

«به نام خالق زیبایی ها»

به روزهای پایانی و جلسات نهایی نزدیک می شوید.
امیدواریم با تمرین و ممارست که از طریق اکانت Demo میسر است خود را برای مضمون واقعی در بازار آماده فرمایید.
برای گشایش حساب آزمایشی Demo Account می توانید به بخش گشایش حساب Demo در سایت fxacm مراجعه فرمایید.

آموزش بورس بین الملل (FOREX)

جلسه سیزدهم

تئوری امواج الیوت

جلسه سیزدهم

تئوری امواج الیوت

در سالهای بین ۱۹۲۰ تا ۱۹۳۰ نابغه ای به نام رالف نلسون الیوت وجود داشت که کشف کرد، بازار بر خلاف آن چیزی که به نظر می آید رفتار مشخصی از خود نشان می دهد.

الیوت ادعا کرد که تریدرها و سرمایه گذاران در اثر عوامل خارجی که احساسات آنها را به شیوه های مختلفی تحت تاثیر قرار می دهد، رفتاری را نشان می دهند که به طور متناوب تکرار می شود.

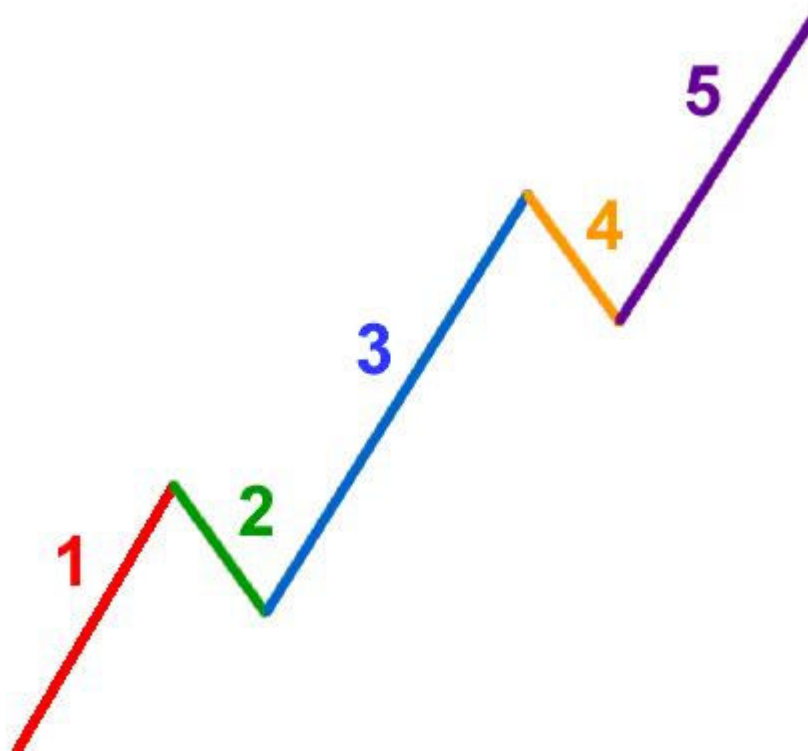
از نظر او حرکت های صعودی و نزولی قابل تشخیص در بازار که از اراده جمعی نشأت می گیرد، همیشه در الگوهای یکسانی تکرار می شود. او این الگوها را "امواج" نامید و نظریه ای به نام: تئوری موجی الیوت، را مطرح کرد.

در این بخش قصد داریم به این مبحث مهم بپردازیم

الگوهای موجی ۳-۵

آقای الیوت نشان داد که یک بازار دارای روند، به شکل الگوی موجی ۳-۵ حرکت می کند. الگوی پنج موجی اول، امواج اصلی (*Impulse*) و الگوی سه موجی بعدی امواج اصلاحی (*Corrective*) نامیده می شوند.

در ابتدا اجازه بدهید که به الگوی پنج موج اصلی نگاهی بیندازیم.



در این قسمت به شرح مختصری از آنچه در طول هر موج اتفاق می افتد می پردازیم .
در مثال از بازار سهام استفاده می کنیم زیرا آقای الیوت هم از همین بازار برای تشریح
تئوری خود استفاده کرده بود . ولی توجه داشته باشید که نوع بازار مهم نیست و می
توانید این تئوری را از بازار ارز گرفته تا بازار نفت و طلا و ... به کار ببرید.

موج 1

سهام حرکت اولیه خود را انجام داده است . این حرکت به این دلیل رخ داده است که
تعدادی از معامله گران به طور ناگهانی (به دلایل مختلف واقعی یا تصوراتشان)
احساس کرده اند که قیمت پایین است و باید بخرند . این عامل موجود رشد قیمت
شده است.

موج 2

در این مرحله عده ای از معامله گران حاضر در موج اول احساس می کنند که قیمت
بیش اندازه بالا رفته و سود خود را گرفته و معاملات خود را بسته اند . این باعث می

شود که سهام دوباره سقوط کند .. اما سقوط آن به اندازه ای نیست که به قیمت پایین تر از ابتدای شروع موج اول برسد .

موج ۳

این موج طولانی ترین و قوی ترین موج است . بازار توجه اکثریت معامله گران را به خود جلب کرده است . بیشتر مردم جذب این سهام شده اند و مایل به خرید آن هستند . این امر باعث می شود قیمت سهام بالا و بالاتر برود . در بیشتر مواقع قیمت سقف در موج سوم بالاتر از قیمت سقف در انتهای موج اول است .

موج ۴

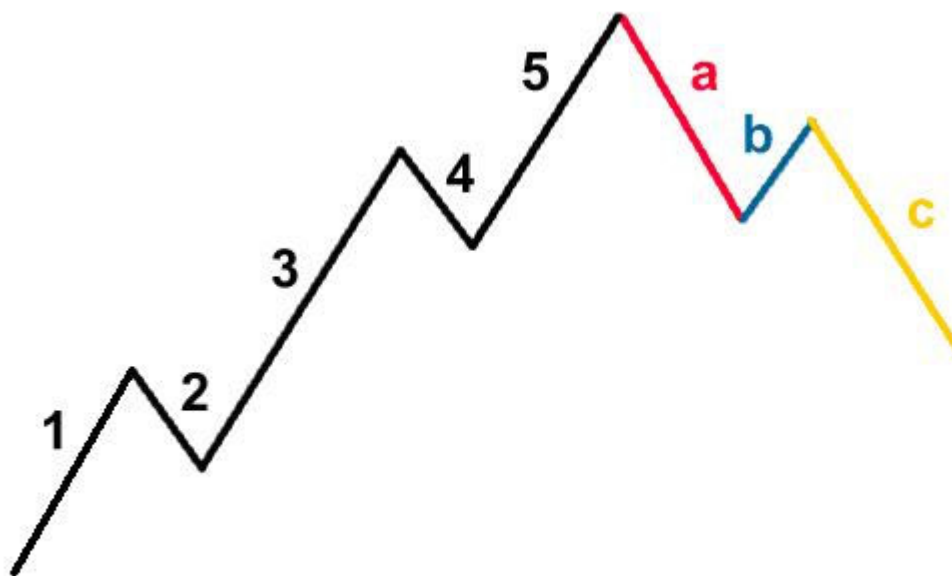
مردم شروع به گرفتن سود و بستن معاملات خود می کنند . زیرا فکر می کنند قیمت بیش از اندازه بالا رفته است . این موج ضعیف است . زیرا بیشتر مردم اعتقاد دارند که قیمت هنوز بالا می رود و می خرند .

موج ۵

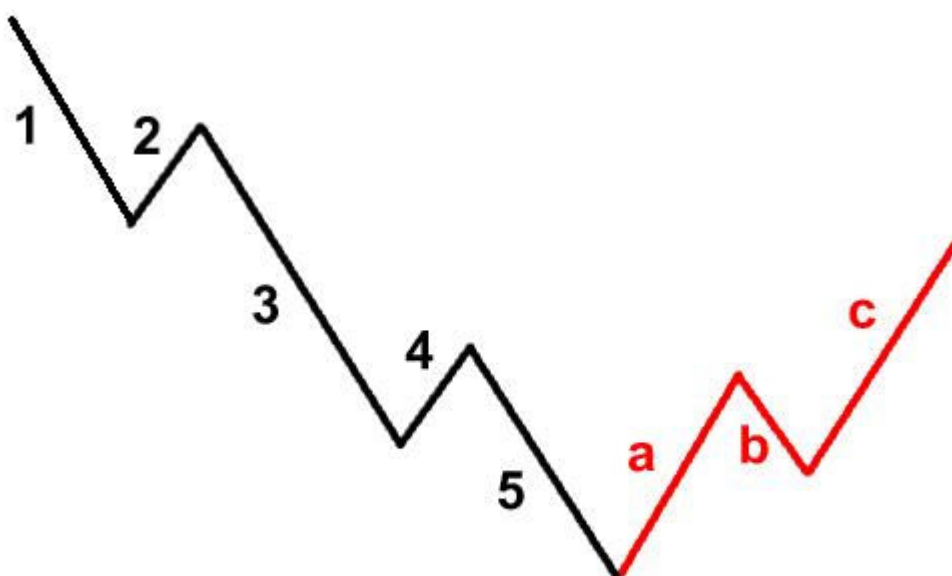
این موجی است که در آن مردم زیادی دیوانه وار ، وارد بازار می شوند و این سهم را می خرند . مدیر عامل شرکتی که این سهم را ارائه می دهد روی جلد مجلات مختلف اقتصادی و مالی به عنوان برترین مدیر سال معرفی می شود ! دلایل بسیاری از کسانی که برای خرید این سهم وارد بازار شده اند شاید خنده دار باشد ولی در هر حال موجب بالا رفتن بیش از اندازه قیمت سهم می شود . محدودیتها با شروع الگوی ABC آغاز می شود .

اصلاح ABC

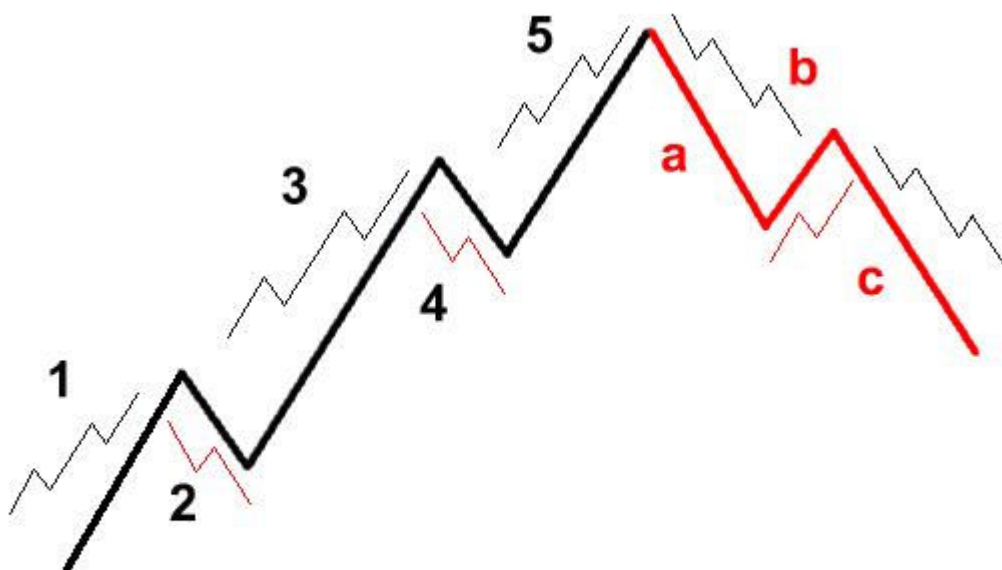
الگوی پنج موجی توسط الگوی سه موجی اصلاح شده و بازار بر می گردد . مثال زیر را برای درک بیشتر قضیه بررسی نمایید .



از آنجاییکه در مثال بازار صعودی را به کار بردم نباید فکر کنید که تئوری الیوت برای بازار نزولی کاربرد ندارد. شکل امواج برای بازار نزولی به شکل زیر است.



نکته مهم دیگری که باید به خاطر داشته باشید این است که هر موج از تعدادی زیر موج تشکیل شده است. در زیر شکل دیگری را مشاهده می کنید.



همانطور که می بینید موج ۱ از پنج موج اصلی کوچکتر و موج ۲ از سه موج اصلاحی کوچکتر تشکیل شده است و به همین ترتیب امواج بعدی.

بسیار خوب ، بیایید نگاهی به یک مثال واقعی بیندازیم.

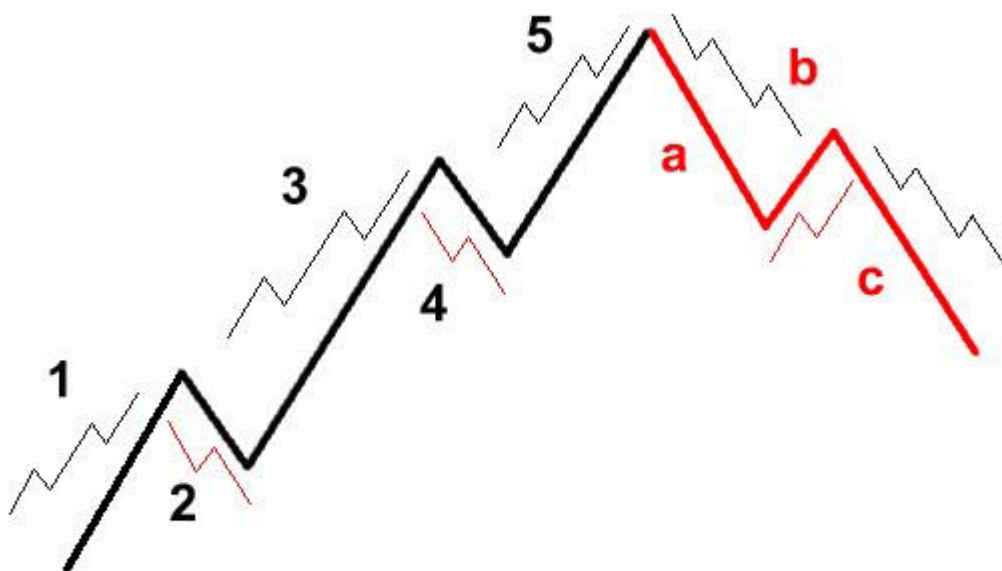


همانطور که متوجه شده اید شکل امواج در دنیای واقعی کاملاً واضح نیست . بسیاری

از اوقات به سختی می توانید امواج را روی نمودار نامگذاری کنید . ولی به مرور زمان و با تمرین روی نمودارهای مختلف ، مساله برایتان جا می افتد.

خب ، این هم از امواج الیوت . به خاطر داشته باشید بازار به شکل امواج حرکت می کند . از این به پس اگر کسی گفت : " موج ۲ کامل شد . " منظور او را می فهمید . آموزش امواج الیوت در آموزش تحلیل الیوت به صورت بسیار مفصل تر آمده است .

- بر اساس تئوری الیوت بازار به شکل الگوهای تکراری که موج نامیده می شوند ، حرکت می کند .
- یک بازار دارای روند به شکل الگوی موجی ۳-۵ حرکت می کند . ۵ موج ابتدایی امواج اصلی نامیده می شوند و ۳ موج بعدی ، امواج اصلاحی هستند .
- اگر با دقت به نمودارها نگاه کنید این امواج را در آنها تشخیص می دهید .



ایجاد یک سیستم معاملاتی

آیا قادر به رویارویی با واقعیت هستید ؟

جالب ترین قسمت ترید ، ایجاد یک سیستم معاملاتی است!

با یک جستجوی ساده در گوگل تعداد زیادی تبلیغ سیستم معاملاتی را مشاهده می کنید که هر کدام ادعا دارند بهترین هستند و تنها با چند هزار دلار می توان آنها را خریداری کرد.

از قرار معلوم این سیستم ها هفته ای هزاران پیپ نصیب ما می کنند و هیچ گاه هم ضرر نمی کنند . نتایجی که ارائه دهنده های آنها نشان می دهند که حاکی از این موضوع است . شما هم پیش خود فکر می کنید که : " خب ، می توانم بابت این سیستم (مثلا) ۳۰۰۰ دلار به این فرد بدهم و با این کارایی که این سیستم دارد این هزینه را تقریبا در همان هفته اول تامین کنم".

من به شما می گویم قبل از خرید سیستم اندکی درنگ کنید . مطالبی هست که هنوز باید بیاموزید.

واقعیت این است که بیشتر این سیستم ها عملکرد خوبی دارند . مشکل اینجاست که تریدرها انضباط لازم را برای دنبال کردن آنها ندارند.

واقعیت بعدی این است که به جای صرف پول می توانید با صرف وقت ، سیستم تان را خودتان طراحی کنید و پولی را که قرار بود برای خرید سیستم هزینه کنید ، سرمایه گذاری کنید.

واقعیت دیگر این است که طراحی یک سیستم زیاد مشکل نیست . آنچه مشکل است دنبال کردن سیستم و قوانینی است که برای خود وضع کرده اید . در اینجا سعی داریم به شما بیاموزیم که چگونه سیستمی مناسب خودتان طراحی کنید . در انتها مثالی از یک سیستم مشابه سیستم مورد استفاده مان می زنیم .

اهداف سیستم معاملاتی شما

می دانم که یک چنین هدفی دارید ، " هدف من از داشتن یک سیستم معاملاتی کسب یک میلیارد دلار است " . با وجود اینکه هدفی جالبی به نظر می رسد ولی هدفی نیست که از شما یک معامله گر موفق بسازد.

هدف شما از طراحی یک سیستم معاملاتی این است:

- (۱) سیستم شما باید تا با حداکثر سرعت ممکن شروع یک روند را تشخیص دهد.
- (۲) این سیستم باید به گونه ای شفاف و دقیق باشد که از هر گونه برداشت دوگانه ای جلوگیری کند.

اگر سیستم شما این دو هدف را تامین کند ، موفقیتتان حتمی است . قسمت مشکل قضیه اینجاست که این دو هدف به نوعی با یکدیگر در تضادند . زیرا در تشخیص خیلی سریع روند بارها ممکن است دچار خطا شویم.

در طرف دیگر اگر بخواهیم کمتر خطا کنیم ، فرایند تشخیص روند کند می شود . وظیفه شما این است که سیستمی طراحی کنید که بهترین مصالحه را بین این دو حالت برقرار کند . راهی پیدا کنید که روند را به سرعت تشخیص دهید و در کنار آن راهی بیابید که سیگنال های تقلبی را از سیگنالهای واقعی تمیز بدهید . در هنگام طراحی سیستم این دو اصل را به خاطر داشت باشید . زیرا کلید موفقیت شما در بازار است.

سیستم " ساده " من!

در این بخش برای اینکه یک ایده کلی راجع به یک سیستم پیدا کنید، مثالی از یک سیستم معاملاتی می آورم.

تنظیمات انجام معامله

- ترید روی نمودار روزانه
- EMA 5 بعد از بسته شدن شمع اعمال می شود .
- EMA 10 بعد از بسته شدن شمع اعمال می شود .
- استوکستیک (۳ و ۳۰)

• $RSI(14)$

قوانین انجام معامله

• استاپ لاس 30 = پیپ

• قوانین ورود به معامله :

(۱) می خرم اگر :

• $5EMA, 10EMA$ را از بالا قطع کرده بود و هر دو خط استوکستیک به

سمت بالا بودند (اگر خطوط استوکستیک قبلا در ناحیه اشباع خرید

بودند، وارد معامله نمی شوم)

• RSI از پنجاه بزرگتر باشد .

(۲) می فروشم اگر :

• $5EMA, 10EMA$ را از سمت پایین قطع کرده بود و هر دو خط

استوکستیک به سمت پایین بودند (اگر خطوط استوکستیک قبلا در

ناحیه اشباع فروش بودند، وارد معامله نمی شوم)

• RSI کمتر از پنجاه باشد .

• قوانین خروج

• اگر $5 EMA$ در جهت مخالف معامله من $10 EMA$ را قطع کرده بود و

RSI دوباره به پنجاه بازگشته بود، خارج می شوم .

بسیار خوب ، بیاید با بررسی یک نمودار نگاهی به عملکرد این سیستم بیندازیم .

به کار گیری سیستم در یک مثال

همانطور که دقت کرده اید تمام ابزار یک سیستم خوب در اختیار ماست اولاً اینکه

تصمیم داریم هر روز معامله کنیم. دوم اینکه از میانگین های متحرک برای تشخیص

شکل گیری روند استفاده می کنیم.

استوکستیک ها به ما کمک می کنند که بعد از تقاطع میانگین های متحرک در صورت

وجود شرایط مساعد وارد معامله شویم و از اینکه در شرایط اشباع خرید یا فروش

معامله کنیم جلوگیری می نمایند RSI . ابزار دیگری است که به تایید شکل گیری روند کمک می کند.

بعد از بررسی شرایط ورود به معامله، ریسک خود را تعیین می کنیم. در اینجا ما با خود قرار گذاشته ایم که برای هر معامله ۳۰ پیپ ریسک کنیم. واضح است که هر چه تایم فریم بزرگتر باشد میزان ریسک باید بیشتر باشد، زیرا سود به دست آمده هم بیشتر است.

بعد نقطه ورود و خروج را تعیین می کنیم.
مثال:

با توجه به سیستم خود و شرایط پیش آمده در نمودار می بینیم که زمان خرید است. روی کاغذ نقطه ورود (قیمتی که در آن وارد معامله می شویم)، استاپ لاس و نقطه خروج را می نویسیم. سپس در نمودار به اندازه یک شمع به جلو پیش می بریم (کلید $F12$ در نرم افزار متا تریدر) تا ببینیم چه اتفاقی می افتد.



در اینجا سود خوبی گرفتید. باید به خودتان جایزه بدهید. وقتی میانگین های متحرک در جهت خلاف معامله یکدیگر را قطع کردند از معامله خارج می شویم. به خاطر داشته باشید همیشه معاملات این گونه پیش نمی روند ولی هر اتفاقی بیفتد شما باید نسبت به سیستم خود وفادار باشید .



در این مثال با شرایط پیش آمده وارد فروش می شویم. اکنون می توانیم نقطه ورود و خروج و استاپ لاس را تعیین کرده و برای اینکه ببینیم چه اتفاقی می افتد نمودار به اندازه یک شمع به جلو پیش می بریم شرط 1000 دلار که این معامله سود دارد.



دیدید درست گفتم . در معامله باقی می مانیم تا شرایط خروج به وجود بیاید. ممکن است با خودتان فکر کنید که این سیستم راحت تر از این حرفهاست که سود ده باشد .

اما کم کم با واژه *KISS* آشنا می شوید که مخفف این است *Keep It Simple Stupid* : در واقع یک سیستم معاملاتی باید ساده باشد. هر چه سیستم پیچیده تر باشد دردسر آن هم بیشتر است. لازم نیست برای وارد شدن به یک معامله از میلیون ها اندیکاتور استفاده کنید. تنها نکته مهم در موفقیت رعایت انضباط در پیروی از سیستم است. همیشه و در هر شرایطی نسبت به سیستم خود وفادار باشید.

وقتی آزمایش های لازم را روی سیستم انجام دادید (آزمایش به همین روشی که توضیح دادیم و آزمایش به طور زنده روی حساب دمو) ، تنها کاری که باید بکنید این است که به سیستم خود اعتماد کنید. اعتماد، اعتماد، اعتماد رمز موفقیت در معاملات .

خلاصه

تعداد بیشماری سیستم سود ده وجود دارد، اما به دلیل اینکه تریدرها در دنبال کردن آنها منضبط نیستند، هیچ وقت به سود نمی رسند.

سیستم معاملاتی شما باید دو هدف زیر را تامین کند:

- (۱) سیستم شما باید تا با حداکثر سرعت ممکن شروع یک روند را تشخیص دهد.
- (۲) این سیستم باید به گونه ای شفاف و دقیق باشد که از هر گونه برداشت دوگانه ای جلوگیری کند.

اگر سیستم شما از آزمایش سربلند بیرون آمد آن را در یک حساب دمو به طور زنده و به مدت دو ماه آزمایش کنید. زیرا شرایطی که بازار واقعا حرکت می کند تا شرایطی که ما در آزمایش خود دستی این حرکت را انجام می دادیم، واقعا متفاوت است. بعد از سود بخش بودن سیستم تان در معامله دوماهه روی حساب دمو، می توانید آن را در معاملات واقعی به کار ببرید. فقط به خاطر داشته باشید در هیچ شرایطی از آن تخطی نکنید.

شش گام طراحی سیستم

تایم فریم مورد نظر خود را انتخاب کنید .

اندیکاتورهایی که به تشخیص روند کمک می کنند تعیین کنید .

اندیکاتور هایی برای تایید این تشخیص پیدا کنید .

ریسک خود را معلوم کنید .

نقاط ورود و خروج را تعیین کنید .

قوانین سیستم خود را روی کاغذ بنویسید و در هر شرایطی به آنها وفادار باشید .

سه مرحله در آزمایش سیستم

یک تاریخ را روی نمودار را انتخاب کنید و بر اساس قوانین سیستم خود معامله کنید و شمع به شمع روی آن به جلو بروید. (یعنی شمعی که خارج از صفحه است و در

هنگام معامله آن را نمی دیدید.) تا ببینید چه نتیجه ای حاصل شده است ..نتایج را ثبت کنید تا از سود دهی سیستم خود اطمینان حاصل کنید .

اگر سیستم تان سود ده بود به مدت دو ماه آن را روی حساب دمو و به صورت زنده آزمایش کنید. این کار ایده خوبی راجع به معامله کردن در بازاری که واقعا در حال حرکت است به شما می دهد و با آزمایش قبلی که به طور دستی جلو می رفتیم، فرق می کند .

اگر سیستم شما از این آزمایش هم سربلند بیرون آمد، می توانید روی یک حساب واقعی با آن کار کنید. فقط به خاطر داشته باشید که تحت هیچ شرایطی از قوانین آن تخلف نکنید.