توالی پنج موج را طی کرده است. پیش‌بینی MOB از پیوت Low قبلی (در این مورد پیوت موج سوم است) یک حمایت قوی برای قیمت در پایان موج پنجم ساخته است.

در اینجا بازار یک Buy نوع دوم را بعد از کامل شدن توالی پنج موج ایجاد کرده است. پیش‌بینی MOB نیز یک تایید اضافی با ایجاد یک سطح حمایت قوی ساخته است. ابزار اضافی دیگر از قبیل کانال‌های رگرسیون ترند می‌توانند جهت ورود کاملاً روشن در مسیر ترید به کار برده شوند.

بعلاوه می‌توان از XTL (اکسپرت مشخص کننده ترند) برای اضافه کردن به پوزیشن‌ها زمانی که موج سوم در جریان است استفاده کرد.

ابزار MOB وسیله بسیار قابل اعتمادی است که می‌تواند موارد صحیح ترید را بالا ببرد. زمان‌هایی وجود دارد که پیش‌بینی‌ها موفق عمل نمی‌کنند. در این موارد بازار سطوح MOB را با یک قدرت اضافی می‌شکند. معمولاً این‌ها نوسان موج سوم هستند. فرد می‌تواند با آشنایی با شمارش موج الیوت در این زمان‌ها از این گونه موارد جلوگیری کند. به مثال توجه کنید.

مثال برای زمانی که قیمت‌ها MOB را رد می‌کنند



در این شکل پیش‌بینی MOB از پیوت High قبلی بدست آمده است. در این مورد پیوت High قبلی موج اول می‌باشد.

زمانی که قیمت به منطقه پیش‌بینی MOB می‌رسد، در حوالی آن برای مدتی باقی می‌ماند سپس با یک مومنتوم زیاد از آن عبور می‌کند.

این همان دلیلی است که ما نام آن را مطالعه Make یا Break می‌نامیم. هم می‌تواند به منطقه MOB برود و ترند را تغییر بدهد و در موارد دیگر ممکن است با یک مومنتوم زیاد منطقه MOB را رد کند.

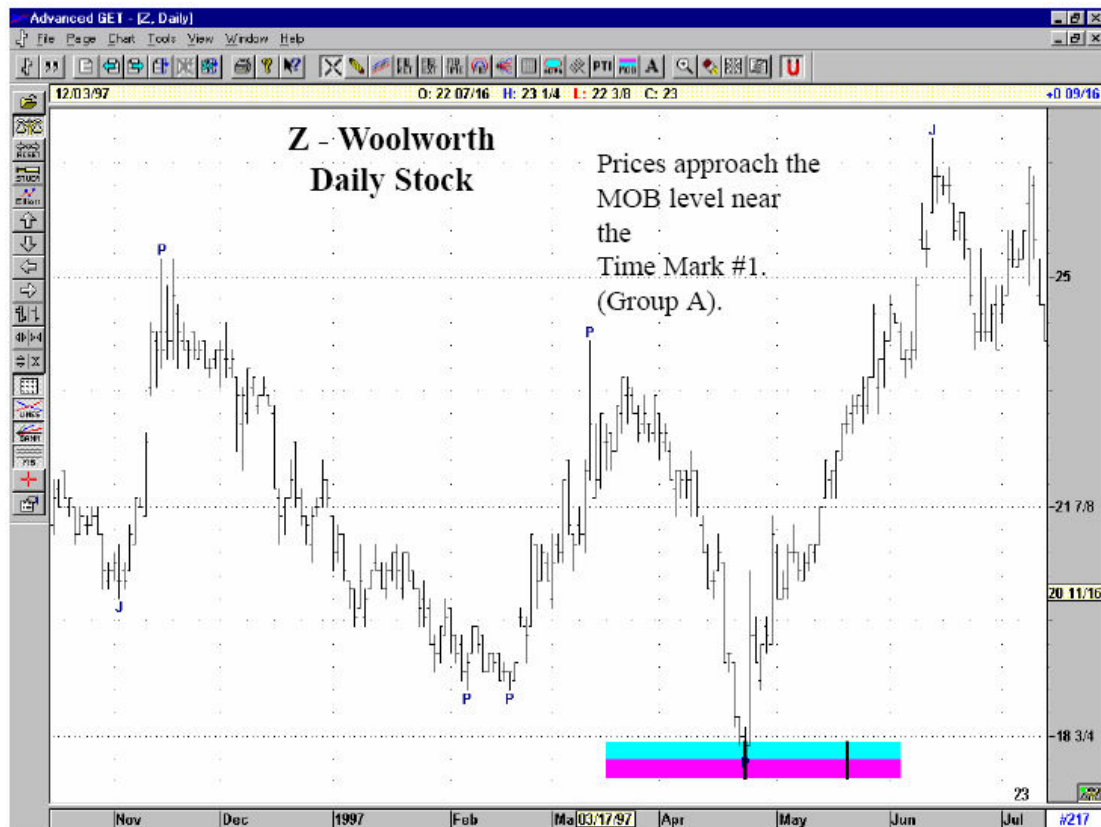
در بیشتر موارد جایی که بازار برمی‌گردد یا از میان منطقه MOB عبور می‌کند، ابزارهایی مانند نوسان‌نمای الیوت می‌تواند برای شناسایی این قبیل شکست‌ها قبل از این که رخ دهند به کار آیند. زمانی که بازار در موج سوم می‌باشد منطقه قیمتی MOB بسادگی به عنوان سطحی است که در آنجا بازار با یک مومنتوم قوی از آن سطح رد می‌شود. همچنین به همین دلیل باید از XTL برای شناسایی این موقعیت‌ها استفاده کرد.

اگر شما به یک «*» بر فورد کردید که بالای شروع MOB نمایش داده می‌شود این به معنای آن است که اطلاعات کافی برای یک MOB با اعتماد ۱۰۰٪ وجود ندارد. شکل MOB فوق را پاک کنید و دوباره زمانی که * از بین رفت MOB را رسم کنید.

من پیشنهاد می‌کنم که زمانی را صرف این کار کنید تا در آن ماهر شوید. همچنین به ویدئو سمینار ۹۶ نگاه کنید. من چندین روش برای پی‌گوانگی استفاده از آن را به‌مث کرده‌ام.

اضافه کردن علامت‌های زمانی جدید به MOB

ما این ابزار جدید را به مطالعه MOB در سمینار Cleveland (۱۰ نوامبر ۱۹۹۷) اضافه کردیم. قبل از آن MOB سطوح قیمتی را ایجاد می‌کرد که در آن بازار تمایل داشت که بازگشت کند. به هر حال MOB فوق نمی‌توانست زمانی را که در آن قیمت می‌تواند به این سطح MOB برسد را آماده کند. براساس تحقیقات، ما روشی برای پیش‌بینی زمان همان طور که در مثال زیر (نمودار روزانه سهام Z-Woolworth) نشان داده شده یافتیم:



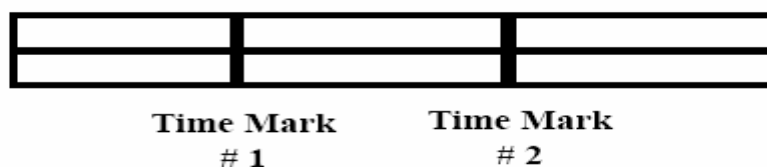
در اینجا MOB از پیوت اولیه قبلی رسم شد (P). همانطور که می‌توانید ببینید قیمت‌ها به سطح MOB پیش‌بینی رسیده و به سرعت برگشت کرده است. اگر شما با دقت آزمایش کنید همچنین MOB دو زمان را به صورت عمودی علامت می‌زند. این دو بازه زمانی پیش‌بینی شده هستند که نرم افزار تمایل بالای قیمت برای رسیدن به سطوح MOB در آن زمان‌ها را محاسبه کرده است.

MOB level.



در مثال بالا قیمت به سطح MOB در روزی که تحت عنوان زمان علامت‌گذاری نامیده شده، رسیده است و به سرعت از سطح MOB پیش‌بینی شده، تغییر جهت داده است.

MOB level.



علامت‌های زمان

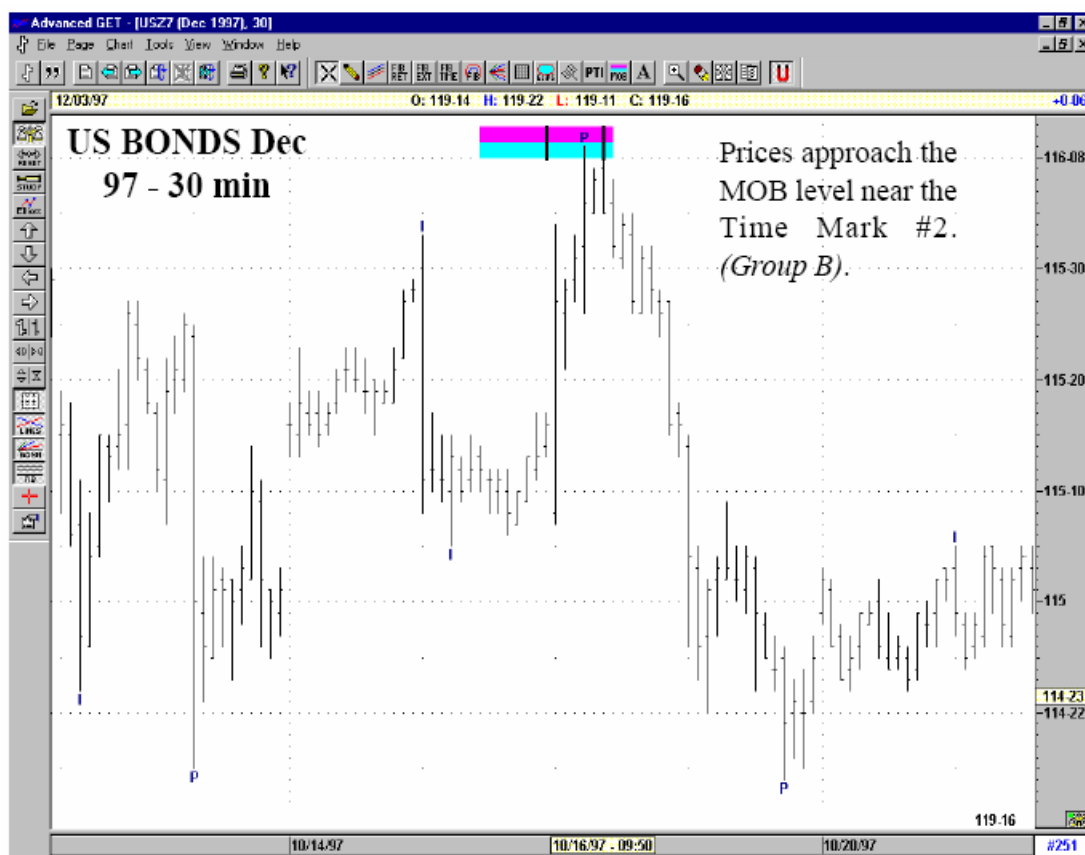
نرم‌افزار دو زمان علامت زده شده را محاسبه می‌کند. دو روز یا دو میله (همچنین در نمودار ۵ دقیقه) وجود دارد که بیشترین تمایل قیمت‌ها برای رسیدن به سطح MOB پیش‌بینی شده در این زمان‌ها است. در آزمایشات ما مشاهدات زیر را داشتیم.

قیمت‌ها در برخورد با سطوح MOB دو گروه می‌شوند.

گروه A تمایل به رسیدن به سطح MOB نزدیک علامت زمانی ۱ دارند. در این موارد قیمت تمایل دارد که به سطح MOB برخورد کند و نزدیک علامت زمانی ۱ برگشت کند. مثال در صفحه قبل برای Woolworth نشان دهنده رفتار قیمت در سطح MOB در علامت زمانی ۱ می‌باشد.

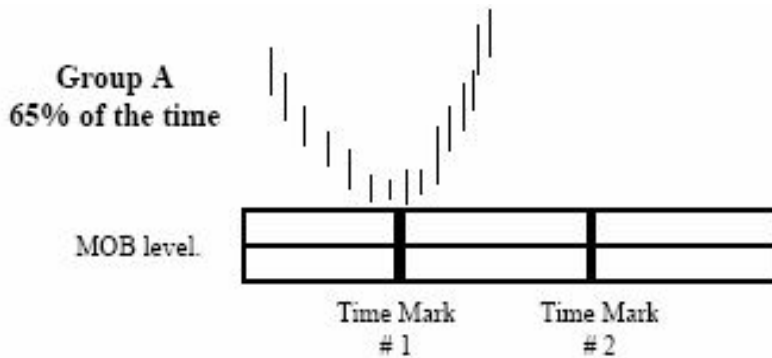
گروه B تمایل دارند که به سطح MOB بین علامت زمانی ۱ و ۲ با یک حرکت (bias) ناچیز به سمت علامت زمانی ۲ برسند.

مثال زیر را ببیند (نمودار ۳۰ دقیقه‌ای US Bonds)



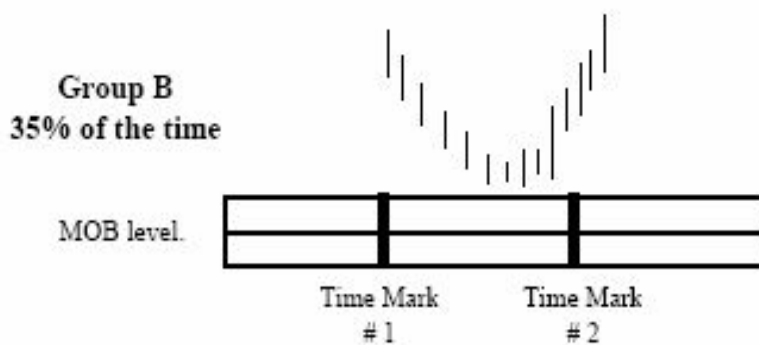
توزیع گروه‌ها

توزیع تقریباً ۶۵ به ۳۵ است. قیمت‌هایی که به سطوح MOB نزدیک زمانی ۱ (گروه A) نزدیک می‌شوند در ۶۵٪ موارد رخ می‌دهد. قیمت‌هایی که به سطح MOB بین علامت زمانی ۱ و ۲ نزدیک می‌شوند در ۳۵٪ موارد رخ می‌دهد.



ملاحظات:

در گروه A قیمت‌ها نزدیک علامت زمانی ۱ می‌شوند (تقریباً در بالای آن).



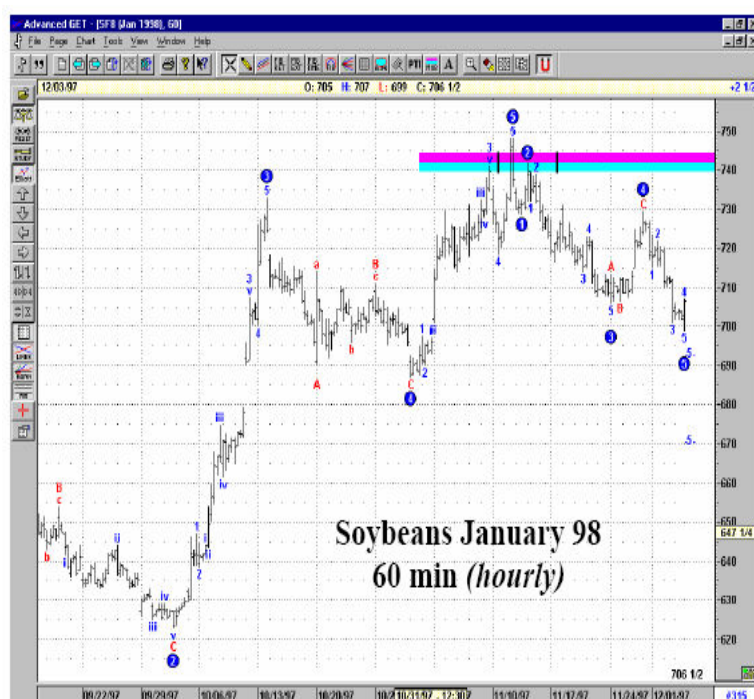
ملاحظات:

در گروه B قیمت‌ها بین علامت زمانی ۱ و ۲ نزدیک می‌شوند (با یک حرکت (bias) ناچیز به سمت علامت زمانی ۲).



مطالعهٔ مربوط به علامت زمانی راهی قطعی (Holy Grail) برای شناسایی دقیق روز یا زمانی که بازار برگشت خواهد کرد نیست. در عوض قالب زمانی را فراهم خواهد کرد که ما انتظار برگشت را داریم. اگر قیمت‌ها به سطح MOB در علامت زمانی ۱ نزدیک نشوند، پس شما بسادگی در گروه A قرار نمی‌گیرید. شما سپس باید منتظر رفتاری مشابه گروه B باشید.

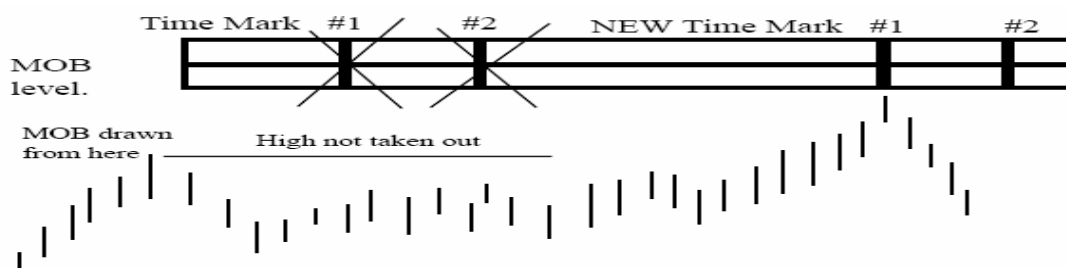
در مثالی که آمده است سطح MOB با مطالعه موج الیوت نشان داده شده است. زمانی که ۵ موج کامل شده است بازار تغییر مسیر داده است. سطح MOB به شناسایی سطوح قیمت که در آنجا تغییر می‌تواند رخ دهد کمک می‌کند. علامت‌های زمان، قالب زمانی را فراهم می‌کنند که ما انتظار بازگشت را داریم.



در این مثال حرکت در گروه B طبقه بندی می‌شود. زمانی که قیمت به MOB زود هنگام نفوذ می‌کند (که High رالی موج ۲) نهایی قبل از بازگشت (است) شماره گذاری می‌شود و این اتفاق در بین علامت زمانی ۱ و ۲ رخ می‌دهد.

محاسبه مجدد علامت‌های زمانی:

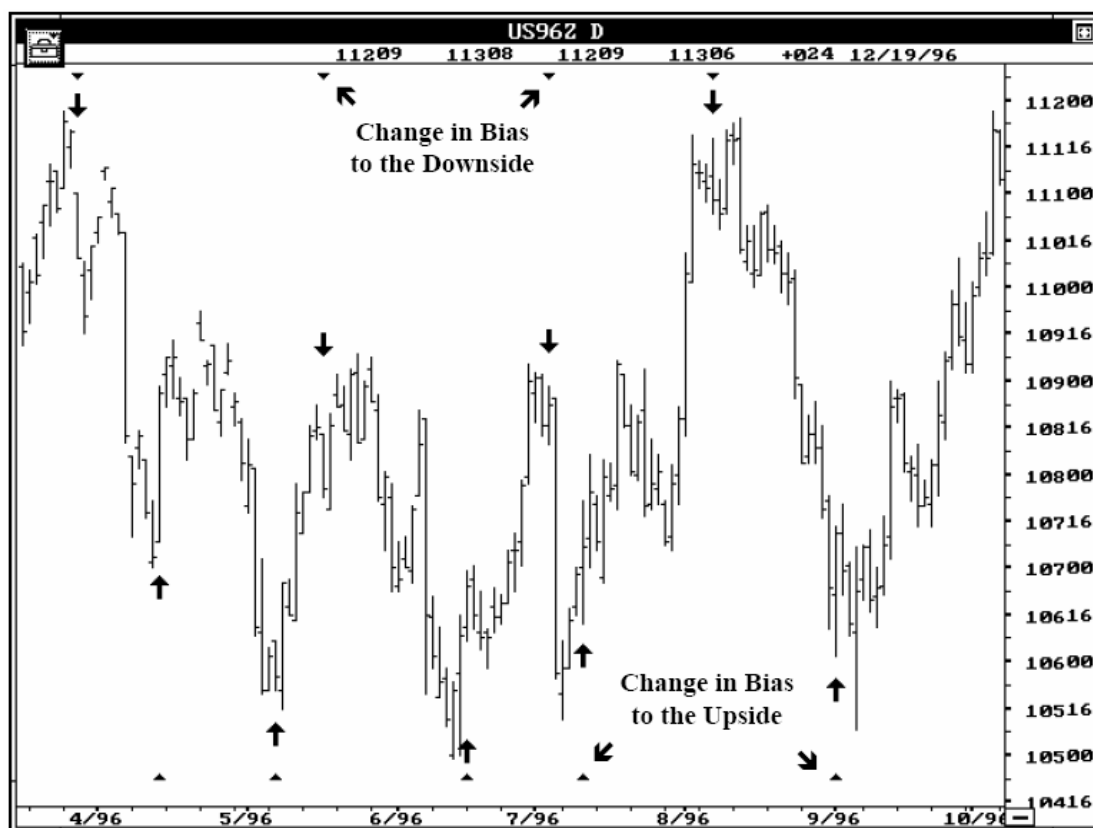
زمانی که MOB برای اولین بار رسم می‌شود نرم افزار علامت زمانی ۱ و ۲ را محاسبه می‌کند. اگر قیمت‌ها به پیوت High نرسند (جایی MOB از آن کشیده شده است) نرم افزار علامت‌های قبلی را کنسل می‌کند و آنها را مجدداً محاسبه می‌کند.



حرکت برگشتی (Bias Reversal)

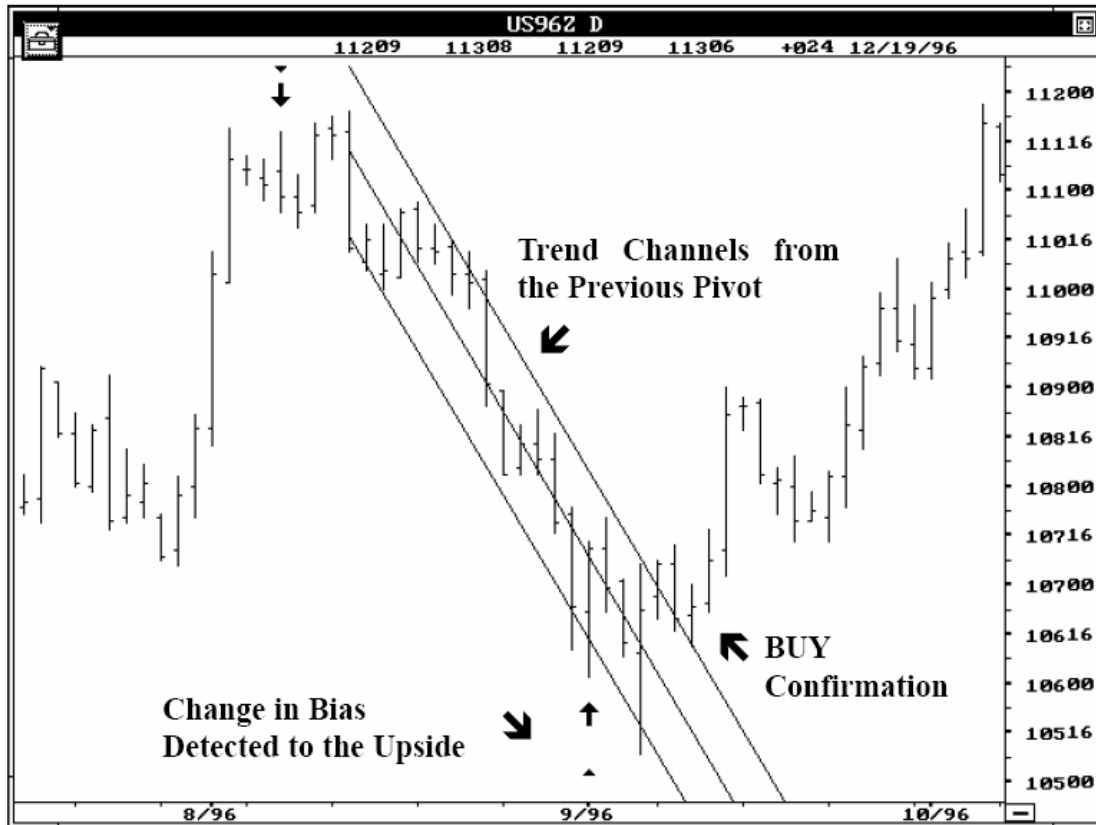
تحقیقات ما با استفاده از مومنتوم و Volatility قیمت توانسته است مناطقی که در آنجا بازار می تواند آماده برگشت قیمت شود را شناسایی کند.

شناسایی اولیه احتمالی برای تغییر در Bias است. بنابراین نام آن Bias برگشتی است. بازار می تواند تغییرات کوچکی در bias داشته باشد ولی هنوز حرکت را در جهت اصلی ادامه دهد. بنابراین زمانی که یک bias برگشتی دیده می شود ما نیاز داریم که تغییرات بیشتری در قیمت ببینیم تا سیگنال فوق قطعی شود. این موضوع در صفحه بعدی بحث شده است. زمانی که یک bias یافت می شود. نرم افزار یک مثلث رسم می کند. اگر نوک مثلث به سمت بالا باشد پس تغییر در bias به سمت بالا خواهد بود و اگر نوک مثلث به سمت پایین باشد bias به سمت پایین خواهد بود. نموداری که در زیر نشان داده شده است نمودار US Bonds در دسامبر ۹۶ می باشد. مثلث ها تغییرات در bias می باشند که بوسیله GET پیشرفته حاصل شده است. پیکان ها با دست کشیده شده اند تا نشان دهند که میله های تغییر bias دیده شده است.



Bias Reversal

زمانی که تغییر در bias دیده شد، ما پیشنهاد می‌کنیم که کانال‌های ترند را از پیوت قبلی رسم کنید. منتظر بمانید تا قیمت‌ها کانال ترند را قطع کنند. این مساله تغییر در ترند را قطعی خواهد کرد.



قبل از این مرحله یک تغییر در bias تغییر در ترند را تضمین نمی‌کند. این دلیلی است که به همان خاطر توصیه می‌کنیم که باید شما از کانال‌های ترند برای قطعی شدن تغییر ترند استفاده کنید.

سیگنال‌های قطعا: زمانی که تغییر در bias دیده می‌شود، نرم‌افزار نیازمند یک یا دو میله برای قطعی کردن سیگنال دارد. اگر قطعی نشد سیگنال فوق خطا تلقی می‌شود و یک خط در زیر یا بالای مثلث رسم می‌شود.

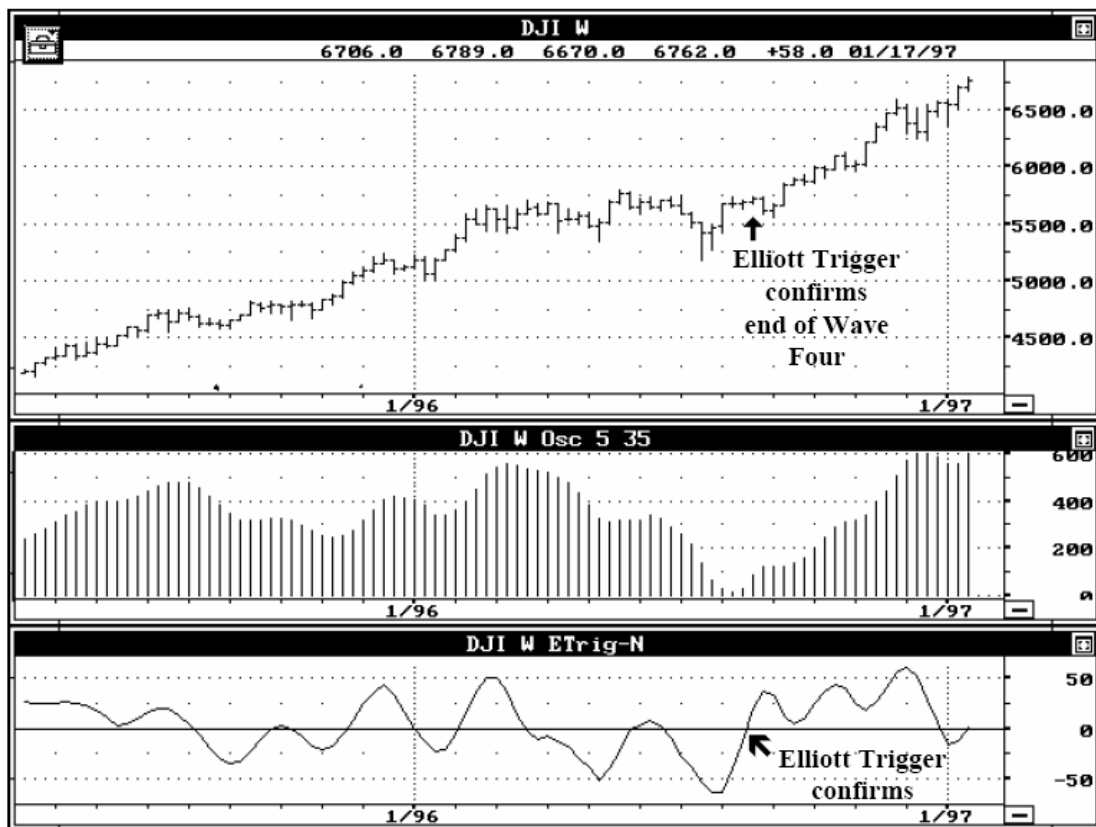
برای ممانعت از اجرای سیگنال خطا گزینه فیلتر را در منوی bias برگشتی روی ON قرار دهید. اگر شما یک سیگنال خطا در bias برگشتی دیدید، پیشنهاد می‌کنیم که این سیگنال را رها کرده و منتظر بعدی بمانید.

همچنین bias برگشتی دو حالت معمولی و Tight دارد. حالت Tight به صورت اولیه یک تکنیک فیلتر دارد که نرم‌افزار باید سیگنال‌های قوی‌تری داشته باشد تا تغییر در bias را نشان دهد.



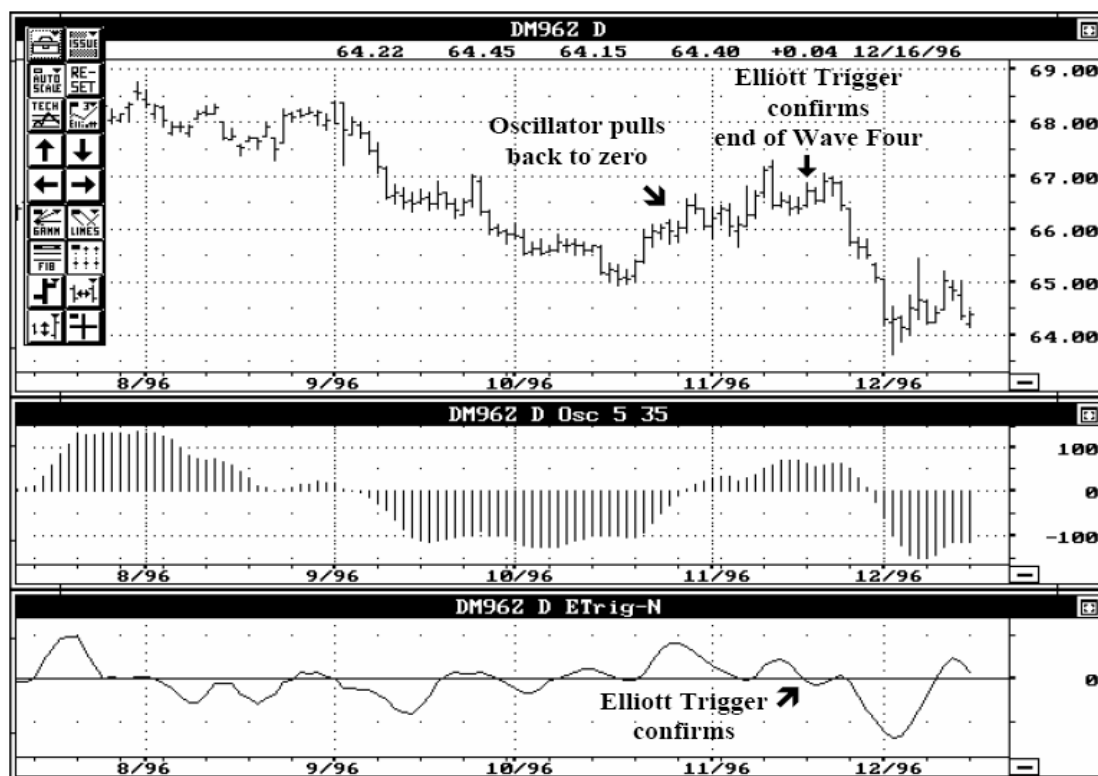
Elliot Wave Trigger

مطالعه EWT برای بالا بردن استفاده از نوسان‌نمای ایوت در پایان اصلاح موج چهارم اضافه شده است. در بسیاری موارد نوسان‌نما به سمت صفر بر می‌گردد و برای زمان زیادی در زیر خط صفر باقی می‌ماند. در این موارد EWT این اطمینان را ایجاد می‌کند که موج چهارم کامل شده است.



نمودار هفتگی داو جونز در بالا نشان داده شده است. نوسان‌نمای ایوت ۵/۳۵ به سمت صفر برگشته است. توجه کنید چگونه EWT همچنین زیر خط صفر است. زمانی که نوسان‌نما به سمت صفر بر می‌گردد منتظر بمانید تا EWT خط صفر را به سمت بالا قطع کند. این حالت قطعیت زیادی جهت اینکه موج چهارم پایان یافته است می‌باشد. جایی که این مطالعه بسیار مفید واقع می‌شود در زمانی است که نوسان‌نما به زیر خط صفر می‌رود و برای مدتی آن جا می‌ماند. در این موارد شما به سادگی منتظر بمانید تا EWT اطمینان لازم را بوسیله حرکت به سمت بالای خط صفر ایجاد کند. صفحه بعد مثال دیگری را نشان می‌دهد.

مثالی که در ادامه می‌آید نمودار D-Mark در دسامبر ۹۶ می‌باشد که در موج چهارم می‌باشد. نوسان نمای ۵/۳۵ به سمت صفر می‌رود و در آن منطقه می‌ماند. اکنون شما باید منتظر بمانید تا EWT به زیر خط صفر برود تا تاییدی بر اتمام موج چهارم باشد. در این مورد زمانی که نوسان نما اطراف خط صفر است. ابزار EWT بسیار مفید است و کمک برای جلوگیری از ورود نادرست می‌کند.



زمانی که بازار در رالی دارای ۵ موج می‌باشد شما باید منتظر بمانید تا EWT به سمت بالا خط صفر را قطع کند تا تاییدی بر پایان موج چهارم باشد. زمانی که بازار دارای یک حرکت رو به پایین دارای ۵ موج باشد شما باید منتظر باشید تا EWT خط صفر را به سمت پایین قطع کرده تا تاییدی بر پایان موج چهارم باشد.

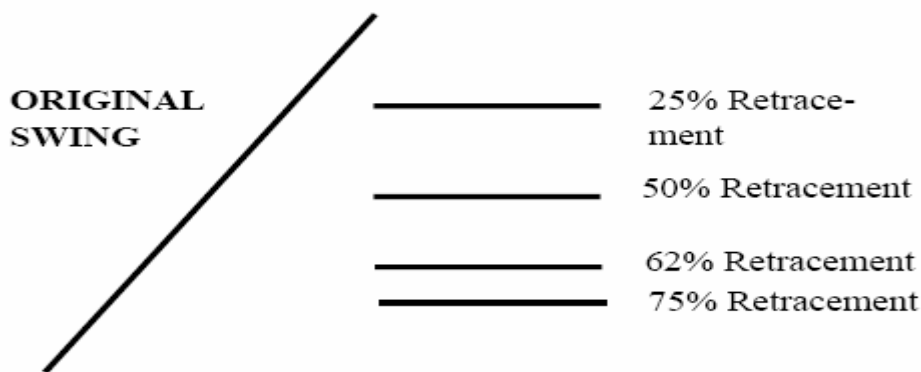
در هر دو مورد منتظر بمانید تا نوسان نمای ۵/۳۵ به سمت صفر برگردد قبل از اینکه نوسان نمای ۵/۳۵ به سمت خط صفر برگردد. ابزار EWT می‌تواند هر وقت که بخواهد خط ضرر را قطع کند. این اتفاق نمی‌افتد.

توالی کارها به صورت زیر است: در یک موج چهارم اجازه دهید تا نوسان نمای ۵/۳۵ به سمت خط صفر برگردد. این مساله در ۹۴٪ موارد رخ می‌دهد. زمانی که نوسان نمای ۵/۳۵ این کار را انجام می‌دهد سپس EWT را جهت تایید پایان موج چهارم کنترل کنید که مثال آن در بالا نشان داده شده است.

T.J.'s ELLIPSE

قبل از اینکه ترند اصلی ادامه یابد چه مقدار نوسان قیمت اصلاح خواهد شد؟ این سوالی است که همه تریدرها در یک زمان یا زمان‌های دیگر در مورد آن سوال می‌کنند. در این موارد مطالعات اصلاحی فیبوناچی کمک خواهد کرد. به هر حال می‌تواند سطوحی مانند ۲۵٪ اصلاحی یا ۵۰٪ اصلاحی را نشان دهد.

اگر یک سطح خوب کار نکند تریدرها به سطح بعدی نگاه خواهند کرد و آماده خواهند بود.



مطالعه جدید تحت عنوان T.J.'s ELLIPSE یک راه حل تکنیکال به این سوال داده است. جزئیات آن در صفحات بعدی بحث شده است. شما باید ویدئو سمینار ۱۹۹۷ را ببینید که در آنجا من جزئیاتی را که نمی‌توان بروی کاغذ توضیح داد بیان کرده‌ام. آنها می‌توانند کیفیت ترید شما را بالا ببرند.



مطالعه جدید، نوسان اولیه را در نظر می‌گیرد و سطوح زمان و قیمت را که می‌تواند اصلاح موج اولیه در آن متوقف شود را نشان می‌دهد. اگر سطوح قیمت و زمان نگه داشته شوند نوسان اولیه در جهت مسیر ترند اولیه ادامه می‌یابد. سطوح زمان و قیمت که در نمودار نشان داده شده‌اند به شکل یک بیضی هستند. به همین دلیل به آن بیضی T.J.'s می‌گوییم.



چگونه این بیضی T.J.'s محاسبه می‌شود: کاربر یک نوسان (High و Low) را شناسایی می‌کند. این نوسان برای مشخص کردن اندازه و قدرت بازار به کار برده می‌شود. با به کار بردن آن GET پیشرفته یک راه پیش بینی کننده برای بیضی را محاسبه می‌کند تا قیمت‌ها را مهار کند. به طور عینی بیضی T.J.'s ادامه خواهد داشت تا قیمت‌ها به آن برسند. زمانی که قیمت‌ها به بیضی برسند بیضی حرکت را متوقف خواهد کرد و یک سطوح قیمتی و زمانی قوی را ایجاد می‌کند. در این زمان برای اینکه بیضی قیمت‌ها را نگه دارد بسیار حیاتی است. اگر موفق به این کار شد سپس نوسان اولیه ادامه خواهد داشت.

لطفاً به نوار سمینار نگاه کنید. ما پندین مالت و مثال را شرح دادیم و توضیح بسیار روشنی را دادیم. شما نیازمند چند ساعت وقت هستید تا به ویدئو سمینار ۱۹۹۷ نگاه کنید. اگر این بیضی‌ها درست استفاده شوند می‌توانند نقطه غیر قابل باوری برای تریدرها باشند.

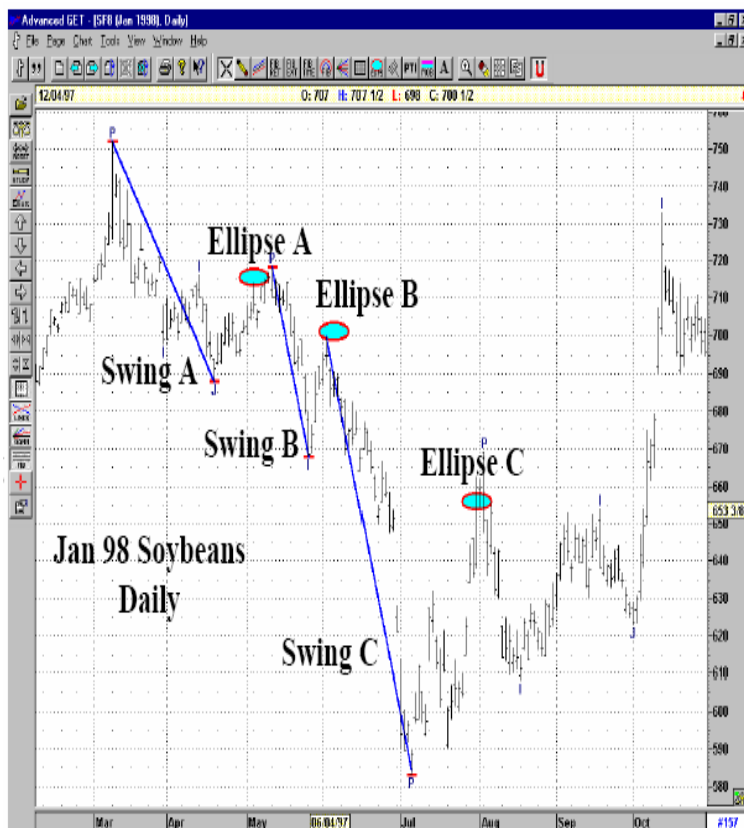


بیضی B بیضی است که از نوسان B ایجاد شده است.

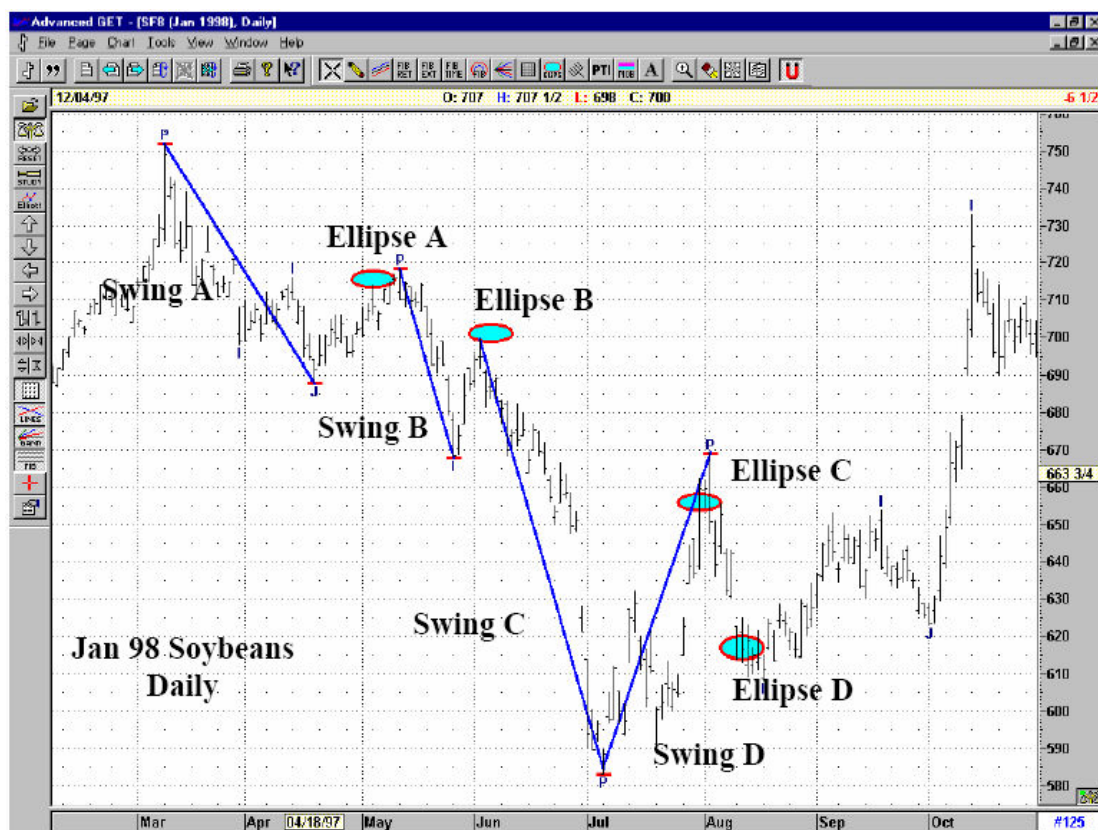
این بیضی قیمت ها را نگه داشته و نوسان B می تواند ترند خود را تا پایین ادامه دهد.

بیضی C بیضی است که از نوسان C تولید شده است.

این بیضی قیمت ها را نگه داشته و نوسان C می تواند ترند خود را تا پایین ادامه دهد.



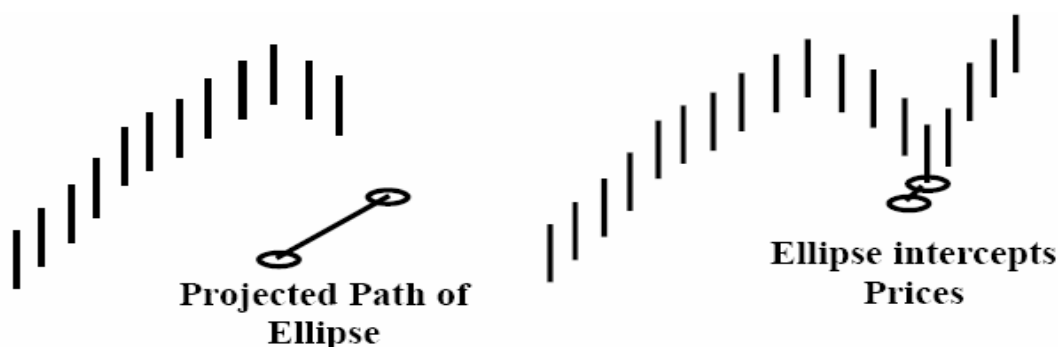
زمانی که بازار حرکت خود را ادامه می‌دهد نوسان جدید ایجاد می‌شود. برای هر نوسان جدید نرم افزار می‌تواند یک بیضی جدید ایجاد کند. همان زمانی که بیضی متناظر با هر بیضی متوقف کننده یک نوسان اولیه می‌تواند در مسیر خود ادامه یابد.



بیضی D از نوسان D ایجاد شده است. بعد از توقف قیمت در بیضی D نوسان D در ترندش بالاتر ادامه مسیر می‌دهد.

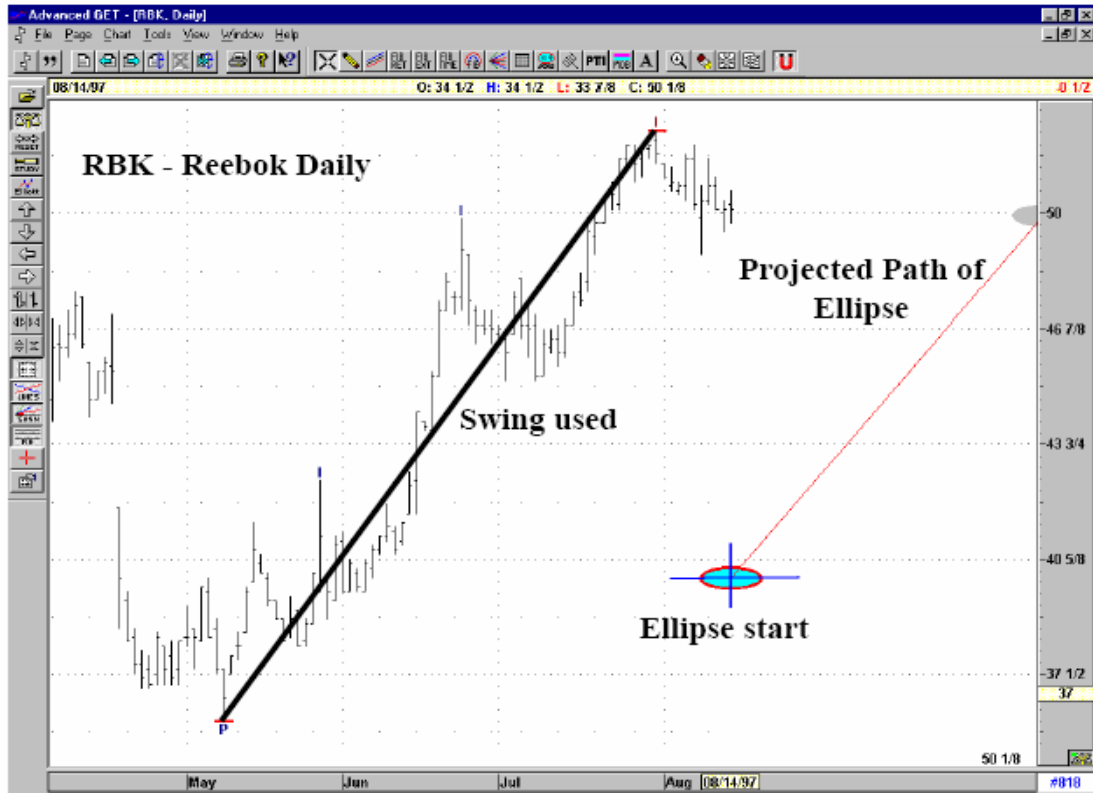
مسیر بیضی (سایه):

زمانی که ابزار بیضی اضافه می‌شود نرم افزار شروع به کشیدن مسیر آن می‌کند تا حرکت قیمت را قطع کند.



مثال-مسیرهای رسم شده برای بیضی:

مثالی که در زیر آمده است نشان می‌دهد که چگونه ابزار بیضی مسیر رسم شده‌ای را که تلاش می‌کند حرکت قیمت را قطع کند نشان می‌دهد.

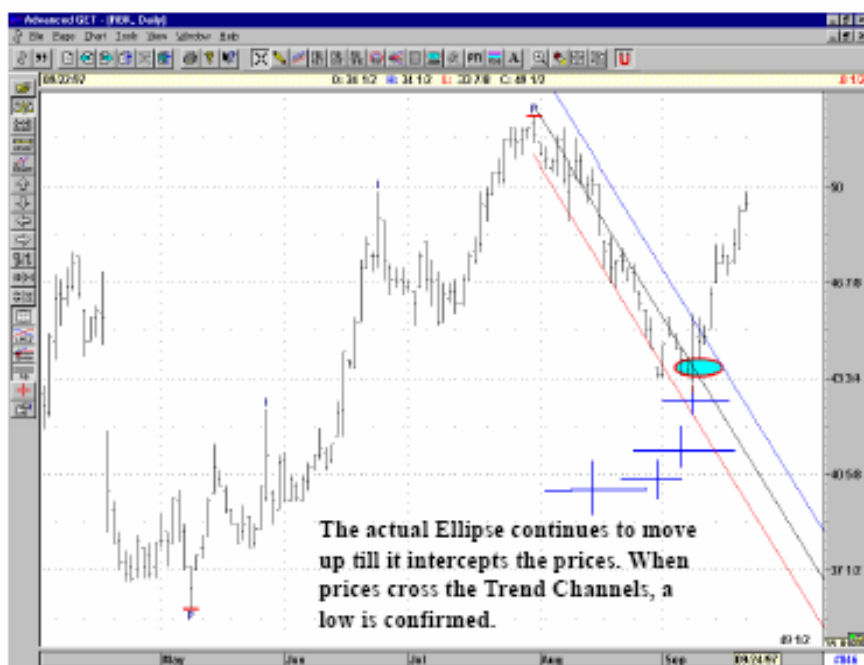


زمانی که قیمت‌ها اصلاح را ادامه می‌دهند بیضی به نزدیک و نزدیک‌تر حرکت می‌کند.

فاصله بین بیضی اخیر و سایه آن (رسم شده) باریک می‌شود تا کاملاً نزدیک قیمت می‌شود.



زمانی که سایه رسم شده به قیمت می‌رسد فوراً کانال رگرسیون ترند برای تایید تغییر جهت واقعی در قیمت بکار ببرید. این تکنیک با جزئیات زیاد در ویدئو سال ۱۹۹۷ بحث شده است. من سعی کردم به بهترین نمونه در این مقاله توضیح دهم اما این کاملاً مشابه ارائه در سمینار نیست.

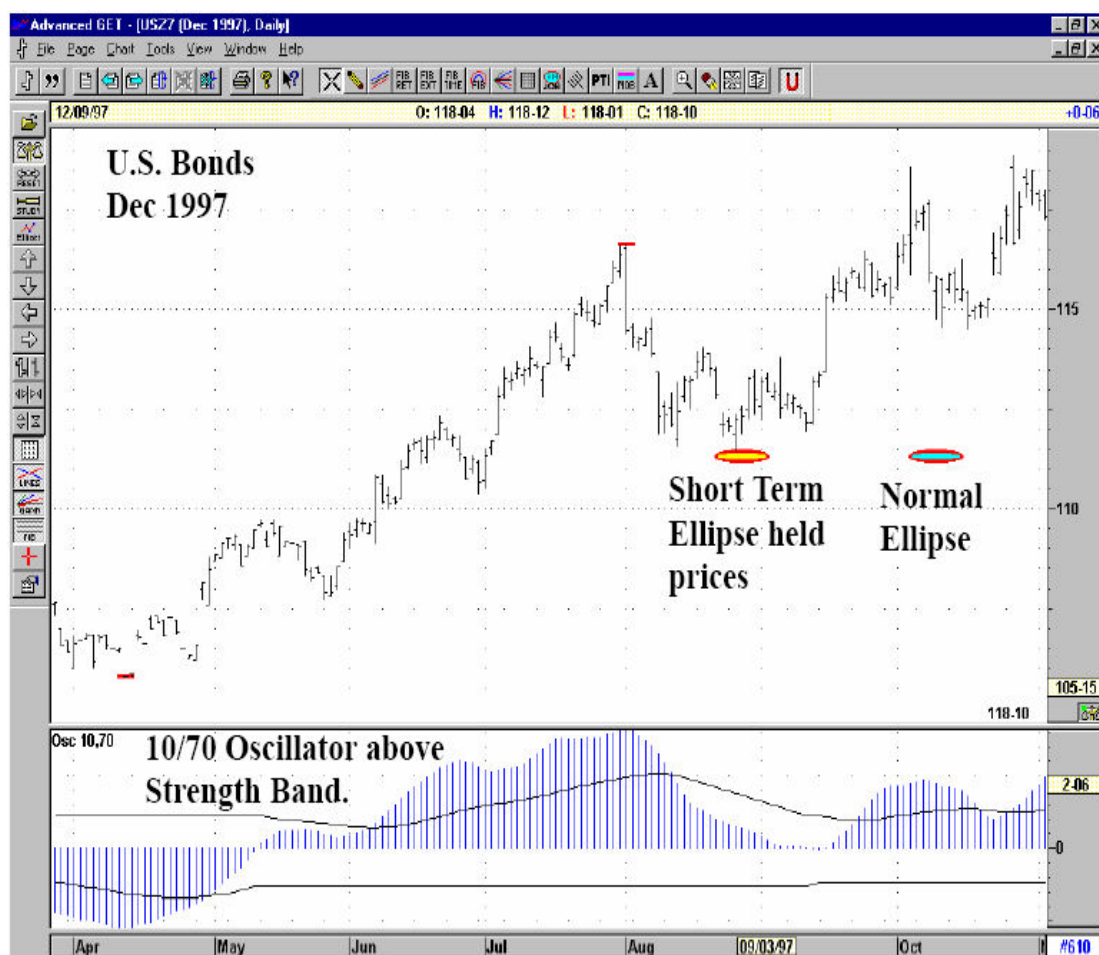


استفاده از بیضی کوتاه مدت و معمولی

مطالعه بیضی سه حالت دارد: معمولی، کوتاه مدت و بلند مدت. در حال حاضر بلند مدت اطلاعات با ارزشی ایجاد نمی کند.

از ۹ مورد از ۱۰ مورد نوع معمولی می تواند بکار رود. در همه بحث های ما از تنظیمات معمولی استفاده می شود.

حالتی وجود دارد که نیازمند استفاده از حالت کوتاه مدت بیضی می باشند. زمانی است که نوسان نمای ۱۰/۷۰ بالای باند قوی آن باشد و بازار در موج سوم قوی باشد. ما توصیه می کنیم از بیضی های کوتاه مدت استفاده کنید به مثال زیر توجه کنید.



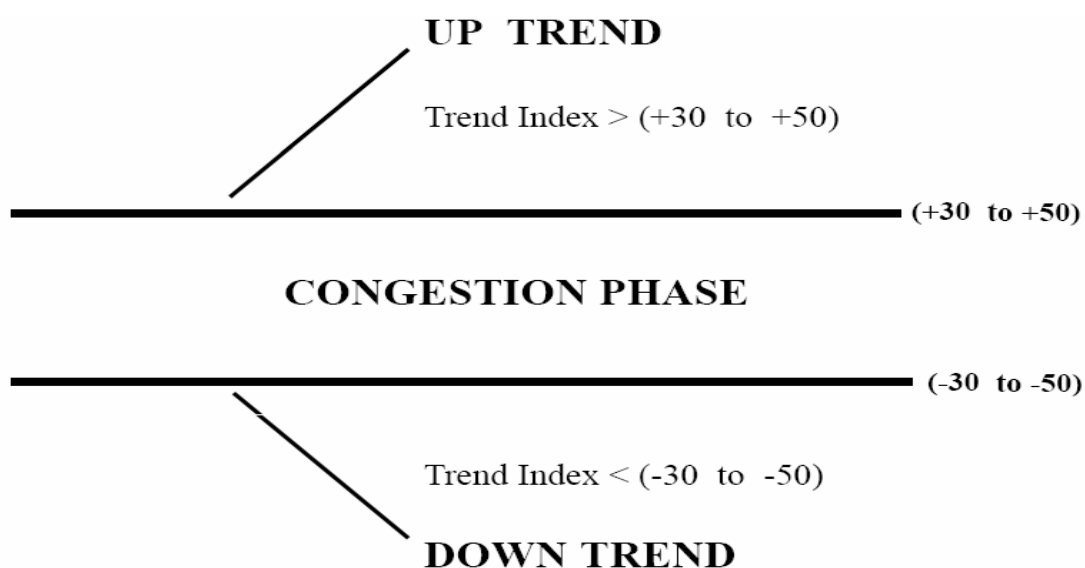
اندکس جوزف ترند (JTI)

ابزار JTI یک مدل ریاضی دینامیک است که می‌تواند در شناسایی ترند بازار، مسیر ترند و قدرت ترند به کار رود. از همه مطالعات GET پیشرفته JTI ترکیب بسیار کاملی است و در بیشتر زمان‌ها محاسبه می‌شود. همچنین JTI الگوریتم یکسانی در همه بازارها و در همه تایم‌ها (از قبیل روزانه، هفتگی و ماهیانه) به کار می‌برد.

ابزار JTI یک Trend Index Value محاسبه می‌کند که می‌تواند با تایم‌های کوتاه مدت، معمولی یا بلند مدت بازار تنظیم شود. اگر Trend Index Value بالاتر از ۳۰-۵۰ باشد این مدل بازار را به عنوان ترند صعودی طبقه‌بندی می‌کند. اگر Trend Index Value کمتر از ۳۰-۵۰ باشد این مدل بازار را به عنوان ترند نزولی طبقه‌بندی می‌کند. زمان‌هایی وجود دارد که در آن‌ها بازار توانایی تولید Trend Index Value را ندارد و معمولاً این حالت در طول دوره‌های بسیار پرتراکم رخ می‌دهد.

ابزار JTI بسیار متفاوت از مطالعاتی از قبیل DMI است. این مطالعه یک همبستگی خاص معمولی را به کار می‌برد که بوسیله آن اندکس ترند را محاسبه می‌کند. ایده اولیه در زمان طراحی JTI این بود که یک مطالعه‌ای را که فرد را از گرفتن پوزیشن در خلاف ترند اصلی منع می‌کند ایجاد کند. آزمایشات صورت گرفته دلالت بر این دارد که JTI این کار را به خوبی انجام می‌دهد.

اضافه شده توانایی JTI است که مطالعه‌ای شده که هشدار زود هنگام قبل از شکسته شدن ترند و پایان ترند می‌دهد.



زمانی که **Trend Index Value** محاسبه می شود نرم افزار خودش محاسبه می کند و ارزش های فعالیتی قیمتی (**Price Action Volume**) متفاوت را رسم می کند که به صورت اتوماتیک با شرایط اخیر بازار جا بجا می شوند. این مساله برای طبقه بندی قدرت ترند به کار می رود و در چهار رنگ دیده می شود:

قرمز: ترند بسیار قوی است.

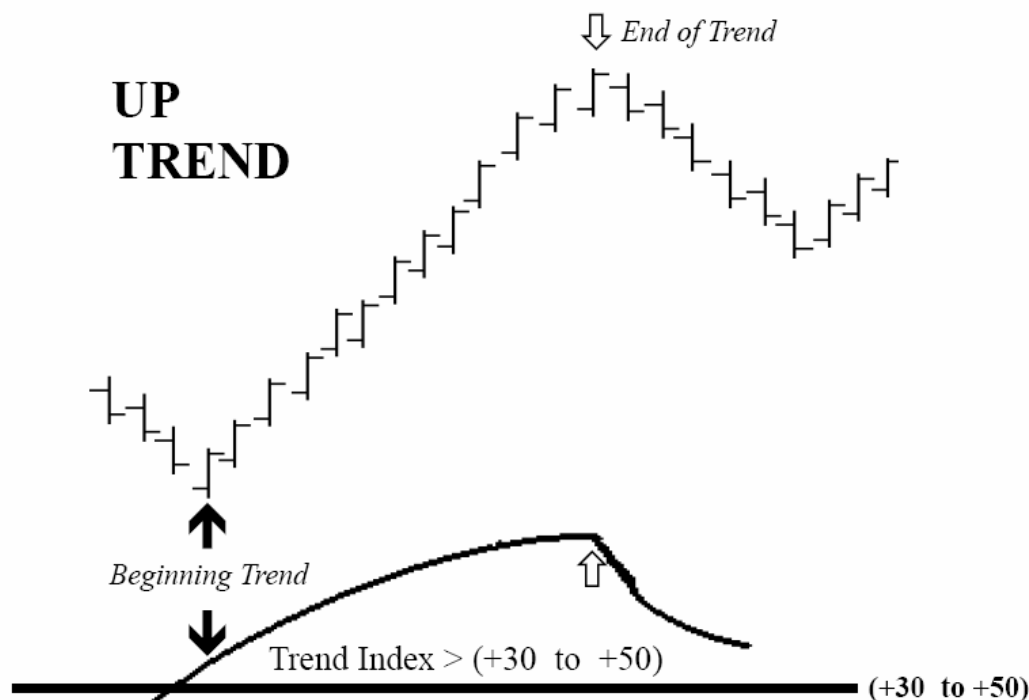
آبی: ترند قدرت متوسطی دارد.

سبز: ترند قدرت کمی دارد

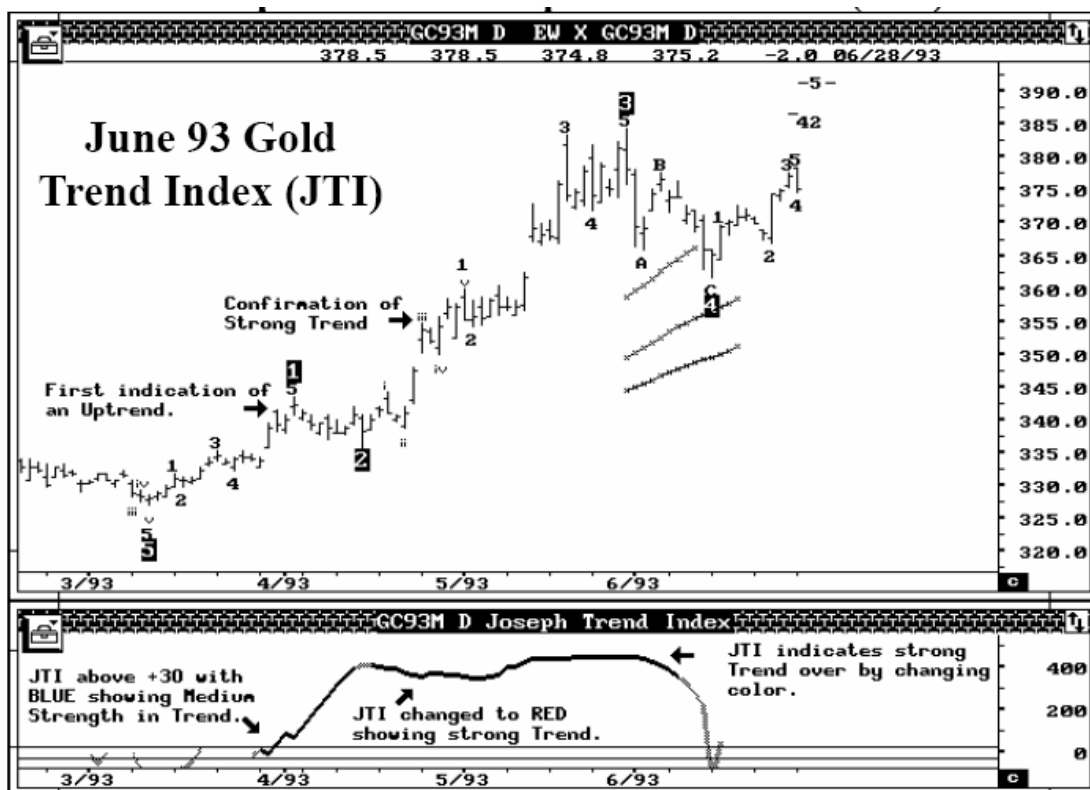
زرد: برای بخش زیادی دلیل ایجاد **Noise** بازار است.

تقریباً همه فازهای موج سوم و موج های پنجم گسترش یافته یک **Trend Index Value** (قرمز) قوی ایجاد می کنند. به طور کلی بیشتر این فازها (۳ و ۵) بدون ترند یا با قدرت متوسط و کم شروع می شوند و با سرعت یک ترند قوی تشکیل می دهند. به هر حال در موارد زیادی ترندهای قوی (قرمز) در مراحل اولیه حرکت و **JTI** طراحی شده برای شناسایی آنها ظاهر می شوند.

همچنین فاز موج سوم و فاز موج پنجم گسترش یافته تمایل قوی آنها به کاهش دادن قدرت ترندشان قبل از کامل شدن نشان داده اند. ابزار **JTI** به سرعت این حالت را می یابد و با کاهش دادن پلهای قدرت ترند و تغییر به رنگ با قدرت کمتر به کاربر هشدار می دهد.







توجه کنید که چگونه JTI در همه مراحل رالی در حالت رنگ قرمز قوی باقی می ماند. سپس نزدیک به قله JTI رنگ را که علامتی است دال بر پایان ترند تغییر می دهد. این همان جایی است که باید به مطالعات الیوت اضافه گردد. بله ترند جاری به قله رسیده است. به هر حال در مطالعات الیوت این موج سوم است. زمانی که موج چهارم اصلاحی یک PTI قابل قبول ارائه می دهد ما می توانیم منتظر تلاش برای رالی دیگر در موج پنجم باشیم. ابزار JTI می تواند این فاز رالی دوم را نیز بعنوان یک ترند متفاوت کلی دیگر بیابد.

استفاده از سطوح متفاوت طول ترند:

در زمان استفاده از طول ترند معمولی (Normal Trend Length) تحقیقات اشاره به این دارد که JTI می تواند هر دو موج سوم و پنجم را بعنوان فازهای ترند مختلف شناسایی کند. طول ترند بلند تمایل دارد که توالی ۵ موج را به عنوان یک فاز ترند نشان دهد.

طول ترند متوسط و کوتاه به کاربر اجازه می دهند که شکست موج سوم بر قطعات ترند کوچکتر را بیابد و می تواند در پوزیشن های کوتاه مدت تر به کار آیند.

ما پیشنهاد می کنیم که شما با طول ترند معمولی شروع کنید و فقط زمانی آن را تغییر دهید که با مطالعه JTI بیشتر آشنا شوید.

تنظیمات پیشنهادی برای JTI :

طول ترند = معمولی

سرعت = خاموش

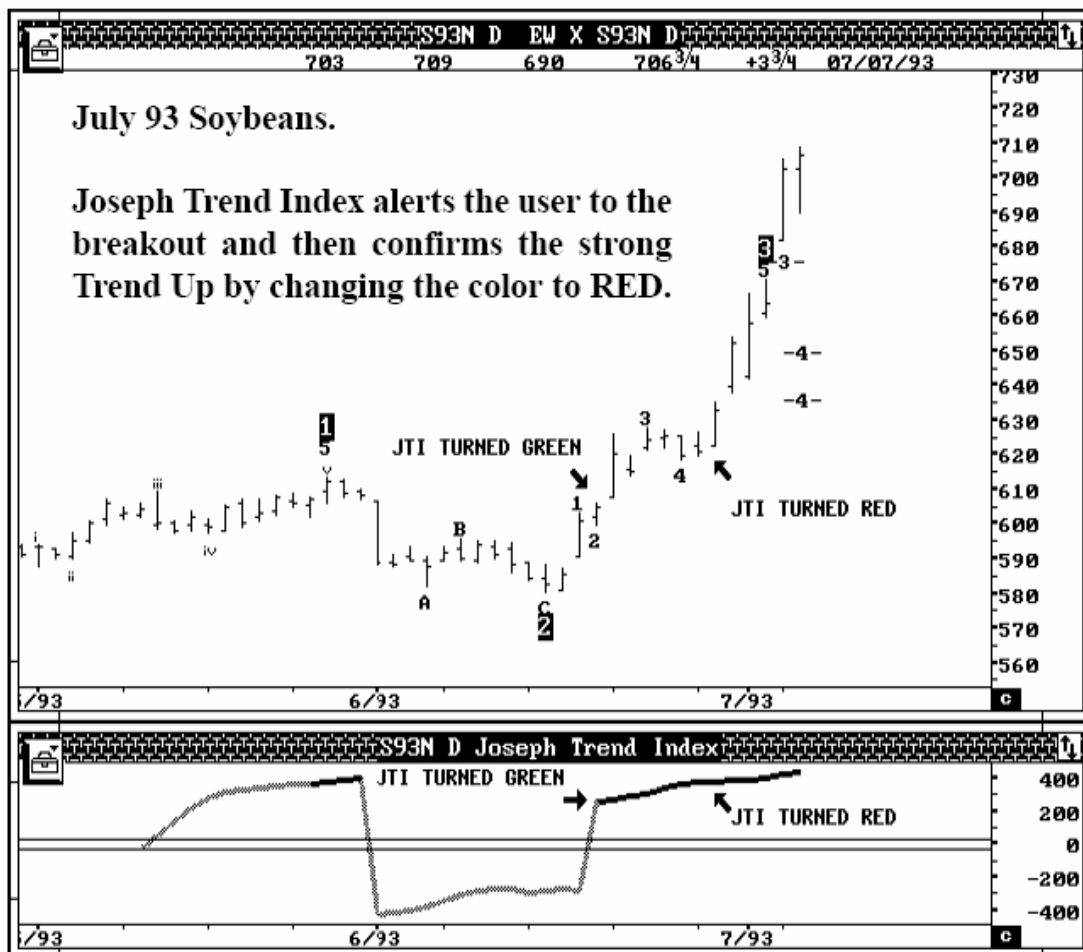
۳۰ = Band ۱

۳۰ = Band ۲

در ادامه نمودار جولای ۱۹۹۳ برای Saybeans آمده است. در حوالی سطوح ۶۰۵ JTI دلالت بر داشتن یک ترند صعودی مناسب داشت. در ۶۲۰ رنگ آن قرمز شد و دلالت بر یک ترند قوی در جولای Saybeans داشت.

مورد A: تریدر می تواند از آنالیز JTI به همراه دیگر تکنیک ها برای ورود به یک پوزیشن بلند مدت استفاده کند.

مورد B: JTI در این مورد یک مدل ریاضی که قدرت ترند را طبقه بندی می کند را مهیا می کند. ترند تحت عنوان ترند صعودی قوی طبقه بندی می شود که باید از گرفتن پوزیشن های کوتاه مدت جلوگیری کرد.



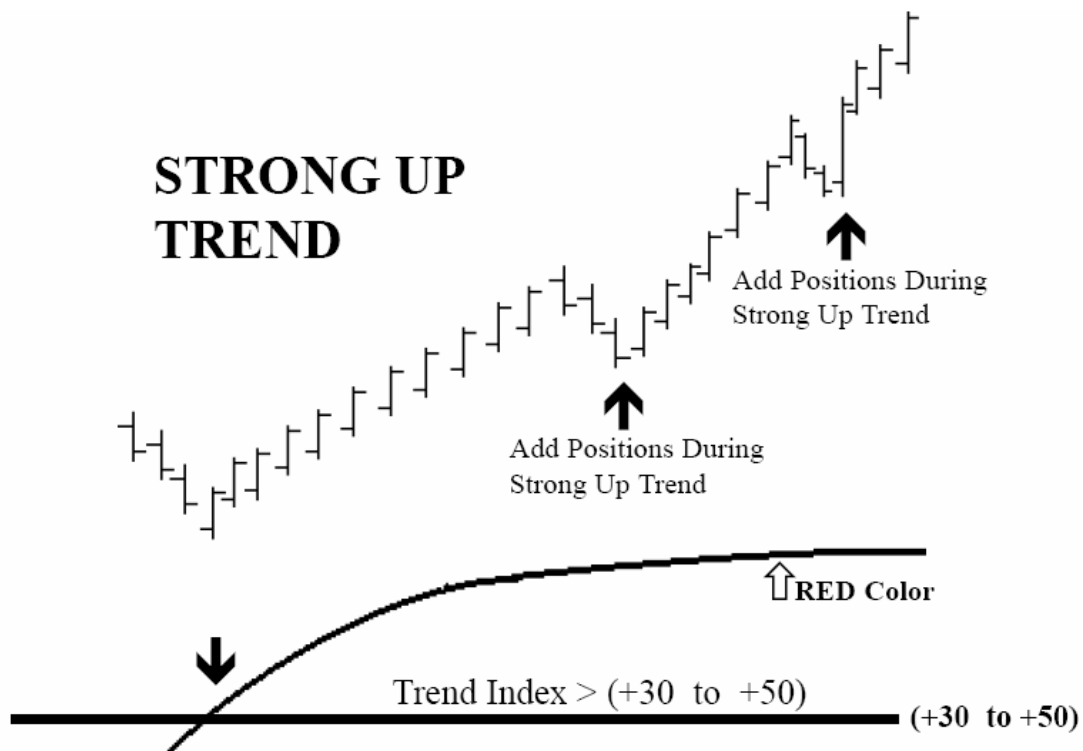
چگونگی استفاده از JTI:

(۱) JTI می‌تواند به عنوان سیگنال هشدار دهنده زود هنگام برای شناسایی مراحل اولیه ترند اصلی استفاده شود.

(۲) JTI می‌تواند به عنوان سیگنال هشدار دهنده زود هنگام برای شناسایی پایان ترند اصلی استفاده شود.

(۳) JTI همچنین می‌تواند به عنوان یک ابزار غیر مشاهده‌ای و غیر خطا دار برای اضافه کردن پوزیشن یا در زمانی موقتی که بازار کمی به عقب بر می‌گردد زمانی که یک ترند قوی و اثبات شده وجود دارد استفاده شود.

(۴) JTI یک مدل ریاضی را آماده می‌کند که قدرت ترند را طبقه‌بندی می‌کند و از ترید کردن فرد در مقابل یک ترند قوی در حالی که ترند قوی هنوز ادامه دارد جلوگیری می‌کند.



به علت اینکه JTI یک مطالعه جدید می‌باشد و کمی غیر معمول در دو بعد اجرا می‌شود (مسیر و قدرت)، عده ای از کاربران ممکن است فهمیدن آن را مشکل ارزیابی کنند. تنها راه برای دستیابی به آن کار با آن با اطلاعات گذشته است و تا زمانی که شما با مطالعه JTI آشنا شوید.



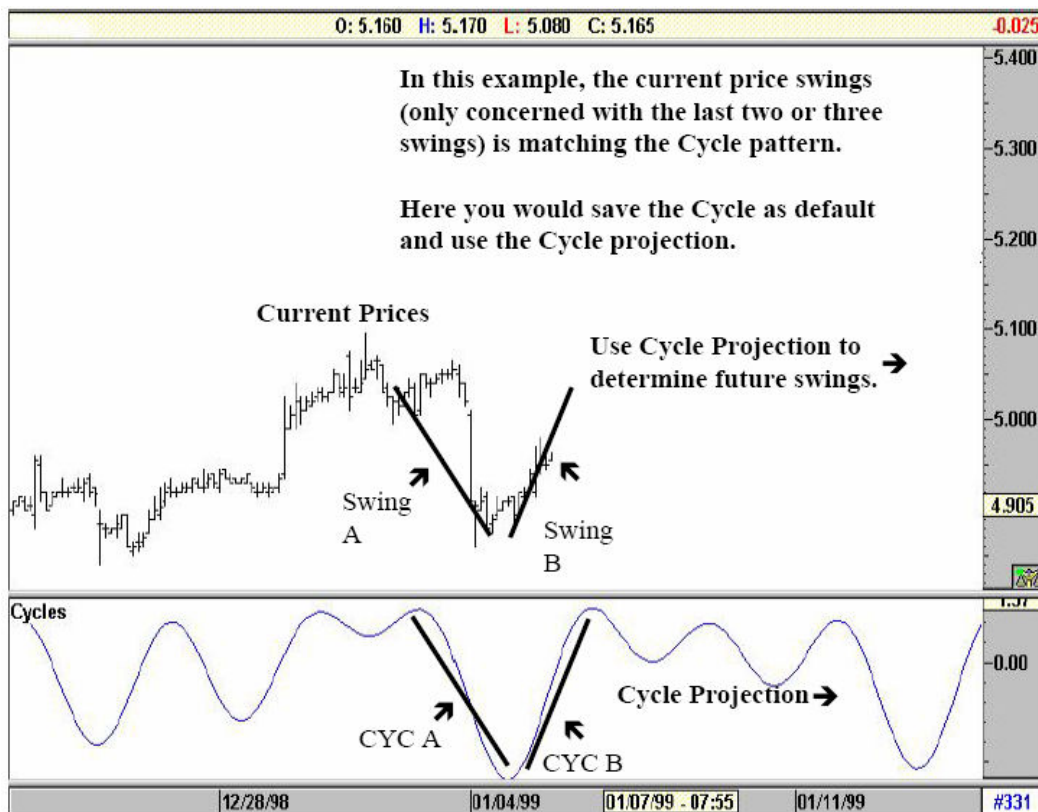
چرخه‌ها

چرخه‌ها مطالعه جدیدی هستند که به نرم افزار GET پیشرفته اضافه شده‌اند. حالت از پیش تعیین شده آن از ۲۰۰ میله برای محاسبه چرخه‌ها استفاده می‌کند و ما توصیه می‌کنیم که آن را در ۲۰۰ بدون تغییر بگذاریم.

زمانی که شما برای اولین بار مطالعه چرخه‌ها را به کار می‌برید نرم افزار چرخه‌های اصلی را بر روی هر تیک جدید محاسبه می‌کند. زمانی که شما فهمیدید تناظری بین چرخه و نوسان قیمت وجود دارد شما می‌توانید چرخه فوق را به عنوان پیش فرض در نظر بگیرید. اکنون اگر چرخه متناظر با نوسان قیمت ایجاد شود شما باید آن را بیابید. ما برنامه‌ریزی کرده‌ایم تا این کار به صورت اتوماتیک در زمان دیگری انجام شود. لطفا مطالب زیر را مطالعه کنید تا چگونگی یافتن این تناظر را بدانید.

تناظر (Maching):

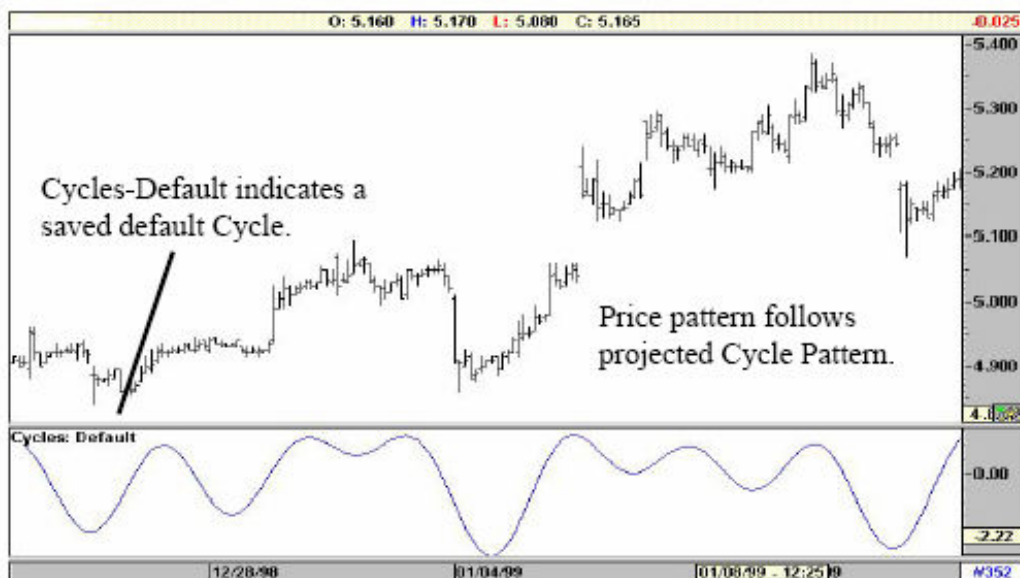
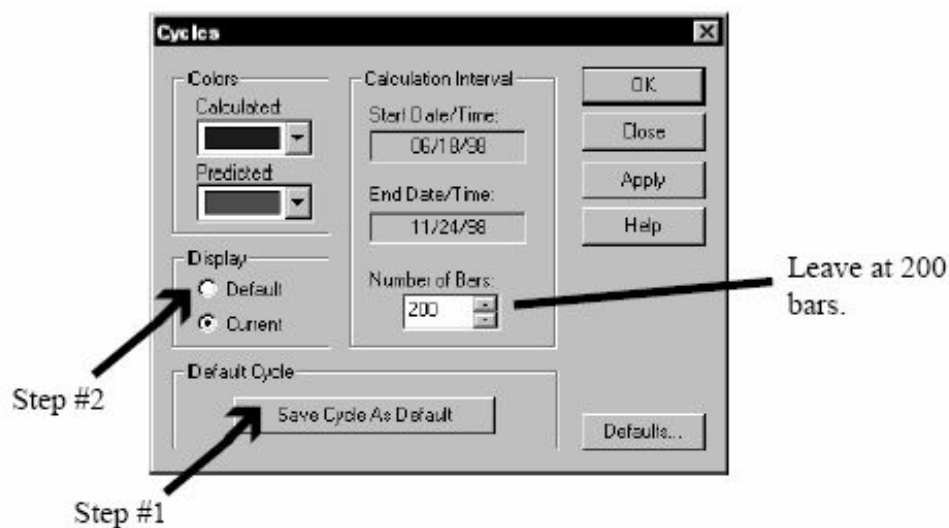
به چند پیوت قبل روی نمودار قیمت توجه کنید. نوسان قیمتی با چرخه متناظر شود. به مثال زیر توجه کنید. اگر هیچ تناظری وجود نداشته باشد سپس اجازه دهید تا محاسبات تا زمان دیدن یک تناظر توسط شما ادامه یابد.



زمانی که یک تناظر یافت می‌شود:

مرحله اول: زمانی که شما یک تناظر مانند آنچه که در صفحه قبل نشان داده شد یافتید ابتدا کلیک راست روی ابزار چرخه انجام بدید تا منوی چرخه‌ها ظاهر شود. حالا دکمه **Save Cycle As Default** را انتخاب کنید. انتخاب این گزینه بسیار مهم است. در غیر اینصورت نرم افزار هر بار که یک میله اضافه شود چرخه را مجددا محاسبه می‌کند.

مرحله دوم: زمانی که شما گزینه فوق را انتخاب کردید سپس **Display** را روی **Default** قرار دهید. این کار **Display Default** را اجرا می‌کند. روی **Ok** کلیک کنید.

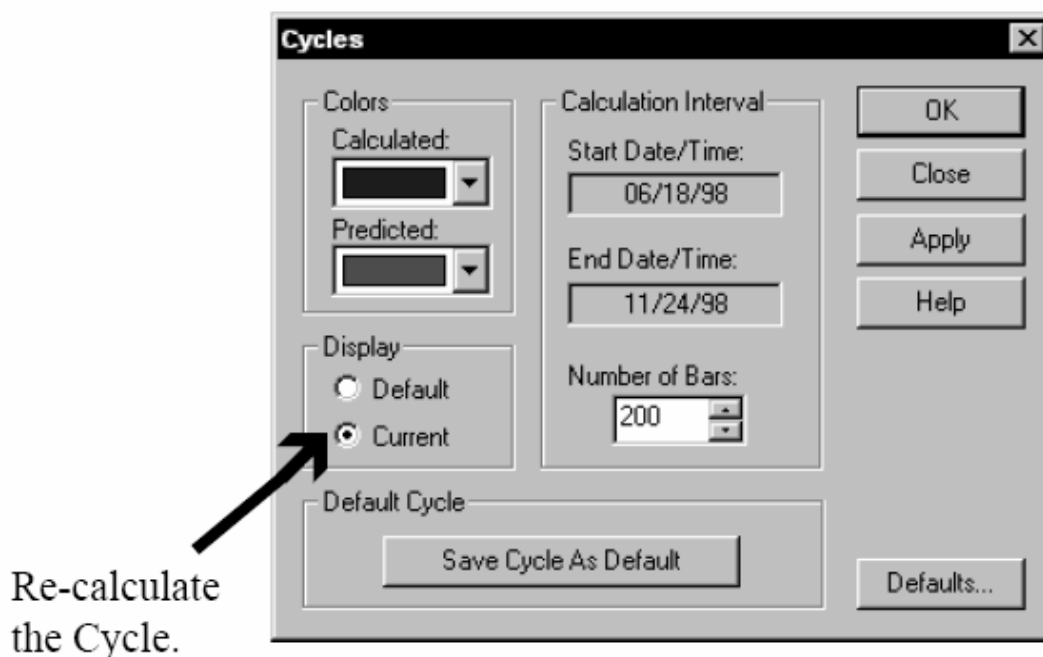


چه زمانی شما می‌توانید چرخه‌ها را مجدداً محاسبه کنید؟

زمانی که شما یک تناظر پیدا کردید از Default Cycle تا زمانی که نوسان قیمت ایجاد شود استفاده کنید و الگوی چرخه رسم شده را در جهت متفاوتی ادامه دهید. زمانی که سیکل ترسیم شده مختل (Fail) شود و به حالت IN SYNC برسد زمانی است که دوباره باید محاسبه شود. ما در حال جستجو برای راه‌هایی هستیم تا این کار را به صورت اتوماتیک انجام دهیم. در حال حاضر شما باید این پایان را بیابید.

چگونه محاسبه دوباره را انجام دهیم؟

روی ابزار چرخه کلیک راست کنید تا منوی چرخه‌ها باز شود. روی دکمه Current در قسمت Display کلیک کنید و سپس OK را بزنید. این کار به نرم افزار این اجازه را می‌دهد که با هر میله جدید چرخه را مجدداً محاسبه کند.





دوباره پیگیری الگوی چرخه زمانی و نوسان قیمت را برای یافتن تناظر ادامه دهید. زمانی که تناظری را یافتید فوراً چرخه فوق را به صورت Save Cycle As Default ذخیره کنید و براساس مطلبی که در صفحه قبل تحت عنوان " زمانی که یک تناظر یافتیم " ادامه دهید.

اطلاعات بیشتر در ویدئو سمینار ۱۹۹۸ که در اوایل فوریه ۱۹۹۹ منتشر شده است می‌توانید بیابید.

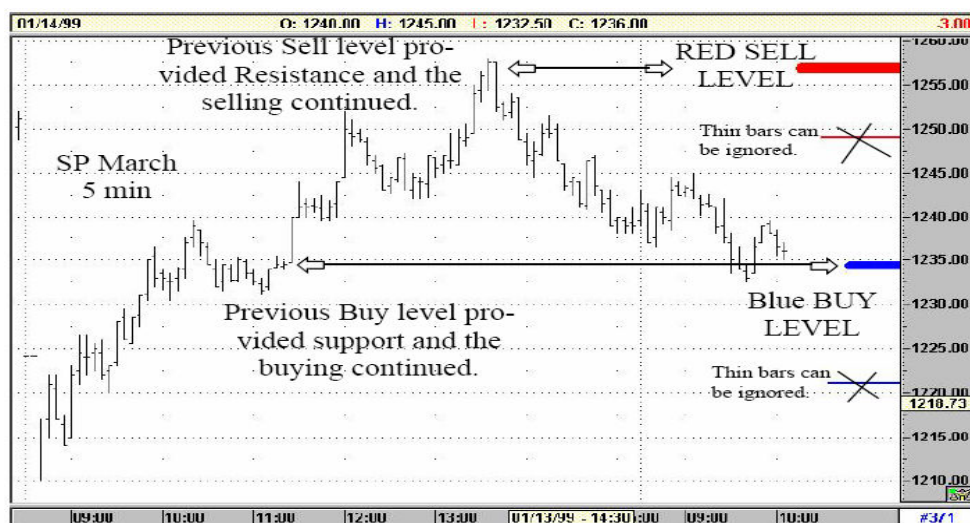
TRADE PROFILE

این ابزار جدیدی است که ما اضافه کرده‌ایم. نرم‌افزار اطلاعات را بررسی می‌کند و سطوحی را می‌یابد که در آن‌ها نوسانات بارز Buy و Sell وجود داشته است. این سطوح براساس میزان حجم درگیر و حرکت واقعی قیمت طبقه‌بندی می‌شوند. برای سهام حجم واقعی و برای Futures حجمی که نشان داده شده به کار می‌رود. زمانی که این سطوح شناسایی می‌شوند تریدرها می‌توانند زمانی که این سطوح دوباره توسط حرکات قیمت تست می‌شوند بررسی کنند.

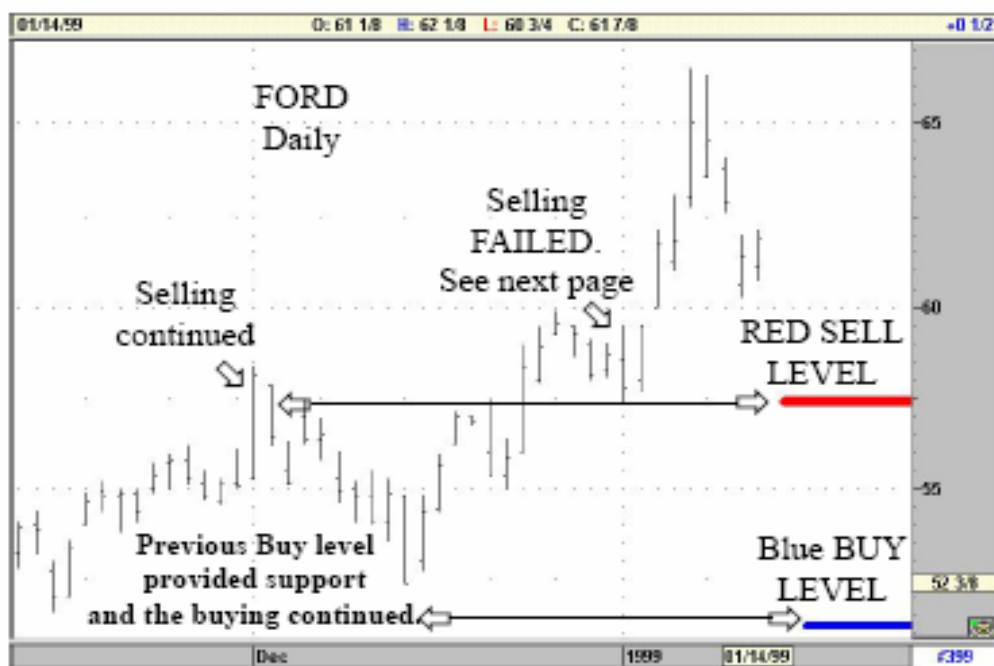
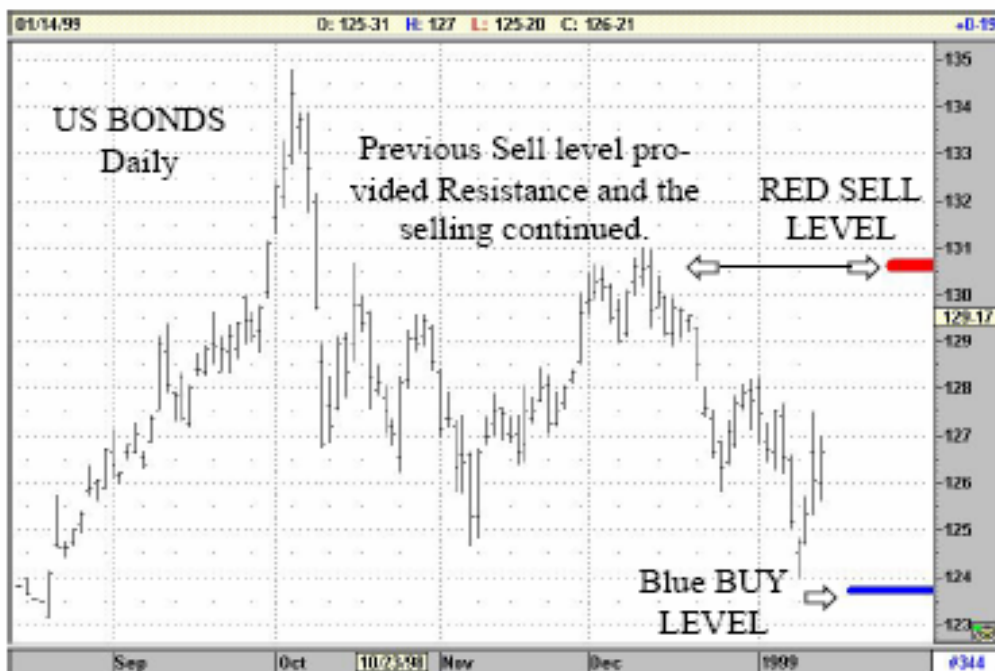
Thickness indicates volume involved  Blue Indicates previous Buy Levels

 Red Indicates previous Sell Levels
Length indicates size of move

بعنوان یک تریدر شما می‌توانید به این سطوح از نظر ضخامت (حجم بالا) و یا طول زیاد (حرکت بالای قیمت) دقت کنید. زمانی که حرکت قیمت به سطح Sell قبلی برسد شما می‌توانید ادامه یافتن Sell را دنبال کنید. همچنین زمانی که قیمت نزدیک سطح Buy قبلی است شما می‌توانید ادامه یافتن Sell را دنبال کنید. این یکی از الگوهایی می‌باشد که توسط TRADE PROFILE ایجاد می‌شود.



ابزار **TRADE PROFILE** می تواند در نمودار روزانه یا هر تایم دیگری استفاده شود. همچنین این ابزار می تواند به خوبی در بازار سهام نیز کار کند. به نمودار **Ford Motor** در زیر نگاه کنید.



زمانی که حرکت قیمت به سطح Sell می‌رسد الگوی عادی این است که Sell مانند مورد A ادامه یابد.

تقریباً ۴۰٪ موارد مورد B رخ می‌دهد. در اینجا سطح Sell قبلی در جلوگیری از ادامه رالی ناتوان بوده است. (؟)

تئوری دیگر این است که تریدرهایی که در این سطوح Sell، فروش می‌کنند ممکن است استاپ پوزیشن‌های آنان عمل کند. این امر باعث می‌شود که رالی با قدرت بیشتری ادامه یابد. **Bottom Line:** اگر قیمت‌ها در این سطوح Sell قبلی ناتوان باشند سپس این سطوح تبدیل به حمایت شده و پایه‌ای برای ادامه رالی می‌شوند.

به همین طریق اگر قیمت‌ها در این سطوح Buy قبلی ناتوان باشند سپس این سطوح تبدیل به مقاومت شده و پایه‌ای برای ادامه نزول می‌شوند.

