

الگوهای فیبوناچی (پترنهای هارمونیک)

ترجمه - تحلیل و بررسی : ساسان امیری

با تشکر از آقای امیر مقدم جهت ترجمه فصول مهمی از کتاب ارزنده هارمونیک تریدر اثر اسکات کارنی

بسم الله الرحمن الرحيم
به لطف خداوند شروع به بررسی پترنهای فیبوناچی میکنیم.

این نوع الگوها در نگاه اول شاید برای ذهن ما که به پترنهای کلاسیک عادت داریم مانوس نباشه اما این پترنهای ناب که با نسبتهای فیبوناچی شکل میگیرند بسیار دقیق هستند و با درصد بسیار بالایی صحیح عمل میکنند.

نکته مفید و دلگرم کننده دیگه در مورد این پترنها تکرار و فراوانی آنها در بازه های زمانی و کلیه ارزها میباشد.

حقیقتا ارزش بررسی و کار بروی این پترنها وجود داره...

اخیرا کتابی از لاری پساونتو بدستم رسید که بطور تخصصی به بررسی این الگوها اختصاص داشت.

مرجع پایه در این تاپیک این کتاب خواهد بود برای بحثهای تحلیلی- تکمیلی از کتاب ارزشمند هارمونیک تریدر آقای اسکات کارنی استفاده خواهیم کرد (و برای بعضی مباحث پیشرفته تر از توضیحات و نسبتهای کتاب جدیدتر ایشان)

انشالله به مرور به بررسی و تحلیل این پترنها خواهیم پرداخت.

پیش از شروع بحث کمی در مسایل فرعی اما مفید در زمینه این تاپیک صحبت کنیم.

برای عزیزانی که مایلند در زمینه این الگوها اطلاعات پیش زمینه داشته باشند چند مرجع معرفی میکنم:

<http://www.longorshort.com>

[http://www.moneytec.com/forums/showthre ... oli+levels](http://www.moneytec.com/forums/showthre...oli+levels)

<http://www.harmonict trader.com>

اما توضیحاتی در مورد این مراجع:

سایت اول سایتی است که حاوی PDF ارزشمندی در مورد دو پترن از 12 پترن کتاب مرجع ما است.

توضیحات خوبی رو میتونید در مورد این دو پترن که مهمترین پترنها در این 12 پترن محسوب میشوند پیدا کنید.

دوست خوبمون با ایدی آلبرتینی در سایت سرمایه لینک این PDF رو معرفی کرده اند اما اگه به خود سایت برید میتونید

با اطلاعات دیگری هم در این زمینه آشنا بشین.

توجه داشته باشین که این PDF یک مرجع کامل نیست بلکه تنها یک مقدمه برای این دو پترن محسوب میشود.

نویسنده و در واقع صاحب سایت در اون اشاره کرده که جزئیات رو باید دریافت کنید که هزینه اش هم \$600 ناقابل است! که در این تایپک با استفاده از مرجع اصل این پترنها (کتاب پساونتو) اون جزئیات رو بررسی خواهیم کرد.

لینک دوم بحث تفصیلی مهمی در مورد دو پترن اشاره شده است که در سایت مانی تک به معرفی تحلیل و بررسی این دو پرداخته است.

در این سایت لینک های دیگری هم برای این مطلب وجود دارد اما این لینک اولین لینکی است که برای این موضوع در اون سایت ایجاد شده است پس برای یادگیری مبانی این دو پترن مرجع خوبی خواهد بود.

سایت سوم سایت بسیار جالبی است در این سایت تلاش شده است که علاوه بر 12 پترن ارایه شده در کتاب پساونتو الگوهای دیگر و در واقع جدیدی با توجه به نسبتهای فیبوناچی ارایه شود (این سایت اسکات کارنی است که انصافا هر کسی مایل به یادگیری و درک عمیق این پترنها باشد میبایست بروی کتب سه گانه ایشان وقت گذاشته و آنها را عمیقا مطالعه نماید)

از نکات جالب دیگر این سایت ارایه یک نرم افزار است که بطور خودکار این پترنها رو برای شما در چارتهای روزانه پیدا میکنه!

میتونم لینک های مفید دیگری هم بعنوان مرجع معرفی کنم اما برای شروع همین منابع میتونه کافی باشه خصوصا که بزودی و با مرجع اصل این پترنها بطور مفصل و مشروح تمامی این پترنها (و نه فقط اون دو نوع الگو) رو بررسی خواهیم کرد.

در پایان برای اون دسته از عزیزانی که مایلند در مورد کتب مرجع ما در این تایپک اطلاعات بیشتری کسب کنند لینکهای زیر ارایه میشود :

Fibonacci Ratios With Pattern Recognition :

<http://www.amazon.com/gp/product/093438...s&v=glance>

و کتب کارنی :

http://www.harmonictrader.com/the_book.htm

مبحث رو شروع میکنیم...

پساونتو در کتاب مقدمه ای دارد در مورد سری اعداد فیبو ناچی و اینکه این اعداد به سبب نسبتهای خاصی که با یکدیگر دارند ترکیبات خاصی را ایجاد میکنند و همچنین این که این سری اعداد حقیقتا مرموز و روابط بین این اعداد را برای اولین بار نابغه ای ریاضیدان از ایتالیا کشف کرده است که به نام خود او امروزه مشهور است.

سپس به مثالهایی در عالم طبیعت اشاره میکند که چطور این نسبتها در آنجا دقیقا رعایت میشوند برای مثال این مطلب را در یک حلزون بررسی کرده است که دقیقا انحنای چرخش بر مبنای نسبتهای دقیقا مشخصی است.

سپس بحث را پیش میبرد و اینکه ما میتوانیم این نسبتهای جادویی را حتی در بزرگترین پدیده های این عالم هم مشاهده کنیم.

مثالی از یک کهکشان که میلیاردها سال نوری از ما فاصله دارد و زمانی که تصویر این کهکشان ماریچ را بررسی میکند مبینیم که در کمال تعجب دقیقا این نسبتهای قبلی در مسیر حلزونی شکل کهکشان به آن عظمت رعایت شده است!

و نتیجه گیری جالبی دارد که گویا این جهان چه در کوچکترین و چه بزرگترین اجرام آن از روابط خاص ریاضی پیروی میکند که ساختار این جهان را شکل میدهد و این نسبتها دقیقا در تمامی پدیده ها در ابعاد مختلف تکرار میشوند...

و این چه نیروی عظیمی است که در پس این وقایع قرار دارد که قادر است این قواعد بسیار دقیق ریاضی را حتی در بزرگترین ابعاد کهکشانهای بسیار دور که میلیاردها سال پیش شکل گرفته اند و میلیاردها سال نوری از ما دور هستند به دقیقترین وجهی حتی در آن ابعاد باور نکردنی رعایت کند...

حقیقتا که درسی است ... البته برای کسانی که بخواهند درس بگیرند...

سپس پساونتو بحث را بصورت کاربردی تر به پیش میبرد.

و سوالی مطرح میکند به این مضمون که وقتی ما مبینیم این نسبتهای خاص دقیقا در طبیعت تکرار میشوند و زمانی که به نسبت خاصی در کنار هم قرار بگیرند دقیقا آینده مسیر مشخص است اینک آیا این نسبتها را میتوان در مسیر طبیعی روند قیمت در چارتهای مختلف هم جستجو کرد و یا خیر؟

سپس به بررسی این نسبتهای خاص در چارتهای روزانه در بازارهای مختلف سرمایه میپردازد و اینکه هر زمان نسبتهای خاصی در چارت شکل میگیرند با درصد بسیار بالا میتوان آینده حرکت قیمت را درست پیش بینی کرد چرا که مسیر در قریب به اتفاق اوقات بر اساس مسیر از پیش تعیین شده بر اساس این نسبتهای خاص ریاضی به پیش میرود.

در این تاپیک فرض را بر این میگذاریم که خواننده با سری اعداد فیبوناچی آشنا است و نحوه رسم صحیح Retracment و بخصوص Projection را در چارت متاتریدر (و یا هر پلت فرمی که ابزار رسم فیو ناچی را داراست) را بخوبی میشناسد .

این مقدمه ای بسیار فشرده از 40 صفحه نخستین کتاب بود!

که به جهت اینکه در این تاپیک تلاش داریم بصورت کاربردی و تنها بروی این 12 پترن بحث و بررسی کنیم بیش از این به اون مطالب که در جای خود بسیار ارزشمند هم هست نمیپردازیم...

پساونتو که اجازه بدین از این به بعد لاری صداس کنیم (!) در ادامه و در فصلی تحت عنوان The Primary Pattern:

شروع به بررسی ابتدایی این الگوها میکند اما در ابتدا کمی در مورد تاریخچه و خاستگاه این پترنها و چگونگی کشف آنها توضیحاتی میدهد که باز فشرده ای از مطالب ارایه شده ارزش مروری کوتاه را دارد.

لاری در ابتدا نحوه آشنایی با این پترن ها را توضیح میدهد که نکته غافلگیر کننده در آن وجود دارد!

او می گوید:

زمانی برایم این امکان بوجود آمد که در Investment Center در سانتامونیکا کالیفرنیا با دان مک و همینطور با جان هیل در مرکزی تحقیقاتی در کارولینای شمالی آشنا بشوم.

در این مراکز کتابخانه های بزرگی در زمینه های بازار های سهامی و کلا هر نوع کتبی که در این زمینه ها باشد وجود داشت.

در اینجا آرشیوهایی از کتب قدیمی در تمامی زمینه ها از قبیل کتب تکنیکال و غیره وجود داشت که سه کتاب بیش از دیگران توجه من رو به خودش جلب کرد.

1. Profits in the Stock Market by H.M.Gartley

2.Torque Analysis of Slock Market Cycles by William Garrett

3.The Profit Magic of Slock Trasacyion Timing by James Hurst

سپس توضیحاتی در مورد این سه کتاب میدهد و خلاصه اینکه در کتاب دوم و سوم نویسندگان برای اولین بار اشاره به یافتن هارمونی های عددی در بعضی شرایط کرده اند.

و اینکه در این دو کتاب آموزش داده شده است که چگونه به این تناسب عددی در تحلیل چارتهای توجه داشته باشیم.

اما کتاب اصلی کتاب اول است که لاری توضیحات زیادی در مورد آن میدهد اما باز بطور خیلی فشرده اینکه:

این کتاب در واقع دوره آموزشی اچ.ام.گارتلی در دهه سی (1930) میلادی بوده است یک دوره آموزشی بسیار گرانقیمت به مبلغ \$1500 که برای تصور این قیمت در آن دوران کافیسست بدانید که در آن دوران با این مبلغ میشده 3 اتومبیل آخرین سیستم فورد که بهترین اتومبیل در آن زمان محسوب میشده خریداری کرد!!!

این کتاب دوره کامل آموزشی برای ورود به بازارهای بورس به حساب میآمده که از صفحه 200-250 آن کل کتاب بیش از 700 صفحه است) اختصاص به پترن های خاصی داشته است.

جالب اینجا است که پس از آن دوران این کتاب کاملا به فراموشی سپرده شده است و پترن های موجود در آن دیگر در هیچ جا و هیچ زمانی بررسی نشده است!

پساونتو سپس به موضوع جالبی اشاره میکند و آن اینکه هر چند این کتاب در ظاهر از صحنه روزگار محو شده است اما در دهه شصت و هفتاد میلادی سیستم تردینگ های بسیار گران قیمتی بر مبنای آن ارایه شد مانند:

The Trident Strategy و یا The Reversal Point Wave و...

لاری میگوید زمانی که ساختار این سیستم تردینگ ها را بررسی میکردم متوجه میشد که این روشهای تردید گرانقیمت (برای مثال ترایدنت به مبلغ \$3000 در دهه هفتاد میلادی) بر اساس پترنهای این کتاب طراحی شده بودند و باز برای مثال سیستم تردینگ مشهور ترایدنت تنها بر اساس پترنهای 1 و 2 کتاب گارتلی عمل میکرده است!

پس در واقع این کتاب برای متخصصین بزرگ ناشناخته نبوده اما دیگر در شرایط عادی برای عموم در دسترس نبوده است (همانطور که لاری هم آن را در آرشیو آن مراکز تحقیقاتی پیدا کرده است)

اما سوالی که پیش میاید این است که آیا ما باید کاشف این پترن ها را گارتلی بدانیم یا پساونتو؟ (کارنی بحث کاشف اصلی این نوع پترن ها رو از دید خاصی هم مورد بررسی قرار داده است که از این دیدگاه کاشف این پترنهای با نسبتهای

خاص آن ایشان محسوب میشوند که در زمان بررسی اختصاصی پترن گارتلی به اون میپردازیم)

این سوال از اینجا پیش میاید که اگر کسی کتاب گارتلی را دیده باشد (متن آن کتاب و بخشهایی از آن را که مربوط به این پترن میشود پساوتنو در کتابش ارایه کرده است) میبیند که :

گارتلی این پترن را معرفی کرده است اما مطلقا اشاره ای به نسبتهای فیبوناچی در آنها نکرده است. در واقع او این پترن را شناسایی و مانند سایر پترنهای کلاسیک طبقه بندی کرده است.

اما کار بزرگی که لاری پساوتنو انجام داده است این است که این پترن را با نسبتهای فیبوناچی ادغام کرده است و در واقع برای فیلتر کردن پترنهایی که سیگنال غلط بدهند از اعداد فیبوناچی استفاده کرده است به این شکل که هر زمان پترن ظاهری مشابه پترنهای معرفی شده توسط گارتلی را پیدا میکند نسبتهای قسمتهای مختلف پترن را با اعداد فیبوناچی میسنجد و اگر این نسبتها با این اعداد همخوانی داشته باشد و بر مبنای این اعداد باشد بر اساس این پترن اقدام به گرفتن پوزیشن میکند.

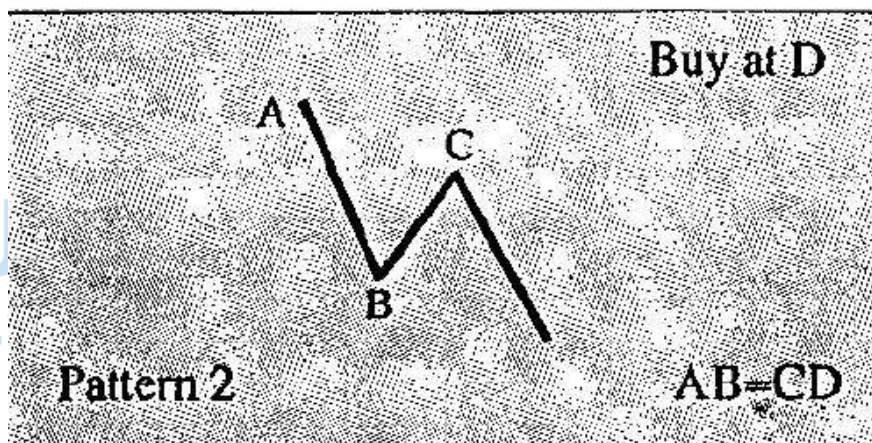
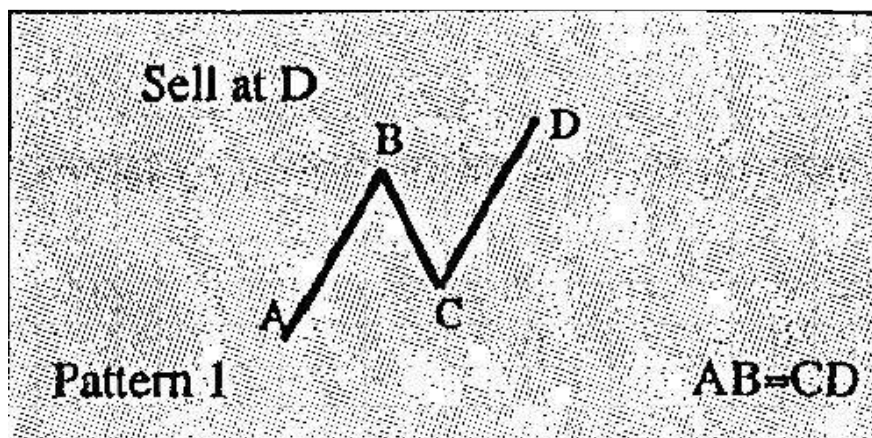
که ناگفته پیداست تا چه حد اعمال نسبتهای فیبوناچی با آن دقت عملی که این اعداد دارند بروی این پترنهای ناشناخته که خود به تنهایی هم پترنهای قدرتمندی بحساب میآیند به آنها قدرت و اعتبار صد چندان میبخشد ...

در ادامه بحث شروع به معرفی مقدماتی پترن های دوازده گانه میکنیم:

فراموش نکنید که این معرفی بسیار ابتدایی و در حد آشنایی با شکل این الگوها و توضیح خیلی مختصری در مورد آنها خواهد بود.

و هدف معرفی و آشنایی با تمامی الگوهاست سپس بعد از آشنایی آغازین با این پترن شروع به بررسی و تحلیل جامع آنها خواهیم کرد.

پس برای شروع لطفا به تصاویر پترنهای شماره 1 و 2 توجه بفرمایید :



با این توضیح کوتاه که این دو الگو مینا و تیوری پایه در در کانالهای موازی هم هستند (کانالهای موازی به زبان بسیار ساده به وضعیتی میگویم که قیمت بین دو خط موازی در حال نوسان است و با دیدن حرکت گذشته قیمت میتوان به پیش بینی حرکت قیمت بین این دو خط موازی در آینده پرداخت)

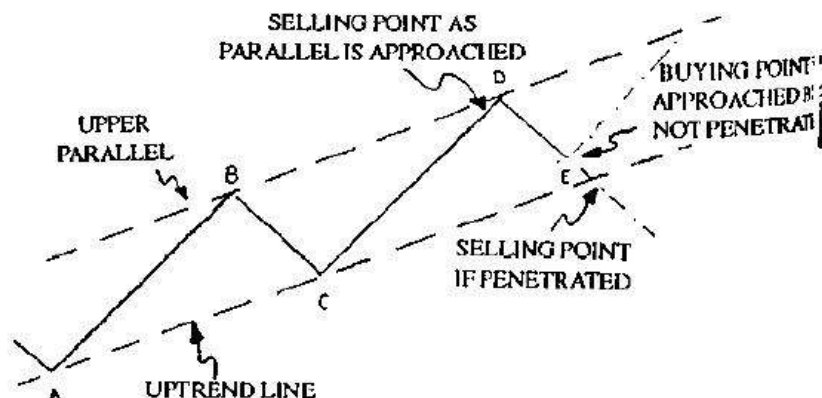
اما همین دو الگوی ساده مینای سیستم تردینگ های بسیار گرانیمتری در دهه های گذشته بوده است که به یکی از آنها اشاره شد (علت اینکه به این مسئله ایجاد سیستم تردینگ های مختلف بر اساس این الگوها اصرار دارم این است که بدانیم سیستم های موفقی در گذشته بسادگی بر اساس همین الگوهای بظاهر ساده کار میکردند و به ارزش و اعتبار این پترنها بیشتر واقف بشویم)

از دیگر سیستم تردینگ های مشهور که در دهه 50 ساختارش بر اساس این دو الگو ارایه میشد میتوان به:

Tubbs Market Course اشاره کرد که در دهه پنجاه قرن گذشته هزینه ای \$1500 برای تهیه کننده اش ایجاد میکرد...

برای درک بهتر مفهوم کارایی این دو الگو در کانال های موازی به تصویر زیر توجه بفرمایید:

PRACTICAL USE OF TREND LINES



پترن های 3 و 4

توضیحی مقدماتی و سپس تصویر این الگوها:

پساونتو در مورد این الگو میگوید یکی از بهترین پترنهایی است که در تمام عمرم پیدا کرده ام (فراموش نکنید که پساونتو خود کتابی در زمینه پترنهای کلاسیک دارد با این وجود این پترن را در صدر قرار میدهد)

این پترن را بنام گارتلی 222 نامگذاری میکند چرا که در صفحه 222 از کتاب "اچ . ام . گارتلی" به معرفی و تشریح این پترن پرداخته شده است هر چند امروزه این پترن اکثرا جهت اختصار و سادگی به نام گارتلی شناخته میشود.

پساونتو نظیر اچ.ام.گارتلی زمان زیادی را صرف بحث و بررسی این پترن میکند و از ابعاد مختلف به آن میپردازد.

یکی از نکات جالب در مورد این پترن اینک بر عکس اکثر پترن ها که ما نیازمند این هستیم که به سقف یا کف یک روند برسیم تا بعد بتوانیم از ریزش (بازگشت) روند استفاده کنیم در مورد این پترن به محض مشاهده در هر مرحله ای از روند هم که باشیم میتوانیم بر اساس سیگنالی که به ما میدهد اقدام به خرید یا فروش نماییم (پترنهای گارتلی که همجهت با ترند اصلی شکل میگیرند پتانسیل عالی برای تریدی موفق را دارا هستند)

از نکات ارزشمند دیگر در این پترن که به آن ارزش و اعتبار مضاعفی میدهد وجود $AB=CD$ در بطن این پترن است (همانطور که میدانیم پترن $AB=CD$ خود به تنهایی الگوی قدرتمندی است و حال که در قلب این پترن قرار میگیرد نوید سیگنال قدرتمندتری به ما داده میشود)

نکته بسیار مهم دیگر در مورد این پترن این است که به ما دقیقا امکان محاسبه میزان ریسک معامله را میدهد.

به این معنی که میتوان با دقت بسیار بالا دقیقا نقطه استاپ لاس را تعیین کرد و دیگر نیازی به روش های کلی نظیر خط مقاومت بعدی و از این قبیل که گاهی منجر بضرر زیادی برایمان میشود نمی گردد(در روشهای سنتی میبایست برای اطمینان قطعی پیدا کردن از مردود بودن تحلیل فرضا تا مقاومت بعدی صبر کنیم که آگه با لات بالا بخواهیم وارد پوزیشنی بشویم ممکن است این امر منجر به ضرر سنگینی شود)

اما در این روش دقیقاً نقطه استاپ محاسبه میشود و چون این پترن با درصد بالایی صحیح عمل میکند و فاصله استاپ تا شروع ترید موفق بسیار کم است (نشانه اعتبار پترن و میزان ریسک خیلی کم) میتوان با لات بیشتری بر اساس آن وارد بازار شویم و در صورت تحلیل خطا با ضرر کمی از پوزیشن خارج شویم (

لاری در ادامه میگوید : معتقدم که اگر تریدری از کل پترنهای این کتاب تنها به همین پترن مسلط شود میتواند به تریدری بسیار موفق تبدیل شود...

و نکته پایانی (البته در سطح مقدماتی) اینک:

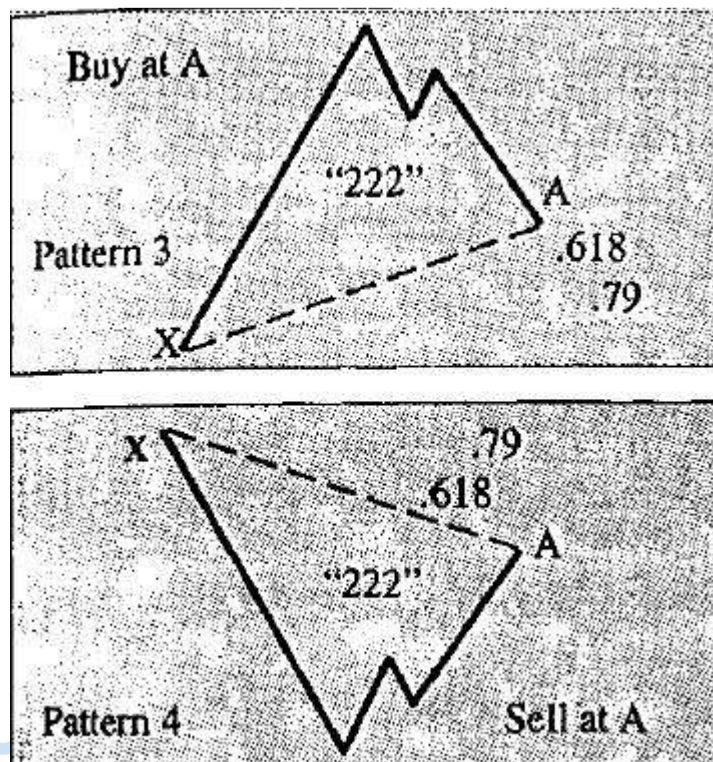
این الگو هر زمان مردود شود (Fail) در قریب به اتفاق موارد با یک حرکت قوی بازار در جهت عکس مواجه هستیم که این خود میتواند فرصت خوبی باشد که ضرر کوچک قبلی را با پوزیشنی جدید در جهت جدید بازار جبران کنیم چرا که این پترن زمانی مردود میشود که با حرکتی بسیار قوی مواجه شود (که میتواند برای مثال تاثیر یک خبر ناگهانی باشد)

و چون غالباً با حرکت شدید بازار در جهت خلاف سیگنال پترن روبرو هستیم میتوان مجدد در این جهت ترید خوبی داشت .

در این مورد اگر پترن گارتلی در انتهای موج 2 الیوت شکل گرفته باشد یعنی بر اساس تیوری الیوت تشخیص بدیم که این پترن انتهای موج دو رو نشون میده و بعد پترن رد بشه (موج دو بالاتر از موج 1 برود) میتوان يك پيپس بالاتر از نقطه رد شدن پترن (بالاي نقطه اکس) اردري خلاف جهت پترن گارتلي قرار داد که این نوع ترید در قریب به اتفاق مواقع سودي عالي در پی دارد.

در این زمینه و در واقع این نوع اردر هاي خلاف ترند بيل ویلیامز روش قدرتمندي رو در کتاب تریدینگ کی آس که در سال 1995 نوشته اند ارایه میکنند که برای اطلاعات بیشتر در این زمینه لطفاً به این کتاب و خصوصاً فصل نهم کتاب مراجعه فرمایید

(کسانی که با پترن شارک آشنا هستند میتوانند در نسبت 127 و خصوصاً 162 فیبوناچی در انتهای این حرکت شکل گرفته مجدداً بر خلاف روند بازار پوزیشن بگیرند)



www.iranbourseonline.com

پترنهای 5 و 6

در مورد این دو پترن و دو پترن بعدی در آینده بحث مفصلی خواهیم داشت و بخوبی از امکانات عملی این 4 پترن آگاه میشیم اما فعلا برای شروع و معرفی کوتاهی در مورد این پترنها به یکی دو نکته اکتفا میکنیم:

پترنهای 5 و 6 پترنهای انعکاسی هستند به این معنی که قیمت بعد از یک حرکت شدید صعودی و یا نزولی یک برگشت موقت خواهد داشت و سپس مسیر گذشته رو دوباره طی میکنه...

و این پترنها میزان اون برگشت رو تعیین میکنند و به ما فرصت خوبی میدهند تا در لحظه مناسب دوباره در جهت اصلی حرکت وارد بازار بشویم.

اما این ریتریس می تونه در 38% 79% 70.7% 62% 50% و 100% (که منجر به تشکیل پترن کلاسیک و دوست داشتنی دابل تاپ و یا دابل باتم می شه) باشه.

میبینیم که این خیلی کلی است و در واقع عملا نمی تونه به ما کمک زیادی در پیدا کردن ریتریس اصلی و سپس ورود به بازار بر اساس اون بکنه اما همونطور که گفتیم فعلا قصد معرفی خصوصیات کلی هر پترن رو داریم انشالله در زمان مناسب به بررسی دقیق و کاربردی این پترنها خواهیم پرداخت.

پساونتو در تحلیل مقدماتی در مورد این دو پترن میگوید ترجیحا از این دو پترن در ریتریس های 62% و 79% استفاده میکند و تنها در شرایط استثنایی در ریتریس 38% وارد بازار همیشه.

اما این شرایط خاص کدوم وضعیته؟
تنها در حرکات بسیار قدرتمند بازار و زمانی که حرکتی بسیار پر فشار ایجاد شده است.

توضیح اینکه در حرکات قیمتی که بعضا پس از اخبار خاصی بوجود میاید بازار شروع به حرکت بسیار پر فشار و قاطع در جهتی میکند.

اما حتی در این وضعیت ها هم این حرکات از قانون ریتریس مستثنی نیستند به این معنی که حتی در این وضعیته ها هم نمودار حرکتی قیمت ریتریس خواهد داشت و به اصطلاح بازار کمی به استراحت خواهد پرداخت و سپس در مسیر قبل خود ادامه خواهد داد.

منتهی چون حرکت بسیار پر قدرت است ریتریس تنها در حد 38% فیوناچی خواهد بود.

لاری در این مورد میگوید تنها زمانی در ریتریس 38 وارد بازار میشوم (پس معلوم میشود که در حالات عادی ریتریس 38 اعتبار 61 و 76 را ندارد) که بازار در یک حرکت قوی باشد و نشونه اون رو هم این میدونه که بازار با کندلهایی به اندازه 3 تا 5 برابر اندازه کندل های عادی بازار به نسبت 38 فیو برسه (یعنی تنها زمانی که مشاهده کنه کندل های بزرگی شکل گرفته و با این نوع کندلها روند بازار از نقطه X به نقطه 1 برسه و سپس تا 38 فیو برگشت کنه) در غیر اینصورت و تعداد کندلهای بیشتر برای ورود به بازار از 38% فیو ناچی استفاده نمیکنه.

لاری در ادامه و باز برای تحلیل مقدماتی این نوع پترن به مطلب دیگه ای اشاره میکند و اون اینکه :
با بررسی ریتریس بازار میتونیم اندازه ریتریس های بعدی بازار رو هم اغلب درست حدس بزیم.

و معتقد که در صورتیکه دیدم در اولین ریتریس بازار تا 38 فیو برگشت میتونیم با احتمال زیاد این میزان برگشت رو در ریتریس بعدی و یا دومین ریتریس هم انتظار داشته باشیم.

به این معنی که میزان یک ریتریس میتونه به ما کمک کنه تا میزان ریتریسهای آینده رو هم با درصد خوبی صحیح تخمین بزیم.

که البته به نظر حقیر این مطلب که ایشون گفته اند خیلی کلی است و تنها بر اساس این نکته نمیتونیم بطور کاربردی در ورود به بازار بر این مبنا اقدام کنیم هرچند از نظر دید کلی به ما کمک میکند روح حاکم بر بازار رو بهتر درک کنیم (البته ممکنه ایشون منظورشون فقط این ریتریس 38% در حرکت های شدید و پر قدرت بازار باشه که به ما قدرت پیشبینی نوع ریتریسهای بعدی بازار رو هم بده و نه اینکه در تمامی اوقات و هر نوع ریتریسی

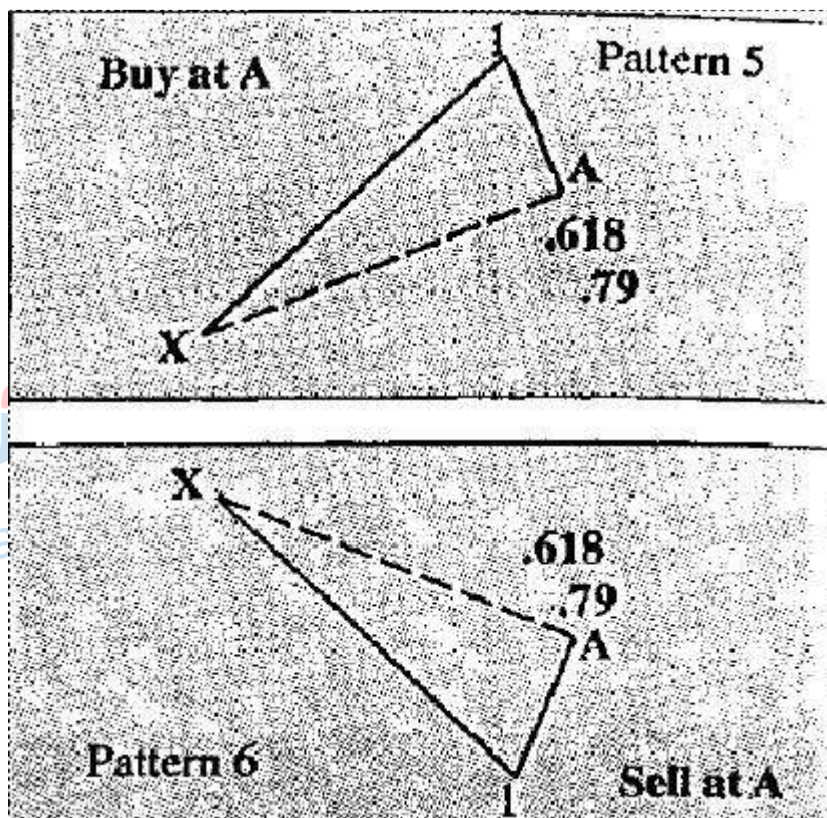
که انشالله در زمان خودش به بررسی مفهومی و کاربردی این پترنها بیشتر خواهیم پرداخت.

تنها یک مطلب میمونه و اون اینکه شاید برای بعضی عزیزان این سوال پیش بیاد که عدد 79 جزو اعداد فیوناچی است؟ و اگر اینطوره 76.4 چه عددی است.

عرض کنم که 79 در واقع گرد شده عدد 78.6 فیو است اما اینکه ما با 76.4 بیشتر مانوس هستیم به این دلیل است که

در پلت فرم متاتریدر عدد پیش فرض 76.4 است و نه 78.6 و اینکه پس چرا این عدد اینقدر دقیق عمل میکند به این خاطر است که بسیاری از بروکر ها از همین عدد پیش فرض استفاده میکنند و در نتیجه این عدد همانند عدد حقیقی 78.6 صحیح عملی میکند چرا که مورد استفاده بیشماری از افراد قرار میگیرد.

لطفا به تصاویر زیر توجه بفرمایید :



پترنهای 7 و 8

پترنهایی بسط یافته (توسعه یافته) هستند.

توضیح اینکه در بیان دو پترن قبلی گفته شد که در مسیر یک حرکت قدرتمند ریتزیسهای کوچکی پیش میاد که به ما امکان مناسبی جهت ورود به بازار در لحظه مناسب رو میده اما پترنهای 7 و 8 دقیقا پترنهایی هستند که پس از پایان یک حرکت قدرتمند بوجود میایند.

به این معنی که هنگامی که یک حرکت قدرتمند سرانجام به پایان رسید در نهایت یک ریتزیس خواهد داشت.

این ریتزیس میتواند در غالب مواقع در نسبت 161 فیبوناچی بوجود بیاید .

کسانیکه با فیوناچی بطور مرتب و دایم کار کرده اند بخوبی به ارزش 161 فیو در چارتهای تحلیلی واقفند چرا که این عدد میزان و معیاری است که در غالب مواقع تریدرها از آن برای خروج از بازار استفاده میکنند و سرمایه های خود را از بازار بیرون میبرند و به همین خاطر است که در قریب به اتفاق مواقع ما با یک رتریس در این لحظه مواجه میشویم (این وضعیت بنام پترن شارک هم معروف است)

این نکته بسیار با اهمیتی است که بدانیم (همونطور که خیلی ها میدانند) همیشه پس از یک حرکت بزرگ ما شاهد یک رتریس قطعی خواهیم بود.

اما مسئله اینجاست که این رتریس در چه لحظه ای بوقع میپیوندد و در واقع چطور میتوانیم لحظه حساس که برای رتریس بوجود میاید را شناسایی و در نتیجه آن بتوانیم به موقع وارد بازار شده و از این مطلب سود ساده اما دایمی بگیریم.

و تجربه ثابت کرده است که نسبت جادویی 161 فیو بسیار دقیق عمل میکند. دوستان کم تجربه تر حتما این عدد رو بخاطر بسپارین تا انشالله در زمان بررسی دقیق این دو پترن بخوبی با کاربرد وسیعش آشنا بشین (استفاده کاربردی از این وضعیت علاوه بر پترن شارک در روش رتریس آخر بازار هم ارزش بالایی دارد)

برای تکمیلتر شدن این بحث مقدماتی لطفا به تصویر چارت رنگی انتهای این کامنت توجه بفرمایید.

در مورد اینکه این پترن ها بسط یافته هستند هم به این معنی است که این پترنها بعد از Extension بوجود میاینند که در ادامه مباحث به نحوه محاسبه و ترسیم رتریسمنت -اکستنشن و پروجکشن خواهیم پرداخت.

اما در مورد 161 فیو زیاد صحبت کردیم (مقدماتی) پساونتو علاوه بر نسبت مهم 161 به نسبت 127 اشاره میکند و اینکه چطور شد که به اهمیت این نسبت فیوناچی پی برد اما از جهت ریاضی هم آگه بررسی کنیم میبینیم که 1.27 مجذور 1.618 است که خود باز نشونه ارتباط تنگاتنگی است که بین اعداد سری فیوناچی وجود دارد.

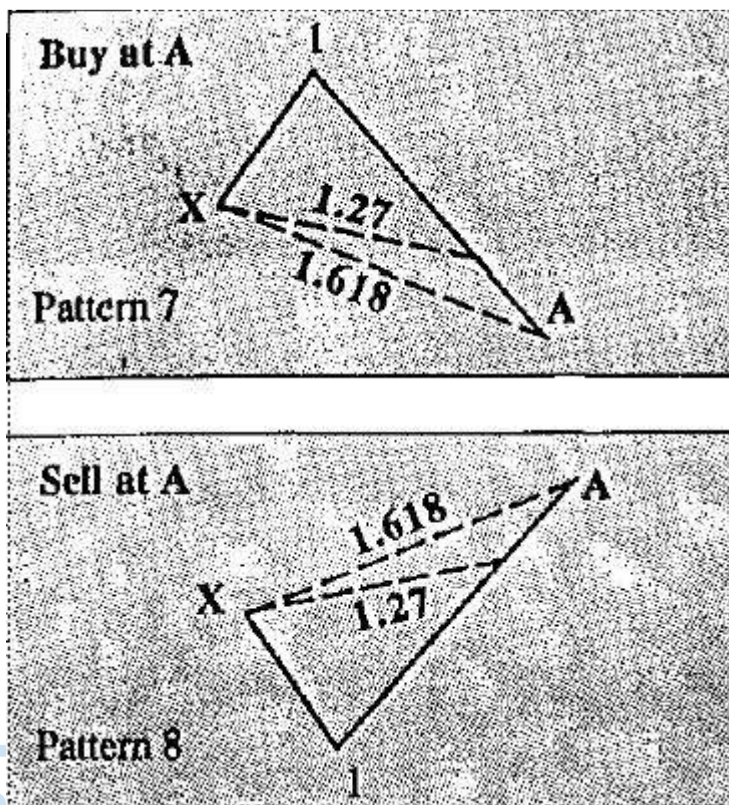
در هر صورت چه 161 و چه 127 از نسبتهای مهم و حساس فیوناچی محسوب میشوند و در زمینه کاربرد این اعداد همونطور که گفته شد مهمترینش اینه که میتونیم از این اعداد پس از اینکه یک حرکت بزرگ شروع شد در انتهای اون با این نسبتهای دقیق لحظه حساس رتریس بازار رو تخمین زده و بموقع وارد بازار بشویم و از برگشت موقت بازار استفاده کنیم.

در کنار اهمیت و ارزشی که این دو پترن دارند پساونتو به یک نکته مهم اشاره میکنه و اون اینکه نباید فراموش کنیم که این دو پترن بر اساس دو نسبت Extension شکل گرفته اند و بنا بر این گارانتی نمیکند که 100% از همین نقاط روند برگرده برای مثال وقتی روند قیمت به 127 رسید از کجا بدونیم که در اینجا برمیگرده و یا تا 161 و حتی بیشتر پیش نمیره ؟

سوال خوبی که پساونتو در اینجا مقدماتی پاسخی میدهد و بطور کلی میگود:

برای اینکه بتونیم رتریس صحیح رو تشخیص بدیم باید به چارت دقت کنیم و ببینیم که آیا نشانه ای برای بازگشت در لحظه ای که قیمت به این دو نسبت میرسد وجود دارد و یا خیر؟

برای مثال باید به نوع کندلی که در اون لحظه در چارت شکل میگیرد توجه کنیم و در صورتیکه برای مثال کندل دوجی و یا چکش (همر) در چارت و در اون لحظه شکل گرفته بود این نشونه و سیگنال بسیار مهمی است که به ما برگشت روند و آغاز رتریس را یادآوری میکند (راه دیگر که در کتاب آقای پساونتو اشاره ای به آن نشده اما کاربردی است آنست که وضعیت را از دیدگاه لیوتی تحلیل نماییم و بر اساس آن تشخیص دهیم که برگشت روند در نسبت 127 محتمل تر است و یا 162)



پترنهای 9 و 10

پترنهای خاص و جالبی هستند.

هر چند در تایم فریم روزانه به ندرت دیده میشوند اما متناوباً در تایم فریمهای میان روز (Intraday) نظیر 5 و 30 دقیقه دیده میشوند.

نکته مهم در مورد این پترنها اینکه باید چشم شما به مشاهده عادت کند و در واقع چشمتان برای دیدنشان تمرین کرده باشد.

این پترنها باید در مقابل چشمانتان ظاهر شود و این نیاز به مدتی تمرین و ممارست برای ملکه شدن ذهن به دیدنشان دارد.

اما وقتی با تمرین چشمتان به دیدنشان عادت کرد به سادگی این الگو در مقابل دیدگانتان در چارتهای مختلف ظاهر میشود.

نکته دیگر اینکه در مورد این پترن نسبتهای فیبوناچی اهمیت زیادی دارد و حتی الامکان باید دقیقاً این تقارن و تناسب بین نسبتهای فیبو رعایت شود.

اگر تلاش کنیم به سختی این نسبتها رو در چارت جا بدیم (بطور نسبی تناسب رو بپذیریم) احتمال خطا بودن پترن بالا

می‌رود و خلاصه اینکه تنها زمانی بر اساس این پترن‌ها تردید کنیم که این نسبت‌ها بخوبی رعایت شود.

و در واقع مهمترین فاکتور در این الگو تقارن- تناسب و هماهنگی بین نسبت‌های فیبوناچی است چه از نظر قیمت و چه از نظر زمان (در مورد فاکتور مهم زمان در این پترن و سایر پترن‌ها در آینده نزدیک صحبت خواهد شد)

یکی دیگر از فاکتورهایی که در تشخیص و استفاده صحیح از این پترن موثر است آشنایی با امواج الیوت است.

هر چند برای بهره برداری از این پترن نیاز به درک عمیق الیوت نیست اما دانستن مبانی الیوت کمک بزرگی به یافتن و تحلیل صحیح این پترن میکند (به سادگی با نگاهی به ظاهر پترن این مطلب واضح میشود) همینطور آشنایی با پترن Diagonal الیوت در درک بهتر و دقیقتر این پترن کمک بزرگی است.

نکته دیگه اینکه اگر کسی با روش Wolf Wave آشنا باشد به نحو بسیار خوبی میتواند با این پترن تردید کرده و دایم تردیهای موفقی داشته باشد.

برای کسانیکه علاقه مندند در مورد این روش (WolfWave) اطلاعات بیشتری کسب کنند لینکی در مانی تک ارایه میشه که امیدوارم مفید واقع بشه:

<http://www.moneytec.com/forums/showthread.php?t=15108>

همینطور در سایت قیمت‌ها لینک‌های مفیدی در زمینه آشنایی و تحلیل بر اساس پترن ولفی ویو است که برای مثال به دو مورد از آنها اشاره میکنیم:

[viewtopic.php?t=1163](http://www.iranbourseonline.com/viewtopic.php?t=1163)

[www.iranbourseonline.com viewtopic.php?t=1229](http://www.iranbourseonline.com/viewtopic.php?t=1229)

و مطلب پایانی اینکه همانطور که پساونتو اشاره میکند این پترن بر خلاف سایر پترن‌های این کتاب پیش از این در دو کتاب دیگر نیز معرفی شده اند:

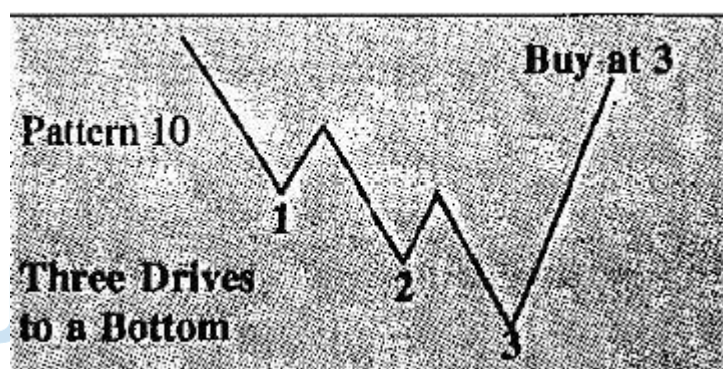
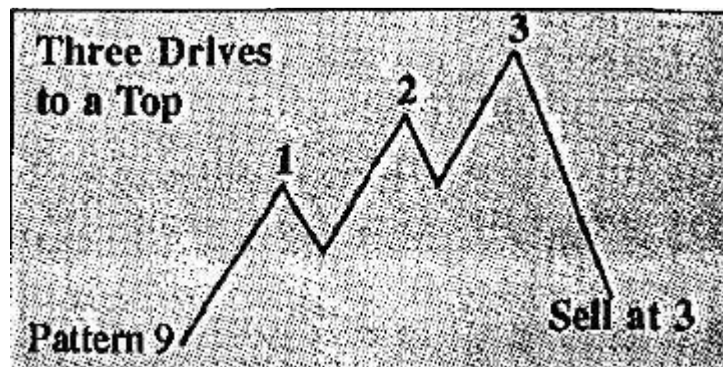
Dunningan's One-Way Method by William Dunningan

Street Smarts by Linda Bradford

که البته در این کتاب دوم این پترن (Three Drive) را با نام

(Three Little Indians) معرفی کرده است.

که خود نکته ای است که ببینیم چطور استادی بلند پایه نظیر پساونتو هم تا این حد مقید است که منابع اصلی را معرفی کند و به محض اینکه از مرجعی استفاده کرد منبع آن را معرفی کند در حالیکه قطعا خود حجم کاری زیادی را بروی این پترن انجام داده است تا آن را تایید و در کتابش معرفی کند اما بازهم این باعث نشده است که مرجع اصل را معرفی نکند ...



www.iranbourseonline.com

پترنهای 11 و 12

یکی دیگر از پترنهای بسیار پر قدرت در فیوناچی.

در واقع بنا به گفته پساونتو این پترن دومین پترن محبوب اوست (بعد از گارتلی).

این پترن با 10 پترن گذشته در مطلبی متفاوت است و اون اینکه این پترن را اچ.ام. گارتلی کشف نکرده است بلکه همونطور که پساونتو میگوید در زمانی که به همراه برابری گیل مور بروی ساخت یک نرم افزار با یکدیگر همکاری میکردند کشف شده است *نرم افزار Wave Trader Software

پترن بسیار قدرتمندی است که در دید اول و از نظر قالب کلی شبیه پترن گارتلی میباشد.

اما یک تفاوت اساسی (علاوه بر تفاوت هایی در ظاهر) با گارتلی دارد و اون اینکه باید این پترن تنها در نقاط مهم سقف و کف بازار مورد استفاده قرار بگیرد.

توضیح اینکه در پترن گارتلی ما میتوانیم در هر شرایطی که ایجاد شد حتی در میانه یک روند هم از سیگنال هایش استفاده کنیم (ترجیحا موارد همجهت با روند اصلی بازار)

اما پترن باترفلای باید تنها زمانی که در سقف یا کف بازار تشکیل شد مورد بررسی و استفاده قرار گیرد و در ازای این محدودیت نسبت به پترن گارتلی به میزان باورنکردنی این پترن صحیح عمل میکند و سیگنالهایی که میدهد دقیقا در جهت آینده بازار است.

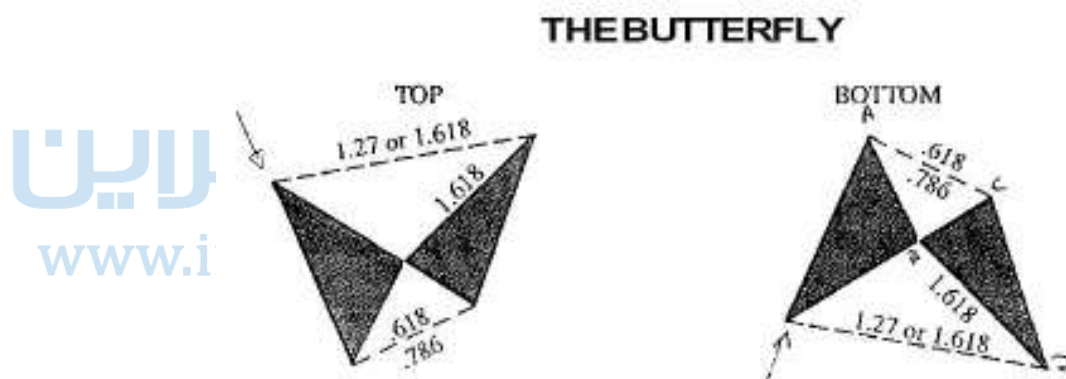
در مورد این پترن مطلب زیاد است که انشالله مفصلا برویش بحث و تحلیل خواهیم کرد اما فعلا برای شروع به یک مطلب دیگه اشاره میکنیم:

پساونتو میگوید این پترن الگوی بسیار سودآوری است منتها میبایست بخوبی به آن مسلط شد.

چرا که پترنی است که نیاز دارد بخوبی چشمتان برای یافتن دقیقش در چارتهای روزانه تمرین کرده باشد. لاری معتقد است که میتوان بهترین روش ترید در جهان رو به افراد معرفی کرد و باز هم شاهد باشیم که عده ای با این روش روزانه ضرر کنند...

چرا که نمیتوانند ایده اصلی و نکات ریز آن را دریابند و سپس با تمرین و ممارست کافی در آن تخصص پیدا کنند .

پساونتو معتقد است که این پترن نیاز داره که زمان بگذاریم و با تمرین کافی بهش مسلط بشیم اما مطمئنا زمانی که میگذاریم ارزشش رو داره و بخوبی در آینده از زحماتمون تقدیر بعمل خواهد آمد !



پترنهای 13 و 14 (دو پترن خاص)

دو پترن که به Crab (خرچنگ) و Bat (خفاش) موسوم هستند الگوهای هستند که اسکات کارنی آنها را برای اولین بار کشف کرده است.

اسکات کارنی در کتاب جدیدش موسوم به

: Harmonic Trading of the Financial Markets: Volume One

دقیقا به بررسی این دو پترن قدرتمند پرداخته است که انشالله در زمان خودش به اونها خواهیم پرداخت.

اما برای شروع و آشنایی مقدماتی با این دو الگو فیبوناچی بر اساس اطلاعات کلی که در سایت هارمونیک تریدر (در حد مقدماتی) در مورد این دو پترن هندسی ارائه شده است به معرفی آنها اقدام میشود.

الگوی خرچنگ که توسط کارنی در سال 2000 کشف شد . یکی از دقیقترین پترنهای هارمونیک بود که در آن منطقه بازگشت احتمالی روند با دقت زیادی تعیین میگردد.

معمولا روند تا 1.61 روند اصلی (XA) پیش رفته و سپس بازمیگردد که این دقیقا زمانی است که برای ما سیگنال خرید یا فروش تعیین میگردد.

طول CD معمولا تا (2.24, 2.618, 3.14, 3.61) از BC امتداد میابد.

این پترن نیاز به استاپ لاس کوچکی دارد (به جهت درصد صحت بالایش) و با درصد بسیار بالایی صحیح عمل میکند و سود آور است.

پترن خفاش (Bat)

پترن دقیق دیگری که در سال 2001 توسط کارنی کشف شد.

بر مبنای ریتریس 0.886 فیبو عمل میکند AB. باید کوچکتر از 61 فیبو باشه (ترجیحا 38 و یا 50 به نسبت XA)

در پترن خفاش از مینیمم 161 اکستنشن استفاده میشود.

بعلاوه بجای میزان $AB=CD$ غالبا باید این نسبت در آن رعایت شده باشد: $AB=CD \cdot 1.27$

پترن بسیار دقیقی است که نیاز به کوچکترین استاپ لاس در تمامی پترنهای فیبوناچی دارد که نشانه صحت عملکرد فوق العاده آن است.

انشالله در زمان بررسی این دو پترن بر اساس کتاب جدید کارنی بروی اونها بررسی خواهیم داشت و بیشتر با این دو الگو آشنا شده و خصوصا بروی نسبتهای ناشناخته ای نظیر 0.886 صحبت خواهیم کرد.

برای دید بهتر نسبت به این الگوها لطفا به تصویر زیر توجه کنید با این توضیح که این پترن که مشاهده میکنید پترن خفاش (Bat) است و تصویر پترن خرچنگ (Crab) پیش از این توسط دوست خوبمون کارلوس در تاپیک سوالات فیبوناچی ارایه شده است ...



پترن 15 (Pattern 5-0) (Pattern 5-0)
 جدیدترین پترن کشف شده توسط اسکات کارنی متخصص بزرگ پترنهای هندسی است...
 www.iranbourseonline.com

در سال 2004 کشف شده است و در سایت هارمونیک تریدر PDF مناسبی در مورد کلیات این پترن بصورت رایگان قرار دارد.

اما همانطور که کارنی میگوید این PDF تنها مقدمه ای برای شناخت کلی بروی این پترن است و نه یک مرجع کامل برای ترید بر اساس این پترن (مشابه PDF که در سایت www.longorshort.com برای دو پترن گارتلی و باترفلای وجود داشت)

اما بطور کلی پترنی است که بر مبنای ریتیرس 50% فیبو عمل میکند و در آن وضعیت $AB=CD$ از اهمیت کلیدی برخوردار است.

برای اطلاعات بیشتر میتونید به سادگی از سایت هارمونیک تریدر نسخه رایگان 13 صفحه ای این پترن رو دریافت کنید اما برای درک مقدماتی و ساده در مورد این پترن تصاویر زیر میتونه موثر باشه...

در جلد دوم سری دو جلدی آقای کارنی این پترن مفصلاً مورد بررسی قرار گرفته است.

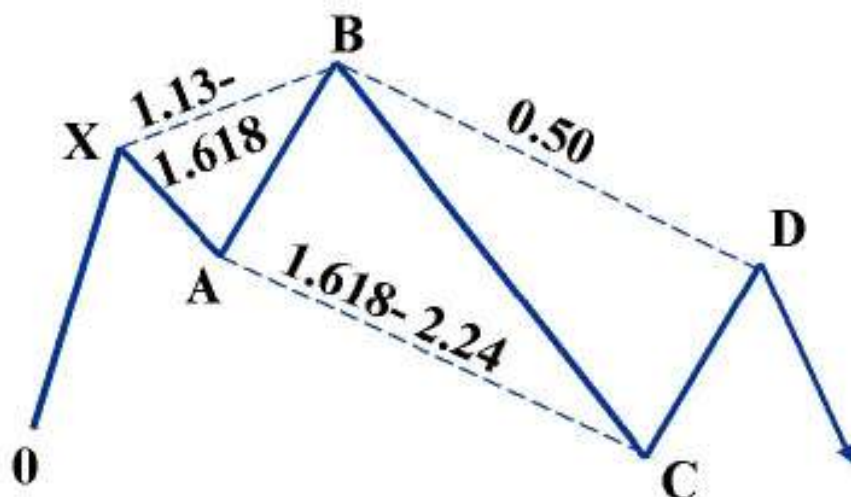
با معرفی این پترن معرفی مقدماتی 15 پترن فیبوناچی (که به اونها پترنهای هندسی هم میتوانیم اطلاق کنیم) به اتمام میرسه.

در ادامه شروع به بررسی جامع این پترنها بر مبنای کتاب پساونتو خواهیم کرد و به مثالهای کتاب استناد میکنیم.

و سپس برای تکمیل شدن بحث هر زمان که مطالب و مثالهای کتاب به اتمام رسید در هر پترن بخشی به نام:

بحث تحلیلی (مرجع ما در این زمینه کتب کارنی خواهد بود)

خواهیم داشت و در آن مفصلا به بررسی هر پترن در تمامی ابعاد آن (در حد بضاعت) و صد البته با استفاده از تمامی منابع (و نه فقط کتاب پساونتو) خواهیم پرداخت .



Bearish 5-0 Pattern

پترن 1

www.iranbourseonline.com

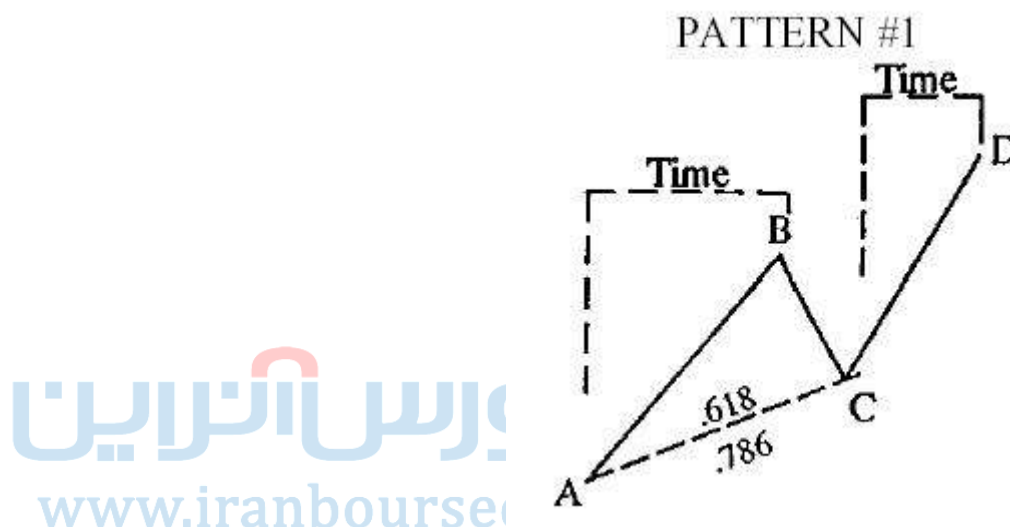
کتاب پساونتو روشی خاص برای تحلیل داره به این شکل که بطور خلاصه در چندین شماره روش تحلیل رو میگو که بازم به نظر بنده کافی نیست و باید بروی تقریبا تک تک شماره ها توضیح داده بشه تا مطلب بخوبی درک بشه.

در ابتدا قصد داشتم در هر شماره بعد از متن کتاب شروع به بررسی و تحلیل کنیم اما به این نتیجه رسیدم که ابتدا تنها متن کتاب ترجمه بشه و مثالهایی از کتاب ارایه بشه و بعد در بخشی مستقل به بررسی جامع تحلیلی در مورد پترن بپردازیم (با کمک تمامی منابع):

1. نوسان بین A و B در 60% موارد باید برابر با CD باشد.
 2. سووینگ BC میتونه 62% و یا 79% فیبوناچی به نسبت AB باشه.
 3. اگه حرکت در AB بسیار پر قدرت باشه نشونه خوبی که بتونیم حدس بزنیم میزان حرکت BC چقدر خواهد بود.
 4. در 60% اوقات باید بازه زمانی که حرکت AB ادامه داره با CD برابر باشه در 40% موارد این تناسب زمانی میتونه به 1.27 یا 1.61 AB هم توسعه پیدا کنه.
 5. در صورتیکه دیدیم در CD حرکت بسیار با قدرت به پیش میرود و یا شاهد یه گپ در روند بودیم اینها نشونه اینه که نباید منتظر AB=CD بود و باید برای 1.27 و یا 1.61 به نسبت AB آمادگی داشت.
- میبینید که توضیحات بسیار کوتاه و تلگرافی است.

شاید لازم باشه بروی تک تک موارد مطرحه توسط ایشون بررسی و با مثالهای زیادی تحلیل شود تا بجزییات برسیم.

اما متاسفانه همونطور که قبلا هم گفته شد این ضعف در کتاب پساونتو وجود داره که از بحثهای تشریحی خیری نیست و در کنار این مطلب در تصاویر هم توضیحات بسیار مختصری است که به کیفیت کتاب لطمه زده است که تلاش میشه بعد از معرفی چند مثال از کتاب (که باز هم از کیفیت مطلوب تصویری ایده ال بدور است) شروع به بحث جامعی بروی هر پترنی که مطرح میشود کنیم .



بنابر این شد که فعلا توضیحی داده نشود.

پس تنها اشاره ای کوتاه در مورد بیان مختصر پساونتو در تصویر:

$AB=CD$ در زمان .

یعنی اینکه AB, CD به میزان برابری طول کشیده است تا تشکیل شوند.

$AB=CD$ در قیمت.

به این معنی که AB, CD در تعداد پوینت (پیپس) برای تشکیل شدن با هم برابرند.

BC به میزان 0.618. فیوناچی نسبت به AB ریتریس داشته است .



AB=CD در قیمت که به معنای برابری پوینتهایی (پیپس) است که آنها را تشکیل داده است.

AD=1.61 XA درکمال ناباوری به نسبتی در تصویر اشاره شده است که مربوط به پترن AB=CD نمی باشد!!!

در واقع پساونتو در تصویر یک پترن باترفلای را به نمایش گذاشته است که در آن پترن داخلی یک AB=CD است که البته باعث اعتبار زیاد پترن باترفلای میشود و از میزان ریزش قیمت بعد از پترن هم این مطلب آشکار است.

مطلب اینجا است که ما میتوانیم برای معرفی پترن AB=CD مثالهای متعددی بزنیم که در آن خبری از پترن گارتلی و یا باترفلای نباشد چه برسد به اینکه برای اثبات پترن AB=CD به یکی از شرایط پترن باترفلای اشاره کنیم!!

صادفانه بگم این پترن را برای معرفی پترن AB=CD مناسب نمیدانم.

درست است که در پترنهای گارتلی و باترفلای وجود این پترن در بطنش به اعتبار آن بسیار می افزاید اما زمانی که ما داریم به تنهایی این پترن را (AB=CD) را بررسی میکنیم شاید شایسته تر باشه (با احترام مجدد به استاد پساونتو) که تنها به مثالهایی بپردازیم که پترن AB=CD مستقل از سایر پترنها باشد (که در بحث تحلیلی مثالهای متعددی در این زمینه خواهیم داشت)



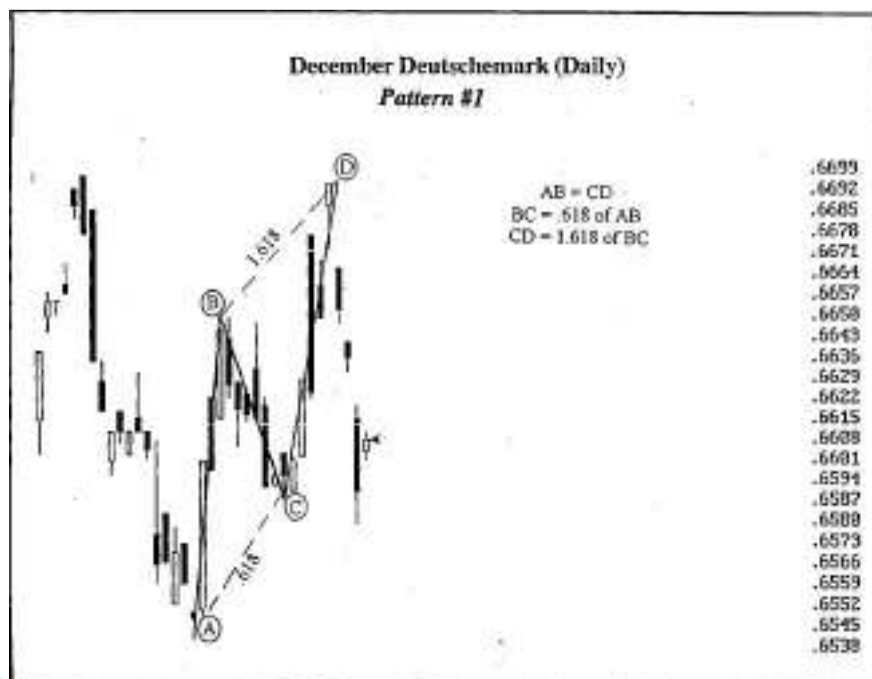
حتی دیگه اشاره هم نشده که در زمان با هم برابرند یا قیمت ! (یکم هم خودمون باید زحمت بکشیم دیگه !)

که در اینجا منظور برابری در قیمت (میزان پیپس) است.

به این معنی که $BC = 0.618 AB$ به این معنی که BC به اندازه نسبت 61 فیبو در AB بازگشت داشته است (این نسبت 61 برای BC از اهمیتی فوق العاده در نسبتهای مختلف فیبوناچی در پترن $AB=CD$ برخوردار است که بزودی به بررسی آن خواهیم پرداخت)

BC $CD = 1.618 BC$ که به این معناست که بازوی CD به میزان اکستنشن 161 بر اساس بازوی BC امتداد داشته است (توضیح تکمیلی و واضحتر در ادامه مباحث ارائه خواهد شد)

در مورد این هماهنگی بین دو نسبت 61 و 161 در این پترن به زودی به نکته ای کلیدی اشاره خواهیم داشت... فعلا همینقدر بدونیم که این هماهنگی باعث اعتبار بسیار یک پترن $AB=CD$ میشود که در تصویر هم میبینیم بازار پس از تشکیل پترن با یک گپ قدرتمند و سپس یک ریزش جدی مواجه شده است .



ایران بورس آنلاین
www.iranbourseonline.com

بحث تحلیلی:

بعد از معرفی پترن 15 عده ای از دوستان گفتند که علی رغم علاقه ای که به دنبال کردن مطالب دارند اما هنوز هم برایشان بعضی مطالب گنگ است و بعضی حتی گفتند که کلیت مبحث هم هنوز برایشون جا نیوفتاده است!

هر چند هنوز بحث های تحلیلی شروع نشده بود اما امیدوار بودم که حداقل دید کلی خوبی نسبت به موضوع تایپک ایجاد شده باشد...

در هر صورت به دلیلی اینکه هدف از این تایپک هم آشنایی و نهایتاً کاربرد این روش در ترید روزانه عزیزان است تلاش میشود مجدداً مروری فشرده در مورد مفهومی که در این تایپک بیان شده است ارائه شود و سپس به بررسی پترن $AB=CD$ پردازیم.

سعی همیشه مجدداً به ساده ترین بیان ممکن مفاهیم پایه این بحث مروری سریع شده و سپس به بررسی جامع پترن اول پرداخت بشه.

روش الگوهای فیبوناچی در واقع متدی است که در آن تلاش میکنم که با استفاده از پترنهای خاصی و همچنین نسبتها (اعداد) خاصی (سری اعداد فیبوناچی) نواحی مهم و حساس بازار را کشف کرده و در این نواحی به دنبال سیگنالهایی باشیم که به ما بازگشت روند را هشدار میدهند.

در واقع معتقدیم که در هر بازار و هر چارتی نواحی وجود دارد که دارای پتانسیل بالقوه برای برگشت روند هستند و کاری که ما میکنیم در حقیقت این است که این نواحی را توسط چند پترن و چند نسبت فیبوناچی شناسایی کنیم و در نتیجه آن از احتمال قریب الوقوع بازگشت روند مطلع شویم و بر این اساس تریدی موفق را آغاز کنیم.

برای درک بهتر مفهوم نواحی که پتانسیل بازگشت دارند خطوط مقاومت مثال خوبی هستند. در واقع کسانی که با خطوط مقاومت ترید میکنند به این امر واقفند که نواحی زیر مقاومت و بالای خطوط حمایت نواحی هستند که پتانسیل قوی برای برگشت روند را دارا هستند.

اما در روش پترنهای فیبوناچی معتقدیم که میتوان با ابزارهای قدرتمندتری نسبت به خطوط مقاومت عادی این نواحی را شناسایی کرد.

به این منظور از پترنهایی برای شناسایی فرصت های موجود در بازار در این نواحی استفاده میکنیم.

علاوه بر این نسبتهای فیبوناچی عملکردی دقیق دارند که همواره از آنها هم میشود برای یافتن نواحی که احتمال برگشت روند وجود دارد استفاده کرد.

حال با ادغام این دو روش (پترنهای و نسبتهای فیبوناچی) به روشی قدرتمند دست میابیم که به ما در پیدا کردن نواحی حساس بازار جهت برگشت روند قیمتی کمک میکند .

پترن $AB=CD$ پایه ای ترین پترن در این سری پترنهای هندسی است.

کسانی که در شناسایی و درک عمیق پترنهای فیبوناچی با مشکلاتی روبرو هستند با تمرکز و دقت بروی این پترن - که پایه همه پترنهای بعدی است - و درک ریزه کاری و جزئیات این پترن کمک بزرگی خواهد بود در راه شناخت عمیق و در پی آن استفاده موثر این گونه پترنها...

تلاش همیشه با بیانی ساده به کلیه جوانب این پترن پرداخته و با مثالهای متعدد به این پترن در ابعاد گوناگون پردازیم:

پترن $AB=CD$ ابتدایی ترین پترن در بین پترن های 12 گانه میباشد اما این نه تنها از اهمیت این پترن نمیگذرد بلکه باید گفت که این پترن در بین سایر پترن ها بینهایت اهمیت دارد.

در واقع اساتیدی هستند که این پترن را از پترن گارتلی هم قدرتمند تر میدانند (کارنی در کتاب سال 99 خود اهمیت و اعتبار زیادی به این پترن میدهد اما در جلد يك کتاب جدیدش بیشترین اهمیت در دقت و اعتبار را برای پترنهای خفاش و خرچنگ قایل است همینطور برای دوستانی که به تحلیل امواج الیوت علاقه دارند هم عرض کنم که بنده از این پترن تنها در زمانی استفاده میکنم که در موج دو یا چهار مشاهده شود)

در هر صورت درک جزئیات این پترن بسیار به تکامل دید ما نسبت به حرکات بازار کمک میکند.

در این پترن طول A تا B اولین حرکت قیمتی است که شکل میگیرد سپس با یک رتریس (برگشت موقت) روبرو هستیم که طول B تا C را شکل میدهد و در نهایت شاهد حرکت آخر هستیم که از نقطه C تا D ادامه میابد که میبایست طول CD برابر با AB باشد.

در واقع با ساختار ساده این پترن در نگاه اول باورش مشکله که تا این حد دقیق عمل کنه اما حقیقت این است که با جستجوی این پترن در چارت های مختلف و بررسی وضعیت این پترن در گذشته به اهمیت و کارایی این پترن بیش از پیش پی میبریم.

به بیان ساده پترنی است که در آن طول AB و CD با هم برابر است (میزان پیپسی که باعث شکل گرفتن این طول ها شده است) و در صورتیکه این برابری را در چارتی مشاهده کردیم میتوانیم به یک ترید سودمند بسیار امیدوار باشیم چرا که این پترن شکل گرفته است و به ما دقیقاً سیگنال خرید یا فروش در زمان مشخصی را میدهد.

بیاید بررسی جزئیات را شروع کنیم:

برای کسانی که مایلند درک عمیقتری از این پترن داشته باشند PDF دوست خوبمون محمد رضا در سایت سرمایه رو توصیه میکنم.

ایشون در قسمت کتاب های رایگان پترن 123 رو معرفی کرده اند (اولین لینک ارایه شده در اون تاپیک) این پترن پایه رو که خیلی ها شاید دست کم بگیرند ... در واقع پایه پترن $AB=CD$ است مجموعه ای 25 صفحه ای درک بسیار عمیقی برای ما به ارمغان میآورد که کمک بزرگی در درک ظرایف پترن $AB=CD$ خواهد بود.

به بحث خودمون برگردیم:

در پترن $AB=CD$ همیشه دقیقا 100% طول AB و CD با هم برابر نیست اما در غالب اوقات با تخفیفی 1-2 پیپسی (پوینت) این پترن را شکل گرفته فرض میکنیم.

این اختلاف 1-2 پوینتی میتواند باعث شود که هم طول CD کمی کمتر و هم کمی بیشتر از AB بشود که قابل اغماض و پذیرش است.

مهمترین نکته در شکل گرفتن این پترن این است که طول AB و CD حداقل با هم برابر باشد (به وضعیتی که طول CD به نسبت مشخصی بیشتر باشد اشاره خواهد شد)

نکته مهم دیگر که به ما کمک میکند تا صحت پترن را تشخیص دهیم این است که دقت کنیم و ببینیم که زاویه ای که AB و CD دارند یکی باشد.

یعنی فرضا اگه AB با زاویه 45 درجه به سمت پایین حرکت میکند این خیلی اهمیت دارد که CD هم با همین زاویه به سمت پایین در حرکت باشد و نه شیب دیگری داشته باشد.

در واقع نوعی تقارن در شیب حرکتی دو طول مورد نظر برایمان اهمیت دارد و در صورت مشاهده این وضعیت میتوانیم به صحت این پترن بسیار امیدوار بود.

نکته مهم دیگر در این پترن این است که از نظر زمانی هم دو طول گفته شده با هم برابر باشند.

یعنی اینکه مدت زمانی که طول کشیده است که طول AB تشکیل شود با مدت زمان تشکیل طول CD برابر باشد.

یعنی فرضا اگه در طول AB ما شاهد 4 کندل در تایم فریم 15 دقیقه هستیم باید وقتی میبینیم که طول CD برابر با طول AB شد (از نظر پیپس یا پوینت) باید از نظر زمانی هم ببینیم که 4 کندل طول کشیده است تا طول CD شکل بگیرد.

اما فراموش نکنیم که این وضعیت (یعنی برابری در میزان پوینت و زمان) یک وضعیت ایده آل است.

یعنی در بررسی پترنهای ما عواملی در اختیار داریم که هرچه تعداد این عوامل در شناسایی پترن بیشتر باشد ما از صحت عملکرد پترن مطمئن تر خواهیم بود فرضا 5 علامت شناسایی به پترن هست خوب اگه هر 5 مورد رو در بررسی به وضعیت بهش رسیدیم که بهترین حالت است و میتونیم با درصد بسیار بالا از عملکرد صحیح پترن مطمئن باشیم اما در صورتیکه 3-4 مورد شناسایی هم در مورد پترن صادق بود هنوز هم این پترن قابل پذیرش و به اصطلاح معتبر است.

در مورد پترن $AB=CD$ هم این موضوع صادق است یعنی اگه دو طول در زمان هم با هم برابر بود (علاوه بر میزان برابری پوینتی دو طول) این بسیار ایده آل است اما در این پترن نکته اصلی و مهم برابری طول AB و CD در پوینت است و در واقع اگه پترنی دارای برابری در پوینت بود اما از نظر زمانی با هم برابر نبودند هنوز هم پترن معتبر است هر چند اگه از نظر زمانی هم با هم برابر باشند دیگه اون پترن بسیار بسیار شانس موفقیت بالایی خواهد داشت.

در ادامه با جزئیات بیشتری آشنا خواهیم شد .

پترن $AB=CD$ میتواند بسیار قدرتمند باشد چرا که در واقع در آن ما در پایین ترین سطح روند نزولی اقدام به خرید و در بالاترین سطح روند صعودی اقدام به فروش میکنیم.

برای درک بهتر این موضوع باید با فرم و قالب کلی این پترن آشنا تر بشویم که به این منظور پترن 123 (که به نامهای دیگری هم شناخته میشود) برای شروع بهترین است پس در ابتدا به بررسی مختصر پترن 123 میپردازیم (برای بحث تفصیلی این پترن به PDF که در کامنت قبلی به آن اشاره شد مراجعه فرمایید) سپس پترن $AB=CD$ که در واقع در ادامه آن پترن بوجود میاید مورد بررسی قرار خواهد گرفت.

پترن 123:

در دسته بندی پترن ها جزو پترنهای دنباله دار محسوب میشود نامهای دیگری هم دارد که از جمله "Higher Low , Lower High" و یا پترن 1234 (با احتساب نقطه چهارم که در واقع نقطه هدف است که پترن به آنجا میرسد)

پترنی است که در انتهای یک روند صعودی و یا نزولی تشکیل میشود و نشونه خوبی برای تغییر جهت روند قیمت (ترند) آرایه میکند.

در واقع شامل 3 نقطه کلیدی است که برای مثال در پترن نزولی (تصویر سمت راست و یا همان LowerHigh) عبارتند از : یک نقطه 1 که بالاترین نقطه صعودی محسوب میشود یک نقطه نزولی (2) در پایین تر از نقطه 1 که ریتریس محسوب میشود و یک نقطه مهم 3 که بالاتر از نقطه دوم است اما در پایین تر از نقطه شماره 1 است و این همان نکته مهم این پترن است به این معنی که زمانی که ترند مجدداً صعودی شد دیگه نمیتونه به نقطه صعودی قبل و بیش از اون برسه و در نقطه ای پایین تر از نقطه صعودی شماره 1 شروع به نزول میکنه...

و این عدم توانایی به صعود بیشتر (و یا در پترن صعودی, نزول بیشتر) نشونه مهمی است که چون روند قیمت نتونسته به قله قبلی (نقطه شماره 1) برسه زمان تغییر روند فرا رسیده است و روند نزولی آغاز خواهد شد.

برای درک بهتر این پترن به تصاویر زیر توجه کنید که این پترن را در دو حالت صعودی و نزولی نشان میدهد.

و سپس در ادامه این دو تصویر شاهد تصویری هستیم که استفاده عملی از این پترن را در تشخیص تغییر جهت در روند و پی آمد آن ترید مناسب را نشان میدهد .



پیش از ادامه بحث در مورد پترن 123 توضیحی اصلاحی برای تصاویر کامنت قبل گفته بشه...

در تصویر اول سمت چپ عدد 2 کمی بد چاپ شده و جای صحیحی قرار نگرفته و محل صحیح قرار گرفتنش بروی ریتریس بعد از نقطه شماره 1 است مشابه تصویر سمت راست

دوم اینکه در تصویر چارت ارایه شده در بالای چارت عبارت Lower High صحیح است اما در پایین تصویر Higher Low صحیح است و نه Lower High در ادامه به توضیحی در مورد این دو عبارت میپردازیم و تفاوت این دو با هم مشخصی میشود.

در پترن 123 چیزی که اهمیت دارد این است که ما مشاهده کنیم در یک روند صعودی (در روند نزولی دقیقا عکس این مطالب) وقتی به یک قله میرسیم دیگر روند نتواند به سطح قبلی بازگردد و بعد از ریتریس به سطحی پایینتر برسد که این نکته کلیدی این پترن است و در تمامی تایم فریمهای مختلف هم معتبر است.

اما مسئله ای که این پترن را بسیار قدرتمند میکند این است که این پترن با نسبتهای فیبوناچی ادغام شود به این معنی که :

ما در ابتدا مشاهده ای چشمی داریم چارتهای مختلف رو به منظور مشاهده یک Lower High و یا Higher Low جستجو میکنیم اما بعد از آن کار اصلی ما شروع میشود و آن اینکه باید بررسی کنیم و بینیم که آیا ریتریس در نقطه دوم به چه میزان از نقطه شماره 1 بوده است

و آگه دیدم که این ریتریس به مقدار یک عدد فیبوناچی بوده است اعتبار این پترن بسیار بالا رفته و احتمال صحت آن بیشتر میشود سپس به انتظار تشکیل نقطه سوم مینشینیم و در لحظه ای که دیدیم نقطه سوم تشکیل شده است و روند شروع به نزول کرد بررسی میکنیم و اگر دیدم که نقطه سوم هم بر اساس یکی از نسبتهای فیبوناچی بود این علامتی بسیار مهم برای صحت پترن 123 است(در واقع نسبتهای فیبوناچی در این پترن باعث میشود که پترن های متعدد 123 که در هر جایی از چارت دیده میشود فیلتر شده و تنها به آنهایی توجه کنیم که در آن نسبتهای دقیق فیبوناچی هم رعایت شده باشد)

که بر اساس آن میتوان تردید موفق آغاز شود.

در حقیقت در این روش با ادغام پترن 123 با نسبتهای فیبوناچی به یک هارمونی ایده آل میرسیم و در صورتیکه نقاط دوم و سوم پترن 123 با نسبتهای فیبوناچی همخوانی داشت (نقطه دوم با نقطه شماره 1 و نقطه سوم هم به نسبت مشخصی

با نقطه دوم (در اینصورت این پترن با درصد بسیار بالا عملکردی صحیح و در جهت سیگنال پترن خواهد داشت.

در ادامه کمی هم در مورد کلمات Higher Low و Lower High توضیح بدهیم:

متاسفانه من معادلی برای این دو کلمه در فارسی سراغ ندارم نمودنم شاید دوستان در سایر فرومها در این زمینه در مباحثشون معادل مناسبی آورده باشند که ممنون میشم بنده رو مطلع بفرمایند.

اگر هم تا حالا معادلی وضع نشده اگه دوستان معادل مناسبی به ذهنشون میرسه بفرمایند تا از این به بعد از آنها استفاده کنیم.

Lower High: به این معنی است که روند در سطح پایینتر (Lower) از نقطه اوج (High) روند شکل گرفته و نتونسته به سطح بالاتر برسد.

Higher Low : به این معنی است که روند در سطح بالاتری (Higher) از نقطه فرورود (Low) شکل گرفته و نتونسته به سطح پایینتری برسد.

البته این کلمات اصطلاح هستند و شاید در زبان انگلیسی هم معنی دقیق لغوی نداشته باشند و بصورت اصطلاحی در تحلیلها و بطور کلی بازارهای تکنیکال از آنها استفاده میشود.

در تصاویر زیرین میتوانید ادغام موثر نسبتهای فیبوناچی با پترن 123 رو مشاهده کنید که ماحصل آن هم تریدهای بسیار موفقی بوده است :

ایران بورس آنلاین

www.i



در نگاه اول این پترن بسیار ساده بنظر میرسد و حقیقتا دشوار است که باور کنیم پترنی است که فرصتی خوب برای ترید سودآور باشد اما زمانی این پترن اهمیتی بیش از پیش پیدا میکند که بدانیم مرتبا در چارتهای مختلف و تایم فریمهای مختلف شکل میگیرد.

مسئله مهم در مورد این پترن جنبه روانی آن است به این معنی که فرضا در پترن Bullish AB=CD از نظر ذهنی بسیار

دشوار است که بپذیریم شرایطی ایده آل برای خرید بوجود آمده است چرا که بعد از نقطه C که نقطه ای پایینتر از نقطه A بوده روند به شدت به سمت پایین در حرکت است و در واقع با دو حرکت قوی قیمت به سمت پایین مواجه هستیم.

تنها باید در این شرایط قرار گرفت تا این مشکل ذهنی را کاملا حس کرد چرا که میبینیم روندی قوی بسمت پایین در جریان است و پذیرش اینکه دقیقا در این لحظه باید سریعاً خرید کرد بسیار دشوار است...

به این خاطر است که برای تردید بروی این پترن حتما باید از نظر ذهنی آمادگی داشت (که با تمرین و دیدن متعدد رفتار بازار پس از شکل گرفتن این پترن آمادگی ذهنی ایجاد میشود)

در واقع این پترن در نگاه اول سیگنالی میدهد که چون کاملا در جهت عکس بازار است پذیرش سیگنالهای کمی دشوار است اما میدانیم که این فرصت تردید در جهت عکس بازار بر مبنای منطقی است...

فرضا اگر روند نزولی بوده است بخاطر پترن 123 بوده و سپس با محاسبه میزان پیس بین طول های AB و CD و همینطور محاسبه نسبتهای فیبوناچی بین این دو طول میتوان بسادگی این فرصت مناسب برای ورود در جهت عکس بازار را پیدا کرد و تنها باید از نظر ذهنی و روانی آمادگی این مطلب را پیدا کرد... (این جنبه روحی قضیه بسیار اهمیت دارد و باید با ممارست به آمادگی ذهنی لازم رسید)

و پس از این مرحله تنها کفایت که مدتی تمرین کنیم و به اصطلاح چشمانمان را به دیدن این نوع پترن (محاسبه چشمنی دو طول AB و CD) عادت دهیم و بعد از تعدد وجود این پترن در چارتهای مختلف شگفت زده خواهیم شد.

در معرفی و بحث مختصری که در زمینه پترن 123 (ABCD نامی دیگر برای این پترن است) شد گفتیم که پترنی دنباله دار است یعنی روند در پی آن ادامه میابد و نه بازگشت کند.

اما نکته مهم و ارتباط اصلی این پترن با پترن AB=CD در این است که در حقیقت پترن AB=CD در دنباله پترن 123 بوجود میاید به این معنی که

پس از اینکه پترن 123 شکل گرفت در انتهای حرکتش به نقطه D میرسد و این نقطه ای است که تازه پترن AB=CD شروع به کار میکند!

و از این لحظه میتوانیم مجدداً بر اساس سیگنال پترن AB=CD تردید کنیم.

جالب اینکه بدونیم زمانی که پترن AB=CD به اتمام میرسد در بسیاری از مواقع پترن تبدیل به گارتلی و یا باترفلای میشود!

عجیب ولی واقعی!

این ارتباط دقیق ما بین این پترنها نشان دهنده ارزش و کارایی آنهاست به این معنی که کافی است پترن 123 رو در چارتی ببایم (مشروط به اینکه نسبتهای فیبوناچی هم در آن رعایت شده باشد)

سپس بر مبنای سیگنال آن وارد بازار میشویم (و چون معمولاً چند پترن بطور مرتب پشت سر هم ایجاد میشوند میشود تردیدی موفق و طولانی را در طول روز کاری شروع کرد)... اما روند تا کجا ادامه خواهد داشت؟

بر اساس پترن 123 نمیتوانیم دقیقا این رو مشخص کنیم اینجاست که پترن AB=CD میتواند بسیار مفید باشد چرا که در پترن AB=CD اتفاقاً دقیقا به دنبال این هستیم که بینیم نقطه D (نقطه انتهایی حرکت قبلی که از پترن 123 شکل گرفته است) کجاست چرا که در نقطه D درست در جهت عکس حرکت ظاهری بازار میتوانیم تردیدی رو آغاز کنیم.

و در آینده خواهیم دید که زمانی که پترن AB=CD به اتمام رسید در بسیاری از موارد دقیقا حرکت انتهایی پترن به گارتلی (و گاهی باترفلای) تبدیل میشود و مجدداً میتوانیم در جهت مخالف پترن AB=CD که اینک به اتمام رسیده است تردیدی را

آغاز کرد (که البته باید نسبتهای فیبوناچی در انتهای هر پترن مجددا بررسی شود)

منظور اینکه حتی کسانی که به تیوری موج الیوت در تحلیل علاقه مند هستند از طریق پیگیری این پترنها میتوانند بخوبی یک حرکت بزرگ (که از حرکات کوچکتر نسبتهای فیبوناچی شکل گرفته است) را بیابند.

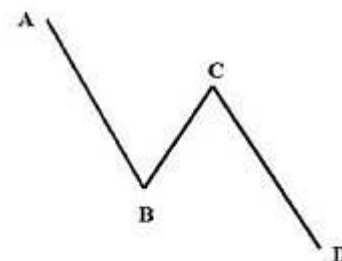
در واقع در نظریه موج الیوت (که مبنای آن بر اساس نسبتهای فیبوناچی است) ما با موجهای متعددی روبرو هستیم تا اینکه حرکات بزرگتر شکل بگیرند و در واقع شناسایی سلسله مراتبی این پترنها میتواند روشی موثر برای شناسایی حرکتها بزرگ در بازار باشد.

از طرفی دیگر توالی و ارتباط این پترنها با یکدیگر نشونه اینه که یادگیری این پترنها دقیقا به همین ترتیب صحیح و لازم است و اینکه مشروط به اینکه پترنی رو خوب درک کنیم به خوبی به ما در شناسایی پترنها دیگر هم کمک میکند چرا که تعدادی از این پترنها در بسیاری از مواقع در پی هم شکل میگیرند و در بطن یکدیگر قرار دارند.

پس بیاید شروع کنیم گام به گام با پترن $AB=CD$ آشنا بشویم:

پترن بولیش (صعودی: $AB=CD$)
در این پترن که تصویرش را در زیر مشاهده میکنید نقطه A بالاترین و نقطه D که در واقع انتهای حرکت در پترن 123 است) پایینترین نقطه محسوب میشود.

بورس آنلاین
www.iranbourseonline



BULLISH $AB = CD$

BUY AT POINT D!

هر طول این پترن (AB) و (CD) میبایست برابر بوده و در زاویه ای مشابه بهم در یک جهت حرکت کنند.

به تصویر توجه کنید نقاط ABC در واقع نقاط پترن 123 هستند که بر اساس آن روند نزولی شکل گرفته است (لطفا این تصویر را با تصویر پترن 123 در کامنتهای قبل مقایسه کنید که منجر به درک بهتر این پترن میشود) نقطه C در واقع همان LowerHigh است و نقطه B ریتریس موقت پترن 123 محسوب میشود .

تعیین حد ضرر در پترن صعودی: $AB=CD$
(Bullish $AB=CD$ Stop Loss)

تعیین حد ضرر در این پترن اهمیت زیادی دارد و برای تعیین آن دو روش کلی وجود دارد:

1. روش تیوریک
2. روش تحلیلی

1. در این روش برای تعیین حد ضرر از یه روش ساده استفاده میشود به این معنی که زمانی که نقطه D مشخص شد از نظر تیوری 1-2 پیپس (پوینت) پایینتر از این نقطه برای حد ضرر کافی است در واقع میبینیم که استاپ لاسی بسیار کوچک دارد که نشونه ای است از اینکه تا چه حد میزان برگشت روند در نقطه D زیاد است.

در این زمینه در سایت مانی تک بحثی شده بود و در مجموع آن بحث به این نتیجه رسیده بودند که برای تایم فریم های بزرگ نظیر روزانه همون 1-2 پوینت پایینتر از نقطه D کفایت میکند اما بر اساس تجربه ای که تریدر های مختلف در تایم فریمهای کوچکتر از 1 ساعته داشته اند تعیین حد ضرر 5 پیپسی منطقی تر است که بازهم میبینیم حد ضرری بسیار کوچک است که میزان ریسک ترید را بسیار کم میکند (در بازار پر نوسانی نظیر فارکس شاید استاپی 10-15 پیپسی برای جلوگیری از شادو های لحظه ای خصوصا در تایم فریمهای پایینتر مناسبتر باشد با اینحال همین میزان استاپ هم در مقایسه با کات لاس های 40 تا 60 پیپسی که در تریدها متداول است قابل توجه است)

اما تعیین این حد ضرر وقتی بخوبی میسر است که نقطه D دقیقا مشخص باشد (چون ما به دو روش نقطه D را بدست میاوریم گاهی دو نقطه بدست میاید و نه یک نقطه مشترک)

به این معنی که گاهی میبینیم که محاسبه نقطه D از طریق اندازه گیری طول AB (یعنی نقطه D را تنها توسط پترن اندازه گیری کنیم سپس از نقطه C آنرا اصطلاحا پروجکت کنیم که در این زمینه توضیح داده خواهد شد) با نقطه D که توسط نسبت اکستنشن طول BC بدست میاوریم کمی با هم متفاوت میشوند.

در این اوقات ما در واقع با یک نقطه واحد مواجه نیستیم بلکه با یک ناحیه روبرو هستیم که اصطلاحا به آن Potential Reversal Zone (ناحیه ای با پتانسیل بازگشت) گویند .

در واقع در این ناحیه که به اختصار با آن PRZ هم گفته میشود با دو نقطه روبرو هستیم که این نقاط عبارتند از:

1. نقطه ای که بر اساس طول AB میزان طول CD را بدست آورده و به طبع آن نقطه D تعیین میشود.
2. نقطه ای که بر اساس محاسبه میزان اکستنشن فیبوناچی نسبت به طول BC محاسبه و بدست آمده است.

در این وضعیت اگر بر اساس روش تیوریک عمل کنیم باید دو نقطه بدست آمده را بررسی و حد ضرر را با توجه به نقطه پایینتر در نظر گرفت و 2 یا 5 پیپس پایینتر آن را قرار داد.

در تصویر زیر بخوبی مفهوم PRZ مشخص است.

در زیر نقطه D میبینید که با دو خط روبرو هستیم این دو خط در واقع همان دو نقطه D هستند که به دو روش بدست آمده اند (محاسبه طول AB و محاسبه میزان اکستنشن به نسبت BC)

اما دومین روش برای محاسبه حد ضرر روش تحلیلی است.

در این روش به عواملی دیگر هم توجه میکنیم در واقع این روش تکنیکی را به ما آموزش میدهد که بر اساس آن چشم بسته و طوطی وار استاپ نگذاریم بلکه در آن لحظه با ملاکهای وضعیت بازار را بسنجیم. این روش نیاز به توضیح دارد که در ادامه سلسله مباحث تلاش میشود به دقت به آن پرداخته بشود اما بطور کلی عرض کنم که در این روش چیزی که اهمیت دارد اینست که:

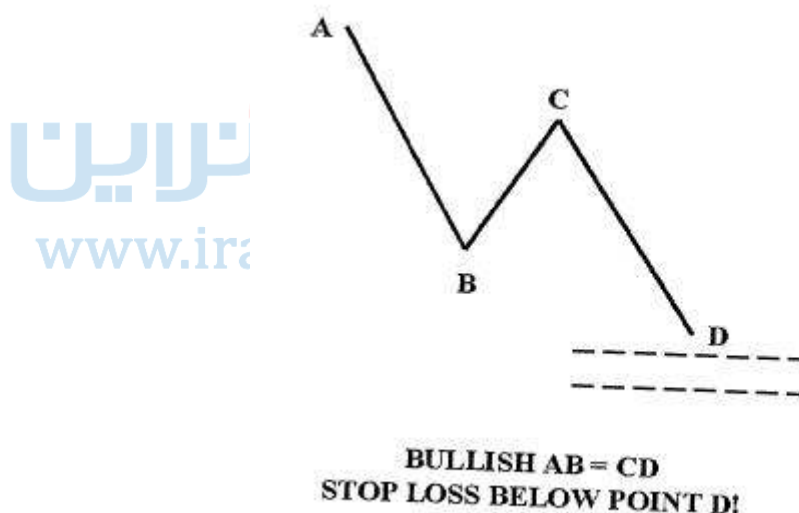
1. در PRZ ما بدنال این هستیم که نشانه ای از بازگشت روند را شاهد باشیم و نه اینکه به محض اینکه روند قیمت به این ناحیه رسید تریدی کرده و حد ضرر را بر اساس تیوری تعیین کنیم.

و به این منظور (تعیین حد ضرر به روش تحلیلی) برای مشاهده نشانه ای از بازگشت روند **تکنیکی** موثر ارایه خواهد شد.

2. در بررسی ناحیه PRZ همواره علایمی خاص وجود دارد که به ما هشدار میدهد که پترن درست عمل نخواهد کرد و فرضاً روند به مسیر خود ادامه خواهد داد.

این علایم که بسیار بسیار مهم هستند به ما درک صحیحی از وضعیت موجود بازار میدهند که بر اساس آن میتوانیم بدون اینکه تنها یک استاپ کلی بگذاریم به تحلیل وضعیت پرداخته و با مشاهده علایم و یا عدم وجود آنها با اعتماد بنفسی به مراتب بالاتر از روش قبل به ترید بپردازیم.

در ادامه مفصلاً به هر دو موردی که در روش تحلیلی اشاره شد خواهیم پرداخت.



پیش از ادامه بحث توضیحی ضروری است و آن اینکه

چون در ارایه مطالب از مثالهای متعددی استفاده خواهد شد که در آن بجای نمودار کندل استیک از بار چارت استفاده شده است به همین منظور لازم است آشنایی هر چند مختصر با مبانی اولیه این نوع نمایش در نمودار قیمت‌ها داشته باشیم و پس از آن به بررسی جامع دو مورد مورد بحث در روش تحلیلی تعیین حد ضرر خواهیم پرداخت.

Price Bar

نمایش قیمت در نمودارها به چند روش میباشد که در کشور ما روش نمودار شمعدانهای ژاپنی متداولتر است. اما روشی قدیمتر نیز وجود دارد که به بار چارت موسوم است.

در این نوع نمودار نمایش قیمتها با 4 عنصر تشکیل دهنده روبرو هستیم که عبارتند از:

قیمت آغازین قیمت پایانی بالاترین قیمت و پایین ترین قیمت (مانند کندل استیک چارت) هر چند این مطلب بسیار ابتدایی به نظر میرسد اما چون در نواحی PRZ (نواحی دارای پتانسیل بازگشت روند) نوع و اندازه PriceBar (نوار قیمتی) اهمیت زیادی دارد و میتوان بر مبنای آن تشخیص داد که علایمی برای برگشت روند وجود دارد و با خیر میبایست با ظاهر این نوع نمایش قیمت هم آشنا بود.

Bullish & Bearish Price Bar

نحوه قرار گرفتن قیمت آغازین و پایانی این نوار قیمت صعودی یا نزولی بودن آنرا تعیین میکند. به این معنی که بسادگی آگه قیمت پایانی بالای قیمت آغازین قرار گرفته باشد پرایس بار صعودی محسوب میشود. و معنی آن اینست که تعداد خریداران از فروشندگان بیشتر است و میزان شدت و قدرت صعودی بودن نوار قیمت بستگی به فاصله بین قیمت آغازین و پایانی دارد (اندازه طول پرایس بار)

در تصاویر زیر با دو نوع پرایس بار روبرو هستیم.

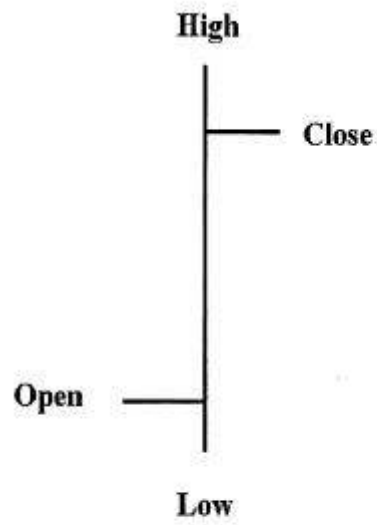
همواره در سمت راست نوار... قیمت پایانی و در سمت چپ نوار... قیمت آغازین رو شاهد هستیم.

وبه این معنی که هر چند قیمت آغازین و پایانی میتوانند بالا و یا پایین نوار قیمت قرار بگیرند اما همواره خط کوچک سمت راست در نوار قیمت نشاندهنده قیمت پایانی و خط کوچک سمت چپ نشاندهنده قیمت آغازین است

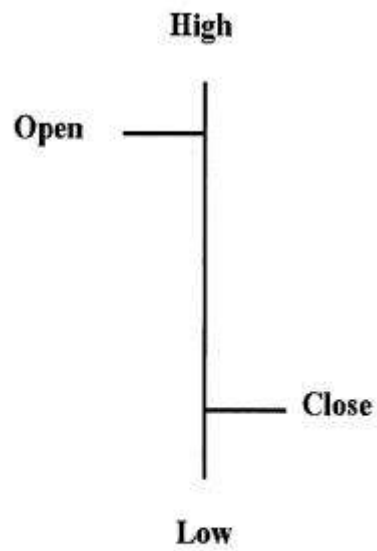
و نکته مهم اینکه اگر این پرایس بار در یک ناحیه با پتانسیل بازگشت قرار بگیرد نشانه و علامتی است که اشاره به بازگشت روند میکند.

که پرایس بار صعودی نشاندهنده بازگشت روند به سمت بالا و نوار قیمت نزولی نشانه بازگشت روند به سمت پایین است.

همانطور که شاهد هستیم یک شمعدان ژاپنی (کندل استیک) به مراتب بهتر این مطلب رو نمایش میدهد و اطلاعات بیشتری را هم در اختیار ما قرار میدهد اما از آنجا که در منابعی که در اختیار دارم مثالهای متعددی در دست است که از جنبه آموزشی بسیار مفید هستند اما با بار چارت ارایه شده اند مروری مختصر بر مبنای بار چارتهای میتوانست مفید باشد و در مثالهایی که در آینده در مباحث آموزشی خواهیم زد آشنایی با این نوع نمودارهای نمایش قیمت میتواند کمکی موثر در درک بهتر جزئیات تصاویر آموزشی برایمان داشته باشد



Bullish Price Bar



Bearish Price Bar

در بحث تعیین حد ضرر برای پترن $AB=CD$ به اینجا رسیدیم که علاوه بر روش کلاسیک تعیین یک حد ضرر 2 الی 5 پیپسی برای ترید میتوانیم از روشی تحلیلی هم استفاده کنیم.

به این منظور دو ایده کلی در روش تحلیلی ارائه شد که در اینجا ابتدا به ایده اول میپردازیم:

زمانی که روند قیمت ارزی به منطقه PRZ وارد شد موضوع مهم اینست که به ظاهر پرایس بار (نوار قیمت) در آن ناحیه توجه کنیم چرا که ظاهر پرایس بار به ما کمک میکند تا بتوانیم از احتمال بازگشت روند و در واقع معتبر بودن پترن در این ناحیه مطلع شویم.

همچنین ظاهر یک نوار قیمت میتواند به ما میزان قدرت و یا ضعف حرکت قیمت در این ناحیه حساس را آشکار کند.

نواحی که پتانسیل بازگشت روند را دارا هستند نواحی مهم و حساسی هستند اما طبیعی است که این به آن معنا نیست که 100% و همیشه روند در این نواحی بازگشت کند بلکه ما باید دنبال نشانه ای برای تشخیص این امر (بازگشت روند) در این نواحی باشیم.

در واقع این نواحی به ما فرصتهای مناسبی برای تشخیص احتمال بازگشت روند ارائه میکنند که باید بدقت توسط ما مورد بررسی و تحلیل قرار بگیرند.

گاهی قیمت در این نواحی بلافاصله بازگشت میکند که شناسایی این امر ساده است اما در موارد دیگر میبایست به بررسی رفتار پرایس بار پرداخت (که با شناخت علایمی میتوانیم از احتمال بازگشت و یا ادامه یافتن روند اطلاع حاصل کرد)

در این زمینه چند فاکتور شناسایی موجود است اما مهمترین آنها اینست که در زمانی که فرضاً روند نزولی است و وارد این ناحیه میشود مشاهده کنیم که:

یک پرایس بار در جهت عکس حرکت کلی (فرضاً در روند نزولی حرکتی در جهت صعودی) ایجاد شود.

بنا بر این اگر در یک روند فرضاً نزولی ما شاهد پرایس باری (راحتر بود بگیم کندلی) در جهت مخالف روند بازار بودیم اگر این نوار قیمت در ناحیه PRZ باشد احتمال بازگشت روند بالاتر میرود.

اما فراموش نکنیم که تنها یک پرایس بار در جهت مخالف روند نشانه خیلی مهمی نیست.

در اینجا است که تکنیکی ارائه میشود که برای ما همواره میتواند به عنوان نشانه ای بسیار مهم تلقی شود و آن اینکه:

ابتدا یک ناحیه PRZ را شناسایی میکنیم (مروری سریع: یعنی اینکه توسط پترن و نسبتهای فیبوناچی ناحیه ای مشترک را بیابیم که احتمال برگشت روند را دارا باشد)

سپس به نمودار قیمت دقت میکنیم به این شکل که برای مثال در یک روند نزولی میبایست:

ابتدا با یک پرایس بار صعودی مواجه شویم و سپس (مهمتر از آن) اینکه پرایس بار بعدی هم صعودی باشد.

و نکته مهم دیگر اینکه:

قیمت پایانی پرایس بار جدید بالاتر از قیمت پایانی پرایس بار صعودی قبلی باشد و همچنین قیمت آغازین آن هم از قیمت آغازین پرایس بار قبلی بالاتر باشد) در واقع پرایس بار جدید کاملاً در سطح بالاتر از قبلی تشکیل شود)

به بیان ساده زمانی که پترنی وارد یک ناحیه با پتانسیل بازگشت میشود باید نوار قیمت را بررسی کرده و

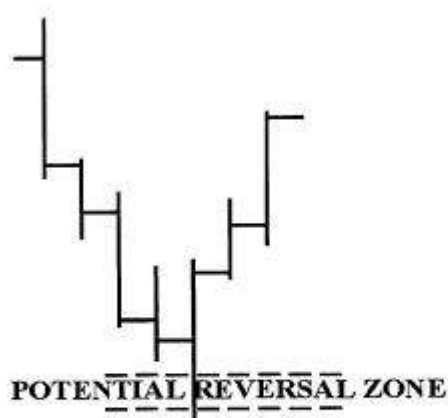
زمانی که دیدیم که فرضاً در یک روند نزولی با **دو پرایس بار صعودی** روبرو بودیم این نشانه قطعی بازگشت روند خواهد بود. تکنیک ساده بنظر میرسد اما روشی بسیار قدرتمند محسوب شده و در چند کتاب دیده ام که این تکنیک را برای تشخیص تغییر جهت روند ارایه کرده اند.

مشاهد تصویر زیر کمک خواهد کرد تا با این تکنیک ساده اما موثر در تشخیص بازگشت روند آشنا تر بشویم.

اما با این وجود برای کسانی که دوست دارند با جزئیات و مثالهای بیشتری در مورد این تکنیک آشنا شوند کتاب *Sure Fire Forex Trading* اثر Mark McRae را معرفی میکنم (صفحه 50 به بعد و تحت عنوان Trend Indicator)

پی نوشت: لینک دسترسی به این کتاب در سایت سرمایه و در قسمت کتابهای رایگان موجود است .

انتراین
www.iran



**Ideal Bullish Reversal in
Potential Reversal Zone**

در بحث تعیین حد ضرر به روش تحلیلی به دو روش موثر اشاره کردیم. روش اول در کامنت قبلی بررسی شد و اینک به روش دوم میپردازیم.

گفتیم که در روش تحلیلی تعیین حد ضرر در پترن $AB=CD$ میبایست ناحیه ای که احتمال بازگشت روند در آن زیاد است را بررسی کنیم.

دومین مورد مهم در بررسی این ناحیه آن است که در این ناحیه در صورتیکه پترن غلط (به اصطلاح نامعتبر باشد) همواره علایمی برای شناسایی برایمان وجود دارد.

یعنی اگر این علایم را بشناسیم به خوبی میتوانیم متوجه بشویم که این پترن هرچند ظاهری مشابه پترنهای فیوناچی

دارد و نسبت‌های فیبوناچی هم در آن رعایت شده است اما درست عمل نخواهد کرد و به عبارتی روند قیمت بر اساس سیگنال پترن نخواهد بود.

بنابراین خلاصه بحث تا اینجا این شد که همواره در نواحی دارای پتانسیل بازگشت روند (PRZ) علایمی وجود دارد که به ما هشدار میدهد که پترن صحیح عمل نمیکند.

پس شروع میکنیم به معرفی و بررسی این علایم:

باید توجه داشت که همواره این سیگنال خطا در این پترن‌ها زمانی رخ میدهد که بازار به اصطلاح بسیار پر تلاطم است و با قدرت مهبیی به پیش میرود که میتواند فرضا تاثیر اعلام خبری باشد که بازار را به حرکتی بسیار پر شتاب و قدرتمند واداشته است (تریدرهای با تجربه بخوبی با تاثیر بعضی اخبار آشنا هستند که چطور حرکات بسیار قدرتمندی ایجاد و هر مقاومت و مانعی را از سر راه خود بر میدارد که تنها اختصاص به پترنهای فیبوناچی ندارد)

بطور کلی ما در هنگام بررسی پترنهای فیبوناچی و برآورد احتمال بازگشت روند با 3 علامت مهم برای شناسایی این وضعیت در چارتهای روبرو هستیم که عبارتند از:

1

Price Gaps (گپ یا شکافت قیمتی)

2

Tail Closes (کندل و یا پرایس بارهایی که فاقد سایه- شادو- هستند)

3

Large Price Ranges (کندل یا نوارهای قیمتی با اندازه ای بسیار بزرگ)

متأسفانه چون برای برخی از این اصطلاحات معادلی در فارسی نمیشناسم سعی میکنم با توضیح خصوصیات آنها مفهومشان بخوبی واضح شود.

البته لزوماً اینطور نیست که در 100% موارد این نشانه‌ها باعث عدم بازگشت روند در پترنهای فیبوناچی شوند و در نتیجه این فکر برایمان ایجاد شود که پس اگر این علایم را در PRZ ندیدیم 100% روند بازگشت میکند به قول معروف در این بازار هر چیزی ممکن است!

اما با بررسی صدها پترن و ترید این 3 نشانه مهمترین علاماتی بوده اند که بطور دایم باعث شده اند که پترن‌ها صحیح عمل نکنند.

بنابراین شناخت دقیق این علایم و در نظر گرفتن آنها در بررسی پترنهای فیبوناچی میتواند بسیار به ما کمک کند تا تریدی اشتباه را شروع نکنیم.

تنها یک نکته میماند که پس از بررسی هر سه نوع علامت بصورت یک قانون ترید برای این 3 علامت و پترنهای فیبوناچی به آن خواهیم پرداخت (که نیازی نیست فعلاً ذهن رو معطوف به آن کنید)

در ادامه به بررسی تک تک این موارد خواهیم پرداخت .

همانطور که در کامنت قبل گفته شد در بررسی PRZ ما با سه نوع علامت بسیار مهم روبرو هستیم که در صورتیکه آنها را مشاهده کردیم به ما هشدار جدی میدهند که بر اساس سیگنال پترن وارد ترید نشویم.

در واقع آشنایی با این نشانه‌ها و در نظر گرفتن آنها در زمان بررسی احتمال بازگشت روند سلاح بسیار موثری است که ما

را از وارد شدن به یک ترید اشتباه برحذر کند.

اما بپردازیم به بررسی اولین علامت مهم در PRZ

Price Gaps:

گپ یا شکاف قیمتی در نمودارها تحلیلی یکی از متداول ترین علائم هشدار دهنده به ما در نواحی دارای پتانسیل بازگشت است.

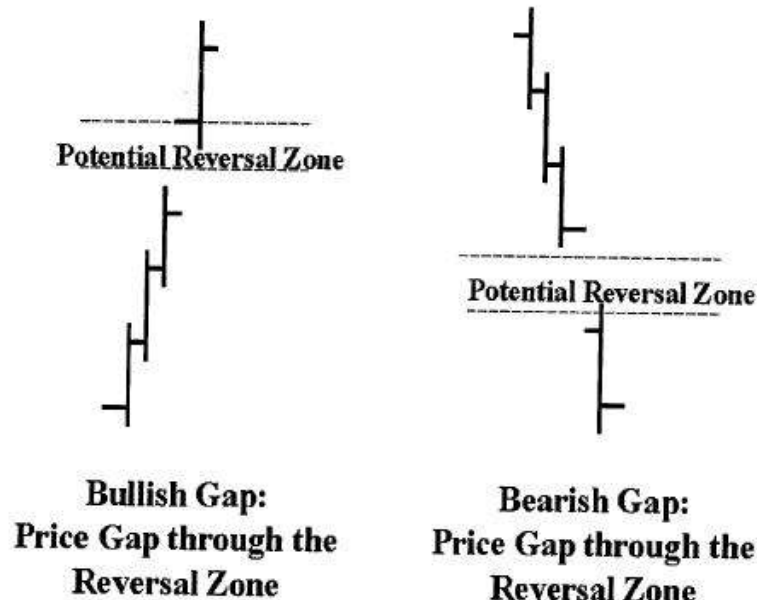
اما تعریفی ساده از گپ:

به بیان ساده به وضعیتی میگوییم که قیمت آغازین روز کاری در کندل و یا پرایس بار و خلاصه نوار قیمت از جایی شروع شود که با قیمت پایانی در روز گذشته و یا کندل قبل متفاوت باشد. در واقع کندل بعدی با فاصله از کندل قبلی ایجاد شود.

زمانی که ما مشاهده کنیم که در یک ناحیه با پتانسیل بازگشت (که قبلا این ناحیه را محاسبه و پیدا کرده ایم) با یک گپ روبرو شدیم این نشانه بسیار مهمی است که به سیگنال پترن مشکوک شویم. اهمیت زیادی دارد که وقتی با یک گپ در PRZ مواجه شدیم از تنظیم اردر اجتناب کرده و دقیقا به رفتار قیمت توجه کنیم چرا که ایجاد یک گپ در این ناحیه حساس نشانه این است که نظر عمومی افراد شرکت کنند در بازار به تصمیمی واحد در جهت حمایت روند فعلی حرکت بازار مصمم شده است.

در بین 3 نشانه و علامتی که برای شناسایی پترنهای نامعتبر برایمان موجود است هشدار گپ مهمترین محسوب میشود و بسیار اهمیت دارد که به پیغامی که برای ما دارد توجه کنیم که در بسیاری از موارد میتواند ما را از تریدی کاملا در جهت عکس حرکت بازار اجتناب دهد (بقول تریدی امریکایی اگر ترجیح میدین از پریدن جلوی قطاری سریع السیر اجتناب کنیم!)

تصویر زیر - که وجود گپ را در هر دو حالت روندهای صعودی و نزولی در PRZ نشان میدهد - کمک خوبی است در درک بهتر این علامت مهم و هشدار دهنده .



چین چرس رایان

www.iranbourseonline.com

Tail Closes

متأسفانه چون معادلی مناسب برای این اصطلاح نمی‌شناسم (= دم بریده) سعی می‌کنم بطور تشریحی به بیان مصداق کلمه بپردازیم.

در واقع این کلمه به معنای کندل و یا پرایس باری (نوار قیمتی است که در آن قیمت پایانی و بالاترین قیمت یکی است) یعنی اینکه برای مثال در یک کندل زمانی که کندل بسته میشود مبینیم که این کندل شادو (سایه) ندارد و قیمت پایانی با قیمت حداکثر یکی است.

کسانی که در زمینه کندل استیک ها مطالعه کرده اند بخوبی میدانند که زمانی که کندلی بسته شود در حالیکه سایه نداشته باشد این نشانه قدرت بسیار زیاد بازار در یک جهت است.

فرضا اگه کندل سایه بالایی نداشته باشد این نشانه روندی بسیار پر قدرت و صعودی است.

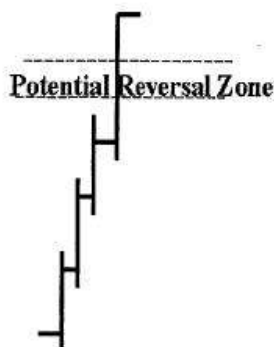
این مطلب همینطور برای پرایس بارها هم صادق است (مثال کندل رو زدم که برای اکثر دوستان مطلب ملموس تر باشه)

در پرایس بارها (که مانند کندل ها دارای قیمت آغازین - پایانی - بیشترین و کمترین هستند) هم زمانی که بینیم قیمت پایانی با بیشترین قیمت در آن نوار قیمت یکی است این هشدار جدی برای ماست که بازار مصمم است با قدرت زیاد به مسیر خویش ادامه دهد.

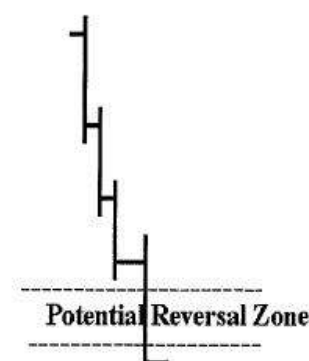
در واقع مفهوم این پرایس بار این است که عده زیادی از افراد شرکت کننده در بازار اعتقادی مشترک بر وضعیت حاکم بر بازار داشته و اکثریت آنها به یک تحلیل معتقدند که نتیجه آنهم حرکتی قدرتمند در یک جهت است.

و معقول ترین عمل برای ما در زمانی که مشاهده میکنیم که با یک Tail Closes در PRZ روبرو هستیم این است که **حداقل یک پرایس بار** صبر کنیم و ببینیم که آیا بازار همچنان با قدرت به پیش میرود و یا خیر.

لطفاً به تصویر زیر که به وضوحتر شدن مطلب کمک میکند توجه کنید :



Bullish Tail Close:
Tail Close through the
Reversal Zone



Bearish Tail Close:
Tail Close through the
Reversal Zone

لاین
www.

Extrem Price Ranges

برای معادل آن میتوانیم کندل و یا نوار قیمتی بسیار بزرگ (از نظر اندازه ظاهری) رو در نظر بگیریم (با این نکته که دیگر نیاز نیست که حتماً قیمت پایانی و بالاترین قیمت یکی باشد)

این کندل و یا پرایس بار بزرگ باز هم نشانه تندی بسیار قدرتمند است.

همواره باید به این نوع علائم در نواحی حساس دارای پتانسیل بازگشت توجه کرد و بر اساس آن وضعیت را تحلیل کرد.

این کار باعث میشود تا کور کورانه ترید نکنیم به محض اینکه یک ناحیه حساس را شناسایی کردیم فرضاً یک Buy Stop یا Sell Stop با یک Cut Loss چند پیپسی قرار ندهیم.

در واقع بنده کاملاً با نوع تریدی که حتی در مانی تک در مورد تنظیم استاپ لاس معرفی شده است مخالف هستیم اما در اینجا هر دو روش رو معرفی کردم و دیگه این انتخاب شماست که کدام روش رو برای تعیین حد ضرر انتخاب کنید.

اما اگر دقت کرده باشین بطور کلی گفتیم کندل یا پرایس باری که اندازه آن بزرگ باشد و دقیقاً اندازه رو مشخص نکردیم.

در این مورد یک راه این است که اندازه کندل را با میانگین اندازه کندل های سابق در همان روند مقایسه کنیم.

به عنوان یک قاعده در نظر داشته باشید که اگر کندلی 1.5 برابر کندل های دیگر بود میتوانیم آنرا Extreme Price Range محسوب کنیم.

با این وجود نیاز نیست که همیشه دقیقا این نسبت را محاسبه کنیم چرا که در غالب مواقع اندازه ظاهری یک کندل بخوبی خود نشاندهنده وضعیتش است و میتوانیم این نوع کندل ها را شناسایی کنیم.

در مورد این علامت و هشدار نیاز به توضیحی است و آن اینکه هر چند این کندل بزرگ میتواند هشدار برای پرهیز ما از ترید بر اساس پترن باشد اما بارها و بارها دیده شده است که با وجود کندلی قدرتمند و بزرگ در ناحیه حساس بازار پس از این کندل بازار بازگشت کرده است.

در اینجا است که باید به این قاعده که بعد از بررسی تریدهای متعدد متخصصین بهش رسیدند همیشه توجه داشت و اون اینک:

در بسیاری از مواقع وجود کندلی بزرگ در روند هر چند در ظاهر نشانه عزم جدی ترند برای ادامه مسیرش است اما میتواند در بسیاری از مواقع هم نشانه **خستگی** بازار باشد (به زبون خودمونی بازار زور آخرشو زده) و بعد روند باز میگردد.

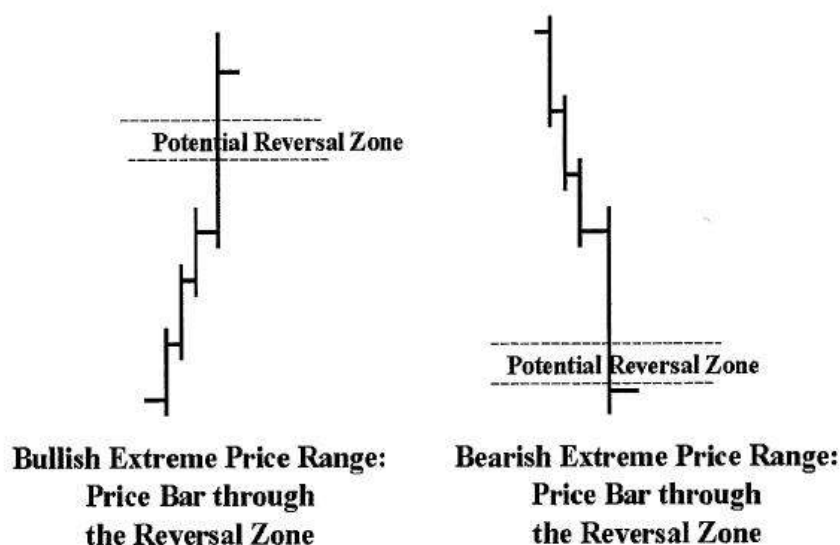
بنابراین در این مواقع که در PRZ شاهد کندلی بزرگ هستیم اگر حقیقتا روند به ادامه مسیر مصر بود میبایست این عمل در کندل های بعدی هم مشاهده شود پس اگر دیدیم با وجود کندلی بزرگ در ناحیه حساس بازار کندل بعدی کندلی کوچک بود (نظیر اسپینینگ تاپ) و یا حتی بهتر از آن شاهد کندل یا پرایس باری در جهت عکس بازار بودیم همچنان میتوان به سیگنال پترن امیدوار بود

منتهی در این وضعیت باید با تاخیر وارد بازار شد و ابتدا به دقت فرضا به نوع کندل و پیامی که برای ما دارد توجه و سپس ترید کرد.

اما اگر بعد از کندل بزرگی مشاهده کردیم که کندل بعدی هم در همان جهت بود دیگر پترن نامعتبر محسوب شد و بهیچوجه نباید بر اساس آن ترید کرد.

در مورد این سه نوع علامت مهم و هشدار دهنده نکات و ریزه کاریهای دیگری هم وجود دارد که در ادامه پس از بیان مقدمه ای و تحت عنوان **قانونی** به آن اشاره خواهد شد.

لطفا به تصویر زیر توجه فرمایید :



زمان بررسی چارتهای و مثالهایی واقعی از پترن $AB=CD$ فرا رسیده است پس بیاید به کلیه مطالب تیوریک بازگو شده بصورت فشرده و کاربردی مروری کوتاه داشته باشیم:

در گذشته اشاره کردیم در صورتی که یک پترن مردود شود فرصتی مناسب برای تریدی جدید بوجود میاید.

به این معنی که زمانی که در نواحی حساس بازار که پتانسیل بازگشت داریم میبینید که علایم 3 گانه گفته شده پیش آمد این نشانه عزم جدی شرکت کنندگان بازار در حمایت از روند جاری است اما این نباید ما را از ترید منصرف کند چرا که در غالب موارد زمانیکه ما با چنین شرایطی روبرو شدیم باید بدانیم که روندی قدرتمند در پیش است و بنابر این میتوانیم با این روند همراه شویم و تریدی موفق داشته باشیم.

در واقع اینبار این پترنها به ما شروع یک ترید خوب در جهت مخالف پترن را یادآوری میکنند! (در صورتیکه یکی از اون علایم سه گانه رو در این ناحیه دیدیم)

اما بطور کلی مطلبی رو عرض کنم و اون اینکه حتی در صورتیکه تمامی شرایط هم برای تریدی موفق بر اساس پترن در ناحیه (PRZ) موجود بود و هیچکدام از علایم سه گانه رو مشاهده نکردیم بهتر است برای نشانه ای از بازگشت روند مکنی داشته باشیم (فرضا اگر چارت ما بر مبنای کندل استیک است با یک پترن قدرتمند نظیر مووینگ استار) و یا اگر از بار چارت استفاده میکنیم حداقل به میزان یک پرایس بار در جهت مخالف روند منتظر بمانیم(علاقه مندان به روش کی آس سیستم هم میتوانند از سیگنال ورود FirstWiseman برای پترنهای فیبوناچی استفاده کنند و سیگنال دانای اول ایجاد شده در ناحیه PRZ را بعنوان تریگر ورودی به پوزیشن مورد استفاده قرار دهند)

در این زمینه قانون زیر میتواند کمک موثری باشد:

قانون یک پرایس بار: (One Price Bar Rule)

زمانی که روند قیمت به یک PRZ میرسد و وقتی که ما شاهد یک سیگنال هشدار هستیم که به ما میگوید پترن صحیح عمل نمیکند در این لحظه باز هم رفتار قیمت است که درجه اول اهمیت را داراست.

به این معنی که زمانی که یک PRZ را بررسی میکنیم در صورتیکه دیدیم در این ناحیه هارمونی بالایی در نسبتهای فیبوناچی و پترن موجود است با وجود آن سیگنال هشدار هنوز هم پترن میتواند معتبر باشد

و قانون در این موارد این است که پرایس بار بعد از سیگنال هشدار را ببینیم (سه گانه ها) و در صورتیکه پرایس باری در جهت مخالف دیده نشد و پرایس بار بعدی هم در جهت سیگنال هشدار بود قطعاً پترن رد شده است.

و نکته ای که در اینجا باقی است این است که در شرایطی که شاهد یک پرایس بار یا کندل در جهت مخالف روند ظاهری بودیم در صورتیکه نسبتهای فیبوناچی بسیار دقیق رعایت شده بود گرچه میتوانیم به معتبر بودن پترن امیدوار باشیم اما باید با تاخیر وارد بازار بشویم

به این معنی که در صورتیکه یک کندل در جهت مخالف بود تا زمانیکه کندل و یا کندلهای بعدی نمونه کندلهایی که نشونه بازگشت روند باشد نباید وارد ترید شد (یعنی نباید به صرف اینکه به کندل در جهت عکس بود وارد بشویم) و اگر پرایس بار بود راه مطمئن این است که منتظر پرایس بار دوم در جهت عکس روند باشیم.

در واقع از طرفی نسبتهای فیبوناچی خیلی خوب رعایت شده و از طرفی یکی از نشونه های سه گانه رد شدن پترن رو شاهدیم بنابراین باید محتاط باشیم و تنها زمانی وارد بازار بشویم که کندل و یا پرایس بار سیگنال مشخصی جهت برگشت روند به ما بدهد که این خود باعث تاخیر ما در ورود به بازار میشود که نتیجه انهم از دست دادن قسمتی از حرکت احتمالی بازار در جهت پترن است

اما در ازای آن از ورود به تردی کاملاً در جهت عکس روند بازار پرهیز میکنیم.

و جمع بندی مطالب اینکه: www.iranbourseonline.com

زمانی که به یک ناحیه با پتانسیل بازگشت روند رسیدیم به دقت نسبتهای فیبوناچی در پترن شکل گرفته رو بررسی میکنیم و در صورتیکه با علایم هشدار دهنده روبرو نشدیم میتوانیم وارد بازار شویم.

هر چند هنوز هم دیدن جزئیات چارت در آن لحظه برای مثال در تایم فریمهای پایین تر و گرفتن تایید از کندلی در جهت تردی ما میتواند روشی عاقلانه باشد.

پس بیاید پیش از دیدن مثال هایی واقعی از بازار به زبانی ساده آخرین مرور برای روش تردیمان را داشته باشیم:

ابتدا شکل ظاهری پترنهای فیبوناچی رو به ذهن میسپاریم سپس چارتهای مختلف در هر تایم فریمی که مایل باشیم رو مروری سریع میکنیم.

هدفمان این است که در نگاه به روند قیمت در ارزهای مختلف شکلی مشابه شکل پترنهای فیبوناچی پیدا کنیم.

بعد که شکلی شبیه یکی از پترنهای فیبوناچی پیدا کردیم شروع به بررسی نسبتهای فیبوناچی در پترن میکنیم به این معنی که فرضاً بررسی میکنیم ریترسی که در پترن پیش اومده آیا با نسبتهای فیبوناچی برابر است؟ (یعنی مثلاً به اندازه نسبت 61 فیو برگشته یا با نسبتهای فیبوناچی هماهنگی ندارد)

به همین شکل تمامی قسمت‌های پترن را که در پترنهای مختلف فیبوناچی میتواند متفاوت باشد با نسبتهای فیبوناچی میسنجیم.

و در این حال در صورتیکه هم شکل پترن شبیه پترنهای فیبوناچی بود و هم اندازه ابعادش با نسبتهای فیبوناچی یکی بود در

این لحظه به احتمال قریب به یقین با یک بازگشت روند روبرو هستیم (که مگر با خبری کاملاً ناگهانی که تاثیر مهمی هم داشته باشد روبرو شویم که در این صورت هم میدانیم رد شدن پترن به معنی بیکار نشستن نیست و باز میتوانیم در جهت روند قدرتمند ترید کنیم)

در پایان برای پیدا کردن لحظه مناسب ورود به بازار میتوانیم از سیگنال یک کندل رورسال در آن لحظه استفاده کنیم که این امر هم با دقت در نوع کندل چارت در اون لحظه و یا در تایم فریم پایین تر بدست میاید .

مثال یک:

نمونه ای کلاسیک از یک پترن $AB=CD$ است.

دارای دو طول AB و CD که به شکلی هماهنگ و با شبیهی مشابه در یک جهت شکل گرفته اند.

نکته مهم دیگر اینکه با دقت بالایی نسبتهای فیبوناچی در پترن رعایت شده است.

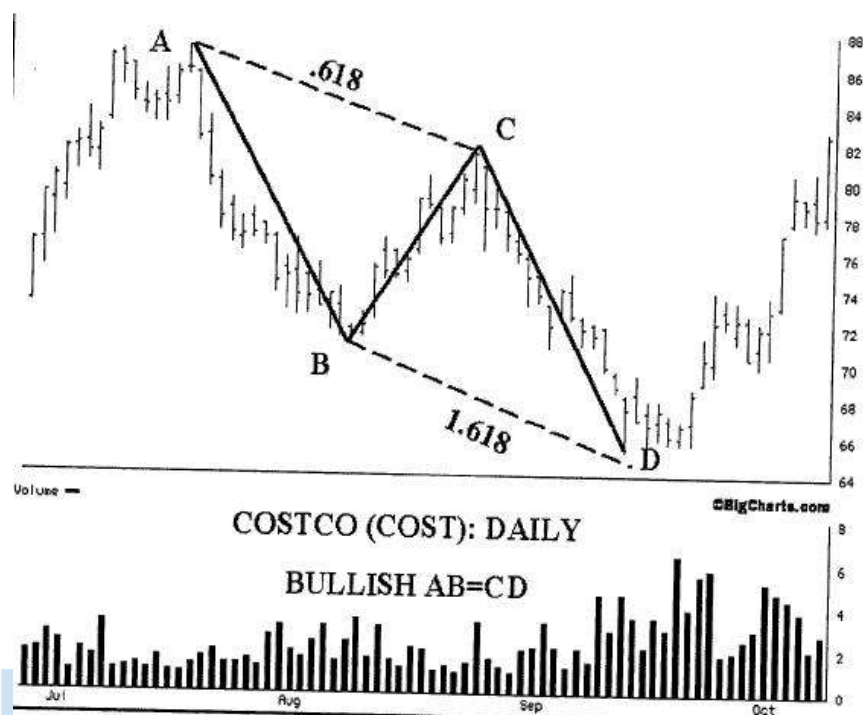
یعنی اینکه رتریس BC تا نسبت 61 فیو و اکستنشن BC به میزان نسبت 161 فیبوناچی رخ داده است که بسیار تناسب بالایی رو ایجاد کرده است.

زمانی که در پترنی نسبت 61 و 161 دیده شد این به آن معناست که سیگنالی بسیار قدرتمند و ایده آل شکل گرفته است.

پترن را از دیدگاه دیگری بررسی میکنیم: تناسب زمانی

طول AB در 16 روز و طول CD در 15 روز شکل گرفته است که از نظر زمانی هم بسیار ایده آل است (فراموش نکنیم که در بحث تشابه زمانی خصوصاً تایم فریم روزانه تا 3 روز اختلاف زمانی هم قابل قبول و امتیازی برای پترن محسوب میشود)

پس از این مثال بحثی در مورد پترن ایده آل خواهیم داشت و در آن بهترین نسبتهای فیبوناچی در پترن $AB=CD$ رو بررسی خواهیم کرد .



پیش از ادامه بحث توضیحی در مورد تصویر قبل ضروری است.

عزیزان اگر دقت کرده باشید نقطه ای که انتهای طول CD رو مشخص کرده با نقطه انتهایی نسبت اکسپنشن 161 فیبو با هم کمی متفاوت است و این مطلب نیاز به توضیحی دارد تا دقیقا به مفهوم آن پی ببریم که نتیجه آن هم عملکرد صحیح در این اوقات است که نتیجه این عملکرد صحیح رو هم بهش اشاره ای نمیکنم!

اما بیاید در ابتدا اشاره ای به مطلبی پایه ای داشته باشیم:

حتما بخاطر دارید که بارها از PRZ یا همان نواحی دارای پتانسیل بازگشت صحبت کرده ایم...

اما آیا تا حالا از خودتون پرسیدین این ناحیه کجاست و ساده تر از اون این ناحیه رو چطور میتونیم بدست بیاریم؟

PRZ در واقع یک ناحیه مجازی است یعنی وجود خارجی ندارد بلکه آنرا به روشهایی بدست میاوریم در واقع PRZ ناحیه ای است که از ادغام شکل پترن فیبوناچی و نسبتهای فیبوناچی بدست میاید.

به این معنی که فرضا ما میخواهیم یک ناحیه با پتانسیل بازگشت را بیابیم برای اینکار ابتدا در چارتهای مختلف بدنال شکلی مشابه پترنهای فیبو میگردیم فرض کنیم ابتدا در چارتی شکلی شبیه پترن $AB=CD$ دیدیم... (شکلی ناقص یعنی هنوز طول CD کامل نشده است و شکل ظاهری ناقص است اما شکل دارای نواحی است که ظاهرا شبیه طول AB و قسمتی شبیه ریتریس BC است)

علت اینکه این پترن ناقص رو فرصتی مناسب برای بررسی فرض کرده ایم این است که میبینیم طولی شکل گرفته است (AB) و از اون مهمتر میبینیم که ریتریسی که بعدش به نسبت طول AB رخ داده برابر با یکی از نسبتهای معتبر فیبو نظیر 61 است اینجاست که این وضعیت رو بعنوان موقعیتی با پتانسیل خوب برای ترید برآورد میکنیم.

میبینیم که این پترن هنوز در حال شکلگیری است یعنی اینکه طول CD هنوز کاملا شکل نگرفته است و اینجاست که ما شروع میکنیم به پیشبینی آینده این حرکت بر اساس تنها پترنهای فیبوناچی به این شکل که

بدون توجه به نسبتهای فیبوناچی و تنها بر اساس قوانین پترنهای فیبوناچی طول CD را بدست میآوریم که از این قرار است:

طول AB را محاسبه و بر اساس آن اندازه طول CD را بدست میآوریم (فرضا اندازه AB برابر 40 پیپس است بنابر این CD هم برابر 40 به حساب آمده و در چارت ناحیه ای که اگر 40 پیپس روند به پیش برود به آنجا میرسد را مشخص میکنیم)

حال بی توجه به پترنهای فیبوناچی و قوانینش تنها به نسبتهای فیبوناچی توجه میکنیم به این معنی که

به ریتریس BC و همینطور طول AB توجه کرده و سپس بر اساس قواعدی که برای رسم اکسپنشن در فیبوناچی میدونیم میزان اکسپنشن را بدست میآوریم فرضا اگر ریتریس BC را محاسبه و به نسبت AB اکسپنشن را رسم کردیم نقطه ای که برابر با 161 فیبوناچی میشود را در چارت مشخص میکنیم.

خوب تا اینجا چه بدست آورده ایم؟ یک نقطه که از محاسبه طول AB طول CD را بدست آوردیم و دیگری اینکه میزان اکسپنشن فیبوناچی را باتوجه به ریتریس BC و طول AB بدست آورده ایم.

همیشه در این موقع دو نقطه داریم که اینها معمولا دقیقا بروی هم منطبق نیستند بلکه با فاصله نسبتا کمی از یک دیگر بروی چارت قرار دارند.

این فاصله ای که بین این دو عدد بدست آمده وجود دارد در واقع همان ناحیه PRZ یا ناحیه ای با پتانسیل زیاد برگشت روند است.

و در این ناحیه است که ما باید بدنال سیگنالی برای برگشت روند باشیم.

که مطمئن ترین و ساده ترین روش انتظار برای تشکیل کندلی با سیگنال برگشت است...

بنابراین حال که با مفهوم PRZ و نحوه بدست آوردنش بیشتر آشنا شدیم میتوانیم به سادگی بفهمیم که چرا در تصویر ارایه شده بین انتهای طول CD و انتهای نسبت 161 فیبوناچی فاصله ای وجود دارد که همانطور که گفته شد ناحیه PRZ است.

اما حال بیاید کمی در مورد این بحث بیشتر وارد جزئیات شویم و بطور کاربردی به وضعیت پردازیم.

در نظر بگیرید در بررسی یک وضعیت به حالتی برسیم که میبینیم فرضا طول CD از نسبت فیبوناچی کوتاه تر است (امکانی طبیعی که غالبا پیش میاید) در این لحظه اگر قیمت به CD رسید آیا میتوانیم به انتظار تکمیل 161 فیو نشویم و وارد ترید شویم و یا باید صبر کنیم قیمت به 161 فیو هم برسد؟

البته در پترنهای مختلف فیبوناچی کمی جزئیات متفاوته اما بطور کلی عرض میکنم و بعد بروی هر پترنی در زمانش بطور خاص بررسی میکنیم.

باید بینیم که در هر پترنی کدام مورد گفته شده از اهمیت بیشتری برخوردار است.

یعنی فرضا در پترن $AB=CD$ مهمترین عامل نه نسبتهای فیبوناچی که برابری طولهای CD, AB است بنابر این زمانی که ما با این پترن کار میکنیم شرط اصلی برای آماده شدن جهت ترید بر اساس پترن برابری دو طول فوق است و در صورتیکه این امر محقق بود سپس میتوانیم به نسبت فیبوناچی توجه کرده و تصمیم گیری کنیم.

اما نکته مهم اینکه حتی زمانی که قیمت دقیقا به میزان طولها CD, AB برابر هم رسید نباید بلافاصله وارد بازار شد بلکه

باید به دقت وضعیت کندل رو بررسی کرد و دید که آیا نشانه ای از بازگشت مشاهده میشود یا خیر. بنابر این اگر دیدم قیمت به این ناحیه رسیده است اما با کندلهای فرضا بزرگی روبرو هستیم بهیچوجه نباید تریدی رو شروع کنیم و باید مشخصا در انتظار علایم بازگشتی باشیم.

در واقع برابری طولها و نسبتهای فیبوناچی به ما ناحیه ای رو معرفی کرده است که احتمال بازگشت زیادی دارد پس باید علایمی از بازگشت روند رو شاهد باشیم.

و در نهایت اینکه بسیار اهمیت دارد که صبور باشیم و تا **بسته شدن** کندل تنها نظاره گر وضعیت بازار باشیم و از اقدام عجولانه پرهیز کنیم ...

پترن ایده آل در $AB=CD$

هر پترنی در بطن خود بیش مشخصات و علایمی برای تحلیل و برآورد میزان احتمال عملکرد صحیح خود را داراست.

و ما با بررسی مجموعه خصوصیات هر پترن تلاش میکنیم میزان صحت آن را بدرستی تخمین بزنیم.

اما طبیعی است که ما در تحلیل چارتهای روزانه همواره با یک "پترن تیوریک-کتابی" کاملا شسته رفته روبرو باشیم و بینیم که فرضا پترنی مشخص ایجاد شده اما در بخشهایی از آن نقاط ضعفی وجود دارد (به این معنی که دقیقا خصوصیات بعضی پارامترهای پترن با پترن کتابی همخوانی ندارد)

در اینگونه وضعیتهاست که باید تلاش کنیم با ابزار و عوامل دیگر تکنیکال میزان صحت و یا ضعف پترن رو برآورد کنیم.

اما طبیعیست که پیش از آن باید ابتدا با بهترین حالتی که یک پترن میتواند شکل بگیرد آشنا باشیم تا در صورت مشاهده این وضعیت ایده آل با اطمینان خاطر بیشتر (که میتواند با استفاده حجم بیشتر از سرمایه مان برای ترید نمود پیدا کند) از فرصت بدست آمده استفاده کنیم.

پترن $AB=CD$ هم از این قاعده مستثنی نیست و این پترن هم دارای وضعیتهایی است که اگر به آن شکل پارامترهای حیاتی پترن شکل بگیرد میتوانیم بسیار به آینده پترن و در واقع پیشبینی صحیح حرکت بازار امیدوار باشیم.

بهترین وضعیت ممکن برای پترن $AB=CD$ به ترتیب اولویت:

1. برابری طول AB و CD

2. ریتریس به میزان 61 و یا 76 فیبوناچی

3. اکسپنشن به نسبت 161 و یا 127 فیبوناچی

4. دارای شیب یکسان بودن طولهای AB و CD با زاویه ای مشابه نزولی و یا صعودی باشند در واقع موازی یکدیگر حرکت کنند

5. برابری در میزان زمان تشکیل شدن دو طول AB و CD

اما توضیح اینکه مهمترین فاکتور در این پترن برابری دو طول مورد نظر است با مشاهده و محاسبه میزان برابری دو طول در چارتی میتوان تنها با همین فاکتور تا حد زیادی به آینده این پترن امیدوار بود.

نکته:

گاهی ندرتا وضعیتی پیش میاید که میبینیم که در نزدیکی برابری دو طول و قبل از اینکه میزان طول CD به اندازه AB برسد روند شروع به برگشت میکند در این وضعیتهای با توجه به اینکه معمولا نسبت اکسپنشن هم طولانی تر از طول CD است بنابراین هنوز هیچکدام از شرایط ایجاد نشده است در این موارد در صورتیکه میخواهید بر اساس این پترن ترید کنید میبایست سیگنالی دقیقا مشخص و قوی از کندلهای بسیار معتبر دریافت کنید (نظیر مورنینگ استار) در غیر اینصورت بهیچوجه ترید نکنید (یعنی مثلا دیدیم کندلی بولیش شکل گرفته است اما کندلی مهم نیست یا میبینیم که پرایس باری به سمت بالا ایجاد شده است)

هر چند در این وضعیت هم تریدرهایی که بسیار با دسیپلین و نظم هستند غالبا از ترید اجتناب و به قوانین ترید و پترن مقید و وفادار میمانند(چرا که بخوبی میدانند که با داشتن نظم و جدیت با فرصتهای متعددی برای ترید بر اساس پترنی ایده آل روبرو خواهند بود)

اما در مورد نسبتهای ایده آل فیبوناچی:

اول اینکه هر چه فاصله بین نقاط بدست آمده بین اکسپنشن فیبوناچی و طول (CD که بر اساس طول AB بدست آمده است) کمتر باشد اعتبار پترن بیشتر شده و در واقع به پترن ایده آل نزدیک تریم که طبیعی است با این استدلال بهترین وضعیت ممکن انطباق دو نقطه است که البته خیلی به ندرت پیش میاید اما فاصله کم بین این دو نقطه بسیار در چارتهای مشاهده میشود که همونطور که گفته شد هر چه فاصله دو نقطه کمتر باشد پترن ایده آل تر و شانس موفقیتش بیشتر است.

برای دانستن نسبتهای مناسب فیبوناچی در این پترن همانطور که گفته شد نسبت ریتریس 61 و 76 بهترین وضعیت محسوب میشود (در پترنهای جدید فیبوناچی که کارنی کشف کرده است نسبتهای دیگری نیز اهمیت پیدا کرده اند)

گرچه همواره باید نسبت اکسپنشن محاسبه شود اما اگر در پترنی مشاهده کردیم که ریتریس 61 با اکسپنشن 161 در پترن شکل گرفت این هارمونی بسیار بالایی ایجاد کرده است و باعث اعتبار بسیار زیاد پترن میشود.

همونطور در ریتریس BC به میزان 76 فیبو در صورتیکه اکسپنشن به میزان 127 باشد مجددا پترنی با هماهنگی بسیار ایده آل شکل گرفته است.

در واقع میتواند فرضا نسبت 127 با 61 پیش بیاید و این پترن هم پترن نامعتبری نیست اما وضعیت ایده آل پس از بررسی صدها ترید به این نتیجه رسیده است که بهترین وضعیت برای اینکه از صحت پترنی اطمینان یابیم اینست که بین نسبتهای فیبوناچی پترن هم به شکلی که گفته شد تناسب وجود داشته باشد و این نوع پترنها (که با وضعیت ایده آل تناسب نسبتها بسیار بوفور هم پیش میایند) شانس موفقیت بسیاری دارند.

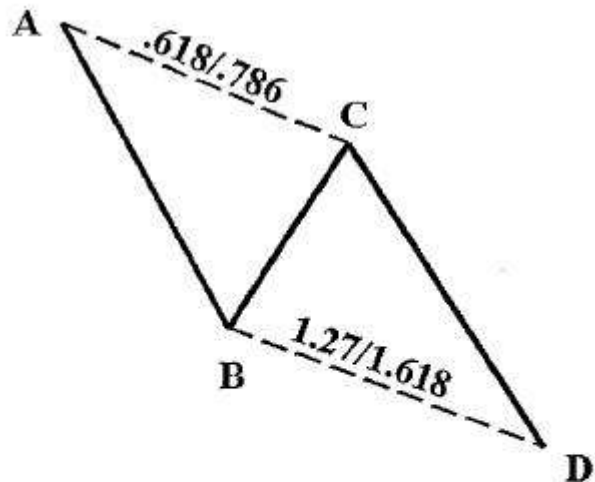
در کتب مرجع از نسبت 61 در مقابل 161 و نسبت 76 در مقابل 127 یاد شده است و این وضعیت رو فرم ایده آل معرفی کرده اند اما در سالهای اخیر با استفاده از قابلیتهای کامپیوتر و بررسی پترنهای بسیار زیاد (که تحلیل این حجم از پترن تنها به کمک کامپیوتر میسر است) به نسبتهای هماهنگ دیگری هم دسترسی پیدا کرده اند.

اسکات کارنی در نرم افزار جستجوگر خودکار خو پیش در مورد پترنهای فیبوناچی از جدولی استفاده میکند که این نسبتهای ایده آل رو درحالات دیگر هم جستجو میکند که دانستن این نسبتها میتونه جالب باشه (هر چند محاسبه آنها بصورت دستی با توجه به اینکه اعدادی خیلی روند نیستند بدون کمک نرم افزار تا حدی خسته کننده است)

خلاصه اینکه در بررسی یک پترن تلاش میکنیم بهترین حالت و ایده آل ترین وضعیت ها رو در چارتهای گوناگون بیابیم که برای

دانستن بهترین وضعیتها از قوانینی برای تشخیص این نوع پترن ها استفاده میکنیم که دانستن این پارامترها به ما در تحلیل وضعیت و در واقع پیشبینی آینده بازار کمک موثری خواهد بود.

در تصویر زیر علاوه بر نسبتهای (61-161) و (76-127) که نسبتهای ایده آل در پترن $AB=CD$ هستند به سایر نسبتهای ایده آل که توسط نرم افزار Harmonic Analyzer محاسبه میشوند توجه فرمایید (با تشکر از فراز عزیز که این نسبتها در این نرم افزار رو برای اولین بار ارایه کردند)



انتراین
www.iranbo

BULLISH AB = CD

BUY AT POINT D!

AB=CD

- AB=CD (0.382/2.240)
- AB=CD (0.500/2.000)
- AB=CD (0.618/1.618)
- AB=CD (0.707/1.414)
- AB=CD (0.786/1.270)
- AB=CD(ab=cd)

هدفهای قیمتی

برای پیدا کردن نقاط دقیق خروج از بوزیشن تکنیکهای مختلفی وجود دارد.

اما مانند تعیین استاپ لاس که دو روش ارائه شد برای تعیین تارگت هم دو روش وجود دارد که عبارتند از:

1. روشی که در مانی تک ارایه شده است و در آن از نسبت 61 فیبوناچی استفاده میشود که بطور خلاصه یعنی زمانی که قیمت به انتهای پترن رسید (در اینجا : نقطه D در طول CD) زمانی که با کندلی برگشتی وارد پوزیشن شدیم تا نسبت CD 61 در بازار باقی و سپس خارج میشویم.

این هدف قیمتی اول ماست اما در صورتیکه بینیم روندی قدرتمند در جریان است و علائمی از بازگشت در دست نیست تردید رو در CD 61 نمیبندیم بلکه تردید رو بر اساس ریتریس AD 61 محاسبه و در نظر میگیریم.

در پترنهای گارتلی و باترفلای (بجهت شروع کارگرایشان این توضیح داده میشود و درآینده این کامنت اصلاح خواهد شد) هدف قیمتی اول CD 61 و هدف قیمتی دوم 61 XA خواهد بود.

روش دوم محاسبه:

روشی است که در کتاب ارزنده Fibonacci for the active trader اثر دریک هابز ارایه شده است و به این شکل است که دو هدف قیمتی نداریم بلکه بین نسبتهای 50 و CD 61 از پوزیشن خارج میشویم اما اگر حرکت قدرتمند بود تا نسبت 127 اکسپنشن پوزیشن رو باز نگه میداریم.

سپس با رسیدن قیمت به این نرخ نیمی از سرمایه رو از بازار خارج و سپس استاپ رو نقطه پایین کندل یا پرایس بار قبلی در نظر میگیریم و پوزیشن رو باز نگه میداریم تا زمانی که به این روش پوزیشن بسته شود.

میدونم که این دو روش و خصوصا روش دوم نیاز به توضیح بیشتر و تصاویر دقیق دارد که انشالله در زمان مناسب به این امر اقدام میشود.

روش دوم روش قدرتمندی است که دیدم دقیقا در کتاب Dynamic Traders اثر رابرت ماینر هم به آن اشاره شده است.

در این کتاب جداول بسیار سودمندی جهت استراتژی های صحیح برای خروج در بهترین وضعیت ممکنه ارایه شده است که انشالله در آینده به آن خواهیم پرداخت .

در بررسی وضعیتهای مناسب و یافتن پتانسیل های ورود به بازار پس از شناسایی دقیق پترن و نسبتهای فیبوناچی در آن و اطمینان به صحت و هماهنگی لازمه در پترن برای ورود به بازار باید به وضعیت کندلها در اون لحظه خاص توجه کنیم و بر اساس سیگنالی برگشتی عمل کنیم.

به مثال زیر توجه کنید:

هماهنگی بسیار عالی در عناصر موجود در پترن دیده میشود: طولهای AB و CD بطور موازی پترنی را شکل داده انکه دور نمازی زیبایی را نوید میدهد! (تناسب و تقارن)

دقت داشته باشید که نقطه D و نقطه پایانی نسبت 161 بسیار بهم نزدیک هستند که این نزدیکی هر زمان شکل بگیرد نشونه پتانسیل بسیار بالای پترن شکل گرفته برای بازگشت روند است.

نکته مهم دیگر اینکه نسبت ریتریس BC برابر با 61 است که با اکسپنشن BC161 تناسبی ایده آل رو شکل داده اند.

تناسب زمانی 9 روز به 11 روز امتیازی دیگر برای پترن شکل گرفته محسوب میشود.

چنین شرایط ایده آلی باید ما رو برای آمادگی جهت تردیدی جدید مجاب کنه...

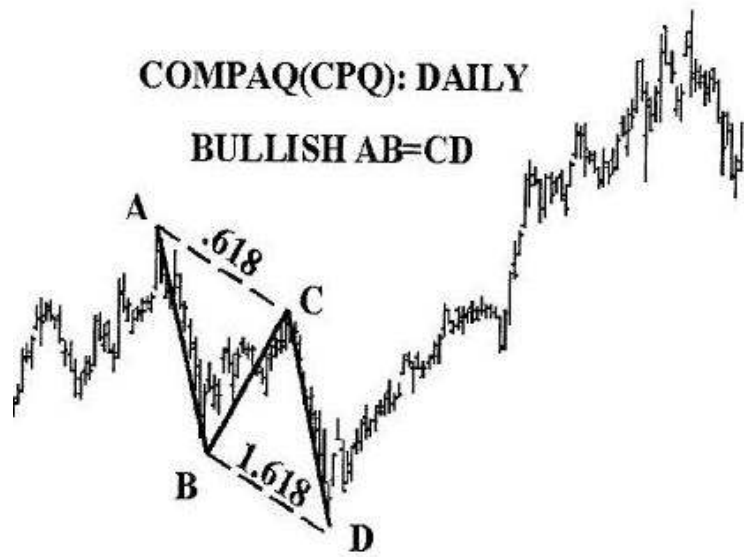
در این شرایط است که برای یافتن سیگنال ورود به پوزیشن با وضعیت کندلها توجه میکنیم:

تصویر بسیار گویاست و نیاز به توضیح زیادی ندارد (دوجی و...)

در آینده دقت بروی کندل ها در اینگونه وضعیتها رو با تفصیل بیشتری بررسی خواهیم کرد.

در این بین نکته بسیار مهمی جهت تشخیص پترنهای صحیح وجود دارد که خود بحث مفصلی است اما بطور خیلی خیلی فشرده عرض کنم که برای تایید یک پترن در یک بازه زمانی باید به تایم فریم بالاترش مراجعه و در صورتیکه پترنی با سیگنال مخالف وجود نداشت میتوانیم به سیگنال این پترن در تایم فریم پایین تر اطمینان یابیم.

این روش جزئیات بیشتری دارد که انشالله در آینده بطور مبسوط برویش بحث خواهیم کرد .



© BigCharts.com

بین
www.



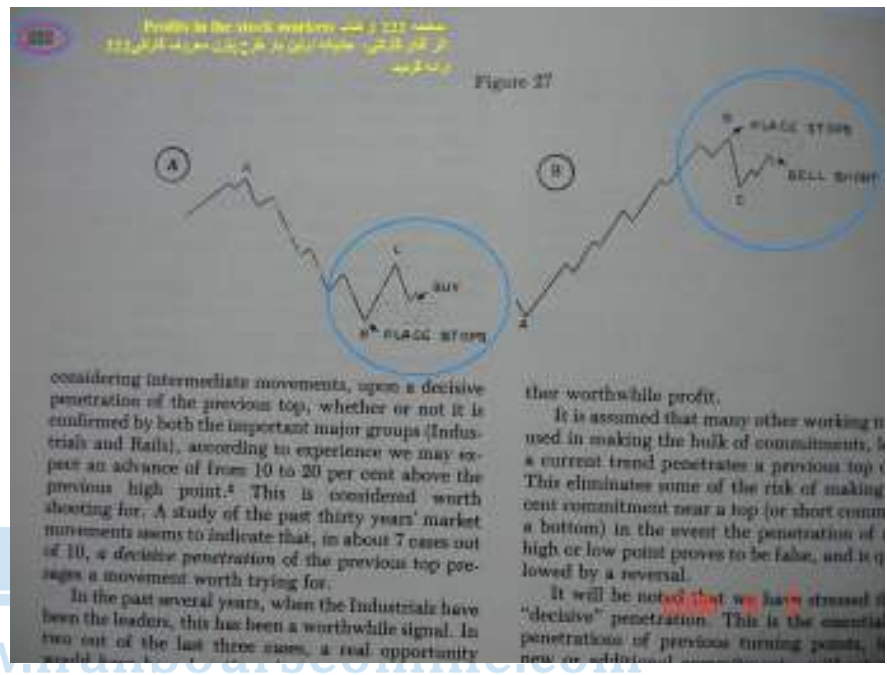
تقديم به علاقمندان پترن ها

عكس هاي زير را دوست عزيزم حميد ارسال فرمودند كه به همه علاقه مندان اين پترن هاي دوست داشتنی تقديم ميشود :

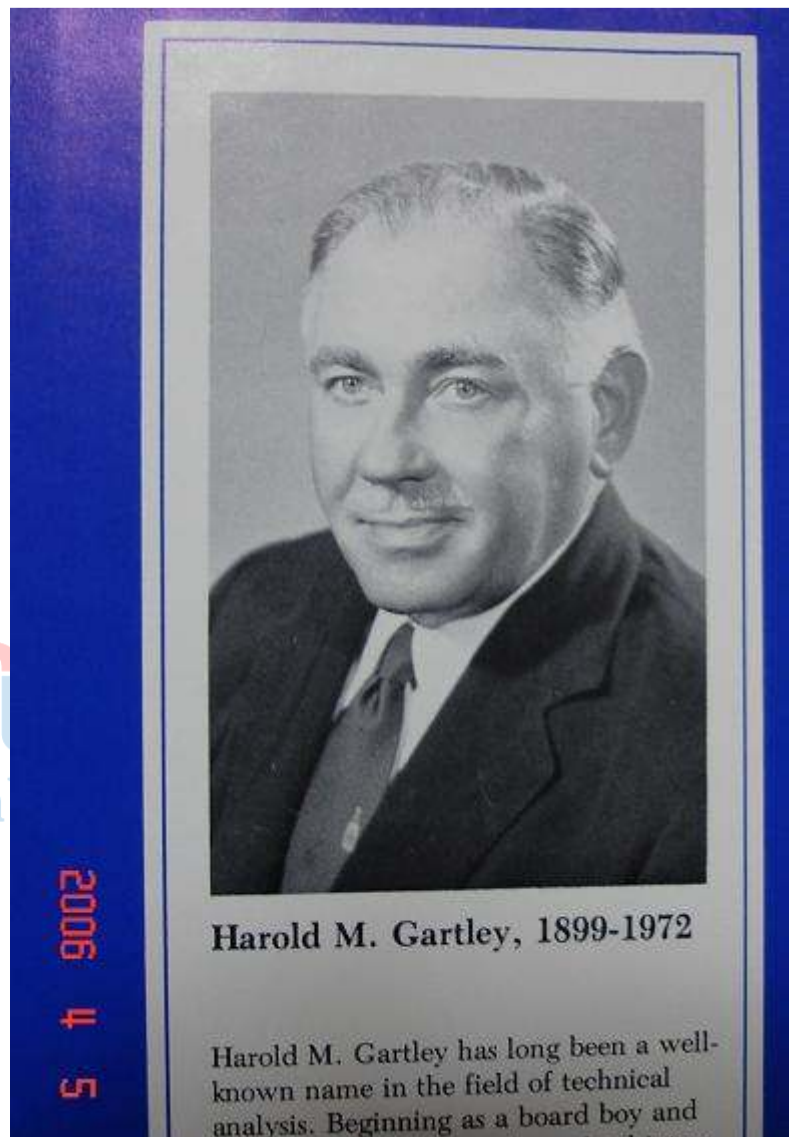
اين تصاویر مربوط به جناب آقای گارتلي و همينطور پترن معروف ايشان است كه در كتاب ارزشمندشان يعني Profits in the stock market - 1935- ارائه شده است. ساليان بعد آقای پساونتو اين پترن را با نسبت های فيبو ناچی تركيب کرده و از آنجا كه اين پترن اولين بار در صفحه 222 اين كتاب عنوان شده بود، آن پترن را گارتلي 222 نامگذاري كرد.

رسم اوريجينال اين پترن در شكل زير مشخص است

روانش شاد ...



ایران
www.IranBourseOnline.com



بحث در مورد پترن $AB=CD$ رو با چند مثال دیگه به اتمام میرسونیم...

لطفا به تصویر زیر توجه بفرمایید

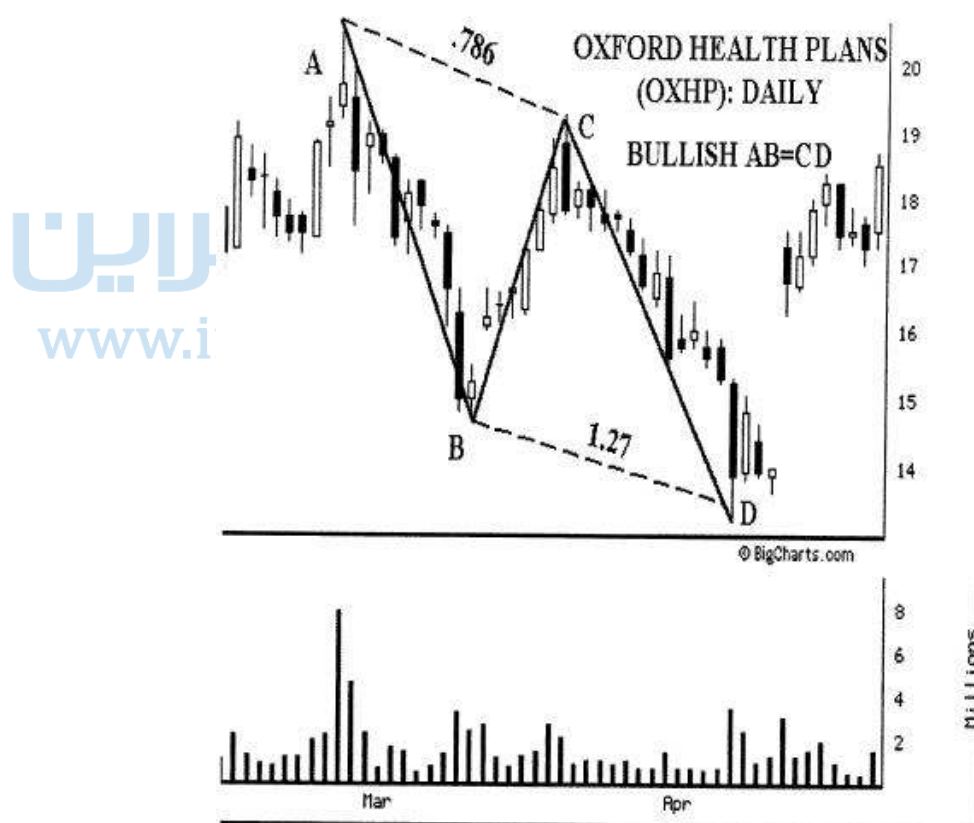
یک پترن ایده آل که در آن نسبتهای اصلی فیبوناچی به خوبی رعایت شده است و نسبتهای 76 و 127 نوید ترید موفق رو میدهند.

مزیت بزرگ دیگه در این مثال نزدیکی و تقریب زیاد نسبت طول CD با نسبت AB 127 است (به این معنی که بدست آوردن طول CD و نسبت فیبوناچی 127 که هرکدام به روشی مستقل بدست میآیند هرچه میزانشان مقدارشان به هم نزدیکتر باشد اعتبار بیشتری به پترن میدهد) که این فاصله کم نشانه ای مهم از پتانسیل بالای بازگشت روند را داراست.

تقریب زمانی (تعداد کندل های تشکیل دهنده در هر نوسان در نسبت های شکل گرفته در پترن) نکته مثبت دیگری بوده است که به شانس موفقیت این پترن کمک می کرده و در نهایت تناسب پترن (موازی بودن خطوط (AB , CD) تریدی موفق رو در پی داشته است.

هارمونی و هماهنگی بین این عناصر شکل دهنده ما را باید برای شروع تریدی جدید آماده کند تنها در این بین میبایست به مطلبی توجه میشد و اون اینکه کندل نزولی بزرگی که به ناحیه PRZ برخورد کرده قدرت زیادی داشته است و همینطور که شاهد هستید اساسا آن روز بازار با گپ آغاز شده که این میبایست ما رو محتاط میکرد که علی رغم کلیه پتانسیل های موجود در انتظار کندلی بازگشتی بمانیم و بروی این کندل قدرتمند نزولی وارد پوزیشن نشویم.

بازگشت 40% روند نزولی در طی چند روز بعد پاداشی برای هماهنگی خوب عناصر تشکیل دهنده این ترید موفق بوده است ...



عزیزان توجه داشته باشند که در بررسی پترن AB=CD بنده تنها با نسبت های مهم این پترن کار میکنم اما این به آن معنی نیست که در این پترن بجز نسبت های (61-161 و 76-127) نشود با نسبت های دیگر ترید کرد.

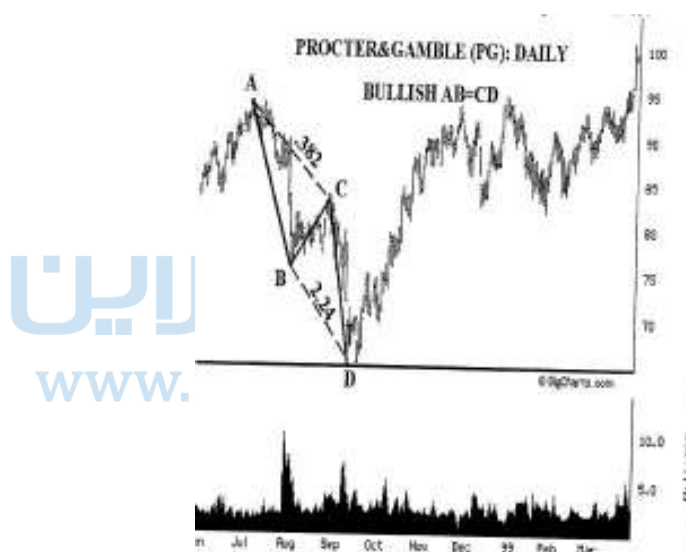
جدول دقیق سایر نسبت ها در قسمتهای قبل ارائه شده است اما به تجربه عرض کنم که بهتره به نسبت های اصلی (پترن

هاي ایده آل) مقید باشیم که انتظار طولانی تر ما برای شکل گیری چنین وضعیت هایی مطمینا ارزشش را خواهد داشت.

در زیر به نمونه ای از نسبتهای دیگر در این نوع پترن بدون توضیح اضافه ای میپردازیم

توجه داشته باشید که کلیه مراحل تشخیص پترن در این نسبتها هم مثل سابق است و تنها به جهت اینکه نسبتهای اصلی فیوناچی نیستند میبایست با آنها با احتیاط بیشتری برخورد کرد و یا احیاناً از روش های تکنیکال دیگر هم برای تاییدشان استفاده کرد.

دوستان هدف از این سلسله مباحث موفقیت شما در ترید است پس مجدداً عرض میکنم که این تجربه شخصی بنده است که شما رو برحذر میکنم که زیاد با این نسبتهای در فارکس ترید نکنید هرچند ممکنه سایر عزیزان تجارب متفاوتی داشته باشند ...



بحث پترن AB=CD رو با الگو نزولی ادامه میدهم.

از جنبه بحث تکنیکال کلیه مباحث گفته شده برای الگوی صعودی این پترن برای الگوی نزولی هم صادق است بنابراین تنها بصورت فشرده مروری به کلیه مباحث گفته شده در مورد الگوی قبلی در این الگوی نزولی خواهیم داشت:

در الگوی نزولی AB=CD نقطه A میبایست پایینترین نقطه پترن باشد و سایر عناصر پترن از این نقطه پایینتر قرار نگیرند همینطور طول CD میبایست بالاتر از نقطه B قرار بگیرد.

با توجه به اینکه در طول CD ما شاهد یک حرکت قدرتمند صعودی هستیم تصور اینکه باید سل کنیم شاید تا حدی دشوار باشد اما با رعایت نکات و در نظر گرفتن نواحی خاصی از روند شانس بزرگی خواهیم داشت تا یک روند نزولی را از ابتدای آن شکار کنیم!

تنظیم حد ضرر به مانند الگوی صعودی بوده و میبایست یک یا دو واحد (پوینت) بالاتر از طول CD و نسبت متناسب

فیوناچی در اون لحظه قرار داده شود (شرح تفصیلی این مطلب را در توضیح شق اول الگو $AB=CD$ مطالعه بفرمایید) بررسی و دقت در نحوه رفتار روند قیمت در ناحیه PRZ به ما فرصت های ترید بسیار خوبی خواهد داد مشاهده سیگنال های بازگشتی توسط کندل ها در این ناحیه نشانه بزرگی جهت تغییر روند حرکتی بازار خواهد بود.

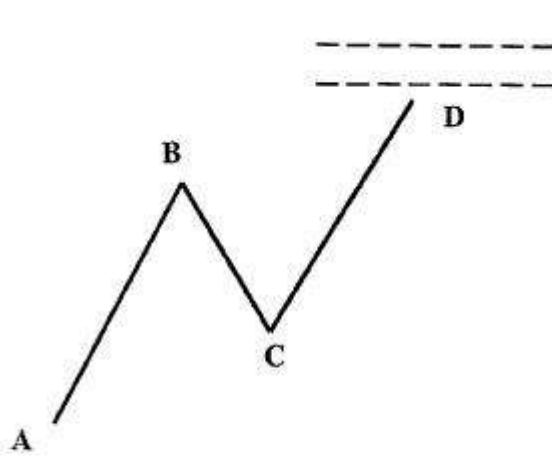
پترن ایده آل در الگوی نزولی نظیر الگوی صعودی میباشد منتهی همه نسبتها در جهت مخالف است برای مثال طول (بازو BC (در وضعیت ایده ال میبایست به میزان 61 تا 76 درصد طول AB ریتریس کرده باشد همینطور به نسبت ریترس که 61 یا 76 باشد میزان بسط فیبو (اکستنشن) میبایست در وضعیت ایده ال به میزان 161 یا 127 باشد.

از جمله نکات مهم دیگر در تشخیص يك الگوی نزولی ایده ال تقریب زمانی است (به زبان ساده تعداد کندل هایی که باعث تشکیل هر طول در پترن شده ترجیحا با هم برابر یا نزدیک به هم باشند)

موازات خطوط AB , CD اعتبار خاصی به این پترن میدهد و از روی تجربه شخصی عرض کنم که شانس موفقیت پترنهایی که این خطوط موازی را داشته باشند و در واقع شکل از هارمونی خوبی برخوردار باشد بسیار زیاد است و ترجیحا از ترید بروی پترنهایی که تناسب و هماهنگی بین عناصرش موجود نیست (علی رغم نسبتهای دقیق فیوناچی) پرهیز کنید.

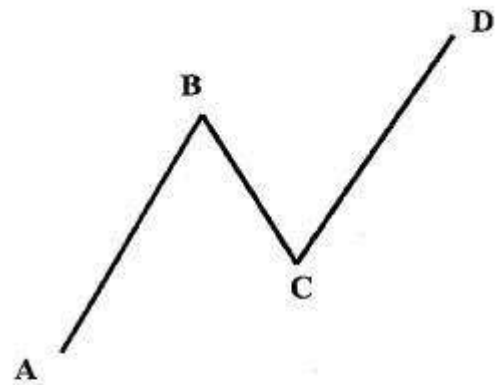
در ادامه با دو مثال به بررسی دقیقتر این الگوی نزولی میپردازیم .

ایران بورس آنلاین
www.iranbourseonline.com



BEARISH $AB = CD$

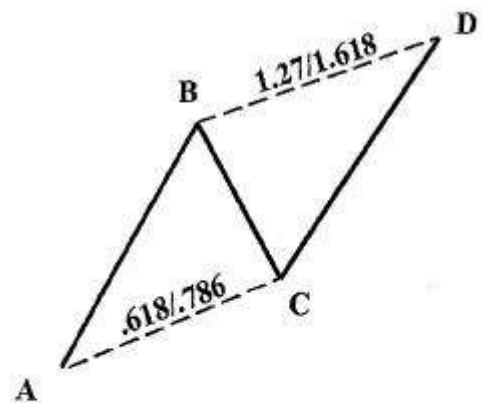
STOP LOSS ABOVE POINT D!



BEARISH $AB = CD$

SELL AT POINT D!

www.iranbourse.com



BEARISH $AB = CD$

SELL AT POINT D!

اولین مثال مربوط به سهام شرکت میکروسافت است (نمیدونم چرا اینقدر سهام میکروسافت و گوگل برام جاذبه دارند !)

در تایم فریم روزانه پترنی دقیق شکل گرفته است پترنی که زمان تشکیل آن بیش از 6 ماه به طول انجامیده است.

پترن دارای مشخصه های واضحی است دو بازو (طول) موازی AB و CD و نسبت BC 127 که میبینیم هماهنگی بین این عناصر چه پترن دقیقی را شکل داده و ریزشی قوی را در پی داشته است.

برای درک عمیقتر وضعیت چارت رو با ریزه کاری بیشتری مورد توجه قرار میدیم

پترن بسیار ایده آل بوده است با این وجود توجه به نکاتی میتونه آموزنده باشه ابتدا توجه به فاصله کم نسبت فیبوناچی و میزان طول CD میکنیم که فاصله ای کم دارند و نشونه وجود ناحیه PRZ قدرتمندی است.

نکته جالب اینکه میبینیم روند پیشین قدرتمند و صعودی بوده است خصوصا دو روز انتهایی روند با قدرت صعود میکرده است بدون اینکه نشانه ای از بازگشت روند رو مشاهده کنیم اما روند پس از رسیدن به این مقاومت مهم و قوی (که از نزدیکی نسبت 127 فیو و طول CD میتونستیم به اون پی ببریم) نتوانسته است به ادامه مسیر ادامه دهد و شروع به ریزش کرده است.

منتهی وجود دو علامت هشدار مهم (یکی گپی که در روند صعودی مشاهده کرده بودیم و همینطور کندل بزرگ صعودی که ایندو دو نشانه از سه نشانه مهم هشدار دهنده هستند و پیش از این بررسی شده اند) میبایست ما رو از فروش زود هنگام برحذر میکرد.

روز بعد با گپی بزرگ بازار شروع به نزولی شدید کرد که در کمتر از یک ماه سقوطی حدود 20 واحد (پوینت) رو شاهد بودیم.

حقیقتا از این مثال درسی بزرگ میشود گرفت و اون اینکه چطور در بازار های سرمایه با وجود روند های قدرتمند صعودی یا نزولی زمانی که یک روند به نواحی خاصی میرسد واکنش نشون داده و شاهد تغییر روند هستیم.

در واقع روی تجربه عرض کنم که در تایم فریمهای بالا حرکات بازار بروی نسبتهای خاص فیبوناچی عمل میکند و هر کسی با کمی تحقیق و بررسی به خوبی به این نتیجه میرسد و اینجاست که اهمیت و اعتبار بیشتر تسلط به روشهای مختلف فیبوناچی و اعتبار بیشتر آنها نسبت به هر روش تکنیکال دیگر (نظیر پیوت و ترند لاین) مشخص میشود.

تنها کفایت بروی تایم فریمهای ماهانه هفتگی و روزانه بررسی کوتاهی کنید تا ببینید چطور بازار بروی نسبتهای اصلی فیبوناچی رفتار میکند...

کارنی در کتاب ارزشمندش در مورد این وضعیت میگوید:

این وضعیت سهام میکروسافت را در زمان شکل گیری اش دنبال میکردم روند از چند هفته قبل با قدرت زیادی صعودی بود و خصوصا در یکی دو روز آخر نه تنها با گپ حرکت صعودی ادامه پیدا کرده بود که در آن روز چندین خبر فاندمنتالی اعلام شد که در ظاهر میبایست نتایج آنها بسیار به روند صعودی کمک کرده و در روند آن تسریع به عمل آورد.

در ادامه میگوید این زمانی است که اکثر شرکت های سرمایه گذاری و سایر محافل به شما پیشنهاد و توصیه خرید میکنند ولی در واقع آن لحظات علی رغم اخبار فاندمنتالی قوی در جهت صعود فرصت ایده ال برای فروش بوجود آمده بود!

وقتی این مطالب رو برای سایت آماده میکردم به یاد خاطره ای افتادم...

یادمه حدود یک سال پیش در سایت پارس مطلبی برای نحوه ترید بروی خبر INFP آماده میکردم و روشی رو از یک تریدر

ارابه کردم و از سایرین هم خواستم که اگه نظري دارند بگند که افراڊي هم نظراتشون رو گفتند...

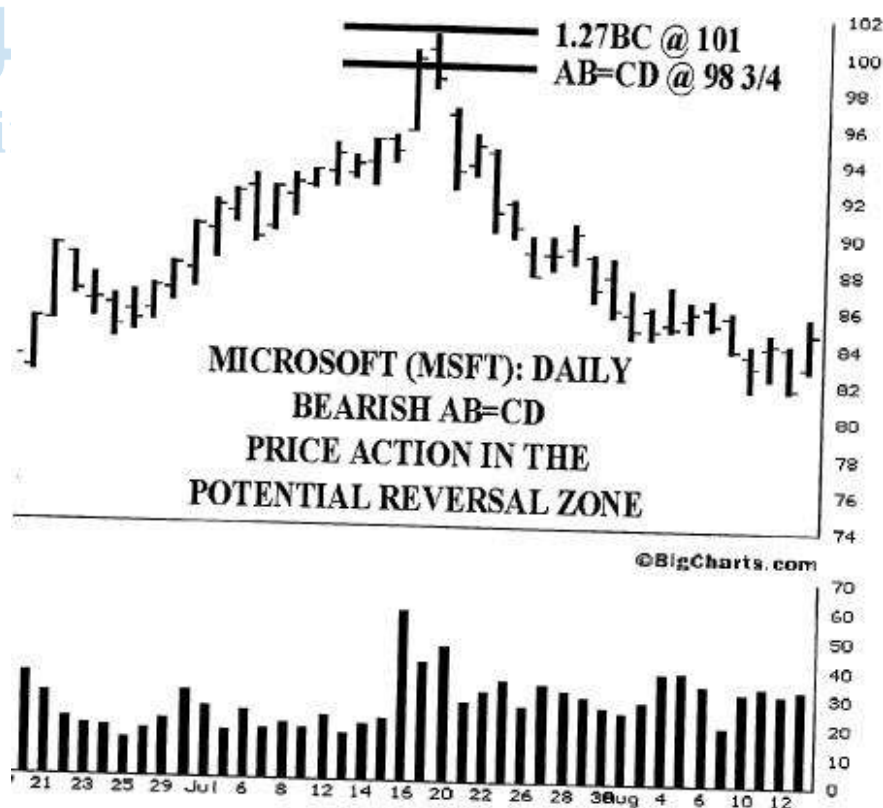
اما يادمه ترڊري که الان نامش از خاطر م رفته تنها يك جمله گفت و اون اينکه اخبار مهم هم تنها با تکنیکال بروي تايم هاي بالا جهتشون مشخص ميشه!

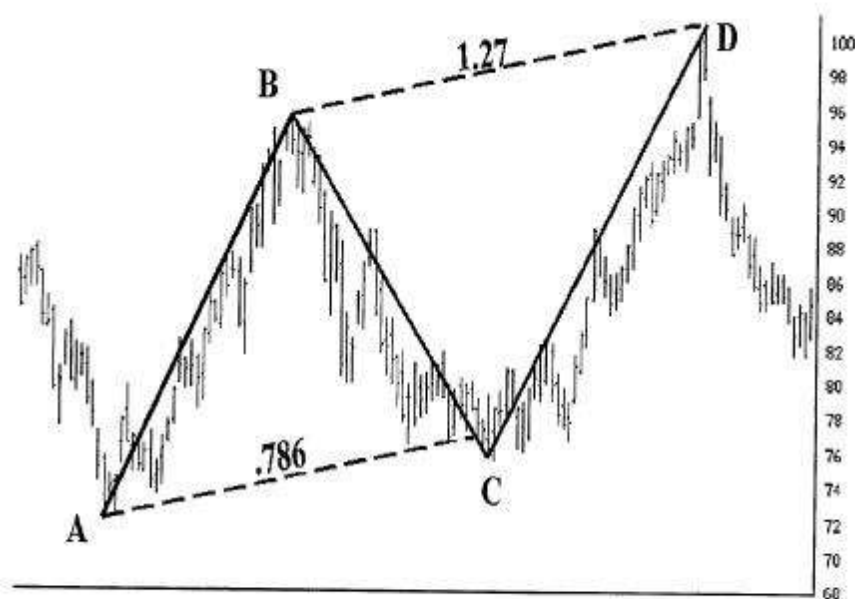
جمله جالبی بود و بعد از اون همیشه این مطلب در ذهنم بود که ایا حقیقتا همیشه با تحلیل تکنیکال دقیق بازه های زمانی بزرگ با درصد تخمین بالا به تعیین جهت اصلی تاثیر اخبار پی برد ؟ (و در واقع به نوعی پاسخ این سوال قدیمی رو داد که چرا بعضی اخبار با وجود اینکه نتیجه اعلام شده فرضا کاملا باید روند رو صعودی کنه منجر به حرکت کاملا برعکس نتیجه اعلام شده ميشه!)

دوستان تنها کافی است که تايم هاي بالاي بازار در هر ارزي رو بررسی کنید تا ببینید که چطور بازار بروي نسبتهاي فیبوناچی عمل میکنه و به طبع زمانی که پترن قدرتمندی در این بازه های زمانی شکل گرفت تا چه حد پتانسیل تغییر روند بازار رو در بطن خود علي رغم ظاهر روند در بر خواهد داشت...

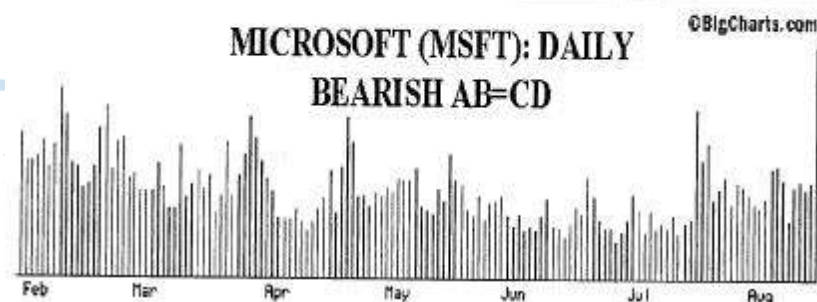
این مثال از سهام مایکروسافت درسي است که تا چه حد بازه های زمانی بالا در تشخیص تغییر جهت روند نقشی اساسی ایفا میکنند و میتوان بر اساس یافتن پترن های فیبوناچی در این بازه ها حرکت بازار رو در تايم هاي کوتاه تر به خوبی و در صد بالا صحیح تشخیص داد .

لایین
www.i





ایران
www.i



مثال دوم مربوط به سهام اینتل است که از جنبه تکنیکال چارت شباهت زیادی با سهام مایکروسافت دارد که پیش از این بررسی شده بود.

تناسب خوبی بین نسبت های فیبوناچی از یک طرف و اندازه ابعاد بازوهای AB , CD وجود دارد.

در چارت مشاهده میکنیم که پیش از نزول شدید روندی صعودی و قدرتمند در پیش بوده است تا زمانی که روند به مقاومت مهمی (ناحیه PRZ) برخورد کرده است و سپس روند نزولی علی رغم قدرت روند صعودی شکل گرفته است که باز هم یادآوری قدرت نسبتهای خاص فیبوناچی و پترن های آن در تشخیص صحیح تغییر جهت روند است.

با توجه به اینکه زمانی که روند به نسبت 161 فیو رسیده است بسیار قدرتمند و کندلی بزرگ را تشکیل داده است میبایست حداقل یک روز صبر میکردیم (تایم فریم هفتگی است) تا از تخفیف قدرت روند و پتانسیل ریزش بازار مطمئن شویم.

همینطور شاهد هستیم در آن ایام که روند بازار به نزدیکی انتهای CD رسیده بوده است شاهد گپی روزانه بوده ایم هر دو این علائم هشدار دهنده میبایست ما رو محتاط میکرد و تا زمانی که علائمی بازگشتی در روند نمیدیدیم علی رغم نسبتهای ایده ال پترن از ترید بروی آن حذر میکردیم.

که در نهایت میبینیم علی رغم قدرت زیاد روند زمانی که به این ناحیه میرسد نمیتواند از آن عبور کرده و در نتیجه ظرف چند روز با ریزشی قدرتمند روبرو بوده ایم که تریڈی موفق را در برداشته است.

عزیزان باز هم توصیه میکنم بدون تریگر کندل ها و تنها به صرف رسیدن به نسبت های خاص فیبوناچی و ایده ال بودن پارامترهای پترن تریڈ نکنید و تنها زمانی پترنی رو برای معامله انتخاب کنید که تریگر مطمئنی از کندل ها رو بروی اون شاهد باشید.

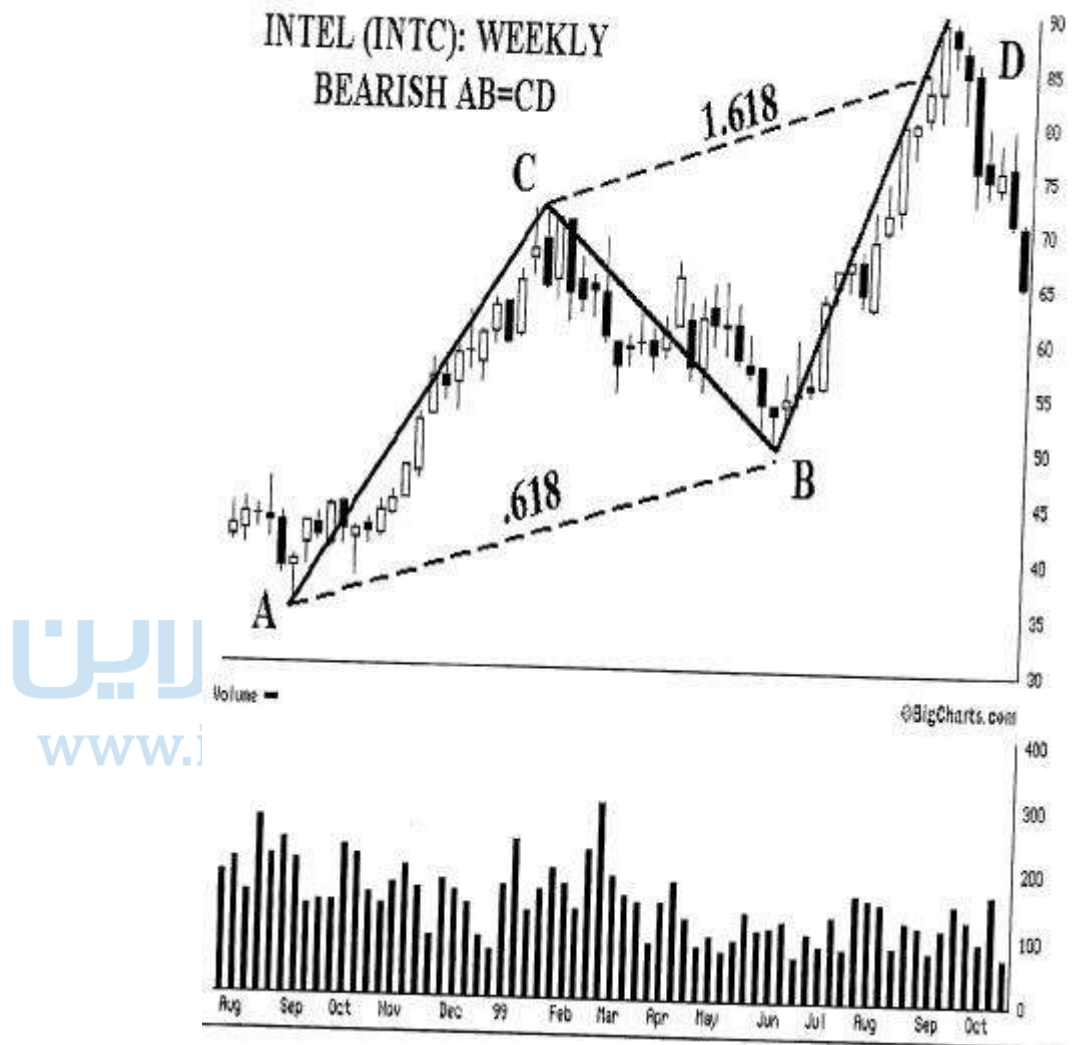
هر چند این امر منجر به این میشه که کمی از سود آغاز حرکت رو از دست بدیم اما عدم تریڈ بخاطر عدم مشاهده تریگر مناسب باعث میشه که از بسیاری تریڈ های ضرر جلوگیری کنیم با این نکته انتهایی که در صورتیکه بروی یک تایم فریم (فرضا در این مثال هفتگی) همه چیز ایده ال بود اما کندل ها نشانه خاصی نداشته اند حداکثر میتوانیم تا دو تایم فریم پایینتر (در این مثال روزانه و 4ساعته) رفته و در صورت مشاهده کندل یا کندل پترن مشخص و مطمئن اقدام به تریڈ بر اساس پترن در بازه زمانی بالاتر کنیم.

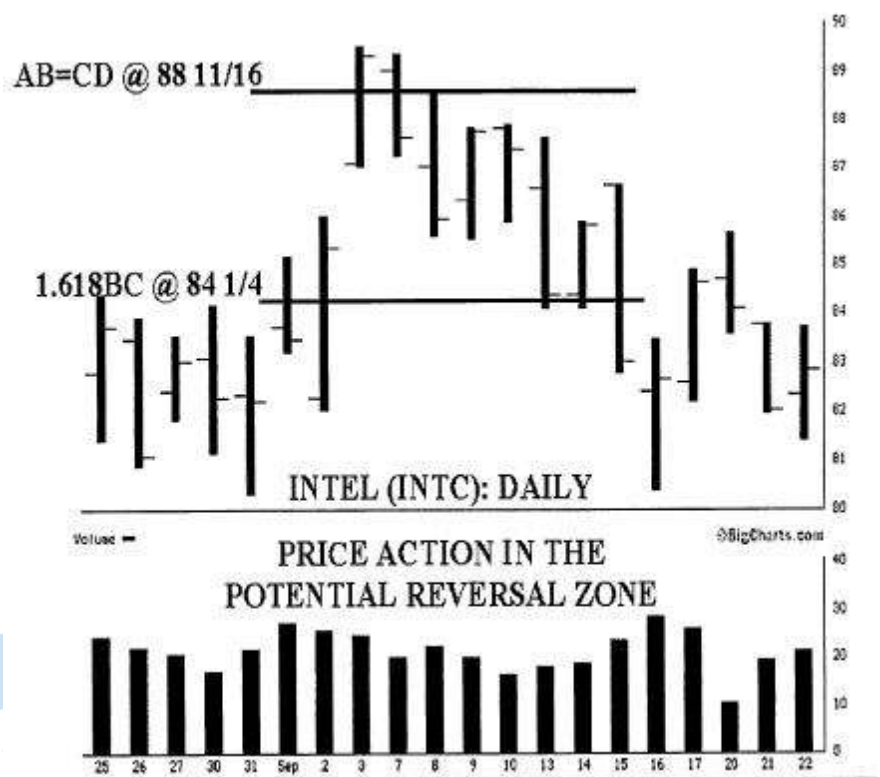
برای وضوح بیشتر مطلب لطفاً به چارت زیر توجه کنید(دقت کنید که چارت روزانه است)

کارنی در توضیح وضعیت فوق میگوید:

این مثال هم از نظر وضعیت فاندامنتالی بسیار شبیه چارت مایکروسافت بود از این جهت که در آن روز اخبار فاندامنتالی بسیار قدرتمندی در جهت تایید روند صعودی اعلام شد و من احتمال زیادی میدادم که PRZ شکسته شود اما بعد از اینکه اولین علایم از نزول رو مشاهده کردم چارت رو با دقت بیشتر دنبال کردم و سرانجام بعد از دو روز که از شروع روند نزولی آغاز شده بود اقدام به تریڈ بروی این سهام کردم.

درسی مجدد از این تریڈر حرفه ای که به ما صبور بودن در زمان تریڈ رو آموزش میده و میبینیم که ایشون حتی در روز نخست روند نزولی هم اقدام به معامله نکرده است و باز هم صبر کرده که از روند نزولی مطمئن شود و با توجه به اینکه این تریڈ در تایم فریم روزانه بوده است (ایده اصلی رو از تایم فریم هفتگی گرفته و بعد برای تریگر از تایم فریم روزانه استفاده کرده است) میدانسته که در صورت شکل گیری قطعی روند نزولی سود خوبی خواهد داشت و در نتیجه به جای آنکه بی صبرانه ترجیح بدهد از ابتدای روند نزولی رو شکار کند (!) دو روز وضعیت نزولی رو به دقت بررسی و سپس با اطمینان از ریزش اقدام به تریڈ کرده است ...





يك حالت خاص:

هر چند در پترن $AB=CD$ برابری طول دو بازو (AB , CD) به ما پترنی بسیار ایده آل و فرصتی مناسب برای ترید رو فراهم میکند اما موارد زیادی است که برای تشخیصی فرصت ترید بروی چارتی باید از حالت های جانشین استفاده کرد.

حالت های جانشین به وضعیت هایی گفته میشود که طول AB با CD برابر نیست اما این نابرابری میبایست مجدداً بر اساس نسبت های خاص فیبوناچی شکل بگیرد و در این صورت باز هم تناسب بین دو بازوی AB , CD حفظ شده است.

این حالت های جانشین خصوصاً در پترن هایی نظیر گارتلی و پروانه کاربرد دارد.

به این شکل که یک پترن شکل گرفته است و در ابعاد مختلف آن نسبت های فیبوناچی صادق و متناسب با یکدیگر است اما در این وضعیت تناسب بین دو بازوی AB , CD نه کاملاً مساوی بلکه بر اساس نسبت های مشخص و تعریف شده ای از فیبوناچی مجدداً تعریف میشود.

دو نسبت مهم و تعیین کننده ای که دو بازوی AB , CD در این مواقع با یکدیگر میسازند عبارتند از:

AB=CD 127 و یا 161 AB=CD

زمانی که دو طول CD , AB در یک پترن با هم برابر نیستند میبایست وضعیت اونها رو در دو حالت فوق در نظر گرفت و در صورتیکه به میزان 127 یا 161 فیوناچی از هم بودند باز هم تناسبی ایده آل از جنبه نسبت های فیوناچی بینشان حاکم است و برای تشخیص ناحیه احتمالی تغییر روند میتوان از آنها استفاده کرد.

در ادامه به بررسی دو وضعیت صعودی و نزولی این نسبتهای میپردازیم:

Alternate Bullish 1.27 or 1.61 AB=CD

همانطور که گفته شد پس از اینکه روند از ناحیه AB=CD عبور کرد از این وضعیت برای تشخیص ناحیه بعدی در روند که پتانسیل بالایی برای تغییر روند دارد استفاده میکنیم که در این حالت این نواحی عبارتند از 1.27 و 1.61 به نسبت بازوی AB

و وقتی که روند قیمت از ناحیه AB=CD عبور کرد میبایست در این نواحی به دنبال نشانه ای از برگشت روند باشیم که همونطور که میدانیم بهترین تکنیک پیدا کردن تریگر (نقطه ورود) توسط کندل ها است.

برای وضوح بیشتر اینگونه وضعیت ها لطفا به چارت زیر دقت کنید:

پیش از هر چیز...

بعضی از عزیزان نگران پیچیدگی ظاهری شکل نشوند که گام به گام به بررسی و تحلیل وضعیت میپردازیم:

در ابتدا به نسبت بزرگ شکل که برابر 61 فیو و برای نقاط X , A است کاری نداشته باشید و تنها به سمت راست تصویر و دو نسبت کوچک توجه کنید.

با نگاهی سطحی مشخص است که در ناحیه ای که روند برگشته است دو بازوی CD , AB با هم برابر نیستند اما آیا زمانی که روند قیمت از ناحیه AB=CD عبور کرد راهی بود که بتوانیم ناحیه بازگشت روند را پیش از وقوع آن تشخیص بدهیم ؟

پاسخ مثبت است.

حال مرحله ای که قبلا گفته ایم رو با هم گام به گام مرور میکنیم:

پس از اینکه روند قیمت از ناحیه AB=CD عبور کرد میبایست نواحی 1.61CD , 1.27AB را محاسبه (با نرم افزار متاتریدر به سادگی صورت میگیرد) و در چارت مشخص کنیم.

تا اینجا تنها نسبت های آتی و احتمال بازگشت روند در دو ناحیه را شناسایی کرده ایم.

اما برای تشخیص اینکه کدامیک از دو نسبت 1.27 و یا 1.61 صحیح عمل خواهد کرد (دقت کنید که هنوز روند به این دو ناحیه نرسیده و ما اطلاع نداریم قیمت در کدام ناحیه واکنش نشان میدهد و برمیگردد) چارت را از نمایی دورتر مشاهده میکنیم (حالا به سمت چپ چارت توجه کنید) و میبینیم که در روند دراز مدت (دقت کنید که چارت هفتگی است) ما یک ریتریس مهم 61 فیوناچی را شاهد هستیم در واقع این چارت در نمایی دورتر به ما نسبت ریتریس مهم 61 را در طول XA نمایش میدهد که میبینیم این نسبت 61 با نسبت BC 161 نزدیک به هم بوده و اصطلاحا کانورجنس دارد.

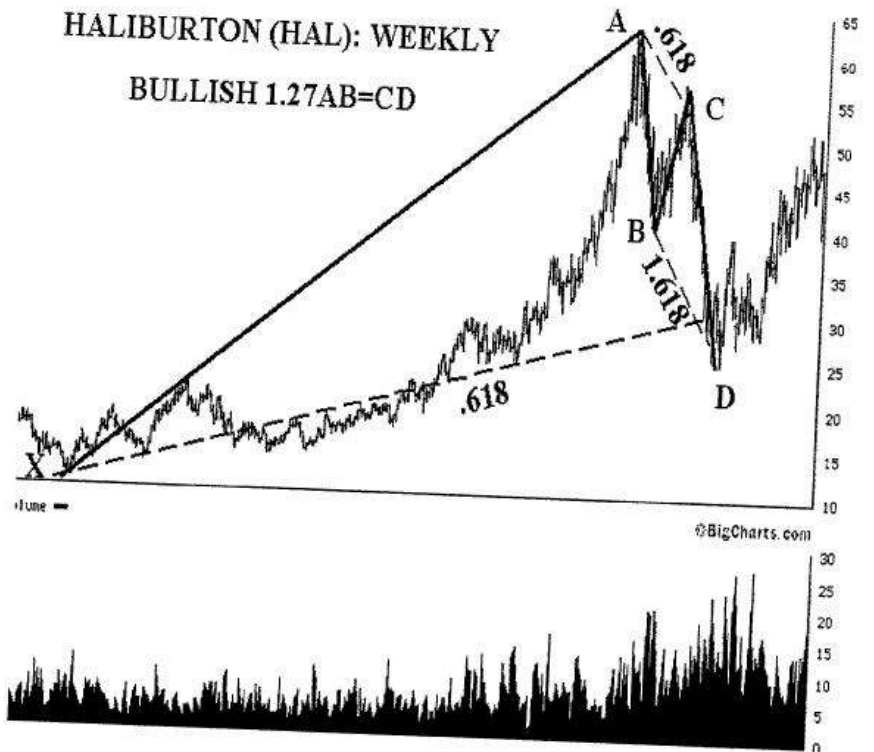
علاوه بر این اگر نسبت 1.27 AB را محاسبه کنیم میبینیم که آن هم در ناحیه نسبت ریتریس 61 XA و 1.61 BC قرار دارد (به

این تکنیک اصطلاحاً پروجکشن گفته میشود که به بیان ساده : مقدار طول AB را محاسبه و از انتهای BC این مقدار را اضافه میکنیم و میزان پروجکشن AB بدست میآید)

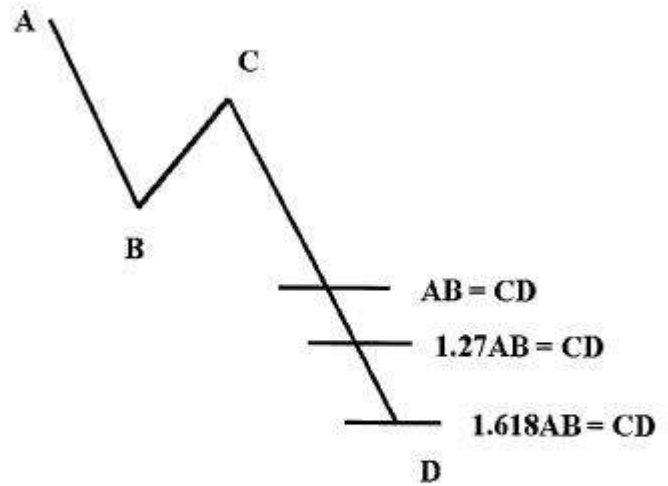
زمانی که در تحلیل چارت ها میبینیم که چندین نسبت فیبوناچی (در این مثال 1.61 و 1.27AB , BC و 61 (XA) در يك ناحیه نزدیک به هم قرار گرفته اند میتوان به سادگی احتمال بازگشت روند را تشخیص داد و به این شکل است که زمانی که دیدیم روند قیمت از ناحیه $AB=CD$ عبور کرد با توجه به نواحی 1.27 یا 1.61 به بررسی پتانسیل های برگشت روند میپردازیم و سپس با بررسی چارت در دورنمای بیشتر میتوانیم با یافتن نسبتهای دیگر فیبوناچی (در این مثال 61 (XA) به یافتن ناحیه ای میپردازیم که این نزدیکی نسبتها بیشتر باشد) یافتن این نوع نسبتهای فیبوناچی در بازهای زمانی طولانی تر به سادگی توسط اندیکاتور زوپ صورت میگیرد) و در نتیجه آن به تشخیص احتمال قوی بازگشت روند موفق خواهیم شد.

در ادامه با ذکر مثالی به بررسی وضعیت نزولی در این حالتهاى جانشین خواهیم پرداخت .

ایران بورس آنلاین
www.iranbourseonline.com



www.iranbourseonline.com



BULLISH 1.27 OR 1.618 AB = CD

BUY AT POINT D!

توضیح: کلیه فصولی که در ابتدای آن مشخص شده است (نظیر فصل 18) حاصل زحمات دوست عزیزم امیر مقدم است که زحمت ترجمه این فصول ارزشمند کتاب آقای اسکات کارنی رو متقبل شدند که در اینجا مجدداً از ایشان تشکر میکنم.

فصل 18

بررسی سهام

من صدها سهم را در طول هفته بررسی می‌کنم. شاید فکر کنید که دنبال کردن این کار بسیار زمانبر است، اما اگر چشم شما برای پیدا کردن این پترن‌ها ورزیدگی کافی را پیدا کرده باشد با صرف وقت کمی به این کار خواهید پرداخت. در واقع؛ بسیاری از سایت‌های اینترنتی امکان دسترسی دقیق به چارت‌های سید سهام را نمی‌دهند و فقط اجازه کلیک برای خرید و فروش را دارند. بنابراین من به شما پیشنهاد می‌کنم در ابتدا ترتیبی اتخاذ کنید تا به چارت‌های سهام مختلف بسهولت دسترسی پیدا کرده از آنها استفاده کنید.

بعد از صرف وقت لازم و کار بر روی پترن‌ها، پیدا کردن آنها بسیار آسان خواهد شد. هرچه بیشتر تمرین کنید؛ پترن‌های بیشتری را شکار خواهید کرد. اولین قدم زمانی برداشته شده است که شما توانسته باشید پترن‌های پایه را تشخیص دهید. انتظار تشکیل پترن در هر روز و یا در هر هفته از یک سهم، غیر معقول است. این متد تردینگ، احتیاج به صبر و بردباری دارد. اگر پترن واضحی تشکیل نشده باشد؛ پیشنهاد من این است که صبر کنید تا آن پترن شکل بگیرد.

اگر پترن واضحی وجود نداشته باشد مساله مقاومت و پایداری شما در برابر اضطراب ورود به بازار، از اهمیت بالایی برخوردار می‌گردد. این مساله باید در ذهن شما نقش بسته و بعنوان عادت درآید که پترن هارمونیک فقط نشاندهنده یک فرصت بوجود آمده است. مارک داگلاس در کتاب Disciplined Trader پیشنهاد کرده است که: "فکر کنید تردی انجام نداده اید، همانطور که پولاتان را در جیب خود قرار داد می‌دهید." من هم با او هم عقیده هستم.

تمام تردی‌هایی که بر پایه استراتژی پترن‌های هارمونیک مورد نظر شما بنا نهاده نشده باشد در زمره تردی‌های تصادفی و شانسی جای می‌گیرد. اگر عملکرد شما به این جهت انحراف پیدا کرد، نتیجه می‌گیریم شما در حال گم کردن راه و روش خود هستید. در بسیاری از اوقات من معاملات بی پایه و اساس انجام دادم و واقعاً نتیجه اش بصورت نکت باری پدیدار شد. در واقع؛ هر موقع من در حرکات آنی بازار اقدام به خرید و یا فروش کردم، تردی‌هایم به ضرر تبدیل شد! پس نتیجه می‌گیریم که اگر شما پترن هارمونیک را پیدا نکردید؛ ترد نکنید!

اگر شما پیدا کردن پترن را با سرعت خوب و در زمان کوتاه انجام دهید، بررسی چارت‌های مختلف برای شما آسان خواهد بود. در اینصورت؛ تشخیص پترن بالقوه در هر سهم فقط چند دقیقه بطول خواهد انجامید. نکته کلیدی در تعیین پترن؛ پیدا کردن الگوی $AB=CD$ ای می‌باشد که در حال شکل گیری است. با توجه به اینکه الگوی $AB=CD$ ، پایه الگوهای ترکیبی هارمونیک است؛ پس بررسی سریع بازار با گشتن این الگو آسان می‌گردد. پس اگر در جایی بازوهای قیمتی، بوضوح دیده شد، می‌توان الگوی $AB=CD$ را در آن بررسی کرد. یک نکته مهم قابل ذکر اینکه؛ الگو را تحت فشار قرار ندهید.

بعد از اینکه پدید آمدن یک الگوی هارمونیک بالقوه را به خود اعلام کردید، شما می‌توانید اقدام به محاسبه رتیب‌های فیبو برای پیدا کردن منطقه برگشتی Reversal Zone شوید. منطقه برگشتی باید حداقل دارای دو عدد (نسبت فیبو) باشد و البته نظر من بر روی حداقل سه عدد است. با تمرین بسیار و دیدن پترن‌های متعدد؛ چشم شما ورزیدگی و توانایی تشخیص مناطقی که نسبت‌های فیبو در آن محدوده تشکیل می‌شود را پیدا خواهد کرد. تا جائیکه شما با چشم خود قادر به فرق گذاشتن بین نسبت‌های 0.618 و 0.786 خواهید بود. و یا در یک حرکت قابل توجه بازار می‌توانید نسبت 1.618 را تشخیص دهید. ورزیدگی چشم در محاسبه نسبت‌های فیبو، یکی دیگر از ابزارهای شما برای بررسی سریع چارت‌ها می‌باشد.

بعد از تشخیص پترن و تعیین منطقه برگشتی؛ مرحله مهم بعد مطالعه رفتار قیمت‌ها در قبل از شکل گیری پترن است.

هرچند محاسبه و بررسی تمام نسبتها ضروري نیست ولي دیدن رفتارهاي هارمونيک قبلي بسيار مفيد است. پس دیدن و بررسی نسبتهاي اصلي فيبو در رفتارهاي قبلي بازار مهم است. اگر نسبتهاي قبلي در این پترن جديد نیز تکرار شود؛ حاکی از قدرت گرفتن احتمال عمل کردن این الگو می باشد.

اگر سهامی دارای تمام شرایط لازمه پترن هارمونيک بود؛ مساله مهم بعدی تدارک دیدن ترید است. ابتدا از چارت پرنین گرفته سپس ساختار پترن را روی آن بکشید. نسبتهاي دقیق فيبو را بر روی آن مشخص کنید. با اینکار عملکرد قیمت در منطقه برگشتی را بهتر بررسی خواهید نمود .

تدارک ترید یکی از موارد ضروري برای تضمین یک ترید می باشد. بنابراین منظور من از موفقیت آمیز بودن؛ رفتار یکسان هر ترید نیست. تا زمانیکه می دانیم ممکن است هرچیز در بازار اتفاق بیفتد؛ مهم این است که خود را از قبل برای هر رفتاری در بازار آماده کرده باشیم. با شناخت تشکیل یک پترن هارمونيک و محاسبه نسبتهاي فيبو؛ یک موقعیت بالقوه را شناسایی کرده ایم. اما؛ فاکتور مهم در اجرای یک استراتژی مشخص کردن این مساله است که آیا این ترید ارزشمند است یا نه.

دقت به نکات هشداردهنده ای که در این کتاب توضیح داده شده است ضروري می باشد. برای ورود بموقع و موفقیت آمیز در اجرای ترید؛ باید روابط قیمتی بازار، زمان و عملکرد قیمت در منطقه برگشتی مورد توجه قرار گیرد. بطور مثال، زمانیکه قیمت در منطقه برگشتی حرکتی سریع از خود نشان می دهد؛ می فهمیم که ممکن است حالا فرصت خوبی برای اجرای ترید نمی باشد. و یا قیمت در حال رسیدن به نسبت دیگری از پترن هارمونيک ما می باشد. بنابراین؛ تعیین حوزه فعالیتی قیمت در منطقه برگشتی قیمت بسیار مهم است.

The Harmonic Trader
Scott M.Carney
chapter 18

ایران بورس آنلاین
www.iranbourseonline.com

پی نوشت:

مطالب بالا نکات ارزشمندی در زمینه درک عمیقتر این پترنها ارائه میکند که در مواردی مختصر توضیحی به آن اضافه میشود :

دو نکته یکی اینکه منظور از جمله مارک داگلاس این است که زمانی که ترید نمیکنید به خودتون بگید که انگار پولتون رو در جیتون حفظ کردین و مانع از بین رفتنش شدین و به این ترتیب با وسوسه ترید احساسی مقابله کنید.

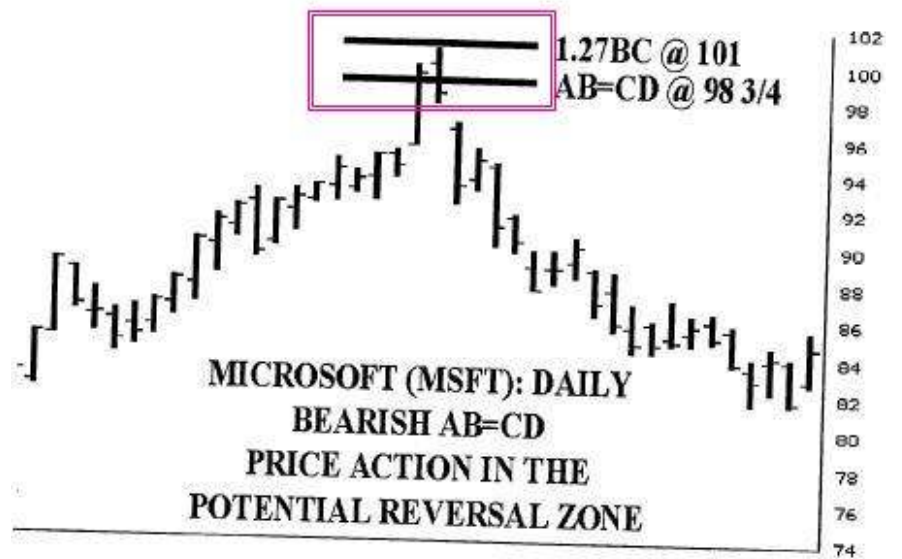
دوم اینکه در جایی گفته شده بود پترن رو تحت فشار قرار ندین که منظور این است زمانی که پترنی نسبتهاي دقیق فیبوناچی در اون حاکم نیست سعی نکنید با توجه و از این قبیل مسایل به زور بگید که این پترن فیبوناچی است نه... تنها بروی پترن هایی ترید کنید که نسبت های دقیق فیبوناچی (و نه تقریبی) برویش حاکم است.

سوال :

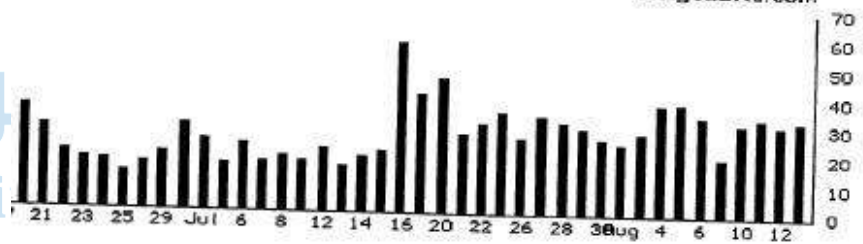
با توجه به شکل های زیر چرا در شکل دوم دوتا خط یکی برای $AB=CD$ و یکی برای $BC=1.27$ رسم شده؟ مگه این دوخط از لحاظ محاسبات ریاضی نباید همیشه روی هم منطبق باشند؟ مگه اون نسبت 1.27 پروجکشن BC نیست؟

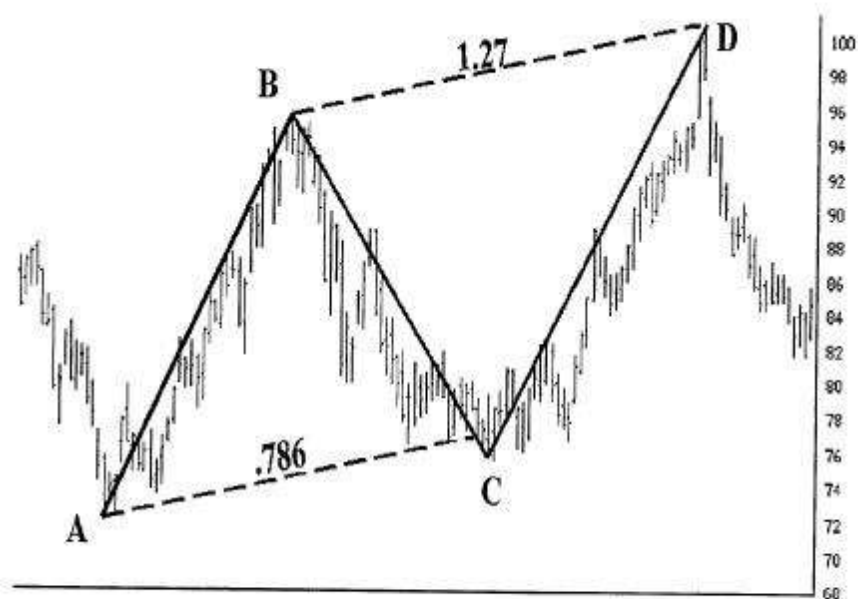
البته این ها همون عکس هایی هستش که خودتون به عنوان مثال آوردین روش توضیح دادین .



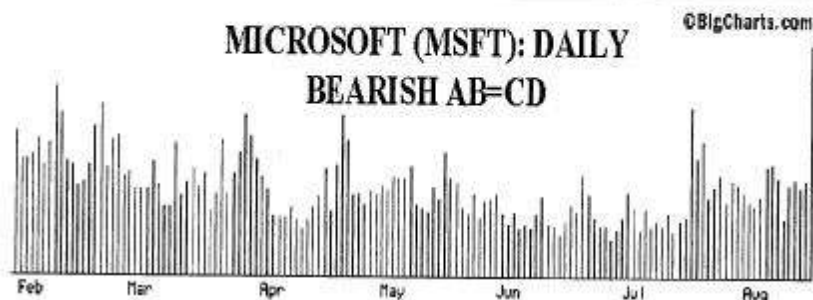


www.i





ایران
www.i



دوست عزیز این سوال شما دو جواب داره

یکی کوتاه مختصر و انشالله مفید!

و دیگری مربوط به پروجکشن خاصی میشه که انشالله در بحث پترن گارتلی بهش میپردازیم.

پس فعلا در حد پاسخ اول:

همونطور که توجه داشتید وقتی نسبتهای 61-161 و 76-127 شکل میگیره در واقع باید نسبت $AB=CD$ هم برقرار باشه اما گاهی طول بازوی BC کمی بلندتر از نسبت فرضا 76 میشه...

در کتاب قدیم کارنی ایشون این وضعیت ها رو هم 76 در نظر میگرفتند و خوب چون کمی نسبت طول BC پایینتر از 76 قرار گرفته بود به طبع کمی در انتهای نقطه D با نسبت فرضا 127 اندازه اش متفاوت میشد و کمی پایینتر قرار میگرفت.

چارتهایی نظیر این باعث شد که کارنی به همکاری یکی از دوستانش بروی نسبت 88 وقت زیادی بگذارند و در نهایت این

نسبت رو بطور کلاسه شده و مدون معرفی کنند.

در کتاب جدید کارنی این نسبت نقش زیادی در این موارد دارا است که انشالله در بررسی پترن خفاش بیشتر بهش میپردازیم .

توضیح : همانطور که گفته شد فصول مشخص شده توسط دوست عزیزمون امیر مقدم ترجمه شده است که برخی از فصول مهم کتاب خارج از ترتیب بحث ارایه شده است که با اینحال مفید و باعث درک عمیقتر پترنهای هارمونیک میگردد:

فصل اول :

Harmonic Trading
The Harmonic Trader
By Scott M. Carney

هارمونیک تریدینگ روشی است که از تشخیص الگوهای قیمتی خاص و اعداد فیبوناچی برای تعیین مناطق با احتمال بالای بازگشت قیمت در سهام بهره می برد. این روش فرض می کند که الگوها و چرخه های معاملاتی مانند تعداد زیادی از الگوها و چرخه ها در حیات، خودشان را تکرار می کنند.

کلید و راهنما شناسایی این الگوهاست و وارد شدن یا خارج شدن در یک موقعیت که این موقعیت با درجه بالایی از احتمال به روی این اصل استوار است که مشابه رفتار قیمتی که در گذشته اتفاق افتاده در آینده نیز اتفاق خواهد افتاد. اگرچه این الگوها 100 درصد صحیح عمل نمی کنند اما این الگوها به مرور زمان به اثبات رسیده اند. اگر این الگوها به درستی شناسایی شوند شما می توانید فرصت های قابل توجهی با یک ریسک بسیار محدود کشف کنید.

یکی از ابتدایی ترین منابع برای هارمونیک تریدینگ به وسیله J.M Hurst در دوره های آموزشی اش در اوایل 1970 پدید آمد. مهمترین مفهوم قابل درک در این دوره ها این بود که موج های قیمت به یکدیگر وابسته می شوند. از این گذشته، اعداد فیبوناچی و الگوهای قیمت این وابستگی را فاش می کنند و ابزاری را برای تعیین محلی که بازگشت قیمت اتفاق می افتد فراهم می آورند.

زمانی که این نقاط بازگشت به درستی مشخص شوند، ترید در یک سطحی از قیمتی که در حال بازگشت است انجام می شود. این نوع ترید کردن زوال یا قدرت گرفتن خرید و فروش را محترم می شمارد. و این چنین معاملات در هماهنگی با بازار صورت می گیرد. برای مثال زمانی که یک سهم در نقطه بازگشت خریده می شود، اکثریت فروش هایی که قیمت را رو به پایین تحریک کرده اند به خاتمه خود بسیار نزدیک هستند. به طور کلی اغلب روش های هارمونیک معاملات را در نقاط بازگشت یا خیلی نزدیک به نقاط بازگشت تشخیص می دهند. زمانی که این معاملات در نقاط بازگشت معتبر ثمر داد، شما طبیعت چرخشی حقیقی حرکت قیمت را درک خواهید کرد.

مهم است که توجه کنید تحلیل هارمونیک به روی همه تایم فریم ها اعم از ساعتی، روزانه، هفتگی و ماهانه کار می کند. من معتقدم که واضح ترین فرصت برای سوئینگ تریدرها و پوزیشن تریدرها روی تایم فریم روزانه پدیدار می شود. اگر چه نمودارهای ساعتی موقعیت های فوق العاده ای را برای تریدهای کوتاه مدت تر یا دی تریدرها فراهم می آورد. حیرت آور است که این روش روی نمودارهای بلند مدت تر هم به همان خوبی کار می کند. نمودارهای هفتگی یا ماهانه مقیاس فوق العاده ای هستند از مناطق به طور تاریخی بحرانی برای سهام. همانطور که خواهید دید این روش رفتار قیمت را در هر وضعیتی بطور موثر مورد آزمایش و اندازه گیری قرار خواهد داد.

و اما مهمترین مفهوم برای یادآوری درباره هارمونیک تریدینگ این است که شما به چرخه های طبیعی بازار احترام می گذارید. یکبار که شما قادر شوید این نقاط بازگشت را تشخیص دهید و این تریدها را بطور موثر انجام دهید، درک خواهید کرد که نوسان قیمت سهام فقط چرخه های صعود و نزول قیمت هستند. بعد از اینکه این چرخه ها توانستند به وسیله روش شناسایی اعداد فیبوناچی و الگوی های قیمتی تایید صلاحیت شوند، ترید کردن با محترم شمردن آهنگ طبیعی بازار ممکن می شود. به علاوه شما درک خواهی کرد که اینجور تجزیه و تحلیل بطور حقیقی تنها وسیله برای فهم و درک رفتار قیمت یک سهم و تعیین فرصت های ترید بالقوه است .

ایجاد یک پلان معاملاتی

قوانین معاملاتی

ترید کردن بطور موافق و سودده به قوانین ویژه ای محتاج است تا فرصت ها را معین کند و ما را به سوی اقدامات بهینه راهنمایی کند. قوانین معاملاتی ما را از رفتار غیر منطقی برحذر می دارد که این رفتار غیر منطقی می تواند یکدفعه و به طرز ناگهانی وارد معامله شدن باشد. ترید کردن به طرز ناگهانی واقعا فقط حدس و گمانه زنی است. درست است من هم اعتراف می کنم که دچار چنین اشتباهی می شوم. هرچند قوانین معاملاتی موثر و کارا، همانطور که توسط تکنیک های هارمونیک تعریف شد، من را به یک سیستم که خود را بارها به اثبات رسانیده، تجهیز کرده است .

اگرچه این تکنیک ها در یک ناحیه بازگشتی همیشه بازدهی ندارند، اما من معتقدم که یک حالت عالی و ممتاز (وجود سه یا بیش از سه نسبت فیبوناچی در ناحیه بازگشتی) در هفت بار از ده بار به ثمر خواهد نشست. این یک ارزیابی شخصی است هرچند من در حقیقت آن را یک برآورد محافظه کارانه می دانم. پس از مطالعه تعداد بسیار زیادی از نمودارهای موجود در این کتاب، باید مشهود باشد که این تکنیک ها بطور باورنکردنی در تعیین فرصت ها موثر هستند .

اقدام) کارهای قبل از دستور ترید ()

اگرچه این تکنیک برای کشف محل های بازگشتی در سهام به اثبات رسیده بود، اما به عنوان یک تریدر، این اقدام درست و شایسته در یک موقعیت ترید است که موفقیت یا شکست شما را رقم خواهد زد. راه درست برای انجام اقدامات موفق، تحلیل رفتار قیمت در ناحیه بازگشتی است. حالت های هارمونیک زیادی ممکن است در یک ناحیه بازگشتی به درستی عمل نکنند. مثال سابق America Online یک مثال خوب از یک حالت بسیار هارمونیک بود که بطور ایدآل در ناحیه بازگشتی عمل نکرد .

در مورد AOL ، حرکت قیمت قبل از اجرای دستور ترید بسیار گمراه کننده بود. سهم در مجموع در طی 50 واحد معامله شد . در ابتدا بیش از 20 واحد کاهش یافت و سپس حدود 30 واحد در سه روز بعد افزایش یافت . هرچند قیمت از ناحیه بازگشتی عبور کرد، اما موقعیت بازم با یک صعود قابل توجه به ثمر نشست .

این مثال، عقیده و تفکری را روشن ساخت که می گوید: « در بازار سهام هر چیزی می تواند اتفاق بیافتد.» بازار هر کاری که بخواهد و در هر زمانی که بخواهد انجام خواهد داد! آماده بودن برای چنین عدم قطعیتی موفقیت بزرگ تر را تضمین خواهد کرد. بنابر این ضروری است که رهنمودهایی را برای عملکرد و رفتار مناسب و محتاطانه در این وضعیت ها تدارک بینیم .

قوانین معاملاتی رفتار شما را در سرتاسر سلسله مراحل ترید کنترل خواهند کرد، مخصوصا نظر به اینکه این وضعیت های ترید می توانند شدیداً احساسی باشند. گاه گاهی عنصر احساس می تواند منجر به اقدامات ناگهانی و معیوب شود. مخصوصا احساسات ناشی از ترس و طمع می تواند باعث شود که شما خیلی زودتر از موعد مقرر وارد بازار شوید یا خیلی زودتر از موعد مقرر از بازار خارج شوید .

من بیش از اینکه من را راضی کند در انجام معاملات اشتباه کرده ام. بسیاری از اوقات بوده که من سهم هایی را خریدم در حالی که باید می فروختم. همچنین اوقات دیگری بوده که من روی سهمی برای سود بیشتر صبر کردم، اما به جای سود بیشتر تمام سود قبلی را هم از دست دادم. من فقط می خواهم بگویم شما قصد دارید که مرتکب اشتباه شوید. این یک قسمت از سلسله مراحل یادگیری است. ولیکن، راه هایی برای بهتر کردن معاملات و جلوگیری از اشتباهات آینده وجود دارد .

طرح یا پلان معاملاتی

یک پلان معاملاتی شخصی همان سیستم خودتان است که موفقیت را برای شما تضمین خواهد کرد . مهم است که شما طرحی برای یورش بردن به سمت بازار داشته باشید. پلان معاملاتی به شما کمک خواهد کرد تا فرصت های سودآور را شناسایی کنید و تصمیمات معاملاتی بهتری بگیرید. من پلان معاملاتی خودم را که برای تحلیل موقعیت ها از آن استفاده

می کنم قرار داده ام. قبل از اینکه من تریدی انجام دهم، سهم مورد نظر را بر اساس این فهرست سوالات مورد ارزیابی قرار می دهم .

- 1- آیا الگویی وجود دارد؟
- 2- آن الگو چیست؟
- 3- آیا یک $AB=CD$ وجود دارد؟
- 4- این الگو کجا کامل می شود؟
- 5- آیا سه یا بیش از سه نسبت فیبوناچی در ناحیه بازگشتی گردهم آمده اند؟
- 6- آن ها چه نسبت هایی هستند؟
- 7- چه چرخه یا تناسب زمانی در حال پیشنهاد است؟
- 8- آیا علامت هشدار وجود دارد؟ (گپ یا شکاف قیمتی، کندل بیش از اندازه بلند، کندل فاقد سایه یا شادو)
- 9- پس از کدام نقطه دیگر ناحیه بازگشتی معتبر نیست؟(استاپ لاس)
- 10- آیا من راضی می شوم در مورد این پترن ریسک کنم؟

اگر موقعیت هایی که کشف نموده اید تا انتهای این سوالات تاب بیاورند و شما مایل به پذیرفتن ریسک معامله باشید این معامله احتمالاً یک مورد معتبر خواهد بود .

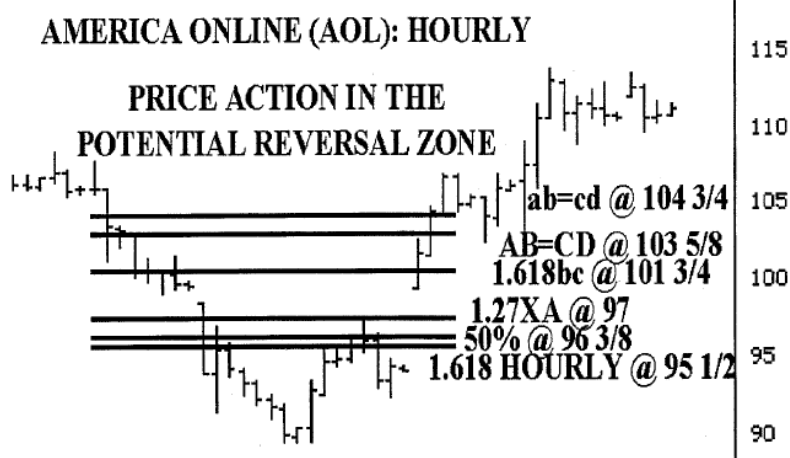
ملزومات معامله

شرایط معدودی وجود دارد که من برای غریب کردن موقعیت ها در ناحیه بازگشتی از آن ها استفاده می کنم. زمانی که به دنبال موقعیت های بالقوه هستم، مهم است دنبال کردن سهم هایی که بسیار سیال و روان هستند (سهم هایی که تعداد یک میلیون از آن ها بطور میانگین در روز خرید و فروش می شوند). هرچند من رفتار بسیار هارمونیک در قیمت سهم هایی که تعداد چند صد هزار عدد در روز معامله می شوند، رصد کرده ام. اما قویا پیشنهاد می کنم که شما به کمپانی های بزرگ بچسبید و روی آن ها متمرکز شوید. همچنین مهم است به کمپانی های با سرمایه بالا که بارها در خبرها ذکر می شوند، توجه کنیم. گروه هایی از قبیل Dow Industrial ، NASDAQ 100 و NYSE موقعیت های بالقوه ای را برای یافتن فرصت های ترید فراهم می آورد، همچنین من بارها سهم هایی را که در فعال ترین حجم معاملاتی هستند، بازبینی می کنم .

ملزومات

- 1- سهم های سیال (بالغ بر یک میلیون سهم معامله شده در روز)
- 2- حداقل تایم فریم نمودار 30 = دقیقه: نمودارهای روزانه و هفتگی باید برای تعیین جهت ترند و سایر مفاهیم قیمتی بزرگ تر مورد رجوع واقع شوند .
- 3- دفتر معاملات روزانه: معاملات باید قبل از بازگشایی بازار یا روز قبل آماده شوند: باید رفتار و وضع معامله و همچنین رفتار ما در مواجهه با آن ثبت شود .
- 4- ثبت کردن نمودار: دنبال کردن هر ترید، من باید نقطه ورود و خروج، سود/زیان و سایر تفاسیر ثبت شده روی نمودار را پرینت بگیرم .
- 5- ثبت سراسری معاملات-منحنی سرمایه: من باید همیشه از منحنی سرمایه شخصی ام با خبر باشم تا از روی آن میانگین برد/باخت، تایم فریم ها و افت سرمایه ام را استخراج کنم .

این قوانین یک تکنیک موثر و نامتناقض تشخیص دادن فرصت ها، را برای ما فراهم می کنند. مهم است که پلان معاملاتی خود را گسترش دهید. آن پلان می تواند شبیه به این باشد یا می تواند سایر قوانین و تکنیک هایی که شما خلق می کنید تا در زمان ترید مصمم باشید، را نیز دربر بگیرد .
سابقا شما یک پلان برای انجام معامله ایجاد کرده اید، شما به یک پلان برای تشخیص زمان کسب سود یا تعیین حد ضرر هم نیاز دارید. دانستن زمان کسب سود یا تعیین حد ضرر می تواند مشکل باشد، مخصوصا زمانی که شما اقداماتی را از قبل برای مواجهه با آن طراحی نکرده اید .



Chapter 21

Guaging The Profit Potential

The Harmonic Trader

By Scott M Carney

ایران بورس آنلاین
www.IranBourseOnline.com

اندازه گیری پتانسیل سود

هنگامی که ترید ما در یک ناحیه بازگشت معتبر (PRZ)، وارد سود شد دانستن اینکه چه موقع با سود مناسب از بازار خارج شویم احتمالاً یکی از مشکل ترین تصمیمات در ترید است. اگرچه این تصمیم به طرز تفکر شخص بستگی دارد، اما قوانین خروج از پوزیشن می تواند تصمیمات شما را در مواجهه با ترید، بهتر و کامل تر کند. توانایی شما برای کسب سود مناسب (take profit)، موفقیت یا شکست شما را تعیین خواهد ساخت. بنابر این تدوین قوانینی که کمک کند با کمترین ضرر از بازار خارج شوید یا اجازه دهد تا پوزیشن سود بیشتری کسب کند، می تواند بسیار مهم باشد .

پایداری و ثبات

به عقیده من مهمترین تفکر در معامله، سود کردن بطور مداوم و پایا در دراز مدت است. البته کار آسانی نیست و احتیاج دارد به اینکه شما فرصت های سودآور را به درستی تشخیص دهید سپس بطور موثر ترید کنید و نتیجتاً سود مناسب را کسب کنید. شما می توانید به طور مداوم سود کنید به شرطی که رفتار خود را از قبل در هنگام مواجهه با مسائل گوناگون مشخص کنید تا بطور ناگهانی و احساسی تصمیم نگیرید. تدوین یک پلان برای کسب سود مناسب کمک خواهد کرد تا شما پایداری و ثبات سود خود را افزایش دهید .

بعضی از بهترین تریدهای من زمانی بوده که من سود بسیار ناچیزی کسب کردم. وقتی که سهمی در آن جهتی که باید حرکت کند، حرکت نمی کند من خیلی نگران می شوم. البته من می خواهم که خود ترید برای من تدبیری بیاندیشد و مشکل را حل کند. هرچند فائق آمدن بر این مشکل که همانا، انتظار برای حرکت بازار در جهت دلخواه من و بر خلاف واقعیت چیزی که در حال رخ دادن است، می تواند بسیار دشوار باشد .

مارک داگلاس نویسنده کتاب های The Disciplined Trader و Trading In The Zone یک متخصص در اینگونه شرایط است. من شدیداً شما را به خواندن این دو کتاب توصیه می کنم. او بطور واضح روانشناسی لازم برای موفق بودن را شرح می

دهد و بر ضرورت قوانین معاملاتی تاکید می کند، همینطور بر ضرورت ابزار، برای موفق بودن بطور مداوم در بازار .
 من در معاملاتم بطور دائم موفق نبودم تا اینکه قوانین معاملاتی ام را تدوین کردم و گسترش دادم. اگرچه من قوانین
 معاملاتی خودم را قرار داده ام، اما شدیداً شما را تشویق می کنم که خودتان برای خودتان قوانینی را طراحی کنید. این به
 معنای این است که شما باید قوانین را رعایت کنید. این کار می تواند مشکل باشد چرا که احساسات مخربی چون ترس و
 طمع می توانند رفتار معاملاتی شما را تحت تاثیر قرار دهند .

قوانین خروج

زمانی که من در حال آماده شدن برای خروج از یک پوزیشن هستم چند قاعده و قانون را مد نظر قرار می دهم. من فاصله
 بین نسبت های فیبوناچی را محاسبه می کنم چرا که این نسبت ها می توانند به عنوان نقاط بازگشت آینده عمل کنند.
 این فاصله شامل هر دو نسبت های اولیه و ثانویه فیبوناچی می شود. این نسبت ها عبارتند از: $0/382$ ، $0/50$ ، $0/618$ ،
 $0/786$ ، $1/00$ ، $27/1$ و $1/618$. برای مثال، اگر من یک سهم را در یک موقعیت مناسب در چارت روزانه خریدم، فاصله بین
 سقف (high) قبلی و کف (low) اخیر را محاسبه می کنم تا نسبت های فیبوناچی بالا را لحاظ کنم. سپس حرکت قیمت را
 در هنگام بالا رفتن در بین این نسبت ها مورد بررسی قرار می دهم. اگر قیمت در سر راه خود از یکی از این نسبت ها
 مقاومتی دید، من معمولاً سودم را می گیرم و پوزیشن را می بندم و به دنبال موقعیت مناسب دیگری می گردم. اگرچه این
 اقدامات وابسته به رفتار قیمت در خارج از ناحیه بازگشتی است .

روش های تعقیب

پس از اینکه من تریدی انجام دادم، از یک روش بسیار ساده برای تعیین طول مدت ماندنم در پوزیشن استفاده می کنم. این
 روش بر اساس تجزیه تحلیل ادامه حرکت قیمت پس از بازگشت از ناحیه بازگشتی است .
 همانطور که تصاویر زیر نشان می دهد، حرکت قیمتی که در جهت واضح ادامه پیدا می کند، باعث می شود که من
 همچنان در پوزیشن بمانم. مثلاً در هنگام خرید، اگر قیمت سهم در خارج از ناحیه بازگشتی افزایش یابد و به ساختن
 higher high ها و higher low ها ادامه دهد، من همچنان در پوزیشن خواهم ماند. اگرچه ممکن است این کار تقریباً ساده و
 ابتدایی به نظر برسد، اما تعداد زیادی از موقعیت های هارمونیک در بازگشت هایی سریع و ادامه دار به ثمر می نشینند .

زمانی که یک سهم صعود می کند، من مناطقی را که نسبت های بحرانی فیبوناچی در آنجا وجود دارند را به دقت بررسی
 می کنم. اگر قیمت از یکی از این نسبت ها شروع به بازگشت کند، من پوزیشن را خواهم بست. گاهی اوقات، من نیمی
 از پوزیشن را می بندم و به ما بقی اجازه ادامه کار را می دهم .

دیگر فاکتور مهم در کسب سود بررسی نوارهای قیمتی یا کندل های پیشین است. مثلاً در هنگام خرید، اگر من در حال
 استفاده از چارت روزانه هستم، دوست دارم به دقت بالاترین، پایین ترین، آغاز و پایان قیمت های روز قبل را نگاه کنم. بطور
 ایدآل من دوست دارم هر چهار مولفه بالاتر از روز قبل باشند. اگرچه وضعیت ایدآل همیشه اتفاق نمی افتد. بنابراین،
 ارزیابی این مولفه ها به عنوان ابزار تعیین محل های کسب سود، مهم است .

من معتقدم که کمترین و بیشترین قیمت (high,low)، در نشان دادن روند آتی یک سهم بسیار مهم هستند. مثلاً هنگام
 خرید، اگر قیمت بتواند یک قله جدید بسازد، من این رفتار قیمت را بسیار پرمعنی قلمداد می کنم. همچنین قیمت می تواند
 بالای کمترین قیمت روز قبل بماند که بر حرکت قوی قیمت اشاره دارد .

low و high مهم هستند، وقتی که به open و close ملحق شوند. همانطور که سابقاً گفته ام، کندل های صعودی و
 نزولی، طبیعت معامله را در طول یک دوره خاص از زمان نشان می دهد. مثلاً در هنگام خرید، سهمی که یک قله جدید در
 مقایسه با قیمت در روز قبل بسازد، می تواند قوی بشود. من می گویم که "می تواند قوی بشود"، زیرا قدرت حرکت قیمت
 وابسته به طبیعت کندل یا نوار قیمتی است. اگر کندل یا نوار قیمتی صعودی است، من در پوزیشن خرید خواهم ماند. اگر
 قیمت به یک کندل نزولی ختم شود در حالی که یک قله جدید ساخته است، من به قدرت حرکت بسیار ضنین خواهم شد .
 پس منتظر کندل بعدی خواهم ماند تا ادامه حرکت را بررسی کنم و زمانی که حرکت قیمت بطور بالقوه ضعیف است برای
 خروج از پوزیشن آماده خواهم شد .

سنجیدن مولفه های حرکت قیمت در ترکیب با نسبت های فیبوناچی می تواند نواحی خوبی را برای کسب سود مناسب
 نشان دهد. اگرچه این تکنیک تا حدی وابسته به طرز تفکر شخص است، با این وجود تجزیه و تحلیل دقیق هر کندل یا نوار
 قیمتی برای اندازه گیری قدرت واقعی حرکت یک سهم، بسیار مهم است .

قوانین شخصی

فاکتور دیگری که من در تعیین زمان کسب سود مناسب (take profit) مورد توجه قرار می دهم، عکس العمل ها و واکنش

های من در مقابل یک ترید است. اگرچه این فاکتور گاهی اوقات برای ایجاد قوانینی در جهت کسب سود مناسب، به روی من موثر واقع شده، اما قوانین شخصی مسلمی وجود دارد که من برای نشان دادن زمان خروج از پوزیشن برقرار می کنم. این قواعد بسیار به طرز تفکر فرد بستگی دارد، اما من این قواعد را در تعیین حد سود بسیار قابل اطمینان و معتبر یافته ام. زمانی که در یک ترید در سود هستیم، من می توانم با بستن پوزیشن تمام سود حاصله را بگیرم. مشکلی که در این طریق کسب سود وجود دارد این است که من هرگاه پوزیشنم را ببندم فقط سودهای حاصله را دریافت می کنم. من برای رسیدن به این مطلب مجبور بودم راهی دشوار را طی نمایم که همانا اجازه تبدیل سودهای قابل توجه به ضررهای بزرگ در بیشتر فرصت های مناسب، می باشد. بنابراین، زمانی که من خودم را از نظر روانی در حال برآورد سودهایم یافته ام، می فهمم که به زمان بستن پوزیشن نزدیک شدم. هرچند این موضوع یک قاعده است که بسیار به طرز تفکر فرد بستگی دارد، اما به من اهمیت وافر طمع نکردن را آموخته است.

قاعده دیگر خارج شدن از بازار پس از یک سود قابل توجه است که در مدت زمان کمی حاصل شده است (بدون توجه به چشم انداز آینده). اگر من سهمی داشته باشم که حرکت قابل توجهی در یک روز یا یک هفته کرده باشد، برای بستن پوزیشن آماده خواهم شد. من مجبور بودم که این درس را از راهی دشوار فرا بگیرم که همانا قرار گرفتن در تعداد زیادی از موقعیت های به سود رفته مانند این و از دست دادن تمام سودها می باشد. کسب چنین تجربیاتی این را به من آموخت که اگر زودتر از بازار خارج شوم بهتر است تا اینکه دیر از بازار خارج شوم در حالیکه سود قابل توجهی را از دست داده ام.

معکوس فکر کردن: فریب تبلیغات زیاد و غلو آمیز را نخورید

قانون شخصی دیگر توجه به رسانه خبری است. من چه در هنگام ورود و چه در هنگام خروج از پوزیشن، این موضوع را مدنظر قرار می دهم. اگر پوزیشن من روی سهمی که در خبرها جای دارد در سود باشد، من با دیدی معکوس به موضوع خواهم نگریست و برای بستن پوزیشن آماده خواهم شد (فرض می کنم که خبر به ضرر من خواهد بود). چنین تفکر معکوسی به جلوگیری از ضرر کمک خواهد کرد.

وقتی که چنین اخباری (تبلیغات) با یک موقعیت بالقوه ترید همزمان شود، بنا به تجربه من رفتار قیمت معمولاً بر خلاف جهت اخبار خواهد بود. برای مثال، اگر یک خبر که تاثیر آن در جهت صعود قیمت است بر یک موقعیت ترید نزولی منطبق شود، من منتظر خواهم ماند و اجازه خواهم داد که قیمت در یک زمان کوتاه افزایش یابد و سپس ترید می کنم (در خلاف جهت خبر). خبرهای اصلی ممکن است برای مدت کوتاهی روی قیمت اثر بگذارد. اگرچه ادامه رفتار قیمت سرانجام بر خلاف جهت خبر خواهد بود. این حالات چیزی بیشتر از تبلیغات زیاد و غلو آمیز نیستند. پس از اینکه این تبلیغات ساکت شد و فروکش کرد، یک بازگشت در ادامه قیمت، نتیجه معمول خواهد بود.

داشتن دیدی معکوس به موضوعات خبری ممکن است چندین تجربه را در بر داشته باشد تا ما را قادر سازد به این سبک تفکر کنیم. سحرآمیز است که داشتن دیدی معکوس به سهم هایی که زیاد تبلیغ می شوند بارها با تعداد زیادی از موقعیت های هارمونیک تطابق پیدا می کند.

من پیشنهاد می کنم که شما تعداد کمی از سهم ها و موضوعات خبری مشابه را تعقیب کنید. برای مثال بیایید فرض کنیم که یک باترفلای نزولی روی نمودار قیمت یک سهم در حال تشکیل است. در همین زمان تعداد زیادی از اخبار خوب (مانند: تخمین سود بیشتر برای سهم یا افزایش عایدی سهم) در مورد شرکتی که این سهم را ارائه می دهد، وجود دارد که موجب صعودی قوی در قیمت می شود. اما قیمت در 1/27 یا حتی 1/618 موج XA قرار دارد. قوانین معاملاتی به ما می گویند: "بفروش". در این بین دودلی یا بدتر از آن، اجتناب از ترید حادث می شود زیرا شما داستان نقل شده توسط اخبار را باور کرده اید.

این کنش بین چیزی که شما در نزدیکی نسبت های فیبوناچی می بینید و چیزی که باور می کنید، منجر به دودلی و اجتناب از ترید می شود. بدبختانه تنها چیزی که می تواند بر این اتفاقات غلبه کند تجربیات واقعی در این وضعیت ها است. پس از اینکه شما تعداد زیادی از موقعیت های ترید هارمونیک که با زحمت زیاد کشف کرده بودید به علت باور کردن اخبار، از دست دادید، اعتماد کردن به رفتار قیمت در نزدیکی نسبت های فیبوناچی را آغاز خواهید کرد.

من یک مثال از Amazon.com آورده ام زیرا این تفکر را به وضوح نشان می دهد. قیمت طی هفته ها به طرز چشمگیری افزایش می یابد و مقدمه ای را برای انتشار اخبار خوب برای سهم فراهم می کند که این اخبار باید منجر به صعود قیمت شوند Amazon.com. یک AB=CD نزولی و فوق العاده را تشکیل می دهد که با این اخبار صعودی همزمان می شود.

Amazon.com بطور آشکار یک پترن نزولی ممتاز را تشکیل داد که قیمت تقریباً درست در نقطه تکامل پترن AB=CD سقوط کرد. در طی چند روز بعد قیمت سرازیر شد و حدود 20 واحد سقوط داشت.

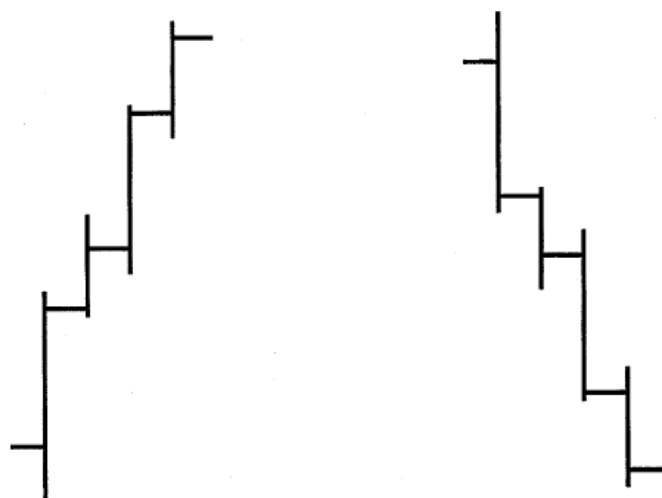
این وضعیت ها بارها جامه عمل به خود پوشانده است. مهم است که ما به پترن اعتماد کنیم و اخبار را نادیده بگیریم. یک شیوه نگرش به چنین وضعیتی این است که از خود این سوال را بپرسیم: با وجود تمامی خبرهای خوب برای یک سهم که

موجب صعود قیمت می شود، افزایش قیمت تا چه حدی می تواند ادامه یابد؟ پس از گواهی دادن تعدادی از این وضعیت ها، معلوم می شود که شما شروع کرده اید به فهم این مطلب که چنین خبرهایی، نشانگرهای معکوس هستند مخصوصاً زمانی که این خبرها با پترن های بسیار واضح، همزمان اتفاق می افتند .

داشتن دید معکوس، به تفکیک اخبار از واقعیت کمک خواهد کرد. اگر شما به خبرهای خوب در مورد یک سهم به عنوان فرصتی برای فروش و به خبرهای بد به عنوان فرصتی برای خرید بنگرید، شما مغزتان را تمرین داده اید تا به یک چارچوب مبتنی بر خرید در کف و فروش در سقف فکر کند. رفتار و برخورد معکوس شبیه به استفاده از پترن $AB=CD$ می باشد چرا که در ابتدا قبول کردن این موضوع که این پترن که با قدرت به پیش می رود در فلان نسبت فیبوناچی بازمی گردد، خیلی مشکل بود اما پس از چندین تجربه عملی این اعتماد حاصل شد. البته این طرز تفکر دشوار است چرا که مغز شما آموزش دیده است که بین اخبار خوب با قدرت و اخبار بد با ضعف، همبستگی برقرار کند . بطور نمونه سهمی که به خوبی در حال صعود است، قوی فرض می شود. مغز شما بطور غریزی به شما می گوید که قوی ترین سهم ها را بخر و از ضعیفترین ها دوری کن. اینجاست که نسبت های فیبوناچی به کمک شما می آیند تا رفتار قیمت را از دیدگاه غیر احساسی تفسیر کنید. وقتی مغز شما یک چیز می گوید نسبت های فیبوناچی چیزی متفاوت به شما پیشنهاد می دهد، پشتیبانی گرفتن از طرز فکری عاری از تعصب که قادر باشد بهترین موقعیت های ترید را تشخیص دهد، بسیار تعیین کننده است. به علاوه اعتماد به چیزی که نسبت های هارمونیک نشان می دهند ضروری است. این اعتماد بیشتر خواهد شد زمانی که تجربیات عملی صحت این نسبت ها را در قابل اطمینان تر بودن از اخبار، به اثبات رساند .



لایین
www.



حرکت مداوم بسوی بالا

حرکت مداوم بسوی پایین

توضیح : توضیحات زیر مطالبی است که آقای امیر مقدم برای مطالب ترجمه شده فوق ارائه کرده اند :

در موقعیت های هارمونیک (موقعیت تردی که یکی از پترن های فیوناچی آن را تعیین کند (ما در سه حالت با اخبار روبرو می شویم.

حالت اول قبل از رسیدن به PRZ ، یعنی قرار گرفتن اخبار در بدنه پترن که نتایج حاصله از این اخبار یا به تکمیل پترن کمک می کند یا پترن را خراب می کند. خیلی برای ما مهم نیست که خبر در جهت دلخواه ما (تکمیل بدنه پترن) پیش می رود یا بر خلاف میل ما که در نهایت در چنین وضعیتی، به دنبال پترن دیگری می گردیم. حالت دوم این است که زمان اعلام خبر، با رفتار قیمت در ناحیه PRZ یا همان نقطه تکامل پترن انطباق پیدا کند. نظر کارنی در چنین شرایطی این است که ما به خبر اعتنای چندانی نکنیم. یعنی اگر جهت خبر بر خلاف سیگنال پترن ما بود، ما بایستی به سیگنال پترن اعتماد کنیم. البته این عقیده کارنی در مورد سهام صادق است زیرا بعضی خبرهای بنیادین در مورد یک سهم از قبیل عایدی یک سهم یا پیش بینی سود سهم در پایان سال مالی، می توانند در بسیاری از موارد حالت تبلیغ گونه داشته باشند. چرا که شرکت ها برای فروش سهام خود ممکن است دست به چنین اقدامی بزنند. در چنین مواردی است که کارنی می گوید در صورت همپوشانی اخبار و سیگنال پترن، باید اخبار را نادیده گرفت و به سیگنال پترن اعتماد کرد. اما یک سری از خبرهای اصلی مثل: اقدام به تولید محصول جدید یا انتشار سهم ها یا بازخرید سهم ها، هستند که نمی توان نسبت به آن ها بی تفاوت بود چرا که تاثیر بیشتری به روی قیمت دارند. ولیکن در بازار فارکس ما نباید نسبت به اخبار در این حالت (حالت دوم) بی اعتنا باشیم و بنا به تجربه باید از تردی کردن در چنین وضعیت هایی که خبر و نقطه تکامل پترن همزمان هستند، اجتناب کنیم.

در حالت سوم زمانی که ما در یک موقعیت هارمونیک وارد تردی شدیم و پوزیشن ما در سود قرار گرفت با اخبار روبرو می شویم. عقیده کارنی این است که خطر نکنیم و همیشه فکر کنیم که خبر به ضرر ما خواهد بود در نتیجه آماده بستن پوزیشن شویم.

اما مطالب زیر توضیحاتی است که بنده در مورد نوشته های آقای مقدم نوشته ام :

عرض کنم که کارنی تکنیکهای بسیار ارزشمندی رو ارایه میکنه و نشون میده که حقیقتا این شخص تا چه حد بروی این پترنها زحمت کشیده است و تا چه حد بروی تردی واقعی و مشاهده رفتار بازار در شرایط حقیقی بر اساس این پترنها وقت گذاشته است.

البته کارنی در کتاب جدیدش فصل مستقلی رو برای این مبحث قرار داده است که ارزش زیادی دارد و گفته که جلد بعدی کتابش (که میبایست تا سپتامبر منتشر میشد...) صرفا اختصاص به استراتژی های پترنهای فیوناچی دارد که مطمینا بسیار ارزشمند است.

عرض کنم که تکنیکهایی که در این بحث معرفی کرده است ارزشمند است منتھی من فکر میکنم در اون موارد که ایشون میگند که بستگی به شخص دارد این خیلی کاربردی نیست (هر چند ایشون حق دارد و حرفشون کاملا صحیح است و بهر حال بی جهت نیست که تردی کار ساده ای برای بسیاری نیست...)

اما نظرم رو عرض کنم و اون اینکه در مورد اینکه ایشون میگند که گاهی نیمی از پوزیشن رو مینند و باقی رو اجازه ادامه میدهند در واقع تکنیکی است که هابز هم در کتابش معرفی کرده است و روش قدرتمند و محکمی محسوب میشود.

اما در بعضی از روشهایی که ایشان ارایه میکنند چون دید کلیشون رو بیان کرده اند بنده به نظرم تکنیکهای تاپیک مدیریت پوزیشن شاید در مرحله عمل کاربرد بیشتری داشته باشند...

در مورد اخبار و نوع دوم بنده هم با نظر شما موافقم و معتقدم که این تکنیک که خلاف اخبار تصمیم بگیریم بروی بازارهای سهامی کاربرد بیشتری دارد و در فارکس کاربردش کمتر است...

در مورد نوع سوم پیش از این در تاپیکی در پاسخ به سوال یکی از دوستان توضیحاتی عرض کرده بودم که خلاصه آن اینکه چون بنده در تایم فریمهای بالا کار میکنم 95% اخبار نمیتونه تاثیر جدي بروی تحلیلیم بگذاره البته میتونه روند رو به تاخیر بندازه و یا نویز موقت ایجاد کنه (همونطور که کارنی اشاره کرده است) اما بروی 95% اخبار تنها به تکنیکال وضعیت فکر میکنم میمونه چند خبر خیلی مهم که حتی در تایم فریمهای بالا هم نتایج اعلام شده آماری میتونه خطرناک باشه نظیر :

NFP-FOMC-GDP و ... که بهیچوجه پیش از این اخبار بر اساس هیچ روش تکنیکالی ترید نمیکنم.

و تلاش میکنم پوزیشنهام پیش از اعلام این اخبار بسته شده باشد و یا آگه در سود خوبی بود پوزیشن رو ببندم (مشابه ایده آفای کارنی) اما آگه تصادفا تریدی به مشکل برخورد بود در این مواقع از استاپ نزدیک استفاده میکنم و در صورتیکه بازار استاپ رو زد صبر میکنم و آگه روند قبلی بعد از نوسان خبری دوباره در جهت تحلیل قبلی ام ادامه پیدا کرد مجددا بر اساس سیگنال فرکتال وارد بازار میشوم (توضیح سیگنال های فرکتال رو در تایپک NTD مطالعه بفرمایید)

بطور کلی عرض کنم کارنی در این کتاب که شما ترجمه میفرمایید و مرجع ما در بحث های تکنیکال است بعضی موارد در مورد مدیریت پوزیشن رو خیلی خوب و دقیق تشریح و بررسی کرده است و بعضی از موارد رو تنها به بیان دیدگاه های کلیش پرداخته است که فکر میکنم بررسی روشهای تعقیب روند که در تایپک مدیریت پوزیشن ارایه شده است بتونه کمک خوبی در این موارد باشه...

Chapter 22
Sticking to the Plane
The Harmonic Trader
By Scott M Carney

ایران بورس آنلاین

www.irnbourseonline.com

تمرکز روی یک پلان

دفتر(تحلیل)گزارشات روزانه سهم ها: ثبت کردن تجربیات

داشتن یک دفتر تحلیل روزانه برای ردیابی و تحلیل موقعیت های معاملاتی بالقوه، بسیار مهم است. یک دفتر تحلیل باید حتما این موارد را دربر بگیرد: نوع پترن، نقطه تکامل $AB=CD$ و بازگشت های فیبوناچی موجود در ناحیه بازگشتی (PRZ)، همچنین، وجود یک دفتر تحلیل در ثبت افکار و استدلال های شما در مورد رفتار قیمت در ناحیه بازگشتی (PRZ)، مفید و موثر است.

تعقیب و دنبال کردن افکار و استدلال هایتان، مخصوصا در مراحل ابتدایی یادگیری ترید کردن به روش هارمونیک، بسیار مهم است. افکار و ایده هایی که در طی مراحل انجام دادن یک ترید شکل می گیرند، راهنماهای شخصی هستند که به تحلیل رفتار قیمت کمک می کنند. مهم است که شما احساسات و اقدامات تان درباره رفتار جاری قیمت، را ثبت کنید. موفقیت ترید در موقعیت های هارمونیک هنوز هم به تحلیل صحیح و شایسته رفتار قیمت در ناحیه بازگشتی، محتاج است. دست یافتن به یک احساس مناسب در مورد نسبت های فیبوناچی، نیازمند یک درک عمیق از علامات ساطع شده از خودتان است یعنی برای اینکه بتوانید به نحو احسن از این نسبت ها استفاده کنید باید ببینید چه ایده ها و افکاری در مواجهه با آن ها به ذهنتان خطور می کند. دفتر تحلیل چگونگی طرز فکر و رفتار معاملاتی شما را ثبت خواهد کرد. تنها بواسطه این قبیل مطالعات و بررسی ها است که شما در آینده اقدامات مناسبتری انجام خواهی داد و تریدر موفق تری خواهی شد.

من پیشنهاد می کنم که شما حداقل برای چند ماه بطور مجازی ترید کنید تا مشاهده کنید این موقعیت های ترید چطور در مثال های واقعی عمل می کنند. سرتاسر این کتاب، من نمودارهای آموزشی زیادی آورده ام که چگونگی حرکت قیمت در مواجهه با پترن ها و نسبت های فیبوناچی را نشان می دهد. اما بهترین وسیله برای پرورش و گسترش حس و درک مناسب در مورد این تکنیک های معاملاتی، تجربیات حقیقی یا همان قرار گرفتن در موقعیت های مذکور است. یک دفتر تحلیل بعنوان صورتجلسه ای از رفتار معاملاتی شما در شرایط حقیقی، عمل می کند. موقعیت های هارمونیک

زیادی وجود دارند که به نحوی از دست می روند و سودی عاید ما نمی کنند. با داشتن یک دفتر تحلیل، آنالیز این موقعیت های از دست رفته که ادعای معتبر بودن داشتند، آسان می شود. همچنین وجود دفتر تحلیل، دست چین کردن گل سرسبد وضعیت های هارمونیک از گذشته و اثبات اعتبار این روش ترید کردن را آسان می کند. اگرچه این ها وسایلی موثر برای مطالعه و بررسی هستند، اما در شرایط واقعی تعداد زیادی متغیر دیگر وجود دارد که به روی قضاوت شما در ترید تاثیر می گذارد. این بسیار شبیه به یک بازیکن بسکتبال است که در حال تمرین به روی پرتاب های آزاد است. ممکن است این بازیکن قادر باشد در تمرینات ده گل بطور پی در پی به ثمر برساند. اما اگر این بازیکن به یک میدان مسابقه که مملو از هزاران هوادار تیم حریف است قدم بگذارد، شرایط محیطی توانایی پرتاب او را تحت تاثیر قرار می دهد. به علاوه، این بازیکن بطور مداوم موفق نخواهد بود تا زمانی که بازی حقیقی را تجربه کند. در این مثال دفتر تحلیل همان کارت امتیاز بازیکن در یک مسابقه واقعی است که حاوی اطلاعاتی از قبیل: نام، امتیازها، تعداد شوت ها، تعداد شوت های گل شده، خطاها و ... می باشد.

من نمونه ای از دفتر تحلیل خودم را قرار داده ام که نشان می دهد که چگونه من به موقعیت های ترید نزدیک می شوم. من موقعیت های گوناگون ترید را از دید خودم پوشش می دهم و رسم می کنم و برای شان صبر می کنم تا به وقوع بپیوندند. اگر هر یک از آن ها در مسیری که من طرح ریزی کرده ام به نتیجه نرسند به سراغ ترید بعدی می روم. پس از اینکه من یک موقعیت ترید را دیدم، رفتار قیمت را تحلیل می کنم. پس از اینکه این فرصت سر آمد من رویدادها و واکنش خودم نسبت به این فرصت را بطور خلاصه بیان می کنم. اگر پذیرفتم که تریدی انجام بدهم، افکار و احساساتم را تا زمانی که هنوز تریدم را آغاز نکرده ام ثبت می کنم. اینجا یک نمونه از دفتر تحلیل خودم را آورده ام.

تاریخ 8/13

UAL = پترن AB=CD در نرخ 71 : نسبت 1/27 در نرخ 69 قیمت دیروز کمتر از نسبت 1/27 بسته شد به همراه یک علامت هشدار = گپ نزولی روی قیمت آغازین امروز زیر نرخ 69 صبر می کنیم برای نسبت 1/618 در نرخ 63.25 برای خرید بالقوه

FDX = فروش ها در نسبت اصلی 1/618 به پایان رسیدند. این نزدیک به یک موقعیت خرید است!!!! صبر می کنیم تا یک AB=CD در نزدیکی نرخ 50 کامل شود. به هر حال یک موقعیت مناسب است! حرکت قیمت در حال تثبیت و کند شدن است. این تثبیت تقریباً ماقبل نسبت 1/618 است، بنابراین من به گذاشتن دستور ترید خیلی نزدیک هستم.

JPM = سطوح حمایت بحرانی در نسبت 0/618 در نرخ 111/1875 و در نسبت 786/0 در نرخ 104/6625

همانطور که در دفتر تحلیل من می بینید، من چندین موقعیت ترید را تشخیص داده ام. برای من دنبال کردن یک سهم برای یک یا دو هفته غیر عادی نیست، مخصوصاً زمانی که من در حال تعقیب رفتار قیمت پس از یک موقعیت هارمونیک مطلوب هستم. من شما را ترغیب می کنم که به استفاده از یک دفتر تحلیل پایبند باشید. من چیزهای زیادی درباره رفتار قیمت و موقعیت های هارمونیک آموخته ام. همچنین من حتی بیشتر، درباره خودم دانستم و ادراکم از این موقعیت های ترید. حتی ضروری تر بود که شما در مراحل آغازین مطالعات تان در مورد ترید کردن به روش هارمونیک، از یک دفتر تحلیل بهره ببرید چرا که اقدامات ترید هر شخص منحصر به فرد است یعنی مختص خود اوست. اگرچه ممکن است دو نفر از این تکنیک های هارمونیک استفاده کنند و PRZ مشابهی را بدست آورند، اما قیمت هایی که در آن اقدام به ترید می کنند به احتمال زیاد متفاوت خواهد بود. ممکن است یک نفر اقدام به ترید کند در حالی که دیگری از آن اجتناب می کند. این اختلاف ناشی از ادراک افراد در مورد رفتار بازار در درون ناحیه بازگشتی (PRZ) است.

بیشتر اوقات دفتر تحلیل به شما کمک خواهد کرد تا علامات ساطع شده از خودتان را تحلیل کنید تا بتوانید رفتار بازار را تفسیر نمایید. به علاوه شما یک حس را در مورد چیزی که باید اتفاق بیافتد، پرورش خواهید داد. بعنوان مثال، شما یک موقعیت هارمونیک قوی که دارای چندین نسبت فیبوناچی درون یک PRZ تنگ می باشد را تشخیص داده اید. این موقعیت دقیقاً یک باترفلای صعودی فوق العاده است. شما در این لحظه انتظار یک علامت برای خرید را دارید اما رفتار قیمت اشاره به یک حرکت قوی در جهت مخالف دارد به علت وجود علامت هشدار (گپ یا شکاف قیمتی، کندل بیش از اندازه بلند، کندل فاقد سایه یا شادو). شما ممکن است اینطور در دفتر تحلیل ثبت کنید که پترن فوق العاده به نظر می رسد اما حرکت قیمت در ناحیه بازگشتی بیش از اندازه قوی برخلاف سیگنال پترن حرکت می کند یا دارای یک علامت هشدار است، بنابراین از ترید کردن اجتناب می کنید. همچنین، ممکن است شما در دفتر تحلیل اینگونه ثبت کنید که یک بازگشت ایدال باید به سرعت از ناحیه بازگشتی خارج شود و علامت های قدرتمندی از بازگشت نشان دهد، از قبیل بسته

شدن قیمت در بالای PRZ در حالت خرید). در این مثال، از آنجایی که قیمت در آن جهتی که باید حرکت کند (صعود) حرکت نمی کند، شما نپذیرفته اید که تریدی انجام بدهید.

در طول این مدت، مهم است که دلایل پذیرش یا عدم پذیرش ترید توسط شما و احساساتی که با طرز عملکرد شما ارتباط داشته را ثبت کنید. همچنین، پس از اینکه یک فرصت ترید خاتمه یافت، مهم است که در دفتر تحلیل خود ثبت کنید که ترید چطور از آب در آمد و شما در هنگام ترید نسبت به تجربیات گذشته چه واکنشی داشته اید. ثبت کردن این رویدادها کمک می کند که شما احساساتتان را در مورد اینکه یک سهم خاص چطور باید عمل کند، پرورش دهید. زمانی که شما فهمیدید که یک سهم بخصوص چطور باید عمل کند، بینش و بصیرت شما در تحلیل رفتار قیمت افزایش می یابد. بنابراین، با پرورش و گسترش بصیرت و بینشتان، اقدامات آتی شما بهبود می یابد.

هرچند همه موقعیت های هارمونیک ایدال نیستند، اما ایجاد کردن استانداردهای معین در مورد رفتار قیمت به ساختن یک چارچوب برای سنجش و محک زدن ناحیه بازگشتی کمک می کند. دفتر تحلیلی که این تجربیات را در خودش ثبت کند، کلید موفقیتی برای پرورش و گسترش بینش و بصیرت شما خواهد بود. واکنش های هر فردی نسبت به رفتار قیمت منحصر به فرد است. بنابراین لازم است که نسبت به علامت هایی که در طول سلسله مراحل یک ترید از خود تولید می کنید، آگاه باشید تا وضعیت تریدهای آینده را بهبود بخشید.

ثبت نمودار: علامتگذاری ترید

روش دیگر برای بهبود بخشیدن به تریدهای تان این است که از نمودار سهمی که به روی آن ترید کردید، پرینت تهیه کنید و روی نمودار، محلی را که در آن اقدام به خرید یا فروش کرده اید را علامتگذاری کنید. با بازدید کردن هر ترید شما به نقاط ضعف و قدرت خود پی خواهید برد. همچنین، با مقایسه کردن نمودار با هیجانان و احساساتتان که در دفتر تحلیل ثبت می شوند، شما به مقدار زیادی در مورد خودتان و معاملات تان آگاهی پیدا خواهید کرد.

من یک نمودار از سهمی که به روی آن ترید کردم را آورده ام. این سهم Etoys.com بود. من محلی که در آن خریدم و همچنین محلی که در آن فروختم را نشانه گذاری کردم.

من در این ترید چند اشتباه مرتکب شدم، مخصوصا از آنجایی که من کمی دیر در این موقعیت وارد ترید شدم. اما، من برای یک فرار قیمت واضح انتظار می کشیدم که بازگشت قیمت را تایید کند. قیمت قبل از صعود چند روزی بر خلاف میل من حرکت کرد. گذشته از این من می توانستم پوزیشنم را نزدیکتر از رینریس 0/382 بسته باشم اما قیمت به طور قدرتمندی در این روز رو به بالا بود. پس از اینکه مشاهده کردم قیمت در حال سقوط است پوزیشنم را بستم و سودم را کسب کردم. تجزیه و تحلیل کردن معاملاتتان در این حالت، اقدامات آتی شما را به طور گسترده ای بهبود خواهد بخشید. من از بازبینی تریدهای گذشته ام چیزهای زیادی آموختم و هنوز هم یک آرشیو از تریدهای سابق را نگهداری می کنم که هر چند وقت یکبار نگاهی به آنها می اندازم.

شیب سرمایه: پیگیری تجربیات

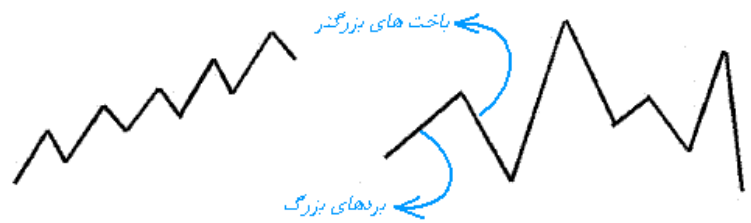
پس از اینکه هر یک از تریدها را روی نمودار ثبت کردم، از ثبت کلی همه تریدها روی یک برگه خلاصه وضعیت سرمایه کمک خواهم گرفت. این برگه عملکرد من در مورد هر ترید را پیگیری می کند که شامل این موارد است: مجموع زیان/سود، مجموع افت سرمایه و مدت زمان هر ترید. دنبال کردن این نتایج به من کمک کرده است تا ماهیت سودها و زیانهایم را درک کنم. به عنوان مثال، من فهمیده ام که بهترین تریدهایم آنهایی هستند که یک هفته یا در نهایت دو هفته به طول می انجامند. همچنین، هر زمان که قیمت بر خلاف جهت ترید من حرکت می کند و من ضررم را محدود نمی کنم و جلوی آن را نمی گیرم، معمولا کارم به ضرری بزرگتر از حد معمول می انجامد. همچنین این اطلاعات ثبت شده، شیب نمودار سرمایه من را نیز تعیین خواهد کرد.

شیب سرمایه درجه یا زاویه ای در مجموع سرمایه شما است که در حال رشد یا کاهش است. شیب سرمایه می تواند ماهیت حقیقی موفقیت معاملات شما را نشان دهد. به عنوان مثال، اگر شما به طور پی در پی افزایش در شیب سرمایه را شاهد هستید، نشانگر این است که معاملات شما به طور مداوم و پایدار سود آور هستند. اگرچه ممکن است شما تعدادی هم معامله متضرر را در این بین تجربه کنید، اما شیب رو به بالا نشانه یک تریدر موفق و ثابت قدم است. هر چند، اگر شیب سرمایه شما به کلی دندان دار و بی ثبات باشد، معاملات شما سرگردان و نا منظم است که افزایش شیب به خاطر بردهای بزرگ و سقوط شیب به خاطر باخت های بزرگتر است. چنین معاملات نامنظمی بسیار خطرناک هستند چرا که عملکرد گذشته شما نشان می دهد که در معرض یک سقوط بزرگ و باخته های بالقوه ویرانگر هستید.

من هر کاری کنم نمی توانم به حد کفایت روی اهمیت ثبت کردن عملکردتان به منظور موفق بودن به طور مداوم و پایدار،

پافشاری کنم. این تنها راهی است که شما به یادگیری خود سرعت ببخشید و از تکرار اشتباهات مشابه جلوگیری کنید. پیگیری کردن احساسات، اندیشه ها و استدلالها و عملکرد واقعی خودتان، اساس پیشرفت و ترقی هستند. پس از اینکه شما عملکرد واقعی تان را درک کردید، می توانید اشتباهات گذشته تان را دوباره ارزیابی کنید و برای بهتر کردن معاملاتتان، تاکتیکهایی طراحی نمایید. اگر شما واقعا می خواهید که تریدر موفقی شوید، اینها ابزار واقعی برای پیشرفت و ترقی هستند.

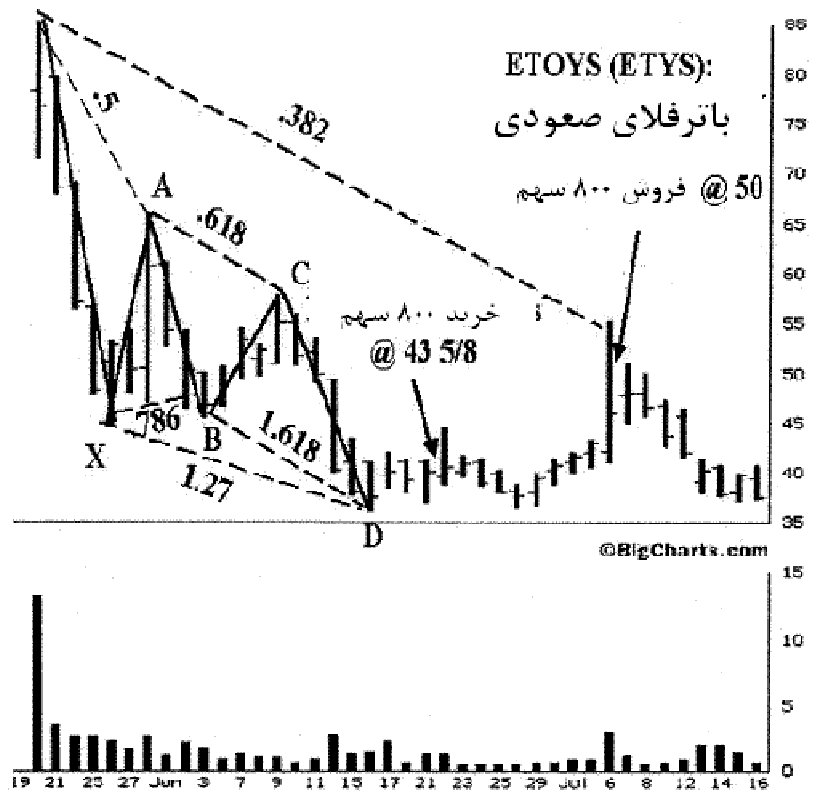
شیب سرمایه



مداوم و پایدار

سرگردان و بی ثبات

لاین
www.



By Scott M Carney

تایید ناحیه با پتانسیل بازگشت (PRZ)

یکبار دیگر شما یک موقعیت هارمونیک را تشخیص داده اید، اما علامت های دیگری نیز وجود دارند که ناحیه PRZ را بطور واضح تری معین می کنند. اگرچه این علامت ها صرفا باید مکمل این ناحیه (PRZ) باشند، اما آن ها می توانند حتی تایید قوی تری را برای اعتبار یک بازگشت بالقوه فراهم کنند. همچنین، این علامت ها می توانند نقطه ورود مطلوب را برای یک ترید نشان دهند.

1- رجوع کردن به نمودارهای دیگر

زمانی که یک PRZ تشخیص داده شده است، نمودارهای دیگر با تایم فریم های مختلف باید رجوع شوند تا اعتبار موقعیت ترید تعیین شود. به عنوان مثال، اگر شما در حال استفاده از نمودارهای روزانه هستید، نمودارهای هفتگی و درونروز (intra-day) باید بررسی شوند تا نقطه اقدام به ترید مطلوب تایین گردد. به خصوص نمودارهای درونروز از قبیل 15، 30 و 60 دقیقه، حتی راهنماهای قوی تری به منظور یک اقدام به ترید موفق فراهم می آورند.

هنگامی که یک PRZ تشخیص داده می شود، اغلب سه 4 یا تعداد بیشتری نسبت فیوناچی وجود دارند که ناحیه بازگشتی را تشکیل می دهند. مسئله ختم می شود به دانستن اینکه کدام نسبت درون این ناحیه (PRZ)، وجود نقطه بازگشت را ثابت خواهد کرد. نمودارهای هفتگی و درونروز محتوی چندین پترن و بازگشت فیوناچی (فیوناچی رتریسمنت) است که روی نمودار روزانه هم مشاهده می شود. بنابراین، اگر این نمودارهای دیگر به همراه موقعیت های موجود در نمودار روزانه رجوع شوند، دقت و صحت بالاتری برای اقدامات منجر به ترید می تواند حاصل آید.

همگرایی پروجکشن های قیمت (یا همان پترن های بسط یافته) در تایم فریم های دیگر جهت تعیین نقطه مطلوب برای اقدام به یک ترید، بسیار موثر است. حتی زمانی که روی نمودارهای درونروز هیچ پترنی مهیا نیست، بازگشت های فیوناچی (فیوناچی رتریسمنت) می توانند نشانه قوی تری برای تایید بازگشت قیمت در آینده فراهم آورند. برای مثال، فرض کنیم که شما یک موقعیت هارمونیک را روی نمودار روزانه تشخیص داده اید که پتانسیل خوبی را برای صعود پیشنهاد می کند. ما به دنبال خرید کردن در یک PRZ صعودی هستیم. اما این ناحیه دارای نسبت های فیوناچی و پترنی است که یک منطقه نسبتا عریضی را به عنوان ناحیه بازگشتی معین کرده است. در نتیجه کمک گرفتن از یک نمودار 15 دقیقه ای بسیار مفید خواهد بود مثلا برای تعیین کردن منطقه ای درون ناحیه بازگشتی که سودمندترین نقطه ورود را خواهد داشت.

نمودار ذیل از America Online این تکنیک را نمایش می دهد AOL. یک موقعیت بسیار هارمونیک را در ژوئن 1999 شکل داد. قیمت بسیار فرار بود در نتیجه AOL از بالای نرخ 175.5 کاهش پیدا کرد و به پایین ترین قیمت در 89.5 تنزل یافت.

در PRZ در این پترن پنج نسبت فیوناچی را در خود جای داد که یک ناحیه فوق العاده را برای خرید در حوالی نرخ 100 معین کرد. هرچند PRZ نسبتا عریض بود، اما آن هنوز یک موقعیت بسیار هارمونیک بود. ما دو پترن را شاهد بودیم، یک باترفلای صعودی و یک $AB=CD$ تقریبا قابل توجه که در این ناحیه با هم همگرا شدند. هر دو این پترن ها یک PRZ نسبتا عریض را در بین نرخ های 97 و 104.625 پدید آوردند.

بازگشت فیوناچی دیگری نیز وجود داشت که نزدیک به نقطه تکامل باترفلای صعودی بود. نمودار بعدی نسبت بازگشتی 50% را از یک کف در گذشته دور تا همین قله اخیر نشان می دهد که این نسبت نرخ 96.375 را مشخص می کند. این

نسبت بسیار اساسی و قابل توجه می باشد چرا که آن فقط کمتر از یک واحد آن طرفتر از نسبت 1.27) XA نقطه تکامل باترفلای) بود. به علاوه آن یک نسبت بازگشتی بود که قریب به یک سال به طول انجامیده است.

با وجود یک چنین نسبت فیبوناچی بازگشتی، من مطمئن و دلگرم در این ناحیه انتظار می کشیدم. من به یک نمودار درونروز رجوع کردم تا بینم که آیا هیچ پروجکشن قیمتی در کوتاه مدت در این ناحیه وجود دارد. به میزان قابل توجهی کافی اینکه یک نسبت پروجکشن 1.618 در ناحیه مذکور وجود داشت. این نسبت پروجکشن نرخ 95.5 را مشخص می کرد نمودار ذیل نسبت های پروجکشن داخل نمودار درونروز را نشان می دهد.

این نمودار درونروز ناحیه مذکور را به عنوان نقطه مناسب اقدامات معاملاتی برای این PRZ، تایید کرد. من بطور قاطع خواستم صبر کنم تا قیمت به 1.27 XA در نرخ 97 برخورد کند. چرا که به نظر من آن باترفلای، یک پترن بسیار هارمونیک بود. همچنین، ترکیب نسبت بازگشتی 50% با پروجکشن 1.618 در نمودار درونروز یک ناحیه بسیار مهم و پر معنا را معین کرد.

اگرچه چندین نسبت فیبوناچی در PRZ وجود داشت اما AOL در اولین روز برخورد با ناحیه بازگشتی (PRZ) به تندی تنزل یافت و سقوط کرد. در حقیقت، قیمت گپی رو به پایین ایجاد کرد و بیش از 11 واحد در یک نقطه نزول کرد. به علت این علامت های هشدار، من از ترید کردن اجتناب کردم و صبر کردم تا چندین تایید برای یک بازگشت قیمت مشاهده کنم. روز بعد قیمت نزول قابل توجه دیگری را تجربه کرد. من در ذیل نمودار ساعتی AOL که شامل همه نسبت های هارمونیک محاسبه شده در PRZ است را آورده ام.

همانطور که می توانید ببینید قیمت به تندی سقوط کرد، سپس وارد این ناحیه بازگشتی شد. مهمترین نسبت در این ترید نسبت 1.27 XA بود که نرخ 97 را نشان می داد. نسبت 1.618 bc که مربوط به باترفلای بود در این ناحیه تشکیل شد. چرا که نرخ 101.75 را نشان می داد. مشکلی که این موقعیت هارمونیک داشت دو پترن AB=CD دیگر بودند که در قیمت 104 همگرا شده بودند. این نقطه تکامل چندین واحد بالاتر از PRZ بود. اما قیمت بطور واضح و با سرعت زیادی از این ناحیه عبور کرد. با رجوع به نمودار ساعتی متوجه می شوید که AOL به تندی نزول یافت و هرگز هیچ نشانه های بازگشت واضحی را ایجاد نکرد. علامت های هشدار در این روزها بودند که شما را از ترید کردن منصرف کردند.

هنگامی که من این موقعیت را دنبال می کردم و عبور قیمت از PRZ را می دیدم، فکر می کردم که قیمت قصد دارد خیلی پایین تر از این برود. اما، AOL در روز سوم در نهایت تا نرخ 89.5 تنزل یافت و سپس شروع به رشد کرد. روز بعد قیمت بازگشت خود را تکمیل کرد، قیمت گپی رو به بالا زد و روندی قدرتمند را در جهت بالا آغاز کرد. در حقیقت، قیمت پس از بازگشت تقریباً 25 واحد را در 3 روز رو به بالا طی کرد.

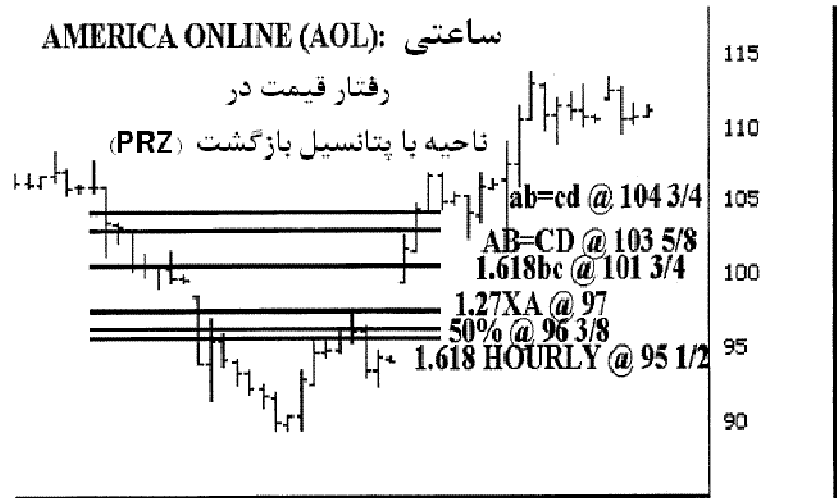
هر چند نمودار ساعتی پیشین، ممکن است گیج کننده به نظر برسد اما همگرایی همه این نسبت های هارمونیک به وضوح نشان داد که این ناحیه یک ناحیه بسیار مهم و قابل توجه بود. همانطور که این مثال نشان داد، ترکیب نسبت های هارمونیک نمودار های روزانه، هفتگی و درونروز، یک ابزار فوق العاده برای تعیین نقطه مطلوب جهت اقدام به ترید می باشد. آگاهی از این نسبت های هارمونیک دیگر، مهم است نظر به اینکه این نسبت ها رفتار قیمت را روی تایم فریم های گوناگون خواهند سنجید.

در این مثال، AOL یک موقعیت بسیار هارمونیک را به اعتبار 3 تایم فریم دارا بود. زمانی که چنین وضعیتی اتفاق می افتد، مهم است که بدانیم قیمت در یک ناحیه بسیار بحرانی و حساس قرار دارد. این نواحی بحرانی، فرصت های بسیار سود آوری را تعیین می کند و تضمینی برای بازگشت های قوی و معتبر ایجاد می نمایند.

AMERICA ONLINE (AOL): ساعتی

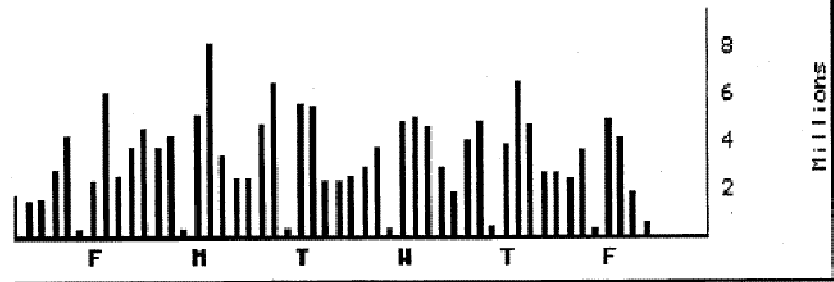
رفتار قیمت در

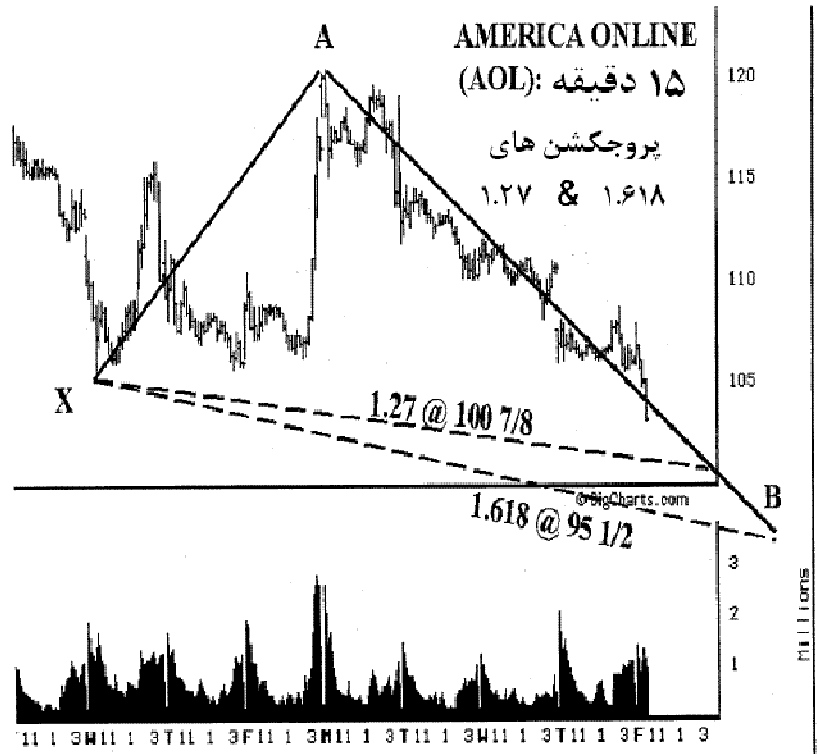
ناحیه یا پتانسیل بازگشت (PRZ)



© BigCharts.com

لایین
www.

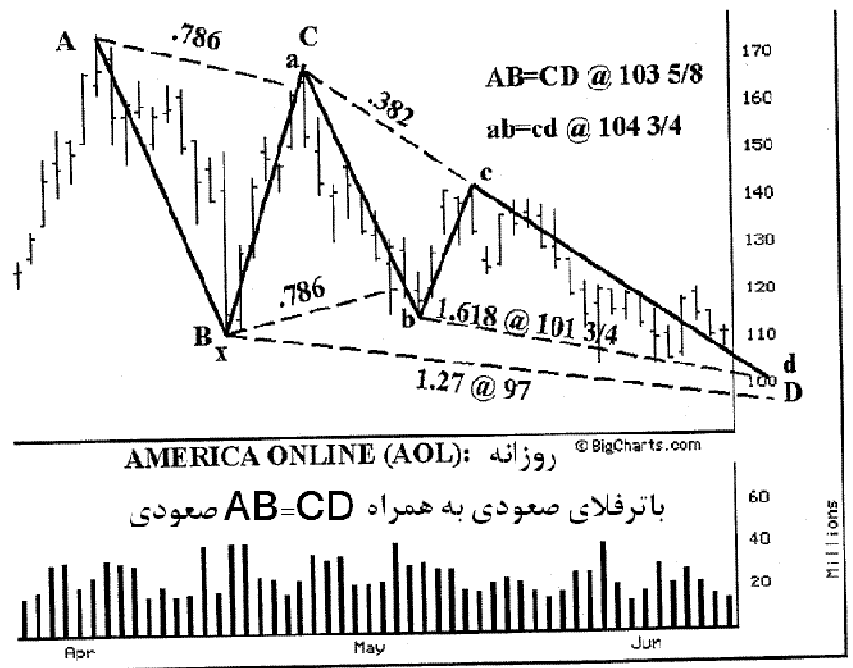
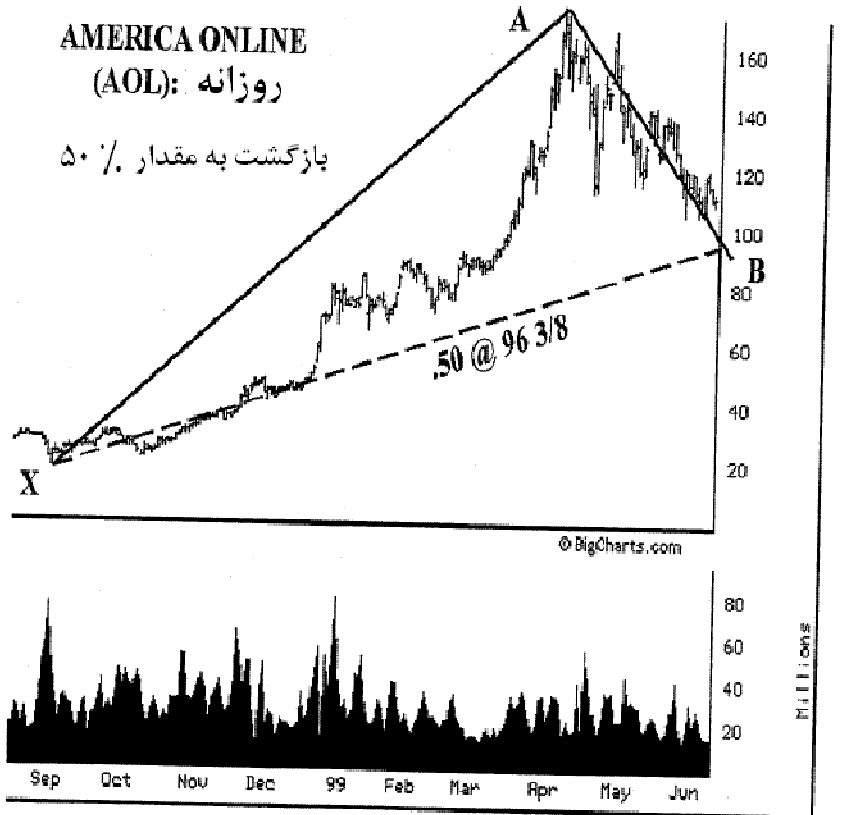




ایران

www.IranBourseOnline.com

ایران
www.



2- گپ های از پیش ایجاد شده (پیشین) در تطابق و برابری با ناحیه PRZ

به مجرد اینکه یک ناحیه PRZ تشخیص داده می شود ، مهم است که به دنبال گپ یا شکاف های قیمتی بگردیم که داخل قیمت های پیشین و هم سطح با ناحیه PRZ هستند. اغلب اوقات گپ پیشینی که با ناحیه PRZ همپراز و هم سطح باشد پر خواهد شد. من از یک تخمین کلی (مفید و نه خیلی دقیق) استفاده می کنم و اون اینکه بیشتر گپ های پیشین بالاخره دیر یا زود پر می شوند. هرچند من نمی توانم مدرک آماری دقیقی برای اثبات اعتبار این قانون در اختیار شما قرار دهم ، اما می توانم مشاهداتم را بر روی هزاران نمودار بیان کنم و آن اینکه گپ های پیشینی که پر می شوند بیشتر از گپ های پرنشده هستند. بنابراین ، گپ های پیشین حتی علامت زودرس یا پیش از موعدی برای یک ناحیه بازگشت فراهم می آورند.

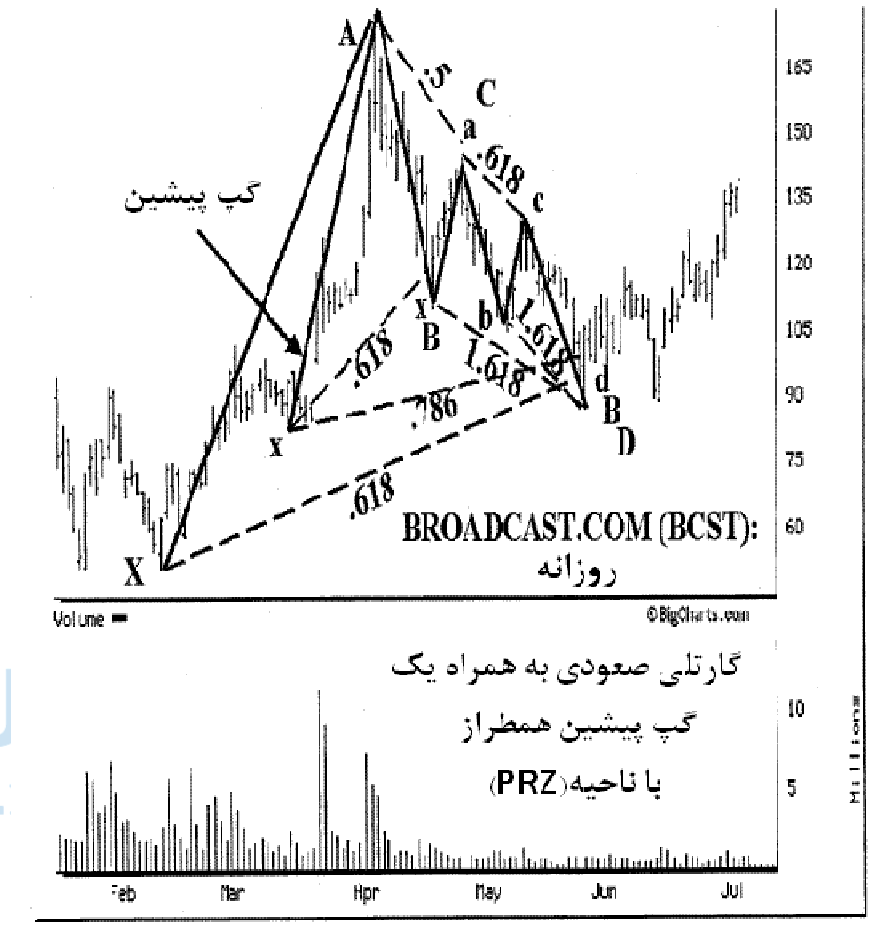
نمودار آورده شده از Applied Material ، اثر بخشی استفاده از گپ پیشین بمنظور تایید کردن یک PRZ را به نمایش می گذارد. قیمت یک گارتلی نزولی که دارای سه نسبت هارمونیک برای تشکیل ناحیه بازگشتی بود ، ایجاد کرد و همچنین قیمت یک گپ پیشین در ناحیه ای بسیار تنگ ایجاد کرده بود.

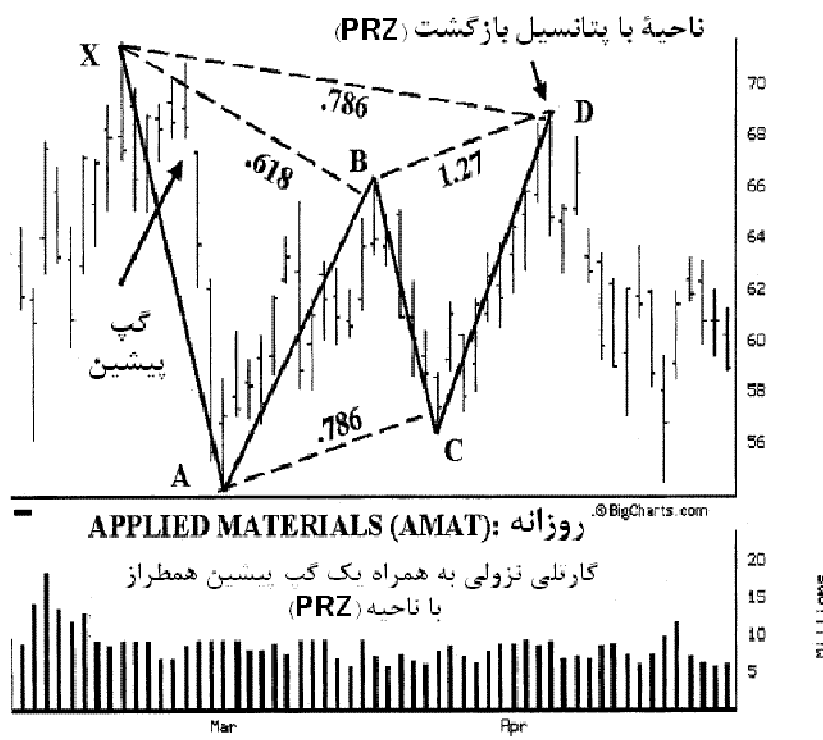
این گارتلی تشکیل شده ، پترنی بسیار واضح بود. ناحیه بازگشتی تشکیل شده بود از : 1- 0.786XA در نرخ 68 . 2 - AB=CD در نرخ 69.8125 . 3- 1.27BC در نرخ 69.75 . این گپ پیشین به خوبی با این سه ناحیه ذکر شده همگرا شد چرا که در نرخ 68.25 قرار داشت. وجود همه این اعداد در یک چنین ناحیه مستحکم و تنگی باعث می شد که احتمال بازگشت قیمت در این ناحیه کاملا بالا باشد.

شکاف های قیمتی ، قابل توجه و معنی دار هستند چرا که آن ها یک مکان را در گذشته رفتار قیمت یک سهم علامت گذاری می کنند ، جایی که تغییر عمده در بینش عموم معامله گران نشان داده می شود. این رفتار قیمت مخصوصا زمانی قابل توجه تر و معنی دار تر است که پس از گپ یک کندل بسیار بزرگ یا یک کندل بدون سایه (شادو) تشکیل شود. بنابراین زمانی که یک گپ پیشینی که هنوز پر نشده همپراز و هم سطح با PRZ باشد ، مهم است است که این وضعیت را به عنوان یک فرصت بسیار قابل توجه تلقی نمایم.

همچنین نمودار بعدی اهمیت گپ های پیشینی که با یک ناحیه بازگشتی همپراز و هم سطح هستند را روشن می سازد. سهم Broadcast . com ، یک گارتلی بسیار صعودی که دارای یک ناحیه بسیار هارمونیک بود را تشکیل داد. قیمت پنج نسبت هارمونیک در ناحیه بازگشتی و یک گپ پیشین همپراز با PRZ را دارا بود.

این تجربه من بوده که گپ های پیشین چند نوع از جهش قیمت را تولید می کنند. گپ های پیشین در ترکیب با PRZ ، فرصت های معاملاتی فوق العاده ای را فراهم می آورند. حرکت قیمت در این نواحی می تواند بسیار تند و تیز و شدید باشد در نتیجه بارها اتفاق افتاده که بازگشت های قیمتی که بعد از پر شدن گپ پیشین روی می دهد با شدت به وقوع بپیوندد ولیکن این فرصت ها بطور مخصوصی با اهمیت هستند .





ایران

www.iranbourseonline.com

3- حجم

حجم اغلب اوقات می تواند يك نشانه واضح برای بازگشت های بالقوه ارائه بدهد ، مخصوصا زمانی که قیمت با ناحیه PRZ برخورد می کند. مهمترین مفهوم حجم در ناحیه بازگشتی (PRZ) ، تشکیل دادن یک ماکسیمم یا میله بسیار بلند است . زمانی که من یک میله حجمی بسیار بزرگ را مشاهده کردم ، چه در هنگام صعود قیمت و چه در هنگام نزول قیمت ، باید فرض کنم که قیمت دچار خستگی و بی رمقی شده است. من این را با یک شرط بیان می کنم و آن اینکه : بازگشت قیمت باید خیلی نزدیک به محل خستگی اتفاق بیافتد. اگرچه وجود یک میله حجمی بلند در ناحیه PRZ ، همیشه نشان از بازگشت نیست اما وجودش در این ناحیه ، احتمال یک تغییر در روند را افزایش می دهد. آگاهی در مورد چنین پدیده ای از اهمیت ویژه ای برخوردار است چرا که از آن به عنوان علامتی برجسته تر برای بازگشت قیمت استفاده می شود. بیایید به یک مثال توجه کنیم.

نمودار ذیل از Becton-Dickenson بطور واضح نشان می دهد که یک میله حجمی بزرگ چطور می تواند از بازگشتی بالقوه در لحظات آتی خبر دهد. این موقعیت ترید بسیار هارمونیک بود ، چرا که دارای دو پترن باترفلای ، دو پترن $AB=CD$ و پنج

نسبت هارمونیک در ناحیه PRZ بود.

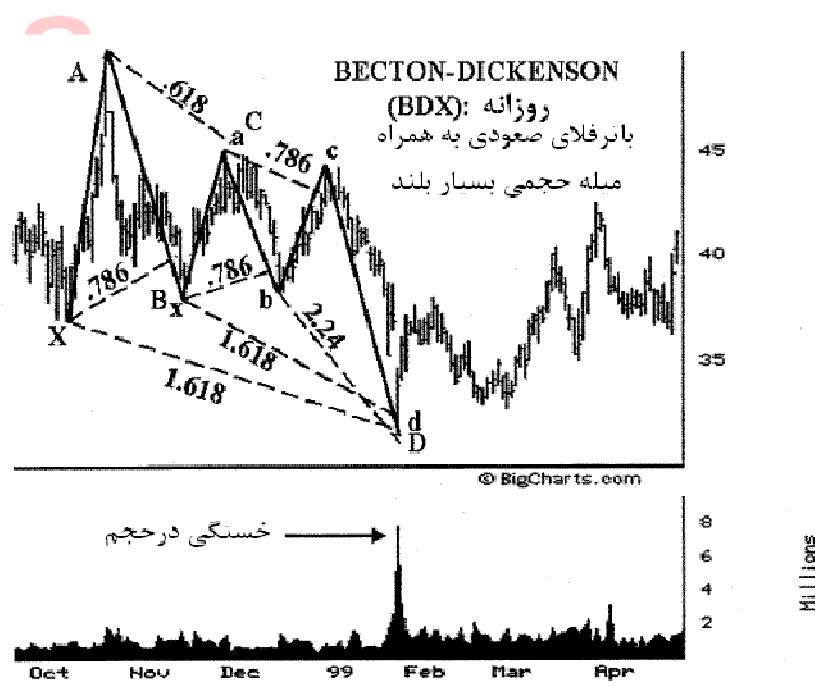
این PRZ شامل پنج نسبت هارمونیک بود که همگی در نرخ 33 همگرا شدند. چنین موقعیت هارمونیکی حاکی از یک بازگشت قیمت بسیار محتمل است. همگرایی این نسبت ها به همراه یک میله حجمی بزرگ ، یک ناحیه مهم و قابل توجه را برای صعود قیمت نشان داد .

اگرچه در آن روز قیمت هنگامی که با ناحیه PRZ برخورد کرد ، کاملاً قدرتمند بود ، اما رفتار قیمت و خستگی در حجم ، در عمل بازگشتی قابل توجه را نشان داد. حتی اگر شما یک روز هم برای گرفتن تایید برای بازگشت قیمت صبر می کردید ، در آن صورت موقعیت هارمونیک مورد بحث یک کف در قیمت را به تصویر می کشید.

میله های حجمی بزرگ اغلب اوقات یک حالت از خستگی و بی رمقی را نشان می دهند. هرچند اینجور میله ها در همه موقعیت های هارمونیک پدیدار نخواهند شد ، اما یک چنین پدیده ای یک موقعیت هارمونیک را به طرز بسیار مطلوبی کمال می بخشد.

بهره جستن از این علامت ها(نمودارهایی با تایم فریم های دیگر ، گپ های پیشین ، حجم بسیار زیاد) به تعیین کردن میزان قدرت و اعتبار ناحیه PRZ کمک خواهد کرد. هرچند این علامات در هر موقعیتی پیش نمی آید اما می تواند اقدامات معاملاتی شما را بهبود ببخشد. زمانی که این علامات با یک موقعیت هارمونیک همپوشانی داشته باشند ، می توانند ضمانت قویتری برای یک ترید موفق فراهم آورند .

لاین
www.



conclusion
The Harmonic Trader
By Scott M Carney

نتیجه گیری

هدف من از نوشتن این کتاب این بود که بطور واضح میزان کارایی تکنیک های هارمونیک را نشان بدهم. من به نحوی امیدبخش ، مطالب و اطلاعاتی را به روشی ساده و قابل فهم ارائه کرده ام. این اطلاعات ممکن است در ابتدا بسیار پیچیده به نظر برسد. اما همانطور که مثال های نموداری نشان داده اند ، رفتار قیمت یک سهم از نسبت های فیبوناچی تاثیر می پذیرد . همچنین تاریخ صحت الگوهای قیمت را به اثبات می رساند و این الگوها هم نواحی بحرانی برای بازگشت های بالقوه را نشان می دهند . بنابراین اگر شما بتوانید چند نسبت هارمونیک مهم را که در یک جا جمع شده اند پیدا کنید و ناحیه قویتری را تعیین کنید آن وقت شما تریدر موفقی خواهید شد .

منطقه همگرایی نسبت های هارمونیک یا همان PRZ ، مهمترین مفهوم در این کتاب است . هر چند نسبت ها و پترن ها می توانند متفاوت باشند ، اما آنها صرفا ارکانی هستند که برای پیدا کردن نتیجه مشابه از منطقه ای (PRZ) استفاده می کنند که رفتار معاملاتی به احتمال زیاد تغییر خواهد کرد . همان طور که هم اکنون می دانید زمانی که چندین نسبت هارمونیک در یک ناحیه معین جمع می شوند ، احتمال یک بازگشت قیمت بسیار زیاد است.

مهمترین مفهوم بعدی این است که به بازار اجازه بدهید تا به شما بگوید چه زمانی وارد معامله شوید . هر چند هر چیزی می تواند اتفاق بیفتد و همیشه آن چیزی که بازار می گوید درست است ، اما موقعیت های هارمونیک مناطقی که شما باید بخرید و بفروشید را نشان خواهند داد . این تکنیک ها درجه بسیار زیادی از صحت و درستی را در تشخیص فرصت های سودآور دارا هستند . من معتقدم که نمودارهای قیمت در این کتاب مدارک کافی برای اثبات این ادعا را فراهم می کنند . مشکل ترین قسمت از این فرآیند می تواند انتظار برای یک موقعیت ترید واضح باشد . اما اگر شما بتوانید صبور باشید ، بازار فرصت های فراوانی را برای انجام ترید های موفق فراهم خواهد کرد . در حقیقت موقعیت هایی به وجود خواهند آمد که آن قدر واضح هستند که نقطه ورود برای ترید را به طور مشهودی آشکار می کنند.

آخرین موردی که می خواهم با گفتن آن از شما وداع کنم این است که سرنوشت و تقدیر خودتان را ، خودتان کنترل کنید . اگر می خواهید که یک تریدر بزرگ بشوید ، شما مجبورید که سرسخت ترین منتقد خودتان باشید . گذشته از این شما باید راغب باشید که برای بازبینی اعمال و اقداماتان ، قدرت بخشیدن به مهارت هایتان و همچنین بهبود بخشیدن به توانایی هایتان وقت صرف کنید.

اولین مرحله این است که تجربیاتتان را در یک دفتر تحلیل ثبت کنید . من دیگر نمی توانم بیش از این در مورد اهمیت این کار علی الخصوص در مراحل ابتدایی یادگیری ، اصرار و پافشاری کنم . شما مهارت های معاملاتی خود را بهبود نخواهید بخشید مگر اینکه احساسات و طرز تفکرتان را در حین مواجهه با یک موقعیت ، ثبت و ضبط کنید . مرحله بعدی این است که پربنتی از نمودار سهمی که دارای یک موقعیت بالقوه است ، تهیه و دقیقا جایی که اقدام به ترید (خرید یا فروش) کرده اید را علامتگذاری کنید و در نهایت یک صورتجلسه از عملکرد کلیتان لازم و ضروری است .

پس از ثبت این اطلاعات ، شما باید این مطالب را از نو بازبینی کنید . دفتر تحلیل و یادداشت های معاملاتی تان قابل اطمینان ترین ارزیابی از رفتار معاملاتی شما هستند . از روی این اطلاعات است که شما می توانید نقاط قوت و ضعف خود را کشف کنید. اگر کارهایی که در هنگام ترید انجام می دهید درست باشد(معاملات موفق) ، ممکن است بخواهید آن کارهایی را که بر اساس اصولی مستحکم استوارند و نتایج خوبی را به ارمغان آورده اند ، ثبت کنید. اگر معاملاتتان موفق نیست ، به خصوص پس از متحمل شدن چندین معامله متضرر پی درپی ، شاید بخواهید ترید کردن را متوقف کنید و به ارزیابی دوباره عملکردتان بپردازید. پس از اینکه اشتباهاتتان را تشخیص دادید ، شما می توانید تکنیک هایی را برای اصلاح این نواقص تدوین کنید.

مهم ترین انگیزه برای بازبینی عملکردتان این است که شما با خودتان روبرو شوید. با بررسی و مرور پی در پی معاملاتتان

می توانید یک ارزیابی قابل اطمینان از پیشرفت خود داشته باشید. بازبینی و بررسی یادداشت های معاملاتی تان می تواند دشوار باشد لیکن این کار باعث می شود مسئولیت کامل همه اقدامات و رفتارهایتان در حین ترید را بپذیرید.

و در نهایت بسیار مهم است که یک ذهن باز و مشتاق یادگیری بیشتر را در خود پرورش دهید. همیشه نسبت ها و روابط جدیدی وجود دارند که قابل یادگیری هستند. شاید شما در آینده ناحیه جدیدی برای رفتار هارمونیک قیمت پیدا کنید که ورای این مباحث آموزش داده شده باشد. من شخصا در حال تجربه و آزمایش تکنیک ها و کاربردهای جدیدی از روش های هارمونیک هستم تا رفتار قیمت را خیلی کامل تر تجزیه و تحلیل کنم. من دائما برای یادگیری بیشتر تلاش می کنم آنقدر که بتوانم شیوه معاملاتی خود را تکمیل کنم.

به عقیده من تنها راه موفق بودن در بازار سهام ، تحلیل کردن بازار با تکنیک های هارمونیک است. این تکنیک ها ثمربخش ترین ابزار برای تشخیص فرصت های سودآور هستند. وقتی که شما شروع به یادگیری این تکنیک ها می کنید تا در سال های آتی ماهر و چیره دست شوید ، از اینکه ترید کردن واقعا به چه سادگی است متحیر خواهید شد. با یادگیری این تکنیک ها من تضمین می کنم که دید شما نسبت به قیمت ها هرگز مثل گذشته نخواهد بود .

Chapter 12

Patterns

The Harmonic Trader

By Scott M Carney

پترن ها

www.iranbourseonline.com

به واسطه تشخیص الگوهای قیمتی می توان به تداوم در معاملات سودده دست یافت . البته ممکن است این امر بعید به نظر برسد ، اما قیمت ها در الگوهای هارمونیکی حرکت می کنند که تشخیص آنها بسیار آسان است . برای تشخیص الگوها ، شما باید چشمانتان را برای کشف این چنین حرکتهای قیمت (پترن) ورزیده کنید .

در خصوص ماهیت حرکت قیمت تئوری های زیادی وجود دارد . بسیاری از نظریه پردازان معتقدند که بازار سهام بطور تصادفی عمل می کند . مطابق تئوری سیر تصادفی ، که در کتاب The Random Character of Stock Market Price نوشته Paul H.Cootner به شهرت رسید ، حرکت قیمت بطور زنجیروار مستقل است . به این معنی که سابقه قیمت شاخص قابل اطمینانی برای حرکت قیمت در آینده نیست . اگر چه این تئوری کم و بیش صحت دارد (از آنجایی که هر چیزی ممکن است در این بازار اتفاق افتد) ، اما تاریخ ثابت کرده است که الگوهای خاصی یقیناً تکرار می شوند . بنابراین مطالعه و بررسی نمونه های گذشته چنین الگوهایی برای داشتن شناخت از فرصت های آتی ، مهم تلقی می شوند.

من پیشنهاد می کنم که شما برگه خلاصه پترن ها را که در انتهای این کتاب قرار دارد ، بردارید و در جایی که اغلب اوقات جلو چشمتان است ، بچسبانید . شما ممکن است بخواهید که آن را در کنار کامپیوتر یا در مکانی که به معامله کردن شما اختصاص دارد بچسبانید . حتی ممکن است که بخواهید چندین کپی از این برگه تهیه کنید و آنها را در هر سوی منزلتان به دیوار بزنید.

در ابتدا ممکن است تشخیص این الگوها دشوار باشد چرا که احتمالا شما یک نمودار قیمت را هرگز از این منظر بررسی نکرده اید . کشف کردن این الگوها تا اندازه ای شبیه به حل کردن جدول است . آشناترین لغات ، ساده ترین لغات برای پیدا کردن خواهند بود . اما لغات پیچیده تر ممکن است قبل از پیدا شدن وقت زیادی از ما بگیرند . بنابراین مهم است برای سر آوردن از این الگوها و کشف آنها در نمودارهای قیمت ، به خودتان وقت بیشتری بدهید . اما هر چه شما بیشتر الگوها را

مطالعه و بررسی کنید ، آنها هم در نمودار بیشتر به چشم خواهند آمد.

این الگوها چارچوب های بسیار اساسی هستند که به تشخیص فرصت های ترید بالقوه کمک می کنند و مناطقی را برای بررسی یک موقعیت ترید به ما نشان می دهند . من نمونه های زیادی را مشاهده کرده ام که قیمت درست بعد از برخورد به نقطه تکامل پترن بازگشته است . مهمترین مفهوم در تشخیص پترن ، معین کردن ناحیه خاصی است که قیمت می تواند در آنجا برگردد . اگر قیمت ، چندین نسبت فیبوناچی که در یک ناحیه کوچک همگرا شده اند را دارا باشد بازگشت قیمت بسیار محتمل است .

پس از اینکه شما کمی تجربه کسب کردید شروع خواهید کرد به اعتماد کردن به پترن ها بیشتر از هر اطلاعات و معلومات دیگری . بنا بر تجربه ام زمانی که من در ابتدا از این تکنیک ها استفاده می کردم ، بارها و بارها مانع از انجام یک سری از اقدامات در زمان مناسب می شدم . برای مثال اگر من در یک سهم در پوزیشن خرید بودم ، معمولا برای سود بیشتر در پوزیشن می ماندم حتی اگر می دانستم که یک پترن دیگری در حال نشان دادن یک ناحیه بازگشتی در سر راه آن است . هر چند به سرعت فهمیدم که این طرز فکر برایم گران تمام می شود . هنگامی که من این تکنیک ها را بطور موثر بکار گرفتم ، معاملاتم و ادراکم از رفتار قیمت بطور چشمگیری بهبود یافت.

مهم است که شما این الگوها را به عنوان تابلو راهنمای قابل اطمینانی از رفتار قیمت در آینده ببینید . آنها شما را در سراسر این بازار بسیار گیج کننده راهنمایی خواهند کرد . بی گمان اغلب ، الگوها یک فرصت بالقوه را نشان خواهند داد در حالی که اخبار در رسانه های خبری چیز دیگری را پیشنهاد می کنند . بنا بر تجربه من این طور بوده که الگوها قابل اطمینان ترین نشانگرها برای روندهای قیمت هستند و آنها مبنای بنیادین من برای تشخیص فرصت های ترید می باشند .

ایران بورس آنلاین

www.iranbourseonline.com

توضیح : مطالب زیر ترجمه دوست عزیز امیر مقدم است که از قول اسکات کارنی ترجمه شده است :

بخش اول

---- تاریخ ثابت کرده است که هرگاه نقطه تکامل يك الگوی قیمت (pattern) با نسبت های فیبوناچی همگرایی داشته باشد، به احتمال بسیار بالایی قیمت در آن ناحیه باز می گردد.

---- هرچه تعداد نسبت های موجود در PRZ بیشتر باشد، احتمال بازگشت قیمت در این ناحیه بیشتر است.

---- کارنی می گوید: هرچند من نمی توانم در مورد رفتار قیمت در هنگام مواجهه با PRZ توضیحی بدهم اما با مطالعه هزاران نمودار فهمیده ام که نسبت های هارمونیک تأثیری شگرف به روی رفتار قیمت می گذارند.

---- نسبت های فیبوناچی خیلی عجیب و غریب هستند چرا که در يك ناحیه PRZ که تعدادی از آن ها در این ناحیه جمع می شوند، دانستن اینکه کدام نسبت باعث بازگشت قیمت شده کار مشکلی است. اما من معتقدم که درجه خاصی از اولویت بین آن ها برقرار است .

---- من از قوانین کلی و سرانگشتی استفاده می کنم که به بهتر شدن اقداماتم کمک می کند:

1- بین چند نسبت فیبوناچی که در يك جا جمع شده اند، نسبتی که از روی ضلع بزرگتری محاسبه شده معمولا قابل توجه تر و معنی دارتر است.

- 2- هرچه پترن بزرگتر باشد ناحیه بازگشتی قابل توجه تری را ایجاد می کند. یعنی پترنی که روی نمودار هفتگی ایجاد شده قابل توجه تر از پترن ایجاد شده روی نمودار روزانه است. همچنین اگر یک پترن کوچکتر درون یک پترن بزرگتر جای گرفته باشد، پترن بزرگتر معمولاً مهم تر و قابل توجه تر است.
- 3- هرچه نسبت های بیشتری در یک ناحیه جمع شده باشد آن ناحیه هارمونیک تر است. اگر PRZ دارای چها یا پنج نسبت باشد باید بسیار هارمونیک فرض شود. اگر قیمت در برخورد با این ناحیه بازگشتی نداشت نشان دهنده این است که ترند قدرت زیادی دارد.
- 4- همچنین PRZ زمانی بسیار هارمونیک است که نسبت ها خیلی به هم نزدیک باشند و ناحیه تنگ تری را ایجاد کنند.

---- تکنیک های هارمونیک صرفاً یک علم محض نیستند بلکه بیشتر شبیه به یک هنر می باشند. درست است که این تکنیک ها نیاز مبرم به محاسبات دقیق دارند اما داشتن یک درک و شهود در مورد نسبت های فیبوناچی برای سنجش درست و دقیق رفتار قیمت بسیار لازم و ضروری است و این بدست نمی آید مگر با صرف وقت، کار و تلاش مداوم و تجربیات عملی.

بخش دوم

---- نسبت های فیبوناچی به دو دسته تقسیم می شوند:

- 1- اعداد اولیه که موثرترین و مهم ترین هستند و عبارتند از 0.618 و 0.786 و 1.27 و 1.618.
- 2- اعداد ثانویه که این اعداد هم دارای خاصیت هارمونیک هستند. درست است که اعداد زیادی را می توان از دل سری فیبوناچی بیرون کشید اما به نظر من همه آن ها دارای شخصیت حقوقی نیستند. به نظر من مهم ترین آن ها عبارتند از: 0.382 و 0.5 و 1.00 و 2.00 و 2.24 و 2.618 و 3.14.
- *----* من تاکید دارم که از اعداد ثانویه برای تکمیل ناحیه PRZ استفاده شود که این ناحیه مضافاً باید دارای نسبت های اولیه و همچنین پترن هندسی واضح باشد.

---- وقتی قیمت از نسبت 1.618 عبور می کند با نسبت های 2.24 و 2.618 و 3.14 روبرو می شود که اصطلاحاً Extreme Number خوانده می شوند که مرسوم ترین آن ها 2.24 است و بعد 2.618 و دست آخر در شرایط بسیار نادر 3.14 مورد بحث است.

---- نسبت 0.382 اصطلاحاً Sharp Number خوانده می شود. چرا که در حرکات شدید قیمت به سرعت و بطور ناگهانی ظاهر می شود

---- نسبت های 0.5 و 1.00 و 2.00 اصطلاحاً Static Number خوانده می شوند چرا که مستقیماً (مانند سایر اعداد ثانویه) از سری فیبوناچی مشتق نشده اند. ریتریس 0.5 زیاد در حرکات قیمت دیده می شود من معتقدم تکنیسین ها از این نسبت بیشتر از نسبت های فیبوناچی استفاده می کنند یعنی بازگشت قیمت به اندازه نصف حرکت قبلی برای تکنیسین ها حائز اهمیت است. من احساس نمی کنم که این اعداد به اندازه سایر اعداد ثانویه هارمونیک باشند. ما می توانیم تنها از آن ها برای تحلیل حرکت قیمت کمک بگیریم. بنابر این من تنها از آن ها به عنوان یک عامل مکمل در یک موقعیت هارمونیک استفاده می کنم.

---- همانطور که قبلا هم گفته شد از اعداد ثانویه فقط باید به عنوان تکمیل کننده اعداد اولیه در ناحیه PRZ استفاده شوند و این اعداد به تنهایی برای تشکیل ناحیه PRZ قابل قبول نیستند. پس مهم است که از وجود این اعداد باخبر باشیم تا بتوانیم يك ناحیه هارمونیک را با وضوح بیشتر مشخص کنیم .

=====

