
آموزش تحلیل تکنیکال

رضا گلشاهیان

تدوین و جمع آوری:
عبدالواحد قادرزاده
تیم فارکس مهاباد



فهرست مطالب

مقدمه چهارده

مقدمه آقای گلشاهیان هفده

۱ ویدئوی شماره ۱-۱۲: رفتار قیمت ۱

۱.۱ قیمت چگونه رفتار می کند؟ ۱

۲.۱ نحوه رفتار قیمت بر روی نمودار ۱

۲ ویدئوی شماره ۲-۱۲: تشخیص اتمام روند ۶

۱.۲ چگونه می توان تشخیص داد که روند در حال تغییر است؟ ۶

۳ ویدئوی شماره ۳-۱۲: اندازه اصلاحی ها ۸

۴ ویدئوی شماره ۱۳: خطوط روند ۹

۱.۴ تعریف خط روند ۹

۲.۴ مشخصات خطوط روند ۹

۳.۴ شرایط روند و تشخیص اتمام روند ۱۰

۴.۴ چگونه می توان تشخیص داد که روند در حال تغییر است؟ ۱۱

۵ ویدئوی شماره ۱۴: خطوط حمایت و مقاومت ۱۲

۱.۵ تعریف خطوط حمایت و مقاومت ۱۲

۲.۵	ماهیت خطوط حمایت و مقاومت	۱۳
۳.۵	تبدیل خطوط مقاومت و حمایت به یکدیگر	۱۳
۴.۵	انواع خطوط مقاومت و حمایت	۱۳
۶	ویدئوی شماره ۱۵: خطوط پیوت	۱۵
۱.۶	تعریف پیوت	۱۵
۲.۶	محاسبه پیوت های روزانه	۱۵
۷	ویدئوی شماره ۱۶: اعداد فیبوناچی، تاریخچه و کارایی	۱۸
۱.۷	اعداد صحیح و اعداد فیبوناچی	۱۸
۲.۷	تاریخچه اعداد فیبوناچی	۱۹
۳.۷	نسبت طلایی	۱۹
۴.۷	نسبت های فیبوناچی	۲۰
۵.۷	اعداد فیبوناچی در طبیعت	۲۰
۶.۷	اعداد فیبوناچی و دلایل اهمیت	۲۱
۷.۷	فیبوناچی در بازارهای مالی	۲۲
۸.۷	فیبوناچی در امواج	۲۲
۱.۸.۷	مورد اول: فیبوناچی اصلاحی یک موج جنبشی	۲۲
۲.۸.۷	مورد دوم: فیبوناچی برای دو موج	۲۳
۸	ویدئوی شماره ۱۷: الگوهای فیبوناچی - بخش اول	۲۵
۱.۸	الگوهای فیبوناچی و ترکیب نسبت های فیبوناچی برای پیدا کردن نقاط برگشت قیمت	۲۵
۱.۱.۸	فیبوناچی ترکیبی و کارایی آن	۲۵
۲.۱.۸	درصدهای فیبوناچی	۲۵
۳.۱.۸	همپوشانی درصدهای فیبوناچی در یک محدوده	۲۶

۹ ویدئوی شماره ۱۸: الگوهای فیبوناچی - بخش دوم ۲۹

- ۱.۹ دسته اول: الگوهای فیبوناچی سه موجی ۳۰
- ۱.۱.۹ الگوی اول: زیگزاگ $AB = CD$ ۳۰
- ۲.۱.۹ الگوی دوم: الگوی سه درایو Three Drive Pattern ۳۰
- ۲.۹ دسته دوم: الگوهای فیبوناچی چهار موجی کوچکتر از موج اول ۳۱
- ۱.۲.۹ الگوی اول: الگوی گارتلی Gartley Pattern ۳۱
- ۲.۲.۹ الگوی دوم: الگوی خفاش Bat Pattern ۳۲

۱۰ ویدئوی شماره ۱۹: الگوهای فیبوناچی - بخش سوم ۳۴

- ۱.۱۰ دسته سوم: الگوهای فیبوناچی چهار موجی بزرگتر از موج اول ۳۴
- ۱.۱.۱۰ الگوی اول: الگوی خرچنگ Crab Pattern ۳۴
- ۲.۱.۱۰ الگوی دوم: الگوی پروانه Butterfly Pattern ۳۵

۱۱ ویدئوی شماره ۲۰: الگوهای شمعی ژاپنی ۳۷

- ۱.۱۱ پیدایش الگوهای شمعی ژاپنی ۳۷
- ۲.۱۱ دسته بندی الگوهای کندل استیک ۳۷
- ۱.۲.۱۱ ساختار یک کندل ۳۸
- ۲.۲.۱۱ تفسیر یک کندل ۳۸
- ۳.۲.۱۱ انواع کندل و تفسیر آنها ۳۹
- ۴.۲.۱۱ الگوهای تک کندلی ۴۰
- ۵.۲.۱۱ الگوهای دو کندلی ۴۵
- ۶.۲.۱۱ الگوهای سه کندلی ۴۶
- ۷.۲.۱۱ ساده کردن کندل ها برای درک بهتر ۴۸
- ۸.۲.۱۱ تأییدیه های الگوهای کندل استیک ۴۹

۱۲ ویدئوی شماره ۲۱: الگوهای قیمت - قسمت اول

- ۵۱ ۱.۱۲ تعریف الگوی قیمت ۵۱
- ۵۲ ۲.۱۲ دسته اول: الگوهای برگشتی یا تغییردهنده روند ۵۲
- ۵۲ ۱.۲.۱۲ الگوی اول: الگوی سر و شانه صعودی و نزولی ۵۲
- ۵۳ ۲.۲.۱۲ الگوی دوم: الگوی سقف و کف دوقلو (دو قله و دو دره) ۵۳
- ۵۵ ۳.۲.۱۲ الگوی سوم: الگوی سقف و کف سه قلو (سه قله و سه دره) ۵۵

۱۳ ویدئوی شماره ۲۲: الگوهای قیمت - قسمت دوم

- ۵۷ ۱.۱۳ الگوهای ادامه دهنده قیمت ۵۷
- ۵۷ ۱.۱.۱۳ الگوی اول: الگوی پرچم Flag Pattern ۵۷
- ۵۸ ۲.۱.۱۳ الگوی دوم: انواع الگوهای مثلث ۵۸
- ۶۰ ۳.۱.۱۳ الگوی سوم: کنج ها Wedges ۶۰
- ۶۱ ۴.۱.۱۳ الگوی چهارم: مستطیل ۶۱

۱۴ ویدئوی شماره ۲۳: اندیکاتورها

- ۶۲ ۱.۱۴ تعریف ابزارهای معاملاتی (اندیکاتورها) ۶۲
- ۶۲ ۲.۱۴ انواع اندیکاتورها ۶۲
- ۶۳ ۱.۲.۱۴ اسیلاتورها یا نوسان سنج ها (Bounded) Ocillators ۶۳
- ۶۳ ۲.۲.۱۴ اندیکاتورهای غیر محدود Not Bounded ۶۳
- ۶۳ ۳.۱۴ اندیکاتور میانگین متحرک Moving Average ۶۳
- ۶۴ ۱.۳.۱۴ انواع میانگین متحرک ۶۴
- ۶۵ ۲.۳.۱۴ کاربردهای میانگین متحرک ۶۵
- ۶۵ ۳.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک به عنوان خط روند Dynamic Trend ۶۵
- ۶۵ ۴.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک به عنوان مومنتوم Momentum ۶۵
- ۶۶ ۵.۳.۱۴ استفاده ترکیبی از میانگین متحرک و کندل برای تعیین مومنتوم ۶۶
- ۶۷ ۶.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک به عنوان حمایت و مقاومت ۶۷

۷.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک برای گرفتن پوزیشن ۶۷

۸.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک برای قرار دادن حد ضرر ۶۸

۱۵ ویدئوی شماره ۲۴: واگرایی ۶۹

۱.۱۵ اندیکاتور مکدی ۶۹

۱.۱.۱۵ چگونگی استفاده از MACD ۷۰

۲.۱۵ واگرایی چیست؟ ۷۱

۱.۲.۱۵ واگرایی معمولی (RD) ۷۱

۲.۲.۱۵ واگرایی مخفی (HD) ۷۲

۳.۱۵ ترکیب واگرایی و تحلیل تکنیکال ۷۲

۱۶ ویدئوی شماره ۲۵: RSI ۷۴

۱.۱۶ شاخص قدرت نسبی Relative Strength Index ۷۴

۲.۱۶ چگونگی استفاده از RSI ۷۴

۱.۲.۱۶ استفاده برای تعیین جهت معاملات ۷۵

۲.۲.۱۶ برای مشخص کردن مناطق اشباع خرید و فروش ۷۵

۳.۲.۱۶ برای تشخیص واگرایی ۷۶

۳.۱۶ استفاده از RSI برای پیدا کردن بهترین جفت ارز برای معامله کردن در بازار ارز ۷۶

۴.۱۶ چگونه از اندیکاتورها برای تعیین جهت قیمت استفاده کنیم؟ ۷۷

۱۷ ویدئوی شماره ۲۶: امواج الیوت ۷۹

۱.۱۷ امواج الیوت ۷۹

۲.۱۷ اصول امواج الیوت ۸۰

۳.۱۷ یک سیکل کامل در الیوت ۸۱

۱.۳.۱۷ قوانین موج های جنبشی ۸۳

۲.۳.۱۷ امواج اصلاحی و قوانین آنها ۸۳

۴.۱۷	الیوت و درصدهای فیبوناچی	۸۴
۱.۴.۱۷	نسبت‌های فیبوناچی امواج جنبشی	۸۴
۲.۴.۱۷	نسبت‌های فیبوناچی اصلاحی‌های امواج جنبشی	۸۶
۳.۴.۱۷	نسبت‌های رایج در موج اصلاحی	۸۷
۵.۱۷	امواج و تاثیر آن بر اندیکاتورها	۸۷
۱۸	ویدئوی شماره ۲۷: مدیریت سرمایه	۸۹
۱.۱۸	هشدار ریسک	۸۹
۲.۱۸	سوال اصلی	۸۹
۱.۲.۱۸	مراحل موفقیت	۹۰
۲.۲.۱۸	نظریه احتمالات در بازار	۹۰
۳.۲.۱۸	قطعه گم شده پازل موفقیت چیست؟	۹۱
۳.۱۸	مدیریت سرمایه	۹۱
۱.۳.۱۸	مدیریت سرمایه در فارکس	۹۲
۴.۱۸	انواع مدیریت سرمایه و قوانین آنها	۹۲
۵.۱۸	قوانین مدیریت سرمایه کوتاه مدت:	۹۳
۱.۵.۱۸	قانون اول از مدیریت سرمایه	۹۳
۲.۵.۱۸	قانون دوم از مدیریت سرمایه	۹۴
۳.۵.۱۸	قانون سوم از مدیریت سرمایه	۹۶
۴.۵.۱۸	قانون چهارم از مدیریت سرمایه	۹۷
۶.۱۸	چگونه از مدیریت سرمایه برای بالا بردن احتمال سود دهی خود استفاده کنیم؟	۹۷
۱.۶.۱۸	معجزه مدیریت سرمایه	۹۷
۲.۶.۱۸	نسبت سود و ضرر در مدیریت سرمایه عادی	۹۸
۳.۶.۱۸	نسبت سود و ضرر در مدیریت سرمایه پیشرفته	۹۸
۷.۱۸	لزوم داشتن طرح و نقشه کار	۹۹

۱۰۷.۱۸	طراحی طرح تجاری (بیزینس پلن)
۲۰۷.۱۸	طرح مدیریت سرمایه
۳۰۷.۱۸	طراحی نقشه معاملاتی
۸.۱۸	چند نمونه استراتژی معاملاتی و تعیین ریسک به ریوارد و نقاط استاپ و تارگت ۱۰۱
۱۰۸.۱۸	پترن تریدینگ
۲۰۸.۱۸	استراتژی پول بک تریدینگ
۳۰۸.۱۸	استراتژی الیوت ویو تریدینگ
۴۰۸.۱۸	استراتژی کندل استیک فرمیشن تریدینگ
۹.۱۸	کلام آخر

۱۹ ویدئوی شماره ۱-۲۸: بسته کامل استراتژی GTS ۱۰۵

۱۰۵	۱.۱۹ هشدار ریسک
۱۰۶	۲.۱۹ سرتیترها
۱۰۶	۳.۱۹ بهترین نقاط ورود به بازار کجا هستند؟
۱۰۷	۴.۱۹ استراتژی GTS
۱۰۷	۱.۴.۱۹ پیش نیاز استفاده از این روش
۱۰۷	۲.۴.۱۹ ابزارهای لازم
۵.۱۹	مرحله اول: تحلیل قدم به قدم تکنیکال و شناخت موقعیت فعلی بازار با چارت خالی بدون در نظر گرفتن اندیکاتورها
۱۰۷	۱.۵.۱۹ مراحل کار
۱۰۸	۲.۵.۱۹ توضیح قدم به قدم مراحل روی چارت
۱۰۹	۳.۵.۱۹ تشخیص ادامه روند یا برگشت آن
۱۱۰	۶.۱۹ ست آپ GTS ابتدای روند
۱۱۲	۷.۱۹ ست آپ GTS وسط روند
۱۱۲	۱۰.۷.۱۹ استراتژی GTS Breakout

۱۱۳	استراتژی GTS Pullback ۲.۷.۱۹
۱۱۴	تشخیص روند و احتمال برگشت قیمت ۸.۱۹
۱۱۴	چگونه قیمت را پس از وارد شدن به ست‌آپ جی تی اس مدیریت کنیم؟ ۹.۱۹
۱۱۵	نقاط تسویه ست‌آپ جی تی اس ۱.۹.۱۹
۱۱۷	است‌آپ جی تی اس شارپ در زمان خبر ۱۰.۱۹

۲۰ ویدئوی شماره ۲-۲۸: بخش دوم استراتژی GTS ۱۲۰

۱۲۰	مرحله دوم: استفاده از ابزارها و اندیکاتورها برای فیلتر کردن ورودی های اشتباه و تشخیص جهت درست بازار با استفاده از GTS Backup ۱۲۰
۱۲۰	عوامل فریب معامله گران ۱.۱.۲۰
۱۲۱	استراتژی GTS Backup ۲.۱.۲۰
۱۲۵	ترکیب مراحل اول و دوم بر روی چارت ۲.۲۰
۱۲۵	مدیریت سرمایه استراتژی GTS ۳.۲۰
۱۲۵	قانون اول ۱.۳.۲۰
۱۲۵	قانون دوم ۲.۳.۲۰
۱۲۶	قانون سوم ۳.۳.۲۰
۱۲۷	قانون چهارم ۴.۳.۲۰

فهرست تصاویر

۱.۱	حرکت جنبشی و حرکت اصلاحی در یک روند صعودی	۲
۲.۱	حرکت جنبشی و حرکت اصلاحی در یک روند نزولی	۲
۳.۱	روند خنثی	۳
۴.۱	نامگذاری نقاط یک موج صعودی	۳
۵.۱	تشکیل Higher X های پشت سر هم در یک روند صعودی	۴
۶.۱	نامگذاری نقاط یک موج نزولی	۵
۷.۱	تشکیل Lower X های پشت سر هم در یک روند نزولی	۵
۱.۲	اخطارهای تغییر روند در انتهای یک روند صعودی	۷
۲.۲	اخطارهای تغییر روند در انتهای یک روند نزولی	۷
۱.۳	اندازه حرکت اصلاحی نسبت به حرکت جنبشی	۸
۱.۴	مفهوم روند صعودی و روند نزولی	۱۰
۲.۴	اخطارهای تغییر روند	۱۱
۱.۵	خطوط حمایت و مقاومت	۱۳
۲.۵	تغییر نقش خطوط حمایت و مقاومت	۱۴
۱.۷	نسبت طلایی در بدن انسان	۲۱
۲.۷	فیوناچی اصلاحی داخلی یک موج جنبشی	۲۲

۳.۷	فیبوناچی اصلاحی خارجی یک موج جنبشی	۲۳
۴.۷	فیبوناچی اصلاحی دو موج	۲۳
۱.۸	ترکیب فیبوناچی اصلاحی و فیبوناچی پروجکشن	۲۶
۲.۸	ترکیب فیبوناچی اصلاحی خارجی با فیبوناچی پروجکشن	۲۷
۳.۸	ترکیب دو فیبوناچی اصلاحی در دو تایم فریم مختلف	۲۷
۱.۹	الگوی زیگزاگ کامل یا $AB = CD$	۳۰
۲.۹	الگوی سه درایو Three Drive Pattern	۳۱
۳.۹	الگوی گارتلی Gartley Pattern	۳۲
۴.۹	الگوی خفاش Bat Pattern	۳۳
۱.۱۰	الگوی خرچنگ Crab Pattern	۳۵
۲.۱۰	الگوی پروانه Butterfly Pattern	۳۵
۱.۱۱	کندل استیک	۳۸
۲.۱۱	تفسیر یک کندل	۳۸
۳.۱۱	انواع کندل	۳۹
۴.۱۱	کندل هامر یا چکش	۴۰
۵.۱۱	کندل شهاب یا ستاره ثاقب	۴۱
۶.۱۱	الگوی چکش در انتهای یک روند نزولی	۴۲
۷.۱۱	الگوی مرد بر دار در انتهای یک روند صعودی	۴۲
۸.۱۱	الگوی ستاره دنباله دار در انتهای یک روند صعودی	۴۳
۹.۱۱	الگوی چکش معکوس در انتهای یک روند نزولی	۴۳
۱۰.۱۱	کندل دوجی	۴۴
۱۱.۱۱	اشکال های دیگر کندل دوجی	۴۴
۱۲.۱۱	کندل قرقره یا Spinning Top	۴۴

۴۵		High Wave	یا بلند موج کندل های	۱۳.۱۱
۴۵		Engulfing Pattern	یا پوشا الگوی	۱۴.۱۱
۴۶		Piercing Line	و الگوی Dark Cloud Cover	۱۵.۱۱
		Morning Star	یا صبحگاهی الگوی ستاره عصرگاهی یا	۱۶.۱۱
۴۷		Evening Star		
		3 White Soldiers	یا سفید سه سرباز الگوی سه کلاغ سیاه یا 3	۱۷.۱۱
۴۷		Black Crows		
۴۸			پوشا الگوی سازی ساده	۱۸.۱۱
۴۹		Piercing Line	الگوی کردن ساده	۱۹.۱۱
۴۹			صبحگاهی الگوی ستاره کردن ساده	۲۰.۱۱
۵۲			الگوی سر و شانه نزولی	۱.۱۲
۵۳			الگوی سر و شانه صعودی	۲.۱۲
۵۴			الگوی سقف دوقلو	۳.۱۲
۵۴			الگوی کف دوقلو	۴.۱۲
۵۵			الگوی سقف سه قلو	۵.۱۲
۵۵			الگوی کف سه قلو	۶.۱۲
۵۸			الگوی پرچم	۱.۱۳
۵۸			الگوی مثلث متقارن	۲.۱۳
۵۹			الگوی مثلث افزایشی	۳.۱۳
۵۹			الگوی مثلث کاهشی	۴.۱۳
۶۰			الگوی کنج افزایشی یا بالا رونده	۵.۱۳
۶۰			الگوی کنج پایین رونده	۶.۱۳
۶۱			الگوی مستطیل صعودی	۷.۱۳
۶۱			الگوی مستطیل نزولی	۸.۱۳

۱.۱۴	میانگین دوره های زمانی قیمت	۶۳
۲.۱۴	استفاده ترکیبی از میانگین متحرک و کندل برای تعیین مومنتوم	۶۷
۱.۱۷	شکل امواج جنبشی Motive Wave	۸۰
۲.۱۷	یک سیکل کامل در الیوت	۸۱
۳.۱۷	امواج الیوت و ریز موج های الیوت	۸۲
۴.۱۷	اشکال مختلف یک موج	۸۲
۵.۱۷	نسبت های فیبوناچی امواج جنبشی	۸۵
۶.۱۷	نسبت های فیبوناچی اصلاحی های امواج جنبشی	۸۶
۷.۱۷	نسبت های رایج در موج اصلاحی	۸۷
۱.۱۸	نسبت های موفقیت در بازارهای مالی	۹۰
۲.۱۸	نیازهای ما برای موفقیت در بازارهای مالی	۹۱
۳.۱۸	محاسبه حجم ورودی به پوزیشن بر اساس ۳٪ ریسک	۹۵
۴.۱۸	نسبت منفعت به ریسک یک	۹۶
۵.۱۸	نسبت منفعت به ریسک دو	۹۶
۶.۱۸	نسبت ریسک به ریوارد ۵۰٪	۹۷
۷.۱۸	طرح تجاری	۱۰۰
۸.۱۸	الگوی کوسه	۱۰۲
۹.۱۸	الگوی فایو – او	۱۰۳
۱.۱۹	تغییر روند	۱۰۹
۲.۱۹	نشانه تغییر روند با فاصله از خط روند	۱۰۹
۳.۱۹	ست آپ 1 GTS	۱۱۱
۴.۱۹	ست آپ 2 GTS	۱۱۱
۵.۱۹	استراتژی GTS Breakout	۱۱۲
۶.۱۹	استراتژی GTS Pullback	۱۱۳

۷.۱۹	نقاط تسویه استراتژی 1 GTS	۱۱۵
۸.۱۹	نقاط تسویه استراتژی 2 GTS	۱۱۶
۹.۱۹	نقاط تسویه استراتژی GTS Breakout	۱۱۶
۱۰.۱۹	نقاط تسویه استراتژی GTS Pullback	۱۱۷
۱۱.۱۹	است آپ جی تی اس شارپ در زمان خبر	۱۱۸

مقدمه

بورس، بازارهای مالی و فارکس اسامی و کلماتی هستند که طی چند سال گذشته در کشور ما ایران بیشتر از قبل به گوش می‌خورند، چه بورس ایران (بورس اوراق بهادار یا اصطلاحاً سهام) که سال گذشته توانسته است عملکرد قابل توجهی داشته باشد و در جای خود بسی جای خوشحالی و مسرت دارد و چه فارکس که بزرگترین بازار دنیاست.

جدای از بحث تخصصی در مورد این بازارها و مزایا و معایب هر کدام، مطلبی که بیشتر از هر چیزی نیاز به پرداختن دارد بحث ورود به این بازارها و آموزش نحوه فعالیت در آنها می‌باشد. برای افراد تازه وارد طبیعتاً اولین مرجع سایت های اینترنتی یا کانال های تلگرامی مختلف است، و از میان انبوه آموزش ها و پکیج های رایگان و غیر رایگان که می‌توان در میان اساتید این حرفه و در پهنه اینترنت یافت تشخیص اینکه آیا آموزش ها کاربردی و واقعی هستند یا اینکه شخص فروشنده آموزش صرفاً یک مقاله رایگان یا ویدئوی زبان انگلیسی یوتیوب را ترجمه کرده و به فروش می‌رساند کار راحتی نیست. درک جزئی این قضیه برای من مبلغی قابل توجه برای خرید پکیج های عموماً بدون کارایی لازم و ماندگار و صرف زمان حدوداً ۶ تا ۷ ماه را دربرداشت و عمده ترین نتیجه این آموزش ها درماندگی از داشتن نتایج مستمر و سردرگمی استفاده صرف و مطلق از انواع اندیکاتورها و اسیلاتورها به جای تمرکز بر قیمت و رفتار آن و روانشناسی بازار و روانشناسی معامله گران بود.

به احتمال زیاد کم نیستند افرادی که به مثابه اینجانب این مسیر پر از اندیکاتور و ابزار و تپی از رفتار قیمت را تجربه کرده اند که یا همچون من با طی این مسیر سخت به مسیر اصلی رسیده اند و یا بالعکس تصمیم به ترک این بازار گرفته اند. نهایتاً پس از طی مسیر تا اینجای کار به این نتیجه رسیدم که برای افراد تازه کار مثل من بهترین کار استفاده از آموزش های رایگان افرادیست که صادقانه سود و ضرر خود را نشان می‌دهند. البته ناگفته نماند افرادی را نیز دیده ام که به صورت حضوری تحت نظر اساتید این حرفه آموزش غیر رایگان دیده اند و نتایج مناسبی هم گرفته اند ولی برای تشخیص کارآمدی یا غیر کارآمدی این قبیل آموزش های غیر رایگان نیاز به تحقیق و بررسی بیشتر در مورد این اساتید بزرگوار است.

چهارده

یکی از بهترین مجموعه های آموزشی رایگان مجموعه آموزشی آقای رضا گلشاهیان^۱ می باشد. پس از دیدن ویدئوهای این مجموعه، آموزش های گذشته هم بیشتر برایم جا افتادند و تازه فهمیدم اصل قضیه قیمت و رفتار آن است و ابزارها صرفا کمک کننده هستند و این بار حتی استفاده از آنها هم برایم راحت تر شد و بعد از مدتی توانستم با چارت خالی هم همان استنتاج ها را تا حدود زیادی داشته باشم.

پس از اینکه بار اول مجموعه ارزشمند آقای گلشاهیان را مطالعه کردم تصمیم گرفتم مانند درس دانشگاهی جزوه این واحد درس را برای خودم تهیه کنم. تا امروز این مجموعه را به دوستان زیادی پیشنهاد داده ام و سعی نموده ام برای تمامی علاقه مندان به فارکس در اطراف خودم روشنگری لازم نسبت به آموزش های رایگان آقای گلشاهیان و سایر اساتیدی که به رایگان آموزه های خود را به اشتراک می گذارند را انجام بدهم. نهایتا به پیشنهاد یکی از دوستان تصمیم گرفتم تا جزوه شخصی ام از آموزش های استاد گلشاهیان را به صورت تایپ شده در اختیار تمامی عزیزان و علاقه مندان بگذارم.

قبل از شروع این جزوه لازم است که به چند نکته دقت لازم و کافی شود:

۱. آقای گلشاهیان تهیه و اشتراک گذاری این سری ویدئوی آموزشی تحلیل تکنیکال را از سال ۲۰۱۱ شروع کرده اند و سال ۲۰۱۹ آموزش های جدیدی در ادامه این آموزش ها در مورد روانشناسی بازار در کانال یوتوب خودشان^۲ به اشتراک گذاشته اند و تنها مرجع رسمی برای آموزش های ایشان کانال یوتیوب خودشان می باشد. البته مطابق گفته آقای گلشاهیان در یکی از ویدئوهای سال ۲۰۱۹ در کانال یوتیوب، تنها منبعی که با کسب اجازه از جناب گلشاهیان آموزش های تحلیل تکنیکال فارکس ایشان را برای دانلود گذاشته اند سایت فراچارت^۳ می باشد پس لطفا دوستان هم سعی کنند از منبع دیگری اقدام به تهیه آموزش تحلیل تکنیکال فارکس آقای گلشاهیان نکنند.

۲. اینجانب عبدالواحد قادرزاده هیچ گونه حق مالکیتی بر محتویات این جزوه و آموزش های آن نداشته و مالکیت معنوی تمامی آموزش ها متعلق به آقای گلشاهیان می باشد و من صرفا آموزش های ایشان را یادداشت برداری و جزوه نویسی کرده ام، دقیقا همچون شاگردی در کلاس درس استاد.

۳. مطالعه این جزوه بدون مشاهده ویدئوهای آموزشی آقای گلشاهیان تاثیر کافی را نخواهد داشت، لذا لازم است قبل از شروع مطالعه ی این جزوه ویدئوها را حتما تهیه کرد.

^۱ Golshahian@yahoo.com

^۲ www.youtube.com/rzgttrader

^۳ farachart.com

۴. آموزش ها در ۲۸ درس تهیه شده اند که از درس ۱۲ مبحث تحلیل تکنیکال شروع می شود و چون هدف و تمرکز بیشتر روی این مبحث بود لذا این جزوه هم از قسمت ۱۲ این مجموعه ویدئویی شروع خواهد شد. پس باید ابتدا ویدئوهای قبلی مشاهده شوند سپس این جزوه کارایی لازم را خواهد داشت.

۵. در بعضی از قسمت ها به ویدئوها ارجاع داده شده است چون دیدن و شنیدن توضیحات و آموزش ها بر روی چارت بسیار کارآمدتر از خواندن در جزوه و بدون چارت است لذا سعی کرده ام در این قسمت ها توضیحات کمتری بنویسم تا مخاطب توجه و دقت بیشتری برای نگاه کردن به این بخش از ویدئو داشته باشد. پس در این قسمت ها حتما به ویدئوها مراجعه شود.

۶. به دلیل کمبود وقت و وقتگیر بودن طراحی عکس های مورد نیاز، ترجیح دادم از ویدئوها اسکرین شات بگیرم و به جای تصاویر مورد نظر قرار بدهم. به همین دلیل متأسفانه تصاویر کیفیت نسبتا پایینی دارند و همین ابتدا بابت این مورد از همه عزیزان عذرخواهی می کنم.

۷. هر گونه استفاده و کپی برداری از محتویات این جزوه با ذکر نام آقای رضا گلشاهیان و اشاره به کانال یوتیوب ایشان بلامانع است.

۸. در صورت هر گونه اشکال یا اشتباهی در متن این جزوه یا مغایرت با ویدئوهای آقای گلشاهیان، لطفا جهت ویرایش و اصلاح از طریق ایمیل شخصی^۴ به اینجانب اطلاع دهید.

تایپ و ویرایش اثر پیش رو کار گروهی تیم فارکس مهاباد با همکاری کیوان ایرانپور، جلال شریفی، صالح ترشی و عبدالواحد قادرزاده می باشد.

بهترین لحظات و روزها را برای همه انسان ها از خداوند متعال آرزو مندم.

تیم فارکس مهاباد

عبدالواحد قادرزاده

فروردین ۱۳۹۹

^۴ Ghaderzadeh1@gmail.com

مقدمه آقای گلشاهیان

قبل از هر سخنی تلاش و جهد دوستانی که همت گماشته اند و آموزش های سال های گذشته ام را به رشته تحریر درآورده اند تا نقش خود را در این زنجیره ادا کنند، تحسین می کنم. در ابتدای شروع آموزش ها سختی ها و سردرگمی هایی را در بازاری پر ابهام و مملو از افراد سودجو تحمل کردم تا راهی بیابم و علیرغم پرداخت هزینه های گزاف بابت به دست آوردن این اطلاعات، با افراد سودجویی برخورد کردم که بابت جزیی از اطلاعات این محصول آموزشی، هزینه های زیادی از من دریافت کردند و در نهایت هم نتیجه ای برایم در بر نداشت، پس با خود عهد کردم در صورت پیدا کردن مسیر درست آن را با دیگران به رایگان به اشتراک گذارم تا کسانی که در چنین مسیری قرار می گیرند حس گم شدگی و سردرگمی مرا تجربه نکنند. این تجربیات در مقطعی از زندگی من اتفاق افتاد که شاید مشکل زیادی برای پرداخت هزینه ها و به هدر رفتن زمان و سرمایه نداشتم ولی می دانم در بازار سرمایه عده زیادی هستند که توان پرداخت چنین هزینه هایی به افراد فرصت طلبی که هر روز هم تعداد آنها رو به افزایش هست ندارند.

اصولا در این بازار به ندرت کسانی یافت می شوند که دانسته های خود را به رایگان در اختیار دیگران قرار دهند و البته هنوز هستند کسانی که طرز فکر بالابردن سطح آگاهی عمومی دارند و سلوک و تفکرشان جای قدردانی دارد ولی جالب اینجاست اکثر آموزش های پولی نقاط ضعف زیادی دارند و برداشت شده از آموزش هایی هستند که قبلا دیگران منتشر کرده اند کسانی هم هستند که بعد از مدتی یادگیری تحلیل تکنیکال این آموزش ها را در مجموعه ای آموزشی تهیه می کنند و به دیگران می فروشند، فارغ از این که این آموزش ها، افراد غیر حرفه ای و بازانگان زیادی را به این بازار معرفی می کنند که نه تنها جیب افراد را برای پرداخت هزینه یاد گیری خالی کرده بلکه باعث هدر رفتن سرمایه، وقت و انگیزه افراد تازه وارد میشود.

دیدگاه تهیه این ویدئو ها، بدون دریافت هیچ مبلغی از علاقه مندانی که شاید توان مالی برای پرداخت هزینه های گزاف درخواستی آموزش دهندگان را ندارند و یا توان مالی هم دارند ولی بعد از صرف هزینه ها نتایج قابل توجهی نمی گیرند و وقت و سرمایه خود را از دست می دهند، بیان واقعیت ها و آموزش تحلیل تکنیکال به موثرترین شکل ممکن که در توان تهیه کننده این

آموزش ها بود، و آشنایی افراد جویای دانش با بازارهای مالی و روشنگری ذهن آنها برای چنین فرصت تجاری در هر نقطه از دنیا و با هر شرایط مالی و سنی که هستند، بوده است.

اثر نوشتاری فعلی بیانگر تحقق این هدف هست و نشان می دهد چنین دیدگاهی موثر بوده چرا که در صورت موثر نبودن چنین تفکری، این اثر توسط یک تیم پر تلاش و با دیدگاه بدون چشمداشت و هدفمند برای بالا بردن سطح آگاهی عمومی تهیه نمی شد.

این اثر برای من نقطه عطفی است که موفقیت بنده را در جهت اطلاع رسانی و ادای دین خود به هموطنان و فارسی زبانان به بهترین شکل بیان می کند و از بابت این که توانسته ام در این زنجیره حمایت از هموطن و همزبان نقش کوچکی ایفا کنم و آنها هم رسم امانتداری را بجا آورده اند و چنین زنجیره ای را پاره نکرده اند و در جهت حفظ این زنجیره، این اثر را تهیه کرده و به رایگان در اختیار بقیه قرار داده اند به خود می بالم و سپاسگزار تهیه کنندگان این اثر و تمام کسانی که زنجیره اتحاد و همدلی را محکمتر می کنند آن هم در زمانه ای که منفعت طلبی به شکل یک ارزش و عرف و عادت در جامعه جا افتاده، هستم. همینطور از کسانی که در زمینه بالا بردن آگاهی جمعی در هر زمینه ای به شکل رایگان برای قشر عظیمی که شاید توان و یا منبعی برای تهیه اطلاعات مفید در زمینه های مختلف را ندارند کوشا هستند، قدردانی می کنم و برای این دسته عزیزان برکت، فراوانی و صحت و سلامتی آرزو می کنم.

در آخر این اثر را تقدیم می کنم به تمام کسانی که ارزش های انسانی را در زمانه ای که ضد ارزش ها ارزش شده اند، هنوز ارج می نهند و شرایط نامناسب اقتصادی و اجتماعی آنها را تغییر نداده و هنوز به اصول اخلاقی و انسانی پایبند مانده اند و این هدیه ای است به آن دسته از همسفران مسیر زندگی.

آرزوی حاکمیت خرد و انصاف

رضا گلشاهیان

فروردین ۱۳۹۹

فصل ۱

ویدئوی شماره ۱-۱۲: رفتار قیمت

۱.۱ قیمت چگونه رفتار می‌کند؟

رفتار قیمت متأثر از هیجانات، ترس‌ها، نگرانی‌ها و امیدها به صورت هم جهت است که تاثیر خود را روی عرضه و تقاضا نشان می‌دهد و باعث ایجاد تغییرات در قیمت می‌شود. در واقع قیمت زمانی در یک جهت حرکت می‌کند که اکثریت معامله‌گران در آن جهت معامله می‌کنند. برای به دست آوردن سود در بازار باید تمایل بازار و معامله‌گران را شناخت و در آن جهت به معامله پرداخت. تمایل یا گرایش بازار که جهت اصلی بازار به آن سمت است را Market Sentiment می‌گویند. جهت شناخت تمایل بازار دو عامل مورد نیاز است:

تشخیص جهت معاملات از طریق آشنایی با نمودارها

تشخیص جو بازار در مورد آن کالا در زمان انجام معامله از طریق اخبار و رسانه‌ها

۲.۱ نحوه رفتار قیمت بر روی نمودار

قیمت بر روی نمودار به صورت ترکیبی از امواج حرکت می‌کند و شناخت جهت تمایل امواج از مهمترین عوامل موفقیت در بازارهای مالی است.

دو نوع حرکت قیمت در بازارهای مالی وجود دارد:

حرکت جنبشی^۱: حرکت قیمت در جهت اصلی روند را که معمولاً با شتاب و انرژی زیادی

^۱ Movement

همراه است حرکت جنبشی می‌گویند.

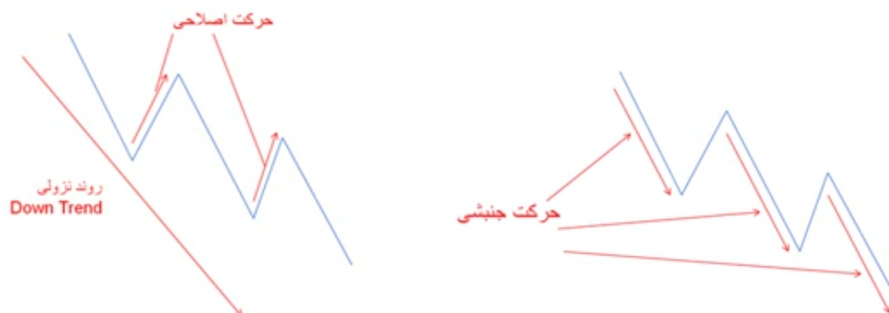
حرکت اصلاحی^۲: حرکت اصلاحی حرکتی است که قیمت پس از حرکت جنبشی و خسته شدن انجام می‌دهد، این حرکت خلاف جهت حرکت جنبشی و روند اصلی می‌باشد.

به عنوان مثال در یک روند صعودی زمانی که قیمت حرکت می‌کند نمی‌تواند به صورت مستقیم و بدون هیچ استراحتی مسافت طولانی را بپیماید و پس از هر حرکت پرشتابی (حرکت جنبشی) حتما نیاز به استراحت (حرکت اصلاحی) دارد. بنابراین پس از اینکه قیمت یک «های» جدید را تجربه کرد استراحت خود را شروع می‌کند و پس از هجوم مجدد سرمایه گذاران، قیمت حرکت جنبشی خود را از سر می‌گیرد و احتمال می‌رود که قیمت سطح بالاتری از سطح قبلی را تجربه کرده و یک نقطه «های» جدید را بسازد. بنابراین حرکت قیمت به صورت ترکیبی از حرکت های جنبشی و اصلاحی است. به عبارتی زمانی که سرمایه گذاران سودهای خود را نقد می‌کنند قیمت افت می‌کند و مجددا زمانی که سرمایه گذاران وارد مارکت می‌شوند قیمت رشد خواهد کرد (شکل ۱.۱).



شکل ۱.۱: حرکت جنبشی و حرکت اصلاحی در یک روند صعودی

در روند نزولی هم حرکت جنبشی و حرکت اصلاحی به همین شکل است با این تفاوت که جهت حرکت آنها متفاوت خواهد بود (شکل ۲.۱).



شکل ۲.۱: حرکت جنبشی و حرکت اصلاحی در یک روند نزولی

^۲Retracement

روند خنثی^۳

روند خنثی روندی است بدون حرکت جنبشی که جهت خاصی به سمت ندارد و صرفاً دارای حرکت اصلاحی می‌باشد (شکل ۳.۱)، در روند خنثی قیمت ممکن است به هر سمتی برود بالا یا پایین و تا زمانی که قیمت راه خودش را پیدا نکرده است معامله‌گران تصمیمی برای خرید یا فروش ندارند و تشخیص آنها این است که مارکت در حال حاضر جهت ندارد. معمولاً سرمایه‌گذاران زمانی سرمایه خود را وارد بازار می‌کنند که جهت مارکت مشخص باشد.



شکل ۳.۱: روند خنثی

نامگذاری امواج

اگر بخواهیم امواج را به صورت واضحتری بشناسیم باید بتوانیم آنها را نام گذاری کنیم تا بتوانیم بر روی چارت جهت آنها را تشخیص بدهیم.



شکل ۴.۱: نامگذاری نقاط یک موج صعودی

همانطور که در شکل ۴.۱ مشاهده می‌شود قیمت در ابتدای روند صعودی یک نقطه بالا (High) و یک نقطه پایین (Low) ساخته است، برای تشخیص بهتر این نقاط و نقاطی که بعد

^۳ Neutural Trend

از آنها ساخته می‌شود نقطه بالای بعدی بالای بالاتر یا Higher High نامیده می‌شود. وجود نقطه Higher High نشان دهنده صعودی بودن روند است چون این نقطه High از نقطه High قبلی بالاتر است و زمانی این نقطه تشکیل می‌شود که روند صعودی باشد. نقطه Higher High را می‌توان HH هم نام گذاری کرد تا بتوان آن را به راحتی بیان کرد.

حال ببینیم نقطه Low که از Low قبلی خود بالاتر است را چه باید نامید، این نقطه از نقطه پایین قبل از خود بالاتر است پس می‌توان آن را Higher Low نامید که آن را نیز می‌توان به اختصار HL نامید. نقطه HL به ما نشان می‌دهد نقطه Low که تشکیل شده است از Low قبلی خود بالاتر است پس این روند یک روند صعودیست.

در یک روند صعودی شاهد تشکیل Higher های پشت سر هم هستیم، هم Higher High و هم Higher Low (شکل ۵.۱).



شکل ۵.۱: تشکیل Higher X های پشت سر هم در یک روند صعودی

در مورد روند نزولی هم به همین شکل است و تنها جهت آن با روند صعودی تفاوت دارد (شکل ۶.۱). در روند نزولی نقطه بالای پایینتر را Lower High یا LH و نقطه پایین پایینتر را Lower Low یا LL می‌نامند که این نقاط هم به وضوح نشان دهنده روند نزولی می‌باشند.

در یک روند نزولی شاهد تشکیل Lower های پشت سر هم هستیم، هم Lower High و هم Lower Low (شکل ۷.۱).

به همین شکل می‌توانیم نامگذاری امواج را انجام دهیم و توسط این نامگذاری جهت مارکت



شکل ۶.۱: نامگذاری نقاط یک موج نزولی



شکل ۷.۱: تشکیل Lower X های پشت سر هم در یک روند نزولی

را مشخص نماییم.

چگونگی تشخیص یک روند و اصلاحی آن

تشخیص یک روند و یک اصلاحی برای یک معامله گر یا تریدر^۴ بسیار مهم است برای تشخیص جهت یک روند به صورت چشمی از روی نمودار کافی است حرکت های جنبشی و اصلاحی را بر اساس «های» ها و «لو» ها تشخیص داد. به عبارتی همان گونه که گفته شد:

تشخیص روند صعودی = تشکیل Higher X های پشت سر هم

تشخیص روند نزولی = تشکیل Lower X های پشت سر هم

^۴Trader

فصل ۲

ویدئوی شماره ۲-۱۲: تشخیص اتمام روند

یکی از مهمترین عوامل موفقیت هر معامله گدر بازارهای مالی تشخیص به موقع تغییر روند است، چون باعث بستن به موقع و در سود پوزیشن ها توسط معامله گر شده و همچنین معامله گر را از باز کردن پوزیشن در جهت خلاف روند مارکت منع می کند.

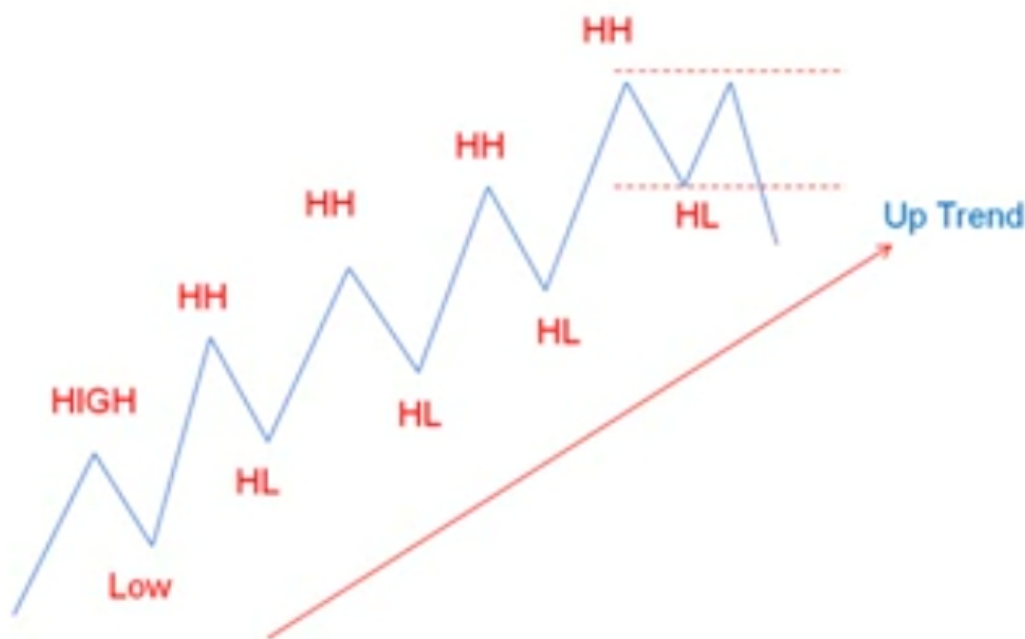
۱.۲ چگونه می توان تشخیص داد که روند در حال تغییر است؟

دو عامل اصلی زیر اولین اخطارهای تغییر روند هستند:

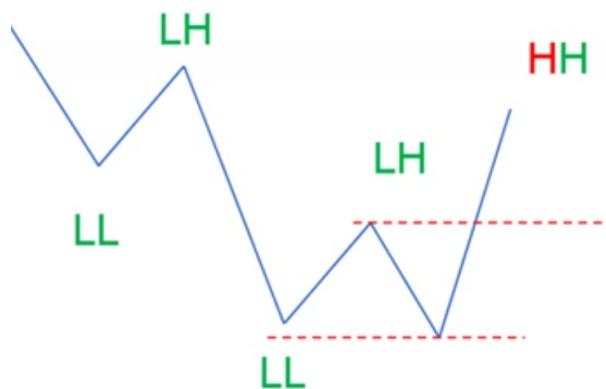
۱. عدم توانایی قیمت در تشکیل «سقف» یا «های» جدید در روند صعودی یا «کف» یا «لو» جدید در روند نزولی

۲. شکسته شدن آخرین «لو» در روند صعودی یا آخرین «های» در روند نزولی

منظور از تغییر روند شروع حرکت اصلاحی روند فعلی یا تغییر کل جهت روند است (شکل های ۱.۲ و ۲.۲).



شکل ۱.۲: اخطارهای تغییر روند در انتهای یک روند صعودی



شکل ۲.۲: اخطارهای تغییر روند در انتهای یک روند نزولی

از تایم ۶ دقیقه و ۵۲ ثانیه ویدئو، آقای گلشاهیان تشکیل نقاط Higher و Lower پشت سر هم و تغییر روند را بر روی چارت توضیح می‌دهند.^۱

کسانی که با چارت آشنایی کافی ندارند می‌توانند برای بررسی ساده تر و قابل فهمتر چارت به جای کندل^۲ از Line Chart استفاده کنند یا یک میانگین متحرک^۳ با دوره «۱» را به چارت اضافه کنند.

^۱ حتماً به ویدئو مراجعه شود.

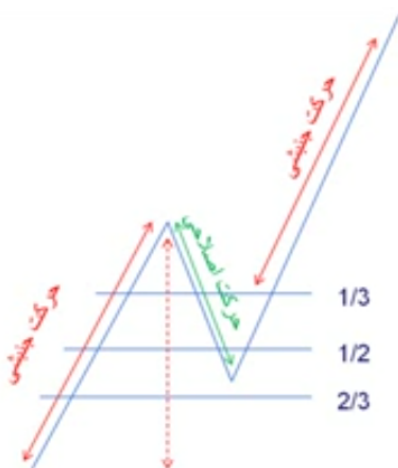
^۲ Candle Stick یا شمعی ژاپنی

^۳ Moving Average

فصل ۳

ویدئوی شماره ۳-۱۲: اندازه اصلاحی ها

آقای گلشاهیان با بررسی HH و HL چارت اونس طلا^۱ این ویدئو را شروع می‌کنند. بعضی وقت ها روند کلی صعودی است ولی در بخشی از روند کلی صعودی HH جدید نمی‌تواند ساخته شود و همزمان HL جدید هم دیگر HL نیست و پایینتر از HL قبلی است و این می‌تواند نشانه نزول باشد ولی وقتی بازه بزرگتری از چارت را نگاه می‌کنیم می‌بینیم که Low جدید شکل گرفته در بازه بزرگتر کاملاً HL است و روند فعلاً صعودی است. حرکت اصلاحی با نسبت های $۱/۳$ ، $۱/۲$ و $۲/۳$ حرکت جنبشی قبلی و به صورت دقیقتر با نسبت های فیبوناچی خواهد بود (شکل ۱.۳).



شکل ۱.۳: اندازه حرکت اصلاحی نسبت به حرکت جنبشی

^۱ Gold یا XAUUSD

فصل ۴

ویدئوی شماره ۱۳: خطوط روند

۱.۴ تعریف خط روند

خط روند خطی فرضی است که قیمت پس از برخورد به آن به جهت اصلی خود ادامه می‌دهد. خط روند از اصولی‌ترین و مفیدترین ابزارهای تکنیکال است که به معامله‌گر کمک می‌کند تا در جهت درست بازار معامله کند. دو نوع خط روند وجود دارد:

خط روند صعودی: خط صافی است که کف موج‌های بالا رونده را به یکدیگر متصل می‌کند و شیبی مثبت دارد.

خط روند نزولی: خط صافی است که سقف موج‌های پایین رونده را به یکدیگر متصل می‌کند و شیبی منفی دارد.

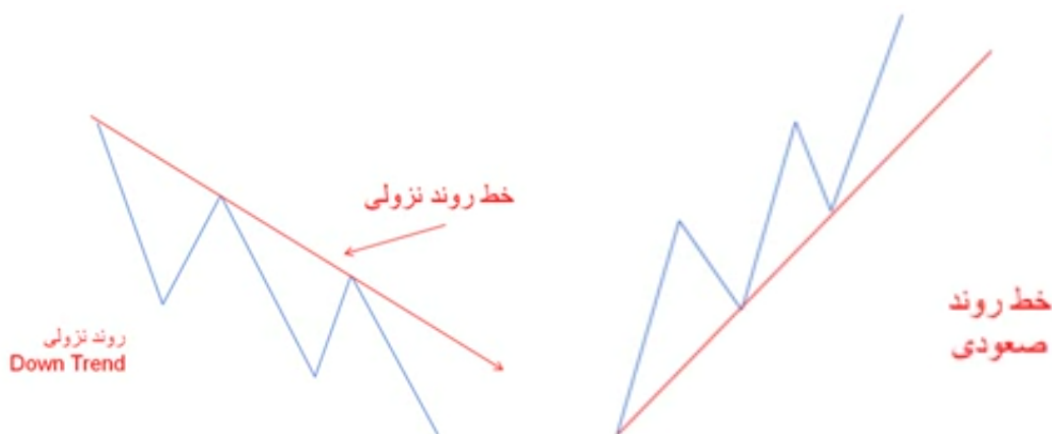
۲.۴ مشخصات خطوط روند

روند رو به بالا یا **صعودی** به صورت حمایت عمل می‌کند و نشان‌دهنده این است که تقاضا با بالا رفتن قیمت افزایش می‌یابد. تا زمانی که قیمت بالای خط روند باقی بماند روند مثبت، محکم و بدون تغییر است. یک شکست قیمت به زیر خط روند مثبت، نشان‌دهنده ضعیف شدن تقاضای خالص بوده و احتمال تغییر دارد.

یک روند نزولی خطی با شیب منفی است که از وصل کردن دو یا چند نقطه ماکسیمم به دست می‌آید. نقطه حداکثر دوم باید پایینتر از نقطه اول باشد تا خطی با شیب منفی را تشکیل

دهد. روند منفی به صورت مقاومت عمل کرده و نشان دهنده افزایش در عرضه علیرغم افت قیمت است.

یک شکست ناگهانی در قیمت و بالا رفتن قیمت از خط روند نشان دهنده کم شدن عرضه خالص بوده و باید احتمال تغییر در روند قیمت را در نظر داشت. هر چه تعداد برخوردها به خط روند بیشتر باشد نشان دهنده اعتبار خط روند است. با رسم خط روند در روند صعودی بیشتر HL ها و در روند نزولی بیشتر LH ها با خط روند برخورد خواهند داشت و پس از برخورد در جهت روند تغییر جهت می دهند (شکل ۱.۴).



شکل ۱.۴: مفهوم روند صعودی و روند نزولی

۳.۴ شرایط روند و تشخیص اتمام روند

در یک روند هر چه تعداد برخورد قیمت با خط روند و برگشت قیمت بیشتر باشد خط روند معتبرتر است. روندها در بازه های زمانی بالاتر اعتبار بیشتری دارند مثلاً روند روزانه از روند یک ساعته معتبرتر است و باید در تایم فریم های بالاتر هم خط روند را رسم کرد. حرکت قیمت در تایم های بالاتر می تواند برای ورود به پوزیشن در تایم های پایینتر مورد استفاده قرار بگیرد. باید در نظر داشت که نفوذ ناچیز قیمت به داخل خط روند به معنای شکسته شدن آن نیست و در صورتی که این اتفاق افتاد باید خط روند ثانویه نیز رسم شود تا در آینده واکنش قیمت به خط روند ثانویه را هم در نظر بگیریم.

۴.۴ چگونه می‌توان تشخیص داد که روند در حال تغییر است؟

با توجه به بحث مهم روند و تغییر آن، تشخیص به موقع تغییر روند از اهمیت زیادی برخوردار است. یک تریدر باید بتواند خطوط روند را رسم کرده و از آنها استفاده نماید تا بتواند در جهت درست معامله کرده و زمان تغییر روند را هم توسط همین خطوط بتواند تشخیص دهد.

دو عامل اصلی اولین اخطارهای تغییر روند هستند (شکل ۲.۴):

۱. کم شدن شیب قیمت و ماندن در نزدیکی خط روند یا همان کم شدن مومنتوم یا شتاب قیمت
۲. شکسته شدن خط روند و نفوذ قیمت به زیر خط روند در روند صعودی و بالای خط روند در روند نزولی

نباید فراموش کرد که عوامل بالا صرفاً اخطار برای تغییر روند هستند نه دلیل محکم.



شکل ۲.۴: اخطارهای تغییر روند

در رسم خط روند یا خطوط حمایت و مقاومت باید دقت کرد که سایه‌ها هم اهمیت دارند. از تایم ۱۳ دقیقه و ۳۹ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان تغییر روند و اخطارهای آن را بر روی چارت توضیح می‌دهند.

فصل ۵

ویدئوی شماره ۱۴: خطوط حمایت و مقاومت

خطوط حمایت و مقاومت خطوط بسیار مهمی برای هر معامله گری می باشند که کار با آنها نیازمند تمرین زیاد است و بیش از نیمی از تحلیل هایی که بر اساس تحلیل تکنیکال انجام می شوند بر اساس خطوط حمایت و مقاومت هستند پس یادگیری این خطوط یکی از مهمترین عوامل موفقیت در بازار فارکس می باشد.

۱.۵ تعریف خطوط حمایت و مقاومت

خطوط حمایت و مقاومت خطوط فرضی مهمی هستند که در یک قیمت مشخص، بازار در گذشته نسبت به آنها عکس العمل نشان داده و انتظار داریم بازار نسبت به این قیمت ها در آینده نیز عکس العمل نشان دهد. در واقع خطوط حمایت و مقاومت فقط یک عدد قیمت هستند که برای تریدرها در هنگام معامله مهم اند. به صورت قراردادی به خطوطی که بالاتر از قیمت کنونی قرار دارند خطوط مقاومت و به خطوطی که پایینتر از قیمت کنونی قرار دارند خطوط حمایت می گویند.

خط حمایت:^۱ پایینتر از قیمت

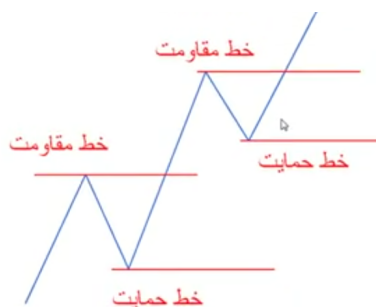
خط مقاومت:^۲ بالاتر از قیمت

Support^۱

Resistance^۲

۲.۵ ماهیت خطوط حمایت و مقاومت

قیمت معمولاً به خطوط حمایت و مقاومت واکنش نشان می‌دهد و نوع واکنش بازار نسبت به این خطوط به این شکل است که روند حرکت قیمت در حول و حوش این نقاط دچار تغییر می‌شود. به بیان ساده تر قیمت در زمانی که به این خطوط یا محدوده آنها برخورد می‌کند دچار تغییر جهت (برگشت) می‌شود (شکل ۱.۵).



شکل ۱.۵: خطوط حمایت و مقاومت

محدوده ای که خط حمایت در آن قرار دارد محدوده حمایتی و محدوده خط مقاومت را محدوده مقاومتی می‌نامند. خطوط حمایت و مقاومت یکی از مهمترین ابزارهای کارآمد برای فعالیت در بازارهای مالی هستند. شناخت صحیح این خطوط برای معامله گر موفق جزو ضروریات می‌باشد.

۳.۵ تبدیل خطوط مقاومت و حمایت به یکدیگر

زمانی که خط حمایت و یا مقاومتی شکسته می‌شود نقش آن برعکس می‌شود. یعنی زمانی که خط مقاومتی شکسته می‌شود آن محدوده از آن پس به صورت حمایت عمل می‌کند. نقاطی که نقش حمایت و مقاومت در آنجا عوض می‌شوند نقاط خوبی برای وارد شدن به مارکت و گرفتن پوزیشن هستند (شکل ۲.۵).

۴.۵ انواع خطوط مقاومت و حمایت

قیمت هایی که به صورت محدوده خطوط حمایت و مقاومت عمل می‌کنند عبارتند از:
نقاط برگشت بازار



شکل ۲.۵: تغییر نقش خطوط حمایت و مقاومت

قیمت های رند^۳

پیوت های روزانه

گپ ها یا شکاف ها

درصدهای فیبوناچی

از تایم ۷ دقیقه و ۴۹ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان خطوط مقاومت و حمایت را روی چارت توضیح می دهند.

برای بهتر کار کردن با خطوط حمایت و مقاومت به صورت مولتی تایم فریم بهتر است که خطوط هر تایم فریم را به یک رنگ جداگانه رسم کرد. تلاقی و روی هم افتادن دو یا چند حمایت و مقاومت از تایم فریم های مختلف، نشان دهنده قدرت آن خط است.

لازم به ذکر است که خطوط حمایت و مقاومت را بر اساس سایه ها هم باید در نظر گرفت ولی اولویت کمتری نسبت به قیمت بسته شدن^۴ دارد. زمانی که از نمودار قیمت به صورت Area Chart استفاده می کنیم سایه ها را از دست می دهیم چون Area Chart فقط بر اساس قیمت بسته شدن رسم می شود.

دقت به این نکته مهم است که هر چه خطوط حمایت یا مقاومت قوی تر و معتبرتر باشند شکستن آنها به انرژی بیشتری نیاز دارد.

^۳ از لحاظ روانی خیلی از پوزیشن ها در قیمت های رند بسته می شوند یا پوزیشن های در انتظار آنجا هستند.

^۴ Close Price

فصل ۶

ویدئوی شماره ۱۵: خطوط پیوت

۱.۶ تعریف پیوت

خطوط پیوت خطوط حمایت و مقاومتی هستند که بر اساس محاسبه مشخصات یک دوره زمانی مشخص بدست می‌آیند. مانند پیوت های روزانه که بر اساس بالاترین قیمت^۱، پایین ترین قیمت^۲ و قیمت بسته شدن روز قبل به دست می‌آیند و کارایی آنها در دوره زمانی مثلا روز بعد از محاسبات است.

۲.۶ محاسبه پیوت های روزانه

پیوت های روزانه نقاطی از قیمت هستند که بر اساس رفتار گذشته قیمت در روز قبل به دست می‌آیند:

$$\text{Pivot} = (\text{Yesterday High} + \text{Yesterday Low} + \text{Yesterday Close})/3$$

نقطه پیوت نقطه ای است که نشان دهنده احتمال رفتار قیمت در روز بعد می‌باشد. اکثر بروکرها صرفا بر اساس پیوت روزانه تحلیل خود را برای کاربران ارسال می‌کنند. بعضی از تحلیل گران حضور قیمت در بالای پیوت روزانه را نشانه روند صعودی و نفوذ قیمت به زیر

High^۱
Low^۲

پیوت را نشان دهنده افت قیمت می‌دانند. خطوط حمایت و مقاومت بر اساس این پیوت های روزانه نیز دارای اهمیت هستند و از فرمول های زیر بدست می‌آیند:

بازار آرام و رنج $\text{Range} = (\text{Yesterday High} - \text{Yesterday Low})$

یعنی قیمت بین High و Low قیمت دیروز در نوسان است و بازار رنج و آرامی است.

خط مقاومت اول $R1 = 2 \times \text{Pivot} - \text{Yesterday Low}$

خط مقاومت دوم $R2 = \text{Pivot} + \text{Range}$

خط مقاومت سوم $R3 = \text{Pivot} + 2 \times \text{Range}$

خط حمایت اول $S1 = 2 \times \text{Pivot} - \text{Yesterday High}$

خط حمایت دوم $S2 = \text{Pivot} - \text{Range}$

خط حمایت سوم $S3 = \text{Pivot} - 2 \times \text{Range}$

اندیکاتورهایی مثل Pivot per day پیوت های روزانه را به صورت اتوماتیک محاسبه می‌کنند و نیازی به محاسبه به صورت دستی نیست.

از تایم ۵ دقیقه و ۴۲ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان پیوت های روزانه را به وسیله اندیکاتور Pivot per day بر روی چارت توضیح می‌دهند.

پیشنهاد اکثر بانک ها و بروکرها برای انجام معاملات روزانه این است که بالای پیوت های روزانه قیمت احتمالا یا ترجیحا بالا می‌رود و ترجیح ما بر این اساس است که پوزیشن های Buy یا پوزیشن های Long بگیریم و بازار فرازی یا بالا رونده را بیشتر در نظر داشته باشیم و زیر پیوت های روزانه قیمت پایین می‌آید و ترجیحا پوزیشن های Sell یا پوزیشن های Short می‌گیریم.

بعضی وقت ها به جای Sell Position می‌گویند Short Position و به جای Buy Position می‌گویند Long Position و نباید این موارد را اشتباه بگیریم و همچنین بازارهای Bullish یا بازارهای گاوی به بازارهایی گفته می‌شود که قیمت در آن جهت صعودی گرفته و در حال افزایش است و در بازارهای مالی اشاره به این حرکت دارد که Bull یا گاو سرش را از زمین به

سمت بالا بلند کرده و هدف خودش را به بالا پرتاب می‌کند و بازارهای Bearish یا بازارهای خرسی بازارهایی هستند که در حال ریزش و افت قیمت هستند و به نوعی اشاره دارد به زمانی که خرس روی دو پای خود ایستاده و برای آمدن روی چهار دست و پا، دو دست خود را پایین می‌آورد.

پیوت های روزانه از این نظر قابل اهمیت هستند چون بانک های بزرگ بر اساس پیوت های روزانه ترید می‌کنند. اگر تریدهای روزانه^۳ انجام می‌دهیم پیوت های روزانه خیلی مهم هستند اما در تحلیل های بلند مدت پیوت روزانه اهمیت خاصی ندارند و پیوت های هفتگی و ماهانه اهمیت پیدا می‌کنند.

اگر قیمت از مقاومت R1 رد شد تا R2 خواهد رفت. شکست حمایت و مقاومت به معنای تشکیل یه کندل کامل در سمت جدید است. کندل بعد از شکست حمایت و مقاومت حتما باید مطابق الگوی کندل شناسی تائید کننده این شکست باشد. قیمت قبل از رسیدن به محدوده حمایت و مقاومت قوی و چندین پیپ مانده به آنها واکنش نشان می‌دهد پس نیاز نیست دقت خاصی در قیمت دقیق حمایت و مقاومت در نظر گرفت.

برای معاملات درون روزانه ترکیب مطالب گذشته و مبحث پیوت ها و همپوشانی آنها تائیدیه بیشتری به ما می‌دهد.

^۳ Intraday یا تریدهای با زمان کمتر از یک روز

فصل ۷

ویدئوی شماره ۱۶: اعداد فیبوناچی، تاریخچه و کارایی

۱.۷ اعداد صحیح و اعداد فیبوناچی

اعداد صحیح

اعداد صحیح مجموعه اعداد طبیعی، صفر و قرینه اعداد طبیعی هستند که ترتیب آنها اختلافی از عدد یک است. این اعداد شناخته شده ترین و ساده ترین پایه ریاضیات هستند. سری اعداد صحیح شامل:

اعداد طبیعی:

۱، ۲، ۳، ۴، ۵، ۶، ۷، ۸، ۹، ۱۰، ۱۱، ۱۲، ...

عدد صفر:

۰

قرینه اعداد طبیعی:

...، -۱۲، -۱۱، -۱۰، -۹، -۸، -۷، -۶، -۵، -۴، -۳، -۲، -۱

اعداد صحیح برای محاسبه و شناخت سری اعداد تکی کاربرد دارند.

۲.۷ تاریخچه اعداد فیبوناچی

در قرن سیزدهم در روم (ایتالیای کنونی) که در آن زمان مهد ریاضیات محسوب می‌شد پادشاه روم فردریک دوم معمایی مطرح کرد و برای کسی که این معما را حل کند جایزه نفیسی در نظر گرفت. این معما توسط لئوناردو فیبوناچی ریاضیدان آن زمان که در شهر پیزای روم زندگی می‌کرد حل گردید و روش حل این معما پایه اعدادی شد که به نام خود او اعداد فیبوناچی نامگذاری شدند.

سوال معما این بود:

در یک محیط بسته طی مدت یک سال، چند جفت خرگوش می‌توان از یک جفت خرگوش تولید کرد، اگر هر جفت در هر ماه یک جفت دیگر به دنیا آورد و هر جفت تولید مثل را از ماه دوم زندگی خود آغاز کند؟

فیبوناچی معمای پادشاه روم را توسط رشته اعدادی به هم پیوسته حل کرد که طبق نظم خاصی به هم مرتبط بودند این اعداد به نام اعداد فیبوناچی نامگذاری شدند و بعدها کاربرد بسیار وسیعی پیدا کردند.

ترتیب اعداد فیبوناچی:

۱، ۱، ۲، ۳، ۵، ۸، ۱۳، ۲۱، ۳۴، ۵۵، ۸۹، ۱۴۴، ۲۳۳، ...

در این سری اعداد فیبوناچی هر عدد مجموع دو عدد قبلی خود است و مبنای شروع آن ابتدای اعداد صحیح است.

حال اگر به معمای پادشاه برگردیم و در سری فیبوناچی هر عدد را برای یک ماه در نظر بگیریم می‌بینیم که جواب معما ۱۴۴ عدد خرگوش بعد از ۱۲ ماه است.

۳.۷ نسبت طلایی

اگر به استثنای چند عدد اول به نسبت اعداد فیبوناچی به همدیگر دقت کنیم متوجه یک عدد ثابت در تمام این مجموعه می‌شویم:

نسبت عدد کوچکتر به بزرگتر:

$$\frac{5}{8} = 0.62$$

$$\frac{21}{34} = 0.618$$

$$\frac{55}{89} = 0.618$$

$$\frac{144}{233} = 0.618$$

نسبت ۰/۶۱۸ در اعداد فیبوناچی را عدد فی هم می‌گویند.

نسبت عدد بزرگتر به عدد کوچکتر عدد ۱/۶۱۸ است.

فی تنها عددی است که وقتی با یک جمع می‌شود حاصل آن معکوس آن است:

$$0.618 + 1 = 1.618 = 1 : 0.618$$

۴.۷ نسبت های فیبوناچی

نسبت های دیگر:

نسبت اعداد یک در میان به هم ۰/۳۸ و ۲/۶۱ است.

$$\frac{55}{144} = 0.38 \quad \frac{144}{55} = 2.61$$

این نسبت ها بین تمام اعضای یک در میان اعداد فیبوناچی برقرار است.

۵.۷ اعداد فیبوناچی در طبیعت

کارایی اعداد فیبوناچی در خلق کائنات و اعضای بدن موجودات قابل مشاهده هستند (شکل ۱.۷). در ساختارهایی مانند:

هر نوع مارپیچ حلزونی ساخت طبیعت مانند لاک حلزون یا اسپیرال گوش موجودات

نسبت دانه های گل آفتابگردان

میوه درخت کاج

اسپیرال یا مارپیچ کهکشان راه شیری

چرخش گردباد و گرداب ها

نسبت چرخش رشته های مارپیچ DNA

نت های موسیقی

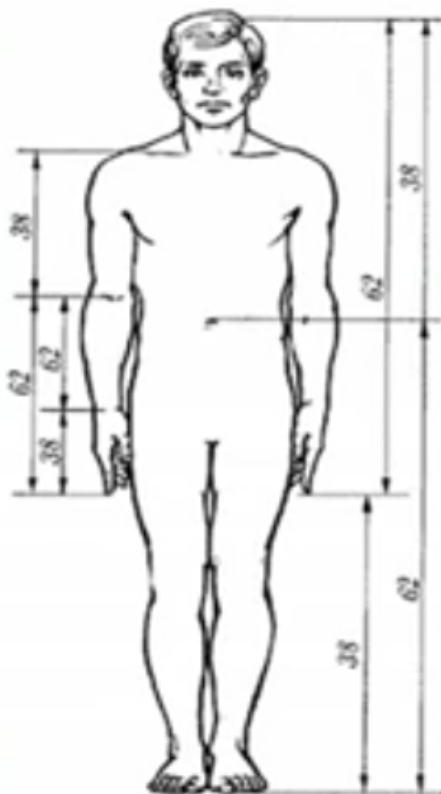
ساختار مولکولی

سلول های عصبی

ساختار کریستال

شکست نور در شیشه

به عدد فی و نسبت عکس آن نسبت طلایی و نسبت پایه و مبنای خلق جهان آفرینش می‌گویند.



شکل ۱.۷: نسبت طلایی در بدن انسان

۶.۷ اعداد فیبوناچی و دلایل اهمیت

در اعداد صحیح ارتباط یک عدد فقط با عدد قبلی یا بعدی خود با اختلاف یک وجود دارد و به جز این ارتباط و تناسب دیگری بین اعداد صحیح نیست. ولی در اعداد فیبوناچی هر عدد با اعداد قبل و بعد از خود هر چقدر هم دور از هم باشند تناسب هارمونیکی دارد و این تناسب باعث ایجاد یک پیوستگی معنادار بین همه اعداد آن می‌شود. در ابتدای زنجیره اعداد فیبوناچی دو عدد یک وجود دارد که این دو «یک» نماد یک جفت هستند.

۷.۷ فیبوناچی در بازارهای مالی

در بازارهای مالی اعداد فیبوناچی به دو دلیل حایز اهمیت هستند:

دلیل اول: بازارهای مالی اجتماعی از افراد مختلف و سرمایه ها به صورت اجتماع و کلونی هستند.

دلیل دوم: در بازارهای مالی کالاها به صورت جفت ارائه می شوند، یا به صورت پول در مقابل پول مثل فارکس یا به صورت سهام یا کالا در مقابل پول.

۸.۷ فیبوناچی در امواج

تاثیر نسبت های فیبوناچی در امواج قیمت به صورت های مختلف واقع می شود که دو مورد از مهمترین اثرات آن به شکل زیر است:

۱.۸.۷ مورد اول: فیبوناچی اصلاحی یک موج جنبشی

فیبوناچی اصلاحی یک موج جنبشی خود شامل دو قسمت است:

الف) استفاده از اعداد فیبوناچی در به دست آوردن انتهای امواج اصلاحی داخلی یک موج جنبشی و نقاط برگشت قیمت به سمت جهت قبلی موج اصلی (شکل ۲.۷)



شکل ۲.۷: فیبوناچی اصلاحی داخلی یک موج جنبشی

یک موج اصلاحی داخلی عموماً تا یکی از سطح های شکل ۲.۷ اصلاح شده و به مسیرش ادامه می دهد. به این نوع فیبوناچی اصلاحی یا Fibonacci Retracement گفته می شود.

ب) استفاده از اعداد فیبوناچی در به دست آوردن انتهای امواج خارجی یک موج و نقاط برگشت قیمت به سمت جهت موج قبلی (شکل ۳.۷). یک موج اصلاحی خارجی تا یکی از سطوح شکل ۳.۷ اصلاح شده و به مسیرش ادامه می‌دهد. به این نوع فیبوناچی امتدادی یا Fibonacci Extension گفته می‌شود.



شکل ۳.۷: فیبوناچی اصلاحی خارجی یک موج جنبشی

در متاتریدر برای به دست آوردن انتهای موارد «الف» و «ب» از ابزار Fibonacci Retracement استفاده می‌کنیم.

۲.۸.۷ مورد دوم: فیبوناچی برای دو موج



شکل ۴.۷: فیبوناچی اصلاحی دو موج

تا اینجا استفاده از ابزار فیبوناچی برای به دست آوردن نقاط برگشت مربوط به یک موج بود. استفاده از فیبوناچی برای به دست آوردن نقاط برگشت دو موج به هم پیوسته هم بسیار پرکاربرد است که به آن فیبوناچی پروجکشن (پروژه) گفته می‌شود. (شکل ۴.۷).

ابزار فیبوناچی پروجکشن در متاتریدر Fibonacci Expansion است. در فیبوناچی پروجکشن فرض بر این است که موج سوم با نسبت های فیبوناچی موج اول، از موج دوم منشعب می شود. از تایم ۱۹ دقیقه و ۴۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان مثال هایی از کاربرد ابزارهای فیبوناچی بر روی چارت را توضیح می دهند.

برای درک بهتر سطوح فیبوناچی و کاربرد آنها لازم است توضیحات آقای گلشاهیان را با دقت زیاد و تمرین و تکرار آنها مشاهده کرد.

یادآوری مجدد: برگشت از سطوح فیبوناچی حتما باید با الگوهای کندل شناسی تأیید شود.

همپوشانی فیبوناچی Retracement و فیبوناچی Expansion در یک ناحیه باعث تقویت برگشت از آن ناحیه می شود.

فصل ۸

ویدئوی شماره ۱۷ : الگوهای فیبوناچی – بخش اول

۱.۸ الگوهای فیبوناچی و ترکیب نسبت های فیبوناچی برای پیدا کردن نقاط برگشت قیمت

۱.۱.۸ فیبوناچی ترکیبی و کارایی آن

فیبوناچی ترکیبی: همپوشانی دو یا چند فیبوناچی در تایم فریم های مختلف در یک محدوده (زون) منجر به ایجاد محدوده قوی حمایتی و مقاومتی می شود.
در این قسمت به بررسی مناطق برگشتی بر اساس همپوشانی درصدهای فیبوناچی می پردازیم و سپس الگوها یا پترن های فیبوناچی را بررسی می کنیم.

۲.۱.۸ درصدهای فیبوناچی

اعداد فیبوناچی دارای درصدهای اصلی و فرعی به شرح زیر هستند:

درصدهای اصلی کمتر از ۱۰۰ درصد: ۳۸/۲٪، ۵۰٪، ۶۱/۸٪

درصدهای اصلی بالای ۱۰۰ درصد: ۱۲۷٪، ۱۶۱٪

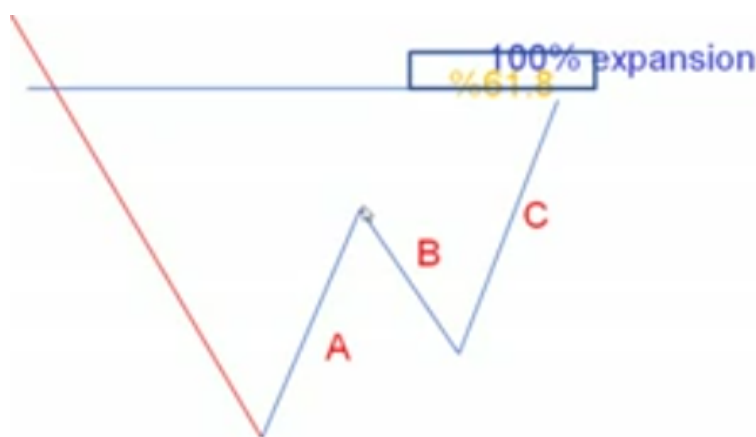
درصدهای فرعی زیر ۱۰۰ درصد: ۲۳/۶٪، ۷۶/۴٪، (۷۸٪)، ۸۸/۶٪

درصدهای فرعی بالای ۱۰۰ درصد: ۲۶۱٪، ۳۶۱٪، ۴۲۳٪
درصدهای فرعی دیگری هم وجود دارند ولی چون اهمیت کمتری دارند ذکر نمی‌شوند.

۳.۱.۸ همپوشانی درصدهای فیبوناچی در یک محدوده

همپوشانی درصدهای فیبوناچی به صورت ترکیبی از دو فیبوناچی در تایم فریم های مختلف است که معمولاً این ترکیب به صورت یک زون یا محدوده برگشتی در نظر گرفته می‌شود.

مثال: ترکیب فیبوناچی اصلاحی و فیبوناچی پروجکشن



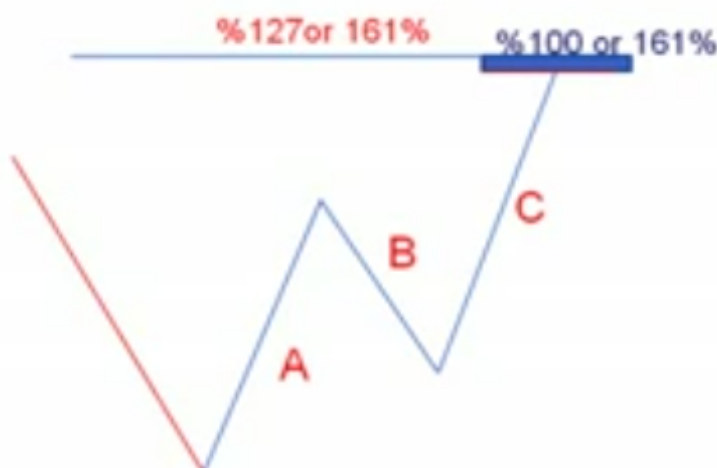
شکل ۱.۸: ترکیب فیبوناچی اصلاحی و فیبوناچی پروجکشن

فیبوناچی اصلاحی موج جنبشی نزولی را در نظر می‌گیریم (شکل ۱.۸) و اگر فیبوناچی پروجکشن خارجی موج B هم روی این منطقه همپوشانی داشته باشد این منطقه را تقویت می‌کند. هر چه همپوشانی درصدهای بیشتری از فیبوناچی را در یک منطقه داشته باشیم در آن منطقه تاکید بیشتری است. بطور مثال در شکل ۱.۸ زمانی که موج C در حال شکل گیری است نمی‌توان گفت آیا در منطقه همپوشانی بر می‌گردد یا نه بلکه زمانی که به این منطقه رسید باید منتظر تشکیل الگوها باشیم. الگوها باید حتماً کامل شوند و در زمان کامل شدنشان باید منطقه مورد بررسی خودمان را زیر نظر بگیریم.

ترکیب فیبوناچی ها انواع مختلفی را می‌تواند شکل دهد که باید در چارت به بررسی و تمرین آنها پرداخته شود ولی در اینجا مثال دیگری را نیز ذکر می‌کنیم.

مثال: ترکیب فیبوناچی اصلاحی خارجی با فیبوناچی پروجکشن (یا رتریسمنت و اکسپنشن)

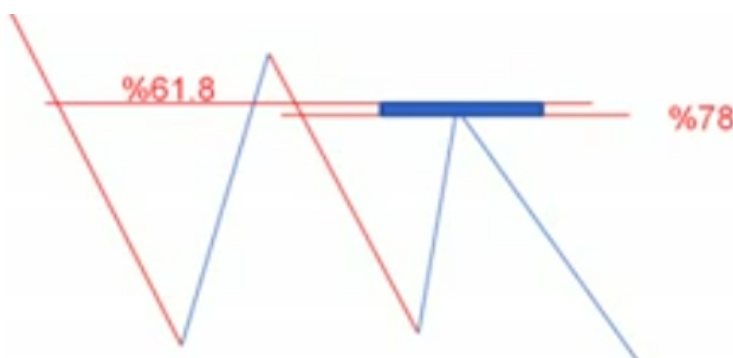
موجی را در نظر می‌گیریم که فیبوناچی اصلاحی خارجی آن ۱۲۷٪ یا ۱۶۱٪ باشد و یک سه موجی هم داشته باشیم که در منطقه ۱۰۰٪ یا ۱۶۱٪ احتمال برگشت وجود داشته باشد. اگر



شکل ۲.۸: ترکیب فیبوناچی اصلاحی خارجی با فیبوناچی پروجکشن

این دو درصد را با هم در نظر بگیریم زونی به ما می‌دهد که احتمال برگشت قیمت از آنجا وجود دارد و این زون را برای گرفتن پوزیشن در نظر می‌گیریم (شکل ۲.۸). باید رفتار قیمت را در منطقه مشخص شده زیر نظر داشت تا تأیید بیشتری گرفت مثل شکست خط روند، شکست آخرین Higher X یا Lower X و همین طور برگشت قیمت از داخل منطقه مشخص شده.

مثال: ترکیب دو فیبوناچی اصلاحی در دو تایم فریم مختلف



شکل ۳.۸: ترکیب دو فیبوناچی اصلاحی در دو تایم فریم مختلف

فرض کنید در یک تایم فریم بزرگتر احتمال برگشت قیمت را در 61.8% می‌دهیم و موج بعدی در تایم فریم کوچکتر است و احتمال برگشت آن در 78% یک زونی به ما می‌دهد که احتمال برگشت قیمت از این محدوده را بسیار زیاد می‌کند (شکل ۳.۸). بنابراین در یک زون هر چه تعداد درصدهای مختلف فیبوناچی بیشتری وجود داشته باشد تأییدیه بیشتری برای احتمال برگشت قیمت از آن زون به ما می‌دهند. همپوشانی دو فیبوناچی اصلاحی در دو تایم فریم مختلف تأیید قوی برای برگشت قیمت دارد. هیچ تضمین 100% برای برگشت قیمت از

منطقه همپوشانی نیست بلکه باید موارد دیگر را نیز بررسی کرد. یکی از مهمترین نکاتی که لازم است به آن توجه شود ترکیب دو عامل دیگر از تحلیل تکنیکال به نام مومنتوم و کندل استیک فرمیشن است که در قسمت های بعدی در مورد آنها توضیح داده خواهد شد.

از تایم ۱۳ دقیقه و ۴۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان ترکیب درصدهای فیبوناچی را روی چارت توضیح می دهند.

مثال هایی که آقای گلشاهیان مطرح می کنند کمک بسیاری برای درک نحوه استفاده از درصدهای فیبوناچی به ما می کنند.

فصل ۹

ویدئوی شماره ۱۸ : الگوهای فیبوناچی – بخش دوم

پترن ها یا الگوهای فیبوناچی الگوهای رایجی از نسبت های فیبوناچی هستند که از همپوشانی نسبت های مختلف دو یا چند موج به دست می آیند. این الگوها که جزو رایجترین الگوهای رفتار قیمت در بازارهای مالی هستند به سه دسته اصلی و هر دسته به ۲ الگو تقسیم می شوند:

دسته اول: الگوهای فیبوناچی سه موجی:

الگوی اول: زیگزاگ کامل یا $AB = CD$

الگوی دوم: الگوی سه درایو Three Drive Pattern

دسته دوم: الگوهای چهار موجی داخلی یا کوچکتر از موج اول:

الگوی اول: الگوی گارتلی

الگوی دوم: الگوی خفاش یا بت

دسته سوم: الگوهای چهار موجی خارجی یا بزرگتر از موج اول:

الگوی اول: الگوی پروانه

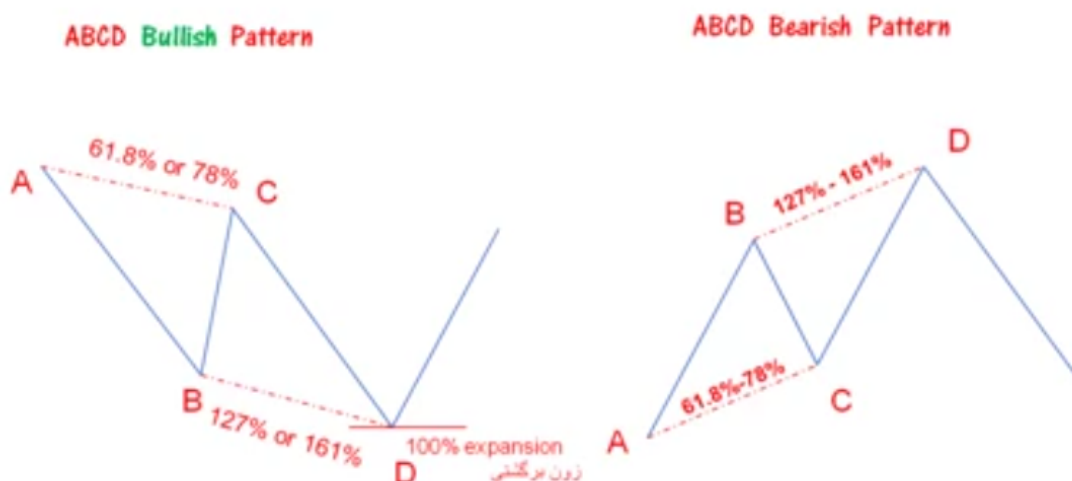
الگوی دوم: الگوی خرچنگ

۱.۹ دسته اول: الگوهای فیبوناچی سه موجی

۱.۱.۹ الگوی اول: زیگزاگ $AB = CD$

فرض می‌کنیم موجی داریم که از نقطه A تا B کشیده شده است و اصلاحی این موج تا نقطه C و محدوده درصدهای فیبوناچی $۶۱/۸\%$ یا ۷۸% باشد، سپس تا نقطه D ادامه پیدا کرده است که نسبت به موج دوم یعنی BC به اندازه ۱۲۷% یا ۱۶۱% و علاوه بر این به اندازه ۱۰۰% فیبوناچی اکسپنشن موج اول یا همان AB می‌باشد، این دو درصد فیبوناچی یک زون برگشتی به ما می‌دهند که احتمال برگشت از این زون را بسیار زیاد می‌کند.

اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت بالا باشد این الگو را **ABCD Bullish Pattern** و اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت پایین باشد این الگو را **ABCD Bearish Pattern** می‌نامند که دقیقاً عکس الگوی **ABCD Bullish Pattern** است (شکل ۱.۹).



شکل ۱.۹: الگوی زیگزاگ کامل یا $AB = CD$

از تایم ۶ دقیقه و ۱۶ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان مثال هایی از الگوی زیگزاگ را روی چارت توضیح می‌دهند.

۲.۱.۹ الگوی دوم: الگوی سه درایو Three Drive Pattern

فرض می‌کنیم موجی داریم که یک کف در نقطه ۱ ساخته است و کف دیگر آن در نقطه ۲ و به اندازه ۱۲۷% یا ۱۶۱% فیبوناچی موج دوم (موج اصلاحی اول) تشکیل خواهد شد و مجدداً قیمت کف دیگری در نقطه ۳ و به اندازه ۱۲۷% یا ۱۶۱% فیبوناچی موج اصلاحی دوم خواهد

ساخت در این صورت الگوی سه درایو Three Drive Pattern ساخته خواهد شد و در نقطه ۳ احتمال برگشت بسیار زیاد می‌باشد.

اگر موج برگشت خورده از نقطه ۳ به سمت بالا باشد این الگو را Bullish و اگر موج برگشت خورده از نقطه ۳ به سمت پایین باشد این الگو را Bearish می‌نامند (شکل ۲.۹).



شکل ۲.۹: الگوی سه درایو Three Drive Pattern

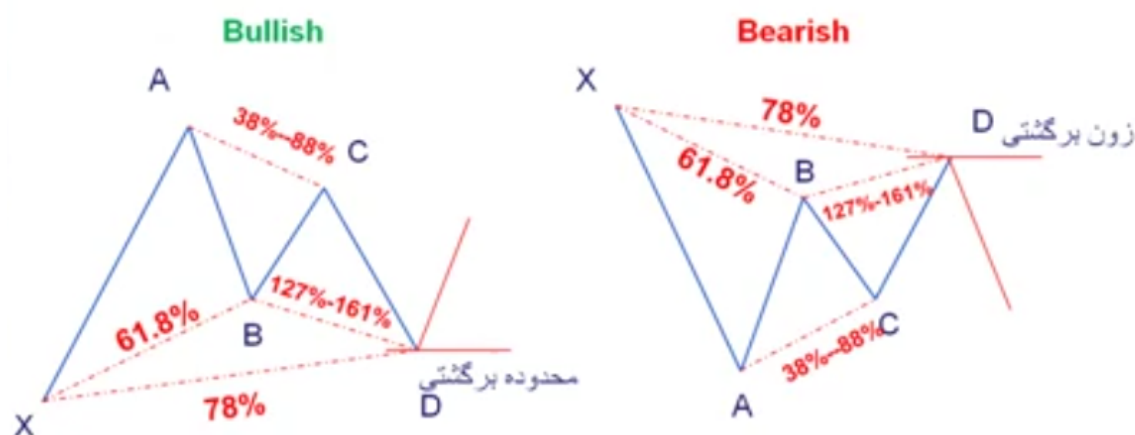
از تایم ۱۲ دقیقه و ۵۰ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان مثال هایی از الگوی سه درایو را روی چارت توضیح می‌دهند.

۲.۹ دسته دوم: الگوهای فیبوناچی چهار موجی کوچکتر از موج اول

۱.۲.۹ الگوی اول: الگوی گارتلی Gartley Pattern

فرض می‌کنیم موجی داریم از نقطه X تا A و موج دوم (اصلاحی موج اول) تا نقطه B و $۶۱/۸\%$ فیبوناچی موج اول کشیده شده است. موج سوم تا نقطه C و به اندازه ۳۸% تا ۸۸% موج دوم بوده که طیف وسیعی از درصدهای فیبوناچی را شامل می‌شود. سپس موج چهارم تا نقطه D و به اندازه ۱۲۷% تا ۱۶۱% موج سوم اصلاح خواهد شد و این نقطه D با درصد ۷۸% موج اول همپوشانی کند که یک محدوده برگشتی برای ما خواهد ساخت و قیمت از آنجا برمی‌گردد.

اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت بالا باشد این الگو را Bullish و اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت پایین باشد این الگو را Bearish می‌نامند (شکل ۳.۹).



شکل ۳.۹: الگوی گارتلی Gartley Pattern

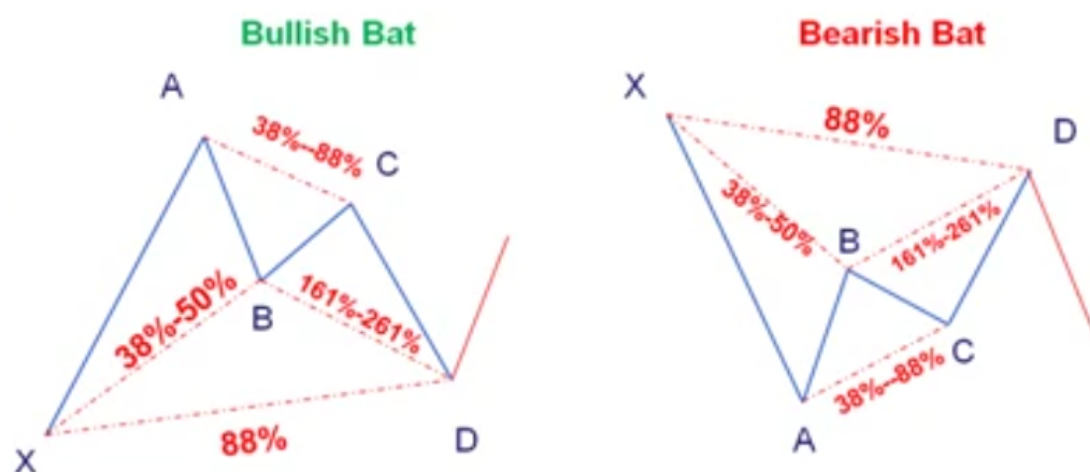
از تایم ۲۰ دقیقه و ۲۱ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان مثال هایی از الگوی گارتلی را روی چارت توضیح می‌دهند.

۲.۲.۹ الگوی دوم: الگوی خفاش Bat Pattern

الگوی خفاش شباهت زیادی به الگوی گارتلی دارد، تفاوت آنها در موج دوم (اصلاحی موج اول) است که نسبت به الگوی گارتلی اصلاح کمتری دارد و تا نقطه B و به اندازه ۳۸٪ تا ۵۰٪ فیبوناچی موج اول اصلاح می‌شود. موج سوم تا نقطه C مطابق الگوی گارتلی به اندازه ۳۸٪ تا ۸۸٪ موج دوم بوده که طیف وسیعی از درصدهای فیبوناچی را شامل می‌شود و همین طور نقطه D که انتهای موج چهارم است با الگوی گارتلی متفاوت است و بیشتر اصلاح خواهد شد و تا ۱۶۱٪ تا ۲۶۱٪ فیبوناچی موج سوم کشیده خواهد شد و این نقطه D باید با درصد ۸۸٪ موج اول همپوشانی کند که یک محدوده برگشتی برای ما خواهد ساخت و قیمت از آنجا برمی‌گردد.

اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت بالا باشد این الگو را Bullish و اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت پایین باشد این الگو را Bearish می‌نامند (شکل ۴.۹).

در هر دو الگوی گارتلی و خفاش موجهای دوم و سوم و چهارم درون موج اول جای می‌گیرند و از آن بیرون نمی‌روند. توجه به این نکته تشخیص این دو الگو از الگوهای بعدی را راحتتر می‌کند.



شکل ۴.۹: الگوی خفاش Bat Pattern

از تایم ۳۱ دقیقه و ۵۷ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان مثال هایی از الگوی خفاش را روی چارت توضیح می دهند.

فصل ۱۰

ویدئوی شماره ۱۹: الگوهای فیبوناچی – بخش سوم

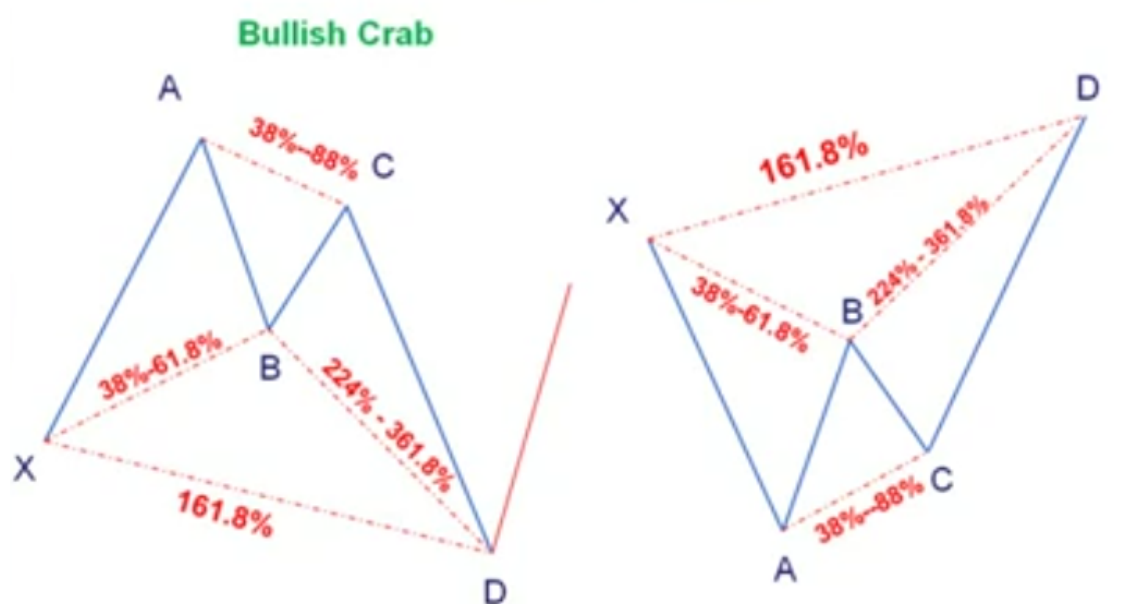
۱.۱۰ دسته سوم: الگوهای فیبوناچی چهار موجی بزرگتر از موج اول

۱.۱.۱۰ الگوی اول: الگوی خرچنگ Crab Pattern

موج اول را از نقطه X تا A فرض می‌کنیم و موج دوم (اصلاحی موج اول) تا نقطه B و ۳۸% تا $۶۱/۸\%$ فیبوناچی موج اول کشیده شده است. موج سوم تا نقطه C و به اندازه ۳۸% تا ۸۸% موج دوم بوده که طیف وسیعی از درصدهای فیبوناچی را شامل می‌شود. سپس موج چهارم تا نقطه D و به اندازه ۲۲۴% تا ۳۶۱% موج سوم اصلاح خواهد شد و این نقطه D با درصد $۱۶۱/۸\%$ موج اول همپوشانی می‌کند که یک محدوده برگشتی برای ما خواهد ساخت و قیمت از آنجا برمی‌گردد.

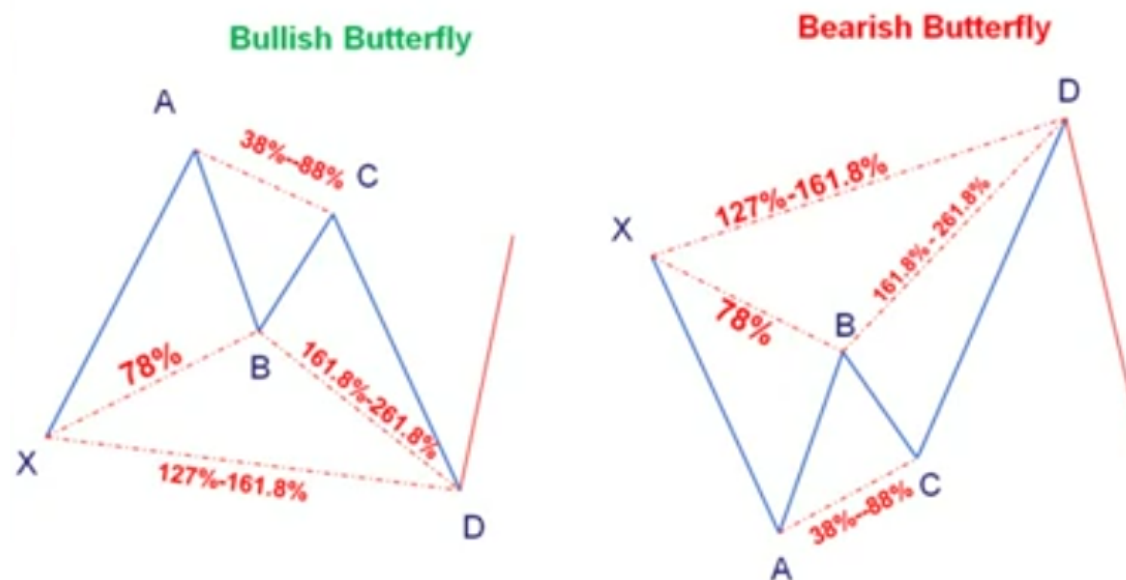
اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت بالا باشد این الگو را Bullish و اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت پایین باشد این الگو را Bearish می‌نامند (شکل ۱.۱۰).

از تایم ۴ دقیقه و ۵۶ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان مثال هایی از الگوی خرچنگ را روی چارت توضیح می‌دهند.



شکل ۱۰.۱۰: الگوی خرچنگ Crab Pattern

۲.۱.۱۰ الگوی دوم: الگوی پروانه Butterfly Pattern



شکل ۲.۱۰: الگوی پروانه Butterfly Pattern

آخرین الگو الگوی پروانه است که در آن موج اول را از نقطه X تا A فرض می‌کنیم و موج دوم (اصلاحی موج اول) تا نقطه B و ۷۸٪ فیبوناچی موج اول کشیده شده است. موج سوم تا نقطه C و به اندازه ۳۸٪ تا ۸۸٪ موج دوم بوده که طیف وسیعی از درصدهای فیبوناچی را

شامل می‌شود. سپس موج چهارم تا نقطه D و به اندازه $۱۶۱/۸\%$ تا $۲۶۱/۸\%$ موج سوم اصلاح خواهد شد و این نقطه D با زون ۱۲۷% تا $۱۶۱/۸\%$ موج اول همپوشانی می‌کند که یک محدوده برگشتی برای ما خواهد ساخت و قیمت از آنجا برمی‌گردد.

اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت بالا باشد این الگو را **Bullish** و اگر موج برگشت خورده از نقطه D به سمت پایین باشد این الگو را **Bearish** می‌نامند (شکل ۲.۱۰).
از تایم ۱۰ دقیقه و ۴۷ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان مثال هایی از الگوی پروانه را روی چارت توضیح می‌دهند.

لازم به یادآوری چند مجدد است که نباید تنها به تائید این الگوها اکتفا کرد بلکه باید تشکیل الگوهای کندل شناسی، مومنتوم قیمت، نزدیک شدن به خطوط حمایت و مقاومت و توجه به «هایر»ها و «لوور»ها را هم داشته باشیم.

فصل ۱۱

ویدئوی شماره ۲۰: الگوهای شمعی ژاپنی

۱.۱۱ پیدایش الگوهای شمعی ژاپنی

در قرن هفدهم یک ژاپنی به نام مانه‌یسا هما دریافت که با استفاده از گذشته قیمت، می‌تواند حرکت های آتی قیمت را در بازار برنج پیش بینی کند و با استفاده از پیوستگی قیمت و تکرار الگوهای آن فقط با در نظر گرفتن این الگوها به ثروتی افسانه ای دست یافت. بعدها یافته های او پایه ای شد در تحلیل تکنیکال که امروز یکی از مهمترین مباحث تحلیل تکنیکال محسوب می‌شود که الگوهای شمعی ژاپنی یا کندل استیک^۱ گفته می‌شود.

۲.۱۱ دسته بندی الگوهای کندل استیک

الگوهای کندل استیک شامل سه دسته هستند:

۱. الگوهای تک کندلی

۲. الگوهای دو کندلی

۳. الگوهای سه کندلی

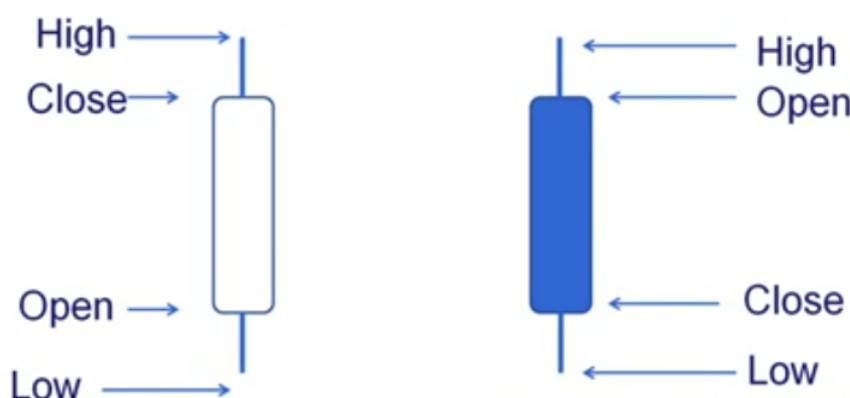
قبل از بررسی الگوها به یادآوری ساختار کندل ها می‌پردازیم.

^۱ Candle Stick Formation

۱.۲.۱۱ ساختار یک کندل

در مورد کندل ها چند شاخص داریم، نقطه High یا بالاترین قیمت دوره، Low یا پایینترین قیمت دوره، Open یا قیمت باز شدن دوره و Close یا قیمت بسته شدن دوره. در کندل صعودی Open پایینتر از Close قرار دارد و حجم بیشتر اردرهای خرید باعث افزایش قیمت و رشد آن شده است ولی در کندل نزولی Open بالاتر از Close قرار دارد و حجم بیشتر اردرهای فروش باعث کاهش قیمت و افت آن شده است (شکل ۱.۱۱).

اندازه بدنه کندل احساسات و جهت غالب بازار را مشخص می‌کند.



شکل ۱.۱۱: کندل استیک

۲.۲.۱۱ تفسیر یک کندل

برای تفسیر یک کندل ابتدا مطابق شکل ۲.۱۱ آن را به ۳ قسمت مساوی تقسیم می‌کنیم.

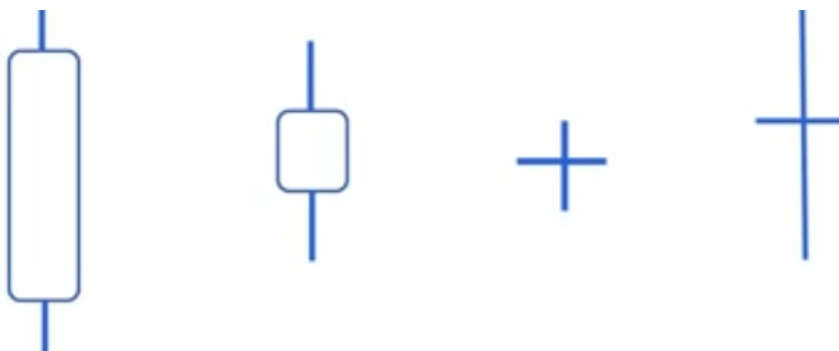


شکل ۲.۱۱: تفسیر یک کندل

بسته شدن قیمت در دوره زمانی مربوط به کندل اهمیت زیادی در ترجمه زبان کندل دارد. بسته شدن کندل در ناحیه ۱ قدرتمندی خریداران، در ناحیه ۳ قدرتمندی فروشندگان و در ناحیه ۲ تقابل طرفین را نشان می‌دهد.

الگوهای کندلی به دلیل ساختار معنادار و لحظه ای رفتار قیمت، امکان تفسیر قیمت در هر کندل و احتمال تغییر روند یا ادامه آن را برای ما مهیا می‌کند. کندل بهترین فرم برای درک رفتار قیمت است. مهمترین نشانه های تغییر روند، ابتدا در الگوهای کندلی نمایان می‌شوند که به آن **الگوهای تغییر روند** می‌گویند و سایر نتیجه گیری های تغییر روند حکم تفسیر و تحلیل ما را دارند.

۳.۲.۱۱ انواع کندل و تفسیر آنها



شکل ۳.۱۱: انواع کندل

کندل بسته به سایز بدنه و سایه مطابق شکل ۳.۱۱ شامل چند نوع است:

کندل توپر با بدنه بلند: این کندل نشان دهنده رشد یا افت واضح در این دوره است و سایه های نه چندان بلند نشان می‌دهند که نوسان زیادی ندارد و اکثر معامله گران بسته به رنگ کندل بر رشد یا افت قیمت توافق دارند.

کندل توپر با بدنه کوچک و سایه های کوچک: این کندل نشان می‌دهد که رشد یا افت زیادی را شاهد نیستیم و بیشتر نشان دهنده خسته بودن یا استراحت قیمت است و سایه ها هم نشان می‌دهد که نوسان شدیدی حاکم نیست.

کندل بدون بدنه با سایه های کوچک: در این کندل نقطه باز شدن و بسته شدن یکی است و سایه های کوچک نشان می‌دهد که هیچ روندی نداریم و نوسان زیادی هم نداشتیم پس با یک بازار آرام روبرو هستیم.

کندل بدون بدنه با سایه های بزرگ: مثل کندل بدون بدنه با سایه های کوچک است ولی نوسانات زیادی را در قیمت داشته و بازار نوسانی و سردرگم بوده است.

این طبقه بندی بر اساس سایز بدنه و سایه می‌تواند در تفسیر کندل و مرتبط کردن انواع آن به هم کمک زیادی به ما نماید.

پس می‌توانیم به صورت خلاصه بگوییم:

بدنه بزرگتر = روند قویتر

بدنه کوچکتر = روند کنونی ضعیفتر (قیمت در حال استراحت یا تغییر جهت)

سایه بزرگتر = نوسان بیشتر، سردرگمی بیشتر

سایه کوچکتر = نوسان کمتر، سردرگمی کمتر

الگوهای قیمت بر اساس محل قرار گرفتن بدنه در سه ثلث کندل تعیین می‌شوند، پس محل قرار گرفتن بدنه در کندل مهمترین نکته در ترجمه زبان کندل های تکی است. بنابراین نتایج زیر را داریم:

کندل توپر با بدنه بلند $\Leftarrow$ بازار روند دار و قوی

کندل توپر با بدنه کوچک و سایه های کوچک $\Leftarrow$ کم شدن سرعت قیمت و ضعیف شدن روند

کندل بدون بدنه با سایه های کوچک $\Leftarrow$ بازار آرام و خسته و بدون نوسان

کندل بدون بدنه با سایه های بزرگ $\Leftarrow$ بازار پر نوسان و سردرگم و خسته و بدون روند

۴.۲.۱۱ الگوهای تک کندلی

الف) الگوی کندل چکش و ستاره دنباله دار:

این الگو شبیه چکش است و یک سایه بلند در پایین و یک بدنه کوچک در بالا دارد (شکل ۴.۱۱).



شکل ۴.۱۱: کندل هامر یا چکش

در الگوی چکش، بدنه در ثلث بالایی قرار دارد و در ثلث های دیگر فقط سایه داریم و این نشانه چربیدن قدرت خریداران به فروشندگان است. در بالای بدنه یک سایه کوتاه یا بدون سایه داریم. در الگوی چکش صعودی یا نزولی بودن (سبز یا قرمز بودن) کندل اهمیتی ندارد. الگوی بعدی چکش برعکس است که چربیدن قدرت فروشندگان به خریداران را نشان می دهد (شکل ۵.۱۱).



شکل ۵.۱۱: کندل شهاب یا ستاره ثاقب

این کندل شهاب یا ستاره دنباله دار یا Shooting Star یا ستاره ثاقب است. بدنه در ثلث پایینی قرار دارد و در پایین بدنه سایه کوتاه یا بدون سایه داریم. صعودی یا نزولی بودن این کندل اهمیت ندارد.

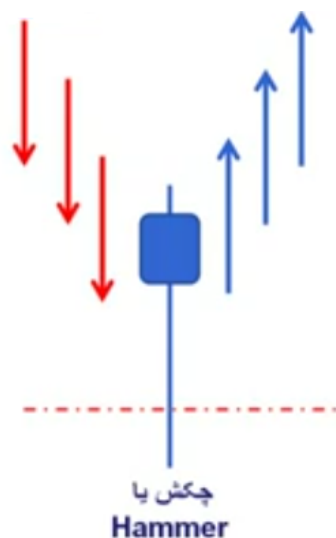
چه عاملی باعث بوجود آمدن این حالت ها در شکل کندل می شود؟

در الگوی چکش برخورد قیمت به موانعی مانند خطوط حمایت، پیوت ها، شکاف ها، زون های الگوهای فیبوناچی یا نسبت های فیبوناچی باعث برگشت قیمت می شود. این برخورد در ثلث پایینی چکش اتفاق می افتد. در الگوی ستاره دنباله دار هم برخورد به خطوط حمایت یا مقاومت یا سایر خطوط مانند الگوی چکش باعث برگشت قیمت می شود.

تفسیر الگوی چکش در یک روند:

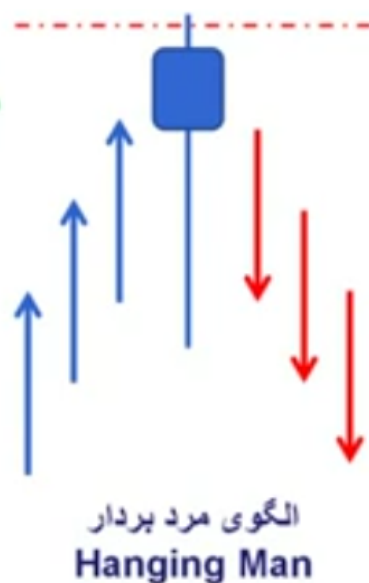
فرض کنید شاهد یک روند نزولی هستیم و قیمت در حال افت است و یک روند رو به کاهش داریم. قیمت پس از برخورد به یکی از موانعی که ذکر شد برمی گردد و کندل به شکل چکش در می آید و این یکی از نشانه های اصلی تغییر روند یا الگوی برگشتی است و احتمال اینکه قیمت از این نقطه صعود کند را برای ما بیشتر می کند. زیبایی الگوهای کندل استیک این است که حتی قبل از شروع روند صعودی احتمال آن را به ما نشان می دهند. تأیید برگشت روند توسط یک کندل صعودی بعدی است (شکل ۶.۱۱).

اگر الگوی چکش در انتهای یک روند صعودی ایجاد شود دیگر الگوی چکش نیست و به



شکل ۶.۱۱: الگوی چکش در انتهای یک روند نزولی

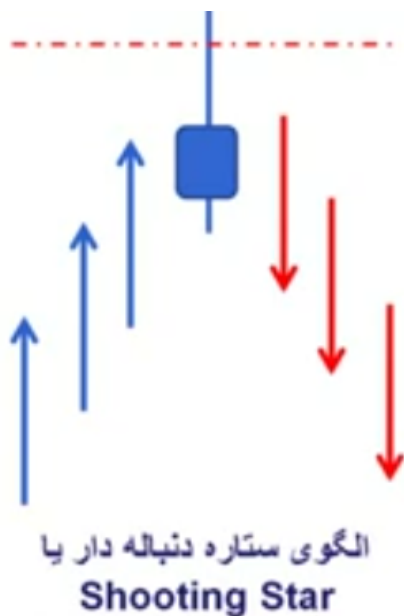
آن الگوی مرد آویزان می‌گویند و تأیید برگشت روند توسط یک کندل نزولی بعدی خواهد بود (شکل ۷.۱۱).



شکل ۷.۱۱: الگوی مرد بردار در انتهای یک روند صعودی

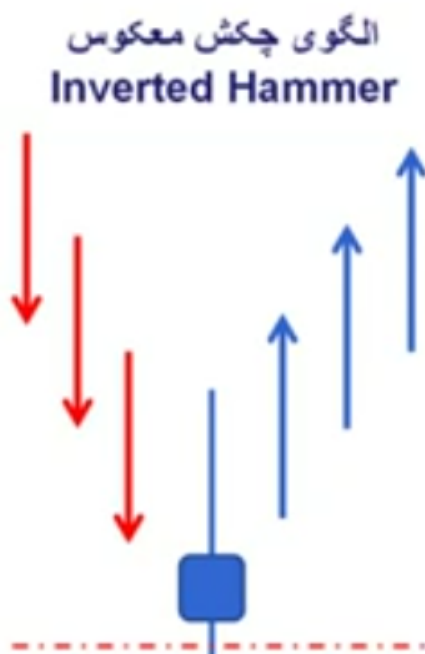
تفسیر الگوی برگشتی ستاره ثاقب یا Shooting Star در یک روند

الگوی ستاره ثاقب را در انتهای یک روند صعودی در نظر می‌گیریم که بعد از برخورد به یک مانع قیمت برمی‌گردد و کندل ستاره ثاقب ساخته می‌شود که بودن بدنه کندل در ثلث پایینی نشان دهنده احتمال نزول قیمت است و تأیید برگشت توسط یک کندل نزولی بعدی می‌باشد (شکل ۸.۱۱).



شکل ۸.۱۱: الگوی ستاره دنباله دار در انتهای یک روند صعودی

الگوی بعدی که شباهت بسیار زیادی به الگوی ستاره ثاقب دارد الگوی چکش معکوس است که در انتهای یک روند نزولی و بعد از برخورد قیمت به یک مانع قیمت ساخته می شود و تأیید برگشت توسط یک کندل صعودی بعدی می باشد (شکل ۹.۱۱).



شکل ۹.۱۱: الگوی چکش معکوس در انتهای یک روند نزولی

رنگ بدنه کندل در الگوی چکش معکوس و الگوی ستاره ثاقب اهمیتی ندارد. تفاوت این

دو الگو این است که الگوی ستاره ثاقب حتما در انتهای یک روند صعودی ساخته می‌شود. از تایم ۲۴ دقیقه این ویدئو آقای گلشاهیان روی چارت این الگوها را توضیح می‌دهند.

ب) الگوی کندل دوجی Doji

کندل بعدی کندل دوجی است که به معنی خستگی بازار می‌باشد. کندل دوجی زمانی تشکیل می‌شود که نقطه باز و بسته شدن قیمت در یک دوره زمانی یکی باشد. در کندل دوجی در طول دوره قیمت نوسان داشته ولی تغییری نکرده است (شکل ۱۰.۱۱).



شکل ۱۰.۱۱: کندل دوجی

شکل های دیگر کندل دوجی به صورت زیر هستند (شکل ۱۱.۱۱):



شکل ۱۱.۱۱: شکل های دیگر کندل دوجی

همگی این اشکال چه نوسان شدید و چه نوسان ضعیف خستگی بازار را نشان می‌دهند.

ج) کندل قرقره یا Spinning Top

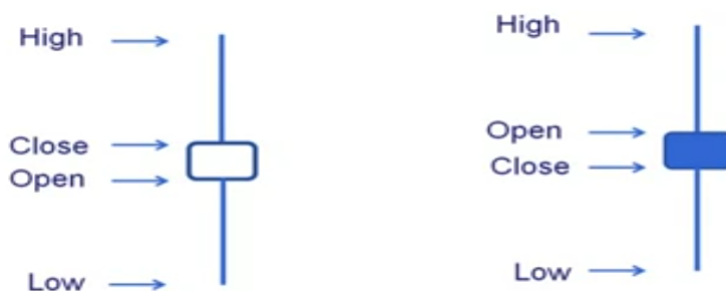
کندل بعدی کندل های قرقره هستند. این کندل ها از اهمیت کمتری برخوردارند، دارای بدنه کوچک و سایه کوچک اند که نشان دهنده کند شدن و ضعیف شدن روند فعلی بازار می‌باشند (شکل ۱۲.۱۱).



شکل ۱۲.۱۱: کندل قرقره یا Spinning Top

(د) کندل های موج بلند یا High Wave

کندل های موج بلند هم اهمیت کمتری نسبت به بقیه دارند، این کندل ها بدنه کوچک و سایه های بلند دارند و فارغ از رنگ کندل به معنای گیج و آشفته بودن بازار هستند (شکل ۱۳.۱۱).

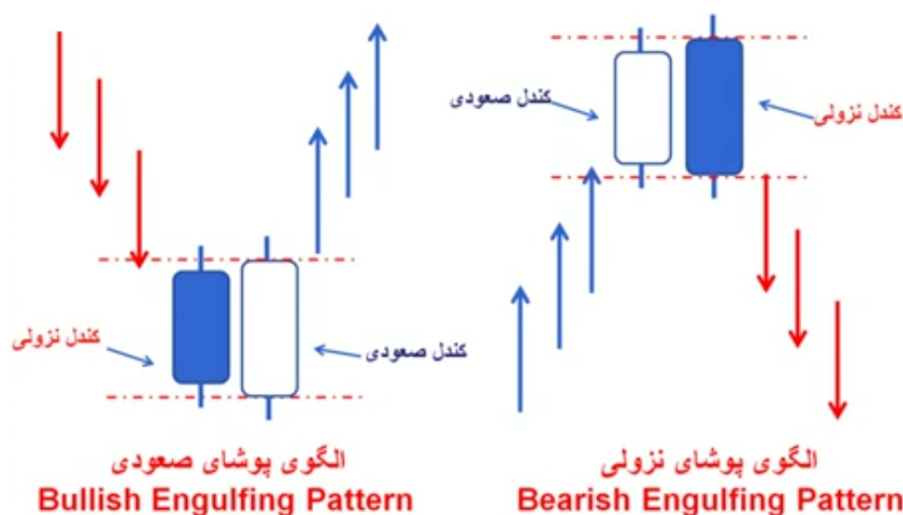


شکل ۱۳.۱۱: کندل های موج بلند یا High Wave

از تایم ۳۴ دقیقه و ۲۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان کندل دوجی، قرقره و موج بلند را روی چارت توضیح می دهند.

۵.۲.۱۱ الگوهای دو کندلی

الف) الگوی پوشا یا Engulfing Pattern



شکل ۱۴.۱۱: الگوی پوشا یا Engulfing Pattern

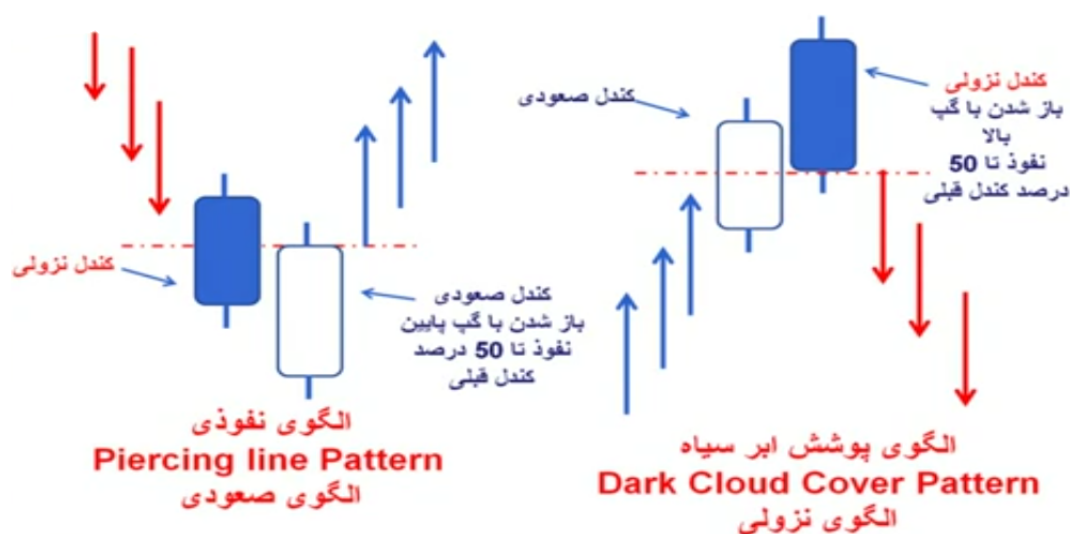
اولین الگو از سری الگوهای دو کندلی الگوی پوشا می باشد. احتمال برگشت در الگوی پوشا زیاد است و حتما باید بدنه کندل تشکیل شده دوم از کندل قبل از خودش بزرگتر بوده و آن را

کاملاً در خود جای دهد (شکل ۱۴.۱۱). این الگو هم با تشکیل یک کندل صعودی بعد از الگوی پوشای صعودی یا یک کندل نزولی بعد از الگوی پوشای نزولی تأیید می‌شود.

از تایم ۴۰ دقیقه و ۱۴ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی پوشا را روی چارت توضیح می‌دهند.

ب) الگوی Dark Cloud Cover & Piercing Line

در الگوی بعدی از سری الگوهای دو کندلی، الگوی نزولی و الگوی صعودی با هم متفاوت ولی کاملاً شبیه هم هستند این الگوها الگوی Dark Cloud Cover و الگوی Piercing Line هستند و احتمال برگشت قیمت را زیاد می‌کنند (شکل ۱۵.۱۱).



شکل ۱۵.۱۱: الگوی Dark Cloud Cover و الگوی Piercing Line

تأیید این الگو نیز کندل بعد از الگوست که در الگوی صعودی باید کندل صعودی و در الگوی نزولی باید کندل نزولی داشته باشیم.

از تایم ۴۴ دقیقه و ۴۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی Dark Cloud Cover و الگوی Piercing Line را روی چارت توضیح می‌دهند.

۶.۲.۱۱ الگوهای سه کندلی

الف) الگوی ستاره صبحگاهی و عصرگاهی Morning and Evening Star

اولین الگو از الگوهای سه کندلی الگوی ستاره صبحگاهی یا Morning Star است که در انتهای یک روند نزولی تشکیل می‌شود. الگوی بعدی الگوی ستاره عصرگاهی Evening Star

است که در انتهای یک روند صعودی تشکیل می‌شود و دقیقاً عکس الگوی ستاره صبحگاهی است (شکل ۱۶.۱۱).

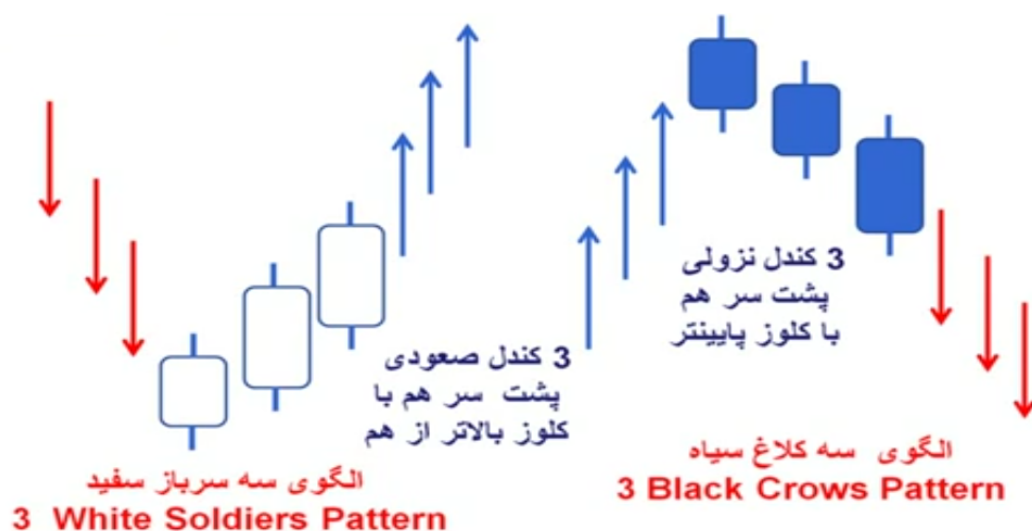


شکل ۱۶.۱۱: الگوی ستاره صبحگاهی یا Morning Star و الگوی ستاره عصرگاهی یا Evening Star

در هر دو الگو صعودی یا نزولی بودن کندل قرقره مهم نیست.

از تایم ۵۰ دقیقه و ۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی ستاره صبحگاهی یا Morning Star و الگوی ستاره عصرگاهی Evening Star را روی چارت توضیح می‌دهند.

ب) الگوی سه سرباز سفید و سه کلاغ سیاه 3 White Soldiers and 3 Black Crows



شکل ۱۷.۱۱: الگوی سه سرباز سفید یا 3 White Soldiers و الگوی سه کلاغ سیاه یا 3 Black Crows

الگوهای آخر از سری الگوهای سه کندلی برای روند نزولی و روند صعودی دارای اسامی متفاوت ولی ظاهر و ویژگی‌های یکسان هستند. الگویی که در انتهای یک روند نزولی می‌آید

الگوی سه سرباز سفید یا 3 White Soldiers و الگویی که در انتهای یک روند صعودی می‌آید الگوی سه کلاغ سیاه یا 3 Black Crows می‌باشند (شکل ۱۶.۱۱).

از تایم ۵۴ دقیقه و ۵۴ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی سه سرباز سفید یا 3 White Soldiers و الگوی سه کلاغ سیاه یا 3 Black Crows را روی چارت توضیح می‌دهند.

انتهای هفته فرصت مناسبی برای بررسی کندل‌های روزانه و هفتگی و مشخص کردن تحلیل برای هفته آینده است.

وجود کندل‌های با بدنه کوچک و سایه بلند (High Wave) نشان دهنده کاهش مومنتوم روند است.

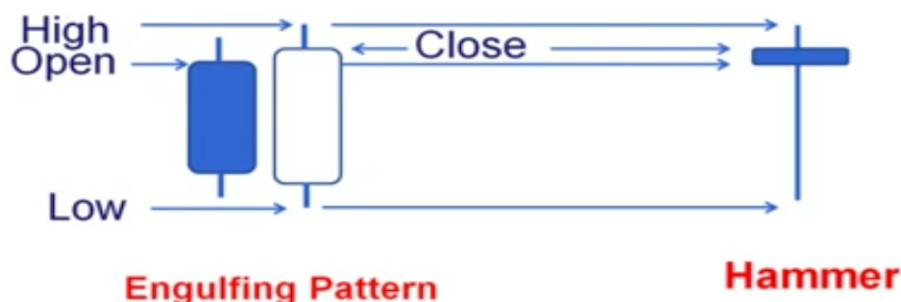
استفاده از اندیکاتورها و دقت به مناطق اشباع آنها می‌تواند در گرفتن پوزیشن‌ها به ما کمک شایانی بکند.

الگوهایی که تا اینجا معرفی شدند الگوهای اصلی کندل استیک بودند و برای شناخت الگوهای فرعی می‌توانیم به کتاب الگوهای شمعی ژاپنی اثر استیو نیسون مراجعه کنیم.

۷.۲.۱۱ ساده کردن کندل‌ها برای درک بهتر

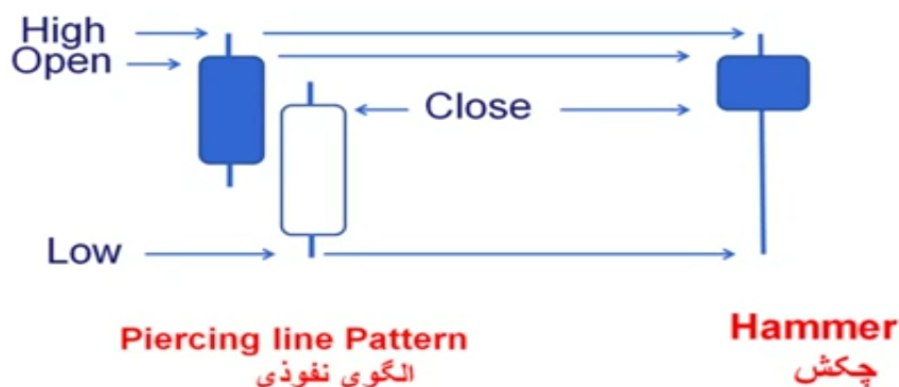
برای درک بهتر الگوهای دو کندلی و سه کندلی آنها را ساده می‌کنیم، برای ساده کردن، بالاترین «های»، پایینترین «لو»، قیمت باز شدن کندل اول و قیمت بسته شدن کندل آخر را در نظر می‌گیریم.

مثال: الگوی Engulfing را ساده می‌کنیم (شکل ۱۸.۱۱):



شکل ۱۸.۱۱: ساده سازی الگوی پوشا

به سادگی الگوی Engulfing به الگوی چکش تبدیل می‌شود و الگوی Engulfing نزولی هم بعد از ساده سازی الگوی تک کندلی شهاب خواهد بود.

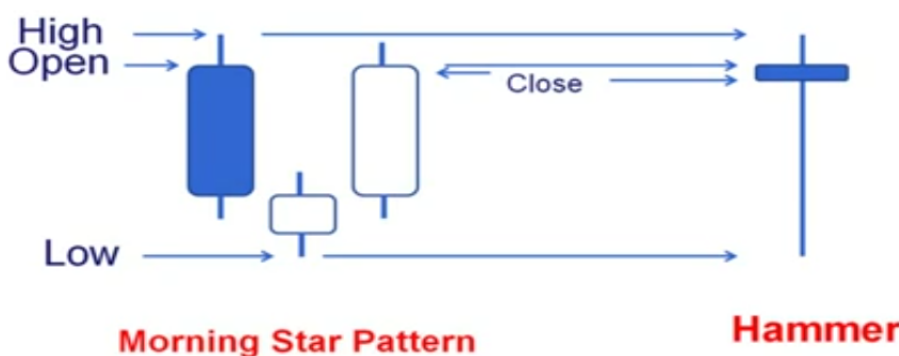


شکل ۱۹.۱۱: ساده کردن الگوی Piercing Line

مثال: ساده کردن الگوی Piercing Line (شکل ۱۹.۱۱):

الگوی Piercing Line به الگوی چکش تبدیل می‌شود و الگوی پوشش ابر سیاه هم بعد از ساده سازی الگوی تک کندلی شهاب خواهد بود.

مثال: ساده کردن الگوی ستاره صبحگاهی (شکل ۲۰.۱۱):



شکل ۲۰.۱۱: ساده کردن الگوی ستاره صبحگاهی

الگوی ستاره صبحگاهی به الگوی چکش تبدیل می‌شود و الگوی ستاره عصرگاهی هم بعد از ساده سازی الگوی تک کندلی شهاب خواهد بود.

۸.۲.۱۱ تأییدیه های الگوهای کندل استیک

الگوهای کندل استیک نباید به تنهایی برای گرفتن سیگنال مورد استفاده قرار گیرند و برای گرفتن پوزیشن نیاز به تأییدیه های دیگری دارند. موارد زیر به عنوان تأییدیه الگوی کندل استیک مورد استفاده قرار می‌گیرند:

خطوط حمایت و مقاومت

الگوهای قیمت، سر و شانه، دو قله یا دو دره، پرچم، ...

خطوط روند

الگوهای فیبوناچی

اندیکاتورهای Moving Average

اسیلاتورها (نوسان سنج ها) MACD, RSI, Stochastic واگرایی و اشباع خرید و فروش

امواج الیوت

هر چه تایم فریم بالاتر باشد نوسانات کمتر و الگوها دقیقتر هستند. الگوها معمولاً در تایم فریم های بالاتر از یک ساعت بهتر عمل می کنند.

نکته آخر اینکه همیشه صبر کنید تا کندل ها بسته شوند و الگوها کامل شوند.

فصل ۱۲

ویدئوی شماره ۲۱: الگوهای قیمت – قسمت اول

۱.۱۲ تعریف الگوی قیمت

الگوهای قیمت اشکالی از رفتار قیمت هستند که به دلیل تکراری بودن، به صورت الگو دارای ارزش پیش‌بینی رفتار آتی قیمت هستند. این الگوها انعکاس بین خریداران و فروشندگان می‌باشند. الگوها براساس نوع پیش‌بینی که از رفتار قیمت به ما می‌دهند، برای وارد شدن به بازار و محاسبه ریسک به ریوارد یا منفعت پوزیشن‌ها اهمیت زیادی دارند.

دسته‌بندی الگوهای قیمت:

۱. الگوهای برگشتی قیمت (تغییر روند)^۱

۲. الگوهای ادامه‌دهنده روند^۲

همین‌طور که از نام این الگوها پیداست، الگوهای برگشتی الگوهایی هستند که باعث تغییر جهت قیمت در جهت عکس روند کنونی می‌شوند و الگوهای ادامه‌دهنده، الگوهای گسترش دهنده روند کنونی هستند.

^۱ Reversal Patterns

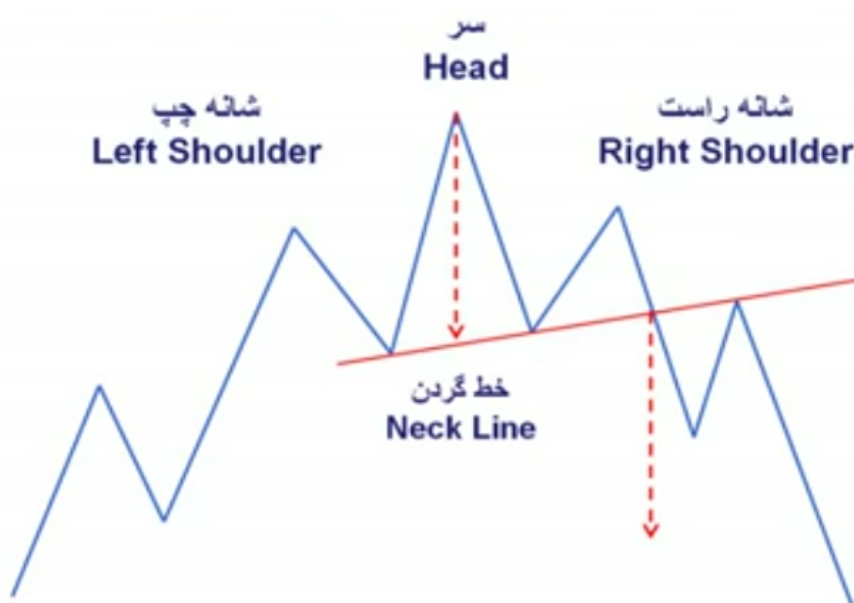
^۲ Continuation Patterns

۲.۱۲ دسته اول: الگوهای برگشتی یا تغییردهنده روند

۱.۲.۱۲ الگوی اول: الگوی سر و شانه صعودی و نزولی

الگوی سر و شانه نزولی Bearish Head and Shoulders Pattern

الگوی سر و شانه نزولی در انتهای یک روند صعودی به وجود می‌آید. در این الگو انتظار می‌رود بعد از شکسته شدن خط گردن به اندازه پیک سر از خط گردن، نزول ادامه پیدا کند (شکل ۱.۱۲).

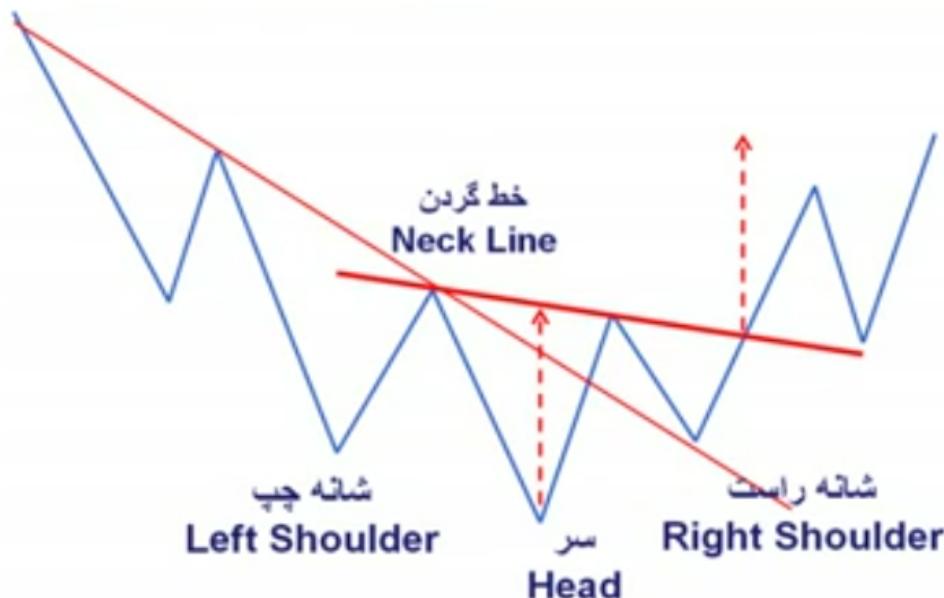


شکل ۱.۱۲: الگوی سر و شانه نزولی

یکی از مهمترین نکته‌ها که باعث اعتبار دادن به الگوی سر و شانه نزولی می‌شود، این است که باید حتماً یک روند صعودی قبل از آن داشته باشیم و اولین نشانه تشکیل سر و شانه شکسته شدن خط روند این روند صعودی می‌باشد. نکته مهم بعدی این است که بعد از شکسته شدن خط گردن، قیمت نباید دیگر خط گردن را به بالا بشکند وگرنه الگوی سر و شانه نزولی دیگر اعتبار ندارد. یک نشانه مهم این است که حجم مارکت در سر کمتر از حجم مارکت در شانه چپ است که برای این منظور می‌توان از اندیکاتورهای استفاده کرد که در ادامه بیشتر بحث خواهد شد. کم شدن حجم مارکت به معنی کاهش روند صعودی است. حجم معاملات در شانه راست هم بسیار پایین خواهد بود. حتماً بایستی یک کندل زیر خط گردن بسته شود، در این صورت شکست خط گردن محسوب خواهد شد و تا قبل از شکسته شدن خط روند احتمال اینکه الگوی سر و شانه تشکیل نشود و قیمت مجدداً در جهت صعودی حرکت کند وجود دارد.

الگوی سر و شانه صعودی Bullish Head and Shoulders Patterns

شرایط الگوی سر و شانه صعودی کاملاً مشابه الگوی سر و شانه نزولی است با این تفاوت که در انتهای روند نزولی تشکیل می‌شود (شکل ۲۰.۱۲). در الگوی سر و شانه می‌توان از واگرایی در اندیکاتور RSI برای تشخیص تغییر حجم معاملات در سر و شانه‌ها استفاده کرد.



شکل ۲۰.۱۲: الگوی سر و شانه صعودی

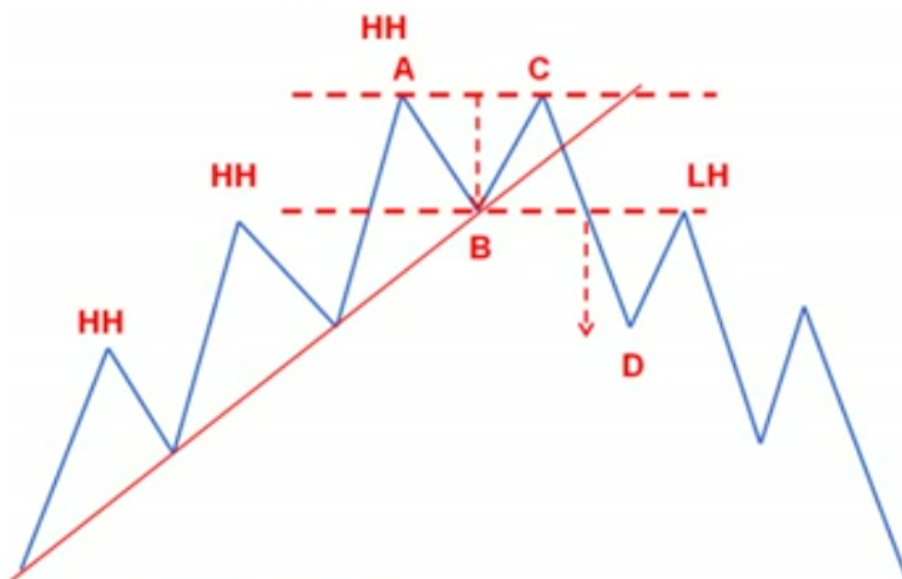
از تایم ۱۱ دقیقه و ۵۲ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی سر و شانه را روی چارت توضیح می‌دهند.

۲.۲.۱۲ الگوی دوم: الگوی سقف و کف دوقلو (دو قله و دو دره)

الگوی سقف دوقلو Double Top Pattern

الگوی سقف و کف دوقلو الگوهای خیلی قابل اعتمادی هستند. الگوی سقف دوقلو در انتهای یک روند صعودی ایجاد می‌شود (شکل ۳۰.۱۲).

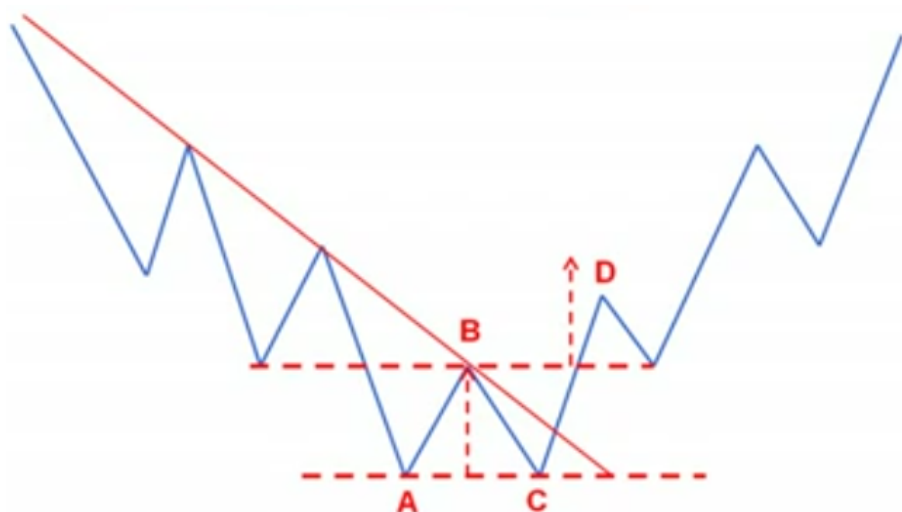
زمانی که حمایت مورب شکسته می‌شود با شکسته شدن حمایت افقی، مطابق شکل ۳۰.۱۲ قیمت به اندازه اختلاف عمودی A تا B پایین می‌آید و نقطه D را می‌سازد. بعد از نقطه D در نقطه‌ای که LH تشکیل می‌شود، قیمت نباید بالای این خط حمایت افقی، هیچ کندلی تشکیل دهد، در این صورت تأیید شروع روند نزولی صادر می‌شود.



شکل ۳.۱۲: الگوی سقف دوقلو

الگوی کف دوقلو Double Bottom pattern

شرایط حاکم بر این الگو مشابه شرایط حاکم بر الگوی سقف دوقلو است و در انتهای روند نزولی تشکیل می‌شود (شکل ۴.۱۲).



شکل ۴.۱۲: الگوی کف دوقلو

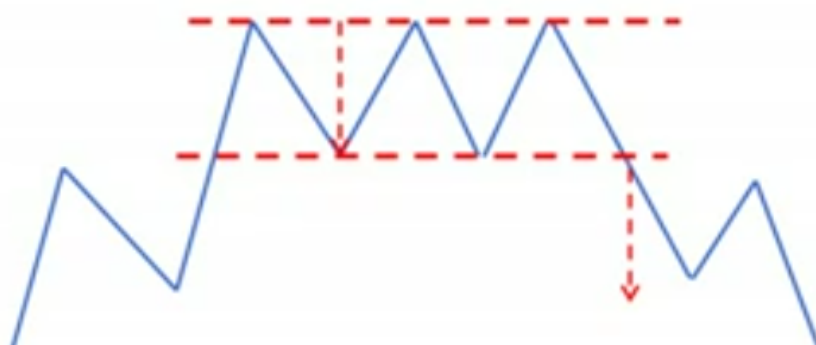
از تایم ۲۰ دقیقه و ۳۷ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی کف و سقف دوقلو را روی چارت توضیح می‌دهند.

در کف دوقلو یا سقف دوقلو در قله یا دره اول نسبت به قله یا دره دوم به وضوح در RSI واگرایی داریم که نشان از تغییر حجم در جهت تغییر روند است.

۳.۲.۱۲ الگوی سوم: الگوی سقف و کف سه قلو (سه قله و سه دره)

الگوی سقف سه قلو Triple Top Pattern

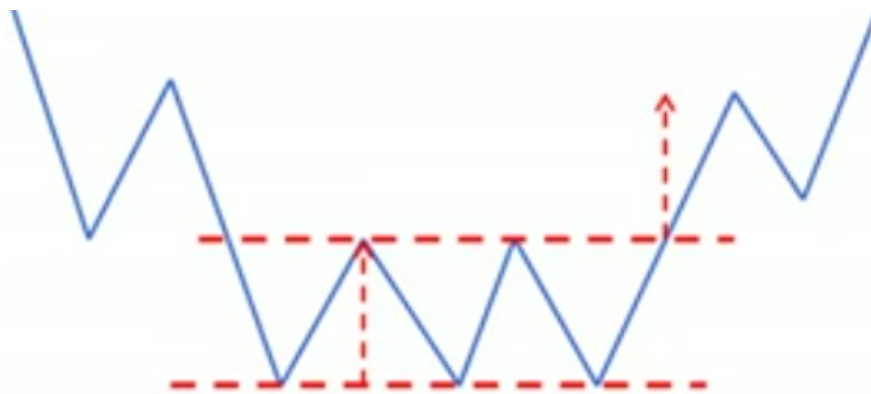
الگوی سقف سه قلو حالت خاصی از الگوی سر و شانه است که در انتهای یک روند صعودی تشکیل می‌شود. به این صورت که سرهم نتوانسته از مقاومتی که شانه‌ها با آن درگیر هستند، عبور کند (شکل ۵.۱۲).



شکل ۵.۱۲: الگوی سقف سه قلو

شرایط حاکم بر سقف سه قلو، شبیه شرایط حاکم بر الگوی سر و شانه است با این تفاوت که سقف‌ها و کف‌ها از یک محدوده مشخص خارج نمی‌شوند. در این الگو باید تناسب زمانی بین سقف‌ها و کف‌ها برقرار باشد. یعنی مثلاً تعداد کندل‌ها در هر برخورد بین سقف و کف تقریباً باید یکی باشند، نه اینکه یکی نصف دیگری باشد. زمان طولانی‌تر بین دو قله یا سه قله در همه الگوها و ارتفاع بیشتر آنها، اشاره به این نکته دارد که پتانسیل بیشتری برای برگشت قیمت وجود دارد. فاصله زمانی بین کف‌ها و سقف‌ها در همه الگوها تأیید قوی است.

الگوی کف سه قلو Triple Bottom Pattern



شکل ۶.۱۲: الگوی کف سه قلو

شرایط الگوی کف سه قلو مشابه الگوی سقف سه قلو است. اگر الگوی سقف سه قلو در انتهای یک روند نزولی تشکیل شود به آن کف سه قلو گفته می‌شود و زمانی این الگو تکمیل می‌شود که قیمت برگردد و آخرین LH را بشکند، انتظار داریم بعد از شکست مقاومت، قیمت به اندازه فاصله سقف تا کف بالا رود (شکل ۶.۱۲).

غیر از این الگو، الگوهای دیگری هم وجود دارند ولی اهمیت کمتری دارند که برای مطالعه آنها می‌توانیم به کتاب «تحلیل تکنیکال در بازار سرمایه» مراجعه کنیم.

واگرایی تغییرات حجم با الگوی سه قلو، تأیید قوی برای برگشت قیمت است.

از تایم ۳۳ دقیقه و ۱۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی کف و سقف سه قلو را روی چارت توضیح می‌دهند.

فصل ۱۳

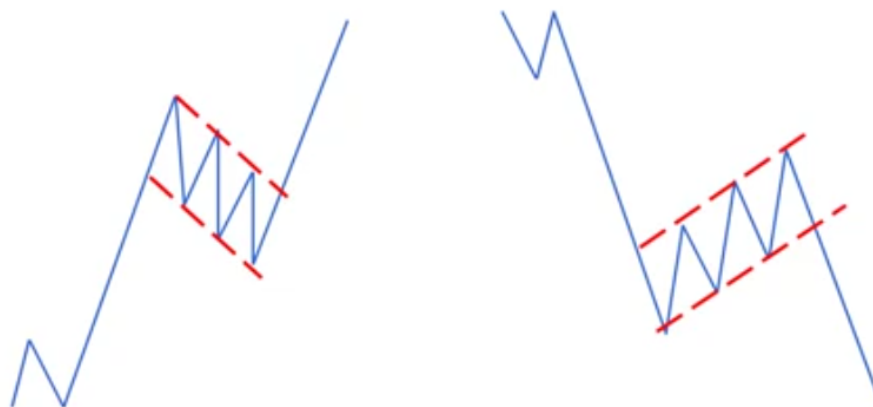
ویدئوی شماره ۲۲: الگوهای قیمت – قسمت دوم

۱.۱۳ الگوهای ادامه دهنده قیمت

همین طور که از نام این الگو پیداست در صورت مشاهده الگوهای ادامه دهنده قیمت شاهد توسعه و ادامه قیمت در جهت روند کنونی خواهیم بود. در واقع می‌توان گفت قیمت در زمان تشکیل این الگوها در حال استراحت و تجدید قوا برای ادامه روند می‌باشد.

۱.۱.۱۳ الگوی اول: الگوی پرچم Flag Pattern

الگوی پرچم یکی از الگوهای ادامه دهنده روند است که به شکل پرچم تشکیل می‌شود (شکل ۱.۱۳). این الگو را در روند نزولی و روند صعودی داریم ولی خلاف روند اصلی است. مشخصه این الگو این است که در جهتی که در حال تشکیل است قیمت به سطح بالایی و سطح پایینی (خط چین‌ها در شکل ۱.۱۳) برخورد می‌کند و این الگو را تشکیل می‌دهد. از مشخصه‌هایی که می‌توان الگوی پرچم را تشخیص داد این است که زمان تشکیل این الگو قیمت شیب زیادی را نسبت به جهت قبلی خودش و خلاف جهت آن دارد و عملاً می‌توان گفت قیمت بعد از یک نزول یا صعود نیاز به استراحت دارد و در حال تجدید قوا برای ادامه دادن به روند اصلی خودش است. الگوی پرچم یکی از اصلیت‌ترین و قابل اعتمادترین الگوهای ادامه دهنده روند است و چون به راحتی قابل شناسایی است از این الگو می‌توان برای گرفتن پوزیشن در جهت روند استفاده کرد.

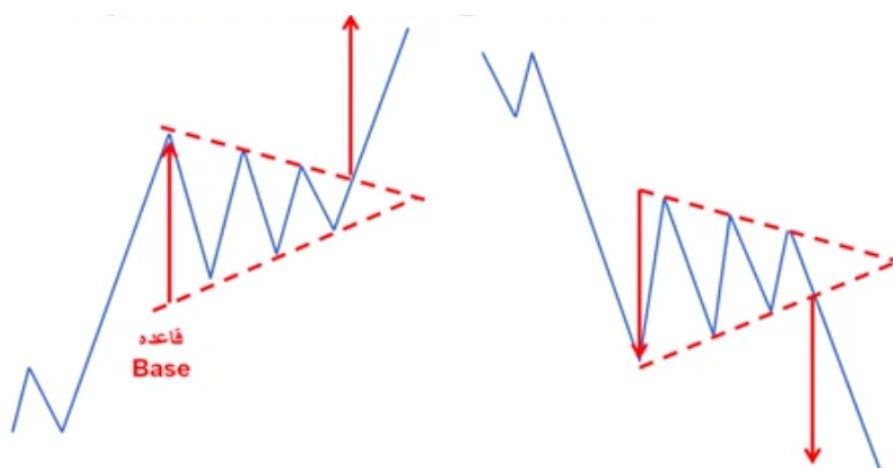


شکل ۱.۱۳: الگوی پرچم

تأیید این الگو، در روند صعودی شکست مقاومت (خط بالایی) و در روند نزولی شکست حمایت (خط پایینی) است. لازم به ذکر است در الگوی پرچم دو برخورد هم قابل قبول است. از تایم ۴ دقیقه و ۱۵ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی پرچم را روی چارت توضیح می‌دهند.

۲.۱.۱۳ الگوی دوم: انواع الگوهای مثلث

الگوی مثلث متقارن Symmetrical Triangle Pattern



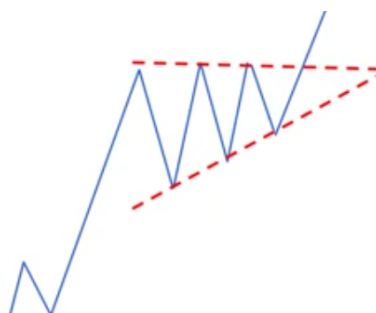
شکل ۲.۱۳: الگوی مثلث متقارن

الگوی مثلث متقارن اولین الگو از سری الگوهای مثلثی است که آن را می‌توان در روند نزولی و روند صعودی مشاهده کرد. بعد از شکسته شدن مقاومت در الگوی مثلث در روند صعودی و

پس از شکست حمایت در الگوی مثلث در روند نزولی می‌توانیم انتظار داشته باشیم قیمت به اندازه قاعده مثلث مسیر قبلی خودش را ادامه دهد (شکل ۲.۱۳).

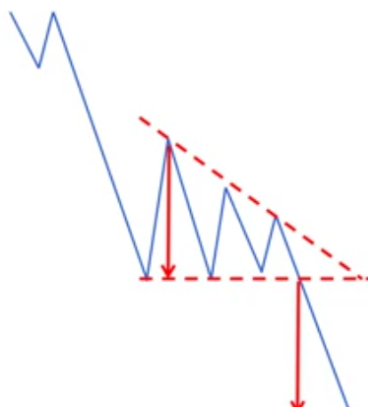
الگوی مثلثی افزایشی Ascending Triangle Pattern

الگوی بعدی از سری الگوهای مثلثی الگوی مثلثی افزایشی است که شبیه الگوی مثلث متقارن می‌باشد با این تفاوت که ضلع بالایی تقریباً صاف و ضلع پایینی مثلث شیب رو به بالا دارد و بعد از شکستن مقاومت ضلع بالا انتظار ادامه روند را داریم. الگوی مثلثی افزایشی در روند صعودی تشکیل می‌شود (شکل ۳.۱۳).



شکل ۳.۱۳: الگوی مثلث افزایشی

الگوی مثلثی کاهشی Descending Triangle Pattern



شکل ۴.۱۳: الگوی مثلث کاهشی

الگوی مثلث کاهشی عکس الگوی مثلث افزایشی است و در روند نزولی رخ می‌دهد. در این الگو ضلع پایینی تقریباً صاف و ضلع بالایی مثلث شیب رو به پایین دارد و بعد از شکستن حمایت ضلع پایین انتظار ادامه روند را داریم (شکل ۴.۱۳).

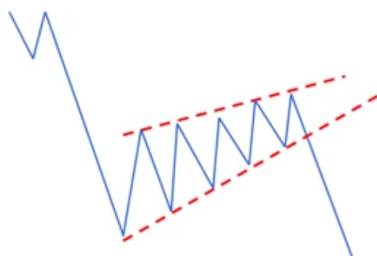
در هر دو الگوی مثلثی افزایشی و مثلث کاهشی انتظار داریم بعد از شکست خط افقی، قیمت به اندازه قاعده مثلث روند را ادامه دهد.

از تایم ۱۲ دقیقه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی مثلث را روی چارت توضیح می دهند.

۳.۱.۱۳ الگوی سوم: کنج ها Wedges

الگوی کنج افزایشی یا بالا رونده Rising Wedge Pattern

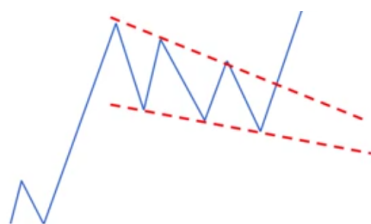
الگوی سوم از الگوهای ادامه دهنده روند کنج ها هستند که در زمان استراحت قیمت تشکیل می شوند. الگوی کنج افزایشی در روند نزولی تشکیل می شود و خطوط آن موازی نیستند. در الگوی کنج خطوط نه مانند الگوی پرچم موازی هستند و نه مانند الگوی مثلث به همدیگر می رسند، زمان تشکیل شدن این الگو شکسته شدن خط پایینی و تشکیل یک کندل (بسته شدن) زیر آن است (شکل ۵.۱۳).



شکل ۵.۱۳: الگوی کنج افزایشی یا بالا رونده

الگوی کنج پایین رونده Falling Wedge Pattern

الگوی کنج پایین رونده، مانند الگوی کنج بالا رونده است با این تفاوت که در روند صعودی تشکیل می شود. سایر شرایط حاکم، مانند الگوی کنج بالا رونده است (شکل ۶.۱۳).



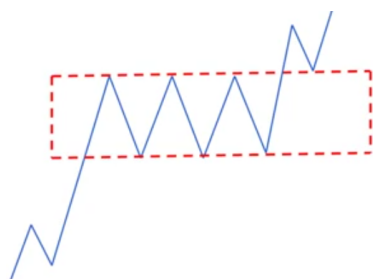
شکل ۶.۱۳: الگوی کنج پایین رونده

از تایم ۱۸ دقیقه و ۱۷ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی کنج را روی چارت توضیح می دهند.

۴.۱.۱۳ الگوی چهارم: مستطیل

الگوی مستطیل صعودی Bullish Rectangle Pattern

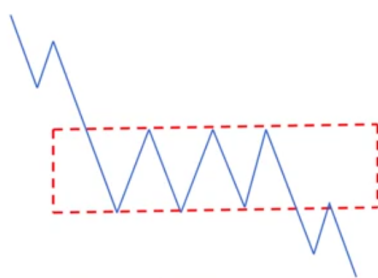
الگوی آخر از الگوهای ادامه دهنده روند الگوی مستطیل است. زمانی این الگو تشکیل می شود که قیمت بین دو حمایت و مقاومت در نوسان باشد. این الگو خیلی شبیه الگوی برگشتی سه قله است با این تفاوت که موفق به شکستن مقاومت شده است ولی احتمال دارد که قیمت برگردد و مجدداً نقطه حمایت را لمس کند و سپس به روند خودش ادامه دهد (شکل ۷.۱۳).



شکل ۷.۱۳: الگوی مستطیل صعودی

الگوی مستطیل نزولی Bearish Rectangle Pattern

الگوی مستطیل نزولی کاملاً عکس الگوی مستطیل صعودی است. الگوی مستطیل نزولی زمانی تکمیل می شود که قیمت بعد از بسته شدن حمایت بسته شود (شکل ۸.۱۳).



شکل ۸.۱۳: الگوی مستطیل نزولی

از تایم ۲۳ دقیقه و ۵۰ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی مستطیل را روی چارت توضیح می دهند.

الگوهای ادامه دهنده روند دیگری نیز وجود دارند ولی اهمیت کمتری دارند. لازم به ذکر است که در مارکت هیچ وقت نباید قطعیت را در نظر گرفت، گاهی اوقات پیش می آید که الگوها در حال تشکیل هستند ولی در آخر درست عمل نمی کنند پس همیشه باید دنبال تأییدهای دیگر هم باشیم.

فصل ۱۴

ویدئوی شماره ۲۳: اندیکاتورها

۱.۱۴ تعریف ابزارهای معاملاتی (اندیکاتورها)

ابزارهای معاملاتی^۱ ابزارهای کمکی هستند که بر اساس اطلاعات گذشته قیمت و داده های آن محاسبه می شوند و به دلیل پیوستگی معنا دار داده ها با گذشته آنها و رفتار قیمت به ما کمک می کنند تا از اطلاعات مربوط به گذشته قیمت برای پیش بینی رفتار احتمالی قیمت در حال یا آینده استفاده کنیم. اندیکاتورها که به عنوان ابزار تحلیل ثانویه برای کمک به شناخت بیشتر تحلیل تکنیکال مورد استفاده قرار می گیرند، معمولاً به صورت شماتیک و نموداری کاربرد دارند و توسط محاسبات ریاضی که رایانه از گذشته قیمت انجام می دهد در اختیار معامله گر قرار می گیرند و معامله گر را از انجام محاسبات تخصصی پیچیده، پر خطا و وقت گیر بی نیاز می کنند. لازم به ذکر است که اتکای صرف به اندیکاتورها اشتباه است و این ابزارها صرفاً کمکی هستند. اندیکاتورها به دوشکل مورد استفاده قرار می گیرند:

الف) برای گرفتن تأیید و حصول اطمینان از رفتار قیمت و کیفیت الگوهای قیمت

ب) برای صدور سیگنال های خرید و فروش

۲.۱۴ انواع اندیکاتورها

اندیکاتورها از نظر ساختاری به دو دسته تقسیم می شوند: اسیلاتورها و اندیکاتورها

^۱ Indicators

۱.۲.۱۴ اسیلاتورها یا نوسان سنج ها (Bounded) Ocillators

اسیلاتورها یا نوسان سنج ها اندیکاتورهایی هستند که داده های آن ها در یک محدوده مینیمم و ماکزیمم محاسبه می شوند و محدود بین دو عدد کمترین و بیشترین هستند. اسیلاتورها نوسانات قیمت را می سنجد و کارایی زیادی دارند. اسیلاتورها در نقاط ماکزیمم و مینیمم نشانگر اشباع خرید یا فروش معاملات هستند، به این صورت که در اسیلاتورهای محدود بین دو عدد صفر و صد، محدوده نزدیک به صد اشباع خرید و محدوده نزدیک به صفر اشباع فروش نامیده می شود.

۲.۲.۱۴ اندیکاتورهای غیر محدود Not Bounded

اندیکاتورهای غیر محدود اندیکاتورهایی هستند که نشان دهنده محدوده ماکزیمم و مینیمم قیمت نیستند و اطلاعات دیگری از رفتار قیمت را مثل میانگین قیمت، واگرایی، قدرت روند، زمان باز و بسته شدن بازار ها و طیف وسیعی از اطلاعات و ابزارهای مورد نیاز را در اختیار ما قرار می دهند.

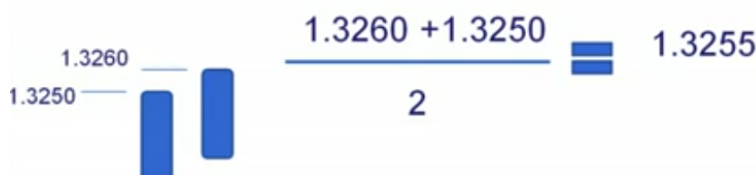
چند نمونه از اسیلاتورها: RSI(Relative Strength Index), Stochastic, Aroon, DT

چند نمونه از اندیکاتورهای غیر محدود یا عادی: Moving Average, Volume, Bollinger

Bound, Parabolic, SAR, Fractal

۳.۱۴ اندیکاتور میانگین متحرک Moving Average

اولین اندیکاتوری که توضیح داده می شود اندیکاتور میانگین متحرک است. میانگین متحرک یا موینگ اوریج بر اساس معدل یا میانگین چند دوره زمانی قیمت مشخص می شود (شکل ۱.۱۴).



شکل ۱.۱۴: میانگین دوره های زمانی قیمت

میانگین متحرک یکی از مهمترین و پر کاربردترین اندیکاتورهاست. دوره زمانی اندیکاتور میانگین متحرک یعنی تعداد کندل هایی که برای محاسبه ی آخرین نقطه این اندیکاتور در نظر گرفته شده اند، دوره زمانی با Period مشخص می شود. معمولاً در رسم میانگین متحرک از قیمت پایانی کندل (Close) استفاده می شود. هرچه Period بیشتر باشد شیب میانگین متحرک کمتر است. استفاده از دوره های زمانی مختلف سلیقه ای است و معمولاً مهمترین دوره ها مطابق اعداد فیبوناچی هستند.

از تایم ۷ دقیقه و ۵۱ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان میانگین متحرک را روی چارت توضیح می دهند.

۱۴.۳.۱ انواع میانگین متحرک

میانگین های متحرک به ۴ دسته اصلی تقسیم می شوند:

۱. میانگین متحرک ساده^۲
۲. میانگین متحرک سطحی^۳
۳. میانگین متحرک نمایی^۴
۴. میانگین متحرک خطی وزنی^۵

غیر از میانگین متحرک ساده بقیه میانگین متحرک ها ارزش بیشتری به قیمت های پایانی برای محاسبه می دهند. EMA تغییرات قیمت را سریعتر از SMA نشان می دهد. مقایسه این ۴ میانگین متحرک در دوره زمانی یکسان دید جالبی از آنها و عملکردشان به ما می دهد. اعداد فیبوناچی در استفاده از تنظیم دوره میانگین ها استفاده زیادی دارند. اعداد زیر بیشترین کاربرد را دارند:

۵، ۸، ۱۳، ۲۱، ۵۰، ۵۵، ۱۰۰، ۱۴۴، ۲۰۰

از تایم ۱۴ دقیقه و ۱۲ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان انواع میانگین متحرک را روی چارت توضیح می دهند.

^۲ Simple Moving Average (SMA)

^۳ Smooth Moving Average

^۴ Exponential Moving Average (EMA)

^۵ Liner Moving Average

۲.۳.۱۴ کاربردهای میانگین متحرک

میانگین های متحرک پرکاربردترین ابزار برای تحلیل، ساختن اندیکاتورهای دیگر و انواع اکسپرت (ربات معامله گر) هستند. می توان گفت عملاً بیشتر از ۵۰٪ اندیکاتورها از میانگین متحرک ساخته شده اند. مهمترین استفاده از میانگین متحرک ها برای تحلیل به شرح زیر است:

۱. استفاده به عنوان خط روند متحرک^۶

۲. برای مشخص کردن مومنتوم^۷

۳. استفاده به عنوان حمایت و مقاومت^۸

۴. برای گرفتن پوزیشن^۹

۵. برای قرار دادن حد ضرر^{۱۰}

۳.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک به عنوان خط روند Dynamic Trend

از تایم ۲۰ دقیقه و ۴۱ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از میانگین متحرک به عنوان خط روند را روی چارت توضیح می دهند.

میانگین متحرک با پیرود بالا به خوبی روند را نشان می دهد. به عنوان مثال دوره زمانی ۲۰۰ گزینه خوبی است و همچنین ۵۰ و ۱۰۰ این خط روند می تواند در تأیید شکست خط روندهای دیگر به ما کمک زیادی بکند.

۴.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک به عنوان مومنتوم Momentum

مومنتوم چیست؟

برای درک بهتر معنای مومنتوم از تعریف شتاب در فیزیک کمک می گیریم. در فیزیک سرعت حرکت جسم در واحد زمان شتاب گفته می شود:

شتاب = تغییر سرعت حرکت جسم در واحد زمان

Dynamic Trend^۶

Momentum^۷

Support & Resistance^۸

Buy & Sell Orders^۹

Stop Loss Setup^{۱۰}

مومنتوم = تغییر سرعت حرکت قیمت در واحد زمان

در بازارهایی که کندل های بزرگ داریم مومنتوم زیاد است و در بازارهایی که کندل کوچک و کنار هم داریم مومنتوم کم است. مومنتوم از مهمترین شاخصه های رفتار قیمت است که تریدر باید قدرت تشخیص آن را داشته باشد زیرا قیمت در اکثر مواقع برای تغییر جهت، مومنتوم خود را از دست می دهد.

از تایم ۲۶ دقیقه و ۳۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از میانگین متحرک به عنوان مومنتوم را روی چارت توضیح می دهند.

اگر قیمت در حال فاصله گرفتن از میانگین متحرک باشد (در مثال تصویری SMA 21 رسم شده است) نشان دهنده افزایش مومنتوم و ادامه دار بودن روند کنونی است. تداخل های زیاد قیمت با میانگین متحرک نشان دهنده از بین رفتن مومنتوم و استراحت قیمت است.

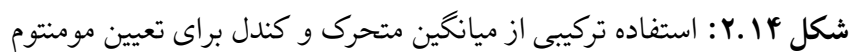
دقیقا مثل خطوط حمایت و مقاومت در روند نزولی قیمت در زیر میانگین متحرک و در روند صعودی قیمت بالای میانگین متحرک خواهد بود. مثلا در روند نزولی، تا زمانی که قیمت زیر میانگین متحرک در حال حرکت باشد ما نیز فقط به فکر پوزیشن های Sell خواهیم بود. هرچه شیب قیمت در یک جهت بیشتر باشد احتمال ادامه داشتن روند در آن جهت بیشتر است. تفاوتی که در استفاده از میانگین متحرک به عنوان مومنتوم نسبت به استفاده از آن به عنوان خط روند وجود دارد این است که در استفاده از میانگین متحرک به عنوان مومنتوم، قیمت بارها آن را قطع می کند و باهم تداخل دارند ولی در استفاده به عنوان خط روند مانند یک حمایت یا مقاومت عمل می کند.

رسم SMA 14 هم گزینه خوبی برای تشخیص مومنتوم است. معمولا از دو میانگین متحرک یکی به عنوان تشخیص روند و دیگری به عنوان تشخیص مومنتوم استفاده می شود، اولی با پیرود بالا و دومی با پیرود پایین، که تداخل این دو میانگین متحرک می تواند علائم جالبی را به ما نشان دهد. تداخل های زیاد قیمت با میانگین متحرک مومنتوم بیانگر تغییر روند است. میانگین متحرک به عنوان خط روند (مثلا SMA200) می تواند مقاومت و حمایت خوبی باشد. همچنین همپوشانی فیبوناچی و خط روند میانگین متحرک می تواند اطمینان نسبتا محکمی باشد.

۵.۳.۱۴ استفاده ترکیبی از میانگین متحرک و کندل برای تعیین مومنتوم

Moving Average + Candle Stick Formation = Momentum

برای یک تریدر تشخیص مومنتوم برای تشخیص جهت مارکت بسیار مهم است و در اینجا به نحوه استفاده از میانگین متحرک در کنار کندل برای تعیین مومنتوم می پردازیم (شکل ۲۰۱۴).



۶.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک به عنوان حمایت و مقاومت

۷.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک برای گرفتن پوزیشن

خیلی از تریدرها از قرار دادن دو میانگین متحرک مثلا SMA55 و SMA21 و برخورد آن ها به همدیگر برای گرفتن پوزیشن استفاده می کنند.

از تایم ۴۷ دقیقه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از میانگین متحرک برای گرفتن پوزیشن را روی چارت توضیح می دهند.

۸.۳.۱۴ استفاده از میانگین متحرک برای قرار دادن حد ضرر

از تایم ۵۲ دقیقه و ۴۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از میانگین متحرک برای قرار دادن حد ضرر را روی چارت توضیح می‌دهند.

بر اساس منطق ترید و معامله گری حد ضرر در جایی قرار می‌گیرد که قیمت، حمایت و مقاومت را به نشانه تغییر روند بشکند. پس از میانگین متحرک می‌توان به عنوان Stop Loss استفاده کرد و برای تشخیص این عملکرد نیاز به تجربه بیشتر و آشنا شدن زیاد چشم‌ها با نمودار دارد. میانگین متحرک ابزار مهمی برای فیلتر کردن خطاهای ماست که نیاز به تمرین دارد تا بتوان به خوبی از آن استفاده کرد.

نکته: خلاف روند ترید نکنید. Trend is your Friend

نکته: مدیریت سرمایه را فراموش نکنید.

نکته: کار کردن در تایم فریم‌های پایین تر ریسک بسیار بالایی دارد.

فصل ۱۵

ویدئوی شماره ۲۴: واگرایی

۱.۱۵ اندیکاتور مکدی

اندیکاتور مکدی^۱ اندیکاتوری دنبال کننده روند و نشان دهنده مومنتوم است که برای مشخص کردن روند از دو میانگین متحرک نمایی با دوره ۲۶ و ۱۲ استفاده می کند و همین طور برای نشان دادن مومنتوم از یک میانگین متحرک ساده با دوره ۹ استفاده می کند که به عنوان صادر کننده سیگنال های خرید و فروش از آن استفاده می شود. اندیکاتور مکدی به ما کمک می کند تا خلاف روند ترید نکنیم. این اندیکاتور یکی از کاراترین اندیکاتورها برای مشخص کردن جهت فعلی قیمت و توان یا ضعف قیمت در ادامه روند کنونی است.

از تایم ۲ دقیقه و ۶ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور مکدی را روی چارت توضیح می دهند.

در اندیکاتور مکدی خطوط میله ای خط مکدی یا Main گفته می شود و اختلاف میانگین متحرک ها با دوره های ۱۲ و ۲۶ است:

$$\text{EMA12} - \text{EMA26} = \text{Main MACD}$$

خط ساده در اندیکاتور مکدی خط سیگنال نام دارد.

لازم به ذکر است که با کمک اندیکاتور مکدی می توانیم خطاها و اشتباهات خودمان را فیلتر کنیم.

^۱ Moving Average Convergence Divergence (MACD)

۱.۱.۱۵ چگونگی استفاده از MACD

۱. برای تعیین جهت روند (با توجه به موقعیت مکدی نسبت به خط صفر)

۲. برای صدور سیگنال های خرید و فروش

۳. برای تشخیص کم شدن قدرت روند، احتمال برگشت روند و واگرایی ها

۱. استفاده برای تعیین جهت روند Trend Determination

از تایم ۱۰ دقیقه و ۲ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور مکدی برای تعیین جهت روند را روی چارت توضیح می دهند.

عبور خط مکدی از خط صفر نشانه تغییر روند است. زمانی که خط مکدی بالای خط صفر است به معنی وجود روند صعودی و زمانی که خط مکدی زیر خط صفر باشد به معنی وجود روند نزولی است. به دلیل تاخیر میانگین متحرک نسبت به قیمت، در لحظه تغییر جهت روند نمی توان از مکدی تأیید گرفت. با استفاده از دو تایم فریم می توانیم روند را بهتر تشخیص دهیم به این صورت که اگر در تایم فریم بالاتر مکدی بالای خط صفر بود ولی در تایم فریم پایینتر مکدی زیر خط صفر بود یعنی روند کلی صعودی است ولی در تایم فریم پایینتر موقتاً روند نزولی داریم و شاهد اصلاح بودیم پس احتمالاً قیمت مجدداً بالا خواهد رفت.

۲. برای صدور سیگنال های خرید و فروش Buy and Sell Signals

از تایم ۱۶ دقیقه و ۳۲ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور مکدی برای صدور سیگنال های خرید و فروش را روی چارت توضیح می دهند.

نکته مهم: لطفاً دقت کنید که بیان این مطالب برای گرفتن سیگنال فقط جنبه آموزشی دارد. شیب خط مکدی برای گرفتن سیگنال بسیار مهم است. یکی از نقاط ورود به معامله تقاطع خط مکدی و خط سیگنال است. زمانی که میله های تشکیل دهنده قله ارتفاع کمتری را ایجاد کردند نشانه تغییر روند است.

البته نباید فراموش کرد که استفاده صرف از اندیکاتور ها می تواند زیان ده باشد. تاخیری بودن اندیکاتور ها باعث می شود که همیشه سیگنال های آنها دیرتر صادر شود.

۳. برای تشخیص واگرایی Divergence Recognition

یکی از موارد استفاده از مکدی استفاده برای تشخیص واگرایی است و همچنین برای تشخیص کم شدن قدرت روند و احتمال برگشت روند نیز استفاده از این اندیکاتور کاربرد دارد و مناسب است.

۲.۱۵ واگرایی چیست؟

در تحلیل تکنیکال، هرگونه تفاوت جهت حرکت بین قیمت و اندیکاتور، واگرایی نامیده می‌شود. در واقع زمانی که جهت حرکت اندیکاتور خلاف جهت حرکت قیمت یک کالا یا جفت ارز باشد، به اصطلاح می‌گویند در آن کالا یا جفت ارز واگرایی رخ داده است. واگرایی یکی از نشانه‌های احتمال خستگی قیمت و احتمال تغییر مسیر قیمت در جهت عکس مسیر فعلی است.

از تایم ۲۷ دقیقه و ۱۹ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور مکدی برای تشخیص واگرایی را روی چارت توضیح می‌دهند.

برای تشخیص واگرایی می‌توان از اندیکاتور RSI هم استفاده کرد.

واگرایی‌ها به دو دسته تقسیم می‌شوند:

۱. واگرایی معمولی^۲

۲. واگرایی مخفی^۳

۱.۲.۱۵ واگرایی معمولی (RD)

واگرایی معمولی زمانی تشکیل می‌شود که قیمت، یک قله یا کف جدید می‌سازد ولی اندیکاتور قادر به ساختن قله یا کف فراتر از قله یا کف قبلی خود نیست. واگرایی معمولی خود به دو نوع تقسیم می‌شود:

۱. **واگرایی معمولی مثبت:** در کف‌ها و زمانی که قیمت کف قبلی را رد می‌کند ولی اندیکاتور نمی‌تواند کف قبلی خود را رد کند تشکیل می‌شود، در این حالت احتمال تغییر جهت قیمت به سمت صعود و مثبت وجود دارد و به همین دلیل به آن RD+ گفته می‌شود.

RD+ or Bullish Divergence

۲. **واگرایی معمولی منفی:** در سقف‌ها و زمانی که قیمت سقف قبلی را رد می‌کند ولی اندیکاتور نمی‌تواند سقف قبلی خود را رد کند تشکیل می‌شود، در این حالت احتمال تغییر جهت قیمت به سمت نزول و منفی وجود دارد و به همین دلیل به آن RD- گفته می‌شود.

RD- or Bearish Divergence

^۲ Regular Divergence (RD)

^۳ Hidden Divergence (HD)

از تایم ۳۲ دقیقه و ۶ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور مکدی برای تشخیص واگرایی معمولی را روی چارت توضیح می دهند.

۲.۲.۱۵ واگرایی مخفی (HD)

واگرایی مخفی عملاً عکس واگرایی معمولی است و زمانی تشکیل می شود که اندیکاتور از نظر ساخت کف یا سقف جدید نسبت به قیمت تقدم دارد. واگرایی مخفی خود به دو نوع تقسیم می شود:

۱. **واگرایی مخفی مثبت (+HD):** در کف ها و زمانی که اندیکاتور کف قبلی را رد می کند ولی قیمت کف قبلی خود را رد نمی کند تشکیل می شود.

۲. **واگرایی مخفی منفی (-HD):** در سقف ها و زمانی که اندیکاتور سقف قبلی را رد می کند ولی قیمت سقف قبلی خود را رد نمی کند تشکیل می شود.

از تایم ۴۵ دقیقه و ۴۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور مکدی برای تشخیص واگرایی مخفی را روی چارت توضیح می دهند.

در واگرایی مخفی قیمت به ادامه روند قبلی خود تمایل دارد ولی در واگرایی معمولی قیمت خستگی خودش را نشان می دهد. در واگرایی مخفی قیمت باید حتماً با تغییر فاز تأیید بدهد، این تغییر فاز به صورت تغییر ناحیه مثبت و منفی اندیکاتور مثلاً مکدی است. بنابراین واگرایی مخفی تأیید کننده روند خودش است. در مثال های آقای گلشاهیان از اندیکاتور مکدی استفاده شده است و بین دو قله ای که از آنها برای تشخیص واگرایی مخفی استفاده شده است، قله یا قله هایی در ناحیه ی مخالف مکدی وجود دارد. در HD+ قله های مکدی در ناحیه منفی هستند و در HD- قله های مکدی در ناحیه مثبت هستند. مکدی قابلیت تبدیل به اسیلاتور را هم دارد یعنی می توانیم حد بالا و پایین برایش تعریف کنیم.

یکی از هدف های تریدرها استفاده از چارت بدون اندیکاتورهاست که این امر فقط با تمرین و تکرار زیاد قابل دستیابی است.

۳.۱۵ ترکیب واگرایی و تحلیل تکنیکال

از تایم ۵۵ دقیقه و ۳۹ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان ترکیب واگرایی و تحلیل تکنیکال را روی چارت توضیح می دهند.

لازم به یادآوری است که نمی‌توان از واگرایی‌ها به تنهایی برای گرفتن پوزیشن استفاده کرد بلکه یکی از تائیدها می‌باشد و در صورت رخ دادن سایر تائیدها مثلاً شکستن خط روند و کندل فرمیشن می‌توان اطمینان بیشتری پیدا کرد. از واگرایی‌ها می‌توان به همراه تحلیل تکنیکال مانند خطوط روند به صورت ترکیبی استفاده کرد.

در واگرایی معمولی حتماً باید قله‌های مکدی پشت سرهم باشند. اگر قیمت نزدیک خط روند باشد و واگرایی معمولی در مکدی در حال شکل گرفتن بود نباید در جهت روند پوزیشن گیری کرد و باید منتظر ماند و در صورتی که خط روند شکسته شد و واگرایی معمولی تکمیل شد و کندل فرمیشن هم تائید داد می‌توان وارد پوزیشن عکس روند قبلی شد که تغییر فاز مکدی تائیدی بر درستی پوزیشن ما خواهد بود. وقوع واگرایی‌ها در زون‌های همپوشانی فیبوناچی بسیار مهم است. کم شدن مومنتوم تائید دیگری بر درستی واگرایی است. برای تشخیص واگرایی می‌توان از شکست روند تایم فریم پایینتر هم کمک گرفت. نباید فراموش کرد تا زمانی که شکست روند تائید نشده است گرفتن پوزیشن خلاف روند ریسک بالایی دارد. حتماً ابتدا باید با تحلیل تکنیکال نقاط و زون‌های مهم را تشخیص داد سپس واگرایی را زیر نظر قرار داد در غیر اینصورت واگرایی گول زننده خواهد بود.

فصل ۱۶

ویدئوی شماره ۲۵: RSI

۱.۱۶ شاخص قدرت نسبی Relative Strength Index

اندیکاتور شاخص قدرت نسبی اندیکاتوری است که بر اساس مقایسه بین میزان رشد و افت قیمت اخیر در یک کالا در یک دوره زمانی معین کار می‌کند و برآیند را بین صفر و صد نشان می‌دهد. این اندیکاتور بر اساس مقایسه قیمت بسته شدن فعلی و مقایسه آن با میانگین قیمت های بسته شدن قبلی از نظر میزان رشد یا افت در یک دوره زمانی مشخص مثلاً ۱۴ روزه عمل می‌کند و بر طبق فرمول زیر محاسبه شده و نتیجه را بین عدد صفر تا صد نشان می‌دهد:

$$RSI = 100 - \frac{100}{(1 + RS)}$$

RS = میانگین بسته شدن قیمت های بالا در یک دوره زمانی تقسیم بر میانگین بسته شدن قیمت های پایین در همان دوره زمانی

RSI اندیکاتوری بسیار مهم و پر کاربرد برای نشان دادن رفتار قیمت است.

از تایم ۲ دقیقه و ۱۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان اندیکاتور RSI را روی چارت توضیح می‌دهند.

۲.۱۶ چگونگی استفاده از RSI

موارد استفاده از اندیکاتور پرکاربرد RSI به شرح زیر می‌باشند:

۱. برای تعیین جهت معاملات (موقعیت نسبت به عدد ۵۰)^۱

۲. برای مشخص کردن مناطق اشباع خرید و فروش^۲

۳. برای تشخیص واگرایی ها^۳

آقای گلشاهیان از RSI برای پیدا کردن مناسب ترین جفت ارز برای پوزیشن گیری هم استفاده می کنند.

۱.۲.۱۶ استفاده برای تعیین جهت معاملات

از تایم ۷ دقیقه و ۱۷ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور RSI برای تعیین جهت معاملات را روی چارت توضیح می دهند.

یادآوری این نکته لازم است که تمامی کارهای ما صرفا احتمالات را به ما می دهند. در استفاده از RSI برای تعیین جهت معاملات ابتدا سطح یا level عدد ۵۰ را اضافه می کنیم. زمانی که RSI زیر خط ۵۰ باشد نشان دهنده شیب نزولی قیمت و بالای خط ۵۰ نشان دهنده شیب صعودی قیمت است پس زمانی که RSI زیر خط ۵۰ باشد باید به دنبال پوزیشن های Sell و زمانی که RSI بالای خط ۵۰ باشد باید به دنبال پوزیشن های Buy باشیم. شیب RSI هم در تشخیص جهت درست مهم است. تمامی موارد تحلیل تکنیکال از جمله خطوط روند، حمایت و مقاومت را می توان روی RSI پیاده کرد.

۲.۲.۱۶ برای مشخص کردن مناطق اشباع خرید و فروش

از تایم ۱۶ دقیقه و ۳۵ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور RSI برای مشخص کردن مناطق اشباع خرید و فروش را روی چارت توضیح می دهند.

مناطق پیش فرض اشباع خرید محدوده بالای ۷۰ اندیکاتور RSI و مناطق پیش فرض اشباع فروش محدوده زیر ۳۰ اندیکاتور RSI است. مناطق اشباع خرید و فروش برای جفت ارزهای مختلف متفاوت است و برای همه ارزها ۷۰ و ۳۰ نیست. یادآوری می شود که تایم فریم های پایین نوسانات زیادی دارند و سیگنال اشتباه در آن ها زیاد است پس از تایم فریم بالا استفاده کنید. بخش اعظم نوسانات تایم فریم های پایین واقعی نیستند و بیشتر بازی بانک ها برای خالی کردن حساب تریدرهای تازه کار است.

^۱ Direction Determination

^۲ Over Bought and Over Sold Determination

^۳ Divergence Recognition

۳.۲.۱۶ برای تشخیص واگرایی

از تایم ۲۷ دقیقه و ۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از اندیکاتور RSI برای تشخیص واگرایی را روی چارت توضیح می‌دهند.

واگرایی تفاوت جهت قیمت و اندیکاتور است و در اندیکاتور RSI می‌تواند به خوبی تغییر روند را نشان دهد. واگرایی‌ها در حالتی که قله‌ها در مناطق اشباع تشکیل شوند اطمینان بیشتری دارند. همپوشانی واگرایی با سایر تأییدهای تحلیل تکنیکال از جمله الگوهای فیبوناچی، کندل فرمیشن یا غیره می‌تواند اطمینان بیشتری برای باز کردن پوزیشن به ما بدهد.

توجه به این نکته خیلی مهم است که پوزیشن‌های ما باید بر اساس تایم فریم‌ها باشند یعنی در تایم فریم‌های پایین‌تر نمی‌توانیم در حال پوزیشن‌های بلند مدت باشیم و انتظار حرکت قیمت هم بسته به تایم فریم متفاوت است. مثلاً تحلیل تایم فریم ۵ دقیقه نمی‌تواند منجر به پوزیشن چند روزه شود.

۳.۱۶ استفاده از RSI برای پیدا کردن بهترین جفت ارز برای معامله کردن در بازار ارز

با استفاده از شاخص نسبی قدرت امکان پیدا کردن مناسب‌ترین جفت ارز در میان همه جفت ارزها وجود دارد. برای پیدا کردن مناسب‌ترین جفت ارز ابتدا قدرت هر ارز را نسبت به یک مولفه ثابت مثل دلار در یک تایم فریم مشخص مثلاً روزانه به شکل زیر پیدا می‌کنیم:

EUR to USD = ۳۳/۴

GBP to USD = ۵۴

AUD to USD = ۳۱

NZD to USD = ۲۷

USD to JPY = ۳۵ change to JPY TI USD = ۶۵

USD to CHF = ۶۵ change to CHF to USD = ۳۵

این اعداد مقادیر RSI در یک لحظه به صورت رند شده برای هر جفت ارز است که از تایم ۳۷ دقیقه و ۵۲ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان اعداد اندیکاتور RSI را برای هر یک از جفت ارزهای بالا یادداشت کرده و کار را ادامه می‌دهند. چون مولفه ثابت این ارزها دلار است پس با حذف دلار می‌توانیم قدرت این مولفه‌ها را نسبت به هم بسنجیم. حال پس از پیدا کردن قدرت

ارزها، بیشترین احتمال موفقیت برای جفت ارزی است که بیشترین اختلاف را در دو ارز خود داشته باشد، در واقع ترکیب قوی ترین ارز با ضعیف ترین ارز، بهترین احتمال را برای معامله پیش روی ما قرار می دهد. برای پیدا کردن بهترین جفت ارز آن ها را به ترتیب قدرت کنار هم می چینیم:

NZD = ۲۷ AUD = ۳۱ EUR = ۳۳

CHF = ۳۵ GBP = ۵۴ JPY = ۶۵

پس جفت ارز NZDJPY بهترین ارز برای احتمال موفقیت است. چون ارز قوی در مخرج و ارز ضعیف در صورت است پس باید روند نزولی با شیب زیاد داشته باشد. برای تست درستی این قضیه باید جفت ارز به دست آمده را در متاتریدر چک کرد.

از تایم ۴۴ دقیقه و ۲۶ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان ارز NZDJPY را روی چارت بررسی می کنند.

لازم به ذکر است که تعیین بهترین جفت ارز به این شیوه احتمال موفقیت ما را بسیار بالا می برد ولی باز هم تضمینی برای ترید عجله ای نیست. در تایم فریم های پایینتر این فرمول و جفت ارز به دست آمده تغییرات زیادی دارند. پس از تشخیص بهترین جفت ارز بهتر است که در روندهای اصلاحی آن وارد ترید شویم.

۴.۱۶ چگونه از اندیکاتورها برای تعیین جهت قیمت استفاده کنیم؟

از اندیکاتورها می توان برای پیدا کردن جهت مارکت استفاده کرد و از اشتباهات احتمالی جلوگیری کرد. برای این کار از دستورالعمل زیر می توان استفاده کرد:

۱. میانگین متحرک ۲۰۰ در تایم روزانه SMA 200

۲. مکدی MACD

۳. آر اس آی 14 RSI

۴. کندل استیک و مومنتوم Momentum and Candle Stick

۵. در صورت نیاز می توان از اندیکاتور کمکی مثل استوکستیک استفاده کرد Stochastic

البته این دستورالعمل فقط یک مثال برای استفاده از اندیکاتورها می باشد و اندیکاتورها موارد استفاده زیادی دارند.

از تایم ۵۰ دقیقه این ویدئو آقای گلشاهیان نحوه استفاده از اندیکاتورهای را روی چارت توضیح می دهند.

شرح دستورالعمل روی چارت

ابتدا SMA 200 را اضافه می کنیم، اگر قیمت بالای آن بود روند صعودی و اگر قیمت زیر آن بود روند نزولی است. سپس MACD را اضافه می کنیم، اگر مکدی بالای صفر بود نشان دهنده روند صعودی است و اگر مکدی زیر صفر بود روند نزولی است. به آخرین میله هیستوگرام باید دقت بیشتری کرد و در صورت داشتن طول میله بیشتر از میله قبل خود، نشان دهنده مومنتوم زیاد است. سپس RSI 14 را اضافه می کنیم موقعیت آن نسبت به خط ۵۰ و شیب آن جهت روند را به ما می گویند. در RSI حتما باید به مناطق اشباع دقت کنیم و برای برگشت احتمالی قیمت آن را زیر نظر می گیریم. حال باید بر اساس رفتار قیمت بهترین نقطه ورود را پیدا کنیم که برای آن به تایم فریم پایین هم حتما مراجعه می کنیم. برای تعیین نقاط اصلاحی و برگشت می توانیم از فیبوناچی استفاده کنیم و در لحظه ای که وارد پوزیشن می شویم از کندل فرمیشن برای تشخیص نقطه درست ورود استفاده می کنیم حالا اندیکاتور استوکستیک را با تنظیمات پیش فرض خود اضافه می کنیم. استوکستیک هم بین صفر و صد نوسان می کند و مانند RSI نقاط اشباع خرید و فروش دارد. استوکستیک دو خط دارد که تقاطع آنها اهمیت دارد و سیگنال است. در استوکستیک شیب خطوط، مناطق اشباع و تقاطع خطوط آن را زیر نظر می گیریم.

فصل ۱۷

ویدئوی شماره ۲۶: امواج الیوت

۱.۱۷ امواج الیوت

این قسمت آخرین قسمت از تحلیل تکنیکال مقدماتی است و پس از آن به بحث مدیریت سرمایه و روانشناسی بازار پرداخته می‌شود.

در نیمه نخست قرن بیستم، شخصی به نام رالف نلسون الیوت با تحقیق بر روی نمودار قیمت متوجه شد که تغییرات قیمت نه تنها منظم است بلکه از ساختار خاص و هماهنگی که در طبیعت نیز مشاهده می‌شود تبعیت می‌کند. وی کشف کرد که قیمت غالباً در حال ساختن الگوهای تکراری و قابل پیش‌بینی هست که مکرراً در بازار تکرار می‌شوند. شناخت این الگوها به مانند نقشه‌ای عمل می‌کند که پیش‌بینی رفتار آینده قیمت را برای ما میسر می‌کند.

الگوهای الیوت مثل خیلی از الگوهای تکنیکال تکرار شونده هستند و در ابعاد مختلف از نظر بزرگی در بازه‌های زمانی (تایم فریم) مختلف تشکیل می‌شوند. الیوت نشان داد که قیمت به صورت امواج ترکیبی و با نظم و آرایش خاصی حرکت می‌کند. وی معتقد بود در هر عرصه‌ای که در آن جنب و جوش و فعالیت مردم به عنوان یک توده زیاد باشد، حرکت‌ها براساس قواعدی قابل پیش‌بینی صورت می‌گیرد و بازار سرمایه واضح‌ترین و بزرگترین نمود این رفتار جمعی است.

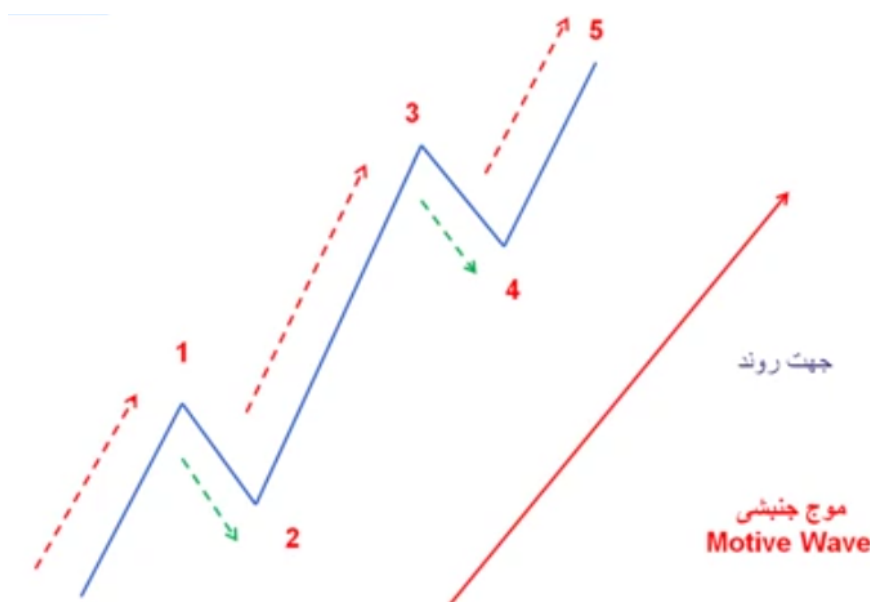
یکی از اصول تکنیکی در بازار سرمایه که پایه تمام تحلیل‌هاست، این است که هر اتفاق و حادثه‌ای در بازار سرمایه ریشه در گذشته دارد و هر حرکت و تصمیمی در بازار سرمایه بر شانه داده‌های مهمی از گذشته سوار است. بنابراین برآیند این تصمیم‌گیری‌های هم‌جهت که باعث حرکت قیمت به صورت امواج می‌شوند، تار و پود بازار را می‌بافند. الگوهای قیمت که الیوت

آن را شناسایی کرد، به اسم خود او امواج الیوت^۱ نامگذاری شد که در این قسمت به یادگیری اصول آن می‌پردازیم.

۲.۱۷ اصول امواج الیوت

برخی از اصول امواج الیوت عبارتند از:

۱. قیمت همیشه به دو صورت حرکت می‌کند: امواج جنبشی و امواج اصلاحی
۲. مهمترین الگوی حاکم بر بازار، الگوی ۵ موج است که سه موج آن موافق با جهت روند (موج‌های جنبشی ۱، ۳، ۵) و دو موج مخالف با جهت روند (موج‌های اصلاحی ۲، ۴) هستند (شکل ۱.۱۷).
۳. امواج اصلاحی غالباً به صورت ۳ موج تشکیل می‌شوند.



شکل ۱.۱۷: شکل امواج جنبشی Motive Wave

در این موج جنبشی ۵ موجی، سه موج موافق روند و دو موج مخالف روند و اصلاحی هستند. از تایم ۶ دقیقه و ۲۴ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان تفسیر جالب و کارآمدی از روانشناسی معاملات توسط امواج الیوت را ارائه می‌دهند که شنیدن کامل و دقیق این توضیحات بسیار کمک کننده است.

^۱ Eliot Waves

۳.۱۷ یک سیکل کامل در الیوت

الیوت چرخه کامل امواج الیوت را به صورت یک موج جنبشی و یک موج اصلاحی پس از آن دانست. به این صورت که یک چرخه کامل الیوت دارای دو موج یکی جنبشی و دیگری اصلاحی است که چون موج جنبشی ۵ موجی و موج اصلاحی ۳ موجی است، عملاً یک چرخه کامل در مجموع شامل ۸ موج می‌باشد (شکل ۲۰.۱۷).



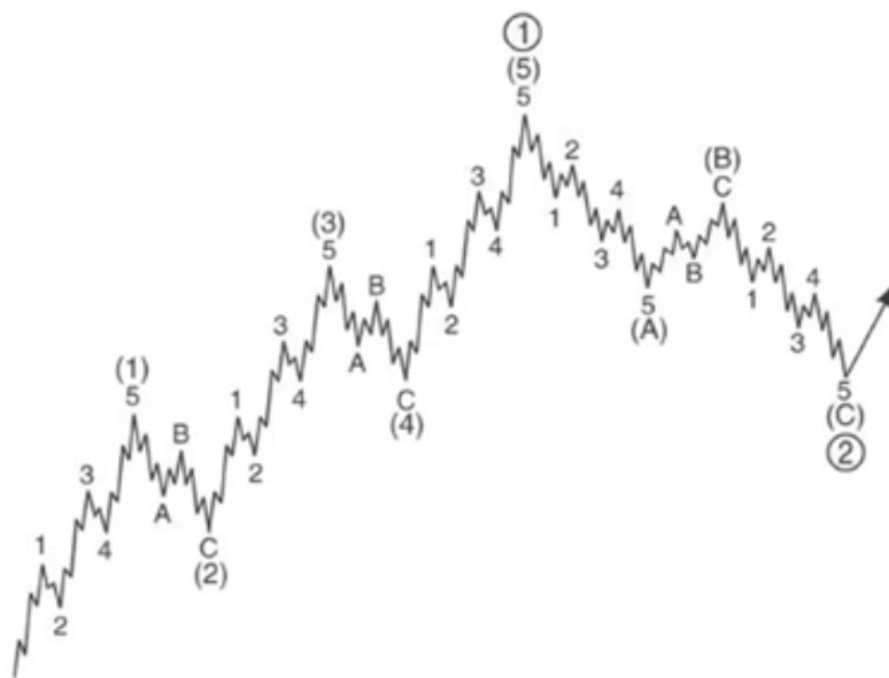
شکل ۲۰.۱۷: یک سیکل کامل در الیوت

تمام امواج الیوت از امواج کوچکتر الیوت و آنها نیز از ریز موج های الیوت تشکیل شده‌اند (شکل ۳.۱۷). الیوت تشخیص داد که هر موج از سیکل یا چرخه ۸ موجی از ریز موج هایی تشکیل شده که تشابه معناداری با موج اصلی دارند. عملاً ریز موج ها از همان ساختار اصلی چرخه ۸ موجی تشکیل شده‌اند، با این تفاوت که از نظر ابعاد کوچکترند. در واقع همین چرخه ۸ موجی‌های کوچک در حال ساختن سیکل‌های بزرگتر هستند^۲ (شکل ۴.۱۷).

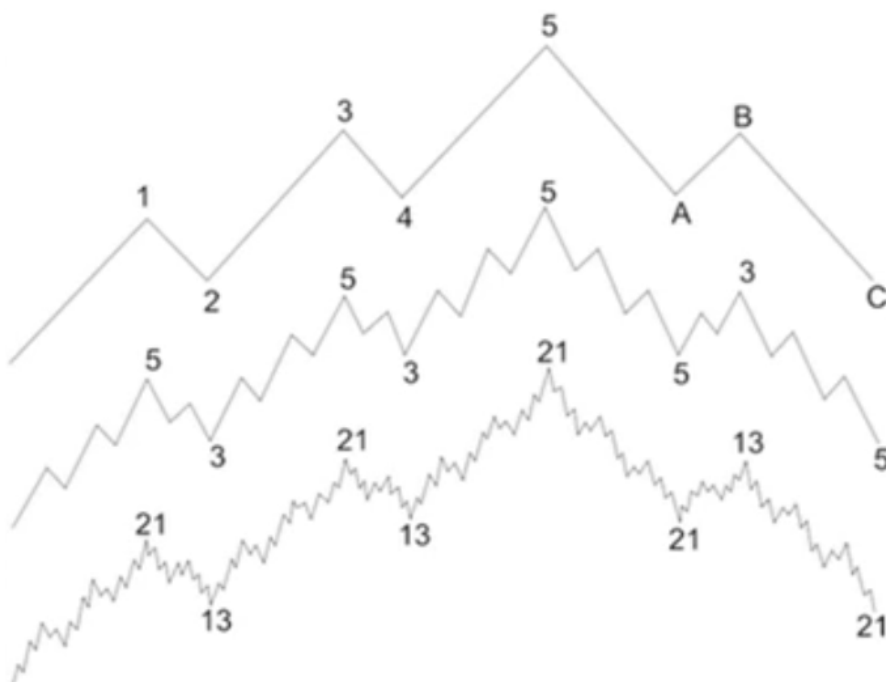
امواج الیوت بسیار مهم هستند و شناخت آنها نیازمند تمرین و تجربه زیاد است. امواج سه موجی اصلاحی الیوت را می‌توان به صورت یک موج زیگزاگ با استفاده از فیبوناچی تشخیص داد. نکته ای که نباید فراموش کرد این است که امواج اصلاحی پیچیدگی بیشتری نسبت به امواج جنبشی دارند و نیازمند دقت و تمرین بیشتری هستند.

از تایم ۳۰ دقیقه و ۴۱ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان یک سیکل کامل در امواج الیوت را

^۲ می‌توان گفت در امواج الیوت فراکتال ها حاکم هستند (البته آقای گلشاهیان اشاره‌ای به اسم فراکتال نمی‌کند).



شکل ۳.۱۷: امواج الیوت و ریز موج های الیوت



شکل ۴.۱۷: اشکال مختلف یک موج

روی چارت توضیح می دهند.

۱۰.۳.۱۷ قوانین موج های جنبشی

موج های ۵ تایی جنبشی معمولاً موج هایی در جهت حرکت موج اصلی از درجه بالاتر هستند که هم جهت با روند می باشند. بنابراین موج هایی واضح، جهت دار و به دور از تداخل و درهم ریختگی در ریز موج های خود هستند. این موج ها به دلیل جهت دار و سر راست بودن به راحتی قابل تشخیص اند.

چند قانون در امواج جنبشی:

۱. موج ۲ هیچگاه به اندازه ۱۰۰٪ موج ۱ بازگشت نمی کند.
۲. موج ۴ هیچگاه به اندازه ۱۰۰٪ موج ۳ بازگشت نمی کند.
۳. موج ۳ از موج ۱ بزرگتر است و در اکثر مواقع بزرگترین موج بین سه موج جنبشی است. در واقع درصد زیادی از حرکت کل موج در موج سوم انجام می شود.
۴. موج ۴ نمی تواند وارد حریم موج اول شود (به جز چند استثناء).

۲.۳.۱۷ امواج اصلاحی و قوانین آنها

امواج اصلاحی که در واقع به علت تسویه سودهای بلندمدت سرمایه گذاری های قبلی به صورت تدریجی و تقابل خریداران و فروشندگان به وجود می آیند و باعث افت موقتی و حرکت قیمت آن کالا در جهت عکس روند اصلی می شوند، امواجی با پیچیدگی زیاد هستند که تحلیل آنها نیز دشوارتر است. روندهای اصلاحی که نتیجه نبرد خریداران و فروشندگان هستند، گاهی اوقات به نفع خریداران و گاهی اوقات به نفع فروشندگان تغییر می کنند و برخلاف روندهای جنبشی که تحلیل واضح و توافق جمعی بر سر جهت روند قیمت وجود دارد، در روندهای اصلاحی سردرگمی و تحلیل های ضد و نقیض بیشتر به چشم می خورد. همین تناقض در تحلیل امواج اصلاحی باعث به وجود آمدن حالت ها و نوع بیشتری در امواج اصلاحی نسبت به امواج جنبشی می شود. بنابراین تحلیل موج های اصلاحی با الگویی مشخص قبل از کامل شدن آنها کار دشواری است.

قوانین کار با امواج اصلاحی:

برای شناخت و درک بهتر امواج اصلاحی باید در نظر گرفت که امواج اصلاحی هیچگاه به تنهایی ۵ موجی نیستند. پس اگر یک ۵ موجی در خلاف روند شکل گرفت، یا شروع یک تغییر روند کلی است و یا تنها تکمیل موج اول اصلاحی است و باید انتظار داشت دو موج بعدی از امواج سه گانه اصلاحی تشکیل شود.

امواج اصلاحی به ۴ دسته تقسیم می‌شوند و تنوع و گوناگونی زیادی دارند:

زیگزاگ ها (۵-۳-۵)

پهنه‌ها (۳-۳-۵)

مثلث‌ها (۳-۳-۳-۳-۳) افزایشی، کاهشی، متقابل

ترکیبی‌ها که شامل تکرار دوباره یا سه‌باره موارد بالا هستند.

بررسی و تشخیص دسته‌های فوق نیاز به تمرین و تکرار دارد.

از تایم ۵۵ دقیقه و ۷ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان امواج جنبشی و امواج اصلاحی را روی چارت توضیح می‌دهند.

۴.۱۷ الیوت و درصدهای فیبوناچی

تحلیل الیوت و اعداد فیبوناچی (دو مقوله مجزا ولی وابسته به هم) دو مقوله مطرح در زمینه رفتار توده‌ها هستند که در عمل به دلیل به وجود آمدن از یک منبع یکسان، وابستگی معناداری به هم دارند. در واقع هر دوی این مباحث سازنده و تکمیل‌کننده همدیگر هستند. ترکیب این دو و شناخت نقاط مهم در بازار براساس این دو از مهمترین مباحث تکنیکال هستند. برای شناخت نقاط مهم در بازار براساس این دو مبحث، اعداد فیبوناچی را برای هر دو نوع موج الیوت بررسی می‌کنیم:

۱. امواج جنبشی و نسبت‌های فیبوناچی حاکم بر آنها

۲. نسبت‌های فیبوناچی حاکم بر امواج اصلاحی

۱.۴.۱۷ نسبت‌های فیبوناچی امواج جنبشی

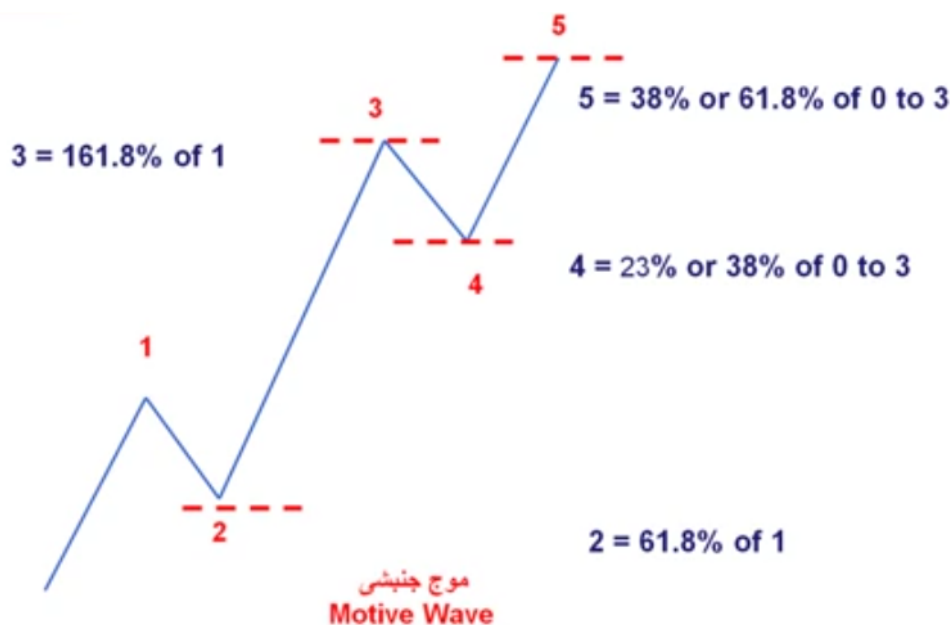
امواج جنبشی معمولاً با نسبت‌های فیبوناچی زیر نسبت به همدیگر اصلاح شده یا حرکت خواهند کرد (شکل ۵.۱۷):

موج ۲ در حالت ایده‌آل به اندازه ۶۱/۸٪ موج ۱ اصلاح خواهد شد و گاهی ۵۰٪ یا ۷۸٪ هم خواهد شد ولی کمتر از ۵۰٪ نیست.

موج ۳ در حالت ایده‌آل به اندازه ۱۶۱/۸٪ موج ۱ پیش خواهد رفت.

موج ۴ به اندازه ۳۸٪ و گاهی ۲۳٪ از موج کامل حاصل از مجموع ابتدای ۱ تا انتهای موج ۳ اصلاح خواهد شد.

موج ۵ به اندازه ۶۱/۸٪ و گاهی ۳۸٪ از موج کامل ابتدای موج ۱ تا انتهای موج ۳ خواهد بود و حتی بعضی اوقات به اندازه ۱۰۰٪ موج ۱ نیز رشد خواهد کرد.



شکل ۵.۱۷: نسبت‌های فیبوناچی امواج جنبشی

از تایم ۱ ساعت و ۱۷ دقیقه و ۴۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان نسبت‌های فیبوناچی امواج جنبشی را روی چارت توضیح می‌دهند.

چون موج ۳ و موج ۵ موج‌های خارجی هستند برای به دست آوردن آنها فیبوناچی Expansion را رسم می‌کنیم.

لازم به یادآوری مجدد است که در این بازار هیچ چیزی قطعی نیست و باید هر احتمالی را همیشه در نظر گرفت. درصدهای ذکر شده همیشه دقیق نیست و فقط حالت ایده‌آل معرفی شده است. علاوه بر این سناریوهای مختلفی در موج الیوت می‌توان متصور شد و هر نقطه‌ای که به عنوان یک موج از امواج الیوت در نظر گرفته شده است، امکان دارد در چند کندل آینده دیگر اعتباری نداشته باشد.

۲.۴.۱۷ نسبت‌های فیبوناچی اصلاحی‌های امواج جنبشی

امواج اصلاحی داخلی امواج جنبشی امواج ۲ و ۴ هستند و موارد زیر در مورد آنها صادق است (شکل ۶.۱۷):

موج ۲:

حاصل سه موج a و b و c است.

موج a و c عموماً با هم برابر هستند.

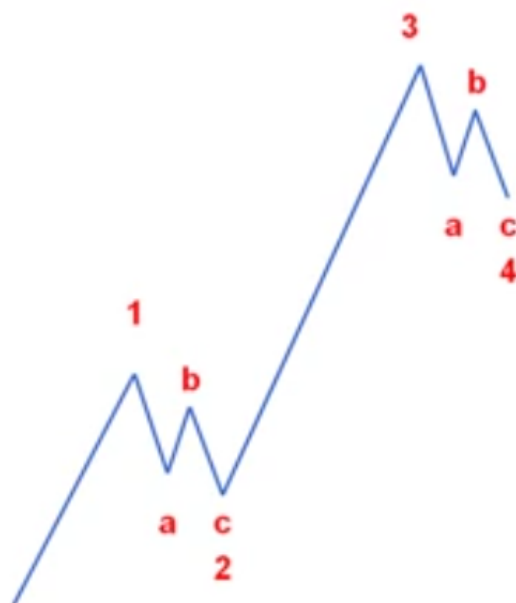
موج b برابر با موج a یا $۶۱/۸\%$ موج a است.

موج ۴:

حاصل سه موج a و b و c است.

موج a و c عموماً با هم برابر هستند.

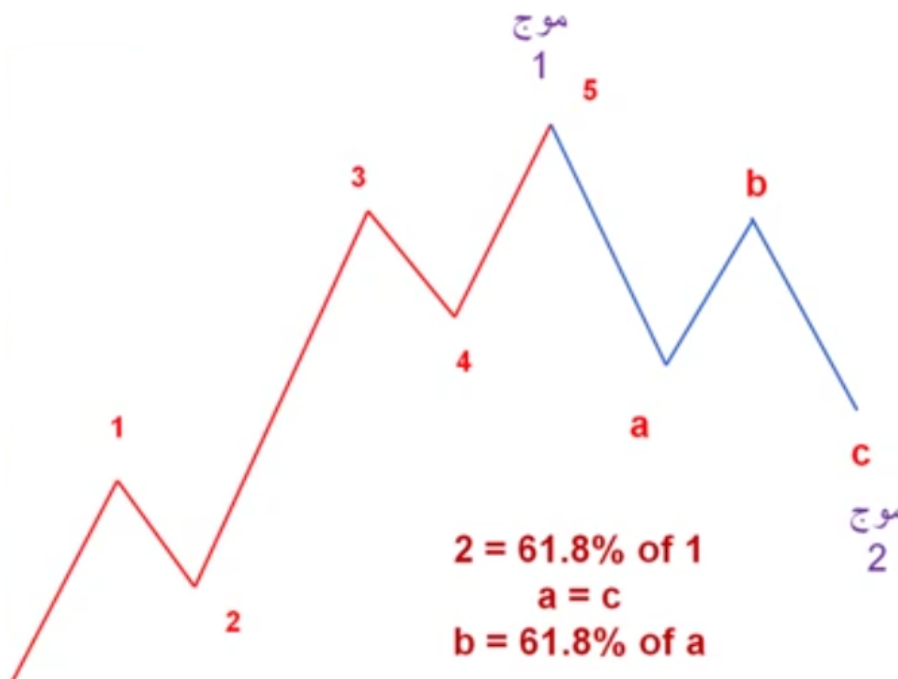
موج b برابر با ۲۳% یا $۳۸/۲\%$ موج a است.



شکل ۶.۱۷: نسبت‌های فیبوناچی اصلاحی‌های امواج جنبشی

۳.۴.۱۷ نسبت‌های رایج در موج اصلاحی

نسبت‌های رایج در موج اصلاحی معمولاً به صورت شکل ۷.۱۷ می‌باشند:



شکل ۷.۱۷: نسبت‌های رایج در موج اصلاحی

۵.۱۷ امواج و تاثیر آن بر اندیکاتورها

در بررسی نقش اندیکاتورها در امواج مختلف، شاهد تغییر نقش اندیکاتورها در روندهای قدرتمند هستیم به طوری که نقش هدایتی اندیکاتورها تبدیل به گمراه‌کننده می‌شود. مواردی که اندیکاتورها به جای هدایت نقش گمراه کردن معامله‌گر را به عهده می‌گیرند عبارتند از:

امواج جنبشی اصلی مانند موج ۳

حرکت‌های سریع بازار

در موج ۳ اشباع فروش یا خرید و واگرایی‌ها دلیل ورود تعداد زیادی از معامله‌گران در جهت عکس روند به دلیل سیگنال‌های فالس یا اشتباه اندیکاتورها می‌شوند که باعث ضرر زدن به معامله‌گر می‌شود. عملاً اندیکاتورها در روندهای قوی ضعف خود را در نشان دادن رفتار قیمت به ما نشان می‌دهند. کارایی اندیکاتورها در بازارهای رنج (Range)، که در آنها به خوبی عمل می‌کند، باعث اعتماد بیش از حد معامله‌گران به اندیکاتورها شده و همین اعتماد و عدم

شناخت رفتار قیمت و تکیه صرف به اندیکاتورهای باعث گمراهی معامله‌گران می‌شود به همین دلیل اندیکاتورهای موافقین و مخالفین زیادی دارند. تشخیص این که قیمت در موج ۳ الیوت است خیلی به ما کمک می‌کند تا به وسیله اندیکاتورهای گمراه نشویم.

از تایم ۱ ساعت و ۴۵ دقیقه و ۴۱ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان تاثیر اندیکاتورهای بر گمراهی معامله‌گران را روی چارت توضیح می‌دهند.

راه‌حل:

به منظور داشتن یک راه‌حل منطقی برای استفاده از اندیکاتورهای موارد زیر پیشنهاد می‌گردد:

۱. شناخت رفتار اندیکاتورهای در بازارهای رنج و روندهای قوی و علم به تغییر نقش اندیکاتورهای در بازارهای مختلف

۲. تکیه نکردن بیش از حد به اندیکاتور به این شکل که نباید روی اندیکاتورهای بیشتر از ۳۰ درصد در تحلیل حساب کرد. این درصد در روندهای قوی به صفر کاهش می‌یابد.

۳. در روندهای قوی مانند موج سوم براساس اندیکاتورهای وارد بازار نشد.

۴. در بازارهای رنج بیشتر می‌توان از اندیکاتورهای کمک گرفت.

۵. در یک زیگزاگ زمانی که قیمت در موج C از 100% موج A گذر می‌کند، احتمالاً قیمت در موج سوم قرار دارد و باید نقش همراه‌کننده اندیکاتورهای را در این مقطع در نظر گرفت. چرا که قیمت در موج سوم در قوی‌ترین روند خود قرار دارد. بنابراین در این مقطع به احتمال زیاد، اندیکاتورهای سیگنال‌های فالس صادر می‌کنند و بنابراین باید از معامله کردن در خلاف جهت روند کنونی اجتناب کرد.

اندیکاتورهایی که باعث گمراهی ما می‌شوند، عموماً اندیکاتورهایی هستند که اشباع خرید و فروش و واگرایی را نشان می‌دهند. استفاده کردن از خط روند، خطوط حمایت و مقاومت، کندل فرمیشن، الگوهای فیبوناچی و الگوهای کندل‌شناسی و امواج الیوت تا حدود زیادی ما را از استفاده از اندیکاتورهای بی‌نیاز می‌کنند.

بحث امواج الیوت بسیار مهم و کاربردی می‌باشد و تمام آنچه در این درس گفته شد صرفاً کلیات آن است و می‌توان دنبال اطلاعات بیشتری نیز بود.

فصل ۱۸

ویدئوی شماره ۲۷: مدیریت سرمایه

۱.۱۸ هشدار ریسک

هشدار به افراد نا آشنا با بازارهای مالی

فعالیت در بازارهای مالی از جمله فارکس که دارای اهرم هستند دارای ریسک بالایی است و به هیچ عنوان به افرادی که در این زمینه دانش و تجربه کافی ندارند توصیه نمی شود. در صورت نداشتن دانش و تجربه کافی در این گونه بازارها سرمایه گذاری نکنید و یا سرمایه خود را در اختیار افراد ناوارد قرار ندهید. چرا که در این صورت سرمایه خود را از دست می دهید. به دوستانی که به تازگی به صفحه آموزش فارکس^۱ پیوسته اند، توصیه می شود برای موثر بودن مراحل آموزشی، آموزش ها را از ابتدا شروع کرده و به مرور و با چند روز تا یک هفته تمرین بر روی هر ویدئوی آموزشی دنبال کنند و در صورتی که آموزش های قبلی را فرا نگرفته اند به هیچ عنوان این ویدئو یا قسمت های انتهایی آموزش ها را نبینند.

۲.۱۸ سوال اصلی

قبل از شروع بحث مدیریت سرمایه سوالی مطرح می کنم، به نظر شما تا کنون پس از ۲۶ قسمت از سری آموزش های فارکس چند درصد از موارد مربوط برای موفقیت در بازار را یاد گرفته ایم؟

^۱ منظور آقای گلشاهیان صفحه ایشان در یوتیوب و فیسبوک است.

جواب این سوال به ما کمک می‌کند تا برای موفقیت در بازار مالی در چه موردی مهارت خود را افزایش دهیم تا در بازارهای مالی به موفقیت مستمر دست یابیم.

۱.۲.۱۸ مراحل موفقیت

هر آنچه تاکنون در مورد تحلیل تکنیکال یاد گرفته ایم و آموزش داده شده است فقط ۲۰٪ از موفقیت ما را در بر می‌گیرد (شکل ۱.۱۸).



شکل ۱.۱۸: نسبت های موفقیت در بازارهای مالی

۲.۲.۱۸ نظریه احتمالات در بازار

واقعیتی که در بازار همیشه باید در نظر گرفت این است که هیچ قطعیتی در بازار وجود ندارد و ما فقط با احتمالات سرو کار داریم. تمام آموخته های ما از دانش تحلیل بازار فقط شناخت ما از درصد احتمال وقوع آنها را بیشتر می‌کند. هیچ کس حتی بزرگترین موسسات و بانک ها و تحلیل گران بزرگ هم از آینده بازار خبر ندارند. هیچ تحلیل گری وجود ندارد که تمام تحلیل های او درست باشد، بالاترین درصد تحلیل های درست بهترین تحلیل گران ۶۰٪ است.

موارد فوق نظریه احتمالات بازار می‌باشد و با توجه به این نظریه به این نتیجه می‌رسیم که در کنار تحلیل تکنیکال چیزهای دیگری نیاز است تا موفقیت ما را در بازار تامین کند.

۳.۲.۱۸ قطعه گم شده پازل موفقیت چیست؟

قطعه گم شده پازل موفقیت چیزی است که از چشم ۹۵٪ از افرادی که با فارکس آشنا می‌شوند پنهان است و ندانستن این راز باعث شکست آنها در بازار می‌شود. اکثریت افراد برای جبران شکست های خود در بازار به دنبال تقویت تحلیل خود می‌روند و بازهم درجا می‌زنند، غافل از اینکه آنچه لازم دارند تا موفق شوند چیز دیگری است.

نیازهای ما برای موفقیت در بازارهای مالی مدیریت سرمایه و روانشناسی بازار است که ۸۰٪ از موفقیت ماست (شکل ۲.۱۸). با توجه به نسبت عوامل موفقیت در بازارهای مالی از جمله فارکس، کامل بودن هر دو قسمت این پازل ضروری است و هیچکدام از دو قسمت ۲۰ و ۸۰ درصدی به تنهایی نمی‌تواند عاملی برای موفقیت در بازار باشد.

بنابراین برای گرفتن نتیجه مستمر در فارکس باید برای هر دو قسمت این تجارت طرح و برنامه ریزی دقیق داشت تا موفقیت ما را به صورت دراز مدت تضمین کند.



شکل ۲.۱۸: نیازهای ما برای موفقیت در بازارهای مالی

۳.۱۸ مدیریت سرمایه

مدیریت سرمایه^۲ پروسه ای محاسباتی از کنترل سرمایه است که در آن ریسک ضرر در مقابل منفعت احتمالی در هر اقدام مالی نظیر سرمایه گذاری، تعیین بودجه، مالیات، مدیریت بانکی و

^۲ Money Management

... مورد محاسبه قرار می‌گیرد. در واقع مدیریت سرمایه پایه علمی محاسباتی برای یافتن توجیه یک تجارت یا اقدام مالی است. برای هر پروژه ای که در آن نیاز به ریسک قرار دادن پول برای کسب منفعت باشد قبل از هر اقدام مالی، مدیریت سرمایه برای تعیین سود آور بودن یا نبودن آن مورد بررسی قرار می‌گیرد.

۱۸.۳.۱ مدیریت سرمایه در فارکس

در هر سیستم اقتصادی از جمله فارکس مدیریت سرمایه دارای قوانینی است که شخص مسئول یا کل مجموعه متعهد به رعایت آنها می‌باشد. در فارکس به دلیل عدم وجود سیستم سازمانی ناظر به دلیل فعالیت انفرادی و یا نبود آگاهی از این قوانین یا حتی عدم تعهد شخص به رعایت قوانین در صورت آگاهی از آنها، میزان موفقیت افراد کاهش می‌یابد. تقریباً تمام کسانی که با فارکس آشنا می‌شوند تحلیل تکنیکال را در ماه های اولیه در سطح یک حرفه ای و گاهی بهتر یاد می‌گیرند، افرادی هستند که سال ها با فارکس و تکنیکال و فاندامنتال و تمام جزئیات آن آشنا هستند ولی هنوز قادر به درآمدزایی از این بازار نیستند در مقابل افرادی تازه کار هستند که درآمدی بالاتر از یک حرفه ای را به صورت مستمر دارند.

علت در ضعف تحلیل نیست پس علت چیست؟

علت اصلی شکست افراد در بازار در عدم رعایت قوانین مدیریت سرمایه به دلیل عدم آگاهی از آنها یا در صورت آگاهی داشتن دلیل طمع و انتظار بیش از حد از بازار است.

قسمت کوچکی از روانشناسی بازار

اکثر افراد تازه وارد دانسته یا ندانسته به جای تجارت در فارکس، قمار می‌کنند و این مهمترین دلیل شکست افراد در این تجارت است. وسوسه سریع پولدار شدن باعث طمع کردن و در نهایت شکست می‌شود انتظار افراد تازه وارد از تجارت فارکس در هیچ تجارت دیگری وجود ندارد.

۱۸.۴ انواع مدیریت سرمایه و قوانین آنها

انواع قوانین مدیریت سرمایه^۳ شامل دو دسته است:

۱. مدیریت سرمایه معاملات کوتاه مدت و میان مدت
۲. مدیریت سرمایه معاملات سرمایه گذاری بدون استاپ برای معامله گران حرفه ای

^۳ Money Management rules

قوانین این دو نوع مدیریت سرمایه با هم متفاوتند و در این مجموعه به آموزش سرمایه معاملات کوتاه مدت و میان مدت یعنی قسمت اول می‌پردازیم.

۵.۱۸ قوانین مدیریت سرمایه کوتاه مدت:

۱.۵.۱۸ قانون اول از مدیریت سرمایه

اولین و مهمترین قانون در مدیریت سرمایه حفظ سرمایه اولیه است. امروزه در قوانین تجارت های بزرگ حفظ سرمایه از سودآوری مهمتر است. یک سرمایه گذار می‌داند در تجارتي که سود بیشتری نهفته است ریسک یا خطر بیشتری هم وجود دارد و همینطور دو احتمال هم باید در نظر گرفت:

ریسک زیاد = سود زیاد

ریسک زیاد = ضرر زیاد

در اکثر مواقع حالت اول به صورت تئوری و روی کاغذ و حالت دوم در عمل اتفاق می‌افتد. امکان ریسک کردن و تعداد فرصت ها برای ریسک کردن در تمامی تجارت ها بجز فارکس محدود است. تنها در فارکس صدها بار امکان ریسک با ۵۰۰ برابر میزان سرمایه در هر روز وجود دارد و این تله جذاب برای همه تازه کارها و کهنه کارها هر لحظه پهن است.

نکته مهمی که نباید فراموش کرد این است که جبران ضرر کار مشکلی است مثلاً در صورت از دست رفتن ۵۰٪ از سرمایه اولیه باید ۲۰۰٪ سود کرد تا سرمایه اولیه برگردد. جبران ضرر تله ای است که تمام مبتدی ها در آن می‌افتند. زمانی که سرمایه اولیه دچار ضرر می‌شود ترس و احساسات جای منطق و دانش را می‌گیرند. تریدر برای جبران ضرر حجم و تعداد معاملات خود را افزایش می‌دهد تا ضرر خود را جبران کند و این اضافه کردن حجم که خارج از قوانین مدیریت سرمایه است باعث ضرر بیشتر به سرمایه اولیه می‌شود. در خیلی از مواقع این جریان تا از دست رفتن کل سرمایه ادامه می‌یابد. اصطلاح شخصی من^۴ از این حالت **باتلاق جبران** است.

به ندرت پیش می‌آید که تریدر در ابتدای کار اکانت خود را مارجین ۵ نکند.

^۴ آقای گلشاهیان

^۵ مارجین کال (Margin Call) یعنی موجودی قابل استفاده در حساب به اتمام رسیده است و اگر قصد ادامه معامله دارید باید پول بیشتری به حساب تان واریز کنید (قادرزاده).

حال برای نیفتادن در باتلاق جبران چه باید کرد؟

برای جلوگیری از افتادن در تله جبران سرمایه باید برنامه حفاظت از سرمایه اولیه داشته باشیم. باید قبل از باز کردن حساب واقعی و شروع به گرفتن پوزیشن، طرح و برنامه مشخص و معینی برای سود یا ضررهای احتمالی داشت.

برنامه حفاظت از سرمایه اولیه مبحثی مجزا در کنار قوانین رایج در مدیریت سرمایه است و به این صورت است که سرمایه اولیه خط قرمز ما برای استفاده از حداقل ریسک ممکن تا ساختن سود است. در واقع وظیفه ما در ابتدا ساختن سود با حداقل ریسک ممکن و استفاده از سود ساخته شده به عنوان سرمایه ثانویه برای در ریسک قرار دادن آن است. بنابراین در ابتدا با یک سوم ریسک رایج در مدیریت سرمایه شروع می‌کنیم و پس از رشد ۳۰ درصدی حساب، قوانین معمول را بکار می‌گیریم.

آشنایی با اصطلاحات رایج در حسابداری بازار:

Balance: میزان نقدی موجودی در حساب قبل از بستن پوزیشن های باز

Equity (تسویه): مقدار نقدی باقیمانده پس از کسر سود و ضرر لحظه ای پوزیشن های باز

Margin (بودجه احتیاطی): مقداری از نقدینگی موجود در حساب که بروکر آن را برای گرفتن پوزیشن ها ضبط می‌کند. این مقدار به اندازه اهرم و شرایط کارگزار بستگی دارد.

Free Margin: مارجین باقیمانده از تسویه پس از کسر مارجین درگیر

$$FreeMargin = Equity - Margin$$

Margin Level: میزان درصدی مارجین آزاد در حساب معاملاتی است. امکان گرفتن پوزیشن زیر مارجین لول ۱۰۰ درصدی وجود ندارد.

$$MarginLevel = \frac{Equity}{usedMargin} \times 100$$

۲.۵.۱۸ قانون دوم از مدیریت سرمایه

در هر پوزیشن گیری هیچ گاه بیشتر از ۳ درصد باقی مانده نقدینگی حساب خود را وارد بازار نکنید. اگر پوزیشن باز دارید فرض کنید تمام پوزیشن های باز شما استاپ خورده اند. فرض کنید در اکانت خود \$ 10.000 دارید و بر اساس ۳٪ پوزیشن باز کرده اید، پس باید به این شکل ادامه دهید:

10.000\$ Account

1st Position: 300\$ loss if hit stop = 9700\$

2nd Position: open position 3% of 9700\$ = 291\$

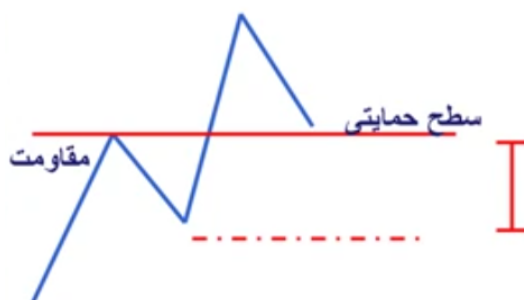
3rd Position: open position 3% of 9409\$ = 282\$

4th Position: open position 3% of 9127\$ = 273\$

پس طبق محاسبات بالا و ادامه آن پوزیشن های خودمان را باز می کنیم.

ولی طبق قانون اول و برنامه حفاظت از سرمایه اولیه باید در ابتدای استارت اکانت واقعی درصد ریسک را روی یک سوم ۳٪ یعنی ۱٪ قرار داد و بعد از رشد موجودی به اندازه ۲۰٪ یا ۳۰٪ آن موقع محاسبات را برای ۳٪ انجام می دهیم.

مثال: برای مشخص کردن حجم ورودی به بازار بر اساس ۳٪ ریسک، فاصله نقطه ورود تا نقطه استاپ احتمالی در شکل ۳.۱۸ را اندازه گرفته و حجم را بر اساس آن بر پایه ۳٪ ریسک تنظیم می کنیم:



شکل ۳.۱۸: محاسبه حجم ورودی به پوزیشن بر اساس ۳٪ ریسک

فرض می کنیم بعد از شکست مقاومت و برگشت قیمت به حمایت جدید پوزیشنی باز می کنیم و نقطه استاپ را هم Low قبل در نظر می گیریم.

حالت اول: فرض می کنیم بازه استاپ ۱۰۰ پیپ باشد:

$$10.000\$ \times 3\% = 300\$ \text{ Risk} \Rightarrow \text{Stop} = 300\$ = 100 \text{ pip}$$

$$\Rightarrow 1 \text{ pip} = 300/100 = 3\$ = 0.3 \text{ lot in EU \& GU}$$

یعنی برای داشتن ۳٪ ریسک در ارزهای یورو- دلار یا پوند- دلار می توان ترید ۰/۳ لات باز کرد.

حالت دوم: فرض می کنیم بازه استاپ ۵۰ پیپ باشد:

$$\text{Stop} = 300\$ = 50 \text{ pip} \Rightarrow 1 \text{ pip} = 300/50 = 6\$ = 0.6 \text{ lot}$$

یعنی می‌توان ترید ۰/۶ لات باز کرد.

لازم به یادآوری است که ارزش هر پیپ در هر ارز متفاوت است.

۳.۵.۱۸ قانون سوم از مدیریت سرمایه

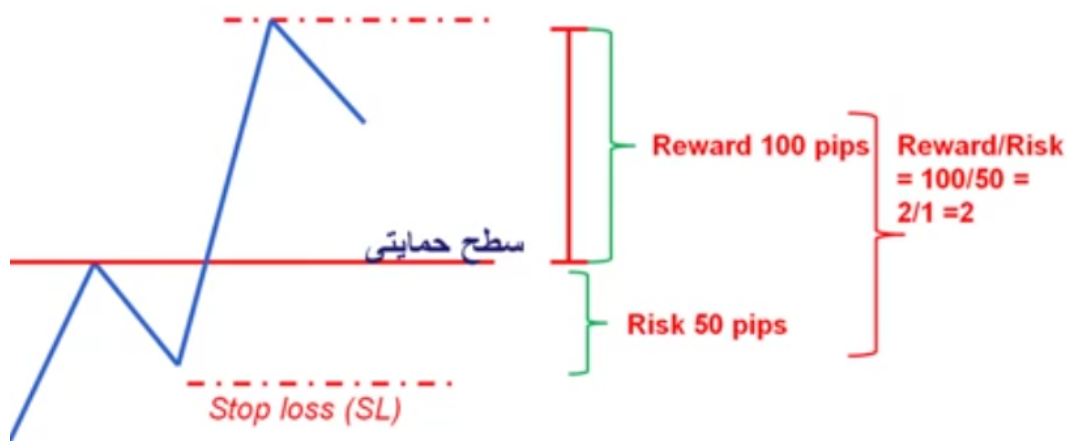
نسبت منفعت به ریسک باید همیشه یک یا بیشتر از یک باشد (شکل های ۴.۱۸ و ۵.۱۸).

$$\frac{\text{Reward}}{\text{Risk}} \geq 1$$



شکل ۴.۱۸: نسبت منفعت به ریسک یک

یعنی نباید پوزیشنی باز کرد که نسبت منفعت به ریسک آن کمتر از یک باشد.



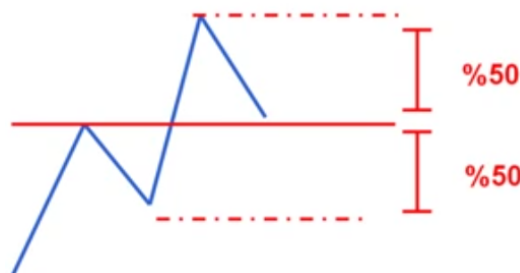
شکل ۵.۱۸: نسبت منفعت به ریسک دو

۴.۵.۱۸ قانون چهارم از مدیریت سرمایه

در آن واحد نباید بیش از ۱۵ درصد از نقدینگی در بازار درگیر باشد. یعنی با ۳٪ ریسک هر پوزیشن، ۵ پوزیشن باز نباید بیشتر داشته باشیم.

$$(3\% \text{ Risk}) \times (5 \text{ OpenPositions}) = 15\%$$

موارد پیشنهادی: با توجه به قانون احتمالات، میزان درصدی گرفتن سود یا زیان در یک معامله با نسبت ریسک به ریوارد یک به یک از بازار ۵۰ به ۵۰ است. هر چقدر هم به پوزیشنی که گرفته شده اعتماد داشته باشیم ولی باید این احتمال را هم در نظر گرفت که در بازاری غیر قابل پیش بینی کار می‌کنیم. بنابراین باید همیشه احتمال ۵۰٪ ضرر را در نظر گرفت (شکل ۶.۱۸).



شکل ۶.۱۸: نسبت ریسک به ریوارد ۵۰٪

۶.۱۸ چگونه از مدیریت سرمایه برای بالا بردن احتمال سود دهی خود استفاده کنیم؟

۱.۶.۱۸ معجزه مدیریت سرمایه

اگر مدیریت سرمایه را به خوبی انجام ندهیم امکانی برای موفقیت ما در بازار وجود ندارد. با چند ترفند ساده می‌توانیم با استفاده از مدیریت سرمایه هوشمند، درصد موفقیت خود را در بازار بالا ببریم. در معاملات با نسبت منفعت به ریسک بالای یک به یک امکان بالا بردن احتمال سود نسبت به ضرر به صورت زیر وجود دارد:

۱. در صورت رفتن پوزیشن به سود به اندازه استاپ، با خارج شدن نصف پوزیشن و تسویه نصف سود، ریسک پوزیشن خود را به صفر کاهش می‌دهیم. چرا که حتی در صورت برگشت قیمت و خوردن استاپ، جمع جبری سود و ضرر برابر صفر است.

۲. با قرار دادن استاپ پس از خارج شدن از نصف پوزیشن در نقطه ورود، میزان سود را تضمین می‌کنیم. با قرار دادن استاپ در نقطه ورود در پوزیشن‌های در سود، پوزیشن را بدون ریسک می‌کنیم. به این حالت به اصطلاح نقطه سر به سر یا بدون ریسک کردن می‌گویند.

Break Even (BE) or Risk Free

در این صورت ۲ احتمال پیش می‌آید:

الف) خوردن استاپ: در این حالت درصد تضمینی سود نصف پوزیشن اولیه است در حالی که احتمال ضرر صفر است.

ب) خوردن تارگت: در این حالت درصد تضمینی سود ۷۵٪ پوزیشن اولیه است در حالی که احتمال ضرر صفر است.

۲.۶.۱۸ نسبت سود و ضرر در مدیریت سرمایه عادی

در مدیریت سرمایه معمولی در مقام مقایسه، احتمالات در حالت‌های مختلف به شکل زیر هستند:

احتمال ضرر %	احتمال سود %
۵۰	۵۰

(ب) زمانی که پوزیشن در ضرر است

احتمال ضرر %	احتمال سود %
۵۰	۵۰

(آ) زمانی که پوزیشن در سود است

جدول ۱۰.۱۸: مدیریت سرمایه معمولی

۳.۶.۱۸ نسبت سود و ضرر در مدیریت سرمایه پیشرفته

در مدیریت سرمایه پیشرفته و خارج شدن نصف پوزیشن، احتمالات در حالت‌های مختلف به شکل زیر هستند:

احتمال ضرر %	احتمال سود %
۵۰	۵۰

(د) زمانی که پوزیشن در ضرر است

ضرر %	سود %	ضرر %	سود %
۰	۷۵	۰	۵۰

(ب) خوردن استاپ (ج) خوردن تی پی

(ج) زمانی که پوزیشن در سود است

جدول ۲۰۱۸: مدیریت سرمایه پیشرفته و خارج شدن نصف پوزیشن

بنابراین با انجام مدیریت سرمایه پیشرفته می‌توانیم به سادگی سود خود را تثبیت و ضرر خود را صفر کنیم.

مقایسه احتمال سود دهی در دو حالت مدیریت سرمایه:

احتمال ضرر %	احتمال سود %
۵۰	۵۰

ضرر %	سود ۷۵ %	سود ۵۰ %
۳۳/۳	۳۳/۳	۳۳/۳

احتمال ضرر %	احتمال سود %
۳۳/۳	۶۶/۶

(آ) حالت کاهش ریسک

(ب)
حالت
معمول

جدول ۳۰۱۸: مقایسه احتمال سود دهی در دو حالت مدیریت سرمایه

۷.۱۸ لزوم داشتن طرح و نقشه کار

طبق آموزش های ارائه شده، یک تریدر برای موفقیت در بازار باید طرح و نقشه مشخص برای وارد شدن در بازار داشته باشد، در غیر این صورت نتیجه ای جز شکست در انتظار تریدر نخواهد بود. جمله معروفی از استاد رابرت ماینر^۶ که در هر بازاری کاربرد دارد این است:

If you fail to Plan, you Plan to fail

یعنی اگر برنامه ریزی نداشته باشید، برای شکست برنامه دارید.

*A Trader **MUST** have Business Plan*

Robert Miner^۶

تمام افراد موفق در مارکت حتما بیزینس پلن دارند.

۱.۷.۱۸ طراحی طرح تجاری (بیزینس پلن)

یک طرح تجاری (بیزینس پلن) باید شامل دو قسمت باشد (شکل ۷.۱۸):

۱. طرح مدیریت سرمایه

۲. طرح معاملاتی



شکل ۷.۱۸: طرح تجاری

۲.۷.۱۸ طرح مدیریت سرمایه

طرح مدیریت سرمایه^۷ باید شامل کلیات و جزئیات حجم ورودی به بازار بر اساس مقدار سرمایه موجود، تعیین میزان ریسک به ریوارد، مدیریت پوزیشن های باز و زمان بستن تمام و یا قسمتی از معاملات باشد. تمام این موارد باید روی کاغذ نوشته شوند و دقیقاً عمل شوند.

۳.۷.۱۸ طراحی نقشه معاملاتی

نقشه معاملاتی^۸ باید شامل انواع استراتژی های ورود به بازار، شرایط ورود و شرایط خروج به طور مشخص باشد. در واقع نقشه معاملاتی تعیین می کند تا فقط در صورت تطبیق شرایط تعیین شده با بازار ترید صورت گیرد و از ورود بی برنامه و احساسی به بازار جلوگیری شود.

^۷ Money Management Plan
^۸ Trading Plan

از تایم ۱ ساعت و ۷ دقیقه و ۵۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان بیزینس پلن خود را شرح می‌دهند. ابتدا مدیریت سرمایه و فایل فعالیت هفتگی پلن مدیریت سرمایه و در تایم ۱ ساعت و ۱۵ دقیقه و ۴۴ ثانیه تریدینگ پلن را توضیح می‌دهند.

برگه هایی که آقای گلشاهیان تهیه کرده اند خیلی کمک می‌کنند بتوانیم نقاط ضعف و قوت کارمان را بهتر بشناسیم.

۸.۱۸ چند نمونه استراتژی معاملاتی و تعیین ریسک به ریوارد و نقاط استاپ و تارگت

۱.۸.۱۸ پترن تریدینگ

از تایم ۱ ساعت و ۲۵ دقیقه و ۳۰ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان پترن تریدینگ را روی چارت شرح می‌دهند.

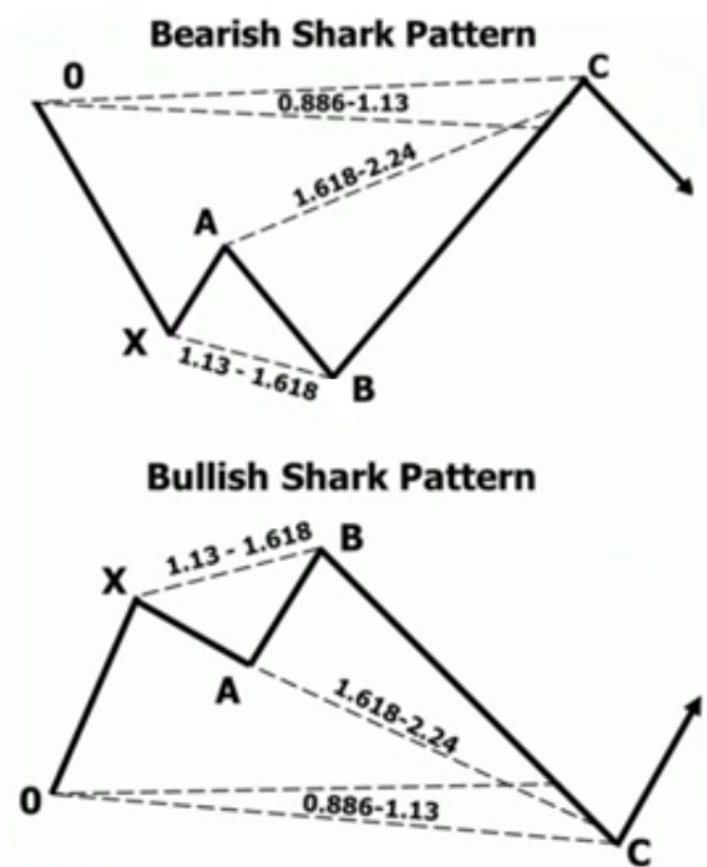
یکی از متداول ترین و قوی ترین استراتژی ها در بازار، پترن تریدینگ^۹ و کار با الگوهای هارمونیک است. یکی از الگوهای هارمونیک که به دلیل اختلاف با سایر الگوها معرفی نشده بود الگوی شارک یا کوسه است.

الگوی کوسه

تفاوت الگوی کوسه^{۱۰} با الگوهایی که قبلا بررسی کرده ایم این است که در الگوی کوسه موج سوم خارج از موج اول خواهد بود در حالیکه در الگوهای دیگر موج سوم موج داخلی بود. فرض می‌کنیم یک روند جنبشی داریم که از نقطه O تا X ادامه پیدا کرده است و موج دوم (اصلاحی موج اول) در نقطه A به پایان رسیده، موج سوم در نقطه B به پایان رسیده و موج AB به اندازه ۱۱۳٪ تا ۱۶۱/۸٪ فیبوناچی اصلاحی خارجی موج دوم کشیده شده است، در این صورت می‌توانیم احتمال بدهیم که یک الگوی کوسه در حال تشکیل است. سپس موج چهارم تا نقطه C و به اندازه ۱۶۱/۸٪ تا ۲۲۴٪ موج سوم اصلاح خواهد شد و این نقطه C با زون ۸۸/۶٪ تا ۱۱۳٪ موج اول همپوشانی می‌کند و یک محدوده برگشتی برای ما خواهد ساخت که قیمت از آنجا برمی‌گردد. موج چهارم می‌تواند داخلی یا خارجی باشد. در شکل ۸.۱۸ به جای درصدها اعداد نوشته شده اند.

Pattern Trading^۹
Shark Pattern^{۱۰}

اگر موج برگشت خورده از نقطه C به سمت بالا باشد این الگو را Bullish و اگر موج برگشت خورده از نقطه C به سمت پایین باشد این الگو را Bearish می‌نامند.



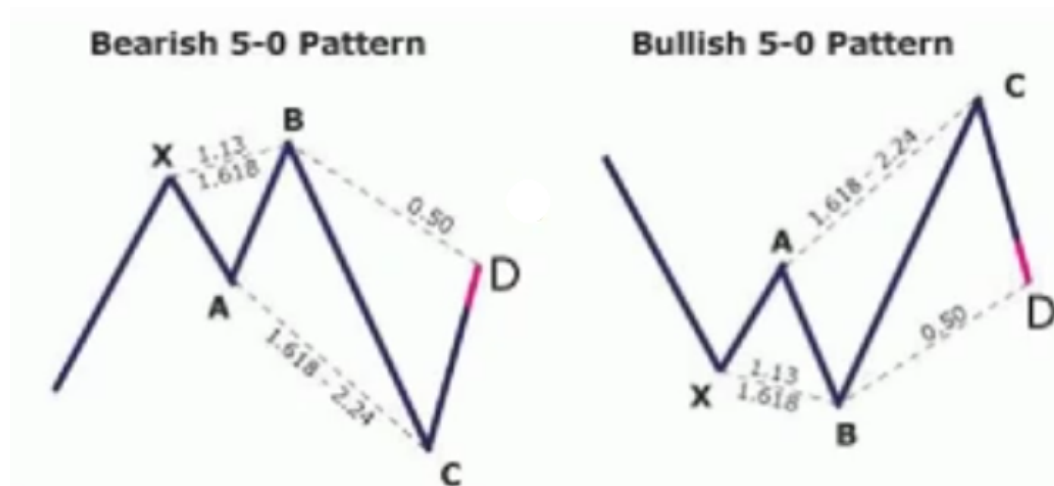
شکل ۱۸.۸: الگوی کوسه

الگوی بعدی که بر اساس الگوی شارک یا کوسه و بعد از آن تشکیل می‌شود الگوی فایو-او است (شکل ۹.۱۸).

این الگو بعد از تشکیل الگوی کوسه تشکیل می‌شود و قیمت در نقطه D که ۵۰٪ موج چهارم یعنی BC است برگشت خواهد داشت. این الگو الگوی فایو-او یا پنج صفر نامیده شده است. تعداد رخ دادن الگوی شارک از الگوی فایو-او بیشتر است و اعتبار دو برابر هم دارد.

از تایم ۱ ساعت و ۳۰ دقیقه و ۲۰ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان الگوی کوسه و فایو-او را روی چارت شرح می‌دهند.

الگوی هارمونیک شارک الگوی بسیار خوبی است که مثال آقای گلشاهیان روی چارت، در درک نحوه استفاده از این الگو کمک شایانی به ما می‌کند. نکات زیر بخشی از نکات آقای گلشاهیان در هنگام توضیح روی چارت است:



شکل ۹.۱۸: الگوی فایو - او

تعریفی به نام Inside Bars داریم یعنی چند کندل آینده می‌توانند در داخل یک کندل پر حجم قبلی جای گیرند و این نشانه کم شدن مومنتوم است.

همیشه باید سمت چپ را در صفحه متاتریدر زیر نظر داشته باشیم چون همیشه قیمت به High و Low های قبلی خود واکنش نشان می‌دهد. نقاط برگشت قیمت در گذشته همیشه می‌توانند نقاط برگشت در آینده باشند.

در الگوهای هارمونیک، نقطه استاپ لاس آخرین کف (در روند نزولی) یا سقف (در روند صعودی) و نقطه تیک پرافیت $38/2\%$ از کل موج نزولی (مجموع موج دوم، سوم و چهارم) بر اساس سطوح فیبوناچی است. همچنین بر اساس مدیریت سرمایه زمانی که پوزیشن به اندازه فاصله استاپ در سود رفت نصف پوزیشن را می‌بندیم و بقیه پوزیشن با این کار ریسک فری می‌شود.

بررسی سنجیدن ریسک به ریوارد قبل از باز کردن پوزیشن کمک زیادی در به صرفه بودن یا نبودن پوزیشن به ما می‌کند و ما فقط پوزیشن هایی را استارت می‌زنیم که نسبت ریسک به ریوارد یک به یک یا ریوارد بالاتر دارند.

۲.۸.۱۸ استراتژی پول بک تریدینگ

آقای گلشاهیان استراتژی پول بک تریدینگ^{۱۱} و استراتژی «1, 2, 3» را با هم توضیح می‌دهند. الگوی «1, 2, 3» الگوی تشکیل اولین HH و HL در ابتدای روند صعودی و اولین LH و LL

^{۱۱} Pull Back Trading

در ابتدای روند نزولی است.

از تایم ۲ ساعت و ۱۲ دقیقه و ۱۷ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استراتژی پول بک تریدینگ و استراتژی «1, 2, 3» را روی چارت شرح می دهند.

نکته: پول بک یعنی برگشت قیمت به سمت مقاومت یا حمایتی که قبلاً شکسته شده است و نقش آن عوض شده است.

۳.۸.۱۸ استراتژی الیوت ویو تریدینگ

از تایم ۲ ساعت و ۲۱ دقیقه و ۲۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استراتژی الیوت ویو تریدینگ^{۱۲} را روی چارت شرح می دهند.

در این بخش استفاده از کانال^{۱۳} هم توضیح داده می شود.

۴.۸.۱۸ استراتژی کندل استیک فرمیشن تریدینگ

از تایم ۲ ساعت و ۳۹ دقیقه و ۱۰ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استراتژی کندل استیک فرمیشن تریدینگ^{۱۴} را روی چارت شرح می دهند.

یکی از بهترین و مهمترین استراتژی ها استراتژی کندل استیک فرمیشن است.

قبل از شروع کار ابتدا باید نقاط مهم بازار را تشخیص داد.

این استراتژی ریسک به ریوارد خیلی خوبی در حد ۱ به ۳ یا بهتر دارد.

۹.۱۸ کلام آخر

قمار نکنید بلکه تجارت کنید. صبور باشید. طمع نکنید. متعهد باشید. منظم باشید. مستقل باشید.

^{۱۲} Elliot Wave Trading

^{۱۳} Channel Trading

^{۱۴} Candle Stick Formation Trading

فصل ۱۹

ویدئوی شماره ۱-۲۸: بسته کامل استراتژی GTS

۱.۱۹ هشدار ریسک

هشدار به افراد نا آشنا با بازارهای مالی

فعالیت در بازارهای مالی از جمله فارکس که دارای اهرم هستند دارای ریسک بالایی است و به هیچ عنوان به افرادی که در این زمینه دانش و تجربه کافی ندارند توصیه نمی شود. در صورت نداشتن دانش و تجربه کافی در این گونه بازارها سرمایه گذاری نکنید و یا سرمایه خود را در اختیار افراد ناوارد قرار ندهید. چرا که در این صورت سرمایه خود را از دست می دهید. به دوستانی که به تازگی به صفحه آموزش فارکس^۱ پیوسته اند، توصیه می شود برای موثر بودن مراحل آموزشی، آموزش ها را از ابتدا شروع کرده و به مرور و با چند روز تا یک هفته تمرین بر روی هر ویدئوی آموزشی دنبال کنند و در صورتی که آموزش های قبلی را فرا نگرفته اند به هیچ عنوان این ویدئو یا قسمت های انتهایی آموزش ها را نبینند.

^۱ منظور آقای گلشاهیان صفحه ایشان در یوتیوب و فیسبک است.

۲.۱۹ سرتیترها

آقای گلشاهیان در این ویدئو بسته کامل استراتژی ورود به بازار و نقاط استاپ و تی پی و مدیریت سرمایه در روش GTS^۲ را تشریح می‌کنند. ضمن ارائه پیش‌نیازها و ابزارهای مورد نیاز، روش ایشان به سه مرحله تقسیم شده است تا به سادگی بیشتر بتوان از آن استفاده کرد:

۱. مرحله اول:

تحلیل تکنیکال براساس رفتار قیمت و تشخیص موقعیت فعلی قیمت

شرح قدم به قدم مرحله اول همراه با مثال‌های زنده روی چارت

۲. مرحله دوم:

استفاده از ابزارها و اندیکاتورها برای فیلتر کردن ورودی‌های اشتباه

شرح کامل دلیل، تنظیمات و نحوه استفاده از هر اندیکاتور در این روش

۳. مرحله سوم:

مدیریت سرمایه در این روش

۳.۱۹ بهترین نقاط ورود به بازار کجا هستند؟

چگونه می‌توان روند بازار را تشخیص داد و در نقاط مناسب وارد بازار شد؟ الگوهای تکرار شدنی در بازار به وفور یافت می‌شوند ولی الگوهایی هستند که با اتکا به آنها می‌توان نقاط کم ریسک ورود به بازار را پیدا کرد.

در این قسمت به شرح جزئیات روش شخصی خودم (آقای گلشاهیان) می‌پردازم و تشخیص جهت روند بازار و نقاط ورود و خروج براساس این روش در دو مرحله آموزش و همین‌طور مدیریت سرمایه به این روش را در بسته آموزشی استراتژی معاملاتی گلشاهیان Golshahian Trading System ارائه خواهم کرد.

^۲ روش شخصی آقای گلشاهیان Golshahian Trading System

۴.۱۹ استراتژی GTS

۱.۴.۱۹ پیش‌نیاز استفاده از این روش

گذراندن دوره کامل آموزش های ارائه شده قبلی
آشنایی با الگوهای هارمونیک و درصدهای فیبوناچی و الگوهای ترسیمی و تا حدودی امواج
الیوت و HL, HH, LH, LL .

۲.۴.۱۹ ابزارهای لازم

اندیکاتورها:

RSI, Zigzag Close, MACD, Moving Average, Pivots

۵.۱۹ مرحله اول: تحلیل قدم به قدم تکنیکال و شناخت موقعیت فعلی بازار با چارت خالی بدون در نظر گرفتن اندیکاتورها

نکته ای که توجه به آن قبل از ورود به چارت مهم است این است که هر چه چارت را ساده‌تر
بینیم و ساده‌تر تحلیل کنیم احتمال موفقیت ما بیشتر است. ما هیچ نیازی به داشتن اطلاعات
پیچیده اقتصادی نداریم و تنها چارت و ابزارها برای ما کافیست.

۱.۵.۱۹ مراحل کار

۱. انتخاب جفت ارز یا کالای مناسب فارغ از در نظر گرفتن اسم

روش انتخاب جفت ارز که در اینجا ذکر می‌شود برای همه ارزها و کالاها و تایم فریم‌ها
قابل استفاده است.

ارزهای نرم:

ارزهایی که نوسان زیاد و تغییر جهت ناگهانی ندارند و جهت و حرکت واضح دارند. برای
این کالا یا ارزها از ۴ استراتژی زیر که توضیح داده خواهند شد، استفاده می‌کنیم:

GTS 1, GTS 2, GTS Breakout, GTS Pullback

ارزهای EURUSD و USDJPY نمونه‌هایی از ارزهای نرم هستند.

ارزهای تیز یا شارپ:

کالا و ارزهایی هستند که حرکت ناگهانی سریع، امواج درهم و تغییر جهت آنی دارند و پیدا کردن نقاط ورود مناسب بسیار مشکل است. این حالت در تایم‌های پایین که نوسانات بازار زیاد است اتفاق می‌افتد. در این ارزها به دو صورت امکان معامله کردن هست که استراتژی ورود بسته به تایم فریم متفاوت است. در تایم فریم‌هایی که قیمت در آنها نوسان بیشتری دارد از استراتژی GTS Sharp استفاده می‌کنیم.

۲. شروع مرحله به مرحله تحلیل تکنیکال جفت ارزی یا کالای انتخاب شده از تایم فریم هفتگی تا چهار ساعته به علاوه تنظیمات چارت

نکات زیر مواردی هستند که باید مدنظر قرار داد:

تعیین نقاط برگشتی براساس قیمت بسته شدن

تعیین روند قیمت و رسم خطوط روند

خطوط حمایت و مقاومت

الگوهای ترسیمی

الگوهای فیبوناچی و درصد های فیبو

امواج الیوت در صورت واضح بودن

۲.۵.۱۹ توضیح قدم به قدم مراحل روی چارت

از تایم ۱۹ دقیقه و ۳۵ ثانیه این ویدیو آقای گلشاهیان مراحل را قدم به قدم روی چارت توضیح می‌دهند.

لازم به یادآوری است که نقاط برگشتی در روند صعودی به صورت محدوده بین قیمت Close و قیمت High و در روند نزولی محدوده بین قیمت Close و قیمت Low است.

نباید فراموش کرد که قبل از هر نوع پوزیشن‌گیری باید چارت را بررسی کرد و نقاط حساس و مهم آن را تشخیص داد و علامت‌گذاری کرد.

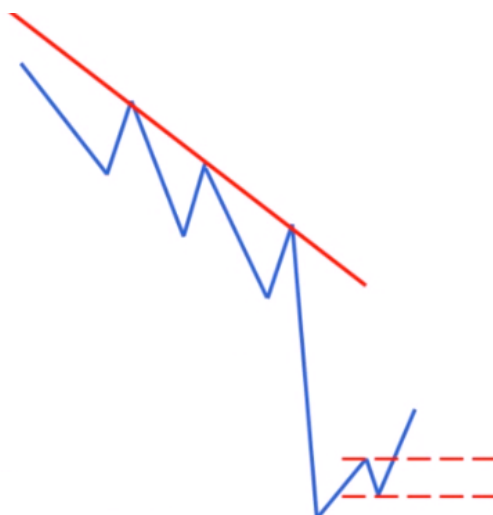
۳.۵.۱۹ تشخیص ادامه روند یا برگشت آن

از کجا بفهمیم قیمت به روند خود ادامه داده یا تغییر روند خواهد داد؟
جواب این سوال در آموزش موج ها بود. به این شکل که اول باید خط روند شکسته شود سپس نقاط High و Low معکوس تشکیل شود در این صورت می‌توانیم انتظار برگشت داشته باشیم. همین قانون تغییر روند راهنمای ما برای روش جی تی اس است (شکل ۱.۱۹).



شکل ۱.۱۹: تغییر روند

زمانی که قیمت از خط روند زیاد فاصله دارد می‌توان از تشکیل نقاط High و Low استفاده کرد ولی چون قیمت کماکان در روند کلی قبلی است پس می‌توان این نتیجه‌گیری را خلاف روند دانست و باید در استفاده کردن از آن احتیاط کرد (شکل ۲.۱۹).



شکل ۲.۱۹: نشانه تغییر روند با فاصله از خط روند

قیمت در بازار همیشه در یکی از حالات زیر قرار دارد:

۱. رنج (Range) در حال برگشت روند
۲. رنج در حال استراحت برای ادامه حرکت در جهت روند (این حالت بیشتر رخ می‌دهد).
۳. روند دار

نقاط ورود به پوزیشن برای ما ابتدای شروع حرکت یا ادامه روند می‌باشد.

برای ورود در بازار رنج در حال برگشت، از ست‌آپ‌های زیر استفاده می‌کنیم:

GTS 1 and GTS 2

برای ورود در روند و بازار رنج در حال استراحت برای ادامه روند، از ست‌آپ‌های زیر استفاده می‌کنیم:

GTS Breakout and GTS Pullback

نقاط برگشتی

نقاط برگشتی همانطور که توسط آقای گلشاهیان در چارت رسم شد و برای پوزیشن‌گیری در دو ست‌آپ اول (GTS 1 and GTS 2) باید زیر نظر گرفت در مناطق زیر هستند:

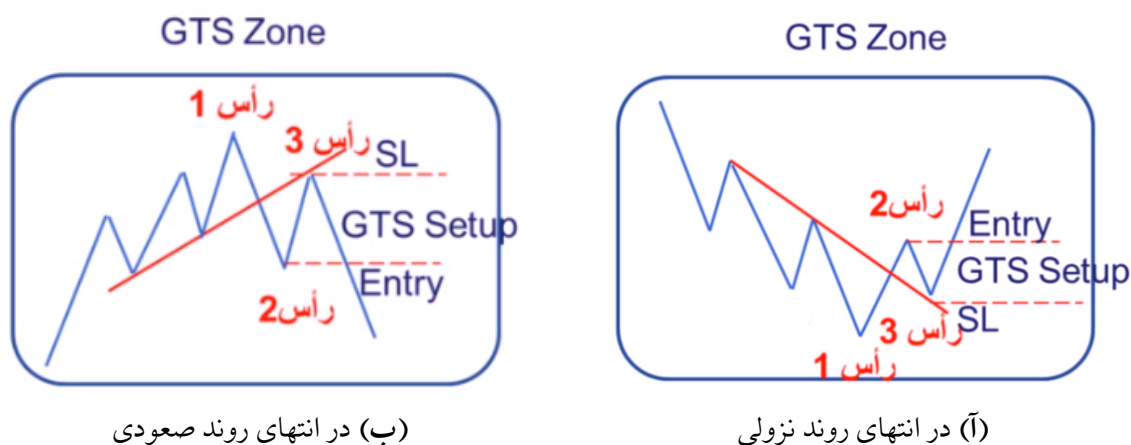
۱. زون‌های الگوهای هارمونیک
۲. درصدهای فیبوناچی
۳. کمترین و بیشترین نقاط بسته شدن قیمت در تایم فریم‌های بالا
۴. واگرایی‌ها
۵. شکست خطوط روند
۶. سطوح حمایت و مقاومت

۶.۱۹ ست‌آپ GTS ابتدای روند

از تایم ۳۹ دقیقه و ۴۵ ثانیه آقای گلشاهیان ست‌آپ‌های ابتدای روند را به صورت کامل توضیح می‌دهند.

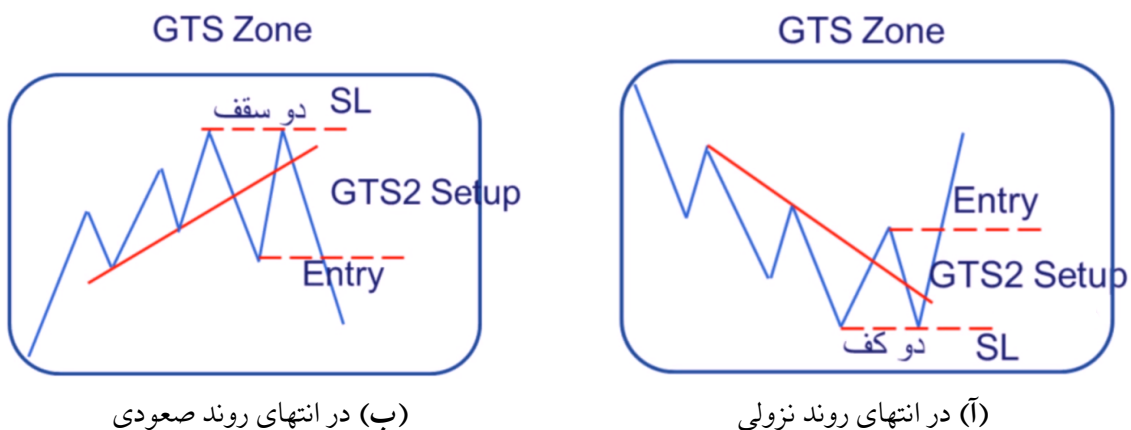
با تشخیص مناطق برگشتی، زونی را به صورت زون جی تی اس مشخص می‌کنیم و ست‌آپ GTS 1 را مطابق شکل ۳.۱۹ خواهیم داشت. در شکل ۳.۱۹ در انتهای یک روند نزولی اگر

یک شکل با سه راس مثل شکل تشکیل شد که راس ۳ بالاتر از راس ۱ قرار گرفت در صورتی که قبلاً راس ۲ خط روند را شکسته بود، نقطه بعد از شکسته شدن راس دوم، نقطه ورود و زیر نقطه راس ۲ نقطه استاپ لاس ماست. برای روند صعودی هم به همین منوال عمل می‌کنیم.



شکل ۳.۱۹: ست‌آپ 1 GTS

همچنین ست‌آپ 2 GTS را مانند شکل ۴.۱۹ در نظر می‌گیریم و از آن استفاده می‌کنیم.



شکل ۴.۱۹: ست‌آپ 2 GTS

در استراتژی 2 GTS زمانی که در روند نزولی الگوی دو کف یا در روند صعودی الگوی دو سقف تشکیل شد، اگر قیمت از حد آخرین قله رد شد وارد پوزیشن می‌شویم و استاپ لاس را در روند نزولی زیر دو کف و در روند صعودی بالای دو سقف قرار می‌دهیم.

استراتژی‌های 1 GTS و 2 GTS نیازمند تائیدهای دیگری هستند تا پوزیشن با اطمینان قوی را برای ما بسازند و چون این استراتژی‌ها برخلاف روند پوزیشن باز می‌کنند باید احتیاط بیشتری را برای آنها لحاظ کرد.

۷.۱۹ ست آپ GTS وسط روند

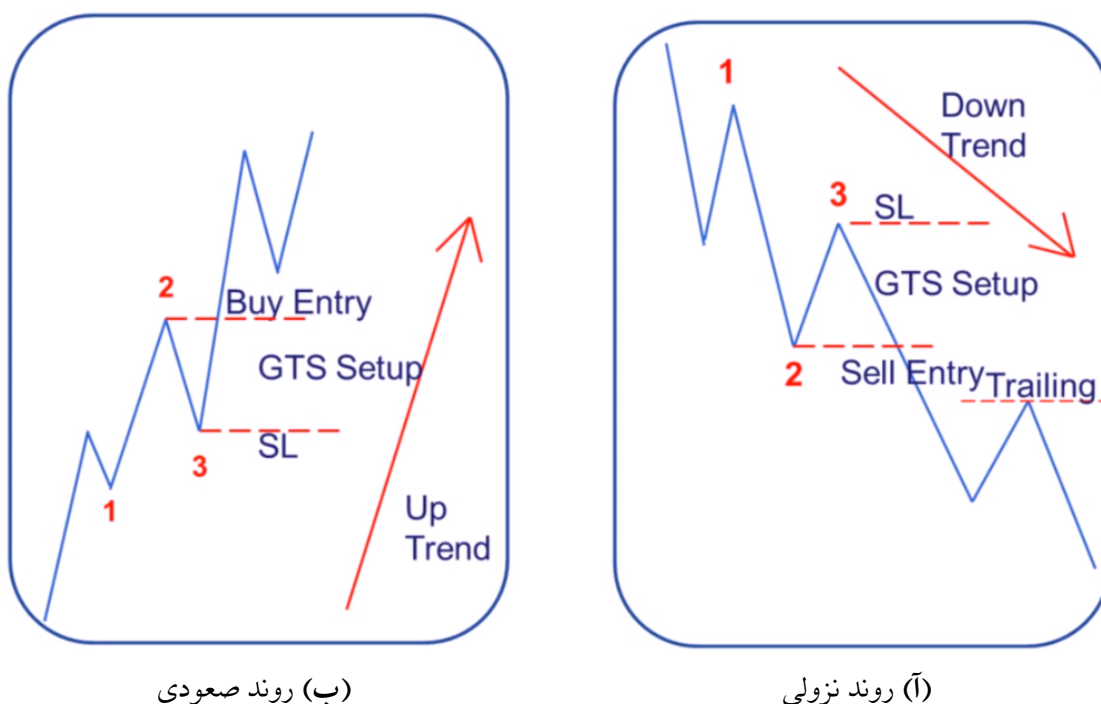
حال به استراتژی ورود به بازار در وسط روند و یا اضافه کردن حجم به پوزیشن‌هایی که قبلاً در ابتدای روند باز شده‌اند می‌پردازیم. برای ورود به بازار زمانی که روند بازار قبلاً آغاز شده و یا برای اضافه کردن حجم به پوزیشن‌های قبلی از دو استراتژی زیر استفاده می‌کنیم:

GTS Breakout

GTS Pullback

از این استراتژی‌ها در روندهایی که واضح هستند استفاده می‌کنیم.

۱.۷.۱۹ استراتژی GTS Breakout



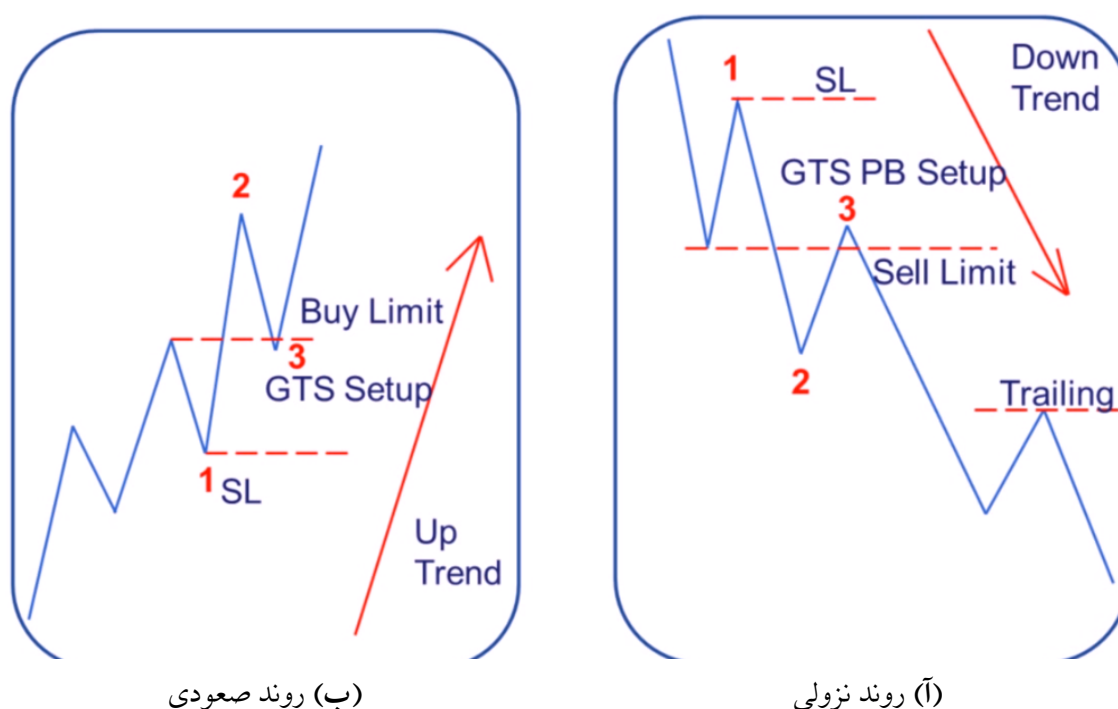
شکل ۵.۱۹: استراتژی GTS Breakout

در این استراتژی یا پوزیشن جدید باز می‌کنیم یا پوزیشن قبلی را اضافه می‌کنیم. در این ست آپ مطابق شکل ۵.۱۹ مثلاً در روند نزولی نقطه ورود را تقریباً یک پیپ زیر نقطه ۲ پوزیشن Sell Stop به صورت Pending قرار می‌دهیم^۳ در نتیجه زمانی که قیمت نقطه ۲ را پوزیشن در انتظار یا Pending شامل پوزیشن‌های Sell Limit، Sell Stop، Buy Limit و Buy Stop می‌باشد.

بشکند پوزیشن فعال می‌شود، استاپ لاس آن را نقطه ۳ تعیین می‌کنیم و در صورتی که بعد از نقطه ورود نوسان داشت در قله بعدی Trailing می‌کنیم. به همین ترتیب برای روند صعودی هم پوزیشن Buy Stop قرار می‌دهیم. در ادامه آموزش‌ها توضیح می‌دهیم که این پوزیشن‌ها را تا کجا ادامه دهید.

۲.۷.۱۹ استراتژی GTS Pullback

استراتژی GTS Pullback شبیه استراتژی GTS Breakout است با این تفاوت که نقطه ورود آنها با هم تفاوت دارد. در استراتژی GTS Pullback مطابق شکل ۶.۱۹ مثلاً در روند نزولی بعد از تشکیل نقطه ۲، بالاتر از آن و در راستای کف قبل از نقطه ۱ پوزیشن Sell Limit قرار می‌دهیم. اگر بعد از تشکیل نقطه ۲ قیمت برگردد تا در نقطه ۳ به امتداد خط کف قبل از نقطه ۱ پول بک کند پوزیشن فعال می‌شود، استاپ لاس را نقطه ۱ تعیین می‌کنیم و در صورتی که بعد از نقطه ۳ نوسان داشت در قله بعدی Trailing می‌کنیم. به همین ترتیب برای روند صعودی هم پوزیشن Buy Limit قرار می‌دهیم.



شکل ۶.۱۹: استراتژی GTS Pullback

۸.۱۹ تشخیص روند و احتمال برگشت قیمت

چه زمان‌هایی با ست‌آپ جی تی اس نباید وارد بازار شد؟

۱. در جهت روند بر روی درصدهای فیبو و زون‌های الگوها که در تایم پایین با واگرایی همراه باشد و یک خط روند کوتاه‌مدت در تایم پایین را شکسته باشد.
۲. بازارهای رنج و بازارهایی که در آنها رفتار قیمت واضح نیست و امواج غیرواضح و درهم پیچیده‌ای دارند. در این حالت جی تی اس بیشترین خطا و کمترین راندمان را دارد. برای کاهش خطا و جلوگیری از ورودی‌های اشتباه، مرحله دوم استراتژی پس از مرحله اول آموزش داده خواهد شد تا ایرادهای این روش برطرف گردد.
۳. برای ورودی‌های خلاف روند در امواج ۴ از امواج الیوت که بعد از تشکیل یک موج سریع تشکیل شوند. چون بعد از تکمیل زیگزاگ، قیمت برای تکمیل موج ۵ سریعاً اقدام خواهد کرد در صورت وارد شدن به پوزیشن باید سریعاً در زون موج ۴ بدون ریسک گردد.
۴. نزدیک بودن به یک خط روند در پوزیشن‌های خلاف روند و مجاورت با روند درازمدت با حمایت یا مقاومت قوی که بدون تأییدیه‌های مرحله دوم هستند.
۵. زمان خبرهای مهم که بازار به شدت نوسانی می‌شود و کل تحلیل‌های تکنیکال را به هم می‌ریزد. در این مواقع برای ورود و خروج‌های سریع از جی تی اس شارپ استفاده می‌شود.

۹.۱۹ چگونه قیمت را پس از وارد شدن به ست‌آپ جی تی اس مدیریت کنیم؟

مدیریت پوزیشن، کسب سود و حفظ آن و مدیریت ضرر بسیار مهم هستند و در این روش به سه شکل مختلف بسته به نوع استراتژی مدیریت می‌شوند.

۱. مدیریت پوزیشن در مرحله اول
 ۲. مدیریت پوزیشن در مرحله دوم
 ۳. مدیریت پوزیشن به وسیله مدیریت سرمایه
- در مرحله اول پس از ورود به ست‌آپ جی تی اس باید قیمت را در محدوده‌های احتمالی برگشتی به دقت زیر نظر داشت. محدوده‌های برگشتی همان‌هایی هستند که در موردشان صحبت شد و در جهت معکوس پوزیشن تشکیل می‌شوند. موارد اصلی برگشتی‌ها عبارتند از:

درصدهای فیوناچی

خطوط حمایت و مقاومت و روند

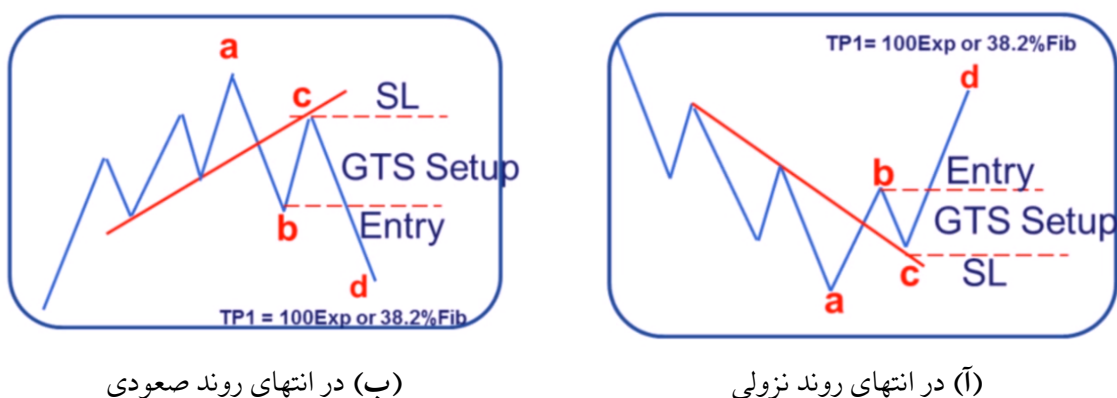
زون‌های الگوهای هارمونیک

پیوت‌ها

۱.۹.۱۹ نقاط تسویه ست‌آپ جی تی اس

نکته خیلی مهم این که بعد از شکسته شدن خطوط روند همیشه باید فیوناچی موج قبلی را بلافاصله رسم کرد و روی چارت نگه داشت تا مناطق برگشتی و اصلاحی را بتوان شناسایی کرد.

در استراتژی 1 GTS تارگت قیمت ۱۰۰٪ فیوناچی Expansion یا ۳۸/۲٪ فیوناچی موج های قبلی است و حتی اگر با اختلاف چند پیپ هم به این درصدها رسید، پوزیشن را تسویه می‌کنیم (شکل ۷.۱۹).



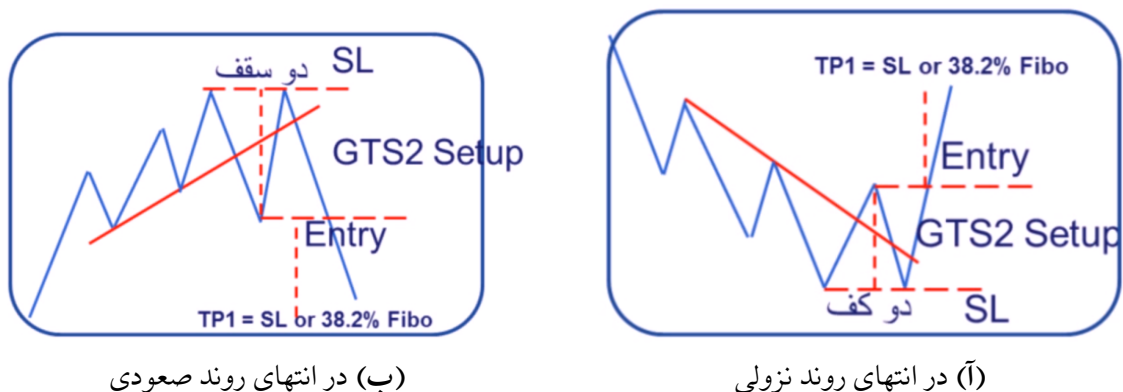
(ب) در انتهای روند صعودی

(آ) در انتهای روند نزولی

شکل ۷.۱۹: نقاط تسویه استراتژی 1 GTS

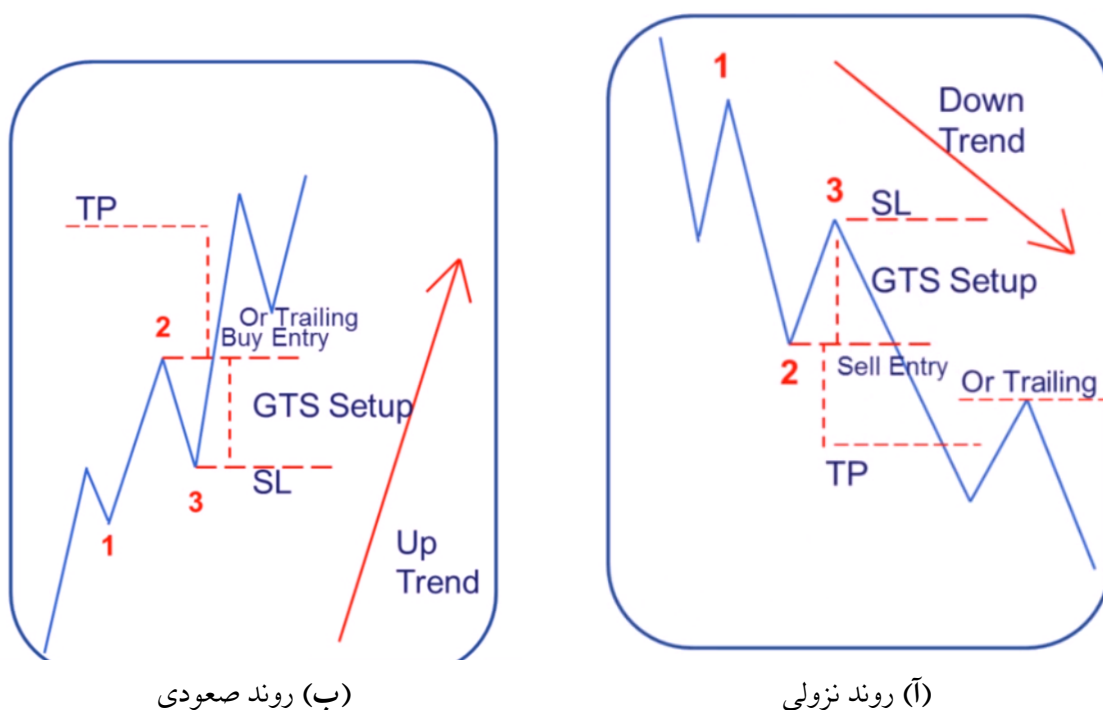
در استراتژی 2 GTS که اصطلاحاً دو کف یا دو سقف ساخته می‌شود نقاط تارگت با استراتژی 1 GTS متفاوت است. در این استراتژی تارگت را در نقطه ۳۸/۲٪ فیوناچی یا به اندازه SL قرار می‌دهیم. اگر در استراتژی 2 GTS نقطه ورود در ۳۸/۲٪ فیوناچی قرار گرفته بود در حوالی ۵۰٪ یا ۶۱/۸٪ فیوناچی پوزیشن را تسویه می‌کنیم (شکل ۸.۱۹).

در نقاط تسویه استراتژی های 1 GTS و 2 GTS منظور از درصدهای فیوناچی، درصدهای موج کلی است نه صرفاً موج قبل از پوزیشن.



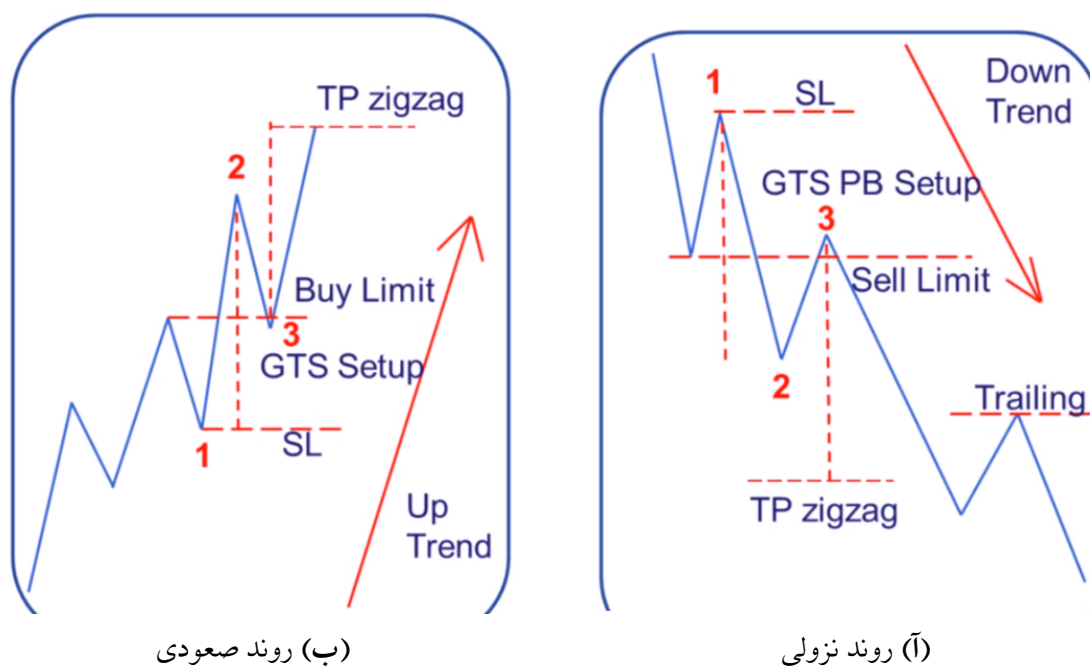
شکل ۸.۱۹: نقاط تسویه استراتژی GTS 2

در استراتژی GTS Breakout تارگت قیمت را به اندازه SL قرار خواهیم داد و یا اگر بعد از ورود به پوزیشن فرصت Trailing داشتیم استاپ لاس جدید را قرار می‌دهیم (شکل ۹.۱۹).



شکل ۹.۱۹: نقاط تسویه استراتژی GTS Breakout

در استراتژی GTS Pullback نیز متفاوت عمل می‌کنیم، به این صورت که تارگت قیمت را به اندازه فاصله موج ۱ تا ۲ در نظر می‌گیریم یا پوزیشن را Trailing می‌کنیم. این استراتژی نسبت ریوارد به ریسک تقریباً ۲ به ۱ دارد و از ست‌آپ‌های خوب معاملاتی ما می‌باشد (شکل ۱۰.۱۹).



شکل ۱۰.۱۹: نقاط تسویه استراتژی GTS Pullback

۱۰.۱۹ ست‌آپ جی تی اس شارپ در زمان خبر

از تایم ۱ ساعت و ۶ دقیقه و ۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان ست‌آپ جی تی اس شارپ را توضیح می‌دهند.

زمان خبرها بسیار پر ریسک است چون به سختی می‌توان تشخیص داد که این خبر چه تاثیری می‌تواند بر بازار بگذارد لذا بهتر است افراد تازه‌کار در این زمان ترید نکنند. در ست‌آپ جی تی اس شارپ هدف، گرفتن خستگی قیمت است. بانک‌ها و بروکرها در زمان اعلام خبر نهایت تلاش خودشان را می‌کنند که استاپ‌تریدرها را زده و پول بیشتری از آنها به جیب بزنند به همین جهت گاهی حوالی خبر را گپ می‌کنند و این قضیه باعث ضرر می‌شود یا بازار نوسانی شده و استاپ‌ها خورده می‌شوند.

در ست‌آپ جی تی اس شارپ سعی می‌کنیم به جای این که روی خبرها تمرکز کنیم فقط از

الگوهای ترسیمی برای ورود و خروج سریع استفاده کنیم. برای استفاده از این استراتژی بهتر است صبر کنیم تا خبر تاثیر خود را گذاشته و تریدرها و بروکرها سودها و ضررها و بازی های خود را انجام دهند. افرادی که در جهت درست بازار متاثر از خبر پوزیشن باز کرده اند تارگت هایشان را با فاصله گذاشته اند و نباید فراموش کرد که قیمت بعد از برخورد به مجموعه ای از تارگت ها برمی گردد، پس ما باید این نقاط یعنی نقاطی که احتمالا تارگت قیمت بسیاری از بانک ها و تریدرهای بزرگ است را پیدا کنیم چون همان طور که اشاره شد بعد از تسویه پوزیشن های آنها قیمت دوباره به همان محدوده قبلی باز می گردد. باید الگوهای ترسیمی را قبل از اعلام خبر رسم کرد. رسم الگوهای ترسیمی تمرین و تجربه زیادی می خواهد. الگوهای ترسیمی که قیمت در گذشته چندین بار به آنها واکنش نشان داده است بسیار قابل اعتمادتر از الگوهایی هستند که دیده نمی شوند مانند پیوت ها. باید به یاد داشته باشیم که الگوهای ترسیمی را همه تریدرها می بینند و بر اساس آنها عمل یا تحلیل می کنند.



شکل ۱۱.۱۹: ست آپ جی تی اس شارپ در زمان خبر

در این استراتژی احتمالا الگوها با محل اعلام خبر فاصله داشته باشند ولی در هر صورت نزدیک ترین الگوها را رسم می کنیم. دقیقا در محل برخورد قیمت به خطوط با پوزیشن پندینگ

وارد بازار می‌شویم. نقطه استاپ را مطابق شکل در قیمت مطمئنی می‌گذاریم و ترجیحا باید استاپ‌های کوچک بگیریم تا در صورت اشتباه بودن پوزیشن با کمترین ضرر خارج شویم. در این استراتژی زمانی که پوزیشن به سود رفت سریع از پوزیشن خارج می‌شویم یا Trailing می‌کنیم (شکل ۱۱.۱۹).

از تایم ۱ ساعت و ۱۶ دقیقه و ۵۲ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان ست‌آپ‌های معاملاتی جی تی اس را روی چارت توضیح می‌دهند و بر اساس این ست‌آپ‌ها وارد پوزیشن می‌شوند.

فصل ۲۰

ویدئوی شماره ۲-۲۸: بخش دوم استراتژی GTS

۱.۲۰ مرحله دوم: استفاده از ابزارها و اندیکاتورها برای فیلتر کردن ورودی های اشتباه و تشخیص جهت درست بازار با استفاده از GTS Backup

آقای گلشاهیان مرحله دوم را به نام GTS Backup نام گذاری کرده اند چون در بازار به پشتیبان هایی برای حمایت از جهت پوزیشن گرفته شده نیاز داریم. ابتدا این سوال پیش می آید که چه عواملی در بازار تعیین کننده جهت قیمت هستند و چه عواملی باعث فریب معامله گران می شوند؟

۱.۱.۲۰ عوامل فریب معامله گران

این عوامل می توانند هم کمک کننده باشند و هم فریب دهنده که عبارتند از:

۱. روند Trend

۲. مومنتوم Momentum

۳. اشباع ها Over Bought / Over Sold

۴. کمال گرایی Prefectionism

۲۰.۱.۲۰ استراتژی GTS Backup

ماهیت حرکت در فیزیک چیست؟ چه چیزی باعث حرکت اجسام می‌شود؟

جواب این سوال در بازارهای مالی هم صدق می‌کند. تمام عوامل تکنیکالی و فاندامنتالی باعث راندن موتور حرکت قیمت به یک جهت می‌شوند. جواب این سوال انرژی است. ما باید انرژی ماشین بازار را بشناسیم و در جهت آن حرکت کنیم. آیا ما باید تک تک عوامل اقتصادی و فاندامنتال را بشناسیم و به تمام جزئیات اخبار و تحلیل وقایع اقتصادی برای وارد شدن به بازار مسلط باشیم؟ قطعاً جواب خیر است. هر اتفاقی که قرار است برای قیمت بیافتد در چارت نشان داده می‌شود. وظیفه ما پیدا کردن انرژی غالب قیمت با ابزارهای موجود در چارت و همسو شدن با آن است.

اندازه گیری انرژی در چارت

انرژی های حرکت دهنده قیمت چه هستند و چگونه می‌توانیم انرژی موجود در چارت و جهت آن انرژی را تعیین کنیم؟

انرژی های قیمت و تشخیص آنها توسط چند ابزار و یا اندیکاتور:

روند: یکی از انرژی های قیمت است که به وسیله خط روند، میانگین متحرک برای ساخت خط روند دینامیک و مکدی قابل تشخیص است.

مومنتوم: انرژی بعدی قیمت است که با میانگین متحرک آن را تشخیص می‌دهیم.

خستگی قیمت: عامل بعدی است که با RSI قابل تشخیص است.

در مرحله دوم تشخیص انرژی و جهت قیمت به روش هایی که آموزش داده خواهد شد را یاد می‌گیریم و سپس تمام این مراحل و اطلاعات را به آموزش های مرحله اول اضافه می‌کنیم.

خط روند:

مشخص کننده گرایش احتمال آتی قیمت و جهت غالب انرژی است.

انواع خط روند:

۱. خط روند استاتیک (ساکن)

۲. خط روند دینامیک (متحرک)

خط روند دینامیک دو مزیت نسبت به خط روند استاتیک دارد:

۱. اشتباهات شکسته شدن غیر واقعی خط روند استاتیک را مرتفع می‌کند.

۲. در مناطق برگشتی که امکان کشیدن خط روند استاتیک نیست و قیمت خط روندی نساخته است به ما کمک می‌کند تا جهت قیمت را تشخیص دهیم.

نحوه رسم خط روند دینامیک در کنار خط روند استاتیک در چارت:

از تایم ۲۲ دقیقه و ۳۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان نحوه رسم خط روند دینامیک در کنار خط روند استاتیک را در چارت توضیح می‌دهند.

هیچ دوره مشخصی به عنوان دوره مرجع میانگین متحرک وجود ندارد و باید با تجربه آن را به دست آورد ولی باید از دوره بالای دوره ۱۰۰ استفاده کرد. آقای گلشاهیان برای چارت طلا از SMA 144 استفاده می‌کنند. خط روند استاتیک خط صاف و مورب یا افقی است و خط روند دینامیک میانگین متحرک با دوره بالای ۱۰۰ می‌باشد. برای اطمینان بیشتر باید در نظر داشت که خط روند استاتیک و دینامیک باید تأیید کننده همدیگر باشند.

آیا خطوط روند دینامیک و استاتیک برای تشخیص جهت قیمت کافی هستند؟

خطوط روند همزمان با ایجاد یک دید برای تعیین جهت قیمت، می‌توانند تریدرها را هم به اشتباه بیندازند. در خیلی از موارد که قیمت با خط روند فاصله دارد تعیین جهت روند بسیار مشکل است. یکی از عوامل فریب تریدرها در حین نقش حمایت گری، خطوط روند هستند. در خیلی از حالت ها تشخیص روند و اینکه در چه جهت وارد بازار شد برای معامله گر مشکل است. بیش از ۹۰٪ معامله گران در تشخیص جهت فعلی قیمت دچار اشتباه می‌شوند. پس به جز خطوط روند راهنمای دیگری برای تشخیص روند و انرژی غالب قیمت در مواردی که قیمت با خط روند فاصله دارد لازم است. همینطور عوامل دیگری نیاز است که نشان دهند آیا قیمت خط روند را خواهد شکست یا نه.

در روش جی تی اس برای تشخیص جهت روند از ابزار مکدی استفاده می‌کنیم به طوری که با یک نگاه به چارت بتوانیم جهت غالب قیمت را پیدا کنیم.

استفاده از مکدی برای تعیین جهت قیمت:

از تایم ۴۶ دقیقه و ۵۸ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان استفاده از مکدی برای تعیین جهت قیمت را در چارت توضیح می‌دهند.

یکی از بهترین نشانگرهای خط روند استفاده از اندیکاتور MACD در تایم چهار ساعته است. در تایم ۴ ساعته از اندیکاتور MACD به عنوان جهت غالب قیمت استفاده می‌کنیم. بنابراین هر زمان برای تعیین جهت روند به مشکل برخوردیم MACD را در تایم ۴ ساعته بررسی می‌کنیم، که نسبت به خط صفر در بالا یا پایین خط صفر قرار دارد و آیا در حال تغییر فاز نسبت به خط

صفر است یا خیر. جهت MACD جهت انرژی غالب قیمت را نشان می‌دهد. پس یکی از اولین کارهای ما قبل از وارد شدن به بازار بررسی MACD در تایم H4 است.

لازم به یادآوری است که یکی از تارگت های ما در برگشت قیمت، سطح $38/2\%$ موج کلی قبلی است و همچنین تمامی نقاطی که در گذشته قیمت به آنها واکنش نشان داده است در آینده هم می‌توانند نقاط واکنش باشند.

عامل فریبنده:

اصلی ترین عامل فریب در بازارهای دارای چارت که باعث وارد شدن اکثر معامله گران در جهت عکس روند و نهایتاً ضرر به معامله گر می‌شود مومنتوم است. یکی از بهترین عوامل موفقیت در بازار نیز تشخیص درست مومنتوم و بکارگیری آن در وارد شدن به بازار است. تشخیص درست مومنتوم هم جلوی ضررهای احتمالی برای وارد شدن در خلاف جهت قیمت را می‌گیرد و هم برای گسترش سود در جهت قیمت مورد استفاده قرار می‌گیرد. در صورت تشخیص درست مومنتوم و ترکیب آن با روند، بیش از 80% ورودی های اشتباه به بازار اصلاح خواهند شد.

هیچ ابزاری برای تشخیص درست مومنتوم وجود ندارد و می‌توانیم برای تعیین انرژی سوختی بازار و مومنتوم از روش هایی که توسط آقای گلشاهیان بر روی چارت توضیح داده خواهند شد استفاده کنیم.

از تایم ۵۹ دقیقه و ۱۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان روش های خودشان برای تشخیص مومنتوم را در چارت توضیح می‌دهند.

تنها ابزاری که قیمت را در واحد زمان اندازه گیری می‌کند میانگین متحرک ها هستند پس آقای گلشاهیان از آنها برای تشخیص مومنتوم استفاده می‌کند. میانگین متحرک ها تمایل قیمت را در دوره ای که انتخاب می‌کنیم مشخص می‌کنند. لازم به یادآوری است که ماهیت اکثر اندیکاتورها بر اساس میانگین متحرک است. آقای گلشاهیان از دو میانگین متحرک^۱ استفاده می‌کنند، یکی با دوره ۳۴ و به رنگ قرمز برای نشان دادن قدرت فروشندگان و یکی با دوره ۲۱ و به رنگ سبز برای نشان دادن قدرت خریداران. هر زمان میانگین متحرک قرمز بالاتر باشد مارکت در دست فروشندگان است و هر زمان میانگین متحرک سبز بالاتر باشد مارکت در دست خریداران است. این دو میانگین متحرک کاملاً جدا از میانگین متحرک خط روند دینامیک هستند.

^۱ مطابق تایم ۷ دقیقه و ۵ ثانیه ویدئوی لایو تریدینگ شماره دو آقای گلشاهیان که در ۳۱ اکتبر ۲۰۱۹ به اشتراک گذاشته اند، این دو میانگین متحرک باید میانگین متحرک نمایی یا Exponential یعنی EMA باشند.

لینک ویدئو https://www.youtube.com/watch?v=zh_pzp0iwfQ

آقای گلشاهیان در مثال چارت در مورد میانگین متحرک به نکته مفیدی اشاره می‌کند که اگر قیمت خط روند استاتیک را مثلاً به سمت پایین شکسته باشد طبیعتاً باید پوزیشن فروش باز کنیم ولی چون میانگین متحرک سبز بالاتر از میانگین متحرک قرمز است پس پوزیشن را باز نمی‌کنیم و در همان لحظه MACD هم بالای صفر است پس پوزیشن فروش فعلاً کنسل است. این نکته اشاره به اهمیت توجه به مومنتوم قبل از باز کردن پوزیشن دارد. در ادامه موقعیت مثال روی چارت، در نقطه ای وارد پوزیشن فروش می‌شویم که MACD زیر خط صفر باشد و میانگین متحرک قرمز بالای میانگین متحرک سبز قرار داشته باشد. نقطه Stop Loss را آخرین و بالاترین High در نظر می‌گیریم و پوزیشن را تا جایی ادامه می‌دهیم که MACD بالای خط صفر بیاید و میانگین متحرک سبز هم بالای میانگین متحرک قرمز قرار بگیرد.

از نکات مهمی که آقای گلشاهیان به آنها اشاره می‌کنند عبارتند از این که هر چه فاصله قیمت از این دو میانگین متحرک بیشتر باشد مومنتوم قیمت بیشتر است. زمانی که قیمت داخل خطوط میانگین متحرک سبز و قرمز باشد نشان از نبود مومنتوم در بازار است. زمانی وارد بازار می‌شویم که هم روند داشته باشیم و هم مومنتوم. نباید فراموش کرد که در ضمن داشتن روند و مومنتوم باید موقعیت ورود مطابق با استراتژی هم داشته باشیم. توجه به فاصله قیمت از خطوط میانگین متحرک قرمز و سبز به ما کمک می‌کند تا وارد پوزیشن‌های اشتباه نشویم.

خستگی بازار:

قیمت اکثراً در نقاطی که به تارگت خود می‌رسد با خستگی همراه می‌شود. این خستگی بیشتر با واگرایی، کاهش مومنتوم و رنج شدن بازار همراه است. با ابزار RSI می‌توان پیش از بروز خستگی بازار آن را تشخیص داد.

تشخیص خستگی بازار توسط اندیکاتور RSI

از تایم ۱ ساعت و ۲۰ دقیقه و ۱۴ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان تشخیص خستگی بازار توسط اندیکاتور RSI را در چارت توضیح می‌دهند.

آقای گلشاهیان از RSI با دوره ۱۴ استفاده می‌کنند. واگرایی در RSI به خوبی می‌تواند خستگی بازار را تشخیص دهد ولی واگرایی به تنهایی دلیل کافی برای ورود نیست.

۲.۲۰ ترکیب مراحل اول و دوم بر روی چارت

در مواقع خبرهای خیلی مهم مثل NFP^۲ و نرخ بهره از این روش استفاده نکنید چون این خبرها با ایجاد نوسانات شدید ترکیب منظم قیمت را بهم می‌ریزند. بعد از خبر و هضم خبر توسط بازار، دوباره می‌توانید نظم حاکم در بازار را به خوبی تشخیص دهید. در زمان خبرها از روش GTS Sharp استفاده کنید.

از تایم ۱ ساعت و ۲۷ دقیقه و ۵۳ ثانیه این ویدئو آقای گلشاهیان ترکیب مراحل اول و دوم را در چارت توضیح می‌دهند و به صورت زنده پوزیشن‌گیری می‌کنند.

۳.۲۰ مدیریت سرمایه استراتژی GTS

همان طور که روش و استراتژی آقای گلشاهیان با سایر روش‌ها تفاوت دارد طبیعتاً مدیریت سرمایه متفاوتی هم می‌طلبد و ما از سیستم مدیریت سرمایه GTS^۳ استفاده می‌کنیم. دلیل شکست بیشتر تریدرها ندانستن تحلیل تکنیکال نیست بلکه نداشتن نظم مشخص در مدیریت سرمایه است. میزان ریسک باید بر اساس میزان استاپ مشخص شود.

۱.۳.۲۰ قانون اول

حفظ سرمایه اولیه در اولویت قرار دارد و همیشه شروع به کار در یک حساب تازه تاسیس باید با کمترین ریسک ممکن صورت گیرد تا رسیدن حساب به سوددهی، ریسک به هیچ عنوان افزایش نمی‌یابد.

۲.۳.۲۰ قانون دوم

میزان ریسک هر پوزیشن ۱ درصد در نظر گرفته می‌شود یعنی پوزیشن‌گیری بدون استفاده از اهرم است.

نحوه محاسبه ریسک ۱ درصد

به ازای هر ۱۰۰۰ دلار سرمایه ۱۰۰۰ واحد قیمت یعنی ۰/۰۱ لات پوزیشن‌گیری می‌کنیم.

^۲ گزارش Non-Farm Payroll یا اشتغال غیر کشاورزی

^۳ GTS Money Management System

مثال:

برای ۵۰۰۰ دلار ۰/۰۵ لات

برای ۷۰۰۰ دلار ۰/۰۷ لات

برای ۵۰۰ دلار ۰/۰۰۵ لات است و چون معمولاً در بروکرها حساب زیر «مینی» ارائه نمی‌شود و حداقل حجم ۰/۰۱ لات است پس ریسک هر پوزیشن ۲ درصد می‌شود و چون چاره ای برای کم کردن حجم وجود ندارد، تعداد پوزیشن گیری کمتر می‌شود.

تمام راز این بازار کنترل ریسک است. تریدر حرفه ای در تعیین حجم پوزیشن ها نظم دارد و به صورت جهشی افزایش حجم نمی‌دهد.

روش افزایش سوددهی در مدیریت سرمایه

بر اساس مدیریت سرمایه در این روش امکان افزایش سوددهی پس از رشد ۲۰ درصدی از حساب به این صورت امکان پذیر است که پس از رشد ۲۰ درصدی حساب، ریسک هر پوزیشن با شروط زیر به ۲ درصد افزایش می‌یابد:

۱. در صورت خوردن استاپ هر پوزیشن ۲ درصدی، ریسک پوزیشن بعد به ۱ درصد کاهش می‌یابد.

۲. در صورت تی پی خوردن پوزیشن ۲ درصدی، ریسک پوزیشن بعد همان ۲ درصد باقی می‌ماند.

۳.۳.۲۰ قانون سوم

نصف پوزیشن های در سود به اندازه ی استاپ تسویه می‌گردند تا کل پوزیشن در حالت بدون ریسک قرار گیرد که در صورت خوردن استاپ مجموع جبری صفر می‌شود.

تبصره

در حساب های کوچک امکان خارج شدن از نصف پوزیشن به دلیل موجودی پایین یا استفاده از حداقل حجم وجود ندارد. در صورت عدم امکان خارج شدن نصف پوزیشن در سود دو حالت زیر توصیه می‌شود:

(الف) کل پوزیشن در تی پی اولی تسویه شود و در موقعیت بعدی مجدداً ورود انجام شود.

(ب) در صورت باز نگه داشتن پوزیشن، استاپ در نقطه ورود قرار گیرد تا نهایتاً پوزیشنی که در سود رفته، در سود یا در نقطه ورود بدون ضرر تسویه شود.

۴.۳.۲۰ قانون چهارم

در صورت گرفتن یک پوزیشن و داشتن پوزیشن باز، گرفتن پوزیشن در جفت ارزی یا کالای دیگر مجاز نیست مگر این که پوزیشن اول بدون ریسک شده باشد. اضافه کردن حجم فقط به پوزیشن در سود مجاز است. داشتن تعداد زیاد پوزیشن های باز با داشتن یک پوزیشن با حجم مجموع آنها هیچ فرقی ندارد و اشتباه است. وقتی پوزیشن باز شد باید منتظر ماند تا یا استاپ بخورد یا تی پی، سپس وارد پوزیشن بعدی می شویم.

کل تنظیمات چارت آموزش های ارائه شده به صورت یک تمپلت با دستورالعمل نصب تهیه شده است. در صورت نیاز به تمپلت ها به آدرس ایمیل زیر مکاتبه کنید:

Golshahian@yahoo.com

آدرس ویدئوهای آقای گلشاهیان:

www.facebook.com/amoozesh.forex

www.youtube.com/rzgtrader

آدرس کانال تلگرام آقای گلشاهیان:

<https://t.me/rzgtrader>

موفق و پر سود باشید.

پایان