



ستاپ ترید بر اساس پیوت سعید خاکستر

گردآورنده:

پژمان نباتی

به نام خدا

پیشگفتار

اهمیت و داشتن یک استراتژی مناسب در بازارهای مالی بعنوان یک نقش تعیین‌کننده در موفقیت بر هیچ‌کس پوشیده نیست. اما متأسفانه تا کنون مرجع مناسبی که نیازهای سرمایه‌گذاران را در این بخش به طرز شایسته‌ای مرتفع کند وجود نداشته است. کتب، جزوات و فایل‌های آموزشی که تا به امروز در اختیار سرمایه‌گذاران قرار گرفته است را می‌توان به دودسته کلی تقسیم کرد: دسته اول منابعی هستند که توسط برخی افراد حاضر در این عرصه و بدون هیچگونه رزومه خاصی نوشته یا منتشر شده است که مطمئناً به هیچ‌وجه قابل اتکا نیستند. دسته دوم که تعدادشان اندک است منابعی هستند که توسط افراد مشهور و حاضر در بازارهای بین‌الملل در اختیار عزیزان سرمایه‌گذار قرار داده شده که متأسفانه بسیاری از آن‌ها در انتقال مفاهیم و عمیق شدن در مطلب عموماً عملکرد مطلوبی نداشته است.

به همین جهت پس از گذراندن دوره آموزش ویدیویی استاد صاحب‌سبک جناب آقای سعید خاکستر و نبود هیچگونه منبع نوشتاری از جزئیات روش تریدی ایشان و همچنین نیاز مبرم علاقمندان به داشتن یک استراتژی قابل اتکا، بر آن شدم تا از میان بیش از ۲۰ ستاپ ارائه شده از سوی ایشان، یکی از مهمترین آنان را که ستاپ پیوتی است برگزینم و با بهره‌گیری از ویدیوهای آموزشی ایشان و پرسش و پاسخ‌های موجود در گروه آموزشی ایشان با نام تریگر پرایس اکشن، منبعی حتی‌الامکان جامع و یکپارچه را در اختیار شما علاقمندان قرار دهم.

لازم است از جناب آقای سعیدخاکستر و زحمتهای دلسوزانه ایشان نهایت تشکر و قدردانی را داشته باشم. امیدوارم ایشان بنده را لایق گردآوری این اثر بدانند و کم و کاستی‌هایش را بر من ببخشند.

پژمان نباتی

مهر ۹۸

چکیده

منبع پیش رو مشتمل بر ۱۱ فصل است. در فصل اول انواع سرمایه‌گذاری از حیث سود و میزان ریسک‌پذیری و همچنین ذهنیت قیمت و گام‌های حرکتی مورد انتظار از بازار را بررسی خواهیم کرد. در فصل دوم بحث از حالت تئوری خارج شده و نخستین کاربرد گام‌های حرکتی و نتیجتاً ایجاد پیوت و نحوه تشخیص آن‌ها مطرح شده است. فصل سوم به استفاده از پیوت‌ها در تعیین محدوده‌های حمایتی و مقاومتی می‌پردازد. در فصل چهار، مسیر و اجزای روند و رویکرد مولتی تایم بودن را خواهیم داشت.

در فصل پنجم، از زاویه‌ای جدید به مقوله و مفهوم شکست یک سطح نگاه خواهیم کرد. تمام شرایط لازم برای تشخیص درست شکست یک سطح در قالب موضوعی تحت عنوان پکیج شکست بررسی خواهد شد. در آنجا گفته می‌شود که چیزی تحت عنوان شکست جعلی وجود ندارد و همچنین در فصل ششم تمام آن شکست‌هایی را که ذهنیت شکست جعلی ایجاد می‌کنند در حالیکه شکست دقیقاً رخ داده است، تحت عنوان الگوهای SO4 معرفی خواهند شد. فصل هفتم الگوهای کندلی و به طور خاص الگوهای برگشت به روند را خواهیم داشت. توصیه می‌شود این فصل به صورت اجمالی و گذرا خوانده شود چرا که ماحصل تمام این فصل (نگاه از یک زاویه دیگر) در مبحث پیوت در فصل ۲ گفته و همه مباحث در قوانین تشکیل پیوت در آنجا گنجانده شده است. مقدمه‌ای بر سطوح عرضه و تقاضا و انواع دیدگاه‌ها در تعیین این نواحی چیزی است که در فصل هشتم به آن پرداخته شده است و در فصل نهم و دهم، این نواحی حاصله از الگوهای شکست و برگشتی با جزییات بیشتری گفته خواهد شد. و نهایتاً فصل یازدهم، که تمام مطالب گفته شده تا قبل از آن، مقدمه‌ای برای شروع این فصل است. انواع ستاپ‌های ترید با تمرکز ویژه بر ستاپ پیوتی، انواع دیدگاه‌های ورود (کلاسیک با تریگرلاین یا اردرگذاری در نواحی پرایسی)، انواع پیوت‌ها و شرایط هر یک و ... بیان خواهد شد.

به امید آنکه این منبع مورد استفاده تمامی شما علاقمندان قرار بگیرد.

فهرست مطالب

عنوان	صفحه
فهرست مطالب	أ
فهرست شکل ها	ت
فصل ۱- ذهنیت قیمت و میانگین واقعی نوسانات	۲
فصل ۲- شناخت پیوت های قیمتی و تعیین محدوده های سطوح حمایت و مقاومت	۱۰
۱-۲- نحوه به دست آوردن محدوده پیوتها	۱۲
۲-۲- نحوه تشخیص تایم فریم یک پیوت	۱۵
۳-۲- پیوتهای مینور و مازور	۱۸
فصل ۳- درجه اهمیت سطوح حمایت و مقاومت	۲۰
فصل ۴- روندهای قیمتی (مسیر، اجزا، تایم)	۲۵
فصل ۵- معرفی انواع شکست و تشخیص شکست یک سطح	۲۹
فصل ۶- مفهوم و ماهیت شکست	۳۵
فصل ۷- الگوهای کندلی برگشت به روند	۳۸
۱-۷- الگو یا کندل های خنثی:	۳۹
۲-۷- الگوهای برگشت به روند:	۳۹
۱-۲-۷- الگوهای برگشت تکی	۳۹
۲-۲-۷- الگوهای برگشت دوتایی	۴۱
۳-۲-۷- الگوهای سه تایی	۴۲
فصل ۸- مقدمه های بر عرضه و تقاضا	۴۵
۸-۱- انواع دیدگاهها در تعیین نواحی عرضه و تقاضا:	۴۶
۱-۱-۸- دیدگاه اول	۴۶
۸-۱-۲- دیدگاه دوم	۴۸
۸-۱-۳- دیدگاه سوم	۴۸
فصل ۹- بررسی الگوی حاصل از شکست RBR/DBD	۵۰

فصل ۱۰- بررسی الگوی پرایسی حاصل از برگشت RBD/DBR.....	۵۷
فصل ۱۱- ستاپهای ترید و تریگرهای ورود.....	۶۰
۱۱-۱- ستاپ ماهیت	۶۰
۱۱-۲- ستاپ شکست	۶۲
۱۱-۳- ستاپ پیوت	۶۳
۱۱-۴- پرسش و پاسخ	۶۸
۱۲-۴- پرسش و پاسخ	۶۹

فهرست شکل‌ها

عنوان	صفحه
شکل ۱-۱ گامهای حرکتی اندیکاتور ATR با پریودهای مختلف	۵
شکل ۲-۱ فاصله حرکتی ۵۰۰ پیپی و حداقل زمان مورد نیاز برای رسیدن به آن	۵
شکل ۳-۱ ATR برابر با ۸۴	۶
شکل ۴-۱ ATR سه روزه، هفت روزه و میانگین	۷
شکل ۵-۱ انتظار بسته شدن یک کندل به اندازه ATR حدوداً ۹۰ پیپی	۸
شکل ۱-۲ سه کندل در تایم بالا نمود یک روند در تایم پایینتر است	۱۱
شکل ۲-۲ ATR هر تایم فریم	۱۱
شکل ۳-۲ مشخص کردن انتهایترین لولها در چارت	۱۳
شکل ۴-۲ محدوده و رنج ناحیه پیوت	۱۳
شکل ۵-۲ تطبیق محدوده با ATR تایم فریم مربوطه	۱۴
شکل ۶-۲ مشخص کردن قله یا درهها	۱۵
شکل ۷-۲ بررسی طول حرکت	۱۵
شکل ۸-۲ رسم خط فرضی (در مواردی که مسترکندل نداریم)	۱۶
شکل ۹-۲ نمونه آرایشهای تشکیل پیوت	۱۷
شکل ۱۰-۲ پیوت ماژور و مینور	۱۹
شکل ۱-۳ وجود یا عدم وجود پیوت	۲۰
شکل ۲-۳ مسیر حرکت قبلی در تایم هفتگی	۲۱
شکل ۱-۴ انتظار حرکت سایه یا رنج بعد از شکست خط روند	۲۶
شکل ۲-۴ حرکت سایه و پیوت پولبکی بعد از شکست خط روند	۲۶
شکل ۱-۵ پولبک کندلی بعد از شکست	۲۹
شکل ۲-۵ پولبک موجی	۳۰
شکل ۳-۵ پولبک روندی	۳۰
شکل ۴-۵ منشا حرکت پس از شکست	۳۱
شکل ۵-۵ کندل شکست قابل قبول	۳۲
شکل ۶-۵ آخرین آیتم در تکمیل پکیج شکست	۳۳
شکل ۷-۵ ناحیه و سطح ورود	۳۳

شکل ۶-۱	سطح خودکشی	۳۶
شکل ۶-۲	انواع SO4	۳۶
شکل ۷-۱	پین بار	۳۹
شکل ۷-۲	تشکیل شوتینگ استار بر روی یک سطح	۴۰
شکل ۷-۳	روند نزولی تایید شده و دو سطوح FTC به نشانه ناتوانی در ادامه روند صعوی	۴۱
شکل ۷-۴	الگوی برگشتی دوکندلی	۴۲
شکل ۸-۱	مفهوم اینگلف (نفوذ به بیرونیترین سطح یک ناحیه)	۴۶
شکل ۸-۲	لگهای حرکتی از نظر قدرت	۴۶
شکل ۸-۳	دیدگاه اول در تعیین محدوده عرضه و تقاضا (در اینجا عرضه)	۴۶
شکل ۸-۴	محدوده عرضه و تقاضا در دیدگاه اول	۴۷
شکل ۸-۵	تعداد برخورد به سطوح عرضا و تقاضا	۴۷
شکل ۸-۶	شرط لازم برای استناد به نواحی عرضه و تقاضا در دیدگاه دوم	۴۸
شکل ۸-۷	نواحی عرضا و تقاضا حاصل از شکست مطابق با دیدگاه سوم	۴۸
شکل ۹-۱	حرکت رالی بیس رالی (RBR)	۵۰
شکل ۹-۲	FTR	۵۲
شکل ۹-۳	ETR	۵۲
شکل ۹-۴	CTR	۵۳
شکل ۹-۵	CBO	۵۳
شکل ۹-۶	ارتباط مستقیم میزان برگشت قیمت از کندل لانگ بار شکست با شدوی این کندل	۵۴
شکل ۱۰-۱	نمونه‌های از یک حرکت رالی بیس دراپ RBD	۵۷
شکل ۱۰-۲	تقسیم ناحیه بیس در حرکت رالی بیس دراپ	۵۸
شکل ۱۱-۱	سطح مقاومتی مربوط به تایم هفتگی	۶۱
شکل ۱۱-۲	رسماً تریگرلاین در تایم ترگیر (چهارساعته)	۶۱
شکل ۱۱-۳	تریگرلاین	۶۲
شکل ۱۱-۴	شکست سطح حمایتی تایم روزانه	۶۲
شکل ۱۱-۵	رسم تریگرلاین در تایم ترگیر	۶۳
شکل ۱۱-۶	اینگلف خط فرضی و تشکیل پیوت روزانه	۶۴
شکل ۱۱-۷	تریگرلاین، نقطه ورود، و استاپ لاس	۶۴
شکل ۱۱-۸	نحوه تارگتگذاری	۶۵

- شکل ۹-۱۱ پیوت پولبکی ۶۶
- شکل ۱۰-۱۱ پیوت تسویه ۶۶
- شکل ۱۱-۱۱ پیوت ریورسال یا برگشتی ۶۷
- شکل ۱۲-۱۱ دو سطح FTC سمت راست: قابل استناد، سمت چپ: غیرقابل استناد ۶۸
- شکل ۱۳-۱۱ بیس پیوت ۷۱
- شکل ۱۴-۱۱ پیوتی که حتی اگر زیر مستر کندل بسته شود ارزش ترید در لحظه تشکیل ندارد.... ۷۲

فصل اول

ذهنیت قیمت و میانگین واقعی نوسانات

فصل ۱- ذهنیت قیمت و میانگین واقعی نوسانات

قبل از پرداختن به این مبحث اجازه دهید اندکی در مورد ریسک های موجود در سرمایه گذاری بحث میکنیم و بطور خلاصه انواع سرمایه گذاری را براساس میزان ریسک و سود بصورت زیر لیست کنیم:

- ۱- سرمایه گذاری در بانک
- ۲- سرمایه گذاری برای اوراق قرضه
- ۳- بازار خرید و فروش سهام و بورس
- ۴- بازارهای سکه و آتی و طلا داخلی
- ۵- خرید و فروش ارز در بازارهای داخلی
- ۶- خرید و فروش در بازار ارز بین الملل

کمترین ریسک مربوط به سرمایه گذاری در بانک است و بیشترین ریسک در بازار بین الملل میباشد. ورود به بازار بین الملل نیازمند تلاش، زحمت، پشتکار و دانش برای رسیدن به سود مستمر دارد. اگر خود را فردی با چنین ویژگی ها می دانید می توانید در این بازار ورود کنید. در غیر اینصورت، این بازار فوق العاده ریسکی و خطرناک است. این بازار برای کسانی که به قصد امتحان و تفریح در آن ورود می کنند فوق العاده خطرناک و اعتیادآور است طوری که همانند یک باتلاق، بیرون آمدن از آن سخت و شاید شما را مادام العمر به سمت دست و پا زدن در آن سوق دهد.

بارها مشاهده شده این قضیه به قدری خطرناک بوده که منجر به فروپاشی بنیاد خانواده ها شده است. ذکر این نکته قابل تامل است که مقصر اصلی این پیشامد هرگز بازار نیست، بلکه تصورات خیالی فرد معامله کننده با افکار به اصطلاح "یک شبه پولدار شدن" متوجه چنین جریانی است. با چنین تفکری هرگز وارد نشوید و یا در صورت ورود نیز هر زمان احساس کردید که قادر به نتیجه گرفتن نیستید فرار را بر قرار ترجیح دهید. جلوی ضرر را هر چه زودتر گرفتن منفعت است.

در صورتیکه شما تمام این شرایط را می دانید و آن توانایی لازم را در خود می بینید، می توانید ورود کنید. از تجربیات دیگران استفاده کنید. این بازار بازاری است که همه می خواهند خودشان تجربه کنند

و بارها مواردی بوده و مشاهده شده که اشخاصی در این بازار حضور داشتند که حتی معنی واژه "pip" را نمی‌دانستند و ورود کردند! شما هرگز آن فردی نشوید که به آن تجربه نقره داغ شدن و سر به سنگ خوردن برسد.

یک آمار ضمنی در این بازار وجود دارد که گفته می‌شود ۹۵ درصد افراد بازنده هستند. نکته جالب‌تر اینجاست که تمام آن ۹۵ درصد خود را جزء ۵ درصد موفق می‌دانند!!!

اجازه بدهید کم کم مباحث را به سمت بحث اصلی خودمان یعنی ذهنیت قیمت و میانگین واقعی نوسانات ببریم. با امید به آن که مباحث گفته شده تلنگر لازم را به شما زده باشد. بنده اکیدا توصیه می‌کنم حتما و لطفا ویدیوی نهم از سری ویدیوهای استاد عزیزمان جناب خاکستر را مشاهده بفرمایید. و اما ذهنیت قیمت؛ ذهنیت قیمت در تمام بازارها وجود دارد. شما فرض کنید قصد خرید یک کالا را دارید. مطمئنا هر کدام از شماها در مورد آن کالا یک ذهنیت قبلی و قیمتی دارید. این ذهنیت به چه صورت شکل گرفته؟ فرض کنید قصد خرید یک کالا همچون یک کیلو مرغ را دارید. همچنین فرض کنید نرخ یک کیلو مرغ برابر با ۸۰۰۰ تومان است. این قیمت براساس شرایط جامعه مثل نرخ تورم، نرخ بیکاری، مسائل سیاسی، اقتصادی، اقلیمی و... مشخص شده و این ذهنیت برای ما اینگونه شکل می‌گیرد که قیمت ۸۰۰۰ تومان قیمت معقولی است. حال اگر این قیمت بیش از حد معقول افزایش یابد آن‌گاه شما بعنوان خریدار در مقابل این افزایش، واکنش و مقاومت نشان می‌دهید.

بطور کلی این بازار دو طرف دارد؛ خریدار و فرشنده. اینکه شما در کدام سمت هستید مطمئنا سمت مقابل بصورت مجموعه ای که قرار است کالایش را عرضه کند شما را بررسی می‌کند.

ذهنیت قیمت یک چیز از پیش تعریف شده در ذهن شماست که خوب یا بد بودن، بالا یا پایین بودن قیمت یک کالا را مشخص می‌کند.

دیدگاه‌های مختلفی در بازار از جمله فاندامنرال، تکنیکال، تحلیل بین بازاری و ... وجود دارد. ما در استراتژی خودمان هیچگونه کاری به دیدگاه فاندامنرال نداریم. به هیچ عنوان به اخبار کاری نداریم. فقط و فقط تکنیکال کار می‌کنیم. تمام تمرکز ما بر چارت و قیمت است. اعتقاد ما همان جمله معروف "همه چیز در قیمت نهفته است" می‌باشد. اما به چه شکل؟ گذشته چراغ راه آینده است اما کو چشم بینا؟! ما می‌خواهیم با قیمت پیش برویم. اولین چیزی که در این مسیر مهم است توانایی حرکت آن کالا، شاخص و یا ارز می‌باشد.

اجازه دهید برگردیم به همان مثال مرغ! قیمت مرغ یک شبه نمی‌تواند خودش را از ۸۰۰۰ به ۸۰۰۰۰ تومان برساند. حتی اگر جنگ جهانی سوم شود! اما می‌تواند طی یک زمان کمتر و در گام‌های

مشخصی خودش را به آن قیمت برساند. این توان و یا گام حرکتی براساس ذهنیتی است که ما برای آن قائل هستیم.

یا در مثالی دیگر فرض کنید توان حرکتی هر فرد در هر روز به میزان ۳ کیلومتر است. حال اگر این فرد این مسافت را با دویدن در فاصله زمانی کمتری طی کند، مطمئناً این فرد پس از طی این مسیر نیاز به توقف و استراحت دارد تا یک تعادل ایجاد شود.

گام های حرکتی کالاهای مختلف متفاوت است. گام حرکتی مورد انتظار برای طلا مطمئناً با مثلاً جفت ارز یورو دلار متفاوت است. چرا که هر کدام از این ها متناسب با گام حرکتی خودشان حرکت می کنند و مجبور هستند همیشه در تعادل باشند. این متعادل بودن، بیس و مبنای دیدگاه ماست. بعنوان مثال فرض کنید قیمت ۱۵۰ درصد میانگین خودش را طی کرده است. در این حالت حرکت بعدی قیمت بایستی ۵۰ درصد میانگین باشد تا به این نحو خودش را به آن تعادل و میانگین اصلی برساند.

از الان به بعد میتوانیم این انتظار را داشته باشیم بازاری که در حالت سایید، فشردگی (cp) و کمتر از میانگین گام حرکتیش در حال حرکت است، بزودی یک حرکت شارپ، یک حرکت با مومنتوم و فراتر از میانگین خودش خواهد داشت. ما در اینجا برای پیدا کردن توان حرکتی ارزها از اندیکاتور ^۱ATR (میانگین واقعی نوسانات) استفاده می کنیم.

برای مثال در شکل ۱-۱ که مربوط به جفت ارز EURUSD در تایم فریم روزانه است، اندیکاتور ATR با پیرو ۱۰ روزه عدد ۸۲ را نشان داده و این عدد در فرمول های مختلف اعداد ۸۶، ۸۳ و ۸۷ است.

^۱Average True Range



شکل ۱-۱ گام‌های حرکتی اندیکاتور ATR با پریودهای مختلف

که با چند پیپ اختلاف نزدیک به هم هستند. ما در اینجا انتظار حرکت‌های ۸۰ پیپی را داریم. اگر فردا روزی یک اردر (Order) بای (Buy) یا سل (Sell) را گذاشتیم نباید انتظار تارگت ۱۰۰۰ پیپی را داشته باشیم. این ارز بصورت میانگین در هر روز ۸۰ پیپ حرکت می‌کند و تازه اینکه ۸۰ پیپی که با روزهای قبلش همپوشانی دارد. (دائم در حال بالا یا پایین رفتن است)



شکل ۲-۱ فاصله حرکتی ۵۰۰ پیپی و حداقل زمان مورد نیاز برای رسیدن به آن

شکل ۲-۱ را مشاهده کنید. فرض کنید قیمت بخواد به سطح مورد انتظار با فاصله ۵۰۰ پیپی برسد. ما در بهترین حالت (یعنی فشردگی قبل از حرکت) انتظار زمان یک هفته ای را برای آن داریم. اما اگر نقطه ورود ما برای تارگت مورد نظر بعد از یک حرکت شارپ باشد این بار نباید انتظار یک

هفته‌ای داشته باشیم. در اینجا قیمت بایستی برای رسیدن به تعادل مورد نظر استراحت کند. بنابراین از این به بعد ما از ATR و گام حرکتی در جاهای مختلف استفاده خواهیم کرد. ما به دنبال رسیدن به یک رنج مشخصی از نظر ذهنیت هستیم که همان گام حرکتی یا توان حرکتی است. فرض کنید در یک روز یک کندل ۲۰۰ پیپی داریم. در روز دیگر کندل ما ۳۰ پیپی می‌شود و در روز بعد به ۵۰۰ پیپی می‌رسد. ما برای اینکه به یک حد تقریباً ثابت برسیم، از اندیکاتور ATR بهره می‌بریم. این اندیکاتور ATR، رنج واقعی هر کندل را مطابق با یکی از چهار فرمولی که برایش تعریف شده، محاسبه می‌کند و در مرحله بعد از اعداد بدست آمده میانگین می‌گیرد. میانگینی که مبنای کار ماست. اینکه از چه پریودی برای این میانگین استفاده کنیم که ثبات بهتری داشته باشد، از نظر ما بستگی به تایم فریم دارد. هرچند در ادامه خواهید دید تفاوت آن چنانی بین اعداد بدست آمده وجود نخواهد داشت. برای مثال بهترین پریودی که می‌توانیم برای تایم روزانه در نظر بگیریم عدد ۲۶۴ (یک سال کاری فارکس برابر با ۲۶۴ روز) است که مطابق با شکل ۱-۳ این عدد برای EURUSD برابر با ۸۴ می‌باشد. یعنی اینکه این ارز در سال گذشته در هر روز بطور متوسط، کندل‌های با نوسانات ۸۴ پیپی داشته است. پس ذهنیتی که می‌توان داشت این است که به طور متوسط ۸۴ پیپی نوسان روزانه این ارز را شاهد هستیم. این عدد قدرمطلق است. یعنی اینکه ممکن است روند قیمتی ما بصورت صعودی اما ATR کاهشی باشد. یعنی ما در اینجا اصلاح ATR داریم. برخلاف مبحث کلاسیک که اصلاح در خلاف جهت روند میباشد ما در اینجا ملاکمان اصلاح ای تی آری است که میتواند در جهت و یا خلاف جهت روند و یا حالت ساید باشد.



شکل ۱-۳ ATR برابر با ۸۴

ما مطابق شکل ۱-۴ در تمپلیت خودمان، ATR سه روزه و هفت روزه داریم. همانطور که می بینید ATR این ارز در ۳ روز گذشته ۶۶ پیپ بوده و در ۷ روز گذشته تقریباً ۹۰ پیپ بوده است. در ۷ روز گذشته نسبت به ۳ روز گذشته حرکت بیشتری داشته است که این یعنی بازار در حال حاضر در حال درجا زدن می باشد تا برگردد به تعادل ۸۶ پیپ. عدد ۸۶ پیپ در اینجا تقریباً با عدد ۸۴ بدست آمده از ATR ۲۶۶ روزه یکی است. بنابراین زیاد فکر خود را مشغول این اعداد با اختلاف چند پیپی ناچیز نکنید.



شکل ۱-۴ ATR سه روزه، هفت روزه و میانگین

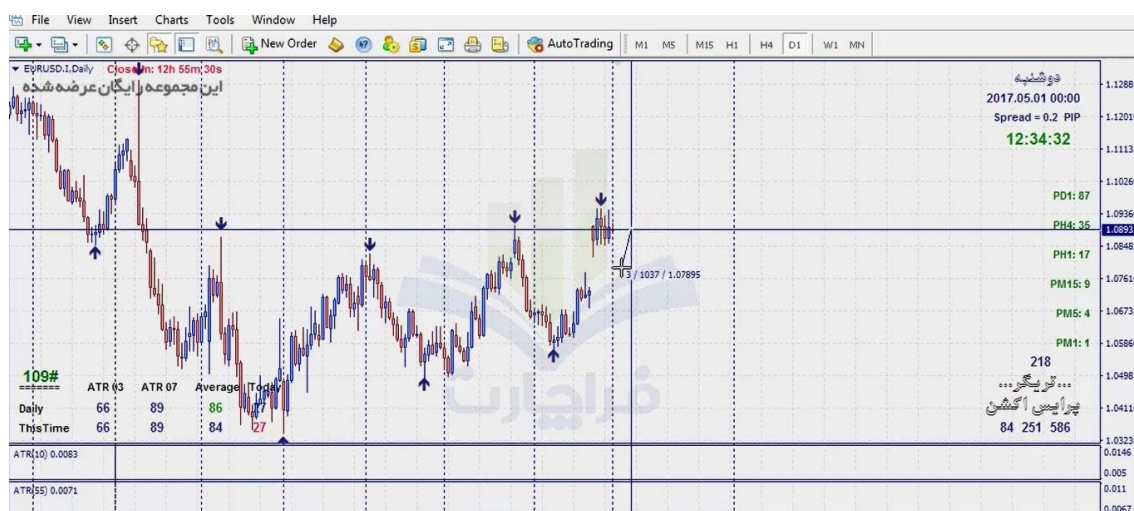
در شکل فوق عدد سبز رنگ ۸۶ مربوط به ATR روزانه و عدد قرمز رنگ ۲۷ مربوط به تایم چهارساعته است. این اعداد با تغییر تایم فریم ثابت هستند. لازم به ذکر است که عدد ۸۴ در زیر عدد سبز رنگ ۸۶، ATR تایم انتخابی است (۲ پیپ اختلاف بدلیل تفاوت در فرمول است و ناچیز، مجدداً عرض می کنیم ذهنتان را درگیر یک یا دو پیپ اختلاف نکنید) که با تغییر تایم فریم این عدد تغییر می کند و مقدار ATR تایم انتخابی را نشان می دهد.

اگر حساس هستید و می خواهید پریمدهای ثابت ATR برای هر تایم فریم را جداگانه حساب کنید می توانید مثلاً به تایم D1 بروید، Ctrl+Y را بزنید که باعث نمایان شدن جدا کننده ها می شود. فاصله کندی بین جدا کننده ها در اینجا ۲۲ است که معادل ۲۲ روز فارکسی که برابر با یک ماه است و الا آخر.

در جلسه بعد ما قصد داریم در مورد پیوت^۱ ها بحث کنیم. بعنوان مقدمه و یک مثال شکل ۱-۵ را

^۱Pivot

در نظر بگیرید فرض کنید بعد از بسته شدن آخرین کندل، کندل بعدی به اندازه یک ATR یعنی حدود ۹۰ پیپ پایین بیاد، در این حالت این کندل بطور کلی ۷ کندل ماقبل خود را اینگلف کرده یا پوشش داده است در چنین شرایطی، سطح مورد نظر یک پیوت را تشکیل داده است.



شکل ۵-۱ انتظار بسته شدن یک کندل به اندازه ATR حدوداً ۹۰ پیپی

این پیوت و این تعریف از پیوت با آنچه که در کتابها و سایر جزوات گفته شده متفاوت است و در جلسه بعد برای شناسایی این سطوح که اولین دیدگاه ما نیز است به تفصیل صحبت خواهیم کرد و قصد داریم با این دیدگاه دو کار را انجام دهیم ۱- طبق این تعریف پیوت می‌خواهیم طبق معمول سایر سبک‌ها یک سطح داشته باشیم و ۲- بتوانیم با استفاده از این تعریف در زمان شکل‌گیری پیوت، ترید کنیم.

فصل ۲

شناخت پیوت های قیمتی و تعیین محدوده های سطوح حمایت و مقاومت

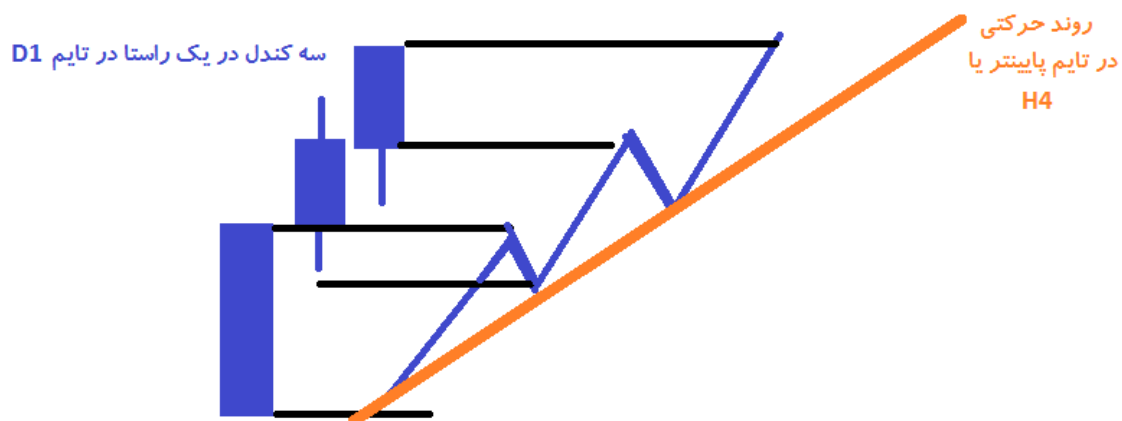
فصل ۲- شناخت پیوت های قیمتی و تعیین محدوده های سطوح

حمایت و مقاومت

بعد از اینکه در جلسه قبل در مورد ATR صحبت کردیم در این جلسه قصد داریم بحث را یک مقدار عملی تر کنیم و سعی داریم تا چگونگی شناخت پیوت های قیمتی و تعیین محدوده های سطوح حمایت و مقاومت را فرا بگیریم.

همانگونه که خودتان بهتر می دانید به محل چرخش مسیر حرکت قیمت، پیوت می گویند.

ما در بحث روند ها، سه روند داشتیم، روند صعودی، نزولی و سایید. تغییر رفتار از صعودی به سایید به ما پیوت نمی دهد. برای ما تغییر جهت حرکت ملاک است (از صعودی به نزولی یا بالعکس). این محل چرخش به اصطلاح به پیوت معروف است که می تواند اسامی دیگری چون مقاومت یا حمایت نیز به خود بگیرد. به گونه ای که اگر این سطح پیوتی زیر قیمت جاری باشد به حمایت و اگر بالای قیمت جاری باشد به مقاومت معروف است. پس پیوت ها می توانند مقاومت یا حمایت باشند. اما به کجا و به چه مکانی محل چرخش یا پیوت می گویند؟ در تحلیل کلاسیک مطرح می شود که اگر به عنوان مثال در یک روند نزولی بعد از چرخش سه کندل صعودی متناوب دیده شد، آن گاه پایین ترین سطح یا همان لوی (LOW) روند نزولی یک پیوت است. در سبک کلاسیک از این محل چرخش ها برای شناخت سطوحی که بازار ممکن است در آینده به آن واکنش نشان دهد استفاده می کنیم. که در این حالت آن سطح پس از گذشت سه کندل دیگر برای ما ارزش ترید ندارد. ما قصد داریم این دیدگاه را تغییر دهیم. به اینصورت که هر گاه سه کندل در یک راستا داشته باشیم در این حالت ما یک مسیر حرکت و یا یک روند داریم (مطابق شکل ۱-۲). سه کندل در تایم پایین تر یک روند را نشان می دهد.



شکل ۱-۲ سه کندل در تایم بالا نمود یک روند در تایم پایینتر است.

حال اگر بعد از حداقل سه کندل در یک راستا کندلی معکوس داشته باشیم که بتواند آخرین کندل (مستر کندل) ماقبل خود را پوشش بدهد آن گاه یک پیوت خواهیم داشت. در این حالت ما از دیدگاه کلاسیک دو کندل جلوتر هستیم. اولین استفاده ATR در این قسمت می باشد. از نظر ما کندلی مستر کندل است که حداقل ۸۰ تا حداکثر ۱۲۰ درصد ATR همان تایم فریم، دامنه نوساناتش باشد و همچنین ۸۰ درصد بادی (Body) یا ۸۰ درصد شدو (Shadow) باشد.



شکل ۲-۲ ATR هر تایم فریم

پس کندل های کوچکتر از ۸۰ درصد ATR، جزء مستر کندل های ما محسوب نمی شوند. بعد از این سه کندل، یا یافتن یک حرکت با سه برابر ۸۰ تا ۱۲۰ درصد ATR، ما به دنبال کندل معکوسی هستیم که مستر کندل قبل خودش را بطور کامل پوشش داده باشد.

در جاهایی ما کندلی داریم که خود آن کندل، اندازه اش به تنهایی سه برابر ۸۰ تا ۱۲۰ درصد ATR آن تایم فریم است (لانگ بار) در این حالت این کندل به تنهایی نقش سه مستر کندل را ایفا میکند. در چنین شرایطی برای یافتن پیوت بایستی مثلاً در یک روند صعودی از High این کندل یک خط بکشیم و به اندازه یک ATR آن تایم فریم پایین بیاوریم کندلی که زیر این خط بسته شود باعث بوجود آمدن پیوت خواهد شد. این خط به " خط فرضی " معروف است.

پس **بطور کلی** هرگاه ۱- حداقل سه مسترکندل در یک راستا داشته باشیم یا ۲- یک حرکت با طول حرکتی برابر با ۳ برابر ۸۰ تا ۱۲۰ درصد ATR داشته باشیم، و کندل بعدی آخرین مسترکندل یا خط فرضی (در صورت عدم وجود مسترکندل) را پوشش دهد (بعد از سطح بسته شود) آن گاه محل چرخش بدست آمده یک پیوت است.

مبحث بعد از تشخیص پیوت، محدوده پیوت است که یک عدد خام و مطلق نیست. اما چگونه می توان دامنه پیوت ها را بدست آورد؟

نکته: شرطی که باید برای کندل پوشاننده لحاظ شود این است که اگر این کندل را به سه قسمت تقسیم کردیم آن گاه این کندل بایستی حتماً در یک سوم پایانی خودش بسته شود (شدوی پایانی آن قدری بزرگ نباشد که ناحیه بسته شدن در وسط یا یک سوم ابتدایی قرار بگیرد). اگر چنین نبود، پیوت به دست آمده ارزش ترید در لحظه تشکیل را ندارد.

۱-۲- نحوه به دست آوردن محدوده پیوت ها

در مرحله اول: انتهای ترین لول ها را بدست می آوریم (مطابق شکل ۲-۳)



شکل ۲-۳ مشخص کردن انتهای ترین لول ها در چارت

در مرحله بعد کندی که شدویش باعث بوجود آمدن High یا Low مورد نظر شده را در نظر می گیریم. از شدوی کندل مدنظر تا مشترک open و close های هم سطح بعنوان یک رنج استفاده می کنیم.



شکل ۲-۴ محدوده و رنج ناحیه پیوت

این رنج و محدوده بایستی با بقیه سطوح و نواحی ای که تشخیص می دهید همخوانی داشته و در یک رنج داشته باشد و اگر همخوانی نداشت آن ناحیه ای که شما تشخیص داده اید مربوط به تایم فریم دیگری است.

۲-۲- نحوه تشخیص تایم فریم یک پیوت

ابتدا به سادگی دره ها یا قله های را که می بینیم علامت می زنیم به فرض مثال شکل ۲-۶ در تایم روزانه:



شکل ۲-۶ مشخص کردن قله یا دره ها

در مرحله بعد حداقل سه کندل (مسترکندل) در یک راستا یا حرکت سه برابر ۸۰ درصد ATR یا سه برابر ۱۲۰ درصد ATR را چک می کنیم (که در پیوت فوق داریم). حال ما تایم فریم را انقدر بالا می بریم تا شروط ذکر شده برای پیوت نقض شود. به تایم فریم هفتگی می رویم:



شکل ۲-۷ بررسی طول حرکت

همانگونه که مشاهده می کنیم پیوت فوق مربوط به هفتگی است. چرا که هم شرط سه برابری برقرار است و هم اینکه کندل معکوسی وجود دارد که زیر خط فرضی بسته شده است.



شکل ۲-۸ رسم خط فرضی (در مواردی که مستر کندل نداریم)

اگر تایم را بالاتر ببریم یعنی ماهانه، شرط سه برابری ۸۰ تا ۱۲۰ درصد ATR ماهانه برای پیوت فوق برقرار نیست.

چند نمونه از شرایط و آرایش های تشکیل پیوت که به هیچ وجه نیاز به حفظ آنها نیست. چرا که با قوانینی که برای تشکیل پیوت در نظر گرفتیم تمام این الگوها قابل تشخیص است.

مستر کندلی با ۸۰ درصد شود پایین اینگلف همیشه

مستر کندلی با ۸۰ درصد بدنه اینگلف همیشه

مستر کندلی که بعد از کندل اسپینگ اینگلف همیشه

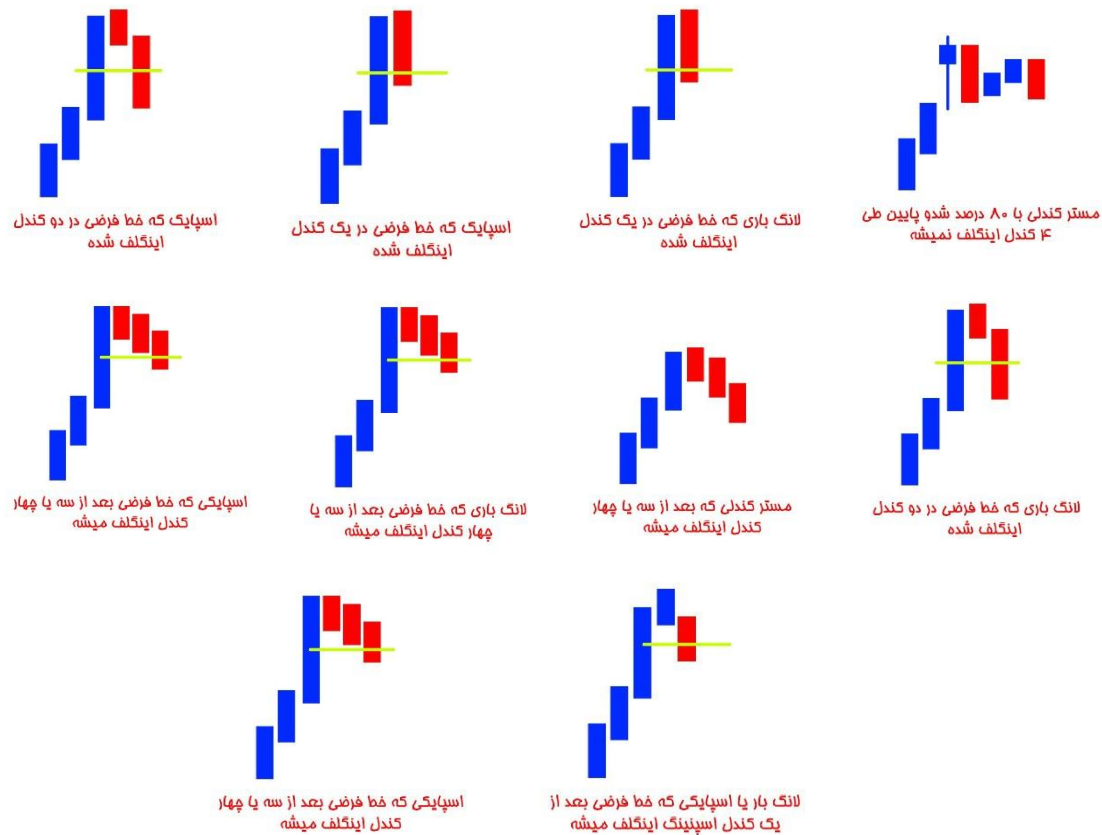
مستر کندلی که بعد از سه یا چهار کندل اینگلف همیشه

مستر کندلی با ۸۰ درصد شود بالا طی ۴ کندل اینگلف همیشه

مستر کندلی با ۸۰ درصد بدنه طی ۴ کندل اینگلف همیشه

مستر کندلی با ۸۰ درصد شود (فرافره) اینگلف همیشه

مستر کندلی با ۸۰ درصد شود بالا اینگلف همیشه



شکل ۲-۹ نمونه آرایش های تشکیل پیوت

نکته: بعد از تشکیل پیوت و برگشت به پیوت و ادامه روند، در مرحله بعد که قیمت به سطح و محدوده ^۱FTC (محدوده ناتوانی در ادامه روند و نتیجتاً برگشت و چرخش قیمت) پیوت ها می رسد انتظار واکنش داریم.

یک راه حل ساده و تقریبی برای تعیین محدوده FTC که در آینده این محدوده دقیقتر بدست خواهیم آورد. (این بخش در فصل آخر دقیقتر و کاملتر مورد بحث قرار خواهد گرفت)

اول اینکه از قله بوجود آمده (بعنوان مثال در یک روند صعودی) تا انتهای کندلی که باعث پوشش شده و پیوت بوجود آورده است یک باکس می کشیم. و از آنجایی که خیر العمور اوسطها، پس میانه این پیوت ها سطح و محدوده FTC ماست.

^۱Failure To Continuation

و یا وقتی پیوت تشکیل شده است. در هر تایم فریمی که هستیم به اندازه ATR یک تایم فریم پایین تر، از کلوز کندل پوشش دهنده به اندازه ATR یک تایم پایینتر، بالا می رویم و سطح به دست آمده همان FTC است.

حالا یک خط داریم اگر به تایم تریگر برویم و در محدوده های آن سطح یک منشاء حرکت (کندل دوجی یا از خانواده های آن) پیدا کردیم چنین سطح و محدوده ای را آپدیت می کنیم. البته در بحث ستاپ ها، ما برای این ورودها روش دیگری نیز تحت عنوان تریگر لاین داریم. که در ادامه به بررسی آن خواهیم پرداخت.

۳-۲- پیوت های مینور و ماژور

مبحث بعدی مربوط به پیوت های مینور و ماژور می باشد. در سبک کلاسیک برای تشخیص ماژور و مینور بودن یک پیوت از اندیکاتور مکدی (علامت زدن تغییر فازهای مکدی و در بین هر تغییر فاز، بالاترین و پایین ترین قیمت را بعنوان پیوت انتخاب می کردیم و در نهایت استفاده از ابزار فیبو برای تشخیص ماژور و مینور بودن!) استفاده می کردیم. اما در روش ما پیوتی ماژور است که با پیوت تایم فریم بالاتر مقایسه می شود. یعنی اگر در تایم روزانه هستیم پیوت های تایم فریم بالاتر (هفتگی و ماهانه) حکم پیوت ماژور تایم فریم روزانه را دارند. و بالعکس پیوت های تایم پایینتر برای روزانه حکم پیوت مینور را دارند که در آینده برای تشخیص قدرت سطوح از آن ها بهره می بریم. یعنی مثلا اگر بازار مطابق شکل زیر از سطح یک تایم فریم بالاتر (در اینجا هفتگی) برگردد احتمال شکسته شدن پیوت یا سطح تایم فریم پایینتر (در اینجا روزانه) خیلی زیادتر است. بطور کلی پیوت های تایم فریم های پایین تشکیل می شوند برای اینکه شکسته شوند.



شکل ۲-۱۰ پیوت مازور و مینور

فصل ۳

درجه اهمیت سطوح حمایت و

مقاومت

فصل ۳- درجه اهمیت سطوح حمایت و مقاومت

در این جلسه قصد داریم تا نگاهی داشته باشیم به درجه اهمیت و اعتبار سطوحی که روش پیدا کردن آن ها را در فصل قبل مطرح کردیم.

یک بار دیگر می گوییم، زمانی که یک پیوت را تشخیص می دهیم باید و باید بدانیم که برای کدام تایم فریم است. بنابراین ما برای خودمان یک معیار گذاشته ایم و آن هم این است که هر جا دره و یا قله ای دادیم بایستی بدانیم چنین دره یا قله ای متعلق به کدام تایم فریم است.

بعنوان مثال در شکل ۱-۳ می خواهیم ببینیم قله مشخص شده در شکل زیر آیا پیوت هست و اگر هست برای کدام تایم فریم؟



شکل ۱-۳ وجود یا عدم وجود پیوت

آنچه که مشخص است ما در این حرکت یک از دو شروط ک ۱- حداقل سه مسترکندل در یک راستا یا ۲- حرکت با طول حرکتی به اندازه سه برابر ۸۰ تا ۱۲۰ درصد ATR را داریم (ATR تایم روزانه ۱۴۴ است). حال دنبال کندل برگشتی می گردیم که یا ۱- آخرین مسترکندل قبل خودش را بطور کامل پوشش دهد و یا ۲- زیر خط فرضی بسته شود. که کندل قرمز رنگ گواه این مطلب است. حال به تایم هفتگی میرویم:



شکل ۲-۳ مسیر حرکت قبلی در تایم هفتگی

همانگونه که میبینید پیوتی وجود ندارد (کندل برگشتی وجود ندارد) پس این پیوت یک پیوت روزانه است.

خب فرض کنید بازار دو پیوت تایید شده دارد میخواهیم ببینیم کدامیک از این دو پیوت مهمتر هستند و کدامیک در آینده احتمال شکستش بیشتر است. بعبارتی و بصورت عامیانه، زور کدامیک بر دیگری می‌چربد. در حالت کلاسیک گفته می‌شود تایم فریم هر چه بالاتر باشد مهمتر است. اما آن سطحی که به دنبالش هستیم در ابتدا باید ببینیم مربوط به کدام تایم فریم است. با در نظر گرفتن همین مساله و تشخیص درست سطح، از نظر ما نیز هر سطحی که تایم فریمش بالاتر باشد ارزشش بیشتر است.

اما زمان هایی می‌رسد که ما دو سطح داریم که هر دوی آن ها متعلق به یک تایم فریم هستند و بازار بین این دو سطح در حال نوسان است. در اینجا چه کاری باید انجام داد؟
گزینه بعدی که برای درجه اهمیت، اولویت و تصمیم گیری در این زمینه استفاده می‌شود **تعداد دفعات برخورد** است.

موضوعی که معمولا در خیلی از منابع و کتابها مطرح می‌شود این است که هرچقدر تعداد دفعات برخورد یک سطح بیشتر باشد درجه اهمیت آن سطح بیشتر است. اما ما شدیداً با این مساله مخالف هستیم. از نظر ما هر چقدر تعداد دفعات برخورد به یک سطح بیشتر باشد از ارزش آن سطح کمتر می‌شود. فرض کنید در یک سطح حمایت قرار داریم. در مرحله اول تعداد زیادی نفرت در این

سطح دیدگاه بای دارند. مطمئناً آن میزان نفراتی که در مرحله دوم رسیدن قیمت به این سطح به بای فکر میکنند کمتر است. یک بحث فانتزی جمع آوری سفارشات وجود دارد که می‌گوید در مرحله بعد یک سری اردر بای در آن سطح ست شده که هم قابل استناد و هم قابل نقض است. اما اگر بخواهیم فعلاً وارد جزئیات و بحث جریان سفارشات نشویم، بطور کلی تعداد دفعات برخورد وقتی بیشتر شود ارزش آن سطح را کم خواهد کرد.

آنچه که در کتابها و متون راجع به رابطه مستقیم تعداد برخورد به سطح و افزایش درجه اهمیت آن سطح است مربوط به زمانی است که آن سطح شکسته شود. یعنی ما در اینجا دو فاز داریم یکی گذشته آن سطح و دیگری وضعیت حال حاضر آن سطح.

مثلاً فرض کنید دو سطح در یک تایم فریم داریم که یکی از آن‌ها دو برخورد در گذشته داشته و هنوز شکسته نشده است و سطح دیگری داریم که سه برخورد در گذشته داشته و شکسته شده است. در این حالت اهمیت سطحی که شکسته شده خیلی بیشتر است.

پس یک بار دیگر اما از زاویه‌ای دیگر، هر چقدر تعداد برخورد یک سطح بیشتر باشد اهمیتش در شرایطی بیشتر می‌شود که آن سطح شکسته شده باشد (زیرا دیدگاه نفرات خیلی زیادی نسبت به این سطح عوض شده است). در غیر اینصورت در لحظه‌ای که هنوز شکستی رخ نداده است، با تعداد دفعات برخورد بیشتر از ارزش آن کاسته خواهد شد.

موضوع بعدی در مورد اهمیت سطح و مقایسه سطوح، فاصله زمانی برخورد است. موازی با همین بحث، بحث دیگری تحت عنوان فاصله قیمتی خواهیم داشت که این دو تقریباً با همدیگر هستند. در مورد فاصله قیمتی: اگر شما یک سطحی داشته باشید که این سطح قادر باشد قیمت را به فاصله زیادی از خودش دور کند و به اصطلاح پرتاب کند و قیمت فاصله زیادی از آن سطح بگیرد مطمئناً چنین سطحی دارای ارزش و اهمیت بیشتری است.

و در مورد فاصله زمانی فرض کنید یک سطح شکسته شده است اینکه بعد از چه مدت زمانی قیمت مجدداً به آن سطح برگشته است نیز مهم است. اگر فاصله زمانی ها کم و کوتاه بشود ارزش آن سطح در حال کم شدن است.

اما موضوعی که اینجا پیش می‌آید، ترکیب این دو بخش است. یعنی ترکیب فاصله قیمتی و فاصله زمانی که برخی از شماها آن را به عنوان واگرایی زمانی یا قیمتی می‌شناسید. به این نحو که اگر قیمت در یک فاصله زمانی مشخص (یا تعداد کندل مشخص) از یک سطح دور شود و در برگشت به آن سطح این فاصله زمانی بیشتر شود (با تعداد کندل بیشتر و حرکت cp و فشرده به آن برگردد) در این جا

واگرایی خواهیم داشت و ارزش این سطح را بالاتر می برد.

جمع بندی:

- ۱- تشخیص تایم فریم یک سطح و تصمیم گیری مطابق با آن تایم فریم
- ۲- تعداد دفعات برخورد: هر سطح را بصورت جداگانه در نظر می گیریم و ببینیم چند بار برخورد قیمت با آن سطح و برگشت قیمتی را داشته ایم. که در اینجا دو دیدگاه داشتیم: ۱- قبل از شکست: هر چه تعداد برخورد بیشتر درجه اهمیت آن پایینتر و ۲- بعد از شکست: که هر چه تعداد برخورد قبل از شکست بیشتر باشد اهمیت آن بعد از شکست بیشتر است.
- ۳- فاصله قیمتی: هر سطحی که قیمت را به اندازه زیادی از خودش دور کند ارزش و اعتبارش بیشتر باشد که البته همزمانی دارد با ۴- فاصله زمانی: هر چقدر فاصله زمانی برگشت قیمت به سطحی که از آن فاصله گرفته بیشتر باشد، ارزش آن سطح بیشتر است.

فصل ۴

روندهای قیمتی (مسیر، اجزاء، تایم)

فصل ۴- روندهای قیمتی (مسیر، اجزا، تایم)

در این جلسه قصد داریم یک مقدار در مورد روندها صحبت کنیم و یک سری خطوط دیگر به سطوح ما اضافه می شود. در بحث روندها با سه بخش روبرو هستیم: مسیر، اجزا و تایم. در این مبحث کار ما راحت است چراکه اکثر شما این مباحث را در جاهای مختلف مشاهده کرده اید. در تحلیل تکنیکال کلاسیک ما سعی می کنیم مسیرهای حرکتی را در ابتدا مشخص کنیم و سعی می کنیم تا در مسیرهای غالب بازار حرکت و ترید کنیم. همان جمله معروف "روند دوست ماست!" اما کدام روند دوست ماست؟ این چه دوستی است که در بیشتر اوقات از پشت خنجر زده است!

گفته می شود که بازار در بیش از ۸۰ درصد مواقع در حالت سایید و رنج است و ۲۰ درصد در حالت روند است. اگر واقعا این آمار درست است پس چرا ما باید سرمایه خود را در جایی استفاده کنیم که احتمال وقوع ۲۰ درصد دارد و به دنبال بازارهای سایید و سوئینگ نمی رویم. به هر حال این دو موضوع اندکی با هم در تناقض است و انشالله که در ادامه بتوانیم به یک جمع بندی مفید برسیم.

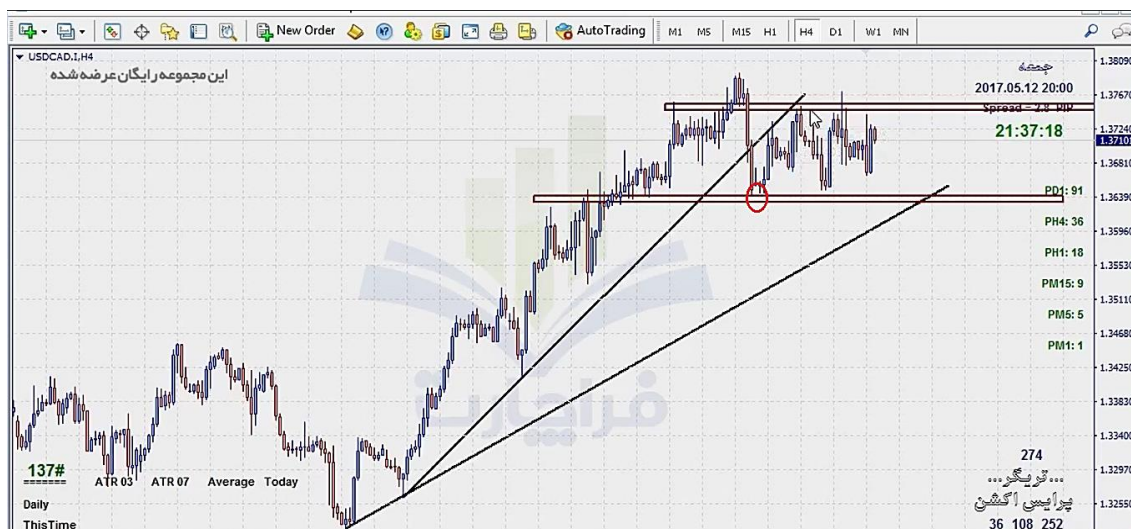
در تعریف برای ترسیم یک روند به دو های یا دو لو نیاز داریم. فرض کنید ما دو LOW داریم که LOW دوم بالاتر از اولی است. اما LOWی دوم چه موقع تایید شده اس؟ زمانی که بازار برود و High ماقبل این LOW عبور کند آن موقع است که ما یک LOWی دوم تایید شده داریم (که در این حالت مثلا در اندیکاتور مکدی تغییر فاز را شاهد خواهیم بود). بعد از شکست سطح High مذکور ما انتظار روند صعودی داریم که در این حالت با استفاده از یک خط دو LOW را به هم وصل کرده و خط روند صعودی را خواهیم داشت. حال در لحظه ای که بازار برمیگردد و به خط روند ما واکنش نشان می دهد، ما یک خط روند صعودی تایید شده داریم! همین مبحث را برای روند نزولی و خط روند نزولی خواهیم داشت و اما زمانیکه باز نتواند های High جدید یا LOWهای جدید ایجاد کند ما در اینجا یک بازار سایید داریم.

تعریف ما از بازار رنج به اینصورت است که زمانیکه ما یک خط روند داریم و بازار برمیگردد و خط روند را می شکند آن گاه مادامیکه بازار بین خط روند شکسته شده و سطح ماقبل و پیش رو حرکت می کند ما یک بازار سایید داریم.



شکل ۴-۱ انتظار حرکت سایب یا رنج بعد از شکست خط روند

در شکل ۴-۱ که بازار خط روند ما را شکسته است، انتظار داریم بازار بین سطح پیش رو و سطح مقابل از شکست نوسان کند و در اینجا ما یک بازار رنج داریم.



شکل ۴-۲ حرکت سایب و پیوت پولبکی بعد از شکست خط روند

یا در شکل ۴-۲ شاهد بازار رنج هستیم. نکته ای که در اینجا نیاز به یاد آوردی است تشکیل پیوت از نوع پولبکی (دایره قرمز رنگ) است. که ترید در این پیوت ریسک بالایی دارد. که درفصول پایانی مجددا در مورد آن بحث خواهد شد.

حال به بحث تایم فریم بپردازیم که یکی از بزرگترین مشکلات متاتریدر در کنار دیگر مشکلات آن، بحث تایم فریم است. آن چه که در خصوص تایم فریم بهترین حالت است رابطه فرکتالی با مضارب

چهار بین تایم فریم هاست. برای مثال از M1 شروع کنیم، تایم بعد M4 که از M5 استفاده می کنیم و به همین ترتیب بطور کلی تایم فریم های ما بصورت M1، M5، M15، H1، H4، D1، W1 و نهایتاً MN می باشد. ما با سه تایم فریم کار میکنیم. یک تایم فریم که ما سطوح را در آن به دست می آوریم که ما آن را **تایم تحلیل یا اصلی یا مادر** تعریف می کنیم. تایم فریم بعدی که یک تایم فریم پایین تر است **تایم الگو یا روند** ماست. و در نهایت تایم فریم سوم (دو تایم فریم پایینتر از تایم اصلی) که ما آن را **تایم تریگر** نامگذاری کردیم، تایمی است که در آن جا وارد بازار می شویم.

نکته: در این دیدگاه، در هر تایم فریمی که تحلیل را انجام می دهیم بطور ضمنی باید حداقل به اندازه دو تایم فریم بعدی به بازار اجازه رسیدن به مثلاً سطح بعدی را بدهیم.

اجازه دهید قبل از ذکر اجزای روند دو تعریف از حرکت پولبکی و و لگ داشته باشیم:

حرکت پولبکی:

کوچکترین حرکتی که ما می توانیم برای بازار تصور کنیم حرکت از یک پیوت مینور به یک پیوت مینور دیگر است. به این حرکت، حرکت پولبکی گفته می شود که معادل یک گام حرکتی است. این حرکت پولبکی در تایم فریم های اصلی خودش بعنوان یک حرکت اصلی است.

لگ:

اگر حرکتی به اندازه سه برابر ATR تایم فریم انجام شود و در این مسیر هیچگونه پیوت دیگری نداشته باشیم آن گاه یک لگ حرکتی خواهیم داشت. که این لگ به خودی خود از اجزای مختلف تشکیل شده است: لگ حرکتی پولبک، لگ حرکتی قوی و لگ حرکتی قوی ترین.

بطور کلی اجزای ما بدین صورت هستند: ۱- روند (که از چند لگ تشکیل شده). ۲- کوچکتر از آن سوئینگ را داریم. ۳- در مرحله بعد لگ حرکتی را داریم و ۴- پولبک.

فصل ۵

معرفی انواع شکست و تشخیص

شکست یک سطح

فصل ۵- معرفی انواع شکست و تشخیص شکست یک سطح

یکی از سختترین مباحث تکنیکال از نظر ما تشخیص شکست یک سطح است. اعتقاد اکید ما بر این است که ما به هیچ عنوان چیزی تحت عنوان شکست جعلی نداریم. تعریف اولیه شکست، عبور یک کندل به اندازه یک ATR از سطح مورد نظر است. که البته این تعریف یک مقدار مشکل دارد و آن هم اولاً شرایط سطح مذکور است و دوماً شرایط کندلی که قرار است سطح مدنظر ما را بشکند. قدم اول تشخیص تایم فریم سطح است چراکه چنین شکستی بایستی در همان تایم فریم بررسی شود. یک نکته در اینجا قابل ذکر است و آن هم این است که بعد از اینکه در تایم تحلیل شکست اتفاق افتاد، در تایم تریگر (دو تایم پایینتر) معمولاً با سه پدیده روبرو هستیم: ۱- پولبک کندلی



شکل ۱-۵ پولبک کندلی بعد از شکست

۲- پولبک موجی یا ۷ شکل به پولبک کندلی (یک لگ حرکتی)



شکل ۲-۵ بولیک موجی

و ۳- بولیک روندی (که از حداقل سه لگ تشکیل شده است)



شکل ۳-۵ بولیک روندی

در معنای دیگر، این شکست زمانی تایید می شود که قیمت سطح بیرونی ناحیه بولیک کندلی را بریک اوت کند. که به این ناحیه و سطح، ناحیه و سطح Accept Breakout می گوئیم. همچنین انتظار داریم تا زمانی که مارکت به سطح منشا این حرکت یا سطح قبل از این سطح نفوذی نداشته باشد، ما انتظار حرکت صعودی را نخواهیم داشت.



شکل ۴-۵ منشا حرکت پس از شکست

و مادامیکه قیمت به سطح اصلی (سبز رنگ) برمی گردد، ما فقط به Sell فکر میکنیم، مگر اینکه قیمت به سطح بعدی خودش در تایم فریم تحلیل رسیده باشد که ما به آن در جلسه بعد تحت عنوان ماموریت شکست اشاره خواهیم کرد.

ما در اینجا از این مباحث بصورت گذرا رد خواهیم شد و در آینده به هر یک از این پدیده ها با عناوین مختلف برخورد خواهیم گشت.

خب مجدداً برگردیم به بحث اصلی. ما تا این جا تشخیص دادیم سطح مربوط به کدام تایم فریم است (از فصول قبل). اینکه پیوت متعلق به کدام تایم فریم است و محدوده و ناحیه آن). موضوع بعدی کندل شکست است. پس اولین موضوع تشخیص درست سطح است که بیش از ۹۰ درصد شکست هایی که برخی از آن تحت عنوان شکست جعلی نام می برند، مربوط به عدم تشخیص درست تایم فریم سطح است.

و اما کندل شکست.

کندل های بریک اوت بایستی لانگ بار باشند. یعنی حداقل برابر با ATR همان تایم فریم. دومین شرط این است که این کندل بایستی یا فول بادی و یا با شدوی خلاف جهت شکست باشد.



شکل ۵-۵ کندل شکست قابل قبول

برای تکمیل پکیج شکست، به دو آیتم دیگر نیاز داریم. یکی از آن دو عامل، شرایط قبل از شکست یا آرایش کندلی قبل از کندل بریک اوت است. اگر قیمت با یک حرکت شارپ یا لانگ به یک سطح برسد حتی اگر با چنین حرکت مومنتوم داری بخواهد یک سطح را بشکند، آن شکست نه اینکه درست نیست، اما طبق سبک ما ارزش ترید در لحظه شکست را ندارد، چرا؟ چون از نظر ما توان حرکتی پر شده است و مطمئناً بعد از این حرکت شارپ، یک بازار نوسانی و یا حتی برگشتی را شاهد هستیم و ترید در چنین شرایطی به اصطلاح زمان خواب سرمایه زیادی دارد.

ما بطور کلی در شکست به دوشکل ترید می کنیم: یکی ورود بلافاصله پس از کندل شکست (که مستلزم حرکت CP و فشردگی قبل از شکست است و) و دیگری ترید بعد از ریترن و پولبک به سطح که این حالت در شرایطی که قبل از شکست حرکت های شارپ و لانگ داریم، اتفاق می افتد.

و اما نهایتاً آیتم آخر که تا حدودی هم به آن اشاره کردیم، شرایط بعد از شکست است که انتظار داریم در تایم تریگر بازار برگشت به سطح داشته باشد و ما در پولبک وارد شویم. اما همین ورود بعد از پولبک تا حدودی ورود زود هنگام است. چرا که این پکیج شکستی که تا به حال در مورد آن صحبت کردیم ۱- تشخیص سطح، ۲- تشخیص آرایش کندلی قبل از کندل شکست ۳- شرایط کندل شکست مورد چهارم که وجود دارد این است که وقتی قیمت، high کندل شکست را شکست، آن گاه پکیج شکست کامل شده است.



شکل ۵-۶ آخرین آیتم در تکمیل پکیج شکست

در این حالت ما یک ناحیه تحت عنوان Accept Breakout داریم و ناحیه‌ای را ایجاد میکند که ما انتظار داریم در مرحله بعد وقتی که بازار به این سطح پولبک کند انتظار واکنش و ورود را داریم.



شکل ۵-۷ ناحیه و سطح ورود

اما همانطور که گفتیم در برخی مواقع ورودی تحت عنوان ورود با عجله هم داریم که در این شرایط، وقتی تمام آیت‌های شکست لحاظ شد، ما دیگر منتظر سطح اکسپت بریک اوت نمی‌شویم و در پولبک اول ورود می‌کنیم. در چنین شرایطی، پولبک دوم به سطح بریک اوت، دومین ورود ما خواهد بود.

فصل ۶

مفهوم و ماهیت شکست

فصل ۶- مفهوم و ماهیت شکست

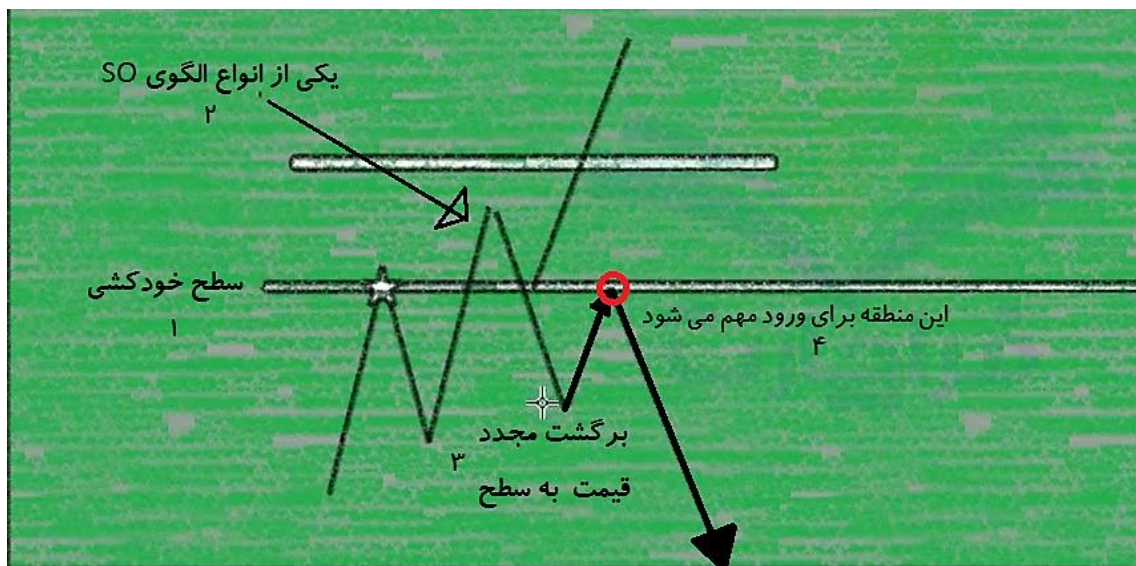
در فصل قبل یک مقدار در مورد شکست صحبت داشتیم و در این جلسه سعی می‌کنیم به مفهوم و ماهیت شکست بپردازیم و تا آن جا که می‌شود این بحث را بصورت مقدماتی جمع بندی کنیم. وقتی که می‌گوییم سطحی شکسته شد و تمام آن شرایط شکست را داشت، آن **گاه قیمت اجبارا و باید خودش را به سطح مقابل برساند**. گاهی مواردی پیش می‌آید که به دلیل عدم تشخیص درست تایم فریم سطح و یا حتی سطح پیش رو ما شاهد آن هستیم که بازار به سطح پیش رو نمی‌رسد اما اصلا همچین چیزی امکان ندارد.

حال اگر بعد از شکست و قبل از پولبک، قیمت خودش را به سطح پیش رو برساند در این حالت **ماموریت شکست** به اتمام رسیده و حتی اگر پولبکی هم به سطح شکسته شده داشته باشد، ترید در این حالت براساس دیدگاه ما نیست.

بعبارت دیگر، اگر قیمت بصورت ظاهری، سطحی را بشکند و بعد از شکست مجددا برگردد، این قضیه از نظر ما دو بخش دارد: یا اینکه سطح شکسته شده و به سطح پیش روی خود رسیده است، و یا اینکه سطح مورد نظر دارای یک محدوده بوده که مربوط به آن تایم فریم نبوده، که در این حالت اصلا شکستی رخ نداده است. پس شکست جعلی از نظر ما بی معناست.

ما برای شکست‌هایی که خود را بلافاصله به سطح پیش رو می‌رسانند (و در متون از آن ها بعنوان شکست های جعلی یا ^۱FB یاد می‌شود) چهار یا پنج حالت تحت عنوان SO داریم. فرض کنید در تایم پترن هستیم. یک سطح رسم می‌کنیم. با این ذهنیت که میدانیم این سطح مربوط به یک تایم فریم بالاتر است. اگر مارکت بیاید و این سطح را بشکند، آن گاه علم به اینکه آیا این سطح را درست انتخاب کرده ایم؟ آیا به سطح مقابل رسیده است؟ بدون در نظر گرفتن تمام این موارد، اگر بازار به سطح برگردد و مجدد در آن نفوذ کند، آن گاه ما به آن سطح مورد نظر سطح خودکشی می‌گوییم و در برگشت قیمت به این سطح انتظار واکنش سطح و برگشت مجدد داریم.

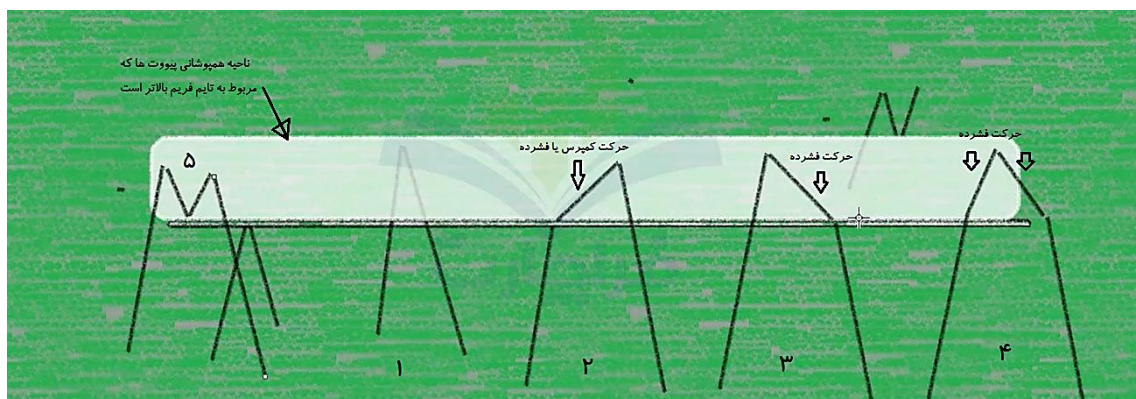
^۱False Breakout



شکل ۱-۶ سطح خودکشی

اینکه ما در آن منطقه مورد نظر ورود می کنیم.

اما این SO ها چهار یا پنج حالت دارد که ما آن ها را SO4 نامگذاری کردیم بصورت زیر:



شکل ۲-۶ انواع SO4

فصل ۷

الگوهای کندلی برگشت به روند

فصل ۷- الگوهای کندلی برگشت به روند

در این فصل سعی خواهیم کرد اندکی در مورد الگوهای کندلی صحبت کنیم و ببینیم که در مجموع چه دیدگاهی در ارتباط با الگوهای کندلی به ویژه الگوهای کندلی برگشت به روند می توان کسب کرد.

در جلسات گذشته در رابطه با شناخت پیوت‌ها توانستیم یک سطح را مشخص کنیم و تشخیص بدهیم که آن سطح متعلق به کدام تایم فریم است. انتظار داشتیم زمانی که مارکت به سطح ما می‌رسد دو ستاپ را در پیش روی خود ببیند. یکی برگشت از سطح و تشکیل پیوت و دیگری هم شکست سطح. در بحث تشکیل پیوت ما شرایطی را داشتیم که این ذهنیت را به ما می‌داد که مارکت از یک سطح برگشته و می‌خواهد به روند برگشتیش ادامه دهد که در بعضی مواقع هم دیده می‌شود که مارکت به جای ادامه روند برگشتیش مجدداً برمیگشت و پیوت را نقض می‌کرد. اما چیزی که در آن جا برای ما مهم بود در هنگام شکل گیری پیوت، ناحیه ورودی ما طوری انتخاب می‌شود که کمترین استاپ لاس ممکن را دارد.

و همچنین در بحث شکست هم انتظار داشتیم ۵ آیتم مربوط به شکست یعنی ۱- تشخیص سطح ۲- شرایط قبل از شکست ۳- کندل شکست ۴- شرایط بعد از شکست و ۵- اکسپت بریک اوت را داشته باشیم.

آنچه که در کتاب‌ها و متون نوشته شده است و می‌دانید، اصل تحلیل تکنیکال بر پایه کندل استیک‌ها یا شمع‌هاست. اگر شما بتوانید کندل‌ها را بشناسید و با آن‌ها، مخصوصاً آرایش‌های کندلی ارتباط برقرار کنید آن موقع است که می‌بینید می‌توانید بازار را چه بسا بهتر هم متوجه شوید. همانطور که میدانید هر یک از کندل‌ها یک اسمی دارند و بیش از ۱۴۰ الگوی کندلی داریم که شاید حفظ کردن و ترید کردن با همه آن‌ها آن چنان ارزشی نداشته باشد.

الگوهای کندلی مشتمل بر سه نوع می‌باشند. دسته اول از الگوها، **الگوهای خنثی**، سرگردان که بازار هنوز در رابطه با ادامه حرکت تصمیم‌گیری نکرده است. دسته بعد کندل‌ها یا الگوهایی هستند که نشانه **برگشت به روند** هستند. و نهایتاً دسته بعدی جزء کندل‌ها یا الگوهای **ادامه دهنده** روند است.

البته یک دسته بندی دیگری هم وجود دارد که ما می‌خواهیم به تمام این سه بخش اضافه کنیم و آن هم خود کندل است. از نظر ما کندل‌هایی که دامنه نوساناتشان کمتر از ۸۰ درصد ATR باشد، جزء

کندل‌های خنثی و بلاتکلیف و غیراستادارد محسوب می شوند مثل برخی اسپینینگ ها و داجی ها و الی آخر.

باور غلطی که در این باره وجود دارد برخی ها فکر می کنند که این الگوها یا کندل ها وحی ملزم هستند و حتما باید عمل کنند اما به هیچ وجه به این شکل نیست.

۷-۱- الگو یا کندل های خنثی:

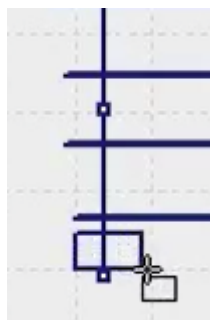
الگوهایی که تا زمانیکه بازار نتواند از های و لوی آن ها عبور کند، تصمیم‌گیری با آنها در لحظه وقوع سخت است.

۷-۲- الگوهای برگشت به روند:

این الگوها که بحث اصلی ما نیز هستند از بخش های مختلفی اعم از کندل های تکی، دوتایی، سه تایی، چهارتایی و ... تشکیل شده است. که ما در اینجا بصورت مختصر به الگوهای تکی، دوتایی و سه تایی میپردازیم.

۷-۲-۱- الگوهای برگشت تکی

در بخش کندل های تکی ما مجموعه ای تحت عنوان پین بارها داریم. کندل هایی که طول استاندارد و بالاتر از استاندارد دارند. اگر مطابق شکل ۷-۱ طول این کندل ها را به چهار قسمت تقسیم کنیم، آن گاه بدنه این نوع از کندل ها بایستی در یک چهارم ابتدایی یا پایانی باشد.



شکل ۷-۱ پین بار

اگر طول حرکت بیشتر از ۱۲۰ درصد باشد ما آن را جزء پین بارها حساب می‌کنیم و کمتر از آن جزء شوتینگ استارها، همرها، مرد حلق آویز و ...

اما موضوع بعدی در مورد شدو است. اجازه بدهید تعریف اولیه ای از شوتینگ استار داشته باشیم و بعد به مبحث شدو بپردازیم. شوتینگ استار کندلی است که دارای بدنه کوچک و شدوی بزرگ‌گست که طول این شدو باید دو برابر بدنه باشد. اگر طول این شدو از دو تا دو و نیم برابر بدنه باشد ما آن را شوتینگ استار و از دو و نیم برابر به بالاتر را پین بار (همرها، مرد حلق آویز و سنگ قبر) می‌نامیم. در تمام این حالات بدنه می‌تواند هم‌رنگ و یا مخالف با رنگ حرکت باشد. از شرایط دیگر می‌توان به شدوی نويز اشاره کرد که این شدو (شدوی در جهت مخالف) نباید بزرگتر از ۱۰ درصد طول کل کندل باشد.

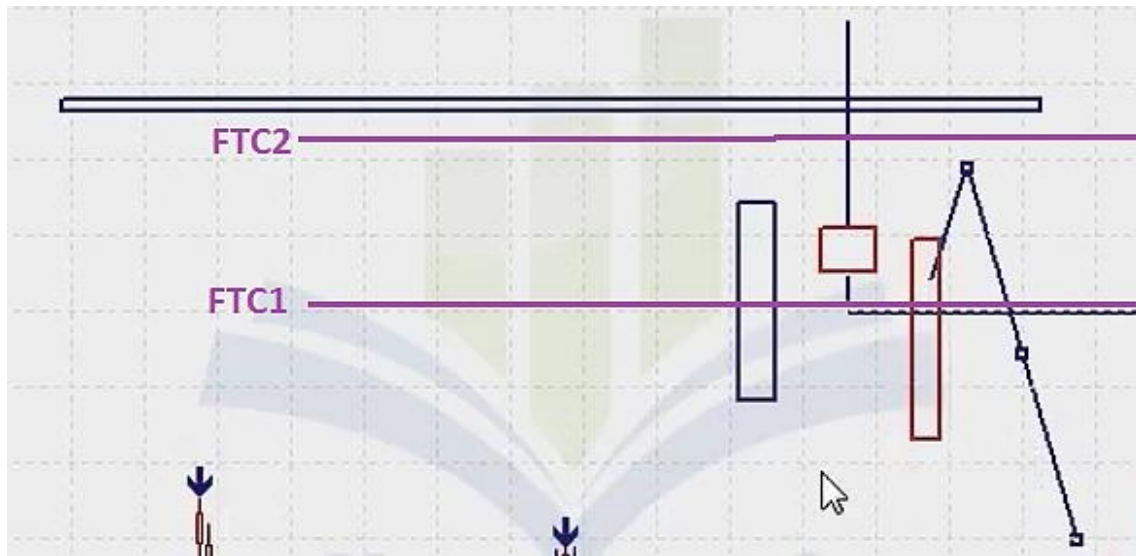
اگر یک سطح داشته باشیم مطابق شکل ۷-۲ که چنین کندلی روی سطح ما ایجاد شود، انتظار داریم که قیمت بعد از این کندل حرکت نزولی را پیش بگیرد که اصلاً انتظار خوبی نیست!



شکل ۷-۲ تشکیل شوتینگ استار بر روی یک سطح

ما نیاز به تایید داریم. تایید بدین شکل است که اولاً کندل بعد از این کندل بایستی کندل نزولی باشد دوماً این کندل بایستی برود و یک High جدید ثبت کند بطوریکه این High از High کندل بعدی پایین تر باشد. سطح پایینی پین بار ما حکم سطح FTC دارد و اگر کندل دوم بیاید و در این سطح نفوذ کنند، آن گاه ما یک روند نزولی تایید شده داریم که از نظر ما بازار ناتوان در ادامه حرکت صعودی خود است.

در فصل آخر به سطح و محدوده FTC خواهیم پرداخت.



شکل ۷-۳ روند نزولی تایید شده و دو سطوح FTC به نشانه ناتوانی در ادامه روند صعودی

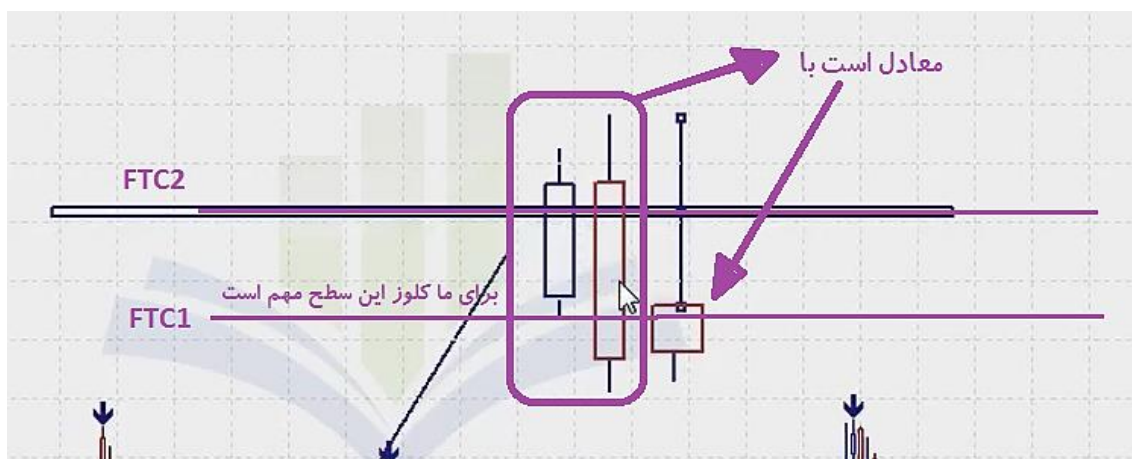
لازم به ذکر است همانطور که قبلا گفتیم، ما در اینجا یک سطح FTC دیگر هم داریم و آن هم سطح ۵۰ درصد شدوی کندل پین بار است. انتظار داریم بازار در برگشت (بعد از بسته شدن کندل دوم و تایید روند نزولی و شکل گیری پیوت) به پیوت تشکیل شده به یکی از این سطوح واکنش نشان دهد.

ذکر این نکته اینجا حائز اهمیت است که علم تکنیکال علم ۵۰-۵۰ است. تمام چیزهایی که ما می‌گوییم به همین نحو است. اما ما با وفاداری به استراتژی‌هایمان و رعایت بحث مدیریت سرمایه می‌توانیم به موفقیت‌های خوبی برسیم.

۷-۲-۲ الگوهای برگشت دوتایی

در بحث مربوط به الگوهای کندلی دوتایی، بیشترین چیزی که معمولا روی آن مانور داده می‌شود، اینگلفینگ است؛ اینگلفینگ صعودی و اینگلفینگ نزولی.

در اینگلفینگ نزولی، ما یک کندل صعودی داریم که کندل بعدی تمام این کندل را اعم از شدو و بدنه، اینگلف می‌کند. اینگلفینگ کاملا ایده آل و کلاسیک معمولا در بازارهایی که شناوری بالایی دارند و نقطه این و کلوز آن‌ها یکی است معمولا خیلی کم اتفاق می‌افتد. به همین خاطر چون این کلوزها معمولا در یک محدوده هستند، در این حالت آن چه که برای مهم هست شدوها هستند. که کلوز کندل دوم بایستی پس از شدوی کندل پین بار باشد.



شکل ۴-۷ الگوی برگشتی دوکندلی

در این جا نیز همچون قبل ما با دو سطح FTC پیش رو داریم. یکی مربوط به لوی کندل صعودی که باید اینگلف میشد و دیگری سطح ۵۰ درصد کندل پین بار معادل این دو کندل. مشابه همین بحث را برای اینگلف صعودی داریم. مجددا تاکید میکنیم تمام کندل های مورد بحث بایستی کندل استاندارد باشند.

۳-۲-۷- الگوهای سه تایی

از دو بخش اصلی ستاره صبحگاهی و ستاره شامگاهی تشکیل شده اند. در این حالت مثلا در یک روند صعودی، اگر بعد از تشکیل آخرین کندل صعودی یک کندل دوم دیگر (اعم از فرفره، داجی، پین بار با هر شکل و شمایلی) شکل بگیرد، در این حالت موضوع اصلی کندل برگشتی سوم است. که بایستی ۵۰ درصد کندل اول را اینگلف کند.

ما از این آرایش ها بصورت گذرا رد می شویم به این خاطر است که پکیج تمام این الگوها همان تشخیص پیوت است.

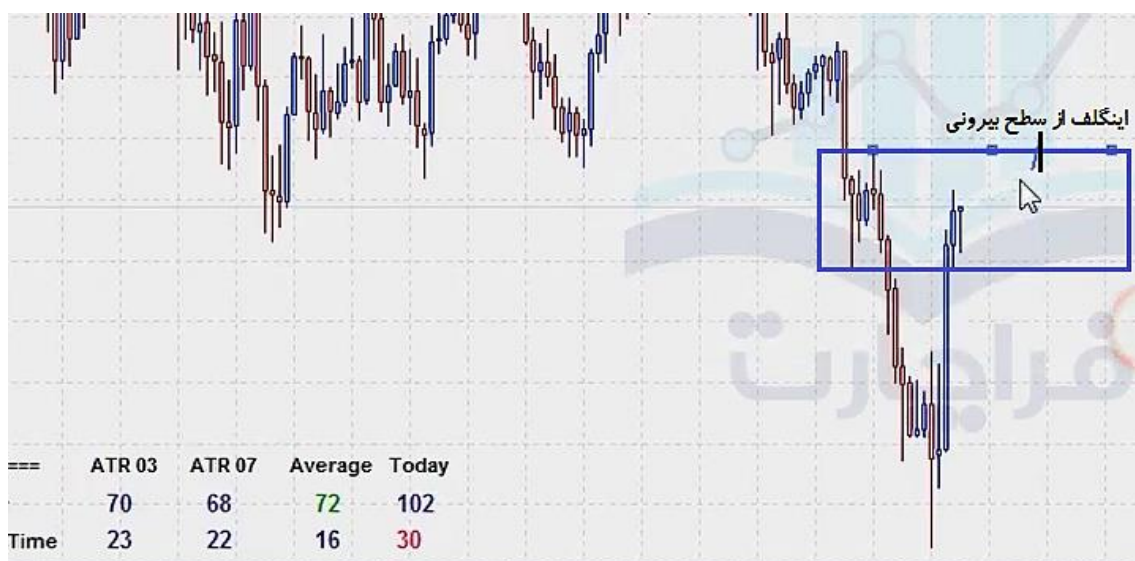
فصل ۸

مقدمه‌ای بر عرضه و تقاضا

فصل ۸- مقدمه‌ای بر عرضه و تقاضا

همانطور که می‌دانید و خدمتتان عرض کردیم از نظر ما تحلیل‌ها به دو بخش کلی تقسیم می‌شوند: یکی تحلیل کلاسیک که همه شما با آن آشنایی دارید و دیگری تحلیلی که ما در خدمت شما هستیم که ما آن را پرایسی نامگذاری کردیم. تحلیل پرایسی که بزرگانی همچون Nial، Al Brooks، Alfonso و Lance، Fuller و ... ورژن مودیفای شده و بهبودیافته‌ای از تحلیل کلاسیک است. از نظر ما پرایس دیدگاه حرکتی و ذهنیتی مارکت است و پرایس اکشن واقعی، آن بُعد روانشناسی قضیه را در نظر دارد. ما در ادامه کار سعی می‌کنیم پرایس اکشن را در حالت الگویی و چارت پترنی بررسی کنیم و بعد از آن تا حدودی به سمت قیمت و جریان سفارشات خواهیم رفت. البته که رسیدن به آن نقطه‌ای که همه ما بتوانیم به همه محدوده‌های عرضه و تقاضا دست پیدا کنیم، کار سختی است. این چیزی است که سطوح پرایسی را از کلاسیک جدا می‌کند. ما از این به بعد همه سطوح پرایسی که معرفی می‌کنیم، که عرضه و تقاضا در این سطوح قرار می‌گیرد، بعنوان **گره‌های معاملاتی** یاد می‌کنیم و هر جا که گفتیم یک گره معاملاتی وجود دارد یعنی آنکه یک سطح عرضه و تقاضا داریم.

از نظر دیدگاه فرقی که بین سطوح حمایت و مقاومت کلاسیک و سطوح عرضه و تقاضا این است که ما اعتقاد داریم سطوح حمایت و مقاومت بایستی شکسته شوند اما سطوح عرضا و تقاضا یا گره‌های معاملاتی ما احتیاج به کلین بریک‌اوت دارند و یا بعبارتی بایستی اینگلف شوند. دوستان دقت فرمایند که اینگلف شدن در اینجا به معنای نفوذ در بیرونی‌ترین سطح است و با معنای کندل اینگلفینگ و آن الگو متفاوت است. در این حالت وقتی می‌گوییم یک سطح اینگلف شده، منظور، نفوذ قیمت در انتهای ترین لول آن سطح است. بعنوان مثال در شکل ۸-۱ زمانیکه قیمت حتی به اندازه یک هزارم پیپ! در سطح بیرونی نفوذ کند آن گاه سطح ما اینگلف شده است.



شکل ۸-۱ مفهوم اینکلف (نفوذ به بیرونی ترین سطح یک ناحیه)

سطوح معاملاتی بیشتر به ما دیدگاه حرکتی آینده می‌دهند و ان‌شالله در ادامه در رابطه با الگوها، پترن‌ها و آن ساختارهایی که تشکیل می‌شوند تا ما به یک سطحی، سطح عرضه و تقاضا بگوییم، بیشتر صحبت خواهیم کرد.

اجازه بدهید گریزی به بحث روندها داشته باشیم و اگر خاطرتان باشد گفتیم روندها در ابتدا شامل سوئینگ‌ها بودند و بعد از آن لگ‌ها را داشتیم که جزء کوچکتری از سوئینگ‌ها بودند. کوچکتر از لگ‌ها، پولبک‌ها را داشتیم که خود آن‌ها حتی می‌توانستند به خودی خود یک لگ باشند. ما دیگر به روند بصورت کلاسیک (با داشتن های و لوهای تایید شده و ...) نیاز نداریم، تنها استفاده ما از روند، سطوح و خطوط روند و کانال است، آن چیزی که برای ما بعنوان یک پرایس اکشن کار مهم می‌باشد و به دنبال هستیم این است که سطوح حمایت و مقاومت، عرضه و تقاضاست و برای ما روند محسوب شوند. برگشت از این سطوح، شکست و چگونگی رسیدن به این سطوح برای ما حکم روند را دارد و از این به بعد به دنبال این هستیم تا لگ‌های حرکتی را مشخص کنیم.

طبق تعریف، لگ، حرکتی از یک پیوت به پیوت دیگر است که در بین راه هیچ پیوت دیگری تشکیل نشده باشد. مطابق شکل زیر این حرکت میتواند بصورت کند مثل پولبک باشد، میتواند یک حرکت شارپ و یا یک حرکت خیلی قوی باشد.



شکل ۸-۲ لگ‌های حرکتی از نظر قدرت

از نظر ما حرکت های weak و strongest سطوح عرضه و تقاضا می‌دهند که منشا این حرکات می‌باشند. برای مثال در شکل بالا منشا حرکت ما در کف شکل می‌گیرد که ما آن را سطح تقاضا می‌نامیم که در ادامه توضیح خواهیم داد.

۸-۱- انواع دیدگاه‌ها در تعیین نواحی عرضه و تقاضا:

۸-۱-۱- دیدگاه اول

فرض کنید یک حرکت صعودی شارپ با نویزهای کم و به دنبال آن یک حرکت نزولی شارپ داریم. در این حالت آخرین کندل صعودی قبل از ریزش را مشخص می‌کنیم از High و Open این کندل مطابق شکل زیر دو خط رسم می‌کنیم، ناحیه و سطح بوجود آمده همان ناحیه عرضه است.



شکل ۸-۳ دیدگاه اول در تعیین محدوده عرضه و تقاضا (در اینجا عرضه)

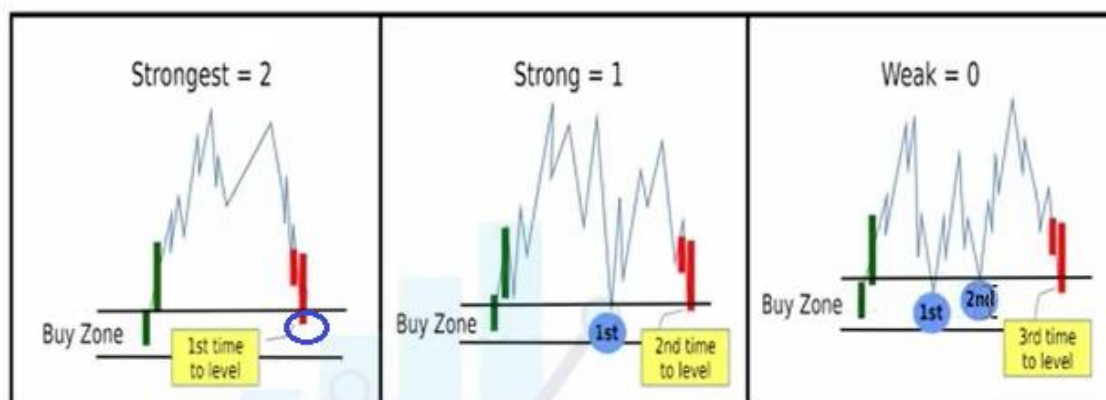
و به همین ترتیب برای ناحیه تقاضا، Open و Low در آخرین کندل نزولی در یک روند شارپ نزول

بصورت زیر:



شکل ۸-۴ محدوده عرضه و تقاضا در دیدگاه اول

موضوع دیگر تعداد دفعات برخوردها به سطوح عرضه و تقاضا و فاصله زمانی است. ما به دنبال اولین برخورد پس از برگشت یا FTB^۱ به این سطوح هستیم.

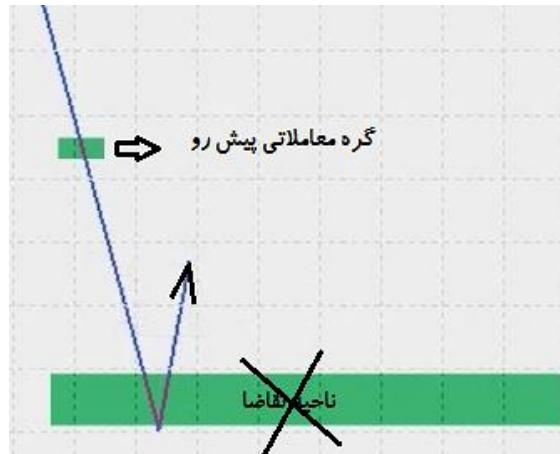


شکل ۸-۵ تعداد برخورد به سطوح عرضا و تقاضا

^۱First Time Back

۲-۱-۸ دیدگاه دوم

طبق این دیدگاه تا زمانی که حرکت مومنتوم دار برگشتی، در سطح عرضه یا تقاضای پیش رویش نفوذ نکند و یا آن را اینگلف نکند، آن گاه سطح عرضه و تقاضای بدست آمده از این حالت، سطح عرضه یا تقاضای قابل استناد نیست.



شکل ۸-۶ شرط لازم برای استناد به نواحی عرضه و تقاضا در دیدگاه دوم

این هم یکی دیگر از دیدگاه‌هایی است که ما از آن استفاده خواهیم کرد و جزء اصول ما برای پیدا کردن این سطوح است.

۳-۱-۸ دیدگاه سوم

سطح ما قبل از شکست یک خط روند توسط یک حرکت مومنتوم دار نیز به ما سطح عرضه و تقاضا می‌دهد.



شکل ۸-۷ نواحی عرضا و تقاضا حاصل از شکست مطابق با دیدگاه سوم

که در این حالت نیاز به حرکت رفت مومنتوم دار نداریم.

فصل ۹

بررسی الگوی پرایسی حاصل از

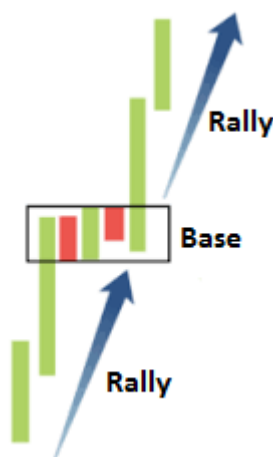
شکست RBR/DBD

فصل ۹- بررسی الگوی حاصل از شکست RBR/DBD

همانطور که می‌دانید این الگوها از شکست یک سطح حاصل می‌شوند. در این فصل قصد داریم درباره نحوه شناخت این الگو، پیدا کردن بهترین سطح و بهینه کردن آن برای ورود به ترید و همچنین انواع و اقسام بیس‌هایی که در این الگو تشکیل می‌شود صحبت خواهیم کرد.

همانطور که خودتان بهتر می‌دانید یکی از اصلی‌ترین روش‌های تشخیص یک سطح عرضه و تقاضا در همه دیدگاه‌های گفته شده، وجود یک حرکت با مومنتوم که می‌تواند دال بر این باشد که سفارش‌های زیادی در این حرکت وجود دارد، است. بنابراین

بعنوان مثال حرکت رالی بیس رالی RBR زیر را در نظر بگیرید.



شکل ۹-۱ حرکت رالی بیس رالی (RBR)

حرکت RBR یا حتی معکوس آن DBD از لگ‌های حرکتی تشکیل شده‌اند و همانطور که در آن سه دسته‌بندی لگ‌های حرکتی نشان دادیم (لگ ضعیف، لگ قوی و لگ قویترین) ما به دنبال لگ‌های قویترین هستیم، البته روی لگ‌های قوی هم می‌شود حساب کرد و در این زمینه نمی‌خواهیم وسواس به خرج دهیم. و اما بیس؟ به تعدادی کندل که درجا می‌زنند و نمی‌توانند بالا یا پایین حداقل و حداکثرها کلوز کنند یا پیوت تشکیل دهند بیس گوییم. با توجه به اینکه ما از ضرایب فرکتالی با نسبت ۴ استفاده می‌کنیم نیاز به حداقل چهار کندل داریم تا بگوییم این بیس برای تایم بالاست (دقت شود ما در تایم الگو هستیم)

انحصاراً دوالگوی RBR و DBD برای ما زمانی قابل استناد است که منجر به شکسته شدن یک سطح شوند. یعنی در مثال فوق حرکت رالی اولیه بایستی یک سطح را شکسته باشد و محدوده بیس بالای سطح شکسته شده قرار بگیرد. اگر خاطرتان باشد در فصل مربوط به شکست، سطحی داشنیم تحت عنوان سطح اکسپت بریک‌اوت، که این بیس همان سطح اکسپت بریک‌اوت است. اینکه در آینده بازار بتوانیم از چنین سطح و ناحیه ای استفاده کنیم نیازمند یک حرکت مومنتوم دار دیگر بعد از تشکیل بیس است تا دال بر آن باشد که در ناحیه سفارش و اردهای زیادی وجود دارد.

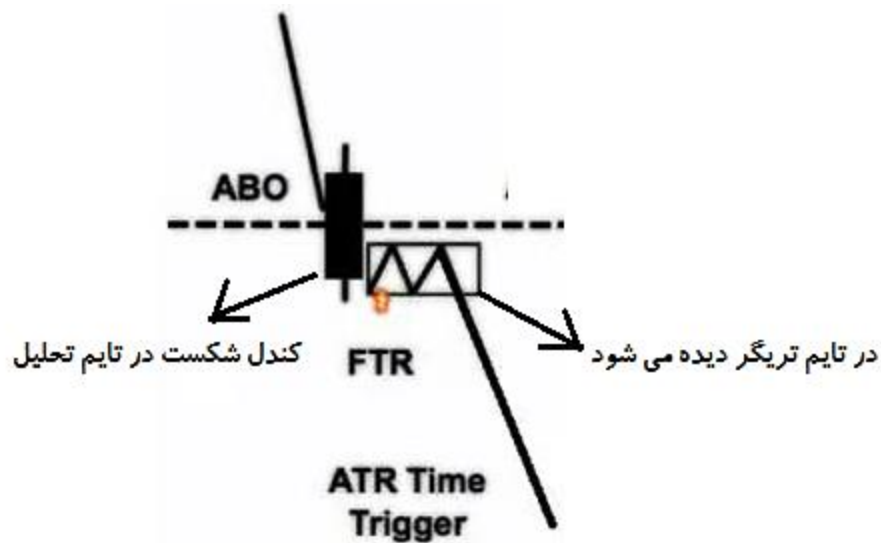
موضوع دیگری که خوب است به آن اشاره شود این است که خیلی از دوستان پرایس کار، دنبال ترید در همین ناحیه هستند و همان چیزی که در بحث شکست و اکسپت بریک‌اوت گفتیم. اما آن چه که ما در اکثر متون دیده‌ایم این است که کمتر کسی وجود دارد که بخواهد در لحظه تشکیل این سطح منتظر ترید باشد. چراکه هنوز شکستی قطعیت پیدا نکرده است. بنابراین در اکثر متون، بعد از تشکیل سطح و حرکت مومنتوم دار، زمانیکه قیمت در حال برگشت به این سطح است آن زمان این سطح و ناحیه ارزش ترید پیدا می‌کند. البته که بعضی از ماها عجل هستیم و در لحظه تشکیل چنین سطحی دست به ترید می‌زنیم.

اجازه بدهید در اینجا این ناحیه شکست یا بیس‌ها را به سه بخش FTR و ETR و CO تقسیم کنیم.

انواع بیس (یا گره معاملاتی، عرضه و تقاضا) :

۱- FTR:

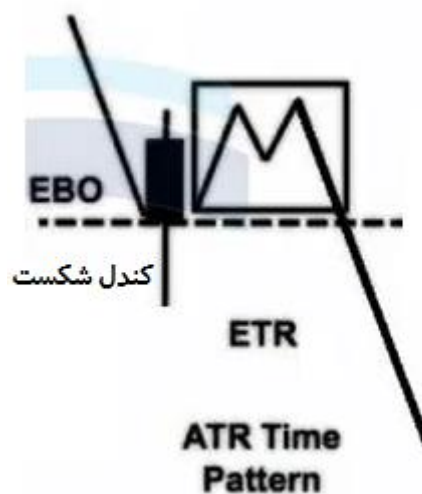
سطح و محدوده حمایتی یا مقاومتی طی یک حرکت شارپ شکسته می‌شود. در ادامه بازار طی چند کندل بصورت رنج سعی در برگشت دارد اما ناتوان از برگشت به سطح و محدوده حمایتی و مقاومتی است و در ادامه طی حرکت شارپ دیگری به ادامه حرکت ادامه می‌دهد. محدوده رنج در این حالت به FTR معروف است. محدوده و طول حرکت برگشتی یا رنج در این حالت، برابر با **ATR** تایم‌تریگر است.



شکل ۲-۹ FTR

۲- ETR

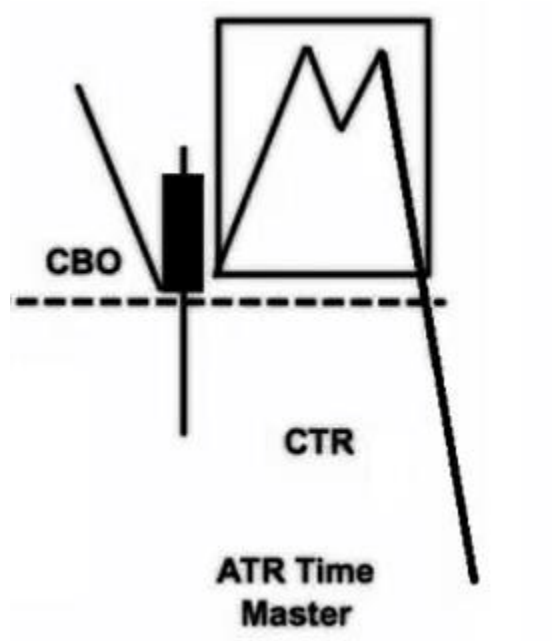
بازار طی یک حرکت شارپ به محدوده حمایتی و مقاومتی نفوذ میکند و آن را اینگلف می کند (در تایم اصلی خودش را بصورت یک کندل با شادو نشان می دهد اما بسته شدن آن در داخل سطح مقاومتی یا حمایتی است). در ادامه بازار طی چند کندل بصورت رنج مجدداً به محدوده مقاومتی و حمایتی وارد می شود و در ادامه طی حرکت شارپ دیگری به ادامه حرکت و شکست سطح جامه عمل می پوشاند. ما محدوده رنج در این حالت به ETR می نامیم. طول حرکت و محدوده برگشتی در این حالت برابر با ATR تایم فریم پترن است. (یک نوع پیش شکست است این حرکت)



شکل ۳-۹ ETR

۳- CTR

حرکتی است که است که سطح و محدوده حمایتی مقاومتی طی یک حرکت شارپ شکسته شود، اگر طول یا گام حرکتی نفوذ و اینگلف به بیرون ناحیه مقاومتی یا حمایتی برابر با ATR تایم تحلیل باشد باشد در این حالت یک CO اتفاق افتاده است. این حالت در تایم الگو می تواند ناحیه برگشتی برابر با ATR تایم تحلیل باشد که ما یک بیس دیگری می دهد.



شکل ۴-۹ CTR

تذکره ۱: اگر ناحیه برگشتی بیشتر از ATR تایم تحلیل باشد آنگاه میشود یک CBO یا کلین بریک اوت اتفاق افتاده و ماموریت شکست انجام شده و بازار به جای صعود، برمیگردد.



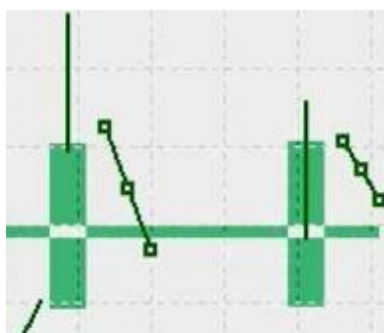
شکل ۵-۹ CBO

نکته ۱: توصیه می شود برای ترید در نواحی بیس گفته شده، اجازه تکمیل الگوهای RBR و DBD را بدهیم آن گاه در مرحله بعد وقتی بازار به این نواحی برگشت در FTB یا اولین برگشت به این سطوح اردرهایمان را ست می کنیم.

نکته ۲: تمام نواحی گفته شده در تایم اصلی، خودشان را به صورت نفوذ شدوی یک کندل در سطح بیرونی شکست نشان می‌دهند. که اگر نفوذ و بسته شدن در بیرون ناحیه مقاومتی یا حمایتی باشد، آن‌گاه در تایم تریگر، FTR یا سطح اکسپ بریک اوت در حال وقوع است. اگر کندل بصورت شدو و اینگلف کردن در بیرون از ناحیه خودش را نشان دهد اما در درون ناحیه حمایتی یا مقاومتی بسته شود، آن‌گاه احتمال تشکیل ETR در تایم پترن محتمل است. اگر کندل در سطح با شدوی بزرگ نفوذ کند و برگردد و زیر ناحیه ما بسته شود و مقدار نفوذ به بیرون سطح برابر با ATR تایم تحلیل باشد آن‌گاه CTR داریم و اگر نفوذ بیشتر از ATR تایم تحلی بود در این حالت یک CO یا CBO را خواهیم داشت.

نکته ۳: تمام نواحی که عرض کردیم در تایم اصلی خودشان را بصورت یک کندل با شدو نشان می‌دهند. اما اما ممکن است در جاهایی دیده می‌شود که دو کندل بصورت two bar داریم که برآیند این دو کندل، نقش آن تک کندل شکستی که شدو دارد را ایفا می‌کند. دلیل این اتفاق این است که ناحیه شکست ما برای تایم تحلیل بالاتر است (مثلا دو روزه یا هشت ساعته که ما آن را نداریم).

نکته ۴: زمانیکه که ما یک کندل لانگ بار داریم که باعث شکست یک سطح مثلا مقاومتی می‌شود، اما شدوی دارد در جهت شکست، آن‌گاه تمایل حرکت برگشتی این کندل نسبت به کندل لانگ بار دیگر اما با شدوی کوچکتر، بیشتر است.



شکل ۹-۶ ارتباط مستقیم میزان برگشت قیمت از کندل لانگ بار شکست با شدوی این کندل

توجه: این برگشت با برگشت و ایجاد نواحی FTR و ETR و ... اشتباه گرفته نشود. چرا که نواحی پرایسی در دل کندل شکست اتفاق می‌افتد.

بطور کلی: هر چه ناحیه بیس ما بزرگتر باشد، ما در منطقه دورتری ورود میکنیم، یعنی:
اگر FTR یا سطح اکسپت بریکاوت داشتیم در برگشت قیمت به این ناحیه، ابتدای ناحیه نقطه ورود ماست.

اگر ETR داشتیم در پنجاه درصد دوم اردر گذاری کنیم.
اگر CTR داشتیم در ۲۵ درصد انتهایی ناحیه ورود می کنیم.

فصل ۱۰

بررسی الگوهای پرایسی حاصل از

برگشت RBD/DBR

فصل ۱۰- بررسی الگوی پرایسی حاصل از برگشت RBD/DBR

در این فصل در مورد دو الگوی RBD و DBR صحبت خواهیم کرد. این الگوها همانطور که از نامشان پیداست، نیاز به دو لگ حرکتی شارپ رفت و برگشت و یک ناحیه بیس دارند. اجازه بدهید در این حالت بدون هیچ توضیحی، مستقیم به بحث اصلی با ذکر مثال بپردازیم.

برای تعیین ناحیه بیس در این حالت بصورت زیر عمل می‌کنیم:

ابتدا حرکت RBD زیر را در نظر بگیرید:



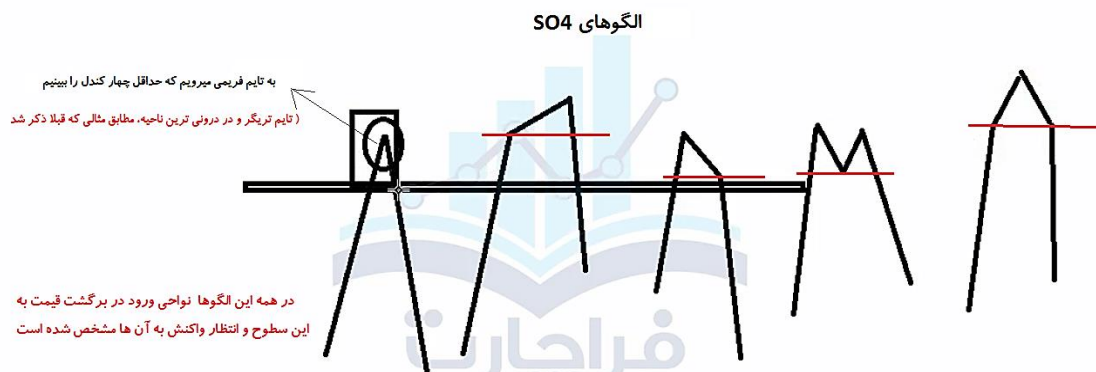
شکل ۱۰-۱ نمونه‌ای از یک حرکت رالی بیس دراپ RBD

برای تعیین نواحی بیس که در این حالت از نوع عرضه هستند، ما بدین صورت عمل می‌کنیم که ناحیه بیس یا درج‌زدن را به دو ناحیه تقسیم می‌کنیم: ناحیه بالایی: از بالاترین شدو تا مشترک open و close کندل‌ها و ناحیه پایینی: پایین‌ترین شدو تا مشترک open و close کندل‌ها.



شکل ۱۰-۲ تقسیم ناحیه بیس در حرکت رالی بیس دراپ

نکته: یکی دیگر از اسامی الگوهای فوق، Caps on Price یا کلاه گذاشتن سر قیمت است. بدین معنی که مثلاً در یک حرکت شارپ صعودی و عبور از یک سطح و شکست آن بعد از تشکیل بیس، ما انتظار حرکت شارپ صعودی داریم، اما می‌بینیم مارکت برمیگردد! چیزی که در اینجا اتفاق می‌افتد همان الگوهای SO4 است که ما خدمت شما گفتیم. در واقع ما اعتقادی به کپس آن پرایس نداریم، چراکه دلیل این امر آن است که ما محدوده مقاومتی و حمایتی که مربوط به تایم بالاتر بوده را نادیده گرفتیم و شکست را در تایم پایینتر بررسی کردیم. در حالیکه در تایم بالا شکست اتفاق نیفتاده است.



فصل ۱۱

ستاپ‌های ترید و تریگرهای ورود

فصل ۱۱- ستاپ‌های ترید و تریگرهای ورود

در بحث کلاسیک اصل موضوع این است که شما به هر روشی که بخواهید تحلیل کنید بایستی در ابتدا یک ناحیه و یا یک سطح را پیدا کنید که این مرحله گام اول تحلیل است. در گام دوم وقتی قیمت به چنین سطح یا ناحیه ای می‌رسد، احتیاج به یک سری از نشانه‌ها برای ورود داریم. این نشانه‌ها می‌تواند نشانه‌هایی دال بر شکسته شدن سطح و عبور قیمت از سطح، یا اینکه نشانه‌هایی مبنی بر چرخش از این سطح و تشکیل پیوت باشد. پس ما به دنبال یک سری از نشانه‌ها هستیم. در سیستم قدیمی اگر یادتان باشد ما یک سطح داشتیم، در مرحله بعد رفتار قیمت را در ناحیه رسیدن به سطح بررسی می‌کردیم که آیا منجر به شکست و یا تشکیل پیوت می‌شود یا خیر. در این حالت در ادامه منتظر تاییدیه بودیم. در بحث تاییدیه و دسته بندی تریگرها که ما دنبال آن آخرین نشانه‌هایی هستیم که به ما آن به اصطلاح قوت قلب لازم در جهت ورود را می‌دهد.

در بحث تکنیکال کلاسیک، ما این تاییدیه یا تریگرها را از اسیلاتورهایی همچون بریک اوت RSI، یا استفاده از MACD و تغییر فازش و یا بحث واگرایی‌ها و یا مووینگ اوریج‌ها و ... می‌گرفتیم. اما آن چه که ما از آن در جهت تریگر ورود بهره می‌بریم استفاده از روش‌های ترسیمی همچون خط روند است. اگر ما تنها از یک تایم فریم برای تحلیل و ورود استفاده کنیم، مطمئناً تارگت‌ها و استاپ لاس‌ها در این حالت با چارچوب مدیریت سرمایه سازگار نخواهد بود. به همین جهت ما برای اینکه بتوانیم یک نقطه بهینه برای ورود داشته باشیم بایستی به صورت مولتی تایم کار کنیم. اجازه بدهید بحث تریگرهای ورود و ستاپ‌هایی که در اینجا ما آن‌ها را جمع بندی خواهیم کرد (ستاپ ماهیت، شکست و پیوت)، بصورت یکجا، مختصر مطرح کنیم و در پایان ستاپ اصلی را که موضوع اصلی جزوه حال حاضر است به تفصیل و با ذکر جزییات شرح خواهیم داد.

۱۱-۱- ستاپ ماهیت

اولین ستاپ ما، استفاده از ماهیت سطح است. یعنی اگر مثلاً یک سطح مقاومتی داریم، در این حالت ترید ما براساس ماهیت این سطح که همانا مقاومتی یا برگشتیست خواهد بود. ما می‌توانیم از همین خاصیت استفاده کنیم. وقتی یک سطح یا یک پیوت در گذشته مطابق با تعاریف گفته شده داریم و مارکت خودش را به آن سطح می‌رساند، آن گاه در این حالت دیدگاه سل (sell) داریم. در این حالت بدون اینکه هیچ اتفاقی بیفتد، ما مستقیماً به تایم تریگر می‌رویم و در آنجا شرایط بازار را برای اینکه آن سطح محل چرخش ما باشد، بررسی می‌کنیم.

برای مثال سطح شکل ۱۱-۱ را در نظر بگیرید که ماهیت مقاومتی دارد.



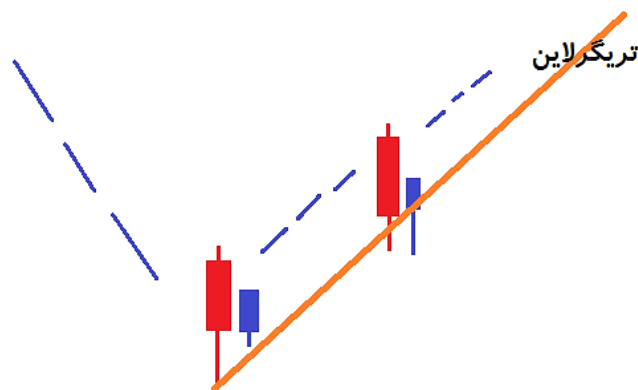
شکل ۱۱-۱ سطح مقاومتی مربوط به تایم هفتگی

در این حالت اصلاً منتظر نمی‌مانیم که در تایم فریم هفتگی بازار بیاید یک هفته به سطح برسد و یک هفته تشکیل پیوت دهد و چند هفته هم برگشت به پیوت داشته باشد. برای همین در این حالت با توجه به ماهیت سطح مستقیم به تایم تریگر می‌رویم و با شکست آن ورود می‌کنیم.



شکل ۱۱-۲ رسماً تریگرلین در تایم تریگر (چهار ساعته)

تریگرلین: رسم یک خط با استفاده از دوتا از آخرین Low ها (در روند صعودی) یا با استفاده از آخرین دو High موجود (در روند نزولی) تریگرلین ما خواهد بود بطوریکه به منظور داشتن بیشترین شیب در تریگرلین و نتیجتاً کمترین استاپ لاس، در اولین سوئینگ، شدو و در سوئینگ دوم مشترک open و close ها را لحاظ می‌کنیم.



شکل ۱۱-۳ تریگر لاین

۲-۱۱- ستاپ شکست

دومین ستاپ مربوط به شکست سطح است. یعنی در یک تایم فریم ما یک سطحی داریم و مارکت مطابق با تمام آن شرایط که گفتیم (پکیج شکست) سطح را می‌شکند. در این حالت بعد از آخرین مرحله شکست و در ریتیرس به سمت سطح شکسته شده با رسم تریگر لاین و شکست این خط وارد مارکت می‌شویم.

بعنوان مثال سطح زیر را در نظر بگیرید:



شکل ۱۱-۴ شکست سطح حمایتی تایم روزانه

شکست اتفاق افتاده، در نتیجه به تایم تریگر می‌رویم:



شکل ۱۱-۵ رسم تریگر لاین در تایم تریگر

در این حالت با رسم تریگر لاین و شکست آن وارد می شویم.

۳-۱۱-ستاپ پیوت

اجازه بدهید در وهله اول و بعنوان مقدمه، ورود به چنین ستاپی را بصورت مختصر و کلاسیک بررسی کنیم تا یک دید کلی از چگونگی این نوع ستاپ داشته باشیم و در پایان فصل و همچنین یک بخش تحت عنوان "پرسش و پاسخ"، سعی می‌کنیم حداکثر جزییات ممکن چنین ستاپی را برای شما تشریح کنیم.

و اما مقدمه:

ستاپ پیوت نیز براساس ماهیت سطح است. اما در این جا صبر میکنیم تا یکی از دو حالت تشکیل پیوت یا شکست روی سطح اتفاق بیفتد. ضمناً این سطحی که در مورد آن صحبت می‌کنیم، بایستی از قبل در مورد تایم فریم آن اطمینان پیدا کنیم و در ادامه به بررسی سایر موارد بپردازیم. یعنی بعنوان مثال اگر یک سطح روزانه داریم باید منتظر تشکیل پیوت روزانه باشیم. آن‌گاه منتظر یک ریترن تو پیوت به سطح FTC باشیم. سطح FTC یک سطح صفر و مطلق نیست و محدوده است. در اینجا که میخواهیم حال کلاسیک و با استفاده از تریگر لاین ورود کنیم، فرض میکنیم هیچگونه ذهنیتی نسبت به محل و محدوده FTC نداریم و میخواهیم کاملاً کلاسیک وارد شویم.

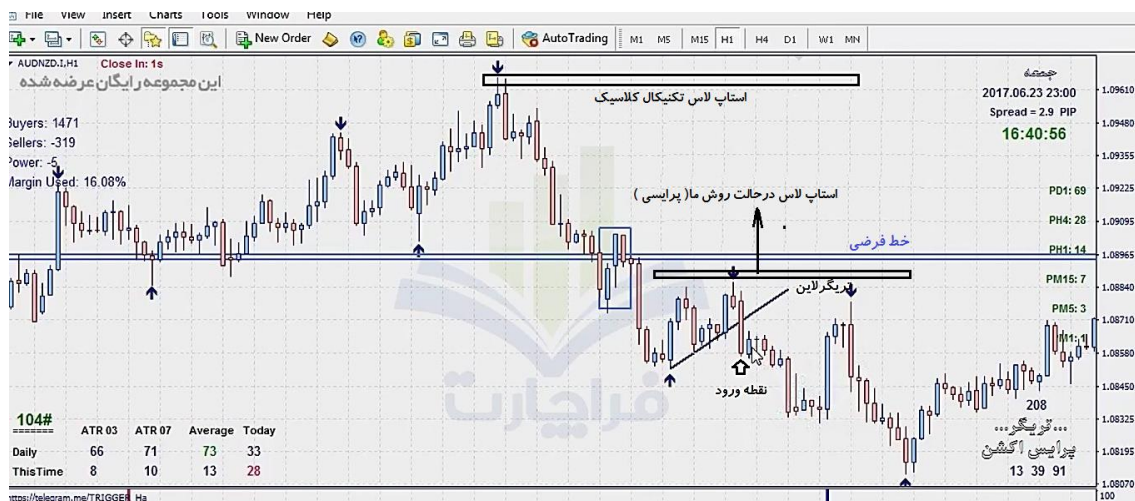
در چنین حالتی چون ما سطح FTC را نداریم لذا بصورت مولتی تایم و از تریگر لاین استفاده می‌کنیم.

بعنوان مثال در شکل ۱۱-۶ همان طور که می‌بینید و همانطور که گفتیم در صورت نداشتن مسترکندل از خط فرضی استفاده می‌کنیم و کندل پوشاننده بایستی این خط را اینگلف یا کلوز کند. با توجه به طول حرکت و این کندل پوشاننده، ما یک پیوت داریم.



شکل ۱۱-۶ اینگلف خط فرضی و تشکیل پیوت روزانه

حال به تایم تریگر می‌رویم که در آنجا منتظر شکست تریگرلاین هستیم.



شکل ۱۱-۷ تریگرلاین، نقطه ورود، و استاپ لاس

استاپ لاس ما در چنین شرایطی برخلاف سطح کلاسیک که در بالای قله و سوئینگ پیوت قبلی (پیوت در تایم تحلیل) قرار میگرفت در این حالت بالای آخرین پیوت مینوری (پیوت تایم تریگر) قبل از شکست تریگرلاین است. استاپ لاس در این حالت برابر ATR تایم تریگر بالای این سوئینگ قبل از

شکست یا همان پیوت مینوری است. و اما تارگت‌ها:

تارگت‌ها از سوئینگ قبل از ورود به ترتیب، برابر با ART تایم یکساعته، چهار ساعته و روزانه خواهد بود (مطابق شکل ۸-۱۱). ما در این حالت که از تریگرلاین استفاده می‌کنیم، برخی از گام‌ها را از دست می‌دهیم و در واقع دورتر اما مطمئن‌تر وارد می‌شویم. لذا حتی می‌توان از تارگت تایم‌های بالاتر هم استفاده کرد. (تارگت‌های یک به یک، یک به سه، یک به هفت و ...)



شکل ۸-۱۱ نحوه تارگت‌گذاری

نکته: بازار مطابق با گام‌های حرکتی پیش خواهد رفت.

و اما انواع پیوت.

بطور کلی پیوت‌ها از نظر عملکردی به سه دسته تقسیم می‌شوند: ۱- پیوت پولبکی، ۲- پیوت تسویه و ۳- پیوت برگشتی یا ریورسال. آنچه که اینجا در مبحث ستاپ پیوت برای ما مهمترین است پیوت‌های از نوع برگشتی هستند که درصد موفقیت بسیار بالاتری دارند. البته که پیوت‌های پولبکی و تسویه نیز در مواردی می‌توان با در نظر گرفتن ریسک به ریوردهایشان، از آن‌ها در ترید بهره برد.

مختصر توضیحاتی در ارتباط با این پیوت‌ها:

۱- پیوت پولبکی:

پیوت پولبکی بعد از شکست یک سطح یا یک خط روند در زمان تشکیل اکسپت بریک‌اوت تشکیل می‌شود. این پیوت بعد از کندل شکست با آن شرایط کندل لانگ‌بار شکست به وجود می‌آید.

در شکل زیر یک پیوت پولبکی به تصویر کشیده شده است.



شکل ۹-۱۱ پیوت پولبکی

۲- پیوت تسویه

این پیوت در زمان رسیدن قیمت به ناحیه حمایت یا مقاومت و در نزدیکی آن‌ها و یا همچنین در تایم‌های پایین‌تر از تایم اصلی خط با اولین برخورد تشکیل می‌شود. این پیوت را معمولاً در زمانیکه قیمت از یک سطح هم‌تراز و یا تایم بالاتر به سطح مینوری برسد، خواهیم داشت. دلیل نامگذاری آن هم این است که چنین پیوتی در زمان تسویه و رسیدن قیمت به تارگت برخی خریداران یا فروشندگان و خروج آن‌ها از بازار شکل می‌گیرد.



شکل ۱۰-۱۱ پیوت تسویه

۳- پیوت برگشتی یا ریورسال

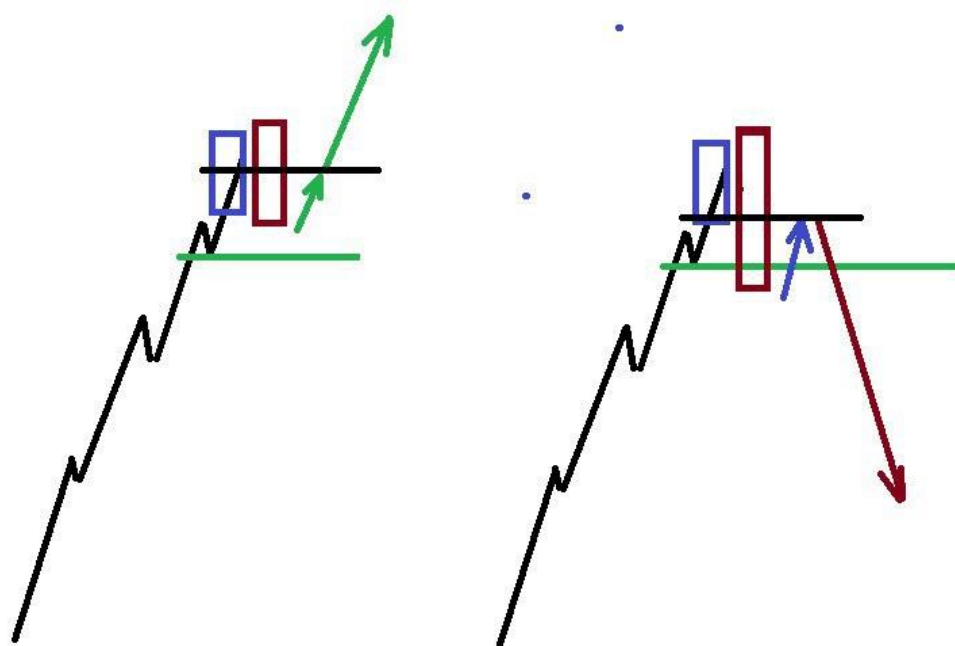
پیوتی که ما به دنبال آن هستیم و بیشترین درجه موفقیت را در تریدها به خودش اختصاص می‌دهد. این پیوت در تایم خود سطح تشکیل می‌شود و زمانی ارزش ترید بالاتری دارد که کندل اینگلف کننده (پوشاننده مسترکندل یا خط فرضی)، علاوه بر وظیفه پوشش خود، گره معاملاتی لگ قبل را اینگلف (نفوذ در بیرونی ترین سطح گره معاملاتی) کند. در چنین پیوتی انتظار برگشت به سطح FTC و واکنش به آن و نهایتاً باعث برگشت و ریورس قیمت می‌شود.



شکل ۱۱-۱۱ پیوت ریورسال یا برگشتی

آنچه که تا به اینجا در مورد ستاپ پیوتی و نحوه ورود به چنین ستاپی مطرح کردیم، تنها راه موجود نیست. همانطور که قبلاً عرض کردیم ما دو راه برای ورود به چنین ستاپی داریم یکی بصورت کلاسیک و رسم تریگرلاین و دیگری از طریق اردرگذاری مطمئناً تا به اینجا در ذهنتان سوالات بسیار زیادی در ارتباط با محدوده FTC و نحوه تعیین آن وجود دارد. در ادامه سعی خواهیم کرد چگونگی یافتن چنین ناحیه‌ای را برای شما شرح دهیم.

از آنجا که تا به حال تا حدودی با سطوح عرضه و تقاضا آشنا شدیم، فهم FTC راحتتر است. همانطور که گفتیم FTC، یک خط صفر مطلق نیست و محدوده است. بدین منظور شکل زیر را در نظر بگیرید.



شکل ۱۱-۱۲ دو سطح FTC سمت راست: قابل استناد، سمت چپ: غیرقابل استناد

همانطور که مشاهده می‌کنید کندل پوشاننده، زیر مستر کندل ما قبل خود بسته شده است (اگر مستر کندل نداشتیم از خط فرضی استفاده می‌کردیم). ما معمولاً در دل مستر کندل یک یا دو گره معاملاتی خواهیم داشت. همان گره‌ها یا بیس‌هایی که در الگوهای پرایسی در فصول قبل به آن‌ها اشاره کردیم. اولین گره معاملاتی یا بالاترین آن (چون در اینجا حرکت ماقبل صعودی بوده) همان محدوده FTC ماست. اما این سطح FTC چه موقع برای ما قابل اتکا و استناد است؟ زمانیکه کندل پوشاننده علاوه بر بسته شدن زیر مستر کندل یا خط فرضی، در سطح بیرونی گره ماقبل از مستر کندل یا خط فرضی نفوذ کند یا بعبارت دیگر آن را اینگلف کند، آن گاه سطح FTC مهم خواهد شد و انتظار برگشت قیمت از آن را خواهیم داشت.

۴-۱۱- پرسشی و پاسخ

۱- آیا بعد از تشکیل پیوت، می‌توان ریترن به پیوت یا همان ریترن به سطح FTC را نیز ترید کرد؟

پاسخ: بله. همانطور که در بحث انواع پیوت گفتیم، در پیوت‌های تسویه و پولبکی سطح FTC واکنش و برگشت قیمت قابل توجهی را موجب نمی‌شود و در نهایت قیمت از سطح FTC عبور میکند و ادامه روند ماقبل انجام می‌شود. لذا در اینگونه موارد ما میتوانیم از تریگری تحت عنوان تریگر مگنتی که

برعکس تریگرلاین متداول ماست، استفاده کنیم و با شکست آن، حتی ریترن تو پیوت را ترید کنیم. بهتر است این استراتژی همانند استراتژی مرسوم ستاپ پیوت در حساب دمو تست شود و بعد از گرفتن فیدبک مناسب یکی از این دو استراتژی و یا هر دو را توامان دنبال کرد.

۲- آیا می‌شود بدون توجه به گذشته چارت ترید کرد؟ یعنی هر جا سه کندل در یک راستا یا یک لگ حرکتی داشتیم و متعاقبا کندل پوشاننده، آن گاه به تایم تریگر رفته و با رسم تریگرلاین یا اردرگذاری ترید کنیم؟

پاسخ: بله. ما در ترید براساس پیوت دو دیدگاه داریم: دیدگاه اول: به گذشته چارت نیاز نیست. هرگاه پیوت تایم مربوطه شکل گرفت به تایم تریگر می‌رویم و با روش کلاسیک یا اردرگذاری در محدوده FTC ورود می‌کنیم.

دیدگاه دوم: به گذشته چارت رجوع می‌کنیم. در این حالت سطحی از گذشته داریم. پیوت در این سطح شکل می‌گیرد. بررسی می‌کنیم پیوت شکل گرفته از کدام نوع از انواع پولبکی، تسویه و ریورسال است. همچنین سابقه آن سطح را می‌شود بررسی کرد (فصل مربوط به ارزش گذاری سطوح و احتمال شکست و ...). بعد از کسب اطمینان از موارد گفته شده به تایم تریگر رفته و متناسب با نوع پیوت ورود می‌کنیم.

۳- تا چه تعداد می‌توان روی یک سطح ریسک ورود داشت؟

پاسخ: ما براساس دیدگاه خودمان روی یک سطح بیش از سه بار ریسک ورود را نخواهیم کرد.

۴- میزان زمان رسیدن به تارگت ؟

پاسخ: حداقل زمان انتظار برای رسیدن به تارگت (تارگت‌های بزرگ با گام حرکتی تایم تحلیل) برای ورود، حداقل برابر با مدت زمان یک تایم فریم بالاتر از تایم تحلیل و برای تارگت خوردن نیز به همان اندازه. مثلا برای پیوت روزانه، یک هفته انتظار برای ورود و یک هفته دیگر برای رسیدن به تارگت.

۵- چه تعداد کندل باید برای کندل پوشاننده فرصت داد؟

پاسخ: ما تا دو کندل بعد از ایجاد مسترکندل یا خط فرضی، به کندل پوشاننده فرصت پوشش می‌دهیم. اگر چنین شد در ریترن تو پیوت وارد می‌شویم. اگر بیش از دو کندل شد، یعنی در کندل سوم به بعد، مستر کندل یا خط فرض پوشش داده شد، آن‌گاه برای ما چنین پیوتی در لحظه تشکیل ارزش ترید ندارد. و صرفاً به ما در تعیین سطوح کمک می‌کند.

چراکه ما در تعریف پیوت به دنبال دو کارایی آن هستیم. یکی به ما در تشخیص سطح کمک میکند و دیگری اینکه در لحظه تشکیل آن‌ها بتوانیم با آن‌ها ترید کنیم.

۶- در زمانی که تریگر لاین قابل ترسیم نیست چه باید کرد؟

پاسخ: میتوان از تایم پایین تر یا دبل تریگر استفاده کرد اما با استاپ‌های تایم تریگر و تارگت‌های ای تی آری.

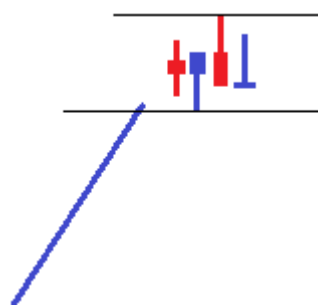
۷- آیا احتمال شکست مثلاً یک سطح چهار ساعته توسط سطح یک ساعته وجود دارد؟

پاسخ: بله. قیمت همیشه از یک پیوت همتراز برمی‌گردد و به پیوت همتراز دیگر می‌رسد. فرض کنید قیمت از یک سطح روزانه در حال برگشت است در این حرکت برگشتی احتمال تشکیل پیوت‌های H4 و H1 وجود دارد. در این بین ممکن است قیمت در ابتدا به پیوت H1 برسد و از این طریق سطح یا پیوت H4 را خواهد شکست. چرا که سطح H1 توسط سطح قویتر روزانه پشتیبانی می‌شود.

۸- اگر قیمت بعد از چند کندل در جازدن نتوانست پیوت تشکیل دهد آن‌گاه چه باید کرد؟

پاسخ: اجازه بدهید سوال شما را بدین صورت تغییر دهیم: اگر قیمت پس از چندین کندل استاندارد (مسترکندل) و یا غیر استاندارد (اسپینینگ) نتوانست پیوت تشکیل دهد و هیچ‌یک از این کندل‌ها نتوانستند زیر Low و یا High یکدیگر کلوز کنند آنگاه چه باید کرد؟ در جواب باید بگوییم هرگاه ما یک لگ حرکتی داشته باشیم و در ادامه حداقل چهار کندل وجود داشته باشد که هیچ‌یک نتوانند همدیگر را پوشش دهند، آن‌گاه بیس پیوت داریم. در این حالت بالاترین و پایین‌ترین محدوده این بیس را مشخص می‌کنیم. به تایم تریگر رفته، هرگاه قیمت یکی از این سطوح را شکست، ما در جهت شکست وارد می‌شویم. استاپ لاس ما سطح مقابل خواهد بود.

لازم به ذکر است، تعداد چهار کندل مد نظر که عرض کردیم، از تایم‌های فرکتالی مضرب چهاری که ما از آن استفاده می‌کنیم، آورده شده است. لذا هرگاه حداقل چهار کندل داشتیم، چنین پیوتی مربوط به یک تایم بالاتر خواهد بود. و لذا تریگر آن یک تایم پایین‌تر از تایمی که حداقل چهار کندل نمایان است، خواهد بود.



شکل ۱۱-۱۳ بیس پیوت

حتی در این حالت میتوان خرید در کف و فروش در سقف با استفاده از تریگرلاین را هم داشت.

توجه: بیس پیوت با پیوتی که بعد از تشکیل حداقل دو کندل از نوع پوشاننده اما ناتوان در پوشش مسٹرکندل، تشکیل می‌شود، اشتباه نشود. چرا که در این حالت گفتیم ارزش ترید در لحظه تشکیل ندارد. (شکل ۱۱-۱۴)



شکل ۱۱-۱۴ پیوتی که حتی اگر زیر مستر کندل بسته شود ارزش ترید در لحظه تشکیل ندارد.

۹- چه موقع می‌توان دبل‌تریگر و یا هتريک کرد؟

پاسخ: وقتی تایم اصلی بزرگ است مثلاً ماهانه، هفتگی و یا حتی روزانه. در چنین حالتی می‌توان به تایم دبل‌تریگر و یا هتريک رفت و ورودهای یک به یک یا نهایتاً یک به دو داشته باشیم. البته باید صبر کرد تریگرلاین تایم تریگر شکسته شود بعد به تایم دبل‌ترگر و هتريک برویم. البته تا قبل از شکست تریگرلاین، می‌توان از تریگر مگنتی و ماهیت مگنتی سطوح نیز بهره برد.

۱۰- آیا قیمت در برگشت به سطح FTC، خود را در تایم تحلیل بصورت یک شدو نشان می‌دهد؟

پاسخ: بله. بعد از تشکیل پیوت در تایم تحلیل، در کندل بعد قیمت یک شدو به سمت سطح FTC می‌زند که این شدو در تایم تریگر به صورت یک موج است.

نکته: وقتی سطح FTC یکبار دیده شد، در مرحله بعد و برگشت مجدد قیمت به پیوت، سطح FTC بی ارزش است و در این حالت ما یک ناحیه داریم به اسم^۱ RTP. این ناحیه از برگشت اولیه قیمت به سمت سطح FTC حاصل می‌شود. که یکی از نواحی پرایسی FTR، ETR یا CTR خواهد بود که براساس مطالب فصل ۹، هر یک نواحی ورود مختص به خود را دارند.

^۱Return To Pivot

هرگاه قیمت یکی از نواحی پرایسی را اینگلف کند (از بیرونی ترین سطح آن‌ها عبور کند)، آن‌گاه انتظار برگشت قیمت را داریم اما در مرحله بعد این نواحی قطعاً خواهند شکست.

۱۱- هرگاه سطوح چند تایم در درون یکدیگر قرار گرفتند، انتظار پیوت در کدام سطوح مدنظر است؟

پاسخ: در همپوشانی سطوح، اولویت با تایم بالاتر است.

۱۲- آیا می‌شود از بالاترین تایم به فکر تشکیل پیوت بود و رویکرد از بالا به پایین داشت؟

پاسخ: یک دیدگاه بدین صورت است که بعنوان مثال فرض کنید یک پیوت ماهانه شکل گرفته و ریترن به FTC را زده و قیمت به ادامه روند برگشتی پرداخته است. در این حالت به تایم هفتگی می‌رویم و به دنبال پیوت هفتگی می‌گردیم. این روند پلکانی از بالا به پایین را تا زمانی ادامه می‌دهیم تا آخرین پیوت آخرین تایم‌فریمی که هنوز ریترن به FTC زده است را بیابیم. این پیوت برای ما حائز اهمیت است.