

آموزش تحلیل تکنیکال مقدماتی و پیشرفته

مدرس: فرهاد سلطانی

<http://mql.blogfa.com/>



1395

تحلیل تکنیکال مقدماتی



Farhad Soltani

<http://mql.blogfa.com/>

1395



مقدمه

در سالهای گذشته به علت اولویت بندی اهدافم ،علاقه ای به پر رنگ شدن در بازار بورس و ... نداشتم و طبیعتا هم تهیه جزو و فعالیت در گروهها و... زمانی تعریف نشده بود و نتیجتا فعالیتی هم نداشتم.چون بیشتر انرژی بنده در زمینه مطالعه و تحقیق بوده است.اما این شرایط زمانی، برای بنده فراهم شده تا تجربیات و مطالعات خودم را بین علاقمندان به حوزه تحلیل تکنیکال در میان بگذارم.این جزو حاصل سالها مطالعه ، تحقیق ، تدریس و جمع آوری از منابع مختلف است.و این اولین جزو رسمی بنده بوده و این نوشتار را به عنوان شروع این رسالت فرهنگی بنده در نظر بگیرید.باشد که در این مسیر با پیشنهادات و انتقادات خودتان ، راهنمایی بفرمایید.

باتشکر

فرهاد سلطانی-پاییز ۹۵

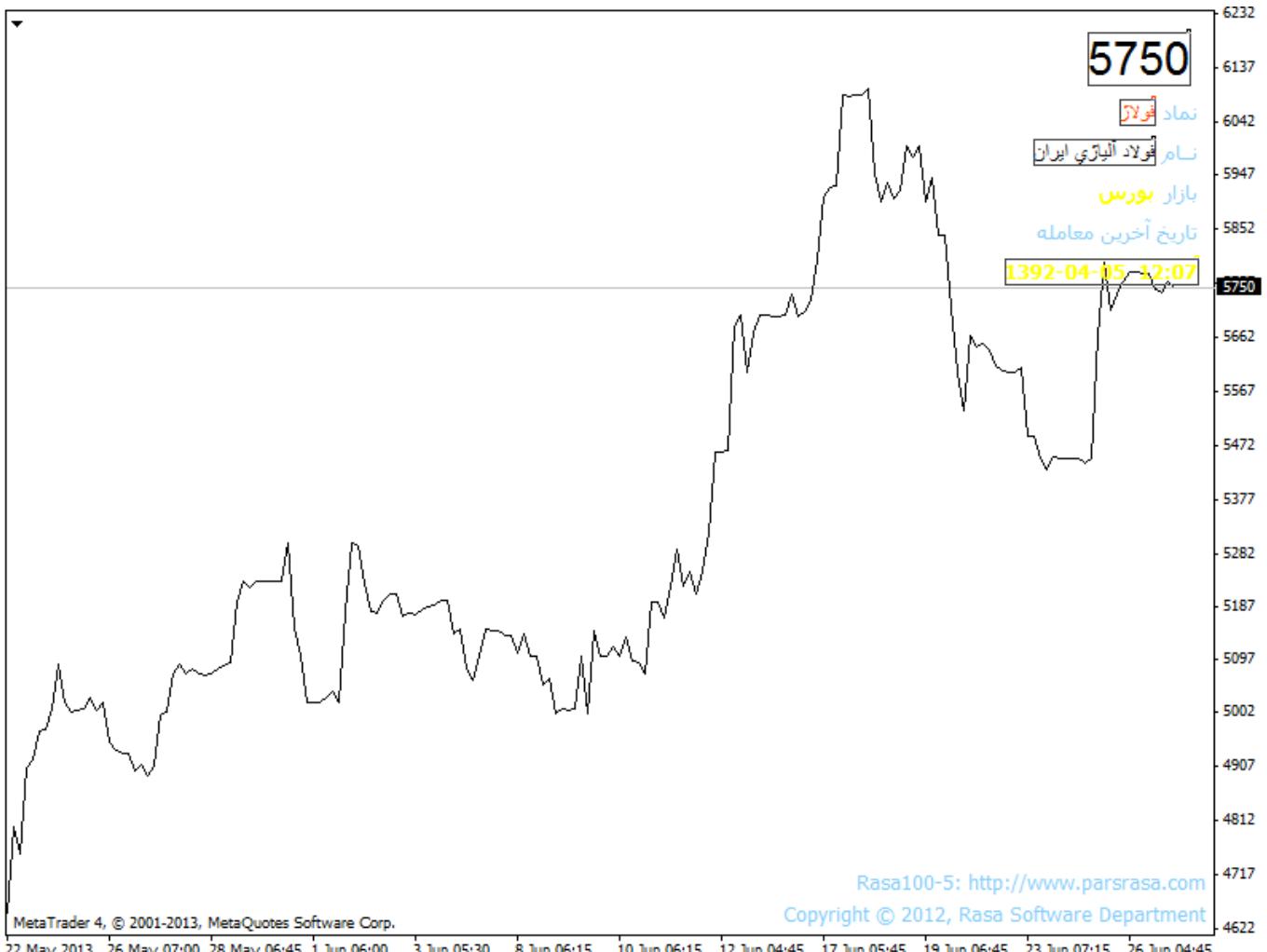
۰۹۱۰ ۹۲۹ ۱۳۷۳

iran_analyst_stock@yahoo.com

<http://mql.blogfa.com>

تعريف تحلیل تکنیکال

مطالعه رفتار و حرکات قیمت سهام در گذشته با هدف پیش بینی روند قیمت ، در آینده. که برای هر نوع کالا یا شاخص یا سهام قابل استفاده است.



آیا گذشته می تواند برای پیش بینی آینده مورد استفاده قرار بگیرد؟

- روش های پیش بینی ، از پیش بینی وضع هوا گرفته تا تحلیل های بنیادی ، کاملا مبتنی بر اطلاعات گذشته می باشد.
- علم احتمالات بر اساس پیش بینی بنا نهاده شده است.
- بیشتر اعمال ما بر اساس تجربیات گذشته ما از آن عمل قابل پیش بینی است.

- نمودار قیمت‌ها تجلی افکار عمومی است که بر اساس اصول روانشناسی عمومی که قابل پیش‌بینی است بنا نهاده شده است.

رفتارهای بازار شامل سه اصل اولیه دارد: قیمت، زمان، حجم

فلسفه تحلیل تکنیکال

- همه چیز در قیمت لحاظ شده است: یعنی همه عوامل سیاسی اقتصادی و... در قیمت لحاظ شده است. تغییرات قیمت تابعی از عرضه و تقاضاست. اگر تقاضا بیشتر از عرضه باشد قیمت صعودی می‌شود و اگر عرضه بر تقاضا پیشی گیرد قیمت کاهش می‌یابد. این تغییرات، اساس تمام پیش‌بینی‌های اقتصادی و بنیادی است.
- قیمت‌ها بر اساس روند حرکت می‌کند: هدف از ترسیم نمودار قیمت، شناسایی روند و پیش‌بینی جهت حرکت این روند است.
- تاریخ تکرار می‌شود. آینده چیزی نیست جز گذشته.

تفاوت تحلیل گر تکنیکال و فاندامنتال

- تحلیل گر تکنیکال عقیده دارد که تغییرات قیمت تنها چیزی است که او نیاز دارد بداند و دانستن علتها و دلایل این تغییرات لازم نیست و در مقابل تحلیلگر فاندامنتال همواره به علتها و دلایل تغییر قیمت می‌پردازد.
- تحلیل گر تکنیکال تاثیر عوامل فاندامنتال بر روی چارت را بررسی می‌کند و چون همیشه تاثیر عوامل فاندامنتال در روی قیمت لحاظ می‌شود بنابرین بررسی فاندامنتال در درجه دوم است.
- چارتیست به راحتی می‌تواند هر نوع بازاری را که تمایل داشته باشد مورد مطالعه قرار دهد حتی اگر دانش فاندامنتال نداشته باشد در حالی که اغلب تحلیلگران فاندامنتال به علت اینکه همواره مقادیر زیادی اطلاعات و صورتهای مالی را باید بررسی کنند، چندان نمی‌توانند از جایی که هستند دور شوند.

ما با تحلیل موج به دنبال پیدا کردن سه نکته هستیم:

۱. زمان تغییر وضعیت .
۲. میزان تغییرات قیمت .
۳. تعیین جهت حرکت .



تاریخچه تحلیل تکنیکال

چارلز داو

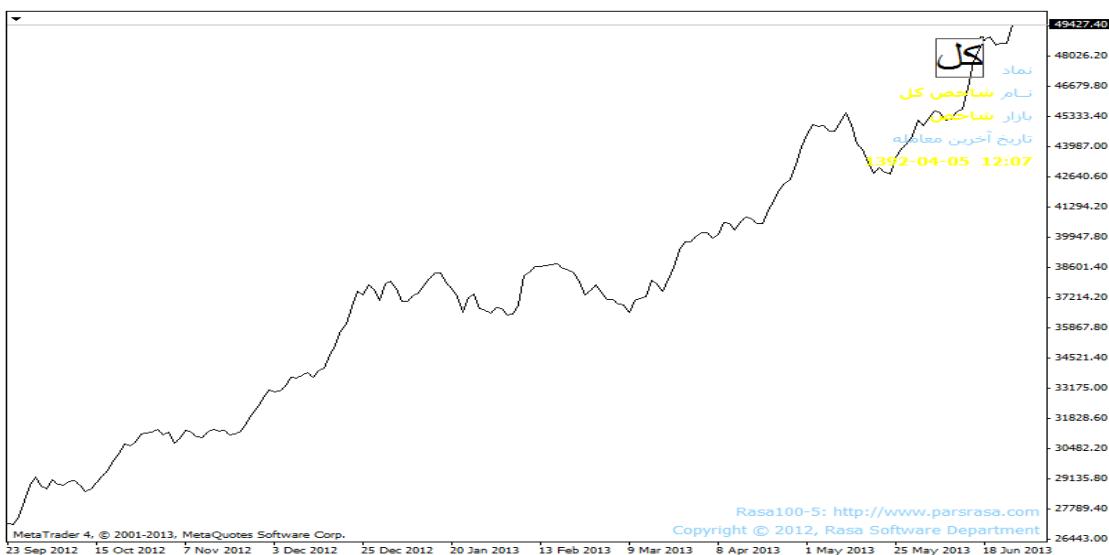
نظریات داو از ۲۵۵ سرمقاله‌ای که برای وال استریت ژورنال نوشته استخراج شده است. چالرز داو، موسس وال استریت ژورنال و بنیانگذار داوجونز است. پس از مرگ او، با جمع آوری مقالاتش نظریه داو شکل گرفت. نظریه داو ۶ اصل اساسی دارد که توسط نلسن، رابرت، رها و همیلتون آن را به صورت امروزی اصلاح کردند.

داو دریافتہ بود که میانگین قیمت پایانی سهام می‌تواند مبنای خوبی برای تشخیص وضعیت اقتصادی کشور باشد. در سوم ژوئن ۱۸۸۴ تخصیص میانگین یا شاخص بازار سرمایه که از میانگین قیمت نهایی ۱۱ شرکت بدست آمده بود توسط داو منتشر شد.

نظریات داو تقریباً به عنوان اصول پایه‌ای تحلیل تکنیکال استفاده می‌شود.

اصل اساسی نظریه داو

۱. همه چیز در میانگین‌ها (شاخص‌ها) لحظه می‌شود.



تعريف روند

روند جهت حرکت قیمت را در بازار نشان می دهد.

بازار هرگز بصورت یک خط راست حرکت نمی کند و تغییرات بازار به صورت یکسری از حرکات زیگزاگ مشخص می شود. این زیگزاک ها همانند یکسری موج های پی در پی می باشند که شامل موجهای صعودی و موج های نزولی می باشند.

برآیند حرکات این موج های صعودی و نزولی روند بازار را تشکیل می دهد که شامل روند های صعودی و نزولی و خنثی می باشد.

۲. بازار سه نوع روند دارد:

۱. روند صعودی: کف موج بعدی از کف موج قبلی بالاتر باشد.





۲. روند نزولی: سقف موج قبلی از سقف موج جدید بالاتر باشد



۳. خنثی یا range side یا سقف و کف موجها در یک محدوده مشترک باشند



از نظر داو یک روند خود مشتمل بر سه روند دیگر است:

۱. روند اولیه یا اصلی یا بزرگ یا جریان : نشان دهنده جریان حاکم بر کل روند است. روند بزرگ یا بلند مدت که ممکن است از یک تا چند سال به طول بیانجامد. اگر بازار پی در پی سقف های بزرگتر و کف های بزرگتر بسازد افزایی است.

۲. روندهای ثانویه یا میان مدت یا امواج :در حقیقت امواجی هستند که جریان یا روند اولیه را تکمیل می کنند. از ۱ تا ۳ ماه به طول می انجامد و تا حدود یک سوم تا دو سوم روند دوم پیش از خود بازگشت انجام می دهد. (عموماً ۳۳ تا ۶۶ درصد از حرکت اصلی قیمت را اصلاح می کند).

۳. روند کوچک یا کوتاه یا سطح ناهموار دریا : از ۱ روز تا ۳ هفته به طول می انجامد و کم اهمیت و گمراه کننده هستند.

اگر هر موج نسبت به موج قبلی نفوذ بیشتری در ساحل داشته باشد جریان جاکم می شود. هرگاه بالاترین نقطه ای که امواج متوالی در ساحل به ان می رساند کاهش داشته باشد جریان رو به بازگشت و نابودی است.

روندهای اصلی یا بزرگ سه فاز دارند:

- فاز تجمعی یا تراکم : زمانی است که خبرگان بازار بر خلاف نظر بازار شروع به خرید می کنند. در این فاز قیمت سهام خیلی تغییر نمی کند زیرا این سرمایه گذاران در اقلیتند.
- فاز مشارکت عمومی: با شروع رشد قیمت مشارکت عمومی همراه می شود و قیمت به سرعت رشد می کند. این فاز تا زمانی اتفاق می افتد که سفته بازی بسیار زیاد می شود.
- فاز توزیع: در این نقطه ، سرمایه گذاران زیرک شروع به توزیع سهام می کنند.

۳. شاخص ها باید یکدیگر را تایید کنند.

در زمان داو ، اولین شاخص او شاخص صنعتی بود و دیگری شاخص شرکت های راه آهن . برای داو ، بازار سعودی برای شاخص صنعتی تا هنگامی که شاخص راه آهن نیز سعود نمی کرد تایید نمی شد. از نظر او زمانی که مابین این دو شاخص واگرایی بود یک هشداری جهت تغییر اوضاع وجود داشت.

۴. حجم معاملات باید روند را تایید کند.

اصولاً نظریه داو بر رفتار نرخ تاکید دارد و حجم تنها برای تعیین موقعیت های نامعلوم بکار می رود. حجم باید در جهت روند اصلی گسترش یابد. با رشد قیمت ، حجم معامله نیز می بایست رشد کند

۵. روندها تا زمانی که اخطارهای قطعی جهت پایان آنها وجود نداشته باشد معتبرند

از نظر داو ، روندها با وجود نویزهای بازار (نوسانات بازار) همچنان پابرجا می مانند. ممکن است قیمت به صورت موقت در خلاف جهت روند حرکت کند اما به سرعت مجدداً به حرکت در جهت اصلی ادامه خواهد داد. تشخیص اخطار قاطع بازگشتی کار ساده‌ای نیست. ابزارهای تحلیل تکنیکی برای شناسایی این هشدارهای بازگشتی بسیار مفیدند اما توسط تحلیلگران مختلف به صورت‌های متفاوت تفسیر می شوند.

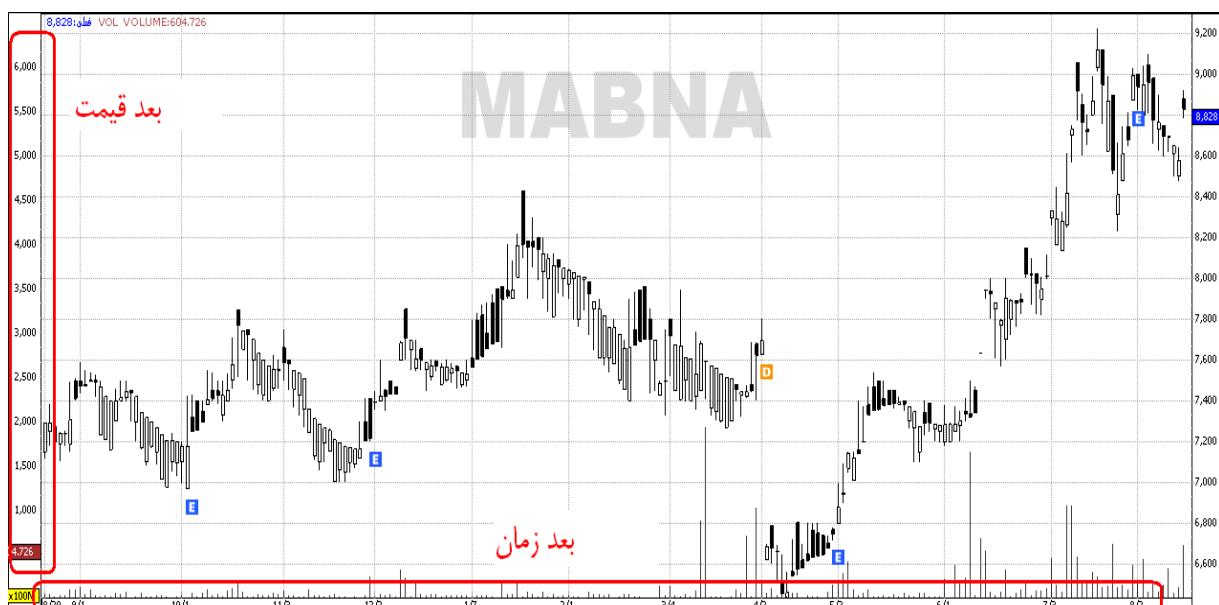
انتقاد به نظریه داو

- بطور متوسط ۲۰ تا ۲۵ درصد از تحرکات بازار پیش از بوجود آمدن اخطار خرید و فروش توسط نظریه داو به خاطر خاصیت ریاضی میانگین قابل پیش‌بینی نیست.

اجزای نمودار

- بعد قیمت و زمان:

نمودارها از دو بعد قیمت و زمان تشکیل شده‌اند. خط افقی نشان دهنده بعد زمان و خط عمودی نشان‌دهنده بعد قیمت است.



- تغییرات قیمت در بازه زمانی:

M1	M5	M15	M30	H1	H4	D1	W1	MN
----	----	-----	-----	----	----	----	----	----

اگر بازه زمانی را یک روزه فرض کنیم در هر روز چهار قیمت اهمیت ویژه دارد.

قیمت اولین معامله در طول یک دوره زمانی مشخص است . Open

بالاترین قیمتی است که سهم در طول یک دوره زمانی مشخص معامله می شود . High

پایین ترین قیمتی است که در طول یک دوره زمانی مشخص معامله می شود . Low

آخرین قیمتی است که ورق بهادری در طول یک دوره زمانی مشخص معامله می شود . Close . قیمت نهایی بدلیل نشان دادن آخرین وضعیت ،بیشترین مورد استفاده را در تحلیل دارد .

ساختار نمودار

نمودارهای قیمت به طور معمول بصورت قیمت و زمان نشان داده می شود. زمان به صورت افقی نشان داده می شود ، که تاریخ ها در پایین نمودار از چپ به راست حرکت می کنند. مقیاس قیمت به صورت عمودی نمایان می شود، از قیمت های پایین تا قیمت های بالاتر.

دو روش برای نشان دادن قیمت ها وجود دارد. رایجترین راه با استفاده مقیاس خطی یا حسابی است. در نمودار مقیاس خطی برای مثال، هر افزایش قیمت به صورت یکسان رسم شده است. برای مثال صعود از ۱۰ به ۲۰ همانند صعود از ۵۰ به ۶۰ نمایش داده می شود، در هر دو مورد ۱۰ واحد صعود شکل گرفته که در مقیاس عمودی یکسان نشان داده می شود. این مقیاس خطی رایجتر است.

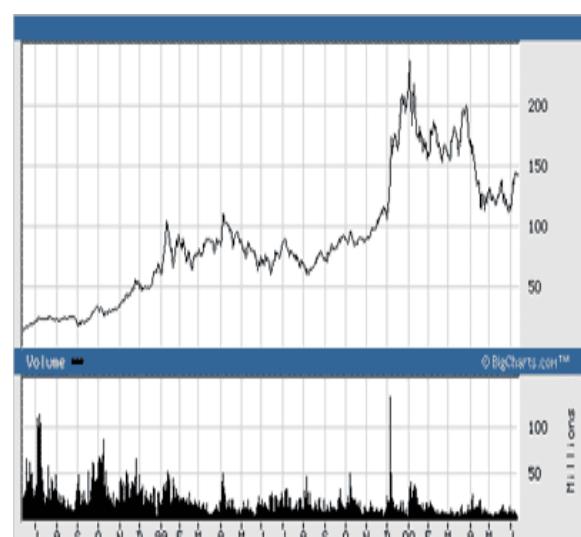
نوع دیگر از مقیاس ها، مقیاس لگاریتمی است. در نمودارهای لگاریتمی تغییرات قیمت به صورت درصدی اندازه گیری می شود. به بیان دیگر، حرکت قیمت از ۱۰ تا ۲۰ بسیار بزرگتر از حرکت قیمت از ۵۰ تا ۶۰ نشان داده می شود. دلیلش این است که از لحاظ درصدی، صعود از ۵۰ تا

معادل ۲۰ درصد رشد است اما صعود از ۱۰ تا ۲۰ معادل ۱۰۰ درصد صعود است. نمودارهای لگاریتمی بر اساس صعود درصدی ایجاد شده اند و صعود از ۱۰ تا ۲۰ را معادل صعود از ۵۰ تا ۱۰۰ نمایش می دهد.

به صورت عمومی، تفاوت مابین دو مقیاس برای دوره های زمانی کوتاه مدت خیلی اهمیتی ندارد. بیشتر تحلیلگران همچنان از مقیاس حسابی برای تحلیل هایشان استفاده می کنند. اما تفاوت در نمودارهای بلند مدت تر اهمیت بیشتری دارد. در یک نمودار لگاریتمی، صعود متواالی قیمت در مقایسه با حرکتهای ابتدایی قیمت کوچکتر نمایان می شود. در نتیجه، خطوط روند در نمودارهای لگاریتمی بسیار سریعتر شکسته می شوند. **هیچ جواب قطعی وجود ندارد که نشان دهد کدام تکنیک برتر است.**



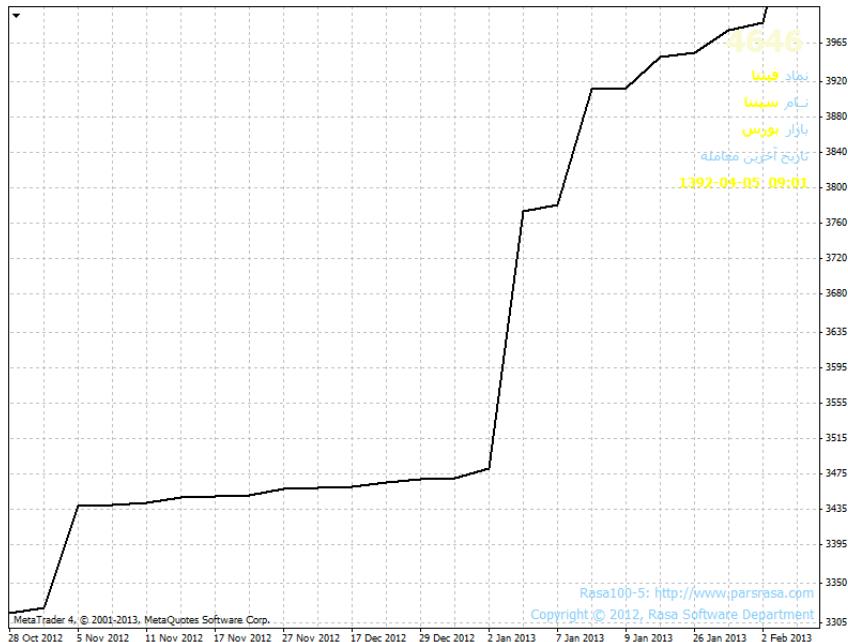
نمودار با مقیاس لگاریتمی



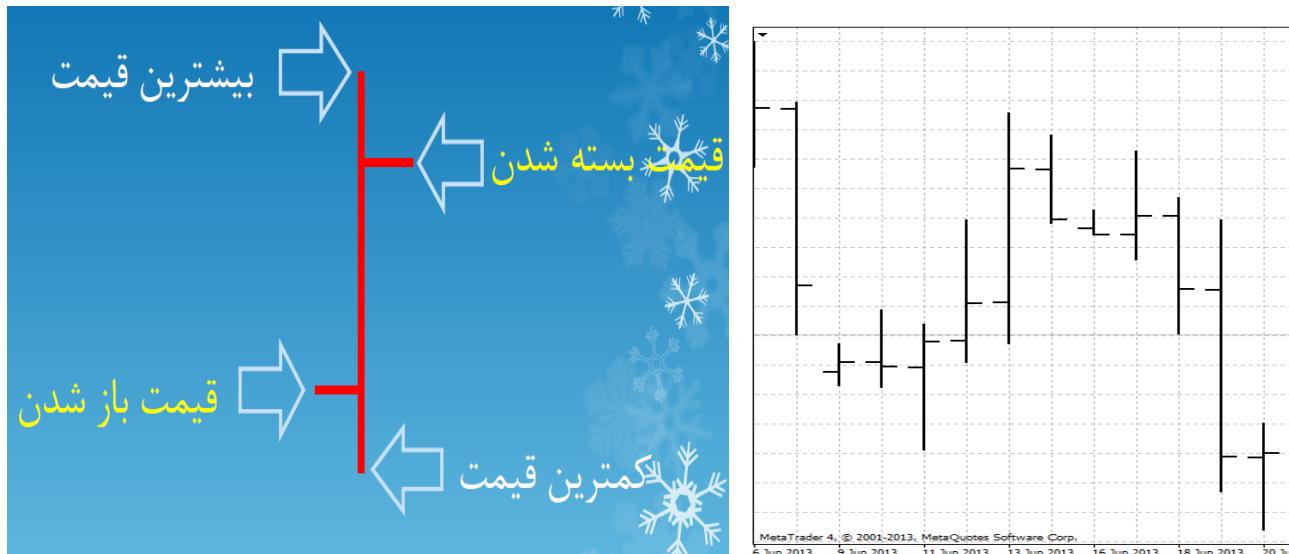
نمودار با مقیاس حسابی یا خطی

أنواع نمودار

۱. نمودار خطی Line Chart: از بهم پیوستن قیمت بسته شدن یک سهم در روزهای متواالی. ضعف: جزئیات کمتری از احساسات بازار را نمایش می دهد مثلاً کمترین و بیشترین قیمت را نشان نمی دهد.



۲. نمودار میله ای Bar chart: نشاندهنده چهار قیمت close & open&high&low



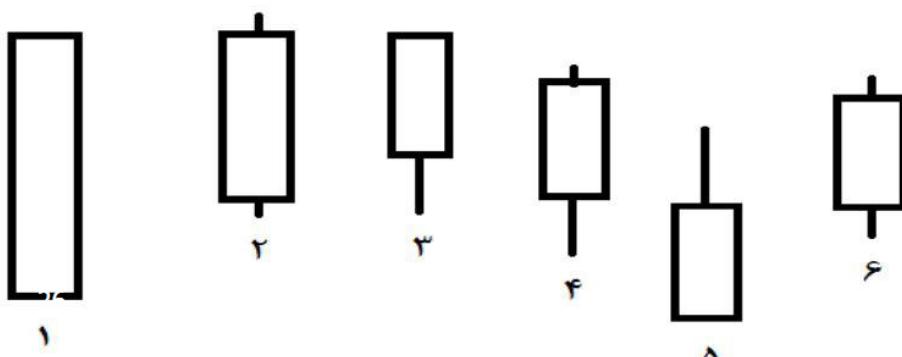
۳. نمودار شمع Candel stick: نشاندهنده چهار قیمت close & open&high&low بصورت



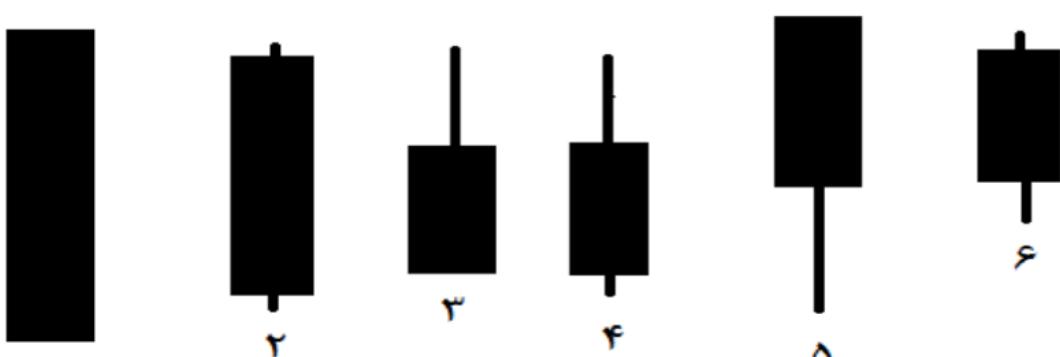
نمودارهای شمعی سفید تو خالی

تفسیر	نام	شماره
افزایشی زیاد	شمع بلند سفید - بدون سایه	۱
افزایشی زیاد	شمع سفید بلند	۲
افزایشی	شمع با سایه پایین تر	۳
افزایشی	شمع سفید بلند - سایه پایین تر	۴
افزایشی ملايم	شمع سفید بلند - سایه بالاتر	۵
افزایشی با ثبات	شمع سفید کوتاه	۶

نمودار زیر انواع شمع های سفید افزایشی را نشان می دهد:

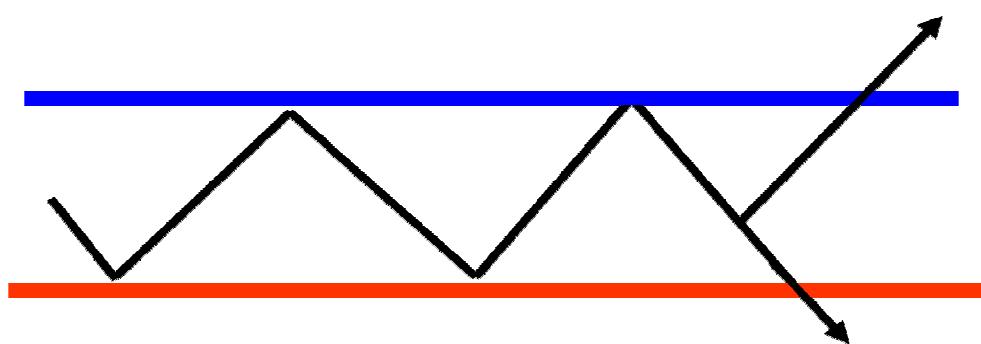


تفسیر	نام	شماره
کاهشی زیاد	شمع سیاه بلند - بدون سایه	۱
کاهشی زیاد	شمع سیاه بلند	۲
کاهشی	شمع سیاه بلند - با سایه بالایی بلند تر	۳
کاهشی	شمع سیاه با سایه بالایی بلند	۴
کاهشی ملايم	شمع سیاه با سایه پایین تر بلند	۵
کاهشی با ثبات	شمع سفید کوتاه	۶



خطوط حمایت و مقاومت

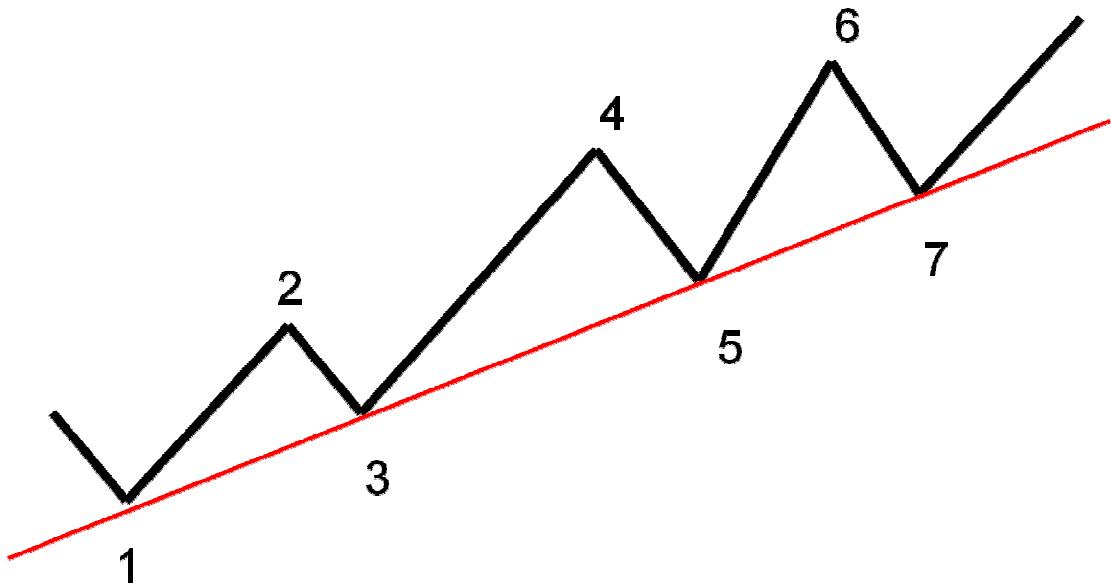
- خط مقاومت خطی است که در مقابل افزایش قیمت از خود مقاومت نشان می دهد و شکست آن نویدی جهت افزایش بیشتر قیمت است.
- خط حمایت خطی است که از قیمت ، جهت جلوگیری از کاهش بیشتر حمایت می کند و شکست آن نشاندهنده کاهش بیشتر قیمت است.



- نکته ۱: خط حمایت و مقاومت با حداقل دو نقطه تایید می شود.
- نکته ۲: پس از شکست خط مقاومت ، این خط تبدیل به خط حمایت می گردد و بالعکس پس از شکست خط حمایت این خط تبدیل به خط مقاومت می گردد.

خط روند صعودی

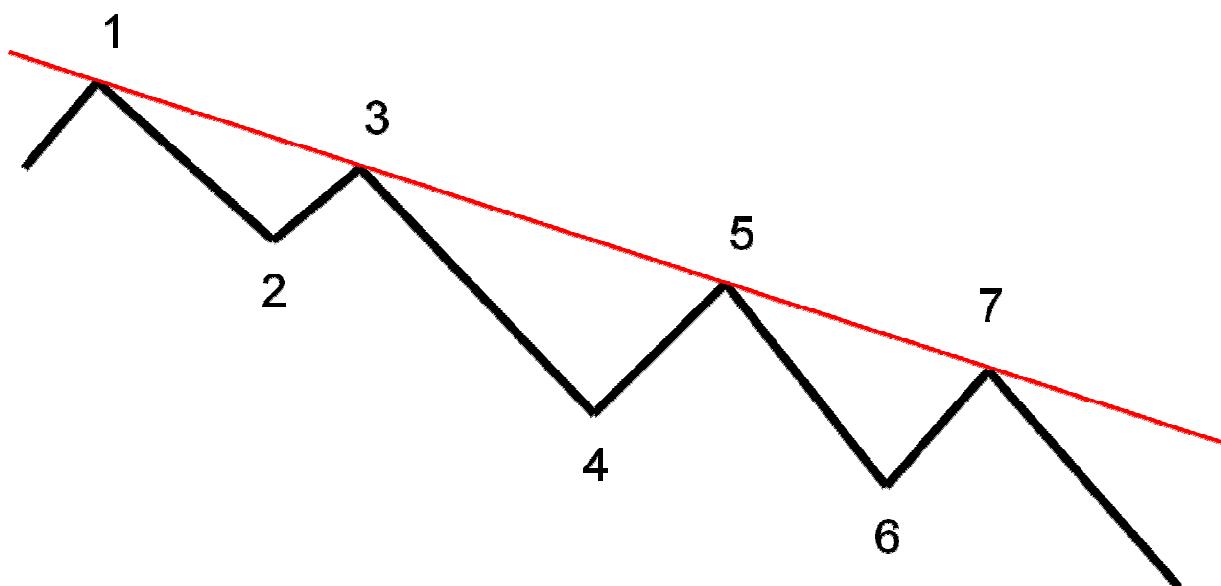
خط روند صعودی خط صافی است که انتهای موج های نزولی را به یکدیگر متصل می کند.



خطوط روند با دو نقطه رسم و با نقطه سوم تایید می شوند.

در اغلب موارد شکسته شدن خط روند یکی از بهترین و سریع ترین اخطارهای برگشت است.

خطوط روند نزولی



- معیار اعتبار خط روند طولانی بودن زمانی که خط روند صحت خود را حفظ کرده و تعداد دفعاتی که در برخورد با قیمت ایستادگی کرده می باشد.
- نفوذ بیشتر از ۳٪ قیمت پایانی آنطرف خط روند و بسته شدن قیمت دو کندل آنطرف آن می تواند تاییدی بر شکست خط روند باشد.

الگوهای شمعی ژاپنی

از تکنیک های نمودارهای شمعی می توان در نوسان گیری و سرمایه گذاریهای کوتاه مدت استفاده کرد. از ادغام و درهم افزایی شمع های ژاپنی و سایر ابزار تکنیکی می توانیم تکنیک های پر توانی را خلق کنیم.

اعتبار الگوهای شمعی امری ذهنی است و به تفکر و بررسی نیاز دارد.

تحلیل تکنیکی بیشتر نوعی هنر است تا علم. شما نباید برای اکثر شکلهای تحلیل تکنیکی انتظار قوانین سفت و سخت داشته باشید، فقط می توانید انتظار راهنمایی داشته باشید.

حدودیت ها

برای رسم یک شمع به قیمت پایانی نیاز داریم. بنابراین برای دریافت اخطار معتبر، منتظر قیمت پایانی بمانید. به این ترتیب تنظیم دستور خرید یا فروش به قیمت پایانی احتیاج دارد و لازم است چند دقیقه قبل از پایان شمع، قیمت پایانی را پیش بینی کنید و دستور خود را قرار دهید یا شاید ترجیح دهید برای تنظیم دستور خود تا باز شدن شمع بعدی منتظر بمانید.

نمودارهای شمعی ، اخطارهای بسیار مفیدی را مهیا می کند اما قیمت هدف را مشخص نمی کند. روش های دیگری برای محاسبه قیمت وجود دارد مانند سطوح حمایت و

مقاومت ، سطوح فیبونانچی ، هدف های نوسان سازی و غیره. برخی از تحلیلگران نمودارهای شمعی با اخطار خرید وارد معامله می شوند و تا زمانیکه اخطار فروش دریافت نکنند با آن معامله باقی می مانند. در الگوهای شمعی هموار باید به حرکات قبلی قیمت و همچنین ارتباط آن با دیگر ابزارهای تکنیکی نیز توجه کرد.

ساختار نمودارهای شمعی

برای ژاپنی ها **مهمترین** قسمت یک شمع بدن اصلی است. سایه ها به عنوان یک فاکتور فرعی در نوسانات قیمت لحاظ می شوند.

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15

شمع بلند سیاهی که در آن قیمت ابتدایی نزدیک به قیمت بالایی و قیمت پایانی نزدیک به قیمت پایانی بوده است و در کل **بیانگر نزول در قیمت** است.



دلالت بر **افزایشی** بودن دارد.



دوچی یا بلند

طول سایه ها در دوچی می تواند هر اندازه ای باشد. و **نشانه بازگشت** هستند

۵ شمعدان دوچی پشت سرهم نشان یک حرکت **پر قدرت** پس از شکست وضعیت

قیمت ابتدایی و پایانی

تحلیگران ژاپنی اهمیت وافری برای قیمت ابتدایی و پایانی قابل هستند. زیرا این دو نقطه نماد هیجن انگیز ترین زمانهای یک روز کاری هستند.

اولین ساعت صبح سکان تمام روز است.

قیمت ابتدایی ، نخستین راهنمای برای تعیین جهت روز است. قیمت ابتدایی تجلی تمام شایعات و اخباری است که شب قبل طرح و بررسی شده اند.

قیمت محوری دیگر، قیمت پایانی یا بسته شدن است. اگر خرید یا فروش عمدی ای در زمان نزدیک شدن بازار در پایان ساعت با هدف تاثیر گذاری در قیمت نهایی انجام شود، ژاپنی ها آن را **حمله شبانه** می نامند. قیمت پایانی برای بسیاری از تکنسین ها، محوری و اساسی است. ممکن است آنها برای تایید اعتبار یک الگو تا دریافت قیمت پایانی منتظر بمانند. بسیاری از سیستم های رایانه ای (برای مثال Moving average) بر مبنای قیمت های پایانی، طراحی شده اند.

۱. الگوهای بازگشتی و افزایشی

تاریکی یک گام جلوتر به کمین نشسته است.

الگولهای بازگشتی ما را از امکان **تغییر جهت روند مطلع** می سازد. الگوهای بازگشتی غربی شامل سقف ها و کف های دو قلو، روزهای بازگشتی، سر و شانه ها و جزیره های سقف و کف هستند. وقوع این الگوها به این معناست که **جو روانی بازار در حال تغییر** است. شما باید روش معامله خودرا با شرایط جدید بازار هماهنگ کنید.

اخطر بازگشت روند، صرفا بیان می کند که روند قبلی مایل به تغییر است ولی به این معنا نیست که الزاماً تغییر جهت می دهد و بازگشت می کند.

سه حالت ممکن برای یک روند سقف بازگشتی: نزولی، صعودی و خنثی



تشخیص پدید آمدن الگوهای بازگشتی، یک مهارت ارزشمند به حساب می آید. معامله موفق مستلزم این است که هم روند و هم احتمالات ممکن به نفع شما رخ دهد.

یک قاعده مهم برای ورود به معامله جدید(بر اساس اخطارهای بازگشت) این است که اگر اخطار در جهت کلی روند بازار بود، وارد معامله شوید.

برای مثال اگر در بازار افزایشی الگوی بازگشتی سقفی بوجود آمد این اخطار تنها می تواند مجوزی برای فروش خریدهای قبلی باشد. اما اگر روند کلی بازار نزولی بود. همان الگوی بازگشتی سقف می تواند مجوزی برای فروش باشد.

اکثر الگوهای نمودارهای شمعی؛ الگوهای بازگشتی هستند.

Hanging Man

شمع هایی با سایه پایینی بلند و بدنه اصلی کوچک را نمایش می دهد.

قدرت زیاد، بازگشتی و در روندهای صعودی ظاهر می شود.

شرایط تایید: طول سایه پایینی دوبرابر بدنه باشد

Hammer

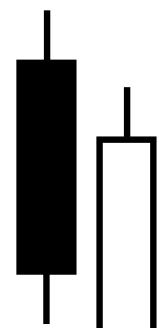
شمع هایی با سایه پایینی بلند و بدنه اصلی کوچک را نمایش می دهد.

قدرت زیاد، بازگشتی و در روندهای نزولی ظاهر می شود.

تاکوری: تلاش برای مشخص کردن عمق آب، بوسیله لمس کردن کف است

الگوی نافذیا سوزنی Piercing line

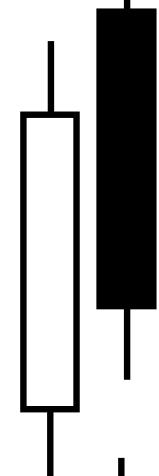
دلالت بر افزایشی بودن دارد.



پوشش ابر سیاه

دلالت بر کاهشی بودن دارد.

اگر بدنه شمع دوم پایین تر از میانه بدنه شمعدان پیشین باشد نیرومندتر خواهد بود.



شمعدان های پوشاننده افزایشی

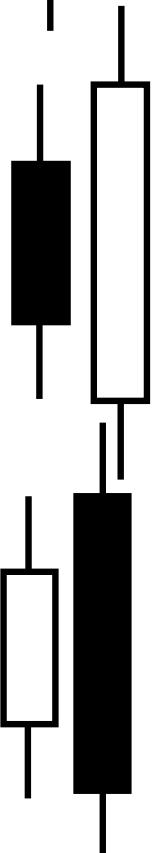
اگر پس از یک روند کاهشی بزرگ رخ دهد بسیار افزایشی خواهد بود.

شرایط تایید: بدنه شمع (پوشش دهد) مهم است و طول سایه اهمیت ندارد.

شمعدان های پوشاننده کاهشی

اگر پس از یک روند افزایشی رخ دهد کاهشی خواهد بود.

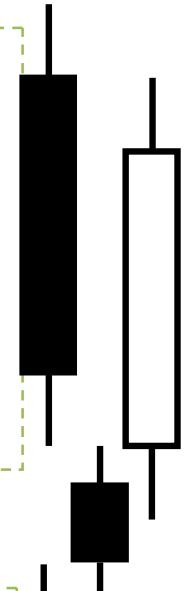
این الگو زمانی رخ می دهد که یک شمع دان بزرگ کاهشی یک شمعدان کوچک افزایشی را بپوشاند.



ستاره بامداد

یک الگوی افزایشی است که یک کف احتمالی را نشان می دهد. ستاره احتمال بازگشت و شمعدان افزایشی تایید می کند

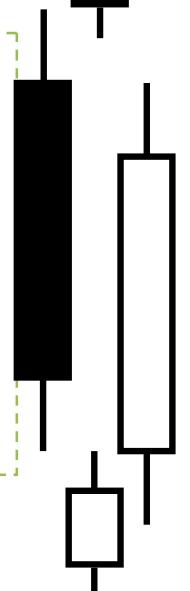
ستاره می تواند خالی یا تو پر باشد



ستاره بامداد یا صبحگاهی Morning Star

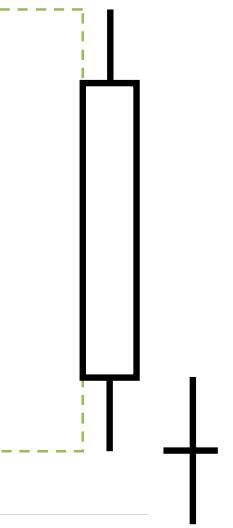
یک الگوی افزایشی است که یک کف احتمالی را نشان می دهد. ستاره احتمال بازگشت و شمعدان افزایشی تایید می کند

ستاره می تواند خالی یا تو پر باشد



ستاره دوجی افزایشی

ستاره نشان بازگشت است اما دوجی نشان دهنده تردید و دودلی است. پس معمولا نشان بازگشت است. باید صبر کنید تا الگوی جهت تایید شود. یعنی **کndl سوم** تشکیل شود مانند ستاره بامداد سه تایی شود.



ستاره دوجی افزایشی

ستاره نشان **بازگشت** است اما داجی نشان دهنده **تردد و دودلی** است. پس معمولاً نشان بازگشت است. باید صبر کنید تا الگوی جهت تایید شود. یعنی **کندل سوم** تشکیل شود مانند ستاره بامداد سه تایی شود.

ستاره شامگاهی

یک الگوی **کاهشی** است که یک سقف احتمالی را نشان می دهد. ستاره احتمال بازگشت و شمعدان کاهشی آنرا تایید می کند. ستاره می تواند خالی یا تو پر باشد

ستاره شامگاهی

یک الگوی **کاهشی** است که یک سقف احتمالی را نشان می دهد. ستاره احتمال بازگشت و شمعدان کاهشی آنرا تایید می کند. ستاره می تواند خالی یا تو پر باشد

ستاره دنباله دار

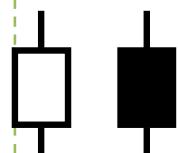
پس از یک روند افزایشی رخ می دهد و یک **بازگشت جزیی** را نشان می دهد. بدنه ستاره باید نزدیک نرخ کمینه باشد و شمعدان باید سایه بالایی بلندی داشته باشد.



۲. الگوهای خنثی

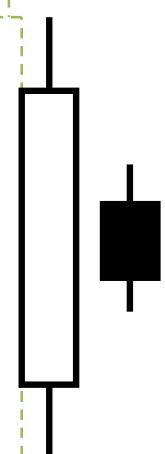
الگوی نخ ریسی

این الگو **خنثی** است. فاصله میان بیشینه و کمینه و فاصله میان نقطه باز شدن و بسته شدن کم است.



Harami یا آبستن

این الگو **کاهش جنبش** است. هنگامی رخ می دهد که یک شمعدان که بدنه کوچکی دارد وسط یک شمعدان که بدنه بزرگتری دارد قرار گیرد

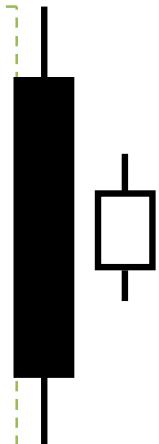


در این الگو سفید یا سیاه بودن شمعها مهم نیست که در طی روند

Bullish Harami یا آبستن هارمی

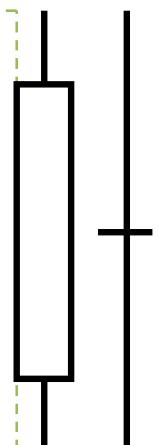
این الگو **کاهش جنبش** است و روند تغییر عمومی قیمت مشخص است.. هنگامی رخ می دهد که یک شمعدان که بدنه کوچکی دارد وسط یک شمعدان که بدنه بزرگتری دارد قرار گیرد

در این الگو سفید یا سیاه بودن شمعها مهم نیست که در طی روند



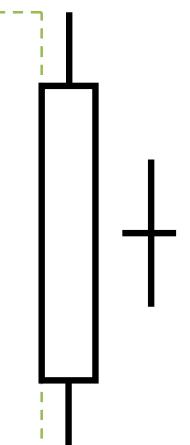
هارمی یا گذر

این الگو **کاهش جنبش** است و نشان تردید است(دوچی)



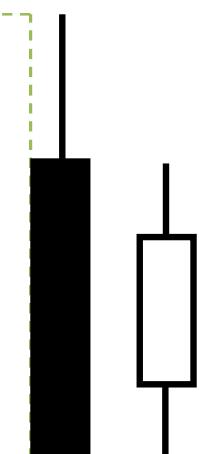
Bullish Harami Cross یا گذار صلیبی

این الگو **کاهش جنبش** است و نشان تردید است(دوچی)



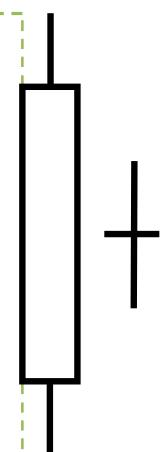
دو شمع دارای کف یکسان Tweezer bottom

هیچ توجهی به بدنه سیاه و سفید، طول سایه ها و... نمی شود. تنها چیزی که مهم است یکسان بودن کف طی دو روز



Bullish Harami Cross هارمی صلیبی

این الگو **کاهش جنبش** است. و نشان تردید است(دوجی)



اندیکاتور Indicator

تعریف اندیکاتور

اندیکاتورها توابع ریاضی هستند که بر اساس فرمول های خاص در جهت تحلیل بازار بوسیله ابزارهای گرافیکی ترسیم و مورد استفاده قرار می گیرند. داده های ورودی در اندیکاتورها بر اساس تعدادی از بازه های قبلی تغییرات قیمت وارد می شود. در هر بازه زمانی اطلاعات قیمت آغاز(Open)، پایان(Close)، سقف(High)، کف(Low) و یا تعدادی از مجموع این اطلاعات مورد استفاده قرار می گیرد.



استفاده از اندیکاتورها

برای استفاده از اندیکاتورها در بازارهای مالی بر اساس تغییرات گذشته قیمت، سه استفاده کلی میشود.

۱. اندیکاتورها در زمان های خاص بر اساس شرایط شکل گرفته روی آنها، قبل از تغییر روند یا همزان با چرخش روند، در بازار علائم بازگشت روند را نشان می دهند. از این رو یکی از مهم ترین استفاده ها از اندیکاتورها برای **تعیین هشدارهای مناسب تغییر روند و جهت حرکت** قیمت است.

۲. **پیش بینی** : یکی از استفاده های اندیکاتورها برای **پیش بینی قیمت** ورودی مناسب است . معمولا اندیکاتورهای **كمی** هستند که برای پیش بینی قیمت ورودی و در عین حال جهت درست، مناسب معامله گری باشند.

۳. **تایید**: از مهمترین استفاده هایی که از اندیکاتورها می شود برای تایید گرفتن تشخیص درست روند یا جهت است. این روش استفاده از اندیکاتورها معمولا زمانی مورد استفاده قرار می گیرد که تحلیل گر بر اساس داده های تکنیکی یا بنیادی جهت و قیمت ورودی مناسب در بازار را پیش بینی کرده است و از اندیکاتور برای تایید گرفتن استفاده می کند.

اندیکاتورها از لحاظ نوع حرکت و رفتار به دو دسته :

۱. **Leading Indicators**: اندیکاتورهای پیشرو معمولا همراه با نوسانات قیمت هشدار و پیش بینی را اعلام می کنند. اندیکاتورهای پیشرو، اغلب موارد سیگنال های بیشتری نسبت به اندیکاتورهای تاخیری ایجاد می کنند و به همین جهت احتمال خطا در آنها بیشتر است.

۲. **Lagging Indicators**: اندیکاتورهای تاخیری معمولا با تاخیر پس از حرکت قیمت و جابجایی بازار هشدار و پیش بینی لازم را ارائه می دهند. اندیکاتورهای تاخیری با اینکه سیگنال های کمتری ایجاد می کنند اما به خاطر اینکه قیمت حرکت اصلی خود را در بازار انجام داده و سپس این اندیکاتورها سیگنال می دهند معمولا تاخیر آنها باعث از دست رفتن موقعیت مناسب ورود می شود. ایراد دیگر اندیکاتورهای تاخیری سیگنال های اشتباه آنها در روندهای رو به جلو است. این دسته از اندیکاتورها معمولا برای بازارها رونددار کاربرد دارند.

انواع اندیکاتورها

در تقسیم بندی ها اندیکاتورها به ۴ خانواده اصلی بر اساس نوع نمایش یا مدل محاسباتی تقسیم بندی می شوند که مهمترین این تقسیم بندی ها شامل:

۱. ابزارهایی برای شناسایی روند Trend.
۲. Oscillators: اسیلاتورها ابزارهایی برای تشخیص روند جاری و محدوده بیش خرید و بیش فروش هستند. اسیلاتورها خود به دو دسته Centered و Banded تقسیم بندی می شوند.
۳. Volumes: برای تشخیص حجم معاملات و استفاده از برایند تعداد پوینت های نوسانات استفاده می شود. این دسته از اندیکاتورها در بازار تبادلات ارزی کاربرد چندانی به واسطه اهمیت نداشتن حجم ندارند.
۴. Bill Williams: برای تشخیص جابجایی سطوح قیمتی روند مورد استفاده قرار می گیرند.

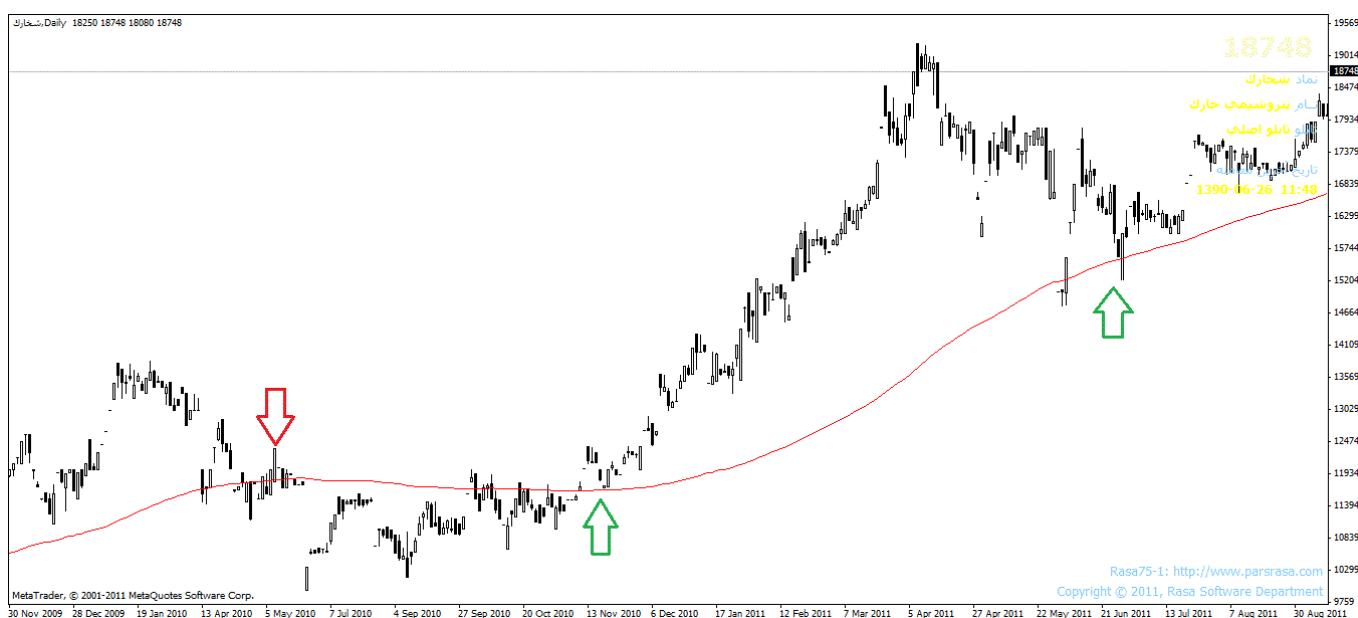
Moving Average

اندیکاتوری است از نوع Lagging Indicators تاخیری و Trend روندی. میانگینی از قیمت هاست (اغلب قیمت بسته شدن) که در بازه زمانی خاصی محاسبه می گردد. عامل حساس در میانگین متحرک، تعداد دوره های زمانی است که در محاسبه میانگین مورد استفاده قرار می گیرد. با تجربه و با امتحان دوره های مختلف، می توان دوره ای را انتخاب نمود که سودآور باشد. کلید این کار یافتن میانگین متحرکی است که دارای سیگنال های درست و سودآور باشد.

میانگین متحرک	روند (دروز)
M15	34,55,144
H1	8,34,55,89,144
H4	8,34,55,89,144
D1	8,13,21,55,89
W1	8,13,21

أنواع ميانگين متحرک:

١. ميانگين متحرک ساده simple: وزنی مساوی به قیمت‌های سری داده‌ها
٢. ميانگين متحرک نمایی Exponential: برای داده‌های جدید وزن بیشتر
٣. ميانگين متحرک وزنی Weighted: برای داده‌های جدید وزن



Simple Moving Average Calculation

Daily Closing Prices: 11,12,13,14,15,16,17

First day of 5-day SMA: $(11 + 12 + 13 + 14 + 15) / 5 = 13$

Second day of 5-day SMA: $(12 + 13 + 14 + 15 + 16) / 5 = 14$

Third day of 5-day SMA: $(13 + 14 + 15 + 16 + 17) / 5 = 15$

Exponential Moving Average Calculation

SMA: 10 period sum / 10

Multiplier: $(2 / (\text{Time periods} + 1)) = (2 / (10 + 1)) = 0.1818 (18.18\%)$

EMA: $\{\text{Close} - \text{EMA}(\text{previous day})\} \times \text{multiplier} + \text{EMA}(\text{previous day})$.

نحوه تحلیل: هرگاه قیمت خط میانگین متحرک را از پایین قطع و به سمت قیمت های بالاتر ادامه مسیر دهد علامتی برای خرید و در صورتیکه از بالا قطع و به سمت قیمت پایین تر ادامه مسیر دهد علامتی برای فروش محسوب می گردد.

همچنین در انتخاب دوره زمانی برای میانگین متحرک باید به موارد زیر توجه کنید .

هر چقدر دوره زمانی طولانی تر انتخاب شود حساسیت میانگین متحرک نسبت به تغییرات قیمت کمتر می شود . تا آنجا که یک میانگین متحرک خیلی بزرگ کاملا از بازار عقب می افتد .

هر چقدر دوره زمانی کوتاه تر انتخاب شود سیگنال های اشتباہ بیشتری به دلیل افزایش حساسیت میانگین متحرک دریافت می شود . به عنوان مثال یک میانگین متحرک کوتاه مدت بارها و بارها توسط قیمت شکسته می شود در حالی که روند حرکت موج تغییری نخواهد کرد.

از آنجا که میانگین متحرک یک شاخص روند محسوب می شود نباید از آن در محدوده های معاملاتی استفاده کرد . محدوده های معاملاتی نواحی هستند که قیمت در این نواحی بین یک کف و سقف مستحکم در رفت و برگشت است .

استثناء: در بازارهای خنثی که سقف و کف مستحکمی در رفت و برگشت استفاده نشود.

بهترین حالت استفاده از میانگین متحرک در بازارهایی است که دارای روند هستند

Moving Average Convergence Divergence:MACD

اندیکاتور میانگین متحرک همگرایی/واگرایی بوسیله گرالد اپل معرفی شد. چیزی که باعث مفید بودن این اندیکاتور می شود **ترکیب** برخی از اصول اسیلاتورهاست. برروی صفحه دو خط دیده می شود در حالیکه در حقیقت در محاسبات از سه خط استفاده میشود.

این شاخص که معمولاً به صورت دوره های ۱۲ و ۲۶ روزه بررسی می شود.

اخطرهای خرید و فروش واقعی در زمان تقاطع دو خط صادر می شود.

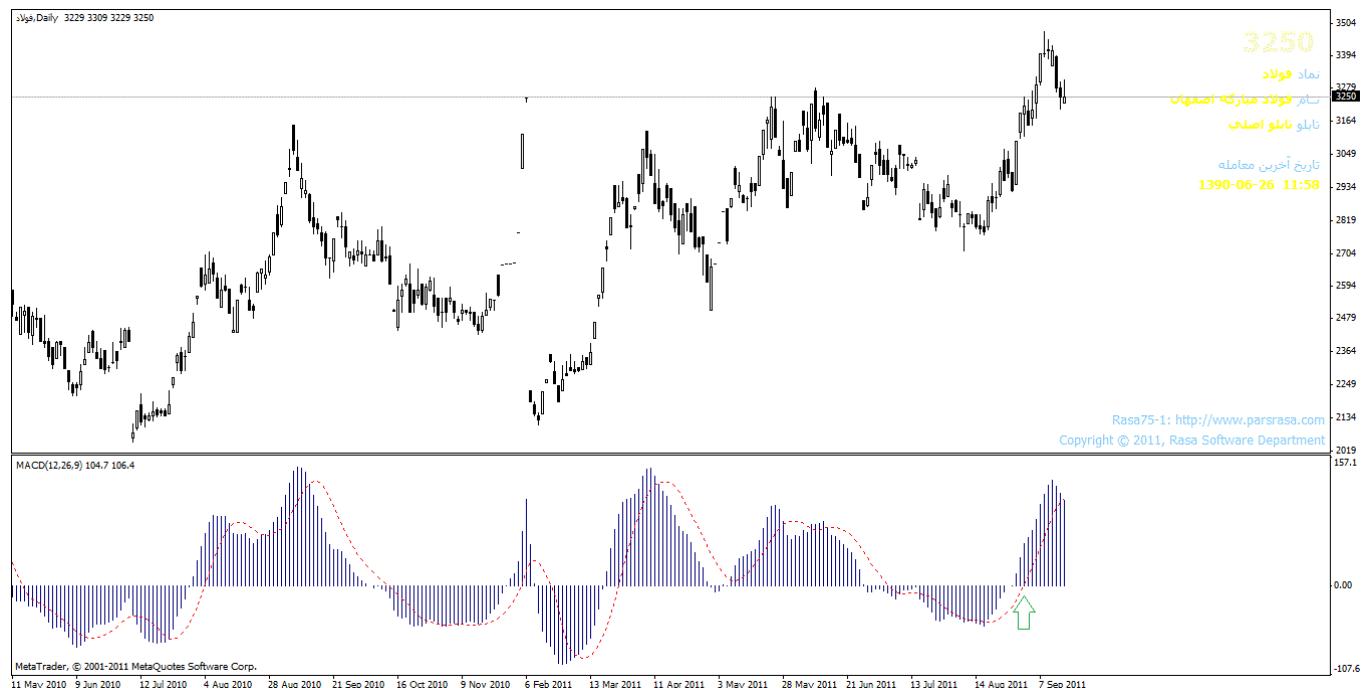
خرید: عبور رو به بالای خط MACD سریعتر از خط کندر اخطار خرید تلقی می شود.

فروش: عبور رو به پایین خط سریعتر از خط کندر اخطار فروش محسوب میشود.

خط صفر: نقش اسیلاتور را دارد. زمانیکه این خطوط تا حد زیادی در بالای خط صفر فاصله می گیرند شرایط خرید هیجانی و بر عکس آن فروش هیجانی.

بهترین اخطار خرید زمانی است که قیمت ها کاملاً در زیر خط صفر قرار می گیرند (فروش هیجانی)

زمانی که مانند مثال پایین، نماگر MACD در جهتی مخالف قیمت سهم در حال حرکت است، باید منتظر برگشت روند حرکت قیمت سهم (در این مثال به سمت پایین) باشیم. با توجه به این که میانگین متحرک ۱۲ روزه در حال عبور از روی میانگین متحرک ۲۴ روزه از قسمت پایین است، پیغام خرید ضعیفی در روزهای آتی می تواند پیغامی از سوی این شرکت باشد.



گرچه بر اساس این اطلاعات نمی‌توان برای خرید یا فروش نتیجه‌گیری قطعی کرد، اما می‌توان اطلاعات خود را برای تعیین مسیر آتی سهم و در نتیجه احتمال موفقیت خود را افزایش داد. نوع استاندارد میانگین متحرک همگرا و اگرا (۲۶، ۱۲، ۹) MACD است.

در یک نمودار MACD معمولاً سه عدد می‌بینید که برای تنظیمات آن استفاده شده‌اند.

۱. اولین عدد، دوره‌های زمانی است که میانگین متحرک سریعتر را محاسبه می‌کند.
۲. دومین عدد، دوره‌های زمانی است که میانگین متحرک کندرتر را محاسبه می‌کند.
۳. و سومین عدد، تعداد میله‌هایی است که یک میانگین متحرک، بین میانگین متحرک سریعتر و کندرتر محاسبه می‌کند.

این اندیکاتور از دو خط تشکیل شده است. MACD اختلاف بین دو میانگین متحرک نمایی با یک خط سیگنال که خود یک میانگین متحرک نمایی است می‌باشد. اگر MACD (خط آبی) و خط سیگنال (خط قرمز) با هم برخورد کنند، این امکان وجود دارد که روند تغییر کند.

همچنین خط سیگنال خطی است در نمودار MACD. اگر MACD بالای خط سیگنال باشد علامت خرید و اگر MACD پایین خط سیگنال باشد علامت فروش می‌باشد. این نمودار در واقع

تفاوت بین میانگین متحرک سریع و کند را رسم می کند. اگر به نمودار بالا نگاه کنید می بینید که هرچه میانگین ها از هم دورتر شوند نمودار بزرگتر می شود. به این واگرایی می گویند. چرا که میانگین متحرک سریع از میانگین متحرک کند دور می شود. هر چقدر میانگین های متحرک به هم نزدیکتر شوند، نمودار کوچکتر می شود. به این همگرایی می گویند چرا که میانگین متحرک سریع به میانگین متحرک کند نزدیک می شود و بدین ترتیب منشأ نام واگرایی همگرایی میانگین متحرک مشخص می شود.

اندیکاتور Parabolic SAR=Parabolic Stop And Reverse

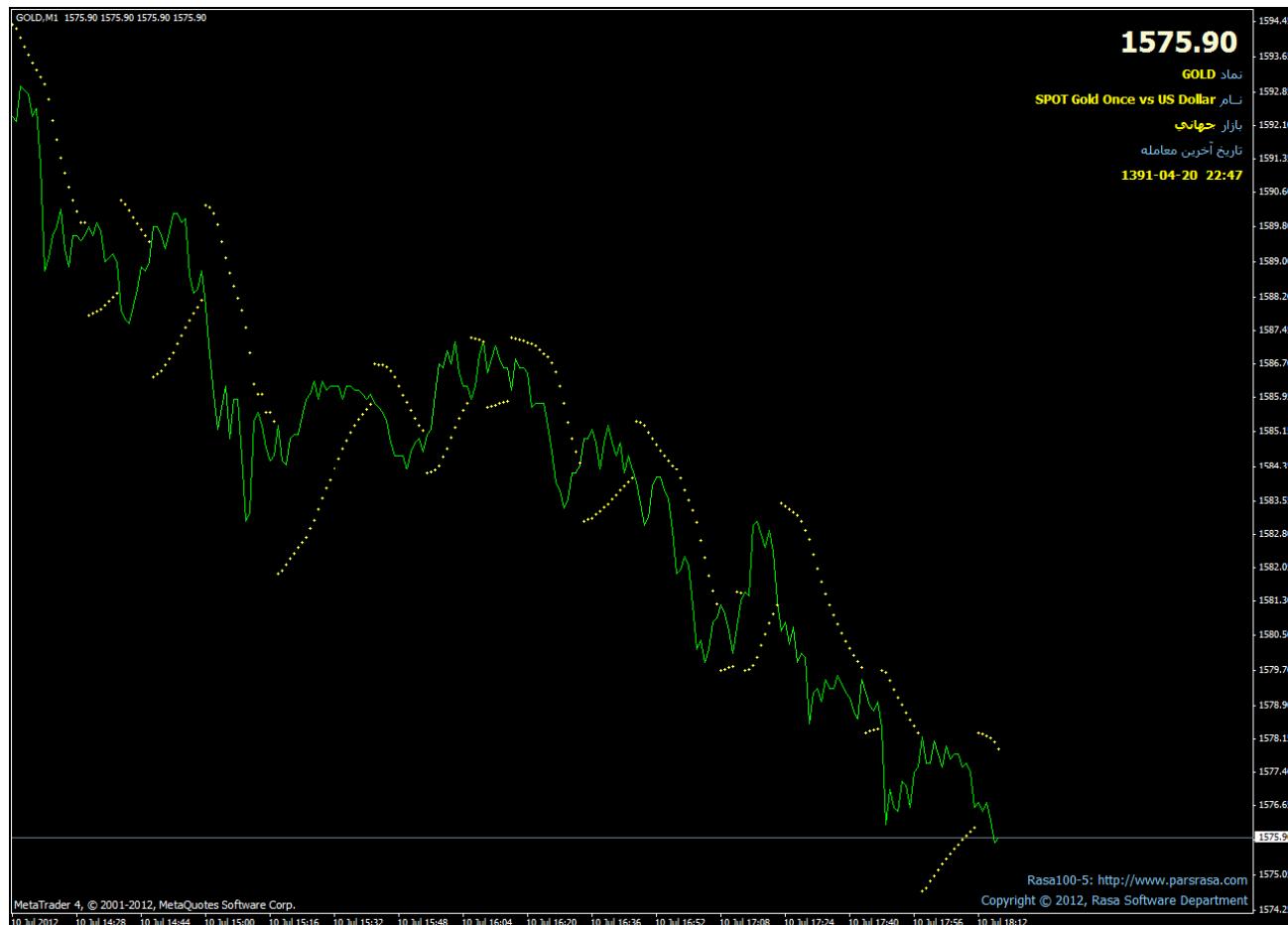
یک سیستم بازگشتی قیمت / زمان می باشد. در ابتدا SAR کند است زمانیکه روند پایدار می شود شتاب می گیرد. و در بازارهای رونددار کاربرد دارد.

اندیکاتوری برای تشخیص روند و بدست آوردن نقاط کلیدی اتمام یک روند است.

مادامی که نقطه های این اندیکاتور روی هر شمع باشد روند نزولی است.

مادامی که نقطه های این اندیکاتور زیر هر شمع باشد روند صعودی است.

در عین حال هر نقطه سبز رنگ این اندیکاتور می تواند حکم یک حمایت یا مقاومت را در بازار داشته باشد. عبور قیمت هر شمع از نقطه سبز رنگ اندیکاتور به معنی پایان روند جاری و آغاز یک روند خلاف جهت است. این اندیکاتور معمولا برای بازارها یا دوره های رو به جلو کاربرد چندانی ندارد.



اندیکاتور RSI شاخص قدرت نسبی:

این شاخص تکنیکی در سال ۱۹۷۸ توسط J.Welles معرفی شده و از محبوبترین اندیکاتورهای تکنیکی در بین اکثر تحلیلگران است. از این رو شاخص قدرت نسبی نام گرفته که قدرت تغییرات قیمت‌های اخیر بسته شدن را با مقادیر پیشینی از دوره‌های قبلی اندازه گرفته و آن را تبدیل به عددی می‌کند که همواره بین ۰ و ۱۰۰ است. اندیکاتور RSI نسبت حرکات صعودی و نزولی را اندازه گیری می‌کند و مقدار بدست آمده را طوری تعیین می‌کند که عددی مابین ۰ تا ۱۰۰ خواهد بود. اگر اندیکاتور RSI عدد ۷۰ یا بزرگتر از آن را نشان دهد، بیان کننده آن است که قیمت در وضعیت حد اشباع خرید قرار گرفته است (در واقع قیمت بیشتر از حد انتظار بازار افزایش یافته است) و اگر RSI عدد ۳۰ یا کمتر از آن را نشان دهد به این معنی است که قیمت

در محدوده اشباع فروش قرار دارد (در این وضعیف قیمت بیشتر از حد انتظار بازار سقوط کرده است).

عدد ۳۰ به معنی در کف بودن سهم و عدد ۷۰ به معنی در سقف بودن سهم است.



سیگنال های خرید

۱. اگر عدد زیر ۳۰ باشد و تشکیل کف دوگانه (ناقص) بدهد
۲. اگر نمودار قیمت تشکیل کف دهد ولی اندیکاتور نتواند این الگو را تشکیل دهد
۳. اگر خطوط روند در نمودار قیمت و اندیکاتور رو به بالا شکسته شود
۴. حرکت اندیکاتور به بالای خط ۵۰ اخطر تاییدی برای خرید می باشد
۵. واگرایی صعودی سیگنال خرید می باشد (مهمترین سیگنال)
۶. در زمان بازار بدون روند بهترین زمان خرید حرکت از زیر عدد ۳۰ به بالا می باشد (از منطقه اشباع فروش خارج شود)

سیگنال های فروش

۱. اگر عدد بالای ۷۰ باشد و تشکیل سقف دوگانه (ناقص) بدهد
۲. اگر نمودار قیمت تشکیل سقف دهد ولی اندیکاتور نتواند این الگو را تشکیل دهد
۳. اگر خطوط روند در نمودار قیمت و اندیکاتور رو به پایین شکسته شود
۴. حرکت اندیکاتور به زیر خط ۵۰ اخطار تاییدی برای فروش می باشد
۵. واگرایی نزولی سیگنال فروش می باشد (Mehmetin سیگنال)
۶. در زمان بازار بدون روند بهترین زمان فروش حرکت از بالای عدد ۷۰ به پایین
۷. می باشد (از منطقه اشباع خرید خارج شود)

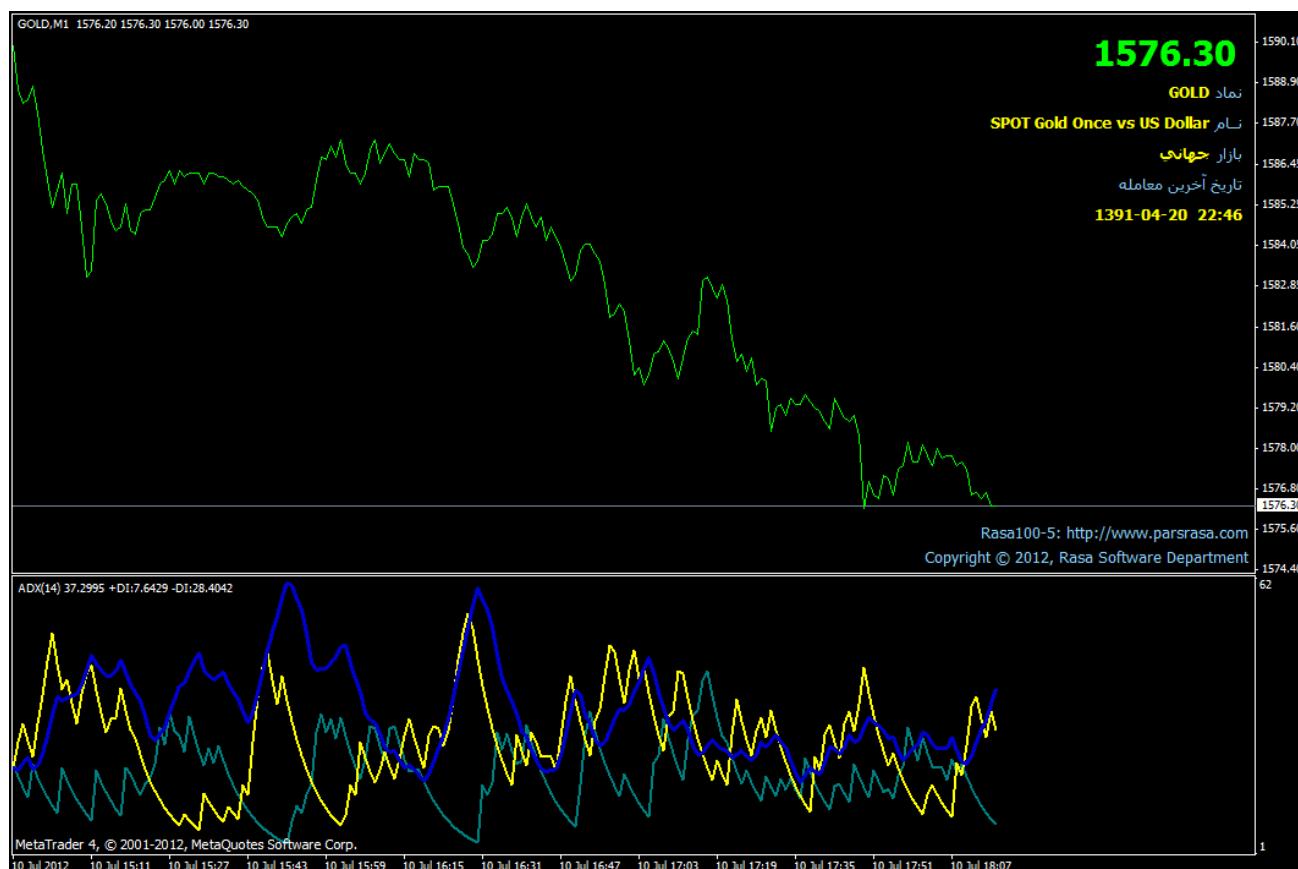
Average Directional Movement Index: ADX

این اندیکاتور یک ابزار تشخیص اینکه بازار روندار هست یا نه؟

بر اساس این اندیکاتور ابتدا مشخص می کنیم که روند نزولی یا صعودی و یا رو به جلو است.

نشانگر ADX شامل دو جهت مخالف $+DI$ و $-DI$ و خط ADX است. که $+DI$ و $-DI$ در خلاف جهت یکدیگر حرکت می کنند و ADX نیز تفاوت این دو را نشان می دهد. هر چقدر $+DI$ و $-DI$ واگرایی بیشتری داشته باشند مقدار ADX نیز بزرگتر است.

نقشه عبور $+DI$ و $-DI$ را از روی یکدیگر می توان مکان ارائه سیگنال در نظر گرفت.



خرید یا فروش	روندها	-DI	+DI	ADX
-	ضعیف		تقرباً خنثی	خیلی ضعیف یا زیر سطح ۲۰
-	در حال تضعیف		همگرایی	کاهشی
خرید	در حال تقویت	کاهشی	افزایشی	افزایش
فروش		افزایشی	کاهشی	
خرید	تشکیل روند	کاهشی	افزایشی	به شکل کف مدور
فروش	جدید	افزایشی	کاهشی	
معامله	بستن با احتمال زیاد	-	-	خیلی قوی
سوده				
-	اشبع از خرید یا فروش	-	-	به شکل سقف مدور

Bollinger Bands اندیکاتور

نوارهای بولینگر دامنه انتظارات معامله گران را نمایش می‌دهند و چنانچه قیمتها از این نوارها خارج شوند تمایل دارند به درون آنها باز گردند.

همانطور که قبل اشاره شد قیمتها بین دو محدوده خریدها و فروشهای افراطی در نوسان هستند. نقاط بالائی و پائینی فقط در لحظاتی کوتاه پدید خواهند شد و ما نمی‌توانیم در آن نقاط معامله‌ای انجام دهیم. اما محدوده‌هایی وجود دارد که نزدیک ترین نقاط به قله یا قعر قیمتی است. این محدوده‌بیرون از نوارهای بولینگر شکل می‌گیرد.

نوارهای بولینگر برای اندازه‌گیری فراریت بازار استفاده می‌شوند. اساساً این ابزار به ما می‌گوید که چه زمانی بازار بی حرکت است و چه زمانی دارای حرکت است. زمانیکه بازار بی تحرک است نوارها به هم نزدیک می‌شوند و هنگامیکه بازار دارای حرکت است نوارها از هم دور می‌شوند. به شکل زیر نگاه کنید. زمانیکه قیمتها بی تحرک است نوارها به هم نزدیک می‌شوند و زمانیکه قیمتها بالا می‌روند، نوارها از هم دور می‌شوند.

نحوه محاسبه:

باندهای بولینگر سه تا هستند که همانطور که ذکر شد خط وسط، میانگین متحرک n دوره ای سهم می‌باشد. یعنی:

$$\text{باند وسط} = \frac{\sum_{j=1}^n Close_j}{n}$$

باند بالایی همان باند پائینی است که به اندازه انحراف معیار(یا ضریبی از آن) به بالا منتقل شده است. یعنی:

$$\left[D + \sqrt{\frac{\sum_{j=1}^n (\text{Close}_j - \text{Middle Band})^2}{n}} \right] + \text{باند بالایی} = \text{باند وسط}$$

که D همان ضریبی است که بعضی موقع در انحراف معیار(قبل از جمع با باند وسط) ضرب میگردد. این ضریب میتواند ۱ یا ۲ باشد.

فرمول مشابهی نیز برای باند پایینی بولینگ وجود دارد. یعنی پس از ضرب کردن D در انحراف معیار باند وسط را به اندازه این مقدار به پایین منتقل میکنیم.

$$\left[D + \sqrt{\frac{\sum_{j=1}^n (\text{Close}_j - \text{Middle Band})^2}{n}} \right] - \text{باند پایین} = \text{باند وسط}$$

آقای بولینگ عدد ۲۰ را عنوان تعداد بازه مناسب برای رسم میانگین متحرک معرفی میکند. {یعنی میانگین متحرک ۲۰ روزه} و نوع میانگین متحرک پیشنهادی ایشان ساده(Simple Moving Average) میباشد. آقای بولینگ ضریب D=2 را پیشنهاد کرده است. از دیگر یافته های آقای بولینگ این است که میانگین متحرک های زیر ۱۰ روزه کارکرد خوبی برای رسم باندهای بولینگ ندارند.

خروج قیمتها از نوارها بیانگر پیشی گرفتن انتظارات معامله گران از جریان اطلاعات است که در محاوره به آن یک کlag چهل کlag می گوئیم. این حرکات تند قیمتی همواره یک دوره تصحیح را به دنبال خواهد داشت.

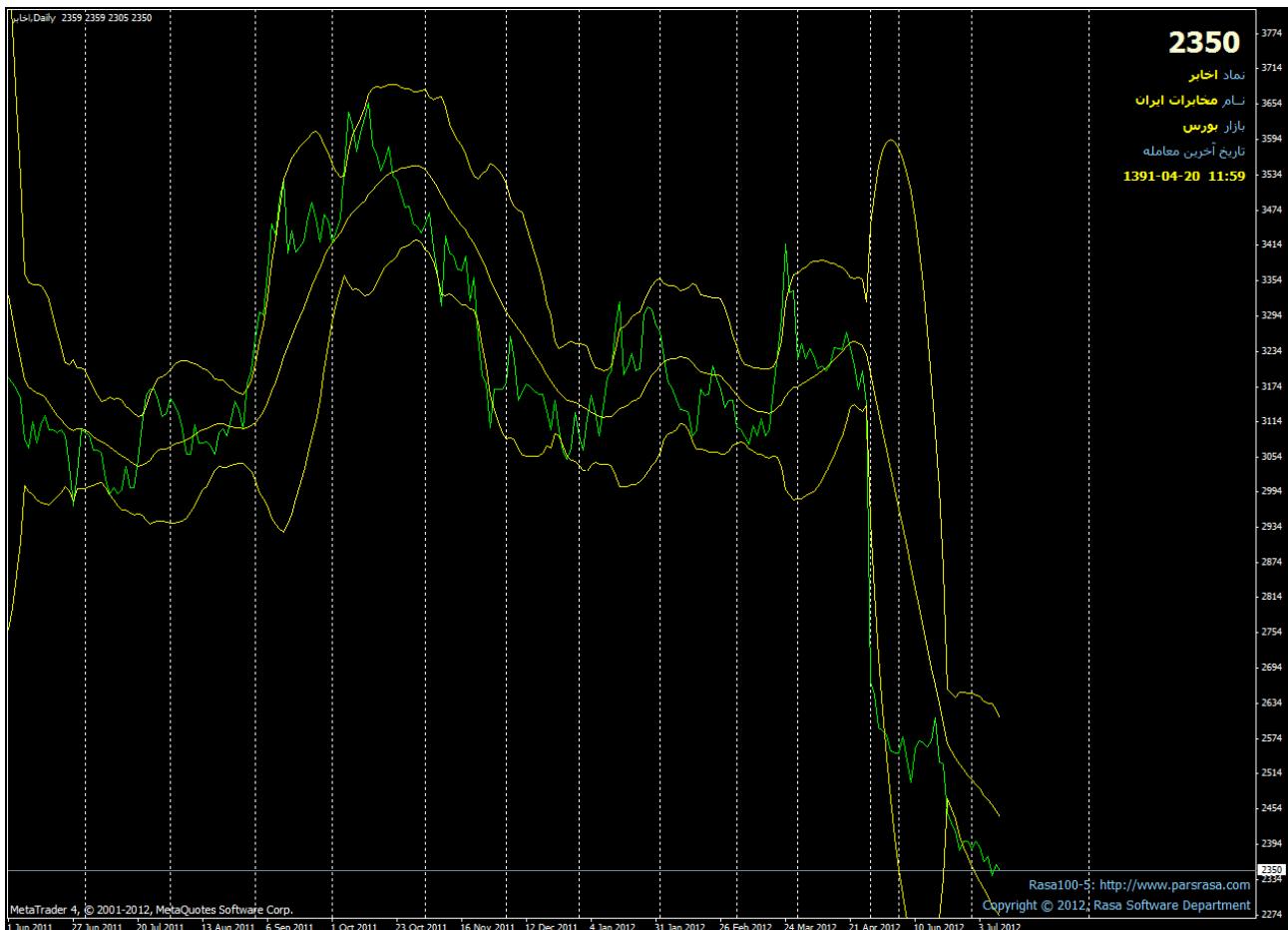
دوره ای که بازار مجددا به اطلاعات شرکت رجوع می کندو آنها را بازنگری می کند. در این شرایط دهانه نوارهای بولینگ بهم نزدیک می خواهد شد و چنانچه به جریان ثبت اطلاعات آتی امیدوار شود مجددا تلاش خریداران منجر به ادامه روند افزایشی خواهد شد. این مسیر تا خروج مجدد قیمتها از نوار بولینگ ادامه خواهد داشت.



کاربرد باندهای بولینگر

۱. بخش عمده نوسانات قیمت(٪.۹۵) در فاصله بین دو بند است
۲. فاصله نوار ها در موقعیت های بازار پر نوسان بیشتر می شود
۳. میانگین متحرک ۱۰ روزه برای کوتاه مدت و ۲۰ روزه برای میان مدت استفاده می شود
۴. هنگامی که فاصله دو نوار زیاد شود پایان روند جاری و وقتی که فاصله کم شود علامت آغاز روند جدید است.
۵. اگر قیمت به نوار بالایی/پایینی حرکت کند و باند وسطی را قطع کند نوار پایینی / بالایی هدف قیمت است.

آقای بولینگر عدد ۲۰ را برای دوره های میانگین متحرک پیشنهاد داده است.



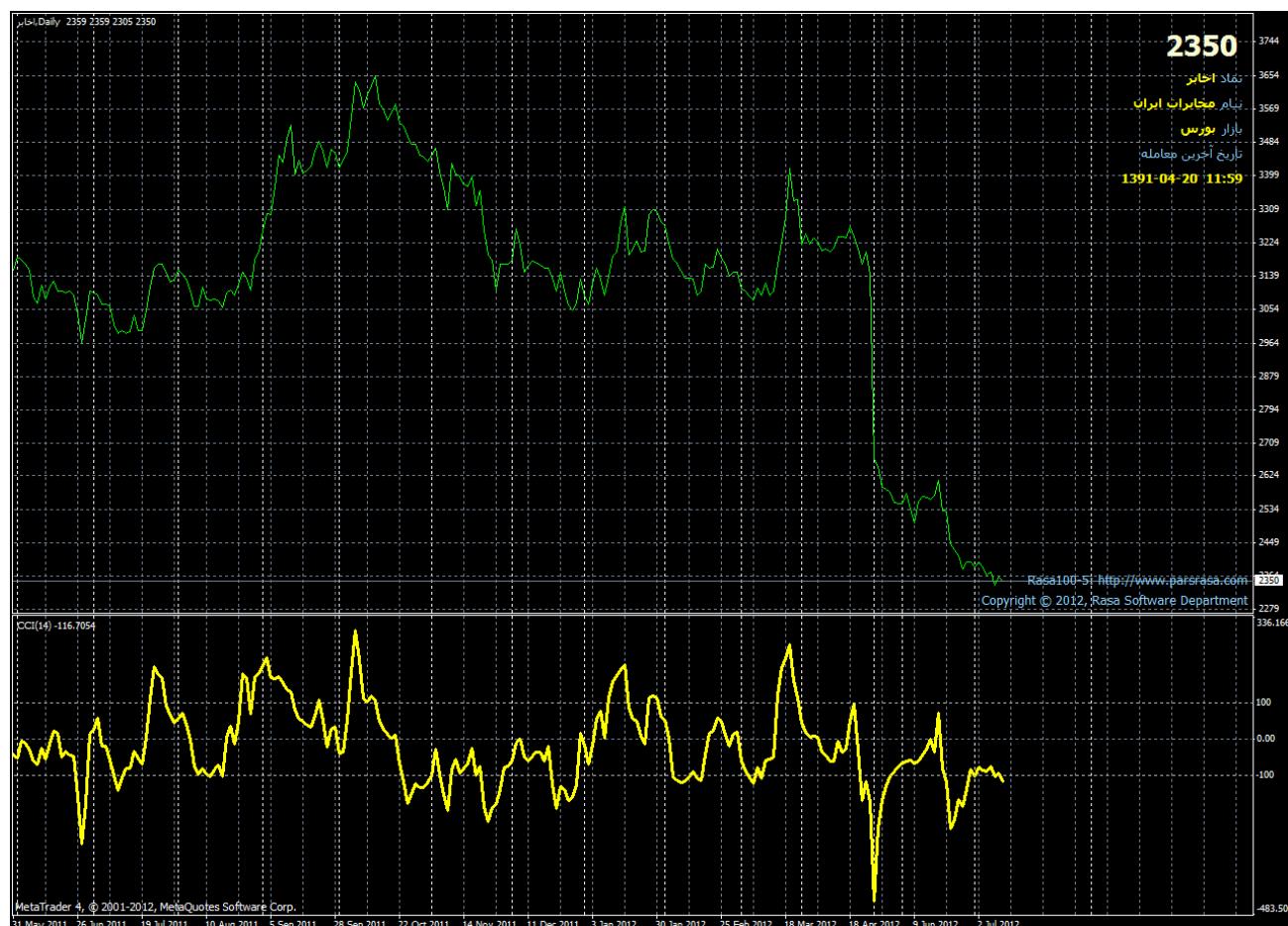
اندیکاتور Commodity Channel Index

اندیکاتور شاخص کanal کالا یا CCI اندیکاتوری برای تشخیص روند و میزان قدرت روند می باشد. بر خلاف اندیکاتورهای خانواده اسیلاتورها این اندیکاتور قادر محدوده بیش خرید و بیش فروش است.

طریقه استفاده از این اندیکاتور بدین ترتیب است که در صورت عبور شاخص CCI از روی عدد ۱۰۰ مثبت دیدگاه جهت و روند، صعودی در نظر گرفته می شود و در صورت عبور شاخص CCI به زیر عدد منفی ۱۰۰ دیدگاه جهت و روند، نزولی در نظر گرفته می شود. هرچه شاخص CCI از

اعداد ۱۰۰ مثبت یا ۱۰۰ منفی بیشتر فاصله بگیرد روند در آن جهت قدرت بیشتری خواهد داشت.

در این اندیکاتور واگرایی به مانند اندیکاتورهای خانواده اسیلاتور مورد استفاده قرار می‌گیرد. در عین حال اندیکاتور CCI از جمله اندیکاتورهایی شناخته می‌شود که همراه و همزمان با تغییرات قیمت سیگنال ارائه می‌دهد و پس از جابجایی قیمت تصحیح انجام نمی‌دهد.



میانگین متحرک

میانگین متحرک (ma) میانگینی از قیمت هاست (اغلب قیمت بسته شدن) که در بازه زمانی خاصی محاسبه می‌گردد. این شاخص ارتباط ملایمی بین قیمت و زمان پدید می‌آورد و این هموارسازی تا به این حد است که گاهی از آن به عنوان نرم کننده قیمت نیز یاد می‌شود. مقدار این هموارسازی از طریق پارامتر دوره زمانی (تعداد شمع‌هایی که باید از آنها میانگین تهیه کرد) معین می‌شود. به عنوان مثال یک میانگین متحرک

دوره ۵ منحنی از به هم پیوستن نقاطی است که هر یک میانگینی از قیمت بسته شدن ۵ شمع است و این روند از جایی که اطلاعات موجود است تا آخرین شمع تشکیل یافته در بازار ادامه دارد.

جهت انتخاب دوره زمانی میانگین متحرک می توانید از تنظیمات پیشنهادی در جدول ۱-۱ استفاده کنید.

اندیکاتور Commodity Channel Index

یکی دیگر از نماگرهای تکنیکی که بسیار قابل اطمینان و با اهمیت هستند نوارهای بولینگر هستند. نوارهای بولینگر شبیه پوشش های میانگین متحرک هستند. نوارهای بولینگر دامنه انتظارات معامله گران را نمایش می دهند و چنانچه قیمتها از این نوارها خارج شوند تمایل دارند به درون آنها باز گردند.

تفاوت بین نوارهای بولینگر و پوشش ها که این پوشش بر حسب درصدی ثابت در بالا و پایین میانگین متحرک ترسیم شده است در حالیکه نوارهای بولینگر با انحراف استانداردی بالا و پایین میانگین متحرک کشیده می شوند.

همانطور که قبلا هم اشاره شد قیمتها بین دو محدوده خریدها و فروشهای افراطی در نوسان هستند. نقاط بالائی و پائینی فقط در لحظاتی کوتاه پدید خواهند شد و ما نمی توانیم در آن نقاط معامله ای انجام دهیم. اما محدوده هایی وجود دارد که نزدیک ترین نقاط به قله یا قعر قیمتی است. این محدوده بیرون از نوارهای بولینگر شکل می گیرد.

نوارهای بولینگر برای اندازه گیری فراریت بازار استفاده می شوند . اساسا این ابزار به ما می گوید که چه زمانی بازار بی حرکت است و چه زمانی دارای حرکت است . زمانیکه بازار بی تحرک است نوارها به هم نزدیک می شوند و هنگامیکه بازاردارای حرکت است نوارها از هم دور می شوند . به شکل زیر نگاه کنید . زمانیکه قیمتها بی تحرک است نوارها به هم نزدیک می شوند و زمانیکه قیمتها بالا می روند ، نوارها از هم دور می شوند .

نحوه محاسبه:

باندهای بولینگر سه تا هستند که همانطور که ذکر شد خط وسط، میانگین متحرک ۱۱ دوره ای سهم میباشد.

يعني:

$$\frac{\sum_{j=1}^n Close_j}{n} = \text{باند وسط}$$

باند بالایی همان باند پایینی است که به اندازه انحراف معیار(یا ضریبی از آن) به بالا منتقل شده است. یعنی:

$$\text{باند بالایی} = \text{باند وسط} + D \cdot \sqrt{\frac{\sum_{j=1}^n (Close_j - \text{Middle Band})^2}{n}}$$

که D همان ضریبی است که بعضی موقع در انحراف معیار(قبل از جمع با باند وسط) ضرب میگردد. این ضریب میتواند ۱ یا ۲ باشد. فرمول مشابهی نیز برای باند پایینی بولینگر وجود دارد. یعنی پس از ضرب کردن D در انحراف معیار باند وسط را به اندازه این مقدار به پایین منتقل میکنیم.

$$\text{باند پایین} = \text{باند وسط} - D \cdot \sqrt{\frac{\sum_{j=1}^n (Close_j - \text{Middle Band})^2}{n}}$$

آقای بولینگر عدد ۲۰ را بعنوان تعداد بازه مناسب برای رسم میانگین متحرک معرفی میکند. {یعنی میانگین متحرک ۲۰ روزه} و نوع میانگین متحرک پیشنهادی ایشان ساده(Simple Moving Average) میباشد. آقای بولینگر ضریب $D=2$ را پیشنهاد کرده است. از دیگر یافته های آقای بولینگر این است که میانگین متحرک های زیر ۱۰ روزه کارکرد خوبی برای رسم باندهای بولینگر ندارند.

خروج قیمتها از نوارها بیانگر پیشی گرفتن انتظارات معامله گران از جریان اطلاعات است که در محاوره به آن یک کlag چهل کlag می گوئیم. این حرکات تند قیمتی همواره یک دوره تصحیح را به دنبال خواهد داشت. دوره ای که بازار مجددا به اطلاعات شرکت رجوع می کندو آنها را بازنگری می کند. در این شرایط دهانه نوارهای بولینگر بهم نزدیک می خواهد شد و چنانچه به جریان مثبت اطلاعات آتی امیدوار شود مجددا تلاش خریداران منجر به ادامه روند افزایشی خواهد شد. این مسیر تا خروج مجدد قیمتها از نوار بولینگر ادامه خواهد داشت.



کاربرد باندهای بولینگر

- ۱- بخش عمده نوسانات قیمت(٪۹۵) در فاصله بین دو بند است
- ۲- فاصله نوار ها در موقعیت های بازار پر نوسان بیشتر می شود
- ۳- میانگین متحرک ۱۰ روزه برای کوتاه مدت و ۲۰ روزه برای میان مدت استفاده می شود
- ۴- هنگامی که فاصله دو نوار زیاد شود پایان روند جاری و وقتی که فاصله کم شود علامت آغاز روند جدید است.
- ۵- اگر قیمت به نوار بالایی/پایینی حرکت کند و بند وسطی را قطع کند نوار پایینی / بالایی هدف قیمت است.
- ۶- آقای بولینگر عدد ۲۰ را برای دوره های میانگین متحرک پیشنهاد داده است.

اندیکاتور STOCHASTIC

۱- این اندیکاتور بر پایه این نظریه بنا شده است که قیمت های پایانی در حالت افزایشی تمایل دارند به سمت بالاترین قیمت دور بروند (و بلعکس)

۲- اکثر اخطار های خرید و فروش را خط $D\%$ صادر می کند.

۳- رایج ترین عدد برای این شاخص عدد ۱۴ است.

: $D\%$ خط

مهمنترین اخطار قابل رویت حالت واگرایی بین این خط و خط قیمت در حالتی که خط وارد مرز های خرید و فروش هیجانی شده است (۲۰-۸۰) می باشد

واگرایی کاهشی زمانی است که این خط بالاتر از عدد ۸۰ باشد و دو قله بسازد که قله دوم مقدار کمتری نسبت به قله اول داشته باشد در حالی که قیمت کماکان صعودی باشد

واگرایی افزایشی زمانی است که این خط کمتر از عدد ۲۰ باشد و دو کف بسازد که کف دوم مقدار بیشتری نسبت به کف اول داشته باشد در حالی که قیمت کماکان نزولی باشد

۵- از استو کاستیک هفتگی برای تشخیص جهت بازار در هفته پیش رو و از استو کاسیک روزانه برای خرید و فروش استفاده می شود

۶- ترکیب اندیکاتور قدرت نسبی (ار اس ای) و استو کاستیک ۱۴ هفته ای : بهترین اخطار زمانی است که هر دو اسیلاتور اخطار خروج از بازار و خرید و فروش هیجانی را صادر کنند

۷- اگر سقف ها کم عرض و کم ارتفاع باشد نیروی صعودی ضعیف و حرکت نزولی بعدی قوی می باشد

۸- اگر کف ها کم عرض و کم ارتفاع باشد نیروی نزولی ضعیف و حرکت صعودی بعدی قوی می باشد

سیگنال خرید

را قطع کند سیگنال خرید است $D\%$ از پایین به بالا (1) اگر

(2) واگرایی سعودی سیگنال خرید است

سیگنال فروش

را قطع کند سیگنال فروش است $D\%$ از بالا به پایین (1) اگر

(2) واگرایی نزولی سیگنال فروش است

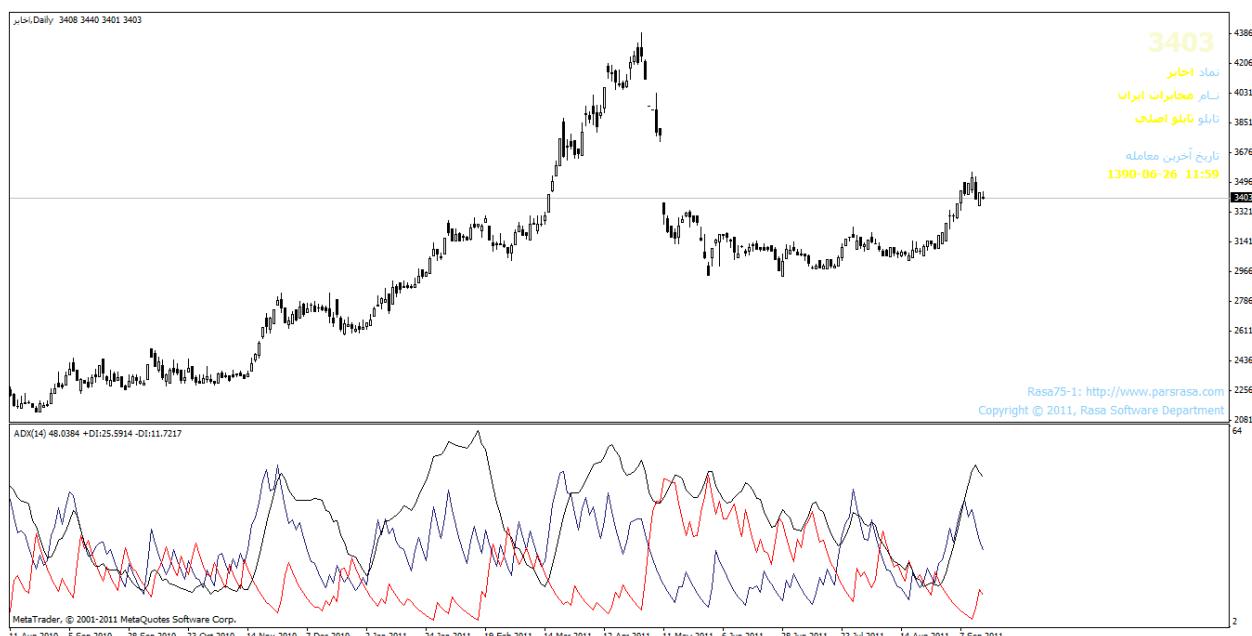
اندیکاتور Directional Movement

اندیکاتوری است که برای تشخیص قدرت بازار به کار می‌رود شاخص ADX نمی‌تواند جهت چارت را به ما بگوید. سه نماگر مختلف هستند که هر سه در سیستم تعیین روند سهم به نام سیستم > حرکت جهت دار (Directional Movement) مورد استفاده قرار می‌گیرند. ADX نیز عددی بین صفر تا صد است که هر چه بالاتر باشد قدرت سهم را برای تداوم روند فعلی (صعودی یا نزولی) نشان می‌دهد.

علاوه بر ADX دو شاخص دیگر به صورت نقطه‌چین نشان می‌دهد که یکی از آنها DI₊ و دیگری DI₋ می‌باشد. شاخص ADX بین ۰ تا ۱۰۰ متغیر است ($100 \sim 0$) تقسیم‌بندی آن بین ۰ و ۲۰ و ۴۰ و ۶۰ و ۱۰۰ می‌باشد.

۱- هرگاه شاخص ADX به سمت بالا حرکت کند نتیجه می‌گیریم که قدرت بازار در حال افزایش می‌باشد (شروع یا تقویت روند جاری)

۲- هر گاه شاخص ADX به سمت پائین نزول کند ضعف روند جاری و یا ورود به نواحی روند خنثی می‌باشد. ولس ویلدر تدوین کننده این شاخص پیشنهاد داده است که وقتی DI₊ بالاتر از DI₋ بود امکان رشد قیمت سهم وجود دارد و بر عکس وقتی که DI₊ پایین تر از DI₋ بود احتمال کاهش قیمت سهم وجود دارد.



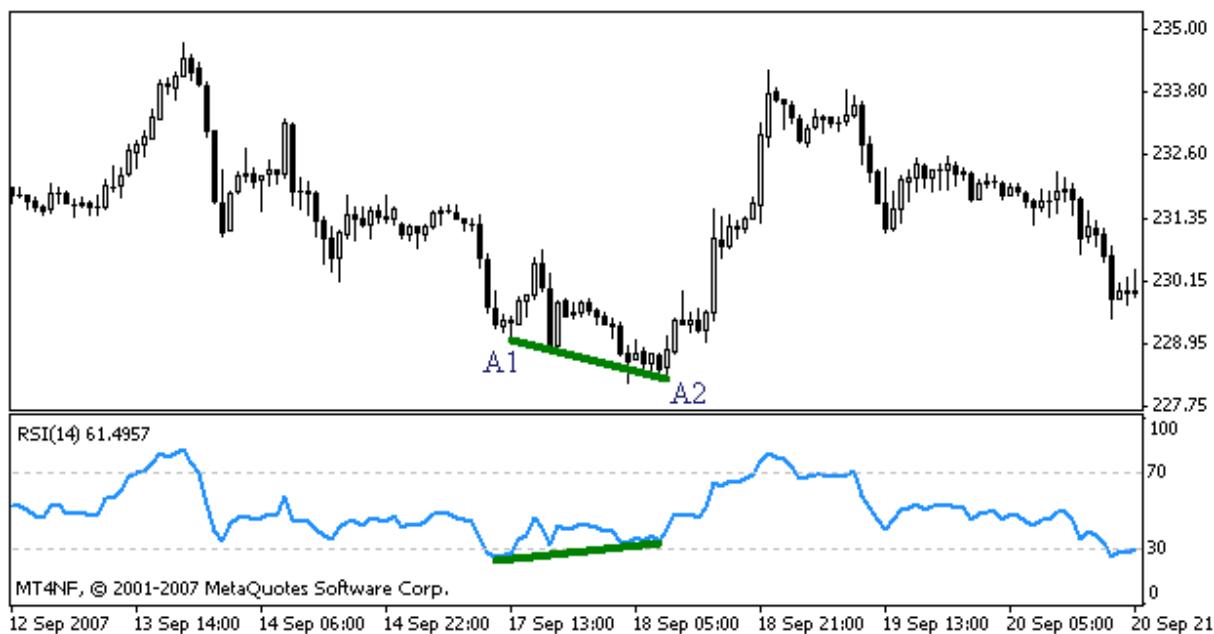
واگرایی در اسیلاتورها

به شکل زیر توجه کنید:

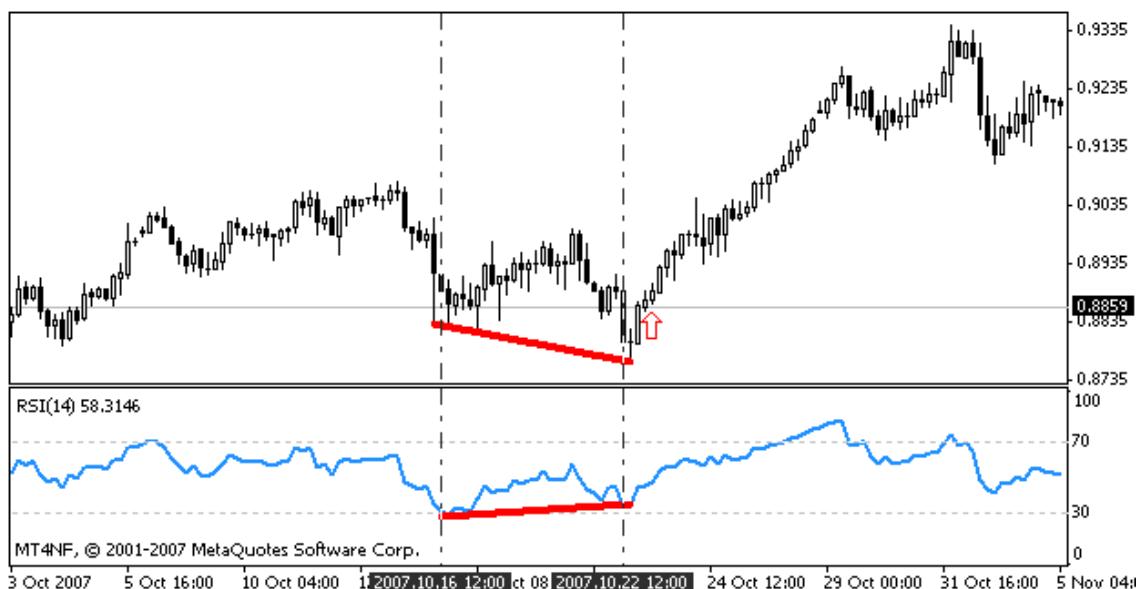


همانطور که ملاحظه میکنید خط واصل از A1 به A2 صعودی است اما در اسیلاتور (RSI) روند خط واصل دونقطه متناظر با A1 و A2 کاملاً نزولی دیده میشود. در این شرایط **واگرایی منفی یا نزولی** بوجود آمده است. با توجه به روند بازار واگرایی ممکن است به دو صورت مثبت و منفی ایجاد شود. واگرایی مثبت در انتهای روند نزولی اتفاق می افتد و بر عکس.

در واگرایی مثبت دو نقطه Low که نقطه دوم پایین تر از نقطه اول است تشکیل میشود. در صورتی که اسیلاتور بطور صحیح تنظیم شده باشد متناظر با هر کدام از نقاط Low درنمودار قیمت یک نقطه Low درنمودار اسیلاتور دیده میشود. اگر نقطه Low دوم در نمودار اوسیلاتور بالا تر از نقطه Low اول باشد (برخلاف قیمت) واگرایی مثبت اتفاق افتاده است.



واگرایی مثبت نشانه قدرتمندی برای پایان روند نزولی میباشد و در صورت تایید با سایر ابزار ها میتوان اقدام به خرید کرد. همانطور که میدانید برای رسم ترند لاین در روند صعودی نقاط Low و در روند نزولی نقاط High به هم متصل میشوند. برای تعیین واگرایی شرایط کاملاً متفاوت است. بطوریکه در تعیین واگرایی مثبت (در روند نزولی) نقاط Low را به هم وصل میکنیم در تعیین واگرایی منفی (در روند صعودی) باید نقاط High را به هم وصل کنیم. دقت داشته باشید که برای تشکیل یک واگرایی نیاز با ۲ نقطه اکسترمم (۲ نقطه ماکزیمم یا دو نقطه مینیمم) در قیمت و دو نقطه اکسترمم در اسیلاتور داریم. در شکل زیر به خطوط قرمز رنگ توجه کنید. نقاط اکسترمم در نمودار قیمت و اسیلاتور در زمان های مشابه اتفاق افتاده است به عبارتی این نقاط در نمودار قیمت و اسیلاتور با یکدیگر متناظر می باشند.



علامت قرمز رنگ نقطه ورود مناسب را نشان میدهد. ملاحظه میکنید که در نمودار قیمت یک کندل صعودی شکل گرفته و نقطه مینیمم کامل شده است. یکی از مزیت های سیگنال های واگرائی بالا بودن نسبت سود به زیان است. مزیت دیگر این روش اخطار سریع پایان روند می باشد. واگرائی ها بسیار سریع تر از سایر ابزار های تکنیکال پایان یک روند قدرتمند را به معامله گر اخطار می دهند. واگرائی منفی در انتهای یک روند صعودی و واگرائی مثبت در انتهای یک روند نزولی شکل می گیرد. بنابراین وجود یک روند نسبتاً قوی اولین شرط تشکیل واگرائی می باشد.



حجم معاملات

اکثر تحلیل گران تکنیکال در بازارهای مالی با دنبال کردن دو عامل قیمت و حجم معاملات از روش‌های چند بعدی برای تحلیل بازار استفاده می‌کنند. تمام مباحث مربوط به نمودار بر این نکته تاکید دارند که بیشتر توجه و تمرکز باید معطوف به حرکات قیمت باشد و البته تا حدی نیز باید به حجم معاملات دقت کرد. حجم تنها شاخصی است که از قیمت ناشی نشده است، و به شما عقیده ای ثانویه از بازار ارائه می‌دهد. با ترکیب حجم با شاخص‌های بازار، شما حس خوبی نسبت به کسی که بازار را کنترل می‌کند پیدا می‌کنید. شاید قیمت راننده (محرك) باشد، اما حجم، سوخت است که بازار را از یک نقطه به نقطه دیگر می‌برد. درنهایت، هر چند حجم می‌تواند یک شاخص مهم باشد، اما شاخص کاملی نیست. برای مثال، مشکل اینست که همیشه نمی‌دانیم که مسئول افزایش حجم، خریدارها هستند یا فروشنده‌ها.

حجم معاملات به عنوان یک شاخص ثانویه

حجم معاملات به میزان معاملات انجام شده در دوره‌ای از زمان گفته می‌شود. تایم فریم مناسب حجم می‌تواند روزانه یا هفتگی باشد و به ندرت از تایم فریم ماهانه برای حجم معاملات استفاده می‌شود. در روند صعودی حجم معاملات باید همزمان با صعود قیمت بیشتر شود و در هنگام پدید آمدن حفره‌ها باید کاهش یابد. تا هنگامیکه که الگو ادامه دارد حجم معاملات باید روند قیمت را تایید کند. چارتیست‌ها همچنین به دنبال یافتن واگرایی هستند. واگرایی هنگامی رخ می‌دهد که نفوذ به بالاتر از نقطه بالایی در یک روند صعودی همراه با کاهش حجم معاملات باشد. ایم وضعیت هشداری به معاملگران در مورد کاهش فشار خرید است.

یک قانون کلی در تمام نقاط شکست اگر اخطار شکست واقعیت داشته باشد باید شاهد حجم معاملات سنگینی باشیم.

حجم معاملات جلوتر از قیمت

با مطالعه همزمان قیمت و حجم معاملات بطور همزمان یک موضع یعنی فشار را اندازه گیری می کنیم. از نظر تحلیگران تکنیکی حجم معاملات جلوتر از قیمت است به این معنی که کاهش شدت صعود در روند صعودی یا افت شدت نزول در روند نزول قبل از اشکار شدن در روندهای برگشتی قیمت، ابتدا در حجم معاملات ظاهر می شود. اصول کلی در استفاده از نشانگرهای حجم:

وضعیت بازار	حجم معاملات	قیمت
خوبینانه	افزایشی	روند افزایشی
بدینانه	کاهشی	روند افزایشی
خوبینانه	افزایشی	روند کاهشی
بدینانه	کاهشی	روند کاهشی

رابطه بین حجم معاملات و قیمت در بازار بصورت زیر است: حجم معاملات به عنوان مقیاسی برای تشخیص قدرت و ضعف وضعیت عمومی بازار در نظر گرفته می شود.

حجم معاملات در صورتی روند صعودی را تأیید می کند که همزمان با صعود قیمت بیشتر شود و در روندهای اصلاحی یک روند صعودی با کاهش قیمت کاهش یابد. این الگو تا هنگامی با قدرت ادامه می یابد که حجم معاملات روند قیمت را تأیید کند.

حجم معاملات در صورتی روند نزولی را تأیید می کند که همزمان با نزول قیمت بیشتر شود و در روندهای اصلاحی یک روند نزولی با افزایش قیمت کاهش یابد. این الگو تا هنگامی با قدرت ادامه می یابد که حجم معاملات روند قیمت را تأیید کند.

واگرایی هنگامی رخ میدهد که در یک روند صعودی نفوذ به بالاتر از نقطه بالایی همراه با کاهش حجم باشد. این وضعیت هشداری است به معامله گران در مورد کاهش فشار خرید همچنین اگر حجم معاملات تمایل به افزایش در حفره ها در این روند داشته باشد روند صعودی دچار اشکال شده است.

در یک روند نزولی نیز واگرایی هنگامی رخ میدهد که نفوذ به پایینتر از نقطه پایینی همراه با کاهش حجم باشد. این وضعیت هشداری است به معامله گران در مورد کاهش فشار روند نزولی همچنین اگر حجم معاملات تمایل به افزایش در روندهای اصلاحی در این روند داشته باشد روند نزولی دچار اشکال شده است.

چارتیست ها همواره بدنیال یافتن علامت واگرایی در یک روند می باشند.

Blowoffs & Selling Climaxes

رشد حبابی و قب فروش

در زمانیکه قیمت سهام در اوج یا کف می باشد اتفاق می افتد.

رشد حبابی زمانیکه بازار در اوج قرار دارد روی می دهد. معمولاً پس از افزایش پیوسته قیمتها طی یک مدت زمانی نسبتاً طولانی ، در اوخر این دوره ، قیمتها با سرعت زیادی صعود کرده و حجم معاملات افزایش می یابد. در این حالت اکثر افرادی که قصد خرید را داشته اند ، سهام مورد نظر را خریده و سود مناسب را بدست آورده بنابراین شروع به فروش سهام می کنند و در نتیجه معمولاً قیمتها بصورت ناگهانی روند کاهشی خود را اغاز می کند.

تب فروش حالت عکس وضعیت فوق است. این حالت در نزدیکی کف قیمت روی می دهد. زمانیکه قیمتها برای مدت طولانی روند نزولی را طی می کند، یک موج نهایی فروش با حجم بالا قیمت را به شدت کاهش می دهد. کسانیکه دنبال خرید سهام در قیمتها شکسته شده هستند در این زمان اقدام به خرید سهام می کنند. پس از این نقطه روند تغییر قیمت وارون می شود و قیمت شروع به افزایش می کند.

اندیکاتورهای حجم:

۱. اندیکاتور حجم متوازن OBV

۲. اندیکاتور جریان سرمایه MFI

۳. اندیکاتور تراکم/توزیع accumulation/distribution

۴. اندیکاتور حجم volumes

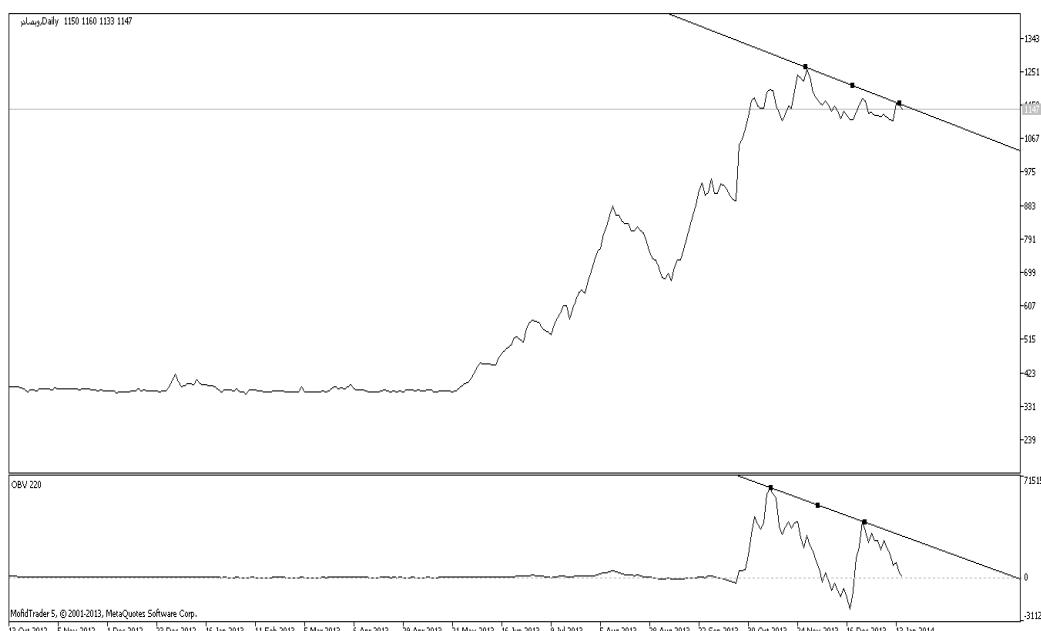
اندیکاتور حجم تعادلی On Balance Volume=OBV

نوع: قیمت / حجم -پیشرو- مناسب اهداف کوتاه مدت

کاربرد:

ساده ترین و معروف‌ترین اندیکاتور حجم می باشد که بوسیله جوزف گرانویل در سال ۱۹۶۳ در کتابش (استراتژی جدید زمان بندی بازارهای سهام روزانه جهت بدست آوردن حداکثر سود) معرفی شد. این شاخص از طریق مقایسه حجم معاملات و حرکتهای قیمت سعی در تعیین سطوح تجمع یا تقاضا و توزیع یا عرضه دارد. در تفسیر این شاخص شبیب و جهت اهمیت دارد نه مقادیر

عددی.



مشاهده می کنید تعقیب کردن روند با OBV آسانتر است.

فرمول ساخت:

اگر قیمت بسته شدن امروز از قیمت بسته شدن روز قبل بیشتر باشد علامت مثبت

$$OBV(I) = OBV(I-1) + VOLUME(I)$$

اگر قیمت بسته شدن امروز از قیمت بسته شدن روز قبل پایین تر باشد علامت منفی

$$OBV(I) = OBV(I-1) + VOLUME(I)$$

اگر قیمت بسته شدن امروز از قیمت بسته شدن روز قبل برابر باشد

$$OBV(I) = OBV(I-1)$$

Date	Close	Up-Down	Volume*	Positive Negative	OBV
27-Oct-10	53.26				
28-Oct-10	53.30	+1	8,200	+8,200	8200
29-Oct-10	53.32	+1	8,100	+8,100	16300
01-Nov-10	53.72	+1	8,300	+8,300	24600
02-Nov-10	54.19	+1	8,900	+8,900	33500
03-Nov-10	53.92	-1	9,200	-9,200	24300
04-Nov-10	54.65	+1	13,300	+13,300	37600
05-Nov-10	54.60	-1	10,300	-10,300	27300
08-Nov-10	54.21	-1	9,900	-9,900	17400
09-Nov-10	54.53	+1	10,100	+10,100	27500
10-Nov-10	53.79	-1	11,300	-11,300	16200
11-Nov-10	53.66	-1	12,600	-12,600	3600
12-Nov-10	53.56	-1	10,700	-10,700	-7100
15-Nov-10	53.57	+1	11,500	+11,500	4400
16-Nov-10	53.94	+1	23,800	+23,800	28200
17-Nov-10	53.27	-1	14,600	-14,600	13600
18-Nov-10	53.60	+1	11,700	+11,700	25300
19-Nov-10	53.65	+1	10,400	+10,400	35700
22-Nov-10	53.62	-1	9,500	-9,500	26200
23-Nov-10	53.27	-1	13,900	-13,900	12300
24-Nov-10	53.44	+1	10,400	+10,400	22700
26-Nov-10	53.28	-1	4,200	-4,200	18500
29-Nov-10	53.14	-1	10,900	-10,900	7600
30-Nov-10	53.31	+1	17,600	+17,600	25200
01-Dec-10	54.09	+1	17,900	+17,900	43100
02-Dec-10	54.08	-1	15,800	-15,800	27300
03-Dec-10	54.01	-1	10,200	-10,200	17100
06-Dec-10	54.17	+1	8,700	+8,700	25800
07-Dec-10	54.24	+1	16,000	+16,000	41800
08-Dec-10	54.45	+1	12,500	+12,500	54300

* Volume rounded and shown in 1000s.

فرض اساسی، در مورد تحلیل حجم همه جانبیه، این است که تغییرات OBV قبل از تغییرات قیمت ایجاد میشود. اگر حرکت قیمت سهام جلوتر از حرکت OBV باشد، یک "عدم تصدیق" روی داده است. وضعیتهای عدم تصدیق میتواند در سقفهای بازار گاوی (وقتیکه سهام بدون، یا قبل از OBV صعود میکند) یا در کفهای بازار خرسی) وقتیکه سهام بدون، یا قبل از اندیکاتور تکنیکی OBV نزول میکند) روی دهد.

در یک روند صعودی است زمانیکه هر قله جدید بالاتر از قله قبلی باشد و هر دره جدید بالاتر از دره قبل از خودش باشد. بهمین ترتیب OBV در یک روند نزولی است زمانیکه هر قله متوالی پایین تر از قله قبلی باشد و هر دره متوالی بالاتر از دره قبل از خودش باشد. وقتیکه OBV در یک روند خنثی قرار گرفته باشد و بالاها و پایین های متوالی تشکیل نمیدهد، در یک روند مشکوک قرار گرفته است.

همینکه یک روند پایرجا شد، تا زمانی که شکسته نشده باشد نیرومند باقی می ماند. دو راه وجود دارد که در آن روند اندیکاتور OBV میتواند شکسته شود. اولین آنها زمانی روی میدهد که روند از روند صعودی به یک روند نزولی، یا از یک روند نزولی به یک روند صعودی تغییر کند.

دومین راهی که روند OBV میتواند شکسته شود این است که روند به یک روند مردد تغییر کند و بمدت بیش از ۳ روز در همان حالت مردد بماند. بنابراین، اگر سهام از یک روند صعودی به یک روند مردد تغییر کند و بمدت فقط دو روز پیش از تغییر برگشتی به روند صعودی مردد بماند، OBV را چنان در نظر میگیرند که گویا همیشه در یک روند صعودی بوده است. وقتیکه OBV به یک روند صعودی یا روند نزولی تغییر میکند، یک "شکست" روند روی داده است. چون معمولاً شکستهای OBV پیش از شکستهای قیمت روی میدهدند، سرمایه گذاران باید معامله خرید را در نقاط شکست فوقانی انجام دهند. به همین ترتیب سرمایه گذاران باید وقتیکه OBV یک نقطه شکست تحتانی ایجاد میکند معامله فروش بکنند. پوزیشنها را باید تا ایجاد تغییر در روند باز نگه داشت. حجم تعادلی ممکن است صعودی یا نزولی باشد. در صورت صعودی بودن یعنی حجم

صعودی بیشتر از حجم نزول است و این تاییدی بر صعودی بودن روند است. حجم تعادلی نزولی معمولاً علامت فروش است. جهت حجم متوازن باید در جهت روند حرکت قیمت باشد. هنگامیکه حجم معامله نتواند در جهت روند قیمت حرکت کند واگرایی ایجاد شده است و هشداری است برای برگشت روند قیمت.

تحلیل به کمک OBV

- اگر یک افزایش قیمت توسط افزایش اندیکاتور تایید شود، به معنای تقویت روند صعودی است.
- اگر یک کاهش قیمت توسط کاهش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند نزولی است.
- واگرایی صعودی و واگرایی نزولی به ترتیب بیانگر ضعف در روند صعودی و نزولی است.
- شکست خط روند رسم شده در اندیکاتور OBV اخطاری مبنی بر وقوع شکست در خط روند نمودار قیمت، در زمانی نه چندان دور خواهد بود.

ایراد OBV

ایراد OBV اینست که حجم معاملات کلی روز را بصورت ارقام + با - مشخص می کن فرض کنید که قیمت پایانی در یک روز به مقدار بسیار کمی نسبت به روز قبل رشد داشته است آیا می بایست کل معاملات آن روز را + فرض کنیم؟

برای حل این مشکل به روزهای که روند قوی تری دارند وزن بیشتری دهیم. به عنوان مثال در روزیکه قیمت رشد داشته حجم معامله را در میزان رشد قیمت ضرب کنیم. برای همین منظور اندیکاتور MFI طراحی گردید.

اندیکاتور شاخص جریان نقدی Money Flow Index=MFI

کاربرد:

این شاخص جریان نقدی ورودی یا خروجی برای خرید یا فروش سهم را نشان می‌دهد. اگر این شاخص بالای ۸۰ باشد در واقع سهم در منطقه اشباع خرید قرار دارد و زمانی که شاخص کمتر از ۲۰ است، سهم در منطقه اشباع فروش واقع است. شاخص جریان پول، شاخص لحظه‌ای است که قدرت جریان ورود و خروج پول به اوراق بهادر را اندازه می‌گیرد. این شاخص با شاخص قدرت نسبی (Relative Strength Index) در ارتباط است، با این تفاوت که RSI سقف قیمتها را شامل می‌شود، ولی شاخص جریان پول، حجم را به حساب می‌آورد.



فرمول ساخت:

برای محاسبه این شاخص باید ابتدا مقادیر قیمت واقعی، جریان پول و نسبت پول را به شکل زیر محاسبه کنیم:

$$\text{Typical Price} = (\text{High} + \text{Low} + \text{Close})/3$$

$$\text{Raw Money Flow} = \text{Typical Price} \times \text{Volume}$$

$$\text{Money Flow Ratio} = (\text{14-period Positive Money Flow})/(\text{14-period Negative Money Flow})$$

$$\text{Money Flow Index} = 100 - 100/(1 + \text{Money Flow Ratio})$$

Date	Typical Price	Up or Down	Volume*	Raw Money Flow	1-period Positive Money Flow	1-period Negative Money Flow	14-period Positive Money Flow	14-period Negative Money Flow	14-period Money Flow Ratio	14-period Money Flow Index
1	3-Dec-10	24.63		18,730						
2	6-Dec-10	24.69	1	12,272	302,976	302,976	-			
3	7-Dec-10	24.99	1	24,691	617,060	617,060	-			
4	8-Dec-10	25.36	1	18,358	465,534	465,534	-			
5	9-Dec-10	25.19	-1	22,964	578,388	-	578,388			
6	10-Dec-10	25.17	-1	15,919	400,628	-	400,628			
7	13-Dec-10	25.01	-1	16,067	401,796	-	401,796			
8	14-Dec-10	24.96	-1	16,568	413,516	-	413,516			
9	15-Dec-10	25.08	1	16,019	401,810	401,810	-			
10	16-Dec-10	25.25	1	9,774	246,780	246,780	-			
11	17-Dec-10	25.21	-1	22,573	569,130	-	569,130			
12	20-Dec-10	25.37	1	12,987	329,483	329,483	-			
13	21-Dec-10	25.61	1	10,907	279,371	279,371	-			
14	22-Dec-10	25.58	-1	5,799	148,335	-	148,335			
15	23-Dec-10	25.46	-1	7,395	188,250	-	188,250	2,643,012	2,700,043	0.98
16	27-Dec-10	25.33	-1	5,818	147,351	-	147,351	2,340,037	2,847,394	0.82
17	28-Dec-10	25.09	-1	7,165	179,766	-	179,766	1,722,977	3,027,160	0.57
18	29-Dec-10	25.03	-1	5,673	141,978	-	141,978	1,257,443	3,169,137	0.40
19	30-Dec-10	24.91	-1	5,625	140,138	-	140,138	1,257,443	2,730,887	0.46
20	31-Dec-10	24.89	-1	5,023	125,057	-	125,057	1,257,443	2,455,317	0.51
21	3-Jan-11	25.13	1	7,457	187,374	187,374	-	1,444,817	2,053,521	0.70
22	4-Jan-11	24.64	-1	11,798	290,653	-	290,653	1,444,817	1,930,658	0.75
23	5-Jan-11	24.51	-1	12,366	303,090	-	303,090	1,043,007	2,233,748	0.47
24	6-Jan-11	24.15	-1	13,295	321,133	-	321,133	796,227	2,554,881	0.31
25	7-Jan-11	23.98	-1	9,257	221,953	-	221,953	796,227	2,207,703	0.36
26	10-Jan-11	24.07	1	9,691	233,205	233,205	-	699,949	2,207,703	0.32
27	11-Jan-11	24.36	1	8,870	216,084	216,084	-	636,663	2,207,703	0.29
28	12-Jan-11	24.35	-1	7,169	174,567	-	174,567	636,663	2,233,936	0.28
29	13-Jan-11	24.14	-1	11,356	274,191	-	274,191	636,663	2,319,877	0.27
30	14-Jan-11	24.81	1	13,379	331,942	331,942	-	968,605	2,172,526	0.45

* Volume shown in 1000s

اگر قیمت واقعی امروز از قیمت واقعی دیروز بیشتر باشد، این امر جریان پول مثبت و چنانچه قیمت امروز کمتر از قیمت دیروز باشد، جریان پول منفی در نظر گرفته میشود. جریان پولی مثبت، مجموع پولهای مثبت در طول تعداد دورههای مشخص است، و جریان پول منفی مجموع پولهای منفی در طول تعداد دورههای مشخص میباشد.

تحلیل به کمک MFI

- اگر یک افزایش قیمت توسط افزایش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند صعودی است
- اگر یک کاهش قیمت توسط کاهش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند نزولی است
- واگرایی صعودی و واگرایی نزولی به ترتیب بیانگر ضعف در روند صعودی و نزولی است.

اندیکاتور شاخص تجمع و توزیع Accumulation Distribution

رابطه بین قیمت و حجم را نشان می دهد ، شاخصی پیشرو و توسط مارک چیکین ساخته شده است .. از بیشتر جنبه ها شبیه OBV است ولی پیجیده تر از آن و عملکردی بهتر دارد

فرمول ساخت:

1. Money Flow Multiplier = $[(Close - Low) - (High - Close)] / (High - Low)$
2. Money Flow Volume = Money Flow Multiplier x Volume for the Period
3. AD = Previous AD + Current Period's Money Flow Volume

Date	High	Low	Close	MF Multiplier	Volume*	MF Volume	Accu-Dist Line
10-Dec-10	62.34	61.37	62.15	.61	7,849	+4,774	4774
13-Dec-10	62.05	60.69	60.81	-.82	11,692	-9,629	-4855
14-Dec-10	62.27	60.10	60.45	-.68	10,575	-7,164	-12019
15-Dec-10	60.79	58.61	59.18	-.48	13,059	-6,230	-18249
16-Dec-10	59.93	58.71	59.24	-.13	20,734	-2,758	-21006
17-Dec-10	61.75	59.86	60.20	-.64	29,630	-18,970	-39976
20-Dec-10	60.00	57.97	58.48	-.50	17,705	-8,809	-48785
21-Dec-10	59.00	58.02	58.24	-.55	7,259	-4,000	-52785
22-Dec-10	59.07	57.48	58.69	+.52	10,475	+5,468	-47317
23-Dec-10	59.22	58.30	58.65	-.24	5,204	-1,244	-48561
27-Dec-10	58.75	57.83	58.47	+.39	3,423	+1,345	-47216
28-Dec-10	58.65	57.86	58.02	-.59	3,962	-2,357	-49574
29-Dec-10	58.47	57.91	58.17	-.07	4,096	-293	-49866
30-Dec-10	58.25	57.83	58.07	+.14	3,766	+512	-49354
31-Dec-10	58.35	57.53	58.13	+.46	4,239	+1,965	-47389
03-Jan-11	59.86	58.58	58.94	-.44	8,040	-3,517	-50907
04-Jan-11	59.53	58.30	59.10	+.30	6,957	+2,093	-48813
05-Jan-11	62.10	58.53	61.92	+.90	18,172	+16,339	-32474
06-Jan-11	62.16	59.80	61.37	+.33	22,226	+7,346	-25128
07-Jan-11	62.67	60.93	61.68	-.14	14,614	-2,016	-27144
10-Jan-11	62.38	60.15	62.09	+.74	12,320	+9,116	-18028
11-Jan-11	63.73	62.26	62.89	-.14	15,008	-2,165	-20193
12-Jan-11	63.85	63.00	63.53	+.25	8,880	+2,194	-18000
13-Jan-11	66.15	63.58	64.01	-.67	22,694	-15,100	-33099
14-Jan-11	65.34	64.07	64.77	+.10	10,192	+1,043	-32056
18-Jan-11	66.48	65.20	65.22	-.97	10,074	-9,759	-41816
19-Jan-11	65.23	63.21	63.28	-.93	9,412	-8,759	-50575
20-Jan-11	63.40	61.88	62.40	-.32	10,392	-3,282	-53856
21-Jan-11	63.18	61.11	61.55	-.57	8,927	-5,132	-58988
24-Jan-11	62.70	61.25	62.69	+.99	7,460	+7,357	-51631

* Volume rounded and shown in 1000s.

تحلیل به کمک AD

- واگرایی: واگرایی صعودی سیگنال خرید و واگرایی نزولی سیگنال فروش است.
- اگر یک افزایش قیمت توسط افزایش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند صعودی است
- اگر یک کاهش قیمت توسط کاهش نشانگر تایید شود، به معنای تقویت روند نزولی است

- شکست خط روند رسم شده در نشانگر اخطاری مبنی بر وقوع شکست در خط روند نمودار قیمت در زمانی نه چندان دور است.

A/D ایراد

- این شاخص شکافها را در نظر نمی گیرد.
- از آنجاکه این شاخص بسیار به حرکات قیمت مخصوصاً قیمت بسته شدن وابسته است اغلب همراه آن حرکت می کند و واگرایی های کمی نشان می دهد.
- گاه ردیابی تغییرات ظریف و نامحسوس در جریانهای حجم دشوار است. نرخ تغییر حجم ریک روند نزولی ممکن است در حال کاهش باشد ولی تا زمانیکه این شاخص به سمت بالا بازگشت نکند قابل تشخیص نیست. این مشکل در اسیلاتور چیکن یا جریان پول چیکن حل شده است.

شاخص کانال کالا Commodity Channel Index

این شاخص انحراف قیمت از میانگین را به عنوان یک متغیر آماری محاسبه می کند. محدوده تغییرات این شاخص معمولاً بین -100 تا $+100$ است. زمانی که این شاخص از پایین -100 را به سمت بالا قطع می کند، علامت خرید و هرگاه از بالا $+100$ را به سمت پایین قطع کند، علامت فروش است.



- ۱- بیشتر چارتیست ها از این شاخص فقط به عنوان شناسایی نقاط خرید و فروش هیجانی استفاده می کند
- ۲- یک میانگین متحرک ۲۰ روزه به عنوان یک مبنا برای محاسبه استفاده می شود
- ۳- اگر بازار روند دار بود از سیگنال مناطق اشباع خرید و فروش استفاده نشود
- ۴- اگر شیب میانگین متحرک کم و نزدیک به صفر بود بازار بدون روند است

سیگنال خرید

۱) بهترین زمان خرید هنگامی است که نمودار شاخص با شیب سعودی و مثبت از منطقه اشباع فروش خارج شود یعنی شاخص با شیب سعودی خط -100 را قطع کند و بالاتر از آن قرار گیرد

۲) زمانی یک واگرایی سعودی مثبت میان نمودار و شاخص پدیدار گردد(رونده دار)

سیگنال فروش

۱) بهترین زمان فروش هنگامی است که نمودار شاخص با شیب نزولی و منفی از منطقه اشباع خرید خارج شود یعنی شاخص با شیب نزولی خط $+100$ را قطع کند و پایین تر از آن قرار گیرد

۲) زمانی یک واگرایی نزولی منفی میان نمودار و شاخص پدیدار گردد(رونده دار)



آرایش یا الگوها

زمانی نیز وجود دارد که بازار **بصورت مستقیم یا خنشی** حرکت می کند. این بخش از نمودارها یعنی بخشی که بازار را کد می باشد و در حقیقت قیمت فعالیت چندانی انجام نمی دهد بخش مهمی از نمودارهاست. نکته بسیار مهم این است که تغییرات اصلی در روندها احتیاج به یک دوره انتقال دارند. مطالعه این دوره های زمانی انتقال و پیش بینی آنها ما را به سمت مبحثی به نام الگوهای قیمت هدایت می کنند. الگوهای قیمت به دو گروه عمده تقسیم می شوند:

۱. الگوهای برگشتی قیمت
۲. الگوهای ادامه دهنده

حجم معامله نقش بسیار مهمی را در تایید الگوها بازی می کند.

نکات اساسی مشترک در الگوهای برگشتی

۱. لازمه شروع هر الگوی برگشتی وجود یک روند اولیه می باشد.
۲. اولین **اخطار** برای ایجاد برگشت روند اکثراً زمانی ساطع می شود که یکی از خطوط روند شکسته شود.
۳. بزرگ بودن الگو نشانه بزرگ بودن (ارتفاع و پهنا) تحرکات بعد از آن می باشد.
۴. الگوهای سقف معمولاً دوره زمانی کوتاه تر و نوسان بلندتری نسب به الگوهای کف دارند. به همین دلیل است که خرید در کف به مراتب ساده تر از فروختن در سقف می باشد.
۵. کف ها معمولاً تغییرات قیمت کمتری دارند و زمان بیشتری برای تشکیل شدن صرف می کنند
۶. حجم معمولاً در نقاط سقف اهمیت فوق العاده ای دارند

الگوهای برگشتی روند آرایش های برگشتی از تنوع زیادی برخوردارند. اما رایج

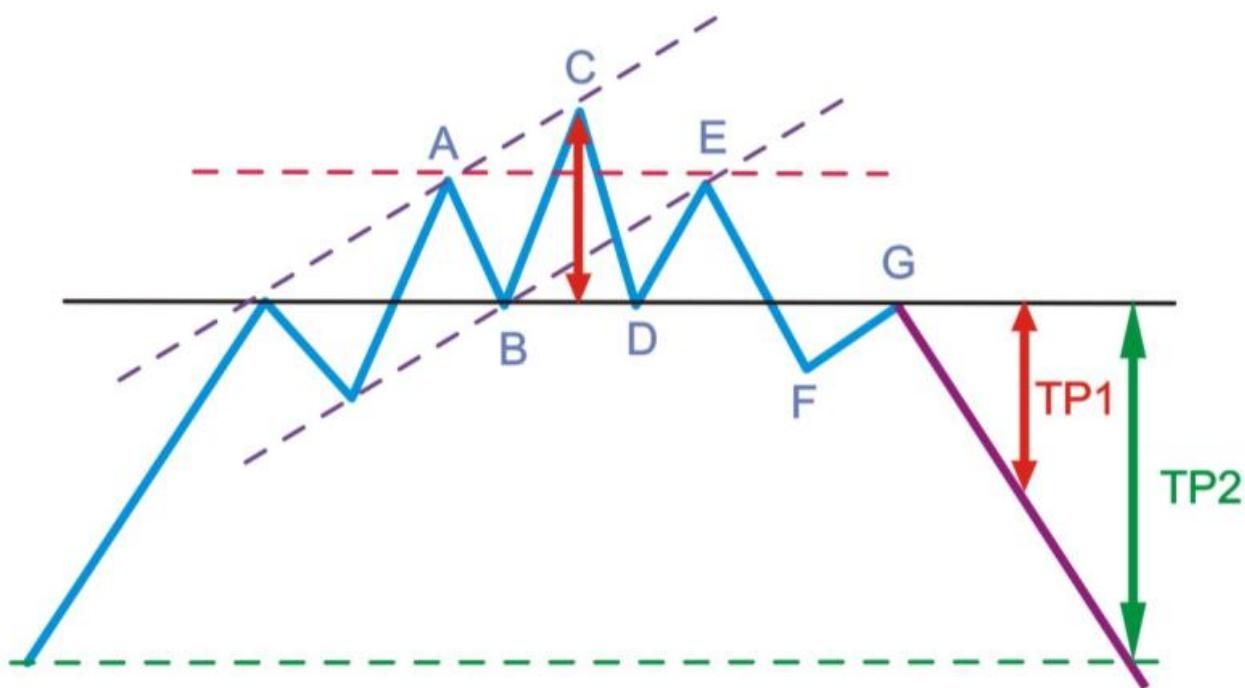
ترین آنها عبارتند از :

۱. آرایش سروشانه
۲. آرایش سروشانه معکوس
۳. آرایش دو قله (سقف دو قلو)
۴. آرایش دو دوره (دو کف)
۵. آرایش سه قله (سقف سه قلو)
۶. آرایش سه دره (کف سه قلو)
۷. آرایش وی
۸. آرایش قوسی پایین و بالا

الگوهای ادامه روند

۱. آرایش پرچم
۲. آرایش‌های مثلثی
۳. آرایش کنج
۴. آرایش مستطیل

الگوی برگشتی سر و شانه- Head and Shoulder



الگوی سرو شانه یکی از قابل اعتماد ترین الگوی نموداری است . این الگو در انتهای یک روند رخ می دهد و روند صعودی را به نزولی و روند نزولی را به صعودی تبدیل می کند. نمونه ای از الگوی سروشانه در نمودار نشان داده شده است.

همانطور که در نمودار می بینید اولین نشانه ایجاد این الگو با شکسته شدن خط روند صعودی به وجود می آید. قیمتها در یک روند به سمت بالا از سطح مقاومت گذشته است. قیمتها در خط گردن به سطح مقاومت نفوذ کرده و به سمت بالا رفته است. این سطح در مرحله بعدی تبدیل به حمایت شده است. شانه چپ هنگامی که قیمتها به در نقطه B به سطح حمایت برخورد می کند شکل می گیرد. پس از به وجود آمدن یک قله قیمتها خط روند را در کanal صعودی شکسته و در شرایط عادی سطح قیمتها به حمایت قبلی خود باز میگردد. در این حالت وقتی که قیمتها افت می کنند شکست سطح حمایت تایید می شود.

الگوی سر و شانه مشتمل بر سه موج پشت سر هم می باشد. موج اول و سوم که شانه ها را شکل می دهد، تقریباً بلندی یکسانی دارند. سر در این الگو توسط موج میانی ایجاد می گردد و بلند تر از شانه ها می باشد. در این الگو هر سه موج از خط حمایتی پیروی می کنند که این سطح به عنوان خط گردن معروف شده است. در آرایش سر و شانه معکوس این سه موج از یک خط مقاومت تبعیت می کنند.

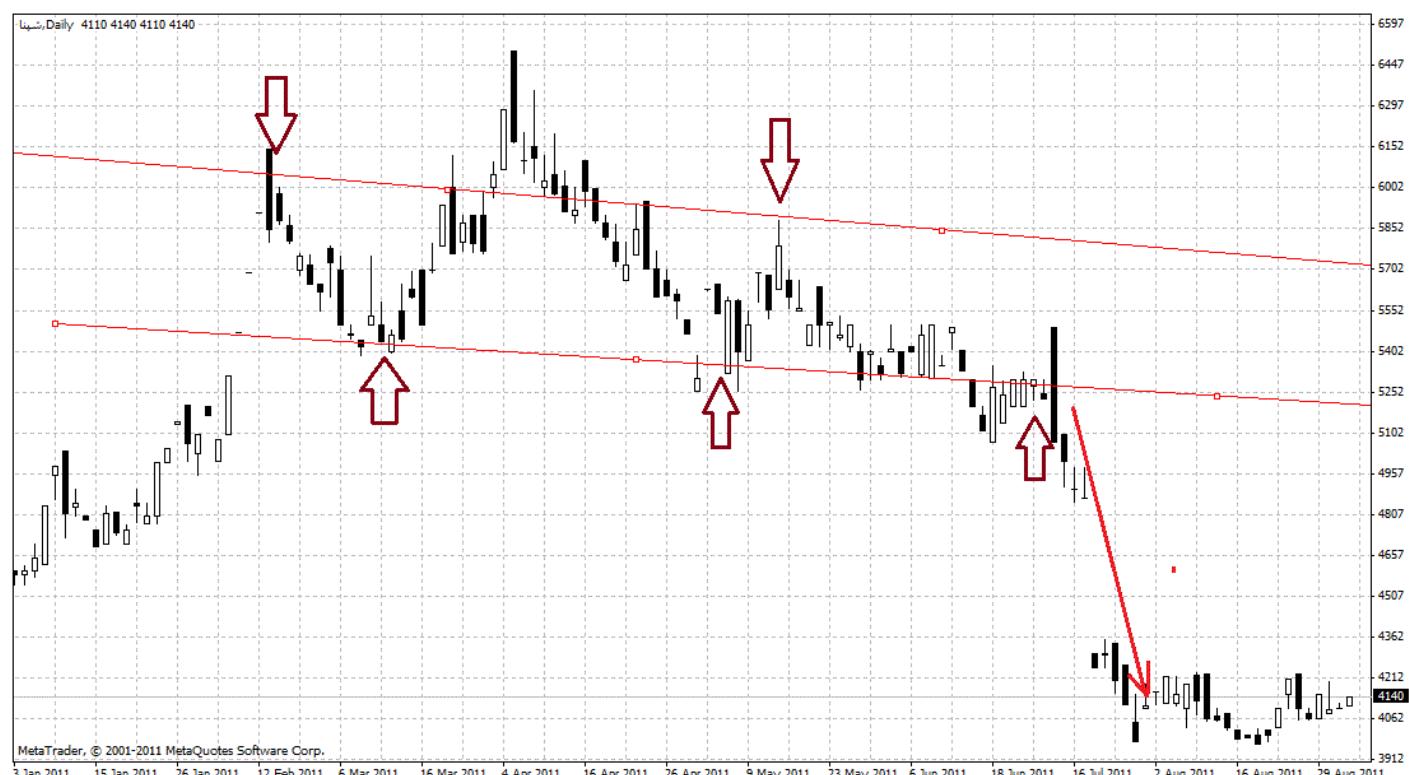


علامت ساخته شده توسط الگوی سر و شانه

۱. خط حمایت با توجه به نقطه B و D قابل شناسایی است. این سطح خط گردن را به نمایش می گذارد.
۲. خط مقاومتی که فشار خرید را کنترل می کند. معمولاً بازار پس از شکست سطح حمایت، خط گردن را دوباره آزمایش می کند.
۳. جهت روند و قیمتها توسط این الگو مشخص می شود. اگر خط گردن فشار خرید را در نقطه برخورد دوباره متوقف سازد، آنگاه الگوی سر و شانه اطلاعاتی راجع به جهت قیمت فراهم می کند.

۴. هدف قیمت از بدست آوردن فاصله سر تا خط گردن قابل محاسبه است(به صورت خط چین و فلش در نمودار بالا) به عنوان تایید این الگو نیاز است که قیمتها تحت حجم معاملات بالا به خط گردن نفوذ نماید.

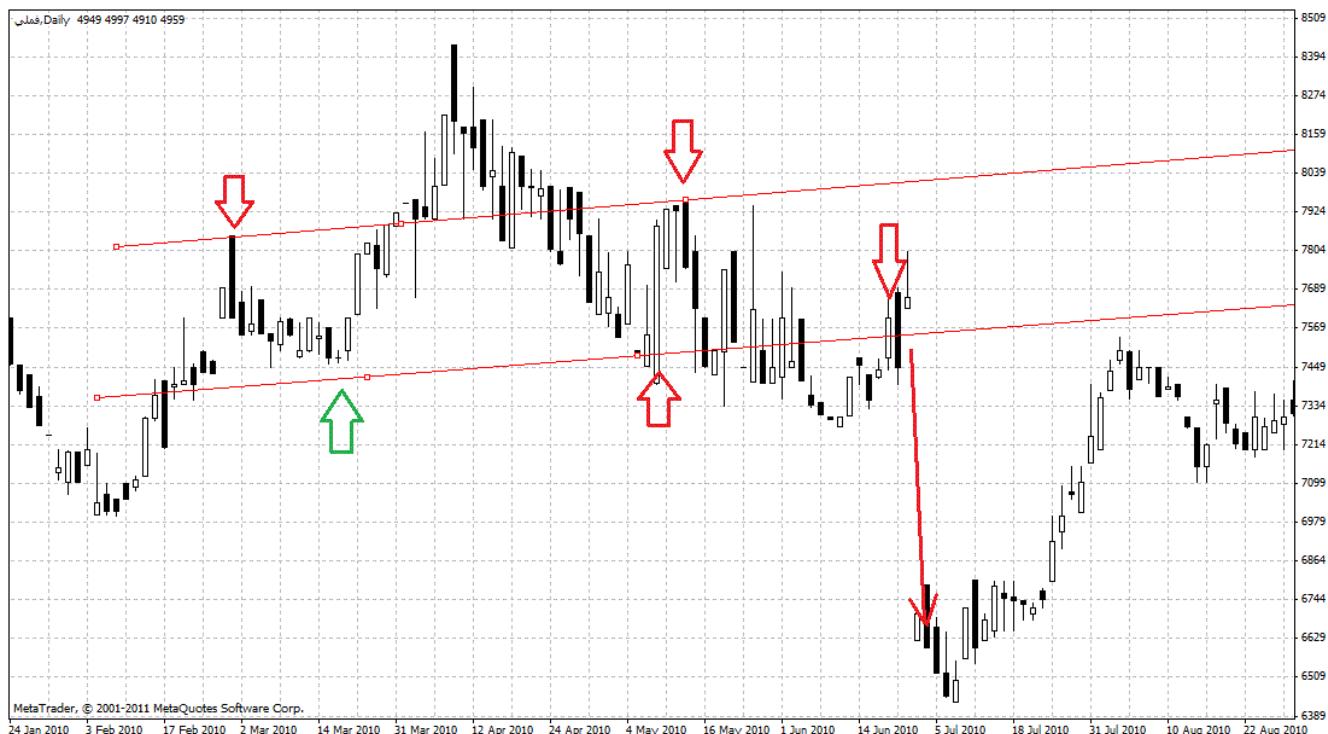
بنابراین فروض اصلی در توسعه این الگو این است که در هنگام شکست خط گردن حجم معاملات بسیار زیاد است و فروشهای زیادی انجام می گیرد.



دوره زمانی در آرایش سرو شانه

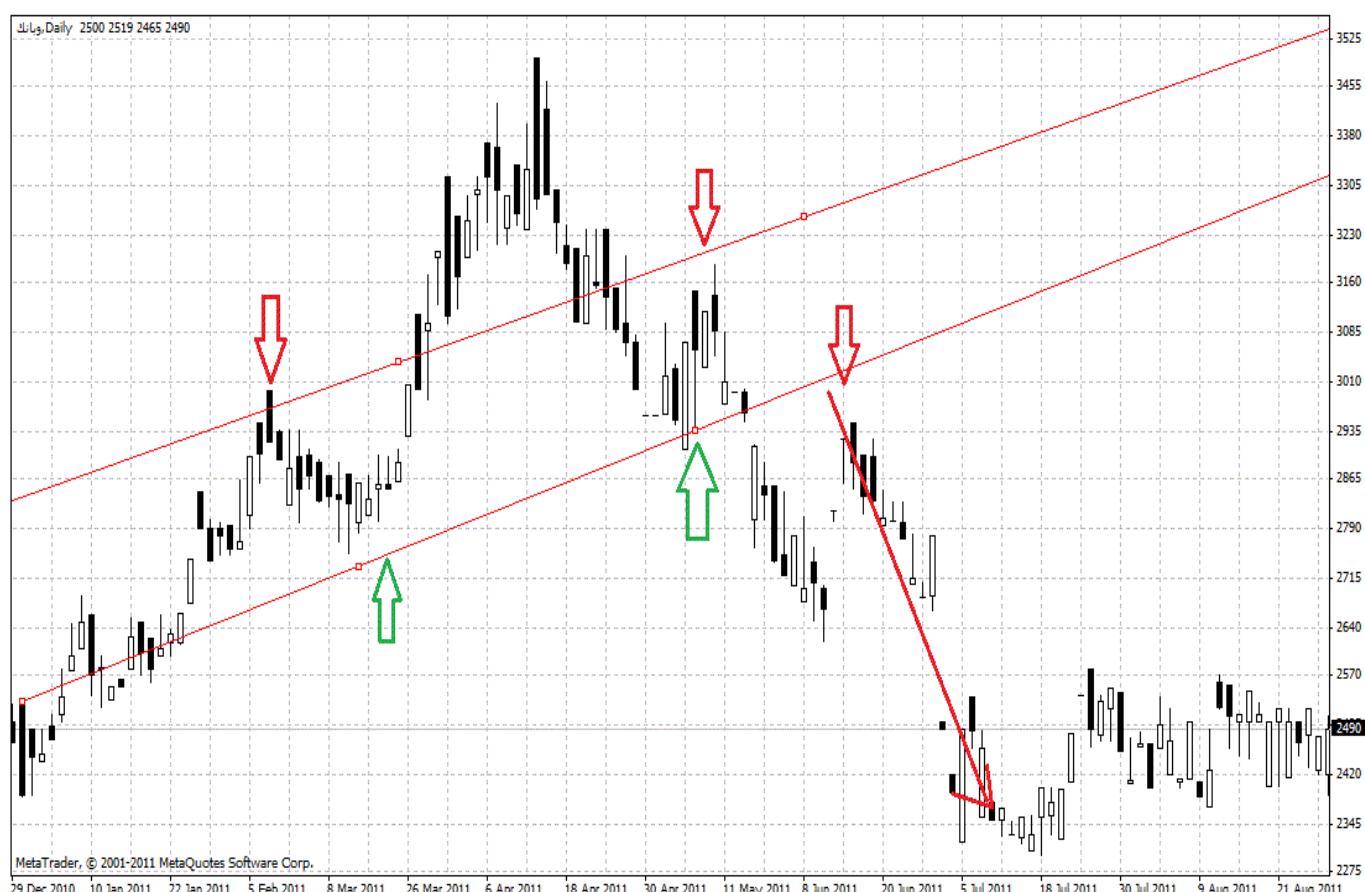
چارچوب زمانی الگوی سرو شانه می تواند از چند هفته تا چند ماه را پوشش دهد. هر چه زمان این الگو طولانی تر باشد این الگو دقیق تر است. اما هدف قیمتی به احتمال زیاد در کوتاه مدت بدست نمی آید. موقعی که برای رسیدن به هدف زمانی با مشکل مواجه می شویم ، اجماع عمومی بر این است که طول مدت گسترش یافتن این الگو با دو ه زمانی آن ارتباط خواهد داشت. با این تاکید که اندازه گیری هدف از نقطه ای که خط گردن شکسته می شود بسیار مهم است.

بسیاری از الگوهای سروشانه ظاهر متفاوتی با نمودار بالا دارند. حالت واقعی قیمت‌ها به اندازه کافی نرمال و متقارن نیستند و آرایش سر و شانه گاهی اوقات وضوح نخواهد داشت. همین طور توجه داشته باشید خط گردن به ندرت افقی خواهد بود. نمونه واقعی این الگو در بازار بورس اوراق بهادار در تغییرات قیمت سهام شرکت سرمایه گذاری غدیر قابل مشاهده است.



شناسایی آرایش سر و شانه

۱. اندازه شانه ها بایستی تقریبا مساوی باشند و از این مهمتر شانه ها نبایستی فراتر از گردن باشند.
۲. لازم است نقاط خط حمایت همگی مماس با خط گردن باشند که اگر این شرط برقرار نباشد، نمیتوان این آرایش را به الگوی سر و شانه نسبت داد.
۳. الگوی سر و شانه تنها در هنگامی که سه موج به صورت امواج برگشتی با سطح حمایت (خط گردن) برخورد نمایند و سپس آنرا قطع کنند کامل و تایید می شود. چنانچه قیمت نتواند خط گردن را قطع کند، الگو اعتبار خود را از دست می دهد.



نقطه نظرات داد و ستد

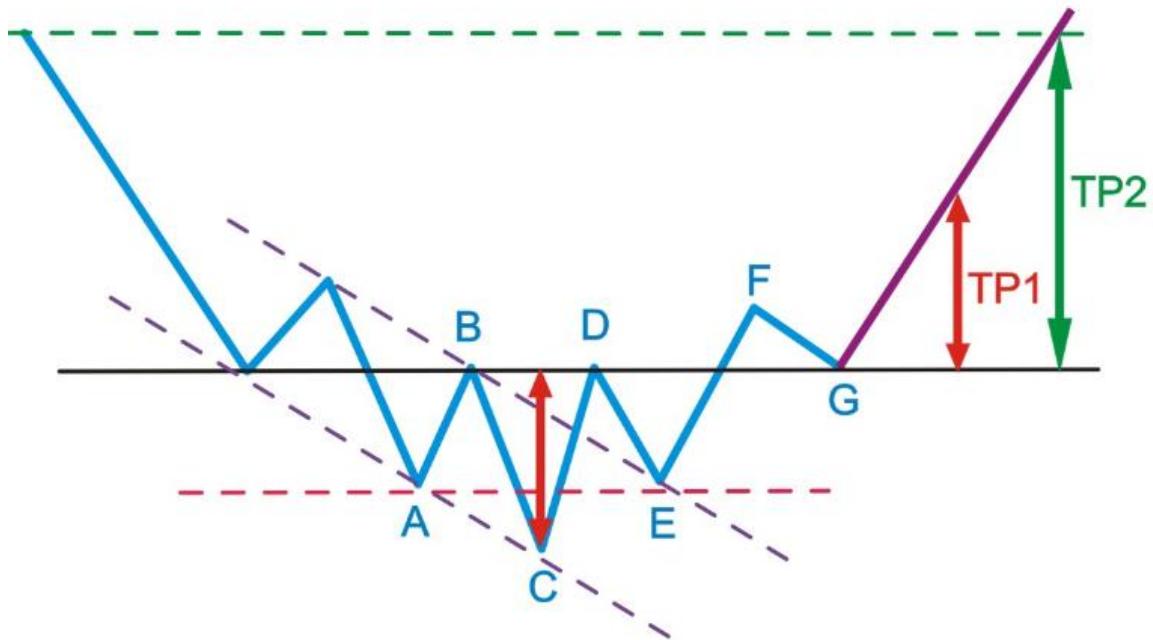
اصولا معامله گران از انواع مختلف نمودارها براساس چارچوب زمانی متفاوت استفاده می کنند. لازم است تاکید کنیم که برای تایید الگو قیمت پایانی بایستی نقاطی خارج از گردن را بوجود آورند. پیشنهاد می شود که در این صورت از نمودار شمعی یا میله ای استفاده شود.

در آرایش سر و شانه بسیاری از معامله گران مترصد عبور قیمتها از خط گردن خواهند بود، اما گزارشات قیمتی معمولاً بسیار گسترده اند و هر وقفه در آن امکان بازگشت دوباره قیمتها را مشکل می کند، و در این شرایط امکان دارد بازار خط گردن را آزمون کند.

در محدودی از بازارها که در آن معامله گران ریسک بالایی را می پذیرند خرید یا فروش قبل از تلاقی خط گردن با قیمت انجام می شود و در نتیجه اگر بازار در خط گردن نفوذ کند سود بسیار بالایی خواهند برد. اگر بازار نتواند از خط گردن عبور کند آنگاه باید هر چه زودتر از بازار خارج شویم تا از زیان بیشتر جلوگیر شود. اگر چه گردن پول بالا و نقدينگی پایین وضعیتی را به وجود می آورد که امکان انجام معامله را از معامله گران سلب می کند. الگوی سر و شانه همواره به صورت یک آرایش منظم و متقارن شکل نمیگیرد.

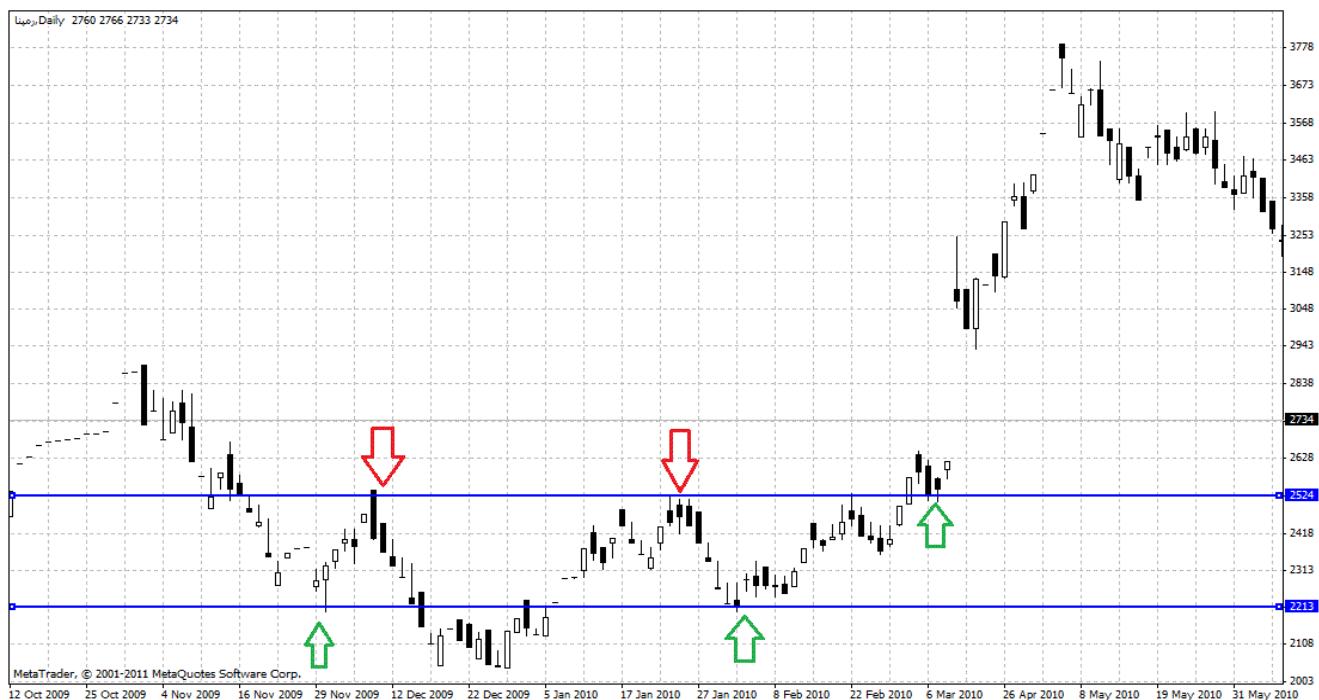
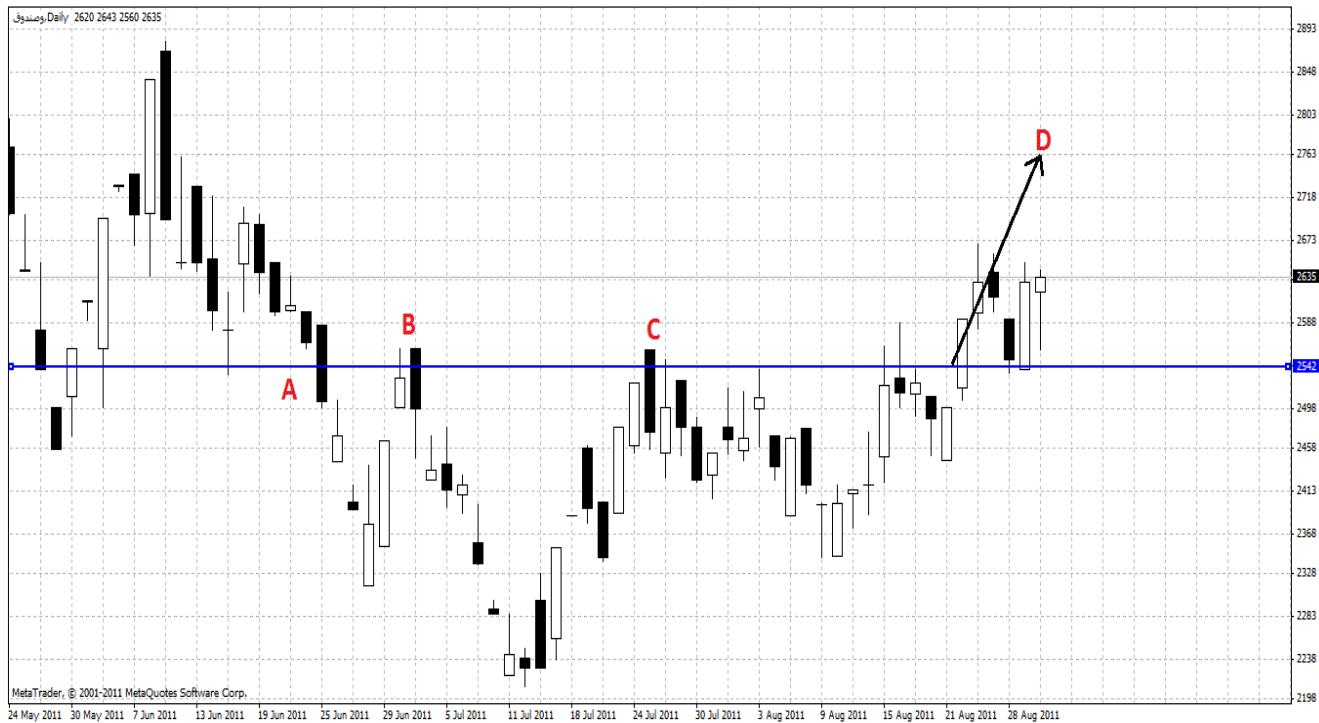


آرایش سر و شانه معکوس

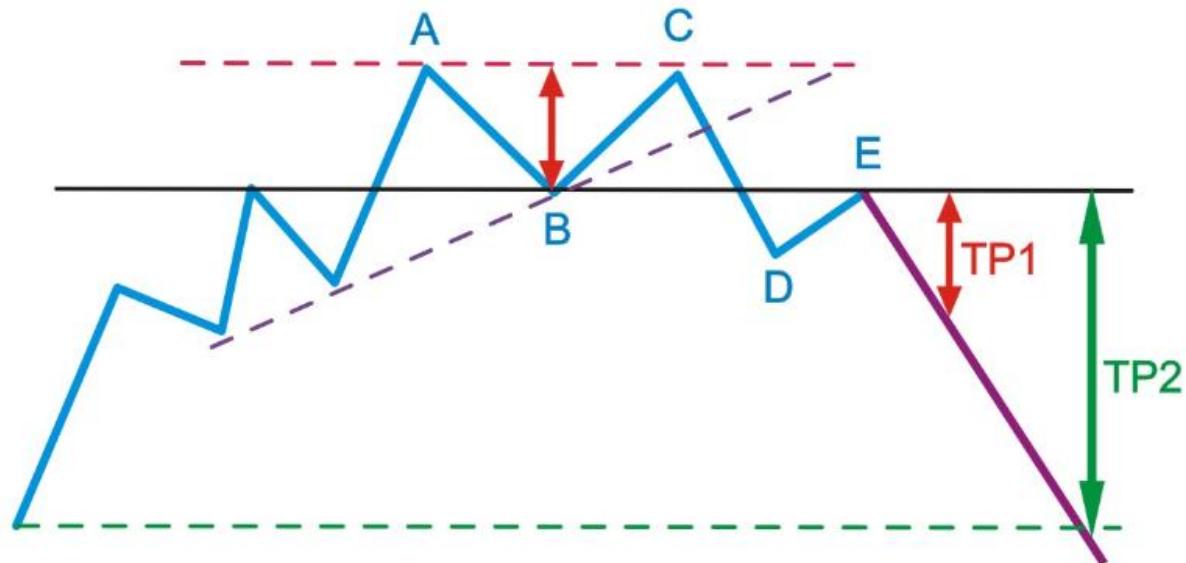


آرایش سر و شانه معکوس یک تصویر درون آینه از الگوی پیشین است. به نمودار بالا توجه کنید. پیش از آنکه قیمتها از نقطه A عبور کند، سطح حمایت در برابر قیمتها خود نمایی می‌کند. زمانی که این سطح شکسته شود، آن خط به یک خط مقاومت مهم و قوی تبدیل می‌شود. اما در طول زمان قیمت دوباره به سوی خط مقاومت پرش می‌کند. سطح حمایت پیشین و سطح مقاومت جدید به عنوان خط گردن در اینجا مطرح می‌شود. قیمتها دوباره نقاط B و C به سوی خط گردن هجوم می‌آورند، اما حرکت آنها با برخورد با این سطح متوقف می‌شود. در نتیجه با تلاش خریداران خط گردن شکسته شده و این بار قیمتها با حجم معاملات بالا از سطح مقاومت عبور می‌کند. پس از عبور قیمت از خط گردن، اکنون این سطح نقش سطح حمایت را ایفا می‌کند. اگر خط حمایت در برابر فشار فروشندگی و آزمون بازار دوام آورد، انتظار می‌رود که قیمتها در نهایت به نقطه D بالا بروند که هدف قیمتی آرایش سر و شانه به شما می‌آید. هدف

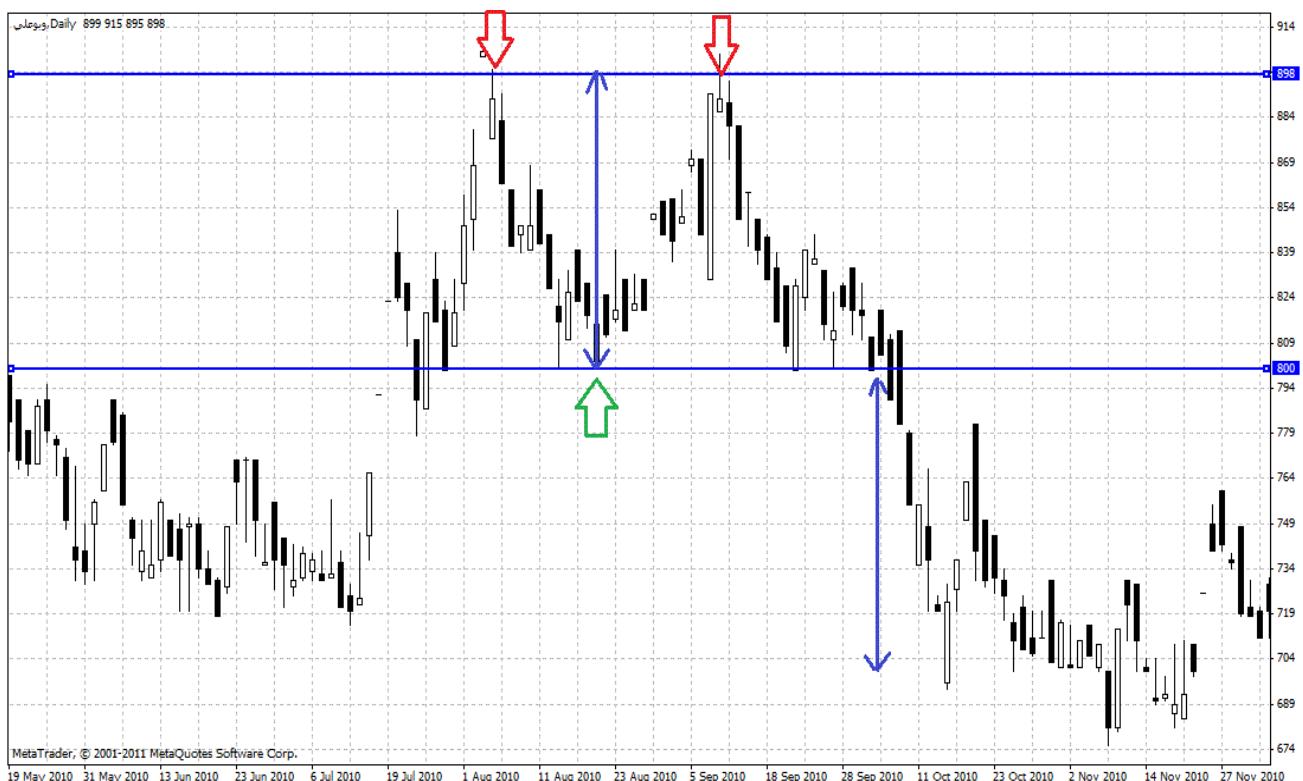
قیمتی احتمالاً با فاصله بین بالای سر و خط گردن است و از نقطه شکسته شدن خط گردن در نقطه مقاومت محاسبه می شود.



آرایش دو قلو (سقف دوقلو)



(



الگوی سقف دوقلو نیز در انتهای روند صعودی یا روند نزولی تشکیل می شود.دو قله آرایش برگشتی دیگری است که بسیار معمول و معتبر است.همانطور که نام این الگو به طور مختصر و واضح بیان می کند؛ این آرایش از دو قله یا بلندی تشکیل شده است که احتمالاً می تواند دارای بلندی برابر باشد.

در این آرایش خطی موازی رو به روی سطح مقاومت کشیده می شود که دو قله را به عم وصل می کند. این جهت شناسایی خط گردن در نظر گرفته می شود.

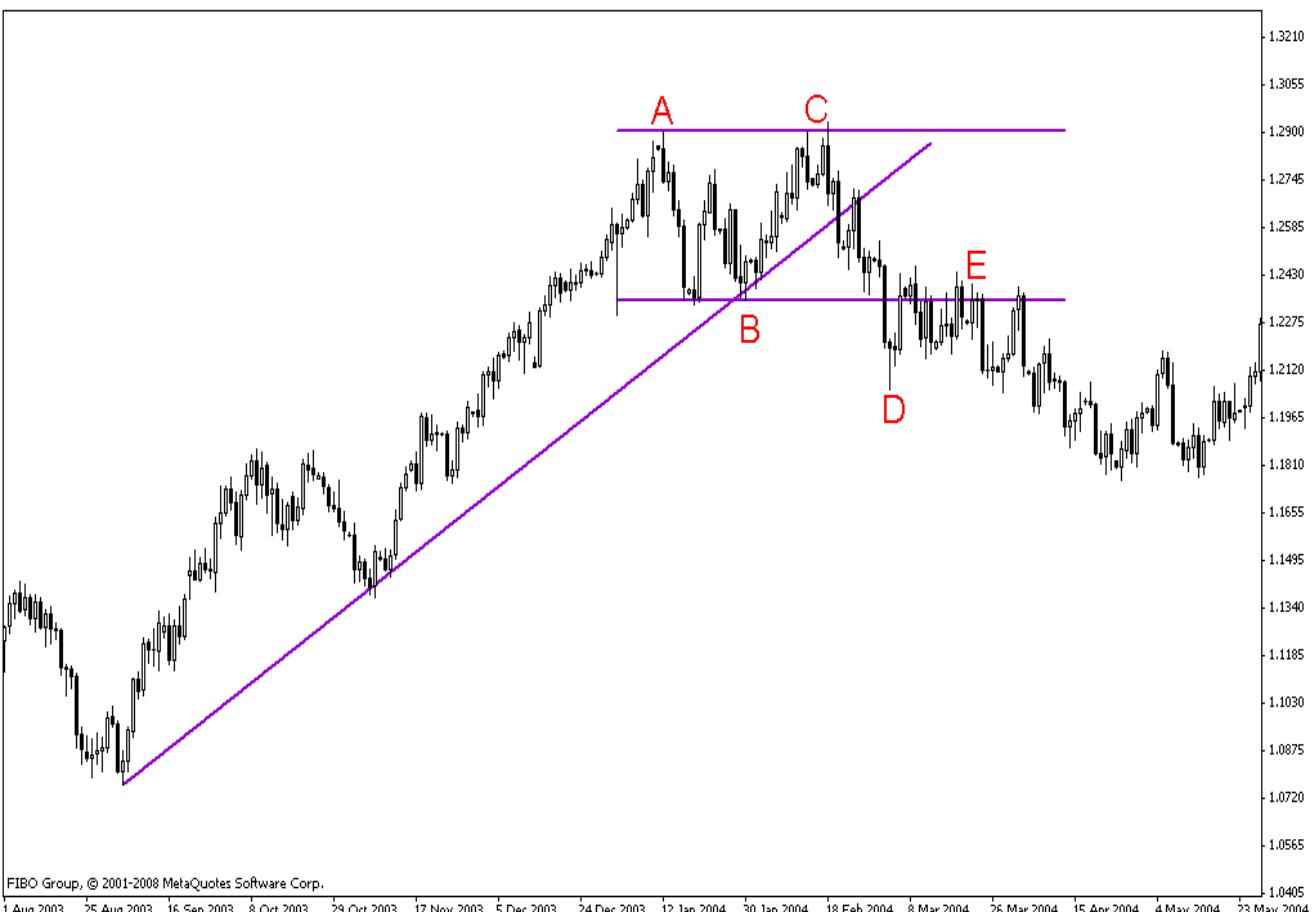
دوباره سعی می کنیم پدید آمدن این آرایش را مرور کنیم.پیش از آنکه قیمتها از نقطه A عبور کنند ، سطح حمایت در برابر قیمتها بوجود آمده و زمانی که این خط شکسته می شود به یک خط مقاومت مهم و قوی تبدیل خواهد شد.قیمتها در برخورد با نقطه B به سطح حمایت برگشت می کنند.این سطح اکنون به عنوان خط گردن مطرح است.امید خریداران به برگشت قیمتها دوام زیادی پیدا نمی کند ، چرا که بار دیگر قیمتها در نقطه بوسیله عرضه هایی بازمی گردند.حرکت قیمتها طوری است که سطح حمایت شکسته می شود ، اما احتمال دارد با تلاش خریداران قیمت به سوی خط گردن متمايل شود.د این حالت خط گردن توسط بازار آزموده شده و می تواند نقش بازدرانده از رشد را بازی کند.اگر خط مقاومت در برابر فشار خریداران دوام بیاورد انتظار می رود قیمت سقوط کند.هدف قیمتی احتمالاً برابر فاصله بین بالای قله ها و خط گردن است و از نقطه شکسته شدن خط روند یه سمت پایین محاسبه می شود.



آرایش دو قله اطلاعاتی را در زمینه های زیر فراهم می کند:

۱. خط حمایت بین نقاط E، C، A ایجاد می شود.
۲. خط مقاومت بین نقاط D، B ایجاد می شود
۳. جهت قیمتی : اگر خط گردن فشار خریداری را کمتر نماید ، آرایش اطلاعاتی راجع به جهت قیمتی فراهم می کند. حرکت قیمتها کاهشی و درست برخلاف قله ها خواهد بود.
۴. هدف قیمتی : بوسیله تایید و تصدیق آرایش فراهم می شود. در این حالت خط گردن بوسیله حجم معاملات زیاد شکسته می شود.

همچنین خاطر نشان می گردد چارچوب زمانی برای تکمیل الگو دو قله ممکن است چندین هفتگه یا چندین ماه به طول بینجامد و هر چه این زمان طولانی تر باشد الگو از اعتبار بیشتری برخوردار است.



شناسایی آرایش

۱. بلندی قله ها باستی برابر باشد.
۲. خیلی مهم است که مقاطع معین و مهم همگی با خط گردن مماس شوند. کوتاهی در این شرط ویژگی های آرایش را کم اعتبار می کند.
۳. آرایش دو قله تنها زمانی تایید می شود که به طور کامل دو موج به سطح مقاومتی برخورد نموده و در برگشت قیمتها نفوذی به خط گردن ایجاد گردد. در این حالت قیمت بسته شدن خارج از خط گردن خواهد بود. چنانچه قیمت نتواند خط گردن را قطع کند الگو اعتبار خود را از دست می دهد.

دیدگاه معامله گر

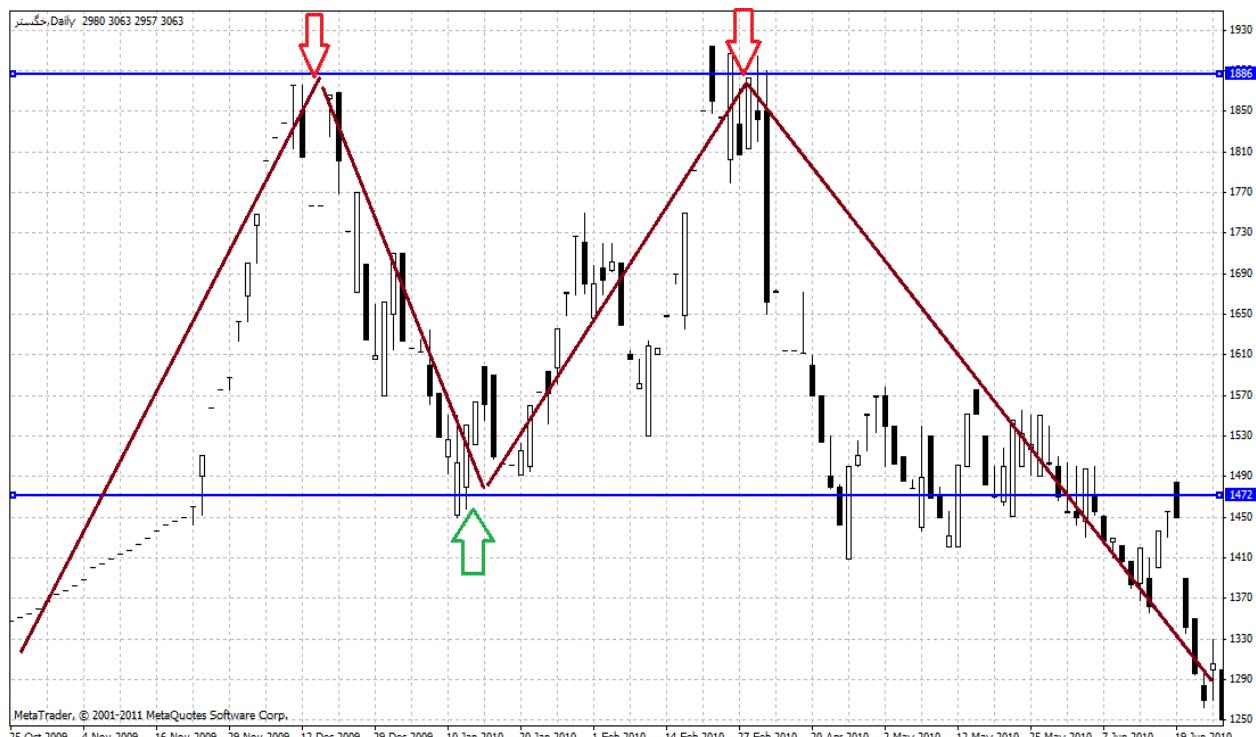
۱. مهم است به خاطر داشته باشیم که تایید شکست خط گردن شامل قیمت بسته شدن سهم بیرون خط گردن است.

۲. اکثریت معامله گران بازار منتظر تایید نفوذ در خط گردن می مانند در حالیه تلاش نمی کنند تا از قافله عقب بمانند. در آرایش دو قله بسیاری از معامله گران مترصد عبور قیمتها از خط گردن خواهد بود؛ اما گزارشات قیمتی معمولاً بسیار گسترده اند و هر وقفه در آن امکان بازگشت دوباره قیمتها را مشکل می کند و در این شرایط امکان دارد بازار خط گردن را آزمون کند.

۳. افراد با ریسک پذیری بالا، در موقع شکسته شدن خط گردن از بازار خارج می شوند. زیرا آنها انتظار بازگشت قیمتها را ندارند. در واقع اگر قیمت به خط گردن نفوذ نماید، آنها از زیان جلوگیری کرده اند. اگر قیمت نتواند از خط گردن عبور نماید، آنگاه باید هر چه زدoter از بازار خارج شویم تا از زیان بیشتر جلوگیری کنیم.

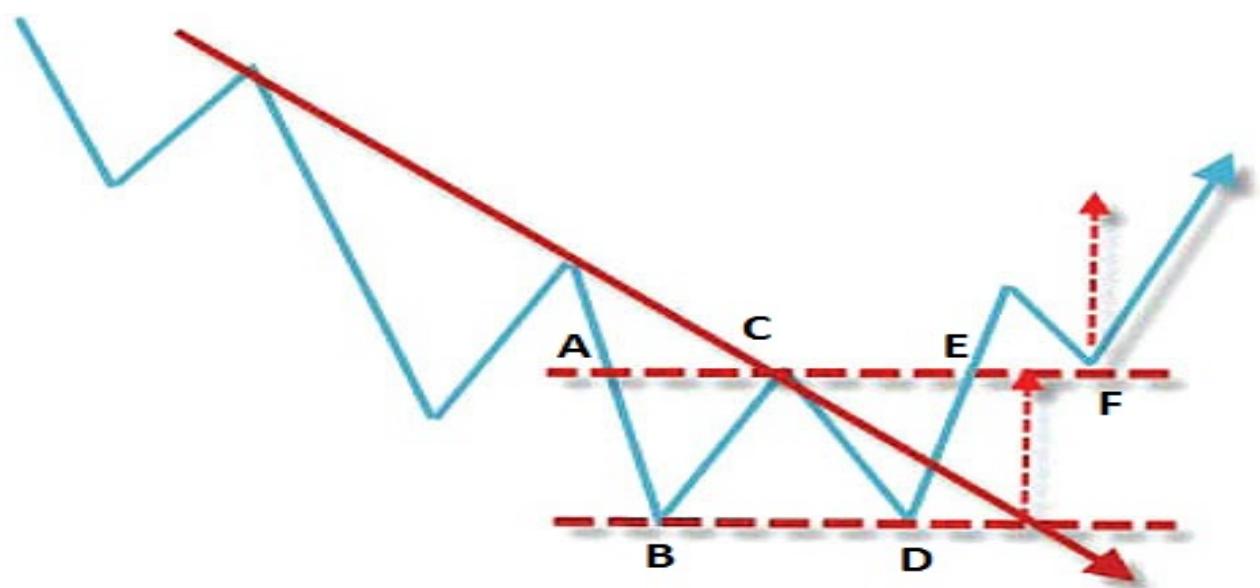
۴. به خاطر انتظار بازار برای تکمیل زودهنگام این آرایش، احتمال دارد که وضعیتهاي وجود داشته باشد که برگشتهای سریع را بدنبال داشته باشیم.

۵. قیمت به طور تصادفی ممکن است در قیمت هدف متوقف شود. عموماً ممکن است قیمت مقداری پایین تر یا بالاتر قرار گیرد. معامله گران بایستی با اطلاعات اضافی خود را برای سازگار نمودن با شرایط بعدی آماده کنند.



در آرایش دو قله بهترین کار آن است که در اولین علامت فروش از بازار خارج شد. خیلی بد است که منتظر دومین افزایش باشیم ، چون ممکن است هرگز اتفاق نیفتد. به هر حال حرکت به طرف دومین روند افزایش ، موقعیت دیگری برای سهامدارانی که به علائم بی اعتنا بودند بوجود می آورد تا از این سهم خارج شوند.

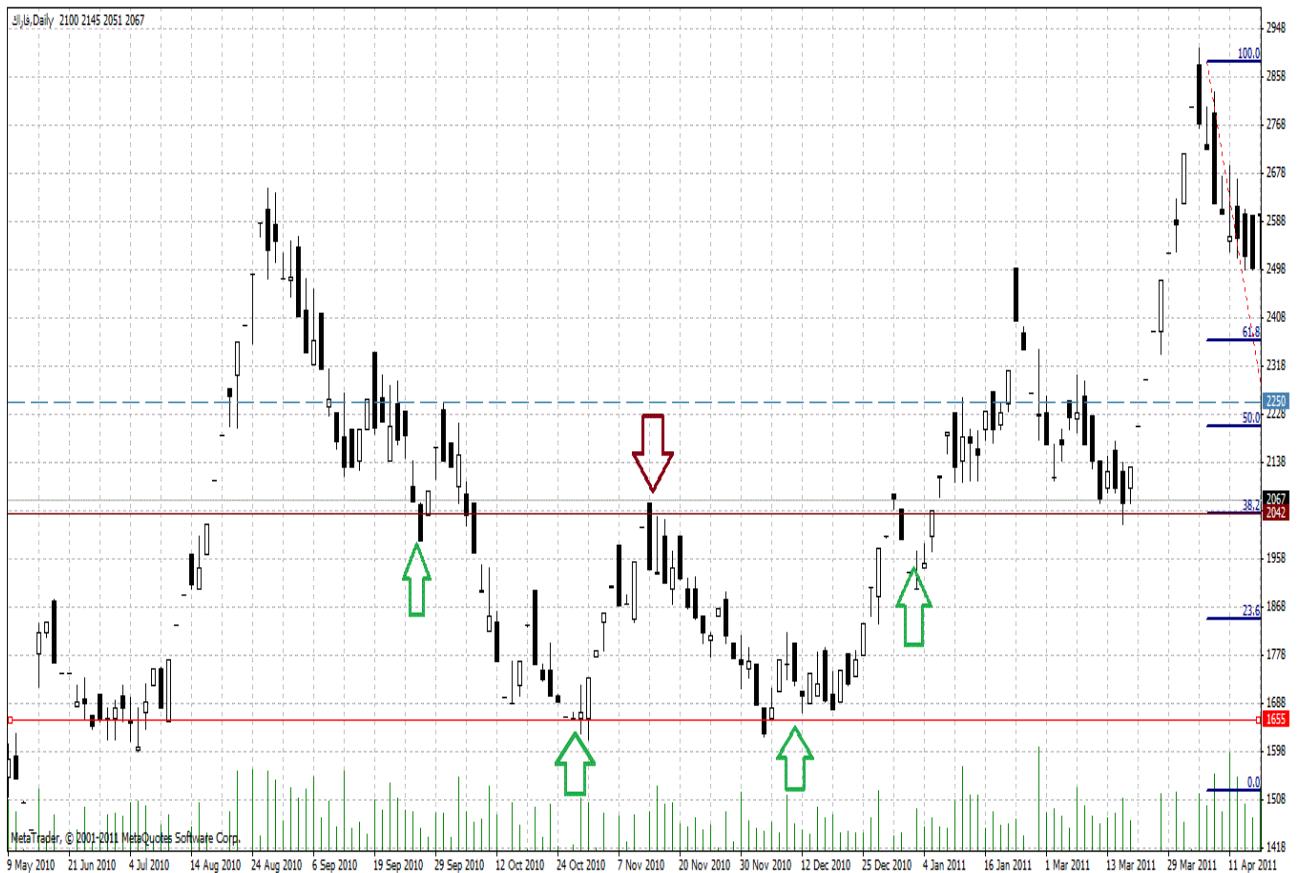
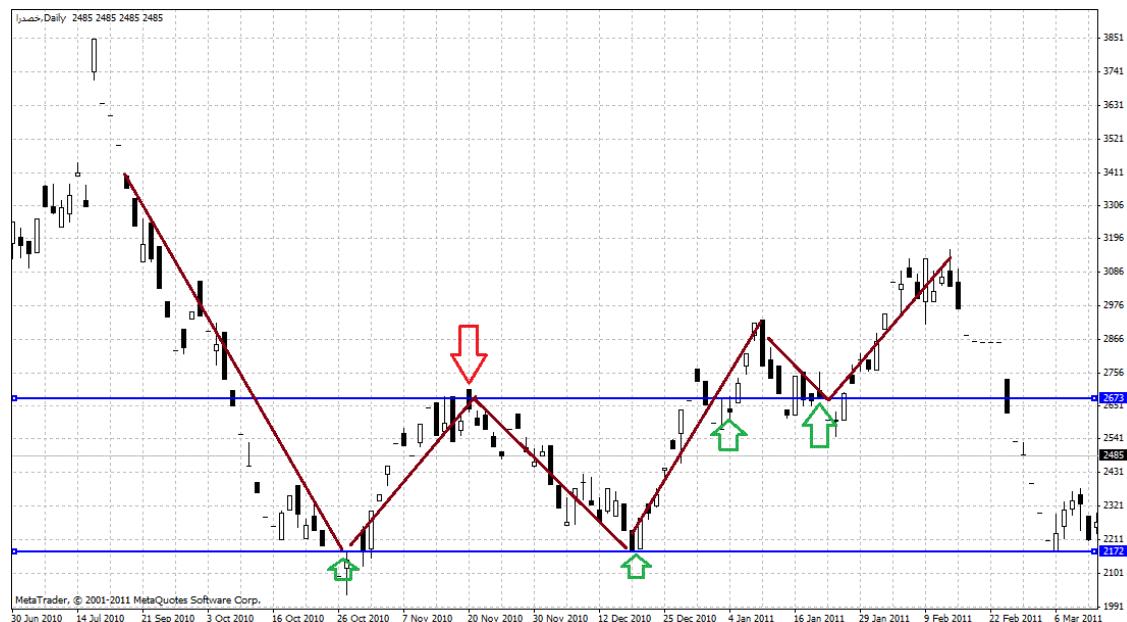
آرایش دو دره (کف دو قله)



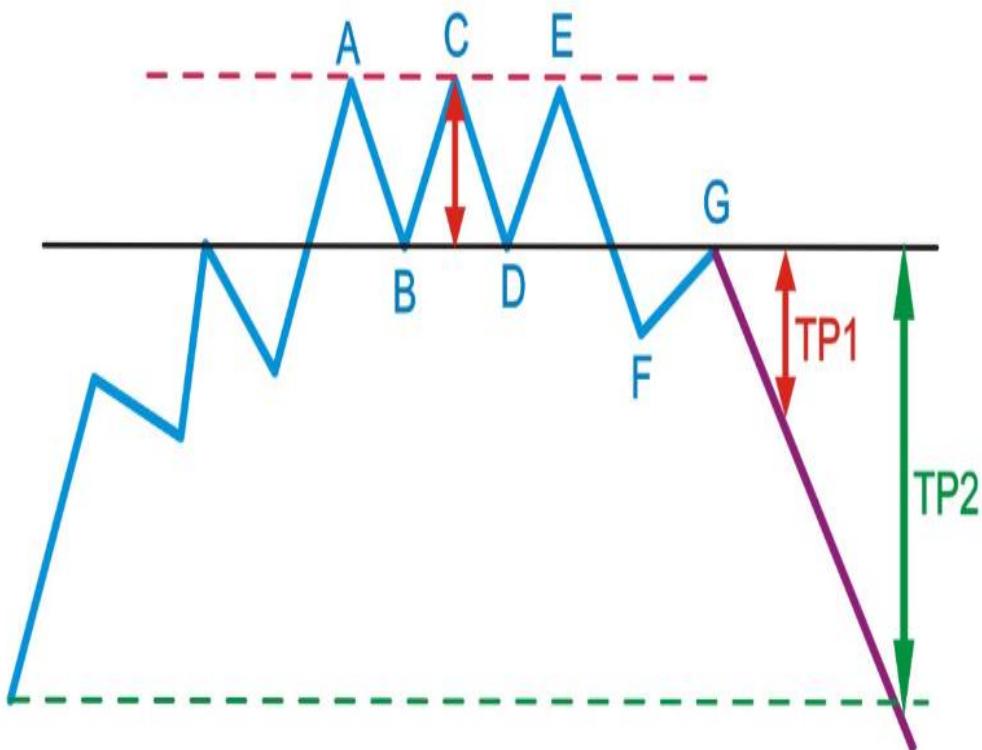
آرایش دو دره ، یک تصویر درون آینه از الگوی پیشین است. بنابراین ویژگی ها ، مسائل بالقوه ، علامتها ، نقطه نظرات معامله گران که در الگوی دو قله ارائه شد را به طور مشابه در این الگو به کار گیرید. دو کف تقریباً دامنه نوسان مشابهی دارند. خط موازی گردن در مقابل خطی که دو کف را به هم وصل می کند تکمیل می شود. دوباره ایجاد آرایش را بررسی می کنیم. پیش از آنکه قیمتها از نقطه A عبور کنند ، قیمتها با سطح حمایتی روبرو بوده اند. زمانی که این خط شکسته می شود ، این خط به یک سطح مقاومت قوی تبدیل می شود. با حرکت قیمتها در طول زمان دوباره برگشتهای و پرشهایی را به سطح مقاومت خواهیم داشت. سطح حمایت پیشین و سطح مقاومت کنونی به عنوان خط گردن در اینجا مطرح می شود. قیمتها دوباره در نقاط D و C به سوی خط گردن هجوم می آورند ، اما حرکت آنها با برخورد با کف متوقف می

شود. در این حالت در کف شکل نخستین خود را به وجود می آورد. در نهایت با تلاش موفقیت آمیز خریداران خط گردن در نقطه E شکسته می شود و این بار قیمتها با حجم معاملات زیاد از سطح مقاومت عبور می کند. زمانی که خط مقاومت قوی شکسته شود یک برگشت دوباره قیمت را انتظار خواهیم داشت نقطه F. در این شرایط خط گردن توسط بازار آزموده می شود و نقش سطح حمایت را ایفا می کند. اگر خط حمایت در برابر فروشنده‌گان دوام بیاورد انتظار داریم قیمتها به اندازه فاصله سر تا خط گردن افزایش یابد.





آرایش سه قله (سقف سه قلو)



سقف سه قلو ترکیبی از آرایش های برگشتی سر و شانه و دو قلو است. بر عکس ، کف سه قلو ترکیبی از سر و شانه معکوس و کف دو قلو است. اثر نتیجه آنها در ویژگی ها ، مسائل بالقوه ، علامتها و نقطه نظرات معامله گران ، به ترتیب با سقف دو قلو و کف دو قلو مشابه هستند.

همانطور که در نمودار مشاهده میکنید ، در آرایش سقفهای سه قلو (سه قله) ، عموماً بلندی ها و قله ها تقریباً ارتفاع مشابهی دارند. یک خط موازی موسوم به خط گردن در مقابل خطی که سه بلندی A ، C ، E را بهم وصل می کند کشیده می شود. هرگاه به عنوان یک خط مقاومت ، خط شکسته شود ، در این صورت نقش خط گردن تغییر کرده و به یک حمایت قوی در نقاط B و D تبدیل می شود. اما در نهایت این سطح حمایت شکسته می شود و باز سطح حمایت به یک سطح مقاومت قوی تبدیل می شود که برگشت قیمت را

در نقطه G متوقف می کند. هدف قیمتی در سطح TP2 است که میانگین ارتفاع بلندی سه قله است و از نقطه C تا خط گردن محاسبه می شود.

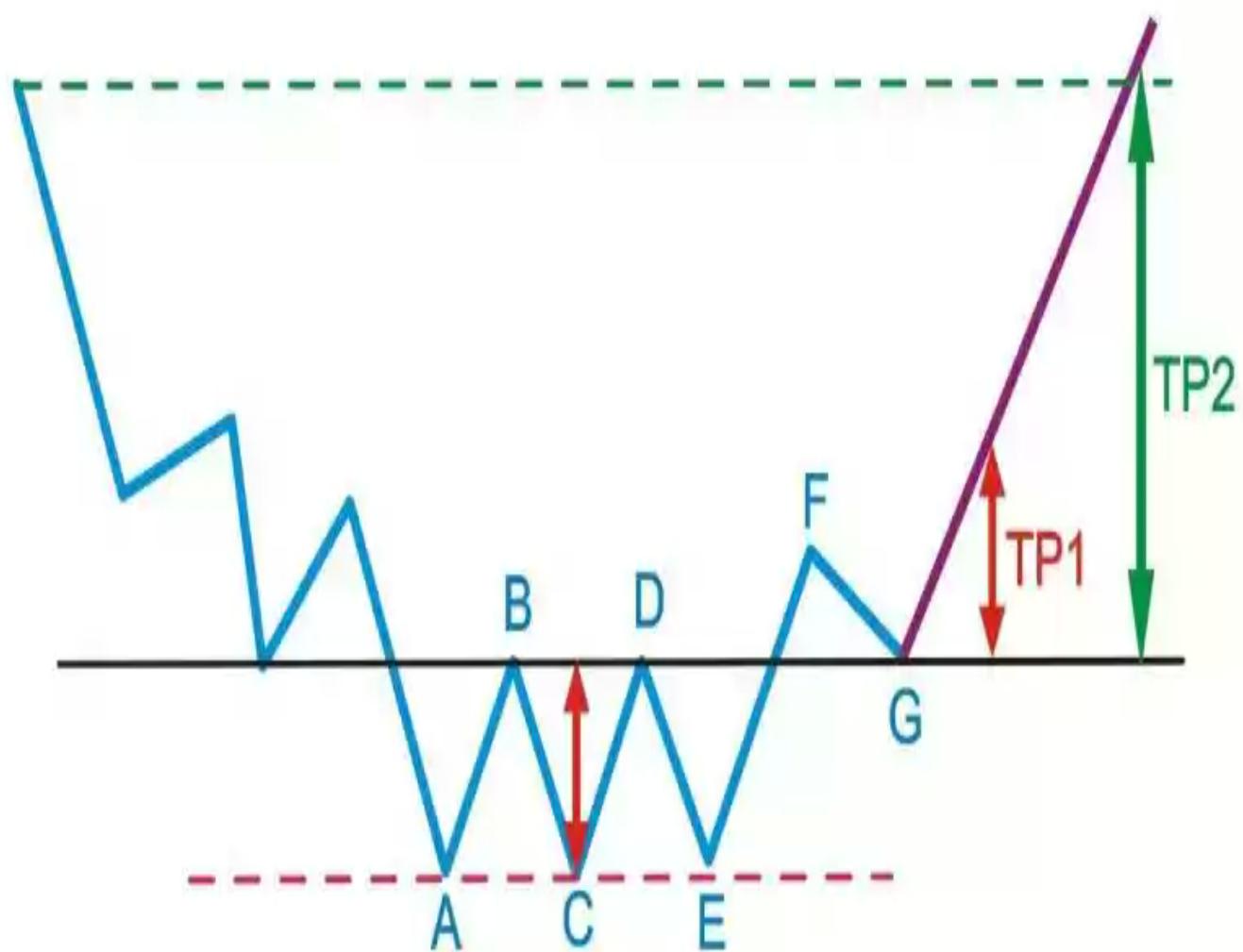
در آرایش سقف های سه قلو (سه قله)، اگر آرایش در نقطه D نتواند از خط گردن عبور نماید قیمتها به تنیدی به سمت نقطه E حرکت می کنند. خط مقاومت یکبار دیگر این موج را نگه می دارد و قیمتها به تنیدی دوباره به سمت خط گردن پایین می افتد. در این سطح فشار بازار قادر است که در خط حمایت نفوذ نماید. بعد از اینکه دوباره خط گردن را تست کرد، قیمت بار دیگر پایین می آید که سرانجام به قیمت هدف دست می یابد.

الگوی سه سقف و الگوی سه کف تشابه بسیاری با الگوی سقف های دو قلو و کف های دو قلو دارد با این تفاوت که به جای دو قله یا دو دره سه قله و سه دره ایجاد شده است. این الگو نیز در انتهای روند ایجاد می شود و شاهد سه سقف یا سه کف در نقاط A، C و E هستیم. دو دره در بین این سقف ها وجود دارد و با شکسته شدن دره ها (نقاط B و D) می توان انتظار داشت بازار از حالت صعودی به نزولی تبدیل شود.



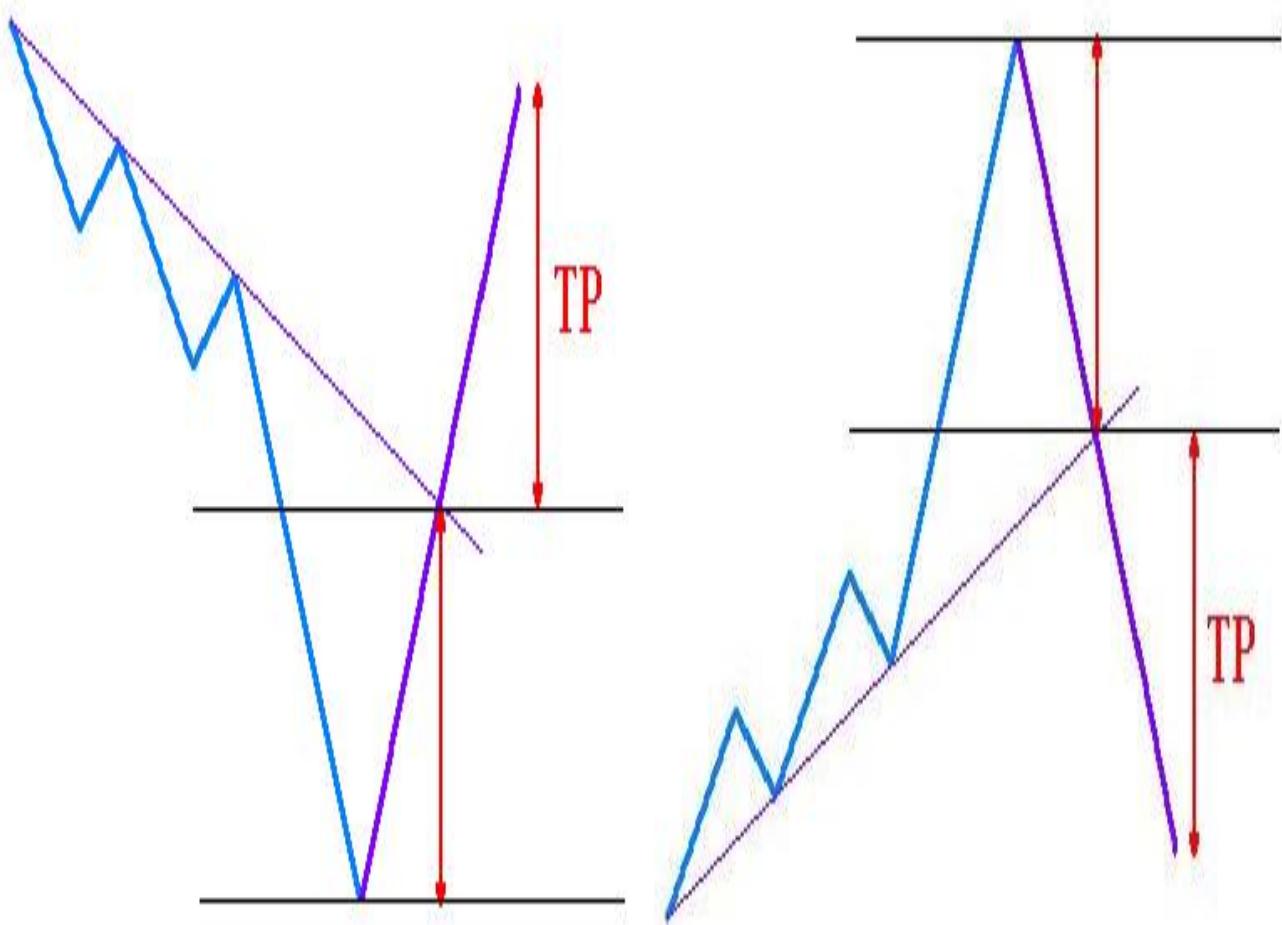
آرایش آرایش سه دره (کف سه قلو)

بر عکس الگوی قبلی، این الگو ترتیبی از ساختارهای سر و شانه های معکوس و کف دو قلو است. در این مورد هم همان ویژگیها، مشکلات احتمالی، نشانه ها و نکات معاملاتی سقف دو قلو به کار برد همی شود. همانطور که در شکل زیر نشان داده است، در یک ساختار کف سه قلو، کف ها تقریباً یکسانند. یک خط (خط پایه) به موازات خطی که سه کف (A و C و E) را بهم وصل می کند، رسم شده است.



سطح حمایت به عنوان یک خط حامی قطع شده است و به یک خط مقاوم برای سطوح نرخ B و D تبدیل شده است. اما نهایتاً در نقطه F قطع می‌شود. خط مقاوم به یک خط حامی تبدیل می‌شود که در نقطه G بازار را به خط پایه برمی‌گرداند. نرخ مورد نظر در سطح TP2 است که میانگین ارتفاع سه کف اندازه گیری شده از نقطه C است.

آرایش وی V

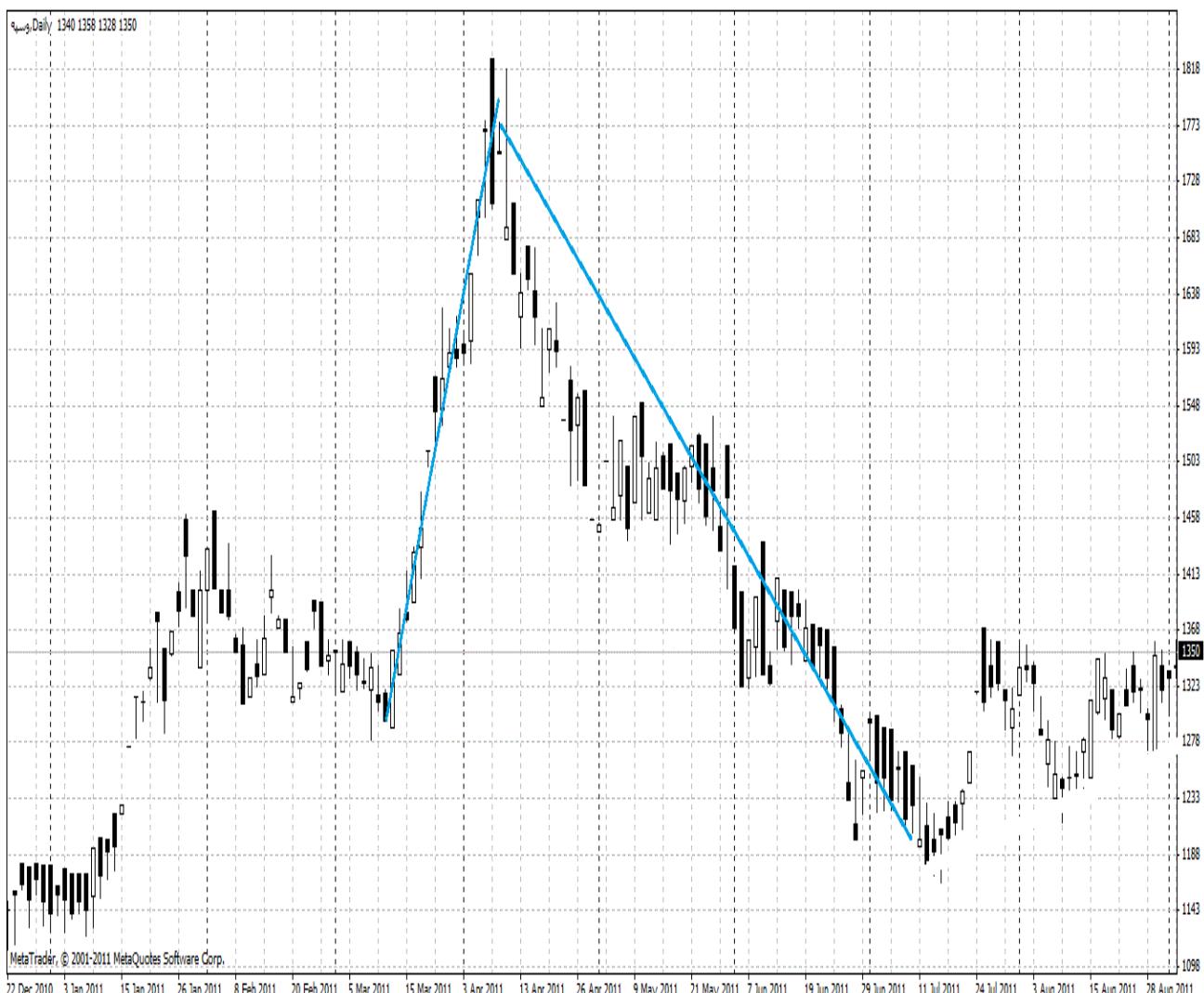


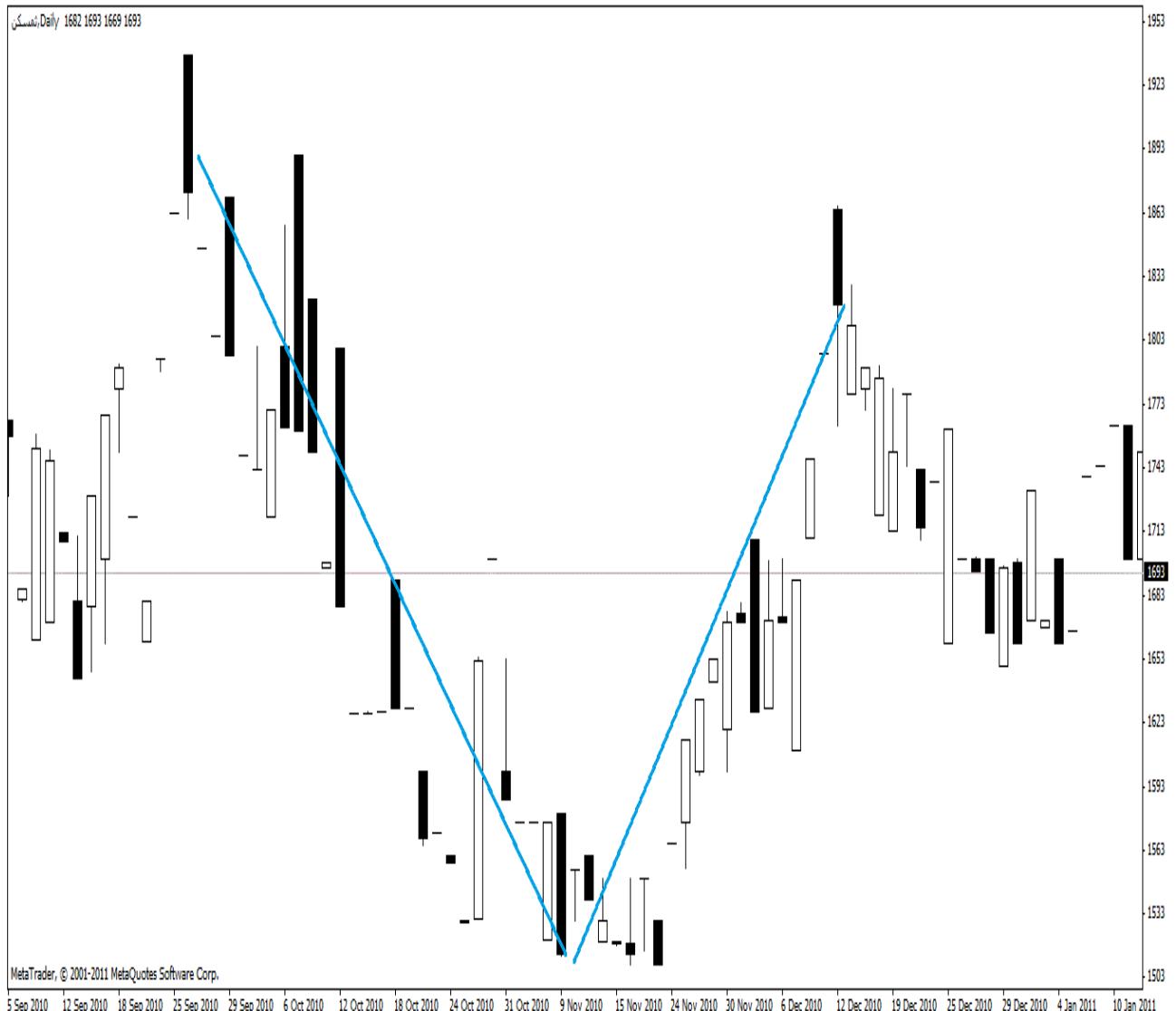
ساختارهای V یا اسپایک (spike)، نوع نادری از ساختار معکوس هستند. در تمامی الگوهای دیگر که در این فصل راجع به آنها بحث شد، بازار سعی دارد که بعد از یک شکست نرخ، قیمتها را دوباره به روند اصلی

برگرداند. اما معکوسهای اسپایک قادر این خصوصیت هستند. آنها بسادگی و **بدون هیچ هشداری**، از یک روند به روند متقابلش تغییر موقعیت می‌دهند و در طی این تغییر موقعیت و یا بعد از آن، حجم زیادی از معاملات را در بر می‌گیرند زیرا در طی زمانی که روند اصلی باید نقدی و یا معکوس شود، موقعیت‌های فوق العاده‌ای به وجود می‌آیند.

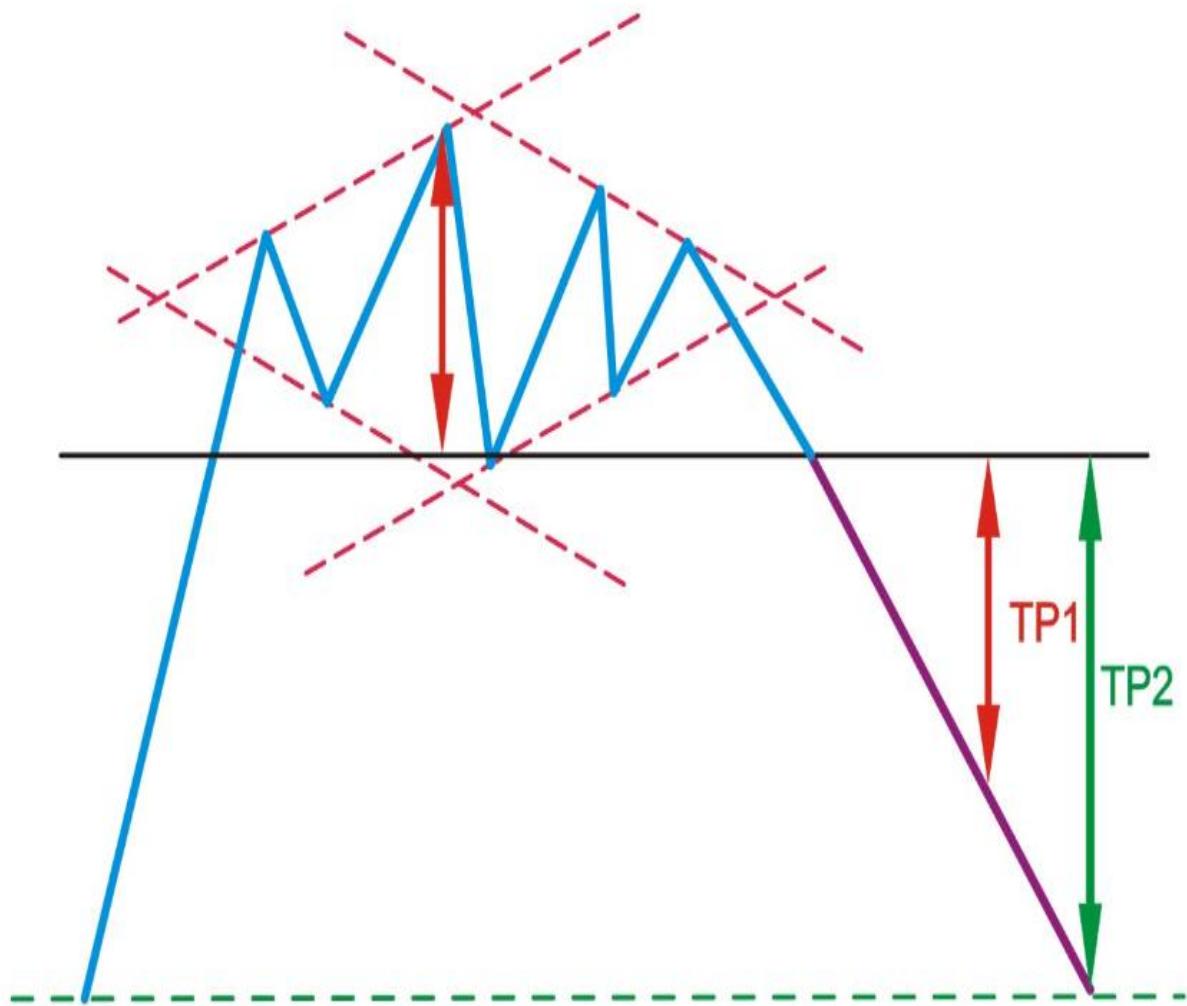
الگوی "وی" **V** با **شکسته شدن خط روند** تکمیل می‌شود و میتوان وارد معامله شد. شاخصه اصلی این الگو بازگشت ناگهانی قیمت می‌باشد و بازگشت‌های داخل الگو بسیار کوتاه و موقت است. مشخصه دیگر الگوی **V** **شیب زیاد موج آخر حرکت روند قبلی** می‌باشد و **بازگشت‌ها معمولاً با همان زاویه‌ای بر می‌گردد** که بازار با آن شیب حرکت اصلی را آغاز کرده است.

شكل زیر، چگونگی ساختار کف **V** را نشان می‌دهد. خطی که در پائین نمودار رسم شده و مینیمم نرخ روند نزولی را نشان می‌دهد، می‌تواند از دیگر خطهای قبلی و بعدی، منحصر باشد. شدید بودن هر دو روند، نشانه قطعیت بازار در مسیر قیمت است.



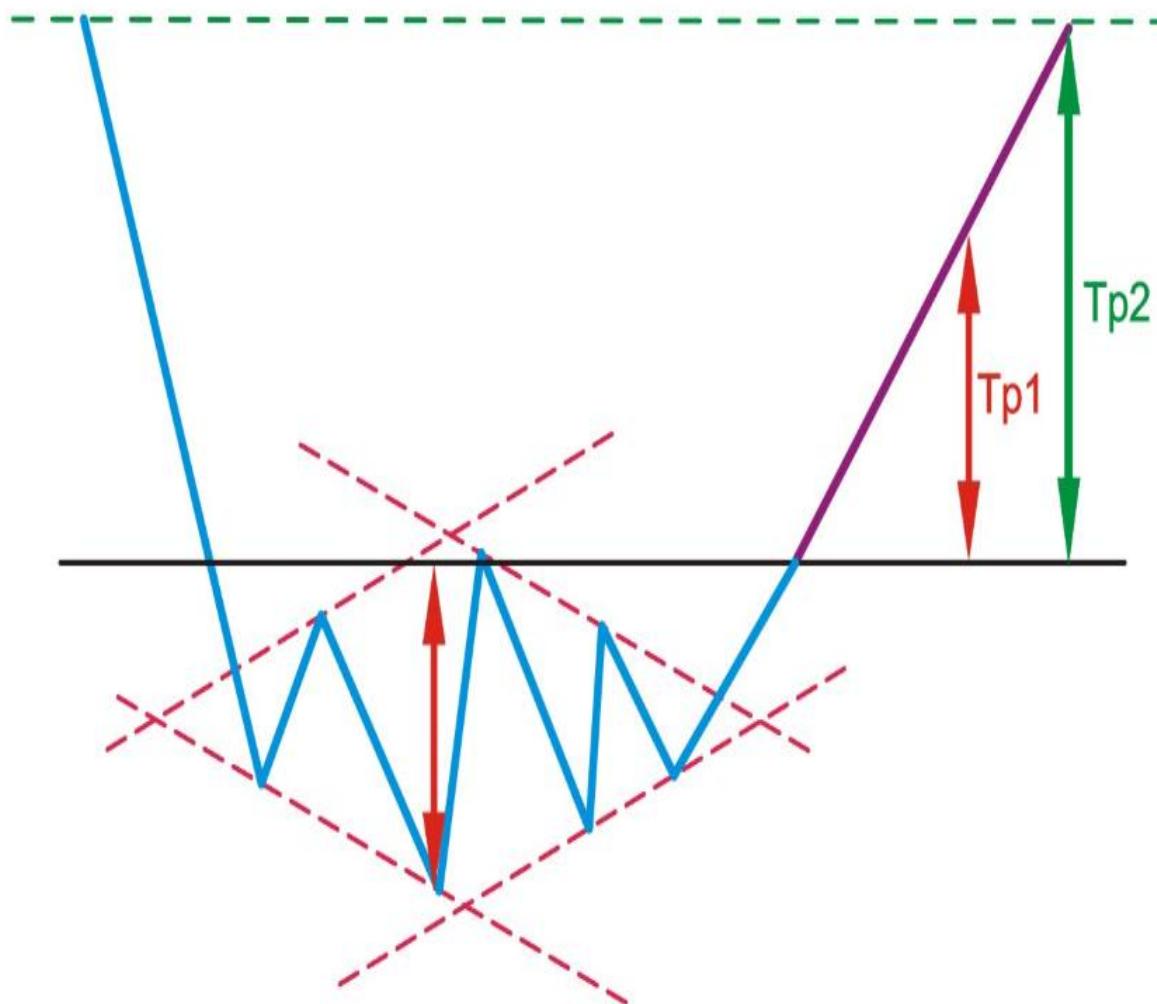


الگوی لوزی

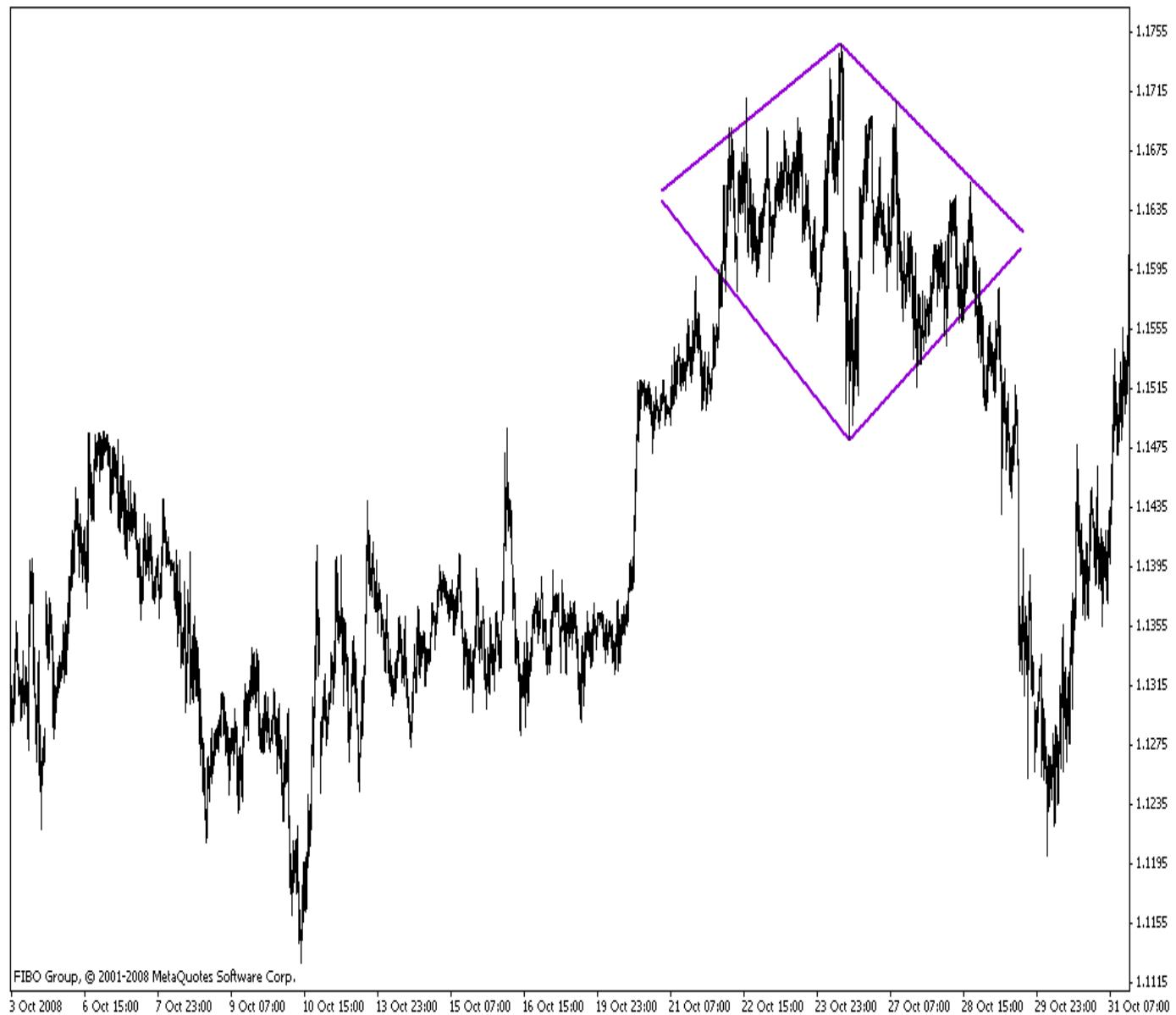


الگو لوزی نیز در انتهای روند به وجود می‌آید. بعد از یک روند صعودی یا نزولی در ابتدا شاهد سقف و کف‌های کوچک هستیم. به مرور دامنه حرکت سقف و کف‌ها بزرگتر می‌شود دوباره در اواخر الگوی اندازه سقف و کف‌ها بزرگتر می‌شود. با شکسته شدن سقف یا کف الگو وارد معامله می‌شویم. حد ضرر معامله ورودی از طریق این الگو با لحاظ مقداری فاصله از بالاترین سقف در حالت صعودی و با لحاظ مقداری از پایین ترین کف در حالت نزولی قرار می‌گیرد. حد سود اول به اندازه فاصله بزرگترین سقف و کف داخل الگو

می باشد و حد سود دوم محدوده آغاز روند است.



نمونه الگوی الماس در بازار سرمایه غالبا کم پیدا می شود با این حال می توانید نمونه ای را در نمودار زیر ببینید که با شکسته شدن امتداد خط گردن عمیقترین دره بازار به هدف قیمتی حد سود اول رسیده است



الگوی سقف و کف مدور

الگوهای سقف و کف های مدور که الگوهای نعلبکی هم نامیده می شوند، جزء روندهای معکوس نادر هستند. این الگوها یک تغییر تدریجی در جهت روند و تزلزلش در پایان روند را نشان می دهند. آیا روند اصلی ادامه پیدا می کند و یا به بالاترین یا پائین ترین حد خود می رسد؟ از آنجائیکه افزایش و کاهش قیمت ها، روند را به دو جهت مختلف می کشنند، معامله کند می شود. تشخیص اینکه ساختار حقیقتاً چه زمانی کامل می شود، غیر ممکن است و شما هیچ عاملی برای رونق دوباره ندارید. این خصوصیات باعث شده که این روند معکوس در بین معامله گران محبوب نباشد. همانند هر الگوی دیگری، هرچه کامل شدن سقف و یا کف مدور بیشتر طول بکشد، تمایل نرخ برای حرکت در یک جهت جدید بیشتر می شود. شکل زیر ساختار یک الگوی کف مدور را نشان داده و شکل ۱۶-۲ نمونه های بازار از ساختار معکوس را نشان می دهد.

الگوهای ادامه دهنده

تحلیل گران تکنیکی ، علاوه بر الگوهای روندهای معکوس اصلی ، الگوهای ادامه دهنده را هم معرفی کرده اند. این الگوها باعث تقویت روندها می شوند و شکست مورد نیاز بازار در طی یک روند شدید را منعکس می کنند. از طریق این ساختارها ، بعضی از معامله گران می توانند کل و یا قسمتی از سود خود را برداشت کنند در صورتی که دیگران در درستی جهت روند شک دارند. به طور کلی این فعالیت‌ها ، باعث ایجاد ثبیت قیمت می شوند که گاهی به عنوان حرکات خنثی اتفاق می افتد ، اما معمولاً در جهت مخالف روند اصلی عمل می کنند. این دوره ثبیت کاملاً کوتاه هستند. شکست‌ها باید به طور طبیعی در جهت روند اصلی اتفاق بیفتد.

مهمنترین الگوهای ادامه دهنده عبارتند از:

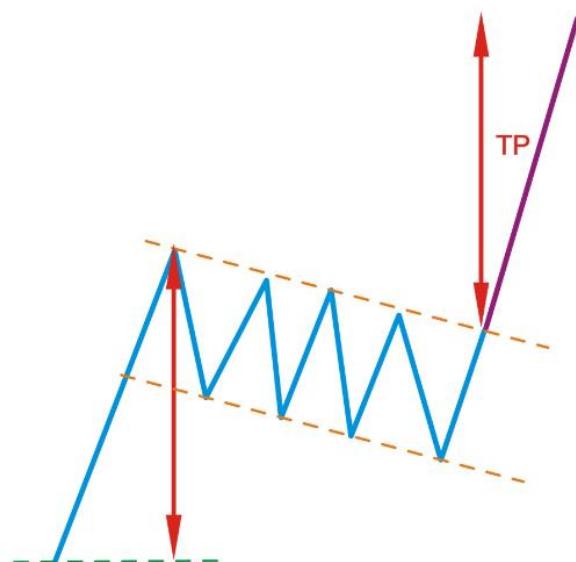
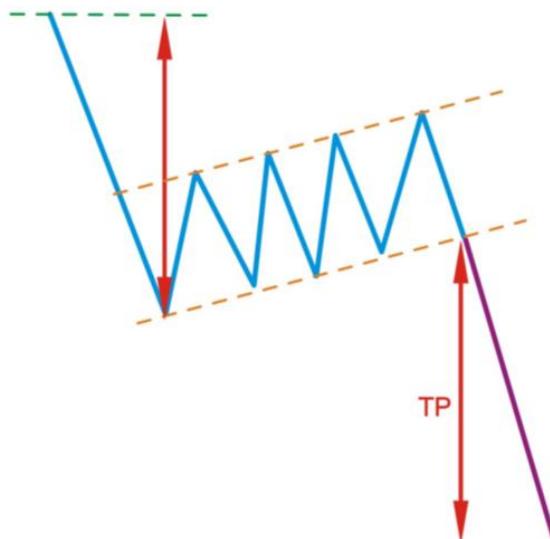
- ۱- پرچم
- ۲- پرچم سه گوش
- ۳- مثلث
- ۴- سه گوش
- ۵- مستطیل ادامه دهنده

الگوی پرچم

پرچم، یک الگوی روند ادامه دهنده معتبر است که نشانه های مهمی بدست می دهد: جهت و نرخ مورد نظر. این ساختار شامل یک دوره ثبات کوتاه مدت در یک روند شیب دار صعودی و یا نزولی است. شیب ثبات یا درخلاف جهت شیب روند اصلی است ، و یا مسطح است. این ثبات بین یک خط حامی و یک خط مقاومت محصور شده است که این دو خط یا با هم موازی هستند(مثل یک متوازی الاضلاع) و یا به سمت هم مایل هستند که باعث می شوند الگو شیبه یک پرچم شود. روند اصلی ، میله پرچم است. هنگامی که قیمت با

شکست ثبات ، دوباره وارد روند شود ، هدف قیمت طول کلی میله پرچم است که از سطح شکست نرخ اندازه گیری می شود.

لگوی پرچم از امتداد اتصال محدوده ای از تغییرات قیمت در میانه یک روند به وجود می آید که شبیه کم و خلاف جهت روند قبل از خود دارد. این الگو عموماً مدت زمان زیادی پایدار نمی ماند و خیلی زود شکسته می شود. با شکسته شدن امتداد خطوط الگو بازار به اندازه ابتدای روند قبلی تا نقطه آغاز اولین موج الگوی پرچم پیش روی دارد.

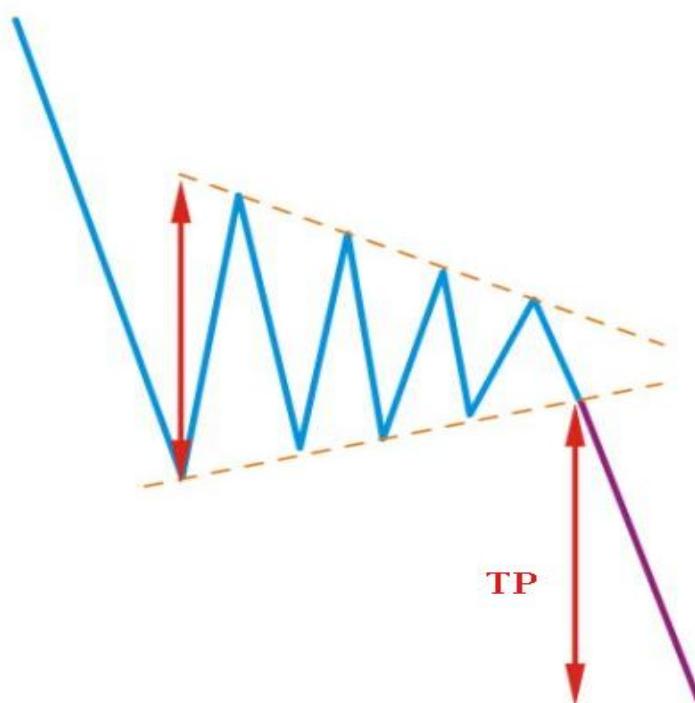
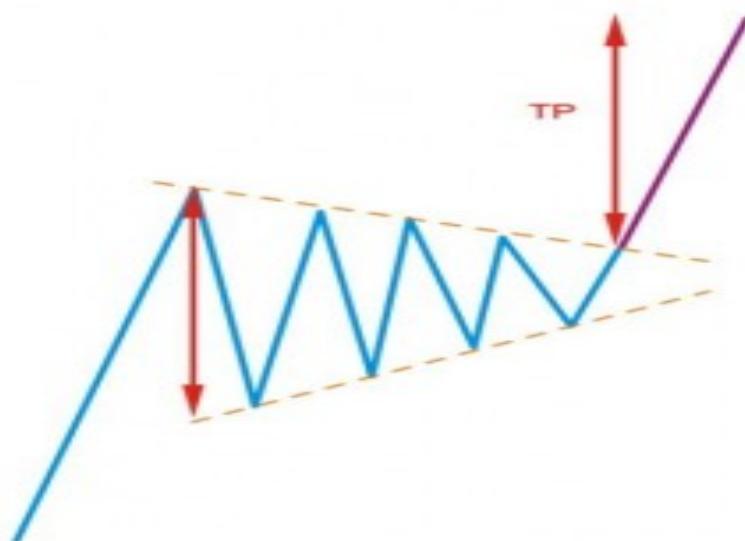




الگوی پرچم سه گوش

الگوی پرچم سه گوش مانند الگوی پرچم در میانه یک روند تشکیل می شود با این تفاوت که اتصال خطوط بیشینه و کمینه در داخل الگو موازی نبوده و متقارن می باشند. شبب اتصال خطوط بیشینه و کمینه در این الگو حتما باید زیاد باشد و قبل از آن حتما روند با شبب زیاد داشته باشیم در غیر این صورت یک الگوی مثلث افزایشی را تشخیص داده ایم. در این الگو دو هدف قیمتی داریم، هدف اول مانند شکل اندازه قاعده اولین حرکت تصحیحی داخل الگو می باشد و حد سود دوم به اندازه فاصله آغاز روند صعودی قبلی تا نقطه

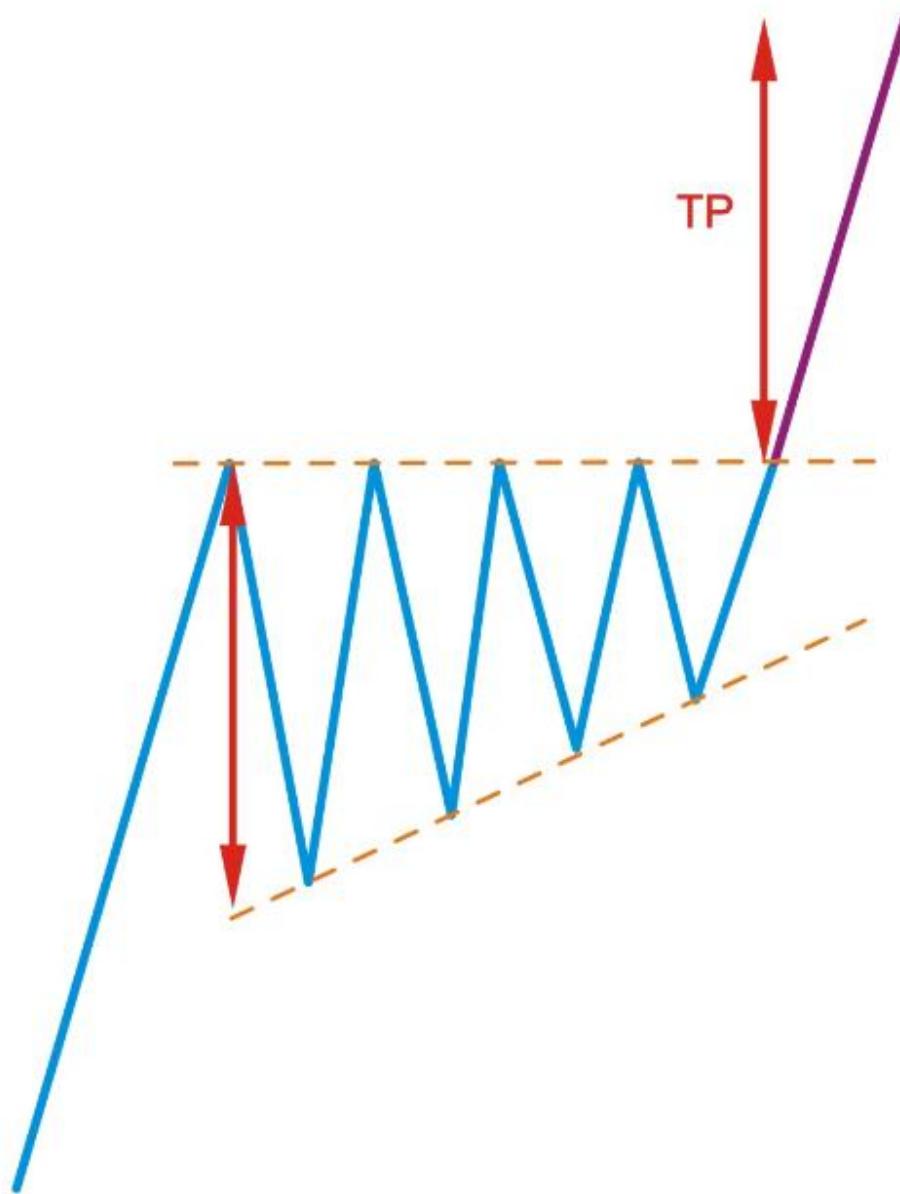
تشکیل الگو می باشد که با شکسته شدن یکی از خطوط بالایی و پایینی الگو انتظار داریم قیمت پیش روی کند.





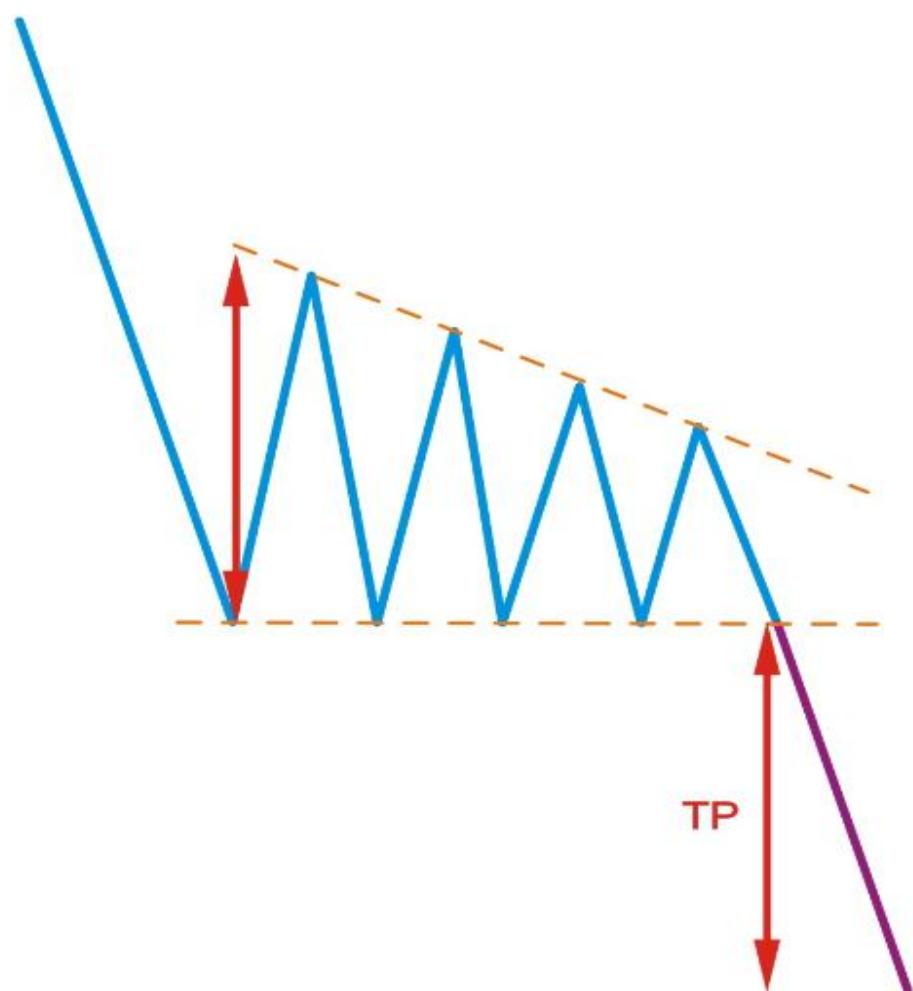
الگوی مثلث

الگوی مثلث افزایشی حالتی از تغییرات قیمت است که قیمت هر بار در صعودهایش در محدوده ای از مقاومت متوقف می شود در حالی که پس از بازگشت از این محدوده مقاومت هر بار به دره یا کمینه قبل از خود نمی رسد. امتداد خطوط پایینی در اتصال به مقاومت بالایی، الگویی می سازد که نشان دهنده آغاز یک حرکت قوی بازار می باشد. تغییرات قیمت معمولاً خط مقاومت در این الگو را می شکند و می توان انتظار داشت که به اندازه قاعده اولین حرکت داخل مثلث افزایشی بازار در جهت بالایی افزایش داشته باشد. این الگو معمولاً بعد از یک روند افزایشی به وجود می آید با اینکه هیچ الزامی به این روند افزایشی نمی باشد.





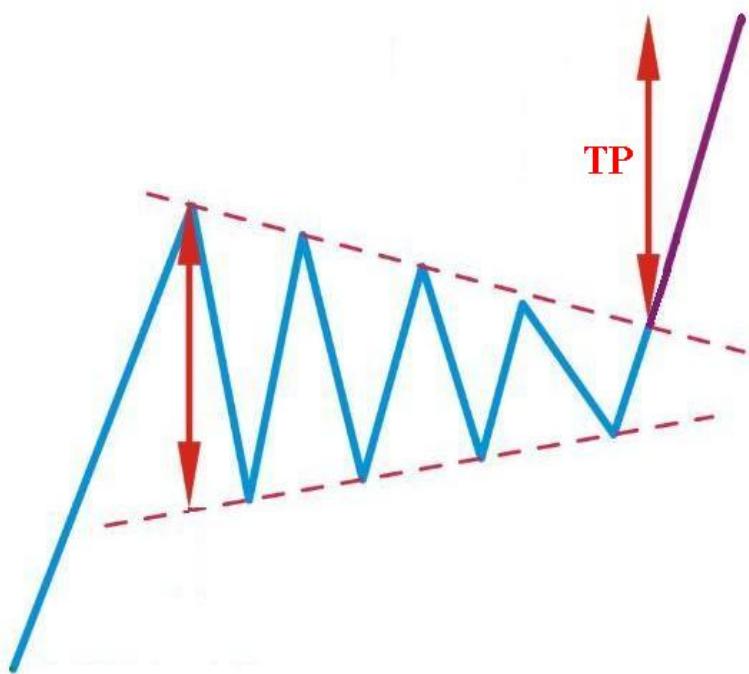
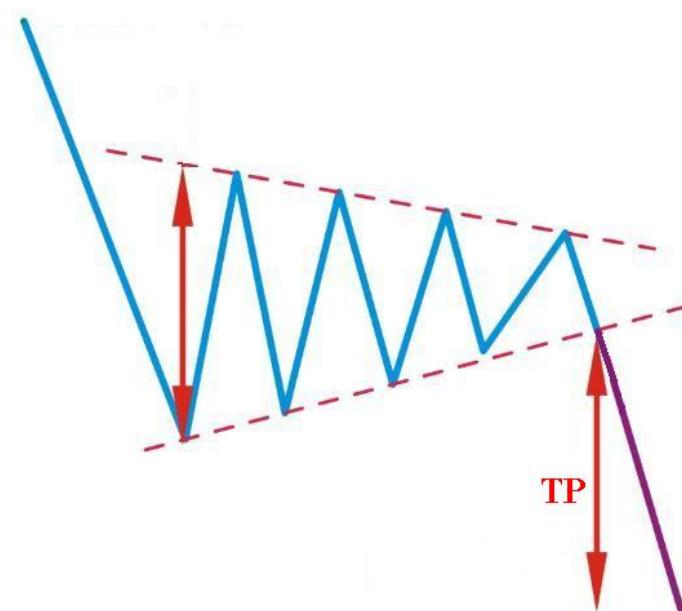
الگوی مثلث کاهشی حالتی از تغییرات قیمت است که قیمت هر بار در نزول هایش در محدوده ای از حمایت متوقف می شود در حالی که پس از بازگشت از این محدوده حمایت هر بار به قله یا بیشینه قبل از خود نمی رسد. امتداد خطوط بالایی در اتصال به مقاومت پایینی، الگویی می سازد که نشان دهنده آغاز یک حرکت قوی بازار می باشد. تغییرات قیمت معمولاً خط حمایت در این الگو را می شکند و می توان انتظار داشت که به اندازه قاعده اولین حرکت داخل مثلث کاهشی بازار در جهت پایینی کاهش داشته باشد. این الگو معمولاً بعد از یک روند کاهشی به وجود می آید با اینکه هیچ الزامی به این روند کاهشی نمی باشد.





الگوی مثلث متقارن Symmetrical Triangles

مثلث متقارن یا همسان الگوی دیگر از خانواده مثلث‌ها می‌باشد که معمولاً بعد از یک روند کاهشی یا افزایشی به وجود می‌آید گرچه هیچ الزامی برای این مورد وجود ندارد. در این الگو حرکات صعودی و نزولی داخل الگو به حمایت‌ها یا مقاومت‌های قبل از خود نمی‌رسند به همین جهت امتداد این خطوط مثلثی متقارن را ایجاد می‌کند. با شکسته شدن امتداد نقاط به هم متصل شده بالایی و پایینی در الگو می‌توان انتظار داشت موج جدید به اندازه فاصله اولین قاعده درونی مثلث پیش روی داشته باشد.

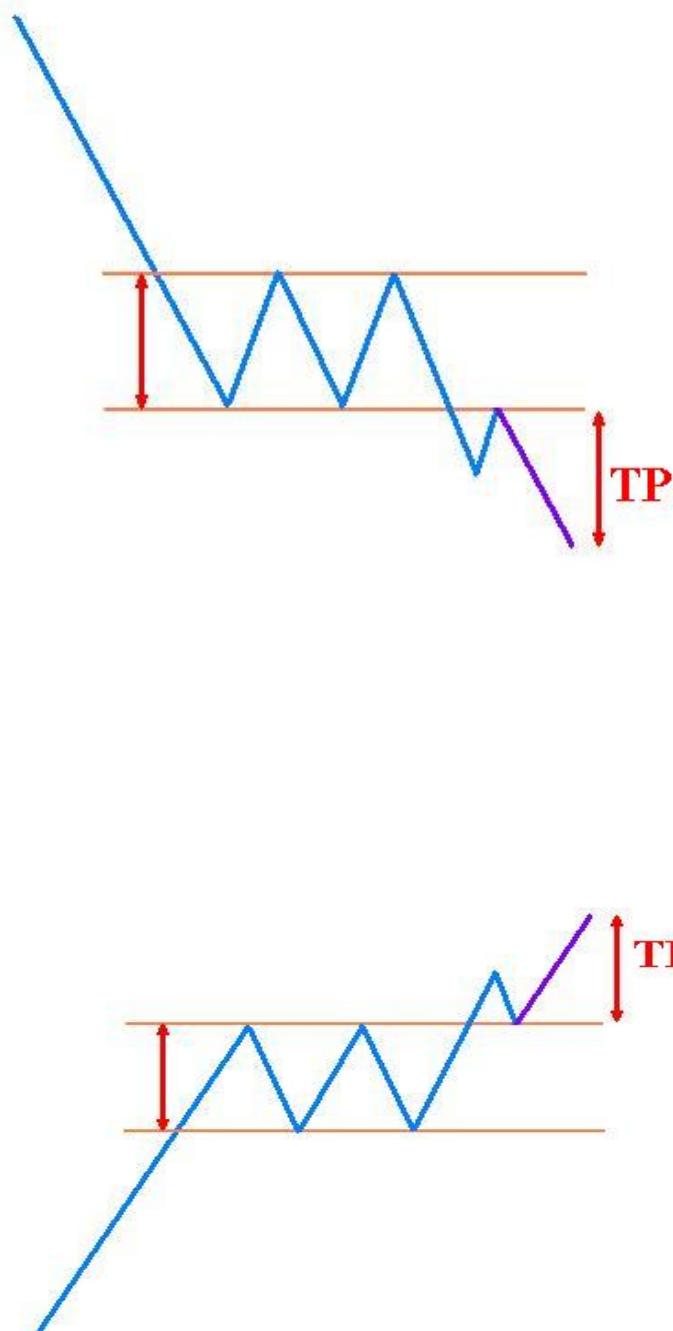




الگوی مستطیل

الگوی مستطیل بعد از یک روند کاهشی یا افزایشی تشکیل می شود که امتداد خطوط بیشینه و کمینه درون آن موازی-افقی بوده و تشکیل یک مستطیل فرضی را می دهد. حداقل دو بار قیمت ها باید به امتداد خطوط بالایی و پایینی در این الگو برخورد کرده باشد. برای حد سود انتظار داریم بعد از شکسته شدن خط

بالایی در روند افزایشی و خط پایینی در روند کاهشی هدف قیمتی جدید به اندازه فاصله درونی دو خط موازی درون الگو پیش روی نماید.





منابع

• کتاب تحلیل تکنیکال جان مورفی ، مترجم : کامیار فراهانی

•



1395

تکنیکال پیشرفته



مهندس فرهاد سلطانی

<http://mql.blogfa.com/>
1395

مقدمه

در سالهای گذشته به علت اولویت بندی اهدافم ،علاقه ای به پر رنگ شدن در بازار بورس و ... نداشتم و طبیعتا هم تهیه جزو و فعالیت در گروهها و... زمانی تعریف نشده بود و نتیجتا فعالیتی هم نداشتم.چون بیشتر انرژی بنده در زمینه مطالعه و تحقیق بوده است.اما این شرایط زمانی، برای بنده فراهم شده تا تجربیات و مطالعات خودم را بین علاقمندان به حوزه تحلیل تکنیکال در میان بگذارم.این جزو حاصل سالها مطالعه ، تحقیق ، تدریس و جمع آوری از منابع مختلف است.و این اولین جزو رسمی بنده بوده و این نوشتار را به عنوان شروع این رسالت فرهنگی بنده در نظر بگیرید.باشد که در این مسیر با پیشنهادات و انتقادات خودتان ، راهنمایی بفرمایید.

باتشکر

فرهاد سلطانی-پاییز ۹۵

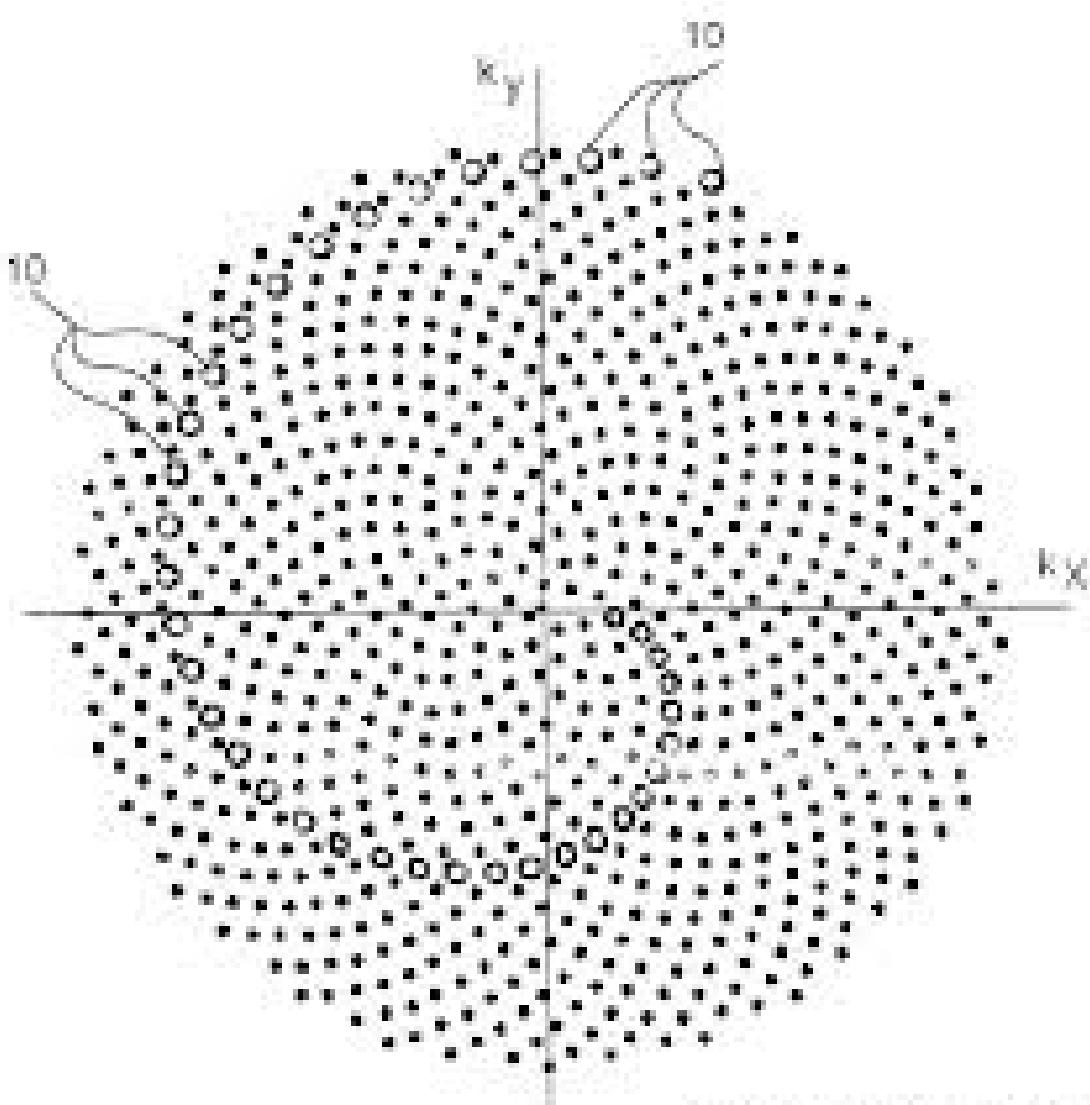
۰۹۱۰ ۹۲۹ ۱۳۷۳

iran_analyst_stock@yahoo.com

<http://mql.blogfa.com>



Fibonacci



Fibonacci

فیبوناچی

لئوناردو فیبوناتچی نخستین ریاضیدان بزرگ اروپا در قرن سیزدهم است. از آنجایی که زادگاه او شهر پیزا در ایتالیا بوده به لئوناردو دا پیزا نیز معروف است. بیشتر کارهای وی مأخوذه از آثار ریاضیدانهای مسلمان به خصوص خوارزمی، کرجی و ابوکامل می‌باشد.

دنباله فیبوناچی

در دوران حیات فیبوناچی مسابقات ریاضی در اروپا بسیار مرسوم بود، در یکی از همین مسابقات که در سال ۱۲۲۵ در شهر پیزا توسط امپراتور فردریک دوم برگزار شده بود مسئله زیر مطرح شد:

فرض کنیم خرگوش‌هایی وجود دارند که هر جفت (یک نر و یک ماده) از آنها که به سن ۱ ماهگی رسیده باشند به ازاء هر ماه که از زندگی‌شان سپری شود یک جفت خرگوش متولد می‌کنند که آنها هم از همین قاعده پیروی می‌کنند حال اگر فرض کنیم این خرگوشها هرگز نمی‌میرند و در آغاز یک جفت از این نوع خرگوش در اختیار داشته باشیم که به تازگی متولد شده‌اند حساب کنید پس از n ماه چند جفت از این نوع خرگوش خواهیم داشت؟

0,1,1,2,3,5,28,13,21,34,55,89,144,233,377,610,987,1597,...



خواص اعداد فیبوناچی

۱. هر عدد از مجموع دو عدد قبلی بدست می آید.
۲. نسبت هر عدد به عدد بعدی خود به 1.618 میل می کند.
۳. نسبت هر عدد به عدد قبلی خود به 1.618 میل می کند.
۴. نسبت هر عدد به دو عدد بعدی خود به 0.382 میل می کند.
۵. نسبت هر عدد به دو عدد قبلی خود به 0.618 میل می کند.
۶. نسبت هر عدد به سه عدد بعدی خود به 0.236 میل می کند.
۷. تقسیم عدد اول به دوم $= 1/1 = 1$ می گردد.
۸. تقسیم عدد دوم به عدد سوم $= 0.5 = 1/2$ می گردد.
۹. ریشه دوم یا جذر $\sqrt{0.618} = 0.786$ و ریشه دوم یا جذر $\sqrt{1.618} = 1.272$ می گردد.
۱۰. معمولاً اعداد را بصورت درصد نمایش می دهند که عبارتند از :

23.6% - 38.2% - 50% - 61.8% - 78.6% - 100 %

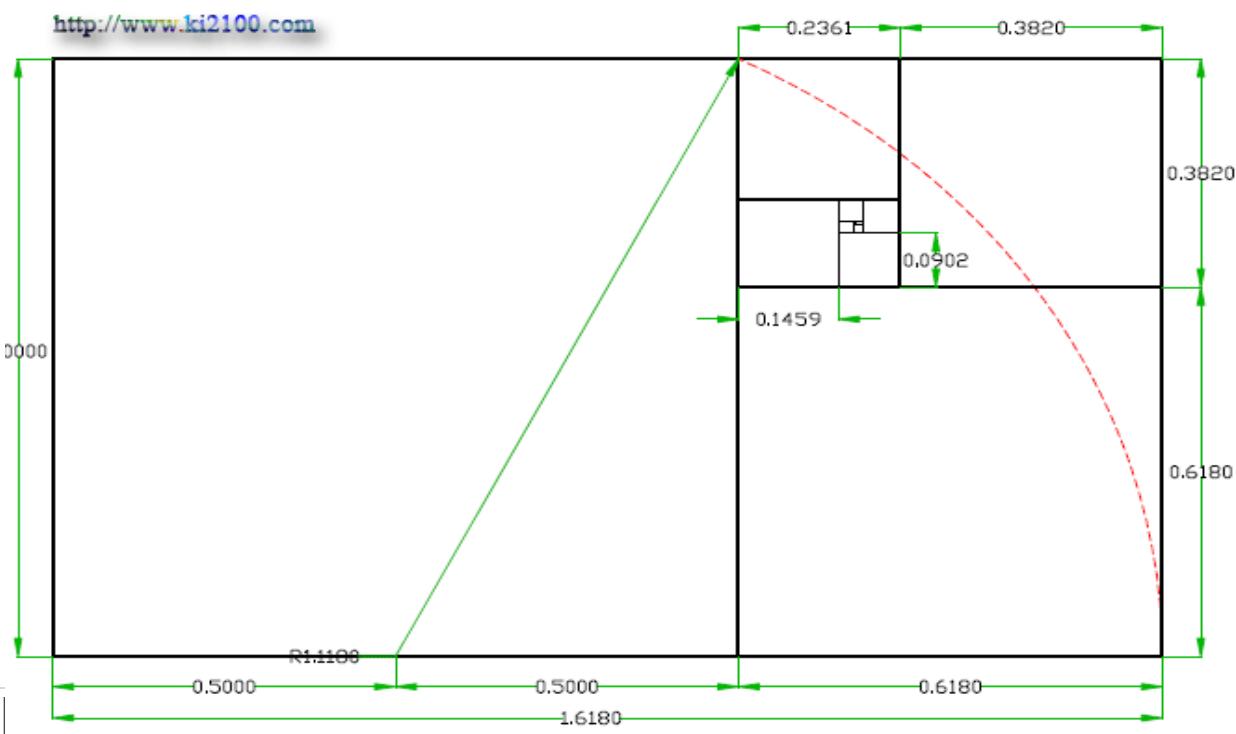
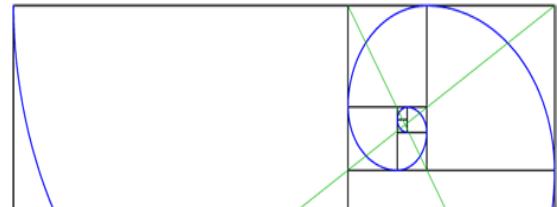
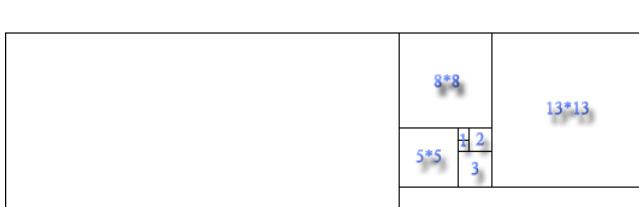
127.2% - 161.8% - 200% - 261.8% - 300% - 323.6% - 423.6%

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L
1	2	3	5	8	13	21	34	55	89	144	
1	1.0000	2.0000	3.0000	5.0000	8.0000	13.0000	21.0000	34.0000	55.0000	89.0000	144.0000
2	0.5000	1.0000	1.5000	2.5000	4.0000	6.5000	10.5000	17.0000	27.5000	44.5000	72.0000
3	0.3333	0.6667	1.0000	1.6667	2.6667	4.3333	7.0000	11.3333	18.3333	29.6667	48.0000
5	0.2000	0.4000	0.6000	1.0000	1.6000	2.6000	4.2000	6.8000	11.0000	17.8000	28.8000
8	0.1250	0.2500	0.3750	0.6250	1.0000	1.6250	2.6250	4.2500	6.8750	11.1250	18.0000
13	0.0769	0.1538	0.2308	0.3846	0.6154	1.0000	1.6154	2.6154	4.2308	6.8462	11.0769
21	0.0476	0.0952	0.1429	0.2381	0.3810	0.6190	1.0000	1.6190	2.6190	4.2381	6.8571
34	0.0294	0.0588	0.0882	0.1471	0.2353	0.3824	0.6176	1.0000	1.6176	2.6176	4.2353
55	0.0182	0.0364	0.0545	0.0909	0.1455	0.2364	0.3818	0.6182	1.0000	1.6182	2.6182
89	0.0112	0.0225	0.0337	0.0562	0.0899	0.1461	0.2360	0.3820	0.6180	1.0000	1.6180
144	0.0069	0.0139	0.0208	0.0347	0.0556	0.0903	0.1458	0.2361	0.3819	0.6181	1.0000

نسبت طلایی

به نظر می رسد که این رشته به عدد طلایی نزدیک می شود. اگر نسبت عدد چهلم این رشته را به عدد قبلی حساب کنیم به عدد 1.618 می رسیم که با تقریب 14 رقم اعشار نسبت طلایی را نشان می دهد . نسبت جملات متوالی به عدد طلایی میل می کند. که یونانیان آنرا با حرف ϕ نمایش می دهند.

توسعه هندسی دنباله فیبوناچی یا سری از اعداد



کاربردهای عدد طلایی

از زمانی که هنرمندان و معماران به عمد شروع به استفاده از نسبت طلایی کردند ، نشان داده شد که مخاطبان شیفتگی و شیدایی بیشتری نسبت به کارهای آنها از خود نشان دادند . مستطیلهای طلایی ، مانند نسبت طلایی فوق العاده ارزشمند هستند . در بین مثالهای بیشمار از وجود این نسبت و یکی از برجسته‌ترین آنها مارپیچ های DNA است . این دو مارپیچ فاصله دقیقی را با هم براساس نسبت طلایی حفظ می‌کنند و دور یکدیگر می‌تابند.

در حالی که نسبت طلایی و مستطیلهای زیبایی را از طبیعت و ساخته‌های دست انسان به نمایش می‌گذارد ، جلوه دیگری از این شکوه وجود دارد که زیبایی‌های حرکت را به نمایش می‌گذارد . یکی از بزرگ‌ترین نمادهایی که می‌تواند رشد و حرکات کاینات را نشان دهد ، اسپیرال طلایی است . اسپیرال طلایی که به آن اسپیرال لگاریتمی و اسپیرال متساوی‌الزاویه نیز می‌گویند هیچ حدی ندارد و شکل ثابتی است . روی هر نقطه از اسپیرال می‌توان به هر یک از دو سو تا بی‌نهایت حرکت کرد . از یک سو هرگز به مرکز نمی‌رسیم و از سوی خارجی نیز هرگز به انتهای نمی‌رسیم . هسته اسپیرال لگاریتمی وقتی با میکروسکوپ مشاهده می‌شود همان منظره‌ای را دارد که وقتی به اندازه هزاران سال نوری به جلو می‌رویم . دیوید برگامینی در کتاب ریاضیاتش خاطرنشان می‌کند که منحنی ستاره‌های دنباله‌دار از خورشید کاملاً شبیه به اسپیرال لگاریتمی است . عنکبوت شبکه تارهای خود را به صورت اسپیرال لگاریتمی می‌باشد . رشد باکتری‌ها دقیقاً براساس رشد منحنی اسپیرال است . هنگامی که سنگ‌های آسمانی با سطح زمین برخورد می‌کنند ، مسیری مانند اسپیرال لگاریتمی را طی می‌کنند . عدد Φ عددی مربوط به خلقت پروردگار یکتا است . اسبهای آبی ، صدف حلزون‌ها ، صدف نرم‌تنان ، موج‌های اقیانوس‌ها ، سرخس‌ها ، شاخهای جانوران و نحوه قرار گرفتن گلبرگ‌های گل آفتاب‌گردان و چیدمان گل مروارید ، همه به صورت اسپیرال لگاریتمی است . گردباد و منظومه‌ها از نگاه بیرون کاملاً در

مسیری به صورت اسپیرال حرکت می‌کنند. طرح مطالب در این زمینه بسیار بسیار زیاد است که در آینده به آن خواهیم پرداخت. امروزه در طراحی مانیتورهای LCD پهن (wide) از این تناسب بھرہ می‌جویند یعنی دقت $1680 \times 1050 = 1680 \times 1050$ برای اینکه داشتن نما و دید در این تناسب برای طراحان، گرافیست‌ها و ضروری است. موضوعی که در گذشته به آن اهمیت داده نمی‌شد ولی صنعت سینما و آن را لازم دانست.

کاربرد سری فیبوناچی در بورس

بازار سهام مجموع نوساناتی به هم پیوسته است که از امواجی از درجه کوچک به بزرگ شکل گرفته میتوان گفت ای بازار مشابه ضرب المثلی است که میگوید زندگی فرایندی است دو قدم به جلو و یک قدم به عقب بازار هم بعد از هر کاهش یا افزایشی موج قبلی خود را اصلاح(بازگشت) کرده و مجدداً روند قبلیش را از سر میگیرد این امواج در بازار توسط خطوط فیبو قابل تفکیک میباشند. در صورتی که بپذیریم نوسانات بازار توسط میلیون‌ها خطوط حمایت و مقاومت موضعی شکل گرفته بعد از آن میشود نقاط اصلاحی(بازگشت) روند قبل را توسط خطوط فیبوناچی تخمین زد.

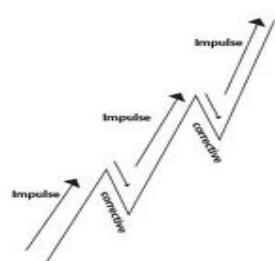
ابزارهای فیبوناچی

- | | |
|------------------------------|------------------|
| ۱. خطوط تصحیح فیبوناچی داخلی | ۲. ابزار تصویرگر |
| Retracement | Projection |
| ۳. ابزار توسعه | Extension |
| ۴. ابزار کمانی | Arc |
| ۵. ابزار بادبزن | Fan |
| ۶. فیبو ناچی | Time |

Retracement

خطوط تصحیح فیبونانچی داخلی

در یک روند صعودی زمانهای نزول هم وجود دارد که به آنها اصلاح Correction گفته می شود. عمدۀ تلاش تحلیل تکنیکال یافتن جهت روند و معامله در انتهای یک اصلاح می باشد. خطوط تصحیح فیبونانچی داخلی نسبت های کوچکتر از ۱۰۰٪ هستند زیرا پایان یک اصلاح کوچکتر از حرکت قبل از آن است.

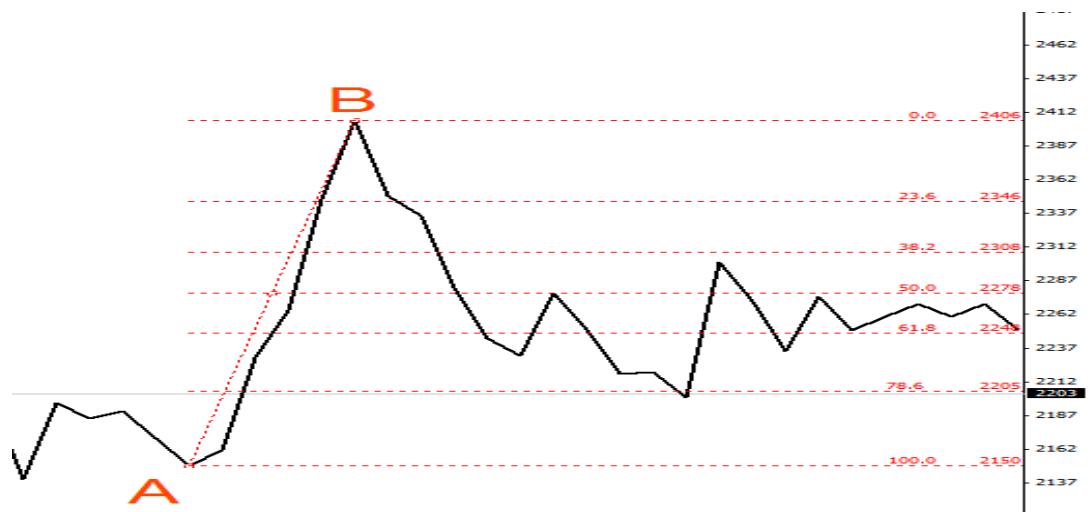


سطوح تصحیح فیبو داخلی مهم: ۳۸.۲٪، ۵۰٪، ۶۱.۸٪، ۷۸.۶٪

سوال اینست که از روی کدام سطوح فیبو برگشت قیمت صورت می گیرد؟ باید منتظر تریگر روی سطوح فیبو بمانیم.

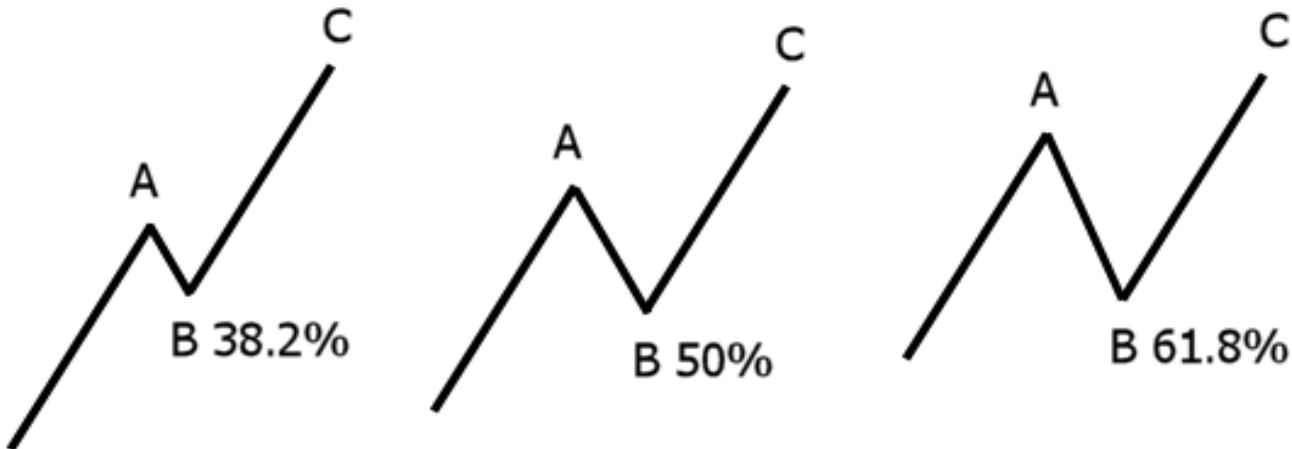
نحوه رسم فیبو Ret

فیبو Ret یک ابزار دو نقطه ای می باشد برای رسم آن باید روی دونقطه از چارت کلیک کنیم. ابتدا نقطه A و سپس نقطه B را انتخاب می کنیم.



قدرت برگشت

هرچه سطح با درصد کمتری برخورد نماید قدرت برگشت آن بیشتر است.



اگر نقطه ورود C روی فیبو 38.2 RET باشد، نقطه خروج D روی فیبو 261.8 EXT خواهد بود.

اگر نقطه ورود C روی فیبو 50 RET باشد، نقطه خروج D روی فیبو 200 EXT خواهد بود.

اگر نقطه ورود C روی فیبو 61.8 RET باشد، نقطه خروج D روی فیبو 161.8 EXT خواهد بود.

اگر نقطه ورود C روی فیبو 78.6 RET باشد، نقطه خروج D روی فیبو 127.2 EXT خواهد بود.

Fibonacci projection

خطوط تصویرگر

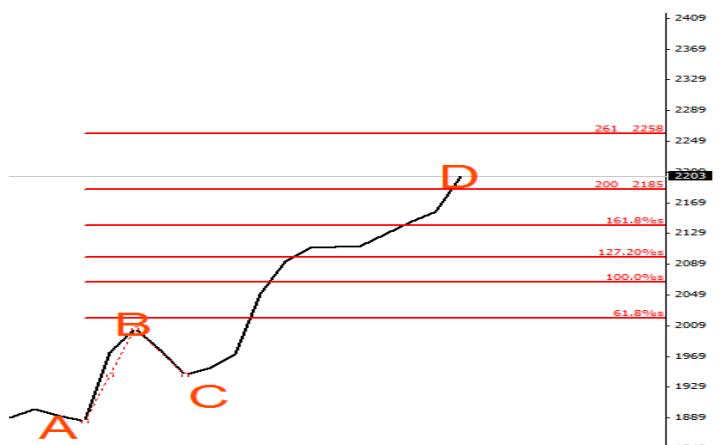
سطوح خارجی مهم: ۴۲۳.۶، ۲۶۱.۸، ۱۶۱.۸، ۱۲۷.۲٪

فیبوناچی Projection ابزاری مانند فیبوناچی اکسپنشن می باشد و نقاط بازگشت بیش از ۱۰۰ درصد بازگشت هر موج را نمایش می دهد با این تفاوت که میزان بازگشت تصحیح قیمت در یک موج برای بدست آوردن نقاط بالای ۱۰۰ درصد آن روند اهمیت دارد. متاسفانه ابزار فیبوناچی پروجکشن در متاتریدر به اشتباہ Fibonacci Expansion نامگذاری شده است. در حالیکه به لحاظ تعریف علمی این ابزار کاربرد فیبوناچی پروجکشن را نمایش می دهد، برای استفاده از فیبوناچی پروجکشن ابزار فیبوناچی اکسپنشن متاتریدر را انتخاب می کنیم سپس از یک بیشینه قیمت (در شکل زیر نقطه A) به کمترین

قیمت آن روند نقطه (B) خط رسم می کنیم. نقطه سوم که میزان تصحیح قیمت در این روند نزولی می باشد را در نقطه C تعیین می کنیم. بعد از رسم صحیح فیبوناچی پروجکشن انتظار خواهیم داشت قیمت از درصدهای ۶۱.۸ - ۱۰۰ - ۱۶۱.۸ و حتی ۲۶۱.۸ به روند نزولی خاتمه دهد و روند صعودی پیدا کند. به بیان دیگر این درصدها می تواند ساپورت هایی برای بازگشت قیمت باشند. درصدهای ۶۱.۸ - ۱۰۰ - ۱۶۱.۸ و ۲۶۱.۸ میزان ادامه روند نزولی می باشند که نقطه آغازین محاسبه آخرین نقطه تصحیح روند (نقطه C) می باشد. در شکل زیر دیده می شود بازار نسبت به نقاطی که با فلش مشخص شده (۱۶۱.۸ درصد و ۲۶۱ درصد) عکس العمل نشان داده است. شایان ذکر است در یک روند صعودی این نقاط بصورت معکوس مورد استفاده قرار میگیرند تا نقاط رزیستنس انتهایی یک روند صعودی محاسبه گردد.

نحوه رسم فیبو Pro

ابتدا نقطه A و BC انتخاب سپس نقطه BC انتخاب می کنیم.





Fibonacci Expansion

خطوط

فیبوناچی اکسپنشن شباهت بسیار زیادی به فیبوناچی پروجکشن دارد و ادامه یک روند نزولی یا صعودی را تا نقطه پایانش محاسبه می کند. تنها تفاوت آن با فیبوناچی پروجکشن استفاده از دو نقطه به جای سه نقطه است. در یک روند نزولی فیبوناچی پروجکشن درصدهای ۶۱.۸ - ۱۰۰ - ۱۶۱.۸ و ۲۶۱ نقطه A تا B را از نقطه آغازین C مورد محاسبه قرار می دادیم تا نقاط D و E بدست بیاید اما در اینجا تنها به درصدهای نقاط A تا B نیاز داریم و با استفاده از درصدهایی که برای فیبوناچی اکستنشن ذکر کردیم انتظار داریم بازار ۱۶۱.۸٪ - ۲۶۱.۸٪ - ۴۲۳.۶٪ از نقطه آغازین حرکت داشته باشد. از همین رو فیبوناچی اکسپنشن را تلفیقی از فیبوناچی اکستنشن و فیبوناچی پروجکشن می دانند. برای رسم فیبوناچی اکسپنشن ابزار خاصی در متاتریدر تعریف نشده است اما میتوان با استفاده از فیبوناچی ریتیرسمنت درصدهای بیش از ۱۰۰ واحد موج اولیه، نقاط بازگشت فیبوناچی اکسپنشن را بدست آورد.

اصول کار با فیبوناچی Arcs و نحوه رسم

فیبوناچی Arcs ابزاری از گروه فیبوناچی ها می باشد که درصد های تصحیح و بازگشت یک روند را بصورت کمانی نمایش نشان می دهد درصدهای عمومی مورد استفاده در این ابزار ۳۸.۲ - ۵۰ و ۶۱.۸ درصد می باشند که کمان های برگشت قیمت را نسبت به یک روند صعودی یا نزولی نمایش می دهند.



شکل بالا نمونه استفاده از ابزار فیبوناچی آرک را نمایش می دهد درصدهای ۵۰ و ۶۱.۸ در شکل بالا برای روند تصحیح نزولی حکم رزیستنس را ایفا کرده و باعث روند نزولی قیمت شده اند.

اصول کار با فیبوناچی Fan و نحوه رسم

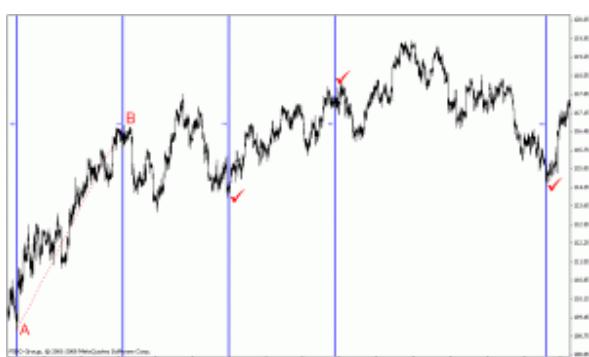
فیبوناچی Fan ابزاری دیگر از گروه ابزارهای فیبوناچی می باشد که بر اساس زاویه روند غالب نقاط بازگشت را از برخورد خط های بادبزن (فن) با قیمت بدست می آورد. در این ابزار نیز درجه های (درصدهای) ۳۸.۲ - ۵۰ - ۶۱.۸ از اهمیت بیشتری برخوردار هستند.



رسم و استفاده از این ابزار در متاتریدر به علت نقص در رسم درجه های قیمت و نشان ندادن درجه های قیمت روند صعودی کاربرد چندانی ندارد. اما میتوان برای رسم درجه های یک روند صعودی از قسمت زاویه های مخالف Fibo Levels و Properties Description با منفی وارد کردن درصدهای زاویه های مخالف را برای روند صعودی ترسیم کرد.

اصول کار با فیبوناچی Time و نحوه رسم

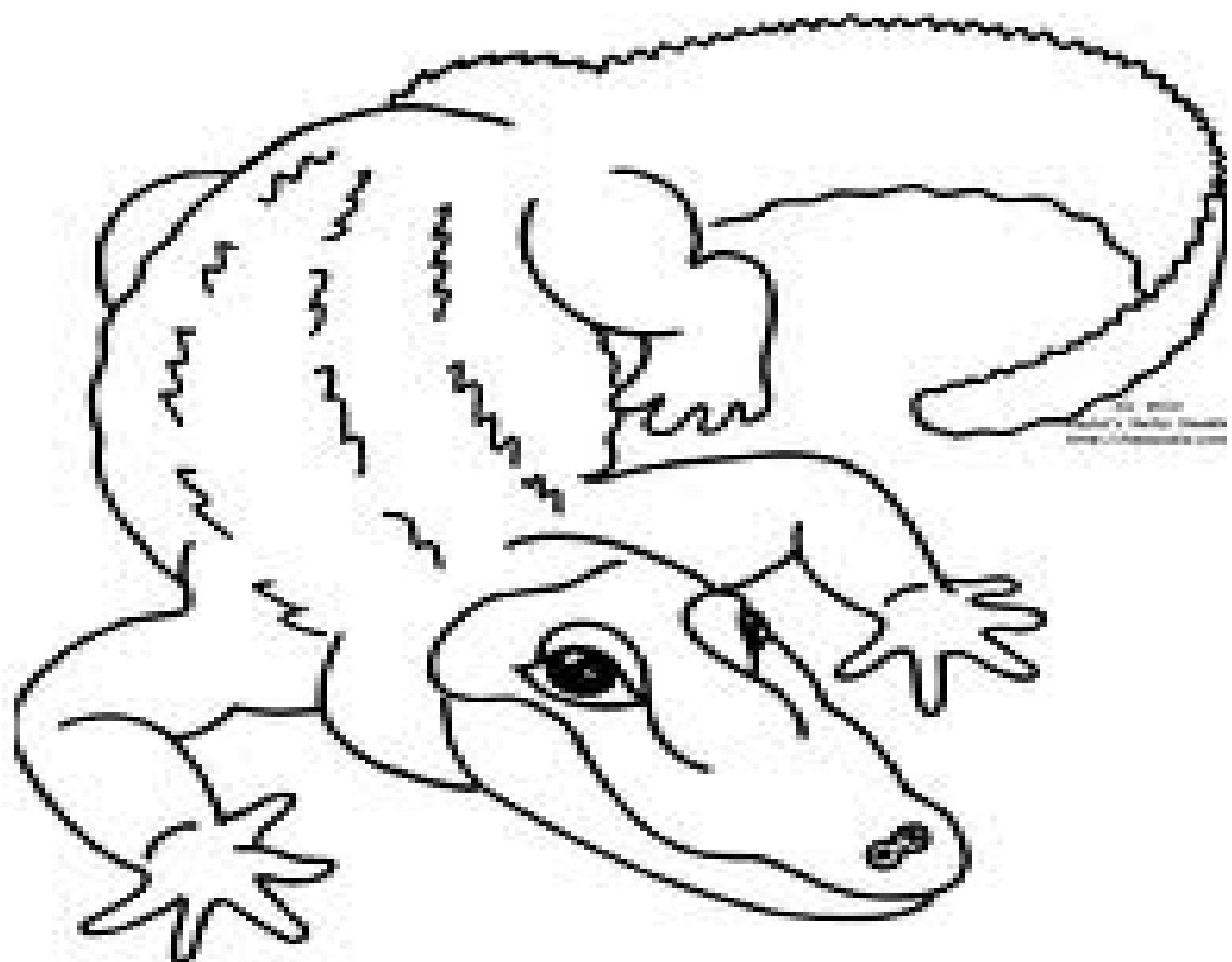
فیبوناچی تایم یا فیبوناچی زمانی ابزاری است که نقاط بازگشت قیمت را بر اساس زمان تعیین می کند از این ابزار به دو روش استفاده می کنند. در روش اول فاصله زمانی دو قله را به عنوان صفر و یک محاسبه میکنند و در نقاطی که زمان به خطوط عمودی ۱-۲-۳-۴-۵-۶-۷-۸ و الی آخر می رسد انتظار ریزش دوباره قیمت را دارند.



در روش دوم مانند مثال بالا، فاصله زمانی پایین ترین قیمت (Low) تا بالاترین قیمت (High) یک موج محاسبه می شود. سپس انتظار می رود در بازه های زمانی ۱-۲-۳-۴-۵-۸ و الی آخر قیمت تغییر جهت بدهد و موج های جدید تشکیل شود.



Bill Williams Chaos Theory



تئوری بی نظمی بیل ویلیامز

بیل ویلیامز توانست از تلفیق جنبه های روانی بازار و تئوری بی نظمی روش جدیدی را برای تحلیل ابداع کند. او چنین عنوان کرد که نتایج مورد انتظار یک فرد از معامله یا سرمایه گذاری بوسیله عوامل روانی فرد تعیین می شود. از اینرو کسی می تواند یک معاملگر خوب باشد و بطور مداوم به سود خود بیفزاید که بتواند به نظم نهفته در حرکات اتفاقی و به ظاهر غیر قابل پیش بینی بازار پی ببرد.

در نتیجه دو جنبه مهم در هر معامله خودآگاهی و دوم شناخت ساختار بازار می باشد. و از نظر او اگر ساختار بازار خوب درک شود بدست اوردن سود آسان است. بدین منظور باید از حقایق درونی بازار که به ان ابعاد بازار گفته می شود آگاه شویم. با کنار هم قرار دادن ابعاد این وجوده بدست می آید:

۱. چرخش Fractal یا فاز تغییرات که از طریق اندیکاتور fractal
۲. جنبش Momentum یا فاز انرژی از طریق اندیکاتور awesome
۳. شتاب یا کندی acceleratin/deceleration
۴. نواحی تجارت zone
۵. خط تعادل معاملات balance line

Alligator

اندیکاتور تماسح یا جهت یاب

تماسح، اندیکاتوری است که برای نشان دادن فقدان، جهت یا شکل گیری یک روند طراحی شده است. "بیل ویلیامز" به رفتار تماسح به عنوان یک تمثیل برای رفتار بازار نگاه می کرد. به این صورت که به محض بیدار شدن تماسح، زمان ساکت به زمان شکار قیمت تبدیل می شود و پس از پایان تغذیه برای خوابیدن بر می گردد. تماسح هرچه بیشتر بخوابد، گرسنه تر می شود و حرکت بازار، قوی تر خواهد بود.

کاربرد

این شاخص به سه خط میانگین حرکتی هموار شده در دوره های زمانی ۱۳، ۸ و ۵ تقسیم بندی می شود که به ترتیب توسط نوارهای ۸، ۵ و ۳ به آینده انتقال پیدا می کنند و با رنگ های آبی، قرمز و سبز مشخص می شوند که نمایانگر آواره، دندان و لب های تماسح هستند.

هنگامیکه این سه خط میانگین در هم می‌پیچند و در یک خط افقی باریک حرکت می‌کنند، به معنای خواب بودن تمساح است. هرچه بیشتر این سه خط از هم فاصله بگیرند، حرکت قیمت زودتر به وقوع خواهد پیوست. ادامه حرکت صعودی این خطوط (حرکت خط سبز به دنبال خطوط آبی و قرمز) خبر از شکل گیری یک روند صعودی را می‌دهد که ما آن را به عنوان یک سیگنال قلمداد می‌کنیم. اگر خطوط میانگین یکدیگر را در یک حرکت اصلاحی نزولی همراهی کنند، سیگنالی قوی از وقوع یک روند نزولی خواهد بود؛ به همین دلیل، فروش در این نقطه مناسبتر خواهد بود.



محاسبه

$$\text{قیمت متوسط} = (\text{بالا} + \text{پایین}) / 2$$

$$\text{آرواره تمساح} = \text{SMMA}_{13} - \text{SMMA}_8$$

$$\text{دندان های تمساح} = \text{SMMA}_8 - \text{SMMA}_5$$

$$\text{لب های تمساح} = \text{SMMA}_5 - \text{SMMA}_3$$

Gator Osilator

نوسانگر تمساح

نوسانگر تمساح (Gator Oscillator) مکمل اندیکاتور تمساح است و در کنار آن استفاده می شود تا درجه کاملی از همگرایی/واگرایی سه خط میانگین حرکتی اندیکاتور تمساح را نشان دهد که اشاره دارند به دوره های خواب و بیداری تمساح (یعنی مراحلی که بازار در روند به سر می برد یا نمی برد

کاربرد

نوسانگر تمساح (Gator Oscillator)، به عنوان یک نوسانگر متشكل از دو گونه آرایش نمودار ستونی در بالا و پایین خط صفر، اختلاف کامل بین دندان و آرواره تمساح (خطوط قرمز و آبی) در محوطه مثبت و اختلاف کامل بین لب ها و دندانهای تمساح (خطوط سبز و قرمز) در محوطه منفی را ترسیم می کند. اگر حجم میله ای از میله ای قبلی اش در این نمودار ستونی بیشتر شود، رنگ آن سبز می شود و اگر کمتر شود، رنگ آن قرمز می شود.

میله های با طول بسیار زیاد در ارتباط با نیروهای روند قدرتمند هستند.

دوره فعالیت تمساح به چهار بخش تقسیم می شود:

۱. تمساح بیدار می شود - :میله های در دو طرف خط صفر، دو رنگ متفاوت دارند.
۲. تمساح تغذیه می کند - :میله ها در دو طرف خط صفر، سبز رنگ هستند.
۳. تمساح کاملاً سیر می شود - :یک میله تکی قرمز رنگ در مرحله تغذیه.
۴. تمساح می خوابد - :میله ها در هر دو سمت خط صفر، قرمز رنگ هستند..



Fractals

چرخش ها

بیل عنوان کرد بهتر است پیش از وقوع اولین چرخش معامله نکنید.

شاخصی است برای مشخص کردن اوج ها و فرودهای نمودار در موقعی که حرکت قیمت متوقف و یا وارونه شده است. این نقاط برگشتی به ترتیب اوج ها و فرودها نامیده می شود.

کاربرد

چرخش ها از یک گروه حدود پنج میله ای تشکیل می شود که دو تای اولی آنها بطور موفق صعود کرده (یا سقوط) کرده اند و دو تای آخری پایین آمده اند (یا صعود کرده اند) و یکی در وسط بیشترین صعود (یا سقوط) را دارد که در مجموع یک گروه را تشکیل می دهند.

- چرخشها خرید، یک پیکان رو به بالا است.
- چرخشها فروش، یک پیکان رو به پایین است.



Awesome Oscillator

اسیلاتور مر موز

نوسان گر مر موز جنبش بازار را تعیین می کند (Awesome Oscillator) یک اندیکاتور شتاب حرکت است که تغییرات دقیق در نیروی محرک بازار را بازنگاری می دهد و به تشخیص قدرت روند برای رسیدن به حداکثر نقاط شکل یافتن یا اصلاح کمک می کند.

کاربرد

سه سیگنال اصلی قابل رویت وجود دارند:

۱. بشقاب از سه ستون پشت سر هم بالای خط صفر، دو ستون اول باید قرمز رنگ باشند (ستون دوم باید کوتاه تر از سه ستون اول باشد) و سه ستون سوم باید سبز رنگ بوده و بالاتر از سه ستون قبلی اش (ستون دومی) باشد. چنین آرایشی یک سیگنال واضح خرید است و اگر همین الگو بطور برعکس در سه ستون های زیر خط صفر شکل بگیرد، به عنوان سیگنال خرید در نظر گرفته می شود.
۲. قطع کردن خط صفر اگر ستونی خط صفر را بطور صعودی قطع کند و از آن عبور کند، ارزش خود را از حالت منفی به مثبت تغییر می دهد. ما به چنین حالتی، یک سیگنال خرید می گوییم. اگر حرکت نمودار ستونی در جهت عکس رخ دهد، سیگنال فروش ایجاد می شود.
۳. دو نوک اگر ستون ها در زیر خط صفر، پشت سر هم دو نوک، شبیه به دو قله واژگون شده را تشکیل دهند بطوریکه نوک دومی از نوک اولی به خط صفر نزدیک تر باشد، یک سیگنال خرید شکل گرفته است. سیگنال فروش هم هنگامی خواهد بود که آرایشی مشابه در بالای خط صفر شکل بگیرد.



Acceleration/Deceleration

شاخص افزایش یا کاهش شتاب

شاخص تحلیل تکنیکی Acceleration/Deceleration نشان دهنده شتاب مثبت و شتاب منفی نیروی پیش برندۀ کنونی بازار است. قاعده عملکردی این اندیکاتور بر اساس فرضیه سازنده آن، "بیل ویلیامز"، است که طبق آن پیش از تغییر جهت حرکت قیمت، از نیروی حرکتی آن کاسته می شود.

کاربرد

بگیرد، تغییر می کند؛ به همین دلیل، از آن برای دریافت زودترین هشدارها در مورد احتمال تغییر جهت روند استفاده می شود.

تغییرات رنگ اندیکاتور به تنها یی می تواند خیلی مهم باشد چراکه خط سبز رنگ کنونی (مستقل از رقمی که نشان می دهد) در مورد پوزیشن های خرید هشدار می دهد و به همین ترتیب خط قرمز رنگ در مورد فروش هشدار می دهد.

اگر معامله گر می خواهد همراه با نیروی پیش برندۀ بازار، وارد بازار شود باید به رنگ و رقم اندیکاتور توجه داشته باشد. دو ستون متوالی سبز رنگ بالای سطح صفر به شما پیشنهاد می دهد که با یک پوزیشن خرید وارد بازار شوید در حالیکه حداقل دو ستون قرمز رنگ زیر سطح صفر ممکن است به عنوان توصیه ای برای فروش قلمداد شوند.

معمولًا در زمانبندی های کمتر از ۴ ساعته، سیگنال های غیرواقعی و اشتباه بیشتر هستند.



MFI

شاخص تسهیل بازار

شاخص تسهیل بازار برای این منظور طراحی شده است که نشان دهد چه مقدار تمایل برای حرکت در بازار وجود دارد. ارزش های ذاتی شاخص برعکس متحرکهایش در ارتباط با متحرک های حجم، به تنها ی هیچ سینگال معاملاتی ای ارائه نمی دهند.

کاربرد

ارزش های ذاتی شاخص توسط میله های نمودار ستونی نشان داده می شوند که در عین حال، سنجش شاخص و حجم متحرکها با رنگ های مختلف ارائه داده می شوند که به نوبه خود برای قرائت علائم شاخص حیاتی هستند.

۱. ستون سبز رنگ - شاخص تسهیل بازار و حجم، هر دو بالا هستند. افزایش فعالیت معامله به معنای شدت گرفتن حرکت بازار است. در این حالت ممکن است به روند ملحق شویم.

۲. ستون آبی رنگ - شاخص تسهیل بازار، بالا و حجم پایین است. علی رغم افت حجم، حرکت ادامه دارد. روند به زودی وارونه خواهد شد.

۳. ستون صورتی رنگ - شاخص تسهیل بازار پایین و حجم بالا است. حرکت نزولی علی رغم افزایش حجم احتمالاً نشانگر شکستن ۱۸۰ درجه ای به شکل U است.

۴. ستون قهوه ای رنگ - شاخص تسهیل بازار و حجم، هر دو پایین هستند. بازار دیگر تمایلی به جهت کنونی ندارد و به دنبال علائمی از یک گسترش در آینده است.



Elliott Wave Theory

3-PART SONG (Sonata No. 1)

Adagio

1st Part: Phased Ascension

Half Cycle on II: Expansion

Half Cycle on III: Final part

2nd Part: Reversal and Re-expansion. Declining on I

Half Cycle on IV: Final part

نظریه موج الیوت

۱۹۳۸ کتاب اصول موج به عنوان اولین مرجع برای مبحثی که امروزه به نام نظریه موج الیوت شناخته می شود منتشر شد.

۱۹۶۴ الیوت دو سال قبل از مرگش در سال کتاب راز هستی تلاش و کارهای خود را نوشت.

۱۹۷۸ فروست و رابت پرچتر در با همکاری هم کتاب نظریه موج الیوت را منتشر کردند.

۱۹۸۰ پرچتر در کتاب تلاش های بزرگ الیوت اثری ماندگار باقی گذاشت.

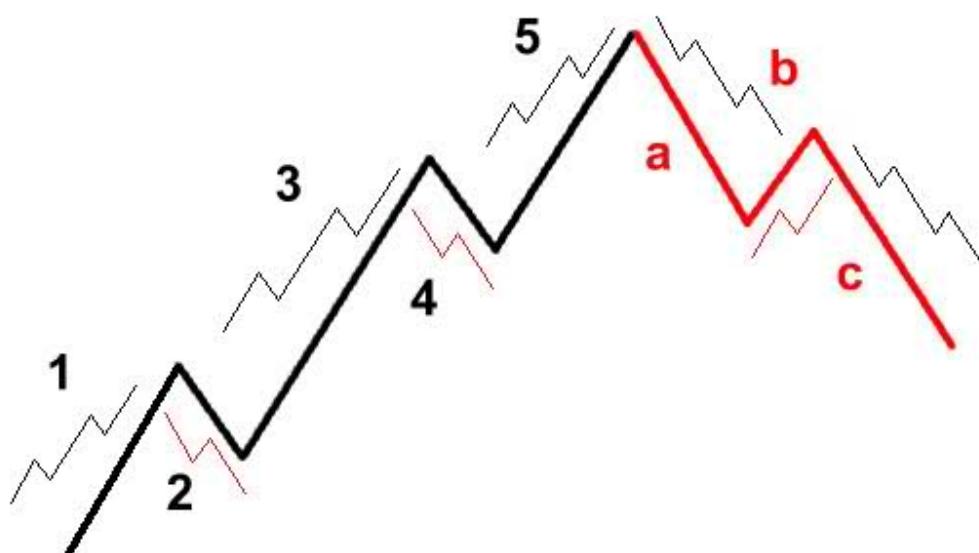
اصول اولیه موج

سه جنبه مهم در نظریه موج وجود دارد: الگو، نسبت، زمان

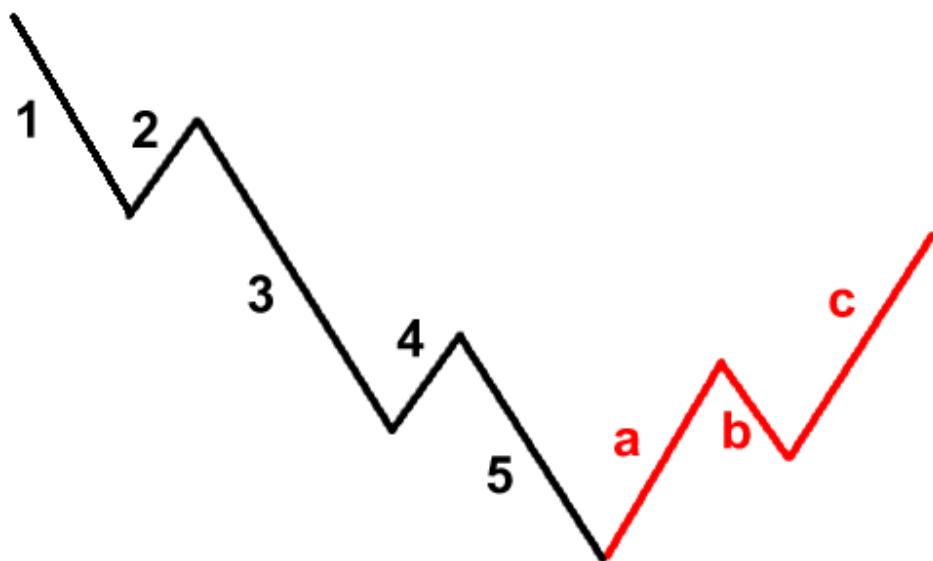
- الگو در نظریه موج به الگوهای موج و اشکال آن اشاره دارد که مهمترین جزء نظریه است.
- تحلیل نسبت ها برای تعیین نقاط صحیح و قیمت های هدف از طریق اندازه گیری ارتباط بین موج های مختلف کاربرد دارد.
- روابط زمان برای تایید کردن الگوهای موج و نسبت ها بکار می رود.

نظریه موج الیوت اصولاً برای میانگین های بزرگ بازار سرمایه بکار می رود مخصوصاً برای میانگین صنایع داوجونز.

ابتدایی ترین تعریف این نظریه: بازار سرمایه براساس یک آهنگ یا ریتم مکرر شامل ۵ موج افزایشی حرکت می کند که در ادامه با ۳ موج کاهشی همراه می شود.



موج های ۱-۳-۵ موج های صعودی و موج های ۴-۲ (موج های تصحیح) برخلاف روند صعودی حرکت می کند. بعد از اینکه ۵ موج پیش رونده کامل شد سه موج تصحیح کننده شروع می شوند که با a-b-c مشخص شده اند.



با وجود فرم ثابت امواج، درجات مختلفی از اهمیت آن وجود دارد. روندها در درجات بسیار مختلفی دارند. الیوت روند را به ۹ درجه مختلف از لحاظ اهمیت یا بزرگی طبقه بندی کرد که از دورهای عظیم ۲۰۰ ساله تا دورهای چند ساعتی را شامل می شود. این نکته را در نظر داشته باشیم که ۸ موج مقدماتی به اینکه در کدام درجه از روند قرار دارد ارتباطی ندارد.

Wave Degree	5s With the Trend					3s Against the Trend		
Grand Supercycle	(I)	(II)	(III)	(IV)	(V)	(a)	(b)	(c)
Supercycle	(I)	(II)	(III)	(IV)	(V)	(a)	(b)	(c)
Cycle	I	II	III	IV	V	a	b	c
Primary	①	②	③	④	⑤	A	B	C
Intermediate	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(A)	(B)	(C)
Minor	1	2	3	4	5	A	B	C
Minute	①	②	③	④	⑤	ⓐ	ⓑ	ⓒ
Minuette	(i)	(ii)	(iii)	(iv)	(v)	(a)	(b)	(c)
Subminuette	i	ii	iii	iv	v	a	b	c

هر موج به موج هایی با درجهات کوچکتر تقسیم می شوند. در این حالت هر موج قسمتی از موج بزرگتر و با درجه بیشتر است.

Submicro – minutes to hours

دقیقه به ساعت

Micro - hours to days

ساعت به روز

Subminuette - days to weeks

روز به هفت

Minuette - days to months

روز به ماه

Minute - weeks to months

هفته به ماه

Minor - weeks to quarters

یک چهارم هفت

Intermediate - months to quarters

یک چهارم ماه

Primary - months to years

ماه به سال

Cycle - quarters to years

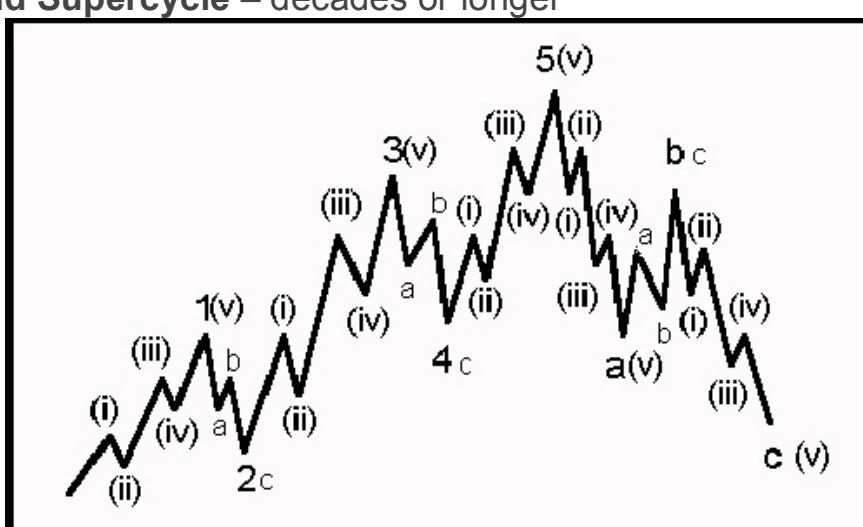
۱/۴ سال (سه ماه)

Supercycle – years

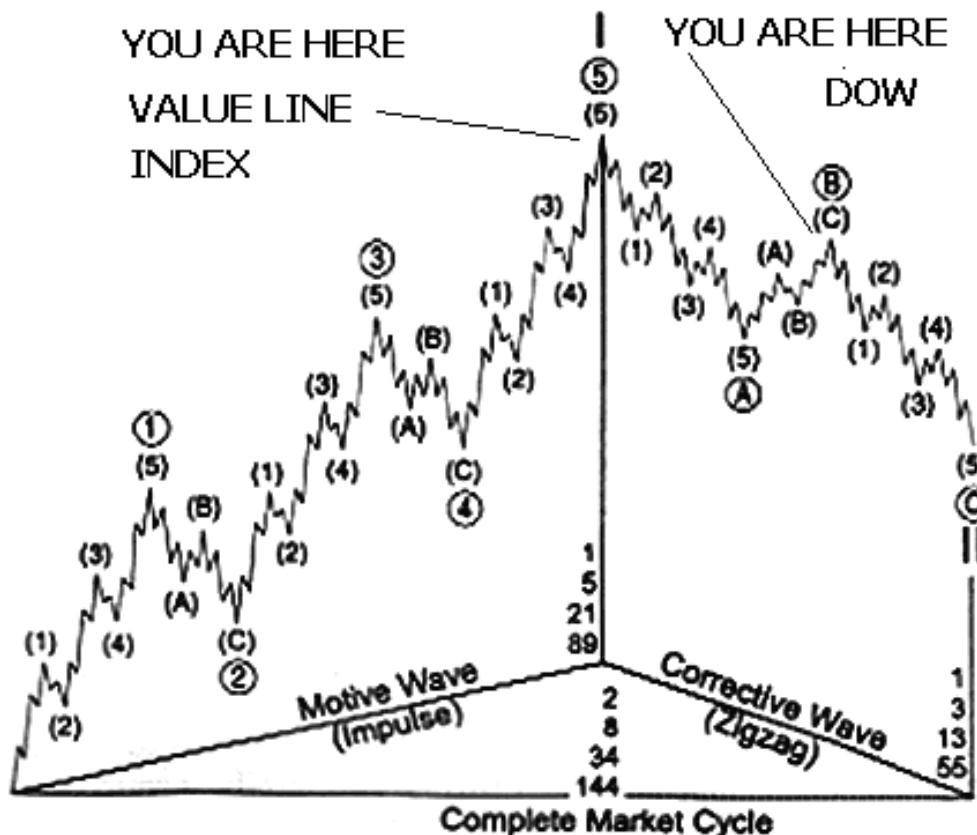
سالانه

Grand Supercycle – decades or longer

طولانی تر



که در این تقسیم بندی به شماره موجهای ۱-۲-۳-۴-۵-۸۹-۵۵-۳۴-۲۱-۱۳-۸-۵-۳-۲-۱-۱۴۴-۸۹-۵۵-۳۴-۲۱-۱۳-۸-۵-۳-۲-۱... می رسمیم که این شماره موجها همان سری اعداد فیبونانچی می باشد که پایه و اساس ریاضیات نظریه موج الیوت می باشد.



توانایی مشخص کردن ۳ یا ۵ موج در به کاربردن این نظریه آشکارا اهمیت زیادی دارد. این اطلاعات به تحلیگر می‌گوید در آینده منتظر چه چیزی می‌باشد.

به عنوان مثال حرکت کامل ۵ موج به این معنی است که این فقط قسمتی از حرکت موج بزرگتر کامل شده و این موج بزرگ ادامه دارد (اگر ۵ موج آخر از موج بزرگ نباشد). یک نکته مهم باید به خاطر داشته باشیم که مرحله تصحیح (a-b-C) هرگز در این ۵ موج اتفاق نمی‌افتد.

اگر در بازار افزایشی ۵ موج نزولی مشاهد شد بیانگر اینست که احتمالاً این اولین موج از ۳ موج کاهشی-a-b-C می‌باشد و احتمالاً شاهد نزول بیشتر روند خواهیم بود.

در بازار کاهشی ۳ موج صعودی باید کاملاً در ادامه روند نزولی باشد و اگر ۵ موج صعودی دیده شد می‌تواند اخطار واقعی برای شروع حرکت صعودی تلقی شود و احتمالاً ممکن است این اولین موج روند صعودی باشد.

قوانين تحلیلی الیوت

الیوت سه اصل برای تفسیر قانون خود بیان کرد:

۱. موج ۲ هیچ وقت به اندازه صد درصد موج ۱ بازگشت نمی کند.
۲. موج ۳ هیچ وقت کوتاه ترین موج نیست.
۳. موج ۴ هیچ وقت وارد دامنه موج ۱ نمی شود.

ویژگی های موج ها

۱. موج ۱ : پیدا کردن این موج کار مشکلی است زیرا این موج اغلب به نظر یک موج اصلاحی می رسد . این موج کوتاه ترین موج در میان موج های حرکتی است.

۲. موج ۲ : پیدا کردن این موج بدلیل ساختار سه موجی آن کار آسان تری است. این موج در حدود ۶۱۸ درصد از موج یک ادامه می یابد. معمولاً زیگزاگ ها (یکی از موج های اصلاحی) در این موج ظاهر می شوند.

۳. موج ۳ : این موج معمولاً بلند ترین موج در میان موج های حرکتی است و معمولاً امتداد ها (Extensions) در این موج رخ می دهند در هر حال کوتاه ترین موج نیست. در این موج معمولاً حجم معاملات بازار بالاست و اخبار فاندامنتال از این موج حمایت می کنند.

۴. موج ۴ : بر اساس قانون تناوب الیوت اگر موج دوم پیچیده باشد موج چهار پیچیده گی کمتری دارد و برعکس . توجه اینکه این موج هیچ وقت وارد حریم موج یک نمی شود.

۵. موج ۵ : این موج آخرین موج حرکتی محسوب می گردد و معمولاً باقیتی فراتر از اوج نقطه موج سوم پیش روند و اما گاهی این اتفاق نمی افتد و اصلاحاً " شکست " و یا " کوتاه شدگی " (Truncation) رخ می دهد.

۶. موج A : پیدا کردن موج A کار چندان آسانی نیست . بهترین راه برای این کار پیدا کردن موجی با ۵ موج فرعی است.

۷. موج B : ممکن است با تنوعات و پیچیدگی های فراوانی همراه باشد زیرا که در زمان تشکیل این موج آخرین خریداران تلاش دارند که آخرین سودهای خود را از بازاری که صعودی بوده است

کسب کنند و فروشنده‌گان تلاش دارند که وضعیت را امتحان کنند و در صورت امکان دست به فروش بزنند.

۸. موج C: موج C پایان روند را نشان می‌دهد این موج که بعد از یک بازار صعودی به وجود آمده است با رسیدن به نرخی پایین‌تر از نرخ حداقل موج A به اتمام می‌رسد.

موج‌های تصحیح گر

موج‌های اصلاحی نسبت به موج‌های حرکتی از پیچیدگی بیشتری برخوردارند معمولاً تا تکمیل نشوند نمی‌توان آنها را تشخیص داد. برای موج‌های اصلاحی فقط یک قانون وجود دارد و آن اینکه این موج‌ها فقط شامل ۵ موج نمی‌شوند (موج‌های تصحیح گر هرگز با ۵ موج اتفاق نمی‌افتد). موج‌های تصحیح گر ۳ تا هستند (به استثنای مثلث‌ها).

(یعنی اینکه چنانچه در یک بازار افزایشی ۵ موج نزولی دیدید این هرگز پایان اصلاح نیست بلکه بخشی از آن است و الگو هنوز کامل نشده است. انواع این موج‌ها به شرح ذیل می‌باشند:

۱. زیگزاگ

الگوی ۳ موج تصحیح گر هستند که برخلاف روند بزرگتر حرکت می‌کنند. ساختار این موج‌ها بصورت ۳-۵-۳-۵ (از چپ به راست بخوانید). زیگزاگ‌ها خود شامل سه دسته تنها، دوقلو و سه قلو ظاهر می‌باشند.

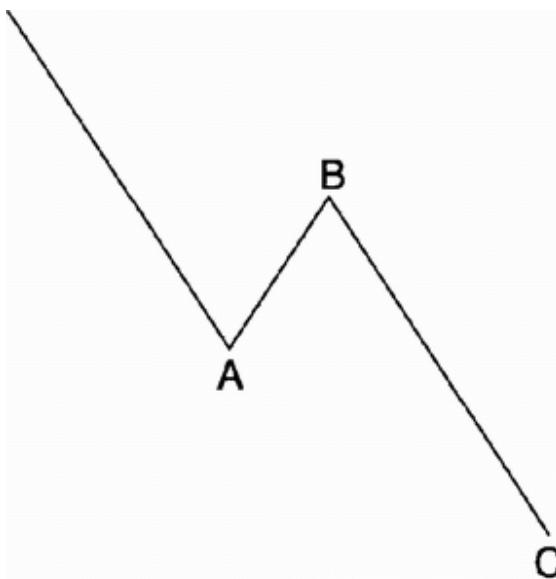


Figure 1-22

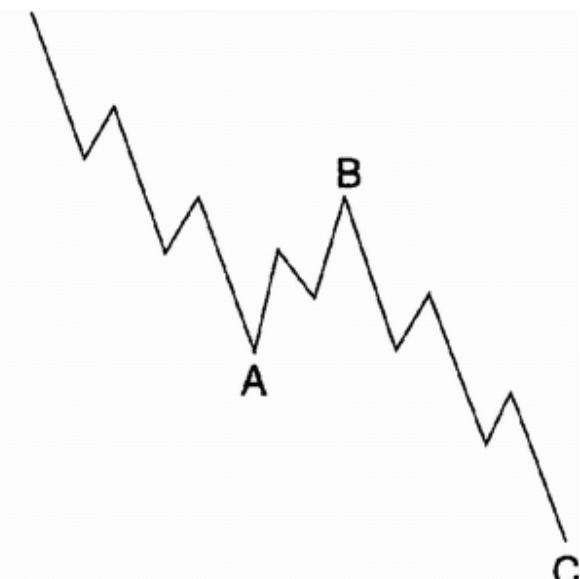


Figure 1-23

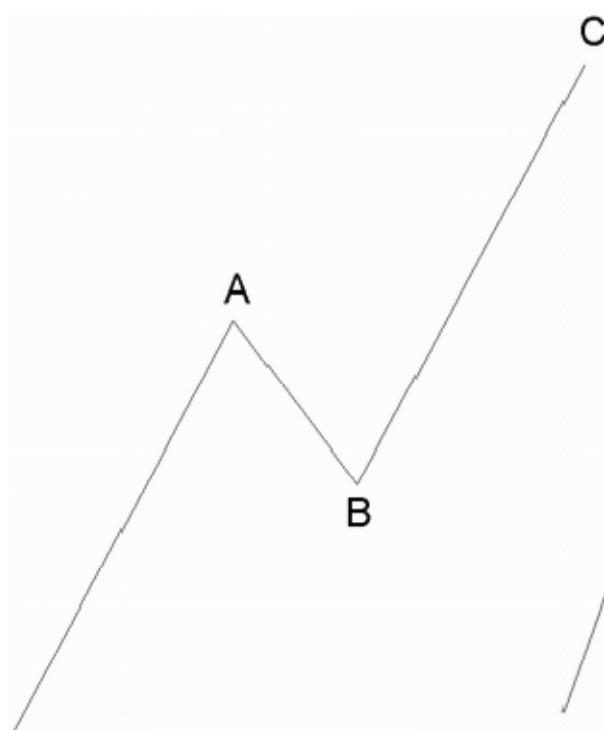


Figure 1-24

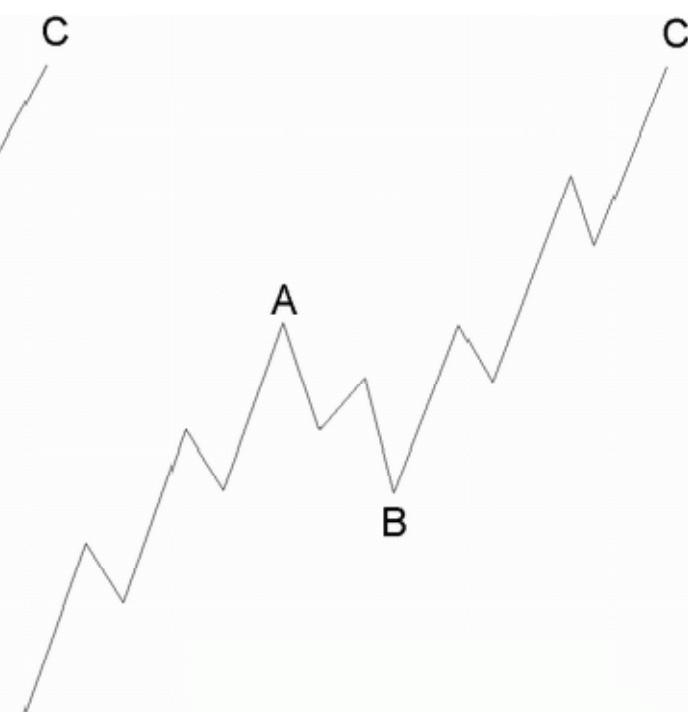


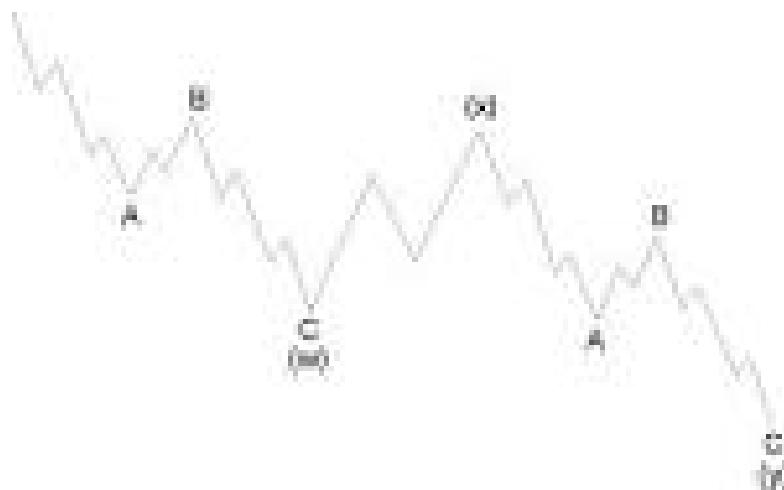
Figure 1-25

می بینید که موج وسط یعنی موج B مقدار کمی به سمت موج A باز می گردد ولی موج C کاملا از انتهای موج A فراتر رفته است.

زیگزاگ ها بوسیله سری های سه تایی از هم جدا می شوند مانند موج X در شکل فوق.

نکته: هر موجی مانند X نشانگر این است که زیگزاگی دیگر در راه است. از ویژه گی های زیگزاگ ها باید گفت که این موج معمولاً در موج دوم از موج های اصلی ظاهر میشود و بندرت در موج چهارم دیده شده است.

یکی از انواع زیگزاگ ها که کمتر مشاهده می شود زیگزاگ دوبل نام دارد. اغلب در الگوهای بزرگ تصحیحی اتفاق می افتد. این نوع متفاوتی از الگوی زیگزاگ 5-3-5 مرتبط با الگوی a-b-c میانی است.

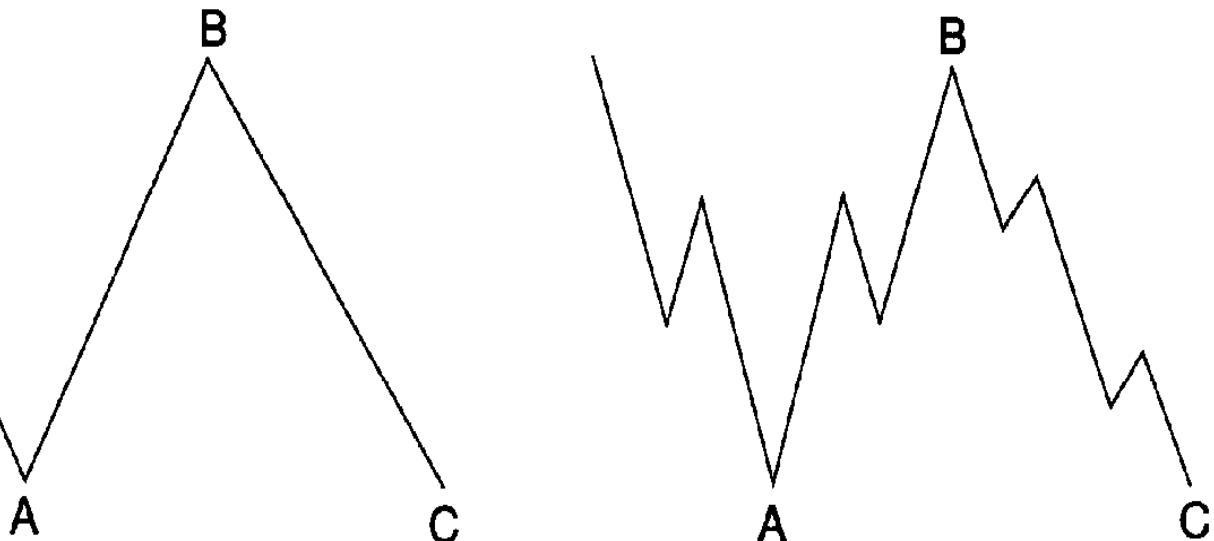


۲. پهنه ها

تمایز بین پهنه ها و زیگزاگ این است که پهنه ها از الگوی ۳-۵-۳ پیروی می کند.

پهنه ها بیشتر علامت تقویت بازار افزایشی هستند و بیشتر الگوی تحکیمی بشمار می آیند تا الگوی تصحیحی.

برای مثال در یک بازار افزایشی تا نقطه اولیه موج A صعود می کند که این نشان از قدرت مضاعف روند بزرگ حاکم دارد. موج C نیز به حوالی انتهایی موج A باز می گردد برخلاف زیگزاگها که موج C کاملاً در پایین انتهایی موج A قرار می گیرد.



دو نوع غیر عادی پهنه تصحیحی نیز وجود دارد:

۱. نوع پهن شونده یا منبسط آن به شکل زیر می باشد که موج B فراتر از نقطه شروع موج A بالاتر رفته و انتهای موج C نیز پایین تر از موج A می رود.
۲. نوع دیگری آن: موج B به بالای موج A می رسد ولی موج C نمی تواند به انتهای موج A برسد که این حالت در بازار افزایشی ، نشانگر قوی بودن بازار است. که بنام پهنه دونده شناخته شده

Advanced GET



نرم افزار Advanced GET و امواج الیوت

در این نرم افزار امواج به صورت اتوماتیک و با تشخیص خود نرم افزار با شماره های ۱ تا ۵ شماره گذاری می شوند. ما فعلا فقط با اعدادی که با دایره های آبی رنگ مشخص هستند کار می کنیم. دقت داشته باشید که شماره موج در انتهای موج نوشته می شود.

همچنین نظریه الیوت بیان می دارد که در انتهای یک حرکت صعودی یا نزولی ۵ موجی الیوت، یک حرکت شدید در خلاف جهت خواهیم داشت که البته خود ممکن است شامل زیر موج و یا امواج اصلاحی دیگر باشد که در نرم افزار با دایره های قرمز رنگ A – B – C نشان داده می شوند.

قوانين امواج الیوت که همیشه باید آنها را در نظر داشته باشید:

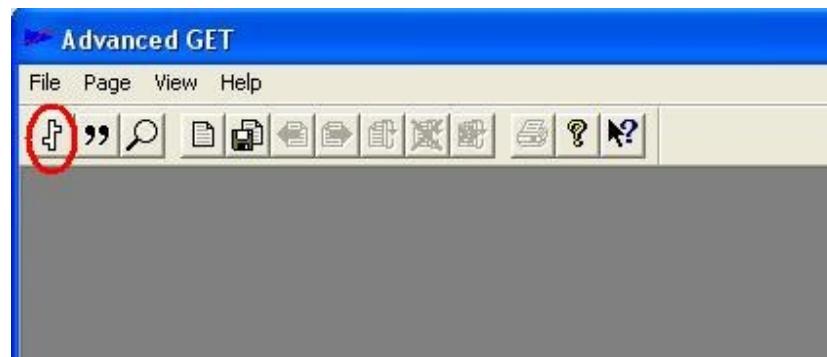
- موج ۳ نباید کوتاهترین موج باشد .یعنی موج ۳ حداقل از یکی از دو موج دیگر (۱ یا ۲) بلندتر می باشد. در بازارهای مالی مانند بورس موج ۳ یا از موج ۵ بزرگتر و یا با آن برابر است.
- موج ۴ نباید با موج ۱ همپوشانی داشته باشد .معنی این جمله اینست که پایان موج ۴ نباید زیر موج اول باشد (در امواج صعودی) و یا اینکه نباید بالای Low موج ۱ باشد (در امواج نزولی)

راه اندازی و تنظیمات اولیه در Mofid Trader

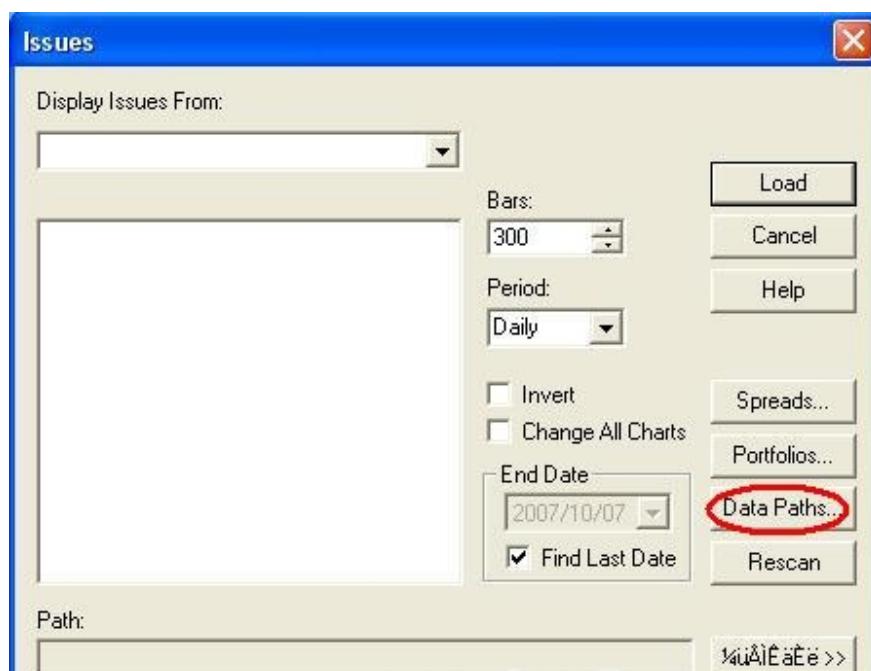
ابتدا اندیکاتور MQL5\Indicators را در پوشه IndSendDataForMofidTrader.mq5 شاخه متاتریدر خود کپی کنید. متاتریدر را اجرا کنید و اندیکاتور را روی چارت مربوطه اضافه کنید. اگر این اندیکاتور را همیشه روی چارت خود داشته باشید با دیدن تایم فریم های مختلف برای هر کدام یک فایل با پسوند PRN در شاخه MQL5/files ایجاد می شود که بعدا آن را توسط Advanced GET در اینجا معرفی می کرد.

راه اندازی و تنظیمات اولیه در Advanced GET

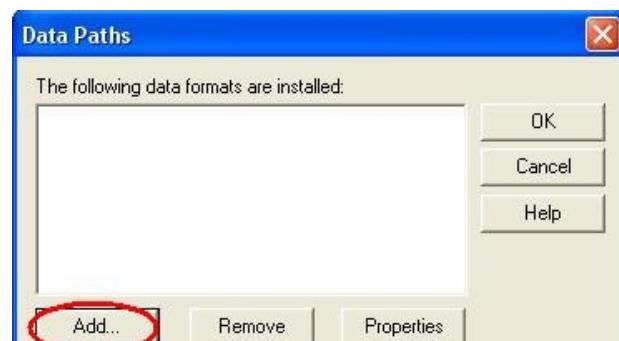
۱. وارد نرم افزار Advanced GET شده که برای انجام تنظیمات بر روی دکمه New Chart کلیک می کنیم:



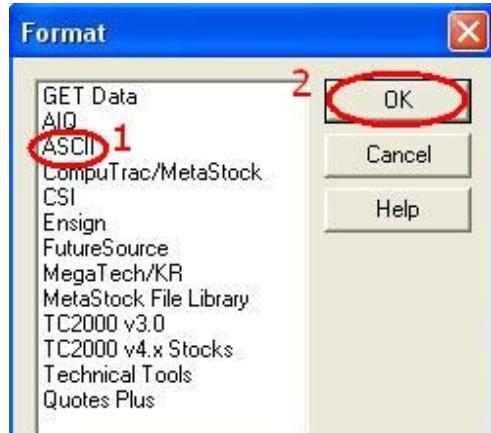
۲. سپس دکمه Data Paths:



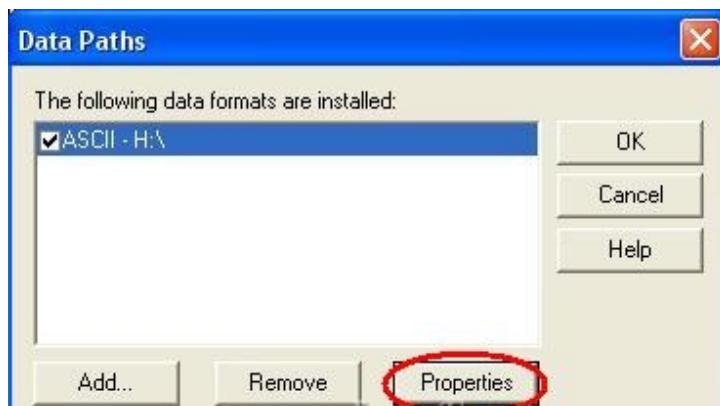
۳. دکمه Add:



۴. مراحل زیر:



Properties: ۵. دکمه



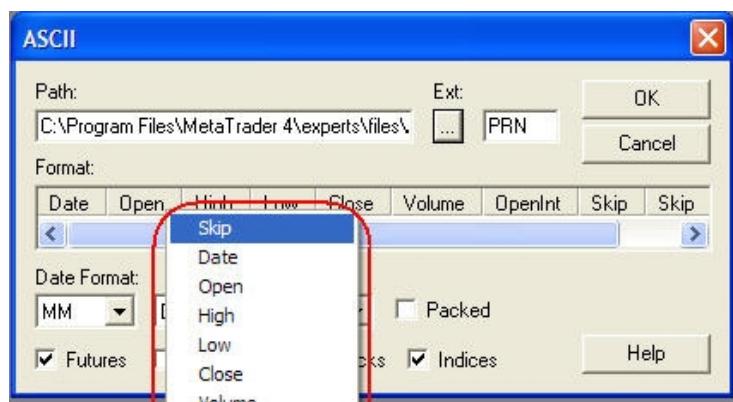
Ext: ۶. دکمه



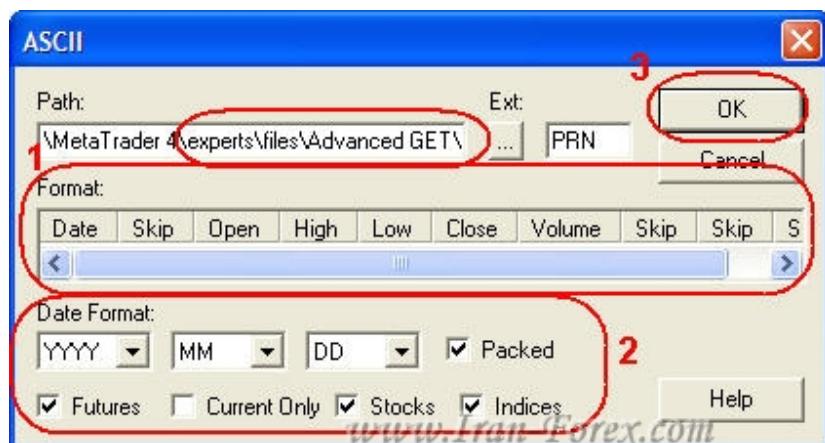
۱. مراحل زیر: (در این مرحله باید مسیر Mql5/files را از شاخه ممتازریدر خود تعیین کنید



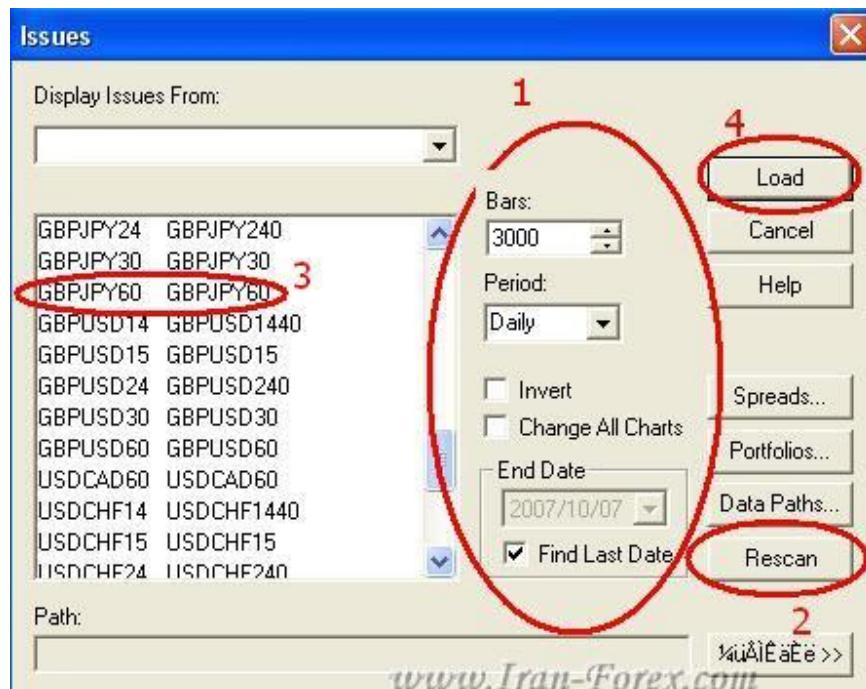
۲. با کلیک راست بر روی قسمت وسط پنجره می توان گزینه مورد نظر را انتخاب نمود مانند زیر:



۳. تنظیمات پنجره را به این صورت انجام دهید:



۴. و در نهایت تنظیمات زیر و دکمه **Load**: دقت داشته باشید که چارت دلخواهی را می‌توانید از سمت چپ انتخاب کنید این چارت‌ها همان فایل‌های PRN هستند که ساخته شده‌اند



چند نکته مهم:

- بعد از زدن دکمه **Load** چارتی مانند زیر به نمایش درمی‌آید:



دقت داشته باشید هر بار که بوسیله دکمه **New Chart** چارت جدیدی را لود می کنید قبل از انتخاب چارت و دکمه **Rescan** حتما دکمه **Load** را بزنید تا اطلاعات بروز رسانی شوند البته قبل از آن هم باید در متاتریدر خود نیز چارت و تایم فریم مربوطه را نمایش دهید تا اطلاعات آن هم بروز شده و با دکمه ذکر شده در پنجره **New Chart** اطلاعات به **Advanced GET** منتقل شوند.

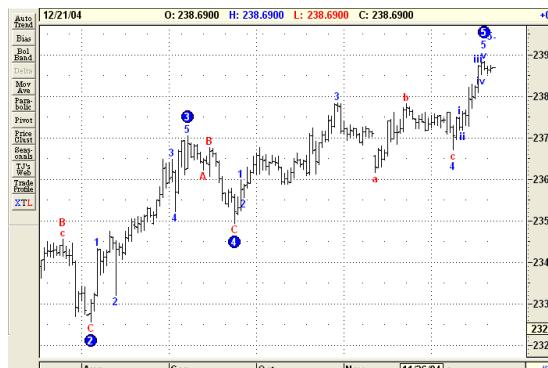
- اگر نخواهید که چارت ها را ببندید برای بروز شدن اطلاعات در نرم افزار بعد از بروز کردن آنها در متاتریدر باید از **Advanced GET** خارج شده و مجددا آن را اجرا نمایید.
- به تاریخهایی که نرم افزار بر روی چارت نشان می دهد توجه نکنید. نمودار و قیمت برای ما مهم است.
- این نرم افزار چارت های زیر روزانه را هم با نام **Daily** می شناسد و نمایش می دهد که شما با نام آن کاری ندارید قبل از نام **Daily** تایم فریم اصلی نوشته می شود و اطلاعات نیز به صورت صحیح نمایش داده می شوند. در حقیقت شما با این کار این نرم افزار را دور زده اید!

تا اینجا کار چارت ما آماده شده است مراحل زیر را بر روی چارت انجام می دهیم تا به الگوی مورد نظر بررسیم :**راست کلیک بر روی چارت و انتخاب گزینه Elliott Waves:**

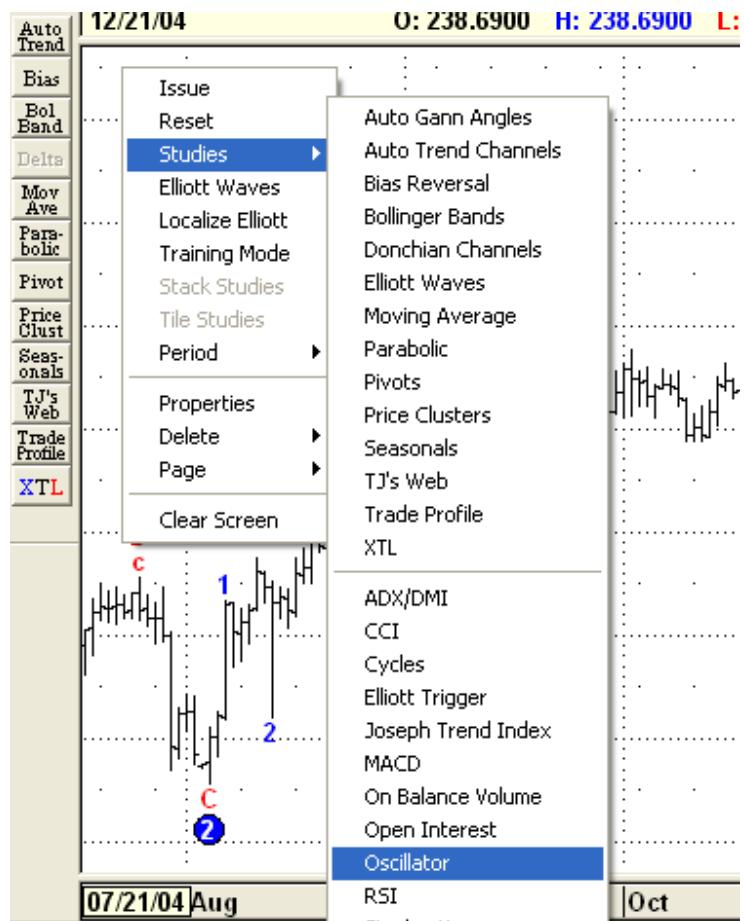


در پنجره باز شده تنظیمات پیش فرض را پذیرفته و **OK** می کنیم در نهایت چارت ما تقریبا به شکل زیر در می آید:

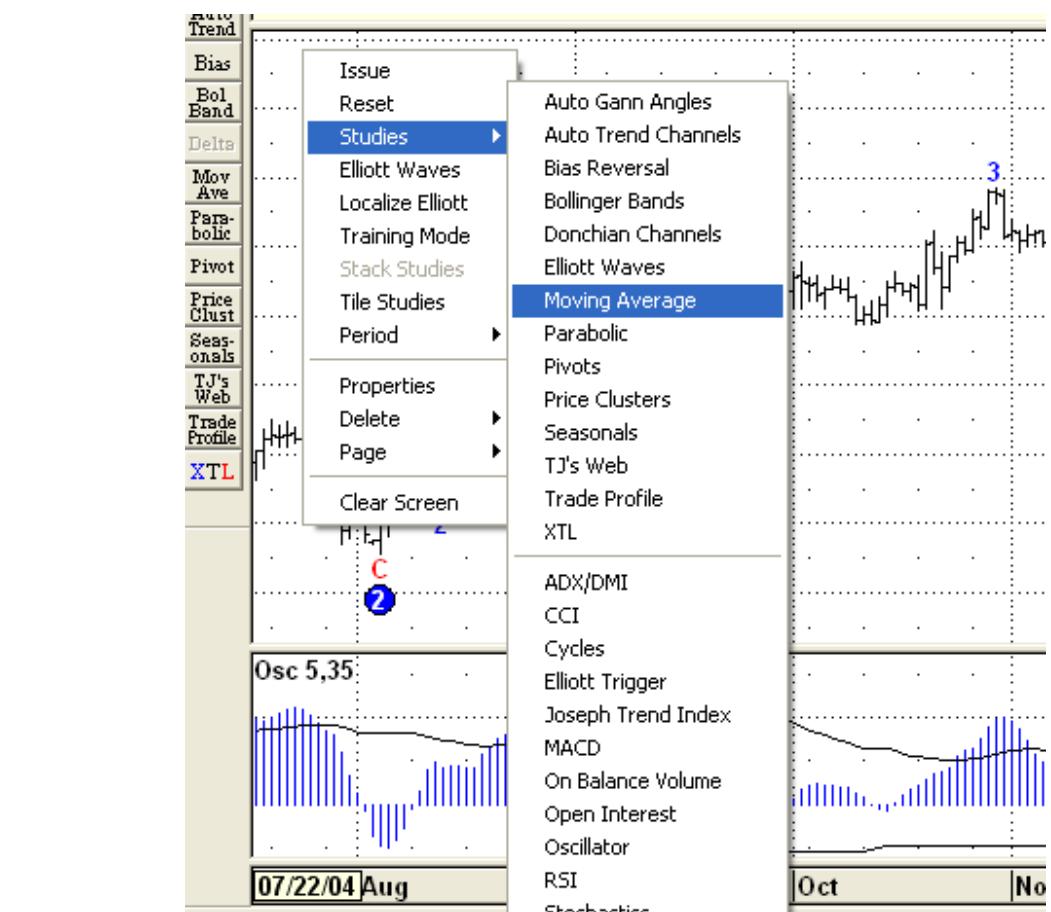
نکته: ممکن است پارامترهای اضافه دیگری نیز ببینید که در مورد آنها توضیح خواهم داد.



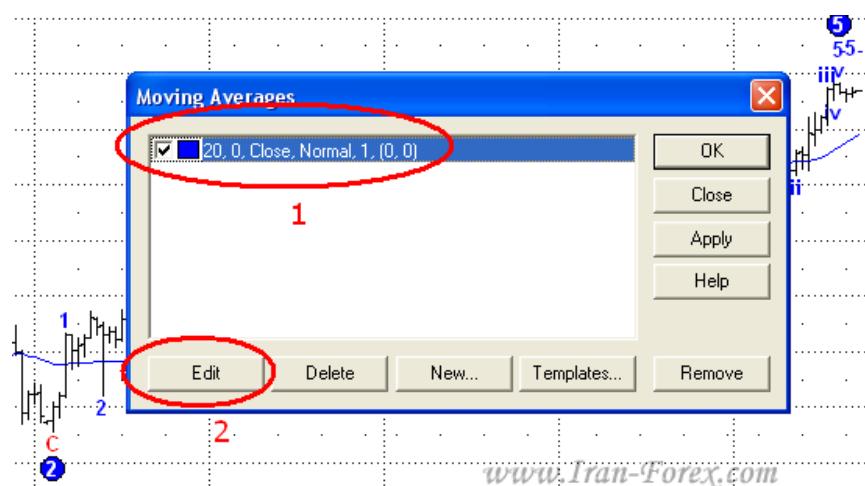
سپس طبق روش زیر اندیکاتور Oscillator را به چارت اضافه می کنیم:

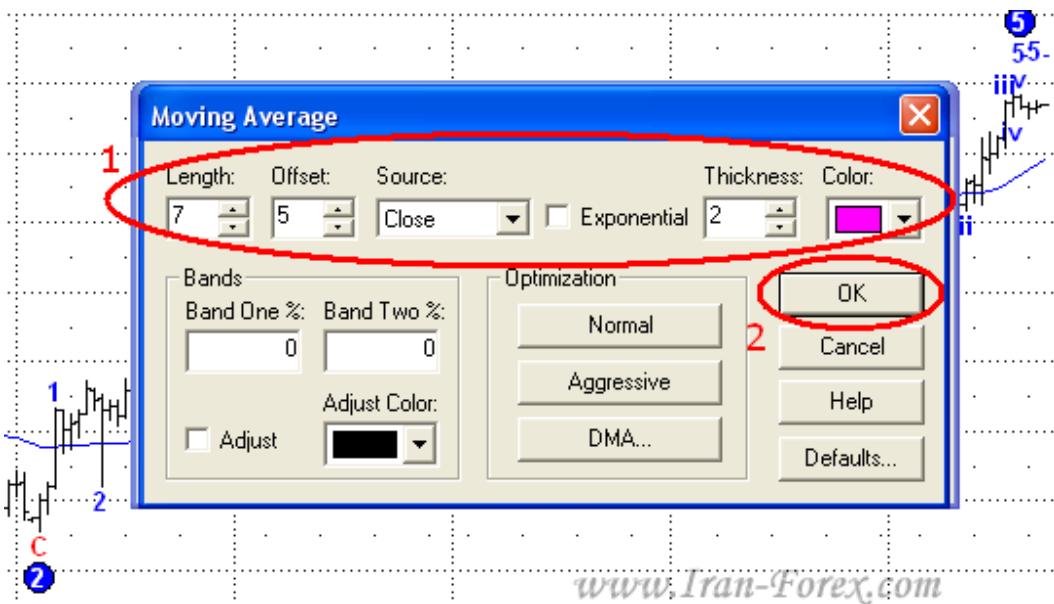


حالا با روش زیر یک Moving Average به چارت اضافه کرده و در پنجره ظاهر شده تنظیمات شکل بعد را می دهیم:

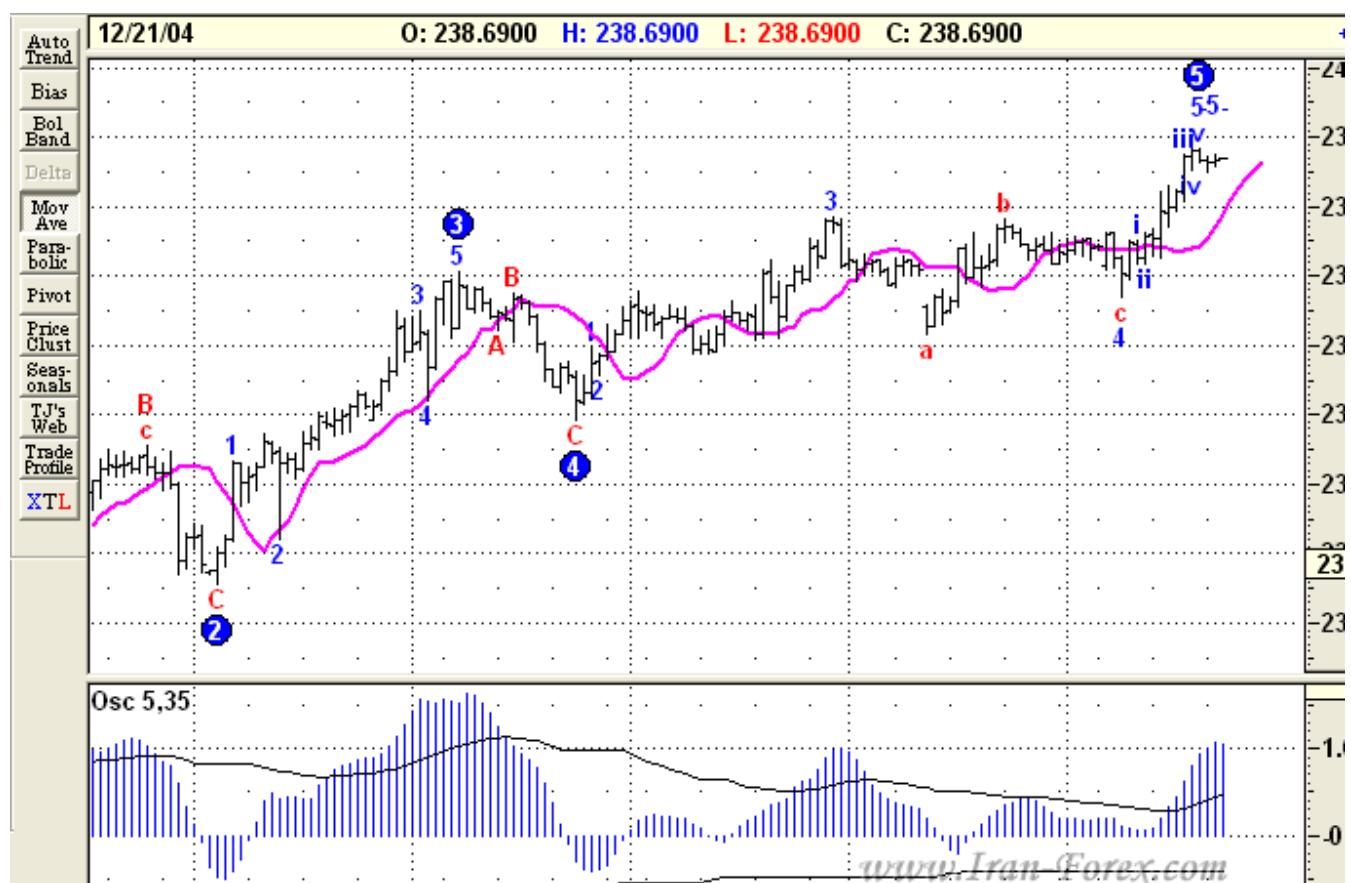


Moving Average: تنظیمات



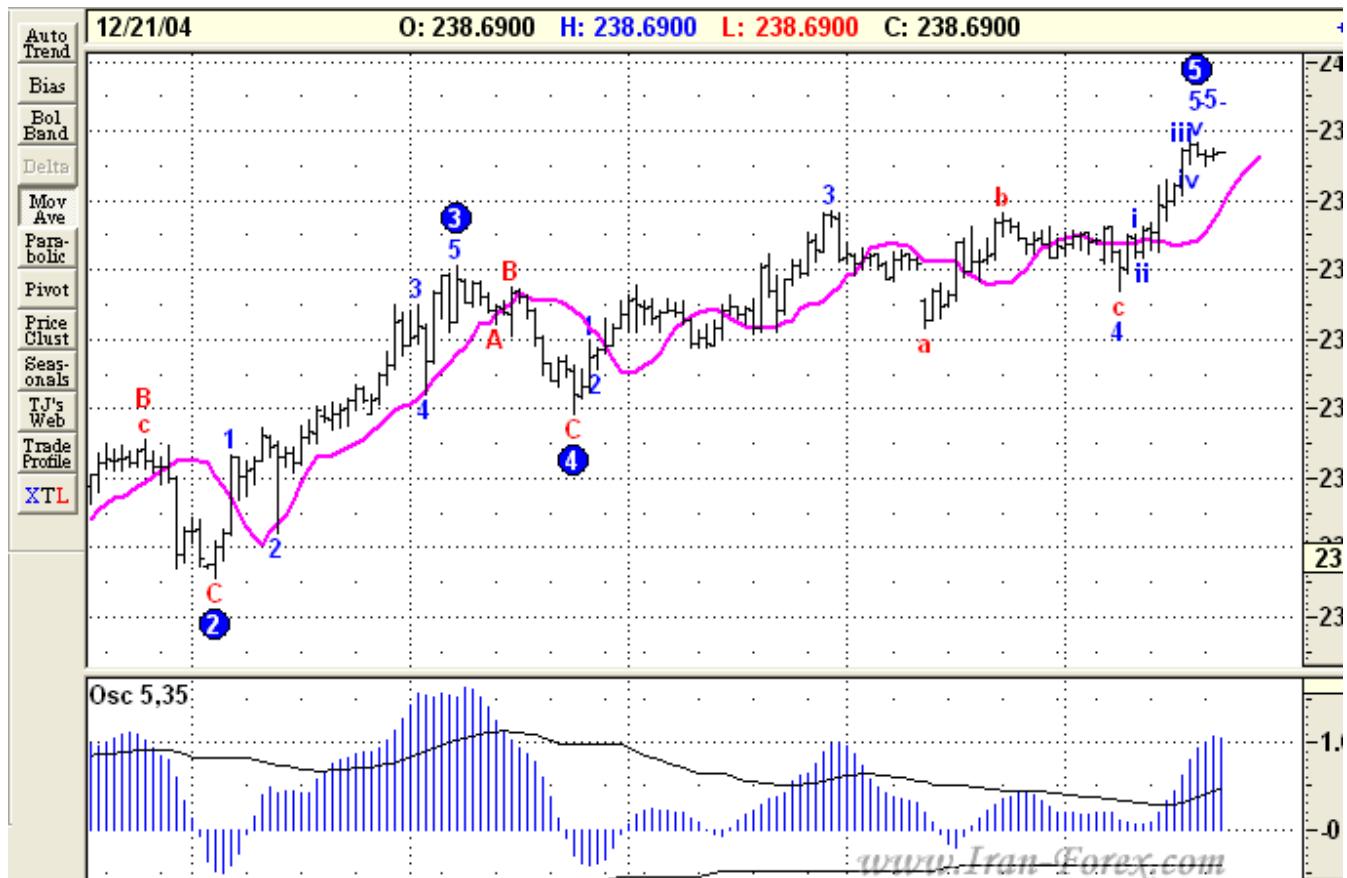


در نهایت الگوی زیر را بر روی چارت خواهیم داشت:



اندیکاتور DMA

همانطور که در شکل پایین می بینید یک Moving Average به رنگ صورتی با پریود ۷ و جابجایی راست ۵ ایجاد کردیم:

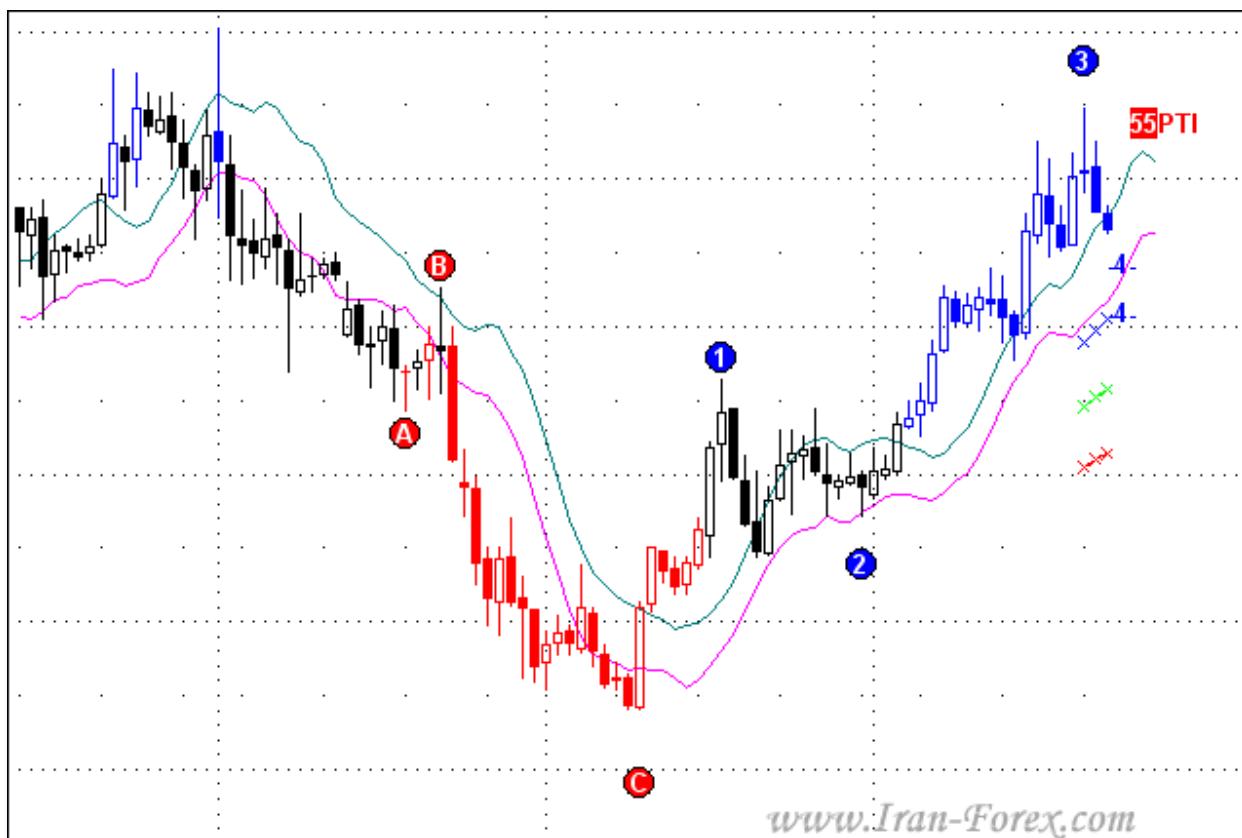
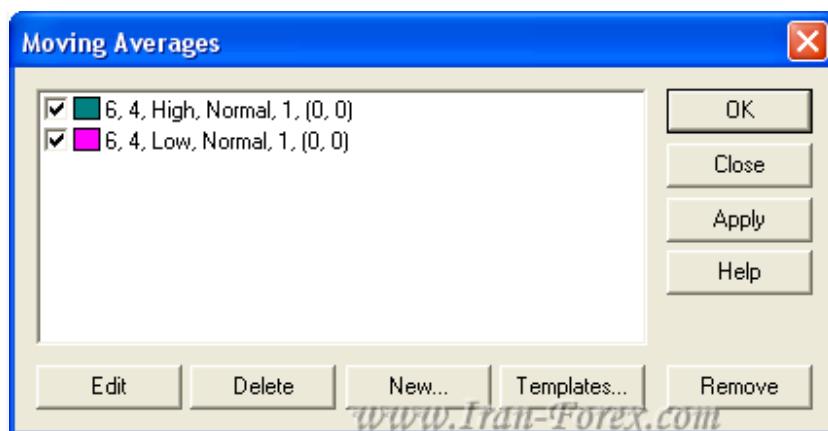


نام آن) DMA (میانگین متوجه جابجا شده) یا Displaced Moving Average است. طبق گفته سازندگان این نرم افزار هدف استفاده از این میانگین متوجه ساده اجراه دادن به بازار برای ادامه مومنتوم است. زمانی که بازار توالی ۵ موج الیوت را تکمیل می کند DMA را قطع خواهد کرد و یک حرکت شدید در خلاف جهت خواهد داشت. در پایان موج پنجم از DMA برای ورود به پوزیشن استفاده خواهیم کرد.

نکته مهم:

DMA فقط برای ورود به پوزیشن در انتهای موج پنجم و در الگوهای مطمئن در پایان موج چهارم طراحی شده است. در مناطق دیگر به هیچ وجه از آن برای ورود استفاده نکنید.

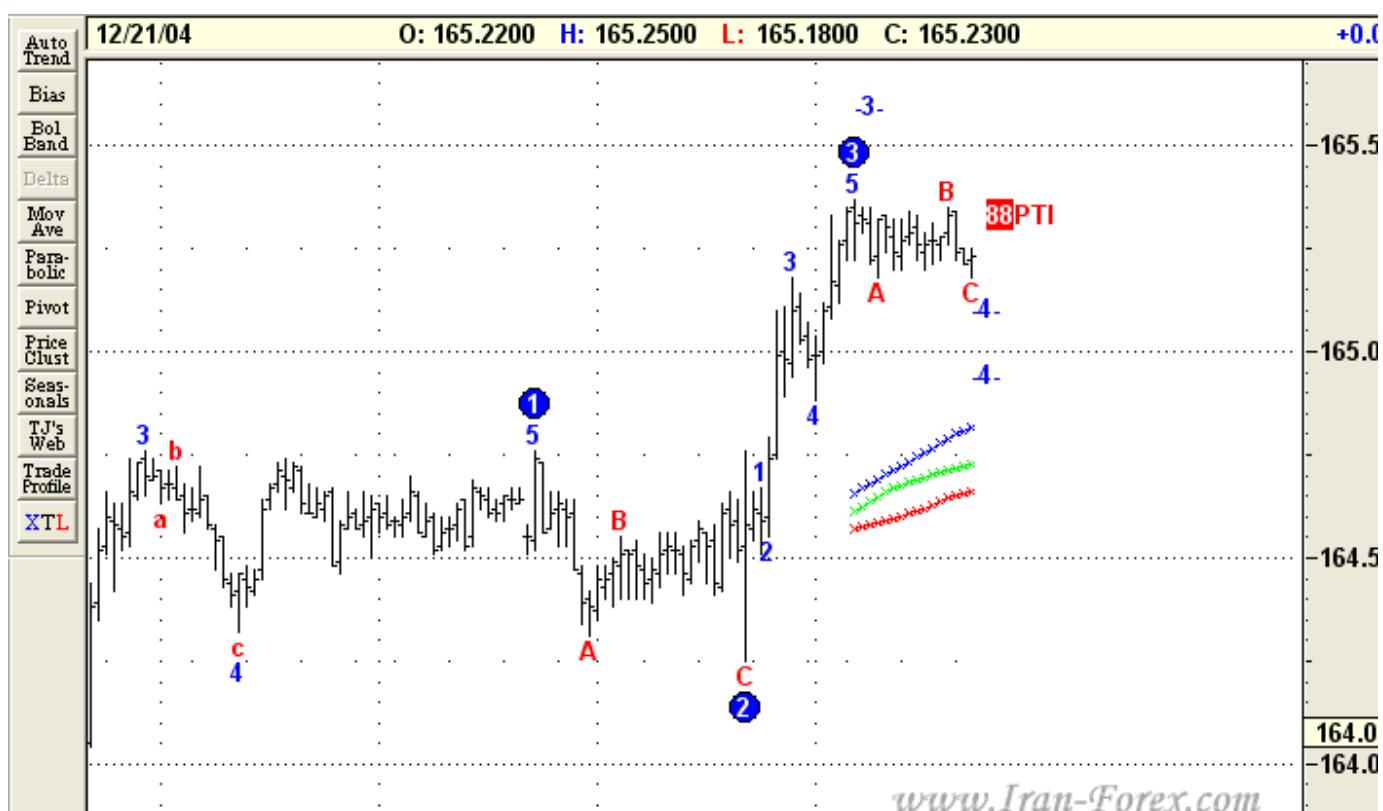
به جای DMA معرفی شده در پست های قبلی از دو DMA با مشخصات زیر استفاده کنید:



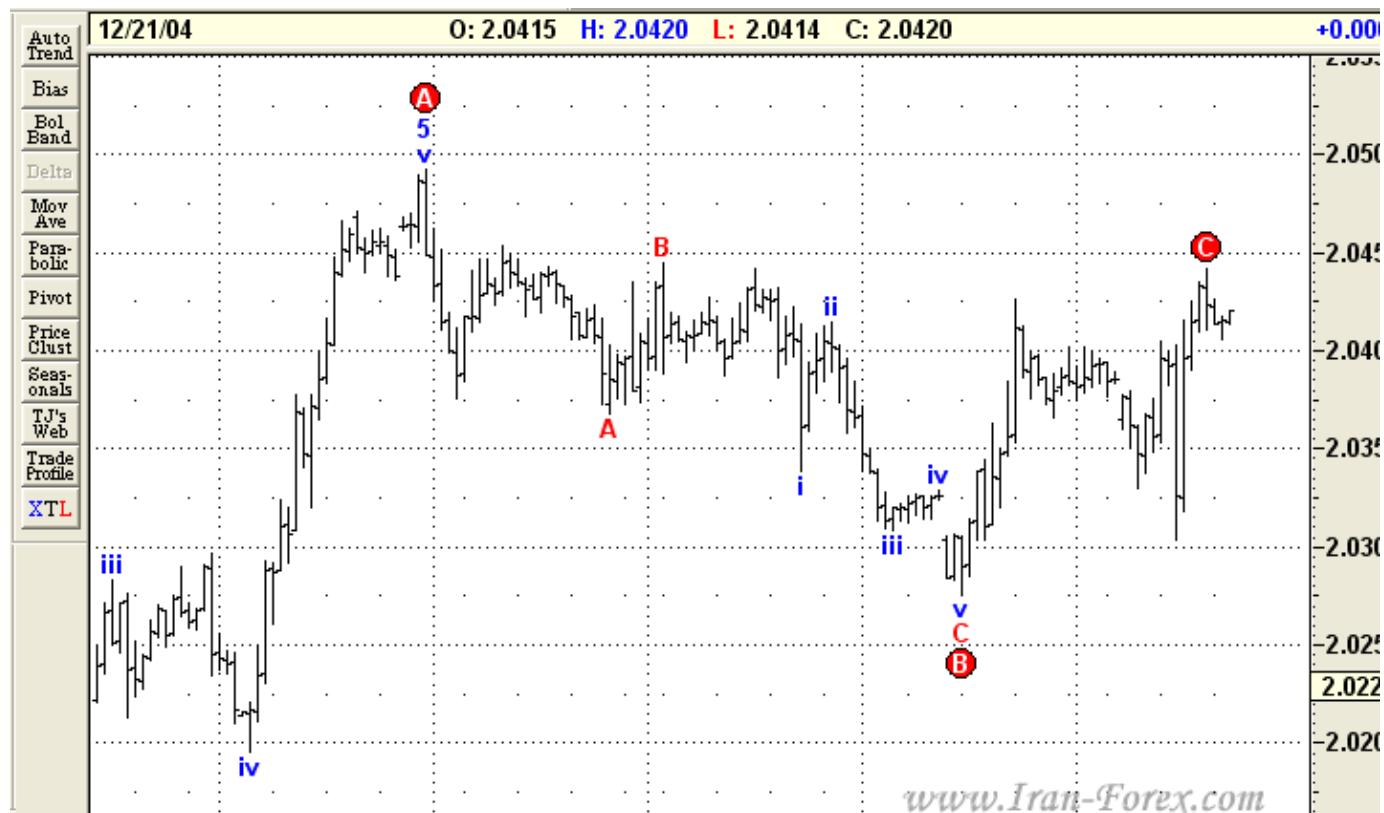
از شکست هر دو DMA جهت تأیید در تریدهای خود بهره بگیرید.

لازم است در اینجا نکته ای را یادآور شوم:

ممکن است بعد از اضافه کردن ابزار امواج الیوت - Elliot Waves - پارامترهای دیگری را نیز همراه آنها ببینید مانند شکل زیر که شامل یک سری خطوط به رنگ های آبی، سبز و قرمز و یک عدد شاخص به نام PTI است که در چارت نشان داده می شوند. در مورد آنها صحبت خواهیم کرد:

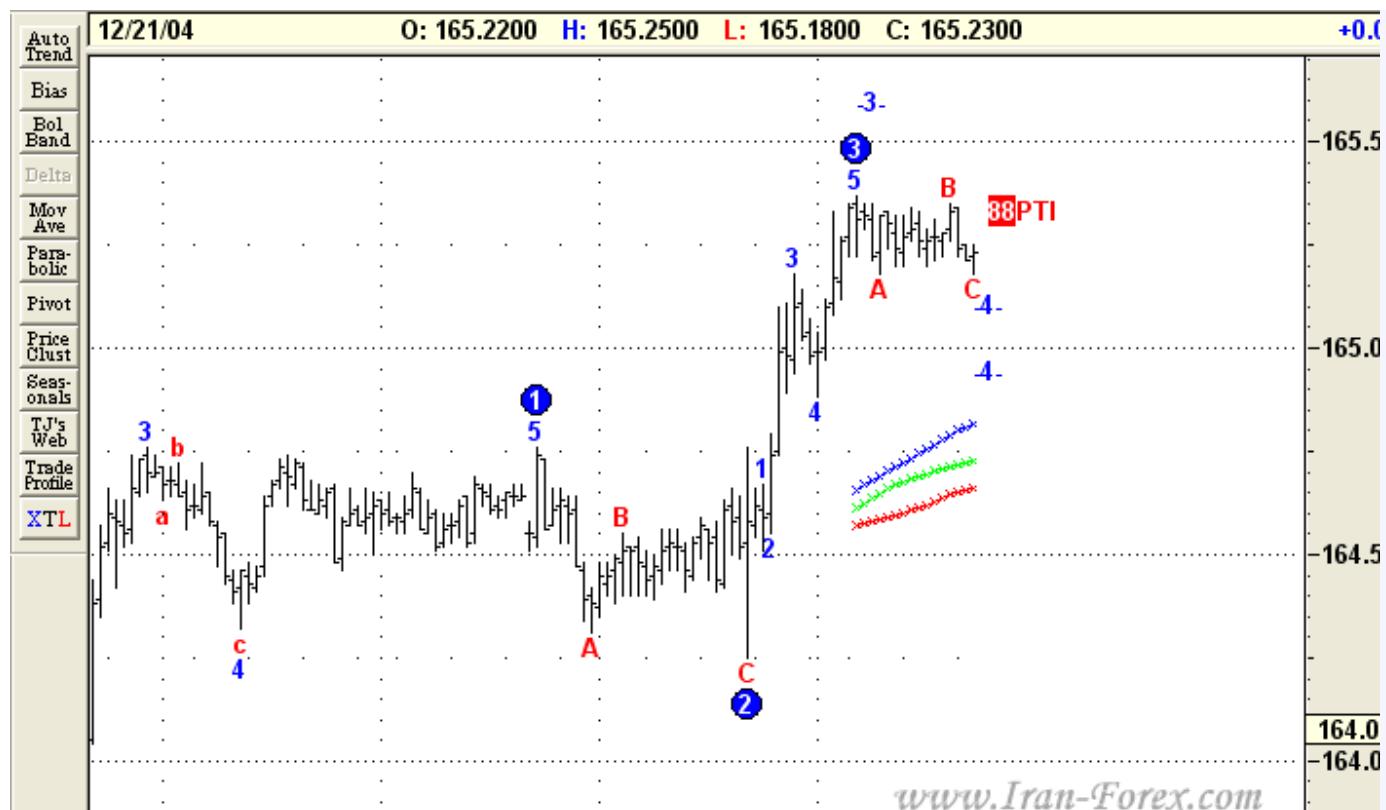


یا مانند شکل زیر به جای عدد، حروف A - B - C با دایره های قرمز رنگ دیده شوند که در مورد آنها نیز صحبت خواهیم کرد:



و کاربرد آن PTI

زمانی که موج سوم ایجاد می شود بر اساس تئوری امواج الیوت باید به دنبال موج چهارم اصلاحی باشیم که به دنبال آن موج پنجم ایجاد می گردد. به شکل زیر دقت کنید:



دیده می شود که نرم افزار تا موج سوم را شماره گذاری کرده و بازار در حال ساخت موج چهارم است. در این زمان پارامتری با رنگ قرمز به نام PTI دیده می شود که مقدار آن در اینجا برابر ۸۸ است. مخفف Profit Taking Index می باشد (شاخص حد سود Momentum Buy ها) و Sell های موج سوم را با موج چهارم مقایسه می کند سپس این مقایسه به الگوریتمی داده می شود که عدد PTI را محاسبه می کند. به طور آماری **اگر عدد PTI بزرگتر از ۳۵ (سی و پنج) باشد بازار تمایل شدیدی دارد که موج پنجم را بسازد**. در این شکل دیده می شود که عدد بدست آمده برابر ۸۸ است که پتانسیل خوبی را برای تشکیل موج پنجم نشان می دهد.

اما در شکل خطوطی نیز به رنگهای آبی، سبز و قرمز دیده می شوند. ما این خطوط را "کanal های موج چهارم" می نامیم.

در یک روند صعودی: **اگر موج چهارم اصلاحی بالای "کanal های موج چهارم" باشد انتظار برای تشکیل موج پنجم زیاد است.**

در یک روند نزولی: اگر موج چهارم اصلاحی پایین "کانال های موج چهارم" باشد انتظار برای تشکیل موج پنجم زیاد است.

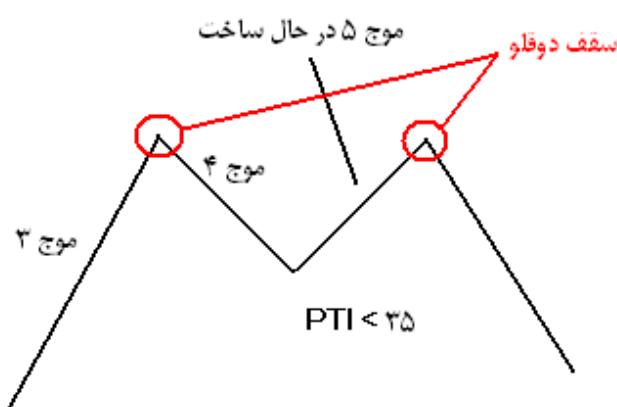
سقف دو قلو - کف دو قلو

تا اینجا با دو نوع اصلی تردید در این نرم افزار آشنا شدیم. حال می خواهیم ۲ موقعیت دیگر را که می توان از آنها نیز برای ورود به پوزیشن استفاده کرد بیان کنیم.

(Double Top)

الگوی سقف دو قلو

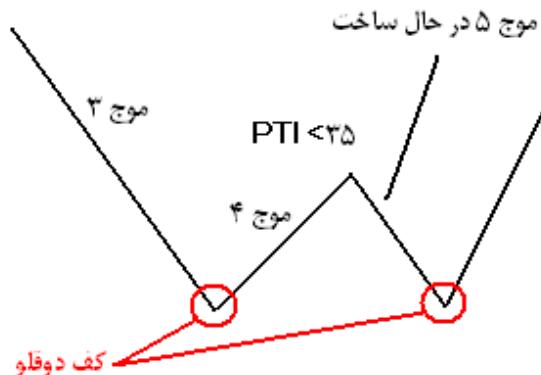
هنگامی که موج چهارم توسط نرم افزار شماره گذاری شده و $PTI < 35$ است دیده می شود که بازار در حال ساخت موج پنجم است. این مقدار برای PTI بدین معنی است که قیمت به هدف اصلی موج پنجم نخواهد رسید. در این حالت احتمال تشکیل سقف دو قلو بسیار زیاد است. هنگامی که قیمت به سقف رسید از شکست DMA برای ورود به یک پوزیشن Sell استفاده کنید.



الگوی کف دو قلو (Double Bottom)

هنگامی که موج چهارم توسط نرم افزار شماره گذاری شده و $PTI < 35$ است دیده می شود که بازار در حال ساخت موج پنجم است. این مقدار برای PTI بدین معنی است که قیمت به هدف اصلی موج پنجم

نخواهد رسید. در این حالت احتمال تشکیل کف دو قلو بسیار زیاد است. هنگامی که قیمت به کف رسید از شکست DMA برای ورود به یک پوزیشن Buy استفاده کنید



پوزیشن گیری یا انواع ترید:

- ترید نوع اول - (Type 1) ورود در انتهای موج چهارم اصلاحی
- ترید نوع دوم - (Type 2) ورود در انتهای موج پنجم.

ترید نوع اول-ورود در انتهای موج ۴ اصلاحی

از نمودار **یک ساعته** جهت ورود استفاده خواهیم کرد که به گفته سازندگان این نرم افزار بهترین تایم فریم برای تشخیص الگوی الیوت است. به مرور زمان از چهار ساعته نیز برای تأیید استفاده می کنیم. از دوستان عزیزم نیز خواهشی دارم و آن اینکه اگر مایل بودند و تصمیم داشتند با شرایطی که از ابتدا بیان می شود همراه بنده پوزیشن بگیرند **حتما از حساب دمو استفاده کنند**. کار ما هنوز تمام نشده است و به تدریج تکمیل خواهد شد و همه نکات یک جا گفته نمی شود. در آخر نیز حتما به جمع بندی خواهیم رسید.

شرایط خرید:

- موج شماره ۳ توسط نرم افزار شماره گذاری شده است.

• **Oscillator** به سمت صفر برگشته است. (نکاتی راجع به این اندیکاتور وجود دارد که در حین کار

توضیح داده می شود

• **PTI** بزرگتر از ۳۵ است.

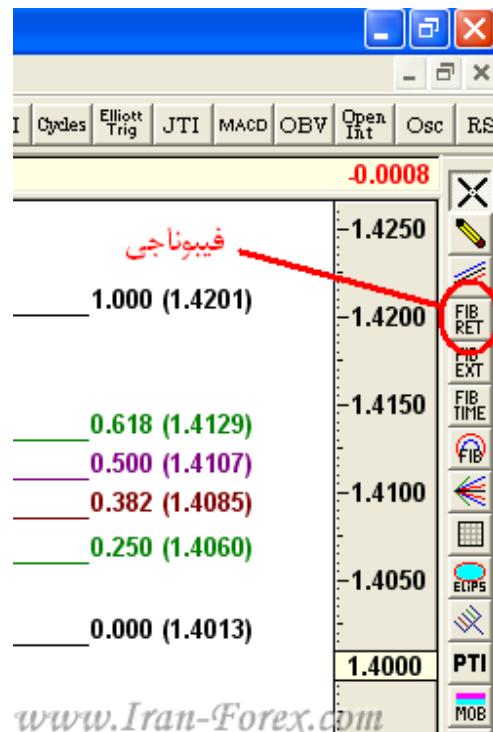
• موج چهارم اصلاحی **بالای** "کانال های موج چهارم" است.

حد سود:

توسط نرم افزار در بالای موج سوم به صورت ۵-۵ شماره گذاری شده است. اگر آن را نمی بینید با موس چارت را جابجا کنید.

حد ضرر:

بوسیله ابزار فیبوناچی که در شکل زیر می بینید سطوح فیبوناچی را از ابتدای موج سوم (پایین ترین نقطه در انتهای موج دوم) تا انتهای موج سوم رسم می کنیم. میزان استاپ لاس دو سطح فیبوناچی پایین تر از نقطه ورود است با کمی فاصله اطمینان. یعنی اگر در سطح $38\% (0.382)$ وارد شدید میزان استاپ لاس کمی پایین تر از سطح $62\% (0.618)$ می باشد. از منوی Tools و انتخاب گزینه Fibonacci Retracement می توانید خطوط فیبوناچی را رسم نمایید:



مثال:



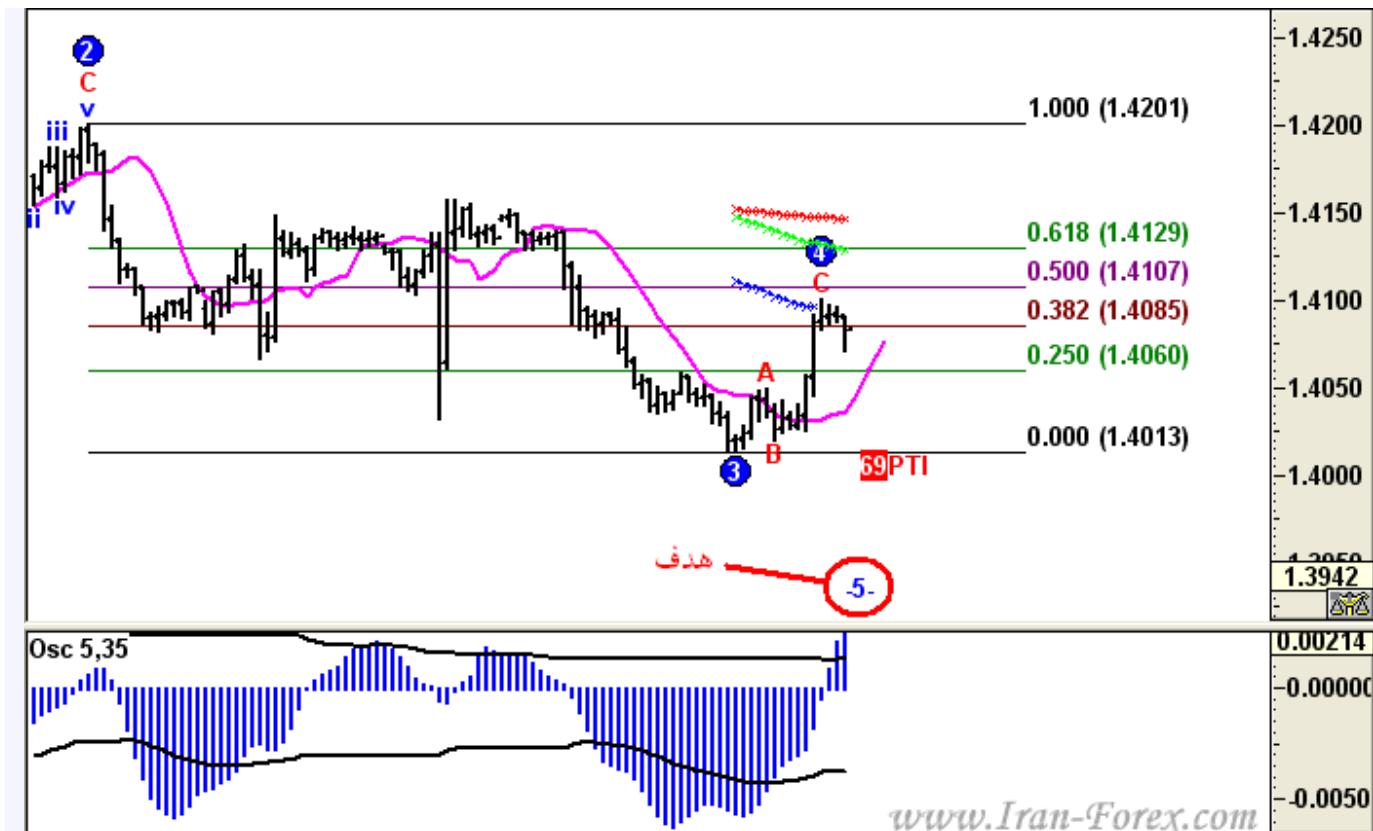
همانطور که در شکل بالا دیده می شود شرایط برای Buy مهیاست. نقطه ورود ۱.۱۸۳۳ می باشد. میزان استاپ لاس را ۱.۱۷۹۰ تعیین می کنیم.

شرایط فروش:

همان شرایط تنها با یک تفاوت:

موج چهارم اصلاحی **پایین** "کanal های موج چهارم" است.

: مثال



همانطور که در شکل بالا دیده می شود شرایط برای Sell مهیا است. نقطه ورود 1.4090 می باشد. میزان استاپ لاس را 1.4135 تعیین می کنیم.

نسبت های فیبوناچی موج چهارم

کم کم خود را برای پوزیشن گیری در شرایط زنده بازار آماده می کنیم . در اینجا نکته ای خدمت شما دوستان عزیز عرض می کنم که می تواند دید نسبتاً مناسبی را در تعیین دقیقتر نقطه ورود و استاپ لاس ترید نوع اول (ترید در انتهای موج چهارم اصلاحی) به ما ارائه دهد:

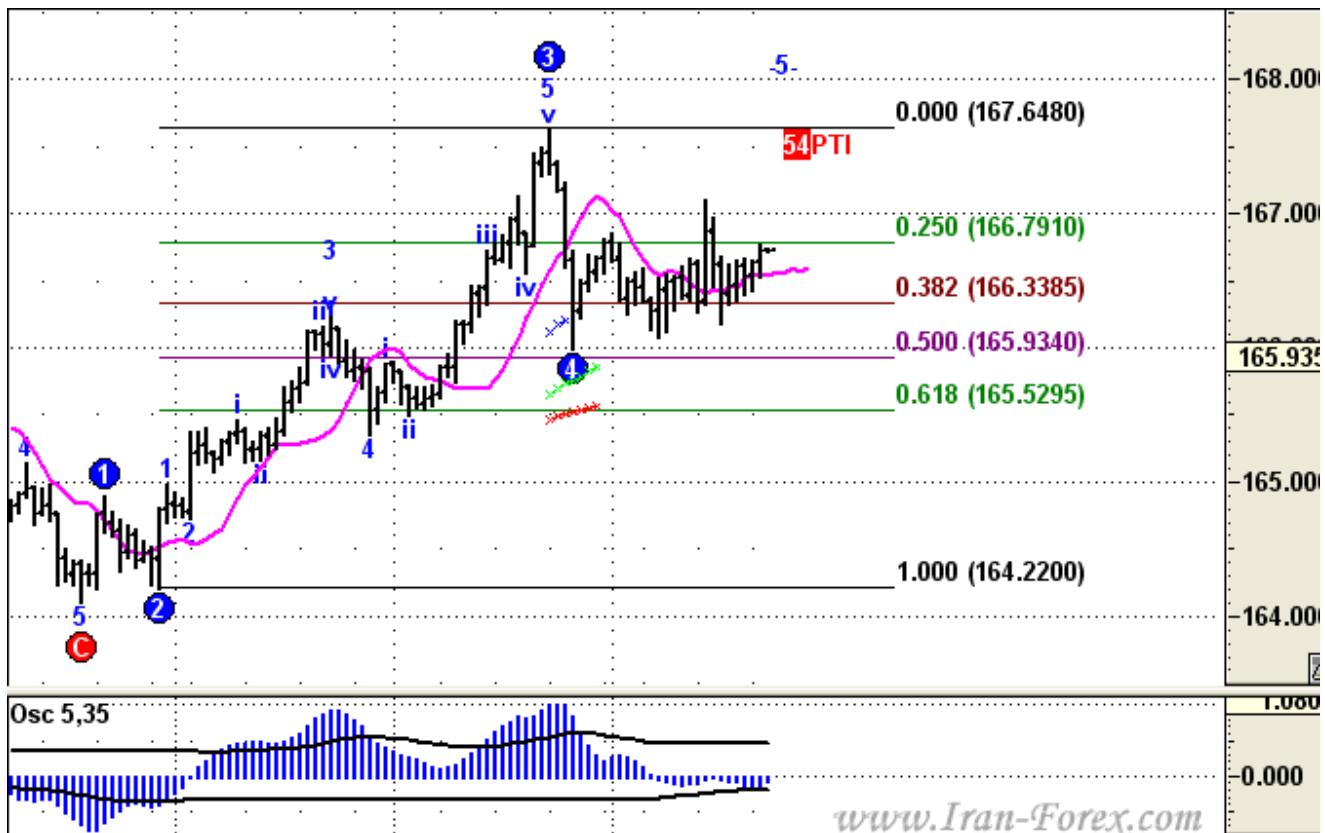
اگر خطوط فیبوناچی را از انتهای موج دوم (اکسترم کندلی که با دایره آبی رنگ شماره ۲ مشخص شده است) تا انتهای موج سوم (اکسترم کندلی که با دایره آبی رنگ شماره ۳ مشخص شده است) رسم کنیم، به لحاظ آماری:

- در ۱۵ درصد موقع، موج چهارم تا بین ۲۴٪ - ۳۰٪ خطوط فیبو بازگشت می کند.
- در ۶۰ درصد موقع، موج چهارم تا بین ۳۰٪ - ۵۰٪ خطوط فیبو بازگشت می کند.
- در ۱۵ درصد موقع، موج چهارم تا بین ۵۰٪ - ۶۲٪ خطوط فیبو بازگشت می کند.
- در ۱۰ درصد موقع، موج چهارم از ۶۲٪ فیبو رد می کند.

تصویر پایین آخرین وضعیت جفت ارز EURJPY در تایم فریم یک ساعته را در پایان بازار هفته گذشته نشان می دهد. همانطور که می بینید موج چهارم تا چند پیپ بالاتر از خط ۵۰٪ فیبو بازگشت کرده است. همچنین:

- موج سوم توسط نرم افزار شماره گذاری شده است.
- Oscillator به سمت صفر برگشته و مقداری نیز در جهت منفی پیشروی کرده است.
- PTI بزرگتر از ۳۵ است.
- موج چهارم بالای "کanal های موج چهارم" است که البته این مورد به اندازه موارد قبلی حیاتی نیست.

با باز شدن بازار می توان با تأیید تایم فریم چهار ساعته وارد یک پوزیشن Buy گردید:



بنده به علت اینکه در هفته گذشته زودتر از این شرایط برقرار شده بود این پوزیشن را گرفته ام که نتیجه را تا بدینجا مشاهده می کنید:

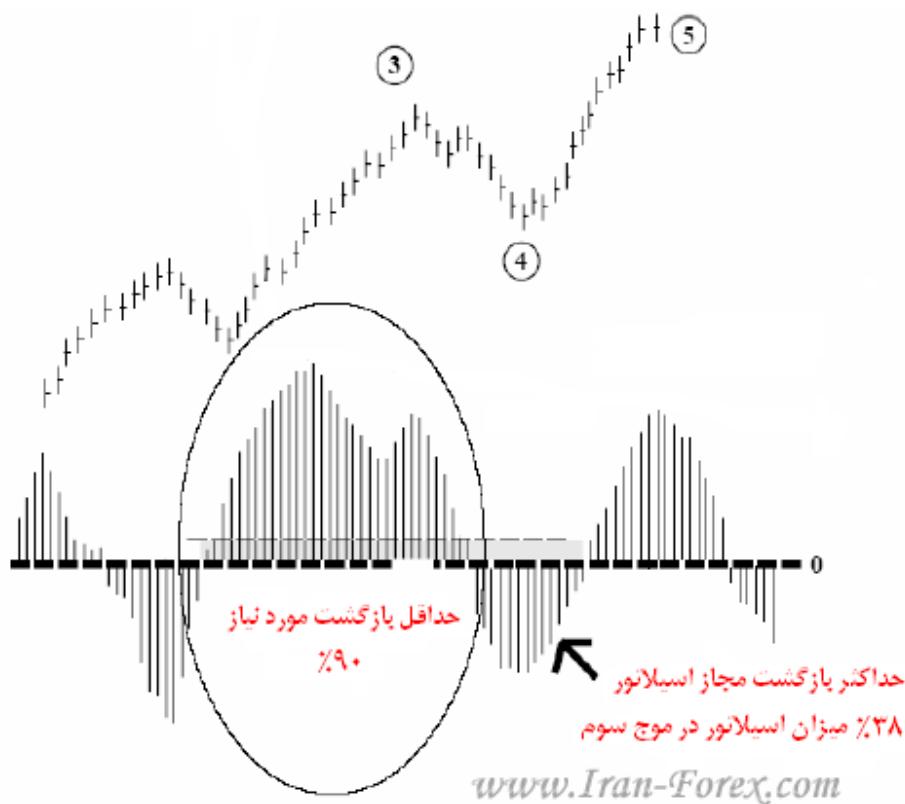
Order	Time	Type	Size	Symbol	Price	S / L	T / P	Price	Swap	Profit
492...	2007.10.12 11:34	buy	0.10	eurjpy	166.36	165.50	167.50	166.73	1.02	31.46

استاپ لاس را هم می توان نقطه ۱۶۵.۹۰ یعنی چند پیپ پایین تر از خط ۵۰٪ درصد فیبو تعیین کرد که خودم برای اطمینان بیشتر زیر خط ۶۲٪ درصد گذاشته ام. حد سود را هم یک هدف کوتاه مدت تعیین کرده ام، یعنی چند پیپ پایین تر از انتهای موج سوم. البته بنده پوزیشن دیگری را نیز با حد سود تعیین شده بوسیله نرم افزار برای موج پنجم باز کرده ام (با چند پیپ پایین تر به عنوان فاصله اطمینان) که صد البته این کار بر روی حساب ریل یا واقعی باید با مدیریت سرمایه انجام شود. درصورت تمایل به گرفتن پوزیشن تا اطمینان کامل لطفا از حساب دمو استفاده کنید.

حداقل بازگشت مورد نیاز و حداکثر بازگشت مجاز برای اسیلاتور در موج چهارم

حداقل بازگشت مورد نیاز و حداکثر بازگشت مجاز برای اسیلاتور در موج چهارم:

حدود ۹۵ درصد موج های چهارم که قادر به ساخت موج پنجم هستند با استفاده از Oscillator قابل شناسایی می باشند. همانطور که گفته شد در ترید نوع اول میزان Oscillator تقریبا باید در نزدیکی های صفر باشد. اگر بخواهیم عمیق تر شویم، Oscillator در این موج ها حداقل به اندازه ۹۰ درصد مقدار اکسترمم (ماکزیمم برای روند صعودی یا مینیمم برای روند نزولی) در موج سوم را بازگشت می کند. از آن طرف، مسئله بسیار مهم دیگر این است که Oscillator نباید بیش از ۳۸ درصد میزان اکسترمم Oscillator در موج سوم را **از سمت دیگر خط صفر** رد کند:



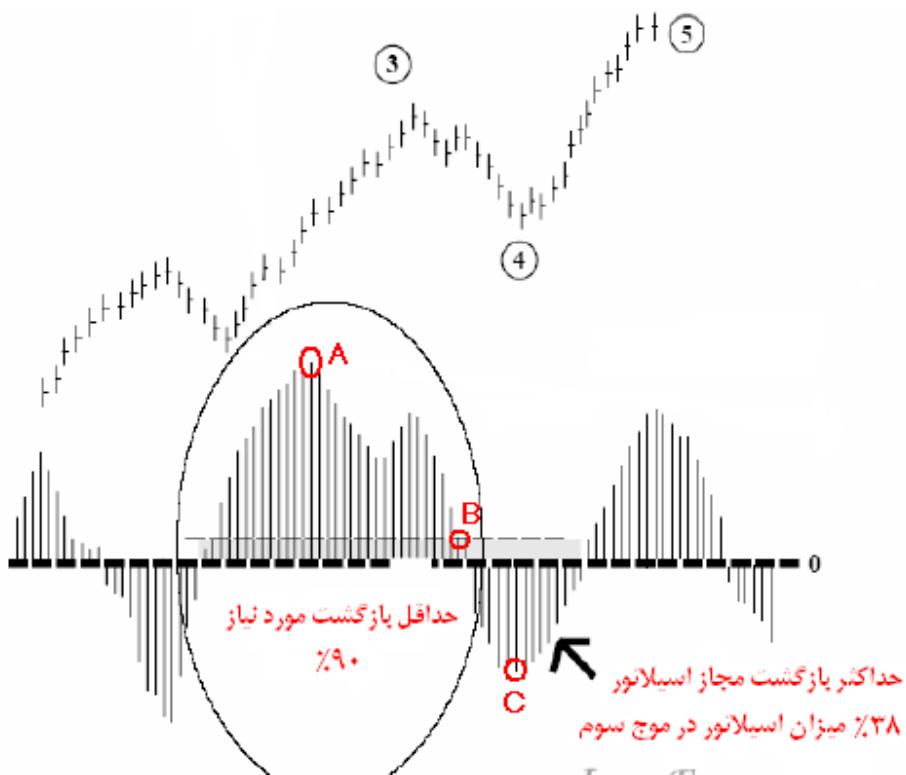
این مطلب را به بیان دیگر شرح می دهم:

شکل زیر را در نظر بگیرید:

نقطه A نقطه ماکزیمم اسیلاتور تا خط صفر برای موج سوم است.

طول نقطه B تا خط صفر برابر ۱۰ درصد طول نقطه A تا خط صفر است.

طول نقطه C تا خط صفر برابر ۳۸ درصد طول نقطه A تا خط صفر است.



اگر به یاد داشته باشید یکی از شروطی که برای ترید نوع اول (ورود در انتهای موج چهارم اصلاحی) باید برقرار باشد اینست که اسیلاتور (Oscillator) به صفر رسیده باشد. در اینجا میزان بازگشت آن را دقیقتر بیان کردیم یعنی گفتیم حداقل مقداری که اسیلاتور لازم است برگردد تا بتوانیم روی آن حساب کنیم برابر با ۹۰ درصد طول نقطه A تا خط صفر است یعنی باید حداقل تا نقطه B پایین بیاید. این از یک طرف. از طرف دیگر گفتیم که نباید بیش از ۳۸ درصد طول نقطه A تا خط صفر در جهت منفی پیش رود. یعنی در شکل، اسیلاتور حداکثر می تواند تا نقطه C پایین بیاید اگر پایینتر آمد دیگر نمی توان روی موج چهارم آن حساب باز کرد.

تعیین میزان بازگشت اسیلاتور در موج ۴ با کمک ابزار FIB EXT

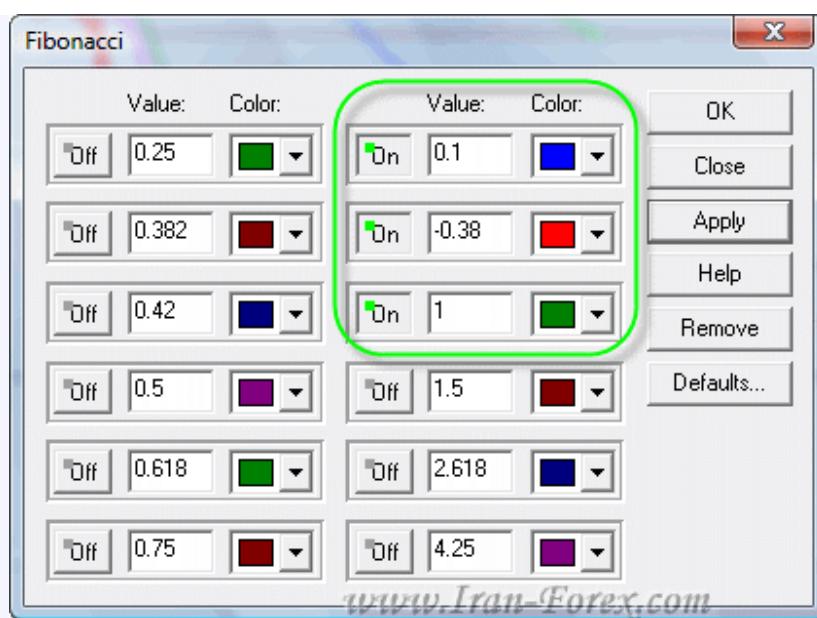
با استفاده از ابزار Fibo Extension موجود در نرم افزار میتوان میزان بازگشت اسیلاتور در موج ۴ را تعیین کرد. حداقل میزان بازگشت اسیلاتور در ترید نوع اول ۰.۹۰٪ (عدد ۱۰۰ مشخص شده در تصویر) از موج ۳ و حداکثر میزان بازگشت اسیلاتور مجاز اسیلاتور ۰.۳۸٪ (عدد ۳۸۰ مشخص شده در تصویر) از میزان نوسان نمای موج ۳ می باشد. مراحل زیر را انجام دهید:



۱- از روی خط پیش فارم اسپلکور قطعه نمایم.
۲- از روی انتقامی هرچهار ۰.۳۸۲ اسپلکور قطعه نمایم.
۳- از روی انتقامی هرچهار ۰.۶۱۸ اسپلکور قطعه نمایم.

www.Iran-Forex.com

برروی یکی از خطوط رایت کلیک کرده و درصدها را مطابق شکل زیر تعیین کنید تا حداقل و حداقل میزان
مجاز نشان داده شوند:



www.Iran-Forex.com

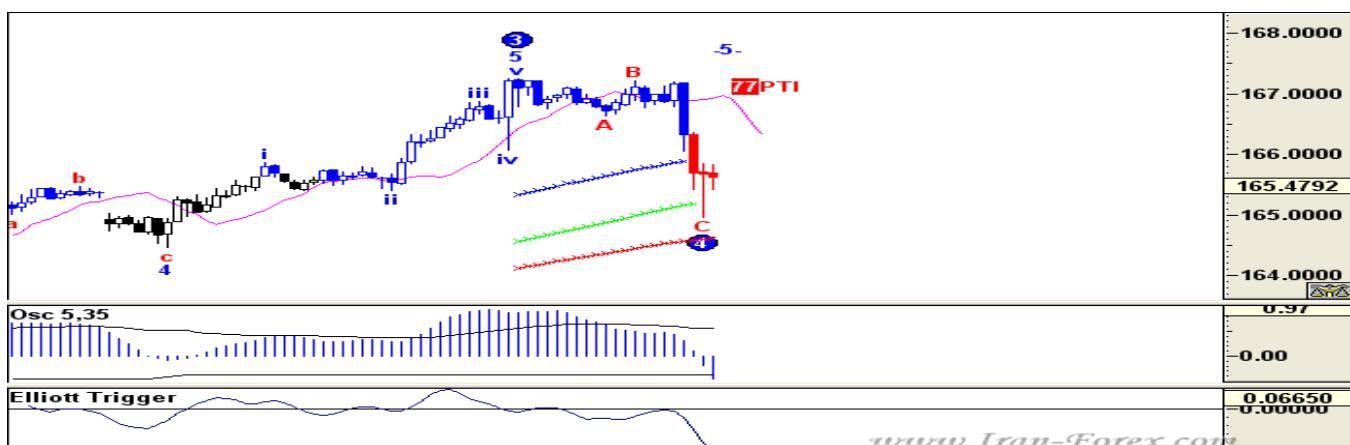
مفهوم کانال های موج چهارم

از لحاظ آماری:

اگر موج چهارم، بالای کanal اول (با رنگ آبی) باشد احتمال اصابت به هدف موج پنجم ۸۰ درصد است.

اگر موج چهارم، بالای کanal دوم (با رنگ سبز) باشد احتمال اصابت به هدف موج پنجم ۶۰ درصد است.

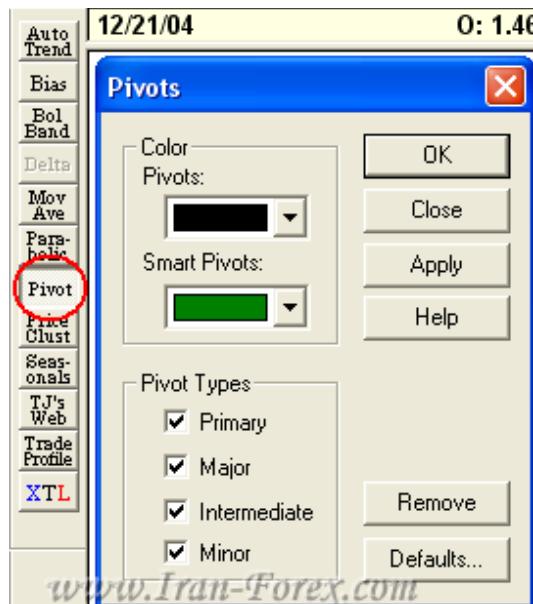
اگر موج چهارم، کanal سوم (با رنگ قرمز) را بشکند احتمال اصابت به هدف موج پنجم بسیار پایین است.



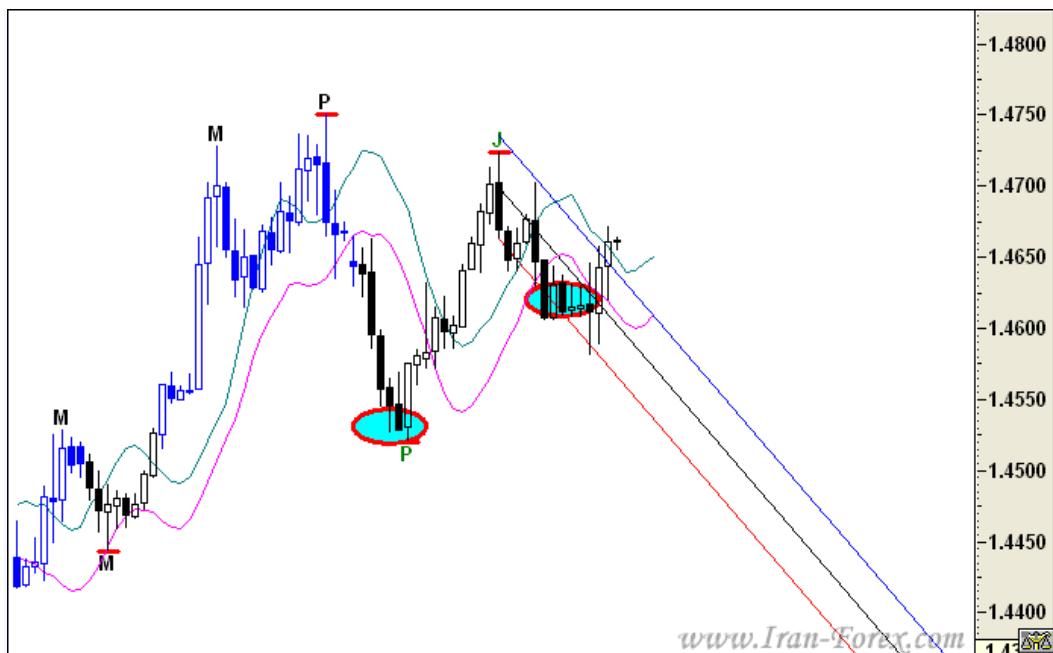
هنگامی که مورد سوم دیده می شود، با توجه به برقرار بودن شرایطی دیگر که توضیح خواهم داد از آلتراتیو ها به عنوان یک ایده دوم استفاده می کنیم. در جاهای دیگر نیز از آلتراتیو ها استفاده می شود که در مورد آنها در پست بعد صحبت خواهم کرد.

Pivot

بر روی ابزار Pivot کلیک و پنجره ظاهر شده را مطابق شکل زیر تنظیم کنید:



بعد از OK حروفی بر روی کندل ها ظاهر می شوند:



از نزدیکترین Low و High که توسط نرم افزار با این حروف نشان داده می شود برای رسم استفاده کنید. با تمرین و آزمون و خطا خودتان می توانید بهترین نقاط را پیدا کنید. Ellipse

برگشت یا شکست MOB=Make or Break



MOB Example

March '03 Daily NY Crude Oil

Thur 3 OCT 2002

Symbol: CL H3,D
Date: 10/03/02
Open 2860
High 2860
Low 2804
Close 2818



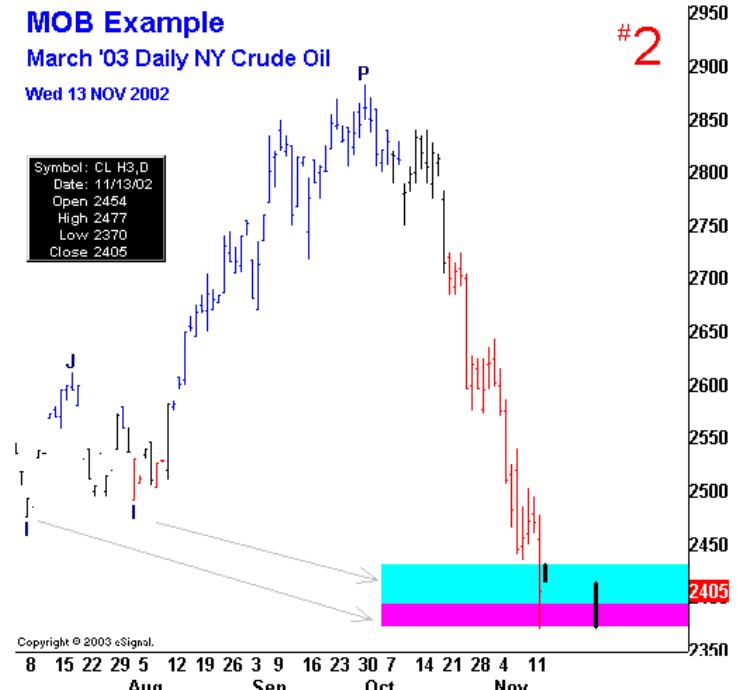
Copyright © 2003 eSignal.
1 8 15 22 29 5 12 19 26 3 9 16 23 30
Jul Aug Sep Oct

MOB Example

March '03 Daily NY Crude Oil

Wed 13 NOV 2002

Symbol: CL H3,D
Date: 11/13/02
Open 2454
High 2477
Low 2370
Close 2405



Copyright © 2003 eSignal.
8 15 22 29 5 12 19 26 3 9 16 23 30 7 14 21 28 4 11
Aug Sep Oct Nov

(CL H3,D) Dynamic, 0:00-24:00

O: 3286 H: 3300 L: 3242 C: 3265 Net: -20

MOB Example

March '03 Daily NY Crude Oil

Thur 23 Jan 2003

Symbol: CL H3,D
Date: 01/24/03
Time: 00:00
Open 3286
High 3300
Low 3242
Close 3265

The MOB can originate from several levels. A very simple approach to Make-Or-Break application is to just focus on Primary and Major pivots. Primary and Major pivots have the greatest odds of holding a price advance. When they do not hold the advance, it is indicative of a still strong trend in progress. The Intermediary and Minor pivots MOB's tend to pause a trend and eventually fail.

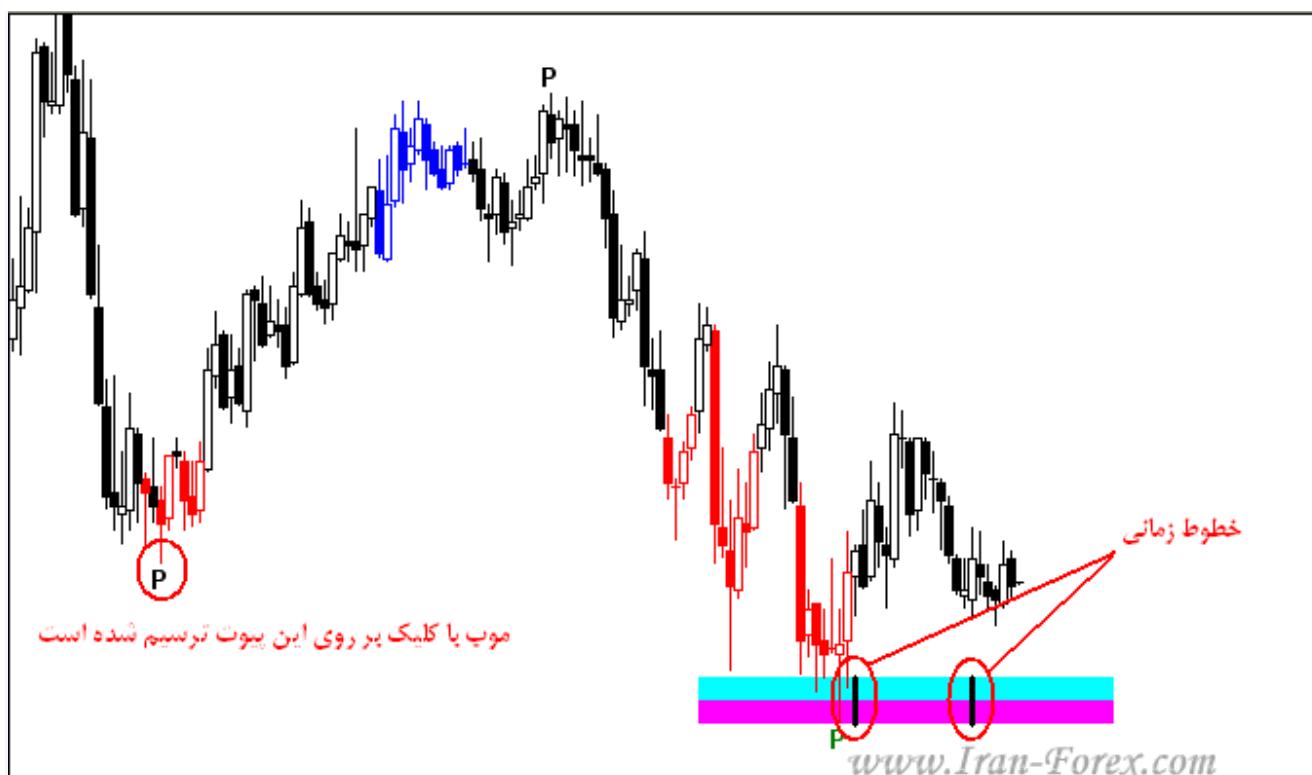


Copyright © 2003 eSignal.
8 15 22 29 5 12 19 26 3 9 16 23 30 7 14 21 28 4 11 18 2 9 16 23 30 6 13 21
Aug Sep Oct Nov Dec 2003 www.Iran-Forex.com

MOB

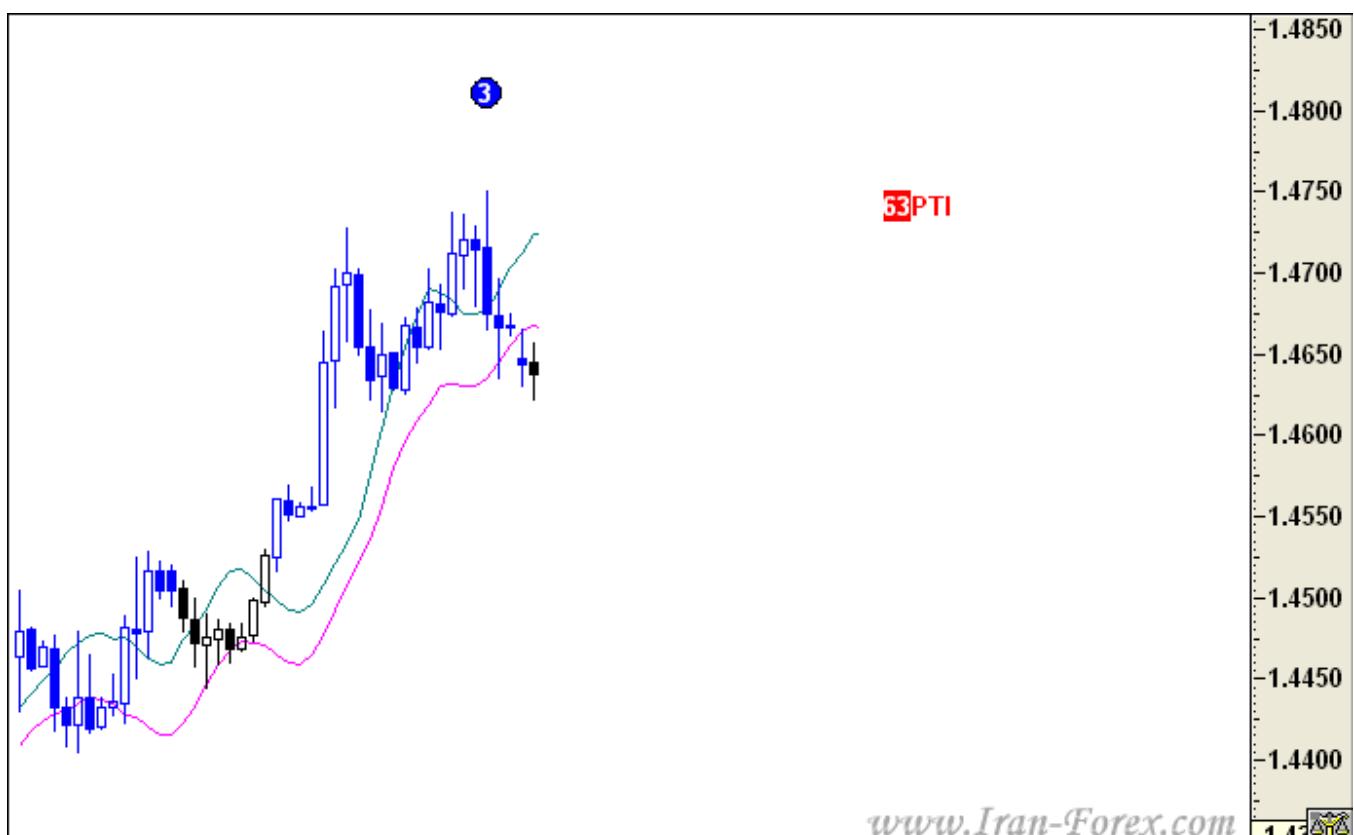
توضیحاتی در مورد ابزار

از ابزار موب برای تعیین سطوح حمایت و مقاومت، و همچنین جهت مشخص کردن تارگت در تریدهای خود استفاده نمایید. قیمت با رسیدن به این سطوح یا برミ گردد و یا با شکست قدرتمند آن به مسیر خود در جهت ترند قبلی ادامه می دهد. به همین دلیل است که آن را شکست یا برگشت می نامند. خطوط سیاه رنگ عمودی که در موب دیده می شود مشخص کننده زمانی است که به احتمال قوی در آن هنگام قیمت به موب خواهد رسید:

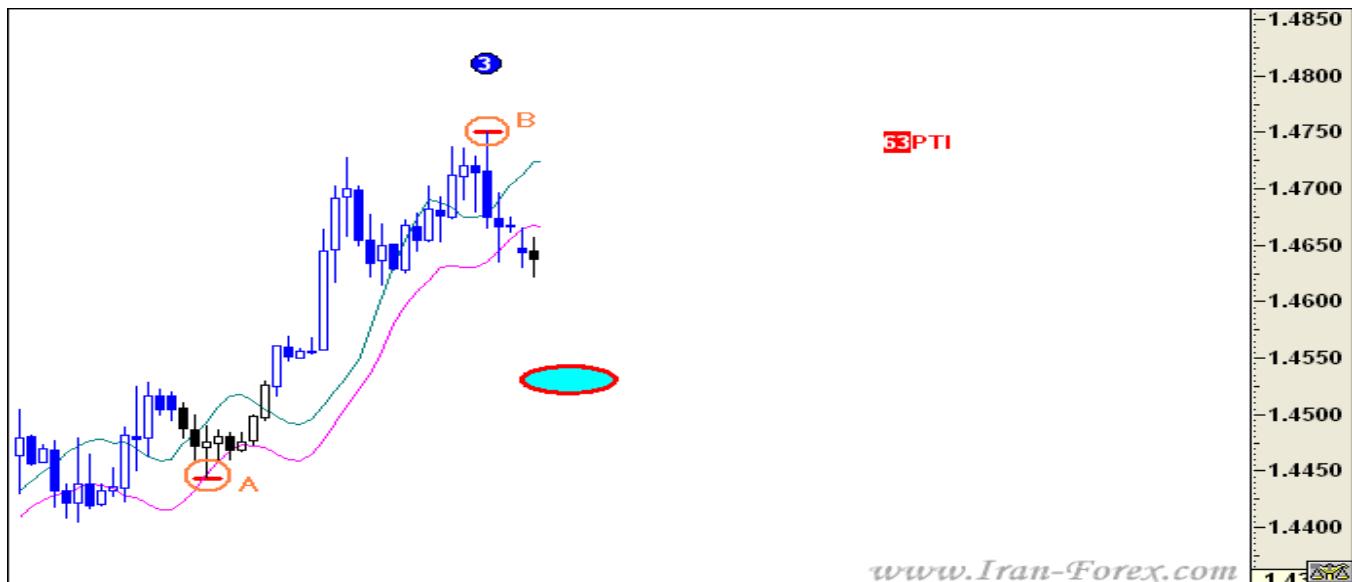


تعیین میزان بازگشت موج چهارم با کمک ابزار TJ's Ellipse

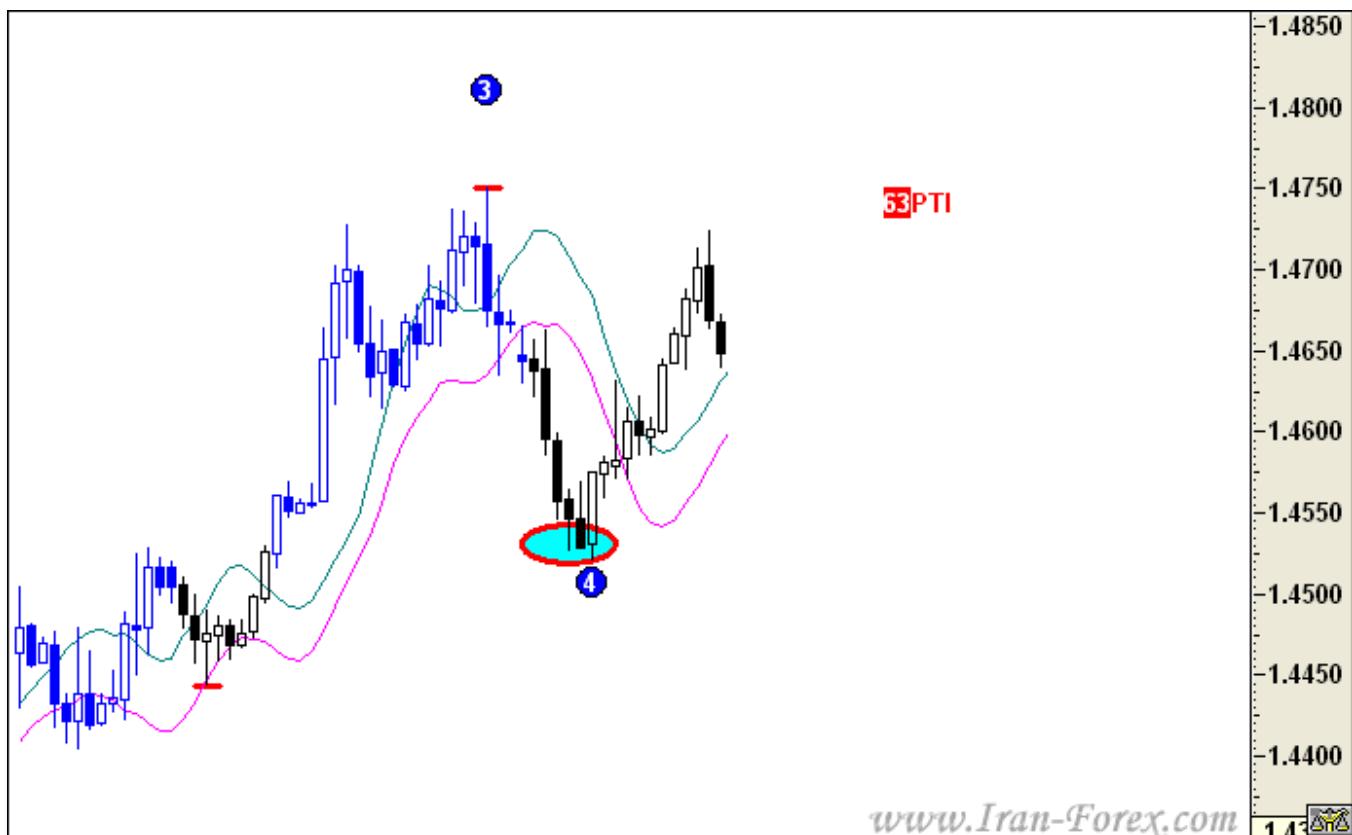
چهار ساعته: EURUSD -



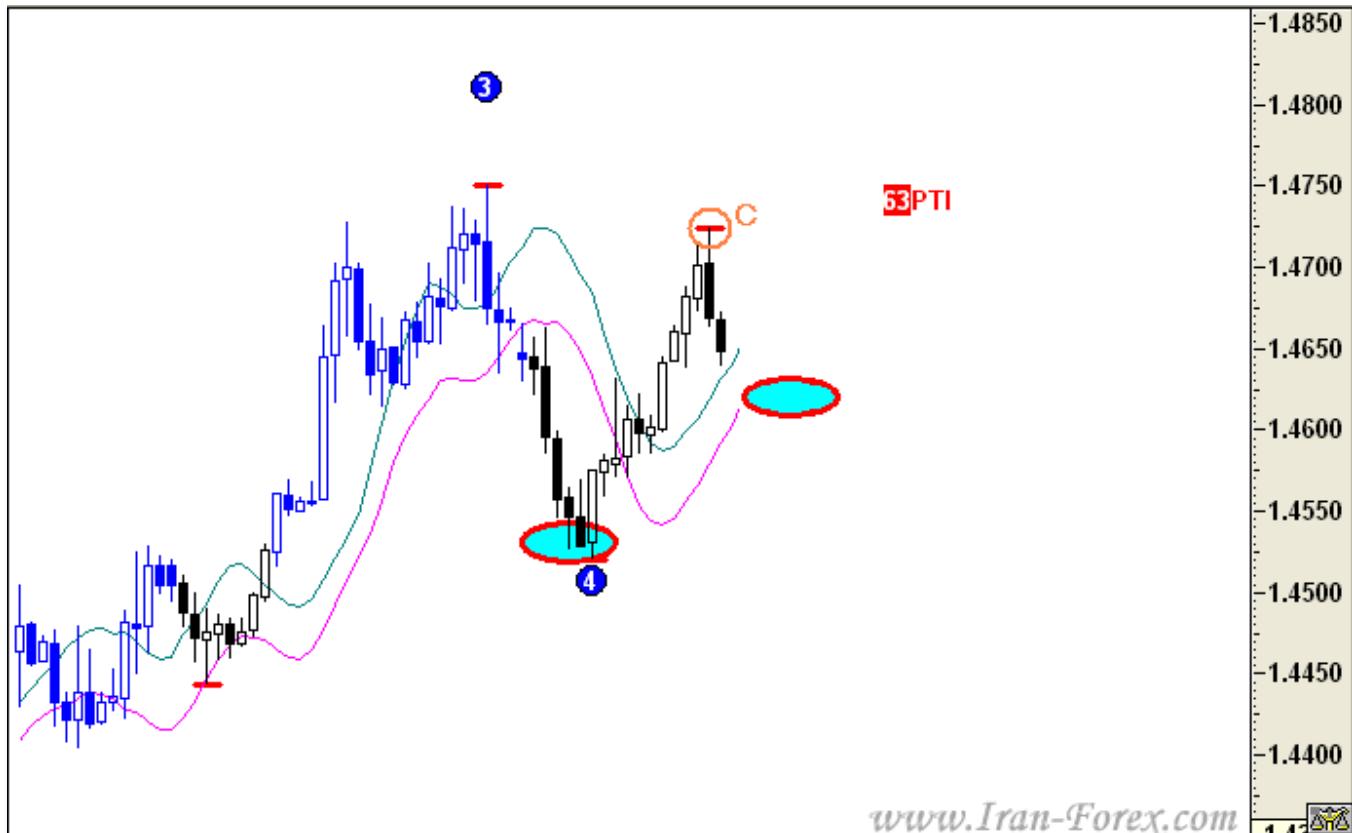
به نظر می رسد موج چهارم آغاز شده است. احتمال می دهد تا کجا پایین بیاید؟ یک راه رسم خطوط فیبوناچی است. ولی احتمال برگشت تا کدام خط بیشتر است؟ قبلًا به صورت کلی در مورد نسبت های فیبوناچی موج چهارم صحبت شده اما موج جاری جزء کدام دسته خواهد بود؟ بوسیله Tools TJ's Ellipse از منوی **A** و پس از آن بر روی نقطه **B** کلیک می کنیم تا بیضی به شکل زیر ظاهر گردد:



پس از چند ساعت:



دیده می شود که موج دوباره در حالت اصلاح قرار گرفته است. مجدداً با TJ's Ellipse ابتدا در انتهای موج چهارم و سپس در نقطه C کلیک می کنیم تا بیضی دیگری ظاهر گردد:



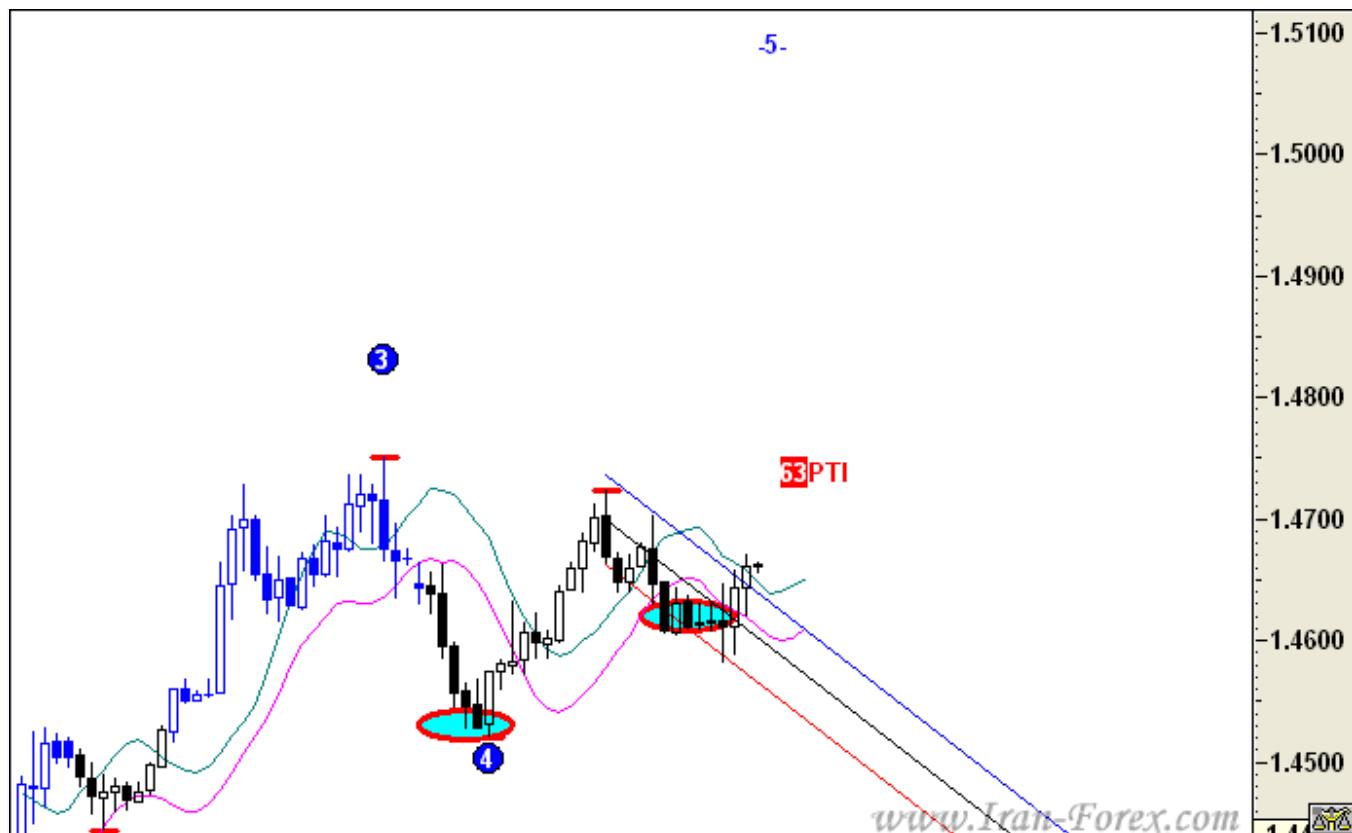
پس از چند ساعت:



ظاهراً موج چهارم که یک موج اصلاحی ترکیبی بوده خاتمه یافته و موج پنجم آغاز شده است.

نکته: ابزار Pivot می تواند شما را در پیدا کردن نقاطی مانند A، B و C که در تصاویر بالا دیدید کمک نماید. در پست بعد راجع به Pivot صحبت خواهم کرد.

در این هفته بر روی این ارز فقط به BUY فکر کنید:



: پیشنهاد

ORDER BUY STOP EURUSD @ 1.4670 TP=400 SL=170

در مورد بیضی نکته ای وجود دارد که در تصاویر داده شده به خوبی رعایت نشده است. در ابتدا که بیضی را رسم می کنید ممکن است محل آن با هدف اصلی تفاوت داشته باشد (در تصویر داده شده پایینتر باشد). اما با حرکت قیمت به سمت پایین، بیضی نیز به سمت بالا حرکت می کند تا در محلی همدیگر را ملاقات نمایند. آن محل، مکانی است که به احتمال قوی تغییر مسیر قیمت در آن رخ خواهد داد. این بیضی بوسیله یک سری

نسبت ها و محاسبات فیبوناچی بین دو پیوت قبلی محاسبه و رسم شده. همچنین خطوط و زوایای گن نیز در ترسیم آن دخالت داشته است.

TJ's Ellipse

نسبتهای فیبوناچی استفاده شده در

نسبتهای فیبوناچی استفاده شده در حلقه های الیپس

Short : %38.2

Normal : %50

Long: %61.8

استفاده از Elliott Trigger برای انتخاب دقیقتر نقطه‌ی ورود در ترید نوع ۱

نقطه‌ی ورود کجاست؟ حتماً این سوال در ذهن شماست که در ترید نوع دوم نقطه ورود کاملاً مشخص است اما در ترید نوع اول چه باید کرد؟ بهترین نقطه ورود کجاست؟ اندیکاتور Elliott Trigger بعد از مهیا شدن تمام شرایط ترید نوع اول، نقطه دقیق ورود را تعیین و خیال ما را آسوده می‌کند. به شکل زیر توجه کنید: نمودار - EURUSD یک ساعته - آخرین وضعیت در ساعات پایانی بازار در هفته گذشته:



تمام شرایط برای یک پوزیشن Buy فراهم شده است:

موج سوم شماره گذاری شده است.

اسیلاتور به صفر رسیده و کمی نیز در جهت منفی حرکت کرده است.

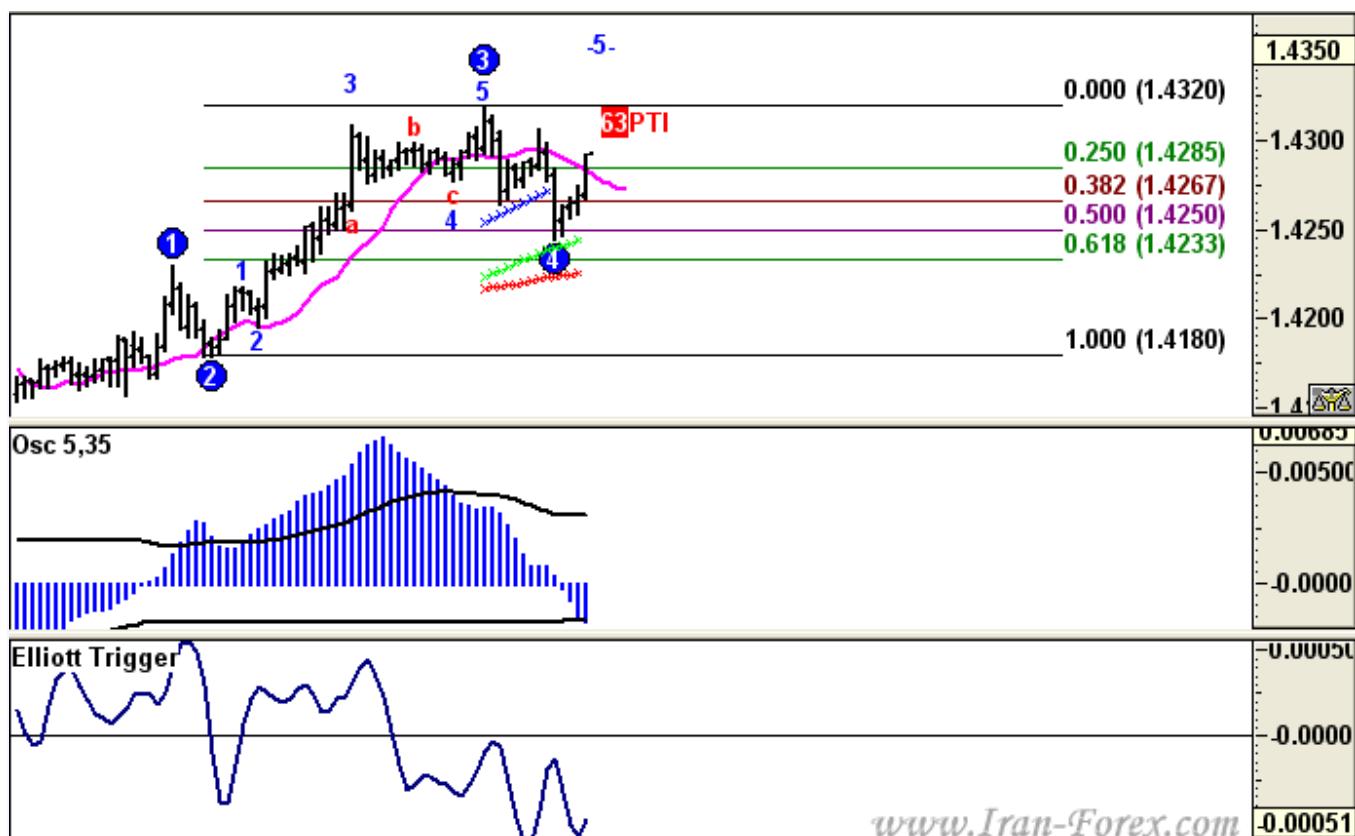
بزرگتر از ۳۵ PTI است.

موج چهارم بالای "کانال های موج چهارم" است.

تایم فریم چهار ساعته نیز در حال تشکیل موج پنجم می باشد و صعودی است.

از منوی Studies زیرمنوی Elliott Trigger را انتخاب کنید (با راست کلیک بر روی نمودار هم می توانید).

شکل زیر را خواهید داشت:

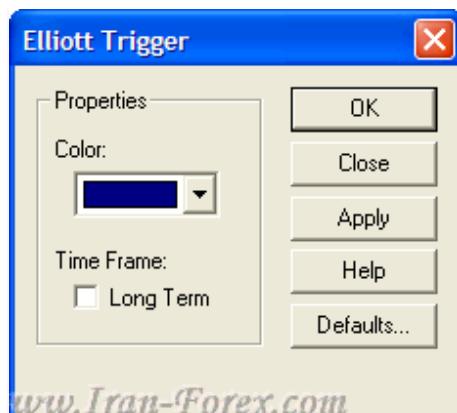


با خیال آسوده صبر کنید تا اندیکاتور Elliott Trigger که هم اکنون زیر صفر است به خط صفر رسیده و آن را به سمت بالا قطع کند. به محض قطع شدن خط صفر در Open کندل بعد وارد می شویم. بدیهی است که برای روند نزولی، این اندیکاتور باید خط صفر را از بالا به سمت پایین قطع کند.

همانطور که قبل‌گفته شده از ابزار الیوت تریگر برای اطمینان از اتمام موج ۴ استفاده می کنیم .

توضیحات مربوط به تنظیمات این ابزار:

برروی الیوت تریگر رایت کلیک کنید و به بخش Properties بروید.



با استفاده از Color میتوانید رنگ مربوط به اندیکاتور را تغییر دهید.
از گزینه‌ی Long Term فقط زمانی استفاده کنید که از شمارش Alternative3 آلتريناطيو ۳ و اسيلاتور ۱۰,۷۰ استفاده می کنید. دو نمونه از موارد استفاده از الیوت تریگر بصورت آنیمیشن:

NZDUSD240-Type 1 Buy

GBPUSD240-Alt3-Type 1 Buy

ترید نوع دوم - (Type 2) ورود در انتهای موج پنجم:

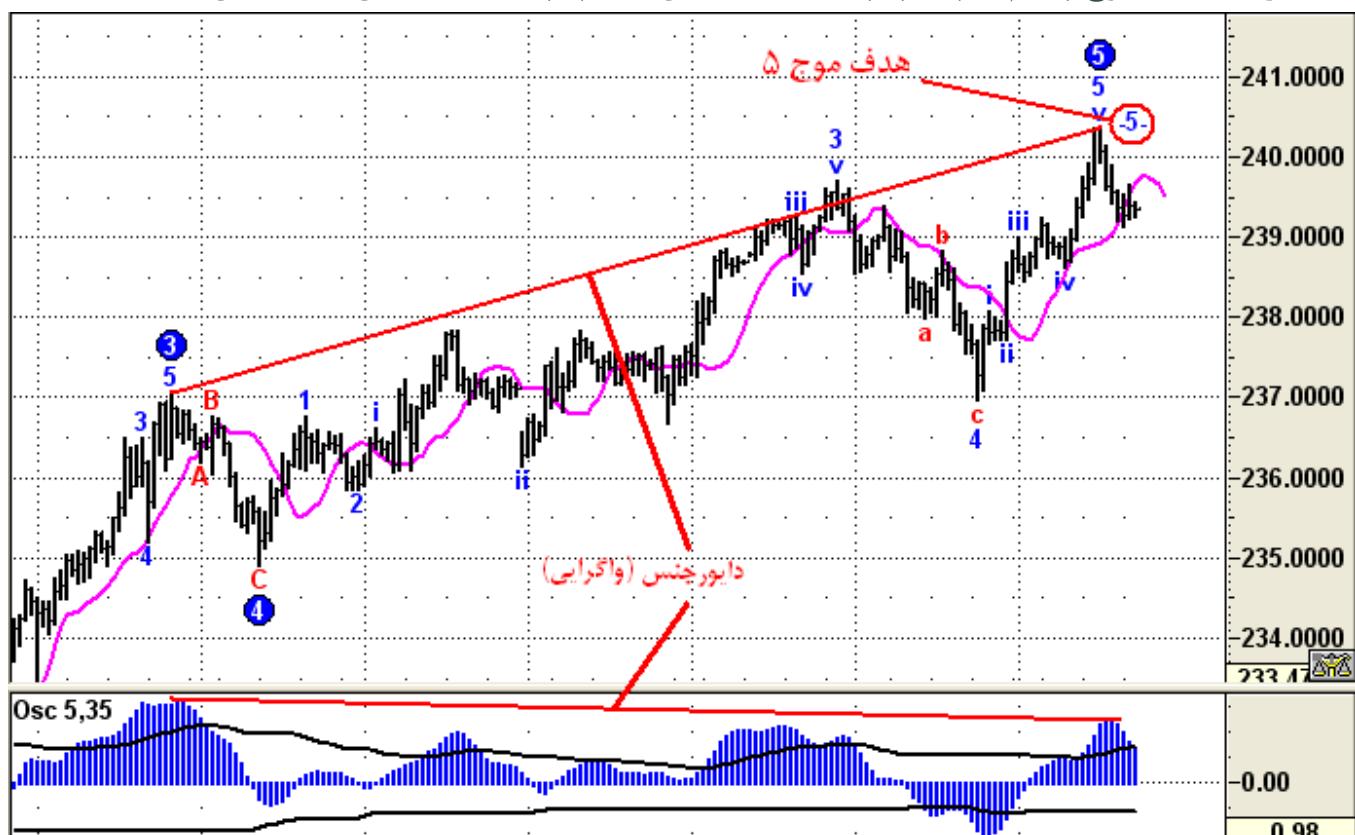
شرایط فروش:

قیمت در نزدیکی هدف موج پنجم است (هدف پیش بینی شده توسط نرم افزار).) High 2- Oscillator موج سوم و High 2- Oscillator موج پنجم یک دایورجنس را نشان می دهد و به سمت صفر در حال حرکت است. به محض شکست Open DMA کندل بعد وارد می شویم.

حد سود:

اولین هدف انتهای موج چهارم (یعنی جایی که دایره آبی رنگ شماره ۴ را می بینید) می باشد. از خطوط فیبوناچی که بین انتهای موج چهارم و انتهای موج پنجم رسم می کنید نیز می توانید به عنوان اهداف کوتاه مدت استفاده کنید .پیشنهاد بندۀ خطوط فیبوناچی است.

حد ضرر High: موج پنجم با چند پیپ فاصله اطمینان (۱۰ پیپ فاصله ایده آل است. مثال:



سایر ابزارها

AGET Auto-Open/Close با AdvancedGet

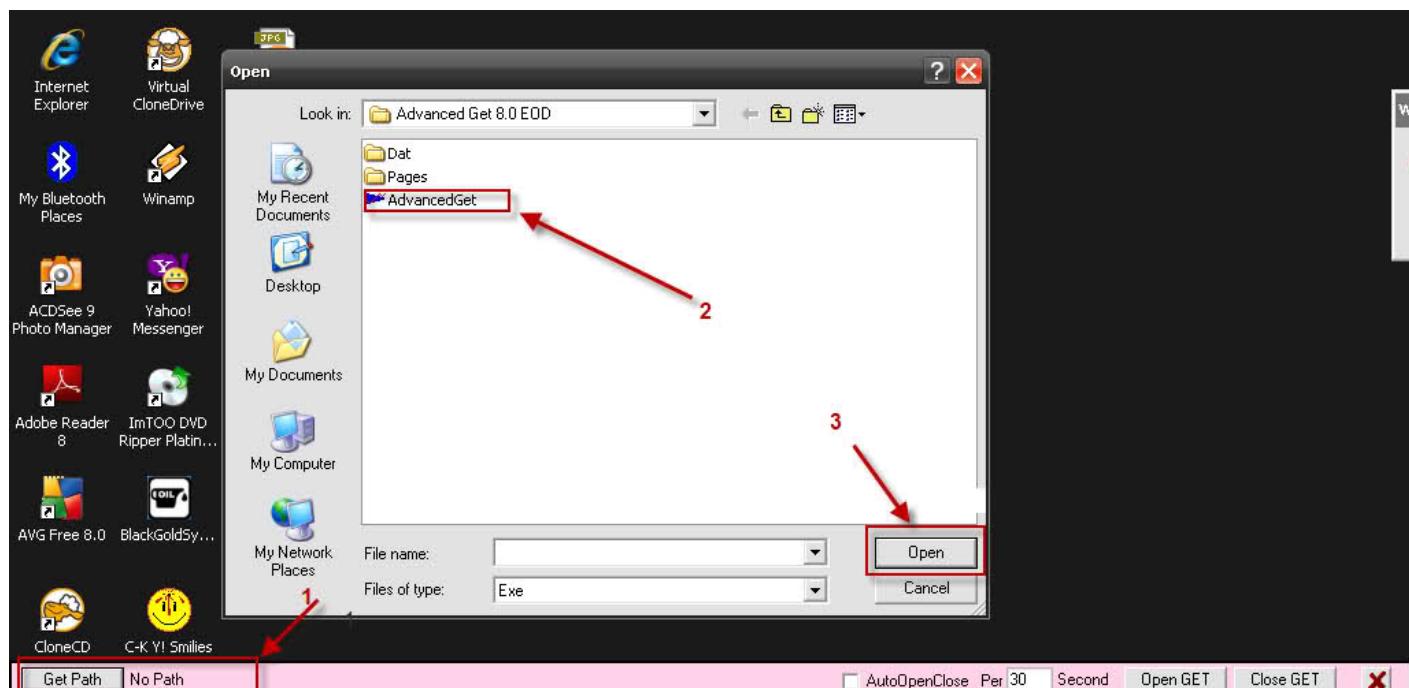
برنامه ای برای راحتی همه دوستانی که در تایم فریمها پایین در AGET کار میکنند و دیگه لازم نیست AGET را مدام باز و بسته کنید.

این برنامه به صورت خودکار برنامه AGET را باز و بسته میکند. کافیست تایم مورد نظر برای بازبسته شدن AGET را به این نرم افزار بدهید.

پس از دانلود و Extract ، برنامه را اجرا کنید:

بعد از اجرای نرم افزار بروی Get Path کلیک کنید و آدرس فایل اجرایی AGET را به آن بدهید. توجه داشته باشید که برای باز و بسته شدن اتوماتیک AGET ، نام فایل اجرایی نرم افزار ادونسدگت باید AdvancedGet.exe باشد. اگر اینطور نیست فایل راRename کرده و به AdvancedGet.exe تغییر دهید.

مراحل زیر به ترتیب انجام دهید:



بعد از انتخاب آدرس آن را مشاهده خواهید کرد: درنهایت مدت زمانی را که میخواهید AGET بعد ابه صورت اتوماتیک بازوسته شود برحسب ثانیه وارد کرده و بعد گزینه AutoOpenClose را فعال کنید. پس از کلیک برروی Open GET نرم افزار AutoOpenClose باز میشود. در صورتی که نایم فایل را به درستی به AdvancedGet.exe تغییر داده باشید با کلیک برروی Close نرم افزار AGET بسته میشود.

کanal رگرسیون ترند

ابزارهای ساده دیگری در Advanced GET وجود دارند که بنا به تشخیص خود می توانید از آنها برای تأیید استفاده کنید. یکی از آنها کanal رگرسیون ترند می باشد که با ابزار AutoTrend در نرم افزار به طور اتوماتیک رسم می شود و به طور اتوماتیک نیز خود را اصلاح می کند. هنگامی که یک روند در یک جهت خاص شروع می شود قیمت تمایل دارد که در این کanal بماند و بین خطوط بالایی و پایینی آن نوسان کند. شکسته شدن کanal نشان دهنده پایان روند است. در موارد زیر می توانیم از این ابزار استفاده کنیم:

- مشخص کردن پایان موج دوم و ورود در ابتدای موج سوم.
 - خروج از معامله در موج سوم به محض شکسته شدن کanal.
 - جهت تأیید برای ورود در انتهای موج چهارم (ترید نوع اول .) خروج از معامله موج پنجم در صورت شکسته شدن کanal و تأییدی برای ورود به معامله در جهت مخالف (ترید نوع دوم.)
- با کلیک بر روی دکمه نشان داده شده و زدن OK در پنجره ظاهر شده کanal رگرسیون ترند به طور اتوماتیک رسم می شوند:

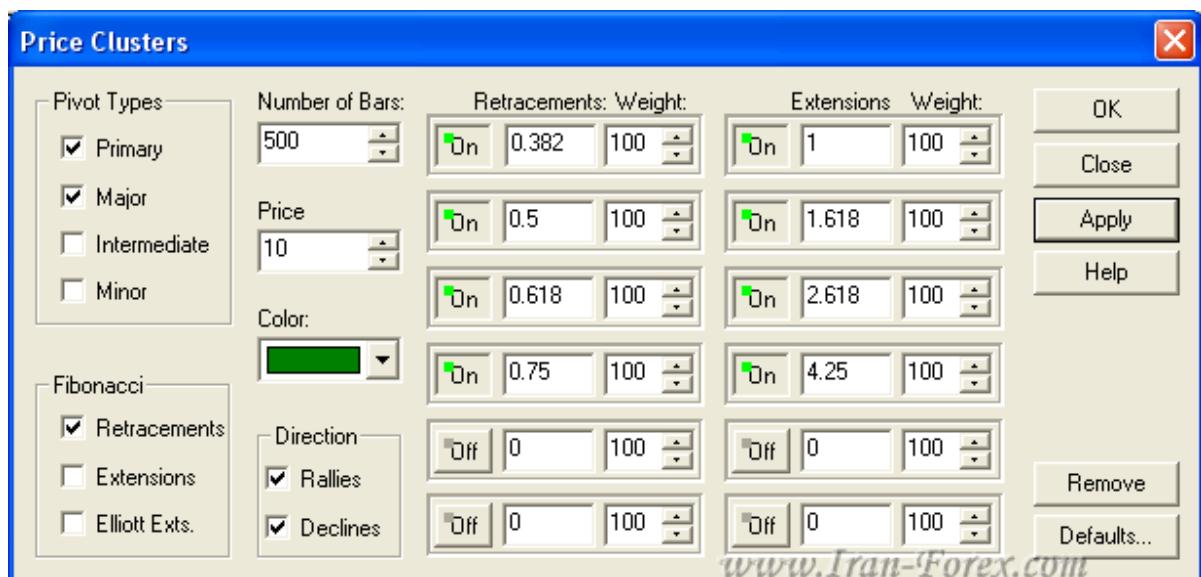


Price Clusters

تا به حال با روش های مختلفی برای اطمینان از پایان موج چهارم آشنا شده ایم. یکی دیگر از این روش ها استفاده از ابزار **Price Clusters** است که قبلا در تاپیک سیگنالها با نمونه ای از آن در نمودار GBPUSD آشنا شدید. از این ابزار جهت تأیید در سایر استراتژی های خود نیز می توانید بهره بگیرید. چارت زیر نمودار یک ساعته AUDUSD را در موقعیت خرید نوع اول نشان می دهد:



با کلیک بر روی ابزار پرایس کلاستر پنجره ای باز می شود که در آن تنظیمات گوناگونی وجود دارد. در صورتی که بخواهید تنها مقاومت های قیمت را ببینید در قسمت Fibonacci فقط عبارت Retracements را تیک بزنید:



بعد از کلیک دکمه OK نمودار به شکل زیر در می آید:



بلندترین نوار سبزرنگ یا کمی پایینتر از آن قویترین مقاومت (خط حمایت) را برای موج چهارم نشان می دهد. از ترکیب این نوار با خطوط فیبوناچی می توانید به نتایج بهتری در تعیین نقطه احتمالی بازگشت قیمت دست پیدا کنید.

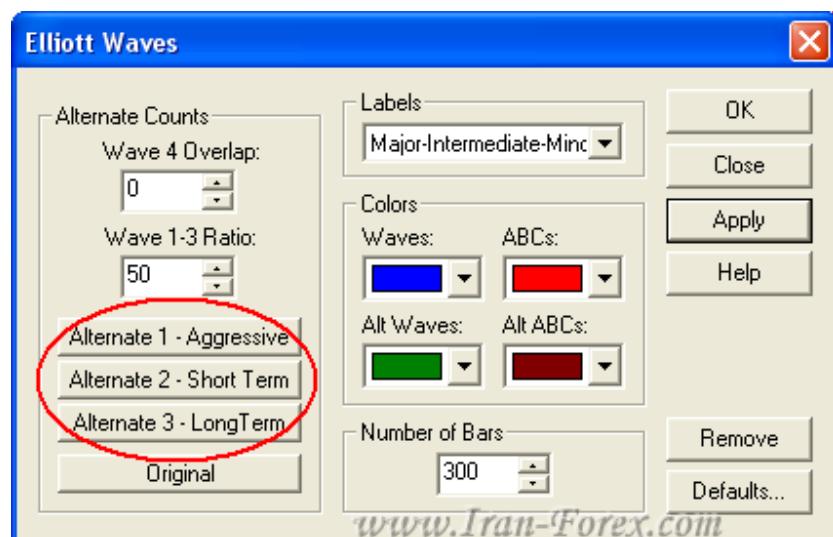
Trade Profile

یکی دیگر از امکانات نرم افزار قابلیت تشخیص سطوح خرید یا فروش در گذشته با توجه به میزان حجم معاملاتی صورت گرفته یا Volume می باشد. این سطوح بوسیله نوارهای آبی رنگ (Buy Zone) و قرمز رنگ (Sell Zone) نشان داده می شوند. انتظار می رود که قیمت با رسیدن به این سطوح عکس العمل نشان داده و مطابق با رنگ نوار عمل نماید بدین معنی که با رسیدن به نوار آبی به سمت بالا و با رسیدن به نوار قرمز به سمت پایین حرکت کند. هر مقدار که این نوارها ضخیم تر و بلندتر باشند قدرت بیشتر آنها را نشان می دهد. با استفاده از این ابزار می توانید برای تعیین نقطه ورود به یک پوزیشن یا تعیین استاپ لاس تأیید بیشتری بگیرید. به گفته طراحان، این قابلیت جدای از به کارگیری در استراتژی های نرم افزار در ۶۰ درصد موارد جوابگوست.



آلترناتیووها

با کلیک راست بر روی چارت و انتخاب Elliott Waves پنجره ای به شکل زیر ظاهر می شود:



در قسمتی که با دایره قرمز رنگ می بینید سه دکمه وجود دارد:

1- Alternate 1 – Aggressive : بعضی مواقع اسیلاتور مدت زیادی را در زیر صفر (برای روند صعودی) یا بالای صفر (برای روند نزولی) می ماند که گاهاً با شکسته شدن کanal قرمز رنگ، افت شدید PTI و رد شدن اسیلاتور از ۳۸ درصد اکسترمم اسیلاتور در موج سوم همراه است. در این گونه موارد از این آلترا ناتیو به عنوان یک ایده دوم برای شماره گذاری امواج استفاده کرده و بر اساس آن ترید کنید.

2- Alternate 2 – Short Term : برای تشخیص ریز موج ها در یک موج بزرگتر به کار می رود. به عنوان مثال این امر در شکار موج سوم ما را یاری می کند.

3- Alternate 3 – Long Term : تکمیل می شود ممکن است برای برگشت قیمت حرکات اصلاحی بوجود آید. در این گونه موارد دایره های قرمز رنگ A ، B و C دیده می شوند. در این شرایط از این آلترا ناتیو به عنوان ایده دوم استفاده نمایید.

دکمه آخر هم Original و یا حالت اصلی و پیش فرض نرم افزار برای شماره گذاری است که با دایره های آبی رنگ در چارت نمایش داده می شوند. شماره گذاری آلترا ناتیو ها با مربع های سبز رنگ دیده می شوند.

Training Mode

از منوی گزینه Training Mode را انتخاب کنید. نوار ابزاری به شکل زیر به نمایش در می آید:



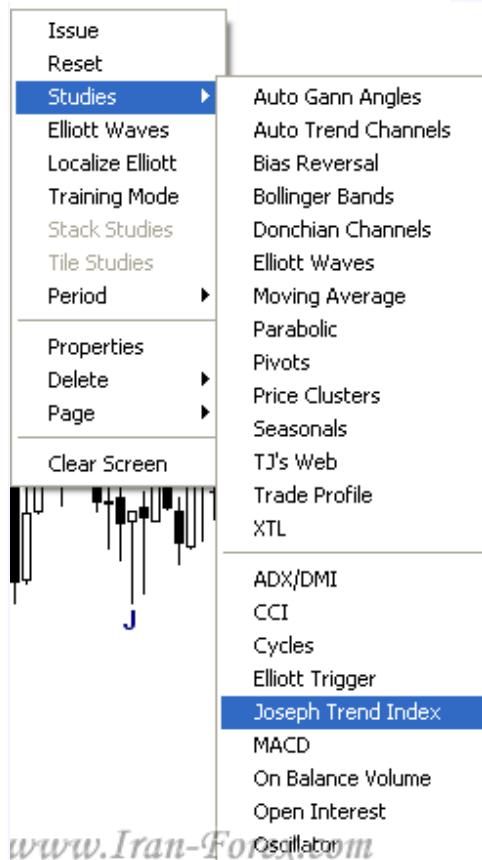
اکنون می توانید به گذشته باز گردید!



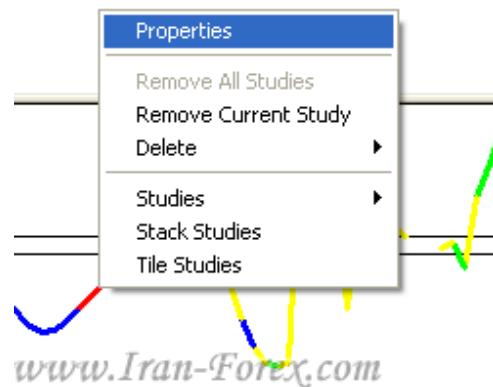
ابزاری جهت شناسایی ترند موجود در بازار است. قدرت بازار طبقه بندی می شود، طبقه بندیها به قرار زیر است:

1. قرمز: بسیار قوی.
2. آبی: قدرت متوسط.
3. سبز: قدرت ضعیف.
4. زرد: نویزهای بازار.

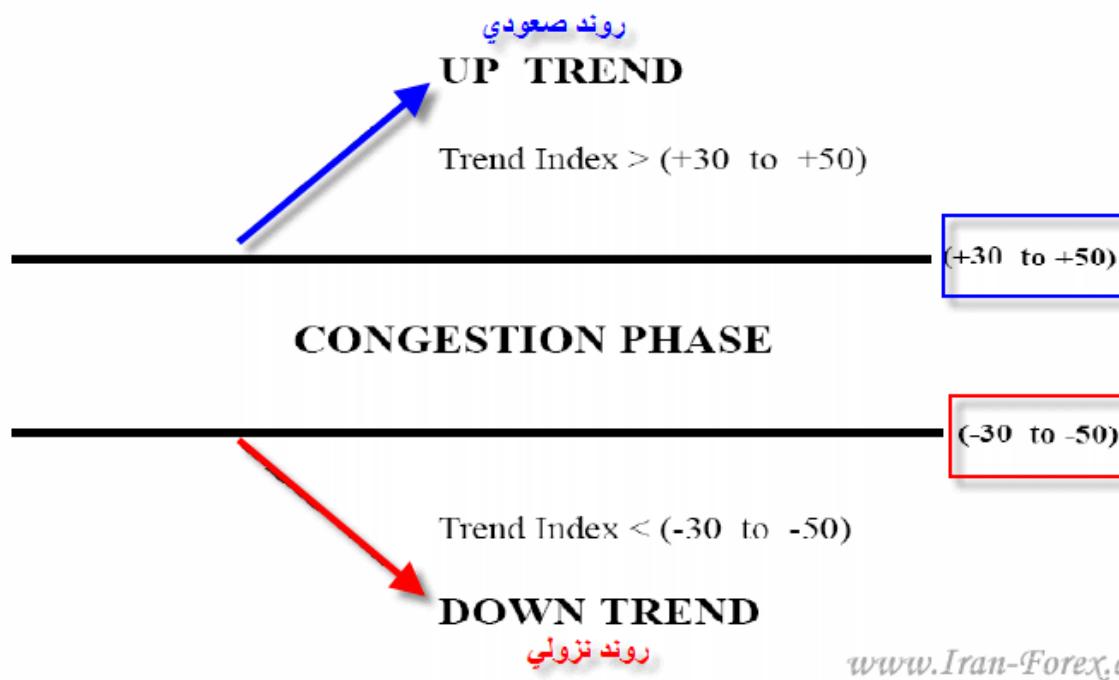
طبق تصویرهای زیر ابزار را فعال کنید.



برای تنظیمات بر روی ابزار راست کلیک کنید. بهتر است تنظیمات را بر روی حالت پیش فرض ثابت بگذارید.

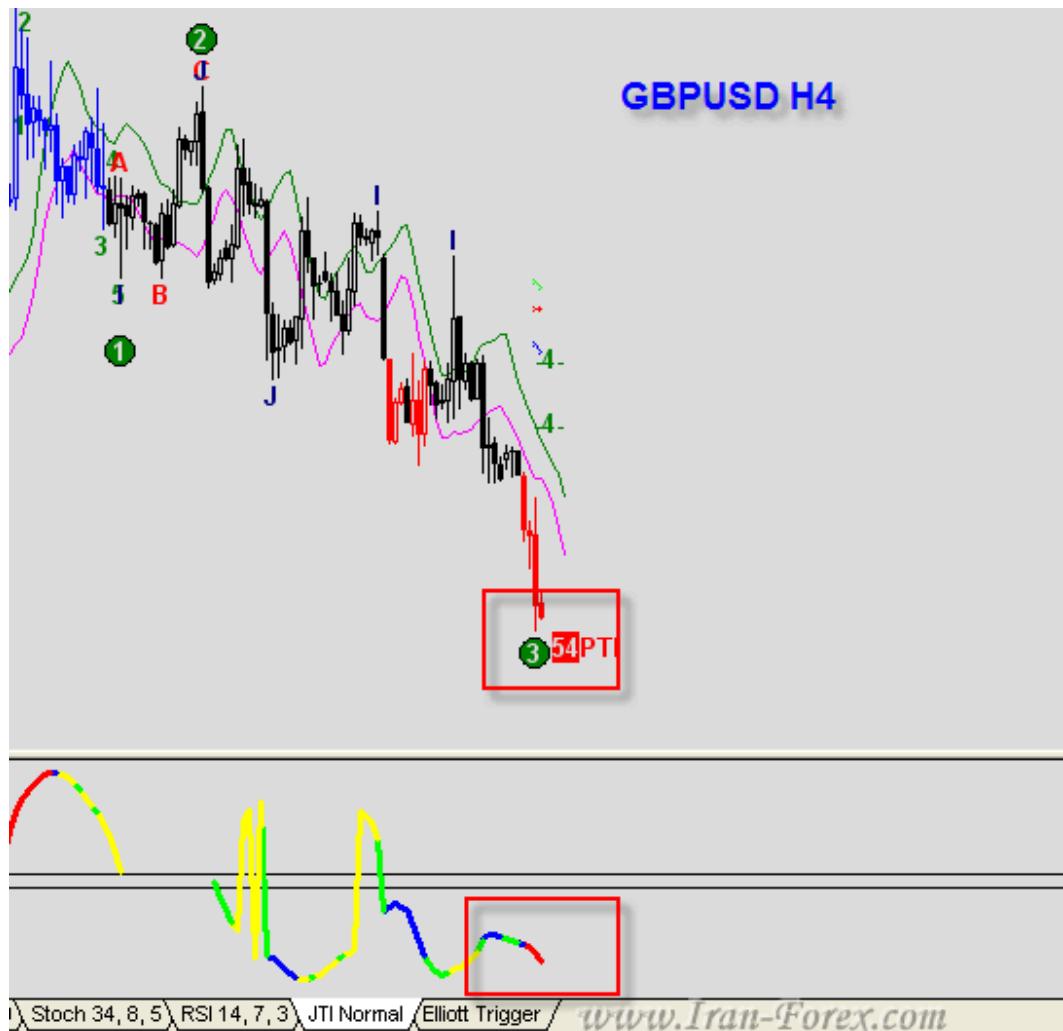


دو باند موجود تعیین کنندهٔ روند صعودی یا نزولی هستند.



در موج های سه و پنج رنگ این ابزار قرمز می شود و تاییدی برای قدرت موج است.

مثال:



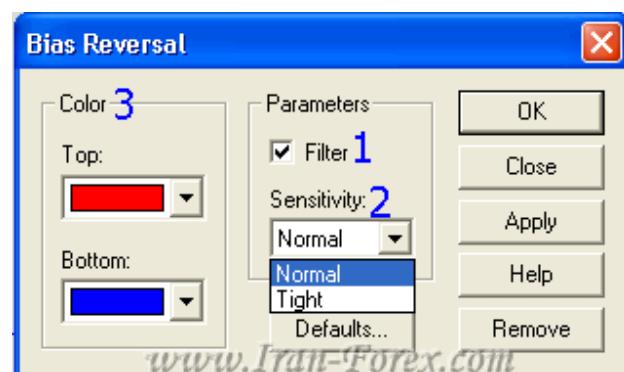
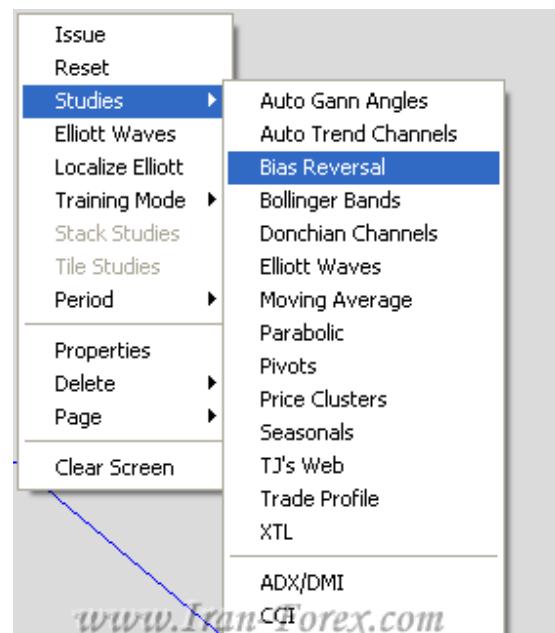
Bias Reversal

تعیین نقاط برگشت قیمت با ابزار

ابزار بایاس ریورسال Bias Reversal تعیین کننده‌ی زمانی مناسب برای اتمام روند است. این ابزار به تنها یی قابل اعتماد نیست و باید با ابزارهای دیگر هم چون کانال رگرسیون مورد استفاده قرار بگیرد.

به این دلیل گفتم سیگنال قطعی نیست چون باید منتظر چند کندل بعد باشید تا علامت بایاس در چارت ثابت شود.

بر روی چارت دکمه‌ی سمت راست موس را بزنید و مانند شکل زیر گزینه‌ی بایاس را انتخاب کنید.



: Filter اگر این گزینه را انتخاب کنید مثلث‌های کوچکی که به عنوان سیگنال برگشتی در چارت ظاهر می‌شد اگر سیگنال خطأ باشند به شکل خودکار از روی چارت حذف می‌شوند اما اگر این گزینه انتخاب نشود بر روی سیگنال‌های خطأ، خطی رسم می‌شود.

حساسیت Sensitivity دونوع حساسیت تعریف شده است. یکی Tight و Normal سختگیرانه : Color انتخاب رنگ برای مثلث‌های تعیین کننده‌ی برگشت می‌باشد.

مثال: بایاس در این شکل حساسیت سختگیرانه دارد.



بایاس در این شکل حساسیت نرمال دارد در انتظار ثبت سیگنال و خروج از کanal رگرسیون می مانیم.



خطوط گن

با استفاده از ابزار Gann Box در نرم افزار می توانید مکان های هندسی احتمالی برای پایان موج های ۳، ۴ و ۵ را تعیین کنید.

نقاط احتمالی پایان موج ۳ و ۵:

بر روی Gann Box کلیک و سپس بر روی نقطه پیوت قبل از آغاز ۵ موج کلیک کنید. معمولاً و نه همیشه این نقطه پیوت در روند صعودی از High موج اول بالاتر و در روند نزولی از Low موج اول پایینتر است. با حرکت موس به سمت قیمت جاری، جعبه گن ترسیم می گردد. با کمی ممارست می توانید از نقاط پیوت قبلی دیگر یا حتی Low خود موج یک که روند را در ترسیم گن بهتر نشان می دهد نیز استفاده کنید.

نقاط احتمالی پایان موج ۴:

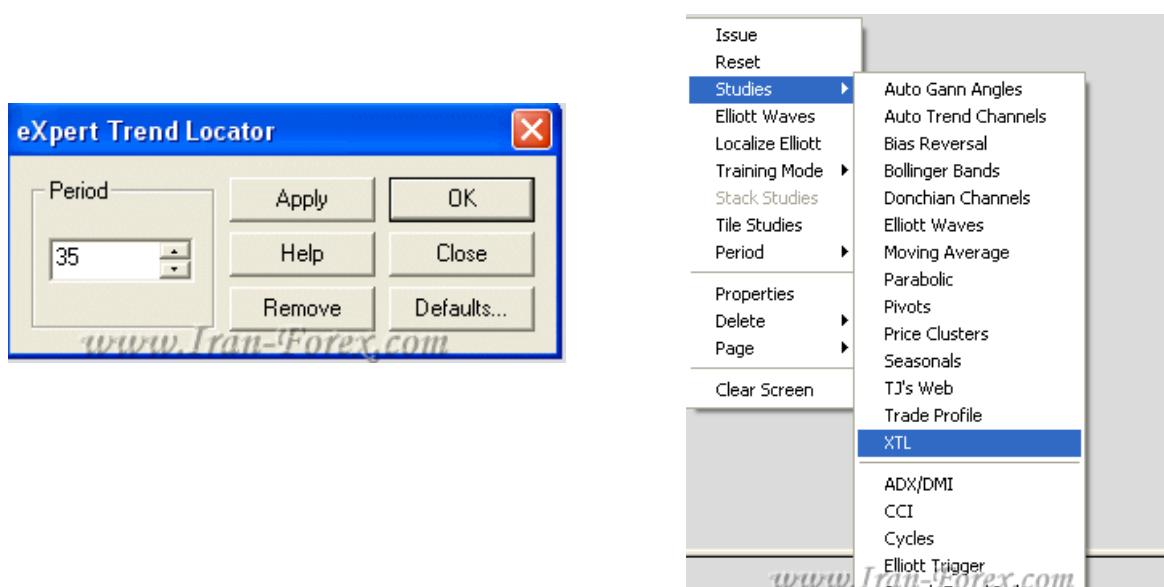
بر روی Gann Box کلیک و سپس بر روی نقطه پیوت قبل از آغاز ۵ موج کلیک کنید. معمولاً این نقطه پیوت در روند صعودی Low ترین نقطه قبل از آغاز ۵ موج و در روند نزولی High ترین نقطه قبل از آغاز ۵ موج است. با حرکت موس به سمت قیمت جاری، جعبه گن ترسیم می گردد. گاهی اوقات نیز می توان انتهای موج دوم را به عنوان نقطه پیوت در نظر گرفت.

تئوری گن: حرکات قیمت که ناشی از رفتارهای فرکتالی معامله گران (ترس، طمع و ...) است، مکان های هندسی روند داری را تشکیل می دهد که قیمت در طول روند با رسیدن به آنها تغییر مسیر می دهد. خطوط گن در بسیاری از موارد این مکان های هندسی را به زیبایی نشان می دهد.

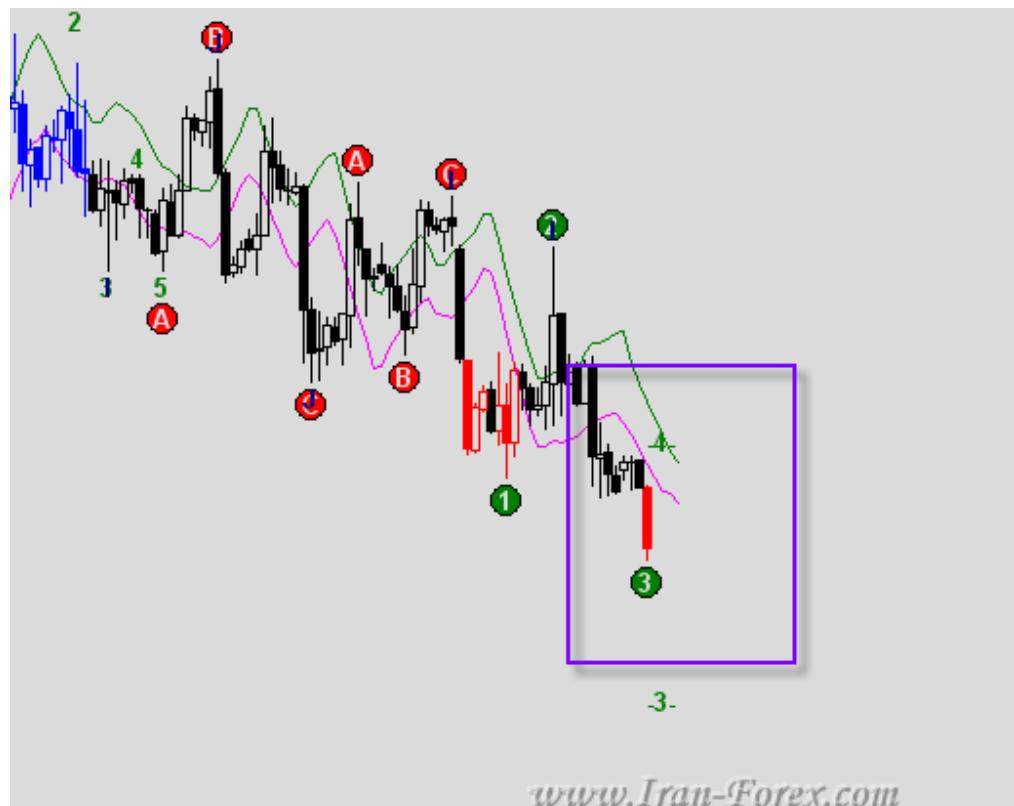
XTL

ابزار – XTL مشخص کننده روند – آبی ترند بالارو و قرمز ترند پایین رو. از آن برای تأیید در تریدهای خود استفاده کنید. شکسته شدن کانال رگرسیون می تواند علامتی بر پایان ترند باشد. تنظیمات پیش فرض را انتخاب کنید ابزاری بسیار قوی در تعیین ترند موجود در بازار است. از این ابزار می توان برای شکار موج ۳ و ۵ در ادونسد گت استفاده کرد.

(XTL is miracle) توصیه می کنم این ابزار را حتما در ابزارهای تحلیل خودتون قرار بديد روش استفاده از XTL را توضیح می دهم اميدوارم سودهای خوبی ازش بگیريد. ابتدا XTL را بر روی چارت فعال کنید و تنظیمات آن را بر روی عدد ۳۵ ثابت بگذارید. این عدد بهترین عدد سیگنالده برای جفت ارزهاست. خطای بسیار کمتری دارد. می توانید از اعداد ۲۱ و ۱۳ نیز استفاده کنید.

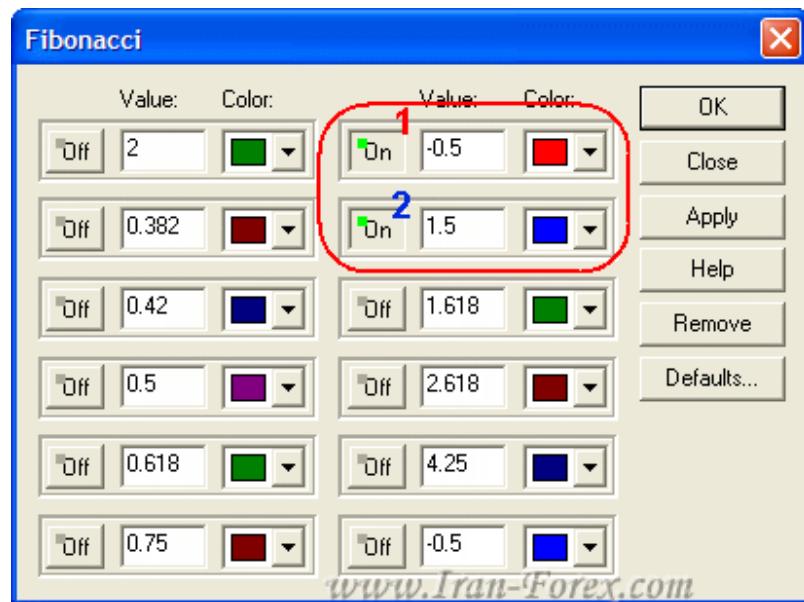


کندلهای قرمز رنگ نشان دهنده ی روند نزولی و کندلهای آبی رنگ نشان دهنده ی روند صعودی است. اولین بار قرمز رنگ یا آبی رنگ ما را برای اردر گذاری فرامی خواند.



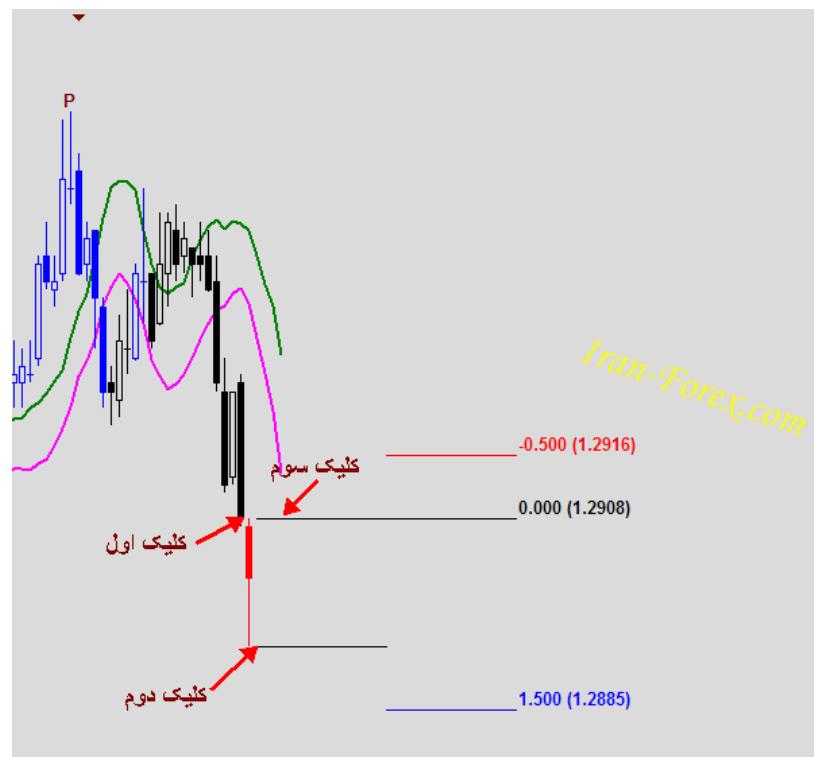
بر روی ابزار فیبو اکستنشن Fibo Extension کلیک کنید و تنظیمات را انجام دهید. باید اردری به اندازه نیم برابر کندل رنگی پایین تر (بالاتر) از این کندل قرار دهید.

نکته: باید تا بسته شدن اولین کندل آبی یا قرمز منتظر بمانید و سپس خطوط فیبو را رسم کنید.

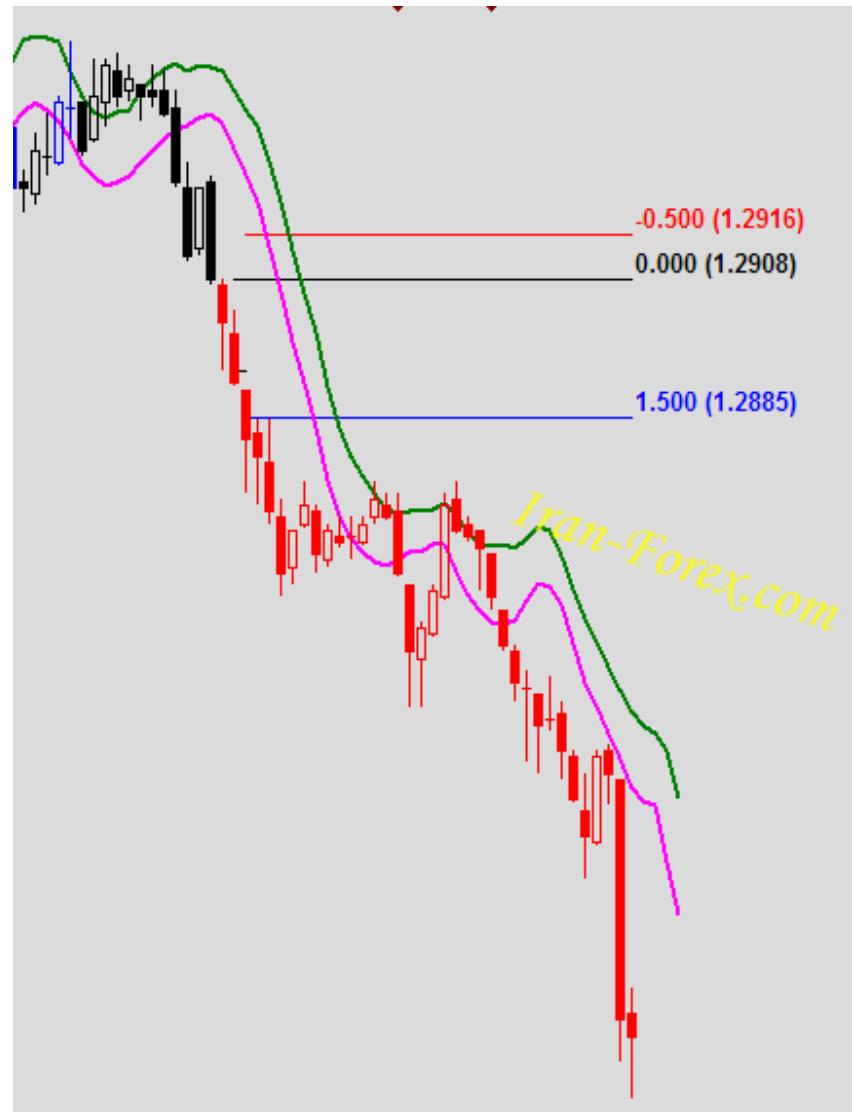


عدد ۱ نقطه‌ی استاپ و ۲ نقطه‌ی ورود است

طبق روش زیر ، برروی اولین کندل رنگی خطوط فیبو را رسم کنید تا نقطه‌ی ورود و استاپ را بدست آورید.



نتیجه‌ی این سیگنال:



ابتدا بر روی High کندل قرمز و بعد Low کلیک کنید تا نیم برابر کندل برای تعیین نقطه ای ورود به همراه استاپ مشخص شود.

قوانين روش:

قانون اول: اگر قبل از فعال شدن Order ، قیمت به نقطه ای استاپ رسید باید Order را حذف کنید.
 قانون دوم : اگر قبل از فعال شدن Order ، رنگ کندل ها سیاه شد، Order را پاک نکنید.
 قانون سوم: اگر قبل از فعال شدن Order ، تغییر رنگ از آبی به قرمز یا برعکس را داشتید ، هر دو Order را آماده بگذارید و هر کدام که فعال شد دیگری را حذف کنید .

نکته ای بعدی این این که چه موقع از پوزیشن خارج شویم:

- ۱- بعد از ادامه‌ی روند و رفتن پوزیشن در سود مناسب با تغییر رنگ کندل‌ها از رنگی به سیاه می‌توانید از بازار خارج شوید.
- ۲- از بایاس ریورسال(سخت گیرانه) بعلاوه‌ی اندیس جوزف ترند و کانال رگرسیون می‌توانید استفاده کنید. امیدوارم سودهای خوبی از این روش کسب کنید.

شمارش مجدد امواج - نوشه‌ی مایکل کریدلر

ماهیت پویای Advanced GET یکی از مواردیست که این نرم افزار را از سایر برنامه‌های آنالیز تکنیکال متمایز نموده است AGET . به بازار واکنش نشان میدهد و خود را با شرایط کنونی آن وفق میدهد که به معامله گر امکان یافتن موقعیت‌هایی را که قبلاً وجود نداشتند ، می‌دهد. این همان ذات پویاست ، هرچند که برخی از کاربران را نگران می‌کند. آنها (کاربران) این حقیقت را می‌بینند که AGET امواج را دوباره شماره گذاری می‌کند که بنوعی اثبات می‌کند شمارش امواج سطحی و غیر قابل اطمینان است. حقیقت مطلب اینست که بسیاری از کاربران بیش از حد ، روی شمارش الیوت تمرکز می‌کنند. نتیجه‌ی اساسی این است که "وقتی یک موقعیت معامله پیش می‌آید شمارش الیوت دیگر چیست؟!!" اگر موقعیت معامله فراهم است ، شمارش مجدد امواج ، معامله‌ی شما را تغییر نخواهد داد. همچنین اگر شمارش مجدد امواج پیش از موقعیت معامله رخ دهد ، پس به دنبال موقعیت بعدی باشید. هدف این نوشتار اینست که به شما بینشی در مورد شرایط اندکی که در آنها شمارش مجدد امواج متعارف است ، داده و دلایل آن را ارائه دهد. الگوریتم الیوتی که ما برای AGET توسعه داده ایم پیچیده است ، به حدی پیچیده که نیازمند یک کامپیوتر برای ثبت تمام متغیرها می‌باشد و این نوشتار در صدد بحث فراگیر در مورد تمامی متغیرها در همه‌ی شرایط نیست ، بلکه در پی فراهم آوردن اصول بسیار اولیه و اساسی راهنمایی برای شماست.

جستجوی موج شماره ۳

شما مکرراً با شمارش مجدد امواج بعد از اتمام موج ۵ و شروع مراحل بعدی مواجه خواهید شد. نرم افزار در این موقع به دنبال بهترین شمارش ممکن است و هر بار (کندل) جدید می‌تواند باعث پدیدار شدن شمارش جدیدی شود.

سوال: در چه نقطه‌ای موج ۳ نشان داده شده قابل اطمینان است؟

پاسخ: زمانیکه یک برگشت قوی از باند گسترش یافته بوجود آید. باند گسترش یافته، خط پر پیج و خمی است که شما در نوسانگر خواهید یافت. بعضی فکر می‌کند که آن، میانگین متحرک نوسانگر است ولی اینگونه نیست. چگونگی محاسبه‌ی باند مهم نیست، آنچه مهم است نحوه‌ی استفاده از آن است. تنها هدف آن تصدیق موجهای ۳ است. وقتی حرکتی پرقدرت بالای این باند (در روند صعودی) یا در پایین این باند (در روند نزولی) ایجاد می‌شود و با یک موج شماره‌ی ۵ پیگیری می‌شود، شما می‌توانید اطمینان بسیاری به شمارش الیوت داشته باشید.

همپوشانی موج ۴

شرایط متعارف دیگری که در آن شمارش مجدد رخ می‌دهد، همپوشانی موج ۴ با موج ۱ است. در اینجا دو قانون با اندکی تفاوت بکار برده می‌شود. نرم افزار همپوشانی موج ۴ با موج ۱ را به اندازه‌ی ۱۷٪ برای بازار کالا اجازه می‌دهد، اما برای **Index** و **Stock** این اجازه ۰٪ است. وقتی شما گسترش موج ۴ را می‌بینید که به موج شماره‌ی ۱ قبلی نزدیک می‌شود، باید انتظار شمارش مجدد امواج را داشته باشید.

قدرت موج ۵

علت وقوع مکرر شمارش مجدد، قدرت موج پنجم است. اگر موج ۵ قدرتی بیش از حد معمول داشته باشد، نرم افزار بطور طبیعی آن را موج ۳ نامگذاری خواهد نمود. به یاد داشته باشید که موج ۵ معمولاً به اندازه‌ی ۶۲ تا ۱۰۰ درصد موج سوم قبلی گسترش می‌یابد. همچنین نوسانگر موج پنجم ضعیفتر از موج سوم قبلی است. اگر شما مشاهده کردید که حرکت قیمت بیش از ۱۰۰٪ تراز گسترش نرمال است، به نوسانگر دقت

کنید. اگر دیگر واگرایی (دایور جنس) وجود ندارد و مخصوصاً موج ۵ از موج ۳ قویتر است ، منتظر شمارش مجدد باشد.

باز هم تکرار می شود که اینها قواعد ساده ای برای راهنماییست. شمارش الیوت یک ابزار برای شما در AGET می باشد. هدف اصلی آن پیدا نمودن موقعیت‌های معامله برای زمانیست که امواج الیوت معقول هستند یعنی زمانیکه همه چیز صحیح است. بعضی از معامله گران از همه‌ی موارد فقط به شمارش امواج دقیق می کنند و سردرگم (دیوانه) می شوند و می خواهند در هر صورت منفرد شمارش الیوت را درک کنند.

اصلاحی بودن یا نبودن، مسئله این است! چه میزان می توان به شماره گذاری نرم افزار اعتماد کرد؟

چه میزان می توان به شماره گذاری نرم افزار اعتماد کرد؟

موج سوم:

در صورتی که این موج توسط نرم افزار شماره گذاری شد به اسیلاتور نگاه کنید. اگر اسیلاتور خطوط نوسانگر خود را قطع کرده است (به سمت بالا برای روند صعودی – به سمت پایین برای روند نزولی) و روند تایم فریم جاری با تایم فریم بالاتر همخوانی دارد می توانید به آن اعتماد کنید. البته همانطور که می دانید به هیچ موردی نمی توان اعتماد مطلق کرد و همیشه احتمال خطا وجود دارد.

موج چهارم:

قبل‌اً راجع به پارامترهایی که بوسیله آنها می توان به اتمام موج چهارم و شماره گذاری آن توسط نرم افزار اطمینان حاصل کرد صحبت شده است مانند: رسیدن اسیلاتور به صفر، کanal های موج چهارم، قطع کanal رگرسیون و قطع هر دو DMA.

موج پنجم:

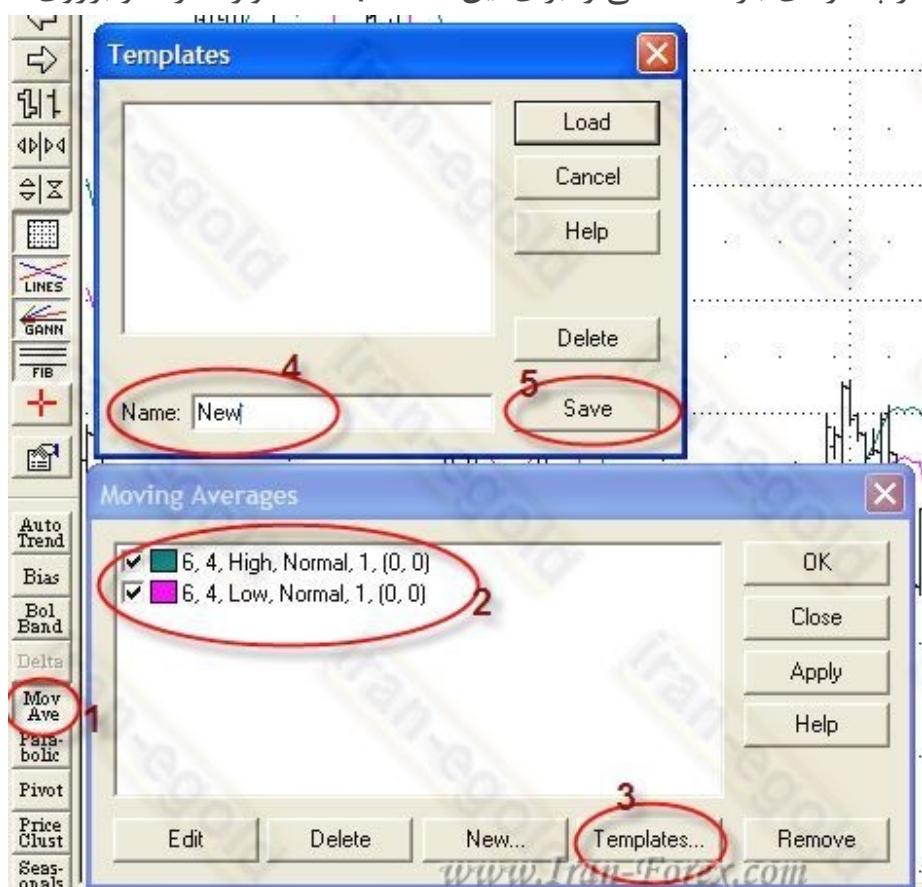
به محض اینکه قیمت از High موج سوم در روند صعودی بالاتر برود و یا از Low موج سوم در روند نزولی پایینتر، موج پنجم شماره گذاری خواهد شد. حال چگونه می توان به اتمام آن اطمینان حاصل کرد؟ پارامترهای نزدیک بودن قیمت به هدف موج پنجم، مشاهده شدن واگرایی (دایور جنس) یا همگرایی (

کانورجنس) در اسیلاتور و قطع هر دو DMA توسط قیمت می تواند در این مورد به ما کمک کنند (ترید نوع دوم).

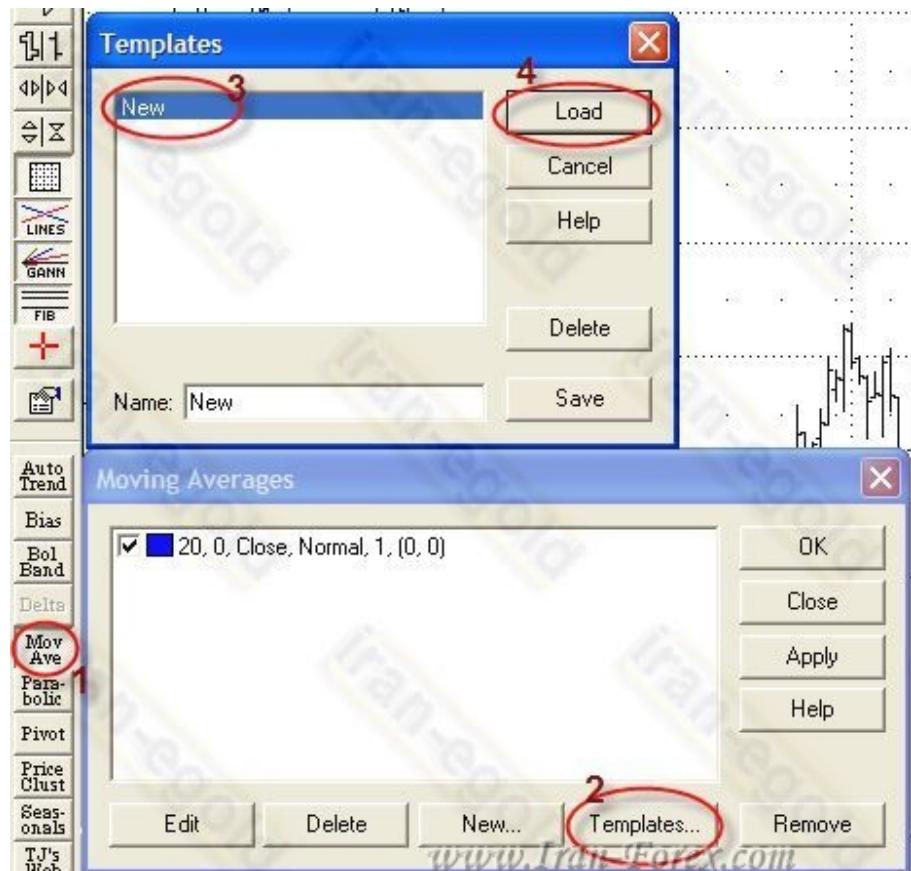
Moving Average: تنظیمات

ابتدا همانند آموزش‌های صفحه‌ی اول چارتی را Load کنید.
در نوار ابزار بروی Mov Ave کلیک کنید تا پنجره‌ی تنظیمات باز شود.
طبق آخرین آموزشها دو مووینگ را اضافه کنید.
بر روی Templates کلیک کنید.

در پنجره‌ی باز شده نامی را برای این Template وارد کرده و بروی Save کلیک کنید.



فرض می‌کنیم چارت دیگری را باز کرده‌اید. برای اینکه مووینگ‌ها را به چارت جدید اضافه کنید کافیست:



برروی Mov Ave و سپس در پنجره باز شده Templates را کلیک کنید New را انتخاب کرده و برروی Load کلیک کنید. دو موینگ با مشخصاتی که از قبل ذخیره کرده اید، نمایش داده میشوند. در نهایت برروی OK کلیک کرده تا موینگها به چارت اضافه شوند.

نکته: برای حذف موینگها از روی چارت ابتدا پنجره Moving Averages را با کمک نوار ابزار باز کنید. برروی Remove کلیک کرده و Ok کنید.

AdvancedGet تنظیمات خصوصیات چارت

در حالت پیش فرض چارتهای جدیدی که Bar Chart Load میکنید به صورت Candle Stick (Candle Stick) علاقه داشته باشند، تنظیمات پیش فرض برنامه را به حالت نمودارهای شمعی تغییر میدهیم تا همیشه پس از باز کردن چارت جدید، نمودارهای کندلی داشته باشیم. برای ایجاد این تغییرات مراحل زیر را دنبال کنید:

- از نوار ابزار همانند شکل بروی Properties کلیک کنید. (این گزینه با رایت کلیک بروی چارت و یا از منوی Chart و سپس Properties نیز در دسترس است
- Bar Type را به Candle Stick تغییر دهید.
- مقدار Spacing را نیز از ۶ به ۴ تغییر دهید.
- بروی Defaults کلیک کنید تا پنجره‌ی مربوط باز شود.
- بروی Save Current Settings As Default کلیک کنید.
- برای اعمال تنظیمات OK کنید.

به این ترتیب هر گاه چارت جدیدی را Load کردید بدون نیاز به انجام تنظیمات به صورت کنسل استیک نشان داده خواهد شد.

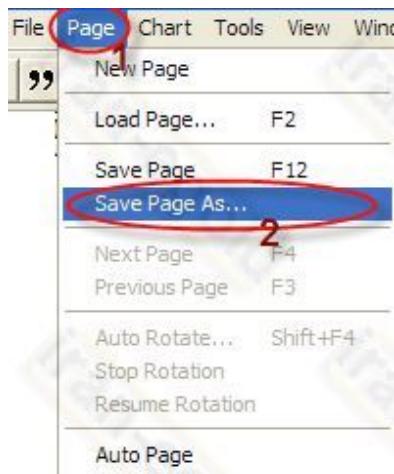
نکته: اگر قصد باز گرداندن تنظیمات برنامه به حالت پیشفرض (Bar Chart) را داشتید در صفحه‌ی Save Current Settings As Default و سپس بروی Original SettingsDefaults کلیک کنید. تنظیمات برای چارت‌های جدید به حالت پیشفرض (Original) باز خواهد گشت.
 نکته: اگر در پنجره‌ی Display و در بخش Properties گزینه‌ی Crosshairs را انتخاب کرده و تنظیمات را Save کنید، در چارت‌های جدیدی که باز می‌کنید Crosshair فعال خواهد بود.

تنظیمات سریع در AdvancedGet - ذخیره و Load کردن چارت‌ها

موارد دیگری که باید به چارت اضافه شوند، امواج الیوت، اسیلاتور، الیوت تریگر، اتوترند، Alt و ... می‌باشد که اکثراً در نوار ابزار موجود هستند و نیازی به توضیح ندارد. پس از اینکه تمامی تنظیمات را بروی یک چارت انجام دادید، می‌توانید آن را Save کرده و در صورت نیاز دوباره Load کنید.

- دقت داشته باشید قبل از ذخیره‌ی چارت، فقط چارت مورد نظر باز باشد و بقیه‌ی چارت‌ها را ببندید. با این روش دیگر نیاز به باز نگه داشتن بیش از یک چارت و قرار دادن آنها به صورت Minimize ندارید.

- چارت مورد نظر فعال باشد. از منوی **Save Page As** کلیک کنید.



در پنجره‌ی **Save As** کلیک کنید تا نامی متناسب با چارت موجود قرار بگیرد. (میتوانید انتهای متن را تغییر دهید مثلاً **GBPUSD H1** را همانند شکل به **GBPUSD60 D** تغییر نام دهید). همچنان شماره‌ی چارت را نیز بررسی کنید. در حالت عادی نرم افزار اتوماتیک به شماره‌ها می‌افزاید.



در سمت چپ در حال حاضر فolder اصلی یا همان **Pages** انتخاب شده. شما میتوانید برای هر جفت ارز با کلیک بر روی علامت **New Folder**، پوشه‌ی جدیدی ایجاد کنید.

حال قصد اضافه کردن چارت های دیگر را داریم.

ابتدا چارت H1 را که ذخیره کردیم، می بندیم.

چارت H4 از همین ارز یا H1 از ارز دیگر را نیز باز کرده و پس از انجام تنظیمات ، همانند قبل مراحل ۱ و ۲ را انجام میدهیم. پس از ذخیره ی تایم H4 ، این نمودار را نیز Close میکنیم. نکته: در پنچره ی Sort با کلیک برروی Save Page ، نرم افزار به صورت اتوماتیک چارتها را براساس حروف مرتب خواهد کرد.

مرحله ی بعدی Load کردن چارت‌های ذخیره شده میباشد.

از منوی Page ، برروی Load Page کلیک کنید تا پنجره ی Load Page ظاهر شود. برای دسترسی آسانتر روی کیبورد کلید F2 را فشار دهید.

پنجره ی Load Page به صورت زیر خواهد بود:

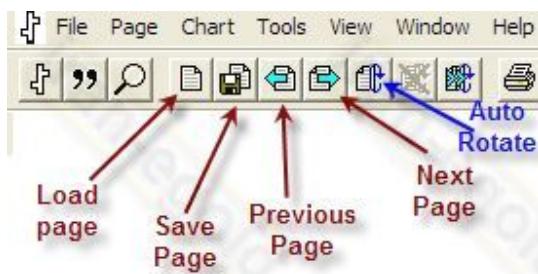


چارت مورد نظر را انتخاب کنید و برروی Load کلیک کنید.

نکته: با کمک کلید F4 برروی کیبورد (یا از منوی Page و انتخاب Next Page میتوانید به چارت ذخیره شده ی بعدی بروید.(با کمک F3 به چارت قبلی برگردید)

نکته: اگر بروی چارتی که Load شده تغییراتی ایجاد کردید، باید تنظیمات جدید را ذخیره کنید. برای این کار پس از اعمال تغییرات از منوی Save Page کلیک کنید.(ویا فشردن کلید F12 برروی کیبورد) اگر قصد دارید تغییرات جدید ذخیره نشوند، بدون ذخیره کردن یکبار F3 و سپس F4 را برروی کیبورد بزنید.

تمامی موارد فوق به راحتی از نوار ابزار در دسترس خواهند بود:



چگونگی چینش چارتها در هنگام ذخیره کردن و مرتب کردن آنها سلیقه ایست. میتوانید تایم یک ساعته ی چندین جفت ارز را در فolder اصلی Pages ذخیره کنید و یا برای هر ارز فolder جداگانه ای ایجاد کرده و تایمهای مختلفی مانند H1 ، H4 ، D1 و ... را ذخیره کنید.

اگر طبق روش پیشنهادی اول عمل کردید و تایم H1 از چندین جفت ارز را در پوشه ای اصلی و یا در پوشه ای خاص پشت سر هم ردیف کردید ، میتوانید از قابلیت Auto Rotate استفاده کنید.

برروی Auto Rotate در نوار ابزار کلیک کنید.(از منوی page نیز در دسترس خواهد بود) (یا کلید Shift+F4 برروی کیبورد)



در پنجره‌ی باز شده تایم را به میزان دلخواه (بر حسب ثانیه) تغییر دهید. (میتوانید برروی Page کلیک کرده و چارت‌هایی را که میخواهید نرم افزار اتوماتیک برای شما نشان دهد مشخص کنید.)

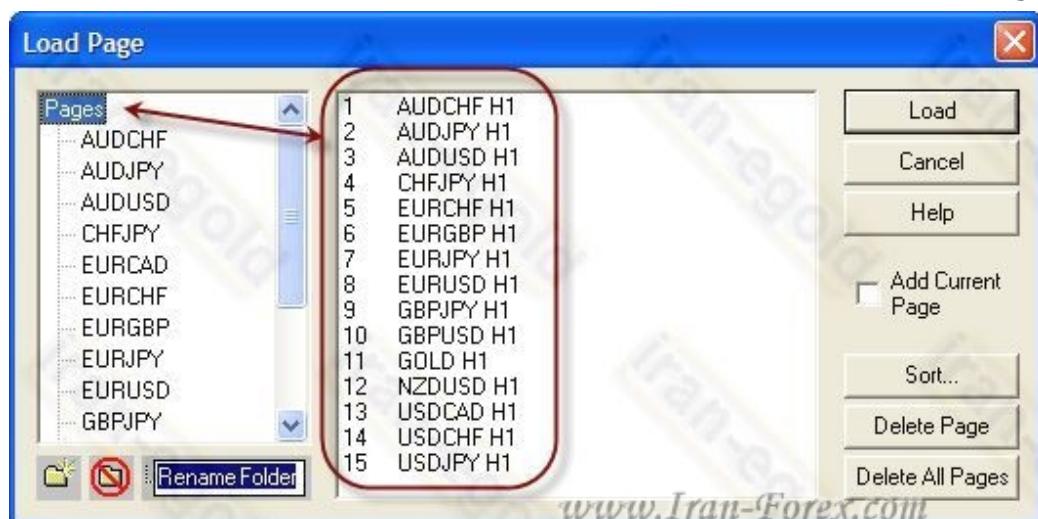
برروی OK کلیک کنید. چارتهایی که در پوشه‌ی مشخص شده قرار دارند با توجه به تایم مشخص شده برای شما به نمایش در می‌آیند. در اینصورت گزینه‌های Stop Rotation و Resume Rotation نیز از منوی Page یا نوار ابزار در دسترس خواهند بود.

نکته: اگر نحوه‌ی قرار گرفتن آیکنها در نوار ابزار به هم ریخت، از منوی View و انتخاب Dock All برای بازگرداندن نوارابزارها به حالت پیشفرض استفاده کنید.

نکته: اگر چارت جدیدی را با کمک New Chart باز کردید به هیچ عنوان برروی Save chart کلیک نکنید. در غیر اینصورت آخرین چرات Load شده به اشتباہ تغییر خواهد کرد. همیشه برای ذخیره‌ی چارتهای جدید از Save Chart As استفاده کنید.

نکته: برای اینکه چارتهای ذخیره شده در هنگام Load آپدیت شوند، باید یکبار برنامه را بسته و دوباره باز کنید.

همانطور که می‌بینید با کمک Sort نرم افزار، جفت ارزها را براساس حروف الفبا (alphabet) مرتب کرده است.

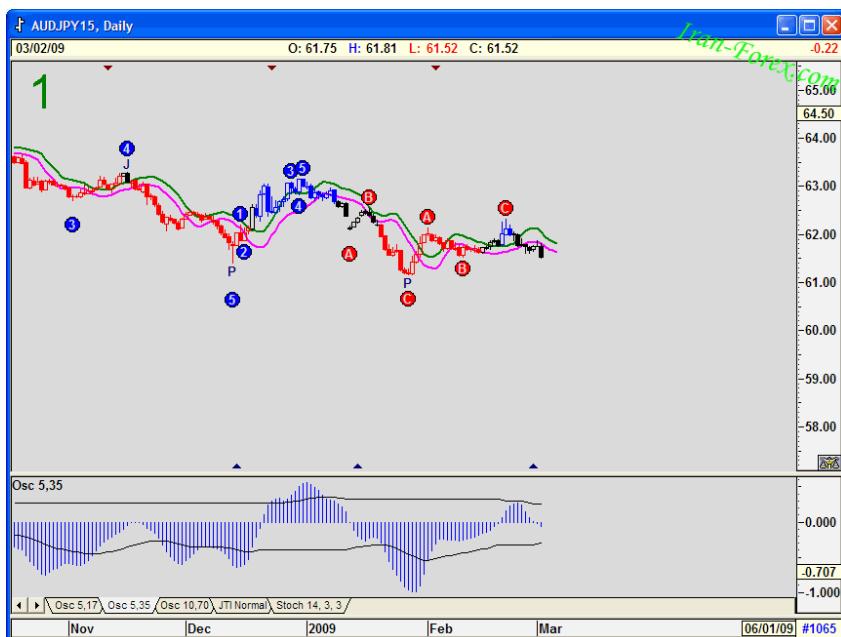


AGET Template جایگزینی برای Quick Load

با توجه به اینکه در نگارش‌های کـرـک شده‌ی Template وجود ندارد و تنظیم تعداد زیادی چارت و تایمهای مختلف وقت گیر می‌باشد. برای حل این مشکل از قابلیت Quick Load در AGET استفاده می‌کنیم.

ابتدا از منوی File/New Chart ، چارتی را به دلخواه باز کرده و تنظیمات مورد نظر را ببروی چارت انجام دهید.

حال همانطوری که چارت با تنظیمات در حال نمایش است ، روی کیبورد ارز مورد نظر و تایم مربوط را وارد کنید مثلاً قصد داریم چارت ۱۵ دقیقه‌ای جفت ارز پوند-دلار را با تنظیمات چارت فعلی اجرا کنیم. عبارت GBPUSD15 را تایپ کرده و کلید Enter را فشار دهید. چارت ۱۵ دقیقه‌ای این ارز باز خواهد شد. حال از منوی Save Page As برروی Page کلیک کرده و چارت را ذخیره کنید. مجدداً در حالتی که چارت ۱۵ دقیقه‌ای پوند-دلار باز است روی کیبورد عبارت GBPUSD30 را تایپ کرده و اینتر کنید. تایم ۳۰ دقیقه‌ای اجرا می‌شود. این چارت را نیز ذخیره کنید. مراحل را تا تایمهای بالاتر ادامه دهید. در اینیشن زیر ابتدا چارت AUDJPY15 اجرا و تنظیمات اعمال شده ، سپس چارت ۱۵ دقیقه‌ای پوند-دلار با همین تنظیمات Load شده است:



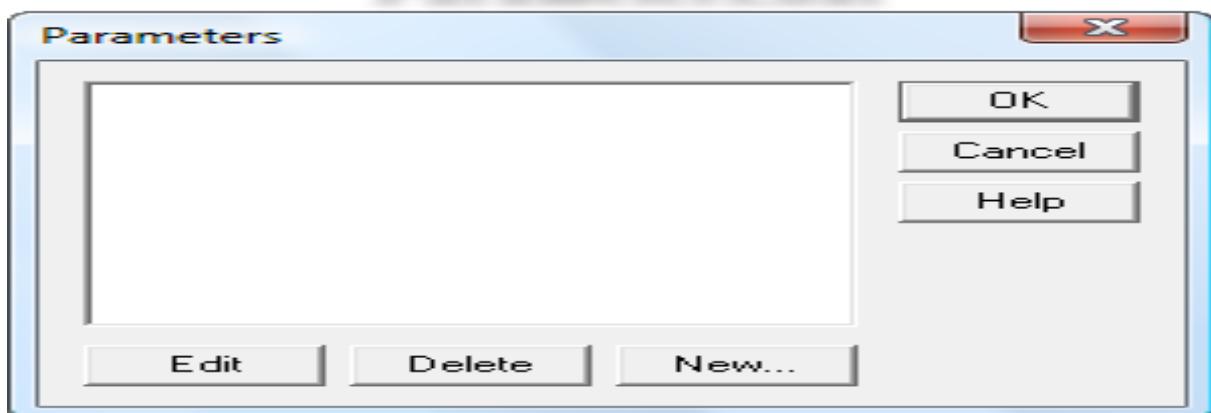
فایل آماده‌ی چک لیست برای پوزیشن‌های نوع ۱ و ۲ نرم افزار Advanced GET را بیندید.

فایل ضمیمه زیر را دانلود و Extract کنید. فایل Parameters.dat را به فolderی که نرم افزار در آن قرار دارد و در فolder dat کپی کرده و جایگزین فایل قبلی (Replace) کنید. فرض میکنیم نرم افزار را در درایو C و Program Files نصب کرده‌اید. فایل را باید به پوشه‌ی کد:

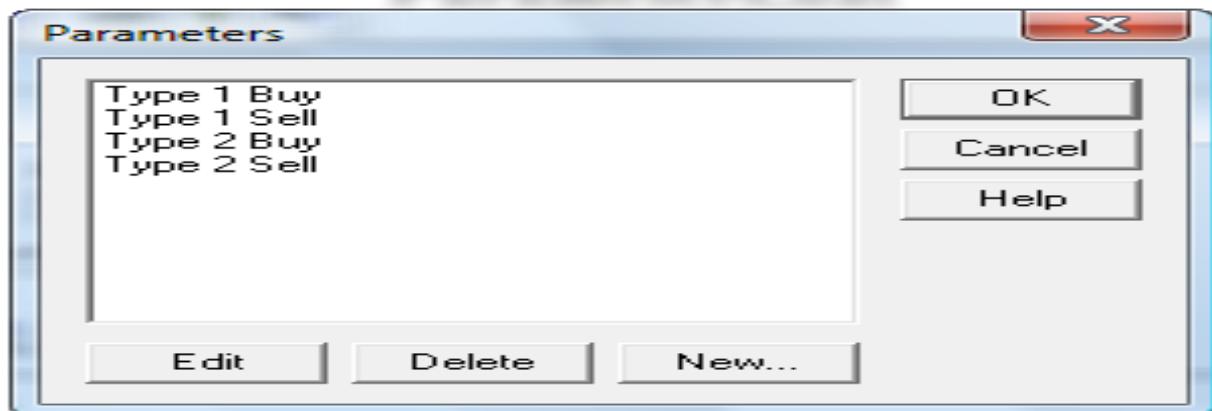
C:\Program Files\GET\dat

کنید. اجرا Advanced را GET کنید و کپی جایگزین و

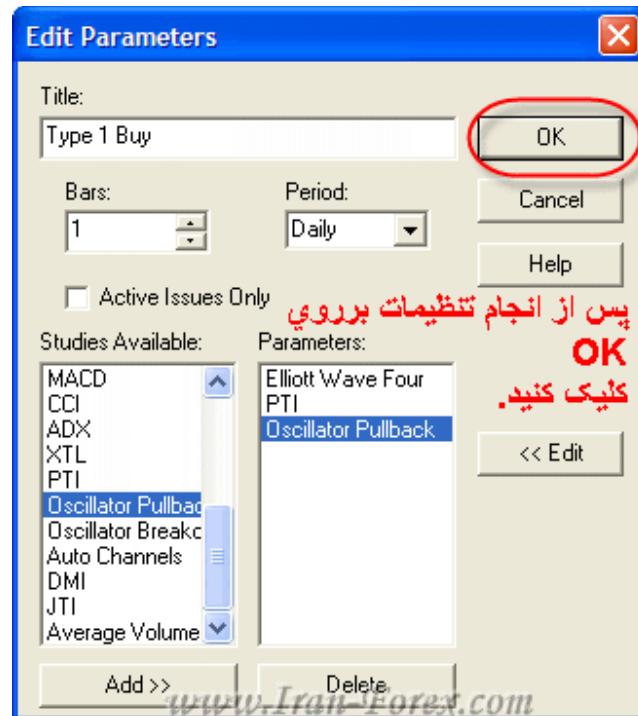
قبل از جایگزین کردن فایل Parameters.dat



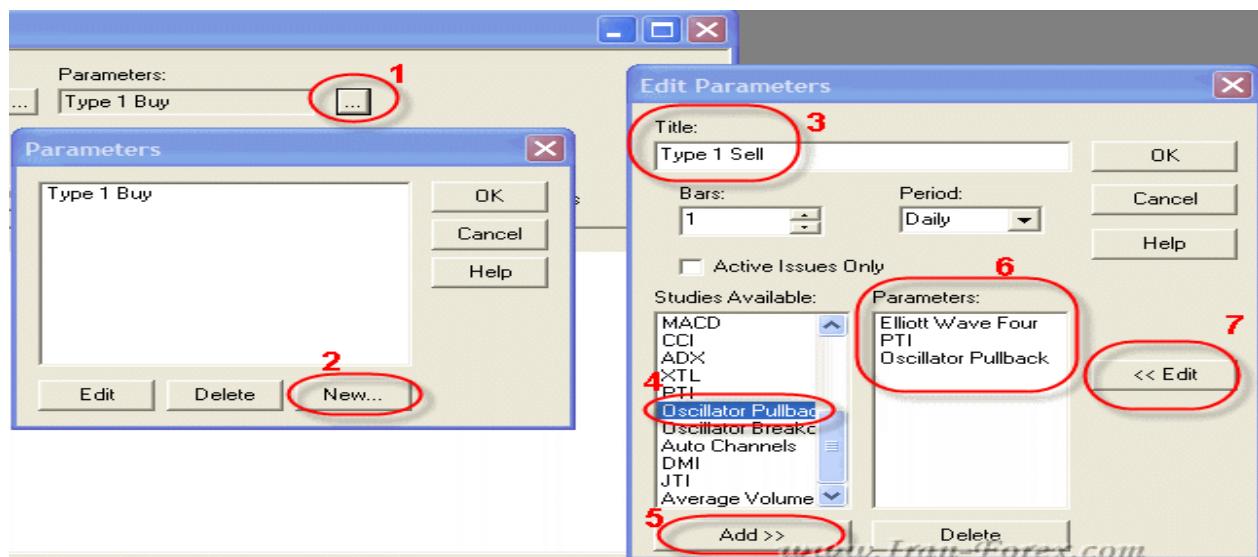
بعد از جایگزین کردن فایل Parameters.dat

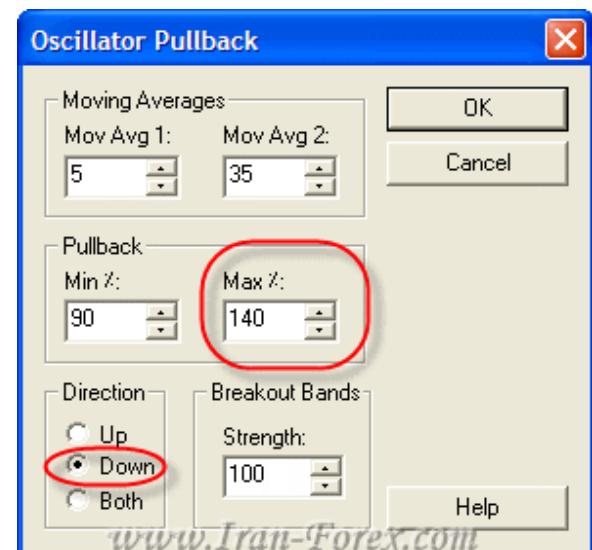
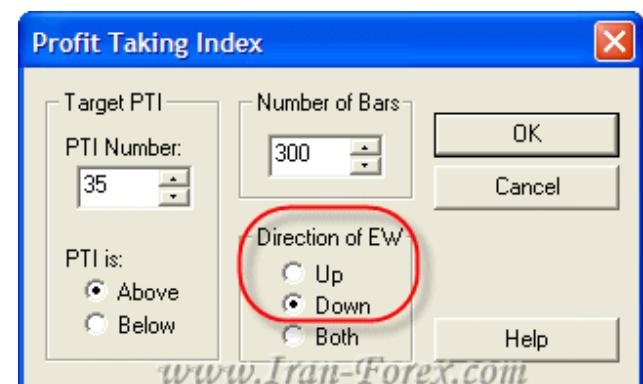
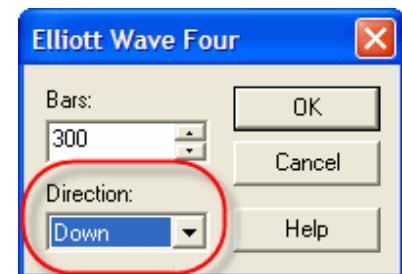


ایجاد چک لیست برای پوزیشن نوع اول (Type 1 Buy)



ایجاد چک لیست برای پوزیشن نوع اول (Type 1 Sell)





Portfolio: Parameters:

<Issue List 11/26/2007> ... Type one Sell ...

Status: **Ready** Found: 25 Of 116 21%

Change All Charts Independent Of Pages

Any Parameter	EW4	PTI	OPB
#DD60	X	X	
#ENQZ760		X	
#EPZ760		X	
#GM60	X	X	
#HPQ60	X		
#IBM60	X		
#JPM60	X	X	
#NGF860	X	X	
AUDNZD60	X	X	
AUDUSD!60			X
AUDUSD60			X
EURHKD60	X		
EURJPY!60	X		
EURJPY60	X		
EURNZD60		X	
EURSEK60		X	
EURUSD!60	X		
EURUSD60	X	X	
GBPNZD60		X	
GBPSEK60	X	X	
GOLD60	X		
USDCHF!60	X		
USDCHF60	X		
USDHRK60	X	X	
USDSGD60	X	X	

دیگر برای چک کردن زمان را از دست نمی دهد.

با کلیک بر روی علامت play نیستی تهیه می شود که در آن ها موقعیت چند مورد انتخابی ظاهر می شود. هرگاه هر سه گزینه علامت داشت نشانه ی ورود است. البته چارت را چک کنید اگر موج ۴ از خط قرمز رد کرده بود دیگر اعتبار ندارد.

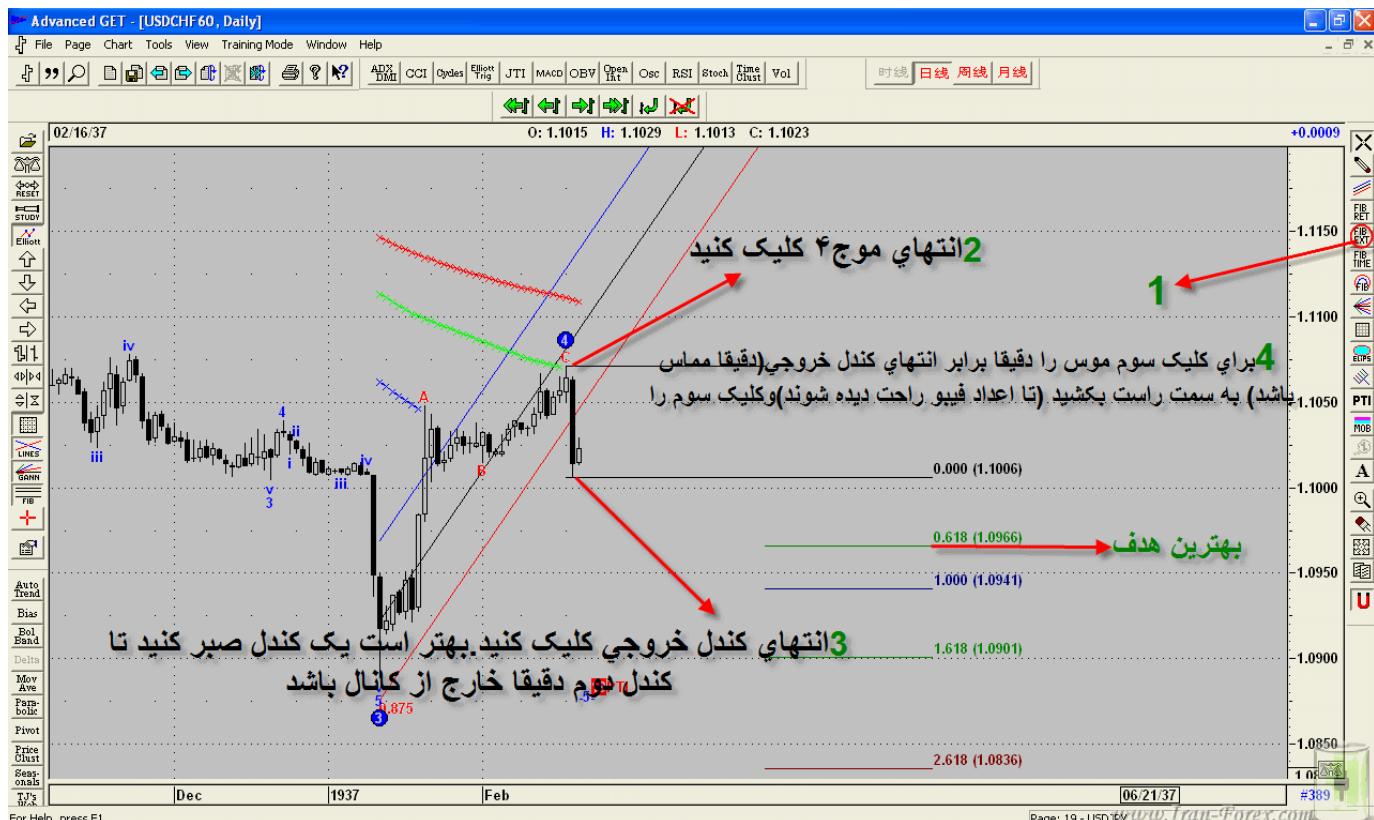
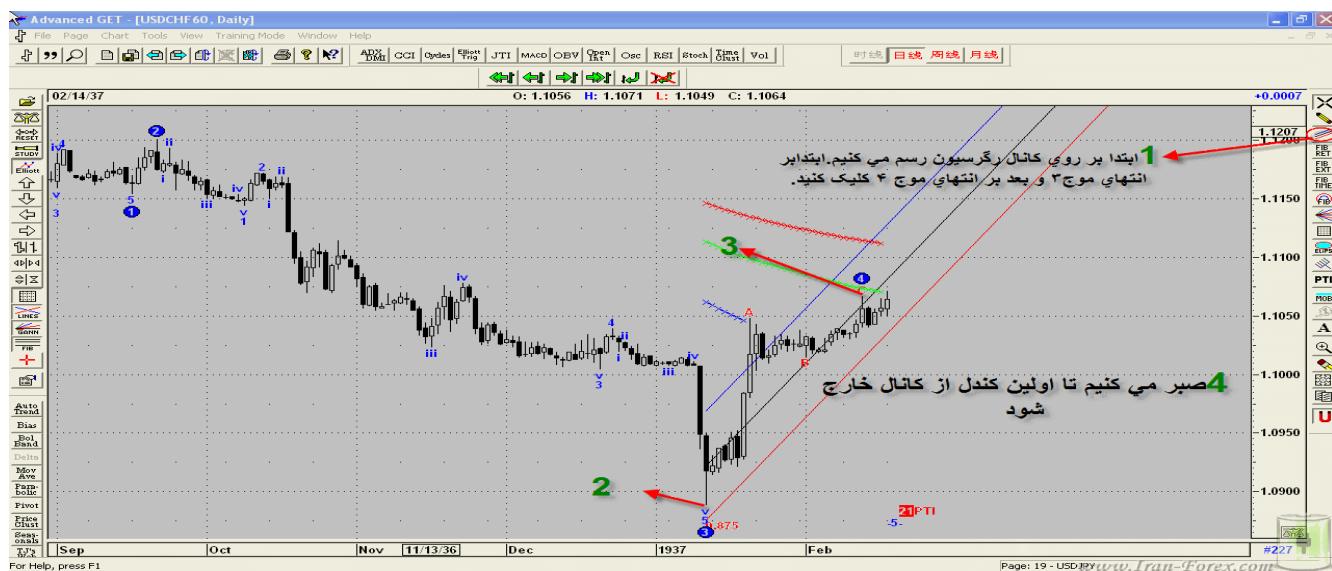
www.Iran-Forex.com

FIBO خطوط

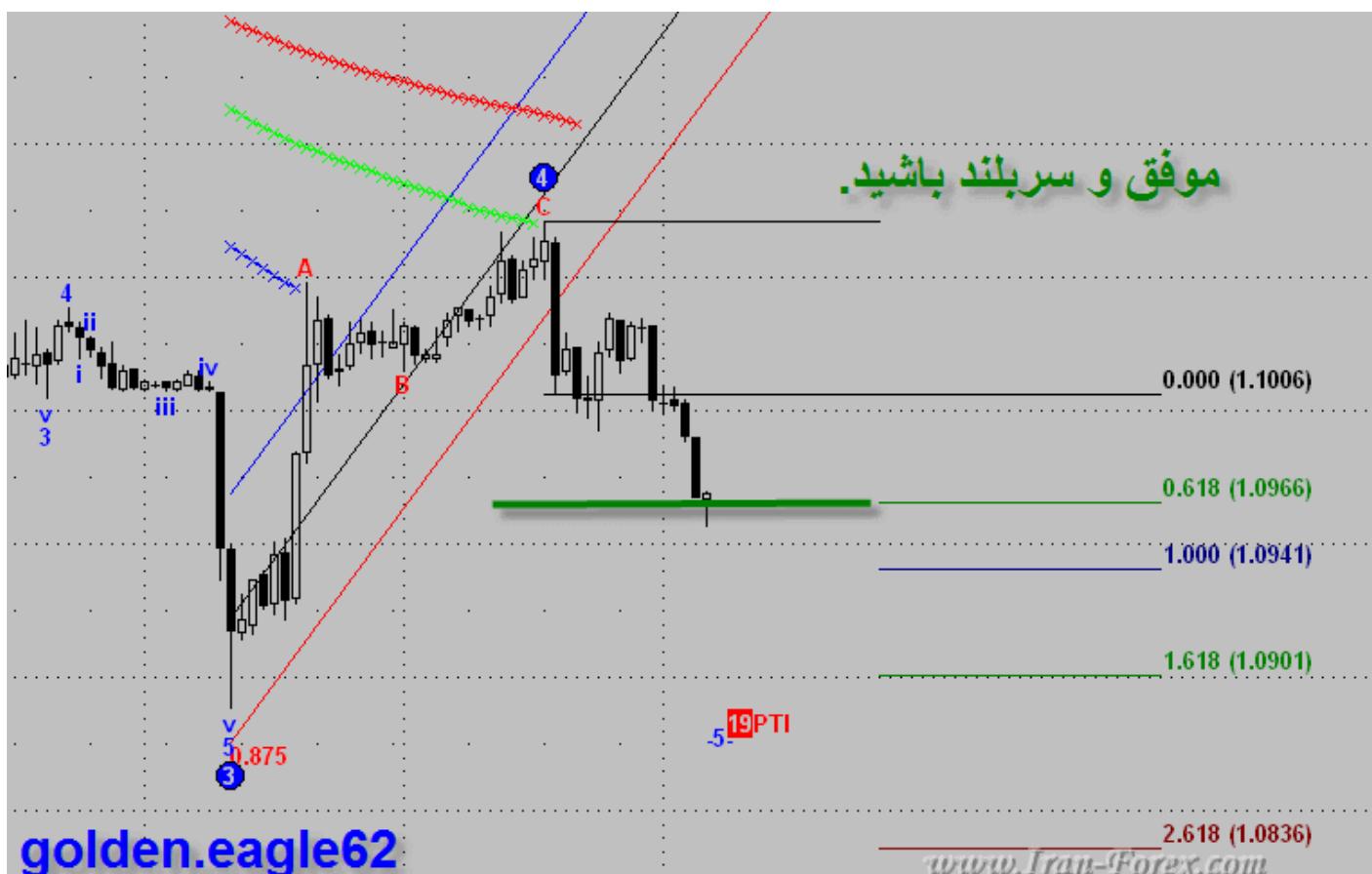
طريقه‌ی رسم خطوط فیبو EXT برای تعیین نقطه خروج برای موج ۵



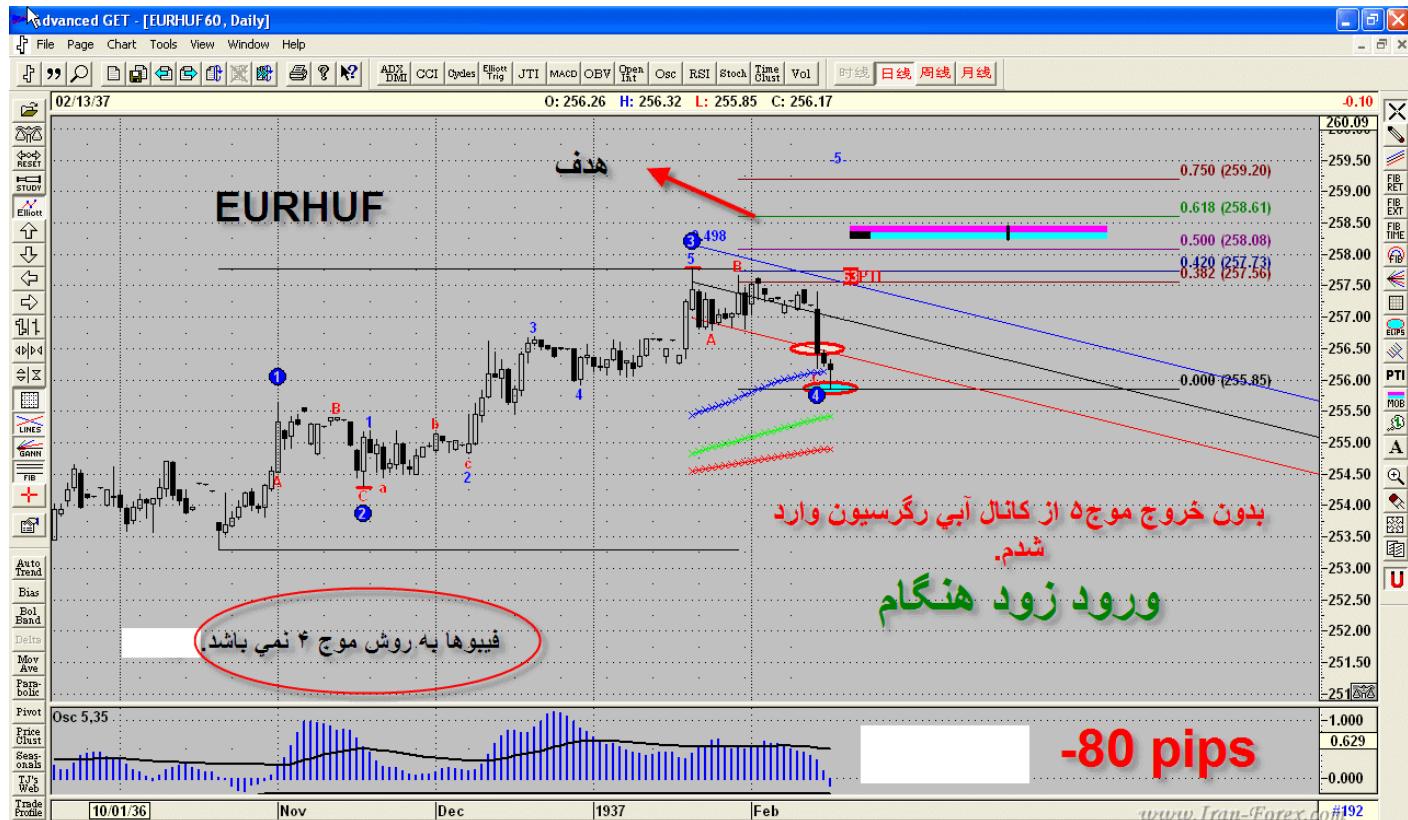
طریقه‌ی رسم خطوط فیبو EXT برای تعیین نقطه خروج بدون شماره گذاری موج ۵



چند مثال از چگونگی استفاده از خطوط فیبو
نتیجه زیاد مطمئن نیست چون pti کمتر از ۳۵ است. تنها جنبه‌ی آموزشی داشت.



گفتم شاید لازم باشه چند تا مثال واقعی در مورد موارد بالا را اضافه کنم.
دلایل شکست ۱. بدون خروج موج ۵ از کانال های آبی، وارد شدم. ۲. استفاده‌ی نابجا از انواع فیبو زدن

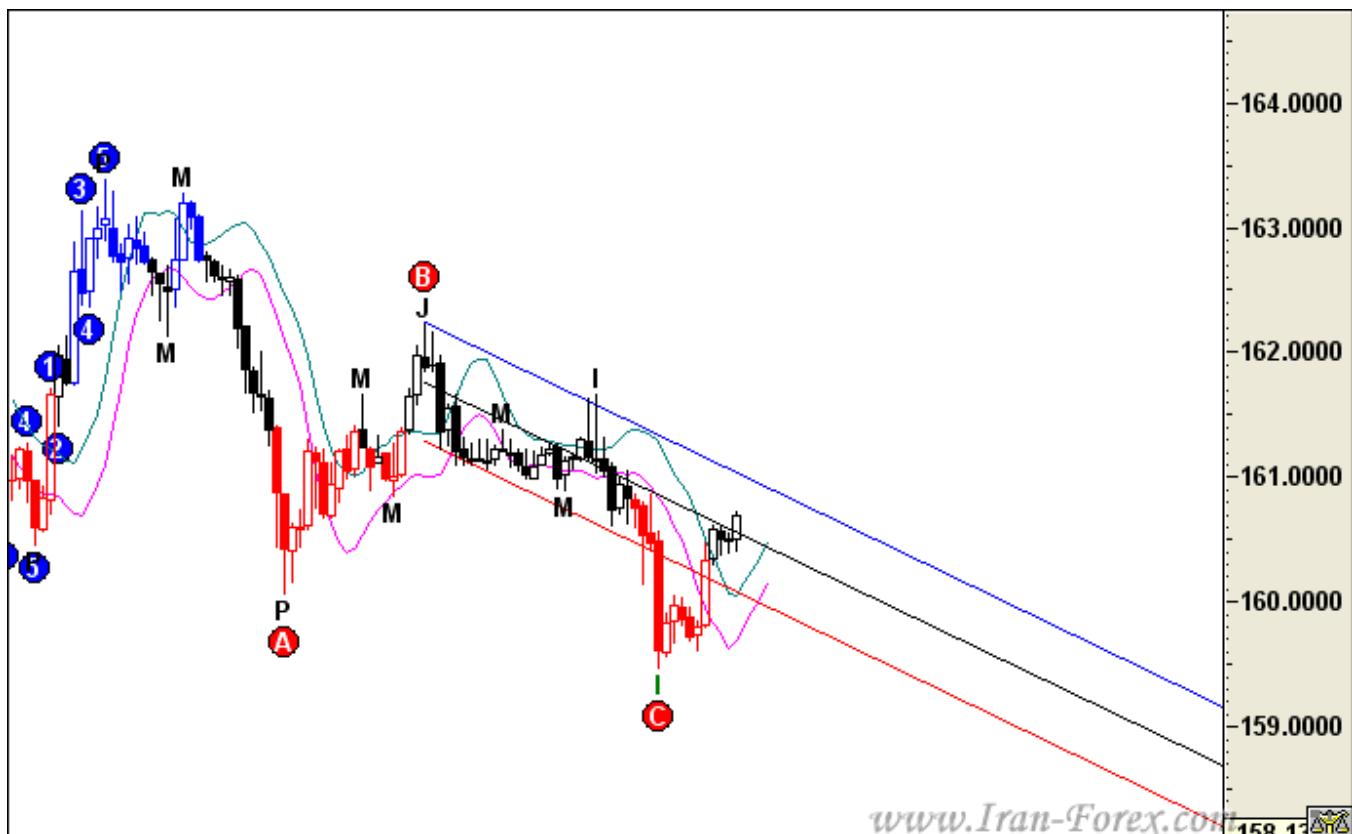


تستی در مورد رابطه طمع و ضرر 61.8% فیبوناچی بهتر است یا 75% از نظر سود 75% طمینان 61.8%.



اسیلاتور

اسیلاتور Advanced GET با خطوط نوسانگر برای متاتریدر) فایل ضمیمه ی پست شده (نقل قول:



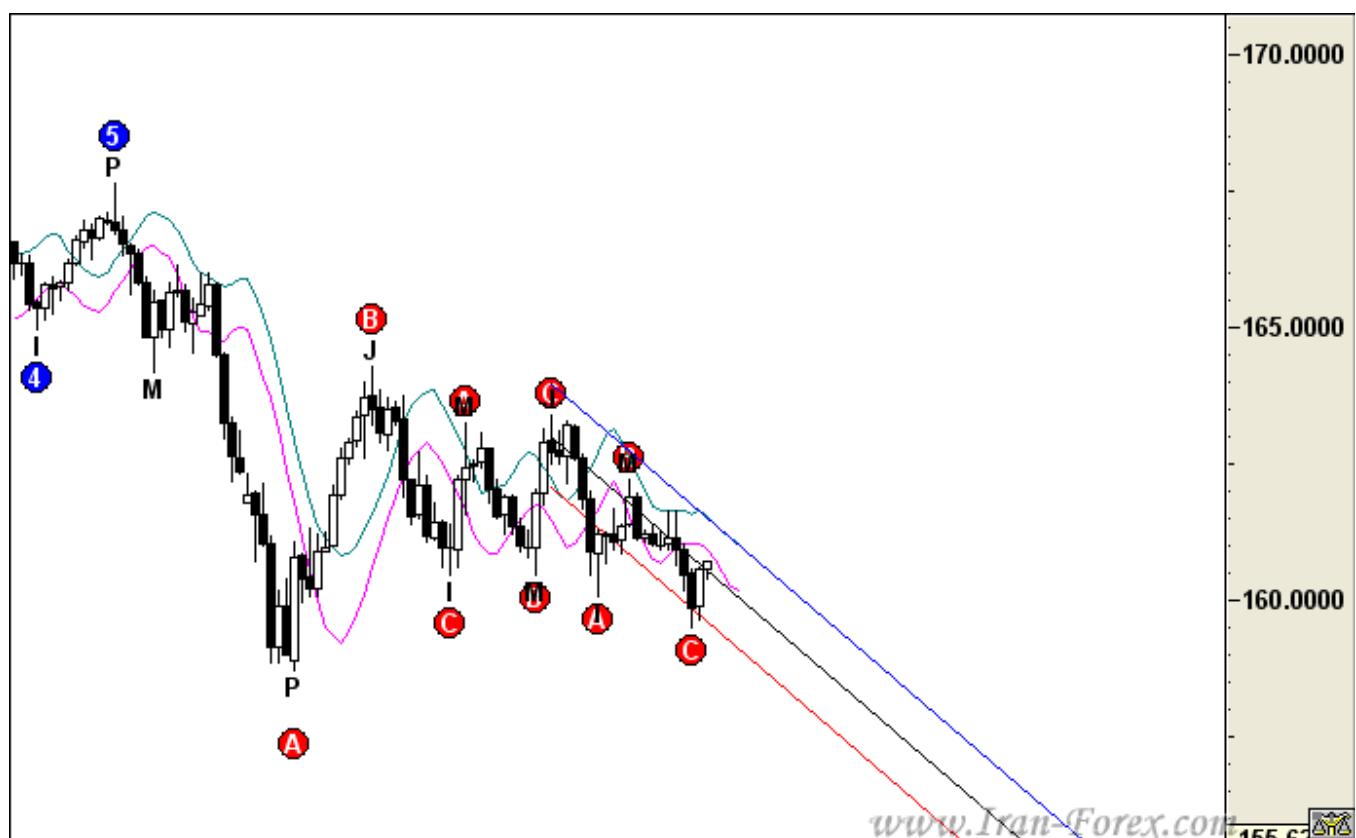
هر دو DMA و خط میانی کanal شکسته شده اند. اگر قیمت در آن سمت خط بالایی کanal بسته شود به احتمال زیاد صعودی در کار است. هنگامی که نرم افزار امواج اصلاحی را نشان می دهد از پنجره Elliott Waves آلترناتیو شماره سه را انتخاب می کنیم:

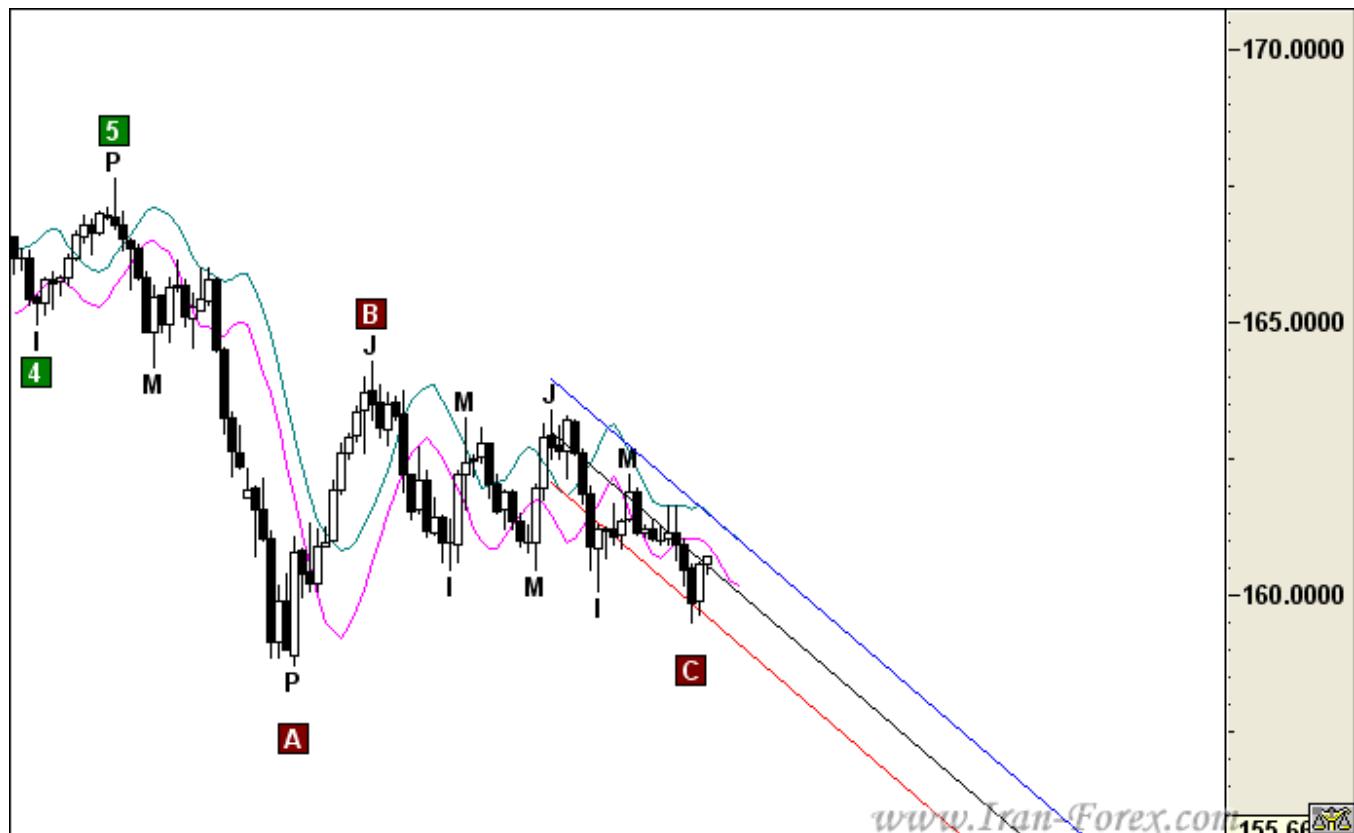


آلترناتیو سه نیز امواج را اصلاحی نشان می دهد. به تایم چهار ساعته می رویم:

این بار هم اصلاحی است. قیمت خط میانی کanal را شکسته اما هنوز موفق به قطع هر دو DMA نشده است.

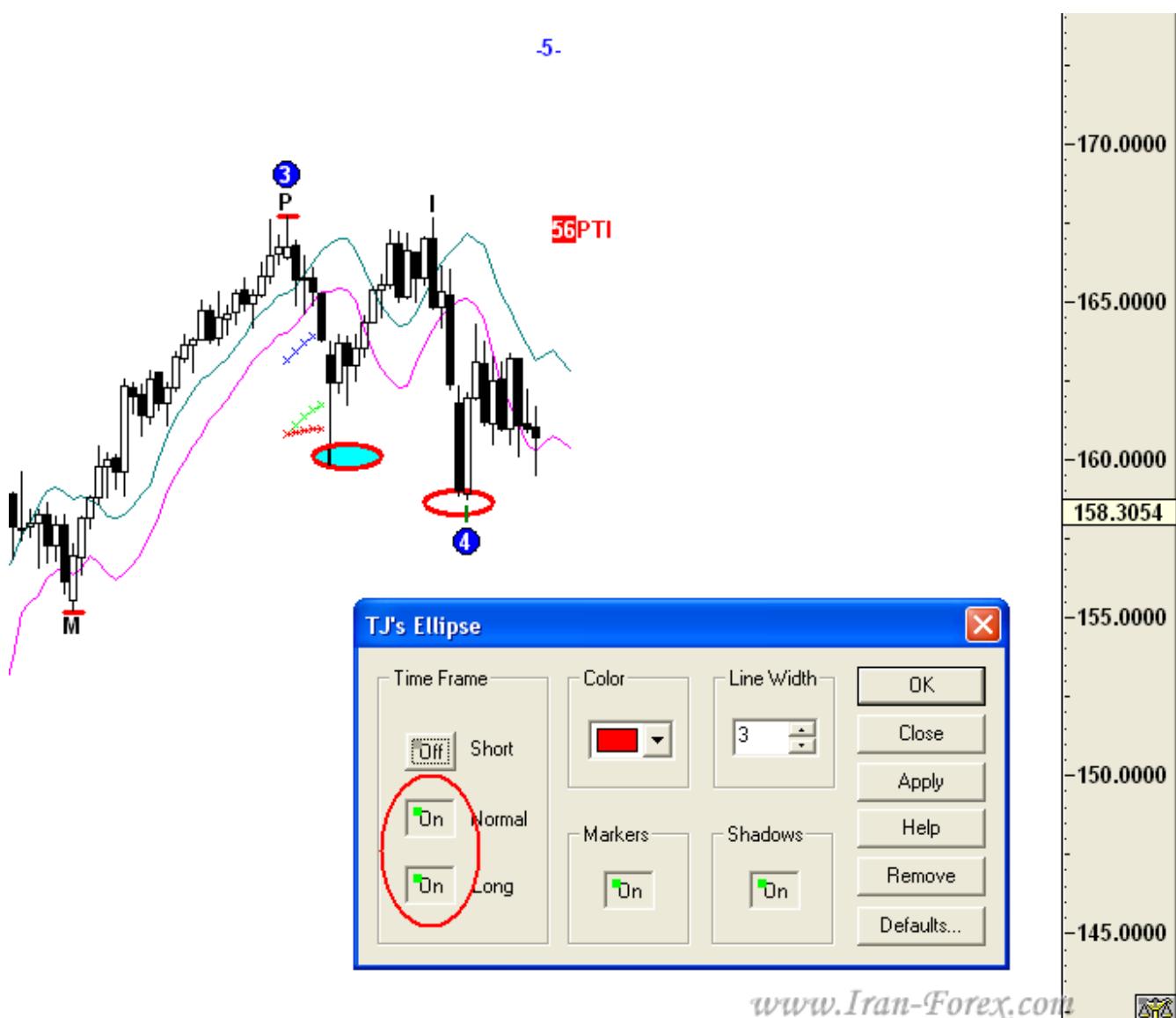
آلترناتیو سه:

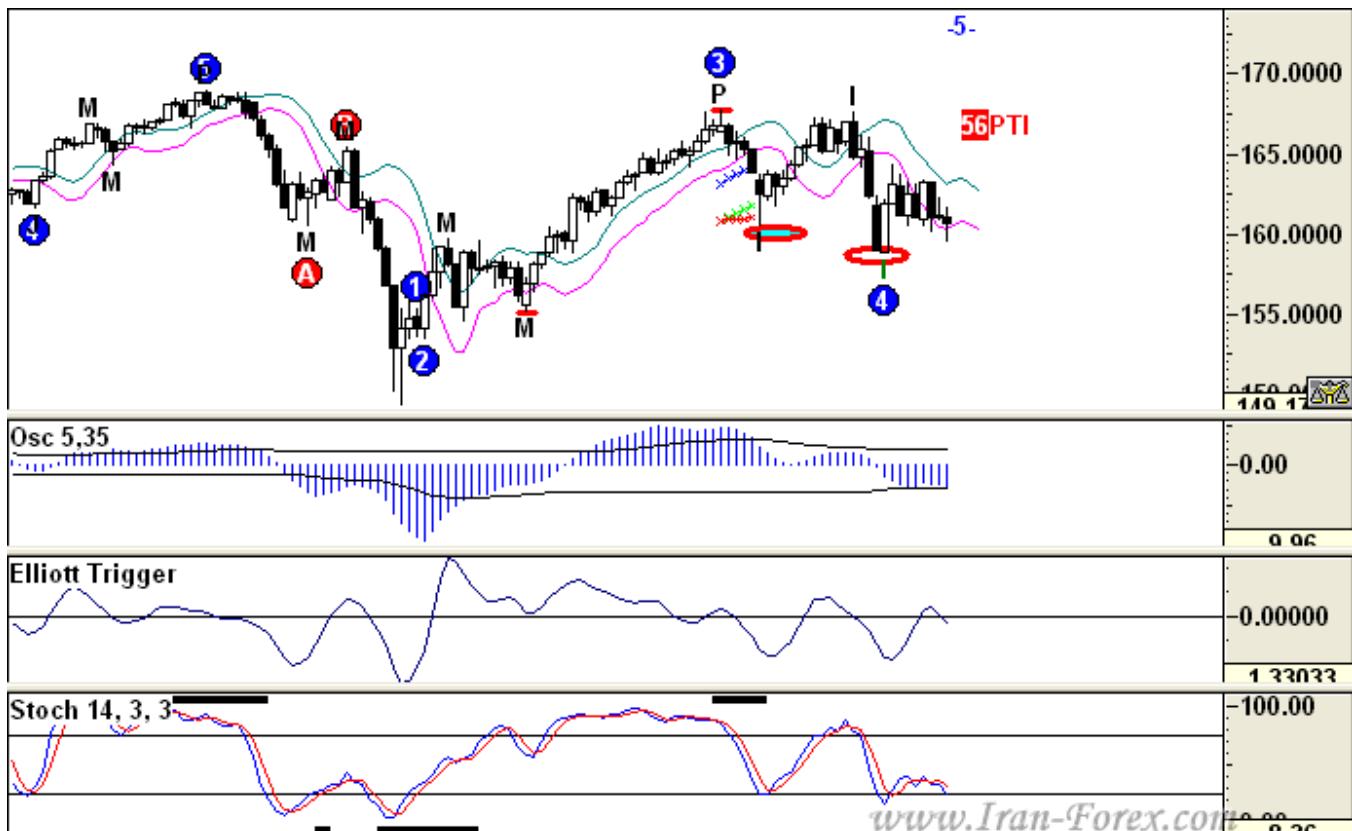




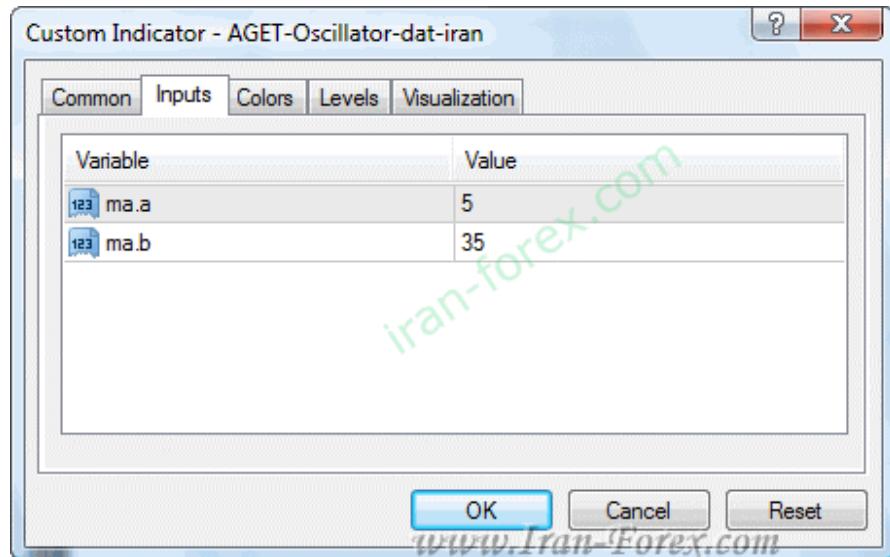
و باز هم اصلاحی. حال به تایم روزانه می رویم:

رونده صعودی است و به نظر می رسد موج چهارم به اتمام رسیده است. همانطور که در شکل نشان داده شده از پیوت M تا پیوت (P) انتهای موج سوم (بیضی) را رسم کنید و در پنجره آن دکمه On در حالت قرار دهید. مشاهده می کنید که قیمت با رسیدن به دو بیضی نرمال و بلند مدت عکس العمل نشان داده است و این مسئله ما را به اتمام موج چهارم مطمئن تر می سازد. می توان صبر کرد تا DMA دیگر نیز شکسته شود اما اگر تایم فریم های پایین تر صعود را نشان دادند می توان زودتر از موعد اقدام به خرید کرد و تمام موج پنجم در تایم روزانه را شکار نمود.





اسیلاتور Advanced GET با خطوط نوسانگر برای متاتریدر با قابلیت تغییر دوره ها
 سیلاتور Advanced GET با خطوط نوسانگر برای متاتریدر
 ندیکاتوری که استاد (آقا بنیامین) زحمت آپلودش را کشیدن ، فقط دوره ی ۵,۳۵ را بروی متاتریدر نشان میدهد و امکان تغییر این اعداد همانند محیط نرم افزار وجود ندارد.
 در صورتیکه از اسیلاتور برای شمارش آلترياناتیوها استفاده میکنید ، می توانید اندیکاتور زیر را دانلود کرده و اعداد مربوط را در متاتریدر هم تغییر دهید.



بالا بردن درصد موفقیت

در اینجا نکاتی جهت بالا بردن درصد موفقیت بیان می شود: اول: از تایم فریم چهار ساعته برای تأیید استفاده کنید. اگر وضعیت مناسب داشت و ساز مخالف نمی زد ترید کنید.

دوم: در ترید نوع اول هنگامی که صفر می رسد بهتر است کمی صبر کنید تا Oscillator تغییر روند دهد. وقت کنید منظور مثبت یا منفی شدن Oscillator نیست. مثلا اگر از سمت مثبت به صفر رسیده است کمی صبر کنید تا روند آن رو به بالا شود حالا چه مقدار آن مثبت باشد چه منفی. در این زمان می توانید استاپ لاس را کمی پایین تر از Low انتهای موج چهارم در روند صعودی و یا کمی بالاتر از High انتهای موج چهارم در روند نزولی قرار دهید. البته اگر تحمل استاپ لاس بیشتر را دارید می توانید در همان لحظه ای که Oscillator به صفر می رسد در Open کندل بعد وارد شوید که در اینجا از خطوط فیبوناچی برای تعیین استاپ لاس استفاده می شود و مطمئن تر است.

سوم: هنگامی که پوزیشن شما در سود نشست استاپ لاس را تنگ تر کنید که البته در این مورد هر کس لستراتژی مخصوص به خود را دارد.

چهارم: اگر به سود کمتر قانع هستید می توانید از اردر گذاری استفاده کنید. بدین روش که در ترید نوع اول:

- در روند صعودی یک اردر **Buy Stop** به فاصله چند پیپ بالای انتهایی موج سوم قرار دهید.
 - در روند نزولی یک اردر **Sell Stop** به فاصله چند پیپ پایین انتهایی موج سوم قرار دهید.
 هدف انتهایی موج پنجم - شماره گذاری شده توسط نرم افزار - می باشد. در اینجا استاپ لاس کمی قضاوتی میشود و بستگی به میزان تحمل ضرر و مدیریت سرمایه شما و وضعیت قیمت و ارز دارد. بین ۳۰ تا ۵۰ پیپ قرار دهید. البته اینجانب از روش اردر گذاری کمتر استفاده می کنم ولی اگر هم استفاده کنم برای GBPJPY بیشتر از ۵۰ و برای سایر ارزها بیشتر از ۳۵ پیپ قرار نمی دهم. در این مورد خود شما باید تجربه کنید و به تنظیمات مناسب برسید.

پنجم: حتما می دانید که لحظه خروج از معامله بسیار مهم است. چه زمانی پوزیشن را دستی ببندیم؟ مثالی می زنم:

در ساعتی خاص مثلا ۷ صبح با برقرار بودن شرایط و تأیید تایم چهار ساعته وارد معامله در یک جفت ارز خاص می شویم. ساعت مثلا ۱۲ دوباره شرایط را بررسی می کنیم و می بینیم که همان پوزیشن هنوز باز است ولی شرایط در جهت معکوس برقرار شده است. چهار ساعته نیز تأیید می کند. دو راه دارید:

- پوزیشن را دستی در سود یا ضرر ببندید و پوزیشنی در جهت مخالف باز کنید.
 - اجازه دهید پوزیشن قبلی باز بماند و پوزیشنی جدید در جهت مخالف باز کنید.

تصمیم گیری با شماست که با رعایت مدیریت سرمایه می توانید انتخاب کنید. در زمینه مدیریت سرمایه نیز به خواست خدا در آینده مطالبی عرض خواهد شد.

دکمه های تایم فریم

در اینجا لازم است نکته ای راجع به دکمه های تایم فریم نوار ابزار عرض کنم. معنای این دکمه ها که با مکس کردن موس بر روی آنها نشان داده می شود شما را به اشتباہ نیاندازد:

۱- دکمه اول یا **Daily Data** برای نمایش چارت یک ساعته.

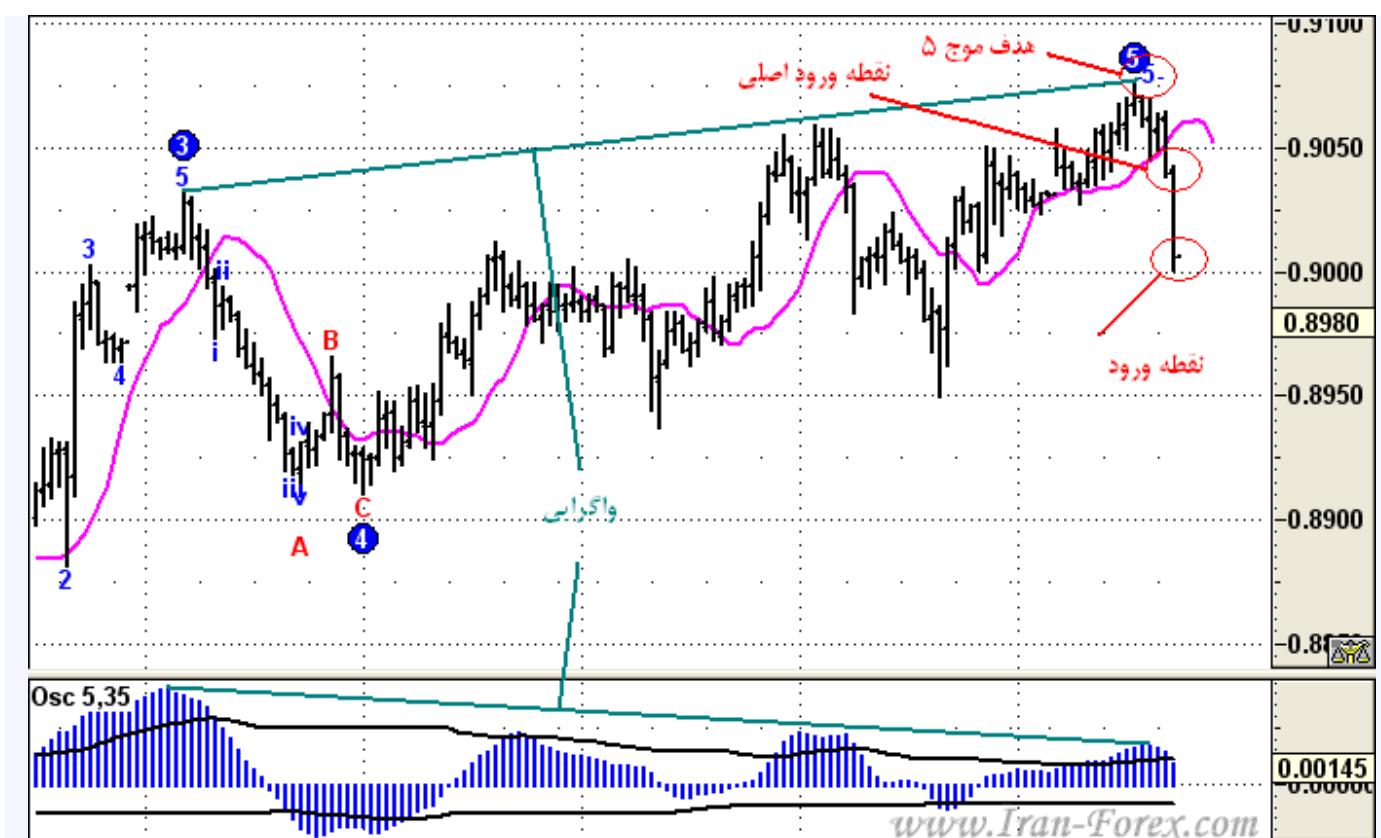
- ۱- دکمه دوم یا **Weekly Data** برای نمایش چارت چهار ساعته.
- ۲- دکمه سوم یا **Monthly Data** برای نمایش چارت روزانه.

برای گرفتن تأیید از تایم فریم چهار ساعته کافیست با کلیک دکمه مربوطه، آن را در همان پنجره مشاهده کنید و نیازی به لود کردن آن از پنجره **New Chart** نیست.

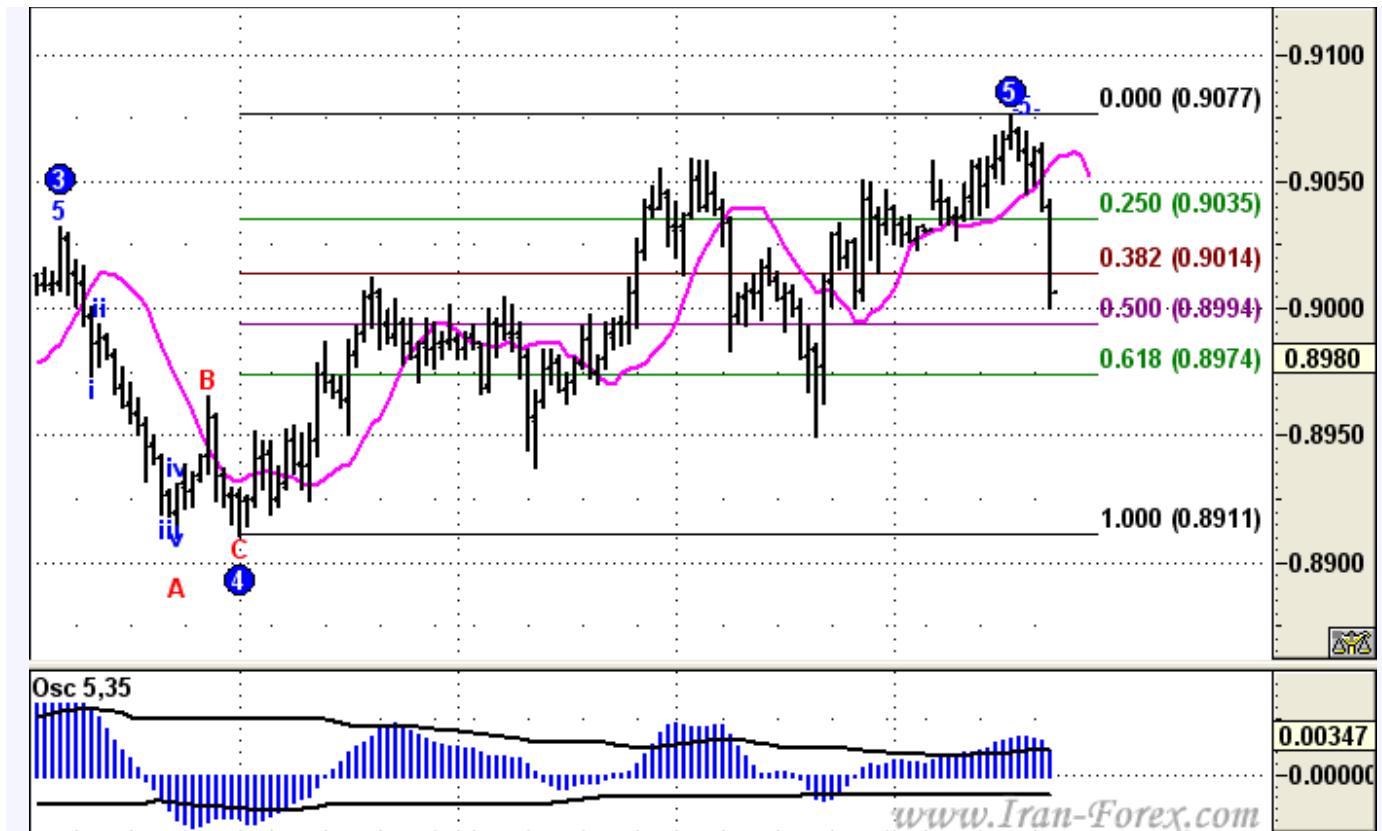


یک مثال - نمونه ای دیگر از نتایج ۱ و ۲

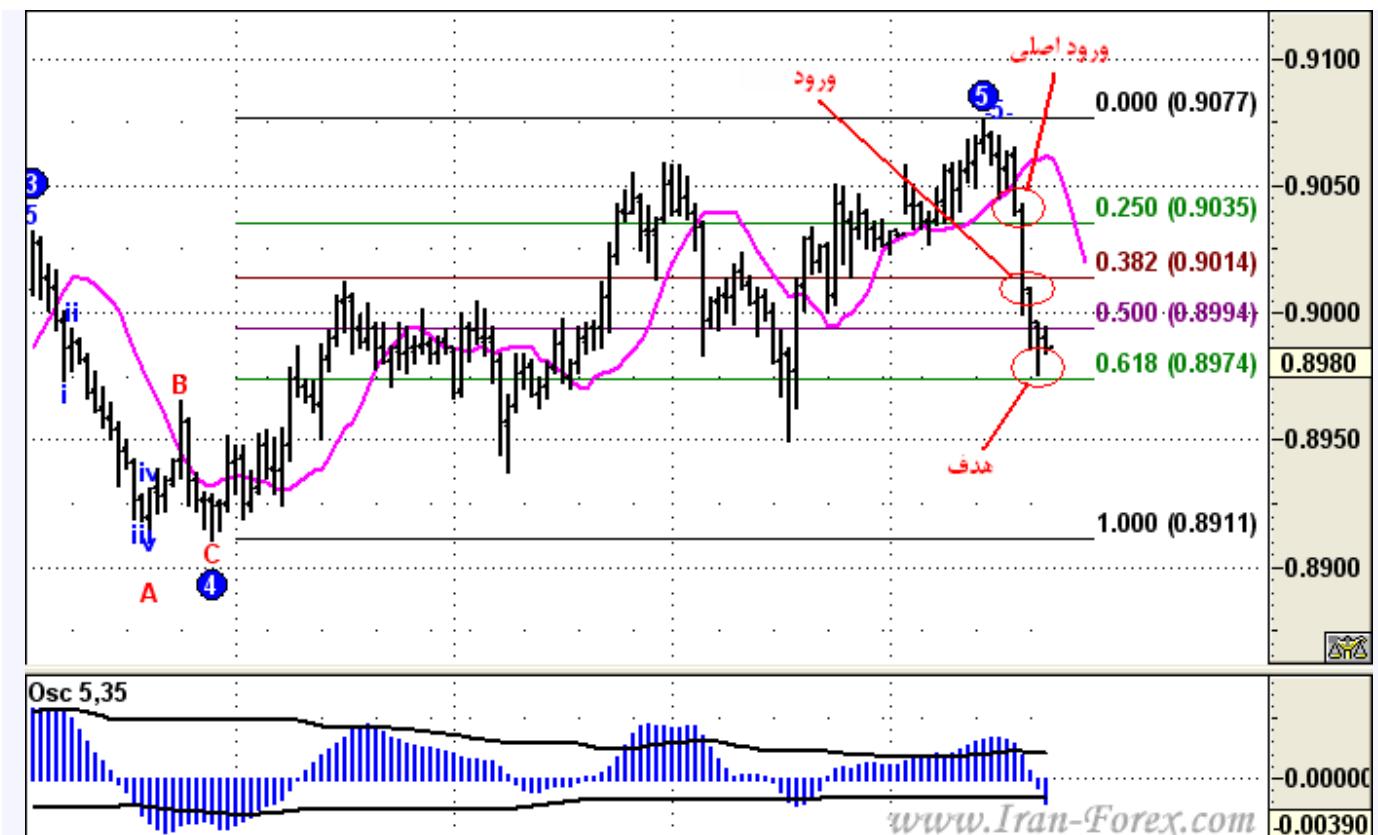
موقعیت امروز برای **AUDUSD** که بنده به دلیل عدم حضور با تأخیر وارد شدم: (سل نوع دوم)



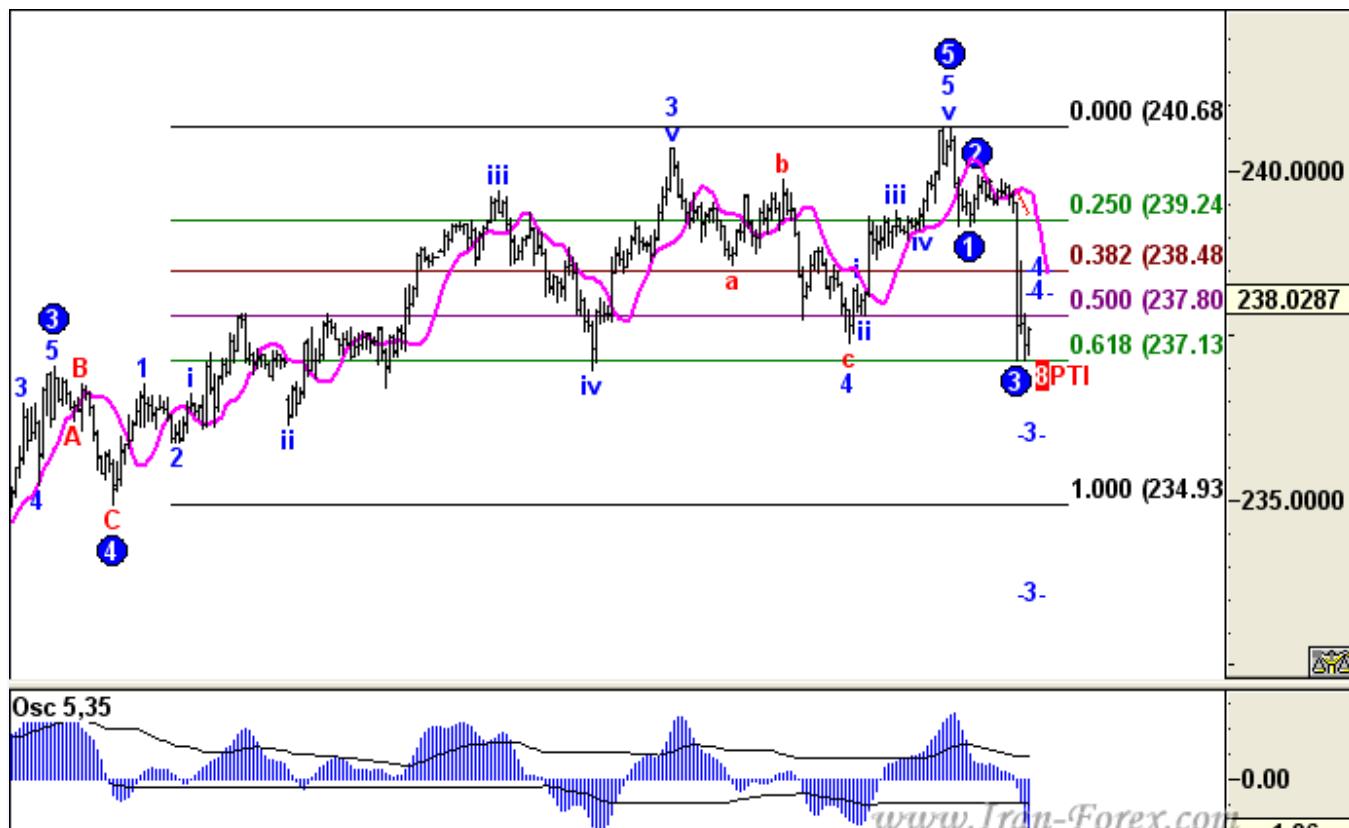
رسم فیبوناچی برای تعیین هدف کوتاه مدت:
 نقطه ۰.۸۹۸۰ کمی بالاتر از ۰.۶۲٪ تارگت مناسبی است



اصابت به هدف:



دو تارگت تعیین شد: چند پیپ بالای خطوط ۳۸٪ و ۵۰٪ که امروز به هر دو اصابت کرد و تا ۶۲٪ نیز پایین آمد:





در مورد آلترينتيو توضیح خواهم داد.



دو نکته (سریعتر لود شدن چارت ها - استفاده از تایم چهار ساعته در ترید نوع دوم)

نکته اول:

برای سریعتر لود شدن چارت ها در متاتریدر که به دلیل اندیکاتور ادونسید گت ممکن است کند شده باشد، در Charts متاتریدر خود به منوی Tools بروید و گزینه Options را انتخاب و در پنجره ظاهر شده به زبانه رفته و از قسمت پایین آن تعداد بارهای History را روی ۲۰۰۰ یا ۳۰۰۰ تنظیم نمایید. متاتریدر را بسته و تمام فایل های PRN ایجاد شده در پوشه Experts/Files را پاک کرده و دوباره متاتریدر را اجرا و چارت های مورد نظر را لود کنید. برای لود کردن چارت ها در نرم افزار نیز از تعداد بارهای ۱۰۰۰ استفاده نمایید.

نکته دوم:

برای ترید نوع دوم سعی کنید از نمودار چهار ساعته استفاده کنید. تصویر زیر نمودار جفت ارز EURJPY را

در تایم چهار ساعته نشان می دهد. به کندل ستاره ایجاد شده (نشانه تغییر روند) که شاخ آن با هدف موج پنجم برخورد داشته توجه کنید، یک چنین نزدیکی به هدف موج پنجم در ترید نوع دوم مد نظر است:



اندیکاتور اصلاح شده

اندیکاتور Aget - Elliot Confirm V003؛ ورژن بعدی آن میباشد که هم این و قبلی توسط همکاران عزیzman در fxpars تهیه شده؛ در این ورژن جدید تر به علت تکرار حلقه برنامه آن برای میله ها به مقدار ۱۷۰۰۰ کمی سرعت اجرای برنامه متاتریدر را در صورت نصب چند نمودار پائین می آورد. و البته این اندیکاتور جدیدترینی Aget - Elliot Confirm V003 کارتر میباشد آن هم در صورتی که بخواهیم نمودار با میله های مورد علاقه و مد نظر خودمان داشته باشیم بدین صورت که مثلا در نمودار یک ساعته چنانچه ضریب آن را به روی ۲ قراردهیم نمودار حاصله در Advanced Get یک نمودار ۲ ساعته باشمارش الیوت مخصوص آن خواهد داشت که با هر باز و بسته شدن برنامه به راحتی آپدیت میشود قبل از تنظیم یک همچین حالتی ما مجبور بودیم که از اندیکاتور Period_Converter_Opt استفاده کنیم آن هم به صورت آفلاین و بدون قدرت آپدیت مداوم که با عنایت همکاران عزیز این مشکل حل شد. اگر دوستان نمیخواهند که دائم نمودار با تنظیم ساعتی مورد نظرشان را داشته باشند و از همین تایفرم ها استفاده میکنند، توصیه بندۀ این است که برای سرعت در کارهایشان از این اندیکاتور قبلی که ایرادات بسیار کوچکش رفع شده استفاده کنند.

ترید نوع سوم

همانطور که می دانید نرم افزار ادونسد گت دارای دو استراتژی می باشد. یکی از آنها ترید در انتهای موج چهارم برای شکار موج پنجم است که ترید نوع اول نام دارد و دیگری ترید در انتهای موج پنجم برای شکار حرکت به سوی انتهای موج چهارم که ترید نوع دوم نامگذاری شده. طی دو سه ماه اخیر که با دقت بیشتری نرم افزار را بررسی کردیم توانستیم روشی را که البته نیاز به تست بیشتری دارد ابداع کنیم و آن ترید در انتهای موج سوم برای شکار موج چهارم است که ما آن را ترید نوع سوم می نامیم. البته این نوع ترید دارای ریسک نسبتا بالایی است زیرا هنگامی که قیمت

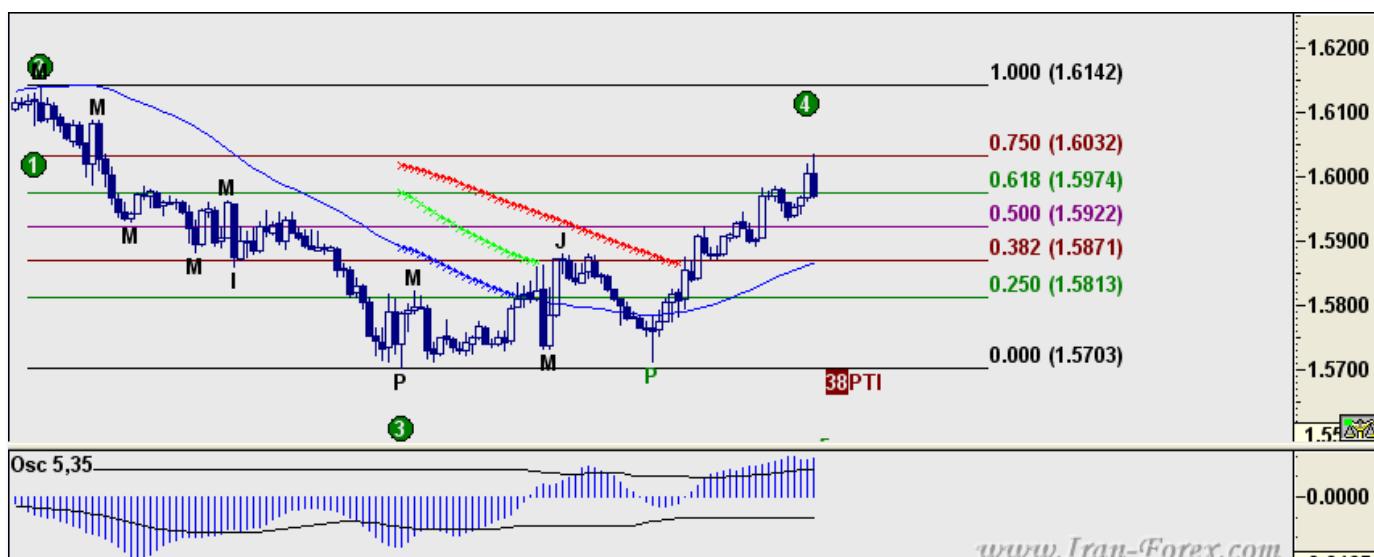
در موج چهارم حرکت می کند با نوسانات بسیار زیادی دیده می شود. در چنین شرایطی نیز هست که سیستم ها و استراتژی های کاملاً مکانیکالی از قبیل Power Break و ... ضررده می شوند. بنابراین ما آن را در همه موارد توصیه نمی کنیم. توجه فرمایید که این نوع ترید هیچ گونه ارتباطی با استراتژی های نرم افزار ندارد و فقط به عنوان یک ایده ابتکاری در این تاپیک مطرح شده است.

تصویر زیر را ببینید:



هنگامی که قیمت در پایان موج سوم به سمت اصلاح خود حرکت می کند و قصد دارد که موج چهارم را بسازد سه کanal رنگی که قبلاً در مورد آنها صحبت شده است ظاهر می گردند ما در اینجا فقط به کanal آبی رنگ یعنی همان کanalی که به قیمت نزدیکتر است توجه می کنیم. این کanal مانند بقیه کanalها یک میانگین متحرک است که دوره یا پریود آن را می توانید با آزمون و خطاب بیابید. در تصویر بالا کanal آبی یک میانگین متحرک با پریود ۴۴ است که قیمت تقریباً آن را قطع کرده. بررسی ها و تجرب نشان داده که با قطع این کanal می توانید به آغاز موج چهارم با احتمال بالایی مطمئن شوید، پس از قطع کanal معمولاً یک برگشت اتفاق می افتد، قیمت در این برگشت نخواهد توانست که از اکسترمم موج سوم رد کند (در اینجا از Low موج سوم)، بعد از آن مجدداً به سمت تکمیل موج چهارم پیش رفته و در یکی از نسبت های فیبوناچی بازگشت می کند. در این نوع ترید نقطه ورود می تواند Open کندل بعد از تقاطع قیمت با کanal آبی باشد یا

اینکه در حرکت بازگشتی که پس از تقاطع معمولاً اتفاق می‌افتد در نظر گرفته شود. اگر این تقاطع در نسبت‌های بالا مانند بیش از ۳۸ درصد اتفاق بیافتد دیگر آن ترید مقرر نمی‌شود. تارگت معمولاً می‌تواند ۵۰ درصد فیبوناچی باشد اما مواردی نیز هست که صرفه نخواهد بود. تارگت معمولاً می‌تواند ۳۸ درصد شروع به ساختن موج پنجم می‌کند. استاپ هم در این نوع ترید **LOW** موج سوم (در اینجا) با ۲۰ یا ۳۰ پیپ فاصله اطمینان است.



یک نکته برای تریدهای بلند مدت ترید‌های کوتاه مدتی که انجام می‌دهیم معمولاً با بررسی تایم‌های یک، چهار و روزانه است. اگر مایل به تریدهای بلند مدت تر هستید می‌توانید از تایم‌های چهار ساعته، روزانه و تأیید از هفتگی استفاده کنید که به نظرم نتیجه آن می‌تواند به مراتب بهتر باشد.



منابع

iran-forex.com از سایت Advanced Get آموزش •

