

تشخیص واگرایی در ایچیموکو

در این مقاله قصد داریم دایورجنس را به کمک ایچیموکو تشخیص دهیم. از آنجا که اکثراً به واگرایی در مکدی مسلط هستند برای آسان شدن مطلب ابتدا به بررسی واگرایی در اندیکاتور مکدی و چگونگی شکل گیری آن میپردازیم و سپس آنرا با ایچیموکو مقایسه میکنیم.

همانطور که میدانید تشخیص واگرایی یا دایورجنس با اندیکاتورهای مثل **MACD** کار نسبتاً راحتی است و به اینصورت که بعنوان مثال در روند صعودی قیمت سقف جدید بزند ولی مکدی سقف بالاتر نزند واگرایی یا دایورجنس رخ داده است همچنین ادعا میکنیم که **MACD** غربی شده اندیکاتور ایچیموکو است. پس با این وجود چرا تشخیص دایورجنس در ایچیموکو کار دشواری است. لذا برای روشن شدن مطلب یک مروری کوتاه بر اندیکاتور مکدی خواهیم داشت و سپس آنرا در ایچیموکو بررسی میکنیم.

همانطور که میدانیم مکدی از فرمول زیر محاسبه میشود:

نحوه محاسبه MACD

- ❖ $MACD\ Histogram = EMA(12) - EMA(26)$ تفاضل میانگین نمایی ۱۲ روزه از میانگین نمایی ۲۶ روزه
- ❖ $Signal\ line := SMA(9)$ خط سیگنال: میانگین نمایی ۹ روزه

و میدانیم اختلاف میانگین ساده **SMA** با میانگین نمایی **EMA** در اینست که در میانگین نمایی به دیتا کندل اخیر وزن بیشتری میدهد و در صورتی که حجم قیمت در مقایسه با روز گذشته یا روزهای قبل فرق کند تاثیر بیشتری میپذیرد. بعنوان مثال روزنامه امروز از دیروز ارزش بیشتری دارد به همین علت دیتاهای اخیر یعنی دیتاهایی که به امروز نزدیک تر هستن در تابع نمایی ضرب میشه و حرکت اون نسبت به **EMA** حرکت تند تری است.

بعنوان توضیح بیشتر گفتیم خاصیت میانگین نمایی اینست که به داده های اخیر وزن بیشتری میدهد به عنوان مثال در بازه ۱۲ روزه روز ۱۲ ارزش یا وزن بیشتری از روز ۱۱ دارد و همینطور روز ۱۱ ارزش و وزن بیشتری نسبت به روز ۱۰ دارد و الی آخر. در صورت نیاز میتوانید از فرمول زیر روابط آنرا محاسبه کنید

میانگین ساده	میانگین نمایی
$SMA = \frac{\sum (Close(i), N)}{N}$ N: دوره زمانی Close (i): قیمت بسته شدن کنونی	$EMA(t) = EMA(t-1) + (K \times [Close(t) - EMA(t-1)])$ N: دوره زمانی t: قیمت جاری K: تابع نمایی $k = 2 / (N+1)$

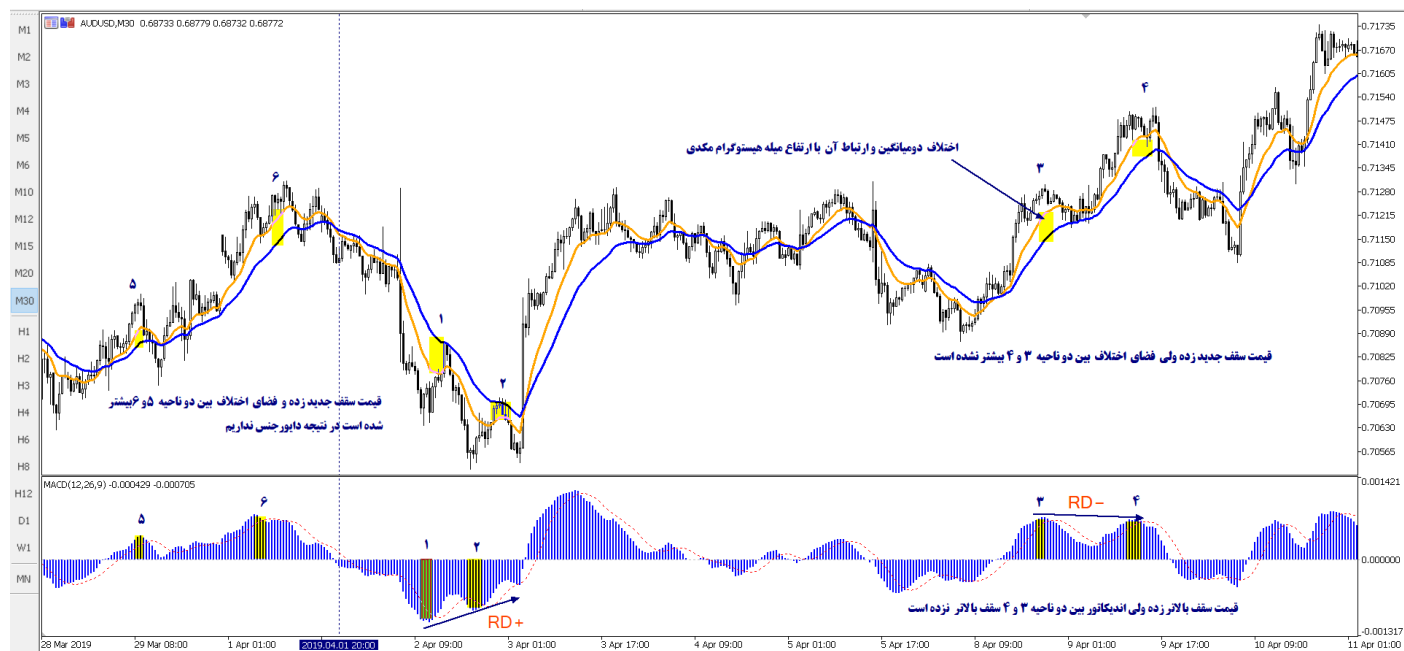
حال پس از معرفی اولیه که احتمالاً با آن آشنایی داشتید به بررسی نحوه شکل گیری واگرایی و سپس تعمیم آن به ایچیموکو میپردازیم:

میدانیم اندیکاتور مکدی از اختلاف میانگین نمایی ۱۲ دوره و ۲۶ دوره بوجود میاید به طوریکه اگر میانگین ۱۲ دوره برود بالای ۲۶ دوره در اندیکاتور مکدی هیستوگرام ها بالای خط صفر نمایش داده میشود و اگر میانگین ۱۲ دوره برود زیر میانگین

نمایی ۲۶ دوره در اندیکاتور مک دی قیمت می‌رود زیر لول صفر مکدی و همچنین لحظه برخورد دو میانگین جایی است که برابر است با لول صفر مکدی
به شکل زیر دقت کنید :



در نتیجه اگر در بازه های اخیر قیمت حجم بیشتری بخورد تاثیر روی میانگین بیشتر میشود به عبارتی فاصله بین دو میانگین کمتر و یا بیشتر میشود که این اختلاف رابطه مستقیم با ارتفاع میله های هیستوگرام از لول صفر مکدی دارد
. به شکل زیر دقت کنید :



حال که با ذات مکدی بیشتر آشنا شدیم و میدانیم که مکدی غربی شده اندیکاتور ایچیموکو می باشد حال برای تطبیق این دو مهندسی معکوس میکنیم تا به تشخیص واگرایی در ایچیموکو برسیم :

۱- لول صفر مکدی یک خط ثابت است و محور تقارن ما می باشد که به صورت ثابت یا استاتیک میباشد که هم برای مکدی مزیت است و هم عیب به این صورت که در مکدی قیمت بالای میانگین نمایی ۲۶ بود میله های مک دی بالای لول صفر هستند در حالیکه این لول در ایچیموکو به صورت داینامیک همراه با قیمت حرکت میکند . در نتیجه در ایچیموکو انتظار داریم هر وقت قیمت بالای کیجنسن برود مکدی بالای لول صفر باشد.

۲- در مک دی میانگین ۱۲ روزه میانگین ۲۶ را به سمت بالا قطع میکرد انتظار صعود داشتیم و طول میله های هستوگرام مکدی از اختلاف این دو میانگین بوجود می آمد پس در ایچیموکو نیز انتظار داریم وقتی تنکنسن ، کیجنسن را به سمت بالا قطع کرد مکدی صعودی شود ضمن اینکه فاصله بین تنکنسن و کیجنسن باید متناسب با ارتفاع میله های هستوگرام مکدی باشد.

نکته : اگر متن بالا را با دقت بخوانید به این قانون در ایچیموکو میرسید که اجزای ایچی نمیتوانند از قیمت فاصله بگیرند و باید به قیمت برسند و یا قیمت به سربعا به اجزای ایچی برمیگردد.

۳- در مکدی کراس دو میانگین ۱۲ و ۲۶ باعث ایجاد لول صفر میشود در نتیجه در ایچیموکو کراس تنکن و کیجن باید باعث لول صفر شود

۴- در مک دی فاصله بین دو میانگین نمایی و اختلاف آنها باعث تشخیص واگرایی ها میشود پس در ایچی فاصله فضای بین تنکنسن و کیجنسن باعث تشخیص واگرایی میشد (این مطلبی است احتمالا آنرا به اسم OA یا زاویه مخالف در آموزشهای کریس یاد گرفته اید که باعث برگشت روند میشود).

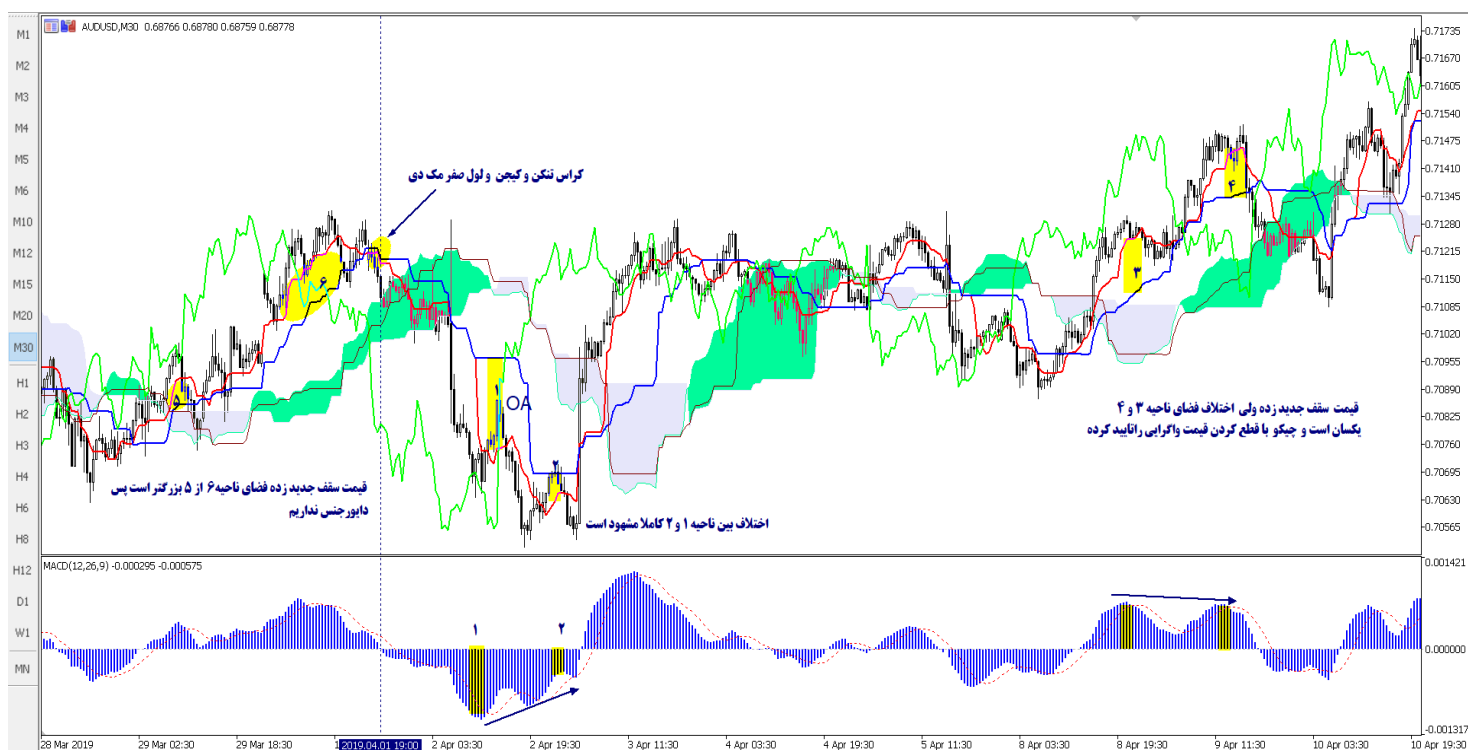
۵- در مک دی خط سیگنال که میانگین ساده ۹ دوره است که برای عملکرد بهتر و یا فیلتر خطا ها استفاده میشود و در ایچیموکو از چیکو که همان کلوز کندلهاست برای اینکار استفاده میشود.

البته ناگفته نماند که یک فرمول دیگری از سیگنال لاین هم وجود دارد که از میانگین ۹ کندل دیتا ساخته نمیشود و از هستوگرام های مکدی ساخته میشود. دقیقا مانند اسپن آ که مستقیم از کندلها دیتا نمیگیرد و دیتای خود را از تنکنسن و کیجنسن میگیرد . پس از این لحاظ میتوان به کاربرد دوگانه سیگنال لاین مکدی اشاره نمود که یک کاربرد برای فیلتر کردن خطاها و کاربرد دیگر در استفاده زمانی از اندیکاتور مکدی است (البته در بازه زمانی مخصوص به خودش).

۶- مکدی که اندیکاتور مولتی تایم نیست نمیتوانیم واگرایی در تایم بالا را تشخیص دهیم ولی در ایچیموکو با توجه به استفاده از کومو و فضای بین اسپن آ و ب میتوان واگرایی در تایم بالا را نیز تشخیص داد برای درک بهتر کافیت از تنظیمات دوبرابر مکدی ۲۴,۵۲,۱۸ استفاده کنید

۷- در مکدی مبنای تشخیص واگرایی اختلاف بین دو میانگین نمایی بود که با خاصیتی که میانگین نمایی در وزن دهی بیشتر به داده های اخیر بازار دارد واگرایی مشخص میشد ولی در ایچیموکو با استفاده از تنکنسن و کیجنسن که به های و لو های اخیر بازار وزن بیشتری میدهند به تشخیص واگرایی میپردازیم.

برای روشن شدن مطالب فوق . مثال قبلی را با ایچیموکو مجددا بررسی مینماییم ؟

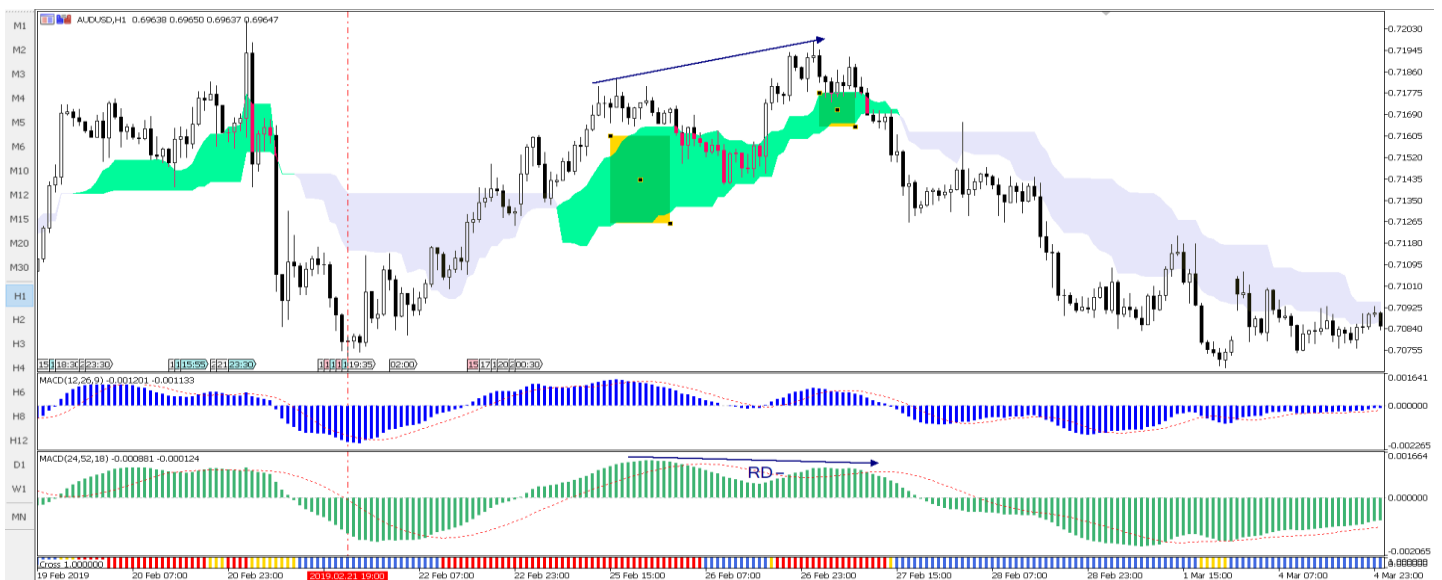
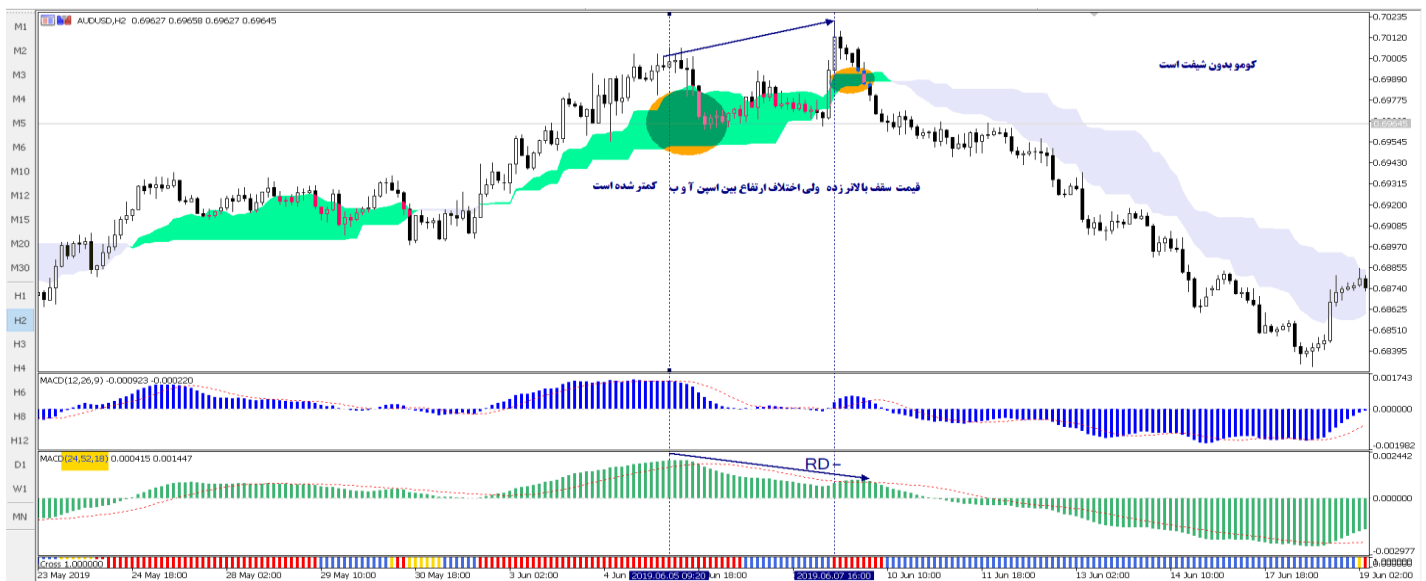


واگرایی بوسیه کومو :

در مقاله قبل گفتیم ایچی اندیکاتور مولتی تایم است . حال باید بتوانیم واگرایی را در تایم بالاتر نیز تشخیص داد که برای اینکار از کومو استفاده میکنیم و میدانیم کومو از اسپن آ و ب تشکیل شده است که از جنس همان تکنسن و کیجنسن است با این تفاوت که اسپن ب دوبرابر کیجنسن است یعنی یک تایم بالاتر . پس هر وقت قیمت اسپن ب را به سمت بالا قطع کرد میگوییم قیمت در تایم بالا رفته بالای لول صفر مکدی و برعکس

پس برای تشخیص واگرایی در تایم بالا کافیست از فضای بین اسپن آ و اسپن ب استفاده میکنیم . برای فهم بهتر شیفِت چیکو که به ۲۶ تا به جلو شیفِت داده شده است را صفر میکنیم و به صورت زیر در نظر میگیریم بعد از تسلط و مهارت میتوانید کومو را مجدداً به جلو شیفِت دهید ولی برای تمرین و عادت کردن چشم بهتر است مدتی با این شیوه تمرین کنید و یا اینکه از ایچی دیفالت استفاده کنید و در عوض مکدی دیفالت را دوبرابر کرده و ۲۶ تا به جلو شیفِت دهید .

مانند شکل زیر



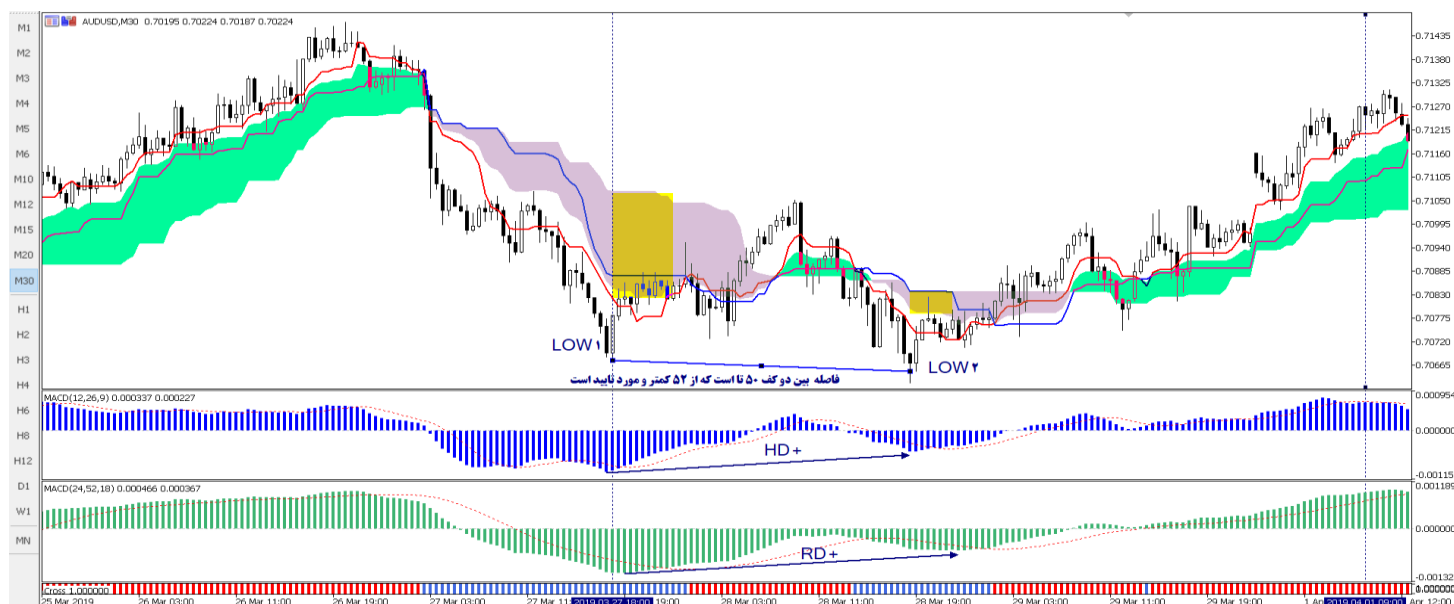
یک نکته ای که باید به آن توجه کرد ایسنت که اندیکاتور ایچیموکو و مکدی و همه اندیکاتور های دیگر زمانی هم هستند به این معنی که در بازه زمانی خودشان تحلیل معتبر دارند . یعنی مکدی که واگرایی را نشان میدهد به ما میگوید در بازه زمانی بین ۱۲ دوره و ۲۶ دوره اختلاف فاز داریم و ایچیموکو هم به همین معنی است . یعنی در ۵۲ دوره به ما اختلاف فاز ها را نشان میدهد . به عبارتی اگر بین دو قله یا دره واگرایی داشتیم و فاصله آنها از ۵۲ کمتر بود با ایچیموکو میتوان آنرا تشخیص داد و اگر فاصله بیشتر بود با این تنظیمات نباید همچین انتظاری داشته باشیم .



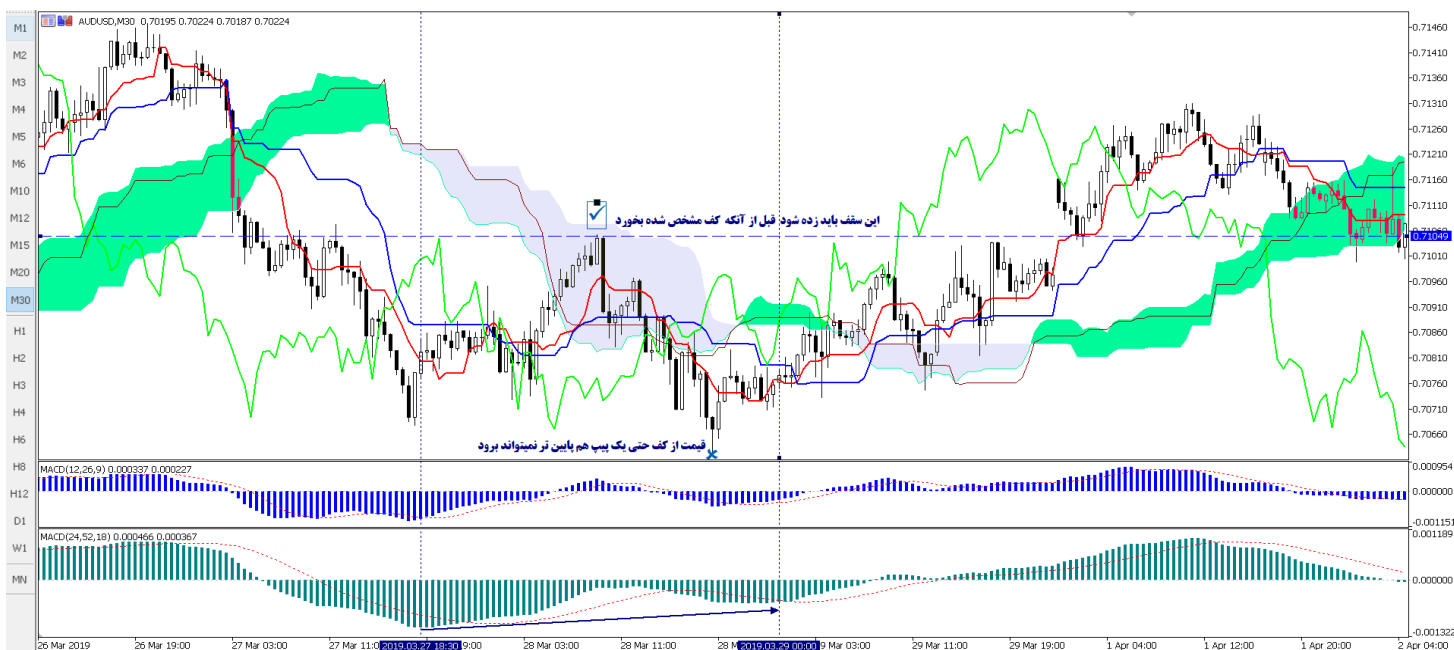
در ضمن باید توجه داشته باشید که نباید انتظار داشته باشید که واگرایی در ایچیموکو و مکدی عینا شبیه هم باشد چرا که دوره های میانگین گیری در مکدی و دوره های میانگین گیری های ولو در ایچیموکو با هم متفاوت است و همچنین تنظیمات دو اندیکاتور با یکدیگر نیز اختلاف هایی دارند. که در این مقاله بیشتر قصد داشتیم به معرفی واگرایی در ایچیموکو با کمک مکدی بپردازیم لذا ممکن است در ایچیموکو در یکجا واگرایی داشته باشیم در حالیکه مکدی آنرا به ما نشان ندهد و برعکس .

دایورجنسی های ایده ال با استفاده از اسپن ب و ریتم ۵۲:

بدون شرح :



در تصویر فوق کومو بدون شیفت است و در تصویر زیر تنظیمات ایچیموکو پیش فرض :



موفق و پر سود باشید

حمید داودی

(تیر ۱۳۹۸)