

معامله با ابرهای ایچیمو کو
راهنمای ضروری تحلیل تکنیکال ایچیمو کو کینکوها یو
مانش پاتل ۲۰۱۰

با سلام؛

امیدوارم با ترجمه این کتاب در افزایش سطح آگاهی از نحوه معامله با «ایچیمو کو کینکو هایو» کمک ناچیزی به هموطنان عزیزم نموده باشم.

همچنین به خاطر وجود کاستی‌ها و کمبودهایی که در ترجمه وجود دارد پوزش می‌طلبم.

لازم به ذکر است از آقای کریسی که آغاز این راه را به ما نشان داده‌اند، تشکر و قدردانی نمایم.

در صورت نیاز لطفاً با ایمیل ashkan22h@gmail.com ارتباط حاصل فرمائید.

ارادتمند شما

سید حسین محمودی

مقدمه:

تاریخچه:

«کندل‌های ژاپنی» عبارتی است که در بین جامعه معامله‌گران به خوبی شناخته شده است. اگر این عبارت در اینترنت جستجو شود، در موتور جستجوی امروز گوگل، ۳۸۱۰۰۰۰ مورد جستجو در دسترس قرار می‌گیرد. در مقایسه، اگر «ایچیموکو» مورد جستجو قرار گیرد، ۱۴۱۰۰۰ مورد جستجو پدیدار خواهد شد، که میزان این تفاوت به روشنی مشخص می‌باشد. استیو نیسون کندل‌های ژاپنی را به دنیای غرب وارد کرد و در این زمینه کار بزرگی انجام داد؛ وی شرح داد چطور کندل‌های ژاپنی را می‌توان مورد استفاده قرار داد تا به یک معامله‌گر موفق مبدل شد. وی تاثیر شگرفی بر جامعه معامله‌گری باقی گذاشت، و امروزه از موسسات بزرگ گرفته تا معامله‌گران جزء، در آنالیز تکنیکال از شمعی‌های ژاپنی به اشکال یا حالت‌های مختلف استفاده می‌برند.

این کتاب بخش جدید و بعدی آنالیز تکنیکال ژاپنی را به دنیای غرب تقدیم می‌نماید، «ایچیموکو کینکو هایو». ایچیموکو کینکو هایو سیستمی است که برای سالیان سال به طور موفقیت‌آمیز در سرتاسر کشور ژاپن مورد استفاده قرار گرفته است اما این تکنیک در دنیای غرب پیشرفت و توسعه نیافته است. اگر یک معامله‌گر، کندل‌های ژاپنی را با ایچیموکو کینکو هایو ترکیب نماید، سیستم قدرتمندی در دسترس وی قرار خواهد گرفت. در واقع، ایچیموکو کینکو هایو به شدت احتمال تبدیل به معامله‌گر موفق شدن را افزایش بخشیده و این مسئله بعد از خواندن این کتاب با معامله‌کردن کردن و نوشتن صورت حساب بر روی «کاغذ» تایید و اثبات می‌گردد. در این کتاب کندل استیک‌های ژاپنی زیاد مورد بحث قرار نخواهند گرفت و برای کسب هر نوع اطلاعات بیشتر در خصوص این موضوع می‌توان از کتاب‌های استیو نیسون و سیمناهای معامله‌گری بهره جست.

زمانی که این کتاب منتشر شود، بازار به صورتی تبدیل خواهد شد که پیش از این آن را تجربه ننموده‌اید؛ حتی معامله‌گران ماهر نیز قادر به پیش‌بینی آنچه در آینده رخ می‌دهد، نمی‌باشند. در این کتاب هیچ اشاره‌ای به مدل‌های فعلی بازار وجود ندارد. ما شاخص فراریت (VIX) (شکل ۱.۱) را ملاحظه نموده‌ایم، که در اواسط این دهه مقداری بین ۱۰ تا ۱۲ را برای چندین سال میانگین‌گیری نموده است، و برای اولین بار در خلال فروپاشی بازارهای مالی جهانی مقدار آن از ۵۰ تجاوز نموده است. چرا این بازار از هر نوع دوره تاریخی دیگر متفاوت شده است؟



شکل ۱-۱: نمودار ماهانه تجاری شاخص فراریت \$VIX.X

یکی از بزرگترین دلایل تفاوت این بازار، تکنولوژی می‌باشد. با ظهور اینترنت، اطلاعات را می‌توان به صورت جهانی در کسری از میلی‌ثانیه دریافت نمود. در خلال سقوط بازار در سال ۱۹۲۹، هیچ کامپیوتری وجود نداشت و تلویزیون نیز در مراحل اولیه پیشرفت خود به سر می‌برد.

اولین برنامه زنده تلویزیونی از یک هواپیما پخش شد. دو سال بعد، بزرگترین خبر جهان این بود: «در سال ۱۹۲۷، رئیس شرکت تلفن و تلگراف آمریکا در نیویورک به وسیله تلفن با هربرت هوور، بیش از ۲۰۰ مایل دورتر، در واشنگتن صحبت نمود. رئیس شرکت تلفن قادر بود به وضوح صورت آقای هوور را همانطور که در حال صحبت بود، مشاهده نماید. این مسئله به دنیا اثبات نمود که الکتریسیته قابلیت انتقال تصویر و همین‌طور صدا را دارد».

در اواسط دهه ۱۹۸۰، کامپیوترها هنوز در مراحل اولیه خودشان قرار داشتند. این زمان تاریخ شروع کامپیوترهای شخصی بود - مایکروسافت سیستم عامل MS-DOS 3.2 را معرفی نموده بود، اپل در حال معرفی Mac Plus بود، IBM در حال راه‌اندازی اولین کامپیوتر لپ‌تاپ بود و غیره. تکنولوژی در یک دوره زمانی کوتاه شروع به پیشرفت چشمگیر نموده بود. اندازه میکروچیپ‌ها کوچکتر و کوچکتر شدند و در مدت زمانی کوتاهی قدرت محاسباتی این میکروچیپ‌ها به صورت نمایی افزایش یافت. آنچه که در حالت معمول فضای کامل یک اتاق را به خود اختصاص می‌داد، امروزه در اندازه یک کامپیوتر رومیزی در دسترس همگان می‌باشد.

مثال کاملی از تغییر سریع تکنولوژی، ابرکامپیوترها می‌باشد. تا قبل از دهه ۱۹۷۰، IBM بر «فضای» ابرکامپیوترها تسلط داشت. ابرکامپیوترها عملیات محاسباتی مورد نیاز را به وسیله چندین گروه صنعتی مختلف انجام می‌دادند. به طور معمول این ابرکامپیوتر فضای کامل یک اتاق به مساحت بیش از ۱۰۰۰ فوت مربع را اشغال می‌نمودند درحالی‌که این کامپیوترها فقط قادر به ذخیره اطلاعات بودند. با این حال همچنین فضای زیادی برای ذخیره کابل‌بندی‌ها و همچنین پشتیبانی سیستم خنک‌کننده با مصرف زیاد برق مورد نیاز همراه بود. هزینه‌های مربوط به ابرکامپیوترها به بزرگی بیش از ۱۰۰۰۰۰ دلار بود. فقط شرکت‌های بزرگ و دانشگاه‌ها قادر بودند چنین «هزینه‌های گزافی» را پرداخت نمایند. شرکت‌های کوچک مجبور بودند محاسباتشان را به صورت دستی انجام دهند و یا مجبور بودند برخی از موسسات بزرگتر را برای انجام وظایفی و کارهایی که نیاز داشتند، استخدام نمایند. با معرفی کامپیوترهای شخصی در اواسط دهه ۱۹۸۰، اکنون شرکت‌های بزرگ و افراد خاص قادر بودند تا به طور مستقیم در حوزه کامپیوتر و تکنولوژی مشارکت نمایند. قیمت‌ها از اعداد شش رقمی به اعدادی کوچک ۳۰۰۰ تا ۵۰۰۰ دلار کاهش یافت. تجربه شخصی من به دهه ۱۹۸۰ بازمی‌گردد که کار با Apple IIE بود و سپس به سمت ماشین‌های IBM XT با Microsoft DOS پیشرفت نمود. این‌ها روزهایی بودند که در واقع هیچ میانجی گرافیکی وجود نداشت و همه چیز فقط به شکل متنی بود. در دهه ۱۹۹۰، تکنولوژی، مفهوم اینترنت و وب جهانی را معرفی نمود. یک حادثه مهم در یک دهکده کوچک در هندوستان را امروزه می‌توان در سراسر جهان در کسری از ثانیه شنید و ملاحظه نمود. انتقال اطلاعات در مقایسه با روزها/هفته‌ها/ماه‌ها در دهه‌های قبل، امروزه در جهان به صورت میکروثانیه‌ها منتقل می‌شوند. در خصوص بازارهای مالی، یک خبر در یک بازار خاص می‌تواند باعث بروز «واکنش زنجیره‌ای» به صورت فوری در سرتاسر بازارهای مالی جهان و در کوتاه‌ترین زمان ممکن گردد. این وقایع نه تنها به صورت همزمان رخ می‌دهند بلکه بر همه افراد نیز تاثیر برجای می‌گذارند، یعنی، کلیه افراد کلاس‌های پائین، متوسط و بالایی در سراسر جهان. تا اواخر دهه ۱۹۹۰، تقریباً هر فردی در سرتاسر جهان دارای یک نوع سرمایه‌گذاری در برخی از بازارهای مالی می‌باشد، که این سرمایه‌گذاری یا از طریق یک حساب بروکری آنلاین همزمان، یا حساب‌های بازار پول CD، یا حساب بازنشستگی (401(k))، و غیره انجام می‌گیرد. در حال حاضر کنترل بازار در دستان معامله‌گران خرده فروش عاطفی است تا در دست یک معامله‌گر حرفه‌ای.

در این کتاب، جنبه‌های اصلی تبدیل شدن به یک معامله‌گر حرفه‌ای را خواهید آموخت. با شما در کلیه مراحل معامله‌گری با ایچیموکو کینکوهايو همراه خواهیم بود. بعد از آن که این کتاب را مطالعه نمودید، منابع مختلفی در دسترس‌تان قرار خواهد گرفت تا مطمئن شوید مسیرتان در «دنیای ایچیموکو» موفقیت‌آمیز بوده است.

انواع معامله‌گری

همواره برای معامله و تجارت، دو سوال کلیدی بایستی در نظر گرفته شود:

سوال ۱: چه زمانی و در چه قیمتی باید وارد معامله شویم؟

سوال ۲: چه زمانی و در چه قیمتی باید از یک معامله خارج شویم؟

دو مدل آنالیز وجود دارد - آنالیز تکنیکال (چارتی) و آنالیز بنیادین (فاندامنتال) - که به معامله‌گر کمک می‌کند تا پاسخ‌هایی برای این سوالات بیابد. آنالیز تکنیکال شامل ملاحظه قیمت و عملکرد زمان برای یک کالای خاص است. امروزه، حساب‌های بروکری آنالیز همراه با سایر اشکال دیگر، صدها اندیکاتور برای قیمت و آنالیزهای زمانی ارائه می‌دهند. این اندیکاتورها گاهی اوقات به نام «مطالعات» نامیده می‌شوند، اندیکاتورها فرمول‌های محاسباتی هستند که عملکرد قیمت و زمان را به روش خاصی نمایش می‌دهند. با مجموعه قوانین خاصی، این اندیکاتورهای گرافیکی به معامله‌گر، اطلاعات اصلی در مورد آنچه که برای قیمت در یک دوره زمانی خاص رخ می‌دهد، ارائه می‌نمایند. مثال‌هایی از این اندیکاتورها، «میانگین‌های متحرک، میانگین دامنه واقعی (ATR)، استوکاستیک‌ها، پیوت پوینت‌ها و غیره» می‌باشد.

برای هر اندیکاتور صدها استراتژی مختلف می‌توان یافت. استراتژی‌ها متشکل از اندیکاتورهای مختلف می‌باشند و با مجموعه خاصی از قوانین همراه هستند که معامله‌گر می‌تواند از این قوانین برای معامله‌گری استفاده نماید. تعداد نامتناهی استراتژی‌های محتمل را می‌توان برای یک سیستم معامله توسط یک معامله‌گر با صدها اندیکاتور که در دسترس می‌باشند، ایجاد نمود. گذشته از این، برخی از این استراتژی‌ها فقط بر روی بازارها و تایم‌فریم‌های خاص تمرکز می‌نمایند. دیگر روزهای معامله‌گری بر اساس یک استراتژی ساده، گذشته و از بین رفته! امروزه نمودارهای تکنیکال با اندیکاتورها، خطوط، متن، اشیاء گرافیکی، و غیره دچار درهم‌ریختگی شده است. نمودارها آنقدر درهم و برهم شده‌اند که برای یک فرد تازه‌کار، درک یک نمودار در «اولین نگاه» کاری سخت و مشکل می‌باشد. برای یک فرد روزها و حتی ماه‌ها زمان می‌برد تا درک نماید چطور بر اساس سیستم معامله‌گری فرد دیگری معامله نماید.

رشته تحصیلی من مهندسی است و در نتیجه مانند بسیاری از مهندسان دیگر تمایل دارم مسائل را به صورت بسیار پیچیده‌ای درآورم. پیش از روزهای آشنایی با ایچیموکو کینکوهايو، اساساً در بازارهای سرمایه و بورس معامله می‌کردم. اگر پیش از این که با ایچیموکو کینکوهايو سازگار شوم کسی به نمودارهای من نگاه می‌انداخت، به طور کامل گیج می‌شد. برای اجرای یک آنالیز تکنیکال، ابتدا با ترسیم خطوط فیوناچی و خطوط گن کار خود را شروع می‌کردم. اگر این خطوط یک احتمال ورود را مشخص می‌نمودند، بعد از آن به اندیکاتور شاخص کالا (CCI)، اندیکاتور دامنه واقعی (ATR)، و اندیکاتور استوکاستیک نگاه می‌کردم. اگر «چراغ سبزی» از این اندیکاتورها دریافت می‌نمودم سپس به شاخص‌های بازار نگاه می‌کردم و می‌دیدم آیا این شاخص‌ها تصمیم من در جهتی که برای آن برنامه‌ریزی نموده‌ام را تایید می‌نمایند.

چون به طور کلی هرگز مایل نبودم در خلاف جهت بازار معامله کنم در نتیجه، به اندیکاتور شاخص تجاری (TRIN) نگاه می‌کردم، و سپس بازار S&P را با فیوناچی/گن/CCI/ATR و غیره پیش‌بینی می‌نمودم. اگر همه چیز با یافته‌هایم هماهنگ بود، آنگاه به سمت معامله بر اساس پیوت‌ها پیش می‌رفتم. می‌خواستم همه از این روش استفاده نمایند زیرا در آن روزها دیوانه بودم. به عقب می‌نگرم و شگفت‌زده می‌شوم چطور این مراحل پیچیده‌ای که ایجاد نموده

بودم را درک می‌نمودم. کارهای زیادی برای آنالیز یک سهم باید انجام می‌دادم. می‌توانید تصور کنید آنالیز همه ۵۰۰۰ سهم چقدر کار سخت و مشکلی بود. فردی وضعیت مرا به طور کامل وقتی که صفحه نمایش کامپیوترم را دید بیان کرد: «کشته شده توسط اندیکاتورها».

برخلاف آنالیز تکنیکال، که به صورت نموداری است، دومین روش آنالیز - آنالیز فاندامنتال - بر اساس اعداد است. ابتدا بیایید به آنالیز فاندامنتال در مورد سهام و این که چطور این روش به کار برده می‌شود، نگاه بیفکنیم. با ارزیابی فاندامنتال سهام، در جستجوی خرید یک سهم بر اساس اطلاعاتی نظیر این هستید که آیا آن شرکت در حال حاضر زیر ارزش واقعی خود قرار دارد. برای تعیین این مسئله که آیا یک شرکت کمتر از ارزش واقعی خود قیمت‌گذاری شده است، نیاز است یک «مقدار عادلانه» برای شرکت تعیین نمائید. برخی از معامله‌گران ممکن است از نسبت سود/درآمد (P/E) برای تعیین این که آیا سهم را بخرند استفاده نمایند. به عنوان مثال، اگر نسبت P/E ۱۰ به کار برده شود، پس هر سهامی در P/E برابر ۱۰ یا کمتر باید مورد خرید قرار گیرد.

یکی از مسائل کلیدی که به آن توجه می‌نمودم، سطح نسبت P/E 10 بر روی یک نمودار بود. اگر به یک نسبت P/E برابر ۱۰ نگاه کنید، به طور معمول حمایت تکنیکال را در آن سهم خاص ملاحظه می‌نمایید. متغیرهای دیگری که ممکن است مورد استفاده واقع شوند، سهام در یک سطح P/E برابر ۱۰ یا کمتر و همین طور سطح دیون پول نقد کوتاه مدت (ST) بود که باید برابر ۵۰ درصد می‌بود. این شاخص نشان می‌دهد سهم در حال معامله در چندین برابر سطح درآمدی خودش می‌باشد. این سهم بدهی‌هایش را به خوبی مورد سرمایه‌گذاری قرار داده است. بدیهی است همه این کارها در آنالیز تکنیکال یا چارتی - آنالیز مالی موسسه - در نظر گرفته نمی‌شود. اما زمانی که این سهام را در یک نمودار قرار می‌دهید قادر خواهید بود سطوح حمایت برای این آنالیزهای فاندامنتال مشاهده و استفاده کنید.

امروزه، اگر به اخبار گوش دهید، مشاهده نمود بسیاری از شرکت‌ها تجدیدنظرهای زیادی در مورد اعداد و ارقام حسابداری شرکت‌شان آماده می‌نمایند و همچنین بسیاری از شرکت‌ها «در حال پختن کتاب‌ها» می‌باشند (کنایه از دقت‌سازی). آنها اعداد و ارقام را پیش از آگهی و اعلام میزان درآمد، دستکاری می‌کنند تا سهم قیمت‌های بالاتری کسب کند. بر اساس این اعداد و ارقام دستکاری شده، فاندامنتالیست‌ها سهم را خواهند خرید/خواهند فروخت. اگر این اعداد و ارقام برخلاف واقعیت باشند، سرمایه‌گذاری آنها به طور کامل از بین خواهد رفت. در چند دهه اخیر، بسیاری از شرکت‌ها بر اساس «عملیات حسابداری» دچار مشکلاتی گردیده‌اند. چطور می‌توانید به نتایج این دفاتر اعتماد کنید در صورتیکه اغلب اوقات این امر بارها و بارها رخ داده است؟ اجازه دهید بگویم اگر شرکتی اعداد و ارقام را دستکاری ننماید و اطلاعاتی سه ماهه خوبی منتشر نمایند، پس چرا یک سهم بعد از این که این پیش‌بینی‌ها اعلام می‌شود و نشان‌دهنده فاندامنتال و بنیاد خوب شرکت است، سهام آن شرکت سقوط می‌کند؟ چرا برخی از شرکت‌ها ۲۰ درصد سریع‌تر از درصد رشد درآمدی‌شان رشد می‌نمایند؟ پاسخ واضحی برای این سوالات وجود ندارد. همه چیز به سفته‌بازی وابسته است، که مسئله‌ای غیرقابل پیش‌بینی است. در اینجا مقاله‌ای از روزنامه «آمریکای امروز» در ۲۷ ژوئن ۲۰۰۲، در مورد شرکتی که WorldCom نامیده می‌شود، وجود دارد:

«بازی حسابداری WorldCom سرمایه‌گذاری که فکر می‌کردند کارخانجات تلکام از این شرکت استفاده می‌نمایند را فریب داده درحالی که این شرکت از سال‌ها پیش یک شرکت بافندگی بوده است. با بیان این که حیل‌های حسابداری ممکن است قدرت خود را از دست داده باشند اما در واقع هرگز این حیل‌های حسابداری از بین نخواهند رفت. WorldCom این حیل را به عنوان هزینه‌های «سرمایه‌گذاری» در نظر گرفته است. باور عمومی بر این است این حقه به سرعت توسط آنالیزورها تشخیص داده می‌شود، و در سایر شرایط این حقه برای تنظیم دفاتر حسابداری با مقادیر بسیار کوچکتری مورد استفاده قرار می‌گیرد.

رابرت ولنز از لمان بروس بیان می‌دارد: «زمانی این مسئله، مشکل بزرگی محسوب می‌شد، اما طی چندین سال این مشکل از بین رفته است». وی می‌پرسد: «چطور این حقه توسط افرادی که به صورت‌های مالی نگاه می‌کنند، کشف می‌شود؟»

WorldCom از این حقه در سطحی که هرگز پیش از آن مشاهده نشده بود، استفاده نمود. این شرکت در سال ۲۰۰۱ به جای ضرر مقدار ۱.۴ بیلیون سود، با استفاده از چیزی که اصولاً قدیمی‌ترین حقه در این نوع دفاتر بود را بیان نمود.

این شرکت به جای کسر نمودن هزینه‌های ویژه - که آنالیزورها فکر می‌کردند برای حفظ و نگهداری سیستم‌های تلکام می‌باشد - از سود، این هزینه‌ها را به عنوان سرمایه‌گذاری‌های بلندمدت نامگذاری نمود. انجام این کار به WorldCom اجازه داد تا درآمدهای شرکت را بالاتر از حد نشان دهد زیرا هزینه‌های مربوط به سرمایه‌گذاری بلندمدت درآمدها در طی دوره‌های بعدی به جای اینکه به صورت یکباره از درآمدها کسر گردند، به صورت بلندمدت کسر می‌شود.

WorldCom گفت که هزینه‌ها به صورت نادرستی ثبت شده‌اند.

مسائل مربوط به سرمایه‌گذاری نامناسب را در ذهن تان نگه دارید:

شرکت‌های با سودآوری بالا قبلاً این مسئله را کنار نهاده بودند. هاوارد اسکیت رئیس مرکز تحقیقات و آنالیزهای مالی بیان می‌نماید این روش، یک روش بسیار ساده برای شرکت‌هایی با رشد قوی می‌باشد تا ثبت هزینه‌ها را به تاخیر بیاورند.

به طور مثال، American Online مبلغ ۳.۵ میلیون دلار جریمه برای کمیسیون اوراق بهادار و بازار سهام در سال ۲۰۰۰ برای تسویه مخارج هزینه‌های ایمیل هزاران دیسکت آموزشی در اواسط دهه ۱۹۸۰ پرداخت نمود.

SEC دریافتی AOL با عدم تسویه هزینه حقوق، به مدت سه سال به جای ضرر سود گزارش نموده است. AOL بیان می‌دارد این شرکت سرمایه‌گذاری هزینه‌ها را در اکتبر ۱۹۹۶ به این دلیل که این مسئله مدل تجاری‌اش را تغییر داده، متوقف ساخته است. سخنگوی شرکت، آن براکیل می‌گوید: «این امر مسئله‌ای کاملاً متفاوت است، همواره حسابداری AOL کاملاً شفاف بوده و AOL اجازه هیچ خطا و اشتباهی در توافق‌نامه پرداخت‌هایش نمی‌دهد».

آنالیز فاندامنتال برای سهام مورد بحث قرار گرفت اما آیا ارزش‌ها هم همین گونه رفتار می‌کنند؟ امروزه شما چطور قادر خواهید بود آنالیزهای فاندامنتال را برای معامله ارزش‌ها به کار ببرید؟ برای پاسخ به این سوال، نیاز است سیاست‌های بانک مرکزی مورد بحث قرار گیرد. ابتدا، hawkish وجود دارد (که اصولی در زمینه افزایش نرخ بهره می‌باشد). هر بانکی می‌تواند این کار را انجام دهد تا تورم را متوقف نماید، عرضه پول را کاهش داده، و غیره. عموماً اگر در رابطه با یک ارز، در آینده انتظار نرخ بهره بالاتری داشته باشیم، پس ارزش آن ارز بایستی افزایش یابد. مسئله بعدی، خوش‌شانسی (dowish) سیاست دیگر بانک مرکزی است (که اصول آن به سمت کاهش نرخ بهره می‌باشد). این سیاست برای افزایش عرضه پول، کمک به تحریک اقتصاد و غیره به کار برده می‌شود. اگر بتوانید یک جفت ارز با کشوری که در حال dovish است و دیگری در حال hawkish است را بیابید، بنابراین از نقطه نظر فاندامنتال شما معامله بزرگ ارزی در دسترس دارید. به عنوان مثال، در چند سال گذشته، ین ژاپن (کشور ژاپن دارای سیاست نرخ بهره صفر می‌باشد) تقریباً در مقابل هر ارز دیگر مثالی از این نوع معاملات است. اگر تا کنون عبارت «معامله را حمل کن» را شنیده باشید، این عبارت مصداقی در خصوص چالش ین ژاپن و سایر جفت‌ارزها می‌باشد. زمانیکه بازارهای مالی در حال سقوط می‌باشند، ایالات متحده دارای سیاستی برای حفظ نرخ بهره زیر ۱ درصد برای یک دوره زمانی طولانی

می‌باشد. در نتیجه، دلار آمریکا ارز در حال انتقال با این ژاپن می‌باشد و بعد از آن این مسئله منجر به کاهش ارزش دلار آمریکا می‌گردد.

عجالتاً آنالیز فاندamental بازار سهام و ارزها مورد بحث قرار گرفت و مشخص شد برای معامله با این نظریه، باید دارای اطلاعات زیادی جهت معامله سهام و ارزها باشید. جهت آنالیز فاندamental سایر بازارها نظیر بازار آتی کالا (ذرت، گندم، سویا، خوراک دام، و غیره) چگونه باید رفتار نمود؟ اگر شما در حال معامله همه این ملزومات هستید، باید بینشی «جهانی» از هر چیزی که در جهان در حال معامله می‌باشد، داشته باشید. برخی از معامله‌گران برای یادگیری وقت صرف می‌کنند، به خصوص از طریق اینترنت؛ هرچند این کار برای افراد زیادی به صورت مجازی غیرممکن است. هدف اصلی این کتاب ساده‌سازی معامله‌گری است. همه نظریه‌های فاندamental از هر نوع بازار و کالا در قیمت خلاصه خواهد شد. بنابراین، می‌خواهیم فقط بر عملکرد قیمت بر روی نمودارها جهت تعیین این که چه زمانی معامله کنیم و چه زمانی دست از معامله بکشیم، تکیه نماییم. این فرضیه‌ای است که در ورای ایچیموکو کینکوهايو، که یک سیستم تکنیکال است، نهفته می‌باشد. اگر یک معامله‌گر فاندamental هستید، پیشنهاد من ترکیب آنالیز تکنیکال و فاندamental با یکدیگر به عنوان بخشی از سیستم معامله‌گری‌تان است. به خاطر داشته باشید، سیستم معاملاتی شما باید چیزی باشد که با آن راحت هستید و از لحاظ «شخصیتی» متناسب با روحیات شماست. هر چیزی کمتر از این، باعث شکست خواهد شد.

اکنون، می‌خواهیم به سمت جلو پیش رویم و شروع به ایجاد «بسته‌های» فاندamental برایتان بنمائیم تا با استفاده از سیستم ایچیموکو کینکوهايو به یک معامله‌گر حرفه‌ای مبدل گردید.

اجزاء یک سیستم معاملاتی

معامله و سرمایه‌گذاری مراحل بسیار ساده‌ای هستند اما به عنوان انسان تلاش داریم تا آن را به چیزی پیچیده‌تر تبدیل نمائیم. متأسفانه، اصول زیادی برای خودمان وضع می‌کنیم و این اصول را به تصمیم‌گیری‌های مربوط به معاملات مان وارد می‌نمائیم.

اعتقاد دارم افراد در واقع چیزی را می‌خواهند که خارج از بازار است و اکثر افراد از موفقیت یا شکست می‌ترسند. در نتیجه تمایل دارند در مقابل تغییر مقاومت نمایند و به پیروی از اصول طبیعت خودشان ادامه دهند و در بازار بازنده شوند. زمانیکه از شر ترس‌ها شدید، تمایل پیدا می‌کنید تا از شر این اصول نیز خلاص شوید.

همین طور در مورد ریسک، حتی افراد بسیار حرفه‌ای نیز قادر به درک این مسئله نیستند، و در واقع مطلب جالب این است زمانیکه ریسک و مدیریت پرتفلیو را درک کنید، قادر خواهید بود یک سیستم معاملاتی را تقریباً با سطح کارایی مطلوب طراحی کنید.

وان کی. تارپ

پیش‌زمینه:

افراد قادرند در مورد زندگی مطالب زیادی را به وسیله مشاهده طبیعت مخلوقات فراگیرند، مشاهداتی که می‌تواند همه جنبه‌های زندگی چیزی را نمایش دهد. بیابید یوزپلنگ آمریکایی را مورد بررسی قرار دهیم و این که چطور طعمه‌اش را شکار می‌کند. یوزپلنگ آمریکایی یکی از مخلوقات درنده طبیعت است. یوزپلنگ آمریکایی زمانی که در جستجوی شکار است، دارای یک استراتژی می‌باشد. اگر یوزپلنگ آمریکایی گله آهوئی را بیابد، صبورانه با مشاهده کل گله صبر خواهد نمود و ضعیف‌ترین فرد گله را انتخاب می‌کند. دلیل این امر این است که یوزپلنگ آمریکایی فقط می‌تواند برای فاصله کوتاهی با حداکثر سرعت خود بدود. بنابراین، لازم است تا حد ممکن به شکارش پیش از این که ضربه کشنده را

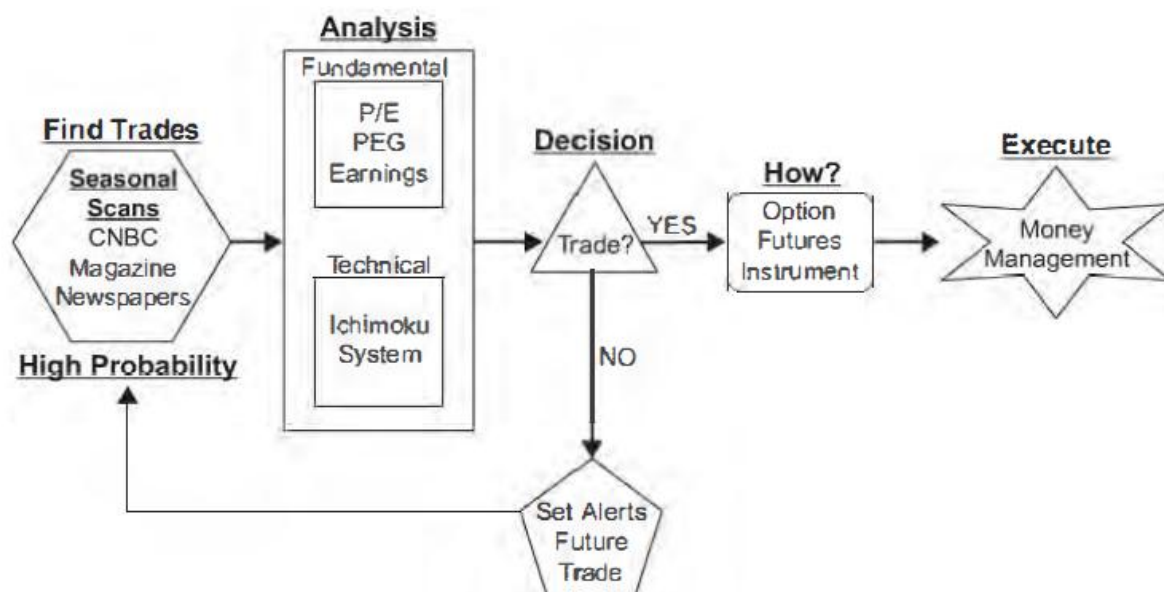
وارد سازد، نزدیک شود. در غیر اینصورت فرصت از دست خواهد رفت و ممکن است تا زمانی که فرصت بعدی پیش بیاید، چندین روز به طول بیانجامد. اگر یوزپلنگ آمریکایی روزهای بیشتری را بدون غذا سپری نماید، سرعتش کاهش خواهد یافت، و بنابراین حمله به سمت شکارش سخت تر و سخت تر می شود.

خوب چرا ما در مورد یوزپلنگ آمریکایی صحبت می کنیم؟

بازی در بازار بسیار شبیه به شکار یوزپلنگ آمریکایی می باشد. خواه شما یک معامله گر بازار فارکس، بازار آتی، بازار فیوچر، بازار سهام و غیره باشید، در هر صورت باید نقشه ای برای ورود به هر معامله داشته باشید. اگر فاقد برنامه باشید، یافتن فرصت به این دلیل که هر بار از دست دادن فرصت منجر به ضربه ها و آسیب های روحی، فیزیکی و روانی بر سلامت شما می گردد، برایتان سخت تر و سخت تر می شود.

بنابراین، باید پیش از ورود به یک معامله، هر بازار را به دقت مورد مشاهده و دیدبانی قرار دهید. به عبارت دیگر، پیش از این که به یک معامله گر تبدیل شود، باید به یک آنالیزور تبدیل شوید. اگر پیش از این که یک آنالیزور باشید، یک معامله گر هستید، پس در هر فرصت معاملاتی در حال ریختن تاس (قمار) هستید. فقط مانند یوزپلنگ آمریکایی که پیش از حمله به شکار، ضعف شکارش را مورد بررسی قرار می دهد، شما نیز بایستی قبل از معامله، آنالیز کنید، در غیر اینصورت موفقیت بیشتر و بیشتر از شما دور خواهد شد.

یک آنالیزور صبورانه تا مشاهده فرصت در بازار، آن را مورد بررسی قرار می دهد. زمانی که یک فرصت پدیدار می گردد، نقشه و برنامه ای را راه اندازی می نماید. این نقشه شامل ضوابط ورود، مدیریت سرمایه، و غیره می باشد. شکل ۱-۲ مثالی از یک برنامه معاملاتی خوب است. یک معامله گر واقعی «بازی احتمالات» را بازی نمی کند اما به جای آن صبر می کند تا فرصت بازار، خودش را به وی از طریق صبوری و نظم و دیسیپلین کاری اش نشان دهد.



شکل ۱-۲: مثالی از یک طرح معاملاتی

زمانی فردی به من گفت «معامله گری نه امری منطقی است و نه امری قابل پیش بینی». بعد از چندین سال معامله گری، صادقانه می توانم بگویم که آن جمله کاملاً صحیح است.

این کار بازی با احتمالات است. بایستی سیستمی برای کمک به افزایش احتمال موفقیت تان داشته باشید در غیر اینصورت فقط در حال قمار کردن هستید. با انداختن تاس، فرد احتمال ۵۰ درصد نتیجه مطلوب دارد. بنابراین، یکی از اهداف ما معامله گری با احتمال موفقیت بیشتر از ۵۰ درصد می باشد. چطور این کار را انجام می دهید؟ این امر با ایجاد یک سیستم معاملاتی که سود را در زمان حدس صحیح و حداقل سازی ضررها در زمان حدس اشتباه، باعث

حداکثرسازی سود می‌شود، امکان‌پذیر است. (یعنی به جای الگوهای ثابت با روند بازی و حرکت کنید). روند چیزی است که قیمت در یک جهت خاص برای یک دوره زمانی طولانی در آن مسیر در حرکت است در حالیکه یک روند سایدوی و تثبیتی، الگویی است که قیمت بین محدوده‌ای از قیمت‌های خاص «عقب و جلو» می‌رود.

طرح معاملاتی

مربی من همواره با عبارات زیر سخنش را آغاز می‌نمود: «یک سیستم بدون چارچوب ذهنی مناسب محکوم به فنا است؛ در حالیکه، چارچوب مناسب ذهنی به طور کامل همگام و همراه با مجموعه چارچوب ذهنی صحیح می‌باشد و به سمت موفقیت در حرکت است».

زمانیکه در حال ارزیابی سیستم‌ها و برنامه‌های معاملاتی هستیم، همواره باید این دو سوال اساسی را از خود پرسیم:

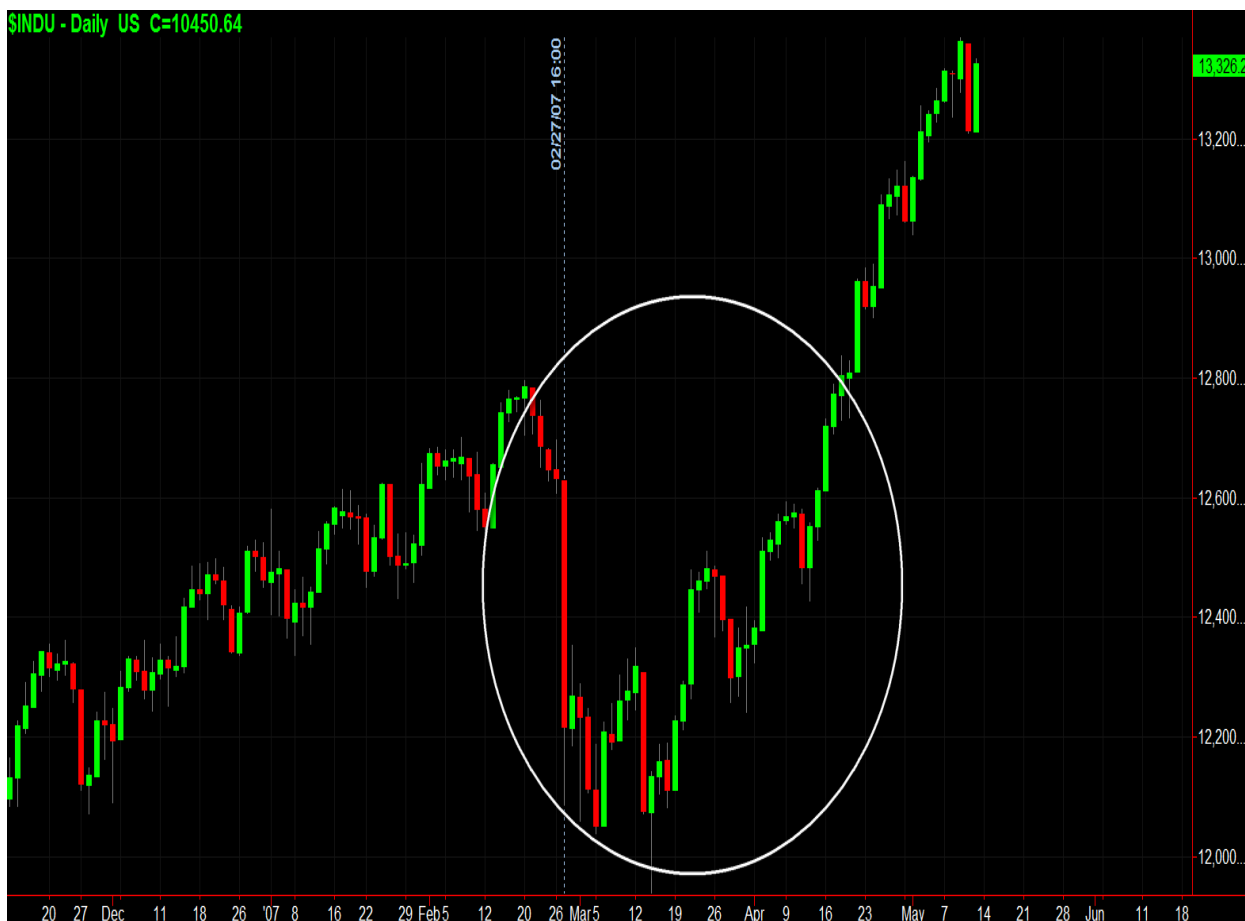
۱- آیا این سیستم/برنامه مجموعه چارچوب ذهنی معامله با این سیستم را پوشش می‌دهد و دربرمی‌گیرد؟

۲- آیا این سیستم/برنامه مسائل شخصیتی مورد نیاز این سیستم معامله‌گری را دربرمی‌گیرد؟

چرا باید این سوالات را پرسیم؟ برنامه‌های معاملاتی زیادی وجود دارند. هر برنامه نیاز به یک مجموعه چارچوب ذهنی خاص و مسائل شخصیتی در مورد معامله‌گری که از این سیستم استفاده می‌کند، دارد. آیا برنامه شما با شخصیت و مجموعه چارچوب فکری‌تان تناسب دارد؟ اگر نه، پس شکست‌تان نزدیک است. وقت و زمان برای کشف چیزی که متناسب با روحیات شماست و می‌تواند برایتان کار کند، اختصاص دهید! اگر برنامه معاملاتی که در این کتاب آن را ایجاد می‌نمایم متناسب با روحیاتتان نیست آن را به حالتی که با آن راحت و آسوده هستید تغییر دهید. اگر با این سیستم احساس راحتی نمی‌کنید، از آن استفاده نکنید.

اولین جزء سیستم معاملاتی، برنامه معاملاتی می‌باشد. برنامه معاملاتی چیزی است که استراتژی خاصی اتخاذ می‌نماید و آن را با مجموعه قوانین خاصی به اجرا درمی‌آورد. این برنامه همه هیجانات و مراحل تصمیم‌گیری را به طور کامل دربرمی‌گیرد طوری‌که فرد فقط باید برنامه معاملاتی را دنبال نماید و به موفقیت برسد. امروزه اکثر معامله‌گران خرد دارای یک برنامه معاملاتی نیستند و به طور کورکورانه در حال معامله هستند. آنها بدون برنامه و به جای داشتن سیستم معاملاتی، فقط در حال قمار کردن هستند. همه آن چیزی که می‌دانند این است که می‌خواهند ثروتمند شوند. بنابراین، از طریق سناریوی آزمون و خطا تلاش می‌کنند تا استراتژی بیابند که برای آنها کار کند (موثر باشد). اگر به طور شانس، این استراتژی شروع به خطا نماید، این استراتژی را دور انداخته و دنبال استراتژی دیگری می‌روند. آنها بین استراتژی‌ها همانطور که «حالت و وضعیت» بازار تغییر می‌نماید، سوئیچ می‌نمایند. این یک استراتژی خطرناک است زیرا اگر فراربت بازار بالا باشد، بازار به شدت به سمت بالا و پائین حرکت خواهد نمود و فرد دچار شکست خواهد گردید. در نتیجه، هیچ ثباتی در معاملات وجود نخواهد داشت. بدون ثبات، معامله‌گر صبر خود را از دست خواهد داد و فردی که صبر کمتری دارد، احتمال خطای بیشتری نیز خواهد داشت (یعنی، ضررهای بیشتر). این یک چرخه فاسد و نادرست است که اکثر افراد قادر نیستند از آن فرار کنند!

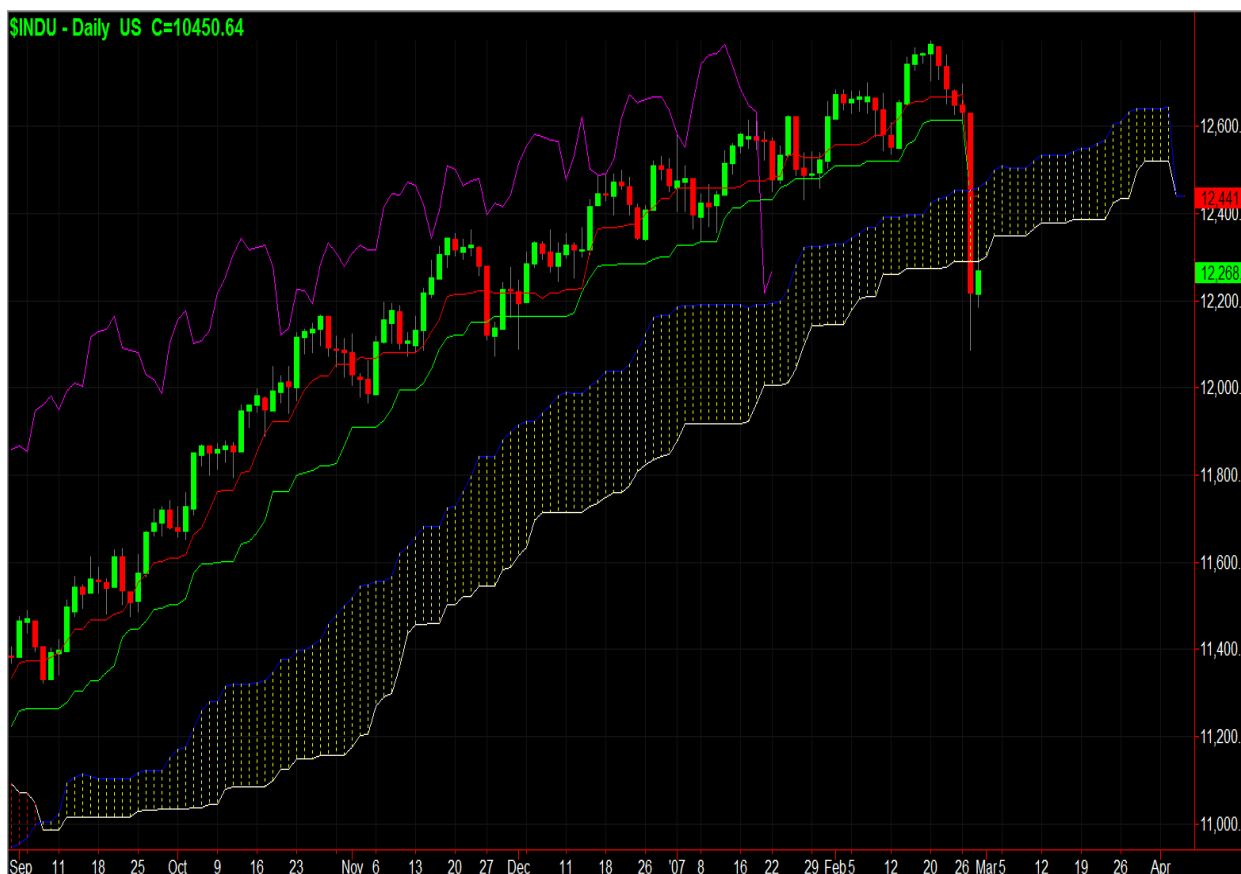
مثال کاملی از این امر در شکل ۳-۱ نشان داده شده است.



شکل ۳-۱: نمودار روزانه معاملاتی، نمودار روزانه SINDU ۲۷ فوریه ۲۰۰۷

این نمودار میانگین صنعتی داو جونز در ۱ می ۲۰۰۷ می باشد. در این تاریخ، بازار به شدت سقوط کرد و فروش گسترده‌ای وجود آمد طوریکه افراد زیادی ناامید شدند. چند ماه بعد در ۱۸ آوریل ۲۰۰۷، بازار به طور کامل به میزان ۱۰۰ درصد به سمت عقب و قیمت اولیه پیش از سقوط بزرگ برگشت نمود. در واقع، بازار به سمت قله بالاتری رهسپار گردیده بود. فکر می‌کنید چند نفر برای ۲۷ فوریه ۲۰۰۷ دارای برنامه معاملاتی بودند؟ چند نفر دارای دستور توقف ضرر بودند؟

اگر پیش از این سقوط مهم، پرایس اکشن را مورد بررسی قرار دهید، خواهید دید که بازارها برای چند سال گذشته به طور مرتب سقف‌های بالاتر و بالاتری می‌زده‌اند. پیش از فوریه ۲۰۰۷، بازار در یک حرکت بولیش (صعودی) قوی بوده است. مجموعه پرایس اکشن از لحاظ روانی در یک وضعیت «پول نقد سریع» قرار داشت. افراد می‌توانستند خرید کنند و سهم را رها سازند و به طور سالانه انتظار میانگین ۱۰ درصد سود داشته باشند، که این سود سه برابر بیشتر از حساب‌های پس‌انداز پول در بازار بود. افراد زیادی فکر می‌کردند این بازار یک «شرط‌بندی مطمئن» است و آنها این شرط‌بندی را شروع کرده بودند تا از سرمایه‌شان برای کسب درآمد سریع استفاده نمایند. آنها این کار را در حساب‌های معمولی بروکری‌شان با حساب‌های بازنشستگی انجام می‌دادند. زمانیکه بازار تصمیم گرفت خودش را اصلاح کند، چندین روز سقوط قیمت باعث ایجاد وحشت زیادی در سراسر جهان گردید. این واقعه در بازار سهام، بازار ارز، بازار اوراق قرضه، بازار کالا، و غیره رخ داد. میله شمعی روزانه نزولی بزرگ وحشتی بود که به وقوع پیوست. افرادی که دارای برنامه معاملاتی بودند به احتمال زیاد پیش از اینکه روز سقوط بزرگ رخ دهد، از بازار خارج شده بودند. اگر در حال معامله با ایچیموکو می‌بودید، از بازار یک یا دو روز پیش از روز سقوط بزرگ خارج شده بودید. (شکل ۴-۱)



شکل ۱-۴: نمودار روزانه معاملاتی ایچیموکو، نمودار \$INDU در تاریخ ۲۸ فوریه ۲۰۰۷

یک برنامه معاملاتی باید شامل چهار بخش زیر باشد:

۱- چه کالایی و در چه زمانی باید مورد معامله قرار گیرد؟

الف: مثال‌هایی از کالاها و اسناد: سهام، صندوق‌های سرمایه‌گذاری، اختیار معامله، آتی، و غیره.

ب: چارچوب زمانی: یک تیک، ۱ دقیقه، ۳ دقیقه، ۱۲۰ دقیقه، روزانه، هفتگی.

۲- قوانین ورود:

الف: بنیادین: PE, PEG, جریان پول نقد و غیره.

ب: آنالیز تکنیکال: ایچیموکو، میانگین‌های متحرک، میانگین دامنه واقعی، فیبوناچی، نظریه گن، پیوت، آنالیز حجم اسپرید، و غیره.

۳- مدیریت سرمایه:

توقف: اگر اشتباه کنید، کجا از معامله خارج خواهید شد؟ چه باور کنید یا خیر، معامله‌گران زیادی وجود دارند که هرگز از استاپ استفاده نمی‌کنند. آنها از این می‌ترسند که بروکرها/مارکت‌میکرها استاپ آنها را مشاهده کنند و قیمت را برای زدن کلیه استاپ‌هایشان به حرکت درآورند. در برخی حالات به ویژه اگر در تایم فریم‌های پایین‌تر در حال معامله هستید این مسئله درست و صحیح است. هرچند، چه اتفاقی برای حساب شما رخ خواهد داد اگر خبر اعلان شود و قیمت به شدت ظرف چند میلی‌ثانیه حرکت خود را آغاز نماید؟ با استفاده از یک سیستم معامله‌گری اتوماتیک با استفاده از آخرین تکنولوژی‌ها، امروزه میلیون معامله‌گر قادرند در کمتر از یک ثانیه دستور معاملاتی خود را به اجرا درآورند! آیا می‌خواهید خارج از معامله باقی بمانید!

توجه داشته باشید، من از کلمه «توقف» به جای «توقف ضرر» استفاده کرده‌ام. از نظر مربی من، بزرگترین مانعی که فرد باید بر آن غلبه یابد، روانشناسی کلمه «توقف» به جای «توقف ضرر» می‌باشد. کلمه «ضرر» دارای مفهومی منفی است که افراد از آن می‌ترسند و تلاش می‌کنند از آن دوری جویند. درحالیکه این مسئله رخ می‌دهد، و در صورت وقوع، وضعیت روانی فرد به نقطه‌ای منتقل می‌شود که بعد از این نقطه تفکر منطقی روی نداده و «وحشت» در روان وی جای می‌گیرد. افراد زیادی باور دارند که وقتی در ضرر هستند وحشت‌زده نمی‌شوند اما در واقع اشکال متنوعی از وحشت و اضطراب وجود دارد.

در اینجا مثال خوبی برای اثبات این نظریه وجود دارد:

در مدرسه ابتدائی، دو کودک هستند، نام اولین کودک بن و نام دومین کودک فرانک است. فرانک دارای توجه و دقت کامل است و به خاطر پیشرفت‌هایش سربلند و مفتخر است و هر روز تلاش می‌کند تا اطمینان پیدا نماید که در همین وضعیت باقی می‌ماند. یک روز، فرانک مثل هر روز در حال رفتن به سمت مدرسه است. همانطور که وی در حال قدم زدن است، پسر دیگر به نام بن به فرانک نزدیک می‌شود. بن بدون هیچ دلیلی، ضربه‌ای به شکم فرانک وارد می‌کند و سپس فرار می‌کند. فرانک درک نمی‌کند چرا با وجود اینکه هیچ کار بدی انجام نداده، بن این کار را انجام داده است. روز بعد فرانک به سمت مدرسه می‌رود و دوباره بن به سمت او حرکت می‌کند. دوباره، بن ضربه‌ای به شکم فرانک می‌زند و سپس دوباره فرار می‌کند. سومین روز فرا می‌رسد و فرانک، کسی که می‌ترسد مورد حمله قرار گیرد، تصمیم می‌گیرد برای جلوگیری از روبرو شدن با بن از مسیر دیگری به مدرسه برود. فرانک از بن دوری می‌جوید اما دیر به مدرسه می‌رسد. مسیری که او باید طی می‌کرد مسیری بود که زمان بیشتری از زمان مورد انتظار وی داشت. توجه و انضباط کامل او در یک روز به خاطر بن نابود شده!

چه چیزی اخلاقی است؟ فرانک یکبار ضربه زده و نقشه‌اش را برای رفتن به مدرسه همانطور که قبلاً انجام می‌داده حفظ می‌کند. وقتی که دومین بار این حادثه رخ می‌دهد، وی مواظب و محتاط می‌شود اما آماده نشده زیرا فکر نمی‌کند این کار دوباره هم اتفاق بیفتد، اما دوباره رخ داد. در سومین بار، واکنش نشان می‌دهد اما انضباط و توجه کامل خودش را از دست می‌دهد. او آنقدر نگران بن بود که انضباط و توجه کاملش را فراموش نموده بود، درحالیکه مسئله انضباط برای وی امری مهم به شمار می‌رفت.

هنگام معامله، اگر کلمه «توقف» را به عنوان ضرر در نظر بگیرید، این کار یک حالت منفی روحی است. اگر این مسئله یکبار، دوبار، سه بار و رخ دهد، به زودی این مسئله حالت روانی ذهن‌تان را به نقطه‌ای سوق خواهد داد که به جای اینکه «برنامه بازی» خودتان را دنبال کنید، شروع به نشان دادن واکنش خواهید کرد. اگر از یک معامله خارج شوید این بدین معنی است که اشتباه کرده‌اید. به خاطر داشته باشید، هدف، داشتن استراتژی است که ضررهایتان را زمان اشتباه حداقل سازد و سودتان را در زمان تصمیم‌گیری صحیح به حداکثر برساند. توجه داشته باشید گفتیم حداقل، نه هیچ؟ استفاده از کلمه «هیچ» واقعی نیست، این یک دنیای خیالی است.

ب: هدف سود: برخی از استراتژی‌ها از هدف سودگیری استفاده می‌کنند و برخی خیر. این کار امری ضروری در مقایسه با یک «توقف» نیست.

ج: مقدار پوزیشن: همانطور که روند در حال حرکت است، گزینه افزودن یا کاهش پوزیشن‌هایتان را در اختیار دارید. یک استراتژی این است هر زمان وارد پوزیشن اولیه می‌شوید با حداقل اندازه معامله/سهم وارد شوید. این کار برای کاهش ریسک و «آزمایش و تست میدان» صورت می‌گیرد. اگر روند به حرکت خود در همان جهت ادامه دهد، پس پوزیشن‌های بیشتر و بیشتری را در پولبک‌ها وارد معامله می‌کنید. دومین استراتژی، بر خلاف استراتژی اول است و با مقدار زیادی معامله/سهم وارد می‌شوید. همانطور که روند در حال حرکت است، پوزیشن‌ها را در حمایت/مقاومت‌های

اصلی کم می کنید. هر کدام از استراتژی های اندازه پوزیشن، طرفداران/مخالفین خود را دارد. می توانید در مورد هر یک از این دو نوع استراتژی جستجوی بیشتری انجام دهید؛ هرچند، به خاطر داشته باشید، باید برنامه ای انتخاب کنید که با شخصیت تان سازگار باشد. اگر هرگز دوست ندارید ریسک کنید، پس هیچ پوزیشنی نگیرید و یا هیچ نوع افزایش حجم در زمان حرکت رو به جلوی روند انجام ندهید.

د: زمان ورود/خروج: برخی از استراتژی ها بر زمان تمرکز می کنند. این استراتژی ها عموماً این کار را به این دلیل انجام می دهند چون حجم در طی زمان معامله گری سود بالا یا پائین است.

ر: مدیریت سرمایه ۱- ریسک هر معامله: این پارامتر بیشترین میزان ریسکی که یک معامله گر می خواهد در هر معامله داشته باشد را تعریف می نماید. اگر معامله گر بلندمدت هستید، ریسک هر معامله در مقایسه با فردی که در تایم فریم کوتاه مدت در حال معامله است، بالاتر و بزرگتر خواهد بود. به عنوان مثال، اکثر افرادی که بر اساس چارت های روزانه ارزشها در حال معامله می باشند دارای ریسک حداکثر ۲۰۰ پیپ در هر معامله هستند. آنها مایلند پذیرای این مقدار ریسک باشند چون انتظار دارند در یک معامله یک یا چهار ماهه، به طور میانگین حدود ۴۰۰ پیپ سود کسب کنند. آنها در این معامله انتظار نسبت ۲:۱ سود/ریسک را دارند. پس چرا این موضوع مهم است؟ دلیل این است که در حال معامله با یک سیستم هستیم و قمار نمی کنیم. چیزی که در یک سیستم تعریف می شود مانند این است که در حال بازی با «اعداد» هستید. اگر شما در دو معامله ضرر کرده باشید و در یک معامله دیگر سود، پس می دانید که حداقل مساوی و برابر خواهید شد زیرا یک برد، ۴۰۰ پیپ سود ایجاد می نماید و دو ضرر در مجموع ۴۰۰ پیپ ضرر. مجموع سود و ضرر صفر خواهد بود. بنابراین، بدترین سناریوی شما این است که یک برد، دو ضرر را جبران کند.

۲- ریسک در ماه: مقدار ریسک در هر ماه باید بر اساس درصد سرمایه ای که سرمایه گذاری نموده اید باشد. این کار برای این است که مطمئن شوید همه پولتان را در یک ماه از دست نمی دهید و پولی برای معامله در ماه دیگر نیز خواهید داشت. به خاطر داشته باشید، باید این کار را مانند یک تجارت انجام دهید. به دلیل تثبیت بازار (بازار بدون روند) برخی ماه های منفی نیز خواهید داشت. فرض می شود در طی این زمان، سیستم تان مقدار ضررها را حداقل نماید. فرض می شود در طی ماه هایی که بازار دارای روند است، سیستم تان سود را حداکثر می سازد. همچنین مقدار ریسک در هر ماه را می توان به عنوان «افت ممتد» نیز نامگذاری نمود.

۳- نسبت ریسک/سود: نسبت ریسک/سود یک محاسبه مهم است. چون ما در حال معامله در یک سیستم رونددار هستیم، پس این نسبت یک عامل کلیدی می باشد. هدف یک سیستم رونددار در زمان تصمیم گیری صحیح، حداکثرسازی سود است و در زمان تصمیم گیری غلط، حداقل سازی ضررها است. برای دستیابی به این امر، نسبت ریسک/سود سیستم تان باید کمتر از یک باشد. توجه داشته باشید، من گفتم «سیستم تان». ممکن است معاملاتی داشته باشید که نسبت ریسک/سود بزرگتر از یک داشته باشند، اما به طور کلی، نتایج بک تست باید نشان دهد سیستم تان نسبت ریسک/سود کمتر از یک دارد. در حالت تئوری، اگر بتوانید سیستم تان را تا حدی بهینه سازی نمائید که همه معاملات ریسک/سود کمتر از یک داشته باشند، پس دارای یک سیستم بسیار قوی و عالی هستید. این مسئله زمانی که مطالب بیشتری در مورد بخش بهینه سازی بک تست ها بیاموزید رخ خواهد داد.

۴- آنالیز بعد از انجام معامله: عامل احتمالات، آنالیز ریسک/سود، آنالیز ضرر. در بخش دیگری، شرح خواهیم داد چطور یک سیستم را بک تست بگیرید. زمانی که یک سیستم بک تست شده باشد، می توانید اطلاعات زیادی از نتایج بک تست به دست آورید. این نتایج باید احتمال برد در مقایسه با ضرر، میانگین ریسک/سود در هر معامله و غیره را نشان دهد. اطلاعات به دست آمده برای تعیین نیاز سیستم به «بک تست» یا «بهینه سازی» باید به کار برده شود. به عنوان مثال، اگر به دنبال ۱۲ درصد سود در هر سال هستید، پس نتایج بک تست باید به طور میانگین ۱۲۰ درصد در هر سال را در

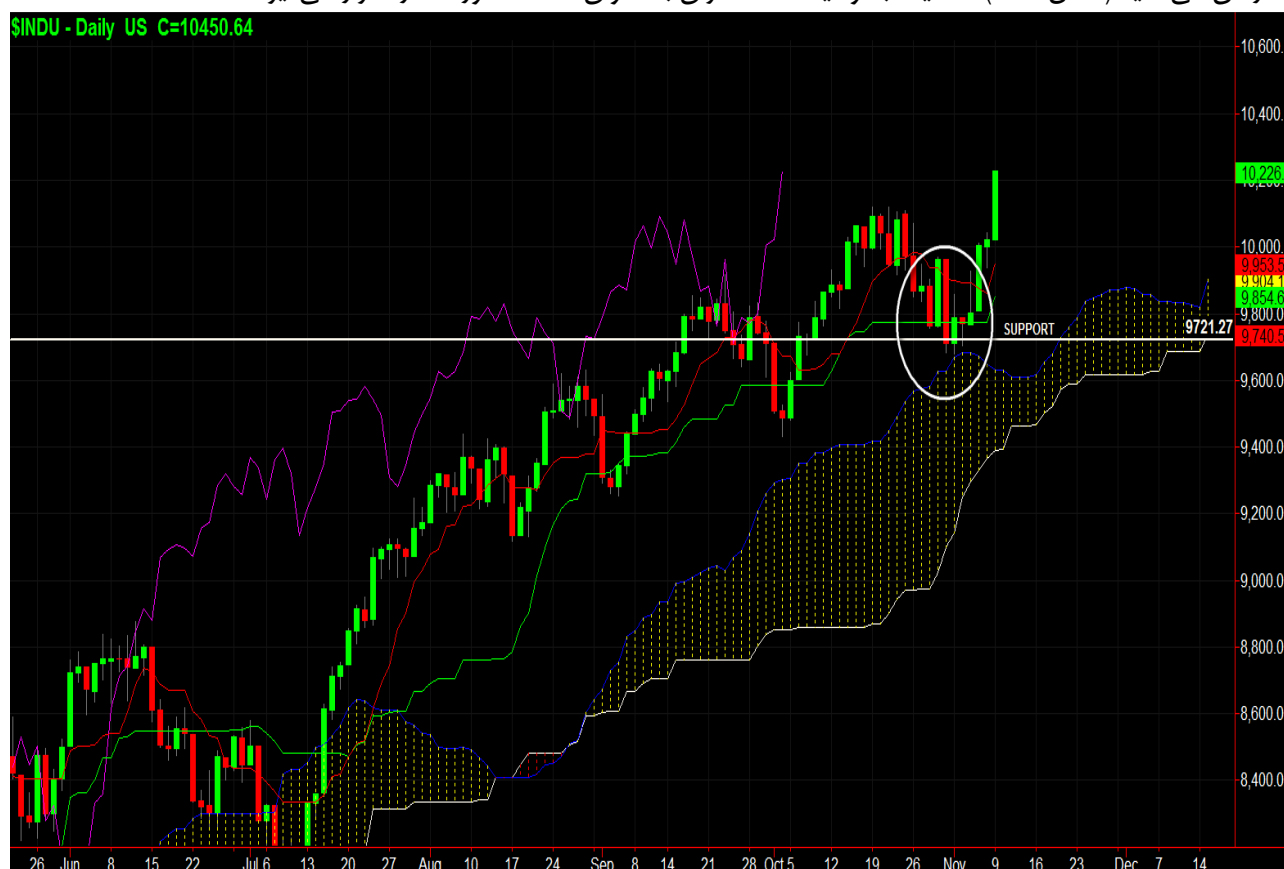
برداشته باشد. اگر سیستم‌تان این مقدار سود نمی‌سازد پس نیاز است سیستم برای دستیابی به اهداف بلندمدت‌تان تغییر داده شود. زمانیکه نتایج بک‌تست سیستم کلیه نیازهای معامله‌گری را برآورده ساخت، سیستم در یک محیط زنده با یک حساب واقعی در حالت معامله قرار داده می‌شود. اکنون نیاز است نتایج برای حساب واقعی ثبت شوند زیرا آنچه که در گذشته رخ داده لزوماً در آینده نیز رخ نخواهد داد. بنابراین، مقادیر آنالیز بعد از انجام معامله باید نگهداری و حفظ گردد تا مشخص شود آیا سیستم اهداف بلندمدت تجارت‌تان را برآورده خواهد ساخت.

به خاطر داشته باشید، هر برنامه معاملاتی مانند یک برنامه تجاری برای انجام یک تجارت است، این مسئله‌ای ضروری است و یک عامل کلیدی در تجارت محسوب می‌شود تا آن تجارت به موفقیت دست یابد.

در این کتاب، ما سیستم معامله‌گری ایچیموکو کینکو هایو را خواهیم آموخت و به صورت مرحله به مرحله بر اساس استراتژی ایچیموکو کینکو هایو یک برنامه معاملاتی ایجاد خواهیم کرد.

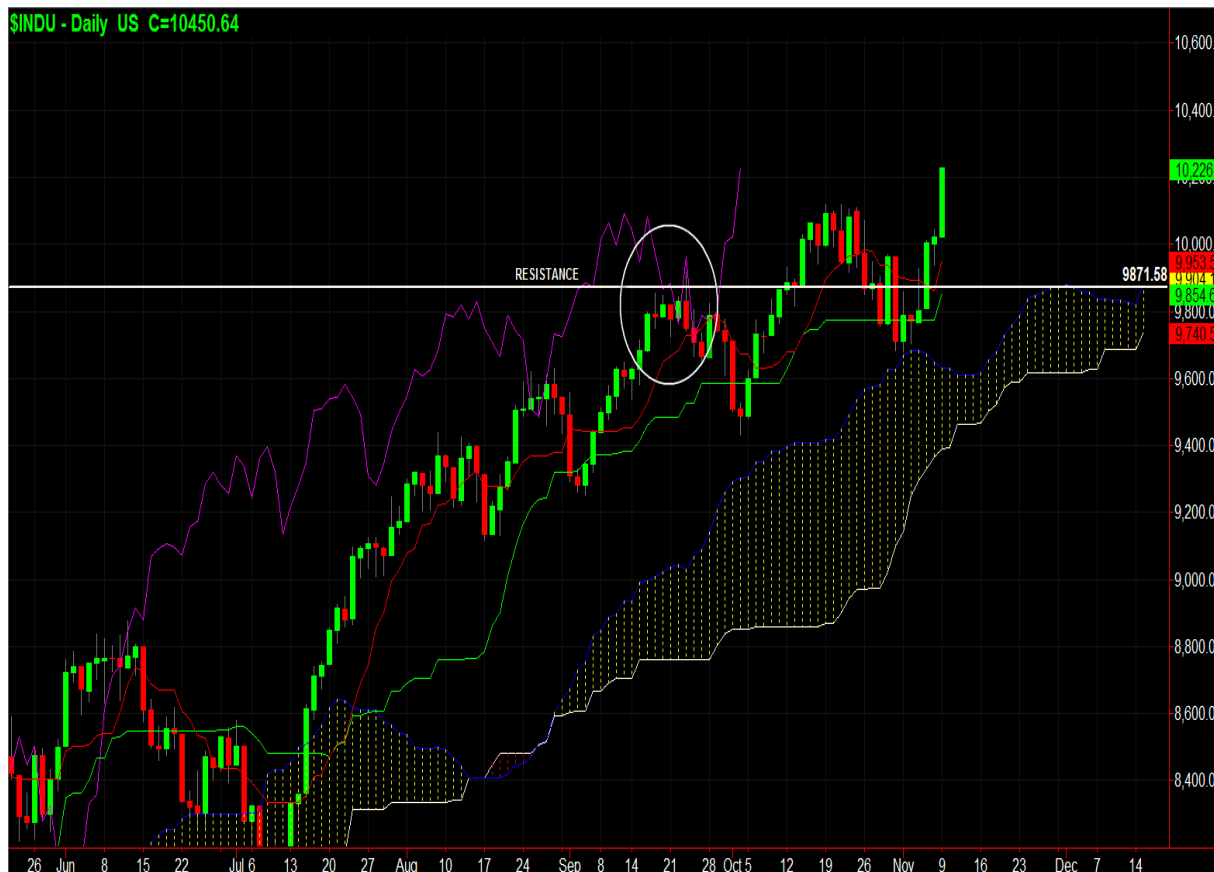
سیستم‌های تکنیکال:

دومین جزء از سیستم معاملاتی‌مان حرکت به سمت اجزاء آنالیز تکنیکال می‌باشد. پس یک سیستم تکنیکال چیست؟ آیا فیبوناچی است؟ آیا جعبه‌های گن است؟ آیا پیوت پوینت‌ها است؟ فیبوناچی، جعبه‌های گن، پیوت پوینت‌ها و غیره، برخی از انواع حمایت و مقاومت هستند. در واقع، هر سیستم تکنیکال دارای برخی اشکال حمایت و مقاومت می‌باشد. خوب پس حمایت و مقاومت چیست؟ حمایت زمانی است که یک کاربر در بازار در یک معامله فروش باشد (شرط‌بندی بر روی حرکت رو به پائین کالا) و قیمت به سمت عددی حرکت می‌کند (یعنی، قیمت حمایت که به هیچ‌عنوان قیمت از آن پائین‌تر نمی‌رود). اگر این سطح، یک سطح حمایت قوی باشد پس قیمت از آن نقطه بازگشت نموده و شروع به بالارفتن می‌نماید (شکل ۵-۱). حمایت به وسیله معامله‌گران به عنوان «کف» مورد اشاره قرار می‌گیرد.



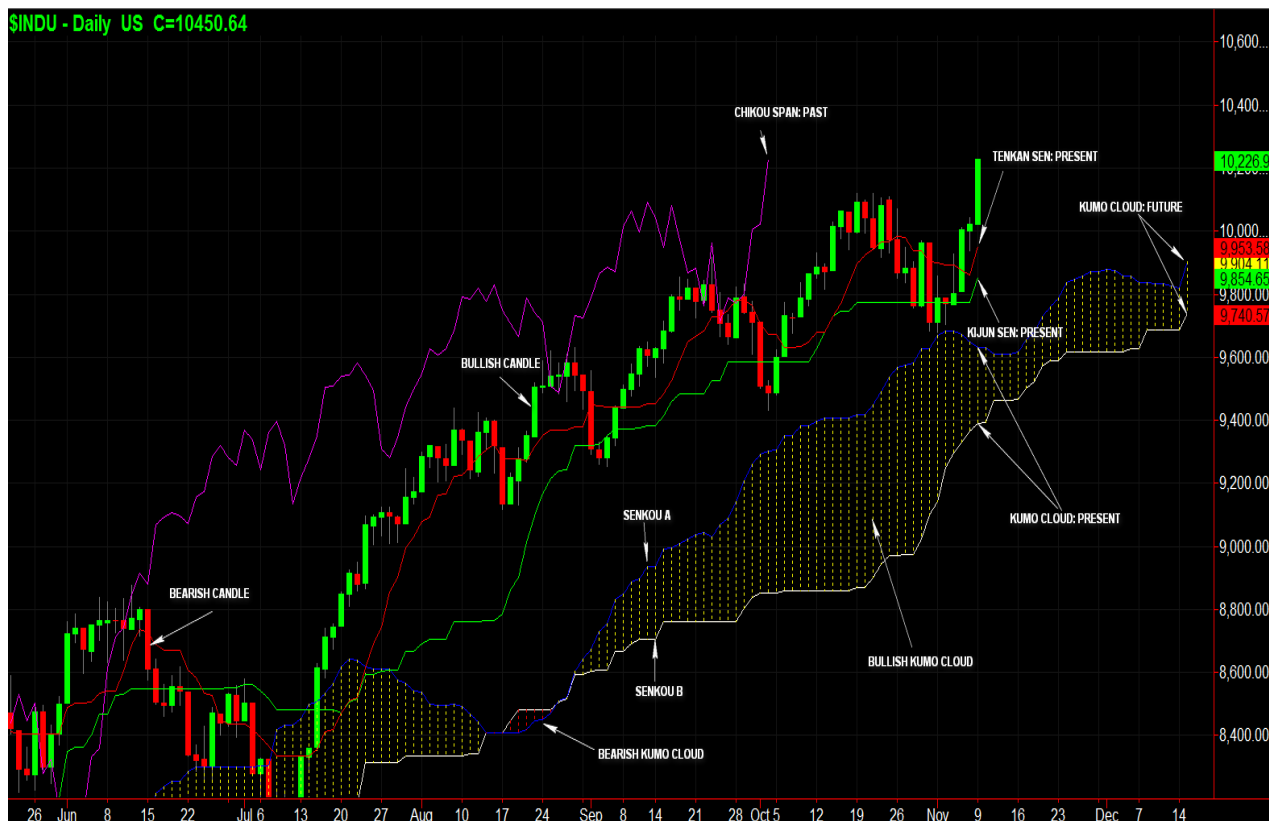
شکل ۵-۱: ایستگاه نمودار روزانه ایچیموکو، نمودار \$INDU در تاریخ ۹ نوامبر ۲۰۰۹

مقاومت زمانی است که کاربر در موقعیت خرید در بازار است (شرطبندی بر روند رو به رشد و بالای کالا) و قیمت به سمت عددی حرکت می‌کند، یعنی، مقاومت قیمتی است که به نظر می‌رسد قیمت به هیچ عنوان از آن بالاتر نمی‌رود (شکل ۶-۱). اگر این قیمت، یک سطح مقاومتی قوی باشد، پس قیمت از آن مقدار به سمت پائین برگشت خواهد نمود و شروع به حرکت به سمت قیمت‌های پائین‌تر می‌نماید. مقاومت توسط معامله‌گران به عنوان «سقف» اشاره می‌گردد.



شکل ۶-۱: نمودار روزانه ایستگاه ایچیموکو، نمودار \$INDU، تاریخ ۹ نوامبر ۲۰۰۹

اگر همه چیز بر اساس حمایت و مقاومت است پس چرا فقط از یک سیستم تکنیکال استفاده نکنیم که ساده باشد، سیستمی که همه مقادیر حمایت و مقاومت اصلی و فرعی را نشان دهد؟ ایچیموکو کینکو هایو یک سیستم تکنیکال است که مقادیر حمایت و مقاومت را به شکلی ساده شرح می‌دهد. در واقع، این سیستم بر اساس ایده ایجاد شده که در «یک نگاه» بتوان تشخیص داد آیا یک کالا در حال تعادل (ثبیت) است یا از تعادل خارج شده (رونددار). ارزشمندترین جنبه ایچیموکو کینکو هایو این است که در جستجوی تاریخچه‌ای است تا خودش را در زمان حال و همچنین در آینده تکرار نماید. از طریق نمودارهای ایچیموکو، می‌توانید رخدادهای «گذشته» را به سادگی مشاهده نمائیم و تصمیم‌گیری‌های حال حاضر را بر اساس رخدادهای گذشته اتخاذ نمائید. دابلو. دی. گان یکی از موفق‌ترین معامله‌گران در طول تاریخ، رخدادهای گذشته را برای تعیین رخدادهای آینده مورد بررسی قرار داد. ایچیموکو به معامله‌گر اجازه می‌دهد تا همین کار را انجام دهد. این سیستم گذشته، حال و آینده را از طریق پنج اندیکاتور نشان می‌دهد (شکل ۷-۱).



شکل ۷-۱: نمودار روزانه ایستگاه ایچیموکو، نمودار \$INDU، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

برخی افراد استدلال می نمایند که رخدادهای گذشته لزوماً در آینده تکرار نخواهند شد؟ این گفته صحیح است اما به چه روش دیگری می توانیم احتمال موفقیت را افزایش دهیم؟ این بهترین روش برای افزایش احتمال موفقیت در معاملات می باشد.

در این کتاب، نمی خواهیم تاریخچه ایچیموکو کینکو هایو را با جزئیات مربوط به آن مورد بحث قرار دهیم. نمودارهای ایچیموکو: مقدمه ای به ابرهای ایچیموکو کینکو از نیکول الیوت بهترین محل برای کشف منشاء ایچیموکو کینکو هایو است. این کتاب جزئیاتی را بیان می کند که چطور گویچی هوسادا ایچیموکو کینکو هایو را در سال ۱۹۴۸ کشف نمود و آن را برای هیدنوبو ساساکی، شخصی که کتابی در مورد ایچیموکو کینکو هایو در ژاپن نوشته است بیان نموده است. برای ما مهم نیست بیاموزیم چطور وی سیستمی ایجاد نمود تا از آن استفاده نماید. برای ما این مسئله مهم است که این سیستم را بیاموزیم و بدانیم چطور از آن استفاده نمائیم تا به یک معامله گر موفق مبدل گردیم. بنابراین، بر روی این موضوع به هیچ عنوان تمرکز نخواهیم نمود.

بخش بعدی در مورد همه اجزای سیستم ایچیموکو کینکو هایو بحث می نماید. همه باید اجزا مجزای ایچیموکو را برای انجام یک معامله موفق درک نمایند. بسیاری از معامله گران تصمیم می گیرند تا از یک یا دو بخش ایچیموکو برای انجام معامله استفاده نمایند. این کار خوبی است اما باید در مورد همه اجزاء آگاهی داشته باشیم و تا حدودی درک کنیم این اندیکاتور چطور از اطلاعات استفاده می نماید. مجبورید درک کنید چرا در ایچیموکو پنج مولفه به جای دو یا سه مولفه وجود دارد.

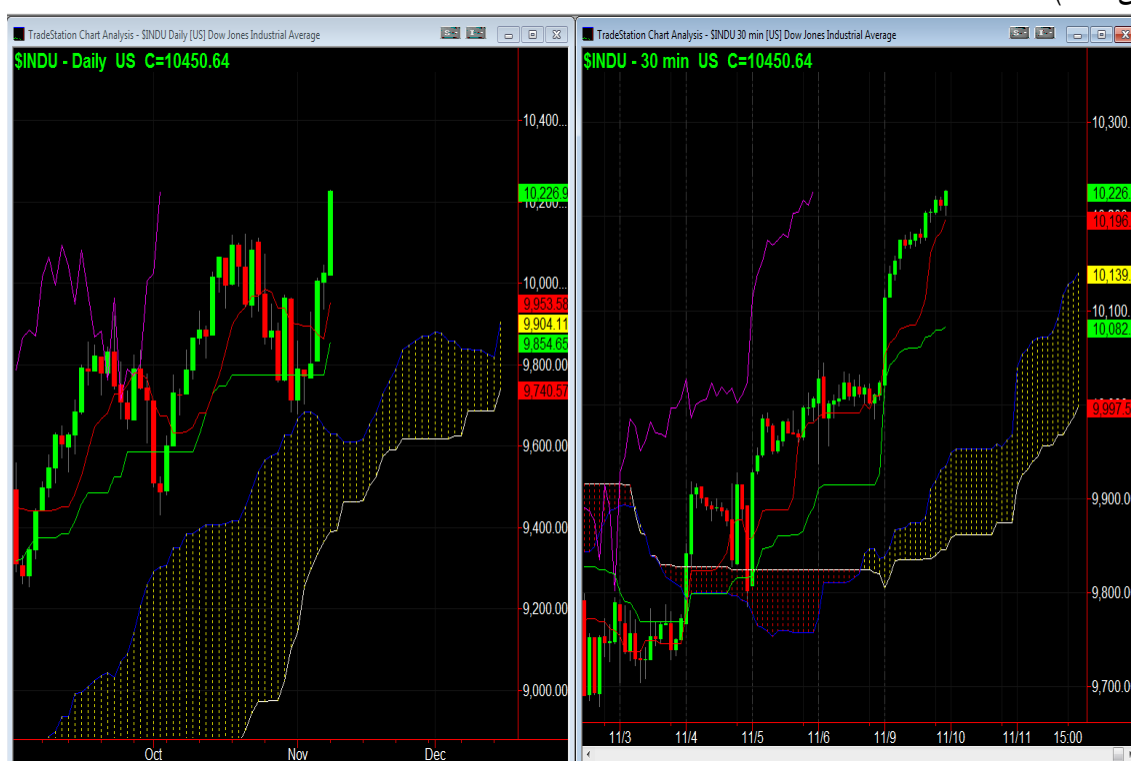
فصل ۱

اجزاء ایچیمو کو

پیش از شروع معرفی کلیه اجزاء ایچیموکو، نیاز است در مورد بعضی اطلاعات پایه بحث کنیم. ابتدا، من از تایم فریم روزانه به عنوان تایم فریم زمانی مرجع در سراسر این کتاب استفاده خواهم نمود. هرچند، این امر بدین معنی نیست ایچیموکو کینکو هایو فقط در تایم فریم روزانه عمل می کند. امروزه، ایچیموکو در سطح تیک، ۱ دقیقه، ۳ دقیقه، ۵ دقیقه، ۶۰ دقیقه، ۱۲۰ دقیقه، روزانه، هفتگی و غیره به کار برده می شود. دلیل این که چرا من تایم فریم روزانه را مورد بحث و بررسی قرار داده ام این است که همه چیز «با سرعت کندتری» نسبت به تایم فریم دقیقه ای حرکت می کند. با این روش می توانید همه چیز را «مشاهده» کنید. برای این که قادر به ترید در تایم فریم سریع تری نظیر ۵ دقیقه باشید، باید در تایم فریم روزانه بسیار ماهر شوید.

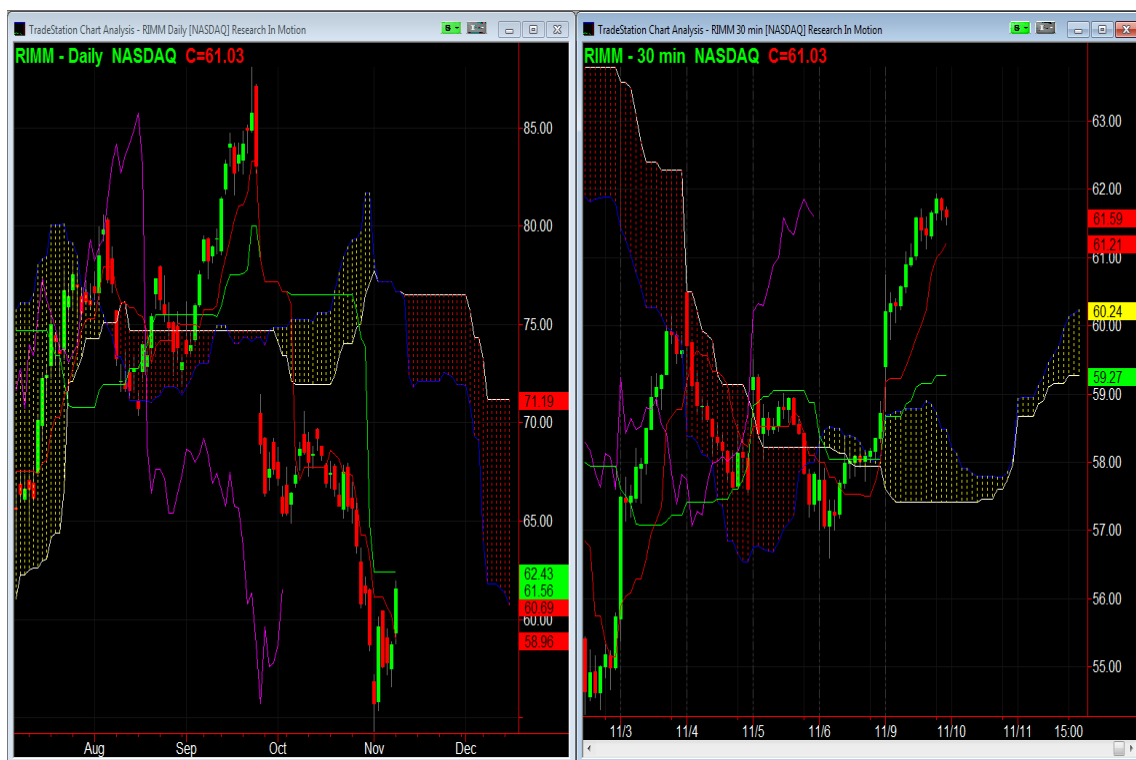
سوال بعدی که همه از من می پرسند این است: آیا باید به تایم فریم پائین تر همراه با تایم فریم روزانه نیز نگاه کنیم؟ برای پاسخ به این سوال باید به سه نوع مختلف ترید که وجود دارد، نگاهی بیاندازیم:

۱- ترید دارای روند: در روند، قیمت در یک جهت برای دوره زمانی طولانی حرکت می کند. در این نوع روند، تایم فریم بالاتر، تایم فریم پائین تر را تحت تاثیر قرار می دهد و در این حالت، تایم فریم پائین تر، تایم فریم بالاتر را تایید می کند. (شکل ۱-۱)



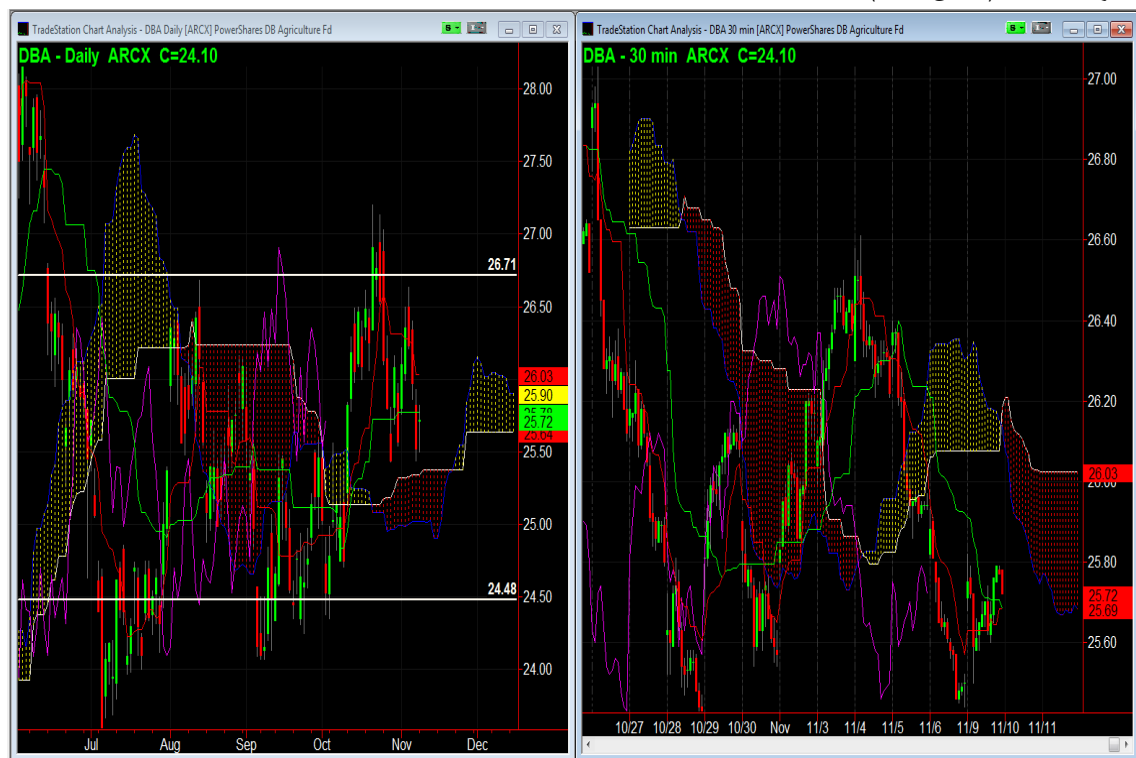
شکل ۱-۱: ایستگاه نمودار روزانه ایچیموکو/۳۰ دقیقه \$INDU، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

۲- برگشت روند: قیمت پیش از این حالت برای مدت زمان طولانی در جهت خاصی حرکت نموده است. اکنون، تریدر اعتقاد دارد روند خاتمه یافته و تریدر می خواهد برخلاف روند قبلی معامله کند. در طی حرکت خلاف روند قبلی، تایم فریم های پائین تر از تایم فریم بالاتر حمایت و پشتیبانی نمی کنند. آنها برخلاف روند قبلی حرکت کرده و به نقطه ای می رسند که تایم فریم بالاتر را تحت تاثیر خود قرار می دهند (شکل ۱-۲)



شکل ۲-۱: نمودار روزانه ایچیموکو/۳۰ دقیقه RIMN، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

۳- خنثی: قیمت در جهت خاصی حرکت نمی کند. قیمت به سمت بالا و پائین بین دو مقدار حمایت و مقاومت قوی در حال حرکت است (شکل ۳-۱).



شکل ۳-۱: نمودار روزانه ایچیموکو/۳۰ دقیقه DBA، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

اگر نمی دانید چطور تشخیص دهید در وضعیت دارای روند قرار دارید، یا در حالت برگشت روند، یا در وضعیت تثبیت، پس زمانی که به تایم فریم های پائین تر نگاه کنید، به احتمال زیاد گیج خواهید شد. استفاده از تایم فریم های چندگانه یک

تکنیک بهینه‌کننده پیشرفته است. زمانیکه مدتی در تایم‌فریم روزانه ترید کردید، یاد خواهید گرفت آیا قیمت دارای روند است، آیا برخلاف روند در حال حرکت است و یا در یک الگوی تثبیت (سایدوی) قرار داد. سیستم ایچیمو کو کینکو هایو از پنج بخش تشکیل شده است (شکل ۴-۱)

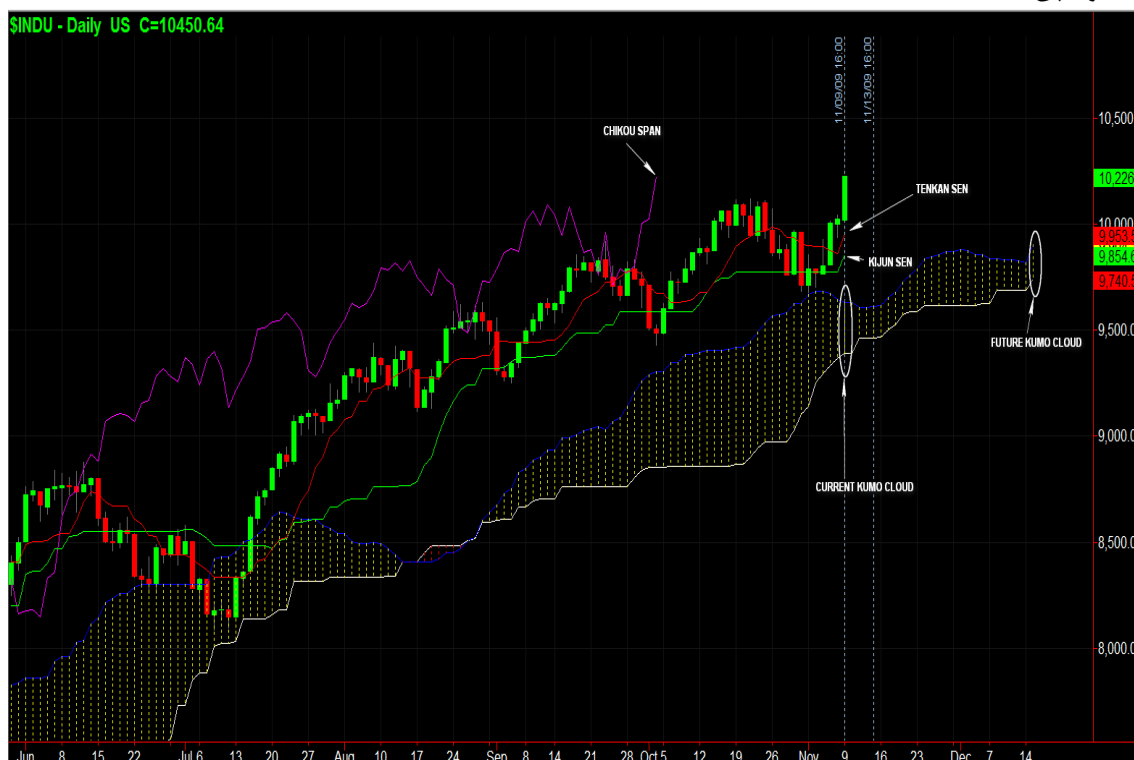
۱- تنکانسن (قرمز)

۲- کینجسن (سبز)

۳- چیکو اسپن (ارغوانی روشن)

۴- سنکواسپن A

۵- سنکواسپن B



شکل ۴-۱: ایستگاه نمودار روزانه ایچیمو کو/۳۰ دقیقه \$INDU، ۱۳ نوامبر ۲۰۰۹

در این کتاب، کلیه تصاویر سیاه و سفید هستند. هرچند، کلیه چارت‌ها در وبسایت (www.eiicapital.com) به صورت رنگی می‌باشند. کدهای رنگی اندیکاتورهای مختلفی که بر اساس اصول معمول روزانه استفاده می‌کنم را در نظر گرفته‌ام تا بتوانید آنها را در وبسایت شناسایی کنید.

پنج مولفه ایچیمو کو به شما همه «داستانی» که در ورای چارت یک بازار خاص وجود دارد را بیان می‌نمایند. افراد زیادی تلاش کرده‌اند تا فقط از دو یا سه مولفه استفاده نمایند ولی به سختی شکست خورده‌اند. عامل اصلی تریدر با استفاده از ایچیمو کو، درک هر یک از اجزاء به صورت مستقل و سپس درک نحوه و چگونگی کارکرد آنها با یکدیگر می‌باشد. زمانیکه در این زمینه مهارت پیدا کردید، قادر خواهید بود با ایچیمو کو بدون هیچ مشکلی ترید کنید. علاوه بر این، اندیکاتورها بر اساس قیمت عمل می‌کنند نه بر اساس زمان. یک عامل زمانی در ایچیمو کو کینکو هایو وجود دارد که در بخش‌های بعدی مورد بحث قرار گرفته است.

تنکاسن:

اولین اندیکاتوری که مورد بحث قرار می‌دهم، تنکاسن است. تنکاسن حرکت کوتاه‌مدت قیمت را نشان می‌دهد. رنگ تنکاسن قرمز است. فرمول تنکاسن (قرمز) به صورت زیر است:

$$\left(\frac{\text{پائین ترین قیمت} + \text{بالا ترین قیمت}}{2} \right) \text{ برای } 9 \text{ دوره}$$

اکثر تریدرهای خرد و موسسات از یک میانگین متحرک ۱۰ دوره‌ای قیمت‌های پایانی (SMA) برای نمایش دوره‌های کوتاه‌مدت استفاده می‌نمایند. با استفاده از میانگین «بالا ترین قیمت» و «پائین ترین قیمت» به جای قیمت‌های بسته شدن، تنکاسن فراریت میان‌روزی را نیز در نظر می‌گیرد.

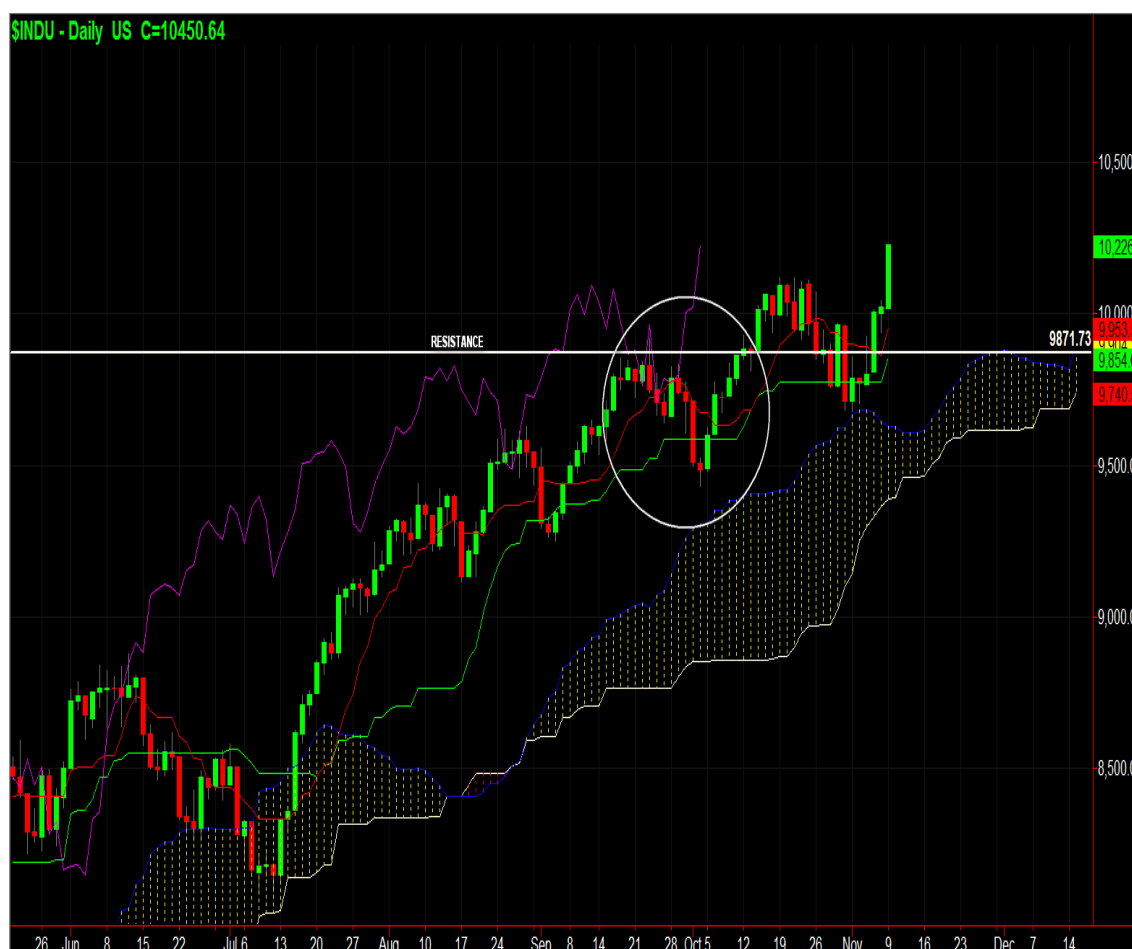
شکل ۵-۱ تنکاسن و SMA ۹ دوره‌ای را برای دلار اروپا/USD (EURUSD) نشان می‌دهد. توجه داشته باشید در طول روند، تنکاسن از پائین ترین قیمت در طول روز فقط یکبار به سمت بالا حرکت نموده است، درحالی‌که SMA ۹ دوره‌ای بیش از ۹ بار، مقدار پائین قیمت در طول روز را نمایش داده است. با استفاده از میانگین «بالا ترین قیمت‌ها» و «پائین ترین قیمت‌ها» به جای قیمت‌های بسته شدن، تنکاسن حرکت قیمت در کوتاه‌مدت را به شکل بهتری منعکس می‌نماید. در واقع، زمانی‌که وارد ترید می‌شود می‌توانید از تنکاسن به عنوان یک «توقف» استفاده کنید. برای تازه‌کارها، یک «توقف» جایی است که در صورت اشتباه، از ترید خارج خواهید شد (یعنی ریسک ترید و معامله). زمانی که یک دستور خرید/فروش را صادر می‌کنید، همواره باید یک دستور توقف در مقابل دستور ورود داشته باشید تا در صورت اشتباه، ترید به صورت خودکار بسته شود. بسیاری از افراد همه سرمایه‌هایشان از دست می‌دهند چون آنها فراموش می‌کنند و یا نمی‌خواهند یک دستور «توقف» در تریدشان قرار دهند. شما باید در سفارشات خرید/فروشتان یک دستور توقف قرار دهید تا به یک تریدر موفق مبدل شوید.



شکل ۵-۱: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

همیشه این سوال از من پرسیده می‌شود: چرا ۹ دوره؟ چرا ۱۰ دوره انتخاب نشده، که روزهای ترید در یک هفته یا دو هفته را منعکس می‌سازد؟ این سوال خوبی است و واقعاً هیچ پاسخ درستی برای آن وجود ندارد. زمانیکه ایچیموکو برای اولین بار در کشور ژاپن اختراع گردید، عدد نه انتخاب گردید تا روزهای ترید را برای آن دوره زمانی منعکس نماید. زمانه عوض شد و بنابراین افراد فکر می‌کنند که این مقدار نیز بایستی عوض شود. درحالیکه پیش از این افرادی دوره‌های زمانی را تغییر داده بودند، اما من هیچ تجربه‌ای با سایر دوره‌های زمانی هر یک از اجزاء اندیکاتور ایچیموکو ندارم. همچنین برای انجام این کار در آینده هم هیچ برنامه‌ای ندارم. من وقتم را برای آنالیز چارت و کار با پارامترهایی که کار کرده‌اند و در طول زمان نیز ارزش خود را اثبات نموده‌اند صرف می‌نمایم. پنج مولفه در اندیکاتور ایچیموکو وجود دارد. اگر فرمول یکی از آنها را تغییر دهید پس باید سایر فرمول‌ها را نیز تنظیم نمایید. فکر می‌کنید چند نوع ترکیب مختلف وجود خواهد داشت زمانیکه شما همه پنج مولفه این اندیکاتور را تغییر دهید؟ هزاران ترکیب مختلف برای تنکانسن، پنج نکته وجود دارد که باید خاطرنشان نمود:

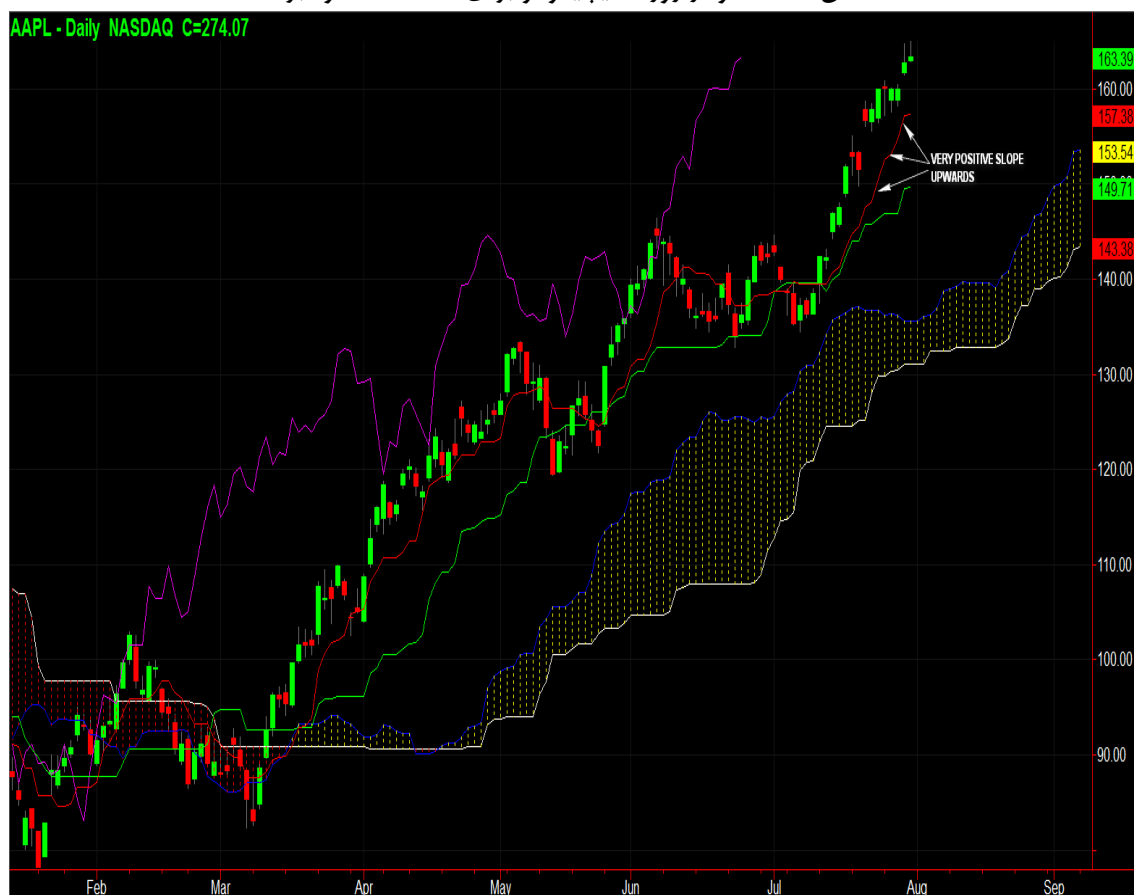
- تمایلات
- بولیش (صعودی): اگر قیمت در بالای تنکانسن باشد (شکل ۶-۱)
- بیریش (نزولی): اگر قیمت زیر تنکانسن باشد. (شکل ۷-۱)
- تنکانسن باید هم جهت با روند حرکت کند. زاویه تندتر، روند سریع‌تر. در شکل ۸-۱، تنکانسن به سمت بالا با یک زاویه تند اشاره دارد. این مسئله نشان می‌دهد کالای مورد معامله در یک روند بولیش (صعودی) قوی است.



شکل ۶-۱: نمودار روزانه ایچیموکو برای خوراک دام، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

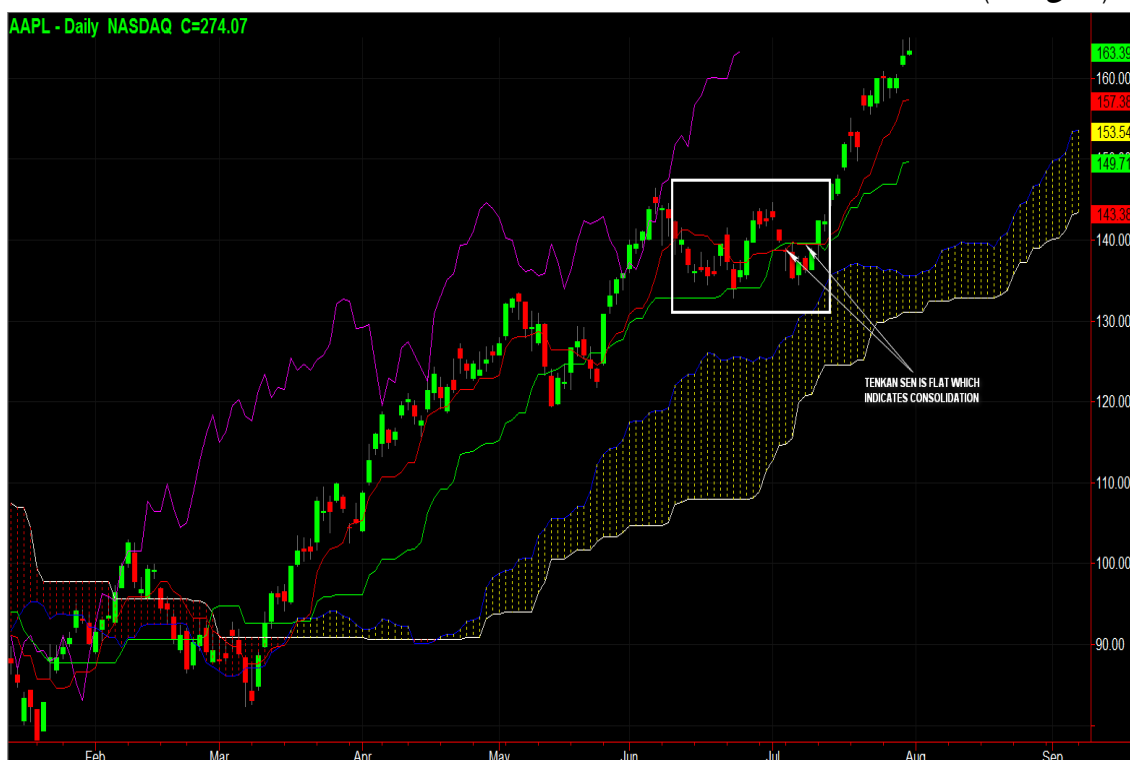


شکل ۷-۱: نمودار روزانه ایچیموکو برای BBD، ۹ نوامبر ۲۰۰۹



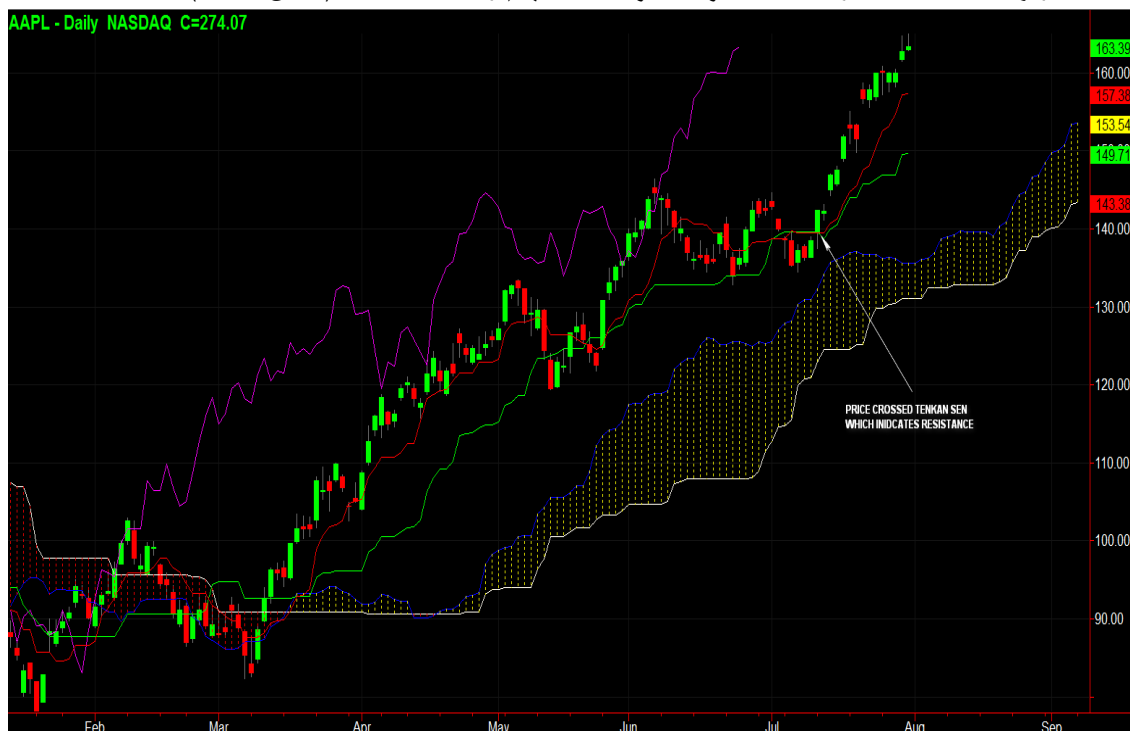
شکل ۸-۱: نمودار روزانه ایچیموکو برای AAPL، ۱ اگوست ۲۰۰۹

- اگر تنکانسن مسطح گردد، این مسئله نشان می‌دهد که قیمت ممکن است در کوتاه‌مدت روند خنثی پیدا کند. اگر در داخل یک ترید باز هستید پس باید مراقب باشید چون روند کوتاه‌مدت می‌تواند به زودی معکوس گردد (شکل ۹-۱).



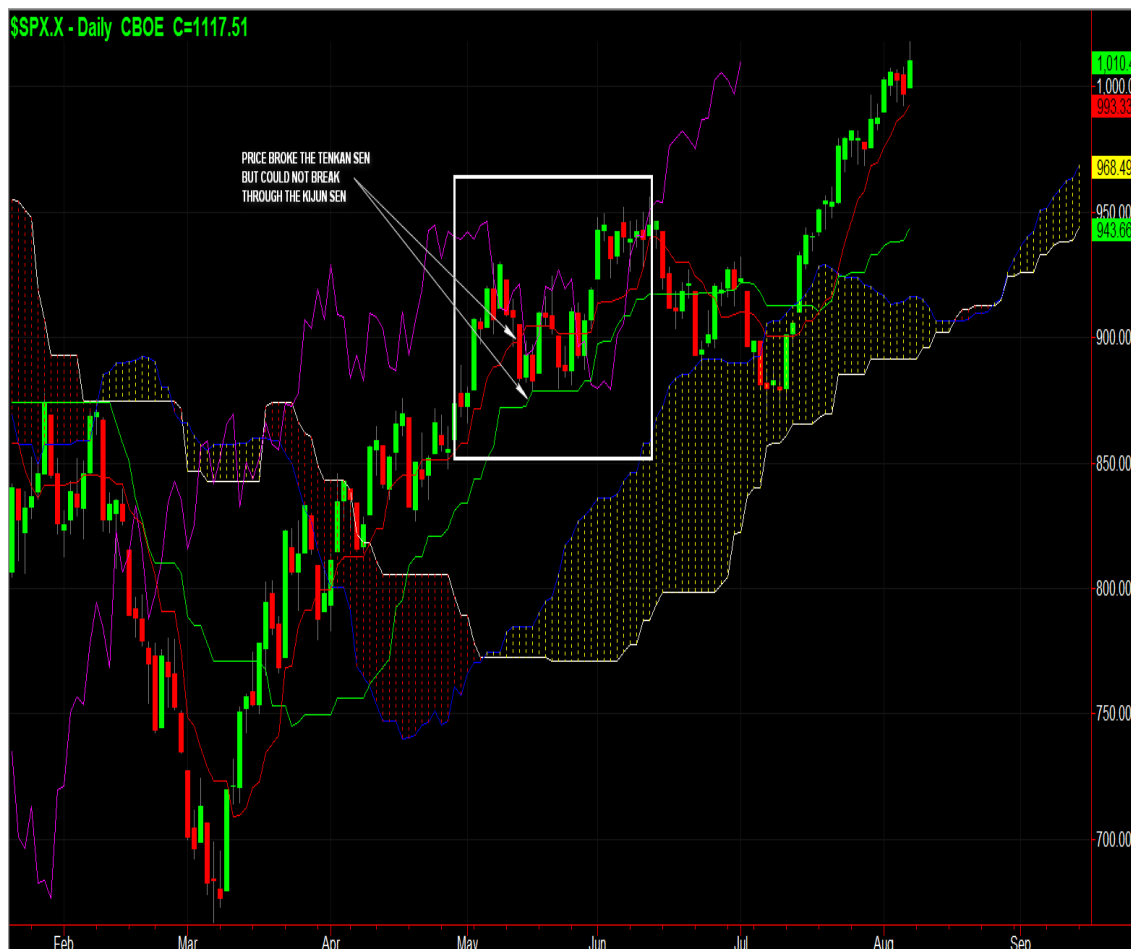
شکل ۹-۱: نمودار روزانه ایچیموکو برای AAPL، ۱ آگوست ۲۰۰۹

- تنکانسن یک حمایت/مقاومت کوتاه مدت است. زمانی که قیمت تنکانسن را قطع می‌کند این مسئله امری مهم است زیرا قیمت یک مقدار حمایت/مقاومت کوتاه‌مدت مهم را شکسته است (شکل ۱۰-۱)



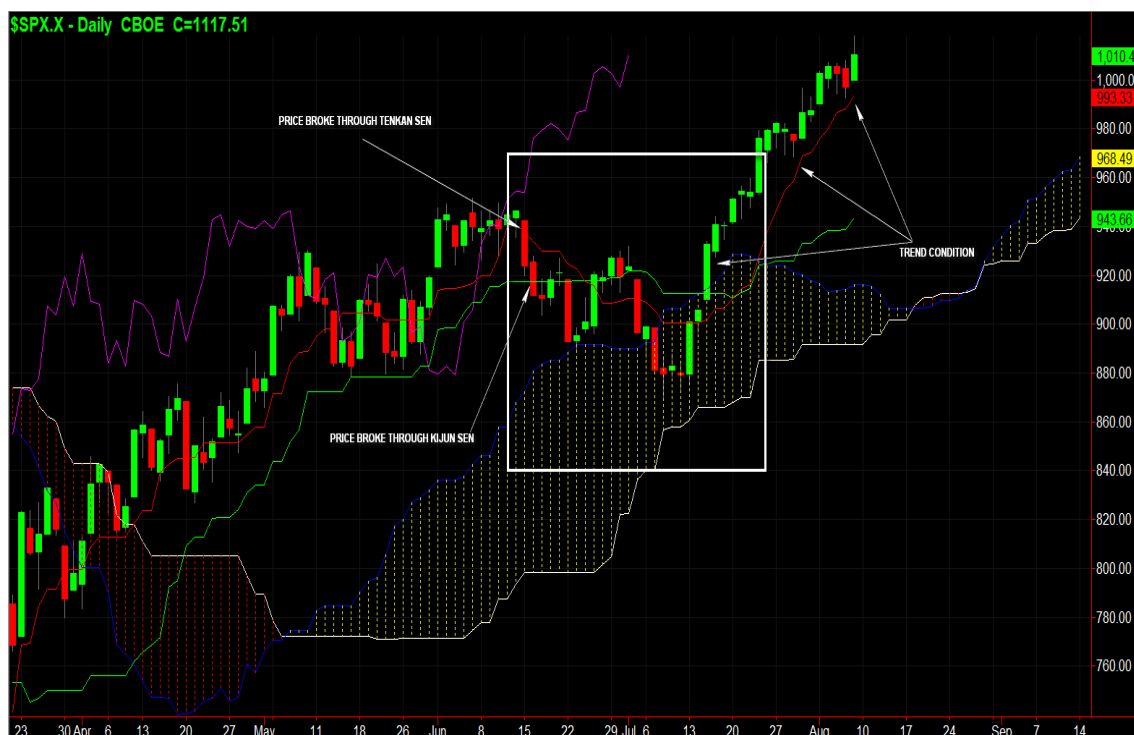
شکل ۱۰-۱: نمودار روزانه ایچیموکو برای AAPL، ۱ آگوست ۲۰۰۹

- در یک روند، اگر قیمت تنکانسن را در جهت مخالف روند قطع کند، این مسئله نشان می‌دهد که سه حالت مختلف می‌تواند رخ دهد:
- پولبک جزئی کوتاه‌مدت: یک پولبک جزئی جایی است که قیمت تنکانسن را قطع می‌کند اما هرگز کیجنسن را قطع نکند. بعد از اینکه قیمت تنکانسن را قطع کند، سپس قیمت مسیر اصلی و اولیه روند را ادامه خواهد داد (شکل ۱۱-۱). این حالت عموماً زمانی رخ می‌دهد که تریدرهای کوتاه‌مدتی سود خود را از بازار می‌گیرند. تریدرهای بلندمدت موقعیت حال حاضر خودشان در بازار را حفظ می‌نمایند.



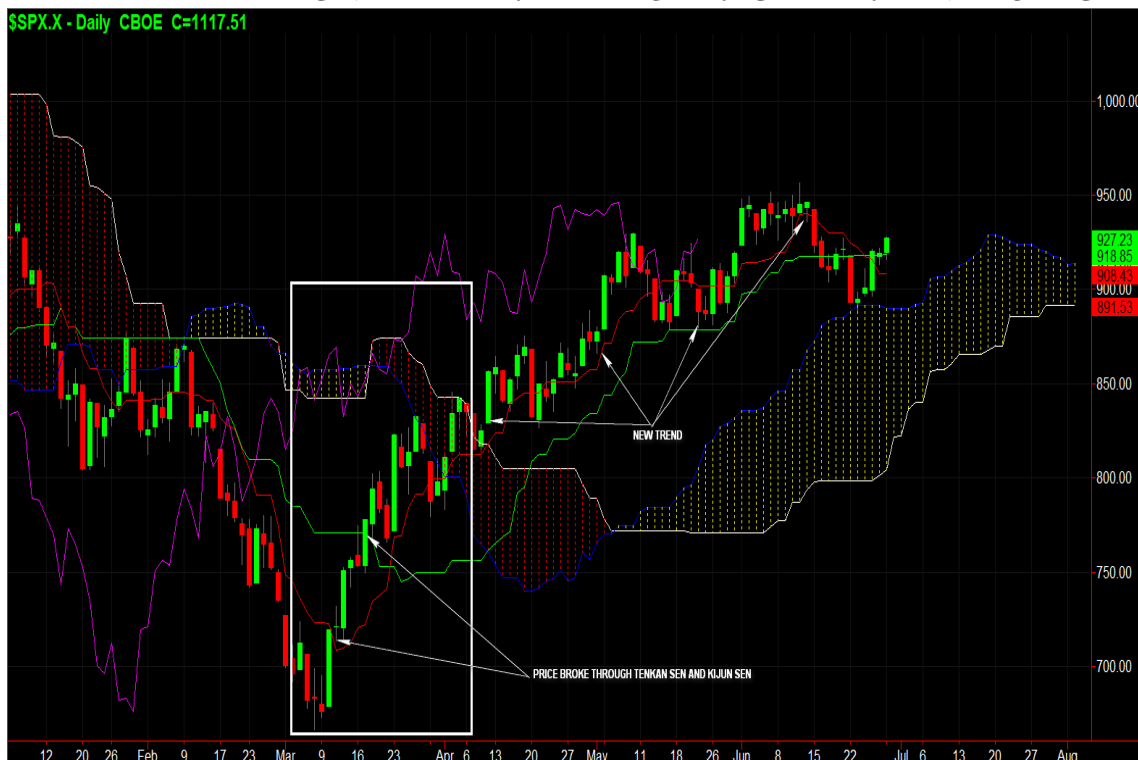
شکل ۱۱-۱: نمودار روزانه ایچیموکو برای SPX، ۷ آگوست ۲۰۰۹

- پولبک کوتاه مدت مهم: در یک پولبک مهم قیمت، تنکانسن و کیجنسن را در جهت مخالف روند قطع خواهد کرد. زمانی که این حالت رخ دهد، در نهایت قیمت با قطع کردن هر دوتای آنها در جهت روند اصلی دوباره باز خواهد گشت (شکل ۱۲-۱). در این حالت، تریدرهایی با موقعیت بلندمدت مقداری از سود خود را خواهند گرفت. آنها هرگز از همه پوزیشن خود خارج نخواهند شد زیرا آنها اعتقاد دارند که این کالا (سهم/ارز) به روند اصلی بعد از این که پولبک اصلی خاتمه یابد، ادامه خواهد داد.



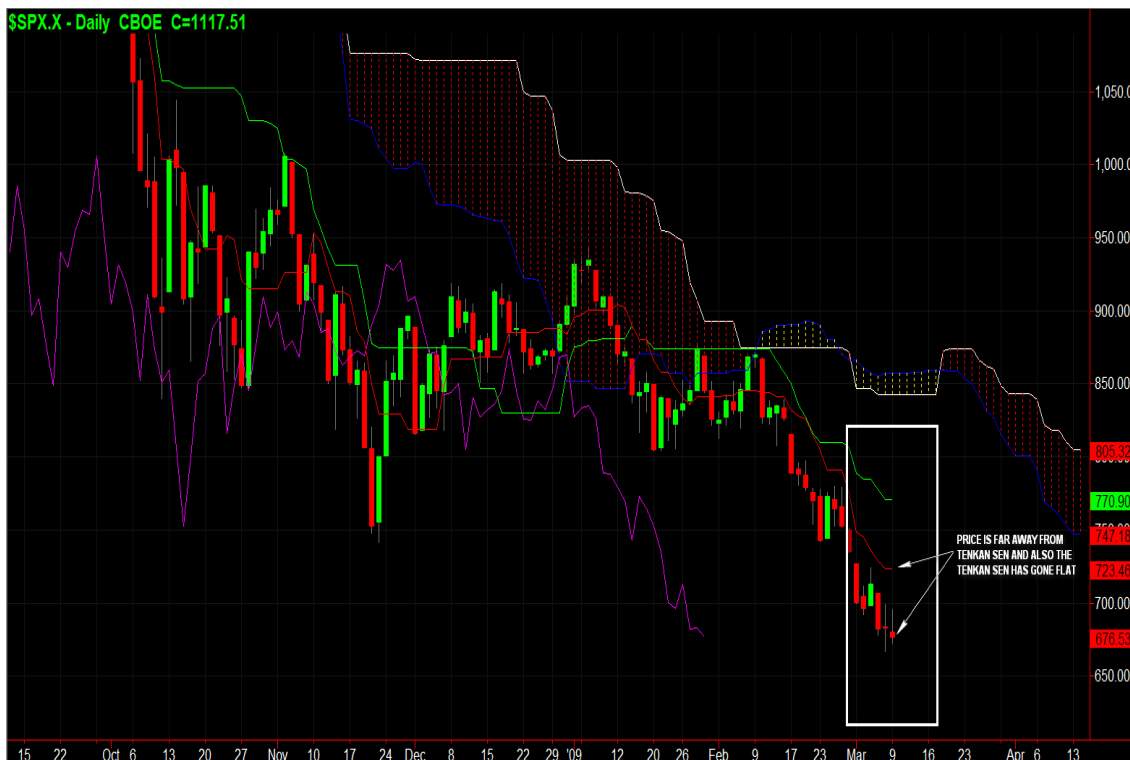
شکل ۱۲-۱: نمودار روزانه ایچیموکو، SPX، ۷ آگوست ۲۰۰۹

- برگشت روند: سومین حالت شبیه به حالت دوم است که قیمت هم تتکانسن و هم کیجنسن را قطع می‌کند. تقاطع در جهت عکس روند رخ خواهد داد. هرچند، روند اصلی هرگز دوباره از سرگرفته نخواهد شد. در این حالت کالا (سهم/ارز) یا وارد یک الگوی تثبیت (سایدوی) می‌شود و یا روند جدیدی شکل می‌گیرد (شکل ۱۳-۱). در این حالت، تریدرهای بلندمدت از پوزیشن‌هایشان به طور کامل خارج می‌شوند. آنها این کار را می‌توانند یا در یک دوره زمانی خاص انجام دهند و یا در برخی موارد این کار را به صورت کامل انجام می‌دهند.



شکل ۱۳-۱: نمودار روزانه ایچیموکو، SPX، ۲۹ ژوئن ۲۰۰۹

- تکناسن باید نزدیک به قیمت باشد. اگر قیمت و تکناسن نزدیک به یکدیگر باشند، پس روند به طور آهسته و بدون هیچ تداخل در حال صعود/نزول ملایم می‌باشد. اگر قیمت از تکناسن فرار کند، پس شانس زیادی وجود دارد که قیمت پولبک کند و تلاش نماید تا دوباره به تکناسن برخورد کند زیرا در این حالت قیمت از تعادل بسیار خارج شده است. شکل ۱-۱۴ توضیح مناسبی از این حالت می‌باشد. گاهی اوقات، ممکن است قیمت حتی تمام راه با کیجنسن و یا حتی تا بعد از کیجنسن برای ایجاد یک پولبک اصلی یا یک برگشت روند مسافتی را با هم طی نمایند. بنابراین، باید زمانیکه قیمت از تعادل با تکناسن خارج می‌شود، مراقب بود.



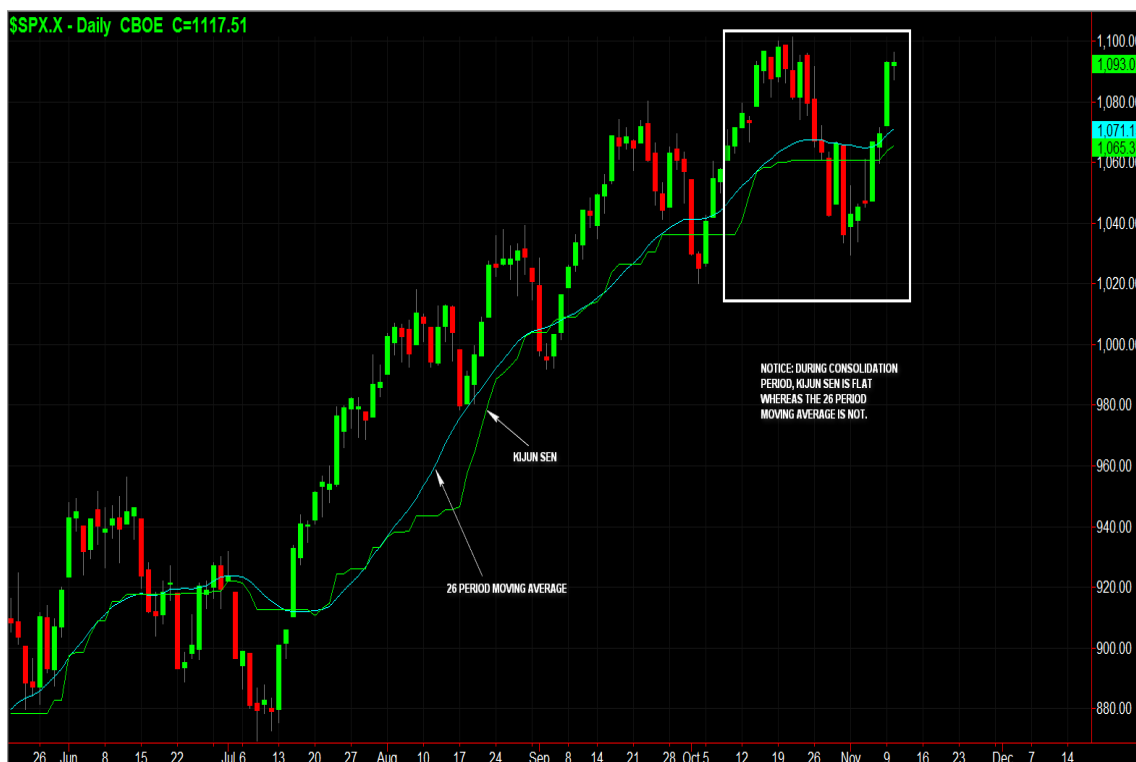
شکل ۱-۱۴: نمودار روزانه ایچیموکو، SPX، ۹ مارس ۲۰۰۹

کیجنسن:

دومین اندیکاتوری که شرح می‌دهم، کیجنسن است. کیجنسن حرکت میان مدت قیمت را نشان می‌دهد. بنابراین، کیجنسن برای تریدرها در بازار دارای اهمیت زیادی می‌باشد. رنگی که کیجنسن به وسیله آن نمایش داده می‌شود، سبز است. فرمول کیجنسن عبارت است از:

$$\text{کیجنسن} = \frac{\text{پائین ترین قیمت} + \text{بالا ترین قیمت}}{2}$$

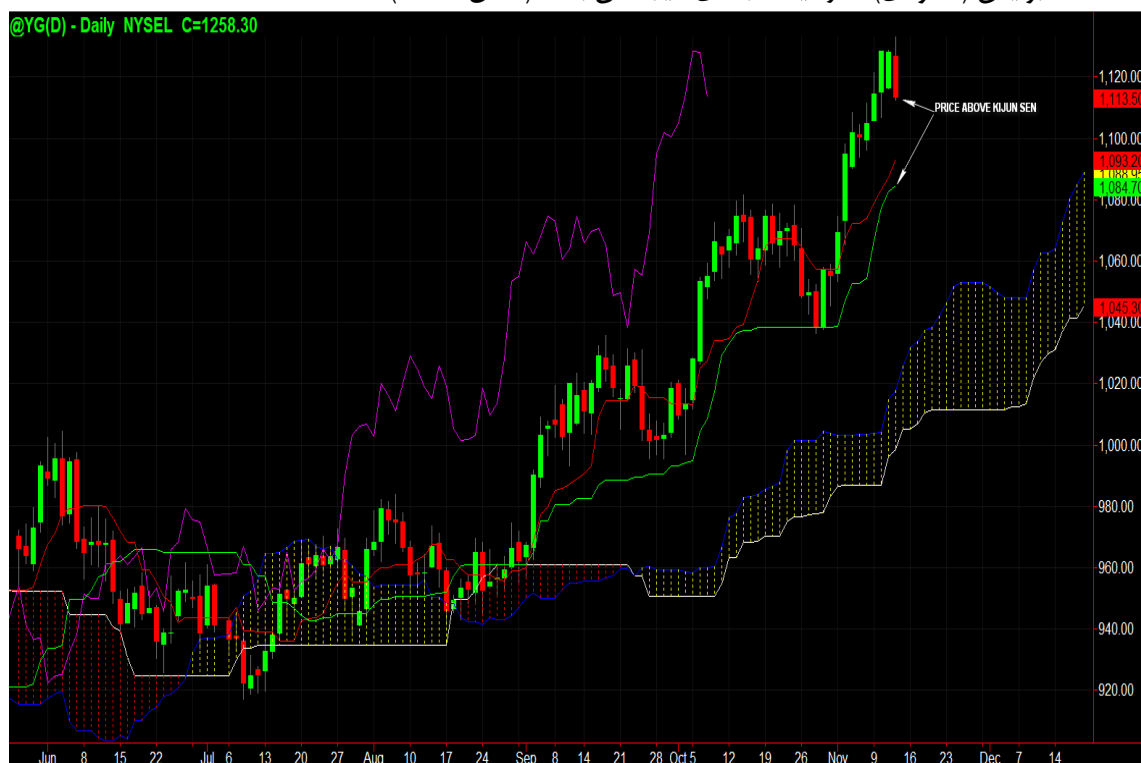
کیجنسن شبیه میانگین متحرک ۳۰ دوره‌ای می‌باشد که اکثر تریدرهای جزء و موسسات از آن استفاده می‌کنند (شکل ۱-۱۵). درست مانند تکناسن، کیجنسن بر اساس «بالا ترین قیمت‌ها» و «پائین ترین قیمت‌ها» می‌باشد. به جای ۹ دوره تکناسن، کیجنسن بر اساس ۲۶ دوره می‌باشد. برای تایم فریم روزانه، کیجنسن تقریباً یک ماه (و یک هفته و یک روز معامله) را نشان می‌دهد، درحالیکه تکناسن تقریباً $\frac{1}{2}$ هفته (که شامل تعطیلات آخر هفته در چارت نیست) را نشان می‌دهد. به همین دلیل است که تعطیلات آخر هفته را محاسبه نمی‌نمایم.



شکل ۱-۱۵: نمودار روزانه ایچیموکو، SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

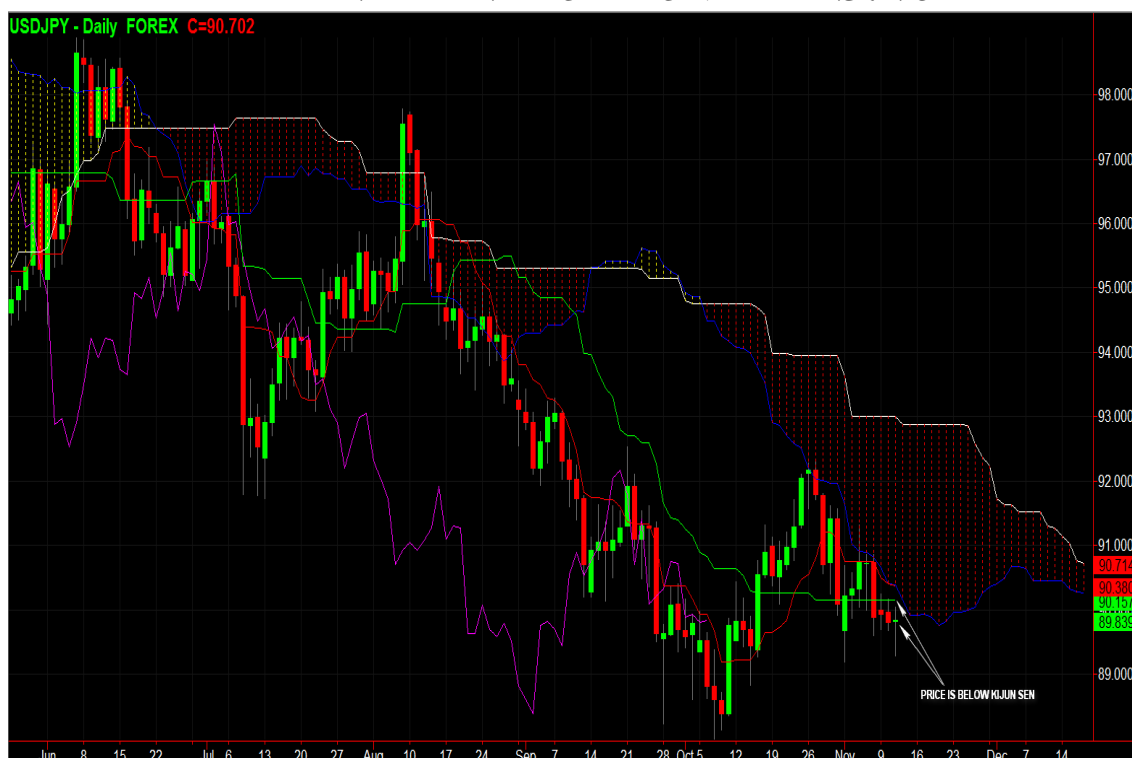
کیجنسن یکی از اندیکاتورهای اصلی سیستم ایچیموکو می باشد. بسیاری از استراتژی های ایچیموکو حول این اندیکاتور متمرکز است. اینجا مطالبی که باید در مورد کیجنسن بیان نمود را خاطرنشان می سازیم:

- تمایلات بازار
- بولیش (صعودی): اگر قیمت بالای کیجنسن باشد (شکل ۱۶-۱)



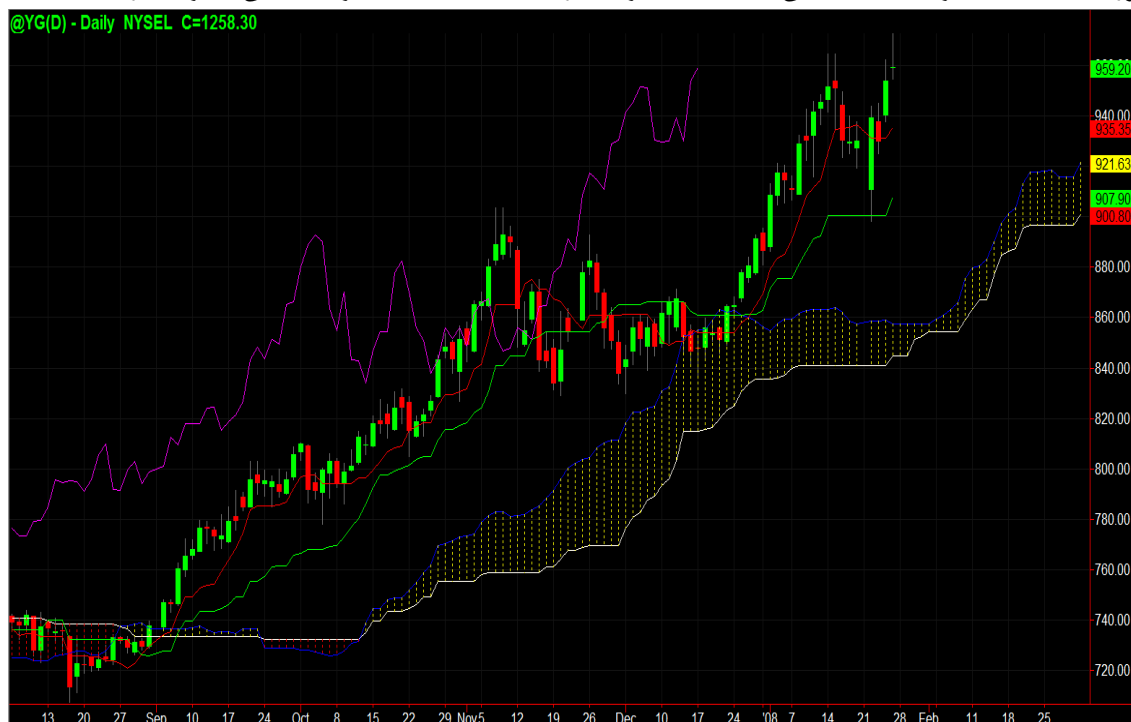
شکل ۱۶-۱: نمودار روزانه ایچیموکو از حساب طلای مینی آتی

- بیریش (نزولی): اگر قیمت پائین کیجنسن باشد (شکل ۱۷-۱)



شکل ۱۷-۱: نمودار روزانه ایچیموکو از USDJPY، ۱۱ نوامبر ۲۰۰۹

- کیجنسن باید در همان جهتی که روند در حال حرکت است، حرکت نماید. شیب تندتر، به معنای روند قوی تر است. در شکل ۱۸-۱، کیجنسن مسطح است و سپس شروع به حرکت به سمت بالا می کند. کیجنسن فقط زمانی به سمت بالا حرکت می کند که قیمت حال حاضر بالاتر از میانگین «بالاترین بالاها» و «پائین ترین پائین های» ۲۶ دوره گذشته باشد. برخلاف تنکانسن، قیمت باید حرکات زیادی داشته باشد تا بر کیجنسن تاثیر بگذارد.

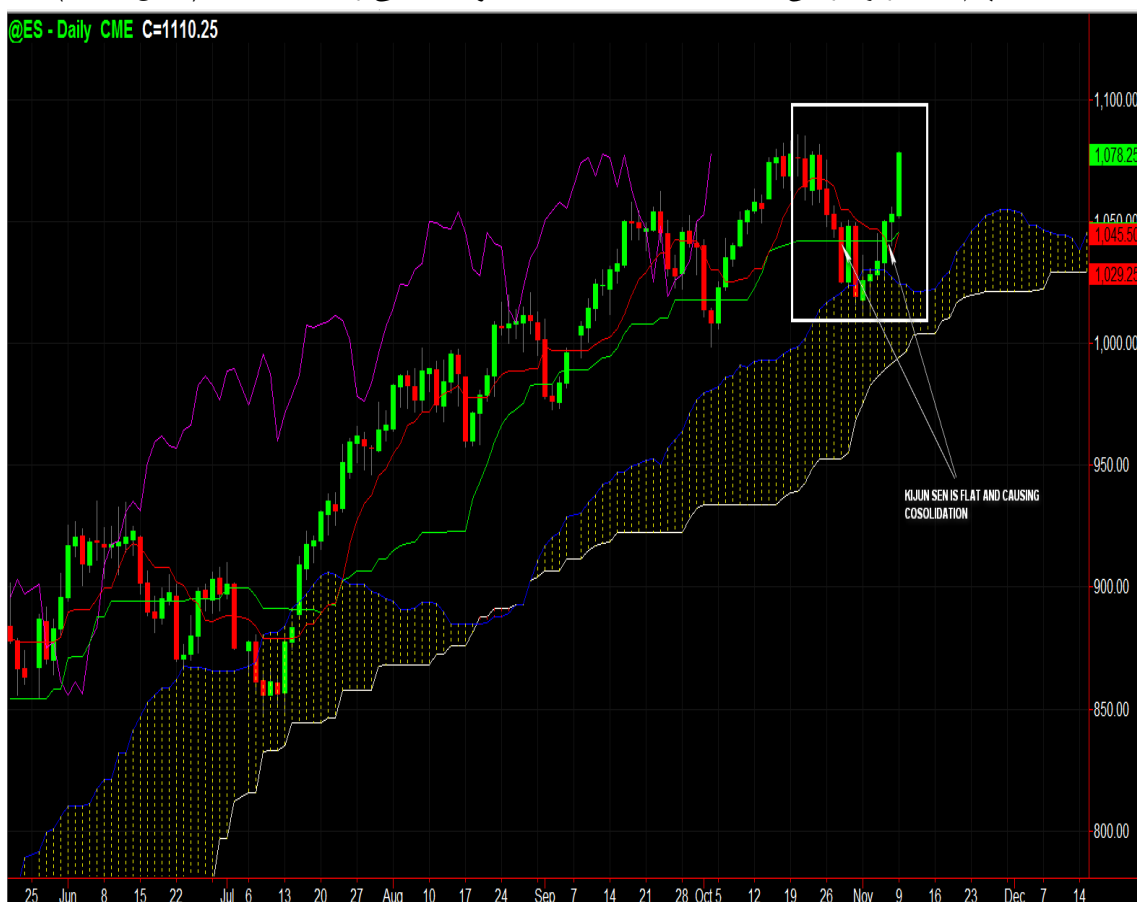


شکل ۱۸-۱: نمودار روزانه ایچیموکو از طلای مینی آتی

در زمان استفاده از کیجنسن، می‌دانیم که قیمت باید برای یک دوره ۲۶ دوره‌ای محاسبه شود. این حرف به چه معنی است؟ آیا شروع روند را از دست خواهیم داد؟ پاسخ به این سوال، بله است. قطعاً آغاز روند را از دست خواهیم داد زیرا منتظر می‌مانیم تا روند خودش را تثبیت کند. چرا اگر از لحاظ قیمتی اثبات نشود امکان وجود روند وجود دارد، در معرض ریسک و خطر قرار می‌گیریم؟ اگر وارد تریدی شویم که روند نداشته باشد، پس روند ما در این صورت باید در حالت سایدوی یا تثبیت باشد. در حالت تثبیت و سایدوی، حساب شما به صورت مثبت و منفی نوسان خواهد نمود.

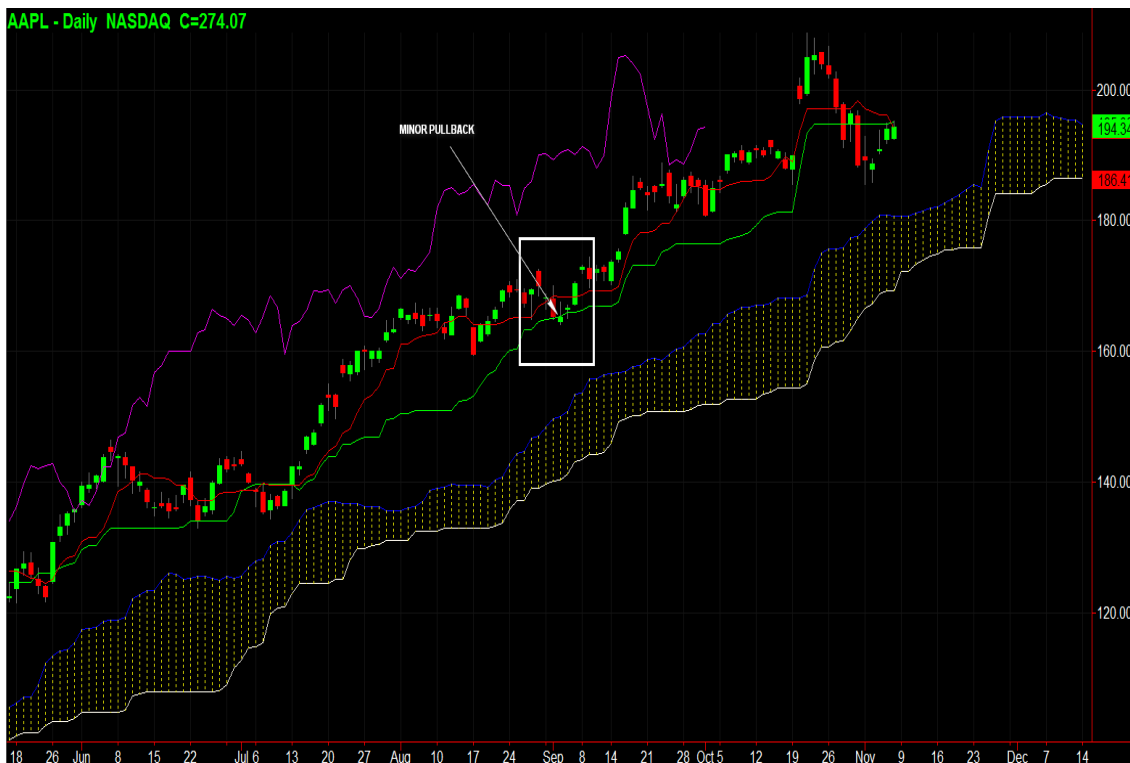
- هنگامیکه کیجنسن مسطح و صاف است، این امر نشان‌دهنده این است که قیمت در حالت تثبیت و سایدوی است و روند ندارد (شکل ۱۹-۱)

- کیجنسن یک حمایت/مقاومت اصلی و کلیدی است. زمانی که قیمت کیجنسن را قطع می‌کند، این تقاطع مسئله‌ای مهم است زیرا در این حالت قیمت یک حمایت/مقاومت اصلی را شکسته است (شکل ۱۹-۱).



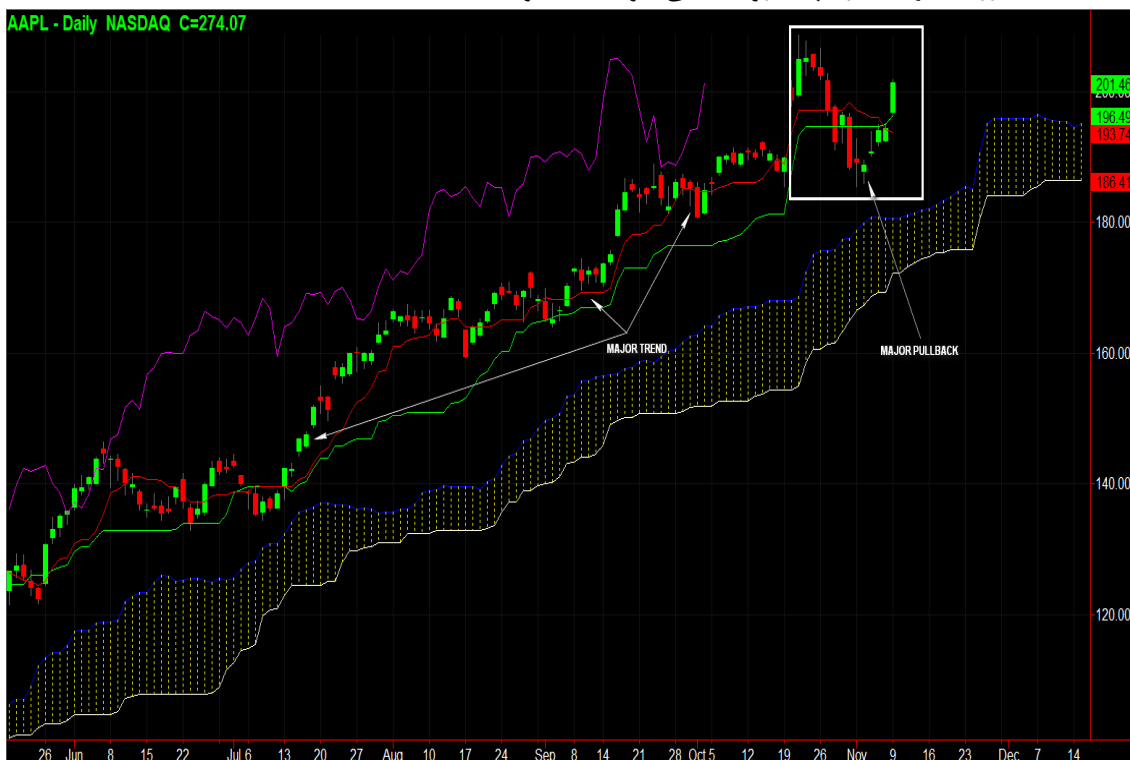
شکل ۱۹-۱: نمودار روزانه ایچیموکو S&P مینی فیوچر، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- زمانی که قیمت کیجنسن را قطع می‌کند، نشان‌دهنده این است که ممکن است تغییر روند رخ دهد. این امر یک مسئله کلیدی جهت تعیین امکان بروز قریب‌الوقوع یک پولبک اصلی یا برگشت روند می‌باشد. اگر قیمت کیجنسن را قطع نکند، هیچ یک از این دو حالت نمی‌تواند رخ دهد (شکل ۱۹-۱).
- با کراس قیمت و کیجنسن، یکی از سه حالت زیر ممکن است رخ دهد:
- پولبک جزئی: قیمت از روی کیجنسن می‌جهد و به مسیر روند اصلی ادامه می‌دهد. برخی افراد سود را در این حالت برداشت می‌کنند، اما اکثر «بازیگران» هنوز پوزیشن‌هایشان را حفظ کرده‌اند و احتمالاً اکنون پوزیشن‌هایشان را با پولبک مینور افزایش می‌دهند. در این حالت تریدرها واقعاً اعتقاد دارند که روند به طور قوی ادامه خواهد یافت (شکل ۲۰-۱).



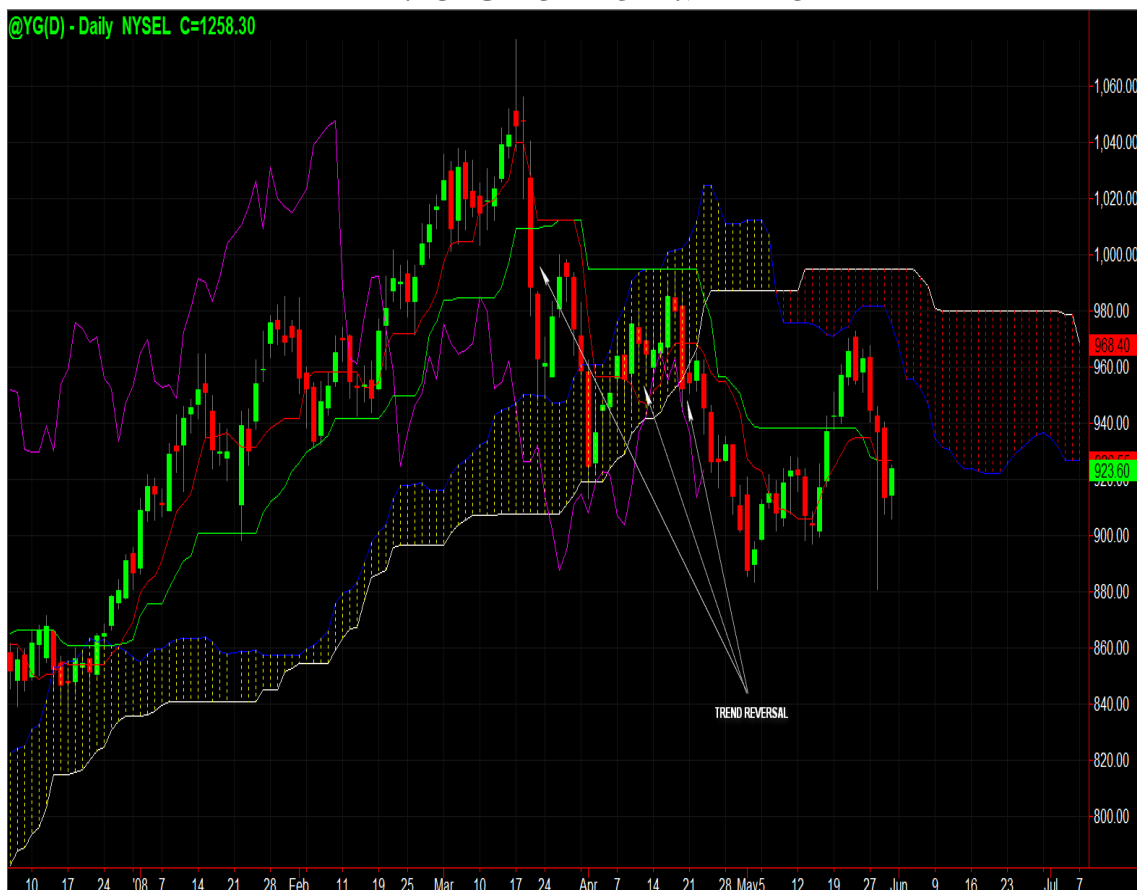
شکل ۲۰-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AAPL، ۶ نوامبر ۲۰۰۹

- پولبک اصلی: قیمت کیجنسن را در خلاف جهت روند قطع نماید و در نهایت دوباره کیجنسن را در جهت روند قبلی قطع نماید، تا روند اصلی که در حال رخ دادن است ادامه یابد. (شکل ۲۱-۱). تریدرهای بلندمدت مقداری سود از این حرکت کسب نموده‌اند اما آنها هنوز مقداری پوزیشن باز دارند زیرا باور دارند کالا/ارز به حرکت در جهت روند اصلی خود ادامه خواهد داد.



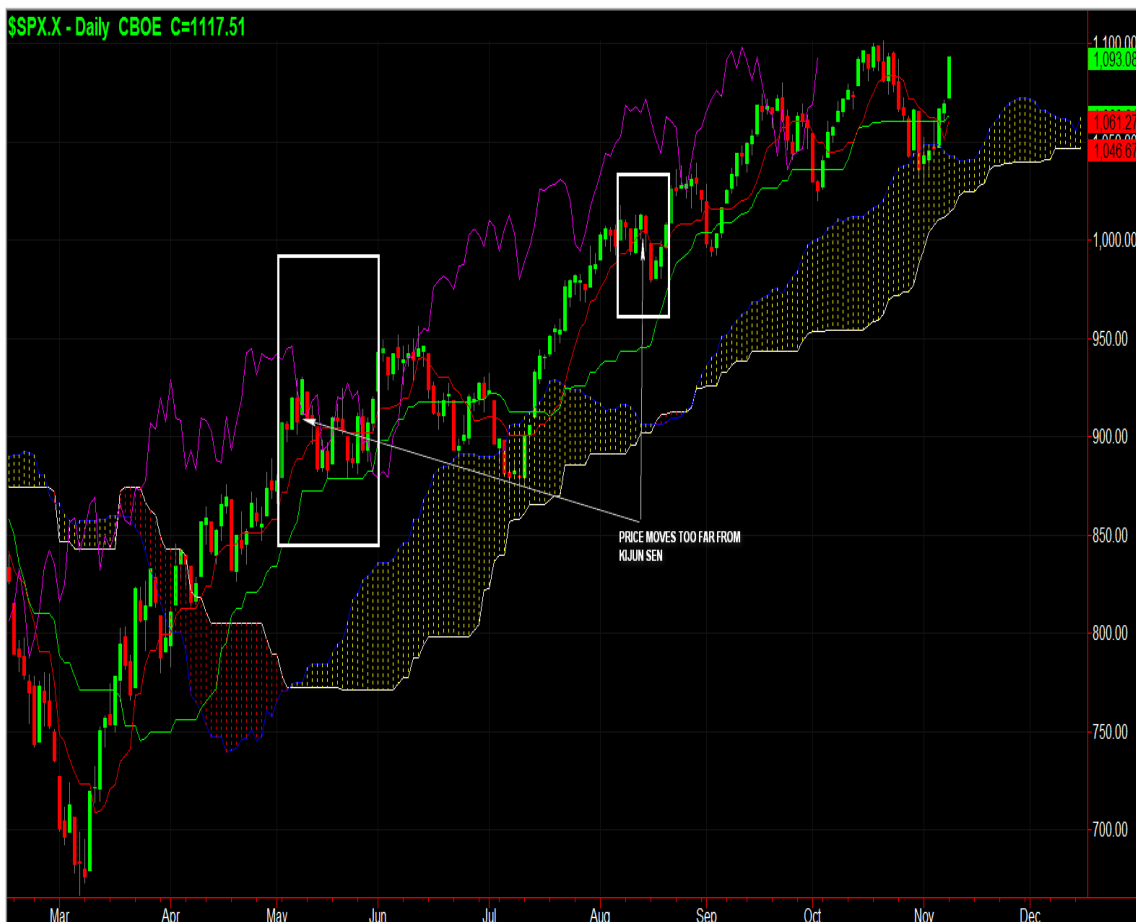
شکل ۲۱-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AAPL، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- برگشت روند: قیمت یکبار کیجنسن را قطع می کند و سپس هرگز مجدداً کیجنسن را برای ادامه روند اصلی قطع نخواهد کرد (فقط یکبار کیجنسن را در خلاف جهت روند اصلی قطع می کند). در این صورت، کالا/ارز وارد دوره تثبیت (سایدوی) شده و یا اینکه باعث برگشت روند می شود (شکل ۱-۲۲). اکثر تریدرهای بلندمدت در این حالت از پوزیشن هایشان خارج می شوند.



شکل ۱-۲۲: نمودار روزانه ایچیموکو مینی گلد فیوچرز، ۳۰ می ۲۰۰۸

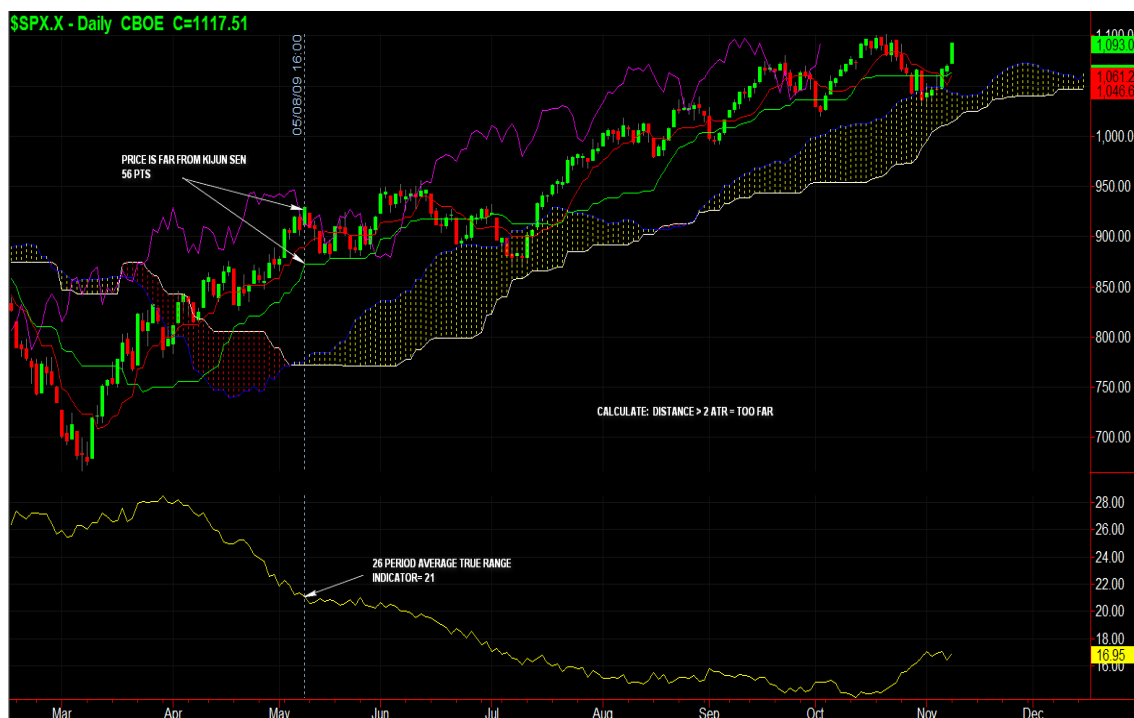
- کیجنسن باید نزدیک قیمت باشد. زمانی که قیمت از کیجنسن خیلی فاصله می گیرد، این مسئله نشاندهنده این است که قیمت با نرخ سریع تری نسبت به کیجنسن حرکت نموده است (شکل ۱-۲۳). یک روند خوب، روندی است که قیمت و کیجنسن با نرخ ثابتی نسبت به هم حرکت نمایند. از آنجائیکه کیجنسن ۲۶ روز را نشان می دهد، احتمال زیادی وجود دارد که قیمت از کیجنسن به دلیل وجود یک پولبک اصلی و یا حتی برگشت روند دور شود.



شکل ۲۳-۱: نمودار روزانه ایچیمو کو SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

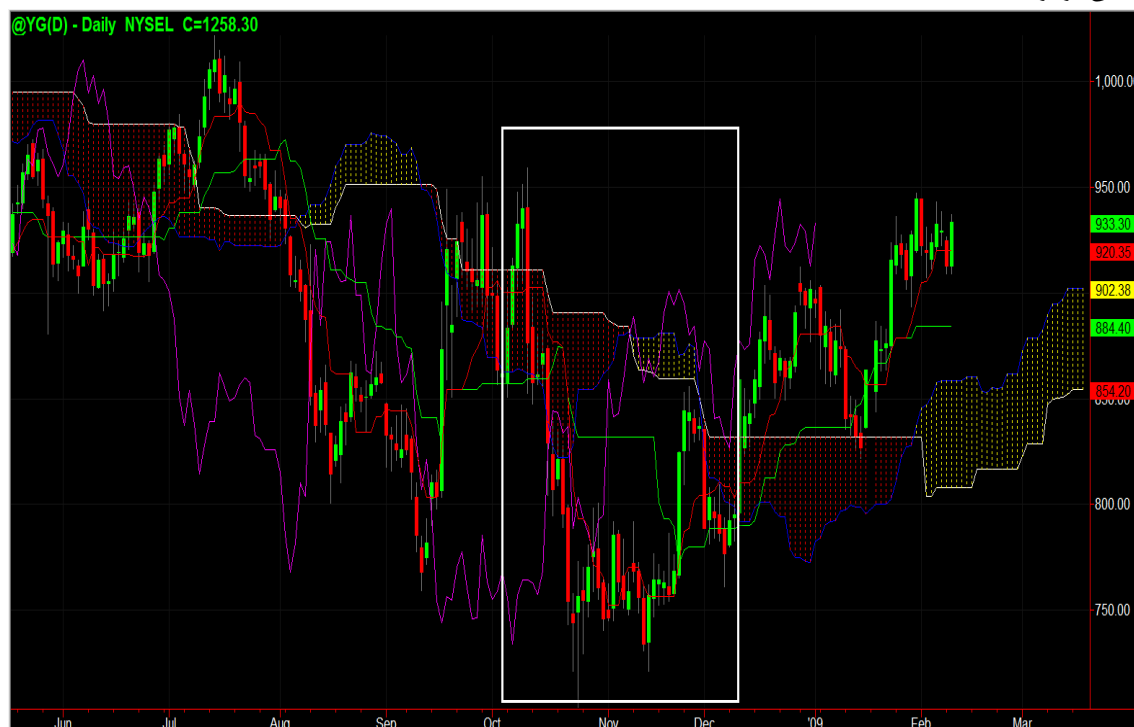
از این جهت، کیجنسن بر اساس ۲۶ دوره چقدر باید از قیمت فاصله داشته باشد؟ برای تعیین مقدار «فاصله»، می‌توانید به زمان‌های قبل (تاریخچه، میله‌های قیمت پیشین) در پولبک‌های اصلی دیگر بازگردید و زمانیکه روند معکوس شده مراجعه کنید و مشخص نمائید قیمت نسبت به کیجنسن چقدر از هم فاصله گرفته‌اند. شکل ۲۳-۱ مثالی بیان می‌نماید که چطور به نمودارهای قبلی نگاه کنید تا مقدار و میزان «فاصله» این دو از هم را مشخص نمایید. مشکل نگاه کردن به نمودارهای قبلی برای تعیین مقدار قطعی «فاصله» این است که این فاصله نسبت به «زمان» متفاوت است. زمان‌هایی که فراریت بازار بالا است این اعداد نسبت به زمانی که فراریت بازار پائین است، بزرگتر خواهد بود. بنابراین، نیاز است مقدار «فاصله» متناسب با فراریت بازار تنظیم گردد.

برخی از تریدرها از اندیکاتورهای فراریت بازار مانند میانگین دامنه صحیح (Average True Range) استفاده می‌نمایند. شکل ۲۴-۱ نشان می‌دهد چطور قیمت در ۸ ژوئن ۲۰۰۹ از $2 \times ATR$ بزرگتر شد و پولبک رخ داده است. بنابراین، می‌توان قانونی وضع نمود که اگر قیمت بیشتر یا مساوی $2 \times ATR$ باشد، پس می‌توان قیمت را «دور و فاصله‌دار» از کیجنسن در نظر گرفت.



شکل ۲۴-۱: نمودار روزانه ایچیموکو SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

بیا بید به مثال دیگری برای درک رابطه قیمت و کیجنسن نظر بیا فکنیم. در شکل ۲۵-۱ می‌توانید ملاحظه نمائید قیمت افت نموده و روند بیریش (نزولی) ادامه می‌یابد. زمانیکه روند در حال ادامه می‌باشد، کیجنسن به سمت پائین حرکت نموده است. بعداً، کیجنسن به حالت فلت و مسطح درآمده، که نشان می‌دهد قیمت به حالت تثبیت و سایدوی درآمده است. از آنجایی که کیجنسن برای مدت زمان طولانی به حالت مسطح باقی می‌ماند، کیجنسن، قیمت و تکناسن را وادار می‌نماید تا به جای اینکه کیجنسن حرکت روند نزولی‌اش را از سرگیرد، «به کیجنسن برخورد نماید و به سمت کیجنسن برگردد».



شکل ۲۵-۱: نمودار روزانه ایچیموکو مینی گلد فیوچرز، ۱۰ فوریه ۲۰۰۹

از این نقطه به بعد، رابطه قیمت و تنکانسن و سپس قیمت و کیجنسن را مورد بحث قرار خواهیم داد. اکنون، بیایید همه این اجزاء سیستم ایچیموکو را کنار هم قرار دهیم تا رابطه بین قیمت، تنکانسن و کیجنسن را مورد بحث قرار دهیم. قیاسی که مایلیم در کلاسم برای بهترین شرح رابطه بین این متغیرها استفاده نمایم این است که یک زوج همراه کودکشان برای قدم زدن به پارکی رفته‌اند. نام این زوج جان و مری و نام فرزندشان بن است. بن قیمت است، جان کیجنسن و مری تنکانسن است. در ابتدا، وقتی که سفر این خانواده در پارک آغاز می‌گردد، هر سه نفر در کنار هم هستند. آنها در یک جهت همراه با هم در حال قدم زدن هستند. بن، مانند اکثر بچه‌ها، به طور مداوم تلاش می‌کند تا سریع‌تر از والدینش حرکت کند. هرچند، هم مری و هم جان، سعی می‌کنند بن را در مسیر صحیح قرار دهند و همیشه او را نزدیک به خودشان نگهدارند. بعد از مدتی، از محل کار جان تماس تلفنی مهمی برقرار می‌شود. در زمان خوردن زنگ تلفن جان، همگی در کنار هم هستند. هرچند، بعد از مدتی، حرکت جان به دلیل تماس تلفنی‌اش آهسته‌تر می‌شود. جان همانطور که آهسته‌تر حرکت می‌کند، در حال دنبال نمودن مری و بن نیز می‌باشد. مری و بن به قدم زدن و حرکت با سرعت معمول‌شان ادامه می‌دهند این امر باعث می‌شود آنها به تدریج جلوتر از جان در حال حرکت باشند. آنها به این دلیل از جان سبقت می‌گیرند چون مکالمه تلفنی، قدم زدن و حرکت آرام آنها را مختل می‌سازد بنابراین آنها خواهان ایجاد مقداری فضا بین جان و خودشان می‌شوند. همانطور که تماس تلفنی ادامه می‌یابد، جان بیشتر و بیشتر از مری و بن دور می‌شود. این امر حالت‌های متفاوتی برای قدم زدن و حرکت آنها ایجاد می‌نماید. این حالت‌ها به صورت زیر می‌باشند.

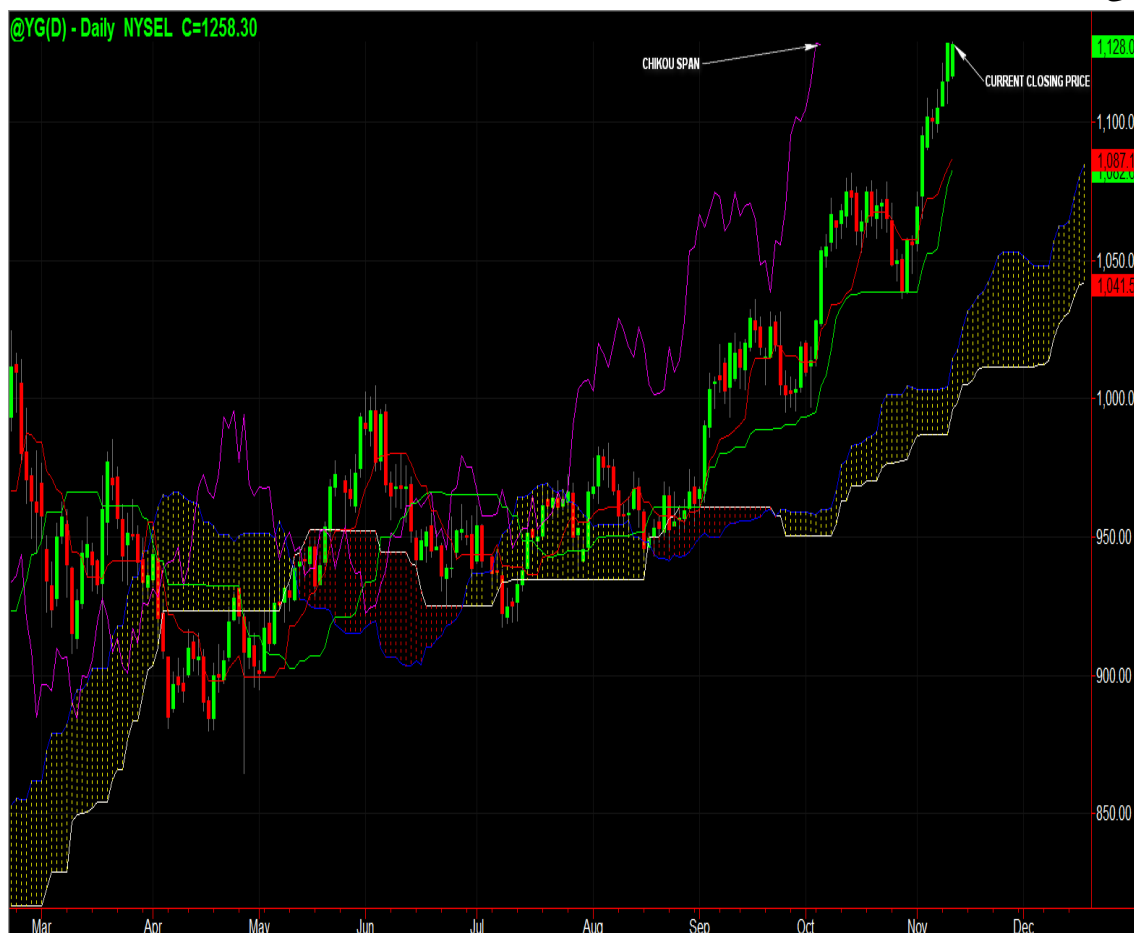
اولین حالت این است که جان تصمیم می‌گیرد آهسته حرکت کند به امید اینکه بتواند بعداً به هر دوی آنها - مری و بن - برسد. هرچند همانطور که زمان می‌گذرد، مری و بن آنقدر از او دور خواهند شد که دیگر قادر نخواهند بود جان را ببینند. این امر باعث ایجاد مشکل بزرگی خواهد شد زیرا اکنون مری باید برای خودش تصمیماتی اتخاذ نماید. یک گزینه این است که هم مری و هم بن هر دو متوقف شوند و منتظر بن بمانند تا به آنها برسد. با این فرض که جان حرکت و راه رفتنش را به طور کامل متوقف ننموده است. هیچ راهی وجود ندارد که مری متوجه این مسئله شود زیرا جان در حوزه دید او نیست. دوم، مری می‌تواند به بن اجازه دهد تا به حرکتش اندکی جلوتر از وی ادامه دهد و در عین حال او با سرعت آهسته‌تری حرکت کند، با این امید که جان به او برسد. اگر بن بسیار از مری دور شده باشد، مری به بن اعلام خطر خواهد کرد که بایستد تا مری بتواند به وی برسد و یا مری به بن خواهد گفت که به سمت او بیاید. زمانی که یکی از این وقایع رخ دهد، بن و مری مجبور خواهند شد منتظر جان بمانند تا جان به آنها برسد. اگر جان برای مدت زمان طولانی به دنبال آنها نیاید، مری مجبور خواهد شد چنین فرض کند که جان حرکتش را به طور کامل متوقف کرده بنابراین آنها باید به سمت عقب برگردند تا جان را پیدا کنند. زمانی که آنها جان را یافتند، آنها مجبورند تصمیم بگیرند که آیا می‌خواهند به حرکتشان در پارک ادامه دهند و یا به خانه برگردند.

دومین سناریو این است که جان تصمیم می‌گیرد به دلیل تماس تلفنی‌اش به طور کامل بایستد. مری می‌بیند جان ایستاده اما مری و بن هر دو به حرکتشان به سمت جلو ادامه می‌دهند. زمانی که آنها به نقطه‌ای خاص می‌رسند و دیگر نمی‌توانند جان را ببینند، توقف خواهند کرد و به جایی که جان حرکتش را متوقف نموده باز خواهند گشت.

این دو مثال فقط دو نمونه از چندین سناریوی مختلفی هستند که در این مثال می‌تواند رخ دهد. شما باید در مورد همه آنها فکر کنید زیرا این امر به شما چشم‌انداز عمیقی در مورد رابطه قیمت، کیجنسن و تنکانسن خواهد داد. می‌توانید یک مرحله جلوتر رفته و می‌توانید مفهوم پولبک را نیز به این مثال مرتبط سازید.

چیکواسپن:

سومین اندیکاتوری که مورد بحث قرار خواهیم داد چیکواسپن است (شکل ۲۶-۱). چیکواسپن مومنتیوم (شتاب و جنبش) قیمت است. به عبارت دیگر، چیکواسپن می‌گوید یک روند می‌تواند رخ دهد و یا می‌تواند رخ ندهد. به خاطر داشته باشید، روند عبارت از حرکت بلندمدت قیمت در یک جهت خاص می‌باشد. رنگی که چیکواسپن را نشان می‌دهد، ارغوانی است.

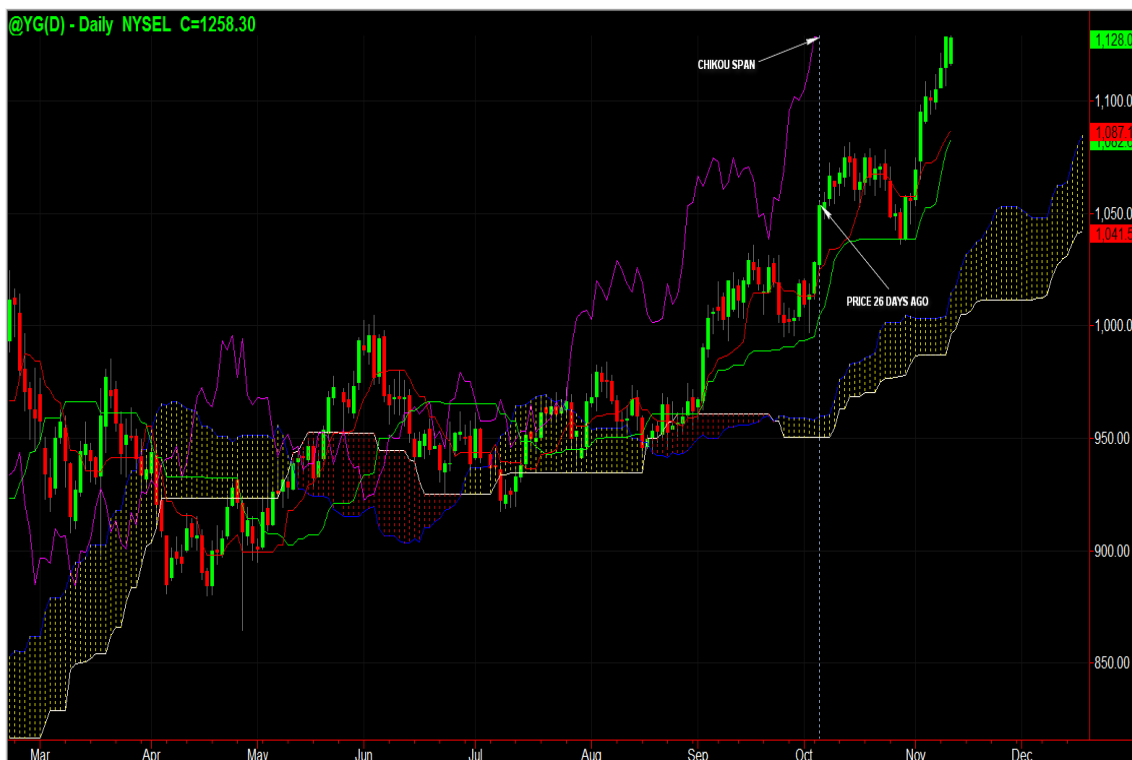


شکل ۲۶-۱: نمودار روزانه ایچیموکو مینی گلد فیوچرز، ۱۰ نوامبر ۲۰۰۹

فرمول چیکواسپن عبارت است از:

قیمت‌های حال حاضر که به ۲۶ دوره قبل تغییر مکان داده شده است.

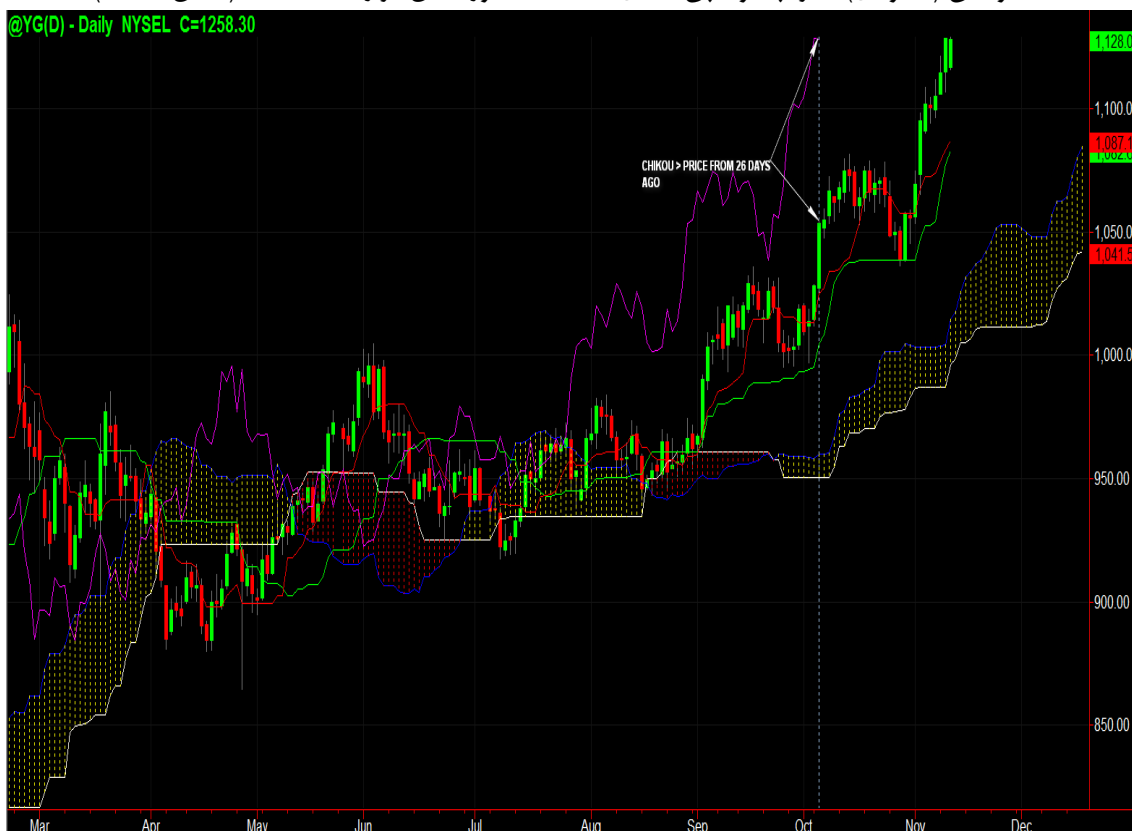
با وجود سادگی، چیکواسپن اندیکاتوری است که اکثر افراد قادر به درک آن نیستند. همچنین چیکواسپن یکی از اندیکاتورهای مورد علاقه من در ایچیموکو است. اساساً، چیکواسپن قیمت امروز است که به ۲۶ دوره قبل تغییر مکان داده است. شما به وسیله این اندیکاتور جابجایی و حرکت قیمت امروز را با قیمت ۲۶ دوره قبل مقایسه نمائید (شکل ۲۷-۱).



نمودار ۱-۲۷: نمودار روزانه ایچیموکو مینی گلد فیوچرز، ۱۰ نوامبر ۲۰۰۹

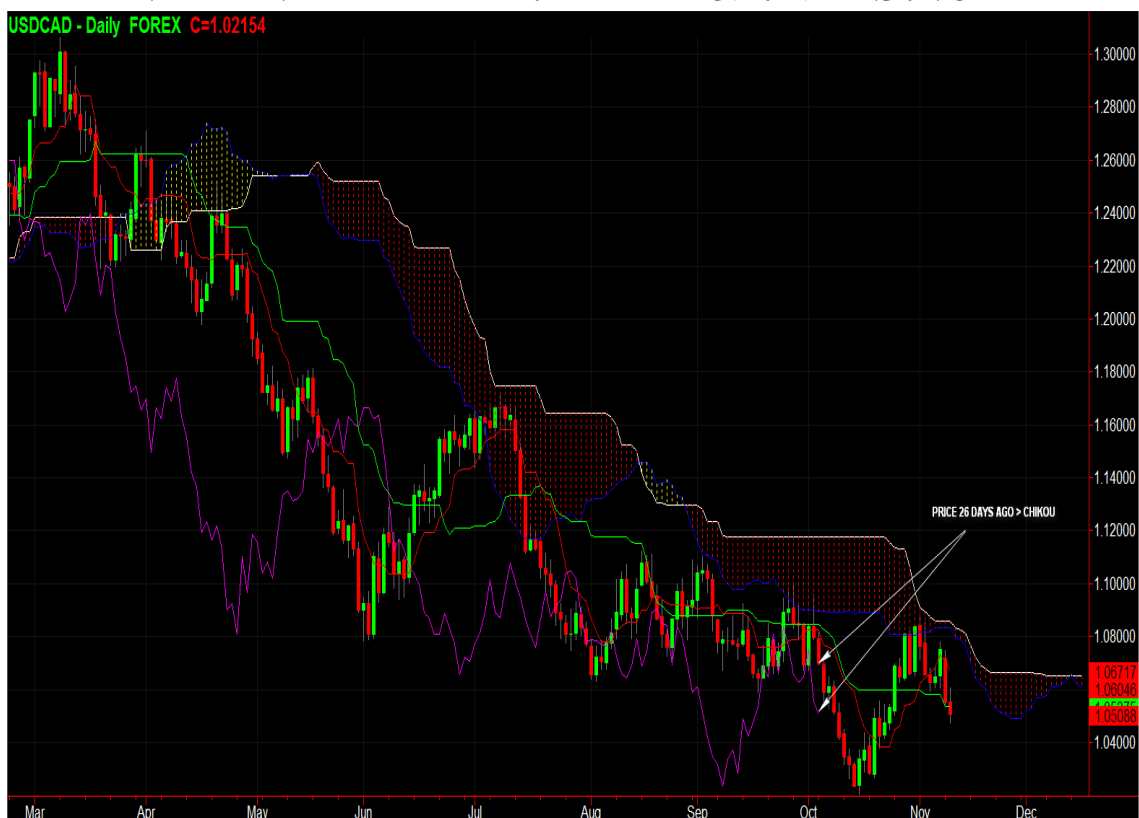
اینجا مطالبی وجود دارد که در مورد چیکواسپن باید خاطرنشان شد:

- تمایلات بازار
- بولیش (صعودی): اگر چیکواسپن بالای قیمت ۲۶ دوره قبل قرار داشته باشد (شکل ۱-۲۸)



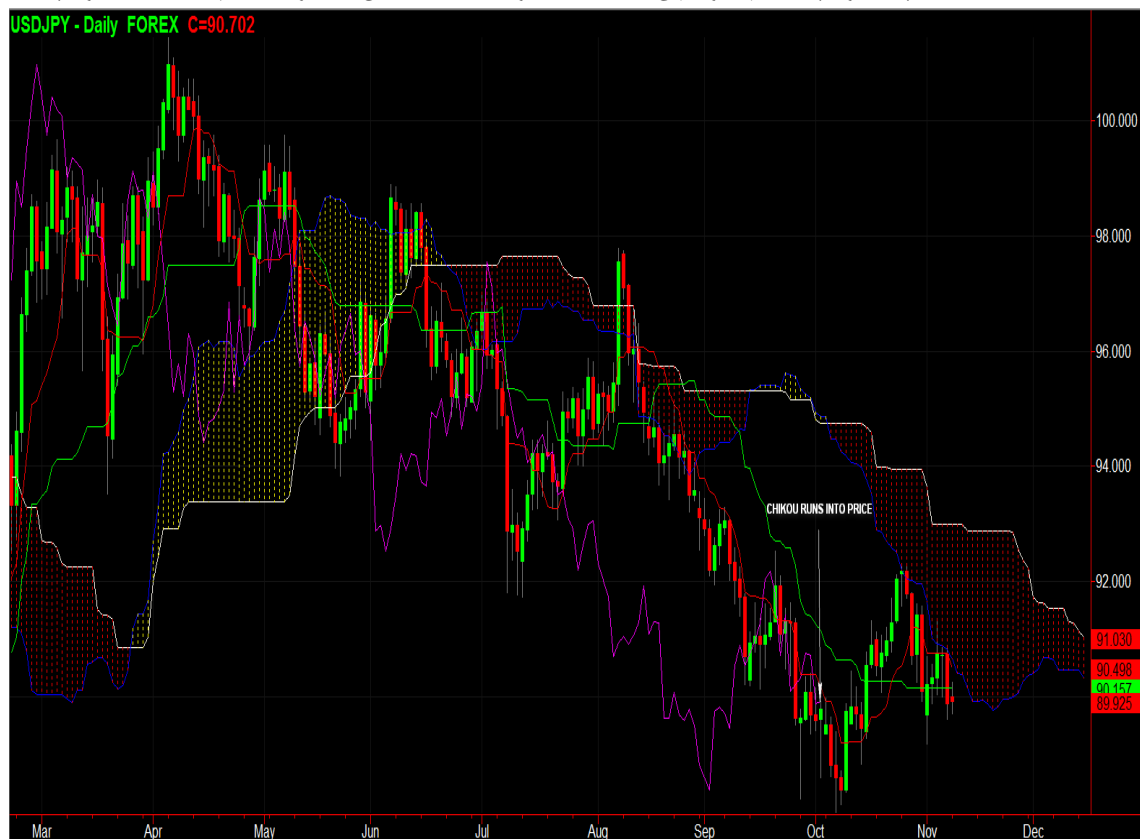
نمودار ۱-۲۸: نمودار روزانه ایچیموکو مینی گلد فیوچرز، ۱۰ نوامبر ۲۰۰۹

- بیریش (نزولی): اگر چیکواسپن زیر قیمت ۲۶ دوره قبل قرار داشته باشد (شکل ۲۹-۱).



شکل ۲۹-۱: نمودار روزانه ایچیموکو USD/CAD، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

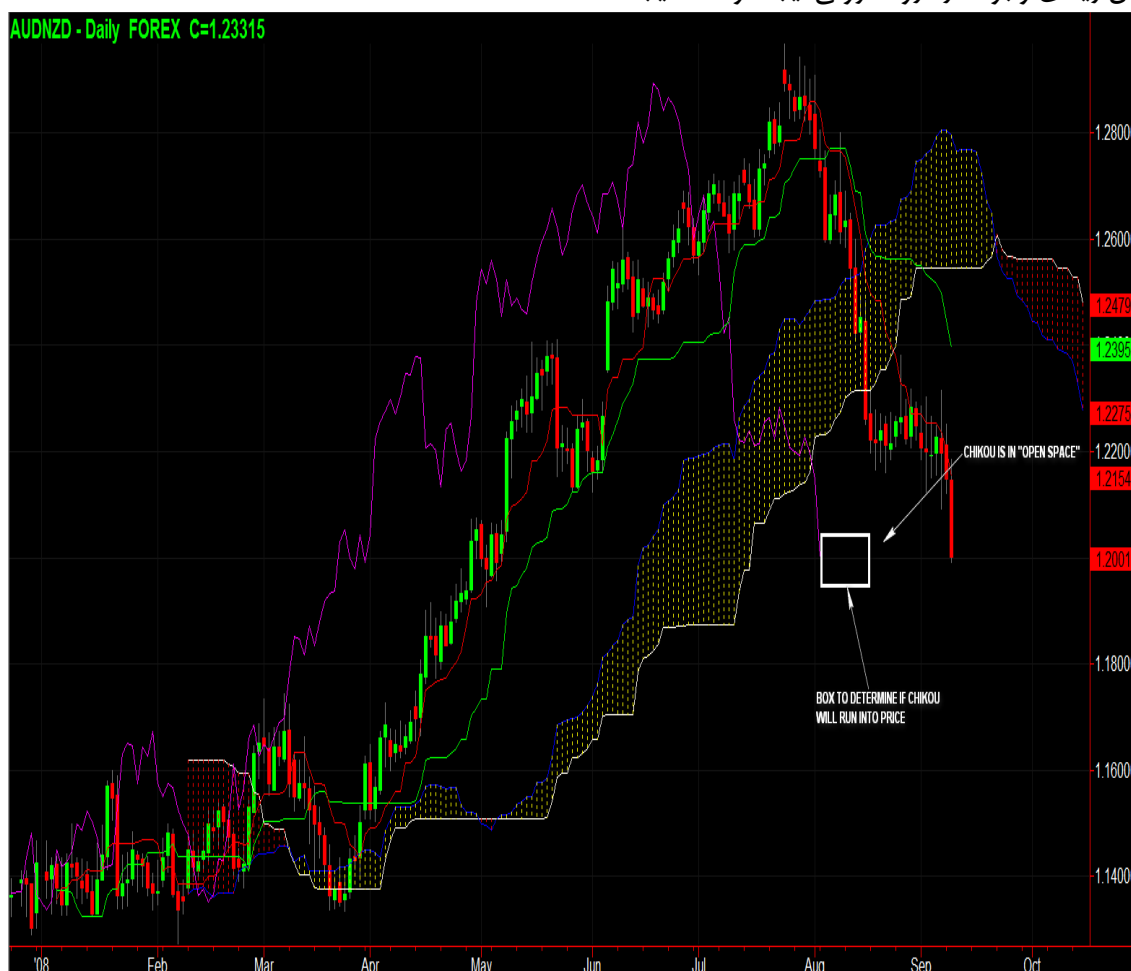
- تثبیت (سایدوی): اگر چیکواسپن قیمت ۲۶ دوره قبل را لمس کند و یا به آنها نزدیک شود (شکل ۳۰-۱).



شکل ۳۰-۱: نمودار روزانه ایچیموکو USD/JPY، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

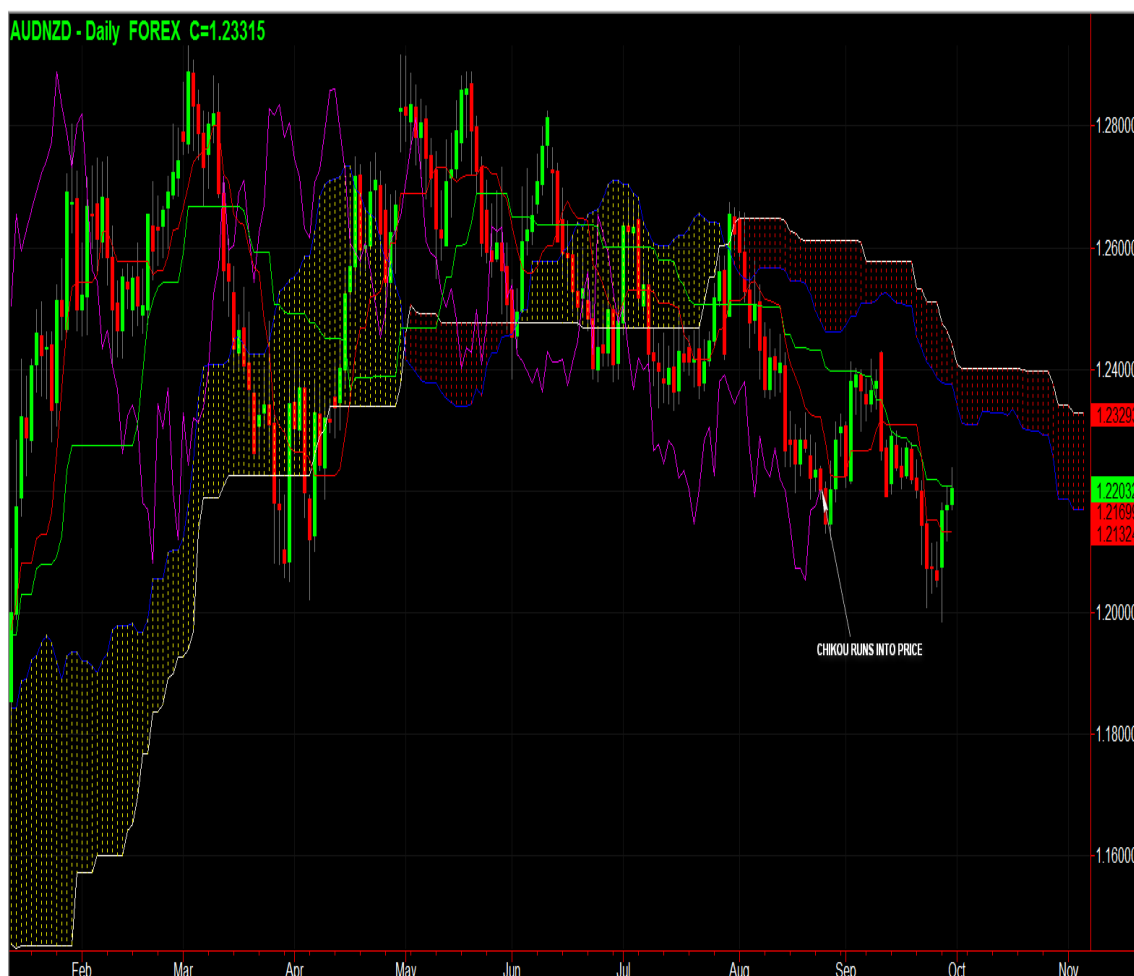
- این اندیکاتور، اندیکاتور شتاب و جنبش بازار است. روش بررسی شتاب و جنبش بازار، تعیین نحوه حرکت چیکواسپین به سمت قیمت در چند دوره بعدی می‌باشد. من معمولاً ۵ تا ۱۰ دوره جلوتر را در نظر می‌گیرم. اگر چیکواسپین به سمت قیمت پیش رود، پس روند، شتاب و جنبش زیادی ندارد. پرایس اکشن گذشته، نشاندهنده حمایت/مقاومت آینده است، که باعث بروز موانع مهمی برای روند جاری می‌گردد. اگر چیکواسپین در «فضای باز» باشد، پس شتاب و جنبش روند قوی است زیرا قیمت امروز تمایل ندارد به هر نوع حمایت/مقاومت قیمتی ۲۶ دوره قبلی خود بازگردد.

شکل ۳۱-۱ مثال خوبی از شتاب/جنبش قوی بازار است. چیکواسپین در زیر قیمت ۲۶ روز قبلی خود است بنابراین چیکواسپین نزولی است. اگر قیمت برای چند روز تثبیت شود و به حالت سایدوی درآید، چیکواسپین هنوز هم به سمت قیمت حرکت نخواهد کرد. چیکواسپین در «فضای سفید باز» است و فقط یک حرکت قوی بزرگ قادر است باعث شود چیکواسپین به سمت قیمت حرکت کند. بنابراین چیکواسپین در یک حالت نزولی قوی است، و این بدین معنی است احتمال زیادی وجود دارد روند نزولی ایجاد و ادامه یابد.



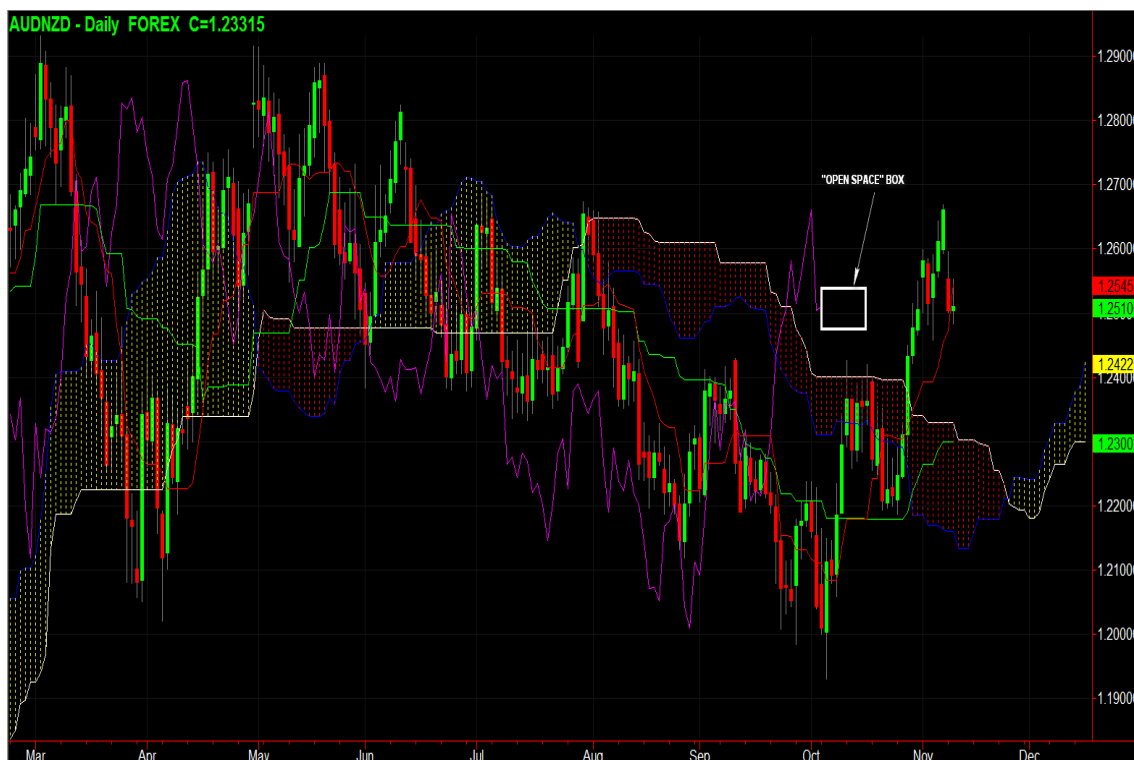
شکل ۳۱-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AUDNZD، ۹ سپتامبر ۲۰۰۸

شکل ۳۲-۱ مثالی از شتاب و جنبش ضعیف چیکواسپین است. بر اساس آنچه در چند روز آینده رخ می‌دهد، چیکواسپین می‌تواند به صورت صعودی (معکوس شدن روند) درآید و یا از لحاظ شتاب و جنبش به صورت سایدوی و تثبیت درآید، دو حالت فوق در زمانی که تصمیم به گرفتن پوزیشن بیریش (نزولی) دارید، حالت‌های خوبی نیستند.



شکل ۱-۳۲: نمودار روزانه ایچیموکو AUDNZD، ۲۹ سپتامبر ۲۰۰۹

زمانیکه شتاب و جنبش بازار را بر اساس چیکواسپن در مورد یک کالا/ارز مورد قضاوت و بررسی قرار می‌دهید، مجبورید به صورت عمودی و افقی نگاه کنید که چه زمانی چیکواسپن می‌تواند به سمت قیمت حرکت نماید. اگر قیمت بین ۵ تا ۱۰ درصد بالا و پائین رود، آیا چیکواسپن می‌تواند به سمت قیمت حرکت نماید؟ اگر قیمت به مدت ۵ تا ۱۰ روز تثبیت شود و به حالت سایدوی درآید، آیا چیکواسپن به سمت قیمت حرکت خواهد نمود؟ برخی از دانشجویانم در واقع یک کادر مربع بصری بعد از چیکواسپن رسم می‌کنند. اگر قیمت این کادر را لمس کند پس شتاب بسیار ضعیف است. سناریوهای مختلفی را در ذهن‌تان مجسم کنید تا ملاحظه کنید چه اتفاقی رخ خواهد داد. شکل ۱-۳۳ «کادر بصری» حول چیکواسپن را برای ارز AUDNZD در ۹ نوامبر ۲۰۰۹ تشریح می‌نماید.



شکل ۳۳-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AUDNZD، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

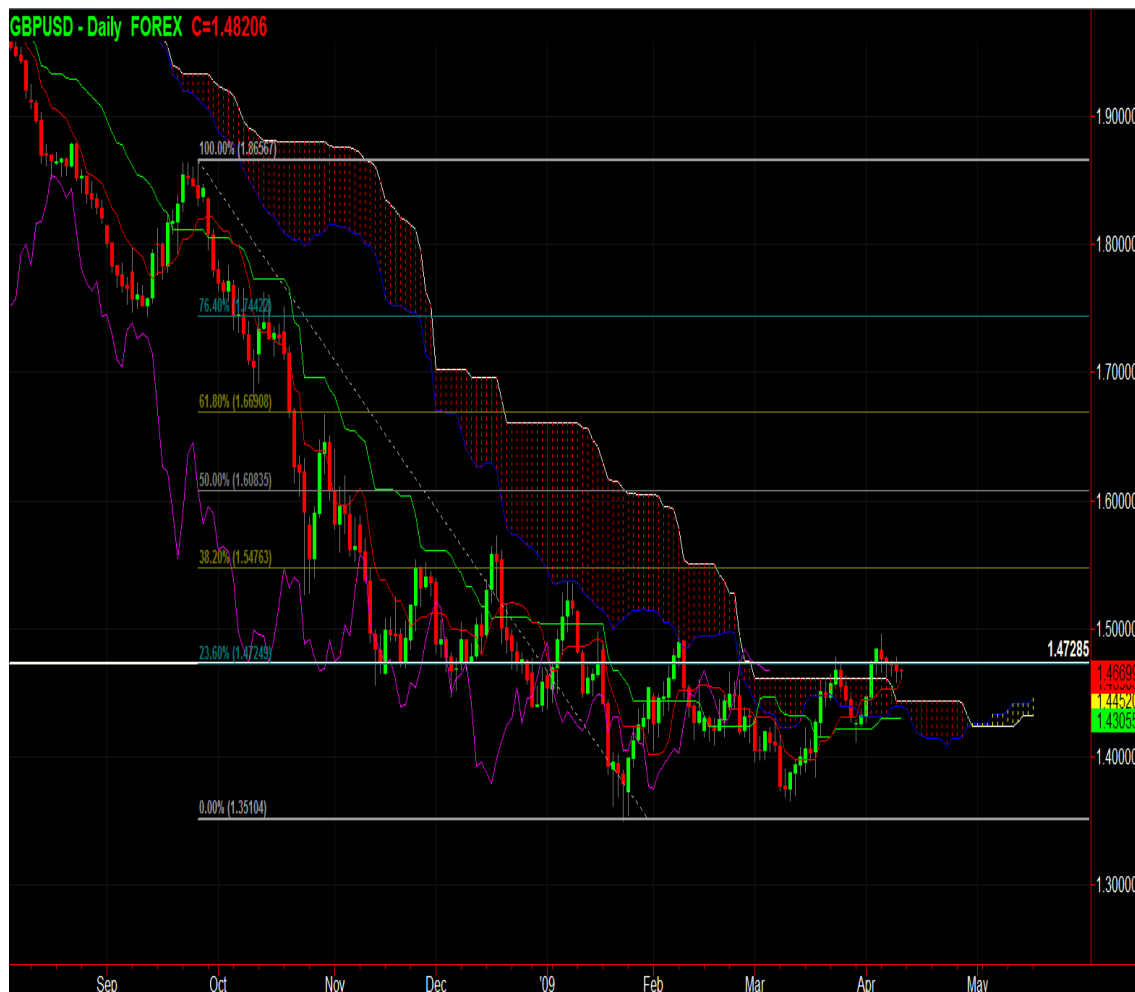
- نقاط اوج چیکواسپن، مقادیر حمایت و مقاومت اصلی هستند. اگر یک خط افقی از اوج‌های چیکواسپن رسم کنید، این خط مقادیر حمایت و مقاومت را نشان خواهد داد. اگر اوج‌های متعددی از چیکواسپن به دست بیاورید که آن خط افقی را لمس کرده باشند، پس این مقدار قیمتی یک مقدار حمایت/مقاومت مهم می‌باشد. در اکثر حالات، اگر دو یا بیش از دو اوج داشته باشید، این منطقه عموماً یک مقدار فیبوناچی می‌باشد.

شکل ۳۴-۱ یک خط افقی ترسیم شده را نشان می‌دهد که این خط پنج اوج چیکواسپن را قطع نموده است.



شکل ۳۴-۱: نمودار روزانه ایچیموکو GBPUSD، ۱۰ آوریل ۲۰۰۹

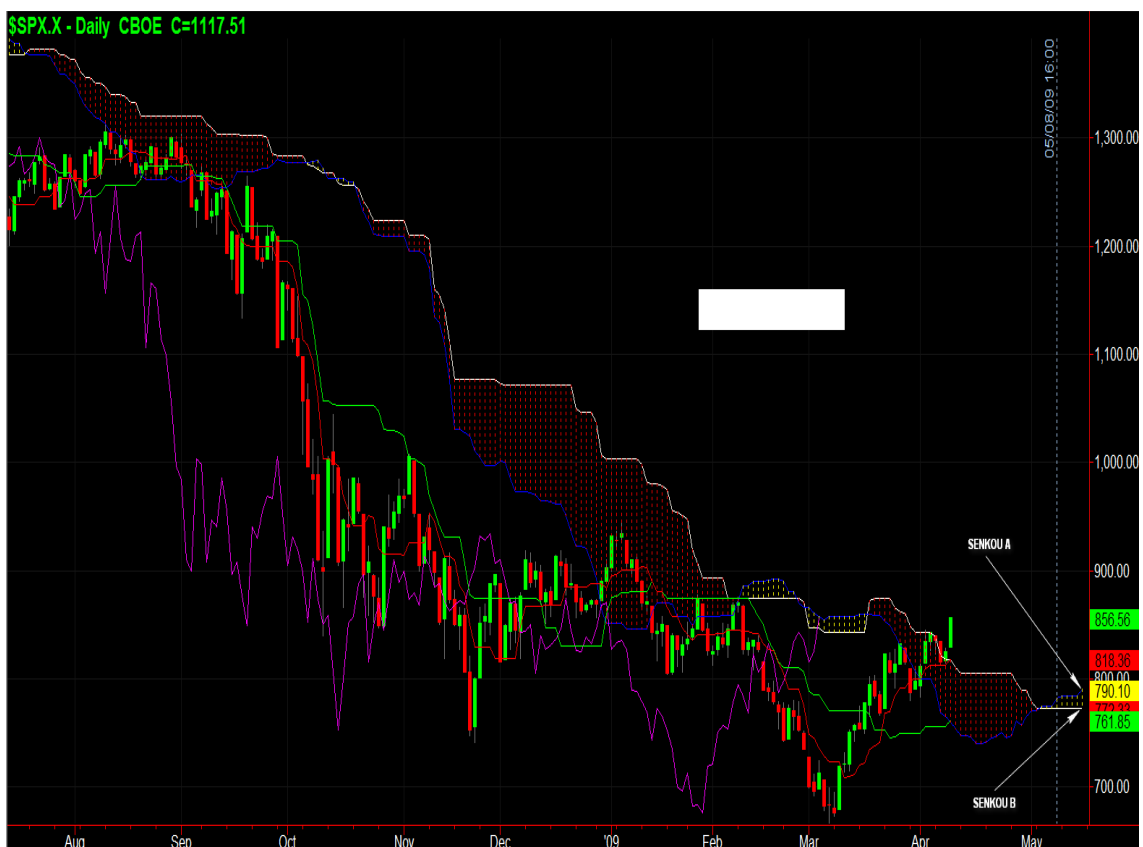
شکل ۱-۳۵ همان نمودار شکل ۱-۳۴ است، اما اکنون مقادیر فیبوناچی را بر روی بالای نمودار قرار داده‌ایم. توجه داشته باشید مقادیر فیبوناچی ۲۳۶۰ درصد ریتریسمنت (بازگشتی) با خط حمایت/مقاومت ترسیم شده از چیکواسپین منطبق است. این فقط مثالی است که چطور سایر اندیکاتورها «درون» ایچیموکو کینکو هایو وجود دارند.



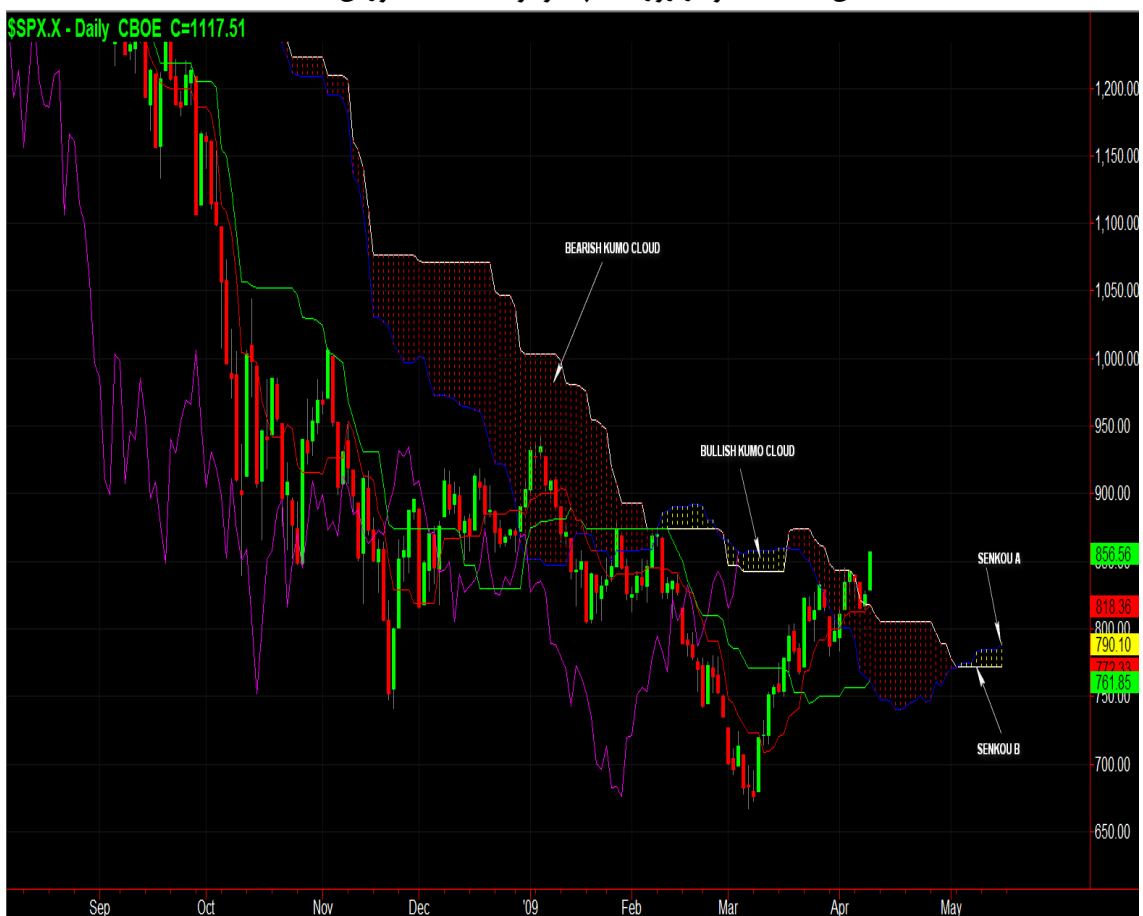
شکل ۱-۳۵: نمودار روزانه ایچیموکو GBPUSD، ۱۰ آوریل ۲۰۰۹

اجزاء ابر کومو:

دو اندیکاتور آخر باقیمانده، سنوکواسپین A و سنوکواسپین B می‌باشند (شکل ۱-۳۶). این دو اندیکاتور به صورت متفاوتی از سایر اندیکاتورهای ایچیموکو مورد بحث قرار می‌گیرند. به این دلیل که این دو اندیکاتور به همراه هم اطلاعات زیادی در اختیارمان قرار می‌دهند. این دو اندیکاتور در کنار هم، ابری ایجاد می‌نمایند که به نام «ابر کومو» نامیده می‌شود. این ابر با پر کردن فاصله بین سنوکواسپین A و سنوکواسپین B با یک رنگ خاص ایجاد می‌گردد. اگر سنوکواسپین A بزرگتر از سنوکواسپین B باشد، پس رنگ زردرنگ (صعودی) است و اگر سنوکواسپین A کمتر از سنوکواسپین B باشد، پس رنگ قرمز (نزولی) می‌باشد. می‌توانید از هر رنگی برای ابر کومو استفاده نمایید، اما این رنگی است که ما به آن در نمودارهایم استفاده می‌کنیم (شکل ۱-۳۷).



شکل ۳۶-۱: نمودار روزانه ایچیموکو SPX، ۹ آوریل ۲۰۰۹

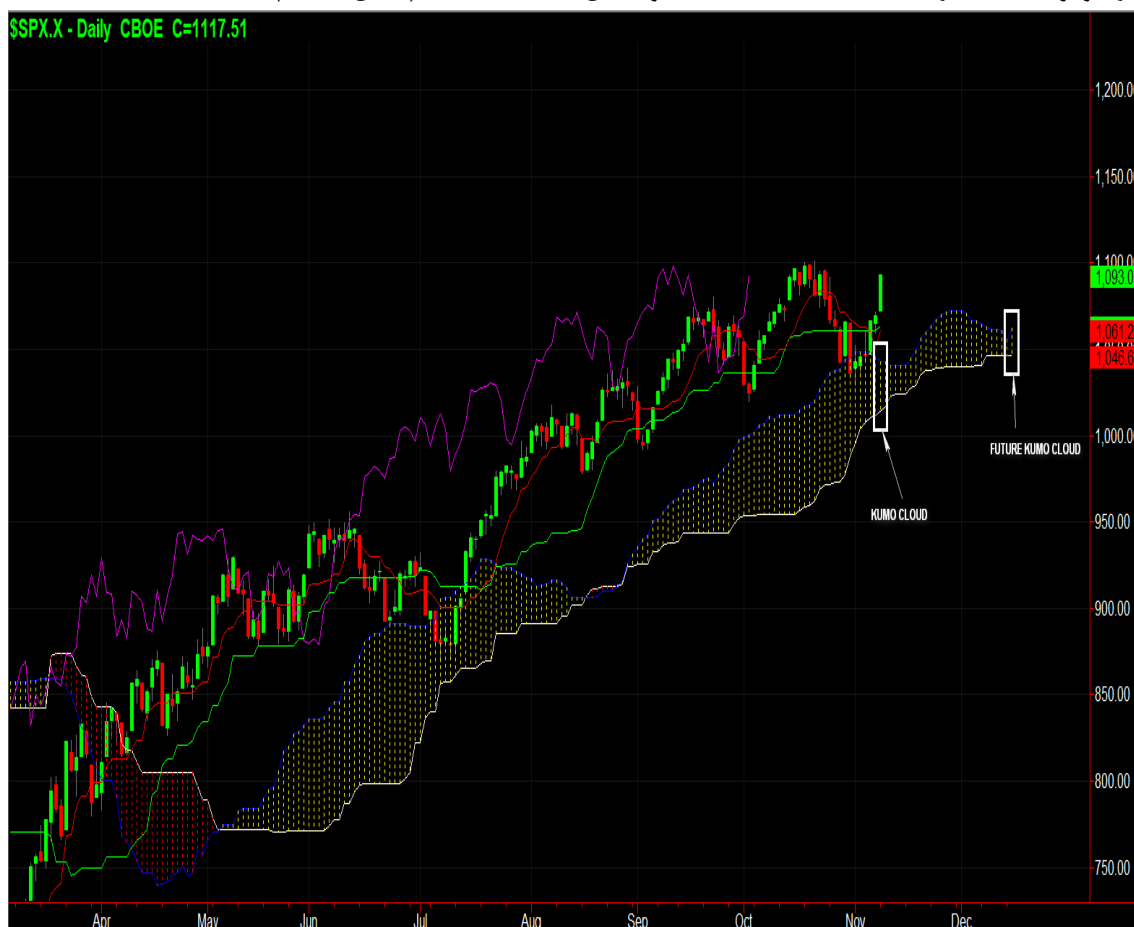


شکل ۳۷-۱: نمودار روزانه ایچیموکو SPX، ۹ آوریل ۲۰۰۹

در این بخش، به دو نوع ابر اشاره می‌کنم:

۱- ابر کوموی حال: ابر بالا و پائین قیمت حال حاضر (شکل ۱-۳۸)

۲- ابر کوموی آینده: ابری که ۲۶ میله به سمت جلو انتقال داده شده است (شکل ۱-۳۸)



شکل ۱-۳۸: نمودار روزانه ایچیموکو SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

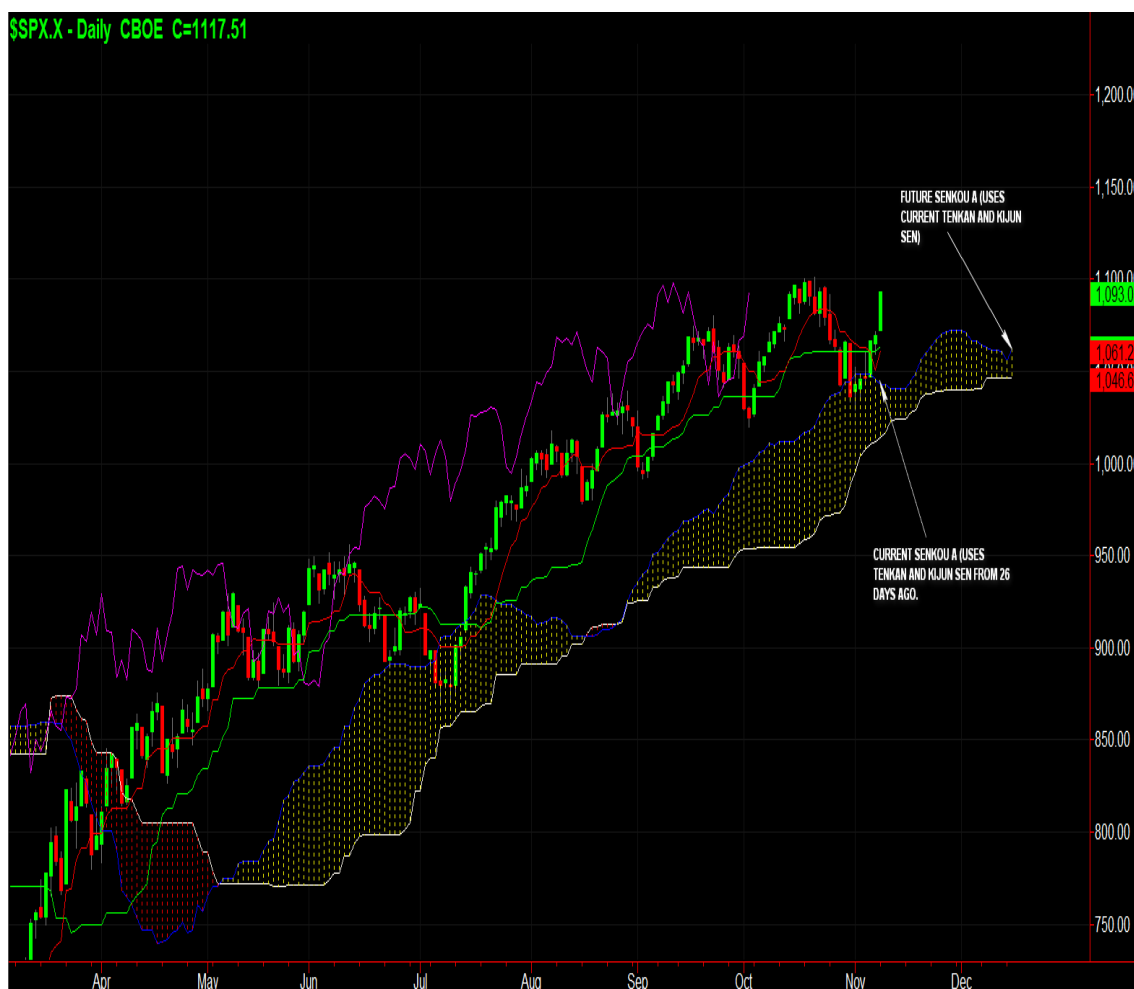
سنوکواسپین A:

چهارمین اندیکاتوری که مورد بحث قرار می‌دهم، سنوکواسپین A است. سنوکواسپین A نیمی از «ابر کومو» که پیش از این در مورد آن بحث کرده‌ام را شکل می‌دهد. رنگی که سنوکواسپین A را نشان می‌دهد، آبی تیره است. فرمول سنوکواسپین A عبارت است از:

$$\frac{\text{کیجنسن} + \text{تنکانش}}{2}$$

که ۲۶ دوره زمانی به سمت جلو انتقال داده شده است.

این اندیکاتور اکثر افراد را گیج می‌نماید زیرا در واقع دو ابر کومو وجود دارد، ابر کوموی حال و ابر کوموی آینده. شما مجبورید به دو سنوکواسپین A نگاه کنید، سنوکواسپین A حال و سنوکواسپین A آینده. سنوکواسپین A حال میانگین تنکانش و کیجنسن ۲۶ دوره قبل است. بنابراین، هنگامیکه در حال مقایسه قیمت حال حاضر نسبت به سنوکواسپین A هستید، در واقع شما در حال مقایسه قیمت حال حاضر با قیمت‌های تنکانش/کیجنسن ۲۶ دوره قبل می‌باشید. سنوکواسپین A آینده میانگین تنکانش حال حاضر و کیجنسن حال حاضر می‌باشد (شکل ۱-۳۹). جابجایی قیمت حال حاضر بر قیمت‌های آینده تاثیر خواهد گذاشت.



شکل ۳۹-۱: نمودار روزانه ایچیموکو SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

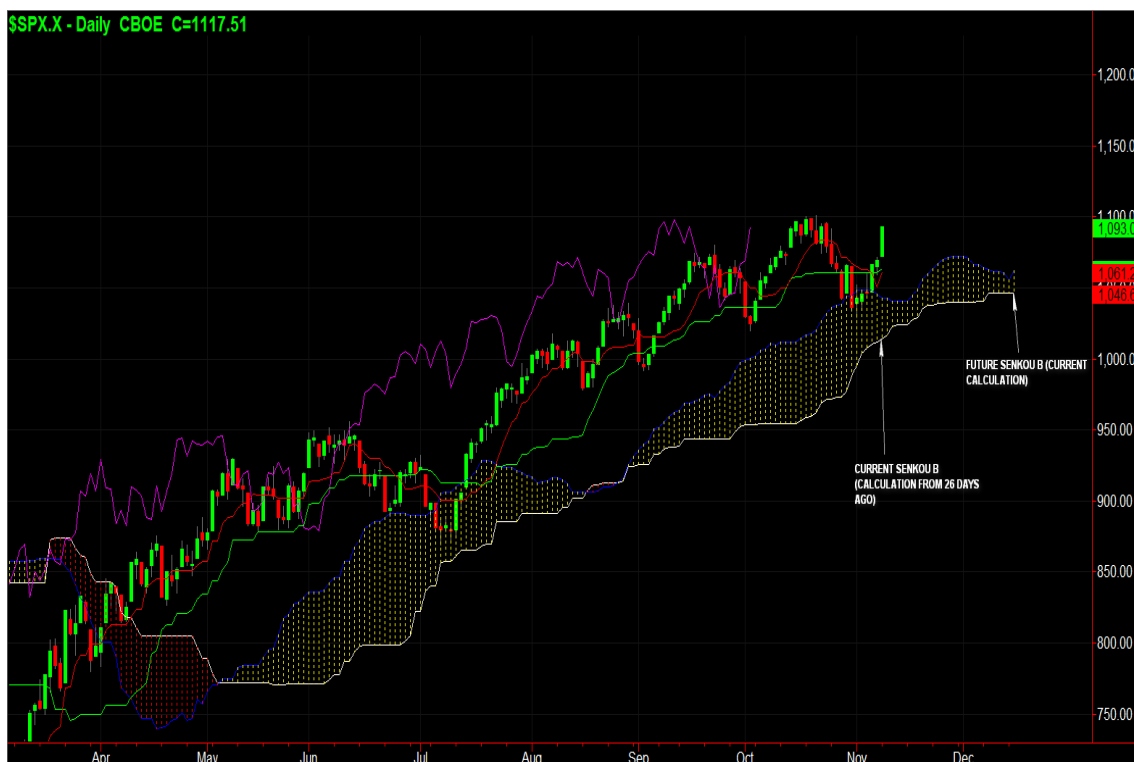
سنوکواسپین B:

پنجمین اندیکاتوری که شرح خواهیم داد، سنوکواسپین B می‌باشد. سنوکواسپین B نیمه دوم «ابر کومو» که پیش از این مورد بحث قرار گرفت، را نشان می‌دهد. رنگی که سنوکواسپین B را نشان می‌دهد، ارغوانی است. فرمول سنوکواسپین B عبارت است از:

$$(\text{پائین ترین قیمت} + \text{بالا ترین قیمت})$$

۲ برای ۵۲ دوره گذشته و سپس انتقال به میزان ۲۶ دوره به سمت جلو

این اندیکاتور از ۵۲ دوره تشکیل شده است، و دارای بیشترین دوره‌ای است که در اندیکاتورهای ایچیموکو وجود دارد. برای تایم فریم هفتگی، مقدار آن برابر ۵۲ هفته است. به خاطر داشته باشید درست همانند سنوکواسپین A، دو نوع سنوکواسپین B داریم. سنوکواسپین B در واقع محاسبه ۵۲ دوره گذشته است. سنوکواسپین B آینده، محاسبات حال حاضر است. این اندیکاتور یک اندیکاتور قدرتمند است زیرا سنوکواسپین B شامل بسیاری از میله‌های قبلی و پیشین می‌باشد (شکل ۴۰-۱).



شکل ۴۰-۱: نمودار روزانه ایچیمو کو SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

ابر کومو:

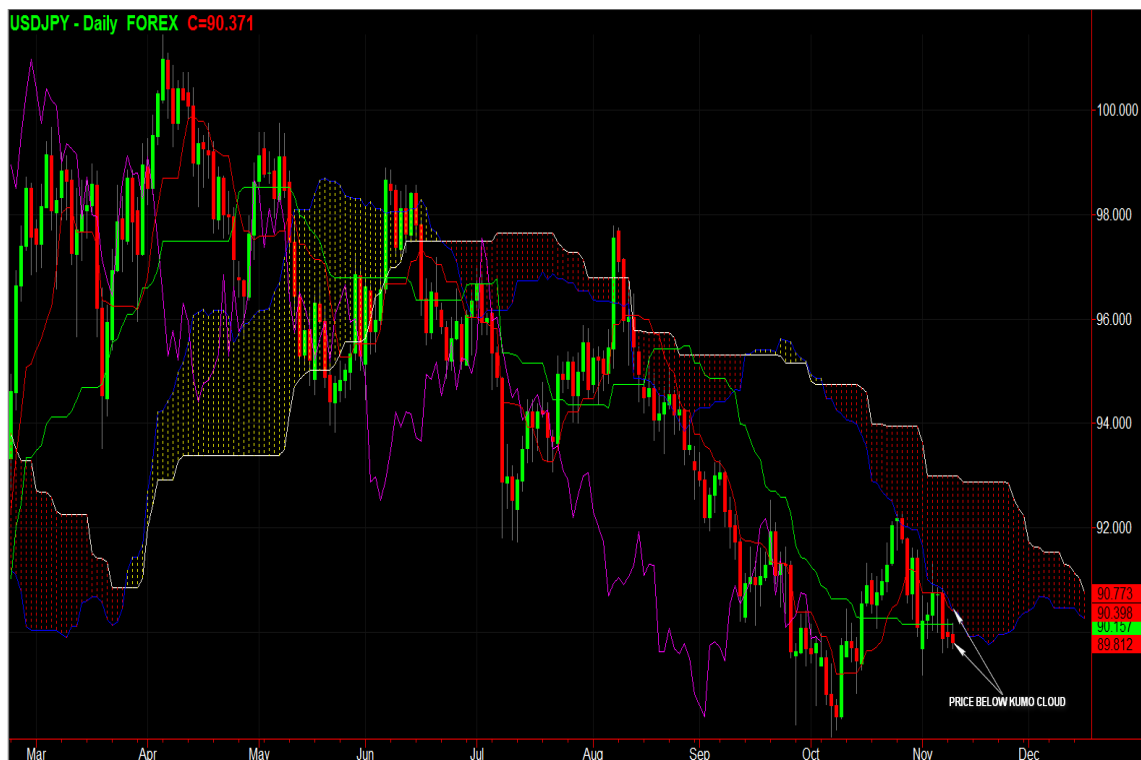
چندین نکته در مورد ابر کومو وجود دارد که عبارتند از:

- تمایلات حال حاضر:
- بولیش (صعودی): قیمت بالای ابر کومو باشد (شکل ۴۱-۱).



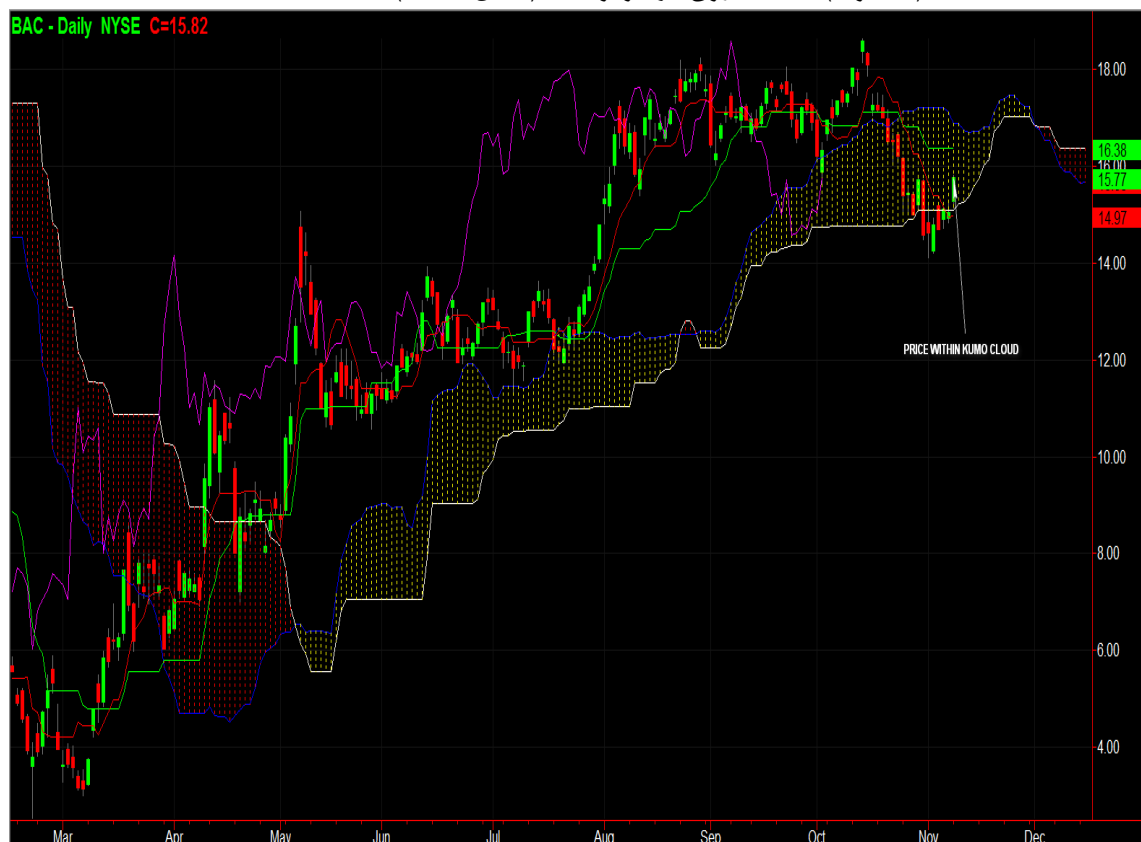
شکل ۴۱-۱: نمودار روزانه ایچیمو کو SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- بیریش (نزولی): قیمت زیر ابر کومو باشد (شکل ۱-۴۲).



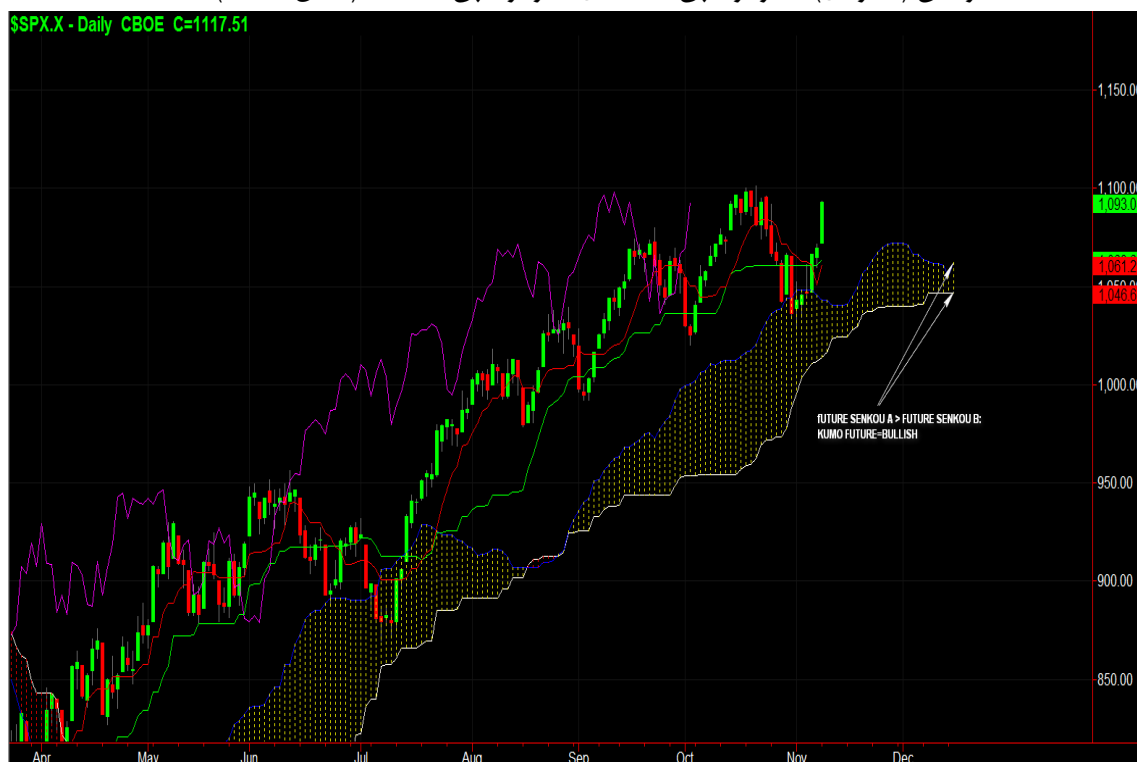
شکل ۱-۴۲: نمودار روزانه ایچیمو کو USDJPY، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- تثبیت (سایدوی): قیمت درون ابر کومو باشد (شکل ۱-۴۳).



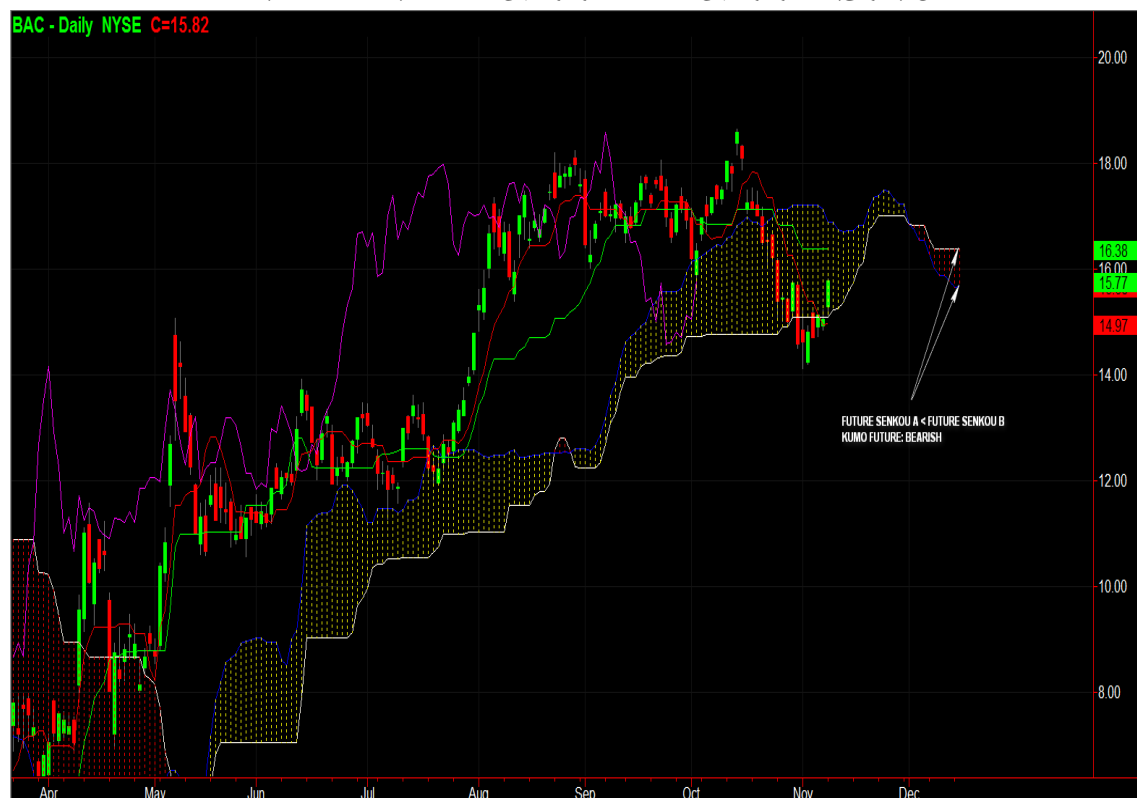
شکل ۱-۴۳: نمودار روزانه ایچیمو کو BAC، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- تمایلات آتی (سنوکواسپین A و سنوکواسپین B آینده):
- بولیش (صعودی): سنوکواسپین A بالای سنوکواسپین B باشد (شکل ۱-۴۴).



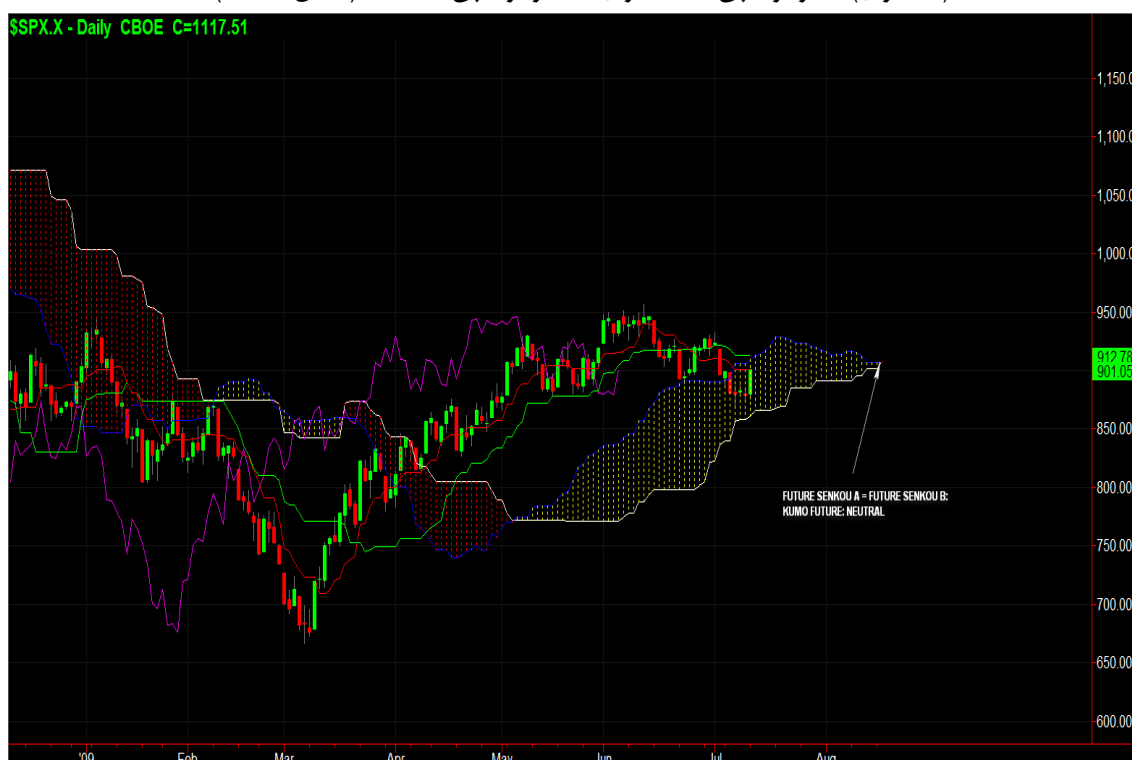
شکل ۱-۴۴: نمودار روزانه ایچیمو کو SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- بیریش (نزولی): سنوکواسپین A زیر سنوکواسپین B باشد (شکل ۱-۴۵).



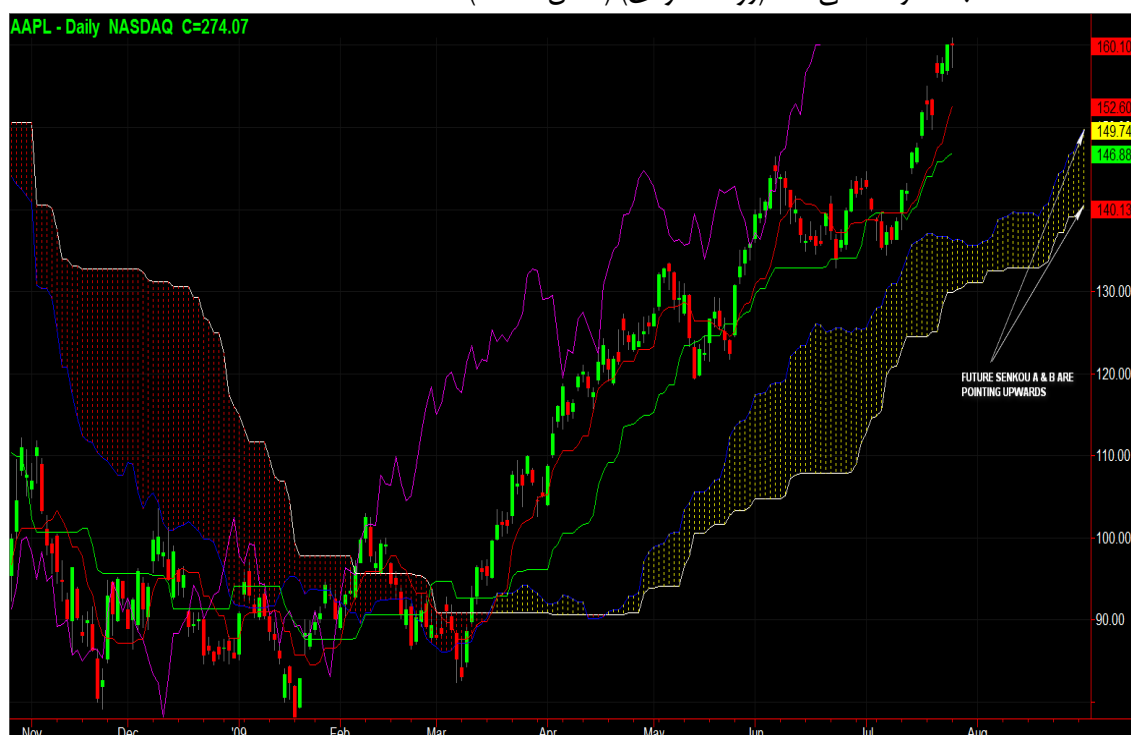
شکل ۱-۴۵: نمودار روزانه ایچیمو کو BAC، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- تثبیت (سایدوی): سنوکواسپن A مساوی با سنوکواسپن B باشد (شکل ۴۶-۱).



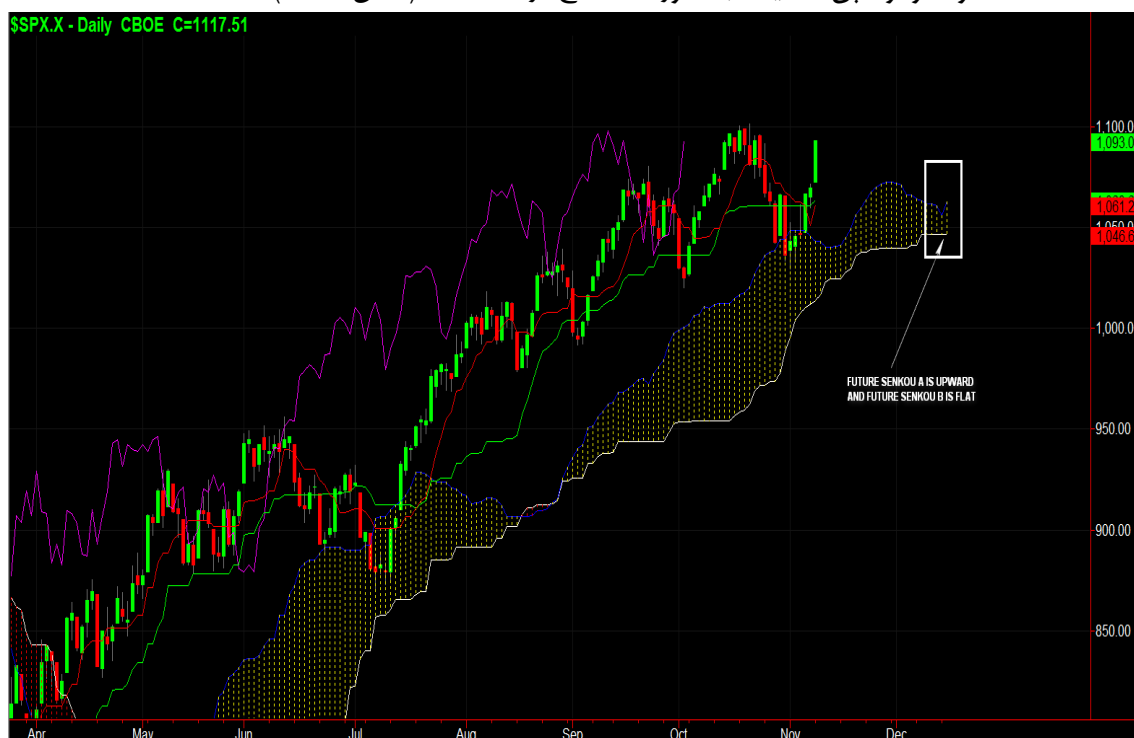
شکل ۴۶-۱: نمودار روزانه ایچیموکو SPX، ۱۳ جولای ۲۰۰۹

- قدرت: قدرت ابر کوموی آینده به وسیله سنوکواسپن A آینده و سنوکواسپن B آینده تعیین می‌شود. در اینجا حالت‌های مختلفی وجود دارد:
- بولیش (صعودی) قوی: ابر آینده صعودی است و هر دو سنوکواسپن A آینده و سنوکواسپن B آینده به سمت بالا حرکت می‌کنند (روند صعودی) (شکل ۴۷-۱).



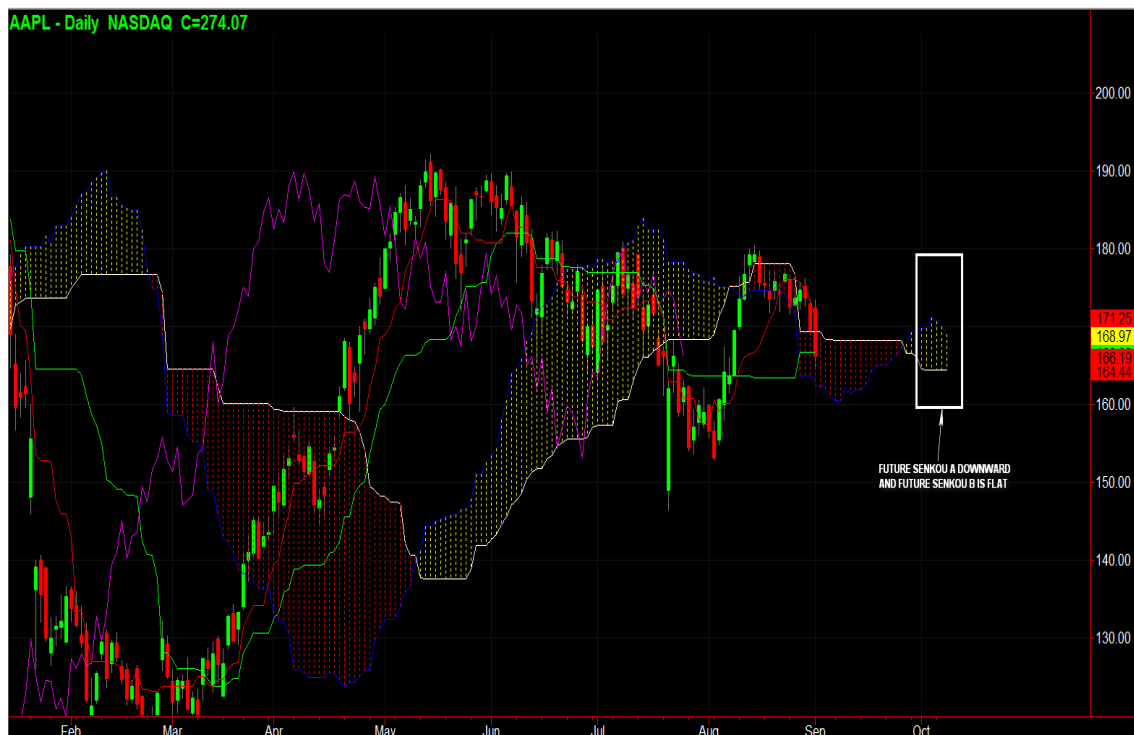
شکل ۴۷-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AAPL، ۲۷ جولای ۲۰۰۹

- بولیش (صعودی) متوسط: کوموی آینده صعودی است، سنوکواسپین A آینده به سمت بالا در حال حرکت است، و سنوکواسپین B آینده به صورت مسطح درآمده است (شکل ۴۸-۱).



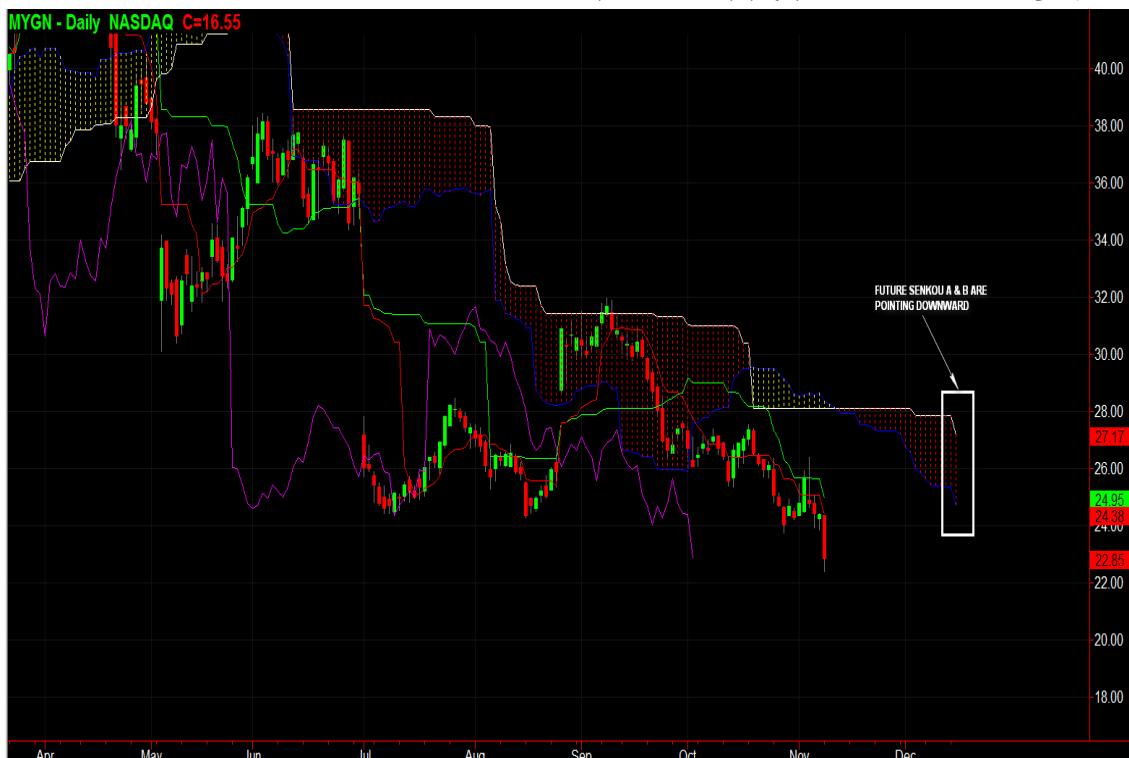
شکل ۴۸-۱: نمودار روزانه ایچیموکو SPX، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- بولیش (صعودی) ضعیف: کوموی آینده صعودی است، سنوکواسپین A آینده به سمت پائین در حال حرکت است، و سنوکواسپین B آینده به صورت مسطح است. به عبارت دیگر، این حالت می‌تواند یک پولبک اصلی و یا برگشت روند باشد (شکل ۴۹-۱).



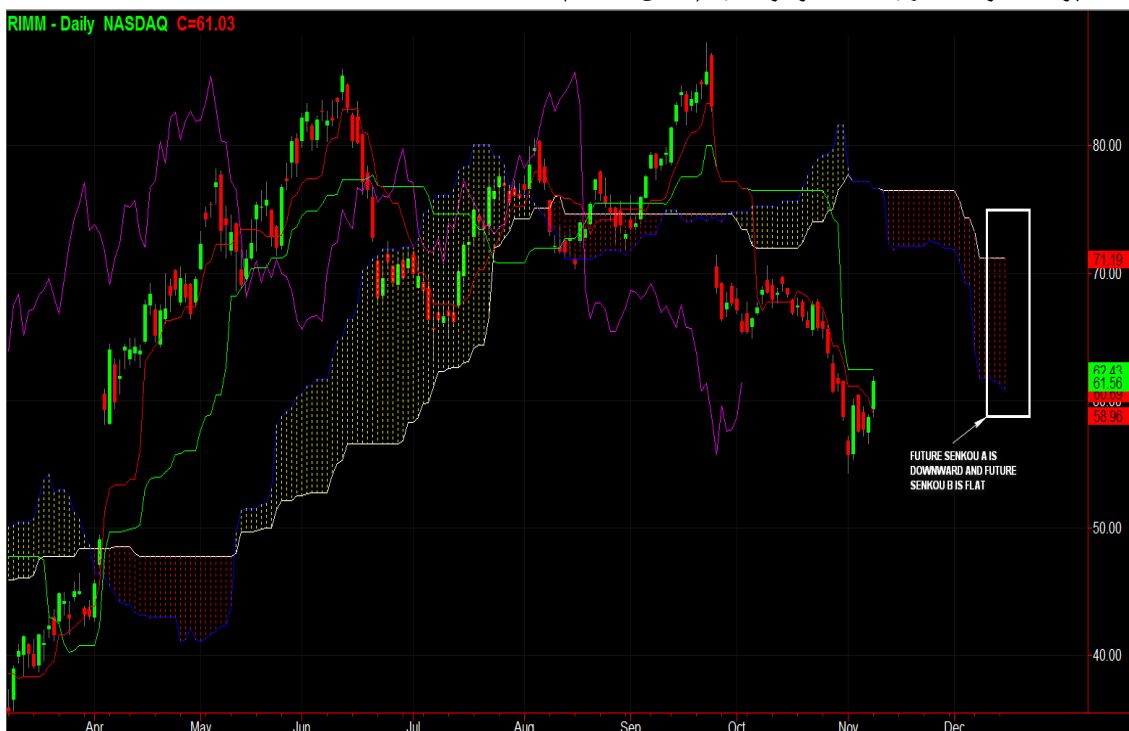
شکل ۴۹-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AAPL، ۲ سپتامبر ۲۰۰۹

- بیریش (نزولی) قوی: کوموی آینده نزولی و هم سنوکواسپن A آینده و هم سنوکواسپن B آینده به سمت پائین در حال حرکت باشند (روند) (شکل ۵۰-۱)



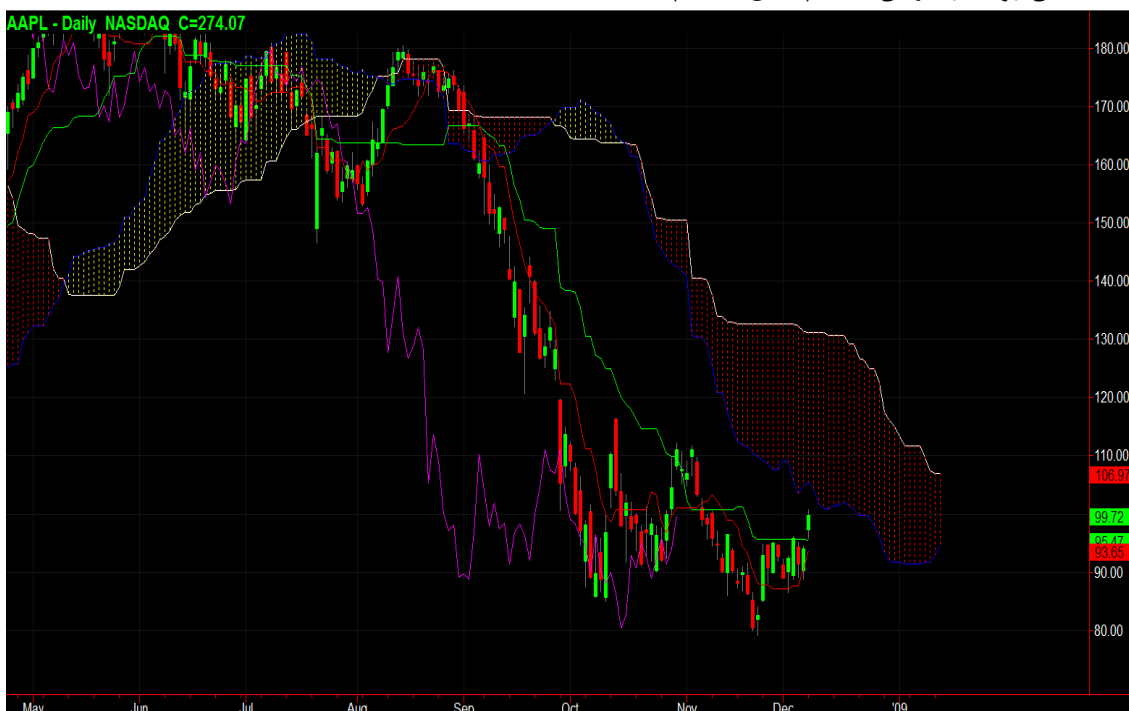
شکل ۵۰-۱: نمودار روزانه ایچیموکو MYGN، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- بیریش (نزولی) متوسط: کوموی آینده به حالت نزولی باشد، سنوکواسپن A آینده به سمت پائین در حال حرکت باشد، و سنوکواسپن A آینده مسطح باشد. این بدین معنی است که یک پولبک ضعیف و یا یک پولبک قوی با فراریت بالا وجود دارد (شکل ۵۱-۱).



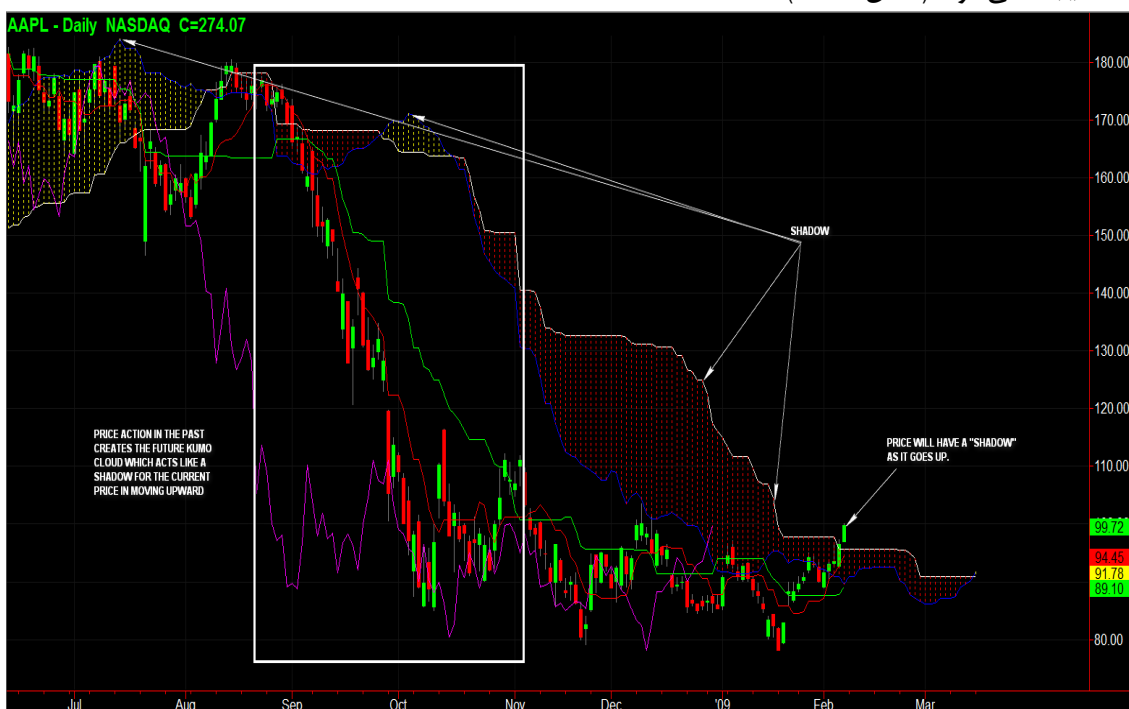
شکل ۵۱-۱: نمودار روزانه ایچیموکو RIMM، ۹ نوامبر ۲۰۰۹

- بیریش (نزولی) ضعیف: کوموی آینده به حالت نزولی باشد، سنوکواسپین A آینده به سمت پائین در حال حرکت باشد، و سنوکواسپین B آینده مسطح باشد. این امر بدین معنی است که یک پولبک مهم یا معکوس شدن روند در جریان است (شکل ۵۲-۱).



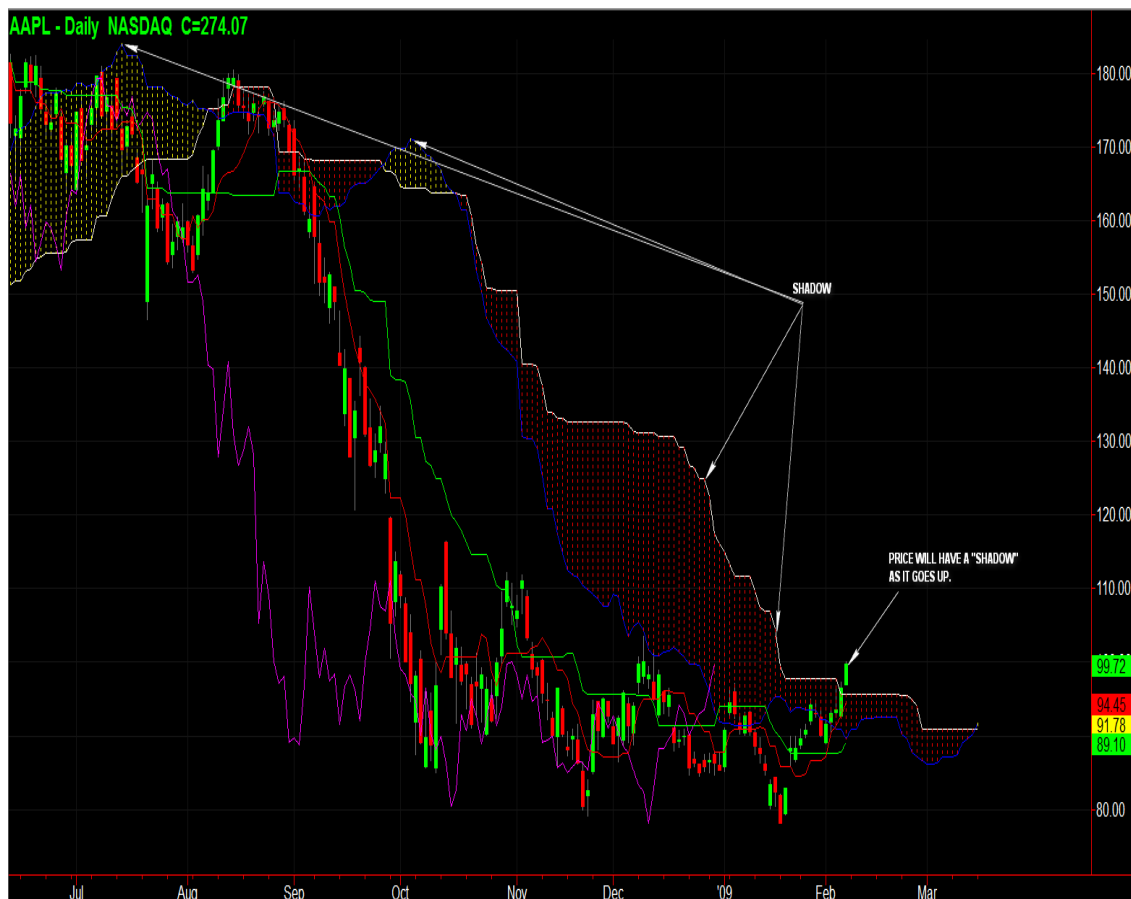
شکل ۵۲-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AAPL، ۸ دسامبر ۲۰۰۸

- سایه‌های کومو نشان‌دهنده مقادیر حمایت و مقاومت قوی می‌باشد. هر سایه کومو ابری است که در ورای قیمت‌ها نهفته است. سایه‌های کومو از الگوهای تثبیت (سایدوی) قدیم و برگشت روند در زمان‌های گذشته ایجاد می‌شوند (شکل ۵۳-۱).



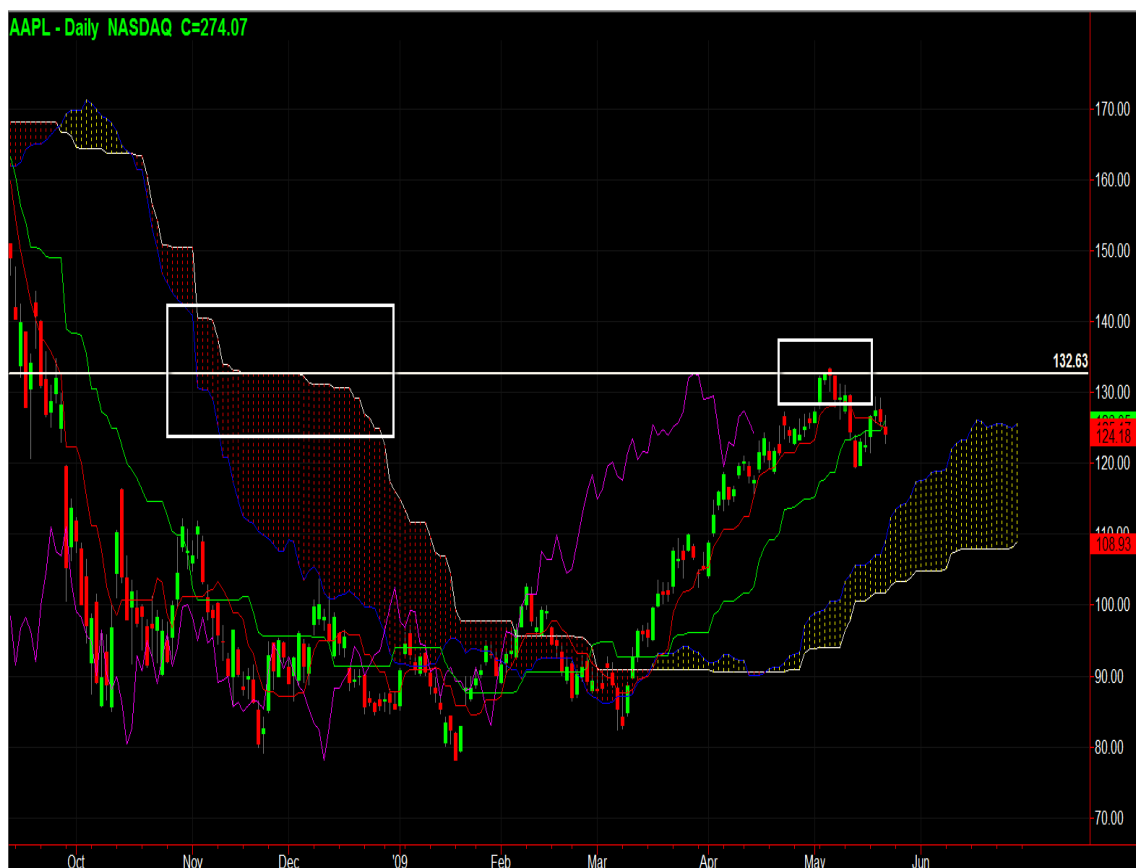
شکل ۵۳-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AAPL، ۶ فوریه ۲۰۰۹

شکل ۱-۵۴ یک سایه کومو برای قیمتی که در حال حرکت به سمت بالا (صعودی) است را نشان می‌دهد. تا زمانی که قیمت در بالای سایه کومو در حال حرکت است، قیمت به سمت مقاومت باز خواهد گشت و باعث می‌شود قیمت به حالت سایدوی و تثبیت درآید. اگر قیمت برای مدتی تثبیت (سایدوی) شود، ضعیف و ضعیف‌تر می‌شود. نزدیک‌تر بودن سایه به قیمت حال حاضر، باعث می‌شود قیمت به میزان بیشتری تحت تاثیر آن قرار گیرد. بنابراین، یک روند قوی در واقع نمی‌تواند رخ دهد مگر اینکه روند از داخل قیمت اوج سایه بریک نماید. سایه‌ها از تثبیت (سایدوی) قیمت‌های گذشته ایجاد می‌شوند، درحالی‌که در حال حاضر نشان‌دهنده مقادیر حمایت و مقاومت کنونی می‌باشند.



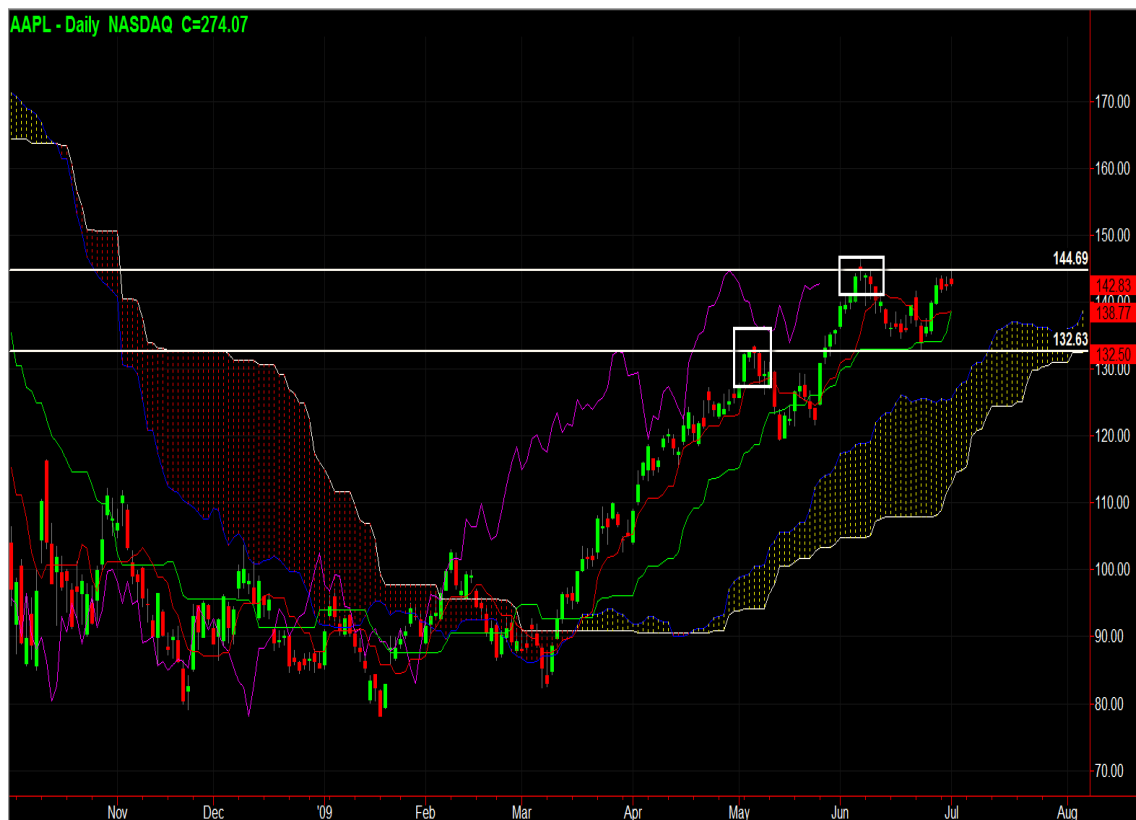
شکل ۱-۵۴: نمودار روزانه ایچیمو کو AAPL، ۶ فوریه ۲۰۰۹

- سنوکواسپین B مسطح ابر کومو یک مقدار حمایت و مقاومت مهم است. طولانی‌تر بودن بخش مسطح سنوکواسپین B، باعث ایجاد حمایت/مقاومت قوی‌تر شده و می‌تواند باعث ایجاد مشکلاتی برای روند حال حاضر یا روند آینده گردد. در شکل ۱-۵۵، قیمت به سختی بالای مقاومت سنوکواسپین B (گذشته) ابر (سایه) کومو نفوذ نموده است. توجه داشته باشید چطور سنوکواسپین در گذشته در حول آن محدوده قیمتی مسطح بوده است. سنوکواسپین به عنوان یک مقاومت مهم برای این نقطه عمل نموده و باعث ایجاد پولبک مهم در روند صعودی شده است.



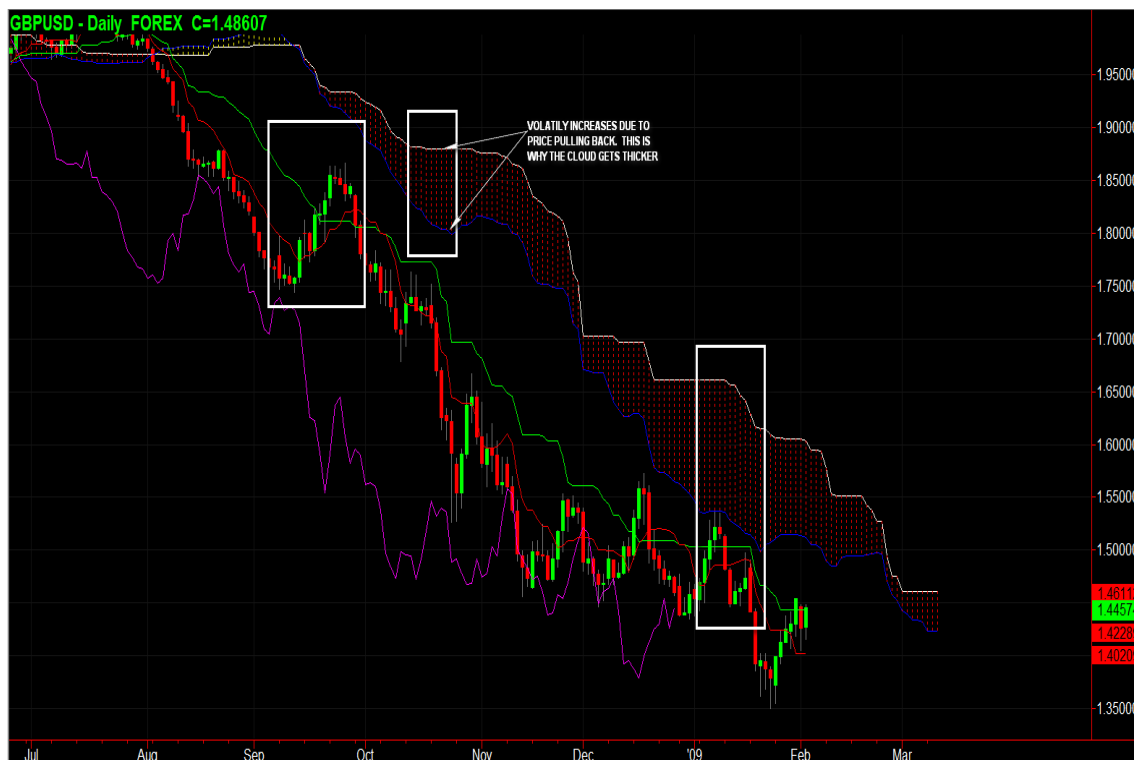
شکل ۵۵-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AAPL، ۲۱ می ۲۰۰۹

- اوج‌هایی که توسط سنوکواسپن A ابر کومو ایجاد می‌شوند مقادیر حمایت و مقاومت قوی می‌باشند (شکل ۵۶-۱).



شکل ۵۶-۱: نمودار روزانه ایچیموکو AAPL، ۱ جولای ۲۰۰۹

فاصله بین سنوکواسپین A و سنوکواسپین B در ابر کوموی آینده نشاندهنده فراریت بازار می‌باشد. ضخیم‌تر بودن ابر آینده نشان می‌دهد در گذشته تثبیت (سایدوی) بیشتری در بازار رخ داده است. در عوض این مسئله باعث فراریت زیادی می‌گردد. زمانیکه یک روند اصلی ایجاد شود، ابر کوموی آینده نازک خواهد بود و هر دو سنوکواسپین A و سنوکواسپین B هم‌جهت با ابر کومو حرکت خواهند نمود (شکل ۵۷-۱).



شکل ۵۷-۱: نمودار روزانه ایچیموکو GBPUSD، ۲ فوریه ۲۰۰۹

فصل ۲

برنامه معاملاتی

ایچیمو کو

در این بخش، برنامه معاملاتی ایچیموکو ایجاد خواهد شد. هنگامیکه برنامه معاملاتی ایجاد شد، این برنامه در بخش بعدی بک تست گرفته می شود تا ببینیم آیا این برنامه با توجه به گذشته بازار طرح موفقیت آمیزی می باشد. این مسئله قابل درک است که نتایج گذشته همیشه نتایج آینده را منعکس نمی سازند. هرچند، اگر نتایج بک تست موفقیت آمیز باشد، احتمال زیادی وجود دارد که نتایج آینده نیز به خوبی موفقیت آمیز باشد.

اجزاء:

برنامه معاملاتی که برای معاملاتمان استفاده می کنیم بعداً شرح داده می شود. یک طرح معاملاتی ساده ایجاد نموده ام؛ هرچند، شما می توانید همه چیز این برنامه معاملاتی را در برنامه معاملاتی مربوط خودتان تغییر دهید. هر فرد متفاوت است و دارای سبک معاملاتی خاصی است. بنابراین، برنامه معاملاتی باید متناسب با سبک معاملاتی شما باشد. اگر سبک خاص خودتان را هنوز نیافته اید، نیاز است برنامه های معاملاتی مختلف را بر روی کاغذ مورد بررسی قرار دهید تا زمانی که بتوانید سبک معاملاتی مربوط به خودتان را مشخص سازید. اگر تصمیم به معامله بر اساس برنامه معاملاتی تان دارید، تا زمانی که قدرت و ضعف برنامه معاملاتی خودتان را نمی دانید، ترید واقعی نکنید. همچنین بدون داشتن یک برنامه معاملاتی مکتوب از ترید کردن خودداری کنید. آیا شما یک فعالیت تجاری را بدون داشتن یک برنامه تجاری آغاز می کنید؟ برای موفقیت مجبورید مانند حالتی که این کار یک تجارت است فکر کنید و عمل کنید. در غیر این صورت شکست خواهید خورد. این برنامه معاملاتی ماست:

- فقط بر روی جفت ارزها معامله می کنیم. هرگز بیش از چهار جفت ارز را به طور همزمان معامله نمی کنیم چون مدیریت بیش از چهار جفت ارز به طور همزمان امری مشکل است.
- هرگز بیش از ۲۰ درصد سرمایه مان را در معامله وارد نمی کنیم.
- افزایش حجم نمی دهیم، بدین معنی، زمانی که وارد یک معامله شدید، پوزیشن های بیشتری را نمی توان به آن افزود.
- فقط ارزی که نتایج بک تست مثبت داشته اند را می توان مورد معامله قرار داد. اگر بک تست برای یک ارز صورت نگرفته، پس این ارز را نمی توان به صورت واقعی مورد معامله قرار داد.
- هرگز هیچ نوع تصمیم گیری لحظه ای نکنید. برنامه معاملاتی را بدون هیچ استثنائی دنبال کنید.
- کلیه معاملات بر اساس اصول ماهیانه مورد آنالیز قرار می گیرند تا مشخص شود برنامه معاملاتی یا استراتژی نیاز به تغییر دارد یا خیر.
- فقط از تایم فریم زمانی روزانه برای معامله استفاده می کنیم.
- فقط از بازار نقطه ای ارز برای معامله استفاده می شود، بدان معنی که هیچ گزینه ارزی دیگری وجود ندارد.
- زمانی که یک ارز مورد آنالیز و بررسی قرار می گیرد «خطارها» و «ورودها» برای هر دو جهت صعودی و نزولی قرار داده می شود. آن ارز را مجدداً مورد بررسی قرار نخواهیم داد تا زمانی که یک اخطار/ورود برای آن ارز راه اندازی شود. همه اخطارها بر اساس اصول هفتگی تعدیل می شوند.
- همیشه اخطارها را در زیر مقادیر مقاومت و در بالای مقادیر حمایت اصلی قرار دهید طوری که بتوان یک ورود را پیش از اینکه یک حرکت اصلی در ارز رخ دهد، قرار داد.

تشریح استراتژی:

در این بخش، بر روی معامله جفت ارزها متمرکز می‌شویم. استراتژی حال حاضر را می‌توان به سهولت تغییر داد و برای سهام، بازار فیوچر، اوراق، و غیره سازگار نمود. ایچیموکو برای همه نوع کالای تجاری عمل می‌نماید. به خاطر داشته باشید، هر کالای تجاری دارای خصوصیات خاص خود است؛ بنابراین ممکن است شما دارای استراتژی‌های مختلفی برای کالاهای خاص و یا گروهی از کالاهای تجاری باشید. به عنوان مثال، میزان توقف ورود/خروج کالای EURUSD (ارز یورو در مقابل ارز ایالات متحده) می‌تواند از GBPUSD (ارز بریتانیای کبیر در مقابل ارز ایالات متحده) متفاوت باشد به این دلیل که EURUSD فراریت و حرکات کمتری نسبت به GBPUSD دارد. اگر از مقادیر دقیق استفاده می‌کنید، پس برای EURUSD می‌توانید دامنه ورود/خروج ۴۰ پیپی داشته باشید، اما در مورد GBPUSD این مقدار باید ۵۰ پیپ باشد. بنابراین، با این کار، دارای یک استراتژی برای EURUSD و یک استراتژی برای GBPUSD می‌باشید. اگر می‌خواهید این کار را ساده‌تر نمایید، می‌توانید از میانگین دامنه صحیح Average True Range برای میزان ریسک استفاده نمایید و یک استراتژی برای هر دو ارز داشته باشید.

استراتژی صعودی (حالتی که قیمت کالا افزایش خواهد یافت)

قوانین	قوانین ورود
	قیمت باید بالای ابر کومو باشد.
	تتکانسن بالای کیجنسن باشد.
	چیکواسپن حرکت جنبشی صعودی قوی داشته باشد (در فضای باز واقع شده باشد)
	حداقل ۵۰ پیپ تا حمایت یا مقاومت اصلی بعدی وجود داشته باشد.
	کوموی آینده صعودی باشد.
	اختلاف بین قیمت ورود و تتکانسن باید کمتر از ۲۰۰ پیپ باشد. در غیراینصورت، باید صبر کنید تا با این مقدار برابر شود و به سمت محدوده مورد نظر بازگردد.
	اختلاف بین قیمت ورود و کیجنسن باید کمتر از ۳۰۰ پیپ باشد. در غیر اینصورت بایستی صبر کنید تا با این مقدار برابر شده و به سمت محدوده مورد نظر بازگردد.
	بافر ورود مساوی ۴۰ پیپ باشد.
	همه اجزاء ایچیموکو باید صعودی باشند.
مدیریت سرمایه	
	اگر قیمت بیش از ۲۰۰ پیپ از تتکانسن فاصله داشته باشد، در صورتی که تتکانسن مسطح شود، از معامله خارج شوید.
	اگر سود برابر یا بیشتر از ۳۰۰ پیپ باشد، از تتکانسن و بافر به عنوان «توقف معامله‌تان» استفاده کنید.
	بافر خروج برابر با ۴۰ پیپ می‌باشد.
	اخطارهای صعودی را قرار دهید و تنظیم نمایید.
	هر روز توقف‌های معاملات را تنظیم و تعدیل نمایید.
	اخطار را در کیجنسن برای بستن سفارشات ورود قرار دهید.

استراتژی نزولی (حالتی که قیمت کالا کاهش خواهد یافت)

قوانین	قوانین ورود
	قیمت باید زیر ابر کومو باشد.
	تتکانسن زیر کیجنسن باشد.
	چیکواسپن حرکت جنبشی نزولی قوی داشته باشد (در فضای باز واقع شده باشد)
	حداقل ۵۰ پیپ تا حمایت یا مقاومت اصلی بعدی وجود داشته باشد.
	کوموی آینده نزولی باشد.
	اختلاف بین قیمت ورود و تتکانسن باید کمتر از ۲۰۰ پیپ باشد. در غیراینصورت، باید صبر کنید تا با این مقدار برابر شود و به سمت محدوده مورد نظر بازگردد.
	اختلاف بین قیمت ورود و کیجنسن باید کمتر از ۳۰۰ پیپ باشد. در غیر اینصورت بایستی صبر کنید تا با این مقدار برابر شده و به سمت محدوده مورد نظر بازگردد.
	بافر ورود مساوی ۳۵ پیپ باشد.
	همه اجزاء ایچیموکو باید نزولی باشند.
مدیریت سرمایه	
	اگر قیمت بیش از ۲۰۰ پیپ از تتکانسن فاصله داشته باشد، در صورتی که تتکانسن مسطح شود، از معامله خارج شوید.
	اگر سود برابر یا بیشتر از ۲۵۰ پیپ باشد، از تتکانسن و بافر به عنوان «توقف معامله تان» استفاده کنید.
	اگر مقدار بافر برابر با ۳۵ پیپ باشد، از معامله خارج شوید.
	اخطارهای صعودی را قرار دهید و تنظیم نمائید.
	هر روز توقف‌های معاملات را تنظیم و تعدیل نمائید.
	اخطار را در کیجنسن برای بستن سفارشات ورود قرار دهید.

فصل ۳

بک تست

ایچیمو کو

زمانیکه فردی با یک تریدر موفق برخورد می‌نماید، معمولاً چه نوع سوالاتی می‌پرسد؟ چه مقدار سود می‌کنید؟ چه مدتی است که در حال معامله‌گری هستید؟ درصد موفقیت سیستم‌تان چقدر است؟ آیا این تنها منبع درآمد شماست؟ این‌ها فقط چند سوال از سوالاتی هستند که افراد از تریدرهای موفق بارها و بارها می‌پرسند. زمانیکه در مورد یک سیستم تحقیق می‌کنید، آیا فکر می‌کنید این سوالات، اولین سوالاتی هستند که باید پرسید؟ زمانیکه تریدر پاسخ‌هایی برای سوالاتتان آماده می‌کند، آیا این پاسخ‌ها واقعی هستند؟ آیا می‌توانید هر چیزی که تریدر به شما می‌گوید را باور کنید؟ در صورتی که در مورد نحوه ترید فرد با سیستم در حال تریدش چیزی ندانید آیا آمارهای مربوط به سیستم تریدر وی برایتان منفعتی دارد؟ اگر بدانید آن فرد چطور ترید می‌کند پس می‌توانید این آمارها را خودتان از طریق گرفتن بک‌تست محاسبه نمایید.

بک‌تست:

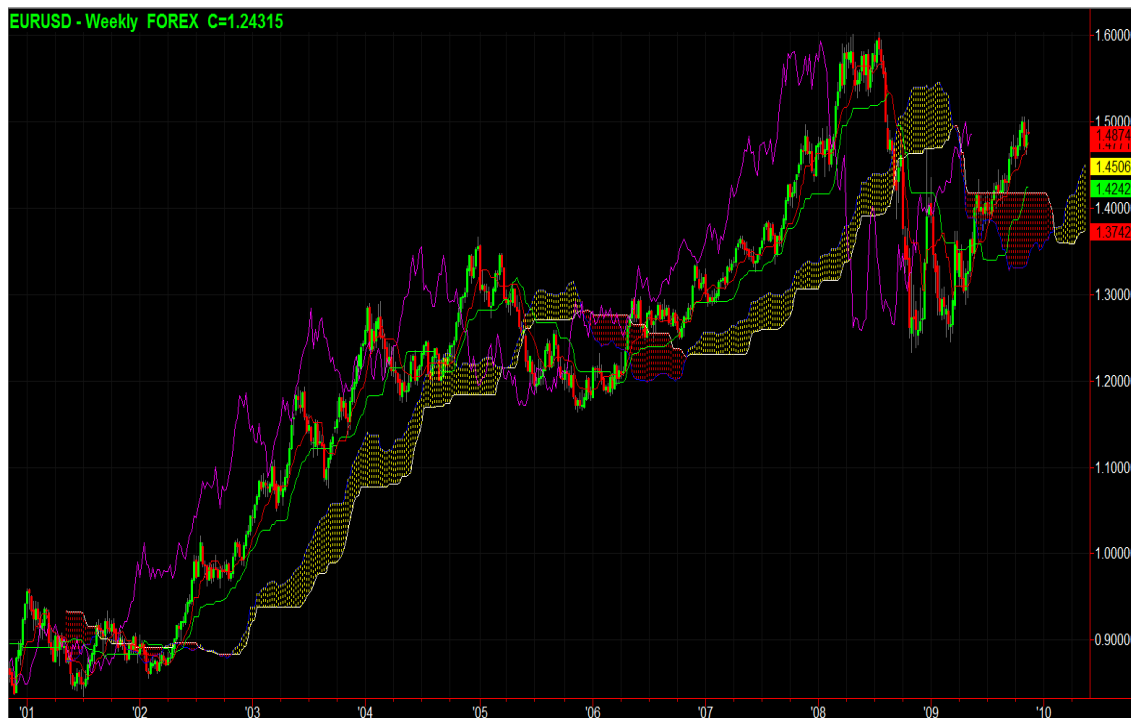
امروزه سیستم‌های تریدری زیادی وجود دارد که آمارهای مختلفی در مورد «مقدار موفقیت‌شان» ارائه می‌کنند. روش آزمایش سیستم‌های تریدری نگاه کردن به تریدهای برنده این سیستم‌ها نیست بلکه به جای آن، نگاه کردن به تریدهای بازنده این سیستم‌ها می‌باشد. در طی یک «حرکت صعودی»، هر فردی می‌تواند سیستمی ایجاد نماید و این سیستم نیز به خوبی عمل می‌نماید. در این حالت فرد فقط باید در طول یک دوره طولانی در روند صعودی باقی بماند. اگر بازار در یک لحظه به طور کامل به حالت معکوس درآید، سیستم آنها چطور عمل خواهد کرد؟ آیا یک سیستم توقف برای نقطه خاصی وجود دارد که باعث شود حاصل دو سال سود فرد از بین نرود. اگر باور ندارید این اتفاق رخ می‌دهد، در مورد آنچه که در سال ۲۰۰۸ برای بسیاری از تریدرها رخ داده، در اینترنت تحقیق کنید. برخی از تریدرها سود چهار ساله خودشان را طی سه ماه از دست دادند!

زمانیکه برای اولین بار مربی‌ام را دیدم، از او پرسیدم در یک هفته یا یک ماه چه مقدار سود می‌کند. اولین چیزی که از او پرسیدم این بود که او چطور ترید می‌کند. من بارها و بارها برای کسب همه دانشی که او در مورد ترید با ایچیموکو برای سال‌ها گردآوری نموده بود، به سخنانش گوش دادم. بعد از پرسیدن چند سوال اساسی، برای تعیین اعتبار گفته‌هایش، حرکت کردم. اعتبارسنجی با بک‌تست گرفتن از سیستم وی برای یک دوره زمانی خاص با لیست هدف‌گذاری شده از کالاهای خاصی به دست آمد. زمانیکه آزمایش بک‌تست کامل شد، نتایج را مورد آزمایش و بررسی قرار دادم و در همان لحظه او تبدیل به مربی من گردید.

مربی من مفهوم گرفتن بک‌تست را درک نکرد زیرا همه آموزشی که کسب نموده بودم، به صورت ترید واقعی بود. همچنین این بک‌تست فقط بازار ارز را هدف‌گیری نموده بود زیرا این تمام چیزی بود که وی می‌دانست. بعد از چند ماه مربی‌گری در حالت «زنده»، با استفاده از همه دانشی که کسب و فراگرفته بودم، برنامه‌های معاملاتی مختلفی فرمولاسیون کردم. سپس این برنامه‌های معاملاتی با بازار سهام، فیوچر، ارزها، اوراق، و غیره بک‌تست گرفتم. به معنی واقعی کلمه حدود شش ماه در حال بک‌تست گرفتن بودم. در خاتمه این مسیر، برنامه‌های تجاری که به لحاظ تاریخی خودشان موفق بودند را انتخاب کردم و شروع به ترید با این برنامه‌ها به صورت واقعی نمودم. تاریخچه معاملاتی، شکل متفاوتی از ترید واقعی می‌باشد. در ترید واقعی، همه هیجانات «مشارکت دارند»، که در عوض همین هیجانات می‌توانند باعث شکست شما نیز شوند. سالیان بعد، من هنوز هم در حال ترید با ایچیموکو کینکو هایو بودم. در واقع، زمانیکه از ایچیموکو برای ترید همه کالاها استفاده نمودم و همچنین دارای برنامه‌های تجاری مختلف و استراتژی‌های متفاوتی برای موقعیت‌های مختلف بازار بودم باعث تعجب مربی‌ام شدم.

EURUSD – یک بک تست دو ساله

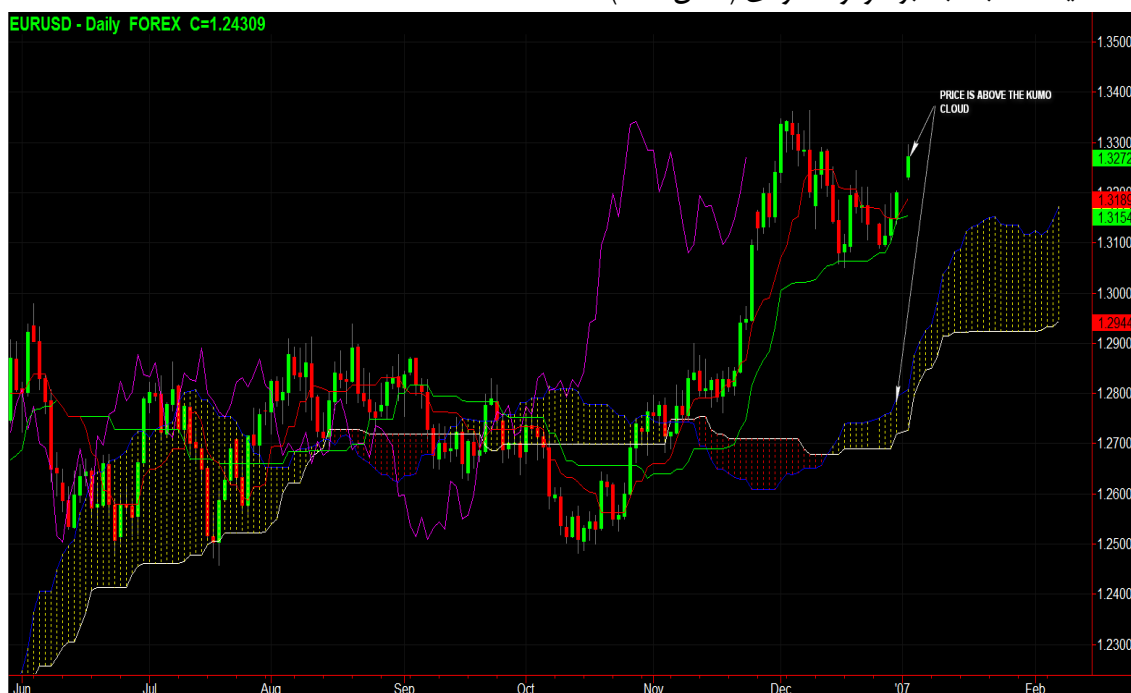
در این بخش، برنامه معاملاتی مان را با دو استراتژی و بک تست آن برای یک کالا مورد بررسی قرار می‌دهیم. ما از کالای جفت‌ارز EURUSD و دوره زمانی بک تست از ۱ ژانویه ۲۰۰۷، تا ۹ نوامبر ۲۰۰۹، یک دوره بک تست دو ساله استفاده می‌کنیم. (شکل ۱-۳)



شکل ۱-۳: نمودار هفتگی از چارت روزانه EURUSD از ۱ ژانویه ۲۰۰۷، تا ۹ نوامبر ۲۰۰۹

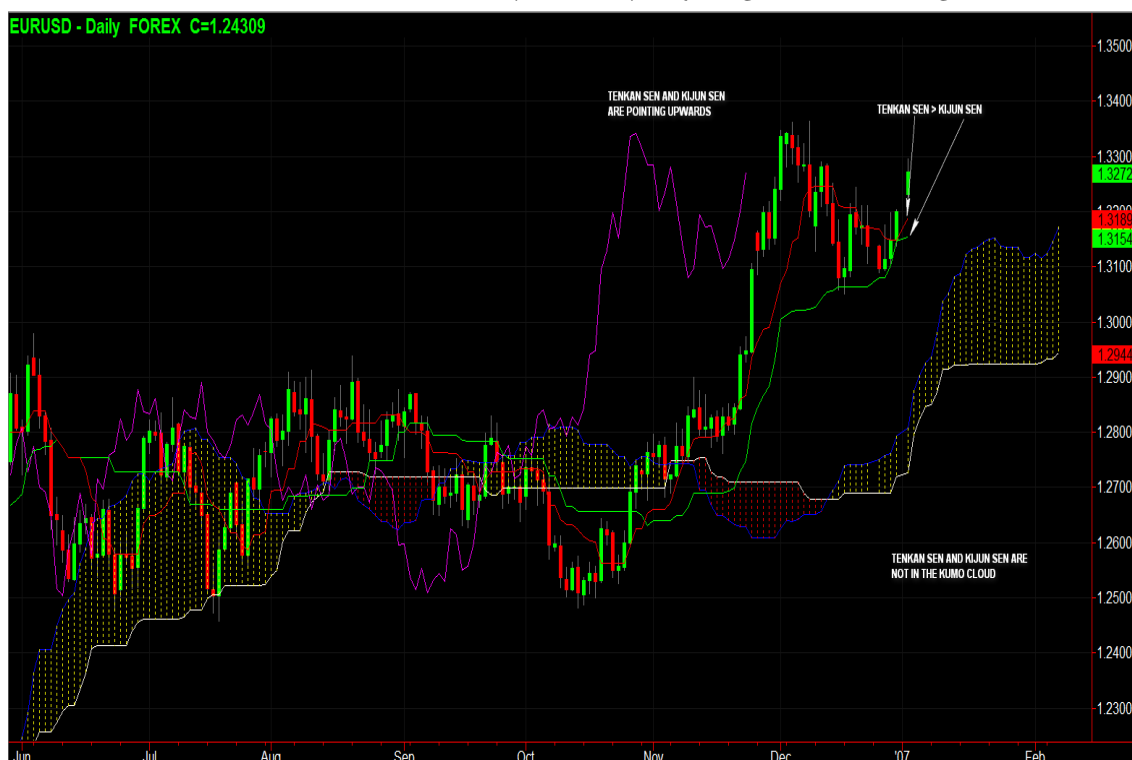
آنالیز کامل اندیکاتورهای ایچیموکو برای ۱ ژانویه ۲۰۰۷ به صورت زیر می‌باشد:

- قیمت نسبت به ابر کومو: صعودی (شکل ۲-۳)



شکل ۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱ ژانویه ۲۰۰۷

• رابطه تنکانسن نسبت به کیجنسن: صعودی (شکل ۳-۳)



شکل ۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱ ژانویه ۲۰۰۷

- فاصله از تنکانسن: $۱.۳۲۷۲ - ۱.۳۱۸۹ = ۰.۰۰۸۳ = ۸۳$ پیپ (داخل ۲۰۰ پیپ مشخص شده در برنامه معاملاتی).
- فاصله از کیجنسن: $۱.۳۲۷۲ - ۱.۳۱۵۴ = ۰.۰۱۱۸ = ۱۱۸$ پیپ (داخل ۳۰۰ پیپ مشخص شده در برنامه معاملاتی).
- قیمت درون ابر کومو: خیر (درون ابر کومو نشان دهنده حالت تثبیت و بدون روند است)
- وجود روند در تنکانسن: بله (در جهت صعودی)
- وجود روند در کیجنسن: بله (تا حدودی در جهت صعودی و برای مدت زمان طولانی مسطح نشده است).
- * چیکواسپین: صعودی (بالای قیمت ۲۶ روز قبل) (شکل ۴-۳)
- پیش‌بینی وضعیت افقی: ضعیف، می‌تواند وارد کندل‌های قیمتی شود اگر برای ۴ یا بیش از ۴ روز قیمت در حالت تثبیت و ساید باشد.
- پیش‌بینی وضعیت عمودی: ضعیف، یک حرکت نزولی ۱۰۰ پیپی می‌تواند باعث شود چیکواسپین قیمت را در ۲۶ روز قبل لمس نماید.
- معیارهای مورد نیاز روند: اگر قیمت بتواند از آخرین قیمت نهایی قبلی که کمتر از ۱۰۰ پیپ دورتر است، عبور کند این شانس وجود دارد که قیمت وارد یک «منطقه باز» قوی گردد. در «منطقه باز»، روند صعودی می‌تواند تا حدودی توسعه یابد.
- داخل ابر کومو: خیر: اگر چیکو درون ابر کومو باشد، نشاندهنده عدم وجود روند و حالت تثبیت است.



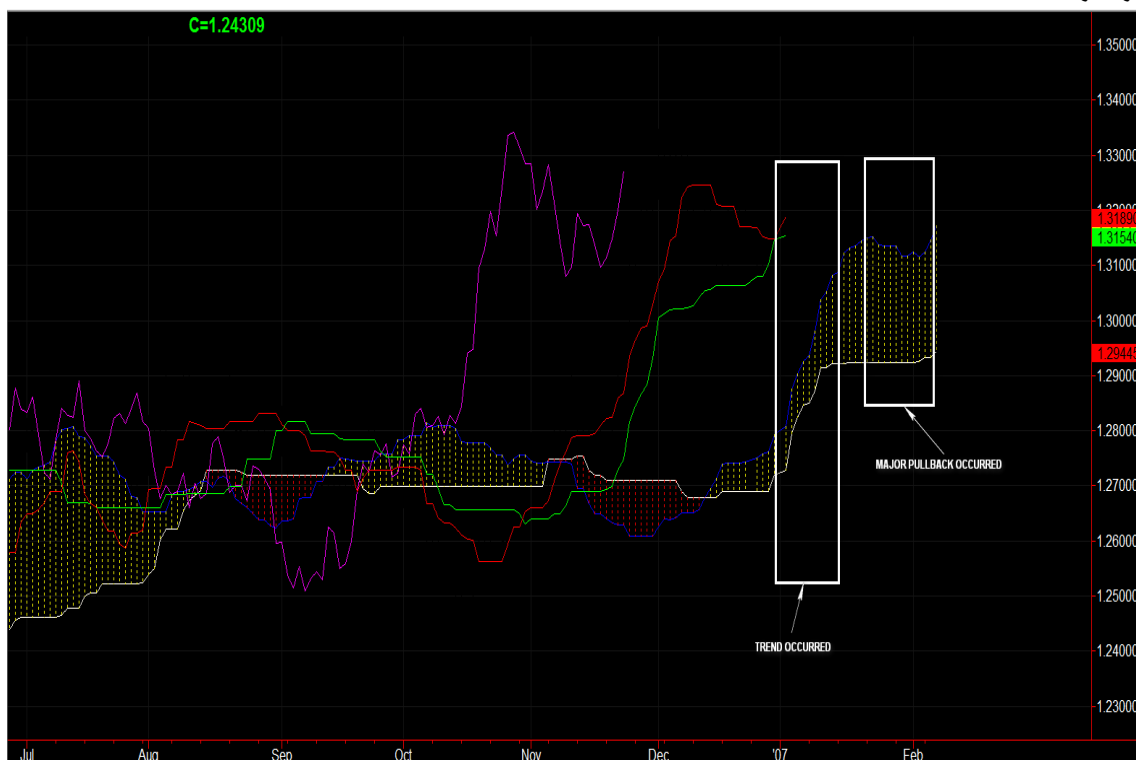
شکل ۳-۴: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱ ژانویه ۲۰۰۷

- ابر کومو (شکل ۳-۵)
- ابر آینده: صعودی
- وجود روند در سنوکواسپین A: بله: در حال حرکت در جهت روند.
- وجود روند در سنوکواسپین B: بله: در حال حرکت در جهت روند.
- ضخامت ابر آینده: ضخیم: نشان می‌دهد روند ممکن است بلندمدت نباشد، و بیشتر نشاندهنده وجود روند میان مدت تا کوتاه مدت است.
- سایه‌های کومو: خیر: در مدت ۱۲ ماه.



شکل ۳-۵: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱ ژانویه ۲۰۰۷

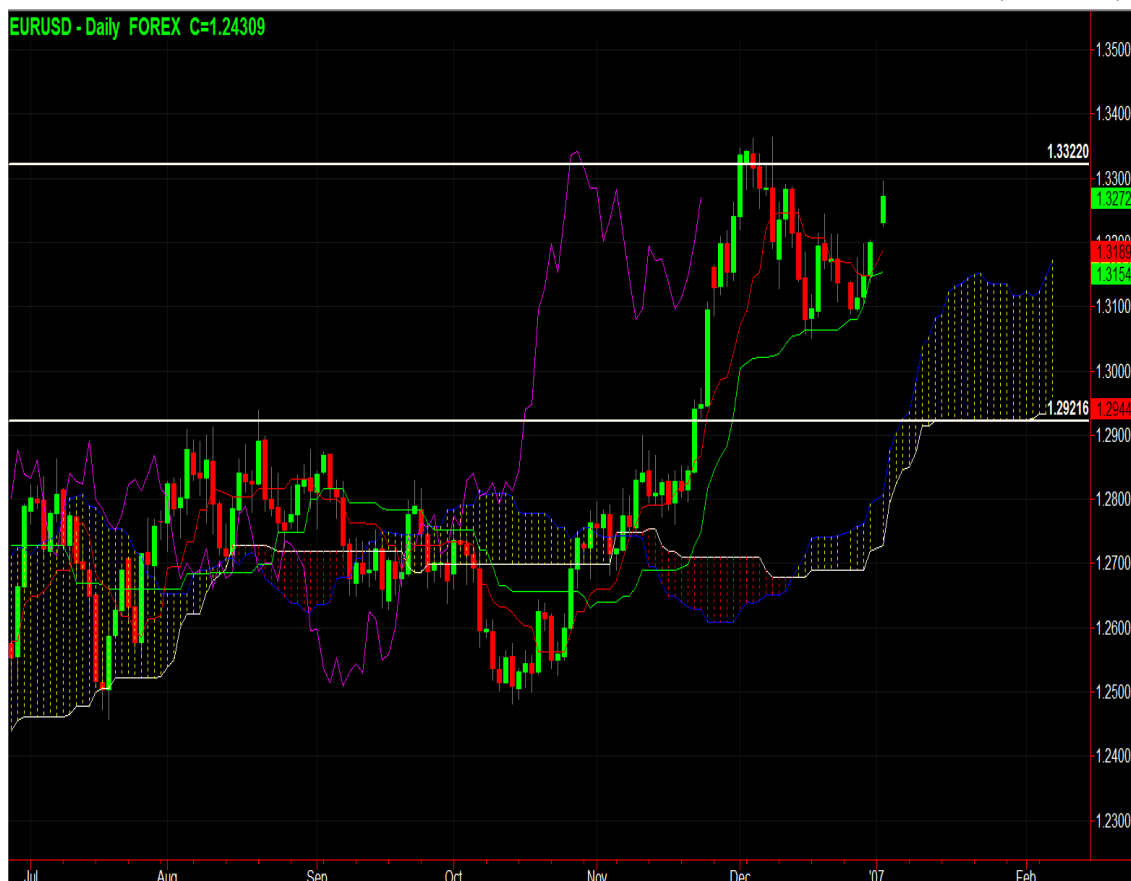
آنالیز نشان می‌دهد همه اندیکاتورهای صعودی هستند. همانطور که در شکل ۳-۶ نشان داده شده، اگر قیمت از نمودار حذف گردد، چه اتفاقی رخ می‌دهد؛ در این صورت آیا از طریق اندیکاتورهای ایچیموکو می‌توانید بگویید در طول زمان چه اتفاقی برای قیمت رخ داده است؟ پاسخ بله است. به وضوح می‌توانید ببینید چه اتفاقی برای قیمت رخ داده است. اگر نتوانید این امر را ملاحظه نمایید، لازم است یکبار دیگر با دقت و تمرین بیشتری به نمودارهای ایچیموکو کینکوها یو نگاه کنید.



شکل ۳-۶: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱ ژانویه ۲۰۰۷

چه باور کنید یا خیر، بهترین راه این است که قیمت را از نمودار حذف کنید و نمودار را مورد بررسی قرار دهید. ابر کوموی آینده نشان می‌دهد روندی پیش از این توسعه یافته و اینکه به دلیل ضخامت ابر کومو و حالت سنوکواسپین A که در حال حرکت به سمت بالا است، انتظار ادامه روند را داریم. همچنین چیکواسپین می‌گوید که نبایست وارد معامله شویم مگر اینکه قیمت به اخطار صعودی ما برخورد نماید (نزدیک به آخرین قیمت بالا بر روی نمودار) که در این نقطه قیمت شانس برای کسب یک حرکت جنبشی دارد.

اقدام: قصد داریم اخطارهای صعودی و نزولی مان را بر روی نمودار قرار دهیم و منتظر بمانیم این اخطارها راه‌اندازی شوند (شکل ۷-۳).

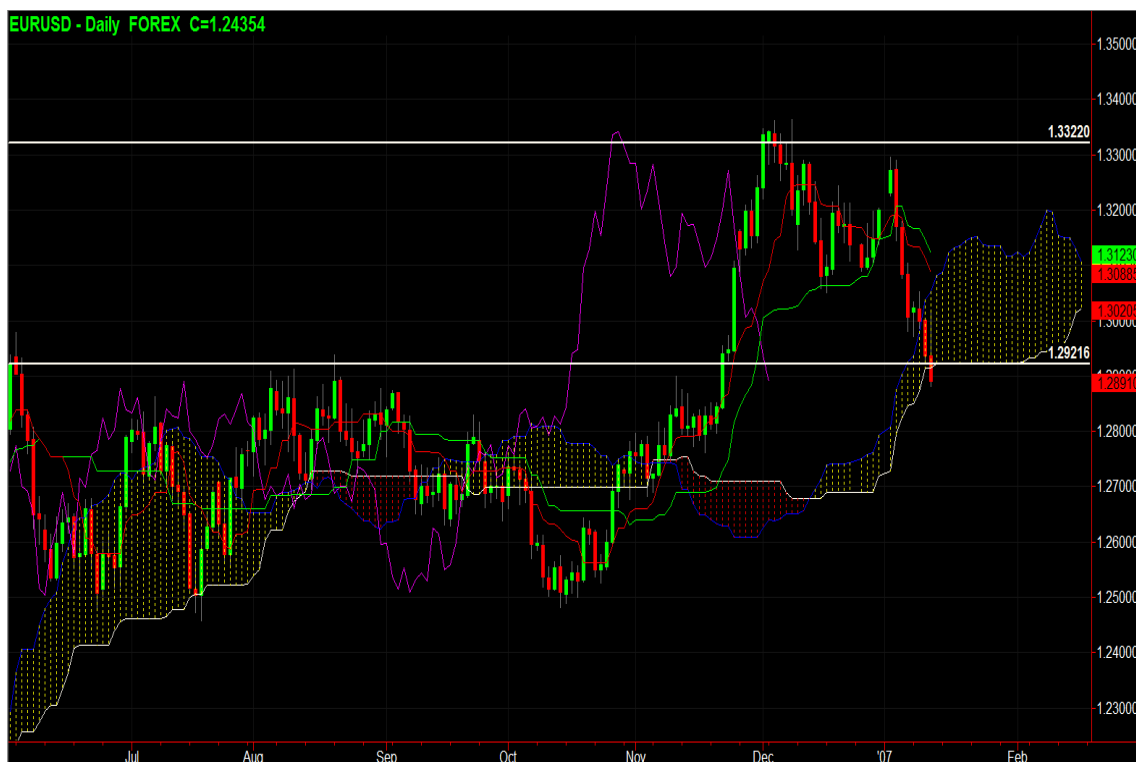


شکل ۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱ ژانویه ۲۰۰۷

اخطار نزولی را می‌توان یا در زیر کیجنسن (که نشان‌دهنده تغییر روند است) و یا در زیر ابر کومو قرار داد. من از ابر کومو برای اخطار نزولی استفاده می‌کنم زیرا ابر کومو ضخیم است. اگر ابر کومو نازک می‌بود، این اخطار را در زیر کیجنسن قرار می‌دادم چون قیمت می‌تواند از داخل یک ابر کوموی نازک عبور نماید.

در مورد اخطار صعودی، به بالاترین قله چیکواسپین نگاه کردم و اخطاری را در زیر این قله قرار دادم. به خاطر داشته باشید، چیکواسپین قیمت بسته‌شدن را که به ۲۶ دوره قبل منتقل شده است نشان می‌دهد، و بالاترین قیمت انتقال یافته به ۲۶ دوره قبل را نشان نمی‌دهد (یعنی پیک قیمت را نشان نمی‌دهد بلکه قیمت بسته شدن را نشان می‌دهد). اگر اخطاری در زیر بالاترین قله در خط چیکواسپین قرار دهیم، پس شانس قراردادن ورود به یک معامله پیش از اینکه قیمت از بالاترین قیمت آخر عبور نماید را در اختیار داریم. به خاطر داشته باشید نمی‌خواهید فرصت را از دست دهید چون اگر فرصت را از دست دهید، مجبور خواهید بود برای ترید بعدی منتظر بمانید، که ممکن است مدتی طول بکشد.

همانطور که در شکل ۸-۳ نشان داده شده، اخطار نزولی، در ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷ راه‌اندازی گردید.



شکل ۸-۳: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷

آنالیز کامل اندیکاتورهای ایچیموکو برای این روز به صورت زیر می باشد:

- قیمت نسبت به ابر کومو: نزولی: همانطور که در شکل ۹-۳ نشان داده شده، قیمت بسته شدن زیر ابر کومو است.



شکل ۹-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷

- وضعیت تنکانسن نسبت به کیجنسن: نزولی (شکل ۱۰-۳).



شکل ۱۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، UERUSD، ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷

- فاصله از تنکانسن: $۱.۳۰۸۸ - ۱.۲۸۹۱ = ۰.۰۰۹۷ = ۹۷$ پیپ (داخل ۲۰۰ پیپ مشخص شده در برنامه معاملاتی)
- فاصله از کیجنسن: $۱.۳۱۲۳ - ۱.۲۸۹۱ = ۰.۰۲۳۲ = ۲۳۲$ پیپ (داخل ۳۰۰ پیپ مشخص شده در برنامه معاملاتی).
- تنکانسن داخل ابر کومو: خیر، اما به زودی وارد خواهد شد. ابر کومو ضخیم است.
- وجود روند در تنکانسن: بله: در حال حرکت نزولی.
- وجود روند در کیجنسن: بله: در حال حرکت نزولی.
- چیکواسپن: نزولی (در زیر قیمت ۲۶ روز قبل) (شکل ۱۱-۳).
- پیش‌بینی وضعیت افقی: نزولی قوی.
- پیش‌بینی وضعیت عمودی: نزولی قوی.
- معیارهای مورد نیاز روند: از قبل در «فضای باز» بوده است.
- داخل ابر کومو: خیر، اگر قیمت داخل ابر کومو باشد، نشاندهنده عدم وجود روند و تثبیت است.



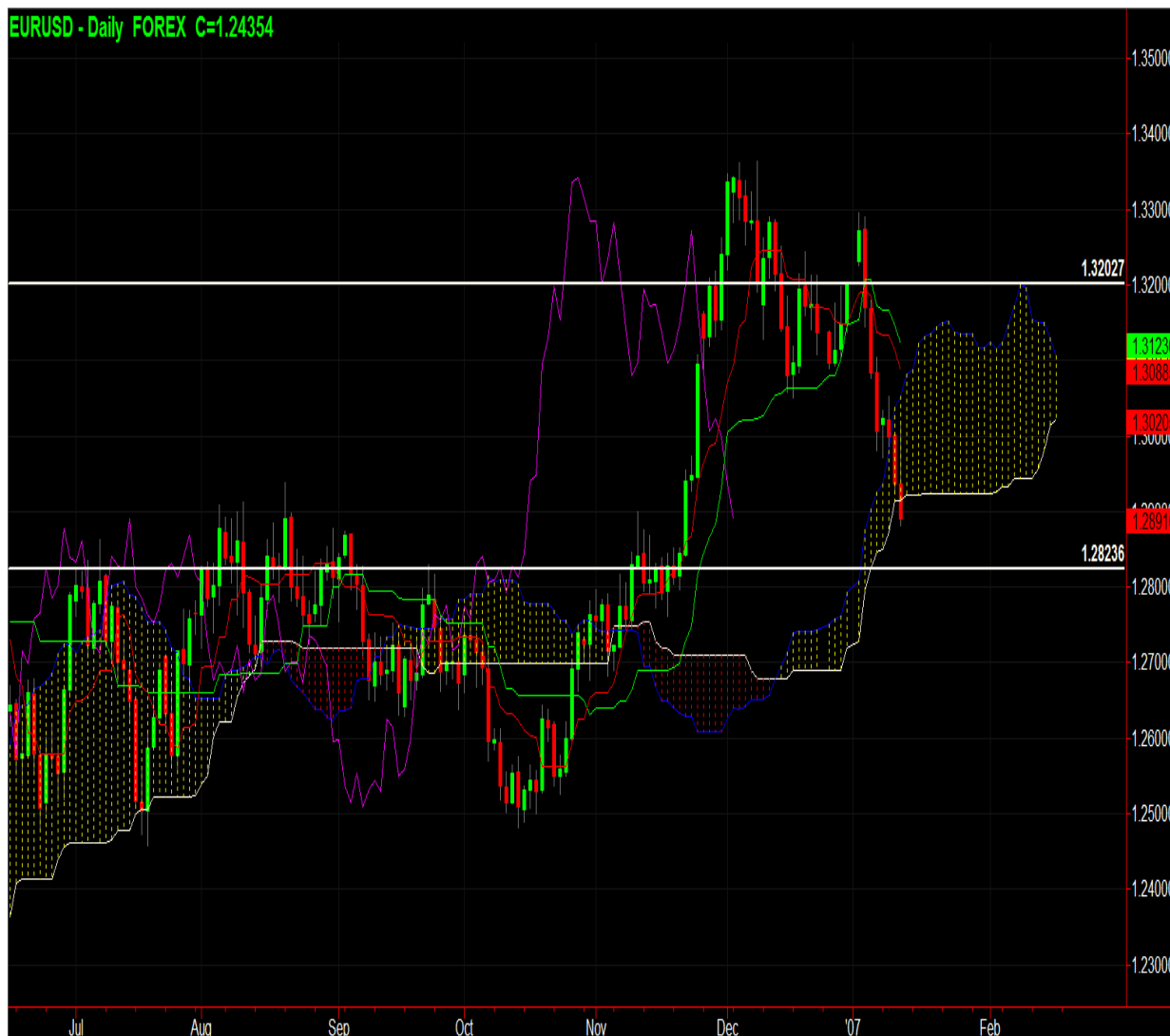
شکل ۱۱-۳: نمودار روزانه ایچیمو کو، EURUSD، ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷.

- ابر کومو (شکل ۱۲-۳).
- ابر آینده: صعودی.
- وجود روند سنوکواسپین A: خیر: در حال حرکت در جهت مخالف روند.
- وجود روند سنوکواسپین B: بله، هنوز هم تا حدودی در حال حرکت به سمت بالا.
- ضخامت ابر آینده: ابر کوموی آینده در حال حاضر در حال نازک شدن است درحالیکه سنوکواسپین A در حال حرکت به سمت پائین است تا با سنوکواسپین B برخورد نماید. یا در یک پولبک اصلی هستیم و یا در حال برگشت روند.
- سایه‌های کومو: خیر، درون یک دوره ۱۲ ماهه.



شکل ۱۲-۳: نمودار روزانه ایچیمو کو، EURUSD، ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷.

اقدام: در این زمان، بین اندیکاتورهای تعارض و ناسازگاری وجود دارد. بنابراین، به سایر هشدارهایمان توجه می‌کنیم (شکل ۱۳-۳). اخطار نزولی به بالای حمایت اصلی بعدی منتقل می‌شود. اگر مطمئن نیستید چه نقطه‌ای را برای اخطار انتخاب نمایید، یک اخطار بسیار محافظه‌کارانه را انتخاب کنید که این نقطه جایی خواهد بود که اخطارتان را درست در حرکت نزولی بعدی به دست خواهید آورد. به خاطر داشته باشید، بهتر است بیشتر به جای اینکه نگران از دست دادن حرکت قیمت باشید، بیشتر هوشیار و مراقب باشید. برای اخطار صعودی، قصد داریم این اخطار را به بالای ابر کومو منتقل نماییم.



شکل ۱۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷.

اخطار صعودی در تاریخ ۲۶ فوریه ۲۰۰۷ راه اندازی گردید. پیش از این که این اخطار را مورد بحث قرار دهیم و آنالیز ایچیموکو را برای آن روز انجام دهیم، آیا به خطایی که پیش از این انجام داده بودیم، توجه نمودید؟ (شکل ۱۴-۳). ما از قوانین برنامه معاملاتی تخطی نمودیم جاییکه اخطارها باید در زیر مقاومت اصلی قرار داده شوند. این اخطار در یک مقاومت مهم قرار داده شد، بالای ابر کومو در تاریخ ۱۱ ژانویه، ۲۰۰۷.



شکل ۱۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷.

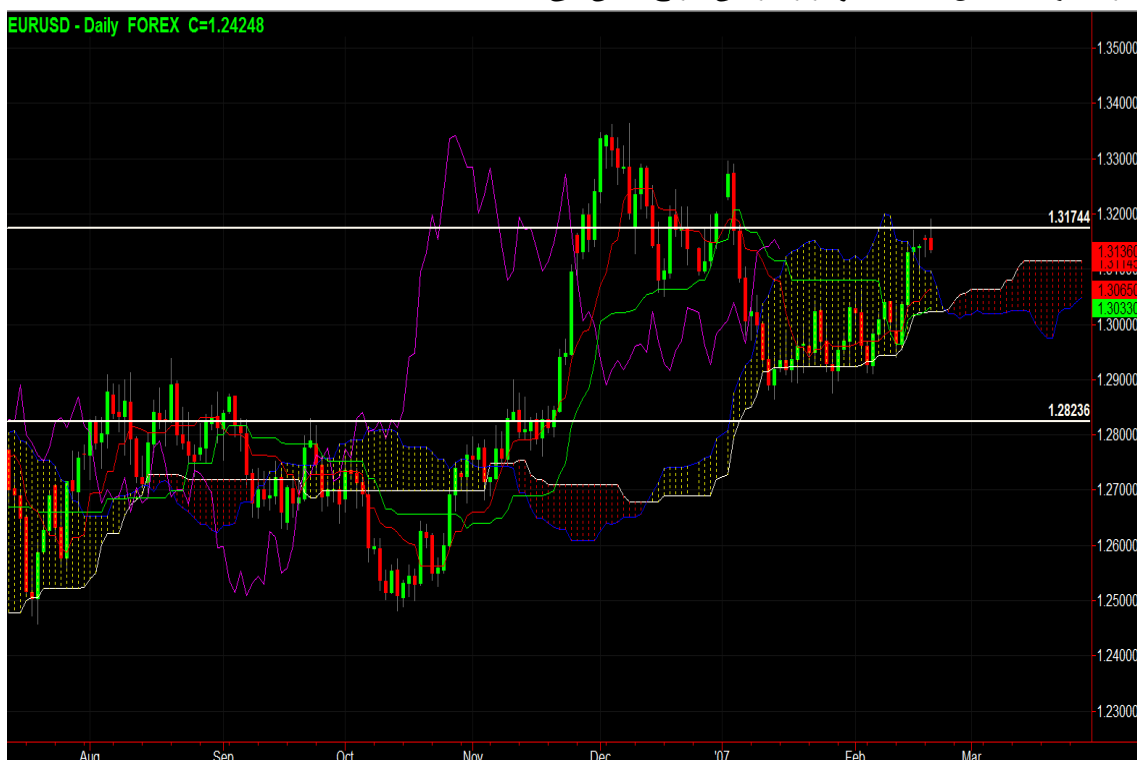
بنابراین، باید اخطار را زیر قله ابر کومو قرار می‌دادیم. به جزئیات بیشتر دقت کنید و برنامه معاملاتی خودتان را دنبال کنید. اگر متوجه اشتباه شدید، کار بزرگی انجام داده‌اید! اکنون، خواهید دید چرا اخطار در زیر مقاومت اصلی قرار داده شده است؟ اگر اخطاری در زیر مقاومت اصلی قرار دهیم زمانیکه این اخطار راه‌اندازی می‌شود، در یک موقعیت کامل قرار خواهیم داشت تا دستور ورود دیگری برای «انجام» بریک‌اوت آن مقاومت مهم داشته باشیم. اگر اخطار در مقاومت اصلی می‌بود، بریک‌اوت مقاومت اصلی فقط باعث می‌شد تا این اخطار راه‌اندازی و اجرا گردد. در آن نقطه، می‌توانستیم یک دستور ورود قرار دهیم.

به دلیل بروز خطا، می‌خواهیم همه چیز را یادآوری کنیم و این کار را به صورت درست انجام دهیم. بنابراین، شکل ۱۵-۳ اخطار درست را نشان می‌دهد که باید در تاریخ ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷ قرار داده می‌شد.



شکل ۱۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ ژانویه ۲۰۰۷.

با توجه به اخطارهای تصحیح شده، اکنون می‌توانیم عملیات بک‌تست‌مان را ادامه دهیم. در ۲۰ فوریه ۲۰۰۷، اخطار ما راه‌اندازی گردید. شکل ۱۶-۳ نمودار را در این تاریخ نشان می‌دهد.



شکل ۱۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ فوریه ۲۰۰۷.

آنالیز ایچیموکویی نمودار شکل ۱۶-۳ در بخش زیر ارائه شده است.

- قیمت نسبت به ابر کومو: نزدیک بالای ابر کومو (شکل ۱۷-۳)



شکل ۱۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ فوریه ۲۰۰۷.

- رابطه تنکانسن نسبت به کیجنسن: صعودی (شکل ۱۸-۳).



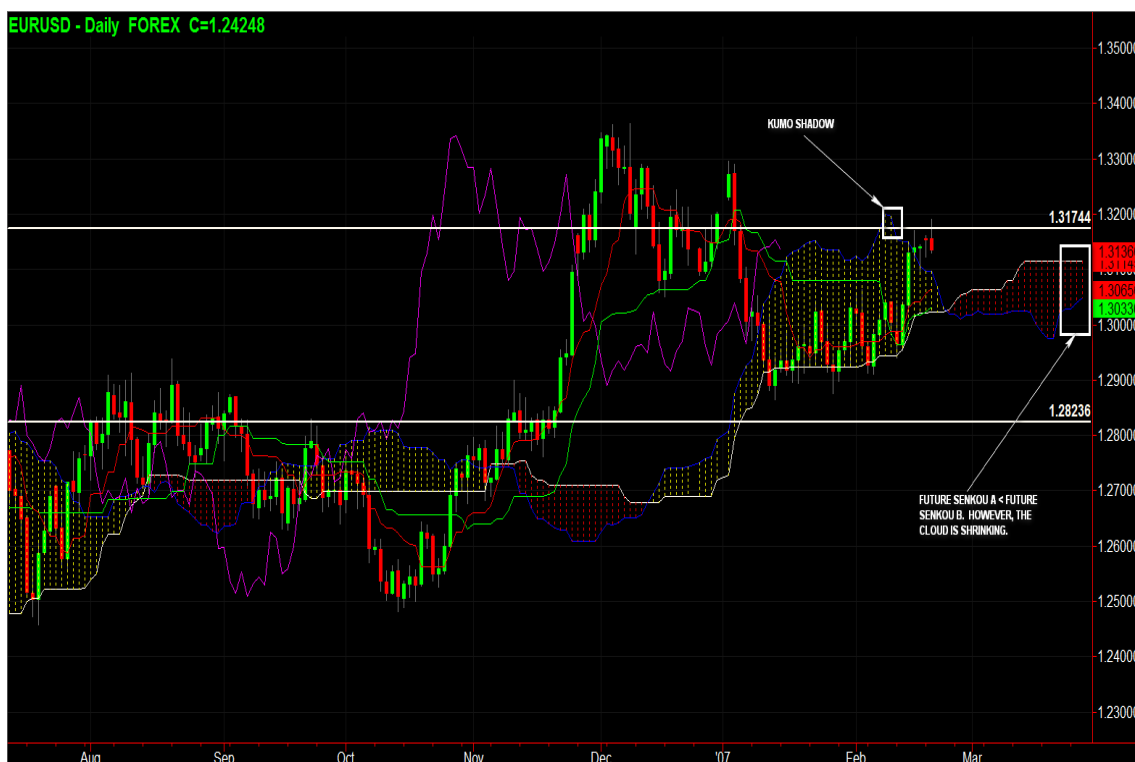
شکل ۱۸-۳: نمودار روزانه ایچیمو کو، EURUSD، ۲۰ فوریه ۲۰۰۷.

- فاصله از تنکانسن: $۱.۳۱۳۶ - ۱.۳۰۶۵ = ۰.۰۰۷۱ = ۷۱$ پیپ (داخل ۲۰۰ پیپ مشخص شده در برنامه معاملاتی).
- فاصله از کیجنسن: $۱.۳۱۳۶ - ۱.۳۰۳۳ = ۰.۰۱۰۳ = ۱۰۳$ پیپ (داخل ۳۰۰ پیپ مشخص شده در برنامه معاملاتی).
- داخل ابر کومو: فقط کیجنسن وارد ابر کومو شده است. هرچند، اگر کیجنسن به سمت بالا حرکت کند، از ابر کومو خارج خواهد شد بنابراین به یک حرکت صعودی نیاز است تا کیجنسن بتواند از ابر کومو خارج شود.
- وجود روند تنکانسن: بله: در حال حرکت صعودی.
- وجود روند کیجنسن: بله: در حال حرکت صعودی.
- چیکواسپین: صعودی (در بالای قیمت ۲۶ روز قبل). (شکل ۱۹-۳).



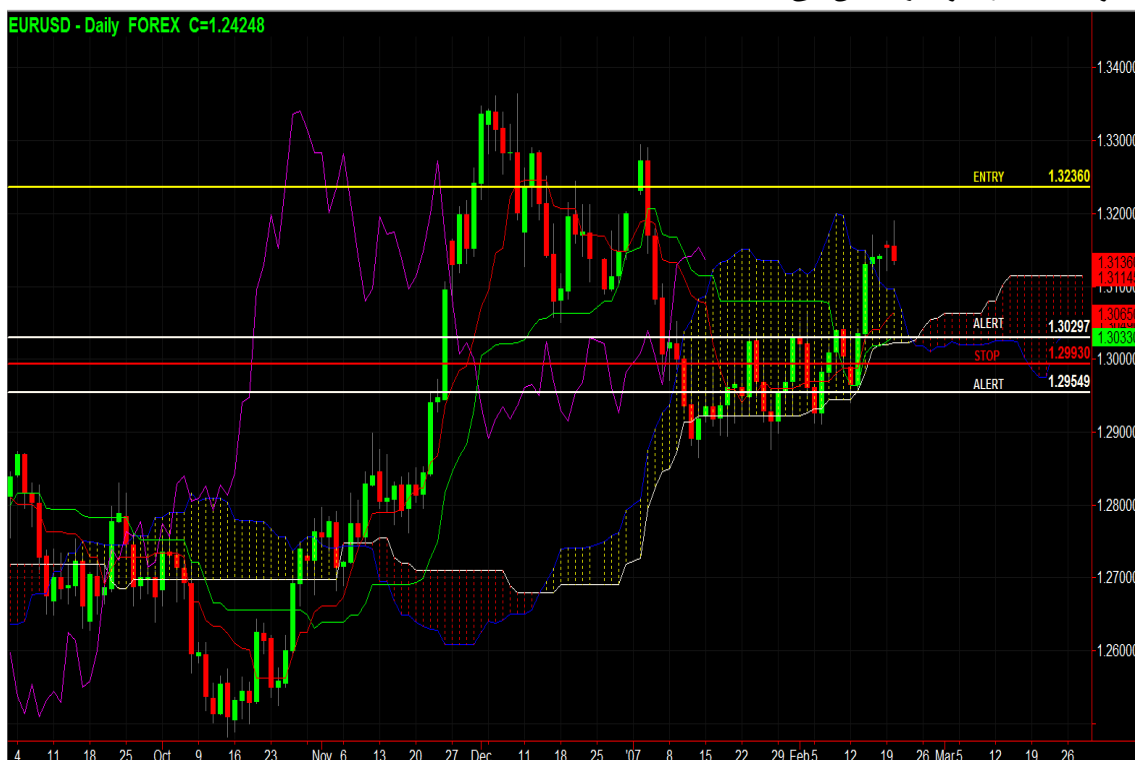
شکل ۱۹-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ فوریه ۲۰۰۷.

- پیش‌بینی افقی: صعودی قوی.
- پیش‌بینی عمودی: صعودی قوی اگر قیمت به سمت بالاتر حرکت کند.
- معیارهای مورد نیاز روند: اگر قیمت به سمت بالاتر حرکت کند، چیکواسپین در یک «فضای باز» قرار خواهد گرفت.
- داخل ابر کومو: خیر، اما اگر قیمت کاهش یابد، چیکواسپین می‌تواند وارد ابر کومو شود.
- ابر کوموی آینده (شکل ۲۰-۳).
- ابر آینده: نزولی (در حال چرخش).
- وجود روند در سنوکواسپین A: بله، در حال حرکت صعودی
- وجود روند در سنوکواسپین B: خیر، به صورت مسطح باقی مانده طوری که سنوکواسپین A می‌تواند آن را قطع نماید و باعث چرخش ابر کوموی آینده به صورت صعودی گردد.
- ضخامت ابر کوموی آینده: نازک که نشان‌دهنده این است که روندی می‌تواند رخ دهد.
- سایه‌های کومو: بله، اما زمانیکه قیمت بالای نوک ابر کومو حرکت کند، سایه دیگری وجود نخواهد داشت.



شکل ۲۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۹ فوریه ۲۰۰۷.

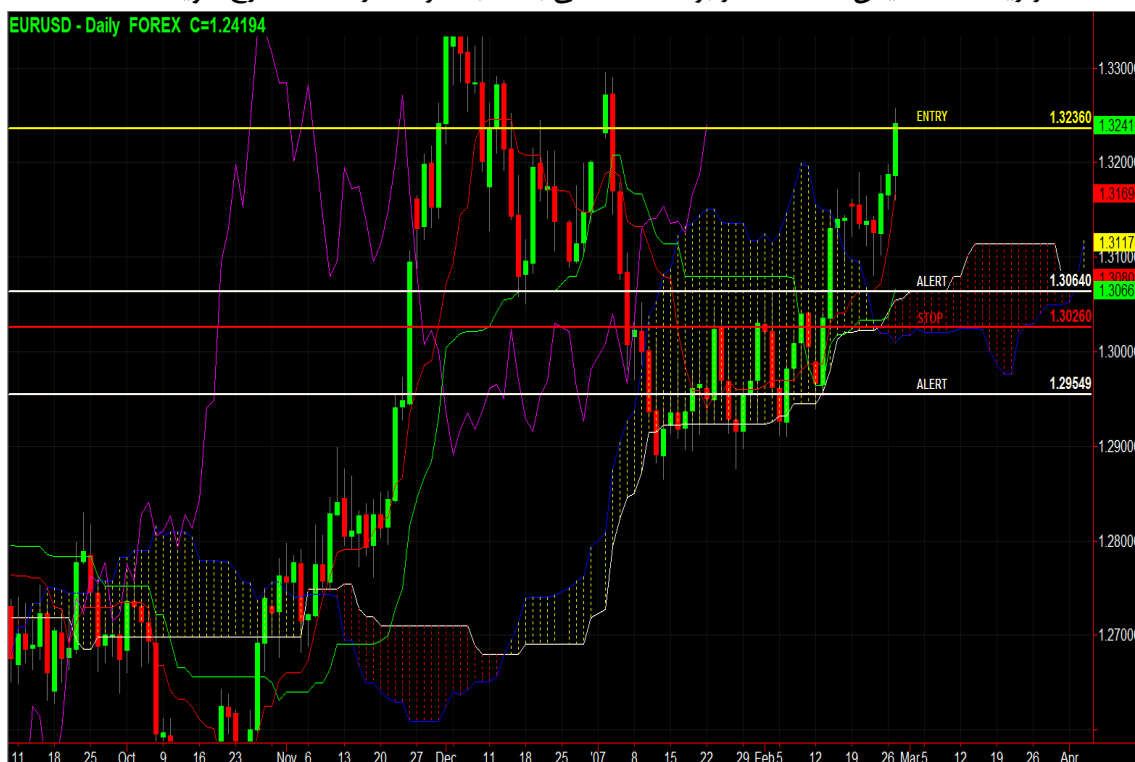
اقدام: یک ورود صعودی و یک اخطار نزولی بر اساس برنامه معاملاتی تنظیم کنید. شکل ۲۱-۳ نمودار را بانضمام نقطه ورود، توقف، اخطارها و غیره نشان می دهد.



شکل ۲۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ فوریه ۲۰۰۷.

- ورود: مقاومت اصلی: ۱.۳۱۹۶، ورود = مقاومت اصلی + بافر ورود (۴۰) = ۱.۳۲۳۶.
- توقف: کیجنسن = ۱.۳۰۳۳ = توقف = کیجنسن منهای بافر خروج (۴۰) = ۱.۲۹۹۳.

- حالت محافظت: تغییر توقف به تنکانسن = ورود + ۳۰۰ پیپ = ۱.۳۴۸۶. لطفاً توجه نمائید: تنظیمات اخطار در کیجنسن نیز وجود دارد. اگر نقطه ورود صعودی راه اندازی نشود و قیمت کیجنسن را قطع کند، پس این اخطار به ما خواهد گفت ورود را حذف کنیم و به جای آن اخطار نزولی قرار دهیم.
- شکل ۳-۲۲ این نمودار را برای EURUSD برای چند روز بعد در ۲۷ فوریه ۲۰۰۷ نشان می‌دهد. در روز ورود، باید: تایید کنید همه اندیکاتورهای ایچیموکو در وضعیت «مطلوب» هستند. اگر یکی از این اندیکاتورها در وضعیت مطلوب نباشد، از پوزیشن خارج شوید.
- تایید کنید قیمت از تنکانسن یا کیجنسن «فرار» نکرده است. اگر قیمت فرار کرده باشد، برنامه معاملاتی را دنبال کنید و در صورت نیاز از معامله خارج شوید.
- «توقف»ها و «اخطار»ها را تنظیم کنید. بعد از تنظیم نقاط توقف و اخطار، اگر در حال حاضر ریسک بزرگتر از مقدار ریسک تخصیص داده شده در برنامه معاملاتی باشد، به سرعت از معامله خارج شوید.



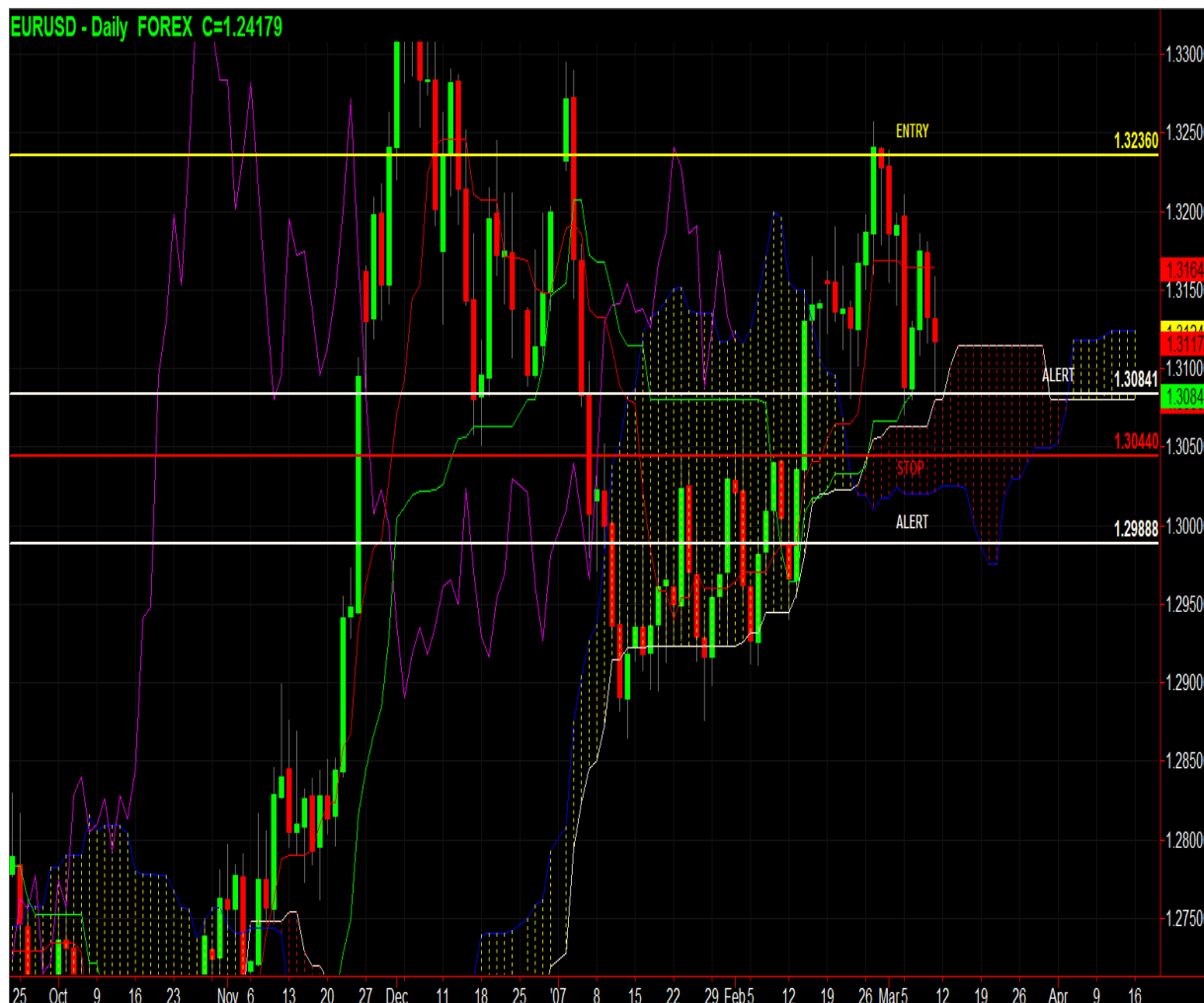
شکل ۳-۲۲: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۷ فوریه ۲۰۰۷.

در ۲۷ فوریه ۲۰۰۷ وارد ترید شدیم (شکل ۳-۲۲). جدول ۱-۳ اعداد مربوط به معامله ورودی را نشان می‌دهد. جدول ۱-۳: اعداد مربوط به معامله ورودی در مورد EURUSD در ۲۷ فوریه ۲۰۰۷، معامله #۱

Statistics	Value
Entry Date	Feb 27, 2007
Entry Price	1.3236
Entry Stop	1.3026
Entry Risk	210 pips

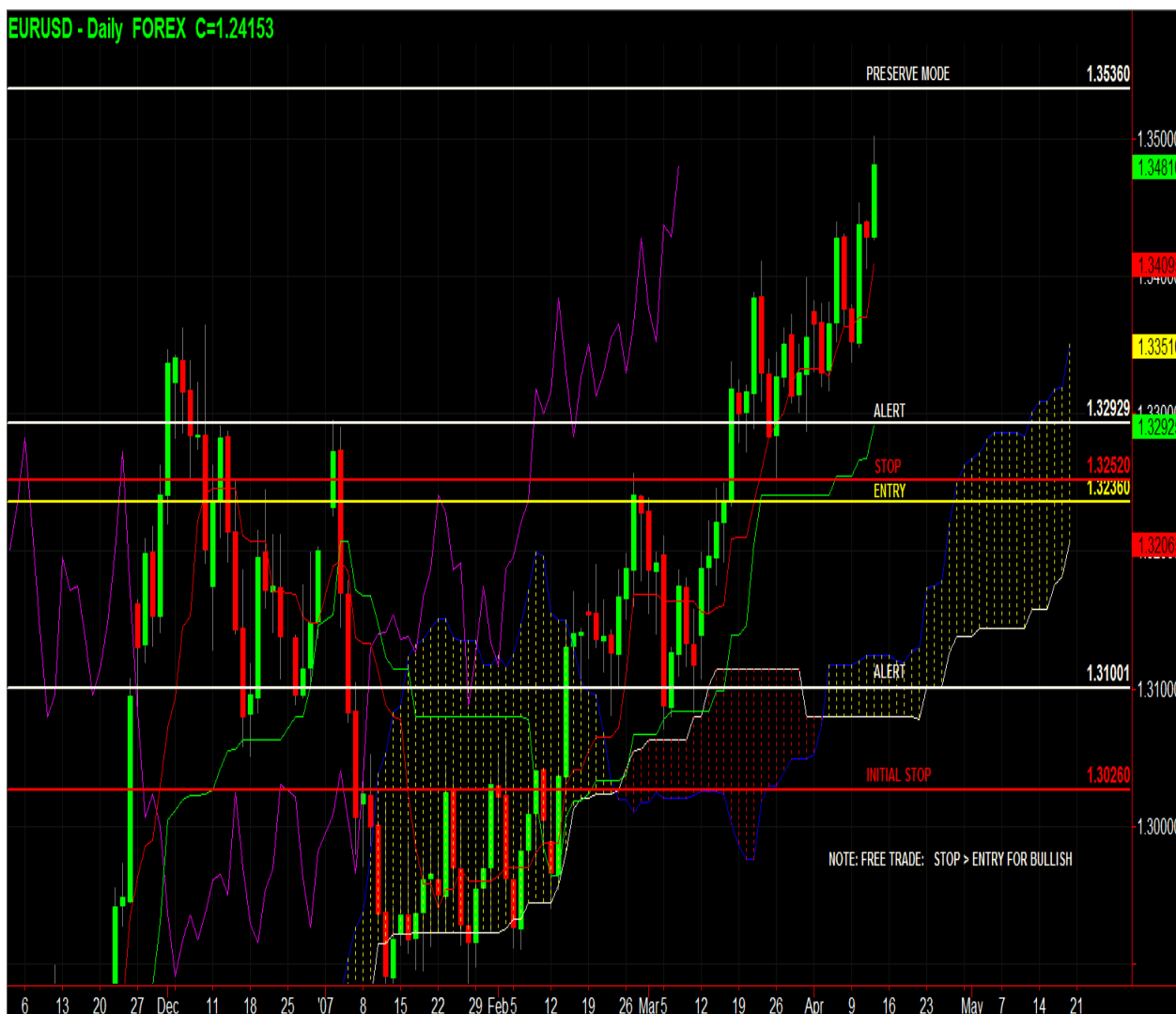
اکنون، نیاز است بخش مدیریت سرمایه برنامه معاملاتی مان را به صورت قدم به قدم و بدون هیچ نوع استثنایی دنبال کنیم. مدیریت سرمایه جایی است که تفاوت بین یک تریدر موفق یا یک تریدر غیرموفق را ایجاد خواهد نمود. از برنامه معاملاتی تان پیروی نمائید!

شکل ۲۳-۳ ترید را در ۹ مارس ۲۰۰۷ نشان می دهد. نقطه توقف مان را بر اساس برنامه معاملاتی مان تنظیم نموده ایم. زمانیکه این کار انجام گرفت، بک تست خودمان را ادامه می دهیم.



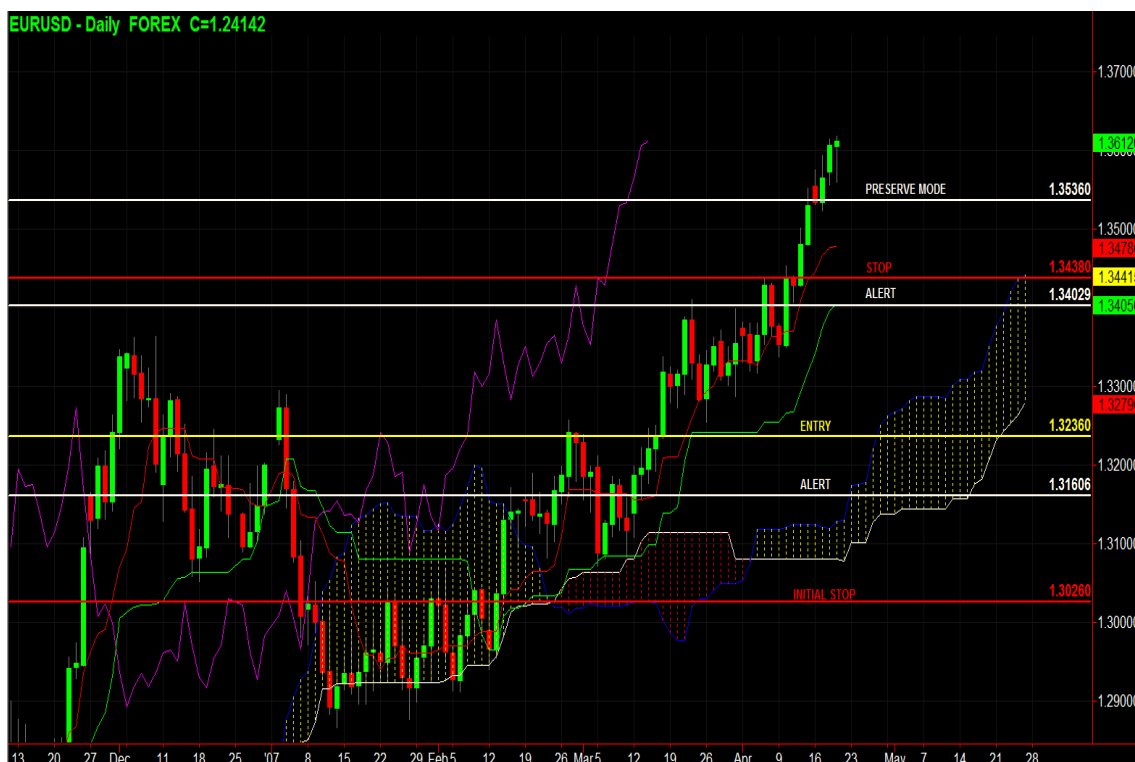
شکل ۲۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۹ مارس ۲۰۰۷.

شکل ۲۴-۳ ترید را در روز ۱۲ آوریل ۲۰۰۷ نشان می دهد. روند به خوبی در حال توسعه و گسترش است. در واقع، اکنون یک «تجارت آزاد» داریم. یک «تجارت آزاد» جایی است که توقف در بالای ورود برای یک موقعیت صعودی قرار دارد. اساساً، اگر امروز دستور توقفمان فعال شود، هیچ چیزی از سرمایه مان را از دست نخواهیم داد. در بسیاری از برنامه های معاملاتی، این محل جایی است که موقعیت دیگری را می توان به معامله افزود زیرا ریسک اولین پوزیشن از بین رفته است.



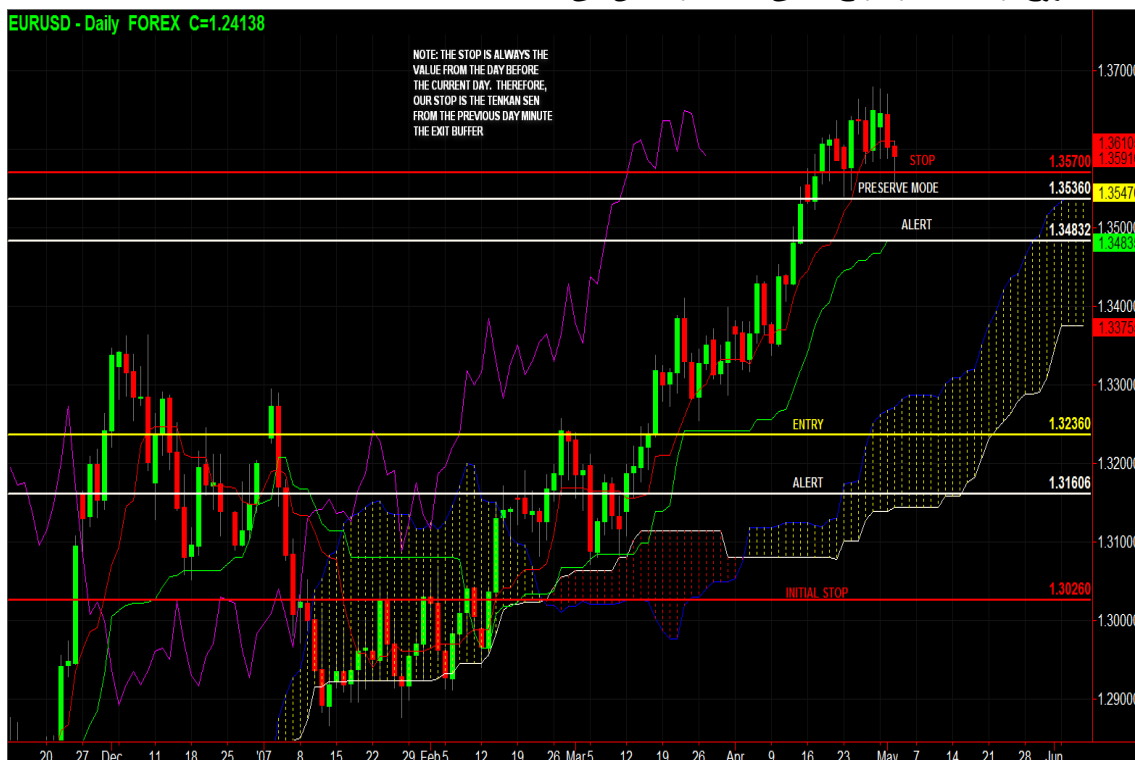
شکل ۲۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۲ آوریل ۲۰۰۷.

در ۱۹ آوریل ۲۰۰۷، همانطور که در شکل ۲۵-۳ نشان داده شده، وارد «حالت حفاظت» شدیم. «حالت حفاظت» جایی است که توقف خودمان را از کیجنسن به تکناسن انتقال داده ایم. و نمی‌خواهیم همه سودمان را به بازار پس دهیم. جمله‌ای در بازار وجود دارد که «سود کردن آسان است، اما حفظ آن سخت است». زمانیکه افراد شروع به سود کردن می‌کنند آنها عموماً شروع به حریص شدن نیز می‌نمایند. این تریدی است که می‌خواهد آنها را میلیونر کند. در نتیجه، این تریدرها از برنامه معاملاتی‌شان تخطی می‌نمایند و زمانیکه آنها باید از ترید خارج شوند، همچنان در ترید باقی می‌مانند. با استفاده از این استراتژی محافظه‌کارانه، می‌خواهیم برای کسب سود از معامله خارج شویم و یا هنگامی که اشتباه کرده‌ایم، با کمترین ضرر از معامله خارج شویم. با استفاده از توقف حال حاضر، در صورتیکه در روز بعدی توقف بخوریم و از معامله خارج شویم، ۲۰۰ پیپ از سودمان را تضمین کرده‌ایم. توجه داشته باشید: اخطار نزولی‌مان را بر اساس برنامه معاملاتی‌مان تنظیم کرده‌ایم. حتی اگر در یک روند صعودی هستی، تنظیم اخطار نزولی را فراموش نکنید. قیمت می‌تواند به طور ناگهانی روز بعد تغییر کند.



شکل ۲۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۹ آوریل ۲۰۰۷.

شکل ۲۶-۳ معامله در روز خروج در تاریخ ۲ می ۲۰۰۷ را نشان می‌دهد. برای هر معامله، نیاز به ثبت کلیه امار و ارقام داریم، تا آنالیزهای بعدی را بتوان برای ردگیری و کشف راندمان تان برای یک برنامه معاملاتی در اختیار داشته باشید و همچنین بتوان مشخص کنید آیا نیاز به بهینه‌سازی استراتژی تان در پایان ماه دارید یا خیر. جدول ۳-۲ اعداد و ارقام مربوط به خروج از معامله در تاریخ ۲ می ۲۰۰۷ را نشان می‌دهد.



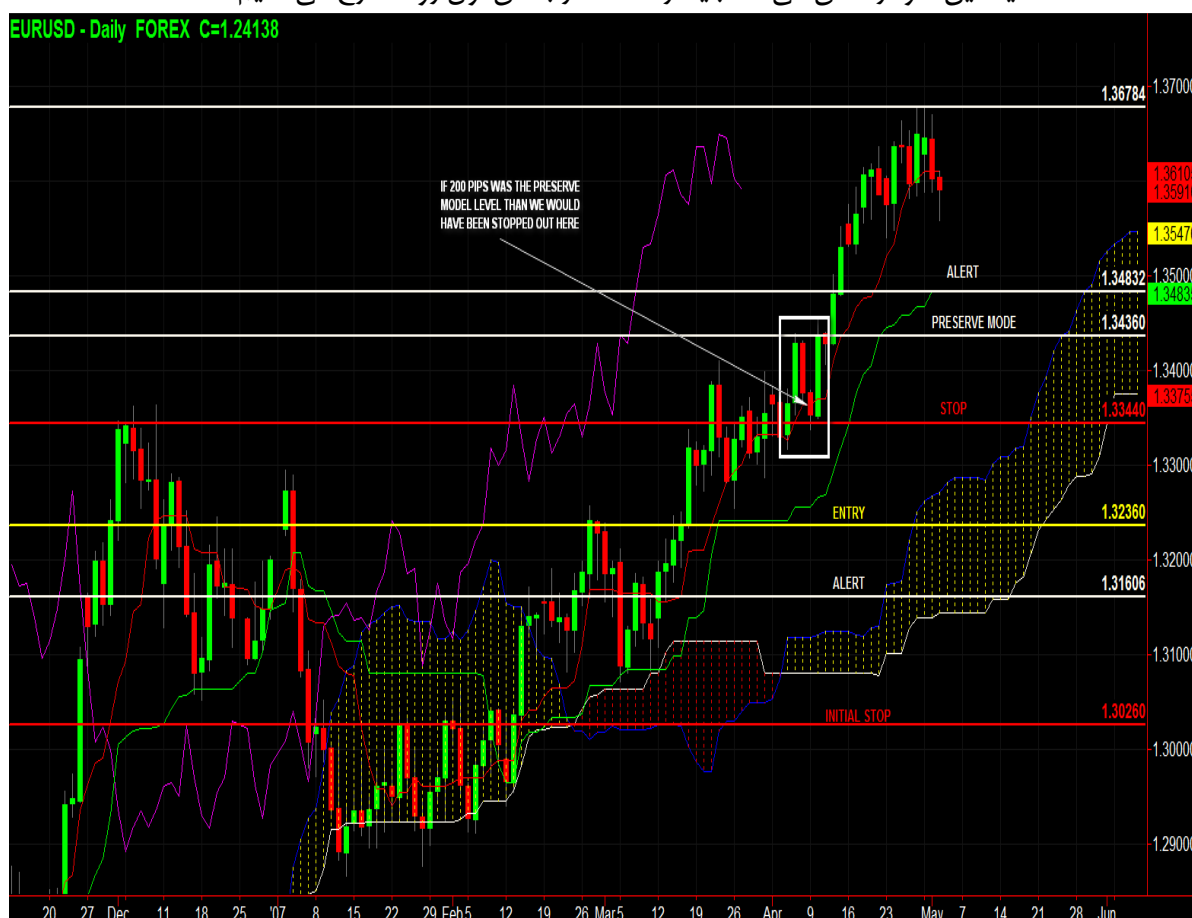
شکل ۲۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ می ۲۰۰۷.

جدول ۲-۳: اعداد و ارقام برای EURUSD برای ترید #۱

Statistics	Value
Entry Date	Feb 27, 2007
Entry Price	1.3236
Entry Stop	1.3026
Entry Risk	210 pips
Exit Date	May 2, 2007
Exit Price	1.3570
Profit	334
Max Profit	445 (1.3681 – 1.3236)
Max Drawdown	1.3236 – 1.3072 = 164
Risk/Reward	0.63

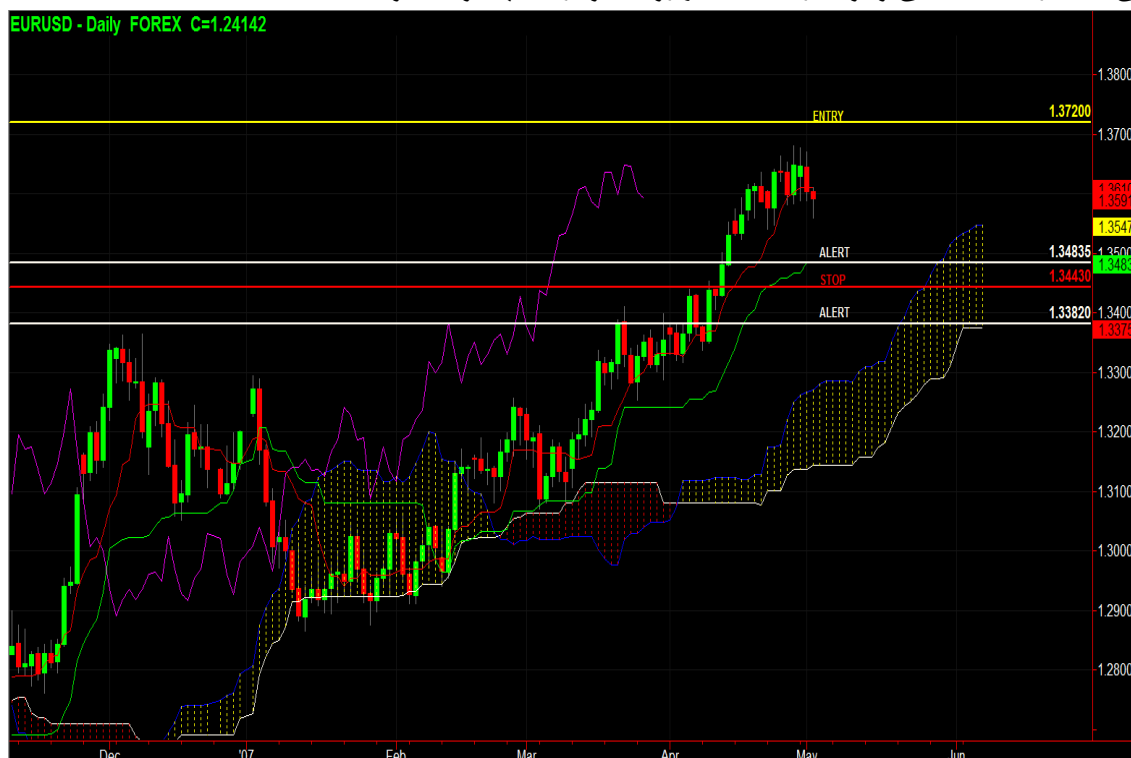
توضیح: ما بیش از ۵۰٪ حداکثر سود را گرفته ایم، که این مقدار خوبی است. این استراتژی برای کسب حدود ۴۰٪ از حداکثر سود طراحی شده است زیرا احتمالات زیادی در این استراتژی وجود دارد. همچنین، به مدت زمانی که این ترید به طول می انجامد نیز توجه نمائید. این معامله مدت زمان طولانی را دربرمی گیرد، بنابراین احتمال زیادی وجود دارد مقدار زیادی از روندی که طی شده، بازگردد.

پیش از این که به بک تست مان ادامه دهیم، بیاید به سناریویی دقت کنیم که برنامه معاملاتی ما برای «حالت محافظت» دارای ۲۰۰ پیپ به جای ۳۰۰ پیپ می بود. در این صورت چه اتفاقی رخ می داد؟ می توانید نتایج را در شکل ۲۷-۳ ملاحظه نمائید. این نمودار نشان می دهد باید از معامله در بخش اول روند خارج می شدیم.



شکل ۲۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ می ۲۰۰۷.

زمانیکه از ترید خارج می‌شدیم، نیاز داشتیم ترید جدیدی تنظیم نمائیم. شکل ۲۸-۳ تنظیمات جدید نمودار را نشان می‌دهد. در اینجا مطالبی وجود دارد که باید بر روی نمودار به آنها توجه نمود:



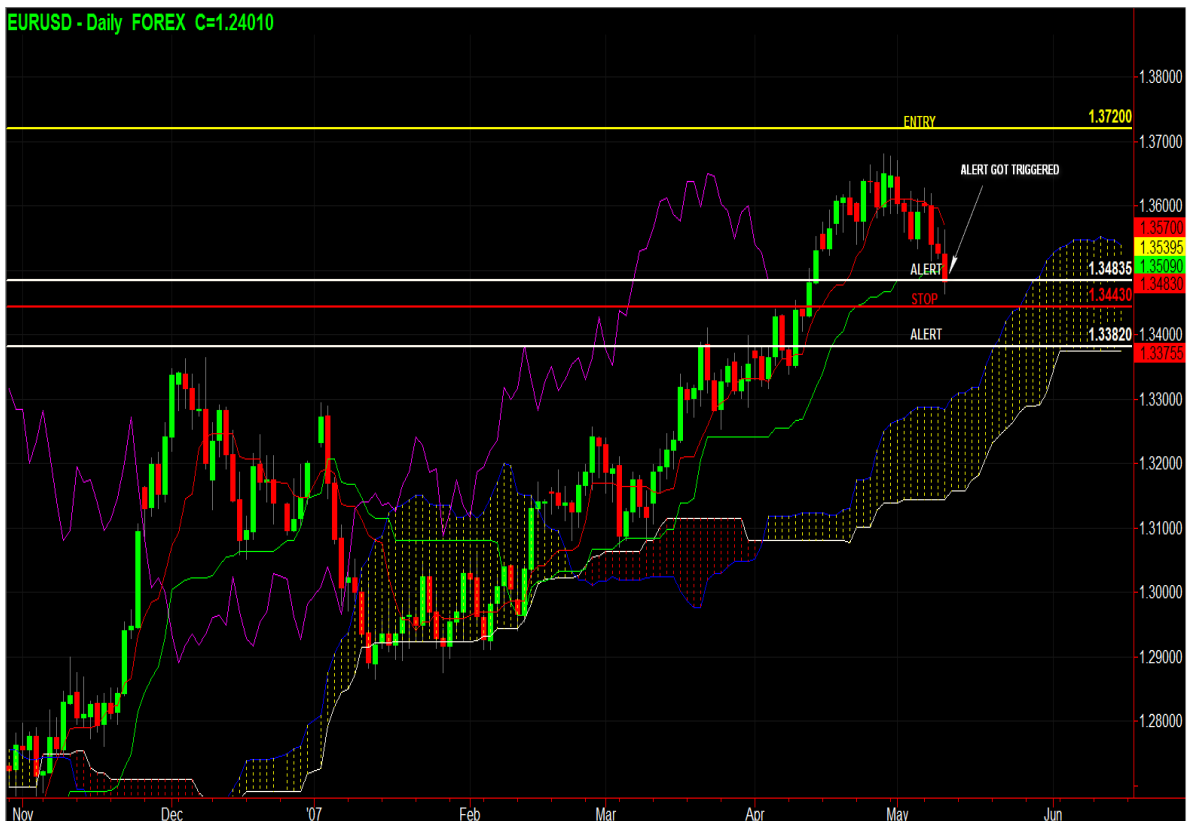
شکل ۲۸-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ می ۲۰۰۷.

- قیمت از کیجنسن کمتر از ۳۰۰ پیپ فاصله دارد بنابراین از برنامه معاملاتی مان تخطی ننموده ایم. اگر قیمت در حدود ۳۱۲ پیپ می‌بود، هنوز هم این فاصله مناسب بود زیرا اگر بتوانید به خاطر آورید، ورود شما به معامله بالاتر از آن مقداری بود که اکنون هست. فرض می‌کنید همه مقادیر ایچیموکو با حرکت به سمت بالاتر تعدیل و تنظیم خواهند شد و درون این محدوده قرار خواهند گرفت زیرا این اجزاء از آن جایی که شروع شده‌اند، خیلی دورتر نرفته‌اند. در بدترین حالت ممکن، اگر وارد یک ترید شوید و این مقادیر در خارج از «مرزهای» مورد نظر باشند، پس از معامله در اسرع وقت خارج شوید.
- چیکواسپن هنوز در «فضای باز» قرار دارد.

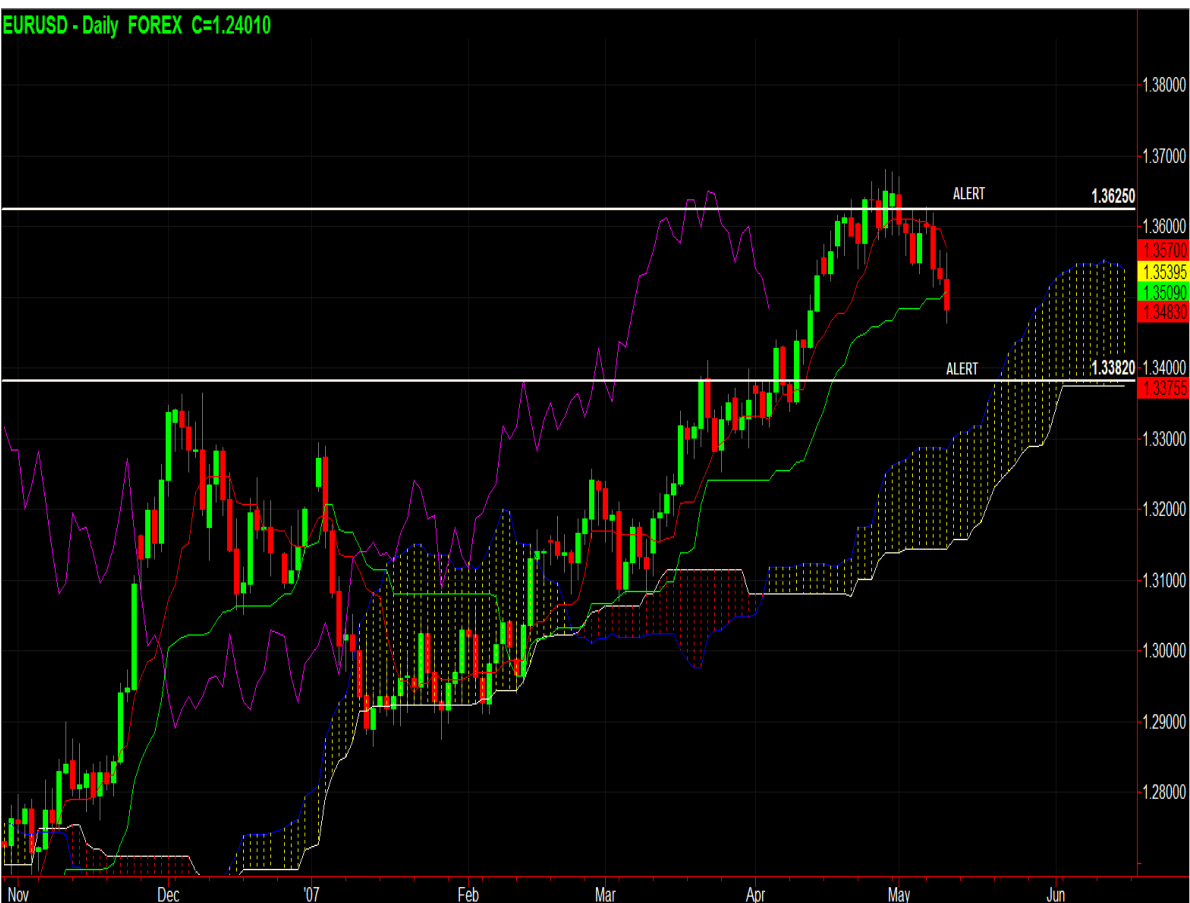
• هنوز هیچ پولبک اصلی رخ نداده است. بنابراین، هنوز در داخل بخشی از یک روند اصلی هستیم.

در بررسی نمودار، می‌توانید توجه کنید برای یک معامله در روند ادامه‌دار نمودارمان را تنظیم نموده‌ایم زیرا همه اندیکاتورهای ایچیموکو هنوز در حالت مطلوبی قرار دارند. زمانیکه روند شروع شود، یک پولبک اصلی در آن رخ نداده است. قیمت در کیجنسن هم نفوذ کرده تا یک پولبک اصلی را ایجاد و ثبت نماید. بنابراین، نیاز است در ورود به تریدهای ادامه‌دار پیش از این که یک پولبک مهم رخ داده باشد، دقت به خرج دهیم. برنامه معاملاتی حال حاضرمان به هیچ نکته‌ای در مورد ورود به تریدهای ادامه‌دار بدون یک پولبک اصلی زمانیکه یک روند ایجاد شده باشد، اشاره نمی‌کند. اکنون آزمایش بک‌تست مان را ادامه خواهیم داد.

در ۱۰ می ۲۰۰۷، همانطور که در شکل ۲۹-۳ نشان داده شده، اخطار کیجنسن راه‌اندازی شده است. برنامه معاملاتی مان نشان می‌دهد که ورود به یک معامله را به یک اخطار تغییر داده‌ایم. به این دلیل در برنامه معاملاتی مان این گزینه را انتخاب کرده‌ایم که هر زمان قیمت کیجنسن را قطع کند، این مسئله نشان‌دهنده تغییر روند می‌باشد. با احتمال تغییر روند، نمی‌خواهیم یک «ورود شناور» داشته باشیم. شکل ۳۰-۳ تنظیمات جدید نمودار را نشان می‌دهد.

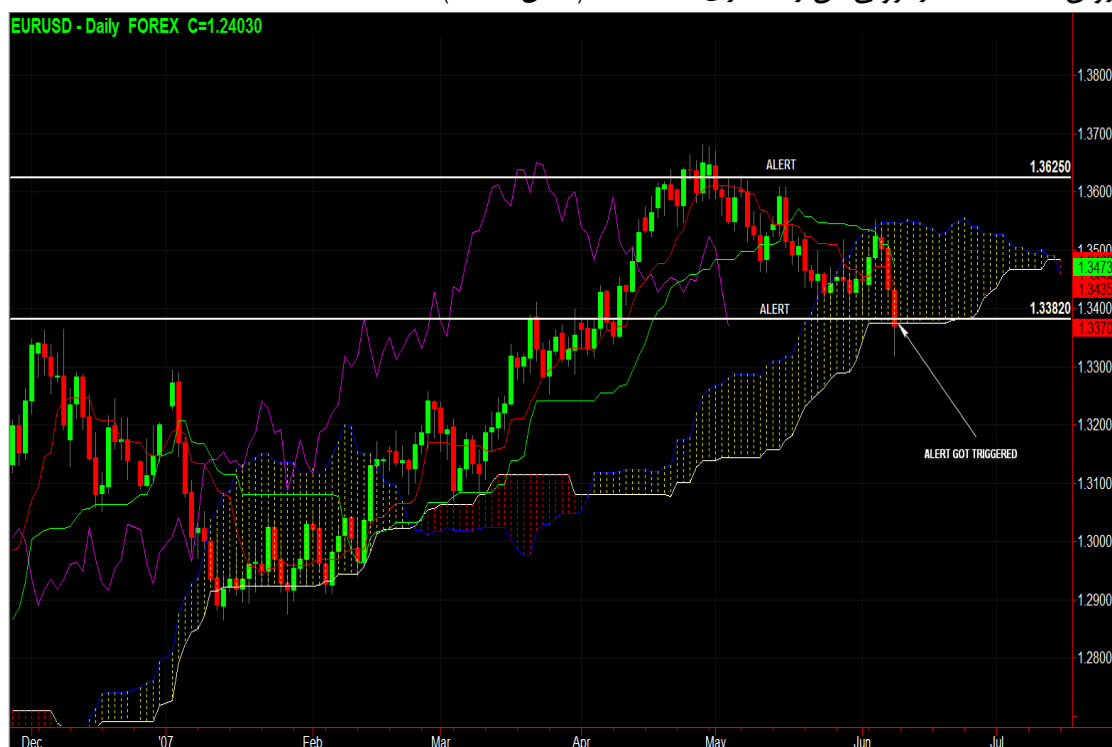


شکل ۲۹-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۰ می ۲۰۰۷.



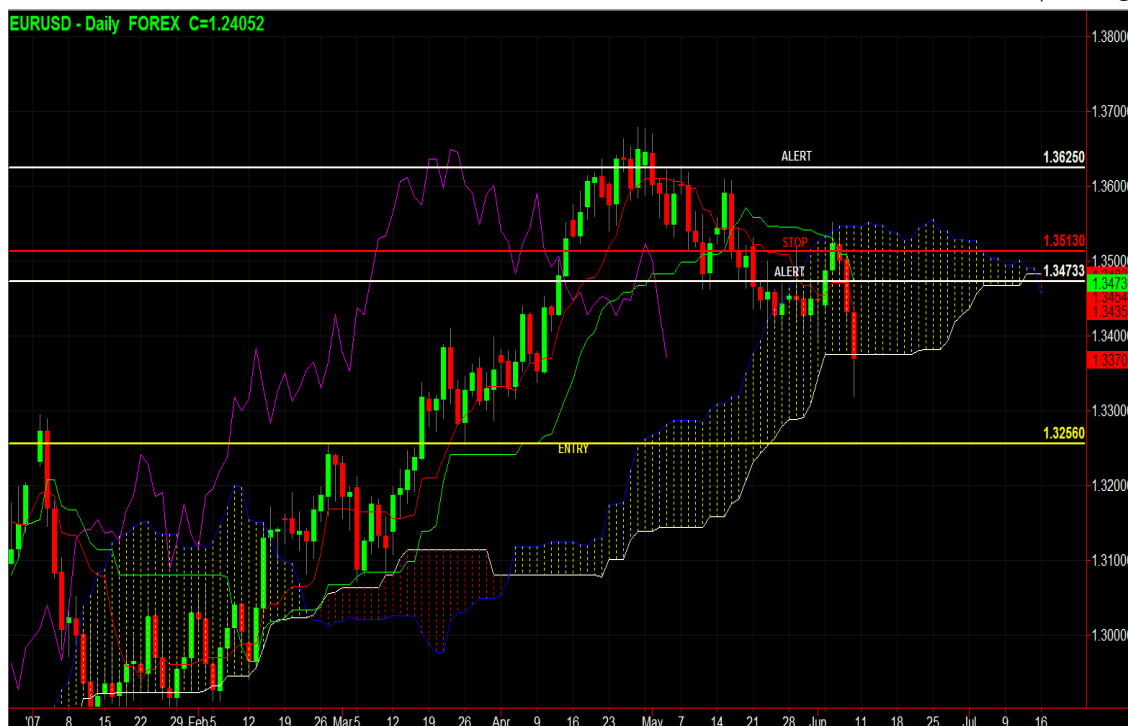
شکل ۳۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۰ می ۲۰۰۷.

در ۸ ژوئن ۲۰۰۷، اختار نزولی مان راه اندازی شده است (شکل ۳-۳۱).



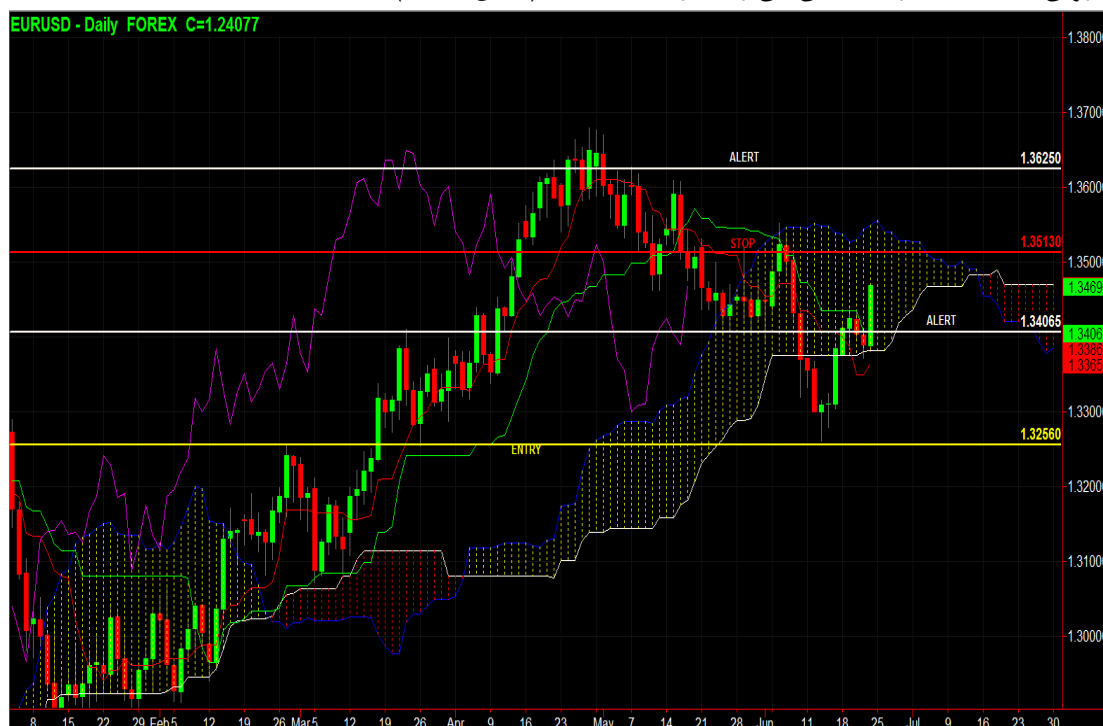
شکل ۳-۳۱: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۰ می ۲۰۰۷.

در آنالیز ایچیموکویی، دو مسئله نگران کننده را در نظر می گیریم. اولین مسئله نگران کننده این است که هم تکناسن و هم کیجنسن داخل ابر کومو باشند و دومین مسئله نگران کننده این است که حمایت بعدی در ۱.۳۲۹۱ است، که کمتر از ۵۰ پیپ دورتر می باشد. برای حل هر دوی این مسائل، می خواهیم نقطه ورود را زیر سطح حمایت بعدی قرار دهیم. (شکل ۳-۳۲).



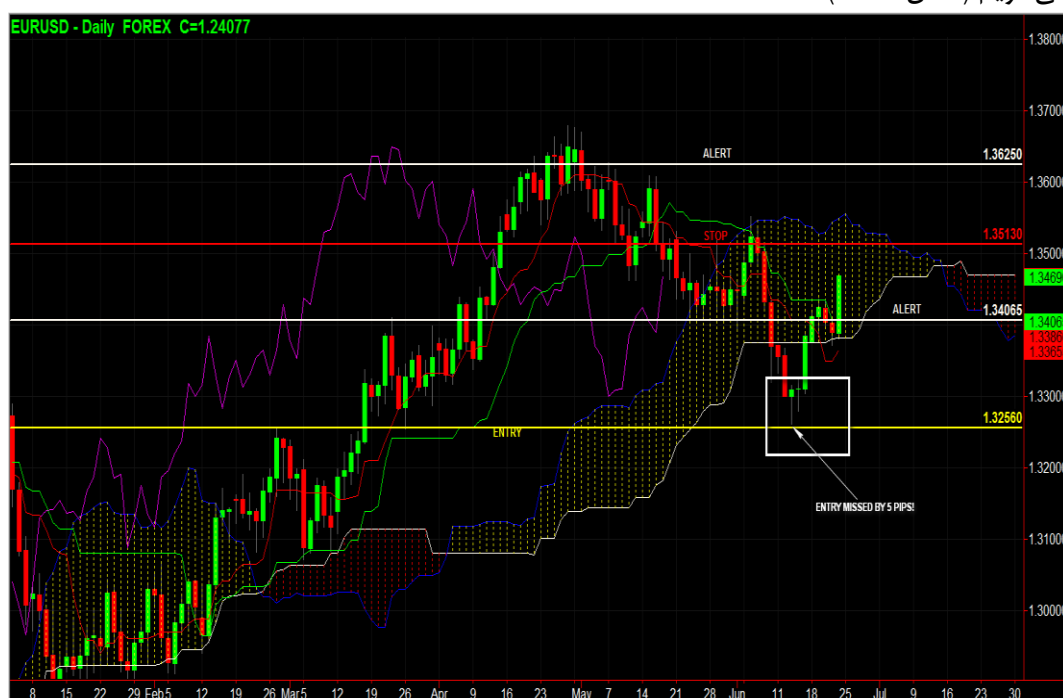
شکل ۳-۳۲: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۸ ژوئن ۲۰۰۷.

زمانی که قیمت وارد این عدد شود، هر دو مسئله فوق بایستی حل شود. اگر این گونه نشود، همان روزی که وارد معامله شده‌ایم، از معامله خارج خواهیم شد. توجه داشته باشید چطور پیش‌بینی می‌کنیم می‌خواهیم قیمت برای حل همه تعارضات ایچیموکویی در چه محلی قرار داشته باشد؟ باید قادر باشید این کار را برای معامله با ایچیموکو انجام دهید. در ۲۲ ژوئن ۲۰۰۷، اخطار کیجنسن مان راه‌اندازی شده است (شکل ۳-۳۳).



شکل ۳-۳۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۲ ژوئن ۲۰۰۷

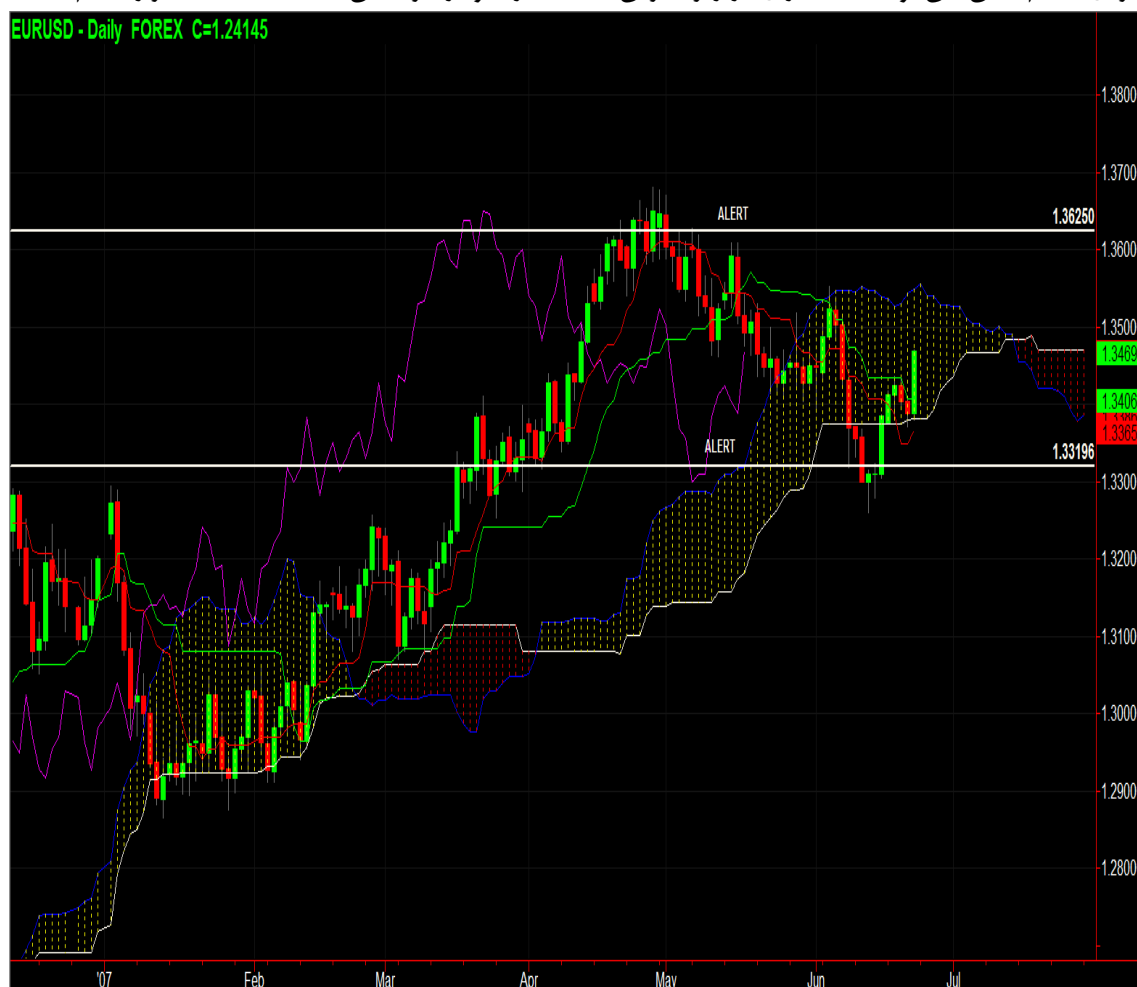
بنابراین، اکنون نقطه ورودمان به اخطار تبدیل شده است. توجه داشته باشید چطور به نقطه ورود به معامله نزولی نزدیک می‌شویم (شکل ۳-۳۴).



شکل ۳-۳۴: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۲ ژوئن ۲۰۰۷

با اختلاف ۵ پیپ وارد روند نزولی نشدیم! اگر وارد ترید می شدیم، ضرر می کردیم. بافر ما را از این ترید دور نگه داشت. بک تست با بافرهای مختلف چیزی است که هر فردی نیاز به انجام آن دارد تا مقدار بافر بهینه را بیابد. این مسئله قسمتی از بخش بهینه سازی شده است.

شکل ۳-۳۵ تنظیمات جدید نمودار بعد از حذف مقادیر ورود به معامله را نشان می دهد. این نمودار روند صعودی و اخطارهای نزولی را نشان می دهد. توجه داشته باشید ما یک اخطار صعودی را خیلی بالا قرار داده ایم. حتی تلاش نکردیم یک نقطه ورود بالای قله ابر کومو قرار دهیم زیرا بیش از ۵۰ پیپ بین مقادیر مقاومت وجود ندارد. مطمئن ترین چیز برای انجام دادن این بود که اخطاری در زیر آخرین قله که در نمودار نیز نشان داده شده است، قرار دهیم.



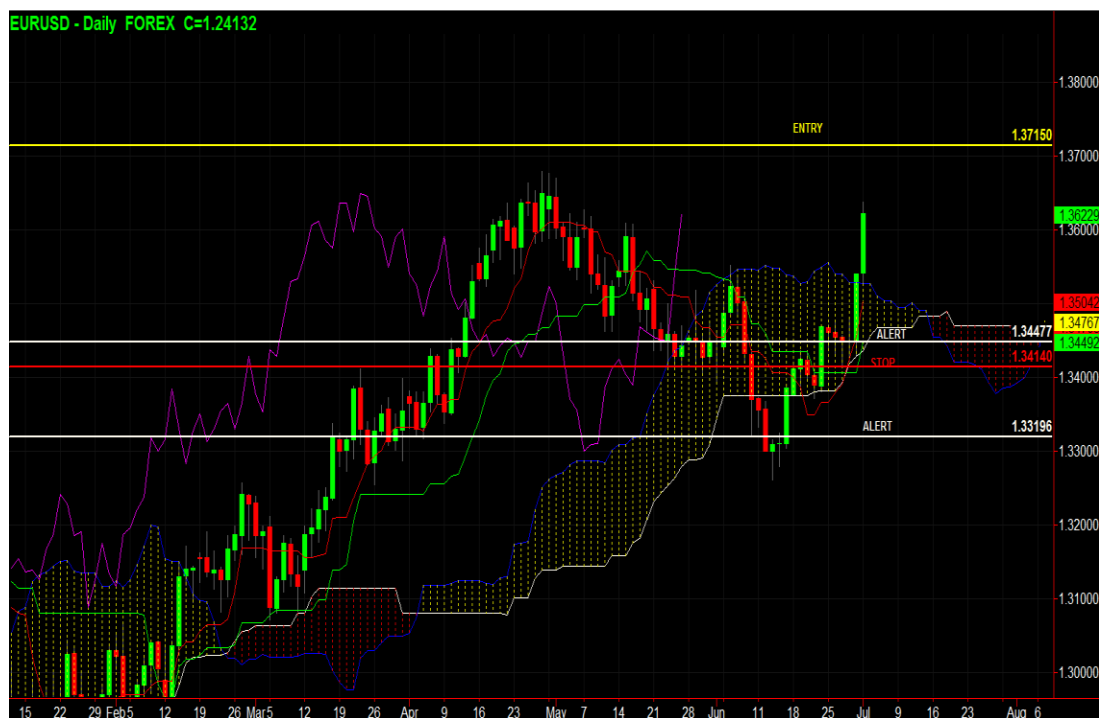
شکل ۳-۳۵: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۲ ژوئن ۲۰۰۷.

در ۲ جولای ۲۰۰۷، اخطار صعودی ما راه اندازی شد (شکل ۳-۳۶).



شکل ۳۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ جولای ۲۰۰۷.

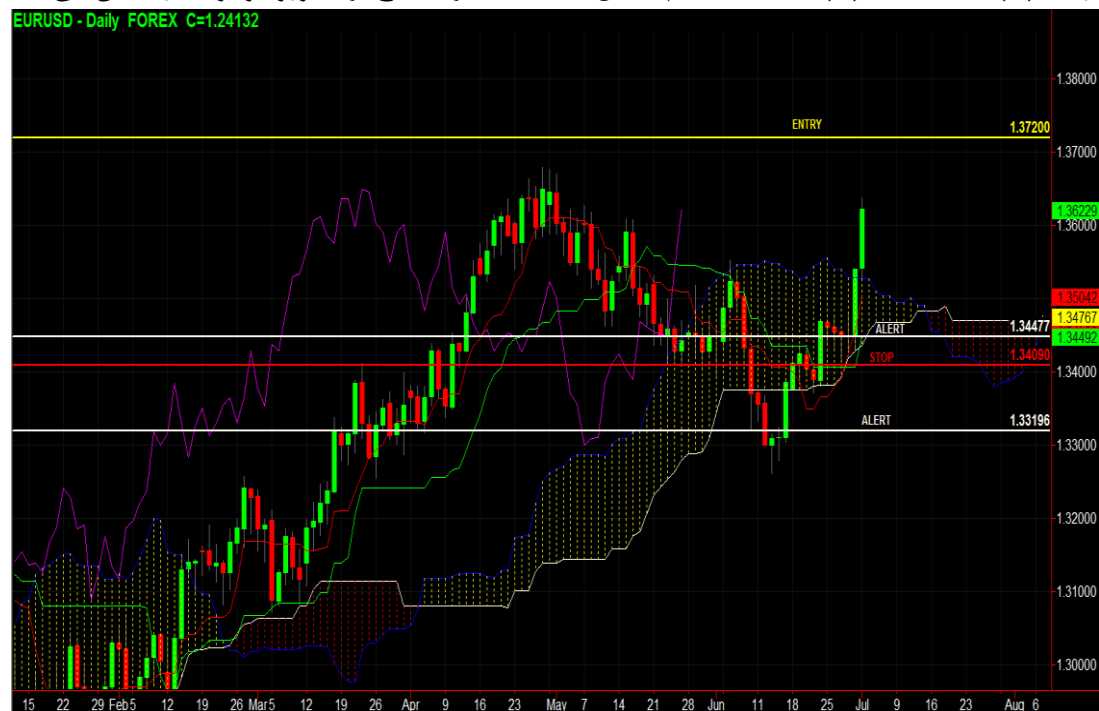
در آنالیز ایچیموکویی مان، دو مسئله نگران کننده را در نظر می گیریم. اولین مسئله نگران کننده این است که تنکانسن و کیجنسن هر دو در داخل ابر کومو هستند. با ورود در نقطه ۱.۳۷۱۵، که ۳۵ پیپ بالای نقطه قله قبلی است، تنکانسن و کیجنسن باید بدون مشکل از ابر کومو خارج شوند زیرا ابر نازک است. دومین مسئله این است که اگر یک توقف از کیجنسن با بافر ۳۵ پیپی را تنظیم نموده باشیم، توقف باید ۱.۳۴۱۴ باشد و نقطه ورودمان باید ۱.۳۷۱۵ باشد. این مقدار یک فاصله ۳۰۱ پیپی است، که بیش از ۳۰۰ پیپ بر اساس برنامه معاملاتی مان می باشد. چون این مقدار تفاوت معنی دار نیست، قصد داریم با ورود به معامله با این فرض که قیمت ورود باید داخل ۳۰۰ پیپ از کیجنسن تعدیل و تنظیم شده باشد، به کارمان ادامه دهیم. در غیر این صورت، از تنکانسن به عنوان توقف مان بر اساس برنامه معاملاتی مان برای ورود به ترید استفاده خواهیم نمود (شکل ۳۷-۳).



شکل ۳۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ جولای ۲۰۰۷.

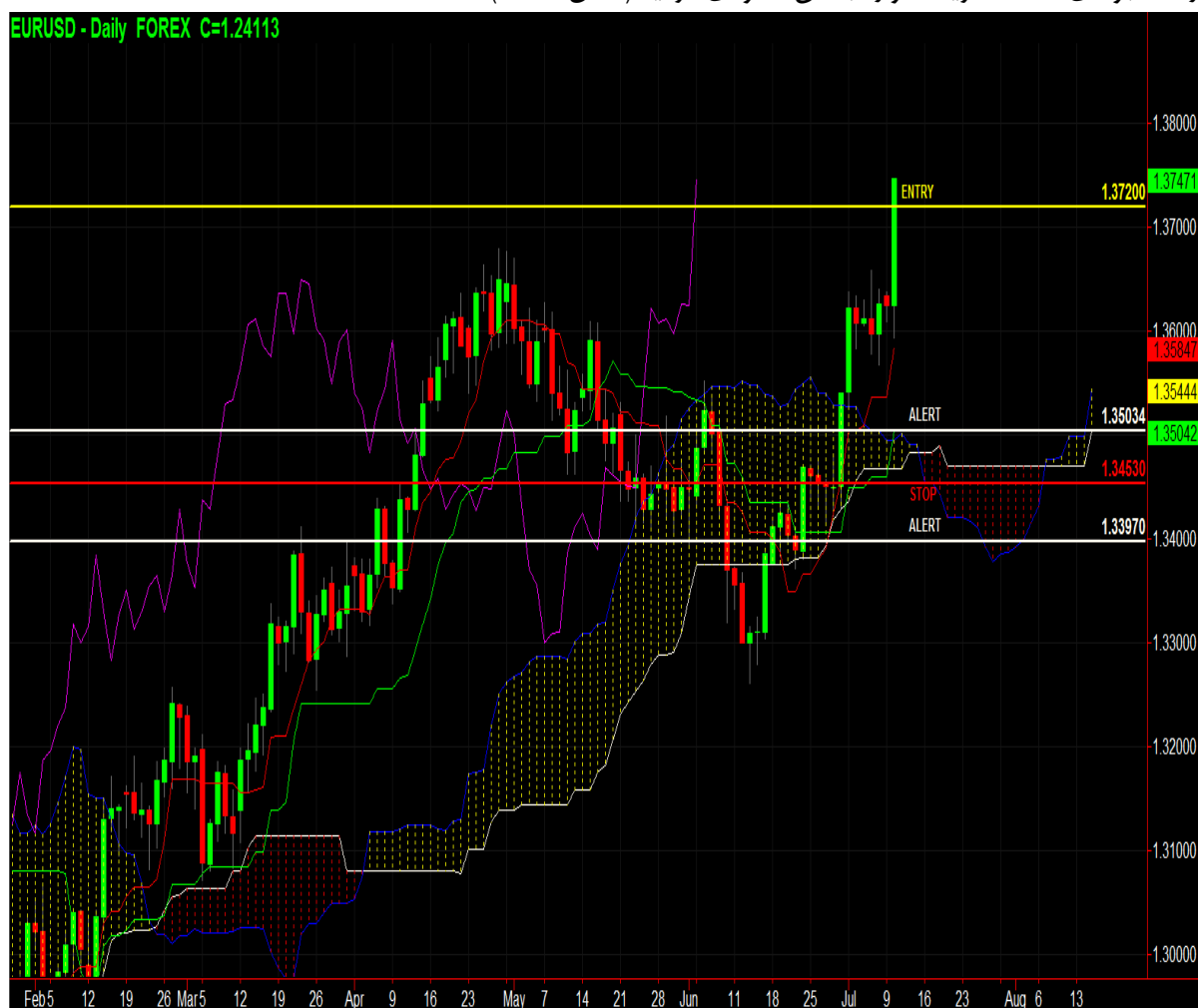
آیا اکنون آماده هستیم تا به جلو حرکت کنیم؟ اگر گفتید «بله» پس شما از برنامه معاملاتی تان تخطی کرده‌اید. آیا ملاحظه نمودید ما کجا از برنامه معاملاتی مان تخطی کردیم؟

اگر خطایی که داشتیم را یافتید، تبریک می‌گوییم! اگر این خطا را نیافتید، پس نیاز به مشاهده مجدد برنامه معاملاتی تان و مطالعه بیشتر آن دارید. این راهنمایی برای شماست تا به موفقیت برسید. اشتباه این بود که ما از بافر سمت نزولی (بیریش) برای ورود استفاده کردیم و همچنین برای توقف نیز از همین مقدار استفاده نمودیم. فرض کرده بودیم از ۴۰ پیپ به جای ۳۵ پیپ استفاده نماییم. شکل ۳۸-۳ مقادیر صحیح برای ورود و توقف را نشان می‌دهد.



شکل ۳۸-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ جولای ۲۰۰۷.

در ۱۰ جولای ۲۰۰۷، ترید ما وارد بخش صعودی گردید (شکل ۳-۳۹)



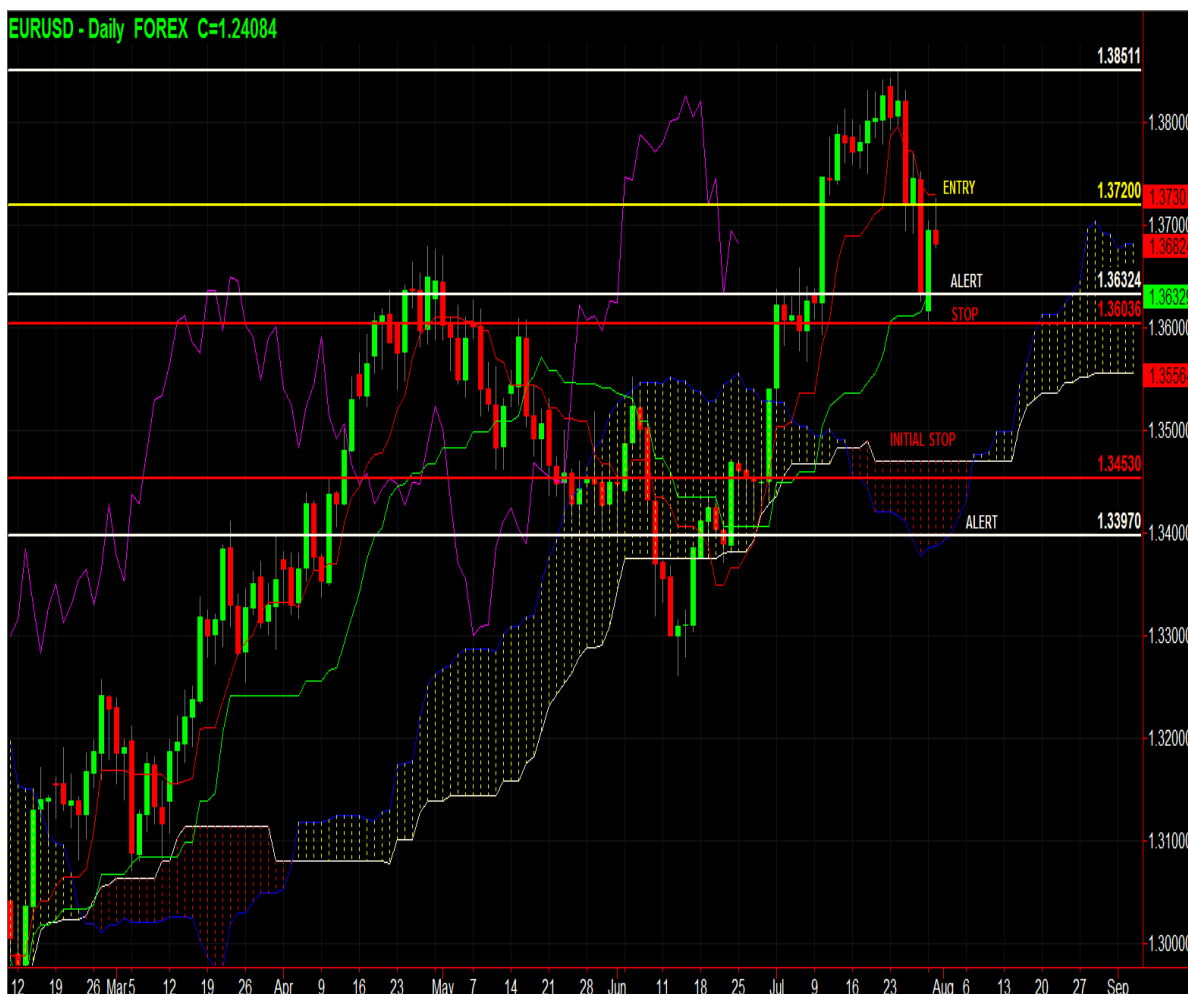
شکل ۳-۳۹: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۰ جولای ۲۰۰۷.

جدول ۳-۳ کلیه اعداد و ارقام ورود به ترید را نشان می‌دهد.

جدول ۳-۳: اعداد و ارقام ورود به ترید EURUSD، ۱۰ جولای ۲۰۰۷، ترید ۲#

Statistics	Value
Entry Date	July 10, 2007
Entry Price	1.3720
Entry Stop	1.3453
Entry Risk	267 pips

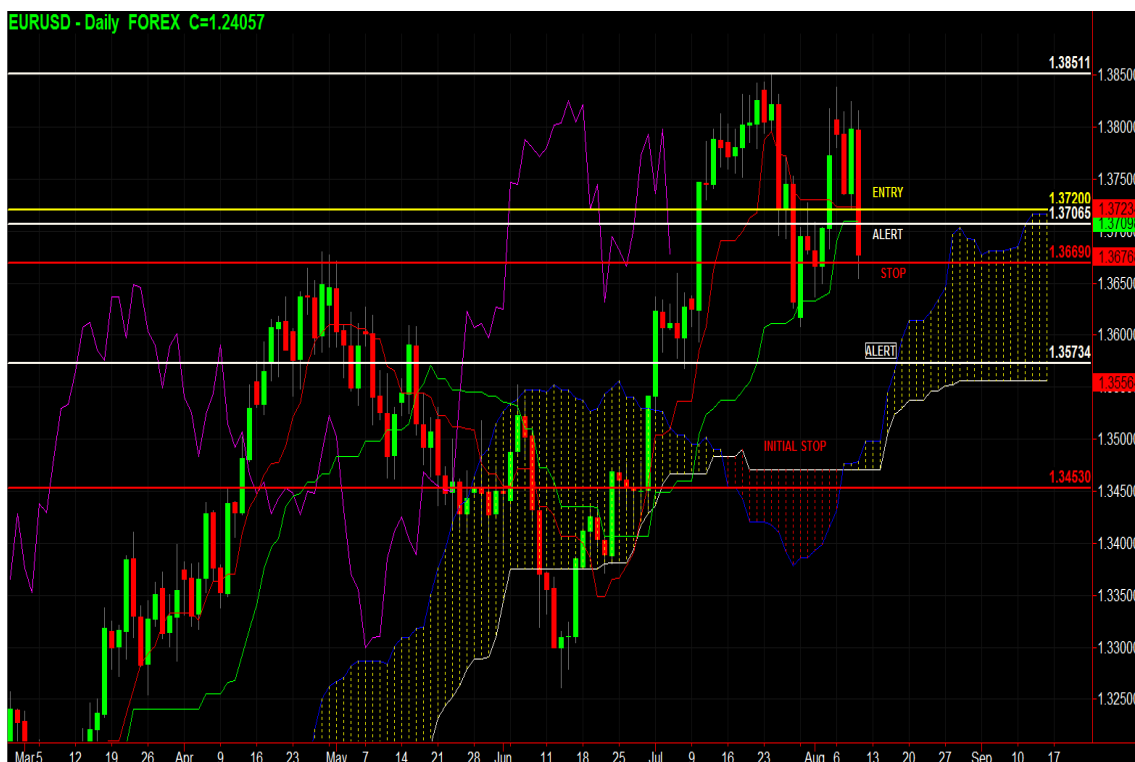
در ۳۱ جولای ۲۰۰۷، تقریباً استاپ خوردیم (شکل ۳-۴۰).



شکل ۳-۴۰: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۱ جولای ۲۰۰۷.

توجه داشته باشید چطور ۴۰ پیپ بافر به خوبی عمل می‌نماید. با فاصله ۵ پیپ استاپ نخوردیم! در بخش ۴، در مورد بهینه‌سازی برنامه معاملاتی صحبت می‌کنیم. در طی این بحث، در مورد تغییر بافرمان صحبت می‌کنیم. برای بهینه‌سازی برنامه معاملاتی‌تان برای حداکثرسازی سود و حداقل‌سازی ضررها، باید به مسائل کوچکی نظیر از دست دادن توقف به میزان ۵ پیپ همانطور که در حال بک‌تست گرفتن هستید، توجه نمائید. در این راه، ایده‌هایی در مورد آنچه می‌توانید در طی مرحله بهینه‌سازی انجام دهید، خواهید داشت. در سرتاسر این کتاب، «اشاره»هایی در مورد مسائل مختلفی که می‌توانید در طی مرحله بهینه‌سازی برنامه معاملاتی‌تان انجام دهید را آماده ساخته‌ام.

در ۹ آگوست ۲۰۰۷، با ضرر از معامله خارج شدیم (شکل ۳-۴۱).



شکل ۴۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۹ آگوست ۲۰۰۷.

جدول ۴-۳ اعداد و ارقام مربوط به ترید ۲# را نشان می‌دهد.

اعداد و ارقام ورود به معامله برای EURUSD در ۱۰ جولای ۲۰۰۷، ترید ۲#

Statistics

Value

Entry Date	July 10, 2007
Entry Price	1.3720
Entry Stop	1.3453
Entry Risk	267 pips

توجه داشته باشید در مقایسه با توقف ریسک اولیه ۲۶۷ پیپی، فقط ۴۶ پیپ از دست داده‌ایم. به ندرت در ریسک اولیه توقف خواهید خورد. فقط دو شانس وجود دارد که این مسئله رخ دهد:

۱- نمودارهای ایچیموکو به طور صحیح تعبیر و تفسیر نشده باشند. فرد هرگز به پنج اندیکاتور ایچیموکو نگاه نکرده باشد و مطمئن نشده باشد که همه آنها در وضعیت مطلوبی قرار دارند.

۲- رخدادهای تصادفی در بازار که کالا به طور ناگهانی در یک دوره کوتاه مدت در آن شکاف و رخنه ایجاد کرده باشد. این امر می‌تواند رخ دهد و به همین دلیل است که همواره از یک «توقف» استفاده می‌کنیم و هرگز ۱۰۰ درصد پرتفولی‌مان را در یک زمان ریسک نمی‌نمائیم (مدیریت سرمایه).

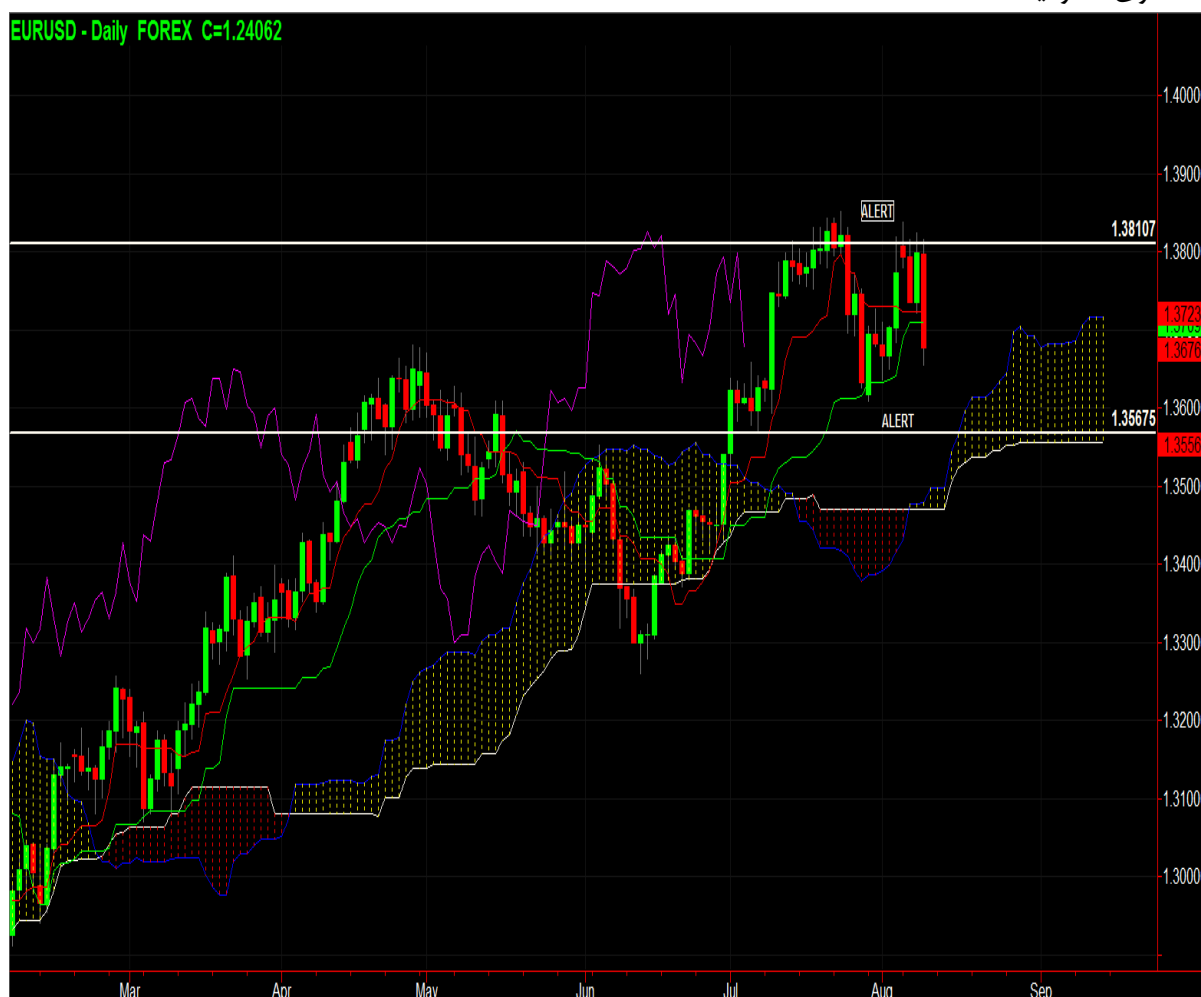
جدول ۳-۴: اعداد و ارقام مربوط به EURUSD در مورد ترید ۲#

Statistics	Value
Entry Date	July 10, 2007
Entry Price	1.3720
Entry Stop	1.3453
Entry Risk	267 pips
Exit Date	August 9, 2007
Exit Price	1.3669
Profit	$1.3669 - 1.3720 = -51$ (loss)
Max Profit	$1.3851 - 1.3720 = 131$ pips
Max Drawdown	$1.3720 - 1.3608 = 112$ pips
Risk/Reward	N/A

نکته: اشتباه کردیم.

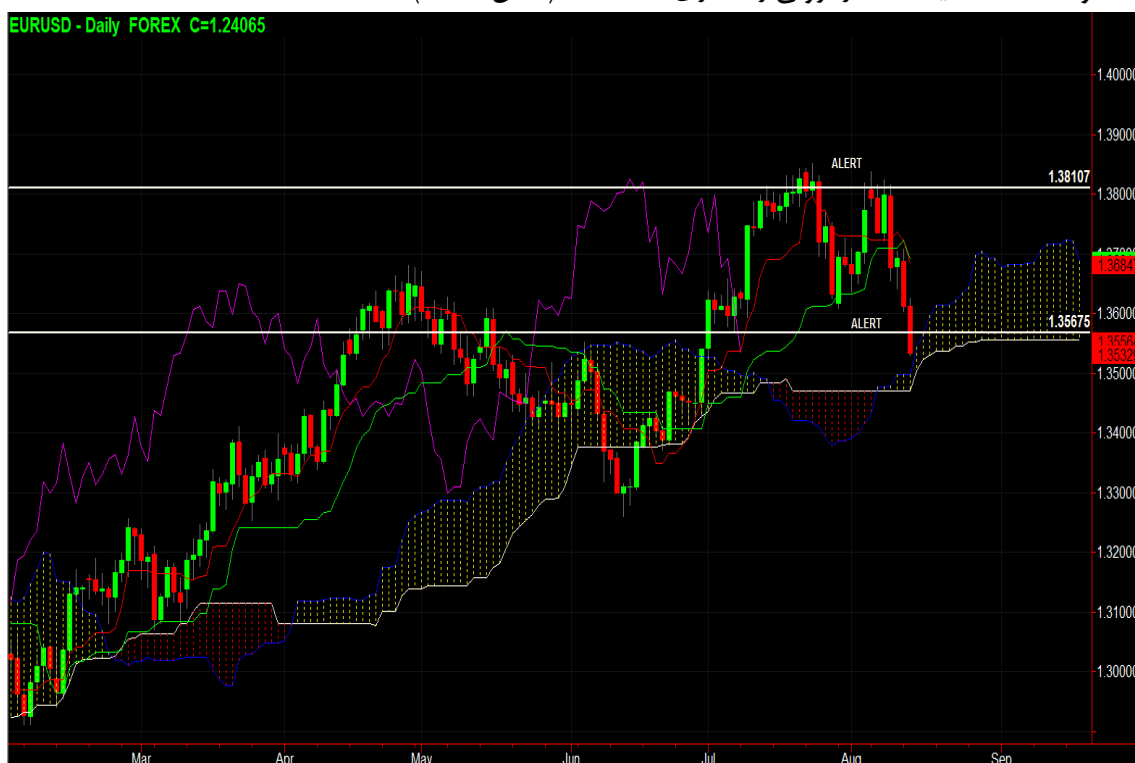
شکل ۳-۴۲ تنظیمات نمودار با اخطارها را نشان می‌دهد. آیا می‌توانید حدس بزنید چرا یک نقطه ورود برای یک روند ادامه‌دار صعودی را مجدداً تنظیم نمودیم؟

دلیل این است که چیکواسپین نزدیک به قیمت است. بنابراین، قراردادن یک نقطه ورود به طور مجدد در این محل امری خطرناک است. قراردادن یک «اخطار» به این دلیل که این اخطار پیش از یک ورود احتمالی راه‌اندازی خواهد شد، امری مضر نیست.



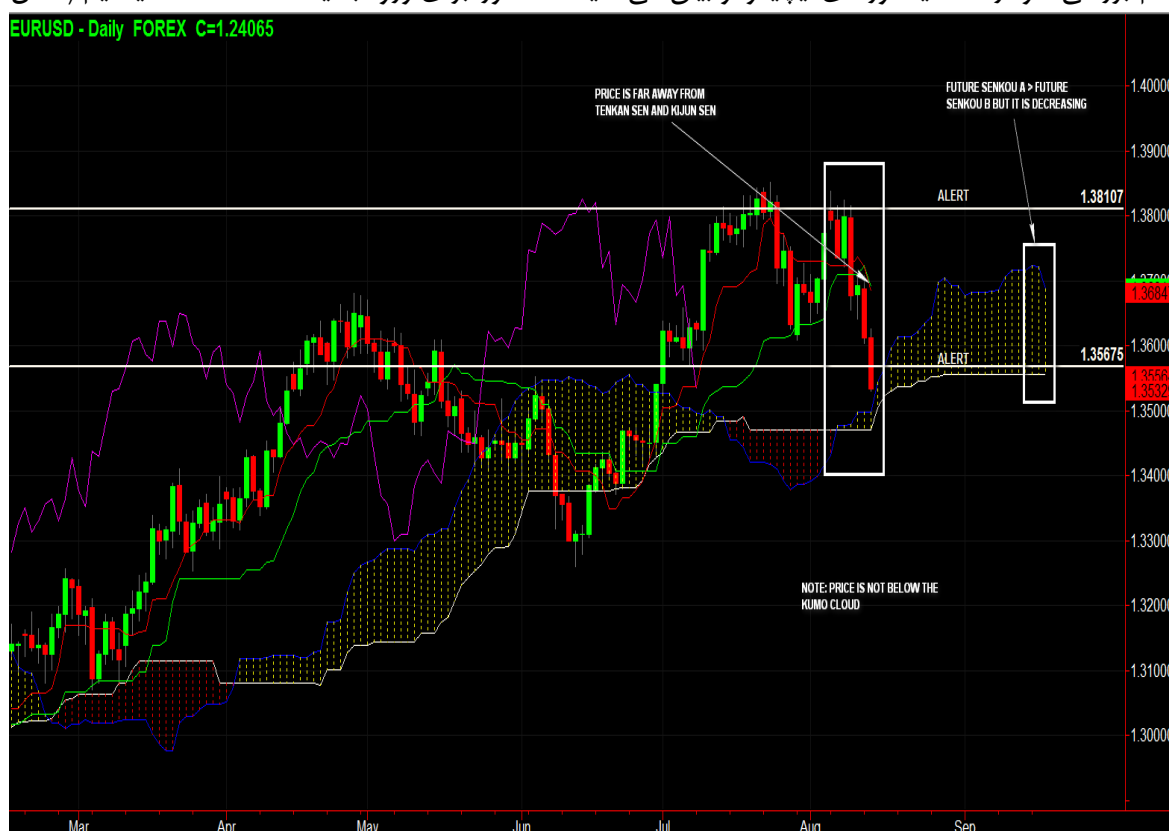
شکل ۳-۴۲: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۹ اگوست ۲۰۰۷.

در ۱۴ آگوست ۲۰۰۷، یک اخطار نزولی راه اندازی شده است (شکل ۴-۴۳).



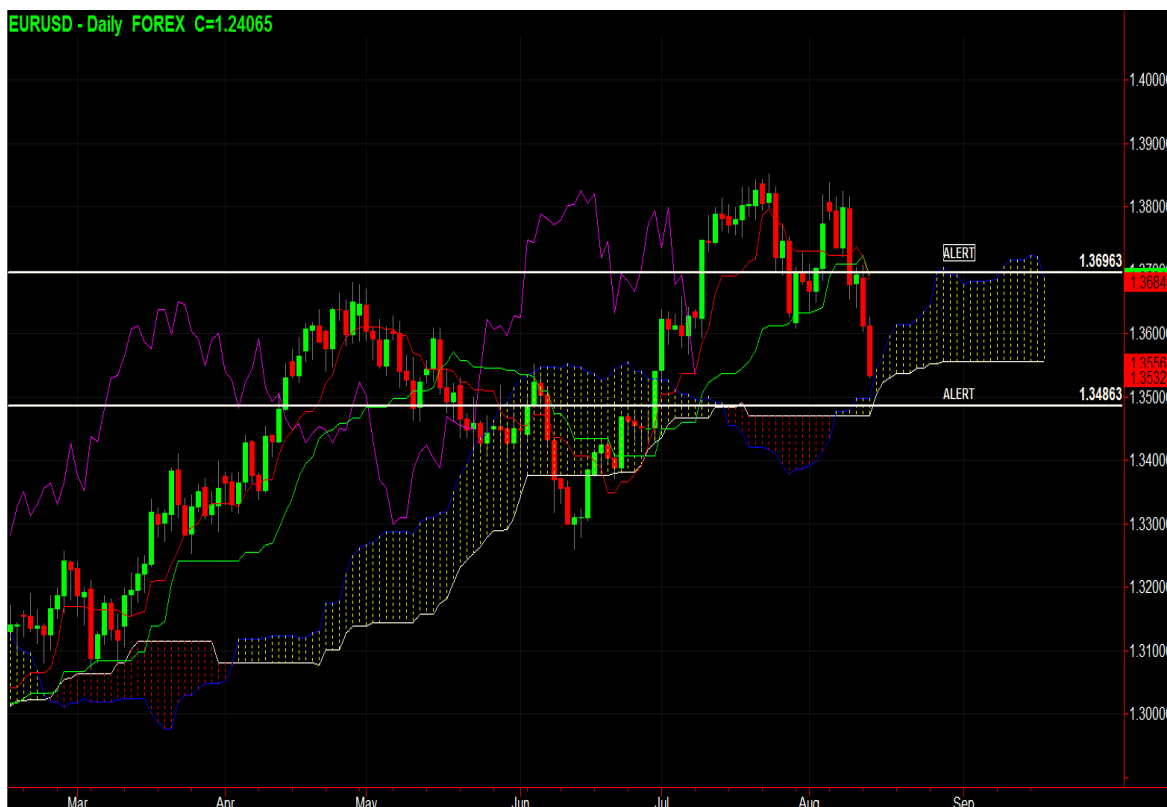
شکل ۴-۳۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۴ آگوست ۲۰۰۷

هنگام بررسی نمودارها، اندیکاتورهای ایچیموکو بیان می نمایند که هنوز برای ورود به یک معامله آماده نیستیم (شکل ۴-۳۴).



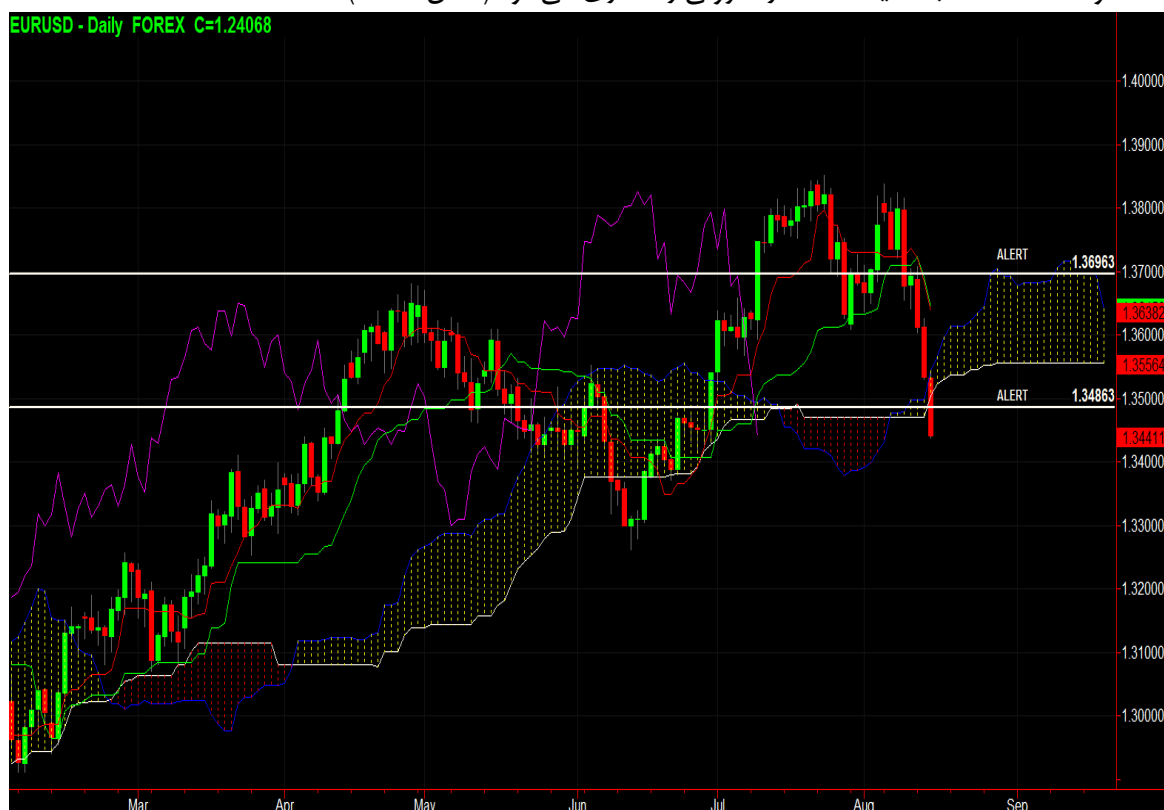
شکل ۴-۳۴: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۴ آگوست ۲۰۰۷

بنابراین، قصد داریم «اخطار» هایمان را بازنشانی کنیم و بک تست را ادامه دهیم (شکل ۴-۳۵)



شکل ۴۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۴ آگوست ۲۰۰۷.

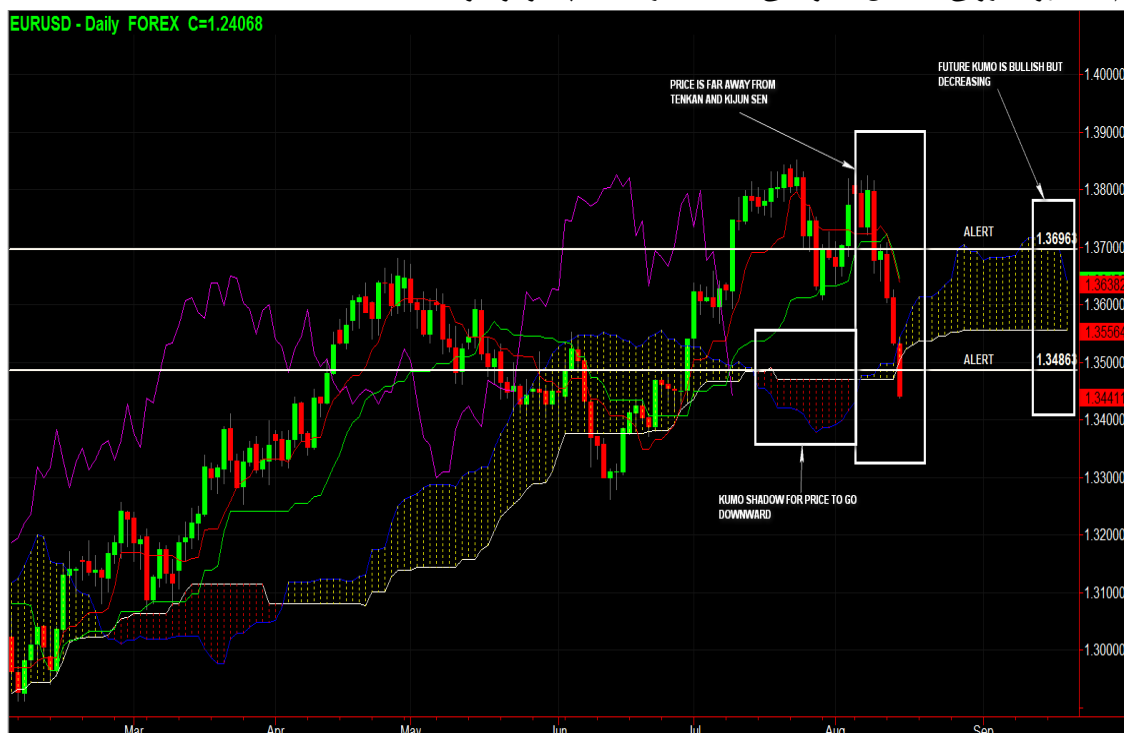
در ۱۵ آگوست ۲۰۰۷، مجدداً یک «اخطار» نزولی راه اندازی می شود (شکل ۴۶-۳).



شکل ۴۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۵ آگوست ۲۰۰۷.

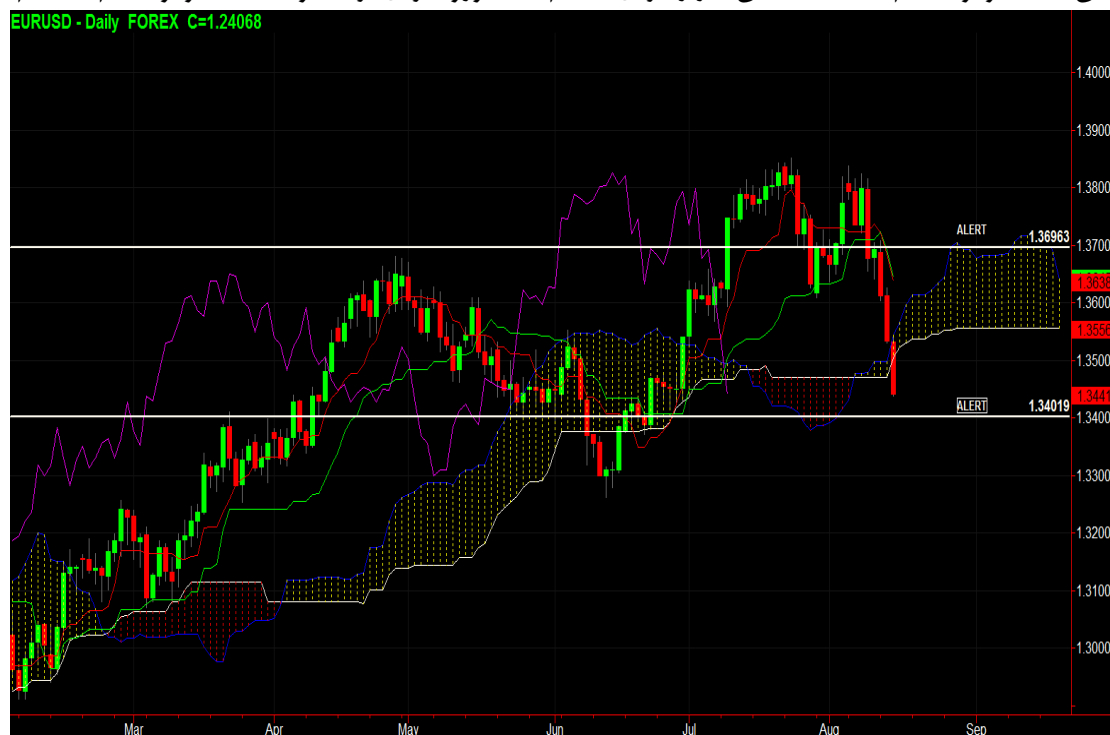
مجدداً، نمودارها هنوز آماده ارائه سیگنال ورود نیستند.

شکل ۳-۴۷ دلیل این که چرا یک نقطه ورود به بازار را قرار نخواهیم داد، را شرح می‌دهد. احتمالاً یک پولبک باعث تنظیم یک روند نزولی به دلیل یکنواختی همه متغیرهای ایچیموکو خواهد شد.



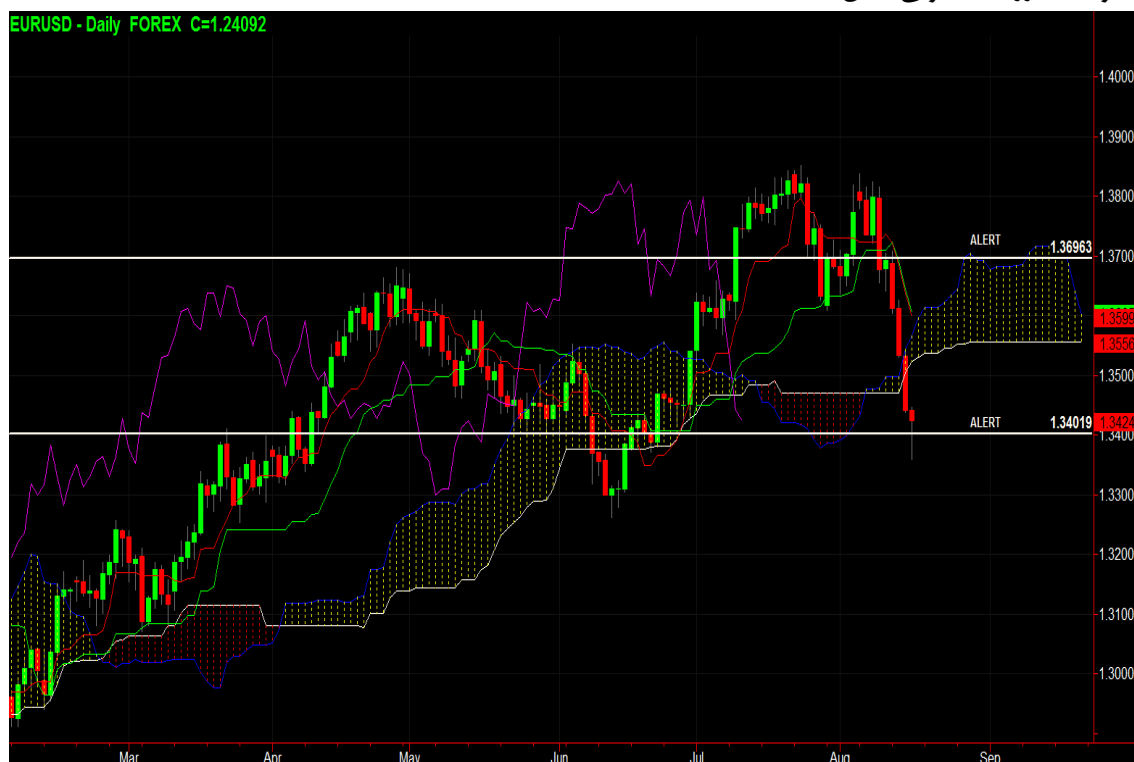
شکل ۳-۴۷: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۵ آگوست ۲۰۰۷.

شکل ۳-۴۸ نمودار را همراه با اظهارهای جدید نشان می‌دهد. هر دو نوع اظهارها برای راه‌اندازی درست قبل از بالا/پائین سایه کومو تنظیم شده‌اند. ما این کار را برای تنظیم نقطه ورود برای بریک‌اوت سایه کومو انجام داده‌ایم.



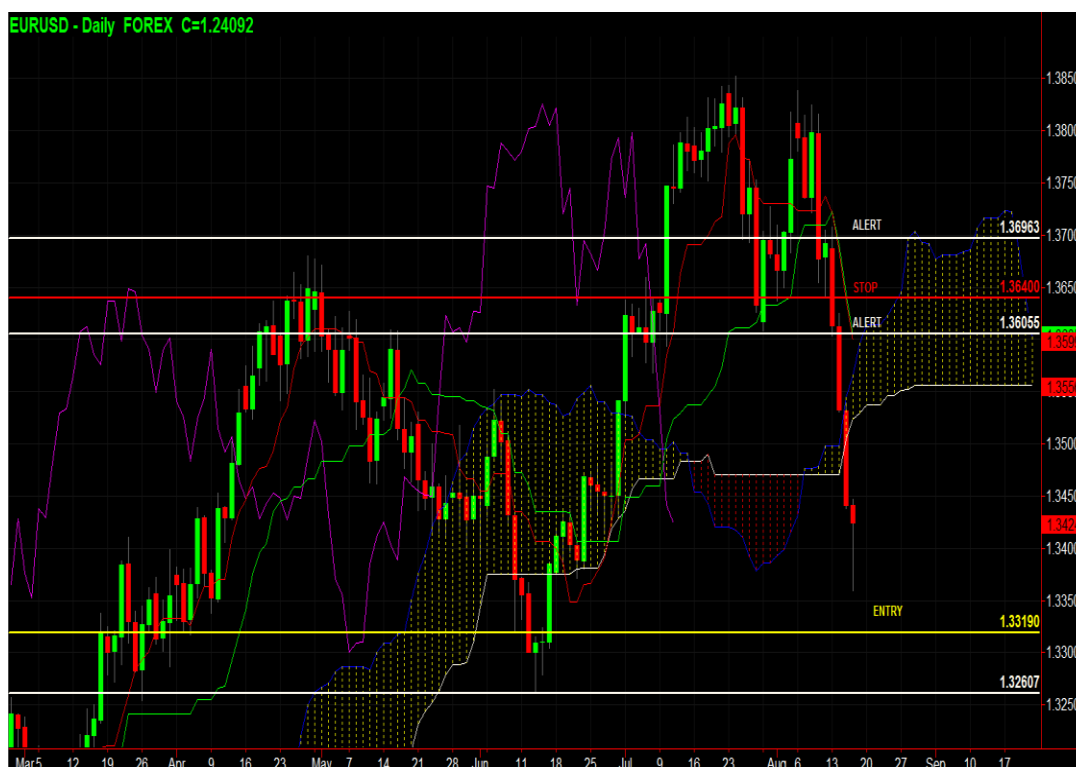
شکل ۳-۴۸: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۵ آگوست ۲۰۰۷.

شکل ۳-۴۹ نشان می‌دهد اخطارهای نزولی راه‌اندازی شده‌اند. در سه روز گذشته، سه حرکت بزرگ داشته‌ایم که اخطارهای ما را به سمت پائین و پائین‌تر رانده‌اند. چون سیگنال‌های ایچیموکو هنوز تنظیم نشده‌اند، وارد معامله نشده‌ایم. بله، ما یک حرکت بزرگ را از دست دادیم، اما به خاطر داشته باشید هیچ پولی هم از دست نداده‌ایم. ممکن است یک جفت ارز دیگر که بر روی آنها در حال ترید هستید چیزی مانند آنچه که EURUSD در این زمان از خود بروز داده است را از خود ارائه نداده باشد. یکی از اهداف برنامه معاملاتی‌مان این است که این برنامه برای کلیه تایم‌فریم‌ها و همه جفت‌ارزها عمل نماید. البته، استثنائاتی نیز وجود دارد، اما به طور کلی این برنامه باید برای اکثر کالاها و جفت‌ارزها به خوبی عمل نماید.



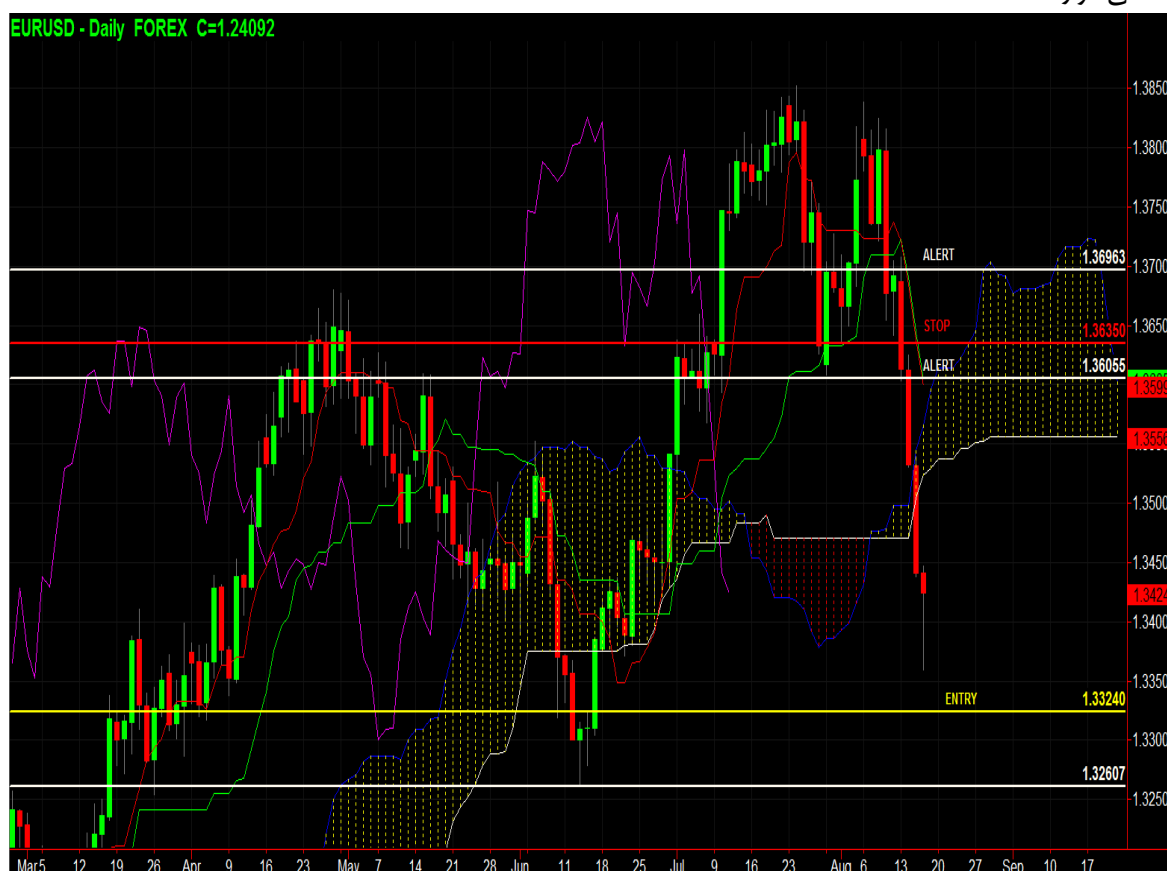
شکل ۳-۴۹: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۶ آگوست ۲۰۰۷.

هدف ما «ساده» نگه داشتن برنامه معاملاتی است. نمی‌خواهیم برنامه معاملاتی‌مان را در این زمان طوری تنظیم نمائیم تا این حرکت را نیز شکار کند. اگر این کار را کرده‌اید، کسی هستید که «منحنی را به خودتان می‌خورانید» که این امر ایده خوبی نیست. افرادی که «منحنی را به خودشان می‌خورانند» هرگز دارای یک برنامه معاملاتی ثابت و پایدار نیستند زیرا این امر مانند یک درب چرخان است، که بارها و بارها تغییر می‌نماید. بنابراین آیا اکنون نمودارها آماده ورود به بازار هستند؟ آیا شکل ۳-۵۰ صحیح است؟ اگر بگویید «بله»، پس شما از برنامه معاملاتی‌تان تخطی نموده‌اید. به خاطر داشته باشید، ما در سمت فروش در حال معامله هستیم (یعنی، نزولی). سمت نزولی دارای مجموعه متفاوتی از قوانین نسبت به سمت صعودی است. شکل ۳-۵۱ نمودارهایی با مقادیر نزولی صحیح بر اساس برنامه معاملاتی‌مان را نشان می‌دهد.



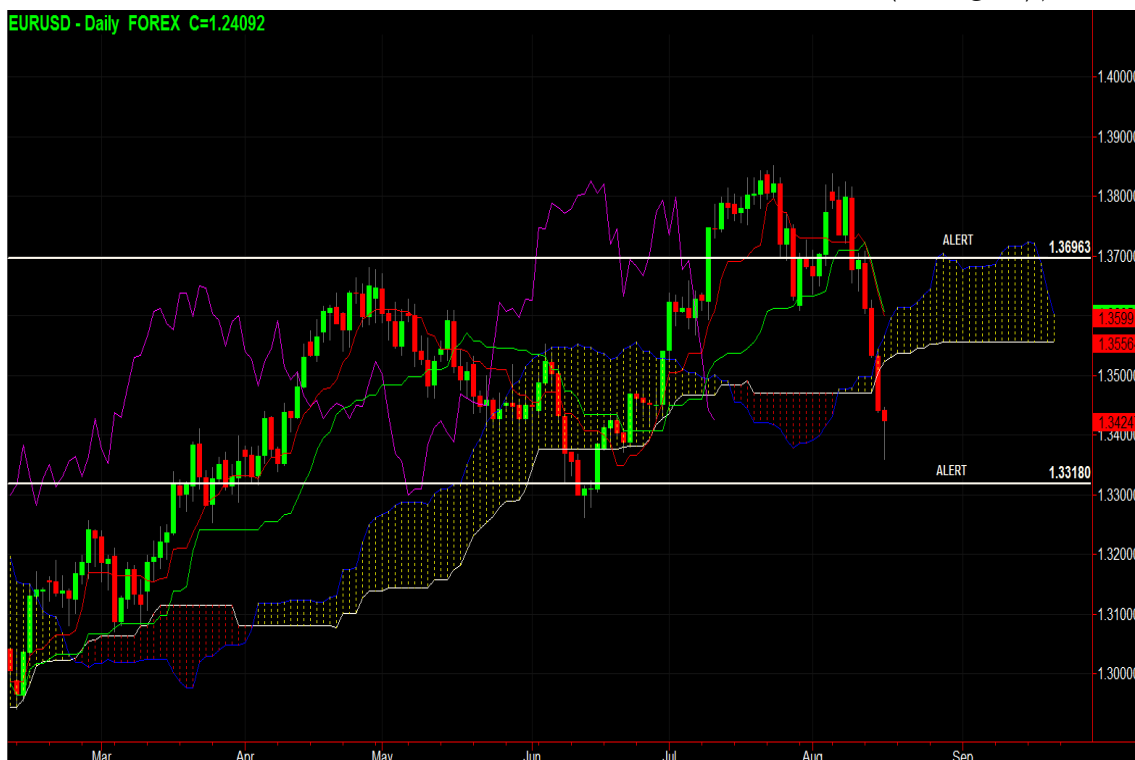
شکل ۵۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۶ آگوست ۲۰۰۷.

به شکل ۵۱-۳ توجه کنید که فاصله قیمت از تنکانسن و کیجنسن در خارج از محدوده موردنظرمان بر اساس برنامه معاملاتی قرار داشت.



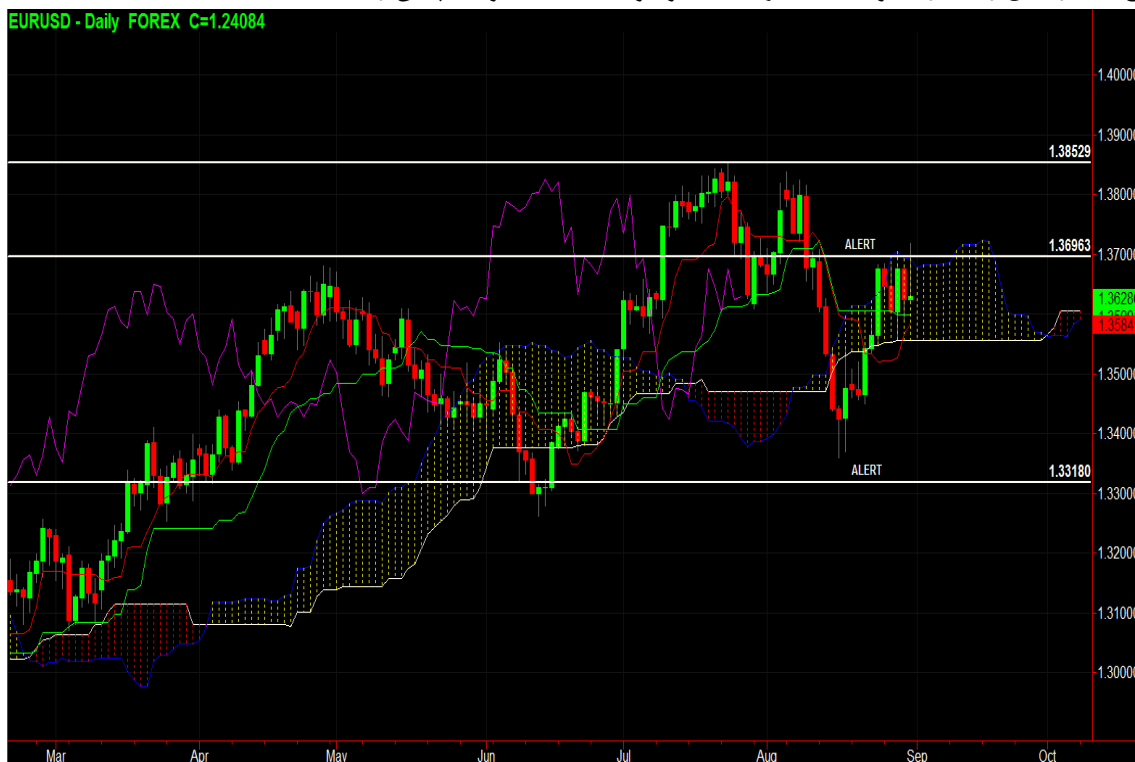
شکل ۵۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۶ آگوست ۲۰۰۷.

در نتیجه، نمی‌توانیم یک ورود در این نقطه قرار دهیم، به جای آن مجبوریم از یک اخطار برای زمان حال حاضر استفاده نمائیم (شکل ۵۲-۳).



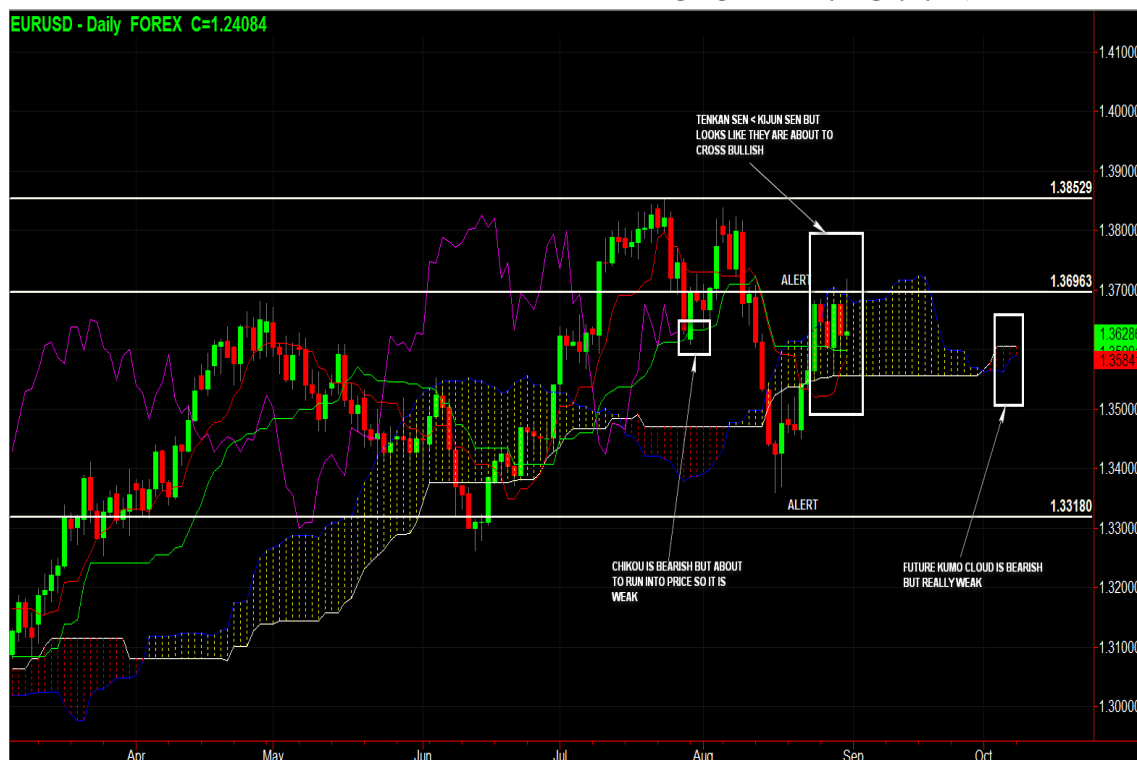
شکل ۵۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۶ آگوست ۲۰۰۷.

در ۳۱ آگوست ۲۰۰۷، اخطار صعودی همانطور که در شکل ۵۳-۳ نشان داده شده، راه‌اندازی گردید. بعد از چند اخطار نزولی که در حال راه‌اندازی بود، قیمت برگشت نمود و به سمت صعودی پیش رفت.



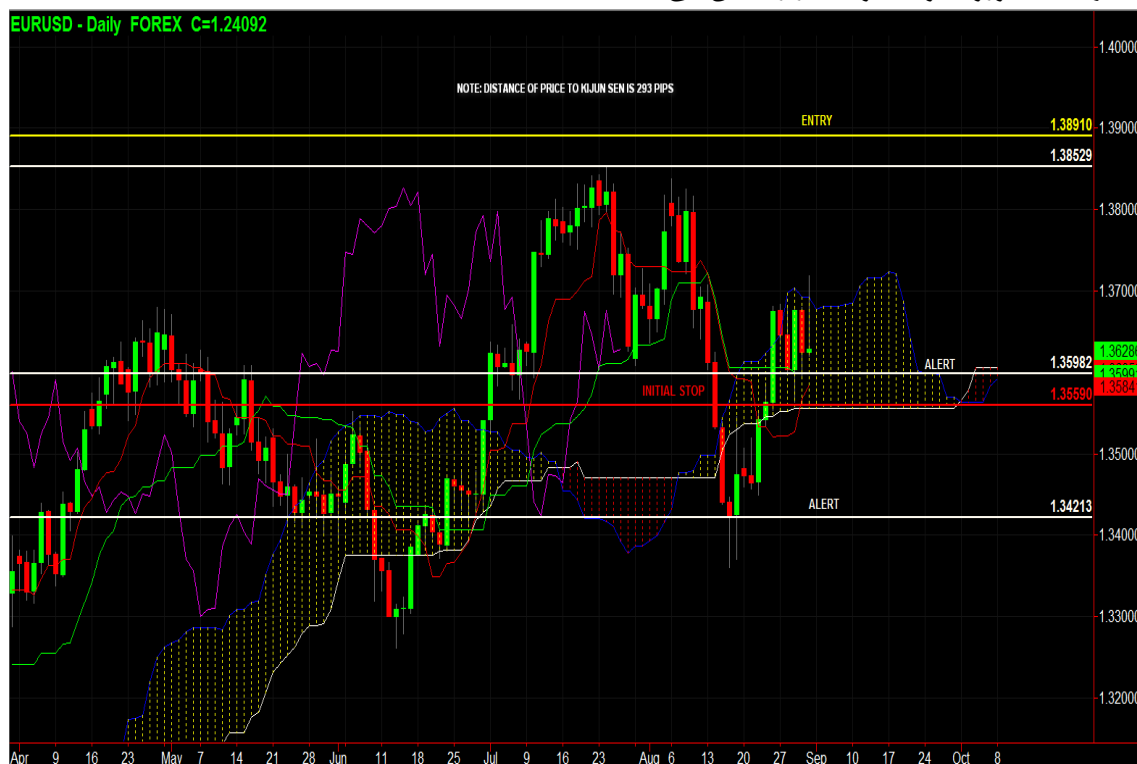
شکل ۵۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۱ آگوست ۲۰۰۷.

شکل ۵۴-۳: آنالیز ایچیموکویی نمودار را نشان می‌دهد.



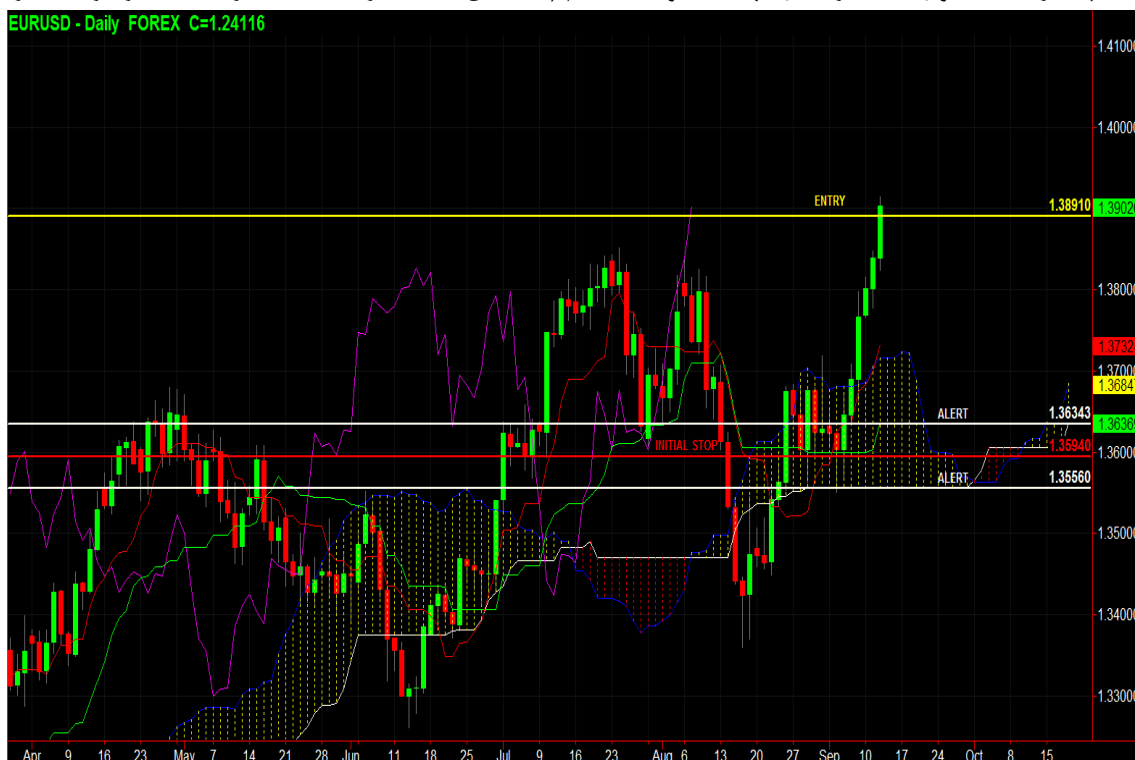
شکل ۵۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۱ آگوست ۲۰۰۷.

به طور کلی، اگر یک نقطه ورود صعودی مطلوب را انتخاب کنیم، کلیه اندیکاتورهای ایچیموکو باید از ترید صعودی حمایت و پشتیبانی کنند. بنابراین، می‌خواهیم تنظیماتی برای ورود به معامله صعودی انجام دهیم. شکل ۵۵-۳ نمودار مورد نظر با نقاط ورود، توقف، و اخطار را نشان می‌دهد.



شکل ۵۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۱ آگوست ۲۰۰۷.

نقطه ورود را بالای قله ایجاد شده در ماه جولای انتخاب می‌کنیم زیرا هر نقطه ورودی پیش از آن مقدار منجر به تخطی از برنامه معاملاتی‌مان در زمینه کسب اطمینان از اینکه ۵۰ پیپ تا مقاومت بعدی باید داشته باشیم، می‌شود. با این نقطه ورود، هنوز درون ۳۰۰ پیپ قیمت نسبت به کیجنسن هستیم. در ۱۲ سپتامبر ۲۰۰۷، وارد یک ترید در جهت صعودی شدیم (به شکل ۳-۵۶ برای کسب جزئیات بیشتر مراجعه گردد).



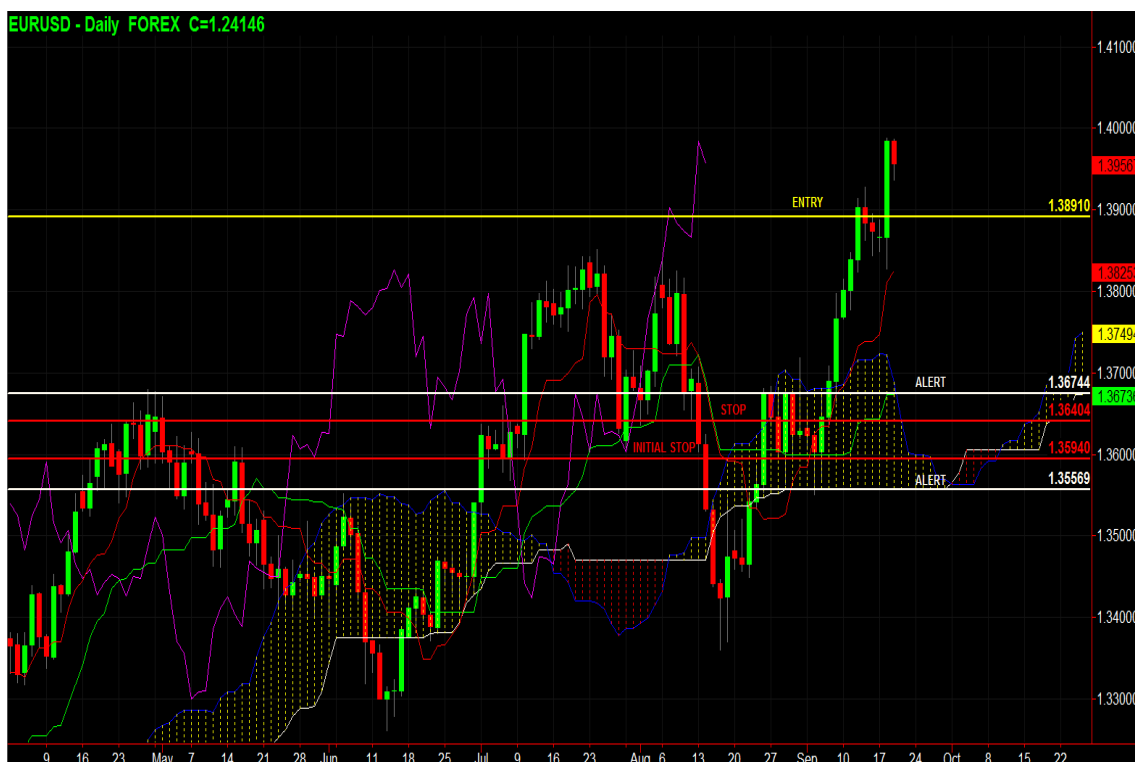
شکل ۳-۵۶: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۲ سپتامبر ۲۰۰۷.

آمار و ارقام مربوط به ورود در جدول ۳-۵ نشان داده شده است.

جدول ۳-۵: آمار و ارقام مربوط به ورود به معامله برای EURUSD در ۱۲ سپتامبر ۲۰۰۷، ترید #۳

Statistics	Value
Entry Date	Sept 12, 2007
Entry Price	1.3891
Entry Stop	1.3594
Entry Risk	297 pips

شکل ۳-۵۷ نمودار یک هفته بعد از ورود به معامله را نشان می‌دهد. نقاط ورود و اخطارهایمان را هر روز تنظیم می‌نمودیم. همچنین، مجبور به بررسی قیمت نسبت به تکناسن بودیم تا مطمئن شویم آنها درون محدوده‌هایشان در همه زمان‌ها هستند. اساساً، ما در حال دنباله‌روی از برنامه معاملاتی‌مان بودیم. می‌دانم چیزهای زیادی را برای چندین بار تکرار کرده‌ام اما این تکرار مورد نیاز است. هدف یادگیری از طریق تکرار است.



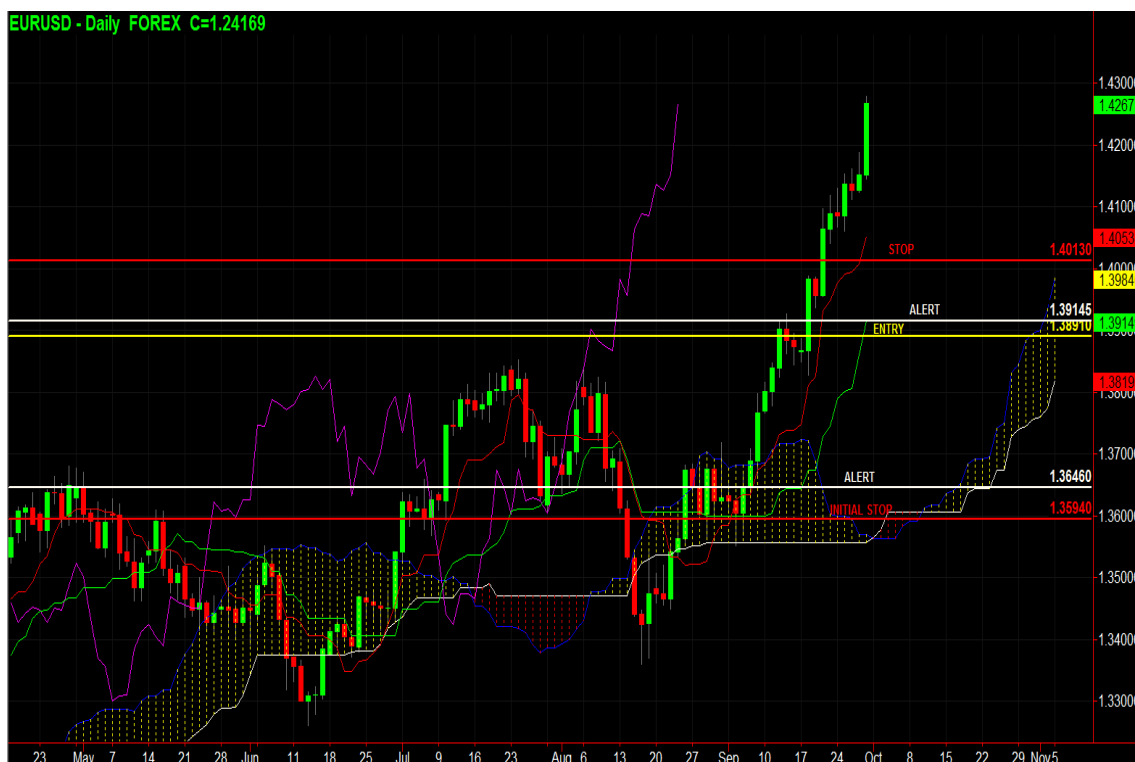
شکل ۵۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۹ سپتامبر ۲۰۰۷.

شکل ۵۸-۳ نمودار EURUSD را در تاریخ ۲۸ سپتامبر ۲۰۰۷ مورد بررسی قرار می‌دهد. (آمار و ارقام مربوط به ترید در جدول ۳-۶) نشان داده شده است.

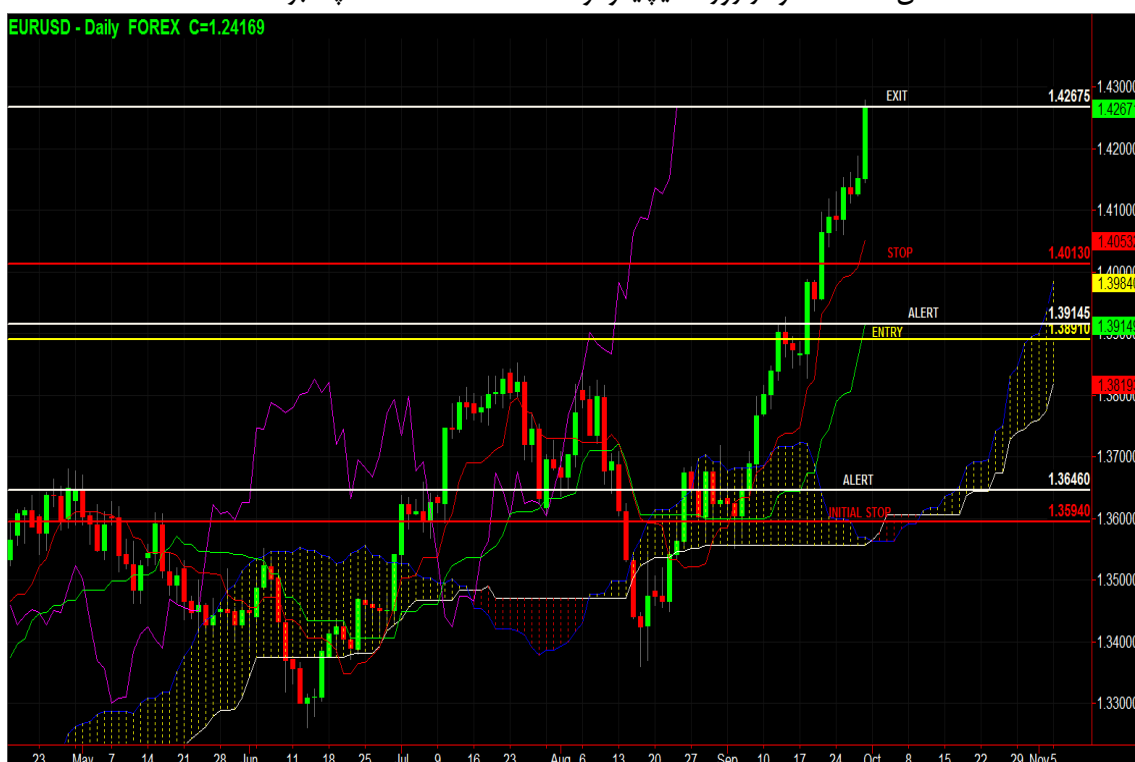
جدول ۳-۶: آمار و ارقام مربوط به EURUSD در ۲۸ سپتامبر ۲۰۰۷، ترید ۳#

Statistics	Value
Entry Date	Sept 12, 2007
Entry Price	1.3891
Entry Stop	1.3594
Entry Risk	297 pips
Exit Date	Sept 28, 2007
Exit Price	1.4267
Profit	1.4267 – 1.3891 = 376 pips
Max Profit	387 pips
Max Drawdown	64 pips
Risk/Reward	297/376 = 0.80
Comment	

در این روز، ترید ما به سمت «حالت محافظتی» پیش رفت. همچنین، اکنون یک حالت «روند آزاد» داریم، که این امر بدین معنی است که حتی اگر هم اکنون «توقف» بخوریم و از معامله خارج شویم، سود کسب نموده‌ایم. توجه داشته باشید که قیمت بسته شدن ۱.۴۲۶۷ است و مقدار تنکانسن ۱.۴۰۵۳ است، که دارای تفاوت ۲۱۴ پیپ تفاوت است. برنامه معاملاتی مان بیان نموده است که اگر قیمت ۲۰۰ پیپ دورتر از تنکانسن بود، باید خارج شویم. در نتیجه، باید از معامله خارج شویم، درست است؟ بله، چون این امر در برنامه معاملاتی مان گنجانده شده است. شکل ۵۹-۳ این نمودار را با آمار و ارقام مربوط به نقطه خروج نشان می‌دهد.



شکل ۵۸-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۸ سپتامبر ۲۰۰۷.

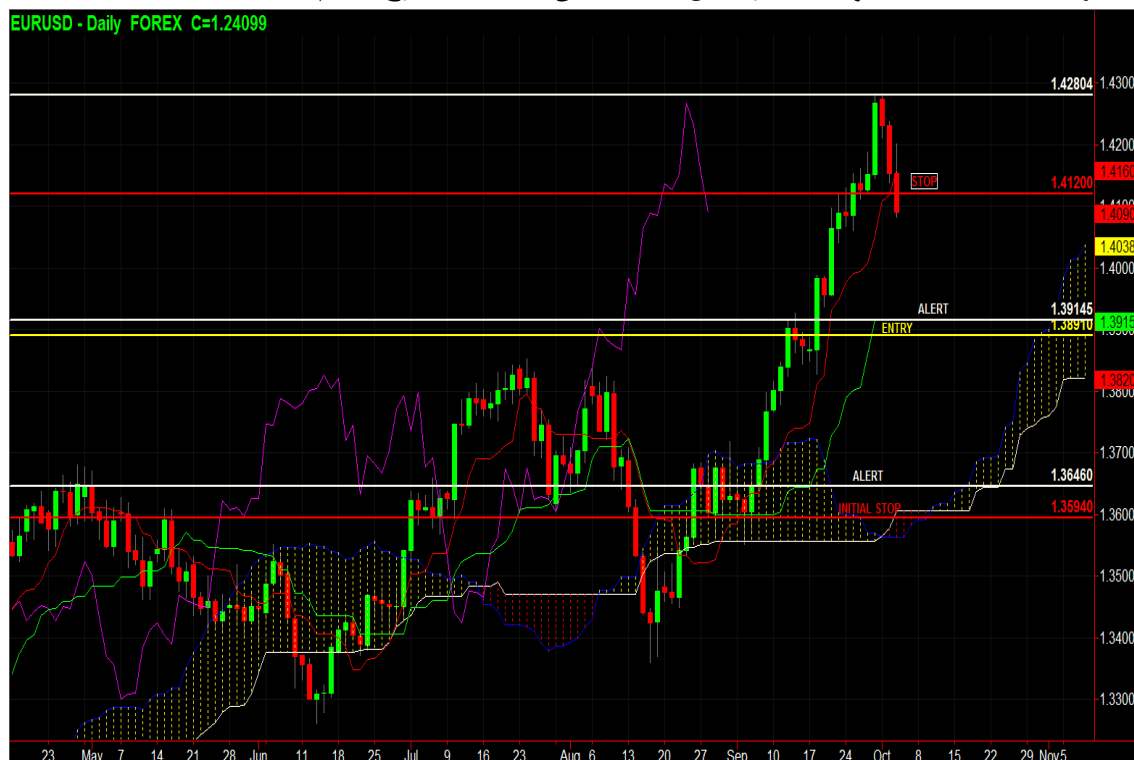


شکل ۵۹-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۸ سپتامبر ۲۰۰۷.

اگر به این نقطه برسید و به اشتباه توجه نکرده باشید، پس هرگز توجهی به برنامه معاملاتی تان نداشته‌اید. من به طور عمدی خطاهایی را در جاهای مختلف قرار داده‌ام تا مطمئن شوم شما در حال دنباله‌روی از برنامه معاملاتی هستید. اگر از برنامه معاملاتی تان دنباله‌روی نمی‌کنید پس شما به جای این که یک تریدر سیستمیک باشید، در حال قمار هستید.

در برنامه معاملاتی ما، ذکر شده زمانیکه قیمت ۲۰۰ پیپ یا بیشتر از تنکانسن در زمانی که تنکانسن به صورت مسطح است، دور شده است، باید از معامله خارج شوید. اگر به این نمودارها نگاه کنید، تنکانسن مسطح نشده است بنابراین نایستی از معامله خارج شویم. زمانیکه یک روند در حال رخ دادن است، در این صورت تنکانسن این روند را به صورت حرکت به سمت بالا نمایش می‌دهد، شما می‌خواهید تا جایی که می‌توانید «سوار» بر روند شوید. موقعیت‌های زیادی وجود خواهد داشت که قیمت از تنکانسن فرار می‌کند و سپس به حرکت خود ادامه می‌دهد. این موقعیت‌ها اساساً زمانی رخ می‌دهد که تنکانسن به جای اینکه مسطح شود، در جهت روند حرکت کند. اکنون اجازه دهید به عقب برگردیم و خطا را تصحیح کنیم. همراه با روند ادامه خواهیم داد زیرا هرگز نایستی از ترید به هیچ‌عنوان خارج شویم.

در ۳ اکتبر ۲۰۰۷، با کسب سودی که در شکل ۶۰-۳ نشان داده شده، خارج شدیم.



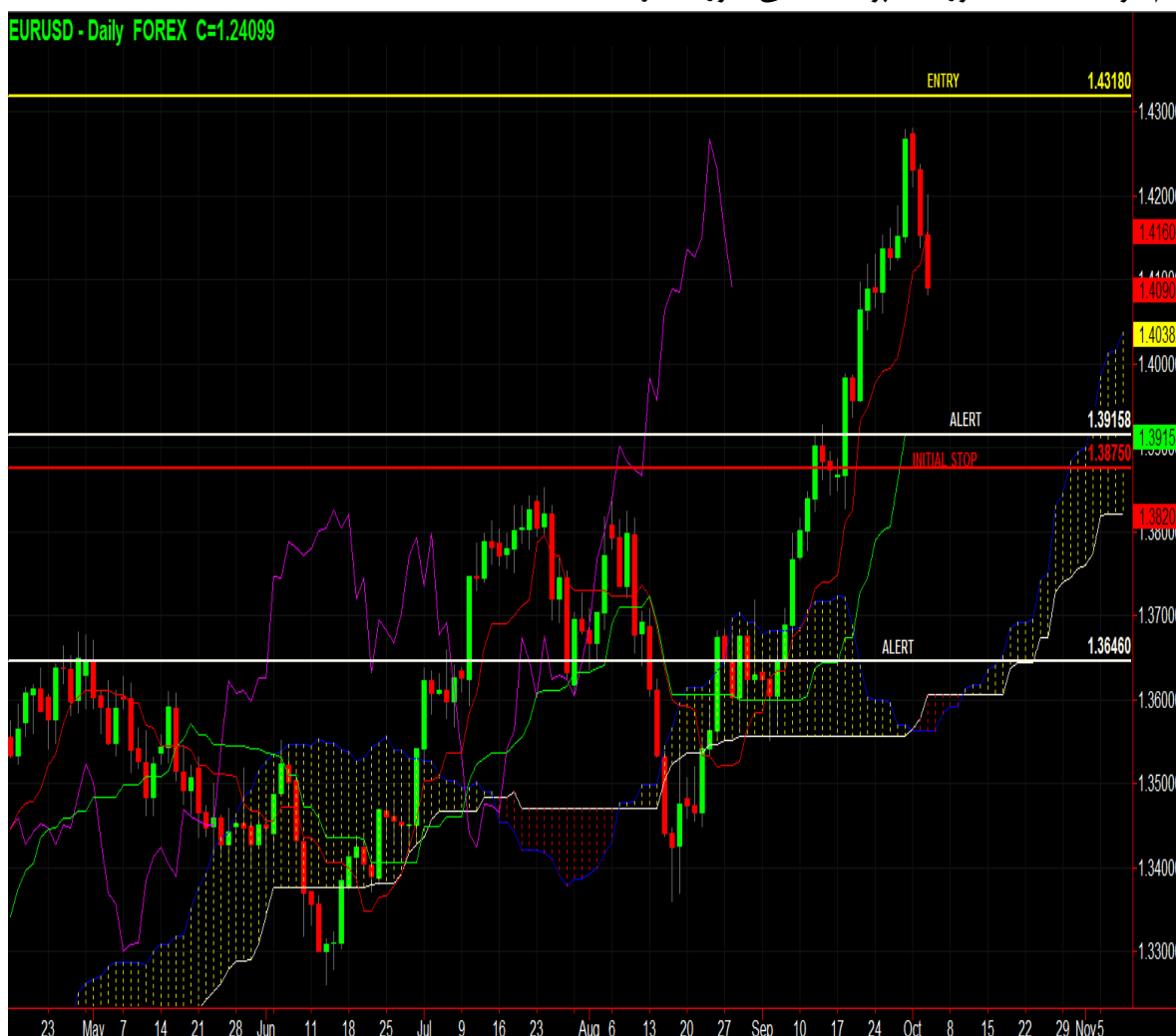
شکل ۶۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۸ سپتامبر ۲۰۰۷.

جدول ۳-۷: آمار و ارقام واقعی برای ترید #۳ را نشان می‌دهد.

جدول ۳-۷: آمار و ارقام معامله EURUSD در ۳ اکتبر ۲۰۰۷، ترید واقعی #۳

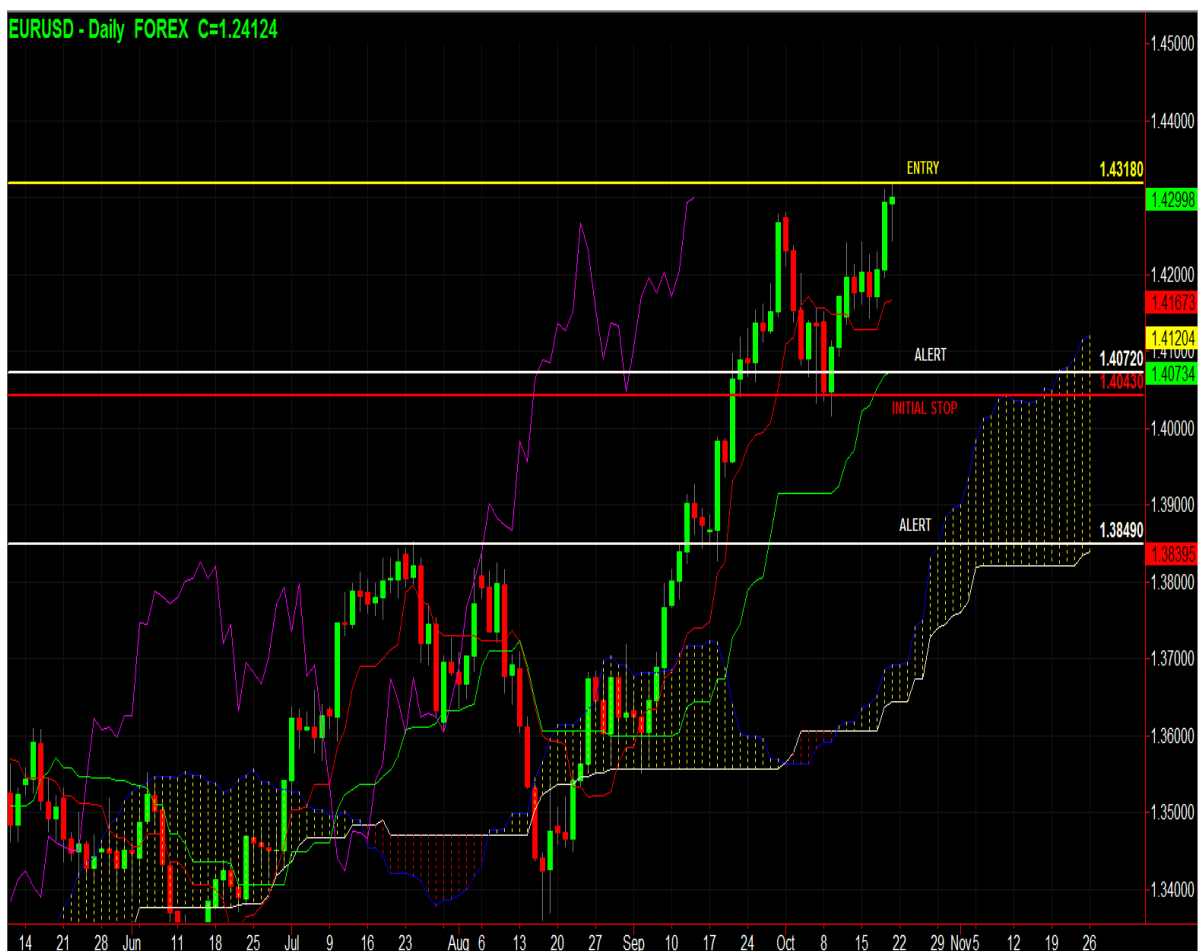
Statistics	Value
Entry Date	Sept 12, 2007
Entry Price	1.3891
Entry Stop	1.3594
Entry Risk	297 pips
Exit Date	Oct 3, 2007
Exit Price	1.4120
Profit	$1.4120 - 1.3891 = 229$ pips
Max Profit	$1.4280 - 1.3891 = 389$ pips
Max Drawdown	$1.3891 - 1.3827 = 64$ pips
Risk/Reward	$297/229 = 1.30$

اگر زمانی که قیمت از تنکانسن دور بود خارج می شدیم، سود می نمودیم، در این صورت ما حداکثر سود برای این ترید را کسب می نمودیم. این مسئله می تواند یک تکنیک بهینه سازکننده باشد که می توان مورد آزمایش و بررسی قرار داد. اساساً، شما زمانی از ترید خارج می شوید که قیمت از تنکانسن دور است و سپس نقطه ورود دیگری در بالای آخرین قله درست در حالتی که روند تصمیم می گیرد تا به مسیر خودش ادامه دهد، قرار می دهید. اکنون به تست خودمان ادامه می دهیم زیرا ترید صعودی خودمان را بسته ایم. شکل ۳-۶۱ خطر و نقطه ورود جدید را نشان می دهد. درحالی که چیکواسپین هنوز در «فضای باز» قرار دارد، می خواهیم یک ترید ادامه دهنده روند را جستجو کنیم. توجه کنید که هنوز یک پولبک اصلی صورت نگرفته است.



شکل ۳-۶۱: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳ اکتبر ۲۰۰۷.

در ۱۹ اکتبر ۲۰۰۷، همانطور که در شکل ۳-۶۲ نشان داده شده، یک روند صعودی شکل گرفته است. آمار و ارقام آماری نقطه ورود در جدول ۳-۸ بیان شده است.

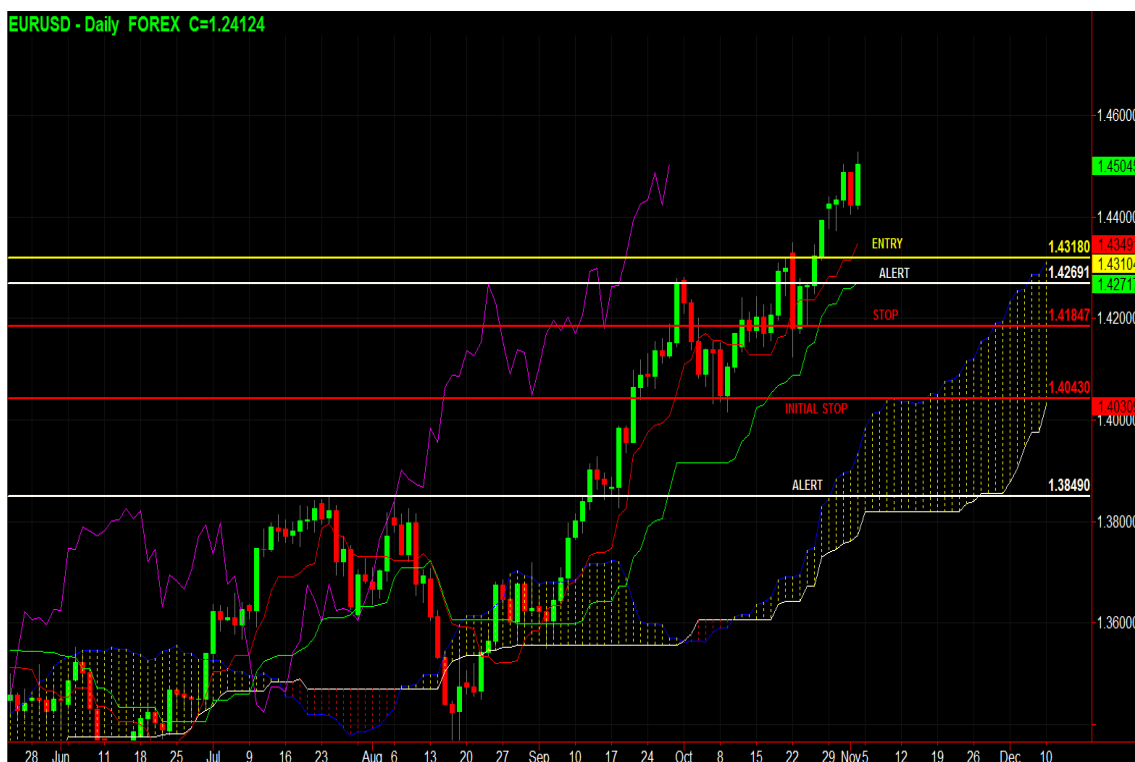


شکل ۶۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۹ اکتبر ۲۰۰۷.

جدول ۸-۳: آمار و ارقام نقطه ورود برای EURUSD در ۱۹ اکتبر ۲۰۰۷، ترید #۴

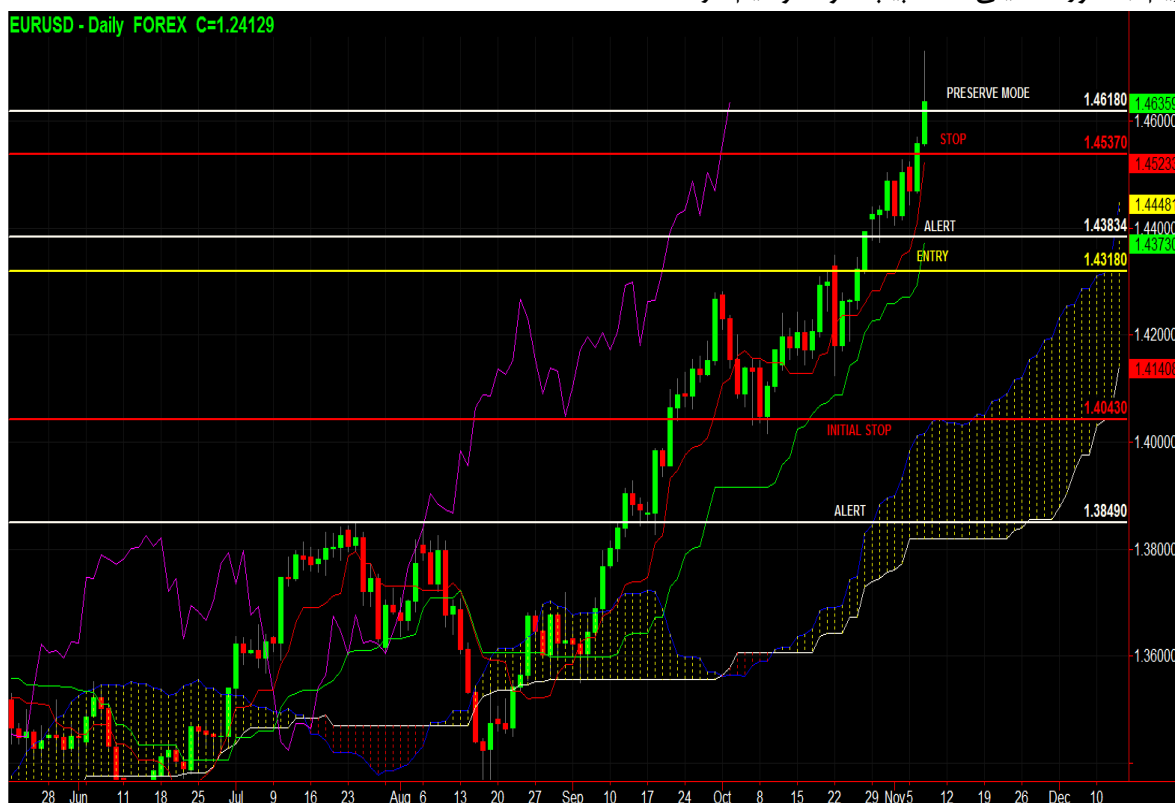
Statistics	Value
Entry Date	Oct 19, 2007
Entry Price	1.4318
Entry Stop	1.4042
Entry Risk	276 pips

شکل ۶۳-۳ نمودار را در تاریخ ۲ نوامبر ۲۰۰۷ نشان می‌دهد. به «حالت محافظتی» نزدیک می‌شویم اما هنوز در این منطقه قرار نگرفته‌ایم. ریسک ما اکنون به کمتر از ۱۰۰ پیپ کاهش یافته است.



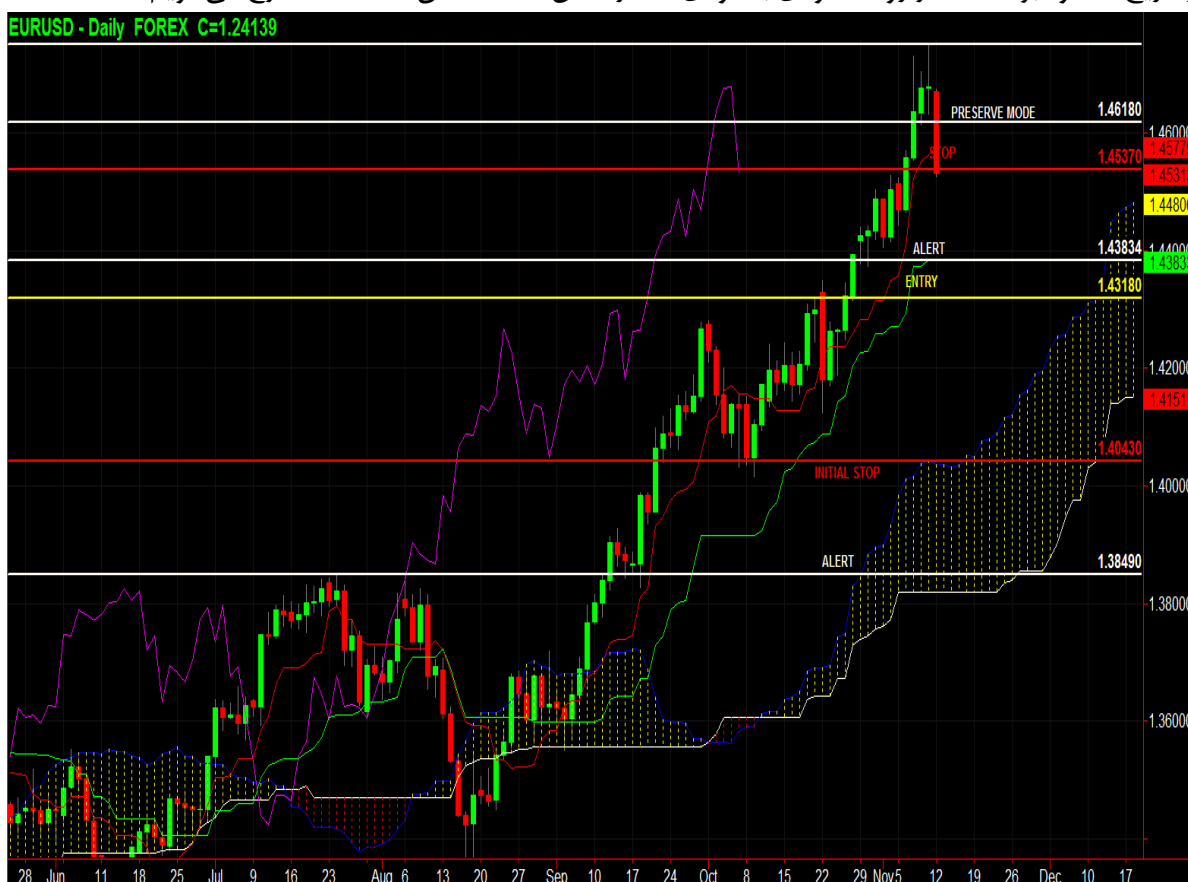
شکل ۶۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ نوامبر ۲۰۰۷.

شکل ۶۴-۳ نمودار تاریخ ۷ نوامبر ۲۰۰۷ را شرح می‌دهد. در این تاریخ، اکنون وارد «منطقه محافظتی» شده‌ایم بنابراین ریسک‌مان به طور کامل به حداقل خود رسیده است. در واقع، در حال حاضر ما در یک «ترید آزاد» نیز قرار داریم. به طور تضمینی ۱۵۰ پیپ سود خواهیم کرد.



شکل ۶۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ نوامبر ۲۰۰۷.

در تاریخ ۱۲ نوامبر ۲۰۰۷، از روند صعودی با سودی که در شکل ۳-۶۵ نشان داده شده، خارج می‌شویم.



شکل ۳-۶۵: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ نوامبر ۲۰۰۷.

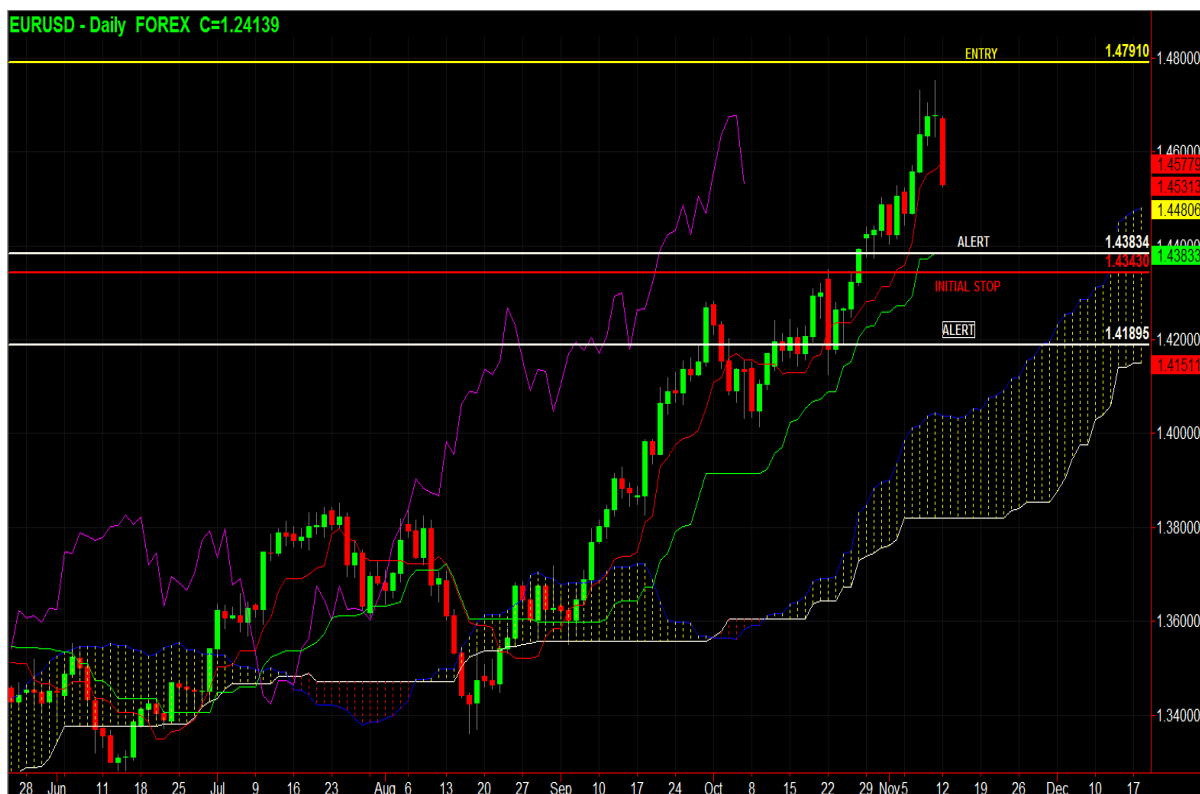
آمار و ارقام مربوط به معامله در جدول ۳-۹ بیان شده است.

جدول ۳-۹: آمار و ارقام مربوط به معامله EURUSD در ۱۲ نوامبر ۲۰۰۷، تردید ۴#

Statistics	Value
Entry Date	Oct 19, 2007
Entry Price	1.4318
Entry Stop	1.4042
Entry Risk	276 pips
Exit Date	Nov 12, 2007
Exit Price	1.45370
Profit	$1.4537 - 1.4318 = 219$ pips
Max Profit	$1.4749 - 1.4318 = 431$ pips
Max Drawdown	$1.43180 - 1.4169 = 149$
Risk/Reward	$276/219 = 1.26$

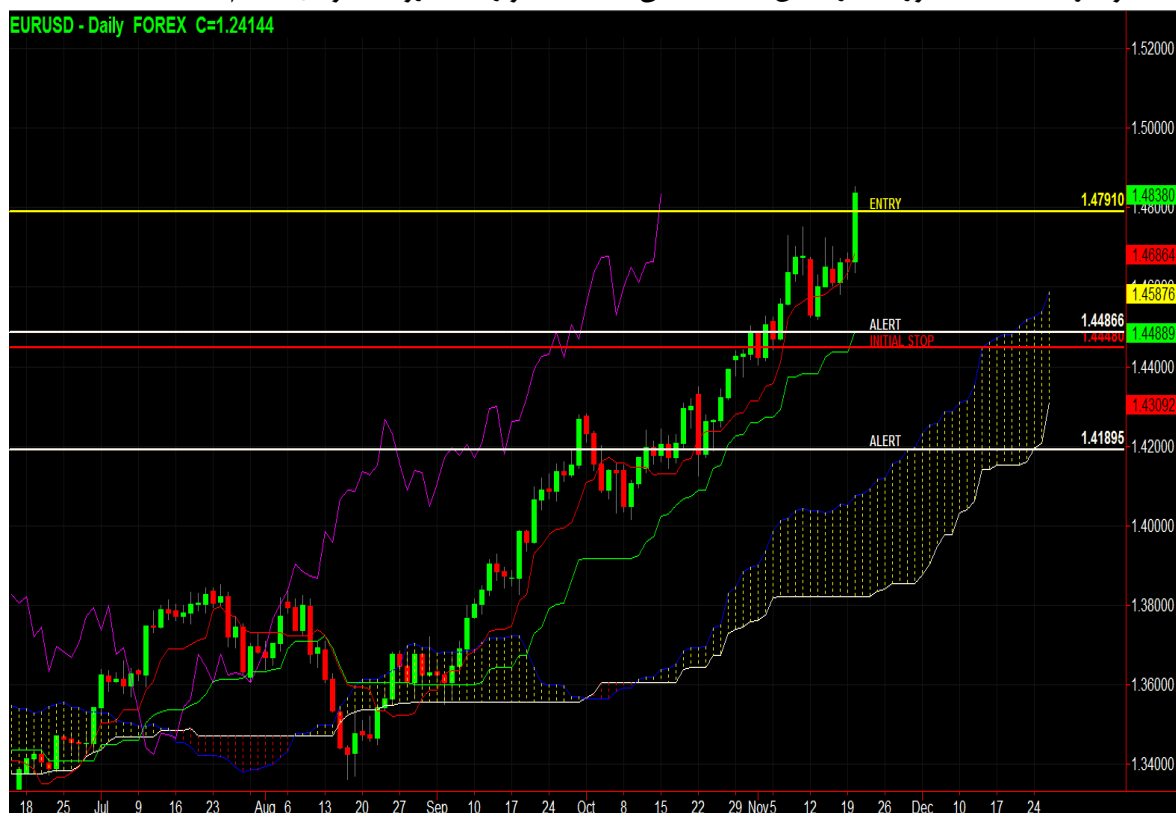
توضیح: ۵۰٪ حداکثر سود را به دست آورده ایم.

شکل ۳-۶۶: اظهارهای جدید و قیمت‌های ورود جدید را نشان می‌دهد. چیکواسپین در «فضای باز» قرار گرفته بنابراین در جستجوی یک معامله در روند ادامه‌دار می‌باشیم. به خاطر داشته باشید که یک پولبک اصلی نیز هنوز رخ نداده است.



شکل ۶۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۲ نوامبر ۲۰۰۷.

در ۲۰ نوامبر ۲۰۰۷، همانطور که در شکل ۶۷-۳ نشان داده شده، وارد یک روند صعودی شدیم.



شکل ۶۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ نوامبر ۲۰۰۷.

آمار و ارقام مربوط به ورود به معامله در جدول ۱۰-۳ نشان داده شده است.

جدول ۱۰-۳: آمار و ارقام ورود به معامله EURUSD در ۲۰ نوامبر ۲۰۰۷، ترید #۵

Statistics	Value
Entry Date	Nov 20, 2007
Entry Price	1.4791
Entry Stop	1.4448
Entry Risk	343 pips

بدون در نظر گرفتن بافر، فاصله بین قیمت و کیجنسن ۳۰۶ پیپ است. این مقدار بالاتر از ۳۰۰ پیپ فاصله‌ای است که مایلیم آن را مورد پذیرش قرار دهیم. آیا باید برنامه معاملاتی را به این دلیل که اختلاف آن تنها ۶ پیپ است، مورد تخطی قرار دهیم؟ اگر هم‌اکنون از برنامه معاملاتی‌تان تخطی نمائید، ممکن است این امر برایتان به صورت عادت درآید و اگر این امر عادت شود، پس چرا یک برنامه معاملاتی دارید؟ نمی‌خواهیم از برنامه معاملاتی‌مان تخطی نمائیم بنابراین از ترید در همین نقطه خارج خواهیم شد. آمار و ارقام مربوط به خروج در جدول ۳-۱۱ لیست شده است.

جدول ۳-۱۱: آمار و ارقام EURUSD در ۲۰ نوامبر ۲۰۰۷، ترید #۵

Statistics	Value
Entry Date	Nov 20, 2007
Entry Price	1.4791
Entry Stop	1.4448
Entry Risk	343 pips
Exit Date	Nov 20, 2007
Exit Price	1.4838
Profit	47
Max Profit	61
Max Drawdown	N/A

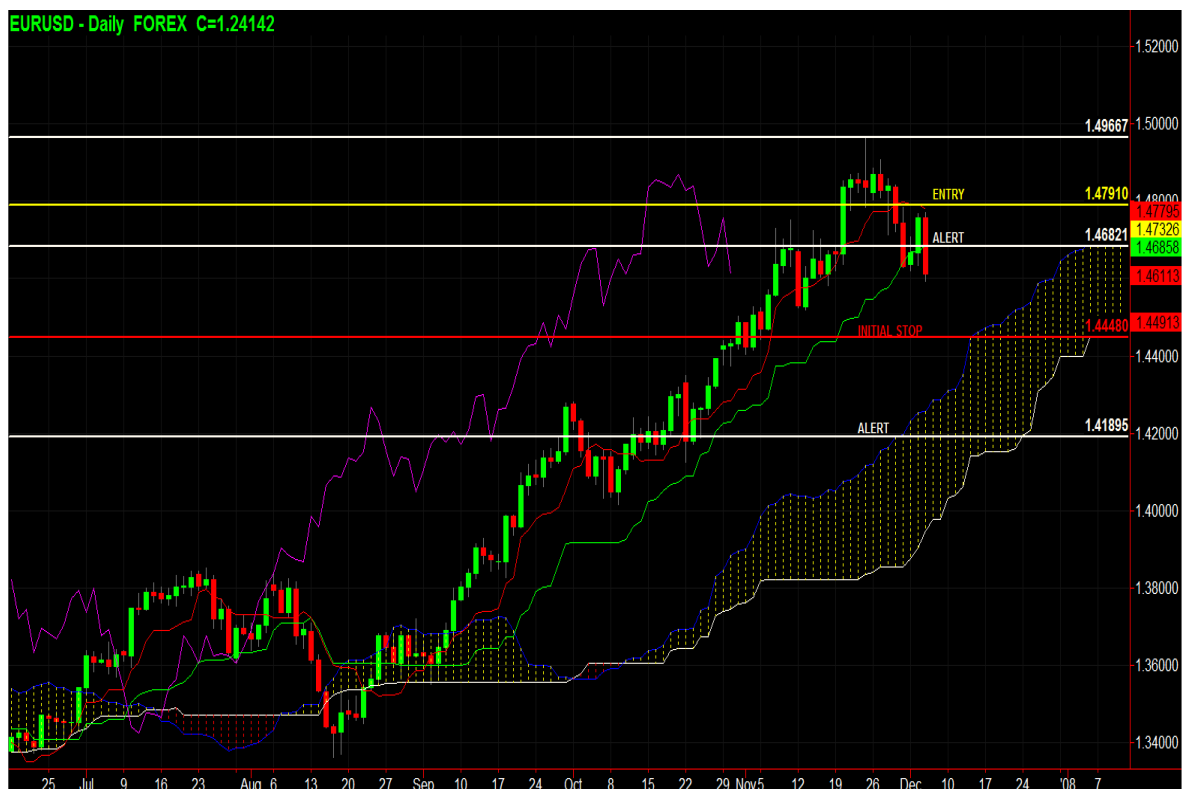
توضیح: از ترید به دلیل فاصله قیمت تا تنکانسن خارج شدیم.

بیاید بررسی کنیم چه اتفاقی می‌افتاد اگر به تریدمان ادامه می‌دادیم. شکل ۳-۶۸ نقطه خروج از ترید در ۵ دسامبر ۲۰۰۷، را با ضرر شرح می‌دهد. آمار و ارقام مربوط به این ترید در جدول ۳-۱۲ لیست شده است.

جدول ۳-۱۲: آمار و ارقام EURUSD در ۵ دسامبر ۲۰۰۷، ترید #۵، شبیه سازی

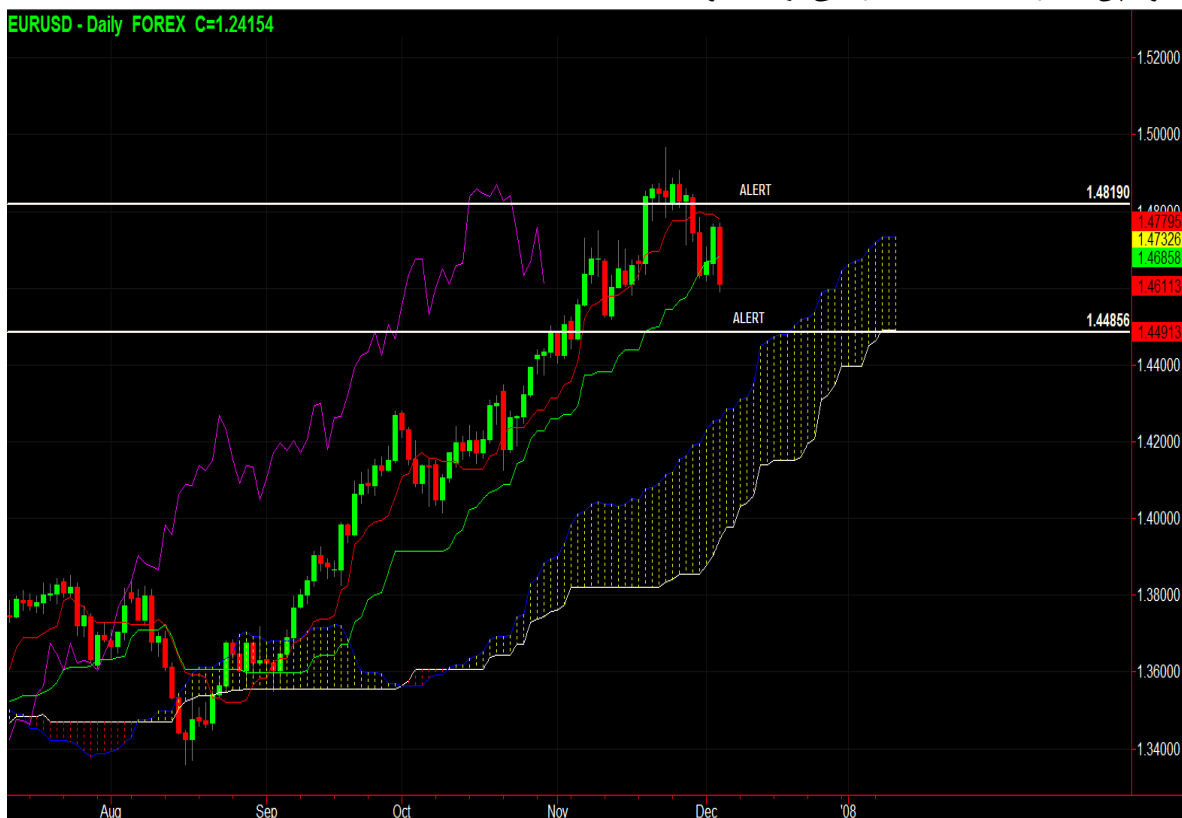
Statistics	Value
Entry Date	Nov 20, 2007
Entry Price	1.4791
Entry Stop	1.4448
Entry Risk	343 pips
Exit Date	Dec 5, 2007
Exit Price	1.4630
Profit	-161 (Loss)

توضیح: ترید شبیه‌سازی شده ...



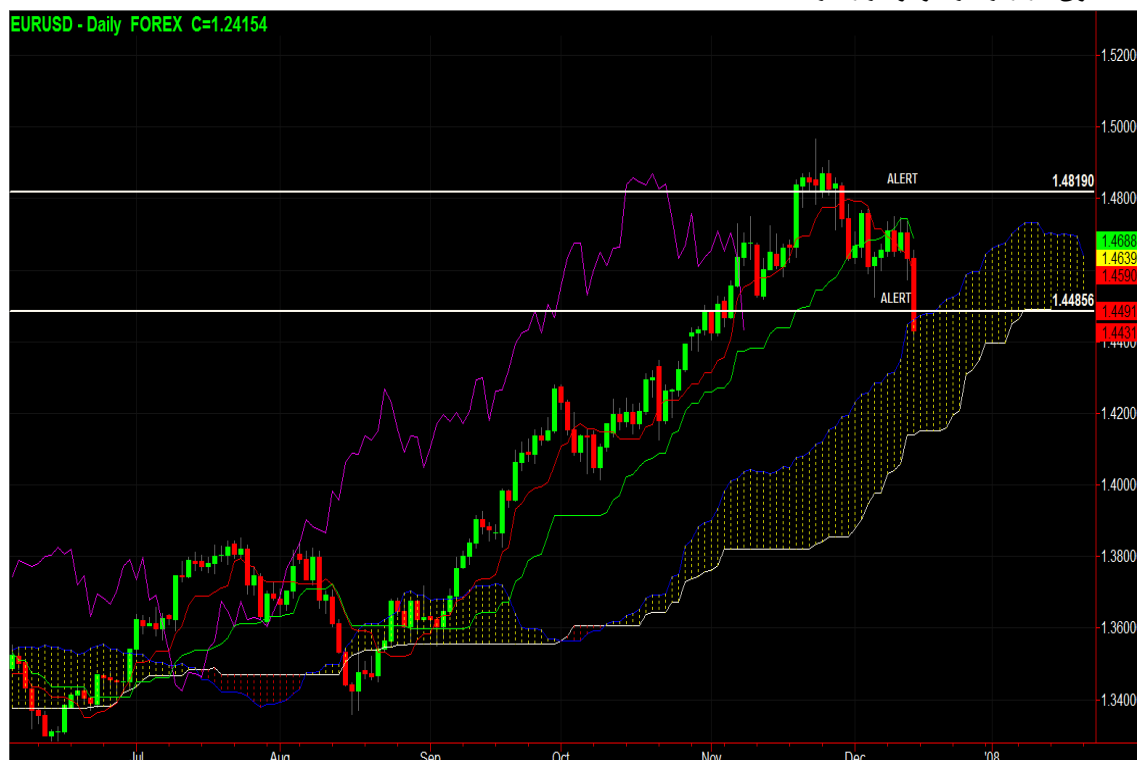
شکل ۳-۶۸: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۵ دسامبر ۲۰۰۷.

شکل ۳-۶۹: اظهارهای جدید در ۵ دسامبر ۲۰۰۷ را شرح می‌دهد. وارد یک معامله ادامه‌دهنده روند نشدیم زیرا چیکواسپین بسیار به قیمت‌های تاریخی نزدیک بود.



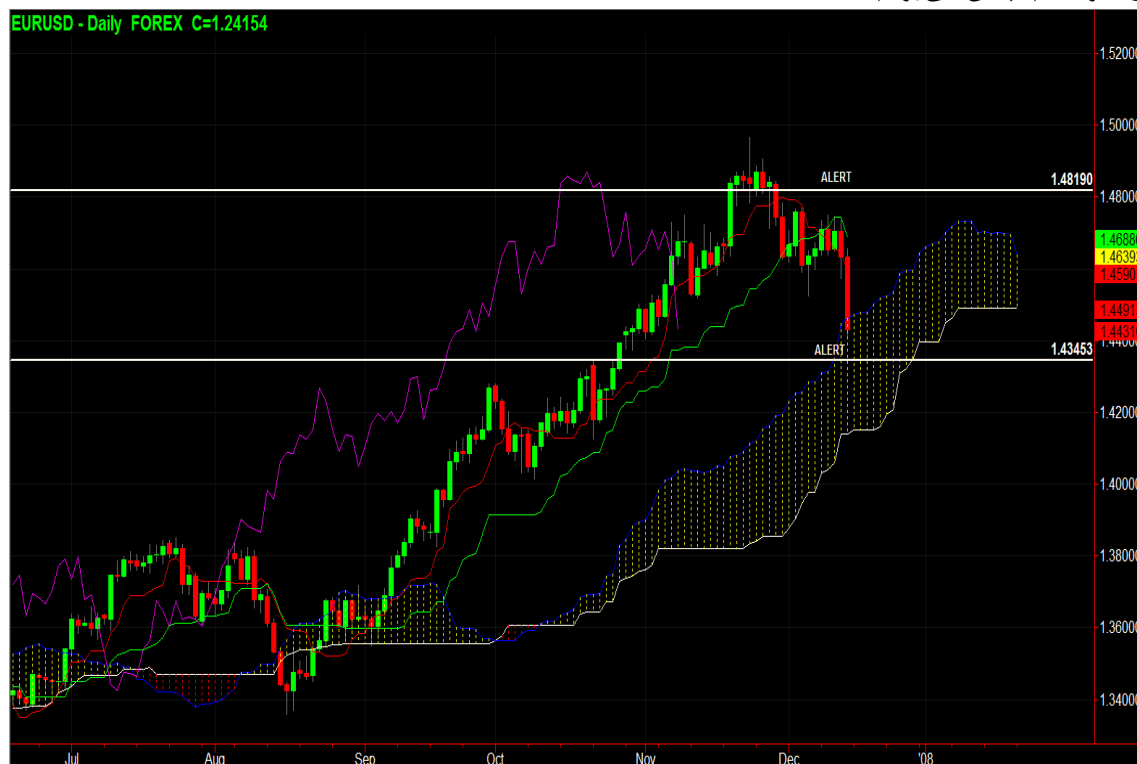
شکل ۳-۶۹: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۵ دسامبر ۲۰۰۷.

نمودارهای شکل ۳-۷۰ نشان می‌دهند که اختارهای نزولی راهاندازی شده‌اند. در واقع هیچ تریدی وجود ندارد زیرا قیمت اکنون در زیر ابر کومو قرار گرفته است.



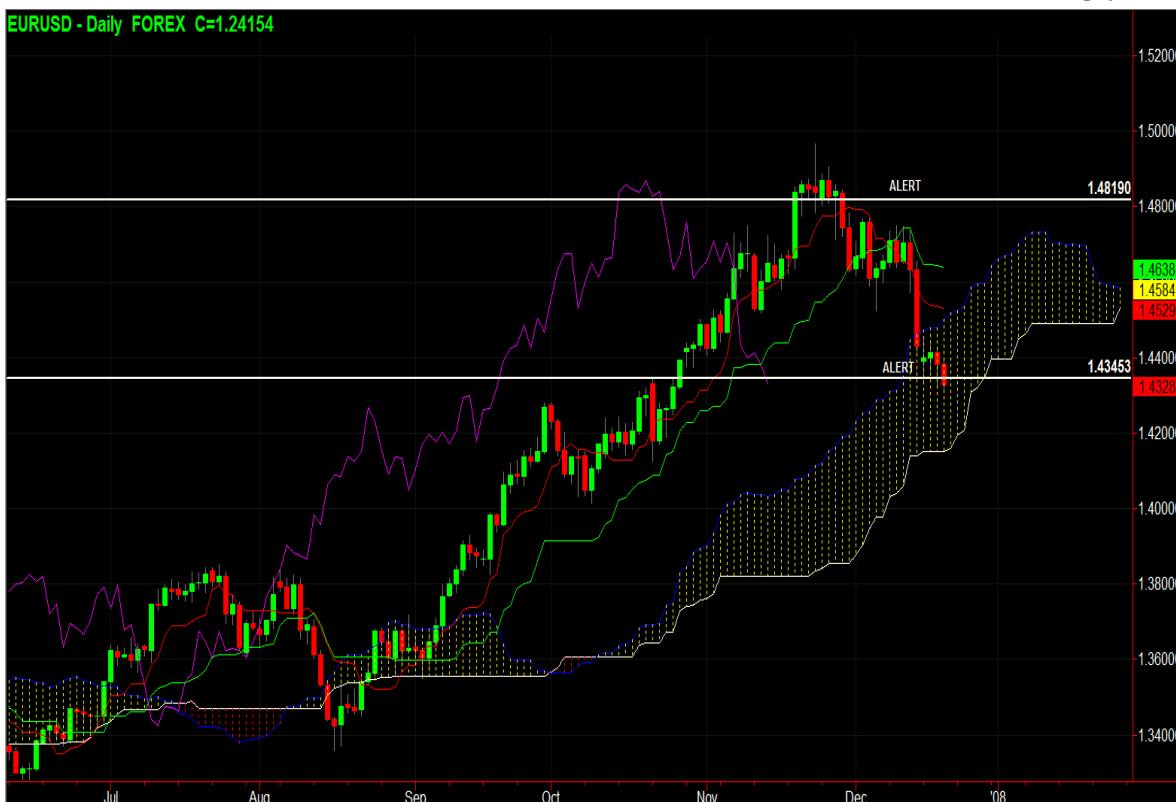
شکل ۳-۷۰: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۵ دسامبر ۲۰۰۷

شکل ۳-۷۱ اختارهای جدید را نشان می‌دهد. ما به حرکت به سمت جلو با بک‌تست‌مان درحالیکه تقریباً یک سال را کامل نموده‌ایم، پیش می‌رویم.



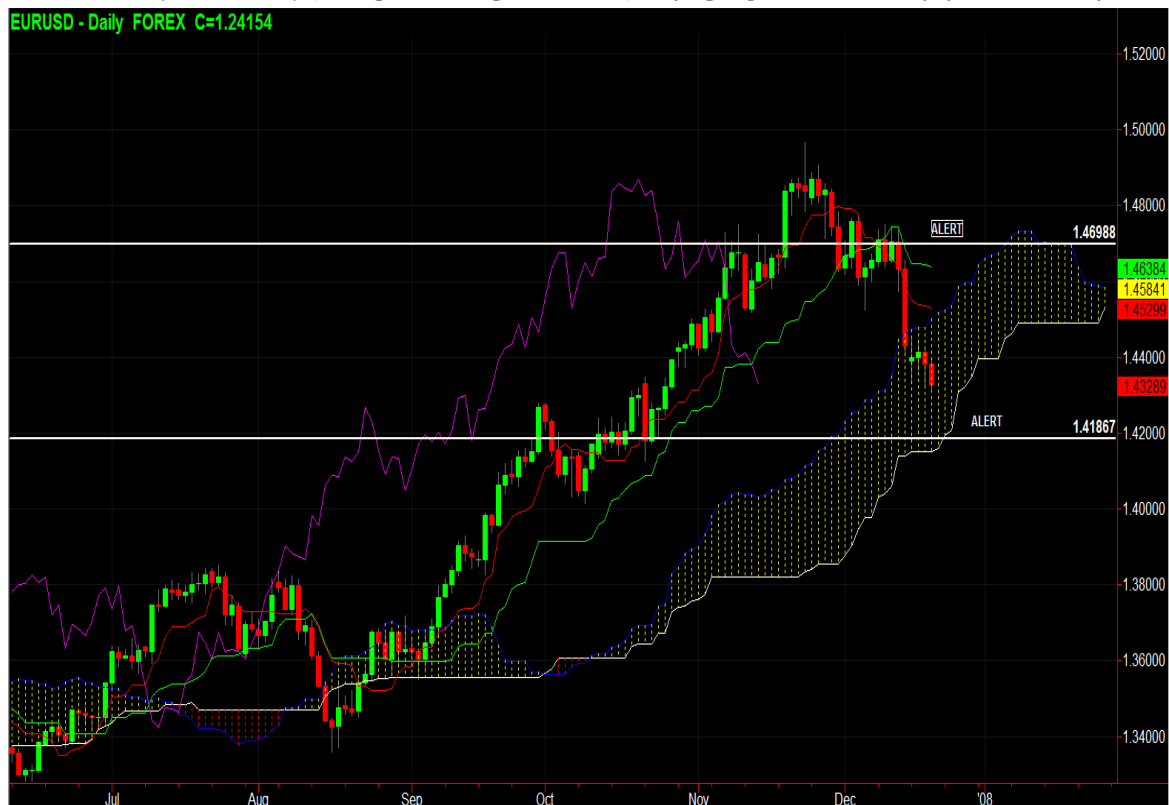
شکل ۳-۷۱: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۵ دسامبر ۲۰۰۷

اخطار نزولی در شکل ۳-۷۲ در ۲۰ دسامبر ۲۰۰۷ راه اندازی شده است.



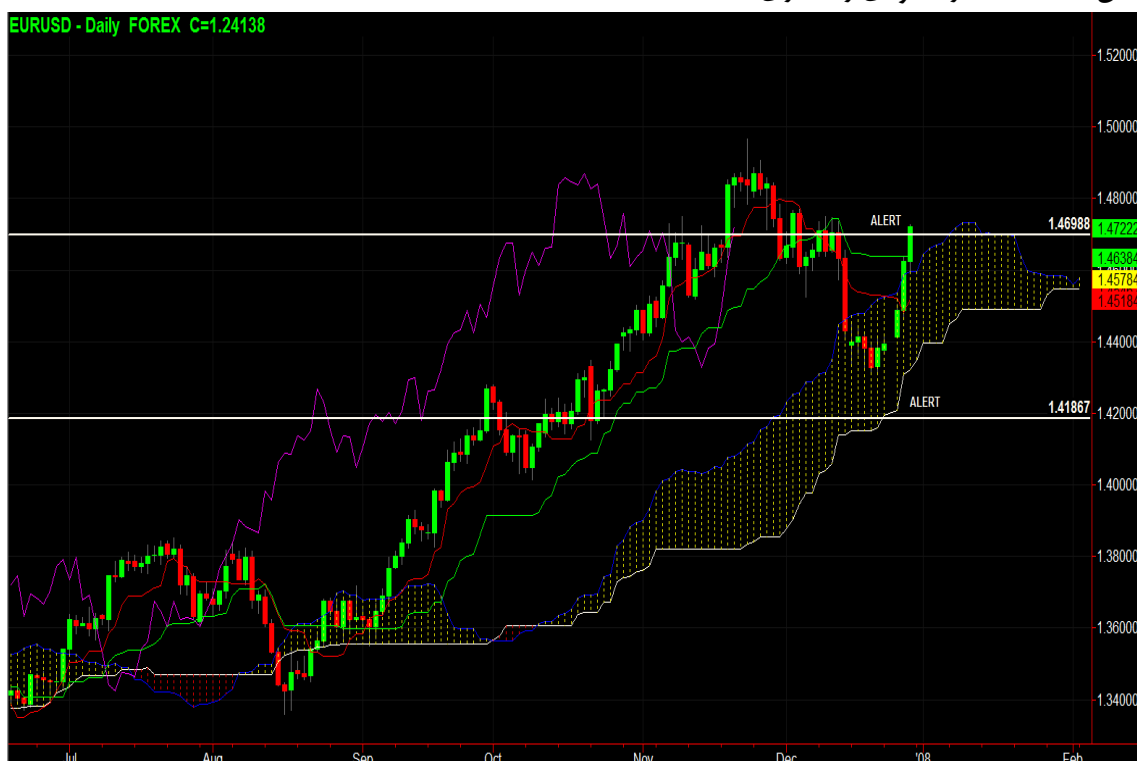
شکل ۳-۷۲: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ دسامبر ۲۰۰۷.

قیمت هنوز در زیر ابر کومو قرار دارد بنابراین می‌خواهیم اخطارهایمان را بازنشانی کنیم. (شکل ۳-۷۳).



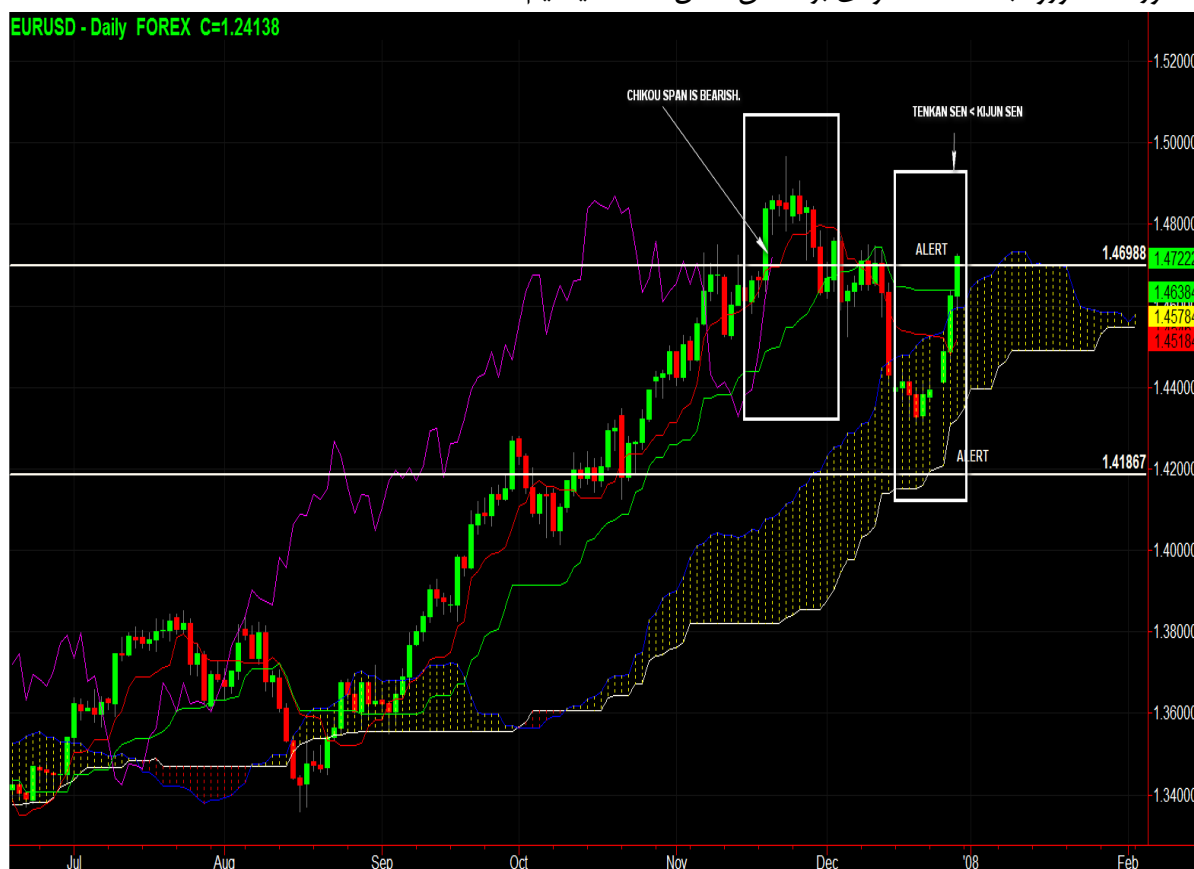
شکل ۳-۷۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ دسامبر ۲۰۰۷.

در شکل ۷۴-۳، اخطار صعودی راه اندازی شده است.



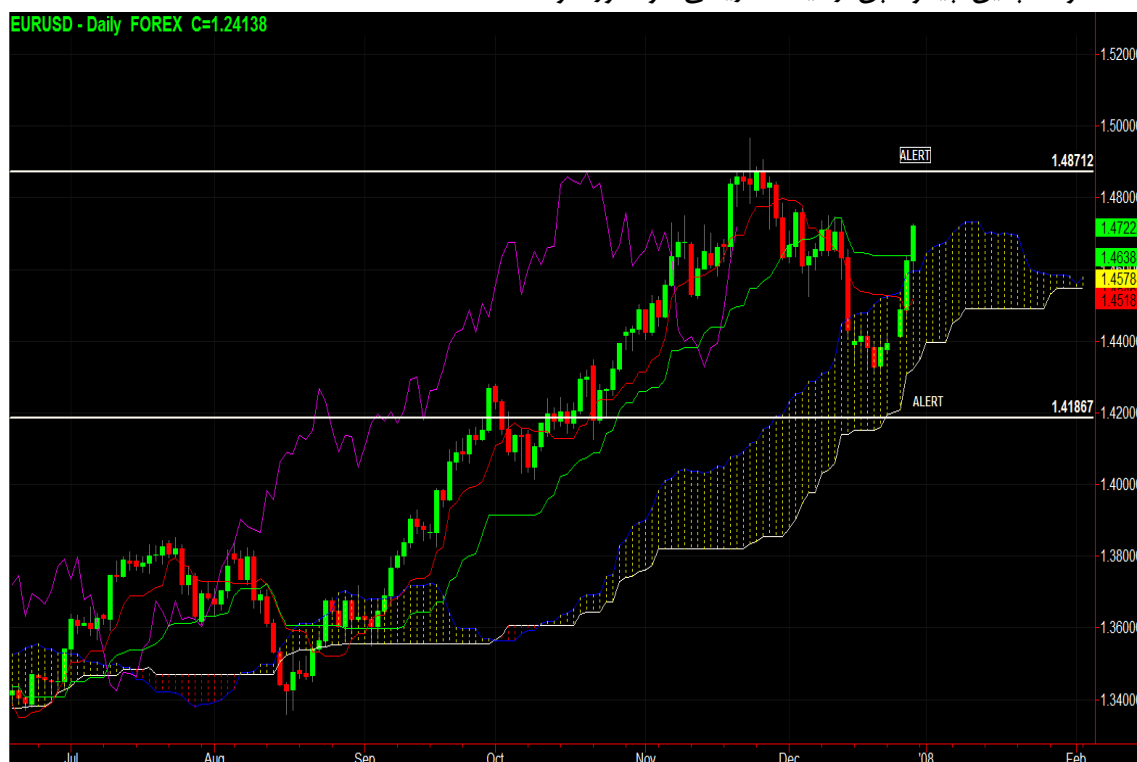
شکل ۷۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ دسامبر ۲۰۰۷.

ما هنوز آماده ورود به معامله صعودی بر اساس شکل ۷۵-۳ نیستیم.



شکل ۷۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۸ دسامبر ۲۰۰۷.

شکل ۳-۷۶ نمودار را با اخبارهای صعودی و نزولی جدید نشان می‌دهد. اخبار صعودی را در این زمان با احتمال بیشتری انتخاب نمودیم زیرا نیاز به یک حرکت بالارونده بزرگ داریم تا باعث شود که تکناسن و کیجنسن یکدیگر را قطع کنند و همچنین چیکواسپن از قیمت تاریخی خود دور شود.



شکل ۳-۷۶: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۸ دسامبر ۲۰۰۷.

در ۴ ژانویه ۲۰۰۸، اخبار صعودی راه‌اندازی شده است (شکل ۳-۷۷).



شکل ۳-۷۷: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۴ ژانویه ۲۰۰۸.

شکل ۷۸-۳ نشان می‌دهد اندیکاتورهای ایچیموکو هنوز آماده ورود به معامله صعودی نیستند.



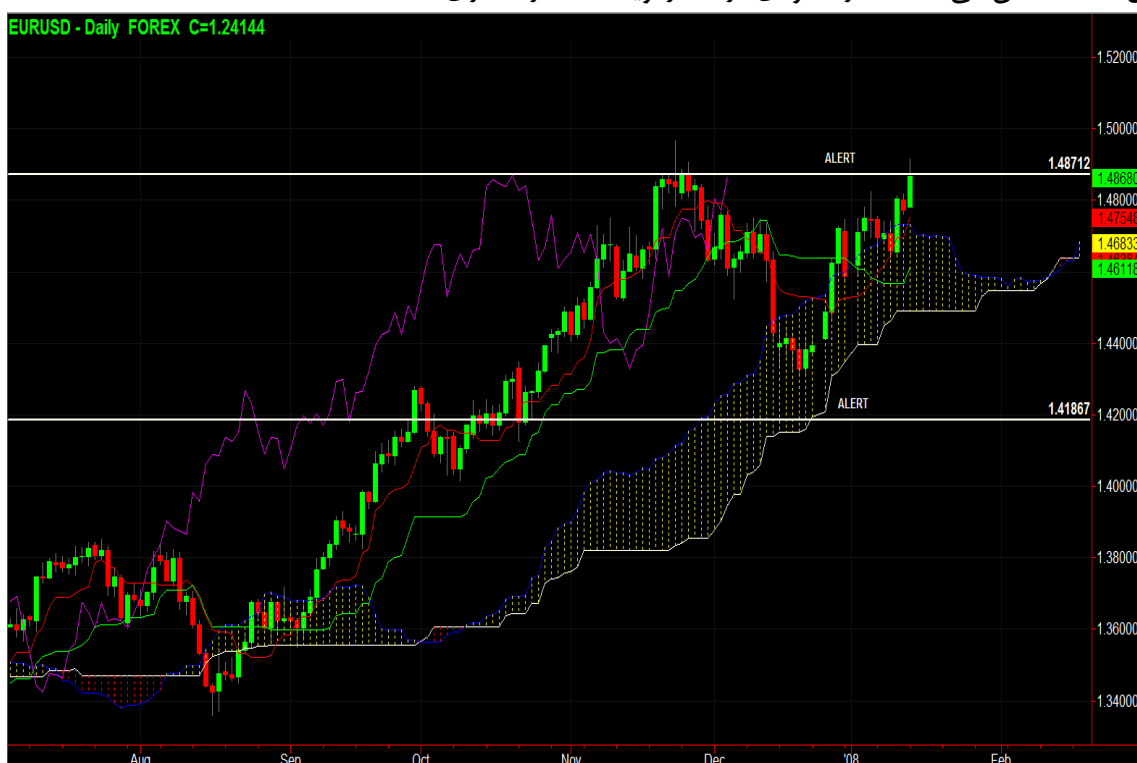
شکل ۷۸-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۴ ژانویه ۲۰۰۸.

بنابراین، خطرها را همانطور که در شکل ۷۹-۳ نشان داده شده، بازنشانی می‌کنیم.



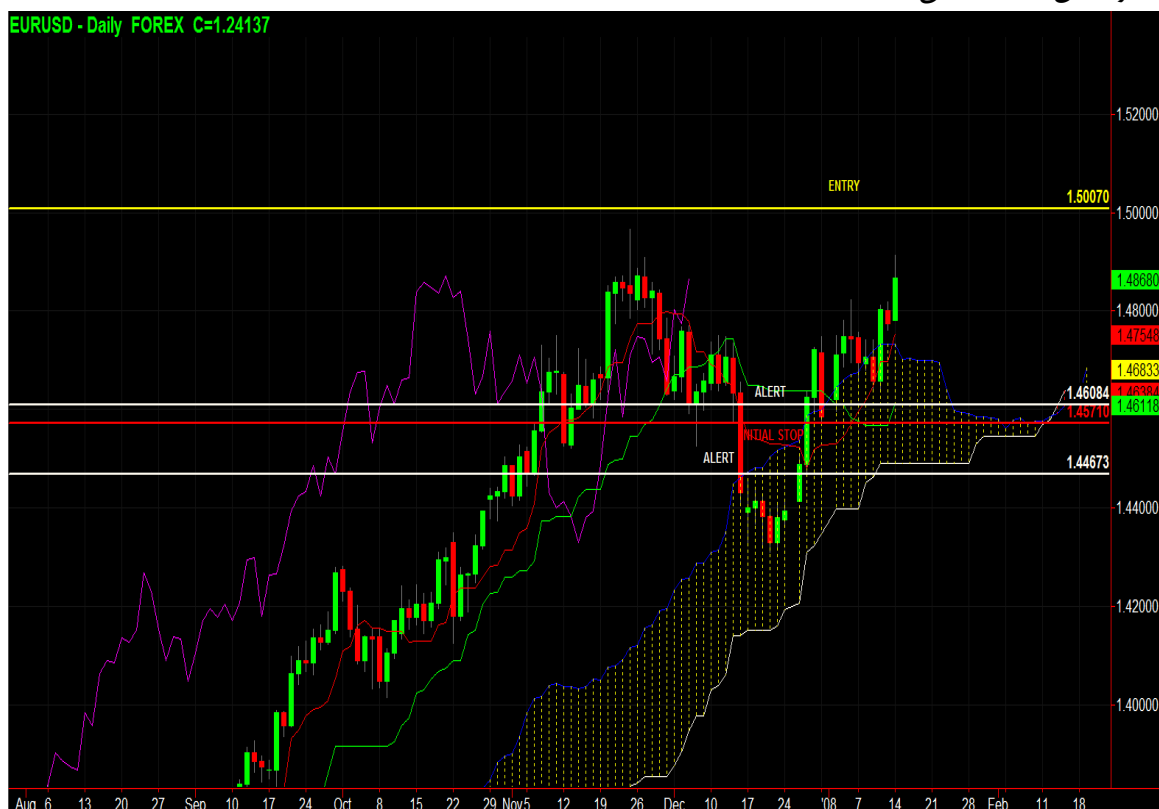
شکل ۷۹-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۴ ژانویه ۲۰۰۸.

شکل ۸۰-۳ نشان می‌دهد اخطار صعودی در ۱۴ ژانویه ۲۰۰۸ راه‌اندازی شده است.



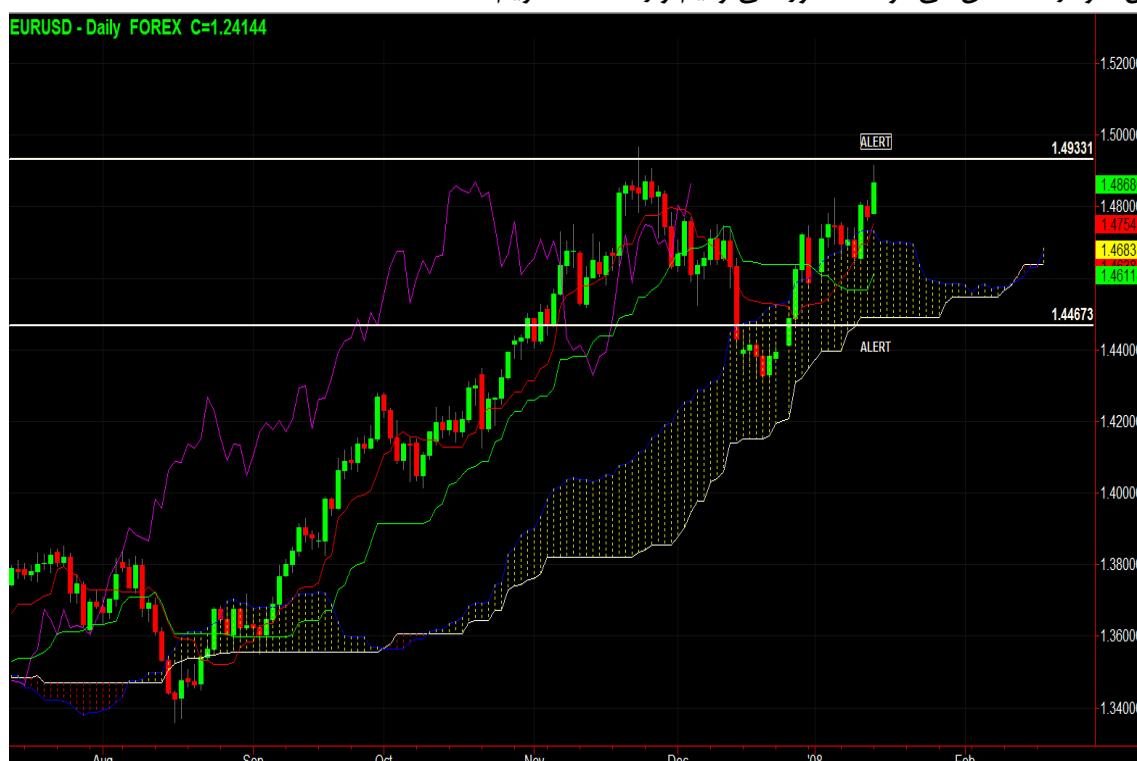
شکل ۸۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۴ ژانویه ۲۰۰۸.

در زمان بررسی نمودار ایچیموکو برای آن تاریخ، همه اندیکاتورها برای یک ورود در وضعیت «عالی» هستند. اطلاعات ورود در شکل ۸۱-۳ نشان داده شده است.



شکل ۸۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۴ ژانویه ۲۰۰۸.

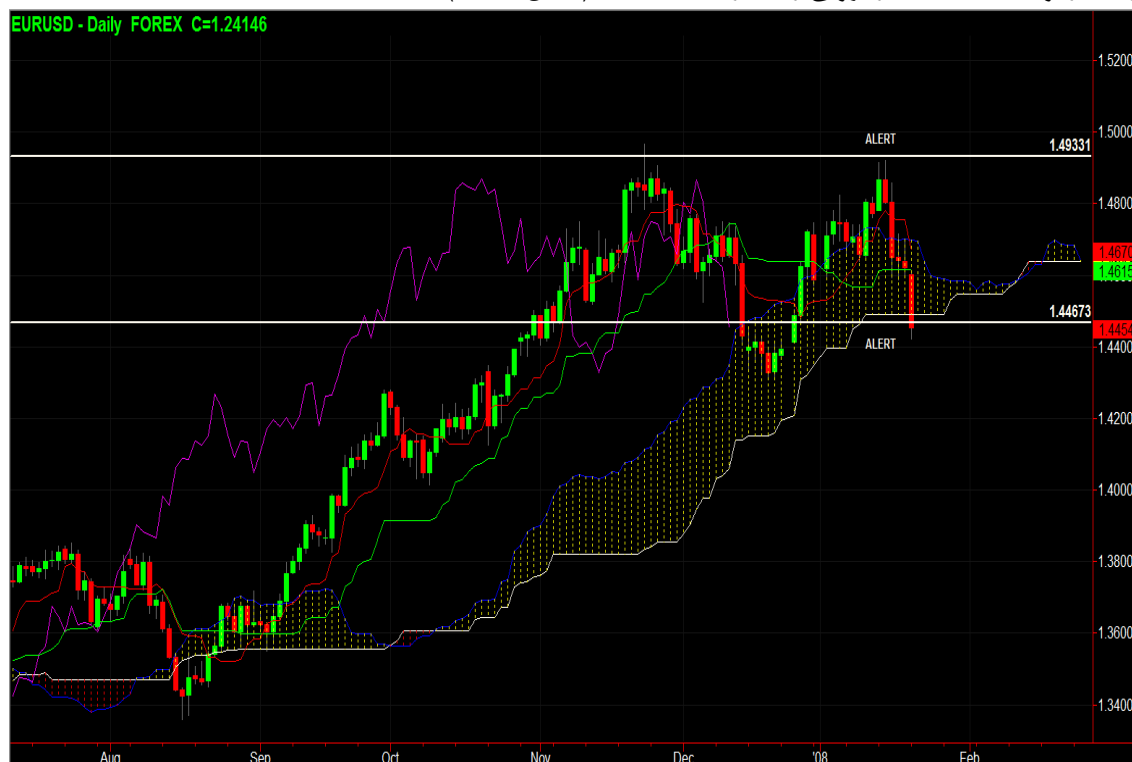
از این نمودار مشخص می‌شود که هنوز نمی‌توانیم وارد معامله شویم.



شکل ۸۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۴ ژانویه ۲۰۰۸.

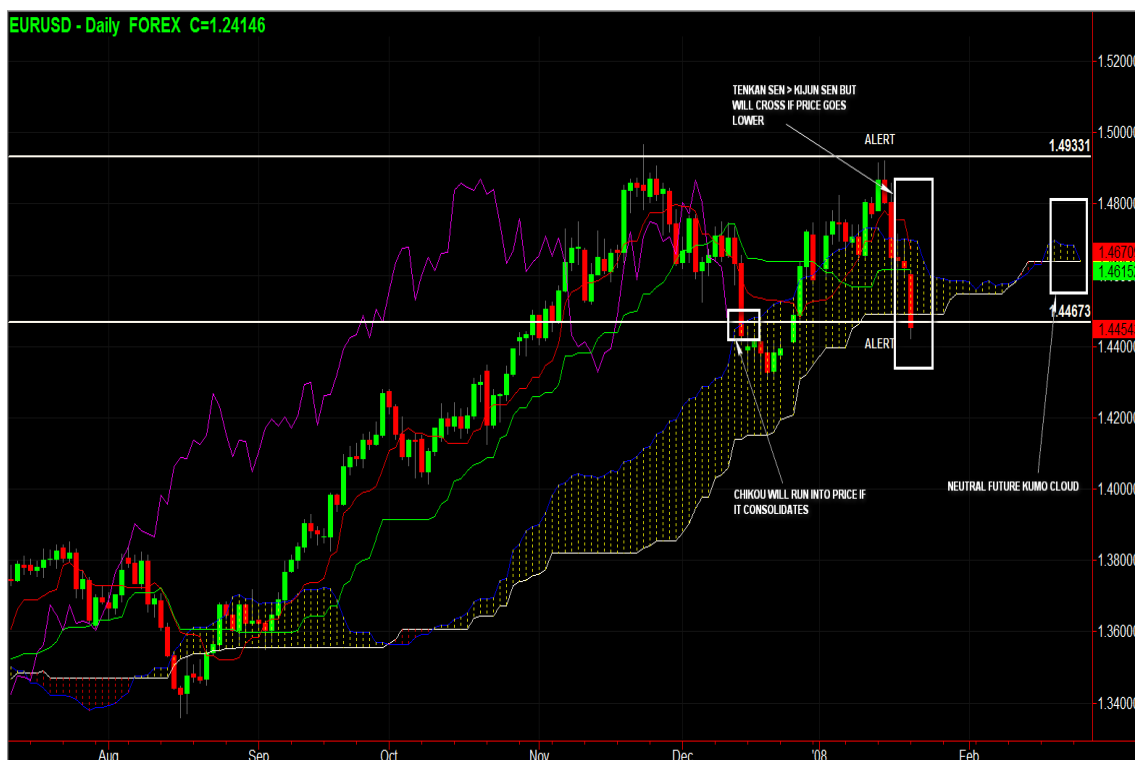
در این زمان، مسئله، فاصله قیمت از کیجنسن است. بنابراین، کلیه اختارها را بازنشانی می‌کنیم و همانطور که در شکل ۸۲-۳ بیان شده است، مجدداً منتظر می‌مانیم.

در ۲۱ ژانویه ۲۰۰۸، اختار نزولی راه‌اندازی شده است (شکل ۸۳-۳).



شکل ۸۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۱ ژانویه ۲۰۰۸.

در این زمان، همانطور که در شکل ۳-۸۴ نشان داده شده، اندیکاتورهای ایچیموکو به هیچوجه آماده ورود به معامله صعودی نیستند.



شکل ۳-۸۴: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۱ ژانویه ۲۰۰۸.

شکل ۳-۸۵: اخبارهای جدید را نشان می‌دهد درحالیکه هنوز نمی‌توانیم وارد معامله شویم.



شکل ۳-۸۵: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۱ ژانویه ۲۰۰۸.

در ۱ فوریه ۲۰۰۸، اختطار صعودی همانطور که در شکل ۸۶-۳ نشان داده شده، راه اندازی می شود.



شکل ۸۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱ فوریه ۲۰۰۸.

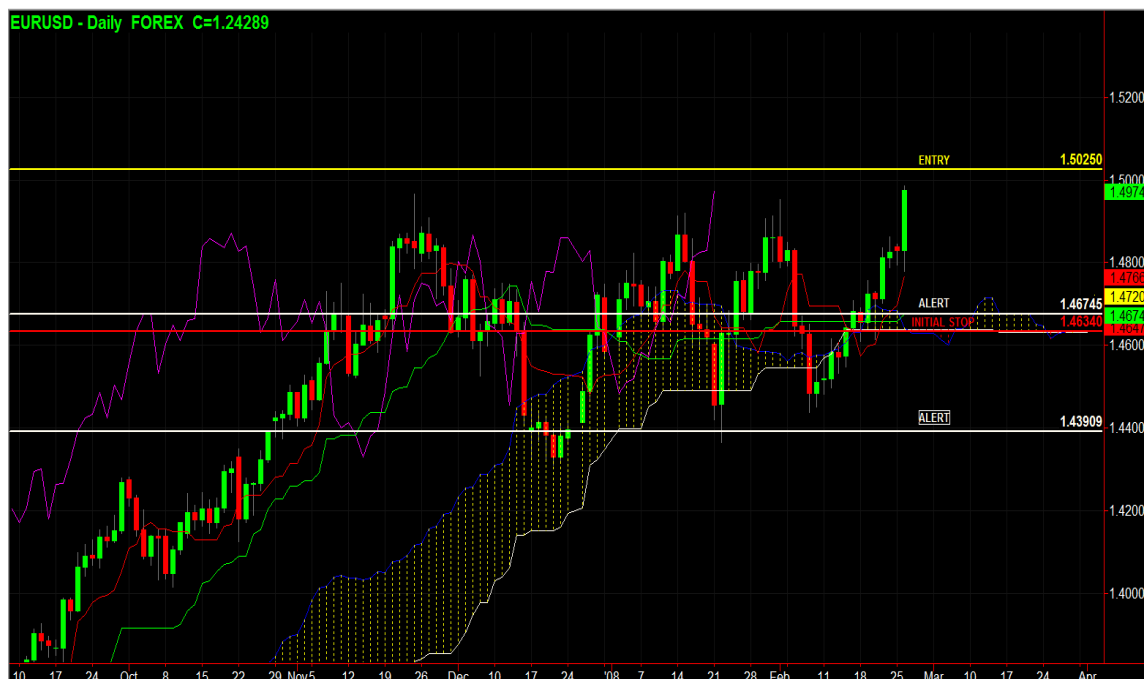
اندیکاتورهای ایچیموکو در حالت خوبی قرار دارند اگر که یک ورود به معامله صعودی را انجام دهیم. هرچند، مسئله این است که نتوانسن از قیمت دور است. قیمت خارج از محدوده ۲۰۰ پپی است که در برنامه معاملاتی مان آن را مشخص نموده ایم. بنابراین، در این زمان نمی توانیم وارد معامله خرید شویم. اکنون، باید اختطار صعودی جدید را انتخاب کنیم. اگر از مقداری که در حال حاضر قرار داریم، بالاتر برویم، ممکن است بریک را از دست بدهیم. بنابراین، می خواهیم همان اختطاری که پیش از این داشتیم را حفظ کنیم.

در ۲۶ فوریه ۲۰۰۸، یک اختطار صعودی همانطور که در شکل ۸۷-۳ نشان داده شده، راه اندازی می شود.



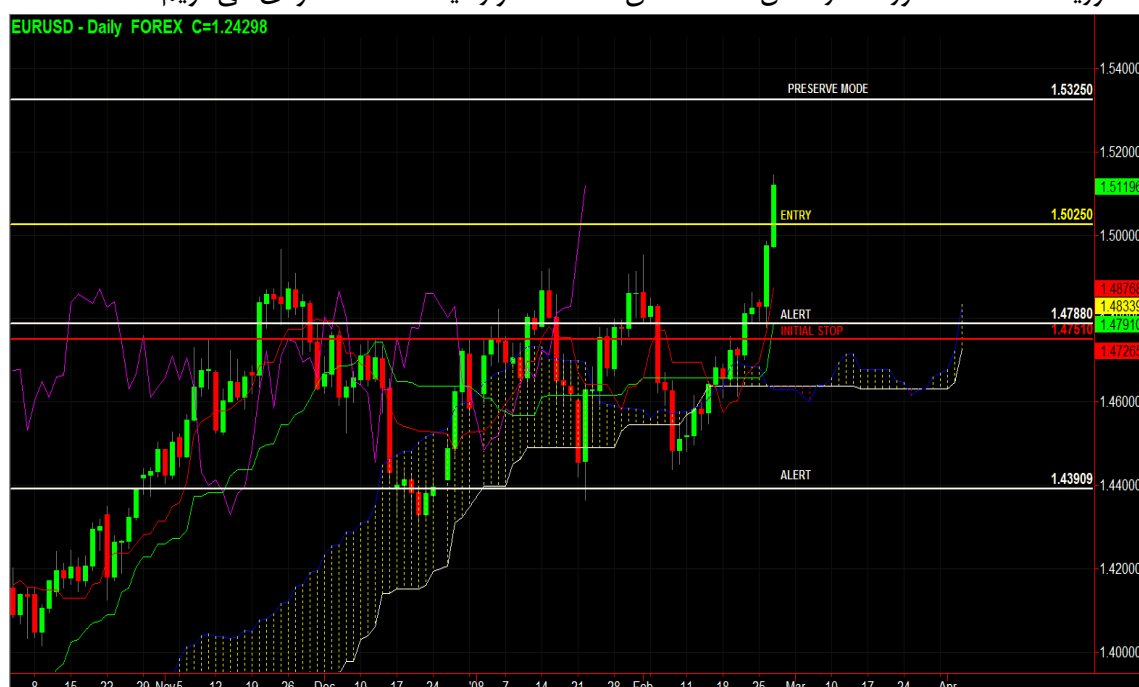
شکل ۸۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۶ فوریه ۲۰۰۸.

اگر به عقب به آخرین احتمال ورود به معامله بازگردید، که به دلیل اینکه قیمت از تنکانسن دور بود به آن وارد نشدیم، ملاحظه خواهید نمود که این امر ما را از ضرر کردن حفظ نموده است. به همین دلیل است که چرا ما این مسئله را در برنامه معاملاتی خودمان جایگذاری نموده ایم. به نمودارهای ۲۶ فوریه ۲۰۰۸ نگاه کنید، می بینید که تنکانسن و قیمت با هم یکسان و یکنواخت شده اند و ما آماده ایم تا روندی را آغاز کنیم. همه اندیکاتورهای ایچیموکو تنظیم شده اند و آماده برای ایجاد روند می باشند. بنابراین تصمیم می گیریم تا نقطه ورود، خطرها، و توقف هایمان را بر روی چارت قرار دهیم. شکل ۳-۸۸ این اطلاعات را نشان می دهد.



شکل ۳-۸۸: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۶ فوریه ۲۰۰۸.

در ۲۷ فوریه ۲۰۰۸، همانطور که در شکل ۳-۸۹ نشان داده شده، وارد یک معامله صعودی می شویم.



شکل ۳-۸۹: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۷ فوریه ۲۰۰۸.

اطلاعات آماری ورود به معامله در جدول ۱۳-۳ نشان داده شده است.
جدول ۱۳-۳: آمار و اطلاعات ورود به معامله EURUSD در ۲۷ فوریه ۲۰۰۸، ترید # ۶

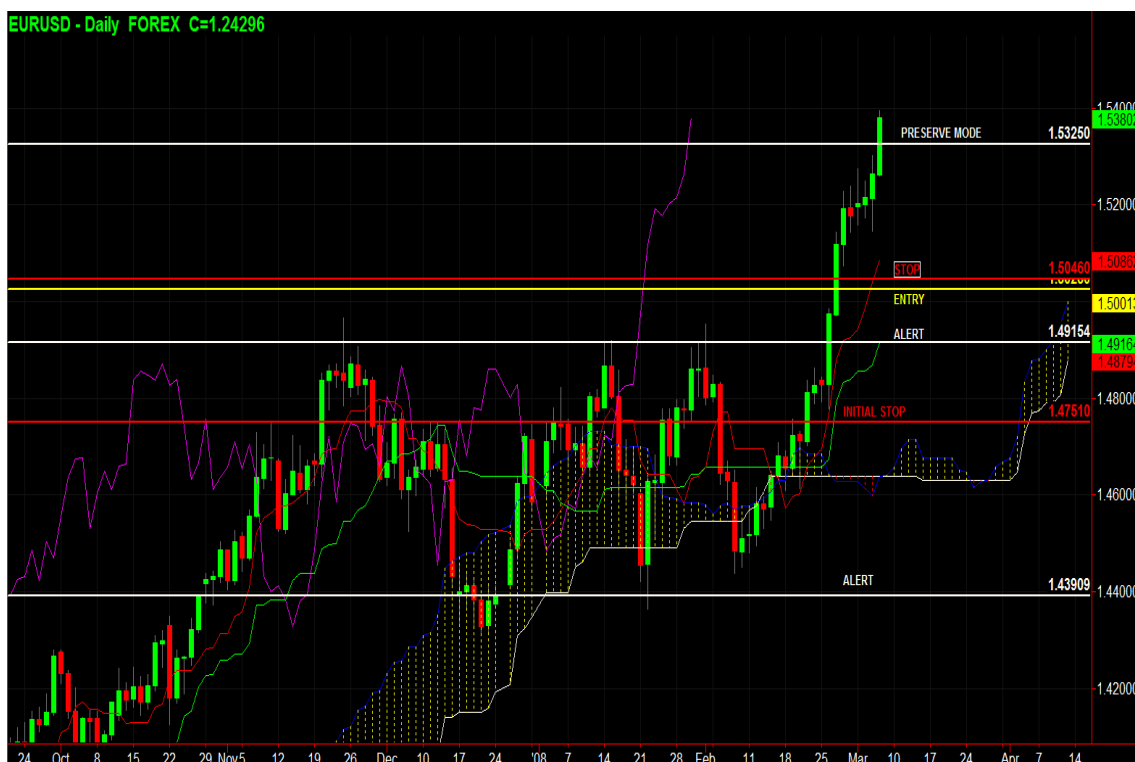
Statistics	Value
Entry Date	Feb 27, 2008
Entry Price	1.5025
Entry Stop	1.4751
Entry Risk	274 pips

توجه کنید که قیمت در ۱.۵۱۱۹ است و تکنانسن در ۱.۴۸۷۶ می باشد. این مقدار بیش از ۲۰۰ پپ دورتر است. بنابراین، باید از معامله برطبق برنامه معاملاتی مان خارج شویم. آمار و داده های مربوط به خروج از معامله در جدول ۱۴-۳ نشان داده شده است.

جدول ۱۴-۳: آمار و اطلاعات معامله EURUSD در ۲۷ فوریه ۲۰۰۸، ترید # ۶

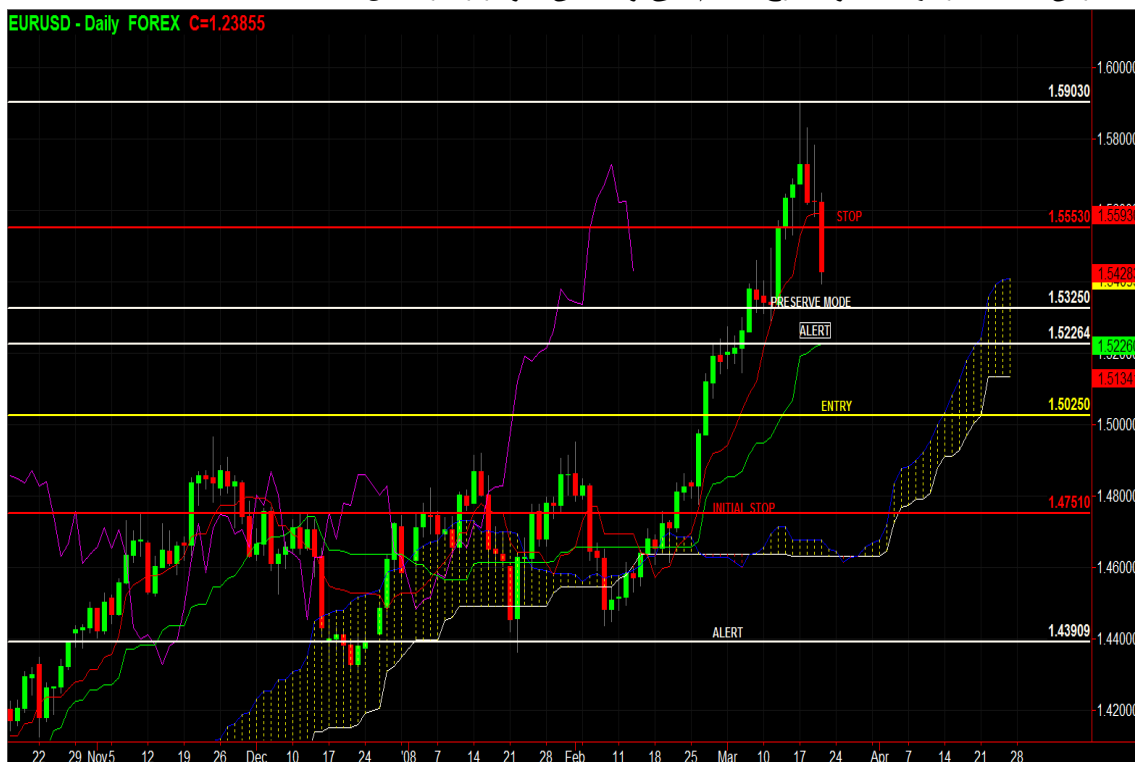
Statistics	Value
Entry Date	Feb 27, 2008
Entry Price	1.5025
Entry Stop	1.4751
Entry Risk	274 pips
Exit Date	Feb 27, 2008
Exit Price	1.5119
Profit	94 pips
Max Profit	118 pips
Risk/Reward	7.29

توضیح: ریسک/ریوارد بالا است درحالی که از ترید در همان روز ورود خارج شدیم. بنابراین، مقدار آن دست بالا گرفته شده است. یک دقیقه صبر کنید، آیا تکنانسن مسطح شده است؟ نه، مسطح نیست، و اینکه قانون ۲۰۰ پپ برای تکنانسن زمانی باید اجرا شود که تکنانسن صاف شده باشد. امیدوار بودم این اشتباه را فهمیده باشید. اگر به این اشتباه پی نبرده باشید، باید کار دیگری کنید تا این امر را بیاموزید زیرا آن کاری که می کنید نتیجه مطلوبی در پی نخواهد داشت. شما بر روی اطلاعات برنامه معاملاتی تمرکز ننموده اید. پیشنهادی که به همه دانشجویانم می کنم این است که از هر دو برنامه معاملاتی «صعودی» و «نزولی» پرینت بگیرند، و آن را لمینیت کنند. زمانی که برنامه معاملاتی لمینیت شد، آن را بالا یا پائین صفحه کامپیوتری که از آن برای ترید کردن استفاده می کنید بیاویزید. به این روش، به طور مداوم همیشه آن را مشاهده می کنید. چون این یک اشتباه بود، می خواهیم با «ترید باز» و عدم خارج شدن از ترید کارمان را ادامه دهیم. در ۶ مارس ۲۰۰۸، وارد «حالت محافظتی» برای معامله صعودی مان شدیم (شکل ۹۰-۳) و اکنون در حالت «معامله آزاد» هستیم.



شکل ۹۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۶ مارس ۲۰۰۸.

توجه داشته باشید که هر زمان وارد «حالت محافظتی» می شویم، این زمان تقریباً برابر با روزی است که وارد یک «روز آزاد» می شویم. این حالت پیش از این نیز به خوبی عمل نموده و کارایی خودش را اثبات کرده است. ممکن است بعدها تغییر نماید اما این بک تست تا کنون برای مدت بیش از ۱ سال و نیم به خوبی عمل نموده است. در ۲۰ مارس ۲۰۰۸، از ترید با سود خارج شدیم. می توانید این نمودار را در شکل ۹۱-۳ مشاهده نمایید.



شکل ۹۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ مارس ۲۰۰۸.

آمار و ارقام مربوط به ترید (جدول ۱۵-۳) به دنبال آن بیان شده است.
جدول ۱۵-۳: آمار و ارقام EURUSD در ۲۰ مارس ۲۰۰۸، ترید واقعی #۶

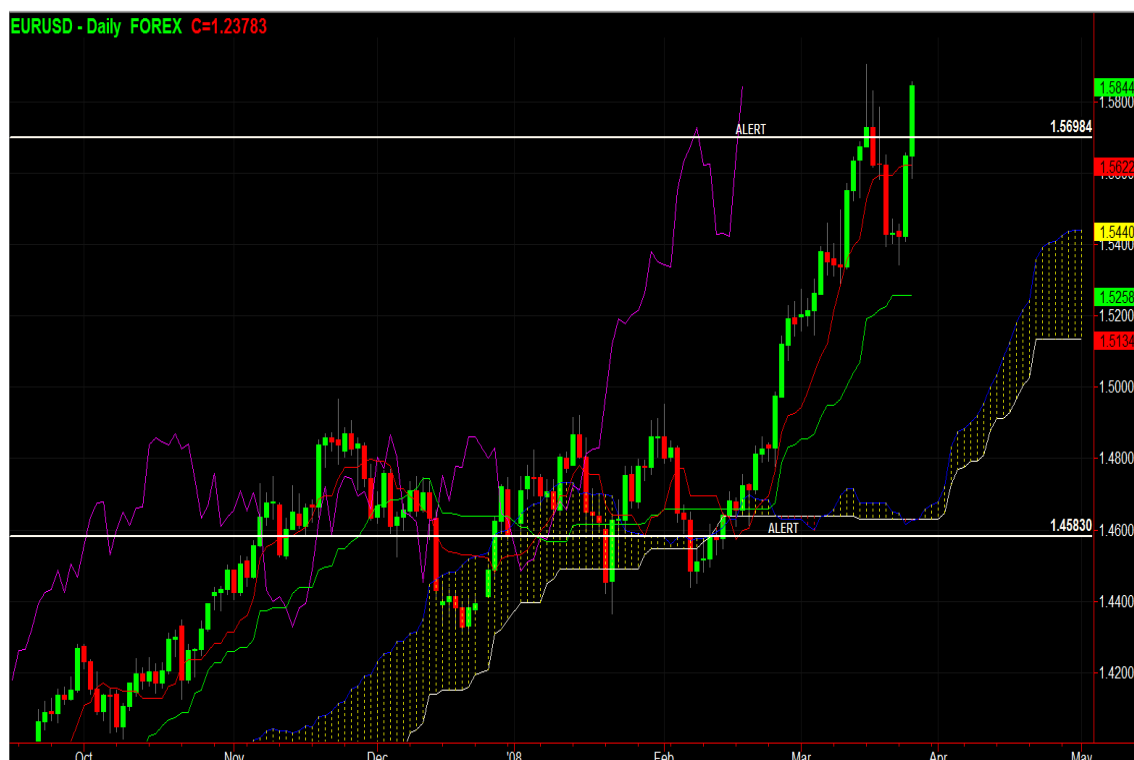
Statistics	Value
Entry Date	Feb 27, 2008
Exit Date	Mar 20, 2008
Entry Price	1.5025
Exit Price	1.5553
Profit	528 pip
Entry Risk	274
Max Profit	878
Max Drawdown	N/A
Risk/Reward	0.52

در این ترید، بیش از ۵۰ درصد حداکثر سود را به دست آوردیم، که واقعاً خوب است. به دست آوردن کل سود کاری مشکل است، به خصوص از زمان شروع روند تا خاتمه یک روند. با استفاده از استراتژی ایچیموکو که در حال حاضر از آن استفاده می‌نماییم، هدف به دست آوردن ۳۰ درصد تا ۴۰ درصد سود یک روند می‌باشد. ما قطعاً نمی‌توانیم آغاز روند را شکار کنیم زیرا چیکواسپن ۲۶ دوره را بکار می‌برد (یعنی، ۲۶ روز). بنابراین، زمانیکه چیکواسپن در «فضای باز» واقع شده باشد، حداقل ۲۶ روز طی شده است، که معمولاً این زمان، زمان آغاز روند می‌باشد. ما نبایستی هرگز در این زمینه ناراحت و مضطرب گردیم زیرا شناسایی آغاز یک روند امری بسیار مشکل است. علاوه بر این، تعویض حالت‌های زیادی در آغاز روند وجود دارد زیرا در ابتدای آغاز روند، روندها عموماً در مرحله تثبیت و ثبات می‌باشند. اکنون می‌خواهیم نمودار را برای هر دو نوع اخطار «صعودی» و «نزولی» تنظیم کنیم. هیچ نقطه ورودی قرار داده نخواهد شد زیرا چیکواسپن نزدیک به قیمت تاریخی خود می‌باشد (شکل ۹۲-۳).



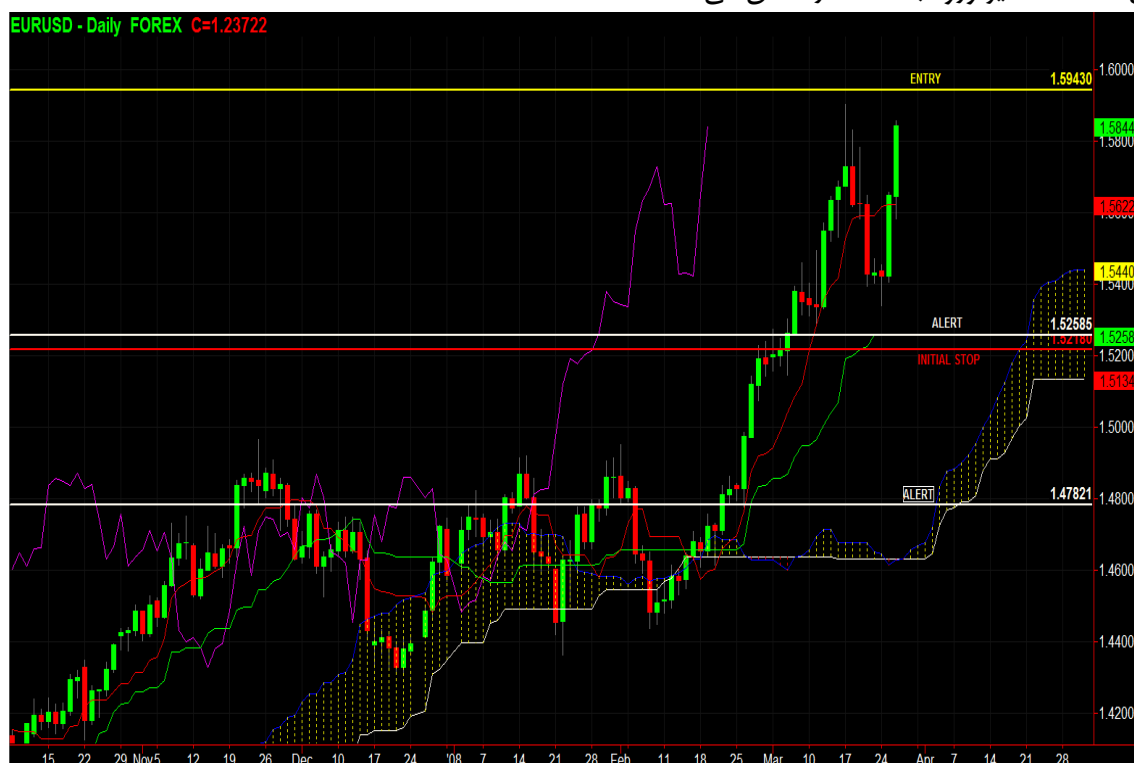
شکل ۹۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ مارس ۲۰۰۸.

در ۲۶ مارس ۲۰۰۸، اخطار صعودی ما همانطور که در شکل ۳-۹۳ نشان داده شده است، راه اندازی گردید. اکنون می‌خواهیم نمودار را برای ورود به معامله صعودی تنظیم کنیم زیرا همه اندیکاتورهای ایچیموکو حالت صعودی را نشان می‌دهند.



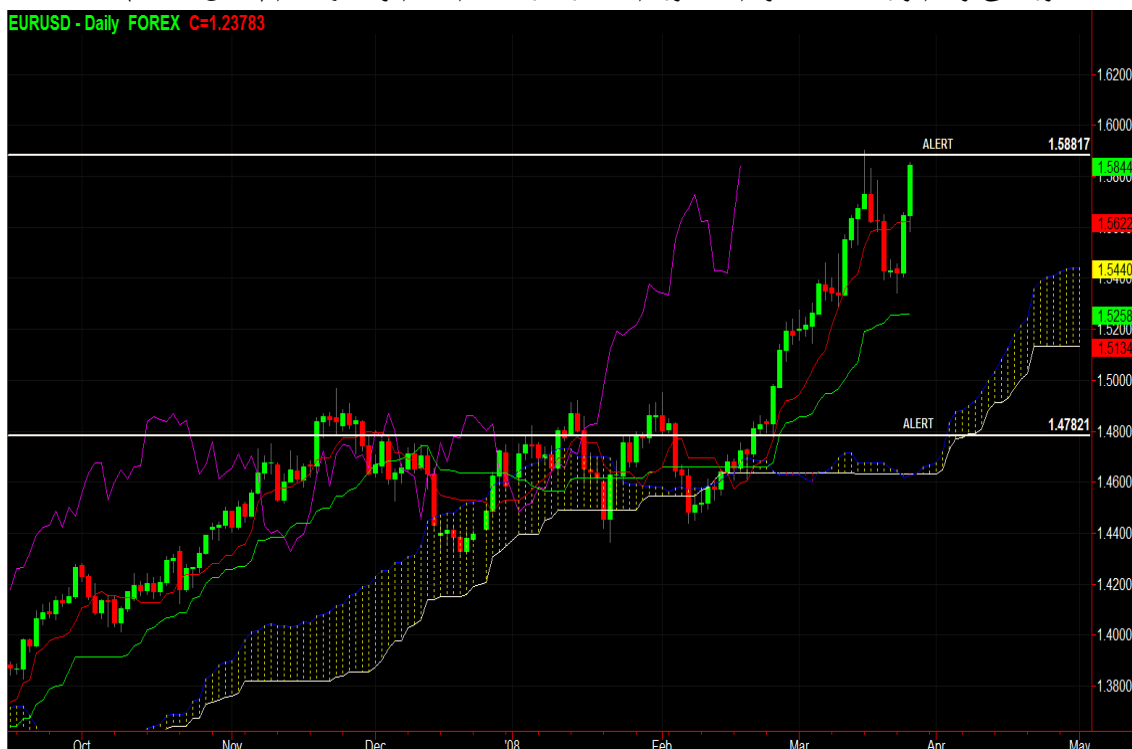
شکل ۳-۹۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۶ مارس ۲۰۰۸.

شکل ۳-۹۴ مقادیر ورود به معامله را نشان می‌دهد.



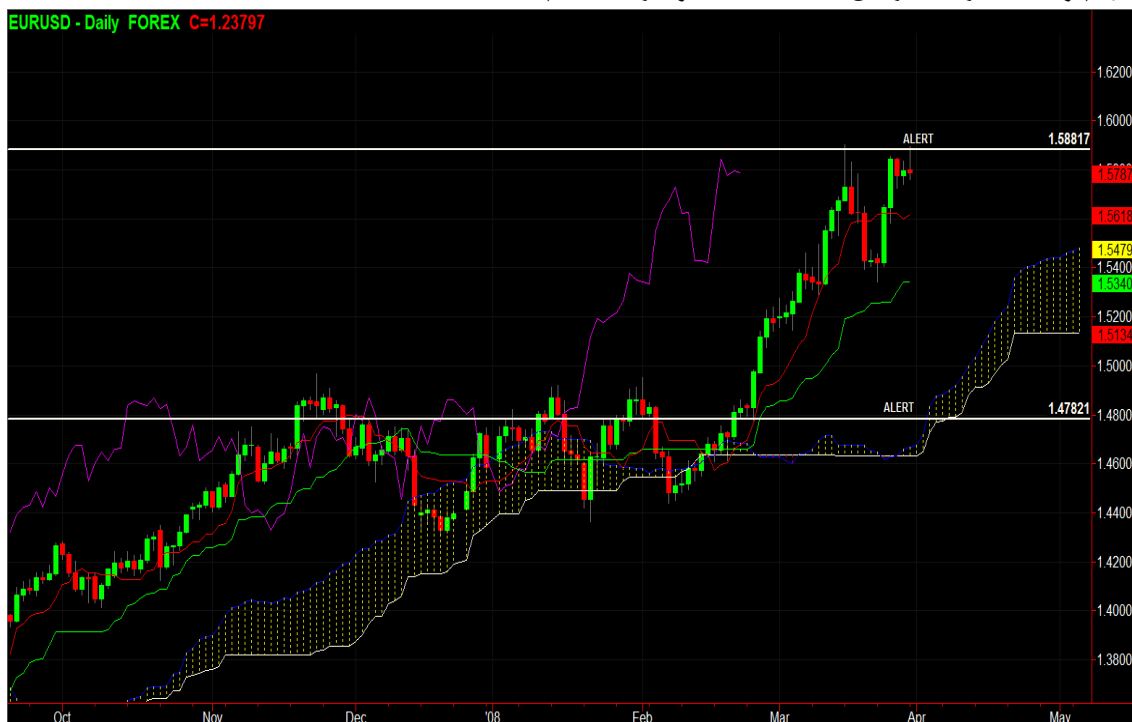
شکل ۳-۹۴: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۶ مارس ۲۰۰۸.

توجه کنید قیمت از تنکانسن و کیجنسن چقدر دور است؛ قیمت خارج از محدوده برنامه معاملاتی ما قرار گرفته است. در نتیجه، هنوز نمی‌توانیم وارد معامله شویم. مجبوریم اخطارها را تنظیم کنیم و صبر کنیم (شکل ۳-۹۵).



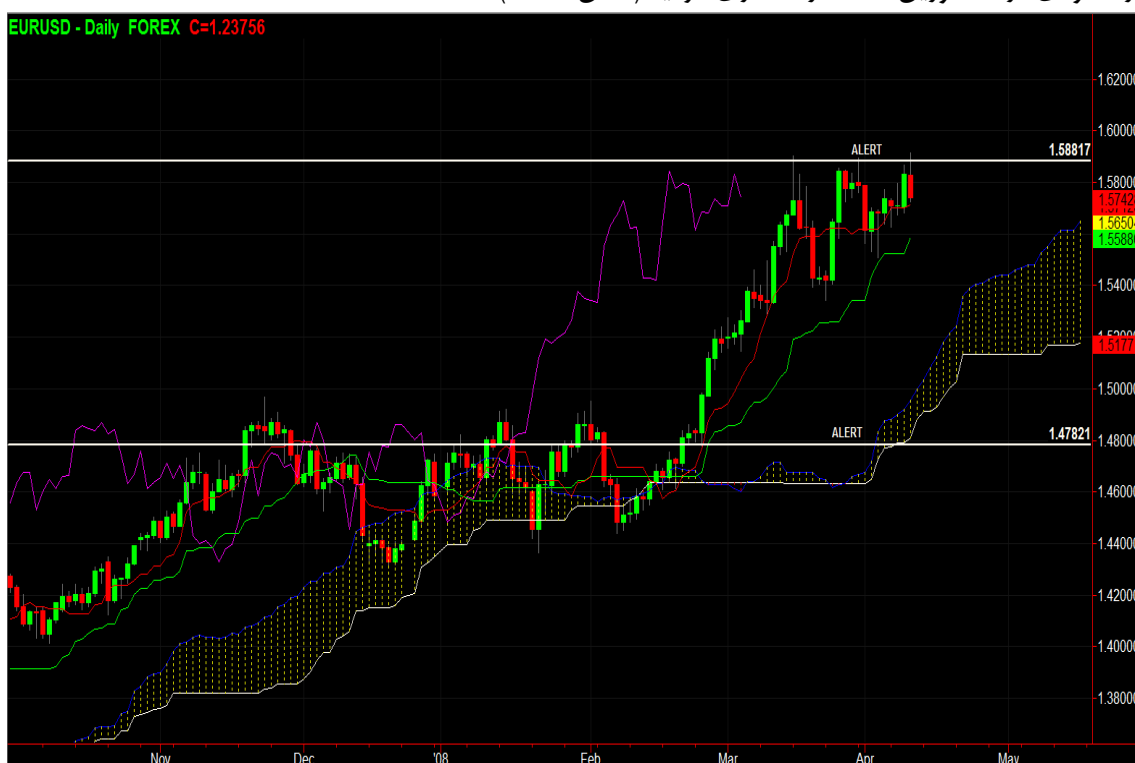
شکل ۳-۹۵: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۶ مارس ۲۰۰۸.

در ۳۱ مارس، اخطار صعودی همانطور که در شکل ۳-۹۶ نشان داده شده، راه‌اندازی شده است. قیمت هنوز از کومو دور است بنابراین مجبوریم اخطارها را بازنشانی کنیم و هنوز منتظر بمانیم. قصد داریم اخطارهایمان را در همان محل نگه داریم و فقط همراه با مراحل بک‌تست به جلو حرکت کنیم.



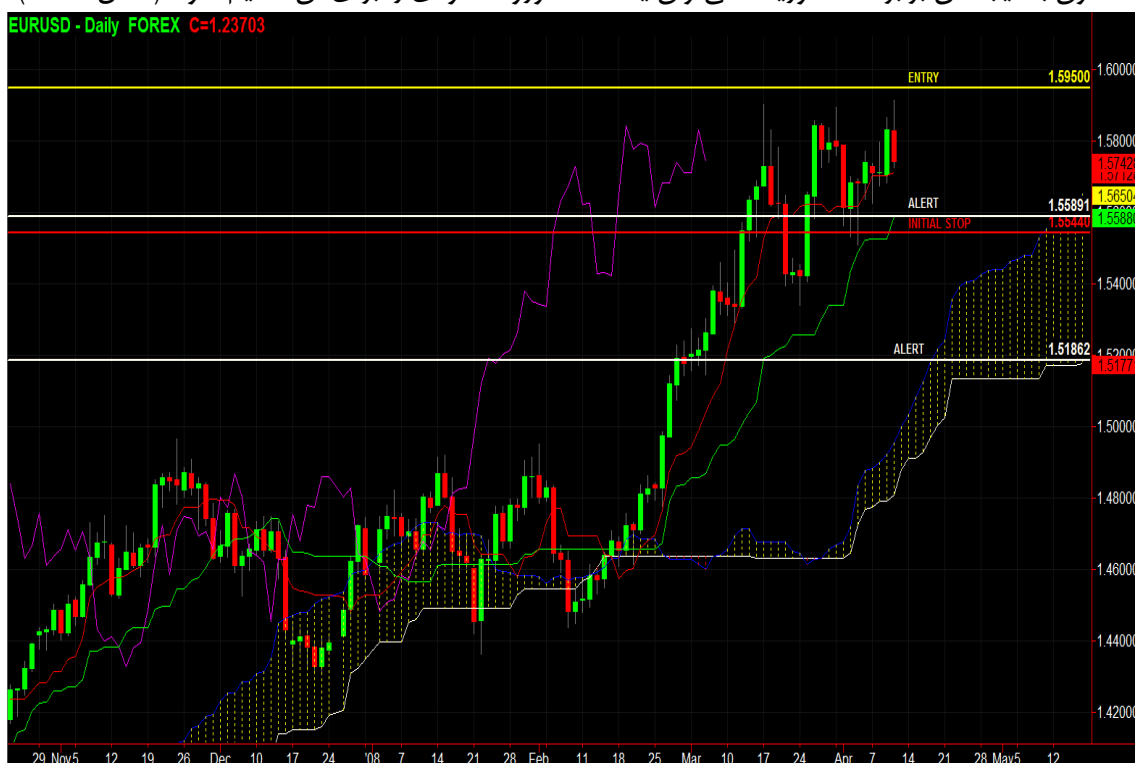
شکل ۳-۹۶: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۱ مارس ۲۰۰۸.

اخطار صعودی در ۱۰ آوریل ۲۰۰۸ راه اندازی گردید (شکل ۳-۹۷).



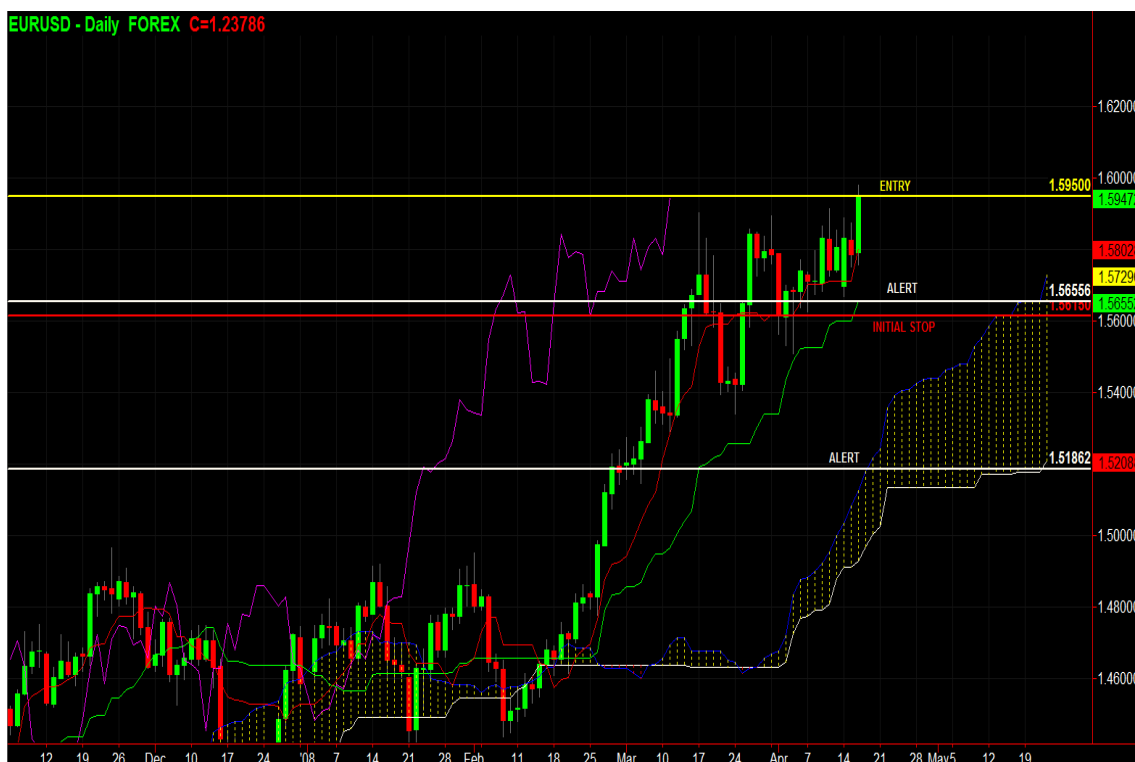
شکل ۳-۹۷: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۱ مارس ۲۰۰۸.

قیمت اکنون با کیجنسن برابر شده طوریکه می توان یک نقطه ورود صعودی را برای آن تنظیم نمود. (شکل ۳-۹۸)



شکل ۳-۹۸: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۰ آوریل ۲۰۰۸.

در ۱۶ آوریل ۲۰۰۸، وارد یک معامله صعودی شدیم و این معامله در شکل ۳-۹۹ شرح داده شده است.

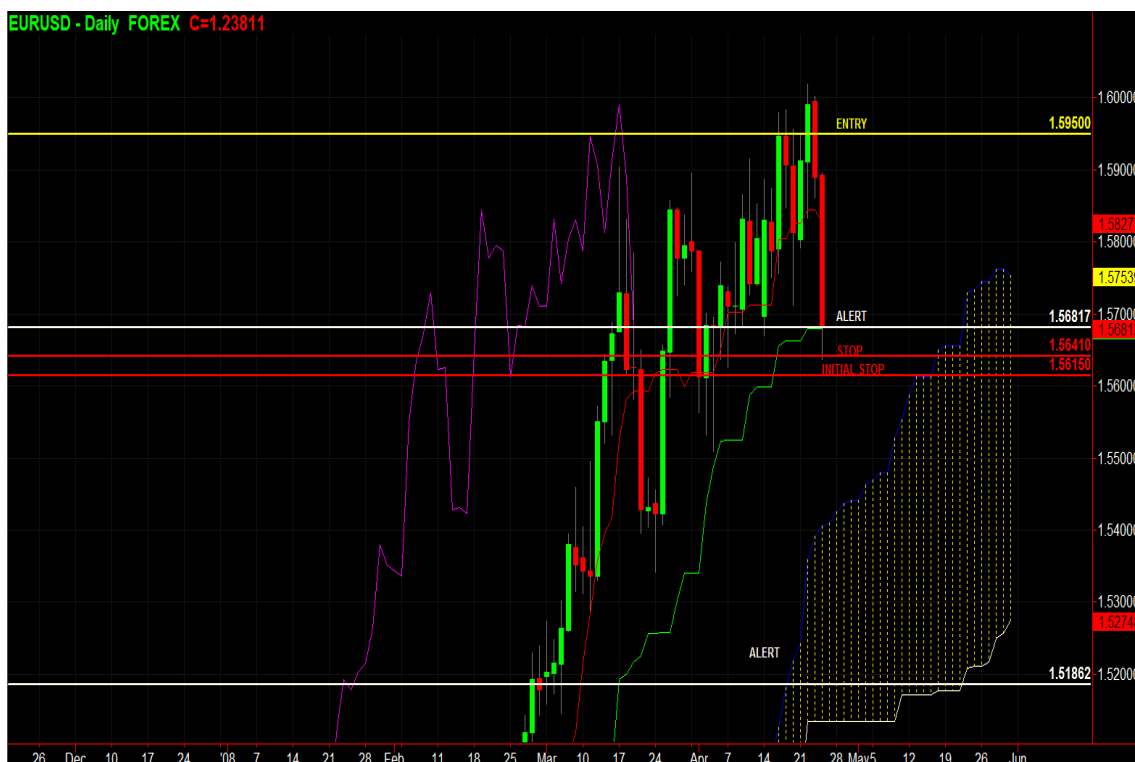


شکل ۹۹-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۶ آوریل ۲۰۰۸.

این دومین معامله صعودی است که در این روند وارد آن شده‌ایم. اگر وارد «مرحله حفاظتی» در ترید قبلی نشده باشیم و به استفاده از کیجنسن به عنوان «توقف» ادامه دهیم، در این زمان هنوز هم داخل ترید خواهیم بود. این یک تغییر بهینه‌سازی شده است که می‌توانید امتحان کنید. اعداد و ارقام ورود به معامله در جدول ۱۶-۳ نشان داده شده است. جدول ۱۶-۳: آمار و ارقام ورود به معامله EURUSD در ۱۶ آوریل ۲۰۰۸، معامله #۷

Statistics	Value
Entry Date	Apr 16, 2008
Entry Price	1.5955
Entry Stop	1.5615
Entry Risk	340 (300 pips from price and Kijun Sen)

در ۲۴ آوریل ۲۰۰۸، به دلیل ضرر کردن در معامله صعودی استاپ خوردیم (شکل ۱۰۰-۳).



شکل ۱۰۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۴ آوریل ۲۰۰۸.

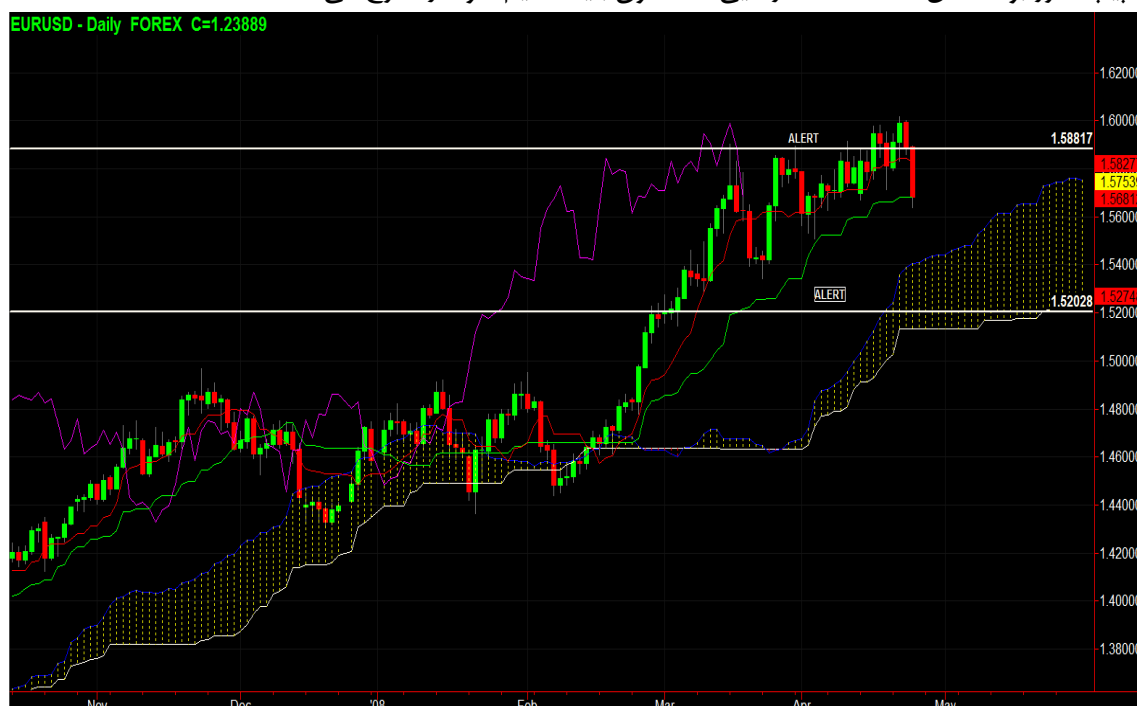
آمار و ارقام مربوط به معامله در جدول ۱۷-۳ نشان داده شده است.

جدول ۱۷-۳: آمار و ارقام معامله EURUSD در ۲۴ آوریل ۲۰۰۸، ترید ۷#

Statistics	Value
Entry Date	Apr 16, 2008
Entry Price	1.5955
Entry Stop	1.5615
Entry Risk	340 (300 pips from price and Kijun Sen)
Exit Date	Apr 24, 2008
Exit Price	1.5955
Profit	-315
Max Profits	63

وای چقدر جالب، این ترید منجر به ۳۱۵ پپ ضرر گردید. چه اتفاقی رخ داده است؟ چطور می‌توانیم بیش از ۳۰۰ پپ ضرر کنیم در حالیکه فرض کردیم دارای «مقدار امن» ۳۰۰ پیپی در برنامه معاملاتی‌مان هستیم؟ در برنامه معاملاتی‌مان، قیمت را نسبت به تکناسن و کیجنسن بدون در نظر گرفتن بافر تعیین نمودیم. بافر برابر با ۴۰ پپ بود. به این دلیل بود که مقدار ضرر ما از ۳۰۰ پپ هم تجاوز نمود. باید در خصوص این ترید فکر کنید و در مورد روش‌های مختلفی که بتوانید این ضرر را حذف نمائید بیاندیشید (یعنی تکنیک‌های بهینه‌ساز). تغییری که می‌توانیم اعمال کنیم این است بگوییم ۳۰۰ پپ ضرر شامل بافر نیز می‌باشد. در صورتیکه ایده‌هایی در این زمینه داشته باشید، باید برنامه معاملاتی‌تان را تغییر دهید و سپس دوباره بک‌تست بگیرید. این مسئله را بعداً در بخش بهینه‌سازی مورد بحث قرار

داده‌ایم. در حال حاضر، این ضرر را خواهیم کرد؛ هرچند، هدف حداقل نمودن ضررها است. این معامله حداقل دارای ۳۰۰ پپ ضرر بود. شکل ۱۰۱-۳ خط‌های که اکنون باید تنظیم شوند را شرح می‌دهد.



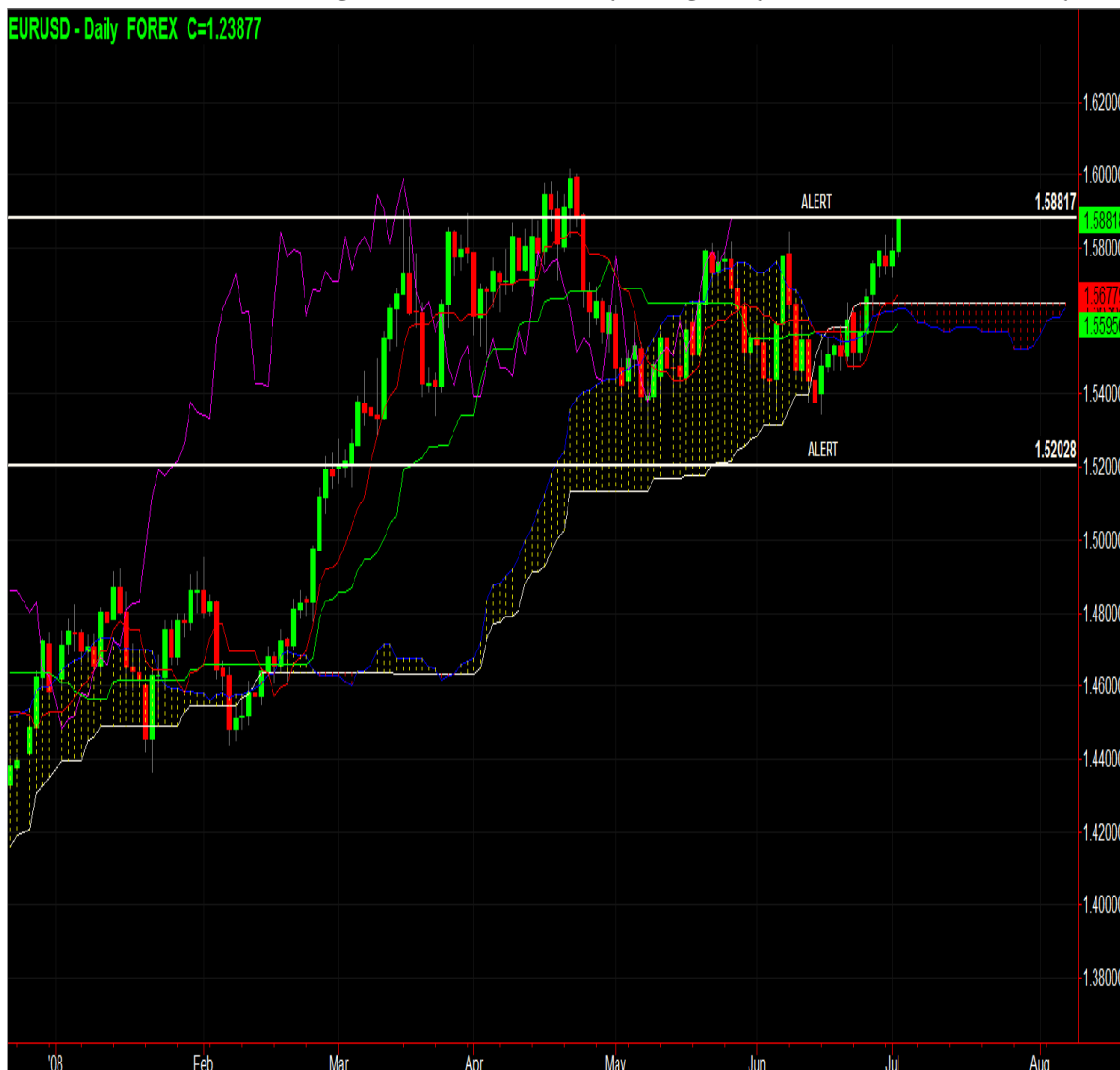
شکل ۱۰۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۴ آوریل ۲۰۰۸.

نمی‌خواهیم وارد یک پوزیشن صعودی دیگر که اکنون تنظیم شده است، شویم. نمی‌خواهیم وارد پوزیشن صعودی دیگری شویم تا زمانی که چندین نوع پولبک ایجاد شود. ما در یک معامله روند ادامه‌دار بدون داشتن پولبک شکست خوردیم، اما نمی‌خواهیم در دو معامله دچار شکست شویم پیش از اینکه پولبکی در این روند رخ دهد. بیش از یک ماه گذشته و هیچ‌یک از خط‌های ما راه‌اندازی نشده‌اند. می‌توانید الگوهای نمودار را در شکل ۱۰۲-۳ ملاحظه نمایید.



شکل ۱۰۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۰ می ۲۰۰۸.

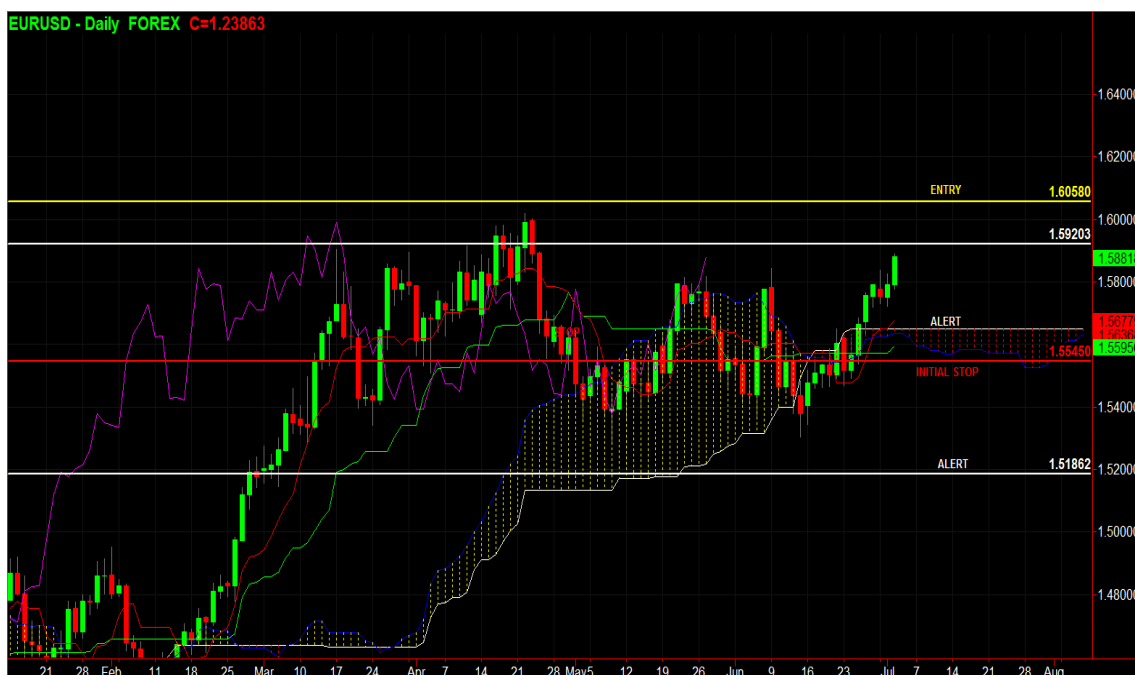
در ۲ جولای ۲۰۰۸، بالاخره اخطار صعودی مان همانطور که در شکل ۳-۱۰۳ نشان داده شده است، راه اندازی گردید.



شکل ۳-۱۰۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۰ می ۲۰۰۸.

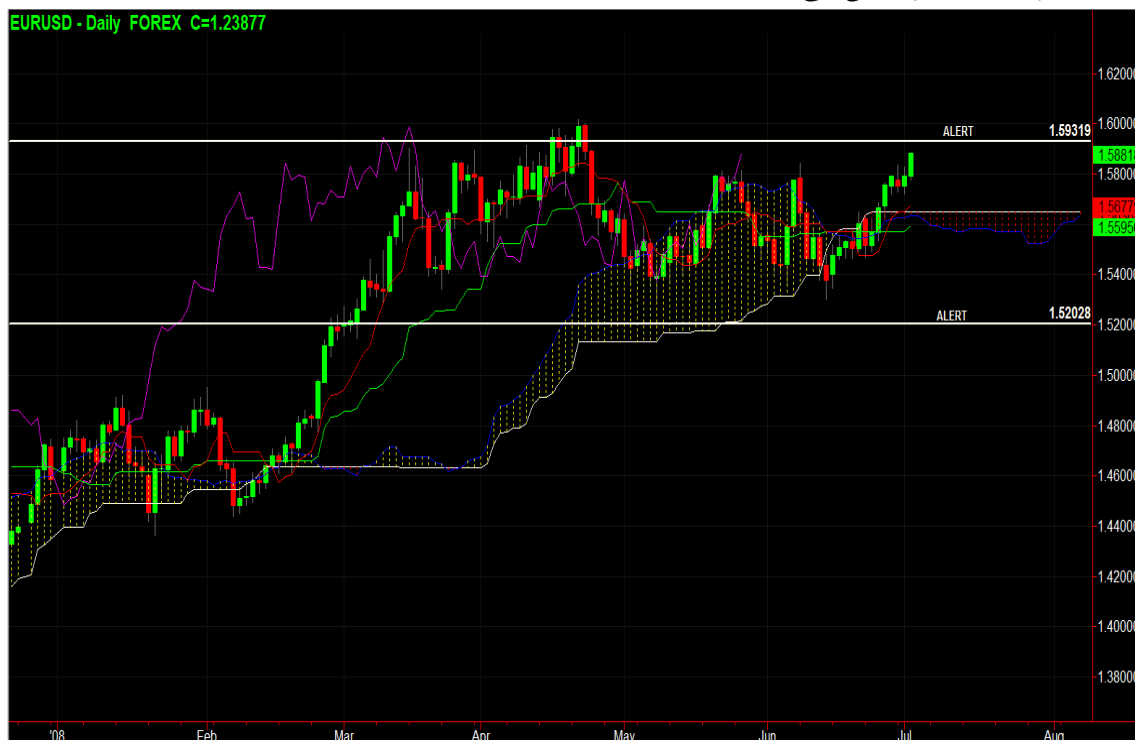
برای چند ماه گذشته، هیچ تردیدی برای EURUSD صورت نگرفته است. بسیاری از افراد متعجب می شوند چطور می توانند معامله واقعی انجام دهند و نتوانند چندین ماه هیچ معامله ای نداشته باشند. به خاطر داشته باشید، ما فقط در حال گرفتن بک تست برای یک جفت ارز خاص هستیم. اگر به آنچه که در گذشته انجام داده بودیم نگاه ببندید، متوجه خواهید شد ما فقط در حال آنالیز یک جفت ارز هستیم. در خلال این آنالیزها، در حال گذاشتن اخطارها/ورود به معامله به صورت صعودی/نزولی بوده ایم. تازمانیکه یک اخطار/ورود راه اندازی شود، هرگز به آن کالا باز نخواهیم گشت. بنابراین، اگر در حال آنالیز و تنظیم اخطارهایی برای هر کالا هستید، باید قادر باشید چندین کالا/جفت ارز را به طور چنگانه معامله نمائید.

در شکل ۳-۱۰۴، می توانید مقادیر مربوط به ورود به معامله را مشاهده نمائید.



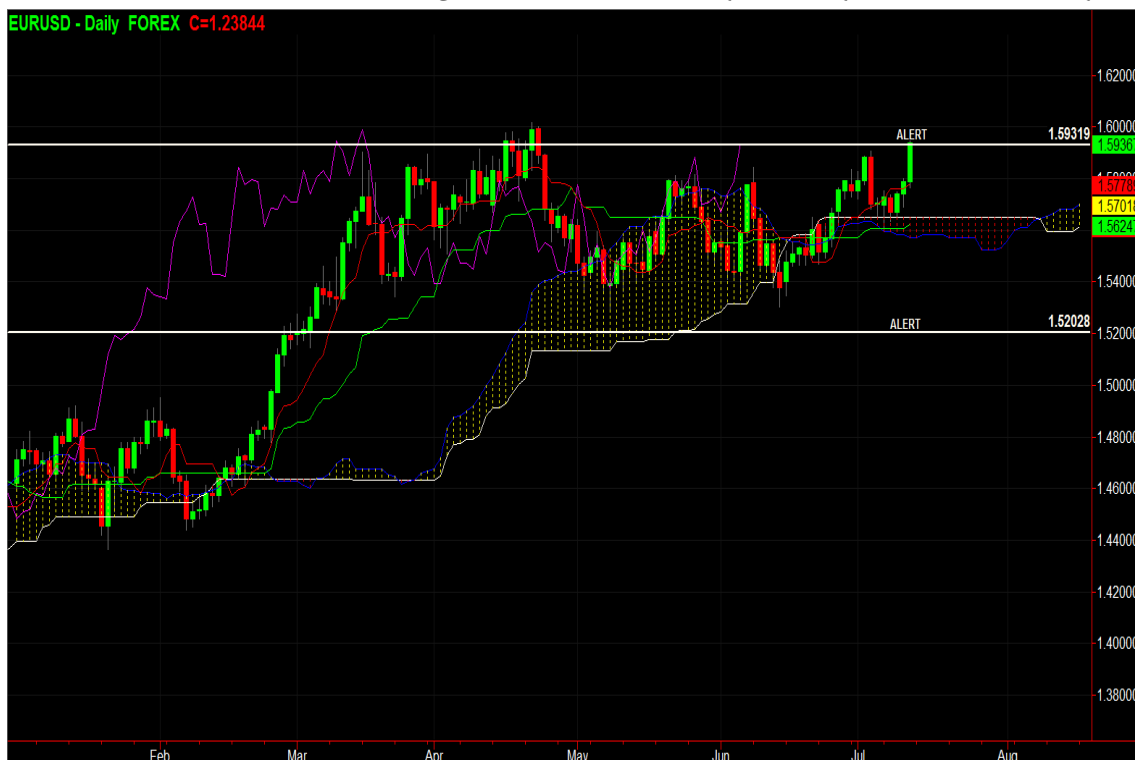
شکل ۱۰۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ جولای ۲۰۰۸.

توجه کنید قیمت برای ورود به معامله از کیجنسن بسیار دور شده است. بنابراین، هنوز نمی‌توانیم وارد شویم. ممکن است برخی اظهار کنند چرا ورود به معامله را آنقدر دور انتخاب کرده‌ای؟ نقطه ورود بافر بالای آخرین قله بود. واقعاً هر مقداری در زیر آخرین قله با برنامه معاملاتی‌مان متناسب نیست. اگر اخطار برای چند روز پیش از ۲ جولای ۲۰۰۸ راه‌اندازی شود، احتمالاً می‌توانیم یک نقطه ورود را انتخاب نمائیم که این نقطه در ۲ جولای ۲۰۰۸ راه‌اندازی خواهد گردید. این کار را به خودتان واگذار کردم تا این تمرین را انجام دهید و ببینید چه اتفاقی ممکن بود رخ دهد. شکل ۱۰۵-۳ اخطارهای جدید را نشان می‌دهد.



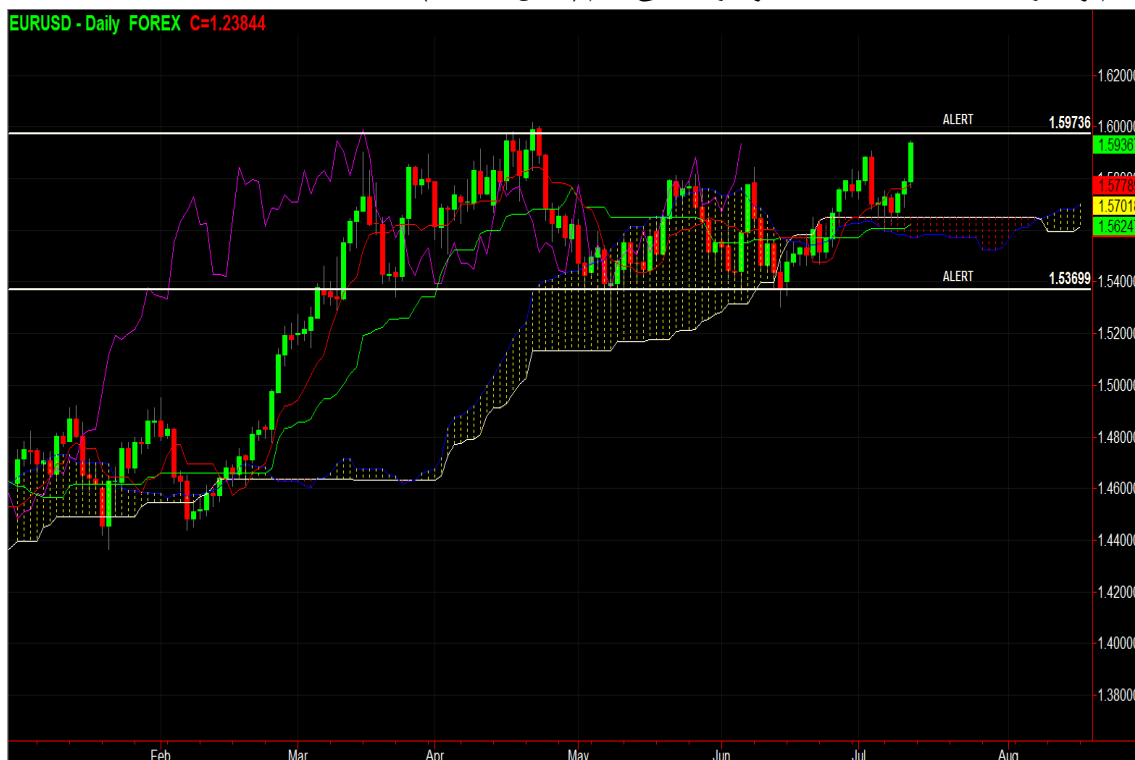
شکل ۱۰۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲ جولای ۲۰۰۸.

در ۱۱ جولای ۲۰۰۸، اختار صعودی همانطور که در شکل ۱۰۶-۳ نشان داده شده، راهاندازی گردید.



شکل ۱۰۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ جولای ۲۰۰۸

کلیه اندیکاتورهای ایچیموکو برای یک روند صعودی در وضعیت مطلوبی قرار دارند. هرچند، قیمت ورود هنوز هم از کیجنسن خیلی دور است. بنابراین، هنوز به معامله وارد نمی‌شویم و صبر می‌کنیم. کلیه اختارهایمان را بازنشانی می‌کنیم و همراه با بک‌تست به سمت جلو حرکت می‌کنیم (شکل ۱۰۷-۳).



شکل ۱۰۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ جولای ۲۰۰۸

در ۱۵ جولای ۲۰۰۸، اختار صعودی همانطور که در شکل ۳-۱۰۸ نشان داده شده، راه اندازی گردید.



شکل ۳-۱۰۸: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۵ جولای ۲۰۰۸.

در حال حاضر، کیجنسن برابر با ۱.۵۶۷۰ است و نقطه ورود احتمالی برابر با ۱.۶۰۷۸ است. این مقدار برای ورود به معامله بیش از ۳۰۰ پیپ است. بنابراین، همه آن چیزی که نیاز داریم انجام دهیم این است که اختارهایمان را بازنشانی کنیم و با بک تست به سمت جلو حرکت کنیم (شکل ۳-۱۰۹).



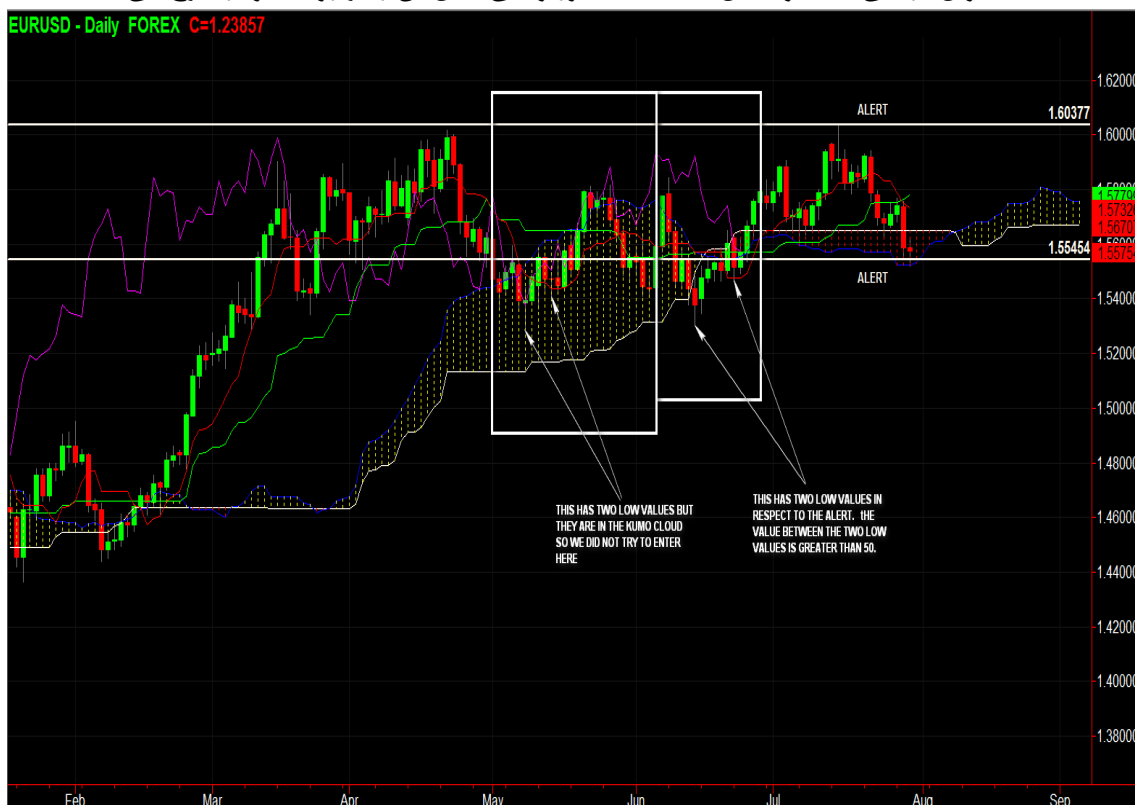
شکل ۳-۱۰۹: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۵ جولای ۲۰۰۸.

در ۳۰ جولای ۲۰۰۸، اخطار نزولی راه اندازی گردید (شکل ۱۱۰-۳).



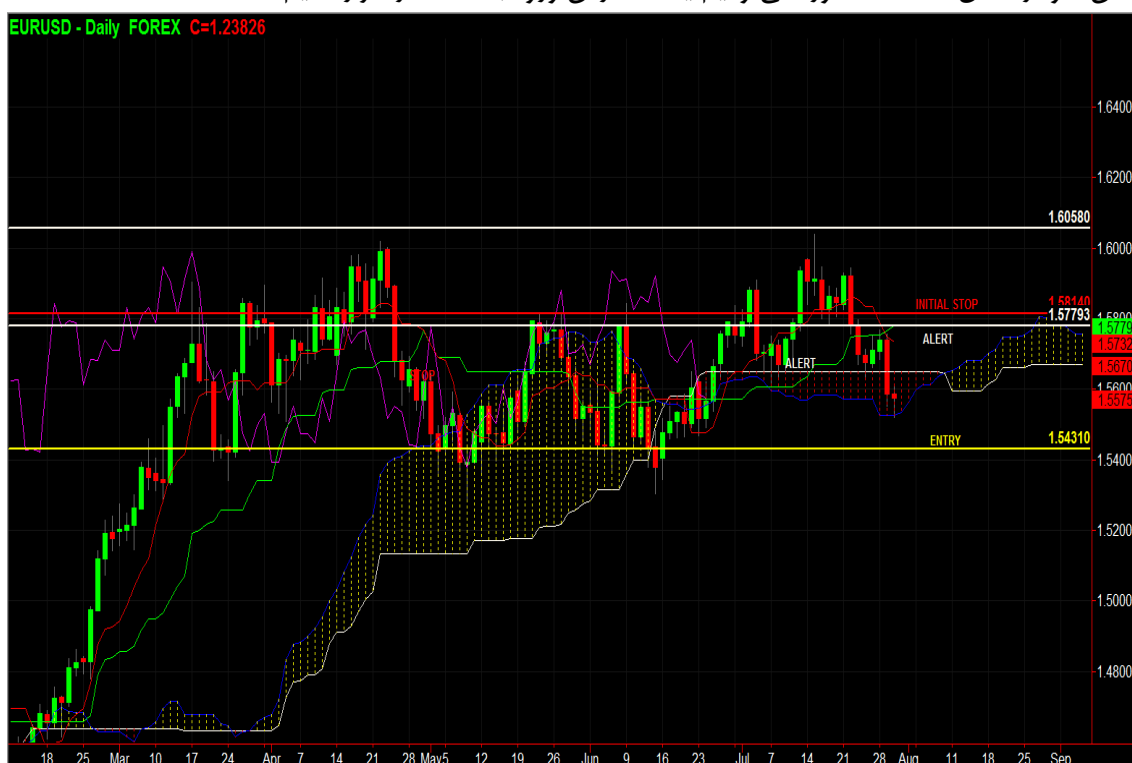
شکل ۱۱۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۰ جولای ۲۰۰۸.

برخی افراد ممکن است متعجب شوند چرا در اینجا اخطار نزولی را انتخاب نمودیم. چرا این اخطار در منطقه پائین تری قرار نداشته باشد؟ سوال درستی است و شکل ۱۱۱-۳ به طور واقعی دلیل آن را بر روی نمودار شرح می دهد.



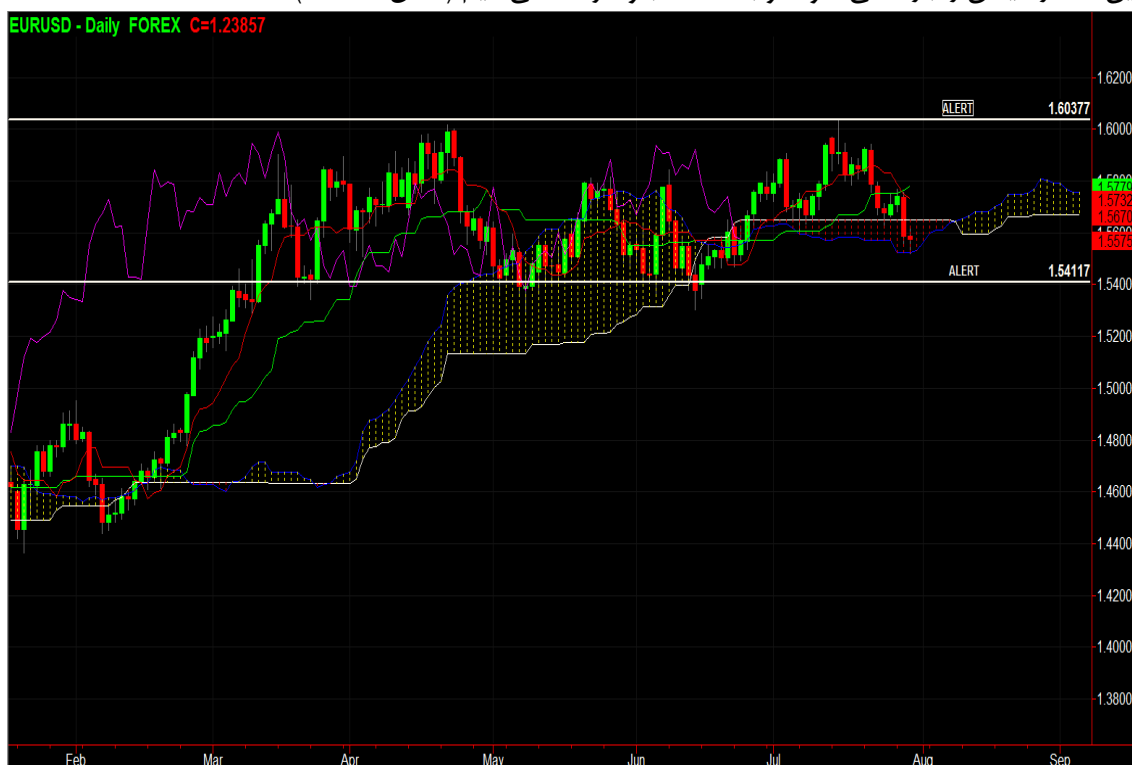
شکل ۱۱۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۰ جولای ۲۰۰۸.

بر اساس نمودار شکل ۱۱۲-۳، هنوز نمی‌توانیم یک سفارش ورود به معامله را قرار دهیم.



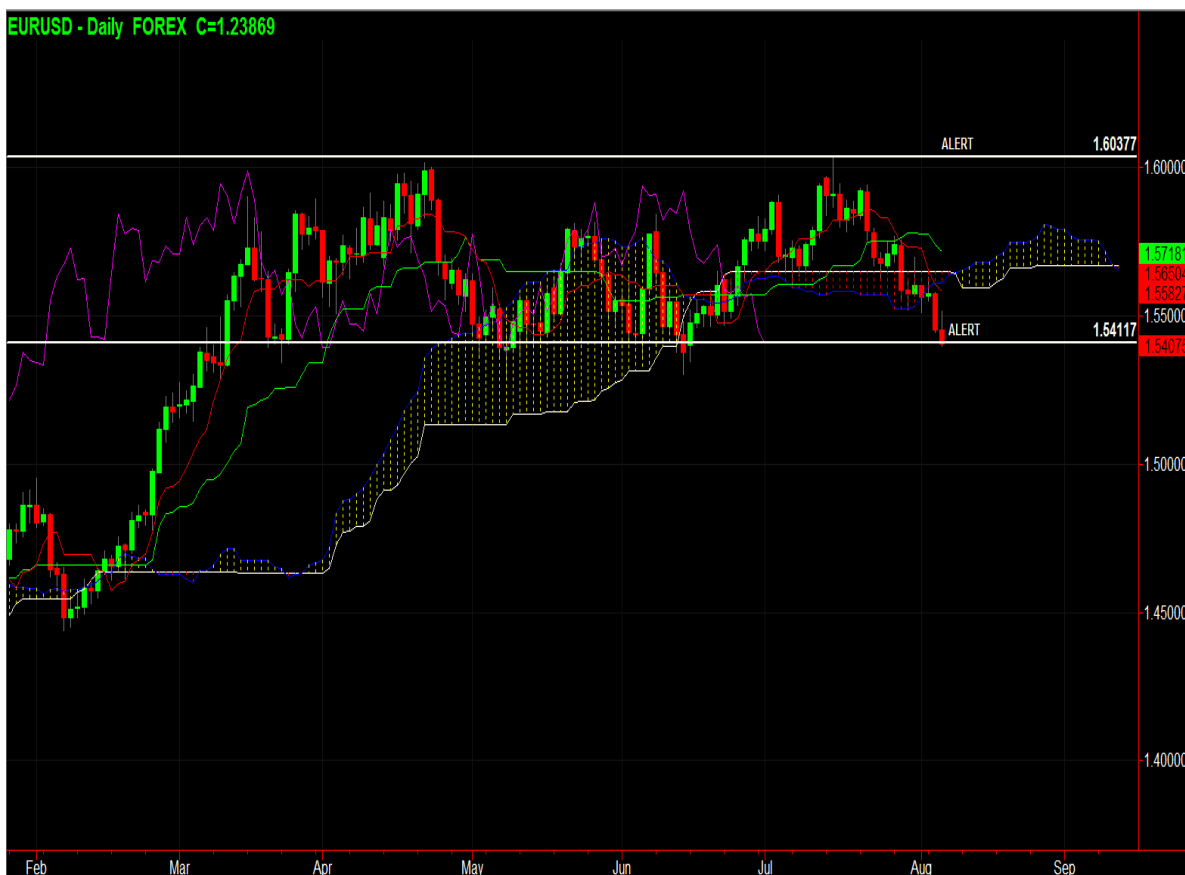
شکل ۱۱۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۰ جولای ۲۰۰۸.

دلیل این است که قیمت ۳۴۰ پیپ از کیجنسن فاصله دارد، که این مقدار خارج از محدوده برنامه معاملاتی مان می‌باشد. بنابراین اخطارهایمان را بازنشانی نموده و به سمت جلو حرکت می‌کنیم (شکل ۱۱۳-۳)



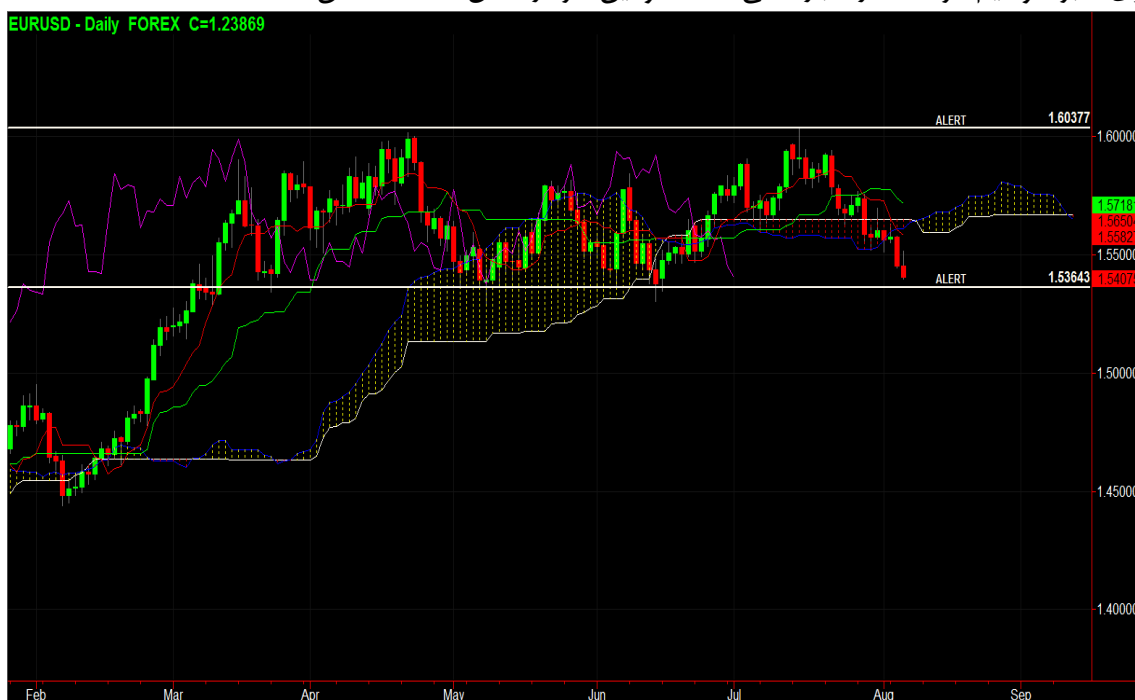
شکل ۱۱۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۰ جولای ۲۰۰۸.

در ۶ آگوست ۲۰۰۸، اخطار نزولی راه‌اندازی شد (شکل ۱۱۴-۳).



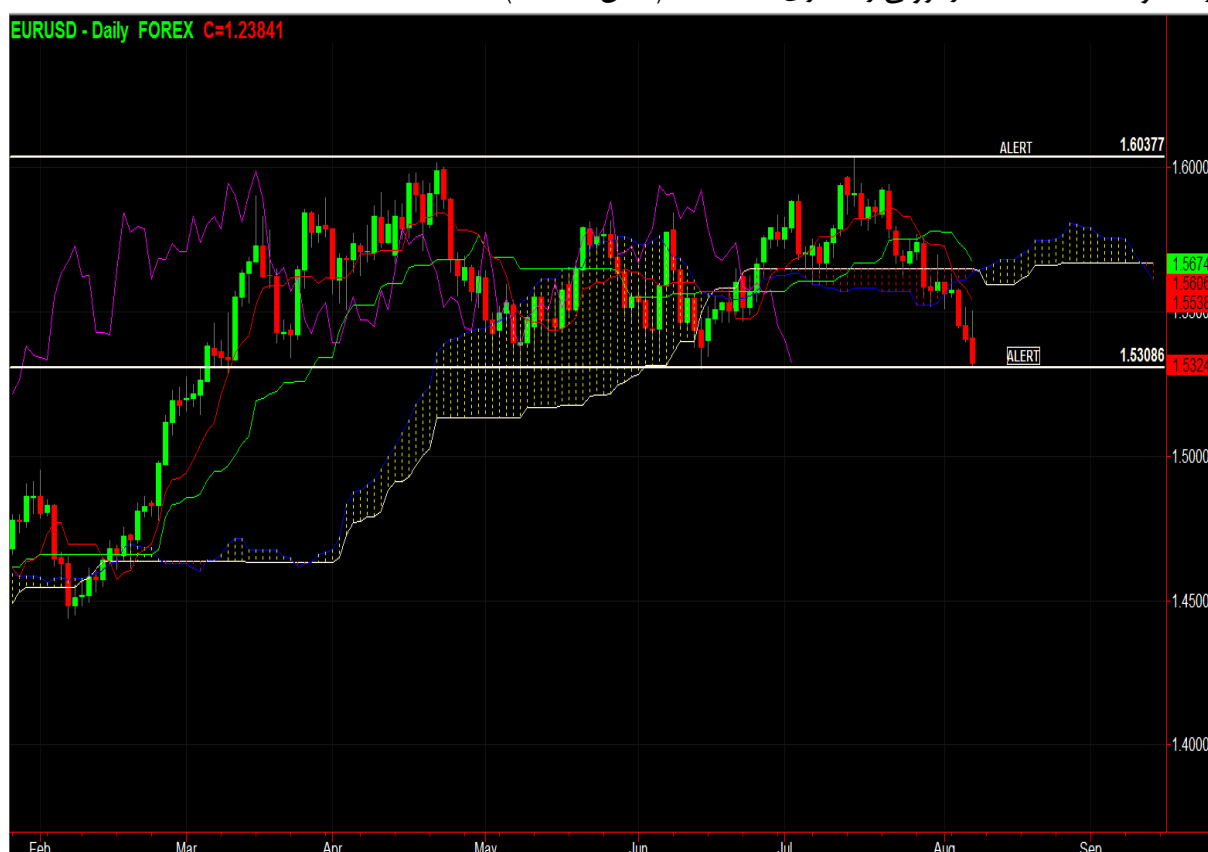
شکل ۱۱۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۶ آگوست ۲۰۰۸.

اندیکاتورهای ایچیموکو نوید معامله نزولی خوبی را می‌دادند. فاصله قیمت نسبت به کیجنسن، که مهم‌ترین مشکل در این زمان می‌باشد، دوباره به یک مشکل مبدل شده است. نیاز داریم این فاصله بیشتر تعدیل شود، بنابراین مقدار دیگری صبر خواهیم کرد. خطارها بازنشانی شده‌اند و این امر در شکل ۱۱۵-۳ نشان داده شده است.



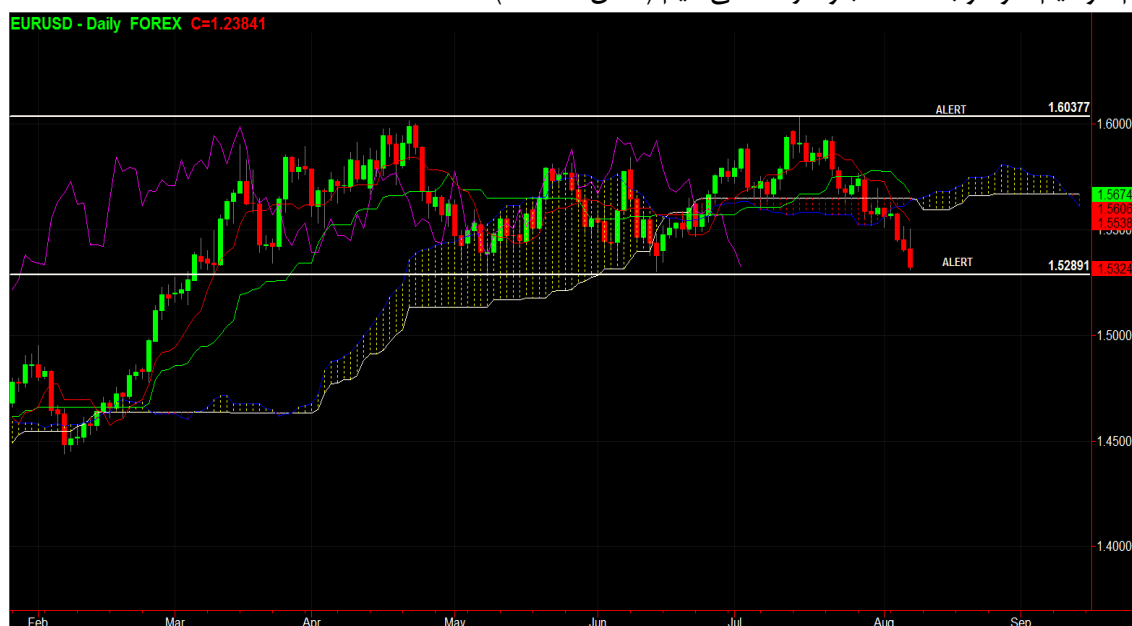
شکل ۱۱۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۶ آگوست ۲۰۰۸.

در ۷ آگوست ۲۰۰۸، خطر نزولی راه اندازی شده است (شکل ۱۱۶-۳).



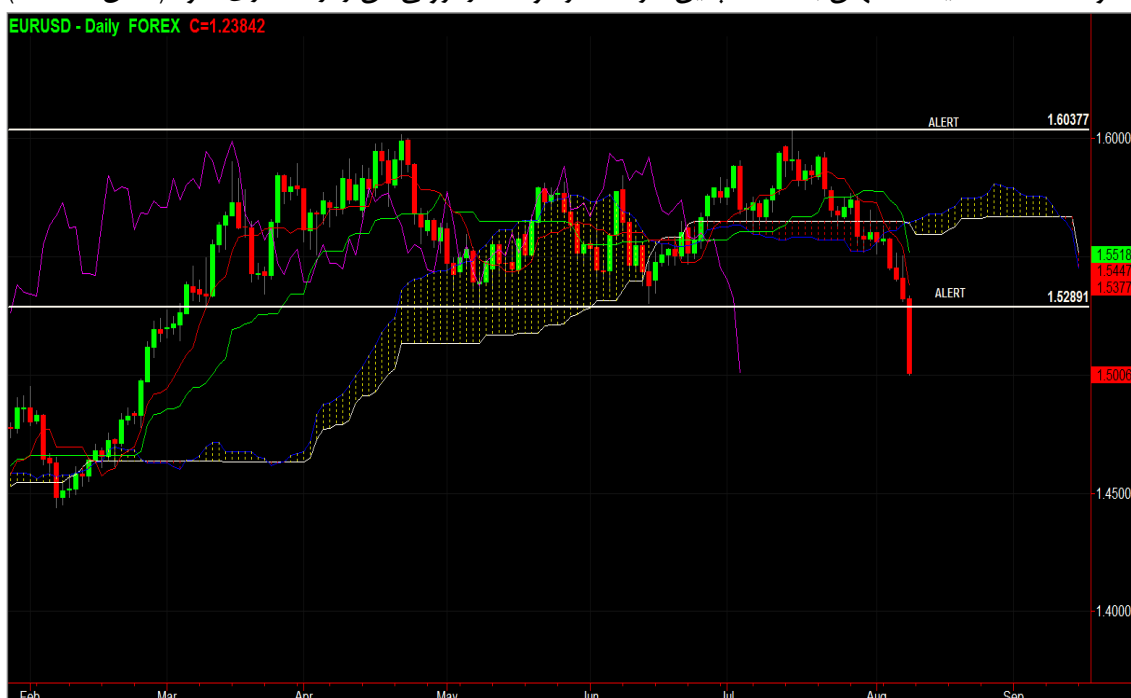
شکل ۱۱۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۷ آگوست ۲۰۰۸.

در زمان بررسی اندیکاتورهای ایچیموکو، برای ورود به یک معامله نزولی تنظیماتمان را انجام داده بودیم. هرچند، قیمت هنوز بیش از ۳۰۰ پیپ از کیجنسن دورتر است بنابراین نمی‌توانیم وارد معامله شویم. توجه کنید کیجنسن همراه با تنکانسن به سمت نزولی نشانه رفته‌اند حتی با وجود فاصله زیادی که بین قیمت و کیجنسن وجود دارد. خطر را تنظیم خواهیم نمود و به سمت جلو حرکت می‌کنیم (شکل ۱۱۷-۳).



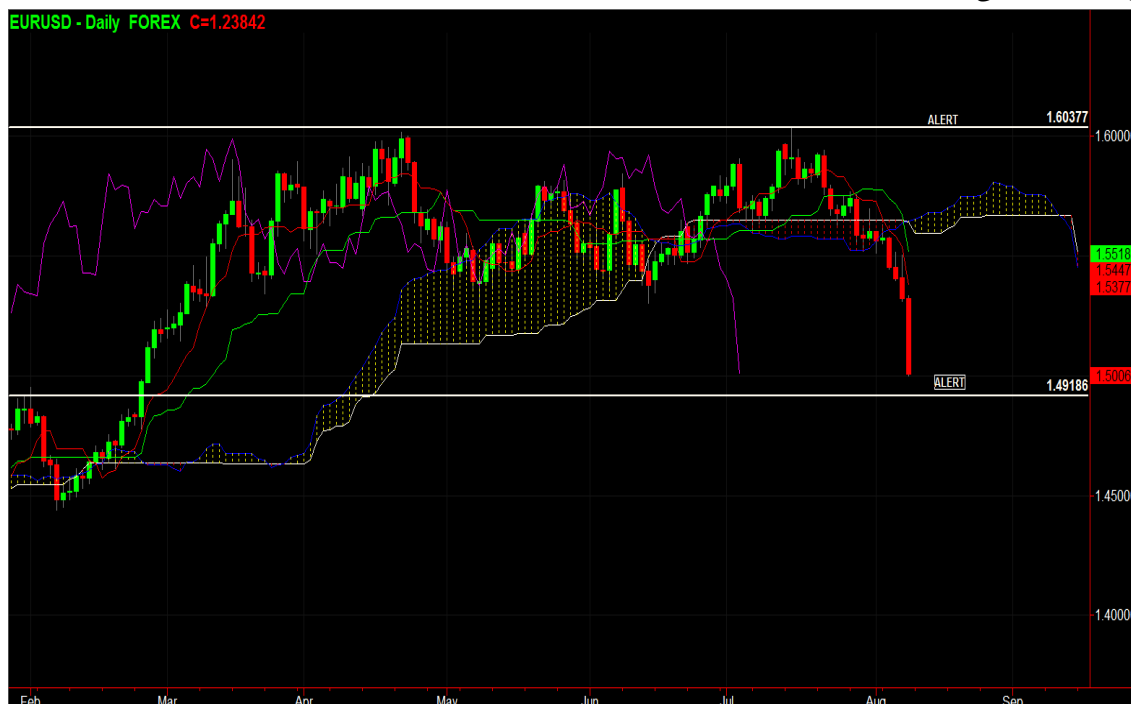
شکل ۱۱۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۷ آگوست ۲۰۰۸.

در ۹ آگوست ۲۰۰۸، قیمت ناگهان به سمت پائین حرکت کرد و اخطار نزولی مان را راه اندازی نمود (شکل ۱۱۸-۳).



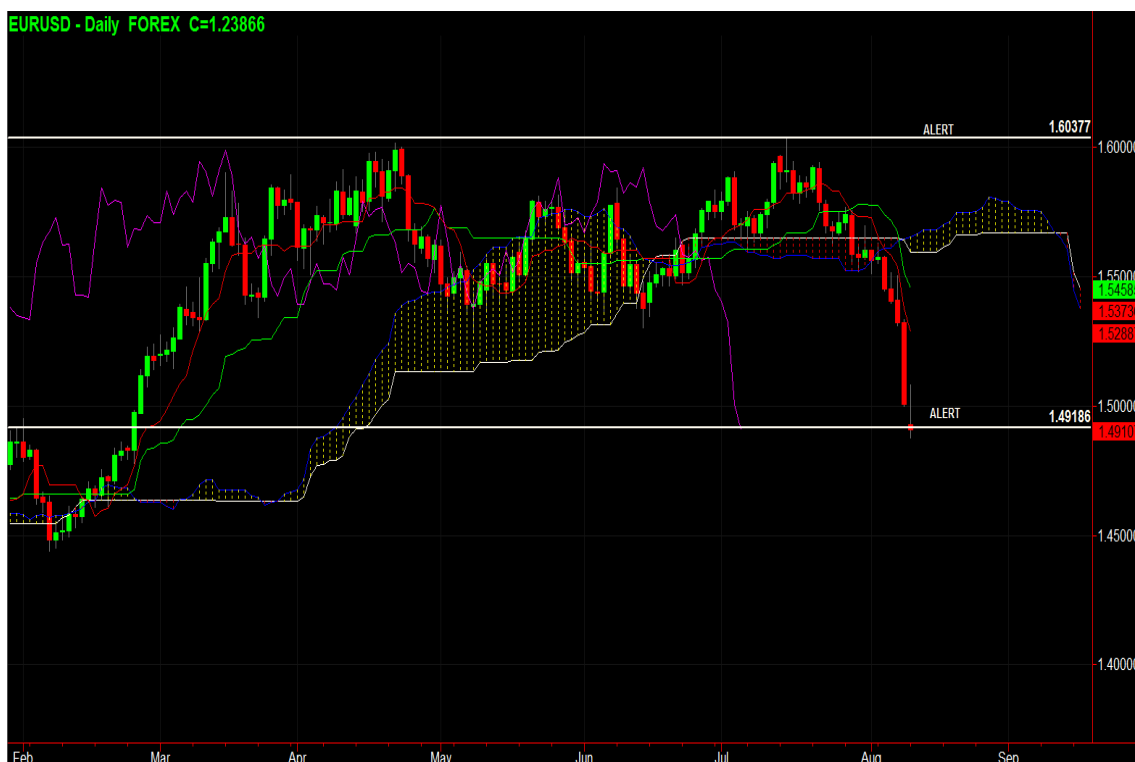
شکل ۱۱۸-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۸ آگوست ۲۰۰۸.

قادر به ورود به معامله نبودیم زیرا قیمت از کیجنسن فاصله داشت و اکنون این فاصله بیشتر شده است. شاید زمانیکه کیجنسن و تنکانسن در یک جهت به سمت روند خاصی در حال حرکت هستند، می‌بایست محدوده فاصله را بیشتر کنیم. می‌توانیم این نکته را به عنوان بهینه‌سازی در نظر بگیریم و بعداً آن را امتحان نمائیم. در حال حاضر، یک برنامه معاملاتی فعال داریم و به حرکت در همان مسیر نیاز داریم. بنابراین، اخطارها را بازنشانی خواهیم کرد و این اخطارها در شکل ۱۱۹-۳ نشان داده شده است.



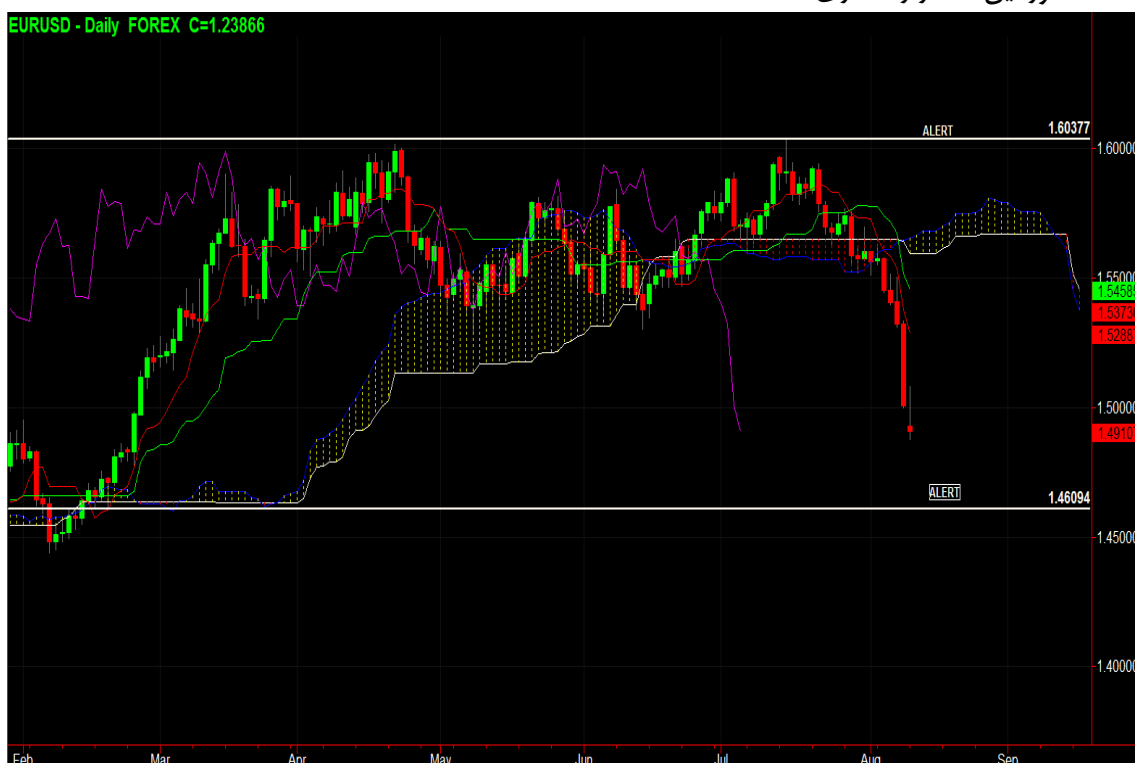
شکل ۱۱۹-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۸ آگوست ۲۰۰۸.

شکل ۱۲۰-۳ نشان می‌دهد اخطار در ۱۱ آگوست ۲۰۰۸ راه اندازی شده است و شرح می‌دهد حرکت بزرگی را از دست داده‌ایم.



شکل ۱۲۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ آگوست ۲۰۰۸.

در نتیجه، قصد داریم به طور ناگهانی به سمت یک اختار نزولی حرکت کنیم و همانطور که در شکل ۱۲۱-۳ نشان داده شده، هنوز این اختار راه اندازی نشده است.



شکل ۱۲۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ آگوست ۲۰۰۸.

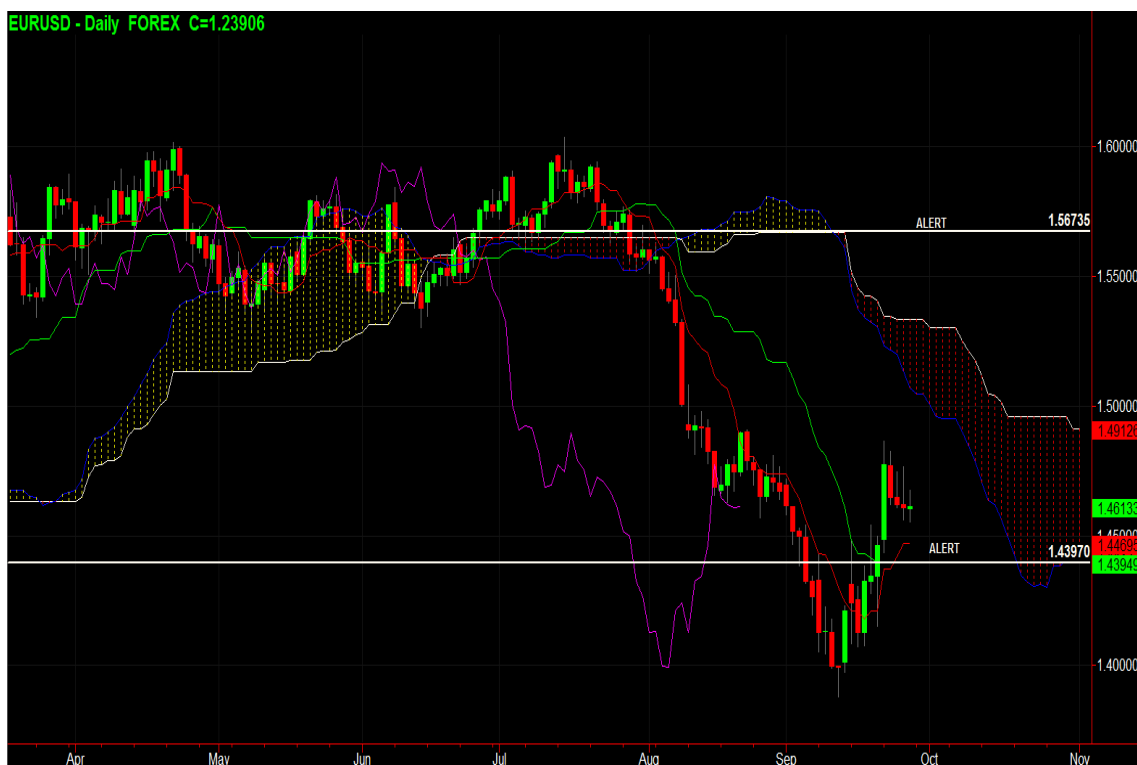
ورود به معامله ای که پیش از این به طور ناگهانی حرکت نموده است، کاری خطرناک است. می توانید وارد یک معامله رونددار در یک پولبک مهم شوید که این کاری است که می خواهیم انجام دهیم.

شکل ۱۲۲-۳ نمودار ایچیموکو در تاریخ ۱ سپتامبر ۲۰۰۸ را نشان می‌دهد. نمودار اکنون نشان می‌دهد یک پولبک احتمالی ممکن است به زودی رخ دهد. نمی‌دانیم آیا این یک پولبک خفیف (مینور) است و یا یک پولبک اصلی (ماژور). فقط زمان به ما در این زمینه پاسخ خواهد داد.



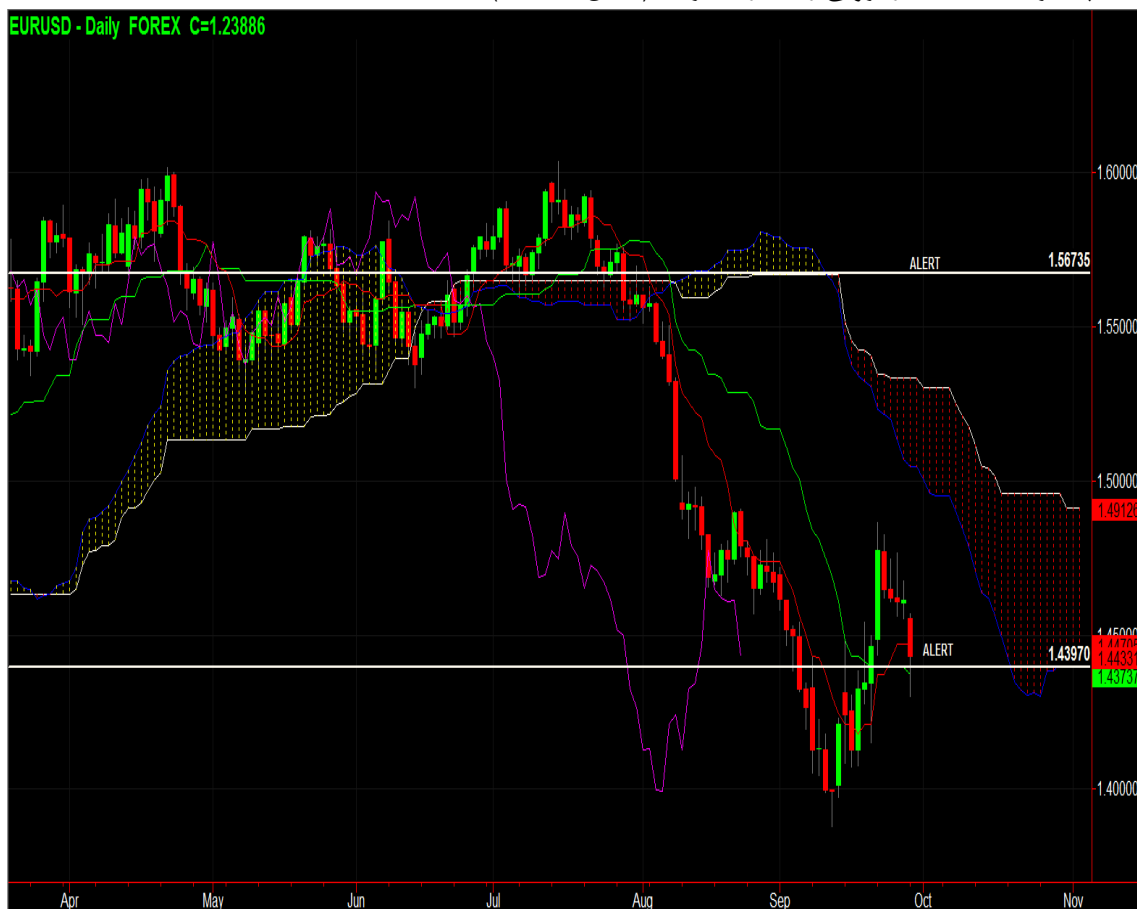
شکل ۱۲۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۱ سپتامبر ۲۰۰۸.

در ۲۶ سپتامبر ۲۰۰۸، در نهایت قادر به تنظیم اخطار نزولی شدیم. شکل ۱۲۳-۳ نمودار را با دو نوع اخطار شرح می‌دهد. ما اخطار نزولی را در کیجنسن انتخاب نموده‌ایم. درحالیکه قیمت بالای کیجنسن رفته است، دو سناریو در حال حاضر وجود دارد. یا روند بازگشت می‌نماید یا یک پولبک اصلی و ماژور رخ می‌دهد. به دلیل حرکت ناگهانی به سمت پائین، احتمال بیشتری وجود دارد که یکسری از افراد سود خود را برداشت نمایند و یک پولبک ماژور رخ دهد. درحالیکه روند ادامه می‌یابد، قیمت باید کومو را قطع کند بنابراین ما یک اخطار دیگر در آن محل تنظیم نمودیم.



شکل ۱۲۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۶ سپتامبر ۲۰۰۸.

در ۲۰ سپتامبر ۲۰۰۸، اختار نزولی راه اندازی گردید (شکل ۱۲۴-۳).

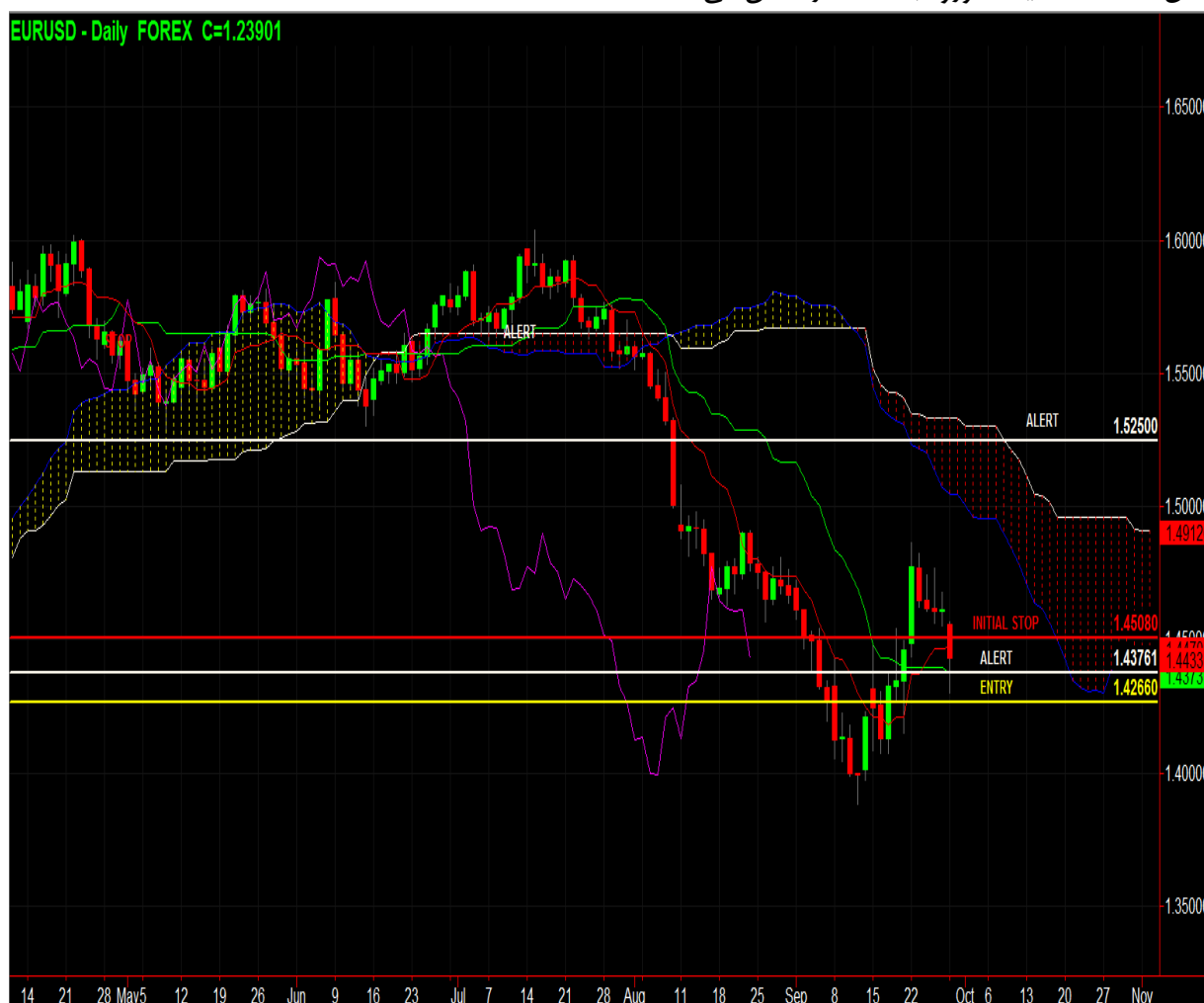


شکل ۱۲۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۹ سپتامبر ۲۰۰۸.

در هنگام بررسی اندیدکاتوره‌های ایچیموکو باید به نکات زیر توجه نمائیم:

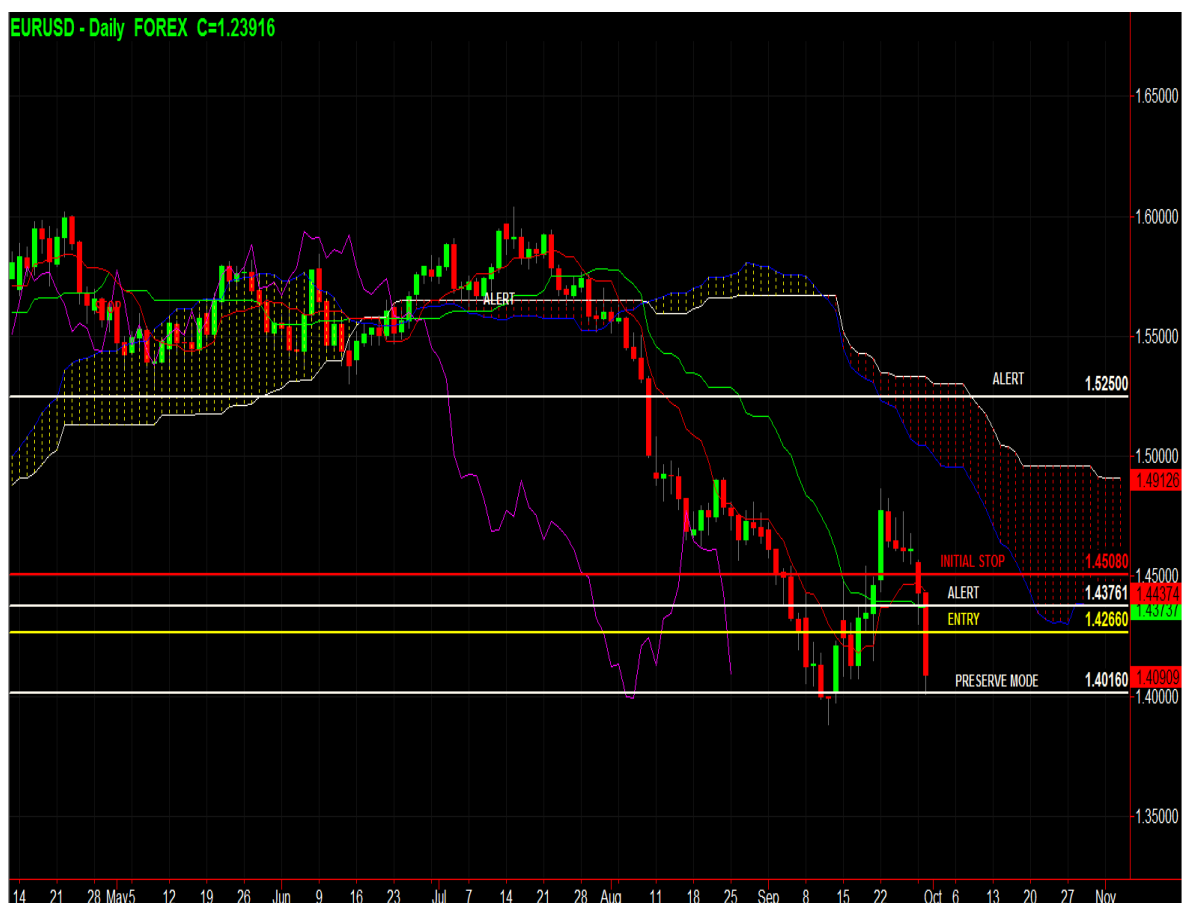
- یک حرکت ناگهانی به سمت پائین باعث خواهد شد تنکانسن و کیجنسن برای ایجاد یک حالت نزولی یکدیگر را قطع کنند.
- چیکواسپن نزدیک به قیمت است اما هنوز شانس این را دارد تا از قیمت دور شود اگر که حرکت به سمت پائین به زودی رخ دهد. بنابراین، اگر نقطه ورودمان برای مدت کوتاهی در این محل واقع شود، مجدداً این نقطه ورود را به یک اخطار تبدیل خواهیم کرد.
- کوموی آینده هنوز سالم است و ابر مقدار کمی نازک شده است.
- کیجنسن به سمت پائین در حال اشاره و حرکت است.

شکل ۱۲۵-۳ تنظیمات ورود به معامله را نشان می‌دهد.



شکل ۱۲۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۹ سپتامبر ۲۰۰۸.

در ۳۰ سپتامبر ۲۰۰۸، وارد یک معامله نزولی شدیم (شکل ۱۲۶-۳). قیمت به شدت به سمت پائین حرکت کرد طوریکه این مسئله باعث شد در «منطقه محافظتی» قرار گیریم. این امر بدین معنی است که در حال حاضر باید شروع به استفاده از تنکانسن به عنوان «توقف» نمائیم. هرچند، مشکلی که وجود دارد این است که تنکانسن از کیجنسن بالاتر است بنابراین کیجنسن در حال حاضر یک «توقف» بهتر است. بنابراین از کیجنسن به عنوان «توقف» استفاده خواهیم کرد تا زمانی که تنکانسن و کیجنسن یکدیگر را قطع کنند.



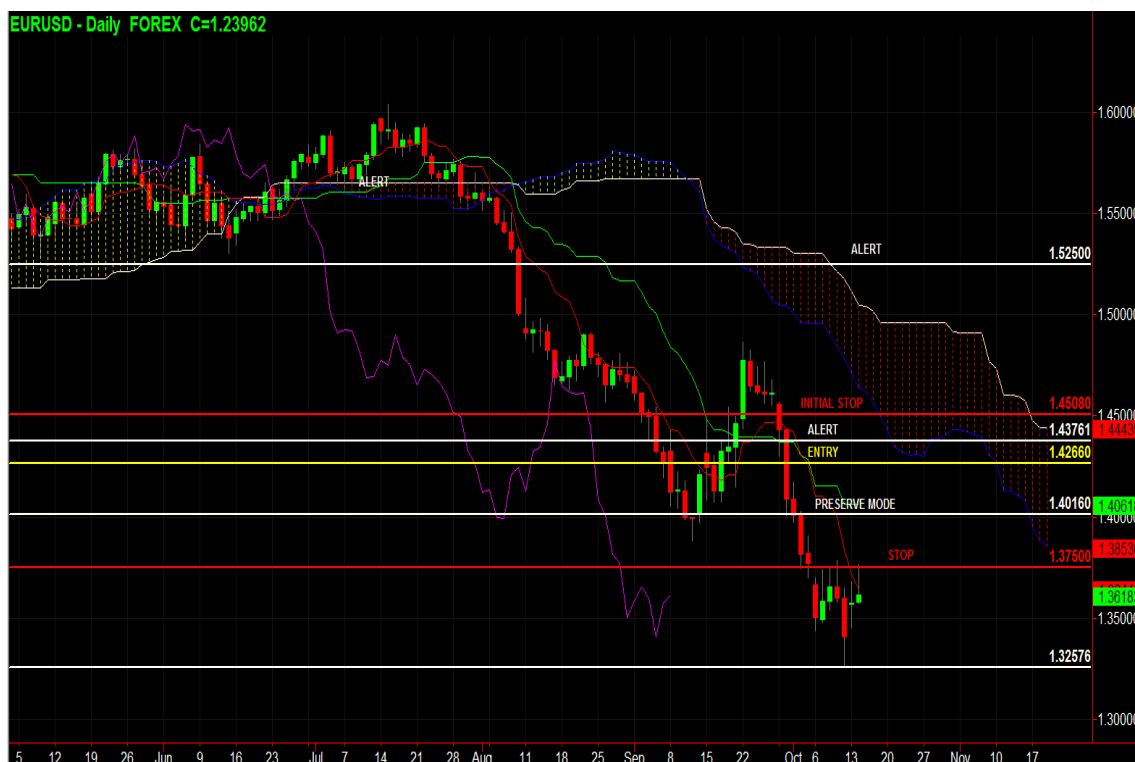
شکل ۱۲۶-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۳۰ سپتامبر ۲۰۰۸.

اعداد و ارقام معامله در جدول ۱۸-۳ نشان داده شده است.

جدول ۱۸-۳: اعداد و ارقام معامله ورود به EURUSD در ۳۰ سپتامبر ۲۰۰۸، معامله #۸

Statistics	Value
Entry Date	Sept 30, 2008
Entry Price	1.4266
Entry Stop	1.4508
Entry Risk	242 pips

در ۱۴ اکتبر ۲۰۰۸، از معامله نزولی مان با کسب سود خارج شدیم. شکل ۱۲۷-۳ نمودار مورد نظر را با کلیه مقادیرش نشان می‌دهد.



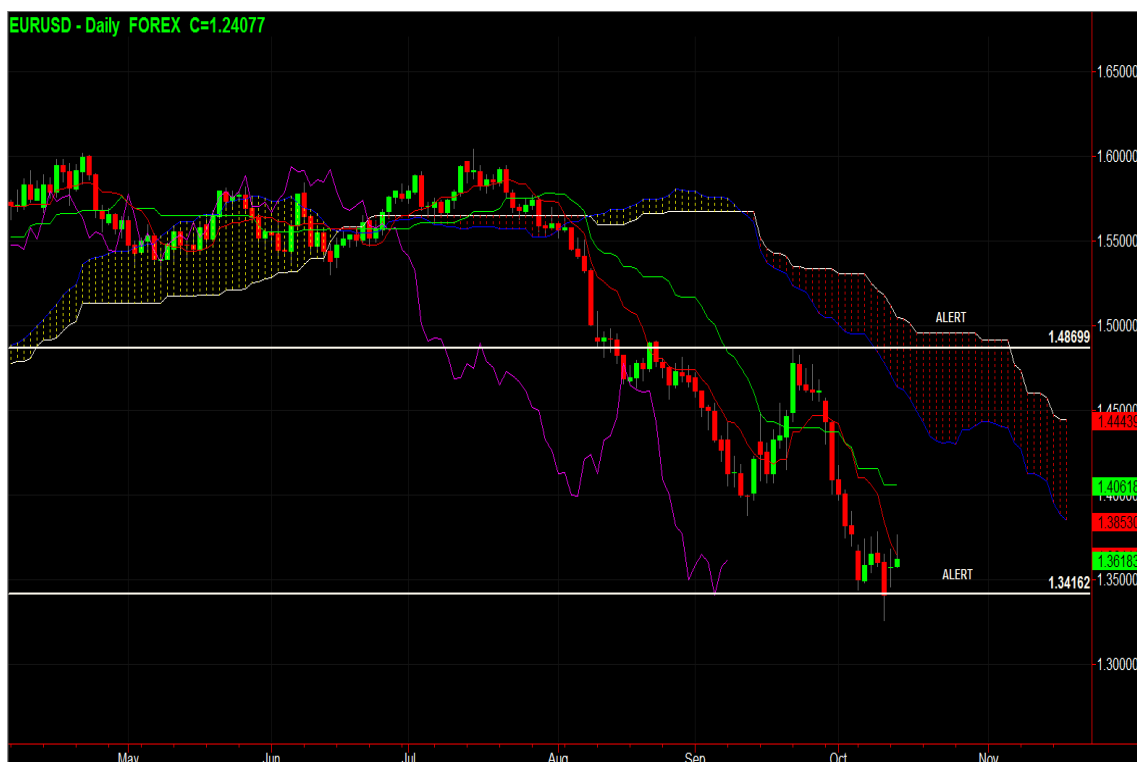
شکل ۱۲۷-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۴ اکتبر ۲۰۰۸.

آمار و ارقام خروج از معامله در جدول ۱۹-۳ نشان داده شده است.

جدول ۱۹-۳: آمار و ارقام معامله EURUSD در ۱۴ اکتبر ۲۰۰۸، ترید #۸

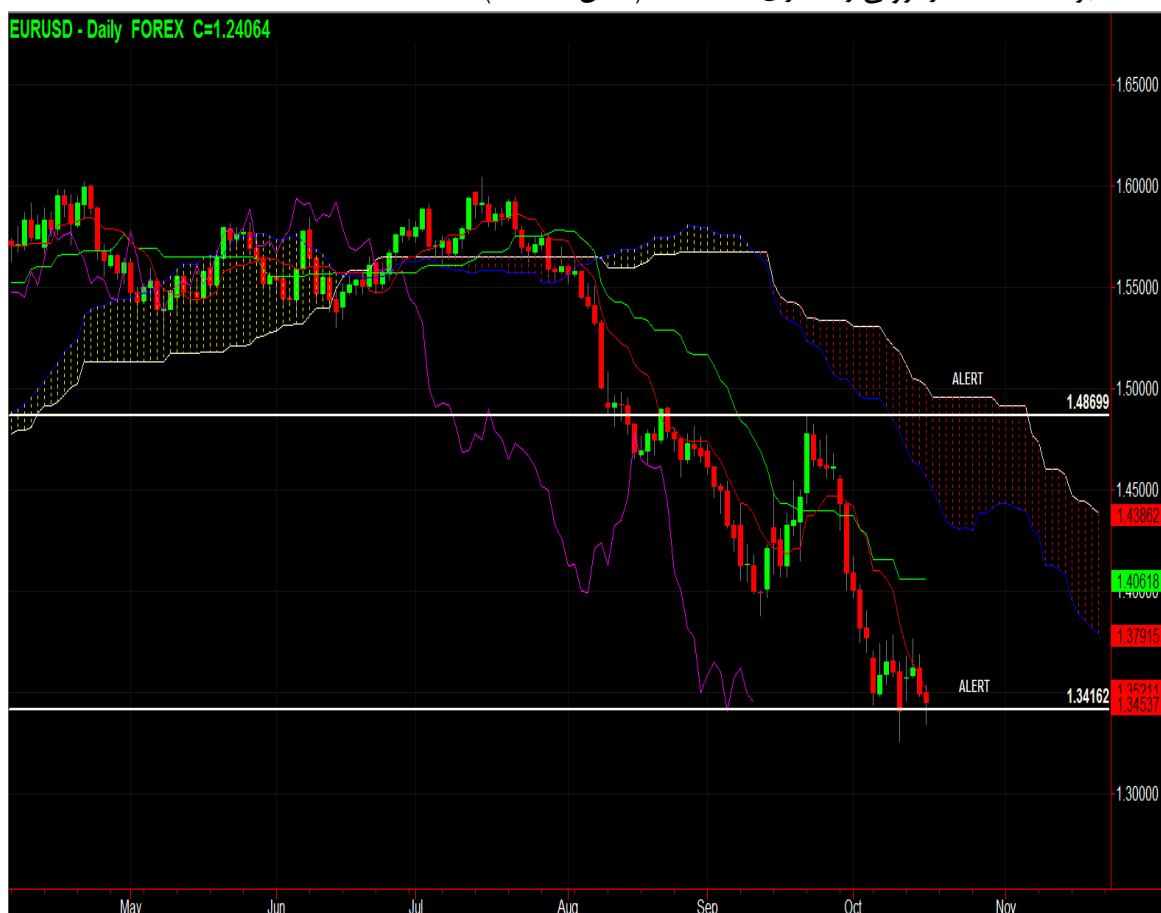
Statistics	Value
Entry Date	Sept 30, 2008
Exit Date	Oct 14, 2008
Entry Price	1.4266
Exit Price	1.3750
Entry Stop	1.4508
Entry Risk	242 pips
Profit	$1.4266 - 1.3750 = 516 \text{ pips}$
Max Profits	$1.4266 - 1.3257 = 1009$
Max Drawdown	N/A
Risk/Reward	0.47

در شکل ۱۲۸-۳، خط‌های جدید برای EURUSD برای ۱۴ اکتبر ۲۰۰۸ را نشان داده‌ایم.



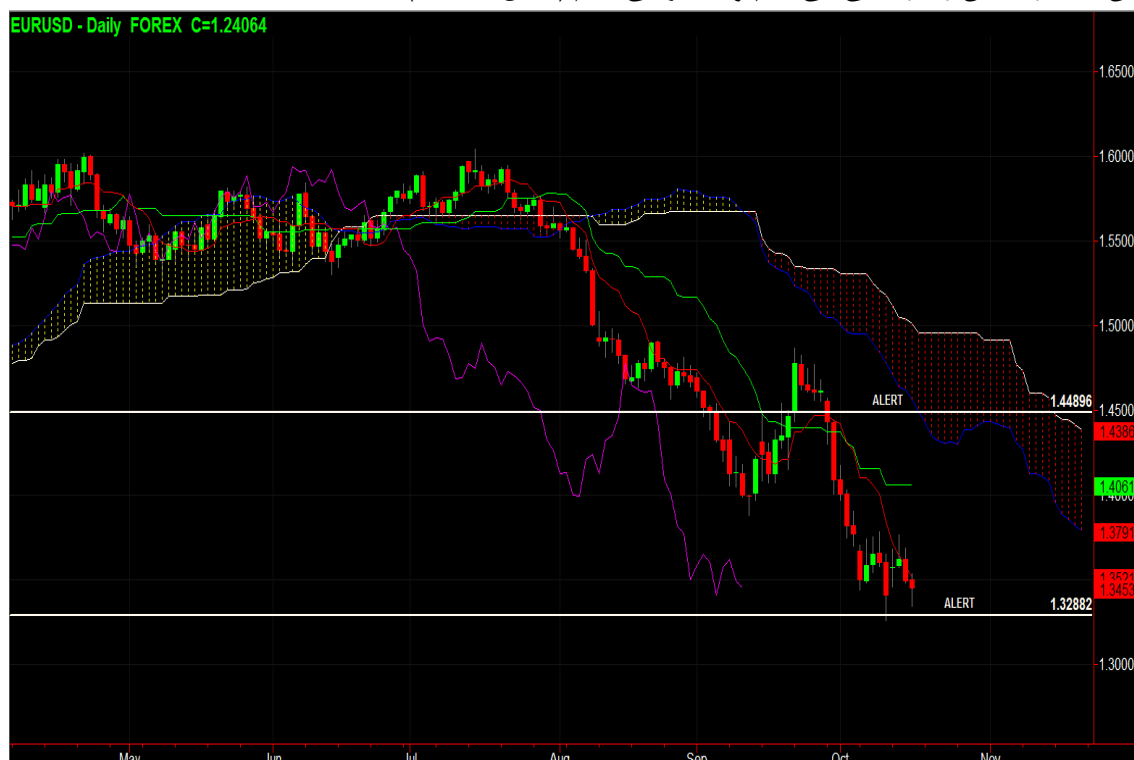
شکل ۱۲۸-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۴ اکتبر ۲۰۰۸.

در ۱۶ اکتبر ۲۰۰۸، اخطار نزولی راه اندازی شده است (شکل ۱۲۹-۳).



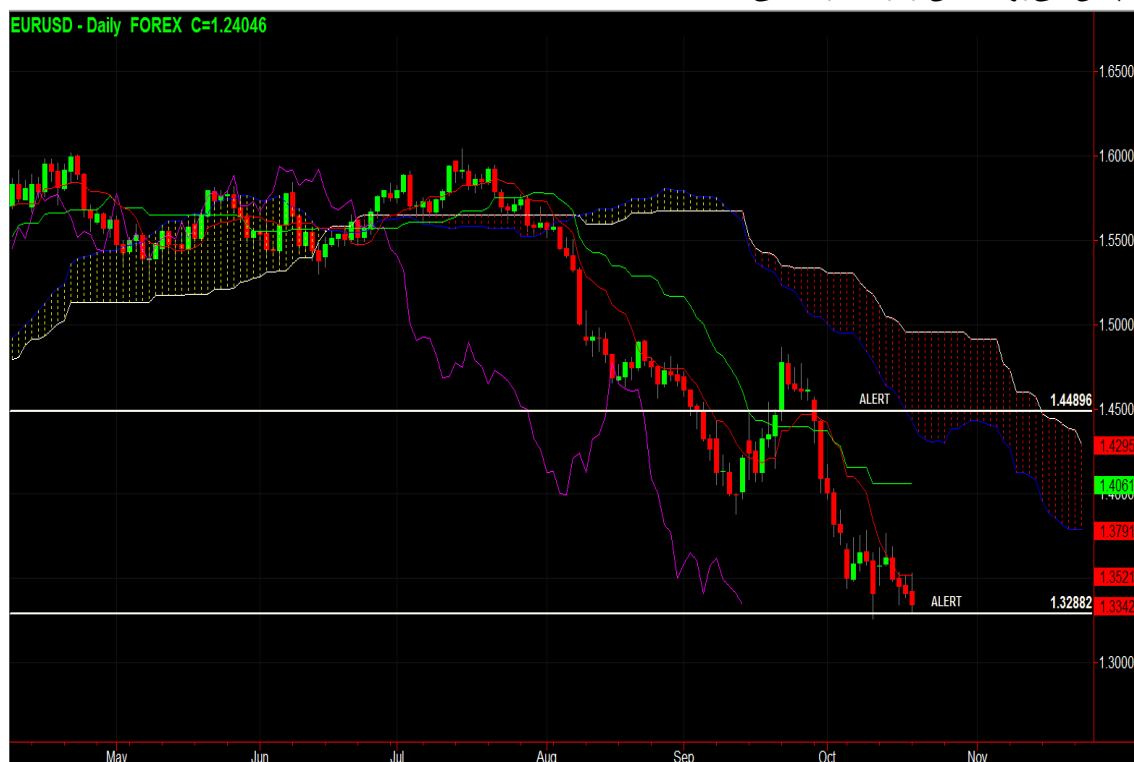
شکل ۱۲۹-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۶ اکتبر ۲۰۰۸.

به نظر می‌رسد اندیکاتورهای ایچیموکو در وضعیت مطلوبی هستند اما فاصله بین قیمت و کیجنسن بسیار زیاد است. بنابراین، اخطارهایمان را بازنشانی می‌کنیم و منتظر می‌مانیم (شکل ۱۳۰-۳).



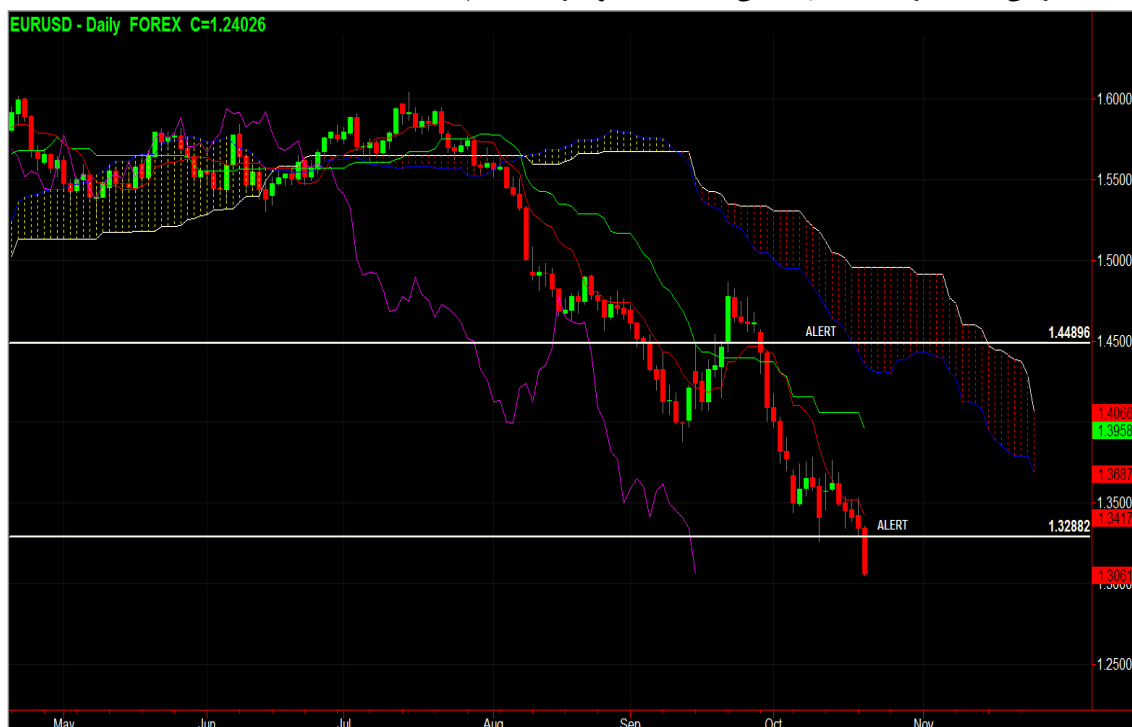
شکل ۱۳۰-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۶ اکتبر ۲۰۰۸.

شکل ۱۳۱-۳ نمودار ایچیموکو را در ۲۰ اکتبر ۲۰۰۸ نشان می‌دهد. در این زمان قیمت برای لمس کردن اخطارمان بسیار پیش می‌رود اما آن را راه‌اندازی نمی‌نماید.



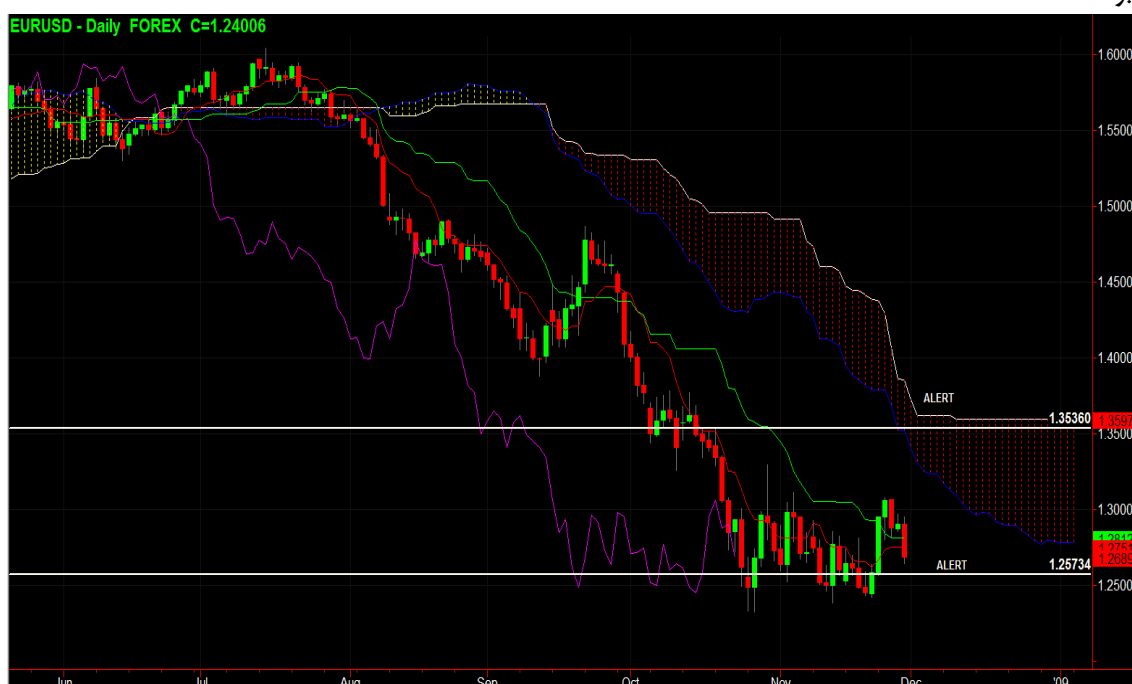
شکل ۱۳۱-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۰ اکتبر ۲۰۰۸.

در ۲۱ اکتبر ۲۰۰۸، اختار نزولی مان دوباره راه اندازی می شود (شکل ۱۳۲-۳). درست مانند قبل، قیمت هنوز از کومو دور است بنابراین باید همراه با اختارهایمان به سمت جلو حرکت کنیم.



شکل ۱۳۲-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۱ اکتبر ۲۰۰۸.

شکل ۱۳۳-۳ نشان می دهد در بک تست مان تا تاریخ ۲۸ نوامبر ۲۰۰۸ به سمت جلو حرکت نموده ایم. بین اکتبر و نوامبر، فرصت های زیادی برای تنظیم ورود به معاملات فروش داشته ایم اما به حرکت در همان مسیر تعیین شده مان ادامه داده ایم. نکته این بود که قیمت خیلی از کیجنسن دور شده است. به عبارت دیگر، مقدار فاصله آن بیش از ۳۰۰ پیپ بوده است.

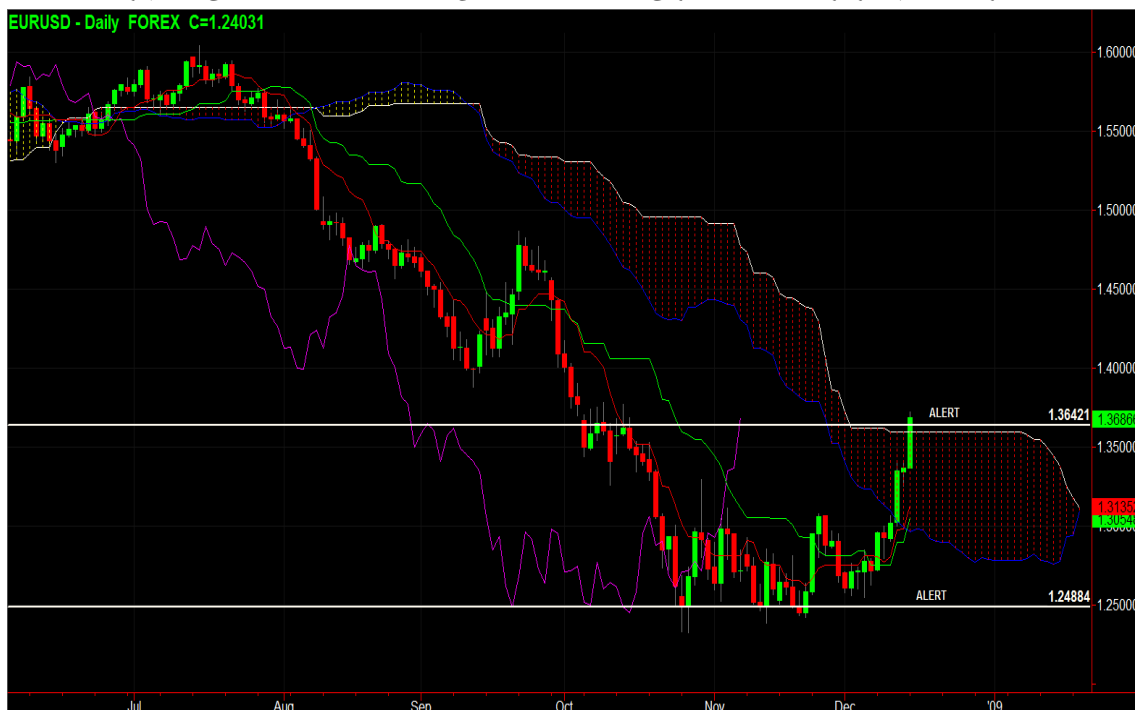


شکل ۱۳۳-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۸ نوامبر ۲۰۰۸.

شکل ۱۳۴-۳ نموداری را شرح می‌دهد که اخطارهای صعودی در آن راه‌اندازی شده است. آنالیز اندیکاتورهای ایچیموکو نشان می‌دهد که:

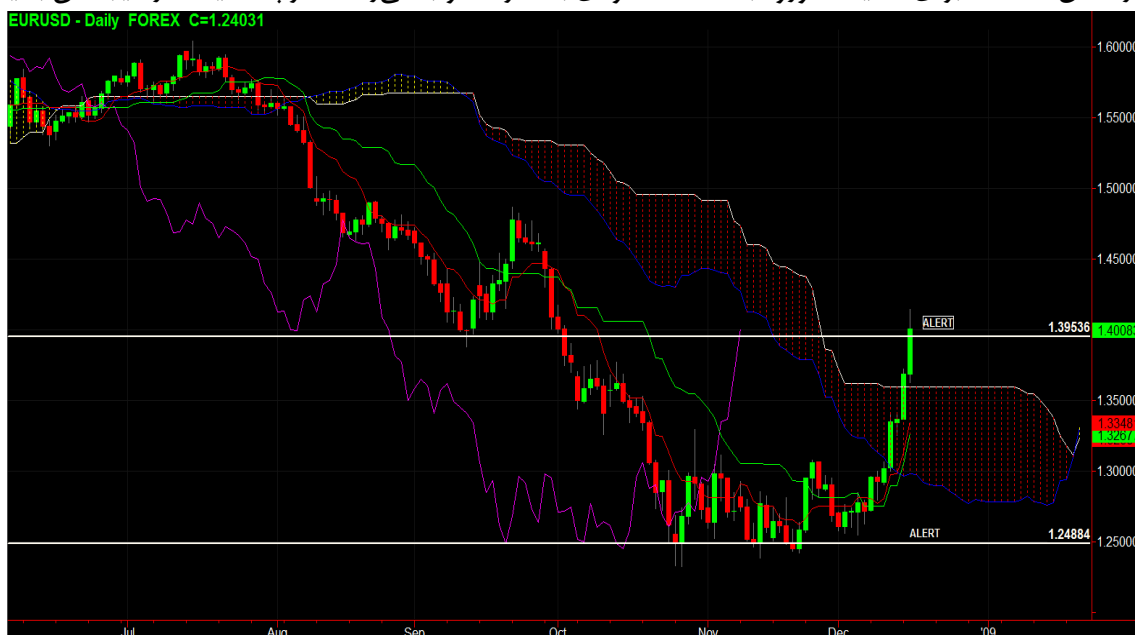
- هم تکناسن و هم کیجنسن درون یک ابر ضخیم هستند، که باعث ایجاد حالت تثبیت و عدم وجود روند می‌شود.
- کوموی آینده خنثی است.
- چیکواسپن در «فضای باز» قرار گرفته است.

هیچ یک از اندیکاتورهای ایچیموکو در حالت مطلوبی قرار ندارند بنابراین باید اخطارها را بازنشانی کنیم و منتظر بمانیم.



شکل ۱۳۴-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۲۸ نوامبر ۲۰۰۸.

نمودار شکل ۱۳۵-۳ برای تنظیمات ورود به معامله صعودی به نظر مطلوب می‌رسند. هرچند، قیمت از کیجنسن بسیار دور است.



شکل ۱۳۵-۳: نمودار روزانه ایچیموکو، EURUSD، ۱۶ دسامبر ۲۰۰۸.

خلاصه دو سال بک تست:

اکنون شما دو سال بک تست جفت ارز EURUSD را با یک برنامه معاملاتی خاص انجام داده‌اید. برنامه معاملاتی مورد استفاده اولین برنامه معاملاتی پایه بود. این برنامه امکان دو سال ترید سودآور را برایمان مهیا می‌سازد. تکنیک‌های بهینه‌سازی مختلف زیادی وجود دارد که می‌توانیم با کمک آنها تلاش کنیم سودمان را به شدت افزایش دهیم. در واقع، اگر در مورد این مسئله فکر کنید، قانونی وجود دارد که ما را از بسیاری از سودهای کلان دور می‌کند. این قانون جایی بود که کیجنسن و قیمت باید در فاصله ۳۰۰ پپی از یکدیگر قرار می‌داشتند. اگر این قانون را بتوان تغییر داد، ممکن است قادر باشیم سودمان را در طی بک تست در فاصله زمانی دو ساله حتی دو برابر سازیم.

فصل ۴

آنالیزهای آتی

بخش آنالیزهای آتی (Post-analysis) یکی از بخش‌های کلیدی بک‌تستینگ است. این بخش به تریدر «تصویر کاملی» از برنامه معاملاتی که برای بک‌تست به کار گرفته شده اعطا می‌کند. هدف آنالیز، بررسی نتایج برای دوره زمانی خاصی از بک‌تست می‌باشد. از طریق نتایج به دست آمده و همچنین بک‌تست، می‌توانید مسیری برای تغییر برنامه معاملاتی جهت افزایش سود، افزایش نسبت ریسک/ریوارد، و غیره بیابید.

در این بخش، شما را از طریق مراحل قدم به قدم آزمایش نتایج بک‌تست عبور خواهیم داد و سپس شروع به حرکت در مسیر سناریوهای بهینه‌سازی برنامه معاملاتی می‌نماییم. مطالب زیادی است که می‌توانید بررسی کنید بنابراین نمی‌گوییم در این مرحله عملیات بهینه‌سازی را کامل کرده‌ایم زیرا تکمیل برنامه عملیاتی به صورت واقعی در اینجا انجام نمی‌شود. بازارها به طور روزانه تغییر می‌کنند بنابراین هیچ پاسخ کاملی در این زمینه وجود ندارد. باید خودمان را با بازار تطابق دهیم، در غیر اینصورت بازار ما را حذف خواهد نمود.

آزمایش نتایج بک‌تست:

جدول ۱-۴ نتیجه معاملاتی که انجام داده‌ایم را با استفاده از برنامه معاملاتی حال حاضر نشان می‌دهد. جدول ۱-۴ آمارهای کاملی در مورد هر هشت ترید انجام گرفته از تاریخ ۱ ژانویه ۲۰۰۷ تا ۱ ژانویه ۲۰۰۹ را در تایم‌فریم روزانه برای جفت‌ارز EURUSD نشان می‌دهد. جدول ۱-۴: نتایج اصلی برنامه معاملاتی ایچیموکو

#	Entry Date	Entry Price	Entry Risk	Exit Date	Exit Price	Max Profit	Max Drawdown	50% Max Profit	Profit	Risk/Reward
1	2/27/07	1.3236	210	5/2/07	1.3570	445	164	Y	334	0.63
2	7/10/07	1.3720	267	8/9/07	1.3669	131	112	N/A	- 51	N/A
3	9/12/07	1.3891	297	10/3/07	1.4120	389	64	Y	229	1.30
4	10/19/07	1.4318	276	11/12/07	1.4537	431	149	Y	219	1.26
5	11/20/07	1.4791	343	11/20/07	1.4838	47	61	Y	47	7.29
6	2/27/08	1.5025	274	3/20/08	1.5553	878	—	Y	528	0.52
7	4/16/08	1.5955	340	4/24/08	1.5955	63	N/A	Y	-315	N/A
8	09/30/08	1.4266	242	10/14/08	1.3750	1,009	—		516	0.47
TOTAL			2,249			3,423			1,507	1.51

در طی این دوره سود کسب کرده‌ایم که این برای شروع خوب است. مسئله‌ای که بایستی در مورد این برنامه معاملاتی در نظر بگیرید این است که در مقایسه با سود به دست آمده، ریسک زیادی نیز وجود داشته است. به عبارت دیگر، نسبت ریسک/سود برابر ۱/۵۱ بوده است. هدف یک سیستم مبتنی بر روند حداقل‌سازی ضرر است زمانیکه اشتباه کرده‌اید یا حداکثرسازی سود است زمانیکه درست تشخیص داده‌اید. زمانیکه یک معامله ضررده بتواند بیش از یک معامله سودآور را «تحت تاثیر» قرار دهد، این مسئله به امر مهمی تبدیل می‌شود.

نتایج فوق با نسبت ریسک/سود ۱/۵۱ می‌تواند رخ دهد. بنابراین، نیاز است نسب ریسک/سود زیر ۱۰۰ شود، به عبارت دیگر، در این معاملات ریسک زیادی متحمل شده‌اید. افراد زیادی برنامه معاملاتی را با معاملات برنده نسبت به معاملات بازنده مورد سنجش قرار می‌دهند. آیا فکر می‌کنید این کار درستی است؟ آیا می‌توانید اعتقاد داشته باشید که یک سیستم فقط ۴۰ درصد درست عمل نماید اما بتواند سود زیادی تولید کند؟ آیا این امری غیرمعمول نیست؟ در بخش گذشته این کتاب، این مسئله را بیشتر مورد بحث قرار دادیم. چه باور کنید یا خیر، درصد سود به دست آمده واقعاً مسئله مهمی نیست. مسئله مهم مقدار سودی است که تریدهای برنده در مقایسه با مقدار ضرر به دست آمده از تریدهای بازنده ایجاد می‌کند.

همانطور که در جدول ۱-۴ نشان داده شده، اکنون نتایج نهایی بک‌تست‌تمان را به روشی سازمان‌یافته در اختیار داریم. می‌توانیم بر هدف‌مان تمرکز نماییم: حداکثرسازی سود و حداقل‌سازی ضرر. اولین کاری که باید انجام دهیم،

حداقل ساختن ضررهايمان است. در برنامه معاملاتی اصلی مان دو بار ضرر کرده ایم. اولین ضرر ۵۱- و دومین ضرر ۳۱۵- پپ است. ضرر ۳۱۵ پپی ۲۱ درصد کل سود ۱۵۰۱ پپی است. در مقایسه با سود دوساله، این مقدار ضرر بسیار زیاد است. در اینجا نیاز داریم دو یا سه کار انجام دهیم. اولین کار این است که ضرر را به سود تبدیل کنیم. برای آن معامله، حداکثر سود فقط ۶۳ پپ بود. این مقدار، سود زیادی نیست، بنابراین گزینه اول امکان پذیر نیست. گزینه دوم حذف کامل ضرر است.

برنامه معاملاتی مان بر حداکثر ضرر در هر معامله به میزان ۳۰۰ پپ متمرکز بود. این معامله دارای ریسک ورود به معامله ۳۴۰ پپ بود، که این مقدار، بالای ۳۰۰ پپ بود. این مقدار ریسک به دلیل وجود بافر ورود به معامله بود. اجازه ورود به معامله را داشتیم زیرا برنامه معاملاتی مان شامل بافر در قوانین صعودی و نزولی نبود. اگر طوری برنامه معاملاتی مان را تنظیم کنیم که این قوانین شامل بافر ورود به معامله نیز باشد، پس می توانیم این معامله را به طور کامل حذف کنیم و از ورود به آن خودداری کنیم. جدول ۲-۴ تغییر قوانین برنامه معاملاتی را برای هر دو حالت صعودی و نزولی نشان می دهد.

جدول ۲-۴: تعدیلات مورد نیاز برنامه معاملاتی ایچیموکو، شامل بافر ورود به معامله

قوانین ورود به معامله صعودی										
قیمت ورود باید از کیجنسن + بافر ورود کمتر از ۳۰۰ پپ باشد. اگر از ۳۰۰ پپ بیشتر است، باید صبر کنید تا قیمت به این مقدار برسد و وارد محدوده موردنظرمان گردد.										
قیمت ورود به معامله باید بیش از ۳۰۰ پپ از کیجنسن - بافر ورود باشد. اگر قیمت از ۳۰۰ پپ بیشتر نباشد، باید صبر کنید تا قیمت به این مقدار برسد و وارد محدوده موردنظرمان گردد.										

جدول ۲-۴: نتایج یک تست دوساله را بعد از تغییر قانون برنامه معاملاتی نشان می دهد.

جدول ۳-۴: مقایسه ریسک ورود ۳۰۰ پپی به جای ریسک ورود فقط بر اساس کیجنسن

#	Entry Date	Entry Price	Entry Risk	Exit Date	Exit Price	Max Profit	Max Drawdown	50% Max Profit	Profit	Risk/Reward
1	2/27/07	1.3236	210	5/2/07	1.3570	445	164	Y	334	0.63
2	7/10/07	1.3720	267	8/9/07	1.3669	131	112	N/A	-51	N/A
3	9/12/07	1.3891	297	10/3/07	1.4120	389	64	Y	229	1.30
4	10/19/07	1.4318	276	11/12/07	1.4537	431	149	Y	219	1.26
5	2/27/08	1.5025	274	3/20/08	1.5553	878	—	Y	528	0.52
6	09/30/08	1.4266	242	10/14/08	1.3750	1,009	—		516	0.47
TOTAL			1,566			3,283			1,775	0.88

به هدف مان برای حذف این ترید به طور کامل دست یافتیم. این کار بیش از ۲۰۰ پپ به سود دو ساله مان می افزاید و نسبت ریسک/سود را به زیر ۱۰۰ کاهش می دهد. دومین گزینه واقعاً خوب عمل نمود. گزینه سوم حداقل نمودن ضرر است. واقعاً نمی توانم به روشی فکر کنم که بتوانیم این ضرر را کاهش دهیم بنابراین این گزینه هرگز در دسترس مان قرار نخواهد گرفت.

حداقل سازی ضررها کاری است که باید به سرعت انجام دهیم زیرا فقط یک ضرر بزرگ را در کارنامه مان داشته ایم. اگر چند ضرر بزرگ می داشتیم، زمان بیشتری طول می کشید تا دلیل آن را تشخیص دهیم. در واقعیت، پیش از اینکه تلاش کنیم تا ضررهايمان را به حداقل برسانیم و یا سودمان را به حداکثر افزایش دهیم، در واقع نیاز است مطمئن شویم مجموعه کاملی از داده های مورد نیاز برای معامله را در دسترس داریم. به عبارت دیگر، نیاز است مطمئن شویم قوانین برنامه معاملاتی بعضی از معاملات خوب را حذف نخواهد کرد. یک روش مطلوب برای انجام این کار، بررسی «حفرات» موجود در تریدهای جدول ۱-۴ می باشد.

اگر به نتایج جدول ۱-۴ نگاه کنید، متوجه خواهید تا ماه می ۲۰۰۸ حداقل هر دو ماه یک معامله انجام داده‌ایم. بعد از می ۲۰۰۸، تا ماه سپتامبر هیچ معامله‌ای انجام نداده‌ایم. این حالت با توالی نرمال یک ترید در هر ماه سازگار نیست. بنابراین، نیاز است دلیل آنرا مشخص کنیم چون در طی این دوره زمانی واقعاً چند معامله خوب نیز می‌توانست صورت گیرد که از آنها چشم‌پوشی نموده‌ایم. اگر این دوره زمانی به صورت سایدوی و حالت تثبیت باشد، بنابراین معاملات خوبی در این دوره زمانی وجود نخواهد داشت. هرچند، اگر نمودارها شرح دهند که این دوره یک دوره دارای روند می‌باشد، پس قوانینی وجود دارد که مانع از انجام معاملات روندی خوبی می‌شود.

اگر به بخش بک‌تست بازگردیم، از ماه می ۲۰۰۸ تا سپتامبر ۲۰۰۸، فرصت‌های معاملاتی زیادی وجود دارد اما هرگز به هیچ یک از این معاملات به دلیل قوانین برنامه معاملاتی به یک معامله وارد نشدیم. قانونی که باعث شد ما از تعداد زیادی از معاملات در این دوره زمانی چشم‌پوشی نماییم قانون فاصله قیمت از کیجنسن به میزان بیش از ۳۰۰ پیپ بوده است. بنابراین، بهینه‌سازی که قصد داریم انجام دهیم حذف این قانون از برنامه معاملاتی در هر دو حالت صعودی و نزولی می‌باشد. با استفاده از این برنامه معاملاتی جدید، مجدداً نیاز به بک‌تست در تایم‌فریم روزانه EURUSD از ۱ ژانویه ۲۰۰۷ تا ۱ ژانویه ۲۰۰۸ داریم. جدول ۴-۴ قوانین بک‌تست برنامه معاملاتی که حداکثر فاصله ۳۰۰ پیپ بین قیمت و کیجنسن را حذف نموده است نشان می‌دهد. جدول ۴-۴ تغییرات زیر در نتایج بدست آمده را نشان می‌دهد.

- چهار ترید جدید
- حداکثر سود با انجام این چهار معامله جدید، دوبرابر شده است.
- سود با انجام چهار معامله جدید افزایش یافته است.
- ریسک/سود در نتیجه انجام چهار معامله جدید افزایش یافته است.

با تغییر این قوانین، اکنون مجموعه داده کاملی برای همه معاملات در خلال این دوره زمانی را در دست داریم. اکنون می‌توانیم به حداقل‌سازی ضررها و حداکثرسازی سودهایمان نگاه کنیم. ابتدا کارمان را با حداقل‌سازی ضررهایمان آغاز می‌کنیم زیرا پیش از اینکه به معاملات برنده بپردازیم نیاز است ضررهایمان را مشخص کنیم. ضررهایمان را پیش از این با تغییر برنامه معاملاتی بر اساس جدول ۲-۴ به حداقل رساندیم. هرچند، در حال حاضر واقعاً نمی‌توانیم این کار را انجام دهیم زیرا قانون فوق را به طور کامل حذف نموده‌ایم. بعد از ملاحظه نتایج جدول ۴-۴، متوجه شدیم حداکثر مقدار کاهش ضرر برابر ۲۲۱ بود. بنابراین، می‌توانیم ریسک ورود به معاملات مان را به طور کامل کاهش دهیم. حالا بیا ببینیم برنامه معاملاتی مان را طوری تغییر دهیم که شامل حداکثر ریسک ورود به معامله ۲۵۰ پیپ باشد.

جدول ۴-۴: حذف قانون فاصله ۳۰۰ پیپ از کیجنسن

#	Entry Date	Entry Price	Entry Risk	Exit Date	Exit Price	Max Profit	Max Drawdown	50% Max Profit	Profit	Risk/Reward
1	2/27/07	1.3236	210	5/2/07	1.3570	445	164	Y	334	0.63
2	7/10/07	1.3720	267	8/9/07	1.3669	131	112	N/A	-51	N/A
3	9/12/07	1.3891	297	10/3/07	1.4120	389	64	Y	229	1.30
4	10/19/07	1.4318	276	11/12/07	1.4537	431	149	Y	219	1.26
5	11/20/07	1.4791	343	12/05/07	1.4630	173			-161	
6	2/27/08	1.5025	274	3/20/08	1.5553	878	—	Y	528	0.52
7	4/16/08	1.5955	340	4/24/08	1.5955	63	N/A	Y	-315	N/A
8	08/08/08	1.5243	315	08/22/08	1.4896	616	N/A	Y	347	0.91
9	08/26/08	1.4590	706	09/15/08	1.4288	703	221	N	302	2.34
10	09/30/08	1.4266	242	10/14/08	1.3750	1,009	—	Y	516	0.47
11	10/21/08	1.3217	731	10/29/08	1.2962	886	N/A	N	255	2.87
	TOTAL		4,001			5,724			2,203	1.82

جدول ۴-۵ نتایج بک تست جدید را نشان می‌دهد.

جدول ۴-۵: حذف قانون فاصله ۳۰۰ پیپی از کیجنسن و افزودن حداکثر ریسک به ۲۵۰ پیپ

#	Entry Date	Entry Price	Entry Risk	Exit Date	Exit Price	Max Profit	Max Drawdown	50% Max Profit	Profit	Risk/Reward
1	2/27/07	1.3236	210	5/2/07	1.3570	445	164	Y	334	0.63
2	7/10/07	1.3720	250	8/9/07	1.3669	131	112	N/A	-51	N/A
3	9/12/07	1.3891	250	10/3/07	1.4120	389	64	Y	229	1.30
4	10/19/07	1.4318	250	11/12/07	1.4537	431	149	Y	219	1.26
5	11/20/07	1.4791	250	12/05/07	1.4630	173			-161	
6	2/27/08	1.5025	250	3/20/08	1.5553	878	—	Y	528	0.52
7	4/16/08	1.5955	250		1.5955	63	N/A	Y	-250	N/A
8	08/08/08	1.5243	250	08/22/08	1.4896	616	N/A	Y	347	0.91
9	08/26/08	1.4590	250	09/15/08	1.4288	703	221	N	302	2.34
10	09/30/08	1.4266	242	10/14/08	1.3750	1,009	—	Y	516	0.47
11	10/21/08	1.3217	250	10/29/08	1.2962	886	N/A	N	255	2.87
TOTAL			2,702			5,724			2,268	1.19

ما ریسک مان را بدون تغییر زیاد برنامه معاملاتی کاهش داده‌ایم. اکنون می‌خواهیم مشخص کنیم چطور سودمان را به حداکثر برسانیم. با بررسی جدول ۴-۵، نتایج ستون «حداکثر سود» به دست آمده و ستون «ریسک/سود» را مشاهده نمودیم. معاملات زیادی وجود دارد که حداقل ۵۵۰ پیپ سود داشتند اما ادعای مقادیر بسیار کمتری از این میزان داشتیم. بنابراین، تصمیم داریم قوانین زیر را به برنامه معاملاتی مان بیافزاییم: اگر ۵۵۰ پیپ سود به دست آید، از ترید خارج شویم. جدول ۴-۶ نتایج جدید را با حذف قانون فاصله ۳۰۰ پیپی از کیجنسن و فاصله از قیمت را نشان می‌دهد. جدول ۴-۶: حذف قانون فاصله ۳۰۰ پیپی از کیجنسن همراه با حذف قانون خروج ۵۵۰ پیپی

#	Entry Date	Entry Price	Entry Risk	Exit Date	Exit Price	Max Profit	Max Drawdown	50% Max Profit	Profit	Risk/Reward
1	2/27/07	1.3236	210	5/2/07	1.3570	445	164	Y	334	0.63
2	7/10/07	1.3720	267	8/9/07	1.3669	131	112	N/A	-51	N/A
3	9/12/07	1.3891	297	10/3/07	1.4120	389	64	Y	229	1.30
4	10/19/07	1.4318	276	11/12/07	1.4537	431	149	Y	219	1.26
5	11/20/07	1.4791	343	12/05/07	1.4630	173			-161	
6	2/27/08	1.5025	274	—	1.5575	550	—	Y	550	0.50
7	4/16/08	1.5955	340	4/24/08	1.5955	63	N/A	Y	-315	N/A
8	08/08/08	1.5243	315		1.4693	550	N/A	Y	550	0.57
9	08/26/08	1.4590	706		1.4040	550	221	N	550	1.28
10	09/30/08	1.4266	242		1.3716	1,009	—	Y	550	0.44
11	10/21/08	1.3217	731		1.2667	886	N/A	N	550	1.33
TOTAL			4,001			5,724			3,005	1.33

لطفاً توجه کنید: به جای ارزیابی مجدد بک تست با قوانین جدید، می‌خواهیم این نتایج را تخمین بزنیم. اگر نتایج به نظر مطلوب برسند پس این برنامه جدید را بک تست خواهیم گرفت. به همین دلیل است که چرا برای برخی از معاملات هیچ تاریخ خروجی ندارد. این کار دقت ۱۰۰ درصدی ندارد زیرا در سود ۵۵۰ پیپی خارج می‌شویم و می‌توانیم معاملات بیشتری انجام دهیم چون می‌توانیم مجدداً وارد معامله شویم.

جدول ۴-۷ نتایج حذف قانون فاصله ۳۰۰ پیپی از کیجنسن و قیمت، حداکثر ریسک ۲۵۰ ورود به معامله، و خروج از معامله با کسب ۵۵۰ پیپ سود را نشان می‌دهد.

جدول ۷-۴: حذف قانون فاصله ۳۰۰ پیپی از کیجنسن همراه با حذف قانون حداکثر ریسک ۲۵۰ پیپی و حذف قانون خروج ۵۵۰ پیپی

#	Entry Date	Entry Price	Entry Risk	Exit Date	Exit Price	Max Profit	Max Drawdown	50% Max Profit	Profit	Risk/Reward
1	2/27/07	1.3236	210	5/2/07	1.3570	445	164	Y	334	0.63
2	7/10/07	1.3720	250	8/9/07	1.3669	131	112	N/A	-51	N/A
3	9/12/07	1.3891	250	10/3/07	1.4120	389	64	Y	229	1.30
4	10/19/07	1.4318	250	11/12/07	1.4537	431	149	Y	219	1.26
5	11/20/07	1.4791	250	12/05/07	1.4630	173			-161	
6	2/27/08	1.5025	250		1.5575	878	—	Y	550	0.50
7	4/16/08	1.5955	250	4/24/08	1.5955	63	N/A	Y	-250	N/A
8	08/08/08	1.5243	250		1.4693	616	N/A	Y	550	0.45
9	08/26/08	1.4590	250		1.4040	703	221	N	550	0.45
10	09/30/08	1.4266	242		1.3716	1,009	—	Y	550	0.44
11	10/21/08	1.3217	250		1.2667	886	N/A	N	550	0.44
TOTAL			2,702			5,724			3,070	0.88

اگر نتایج جدول ۱-۴ تا ۷-۴ را با هم مقایسه کنید، متوجه خواهید شد سودمان دوبرابر شده و نسبت ریسک/سودمان به نصف کاهش یافته است. اکنون باید برنامه معاملاتی مان را با قوانین جدید بک تست نمائیم تا مطمئن شویم نتایج بک تست واقعی با نتایج بک تست تخمین زده شده هماهنگ است. شما را با بک تست همه این قوانین رها می سازیم و این امکان را برایتان فراهم می سازیم تا نتایجی که به دست می آورید را در وبسایتمان www.eiicapital.com مقایسه نمائید.

بهینه سازی صورت گرفته واقعاً خوب عمل نمود. فقط فکر کنید که این آغاز راه بهینه سازی برنامه معاملاتی می باشد. چیزهای زیاد دیگری وجود دارد که می توانید آنها را نیز مورد آزمایش قرار دهید. در اینجا لیستی از هفت مورد از این نکات وجود دارد:

- ۱- افزایش «مقدار محافظتی» از ۳۰۰ به ۳۵۰، ۴۰۰، ۴۵۰، ۵۰۰.
- ۲- افزایش بافر خروج صعودی به ۵۰، ۶۰، ۷۰.
- ۳- افزایش بافر خروج نزولی به ۴۰، ۵۰، ۶۰، ۷۰.
- ۴- اگر قیمت ۲۰۰ پیپ از کیجنسن در زمان ورود فاصله دارد، از تکناسن به عنوان توقف استفاده نمائید.
- ۵- در مورد تریدهای دارای روند ادامه دار همیشه از تکناسن به جای کیجنسن برای توقف استفاده نمائید.
- ۶- همیشه از تکناسن به عنوان توقف استفاده نمائید.
- ۷- همیشه از کیجنسن به عنوان توقف در حالتی که «حالت محافظتی» ندارید، استفاده کنید.

بهینه سازی برنامه معاملاتی:

اکنون شرح دادیم چطور یک برنامه معاملاتی در حول یک استراتژی ایچیموکویی ایجاد نمائید، استراتژی که برای شکار روندها برای حداکثرسازی سود در زمانی شکل گیری روند طراحی شده و همچنین این استراتژی در زمان عدم شکل گیری روند برای حداقل سازی ضررها ایجاد می شود. در طی مراحل بک تست برنامه معاملاتی مان «توقف» نیز خوردیم و نشان دادیم چطور می توانید برنامه معاملاتی تان را با ملاحظه آمار و ارقام بعد از انجام آنالیز بهینه سازی نمائید. استراتژی نهایی به دست آمده «استراتژی پایه» است. این یک استراتژی پایه است چون این استراتژی فقط حداکثر ۴۰ درصد تا ۵۰ درصد سود به دست می آورد.

از طریق سایر تکنیک‌های بهینه‌سازی، می‌توانید حداکثر سود بیشتری به دست آورید، ضررهایتان را بیشتر کاهش دهید، و سودتان را به حداکثر برسانید. در ادامه تکنیک‌های پیشرفته بهینه‌سازی را مورد بحث و بررسی قرار خواهیم داد. تجزیه و تحلیل چهار تکنیک بهینه‌سازی پیشرفته که در آینده مورد بحث قرار خواهیم داد، عبارتند از:

۱- الگوهای نموداری (چارت پترن)

۲- آنالیز در چندین تایم‌فریم Multi-Time Frame Analysis

۳- استراتژی‌های ورود

۴- مدیریت سرمایه پیشرفته (مقدار ورود و خروج)

فصل ۵

استراتژی‌های ایچیموکو

در این بخش، در مورد سایر استراتژی‌های ایچیمو کو بحث می‌کنیم. واقعاً مردد بودم این بخش را در کتاب قرار دهم چون این بخش می‌تواند بسیار مخرب باشد. منظورم از «مخرب بودن» این است که با مطالعه این بخش فرد فقط بر روی یک استراتژی متمرکز نخواهد شد. آنها به طور همزمان همه استراتژی‌ها را در نظر می‌گیرند و تلاش خواهند کرد ببینند در مرحله آغاز یادگیری ایچیمو کو کدام استراتژی بهتر است. آنها به جای بک‌تست گرفتن با یک استراتژی، شروع به بک‌تست گرفتن از همه استراتژی‌ها خواهند نمود و تلاش می‌کنند تا همه این استراتژی‌ها را بک‌تست بگیرند تا ببینند کدام استراتژی بهترین استراتژی است. اگر فردی این کار را انجام دهد، محکوم به شکست است.

اگر در معامله با ایچیمو کو تازه کار هستید، واقعاً نیاز دارید برای درک استراتژی «ایده‌آل» که در بخش‌های پیشین شرح داده شده، زمان صرف کنید. استراتژی بخش پیشین، «استراتژی پایه» سایر استراتژی‌هاست. با استفاده و درک استراتژی «ایده‌آل» درک‌تان از همه اندیکاتورهای ایچیمو کو آغاز می‌شود. بدون حرکت در مراحل بخش‌های طراحی شده پیشین، هیچ راه دیگری وجود نخواهد داشت که بتوانید در سایر استراتژی‌های پیشرفته معاملات موفقیت‌آمیزی انجام دهید. استراتژی‌های پیشرفته فقط «بخش‌هایی» از استراتژی‌های «ایده‌آل» همراه با انواع قوانین مختلف هستند. در اینجا پنج استراتژی ایچیمو کو بیان می‌گردد:

۱- استراتژی ایده‌آل ایچیمو کو

۲- استراتژی کراس (تقاطع) تنکانسن/کیجنسن.

۳- استراتژی کراس کیجنسن

۴- استراتژی بریک‌اوت ابر کومو

۵- استراتژی تقاطع سنوکواسپن آینده.

هر استراتژی اهداف خودش را دارد. این استراتژی‌ها را به طور مختصر شرح خواهیم داد و مسائل مربوط به هر استراتژی و قوانین بنیادین آنها را شرح می‌دهم. تریدرهای مختلف سیستم ایچیمو کو، برای هر استراتژی مجموعه قوانین مختلفی دارند. مجموعه قوانینی که تشریح می‌شوند، قوانینی هستند که با هر دو نوع حالت معامله در گذشته و معامله واقعی تجربه نموده‌ام.

استراتژی ایده‌آل ایچیمو کو:

این استراتژی همان استراتژی به کار برده شده در بخش‌های قبل است. من به این استراتژی به عنوان یک استراتژی «با بالاترین احتمال» می‌نگرم زیرا این استراتژی یک استراتژی امن و محافظه‌کارانه است. هدف این استراتژی کسب ۳۰ تا ۴۰ درصد سود از یک روند است. در این استراتژی شما پایان روند را شکار نخواهید کرد. در واقع، بسته به برنامه معاملاتی‌تان، همانطور که روند در حال حرکت است، به احتمال زیاد آنرا از دست خواهید داد. این استراتژی از همه اندیکاتورهای ایچیمو کو استفاده می‌نماید بنابراین شما باید همه اندیکاتورها را درک کرده باشید و بدانید برای معامله در این استراتژی چطور این اندیکاتورها با یکدیگر کار خواهند کرد. همچنین من آن را به نام «استراتژی پایه» می‌نامم. بدون دانستن کامل این استراتژی، قادر نخواهید بود سایر استراتژی‌ها را به طور موفقیت‌آمیزی درک نمایید. قوانین صعودی پایه برای این استراتژی عبارتند از:

- قیمت بالای ابر کومو باشد.
- تنکانسن بالاتر از کیجنسن باشد.
- چیکواسپن بالاتر از قیمت ۲۶ دوره قبل است.
- سنوکواسپن A آینده بالاتر از سنوکواسپن B آینده است.
- قیمت از کیجنسن و تنکانسن خیلی دور نیست.

- تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپن نباید درون یک ابر کوموی ضخیم باشند.
- قوانین نزولی پایه برای این استراتژی عبارتند از:
- قیمت زیر ابر کومو باشد.
- تنکانسن پائین تر از کیجنسن باشد.
- چیکواسپن پائین تر از قیمت ۲۶ دوره قبل است.
- سنوکواسپن A آینده پائین تر از سنوکواسپن B آینده است.
- قیمت از کیجنسن و تنکانسن خیلی دور نیست.
- تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپن نباید درون یک ابر کوموی ضخیم باشند.

استراتژی کراس تنکانسن و کیجنسن:

در دنیای معاملات، افراد زیادی از استراتژی‌های ساده‌ای نظیر استراتژی تقاطع ۱۰/۳۰ استفاده می‌کنند. ۱۰ یک میانگین متحرک ساده و ۳۰ یک میانگین متحرک ساده است. معامله‌گران از این تقاطع همراه با میانگین متحرک ساده ۲۰۰ دوره‌ای استفاده می‌نمایند (SMA). اگر SMA ۱۰ دوره‌ای، SMA ۳۰ دوره‌ای را قطع کند در زمانیکه قیمت بالای SMA ۲۰۰ دوره‌ای می‌باشد، پس معامله‌گر وارد معامله صعودی می‌شود. اگر SMA ۱۰ دوره‌ای زیر SMA ۳۰ دوره‌ای باشد زمانیکه قیمت زیر SMA ۲۰۰ دوره‌ای باشد، پس آنها وارد یک معامله نزولی می‌شوند. SMA ۲۰۰ دوره‌ای نشاندهنده جهت روند است. این استراتژی در حال استفاده می‌باشد و برای سالیان سال جهت معامله مورد استفاده قرار گرفته است. در واقع، تعداد زیادی از استراتژی‌ها بر اساس این استراتژی شکل گرفته‌اند. استراتژی تقاطع تنکانسن/کیجنسن شبیه به این استراتژی است.

قوانین صعودی پایه برای این استراتژی عبارتند از:

- قیمت بالای ابر کومو باشد یا در فاصله خاصی در زیر یک ابر کوموی نازک قرار گرفته باشد. در مورد جفت‌ارزها، از مقدار ۵۰ پیپ زیر ابر کومو در صورتیکه ابر کومو نازک باشد، استفاده می‌نمایم. دنبال یک ابر کوموی نازک هستیم زیرا فرض می‌کنم قیمت می‌خواهد از داخل ابر کومو به سمت خارج و به بالا حرکت نماید.
- تنکانسن از زیر به سمت بالا کیجنسن را قطع کند.
- چیکواسپن در «فضای باز» قرار گرفته باشد.
- قیمت، تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپن نایستی درون ابر کومو باشند. اگر آنها داخل ابر باشند، این ابر باید یک ابر کوموی نازک باشد.
- اختیاری: سنوکواسپن A آینده باید بزرگتر یا مساوی سنوکواسپن B آینده باشد.
- اختیاری: ابر کوموی آینده نباید ضخیم باشد.

قوانین نزولی پایه برای این استراتژی عبارتند از:

- قیمت زیر ابر کومو باشد یا در فاصله خاصی در بالای یک ابر کوموی نازک قرار گرفته باشد. در مورد جفت‌ارزها، از مقدار ۵۰ پیپ بالای ابر کومو در صورتیکه ابر کومو نازک باشد، استفاده می‌نمایم. دنبال یک ابر کوموی نازک هستیم زیرا فرض می‌کنم قیمت می‌خواهد از داخل ابر کومو به سمت خارج و به پائین حرکت نماید.
- تنکانسن از بالا به سمت پائین کیجنسن را قطع کند.

- چیکواسپین در «فضای باز» قرار گرفته باشد.
- قیمت، تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپین نایستی درون ابر کومو باشند. اگر آنها داخل ابر باشند، این ابر باید یک ابر کوموی نازک باشد.
- اختیاری: سنوکواسپین A آینده باید کوچکتر یا مساوی سنوکواسپین B آینده باشد.
- اختیاری: ابر کوموی آینده نباید ضخیم باشد.

شکل ۵-۱: مثالی از یک تقاطع صعودی تنکانسن/کیجنسن را نشان می‌دهد.



شکل ۵-۱: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱۶ مارس ۲۰۰۹

این نمودار یک نمودار جالب است زیرا این نمودار با «چشمان غیر مسلح»، نمودار زشتی به نظر می‌رسد. قیمت بیش از ۲۰۰ پپ از کیجنسن و تنکانسن فاصله دارد و آماده ورود به یک ابر کوموی ضخیم می‌باشد. می‌توانید قوانین پایه را که برایتان مهیا نموده‌ام به نمودار اعمال کنید و خواهید دید که همه این قوانین برای این معامله دارای اعتبار هستند. پیش از انجام این کار، نیاز به ایجاد یک برنامه معاملاتی در مورد قوانین پایه آماده‌سازی شده دارید. هیچ نوع اطلاعاتی در مورد برنامه معاملاتی نظیر اینکه چه «توقفی» را مورد استفاده قرار دهیم، مقدار «حالت محافظتی» چقدر است و در صورتی که «حالت محافظتی» وجود داشته باشد و غیره ارائه نخواهم نمود. در نمودار قبل، نشان دادم چطور یک برنامه معاملاتی برای یک استراتژی، بک تست برنامه معاملاتی، و سپس بهینه‌سازی برنامه معاملاتی را ایجاد نمایید. برای هر کدام از این استراتژی‌های پیشرفته ایچیموکو، نیاز به انجام این کار دارید. جزئیات کامل یا مثالی از برنامه معاملاتی برای این استراتژی‌های پیشرفته در این کتاب وجود نخواهد داشت. دلیل این امر این است که برای درک و استفاده از استراتژی‌های پیشرفته، باید در استفاده از استراتژی پایه ماهر شوید. نیاز است مراحل کامل را فراگیرید و بدانید چطور این کار را انجام دهید زیرا هیچ چیزی «قطعی» نیست. همانطور که بازارها تغییر و تکامل می‌یابند، برنامه‌های معاملاتی نیز تغییر و تکامل می‌یابند.

شکل ۲-۵ مثال دیگری از کراس صعودی تکناسن/کیجنسن است. این نمودار نسبت به مثال قبل بسیار «تمیزتر» به نظر می‌رسد. همه قوانین در وضعیت خوبی قرار دارند بنابراین ورود به یک معامله صعودی بدون هیچ مشکلی می‌تواند تنظیم گردد.



شکل ۲-۵ نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۷ می ۲۰۰۹

شکل ۳-۵ نتایج ورود به معامله صعودی را نشان می‌دهد.



شکل ۳-۵: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱۵ ژوئن ۲۰۰۹

بسته به برنامه معاملاتی‌تان، می‌توانستید از این معامله ۲۵۰ تا ۴۰۰ پیپ سود یا ضرر کسب کنید. اگر از «استراتژی ایده‌آل» استفاده می‌نمودید، پس شما در این معامله سود کمی را کسب می‌نمودید. حالا می‌توانید ملاحظه نمائید که این استراتژی‌های پیشرفته به شما امکان شکار مقدار بیشتری از روند را اعطا می‌نمایند. هرچند، انجام این کار پیامدهایی نیز در پی دارد. شما این پیامدها را همانطور که برنامه معاملاتی‌تان با این استراتژی‌ها را مورد بک‌تست قرار می‌دهید، آشنا می‌شوید.

استراتژی کراس کیجنسن:

این استراتژی را استراتژی معاملاتی روزانه می‌نامیم. استراتژی‌های دیگری را می‌توان برای معاملات روزانه بکار برد اما این استراتژی برای معاملات روزانه یک استراتژی ایده‌آل است زیرا این استراتژی دارای کمترین میزان ریسک در مقایسه به سایر استراتژی‌ها می‌باشد. برای اینکه پائین‌ترین مقدار ریسک را داشته باشیم، مجبورید چیزهای دیگری را رها کنید. آیا کسی می‌تواند حدس بزند این چیزها چیستند؟ خوب، آن احتمال موفقیت است. احتمال موفقیت در این استراتژی پائین‌تر است زیرا در این حالت در مقایسه با سایر استراتژی‌ها، اغلب اوقات استاپ و «توقف» می‌خورید. نسبت سود/ضرر این استراتژی به شدت بالا است.

قوانین پایه صعودی برای این استراتژی عبارتند از:

- قیمت کیجنسن را به سمت بالا قطع کند.
- اگر تنکانسن در زیر کیجنسن قرار دارد، پس تنکانسن باید در زمانی که کیجنسن به صورت مسطح است، به سمت بالا حرکت کند.
- یا تنکانسن بالاتر از کیجنسن قرار داشته باشد.
- چیکواسپن در «فضای باز» قرار گرفته باشد.
- سنوکواسپن A آینده مسطح باشد یا در حال حرکت به سمت بالا باشد.
- اگر سنوکواسپن A آینده کوچکتر از سنوکواسپن B آینده باشد، پس سنوکواسپن A آینده باید به سمت بالا در حال حرکت باشد.
- قیمت، تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپن نباید درون ابر کومو باشند. اگر درون ابر کومو باشند، ابر کومو باید ابری ضخیم باشد.
- قیمت از تنکانسن و کیجنسن دور نباشد.
- اختیاری: ابر کوموی آینده نباید ضخیم باشد.
- قوانین نزولی پایه برای این استراتژی عبارتند از:
- قیمت کیجنسن را به سمت پائین قطع کند.
- اگر تنکانسن در بالای کیجنسن قرار دارد، پس تنکانسن باید در زمانی که کیجنسن به صورت مسطح است، به سمت پائین حرکت کند.
- یا تنکانسن پائین‌تر از کیجنسن قرار داشته باشد.
- چیکواسپن در «فضای باز» قرار گرفته باشد.
- سنوکواسپن A آینده مسطح باشد یا در حال حرکت به سمت پائین باشد.
- اگر سنوکواسپن A آینده بزرگتر از سنوکواسپن B آینده باشد، پس سنوکواسپن A آینده باید به سمت پائین در حال حرکت باشد.

- قیمت، تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپن نباید درون ابر کومو باشند. اگر آنها درون ابر کومو باشند، ابر کومو باید ابری ضخیم باشد.
- قیمت از تنکانسن و کیجنسن دور نباشد.
- اختیاری: ابر کوموی آینده نباید ضخیم باشد.

شکل ۴-۵ مثالی از استراتژی کراس کیجنسن را نشان می‌دهد. همه شرایط به جز یکی مطلوب هستند - چیکواسپن. چیکواسپن هنوز نزولی و درون ابر کومو است. اگر یک ورود به معامله بالای مقاومت اصلی ۱.۳۶۱۵ تنظیم نمائیم پس چیکواسپن دیگر گزینه و مسئله مهمی محسوب نمی‌شود.



شکل ۴-۵: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۲۹ آوریل ۲۰۰۹

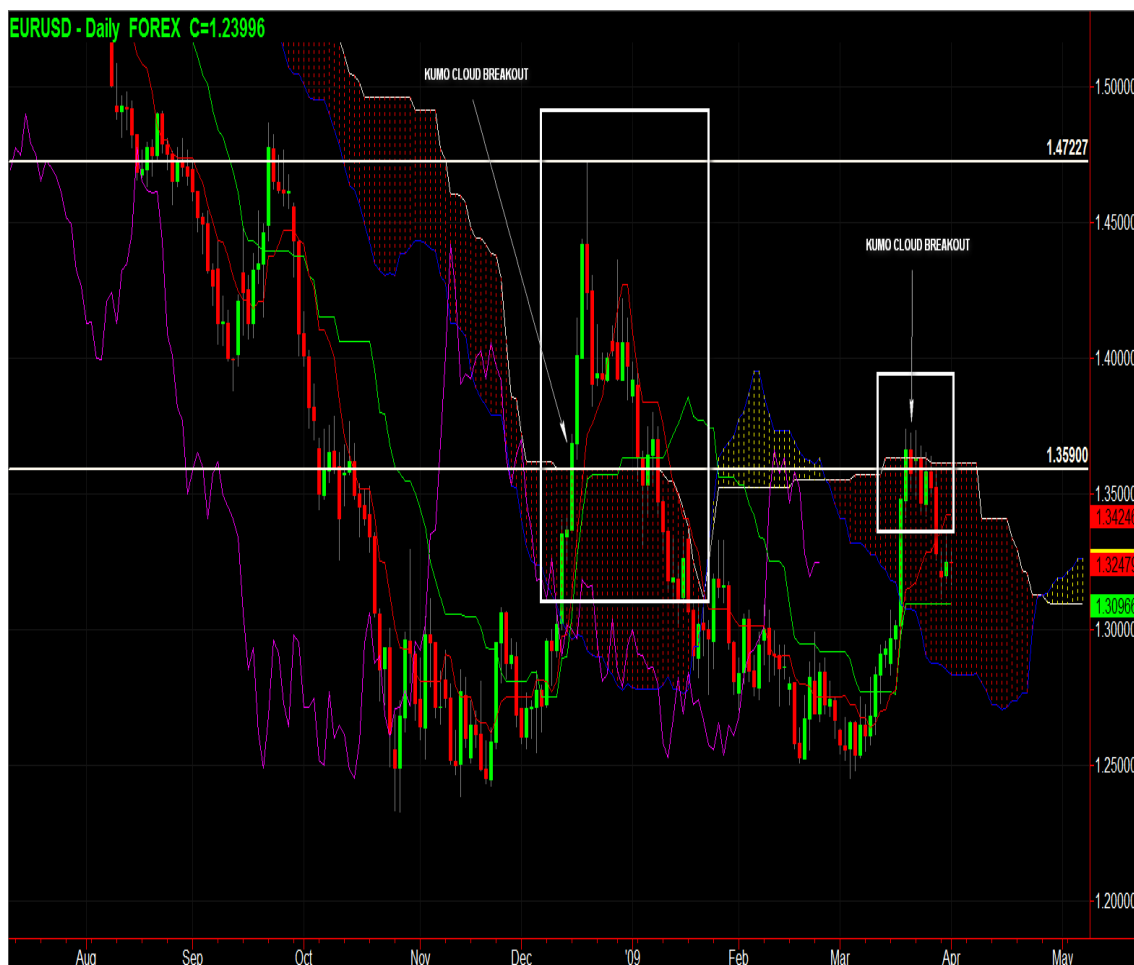
بنابراین، اگر برنامه معاملاتی مان اجازه بدهد می‌توانیم وارد یک معامله صعودی شویم. شکل ۳-۵ نتایج این معامله را نشان می‌دهد. در زمان ورود به این معامله، استراتژی «ایده‌ال» و همچنین استراتژی تنکانسن/کیجنسن نیز در حال مطلوبی قرار خواهند داشت. ممکن است تفاوت کمی در مورد قیمت ورود در این دو استراتژی داشته باشیم اما مقدار این تفاوت چشمگیر نمی‌باشد.

استراتژی بریک‌اوت ابر کومو:

این استراتژی دارای کمترین محبوبیت در بین استراتژی‌های من است. اساساً، به محض اینکه قیمت ابر کومو را قطع کند، وارد یک معامله می‌شوید. من این استراتژی را زیاد دوست ندارم زیرا زمان‌های زیادی است که قیمت ابر کومو را قطع می‌کند و سپس کندل یا کندل‌های بعدی مسیر را عوض می‌کنند. این حالت اساساً یک فیک‌بریک‌اوت از مقاومت یا حمایت اصلی است.

قوانین صعودی پایه برای این استراتژی عبارتند از:

- قیمت در بالای ابر کومو بسته شود.
 - اگر تنکانسن در زیر کیجنسن است پس در حالیکه کیجنسن مسطح است، تنکانسن باید به سمت بالا در حال حرکت باشد.
 - یا تنکانسن از کیجنسن بالاتر باشد.
 - چیکواسپن در «فضای باز» قرار داشته باشد.
 - سنوکواسپن B آینده مسطح باشد یا به سمت بالا در حال حرکت باشد.
 - اگر سنوکواسپن A آینده کوچکتر از سنوکواسپن B آینده است، پس سنوکواسپن A آینده باید به سمت بالا در حال حرکت باشد.
 - قیمت، تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپن نایستی درون ابر کومو باشند. اگر آنها درون ابر کومو باشند، این ابر باید ابری ضخیم باشد.
 - قیمت از تنکانسن و کیجنسن خیلی فاصله نداشته باشد.
 - اختیاری: ابر کوموی آینده نباید ضخیم باشد.
- قوانین پایه نزولی برای این استراتژی عبارتند از:
- قیمت در زیر ابر کومو بسته شود.
 - اگر تنکانسن در بالای کیجنسن است پس در حالیکه کیجنسن مسطح است، تنکانسن باید به سمت پایین در حال حرکت باشد.
 - یا تنکانسن از کیجنسن پایین تر باشد.
 - چیکواسپن در «فضای باز» قرار داشته باشد.
 - سنوکواسپن B آینده مسطح باشد یا به سمت پایین در حال حرکت باشد.
 - اگر سنوکواسپن A آینده بزرگتر از سنوکواسپن B آینده است، پس سنوکواسپن A آینده باید به سمت پایین در حال حرکت باشد.
 - قیمت، تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپن نایستی درون ابر کومو باشند. اگر آنها درون ابر کومو باشند، این ابر باید ابری ضخیم باشد.
 - قیمت از تنکانسن و کیجنسن خیلی فاصله نداشته باشد.
 - اختیاری: ابر کوموی آینده نباید ضخیم باشد.
- شکل ۵-۵ مثالی از استراتژی بریک‌اوت ابر کومو را نشان می‌دهد.



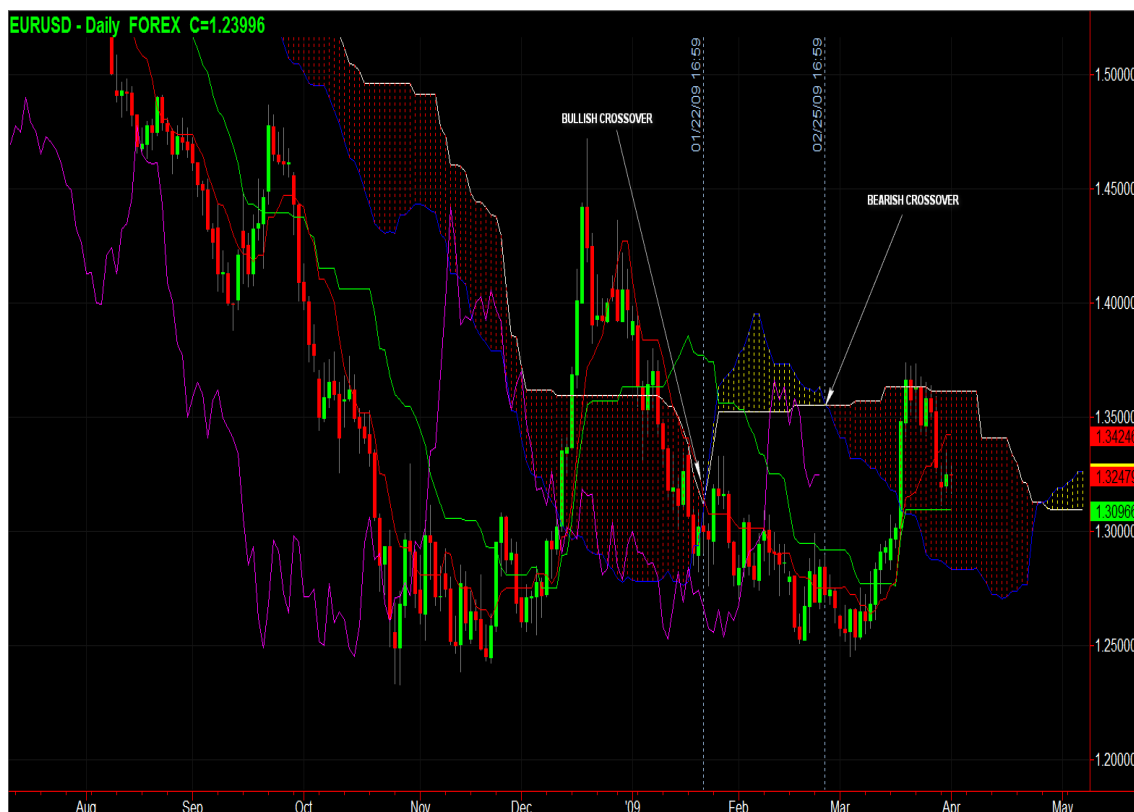
شکل ۵-۵: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱ می ۲۰۰۹

توجه داشته باشید دو بریک‌اوت وجود داشت که برای این کالا در طی یک دوره شش ماهه رخ داده بود. اولین بریک‌اوت ۱۰۰۰ پیپ سود و دومین بریک‌اوت کمتر از ۱۰۰ پیپ سود داشت. اگر کندل‌های قیمت بعد از کندل بریک‌اوت را نمی‌دیدید، آیا فکر می‌کنید هر دو بریک‌اوت یکسان و مشابه بودند؟ تنظیمات مربوط به کندل‌ها یکسان و مشابه به نظر می‌رسند. در هر دو نوع بریک‌اوت تنکانسن و کیجنسن در حال عبور از داخل ابر کومو بودند. در هر دو بریک‌اوت چیکواسپن در «فضای باز» قرار داشت. هر دو دارای ابر کوموی آینده‌ای بودند که صعودی بود. از لحاظ نظری، هیچ تفاوت بزرگی بین آنها وجود ندارد. یکی از این بریک‌اوت‌ها موفقیت‌آمیز بود و دیگری بسیار ناموفق. این استراتژی به نفسه یک استراتژی ضعیف است. اگر این استراتژی را با سایر استراتژی‌ها ترکیب کنید آنگاه به یک استراتژی قوی مبدل می‌شود.

استراتژی کراس سنوکواسپن‌های آینده:

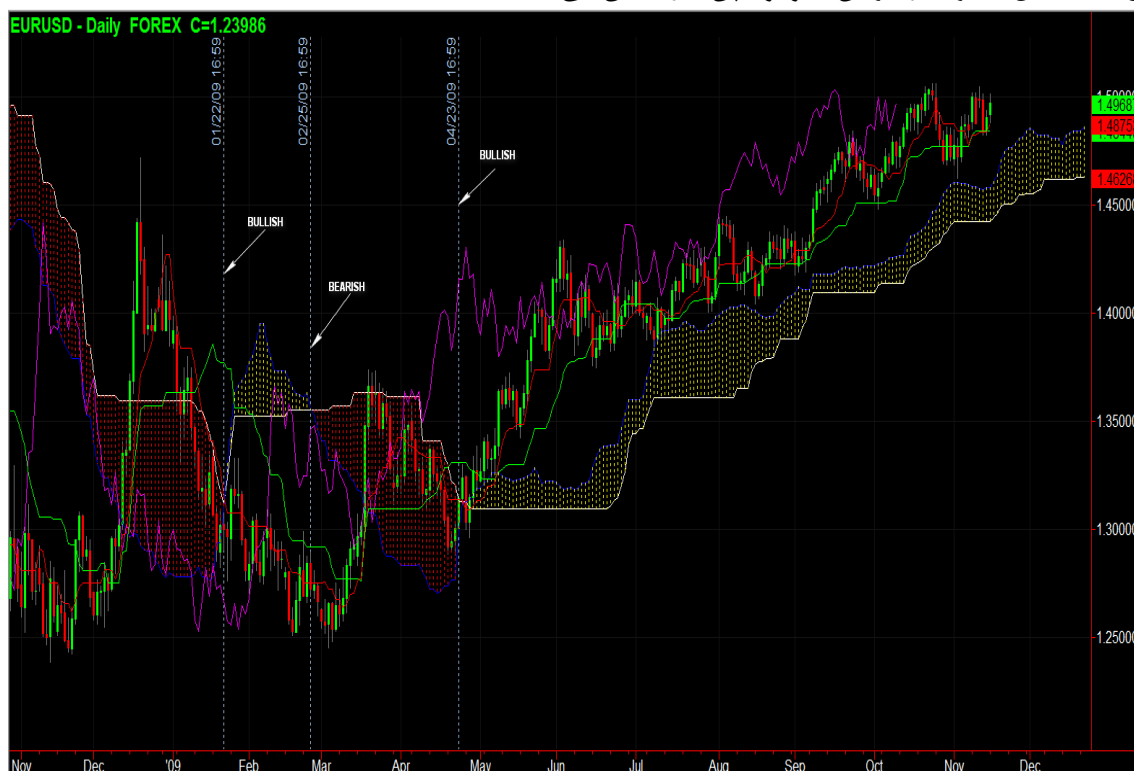
این استراتژی یک استراتژی جالب است. برای من، این استراتژی بیش از یک استراتژی مبتنی بر زمان است. می‌توانید از طریق نمودارها محل‌هایی که سنوکواسپن A، سنوکواسپن B را قطع نموده، مشاهده نمائید. بنابراین، می‌توانید یک خط زمانی عمودی بر روی آن نقطه کراس ترسیم نمائید. پس این خط زمانی یک نقطه احتمالی برگشت روند یا ادامه یک روند را مشخص می‌سازد. به نفسه، فکر نمی‌کنم این استراتژی یک استراتژی قدرتمند باشد. هرچند، با ترکیب این استراتژی با سایر استراتژی‌های پیشین، این استراتژی به یک استراتژی قدرتمند مبدل می‌شود. قوانین صعودی پایه برای این استراتژی عبارتند از:

- سنوکواسپین A حال حاضر بالاتر از سنوکواسپین B حال حاضر باشد.
 - قیمت بالای ابر کومو بسته شود.
 - اگر تنکانسن پائین تر از کیجنسن است، پس تنکانسن باید در حالیکه کیجنسن مسطح است، به سمت بالا حرکت نماید.
 - یا تنکانسن از کیجنسن بالاتر باشد.
 - چیکواسپین در «فضای باز» قرار داشته باشد.
 - سنوکواسپین B آینده مسطح باشد یا در حال حرکت به سمت بالا باشد.
 - اگر سنوکواسپین A آینده کوچکتر از سنوکواسپین B آینده باشد، پس سنوکواسپین A آینده باید در حال حرکت به سمت بالا باشد.
 - قیمت، تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپین نباید درون ابر کومو باشند. اگر آنها داخل ابر کومو باشند، این ابر نباید یک ابر ضخیم باشد.
 - قیمت از تنکانسن و کیجنسن فاصله زیادی نداشته باشد.
 - اختیاری: ابر کوموی آینده نباید ضخیم باشد.
 - قوانین نزولی پایه برای این استراتژی عبارتند از:
 - سنوکواسپین A حال حاضر پائین تر از سنوکواسپین B حال حاضر باشد.
 - قیمت زیر ابر کومو بسته شود.
 - اگر تنکانسن بالاتر از کیجنسن است، پس تنکانسن باید در حالیکه کیجنسن مسطح است، به سمت پائین حرکت نماید.
 - یا تنکانسن از کیجنسن پائین تر باشد.
 - چیکواسپین در «فضای باز» قرار داشته باشد.
 - سنوکواسپین B آینده مسطح باشد یا در حال حرکت به سمت پائین باشد.
 - اگر سنوکواسپین A آینده بزرگتر از سنوکواسپین B آینده باشد، پس سنوکواسپین A آینده باید در حال حرکت به سمت پائین باشد.
 - قیمت، تنکانسن، کیجنسن و چیکواسپین نباید درون ابر کومو باشند. اگر آنها داخل ابر کومو باشند، این ابر نباید یک ابر ضخیم باشد.
 - قیمت از تنکانسن و کیجنسن فاصله زیادی نداشته باشد.
 - اختیاری: ابر کوموی آینده نباید ضخیم باشد.
- شکل ۵-۶ مثالی از استراتژی کراس سنوکواسپین A و سنوکواسپین B را نشان می‌دهد.



شکل ۵-۶: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱ آوریل ۲۰۰۹

خط عمودی برای هر کراس (تقاطع) قرار داده‌ایم و نوع کراس را نیز مشخص کرده‌ایم. توجه نمائید هیچ یک از کراس‌های سنوکواسپین‌ها هرگز عمل ننمودند.
شکل ۵-۷: مثال دیگری از کراس سنوکواسپین‌ها را نشان می‌دهد.



شکل ۵-۷: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱ آوریل ۲۰۰۹

در این زمان، کراس سنوکواسپن صعودی عمل نموده و واقعاً هم به خوبی کار کرده است. اگر در این زمان سیگنال‌هایی از کراس مشاهده نمودید، همه استراتژی‌های دیگر نیز در این زمان سیگنال‌های ورود را نیز نشان می‌دهند. آیا این جالب نیست؟

این امر چشم‌انداز جالبی برایمان به ارمغان می‌آورد. اکنون همه استراتژی‌ها را به صورت مجزا مورد بحث قرار دادیم و مزایا و معایب هر استراتژی را نیز شرح دادیم. هنگام اجرای هر استراتژی، باید توجه داشته باشیم بالاترین احتمال موفقیت زمانی مشاهده می‌شود که دو یا بیش از دو استراتژی سیگنال‌های ورودی را در قیمت‌های نزدیک به هم نشان دهند. در شکل ۵-۷، آخرین سیگنال دارای چهار استراتژی است که نشان‌دهنده سیگنال‌های ورودی به فاصله چهار روز از یکدیگر می‌باشند. توجه داشته باشید نتایج نهایی این معامله این است که روند برای یک دوره هفت ماهه ۲۰۰۰ پیپ پیش رفت.

در اینجا ترکیباتی از استراتژی‌های مفید قرار دارد که از آنها استفاده می‌نمایم:

- کراس کیجنسن و سپس کراس تنکانسن و کیجنسن.
- استراتژی بریک‌اوت کومو و سپس کراس تنکانسن و کیجنسن.

فصل ۶

عناصر زمانی ایچیمو کو

معمولاً در بیان بحث عناصر زمانی ایچیموکو دچار تردید می‌شوم. به این دلیل که عناصر زمانی ایچیموکو، پیچیده‌ترین عنصر ایچیموکو هستند. همچنین، بدون درک ارتباط ایچیموکو با قیمت، اگر غیرممکن نباشد، درک عنصر زمانی کاری بسیار مشکل است. فقط به دلیل اشاره به مباحث زمانی در فروم ایچیموکو، در این زمینه مطالبی را در این کتاب خواهم نوشت. در معاملات، از عناصر زمانی ایچیموکو استفاده نمی‌کنم. به جای آن از عناصر زمانی دابلو. دی. گان استفاده می‌نمایم. شباهت‌های زیادی بین این دو نظریه وجود دارد اما ترجیح می‌دهم دابلو. دی. گان استفاده نمایم. اکنون بین این دو نظریه مقایسه‌ای انجام خواهم داد و به شما اجازه می‌دهم خودتان تصمیم بگیرید کدام یک بهترین نظریه است.

عناصر زمانی ایچیموکو:

پیش از ورود به بحث عناصر زمانی، اجازه دهید برای این آنالیز فرضیاتی را در نظر بگیریم. هنگام آنالیز بازار سهام، با یک مسئله مهم روبرو هستید که آیا باید تعطیلات آخر هفته را در تحلیل‌هایتان در نظر بگیرید یا خیر. تعطیلات آخر هفته روزهایی هستند که در آنها معامله‌ای صورت نمی‌گیرد. برخی افراد تعطیلات را در تخمین‌های زمانی‌شان وارد می‌کنند و برخی از این کار خودداری می‌نمایند. چه باور کنید یا نه، هیچ پاسخ درست یا اشتباهی وجود ندارد. بنابراین باید چکار کنید؟ خوب، بهترین کاری که می‌توانید انجام دهید این است که قوانین ایچیموکو را بپذیرید و دیگر به این مسائل فکر نکنید. تا زمانی‌که این فرضیات را تغییر نداده‌اید، کلیه پیش‌بینی‌های زمانی‌تان در ایچیموکو معتبر است. اگر به طور شانس، این فرضیه تغییر نماید، پس مجبورید همه پژوهش‌هایتان را دوباره انجام دهید. دومین فرضیه این است که عناصر زمانی ایچیموکو اساساً برای تایم‌فریم‌های روزانه و هفتگی کار می‌کند. می‌توانید از این عناصر در تایم‌فریم‌های زمانی پائین‌تر استفاده نمائید اما بر اساس تجربه شخصی من این عناصر در تایم‌فریم‌های پائین‌تر خیلی موثر نیستند. لطفاً درستی این امر را از طریق بک‌تست و آنالیز نمودارها به خودتان اثبات نمائید.

جدول ۱-۶ عناصر زمانی ایچیموکو را شرح می‌دهد.

اعداد اصلی معامله

9
17
26
33
42
51
65
76
83
97
101
129
172
200
257

در جدول فوق اعداد اصلی، اعداد ۹، ۱۷ و ۲۶ هستند. اعداد ۹ و ۲۶ از فرمول ایچیموکو در مورد تنکانسن و کیجنسن نشأت گرفته‌اند. کلیه اعداد دیگر از جمع یا تفریق این اعداد با سایر مشتقات این اعداد به دست آمده‌اند. عبارات فوق، ممکن است باعث گیج شدن گردند اما با نمایش محاسبات واقعی عناصر زمانی ایچیموکو، فلسفه آنها را درک خواهید نمود. این محاسبات را می‌توانید در جدول ۲-۶ ملاحظه نمایید.

جدول ۲-۶: محاسبات مقادیر عناصر زمانی ایچیموکو

9	9
17	$9 + 9 - 1$
26	$9 + 9 + 9 - 1$
33	$26 + 9 - 1$
42	$26 + 17 - 1$
65	$33 + 33 - 1$
76	$26 + 26 + 26 - 2$
129	$65 + 65 - 1$
172	$65 + 42 + 42 + 26 - 3$
257	$129 + 129 - 1$

در زمینه این که چطور این محاسبات به دست آمده‌اند؛ نمی‌توانم الگویی مشاهده کنم و به جای درک محاسبات آنها، فقط این اعداد قبول نموده‌ام و این مقادیر را در نمودارها برای کالاهای مختلف اعمال می‌نمایم. متوجه خواهید شد در برخی مقالات افراد دامنه‌هایی در حول مقادیر اصلی قرار داده‌اند. به عنوان مثال، اولین عنصر زمانی اصلی ایچیموکو عدد ۹ است. برخی از افراد می‌گویند عدد ۹ زمانی معتبر است که این عدد بین ۷ و ۱۱ قرار داشته باشد. این محدوده اعدادی است که باعث می‌شوند عنصر زمانی ایچیموکو ۹ دارای اعتبار گردد. جدول ۳-۶ دامنه‌های معتبر عناصر زمانی ایچیموکو را نشان می‌دهد.

جدول ۳-۶: اعداد و دامنه عناصر زمانی ایچیموکو

Key Trading Number	Range
9	7-11
17	13-21
26	24-28
33	30-37
42	39-46
51	56-72

آیا مشکلی در زمینه نظریه دامنه‌های عناصر زمانی ایچیموکو که در شکل ۲-۶ نشان داده شده ملاحظه نمودید؟ اگر این محدوده‌ها را با عناصر زمانی ایچیموکو در نظر بگیرید، تقریباً همه اعداد را دربرخواهد گرفت. استفاده از دامنه‌های زمانی باعث می‌شود به جای اینکه اعداد کمی وجود داشته باشند، تعداد زیادی عدد را دربرخواهند گرفت. بنابراین بهتر

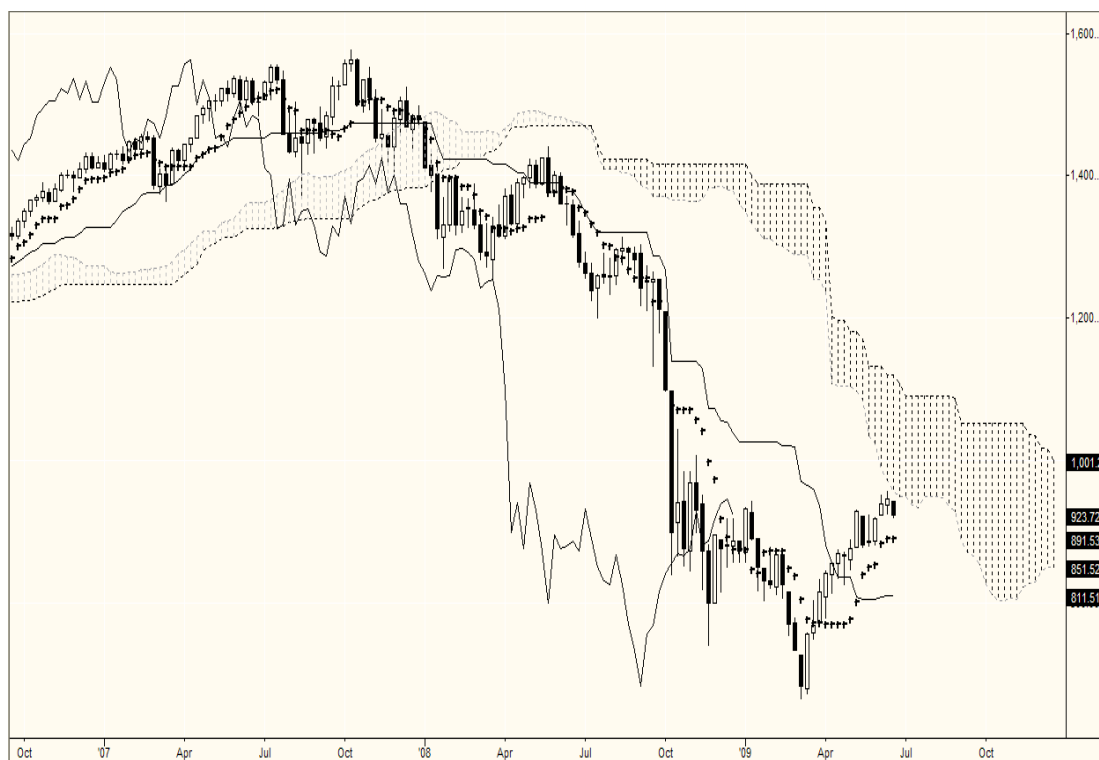
نیست اعدادی که در این محدوده قرار نگرفته‌اند را مورد بررسی و آنالیز قرار دهیم؟ در این صورت نمونه کوچکتری خواهید داشت. به عنوان مثال، بین ۷ و ۲۱، تنها عددی که در این محدوده قرار نگرفته است، عدد ۱۲ است. این مسئله چطور کمکمان می‌کند؟ این امر به هیچ‌وجه سودمند نیست. بنابراین، از محدوده اعداد در مورد عناصر زمانی ایچیموکو استفاده نکنید. شما فقط مجازید از یک عدد قبل و بعد هر عنصر زمانی استفاده نمائید.

شکل ۱-۶ نمودار روزانه EURUSD را در ۱۶ جولای ۲۰۰۹ نشان می‌دهد.



شکل ۱-۶: نمودار روزانه ایچیموکو EURUSD، ۱۶ ژوئن ۲۰۰۹

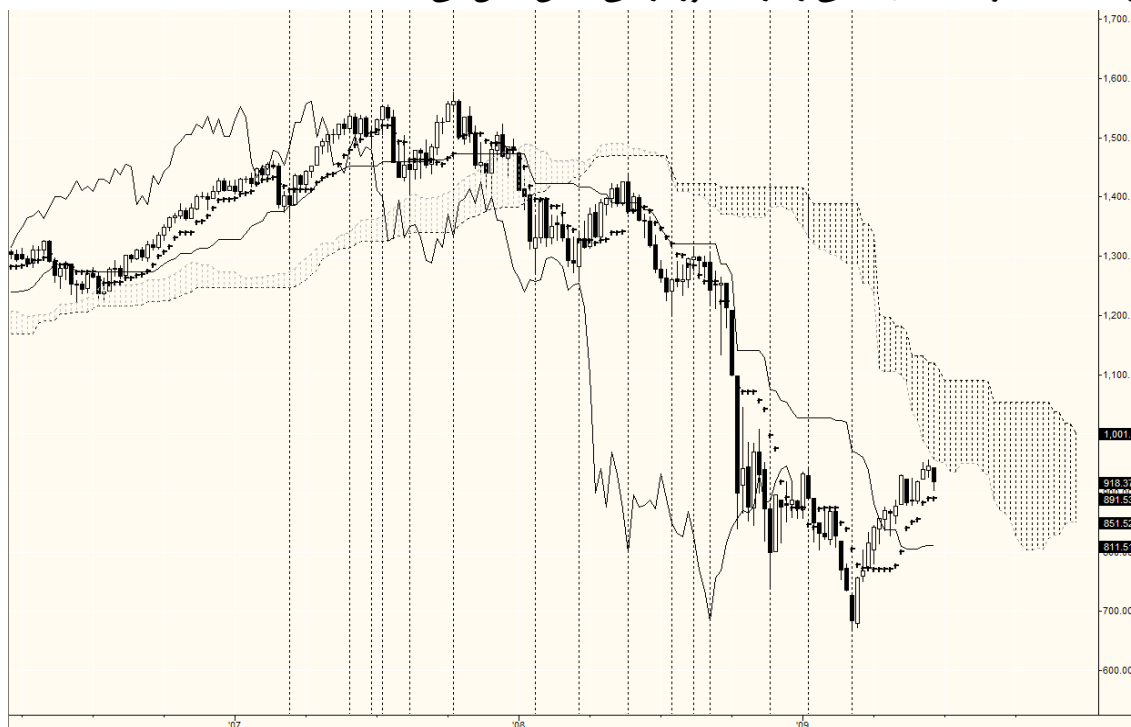
این نمودار برخی از عناصر زمانی ایچیموکو را شرح می‌دهد که با استفاده از اعداد ۹، ۳۳، ۴۳ و ۶۶ ایجاد شده‌اند. توجه کنید که ۴۳ به اندازه ۱ واحد از عدد ۴۲ بیشتر است و عدد ۶۶ نیز یک واحد از عدد ۶۵ بیشتر است. پذیرش این اعداد به میزان ۱ واحد بیشتر از اعداد زمانی ایچیموکو امری قابل قبول است. هیچ دلیلی علمی قطعی در معامله با انحراف ± 1 وجود ندارد، بنابراین این مقادیر قابل قبول می‌باشند. چطور این اعداد را بدست آوردید؟ چطور از عناصر زمانی ایچیموکو استفاده می‌کنید؟ بیایید مرحله به مرحله پیش برویم تا نشان دهیم چطور عناصر زمانی ایچیموکو بر زمان تاثیر می‌گذارند. همانطور که در شکل ۲-۶ نشان داده شده، ابتدا کارمان را با ملاحظه نمودار هفتگی SPX در ۱۹ ژوئن ۲۰۰۹ شروع می‌کنیم.



شکل ۲-۶: نمودار هفتگی ایچیموکو SPX، ۱۹ ژوئن ۲۰۰۹

سپس، خطوط عمودی را در هر برگشت قیمت قرار دهید. تعریف برگشت قیمت چیست؟ قیمت برگشتی زمانی است که قیمت تغییر جهت داده و جهت‌شان حداقل به میزان دو کندل با نقاط «بالای بالاتر» یا «پائین پائین‌تر» بر اساس جهت برگشت قیمت، برگشت نموده است. این کاری خسته‌کننده است اما این چیزی است که نیاز داریم انجام دهیم تا عناصر زمانی ایچیموکو را بیاموزیم.

شکل ۳-۶: کلیه برگشت‌های قیمتی را در یک دوره زمانی خاص نشان می‌دهد.



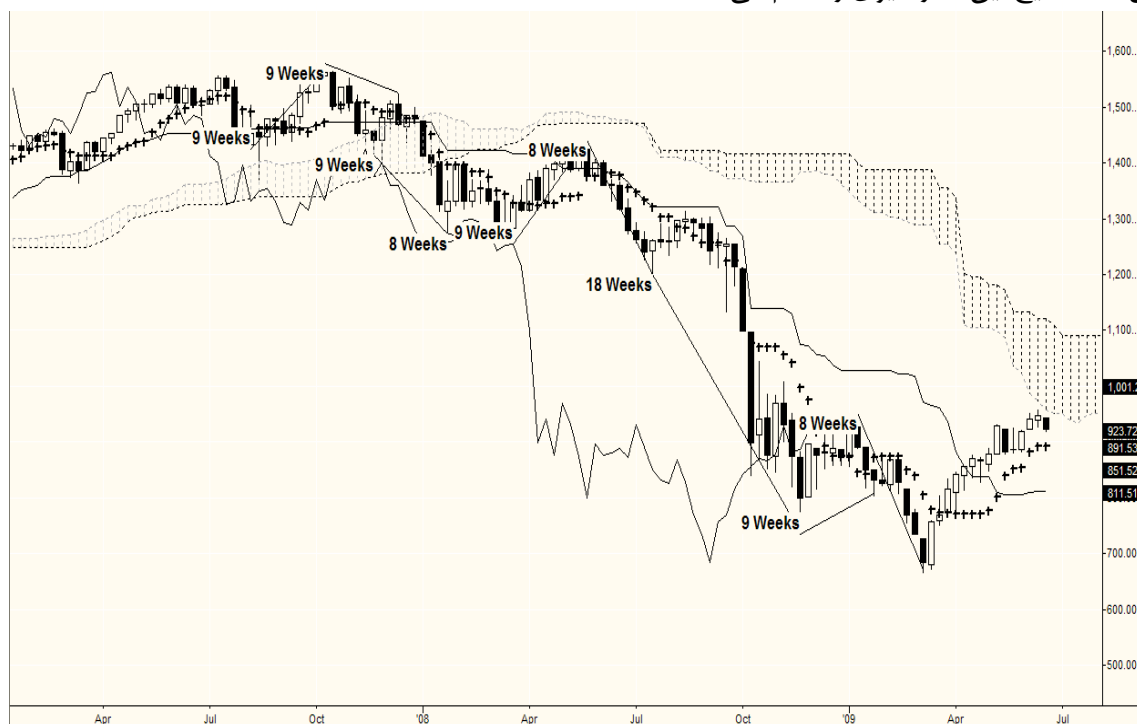
شکل ۳-۶: نمودار هفتگی ایچیموکو SPX، ۱۹ ژوئن ۲۰۰۹

یکی از مسائلی که ممکن است با آن روبرو شوید زمانی است که دو کندل قیمتی با بالا یا پائین یکسان در نقطه برگشت قیمت داشته باشید. خط عمودی تان را کجا قرار دهید؟ برای این کندل هیچ پاسخ صحیح یا غلطی وجود ندارد. مجبورید هر دو حالت را بررسی کنید و ملاحظه کنید عناصر زمانی در کدام حالت دارای بهترین شرایط است. اولین خط عمودی در سمت چپ شکل ۳-۶ دو کندل متعارض را نشان می‌دهد.

زمانیکه خط عمودی بر روی نمودار قرار گرفت، تلاش کنید کلیه مقادیر زمانی مختلف بین خطوط عمودی را مشخص نمایید. به طور متوالی به جلو حرکت می‌کنم. منظور من این است آنچه که ابتدا نیاز دارید اندازه‌گیری فاصله زمانی بین اولین خط عمودی و دومین خط عمودی است. اگر این مقدار مساوی یکی از مقادیر زمانی ایچیموکو بود یا با فاصله ۱ واحد از آن قرار داشت، پس این اندازه‌گیری را حفظ کنید. سپس، نیاز به اندازه‌گیری اولین خط عمودی و سومین خط عمودی دارید. اگر این مقدار مساوی یکی از مقادیر زمانی ایچیموکو یا با فاصله ۱ واحد از آن قرار داشت، پس شما اندازه‌گیری زمانی تان را حفظ کنید. در نهایت، فاصله بین اولین خط عمودی و چهارمین خط عمودی را اندازه‌گیری کنید. به انجام این مراحل به طور مکرر ادامه دهید تا زمانیکه اولین خط عمودی را با همه خطوط عمودی دیگر مقایسه نمایید. همه اندازه‌گیری‌هایی که مساوی یکی از مقادیر زمانی ایچیموکو یا ۱ واحد بیشتر از آنها می‌باشند را حفظ کنید. اکنون، توالی بررسی اولین خط عمودی را نسبت به کلیه خطوط عمودی آینده تکمیل نموده‌اید (یعنی، خطوط سمت راست خطی که در حال اندازه‌گیری فاصله نسبت به آن هستید).

زمانیکه این کار انجام پذیرفت، دومین خط عمودی را در نظر بگیرید و مقدار فاصله این خط را با هر خط عمودی دیگر در آینده (سمت راست) مقایسه کنید. به انجام این کار ادامه دهید تا زمانیکه این خطوط عمودی نسبت به کلیه خطوط عمودی دیگر مورد اندازه‌گیری قرار گیرد. زمانی را برای انجام این اندازه‌گیری‌ها به طور کامل اختصاص دهید. از هیچ میانبری استفاده نکنید. انجام کارهای تکراری خسته‌کننده است اما این کاری است که نیاز دارید انجام دهید بنابراین در واقع درک خواهید کرد چطور عناصر زمانی برای ترید عمل خواهند کرد.

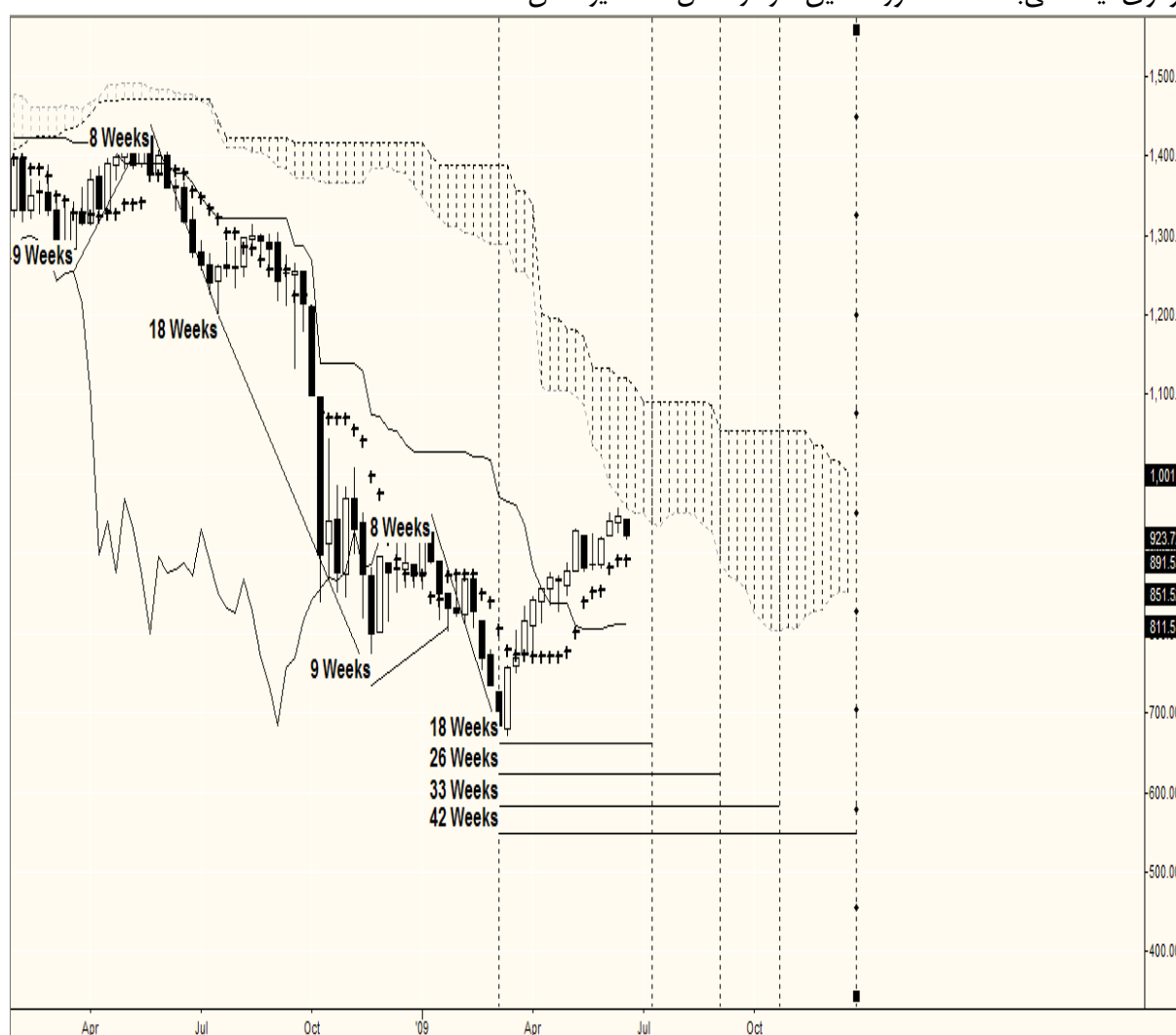
شکل ۴-۶ نتایج این اندازه‌گیری را نشام می‌دهد.



شکل ۴-۶: نمودار هفتگی ایچیموکو SPX، ۱۹ ژوئن ۲۰۰۹

ممکن است اعدادی را داشته باشید که من ندارم اما در مورد این اعداد نگران نباشید. هیچ پاسخ صحیح یا غلطی در این زمینه وجود ندارد. توجه داشته باشید چطور قیمت در برخورد با عناصر تطابق یافته زمانی ایچیموکو برگشت می نماید؟ اعداد زمانی در آغاز روندهای نزولی دقیق هستند اما زمانیکه یک روند قوی، بیش از ۱۸ هفته رخ می دهد، در واقع هیچ تطابق و سازگاری با عناصر زمانی ایچیموکو وجود ندارد. آیا این اتفاق می تواند رخ دهد؟ بله، این اتفاق می تواند اغلب اوقات بیش از آنچه در باور شما می گنجد، رخ دهد. عناصر زمانی نشان دهنده برگشت احتمالی قیمت هستند. عناصر زمانی به خودی خود خیلی ارزشمند نیستند. هرچند، زمانیکه این اعداد با آنالیز تکنیکال ترکیب می شوند، به شدت می توانند کمک کنند.

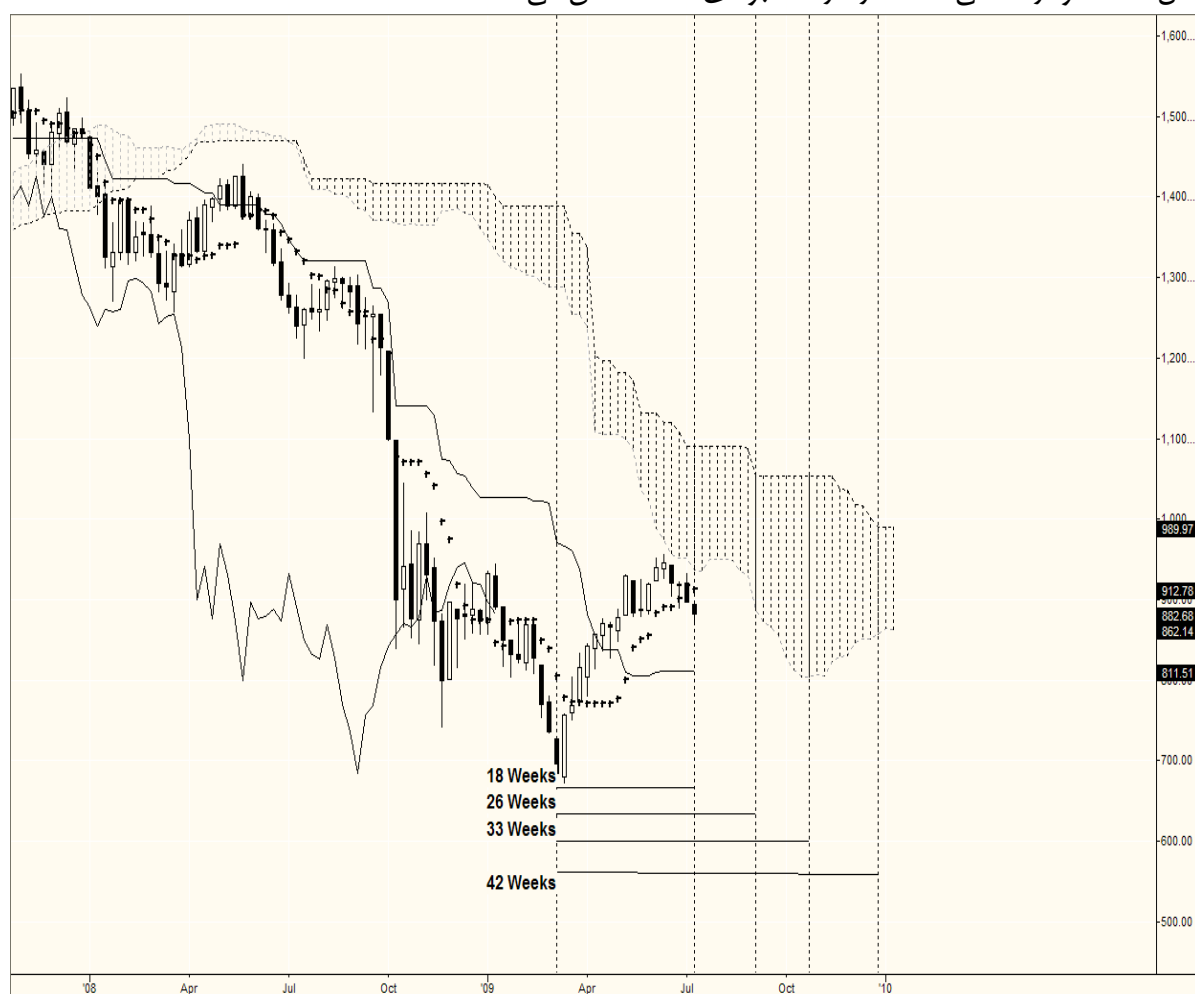
چطور می توانم از این عناصر زمانی برای معامله استفاده نمایم؟ روشی که من از عناصر زمانی ایچیموکو استفاده می کنم قراردادن خطوط عمودی بر روی چارت برای کلیه عناصر زمانی اصلی ایچیموکو از آخرین برگشت قیمت تا ابرهای کوموی آینده می باشد، همانطور که این امر در شکل ۵-۶ نیز نشان داده شده است.



شکل ۵-۶: نمودار هفتگی ایچیموکو SPX، ۱۹ ژوئن ۲۰۰۹

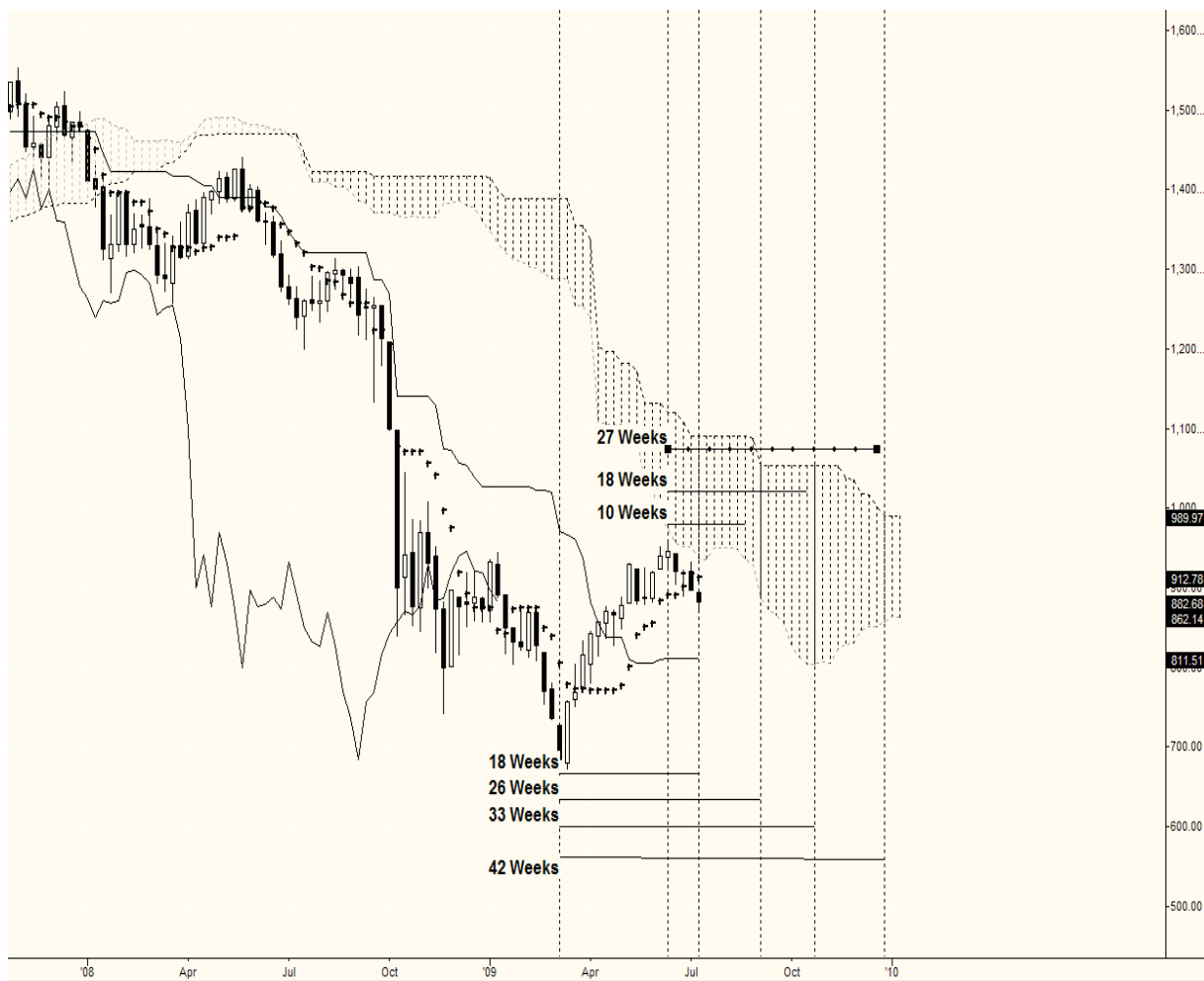
زمانیکه خطوط عمودی قرار داده شدند، من به این خطوط عمودی برای دریافت اظهارها مراجعه می کنم. با این روش، زمانیکه تاریخ معامله حال حاضر به سمت یکی از این خطوط عمودی در حال حرکت می باشد، بلافاصله متوجه می شوم. سپس به نمودار اظهار داده شده می روم و آنالیزهای تکنیکال جهت تعیین وجود ترید در این نمودار را انجام می دهم. اگر تریدی در این نمودار وجود نداشت، کلیه اظهارهایم را بازنشانی می کنم و به حرکت خودم ادامه می دهم.

شکل ۶-۶ نمودار هفتگی SPX را در ۱۰ جولای ۲۰۰۹ نشان می‌دهد.



شکل ۶-۶: نمودار هفتگی ایچیموکو SPX، ۱۹ ژوئن ۲۰۰۹

اولین اخطارمان راه‌اندازی شده و نمودارها را بر اساس آنالیز تکنیکال مان مورد بررسی قرار می‌دهیم. در حال حاضر، هیچ تریدی وجود ندارد بنابراین به حرکت به سمت جلو ادامه می‌دهیم. پیش از این که به جلو حرکت کنیم، اکنون باید عناصر زمانی را در آخرین نقطه برگشت قیمت بیافزاییم. مجبوریم این کار را در هر نقطه برگشت قیمتی انجام دهیم. شکل ۶-۷ افزودن خطوط عمودی را در برگشت قیمت پیشین نشان می‌دهد.



شکل ۷-۶: نمودار هفتگی ایچیموکو SPX، ۱۷ نوامبر ۲۰۰۹

شکل ۷-۶ نمودار SPX را در ۱۷ نوامبر ۲۰۰۹ نشان می‌دهد. می‌توانیم ملاحظه نمائید چطور عناصر زمانی طراحی شده در گذشته بر برگشت‌های قیمتی در آینده تاثیر گذاشته‌اند. این تاثیر می‌تواند کم (مینور) یا زیاد (ماژور) باشد. ما از مربع اعداد زوج و فرد استفاده می‌کنیم تا نه تنها نشانه‌ای از حرکت بازار بیابیم، بلکه حتی بتوانیم دلیل این حرکت را نیز بیابیم.

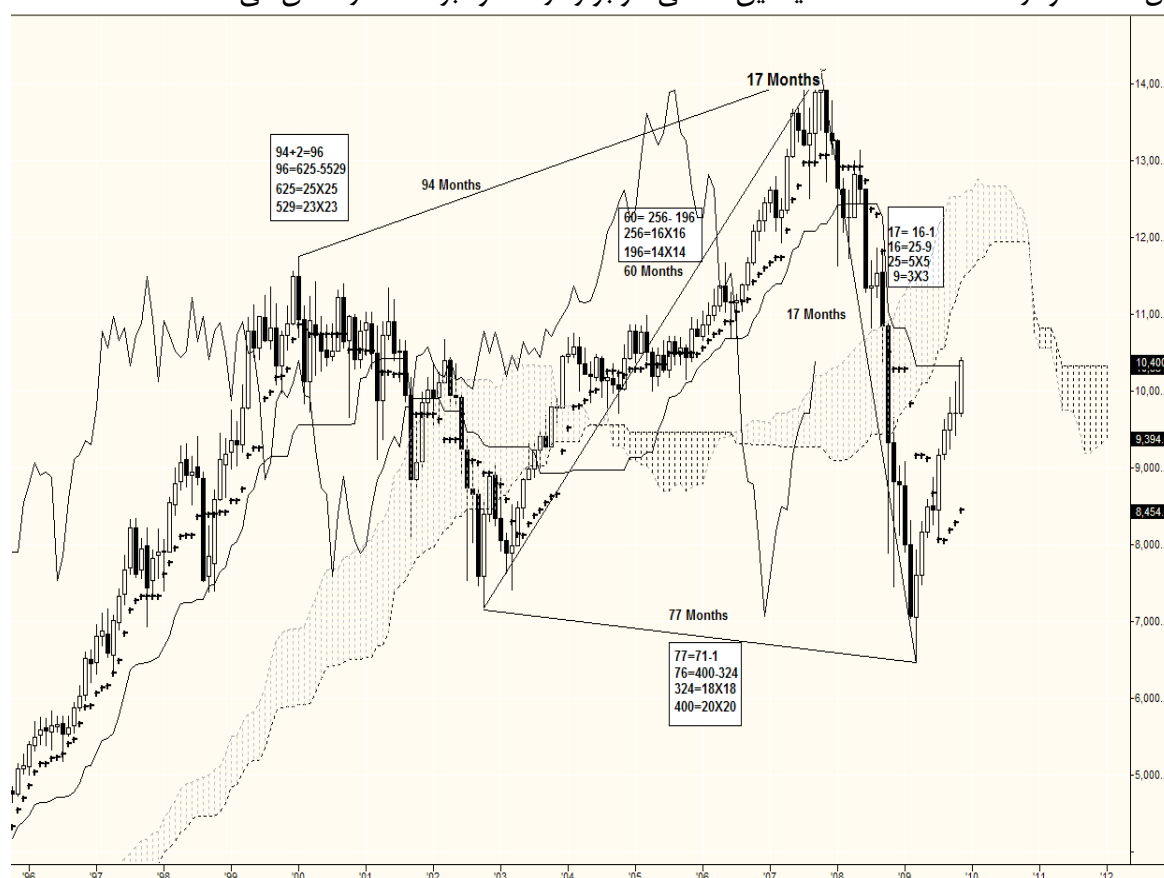
- دابلو. دی. گان

این نقل قول نشان می‌دهد چطور دابلو. دی گان بسیاری از این نظریه‌ها را به دست آورده است. ما عناصر زمانی ایچیموکو را به طور دقیق مورد بحث قرار دادیم. اکنون به طور مختصر سراغ عناصر زمانی دابلو. دی. گان می‌رویم. هیچ راهی وجود ندارد که بتوانیم همه نظریه‌های عناصر زمانی دابلو. دی. گان را در این کتاب بررسی نمائیم. کتاب‌ها و سمینارهای زیادی در مورد نظریه گان وجود دارد. در واقع، یک عمر طول می‌کشد تا در همه و یا حتی در بخشی از این نظریه‌ها مهارت پیدا نمائیم. این کار برای من بیش از دو سال به طول انجامید تا درک کاملی از برخی از این کارها به دست آورم. امروزه، از بسیاری از این محاسبات زمانی برای برگشت‌های قیمت در آینده استفاده می‌نمائیم. عناصر زمانی که در این کتاب بر روی آنها متمرکز شده‌ایم فقط برخی از این نظریه را شرح می‌دهد که شامل مربع اعداد فرد است. جدول ۴-۶ توالی اعداد فرد را بیان می‌کند.

جدول ۴-۶: جدول مربع چندتایی اعداد فرد

Number	Odd Multiple	Subtract
1	1×1	
9	3×3	$9 - 1 = 8$
25	5×5	$25 - 9 = 16$
49	7×7	$49 - 25 = 24$
81	9×9	$81 - 49 = 32$
121	11×11	$121 - 81 = 40$
169	13×13	$169 - 121 = 48$
225	15×15	$225 - 169 = 56$
289	17×17	$289 - 225 = 64$
361	19×19	$361 - 289 = 72$
441	21×21	$441 - 361 = 80$
529	23×23	$529 - 441 = 88$
625	25×25	$625 - 529 = 96$

محاسبات ساده است. اولین مربع اعداد فرد با یکدیگر است که در ستون سمت چپ شرح داده شده است. سپس، مربع یک عدد را گرفته و آن را از مربع مقدار قبلی تفریق می‌کنیم. این محاسبات در سمت راست نشان داده شده است. اکنون کلیه عناصر زمانی موردنیازمان را داریم که نشان می‌دهد برگشت‌های احتمالی قیمت در این زمان‌ها رخ می‌دهد. اکنون زمان آن رسیده که این مقادیر را به نمودارها درست مانند آنچه در مورد عناصر زمانی ایچیموکو انجام دادیم، بیافزاییم. شکل ۸-۶ نمودار ماهانه \$INDU، میانگین صنعتی داو جونز در ۳۰ نوامبر ۲۰۰۹ را نشان می‌دهد.



شکل ۸-۶: نمودار ماهانه ایچیموکو INDU، ۳۰ نوامبر ۲۰۰۹

زمان برگشت قیمت را بر اساس اصول ماهانه مورد بررسی قرار داده‌ایم. می‌توانیم ملاحظه نمائیم چطور این اعداد با مقادیر مربع اعداد فرد متناسب و سازگار شده‌اند.

این مسئله قسمت عناصر زمانی را تکمیل می‌نماید. اکنون به بخش بعدی می‌رویم که احتمالاً یکی از مهم‌ترین بخش‌ها در این کتاب است. در این بخش به چالش کشیده می‌شوید. این بخش در واقع توسط دوست نزدیک من، دوگ لوگلین نوشته شده است. وی یک تریدر موفق است و پیشنهادهای خوب زیادی به من در زمینه «روانشناسی ذهن» ارائه نموده است. اگر بخوایم صادق باشم برای خواندن این بخش حداقل دوبار پیش از شروع معامله با سرمایه واقعی زمانی را اختصاص می‌دهم.

فصل ۶

روانشناسی کاربردی

معامله‌گری

دوگ لاگین

در این بخش می‌آموزید نمودارهای ایچیموکو و سیستم معاملاتی آن می‌تواند چشم‌انداز قدرتمندی از بازار برایتان مهیا سازد. این نگرش به بازار می‌تواند به عنوان پایه‌ای برای یک سیستم معاملاتی پایدار در نظر گرفته شود و زمانیکه به طور مناسب به کار برده شود، این سیستم معاملاتی ابزاری برای معامله در بازارها، خواه بازار ارزها، سهام، یا هر نوع بازار کالای دیگر که تمایل دارید در آن معامله انجام دهید ارائه می‌نماید. متأسفانه نه ایچیموکو و نه هیچ سیستم معاملاتی پیشرفته دیگری نمی‌تواند باعث تضمین موفقیت‌تان به عنوان یک معامله‌گر شود. بهترین سیستم‌های معاملاتی قبلی دارای رکوردهای ثبت شده بلندمدت، یک برنامه معاملاتی پایدار، و قابل کاربردی در تایم‌فریم‌های چندگانه و تحت خصوصیات مختلف بازار می‌باشند.

هدف این کتاب آموزش عناصر یک سیستم معاملاتی موفق و مولفه‌های اصلی آن است. هدف این بخش اذعان و پذیرش این فرضیه است که به عنوان یک فرد در حال آموزش، تاریخچه‌ای از تعصبات، هیجانات و ادراکات شخصی نسبت به بازار ارائه دهیم. مهم نیست این کار چقدر مشکل است، با وجود ادراکات، ترس‌ها، انتخاب‌ها و پیش‌قضاوتی‌هایی در معاملاتی‌مان داریم تلاش می‌کنیم تا در معامله باقی بمانیم. مهم است که اول درک کنیم و سپس برای کنترل این عناصر که در ذات‌مان هستند روش‌هایی طراحی نمائیم تا این عناصر در مسیر اجرای موفقیت‌آمیز سیستم معاملاتی‌مان وارد نشوند.

در طول تاریخ همه معامله‌گران موفق دارای سیستم پیشرفته‌ای بودند که سیستم‌شان در زمان‌های مختلف و در شرایط مختلف بازار ثابت و پایدار بوده است. هیچ یک از آنها معامله‌گران عالی نبودند. همه آنها از اطلاعاتی که توسط تریدرهای پیشین توسعه یافته بود استفاده می‌کردند، آنها این اطلاعات را فراگرفته بودند و سپس با استفاده از آزمون و خطا سیستم شخصی خودشان را به خوبی تنظیم نمودند تا زمانیکه نهایتاً متوجه شدند کدام سیستم برایشان موفقیت به ارمغان می‌آورد. ممکن است بپرسید چرا به سادگی فقط سیستمی که یک تریدر موفق قبل از شما برای کسب سود استفاده می‌نموده است را کپی‌برداری نکنیم؟ سوال خوبی است که باید توجه بیشتری به آن نمود.

آیا تدریس یک سیستم جدید به همین سادگی است؟

هزاران معامله‌گر در طول سال‌ها تلاش کرده‌اند تا از یک سیستم موجود کپی‌برداری کنند و با این حال به چندین دلیل نتوانسته‌اند به همان نتایج دست یابند. حتی آزمایشات رسمی که توسط بهترین سیستم معاملاتی Turtles که به نظر می‌رسد توسط ریچارد دنیس در اوایل دهه ۱۹۸۰ به افراد در خیابان آموزش داده می‌شده است و این سیستم معاملاتی به خوبی نیز مستندسازی شده، در این باره وجود دارد. وی دارای نتایج مستند عالی بود (به طور فرضی وی ۵۰۰۰ دلار حساب معاملاتی را به ۱۰۰/۰۰۰/۰۰۰ دلار تبدیل نمود) و می‌خواست ببیند آیا می‌تواند این سیستم را به سایرین نیز آموزش دهد و ملاحظه نماید آیا آنها می‌توانند به همین نتایج دست یابند. وی «دانشجویان» جدیدش را با اعلام یک آگهی در مجله وال‌استریت یافت و برای یادگیری سیستمش از طریق مراحل انتخاب دقیق ۱۴ معامله‌گر را انتخاب نمود.

این کار به این دلیل بود که ریچارد دنیس می‌خواست معامله‌گرانی که فاقد تجربه قبلی بازار بودند را به جای معامله‌گرانی که تجربه قبلی از بازار داشتند آموزش دهد. وی نمی‌خواست شاگردان جدیدش نگرش‌های قبلی و پیش‌فرض‌های خود از بازار داشته باشند. وی به سادگی از آنها خواست تا به دقت سیستم او را بیاموزند و نکات وی را دنبال نمایند. معامله‌گرانی که پیش از این سیستم‌های خودشان را اجرا می‌نمودند و موفقیت و شکست‌های خودشان را تجربه نموده بودند نگرش‌های خودشان، شامل شک و تردیدهایشان را به سیستم وی وارد می‌کردند و حتی ایده‌های جدیدی برای بهینه‌سازی سیستم وی نیز ارائه می‌نمودند. در نهایت، دانشجویان مبتدی که اساساً با سیستم وی درست

همانطور که فراگرفته بودند معامله می کردند، باید به تریدرهای حرفه ای مبدل می شدند اما آنها در خاتمه با توجه به ترجیحات و اعتقادات خود سیستم شخصی خودشان را سفارشی می کردند.

در این کتاب که نکات ظریف سیستم ایچیمو کو را دربرمی گیرد هیچ روش کاملی برای معامله با این سیستم ارائه نشده است. هرچند، یک سری اجزای کلیدی وجود دارند که باید اجرا شوند تا در معامله با این سیستم به موفقیت رسید. از این رو به هر فرد معامله گر توصیه می شود این عناصر را به میل خود تغییر دهد و اطمینان حاصل نماید که در نهایت این سیستم با سبک معاملاتی شخصی وی متناسب گردیده است. این ترفندهای نهایی که توسط معامله گر به کار برده می شود باید منجر به ایجاد تاریخچه معاملاتی گردد که اعتبار و موفقیت لازم را مهیا نماید و به معامله گر اجازه دهد قوانینی که برنامه معاملاتی وی بر اساس آنها ایجاد شده اند را دنبال نماید.

مشکلاتی که با آنها در مسیرمان مواجه شدیم

باید خاطرنشان کنیم معامله گری یک ویژگی ذاتی انسان نیست. بهترین سیستم ها اغلب با موانعی از خصوصیات ذاتی مان که می گویند چه کاری باید انجام دهیم، مواجه می شوند. همه ما به عنوان انسان دارای تمایل ذاتی برای «دنباله روی از گله» در تمام جنبه های زندگی هستیم. این چیزی است که منجر به ایجاد هوس و روحیه ای می شود که این روحیه دنباله رو بودن، در سبک لباس، مسکن، استفاده از زبان و هر چیزی از جنبه های زندگی رخ دهد. زمانیکه وارد دنیای تجارت می شوید، میل طبیعی مان در پیروی از رهبری دیگران می تواند بدترین دشمن مان باشد با این حال هنوز غرایز مان می گویند باز هم این کار را انجام دهیم. به همین دلیل است که لازم است سیستمی داشته باشیم که با مجموعه قوانین سختگیرانه ای تنظیم شده باشد. غرایز انسانی پایه ما اغلب خواهند گفت کاری مخالف آنچه سیستم مان می گوید را انجام دهیم. بنابراین، اگر اعتقاد واقعی به سیستم مان که از طریق عملکرد تاریخی به آن دست یافته ایم نداشته باشیم، تمایل به ترک سیستم باعث می شود درست در زمان سیستم مان را اشتباه ترک کنیم و از غرایز مان پیروی کنیم.

بسیار گفته شده که بیش از ۹۰ درصد معامله گران بعد از شکست خوردن تسلیم می شوند و در زندگی خود به دنبال منبع درآمد دیگری می گردند. فکر کنید این مسئله چقدر شگفت انگیز است زمانیکه امیدهای زیاد معامله گران تازه وارد برای ایجاد زندگی که می توانند بدون زحمت در خانه و بدون داشتن رئیس کار کنند و به طور کلی مایلند سرنوشت خودشان را خودشان کنترل کنند را مشاهده می کنید زمانیکه هنوز آنها به تجارت معامله گری وارد نشده اند. نغمه حوریان دریایی زندگی معامله گران، واقعاً یک رویای سرخوش کننده برای عده زیادی از افراد است. با وجود تمایلات قوی، میزان شکست کاملاً ناراحت کننده است.

با در نظر گرفتن این مطلب، چرا درحالی که آرزوهای آنها آنقدر بزرگ است، دچار شکست می شوند؟ پیش از همه باید اذعان داشت هر معامله دارای شانس ۵۰/۵۰ است، آیا این طور نیست؟ کالای تجاری باید یا به سمت بالا و یا به سمت پایین حرکت کند. این مسئله به تنهایی موید این نکته است که حداقل ۵۰ درصد تریدرهای جدید باید موفق باشند - درست است؟ و با کسب آموزش باید انتظار داشته باشید که این ۵۰ درصد با سرعت نسبتاً زیادی از موفقیت ۵۰ درصد به سمت جلو پیشرفت نمایند. ممکن است قبلاً جمله «اگر این کار اینقدر آسان بود - همه می توانستیم این کار را انجام دهیم» را شنیده باشید اما در واقع همه می توانیم این کار را انجام دهیم. چه کسی نمی خواهد زندگی داشته باشد که زمان بندی آن همراه با کسب درآمد راحت در خانه و تحت کنترل خودش داشته باشد؟ حتی ممکن است برخی این زندگی را «رویای آمریکایی» بنامند.

آیا توطئه‌ای برای تریدهای خرد وجود دارد؟

بنابراین اگر اینطور فکر می‌کنید، پس در آغاز راهی هستید تا تقریباً احساس کنید توطئه‌ای خارجی وجود دارد تا ما را از موفقیت دور کند! چطور بسیاری از افراد می‌توانند در یک سیستم شکست بخورند درحالیکه این سیستم دارای شانس ۵۰/۵۰ است و مریدان مجربی در این سیستم وجود دارند و بیش از ۱۰۰ سال از آغاز این تجارت می‌گذرد و هنوز آنها شکست می‌خورند؟ این تفکر برای ده‌ها و قرن‌ها تا به امروز منشاء ناامیدی‌های عظیمی برای معامله‌گران جدید بوده است. تا امروز دائماً از معامله‌گران در هر جا می‌شنوم که «مارکت‌میکرها در حال کنترل بازار هستند» یا «تنها کسی که پول درمی‌آورد، بروکرها هستند» یا «تنها کسانی که پول درمی‌آورند افراد بسیار پولدار هستند». من اینجا هستم تا به شما بگویم امروزه هیچ یک از این توطئه‌ها واقعی نیستند و احتمالاً هرگز نیز رخ نخواهند داد. این تفکرات فقط روش‌هایی برای توجیه ناتوانی‌مان در اجرای موفقیت‌آمیز سیستم معاملاتی در محیطی است که می‌دانیم دارای عناصر پایه ضروری است تا به ما امکان موفقیت را اعطا نماید.

به عنوان رهبر پیشین گروه معامله‌گری پیشرفته خودم، اغلب شوکه می‌شوم وقتی که برخی از نظرات بیان شده توسط اعضاء گروه خودم را می‌شنوم و هنوز هم هر زمان شکست می‌خوریم و ناامید می‌شویم، باز هم شاهد اظهار این نظریات هستیم. هیچ کس نمی‌خواهد خودش را به عنوان یک بازنده در نظر بگیرد و به همین دلیل اکثر ما به طور ذاتی حتی نمی‌خواهیم ضرر کنیم. جامعه ما پیروزی را جشن می‌گیرد و در مورد فضایل تلاش سخت‌تر و انجام بهتر کار «به این صورت که فقط آن را انجام بده» تا رخ دهد، اغراق می‌کنند. هرچند این فلسفه‌ها ممکن است به خوبی در بسیاری از جنبه‌های زندگی کار کند اما این طرز فکر در دنیای تجارت به هیچ‌وجه مناسب نیست.

بسیاری از افراد موفق تلاش کرده‌اند تا تریدر شوند زیرا آنها لانه تخم‌مرغ خوبی از موفقیت‌های تجاری‌شان ساخته بودند و اکنون آماده معامله با حساب‌های معاملاتی‌شان برای زندگی به عنوان یک شغل جدید بودند. زمانی که آنها تلاش می‌کنند چیزی که در دنیای تجاری‌شان به خوبی برایشان کار می‌کرده را در دنیای تجاری جدید به کار برند - آنها فقط دریافته‌اند که روش فوق در شغل اصلی آنها به خوبی عمل نموده اما ممکن است در واقع در شغل معامله‌گری تازه‌شان این طرز فکر به دشمن آنها مبدل شود. به سختی قابل هضم است و قتیکه هیچ‌چیزی از معامله‌گری نمی‌دانستید، موفق بودید و شجاعانه وارد دنیای جدیدی از تجارت می‌شدید که فقط می‌دانستید ظاهراً باید کار ساده‌ای باشد اما در واقع این تجارت سخت‌ترین چیزی است که تا کنون انجام داده‌اید. اغلب می‌بینیم چیزهای یکسانی رخ می‌دهد زمانیکه مالکان تجارت‌های موفق خرید می‌کنند و کنترل را به دست می‌گیرند و تلاش می‌کنند تا این کار را مانند فعالیت‌های تجاری‌شان به اجرا درآورند - و سپس درمی‌یابند که هوش تجاری‌شان در این حوزه به خوبی عمل نمی‌کند. فراگیری تجارت معامله‌گری دارای مفاهیم یکسانی می‌باشد.

به این دلیل است که باید ذهن‌تان را باز کنید و این واقعیت را بپذیرید که «نمی‌دانید چه چیزی نمی‌دانید» و بنابراین استفاده از یک سیستم انعطاف‌ناپذیر با نتایج اثبات‌شده تنها روشی است که منجر به ایجاد یک تجارت معامله‌گری موفق می‌گردد. درحالیکه حساب معاملاتی شما به تدریج به سمت صفر پیش می‌رود، تا زمانیکه بیاموزید چطور معامله کنید، بازار با خوشحالی ضربات سختی به شما وارد می‌کند. اما مطمئناً و در بسیاری از موارد، هرچقدر سخت‌تر تلاش می‌کنید کمتر به دست می‌آورید.

اسطوره معامله‌گران - افراد زرنگ بهترین معاملات را انجام می‌دهند

ون تارپ نویسنده کتاب «با روش خودتان برای آزادی مالی معامله کنید» آزمایشی را شرح می‌دهد که ۴۰ دکتر در آزمایشی برای اندازه‌گیری قابلیت هوش افراد جته تبدیل شدن به تریدر موفق شرکت کرده بودند. در آزمایش اجرا شده

توسط رالف وینس، دکتران شرکت کننده در هر بازی کامپیوتری ساده ۱۰۰ معامله را به اجرا درآوردند، درحالیکه به هر یک از شرکت کنندگان گفته شده بود وی باید در ۶۰ درصد برنده باشد. به هر یک از آنها ۱/۰۰۰ دلار داده شده بود و گفته شده بود می‌توانند بر روی هر یک از معاملاتشان با هر مقدار دلخواه شرط‌بندی نمایند. در پایان بازی فقط دو نفر از ۴۰ شرکت کننده واقعاً بیش از مبلغ اولیه‌شان ۱/۰۰۰ دلار درآمد کسب کرده بودند (حتی با وجودی که آنها ۶۰ درصد شانس برد داشتند. چطور چنین چیزی ممکن است؟

به طور مطلوب آنها باید مقدار مساوی در هر معامله سرمایه‌گذاری می‌نمودند، اگر این کار را می‌کردند، همه آنها می‌توانستند پول دریاورند. هرچند، آنها مایل بودند دو برابر و حتی سه برابر شرط‌بندی خود بعد از یک سری مداوم از معاملات ضررده در سه یا چهار بار باخت شرط‌بندی کنند. و با انجام این کار آنها باید تقریباً ۶۰ درصد برنده می‌شدند درحالیکه تعداد زیادی از بازنده‌ها بعد از باخت مقدار شرط‌بندی‌شان را افزایش می‌دادند. بعد از ضرر با مقدار شرط‌بندی بزرگتر، آنها مایل بودند حتی در شرط‌بندی بعدی میزان بیشتری نیز شرط‌بندی کنند که این کار منجر به ضرر بزرگتری برایشان می‌شد. و در نهایت، آنها با این استراتژی با اتمام حساب‌شان از بازی خارج می‌شدند. آنچه این شرکت کنندگان آن را درک نکرده بودند این بود حتی با وجود درصد اطمینان تضمینی ۶۰ درصد، همه سیستم‌ها دارای یک سری تریدهای بازنده متوالی نیز می‌باشند. این چیزی است که شما هر وقت یک سری تریدهای بازنده دارید انجام می‌دهیم که این امر اغلب مشخص خواهد کرد به چه نوع تریدری تبدیل خواهید شد.

معاملات ضررده را می‌پذیریم

اگر مشکل شما پذیرش ضرر و زیان است، مهم است برای غلبه بر ناتوانی در معامله پیش از این که پول قابل توجهی را در بازار وارد نمائید، کار کنید. در فعالیت تجاری معامله‌گری ضرر جزئی از آن می‌باشد. این ضرر و زیان‌ها باید پذیرفته شوند و به عنوان بخشی از چشم‌انداز کلی این تجارت باید انتظار ضرر را نیز داشت. هرکس که در زمینه پذیرش ضرر و زیان در این تجارت مشکل دارد یا باید بر این نقطه نظر غلبه پیدا نماید و یا باید به شغل دیگری در زندگی‌اش بپردازد و باید اجازه دهد فرد دیگری مدیریت پولش را بر عهده بگیرد. در واقع هنگامیکه در حال معامله‌گری به صورت واقعی هستید، درک خواهید نمود که ضرر و زیان فقط بخشی از مراحل ضروری معامله‌گری می‌باشند. این ضرر و زیان‌ها فی‌الذاته نه بد و نه خوب هستند - آنها فقط بخشی از این روند هستند. زمانی که شروع به پذیرش این امر می‌کنید برای توسعه و اجرای یک سیستم آمادگی بهتری کسب خواهید نمود.

بنابراین پیش از این در مورد جذابیت زندگی یک معامله‌گر تمام وقت بحث نموده‌ایم. مهم است که در ورای رویاها و خواسته‌های زندگی معاملاتی حرکت کنیم تا بتوانیم سیستمی را بیابیم که به بهترین شکل برایمان مناسب است. اینجا، جایی است که هر کسی به نحوی تغییر خواهد کرد. برخی از ما ترجیح می‌دهند معاملات روزانه را در طول روز انجام دهند. برخی دیگر ترجیح می‌دهند فقط یک یا دو معامله در روز انجام دهند. زمانی من از سیستمی استفاده می‌کردم که فقط نیاز به یک ترید در ماه داشت. تعداد معاملات تان هرگز مهم نیست. شما باید تعداد معاملاتی که به بهترین شکل مناسب شما هستند را بیابید.

علاوه بر کشف سیستمی که به بهترین وجه با رویاهایتان از نظر تعداد معاملات متناسب است - نیاز دارید سیستمی بیابید که با شرایط حال حاضر سیستم معاملاتی‌تان نیز متناسب باشد. اگر به طور تمام وقت مشغول کار هستید و در عین حال در حال معامله‌گری نیز هستید، مهم است سیستمی را توسعه دهید که با سبک زندگی و شرایط شما تاکید نماید. نیاز است این سیستم متناسب با زندگی‌تان باشد و نیاز است متناسب با شرایط شما باشد. در غیر اینصورت، ممکن است بهترین سیستم معاملاتی طول تاریخ را نیز بیاموزید، اما اگر این سیستم با موقعیت شما متناسب نباشد، تقریباً با اطمینان این سیستم باعث شکست تان خواهد گردید. این دلیل یکی از دلایلی است که هیچ سیستم کامل و یا

سیستم ضعیفی وجود ندارد. هر کسی که بگوید این چنین سیستمی وجود دارد، به احتمال زیاد تلاش می کند چیزی را به خاطر منافع خودش به شما بفروشد.

یکی از مزایای سیستم ایچیموکو این است که می توان این سیستم را در تایم فریم های زمانی مختلف مورد استفاده قرار داد. بنابراین، می توانید تعداد تریدهایتان را بر حسب زمان بندی موردنظرتان تنظیم کنید. همچنین سیستم ایچیموکو قابل استفاده در کالاهای تجاری مختلف نیز می باشد. بنابراین یک بار دیگر می گوئیم که شما می توانید این سیستم را در مورد کالاهای تجاری به کار برید که ممکن است با زمان بندی شما بهترین تناسب را داشته باشند. افراد زیادی که در حال معامله با ارزها هستند را می شناسم بنابراین این افراد می توانند در شب و یا در ساعات اولیه صبح پیش از آغاز کار تمام وقت شان با این سیستم معامله نمایند. هر چند آنها می توانند در صورتی که ترجیح می دهند به سادگی معاملات طولانی مدت تری را در بازار سهام یا ETFs به اجرا درآورند. مهم است که قوانین و سیستم خودتان را برای بهینه سازی شرایط جدیدتان بهینه سازید. احتمالاً هزاران سیستم معاملاتی وجود داشته باشد که بتوان آنها را به طور موفقیت آمیزی به کار برد. نکته کلیدی برای شما به عنوان یک تریدر، توسعه سیستمی است که دارای انتظار موفقیت مثبت است و سپس چسبیدن به این سیستم است.

عامل دیگری که بر معامله گران تاثیر می گذارد، تعداد معاملات برنده در مقابل تعداد معاملات بازنده است. معامله گران بسیاری وجود دارند که به سختی سیستمی را می پذیرند که دارای باخت های مکرر است. طنز موجود در این واقعیت این است که بسیاری از بهترین سیستم های معاملاتی بیشتر از آن که دارای معاملات برنده باشند، معاملات بازنده دارند. دلیل موفقیت این سیستم ها این است که تعداد برنده هایشان به طور شایان توجهی بیشتر از تعداد بازنده ها می باشد. اگر به خوبی به یاد بیاورم، سیستم معاملاتی Turtles ریچارد دنیس باید منجر به انجام معاملات بازنده بیشتری نسبت به معاملات برنده می شد (معمولاً حدود ۴۰ درصد معامله برنده). هر چند، این سیستم منجر به ایجاد معاملات برنده ای می شد که از لحاظ اندازه و مقدار بزرگ بودند و این معاملات برنده می توانست چندین معامله بازنده را پوشش دهد.

یک سیستم موفق باعث تقویت اعتقاد راسخ تان خواهد شد

سال ها پیش، زمانیکه جانی کارسون میزبان «برنامه امشب» بود را به خاطر می آورم زمانیکه وی میزبان کسانی بود که به عنوان «بزرگترین معامله گران جهان» خوانده می شد. همین طور به خاطر می آورم، که میهمان در مورد این نامگذاری عصبانی بود اما تایید می کرد که وی میلیون ها دلار در سال سود کسب نموده است. کارسون به میهمان گفت که اگر وی میلیون ها دلار در سال سود کسب نموده است پس او باید یک فرد برنده خوب باشد و از میهمان پرسید عموماً چه میزان موفقیت داشته است. زمانیکه میهمان به وی گفت که وی عموماً درصد بردش را بین ۴۲ تا ۴۳ درصد به طول کلی در نظر می گیرد باعث شوکه شدن کارسون گردید و همچنین گفت که بهترین سالی که موفق به کسب میلیون ها دلار شده است درصد موفقیتش تقریباً ۴۵ درصد بوده است. کارسون فریاد زد و گفت که هر کسی می تواند به میزان ۵۰ درصد موفقیت در بازار دست یابد و چطور یک معامله گر بزرگ بیش از آنچه که می تواند به دست آورد را از دست می دهد و در عین حال موفق می شود، در این زمان حضار شروع به خندیدن کردند. سپس معامله گر در ادامه همانطور که از خنده غش کرده بودند، به او گفت که معاملات برنده وی بسیار بزرگتر از معاملات بازنده اش بوده اند.

این درس که توسط میهمان کارسون اثبات گردید برایمان به عنوان تریدر، درس مهمی است. مهم نیست چند بار موفق می شوید - مهم این است که چه مدت زمانی در یک معامله برنده قرار دارید. باید خودتان را برای باخت آماده کنید و باخت در اغلب اوقات فقط جزئی از معامله گری است. اینگونه نیست که بگوئیم نمی توانید از معاملات بازنده تان مطلبی بیاموزید. می توانید و باید از معاملات بازنده تان مطالبی بیاموزید. روش آزمون و خطا است که در نهایت شما را به

معامله‌گر بهتری تبدیل می‌کند. عامل کلیدی این است زمانیکه در حال یادگیری از اشتباهاتان هستید، حساب‌تان را از بین نبرید.

بیاد آورید که پیش از این در این بخش در مورد اعتقادات معاملات‌تان و سیستم معاملاتی‌تان صحبت کرده‌ام. اعتقاد کورکورانه می‌تواند یک سیستم معاملاتی خطرناک باشد. هزاران معامله‌گر وجود دارند که در طی سالیان متمادی سیستمی را فراگرفته‌اند و سرمایه‌گذاری عظیمی بر اساس آن به طور کورکورانه بر اساس این سیستم انجام داده‌اند و ضررهای زیادی متحمل شده‌اند. اعتقادات شما مهم هستند اما این اعتقادات باید از آزمون‌های قبلی در شرایط مختلف بازار به دست آمده باشند و زمانیکه به کالای معاملاتی که قصد دارید در نهایت در آنها سرمایه‌گذاری کنید (بازار سهام، ارزها و غیره) اعمال می‌شوند باید مورد آزمایش قرار گرفته باشند. این امر بدین معنی است که نیاز به ارزیابی کاربردهای تاریخی و قبلی سیستم‌تان در یک کالای معین دارید تا این واقعیت را تشخیص دهید که آیا این سیستم انتظارات مثبتی را برآورده می‌سازد. هر کاری غیر از این، یک حدس ساده است و احتمالاً نتایج نامطلوبی در پی خواهد داشت.

کسانی که به طور گسترده‌ای سیستم‌شان را پیش از اجرای آن مورد آزمایش قرار می‌دهند لازم است ایده خوبی در مورد پیامدها (و ضررهای) این سیستم در معامله واقعی داشته باشند. کلیه سیستم‌های معاملاتی دارای نقایصی نیز می‌باشند، که این نقاط ضعف بالاترین احتمال ضرر برای حساب معاملاتی‌تان را نشان می‌دهد. ممکن است یک سیستم معاملاتی عالی داشته باشید اما اگر این سیستم حداکثر ۴۰ درصد ضرر در طی مراحل آزمایشات دوره‌های زمانی قبلی ایجاد کند (افت)، این مقدار ضرر ممکن است به طور شایان توجهی بیش از ضررهایی باشد که یک تریدر دم‌دمی مزاج متحمل گردد. بنابراین، هرچند این سیستم ممکن است در نهایت نتایج بلندمدت استثنایی ایجاد نماید، ممکن است یک سیستم وحشتناک نیز برایتان باشد چون شما نمی‌توانید از لحاظ هیجانی ۴۰ درصد ضرر را تحمل نمائید. سایر سیستم‌ها ممکن است حداکثر ضرر ۲۰ درصدی داشته باشند اما میزان سود آنها نیز ممکن است به میزان شایان توجهی کاهش یابد.

همه ما دارای آستانه درد شخصی هستیم که مختص خودمان است و نقش مهمی را در زندگی مان به عنوان یک معامله‌گر ایفاء می‌نماید. این آستانه درد یکی از دلایل اصلی است که یک تریدر که در حال معامله در یک حساب دمو به خوبی بتواند معامله و داد و ستد نماید و سود کسب نماید اما زمانیکه وی معامله را به حالت واقعی و «پول واقعی» با استفاده از همان استراتژی انتقال می‌دهد وی شروع به ضرر کردن نماید. فهمیدیم زمانیکه از پول واقعی برای معامله استفاده می‌نمودیم یک عنصر هیجانی را نیز به استراتژی مان افزودیم که این عنصر در زمانیکه با پول مجازی در حال معامله بودیم وجود نداشت و این عنصر هیجان یکی از تفاوت‌هایی است در زمانیکه ضررهایمان آغاز می‌شود به این هیجان واکنش نشان می‌دهیم. یک معامله‌گر هیجانی در نهایت به یک معامله‌گر بازنده تبدیل خواهد شد حتی با وجود استفاده از تکنیک‌ها و اطلاعات مناسب وی تبدیل به یک معامله‌گر بازنده خواهد شد. احساساتشان باعث خواهد شد آنها کارهای اشتباهی در زمان‌های اشتباه انجام دهند. به خاطر داشته باشید، غریزمان به ما خواهند گفت از گله پیروی کنیم و در اکثر شرایط دنباله‌روی از گله باعث می‌شود در جهت اشتباه قرار گیریم. تریدر مشهور، جیمی روگرز اغلب اوقات می‌گفت که او با شادی کالاهایی که فروشندگان با ناامیدی می‌فروشدند را می‌خرد و با شادی این کالاها را به کسانی که می‌خواهند آنها را بخرند، می‌فروشد.

خودتخریبی و چطور این عامل بر معاملات‌تان اعمال می‌شود

هرچند نگرانی‌های خوبی در مورد تجارت داریم، همچنین اغلب می‌توانیم قربانی تخریب خودمان به دلیل باورهای درونی مان شویم. این باورهای عجیب و غریب اغلب به عنوان ناخودآگاه اشاره می‌شوند. هرچند ذهن خودآگاه ما فقط بر

روی بسیاری از مطالب به طور همزمان می‌تواند متمرکز شود - معمولاً فقط پنج تا هشت مطلب - ناخودآگاه‌مان هزاران وظیفه را در یک زمان انجام می‌دهد. ناخودآگاه همه چیز را از بدو تولد، حرکت، حافظه و غیره و حتی عناصر اصلی نظیر جریان خون‌مان را دستکاری می‌نماید، همه چیزهایی که به ما اجازه می‌دهد تا بر روی تفکرات خودآگاه اصلی‌مان متمرکز شویم. مشکل این است هرچند ممکن است بر روی تفکرات خودآگاه‌مان تمرکز داشته باشیم، همچنان می‌توانیم بر روی یک تفکر ناخودآگاه قدیمی (اما هنوز هم پابرجا) پافشاری کنیم که کاملاً شگفت‌انگیز است.

بیابید مثالی بزنیم. زمانی به یک کارگاه آموزشی وارد شدم که از تکنیک‌های حرکتی و تکنیک‌های آزمون عضلانی برای بررسی باورهای درونی‌مان استفاده می‌نمود. از خواهر من، که یک سرمایه‌گذار باتجربه املاک و مستقالات است، خواسته شد تا داوطلب آزمایش اعتقادات درونی شود که بسیاری از ما برای سالیان طولانی با آنها درگیر بوده‌ایم. درحالی‌که عبارت مشهور «پول ریشه همه شرارت‌ها است»، او باور مثبتی در مورد این باور به دست آورد که بشدت باعث شک و ناامیدی او گردید. به عنوان یک سرمایه‌گذار، او به سرعت عمق حفظ این باور را شناسایی نمود. با کمک مربیان‌مان در طی ۲۰ دقیقه بعدی، او فراگرفت چطور این باور و اعتقادات را از بین برده و دوباره مورد بررسی قرار گرفت تا مشخص شود که آیا او این اعتقادات بالقوه مضر را حذف نموده است.

مشکل ما به عنوان یک معامله‌گر این است که اکثر ما دارای باورهای درونی هستیم که از اوایل زندگی‌مان به صورت یکپارچه‌ای درآمده‌اند - شاید حتی در دوران کودکی - و این باورها هنوز وجود دارند و هنوز هم در ناخودآگاه‌مان زنده هستند. در اکثر حالات، ما قبول نمی‌کنیم که این باورها وجود دارند و بنابراین فکر می‌کنیم انتخاب‌ها، سیستم‌ها، و تمایلات درستی را صورت می‌دهیم تا به یک معامله‌گر موفق تبدیل شویم. درحالی‌که، باورهای درونی داریم که هرگز مورد بررسی قرار نگرفته‌اند - به میزان بسیار کمی حذف شده‌اند - که این باورها می‌توانند و عموماً برای تخریب نتایج‌مان زمانیکه تلاش می‌کنیم به یک معامله‌گر موفق تبدیل شویم، به کار گرفته خواهند شد. برخی ممکن است این ویژگی‌های خودتخریبی را بیان نمایند. اما آنها واقعاً باورهای غلطی هستند که باید آنها را درون‌مان حفظ کنیم (در بسیاری از شرایط) تا ما را از چیزهایی که می‌ترسیم و برایمان مضر می‌باشند، محافظت نمایند، یعنی، با داشتن مقدار زیادی پول تبدیل به شیطان شویم. در مورد برخی از جملاتی که در جامعه به کار می‌بریم، نظیر «ثروتمند پلید» فکر کنید و ببینید سیاست‌های ما چطور این احساس را در ذهن‌مان به وجود می‌آورند که ثروتمندان بزرگ تا حدودی مسئول شرایط نامناسب افراد لگدمال شده و به نوعی شیوه‌های توطئه‌گرانه می‌باشند. جای تعجب نیست اگر باورهای درونی داشته باشیم که ما را در مسیر معامله‌گری موفق قرار می‌دهند.

یکی از جالب‌ترین موارد معامله‌گری بود که مایل بود ۸۰.۰۰۰ دلار را به صورت فصلی به دست آورد و زمانی که به این مبلغ در طی یک سال رسید، وی شروع به از متضرر شدن و بنا به دلایل نامشخص نمود. در نهایت با کمک مشاوره وی از این مفهوم درونی پرده‌برداری نمود که همواره پدرش را مورد احترام قرار می‌داده است و وی را به عنوان بهترین مرد روی زمین در نظر می‌گرفته. با بررسی‌های بیشتر کشف شد بالاترین میزان درآمد پدر وی در حدود ۸۰.۰۰۰ دلار در سال بوده است. پسر بعدها متوجه شد احساس می‌کرده ارزشش بیشتر از پدرش نیست و بنابراین هر زمان او به حداکثر درآمد پدرش دست می‌یافت به طور ناخودآگاه معاملاتش را خودتخریب می‌نمود چون نمی‌خواست احساس کند که می‌تواند بزرگتر از بزرگترین مردی که او همواره تحسین می‌نموده باشد. با کمک مشاور وی آموخت این ایده را بپذیرد و قبول کند کسب درآمدی بیشتر از درآمد پدرش برایش مطلوب است و از این نقطه وی با استفاده از همان تکنیک‌هایی که در گذشته استفاده می‌کرد شروع به کسب درآمدی به میزان بسیار بالاتر از ۸۰.۰۰۰ دلار در هر سال نمود.

هدف من در این بخش آموزش تکنیک‌هایی برای کشف و در نهایت جایگذاری سیستم‌های باورهای درونی تان نیست. چندین گروه روش‌های مختلفی در دسترس قرار دارند که به شما با ابزارهای مختلف و تکنیک‌های متنوع کمک کنند تا این باورهای بیمار درون تان را کشف و حتی تغییر دهید. گروهی که در این روش‌ها خبره می‌باشند، گروهی است که به نام Psych-K شناخته می‌شوند. گروه‌های دیگری نیز وجود دارد که بر روی جهت‌دهی بر تمایلات درونی با استفاده از تکنیک‌هایی مانند NLP (برنامه‌های زبان‌شناختی) تا روش‌های هیپنوتیزمی و حتی درمان‌های رگرسیونی فعالیت می‌نمایند. همچنین مربیان آموزشی بیشمار دیگری نظیر وان تراپ تا آدریان توغرای مشهور نیز وجود دارند که می‌توانند به معامله‌گران در جنبه‌های مختلف روانشناسی معامله‌گری کمک نمایند.

خلاصه – روانشناسی کلی معامله‌گری

آنچه می‌خواهم بدست بیاورید این است که درک کنید نتایج معاملاتی تان ترکیبی از سیستم‌های معامله‌گری جامع است که به بهترین شکل نیازهایتان را برآورده می‌سازد و سبک معامله‌گری همراه با باورهای سالم برای سیستمی است که می‌دانید مورد آزمایش قرار گرفته و موفق است. پس باید این امر را با سیستم خودآگاه سالم و باورهای ناخودآگاه ترکیب کنید تا مطمئن گردید در مسیر توسعه موفقیت‌آمیز برنامه معاملاتی تان قرار دارید. نویسنده این کتاب، مانس پاتل، شما را تشویق نموده تا سیستم تان را شامل نقاط ورود، راه‌اندازی و خروج بک‌تست بگیرید تا مطمئن گردید یک سیستم موفق را توسعه داده‌اید که با شخصیت و شرایطتان متناسب است. وی به شما مثال‌هایی از سیستمی ارائه نموده که می‌توانید آن را برای ایجاد سیستمی که به طور کامل با شخصیتتان متناسب است، توسعه دهید.

پیشنهاد می‌کنم زمانیکه در حال توسعه سیستم‌تان هستید، مهم است تاریخچه‌ای از کلیه تریدهایتان داشته باشید. مطمئن شوید در هر معامله علت ورود به معامله زمانیکه وارد معامله می‌شوید را ثبت نموده‌اید و سپس یادداشت کنید زمانیکه از این معامله خارج شدید چرا از معامله خارج شده‌اید. توجه خاصی به معاملات بازنده‌تان داشته باشید. گاهی اوقات به سادگی به دلیل وضعیت بازار که تحت کنترل شما نیست دچار ضرر می‌شوید. برخی معامله‌گران باتجربه این ضررها را به عنوان «ضررهای خوب» می‌نامند. و سپس احتمالاً متوجه خواهید شد که معاملات ضررده دیگری داشته‌اید که به دلیل این که از سیستم‌تان پیروی نکرده‌اید متحمل شده‌اید. این دسته از معاملات، معاملاتی هستند که نیاز است تمرکز بیشتری بر روی آنها داشته باشید. ممکن است روندهای قطعی با این گونه معاملات بیابید که در نهایت شما را به سمت باورهای مضر پوشش داده نشده‌ای که دارا هستید رهنمون می‌سازد که این باورها در مسیر تبدیل به معامله‌گر موفق درون تان وجود دارد. هنگامی که این باورها را تایید کردید، در مسیر مطلوب‌تان برای کشف این باورها هستید و سپس این تریدهای مضر را که در مسیر اجرای موفقیت‌نهایی خودن به عنوان یک تریدر کسب می‌نمایند، تصحیح می‌نمائید. توصیه می‌کنم به ثبت و حفظ این یادداشت‌ها بعد از این به عنوان یک معامله‌گر همانطور که به کشف سایر «سقف‌های شیشه‌ای» ادامه می‌دهید که می‌تواند مانعی برای توسعه مستمر شما به عنوان یک معامله‌گر می‌شود.

فصل ۸

معامله‌گری با ایچیموکو

در طول روز

احتمالاً این فصل «مرگبارترین» فصل است، شاید اکثر افراد مستقیماً به این بخش رجوع کرده باشند و شروع به استفاده در یک حساب واقعی کرده باشند. امروزه، معامله‌گری در طول روز به «پول نقد سریع» وابسته است. افراد ممکن است داستان‌هایی در مورد موفقیت شنیده باشند که چطور در طول یک سال ۵۰۰۰ دلار را به ۱.۲ میلیون تبدیل کرده‌اند. از طریق مفهوم مارجین، امروزه افراد شانس «سفر به ماه» یا سفر به «اعماق دریا» در یک زمان کوتاه را دارند.

پیش از اینکه این فصل را آغاز نمایم، اجازه دهید داستان یکی از دانشجویان سابق ایچیموکویم را نقل کنم. در سال ۲۰۰۶، در حال تدریس کلاس ایچیموکو در آیینای گرجستان بودم. دانشجوی مشتاقی داشتم که تضمین نمود می‌تواند به بهترین دانشجوی ایچیموکو که تا به حال داشته‌ام تبدیل شود. او مهندسی بود که مشتاق بود از شر «کارش» خلاص شود. ساعات کاری‌اش زیاد و میزان دستمزدش اندک بود.

اکثر افراد شاغل می‌توانند احساسات این دانشجو را درک نمایند. این حالت سناریوی معمولی برای کارمندان در دنیای تجارت است. استراتژی ماموریت شرکت‌ها عموماً بر «کار بیشتر و پرداخت دستمزد کمتر» استوار است. این کار باعث افزایش درآمد و کاهش هزینه‌های شرکت می‌شود و باعث می‌شود سود زیادی عاید شرکت شود. من در این محیط به مدت ۱۶ سال و در دنیای تجارت مخابرات زندگی کرده‌ام. اکثر افرادی که استخدام می‌شوند به سن ۶۵ سالگی می‌رسند و درمی‌یابند هیچ‌چیزی ندارند چون نرخ تورم با سرعت بالاتری نسبت به حساب‌های پس‌اندازشان افزایش داشته است. اگر باور ندارید، به گذشته نگاه کنید. در سال ۱۹۷۰، درآمد یکی از والدین برای کل خانوار کافی بود. امروزه، هم پدر و مادر هر دو مجبورند کار کنند تا بتوانند چک‌هایشان را پرداخت نمایند. به مراکز مراقبت‌های روزانه موجود در دهه ۱۹۷۰ در مقایسه با مراکز امروزی نگاه کنید که تعداد آنها چقدر افزایش یافته است.

دلیل اینکه چرا در مورد این مسائل صحبت می‌کنم این است که افراد زیادی وجود دارند که به سمت معامله‌گری می‌روند تا از چرخه فاسد «کار» فرار کنند. آنها نمی‌خواهد برای پرداخت چک‌هایشان زندگی کنند. آنها می‌خواهند به نقطه‌ای برسند که مجبور نباشند در حال حاضر و حتی در آینده نگران پول باشند. در نتیجه، آنها به سمت معامله‌گری می‌آیند اما معامله‌گری آنها بلندمدت نیست، در عوض آنها شروع به معامله‌گری روزانه می‌نمایند. درک آنها از معامله‌گری روزانه این است که با سرمایه‌گذاری اندک بتوانند به سرعت پول به دست آورند (یعنی، ریسک زیاد). آنها می‌خواهند داستان فرد موفق برنامه شبانه بعدی باشند. متأسفانه، این حالت بسیار نادر است. در واقع، ثابت شده اگر یک معامله‌گر مبتدی در اولین معامله‌اش موفق عمل نماید، آنها همه پول سرمایه‌گذاری‌شان را از دست خواهند داد. ممکن است بپرسید چرا؟ اولین معامله موفقیت‌آمیز «احساس اشتباهی از امید» است. این احساس، به معامله‌گران مبتدی احساس راحتی عطا می‌کند و احساس خواهند کرد نمی‌توانند به نقطه‌ای که شروع به سرمایه‌گذاری نموده‌اند باز گردند و پول بیشتر و بیشتری را در این کار سرمایه‌گذاری می‌کنند. در واقع، برخی از آنها بر روی پولی سرمایه‌گذاری می‌کنند که هرگز آن را نداشته‌اند. در برخی مواقع، شانس آنها پایان می‌پذیرد و اکنون ریسک را تا جایی بالا می‌برند که یک حرکت بد در بازار باعث می‌شود آنها همه چیزشان را از دست بدهند. آیا در مورد این نوع داستان‌ها چیزهایی شنیده‌اید؟ نه؟ داستان زیر را بخوانید.

«یک سال پیش، کاریاک مازسکا، معلم یک مدرسه کوچک کمک به کودکان ناتوان در نزدیکی بالتیمور اثبات نمود اگر فرد دارای هوش کافی باشد می‌تواند از طریق معاملات آنلاین سهام ثروتمند شود.

مازسکا، مانند یک راننده کامیون تقریباً ناگهانی طی یک شب میلیونر شد. تنها در طی چهار سال، مازسکا، که ۳۰ ساله است، سرمایه‌گذاری اولیه ۲۰.۰۰۰ دلار در پرتفیلویش بود که بعد از مدتی بیش از ۲.۲ میلیون دلار ارزش پیدا نمود. فعالیت وی باعث شود بتواند یک آپارتمان دوخوابه در حومه بالتیمور و یک ماشین اسپورت BMW را به طور نقد

خریداری نماید. حتی بعضی از آشنایانش پیشنهاد دادند از شغل تدریس خارج شود و فقط در بازار سهام معامله‌گری نماید.

کاری خوبی که کرد این توصیه‌ها را انجام نداد. به دلیل روند نزولی شدید سال گذشته، پرتفیولی مازوسکا به ۴۲۰.۰۰۰ دلار کاهش یافت. هی، او هنوز از برنامه‌اش جلوتر بود، درست است؟ در واقع، این موقعیت بسیار بدتر از آن چیزی است که به نظر می‌رسد. مازوسکا به «سرویس درآمدهای داخلی» بیش از ۳۵۰.۰۰۰ دلار به خاطر مالیات‌های پرداخت‌نشده‌اش از سودهای معاملاتی عظیمش در سال ۱۹۹۹ بدهکار بود. روی‌هایش برای بازنشستگی زود هنگام جایشان را به واقعیت تلخ قرارگرفتن در یک قدمی ورشکستگی داده بودند. این روزها، او و وکلیش زمانی زیادی صرف می‌کردند تا بدون نیاز به تسویه کل پرتفیولیش در حالت بدهکار مالیاتی باقی بماند.

مازوسکا موقعیتش را در یک سری مصاحبه‌ها در دو هفته گذشته بیان می‌کند که: «به جای اینکه به راحتی بازنشسته می‌شدم، در دسامبر به نقطه‌ای از ناامیدی بازگشتم که مجبور شدم فروش خانه‌ام را مدنظر قرار دهم». من حریص بودم. بیش از حد اعتماد به نفس پیدا کرده بودم و به نفسم اجازه دادم بر من غلبه یابد.

داستان مازوسکا، ثروتمندی که به فرد فقیر تبدیل شد مثال روشنی از احساس دردی است که توسط میلیون‌ها سرمایه‌گذار در اثر رکود بازار در سال گذشته تجربه شده بود. در نهایت، اشتباهاتش بسیار دردناک بودند - مازوسکا بیش از حد مارجینش سهام خریداری کرده بود، بیش از حد در سهام فناوری سرمایه‌گذاری کرده بود، برای پرداخت مالیات سود سرمایه‌گذاری‌اش در سودهای قبلی بیش از حد صبر نموده بود. شاید بدتر از همه، او بیش از حد به قدرت و توانایی‌اش در انتخاب سهام باور پیدا نموده بود.

اما داستان مازوسکا چیزی بیشتر از چک‌لیست سرمایه‌گذاری است. آن داستانی احتیاطی است که چطور معامله‌گری آنلاین می‌تواند باعث شود سرمایه‌گذار قدرت خرید سهام را به دلیل ناتوانی در سرمایه‌گذاری‌های آینده از دست بدهد. هرچند، با نگاه به گذشته، به سادگی می‌توانیم ملاحظه کنیم چطور معامله‌گری آنلاین می‌تواند این قدر اغواکننده باشد. فقط در سال ۱۹۹۹، مازوسکا سود ۱.۴۶ میلیون دلاری از پرتفیولیش به دست آورد. همچنین وی دارای بیشترین میزان موفقیت در کلپ سرمایه‌گذاری - کلپ سرمایه‌گذاری درزرت استورم - برای خودش، والدینش، برادرش و چند نفر دیگر بود. (مازوسکا پیش از رفتن به دانشگاه، داوطلب ارتش دریایی آمریکا شد و در جنگ خلیج فارس هم شرکت جست. مهم‌ترین بخش خدمتش را زمانی سپری کرد که نگرهان کمپ‌های جنگی و مین‌روبی زمین‌ها گردید). یکی از بهترین کارهای مازوسکا در طی تابستان ۱۹۹۹ بود، زمانیکه وی ۴۰۰.۰۰۰ سهام USWeb/CKS - یک کارخانه مشاوره اینترنتی که اکنون بخشی از ماکروسافت است (MRCH) را خریداری نمود. در آن زمان، سهام USWeb در حدود ۲۰ دلار به فروش می‌رفت. مازوسکا اکثر سهامش را زمانی فروخت که سهام به قیمت ۴۰ دلار در طی چند هفته بعد رسیده بود - و ۸۰۰.۰۰۰ دلار سود برد.

اما مانند بسیاری از سرمایه‌گذاران، سرمایه مازوسکای در ماه آوریل گذشته، زمانی که ترکیب NASDAQ با اولین فروش‌های شدید در بازار سهام و تکنولوژی آسیب دید، شروع به از بین رفتن کرد. در شرایط مازوسکا، مشکل وی از ترکیب زمان‌بندی بد و قضاوت بد نشأت می‌گرفت. درست پیش از اینکه زمین زیر پای NASDAQ شروع به لرزیدن کند، مازوسکا بر روی E*Trade Group (ET) شرط‌بندی ۱۷۵.۰۰۰ سهامی نمود و تقریباً تمام پولش را در بازار سهام وارد کرد. در قیمت ۲۶ دلار برای هر سهم، مازوسکا قانع شد که حق‌الزحمه دلالی سهام بسیار بیشتر از مقدار ارزش‌گذاری شده است. در عوض او گفت که این یک بازی کوتاه‌مدت است، اما احساس کرد این سهام حرکت صعودی در آینده خواهد داشت. مازوسکا آنقدر از خودش مطمئن بود که نیمی از این سهام را بر اساس مارجینش از

بروکرش، چارلز شواب (SCH) خریداری کرد، همانطور که پیش از این نیز این کار را چندین بار در گذشته انجام داده بود.

اما طی چند روز، قیمت سهام به ۲۱ دلار رسید. شواب درخواست کال مارجین شدن داد، و مازوسکا مجبور به فروش مقداری از سهامش به ارزش ۲۰۰.۰۰۰ دلار شد تا این بدهی را پوشش دهد. سپس خبرهای بدتری دریافت کرد: حسابدارش گفت که وی حدود ۵۰۰.۰۰۰ دلار مالیات به خاطر سود سرمایه‌گذاری سال ۱۹۹۹ خودش بدهکار است. (مازوسکا انتظار داشت بیش از ۳۰۰.۰۰۰ دلار بدهکار نشود). در عین حال، مازوسکا امیدش به بازگشت سهام E*Trade را حفظ نمود. در حالیکه این اتفاق رخ نداد.

مازوسکا می‌گوید: «سقوط کردم و هرگز فکرش را نمی‌کردم چون من پیش از این بسیار موفق بودم». «اعتماد به نفس کاملی داشتم - همه قوانین را شکستم و باید همه سهامم را یکجا می‌فروختم». حسابدارش، کنت پترز، به مازوسکا می‌گوید خطایی در «ازدواج با سهامش» مرتکب شده است و بسیار شیفته خرید مارجینی شده است. اکنون، مازوسکا می‌فهمد اولین چیزی که باید در سال ۲۰۰۰ انجام دهد پرداخت مالیات سال ۱۹۹۹ است، حتی اگر به این معنی باشد که تعداد زیادی از سهامش را بفروشد. به جای آن، وی در زمینه یک برنامه پرداخت اقساط ماهیانه با IRS مذاکره می‌کند. اما مشخص است صورتحساب ۳۰.۰۰۰ دلار در هر ماه، صورتحساب بسیار زیادی است، به خصوص وقتی که مقدار سهام حساب مازوسکا همچنان در حال نزول است. اکنون او و وکیلش تلاش می‌کنند یک برنامه پرداخت بهتری را سروسامان دهند».

نتایج معامله گری بدون داشتن یک برنامه معاملاتی:

چه باور کنید یا خیر، این مثال وجود دارد. اکنون بیایید دانشجویی را مورد بحث قرار دهیم که در کلاس بود. در این داستان او را بن می‌نامیم. بن ازدواج کرده بود و جوان بود. او تصمیم گرفت تا مطالب بیشتری در مورد بازار ارزها بداند چون شنیده بود افراد زیادی از دلار آمریکا پول زیادی به دست آورده‌اند. بن رفت تا سهام خودش را خریداری نماید و امیدوار بود در سن جوانی از طریق معامله‌گری در بازار ارز بازنشسته شود. در اولین روز کلاس، بن اصول اندیکاتورهای ایچیموکو را آموخت. در روز دوم، به او استراتژی ایده‌آل ایچیموکو را آموختیم. پیش از کلاس، بن ۱۰.۰۰۰ دلار از حساب همسرش بدون اجازه وی برداشت نموده بود. وی تصور نموده بود بعد از این که ۱۰۰.۰۰۰ دلار درآمد کسب کرد این مسئله را به همسرش بگوید. بعد از دومین روز کلاس، بن تصمیم گرفت با ۱۰.۰۰۰ دلار معاملاتش را شروع کند. در ابتدا، چند معامله اولش موفقیت‌آمیز بود و او به سادگی توانست حداقل ۱۵ پیپ از هر ترید به دست آورد. حتی با وجود ضررها، وی دارای تریدهای برنده نیز بود، این تریدها پیش از این که برگردند حداقل ۵ پیپ سود برایش در برداشتند.

بعد از مدتی، اعتماد به نفسش آنقدر افزایش یافت که تصمیم گرفت مقدار معامله‌اش را افزایش دهد و هدفش را نیز ۳ پیپ بیشتر نماید. در معامله بعدی، مقدار معامله‌اش را به شدت افزایش داد. او ناگهان ۳.۰۰۰ دلار در طی ۳۰ ثانیه ضرر کرد. به وضوح، اعلام یک خبر در چند ساعت بعدی برای جفت ارزهایی که در حال معامله بود، صورت می‌گرفت. به جای خارج شدن از معامله، بن تصمیم گرفت در معامله باقی بماند به این امید که ۳۰.۰۰۰ دلار ضرر را جبران کند. او متعقد بود جفت ارز باید صعود کند چون تایم‌فریم‌های بالاتر همگی صعودی بودند. نه تنها بن ۳.۰۰۰ دلار ضرر کرده بود بلکه او تصمیم گرفت بخواهد چون واقعاً دیروقت بود و خسته شده بود. بن مجبور بود صبح روز بعد زودتر در محل کار حاضر شود. بن بدون اینکه توقفی در معامله قرار دهد چون معتقد بود به زودی معامله به سمت صعودی حرکت خواهد کرد، خوابید.

بعد از چند ساعت خواب، بن با اضطراب بلند شد تا ببیند معامله وی در چه حالی است. در حدود ۵ صبح زمان استاندارد شرق در آتلانتا بود. او به حسابش نگاه کرد و مقدار حساب برابر ۲۰۰۰ دلار بود و حساب اکنون «قفل» شده بود چون کال مارجین شده بود. در ساعت ۴:۳۰ دقیقه صبح ESTW، اعلام خبر صورت گرفته بود و جفت ارزی که در حال معامله بود با گپ به سمت پائین باز شده بود. این گپ باعث شد معامله وی به جای اینکه منفی شود، ناگهان صفر شود. بروکر وی نتوانست در نقطه صفر به دلیل وجود گپ وی را از معامله خارج کند. اکنون، به شرکت بروکری مبلغی نیز بدهکار شده بود. یک معامله، یک شب، یک ضرر باعث شد وی به طور کامل از معامله خارج شود. اکنون مجبور بود دوباره کار کند تا بتواند آن پول را برگرداند چون این پول، پول همسرش بوده است.

سوالی که پیش از شروع این بخش باید از خودتان پرسید «آیا این اتفاق برای شما نیز رخ داده است؟» آیا صبر، دیسیپلین، و ثبات برای کنترل حرص و هیجاناتان دارید؟ امیدوارم اینگونه باشد چون معامله‌گری در تایم‌فریم‌های کوچک باعث می‌شود معاملات با سرعت بسیار بیشتری نسبت به تایم‌فریم‌هایی مانند نمودارهای روزانه جابجا شوند. اگر به هیجاناتان اجازه دهید بروز نمایند، چند ثانیه تردید می‌تواند هزینه زیادی برایتان در برداشته باشد.

برنامه معاملاتی:

هدف معامله‌گری روزانه باید کسب واقع‌گرایانه سود در طی یک ماه باشد. هدف باید چیزی باشد که هیچ فشاری بر معاملاتتان وارد نسازد. این مسئله اجازه می‌دهد زمانیکه در حال معامله هستید، سرخوش باشید. بنابراین، گفته‌های یک معامله‌گر مبتدی که بگوید می‌خواهد ۴۰۰۰ دلار ماهیانه به دست آورد، سخنی بیهوده است. هدف یک مبتدی باید کسب ماهیانه ۵۰۰ دلار سود باشد. بعد از به دست آوردن این مقدار سود در طی شش ماه به طور مداوم، سپس می‌توانید مقدار سودتان را به ۱۰۰۰ دلار در ماه افزایش دهید و همین‌طور. درست مانند یک تجارت، انتظار افزایش سود به صورت تدریجی امری واقع‌گرایانه است. شما هرگز قادر نخواهید بود حقوق یک «شغل» را حداقل طی دو سال ثابت نگه دارید. افزایش سود در طی دو سال قابل‌دستیابی است اگر سخت کار کنید و دیسیپلین معاملاتی‌تان را حفظ کنید.

اکنون بیایید ببینیم چرا این بخش را می‌خوانید - چطور از ایچیموکو کینکوهاو برای معاملات روزانه استفاده می‌کنید. ابتدا، نیاز به ایجاد یک برنامه معاملاتی برای معاملات در طول روز داریم. از همان برنامه معاملاتی که پیش از این ایجاد نموده‌اید همراه با مقدار اصلاحات استفاده خواهیم کرد. در اینجا برخی از اصلاحاتی که نیاز است انجام دهیم را بیان نمودیم:

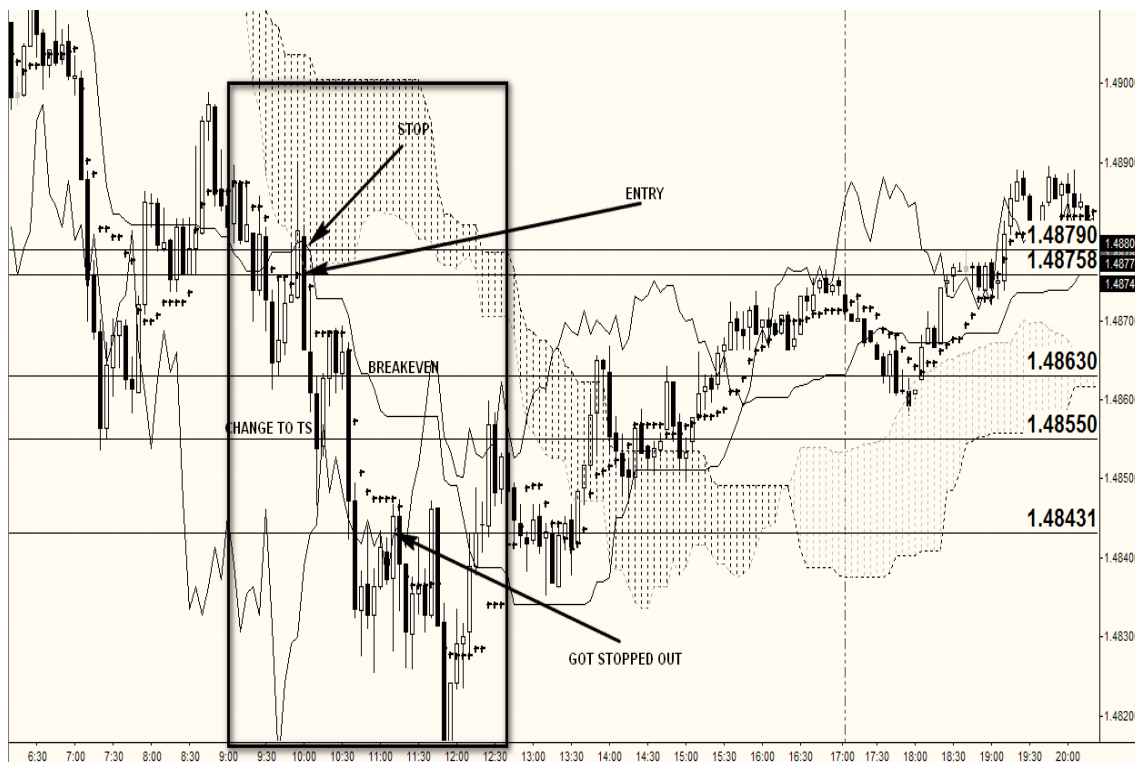
- هدف سود ماهیانه برابر ۲۵۰ دلار است. اگر بتوانیم به طور مداوم به این سود در مدت شش ماه دست یابیم سپس هدف سودمان را ۲۵۰ دلار دیگر افزایش خواهیم داد.
- فقط دو ضرر در هر روز مجاز است.
- بیش از پنج معامله در هر روز نمی‌توان انجام داد.
- حدکثر ضرر در هر معامله ۲۵ پیپ است (شامل اسپرد).
- سرمایه اولیه ۲۵۰ دلار است.
- تخصیص اندازه معامله برای اهداف هدف‌گیری شده ماهیانه:
 - ۱ معامله مینی برای هدف ۲۵۰ دلار ماهیانه.
 - ۲ معامله مینی برای هدف ۵۰۰ دلار ماهیانه.
 - ۵ معامله مینی برای هدف ۱۰۰۰ دلار ماهیانه

- ۱۰ معامله مینی برای هدف ۱.۵۰۰ دلار ماهیانه.
- کالای مورد معامله EURUSD است. ارز EURUSD را به این دلیل انتخاب کردیم چون بالاترین اسپردی که در اکثر بروکرها برای این جفت ارز می‌باشد، ۲ پیپ است. نیاز است میزان اسپرد پائین باشد چون در حال معامله در طول روز هستیم. در معاملات در طول روز، انتظار حرکات شدید قیمتی نداریم. اسپرد ۱۰ پیپی می‌تواند سود معاملات روزانه را خنثی سازد به خصوص اگر که در هر معامله ۱۵ پیپ سود اختصاص داده باشیم. در مورد تایم فریم‌های بالاتر نظیر تایم فریم روزانه، می‌توانیم میزان اسپرد را بالاتر در نظر بگیریم چون اهداف معاملاتی‌مان حدود ۲۰۰ پیپ سود در هر معامله است چون این معامله، یک معامله بلندمدت است.
- مقدار آستانه/توقف
- از کیجنسن همراه بافر به عنوان توقف استفاده نمائید مگر اینکه ریسک‌تان از ۲۵ پیپ بیشتر باشد. در غیر اینصورت، از تکناسن همراه با بافر به عنوان توقف استفاده نمائید.
- زمانی که ۱۲ پیپ سود به دست آوردید، نقطه توقف را به نقطه سربه‌سر انتقال دهید.
- زمانی که ۲۰ پیپ سود به دست آوردید، از تکناسن به عنوان توقف استفاده کنید.
- اگر کندل با گپ باز شد، از معامله با حداقل ۲۰ پیپ سود خارج شوید.
- تایم فریم: ۵ دقیقه.
- بافر توقف ورود ۱۰ پیپ است. بافر بعد از ورود به معامله، ۵ پیپ است.
- استراتژی ایچیموکو (توالی)
- تقاطع کیجنسن
- شکیبایی برای پولبک قیمت با کیجنسن یا نزدیک شدن قیمت به کیجنسن.
- تنظیم نقطه ورود به معامله دقیقاً در تکناسن.

بک‌تست:

شکل ۸-۱ اولین معامله در تاریخ ۱۷ نوامبر ۲۰۰۹ ارز EURUSD در نمودار ۵ دقیقه‌ای نشان می‌دهد. جدول ۸-۱ اعداد و ارقام مربوط به معامله را نشان می‌دهد. فرض می‌کنیم روز معامله از ۷ صبح تا ۴ عصر به وقت زمانی استاندارد شرقی می‌باشد.

این معامله، معامله سودآوری بود. پولبک تا کیجنسن و همچنین بخش پائینی ابر کومو صورت گرفته بود. بخش پائینی ابر کومو و کیجنسن به عنوان مقاومت عمل نموده بودند. دو اندیکاتور ایچیموکو با دو فرمول متفاوت، مقدار مقاومت یکسانی را نشان دادند. این یک عامل قدرتمند است و باعث می‌شود این عدد به مقاومت مهمی تبدیل شود. نتایج معامله در جدول ۸-۱ نشان داده شده است.

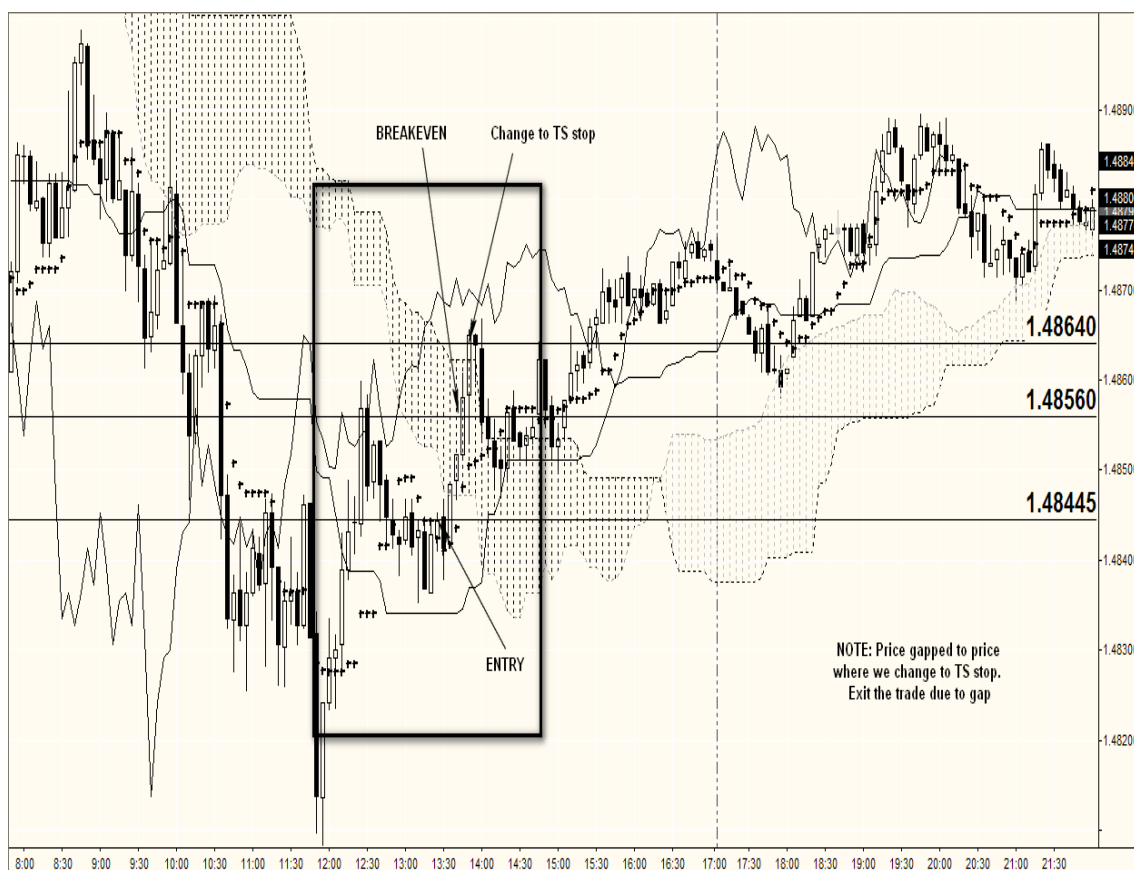


شکل ۱-۸ نمودار چارت ۵ دقیقه‌ای EURUSD، ۱۷ نوامبر ۲۰۰۹، ترید # ۱

جدول ۱-۸ اعداد و ارقام معامله # ۱

Entry Date	11/17/09
Entry Time	10:00
Entry Price	1.4875
Entry Stop	$1.4878 + 0.0010 = 1.4888$
Exit Date	11/17/09
Exit Time	11:10
Exit Price	1.4843
Profit	32 pips – spread (0.0002) = 30 pips
Risk	23 pips

در شکل ۱-۸ دومین روز معاملات را ملاحظه می‌کنید. جدول ۱-۸ اعداد و ارقام مربوط به معاملات را نشان می‌دهد. معامله در حدود ۱۸ پیپ سود داشت. توجه کنید، در زیر ابر کومو وارد معامله شده‌اید به دلیل وجود گپ در کندل ۵ دقیقه‌ای سود به دست آورده‌اید. اگر از ترید به دلیل وجود گپ خارج نمی‌شدید، حدود ۴ پیپ سود به دست می‌آوردید. اگر برنامه معاملاتی‌تان از کیجنسن منهای بافر استفاده می‌نماید، باید در ۱.۴۸۶۴ از ترید خارج می‌شدید. این همان قیمتی است که به دلیل وجود گپ از معامله خارج شده‌اید.



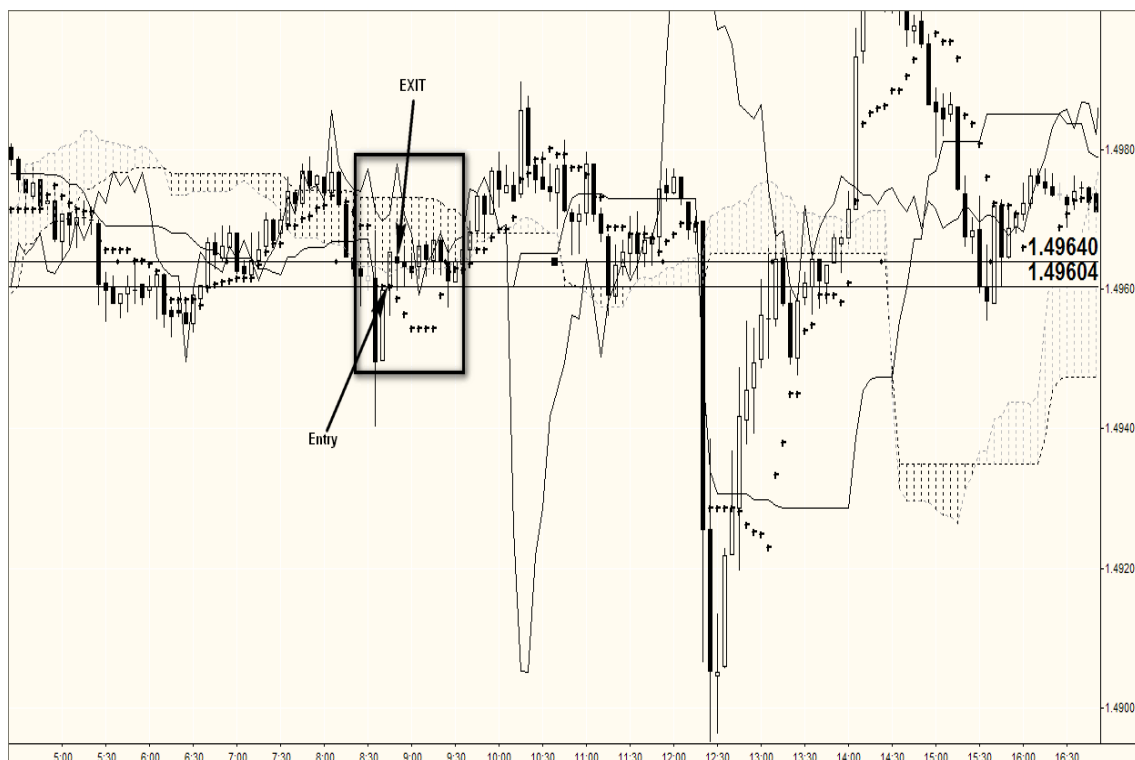
شکل ۲-۸ نمودار چارت ۵ دقیقه‌ای EURUSD، ۱۷ نوامبر ۲۰۰۹، ترید # ۲

جدول ۲-۸: اعداد و ارقام معامله # ۲

Entry Date	11/17/09
Entry Time	13:25
Entry Price	1.4844
Entry Stop	$1.4834 - 0.0010 = 1.4824$
Exit Date	11/17/09
Exit Time	13:50
Exit Price	1.4864
Profit	$20 \text{ pips} - \text{spread } (0.0002) = 18 \text{ pips}$
Risk	20 pips

روزی که برای بک‌تست گرفتن انتخاب کرده‌ایم دو معامله موفقیت‌آمیز اعطا نموده است. برای یادگیری، باید از معاملات ضررده‌مان نیز مطالبی بیاموزیم. بنابراین، می‌خواهیم به زمان عقب باز می‌گردیم تا روزهایی برای پیدا کردن برخی از ضررها و بررسی آنها بیابیم. روز بعدی که انتخاب نمودیم ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹ برای نمودار ۵ دقیقه‌ای EURUSD است.

شکل ۳-۸ اولین روز معاملاتی در ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹ را نشان می‌دهد.



شکل ۳-۸ نمودار چارت ۵ دقیقه‌ای EURUSD، ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹، ترید # ۳

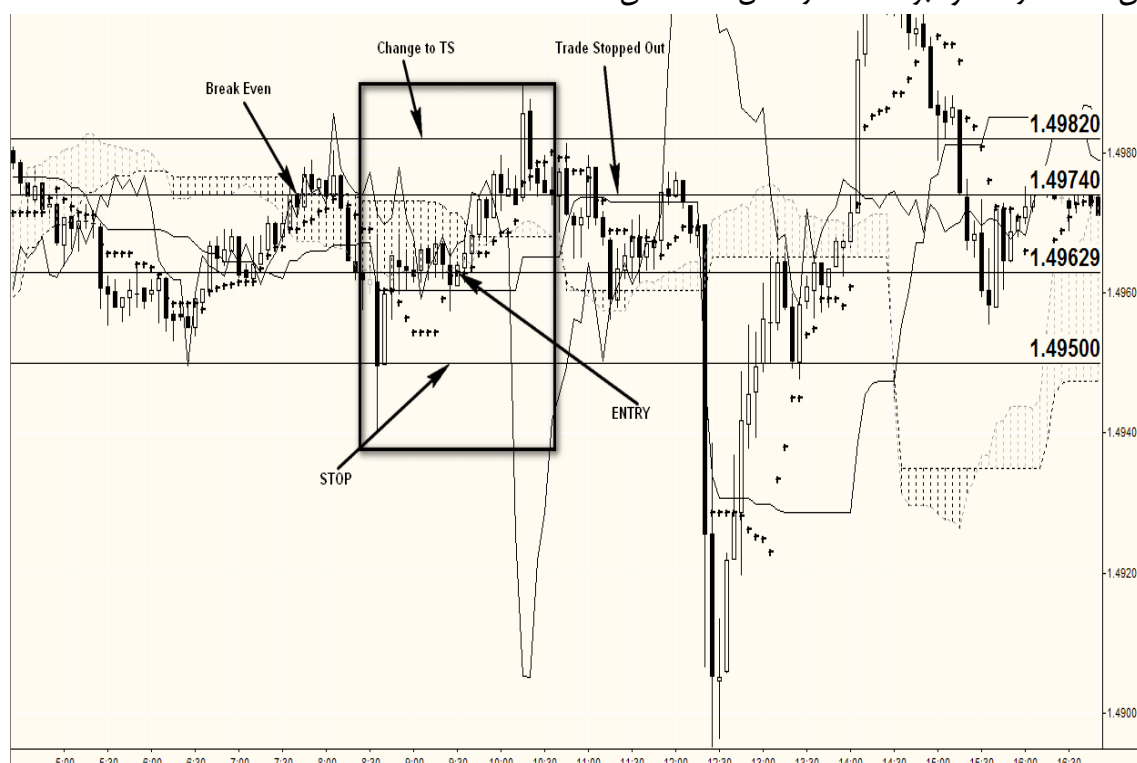
این معامله همانطور که در جدول ۳-۸ نشان داده شده، با ضرر بسته شده است.

جدول ۳-۸ معامله #۳ آمار و ارقام سطح بالا

Entry Date	11/16/09
Entry Time	
Entry Price	1.4960
Entry Stop	
Exit Date	
Exit Time	
Exit Price	
Profit	4 pips
Risk	

قیمت به طور ناگهانی با شکاف به سمت پائین حرکت کرده و کیجنسن را قطع نموده است. این حرکت باعث می‌شود تکنسین به طور ناگهانی به سمت پائین حرکت کند و علامت نزولی صادر نموده است. بنابراین، معامله را بر اساس برنامه معاملاتی‌مان به صورت نزولی تنظیم می‌کنیم. بعد از آن این کندل به سمت بالاتر حرکت نمود طوری‌که این کندل دوباره کیجنسن را قطع کرد. این کندل آنقدر به سمت بالا حرکت نکرد که به توقف ما برسد. هرچند، تکنسین، کیجنسن را به سمت بالا قطع نموده است. بنابراین، چون این معامله علائم روند صعودی را صادر نمود، پس با ضرر از معامله خارج شدیم. اگر هر یک از علائم ایچیموکو جهت خود را تغییر دهد، پس باید هم‌اکنون از معامله خارج شویم. این یک ترید بد بود. مشکل از ابتدا، رابطه بین تکنسین و کیجنسن بود. بر اساس این معامله، قطعاً می‌دانیم که ممکن است نیاز به تغییر برنامه معاملاتی‌مان جهت جلوگیری از بروز این گونه شرایط بد داریم.

دومین معامله در ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹، در شکل ۴-۸ نشان داده شده است.



شکل ۴-۸ نمودار چارت ۵ دقیقه‌ای EURUSD، ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹، ترد # ۴

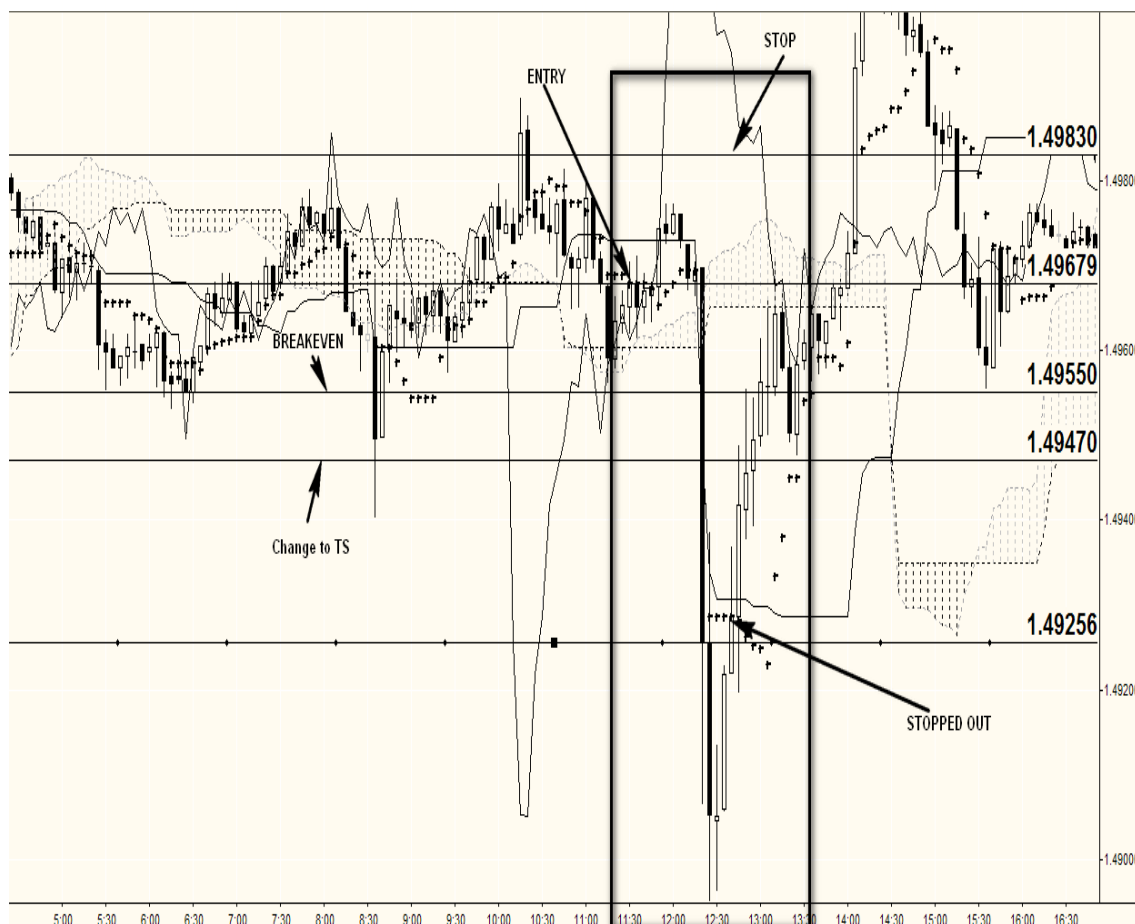
جدول ۴-۸ آمار و ارقام مربوط به معامله # ۴ را نشان می‌دهد.

جدول ۴-۸ آمار و ارقام معامله # ۴

Entry Date	11/16/09
Entry Time	09:30
Entry Price	1.4962
Entry Stop	$1.4860 - 0.0010 = 1.4850$
Exit Date	11/16/09
Exit Time	10:25
Exit Price	1.4974
Profit	$12 \text{ pips} - \text{spread } (0.0002) = 10 \text{ pips}$
Risk	12 pips

این معامله تقریباً درست بعد از معامله ضررده رخ داده است. دلیل این است که در این دوره زمانی قیمت بر روی کیجنس به سمت بالا و پائین حرکت نموده است. به خاطر داشته باشید، برنامه معاملاتی‌مان بیان می‌کند نمی‌توانیم در ادامه این روز معامله‌ای داشته باشیم اگر دو معامله ضررده در کارنامه آن روز داشته باشیم. این امر را در برنامه معاملاتی‌مان گنجانده‌ایم چون روزهایی وجود دارد که معاملات درست پیش نمی‌روند. در این روزها، هرگز نمی‌خواهیم معامله دیگری انجام دهیم. به سختی می‌توان این روزها را مشخص کرد بنابراین باید حداقل دو معامله انجام دهیم تا مشخص کنیم آیا این روز جزو روزهایی است که نباید در آن معامله‌ای انجام داد.

شکل ۵-۸ معامله # ۵ در ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹ نشان می‌دهد.



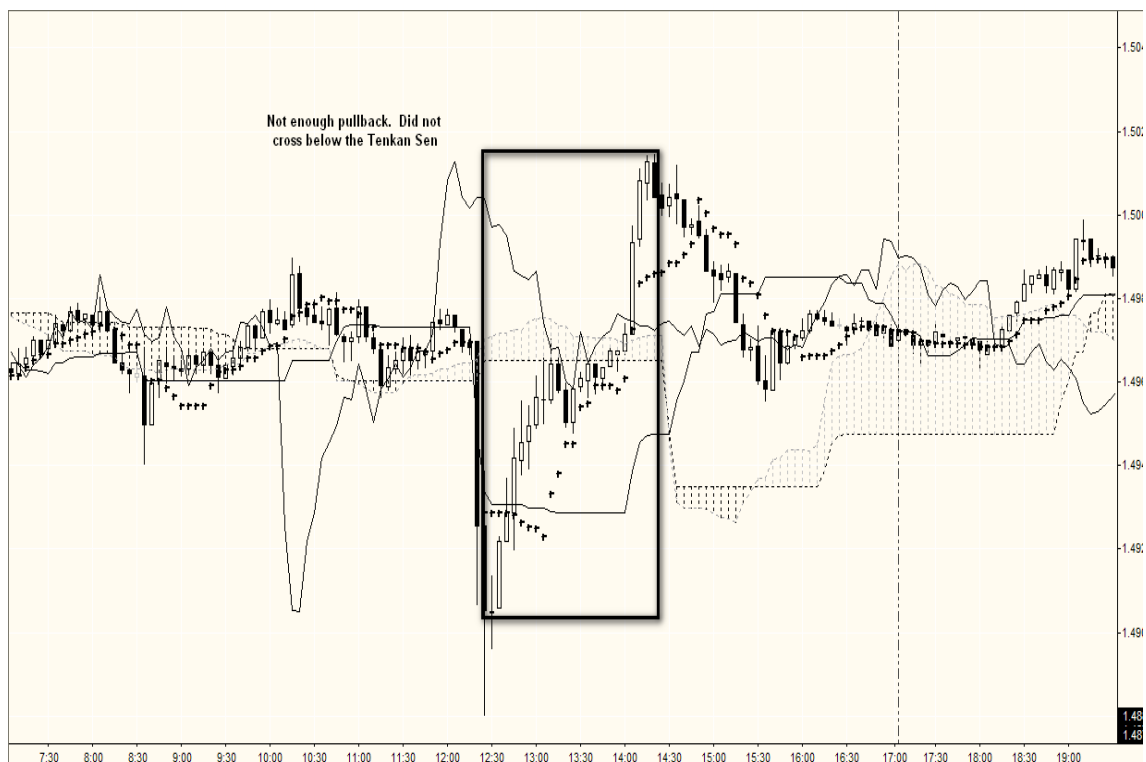
شکل ۵-۸ نمودار چارت ۵ دقیقه‌ای EURUSD، ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹، ترید # ۵

اولین معامله ضررده بود. دومین معامله سود داشت. اکنون سومین معامله ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹ را آنالیز می‌کنیم که در مجموع چهارمین معامله است. این معامله بسیار سودآور بود. دلیل آن شکاف بزرگ ایجاد شده به دلیل حرکت قیمت به سمت پائین بود. این معامله بر اساس خبر بود اما با این حال، ما این ترید را انجام می‌دهیم. جدول ۸-۵ آمار و ارقام مربوط به این معامله را نشان می‌دهد.

جدول ۸-۵ آمار و ارقام معامله # ۵

Entry Date	11/16/09
Entry Time	11:35
Entry Price	1.4967
Entry Stop	$1.4873 - 0.0010 = 1.4883$
Exit Date	11/16/09
Exit Time	12:40
Exit Price	1.4925
Profit	$42 \text{ pips} - \text{spread } (0.0002) = 40 \text{ pips}$
Risk	16 pips

شکل ۶-۸ چهارمین معامله بالقوه را در ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹ نشان می‌دهد.



شکل ۶-۸ نمودار ایچیموکو چارت ۵ دقیقه‌ای EURUSD، ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹، ترید # ۶

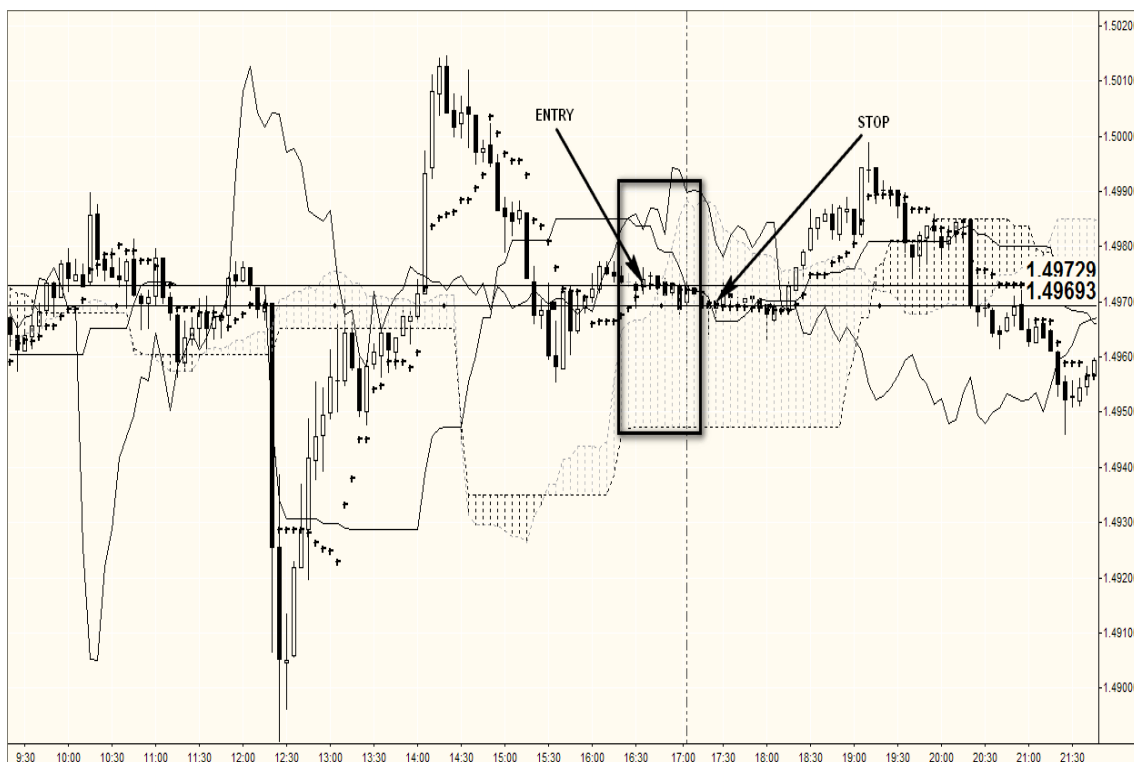
جدول ۶-۸ آمار و ارقام مربوط به این معامله را نشان می‌دهد.

جدول ۶-۸ آمار و ارقام معامله # ۶

Entry Date	11/16/09
Entry Time	17:05
Entry Price	1.4972
Entry Stop	$1.4972 + 0.0010 = 1.4982$
Exit Date	11/16/09
Exit Time	18:15
Exit Price	1.4969
Profit	$3 \text{ pips} - \text{spread } (0.0002) = 1 \text{ pips}$
Risk	10 pips

حداکثر مجاز به انجام ۵ معامله در هر روز هستیم. اگر بتوانیم ۵ معامله در روز انجام دهیم پس این روز، یک روز موفقیت‌آمیز خواهد بود اگر سه یا بیش از سه بار برد برای آن روز داشته باشیم. برای این معامله بالقوه، وارد این معامله نشدیم چون پولبک زیادی صورت نگرفته بود. نیاز داریم پولبک به زیر تنکسن برود تا بتوانیم آن را به عنوان یک پولبک در نظر بگیریم.

شکل ۷-۸ آخرین معامله در ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹ را نشان می‌دهد.



شکل ۷-۸ نمودار ایچیموکو چارت ۵ دقیقه‌ای EURUSD، ۱۶ نوامبر ۲۰۰۹، ترید # ۵

این معامله ضررده بود. همه اعداد را خودتان محاسبه کنید و ببینید که ضرر می کنید.

نتیجه گیری:

اکنون کارمان با بک تست معاملات در طی روز به خاتمه رسیده است. باید ایده خوبی در مورد این که چطور از ایچیموکو کینکو هایو برای معاملات در طول روز به کار برده شود داشته باشید. البته، این برنامه فقط یک برنامه معاملاتی برای یک استراتژی است. استراتژی‌های زیاد دیگری وجود دارند. از تکنیک‌هایی که فراگرفته‌اید استفاده کنید تا برنامه‌های معاملاتی مختلفی با استراتژی‌های معاملاتی در طول روز ایجاد نمایید. تا زمانی که بک تست موفقیت‌آمیز نداشته‌اید، هرگز در یک حساب واقعی معامله نکنید.

فصل ۹

نتیجه‌گیری

اکنون در پایان سفر ایچیموکو قرار داریم. شرح دادیم چطور مرحله به مرحله به یک معامله‌گر موفق تبدیل شوید. این مراحل درست به این صورت شروع می‌شوند که فردی شروع به ایجاد یک تجارت جدید نماید، یعنی، با ایجاد یک برنامه معاملاتی. برنامه معاملاتی «طرح»های تجاری را مشخص می‌سازد و نشان می‌دهد چطور همه این طرح‌ها باید همراه با یکدیگر به کار برده شوند تا درآمد ایجاد کند و هزینه‌ها را در قیمت‌های تعریف شده نگه دارد. برای معامله‌گری، راه انجام دقیقاً یکسان است. به جای یک برنامه تجاری، یک برنامه معاملاتی ایجاد نمودیم. برنامه معاملاتی مرحله به مرحله نشان می‌دهد چطور معامله خواهیم کرد. برنامه معاملاتی سیستم بنیادی، سیستم تکنیکال، مدیریت سرمایه، فرضیات و غیره را نشان می‌دهد که از این عوامل برای معامله‌گری استفاده می‌شود. این برنامه در زمان‌های خاص مورد آزمایش قرار می‌گیرد تا ببینیم اهداف این برنامه آیا برآورده می‌شوند. در صورت عدم برآورده‌سازی اهداف، اصلاحاتی باید صورت گیرد تا به هدف نهایی دست یابیم. درس‌هایی که در این کتاب آموختیم پایه‌های اصلی تبدیل شدن به یک معامله‌گر موفق است. این مسئله به خودمان بستگی دارد که درس‌ها را دنبال کنیم، تحقیق کنیم، بک‌تست بگیریم و فکر کنیم.

کارمان تمام شده است. امیدوارم این کتاب سرمایه ارزشمندی برای شما باشد. لطفاً نظراتتان را از طریق وبسایتمان www.eijcapital.com با ما در میان بگذارید. در بخش بعدی لیستی از وبسایت‌هایی است که ابزارهای حمایتی برایتان مهیا می‌سازند. لطفاً از آنها استفاده کنید. این سایت‌ها وجود دارند تا به شما در یک سفر موفقیت‌آمیز کمک نمایند.

وب سایت اصلی: www.eiicapital.com

فروم‌های مباحثه‌ای: www.kumotrader.com

وبلاگ: www.blog.kumotrader.com

ویکی‌پدیای ایچیموکو: www.ichimoku.org

برگه‌های تحلیل و تجزیه ایچیموکو

	پرسشنامه معاملاتی ایچیموکو	
	تاریخ:	
	کالا:	
	توضیحات:	
روابط	نتایج	
قیمت نسبت به ابر کومو		
صعودی یا نزولی؟	صعودی: قیمت بالای ابر کومو	
	نزولی: قیمت زیر ابر کومو	
	سایدوی: قیمت درون ابر کومو	
سایه‌های کومو	صعودی قوی: فاقد سایه	
(ابر کومو پشت قیمت)	نزولی قوی: فاقد سایه	
	صعودی ضعیف: دارای سایه	
	نزولی ضعیف: دارای سایه	
تنکانسن/کیجنسن		
صعودی یا نزولی؟	صعودی: تنکانسن < کیجنسن	
	نزولی: کیجنسن < تنکانسن	
	خنثی: کیجنسن = تنکانسن	
فاصله قیمت از کیجنسن؟	نزدیک (قوی)	
	دور (ضعیف)	
آیا اندیکاتورهای ایچیموکو درون ابر قرار دارند؟	سایدوی: کیجنسن درون ابر کومو (ضعیف)	
	سایدوی: تنکانسن درون ابر کومو (ضعیف)	
	رونددار (قوی)	
فاصله قیمت از تنکانسن؟	نزدیک (قوی)	
	دور (ضعیف)	
آیا کیجنسن مسطح است؟	سایدوی: مسطح (ضعیف)	
	در حال حرکت در جهت روند (قوی)	
چیکواسپن		
صعودی یا نزولی؟	صعودی: چیکواسپن بالای ابر کومو (گذشته)	
	نزولی: چیکواسپن زیر قیمت (گذشته)	
آیا چیکواسپن درون ابر کومو است؟	سایدوی: درون ابر کومو (ضعیف)	

	رونددار (قوی)	
	وارد کندل‌های قیمت خواهد شد: ضعیف وارد کندل‌های قیمت نخواهد شد: قوی	حرکت آینده (اگر سایدوی شود، آیا چیکواسپین وارد کندل‌های قیمت می‌شود)
		گوموی آینده
	صعودی: سنوکواسپین A بزرگتر از سنوکواسپین B	صعودی یا نزولی؟
	نزولی: سنوکواسپین B بزرگتر از سنوکواسپین A	

رابطه			نتیجه
صعودی	سنوکواسپین A آینده	سنوکواسپین B آینده	
در حال صعود	صعودی	مسطح	قوی
مسطح	نزولی	مسطح	ضعیف
در حال نزول	صعودی	صعودی	قوی
سنوکواسپین A آینده	مسطح	مسطح	
سنوکواسپین A آینده	نزولی	صعودی	ضعیف
صعودی	سنوکواسپین A آینده	سنوکواسپین B آینده	
	نزولی	مسطح	قوی
	صعودی	مسطح	ضعیف
	نزولی	نزولی	قوی
	مسطح	مسطح	
	صعودی	نزولی	ضعیف
اندیکاتورهای ایچیموکو			
تنکانسن (قرمز)	قرمز: بالاترین قیمت‌ها + پائین‌ترین قیمت/۲ برای ۹ دوره		
کیجنسن (سبز)	سبز: (بالاترین قیمت‌ها + پائین‌ترین قیمت)/۲ برای ۲۶ دوره		
چیکواسپین (ارغوانی)	ارغوانی (قیمت حال حاضر که ۲۶ دوره به عقب انتقال داده شده است)		
ابر کومو			
سنوکواسپین A	زمینه سفید: (تنکانسن + کیجنسن)/۲ که ۲۶ دوره به جلو انتقال یافته است.		
سنوکواسپین B	زمینه ارغوانی: (بالاترین قیمت‌ها + پائین‌ترین قیمت‌ها)/۲ برای ۵۲ دوره گذشته که ۲۶ دوره به جلو انتقال یافته است.		
فارکس			
خرید ورود/توقف	اسپرد + بافر		
فروش ورود/توقف	بافر		