به نام خداوند جان و خرد

آشنایی با روش ترید ۳-۲-۱

نگارش : **ساسان امیری**

ویرایش : سید محمد آیتی مقدم

دی ماه ۱۳۸۶

http://www.gheymatha.com/

www.gheymatha.com

مقدمه

در میان روش های معاملاتی (System Tradings) ، همواره روش هایی که مبتنی بر سری اعداد فیبوناچی و نسبت های حاکم بین آنها بوده ، اعتبار خاصی داشته اند . این نسبت های خاص و به عبارتی مرموز ! در تمامی عرصه های طبیعت نقش مهم خویش را نشان داده اند . برای مثال در طبیعت ، از پدیده های کوچک نظیر نسبت شعاع حلقه های مارپیچ روی صدف یک حلزون تا نسبت شعاع دایره های عظیمی که مارپیچ کهکشان های بیکران را در فضا شکل می دهند ، زمانی که در ساختار آنها دقت می کنیم ، می بینیم که بر اساس نسبت های اصلی سری اعداد فیبوناچی شکل گرفته اند .

بی آن که قصد داشته باشیم وارد این بحث شویم خوب است همین قدر بدانیم که در بازارهای سرمایه هم زمانی که چارت های مختلف را بررسی می کنیم با تعجب متوجه می شویم که روند و نوسانات بازار با رسیدن به نسبت های فیبوناچی از خود واکنش نشان می دهند . بر این اساس ، روش های تحلیلی شکل گرفته است که بر اساس این نسبت ها بتوانیم بازار را تحلیل کرده و فرضاً با توجه به مشاهده نسبت بعدی فیبوناچی در چارت که در آینده نزدیک روند قیمت به آن می رسد و می دانیم که به احتمال زیاد بازار به آن نسبت واکنش نشان می دهد ، می توانیم به طور نسبی روند آتی بازار را پیش بینی کنیم و بر اساس آن اقدام به ورود به بازار و معامله نماییم . علت دیگری که باعث محبوبیت روش های مبتنی بر نسبت های فیبوناچی شده ، این است که می توانیم بر اساس این نسبت ها و ارتباطی که با یکدیگر دارند به سادگی به تعیین اهداف قیمتی (Targets) و نیز حد ضرر (Stop Loss) بپردازیم و چون این مقادیر همیشه دقیقاً قابل محاسبه هستند ، می توان بر اساس این مقادیر به بررسی میزان Risk/Reaward (میزان ریسکی که برای ترید می کنیم در مقابل میزان امیدی که به سود حاصله داریم) بپردازیم و در صورتی که نسبت سود فرضاً دو برابر میزان ضرر احتمالی بود به گرفتن پوزیشن مبادرت کنیم . تمامی مقادیر هدف ، حد ضرر و نسبت سود به ضرر در روش های مبتنی بر نسبت های فیبوناچی به سادگی قابل محاسبه هستند . برای استفاده از نسبت های فیبوناچی روش های مختلفی ابداع شده اند که تمامی آنها با توجه به این که بر اساس این نسبت ها چارت را تحلیل می کنند روش های قدرتمندی محسوب می شوند . در این بین روش تحلیلی پترن های فیبوناچی که توسط لاری پساونتو معرفی و توسط اسکات کارنی به اوج رسید یکی از مشهورترین آنهاست. مثال دیگر روش تحلیلی رابرت فیشر در کتاب New Fibonacci Trader است که مبنای آن یافتن چندین نوع شکل هندسی مختلف است به گونه ای که نسبت های فیبوناچی در شکل گیری آنها نقش اساسی دارند و با توجه به نسبت های

www.sheymatha.com

اصلی شکل گرفته در آن اشکال هندسی به تحلیل بازار می پردازد . هر دو روش فوق از روش های قدرتمند و دقیق تحلیلی در دنیای تکنیکال محسوب می شوند .

روشی که ما در این مجموعه آموزشی پی می گیریم ، روش استفاده از تکنیک نسبت های فیبوناچی در ریتریس ها و اکستنشن هاست . Retracement & Extension دو روش قدرتمند برای تحلیل وضعیت هر روندی می باشند . در این مجموعه مرجع اصلی ما برای تدوین یک سیستم تریدینگ قدرتمند کتاب ارزشمند Practcal Fibonacci Methods For Forex Trading اثر ارزشمند کن مارشال و راب موبرای است . این دو تریدر شناخته شده در این کتاب روشی ساده اما قدرتمند در تحلیل تقریباً هر وضعیتی را معرفی می کنند تا بتوانیم بر اساس آن و به محض شکل گیری فرم مورد نظر با اطمینان زیاد وارد بازار شویم . خوشبختانه مرجع اصلی ما قبلاً با تلاش دوستان عزیزمان ترجمه شده و در قالب یک فایل PDF در دسترس است .کتاب فوق که به وسیله آقای بهروز نعیمی (arak_fx) ترجمه و به همت آقای behrouz fx گردآوری و ویرایش شده ، مرجع اصلی ما خواهد بود . اما در این مجموعه از منابع دیگر هم برای تکمیل بحث استفاده خواهد شد و علاوه بر آنها ، به تجربیات مختصر بنده در طول دورانی که از آن استفاده کرده ام ، برای روشن شدن بعضی نکات و ریزه کاری ها و به اصطلاح قلق های این روش اشاره خواهد شد تا انشاءالله در پایان بحث ، مجموعه ای تا حد ممکن کامل در اختیار عزیزان قرار بگیرد .

این روش ترید نام های مختلفی دارد که متداول ترین آنها ، سیستم تریدینگ پترن ۳-۲-۱ است . علت این نام گذاری هم این است که شماره گذاری هایی که روی پترن شکل گرفته انجام می دهیم ، با اعداد ۱ و۲ و۳ صورت می گیرد . برای درک پایه ای و مفهومی پترن ۳-۲-۱ (بدون توجه به نسبت های فیبوناچی و تنها به فرم کلی اش) مقاله 1-2-3 Trading Signal اثر آقای Mark Crisp بسیار مفید است . پس از مطالعه این مقاله ، برای درک بیشتر مفهوم روش می توانید از نوشته آقای Mark Mcrae که به وسیله دوست خوبمان آقای علی حسینی ترجمه شده استفاده کنید . اگر چه در این مقاله روش ۳-۲-۱ به سبکی استفاده شده است که دقیقاً با روشی که در این مجموعه ارائه خواهد شد منطبق نیست اما باز هم برای درک مفهومی روش می تواند بسیار مفید باشد . علاوه بر این دو مقاله مفید ، دو کتاب ارزشمند هم در زمینه روش ۳-۲-۱ موجود است که بسیار کاربردی و مفید بوده و برای کسانی که مایلند در مورد این نوع ترید و تکنیک های مختلفی که در این زمینه ارائه شده اطلاعات بیشتری کسب کنند این دو مرجع هم معرفی می شوند .

1 . Candlesticks, Fibonacci, and Chart Pattern Trading *By Robert Fischer*
2 . Ross Hook *By Joe Ross*

www.sheymiaha.com

شرح روش

عزیزان توجه داشته باشند که این روش ، روش قابل انعطافی است و به گونه های مختلف می شود از ابزار مکمل به همراهش استفاده کرد . اما باز هم یادآوری می شود که در این مجموعه ، روال کار دقیقاً بر اساس روشی است که در کتاب Practical Fibonacci For Forex Trading اثر کن مارشال و راب موبرای آورده شده است . در طول روند کار ، نکات و مطالب متعددی به روش اولیه اضافه خواهد شد تا انشاءالله روش به کیفیت بهینه ای برسد .

به طور خلاصه روش را مرور می کنیم :

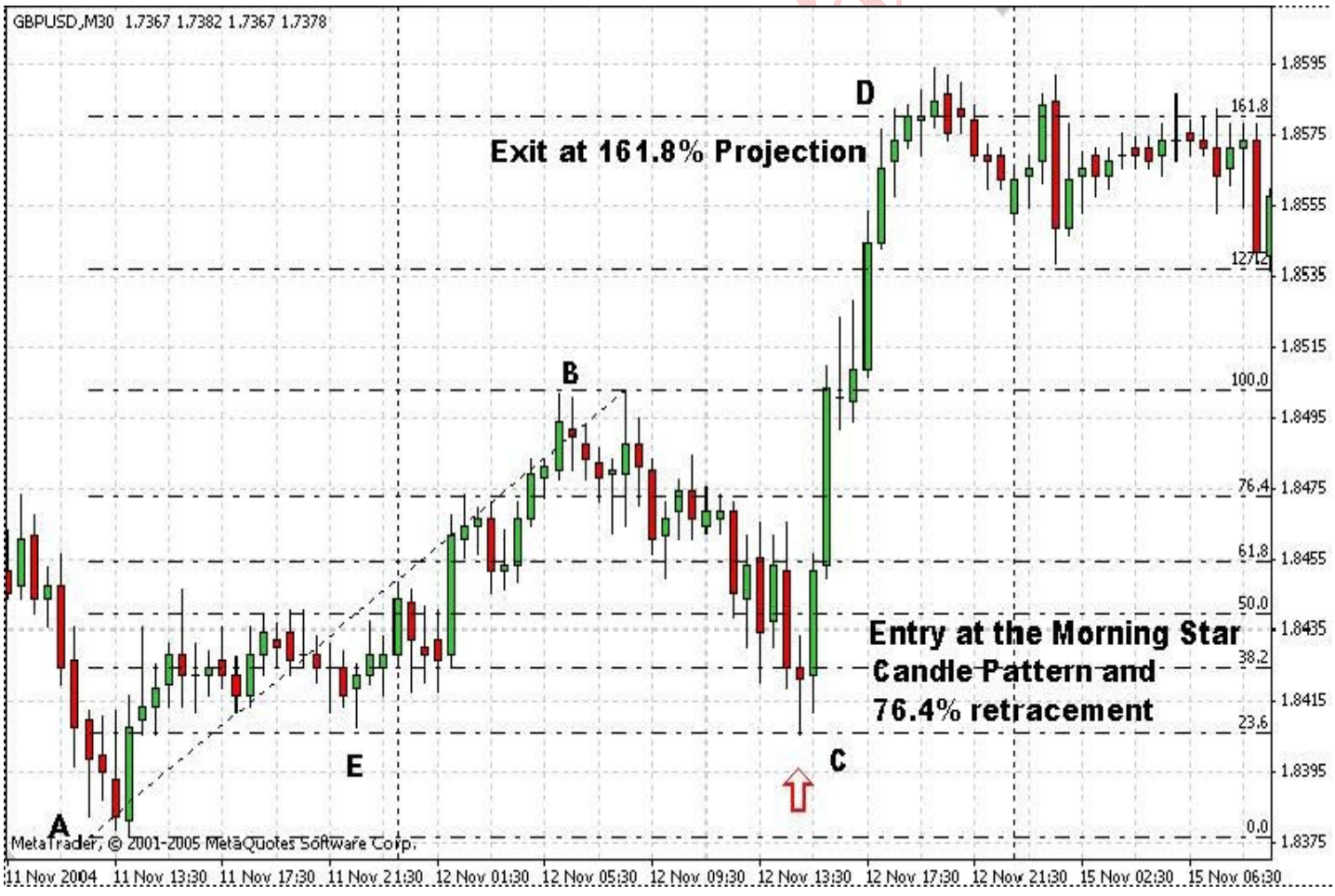
در بررسی چارت ها به دنبال پترن ۳-۲-۱ می گردیم . پس از آن که به طور چشمی پترنی را تشخیص دادیم در مرحله دوم نسبت های فیبوناچی را روی آن رسم می کنیم . در صورتی که نسبت های معتبر فیبوناچی (در این مجموعه تنها نسبت های ۶۱ و ۷۶) روی نقطه C قرار گرفت ، در مرحله سوم به بررسی وضعیت نقطه ورود یا تریگر (Trigger) می پردازیم . برای ورود به بازار بهترین تریگر در این روش استفاده از دانای اول (First Wiseman) است . اما در صورتی که در ناحیه ۶۲ و ۷۶ فیبوناچی این پرایس بار (= بار چارت) مشاهده نشد در اولویت دوم به بررسی کندل ها در ناحیه مورد نظر می پردازیم و در صورتی که یکی از کندل پترن های مورنینگ و ایونینگ استار ، بولیش و بیریش انگولفینگ ، تویزر تاپ و باتم شکل گرفته بود اقدام به گرفتن پوزیشن می کنیم . علاوه بر این کندل ها به شخصه با کندل های دوجی ، همر و شوتینگ استار مشروط به تأیید کندل بعدی یا سایر عوامل تأییدی هم ترید می کنم . هدف قیمتی (Target) هم برای ریتریس ۶۱ هدف ۱۶۱ و برای ریتریس ۷۶ ، هدف اکستنشن ۱۲۷ فیبوناچی خواهد بود و بالاخره این که حد ضرر هم در زمان Buy بر اساس کتاب مارشال ۱۰ پیپس پایین تر از آخرین نوسان نزولی قبلی و در وضعیت Sell به میزان ۱۵ پیپس بالاتر از آخرین نوسان صعودی قبلی خواهد بود . از این روش برای تعیین حد ضرر به طور مرتب استفاده کرده ام و در عمل بسیار کارآمد نشان داده است . توجه داشته باشید که این سیستم تریدینگ بر روی تمامی تایم فریم ها از ۵ دقیقه تا هفتگی قابل اعمال است اما شخصاً از این روش تنها بر روی تایم فریم ۴ ساعته استفاده می کنم(و خیلی به ندرت در تایم فریم روزانه) . البته شما می توانید بر اساس استراتژی ، سرمایه یا روحیاتی که دارید تایم فریم خاص خودتان را پیدا کنید . معتقدم هر شخصی باید یک استراتژی صحیح را با توجه به روحیات خودش به نحوی شکل بدهد که با آن راحت باشد . یعنی فرضاً اگر

www.sheymiaha.com

من با این روش در تایم فریم ۴ ساعته کار می کنم به دلایل شخصی است و این موضوع وحی منزل نیست . ممکن است شخصی دیگر این روش را در تایم فریم ۱ ساعته کارا تر ببیند یا حتی در تایم فریم ۱۵ دقیقه . یا فرضاً بنده کارا ترین استفاده از تحلیل های امواج الیوت را در تایم فریم روزانه می بینم ، در حالی که شاید شخصی دیگر این کارایی را در تایم فریم ۴ ساعته یا هفتگی بداند . بنابراین ، این که فرضاً من با سیستم تریدینگ ۳-۲-۱ در تایم فریم ۴ ساعته یا با الیوت در تایم روزانه کار می کنم قانون نیست و شما می بایست روش را بررسی کرده و سپس با توجه به سبک ترید خود از آن استفاده کنید . همان طور که بنده خیلی خیلی به ندرت از پترن های فیبوناچی در تایم فریم کمتر از ۱ ساعت استفاده می کنم هر چند همه می دانیم این پترن ها در بازه های زمانی کمتر از ۱ ساعته هم کاملاً قابل ترید هستند .

انشاءالله که این سیستم تریدینگ هم کارایی خودش را نشان بدهد و در آینده دوستان عزیز بتوانند به خوبی از این روش در ترید های روزانه خودشان استفاده کنند .

بررسی روش را با بررسی یک چارت آموزشی پی می گیریم :



چارتی است در تایم فریم نیم ساعته (همان طور که قبلاً گفته شد این روش بر روی تمامی بازه های زمانی قابل اجرا است) . ابتدا پترن ۳-۲-۱ را شناسایی می کنیم (این پترن اسامی دیگری هم دارد مانند : ABC ،

ABCD و 4-3-2-1) . سپس فیبوناچی ریتریسمنت را روی چارت اعمال می کنیم تا ببینیم نقطه مهم C روی نسبت های معتبر فیبوناچی قرار دارد یا خیر . پس از مشاهده نسبت معتبر ۶۱ فیبوناچی (با توجه به Shadow این نسبت ۷۴ است اما به تجربه به بنده ثابت شده که بدنه در این وضعیت ها نشانه دقیق تری برای سنجش وضعیت است) به وضعیت کندل توجه می کنیم و با مشاهده کندل پترن مورنینگ استار اقدام به خرید می کنیم . حد ضرر ۱۰ پیپس پایین تر از آخرین نوسان نزولی قبلی است (حدود ۱,۸۴۰۰) و هدف هم نسبت ۱۶۱ فیبوناچی .

بعد از این مثال آموزشی مراحل این روش را در یک وضعیت حقیقی بررسی می کنیم .

لطفاً به چارت زیر توجه کنید :

EUR/JPY (1 Hour)

۱- پترن ۳-۲-۱ را تشخیص می دهیم .

۲- نسبت های فیبوناچی را بر روی آن رسم می کنیم .

۳- با مشاهده نقطه C بر روی نسبت ۷۶ فیبوناچی شروع به بررسی وضعیت کندل ها می کنیم .

۴- در سری اول کندل ها با توجه به کندل های ارائه شده در کتاب مارشال کندل مناسبی نداریم اما سپس شاهد یک کندل پترن بولیش انگولفینگ هستیم که نشانه تأیید روند صعودی است .

۵- پوزیشن خرید باز کرده و هدف را نسبت ۱۲۷ فیبوناچی قرار می دهیم .

۶- زمانی که به این نسبت رسیدیم در صورتی که کندل برگشتی مشاهده نکردیم (در واقع علامتی از برگشت روند یا تضعیف روند را شاهد نبودیم) هدف را ۱۶۱ فرض می کنیم و تا زمانی که کندل برگشتی مشاهد نشد در پوزیشن باقی می مانیم .

اما در کندل بعدی کندلی نزولی شکل گرفته است که این باید ما را متقاعد کند که پوزیشن را ببندیم . به نظر می رسد در مثال بالا همه چیز ایده آل و صحیح بوده و ما تریدی موفق را انجام داده ایم . ولی ما در ترید یاد شده موضوع بسیار مهمی را از نظر دور داشته ایم .

یک نکته مهم وجود دارد که نه در این سیستم تریدینگ که بلکه در تمامی روش های ترید در بازار های سرمایه همواره باید آنرا مد نظر قرار دهیم و بدون آن هر تریدی و هر روش صحیحی حتی اگر سود ده هم باشد در دراز مدت محکوم به شکست است . یعنی این تریدی که کاملاً بر اساس روش انجام داده ایم و کاملاً هم موفق و با سود خوب بوده است را اساساً نباید انجام می داده ایم !

علت نادرست بودن ترید فوق این است که اگر در نقطه بالای کندل انگولفینگ وارد بازار شویم و هدف نسبت ۱۲۷ فیبوناچی باشد ، نسبت سود به ضرر مناسبی نخواهیم داشت . در بخش بعدی موضوع مدیریت سرمایه و محاسبه ریسک پوزیشن را بررسی می کنیم .

مدیریت سرمایه و محاسبه ریسک

بحث مدیریت سرمایه و محاسبه دائمی میزان ریسک پذیری (Risk/Reaward) یکی از مهم ترین مباحث برای موفقیت دراز مدت هر تریدر است. متأسفانه معمولاً بهای کمی به این مقوله داده می شود در حالی که نهایت اهمیت را داراست .

www.sheymaha.com

البته بسته به نوع ترید میزان سرمایه و عوامل متعدد استراتژی های محاسبه ریسک/ ریوارد متفاوت می شود اما بنده یک روش خیلی ساده معرفی خواهم کرد که برای هر روش ترید و هر تریدر بی تجربه ای هم به سادگی قابل استفاده باشد .

عزیزان توجه داشته باشند که بحث مدیریت سرمایه و محاسبه میزان ریسک بسیارگسترده است . برای مثال بنده به کتابی بسیار حجیم برخوردم که تنها و تنها به مسأله مدیریت سرمایه پرداخته بود و یا با نرم افزاری آشنا هستم که ۱۲ استراتژی برای محاسبه R/R درسیستم تریدینگ های متفاوت و سرمایه های مختلف و یا بسته به این که تریدر بلندمدت هستیم یا میان مدت یا روزانه روش های مختلف و بسیار جالبی را ارائه کرده است . اما شخصاً ترجیح می دهم روشی کاربردی و در عین حال ساده ارائه شود که برای همه افراد در سطوح مختلف معلومات و تجربه ، مفید باشد .

بحث مدیریت سرمایه و محاسبه میزان ریسک به سود را با مثالی ساده شروع می کنیم و سپس وضعیت ترید چارت قبلی را با این مثال تطبیق داده و محاسبه می کنیم .

در کتب زیادی مشاهده می کنید که به ما توصیه کرده اند که ۲ الی حداکثر ۳ درصد از سرمایه را در هر ترید درگیر کنیم تا در صورت زیان و این که روند بازار بر خلاف پیش بینی ما حرکت کرد بتوانیم با ضرر کمی از بازار خارج شویم . در واقع این اولین گام در راه موفقیت دراز مدت در ترید است .

بیاید با یک مثال وضعیت را تحلیل کنیم . فرض کنید سرمایه ای معادل ۱۰۰۰۰ دلار داریم (عدد ۱۰۰۰۰ برای سادگی محاسبه صورت گرفته و برای سایر سرمایه ها هم محاسبات به همین سادگی انجام می شود) . فرصت خوبی هم برای ترید حاصل شده است . ابتدا می بایست حساب کنیم که ۳٪ از سرمایه ما چقدر می شود ؟ به سادگی مشخص می شود که این مقدار برابر است با ۳۰۰ دلار . خوب پس تا اینجا متوجه شدیم که حداکثر می خواهیم میزان ۳۰۰ دلار در این ترید ریسک کنیم .گام دوم اجرای عملی این مبلغ در تریدمان است به این شکل که شروع به محاسبه حدود ضرر خود در این ترید می کنیم (این نکته خود نشان دهنده میزان اهمیت داشتن حد ضرر در هر ترید است) فرض می کنیم این میزان ضرر برابر است با ۶۰ پیپس (تمام این اعداد فرضی است و انشاءالله در آینده با ارائه مثال ، مطالب بهتر توضیح داده می شوند) . پس حد ضرر ما معادل ۶۰ پیپس است اما با چه لاتی باید وارد این پوزیشن شویم ؟ اینجاست که باید میزان ۳۰۰ دلار را با این ۶۰ پیپس بسنجیم اما چطور ؟ اگر این پوزیشن را با ۱ لات استاندارد بگیریم و فرض کنیم در لات استاندارد هر پیپس معادل ۱۰ دلار خواهد بود . چون استاپ ما ۶۰ پیپس است در صورتی که این ترید ناموفق باشد به میزان ۶۰۰ دلار ضرر خواهیم کرد. . از طرفی برای این که میزان حداکثر ۳٪ در هر ترید ریسک کنیم می بایست تنها

www.sheymiaha.com

مبلغ ۳۰۰ دلار ریسک کنیم . راه حل مسأله این است که این پوزیشن را به جای ۱ لات ، با ۰,۵ لات بگیریم چرا که در نیم لات هر پیپس معادل ۵ دلار است و در نتیجه حد ضرر ۶۰ پیپسی برابر می شود با ۳۰۰ دلار .
در واقع با یک عمل ساده تقسیم (۵=۶۰÷۳۰۰) به این نتیجه می رسیم که بایستی میزان لات ما به گونه ای باشد که هر پیپس معادل ۵ دلار باشد .

پس تا اینجا مشخص شد که می خواهیم ۳٪ سرمایه معادل ۳۰۰ دلار ریسک کنیم و چون حد ضرر معادل ۶۰ پیپس است باید پوزیشن را با ۰,۵ لات باز کنیم . نکته مهم دیگر برآورد میزان سود احتمالی است . یعنی پس از این که برآورد کردیم حداکثر زیانمان در این ترید چقدر است باید سود احتمالی را هم محاسبه کنیم (باز هم می بینیم تا چه حد داشتن یک استراتژی منظم و دقیق که حد سود و ضرر آن مشخص باشد برای یک روند دراز مدت و موفق لازم است) . البته در روش های ترید مختلف تعیین هدف قیمتی متفاوت است اما همان طور که می دانید فیبوناچی یکی از بهترین روش های محاسبه هدف احتمالی است . فرضاً در همین روش ۳-۲-۱ هدف دقیقاً مشخص است و یا در روش پترن های فیبوناچی دقیقاً حدود سود و ضرر مشخصی داریم .
فرض کنیم در این ترید هدف ما نسبت ۱۶۱ فیبوناچی است . حال باید میزان پیپس سود در هدف را محاسبه کنیم و اگر دیدیم که این میزان پیپس به نسبت مشخصی بیش از ۶۰ پیپس حد ضرر ما است به ترید مبادرت کنیم . اما این میزان پیس به چه نسبتی باید بیشتر از حد ضرر باشد ؟ در کتب مختلف تقریباً اتفاق نظر وجود دارد که اگر این نسبت ۲ به ۱ باشد ایده آل است . یعنی اگر میزان سود ما در این مثال برابر ۱۲۰ پیپس بود ما به نسبت R/R معادل 1/2 دست پیدا کرده ایم و وضعیت برای ترید ایده آل است . البته در فارکس میزان نسبت ریسک به سود برابر 1/1.5 هم اگر باشد خوب و ترید قابل اجرا است اما مثل همیشه و همه موارد ترجیحاً وضعیت های ۱ به ۲ را انتخاب می کنیم . یعنی اگر در بررسی چارت های مختلف دیدیم که دو پتانسیل ترید مشابه وجود داردیکی از راه های تصمیم گیری محاسبه میزان R/R دو پوزیشن است . به این ترتیب با هر ترید موفقی که انجام بدهیم به میزان دو برابر یک ترید ناموفق سود می کنیم و ناگفته پیداست که این روند در دراز مدت به منجر به سودآوری مداوم می شود . در صورتی که این قاعده را رعایت کنیم و از ترید روی وضعیت هایی که علی رغم ایده آل بودن (از نظر روش ترید) با محاسبات R/R ما همخوانی نداشت اجتناب کنیم در دراز مدت سودی پایدار خواهیم داشت هر چند که چندین ترید پشت سر هم منجر به ضرر هم داشته باشیم . چرا که می دانیم با یک استراتژی صحیح و در دراز مدت سود های ما ، به جهت درصد دو برابری که در هر ترید دارند ضررها را جبران خواهند کرد .

همان طور که می بینید روند کار بسیار ساده است اما متأسفانه اکثر افراد این روش را در ترید های خود رعایت نمی کنند و به محض این که فرصت تریدی مهیا می شود پوزیشن جدیدی باز می کنند و به تنها چیزی

www.sheymiha.com

که توجه می کنند سود و بالا رفتن حساب بانکی شان است اما نباید هیچ گاه فراموش کنیم که لازمه موفقیت دراز مدت در ترید پیروی از یک استراتژی خوب به همراه انضباط کاری و داشتن مدیریت سرمایه دقیق است . به این شکل است که می توانیم تعداد ضررهایمان (که مطمئناً پیش خواهد آمد) را به نسبت سود ها کمتر نگه داریم .

اینک مثال ابتدای این بحث را مجدداً بررسی می کنیم تا ببینیم هر چند تریدی بسیار موفق بوده ، آیا در آن رعایت قوانین مدیریت سرمایه و میزان ریسک پذیریی صورت گرفته است یا خیر . لطفاً دوباره به چارت توجه بفرمایید :

EUR/JPY 1hr

forexa.com

نقطه ورود ما کندل بزرگ بولیش انگولفینگ بوده است در واقع به محض اینکه این کندل بسته شد باید با آغاز کندل بعدی وارد پوزیشن شویم . پس نقطه ورود ما نقطه ۱۴۵,۵۵ است (توجه داشته باشید که برای راحتی کار میزان اسپرید را از محاسبه حذف کرده ایم) . با توجه به اینکه ریتریس بر روی نسبت ۷۶ فیبوناچی بوده است پس هدف قیمتی بر اساس روش۳-۲-۱ ، برابر میزان ۱۲۷ فیبوناچی است که در اینجا معادل ۱۴۵,۹۵ است . یعنی اگر قیمت به هدف تعیین شده برسد و پوزیشن با سود بسته شود ، سود به دست آمده برابر با ۴۰ پیپس می شود . اما در صورتی که روند قیمت بر عکس تحلیل ما پیش می رفت و ترید منجر به ضرر می شد چه اتفاقی می افتاد ؟ حد ضرر ما در این ترید برابر بود با ۱۰ پیپس پایین تر از آخرین نوسان نزولی که برابر است با ۱۴۵,۰۵ . با توجه به نقطه ورود ما به پوزیشن که برابر بود با ۱۴۵,۵۵ ، میزان ریسکی که می کنیم برابر است با ۵۰ پیپس . پس در صورتی که سود کنیم ۴۰ پیپس به دست می آوریم و در صورتی که ضرر کنیم ۵۰ پیپس از دست می دهیم . بنابر این قبل از این که اقدام به گرفتن این پوزیشن کنیم به جهت این که میزان ریسک به سود (R/R) حتی برابر با نسبت 1/1 هم نبوده است نمی بایست اقدام به گرفتن پوزیشن می کردیم . چون این نسبت می بایست حداقل به میزان 1/1.5 و در حالت ایده آل 1/2 باشد بنابر این در آن زمان ما نمی بایست این ترید را انجام می دادیم . البته الان می دانیم که آن ترید با موفقیت انجام می شده اما در حالت عادی هرگز آینده یک پتانسیل ترید مشخص نیست پس می بایست همواره ابتدا میزان ریسک به سود را محاسبه نمود و پس از آن اقدام به پوزیشن گیری کنیم چرا که می بایست هر ترید ما میزان سودش بیش از میزان ضرر باشد تا هر ترید موفق ما باعث شود در مقابل تریدی ناموفق باز هم در سود باشیم و این است روشی که در دراز مدت منجر به سود دائمی برای ما می شود .

روشی که در مورد مدیریت سرمایه گفته شد روشی ساده اما بسیار مفید است . با به کار گیری مداوم این روش به کاربردی بودن آن پی می برید . منتهی این روش نیاز به یک توضیح کوتاه تکمیلی دارد که در زیر شرح داده می شود . زمانی که وارد بازار می شویم می توانیم بر اساس سیگنال های بعدی که به ما ارائه می شود مجدداً وارد بازار شویم و به اصطلاح به افزایش حجم لات پوزیشن های خود بپردازیم . برای مثال در روش ۳-۲-۱ بعد از تریگر ورودی اولیه (مثلاً دانای اول) ممکن است بر اثر سیگنال دوم (دانای دوم) هم برای ما فرصتی جهت افزایش لات و کسب سود بیشتر پیدا کنیم . اما در این بین تکلیف وضعیت پوزیشن جدید از نظر مدیریت سرمایه چه می شود ؟ گفتیم که برای ورود به بازار با اولین پوزیشن می بایست بر اساس سرمایه ای که داریم محاسبه کنیم میزان ۳٪ آن چقدر می شود و بعد بر اساس این که فرضاً هر پیپس معادل چند دلار است (بر اساس میزان لاتی که می گیریم) میزان پیپسی که برای حد ضرر انتخاب می کنیم را مشخص کنیم که در بالا توضیح داده شد . زمانی که سیگنال جدیدی صادر می شود و می خواهیم دومین

www.sheymiaha.com

پوزیشن را بگیریم می بایست حتماً فرض را بر این بگیریم که پوزیشن اول منجر به ضرر می شود . یعنی فرضاً اگر سرمایه ای ۱۰۰۰ دلاری داریم و پوزیشن اول را به گونه ای گرفته ایم که حد ضرر ۳۰ پیپسی دارد حتی اگر پوزیشن در سود هم هست می بایست فرض کنیم این پوزیشن به ضرر منجر می شود و در این ترید ۳۰ دلار متضرر می شویم . چرا اینکار را می کنیم ؟ برای این که می بایست زمانی که با پوزیشن اول در بازار هستیم بتوانیم میزان ریسکی که برای پوزیشن دوم برای ما امکان پذیر است را محاسبه کنیم و چون در آن لحظه نمی دانیم که سرانجام پوزیشن اول چه می شود و در نتیجه آن سرمایه ما بیشتر یا کمتر می شود پس می بایست فرض را بر ضرر پوزیشن اول بگذاریم . این باعث می شود که وقتی می خواهیم میزان ریسک برای پوزیشن دوم را محاسبه کنیم ، این کار را به جای در نظر گرفتن سرمایه ۱۰۰۰ دلاری با ۹۷۰ دلار انجام دهیم و میزان ۳٪ از ۹۷۰ دلار را بدست بیاوریم و از روی آن میزان پیپس قابل ریسک را محاسبه کنیم . به این ترتیب هیچ وقت بیش از ۳٪ سرمایه را بر روی پوزیشن دوم ریسک نکرده ایم . در واقع بدترین حالت ممکن را در نظر گرفته ایم که پوزیشن اول منجر به ضرر می شود و چون ما از قبل ۳٪ از سرمایه ۹۷۰ دلاری را حساب کرده ایم ، در نتیجه ریسک ما روی پوزیشن دوم هم بیشتر از ۳٪ نمی شود . به این ترتیب می توانیم پوزیشن های بعدی را بگیریم بدون این که هیچ وقت بیش از ۳٪ سرمایه را ریسک کرده باشیم . پس اگر بخواهیم سومین پوزیشن را هم بگیریم (مثلاً با مشاهده فراکتال به عنوان سیگنال سوم یا هر نشانه دیگری) ، در این صورت باز می بایست فرض را بر این بگیریم که دو پوزیشن قبلی با ضرر بسته خواهند شد ومیزان ضرر بر اثر به ضرر رسیدن دو پوزیشن اول را محاسبه از کل سرمایه کسر کنیم و ۳٪ باقی مانده را محاسبه کرده ، بر اساس آن میزان پیپس امکان پذیر برای تعیین حد ضرر پوزیشن سوم را مشخص کنیم .

نکته دیگری که بایستی به آن توجه داشت این است که اگر بخواهیم در شروع پوزیشن گیری به جای یک پوزیشن ، دو پوزیشن برابر اما کوچک تر بگیریم می بایست مجموع ضرر احتمالی این دو پوزیشن برابر با همان ۳٪ شود . در واقع حد ضرر هر کدام باید ۱,۵٪ شود تا مجموع ضرر دو پوزیشن بیش از ۳٪ کل سرمایه نشود .

یک مطلب تکمیلی دیگر هم که لازم است بیان شوداین است که رابرت ماینر برای این مسأله درصد دیگری را در نظر می گیرد که آن را هم مطرح می کنیم . بهتر است دوستان هر دو روش را بررسی بفرمایند و روشی که به نظرشان مناسب تر است را استفاده کنند . آقای ماینر معتقدند که می بایست در ابتدای امر دو پوزیشن گرفت به طوری که مجموع ضرر این دو پوزیشن بیش از ۵٪ کل سرمایه نشود . در پوزیشن های احتمالی بعدی (برای افزایش لات بر اساس سیگنال ورودی بعدی) میزان ریسک روی تک پوزیشن بعدی نمی بایست

www.sheymiaha.com

بیش از ۲,۵٪ شود . بنابراین ایشان به جای ۳٪ برای هر پوزیشن ، برای پوزیشن های تکمیلی که در ادامه روند شکل می گیرد میزان ۲,۵٪ را پیشنهاد می کنند .

نکته دیگری که باید به آن اشاره شود هر چند ظاهراً ساده است اما افراد بسیاری این را در نظر نمی گیرند و دانستنش می تواند خیلی مفید باشد . فرض کنیم امروز چارت های مختلف را بررسی می کنیم و می بینیم که پوند در مقابل ارزهای مختلفی یک وضعیت تقریباً واحد و مشابه را داراست . در اینحالت باید چه کنیم ؟ فرضاً GBP/USD ، GBP/JPY ، GBP/CHF و ... تماماً به ما سیگنال می دهند که در انتهای موج ۴ هستیم و بایدSell کرد . یا همگی به ما پترن ایده آلی را نشون می دهند که فرصت Sell خوبی را فراهم کرده است چه باید بکنیم ؟ بر روی تمامی ارزهایی که پوند طرف مقابل آنهاست و از نظر تکنیکالی یک وضعیت را نشان می دهند Sell کنیم ؟

پاسخ این است که اگر این کار را انجام دهیم دچار اشتباه بزرگی شده ایم . علت این است که چون تمامی این ارزها یک طرفشان پوند است درست است که به طور نسبی یک رفتار مشابه را نشون می دهند (در مقابل تضعیف و یا تقویت پوند) . اما مسأله اینجاست که اگر تحلیل ما در مورد پوند اشتباه باشد ، ناگهان تمامی آن پوزیشن هایی که گرفته ایم وارد ضرر می شوند ! این نکته مهمی است که زمانی که می خواهیم چند پوزیشن بگیریم ، دقت کنیم و ببینیم که آیا یک طرف همگی آنها یک ارز یکسان نباشد . چون اگر فرضاً همگی پتانسیل فروش نشان دهند ، اما به هر دلیلی تحلیل ما اشتباه باشد و روند صعودی شود ، طبیعی است که تمامی آن پوزیشن های فروش ما وارد ضرر می شوند و ضرر بزرگی می کنیم . بنابراین همیشه این نکته را به خاطر داشته باشیم ، زمانی که می بینیم ارز خاصی در مقابل ارزهای دیگر وضعیت مشابهی را دارد ، نباید بر روی تمامی آنها فروش یا خرید کنیم تا اگر تحلیل به خطا رفت تمامی پوزیشن ها منجر به ضرر نشوند . در صورتی که سرمایه ما اجازه می دهد بیش از یک پوزیشن بگیریم ، به این شکل عمل کنیم که فرضاً وضعیت پوند را مقابل ارزهای مختلف مقابلش بررسی کنیم و ایده آل ترین آنها را برای گرفتن پوزیشن انتخاب کنیم . اگر مارجین ما اجازه گرفتن پوزیشن دوم را می داد دیگر بر روی ارزهایی که یک طرفش پوند است و تحلیل مشابه وضعیت قبلی به آن هم صدق می کند ترید نکنیم و کلاً روی ارز دیگری تحلیل کرده و اقدام به گرفتن پوزیشن کنیم . این نکته ساده ای است اما بارها و بارها مشاهده شده که حتی تریدرهای با تجربه هم به این مسله دقت کافی ندارند و گاهی چندین پوزیشن را به گونه ای می گیرندکه یک طرف پوزیشن هایشان ارز واحدی است و این احتمال ریسک و خطر را خیلی بالا می برد .

www.sheymiaha.com

پرسش : در صورتی که مخالف با تایم فریم روزانه سیگنال داشتیم آیا هدف را روی اولین خط حمایت یا مقاومت قرار دهیم یا باید محلی قرار داد که نسبت سود به ضرر ۱,۵ رعایت شود؟چون ممکن است در اولین تارگت نسبت سود به ضرر مقداری کمتر از ۱,۵ باشد ؟

پاسخ : در هر سیستم تریدینگی می بایست به قواعد R/R مقید باشیم . اما چرا ؟ علت این است که اگه این موضوع را رعایت نکنیم حتی اگر پیش از ترید هم دقیقاً بر اساس این قوانین پوزیشن را گرفته باشیم باز هم اگر قرار باشد که قبل از این تارگت ها پوزیشن را ببندیم دیگر بر اساس آن قوانین عمل نکرده ایم . یعنی مثلاً تریدی ۳۰ پیپس در سود است و استاپ آن هم ۵۰ پیپس است . اگر به جهت نگرانی از برگشت روند یا هر دلیل دیگری پوزیشن را ببندیم انگار تریدی کرده ایم که از ابتدا هدف آن ۳۰ پیپس و حد ضرر آن ۵۰ پیپس بوده و می دانیم که تا چه حد ترید بر این اساس غلط و در دراز مدت زیان ده است . بنابر این باید دقیقاً بر قوانین ترید پایدار باشیم . در صورتی که می بینیم که مقاومت خیلی مهمی پیش از تارگت ترید ما قرار دارد می بایست این را در لحظه گرفتن پوزیشن در نظر می گرفتیم و در نتیجه ترید نمی کردیم . خلاصه این که اصلاً نباید پس از ورود به پوزیشن ، نقطه هدف و حد ضرر را تغییر داد هر چند می شود حد ضرر را با توجه به حرکت روند قیمت در جهت سود تغییر داد که در آینده بیشتر توضیح داده می شود .

پرسش : بعد از گرفتن چند پیپ سود (در حالت آرمانی) حد ضرر را بر روی نقطه ورودی خود قرار دهیم؟

پاسخ : برای این کار روش های مختلفی ارایه شده است . برای مثال کن مارشال و راب مبرای در کتاب CI System معتقدند که اگر ترید شما ۳۰ پیپس سود داده بود ، حد ضرر را روی نقطه ورود (BreakEven) قرار بدهید . بنده این روش را امتحان کرده ام . اما صادقانه بگویم روش توصیه شده ایشان که حد ضرر را ۱۰ یا ۱۵ پیپس بالاتر می گیرند و معتقدند این روش انتقال حد ضرر به نقطه ورود بعد از این که پوزیشن به اندازه ۳۰ پیپس وارد سود شد خیلی خوب جواب داده ، در عمل برای بنده موفقیت زیادی به همراه نداشته و بارها باعث شده که بعد از این که قیمت به نقطه ورودم برگشته و پوزیشن بسته شده ، روند به سمت هدف پیش رفته است . به بیان دیگر ، به نظر من ۳۰ پیپس فاصله خوبی برای تعقیب روند نیست . استیو گریفیث سازنده نرم افزار MTP روشی را پیشنهاد می کند که اساسش بر این مبنا است که ببینید در ابتدای ورود به پوزیشن میزان حد ضرری که تعیین کرده اید چقدر است و این مقدار را مبنای میزان انتقال حد ضرر قرار می دهد . فرضاً اگر ۵۰ پیپس بوده ، هر وقت پوزیشن شما به میزان ۵۰ پیپس وارد سود شد ، حد ضرر را به نقطه ورود منتقل کنید . فکر می کنم که این روش که انتقال حد ضرر به نقطه ورود هنگامی انجام می شود که سود به دست آمده برابر با میزان استاپ اولیه باشد از روش مارشال بهتر عمل می کند . هر چند که دوست

www.sheymaha.com

عزیزمان کامیار از قول دوستی حرفه ای که بیش از ۲ سال است به طور حرفه ای و مداوم از نرم افزار MTP استفاده می کند این روش را خیلی کارآمد نمی داند . یعنی آمار دقیقی که از ترید هایش دارد بیانگر این است که در این روش هم زیاد اتفاق می افتد که روند به طرف نقطه ورود برگشته و بعد از لمس حد ضرر در نقطه ورود به سمت هدف باز می گردد . در مورد این که پس راه حل صحیح در این موارد چیست باز هم در ادامه صحبت می کنیم .

پرسش : در شرایط ایده آل وبعد از این که دائماً سود افزایش پیدا کند آیا مناسب تر است که حد ضرر را نیز مرتباً در جهت سود تغییر داد تا در صورت برگشت احتمالی روند با سود از معامله خارج شد؟ در صورتی که جواب مثبت است آیا اولین مکانی که حد ضرر را هنگام تغییر آنجا قرار می دهیم مکانی است که نسبت سود به ضرر ۱,۵ رعایت شده باشد؟

پاسخ : مشکل اساسی که تمامی این گونه سؤالات از آن سرچشمه می گیرد این واقعیت است که ما زمانی که روندی شکل می گیرد و پوزیشن در جهت سود ما حرکت می کند دقیقاً نمی دانیم که چه قدرتی در این روند نهفته است و به بیان ساده تا چه حد این روند می تواند دنباله دار باشد . به جای این که در مورد سایر روش های متداول برای تغییر استاپ صحبت کنیم بنده معتقدم که می بایست ابزاری داشته باشیم که بتواند به طور مداوم به ما قدرت نهفته در روند که منجر به حرکت قوی یا ضعیف آن می شود را نشان بدهد . طبیعتاً زمانی که دیدیم این ابزار به ما اعلام می کند که روند خیلی ضعیف شده ، در آستانه تغییر جهت روند هستیم و می توانیم با خیال راحت پوزیشن را ببندیم . یا در صورتی که دیدیم ابزارمان به ما می گوید که روند موجود قدرت زیادی دارد می توانیم با اطمینان پوزیشن را همچنان باز نگه داریم . در آینده به ماهیت و چگونگی استفاده از این ابزار به طور مستقل و جامع خواهیم پرداخت .

پرسش : برای این که روی این نوع تحلیل در تایم فریم ۴ ساعته بخواهیم هم جهت با روند اصلی وارد پوزیشن شویم روند را در چه تایم فریمی مورد بررسی قرار می دهیم؟

پاسخ : برای ترید روی هر بازه زمانی حداقل می بایست تایم فریم بالاترش را حتماً در نظر بگیریم . یعنی برای تایم فریم ۴ ساعته همیشه باید حداقل تایم فریم روزانه را بررسی کنیم . در بررسی تایم فریم روزانه گاهی می بینیم که اساساً این تایم فریم به ما سیگنال مخالف سیگنال تایم فریم ۴ ساعته نمی دهد و خنثی است (پیام خاصی ندارد و هیچ سیگنالی برای خرید یا فروش به ما نمی دهد) . در این صورت می توانیم بر اساس تحلیل

www.gheymatha.com

تایم فریم ۴ ساعته عمل کنیم . اما گاهی می بینیم که سیگنالی کاملاً بر عکس روند ۴ ساعته می دهد که در این صورت می بایست خیلی احتیاط کرد و یا اساساً از ترید بر اساس سیگنال ۴ ساعته منصرف شد .

پرسش : اگر پس از بررسی و تحلیل یک جفت ارز را برای ترید انتخاب کردیم و مارجین هم اجازه می داد ، آیا می توان با لات بیشتر آن پوزیشن را گرفت؟

پاسخ : همواره باید حداکثر پیپس قابل ریسک را در نظر بگیرید. یعنی اگرفرضاً سرمایه شما اجازه می دهد که حداکثر یک پوزیشن ۱ لاتی بگیرید که حد ضرر آن هم حداکثر می تواند ۶۰ پیپس باشد(که حداکثر ۳٪ ریسک سرمایه را در نظر گرفته باشید) و فرض کنیم شما با بررسی و تحلیل زیاد ، فوق العاده از وضعیت یک پوزیشن مطمئن هستید ومی خواهید بیشتر از یک لات مجاز خود پوزیشن بگیرید (مثلاً ۲ لات) . در اینصورت حتماً و حتماً می بایست حد ضرر خود را به ۳۰ پیپس کاهش دهید تا در این حالت هم ریسک ۳٪ سرمایه رعایت شده باشد . پس اصل مهم این است که همیشه مدیریت سرمایه را در نظر بگیرید .

حالت دیگری که ممکن است پیش بیاید این است که شما می خواهید یک پوزیشن باز کنید که شرایط بسیار عالی دارد اما حد ضرر بالایی دارد . مثلاً حد ضرر محاسبه شده برای آن ۱۲۰ پیپس است . در این حالت هم اگر خیلی مصر هستید که این پوزیشن را بگیرید ، باید به جای یک لات و ۶۰ پیپس حد ضرر ، این پوزیشن را با ۰,۵ لات و ۱۲۰ پیپس حد ضرر بگیرید .

اگر دقت کرده باشید ، در کتب تکنیکال دراین طور مواقع می گویند که این پوزیشن را نباید بگیرید . علتش این است که این کتب بیشتر برای بازارهای سهام نوشته شده است و چون در آنجا شما با سهام سر و کار دارید و هر سهم یک حداقل قیمتی دارد که نمی توانیدکمتر از آن سرمایه گذاری کنید ، وقتی می بینید که حد ضرر از آن حداقل سهم قابل ریسک هم بیشتر می شود ، نباید آن پوزیشن رو بگیرید و توصیه می شودصبر کنید تا روند تثبیت شود و با تریگرهای بعدی که در پی روند شکل می گیرد وارد بازار شوید . اما در فارکس این امتیاز وجود دارد که شما با قیمت حداقل برای هر سهم روبرو نیستید و به سادگی می توانید میزان لات را نصف و یا حتی کوچک تر کنید تا میزان پیپس و در نهایت میزان ریسکی که می خواهید داشته باشید ، با اصول مدیریت سرمایه ات تداخلی پیدا نکند . فقط باید دقت کنید که اگر فرضاً پوزیشن را می توان با ۳۰ پیپس استاپ گرفت (مثلاً با ۲ لات) ، باید ببینید که این ۳۰ پیپس اعتبار داشته باشد . مثلاً حد ضرر بالای یک خط مقاومت قرار بگیرد . وگرنه صرف اینکه چون از وضعیت مطمئن هستیم یخواهیم لات را بیشتر بگیریم و پیپس حد ضرر را کم کنیم کار درستی نیست چون ممکن است روند به گونه ای باشد که خیلی ساده به حد ضرر ما برسد (چون حد ضرر تعیین شده در جای مطمئنی نبوده است) .

www.sheymiaha.com

تشخیص قدرت روند

در پاسخ به پرسش های گذشته به این نکته رسیدیم که یک مشکل پایه ای و مهم نه فقط در روش ۳-۲-۱ بلکه در هر روشی این است که تشخیص دهیم قدرت نهفته و پتانسیل روند قیمتی بازار برای ادامه چقدر است . در این مورد از یک سری ابزار استفاده می شود . برای مثال اندیکاتور ADX برای تشخیص این که روندی وجود دارد یا بازار رنج است خیلی مناسب است اما مشکلی که این اندیکاتور دارد این است که تنها به ما می گوید روند وجود دارد و نمی تواند جهت آن را مشخص کند . اندیکاتور دیگری نیز در این زمینه یعنی تشخیص قدرت ترند وجود دارد که به نام MFI یا Market Facilitation Index موسوم است . اندیکاتوری است که اولین بار توسط دکتر ویلیامز در کتاب مشهور Chaos Trading در سال ۱۹۹۵ ارایه شد و این اندیکاتور به همراه اسیلاتور الیوت در زمان خودش تحول بزرگی در تحلیل ها محسوب می شد. MFI اندیکاتور قدرتمندی است که متأسفانه کار با آن خصوصاً برای نوآموزان کمی دشوار است . اندیکاتور های دیگری هم در زمینه تشخیص قدرت روند وجود دارند که بعضی از آنها قابلیت تشخص جهت روند را هم دارا هستند که برای جلوگیری از طولانی شدن بحث به آنها نمی پردازیم . مثلاً Brain Trade نمونه ای دیگر از آنها است . در این زمینه می خواهم به معرفی اندیکاتوری بپردازم که در عین سادگی بسیار قدرتمند بوده و به خصوص اگر در تایم فریم های خاصی از آن استفاده شود ، با دقت عجیبی قادر به تشخیص قدرت و جهت روند است . این اندیکاتور به نام Trend Manager موسوم است و بسیار اندیکاتور قدرتمندی است . اندیکاتور به سادگی از دو نوع پرایس بار آبی و قرمز تشکیل شده است و هر کندل را به یکی از رنگ های آبی یا قرمز در می آورد (با نشان دادن خطی در پایین کندل) . خط قرمز نشانه Sell و خط آبی نشانه Buy است . هر زمان هم که دیدیم زیر کندل خطی وجود ندارد به معنی رنج بودن بازار و فقدان روند است .این اندیکاتور به همین سادگی به شما می گوید که چه موقع خرید و چه موقع فروش کنید ! البته با ذکر این نکته که این اندیکاتور چون تنها در روند ها سود آور است در وضعیت های رنج دائماً به ما سیگنال خطا داده و در نتیجه ترید های کوچک منجر به ضرر خواهیم داشت اما در یافتن ترند و همینطور اتمام یک روند به نحوه فوق العاده ای قدرتمند عمل می کند . این اندیکاتور در گذشته فروشی بود و شارژی معادل ۱۵۰ دلار در ماه داشت ! اما امروزه می توانید آن را از لینکی که ارایه می شود به رایگان دریافت کنید . فقط فراموش نکنید که این اندیکاتور را به تنهایی استفاده نکنید بلکه زمانی که فرضاً بر اساس سیستم تریدینگ ۳-۲-۱ سیگنال خرید یا فروشی را دیدید ، برای این که دچار بازار رنج نشوید این اندیکاتور را بر روی چارتی که روی آن تحلیل کرده اید قرار دهید. در این صورت به سادگی خواهید فهمید که روند قیمت در چه

www.sheymaha.com

جهتی است و در نتیجه از خیلی ترید هایی که مخالف جهت روند است پرهیز خواهید کرد . دقت کنید که این اندیکاتور بهترین کیفیت را در تایم فریم یک ساعته دارد اما برای ۴ ساعته هم کاملاً قابل استفاده است . علاوه بر این ، زمانی که پوزیشن شما در سود باشد با بررسی خطوط رنگی زیر کندل ها خواهید دانست که تا چه زمانی می توانید پوزیشن خود را باز نگه دارید . فرضاً اگر یک پوزیشن خرید دارید می توانید خطوط آبی رنگ زیر کندل ها را دنبال کنید . تا زمانی که این خطوط آبی رنگ زیر کندل ها باشد نیازی نیست که پوزیشن خود را ببندید . می بینید که با کمک این اندیکاتور به جای این که نگران این باشیم که چطور حد ضرر را به نحو مؤثری جابه جا کنیم می توانیم با تعقیب روند قیمت و توجه به خطوط آبی یا قرمز زیر کندل ها ، به قدرت و جهت روند پی برده و بر اساس آن حد ضرر خود را تنظیم کنیم . توصیه می کنم از این اندیکاتور به تنهایی استفاده نکنید و از آن تنها به عنوان یک فیلتر و تأیید کننده تحلیل های خود استفاده کنید و در واقع نقشی مکمل برای تحلیل هایتان داشته باشد . به جای قرار دادن اندیکاتور در سایت ، لینک سایت مرجع آن را ارائه می کنم که بتوانید به اطلاعات مفید بیشتری هم دسترسی داشته باشید :

http://www.traderstradingsystem.com/

در انتهای صفحه سایت قسمتی قرار دارد که شما می بایست نام و یک ایمیل به سایت بدهید . سایت برای شما نامه ای ارسال می کند که از طریق لینکی در آن نامه می توانید این اندیکاتور را به رایگان دریافت کنید .

پرسش : در مورد اندیکاتورهای trend manager و entrex بیشتر توضیح دهید .

پاسخ : اندیکاتور Trend Manager را می توانید از سایتی که در بالا معرفی شد دانلود کنید. اندیکاتور entrex در واقع همان اندیکاتور Envelops در متاتریدر است که در پارامترهایش تغییراتی داده شده که در زیر می توانید ببینید .

برای تایم فریم یک ساعته می بایست پارامترهای Envelops را به این صورت تغییر دهید .

Period : 26 – Shift : 0
MA Method : Exponential
Apply to :Typical Price (HLC/3)
Devation : 0.7

www.sheymaha.com

برای تایم فریم ۴ ساعته تمامی پارامترهای فوق صحیح است تنها باید در قسمت انتهایی بجای ۰,۷ از مقدار ۱,۱۱ استفاده کرد یعنی به این شکل

Devation : 1.11

با تغییر پارامترهای اندیکاتور Envelops به شکل گفته شده ، دقیقاً به نتایج اندیکاتور Entrex می رسیم.
برای راحتی کار می توانید اندیکاتور Trend Manager را از آدرس زیر هم دانلود کنید .

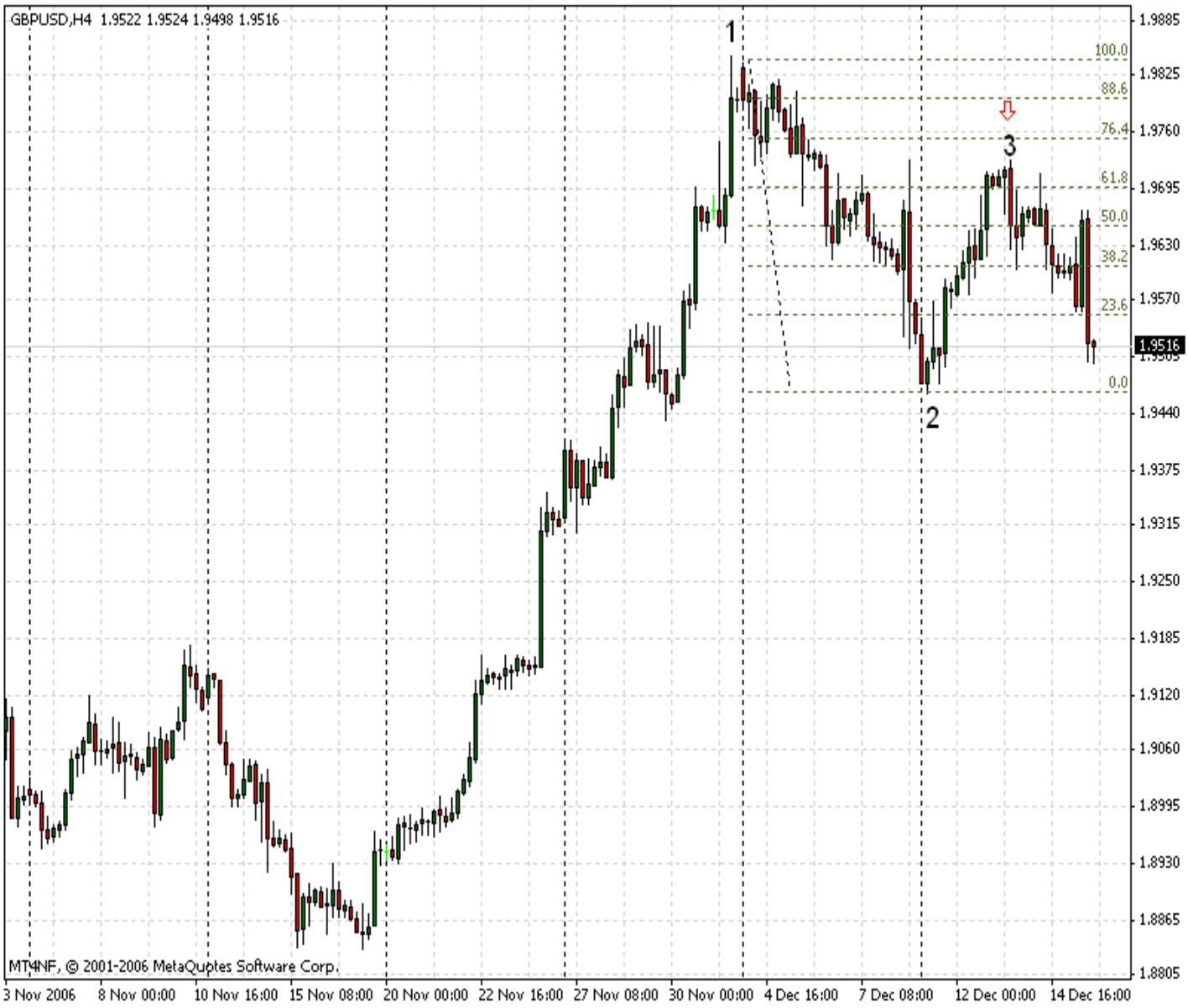
http://gheymatha.com/download.php?id=3309

مثال های عملی

همان طور که قبلاً گفته شد ، بنده از این روش تنها در تایم فریم ۴ ساعته استفاده می کنم اما شما می توانید از آن در تایم فریم های دیگر هم استفاده کنید (خود من هم مدتی است این روش را در تایم فریم نیم ساعته هم زیر نظر دارم)
یادآوری می شود که عناصر لازم برای ترید براساس روش ۳-۲-۱ عبارتند از :
۱ - پترن ۳-۲-۱
۲- نسبت های ۶۱ یا ۷۶ فیبوناچی
۳- تریگر دانای اول یا در اولویت بعدی ،کندل معتبر
در چارت زیر هر سه عامل را دارا هستیم . برای کندل استیک هم از کندل پترن بیریش انگولفینگ برای تریگر استفاده شده است .

نکته : در مرجع اصلی ، برای ورود به پوزیشن از کندل پترن های مورد اشاره استفاده می شود اما طی مدت استفاده از این روش ، ورود به پوزیشن را با تریگر دانای اول هم امتحان کرده ام که حتی نتایج بهتر و سود بیشتری نسبت به روش کندل های کلاسیک دارد .
باز هم یادآوری می شود ، برای این که ریسک ترید را کم کنید می توانید زمانی که پوزیشن وارد سود خوبی شد حد ضرر را به نقطه ورود پوزیشن منتقل کنید و یا به روشی که در مرجع اصلی برای این کار معرفی شده است عمل کنید .

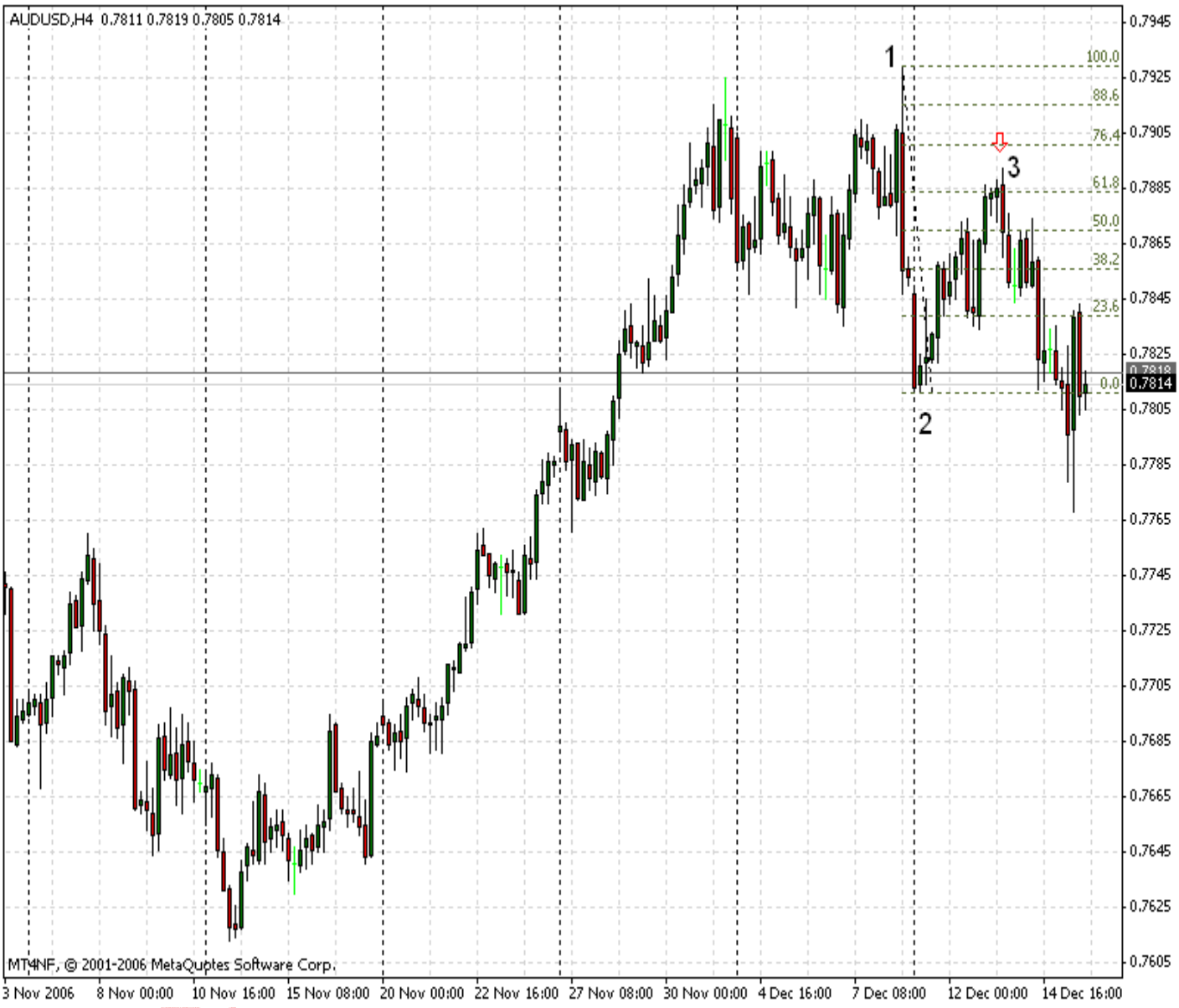
www.gheymatha.com


GBPUSD,H4 1.9522 1.9524 1.9498 1.9516
1
2
3
100.0
88.6
76.4
61.8
50.0
38.2
23.6
0.0
1.9516
MT4NF, © 2001-2006 MetaQuotes Software Corp.
3 Nov 2006
8 Nov 00:00
10 Nov 16:00
15 Nov 08:00
20 Nov 00:00
22 Nov 16:00
27 Nov 08:00
30 Nov 00:00
4 Dec 16:00
7 Dec 08:00
12 Dec 00:00
14 Dec 16:00

****

www.g

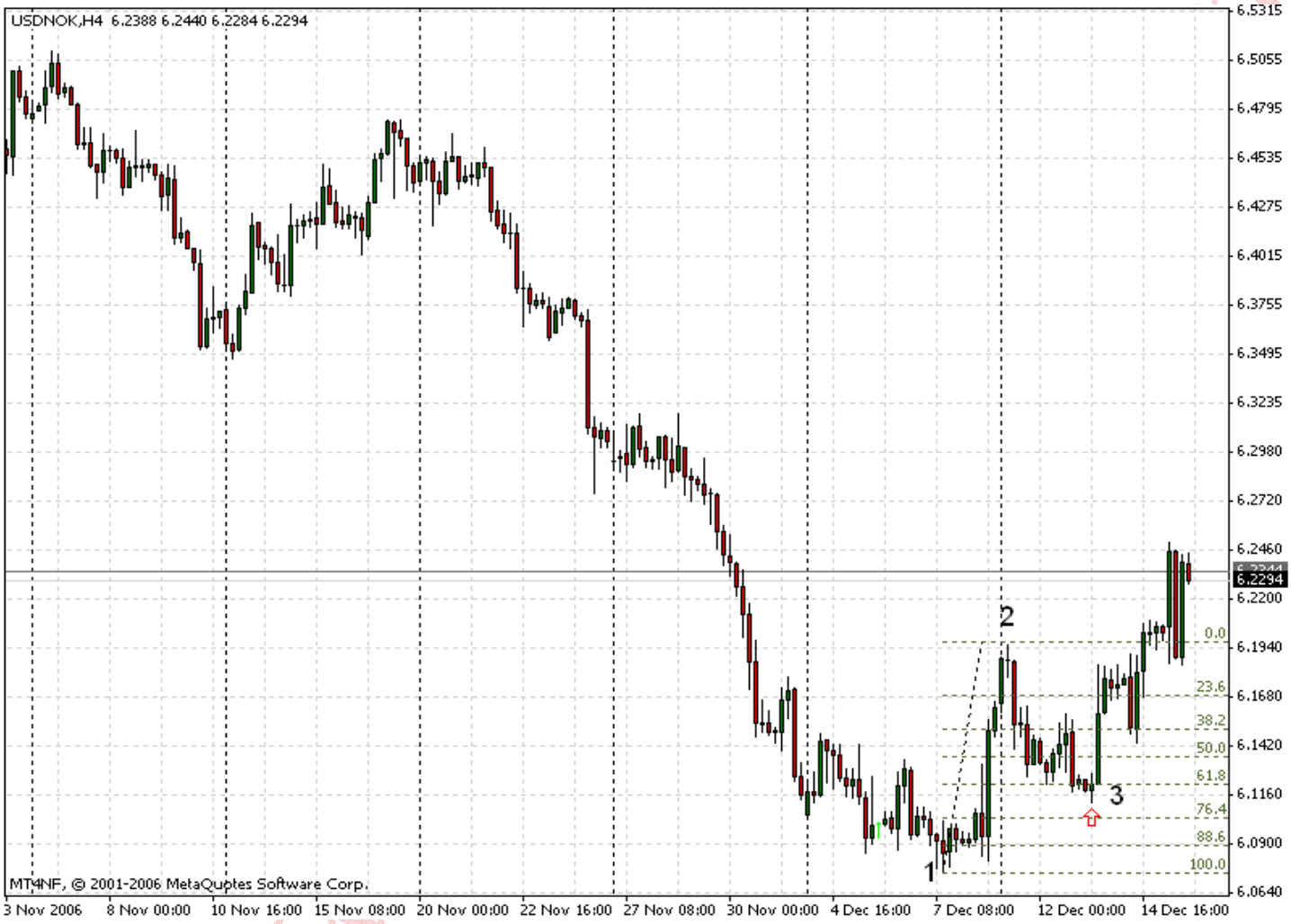
نکته : توصیه می شود همیشه ارزهای مختلف را در تایم فریم ۴ ساعته زیر نظر داشته باشید و در صورت شکل گرفتن پترن مورد نظر از آن استفاده کنید . مثل پترن زیر که در تایم فریم ۴ ساعته جفت ارز AUD/USD تشکیل شده است . برای تریگر از کندل بیریش انگولفینگ استفاده شده .



****

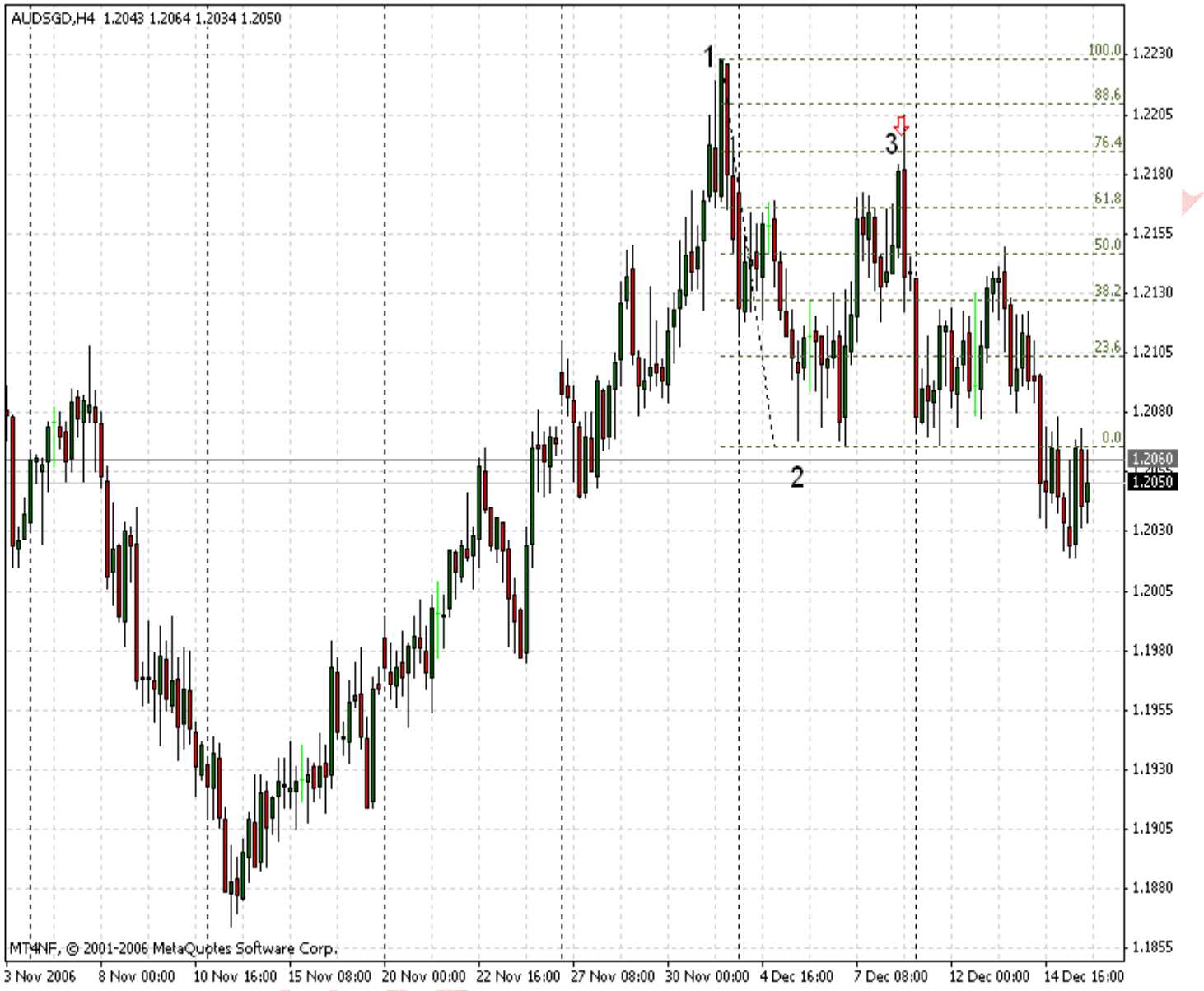
نکته : این فرم بر روی ارزهای مختلف حتی آنهایی که کمتر تحلیل و ترید می شوند به سادگی مشاهده و به خوبی عمل می کند .

در زیر نمونه دیگری از ترید بر اساس این روش را مشاهده می کنید . جفت ارز دلار به کرون نروژ در تایم فریم ۴ ساعته :

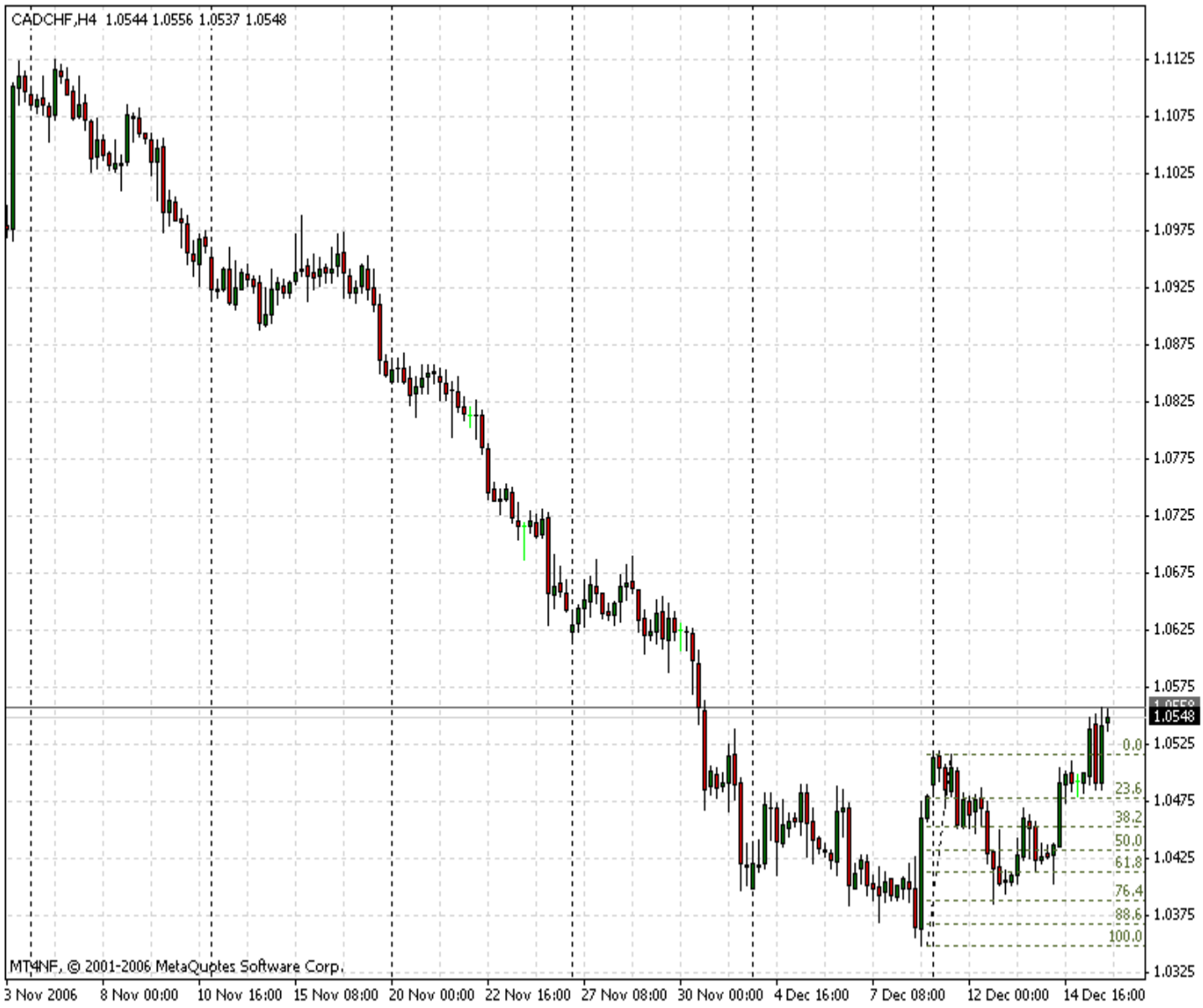


****

مثال های دیگری از ترید به روش ۳-۲-۱



www



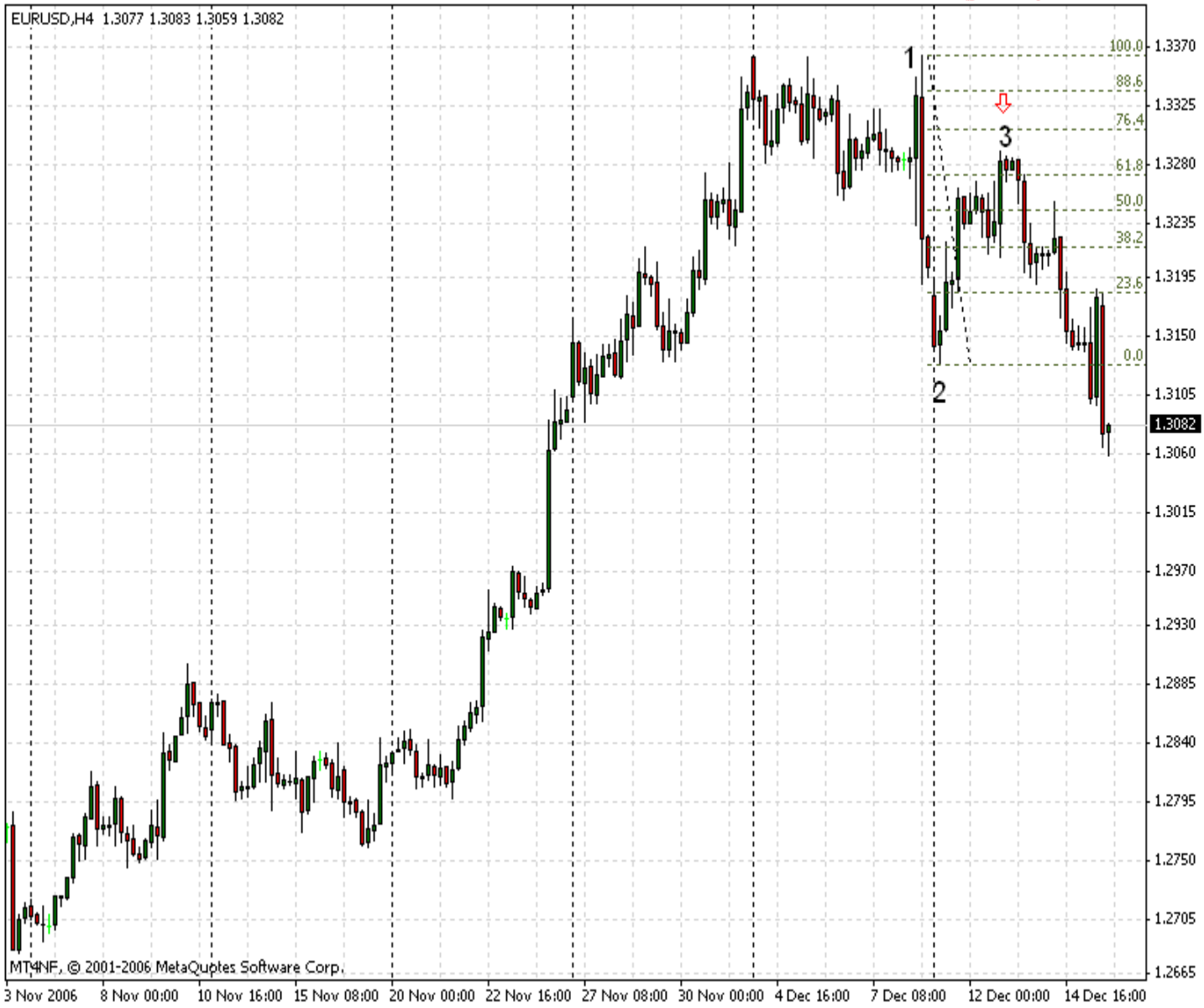
****

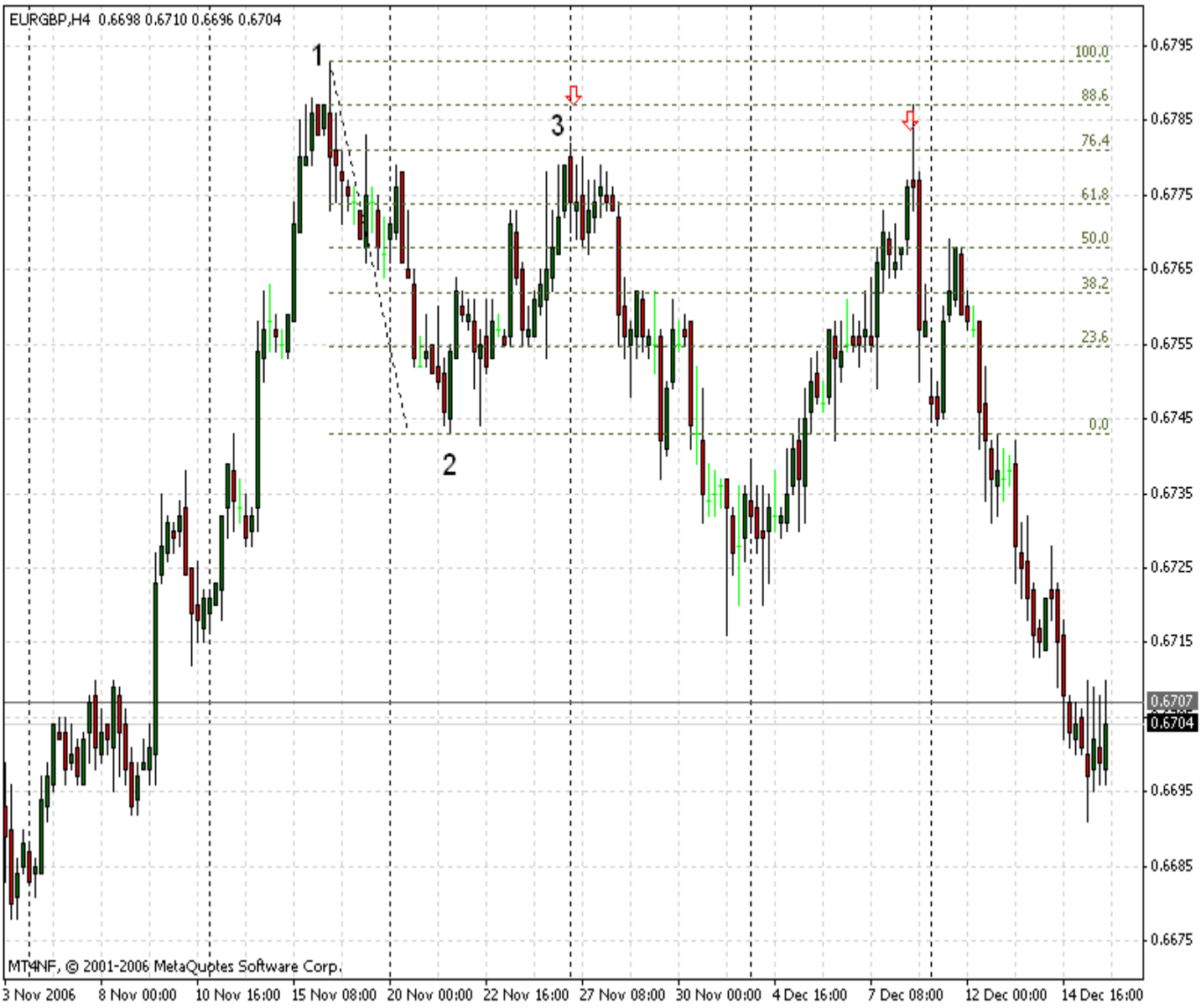
در صورتی که به طور مرتب روش ۳-۲-۱ را در تایم فریم ۴ ساعته و در ارزهای مختلف دنبال کنید از میزان دفعاتی که این روش صحیح عمل کرده و سود عالی به همراه داشته تعجب خواهید کرد .

در چارت اول EUR/USD شاهد موفقیت این روش ساده اما مؤثر هستیم . توجه به این نکته که حتی روش های بسیار قدرتمند و پیچیده ای نظیر الیوت هم این اواخر در تحلیل دقیق یورو مشکلات متعددی داشته اند می تواند درسی دیگر باشد که گاهی چه ساده می شود رفتار یک ارز را تا حد بالایی به دقت تحلیل و نتیجه گیری کرد . در چارت EUR/GBP حتی شاهد دو ترید بسیار موفق بر اساس این روش هستیم . در چارت سوم EUR/CAD این روش ترید را بر اساس نسبت ۸۸ فیبوناچی (کشف شده توسط اسکات کارنی)

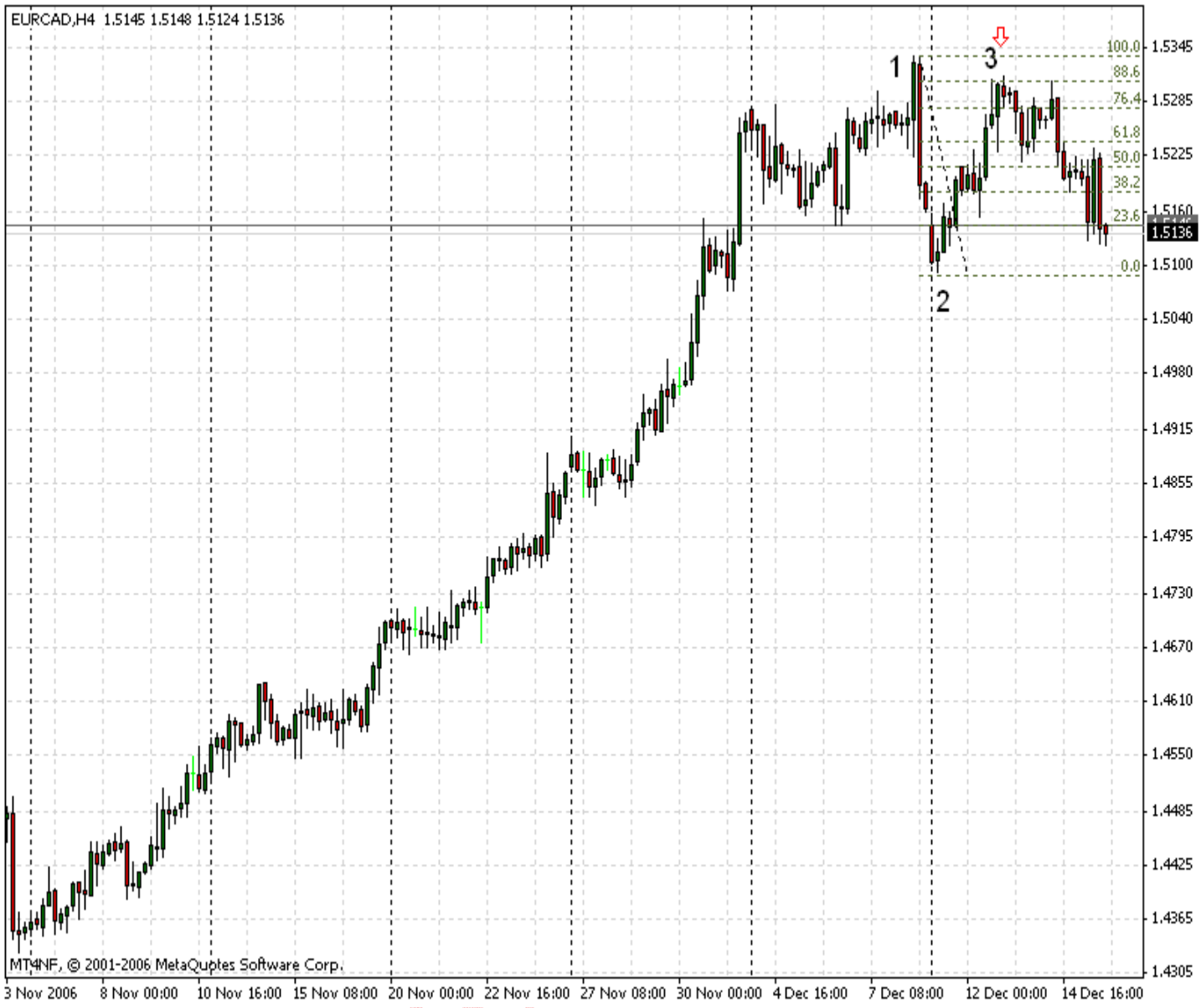
مشاهده می کنید . این نسبت نمونه ای از وضعیت های مدرن این روش است و می تواند به عنوان سوژه ای برای تکمیل و پیشرفت ترید بر اساس روش ۳-۲-۱ معرفی و تست شود (ایده دیگر که قبلاً هم به آن اشاره شد گرفتن تریگر بر اساس دانای اول است) . این دو روش مکمل می توانند در صورت تست و بررسی های زیاد و در صورت نتیجه دادن به عنوان روشی جهت تکمیل این سیستم تریدینگ معرفی شوند .

باز هم تأکید می شود که این روش را خصوصاً در تایم فریم ۴ ساعته جدی بگیرید و همیشه با هر روشی که تحلیل و ترید می کنید همواره نیم نگاهی هم به چارت ۴ ساعته ارزهای مختلف داشته باشید و امکان ایجاد این پترن خاص ۳-۲-۱ را بررسی کنید . اطمینان داشته باشید که در دراز مدت از این روش راضی خواهید بود .




EURGBP,H4 0.6698 0.6710 0.6696 0.6704
1
2
3
100.0
88.6
76.4
61.8
50.0
38.2
23.6
0.0
0.6795
0.6785
0.6775
0.6765
0.6755
0.6745
0.6735
0.6725
0.6715
0.6707
0.6704
0.6695
0.6685
0.6675
MT4NF, © 2001-2006 MetaQuotes Software Corp.
3 Nov 2006
8 Nov 00:00
10 Nov 16:00
15 Nov 08:00
20 Nov 00:00
22 Nov 16:00
27 Nov 08:00
30 Nov 00:00
4 Dec 16:00
7 Dec 08:00
12 Dec 00:00
14 Dec 16:00

www.gf

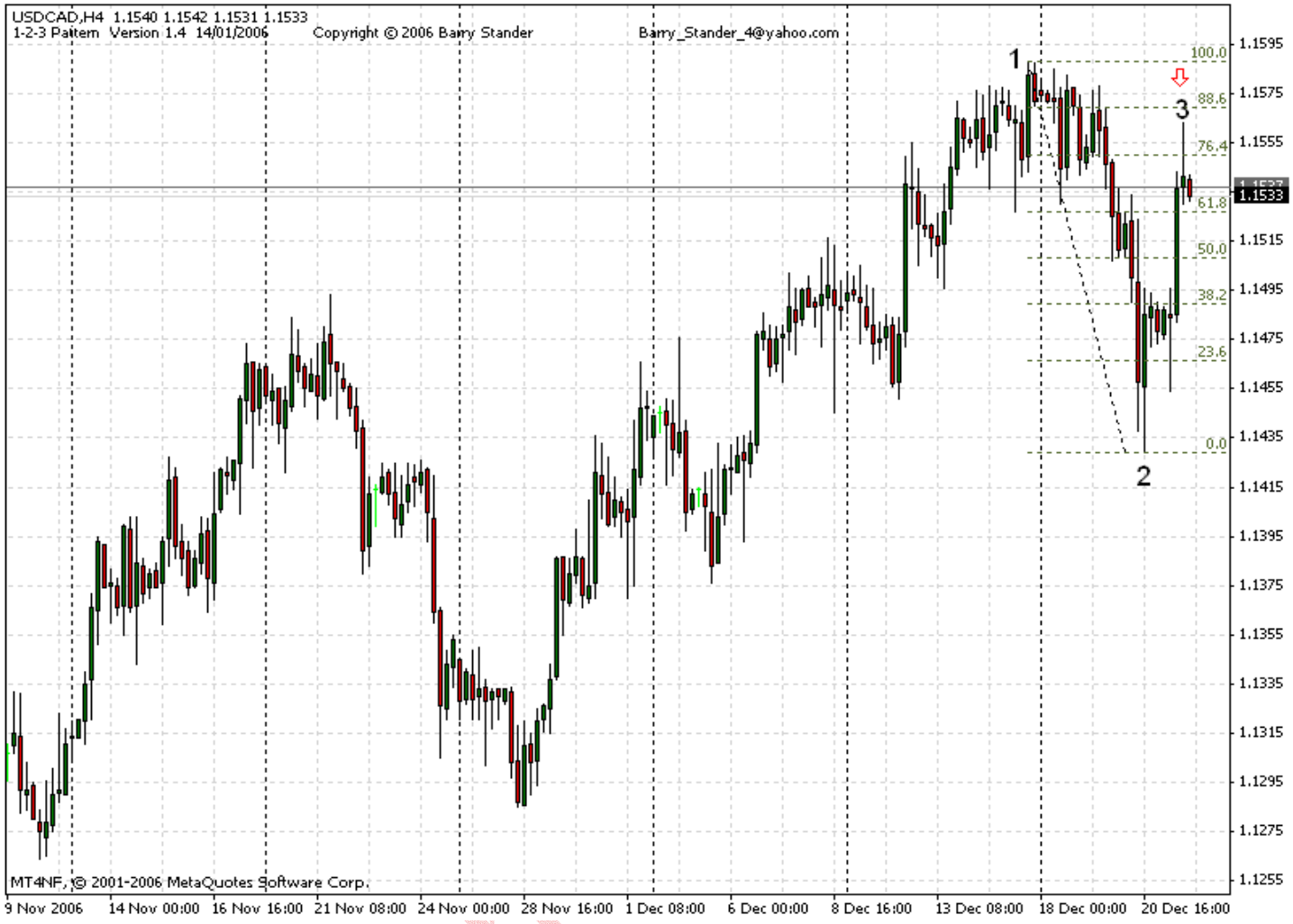


توجه : در تمامی این چارتها نکته ای نهفته است که با دقت و توجه خواننده قابل درک خواهد شد !

****

www.g

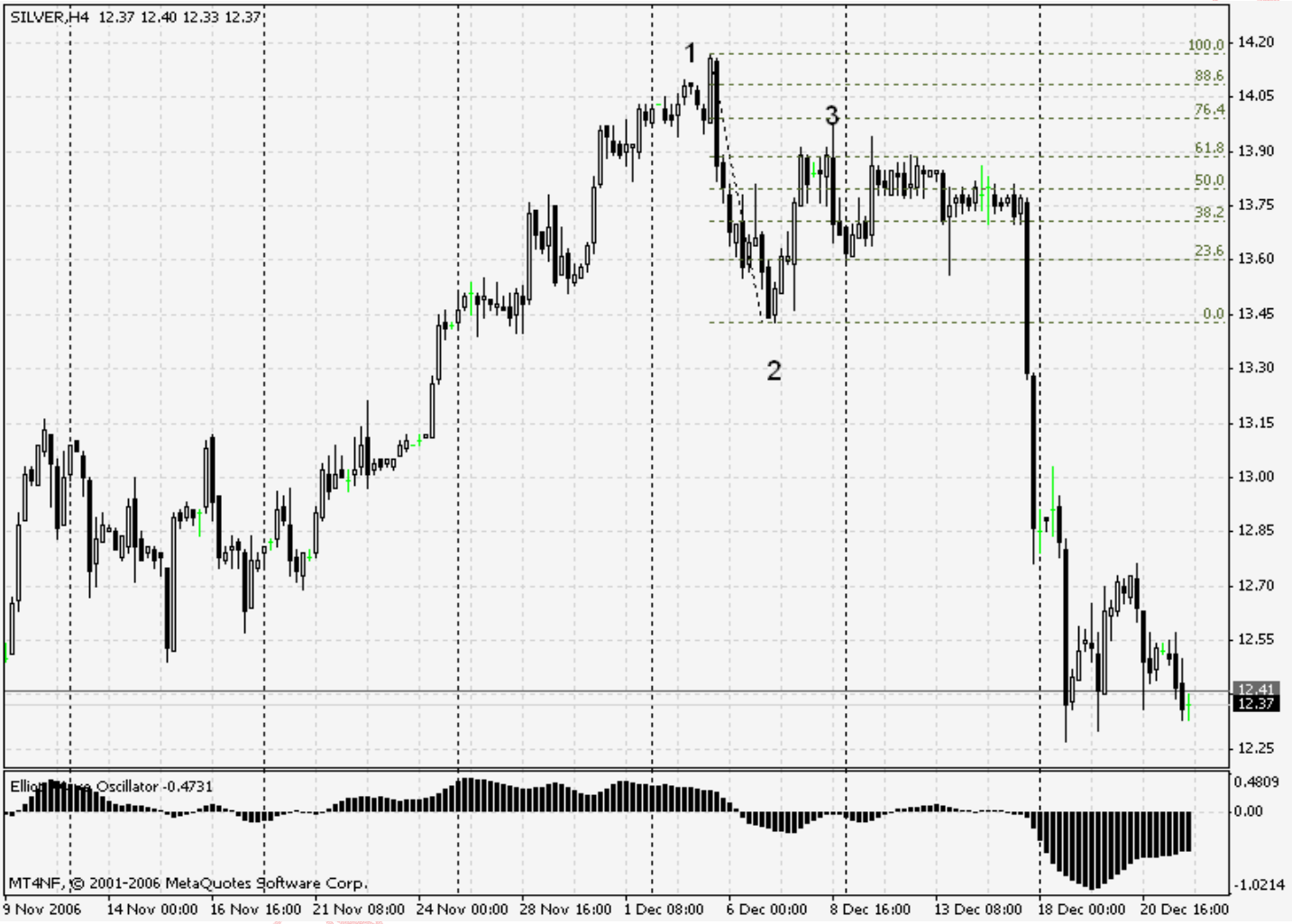
یک مثال دیگر



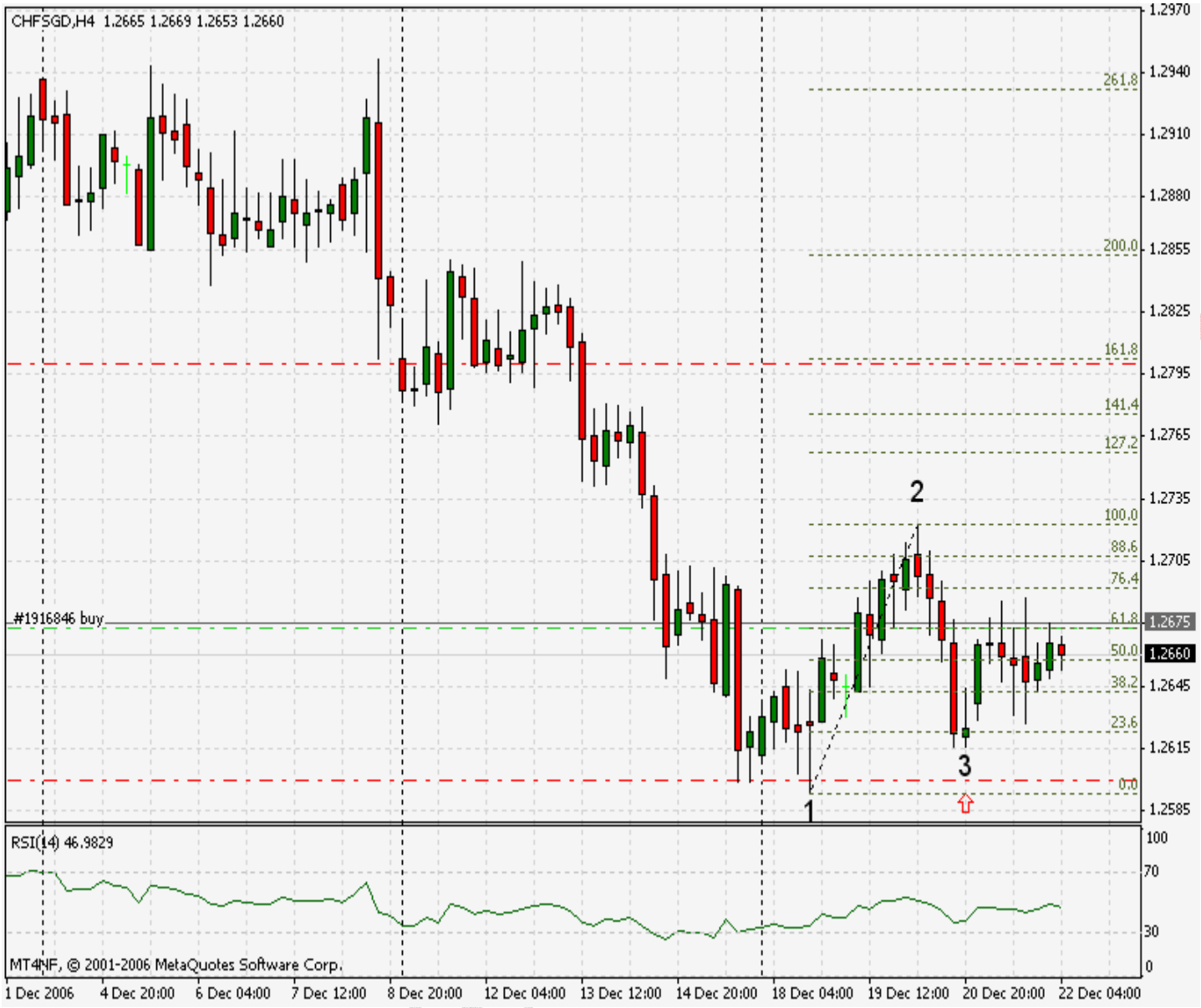
****

www.gl

به چارت زیر توجه کنید . نقره در تایم فریم ۴ ساعته که دقیقاً بر اساس روش ۳-۲-۱ قابل تریـد بـوده و بـسیار هم موفق بوده است . فراموش نکنید که هر ۰,۱ لات در نقره معادل ۵ دلار است . با یک حـساب سـر انگـشتی معلوم می شود که این ترید حتی تنها با ۰,۱ لات چقدر سود می داده است . و اگـر بـر اسـاس روش کـی آس ویلیامز به تعداد تریدها اضافه می کردیم باز هم به سود حاصل از ترید فوق افزوده می شد .

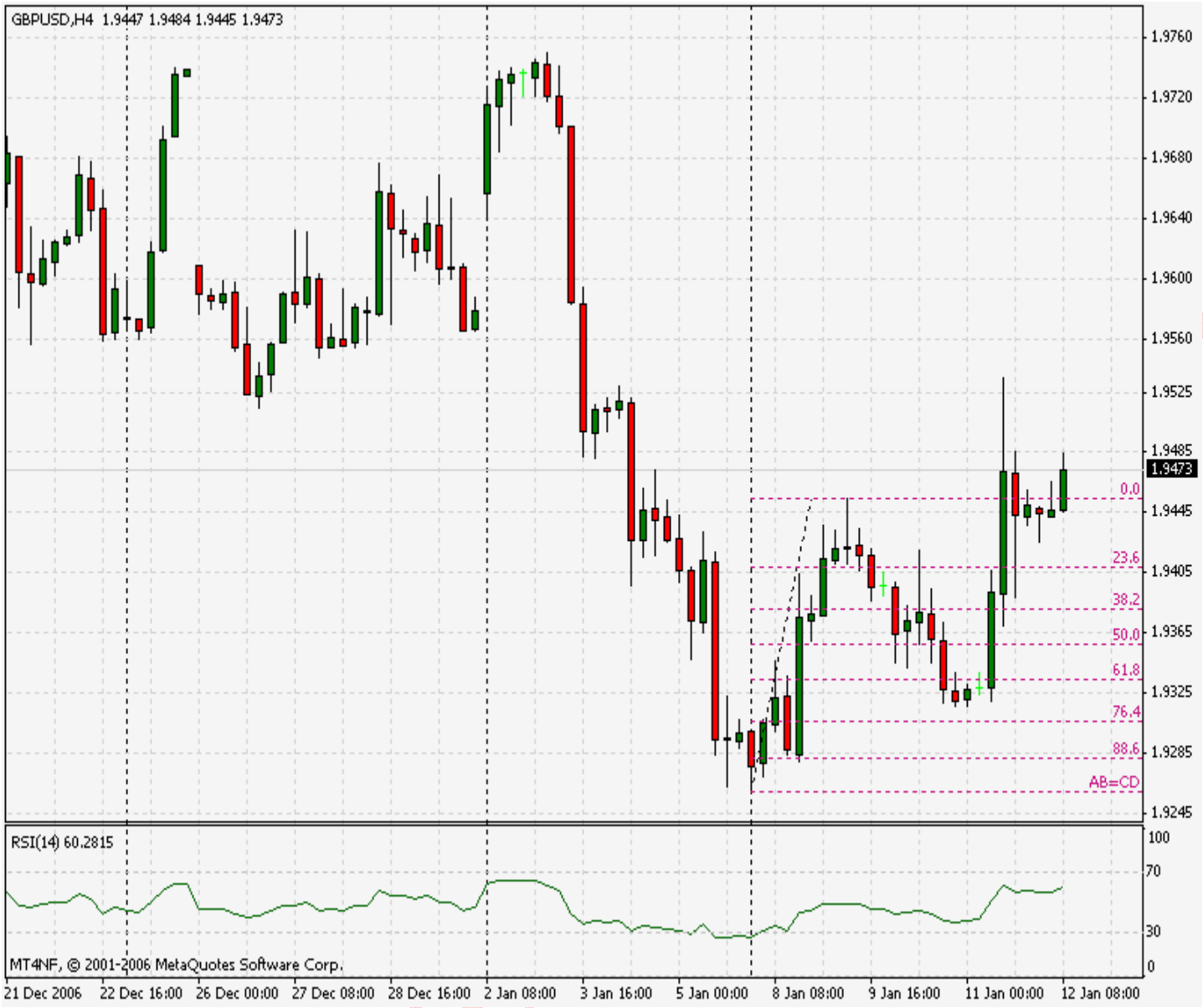


****


CHFSGD,H4 1.2665 1.2669 1.2653 1.2660
261.8
200.0
161.8
141.4
127.2
100.0
88.6
76.4
61.8
50.0
38.2
23.6
0.0
#1916846 buy
1
2
3
1.2970
1.2940
1.2910
1.2880
1.2855
1.2825
1.2795
1.2765
1.2735
1.2705
1.2675
1.2660
1.2645
1.2615
1.2585
RSI(14) 46.9829
100
70
30
0
MT4NF, © 2001-2006 MetaQuotes Software Corp.
1 Dec 2006
4 Dec 20:00
6 Dec 04:00
7 Dec 12:00
8 Dec 20:00
12 Dec 04:00
13 Dec 12:00
14 Dec 20:00
18 Dec 04:00
19 Dec 12:00
20 Dec 20:00
22 Dec 04:00

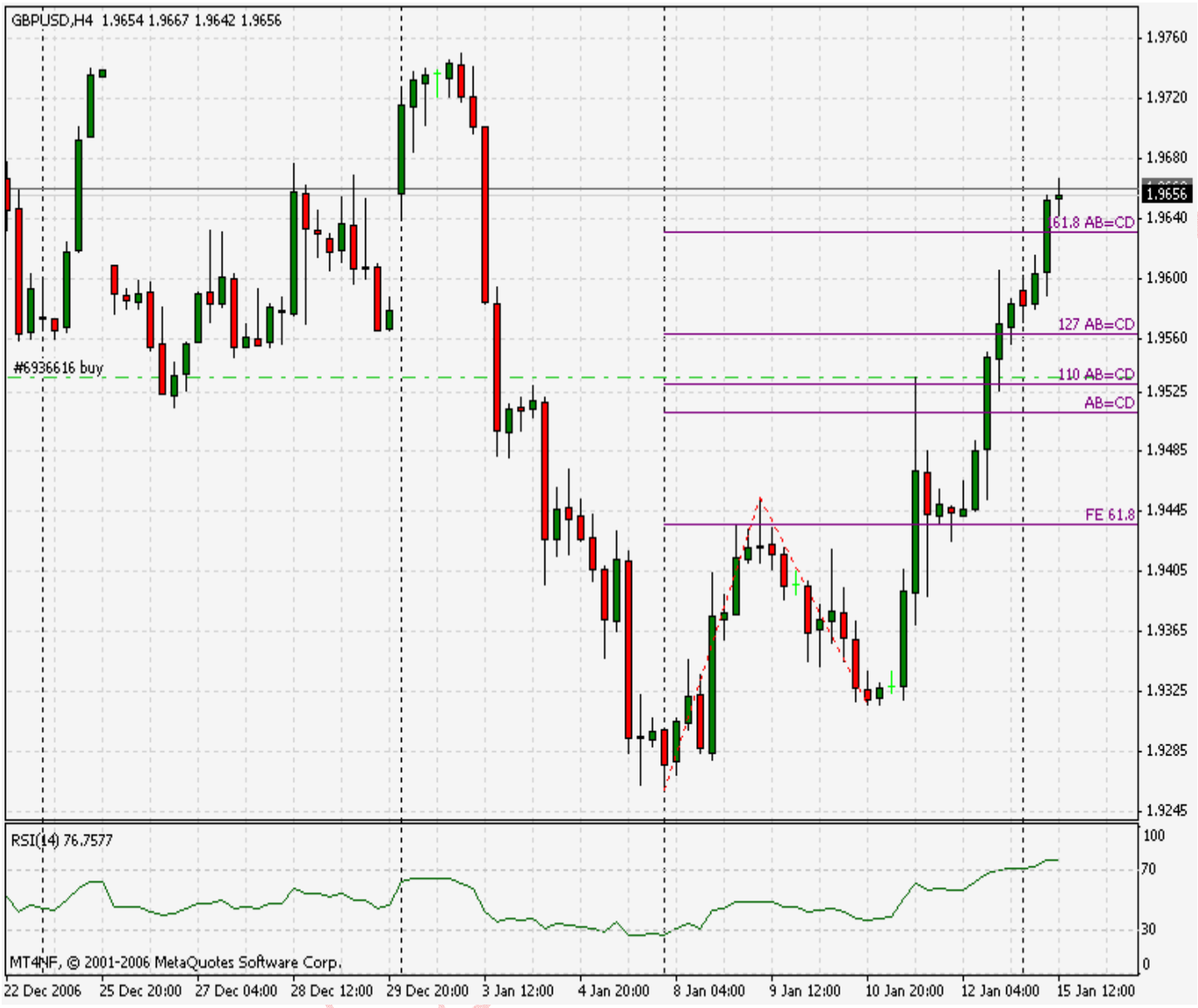
****

www.g


GBPUSD,H4 1.9447 1.9484 1.9445 1.9473
1.9760
1.9720
1.9680
1.9640
1.9600
1.9560
1.9525
1.9485
1.9473
1.9445
1.9405
1.9365
1.9325
1.9285
1.9245
0.0
23.6
38.2
50.0
61.8
76.4
88.6
AB=CD
RSI(14) 60.2815
100
70
30
0
MT4NF, © 2001-2006 MetaQuotes Software Corp.
21 Dec 2006
22 Dec 16:00
26 Dec 00:00
27 Dec 08:00
28 Dec 16:00
2 Jan 08:00
3 Jan 16:00
5 Jan 00:00
8 Jan 08:00
9 Jan 16:00
11 Jan 00:00
12 Jan 08:00

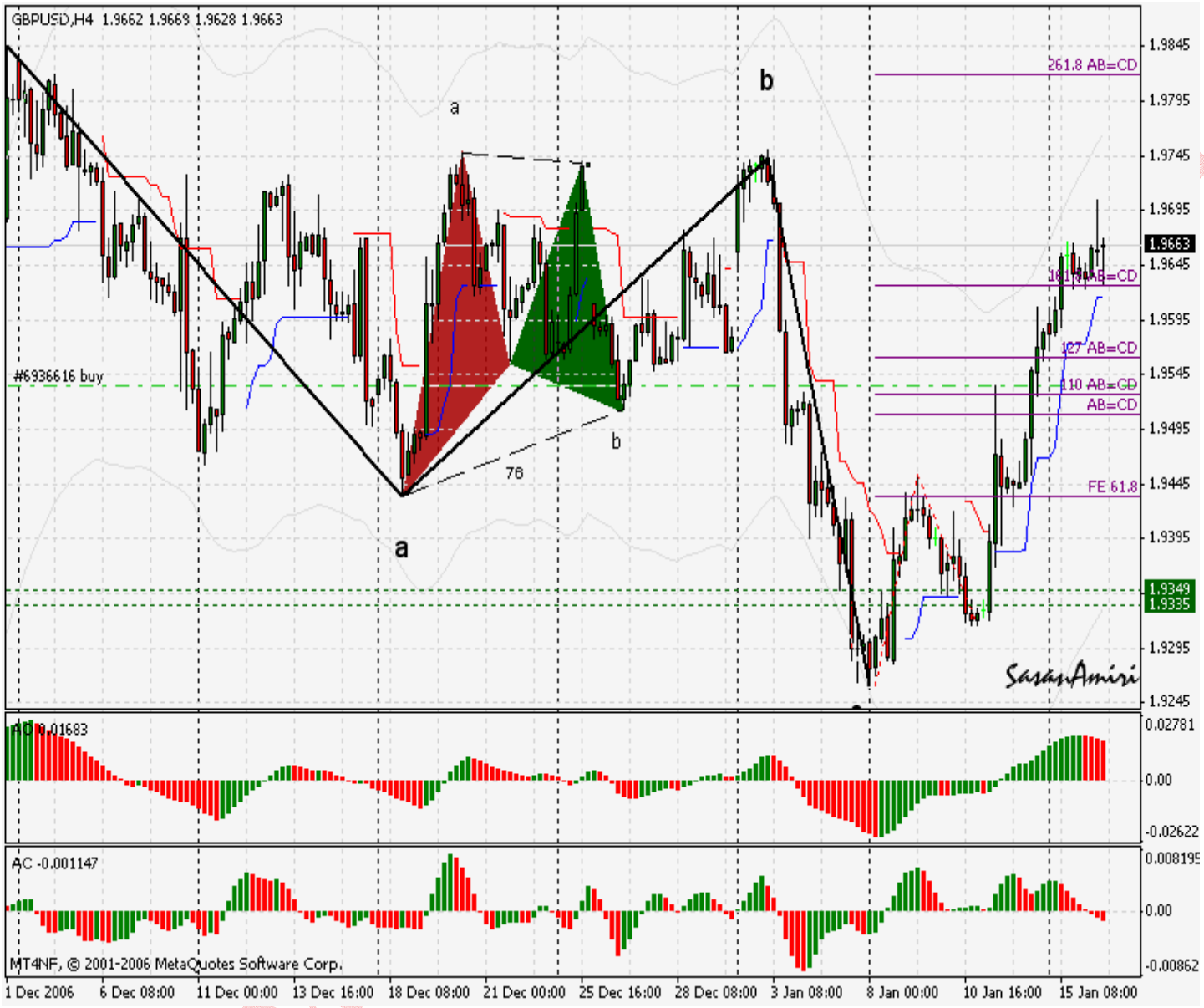
www.g

چارت آپ دیت شده مثال فوق

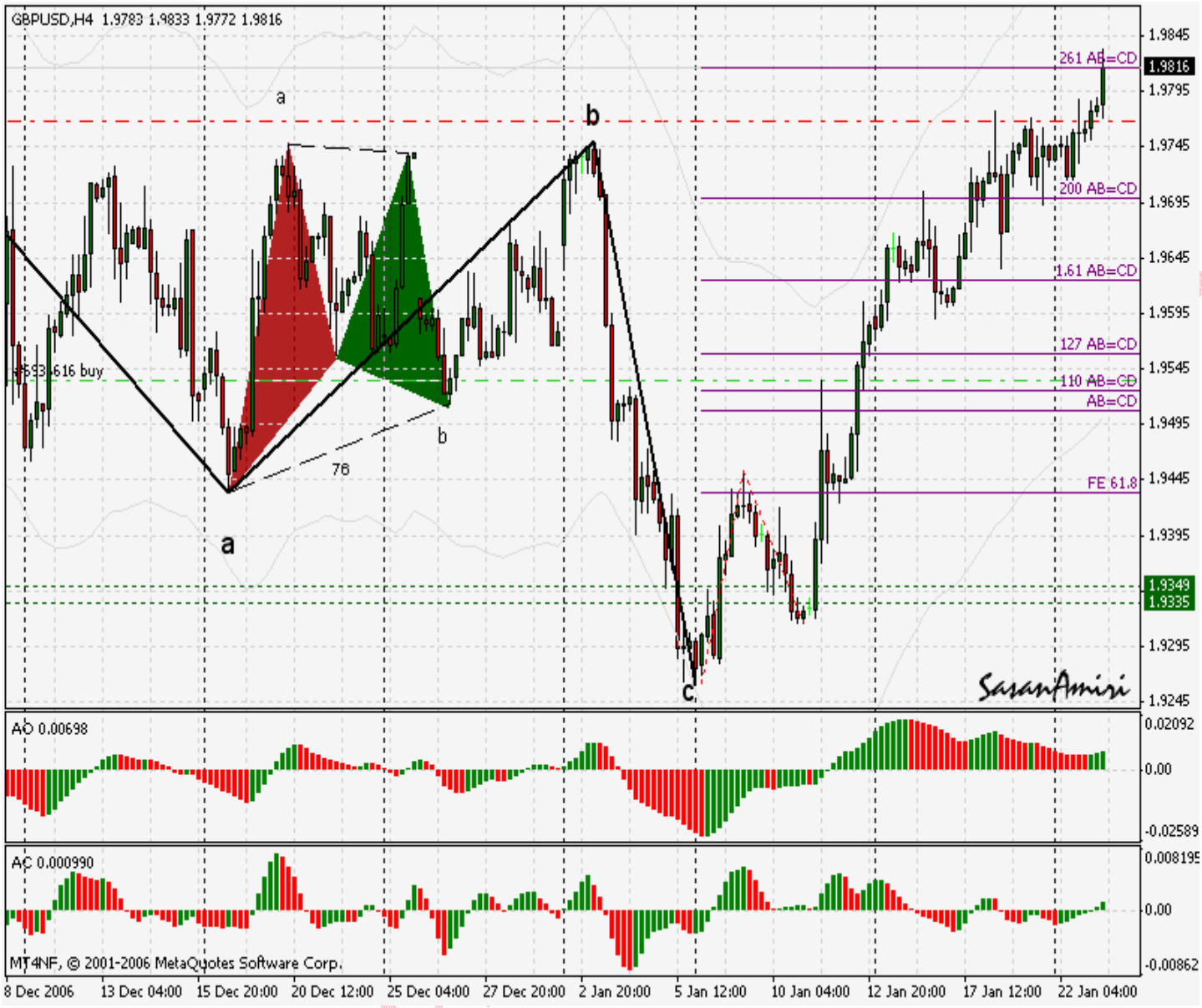


در مورد نسبت ۱۱۰ فیبوناچی که روی چارت ثبت شده لازم به توضیح است که این نسبت در اصل مربوط به روشی است که ویلیامز در ترید به روش الیوت از آن استفاده می کند و ربطی به روش ۳-۲-۱ ندارد. این عدد صرفاً به دلیل فراموشی روی چارت باقی مانده است .

آپدیت مجدد چارت پوند



با توجه به رسیدن به هدف نهایی ۲۶۱ ، حد ضرر را به زیر آخرین کندل منتقل می کنیم . البته اگر کسی هدفش ۲۶۱ فیبو بوده می توانسته در همان زمان از بازار با سود بیشتری خارج شود (چرا که احتمال زیادی هست که در ادامه روند نزولی شده و با رسیدن قیمت به حد ضرر با سود کمتری خارج شویم) اما با توجه به این که هنوز احتمال صعود مختصری وجود دارد از نظر تئوری می بایست حد ضرر را به یک پیپس پایین تر از آخرین کندل صعودی منتقل کرد و بعد در صورت تداوم کندل های صعودی کندل به کندل حد ضرر را به زیر هر کندل صعودی جدید منتقل کرد تا با لمس حد ضرر از بازار خارج شویم .

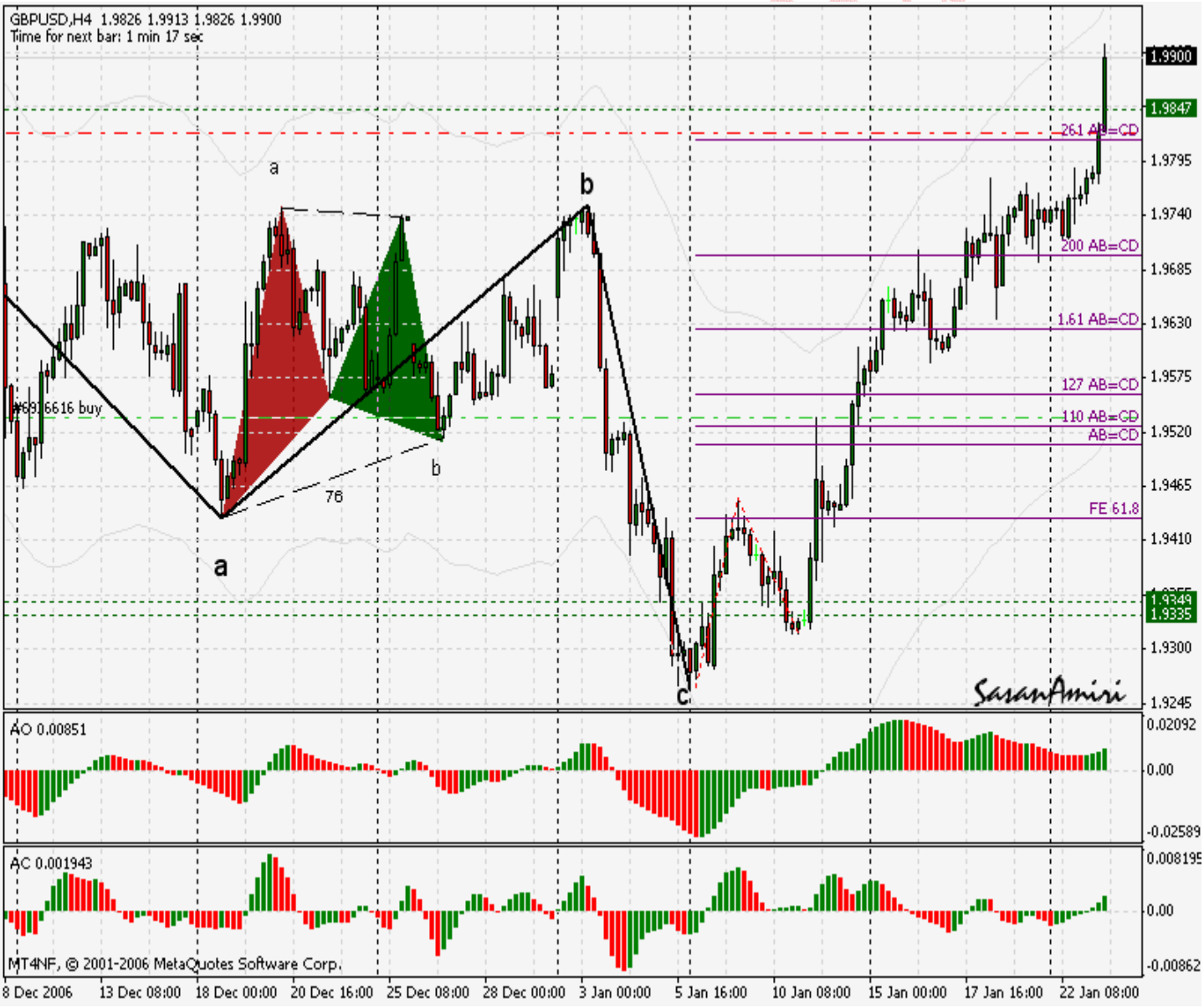


روش جا به جایی حد ضرر به یک پیپس پایین تر از آخرین کندل ایجاد شده را در چارت زیر که آپدیت شده چارت های قبلی است مشاهده می کنید . واقعاً با بررسی روش تریدرهای حرفه ای مفهوم ضرب المثل مو و پیچش مو برای ما آشکار می شود . می بینید که این ایده که وقتی به هدف یک موج رسیدیم پوزیشن را نبندیم ، بلکه حد ضرر آن را به انتهای آخرین کندل منتقل کنیم گاهی تا این حد می تواند سودآور باشد .

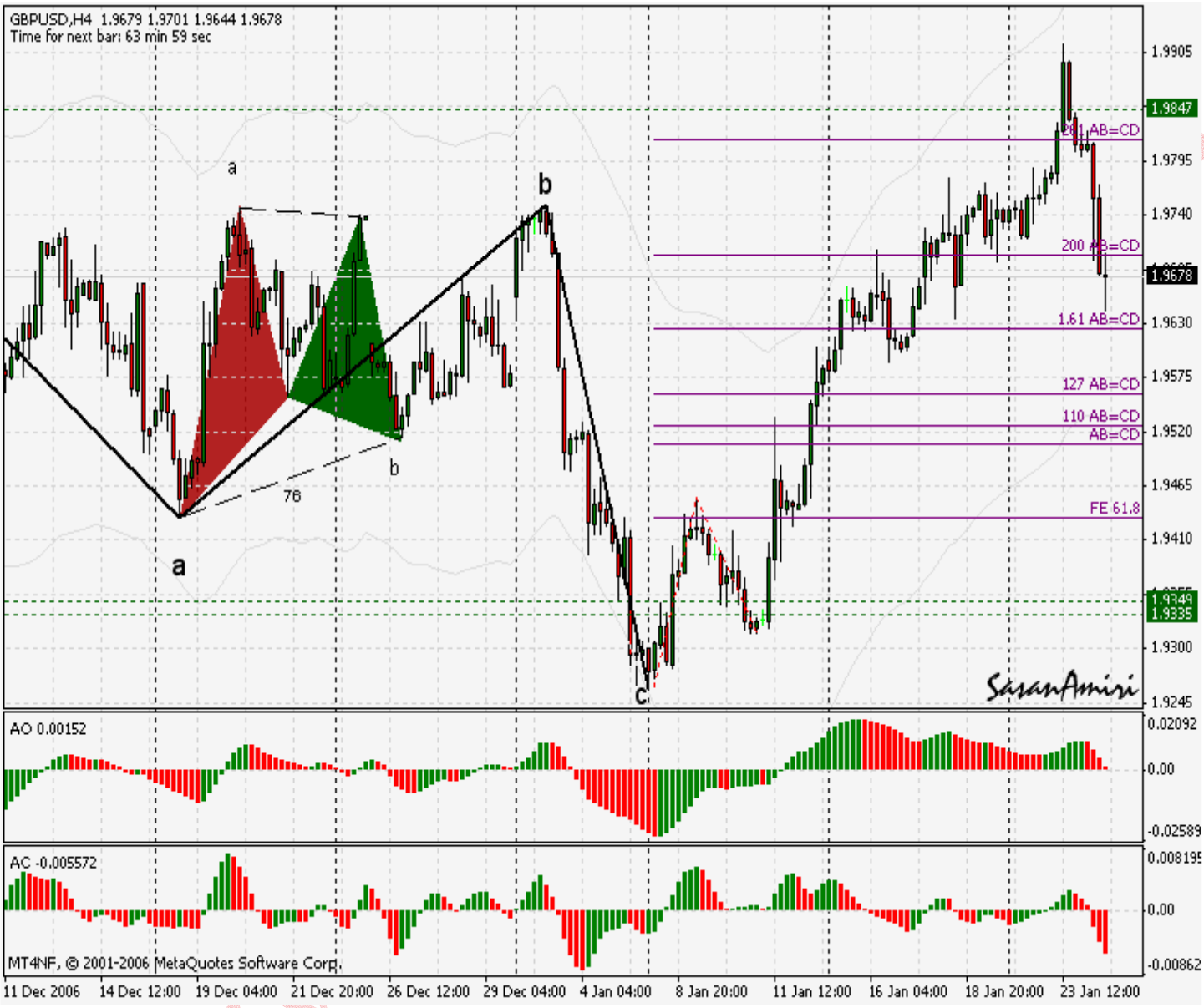
توجه داشته باشید که هدف از تمامی این چارت ها جنبه آموزشی آن است . پس می بایست دقیقاً ایده های تریدرهای بزرگ را پیروی و روی این روش ها تجربه کسب کنیم .

لازم است در مورد نبستن پوزیشن در چنین مواقعی توضیحی داده شود و آن این که ویلیامز معتقد است زمانی که روند جدیدی شروع می شود از انتهای موج ۳ می بایست ۳ پوزیشن باز کنیم فرضا سه تا ۰,۱ (میزان حجم

معامله مورد بحث فعلی نیست) و معتقد است که زمانی که به هدف تئوریک رسیدیم تنها حق داریم دو پوزیشن از سه پوزیشن را ببندیم و می بایست پوزیشن آخر را باز نگه داریم . فقط باید حد ضرر را به نقطه ورود بیاوریم . ویلیامز علت این کار را چنین بیان می کند که در موج ۳ ، در بسیاری از مواقع به خاطر روند قدرتمندی که شکل می گیرد انتهای موج ۳ می تواند بیش از برآوردها حرکت داشته باشد و به این شکل می توانیم یک پوزیشن را بدون این که ریسک ضرر داشته باشیم ، باز نگه داریم و از آن برای گرفتن سود بیشتر بر روی این نوع حرکات بازار (با جابه جایی نزدیک حد ضرر به نسبت روند) استفاده کنیم . البته به این نکته هم توجه داشته باشید که همه روزه ما شاهد چنین روندهای قدرتمندی نیستیم ولی زمانی که به تکنیک های معرفی شده این اساتید تکنیکال عمل می کنیم و در مورد آنها تجربه کسب می کنیم طبیعی است که گاهی هم بتوانیم از مزایای تجربه این افراد متخصص استفاده خوبی برده و سود بیشتری کسب کنیم .



سرانجام در نرخ ۱,۹۸۳۲ از بازار خارج شدیم . اینک باید در جستجوی انتهای موج ۴ باشیم تا مجدداً وارد بازار شویم...

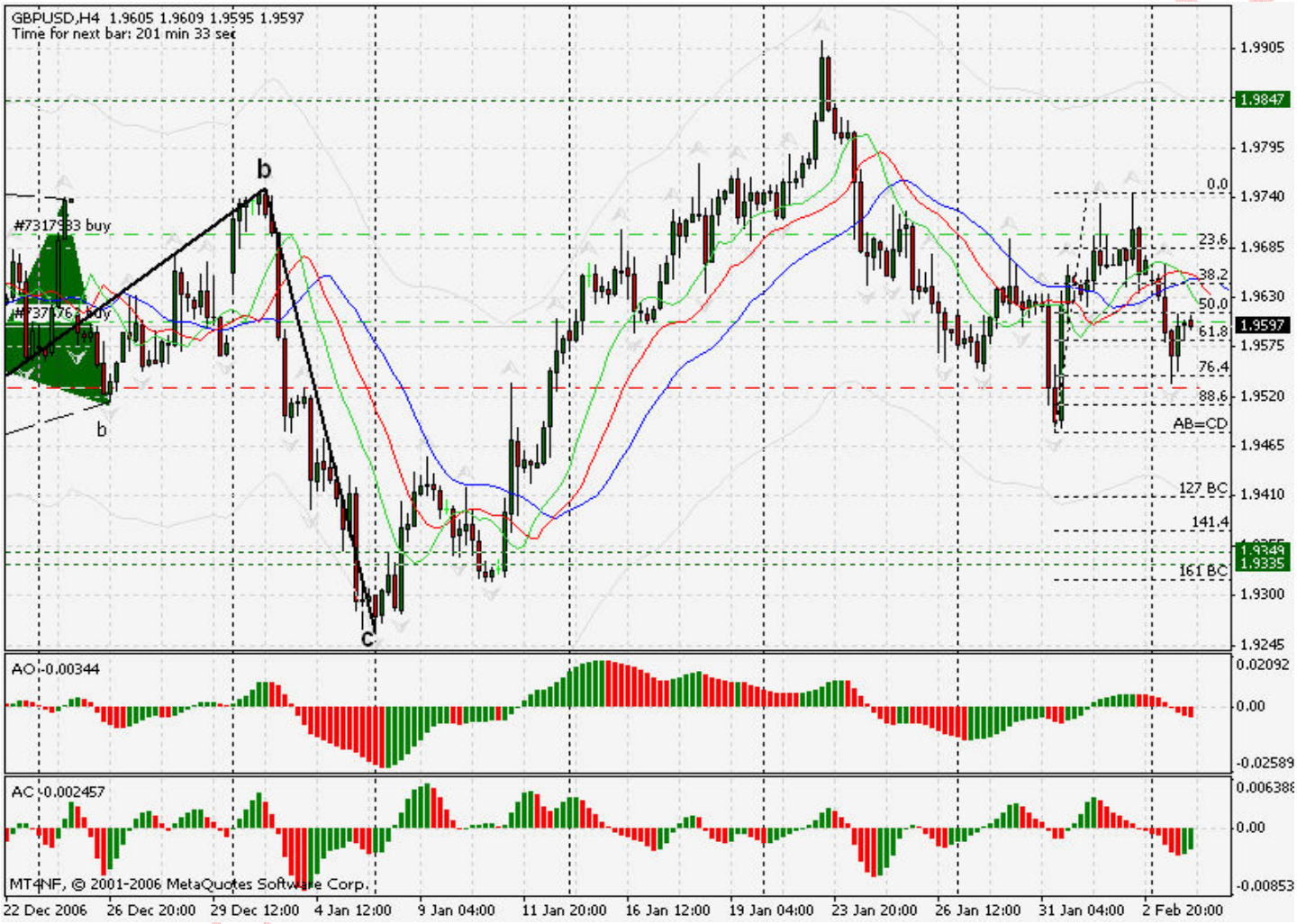


****

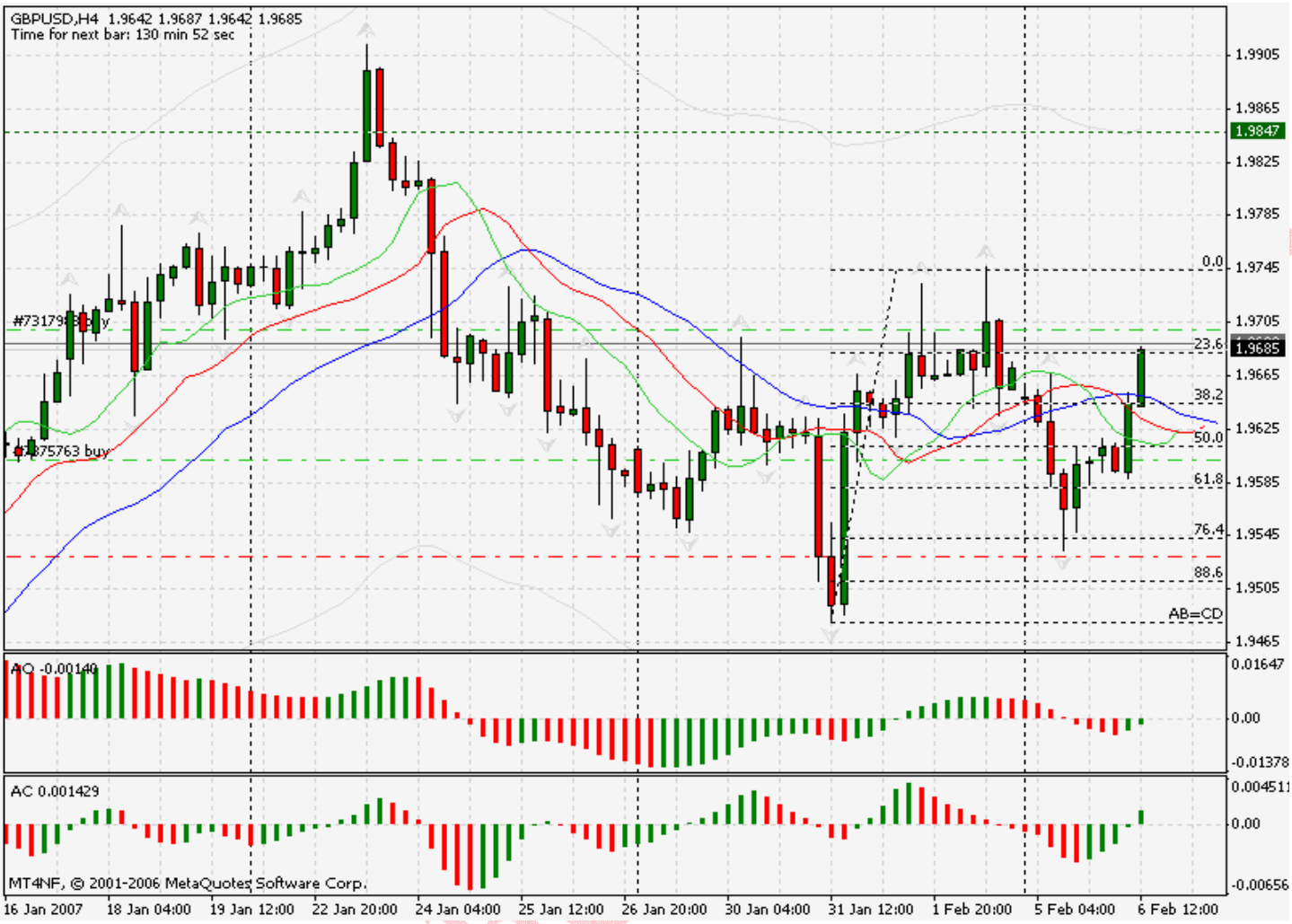
در این چارت بر اساس روش ۳-۲-۱ فرصت تریدی بر روی پوند پیش آمده .

دقت داشته باشید که چند نوع حد ضرر برای این وضعیت محتمل است و حد ضرر تعیین شده بنده تنها حالت ممکن نیست (در واقع ، این کم ریسک ترین حالت است) . اما اگر سرمایه شما و یا قواعد مدیریت سرمایه تان اجازه می دهد ، می توانید حد ضرر بزرگتری را در نظر بگیرید (برای مثال انتهای نقطه ۱ در شروع پترن ۳-۲-۱) .

وضعیت چارت زیر اگر بر اساس الیوت بررسی شود ، ممکن است که هنوز در موج C قرار داشته باشیم و این موج چون می تواند بیشتر نزول کند ، ممکن است حتی از نقطه ۱ هم پایین تر برود . با فرض نقطه ۱ معادل A و نقطه ۲ معادل B . اما با این حال به جهت این که پترن ۳-۲-۱ شکل گرفته ، می توان با لات کم وارد پوزیشن شد و در صورتی که ترند شکل گرفت به مرور به حجم لات اضافه کرد . در صورتی هم که این حرکت نزولی هنوز در ادامه C باشه به هیچ وجه نباید حد ضرر را تغییر داد و می بایست از بازار خارج شد .



چارت آپ دیت شده مثال بالا :

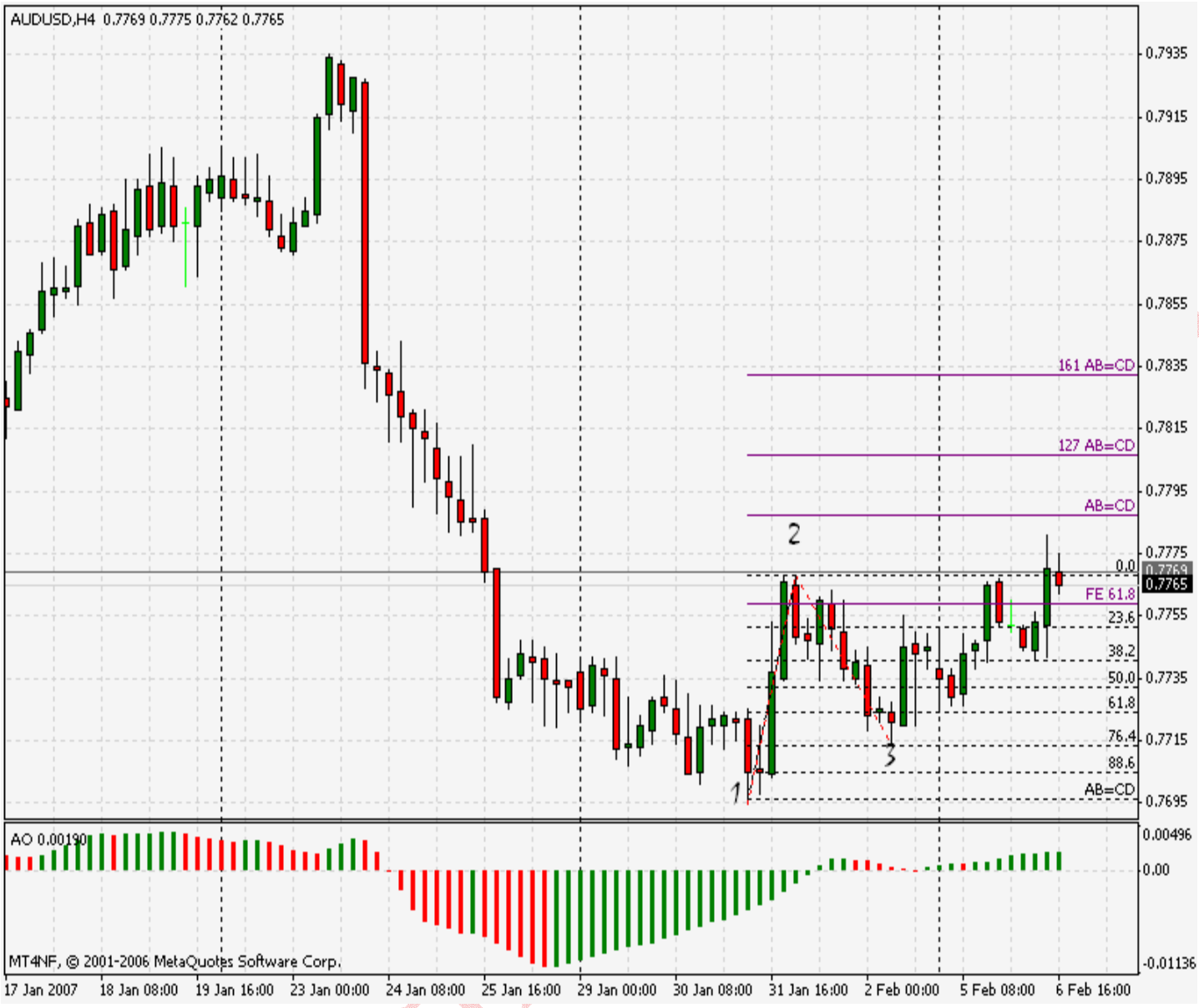


این پوزیشن نهایتاً با سود کمی بسته شد (روند برگشت و به تارگت نرسید و با ابزار مدیریت پوزشن با سود کم از بازار خارج شدیم) .

****

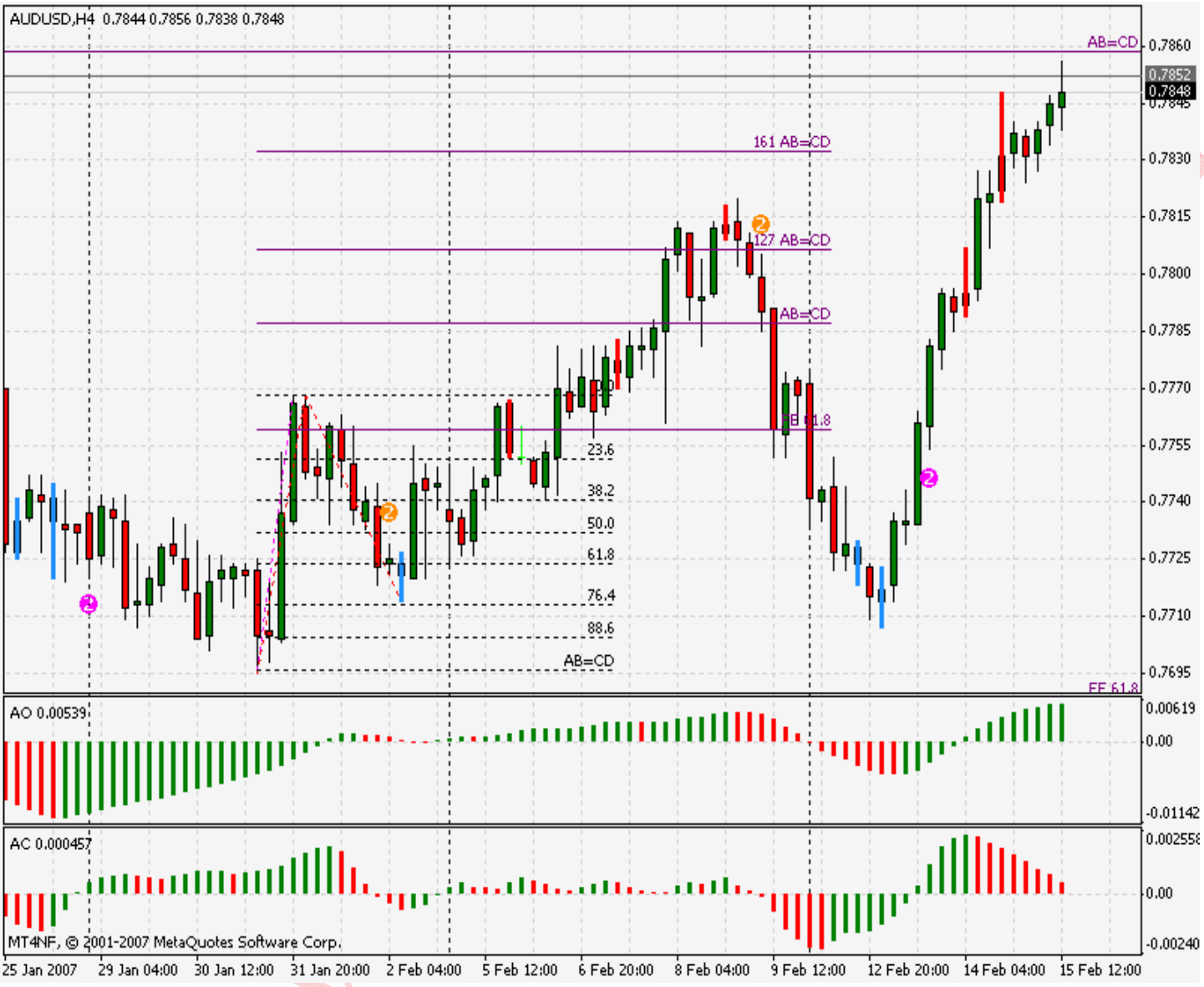
نمونه دیگری از پتانسیل موجود بر اساس روش ۳-۲-۱

دقت داشته باشید که از جنبه الیوت وضعیت ، در موج ۴ هستیم و در نتیجه می توانیم انتظار یک کارکشن ABC را داشته باشیم . با توجه به ریتریس تا ناحیه ۷۶ ، می توان هدف را ۱۲۷ فیبوناچی در نظر گرفت (در واقع کمی از شروع حرکت از دست رفته است اما هنوز تا ۱۲۷ فیبوناچی هم ۴۰ پیپس در پیش است) . این حرکت می تواند تا ۱۶۱ فیبو هم ادامه داشته باشد ، اما بیش از آن با توجه به این که در موج ۴ هستیم توصیه نمی شود .



این پوزیشن در نهایت به نسبت ۱۲۷ فیبوناچی که تارگت ما بود رسید . ریتریس بر روی نسبت ۷۶ فیبوناچی بود و با تریگری دقیق (باز هم شاهد قدرت تریگر دانای اول در این موارد هستیم) و در نسبت ۱۲۷ فیبو با سودی مناسب می توانستیم از بازار خارج شویم . دقت کنید که در طی مسیر صعودی دلار استرالیا دو بار شاهد سیگنال تریگر دانای اول برای Sell بوده ایم . همیشه به خاطر داشته باشید که ابتدا می بایست جهت ترند اصلی را تشخیص داد و سپس تنها تریگرهایی را مورد استفاده قرار داد که همسو با جهت ترند اصلی باشند (به همین خاطر است که برای ترید صرفاً از تریگر استفاده نمی کنیم بلکه ابتدا جهت ترند را با سایر ابزارها تشخیص می دهیم و سپس تنها جهت ورود به بازار از تریگر استفاده می کنیم) . نکته جالب و از جهتی مهم این که مجدداً می بینیم بعد از این که به نسبت ۱۲۷ رسیدیم ، مجدداً دلار استرالیا روی نسبت ۷۶ ریتریس

داشته و مجدداً تریگر دوست داشتنی دانای اول بر روی آن شکل گرفته که به ما فرصتی دوباره برای ورود به بازار و ترید موفق دیگری را داده است .

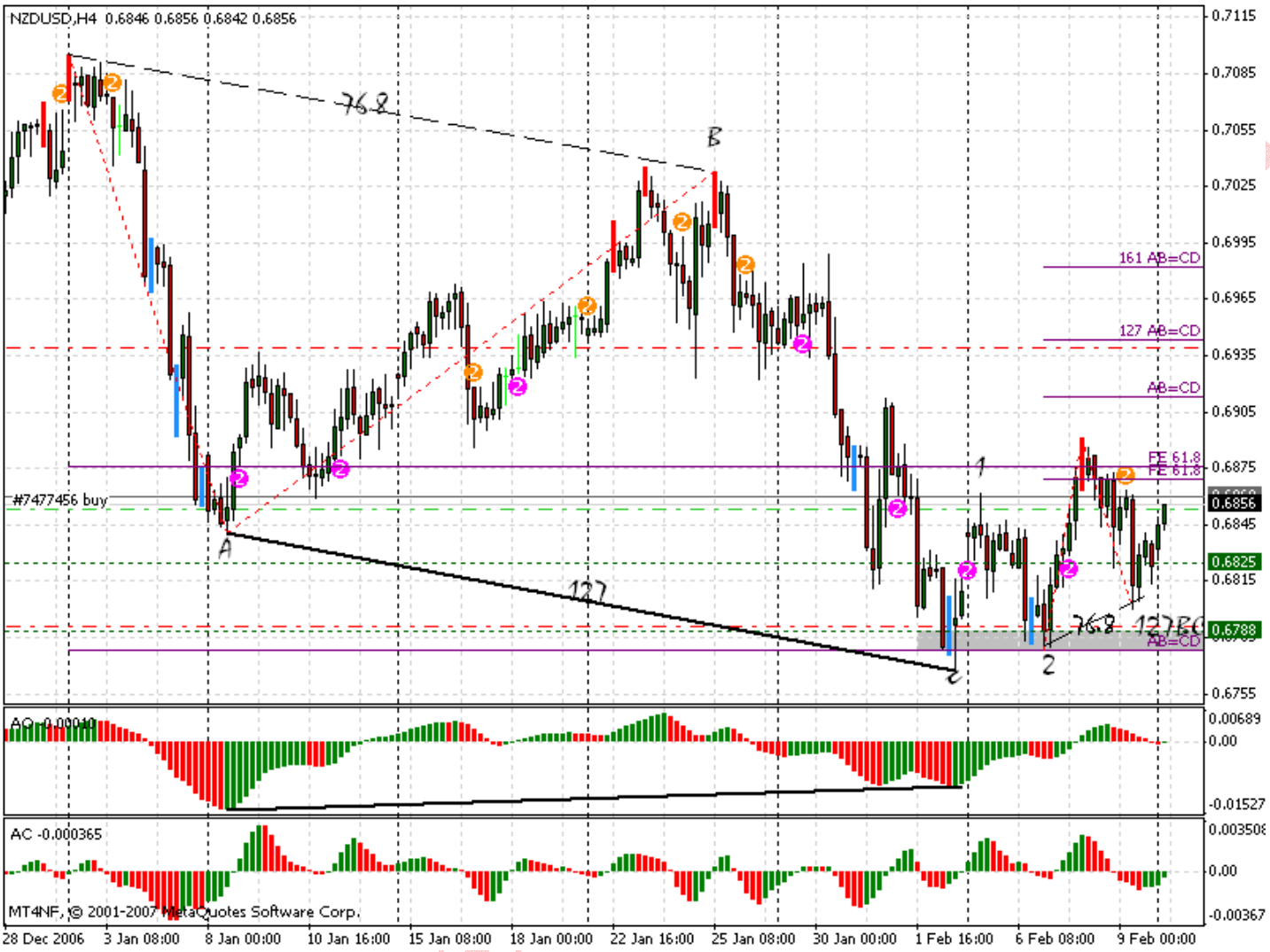


****

این چارت هم موقعیت مناسب دیگری برای ترید بر اساس روش مورد بحث را نشان می دهد .

متأسفانه فرصت خالی کردن چارت از تحلیل های گذشته را نداشتم به طوری که چارت تنها بر اساس روش ۳-۲-۱ باشد . امیدوارم وضعیت واضح باشد .

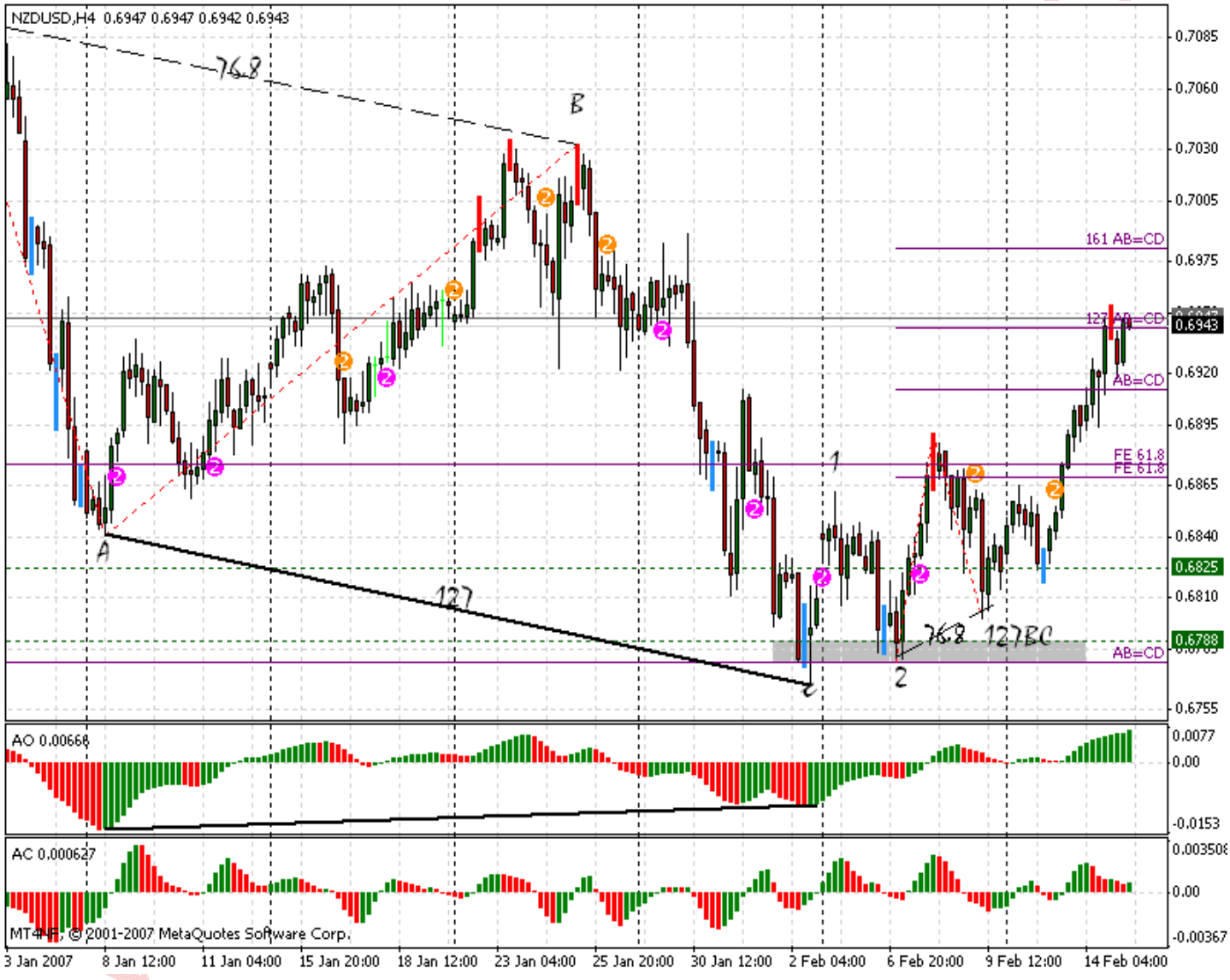
دقت کنید که نقطه دقیق ورود در این پوزیشن نرخ ۰,۶۸۲۵ بوده است که متأسفانه زمان ورود مناسب را از دست داده ایم و با تأخیر وارد بازار شده ایم .



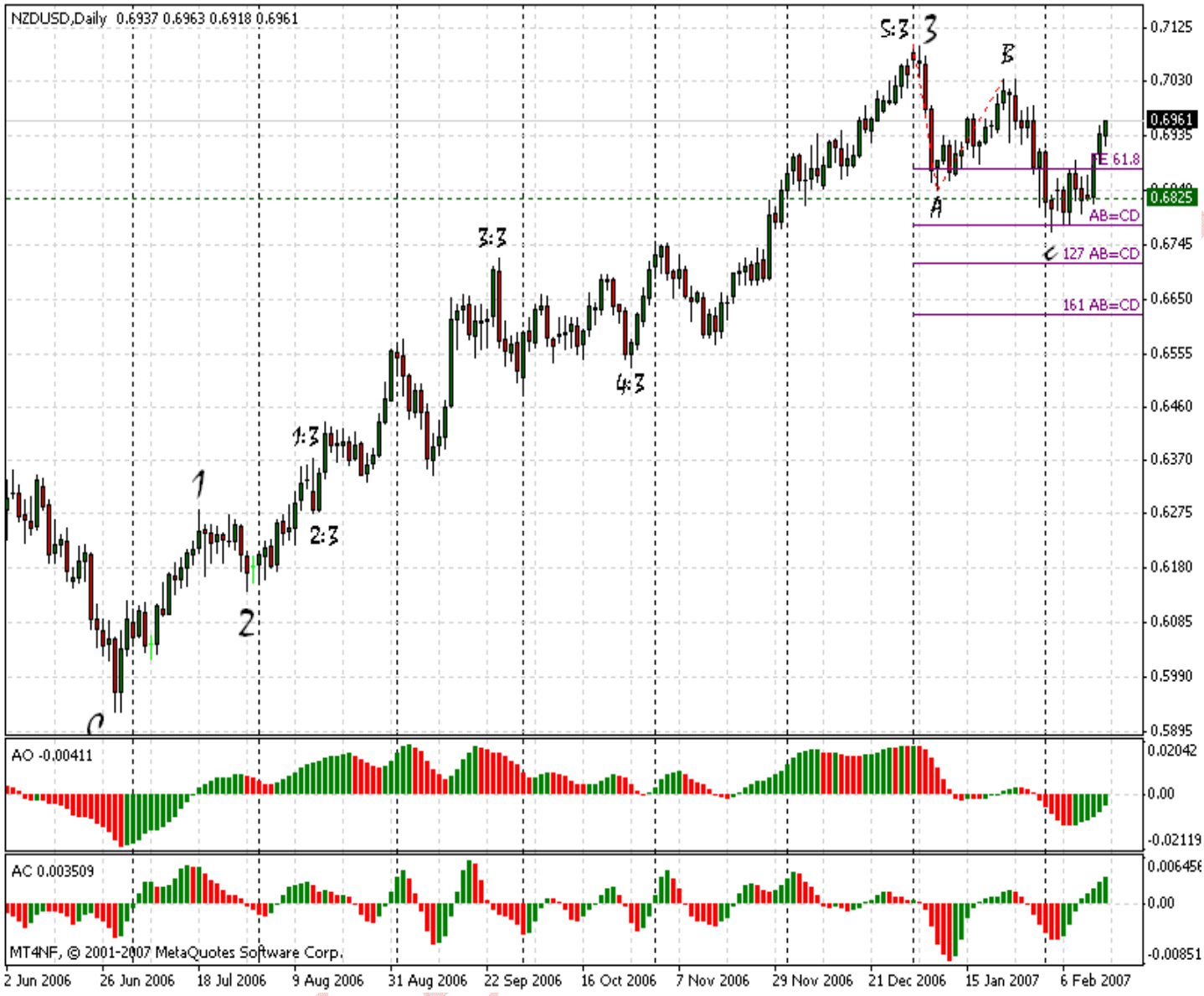
پوزیشن فوق در نهایت به تارگت رسید . چون ریتریس بروی نسبت ۷۶ رخ داده بود در نتیجه تارگت ما نسبت ۱۲۷ بود . همان طور که گفته شد ، نرخ ۰,۶۸۲۵ لحظه دقیق ورود به بازار بود . روند صعودی شد و به تارگت ما که ۰,۶۹۴۰ بود رسید . نکته جالب این وضعیت در این بود که روند ، نزول موقتی داشت و مجدداً در ناحیه نرخ ۰,۶۸۲۵ تریگری دقیق داد که برای افرادی که تریگر اول را از دست داده بودند می توانست نقطه ورود مناسبی باشد . تصویر زیر نمای نهایی این ترید را نشان می دهد .

دوستان عزیز توجه داشته باشند که در روندها (چه صعودی و چه نزولی) بار ها و بارها شاهد این ریتریس ها هستیم و در نتیجه اگر با روش ۳-۲-۱ به خوبی آشنا باشیم می توانیم بر روی هر ریتریسی که شرایط مناسب را

داشت (نسبت ۶۱ یا ۷۶ و تریگر مناسب برای ورود) مجدداً وارد بازار شویم . در واقع زمانی که بتوانیم ترندی را از ابتدای آن به دقت تشخیص بدهیم (برای مثال به کمک روش های مبتنی بر الیوت) ، بعد از آن کار برای ما ساده می شود و می توانیم بارها بر اساس ریتریس هایی که در روند شکل می گیرد مجدداً وارد بازار شویم و یا به حجم لاتی که در ابتدای ترند وارد بازار نموده ایم بیافزاییم . توجه داشته باشید که در این مثال ، در ادامه روند صعودی ، تریگر دانای دوم هم صادر شده بود که می شد بر اساس آن هم به حجم لات درگیر در پوزیشن اولیه افزود و در پایان با سود بیشتری از بازار خارج شد .



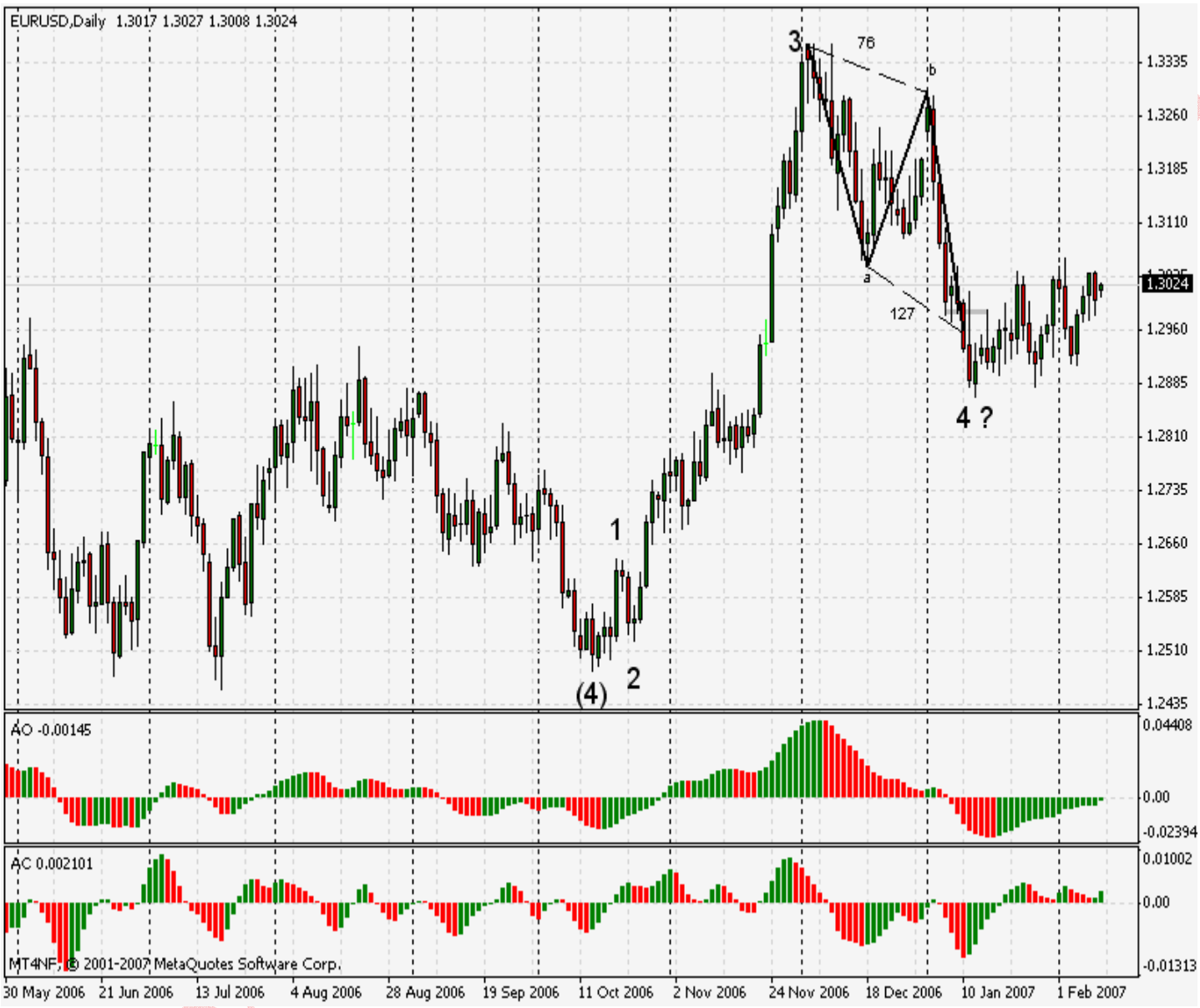
با توجه به بحثی که در مورد کاربرد الیوت برای یافتن ترند از ابتدای آن شد برای دوستانی که مایل هستند از وضعیت الیوت روزانه این جفت ارز مطلع باشند ، چارت روزانه این ارز همراه تحلیل الیوت آن ارائه می شود .

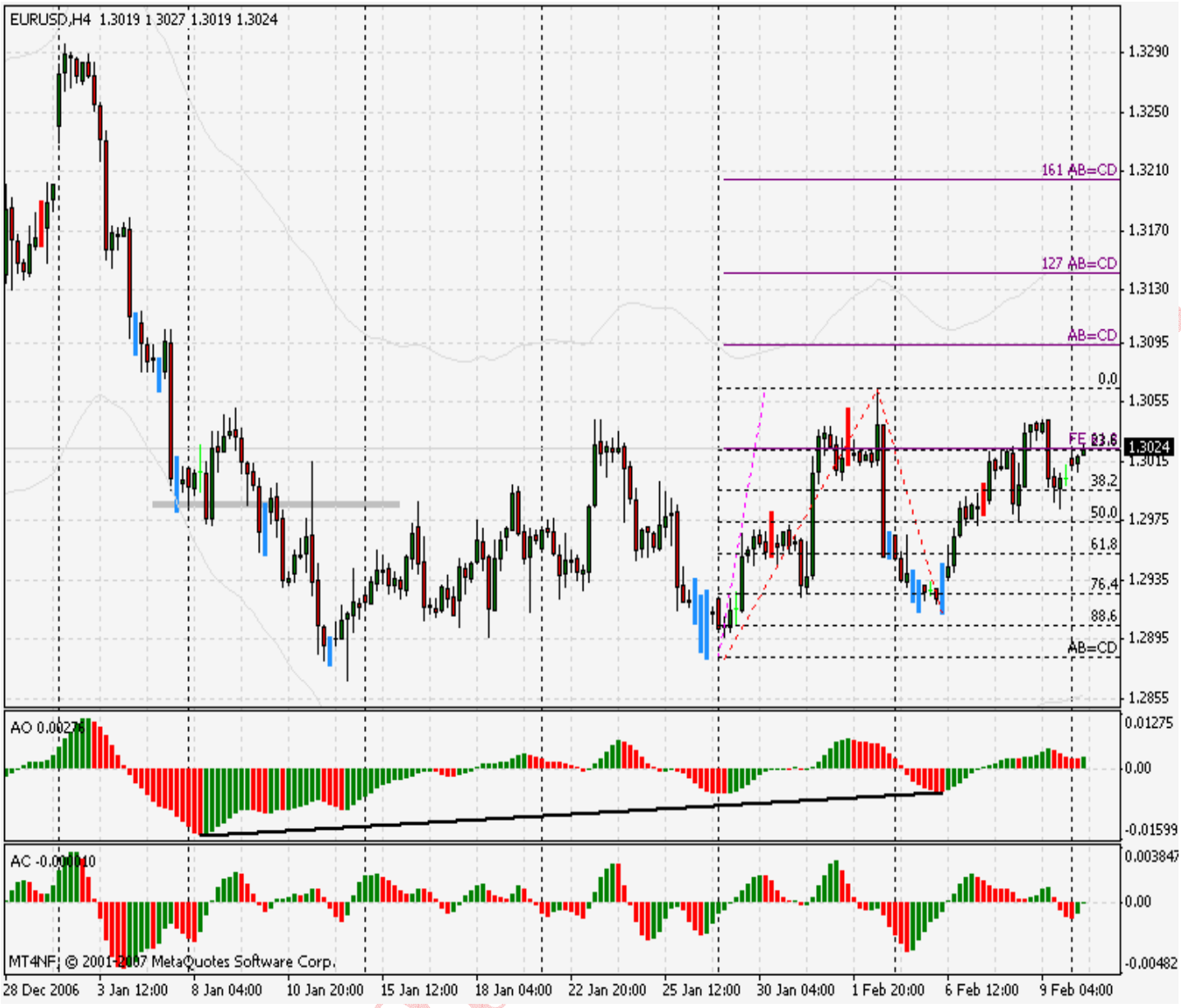


****

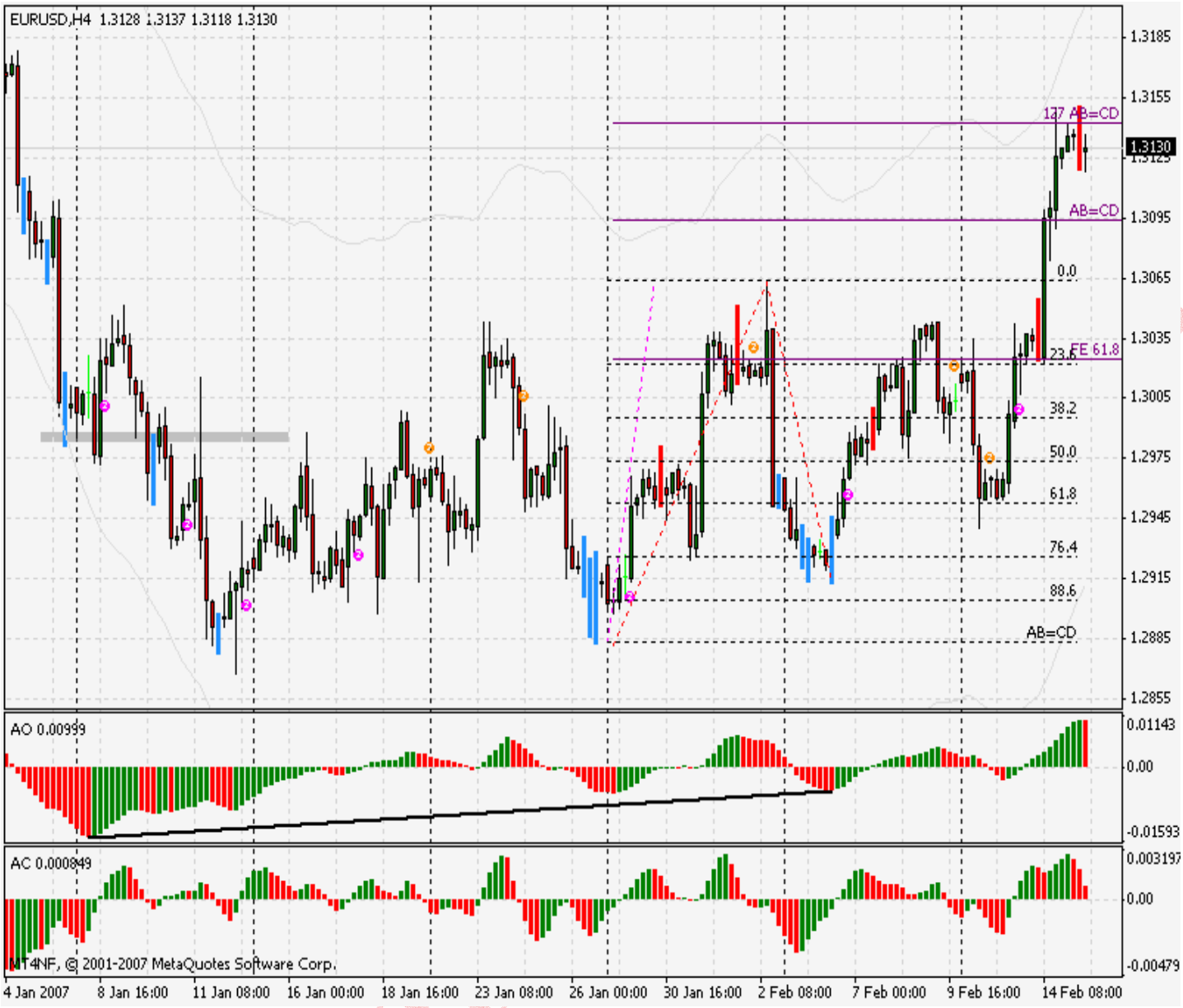
همان گونه که در چارت زیر دیده می شود ، در یورو هم پتانسیل ترید خوبی بر اساس روش ۳-۲-۱ شکل گرفته است که می شد به این روش تریدی انجام داد منتهی چون در روزهای نگارش این مطالب یورو رفتار عجیب و تا حد زیادی غیر تکنیکال از خود نشان داده ترجیح داده شد که روی این ارز وارد ترید نشویم و تنها وضعیت موجود را تحلیل کنیم .

در چارت ۴ ساعته یورو پترن واضح ۳-۲-۱ را شاهد هستیم که از جنبه آموزشی می تواند قابل بررسی باشـد .
و چه تریگر به موقعی هم داشته .





در تصویر زیر نتیجه پایانی چارت ۴ ساعته یورو را مشاهده می کنیم که به هدف ما که ۱۲۷ فیبو بود رسیده است (ریتریس در ۷۶ فیبو بود) . عزیزان دقت کنید که چطور یورو در روند صعودی مجدداً بر روی نسبت مهم دیگری از فیبوناچی و این بار بر روی نسبت ۶۱ ریتریس کرده و مجدداً فرصت ترید ایده آلی را برای کسانی که تریگر اولیه را برای ورود به بازار از دست داده بودند فراهم کرده است (و یا برای افزایش حجم سرمایه بر روی ترید قبلی) . به دقت چارت را بررسی کنید و می بینید که در طی روند صعودی یورو دو بار سیگنال های دانای دوم صادر شده است که هر دو می توانستند به موفقیت هر چه بیشتر و سود آوری هر چه افزون تر این ترید اضافه کنند (دقت داشته باشید که دو بار هم سیگنال های دانای دوم در جهت مخالف ترند بوده است که می بایست آنها را در نظر نگرفت و تنها از سیگنال های موافق جهت ترند اصلی استفاده کرد) .



****

به چارت زیر که نشان دهنده وضعیت پوند است توجه بفرمایید .

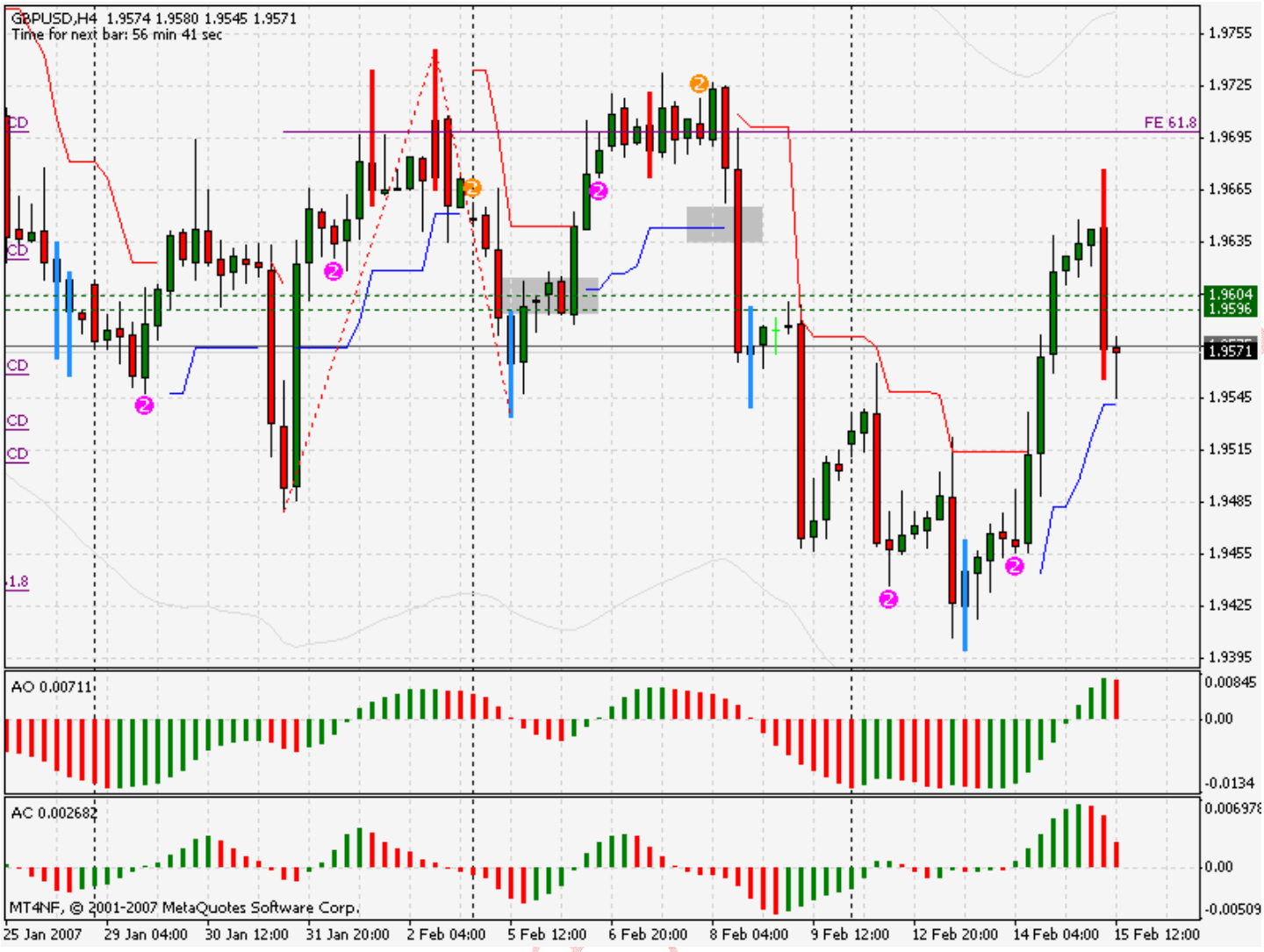
بعد از این که پترن ۳-۲-۱ روی چارت پوند به دلار شکل گرفت ، روند صعودیش آغاز شد اما به تارگت نرسید و روند نزولی شد و بعد از شکل گیری روند نزولی مجدداً روند صعوی شکل گرفت (در روز مورد بحث خبری برای تعیین نرخ بهره در انگلستان داشتیم که پیش بینی ها هم حاکی از عدم تغییر نرخ بود و نتیجه اعلام شده هم بدون تغییر بود اما پوند به شدت ضعیف شد که حتی برای دوستانی که بروی اخبار تخصص خوبی دارند هم این وضعیت عجیب بود . اما ببینیم این وضعیت از چه جهاتی قابل بحث بوده و حاوی چه نکات مفیدی است . ابتدا این که روش ۳-۲-۱ هم مانند هر روش تکنیکال دیگری گاهی نتیجه نمی دهد که طبیعی است . منتهی یک روش موفق روشی است که تعداد دفعات سودآوری اش بیش از زیان دهی آن باشد .

بنابراین می بایست برای این وضعیت هم آمادگی داشته باشیم . توصیه همیشگی بنده استفاده از ابزار مدیریت پوزیشن است که خود بحث مفصل و جداگانه ای را می طلبد . بر روی چارت اندیکاتور ATR STOPS را مشاهده می کنید . این اندیکاتور ، ابزار محبوب من برای ردیابی ترندهاست . زمانی که روند صعودی شد حد ضرر را به یک پیپس پایین تر از نوار آبی رنگ ATR STOPS منتقل می کنیم و سپس بر اساس میزان روند صعودی و تغییر و جابه جایی خط آبی رنگ (و یا قرمز رنگ در روندهای نزولی) حد ضرر مرتباً جا به جا می کنیم . این روش برای این است که اگر به هر دلیلی روند برگشت ، زیان نکنیم .

نقطه ورود دقیق این پوزیشن نقطه ۱,۹۵۹۵ بود (یک پیپس بالاتر از تریگر دانای اول) که البته بنده در نقطه ۱,۹۶۰۴ وارد بازار شده بودم . استفاده از ابزار ATR STOPS منجر به این شد که هنگام برگشت روند ، در نقطه ۱,۹۶۳۹ از بازار خارج شدم که منجر به سود کمی شد . اندیکاتور ATR باعث شد تا ما با اطمینان بتوانیم حد ضرر را به طور معقولی جابه جا کنیم و بدون این که از ترند فاصله خیلی زیاد یا خیلی کمی داشته باشیم آن را تعقیب کنیم . در برگشت روند ، استفاده از این اندیکاتور باعث شد تا بدون سود از بازار خارج نشویم . اما در استفاده از این اندیکاتور باید به یک نکته توجه داشته باشیم و آن این که استاپ های نشان داده شده توسط این اندیکاتور (با ترسیم خطوط آبی و قرمز) کاملاً قابل اعتماد است با یک استثنا و آن این که نباید از این خطوط در ابتدای پوزیشن گیری استفاده کرد . در واقع تنها زمانی که ترند شکل گرفت (حالا هر چقدر هم که ترند ضعیف باشد) از آنجا به بعد می توانیم از خطوط ATR برای جابه جایی حد ضرر استفاده کنیم اما حد ضرر اولیه را می بایست بر اساس روش ترید خود تعیین کنیم و از خطوط ATR در ابتدای پوزیشن گیری استفاده نکنیم . برای مثال در روش ۳-۲-۱ حد ضرر اولیه می تواند یک پیپس پایین تر از نقطه شماره ۱ ترند و یا اگر می خواهیم ریسک کمتری کنیم ، ۱۰ پیپس پایین تر از نسبت قبلی فیبوناچی به نقطه ورود ما به بازار باشد . نکته دیگر این که در این پوزیشن سیگنال دانای دوم هم صادر شده بود که در صورتی که پوزیشن دومی بر این اساس باز کرده بودیم این پوزیشن با ضرر بسته می شد که با توجه به میزان ضرر پوزیشن دوم و سود پوزیشن اول بازهم در مجموع این دو ترید با ضرر کمی به اتمام می رسید .

روش ۳-۲-۱ روش بسیار قدرتمندی است . در صورتی که این روش با یک تحلیل ساده الیوت همراه شود ، می تواند به عنوان یک سیستم تریدینگ بسیار قدرتمند مورد توجه قرار بگیرد . مثال هایی که تا کنون بررسی شده می تواند به خوبی نشانگر ارزش این سیستم تریدینگ ساده اما کارا باشد .

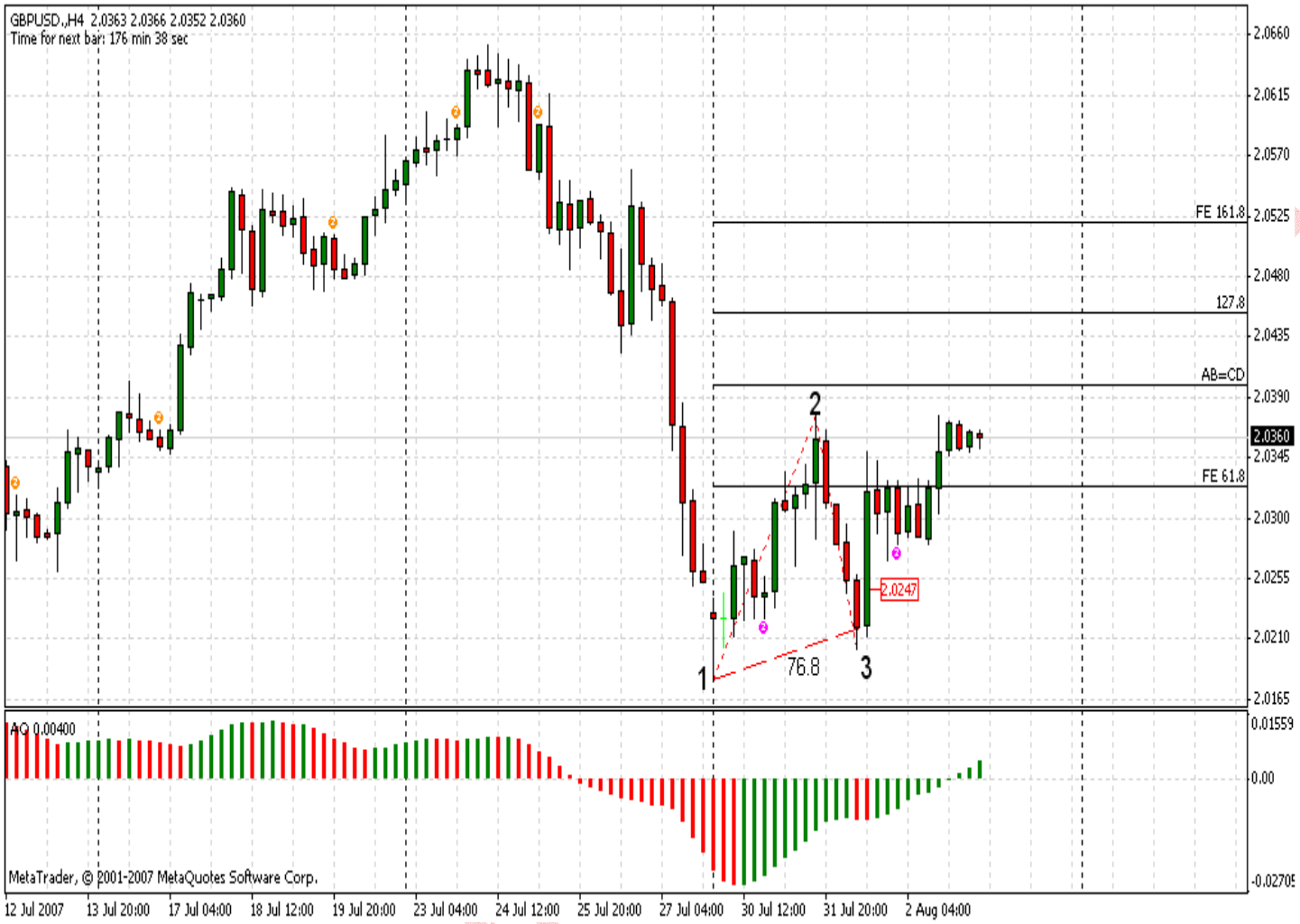
www.gheymatha.com



****

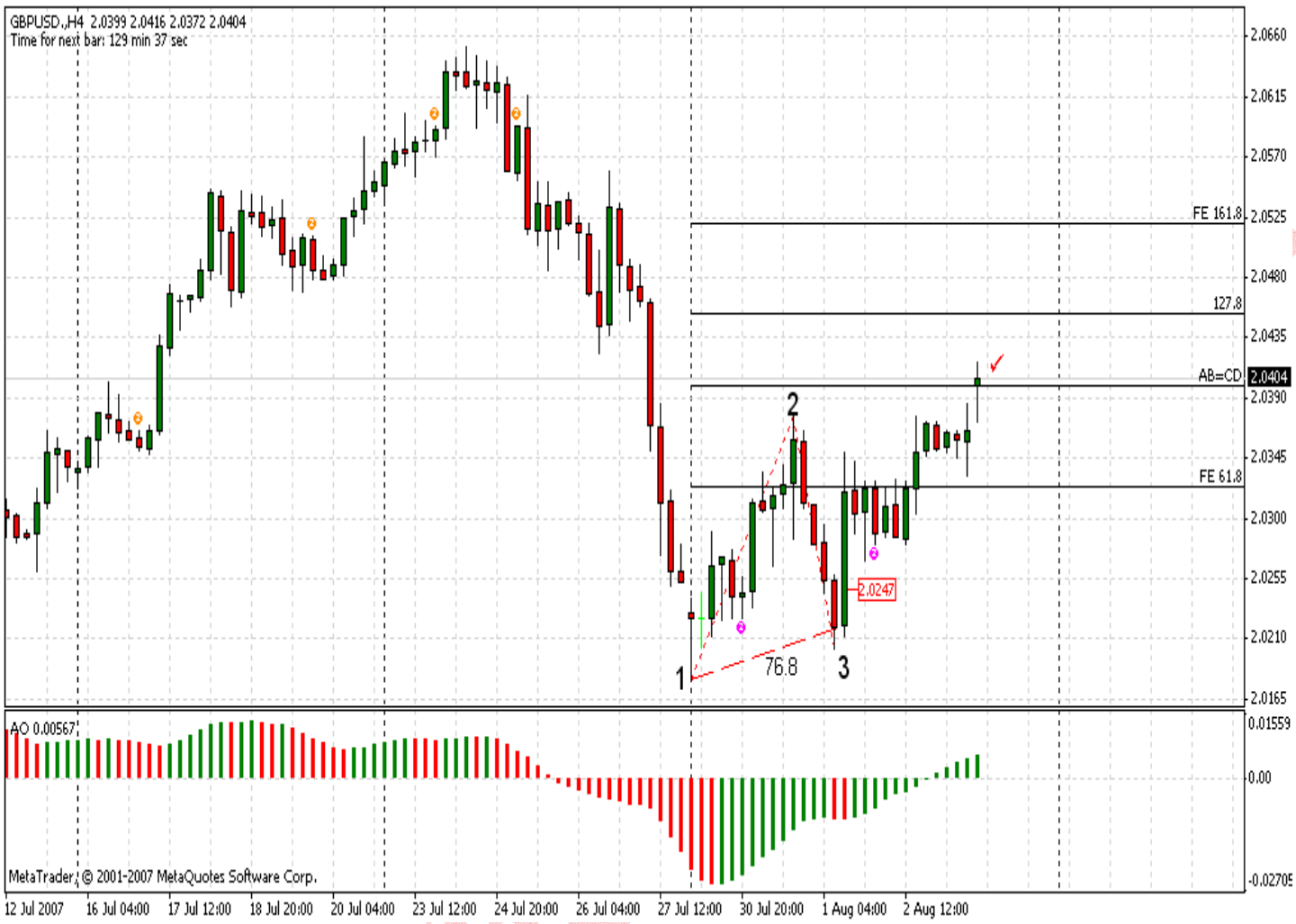
نمونه دیگری از ترید بر اساس روش ۳-۲-۱ . ریتریس ۷۶ و تارگت ۱۲۷ فیبوناچی .

در این گونه مواقع که تریگر واضحی برای ورود نداریم می توانیم حداکثر تا دو تایم فریم پایین تر برویم و در صورت مشاهده تریگر مناسب وارد پوزیشن شویم (عدد ۲,۰۲۴۷ نقطه ورود بر اساس تریگر شکل گرفته در تایم فریم نیم ساعته است) . این روش باعث می شود تا انتظار جهت شکل گیری تریگر در تایم فریم اصلی منجر به از بین رفتن مقدار زیادی از سود نشود . هر چند بهترین تریگر برای هر روشی تریگر در همان تایم فریمی است که بر رویش تحلیل داشته ایم . در ضمن توجه داشته باشید که تحلیل وضعیت الیوت پوند در تایم فریم بالاتر (روزانه) تایید قوی برای ورود به بازار و خرید بوده است .


GBPUSD.,H4 2.0363 2.0366 2.0352 2.0360
Time for next bar: 176 min 38 sec
FE 161.8
127.8
AB=CD
FE 61.8
2.0247
76.8
1
2
3
AO 0.00400
MetaTrader, © 2001-2007 MetaQuotes Software Corp.
12 Jul 2007
13 Jul 20:00
17 Jul 04:00
18 Jul 12:00
19 Jul 20:00
23 Jul 04:00
24 Jul 12:00
25 Jul 20:00
27 Jul 04:00
30 Jul 12:00
31 Jul 20:00
2 Aug 04:00

www.gl

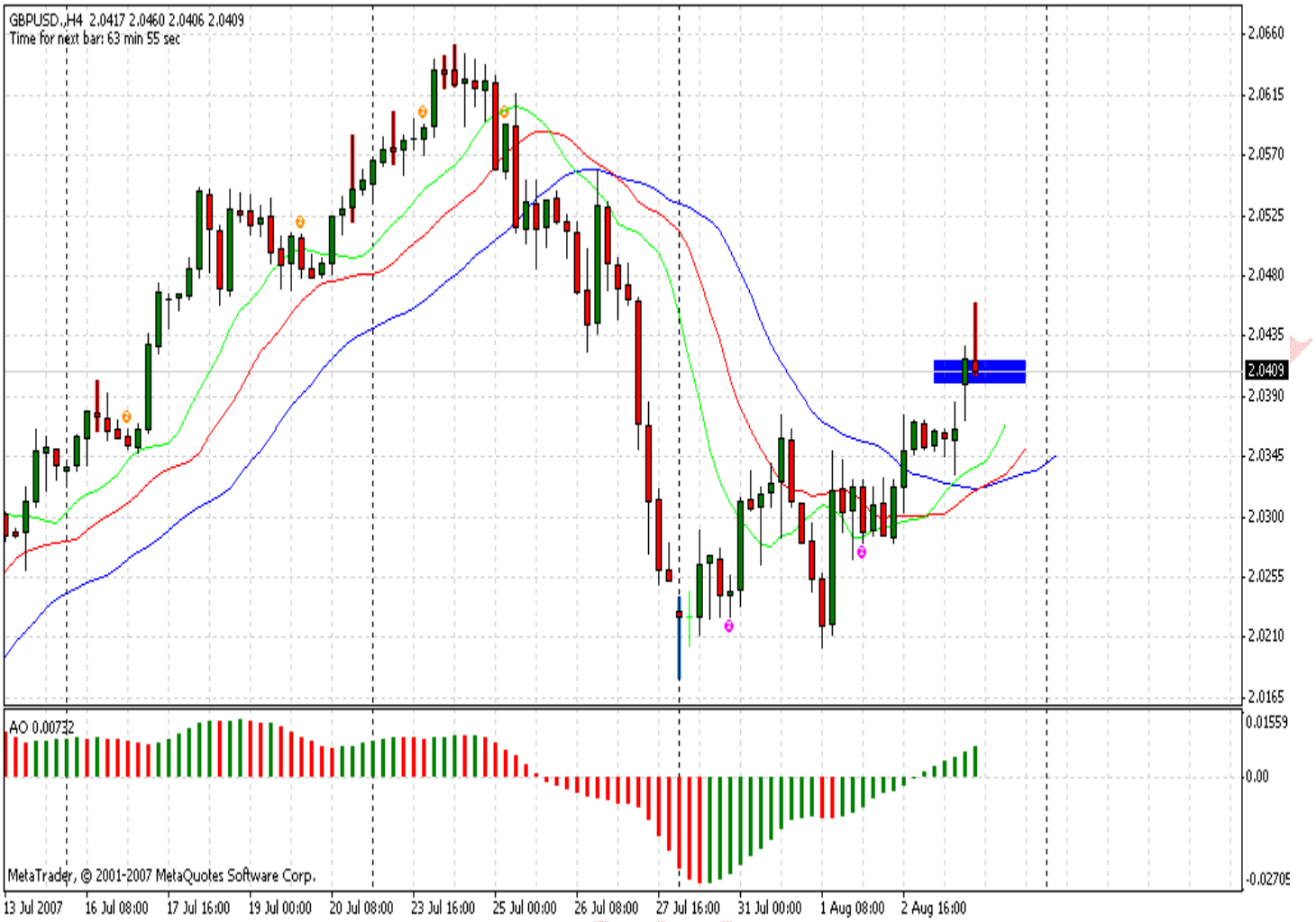
نتیجه چارت فوق :



ادامه بررسی چارت بالا :

تشکیل دانای اول نزولی در ناحیه PRZ می تواند نشانه خوبی برای شروع روند نزولی باشد . مشروط به این که زمانی که کندل جدید تشکیل شد همچنان کندل قبلی دانای اول باقی مانده باشد .

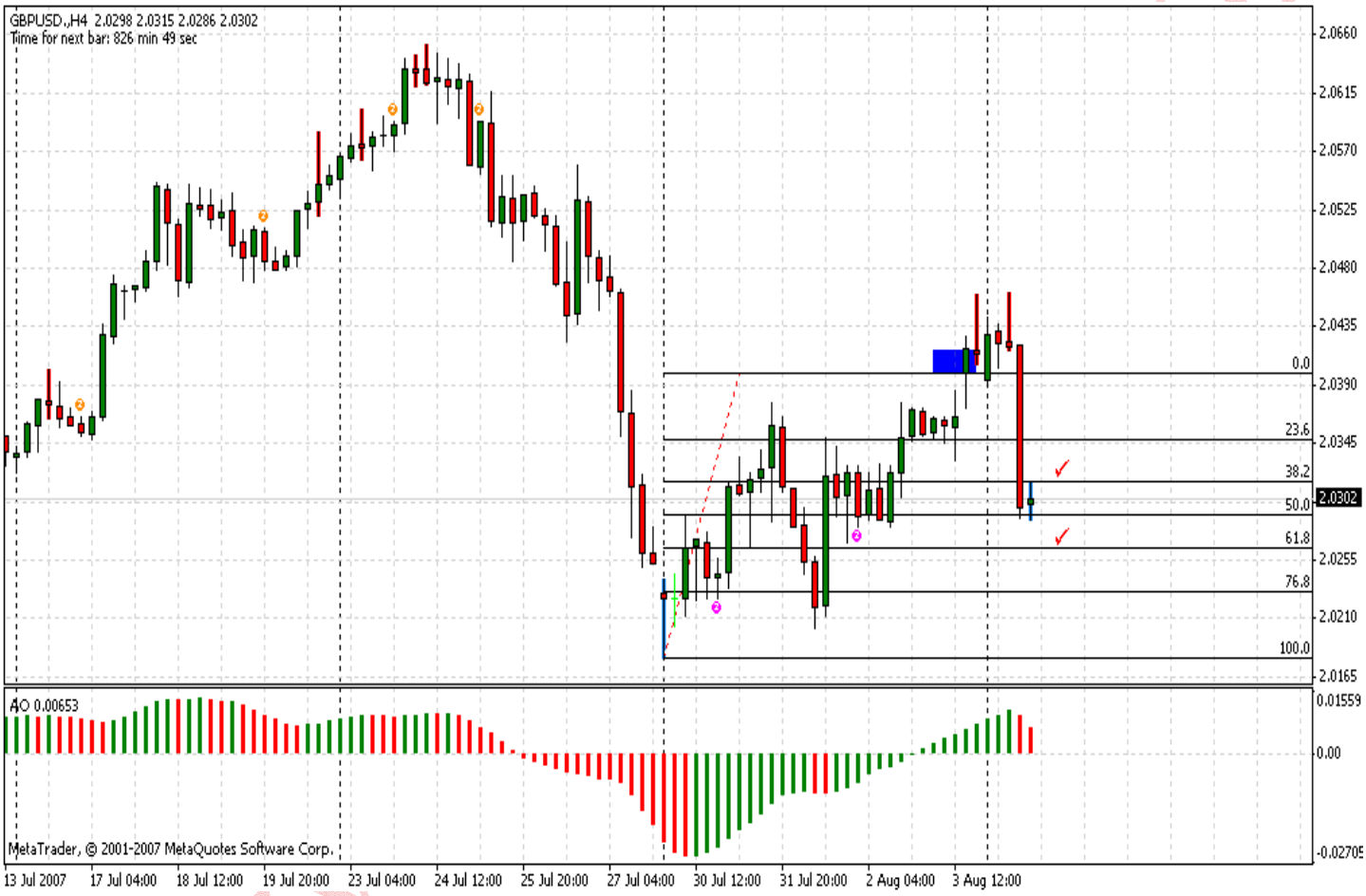
www.gh



****

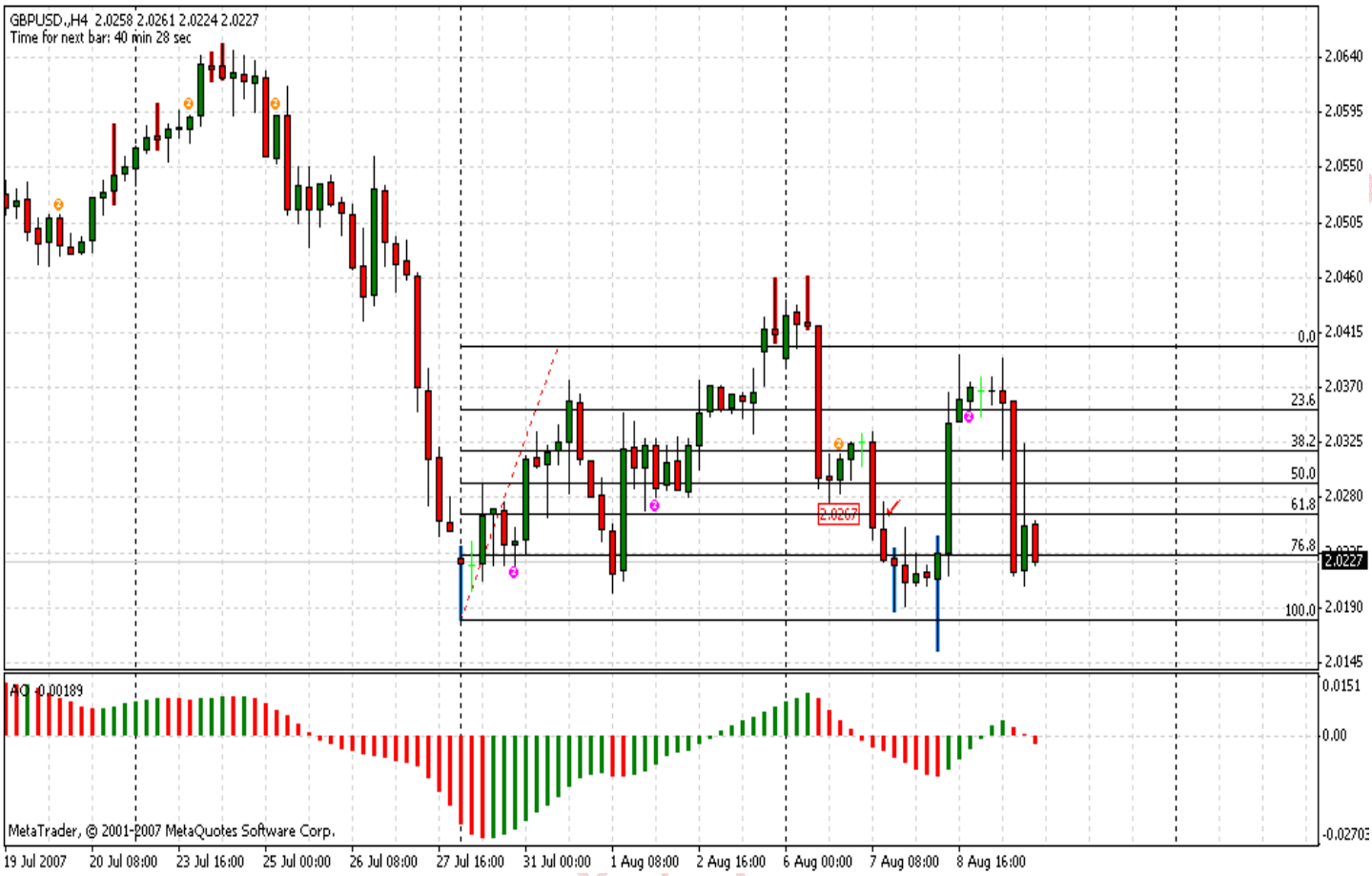
ترید موفق دیگری بر اساس پترن AB=CD . زمانی که این پترن بر روی نسبت های ایده آل خود شکل بگیرد و همینطور از نظر الیوت در تایم فریم بالاتر هم با روند کلی هم جهت باشد ، شانس موفقیتش بسیار بالا می رود . بر اساس کتاب کارنی (جلد اول از دوره دو جلدی) هدف را می توان نسبت ۳۸ و یا ۶۱ فیبوناچی در نظر گرفت . به شخصه همیشه نسبت ۶۱ را در نظر می گیرم . هر دو نسبت روی چارت با تیک مشخص شده اند که قیمت به هدف اول رسیده و در نزدیکی هدف دوم قرار دارد . اگر به چارت دقت کنید می بینید که از ابتدای شکل گیری پترن AB=CD که انتهای روند نزولی قبلی بوده است ، سیگنال برگشت روند و حرکت صعودی را دانای اول به خوبی تشخیص داده است . یعنی بر اساس دانای اول به خوبی می شد انتهای روند نزولی را تشخیص داد . در حال حاضر هم انتهای روند صعودی (انتهای پترن AB=CD) توسط دانای اول نشان داده شده است . چه سیگنال ورودی معتبرتر از این که بتواند هر تغییر روندی را به این دقت به ما

نشان دهد ؟ تریگر دانای اول بارها به من دقت و سرعش در تشخیص تغییر روندها را نشان داده است . در این چارت هم می بینید که هم تغییر روند به سمت بالا و هم به سمت پایین را به خوبی نشان داده است . برای یادآوری عرض کنم که در روش ۳-۲-۱ به سبک مارشال حد ضرر ما ۱۵ پیپس بالاتر از آخرین نوسان صعودی و یا ۱۰ پیپس پایین تر از آخرین نوسان نزولی است . لطفاً به چارت نهایی پوند توجه کنید . دقت کنید که در این چارت هم بر اساس روش ۳-۲-۱ تریدی موفق داشته ایم و هم با شکل گیری پترن AB=CD تریدی ایده آل .



نتیجه چارت پوند . سرانجام پترن AB=CD تا نسبت ۶۱ فیبوناچی ریزش کرد و به هدف تعیین شده رسید .

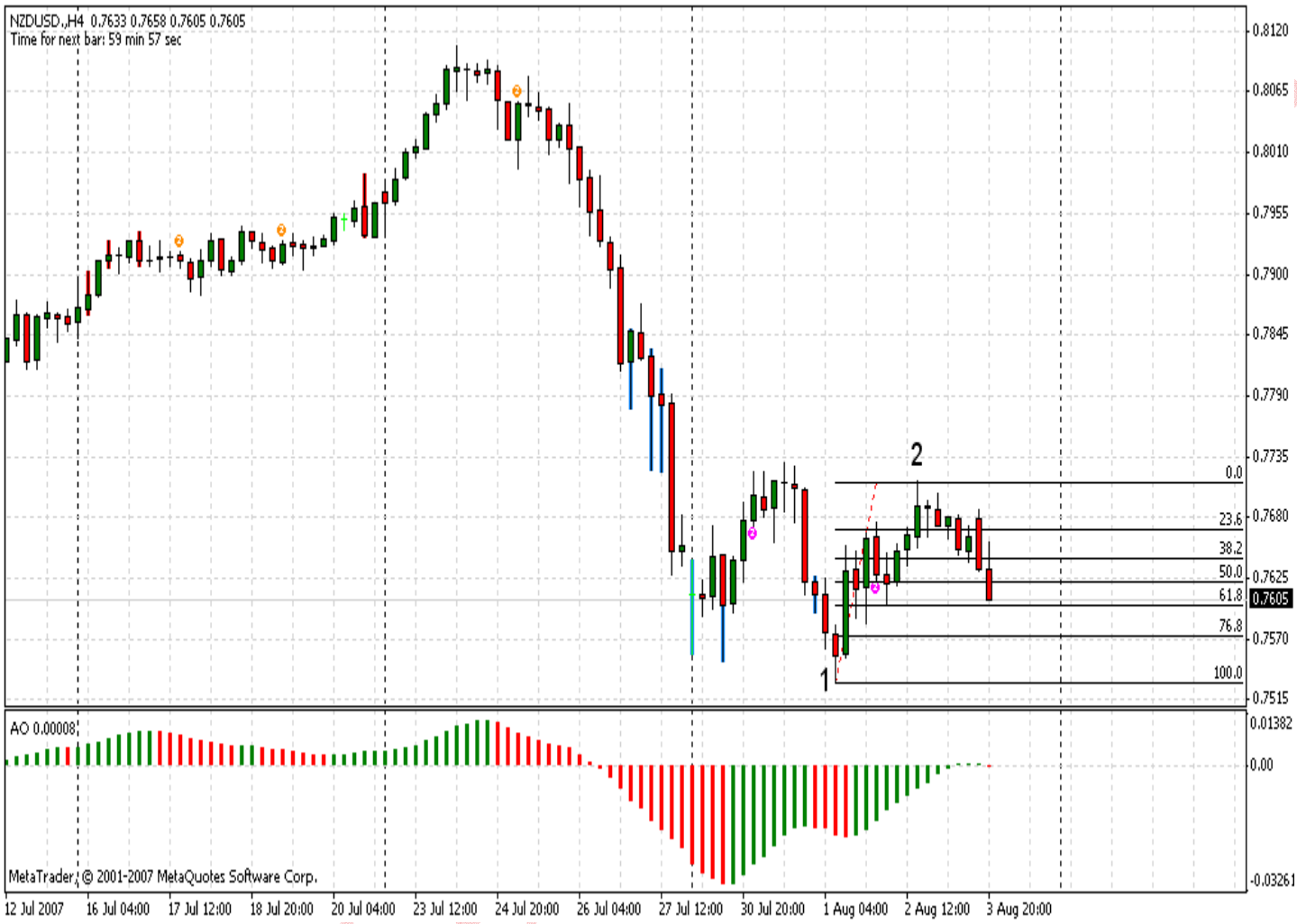
لطفا به چارت توجه بفرمایید .



****

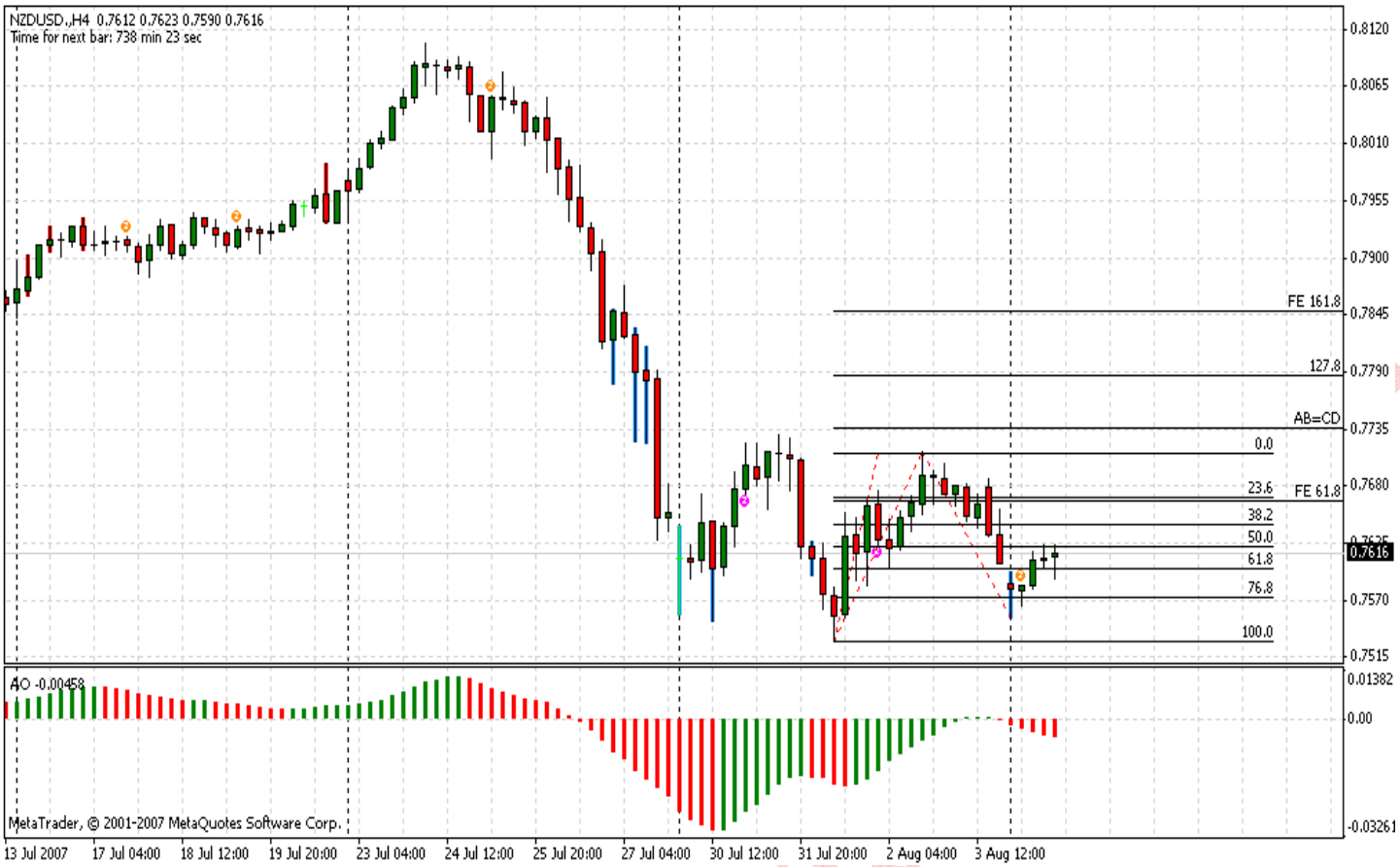
www.gh

در چارت زیر هم پتانسیل ترید به روش ۳-۲-۱ دیده می شود . منتهی می بایست در ناحیه ۶۱ یا ۷۶ تریگری برای برگشت روند ظاهر شود . در چنین وضعیتی که با کندل های قدرتمند روند نزولی است ، بایستی وضعیت را زیر نظر داشته باشید . ممکن است پتانسیل ترید خوبی در پیش باشد .



سرانجام روی نسبت ۷۶ فیبوناچی ، دانای اول تشکیل شد . Buy Stop این پوزیشن یک پیپس بالاتر از کندل دانای اول بوده که در نتیجه در حال حاضر تریگر خورده است . جالب این که سیگنال دانای دوم هم در این پوزیشن شکل گرفته است و تریگر هم خورده است .

www.

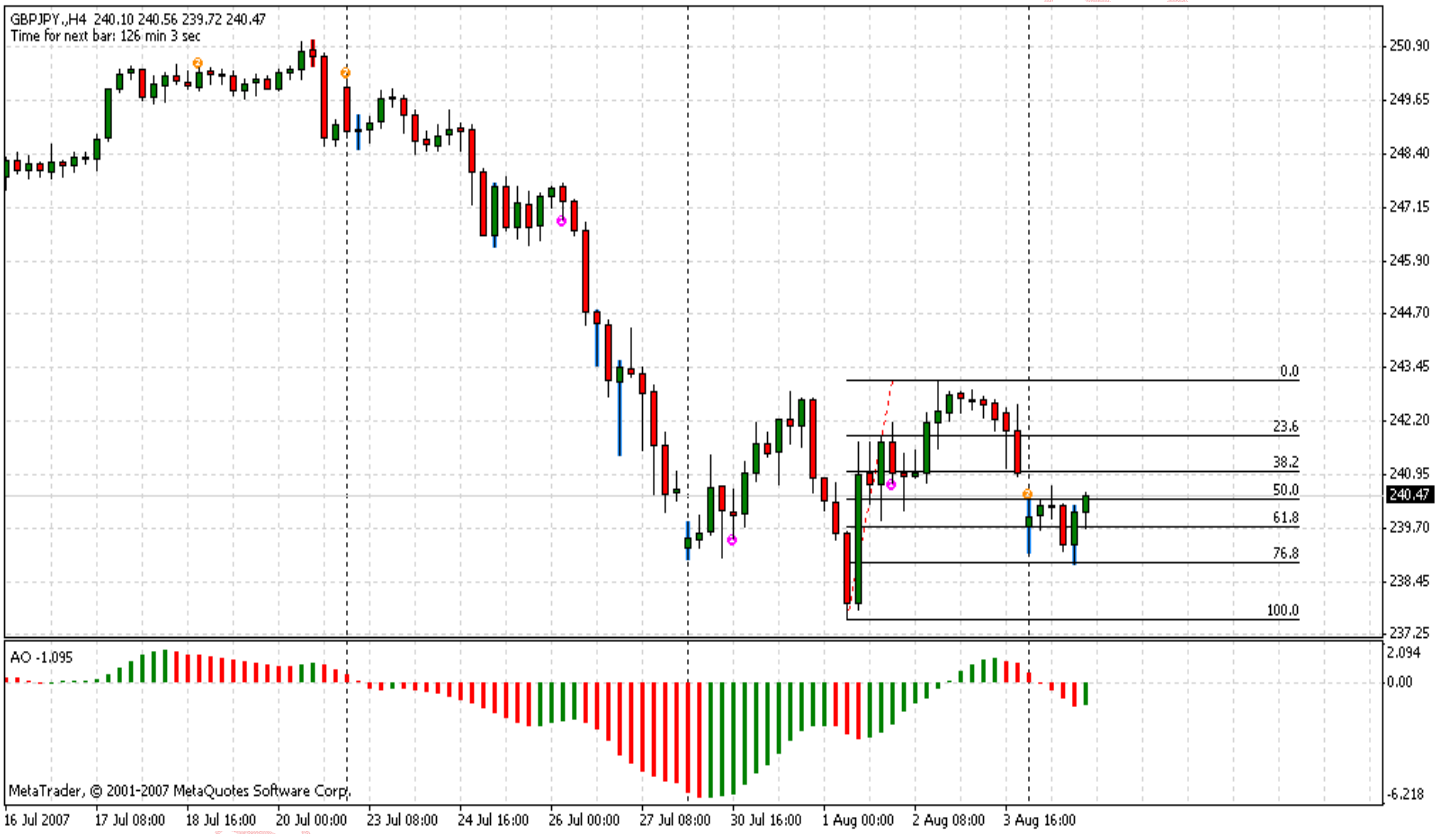


****

چارت زیر هم موقعیت خوبی برای ترید به روش ۳-۲-۱ را روی جفت ارز پوند به ین در تایم فریم ۴ ساعته نشان می دهد .

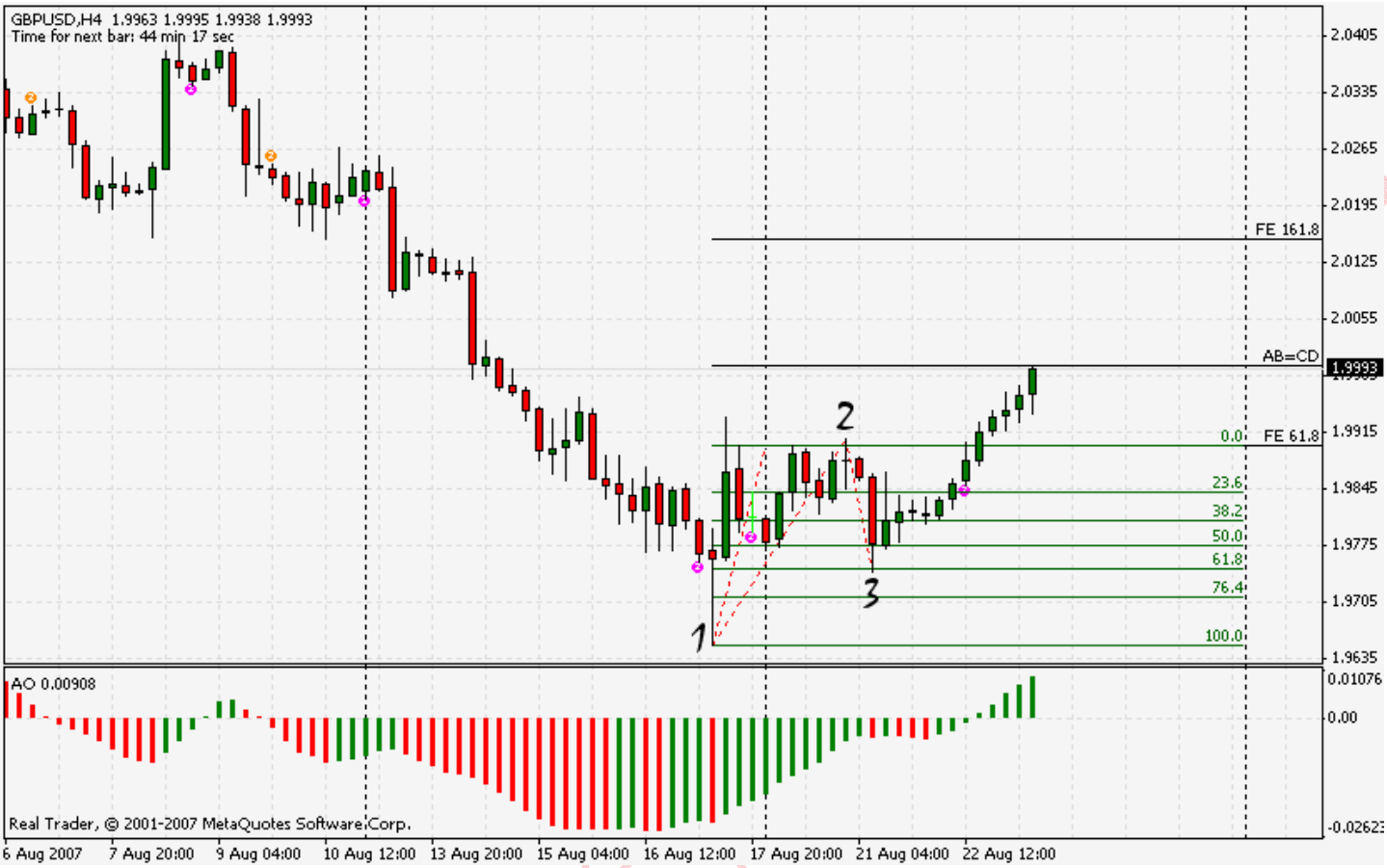
پوزیشن تریگر خورده است و حد ضرر ما ۱۰ پیپس پایین تر از کندل دانای اول است (کندل دانای اولی در سمت چپ دانای اول اخیر) . دقت کنید که همواره حد ضرر را بر اساس مارجینی که دارید بررسی کنید . اگر حد ضرر تعیین شده از میزان ریسکی که در هر پوزیشن می توانید بپذیرید بزرگ تر بود وارد پوزیشن نشوید و یا با لات کمتر وارد شوید . محاسبه ۳٪ ریسک در هر ترید میزان خوبی برای مقایسه است . فرض کنیم با توجه به سرمایه شما حداکثر میزان ضرر هر پوزیشن می تواند ۶۰ پیپس باشد . حالا فرضاً موقعیت تریدی پیش می آید که وقتی می خواهید حد ضرر را ۱۰ تا ۱۵ پیپس بالا یا پایین تر از نوسان قبلی قرار دهید می بینید که حد ضرر فرضاً ۱۲۰ پیپس می شود . در اینجا سه راه دارید . یا این که اساساً این پوزیشن را نگیرید . دوم این که با نصف لات عادی بگیرید یعنی مثلاً اگر سرمایه شما اجازه می داد که استاپ ۶۰ پیپسی را با یک لات بگیرید اینک استاپ ۱۲۰ پیپسی را با ۰,۵ لات بگیرید(یعنی در واقع تحت هیچ شرایطی بیش از

۳٪ ریسک ضرر در یک پوزیشن را متحمل نشویم) . راه سوم این است که صبر کنید و وقتی ترند در جهت تحلیل شما پیش رفت از سیگنال هایی دنباله رو استفاده کنید . توضیح این که می دانیم دو نوع سیگنال ورود داریم . یکی سیگنال های برگشتی ، مانند همین دانای اول که به ما تغییر جهت روند را اطلاع می دهد و به کمک آن در خلاف جهت روند فعلی وارد بازار بشویم . دوم سیگنال هایی که در ادامه شکل گیری روند ایجاد می شوند و به ما اجازه افزایش لات پوزیشن را می دهند . البته در اینجا ما افزایش لات نمی دهیم . بلکه وقتی روند شکل گرفت و مقداری صعود کرد و در واقع ریسک کمتری داشت بر اساس سیگنال این نوع کندل ها وارد بازار می شویم (یعنی با تأخیر و زمانی که حداکثر حد ضرر سرمایه محاسبه شده ما اجازه داد وارد بازار می شویم) .



****

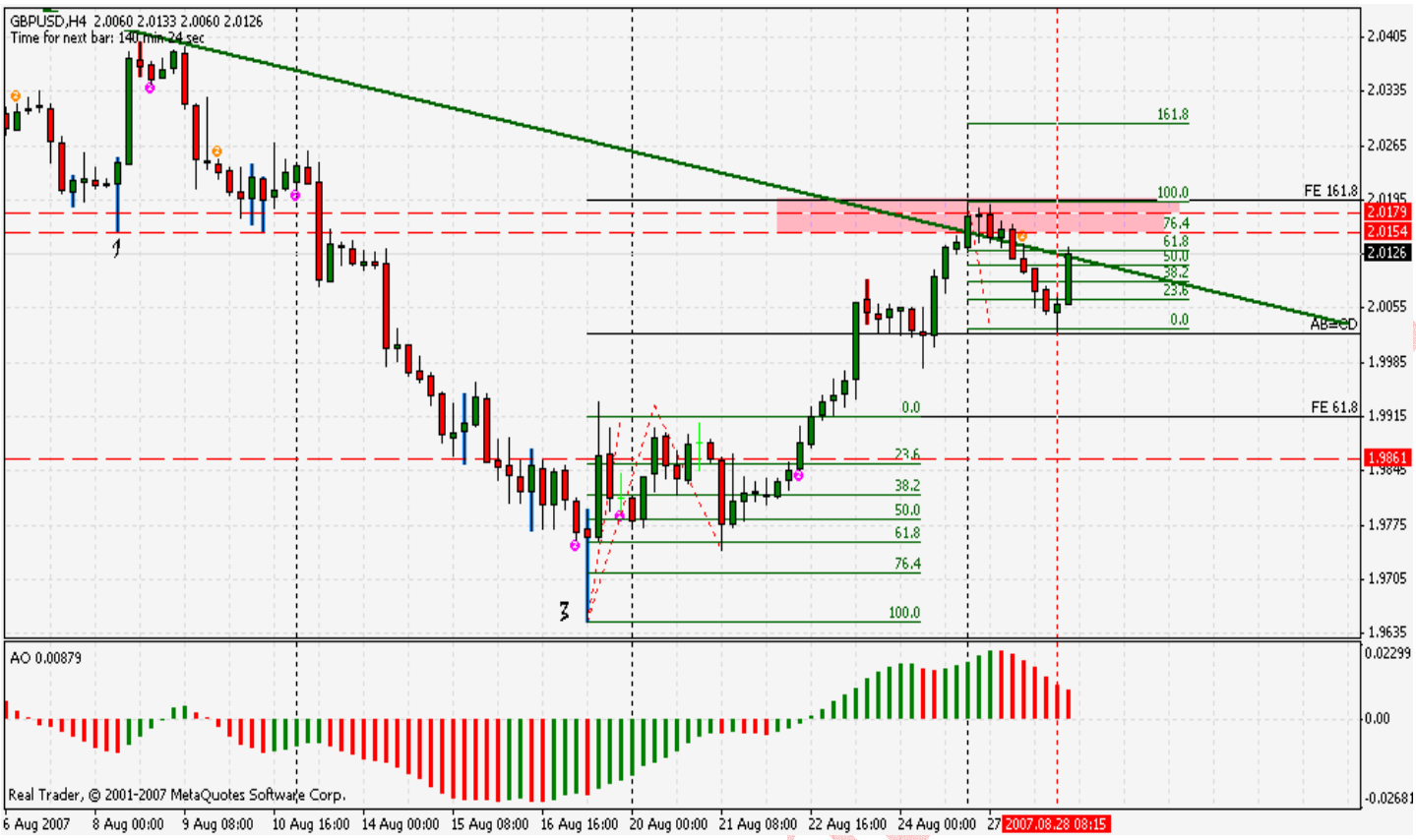
نمونه موفق دیگری به روش ۳-۲-۱ . تریگر مناسب هم در تایم فریم یک ساعته و هم در نیم ساعته موجود بوده است .



****

در چارت زیر هم به روش ۳-۲-۱ پتانسیل تریدی در حال شکل گیری است . دقت کنید که در ناحیه بین ۶۱ تا ۷۶ می بایست حتماً تریگر ورودی را مشاهده کنید (ترجیحا دانای اول) . در غیر این صورت و صرفاً به خاطر رسیدن به این ناحیه نباید وارد بازار شویم . البته در صورت عدم مشاهده تریگر در تایم فریم ۴ ساعته تا حداکثر دو تایم فریم پایین تر هم می شود به دنبال تریگر ورودی گشت (هر چند اعتبار تریگر ورودی در تایم فریم اصلی که روی آن تحلیل انجام شده است بیشتر از تایم فریم های پایین تر است) .

لطفاً به چارت توجه کنید . با عرض پوزش به خاطر خطوط مربوط به روش های دیگر که در چارت دیده می شوند.


GBPUSD,H4 2.0060 2.0133 2.0060 2.0126
Time for next bar: 140 min 24 sec
161.8
100.0
FE 161.8
76.4
61.8
50.0
38.2
23.6
0.0
AB=CD
0.0
FE 61.8
23.6
38.2
50.0
61.8
76.4
100.0
AO 0.00879
Real Trader, © 2001-2007 MetaQuotes Software Corp.
6 Aug 2007
8 Aug 00:00
9 Aug 08:00
10 Aug 16:00
14 Aug 00:00
15 Aug 08:00
16 Aug 16:00
20 Aug 00:00
21 Aug 08:00
22 Aug 16:00
24 Aug 00:00
2007.08.28 08:15

****

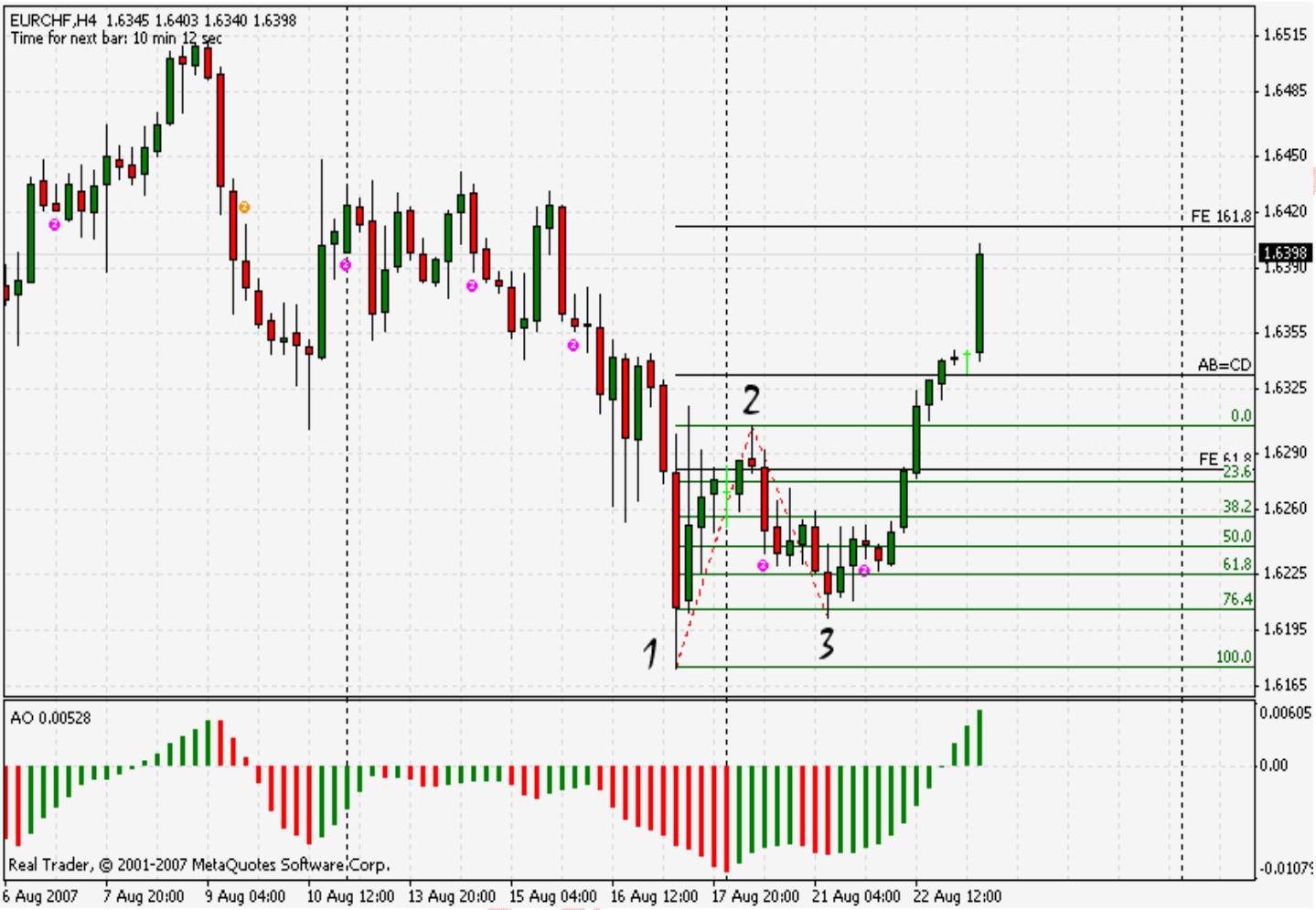
www.gheymat

با توجه به چارت زیر در تایم فریم ۴ ساعته مجدداً پتانسیل بسیار خوبی جهت فروش پیش آمده است . البته باید صبر کنید تا تریگر خوبی بر رویش ایجاد شود .

****

www.ghej

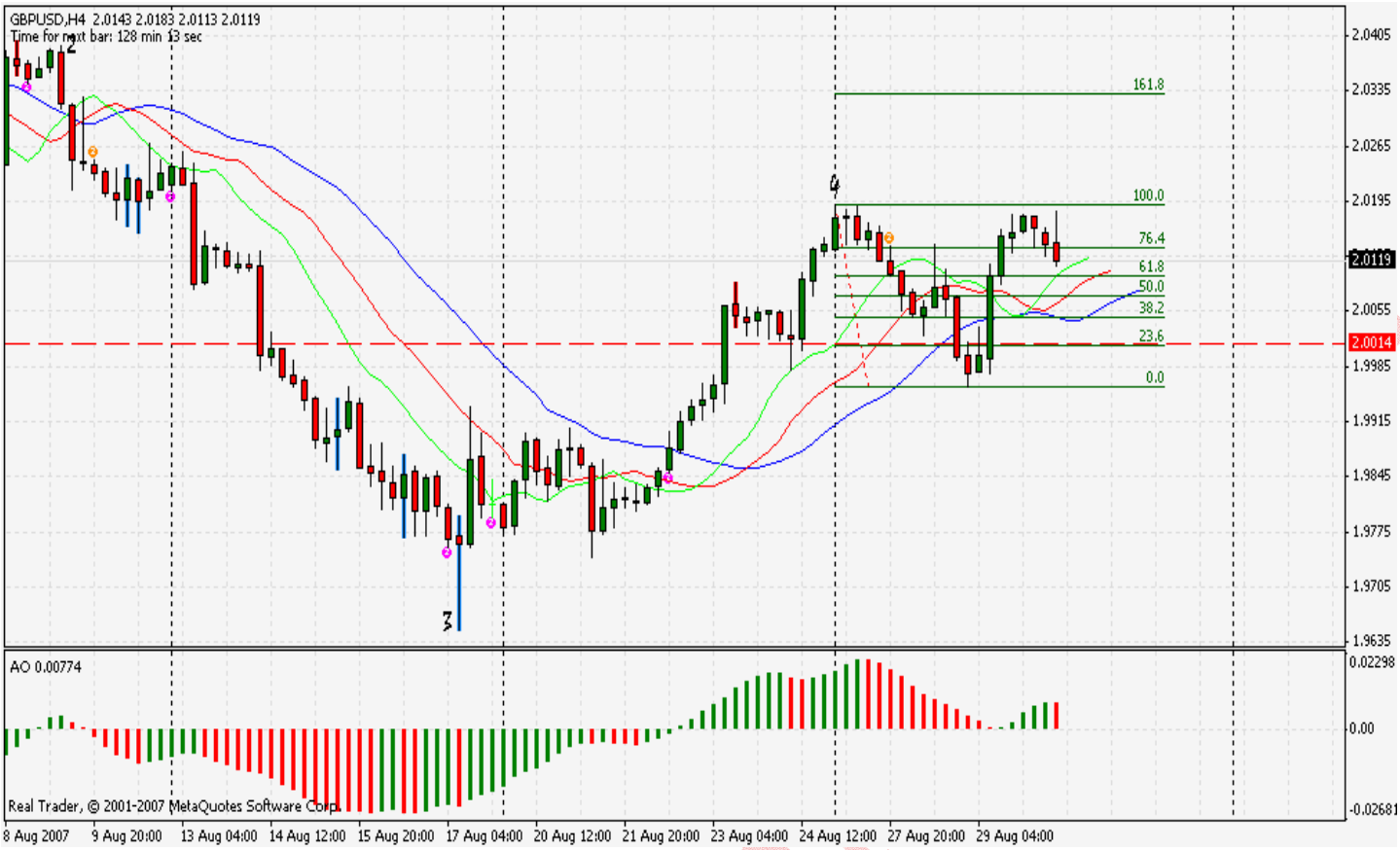
نمونه بسیار موفق دیگری به این روش . تریگر بولیش انگولفینگ در تایم فریم یک ساعته (در ادامه هم سیگنال دانای دوم ایجاد شده است) .



****

لطفاً به چارت زیر توجه کنید . نشانه هایی از برگشت روند مشاهده می شود . منتهی به جهت این که هنوز در ناحیه حساسی هستیم نظیر آغاز تریدهای دو روز گذشته ترجیح می دهیم نشانه های قوی تری برای روند نزولی مشاهده کنم و بعد وارد بازار شویم .

www.

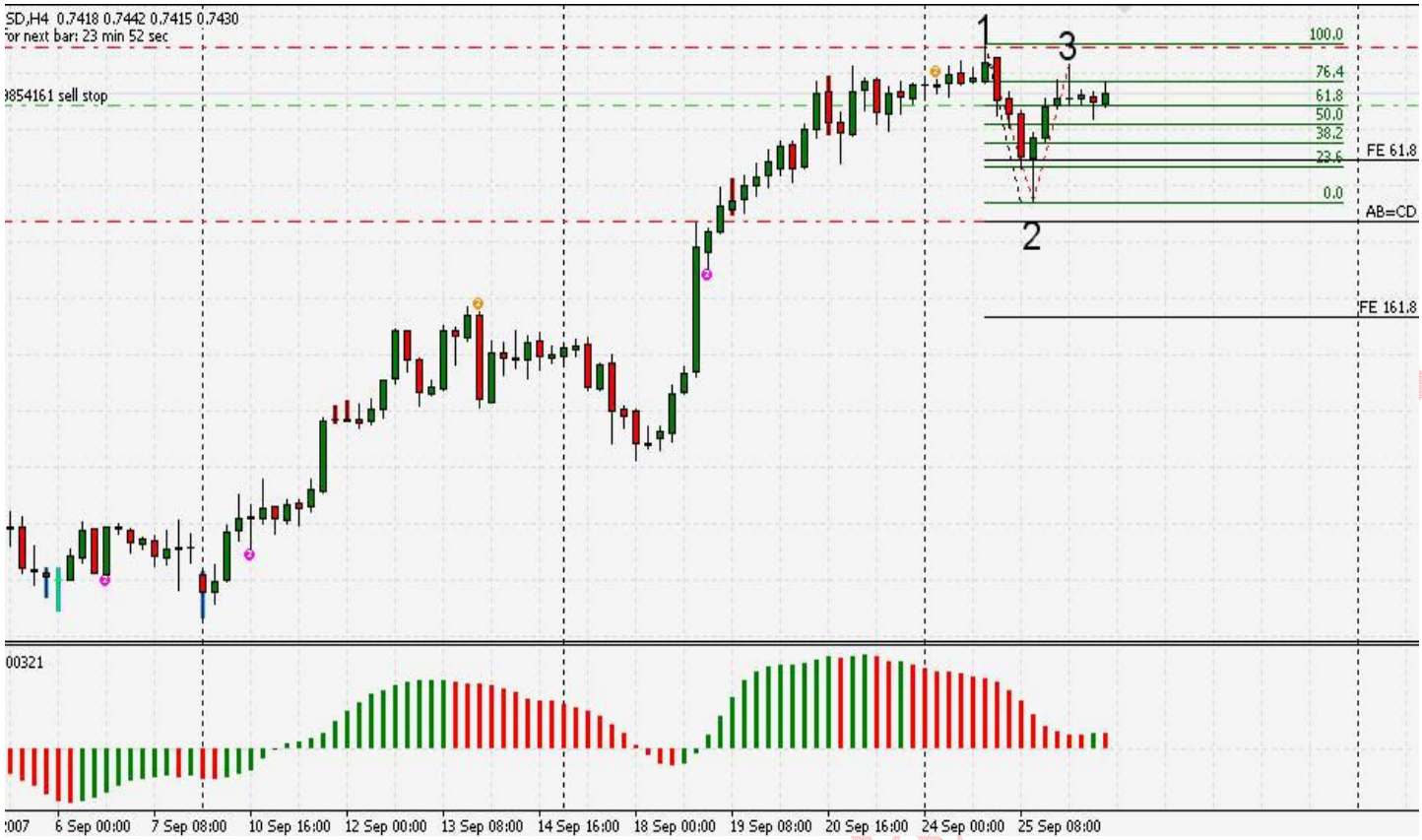


****

پتانسیل جدید ترید بر اساس روش ۳-۲-۱ درتایم ۴ ساعته دلار نیوزلند .

البته بر اساس تریگر دانای اول (در نقطه ۳) می بایست وارد پوزیشن می شدیم اما برای کسانی که مثل من دیر متوجه شکل گیری این وضعیت شده اند با توجه به چارت هنوز هم برای ورود به پوزیشن دیر نیست .

www.sheym



پرسش : چرا در چارت مثال بالا حد ضرر را دقیقاً بر اساس کندل دوجی شکل (البته به علاوه اسپرید)تنظیم نکرده اید ؟

پاسخ: توجه بفرمایید که حد ضرر بر اساس همان کندل (شوتینگ استار) محاسبه شده است اما بر اساس روش ۳-۲-۱ مارشال- موبرای ، یعنی ۱۵ پیپس بالاتر از آخرین نوسان قبلی (همان کندل ستاره دنباله دار) و بعلاوه اسپرید که تصادفاً در چارت بالای شماره یک قرار گرفته . نه این که استاپ از اول بالای شماره ۱ در نظر گرفته شده باشد .

پرسش : اگر پتانسیل ترید در تایم فریم ۴ ساعته مشاهده شود ، تریگر را می شود از تایم یک ساعته گرفت ؟

پاسخ : بله شما می توانید برای پیدا کردن تریگر مناسب تا دو تایم فریم پایین تر هم بروید و تریگر را از آن تایم فریم ها بگیرید اما فراموش نکنید که اعتبار تایم فریم اصلی بالاتر است.

پرسش : لطفاً در مورد تریگر بولیش یا بیریش انگولفینگ توضیح کامل تری بدهید .

پاسخ : بولیش یا بیریش انگولفینگ نوعی کندل پترن (الگوهای شمعدانی) هستند که برای تریگر (نقطه دقیق ورود به بازار) استفاده می شوند . از نظر اصطلاحات شمعدان ها به ترکیبی از دو کندل پشت سر هم

www.sheyma

گفته می شود به گونه ای که کندل دوم کل کندل اول را در بر بگیرد . یعنی از نقطه پایین کندل کوچک تا بالاترین نقطه این کندل در بطن کندل بزرگ بعدی قرار بگیرد .

شکل زیر همان چارت EUR/CHF قبلی را در تایم فریم یک ساعته نشان می دهد . به قسمتی که به صورت مستطیل مشخص شده است توجه بفرمایید (کندل کوچک و کندل بزرگی که در سمت راستش قرار دارد و به اصطلاح آن را در برگرفته است) . به مجموعه این دو شمعدان بولیش انگولفینگ می گویند . در صورتی که کندل دوم یک کندل نزولی باشد ، این ترکیب را بیریش انگولفینگ می گوییم . اصطلاح شمعدان دربر گیرنده مثبت یا منفی به عنوان معادل فارسی این ترکیب ها انتخاب شده است .

همان طور که قبلاً هم گفته شد ، بنده برای ورود به بازار تریگر دانای اول (First Wiseman) را ترجیح می دهم . اما اگر در ناحیه مشخصی باشیم که نیاز به تریگر باشد و دانای اول هم شکل نگرفته باشد به عنوان اولویت دوم از کندل ها برای ورود استفاده می کنم .

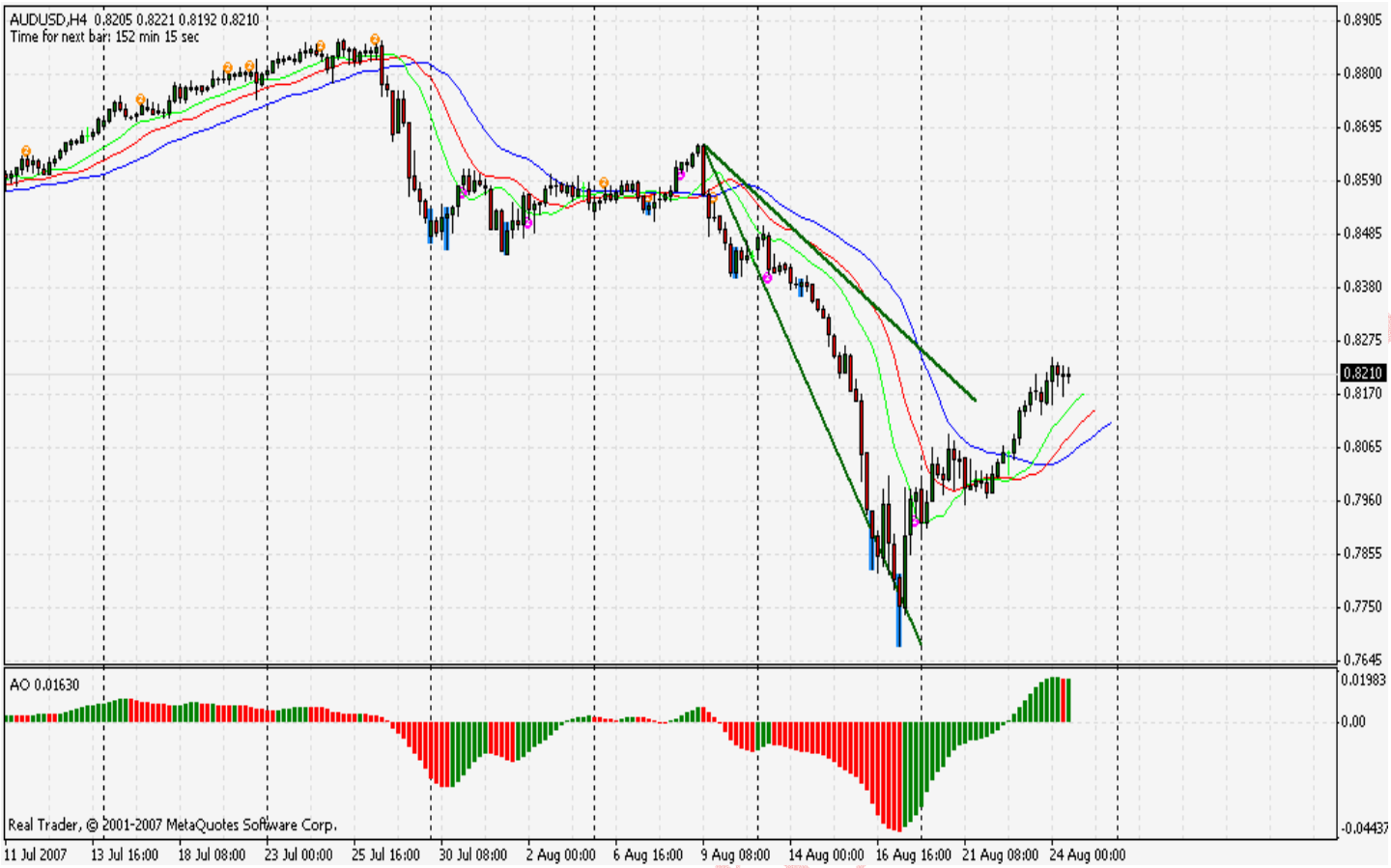
پرسش : در مورد دانای اول و دوم و اندیکاتورهای مربوط به آنها توضیح دهید .

پاسخ : برای آشنایی بیشتر با مفهوم دانای اول و دوم و دریافت اندیکاتورهای آنها بایستی به مباحث مربوط به روش ترید NTD یا مبحث آشنایی با اندیکاتورهای مورد استفاده ویلیامز در سایت قیمت ها مراجعه کنید . به طور مختصر اندیکاتور دانای اول کندل های مورد نظر را با رنگ آبی و قرمز متمایز می کند و اندیکاتور دانای دوم نیز با قرار دادن دایره های کوچکی که عدد 2 در آنها نوشته شده روی کندل مورد نظر سیگنال ورودی را به ما نشان می دهد .

پرسش : در مورد مفهوم انگولیشن توضیح دهید .

پاسخ : انگولیشن به طور خلاصه به حالتی گفته می شود که روند قیمت با خطوط اندیکاتور الیگیتور فاصله پیدا کرده باشد و بین روند قیمت و فرضاً موونگ قرمز رنگ الیگیتور زاویه ایجاد شده باشد . هر چقدر این زاویه بیشتر باشد انگولیشن قدرتمندتری را شاهد هستیم و هر چه انگولیشن قوی تر باشد دانای اولی که در انتهای روند شکل می گیرد سیگنال قدرتمندتری دارد همان طور که در تصویر مشاهده می کنید . بین موونگ قرمز رنگ و روند قیمت به تدریج زاویه ای ایجاد شده است که دائماً افزایش پیدا می کند . من برای ترسیم انگولیشن همواره از مقایسه روند قیمتی با موونگ قرمز استفاده می کنم اما در کتاب مرجع این ترسیم بین روند قیمت با موونگ آبی رنگ هم صورت گرفته است . طبیعی است که تریگر دانای اولی که در انتهای روند شکل می گیرد باید بسیار پرقدرت باشد و ترید موفقی را در پی داشته باشد .

www.gheymatha.com



پرسش : در چارت زیر که در تایم فریم یک ساعته است ، اگر بخواهیم تریگر را از دانای اول نزولی بگیریم ، در حال حاضر تریگر زده نشده است و قیمت از high دانا بالاتر رفته است باز هم می توانیم بر اساس همین دانای اول نزولی تریگر بگیریم اگر جواب بله است حد ضرر کجا باید باشد؟

www.sheyri

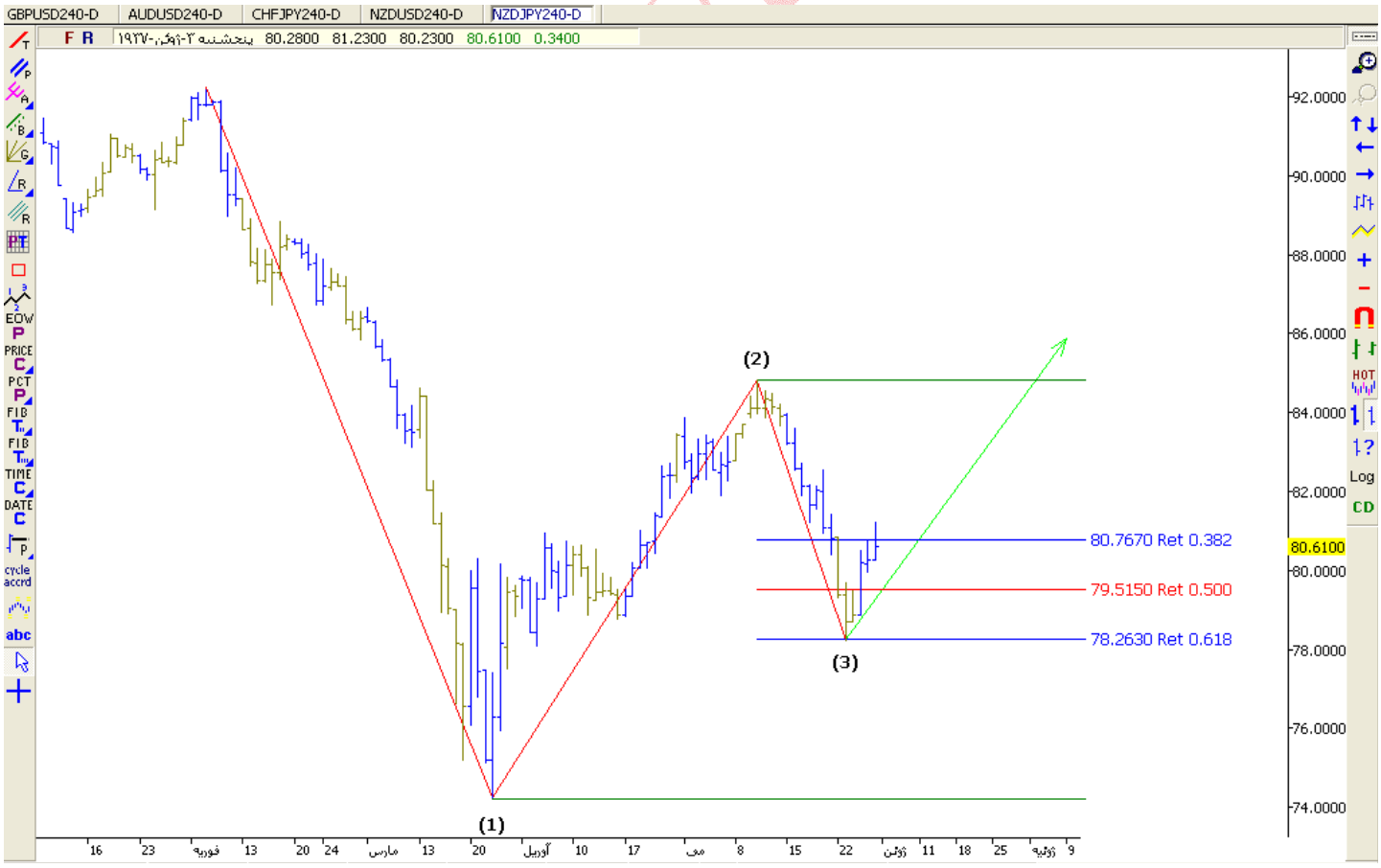
پاسخ : بله . تا زمانی که دانای اول دیگری شکل نگیرد می توانید یک Sell Stop را یک پیپس پایین تر از این تریگر داشته باشید و حد ضرر هم می شود ۱۵ پیپس به علاوه اسپرید این ارز (که معمولا ۴ پیپس است) بالاتر از نقطه High دانای اول . منتهی هر چقدر تعداد کندل های ایجاد شده بعد از تریگر زیادتر شود و این تریگر فعال نشود از اعتبارش کم می شود . به طور کلی در چنین ترندهای قدرتمندی که به نظر می رسد در اواخرش باشیم معمولا تریگرهای دانای اول بعدی به سرعت از راه می رسند و می توان بر اساس آنها سریع تر وارد بازار شد . منتهی با توجه به این که در روزی که این چارت مربوط به آن است ، روند صعودی پوند خیلی خیلی قدرتمند بود (در واقع نسبت به دانای اول پایین که بر روی L3 شکل گرفت ، بیش از ۱۸۰ پیپس صعود داشته ایم) . بنابراین در چنین شرایطی ترجیحاً به دنبال تریگر در تایم فریم های پایینتر (در روش ۳-۲-۱) نباشید و بهترین کار این است که صبر کنید تا ابهام این ناحیه حساس بازار برطرف شده و وضعیت مشخص تر

شود . در چنین شرایط مبهمی اگر هم اصرار به پیدا کردن تریگر دارید بهتر است تا شکل گیری تریگر در تایم فریم اصلی ، یعنی ۴ ساعته دست نگه دارید .

پرسش : در مورد میزان اعتبار پترن های زیر و صحیح بودن نسبت های آنها راهنمایی بفرمایید .

www

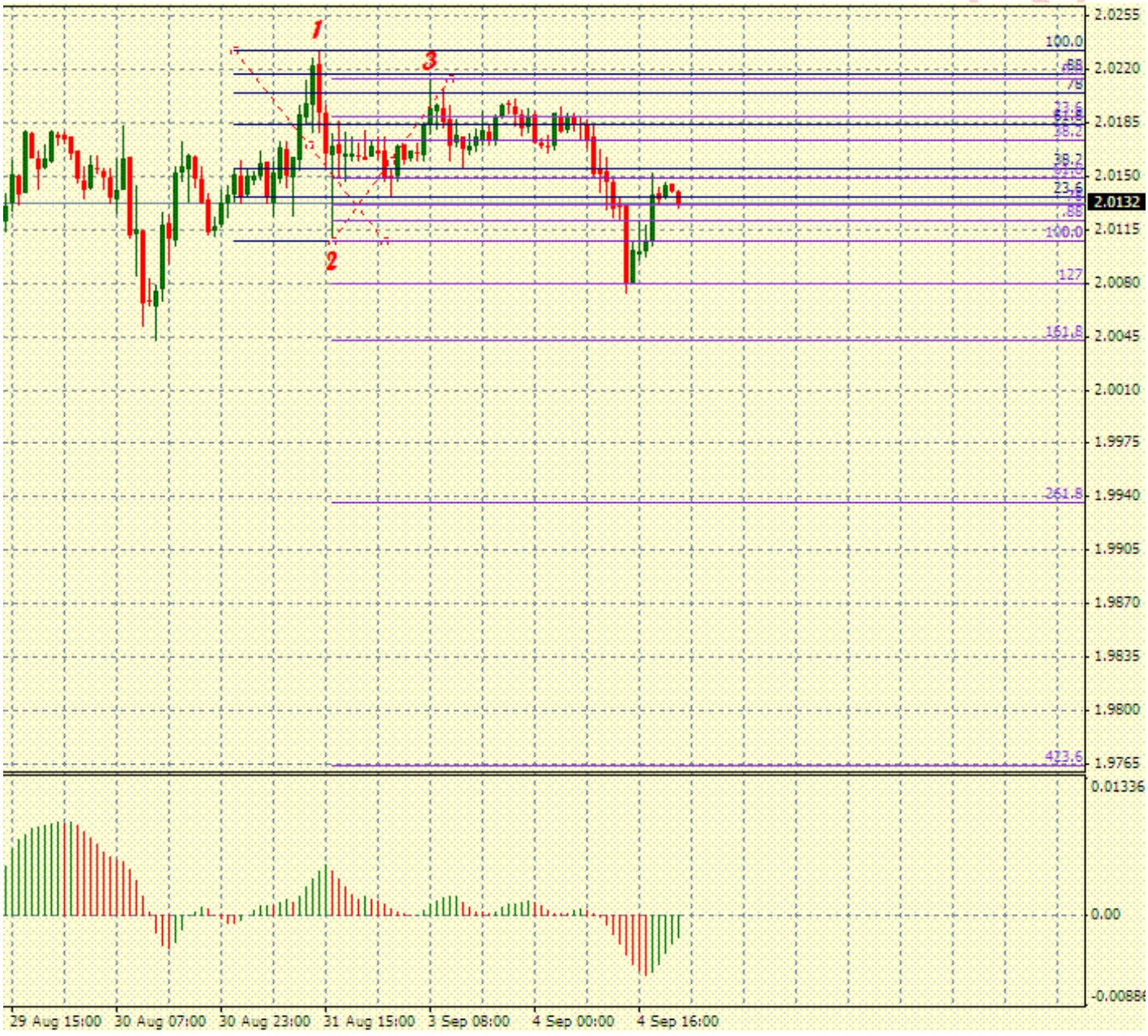
GBPUSD240-D
AUDUSD240-D
CHFJPY240-D
NZDUSD240-D
F R
سه شنبه ۲۲-ژوئن-۱۹۲۷ 0.6991 0.7036 0.6989 0.7009 0.0017
(1)
(2)
(3)
0.7031 Ret 0.382
0.6956 Ret 0.500
0.6881 Ret 0.618
Vol 14
O 0.6991 H 0.7036 L 0.6989 C 0.7009 R 0.0047 0.0017 0 SW1


GBPUSD240-D
AUDUSD240-D
CHFJPY240-D
NZDUSD240-D
NZDJPY240-D
F R
پنجشنبه ۳-ژوئن-۱۹۲۷ 80.2800 81.2300 80.2300 80.6100 0.3400
(1)
(2)
(3)
80.7670 Ret 0.382
79.5150 Ret 0.500
78.2630 Ret 0.618

پاسخ : اگر چه بر اساس کتاب کن مارشال و راب موبرای ، با نسبت ۵۰ هم می توانیم ترید کنیم اما باز هم بر نسبت های ۶۱ و ۷۶ تأکید دارند . بنده هم به هیچ وجه استفاده از نسبت ۵۰ را توصیه نمی کنم و در تریـدهای شخصی ام به روش ۳-۲-۱ از این نسبت استفاده نمی کنم .

پرسش : پترن های زیر پترن ۱-۲-۳ هستند یا خیر:

GBP/USD 1hr

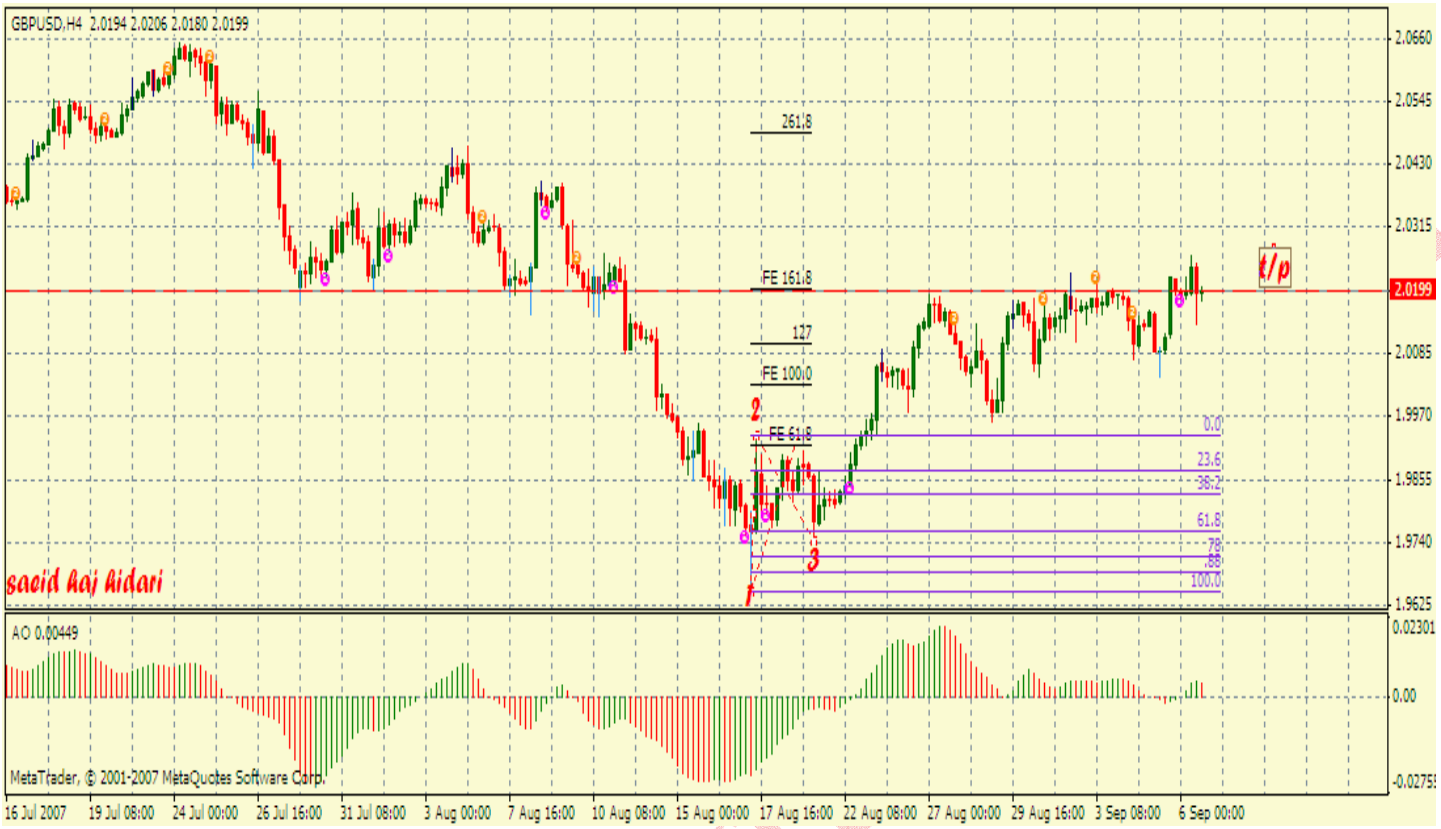


EUR/JPY 1hr

پاسخ : پترن ها صحیح هستند اما باز هم یادآوری می کنم که بنده از روش پترن ۳-۲-۱ تنها در تایم فریم ۴ ساعته استفاده می کنم .

www.gh

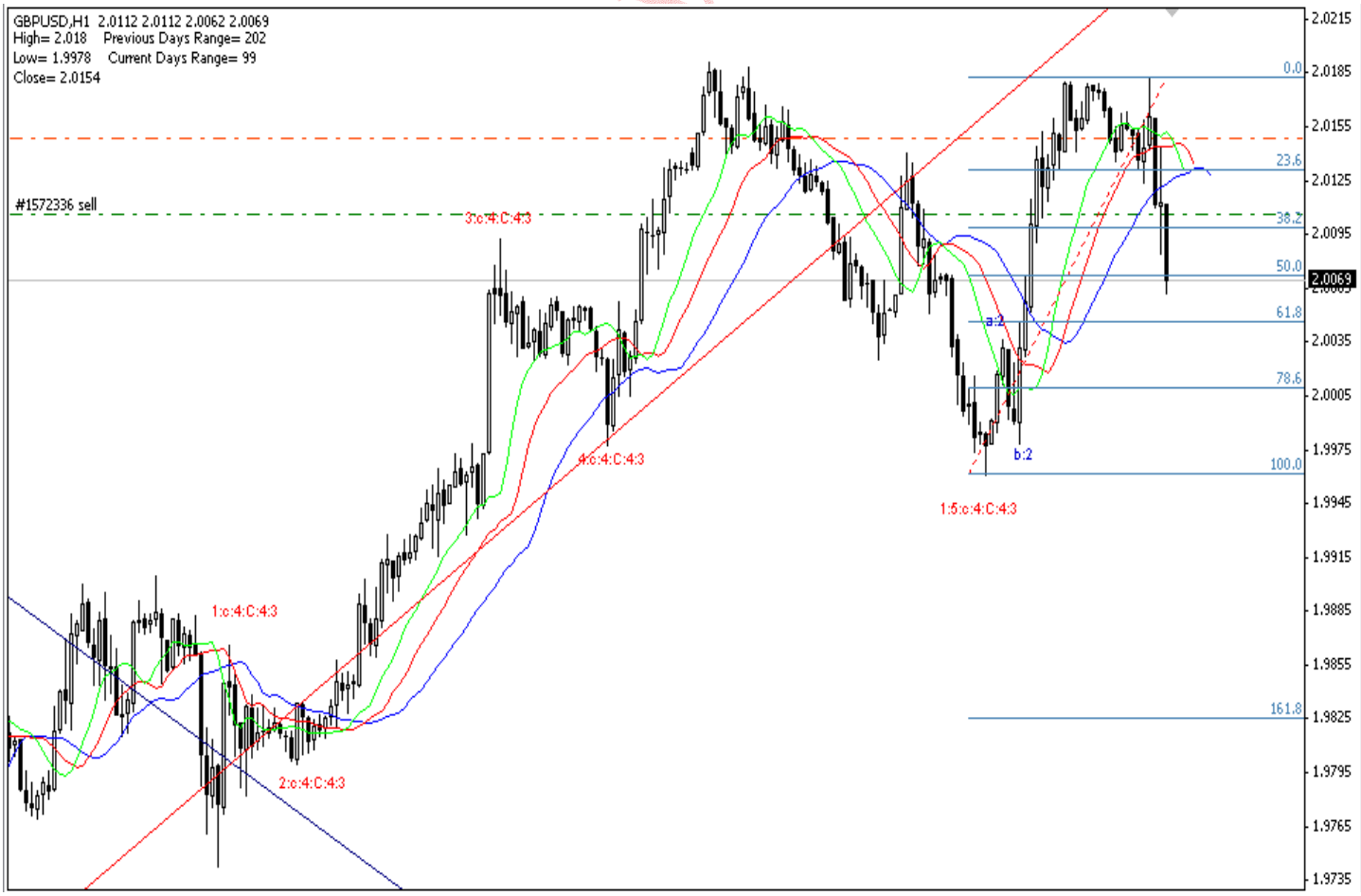
پرسش : در چارت زیر می توان گفت پترن ۱-۲-۳ شکل گرفته است ؟



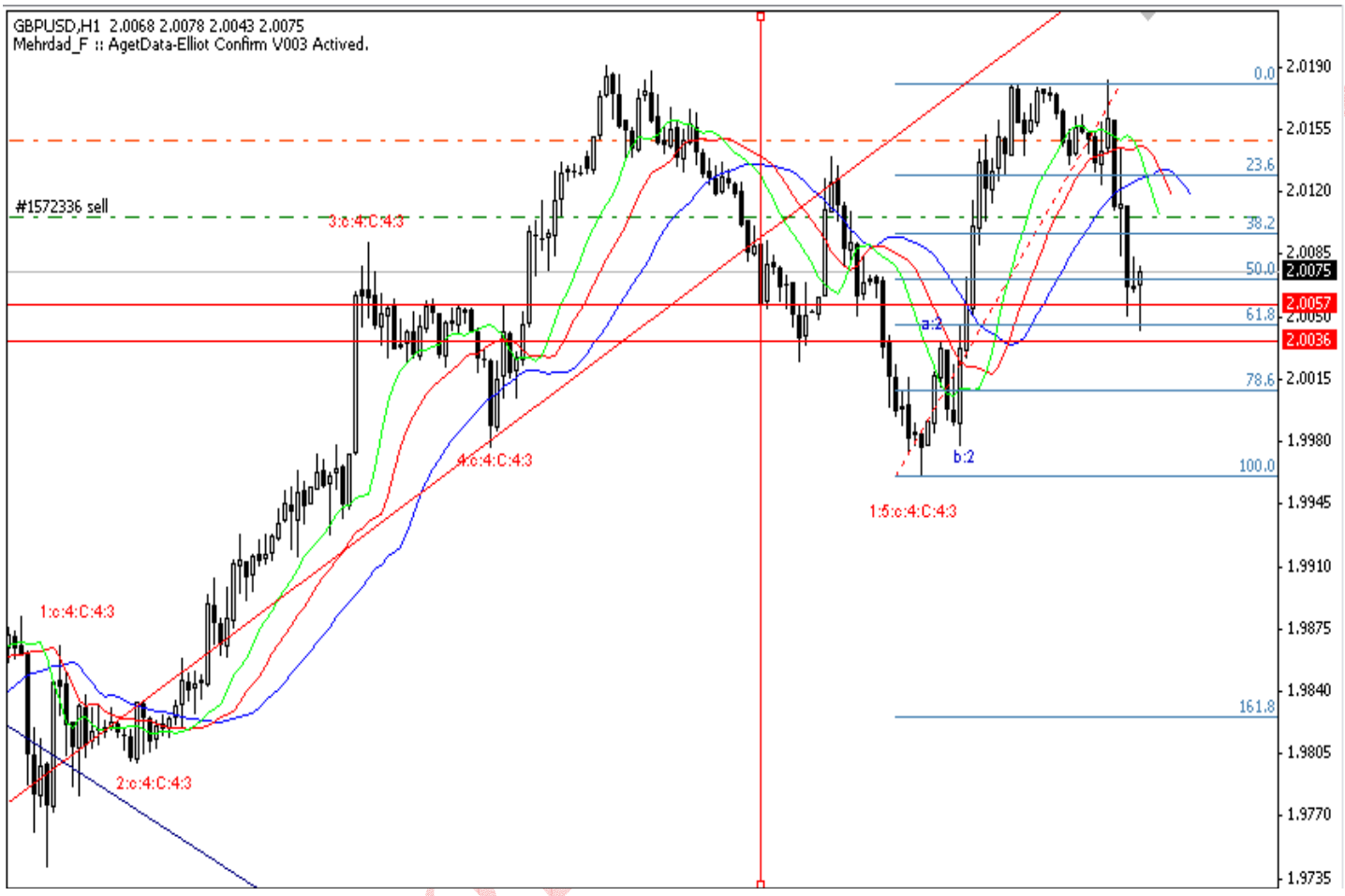
پاسخ : پترن کاملاً درست است . اما جالب اینجاست که بعد از رسیدن قیمت به هدف ، روند خیال برگشتن ندارد ! در واقع بر اساس همان پترن ۳-۲-۱ ، روند صعودی شکل گرفت و به هدف AB=CD وحتی AB=CD ۱۶۱ هم رسید ! در واقع بعد از نسبت ۱۶۱ ، دیگر به طور جدی می بایست به جای یک کارکشن AB=CD به یک موج ۳ فکر کرد که همین ابهام برانگیز است . چرا که اگر روند صعودی بخواهد ادامه پیدا کند ،کل شمارش های قبلی زیر سؤال می روند .البته همان طور که در تحلیل سایت ماینر هم دیده اید ، این مسأله به این سادگی نیست . در یک هفته ای که چارت بالا مربوط به آن است ، پوند در این حدود در حال نوسان است و سیگنال واضحی جهت تشخیص ادامه روند نزولی و یا صعودی مشاهده نمی شده است . بعد از آن پترن ۳-۲-۱ که در ابتدای این روند صعودی به آن اشاره کرده بودید ، دوباره بر اساس همین روش ۳-۲-۱ ترید موفقی شکل گرفته بود که آن هم به هدف رسید . تصویر زیر را مشاهده بفرمایید .

www.elevi

پرسش : در چارت زیر احتمال تشکیل ۱۲۳ روی پوند وجود دارد؟



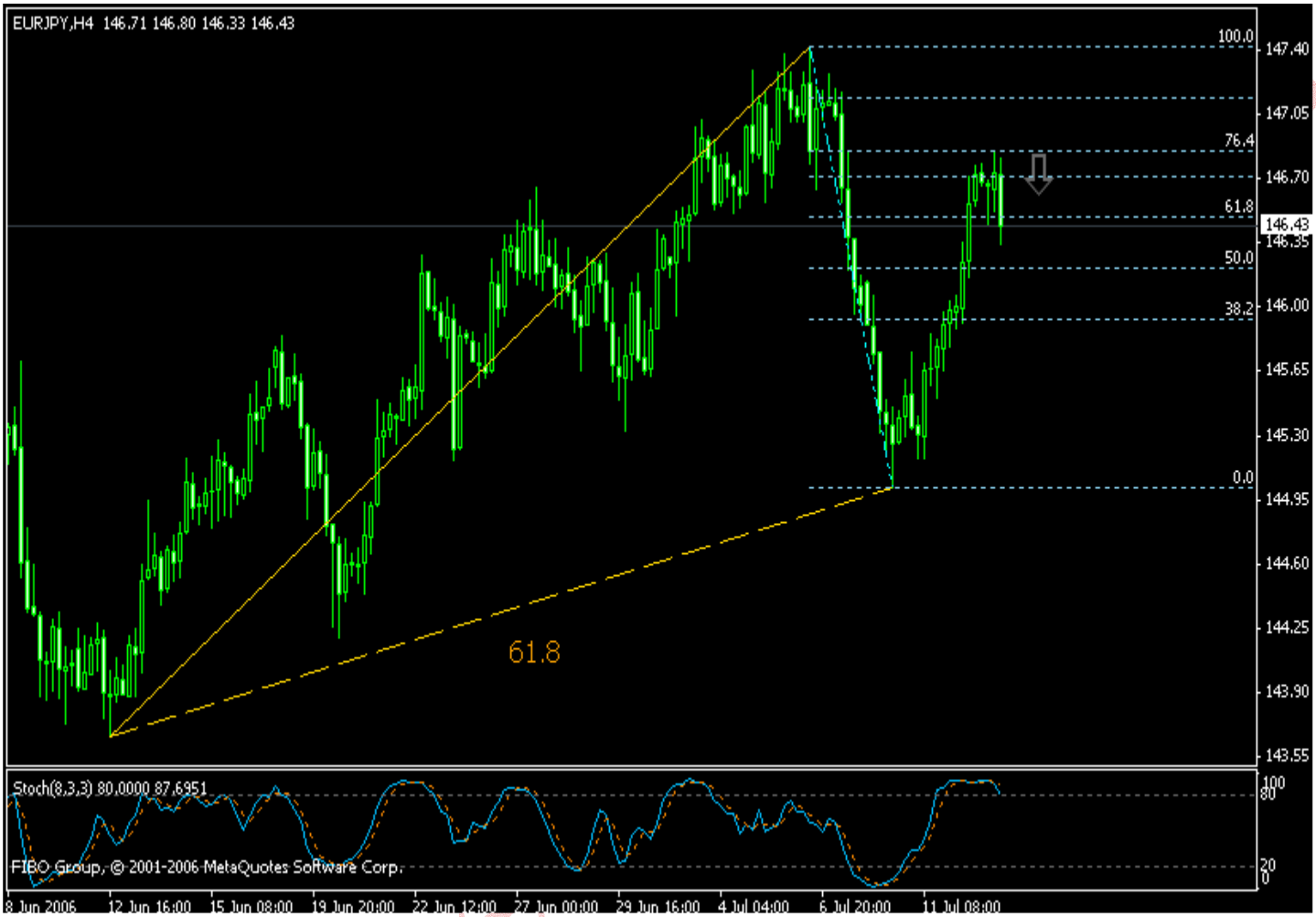
به نظر می رسد سیگنال بدی نباشد اما به شخصه احتمال می دهم اینجا شروع یک ریتریس موقت باشد . بنابراین ترجیح می دهم روی این موقعیت ترید نکنم . نظر شما چیست؟



پاسخ : به نظر بنده سیگنال خیلی خوبی نیست چون XA که موج ایمپالس ما هست تقریباً برابر با AB است .

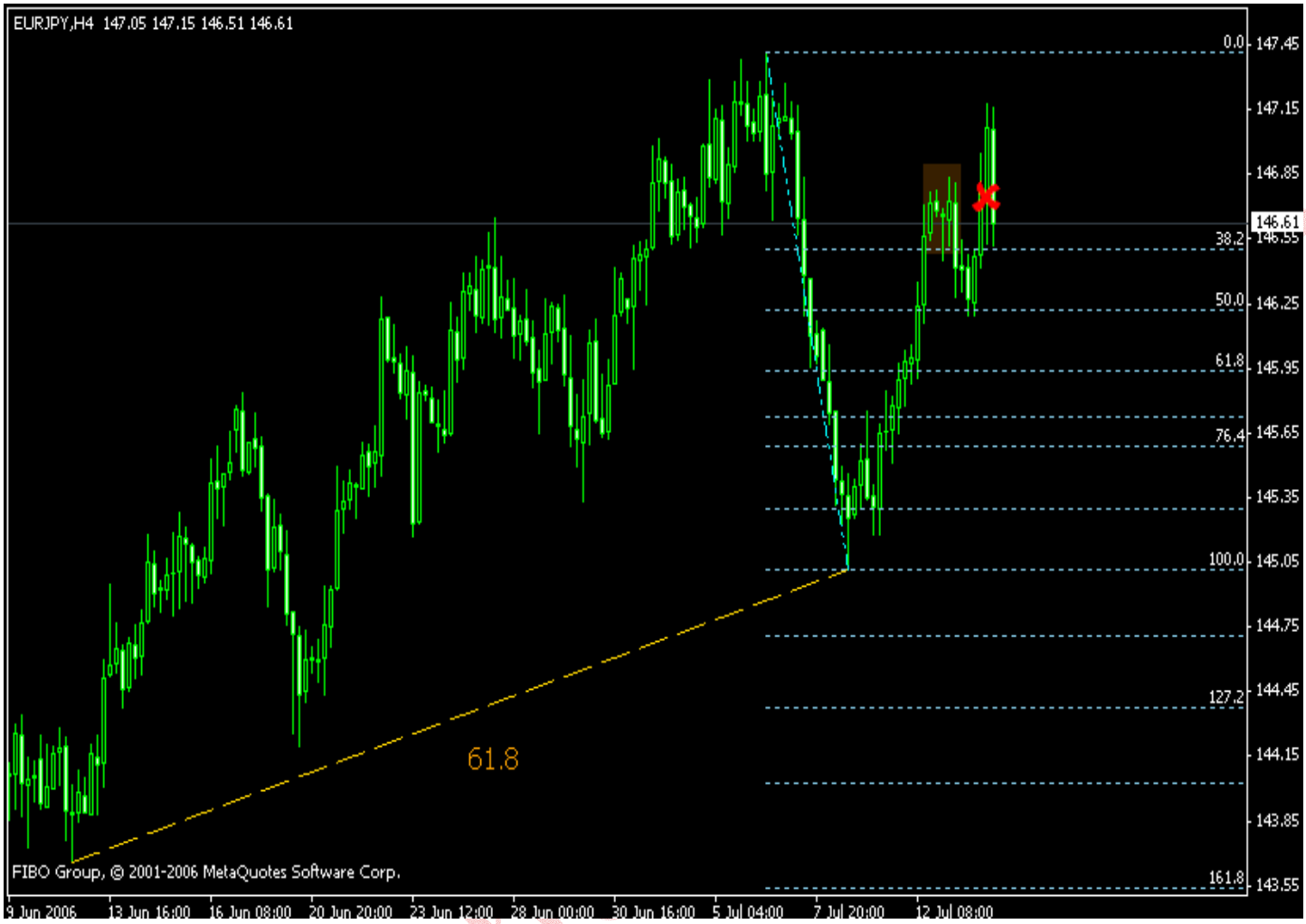
www.s

پرسش : در چارت زیر ترند اصلی صعودی بوده و با رسیدن قیمت به ریتریس ۶۱٫۸ در صد انتظار ادامه روند صعودی را داشته ایم . آیا در این حالت می توانستیم از این پترن ۳-۲-۱ استفاده کنیم و در جهت فلش وارد پوزیشن Sell شویم ؟



پاسخ : بله وضعیت ایده آلی بوده است . در مورد این که هم جهت با ترند اصلی نبوده هم عرض کنم که تجربه بنده این است که از این روش می توان در خلاف جهت روند هم استفاده کرد اما باید در این موارد دقت کرد و از هدف های کوچک تری نسبت به هدف های اصلی این روش استفاده کرد و نیز این که در پوزیشن های به سود رسیده با دقت بیشتری روند را دنبال کرد . در مجموع اگر پوزیشن هم جهت با روند اصلی باشد مطمئناً شانس موفقیت بیشتری دارد . قانون شخصی بنده برای ترید در این موارد ورود به پوزیشن با لات بیشتر در جهت ترند و با لات کمتر در موارد مخالف ترند است .

نکته : دیدن چارت قبلی بعد از آپدیت شدن خالی از لطف نیست



توضیح : با بررسی دقیق تر چارت فوق مشخص شد که کندل نزولی دقیقاً بر روی پیوت هفتگی قرار گرفته است . برای تایم فریم روزانه و ۴ ساعته پیوت هفتگی می تواند فیلتر خیلی خوبی باشد . بهتر بود در آن زمان صبر می کردیم تا کندل زیر خط پیوت بسته شود که طبیعتاً در آن زمان قسمت زیادی از حرکت شکل گرفته بود (به معنی کندل بزرگ نزولی که در صورت بسته شدن دیگر نباید وارد پوزیشن می شدیم ، چون دیگر برای این کار دیر شده بود .مگر این که با تریگر در تایم فریم پایین تر و زودتراز این زمان وارد پوزیشن شده باشیم) . مارشال در کتابش معتقد است که در این موارد اگر به سود ۱۰ پیپسی رسیدید باید حد ضرر را ۱۰ پیپس جابجا کنید و در صورت ادامه روند باز هم به همین شکل عمل کنید . اگر پوزیشن به میزان ۳۰ پیپس در سود بود حد ضرر را باید روی نقطه ورود بیارید .

در هر صورت با لحاظ کردن پیوت هفتگی به عنوان یک فیلتر مناسب ، بهتر می توان از روش ۳-۲-۱ استفاده کرد . به طور کلی خطوط پیوت مانند یک مقاومت عمل می کنند . با رسیدن به این خطوط می توانید

پوزیشن در سود را ببندید یا اگر طبق تحلیل شما روند خیلی قوی است و احتمال شکسته شدن مقاومت وجود دارد ادامه دهید و پوزیشن را باز نگه دارید یا از تکنیک های مدیریت پوزیشن برای نظارت وضعیت استفاده کنید .

به نظر بنده بهترین فیلتری که برای این روش وجود دارد این است که تنها در تایم فریم ۴ ساعته از آن استفاده شود و خصوصاً برای تریگر به تایم فریم های پایین تر نرویم و منتظر تریگر معتبر در همین بازه زمانی بمانیم .

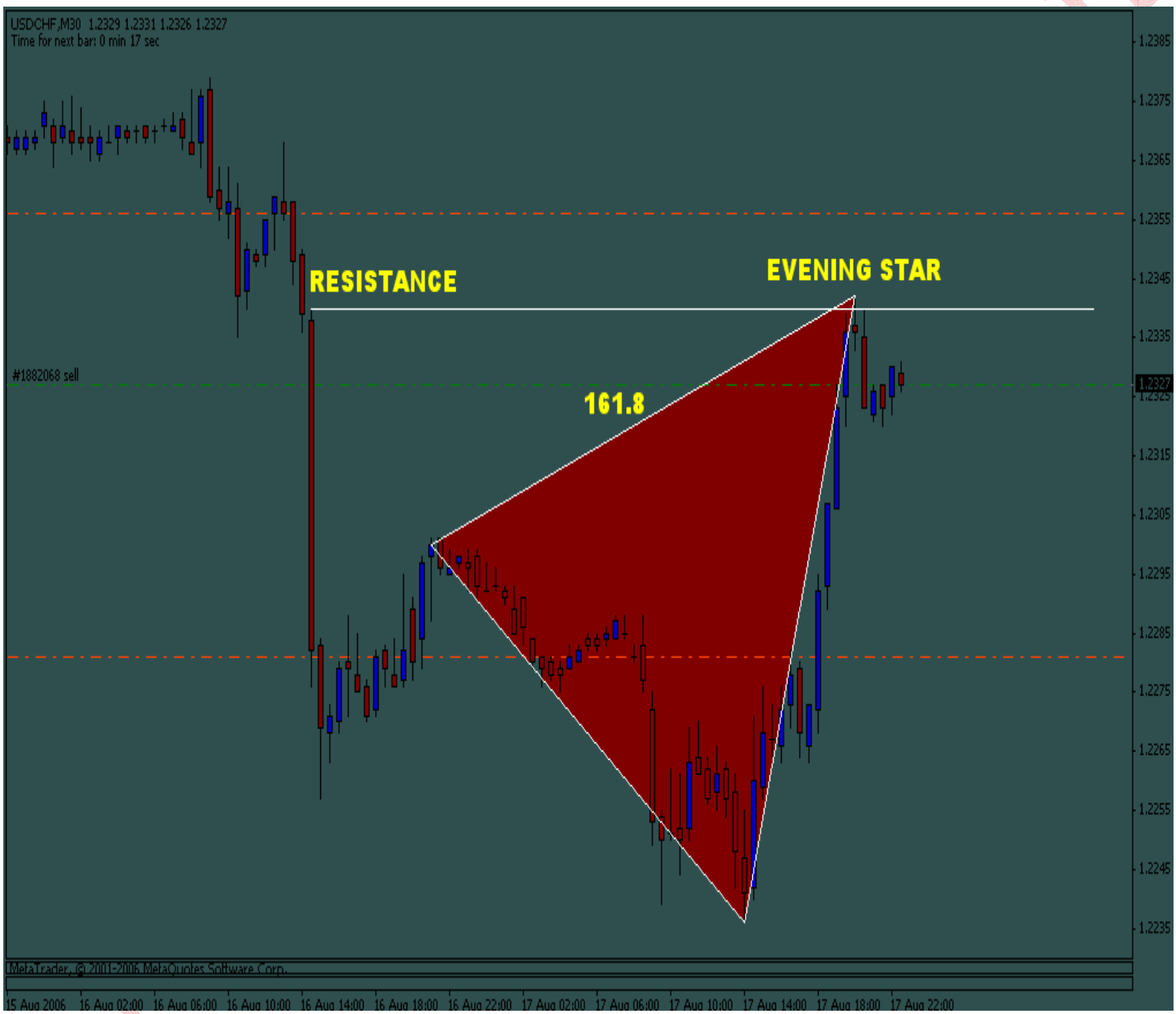
در صورتی که به تحلیل الیوت هم آشنایی داشته باشیم می توانیم ببینیم وضعیتی که برای ترید پیش آمده منطبق با چه موجی است و در صورتی که در ناحیه موج ۲ یا ۴ باشد با اطمینان بیشتری ترید را انجام دهیم .

پرسش : نظر شما درباره ترید بر اساس چارت زیر چیست؟

پاسخ : به عنوان یه قاعده کلی باید عرض کنم که برای ترید موفق بهتر است همواره روند کلی را در نظر داشته باشید . همان طور که می دانید برای هر بازه زمانی ، تایم فریم های بالاتر و نزدیک به آن تایم فریم بسیار مهم هستند . برای تایم فریم ۱۵ دقیقه همیشه تایم فریم ۱ ساعته را باید چک کنید که روند کوتاه مدت را برای شما مشخص می کند و بعد از آن می توانید برای تریگر از تایم فریم ۱۵ دقیقه استفاده کنید .

در چارتی بالا به شرط هم جهت بودن با روند ، می توانید با دیدن یکی از کندل هایی که مارشال در کتابش معرفی کرده وارد پوزیشن شوید . همان طور که می بینید چنین کندلی در آن لحظه مهیا نبوده است (شوتینگ استار جزو آنها نیست و اگر هم بخواهیم ایونینگ استار در نظر بگیریم ، shadow شوتینگ استار و خصوصاً shadow کندل سوم اصلا پترن ایده الی را نشان نمی دهد . نکته مهم دیگری هم هست که همیشه باید به آن توجه داشت و آن زمان انجام یک ترید است . چارتی که شما ارائه کرده اید مربوط به زمان آرامش بازار و انتهای بازار نیویورک است . طبیعتاً در آن لحظه تریدرهای زیادی در بازار حضور ندارند و به طبع آن ، حرکت ضعیف شده و انتظار روند قوی و به دنبال آن ترید موفق کمتر وجود دارد . همیشه به زمان شروع یک ترید دقت کنید . طبیعتاً یکی دو ساعت ابتدایی هر بازاری بهترین فرصت ها را در اختیار ما قرار می دهد .

پرسش : چارت زیر یک پترن بسط یافته ۱۶۱٫۸ است که منجر به ضرر شد . مطابق چارت دوم در یک تایم بالاتر دو کندل صعودی و بزرگ داریم ایا این دلیل می توانسته ما را از ترید دور کند؟ یا حرکت کندل های اولیه در ۱۲۳۴ که بعد از آن ریتریس داریم مهم است؟ مثلا اگر کندل ها بزرگ و قدرتمند باشند احتمال موفقیت ترید و رسیدن به هدف بیشتر است؟



پاسخ : پیش از هر چیز عرض کنم که این چارتی که شما ارائه کرده اید ، سیستم تریدینگ ۳-۲-۱ نیست بلکه پترن های ۵ و ۶ در الگوهای فیبوناچی محسوب می شوند (نسبت های ۱۶۱ و ۱۲۷) .

در مورد کندل هایی که بسیار پرقدرت و بزرگ هستند در بحث پترن ها گفته شده که این نوع کندل های یکی از سه نوع کندل هایی هستند که اگه در ناحیه PRZ شکل بگیرند نباید بر اساس آنها تریدکرد چون ممکن است که قدرت روند خیلی زیاد باشد و منجر به عبور از این ناحیه شود و خلاصه این که ریسک بالایی دارند . در مورد این نوع کندل ها مطلب دیگری هم هست و آن این که اگر در شکل گیری یک نسبت فیبوناچی ، دو سه کندل بزرگ منجر به این شکل گیری بشود ، این باعث می شود که روند از نظر زمانی خیلی سریع باشد (یعنی تعداد کندل هایی که باعث شکل گیری شده خیلی کم و معدود است) و این موضوع

همان طور که گریفیث بیان می کند ، می بایست هشداری برای ما باشد که از ترید روی این وضعیت جداً پرهیز کنیم .

در نهایت این که وقتی بر اساس هر پترنی و یا بر اساس همین روش ۳-۲-۱ ترید می کنیم ، وجود کندل های بزرگ بعد از تریگر خوردن پوزیشن نشانه روند قدرتمند و شانس بالای موفقیت آن ترید است . در واقع اگر بر عکس به قضیه نگاه کنیم ، در این مورد نظر کارنی این است که وقتی بر اساس پترنی ترید کردید و پوزیشن شما تریگر خورد و بعد از آن بازار رنج شد ، اگر از زمان مشخصی که قاعتاً می بایست پترن شروع به حرکت کند باز هم بازار رنج بود ، این موضوع باعث می شود که احتمال رد شدن پترن بالا برود . به طور خلاصه یک نشانه از پترن یا روش ۳-۲-۱ موفق این است که وقتی قیمت به ناحیه مورد نظر رسید نسبتاً سریع واکنش نشان بدهد و منجر به تغییر روند شود .

****

مدیریت پوزیشن

در کتب ماینر ، ویلیامز و هابز برای گرفتن یک پوزیشن آن را به چند قسمت تقسیم می کنند .یعنی به جای این که یک پوزیشن منفرد بگیرند آن را به سه قسمت مساوی و کوچکتر تقسیم کرده و سه پوزیشن می گیرند . روش ویلیامز در کتاب هایش به این صورت است که به جای یک پوزیشن ۱۰ لاتی ، سه پوزیشن ۳ لاتی باز می کند . ماینر و هابز همان پوزیشن ۱۰ لاتی را به صورت دو پوزیشن ۵ لاتی باز می کند . علت این است که این تریدرهای حرفه ای می دانند که یک تحلیل هر چقدر هم که دقیق باشد همواره این احتمال وجود دارد که پس از پیش روی روند قیمت در جهت تحلیل ، ناگهان به هر دلیلی روند برگردد . یا این که زمانی که روند قیمت به تارگت رسید در بسیاری از مواقع مشاهده می کنیم که قیمت بسیار بیش از تارگت مورد نظر پیش می رود . اگر تنها یک پوزیشن داشته باشیم ، زمانی که ناگهان روند برگردد فقط می بایست صبر کنیم و ببینیم که آیا ضرر می کنیم یا مجدداً روند صعودی می شود ! راه دیگری نداریم چون تنها یک پوزیشن گرفته ایم . یا زمانی که به هدف تعیین شده می رسیم راهی نداریم جز این که پوزیشن را ببندیم و از ادامه احتمالی روند و کسب سود بیشتر چشم بپوشیم . این تریدرهای حرفه ای برای رفع این مشکل پوزیشن مورد نظر را به قسمت های کوچک تر تقسیم می کنند و همه را هم زمان باز می کنند تا بتوانند در مراحل مختلف روند ، بعضی را بسته و برخی را بیشتر از حد معمول باز نگه دارند . این که در چه مرحله ای کدام پوزیشن بسته شود و در چه مرحله ای پوزیشن دیگر باز بماند بین این تریدرها اختلاف نظر هست و هر کدام روشی را پیشنهاد می

www.sheymatha.com

کنند که از جهاتی هم با یکدیگر مغایر است . بنده هر سه روش را بررسی کرده ام و شاید جالب باشد بدانید که با وجود این که ایده تقسیم پوزیشن بتدایی به قسمت های کوچکتر را پذیرفته و سعی در عمل به آن دارم اما این که در چه مرحله ای از روند پوزیشن ها باید بسته شود و یا باز بماند ، در عمل به گونه ای متفاوت از هر سه روش عمل می کنم . علت این است که با بررسی هر سه روش و آزمودن آنها در بازار فارکس دریافتم که این روشی که عرض خواهم کرد بهترین نتیجه و کیفیت را داراست . آن تریدرهای محترم عمدتاً در بازارهای غیر از فارکس ترید می کنند و طبیعتاً شاید با جزییات و خصوصیات بازار ارز کمتر از فرضاً فیوچرز آشنایی داشته باشند . بنده معتقدم که می بایست ایده اصلی را از این بزرگان تحلیل تکنیکال گرفت و سپس در بازاری که کار می کنیم روش را آزمود و به شکل بهینه اش در آورد تا بهترین کیفیت را پیدا کند . درهر صورت شما هم می توانید ایده کلی را گرفته و بعد با بررسی بازار و یا ارز مورد علاقه خود ، روش را به شکل مطلوب خود اصلاح کرده و استفاده کنید .

بنده همواره در شروع یک پوزیشن ، آن را به صورت دو قسمتی می گیرم . یعنی فرضاً اگر حداکثر سرمایه و مارجین من اجازه باز کردن پوزیشن ۱ لاتی را بدهد آن را در دو پوزیشن ۰,۵ لاتی می گیرم .

فرض کنیم یک پترن ۳-۲-۱ در چارتی مشاهده شد و بر اساس تریگر وارد بازار شدیم (با دو پوزیشن یکسان) . فرض می کنیم روند در جهت تحلیل و ترید ما شروع به حرکت کرد . اولین پوزیشن را در نسبت ۶۱ فیبوناچی می بندم (در چارت شکل زیر ، این قسمت با نام FE61.8 مشخص شده است) . حال یک پوزیشن داریم که باز است که آن را نخواهیم بست تا به هدف برسد . شاید این سؤال پیش بیاید که اگر به تحلیل اطمینان نداریم چرا فقط یک پوزیشن را می بندیم و هر دو را نمی بندیم و اگر به تحلیل خود مطمئن هستیم چرا یکی را می بندیم و اجازه نمی دهیم هر دو پوزیشن باز بمانند؟!

در پاسخ باید گفت همان طور که در ابتدا اشاره شد ، هر تحلیلی هر چقدر هم که دقیق و بر اساس آنالیز عمیق بازار با ابزار متعدد باشد ، هیچ گاه در بازارهای سرمایه تضمینی برای این که به هدف برسد وجود ندارد . بنابراین صلاح در این است که همواره وقتی روند تا حدودی در جهت تحلیل و در واقع به سود ما پیش رفت ، قسمتی از پوزیشن را بسته و مقداری از سود را از بازار خارج کنیم تا در صورتی که روند به هر دلیلی برگشت بدون سود از بازار خارج نشده باشیم . بنده زمان بستن پوزیشن اول را به تجربه در بهترین حالت همین نسبت ۶۱ می دانم (در روش ترید بر اساس پترن ۳-۲-۱) . دقت کنید که حد ضرر پوزیشن اول و دوم را تا زمانی که به این نسبت نرسیده ایم مطلقاً نباید به نقطه ورود (Break Even) بیاوریم . باز به تجربه برای من ثابت شده است و بارها و بارها مشاهده کرده ام که روند به طور موقت برمی گردد و به حد ضرر منتقل شده به نقطه ورود می رسد . به این صورت بعد از بسته شدن پوزیشن ما ، روند مجدداً مسیر اصلی خود را طی کرده و به

www.sheymatha.com

هدف می رسد ! بنابراین باید صبر کنیم تا پوزیشن اول به این نسبت برسد و با سود بسته شود یا این که روند برگشته و حد ضرر اولیه ما را که ۱۵ پیپس به علاوه اسپرید ارز مورد نظر پایین تر از آخرین نوسان نزولی و یا صعودی قبلی است را لمس کند . پس به هیچ وجه حد ضرر اولیه را در پوزیشن به اصطلاح کوتاه مدتمان تغییر نمی دهیم تا این که یا حد ضرر لمس شود و یا به نسبت ۶۱ برسیم . در هر دو صورت پوزیشن اول بسته شده و پوزیشن دوم باقی مانده است . در صورتی که کندلی بالای این نسبت بسته شد (دقت کنید که کندل بسته شود نه این که فقط شادو بزند) ، در این صورت حد ضرر پوزیشن دوم را به نقطه صفر (نقطه ورود به بازار) منتقل می کنیم . در این مرحله هم دیگر حد ضرر را تغییر نمی دهیم تا این که یا به هدف برسیم و یا روند برگردد و با رسیدن قیمت به حد ضرر ما در نقطه ورود ، پوزیشن بسته شود .

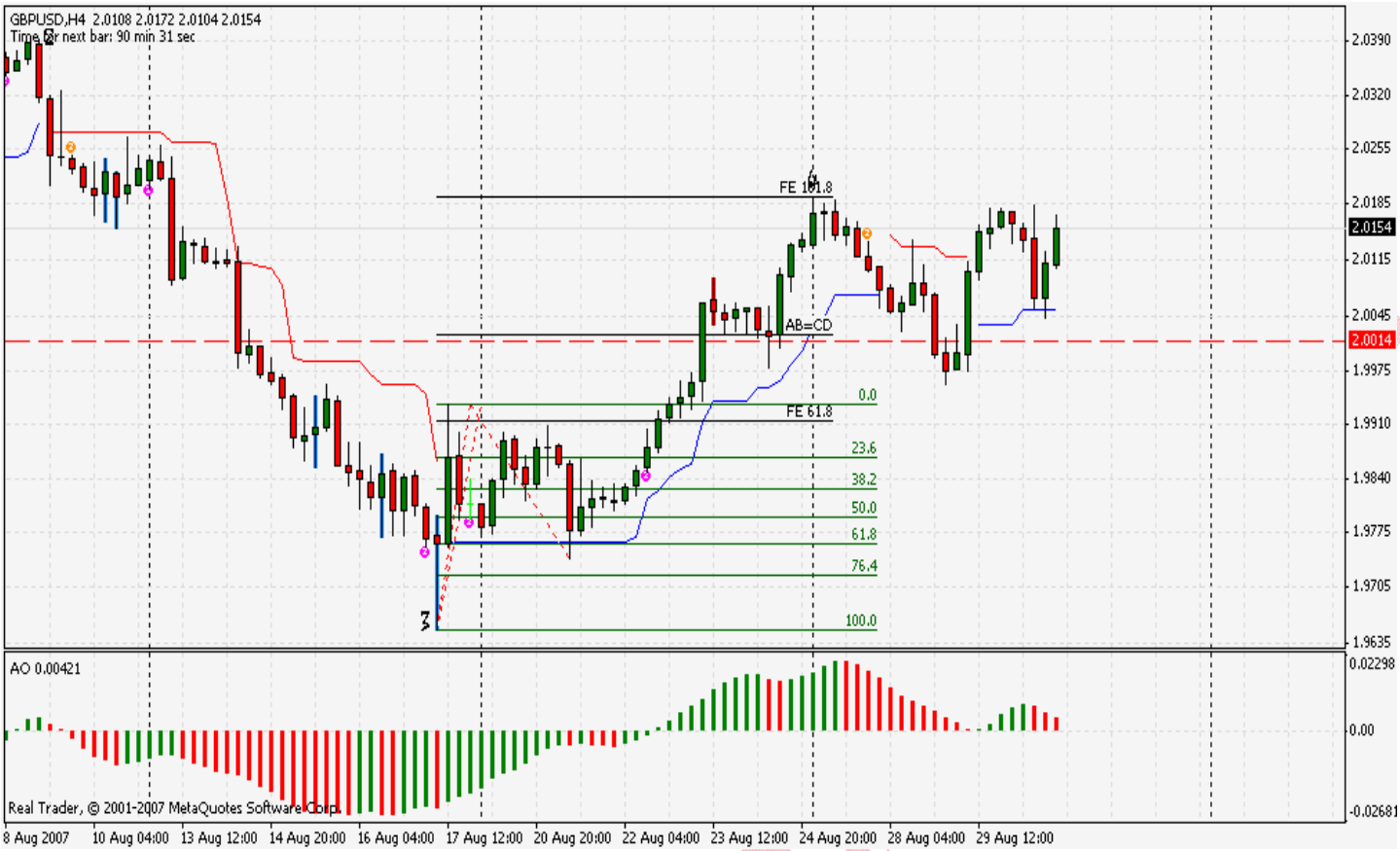
درست است که دیدن پوزیشنی که در سود خوبی است اما بالاخره به تارگت نرسیده و نهایتاً در نقطه صفر بسته شده سخت است اما این روش با بررسی چارت های متعدد و ترید های زیادی به دست آمده است . وضعیت های متعدد و گوناگون زیادی به این روش تست شده و این حالت که توضیح داده می شود حالت بهینه در ترید به روش پترن ۳-۲-۱ است . هر چند در این روش هم گاهی با یک شادو غیر منصفانه از بازار خارج می شویم و بعد تارگت زده می شود یا در نیمه راه سود خوبی ، روند برگشته و با سود صفر از بازار خارج می شویم ، اما در غالب اوقات این روش مؤثر بوده و منجر به بهترین حالت سود می گردد . می بایست تا جایی که می شود سعی کنیم این روش را ماشینی انجام دهیم و نتایج ترید باعث تصمیم احساسی ما نشود . تنها در این صورت است که در دراز مدت می توانیم از بیشترین سود ممکن بهره ببریم .

در بررسی روش به جایی رسیدیم که با رسیدن به نسبت FE61.8 پوزیشن اول بسته شده و حد ضرر پوزیشن دوم هم به نقطه ورود منتقل شده. از اینجا به بعد بایستی صبر کنیم . در صورتی که به هدف رسیدیم می توانیم از بازار خارج شویم اما در بسیاری از موارد می بینیم که روند خیلی بیش از هدف ما و در جهت تحلیل ما پیش می رود ، نظیر همین چارتی که مشاهده می کنید و از تارگت ما (AB=CD) پیش تر رفته است . در اینجا اگر مایل نبودیم پوزیشن را در قیمت هدف ببندیم دو راه داریم . به یاد دارید که گفتیم ویلیامز برای این که پوزیشن به هدف رسیده را ببندد و هنوز هم در بازار باشد در شروع گرفتن پوزیشن ، سه پوزیشن مساوی می گیرد و در این مرحله پوزیشن سوم را باز نگه می دارد تا بعد از رسیدن به تارگت هنوز هم در بازار حضور داشته و از سود احتمالی آتی هم بهرمند شود . اما در روش مورد بحث ما که در ابتدای کار دو پوزیشن مساوی گرفته شده هم در این مرحله که با دیدن هر نشانه و قرینه ای ویا به هر دلیل تکنیکالی تصمیم داریم در بازار بمانیم ، به دو روش می توانیم کار را ادامه دهیم .

روش اول این که بازار را با اندیکاتور ATR Stops دنبال کنیم . یعنی به جای خروج از بازار ، حد ضرر را از نقطه ورود به یک پیپس پایین تر از خط آبی یا قرمز اندیکاتور ATR Stops منتقل کنیم و اینقدر این تریلینگ را ادامه دهیم تا در نهایت قیمت به حد ضرر رسیده و از بازار خارج شویم .

روش دوم روشی است که ماینر استفاده می کند . ایشان زمانی که پوزیشن به هدف می رسد ، روند قیمت را به فاصله یک کندل دنبال می کند . یعنی حد ضرر را از نقطه صفر به یک پیپس پایین تر (یا بالاتر) از کندل ماقبل آخر منتقل می کند . در اینجا نکته خیلی مهمی هست و آن این که ایشان این روش را برای تایم فریم روزانه استفاده می کنند و در صورتی که بخواهیم از این روش برای مثال در تایم فریم ۴ ساعته استفاده کنیم ، اشتباه بزرگی است که روند قیمت بازار را با کندل ماقبل آخر در چارت ۴ ساعته دنبال کنیم و حد ضرر را بر اساس این کندل جا به جا کنیم ! اگر ماینر در تایم فریم روزانه این فاصله یک کندلی را دنبال می کند به این خاطر است که هر کندل روزانه یک روز کاری است و در نتیجه ، نقاط High و Low آن ، مناطق حساس و قدرتمندی هستند که قیمت به سادگی نمی تواند از آنها عبور کند . در صورتی که چنین شرایطی برای کندل های میان روز وجود ندارد و آنها چنین اعتباری را دارا نیستند . با این حال اگر فرضاً در تایم فریم ۴ ساعته ترید می کنیم و از طرفی مایلیم که تکنیک ماینر برای تریلینگ بعد از رسیدن به هدف را دنبال کنیم باید در تایم فریم روزانه آخرین کندل را یافته نقطه High و یا Low آن را بدست بیاوریم و بعد در چارت ۴ ساعته از آن نقطه (قیمت) برای جا به جا کردن استاپ استفاده کنیم . بنابراین به هیچ وجه نباید از کندل ماقبل در تایم فریم ۴ ساعته و یا تایم فریم های دیگر برای تریلینگ بعد از هدف استفاده کرد و حتماً می بایست از روی تایم فریم روزانه و کندل ماقبل در آن میزان جا به جایی حد ضرر را شناسایی و در چارت ۴ ساعته روی پوزیشن خود اعمال کنیم . به چارت زیر توجه کنید که در آن نقطه FE 61.8 (هدف اولیه) ، AB=CD (تارگت اصلی) و ATR Stops (در اینجا نوار آبی رنگ آن) برای مرحله پس از رسیدن به هدف قابل مشاهده است .

www.shevnaha.com



پرسش : در خصوص مطلبی که بالا ارائه شد ، نقطه ابهامی وجود دارد که مـی خواسـتم مطـرح کـنم . همـان طور که مستحضر هستید ویلیامز در مقابل هر بار ورود ، یک سری Order در جهت مخالف قرار می دهد . به طوری که هر بار پوزیشنی به حد ضررمی رسد ، بلافاصله چند پوزیشن در جهت مخالف باز می شوند و هدف آنها را به گونه ای تنظیم می کند که ضرر پوزیـشن هـای قبـل را جبـران مـی کنـد (در بعـضی مراحـل هـم در حقیقت سودهایش را از بازار جمع می کند) . می خواستم بدانم در روشی که شما فرمودید ، برای حـالتی کـه قیمت حتی به نسبت ۶۱،۸ پروجکشن هم نرسد برنامه خاصی دارید ؟

پاسخ : همان طور که می دانید ، ویلیامز بر اساس روش تحلیل الیوتش خصوصاً زمانی که در ابتدای یک ترند جدید قرار دارد ، فرض را بر این می گذارد که موج ۲ نمی تواند موج ۱ را کاملاً بپوشاند (یعنی بیش از ۱۰۰٪ موج ۱ ریتریس کند که فرض صحیحی است) . ایشان در این شرایط پوزیشن هایی خـلاف جهـت رونـد مـی گیرند . چرا که معتقدند اگر موج ۲ بیش از ۱۰۰٪ موج ۱ ریتریس کند در واقع ما در یک ترند جدید نبوده ایم بلکه آن حرکت موج ۱ و ۲ در واقع یک کارکشن در روند قبلی بوده است و در نتیجه ایـشان معتقدنـد چنـین وضعیت هایی منجر به حرکت سریع بازار می شود که در این صورت می شود بـا گـرفتن پوزیـشن در خـلاف

www.greymarket

جهت ترند پیش فرض ضرر قبلی را جبران کرد که این کار را با حجم لاتی بیش از لات پوزیشنی که با فرض ترند جدید گرفته اند انجام می دهند .

منتهی در روشی که بنده ارائه کردم ، گاهی ما فرضاً در موج ۴ و یا شروع موج ۵ هستیم . طبیعتاً در این زمان دیگر این فرض که ترند جدیدی در کار نباشد و در یک کارکشن باشیم مطرح نمی شود . به همین خاطر است که دیگر پوزیشن معکوس نمی گیریم . برای پترن های ۳-۲-۱ که در موج ۲ شکل می گیرند می توان از تکنیک دکتر ویلیامز استفاده کرد منتهی چون می بایست بر اساس روش ویلیامز دو برابر پوزیشن اولیه Sell Stop و یا Buy Stop بگذاریم و برای اینکار بایستی دقیقاً محاسبه کنیم بر اساس سرمایه ای که داریم پوریشن با چه لاتی می بایست تنظیم شود و چه مقدار حد ضرر در نظر بگیریم و خصوصاً هدف در این روش خیلی دقیق نیست و ممکن است که این روش پوزیشن گیری معکوس برای دوستانی که تجربه کمی دارند منجر به ضرر بزرگی شود . در نتیجه در این مقطع ازمطرح کردنش به کلی طرف نظر شد . اما برای تریدرهای با تجربه در موج ۲ این روش قابل استفاده است .

نکته ای که در اینجا هست و شاید به عنوان سؤال مطرح شود این است که چرا هدف اولیه را نسبت ۶۱,۸ قرار می دهیم . پاسخ این است که همان طور که می دانید گاهی اوقات پترن ۳-۲-۱ می تواند به پترن گارتلی تبدیل شود . نیز می دانید که در پترن گارتلی روند مسیری را طی می کند اما وقتی به نسبت ۶۱ رسید برگشت می کند و سپس در نسبت ۷۶ مجدداً شروع به حرکت در جهت اصلی می نماید (در پترن گارتلی ایده ال) . این است که به تجربه ثابت شده است که در بسیاری از مواقع اگر بعد از ورود به پوزیشن در نسبت ۶۱ فیبوناچی و در روش ۳-۲-۱ ، هدف را در FE61.8 قرار دهیم ، این باعث می شود که در حالت هایی که ترند به طور مستقیم تا هدف (منظور AB=CD است) نمی رود و برمی گردد و سپس پترن گارتلی شکل می گیرد هم بتوان سود خوبی دریافت کرد . در واقع این نسبت FE 61.8 باعث می شود که سود حالت هایی نظیر گارتلی را هم دریافت کنیم (در حالی که قبل از شکل گیری گارتلی اطلاعی نداریم که این پترن ۳-۲-۱ آیا مستقیماً تا هدف (فرضاً نسبت ۱۶۱ فیبوناچی) می رود و یا برمی گردد و در نسبت ۷۶ به گارتلی تبدیل می شود .

www.sheymaha.com

در مباحث روش ترید NTD و کمریلا که قبلاً به صورت PDF ارائه شد ، از نقش مهم اندیکاتور AO یا همان الیوت اسیلیتور مطلع شده ایم . اندیکاتور بسیار قدرتمندی است که اگر به دنبال این نباشیم که صرفاً و تنها بر اساس روش الیوت ترید کنیم (که در اینصورت به غیر از این اندیکاتور نیاز به استفاده از ابزار مکمل دیگر و همینطور استفاده مکرر از نسبت های فیبوناچی برای تحلیل دقیق وضعیت خواهیم داشت) و تنها بخواهیم دیدی کلی از الیوت بازار داشته باشیم این اندیکاتور با دقت خوبی به ما درک عمیقی از وضعیت کلی بازار و موقعیتی که می خواهیم در آن ترید کنیم می دهد . اما این مسأله چه اهمیتی می تواند داشته باشد؟ مسأله این است که ما با هر روشی که ترید کنیم چیزی که اهمیت زیادی دارد این است که موقعیت کلی پوزیشن ما نسبت به روند اصلی بازار در کجا قرار گرفته است . این موضوع به ما کمک می کند که همواره هم جهت با روند اصلی ترید کنیم . مثلاً می بینیم که یک پترن گارتلی سود خیلی خیلی عالی و طولانی مدت به ما می دهد اما پترنی دیگر با همان شرایط ، سود کم و یا حداقل به نسبت قبلی خیلی کمتر می دهد . شاید این سؤال پیش بیاید که چه خصوصیتی بوده که باعث شده سود یکی زیاد و دیگری کم شود ؟ البته عوامل مختلفی در این امر دخیل است اما یکی از مهمترین عوامل این است که پوزیشن ما در چه ناحیه ای از بازار به نسبت روند اصلی قرار گرفته است . یعنی اگر فرضاً پترن گارتلی ما در انتهای موج ۲ از روند اصلی صعودی قرار گرفته باشد طبیعی است که روند صعودی قدرتمند موج ۳ را در پیش داریم و این می تواند ترید بسیار موفقی را به ارمغان بیاورد . اما همین پوزیشن اگر فرضاً در اواخر موج ۵ شکل گرفته باشد چون دیگر زمان زیادی به اتمام روند و پایان موج ۵ نمانده است بنابراین سود کمی می دهد . اهمیت این مسأله که پوزیشن ما در چه ناحیه ای از بازار قرار گرفته است و در نتیجه پتانسیل سود به چه میزان است در هر روش تریدی وجود دارد . مثال دیگری برای این موضوع و این بار در روش NTD توضیح داده می شود . فرضاً اگر در این روش خطوط الیگیتور در موج ۳ توسط فراکتال شکسته شود سودی عالی و اگر فرضاً در موج ۱ این اتفاق بیفتد سود کمتری خواهیم داشت (چرا که غالباً طول موج ۳ به مراتب بیش از موج ۱ است) . بنابراین باز هم می بینیم که به هر روشی که ترید کنیم می بایست بدانیم پوزیشن ما در چه موقعیتی نسبت به روند اصلی بازار قرار دارد .

اندیکاتور AO روشی ساده اما قدرتمند برای شناسایی موقعیت کلی ما در بازار است . به سادگی می توانیم به کمک آن تشخیص بدهیم که در مسیر روند اصلی قرار داریم و یا در یک کارکشن هستیم . آیا در موج ۳ یا ۵ هستیم و یا در کارکشن ۴ می باشیم ؟ و خلاصه این که حدود ناحیه ای که قرار گرفته ایم را نشان می دهد . طبیعی است که وقتی فرضاً متوجه شدیم در اواخر موج ۳ قرار داریم ، اگر بخواهیم دقیقاً بر اساس روش الیوت عمل کنیم می بایست نسبت های دقیق فیبوناچی و سایر ابزار دقیق و متعدد الیوت را به کار بگیریم . اما

www.sheymiaha.com

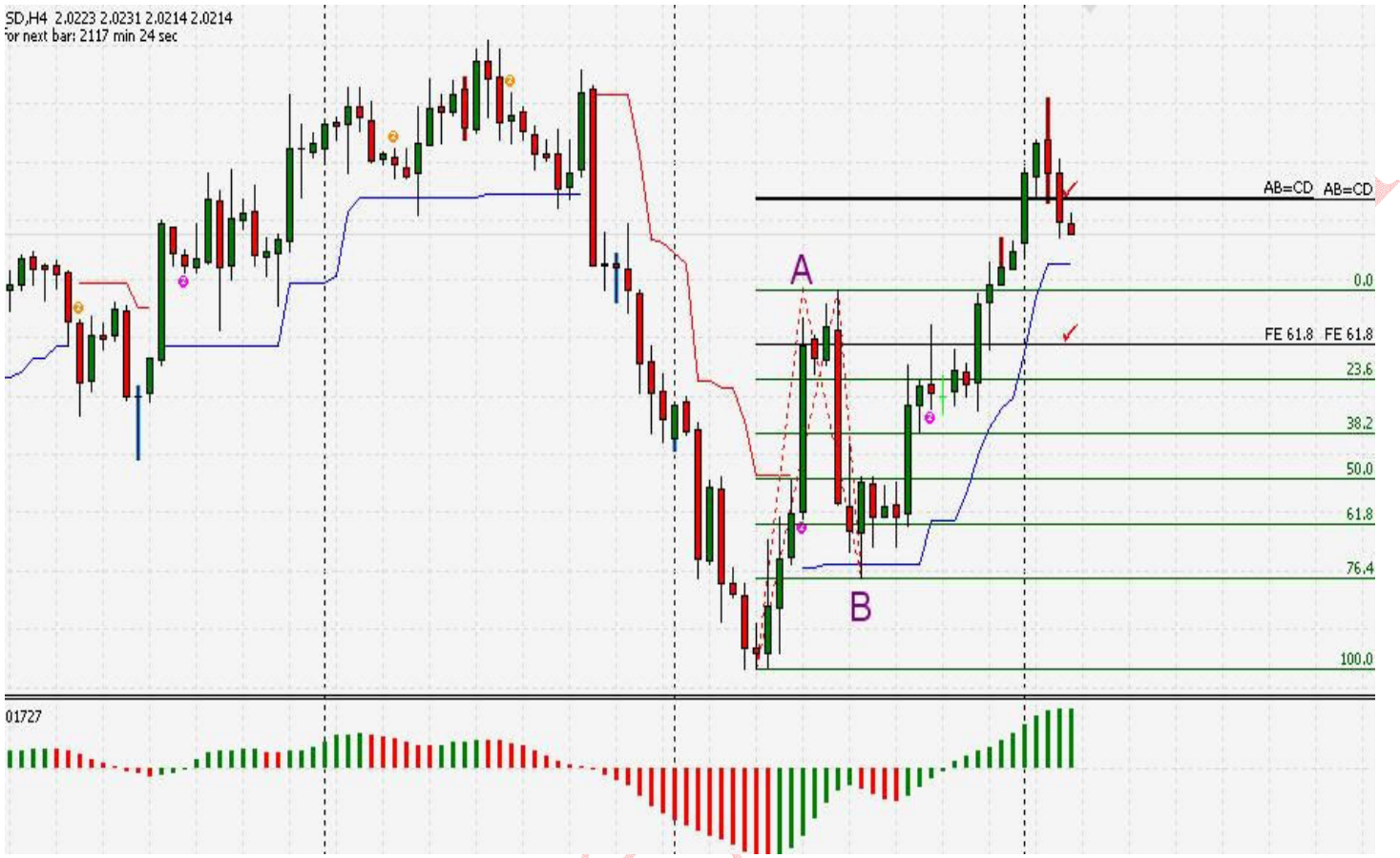
زمانی که روش تریدمان چیزی به جز الیوت است و تنها می خواهیم دیدی کلی از بازار پیدا کنیم آن زمان است که ارزش این اندیکاتور بیش از پیش مشخص می شود . به سادگی می توانیم دیدی صحیح از موقعیت کلی پوزیشن در مقابل روند اصلی بازار پیدا کنیم و طبیعتاً وقتی بدانیم در جهت ترند اصلی قرار داریم آنگاه می توانیم با روش تریدمان (که دیگر ارتباطی به الیوت ندارد) نقاط ورود مناسب تر و همین طور هدف های بالاتر و یا زمانی که در یک کارکشن (حرکت اصلاحی) قرار داشته باشیم هدف های کوچکتری برای خود قرار بدهیم .

در روش ۳-۲-۱ هم از این اندیکاتور استفاده می کنیم تا تشخیص بدهیم کدام پوزیشن ها را بگیریم و کدام را نه . در واقع این اندیکاتور نقش یک فیلتر بسیار قدرتمند در روش ۳-۲-۱ را ایفا می کند . همان طور که می دانیم بازار دائماً در نوسانات خود بر روی نسبت های ۶۲ و ... قرار می گیرد . سؤال اینجاست که از کجا بدانیم که فرضاً روی این نسبت ۶۱,۸ که در حال حاضر شکل گرفته است باید وارد بازار شویم یا خیر؟ (به بیان دیگر این نسبت هم جهت با روند کلی و اصلی بازار هست یا نه) . اینجاست که اهمیت اندیکاتور AO مشخص می شود . در روش ۳-۲-۱ بهترین کیفیت و بهترین پتانسیل های ترید را در موج ۲ و همین طور موج ۴ شاهد هستیم . توسط این اندیکاتور می توانیم به سادگی تشخیص بدهیم که الان در چه وضعیتی از بازار هستیم و در صورتی که این سیگنالی که روش ۳-۲-۱ به ما ارائه کرده است در این دو ناحیه مذکور باشد ، ترید شانس بالایی برای موفقیت دارد .

برای واضح تر شدن مطلب ، این توضیحات را با چند چارت بررسی می کنیم و خصوصاً می بینیم که چطور می شود ما در آن واحد با دو نسبت ۶۱,۸ روبرو باشیم که هم زمان یکی به ما سیگنال Buy و دیگری سیگنال Sell می دهد و این که چطور به کمک فیلتر قوی AO تشخیص بدهیم کدام یک معتبر و برای ترید مناسب است . در چارت زیر به ابتدای روند صعودی در پایین چارت توجه کنید . زمانی که روند صعودی شروع شده است ، در اندیکاتور AO شاهد تشکیل یک پیک بزرگ هستیم که به ما پیغام شکل گیری و اتمام موج ۳ را می دهد . از اینجا می توانیم با اطمینان خوبی فرض را بر این بگیریم که موج ۳ به اتمام رسیده است . هدف این است که بتوانیم در صورتی که پترن ۳-۲-۱ شکل گرفت در موج ۴ سود خوبی کسب کنیم . بنابراین بازار را تعقیب می کنیم و پس از شکل گیری موج A به دقت ریتریس را زیر نظر می گیریم و اگر این ریتریس روند در ناحیه ای بین ۶۱,۸ و ۷۶,۴ قرار گرفت ، درصورت مشاهده تریگر دانای اول با پوزیشن خرید وارد بازار می شویم . هدف ما هم بر اساس شکل گیری موج C است که نقطه انتهایی آن AB=CD می شود . لطفاً به چارت توجه کنید که دقیقاً این فرایند گفته شده در آن اجرا شده است . توجه داشته باشید که این مثال

www.sheymaha.com

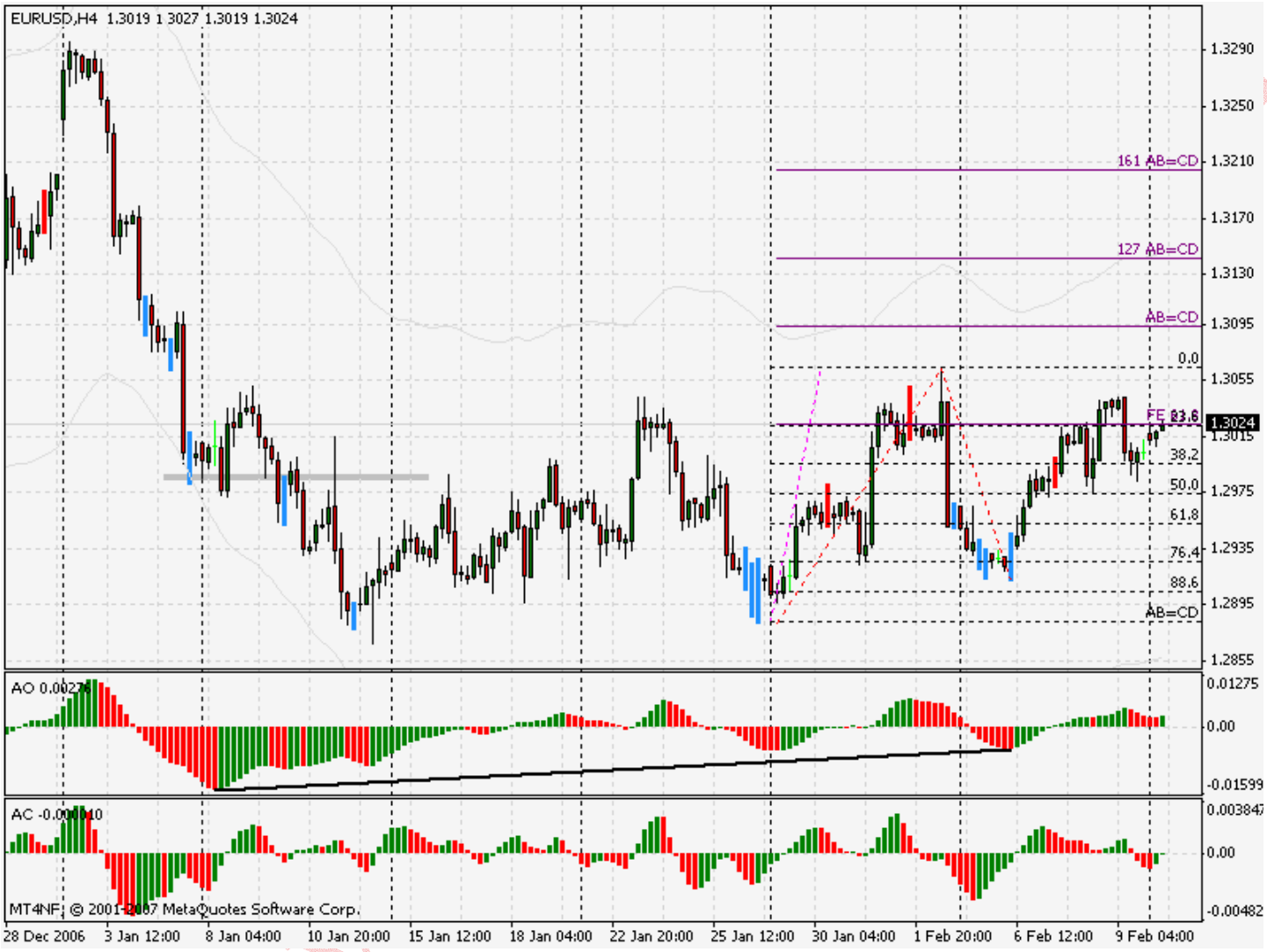
یک مثال از پیش تعیین و انتخاب شده نیست و همین روز گذشته کاری دوستان آن را ارائه کـرده بودنـد کـه نشان می دهد این روش تا چه حد کاربردی و قابل تکرار در بازارهای لایو و هر روزه است .



وضعیت دیگر زمانی است که در اندیکاتور AO شاهد دو پیک هستیم . یکی بزرگتر و دیگری کوچکتر کـه همان طور که می دانید نشانه شکل گیـری مـوج هـای ۳ و ۵ هـستند (و وجـود یـک دایـورجنس در چـارت ، سیگنال مهمی برای تایید اتمام روند فعلی و شروع روند جدید است) . در این وضعیت می دانیم با اتمام مـوج ۵ شاهد تغییر جهت روند خواهیم بود . این وضعیت ها هم از آن مواردی است که روش ۳-۲-۱ با قدرت زیاد و شانس موفقیت بالایی قابل اجرا است . در ایـن حالـت بـه دنبـال ریـزش اولیـه پـس از اتمـام مـوج ۵ (همـان کارکشن موج A) بازار دچار یک کارکشن می شود و روند قیمت ریتریس می کند . در این موقعیـت دقیقـاً این ریتریس را زیر نظر گرفته و در صورتی که این ریتریس در ناحیه بین ۶۲ و ۷۶ فیبوناچی بود با تریگر دانای اول و یا کندل استیک هایی که در ابتدای مطلب بیان شده است وارد بازار می شویم (در واقع این همان نکتـه مهمی است که در صفحه حدود ۲۳ پرسیده بودم و دوستان حدسهای مختلفی زده بودند ...) . در واقع در ایـن

گونه موارد ، استفاده از اندیکاتور AO مانند فیلتری عمل کرده و منجر به این می شود که بهترین پتانسیل های موجود به روش ۳-۲-۱گلچین شده و محتمل ترین آنها را برای ترید انتخاب کنیم .

مثال زیر نمونه ای از این حالت است .



در تصویر فوق ، پیک های موج ۳ و ۵ و همین طور دایورجنس ، نشانه اتمام روند است . پس از آن بر اساس توضیحی که ارائه شد می توانیم به سادگی به دنبال پترن ۳-۲-۱ بگردیم و بر اساس آن وارد بازار شویم . بعد از این که وارد بازار شدیم و به هدف رسیدیم (نسبت های ۱۲۷ و ۱۶۱) ، اینک باز به کمک اندیکاتور AO است که می توانیم تشخیص بدهیم که این پترن ۳-۲-۱ تنها یک کارکشن نظیر موج ۴ بوده است و یا شروع یک حرکت و روند جدید در بازار است . بنابراین اگر بر اساس AO ، در یک کارکشن بودیم دیگر از نسبت های ۶۲ و ۷۶ که روند بازار بر روی این نسبت ها قرار گرفته است برای ورود به بازار استفاده نمی کنیم

چرا که می دانیم پترن شکل گرفته ۳-۲-۱ جدید که هم راستای ترید قبلی ما بوده است اشتباه است و قرار است حرکت موج ۵ شروع شود و دیگر نمی بایست بر اساس نسبت های ۶۲ و ۷۶ در جهت قبلی (کارکشن موج ۴) پوزیشن بگیریم . به همین شکل اگر بدانیم که در ترند جدیدی قرار داریم (با مشاهده پیک های موج ۳ و ۵ و دایورجنس) بعد از این که پترن ۳-۲-۱ اولی را در روند جدید گرفتیم ، هر پترن ۳-۲-۱ جدیدی که شکل بگیرد و در راستای پترن ۳-۲-۱ قبلی ما باشد را می توانیم مجدداً گرفته و وارد بازار شویم (بر عکس موج ۴ که دیگر در جهت پترن ۳-۲-۱ قبلی وارد بازار نمی شدیم چون کارکشن به اتمام رسیده بود و جهت اصلی روند مخالف پترن قبلی ما است) .

توجه : در چارت EUR/USD صفحه قبل باندهایی مشاهده می شوند که توسط اندیکاتور Entrex رسم شده اند . این اندیکاتور در مبحث روش های مدیریت پوزیشن در سایت قیمت ها ارائه شده که برای اطلاعات بیشتر در مورد خصوصیات آن می توانید به صفحه ۳ آن مبحث مراجعه بفرمایید .

****

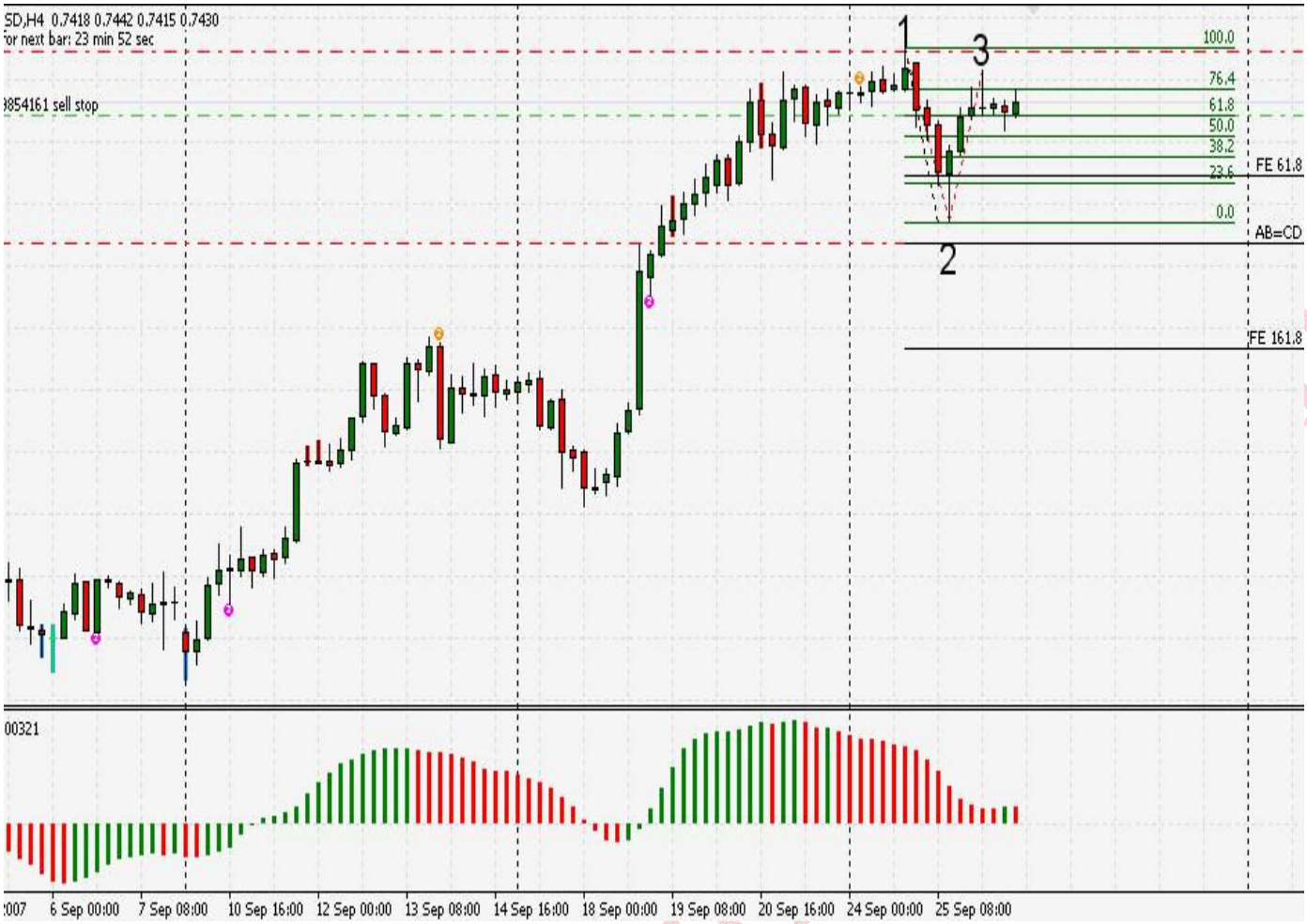
لطفاً به چارت زیر توجه کنید . در این چارت بعد از مشاهده پیک های ۳ و ۵ و دایورجنس ، پترن ۳-۲-۱ اولی را گرفته ایم (با شماره ۱ و ۲ مشخص شده است) . پس از رسیدن به هدف (کندل قرمز رنگ که دانای اول نزولی بوده است) ، مجدداً روند ریتریس کرده است (تا نسبت ۷۶,۸) که چون بر اساس اندیکاتور AO تشخیص می دهیم روند جدیدی در پیش است ، مجدداً بر اساس پترن ۳-۲-۱ وارد بازار می شویم . به این ترتیب اندیکاتور AO به عنوان یک فیلتر بسیار قوی عمل می کند و به ما بهترین فرصت های ترید بر اساس روش ۳-۲-۱ را ارائه می کند و خصوصاً بر اساس این اندیکاتور می توانیم تشخیص بدهیم که آیا در یک روند جدید هستیم و در نتیجه هر کارکشنی که بر روی نسبت های ۶۲ و ۷۶ شکل گرفت را به عنوان فرصتی برای ورود به بازار استفاده کنیم و یا در یک کارکشن در جهت مخالف روند اصلی هستیم (نظیر کارکشن موج ۴) و نمی بایست به پترن های ۳-۲-۱ بعدی که در جهت کارکشن موج ۴ است وارد بازار شویم چرا که موج ۵ در راه است که در خلاف جهت پترن ۳-۲-۱ جدید به وجود آمده است .

www.sheymaha.com

****

چارت زیر مثال دیگری ازپتانسیل ترید بر اساس روش ۳-۲-۱ در جفت ارز دلار نیوزلند به دلار امریکا در تایم فریم ۴ ساعته است . البته بر اساس تریگر دانای اول (در نقطه ۳) می بایست وارد پوزیشن می شدیم اما برای کسانی که مثل بنده دیر متوجه شکل گیری این وضعیت شده اند در قیمت فعلی هم برای ورود به پوزیشن دیر نیست .

www.sh



پرسش : چرا در ترید فوق حد ضرر را دقیقاً پشت کندل دوجی شکل تنظیم نکرده اید ؟ (البته آن مقدار به علاوه اسپرید)

پاسخ : حد ضرر بر اساس همان کندل (شوتینگ استار) محاسبه شده است اما بر اساس روش ۳-۲-۱ مارشال- موبرای ، یعنی ۱۵ پیپس بالاتر از آخرین نوسان قبلی (یعنی همان کندل ستاره دنباله دار) به علاوه اسپرید که تصادفاً در چارت بالای شماره یک قرار گرفته نه این که از ابتدا حد ضرر را بالای آن در نظر گرفته باشیم .

****

www.ghevar.com

در چارت زیر هم یک وضعیت مناسب برای ترید به روش ۳-۲-۱ را مشاهده می کنید .

****

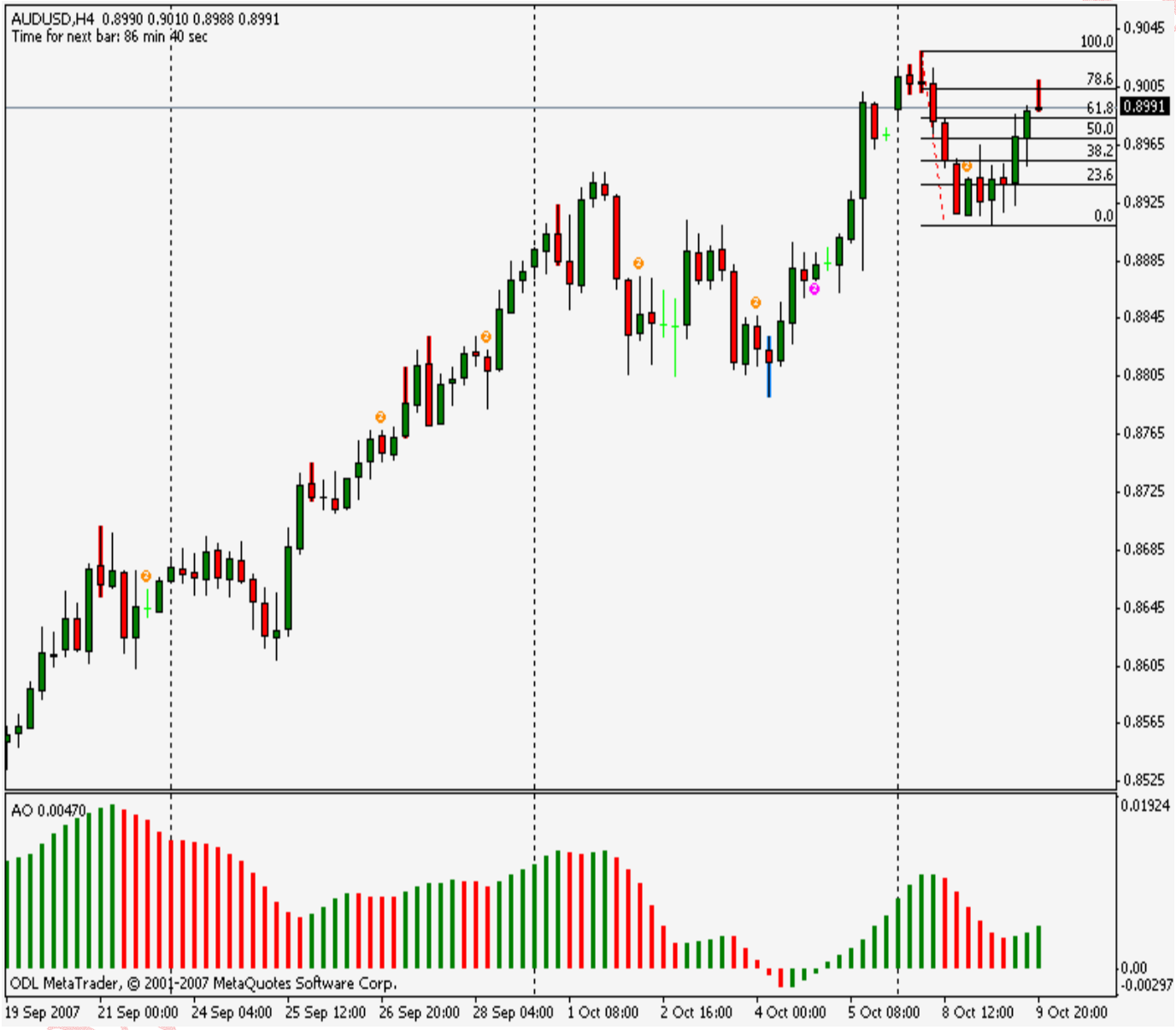
تصاویر ذیل نشان دهنده همان موردی است که در نکته ها گفته شد یعنی به وجود آمدن یک وضعیت یکسان تکنیکال « در یک زمان » بر روی ارزهای مختلف .

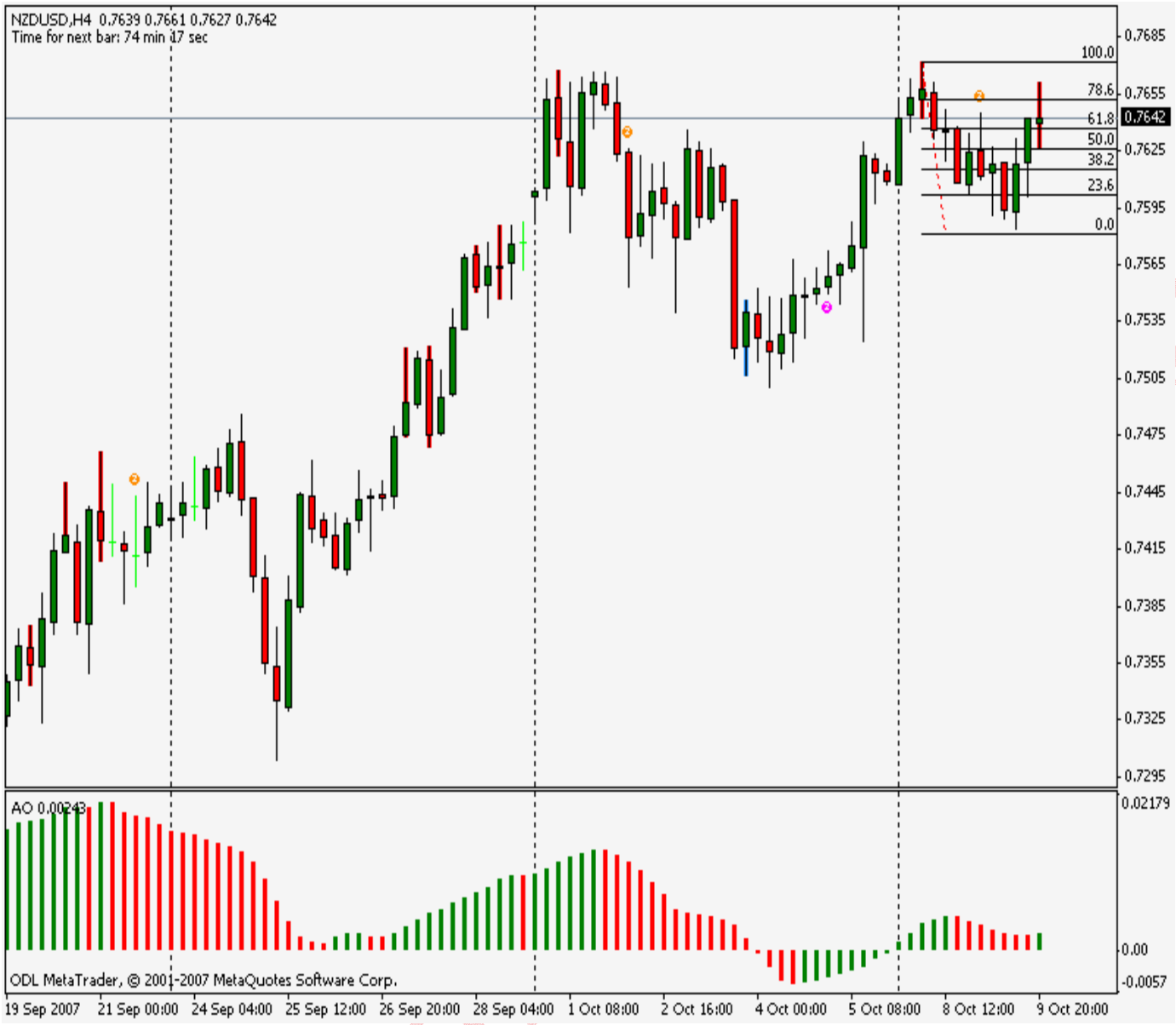
در دو تصویر اول ، هر دو ارز دلار استرالیا و دلار نیوزلند در مقابل دلار امریکا هستند بنابراین اشتباه بزرگی است که در هر دو Sell کنیم . چرا که اگر تحلیل اشتباه باشد و دلار امریکا به هر دلیل تضعیف شود هر دو پوزیشن وارد ضرر می شوند .

دو تصویر بعدی وضعیت پوند به ین و یورو به ین را نمایش می دهند . مجدداً می بینید که در هر دو وضعیت ، پتانسیل خیلی خوبی برای Sell پیش آمده است اما باز هم اشتباه است اگر در هر دو چارت Sell کنیم . چرا که در هر دو چارت پوند و یورو در مقابل ین هستند و در صورتی که ین به هر دلیلی تضعیف شود هر دو پوزیشن ما وارد ضرر می شوند .

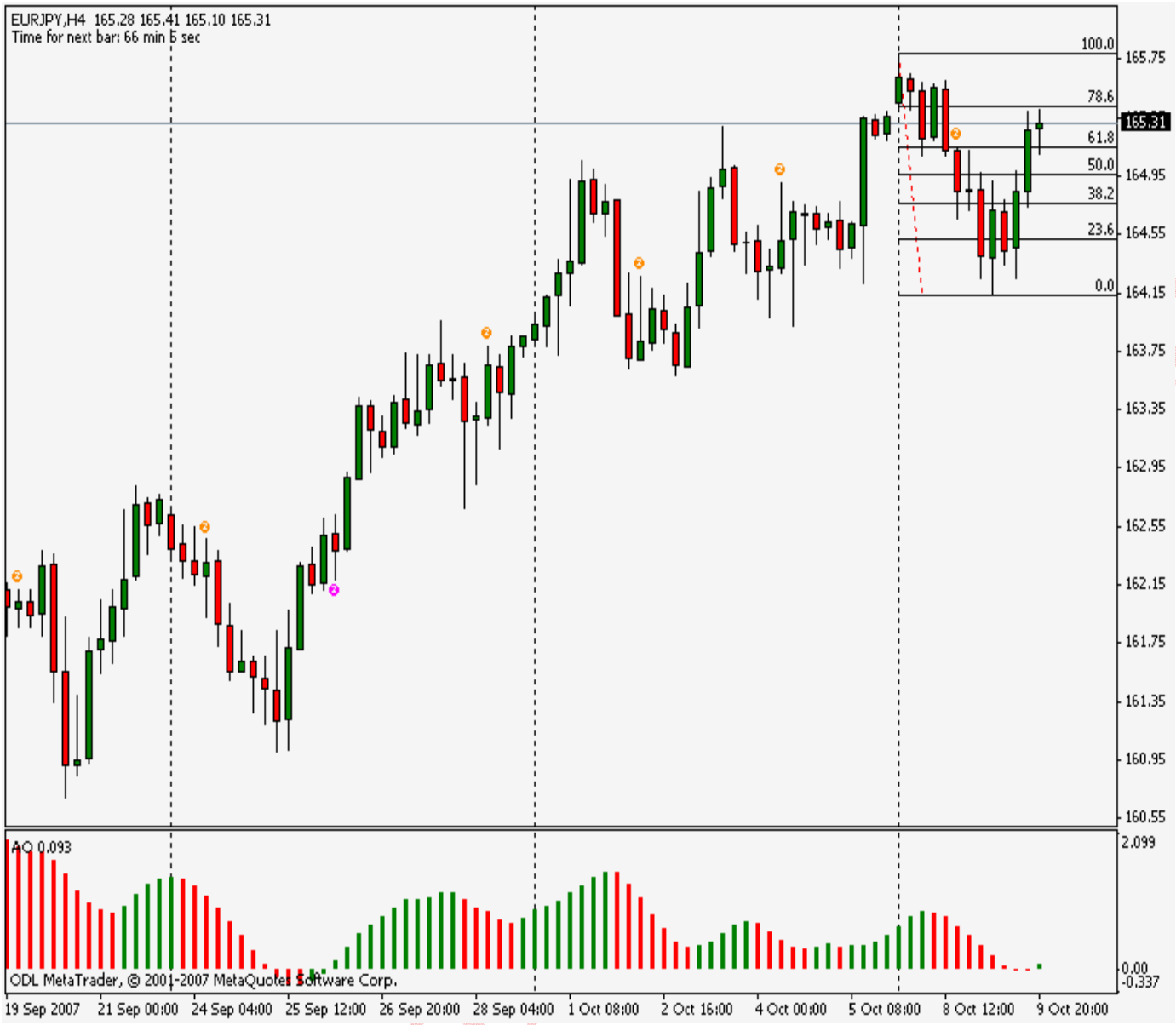
در این گونه مواقع در صورتی که مارجین ما اجازه بدهد که بیش از یک پوزیشن داشته باشیم ، می توان یک ترید بر روی پوند به ین و ترید دیگر را هم زمان بر روی دلار استرالیا به دلار امریکا انجام داد . در این صورت با توجه به این که ارزهایی که روی آنها پوزیشن گرفته ایم هیچ ارتباطی به هم ندارند ، خطر به ضرر نشستن هم زمان هر دو پوزیشن بسیار کمتر خواهد بود .

لطفاً به تصاویر توجه بفرمایید .

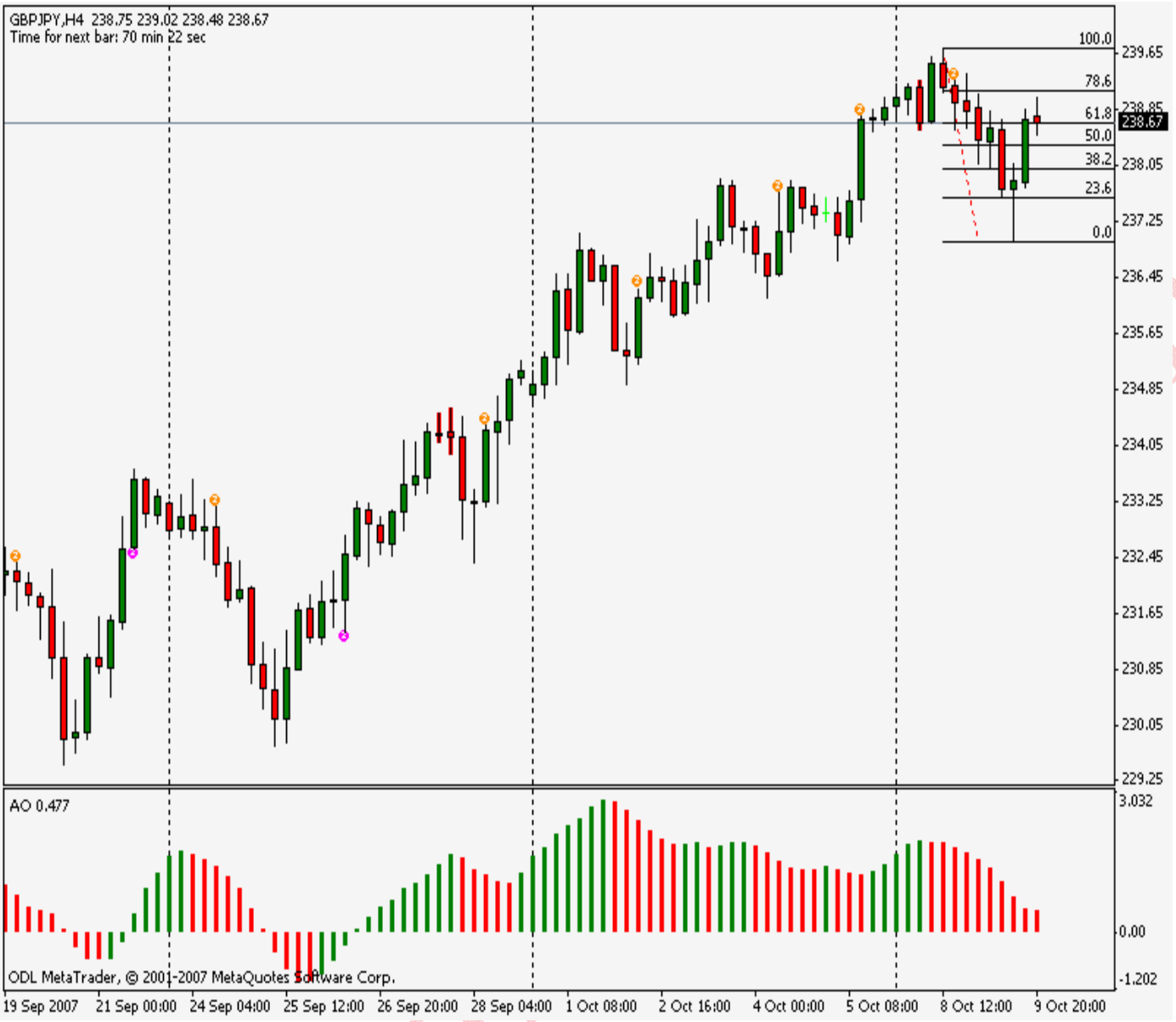



NZDUSD,H4 0.7639 0.7661 0.7627 0.7642
Time for next bar: 74 min 17 sec
100.0
78.6
61.8
50.0
38.2
23.6
0.0
0.7642
0.7685
0.7655
0.7625
0.7595
0.7565
0.7535
0.7505
0.7475
0.7445
0.7415
0.7385
0.7355
0.7325
0.7295
AO 0.00243
0.02179
0.00
-0.0057
ODL MetaTrader, © 2001-2007 MetaQuotes Software Corp.
19 Sep 2007
21 Sep 00:00
24 Sep 04:00
25 Sep 12:00
26 Sep 20:00
28 Sep 04:00
1 Oct 08:00
2 Oct 16:00
4 Oct 00:00
5 Oct 08:00
8 Oct 12:00
9 Oct 20:00

www.gl

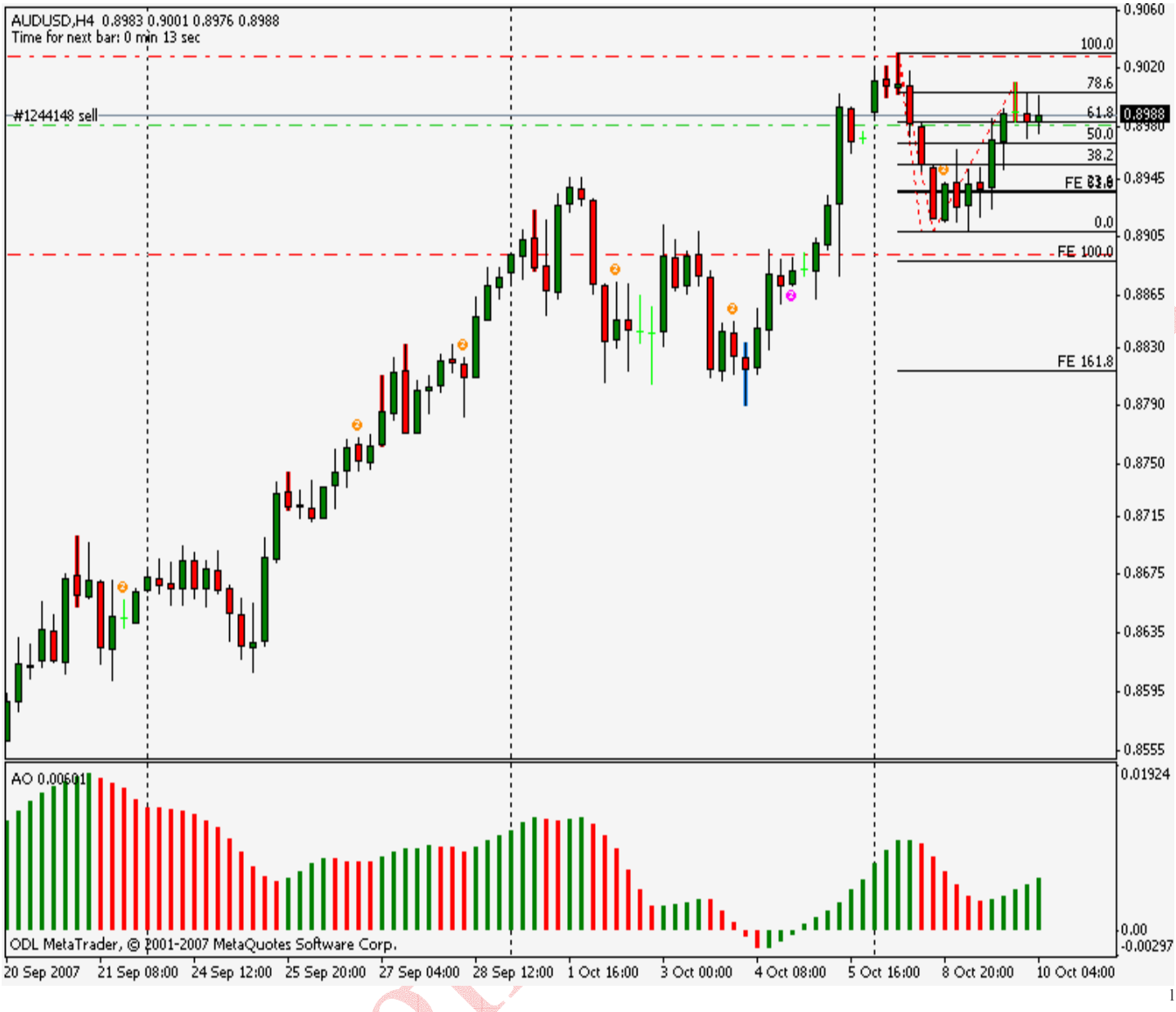

EURJPY,H4 165.28 165.41 165.10 165.31
Time for next bar: 66 min 5 sec
100.0
78.6
61.8
50.0
38.2
23.6
0.0
165.75
165.31
164.95
164.55
164.15
163.75
163.35
162.95
162.55
162.15
161.75
161.35
160.95
160.55
AO 0.093
2.099
0.00
-0.337
ODL MetaTrader, © 2001-2007 MetaQuotes Software Corp.
19 Sep 2007
21 Sep 00:00
24 Sep 04:00
25 Sep 12:00
26 Sep 20:00
28 Sep 04:00
1 Oct 08:00
2 Oct 16:00
4 Oct 00:00
5 Oct 08:00
8 Oct 12:00
9 Oct 20:00

www.g



****

چارت زیر هم یک ترید بر اساس روش ۳-۲-۱ روی جفت ارز دلار استرالیا به دلار امریکا را نشان می دهد . نقطه ورود به پوزیشن ۰,۸۹۸۱ و هدف نقطه ۰,۸۸۹۳ است . حد ضرر هم ۰,۹۰۲۸ بوده که بر اساس مقادیر ذکر شده می توان گفت نسبت R/R این ترید ۱,۸ : ۱ می باشد .



****

به یک مثال جالب از ترید به روش ۳-۲-۱ توجه بفرمایید .

چارت زیر هم مربوط به تریدی است که یکی از دوستان انجام داده اند . نکته جالب این است که ایشان دقیقاً از همان ابتدای شروع ترند نزولی وارد پوزیشن شده اند (درست از زیر تریگر دانای اول نزولی) .

تحلیل ایشان از این وضعیت این بوده : پیک بزرگ AO نشانه موج ۳ است که در نتیجه بر اساس روش ۳-۲-۱ و بر روی نسبت ۷۶,۴ فیبوناچی برای گرفتن موج ۴ وارد بازار شده اند . انتهای موج ۴ می تواند پترن AB=CD باشه که باز هم برای گرفتن موج ۵ می توان وارد بازار شد .

لطفاً به چارت مورد نظر توجه بفرمایید .

دوست ما بر اساس روش مطرح شده ، پوزیشن اولیه را در دو بخش مساوی و کوچک تر گرفته اند . پوزیشن اول به هدف خود رسیده و در نسبت ۶۱,۸ فیبوناچی بسته شده است . در مورد پوزیشن دوم ، با بسته شدن کندل (دقت کنید کندل زیر نسبت ۶۲ بسته شده است ، نه این که شادو زده باشد) حد ضرر را به نقطه ورود (BreakEven) منتقل کرده اند . در نتیجه اینک این پوزیشن دیگر مطلقاً ریسکی ندارد و حتی در صورت برگشت روند هم هیچ ضرری متحمل نخواهند شد . تنها یک نکته قابل ذکر است و آن این که ممکن است مایل باشید پوزیشنی که اینک بیش از ۱۲۰ پیپس در سود است را با فاصله کمتری دنبال کنید . در این صورت می توانید از اندیکاتور ATRStops استفاده کنید .

در تصویر زیر به خط قرمز رنگ این اندیکاتور توجه بفرمایید . بر اساس این خط ، می توانیم حد ضرر را از نقطه ورود به یک پیپس بالاتر از خط قرمز منتقل کنیم . همان طور که در چارت مشخص شده است این مقدار معادل ۲,۰۳۶ می شود . البته توجه داشته باشید که حفظ حد ضرر در نقطه ورود مطمئن تر است هر چند گاهی ممکن است روند برگردد و یا با اعلام خبر و ایجاد یک شادو ناگهانی پوزیشن ما بسته شده

و از بازار خارج شویم اما این روش در دراز مدت سود بیشتری خواهد داشت . با این حال روش حرکت دادن حد ضرر (Trailing Stop) با اندیکاتور ATR Stops هم کاملاً پذیرفته شده است .

****

به عنوان آخرین مثال از روش پترن ۳-۲-۱ به چارت زیر توجه کنید (جفت ارز یورو ، ین در تایم فریم ۴ ساعته) . باز هم به طور خلاصه مراحل تحلیل این روش را بررسی و مرور می کنیم .

۱. پترن ۳-۲-۱ در چارت به صورت چشمی شناسایی می شود.

۲. نسبت های فیبوناچی بر روی چارت رسم می شود که در این وضعیت نسبت ۷۸,۶ یکی از دو نسبت ایده الی است که پتانسیل وضعیت را بر اساس آن می سنجیم.

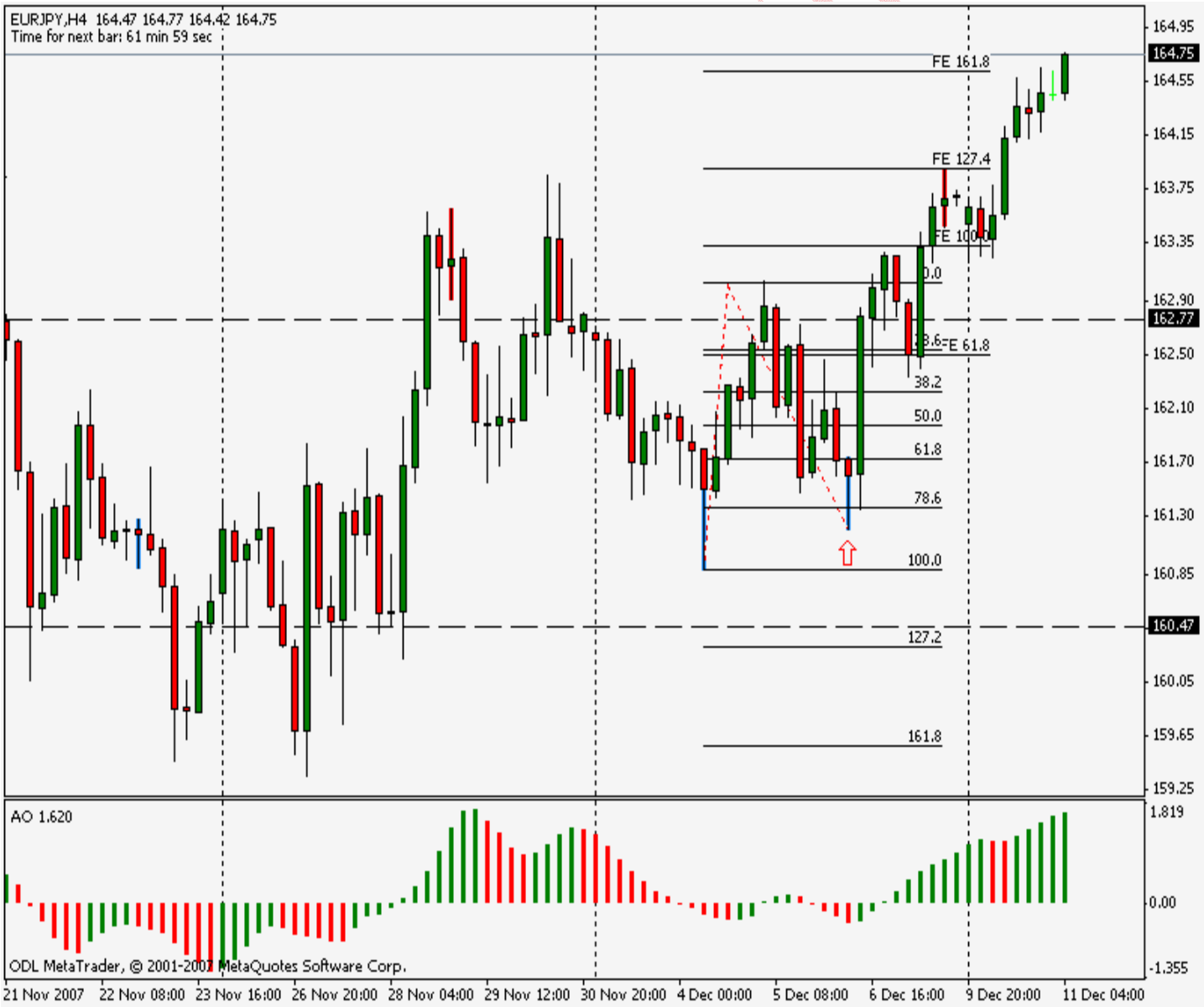
۳. تریگر دانای اول در ناحیه نسبت ۷۸ فیبوناچی (ویا ۷۶) شکل گرفته است که با مشاهده این سه مورد تحلیل پتانسیل وضعیت را تایید می کند.

۴. به بررسی نکات گفته شده در تحلیل می پردازیم . برای مثال اندیکاتور AO را در نظر می گیریم . پیک بزرگ قبلی انتهای موج ۳ را به ما نشان می دهد . در نتیجه شکل گرفتن پترن ۳-۲-۱ در انتهای موج ۴ پتانسیل بسیار خوبی برای صعود مجدد را نشان می دهد .

۵ . با توجه به همه دلایل فوق یک پیپس بالاتر از تریگر دانای اول یک دستور Buy Stop قرار می دهیم .

درباره تعیین هدف بر اساس روش ۳-۲-۱ و نسبت های فیبوناچی قبلاً بحث شده است . در اینجا نسبت ۱۲۷ فیبوناچی و یا به طور کلی AB=CD به عنوان هدف در نظر گرفته می شود . و حد ضرر هم ۱۵ پیپس به علاوه اسپرید ارز مورد نظر پایین تر از تریگر قرار می گیرد.

بعد از رسیدن به تارگت می توانیم از بازار خارج شویم و یا به روش های گفته شده عمل جا به جایی حد ضرر را انجام دهیم.



منابع و مراجع مفید

ترجمه کتاب Practcal Fibonacci Methods For Forex Trading اثر کن مارشال و راب موبرای ترجمه آقای بهروز نعیمی و گردآوری آقای behrouz fx

http://www.4shared.com/file/25780340/ab ... d=5c669e3d

مقاله 1-2-3 Trading Signal اثر آقایMark Crisp اولین بار در سایت سرمایه به صورت PDF ارائه شد .

http://www.4shared.com/file/25524417/64 ... d=64dc9cf6

مقاله آقای Mark Mcrae اولین بار توسط آقای علی حسینی ترجمه و در سایت پارس ارائه شده است که با ذکر مرجع در اینجا مجدداً ارایه می شود .

http://www.4shared.com/file/25525074/14 ... d=64dc9cf6

Candlesticks, Fibonacci, and Chart Pattern Trading *By Robert Fischer*

لینک کتاب رابرت فیشر در سایت آمازون :

http://www.amazon.com/Candlesticks-Fibo&۹۶۰ ... sr=1-1

Ross Hook *By Joe Ross*

لینک کتاب جو راس در سایت آمازون :

http://www.amazon.com/Trading-Ross-Hook۹۷۶۸۱۰۸۲۷۴ ...

www.sheymatha.com