جزوه تکمیلی
آنالیز تکنیکال

ترجمه: حامد بهاری
Email: Dr.H.Bahari@Gmail.com

با تشکر از:

سروران گرامی آقایان: غلامحسین جمیلی

وهاب قهرمانی

مهرداد فراهانی

رضا حسینی

فرزاد سروقدی

WWW.FXPARS.COM

فهرست: **صفحه**

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

قواعد: ترید نوع ۱ ۴۳

قواعد: ترید نوع ۲ ۴۵

مثال‌های تریدهای نوع یک و دو ۴۶

بررسی Buy نوع اول ۴۶

Buy نوع دوم ۴۷

بررسی سل نوع دوم ۴۸

پیش‌بینی عدم تشکیل موج ۵م یا تشکیل سقف دوقلو ۴۹

بررسی عدم تشکیل موج ۵ ۴۹

قدرت نمودارهای ۱ ساعته ۶۴

ارجاع به اطلاعات هفتگی ۷۹

آلترناتیوهای آنالیزور موج الیوت ۸۳

شمارش منطقه‌ای موج الیوت ۸۳

شمارش آلترناتیو ۸۴

آلترناتیو ۳ (بلند مدت) ۸۴

آلترناتیو ۲ (کوتاه مدت) ۸۶

آلترناتیو ۱ (تهاجمی) ۸۷

تکنیک‌های گان ۹۱

خطوط و زوایای گان ۹۲

استفاده از زوایای گان با امواج الیوت ۹۶

خطوط گان بهینه شده ۹۸

آنالیزور GANN BOX ۹۸

کانال‌های رگرسیون ترند ۱۰۶

سطوح T.J.'s Web ۱۰۸

نسبت های زمانی گسترش فیبوناچی ۱۱۱

خوشه‌های گسترش فیبوناچی قیمت ۱۱۶

خوشه‌های اصلاح فیبوناچی قیمت ۱۱۸

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

تکنیک موج الیوت

نگرش عملی- در ترکیب با GET

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

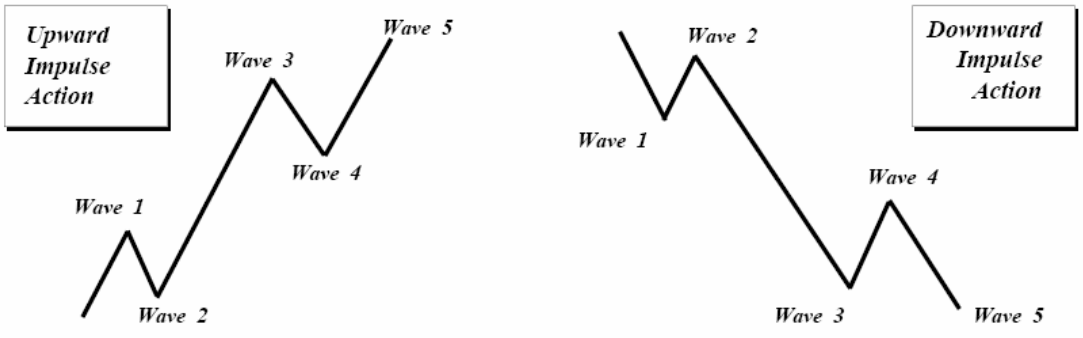
زمانی که آنالیز روشن و واضح نمی‌باشد چرا نباید بدنبال بازار دیگری باشیم که با الگوی موج الیوت تطابق داشته و ساده‌تر می باشد.

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

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

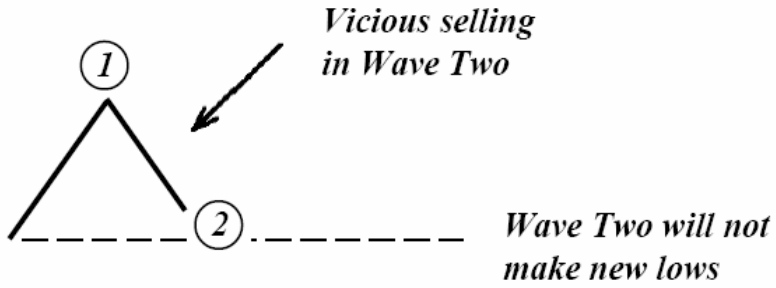
الگوهای حرکت

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

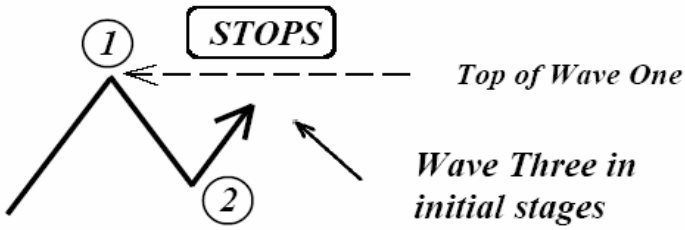


موج اول دارای رالی ضعیفی بوده و درصد کمی از تریدرها در این موج دست به ترید می‌زنند. بعد از اتمام موج اول، موج دوم آغاز می‌شود که Sell در یک ۵ موج صعودی کار

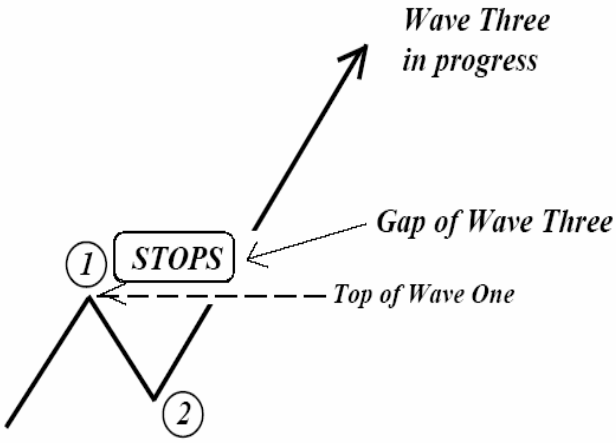
خطرناکی می‌باشد. موج دوم بدون آن که قیمت **Low** جدیدی بسازد، به اتمام می‌رسد و بازار از حول و حوش همان نقطه آماده رالی دیگری می‌شود.



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

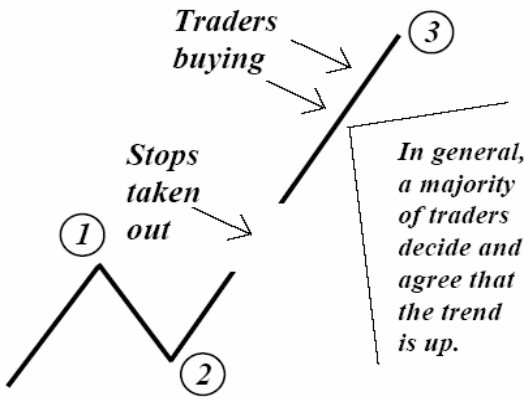


تریدرها از ادامه این رالی مطمئن نبوده و آن را کوتاه مدت در نظر می‌گیرند. برای اینکه این آنالیز صحیح باشد بازار نباید از بالای موج قبلی بالاتر برود.
بنابراین بالای موج ۱ **Stop**های زیادی وجود خواهد داشت.
رالی موج ۳ **Top** موج اول را رد می‌کند. در این زمان بازار از **Top** موج اول رد شده و **Stop**های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



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

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

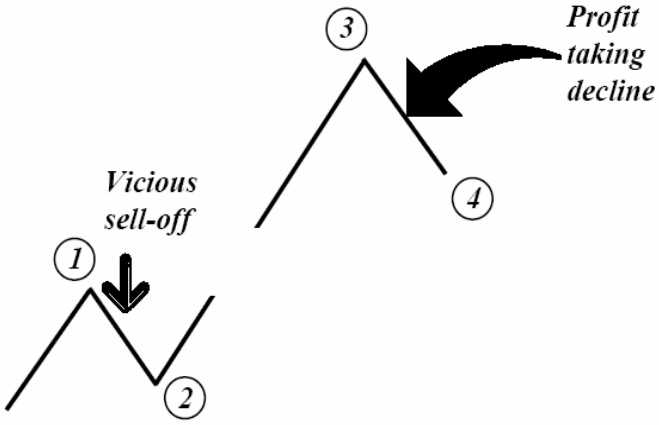


این زمان، زمانی است که اکثر تریدرها معتقدند که ترند بازار صعودی می‌باشد. در نهایت نیز همه التهاب‌های ناشی از Buy خاموش خواهند شد و موج سوم متوقف می‌شود.

در این زمان تریدرهایی که به طولانی بودن حرکت صعودی اعتقاد داشتند تصمیم به حصول سود خود می‌گیرند. آن‌ها ترید خوبی داشته‌اند و تصمیم می‌گیرند که سود خود را دریافت کنند.

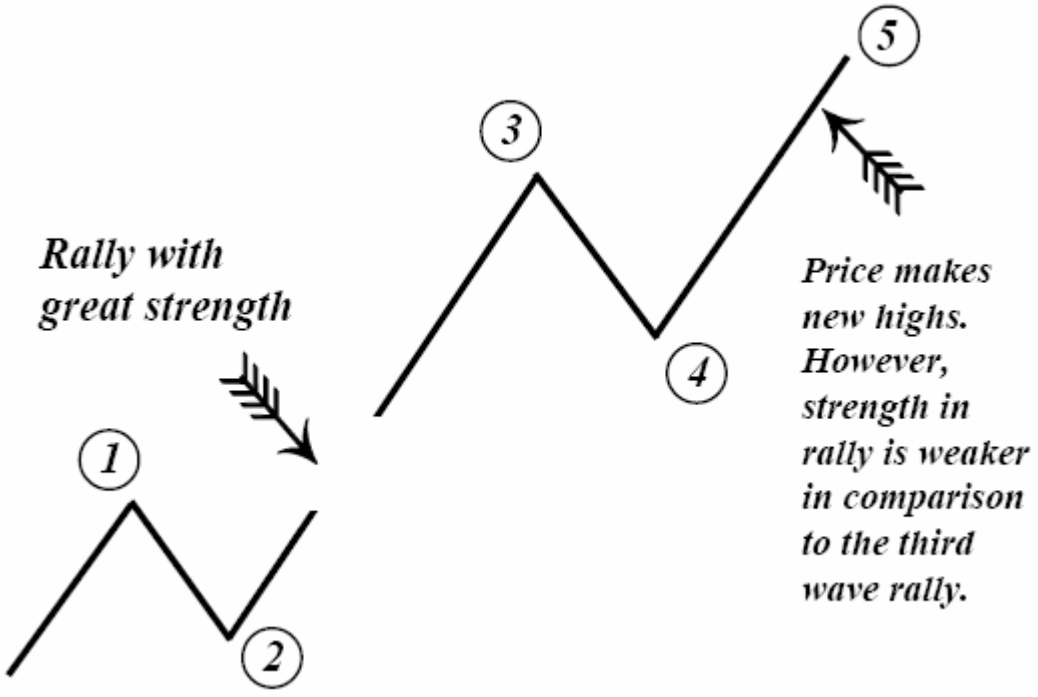
به این دلیل قیمت افت می‌کند و موج ۴ ساخته می‌شود. موج ۲ محل Sellهای خطرناک و موج ۴ محل عمل کردن Take Profit می‌باشد.

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



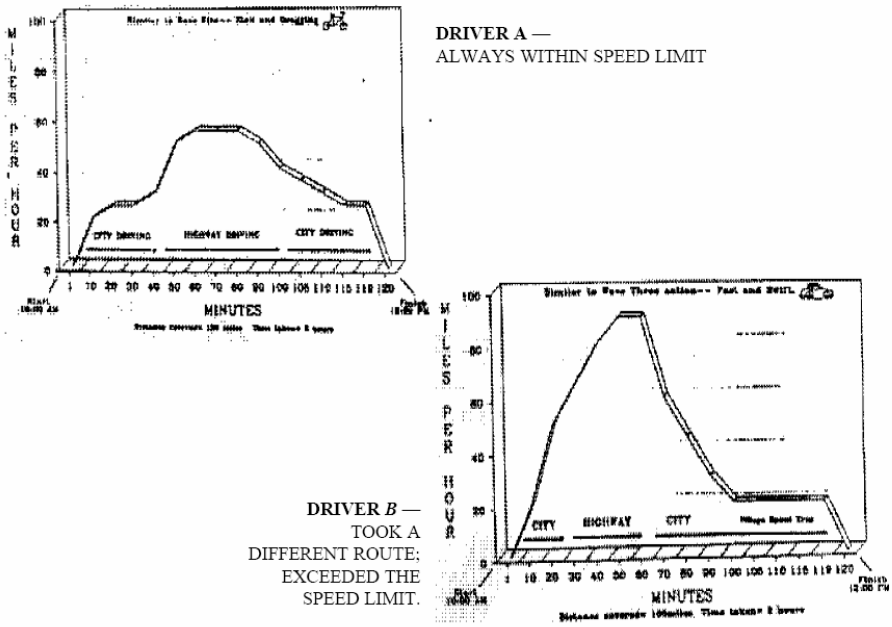
موج ۵ در مقایسه با موج ۳ از قدرت و تدام لازم برخوردار نیست. توسعه موج ۵ به خـاطر گروه کوچکی از تریدرها می‌باشد. زمانی که موج ۵ High بالاتری از موج ۳ می‌سازد برای توسعه یافتن از قدرت و تداوم لازم در مقایسه با موج ۳ برخوردار نیست.

در نهایت زمانی که این آخرین Buyها نیز خاتمه یافت نقاط پایانی بـازار خاتمـه یافتـه و وارد فاز جدیدی می‌شویم.



اندیکاتوری برای شمارش موج الیوت

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



DRIVER A —
ALWAYS WITHIN SPEED LIMIT

DRIVER *B* —
TOOK A DIFFERENT ROUTE; EXCEEDED THE SPEED LIMIT.

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

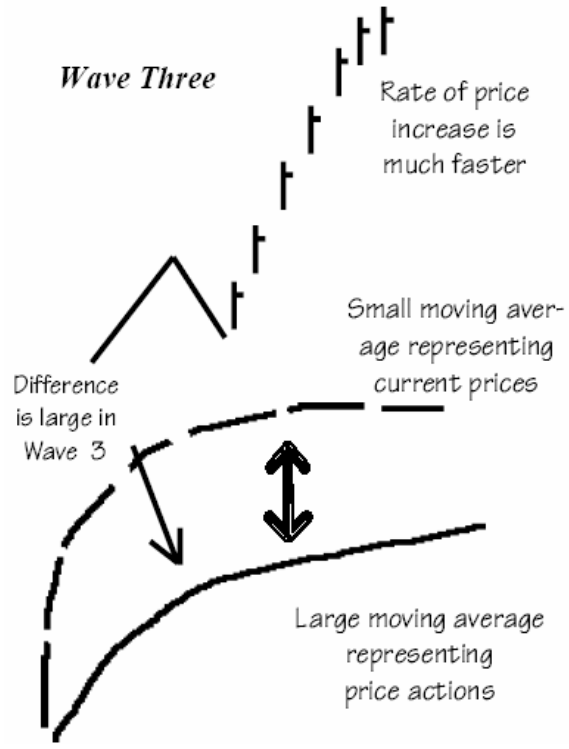
بسیار بزرگتر است. بنابراین ما نیازمند استفاده از یک اندیکاتور اندازه‌گیری قدرت موج سازنده می‌باشیم تا تفاوت را بیان کند.

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

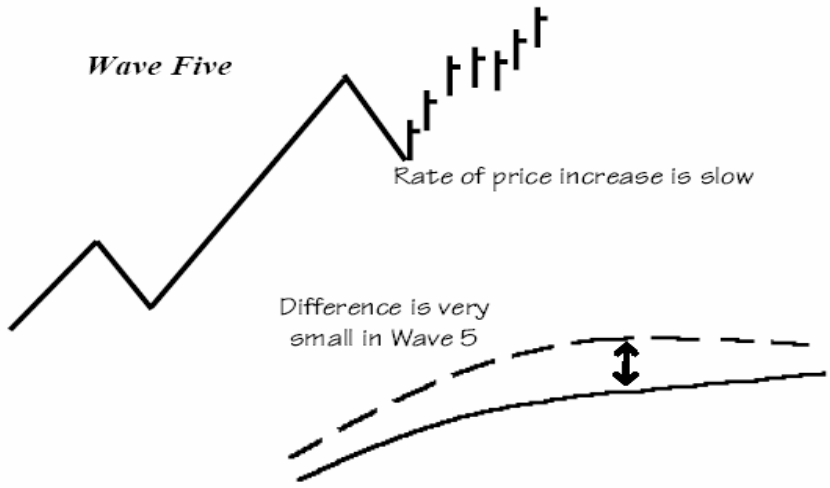
یک نوسان نمای الیوت به طور اولیه و پایه‌ای از تفاوت بین دو میانگین متحرک محاسبه می‌شود. اگر ما یک میانگین متحرک کوتاه مدت را با یک میانگین متحرک بلند مدت به کار ببریم تفاوت بین این دو، میزان افزایش در قیمت را نشان می‌دهد.

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

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



در موج ۵ قیمت جاری حرکتی به میزان سرعت قبلی دارد و بنابراین تفاوت بین میـانگین متحرک کوتاه مدت و بلند مدت کم است. این موضوع میـزان کـوچکی از نوسـان نمـا را ایجاد می‌کند.

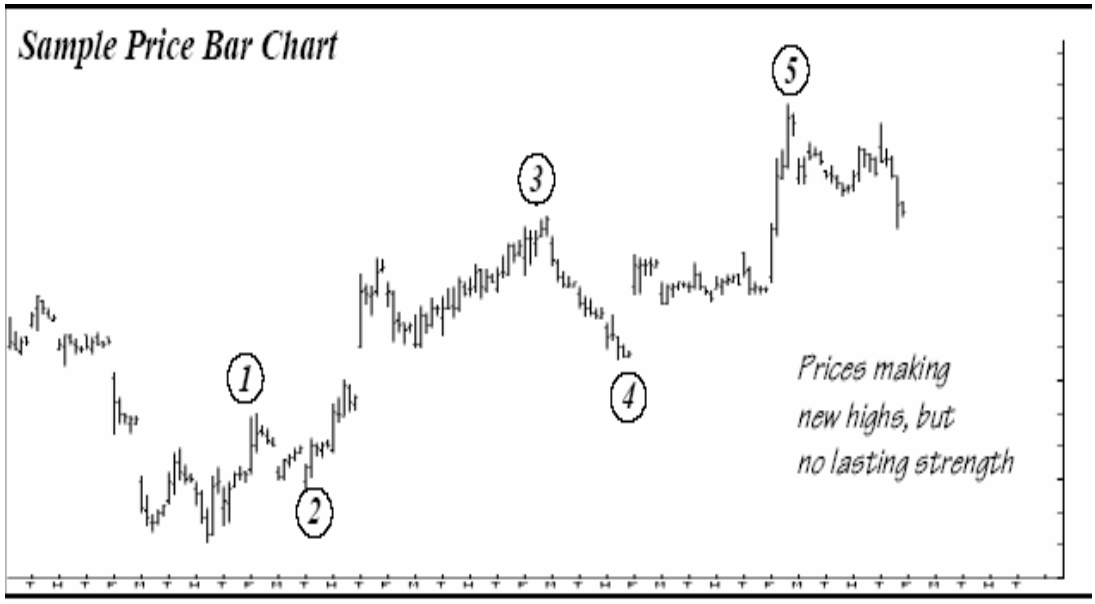


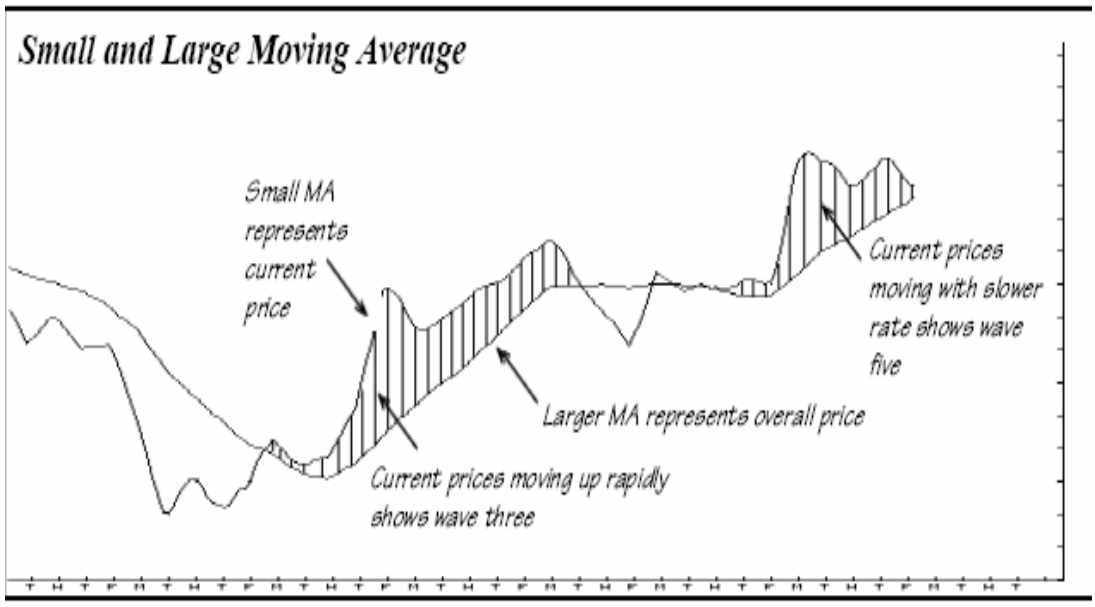
علت شناسی این مساله مشابه دو راننده می‌باشد. موج ۳ مانند راننـده B مـی‌باشـد کـه سرعتش افزایش می‌یابد و سرعت بالاتری دارد در حالی که موج ۵ آهسته بوده و آهـسته شدن تغییرات قیمت را نشان می‌دهد.

نوسان نمای الیوت: کاربرد مرحله به مرحله

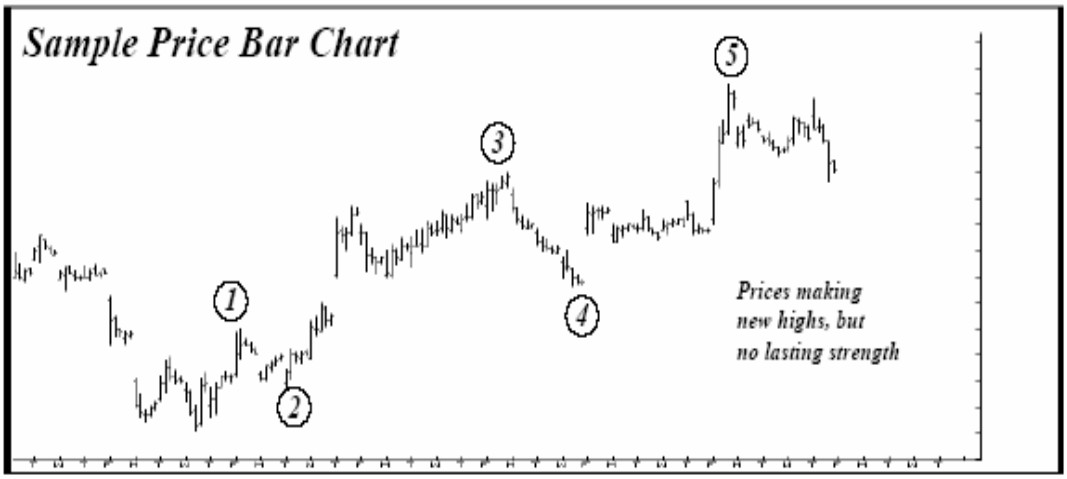
ما نمودار یکسانی را برای نشان دادن استفاده می‌کنیم. زمانی که قیمت بـه Top مـوج ۱ گسترش می‌یابد نوسان نمای الیوت High جدیدی ایجـاد مـی‌کنـد. همچنـین بایـد بـه Gapها توجه کنید. این حرکت جدید موج ۳ نام گذاری می‌شود.

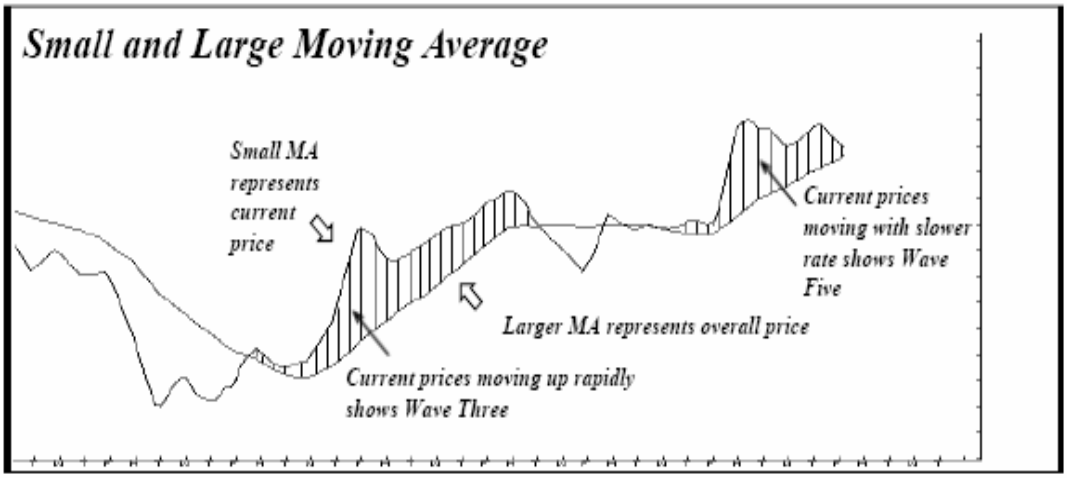
در نهایت Buyها در موج ۳ متوقف می‌شوند. تریدرها شروع به دریافت سود می‌کنند. در این زمان عموم مردم مشتاقانه منتظر یک منطقه جهت خرید در آن هـستند. زمـانی کـه نوسان نمای الیوت به سمت سطح صفر برمی‌گردد یا به آرامی به زیر آن می‌رود بـازار بـه منطقه مورد نظر (Neutral Area) می‌رسد.

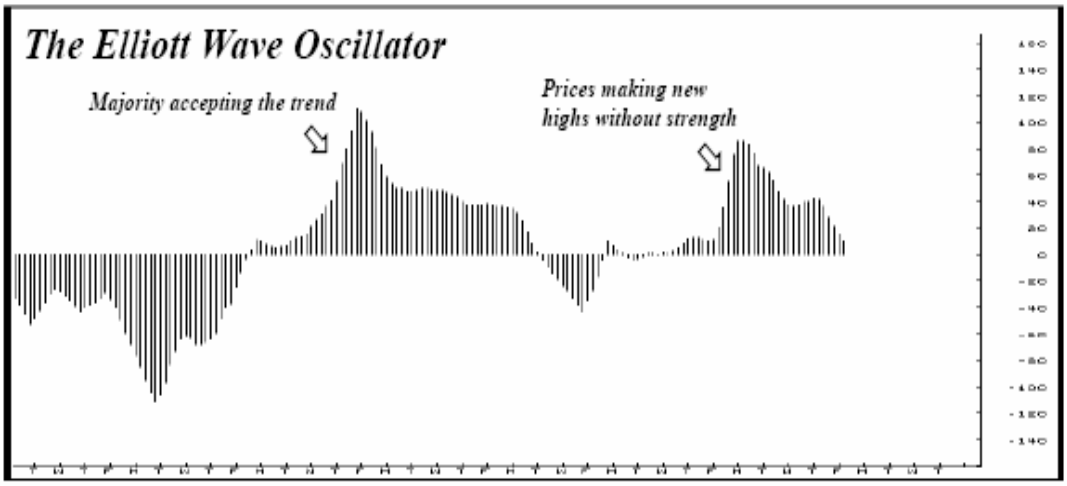




زمانی که موج ۴ پایان یافت، Buy توسط تریدرهایی انجام می‌شود کـه در رالـی مـوج ۳ سهیم نبوده‌اند. در این زمان قیمت High جدیدی می‌سازد. نسبت افزایش قیمت در ایـن رالی به اندازه موج ۳ نیست. این تفاوت در میزان حرکت قیمت بوسیله نوسان نمـا نـشان داده می‌شود و به راحتی مشخص می‌شـود. نتیجـه (MORAL OF THE STORY): همیشه اجازه دهیم نوسان نمای الیوت شمارش موج الیوت را همراهی کند.

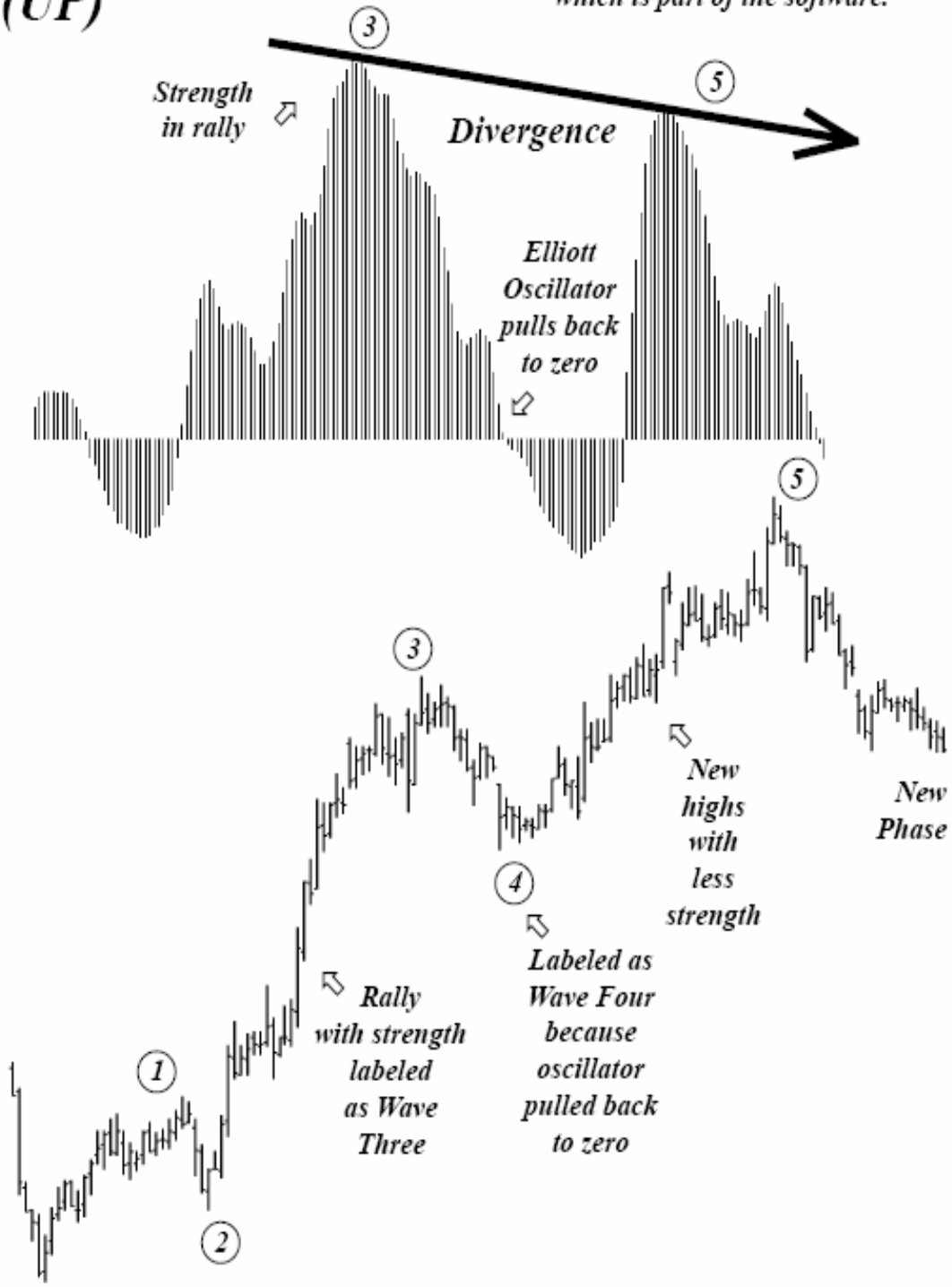

Sample Price Bar Chart
1
2
3
4
5
Prices making
new highs, but
no lasting strength

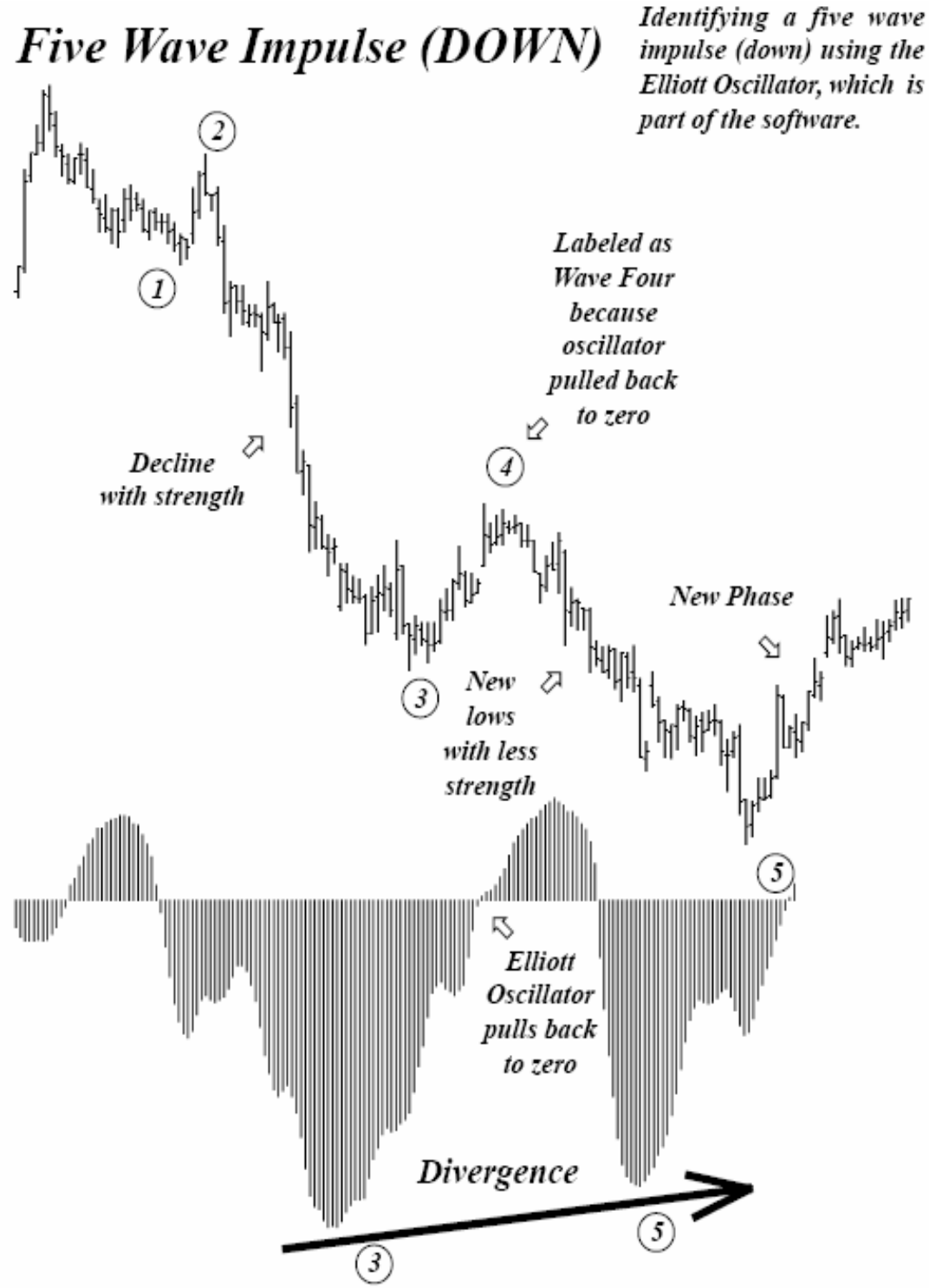

Small and Large Moving Average
Small MA
represents
current
price
Current prices
moving with slower
rate shows Wave
Five
Larger MA represents overall price
Current prices moving up rapidly
shows Wave Three


The Elliott Wave Oscillator
Majority accepting the trend
Prices making new
highs without strength

Five Wave Impulse (UP)

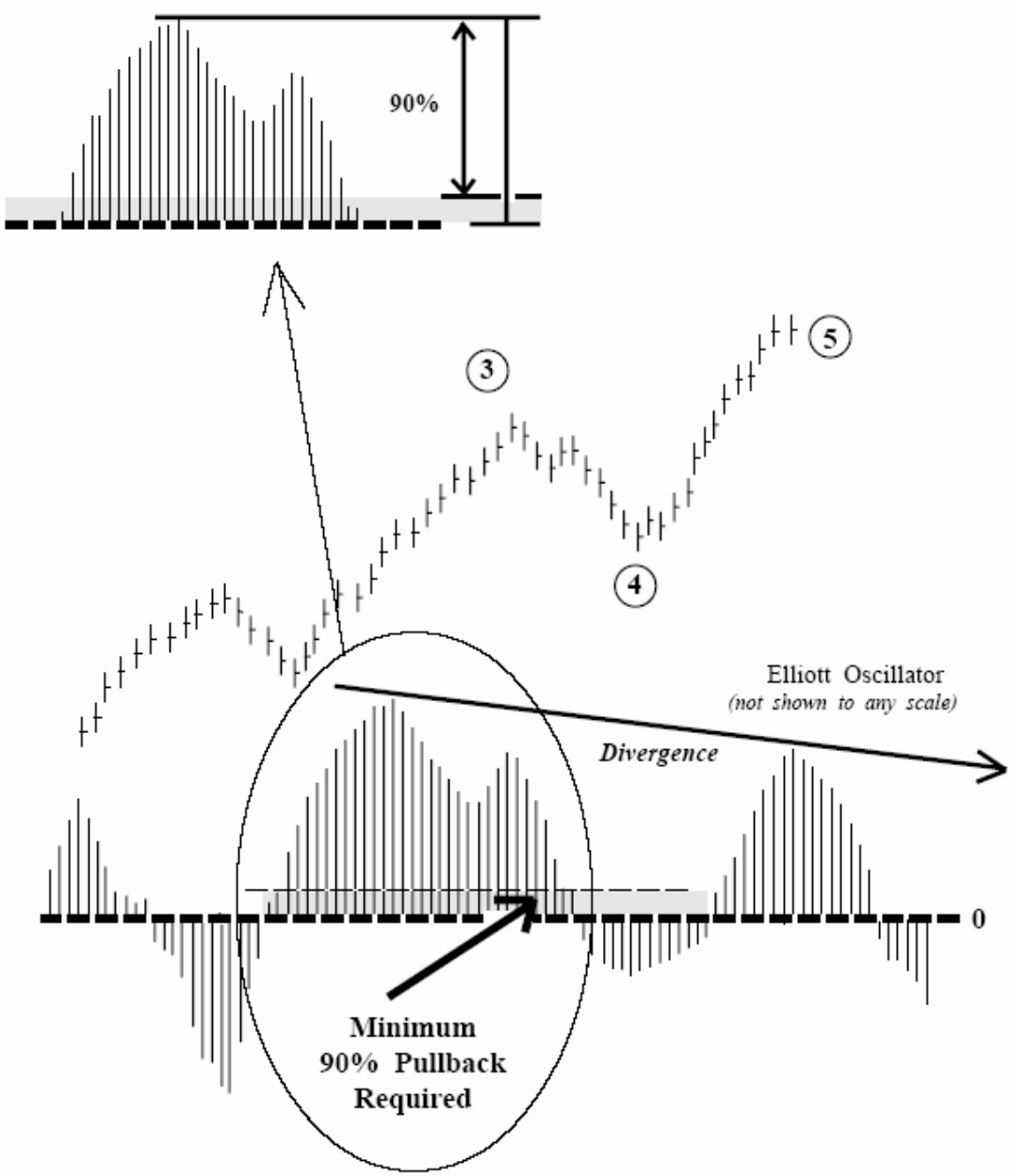
Identifying a five wave impulse (up) using the Elliott Oscillator, which is part of the software.




Five Wave Impulse (DOWN)
Identifying a five wave impulse (down) using the Elliott Oscillator, which is part of the software.
2
1
Labeled as Wave Four because oscillator pulled back to zero
Decline with strength
4
New Phase
3
New lows with less strength
5
Elliott Oscillator pulls back to zero
Divergence
3
5

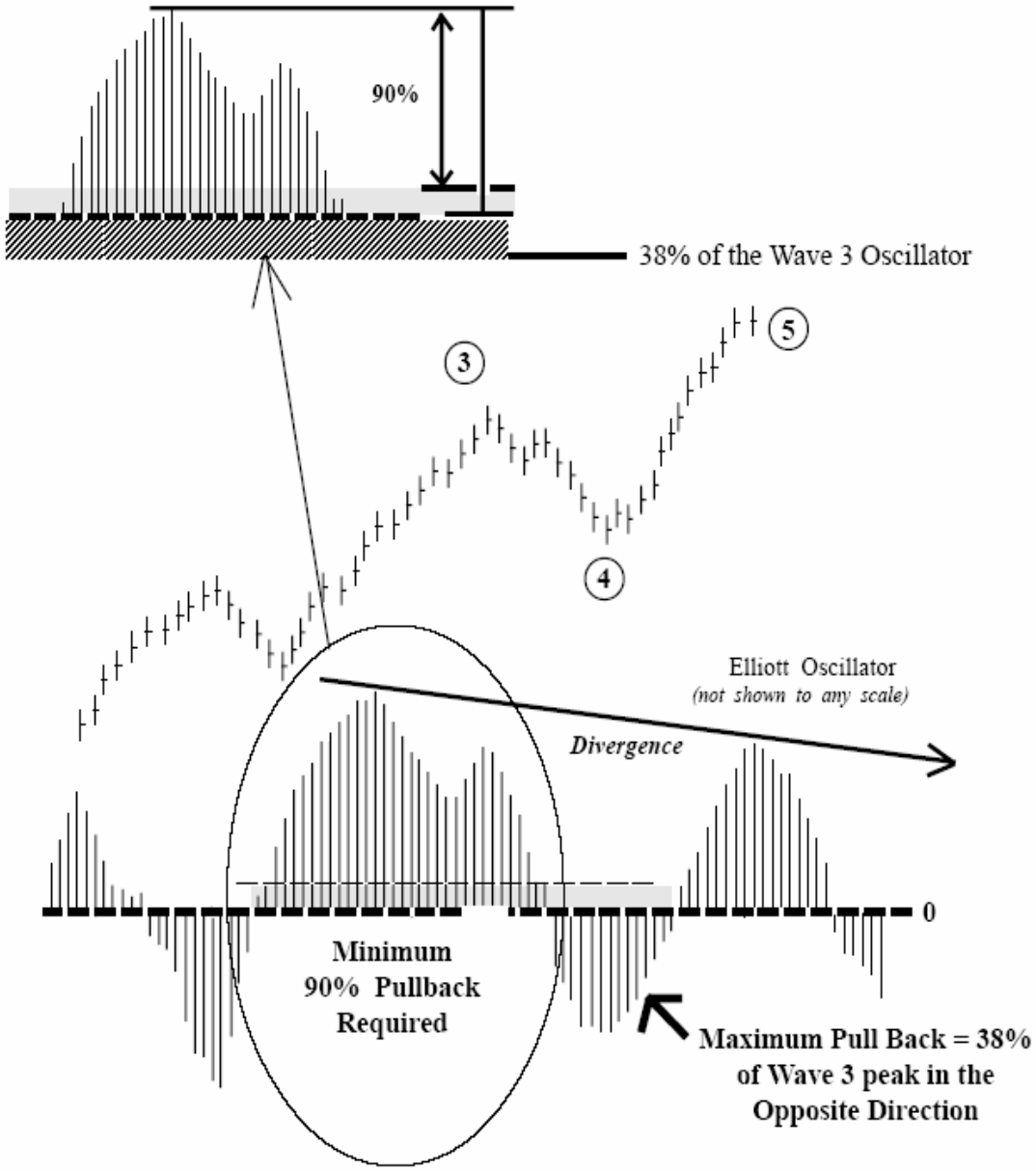
حداقل بازگشت مورد نیاز

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



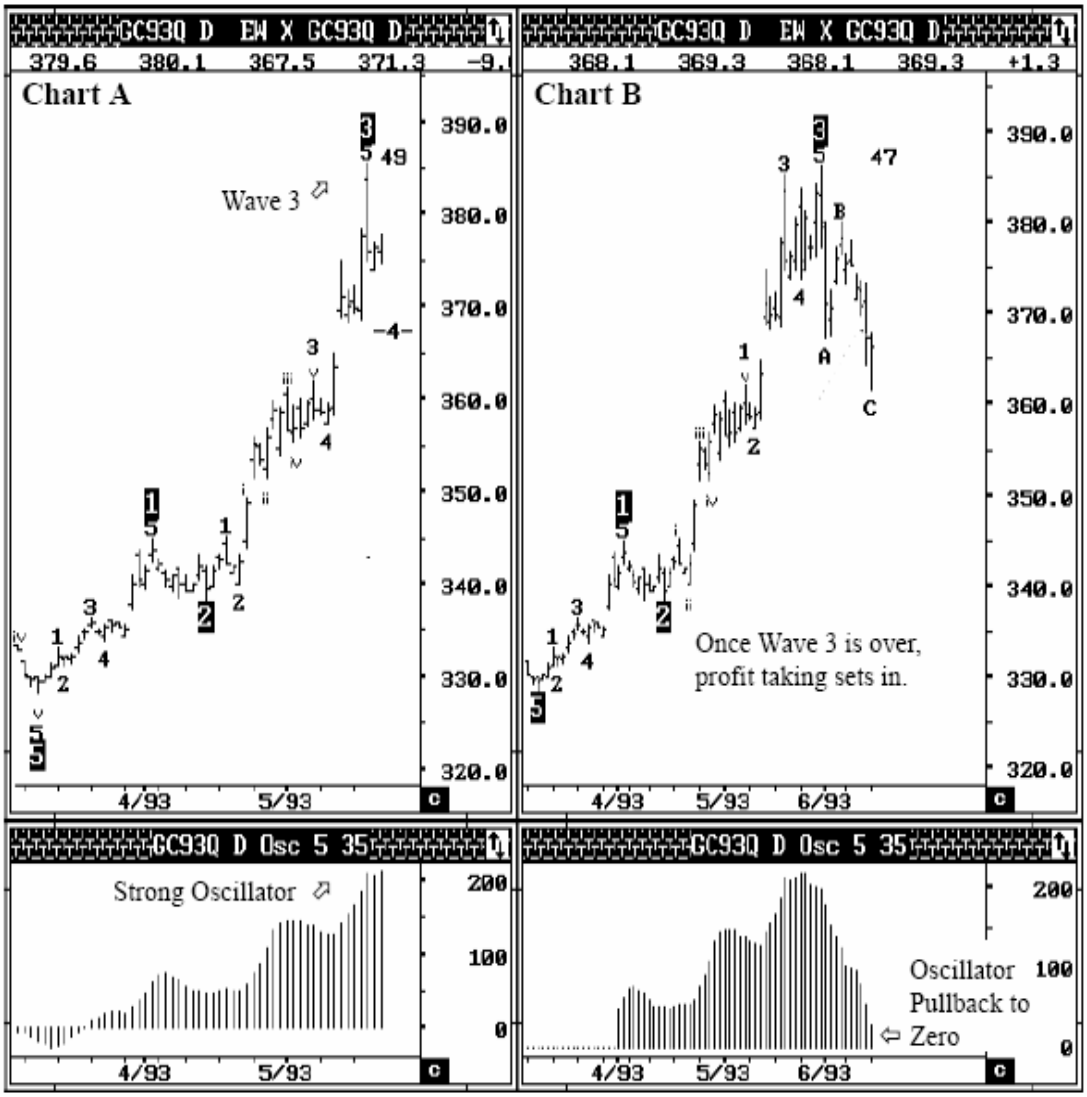
حداکثر بازگشت مجاز

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



استفاده از نوسان نمای الیوت در موج سوم

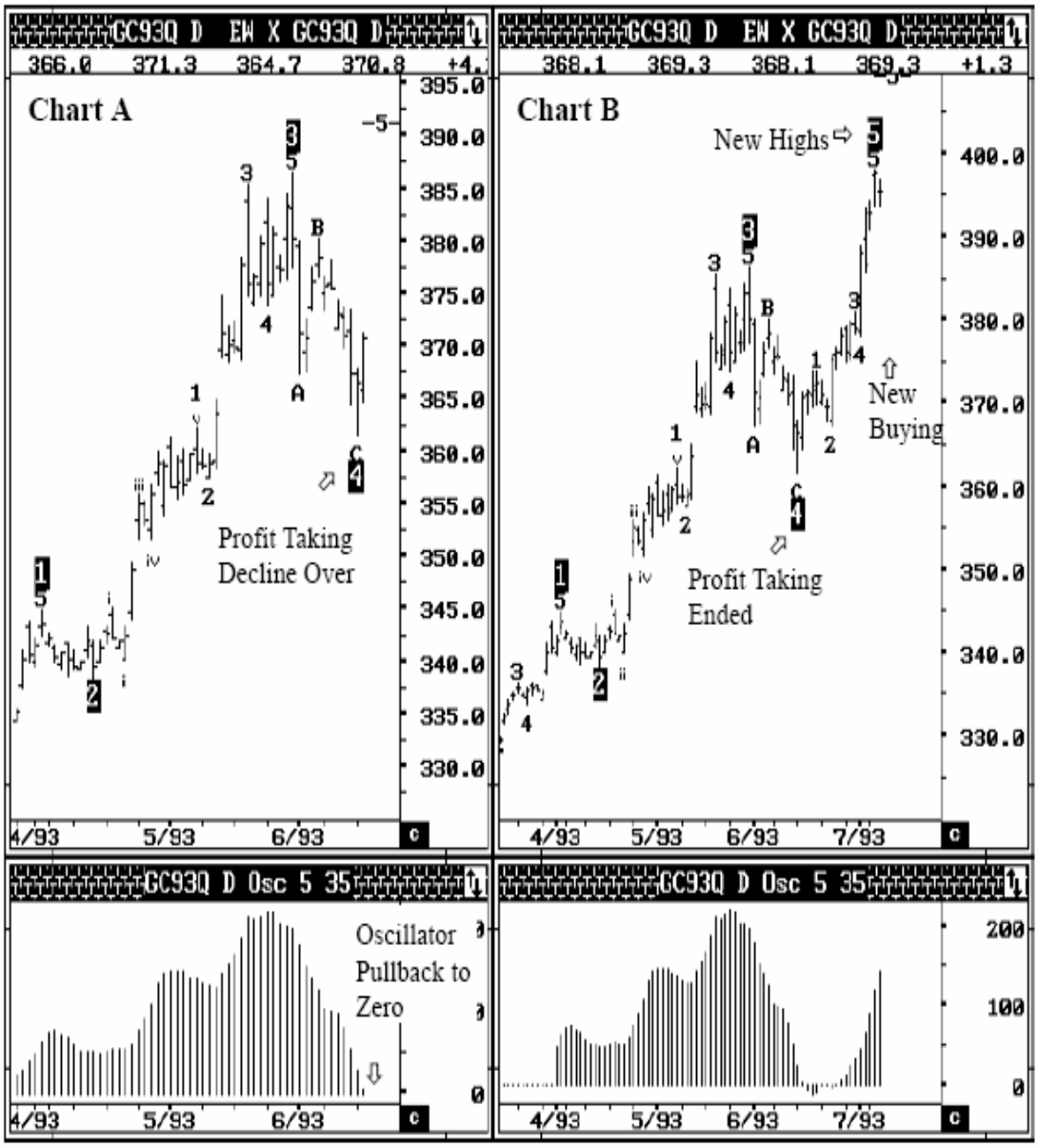
مانند نمودار A زمانی که بازار در یک رالی با نوسان نمای الیوت قوی همراهی شــود ایــن رالی تحت عنوان موج سوم نام گذاری می‌شود.



زمانی که موج سوم به پایان می‌رسد بازار جهت حصول سود نزول می‌کند. در ایــن زمــان نوسان نمای الیوت باید به سمت خط صفر برگردد (همان طور که در نمودار B نــشان داده شده است.)

استفاده از نوسان نمای الیوت در موج چهارم

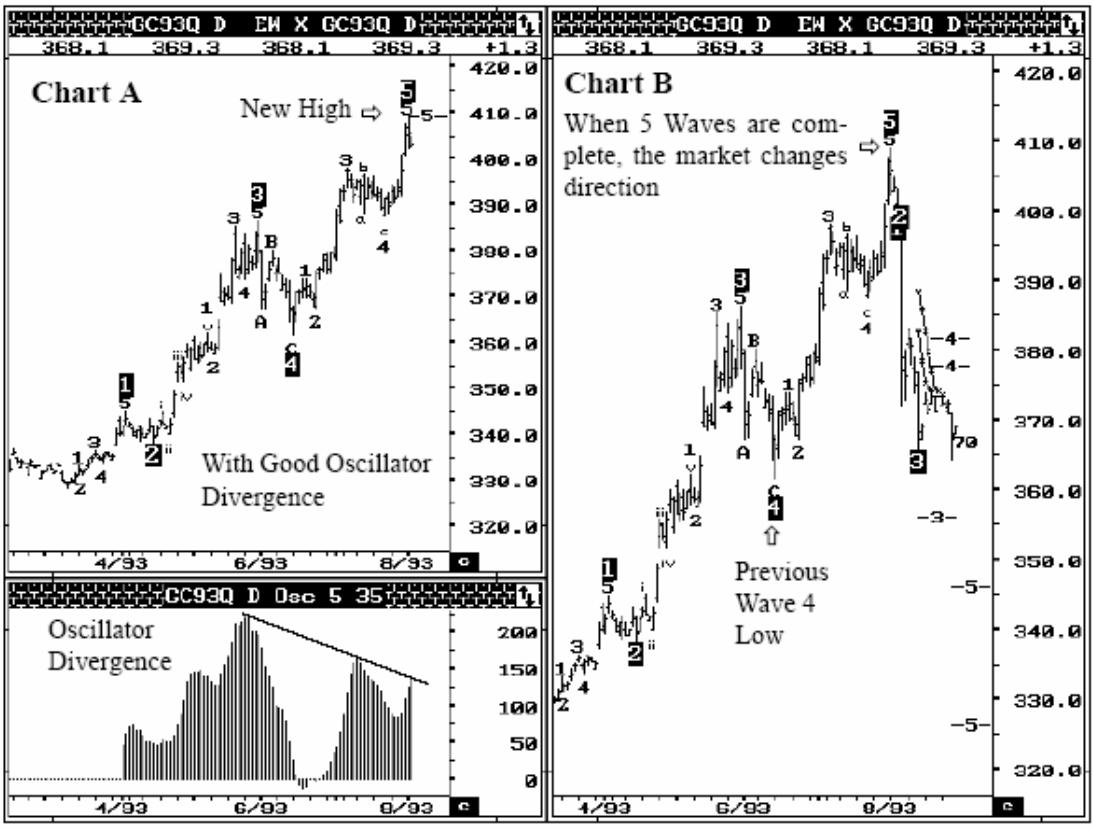
زمانی که نوسان نمای الیوت به سمت خط صفر برمی‌گردد این مساله علامتی است جهت پایان یافتن نیروی موج چهارم نزولی که در نمودار A نشان داده شده است.



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

استفاده از نوسان نمای الیوت در موج پنجم

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



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

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

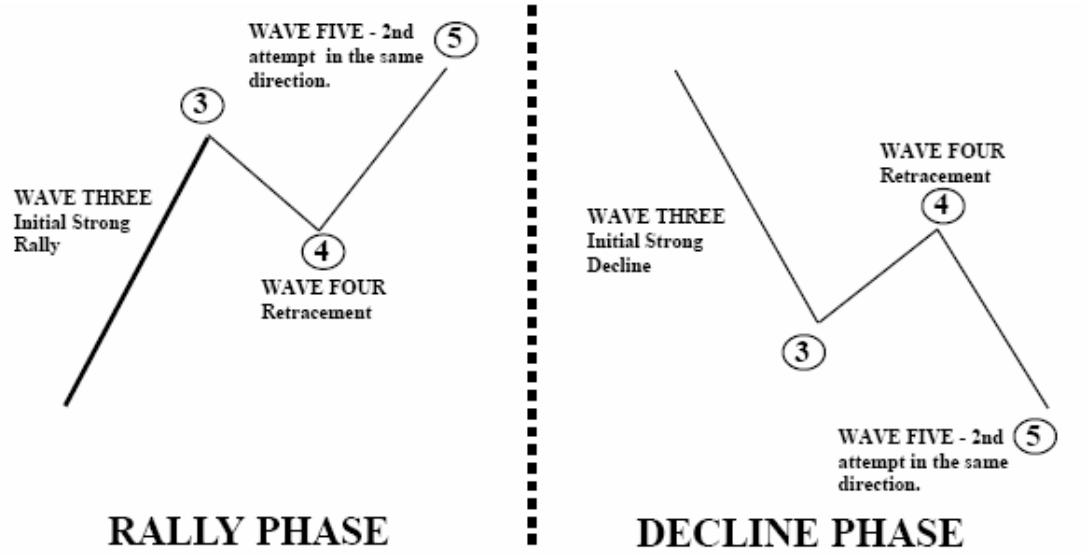
نوارهای قطع کننده (Breakout) نوسان نما

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

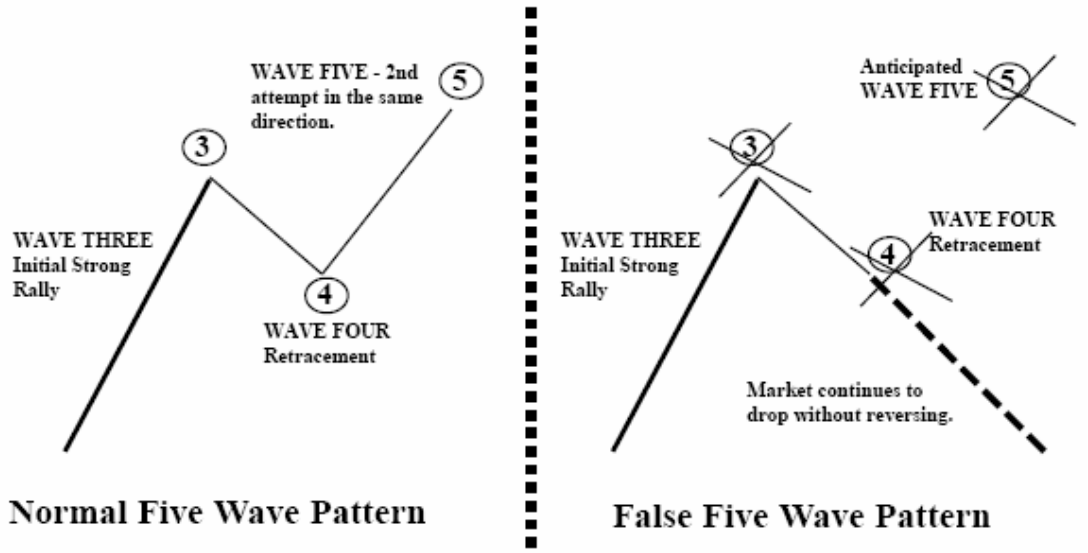
پایینی دارد. هر زمان که نرم افزار موج ۳ را نام گذاری کرد لازم است که نوسان نما نیز به بالای نوارهای فوق برود. پیشنهادات ما معمولا ۸۰٪ موارد براساس این نوارها می‌باشد.
نموداری که در پایین قرار داده شده است نمودار روزانه فرانک سوئیس از دسامبر ۹۴ می‌باشد. در اینجا زمانی که نرم افزار موج ۳ را نامگذاری کرده است این رالی با یک نوسان نمای قوی ترکیب شده است به طوری که باندها را به سمت بالا قطع کرده است.
بنابراین شمارش این موج در این زمان و در این بازار صحیح است. مثال دیگر نیز در زیر نمایش داده شده است. زمانی که نوسان نما بالای نوار بوده و با یک آنالیزور موج الیوت نیز تایید شده است.

PTI (اندکس حد سود)

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

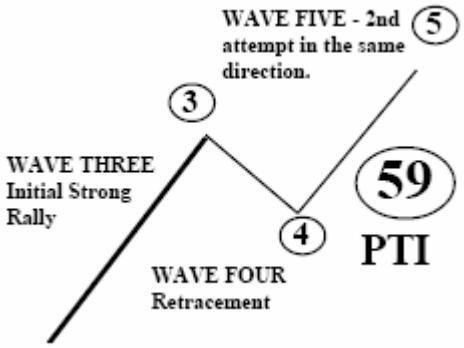


الگوهای بالا توالی ۵ موج را تکمیل کردند و از میزان مورد انتظار نیز فراتر رفته‌اند. به هر حال زمانی که الگوها در حال تکمیل‌اند تریدر با مساله مشکلی در پایان موج ۴ اصلاحی مواجه است که این مساله به این علت است که در موارد زیادی این حرکت دوم به وقوع نمی‌پیوندد.



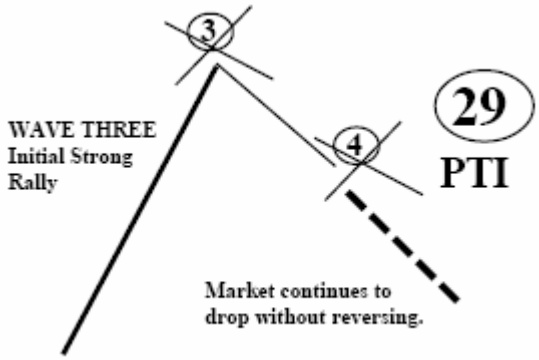
تحقیقات در این سال‌ها ادامه یافت و ما موفق به طراحی PTI (Profit Taking Index) شدیم. ابزار PTI مومنتوم Buyها و Sellهای موج ۳ را با موج ۴ مقایسه می‌کند. سپس این مقایسه به الگوریتمی داده می‌شود که عدد PTI را محاسبه می‌کند.

مثال ۱: الگوی ۵ موج صحیح



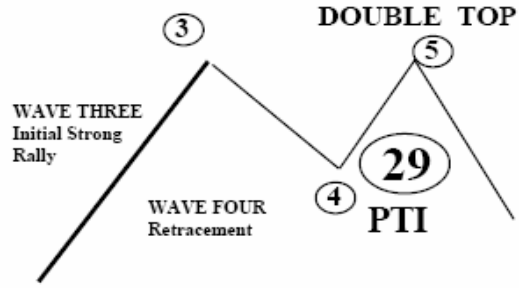
به طور آماری اگر PTI بالاتر از ۳۵ باشد بازار تمایل شدیدی دارد که موج ۵ یا دومین موج حرکت را بسازد.

مثال۲: الگوی ۵ موج نادرست



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

مثال ۳: الگوی موج پنجم ناقص: سقف دوقلو



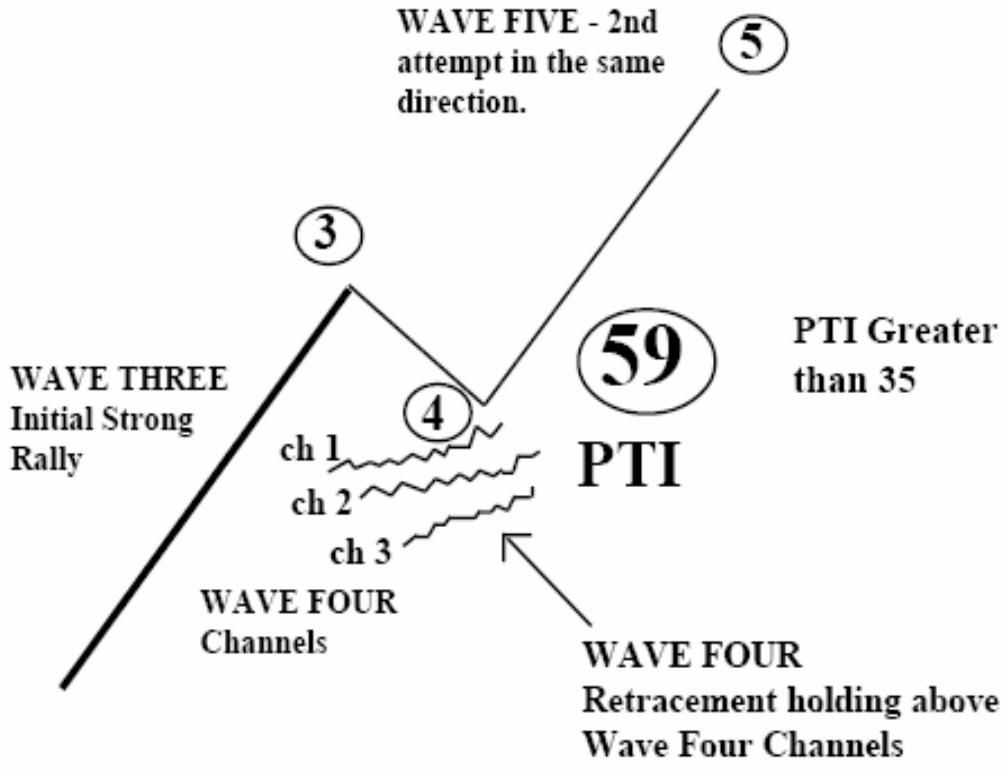
اگر PTI کمتر از ۳۵ بود و بازار در حال ساخت موج ۵ بود احتمال تشکیل سقف دوقلو بسیار زیاد است.

اضافه کردن کانال‌های موج چهارم

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

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

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



مفهوم کانال‌های موج چهارم:

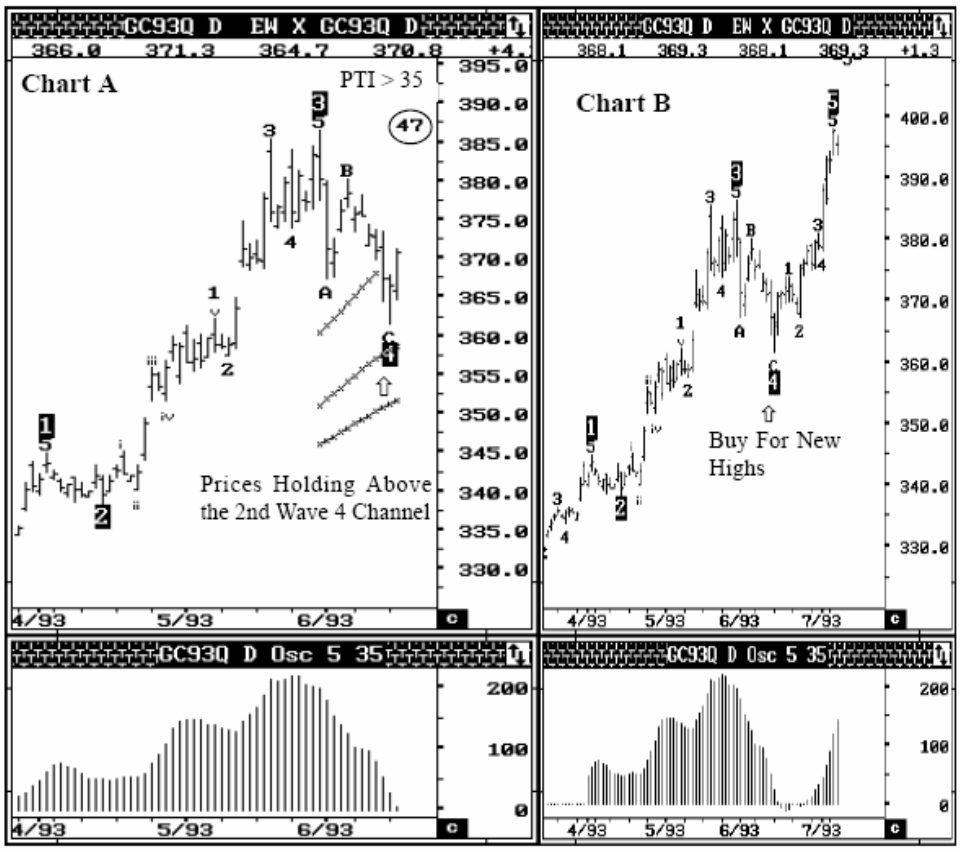
۱)اگر موج چهارم بالای کانال اول باشد (با رنگ آبی مشخص است) از نظر آماری بالای ۸۰٪ انتظار برای یک رالی موج ۵ قوی می‌باشد.

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

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

PTI و کانال‌های موج چهارم

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

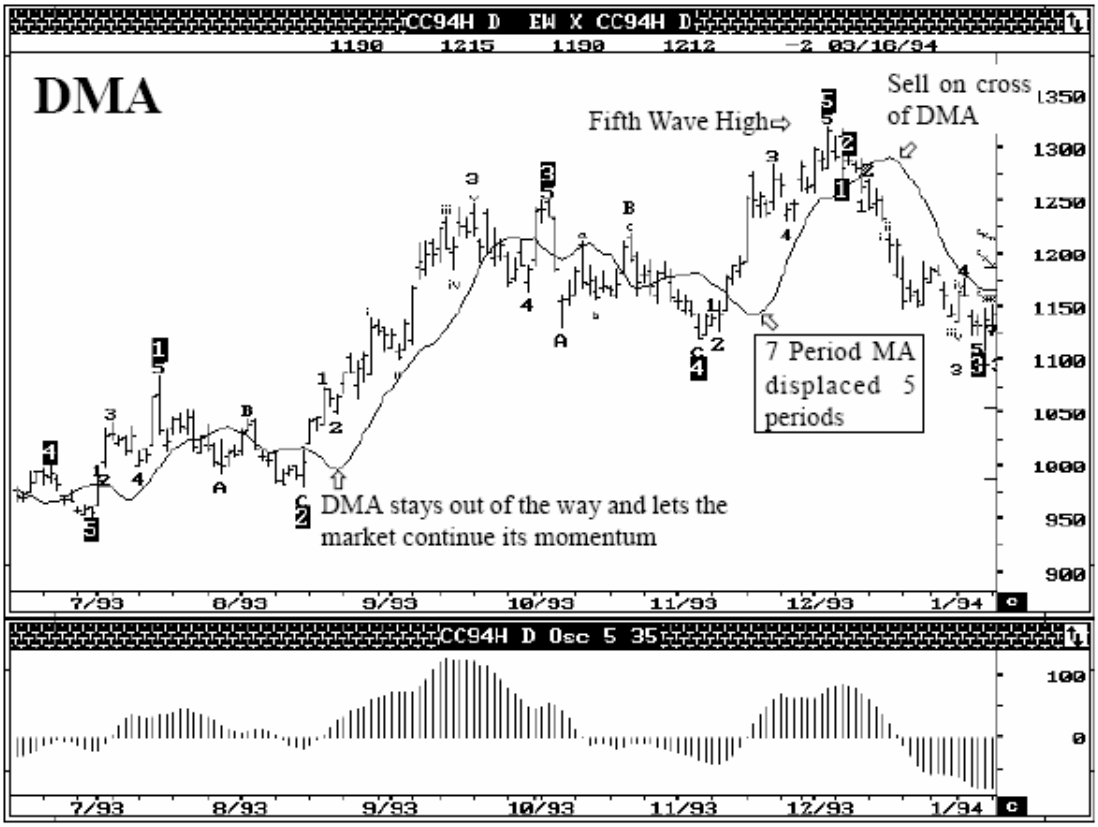


* بعلاوه قیمت باید بالای کانال‌های موج چهارم باشد که مدت زمان مناسبی را برای PTI ایجاد می‌کند. در نمودار A قیمت بالای کانال‌های موج چهارم می‌باشد.
* همه چیز در اینجا برای Buy مناسب است.

اضافه کردن میانگین متحرک جابه‌جا شده

(Displaced Moving Average)

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



* در پایان موج ۵ از DMA برای ورود به ترید استفاده کنید. ما پیشنهاد می‌کنیم که از یک میانگین متحرک ۷ روزه که به سمت راست جابه‌جا شده با دوره‌های ۵ استفاده شود.

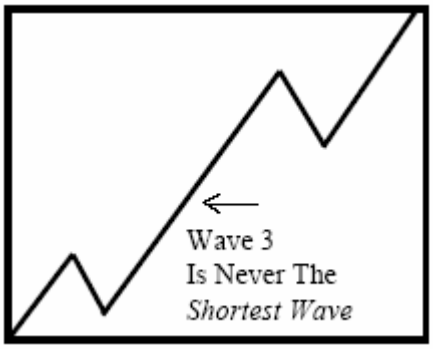
* **هشدار**: DMA برای ورود به پوزیشن در انتهای موج ۵ و در الگوهای مطمئن در پایان موج چهارم طراحی شده است. نباید DMA را به عنوان ابزاری جهت Buy یا Sell کردن در مناطق دیگر استفاده کرد. دقت DMA بعنوان یک ابزار کمتر از ۲۱٪ می‌باشد.

راهنما و قوانین موج الیوت

۱)موج سوم نباید کوتاهترین موج باشد (قانون)

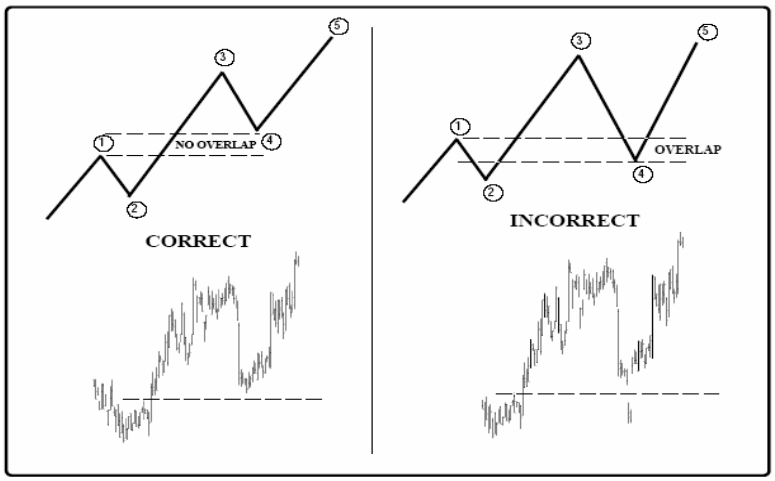
معنی جمله فوق این است که موج سوم همیشه حداقل از یکی از دو موج دیگر (۱ یا ۲) بلندتر می‌باشد. معمولا موج سوم بلندتر از هر دو موج می‌باشد.

شما نباید هیچ وقت بدنبال موج سومی باشید که از دو موج دیگر کوتاه‌تر باشد. در بعضی مواقع موج سوم در نقاط برابری پایان می‌یابد ولی هیچ‌گاه کوتاه‌تر نیست. برای این قانون هیچ استثنایی وجود ندارد.



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

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

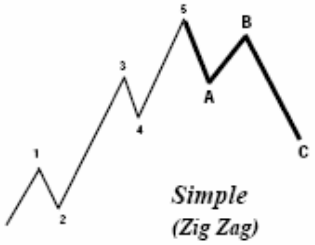


اصلاح‌های موج الیوت

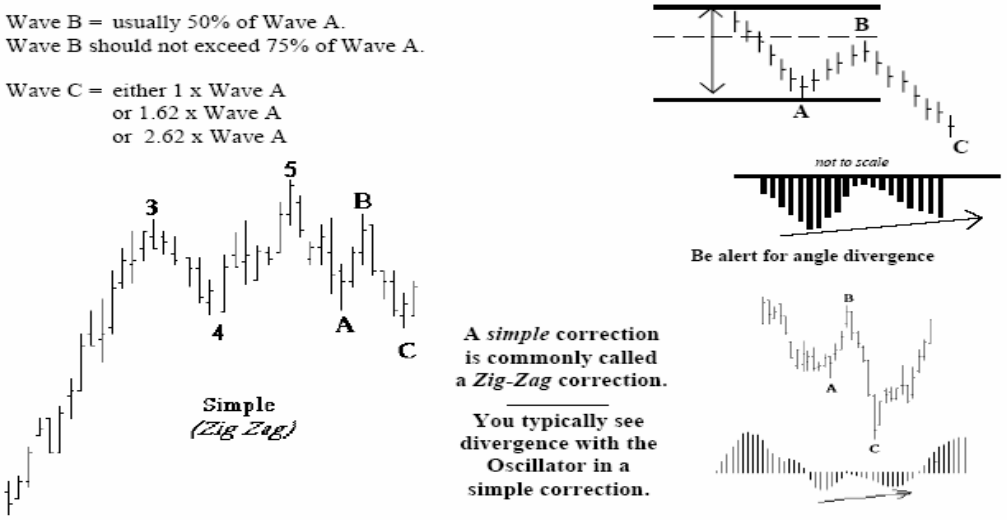
غلبه بر اصلاح‌ها کار بسیار دشواری می‌باشد. اغلب تریدرهای الیوت در حین الگوی حرکت پول بدست می‌آورند و سپس آن را در طی فاز اصلاح از دست می‌دهند. الگوی حرکت شامل ۵ موج است. الگوی اصلاح شامل ۳ موج است و حالت بخصوصی از یک مثلث است. معمولا بدنبال یک الگوی حرکت الگوی اصلاح ایجاد می‌شود. الگوی اصلاح به دو دسته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

اصلاح ساده

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



نسبت‌های فیبوناچی در داخل اصلاح زیگزاگ

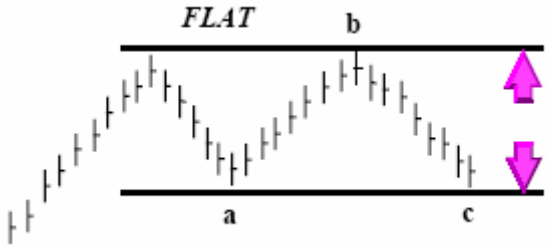


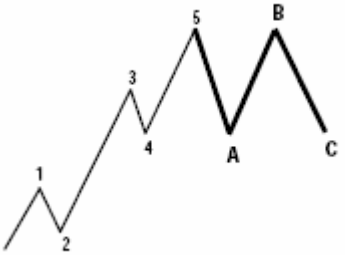
اصلاح ترکیبی- مسطح، منظم، مثلث

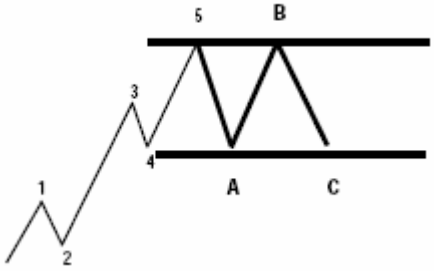
گروه اصلاح ترکیبی شامل سه قسمت است: ۱)مسطح ۲)نامنظم ۳)مثلث

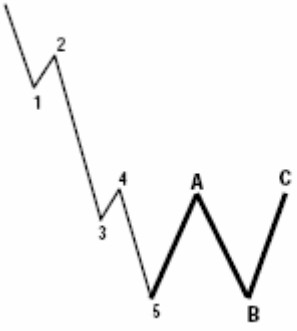
اصلاح مسطح

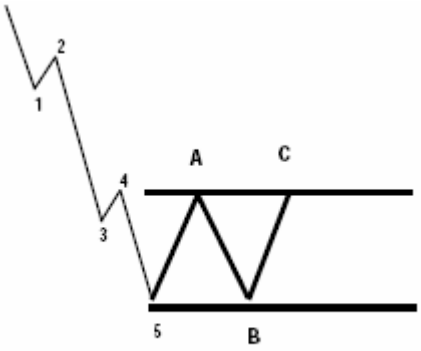
در یک اصلاح مسطح طول موج‌ها با یکدیگر یکسان است. بعد از یک الگوی حرکت ۵ موجی بازار به موج A می‌رسد. سپس موج B که تشکیل شد به نقطه High موج A قبلی می‌رسد. در نهایت نیز بازار در موج C به Low قبلی خود در A می‌رسد.





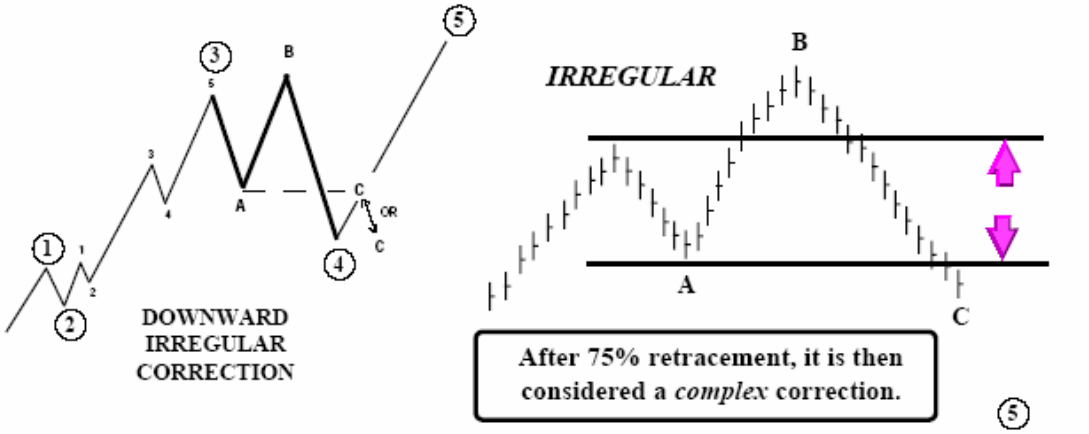






اصلاح نامنظم

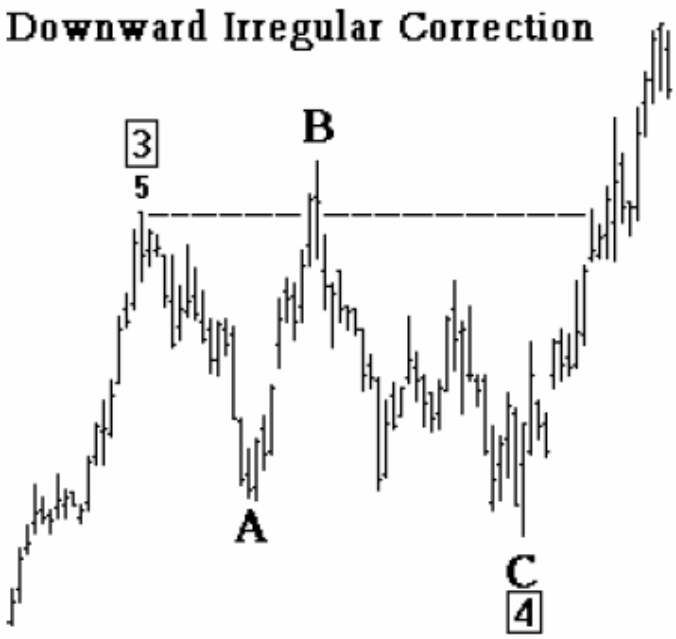
در این نوع از اصلاح موج B یک High جدید ایجاد می‌کند. در نهایت نیز موج C می‌تواند به نقطه شروع A یا پایین‌تر از آن برسد.



نسبت‌های فیبوناچی در موج نامنظم

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

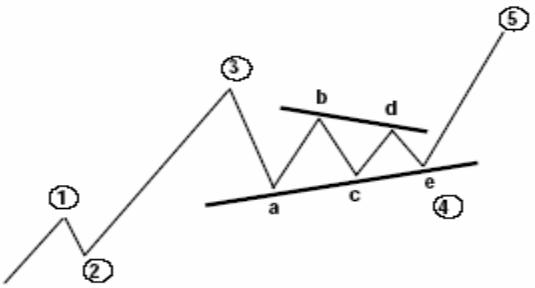
Wave C = either 1.62 x Wave A
or 2.62 x Wave A



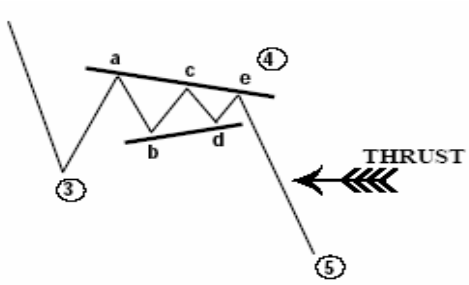
اصلاح‌های مثلث

الگوهای اصلاحی دیگری وجود دارد که الگوی مثلث نامیده می‌شوند. بررسی مثلث امواج الیوت بسیار متفاوت از دیگر انواع مثلث‌ها می‌باشد.

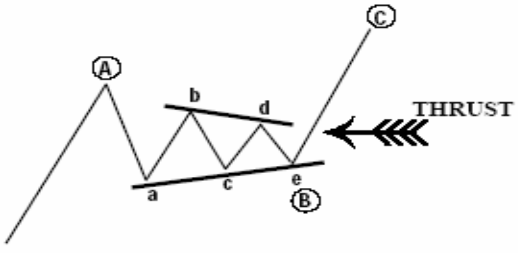
مثلث الیوت یک الگوی ۵ موجی می‌باشد که همه موج‌ها دیگر موج‌ها را در بر مـی‌گیـرد. این ۵ زیر موج از یک مثلث تحت نام A، B، C، D و E نامگذاری می‌شوند.



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



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



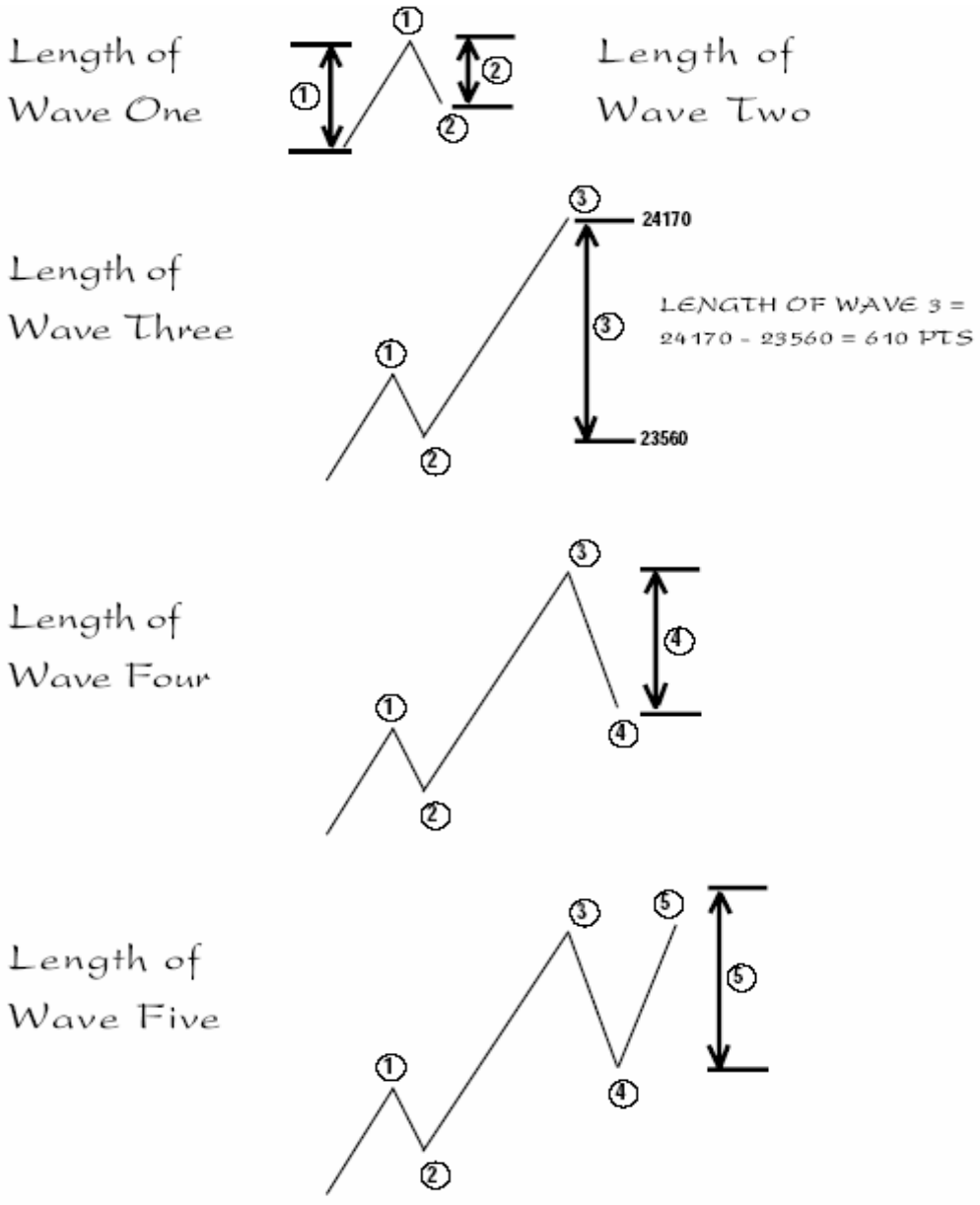
قوانین فرعی

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

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

نسبت‌ها و اندازه‌گیری موج

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



نسبت‌های فیبوناچی امواج

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

توضیحاتی در مورد نسبت‌های فیبوناچی

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

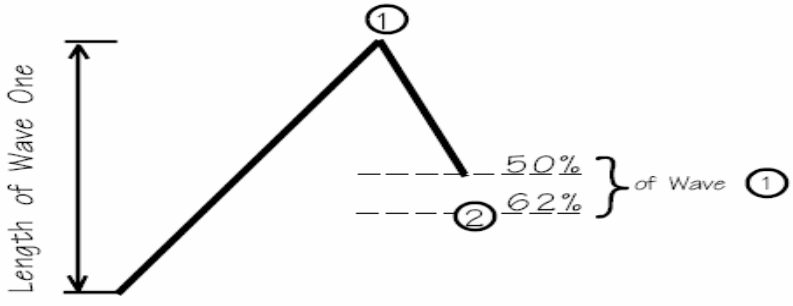
1 - 1.618 - 2.618 - 4.23 - 6.85 *(multiples)*
0.14 - 0.25 - 0.38 - 0.5 & 0.618 *(ratios)*

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

نسبت‌های موج دوم

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

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

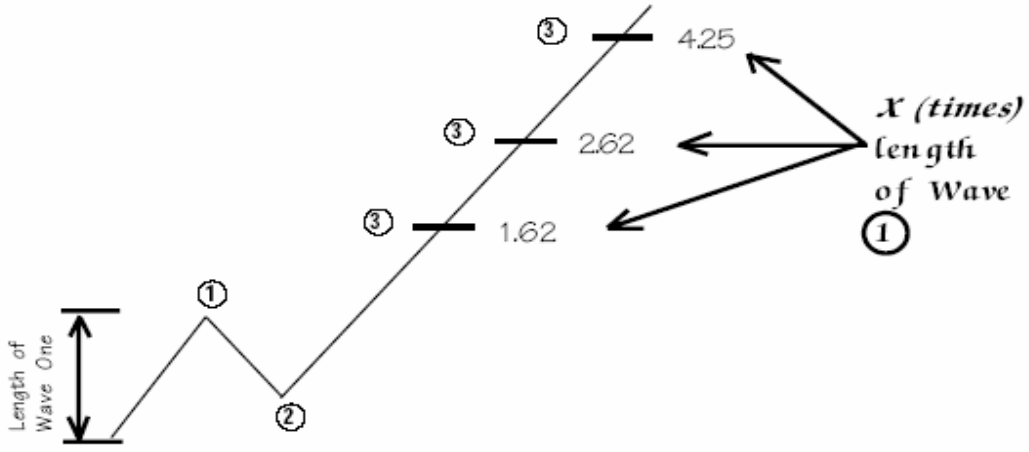


نسبت‌های موج سوم

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

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

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

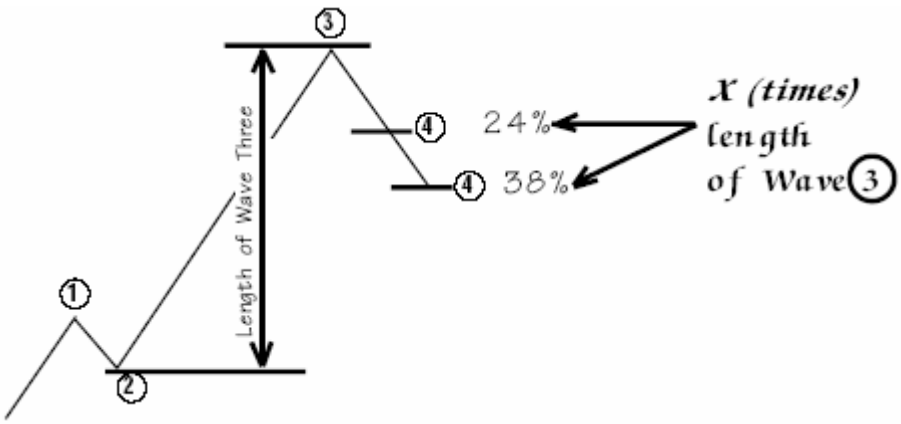


نسبت‌های موج چهارم

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

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

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

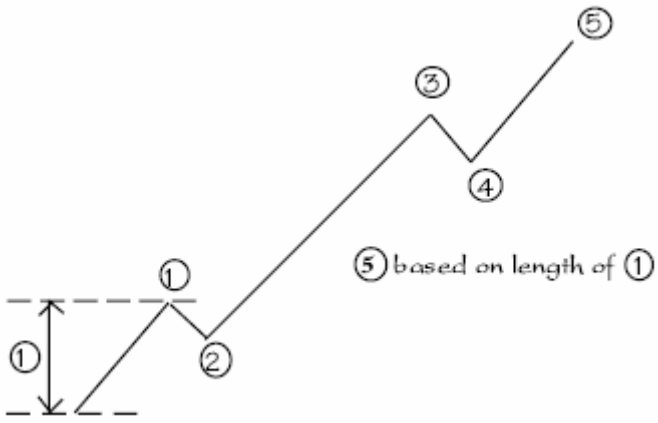


نسبت‌های موج پنجم

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

۱)اگر موج سوم بیش از ۱/۶۲ بوده یا گسترش یافته باشد در این هنگام نسبت‌های موج ۵ بر این اساس است:

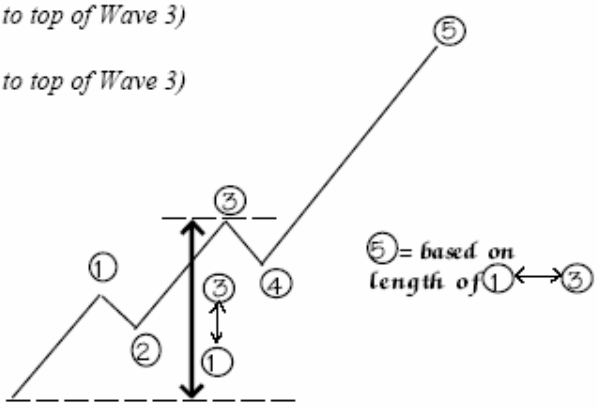
Wave 5 either = Wave 1
or = 1.62 x Wave 1
or = 2.62 x Wave 1



۲)اگر موج سوم کمتر از ۱/۶۲ بود نسبت‌های موج پنجم براساس زیر است:

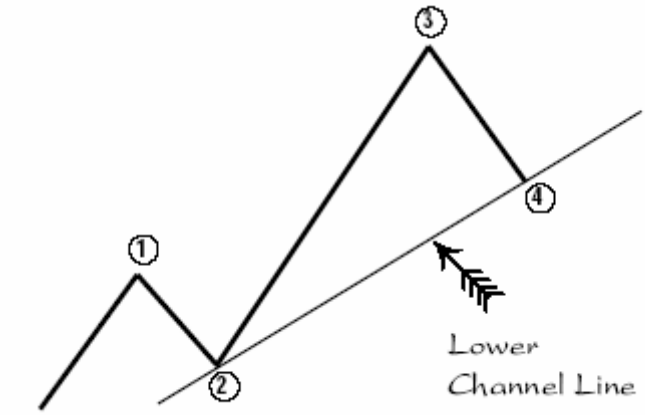
زمانی که موج سوم کمتر از ۱/۶۲ باشد موج گسترش بسیار بیشتری می‌یابد. در بررسی‌ها مشخص شده نسبت موج پنجم برپایه طولی است که اندازه آن از شروع موج اول تا پایان موج سوم می‌باشد:

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

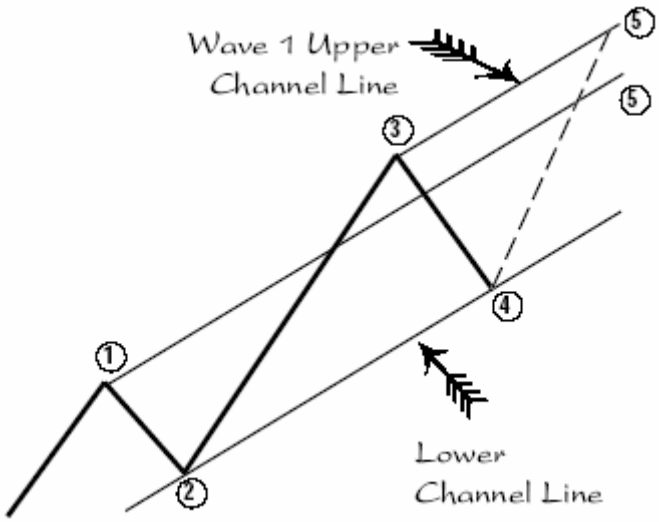


کانال‌های الیوت برای شناسایی Top موج ۵

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

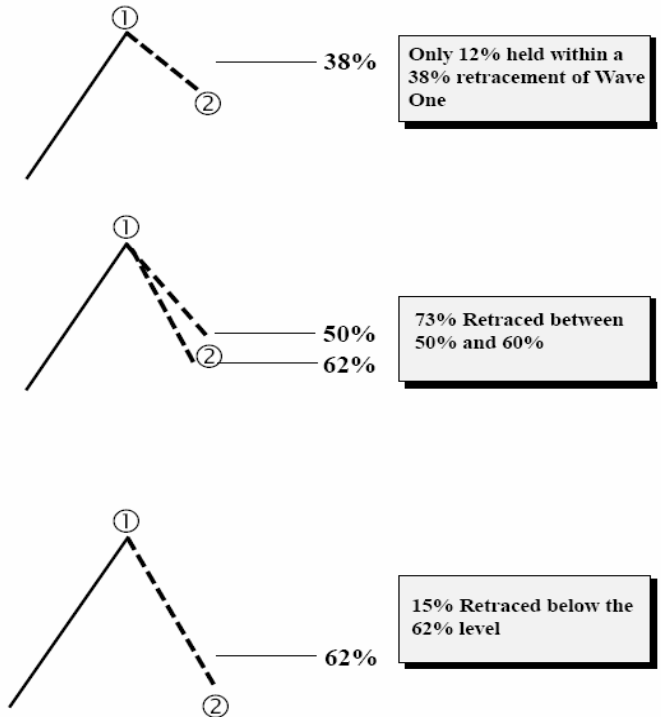


حالا دو خط موازی با خط پایینی از نقاط Top موج‌های ۱ و ۳ رسم کنید.

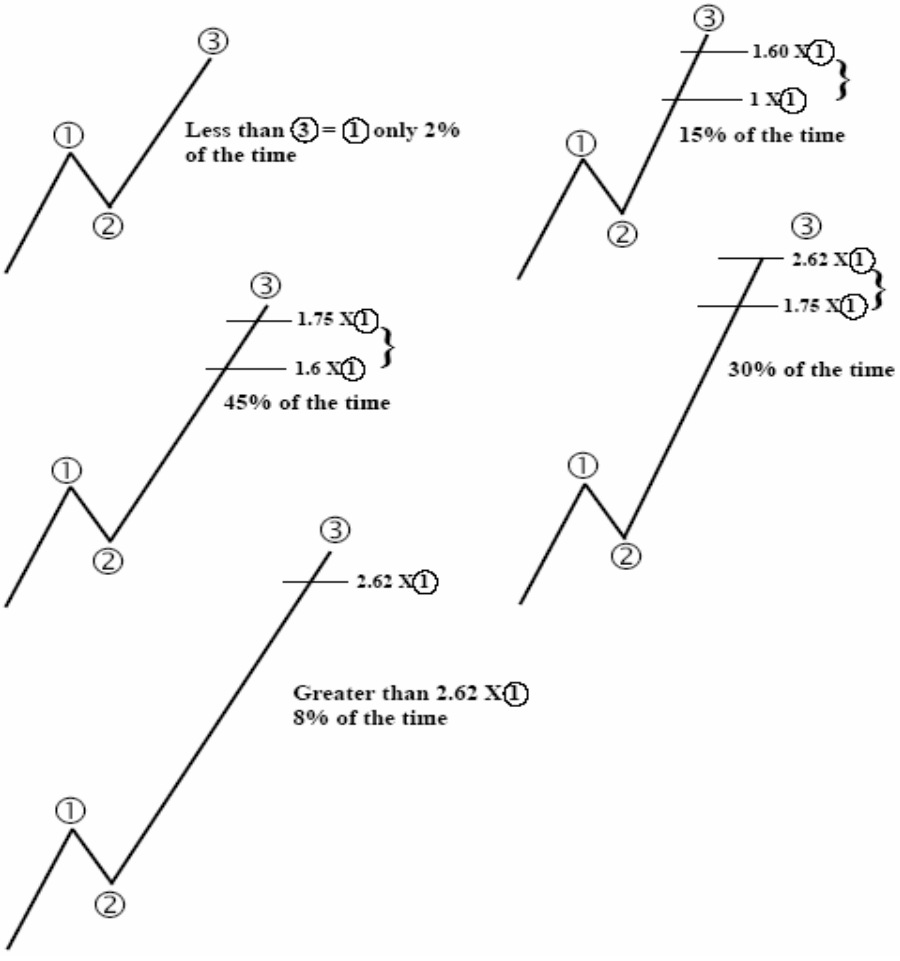


انتظار داریم که موج ۵ در دو کانال بالایی به اتمام برسد. معمولا اگر موج سوم یـک مـوج معمولی باشد موج ۵ تمایل دارد که تا کانالی که از Top موج ۳ رسم شده ادامه یابد. اگـر موج سوم گسترش یافته باشد موج ۵ تمایل دارد که تا کانالی که از Top موج ۱ رسم شده ادامه یابد.

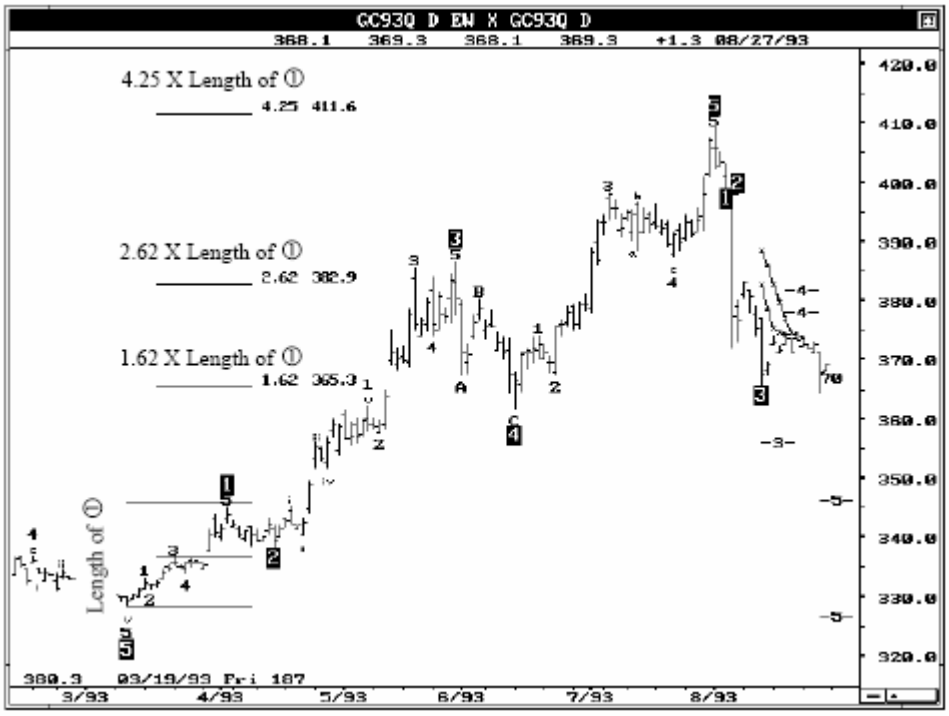
آنالیز آماری نسبت‌های موج دوم



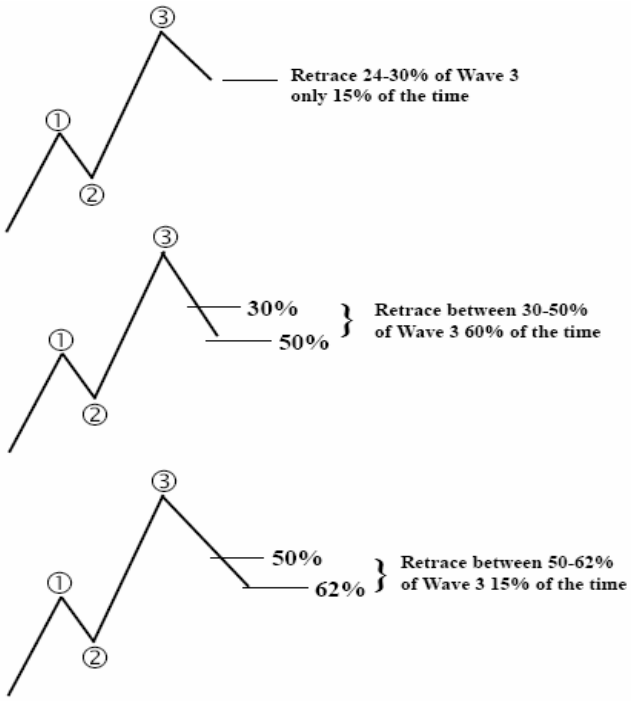
آنالیز آماری نسبت‌های موج سوم



نسبت‌های موج سوم

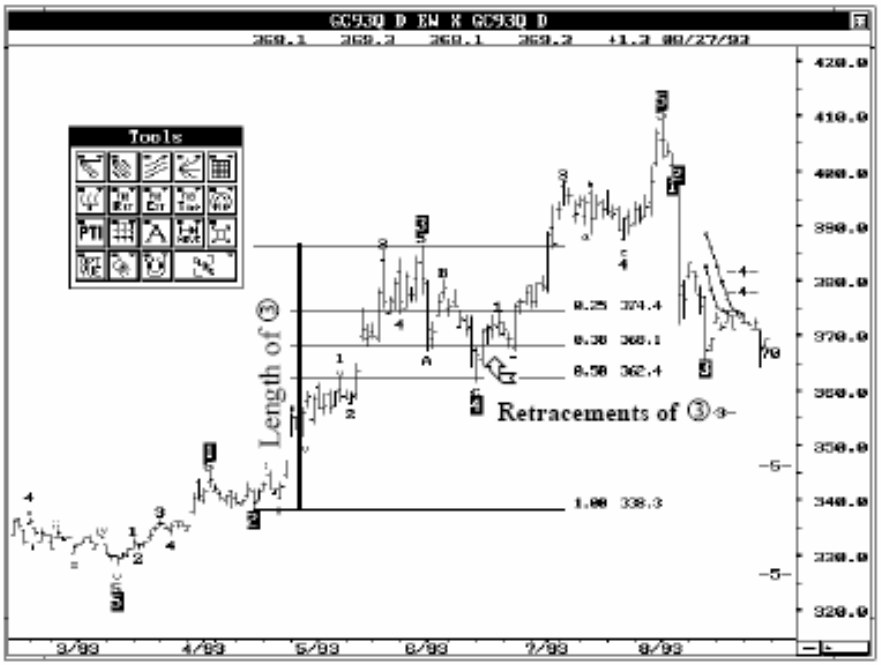


آنالیز آماری نسبت‌های موج چهارم



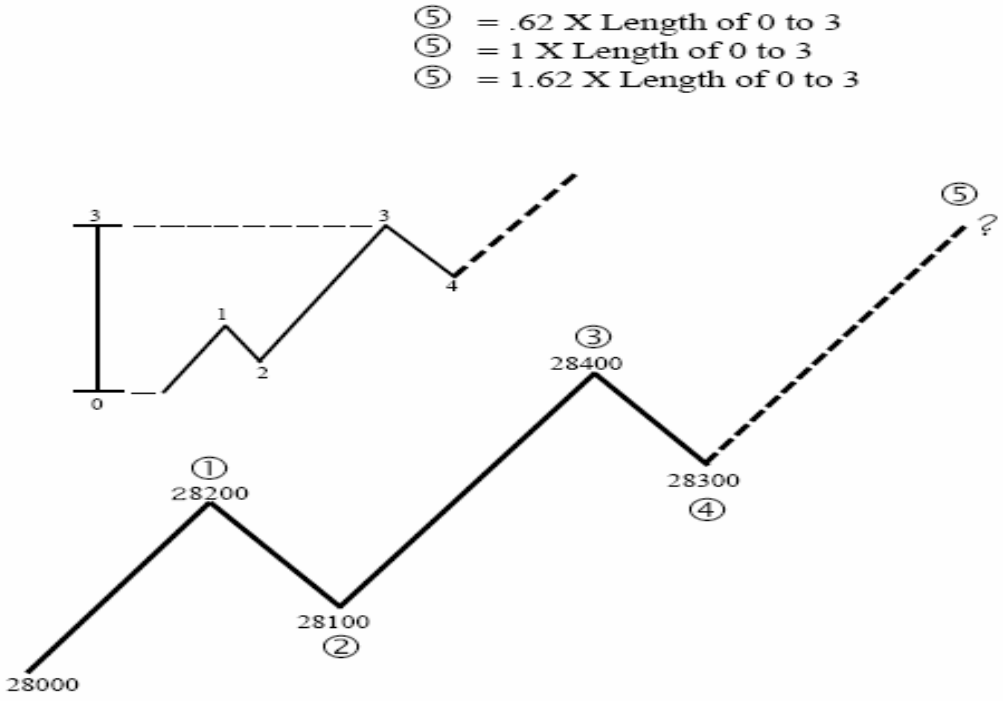
Under 62% retracement of Wave 3 = 10% of the time

نسبت‌های موج چهارم

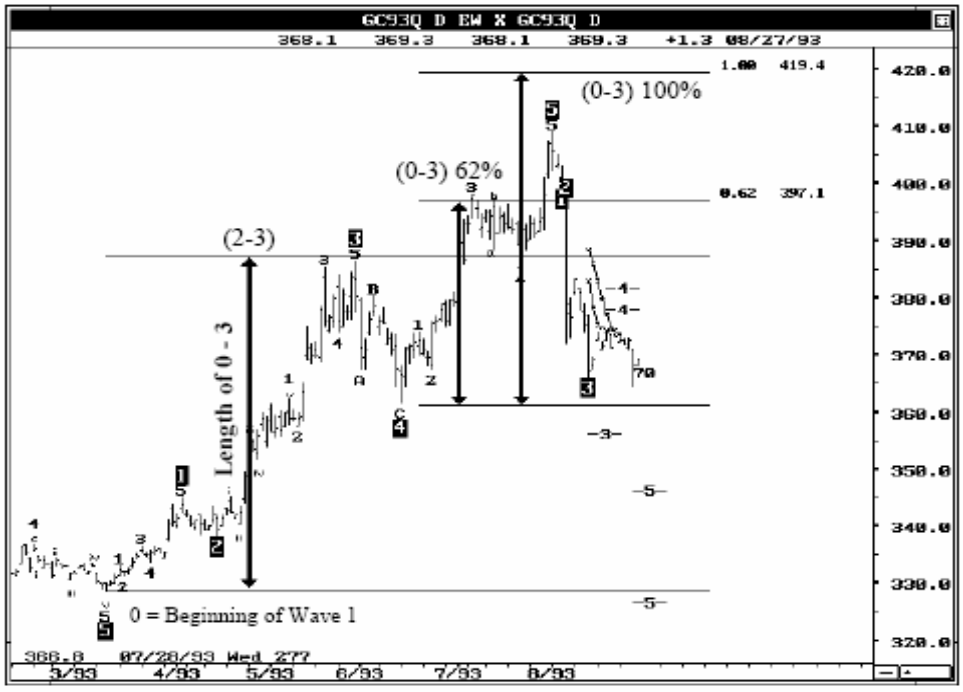


موج پنجم

(در صورتی که موج سوم کمتر از ۱/۶۲ برابر موج اول باشد گسترش می‌یابد):



نسبت‌های فیبوناچی الیوت برای موج ۵



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

قواعد: ترید نوع ۱

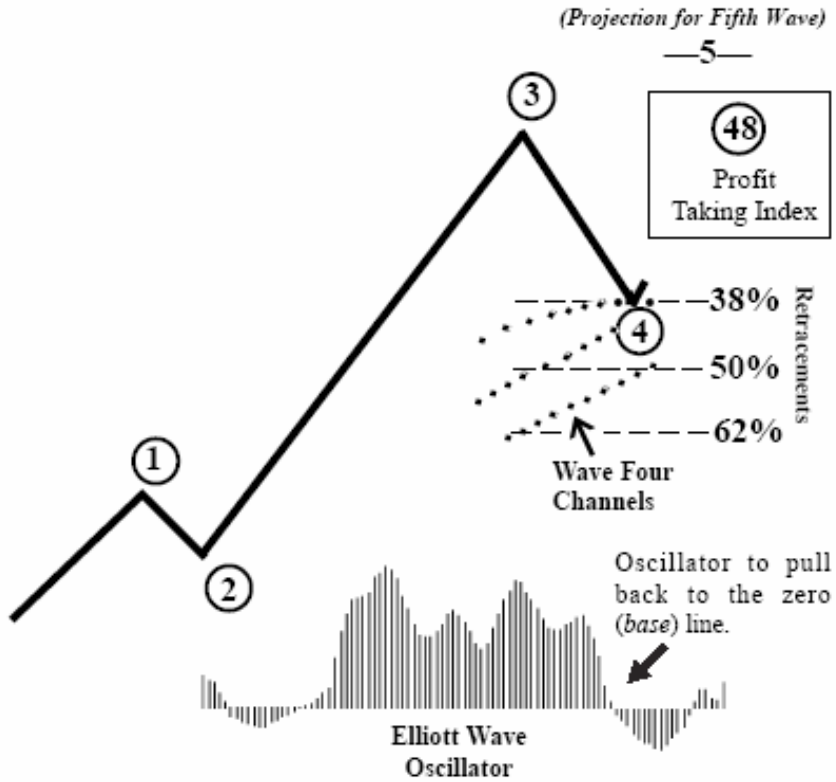
(Buy در انتهای یک موج چهارم اصلاحی)

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

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

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

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



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

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

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

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

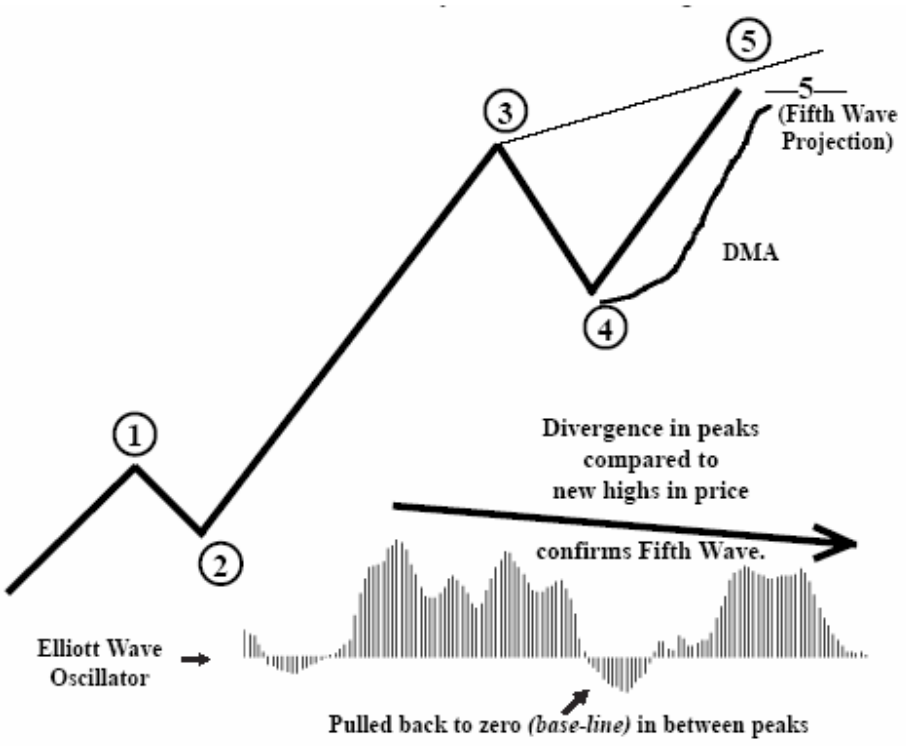
قواعد: ترید نوع ۲

(Sell در انتهای رالی موج پنجم)

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

۱)توجه کنید که قیمت در نزدیکی موج پنجم مورد نظر باشد.

۲)اطمینان حاصل کنید که نوسان نمای الیوت یک موج پنجم را با یک دایورجنس روشن و برگشت به سمت صفر قطعی کرده است.

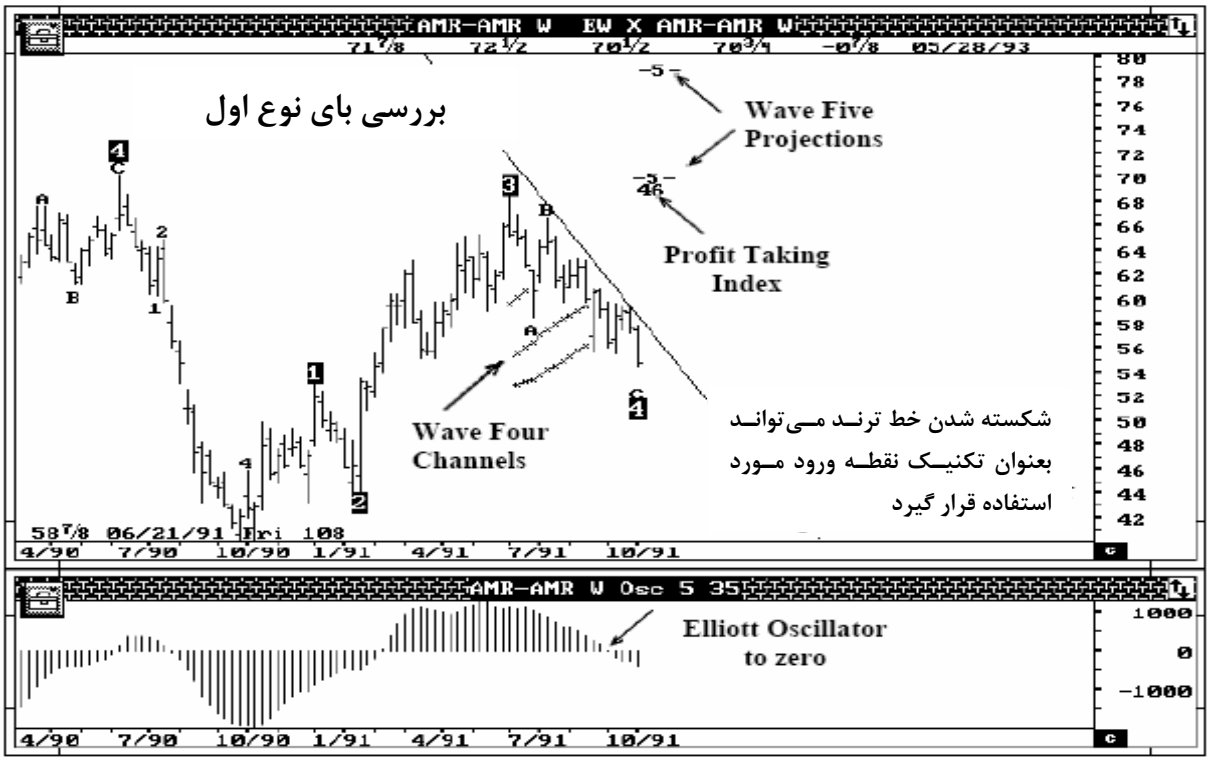


۳)از DMA بری گرفتن Sell در سمت دیگر استفاده کنید. در DMA یک میانگین متحرک ساده به سمت راست جابه‌جا شده است. زمانی که مومنتوم در بازار ادامه دارد DMA خارج از مسیر قرار دارد. زمانی که قیمت در موج پنجم از نقطه Top خود برگشت می‌کند این نقطه شکست DMA می‌باشد. این مساله نقطه ورود را قطعی می‌کند. همچنین یک Stop قطعی بالای این نقطه High ایجاد می‌کند.

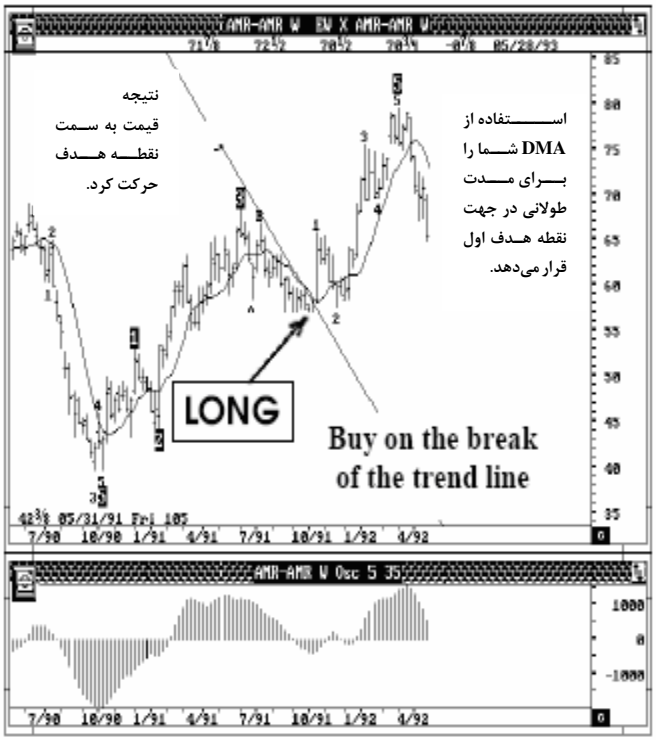
۴)یک Stop بالای High قبلی قرار دهید.

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

مثال‌های تریدهای نوع یک و دو



بررسی Buy نوع اول



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

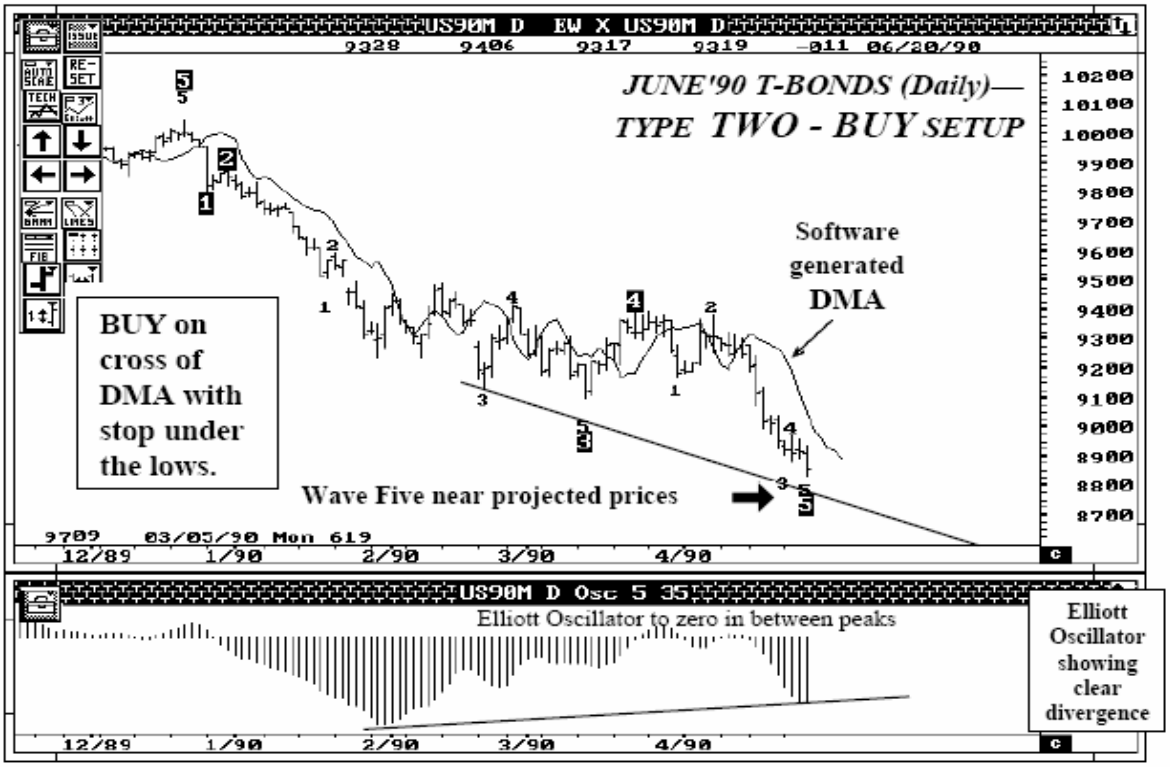
مرحله B: خط ترند را بعنوان نقطه ورود تکنیکال در نظر بگیرید. این تکنیک برای این بکار می‌رود که در صورت شکسته شدن خط ترند نقطه ورود به پوزیشن ایجاد می‌شود.

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

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

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

Buy نوع دوم



بررسی Buy نوع دوم

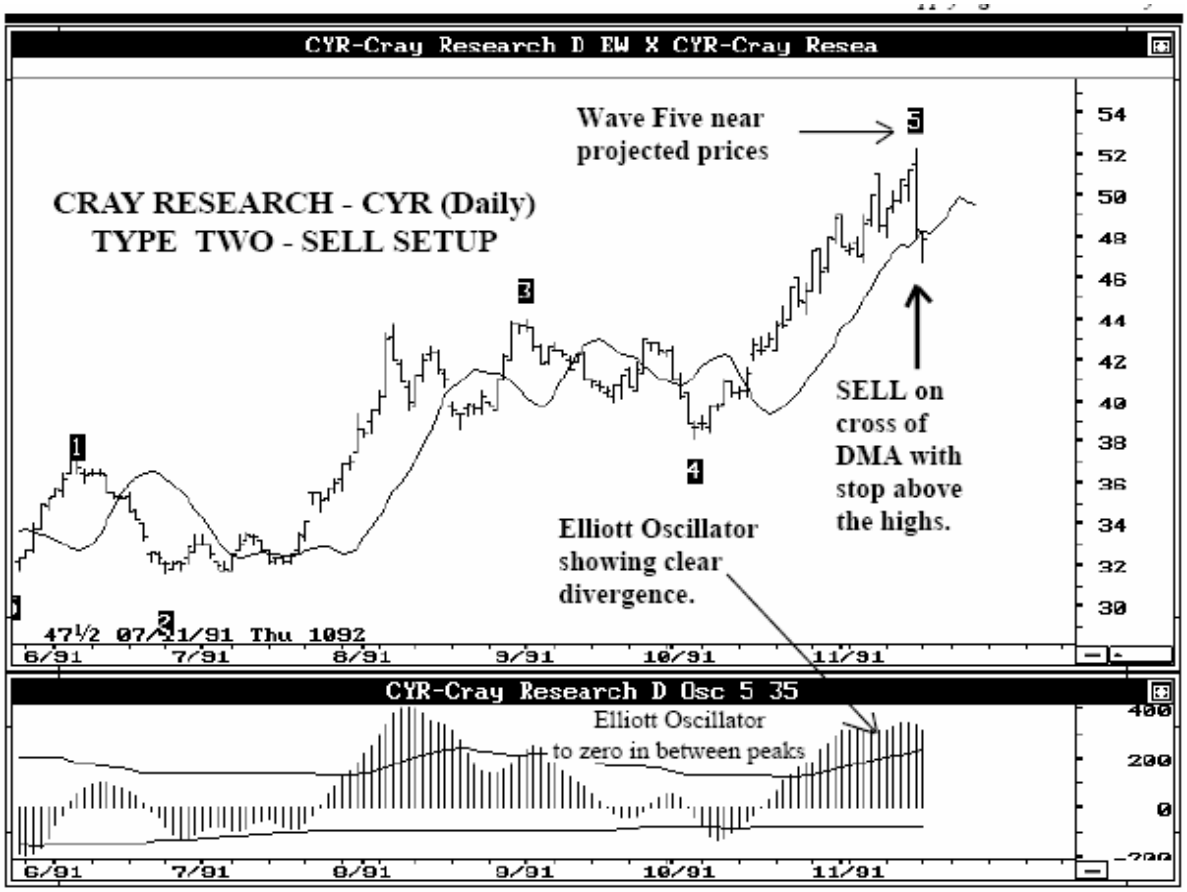
مرحله A: قیمت نزدیک موج ۵ پیش‌بینی شده می‌باشد.

مرحله B: نوسان نمای الیوت دایورجنس واضحی را نشان می‌دهد. همچنین نوسان نمای الیوت در بین دو قله به سمت صفر بازگشته است.

مرحله C: از تقاطع DMA برای ورود به یک پوزیشن Buy استفاده کنید.

مرحله D: Stop مورد نظر را در زیر Low قرار دهید.

مرحله E: زمانی که فاز بعدی شروع می‌شود با استفاده از DMA سود خود را محافظت نمایید. حالا خود را آماده بررسی یک پوزیشن نوع یک کنید.



بررسی سل نوع دوم

مرحله A: قیمت نزدیک موج پنجم مورد انتظار است.

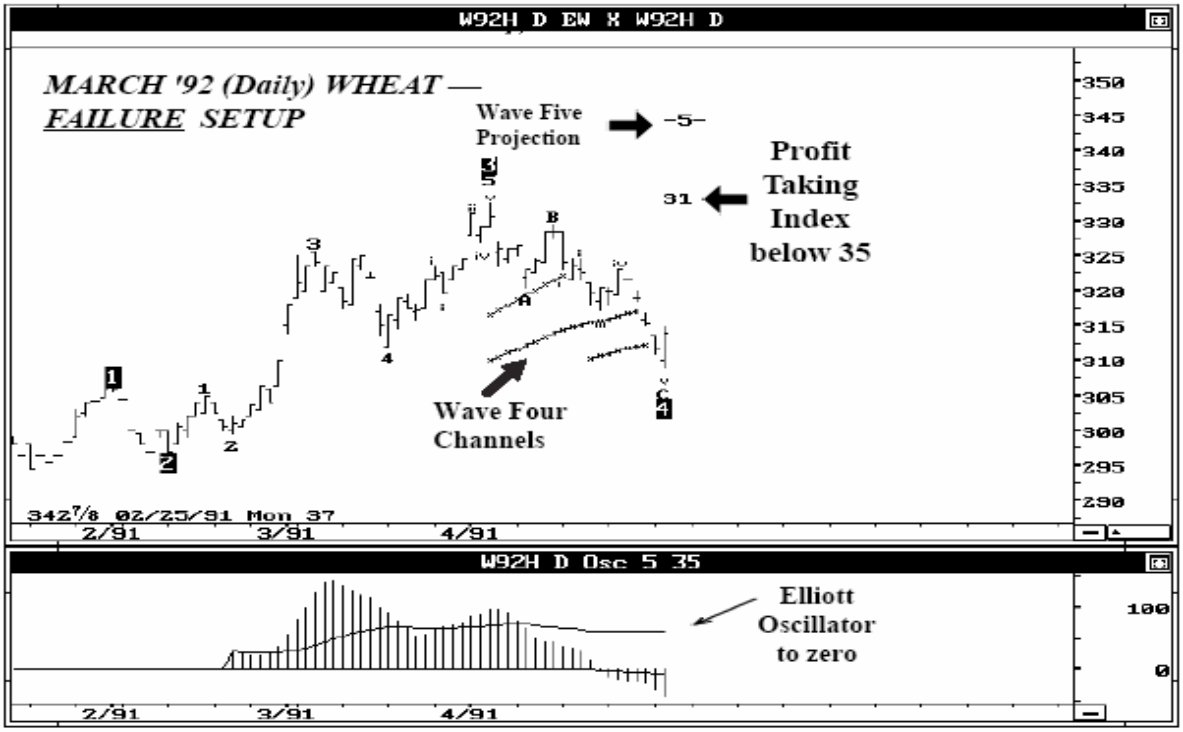
مرحله B: نوسان نمای الیوت یک موج ۵ را با دایورجنس واضح نشان می‌دهد.. نوسان نمای الیوت در بین دو قله به خط صفر بازگشته است.

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

مرحله D: Stop را در بالای High قرار دهید.

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

پیش‌بینی عدم تشکیل موج ۵م یا تشکیل سقف دوقلو



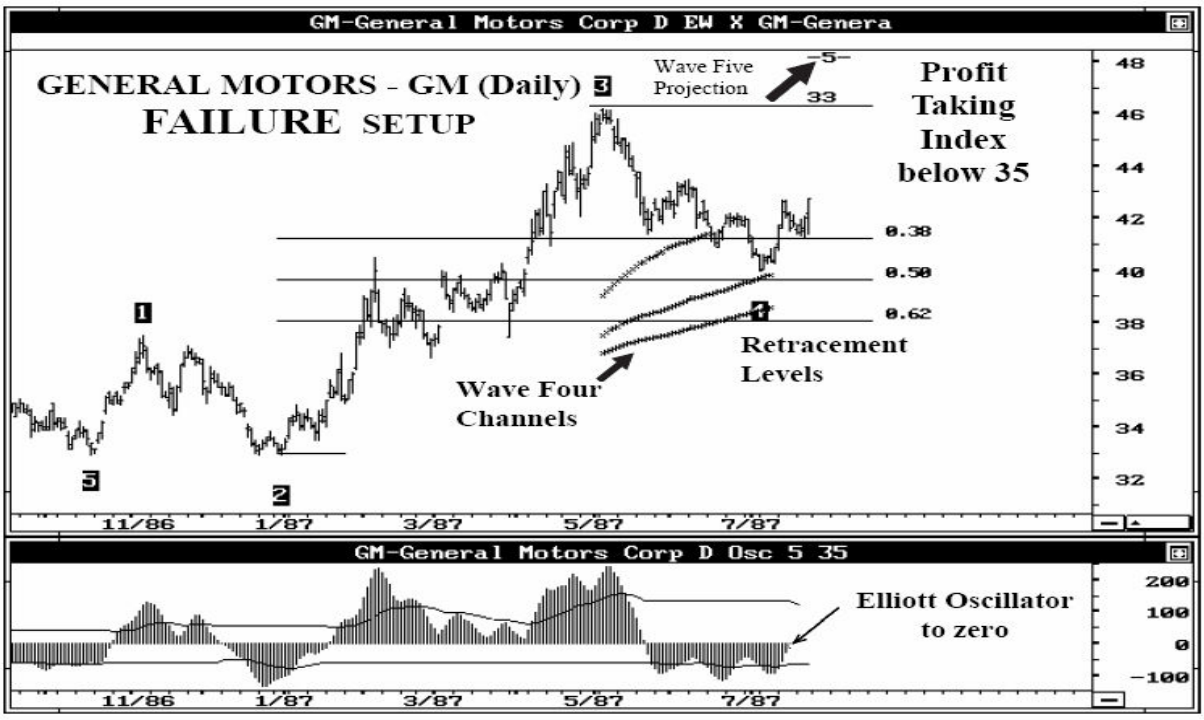
بررسی عدم تشکیل موج ۵

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

یک راه حل محافظه کارانه این است که از این ترید Buy صرف‌نظر کنیم.

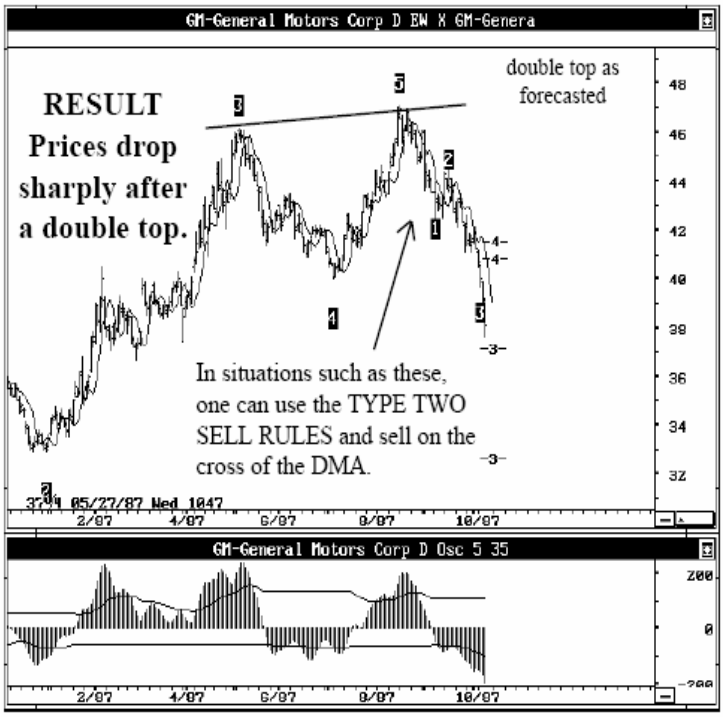
اگر این ترید (حالت تهاجمی) صورت گیرد به احتمال زیاد با Stop بسته خواهد شد.

پیش‌بینی عدم تشکیل موج ۵م یا تشکیل سقف دوقلو



بررسی عدم تشکیل موج ۵

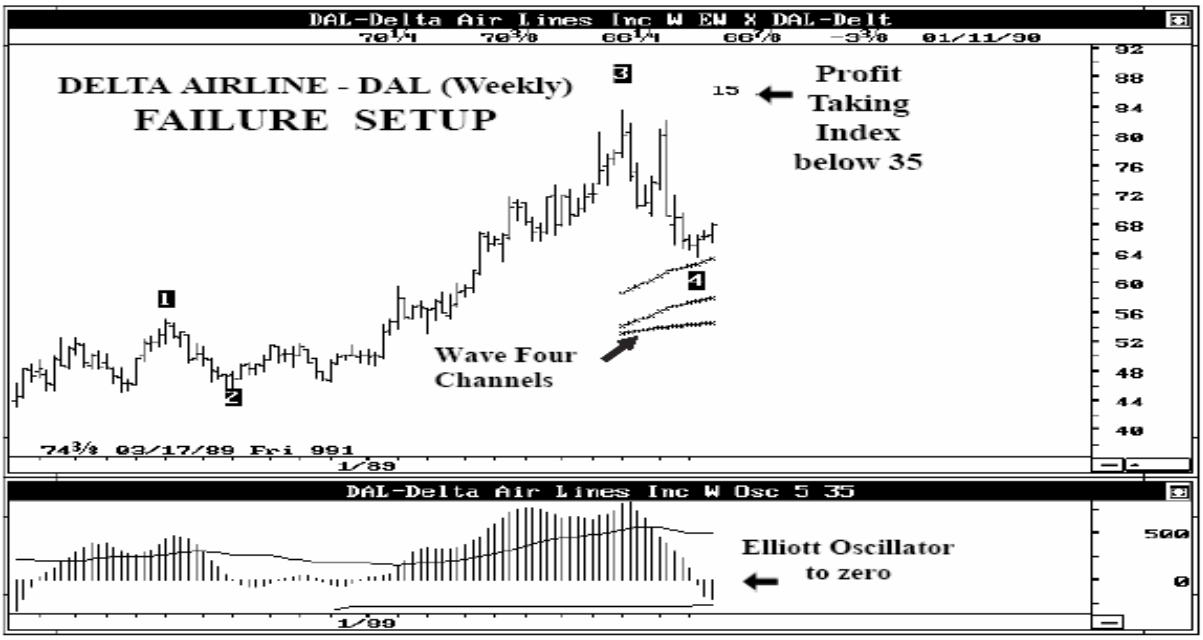
عـدد PTI کمتـر از ۳۵ شـده اسـت. به طور آماری این حالت دلالت بر ایـن نکتـه دارد کـه احتمـال تـشکیل مـوج ۵ بـه شدت کاهش یافته اسـت و یـا یـک سـقف دوقلـو تـشکیل خواهد شد.



یک راه حل محافظه کارانه این اسـت کـه از ایـن تریـد Buy صرف‌نظر کنیم.

اگر این ترید (حالت تهـاجمی) صورت گیرد به احتمال زیاد بـا Stop بسته خواهد شد.

پیش‌بینی عدم تشکیل موج ۵م یا تشکیل سقف دوقلو



بررسی عدم تشکیل موج ۵

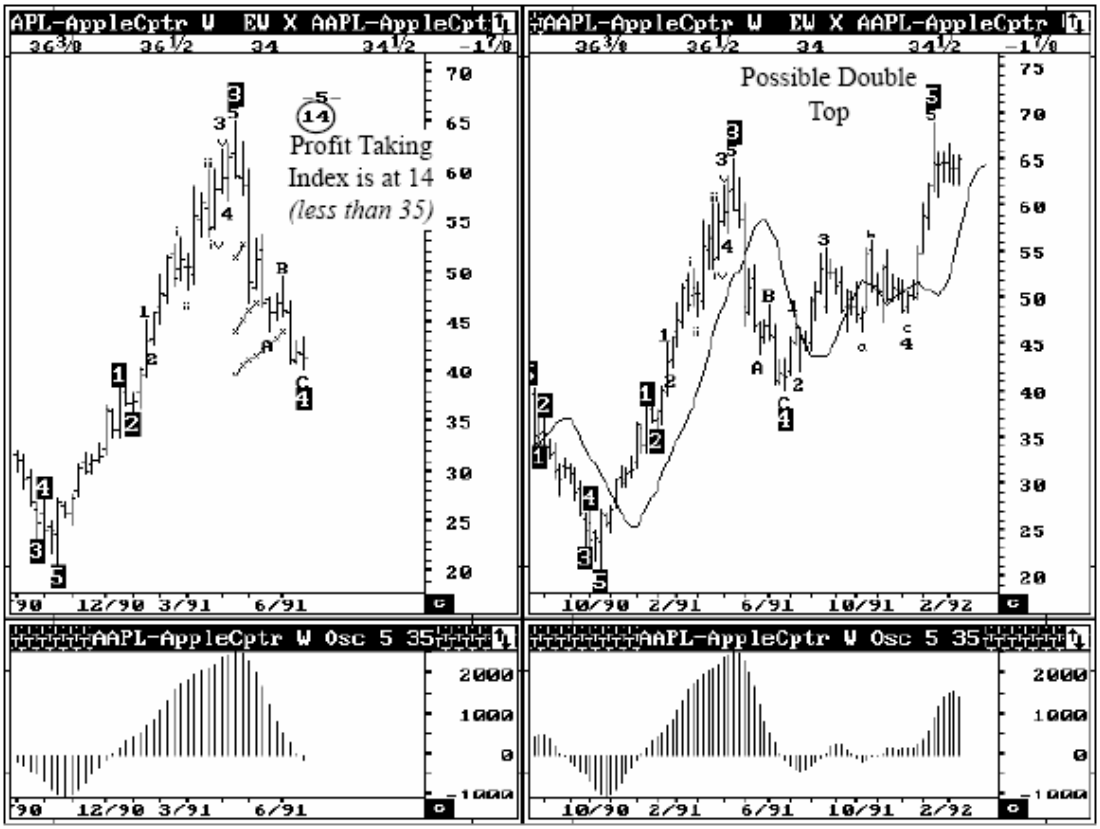
عدد PTI کمتر از ۳۵ شده است. به طور آماری این حالت دلالت بر این نکته دارد که احتمال تشکیل موج ۵ به شدت کاهش یافته است و یا یک سقف دوقلو تشکیل خواهد شد.

یک راه حل محافظه کارانه این است که از این ترید Buy صرف‌نظر کنیم.

در صورتی که توجه کنید می‌بینید که عدد PTI (۱۵) بسیار پایین است. پایین بودن بیش از حد PTI به شدت تاکید می‌کند که موج ۵م تشکیل نمی‌شود.

تشخیص عدم تشکیل موج ۵ام (سقف دوقلو)

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

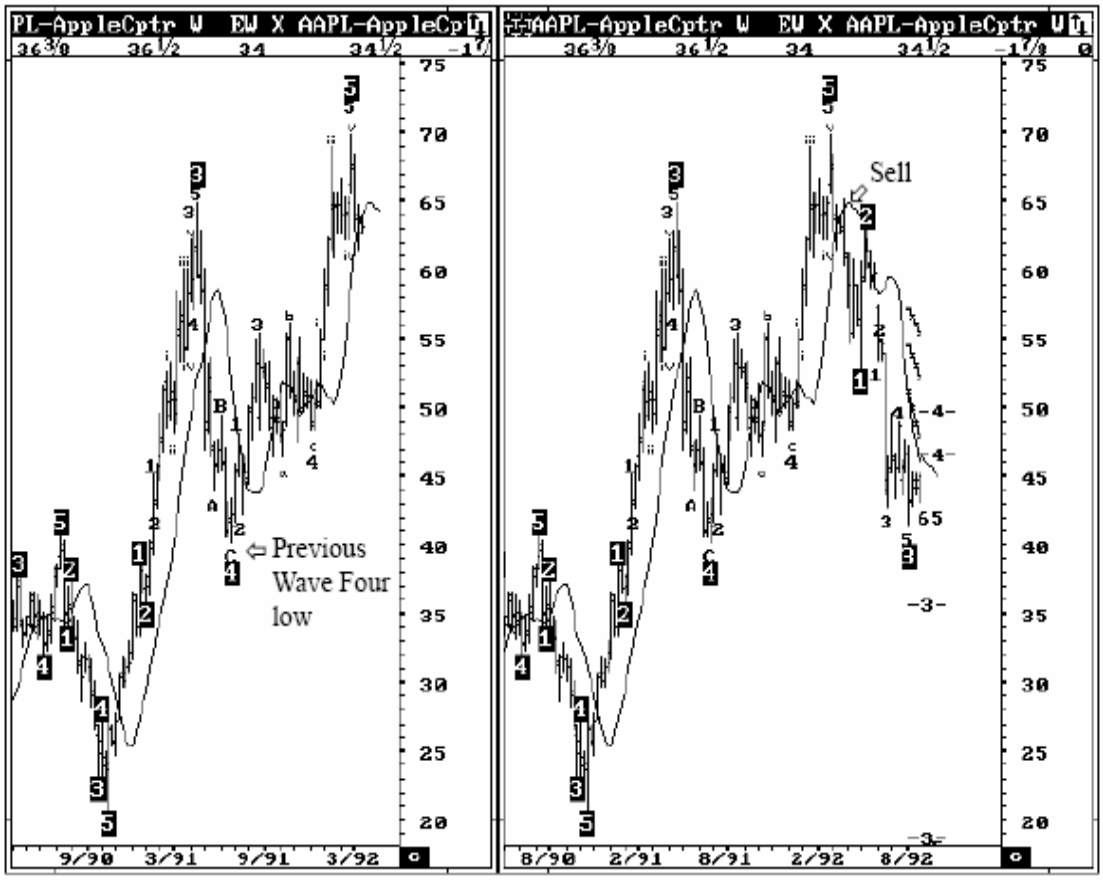


* زمانی که **PTI** کمتر از ۳۵ باشد حد سود بالاتر از حد مورد نظر در موج ۴ام دیده خواهد شد. این امر منجر به عدم تشکیل موج ۵ام و تشکیل سقف دوقلو خواهد شد (به صفحه بعد نگاه کنید).

سقف دوقلو (عدم تشکیل موج ۵ام)

Apple Computer(هفتگی)

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

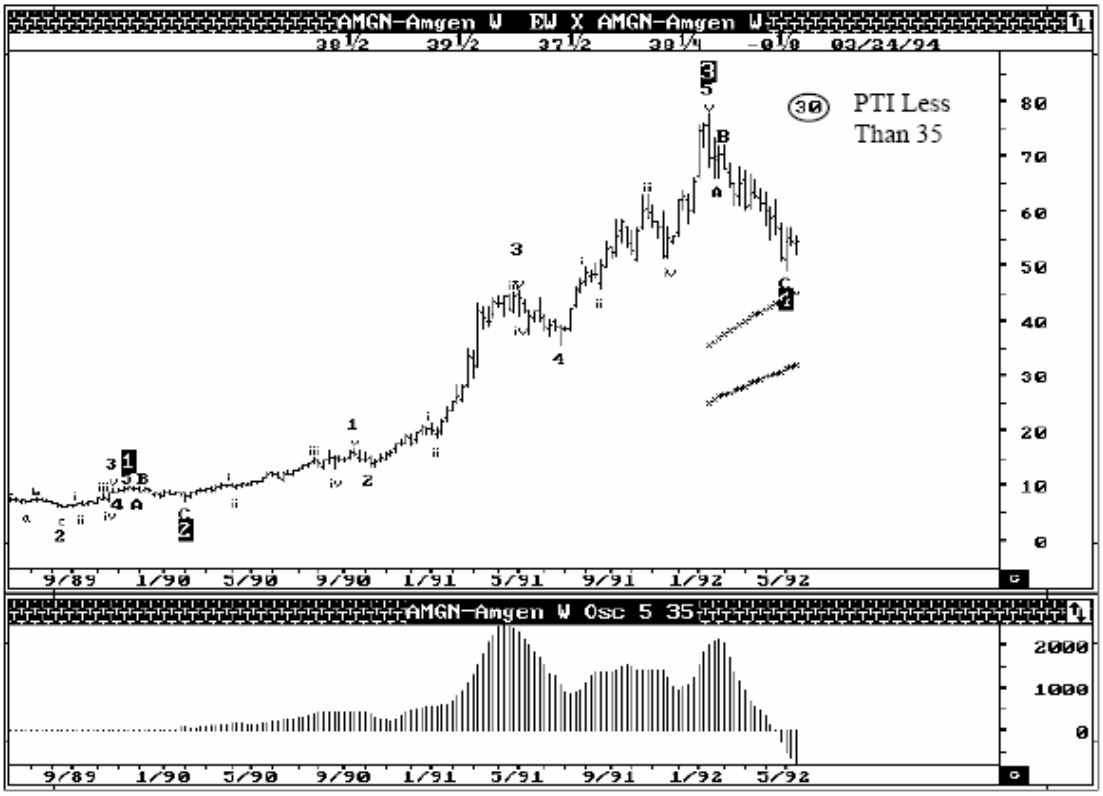


*** از DMA برای ورود به یک پوزیشن Sell استفاده کنید و Stop را بالای High قرار دهید.**

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

سقف دوقلو (عدم تشکیل موج ۵ام)

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

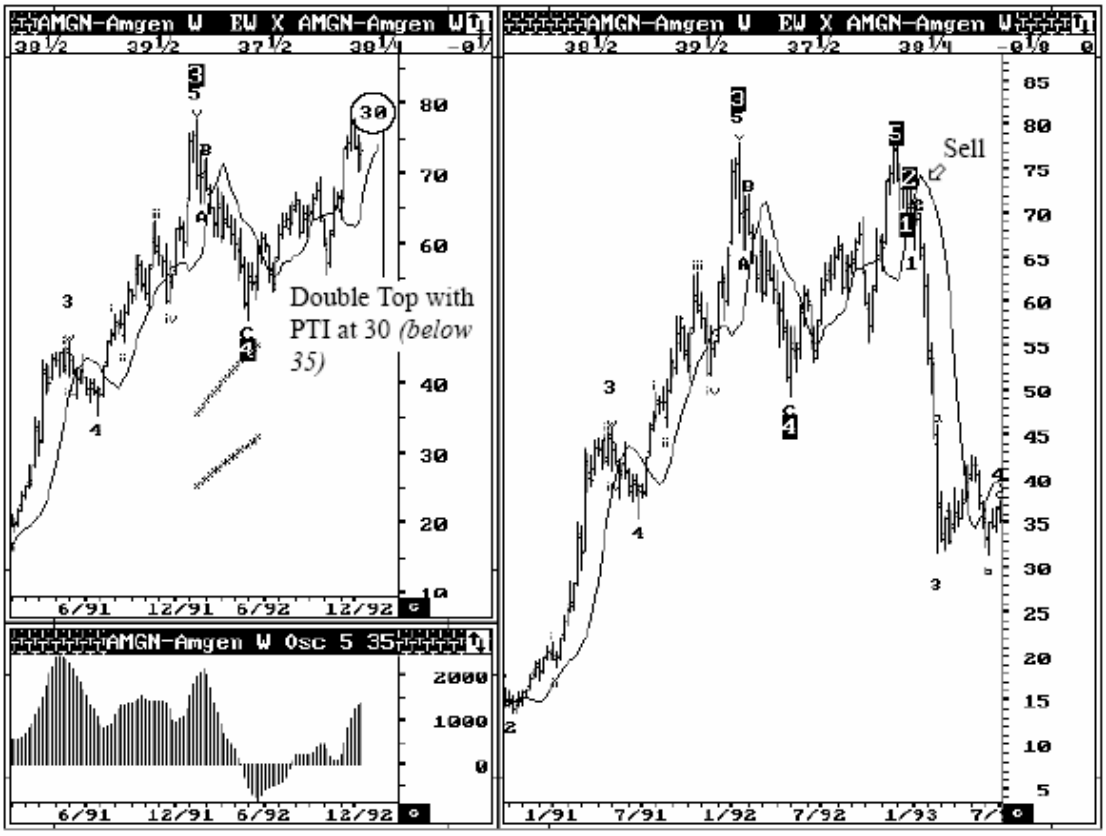


*** این مساله باعث می‌شود که سقف دوقلو تشکیل شده یا High موج ۵ام تشکیل نشود (به صفحه بعد نگاه کنید).**

سقف دوقلو (عدم تشکیل High موج ۵ام)

نمودار هفتگی AMGEN

* زمانی که PTI در حد ۳۰ بود و توجه بازار به High مـوج سـوم باشـد احتمـال عـدم تشکیل موج ۵ام یا تشکیل سقف دوقلو زیاد است.



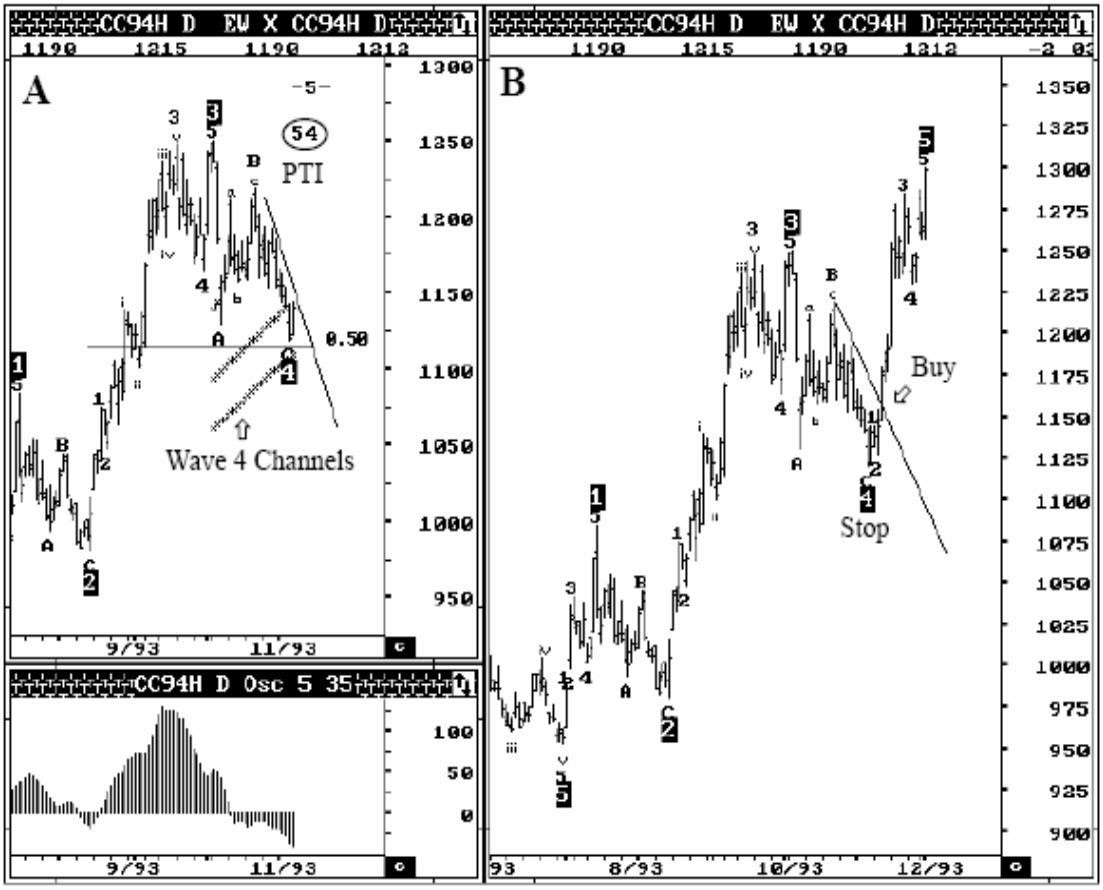
* از DMA برای ورود به پوزیشن Sell استفاده کنید و Stop را بالای High قرار دهید.

* Low موج ۴ام که نزدیک ۵۰ می‌باشد اولین هدف است. در این زمان مـی‌تـوان Stop مورد نظر را کوچکتر کرد و یا منتظر ماند تا نرم‌افزار شمارش جدید بـرای مـوج ۳ام را در همان مسیر انجام دهد.

بای نوع اول در مارس ۹۴ برای Cocoa

*** نمودار A پایان موج نزولی چهارم را نشان می‌دهد. نوسان نمای الیوت نیز به سمت صفر برگشت نموده است و این امر را محتمل‌تر می‌سازد.**

*** در اینجا نیز PTI بالاتر از ۳۵ بوده (۵۴) که نشان دهنده پتانسیل خوبی بـرای ایجـاد یک رالی که High جدیدی خواهد ساخت می‌باشد.**



*** کانال‌های موج چهارم نیز این پتانسیل خوب را بـرای تـشکیل رالـی جدیـد را نـشان می‌دهد.**

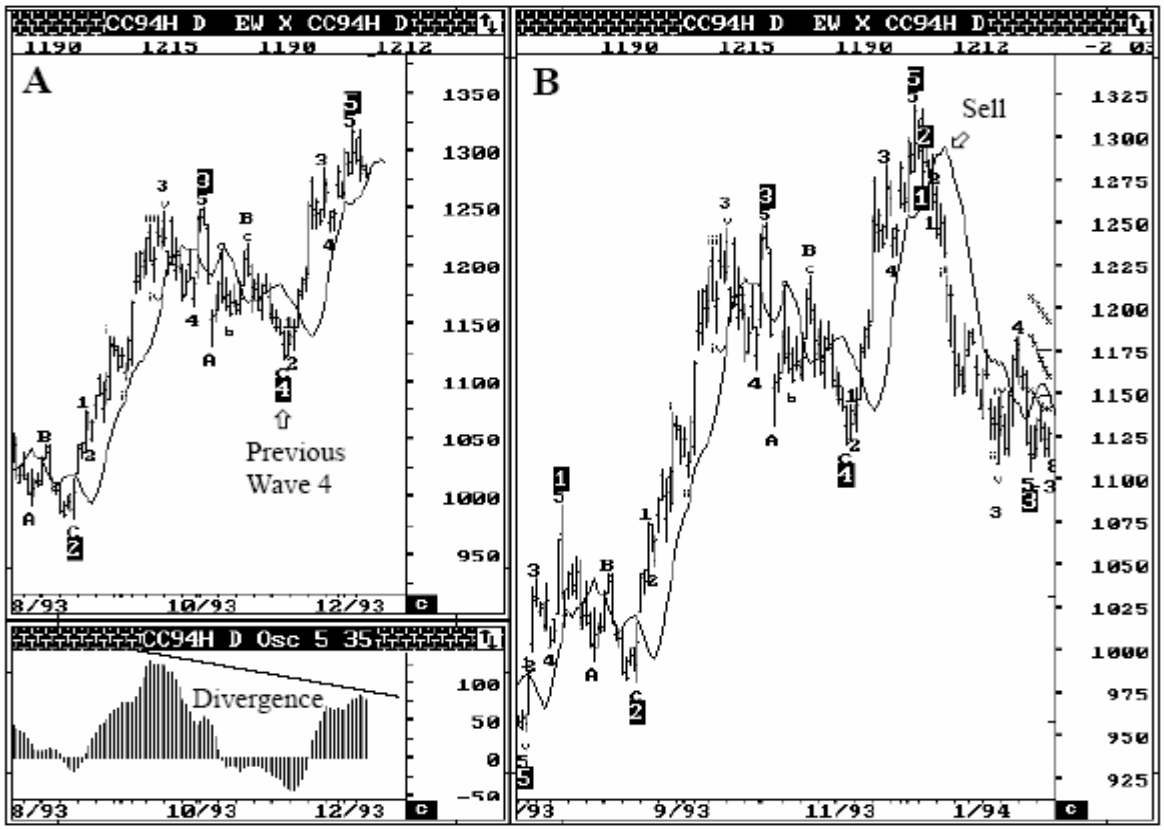
*** Buy در محل تقاطع خط ترند با DMA انجام می‌شود و Stop نیز در زیر Low موج ۴ قرار داده می‌شود. هدف اول نیز بالای ۱۲۵۰ می‌باشد. پیش‌بینی نرم افزار به صـورت -۵- نشان داده شده است (باخط‌هایی در دو طرف آن).**

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

سل نوع دوم در مارس ۹۴ برای *Cocoa*

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

*** نوسان نمای الیوت نیز دایورجنس واضحی را نشان می‌دهد.**



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

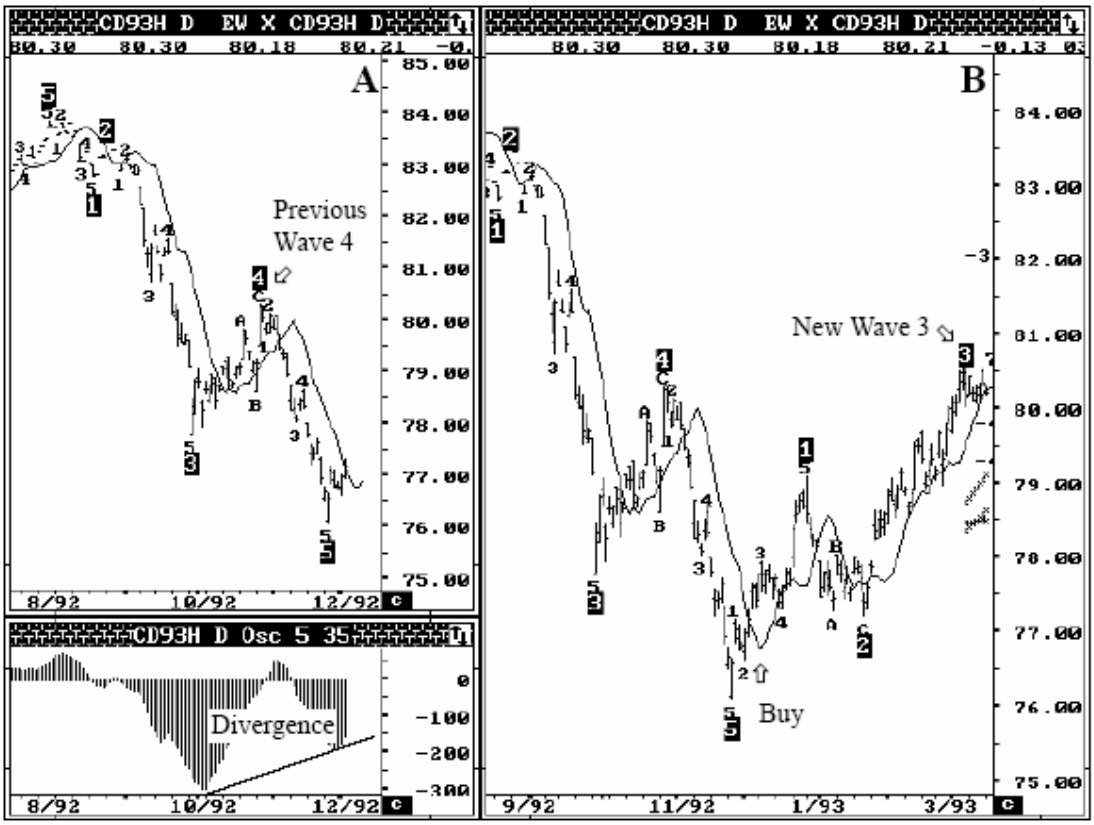
*** اولین هدف در نزدیکی موج ۴ام حدود ۱۱۱۰ می‌باشد.**

*** نمودار B نقطه سل را در ادامه نشان می‌دهد.**

بای نوع دوم در مارس ۹۳ برای دلار کانادا

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

* نوسان نمای الیوت نیز دایورجنس واضحی را نشان می‌دهد.



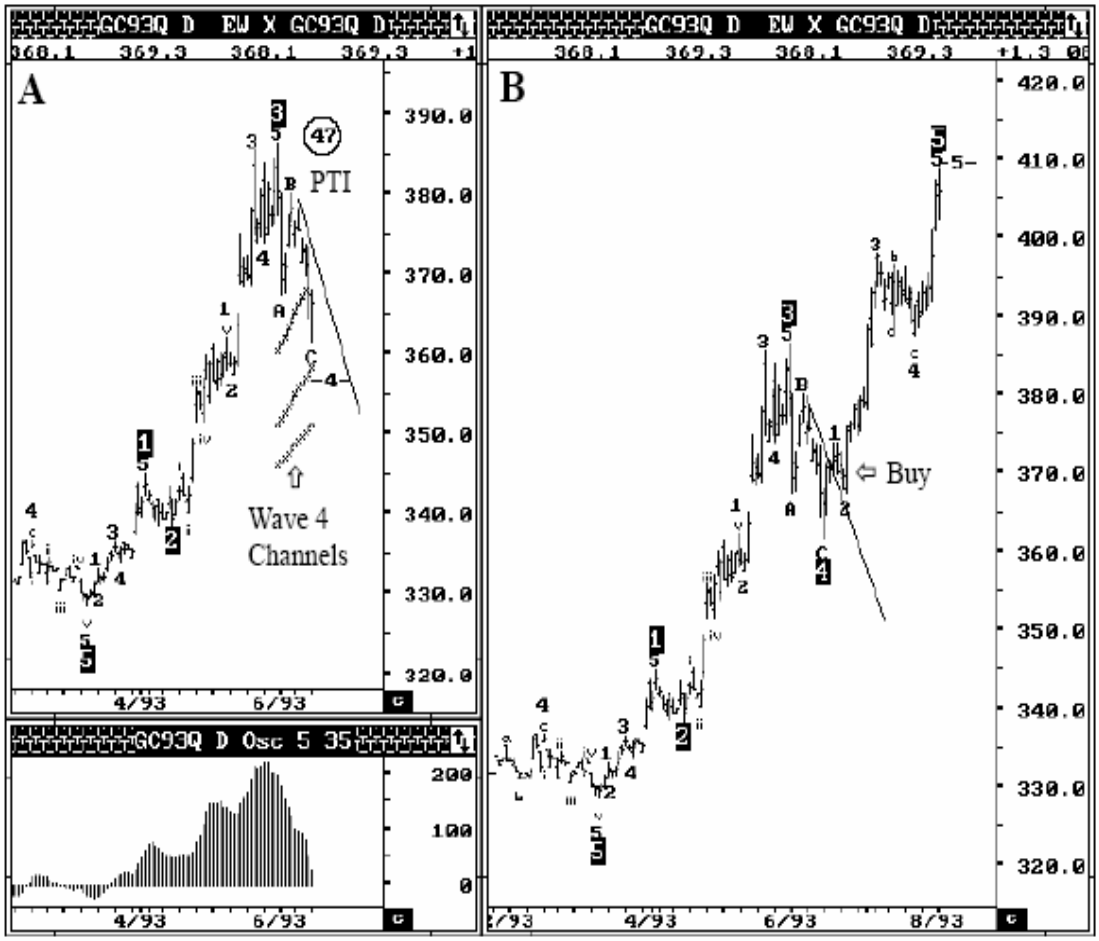
* بای در محل تقاطع خط ترند یا DMA انجام شود و Stop زیر Low قرار داده شود.

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

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

بای نوع اول در آگوست ۹۳ برای طلا

* نمودار A تکمیل موج ۴ام را نشان می‌دهد. نوسان نمای الیوت نیز این امر را تایید می‌کند.
* در اینجا PTI بالاتر از ۳۵ (۴۷) می‌باشد که دلالت بر پتانسیل قوی برای رالی که بتواند High جدیدی بسازد می‌باشد.

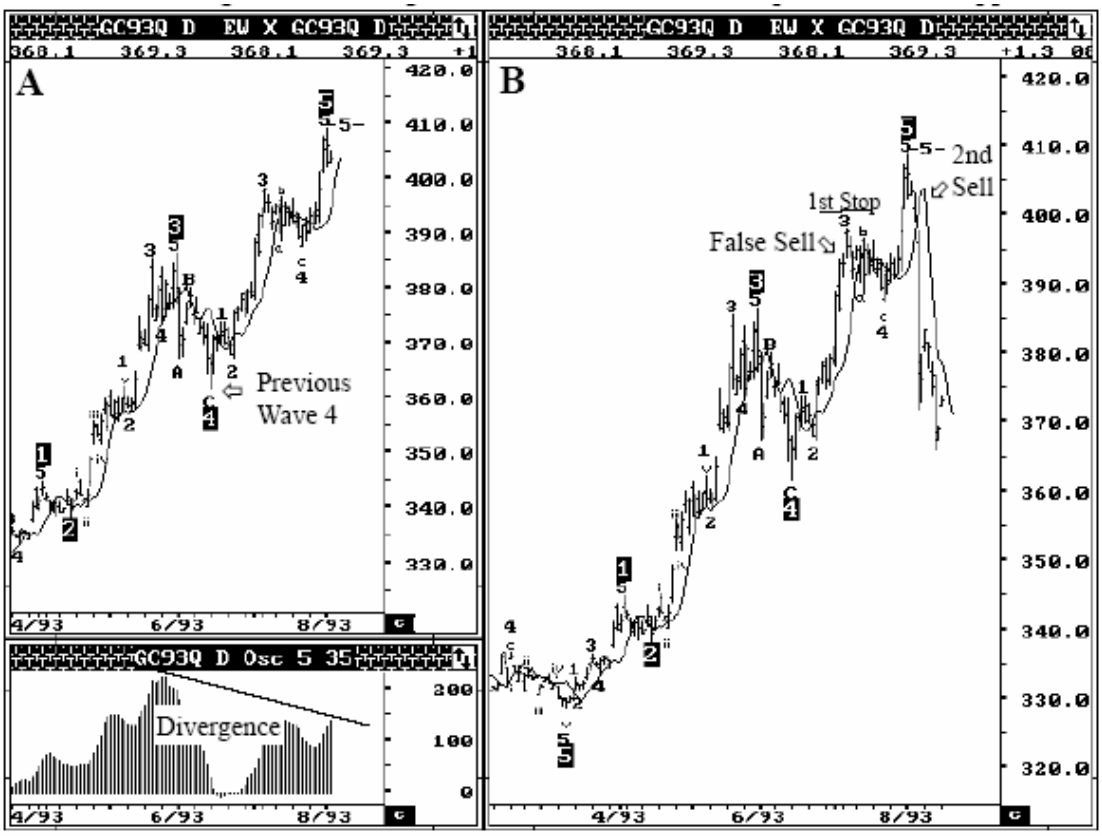


* کانال‌های موج چهارم قیمت‌هارا در این سطح نگه داشته و حمایتی برای رالی بالقوه آن در آینده می‌باشند.
* Buy در محل تقاطع خط ترند با DMA انجام شود و Stop زیر Low موج چهارم قرار داده شود. اولین هدف در بالای سطح ۳۹۰ می‌باشد.
* این موارد معمولا Sell نوع دوم را نیز به همراه دارند (به صفحه بعدی نگاه کنید).

سل نوع دوم در آگوست ۹۳ برای طلا

(با یک سیگنال خطا)

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

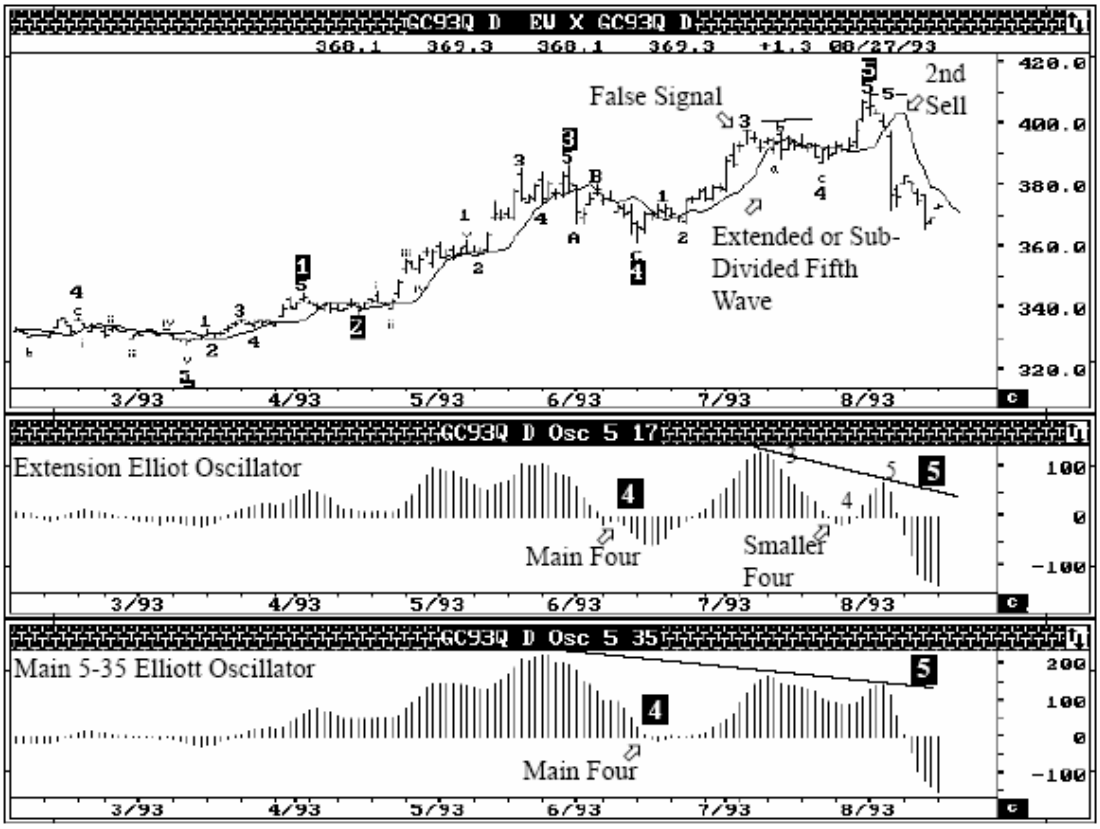


* سیگنال Sell دوم ما را وارد یک روند نزولی کرد. هدف اول در Low موج چهارم در نزدیکی ۳۶۰ می‌باشد.
* سیگنال Sell اول سیگنال خطا بود. این مساله بعلت یک تقسیم کوچک یا گسترش موج ۵ام بود.
* به صفحه بعد نگاه کنید تا نشان دهد چگونه سیگنال خطایی که بعلت تقسیم موج ۵ام ایجاد شده کنترل شود.

کنترل سیگنال خطای نوع دوم

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

* نوسان نمای الیوت معمولی یا اصلی (Tom's ۵-۳۵) درجه بالاتر از موج ۵ام را نشان می‌دهد.
* زمانی که موج ۵ام گسترش می‌یابد یا به زیر موج‌هایی تقسیم می‌شود، سیگنال خطای سل اول ایجاد می‌شود.

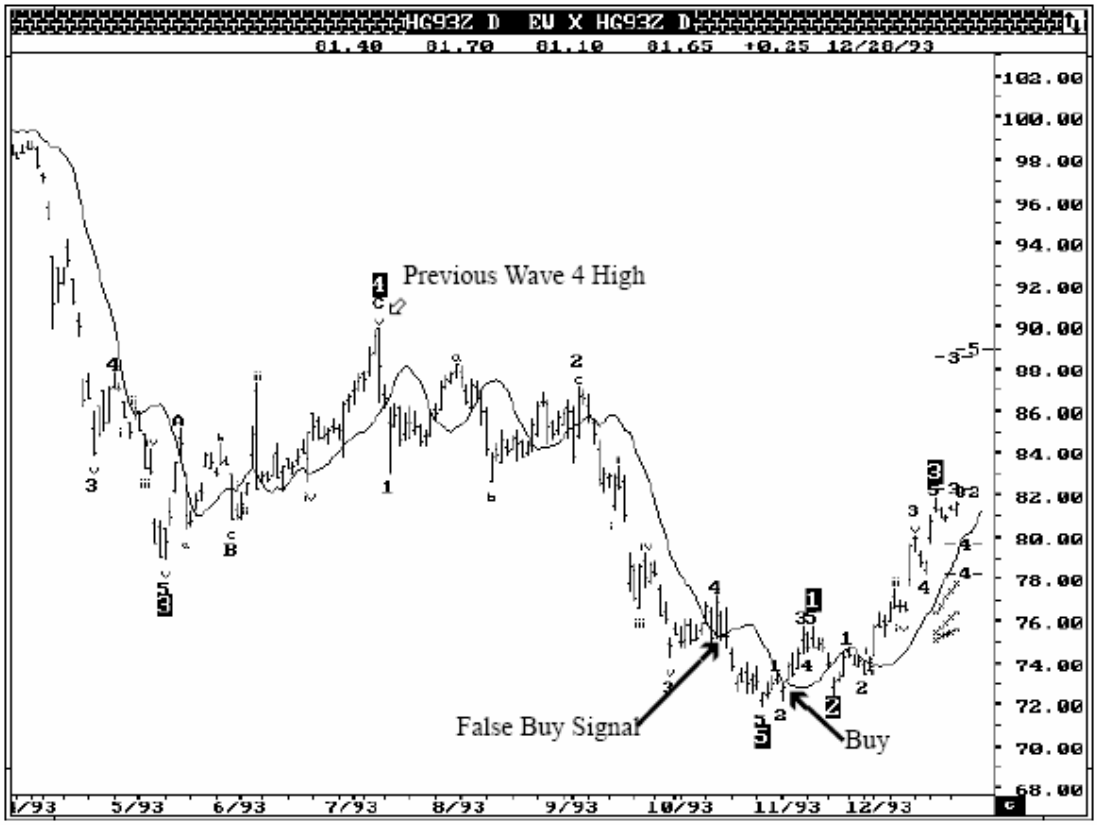


* زمانی که شما به سیگنال خطایی که بعلت گسترش یا تقسیم موج ۵ام به زیر موج‌ها ایجاد می‌شود بر می‌خورید از نوسان نمای الیوت گسترش یافته (نوسان نمای گسترش یافته Tom's ۵-۱۷) برای دیدن دایورجنس در زیر موج‌های آن استفاده کنید.
* راه دیگر این است که قبل از گرفتن پوزیشن مجدد منتظر بمانید تا نرم‌افزار این محل را نشان دهد. این محل به صورت -۵- (یک عدد با دو خط در دو طرف) نشان داده می‌شود.

بای نوع دوم در دسامبر ۹۳ برای مس

(با سیگنال خطا بعلت بعلت گسترش یا تقسیم موج ۵م به زیر موج‌ها)

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



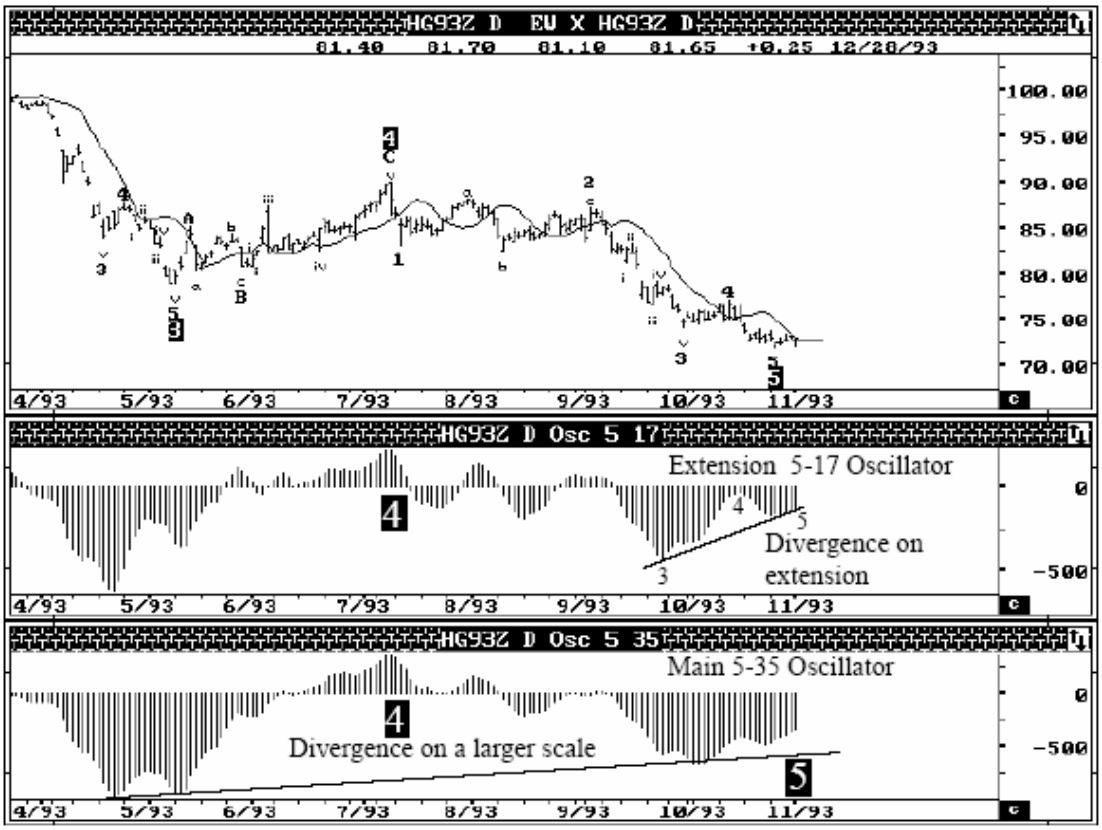
* اولین سیگنال خطا بود و پوزیشن فوق Stop خورد.
* سیگنال Buy دوم رالی را ایجاد کرد. حال به High موج ۴م بعنوان هدف اول توجه کنید.
* اولین سیگنال خطا بود. علت این امر گسترش یا تقسیم موج ۵م به زیر موج‌ها بود.
* به صفحه بعد نگاه کنید تا نشان دهد چگونه سیگنال خطایی که بعلت تقسیم موج ۵م ایجاد شده کنترل شود.

کنترل سیگنال خطای بای نوع دوم

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

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

* زمانی که موج ۵ام گسترش می‌یابد یا به زیر موج‌هایی تقسیم می‌شود، سیگنال خطای Sell اول ایجاد می‌شود.



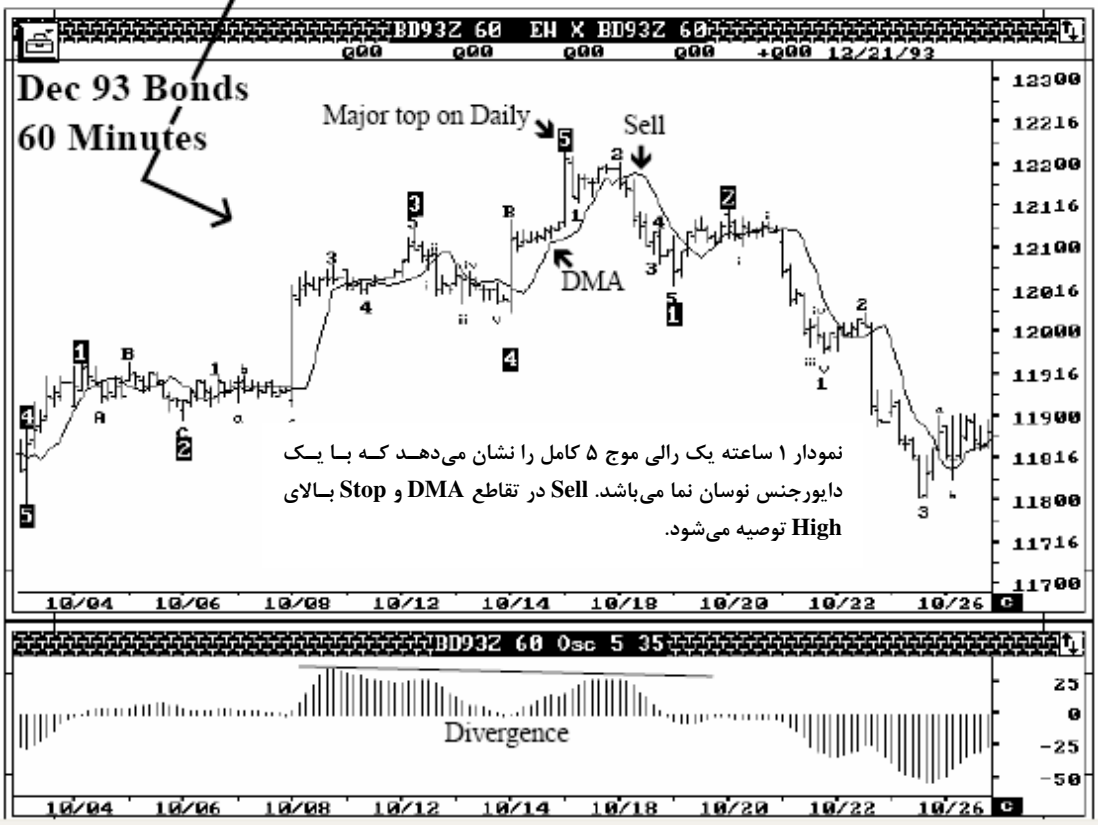
* زمانی که شما به سیگنال خطایی که بعلت گسترش یا تقسیم موج ۵ام به زیر موج‌ها ایجاد می‌شود بر می‌خورید از نوسان نمای الیوت گسترش یافته (نوسان نمای گسترش یافته ۱۷-۵ Tom's) برای دیدن دایورجنس در زیر موج‌های آن استفاده کنید.

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

قدرت نمودارهای ۱ ساعته

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

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



نمودار ۱ ساعته یک رالی موج ۵ کامل را نشان می‌دهد که با یک دایورجنس نوسان نما می‌باشد. **Sell** در تقاطع **DMA** و **Stop** بالای **High** توصیه می‌شود.

مارس ۹۴ برای SP ۵۰۰

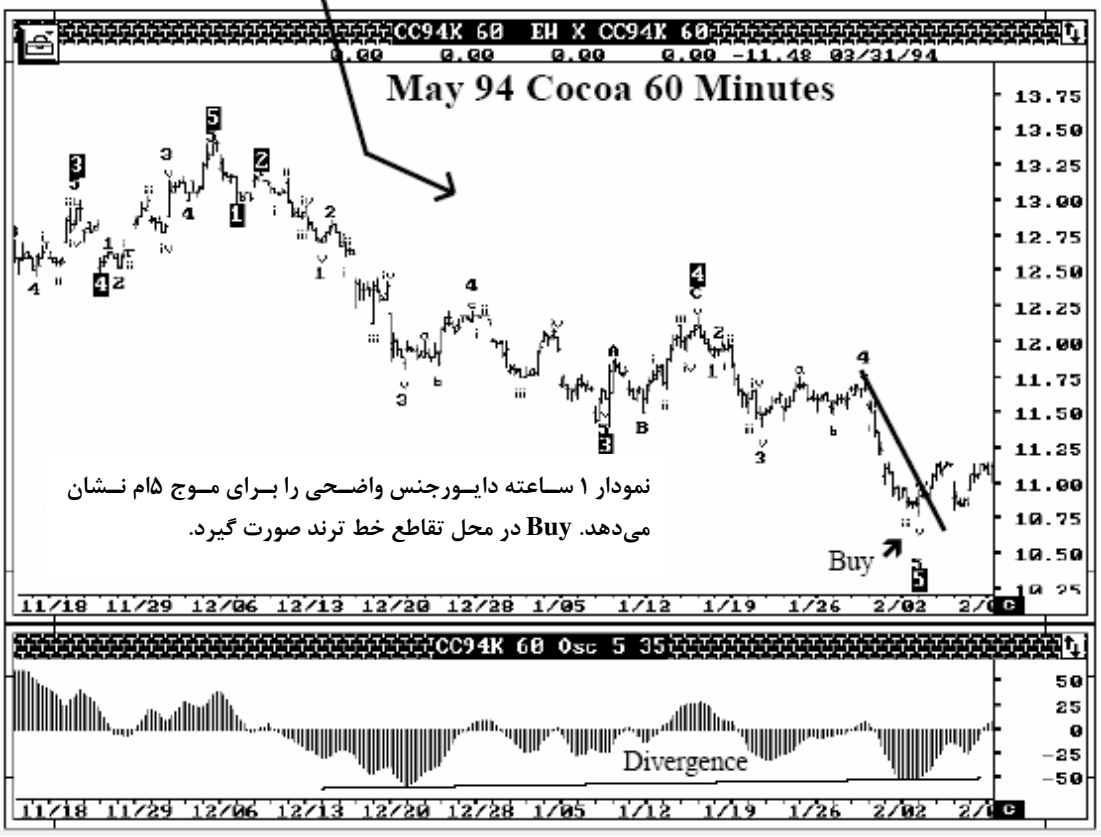
در نمودار روزانه SP ۵۰۰ نشان داده شده است که High موج ۵ام کامل شده است. نمودار ۱ ساعته یک موج ۵ام را نشان می‌دهد که کامل شده است.

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

نمودار ۱ ساعته تکمیل موج ۵ام را به همراه دایورجنس کامل نوسان نما نشان می‌دهد. Sellدر محل تقاطع DMA کنید.

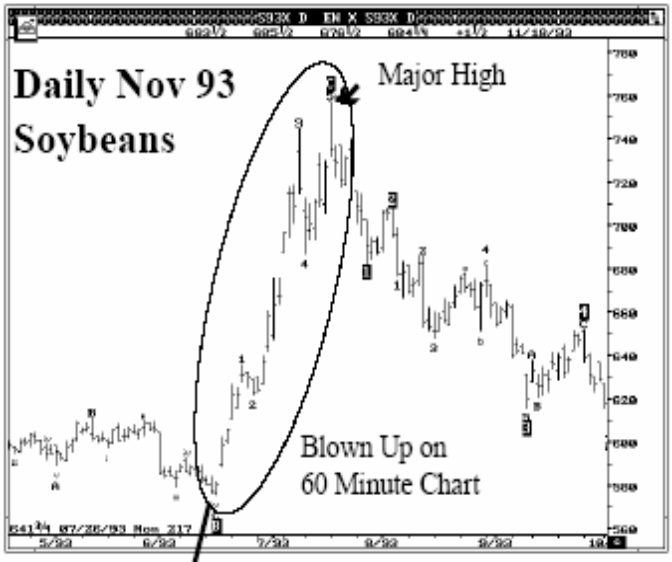
مارس ۹۴ برای Cocoa - قدرت نمودارهای ۱ ساعته

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

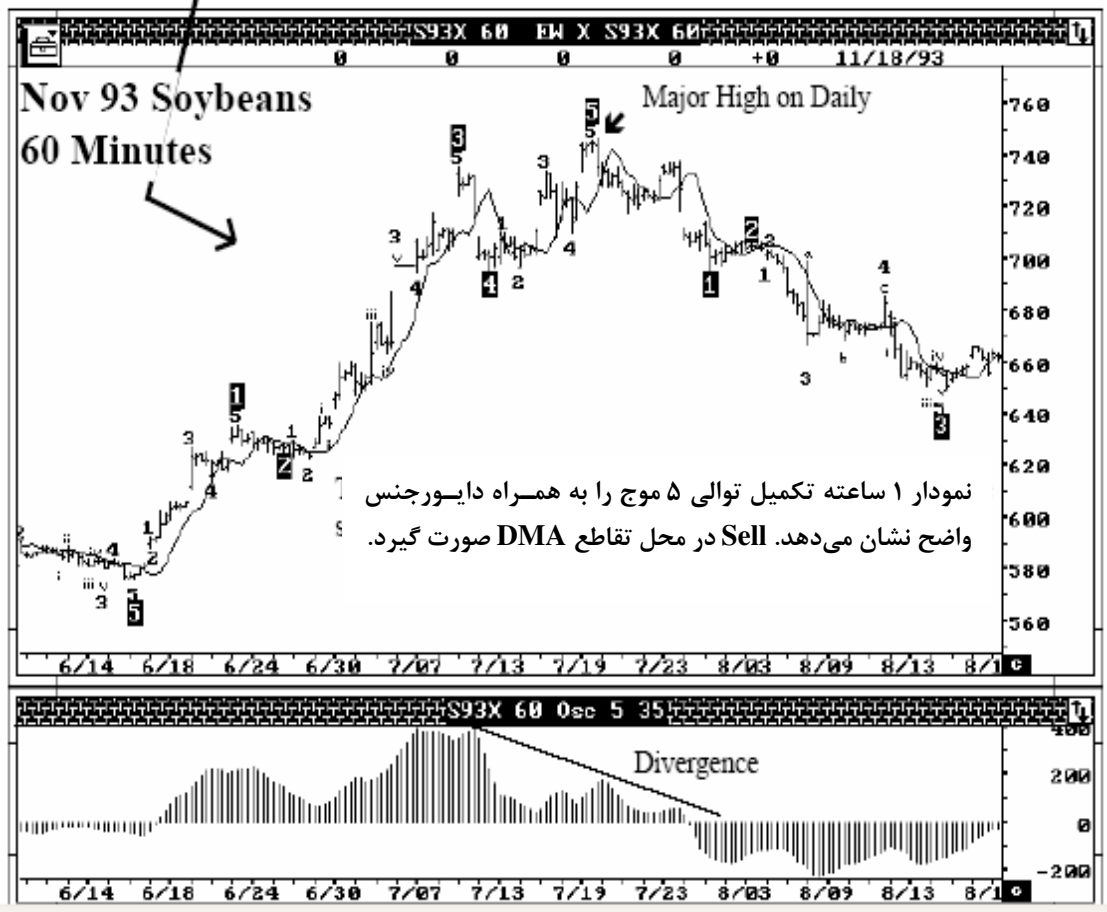


نمودار ۱ ساعته دایورجنس واضحی را برای موج ۵ام نشان می‌دهد. Buy در محل تقاطع خط ترند صورت گیرد.

نمودار Soybeans درنوامبر ۹۳

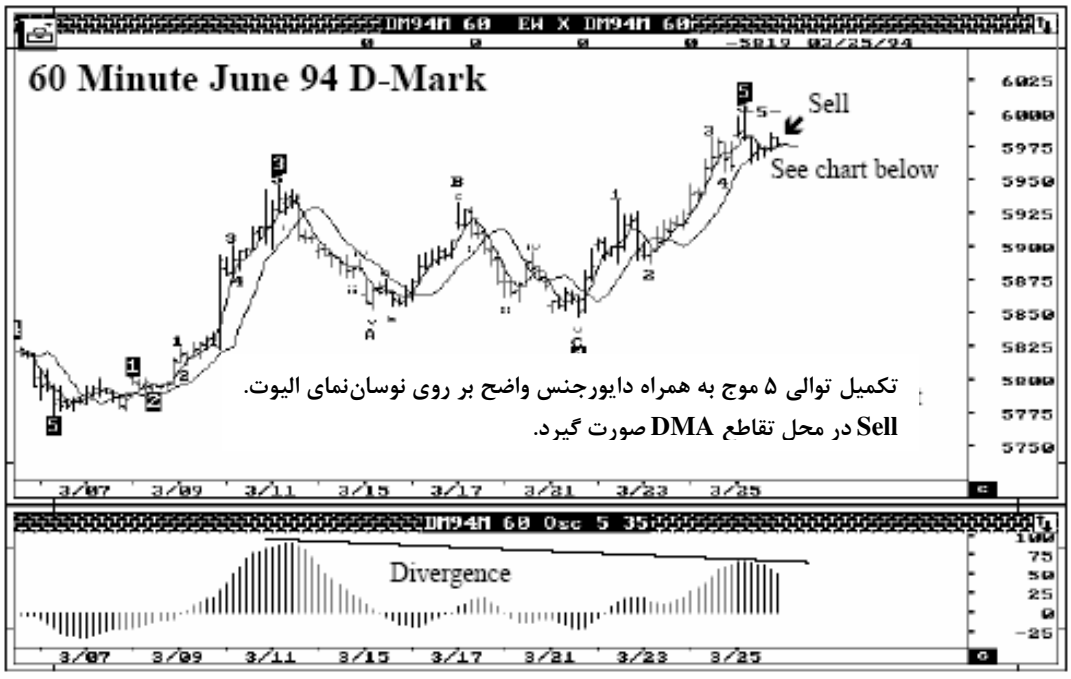


در نمودار روزانه یک High اصلی ایجاد شده است.
در نمودار ۱ ساعته توالی ۵ موج کامل شده است. می‌توان وارد یک پوزیشن Sell در ۷۳۰ شد که چند سنت پایین‌تر از High اصلی است.

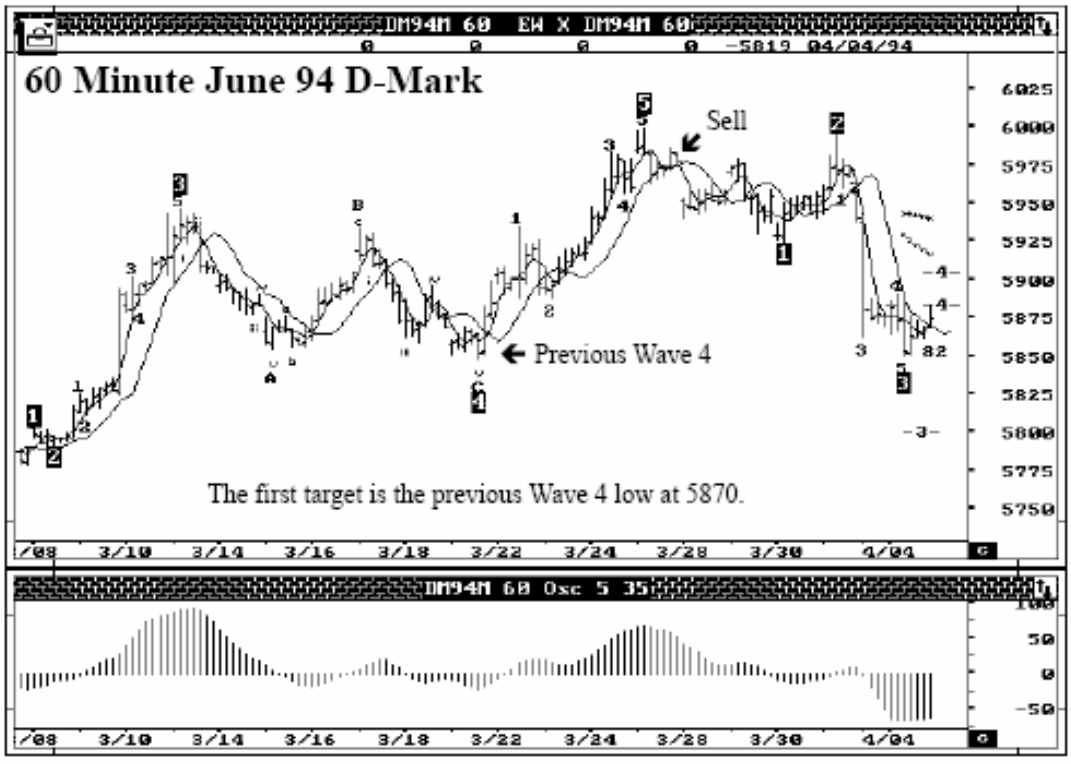


نمودار ۱ ساعته تکمیل توالی ۵ موج را به همراه دایورجنس واضح نشان می‌دهد. Sell در محل تقاطع DMA صورت گیرد.

نوع دوم ژوئن ۹۴ برای DM – نمودار ۱ ساعته



تکمیل توالی ۵ موج به همراه دایورجنس واضح بر روی نوسان‌نمای الیوت.
Sell در محل تقاطع **DMA** صورت گیرد.



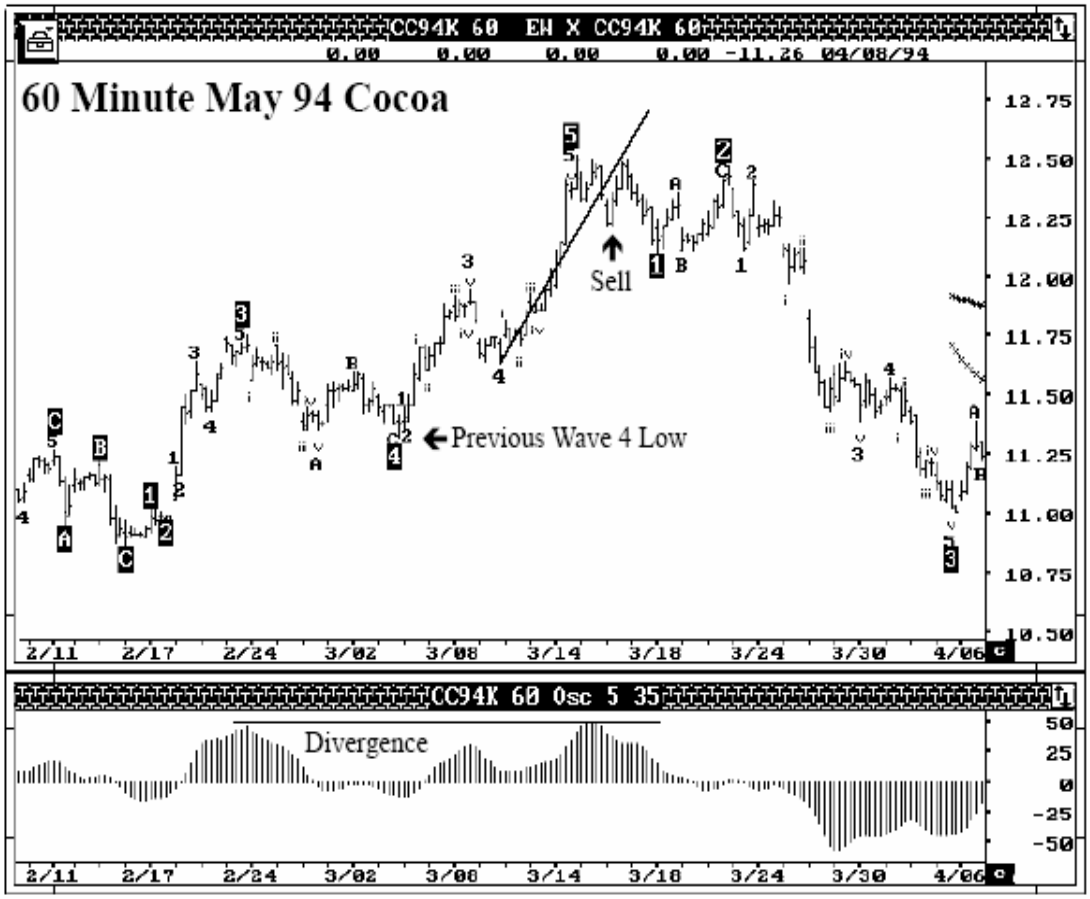
نوع دوم می ۹۴ برای *Crude Oil* – نمودار ۱ ساعته

نرم افزار تکمیل توالی ۵ موج را به همراه دایورجنس واضح نشان مـی‌دهـد. **Buy** در محـل تقاطع خط ترند صورت گیرد.

نمودارهای ۱ ساعته برای Cocoa مارس ۹۴

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

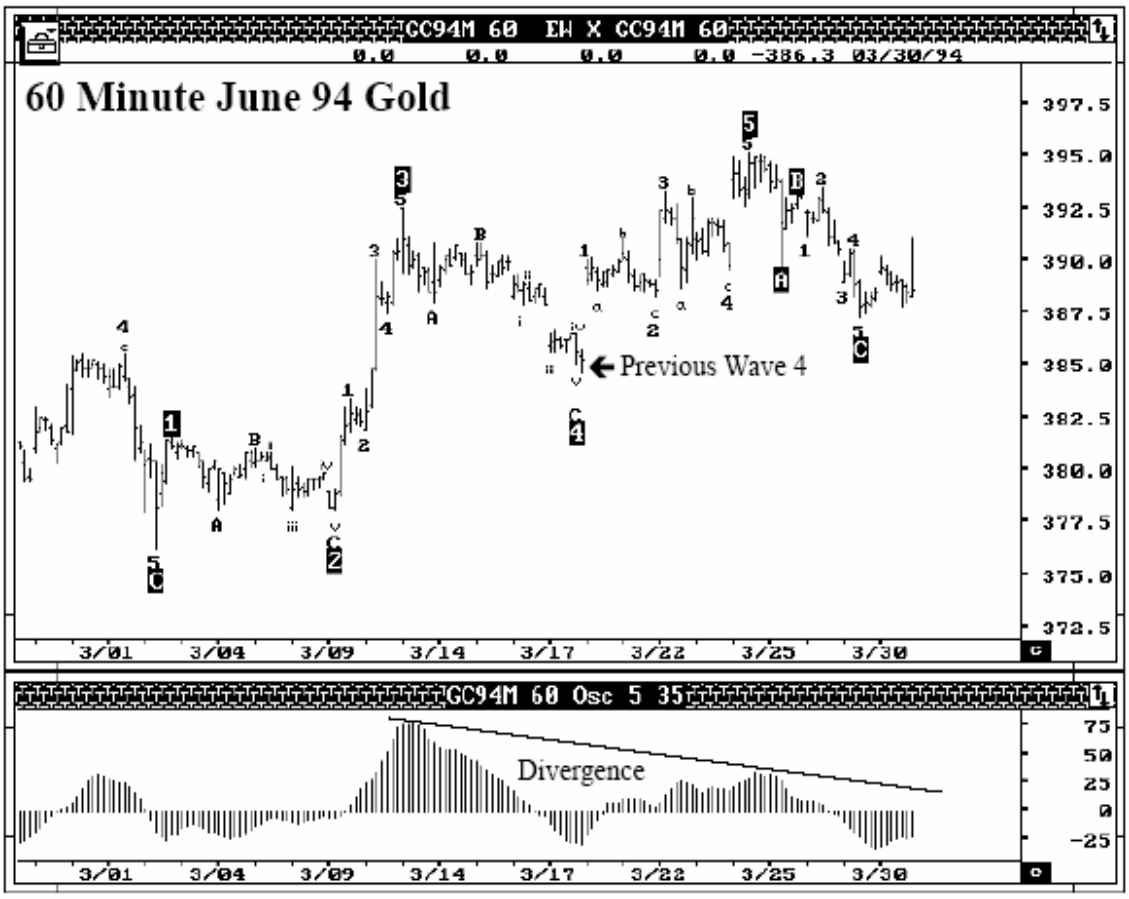
*نوسان نمای الیوت نیز دایورجنس واضحی را بین **High** موج سوم و پنجم نشان می‌دهد.



* **Sell** در محل تقاطع خط ترند انجام شود و **Stop** بالای **High** قرار گیرد.
* **Low** موج ۴ام قبلی به عنوان هدف اول می‌باشد (۱۱/۵۰).
* زمانی که قیمت به این هدف می‌رسد **Stop** را کوچک کرده و منتظر می‌مانیم تا نرم افزار موج ۳ جدید را در مسیر نام‌گذاری کند.

نمودار ۱ ساعته طلا در ژوئن ۹۴

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



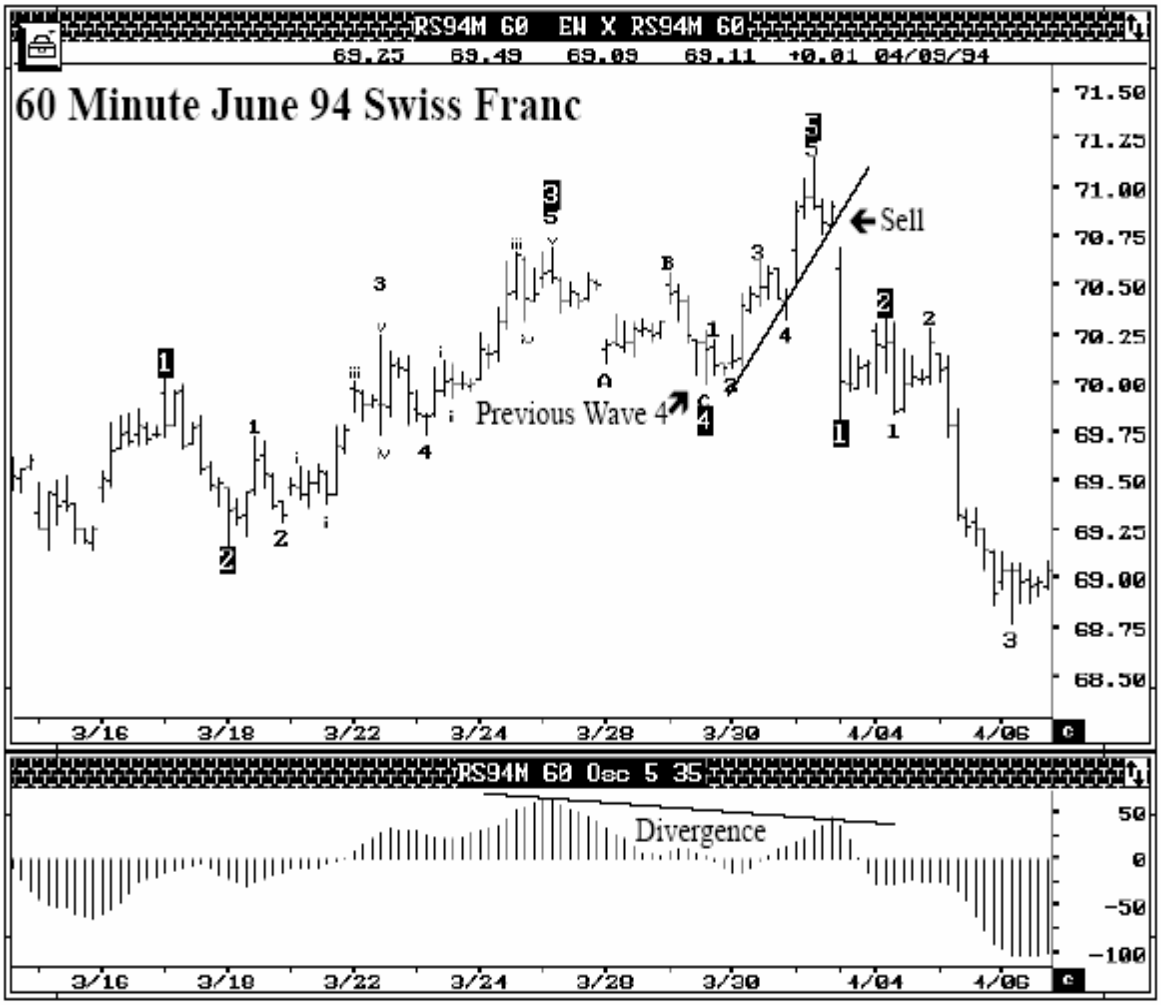
* در محل تقاطع خط ترند **Sell** کنید و **Stop** را بالای **High** قرار دهید.

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

نمودار ۱ ساعته فرانک سوئیس در ژوئن ۹۴

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

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



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

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

شمارش امواج الیوت در نمودار هفتگی ین

نمودار هفتگی فرانک سوئیس – سقف دوقلو

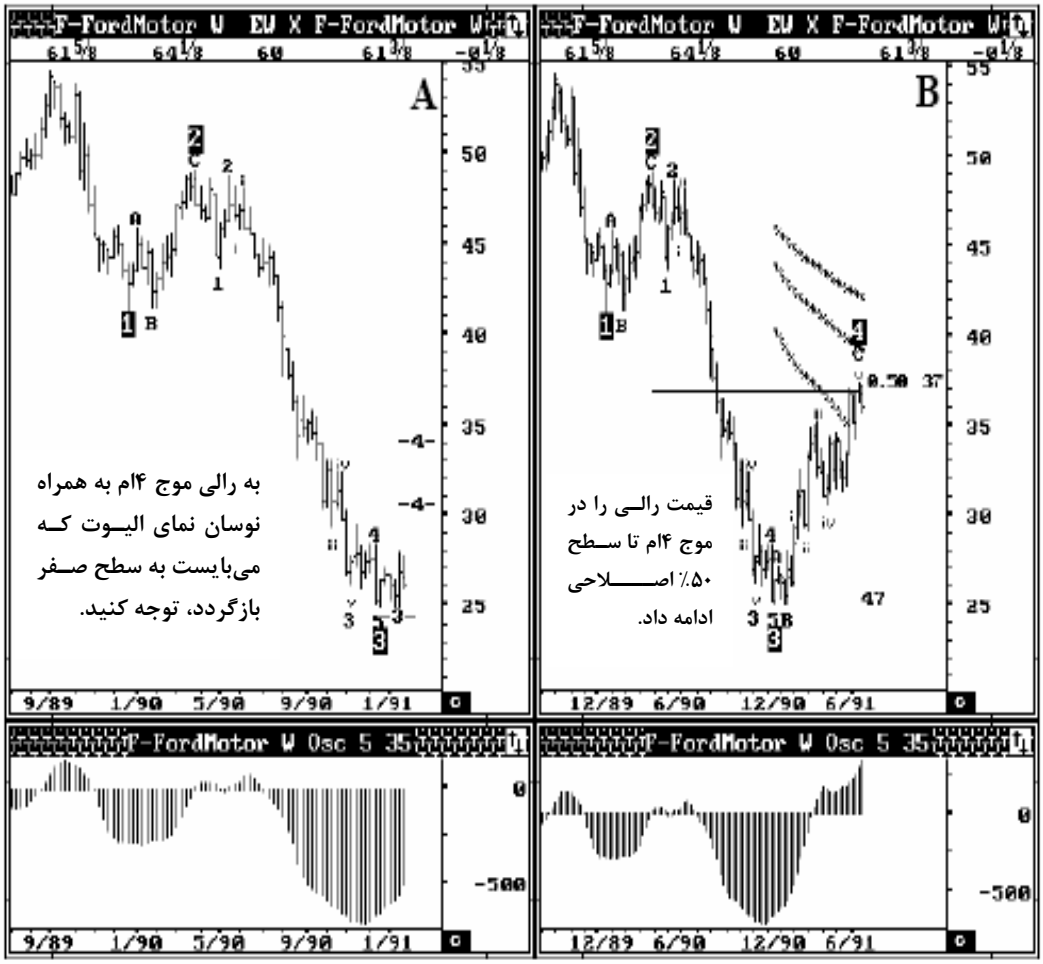
ما نگاه دقیقی به موج ۴ام خواهیم داشت و انتظار PTI را داریم. زمانی کـه PTI زیـر ۳۵ باشد احتمال تشکیل سقف دو قلو افزایش می‌یابد.

به صفحه بعد برای ادامه روند نگاه کنید.

نمودار هفتگی فرانک سوئیس – سقف دوقلو

بررسی سل نوع اول بر روی نمودار هفتگی *Ford Motor*

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

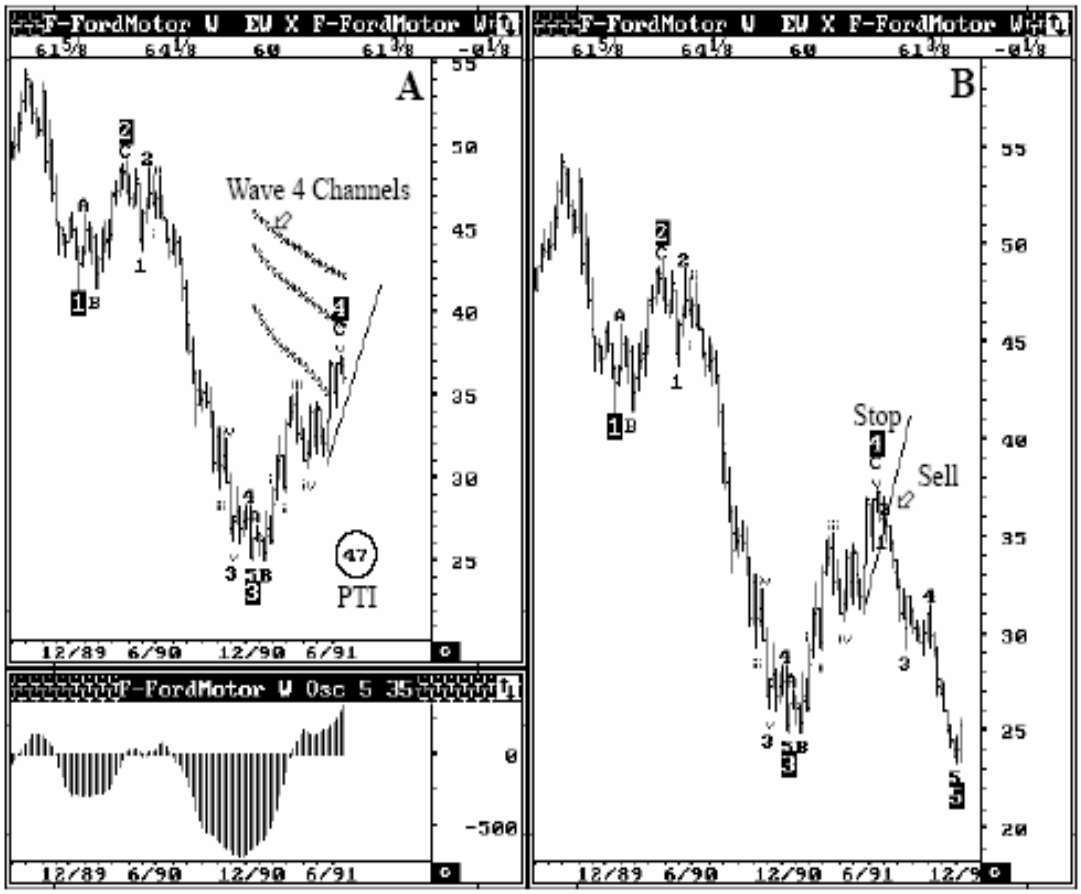


* در نمودار **B** رالی قیمت به سطوح ۵۰٪ فیبوناچی اصلاحی (**Retracement**) رسیده است. رسیدن نوسان نمای الیوت به سطح صفر دلالت بر رهایی از شرایط بیش فروش می‌باشد. به صفحه بعدی برای **Sell** نوع اول توجه کنید.

سل نوع اول بر روی نمودار هفتگی *Ford Motor*

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

* کانال‌های موج چهارم نشان می‌دهد که پتانسیل مناسبی برای یک موج چهارم نزولی سریع وجود دارد.



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

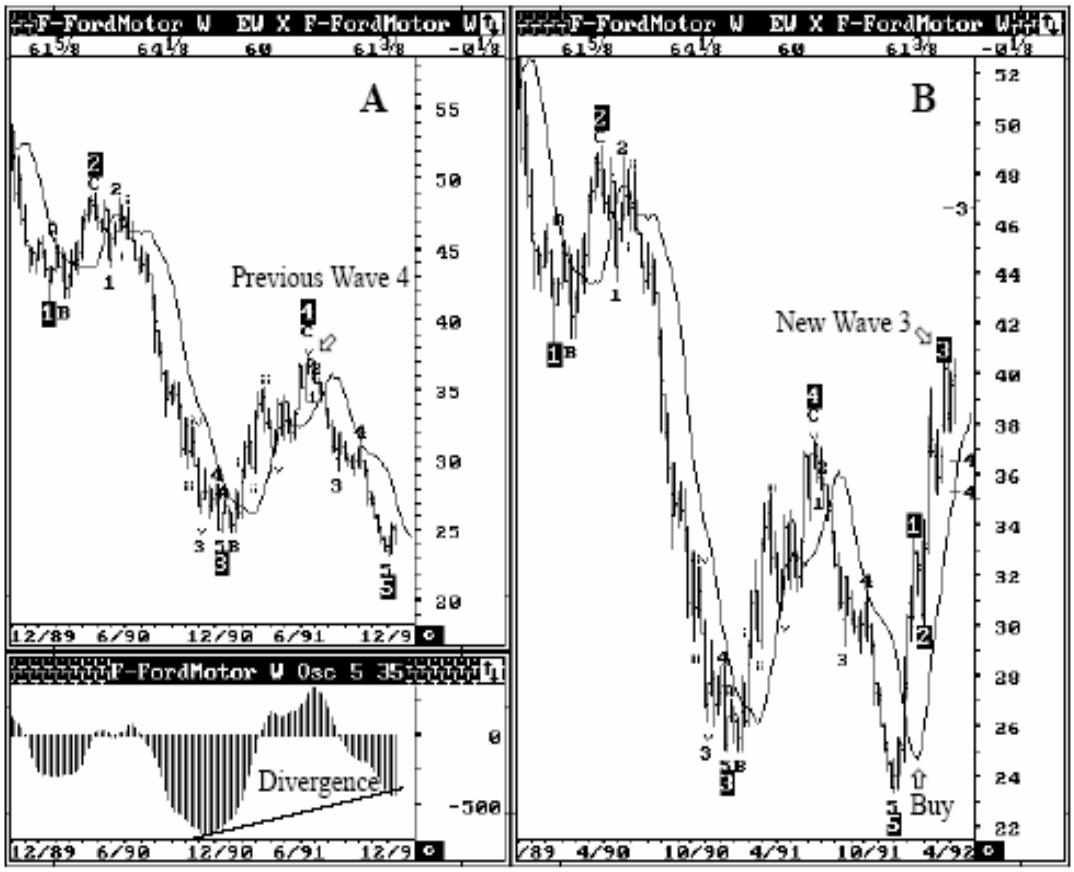
* نمودار **B** محل **Sell** را در موج ۵ام نشان می‌دهد.

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

بای نوع دوم بر روی نمودار هفتگی *Ford Motor*

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

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



* اولین هدف در **High** موج ۴ام نزدیک ۳۷ می‌باشد.

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

ارجاع به اطلاعات هفتگی

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

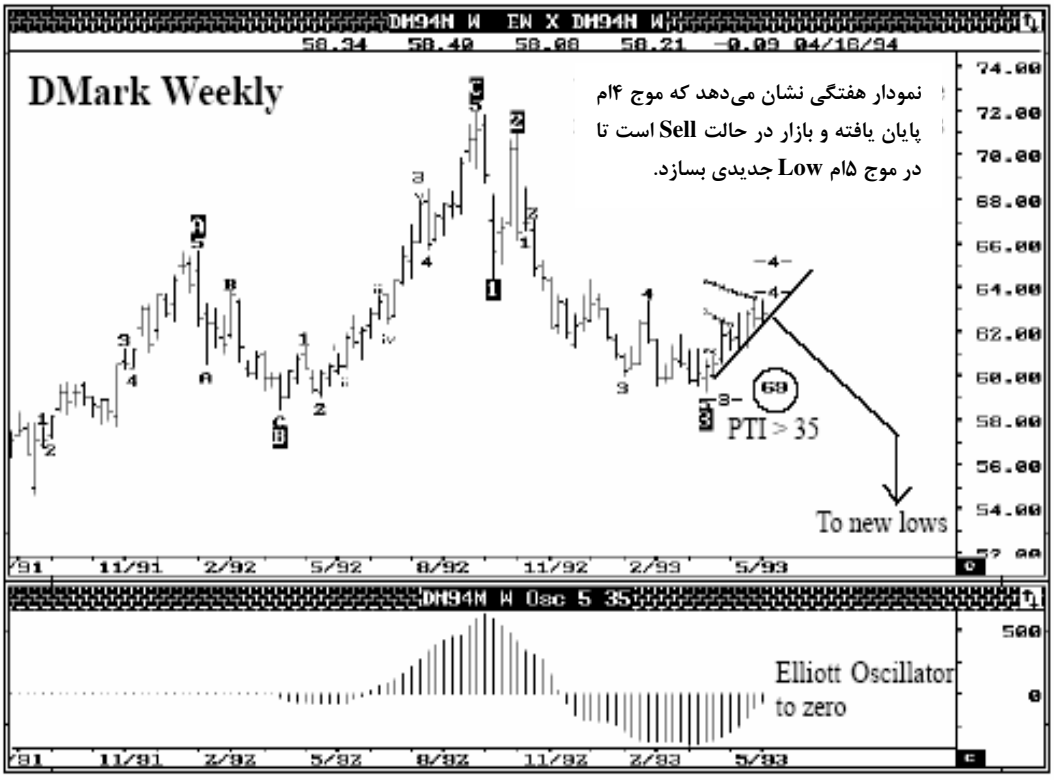
* نوسان نمای الیوت به خط صفر برگشته است و PTI از ۳۵ بزرگتر است (۴۶).

کانال‌های موج چهارم نیز این مساله را تایید می‌کنند.

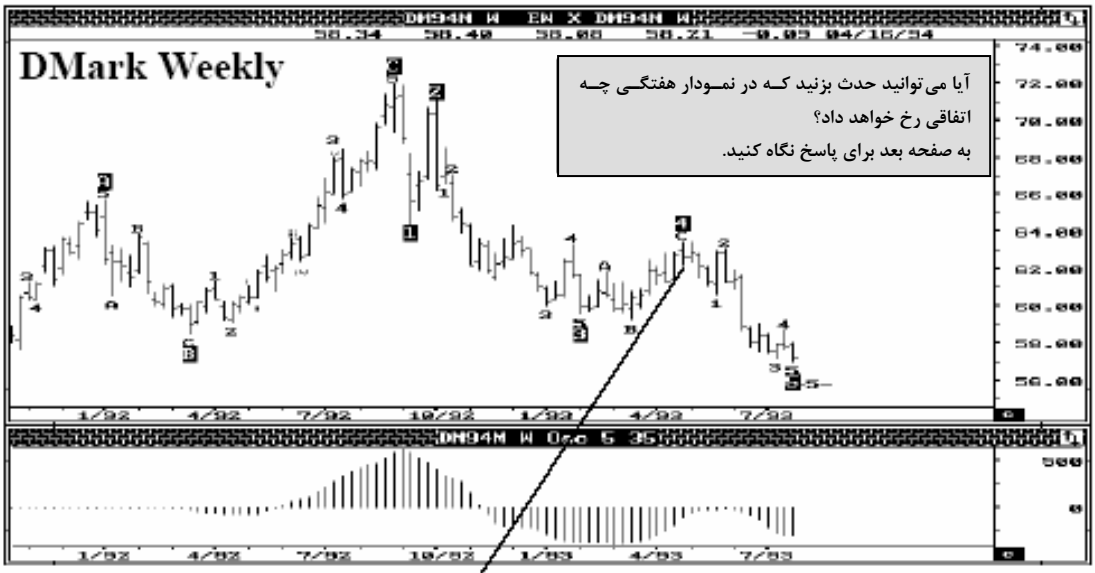
* همه این‌ها نشان دهنده رالی برای تشکیل یک High جدید است.

* اکنون به نمودار هفتگی در صفحه بعد نگاه کنید.

ارجاع به اطلاعات هفتگی از روزانه

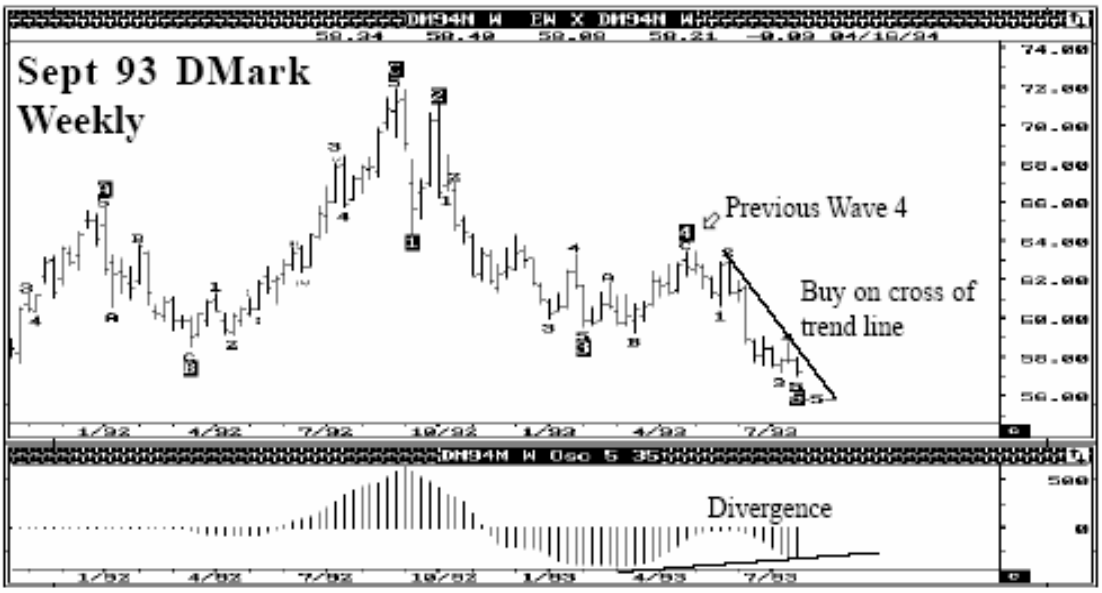


نتیجه ارجاع


DMark Weekly
آیا می‌توانید حدث بزنید کـه در نمـودار هفتگـی چـه اتفاقی رخ خواهد داد؟
به صفحه بعد برای پاسخ نگاه کنید.

Sept 93 DMark Daily
4
نمودار روزانه ABC اصلاحی موج ۴ام را همان طـور کـه در نمودار هفتگی نشان داده شده کامل کرده است.
بازار همان طـور کـه در نمـودار هفتگـی حدث زده می‌شد Low جدیدی سـاخته است.

توالی حرکت برای *Dmark* در نمودار هفتگی

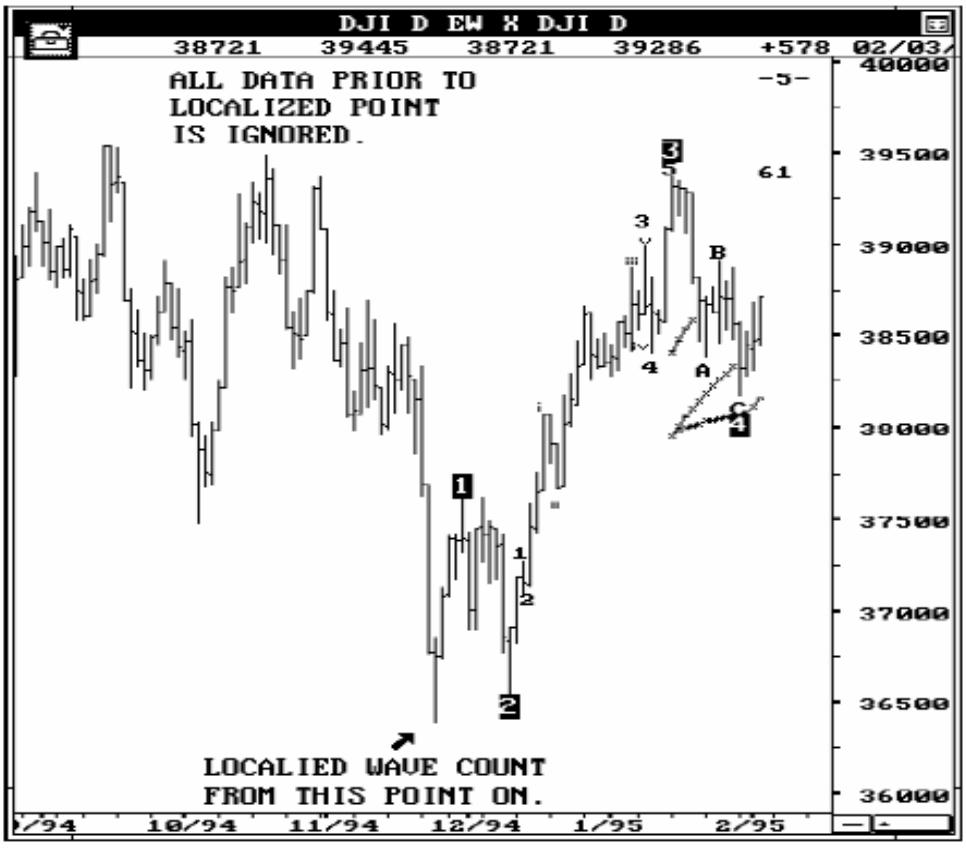


آلترناتیوهای آنالیزور موج الیوت

شمارش منطقه‌ای موج الیوت

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

با منطقه‌ای کردن شمارش موج الیوت، نرم افزار مـی‌توانـد اطلاعـات گذشـته را در نظـر نگیرد و فقط اطلاعات را از نقطه‌ای که کاربر مشخص کرده در نظر گرفته و شمارش مـوج الیوت را انجام دهد.

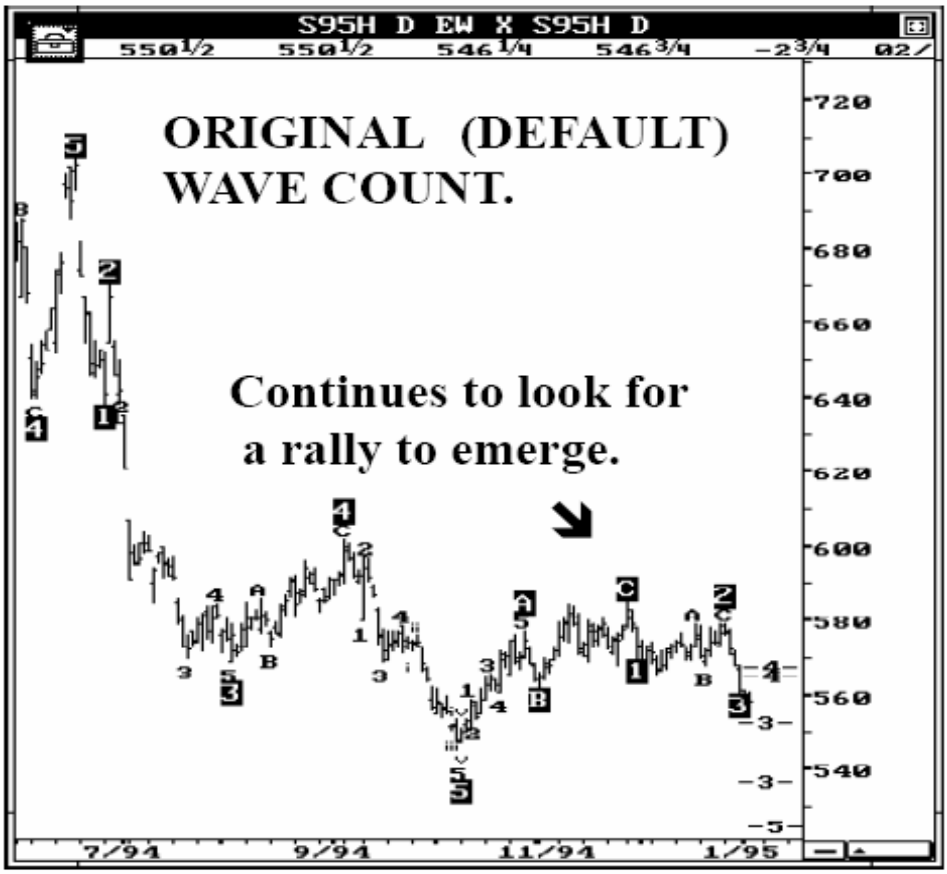


شمارش آلترناتیو

شمارش موج الیوت از طریق آلترناتیو به کاربر این اجازه را می‌دهد که شمارش موج آلترناتیو را به چند صورت داشته باشد. سه نوع متفاوت شمارش امواج آلترناتیو وجود دارد. در اینجا ما درباره شمارش موج های آلترناتیو مختلف بحث خواهیم کرد.

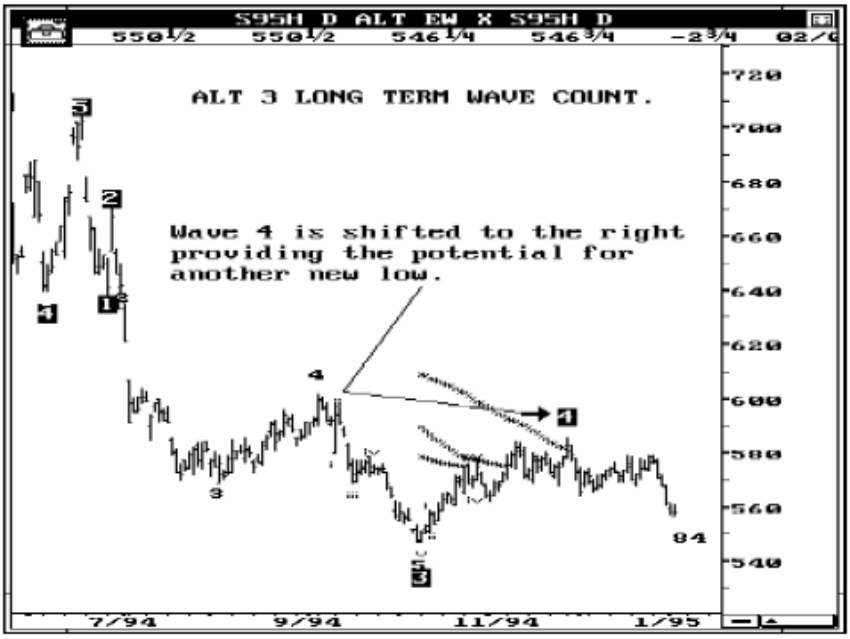
هدف اصلی شمارش امواج آلترناتیو تدارک دیدن این امکان برای کاربر است که در مواقع بحرانی و سخت ایده دومی نیز داشته باشد.

آلترناتیو ۳ (بلند مدت)



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

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



آلترناتیو ۳

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

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

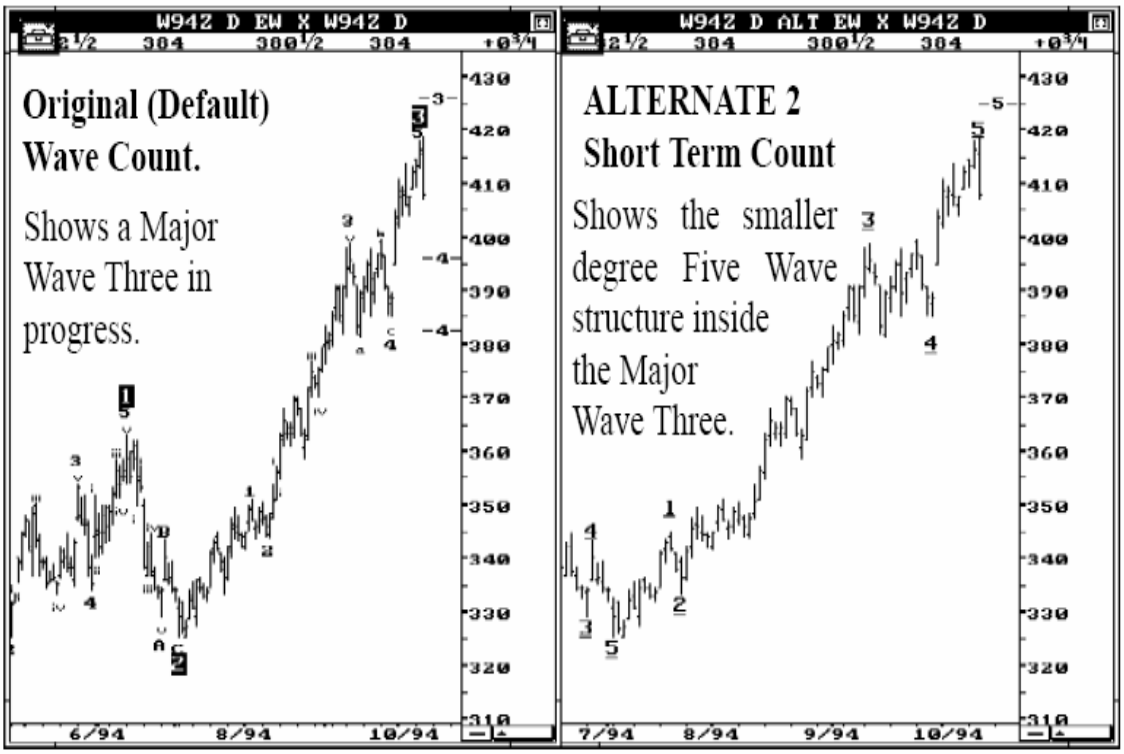
A) اگر رالی که از توالی یک ۵ موج آغاز می‌شود, قادر نباشد تا یک ۳ موج را در جهت مخالف ایجاد کند ما توصیه می‌کنیم از شمارش موج ALT۳ استفاده کنید.

B) اگر مومنتوم بازار به پارامترهای ATL۳ برسد سپس نرم افزار شمارش موج آلترناتیوی را ایجاد می‌کند که دارای یک نمای بلند مدت است. زمانی که شمارش آلترناتیو اجرا می شود کاربر باید با دقت و هوشیاری منتظر یک Low بالقوه جدید باشد.

C) *موارد زیادی وجود دارد که پارامترها به نقطه مورد نظر نمی‌رسند و شمارش امواج ALT۳ مشابه شمارش امواج از قبل تعیین شده می‌باشد*. در این موارد کاربر باید از شمارش اصلی موج استفاده کند.

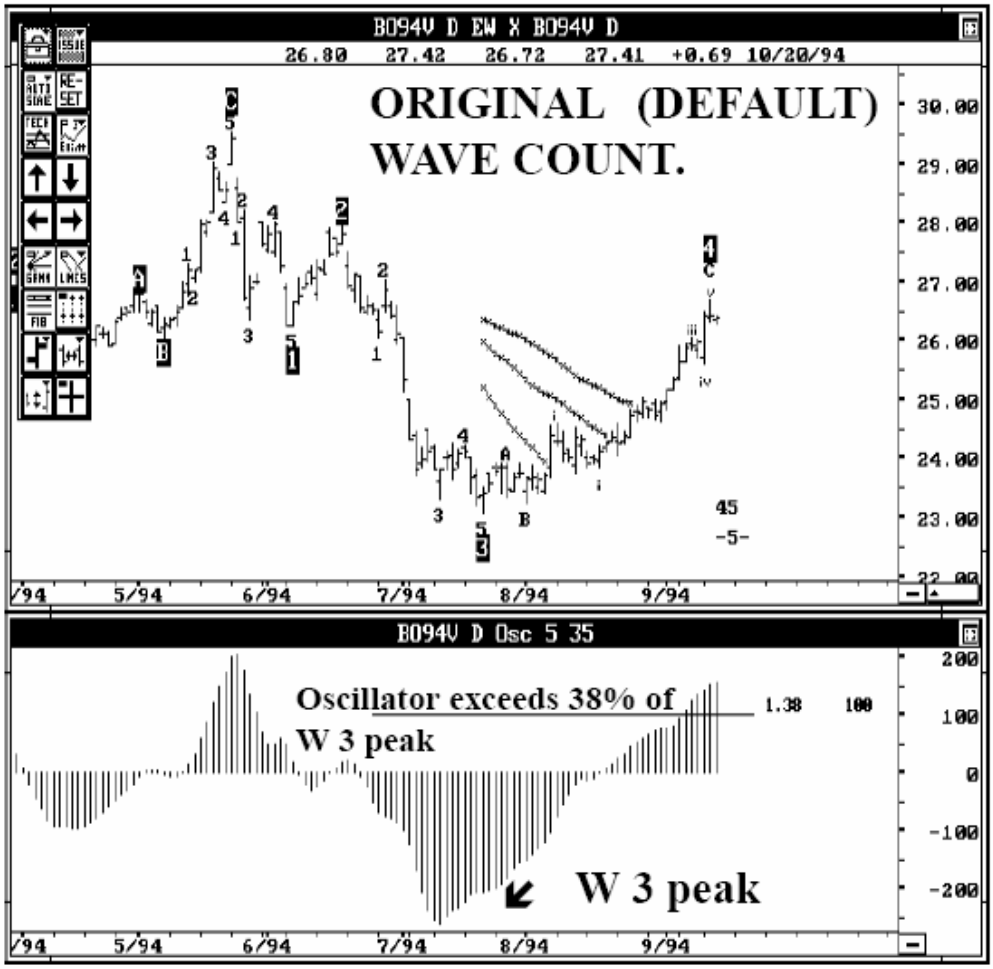
آلترناتیو ۲ (کوتاه مدت)

این آلترناتیو یک نمای کوتاه مدت از شمارش اصلی را نشان می‌دهد. برای مثال زمانی که یک رالی موج اصلی در شمارش اصلی وجود دارد ALT۲ می تواند ۵ موج را در داخل موج سوم اصلی را نشان دهد. این امر برای کسب سود در پایان موج ۳ اصلی به کار می‌رود.



آلترناتیو ۱ (تهاجمی)

تا زمانی آنالیزور اصلی موج ها در موج چهارم باقی می‌ماند که موج چهارم با موج اول ٪۱۷ در مورد بازار کالاها هم پوشانی داشته باشد. (در ایندکس و سهام ٪۵) در مـوارد زیـادی حتی زمانی که PTI به حد بسیار پایین افت می‌کند و بیش از ٪۳۸ از موج سوم نوسـان نما اصلاح می‌یابد نرم افزار هنوز بر مبنای شماره گذاری قبلی باقی می‌ماند.



نمودار بالا مربوط به ماه اکتبر Beanoil با شماره‌گذاری موج اصلی است. همان طـور کـه می‌بینید کانال‌های موج چهارم شکسته شده‌اند و رالی موج اول را گرفته اسـت و از همـه مهمتر اینکه نوسان‌نما بیش از ٪۳۸ در جهت مخالف اصلاح یافته است.

ولی هنوز نرم افزار شماره‌گذاری قبلی را ادامه می‌دهد. که متاسفانه ایـن مـساله قابـل قبول نیست.

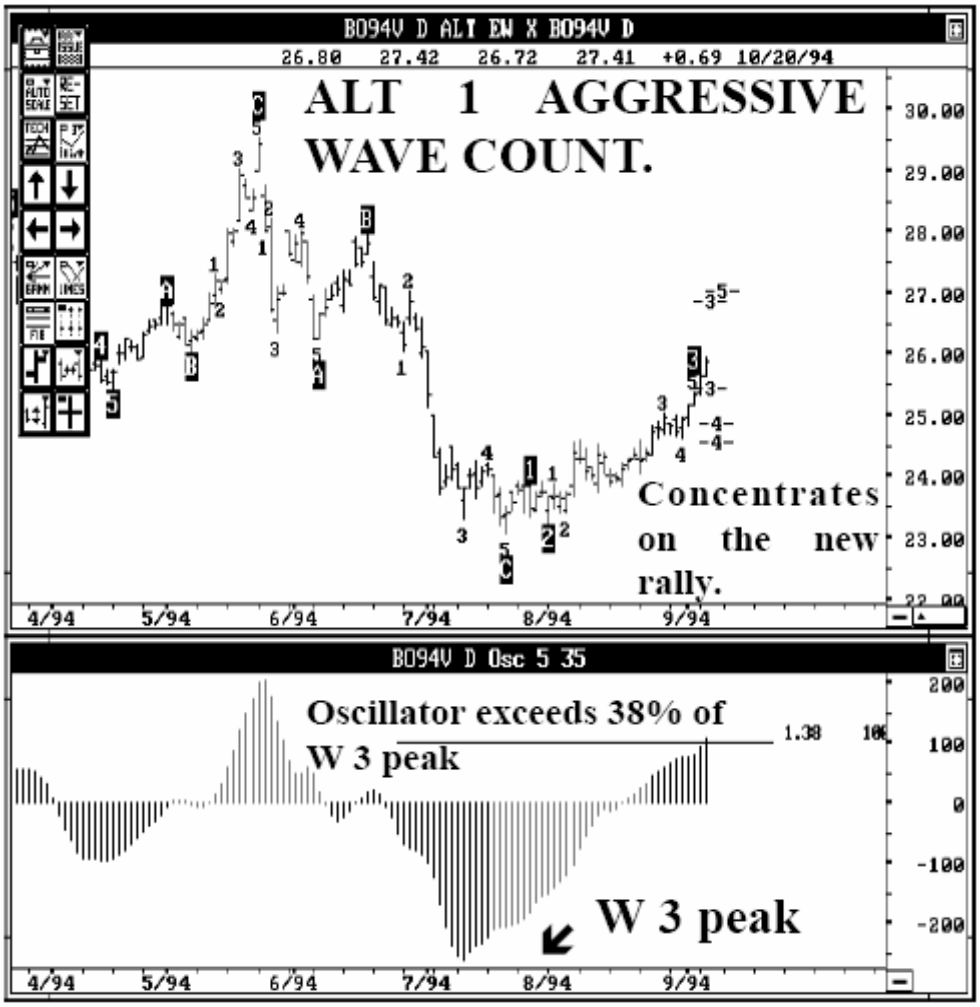
آلترناتیو ۱ برای پایان دادن به این موج چهارم طول کشیده طراحی شده است و این موج را تبدیل به یک موج سوم در خلاف جهت می‌کند. *استفاده از ALT 1 در موارد زیر توصیه می‌شود.*

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

B) همچنین این شرایط در ۶۵٪ از موارد با یک PTI زیر ۳۵ همراه می‌شود.

در این گونه شرایط ما توصیه می‌کنیم از ALT 1 به عنوان آلترناتیو یا یک ایده دوم استفاده کنید. صفحه بعد مثال‌ها را نشان می‌دهد.

آلترناتیو ۱ (تهاجمی)



نموداری که در زیر آمده است نشان دهنده شمارش امـواج آلترنـاتیو ۱ در مـورد نمـودار اکتبر Bean Oil اسـت. ***در اینجا نـرم افـزار مـوج نزولـی را تحـت عنـوان ABC مجـددا شماره‌گذاری کرده است. منطق نرم افزار ایده ۵ موج نزولی را باطل کرده و بـه جـای آن مرحله رالی جدیدی را قرار داد.***

لطفاً این مساله را در ذهن داشته باشید که شمارش ALT۱ فقط زمانی مورد استفاده قرار می‌گیرد که بازگشت نوسان‌نما بیش از ۳۸٪ پیک موج سوم اصـلی را در جهـت مخـالف داشته باشد. در این مثال، پیک نوسان‌نما موج سوم ۲۶۲ بوده اسـت و ۳۸٪ آن در جهـت مخالف ۹۹ می‌شود.

این سطح ۳۸٪ که بیش از آن در نوسان‌نما مورد نظر است بوسیله ابزار بازگـشتی کـه در ابزار کشیدن قرار داده شده است قابل ترسیم است.

درصد هم‌پوشانی

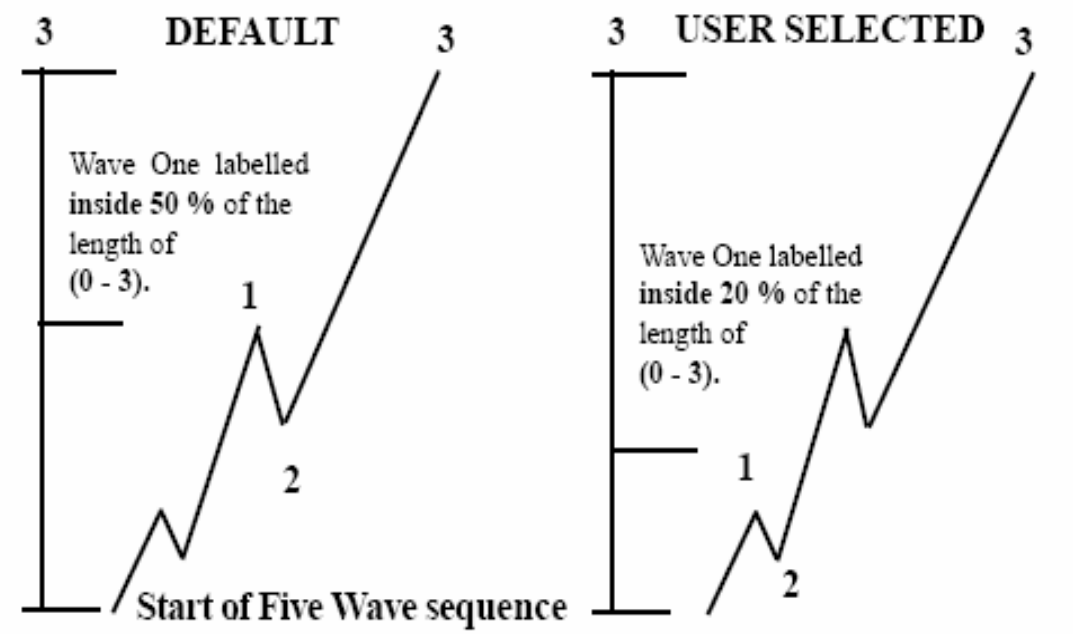
به صورت از پیش تنظیم شده نرم‌افزار به صورت اتوماتیک اجازه مـی‌دهـد کـه در مـورد کالاها ۱۷٪ از هم‌پوشانی بین موج ۱ و ۴ وجود داشته باشـد کـه در مـورد بـازار سـهام و اندیکس‌ها به ۰٪ رسیده است.

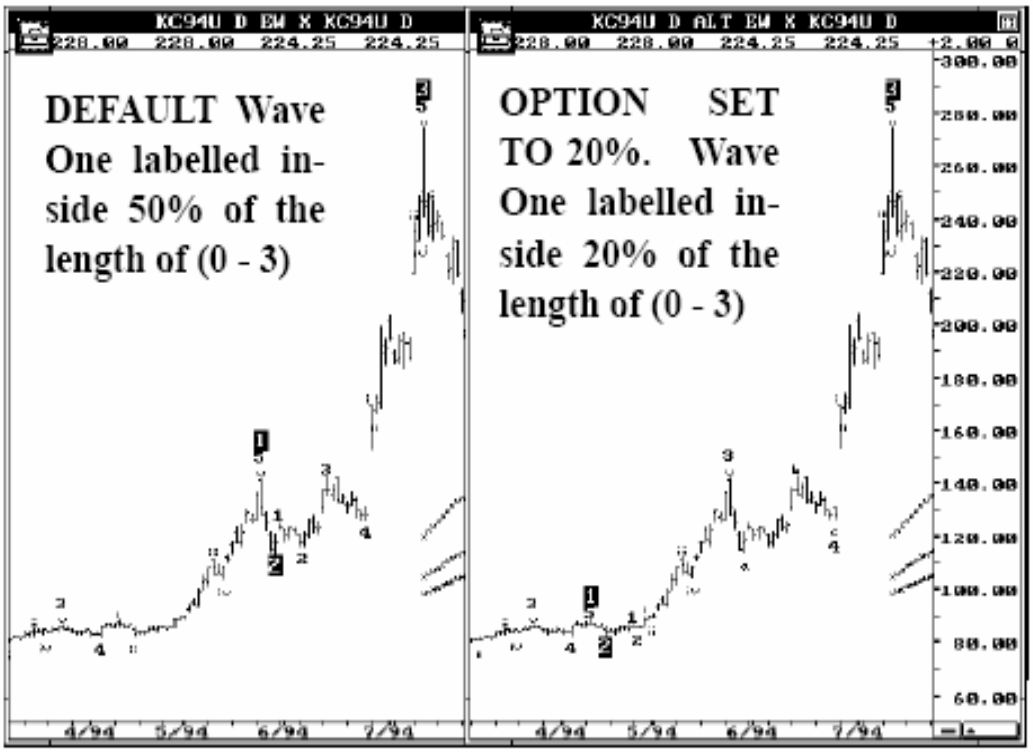
قوانین الیوت اجاره این هم‌پوشانی را در همه مـوارد نمـی‌دهنـد. ***بـه هـر حـال براسـاس تحقیقات، ما پی برده‌ایم که بسیاری از کالاها تمایل دارند که بین موج ۱ و ۴ هم‌پوشانی وجود داشته باشد و در ادامه یک توالی ۵ موج کاملاً روشن را تشکیل دهنـد.*** به هر حـال شما می‌توانید درصد این هم‌پوشانی را تغییر دهید که براساس نظر شما خواهد بود. زمانی که شما این هم‌پوشانی را تغییر دهید GET شمارش امواج الیـوت را براسـاس شـمارش آلترناتیو خواهد داشت.

شمارش براساس امواج آلترناتیو با رنگ سبز نمایش داده می‌شـود و بـرای نمـایش آن براساس شمارش از پیش تعریف شده براساس رنگ آبی است.

درصد هم‌پوشانی موج ۱ و ۳ (Option) : زمانی که شماره‌گذاری امواج الیوت انجـام شـد شمارش از پیش تعیین شده به نرم افزار اجازه می‌دهد که موج اول را در هر کجـایی بـین شروع توالی پنج موج و ۵۰٪ ارتفاع ۳-۰ شماره‌گذاری کند. در بعضی موارد نرم افزار نقطه پیوتی را انتخاب می‌کند که این نقطه در بالاترین محدوده قرار دارد و موج اول بـه خـوبی

در داخل موج سوم شماره‌گذاری می‌شود. کاربر می‌تواند این حالت از پیش تعیین شـــده را باطل کند و محدود کند به اینکه موج اول در کجا شماره‌گذاری شود.





تکنیک‌های گان

W. D. Gann

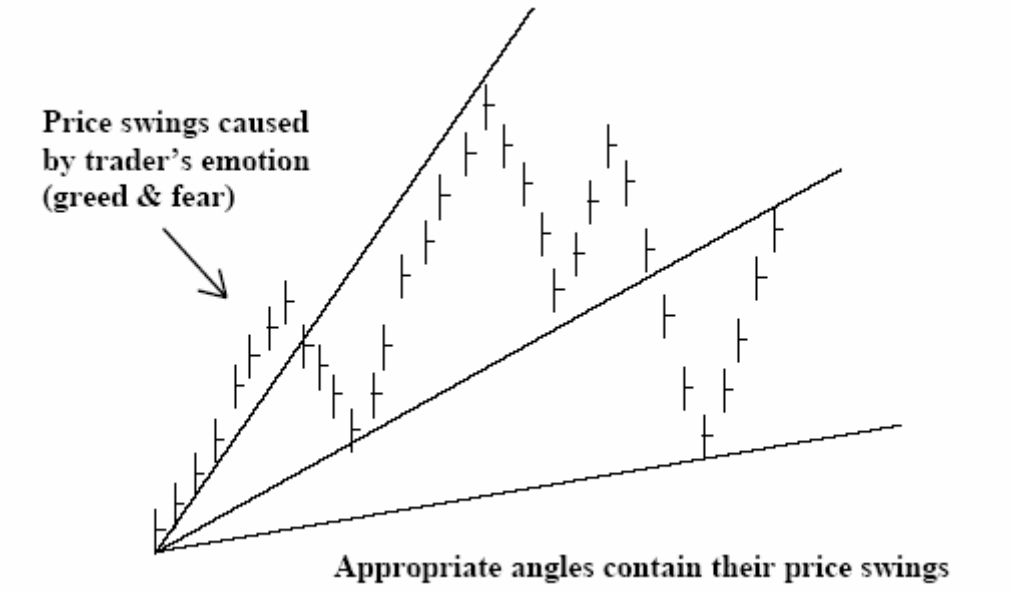
بنا بر بعضی از دلایل و مسایل دیگر هر چیزی در ارتباط با گان به نظر اسرار آمیز و گنگ به نظر می‌رسد. مقالات بسیاری از این رویکرد استفاده می‌کنند و در توضیحات آن، روش سختی را برای یادگیری به کار برده‌اند. به منظور فهمیدن کامل این تکنیک و به منظور باور آن باید ابتدا تابوی گیج کننده آن از بین برود و باور داشت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

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

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

خطوط زوایای گان

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



خطوط و زوایای گان

زمانی که رالی قیمت به یک **Low** خاتمه می‌دهد میزانی که است که نوسانات و رالی‌های بازار بوسیله ترس و طمع تریدرهایی که در بازار هستند کنترل می‌شود. ترس و طمع باعث نوسانات (**Swing**) بازار است. این رفتار افراد از یک **Extreme** تا **Extreme** دیگر در سیکل‌های با درجات متفاوت در حال حرکت است. این سیکل‌های متفاوت می‌توانند با پارامترهای زوایای اصلی دقیق با استفاده از قیمت **Low** مشخص شوند.

کار اصلی یافتن تنظیم مناسبی از زوایاست که می‌تواند سیکل‌های متفاوتی را که از باز خورد طمع و ترس تریدرهای دارای نظرات شخصی ایجاد شده است رابیابد.

Incorrect Approach

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

زوایای مناسب یک شبه بدست نمی‌آیند. نمودار بالا گان چندین سال را نشان مـی‌دهـد. بوسیله کمک از کامپیوتر و دریافت صحیح ما قادر خـواهیم بـود تـا زوایـای بـسیاری از کالاهایی که در ایالات متحده ترید می‌شوند و بعضی از بازارهای دیگر را محاسـبه کنـیم. زوایای ما براساس اطلاعات ۱۰- ۵ سال قبل استوار است زاویه مرکزی برای هر بازار ثابـت است و در طول زمان تغییر نمی‌کند. حساسیت و اهمیت به آهستگی تغییر مـی‌کنـد امـا زاویه مرکزی یکسان باقی می‌ماند.

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

A Real-Time Example

سیکل های ترس و طمع

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

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

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

تشخیص نوسانات قیمت

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

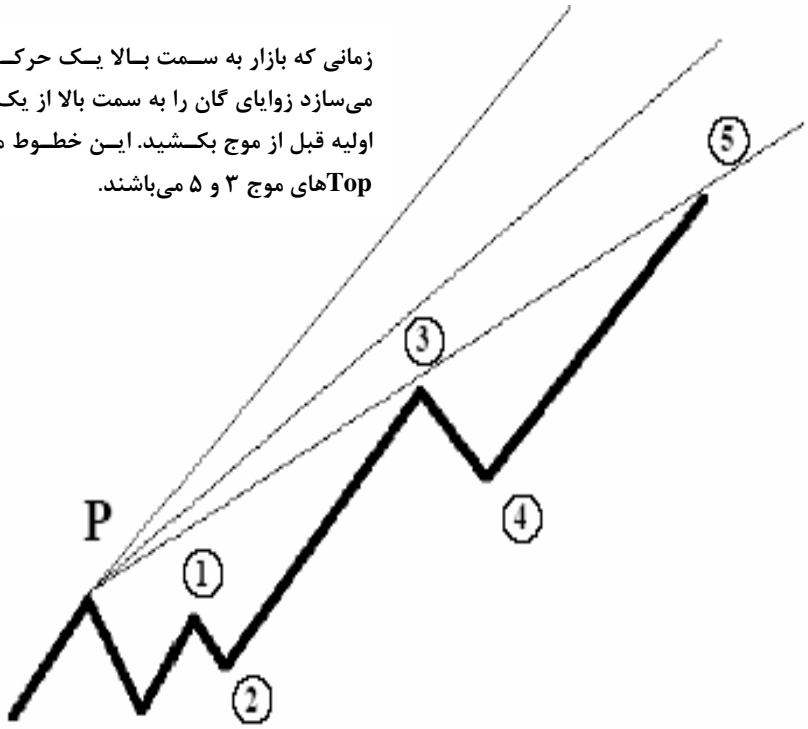
نرم‌افزار GET بوسیله اندازه‌گیری درصد نوسان قیمت از هر low و High، نقاط پیوتی را مشخص می‌کند که تحت نام p= اولیه، J= اصلی، I= بنیابینی و M= فرعی (که در بالا نشان داده شده‌اند) نام گذاری می‌کند.

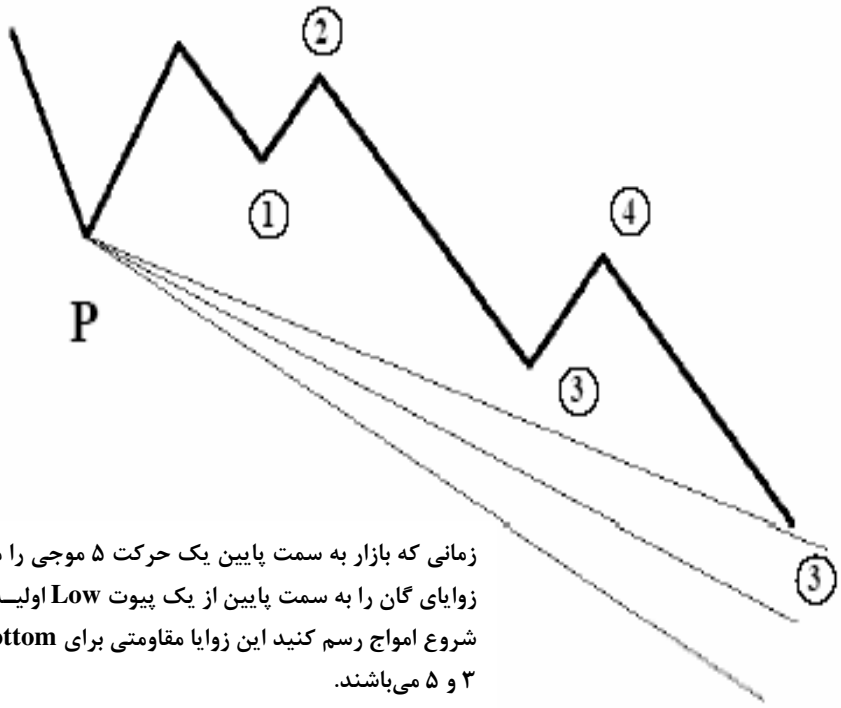
زوایای گان که از Low/High اولیه ترسیم می‌شوند ارزش بسیار بیشتری در تشخیص مسیر بعدی سیکل‌های احساسی تردیدرها دارند. توالی آن‌ها براساس اهمیت به ترتیب اصلی، بینابینی و فرعی می‌باشد.

به صورت کلی همه زوایای گان می‌توانند یک حمایت یا مقاومت برای نوسان قیمت ترسیم کنند. به هر حال زوایایی که نشان‌دهنده راه‌های فوق هستند مثل زوایایی که از نقاط اصلی رسم می‌شوند خطوط حمایت و مقاومت قوی و محکمی را نشان خواهند داد.

استفاده از زوایای گان با امواج الیوت
(برای موج ۳, ۵)

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

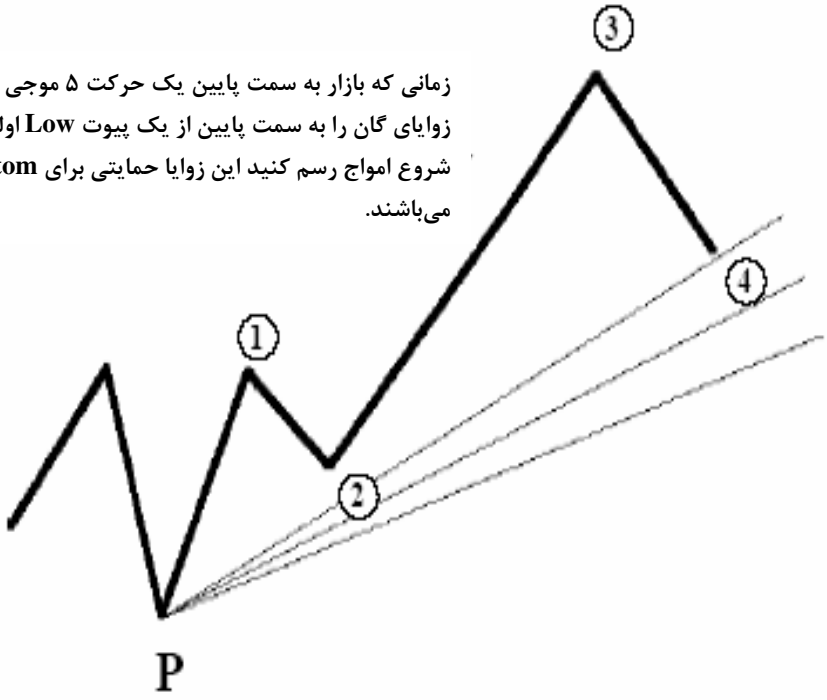


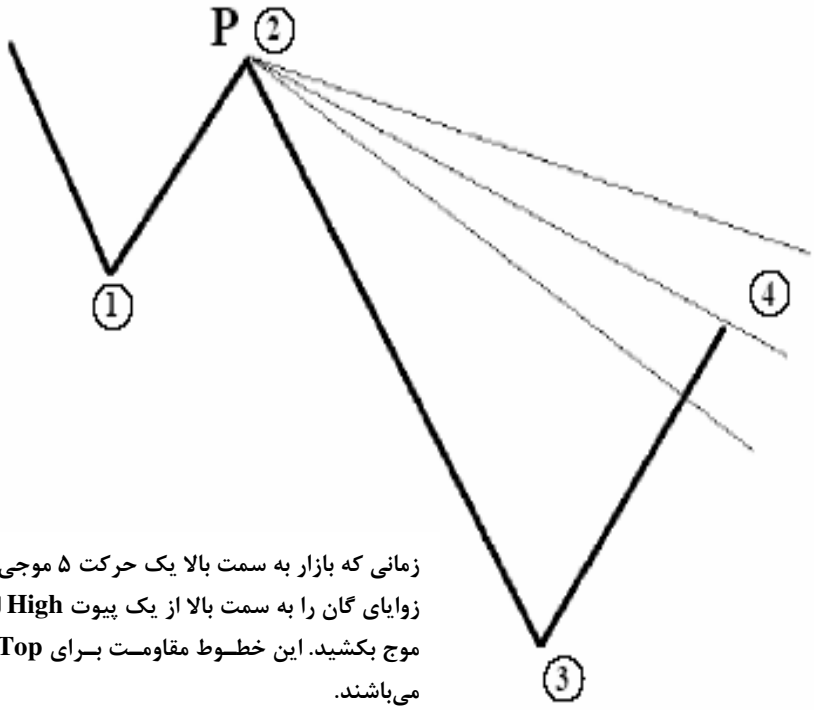


زمانی که بازار به سمت پایین یک حرکت ۵ موجی را می‌سازد زوایای گان را به سمت پایین از یک پیوت **Low** اولیه قبل از شروع امواج رسم کنید این زوایا مقاومتی برای **Bottom** موج ۳ و ۵ می‌باشند.

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

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





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

خطوط گان بهینه شده

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

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

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

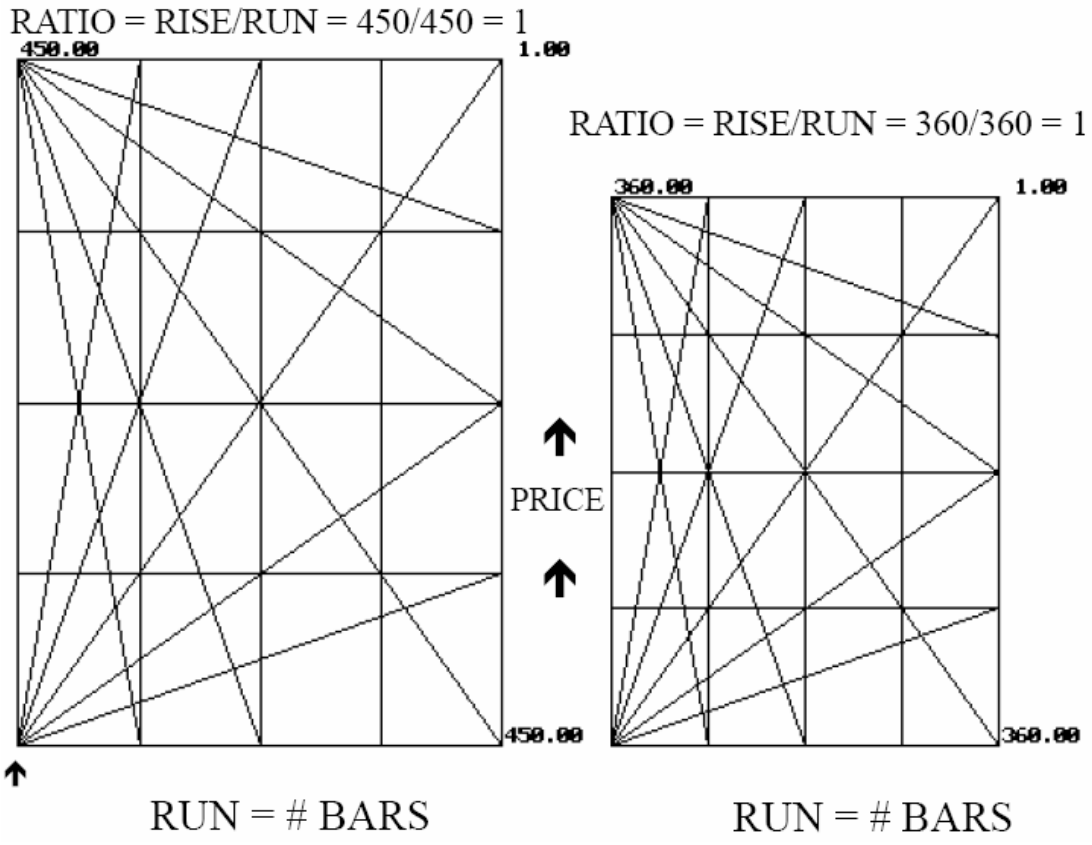
در حال حاضر ما این ویژگی را جزو موارد روتین در آورده‌ایم که به کاربر اجازه می‌دهد تا خطوط بهینه را برای همه بازارهایی که قابل Load شدن هستند بیابد که شامل سهام، Spread, Cross Rate, Foreign Issue می‌شود. موارد روتین همچنین شامل Volatility Adjustments می‌شوند. مقیاس بهینه شده بر روی نمودار قرار می‌گیرد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

آنالیزور GANN BOX

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

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

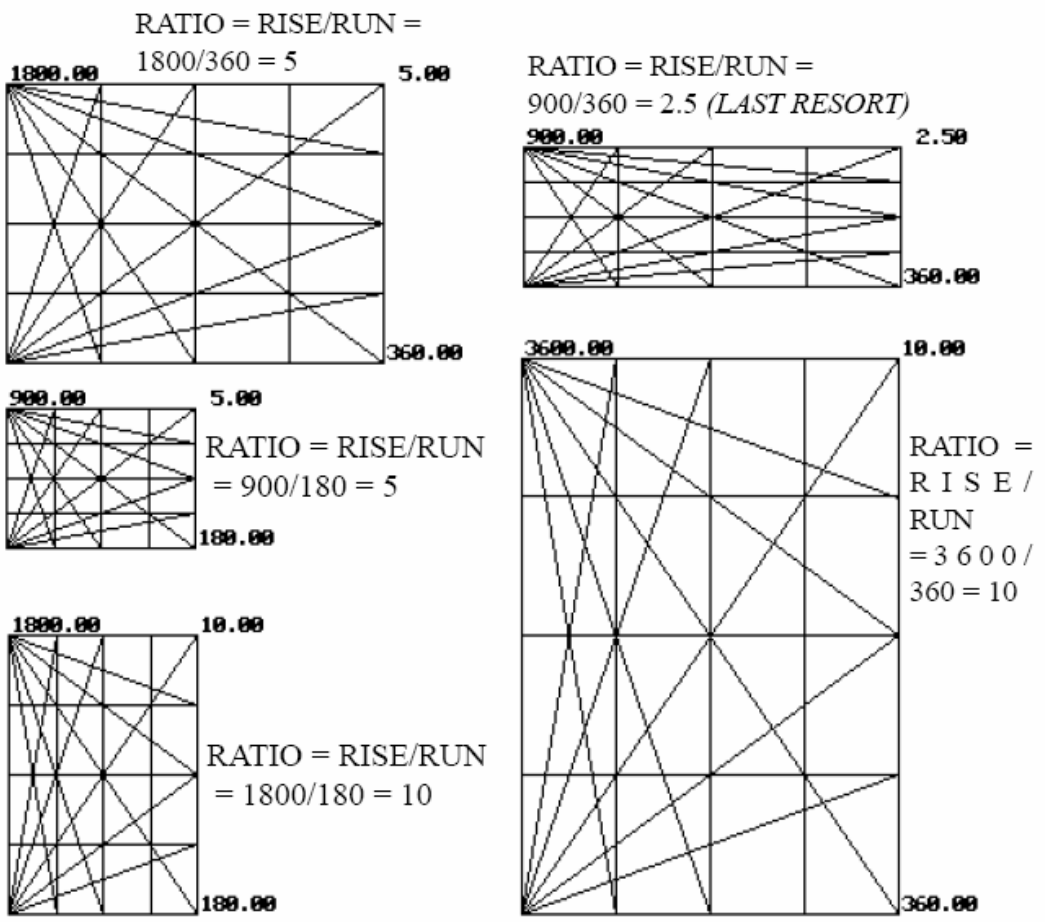
ویژگی اصلی که ما در این تحقیق یافتیم این است که نسبت Rise/Run جعبه باید ۱ یا مضاربی از قبیل ۱۰ و ۲۰ و غیره باشد. جعبه‌های گان از High یا Lowهای اصلی (major) رسم می‌شوند. فاصله قیمت از نقطه مورد نظر Rise و تعداد ستون‌ها از نقطه فوق Run نامیده می‌شود. جعبه‌ای که در زیر نشان داده شده از ۴۵۰ بار (Run) و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



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

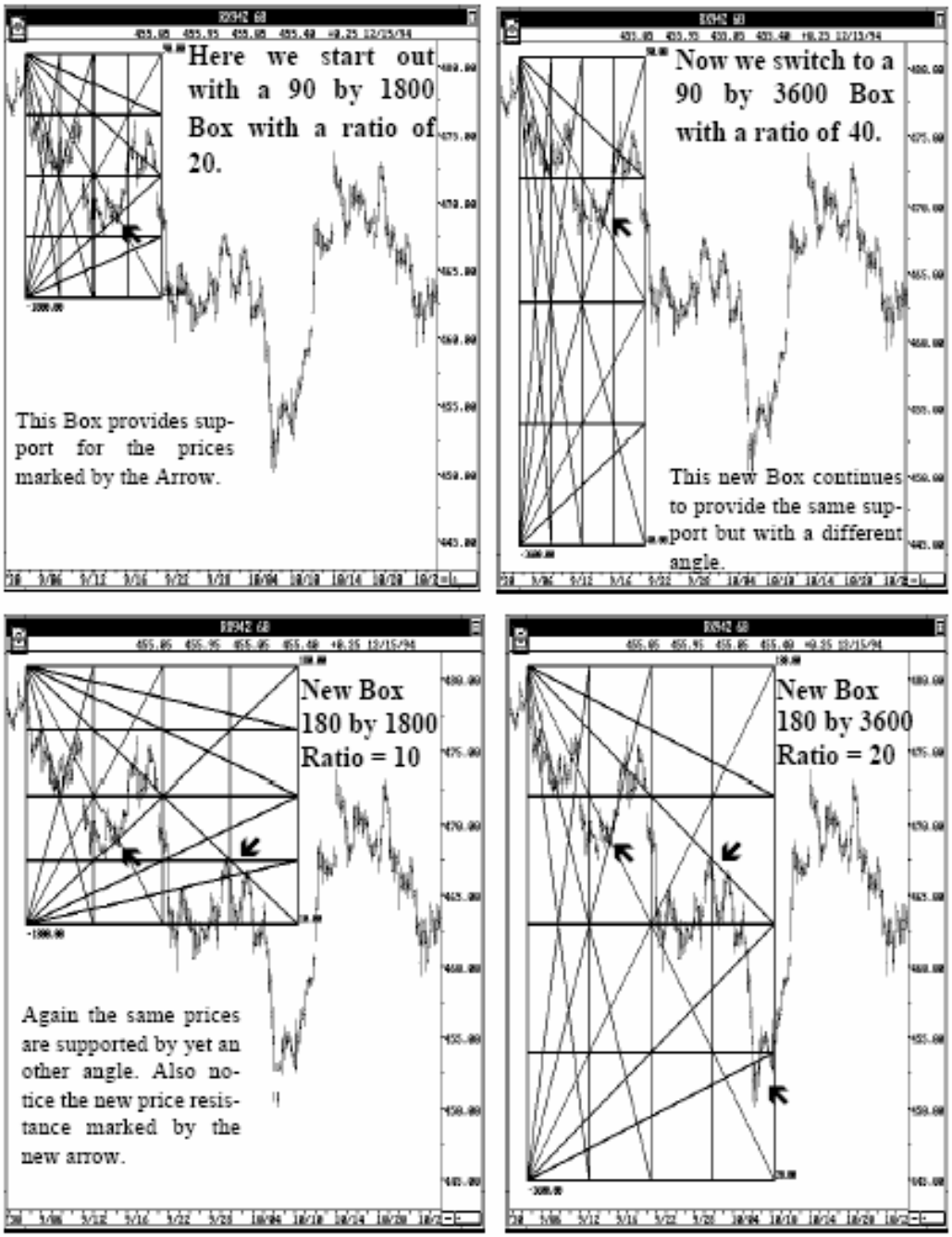
تحقیقات ما بر روی همه بازارها و همه بازه‌های زمانی نشان داده که اگر شما نسبت‌های گفته شده(موارد بسیار مهم) ۱، ۲، ۵، ۱۰، ۲۰، ۴۰ و ۲/۵ (بعنوان آخرین مورد) را به کار ببرید و جعبه گان را از **Low** یا **High** اصلی (**Major**) رسم کنید خطوط رسم شده سطوح حمایت و مقاومتی را ترسیم می‌کنند که بازار در آینده در آن‌ها حرکت می‌کند. همچنین این تکنیک علاوه بر این نسبت‌ها برای شما بازه‌های زمانی ثابت ۴۵و۹۰و۱۸۰و۳۶۰ روزه و مانند آن را فراهم می‌کند. ***جعبه‌هایی که در ادامه آمده‌اند بعضی نسبت‌های دیگر را نشان می‌دهند که می‌توان از آن‌ها استفاده کرد.***

(جعبه‌های گان که با نسبت‌های دیگر رسم شده‌اند)

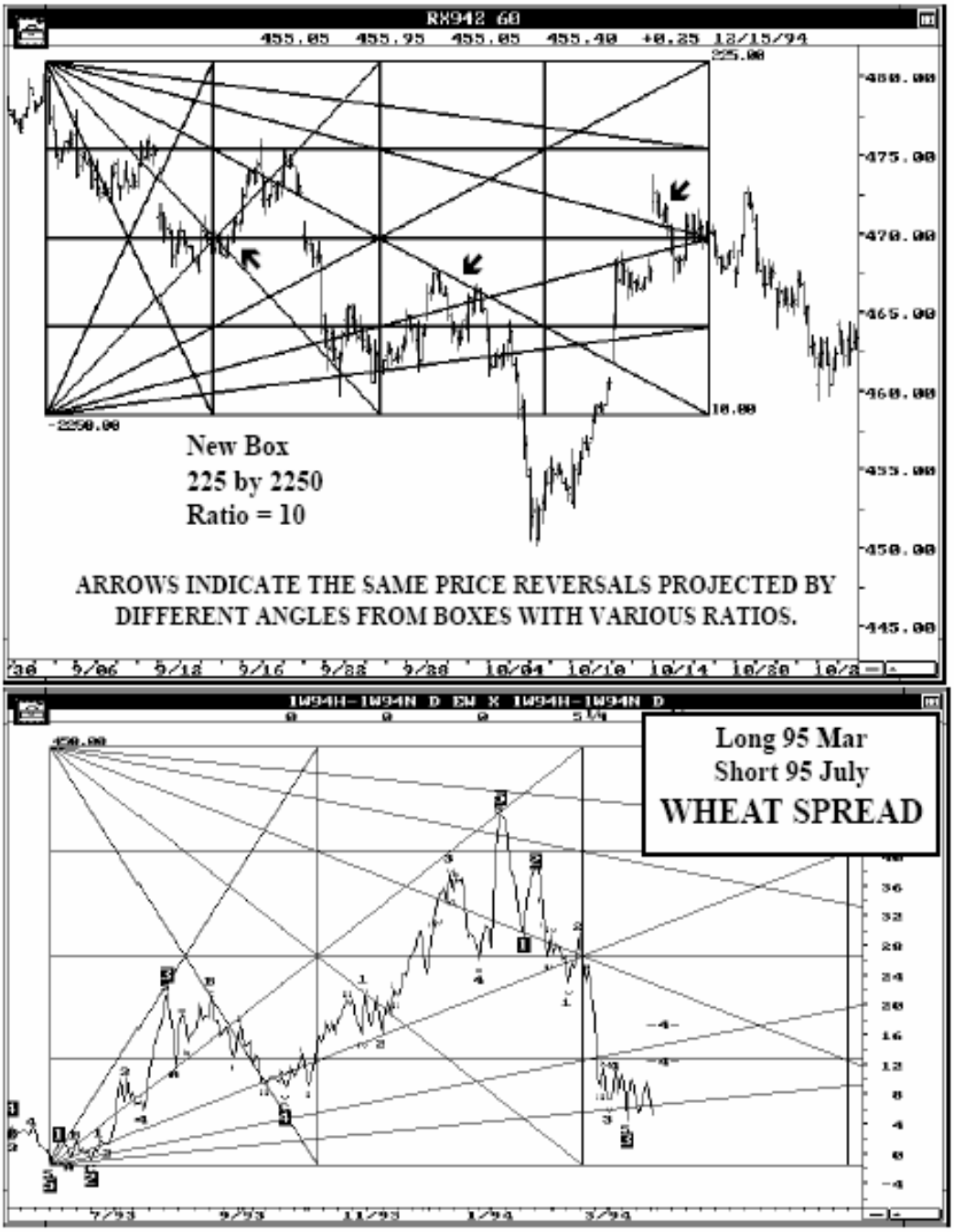


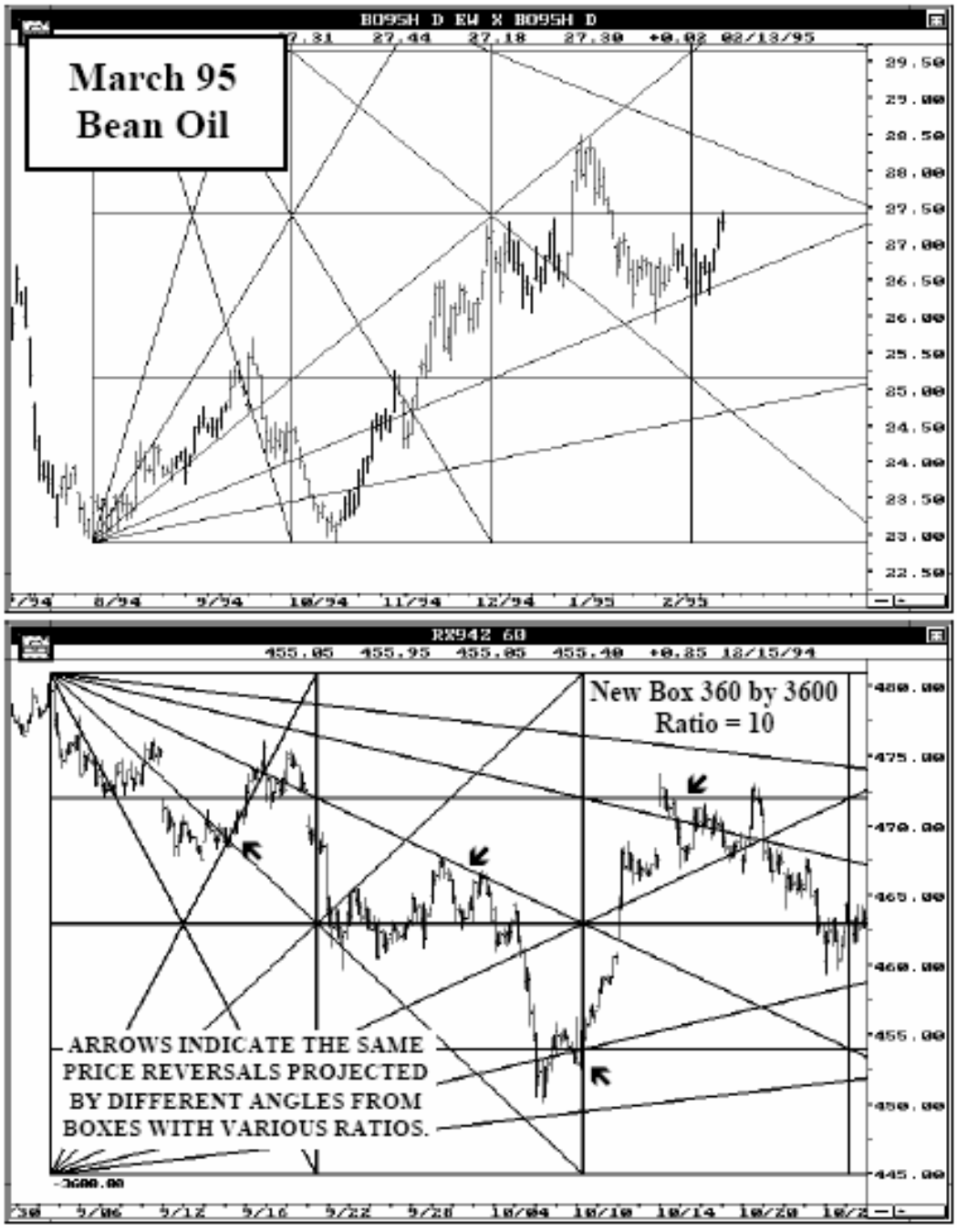
زمانی که جعبه‌ها رسم می‌شوند آن‌ها یک مسیر یا نقشه راهی برای بازار تداری فراهم می‌کنند. ترکیب Pre-Fixed Rate و Fixed Time Intervals نتایج نهایی قابل توجهی ارائه می‌دهد.

همانطور که در صفحه قبل توضیح داده شد ما از Pre-Fixed Time بـا اعـداد ۹۰، ۱۸۰، ۲۲۵، ۳۶۰، ۴۵۰ و غیره برای استفاده در طول و همراه با Pre-Fixed Price بـه منظـور تهیه نسبت جعبه ۱، ۲، ۵، ۱۰، ۲۰، ۴۰ و ۲,۵ استفاده کـردیم. بـا اسـتفاده از نـسبت‌هـای Pre-Fixed که با استفاده از محاسبات ریاضی می‌باشند با وجودی که سـایز بـاکس هـا متفاوت است همه موارد یکسان باقی می‌مانند. در مثال‌های زیر ما از باکس‌هـای متفـاوت برای حرکت بازار استفاده کرده‌ایم.



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





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

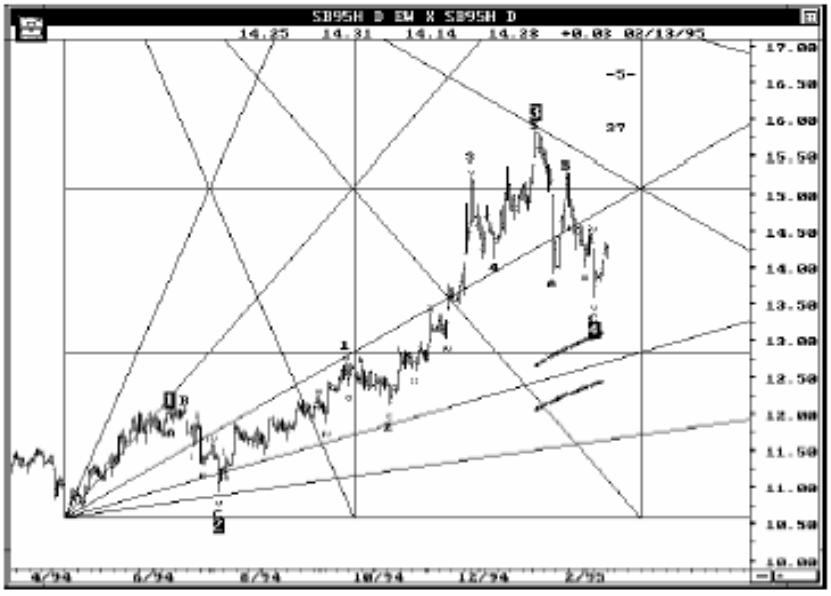
AAPL-Apple Computer Inc D
APPLE
Computer

RJPSH 60
March 95 Yen
- 60 min

استفاده از جعبه گان Pre-Fixed با امواج الیوت

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

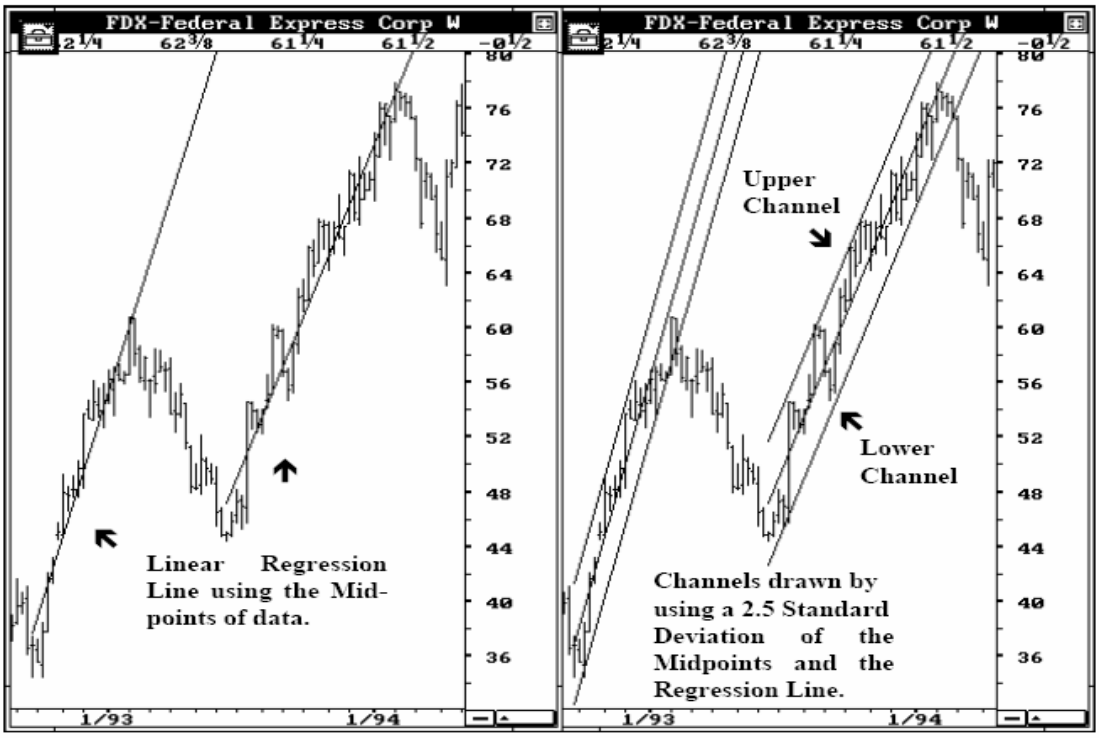
FEB 95
Live Cattle



MAR 95
SUGAR

کانال‌های رگرسیون ترند

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



نمودار سمت چپ دو نوسان قیمت را از Low تا High نشان می‌دهد. خطی که از وسط کشیده شده است خط رگرسیون استاندارد می‌باشد که از نقاط وسط نوسانات قیمت استفاده کرده است. نمودار سمت راست کانال‌های بالایی و پایینی را که با فاصله ۲,۵SD از خطوط رگرسیون و نقاط میانی رسم شده‌اند را نشان می‌دهد. منوی کانال رگرسیون به کاربر اجازه می‌دهد که خطوط ترند یا رگرسیون را بوسیله نقاط میانی بالایی یا پایینی و غیره محاسبه کند. همچنین به کاربر اجازه می‌دهد که میزان SD برای کانال‌های بالایی و پایینی را تنظیم کند.

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

استفاده از کانال‌های رگرسیون ترند

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

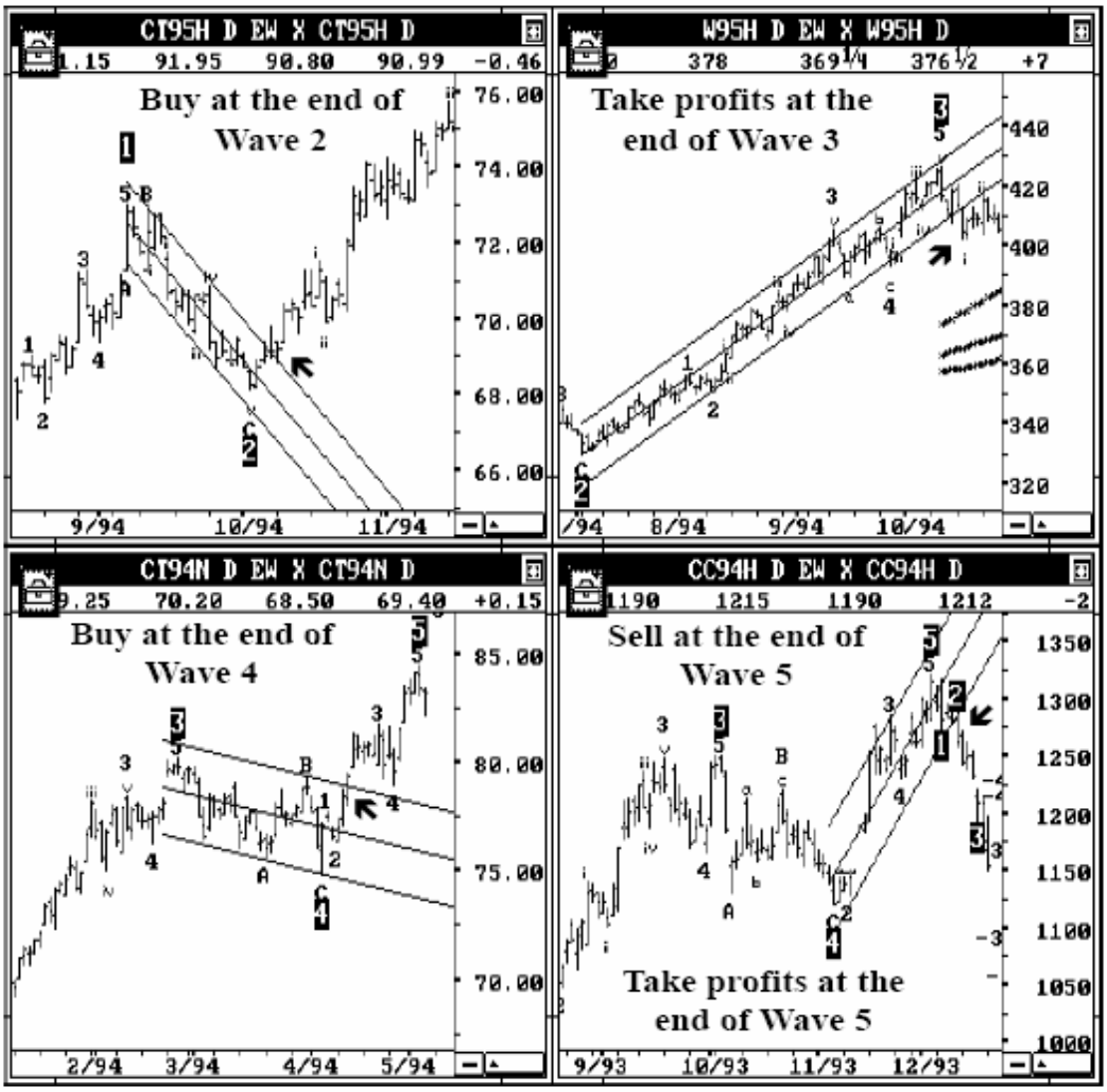
عملکرد اولیه کانال‌های رگرسیون ترند شامل موارد زیر است:

۱) مشخص کردن پایان موج دوم برای ترید در موج سوم

۲) مشخص کردن حد سود در داخل موج سوم

۳) ورود در پایان موج چهارم برای شرکت در موج پنجم

۴) مشخص کردن حد سود در داخل موج پنجم و ورود به ترید در جهت مخالف در پایان موج پنجم. مثال‌هایی که در ادامه آمده است بسیار روشن است.



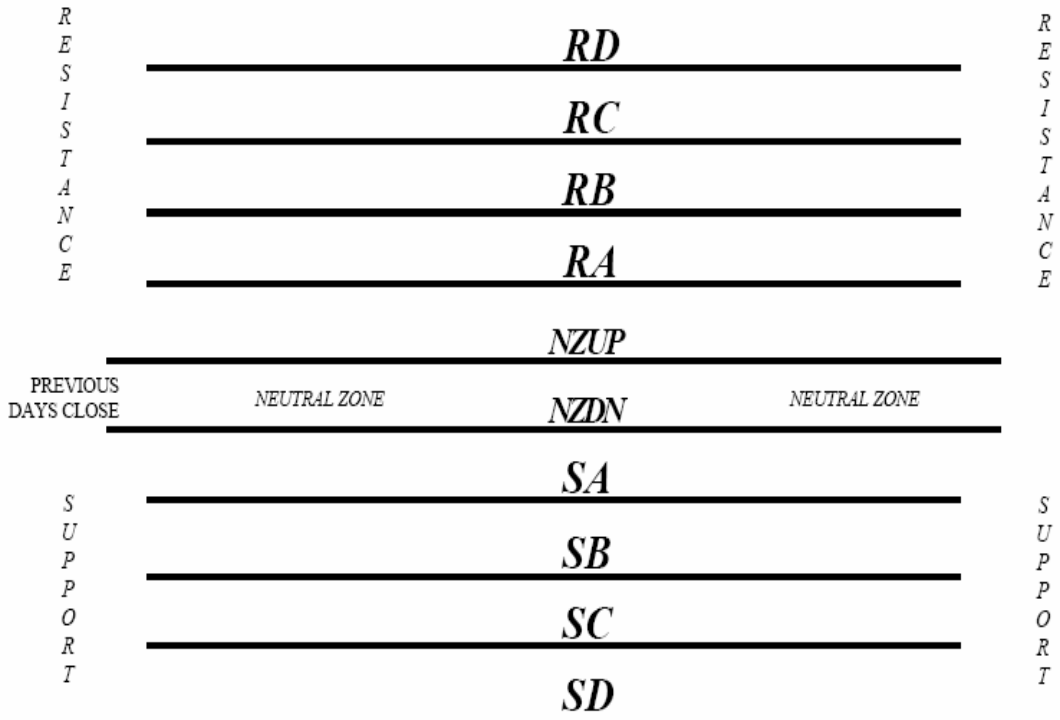
سطوح T.J.'s Web

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

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

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

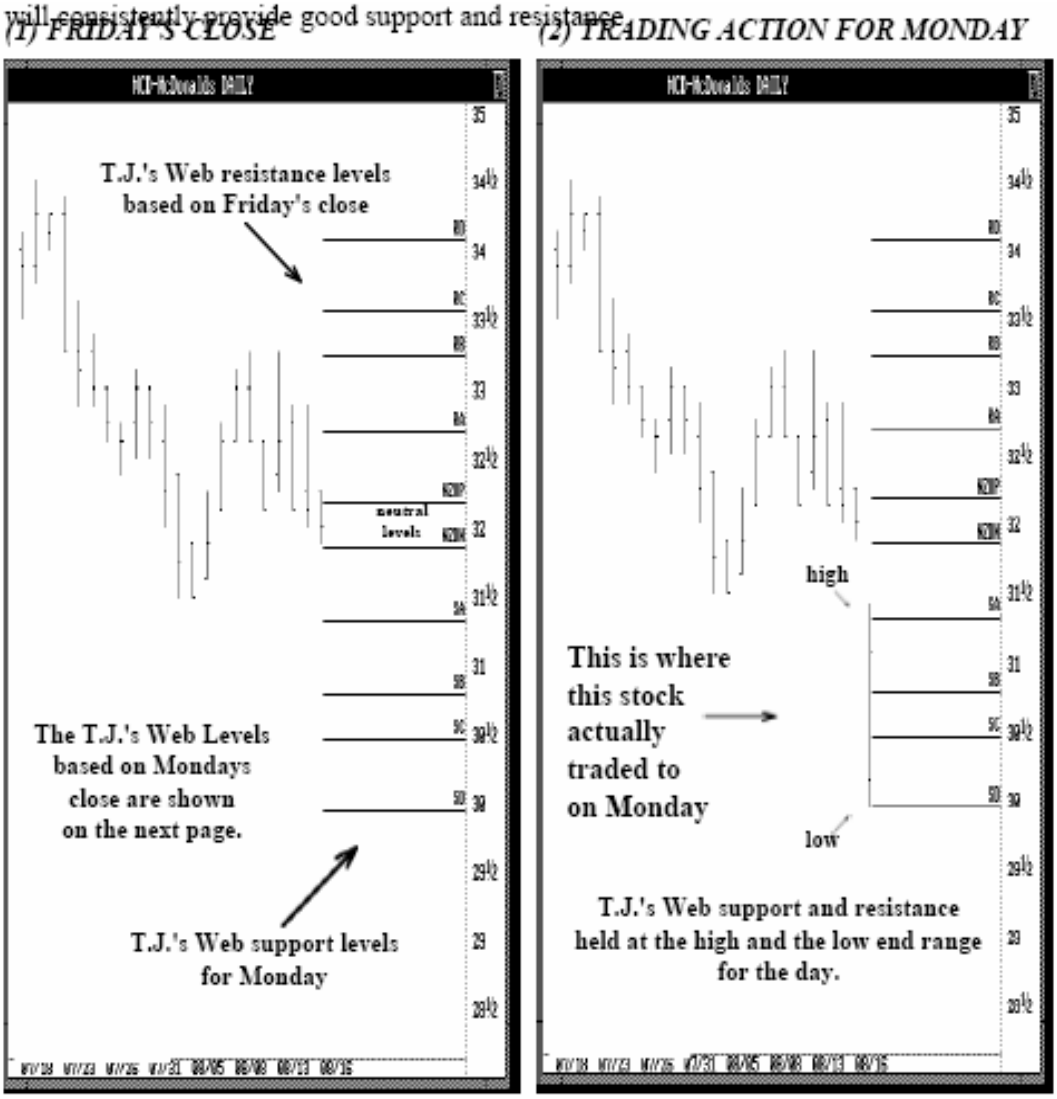
منطقه حمایت: **در زیر منطقه خنثی چهار سطح حمایت وجود دارد که تحت نام SA، SB، SC و SD نام گذاری شده‌اند. این‌ها خطوط حمایت فیبوناچی هستند که بر پایه فعالیت‌های قیمت سهام در هفته قبل بنا شده‌اند.**



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

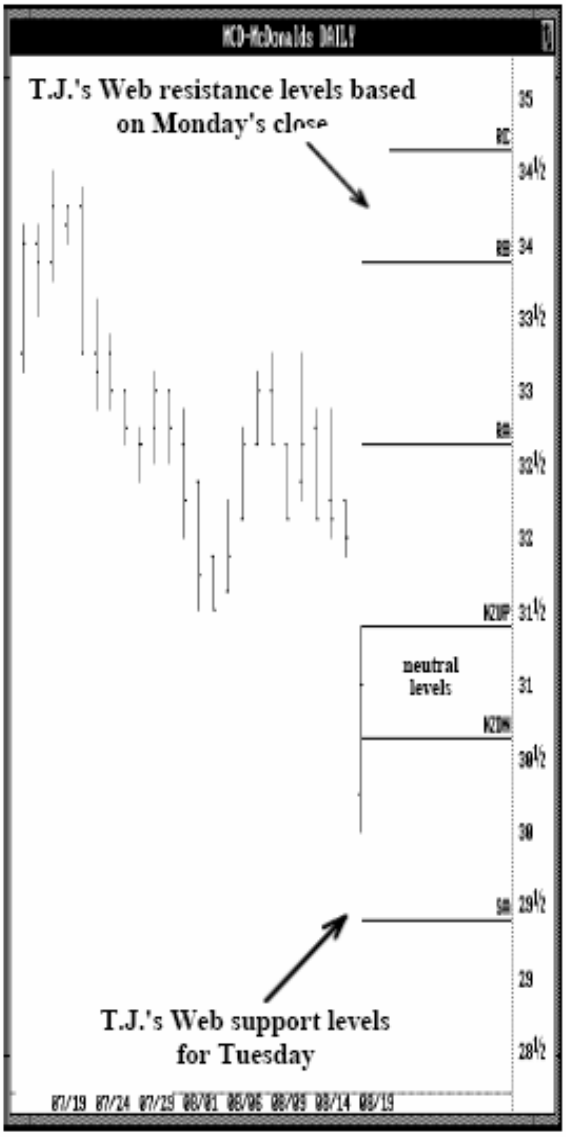
سطوح Web سطوح حمایت و مقاومتی را برای ترید روز بعدی نشان می‌دهند. اگر قیمت سهام در روز دوشنبه رالی داشته باشد آخرین سطح مقاومت RD مطرح کننده این موضوع است که سهام فوق نباید قبل از سطوح ۳۴ ترید شود و به طور مشابه آخرین سطح حمایت دلالت بر این دارد که سهم فوق نباید قبل از سطوح ۳۰ ترید شود. در روز دوشنبه سهام مک دونالد در سطح بالایی ۳/۸ -۳۱و پایینی ۳۰ معامله شد و حرکت این سهم در محدوده SA, SD سطوح Web بود. این مثال، اصولی را در مورد T.J.'s Web برای ما روشن می‌کند. شما نباید انتظار داشته باشید که این خطوط همیشه درست کار کنند. اما اگر آنها را به طور متناوب و پیوسته به کار ببرید آنها می‌توانند سطوح مقاومت و حمایت‌های خوبی را به ما نشان دهند.

will consistently provide good support and resistance.

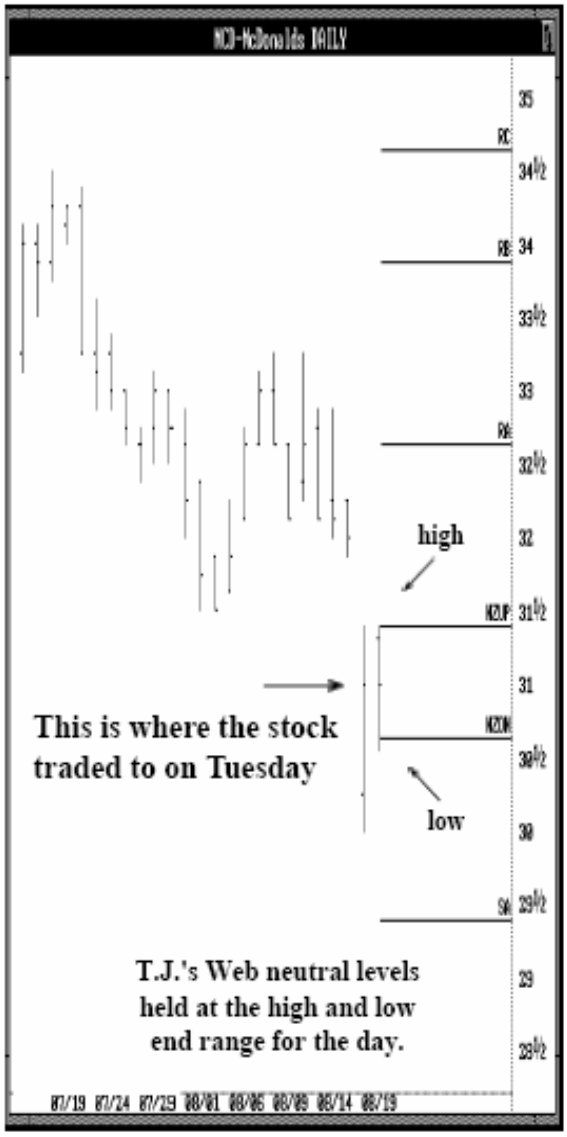


سطوح **T.J.'s Web** می‌توانند با اندیکاتورهای روزانه مثـل استوکاسـتیک آهـسته ۲۱ و نوسان نمای الیوت در روی نمودار ۵ دقیقه‌ای استفاده شوند. زمانی که نوسان نمای الیوت یـک دایـورجنس صـحیح را نـشان داد؛ کـه قـبلاً ایـن موضـوع توضـیح داده شـده و استوکاستیک بالای ۸۰ بود یک سیگنال کوچک در حـال شـکل‌گیـری بـوده و از سـطح **T.J.'s Web** بعدی به عنوان پایان معامله استفاده کنید. سیگنال **Buy** دقیقاً بر عکـس مطلب گفته شده می‌باشد.

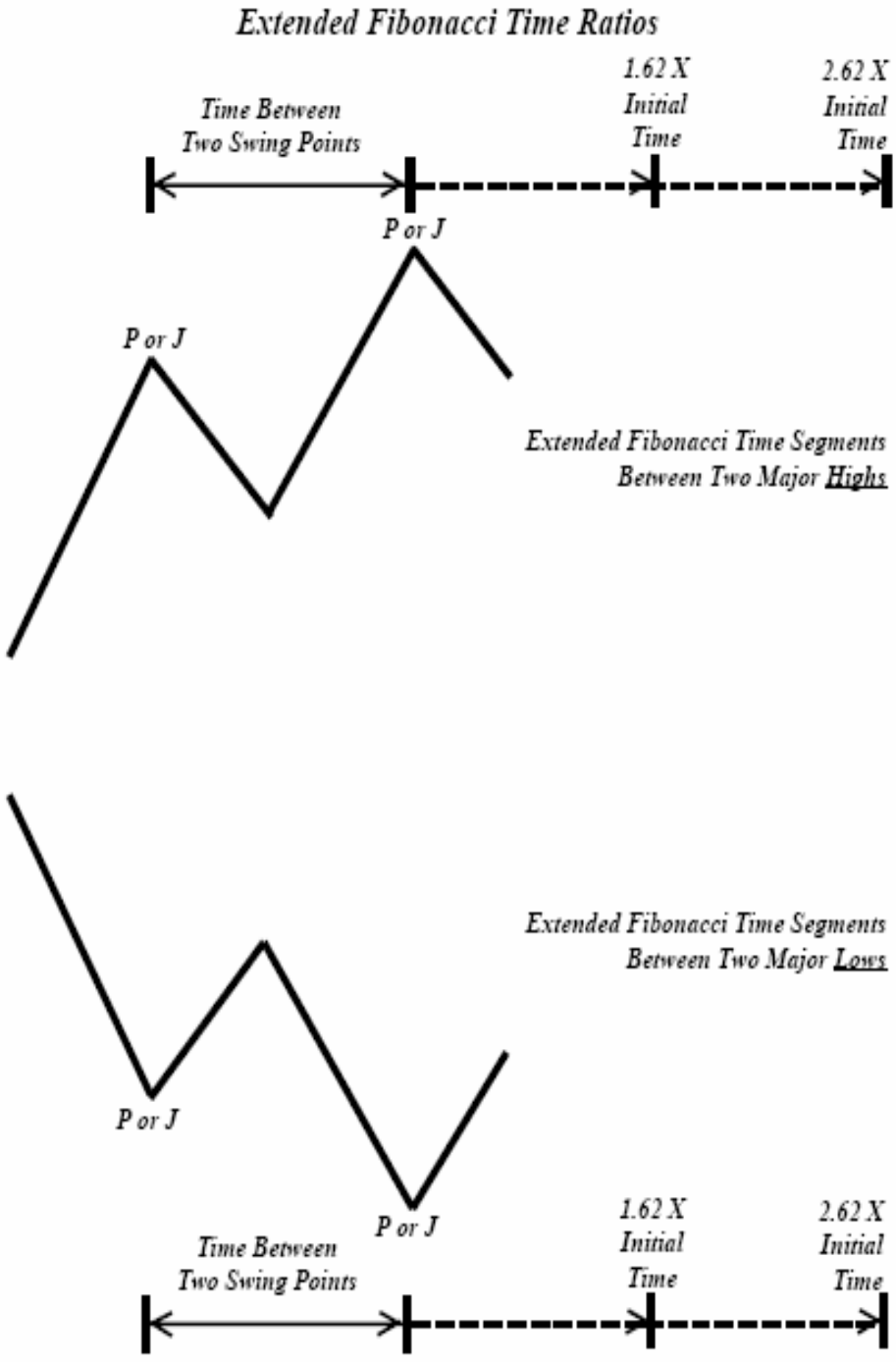
(3) MONDAY'S CLOSE

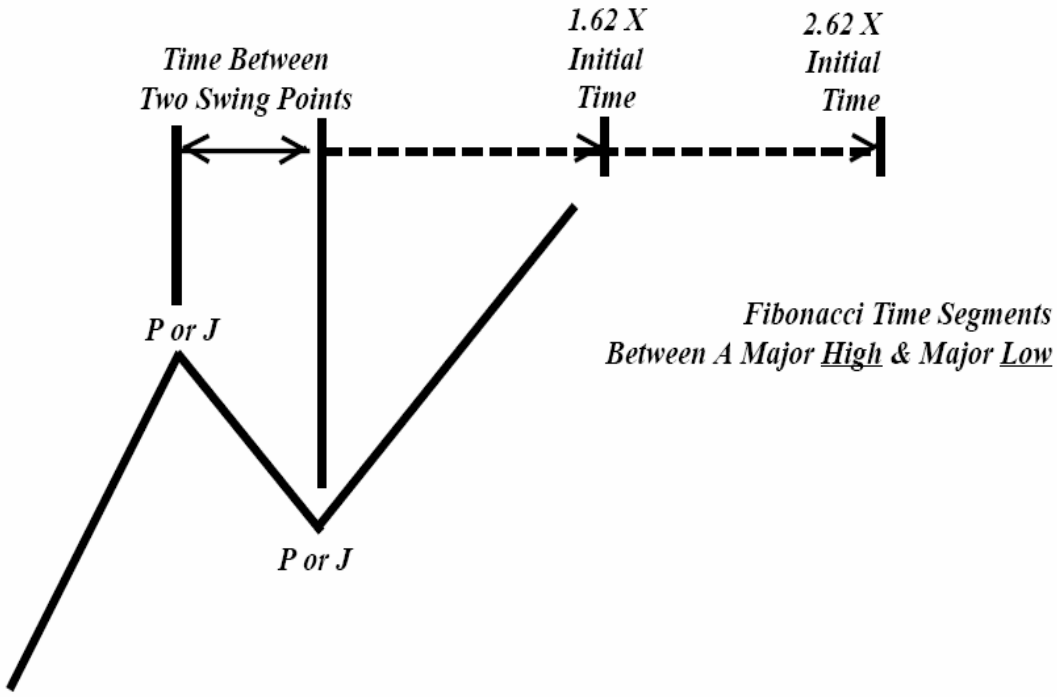


(4) TRADING ACTION FOR TUESDAY



نسبت های زمانی گسترش فیبوناچی





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

این بازه زمانی اولیه برای پیش‌بینی، با استفاده از نسبت‌های فیبوناچی متفاوت برای انجام پبش‌بینی، گسترش می‌یابند. ما پیشنهاد می‌کنیم که از نسبت‌های ۱/۶۲ ,۲/۶۲ استفاده کنید. بر هر حال شما باید ترکیبات متفاوتی را به کار ببرید. اگر شما نسبت‌های حاضر را که ما اضافه کرده‌ایم نمی‌پسندید خودتان می‌توانید اعداد خود را مثل ۳/۷۹ ,۲/۹۴ وارد کنید.

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

خوشه‌های زمانی فیبوناچی

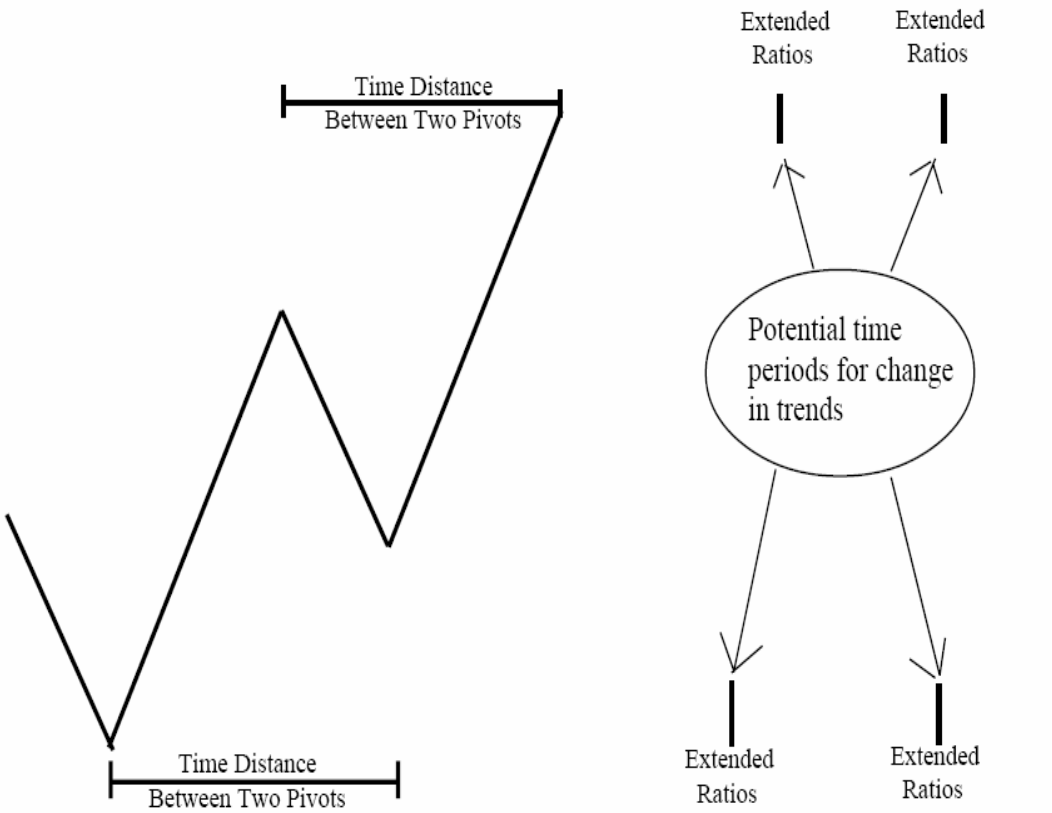
از فاصله زمانی (تعداد ستون‌ها)بین دو پیوت و نسبت‌های گسترش یافته این فاصله زمانی، به منظور نشان دادن آینده استفاده کنید. شما باید توجه داشته باشید که بسیاری از پیوت‌هایی که در آینده خواهند آمد(نقاط تغییر ترند)در این دورهای زمانی گسترش یافته رخ می‌دهند.

سوال:

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

جواب:

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



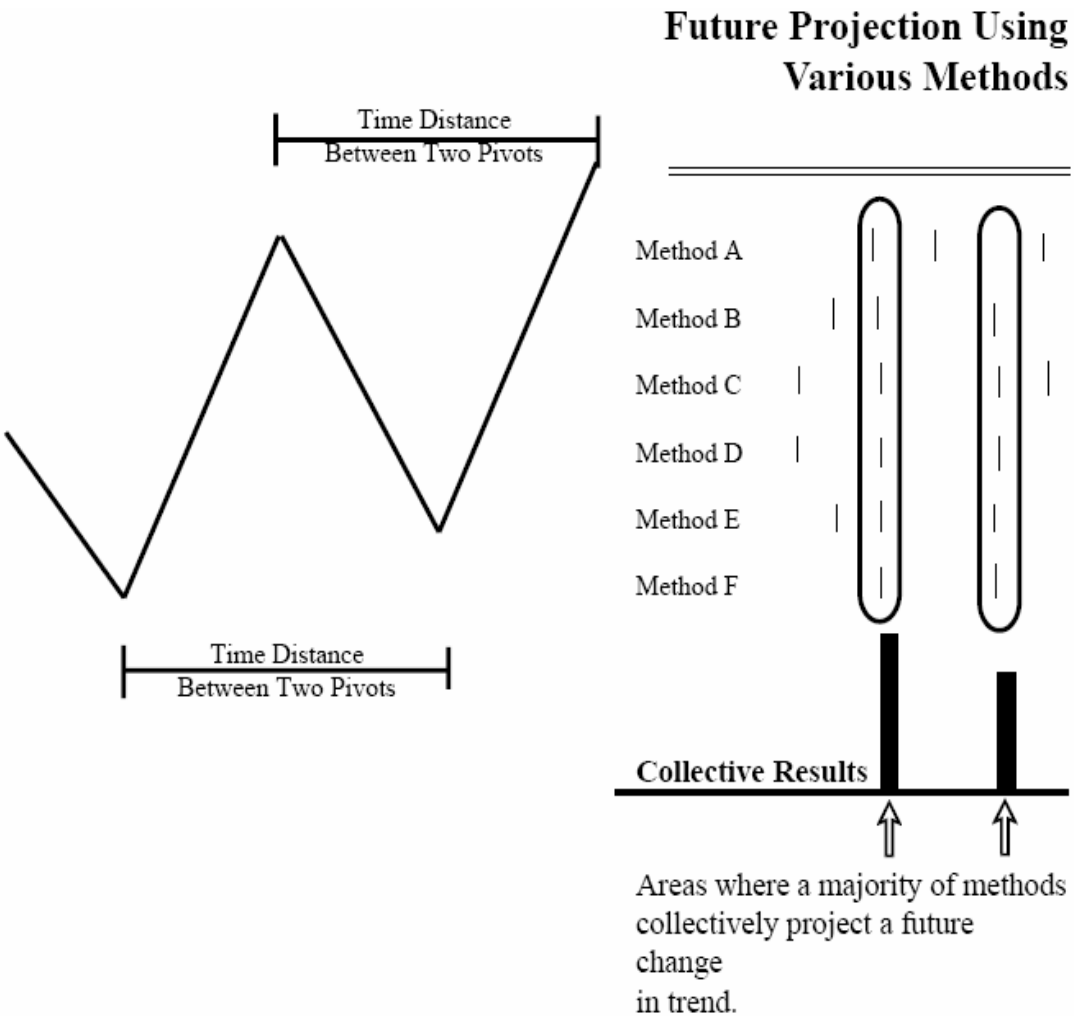
سوال؟

حال چگونه می توان از این ابزار استفاده کرد؟

جواب:

تمام ترکیب‌های قابل دسترس را بکار ببرید و گروهی از خوشه ها را بیابید. اجازه دهید بگوییم که تعدادی از تریدرها از این مطالعه استفاده می‌کنند که هر کدام نسبت‌ها و پیوت‌های متفاوتی را به کار می‌برند. جدا از اینکه کدام یک از این ترکیبات مورد استفاده قرار می‌گیرند پیش‌بینی‌های انتخاب شده همه تریدرها منتج به منطقه‌ای خواهد شد که در آن همه تریدرها معتقد به تغییر ترند می‌باشند.

بنابراین مناطقی که بوسیله گروهی از خوشه‌ها مشخص می‌شوند تحت نام سطوح پیش‌بینی کننده انتخابی نامگذاری می‌شوند.



مثال: خوشه‌های زمانی فیبوناچی

نمودار نشان داده شده در زیر نمـودار سـهام روزانـه D-Mark در سـال ۱۵۹۸ در مـاه دسامبر می‌باشد. خوشه‌های زمانی با استفاده از موارد زیر بدست آمده‌اند.

- همه پیوت‌های اولیه و اصلی

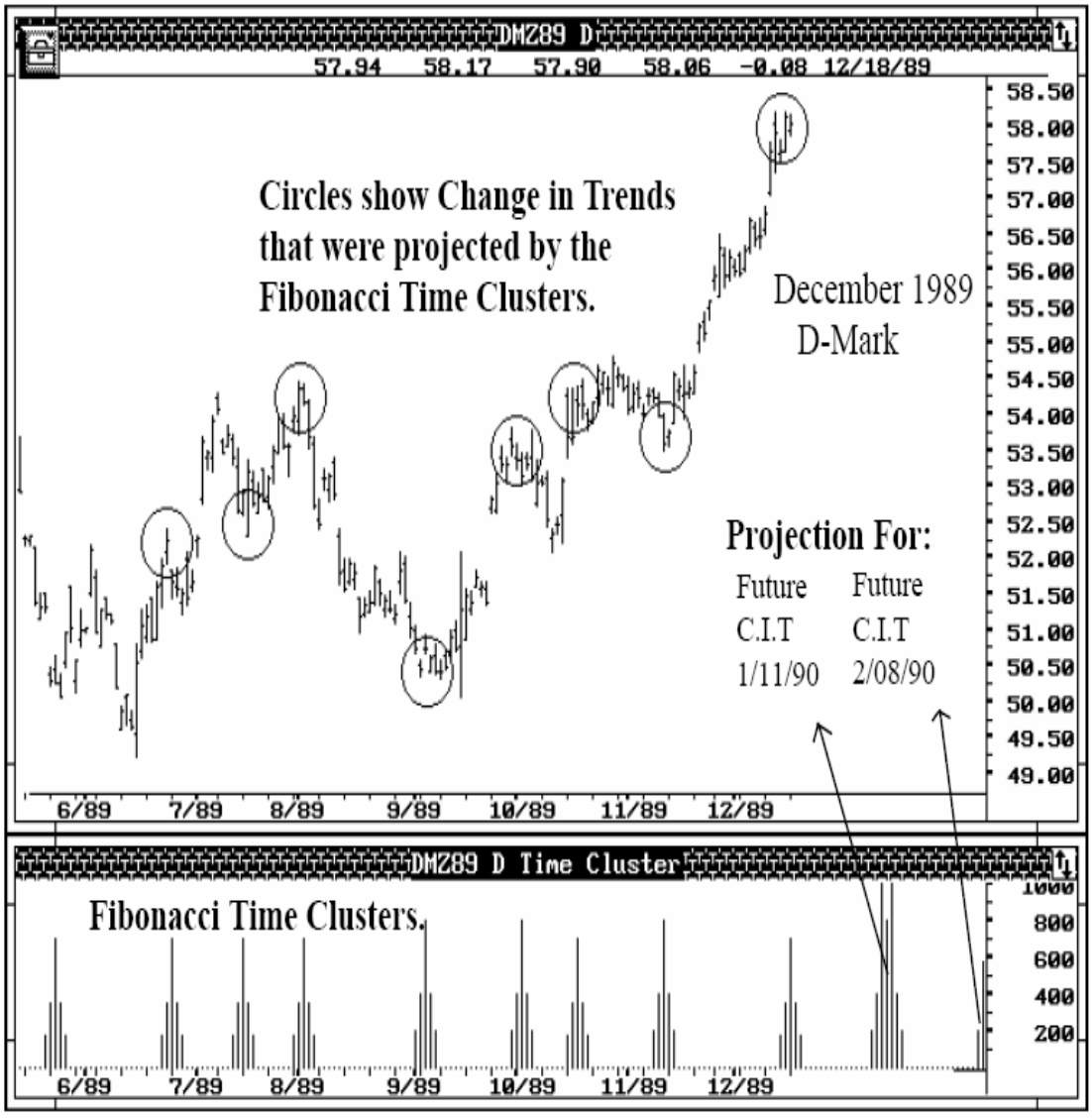
- درصدهای ۱/۶۲و ۲/۶۲ گسترش فیبوناچی زمانی با پوشش ۱۰۰٪

- استفاده از نوسان (swing) High به High و Low به Low

- حداقل وجود ۱۰ میله بین پیوت‌ها

- حداکثر وجود ۱۰۰ میله در بین پیوت‌ها

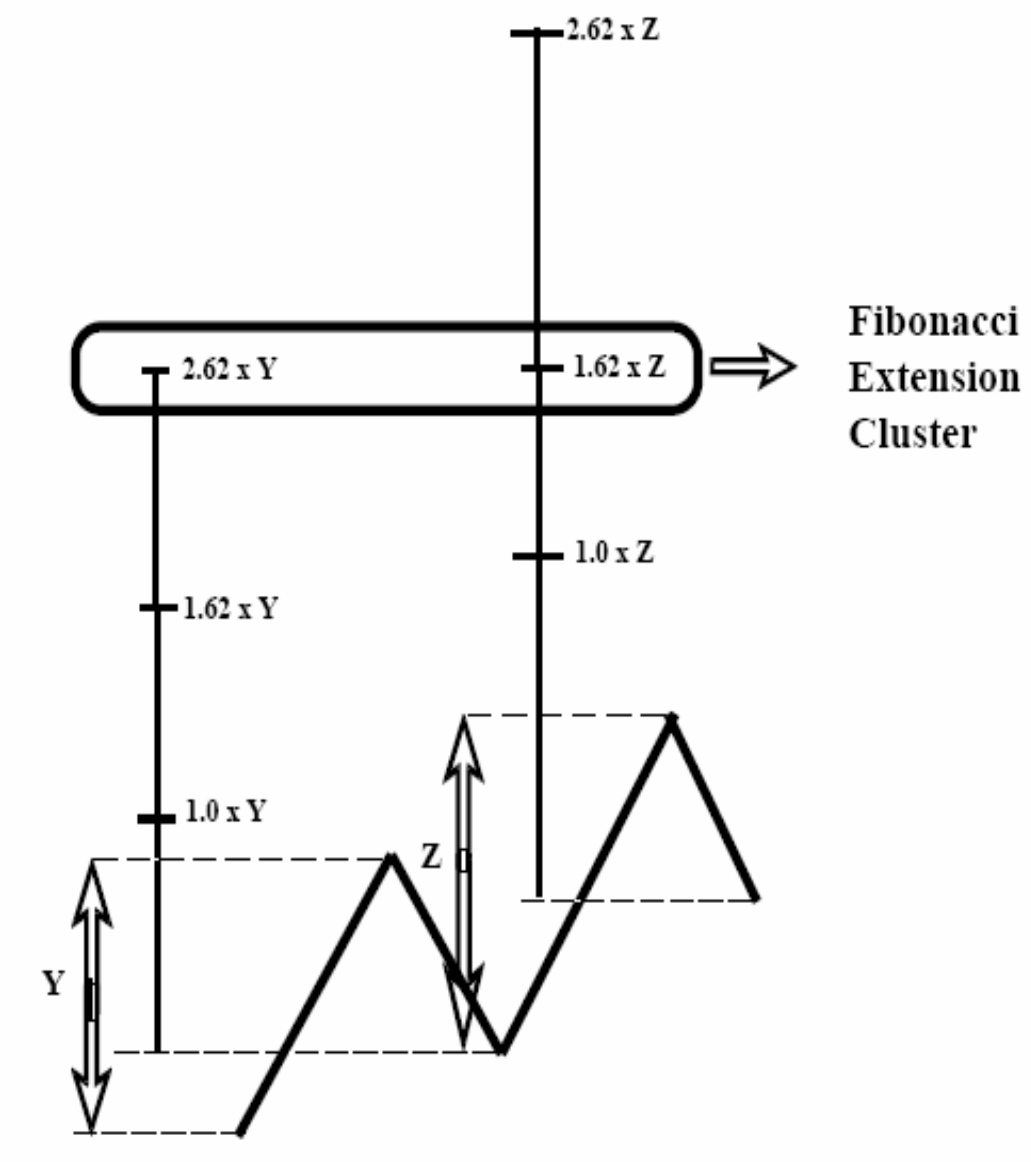
برای دیدن جزئیات بیشتر مطالب بالا صفحه بعدی را ببینید.



خوشه‌های گسترش فیبوناچی قیمت

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

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

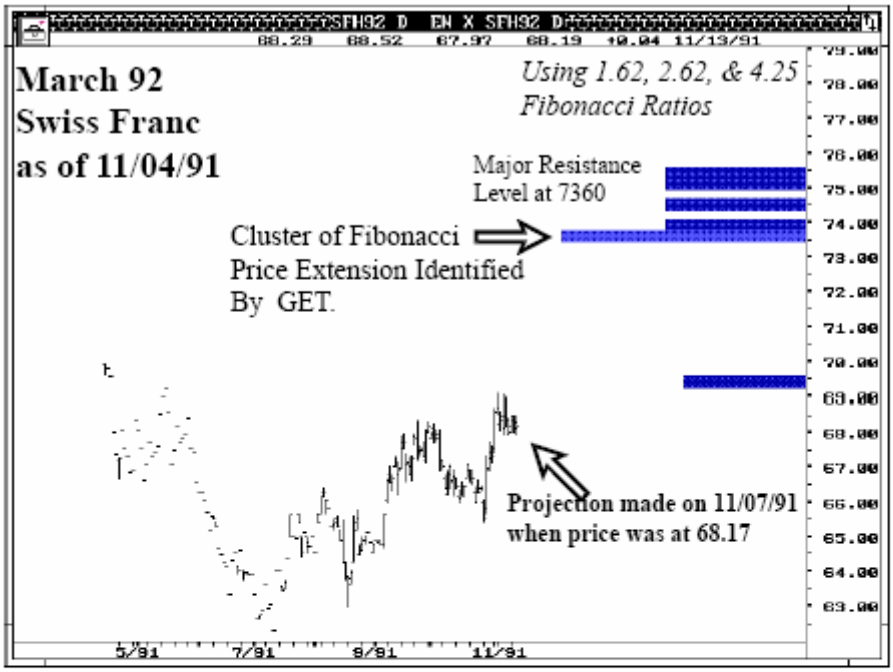


مثال: خوشه‌های گسترش فیبوناچی قیمت

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

*** همه پیوت‌های اصلی و اولیه**

*** گسترش فیبوناچی قیمت با ۱/۶۲ و ۲/۶۲ و۴/۲۳ با پوشش ۱۰۰٪ و با استفاده از رالی‌ها**



پیش بینی:

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

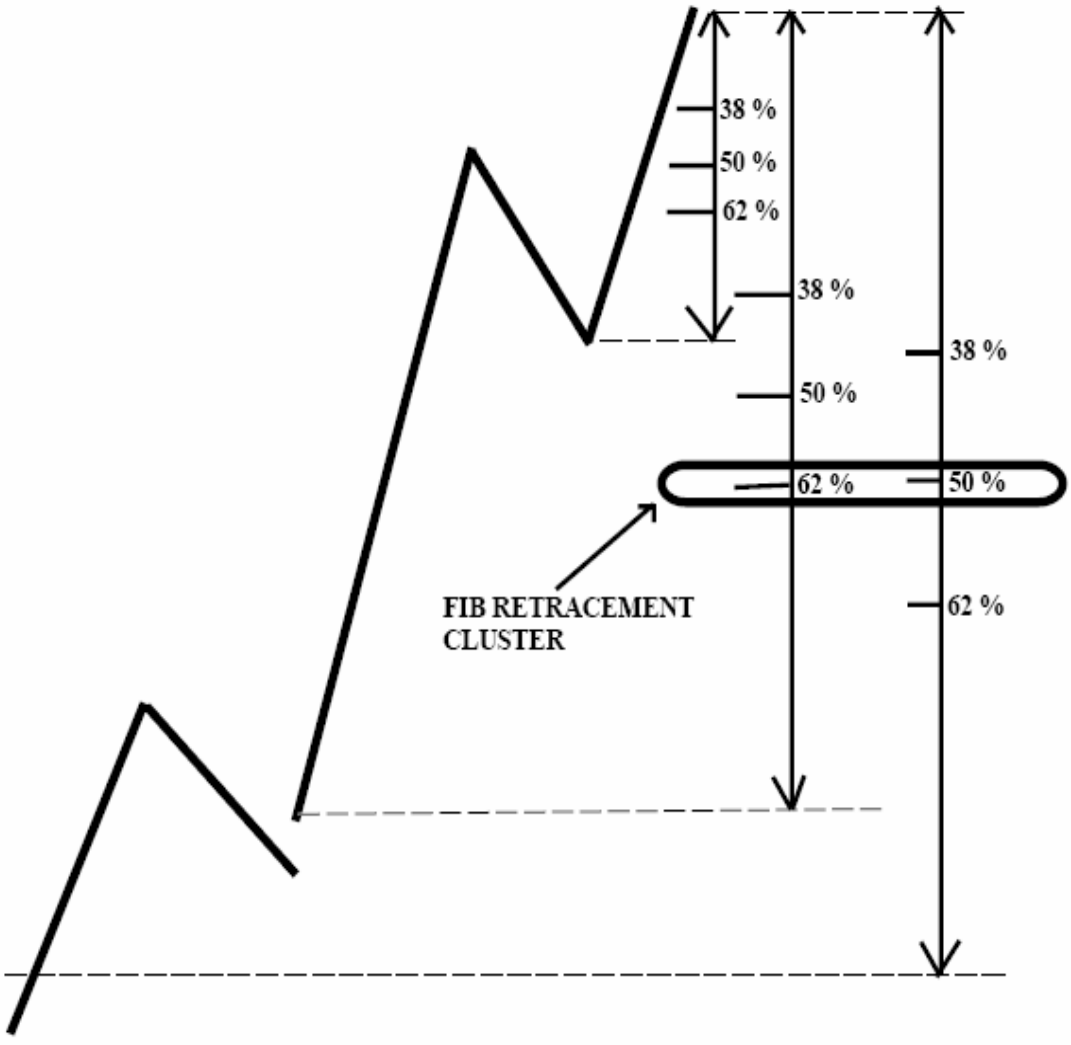
نتیجه:

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

خوشه‌های اصلاح فیبوناچی قیمت

درست مانند گسترش‌ها همه تریدرها در سرتاسر دنیا از سطوح اصلاحی فیبوناچی قیمت برای تعیین خطوط حمایت و مقاومت استفاده می‌کنند. تریدرها از سطوح اصلاح متفـاوتی استفاده کرده و همچنین از سطوح نوسان متفاوتی این محاسبه را انجام می‌دهند.

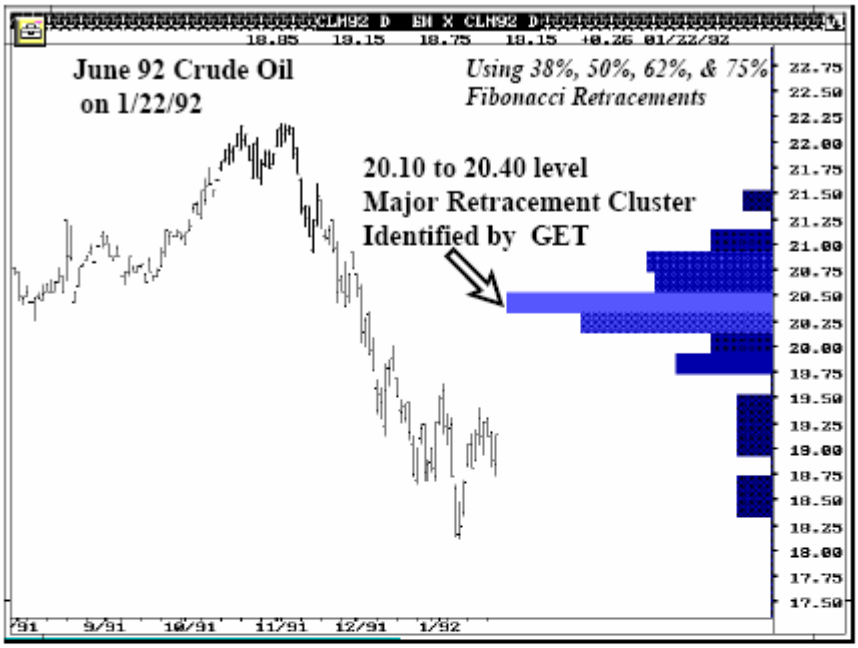
بدون توجه به تعداد روش‌های مورد استفاده پیش‌بینی همه تریـدرها منـتج بـه سـطوح قیمتی می‌شوند که در آن تعداد زیادی از تریدرها قائـل بـه سـطوح حمایـت و مقاومـت یکسانی هستند. نرم افزار قادر است این سطوح را بوسیله راه‌هـای خوشـه‌ای شناسـایی کند.

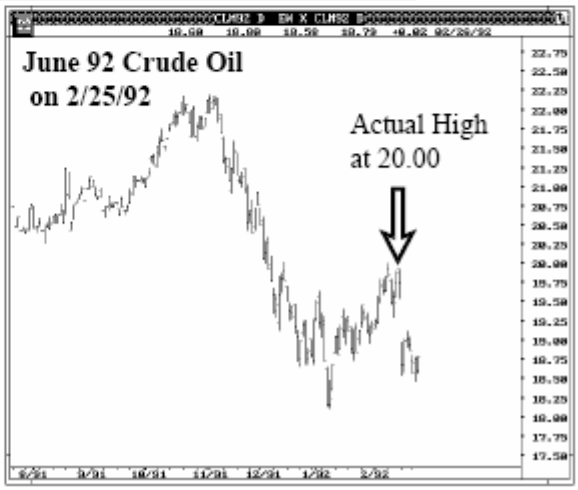


مثال، خوشه های اصلاح فیبوناچی قیمت

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

- همه پیوت‌های اصلی و اولیه. اصلاح فیبوناچی قیمت در سطوح ۳۲٪،۵۰٪، ۷۵٪ با استفاده از۱۰۰٪ حرکت نزولی





پیش بینی:

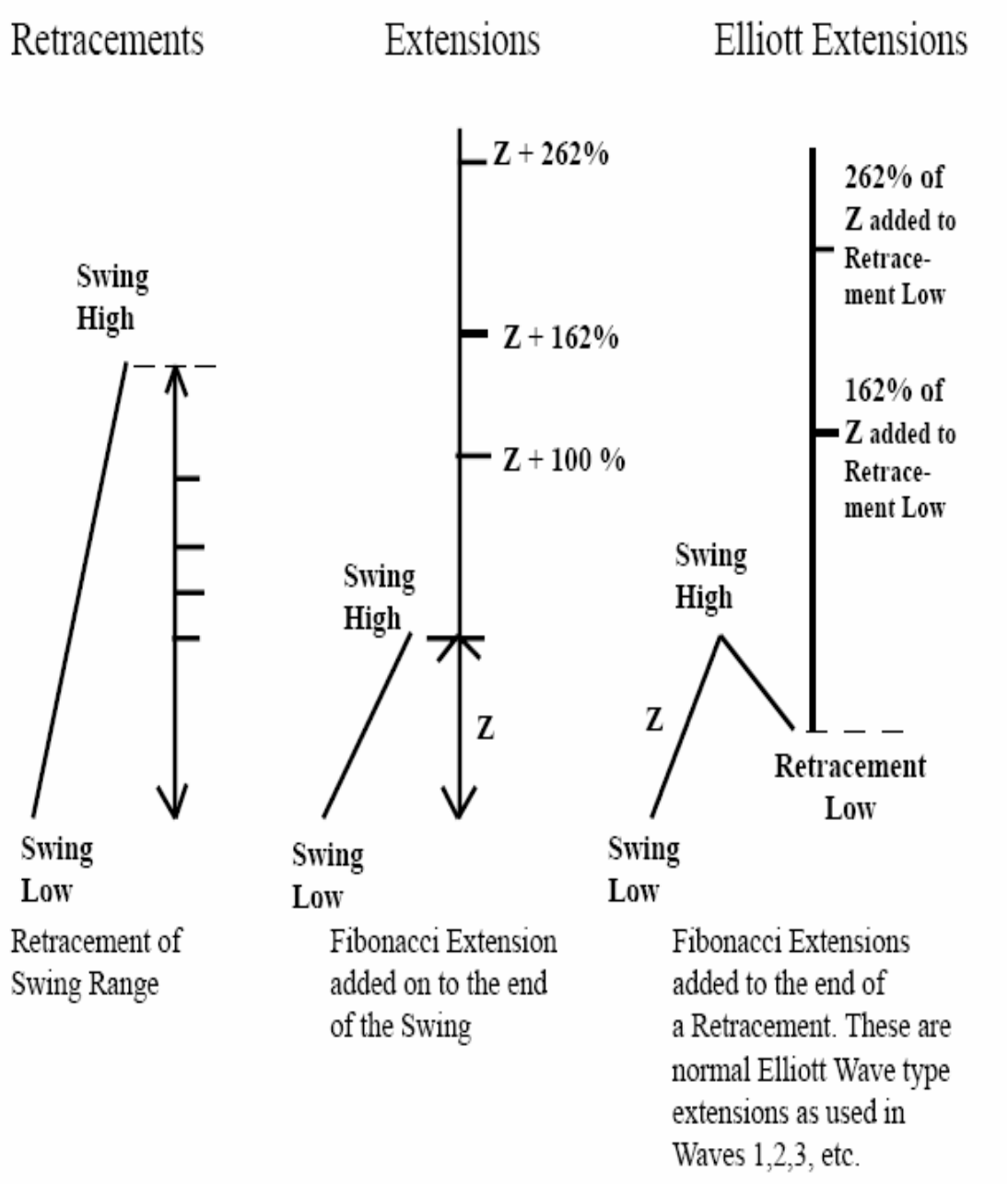
اولین خوشه در ۲۰۴۰-۲۰۱۰ قرار گرفته است.

نتیجه:

یک High واقعی در نمودار ژوئن سال ۹۲ این سهم در ۲۰،۰۰ بوجود آمده است.

''قرار دادن اصلاح‌ها و گسترش‌ها و گسترش یک الیوت''

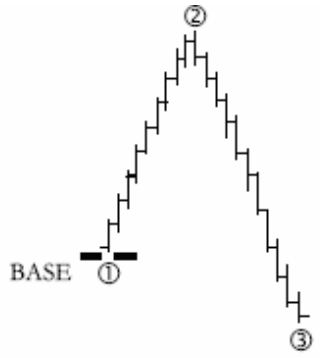
سه نوع متفاوت از خوشه‌های قیمت قابل محاسبه است. آن‌ها در زیر نمایش داده شده‌اند.



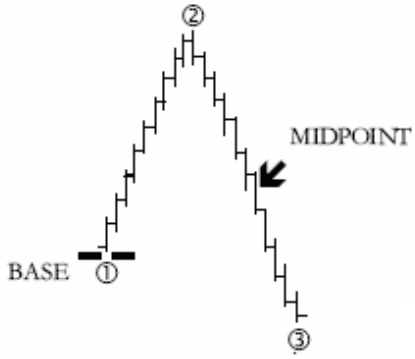
خطوط میانه اندروز

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

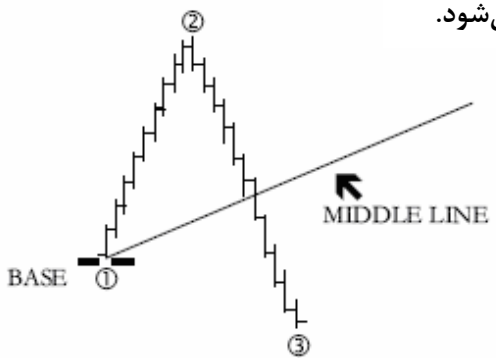
برای رسم خطوط میانه ما نیاز به ۳ نقطه داریم. زمانی که ۳ نقطه در بازار شناسایی شد شما آماده خواهید شد تا از خطوط فوق استفاده کنید. نقطه اول نقطه پایه (Base) نامیده می‌شود.



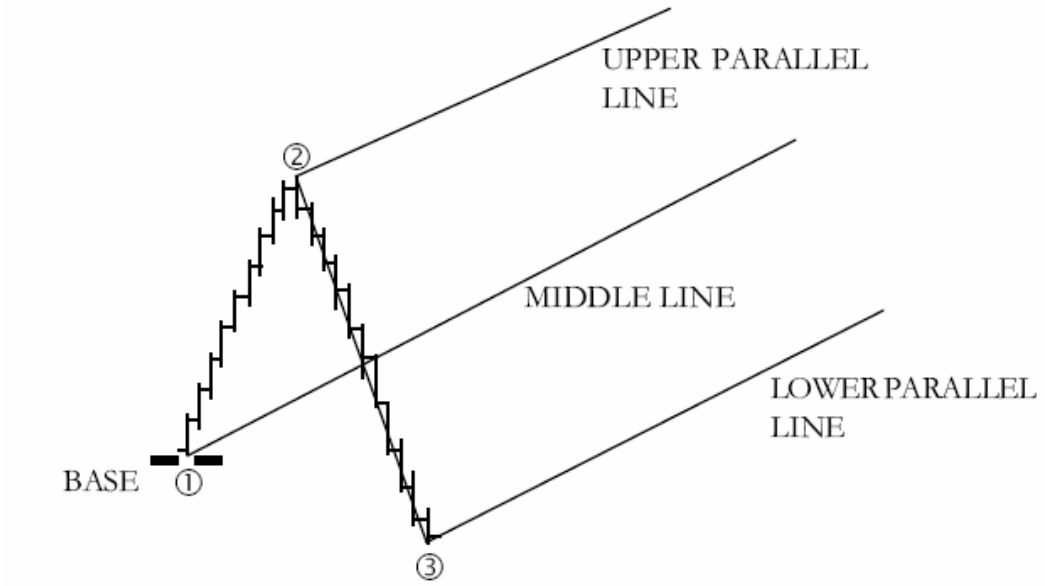
یک خط از نقطه ۲ به ۳ رسم می‌کنیم.



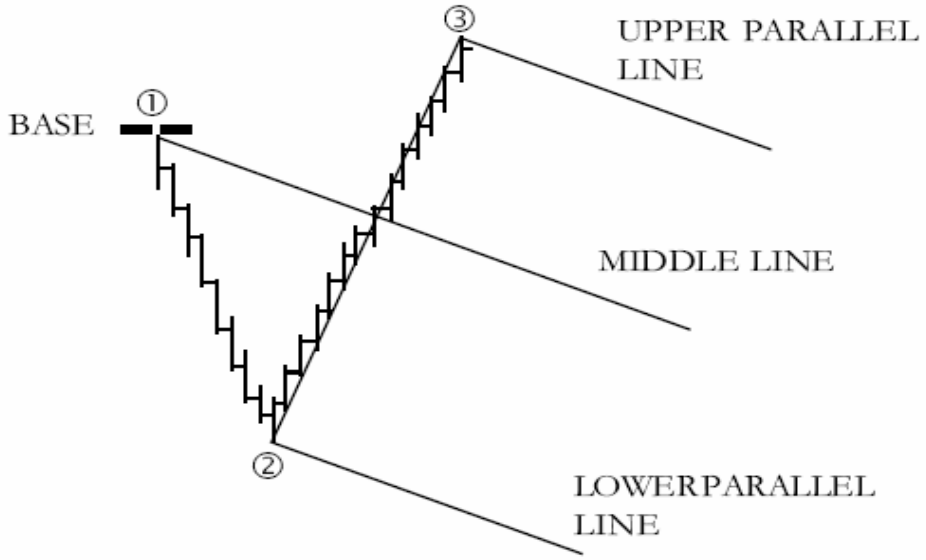
خطی از نقطه پایه به نقطه میانی ۳ , ۲ وصل می‌کنیم. این خط خط میانه نامیده می‌شود.



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



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



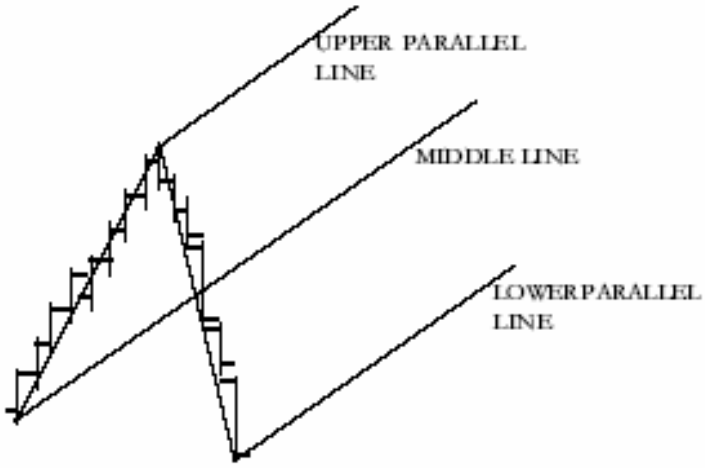
در قوانین دکتر اندروز قیمت یکی از دو حالت زیر را در برخورد با خط میانه خواهد داشت.

۱) قیمت در خط میانه برگشت خواهد داشت و یا

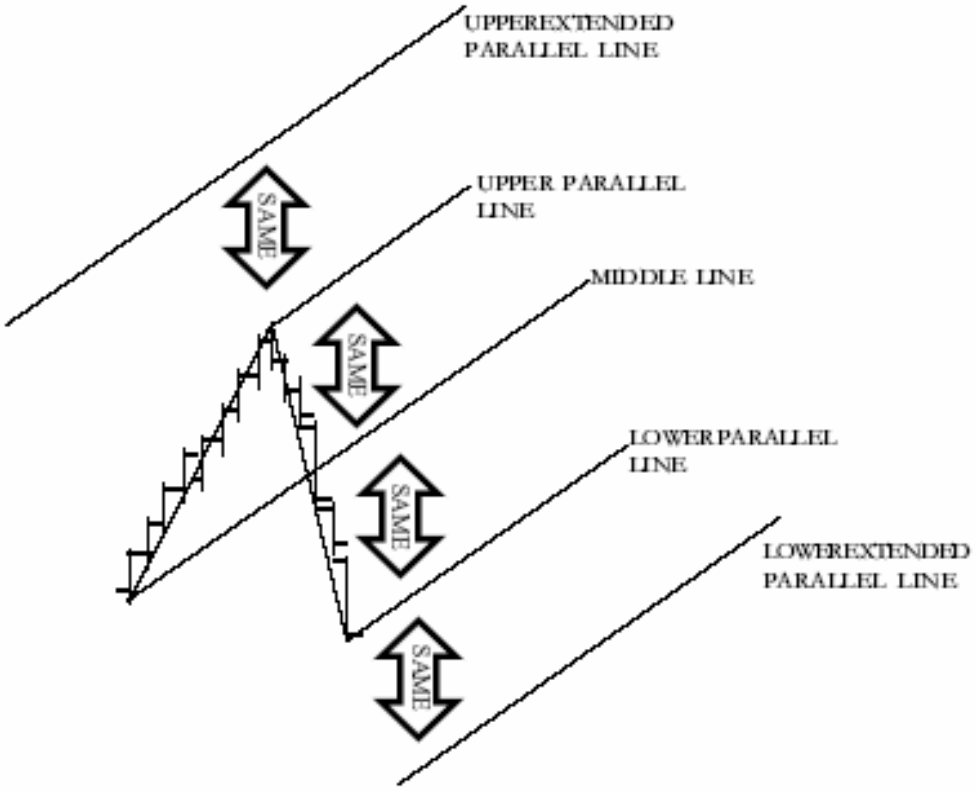
۲)قیمت از خط میانه خواهد گذشت و با خط موازی بالایی برخورد خواهد کرد. مثال‌هـــایی در هر دو مورد در ادامه آمده است:

خطوط موازی گسترش یافته

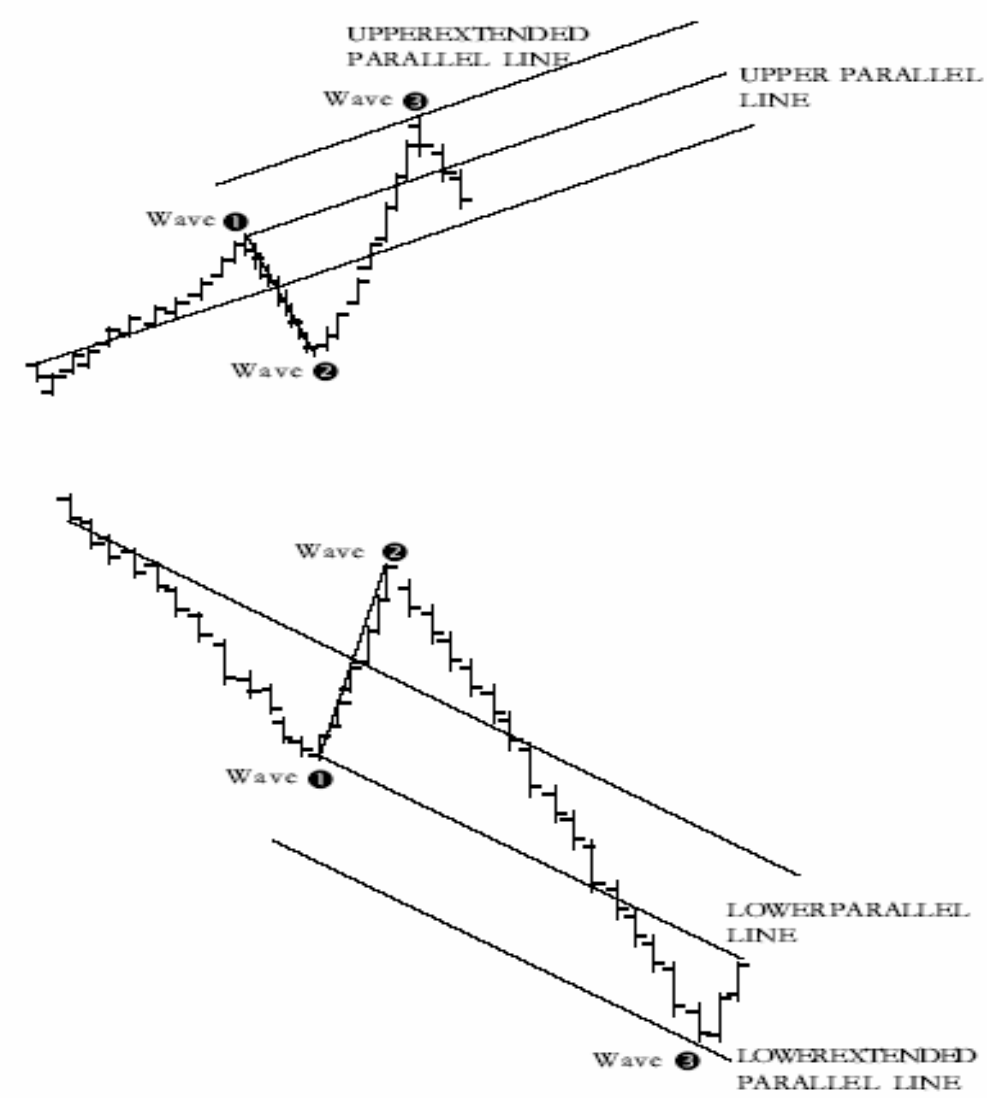
در بعضی موارد خطوط موازی استاندارد گسترش می‌یابند. این حالت برای زمانی که بـازار حرکت تندی دارد لازم است. مجددا زمانی که خط میانی استاندارد رسم شد. کانـال‌هـای موازی بالایی و پایینی رسم می‌شوند. سپس شما آماده‌اید که خطـوط مـوازی معمـولی را گسترش دهید فاصله بین خط میانه و خط موازی بالایی را رسم کنیـد. از همـین فاصـله استفاده کنید و یک خط موازی با خط موازی بالایی رسم کنید. همین کـار را بـرای خـط موازی پایینی نیز انجـام دهیـد. اگـر شـما از ابـزار **Pitchfork** در **Glabal ToolBox** استفاده کنید می‌توانید به راحتی این کار را انجام دهید. بصورت اتوماتیـک فاصـله بـین خطوط موازی بالایی و پایینی را محاسبه می‌کند و خطوط موازی گسترش یافته هر دو خط موازی بالایی و پایینی را رسم می‌کند.



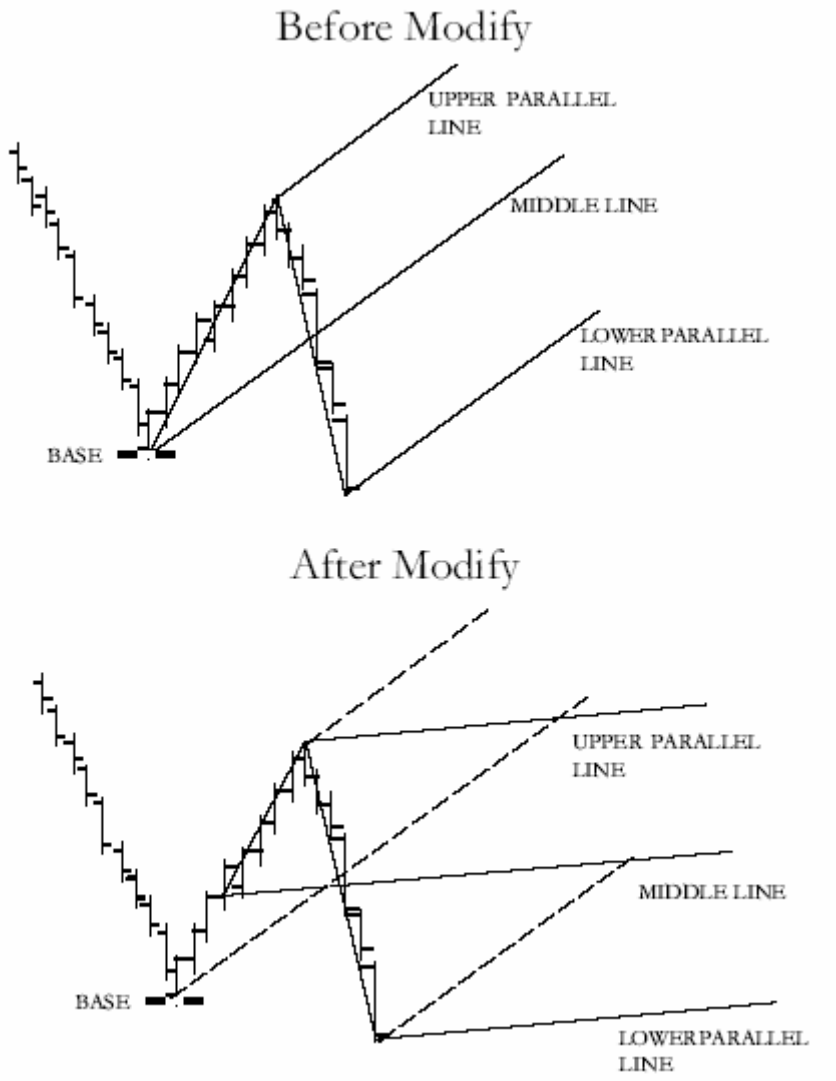
Extended Parallel Lines



کشیدن خطوط موازی گسترش یافته جهت یافتن بالای موج ۳ ضروری است. این امـر در زمانی که حرکت بازار در خلال یک حرکت قوی موج ۳ فاصله ایجـاد مـی‌کنـد ضـرورت می‌یابد.



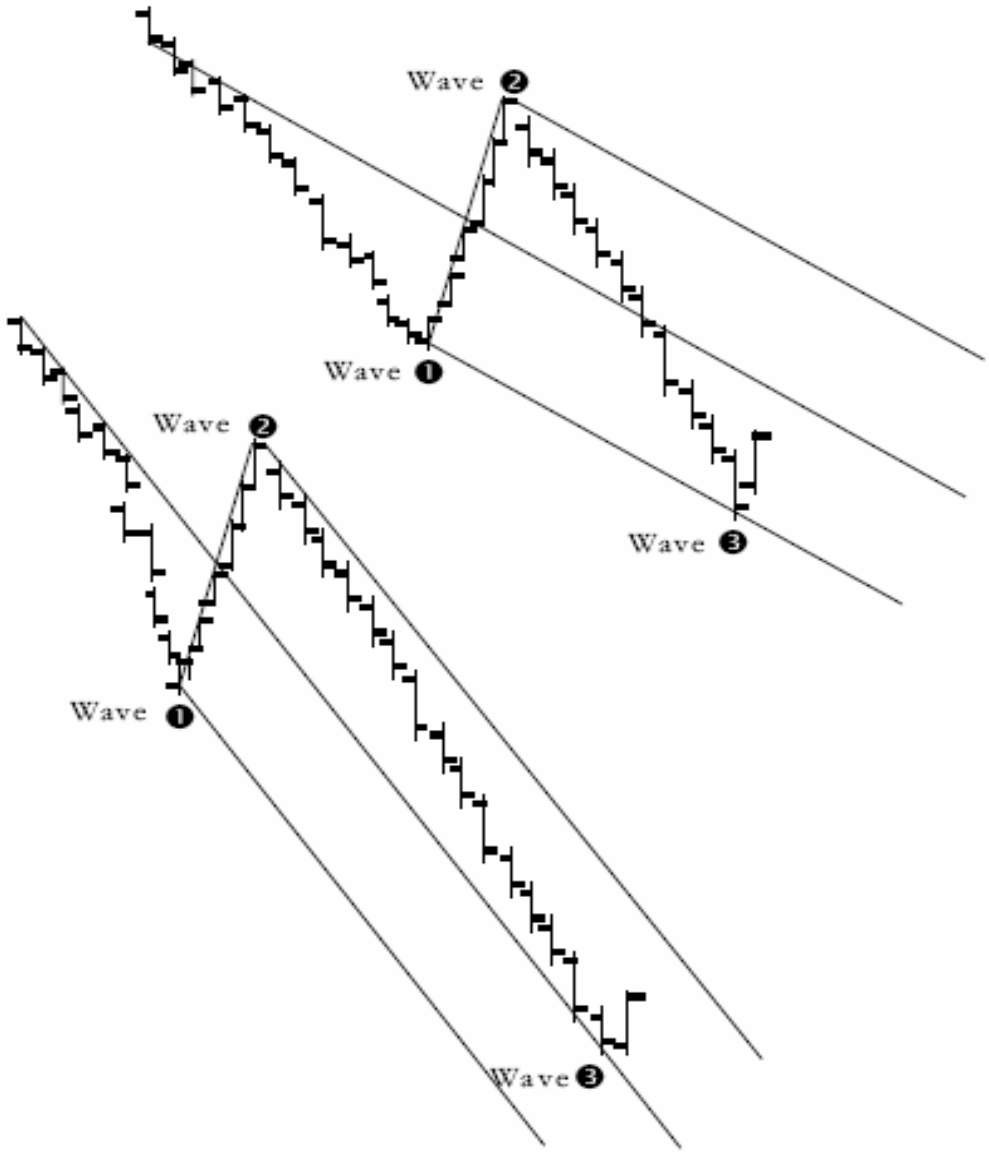
زمان‌هایی وجود دارد که در آن موج ۲ حرکت اصلاحی ما شیب تنـدی دارد. ایـن زمـانی است که شما باید Modify را در جعبه ابزار Pitchfork استفاده کنید. با تغییر این دکمه به روی حالت On خود Pitchfork بصورت اتوماتیـک حالـت مـستقیم را تغییـر داده و فاصله‌ها را مطابق با اصلاح موج ۲ تغییر می‌دهد. شما باید نقطه پایه را پیدا کرد و سـپس GET خودش آنها را برای شما Modify می‌کند.



ترکیب خطوط میانه با موج ۳

زمانی که خط میانه بر روی موج ۱ و ۲ رسم شود شما می‌توانید تکنیک خط میانه را بـرای پیش‌بینی اوج موج۳ بکار ببرید.

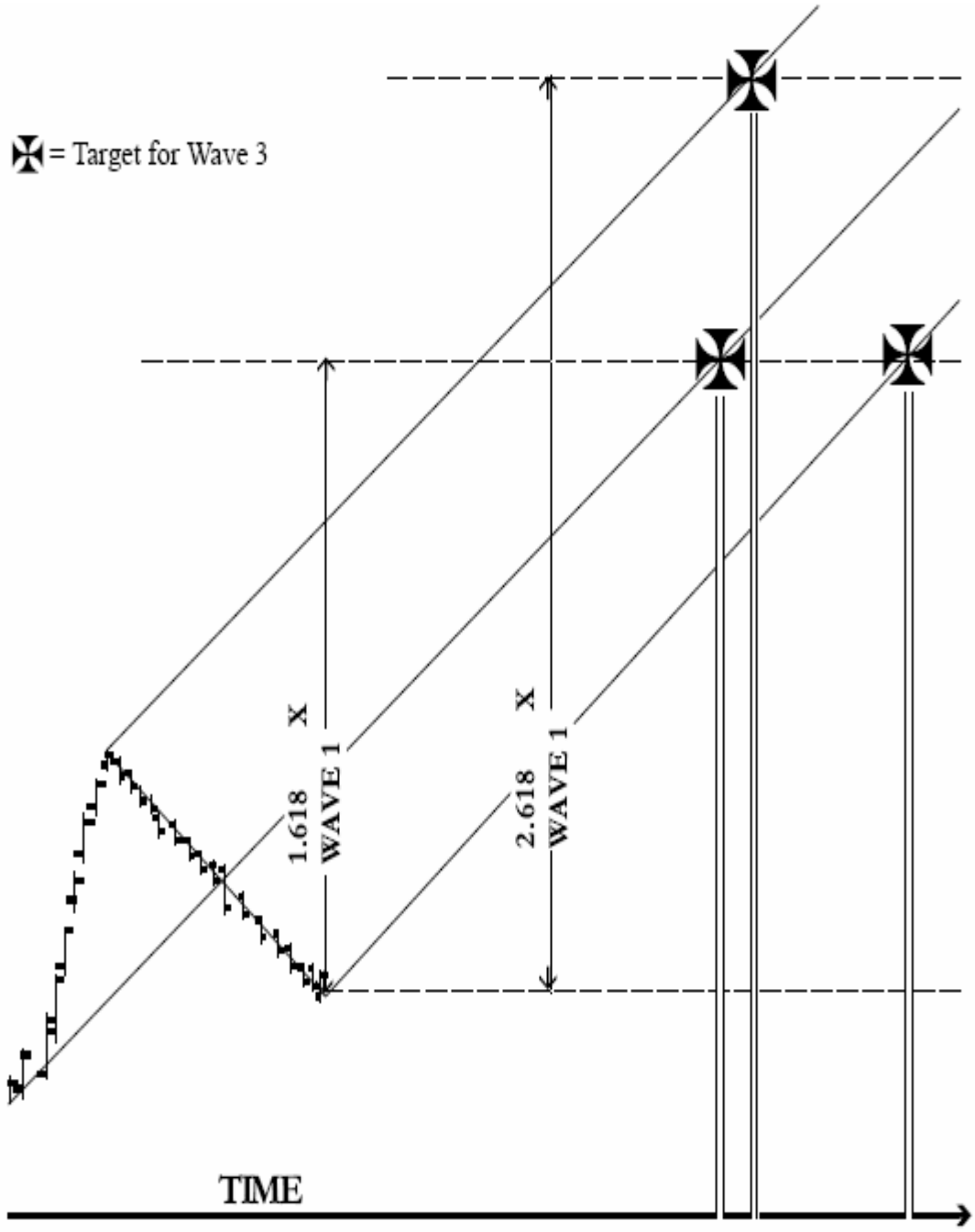
معمولا موج ۳ در خط میانه یا خط موازی بالایی یا پایینی پایان می‌یابد.



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

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

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


= Target for Wave 3
X
1.618
WAVE 1
X
2.618
WAVE 1
TIME

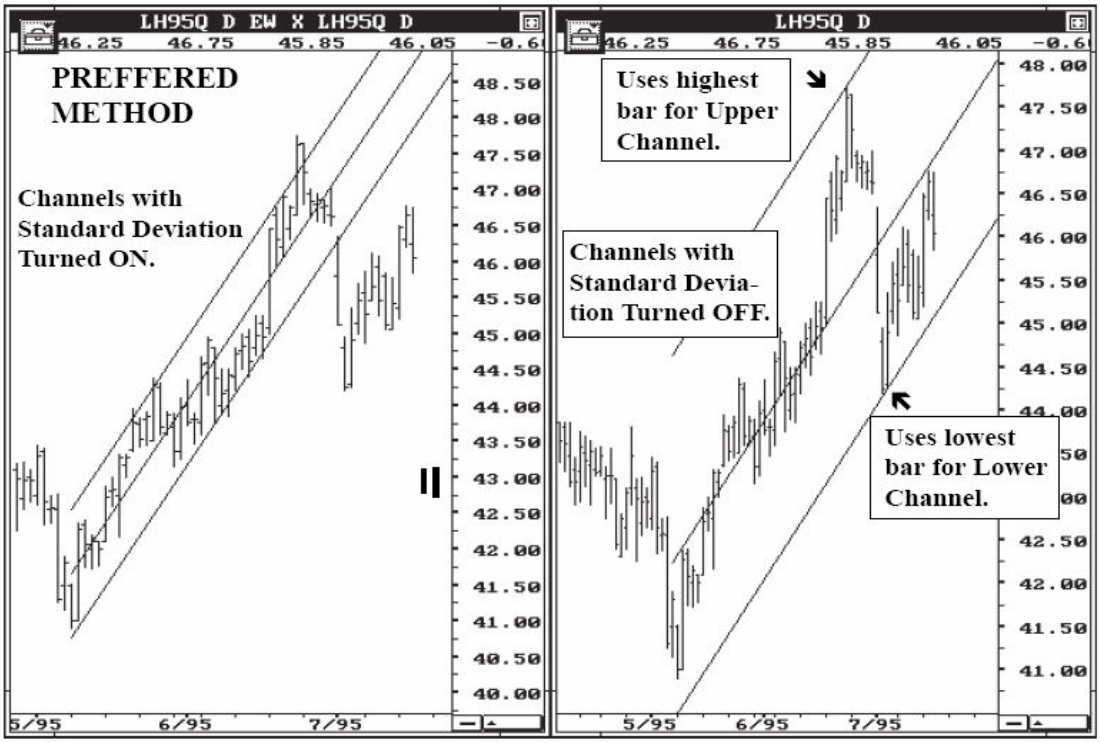
کانال‌های رگرسیون ترند اتوماتیک

چگونه از آن استفاده و با آن ترید کنیم

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

مشکل موجود

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

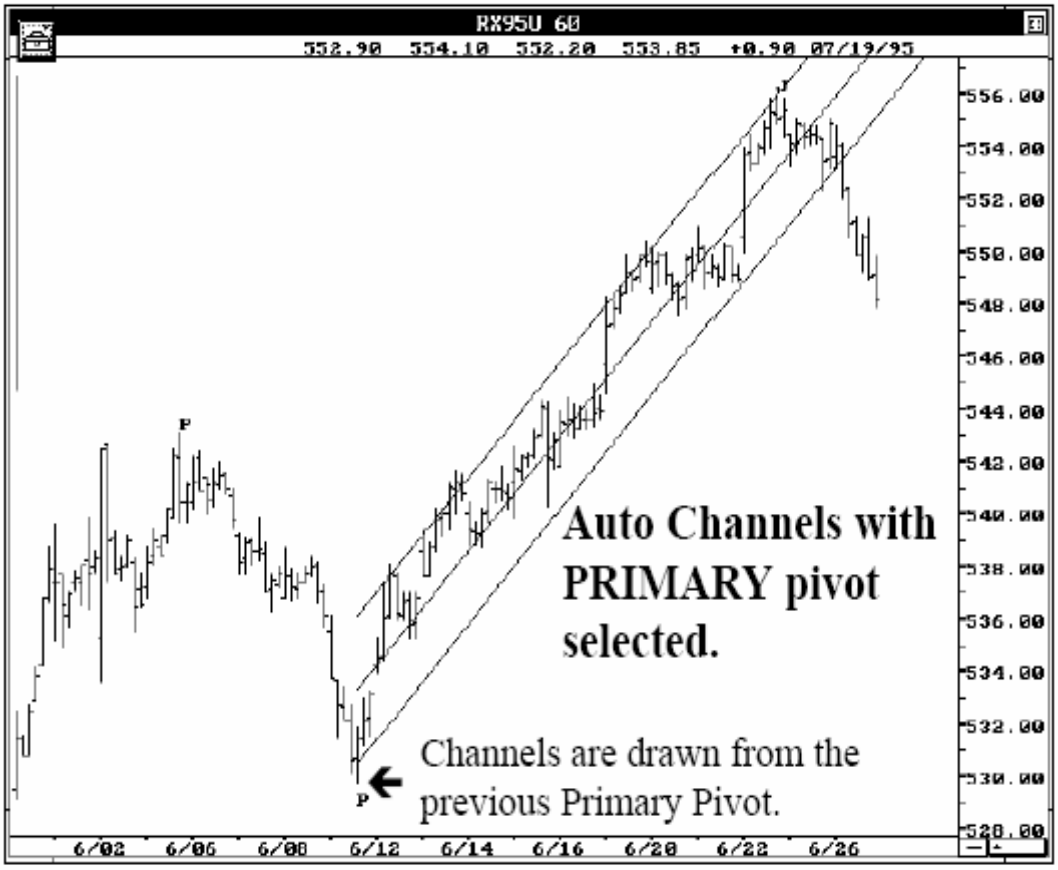


Min Pivot Select برای کانال اتوماتیک

ما چندین روش را آزمایش کردیم و در ادامه توضیح دادیم. کاربر یک پیوت قبلی را که نرم افزار بعد از آن کانال را رسم کرده است می‌یابد. برای ترند بلند مدت از حالت اصلی یا اولیه استفاده کنید. برای ترندهای کوتاه مدت از حالت مینور یا بینابینی استفاده کنید.
ما توصیه می‌کنیم این مطالعه بوسیله پیوت اصلی یا اولیه انتخاب شود. در غیر اینصورت کانال‌های اتوماتیک بصورت مداوم در هر زمان که رسم می‌شوند از یک پیوت مینور استفاده می‌شوند. این تغییر مداوم می‌تواند این کانال‌های اتوماتیک را بلااستفاده کند. مثال‌هایی که در ادامه می‌آید می‌تواند انتخاب پیوت را روشن کند.

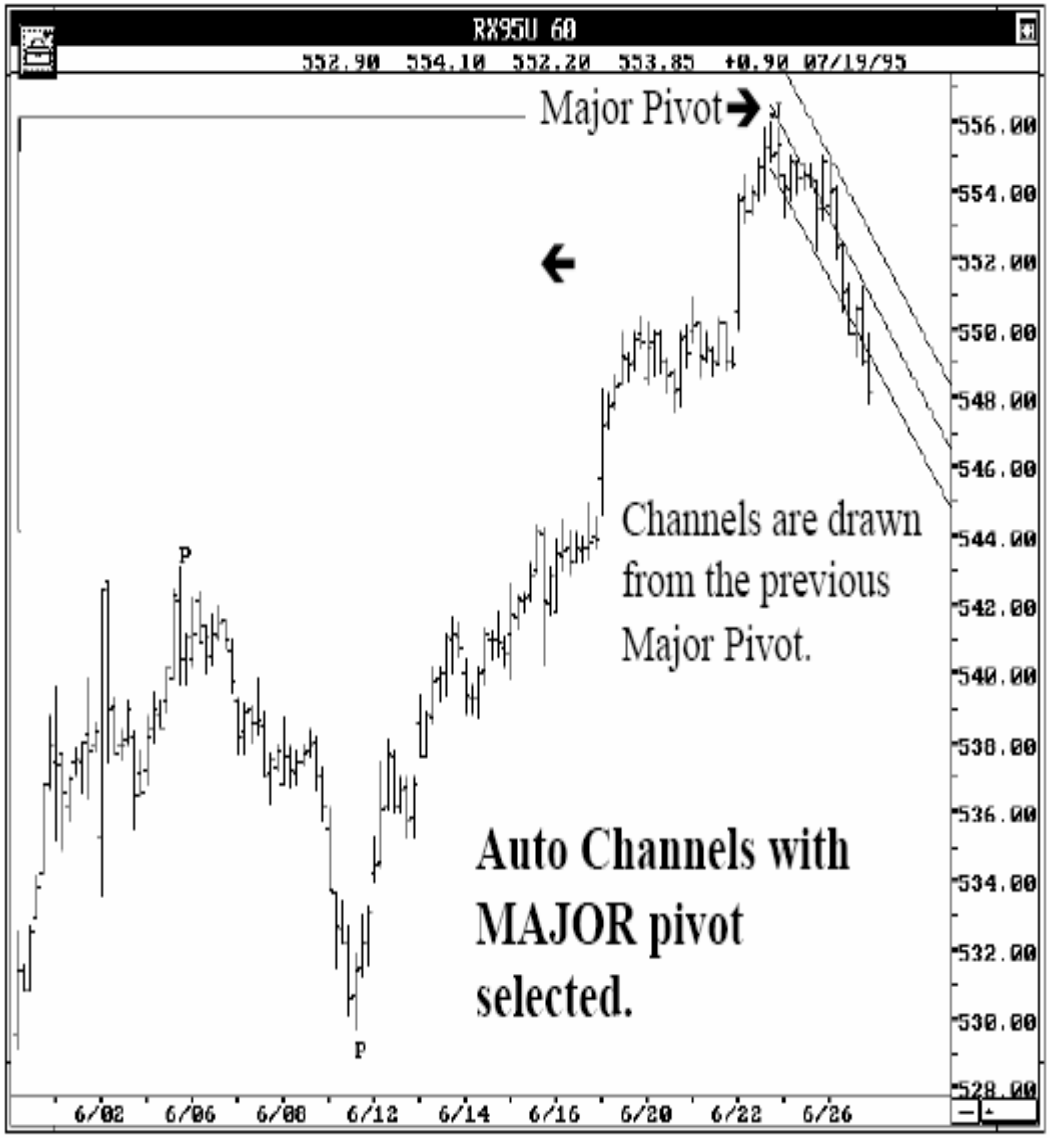
پیوت اولیه

بوسیله انتخاب پیوت اولیه به عنوان پیوت مینیموم نرم افزار بدنبال پیوت اولیه قبلی می‌گردد و کانال رگرسیون ترند را از این پیوت رسم خواهد کرد. زمانی که یک پیوت اولیه شماره‌گذاری شد کانال‌ها به صورت اتوماتیک از پیوت جدید رسم می‌شوند.



پیوت اصلی

بوسیله انتخاب پیوت اصلی به عنوان پیوت مینیموم نرم افزار بدنبال پیوت اصلی قبلی می‌گردد و کانال رگرسیون ترند را از این پیوت رسم خواهد کرد. زمانی که یک پیوت اصلی جدید شماره‌گذاری می‌شود کانال‌ها به صورت اتوماتیک مجددا از این پیوت جدید رسم می‌شوند.



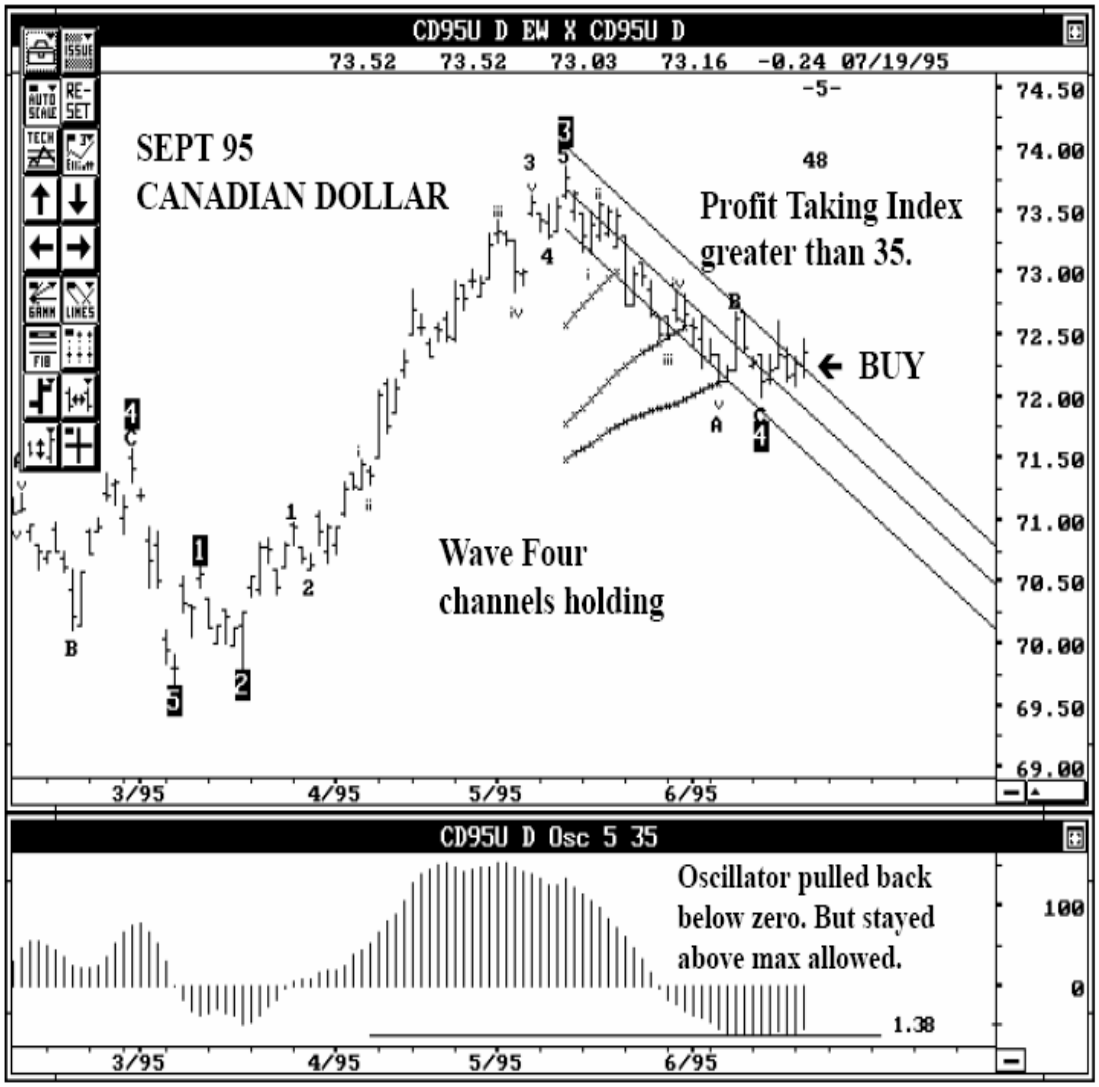
مثال واقعی استفاده از کانال‌های اتوماتیک

تریدی که در ادامه می‌آید در مورد دلار کانادا در ماه سپتامبر با استفاده از آنالیزور مــوج الیوت و کانال‌های رگرسیون ترند اتوماتیک و نوسان نمای الیوت است.

مواردی که باید رعایت شوند:

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

*** PTI در عدد ۴۸ است (بیشتر از ۳۵). معنی آن این است که حالت خوبی برای شــروع رالی ۵ وجود دارد. Buy برای دلار کانادا در ماه سپتامبر در محل شکــسته شــدن کانــال ترند وجود دارد.**



اکسپرت مشخص کننده ترند (XTL)

نیاز برای XTL:

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

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

ب) ترید در پایان موج ۵ در ترید نوع دوم

این مساله می‌توانست بسیار پربارتر شود در صورتی که می‌توانسیم با مکانیسم فوق در بعضی از موج‌های سوم گسترش یافته که در بازار ایجاد می‌شوند شرکت کنیم. به همین دلیل این کار با ماندن در تریدهای نوع دوم که در انتهای موج ۵ام صورت می‌گیرد قابل انجام است که در این حالت باید منتظر موج سوم که تولید خواهد شد ماند. در بعضی اوقات تعدادی از کاربران ما درخواست کردند که ما تکنیکی ارائه دهیم که اجازه دهد زودتر به نوسان موج سوم وارد شوند.

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

ابزار

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

تئوری XTL:

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

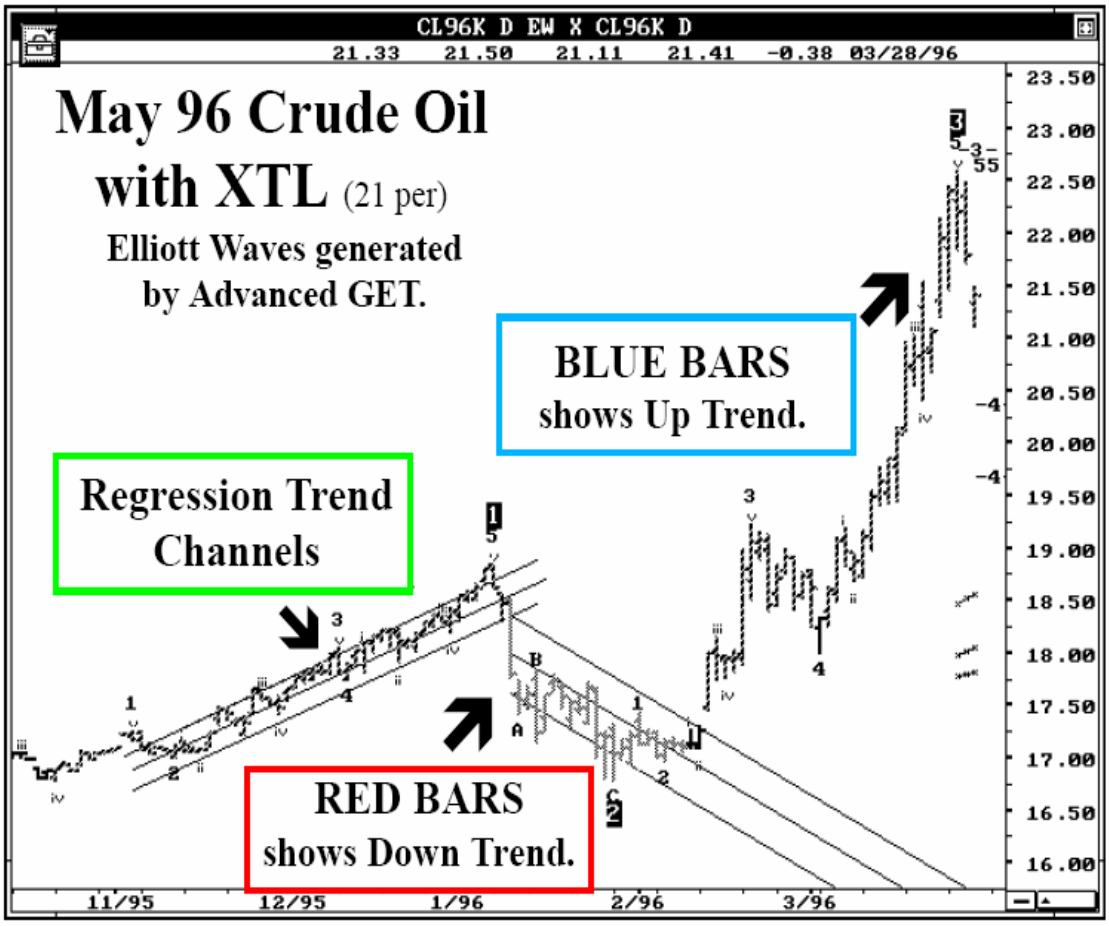
برای بحث در مورد این مساله باید گفت که بازاری است که در آن ترید کردن در یک روش تصادفی اسـت. در صورتی که شما در این بازار با استفاده از ترندی که این سیستم به شما می‌دهد ترید انجام دهید، شما باید **Buy** در نقاط **High** انجام داده **Sell** در **Low** انجـام دهید. ترندی که براساس مدل گفته شده ایجاد می‌شود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

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

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

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

ما یک مدل آماری را ایجاد کردیم که به صورت تصادفی اطلاعات داده شده را بررسی می‌کند. مدل مشابه یک تست برای موارد تصادفی می‌باشد (در کتاب‌های آماری پیشرفته بیابید). مدل آماری ما ارزشی معادل ۰ و ۱ برای اطلاعات داده شده محاسبه می‌کند. (۰ به طور کامل تصادفی است و ۱ کاملا biased) به علاوه ما همچنین راهی برای اندازه‌گیری سطوح آستانه یافتیم. اگر آزمایش ما برای اطلاعات داده شد تصادفی شده از این آستانه بالاتر بود ما انتظار خواهیم داشت که بازار به صورت بالقوه حرکت کند یا تریدی همراه با یک bias در مراحل اولیه یک ترند ماژور صورت خواهد پذیرفت.
زمانی که یک bias رو به پایین یا ترند رو به پایین یافت می‌شود ستون‌ها به رنگ قرمز می‌شوند و زمانی که bias رو به بالا یا ترند رو به بالا یافت می‌شود ستون‌ها به رنگ آبی می‌شوند. اگر ترند نه به سمت بالا و نه به سمت پایین باشد ستون‌ها به رنگ سیاه دیده می‌شوند.



قابلیت جابه‌جایی

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

سازگاری با آنالیزور موج الیوت:

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

طراحی برای استفاده از XTL:

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

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

تنظیمات XTL:

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

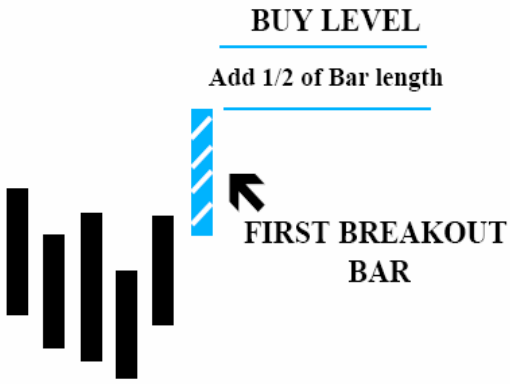
بنابراین با وجودی که XTL با دوره ۳۵ سیگنال‌های خطای کمتری ایجاد می‌کند، XTL با دوره ۲۱ ترند ماژور را یک یا دو میله زودتر شناسایی می‌کند.

استفاده از هر کدام از تنظیمات (دوره ۳۵ یا ۲۱) بستگی به سلیقه شخصی شما دارد. بهترین راه برای تصمیم‌گیری برای بهترین تنظیم استفاده آزمایشی و گرفتن تست بر روی اطلاعات گذشته و یافتن تنظیمی که با اصول ترید شما متناسب باشد، است.

همچنین ما مثال‌هایی را پیوست کرده‌ایم که از هر دو تنظیم استفاده شده تا نتایج و اشکال آن‌ها را با هم توضیح دهد.

چگونگی استفاده از XTL:

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



اولین میله که رنگش تغییر می‌کند **اولین میله شکست** نامیده می‌شود.

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

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

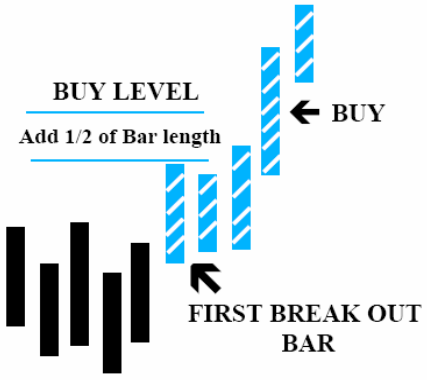
الف) XTL نباید یک میله، با رنگ مخالف ترند داشته باشد. در مورد بالا Buy با یک سیگنال ترند بالایی ایجاد شده است. بنابراین شما نباید میله قرمز رنگی را قبل از نفوذ به سطح Buy ببینید. **میله‌های سیاه (Neutral) مشکل ندارند و استراتژی را مخدوش نمی‌کنند.**

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

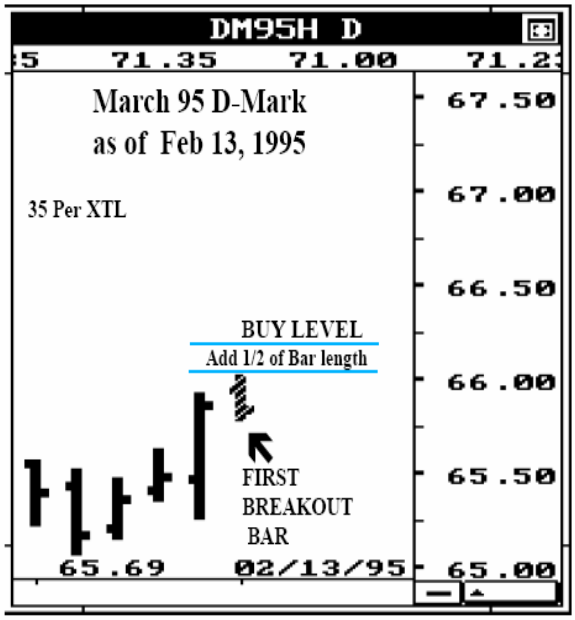
ما پیشنهاد می‌کنیم که نصف طول میله قطع کننده را اضافه کنید. لطفا با آزادی کامل یک تست در حالت آزمایشی بگیرید و بهترین طولی را که برای شما مناسب‌تر است بیابید.

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

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



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



شکل بالا نمودار مربوطه به مارس ۹۵ در مورد D-Mark می‌باشد. که از ۱۳ فوریه می‌باشد. ابزار XTL یک حالت بالقوه در بازار را نشان می‌دهد.

این میله با رنگ آبی نشان دهندهٔ ترنر رو به بالا می باشد همچنین این میله به عنوان اولین میله قطع کننده نامیده می‌شود.

اکنون نصف ارتفاع این میله قطع کننده را جهت بدست آوردن سطح Buy محاسبه می‌کنیم.

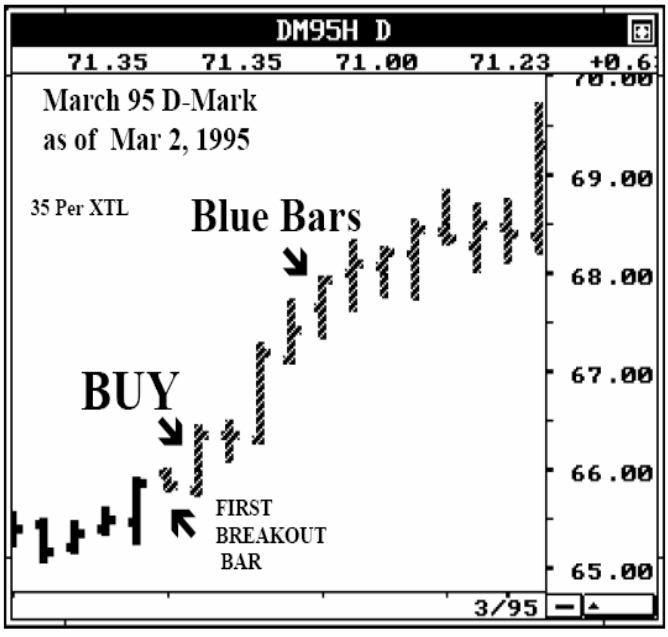
در زمان اولین میله قطع کننده، XTL نباید:

۱) موردی بر خلاف ترند را داشته باشد.

۲) استاپ نباید Taken Out شده باشد.

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

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



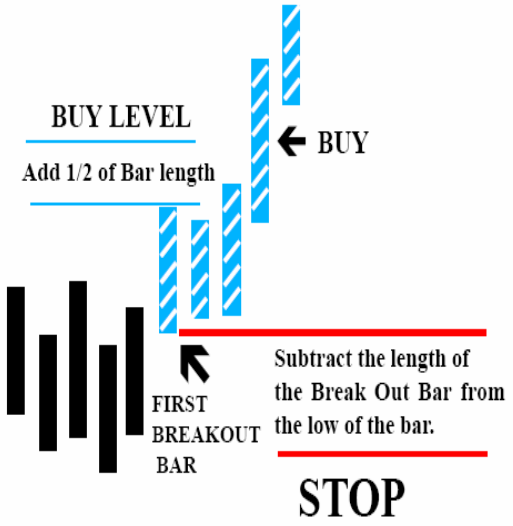
نکته: قبل از حرکت بازار به سمت سطح Buy ممکن است میله‌های سیاه دیده شود. **میله‌های سیاه استراتژی را مخدوش نمی‌کنند.**

استفاده از استاپ:

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

ما پیشنهاد می‌کنیم که آزمایش کنید و یک روش استاپ که با استراتژی و استیل شما هماهنگ است بیابید.

اگر احساس می‌کنید که استاب بسیار کوچک است می‌توانید از ۲ برابر طول میله قطع کننده استفاده کنید. در مقابل اگر احساس می‌کنید که استاپ خیلی بزرگ است در آن زمان می‌توانید از نصف طول میله قطع کننده استفاده کنید.



برای مثال: میله قطع کننده در محدوده High=۷۶۵۰ و Low=۷۶۳۰ قرار دارد. بنابراین طول میله قطع کننده ۲۰=(۷۶۳۰-۷۶۵۰) می‌باشد.

سیگنال بای ترند روبه بالا

برای بدست آوردن سطح Buy شما باید ۱/۲ طول میله قطع کننده را بیابید. در این مورد ۱/۲ ارتفاع میله قطع کننده =(۲۰*۰/۵)=۱۰ می‌باشد. این عدد را به High میله قطع کننده اضافه کنید تا سطح Buy بدست آید =(۷۶۵۰+۱۰)=۷۶۶۰

برای بدست آوردن سطح استاپ شما باید طول میله قطع کننده را از Low آن کم کنید =(۷۶۳۰-۲۰)=۷۶۱۰ که این عدد استاپ پیشنهادی ما می‌باشد.

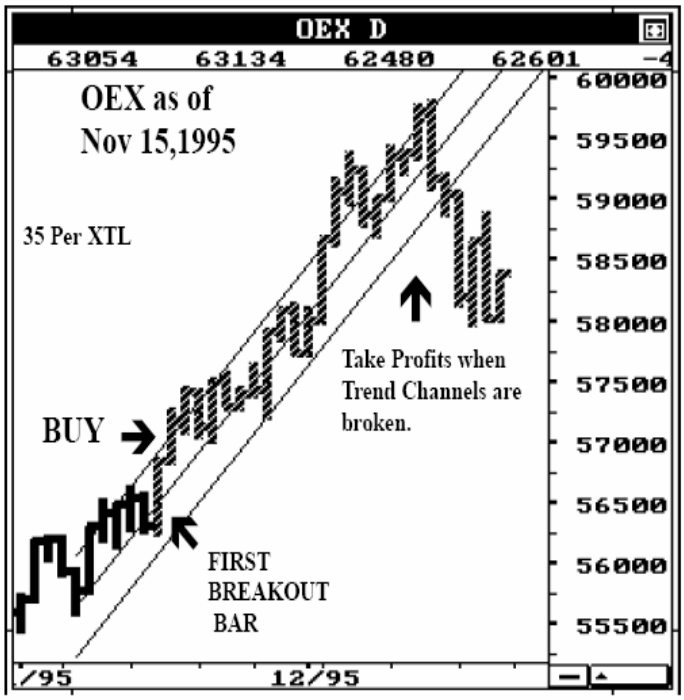
سیگنال‌های سل ترند رو به پایین

برای سیگنال‌های ترند رو به پایین شما باید درست برعکس عمل کنید. از مثال بالا استفاده کنید، ۱/۲ طول میله قطع کننده ۱۰ پوینت می‌باشد. این عدد را از Low میله قطع کننده کسر کنید تا سطح Sell بدست آید =(۷۶۳۰-۱۰)=۷۶۲۰

برای بدست آوردن استاپ پیشنهادی ما شما باید طول میله قطع کننده را با High آن جمع کنید =(۷۶۵۰+۲۰)=۷۶۷۰ این نقطه استاپ پیشنهادی ما است.

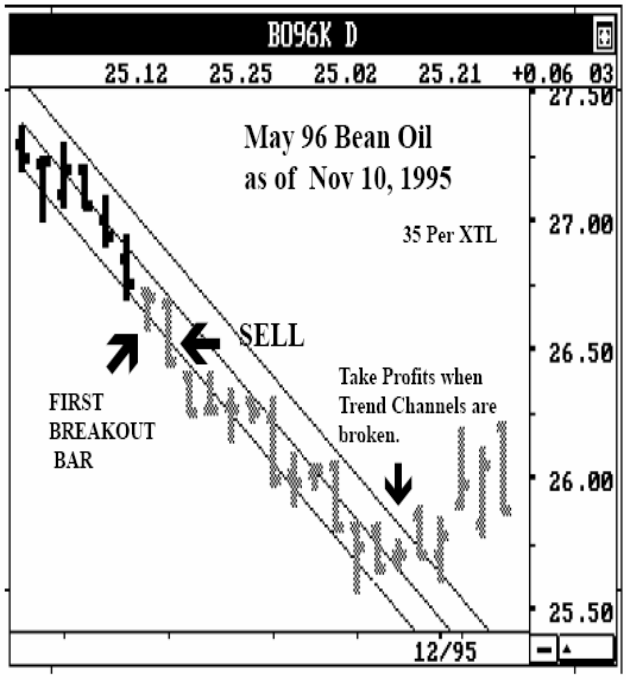
حد سود

حد سود جایی است که از یک تریدر به تریدر دیگر متفاوت است. به هر حال زمـانی کـه تصمیم می‌گیرید که در مورد سود فکر کنید ما پیـشنهاد مـی‌کنـیم کـه از ابـزار GET پیشرفته در کانال رگرسیون ترند استفاده کنید. شما می‌توانید از آن براساس حالت ثابـت و اتوماتیک یا از پیوت قبلی استفاده کنید. این کانال‌ها برای ماندن با ترنـد بـازار بـسیار عالی است.



یکی از قدرت‌های بالای این کانال رگرسیون ترند کمک به ماندن با ترند بازار است. زمـانی کـه ترنـد بـازار کانـال‌هـا را قطـع مـی‌کنـد معمولاً علامتی دال بر پایان ترند است.

با این فکر ما پیشنهاد مـی‌کنـیم که حد سود زمانی است که کانال توسط قیمت شکسته می‌شود.

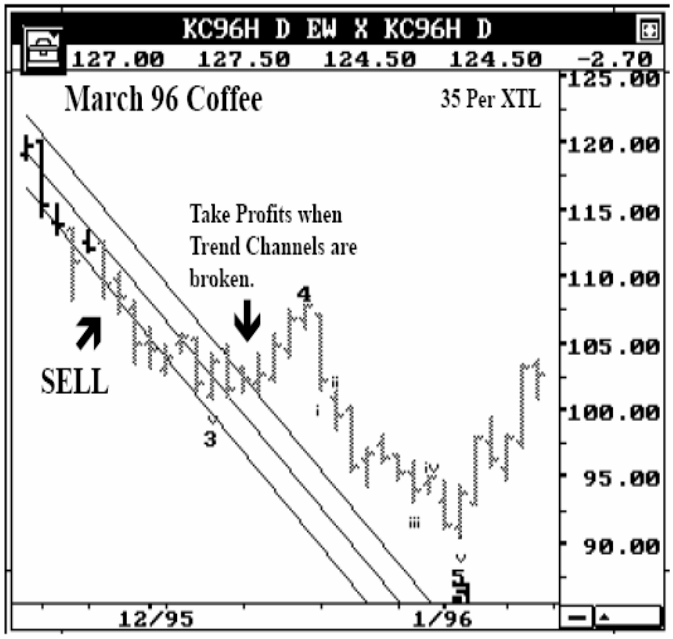


ابزار XTL همچنین می‌تواند بـرای شناسایی ترنـد رو بـه پـایین مـاژور مورد استفاده قرار گیرد. مثال نشان داده شده مربـوط بـه Bean Oil در می ۹۶ می‌باشد.

در همـین زمـان نیـز مـا پیـشنهاد می‌کنیم که سود باید در زمانی کـه قیمت کانال رگرسیون ترند را قطع می‌کند حاصل شود.

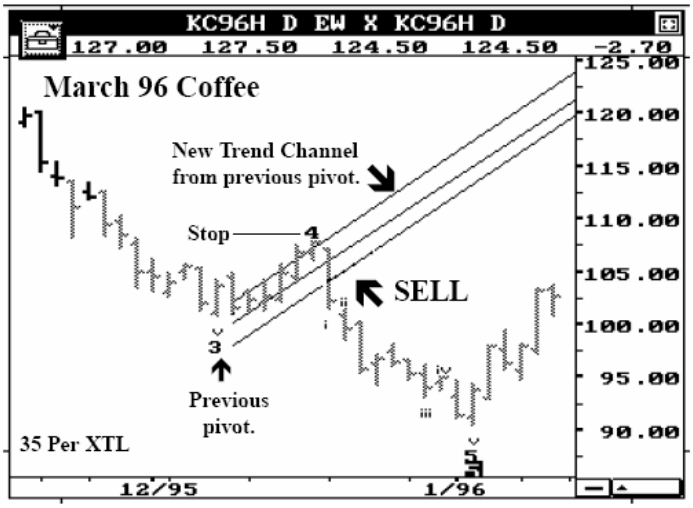
ادامه ترید (ماندن در ترید):

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



پیش‌بینی ایـن مـساله کـه یک شکست در کانال ترنـد یک تغییر واقعـی در ترنـد است یا فقـط یـک تغییـر موقت است بسیار مـشکل است. ما توصیه می‌کنیم که در این شرایط سود را کسب کنید. اگر ترند اولیه ادامـه یافت شما می‌توانید ماننـد زیر دوباره وارد بازار شوید.

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



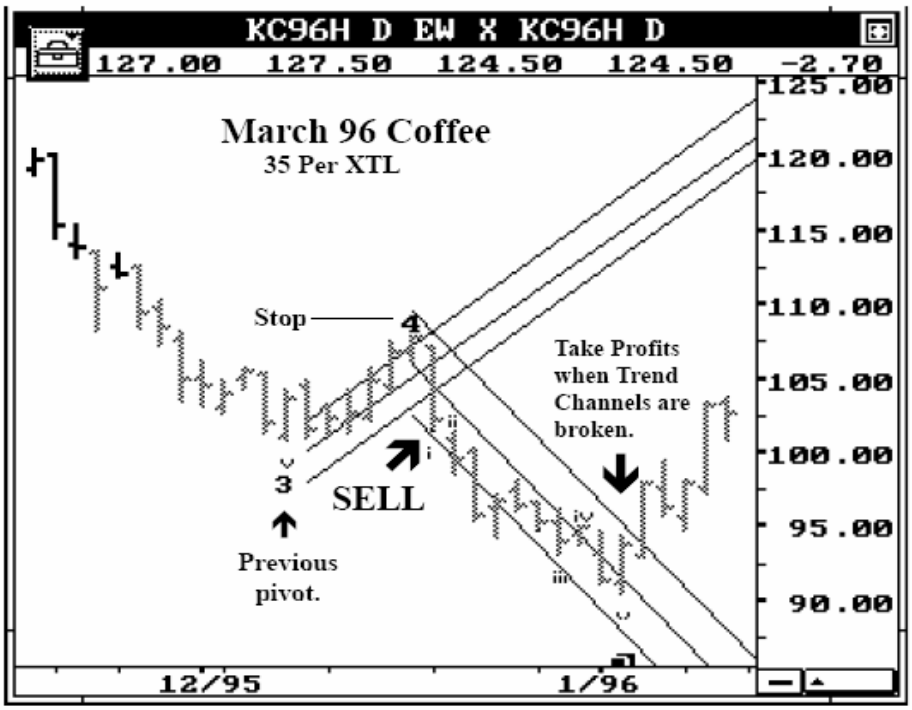
نقطهٔ ورود محل شکـسته شدن کانال ترند می‌باشد.

راهنما جهت ادامه ترند:

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

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

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

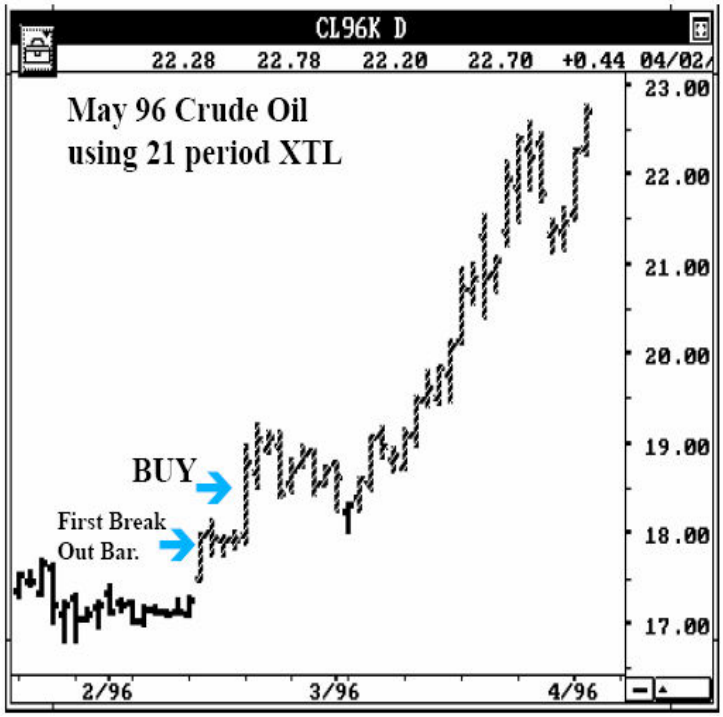


ترید جدید:

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

استفاده از تنظیمات متفاوت برای XTL

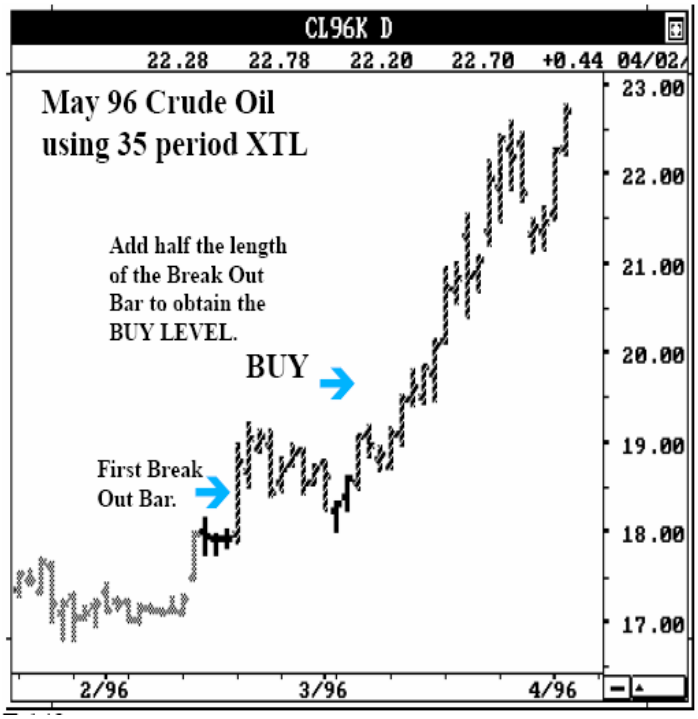
در این صفحه ما تفاوت استفاده از دوره‌های ۲۱ در XTL با دوره‌های ۳۵ آن را نشان خواهیم داد. از XTL با دوره‌های ۲۱ برای ورود زودتر در بازار استفاده می‌شود. به هر حال اشکال اساسی در استفاده از تنظیمات دوره ۲۱ تعدادی سیگنال خطا است، که در صفحه بعد نشان داده شده است.



استفاده از XTL با دورهٔ ۲۱:

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

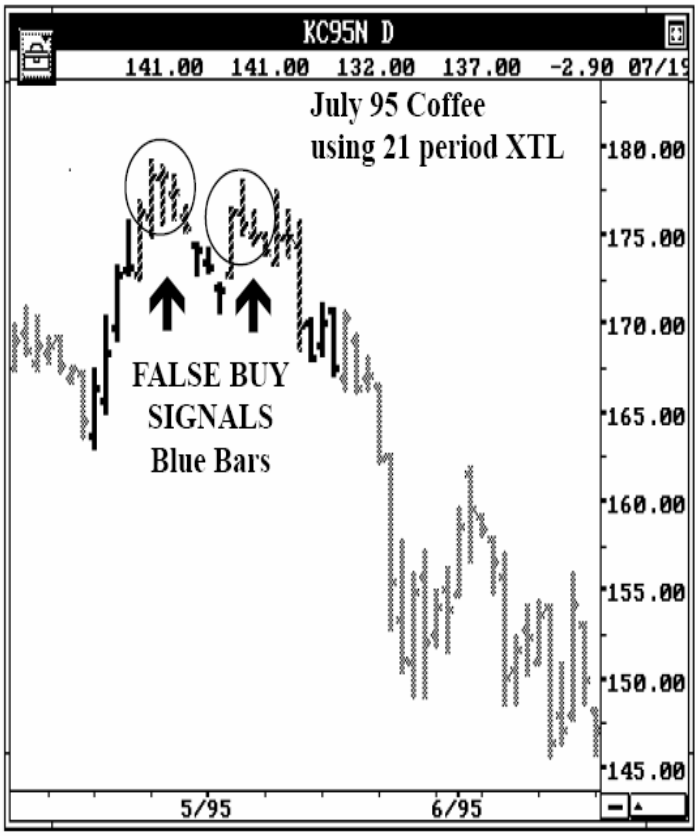
این حالت می‌تواند همچنین تعدادی سیگنال خطا که در صفحه بعد نشان داده شده را ایجاد کند.



استفاده از XTL با دوره ۳۵:

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

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

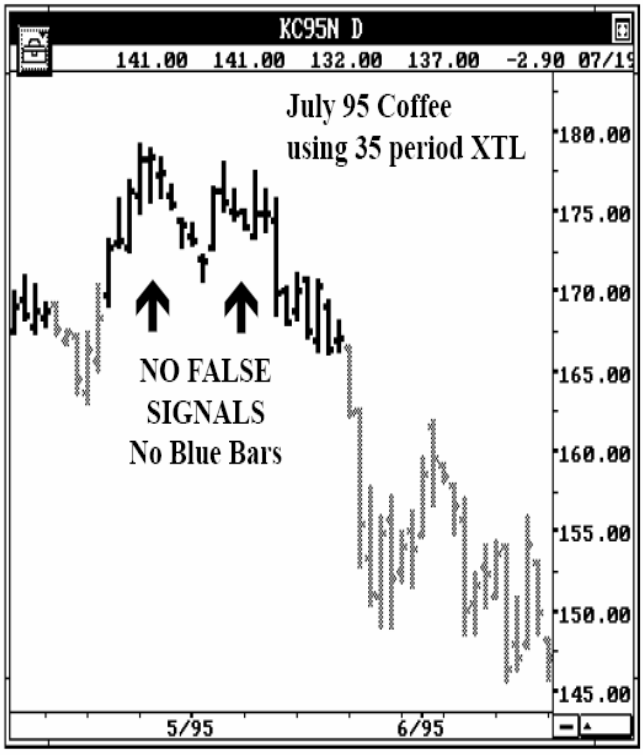


استفاده از XTL با دوره ۲۱:

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

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

اشکال اساسی در استفاده XTL با دوره ۲۱ پتا نسیل بالقوه برای سیگنال‌های خطا می باشد.

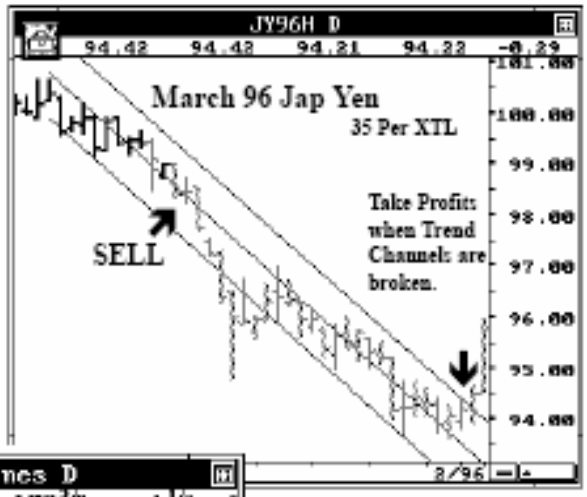


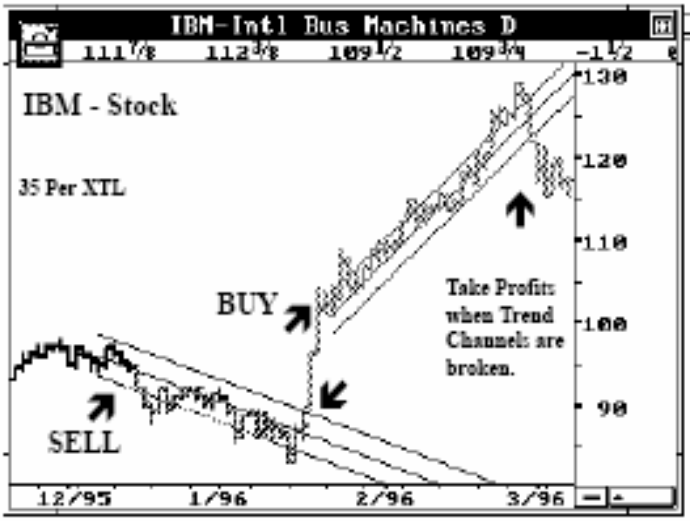
استفاده از XTL با دورهای ۳۵:

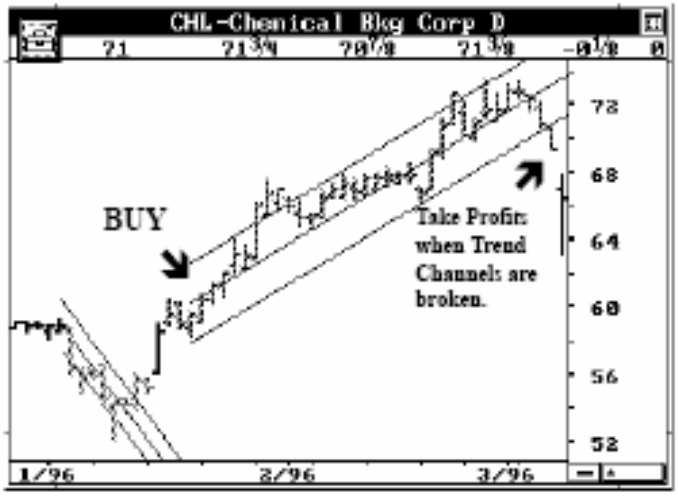
استفاده از XTL با دورهای ۳۵ مانع از سیگنال‌های خطا می‌شود. این مساله مهمترین فایده در استفاده از XTL با دوره ۳۵ می‌باشد.

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

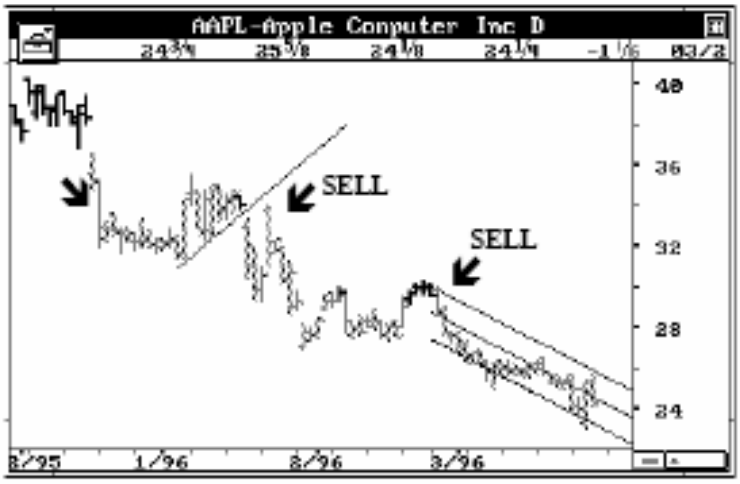
Examples on using XTL





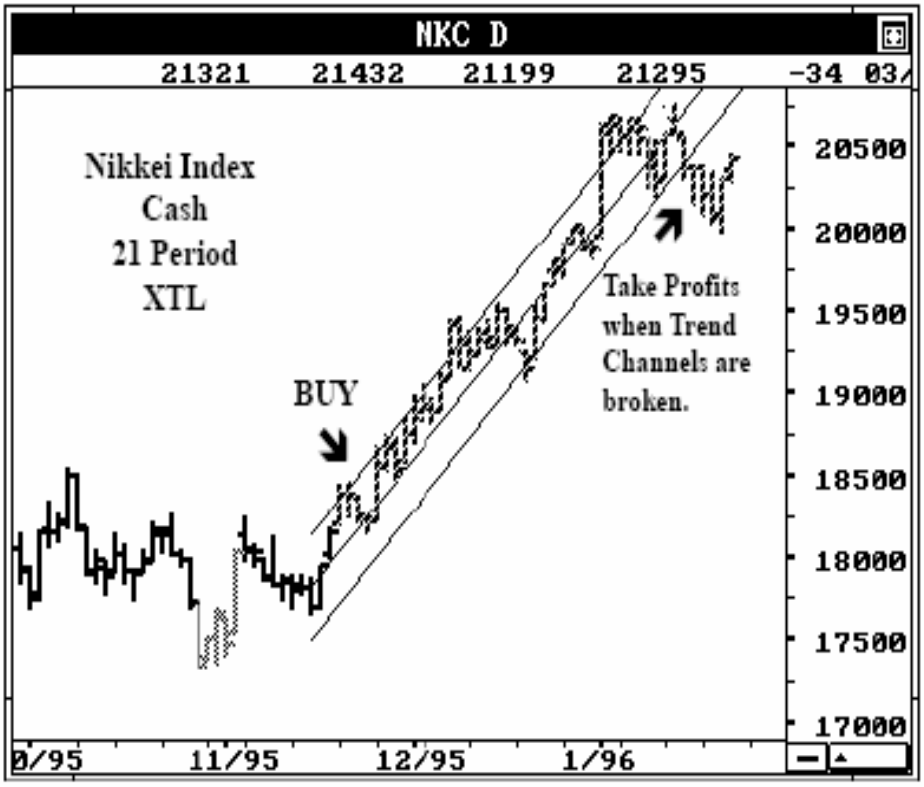


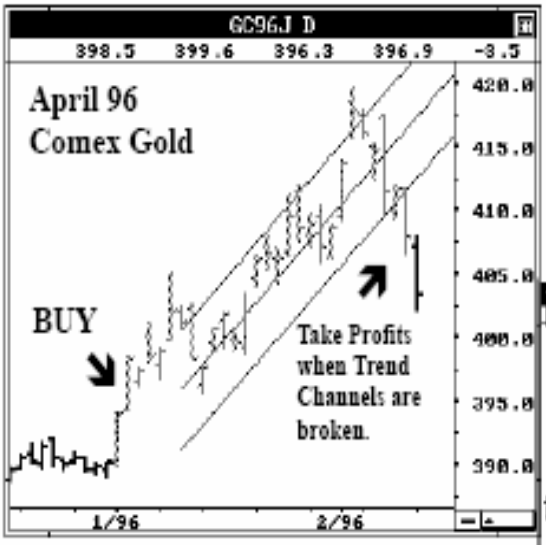
Chemical Bank-Stock
35 Period XTL

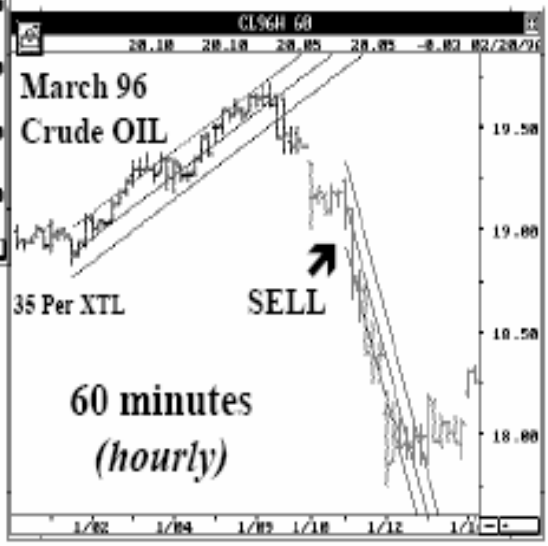


Apple Computer
35 Period XTL

March 96
German Bunds
35 Period XTL


NKC D
21321 21432 21199 21295 -34 03/
Nikkei Index
Cash
21 Period
XTL
BUY
Take Profits
when Trend
Channels are
broken.
20500
20000
19500
19000
18500
18000
17500
17000
0/95
11/95
12/95
1/96

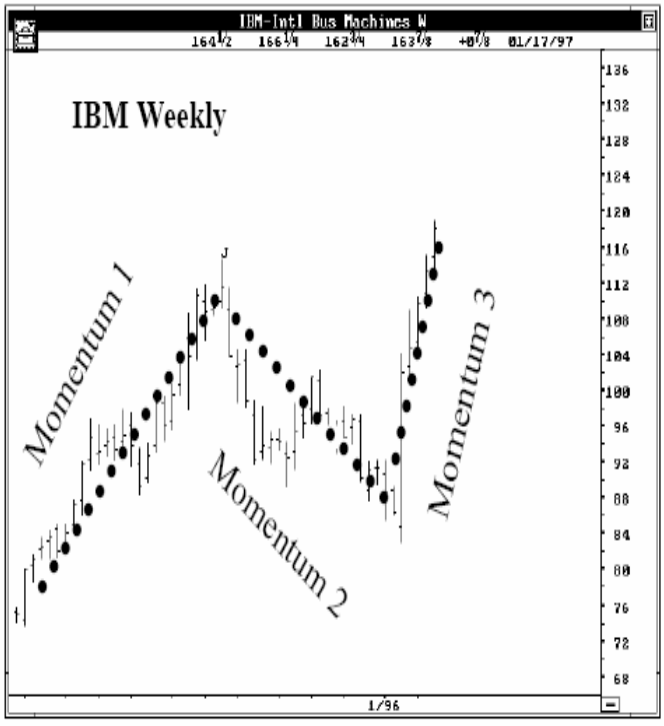

GC96J D
398.5 399.6 396.3 396.9 -3.5
April 96
Comex Gold
BUY
Take Profits
when Trend
Channels are
broken.
420.0
415.0
410.0
405.0
400.0
395.0
390.0
1/96
2/96


CL96H 60
March 96
Crude OIL
35 Per XTL
SELL
60 minutes
(hourly)
19.50
19.00
18.50
18.00

مطالعه MOB (شکست یا برگشت) با بازه‌های زمانی بازار

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

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

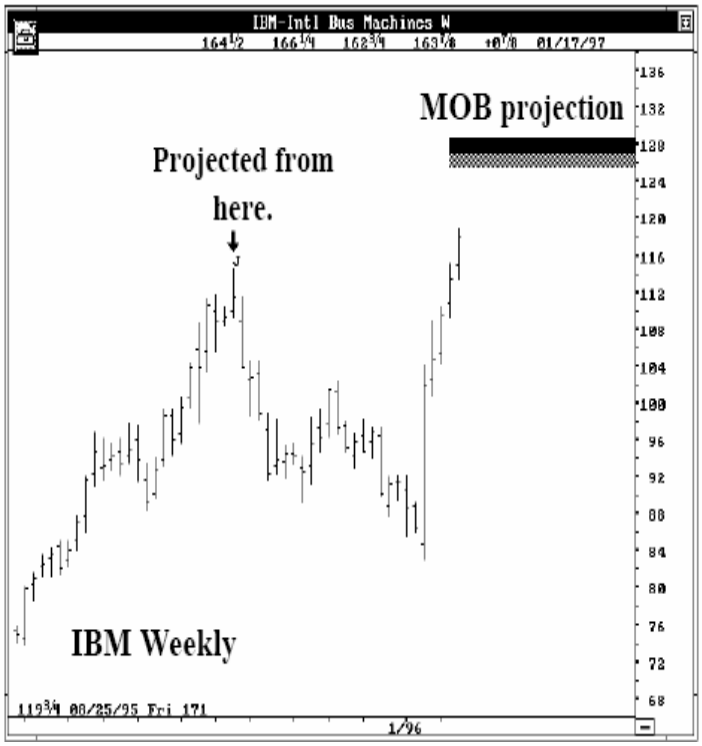


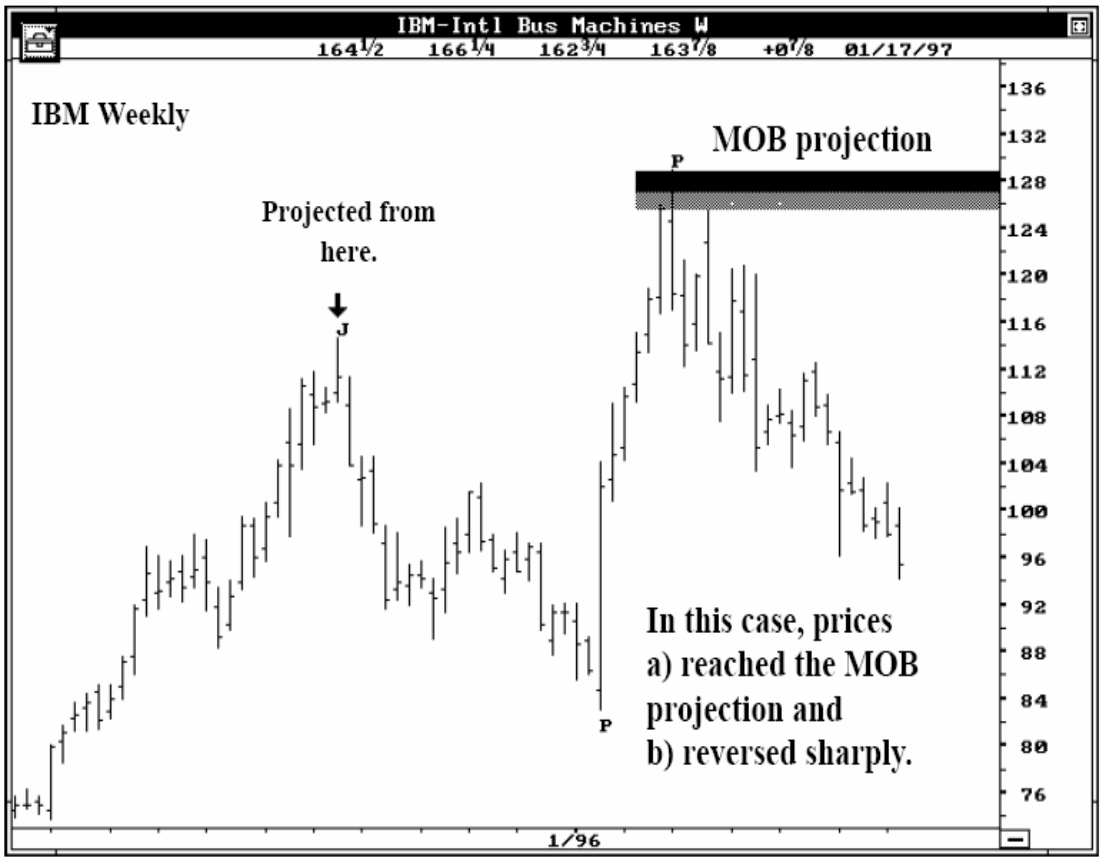
نمودار هفتگی IBM در سمت چپ نشان داده شده است. نوسانات متفاوت براساس ارزش‌های مومنتوم مجزا تحت عنوان مومنتوم ۱ و ۲ و ۳ چیده شده‌اند.

با به کار بردن نسبت این مومنتوم‌های متفاوت GET پیشرفته یک منطقهٔ پیش‌بینی قیمت را محاسبه می‌کند.

پیش‌بینی قیمت می تواند یک مقاومت اصلی برای رالی قیمت بوجود آورد.

۱) قیمت می‌تواند به سمت **MOB** پیش‌بینی شده رالی داشته باشد.
۲) تقریباً ۷۰٪ از زمان‌ها قیمت به سمت **MOB** پیش‌بینی شده حرکت می‌کند و بر می‌گردد.
۳) در زمان استراحت، قیمت‌ها به قیمت **MOB** پیش‌بینی شده می‌رسند و ترید با یک مومنتوم قوی ادامه می‌یابد. از این رو به آن **Make** یا **Break** می‌گویند. قیمت‌ها یا بر می‌گردند یا با افزایش مومنتوم ادامه می‌یابند.

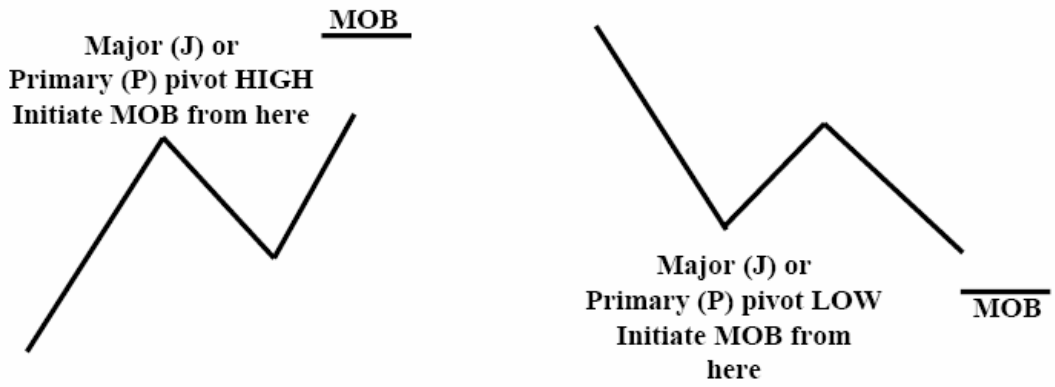




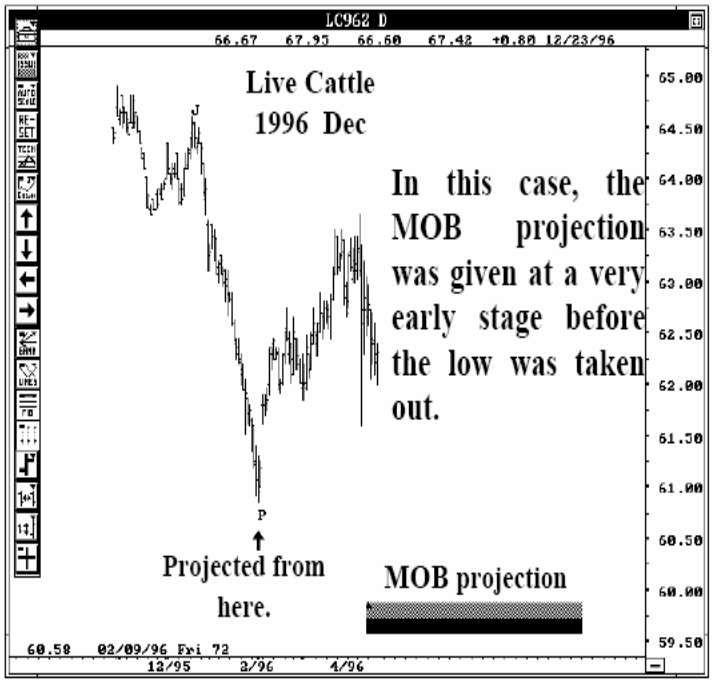
منطقه پیش‌بینی قیمت براساس مومنتوم نوسان جدید و دو نوسان قبلی مشخص می‌شود.

کجا باید محاسبه MOB را قرار داد: ساده‌ترین راه این است که محاسبه **MOB** از یک پیوت قبلی (اولیه یا ماژور) شروع شود. در مثال بالا در مورد نمودار هفتگی **IBM** سطوح **MOB** از یک پیوت ماژور شروع شده است. پیوت‌ها می‌توانند بوسیله نرم‌افزار و انتخاب ابزار پیوت محاسبه شده و اجرا شوند.

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



مثال MOB با امواج الیوت

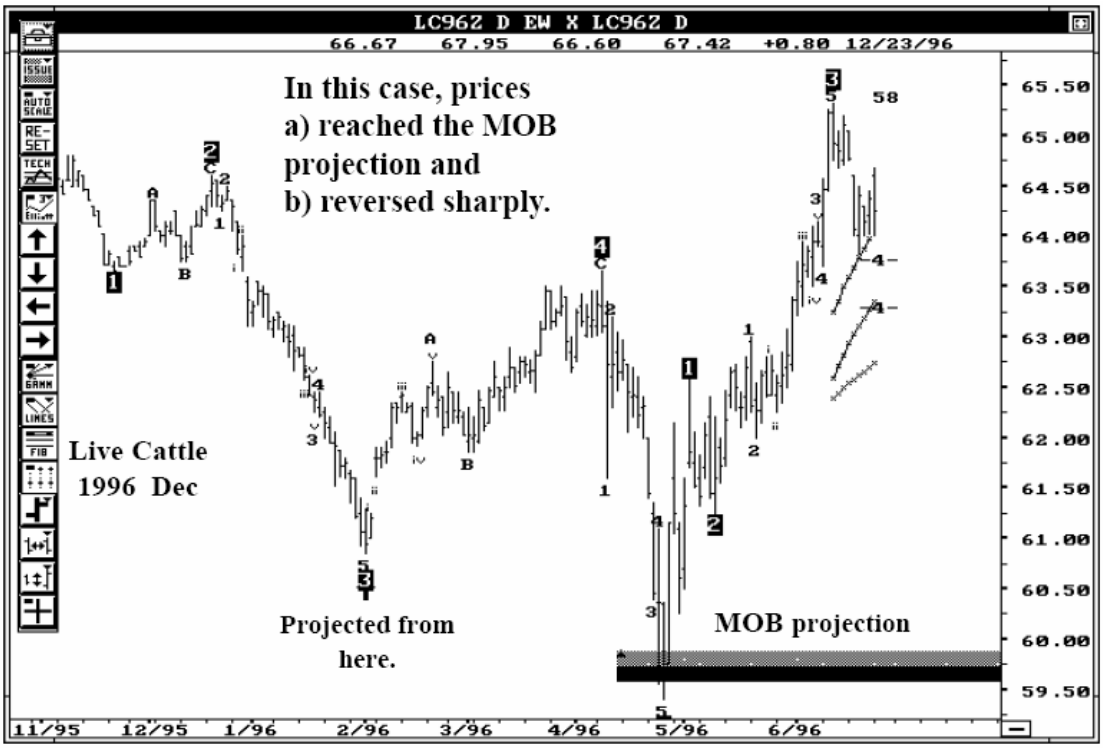


نمودار روزانه **Live Cattle** برای ماه دسامبر ۹۶ در شکل سمت چپ نشان داده شده است.

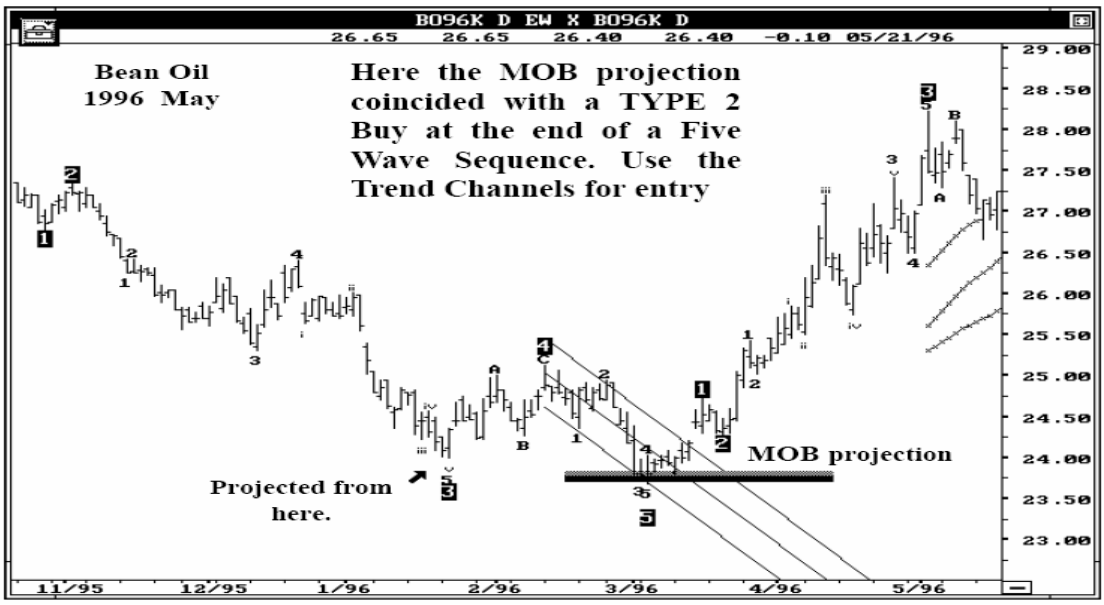
ابزار **MOB** از پیوت **Low** قبلی شروع شده است. با استفاده از نسبت این مومنتوم های متفاوت **GET** پیشرفته منطقه پیش‌بینی قیمت را محاسبه می‌کند.

قیمت پیش بینی شده یک حمایت قوی برای این روند نزولی می‌باشد.

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



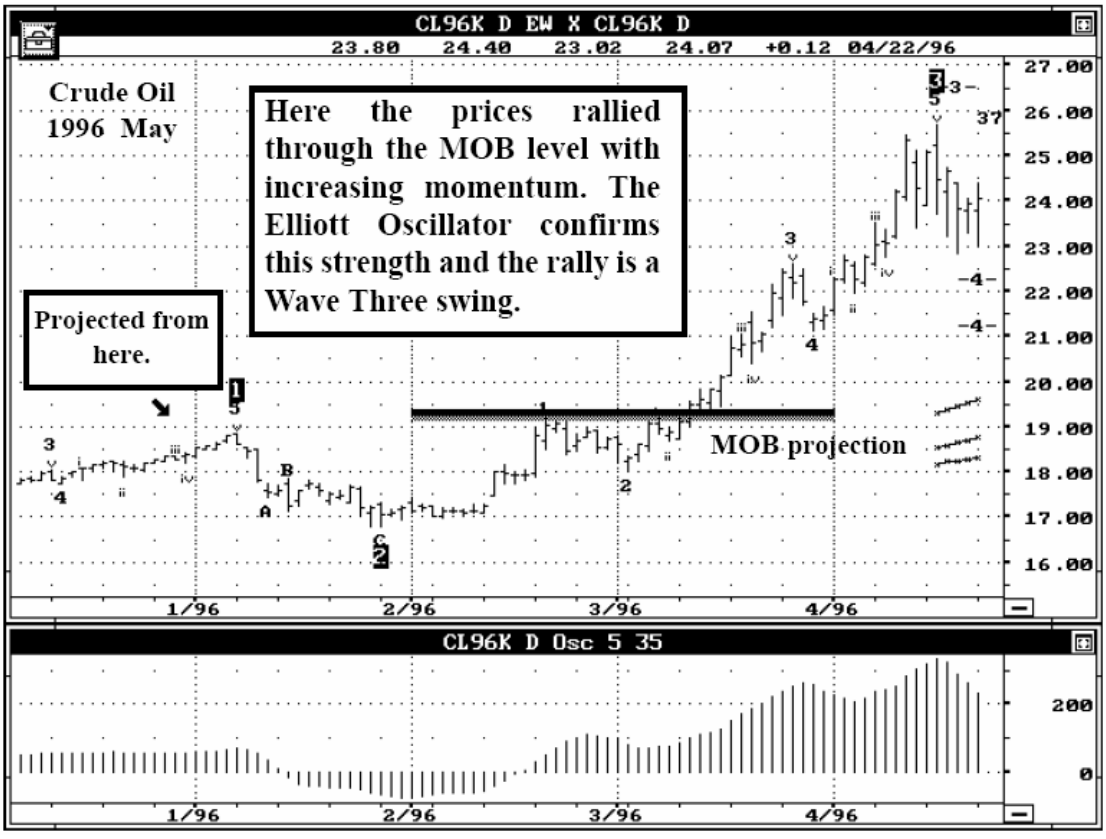
مثال MOB با کانال‌های ترند و امواج الیوت



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

در اینجا بازار یک Buy نوع دوم را بعد از کامل شدن توالی پنج موج ایجاد کرده است. پیش‌بینی MOB نیز یک تایید اضافی با ایجاد یک سطح حمایت قوی ساخته است.
ابزار اضافی دیگر از قبیل کانال‌های رگرسیون ترند می‌توانند جهت ورود کاملا روشن در مسیر ترید به کار برده شوند.
بعلاوه می‌توان از XTL (اکسپرت مشخص کننده ترند) برای اضافه کردن به پوزیشن‌ها زمانی که موج سوم در جریان است استفاده کرد.
ابزار MOB وسیله بسیار قابل اعتمادی است که می‌تواند موارد صحیح ترید را بالا ببرد. زمان‌هایی وجود دارد که پیش‌بینی‌ها موفق عمل نمی‌کنند. در این موارد بازار سطوح MOB را با یک قدرت اضافی می‌شکند. معمولاً این‌ها نوسان موج سوم هستند. فرد می‌تواند با آشنایی با شمارش موج الیوت در این زمان‌ها از این گونه موارد جلوگیری کند. به مثال توجه کنید.

مثال برای زمانی که قیمت‌ها MOB را رد می‌کنند



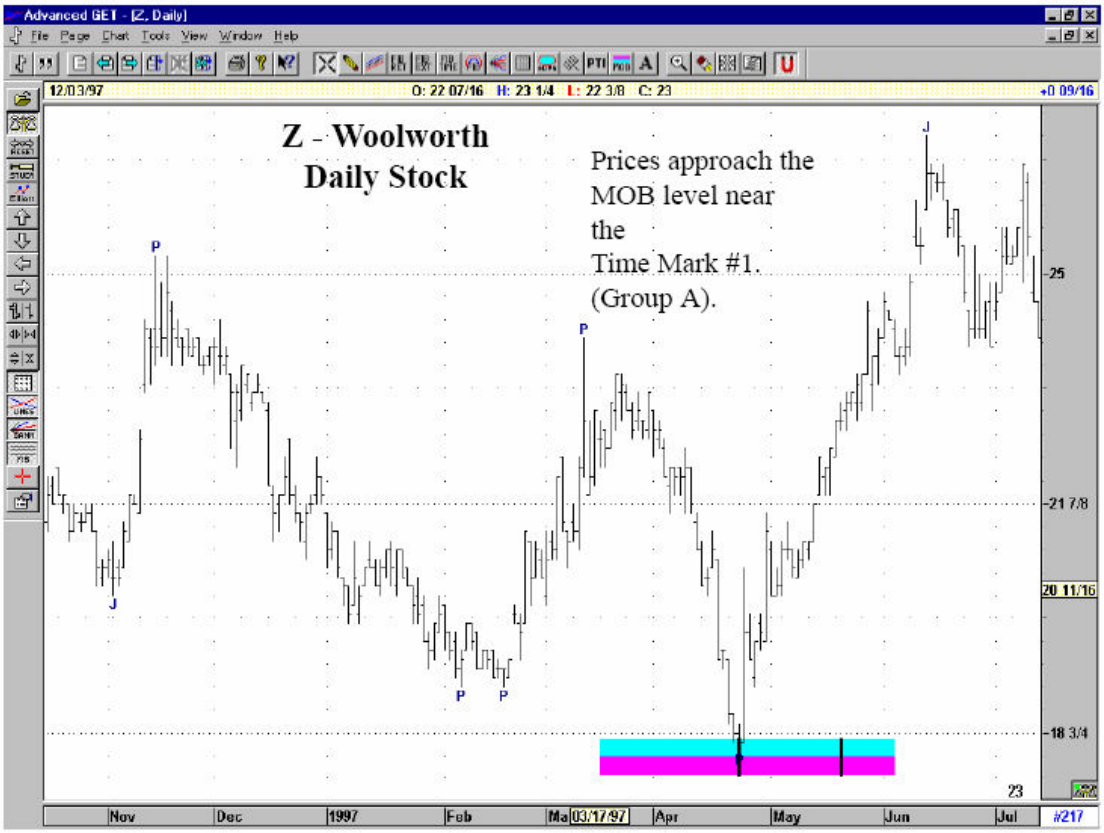
در این شکل پیش‌بینی MOB از پیوت High قبلی بدست آمده است. در این مورد پیوت High قبلی موج اول می‌باشد.
زمانی که قیمت به منطقه پیش‌بینی MOB می‌رسد، در حوالی آن برای مدتی باقی می‌ماند سپس با یک مومنتوم زیاد از آن عبور می‌کند.
این همان دلیلی است که ما نام آن را مطالعه Make یا Break می‌نامیم. هم می‌تواند به منطقه MOB برود و ترند را تغییر بدهد و در موارد دیگر ممکن است با یک مومنتوم زیاد منطقه MOB را رد کند.
در بیشتر موارد جایی که بازار برمی‌گردد یا از میان منطقه MOB عبور می‌کند، ابزارهایی مانند نوسان نمای الیوت می‌تواند برای شناسایی این قبیل شکست‌ها قبل از این که رخ دهند به کار آیند. زمانی که بازار در موج سوم می‌باشد منطقهٔ قیمتی MOB بسادگی به عنوان سطحی است که در آنجا بازار با یک مومنتوم قوی از آن سطح رد می‌شود. همچنین به همین دلیل باید از XTL برای شناسایی این موقعیت‌ها استفاده کرد.

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

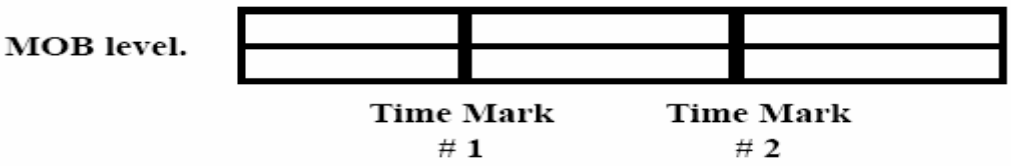
من پیشنهاد می‌کنم که زمانی را صرف این کار کنید تا در آن ماهر شوید. همچنین به ویدئو سمینار ۹۶ نگاه کنید. من چندین روش برای چگونگی استفاده از آن را بحث کرده‌ام.

اضافه کردن علامت‌های زمانی جدید به MOB

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



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



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

علامت‌های زمان

نرم‌افزار دو زمان علامت زده شده را محاسبه می‌کنـد. دو روز یـا دو میلـه (همچنـین در نمودار ۵ دقیقه) وجود دارد که بیشترین تمایل قیمت‌ها برای رسـیدن بـه سـطح MOB پیش‌بینی شده در این زمان‌ها است. در آزمایشات ما مشاهدات زیر را داشتیم.

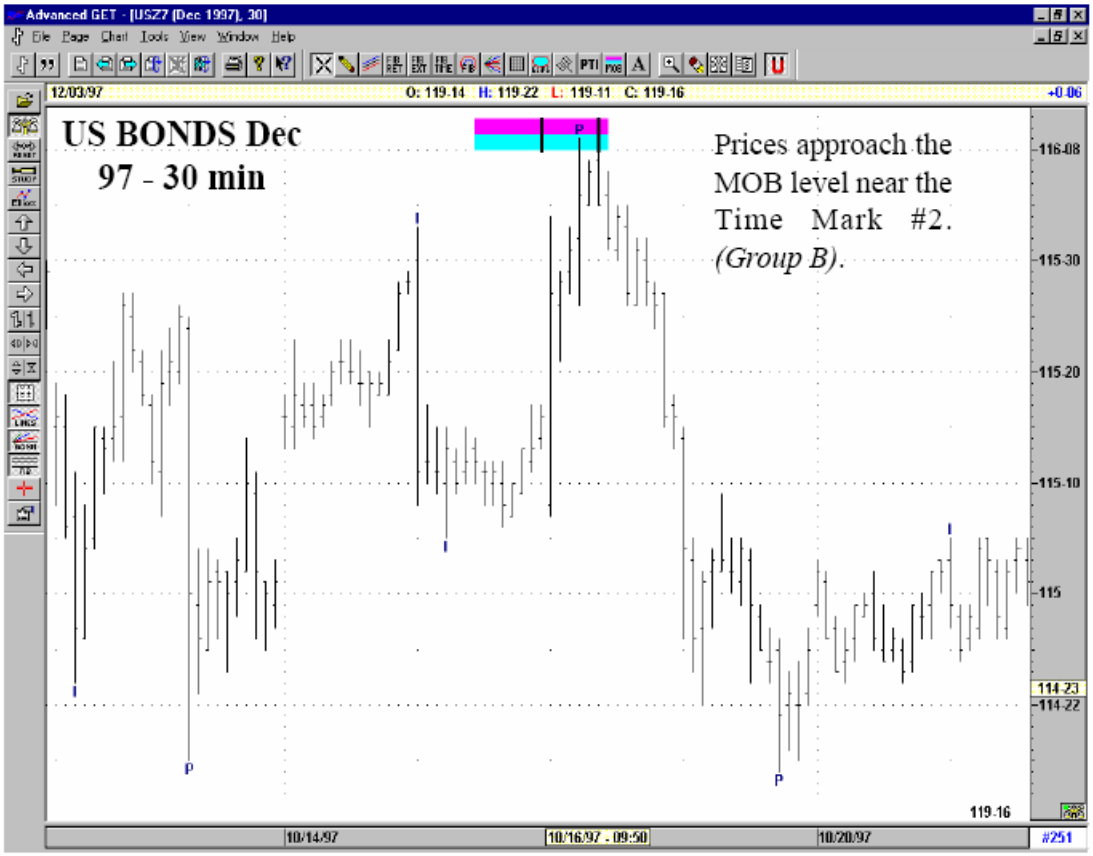
قیمت‌ها در برخورد با سطوح MOB دو گروه می‌شوند.

گروه A تمایل به رسیدن به سطح MOB نزدیک علامت زمانی ۱ دارنـد. در ایـن مـوارد قیمت تمایل دارد که به سطح MOB برخورد کند و نزدیک علامت زمانی ۱ برگشت کند.

مثال در صفحهٔ قبل برای Woolworth نشان دهندهٔ رفتـار قیمـت در سـطح MOB در علامت زمانی ۱ می‌باشد.

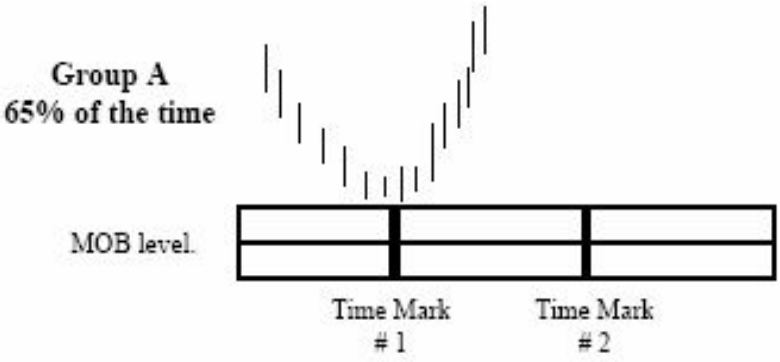
گروه B تمایل دارند که به سطح MOB بین علامت زمانی ۱ و ۲ بـا یـک حرکـت (bias) ناچیز به سمت علامت زمانی ۲ برسند.

مثال زیر را ببینند (نمودار ۳۰ دقیقه‌ای US Bonds)

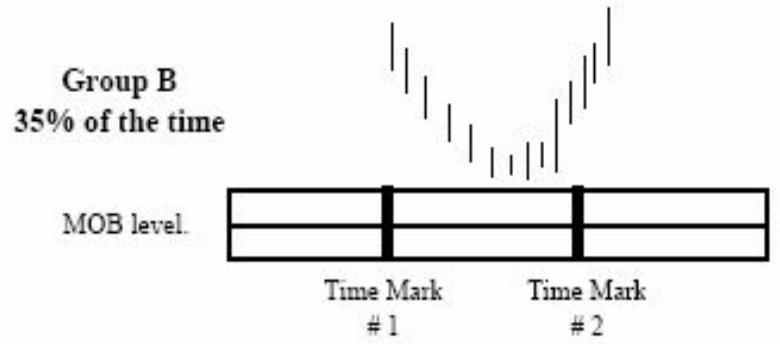


توزیع گروه‌ها

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



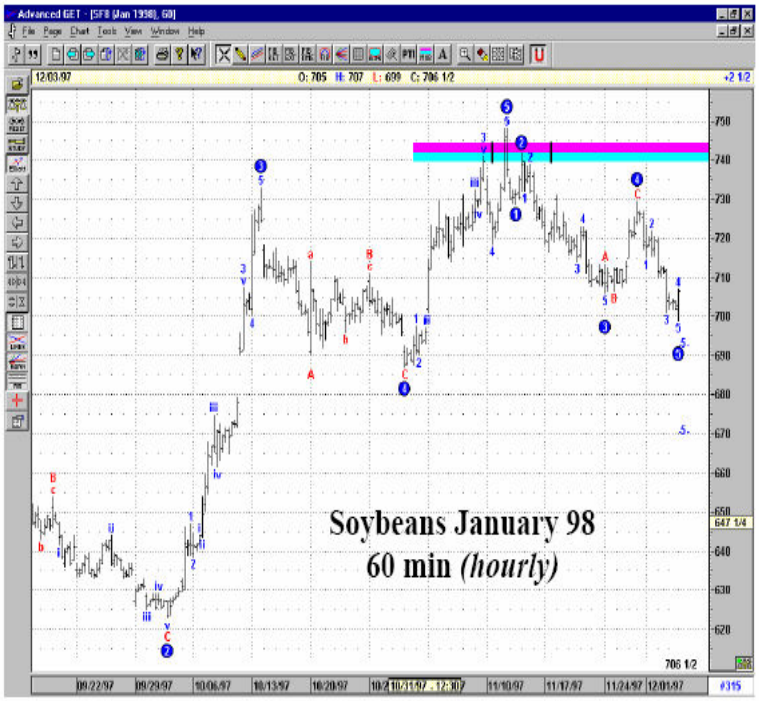
ملاحظات:
در گروه A قیمت‌ها نزدیک علامت زمانی ۱ می شوند(تقریباً در بالای آن).



ملاحظات:
در گروه B قیمت‌ها بین علامت زمانی ۱ و ۲ نزدیک می شوند(با یک حرکت (bias) ناچیز به سمت علامت زمانی ۲)

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

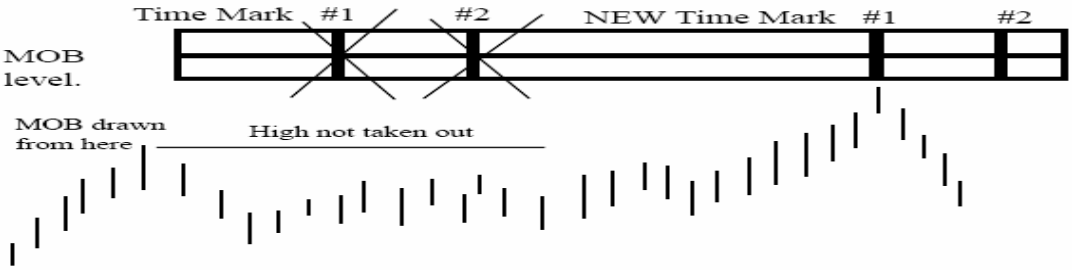
در مثالی که آمده است سطح MOB با مطالعه موج الیوت نشان داده شده است. زمانی که ۵ موج کامل شده است بازار تغییر مسیر داده است. سطح MOB به شناسایی سطوح قیمت که در آنجا تغییر می‌تواند رخ دهد کمک می‌کند. علامت‌های زمان، قالب زمانی را فراهم می‌کنند که ما انتظار بازگشت را داریم.



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

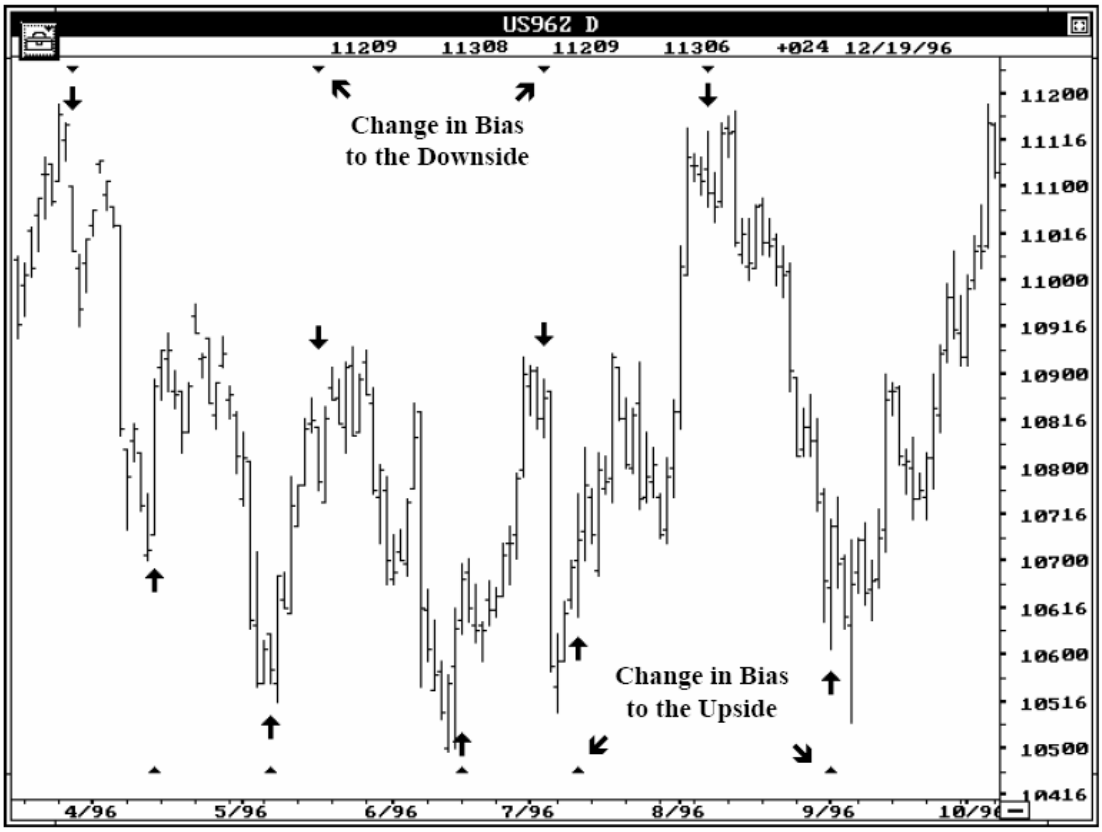
محاسبه مجدد علامت‌های زمانی:

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



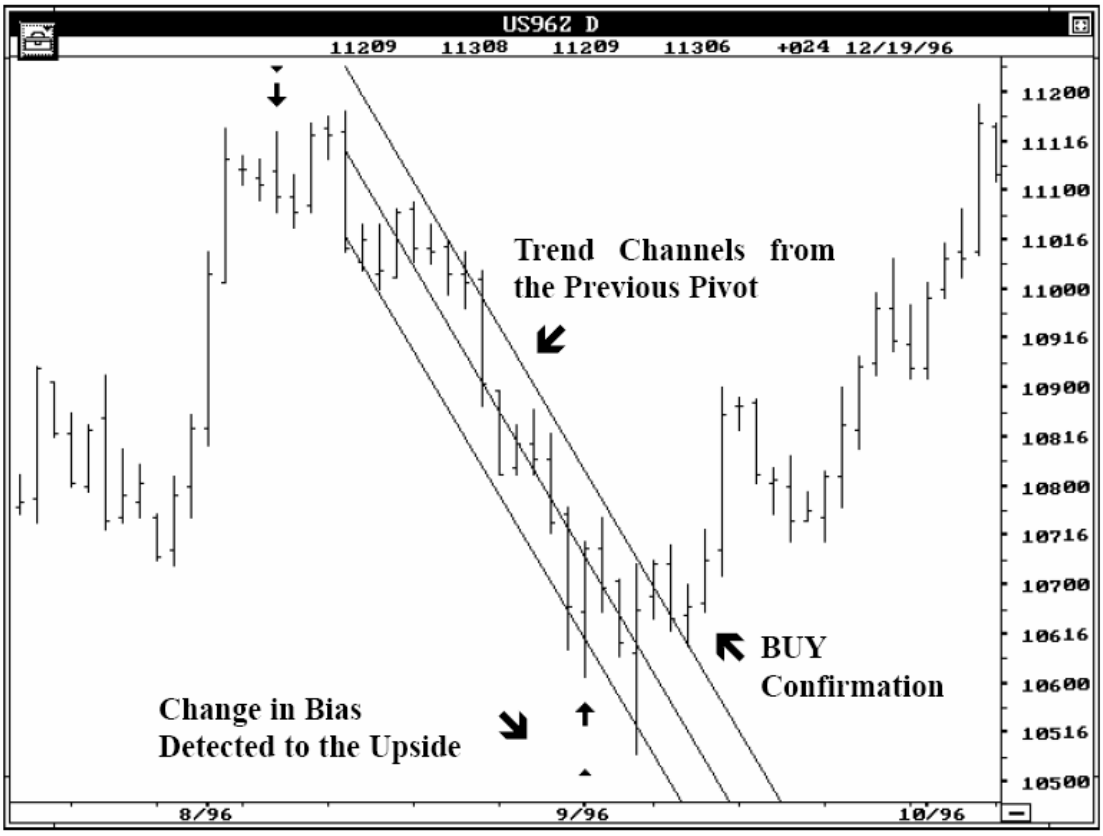
حرکت برگشتی (Bias Reversal)

تحقیقات ما با استفاده از مومنتوم و Volatility قیمت توانسته است مناطقی که در آنجا بازار می‌تواند آماده برگشت قیمت شود را شناسایی کند.
شناسایی اولیه احتمالی برای تغییر در Bias است. بنابراین نام آن Bias برگشتی است.
بازار می‌تواند تغییرات کوچکی در bias داشته باشد ولی هنوز حرکت را در جهت اصلی ادامه دهد. بنابراین زمانی که یک bias برگشتی دیده می‌شود ما نیاز داریم که تغییرات بیشتری در قیمت ببینیم تا سیگنال فوق قطعی شود. این موضوع در صفحه بعدی بحث شده است. زمانی که یک bias یافت می‌شود. نرم افزار یک مثلث رسم می‌کند.
اگر نوک مثلث به سمت بالا باشد پس تغییر در bias به سمت بالا خواهد بود و اگر نوک مثلث به سمت پایین باشد bias به سمت پایین خواهد بود.
نموداری که در زیر نشان داده شده است نمودار US Bonds در دسامبر ۹۶ می‌باشد.
مثلث‌ها تغییرات در bias می‌باشند که بوسیلهٔ GET پیشرفته حاصل شده است.
پیکان‌ها با دست کشیده شده‌اند تا نشان دهند که میله‌های تغییر bias دیده شده است.



Bias Reversal

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



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

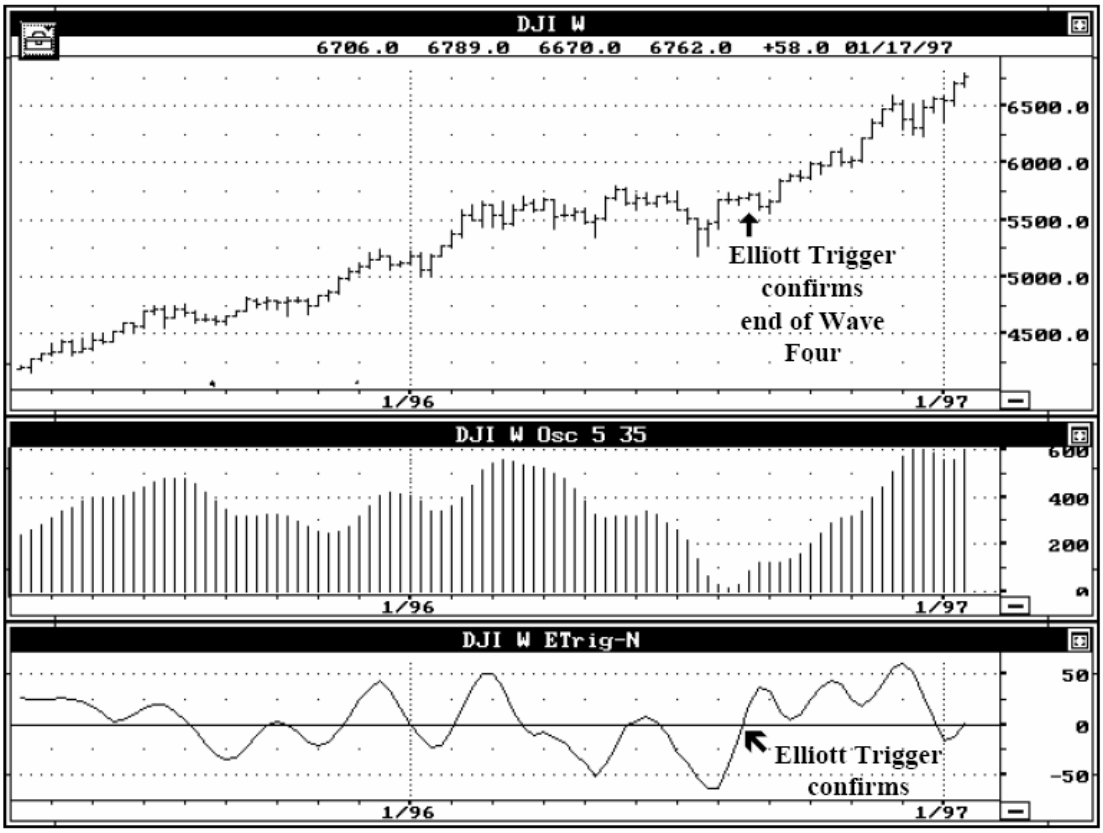
سیگنال‌های خطا: زمانی که تغییر در **bias** دیده می‌شود، نرم‌افزار نیازمند یک یا دو میله برای قطعی کردن سیگنال دارد. اگر قطعی نشد سیگنال فوق خطا تلقی می‌شود و یک خط در زیر یا بالای مثلث رسم می‌شود.

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

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

Elliot Wave Trigger

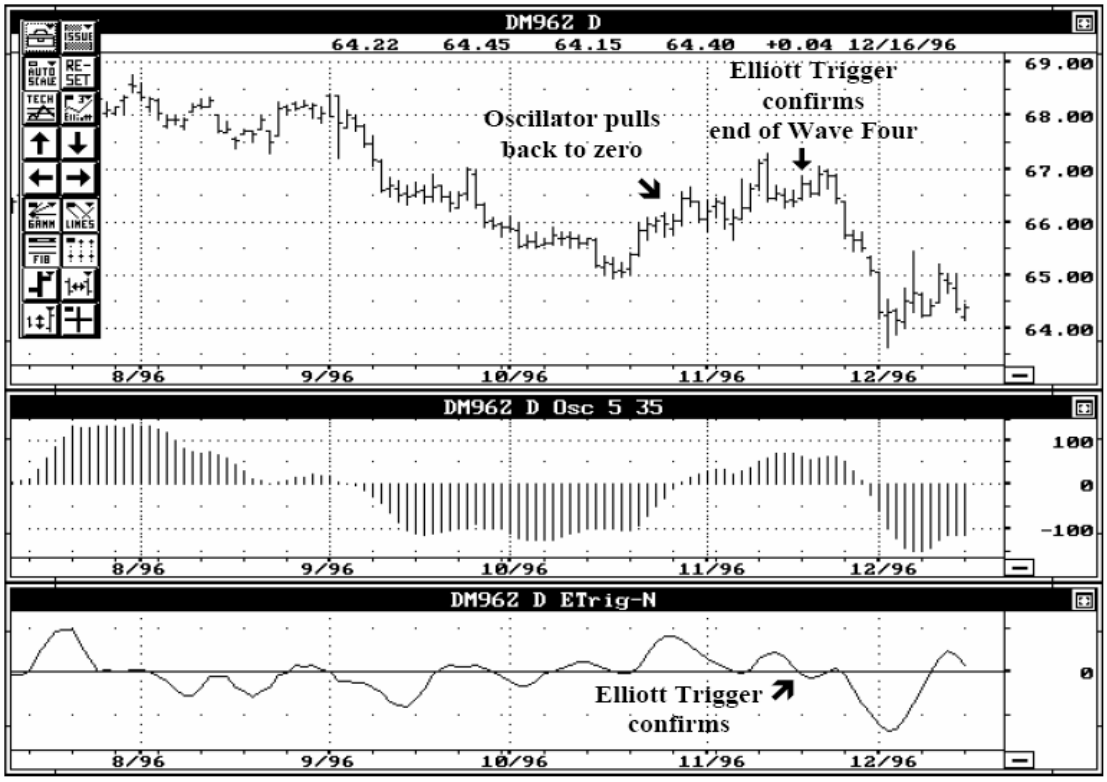
مطالعه EWT برای بالا بردن استفاده از نوسان‌نمای الیوت در پایان اصلاح مـوج چهـارم اضافه شده است. در بسیاری موارد نوسان‌نما به سمت صفر بر می‌گردد و برای زمان زیادی در زیر خط صفر باقی می‌ماند. در این موارد EWT این اطمینان را ایجاد می‌کند که مـوج چهارم کامل شده است.



نمودار هفتگی داو جونز دربالا نشان داده شده است. نوسان‌نمای الیوت ۵/۳۵ بـه سـمت صفر برگشته است. توجه کنید چگونه EWT همچنین زیر خط صـفر اسـت. زمـانی کـه نوسان‌نما به سمت صفر بر می‌گردد منتظر بمانید تا EWT خط صفر را به سمت بالا قطـع کند. این حالت قطعیت زیادی جهت اینکه موج چهارم پایان یافته است می‌باشد.

جایی که این مطالعه بسیار مفید واقع می‌شود در زمانی است که نوسان‌نما به زیر خط صفر می‌رود و برای مدتی آن جا می‌ماند. در این موارد شما به سادگی منتظر بمانید تـا EWT اطمینان لازم را بوسیله حرکت به سمت بالای خط صفر ایجـاد کنـد. صـفحه بعـد مثـال دیگری را نشان می دهد.

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



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

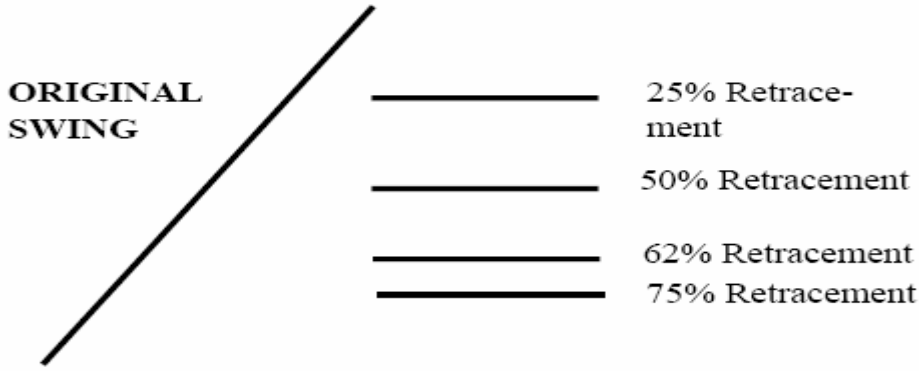
در هر دو مورد منتظر بمانید تا نوسان‌نمای ۵/۳۵ به سمت صفر برگردد قبل از اینکه نوسان‌نمای۵/۳۵ به سمت خط صفر برگردد. ابزار EWT می‌تواند هر وقت که بخواهد خط ضرر را قطع کند. این اتفاق نمی‌افتد.

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

T.J.'s ELLIPSE

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

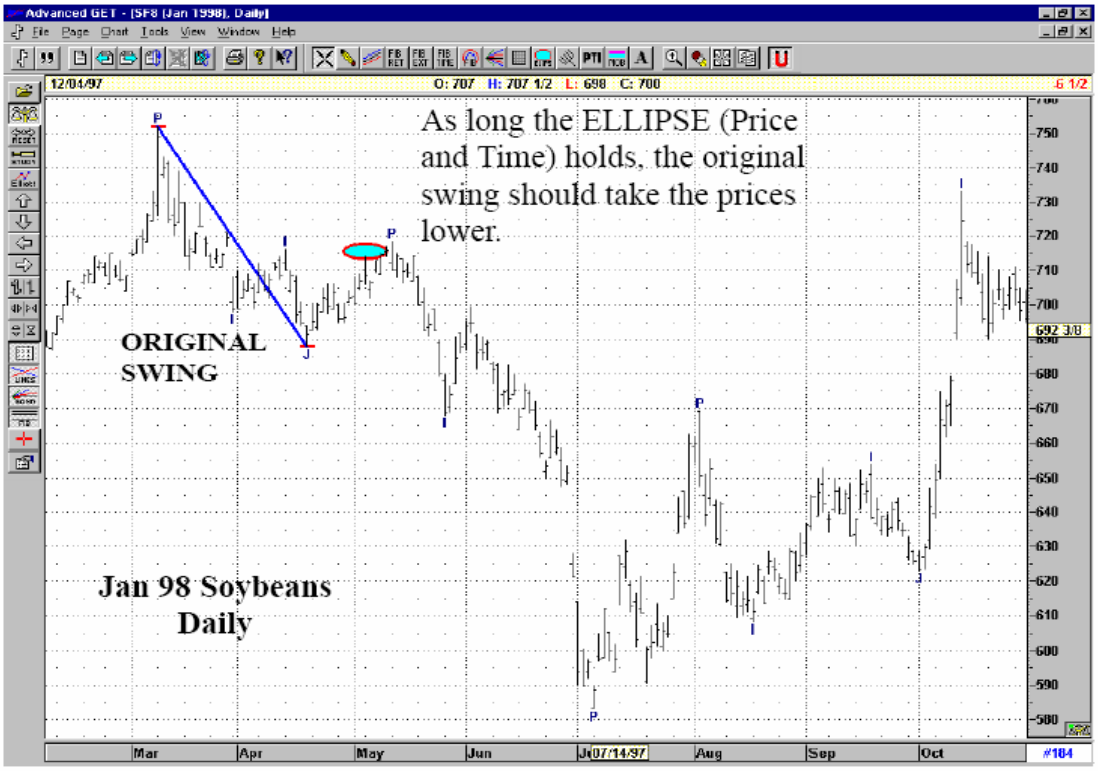
اگر یک سطح خوب کار نکند تریدرها به سطح بعدی نگاه خواهند کرد و آماده خواهند بود.



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

مطالعه جدید، نوسان اولیه را در نظر می‌گیرد و سطوح زمان و قیمت را که می‌تواند اصلاح موج اولیه در آن متوقف شود را نشان می‌دهد.

اگر سطوح قیمت و زمان نگه داشته شوند نوسان اولیه در جهت مسیر ترند اولیه ادامه می‌یابد. سطوح زمان و قیمت که در نمودار نشان داده شده‌اند به شکل یک بیضی هستند. به همین دلیل به آن بیضی T.J.'s می‌گوییم.



چگونه این بیضی T.J.'s محاسبه می‌شود:

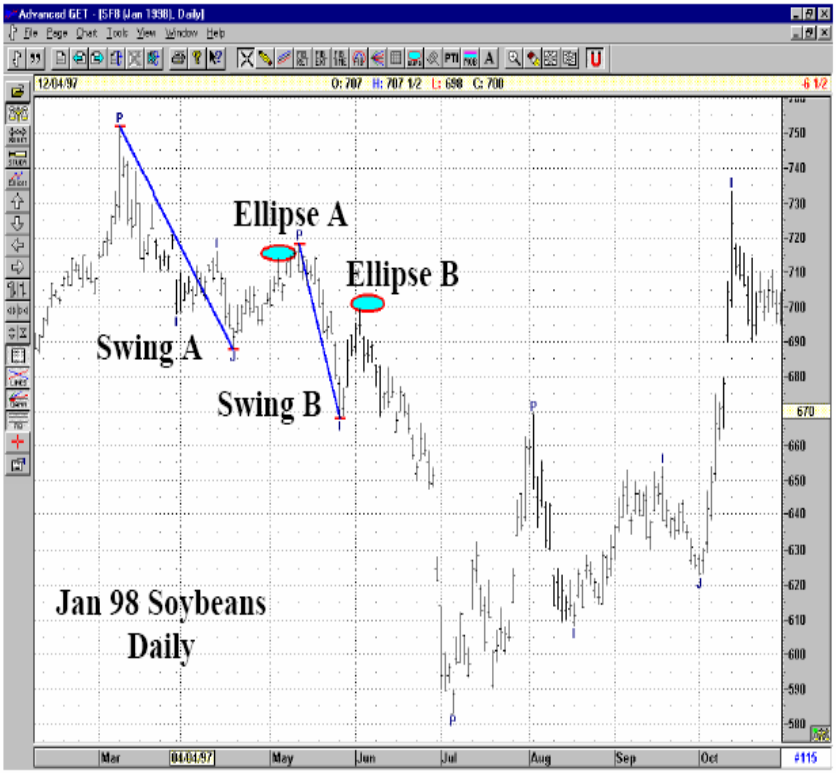
کاربر یک نوسان (Low و High) را شناسایی می‌کند. این نوسان برای مشخص کردن اندازه و قدرت بازار به کار برده می‌شود. با به کار بردن آن GET پیشرفته یک راه پیش بینی کننده برای بیضی را محاسبه می‌کند تا قیمت‌ها را مهار کند. به طور عینی بیضی T.J.'s ادامه خواهد داشت تا قیمت‌ها به آن برسند. زمانی که قیمت‌ها به بیضی برسند بیضی حرکت را متوقف خواهد کرد و یک سطوح قیمتی و زمانی قوی را ایجاد می‌کند.

در این زمان برای اینکه بیضی قیمت‌ها را نگه دارد بسیار حیاتی است. اگر موفق به این کار شد سپس نوسان اولیه ادامه خواهد داشت.

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

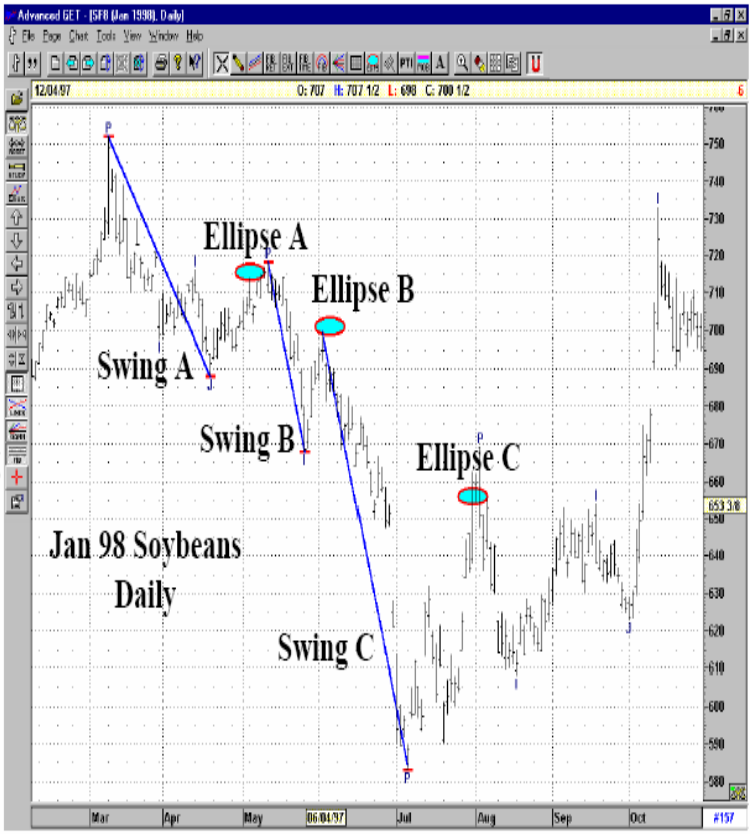
بیضی B بیضی است که از نوسان B ایجاد شده است.

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

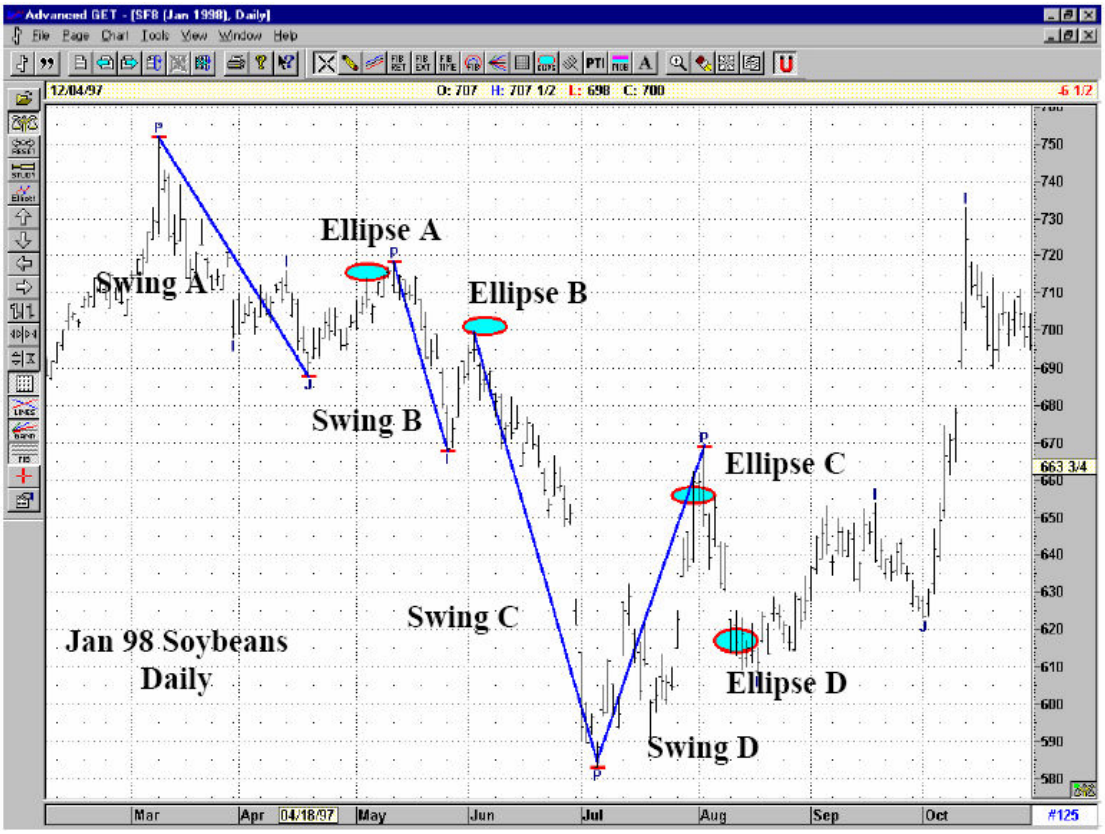


بیضی C بیضی است که از نوسان C تولید شده است.

این بیضی قیمت‌ها را نگه داشته و نوسان C می‌تواند ترند خود را تا پایین ادامه دهد.



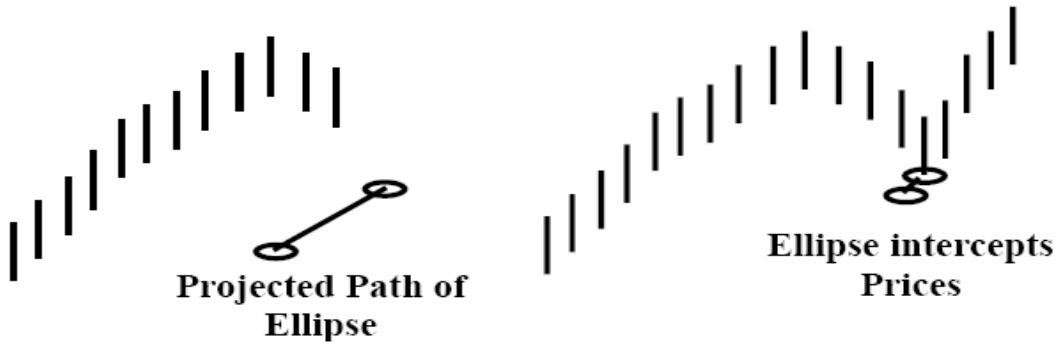
زمانی که بازار حرکت خود را ادامه می‌دهد نوسان جدید ایجاد می‌شود. برای هر نوسان جدید نرم افزار می‌تواند یک بیضی جدید ایجاد کند. همان زمانی که بیضی متناظر با هر بیضی متوقف کننده یک نوسان اولیه می‌تواند در مسیر خود ادامه یابد.



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

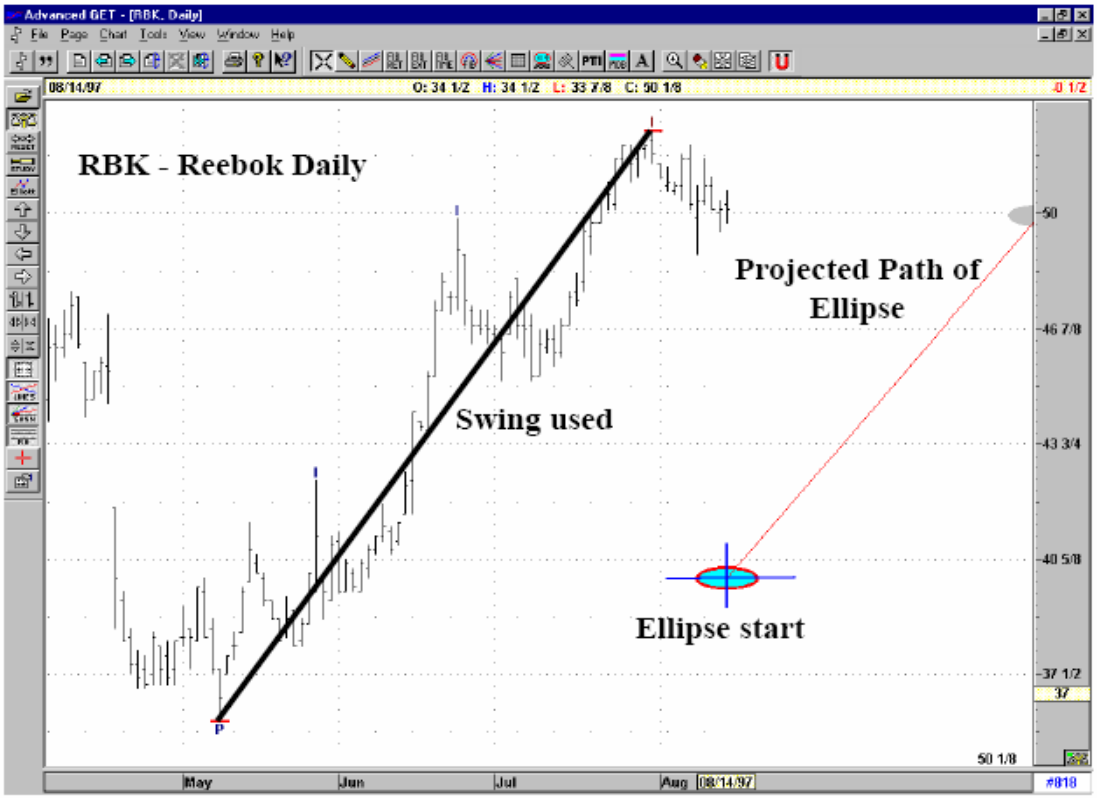
مسیر بیضی (سایه):

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



مثال-مسیرهای رسم شده برای بیضی:

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



زمانی که قیمت‌ها اصلاح را ادامـه مـی‌دهنـد بیضی به نزدیک و نزدیک‌تر حرکت می‌کند.

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

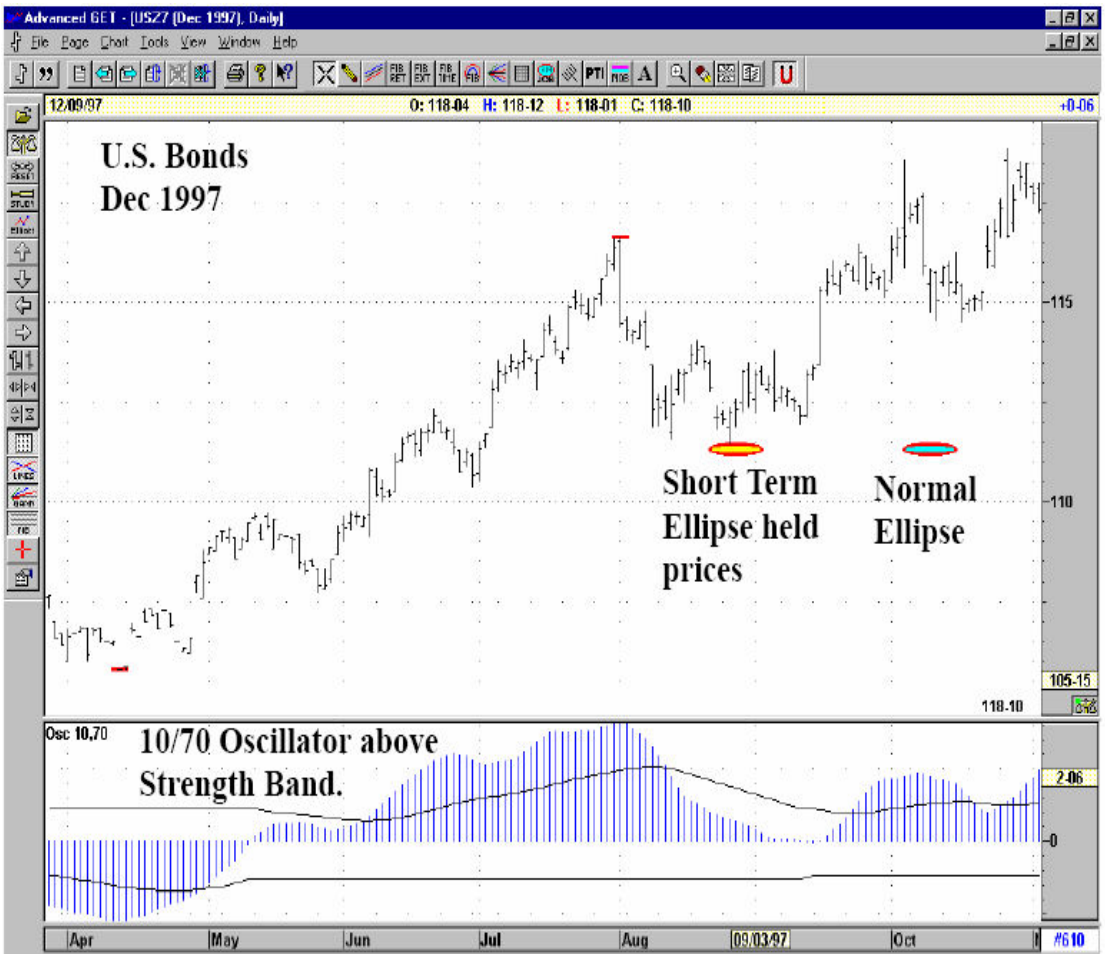
زمانی که سایه رسم شده به قیمت می‌رسد فورا کانال رگرسیون ترند برای تایید تغییر جهت واقعی در قیمت بکار ببرید. این تکنیک با جزئیات زیاد در ویدئو سال ۱۹۹۷ بحث شده است. من سعی کردم به بهترین نحوه در این مقاله توضیح دهم اما این کاملا مشابه ارائه در سمینار نیست.

استفاده از بیضی کوتاه مدت و معمولی

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

از ۹ مورد از ۱۰ مورد نوع معمولی می‌تواند بکار رود. در همه بحث‌های ما از تنظیمات معمولی استفاده می‌شود.

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



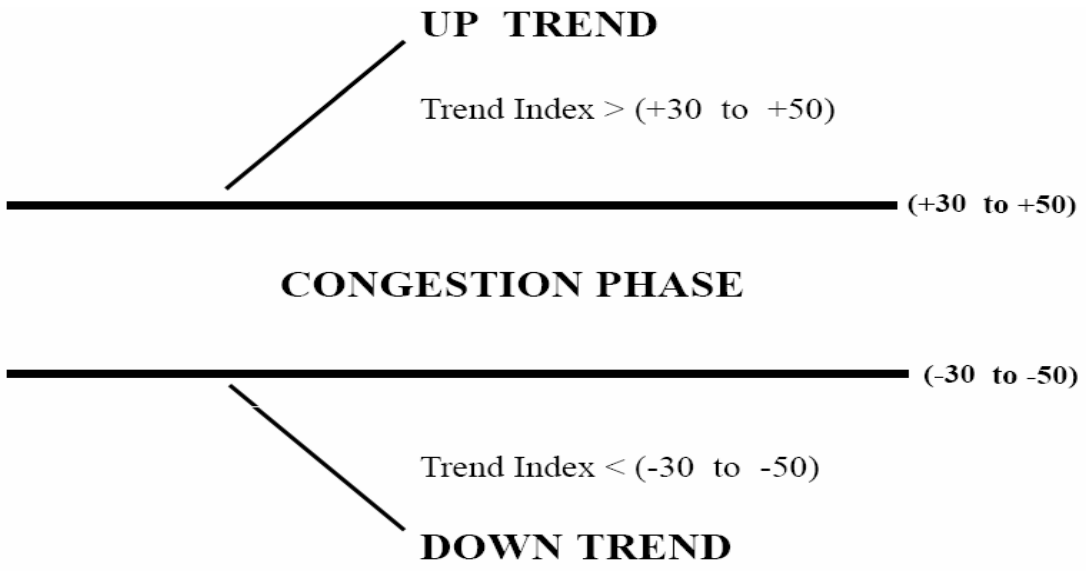
اندکس جوزف ترند (JTI)

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

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

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

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



زمانی که **Trend Index Value** محاسبه می‌شود نرم افزار خودش محاسبه می‌کند و ارزش های فعالیتی قیمتی (**Price Action Volume**) متفاوت را رسم می‌کند که به صورت اتوماتیک با شرایط اخیر بازار جا بجا می‌شوند. این مساله برای طبقه‌بندی قدرت ترند به کار می‌رود و در چهار رنگ دیده می‌شود:

قرمز: ترند بسیار قوی است.

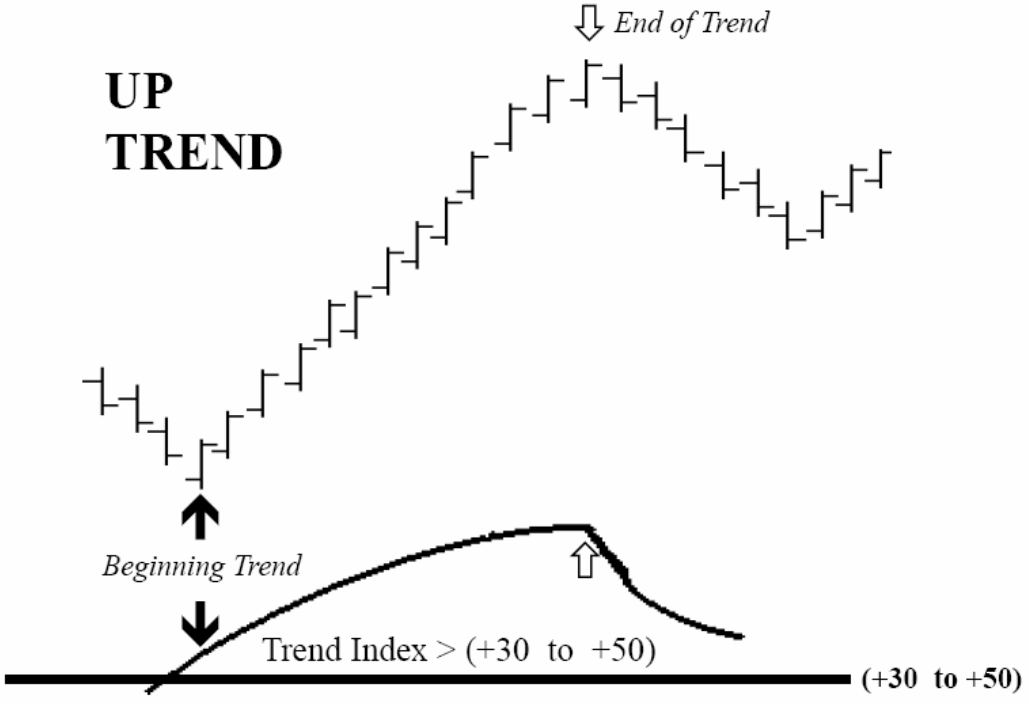
آبی: ترند قدرت متوسطی دارد.

سبز: ترند قدرت کمی دارد

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

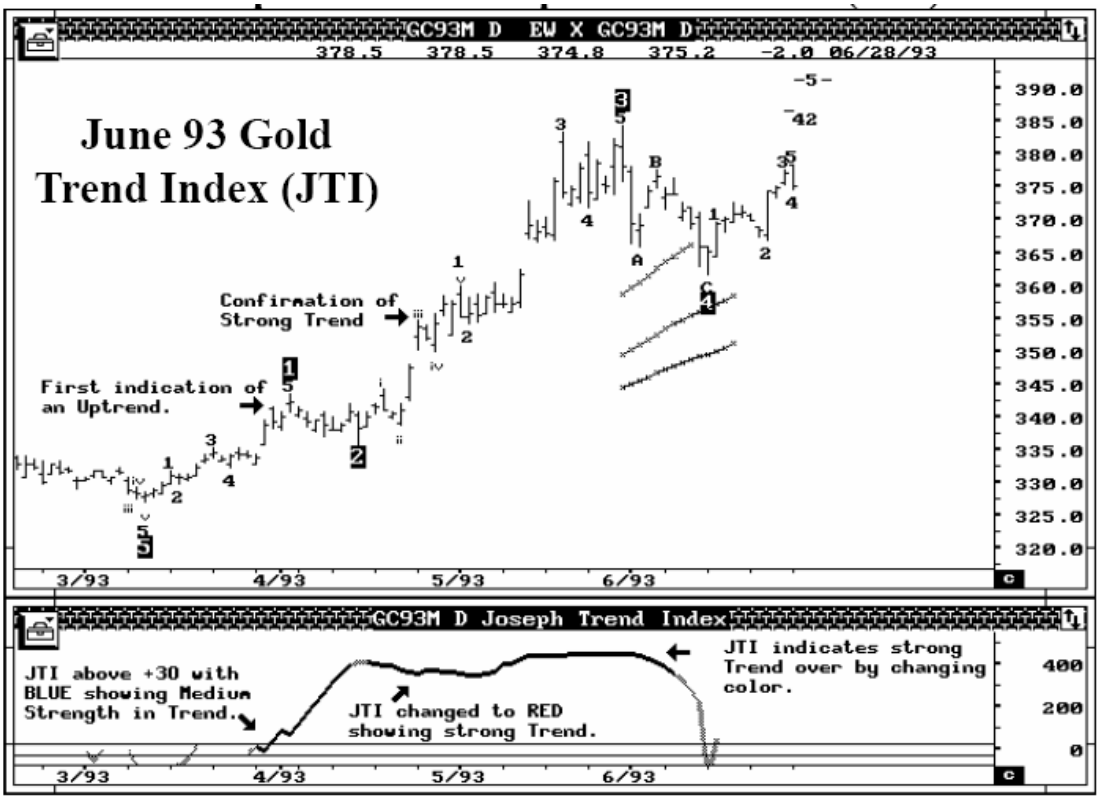
تقریبا همه فازهای موج سوم و موج‌های پنجم گسترش یافته یک **Trend Index Value** (قرمز) قوی ایجاد می‌کنند. به طور کلی بیشتر این فازها (۳ و ۵) بدون ترند یا با قدرت متوسط و کم شروع می‌شوند و بسرعت یک ترند قوی تشکیل می‌دهند. به هر حال در موارد زیادی ترندهای قوی (قرمز) در مراحل اولیه حرکت و **JTI** طراحی شده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

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



JUNE 93 GOLD
The JTI is breaking above (+30) level and also shows a BLUE color. This indicates the prices are breaking out in a well defined Up Trend.
First indication of an Uptrend.
JTI above +30 with BLUE showing Medium Strength in Trend.

JUNE 93 GOLD
The JTI changes to a RED color indicating a very strong Trend.
Confirmation of Strong Trend
First indication of an Uptrend.
JTI above +30 with BLUE showing Medium Strength in Trend.
JTI changed to RED showing strong Trend.



توجه کنید که چگونه JTI در همه مراحل رالی در حالت رنگ قرمز قوی باقی می‌ماند. سپس نزدیک به قله JTI رنگ را که علامتی است دال بر پایان ترند تغییر می‌دهد.

این همان جایی است که باید به مطالعات الیوت اضافه گردد. بله ترند جاری به قله رسیده است. به هر حال در مطالعات الیوت این موج سوم است. زمانی که موج چهارم اصلاحی یک PTI قابل قبول ارائه می‌دهد ما می‌توانیم منتظر تلاش برای رالی دیگر در موج پنجم باشیم. ابزار JTI می‌تواند این فاز رالی دوم را نیز بعنوان یک ترند متفاوت کلی دیگر بیابد.

استفاده از سطوح متفاوت طول ترند:

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

طول ترند متوسط و کوتاه به کاربر اجازه می‌دهند که شکست موج سوم بر قطعات ترند کوچکتر را بیابد و می‌تواند در پوزیشن‌های کوتاه مدت‌تر به کار آیند.

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

تنظیمات پیشنهادی برای JTI :

طول ترند = معمولی

سرعت = خاموش

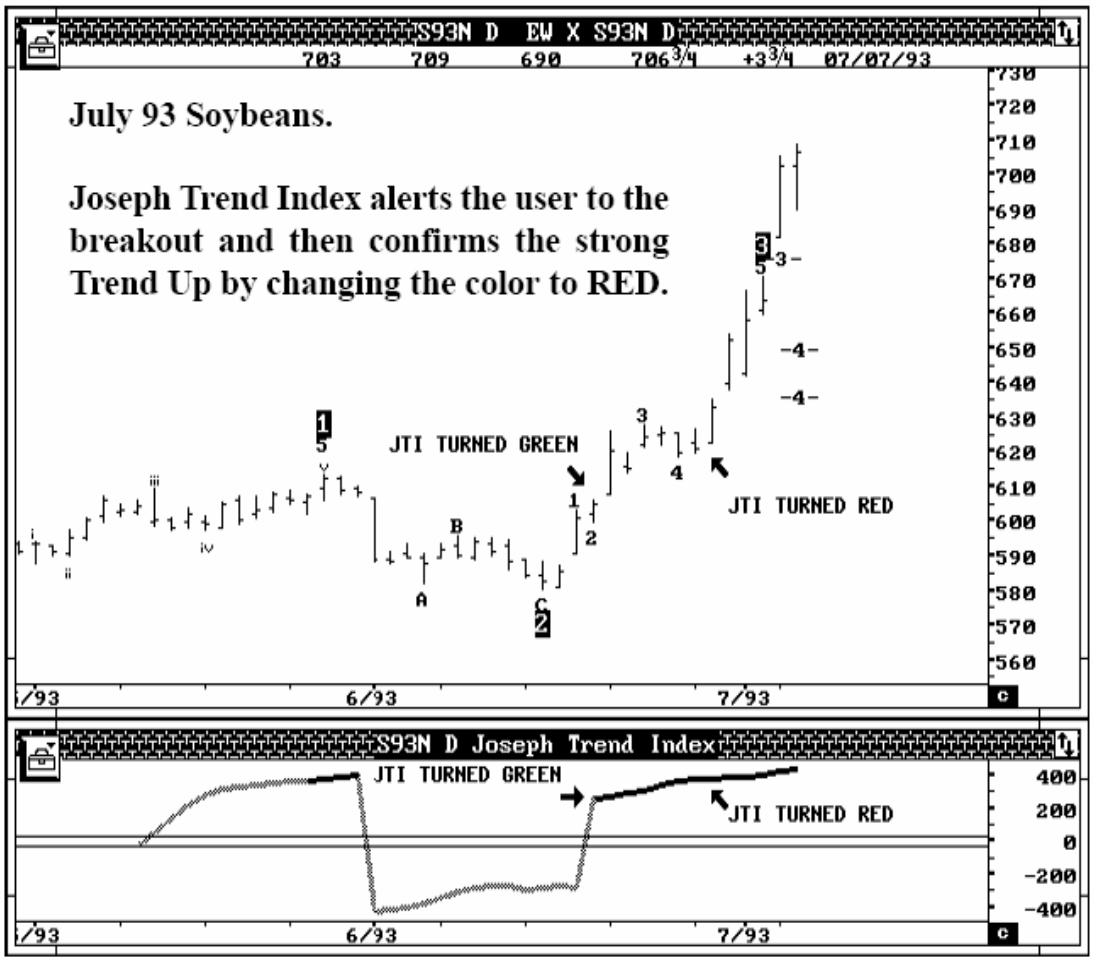
۳۰ = Band ۱

۳۰ = Band ۲

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

مورد A: تریدر می‌تواند از آنالیز JTI به همراه دیگر تکنیک‌ها برای ورود به یک پوزیشن بلند مدت استفاده کند.

مورد B: JTI در این مورد یک مدل ریاضی که قدرت ترند را طبقه‌بندی می‌کند را مهیا می‌کند. ترند تحت عنوان ترند صعودی قوی طبقه‌بندی می‌شود که باید از گرفتن پوزیشن‌های کوتاه مدت جلوگیری کرد.



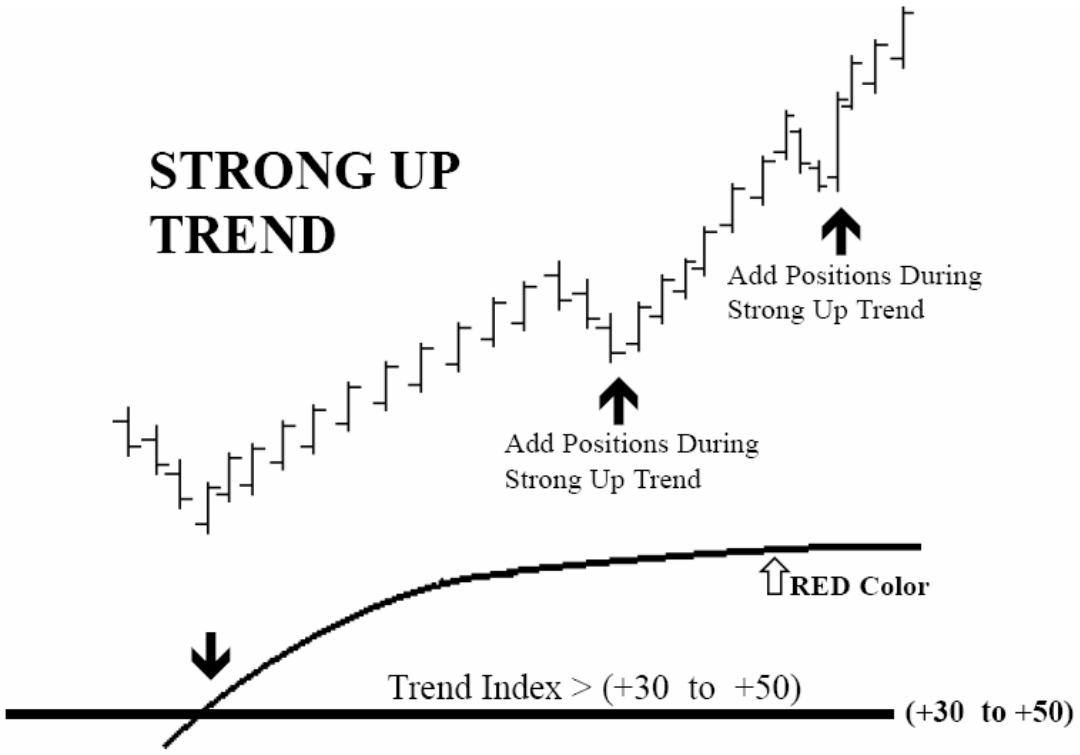
چگونگی استفاده از JTI:

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

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

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

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



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

چرخه‌ها

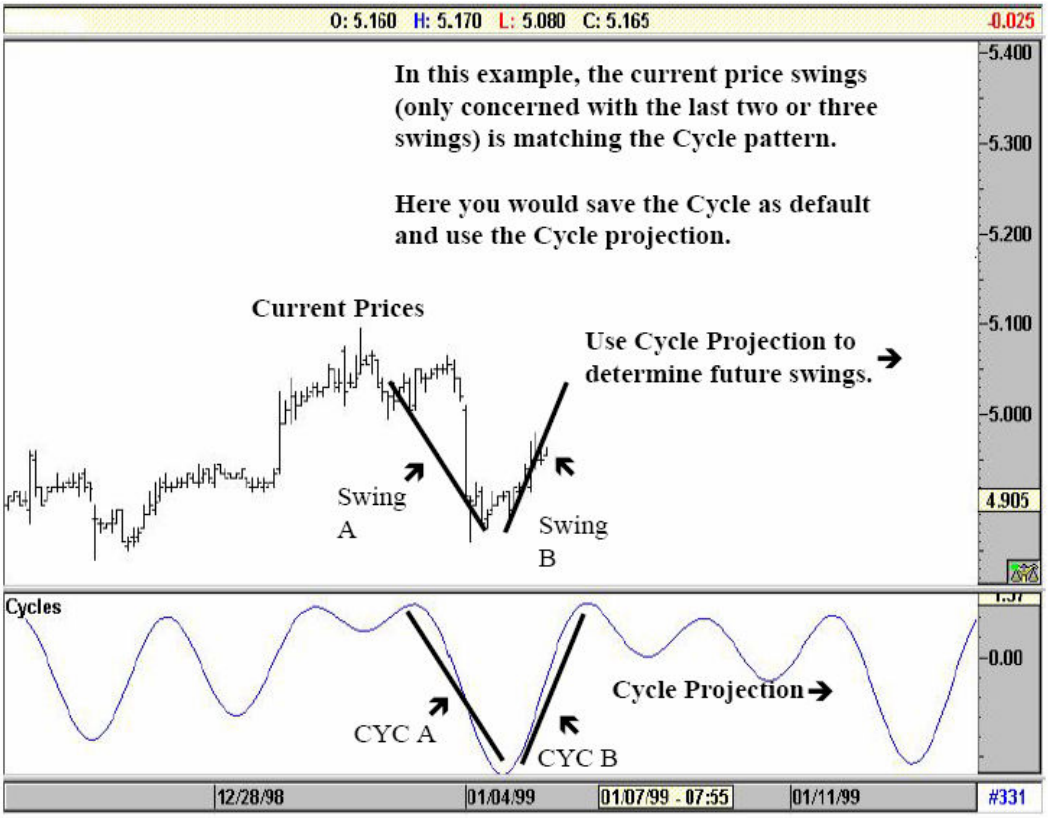
چرخه‌ها مطالعه جدیدی هستند که به نرم افزار GET پیشرفته اضافه شده‌اند. حالت از پیش تعیین شده آن از ۲۰۰ میله برای محاسبه چرخه‌ها استفاده می‌کند و ما توصیه می‌کنیم که آن را در ۲۰۰ بدون تغییر بگذاریم.

زمانی که شما برای اولین بار مطالعه چرخه‌ها را به کار می‌برید نرم افزار چرخه‌های اصلی را بر روی هر تیک جدید محاسبه می‌کند. زمانی که شما فهمیدید تناظری بین چرخه و نوسان قیمت وجود دارد شما می‌توانید چرخه فوق را به عنوان پیش فرض در نظر بگیرید.

اکنون اگر چرخه متناظر با نوسان قیمت ایجاد شود شما باید آن را بیابید. ما برنامه‌ریزی کرده‌ایم تا این کار به صورت اتوماتیک در زمان دیگری انجام شود. لطفا مطالب زیر را مطالعه کنید تا چگونگی یافتن این تناظر را بدانید.

تناظر (Maching):

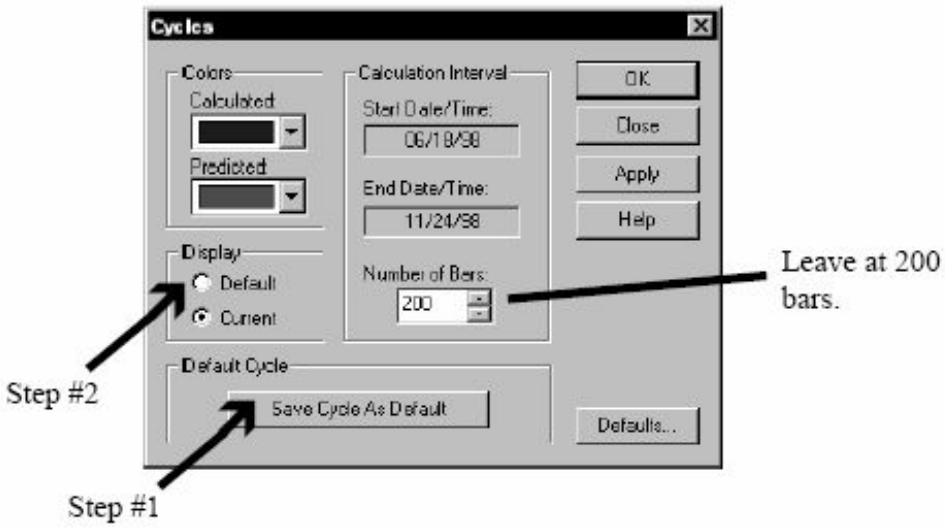
به چند پیوت قبل روی نمودار قیمت توجه کنید. نوسان قیمت بایستی با چرخه متناظر شود. به مثال زیر توجه کنید. اگر هیچ تناظری وجود نداشته باشد سپس اجازه دهید تا محاسبات تا زمان دیدن یک تناظر توسط شما ادامه یابد.

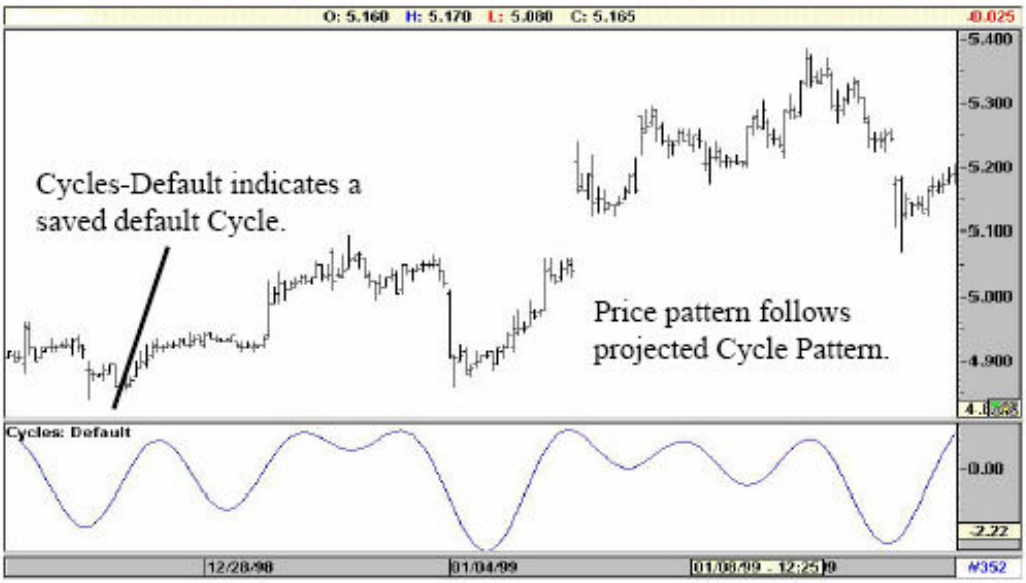


زمانی که یک تناظر یافت می‌شود:

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

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



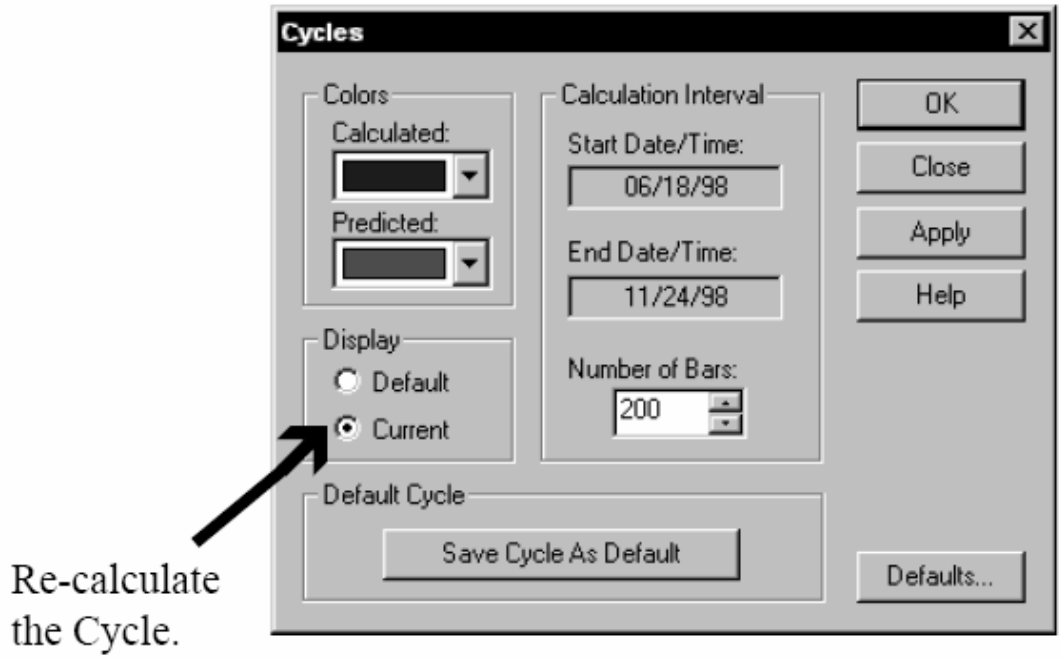


چه زمانی شما می‌توانید چرخه‌ها را مجددا محاسبه کنید؟

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

چگونه محاسبه دوباره را انجام دهیم؟

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

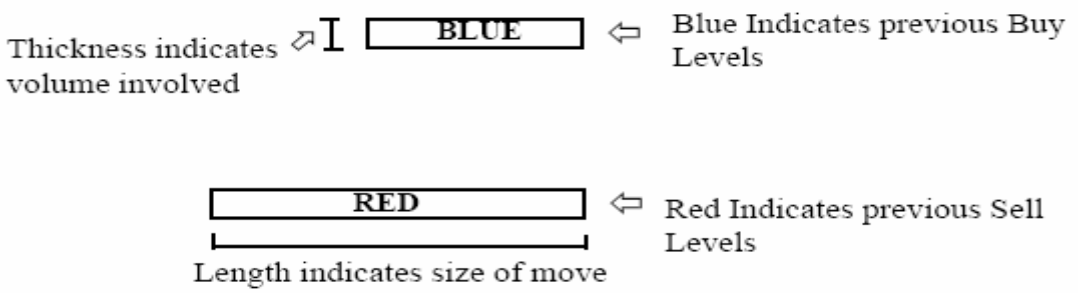


دوباره پیگیری الگوی چرخه زمانی و نوسان قیمت را برای یافتن تناظر ادامه دهید. زمانی که تناظری را یافتید فورا چرخه فوق را به صورت **Save Cycle As Default** ذخیره کنید و براساس مطلبی که در صفحه قبل تحت عنوان " زمانی که یک تناظر یافتیم " ادامه دهید.

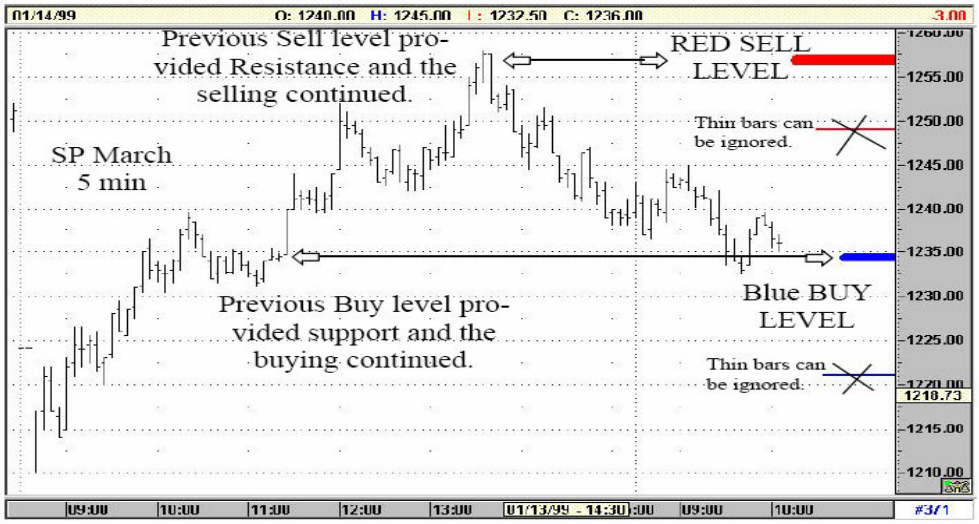
اطلاعات بیشتر در ویدئو سمینار ۱۹۹۸ که در اوایل فوریه ۱۹۹۹ منتشر شده است می‌توانید بیابید.

TRADE PROFILE

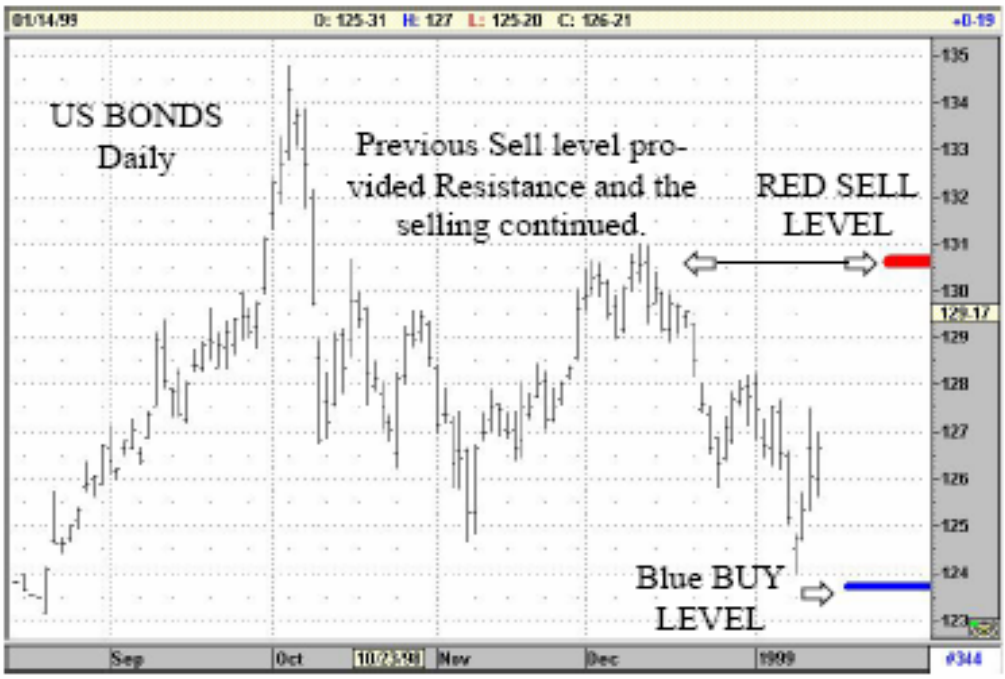
این ابزار جدیدی است که ما اضافه کرده‌ایم. نـرم‌افـزار اطلاعـات را بررسـی مـی‌کنـد و سطوحی را می‌یابد که در آن‌ها نوسانات بارز **Buy** و **Sell** وجود داشته است. این سـطوح براساس میزان حجم درگیر و حرکت واقعی قیمت طبقه‌بندی می‌شوند. برای سهام حجـم واقعی و برای **Futures** حجمی که نشان داده شده به کار می‌رود.
زمانی که این سطوح شناسایی می‌شوند تریدرها می‌توانند زمانی که ایـن سـطوح دوبـاره توسط حرکات قیمت تست می‌شوند بررسی کنند.

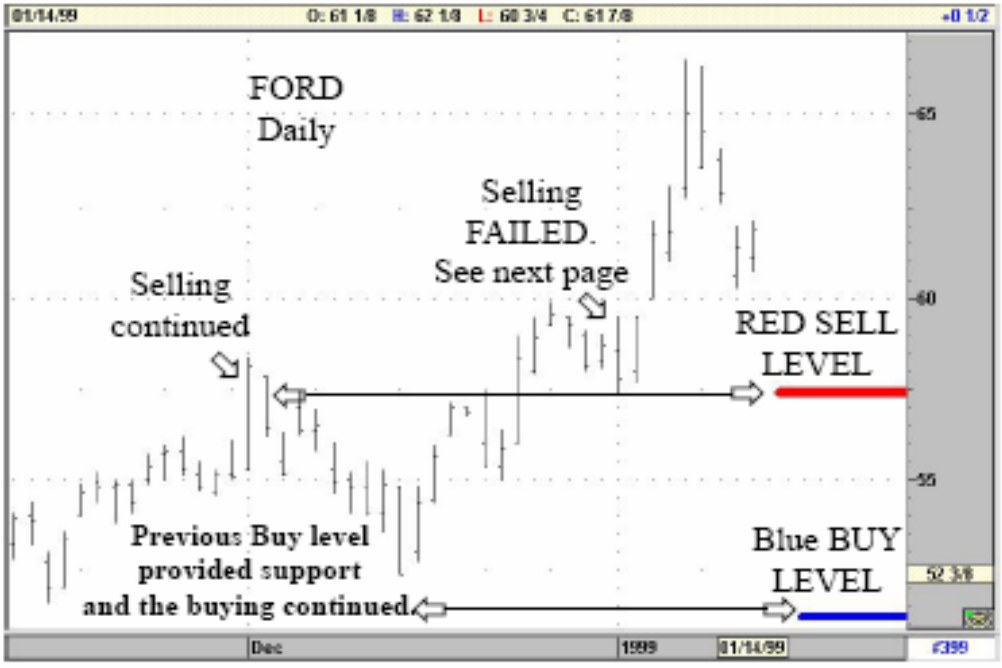


بعنوان یک تریدر شما می‌توانید به این سطوح از نظر ضخامت (حجم بالا) و یا طـول زیـاد (حرکت بالای قیمت) دقت کنید. زمانی که حرکت قیمت به سطح **Sell** قبلی برسـد شـما می‌توانید ادامه یافتن **Sell** را دنبال کنید. همچنین زمانی که قیمت نزدیـک سـطح **Buy** قبلی است شما می‌توانید ادامه یافتن **Sell** را دنبال کنید. این یکی از الگوهایی می‌باشـد که توسط **TRADE PROFILE** ایجاد می‌شود.



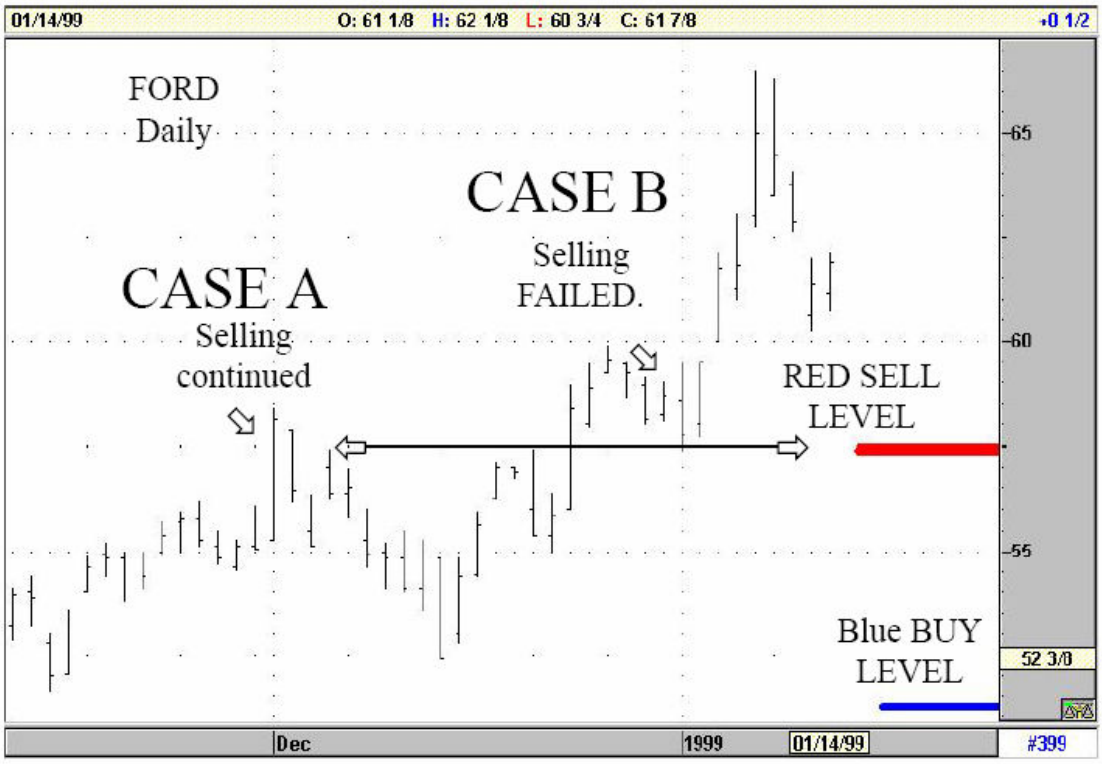
ابزار **TRADE PROFILE** می‌تواند در نمودار روزانه یا هر تایم دیگری استفاده شـود. همچنین این ابزار می‌تواند به خوبی در بازار سهام نیز کار کند. به نمـودار **Ford Motor** در زیر نگاه کنید.





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

تقریبا ۴۰٪ موارد مورد **B** رخ می‌دهد. در اینجا سطح **Sell** قبلـی در جلـوگیری از ادامـه رالی ناتوان بوده است.(؟)

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

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