

Trading System

مجموعه جلسات برگزار شده در گروه دانش سرای تحلیلگران بورس ایران

مدرس: خاطره نیکویی

تریدینگ سیستم

قرار شد تریدینگ سیستمی بسازیم که نقطه ورود، نقطه خروج، استاپ لاس و مدیریت ریسکمان جزو اصلی این تریدینگ سیستم، تریدینگ پلن است که را مشخص کند.

برنامه ای که تنظیم میکنیم تا در طول ترید بدانیم چه باید بکنیم. وقتی پوزیشن میگیرید و روند بر خلاف شما میشود و وارد ضرر میگردید، دیگر نمی دانید باید چیکار کنید و تصمیم احساسی میگیرید اما اگر از قبل تصمیم گرفته باشید، تکلیفتان با خودتان روشن خواهد بود.



نمودار 1

در این جلسه می خواهیم طلای جهانی را باهم تحلیل کنیم و نقش موینگ اوج ها و طریقه ی استفاده از آنها را ببینیم.

اولین کار دیدن نمودار در تایم فریم ماهانه ست. نمودار 1

موقعیت آخرین قیمت را پیدا میکنیم. در حال حاضر پایین ترین قیمت به فیب 50 برخورد کرده و یک تصحیح حرکتی کرده است. زمانیکه قیمت به فیب برخورد میکند، اگر متوقف بشود معمولا حول محور آن فیب یا بین دو فیب شروع به ساختن پترن میکند که در نمودار 1 رسم شده است.



نمودار 2

یکی از بهترین روشها استفاده ی چند موینگ کنار همدیگر می باشد.

موینگ قرمز 50 و موینگ آبی 100 می باشد.

توجه کنید که موینگهایی که استفاده میکنیم با تنظیم سیمپل و قیمت کلوز هستند.

به حرکت آخر طلا نگاه کنید که به موینگ 100 برخورد کرده و نتوانسته بالاتر برود و این حرکت مربوط به حرکت جمعه ی قبل است. به حرکت ماندالایی قیمت حول موینگ توجه کنید. کمی بالاتر زمانیکه که موینگ 50 قرمز رنگ شکسته شده است، یک حرکت برگشتی به موینگ داشته ولی بالاتر نتوانسته برود و به حرکت نزولی خودش تا قیمت کف ادامه داده است. پس میتوانیم نتیجه بگیریم که موینگها به عنوان تعیین کننده ی نگهداری و یا بستن پوزیشن بسیار موثر هستند.

شما طلا را سل یا فروختید و شروع به برگشتن میکند، میتوانید مدیریت ریسکتان را بر اساس موینگها بچینید.

حالا ببینیم در شروع چطور باید با موینگها کار کنیم.

شما زمانی که با موینگ کار میکنید و وارد معامله میشوید که یک روند پایان گرفته است، مارکت پترن ساخته و بعد از شکستن پترن وقتی مارکت از موینگ 50 رد شد، وارد معامله میشوید. وقتی پترن ساخته بشود و تموم شود و موقع پوزیشن گرفتن باشد، موینگ 50 به مارکت نزدیکتر و موینگ 100 دورتر است. بنابراین اگر چیزی به غیر از این بود به این معناست که موقع پوزیشن گرفتن نیست.



نمودار 3

در نمودار 3 نمودار هفتگی را داریم. به موقعیت موینگهای 50 و 100 و قرارگیریشان توجه کنید. این شکل درست موینگهایی است که میتوانید با آنها پوزیشن بگیرید.

زمانیکه موینگ 50 شکسته بشود، میتوانید وارد معامله خرید شوید و با گذر از 100 به پوزیشن خودتان اضافه کنید و استاپتان یا حد ضرر را زیر فیب 50 بگذارید.

این یک تریدینگ سیستم بسیار ساده و کارآمد.

دوستان دنبال پیچیدگی بودن در بازار سرمایه تنها باعث پیچیدگی در پول خواهد شد.

طراحی این سیستم 1,5 سال کار برده تا بتوانم همین چند خط را با اطمینان به شما بگویم.



نمودار 4

در نمودار 4 ببینید که قیمت پس از برخورد به فیب 38، کندل برگشتی شکل داده و کف قیمت تا نزدیکی موینگ 100 برگشته و نتوانسته پایین تر برود.



نمودار 5

و اما در تایم فریم یک ساعته چه اتفاقی افتاده است. در نمودار 5 می بینیم بعد از گذر مارکت از 50 و 100 که در واقع رزیستنس ما در 4 ساعته بوده است، می توانستیم معامله خرید باز کنیم و کانال حرکتی را بکشیم. برای دوشنبه پیش بینی میکنم اگر کانال صعودی شکسته بشود، قیمت به موینگهای خودش در نمودار 5 که علامت بیضی زدم برخواهد گشت و اگر به حرکتش ادامه بدهد، به موینگهای تایم فریم روزانه نمودار 3 خواهد رسید.

پس منتظر خواهیم ماند تا عملکرد موینگها را در هفته ی پیش رو ببینیم.

این جلسه می خواهیم پیش بینی هفته ی پیش را بررسی کنیم و اعتبار موینگ اورچها را بسنجیم. نمودار 1 نمودار هفته پیش است.



نمودار 1

اگر به جلسه ی پیش برگردید این پیش بینی را خواهید دید (برای دوشنبه پیش بینی میکنم اگر کانال صعودی شکسته بشود، قیمت به موینگهای خودش در نمودار 5 که علامت بیضی زدم برخورد گشت و اگر به حرکتش ادامه بدهد، به موینگهای تایم فریم روزانه نمودار 3 خواهد رسید.)

و اما آنچه اتفاق افتاد.



نمودار 2

در نمودار 2 میبینیم که دقیقا دیروز طلا به موینگ 50 روزانه برخورد کرده و نتوانسته عبور کند و این موینگ قیمت را به پایین رانده است. در نقطه ای که علامت خورده است، زوم کنید تا برخورد طلا به موینگ 50 روزانه را ببینید.

جلسه ی پیش در مورد موینگها توضیح مختصری دادم و این جلسه از شروع یک پوزیشن تا انتها رو پیش میرویم.

اولین کاری که میکنیم دنبال یک پترن در آخرین برخورد و برگشت پیدا می کنیم.

قبلا گفته شد که در نقاط قوی و اصطلاحا اعداد روانی، برگشت قیمت را داریم و قیمت حول خط یا عدد شروع به ساختن پترن میکند. زمانیکه روند بازار کند شده و بین یک محدوده حرکت میکند که اصطلاحا رنج میشود، موینگها وارد محدوده ی حرکتی قیمت میشوند و تشخیص پوزیشن درست از بین میرود بنابراین متوجه میشویم که بازار در حال انتظار است. در این زمان حتما نباید پوزیشن داشته باشیم. می توانیم منتظر بمانیم تا تکلیف بازار معلوم بشود.



نمودار 3

نمودار 3 نمودار هفتگی یورو را نشان میدهد و قسمت آبی را در نمودار 4 که نمودار روزانه است می بینیم.



نمودار 4

در این قسمت می بینیم که قیمت با موینگها درگیر شده و تشکیل پترن مثلث کاهشی داده و در هفتگی این قسمت بالای موینگ 50 بوده است و هنوز نمی توانسته سقوط کند و معامله فروش بدهد زیرا در نمودار 3 که هفتگی ست، هنوز نشکسته است.

بعد از اینکه پترن شکست و قیمت از موینگها عبور کرد چه اتفاقی میفتد؟

موینگها در حالت افقی باقی میمانند و کراس میکنند و با حرکت بیشتر قیمت، موینگها هم دنبال قیمت اما با فاصله حرکت میکنند و هر بار که مارکت به عددی میخورد و تصمیم به تصحیح حرکتی میگیرد، برگشته و به موینگ برخورد کرده و دوباره به حرکت خودش ادامه میدهد.



نمودار 5

در نمودار 5 به علامتهای آبی توجه کنید تا ببینید موینگها چطور میتوانند شما را در باقی ماندن در روند، کمک کنند و چراغ راهنمایی برای شروع و خاتمه ی روند باشند.

در واقع شما بهترین رزیستنس ها را در روند، در همان تایم فریم خواهید داشت و اگر یک تایم فریم بالاتر بروید ساپورتتان را هم پیدا میکنید.

به نمودار 6 توجه کنید .



نمودار 6

بعد از شکست 50 حرکت صعودی شروع شده و تا 100 ادامه پیدا کرده است و بعد از گذر از 100 یکبار برگشت زده به 100 ولی نتوانسته عبور کنه و 100 ساپورت شده و قیمت ادامه پیدا کرده است

حالا برای اینکه بدانیم روند صعودی تا کجا ادامه دارد و کجا شکسته میشود، به تایم فریم پایین تر میرویم.