

«به نام خالق زیبایی ها»

یکی از بهترین دغدغه های تریدر ها در این بازار، بخصوص افرادی که در ایران هستند چگونگی واریز و برداشت از حساب می باشد.
Fxacm با ارائه تسهیلاتی استثنایی در کمترین زمان و بدون کارمزد امور واریز و برداشت را برای مشتریان انجام می دهد و شما می توانید به راحتی پول خود را به ریال پرداخت و به ریال دریافت دارید و از گرفتاریهای تبدیل ارز و ارسال و مراسلات بانکی و هزینه های مربوطه که فعلا نیز تقریباً غیر ممکن است رهایی یابید.

آموزش بورس بین الملل (FOREX)

جلسه هشتم

میانگین های متحرک

جلسه هشتم

میانگین های متحرک

تعدیل کننده های قیمت (Price smoothies)

یک میانگین متحرک (Moving average) یک راه برای تعدیل حرکت قیمت است. با میانگین متحرک ما در واقع میانگین قیمت بسته شدن یک ارز را در "x" پریود آخر در نظر می گیریم.



میانگین های متحرک هم مانند سایر اندیکاتورها به ما در پیش بینی قیمت کمک می کنند. شما با نگاه کردن به شیب یک میانگین متحرک می توانید یک دید کلی نسبت به حرکت آینده قیمت داشته باشید.

همانطور که قبلا گفتیم، یک میانگین متحرک حرکت قیمت ما را تعدیل می کند. میانگین های متحرک متفاوتی وجود دارد و هر کدام درجه متفاوتی از تعدیل سازی را دارند. در هر حالت کلی هر چه میانگین متحرک ما ملایم تر باشد عکس العمل آن

نسبت به قیمت کندتر است و هر چه تیزتر باشد، نسبت به حرکات قیمت عکس العمل سریعتری دارد.

در ابتدا به معرفی انواع مختلف میانگین های متحرک می پردازیم و بعد از آن جنبه های مثبت و منفی هر یک را توضیح می دهیم ..

میانگین های متحرک ساده (Simple Moving Averages)

میانگین های متحرک ساده (SMA)

یک میانگین متحرک ساده، ساده ترین نوع میانگین های متحرک است. (نه بابا، راست می گی). اساسا یک میانگین متحرک ساده به این صورت بدست می آید: قیمتهای بسته شدن در "X" پیوند اخیر را با هم جمع می کنیم، سپس حاصل را بر "X" تقسیم می کنیم. اجازه بدهید بیشتر توضیح بدهم.

اگر می خواهید میانگین متحرک با دوره پنج را در یک نموداریک ساعتی رسم کنید باید در نقطه مورد نظر قیمتهای بسته شدن برای پنج ساعت آخر قبل از آن را با هم جمع کرده و حاصل را بر پنج تقسیم کنید. همین طور برای تمام نقاط تا آخر و در نهایت اتصال این نقاط به همدیگر میانگین متحرک شما را تشکیل می دهد.

اگر می خواهید میانگین متحرک با دوره پنج را در یک نمودار ده دقیقه ای رسم کنید باید در نقطه مورد نظر قیمتهای بسته شدن برای پنجاه دقیقه آخر قبل از آن را با هم جمع کرده و حاصل را بر پنج تقسیم کنید. همین طور برای تمام نقاط تا آخر و در نهایت اتصال این نقاط به همدیگر میانگین متحرک شما را تشکیل می دهد.

اگر می خواهید میانگین متحرک با دوره پنج را در یک نمودارسی دقیقه ای رسم کنید باید در نقطه مورد نظر قیمتهای بسته شدن برای صد و پنجاه دقیقه آخر قبل از آن را با هم جمع کرده و حاصل را بر پنج تقسیم کنید. همین طور برای تمام نقاط تا آخر و در نهایت اتصال این نقاط به همدیگر میانگین متحرک شما را تشکیل می دهد. و همین طور الی آخر.....

بیشتر بسته های نرم افزار نمودار این محاسبات را برای شما انجام می دهند . دلیل اینکه ما اینها را در اینجا برای شما توضیح می دهیم این است که شما مبانی اساسی میانگین های متحرک را آموخته و با توجه به نحوه محاسبه آنها ببینید که کدامیک برای سیستم معاملاتی شما بهتر است.

میانگین های متحرک هم مانند سایر اندیکاتورها با تاخیر عمل میکنند .



در اینجا مثالی از نحوه ملایم کردن حرکت قیمت توسط میانگین متحرک را مشاهده می کنیم.

در نمودار بالا شما سه SMA ساده را می توانید مشاهده کنید . همانطوری که می بینید ، هر چقدر دوره SMA طولانی تر باشد ، آن میانگین از قیمت دورتر می شود . دقت کنید که چگونه $SMA 62$ از $SMA 30$ و $SMA 5$ از قیمت دورتر است . این به خاطر این است که شما برای $SMA 62$ قیمت های بسته شدن ۶۲ دوره قبل را با هم جمع زده و به ۶۲ تقسیم کرده اید و همین امر باعث کندی عکس العمل میانگین به حرکت قیمت شده است.

SMA های موجود در این نمودار یک دید کلی از تمایل بازار در آن نقطه به شما می دهد . با کمک میانگین های متحرک ما به جای آنکه روی قیمت فعلی تمرکز کنیم ، دید بازتری نسبت به قیمت پیدا می کنیم و پیش بینی ما به واقعیت نزدیکتر خواهد بود

میانگین های متحرک نمایی (*Exponential Moving Average*)

میانگین های متحرک نمایی (*EMA*)

با وجود اینکه میانگین های متحرک ساده ابزاری عالی هستند ولی یک عیب بزرگ هم دارند و آن این است که نسبت به حرکات تیز قیمت آسیب پذیر می باشند . با یک مثال منظور را واضح تر بیان می کنم:

فرض کنید می خواهیم میانگین متحرک ساده با دوره پنج روی نمودار روزانه EUR/USD بکشیم و قیمت های بسته شدن هم برای این پنج روز عبارتند از :

روز اول : ۱,۲۳۴۵

روز دوم : ۱,۲۳۵۰

روز سوم 1.2360 :

روز چهارم : ۱,۲۳۶۵

روز پنجم : ۱,۲۳۷۰

میانگین متحرک مورد نظر بدین گونه محاسبه می شود:

$$(1.2345 \ 1.2350 \ 1.2360 \ 1.2365 \ 1.2370) \div 5 = 1.2358$$

خیلی ساده است مگر نه ؟

حال اگر قیمت روز دوم ۱,۲۳۰۰ بود چطور ؟ مقدار میانگین خیلی کمتر می شد و این احساس را در شما به وجود می آورد که قیمت در حال سقوط است ، در حالیکه

ممکن است در همان یک روز چنین اتفاقی افتاده باشد (مثلا شاید نرخ بهره کاهش یافته باشد).

منظورم این است که شاید گاهی این میانگین های متحرک بیش از اندازه ساده باشند . باید راهی وجود داشته باشد که شما بتوانید این قیمت های تیز را فیلتر کنید . بله ... راهی وجود دارد .

این راه در واقع همان ، میانگین های متحرک نمایی است.

میانگین های متحرک نمایی (EMA) وزن بیشتری به دوره های اخیر می دهند . در مثال ما یک میانگین متحرک نمایی وزن بیشتری به روزهای ۳-۵ می دهد . و این بدان معنی است که قیمت تیز روز دوم با وزن کمتری در میانگین دخالت دارد و در نتیجه نمی تواند تاثیر زیادی روی آن بگذارد . درواقع این میانگین های بیشتر به آنچه معامله گران اکنون در حال انجام آن هستند توجه دارند.



به عبارت دیگر خیلی بهتر است که ما رفتار اخیر معامله گران را در نظر بگیریم تا رفتاری که آنها مثلا در هفته یا ماه گذشته نشان داده اند.

SMA در مقابل EMA

کدامیک بهترند ؟ ساده یا نمایی

در ابتدا با میانگین متحرک نمایی آغاز می کنیم . اگر شما می خواهید که میانگین شما به حرکات قیمت عکس العمل سریعتری داشته باشد بهتر است از یک میانگین متحرک نمایی با دوره زمانی کوتاه استفاده کنید . این امر باعث می شود که شما روند را سریعتر تشخیص دهید و سریع تشخیص دادن روند به معنی گرفتن سود بیشتر است.

از طرف دیگر ممکن است شما دچار اشتباه شوید . چرا که میانگین خیلی سریع به قیمت عکس العمل نشان می دهد و شما در جایی فکر کنید که یک روند در حال شکل گیری است در صورتیکه آن یک جهش موقت قیمت بیشتر نبوده است .

در مورد میانگین های متحرک ساده عکس این موضوع صحیح است . وقتی می خواهید که میانگین شما خیلی ملایم و کند به قیمت جواب دهد ، بهتر است از یک میانگین متحرک ساده با دوره طولانی استفاده کنید .

از یک طرف این واکنش های کند شما را از اشتباهات مصون می دارد و از طرف دیگر ممکن است در تشخیص روند دچار تاخیر شده و معامله را از دست بدهید.

	SMA	EMA
مزایا:	یک حرکت ملایم را نشان می دهد و باعث می شود در حرکات تیز قیمت دچار اشتباه نشویم .	حرکتی سریع را نشان می دهد و کوچکترین جهش قیمت را نشان می دهد.
معایب:	با حرکت کند موجب تاخیر در تشخیص خرید یا فروش می شود .	باعث می شود جهش موقت قیمت با روند اشتباه گرفته شود .

پس کدامیک بالاخره بهترند ؟ این دیگر به شما بستگی دارد . بیشتر معامله گران چندین میانگین متحرک می کشند تا هر دو طرف داستان را داشته باشند . آنها ممکن است از یک میانگین متحرک ساده با دوره طولانی برای تشخیص روند استفاده کنند و یک میانگین متحرک نمایی بادوره کوتاه را برای تشخیص زمان ورود به معامله به کار می برند.

در واقع بیشتر سیستم های معاملاتی از تلفیق میانگین های متحرک استفاده می کنند . در ادامه به شما می آموزیم چگونه میانگین های متحرک را در سیستم معاملاتی خود به کار بگیرید.

خلاصه

یک میانگین متحرک راهی برای ملایم کردن حرکت قیمت است. انواع زیادی از میانگین های متحرک وجود دارد که دوتا از رایج ترین آنها عبارتند از: میانگین های متحرک ساده SMA و میانگین های متحرک نمایی EMA .

میانگین های متحرک ساده، ساده ترین نوع میانگین های متحرک هستند ولی نسبت به جهش قیمت آسیب پذیرند.

میانگین های متحرک نمایی وزن بیشتری به قیمتهای آخر می دهند، در نتیجه آنچه را که معامله گران اکنون در حال انجام آن هستند به ما نشان می دهند. خیلی بهتر است که ما رفتار اکنون معامله گران را در نظر بگیریم تا آنچه را که آنان در هفته یا ماه گذشته انجام داده اند.

میانگین های متحرک با دوره طولانی از میانگین های متحرک با دوره کوتاه ملایم ترند. میانگین های متحرک تیز نسبت به حرکت قیمت سریع تر واکنش نشان می دهند و می توانند روند را به سرعت تشخیص دهند ولی همین موضوع باعث می شود که نسبت به جهش های ناگهانی قیمت آسیب پذیر باشند.

میانگین های متحرک ملایم نسبت به حرکت قیمت واکنش کندی دارند ولی شما را از اشتباه کردن در مورد حرکات تیز قیمت مصون می دارند. ولی همین موضوع خود باعث می شود که نتوانید روند را به موقع تشخیص داده و وارد معامله شوید.

بهترین راه استفاده از میانگین های متحرک این است که انواع مختلفی از آنها را بکشید و بتوانید هم حرکات بلند مدت را ببینید و هم حرکات کوتاه مدت را.