

به نام خدا

سیستم تریدینگ NTD

برگرفته از کتاب :

New Trading Dimensions

نقشته :

دکتر بیل ویلیامز

ترجمه :

ساسان امیری

گرد آوری :

(Behrouz fx)

سیستم تردینگ NTD:

با نام و یاد خدا شروع به بررسی تئوری Chaos میکنیم .

پیش از هر چیز نیاز به مقدماتی در رابطه با این موضوع به نسبه ناشناخته در میان فارکس کاران ایرانی است ...

دکتر بیل ویلیامز بنیانگذار این نوع تردید در کتب سه گانه اش نوعی از تردید و یک استراتژی غنی را معرفی میکند که مشروط به اینکه حقیقتا و عمیق درک شود میتواند کاملا نگاه ما را به بازار متفاوت کرده و با این درک عمیق از زیر ساخت های حقیقی بازار میتوانیم تردید های بسیار موفقی را داشته باشیم .

Chaos که تلفظ صحیحش عبارت است: کی-آس (کی معادل تلفظ لغت کی به معنی چه وقت) یک تئوری مشهور است که موسوم به نظریه آشوب میباشد .

این نظریه که در نوع خود بسیار جالب و مفسر بسیاری از پدیده های خاص است حجم نسبتا وسیعی از مباحث تئوریک را شامل شده و بسیاری از مقوله ها از علوم زیستی تا علوم انسانی را در بر گرفته و به ما قابلیت های جدیدی برای بررسی و تحلیل پدیده های مختلف میدهد .
به جهت اینکه این نظریه در بدو امر پیچیده به نظر میرسد ارجحتر است که فعلا وارد این بحث نشده و تنها بطور کاربردی بر روی سیستم تردینگ NTD متمرکز شویم .

انشالله در آینده شاید بر روی این نظریه به بیان ساده مطالبی داشته باشیم .
در بدو امر مطلب بالا این فکر را ایجاد میکند که احتمالا باید سیستم تردینگ NTD با کی - آس متفاوت باشد که قرار است بطور مستقل بررسی شوند ... توضیح اینکه :

واقعیت این است که ویلیامز در کتب سه گانه خود هر چند شالوده یک نگاه خاص به بازار را پی ریزی میکند (و این نشانه ارتباط و پیوستگی این سه کتاب و مکمل بودن آنهاست) اما این سه کتاب چون در مقاطع زمانی متفاوت نوشته شده اند از جهات زیادی مشابه هم و از جهاتی دیگر که در جای خود بسیار هم مهم است تفاوت اساسی دارند .

به این منظور در معرفی و بررسی سیستم تردینگ های ویلیامز برای کتاب Chaos Trading 1995 میبایست یک روش تردید و برای دو کتاب بعدی یعنی New Trading Dimensions و Chaos Trading 2004 دو روش دیگر معرفی کرد .

در اینجا ابتدا به معرفی و بررسی سیستم تردینگ (New Trading Dimensions) NTD خواهیم پرداخت و سپس در آینده به بررسی سیستم تردینگ Chaos 2004 میپردازیم .

برای کتاب اول ویلیامز که اندیکاتور و روش خاص خود را دارد تمامی ابزارهای آن معرفی میگردد اما بطور مستقل روش آن بررسی نخواهد شد .

همانطور که گفته شد مرجع ما در ارایه این مطلب کتاب New Trading Dimensions اثر بیل ویلیامز که در سال ۱۹۹۸ نوشته شده است خواهد بود لینک این کتاب در سایت آمازون موجود است .

در اینجا، تمامی تلاش بر این منوال است که روش بصورت کاملا کاربردی ارایه گردد و از بحث های طولانی و بعضا خسته کننده تئوریک دوری شود ...

هر روش تردید قدرتمند و منسجم میبایست پاسخ های دقیقی به چند سوال داشته باشد تا بتوانیم با دانستن این پاسخ ها بر اساس یک استراتژی منظم و بطور دقیق و خودکار و بدور از احساسات شخصی تردید کنیم .

اما این سوالات کدامند؟ با نگاهی به این سوالات کاربرد آنها و قدرتشان در تصمیم گیری بر روی هر سیستم تردینگ مشخص میشود :

۱- کدام ارز ها و یا سهامی برای این روش مناسب است ؟ (باید بررسی کنیم و ببینیم چه نوع ارز یا سهامی بر اساس استراتژی ما بهتر جواب میدهند و عواملی که در یک تردید بر اساس روشمان منجر به ضرر میشود در آنها کمتر دیده میشود که در این مورد توضیح بیشتر داده خواهد شد.)

۲- پس از اینکه توانستیم انواع ارز یا سهام مورد دلخواه را شناسایی و یک لیست ثابت برای بررسی و چک کردن هر روزه تهیه کنیم اصطلاحا (Watch List) حال باید ببینیم آیا اینک پتانسیل تردیدی وجود دارد ؟ (یعنی دقیقا بر اساس ابزارها و سیگنال های مشخص سیستم بتوانیم پتانسیل های صحیح و قدرتمند بازار را شناسایی کنیم.)

۳- پس از شناسایی دقیق پتانسیل ترید ، دقیقا نقطه ورود بر اساس روش کجاست ؟

۴- پس از گرفتن پوزیشن جدید دقیقا نقطه استاپ و خروج ما در صورتیکه بازار خلاف جهت تحلیل ما حرکت کرد کجاست ؟

۵- در صورتیکه روند بازار در جهت ترید ما حرکت کرد دقیقا روش مشخصی برای جابجایی استاپ داشته باشیم (اصطلاحاً تریلینگ استاپ) و بدین شکل در عین حال نباید استاپمان خیلی به روند نزدیک باشد (که به سادگی توسط قیمت لمس شده و ما را از جریان بازار خارج کند) و بتوانیم روند قیمت را با فاصله ای معقول دنبال کنیم و به این شکل ضمن اینکه شانس تعقیب روند و سود بیشتر را از دست ندهیم بتوانیم از سودهای حاصله هم محافظت کرده و مانع از بین رفتنشان شویم. (خیر خوب اینکه در این سیستم تریدینگ روش بسیار قدرتمندی به این منظور اختصاص دارد که حتما با جزئیات زیادی به آن خواهیم پرداخت.)

۶- در صورتیکه ترید در جهت موافق تحلیلمان پیش رفت دقیقا نقطه خروج (تارگت) کجاست ؟

۷- در صورتیکه پوزیشن در ابتدای امر فعال شد (تریدر خورد) و بعد بلافاصله در جهت عکس تحلیل حرکت کرد (!) که گاهی پیش میاید نقطه خروج دقیقمان کجاست ؟ (این زمانی است که ترید در جهت روند موافق ما حرکت نکرده و فرصت این پیش نیامده که از قواعد شماره ۴ و ۵ استفاده کنیم.)
سیستم تریدینگ NTD روشی است که دقیقا به تمامی سوالات بالا پاسخ دقیق و مشخصی میدهد و در نتیجه از کلی گویی و قضاوت شخصی کاملا بدور خواهیم بود و به روشی تقریباً مکانیکال خواهیم رسید که در زمانی خیلی کوتاه میتوانیم هر چارتری را به سرعت تحلیل کرده و حتی در ارز یا سهامی که مطلقاً با آن کار نکرده ایم و تجربه ای نداریم تصمیم های صحیح و دقیقی خواهیم گرفت .

طبیعی است که هر روش تکنیکال ۱۰۰% کامل نیست و گاهی منجر به ضرر میشود مهم اینست که میزان ضرر در مقابل سود کوچک و میزان ترید های موفق به نسبت ناموفق درصد بیشتری را شامل شود و این چیزی است که دقیقا در این روش اتفاق افتاده است .

بنابر این روش با یک مدیریت سرمایه خیلی خیلی ساده و ابتدایی میتواند تبدیل به روشی بسیار قدرتمند و سود آور شود .

در ادامه به معرفی اجمالی ابزار مورد نیاز در این روش پرداخته و سپس به نحوه صحیح ادغام آنها که مهمترین جنبه این سیستم است و آنرا از هر نوع سیستم تریدینگ منحصر به اندیکاتور متفاوت و متمایز میکند خواهیم پرداخت .

سپس گام به گام ، تک تک سوالات فوق را مطرح و دقیقا بر اساس روش NTD به آنها پاسخهای دقیق به همراه چارتهای متعدد آموزشی خواهیم داد تا روش به خوبی واضح و قابل استفاده شود .

پی نوشت : بار دیگر یادآور میشوم که در این کتاب تلاش میکنیم حتی امکان از بحث های تیوریک و کلی اجتناب کرده و صرفاً به روش این سیستم پرداخته شود تا عزیزان بتوانند از این سیستم تریدینگ در ترید های خود بطور کاملا کاربردی و عملی استفاده کنند.

حال شروع به بررسی ابزار مورد نیاز در روش NTD میکنیم (عزیزان توجه داشته باشند که بعضی از ابزار هستند که در روش کی آس استفاده میشوند و در نتیجه در اینجا به آنها اشاره نمیشود.)

در این روش ما به چند اندیکاتور نیاز داریم که عبارتند از :

- Aligator -1
- Awesome Oscilator -2
- Accelerator -3
- GatorOscillator -4
- Fractals -5

Aligator

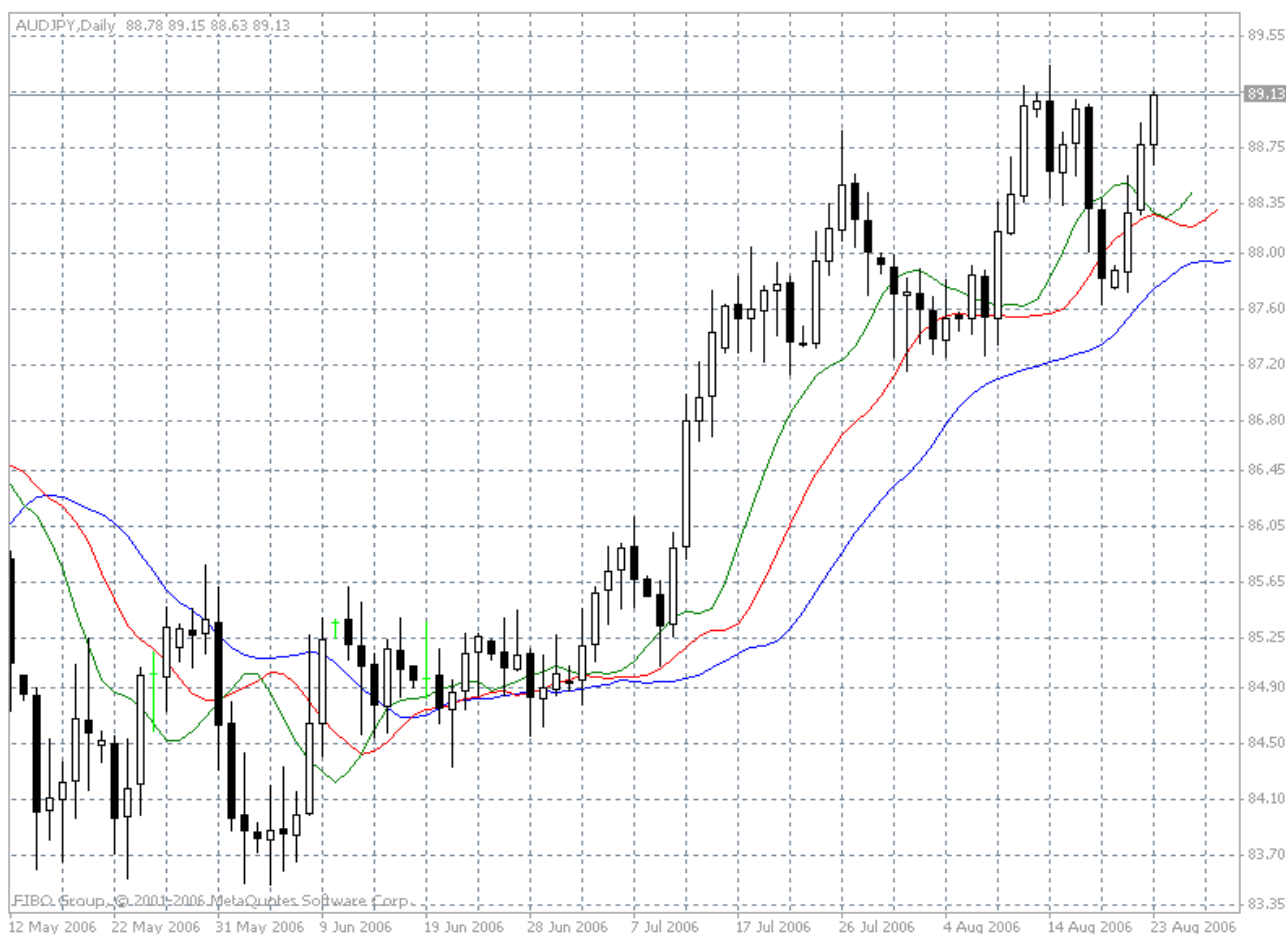
به بیان ساده الیگاتور (تمساح) اندیکاتوری است که از سه نوع مووینگ اوریج تشکیل شده است این سه مووینگ در واقع روند را به ما نشان میدهند مووینگ آبی رنگ روند دراز مدت - مووینگ قرمز روند میان مدت و مووینگ سبز روند کوتاه مدت را نمایش میدهد .

اما کاربرد این اندیکاتور در این است که مانع از این میشود که در بازارهای رنج و بی قدرت (فاقد روند) اشتباهات وارد شویم و در نتیجه دچار بازار بی نوسان شویم و برعکس باعث میشود تا بتوانیم زمانی که یک ترند در شرف وقوع است آن را با دقت زیادی شناسایی و تنها در این نوع بازار های ترند دار وارد شویم .

علاوه بر این اندیکاتور الیگاتور به ما نقاط دقیق ورود و خروج را میدهد .

از دیگر قابلیت های خوب این اندیکاتور قدرتمند این است که به ما نشان میدهد تا چه زمانی باید با یک ترند همراه باشیم در واقع برای ما زمان اتمام ترند را مشخص میکند و در نتیجه از خروج زود هنگام یک پوزیشن در سود به سادگی دوری میکنیم و میتوانیم هر پوزیشن را در حداکثر سود ببندیم .

این اندیکاتور قابلیت های دیگری هم دارد اما بطور کاربردی در روش NTD از همین قابلیت های استفاده میکنیم و البته در معرفی اندیکاتور Accelerator به قابلیت اشتراکی دیگرش هم اشاره خواهد شد.



Awesome Oscillator

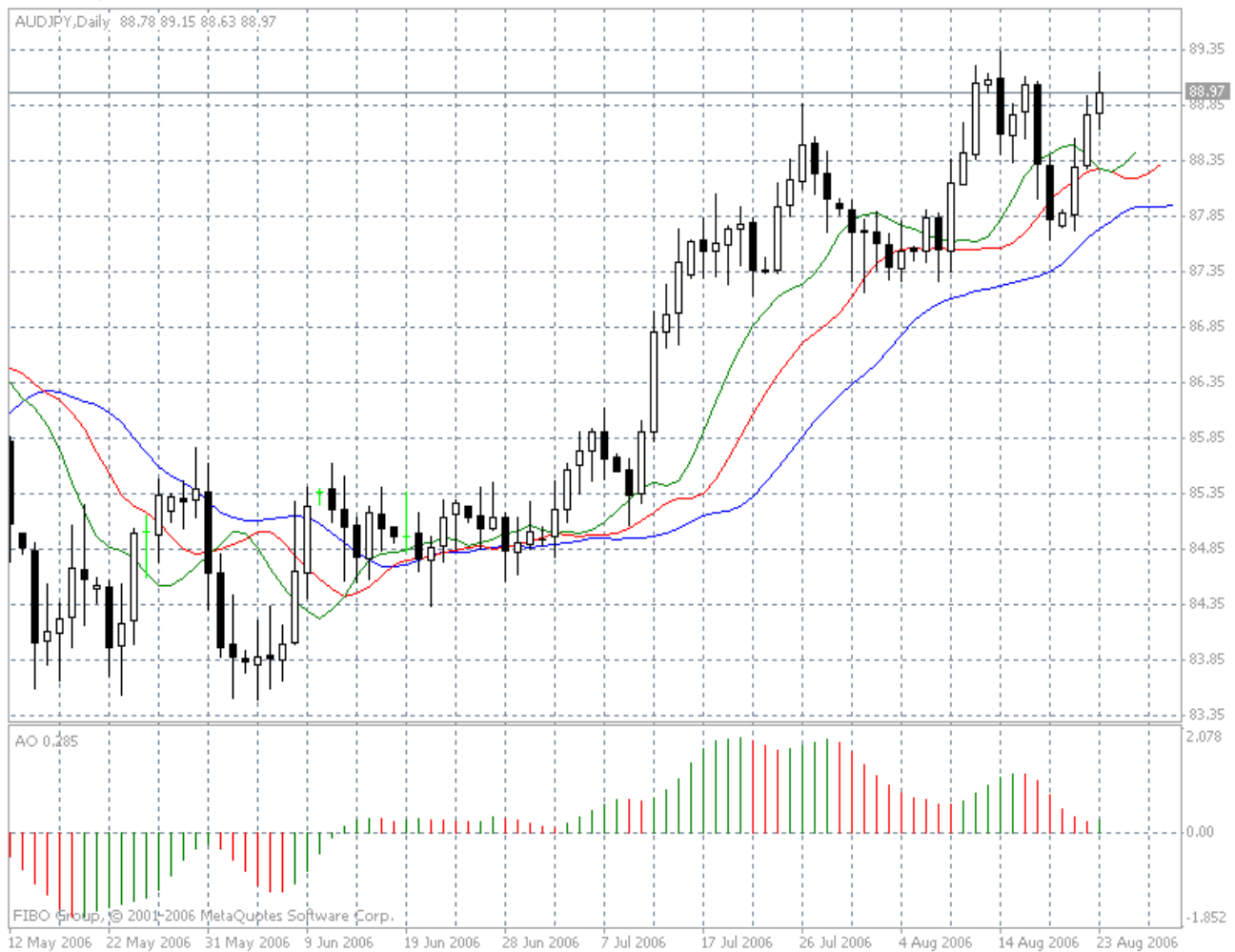
اندیکاتور آست که توسط دکتر بیل ویلیامز ابداع شده است و بسیار قدرتمند محسوب میشود .

این اندیکاتور در واقع همان MACD است منتهی با پارامترهای خاص ویلیامز که عبارتند از ۵/۳۴/۵ که به نام Elliot Oscillator هم معروف است و شهرتش در تحلیل های الیوت بی نیاز از توضیح بیشتر است ...

اما ویلیامز برای اینکه در روش NTD بتواند از قابلیت های دیگر اندیکاتور الیوت استفاده کند به تکمیل آن پرداخت و امروزه این اندیکاتور که به اختصار AO هم نامیده میشود از نوارهای رنگی سبز و قرمز تشکیل شده است که بصورت هیستوگرام نمایش داده میشوند .

رنگ های متفاوت به ما سیگنال های بیشتری به نسبت اسیلیتور الیوت میدهد و قابلیت های بیشتری را دارا است که باز بطور خلاصه عبارتند از :

قدرت تشخیص جهت روند ، قدرت روند و همینطور به ما سیگنال های خرید و فروش هم میدهد که در جای خود به آنهایی که در روش NTD کاربرد بیشتری دارد خواهیم پرداخت.



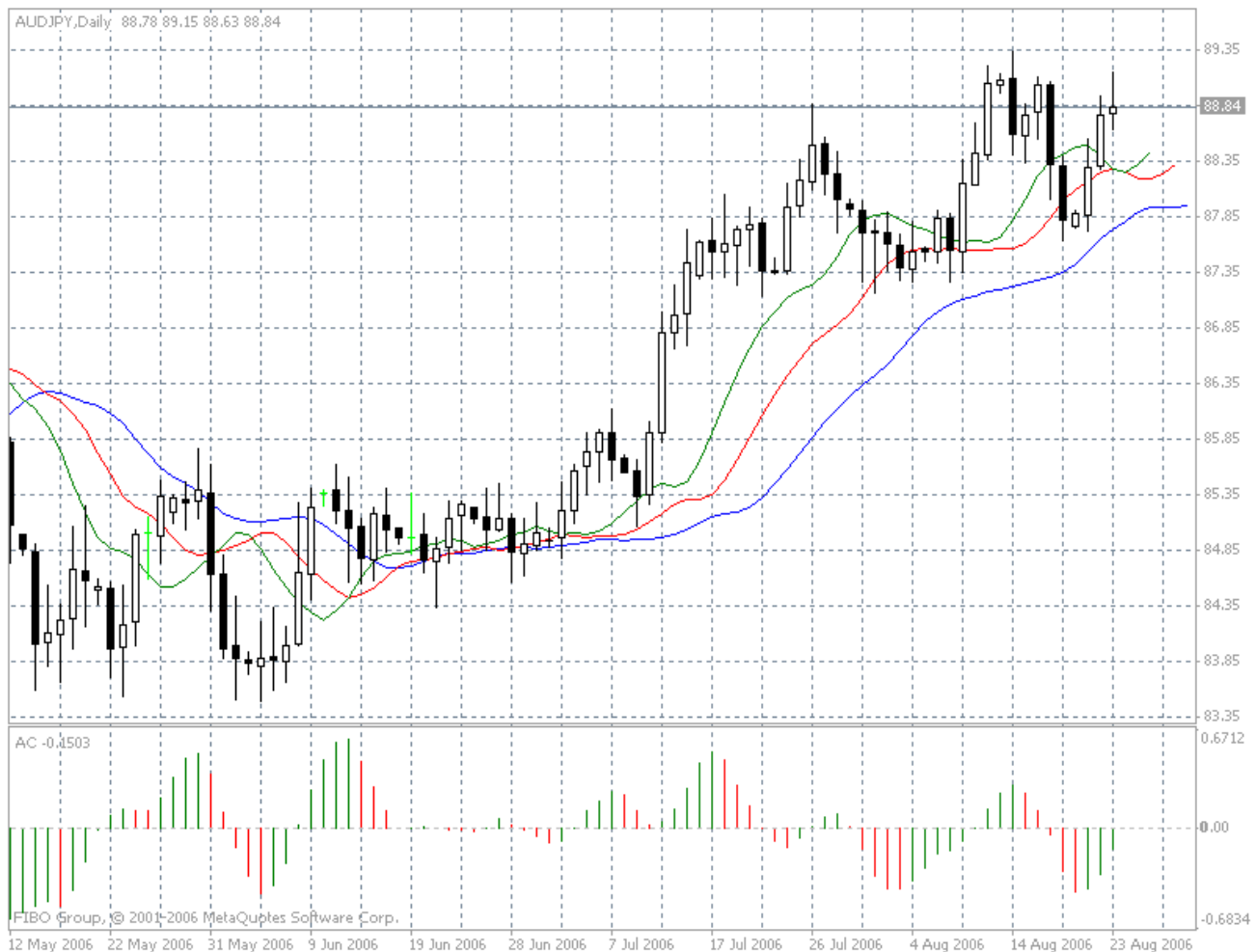
Accelerator

اندیکاتور Accelerator که به اختصار به آن AC هم گفته میشود .

اندیکاتوری است که به ما شتاب لحظه ای روند فعلی بازار را اعلام میکند .
بسیار حساس به بازار بوده و بلافاصله به ما میزان افزایش و یا کاهش شتاب و قدرت بازار را هشدار میدهد ...

در واقع ابزار بسیار حساس و دقیقی است که هر گونه تغییری در جهت و قدرت آتی روند را بلافاصله به ما یادآوری میکند.

در واقع مانند اندیکاتور AO قادر است که قدرت و جهت بازار را تشخیص بدهد اما چون بسیار حساس و دقیق است از AO این مسئله را سریعتر تشخیص و هشدار میدهد و در نتیجه در صورت ادغام صحیح این دو اندیکاتور به سادگی و سرعت میتوانیم تغییر روند در آینده نزدیک را تخمین زده و بر اساس این دو ابزار قدرتمند بخوبی به هر اطلاعات حیاتی که برای تشخیص تغییر روند نیاز داریم دسترسی پیدا کرده و در نتیجه آماده پوزیشن گیری در زمان صحیح شویم.



پی نوشت :

هر چند دوستان با اندیکاتور الیوت اسپلیتور در منابع الیوت آشنايي دارند اما براي اینکه مطلب استقلال مطلب حفظ شود و کسانی که مایلند تنها بروی این روش متمرکز شوند و برای شناخت بیشتر در مورد اسپلیتور الیوت نیازی به منابع دیگر نداشته باشند این لینک میتواند مفید باشد :

http://www.tradingfives.com/articles/elliott_oscillator.htm

Gator_Oscillator

ابزار مفیدی است که برای مطالعه بهتر و دقیقتر اندیکاتور Alligator ارایه شده است .

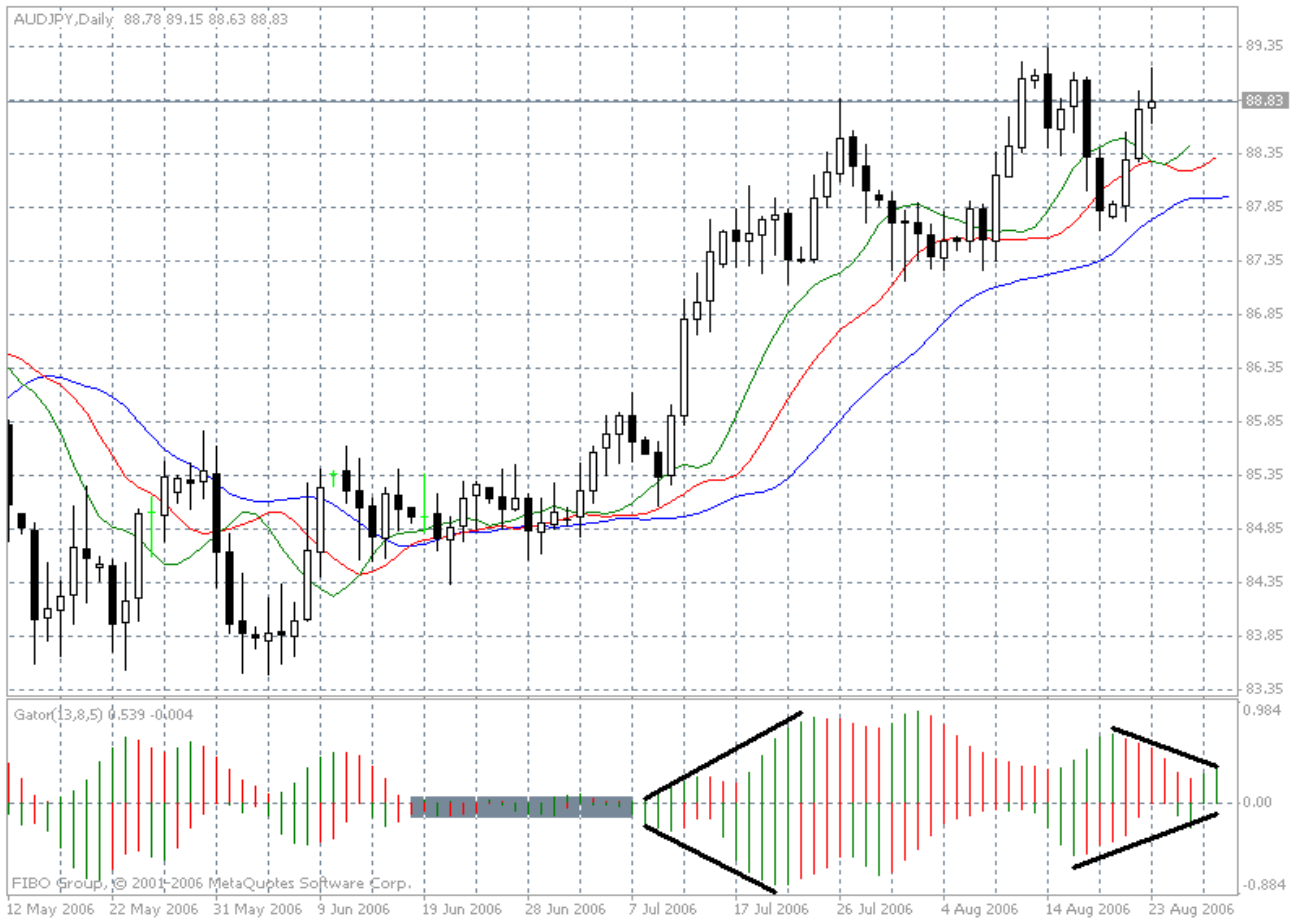
گاهی از موارد پیش میاید که تشخیص دقیق وضعیت فرار گرفتن خطوط الیگاتور دشوار میشود در این اوقات این اندیکاتور بسیار کارایی دارد .

مضاف بر اینکه بر اساس این اندیکاتور میتوان به سادگی زمانهایی که خطوط الیگاتور به هم نزدیک یا دور هستند را تشخیص داد و زمان تقریبی اتمام ترند را پیدا کرد .

بطور کلی روش کار بر اساس این اندیکاتور به این شکل است که زمانی که خطوط بسیار به هم نزدیک هستند نشونه این است که بازار فاقد روند است و زمانی که این خطوط از هم دور میشوند به معنای شروع ترند است و هر چه این خطوط از هم دورتر شوند با ترند قدرتمندتری روبرو هستیم .

زمانی که پهنای باند این خطوط به حداکثر خود برسد به سادگی میشود اتمام روند را تخمین زد .

بر روی این اندیکاتور خطوطی رسم میکنند که این کار را راحت میکند که در زمان خودش بیشتر به آن میپردازیم اما فعلا باید در همین حد دانست که زمانی که خطوط به هم نزدیک میشوند نشانه کاهش قدرت ترند و نزدیک شدن به اتمام روند هستیم و زمانی که خطوط خیلی از هم دور شوند نشانه نهایت قدرت ترند است.



ادغام صحیح این اندیکاتور با سایر ابزار این روش به ما قدرتی شگرف در تحلیل صحیح هر وضعیتی را میدهد که انشالله در آینده نزدیک به آنها با خواهیم پرداخت .

fractals

ابزار قدرتمندی هستند که اولین بار توسط دکتر ویلیامز وارد بحث های تیوریک و تحلیلی در بازارهای سرمایه شده است .

فرکتال ها در علوم تعریف مشخص دیگری دارند اما ویلیامز آنها را با تعریفی خاص در بازارهای تکنیکال وارد و به همه قدرت آنها را نشان داد .

بدون اینکه وارد بحثهای تیوریک آن شویم (علاقه مندان میتوانند به هر کدام از سه کتاب ویلیامز برای اطلاعات بیشتر مراجعه کنند که در هر یک فصلی مستقل برای فرکتالها اختصاص داده شده است.)

همانطور که قبلا هم اشاره شده بود در ارایه این مطلب از بحثهای تیوریک طولانی اجتناب کرده و تلاش داریم دقیقا به روش ترید بپردازیم تا عزیزان بتوانند به سرعت از این روش در تریدهای روزانه استفاده کنند . فرکتال ها بر اساس تعریفی که ویلیامز از آنها ارایه میکند به مجموع حداقل ۵ بار چارت یا پرایس بار گفته میشود که باید به ترتیب خاصی در کنار هم قرار گرفته باشند .

بنابر این حداقل نیاز به ۵ پرایس بار داریم تا یک فرکتال تعریف شود .

بطور خلاصه اینکه برای مثال در روندهای صعودی ما نیاز داریم به اینکه در دو طرف یک پرایس بار حداقل دو پرایس بار در سمت راست و دو پرایس بار در سمت چپ آن پایینتر از پرایس بار مرکزی قرار بگیرند تا پرایس بار مرکزی بعنوان فرکتال محسوب شود .

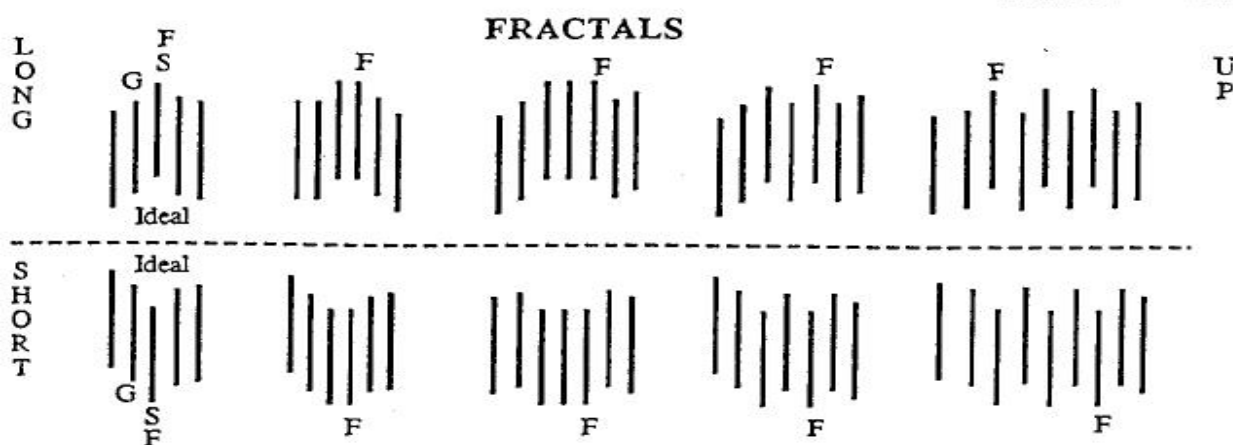
همینطور برای فرکتال در روندهای نزولی میبایست حداقل دو طرف پرایس بار مرکزی دو پرایس بار در سمت راست و دو پرایس بار در سمت چپ آن قرار داشته باشند که از پرایس بار مرکزی بالاتر قرار بگیرند .

با مشاهده تصویر فرکتال ها به سادگی این دو تعریف درک میشود .

ویلیامز ثابت کرد که روند ها پیش از تغییر جهت به ایجاد یک فرکتال میپردازند و در نتیجه با شناسایی این فرکتالها میتوانیم به خوبی از تغییر روند در آینده نزدیک مطلع شویم .

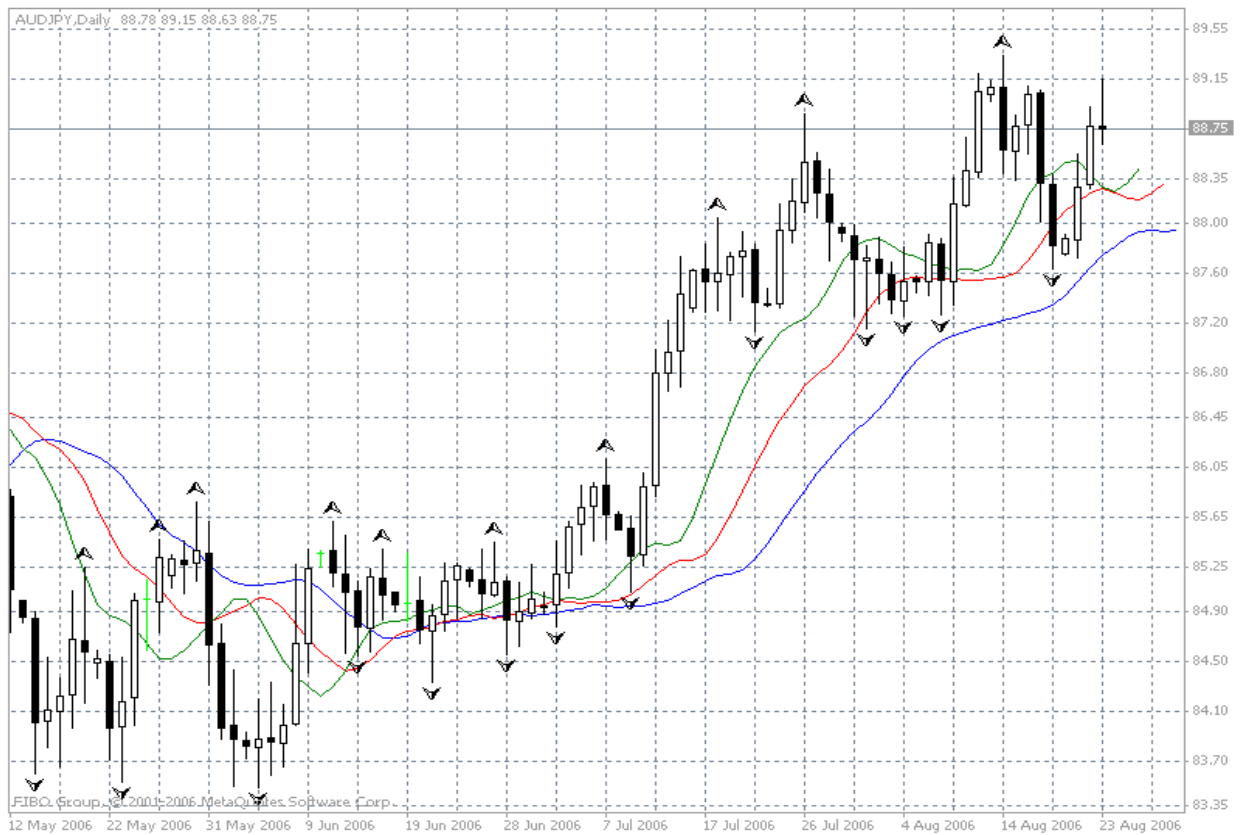
بحث فرکتال ها را در آینده نزدیک با مثالهای مختلف به وضوح و بطور کاربردی بررسی خواهیم کرد اما فعلا برای شروع کار لطفا به تصاویر فرکتال ها توجه کنید .

دقت داشته باشید که در فرکتال ها هم ، مانند هر ابزار تکنیکال دیگر با وضعیت های ایده ال و غیر ایده ال روبرو هستیم که در تصویر وضعیت های ایده ال بخوبی مشخص شده اند:



A five- (or more) bar sequence where the center bar (or group of bars) is preceded and followed by two lower bar highs for long signals or two higher lows for short signals. Bar lows have no significance on up fractals and bar highs have no significance on down fractals.

برای تشخیص فرکتالها نیاز نیست دایما پرایس بارهای ه گانه را شمارش و وضعیت قرار گرفت آنها را بررسی کنیم این کار با اندیکاتور FRACTALS در متاتریدر به سادگی صورت میگیرد و در چارت بر روی پرایس بارهایی که فرکتال محسوب میشوند فلشی قرار میگیرد:



www.gheymatha.com

بعد از معرفی کلی ابزار این روش به جهت اهمیت زیادی که اندیکاتور Alligator در این روش دارد و قابلیت‌های مختلفی چه برای پوزیشن‌گیری و چه برای خروج از پوزیشن دارد اینک به بررسی دقیق‌ترش می‌پردازیم (باز هم با این فرض که حتی امکان از وارد شدن به بحث‌های تیوریک طولانی اجتناب کرده و تلاش در جهت اکتفا به حداقل برای درک صحیح و سریع روش و استفاده از آن در تردید است.)

Alligator اندیکاتوری است که توسط ویلیامز بوجود آمد هر چند در نگاه اول این اندیکاتور تنها از مووینگ اوریج‌هایی با پارامترهای مختلف شکل گرفته اما از همینجاست که تفاوت ماهوی اندیکاتورهای ویلیامز با سایر اندیکاتورها مشخص می‌شود .

ویلیامز اندیکاتورهای رو ساخت که برآورنده نیازهایش بودند نیازهایی که بر اساس نگاه خاصش به بازار بود .

برای مثال این ۳ مووینگ که اندیکاتور الیگاتور رو شکل می‌دهند مووینگ‌هایی هستند که بر اساس نسبت‌های فیبوناچی ایجاد شده اند و هر کدام به نسبت تایم فریم بالاتر خود بر اساس نسبت ۶۱ فیبوناچی شکل گرفته اند .

چیزی که مهم است بدانیم اینست که مووینگ‌های اندیکاتور الیگاتور ویلیامز به ما روندهای مختلف بازار بر اساس تایم فریم‌های مختلف را نشان می‌دهند و در نتیجه با داشتن این اندیکاتور بروی یک چارت در یک تایم فریم می‌توانیم روند کلی را در بازه‌های زمانی طولانی ، میان مدت و کوتاه مدت دنبال کنیم و در نتیجه هم جهت با روند تردید کنیم و نه در خلاف جهت .

این مووینگ‌ها به سه رنگ می‌باشند مووینگ آبی رنگ نشانه روند دراز مدت است و در نتیجه مانند یک مقاومت قدرتمند عمل میکند و روند حقیقتاً باید قدرتمند باشد و تغییر جهت روند قطعی تا این خط شکسته شود .

بنابر این کاربرد این خط آبی رنگ این است که در صورتیکه روند قیمت از آن گذشت به ما پیام قطعی تغییر روند را داده و می‌توانیم پوزیشن خود را ببندیم و یا بسته به وضعیت بر اساس روند جدید اقدام به گرفتن پوزیشن جدید کنیم .

در واقع مووینگ آبی رنگ مانعی است بین نویزها و ترند‌های اصلی بازار و در نتیجه با شکسته شدن آن به سادگی می‌توانیم از تغییر جهت روند و ایجاد ترند جدید اطلاع حاصل کنیم .

قابلیت مهم دیگر این خط آبی رنگ برای ما تعیین نوعی قابلیت برای تریلینگ استاپ است که در جای خود بسیار ارزشمند است و در زمان مناسب با جزئیات بسیار به آن می‌پردازیم .

فعلاً همینقدر باید بدانیم که بر اساس این مووینگ می‌توان استاپ پوزیشن‌های خود را به نحوه صحیحی جابجا کنیم و در عین اینکه روند بازار را با فاصله معقولی تعقیب می‌کنیم به حفظ سودهای حاصله هم اقدام می‌نماییم .

مووینگ قرمز رنگ :

در واقع این مووینگ نشانه روند میان مدت بازار است .

زمانی که قیمت به این خط قرمز رنگ رسید به ما زمان قریب الوقوع تغییر روند را هشدار می‌دهد . علاوه بر این نوعی ترکیب بین این خط و خط آبی رنگ است که در زمینه تریلینگ استاپ پوزیشن‌هایمان بسیار کاربرد دارد که انشالله در آینده به آن می‌پردازیم .

مووینگ سبز رنگ :

این مووینگ نشانه روند کوتاه مدت است .

قیمت به نسبت دو خط پیشین به راحتی بیشتری از این خط مقاومت عبور میکند . معمولاً عبور از این خط نشانه آغازین اتمام ترند اصلی است و در نتیجه از این خط سبز رنگ برای تنظیم تریلینگ استاپ‌های دقیق و نزدیک به روند اصلی قیمت در اواخر ترند استفاده می‌کنیم (که در آینده با مثال‌هایی واضح بخوبی بروی این مطلب بررسی می‌کنیم.)

زمانی که روند قیمت به خط سبز رنگ خیلی نزدیک می‌شود می‌بایست به دو اندیکاتور AO و AC به دقت توجه کرد و بر اساس سیگنالی که این سه ابزار به ما می‌دهند دقیقاً تریلینگ نهایی را انجام دهیم .

کسانی که تحلیل‌های جدید ویلیامز را دیده اند میدانند که ایشان اخیراً از یک مووینگ بنفش رنگ هم در تحلیل‌هایش استفاده می‌کند که البته در کنش نامی از آن نبرده است که کاربرد آن هم برای نقطه ورود و خروج دقیق‌تر در پوزیشن است که انشالله در مثال‌های آتی به اون هم می‌پردازیم .

می‌بینیم که بر اساس اندیکاتور الیگاتور می‌توان نوعی خاص از تریلینگ استاپ را انجام داد و در نتیجه موفق می‌شویم ترید‌های سود ده را در حداکثر سود ببندیم و از خروج زود هنگام جلوگیری کنیم که این امر و اهمیتش برای هر تریدر با تجربه ای بی نیاز از توضیح بیشتر است که انشالله در آینده با مثال‌های زیادی به اهمیت و کاربرد بالای این روش خواهیم پرداخت .

در شکل زیر نمونه ای از تحلیل های دکتر ویلیامز بر اساس روش NTD را میبینید ...

دقت داشته باشید که در فروم مانی تک و بعضی از فرومهای دیگر گفته شده که دکتر ویلیامز بر روی بازار فارکس ترید نمیکنند شاید حالب باشد بدانید که این تصویر چارت روزانه جفت ارز EUR/USD است!



www.gheymatha.com

شروع توضیحات اصلی :

بعد از معرفی ابزار مورد نیاز این روش و توضیح بیشتری در مورد قابلیت‌های اندیکاتور الیگاتور شروع میکنیم به بررسی تک تک سوالات مرتبط به یک استراتژی قدرتمند که میبایست این روش ترید برای همه آنها پاسخ‌های دقیق و مشخصی داشته باشد ...

۱- کدام ارزها و یا سهام برای این روش مناسب است ؟

در هر روش تکنیکالی عواملی هستند که منجر به رد شدن تحلیل میشوند البته همیشه عواملی ناگهانی و خارج از کنترل ما هستند که ما در برابرشان انتخابی نداریم و باید با مدیریت سرمایه و پوزیشن این نوع ضررها را به حداقل برسانیم اما سواي این نوع عوامل یکسری عوامل هستند که همواره در نوع تحلیل‌مان زمانی که رخ دهند منجر به رد شدن تحلیل میشوند .

برای مثال میدانیم در روش تحلیل الگوهای فیوناچی وجود کندل بزرگ و پرفدرت در ناحیه PRZ نشانه و هشداري است که احتمال رد شدن تحلیل و عبور قیمت از ناحیه بازگشت روند وجود دارد .

همانطور که با بررسی چارتهای متعدد پترنهای فیوناچی چند نوع عامل رد کننده احتمالی شناسایی شده اند میبایست در روش NTD هم عوامل مخرب و زیان ده روش رو تا حد ممکن شناسایی و از آنها برحذر باشیم .

با این مقدمه به بررسی این عوامل و در نهایت پاسخ سوال میپردازیم .

با یک نگاه به اندیکاتور الیگاتور میبینیم که این اندیکاتور به ما روند را نشان میدهد بنابراین اولین رمز موفقیت این است که با ارزها و یا سهامی کار کنیم که ببینیم رفتار گذشته ارز یا سهام بشکل پیوسته و مناسبی بالا یا پایین الیگاتور در حرکت بوده است .

توضیح اینکه چون نقاط خروج ما از پوزیشن با این اندیکاتور تعیین میشود اگر قرار باشد دایما روند قیمت خطوط اندیکاتور را قطع کند دایما استاپ پوزیشنهای ما خورده و از بازار خارج میشویم .

بنابراین میبایست چارتهایی را در فهرست مشاهده روزانه قرار دهیم که با بررسی وضعیت گذشته چارت ببینیم که ارز یا سهام رفتاری معقول داشته است .

یعنی ارز یا سهامی نباشد که دایما دارای حرکات وحشی یا گپ‌های ناگهانی و بزرگ و خلاصه روندی نامشخص باشد .

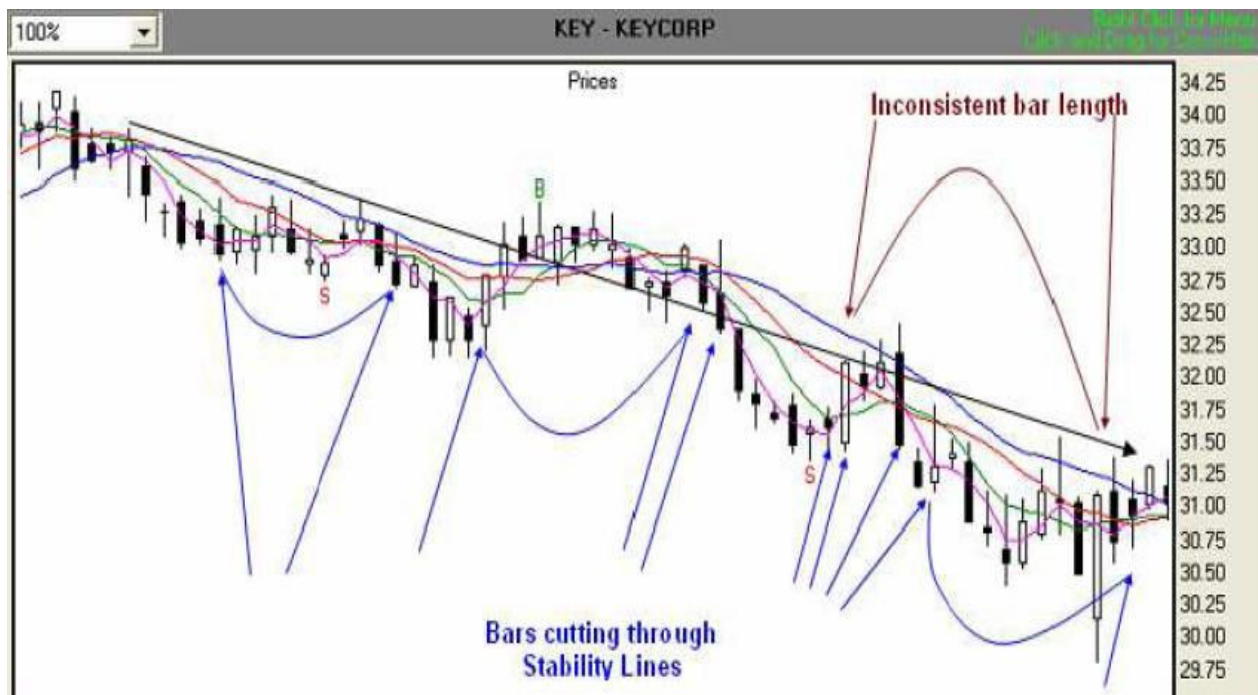
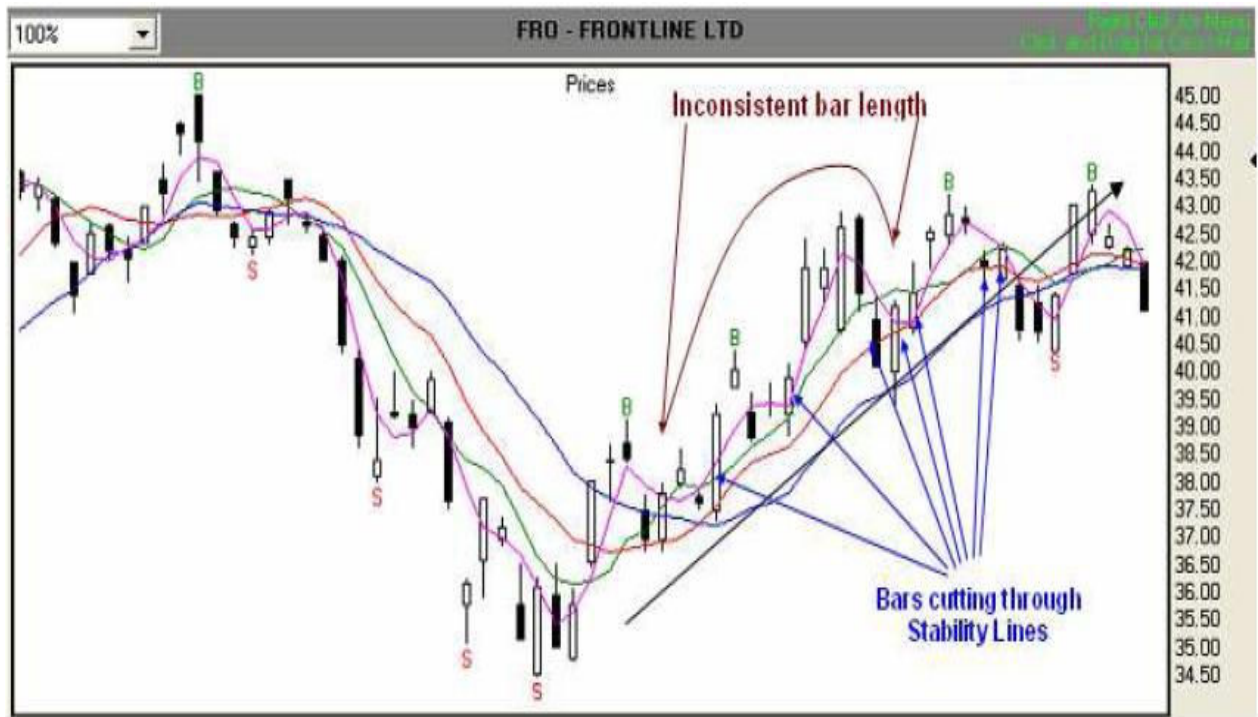
از اینجا مطلب دیگری هم مشخص میشود و آن اینکه برای ترید موفق بر اساس این روش نیاز نیست که حتما ما در یک روند با کندل‌های بزرگ موافق جهت پوزیشن‌هایی که داریم روبرو باشیم بلکه کافی است روندی مستدام و مداوم اما در یک جهت را دارا باشیم یعنی میتوان حتی در ارز یا سهامی یک روند را شاهد باشیم که فرضا در طول روزها حرکت صعودی و یا نزولی داشته باشد با کندلهایی کوچک اما مداوم و اتفاقا این نوع روندها هستند که سود بسیار خوبی در این روش عاید ما میکنند ...

باید توضیح بیشتر این مطالب گفته شده رو با چند چارت ببینیم :

چارت زیر نمونه ای است از سهمهایی که برای این روش مناسب نیستند ، میبینید که دایما روند خطوط الیگاتور را قطع کرده و دایما استاپ پوزیشن ما میخورد بنابراین متوجه میشویم که بر اساس این روش نباید روی تمامی ارزها و یا سهامها ترید کنیم و میبایست در بررسی هر چارتهای ابتدا به گذشته اش و نوع رفتاری که دارد بپردازیم و به سادگی آنهایی که رفتار موزون و هماهنگی در روند حرکتیشان نشان نمیدهند را از لیست مشاهده روزانه حذف کنیم . در واقع ترید بر روی سهامی که در چارت زیر میبینید با این روش مجاز نیست و در لیست سهام با ریسک بالا طبقه بندی میشود :

میبینیم که کندل‌هایی که روند را شکل میدهند از طرفی انسجام لازم را ندارند یعنی یک کندل بزرگ است و یکی کوچک یا بازار دایما با گپ آغاز میشود از طرفی میبینیم که کندلها دایما خطوط الیگاتور را که برای ما نقاط خروج از پوزیشن را معرفی میکنند قطع کرده اند و در نتیجه ترید بروی این سهم مناسب نمیباشد:

و تصویر دوم هم نمونه نامناسب دیگری است که دیگر الان دقیقا علت مناسب نبودنش را میدانیم:



در مقابل ارزها و یا سهامی هستند که بسیار عالی به این روش جواب میدهند .

این گروه که خوشبختانه طیف وسیعی را هم شامل میشوند این خصوصیت را دارند که خصوصا در تایم فریم روزانه کندل ها با نظم مشخصی به پیش میروند و همینطور زمانی که روندی چه صعودی و چه نزولی شکل میگیرد ندرتا به خطوط اصلی استاپ الیگیتور برخورد میکنند و در واقع کافی است بتونیم ابتدای روند جدید را در این نوع ارز یا سهام پیدا کنیم و در نتیجه آن گاهی حتی تا چند ماه به سادگی شاهد روند رو برشد سودمان باشیم !

در این بین ارز یا سهامی هم هستند که ما بین این دو دسته قرار میگیرند یعنی نه انطور رفتاری غیر تکنیکال و کاملا نا منظم دارند و نه بسیار منظم و ایده آل رفتار میکنند که به تجربه عرض کنم این نوع ارز یا سهام را بهتر است در تایم فریم ۶ ساعته ترید کنیم و به سودهای کوچکتر (البته به نسبت تایم فریم روزانه و تقریبا بین ۵۰ تا ۸۰ پیپس قانع باشیم)

شاید دوست داشته باشید که لیست کاملی از ارز یا سهام مناسب این روش در اینجا ارایه شود اما مساله این است که اولاً تعداد سهام بسیار زیاد است ثانياً خبر خوب اینکه در فارکس غالب ارزها خصوصا در تایم فریم روزانه مناسب این روش بوده و جزو گروه ایده ال محسوب میشوند .

و خلاصه اینکه تکنیک شناسایی ارزشها و سهام مناسب و نامناسب ارایه شد و به سادگی میتوانید خودتان هر نوع ارزش یا سهامی را بررسی و طبقه بندی کنید .

در زیر دو نمونه از سهامی که رفتاری مناسب این روش را دارند مشاهده میکنید .

خصوصیت هر دو آنها این است که کندل ها منظم و مرتب هستند و روند صعودی یا نزولی وقتی که شکل میگیرد تداوم خوبی دارد و همینطور برخورد روند با خطوط قرمز رنگ که برای استاپ استفاده میشود (جزئیات بیشتر در زمان خودش بیان خواهد شد) تنها در زمانی رخ میدهد که ما روند سودآور طولانی را پشت سر گذاشته ایم .

بنابر این پاسخ سوال اول مشخص شد و آن این است که میبایست با این تکنیک که روی آن صحبت کردیم لیستی تهیه کنیم و ارزشها و یا سهامی که مناسب روش ما هستند را در آن قرار داده و روزانه وضعیتشان را بررسی و فرصت های ترید را تنها در این لیست جستجو کنیم .

بررسی نحوه جستجوی پتانسیل های ترید در این روش و در این لیست منتخب در واقع پاسخ به دومین سوال در یک استراتژی قدرتمند است که انشالله در ادامه به آن خواهیم پرداخت...



***نکته:**

این مووینگ بنفش که در شکل میبینید در اصل ایده کن هربرت است که برای خروج دقیقتر ارایه شده است و ویلیامز هم در تحلیلهای اخیرش از آن استفاده میکند که همان SMA3 میباشد .

مووینگ های الیگاتور دکتر ویلیامز بر اساس اعداد (۱۳،۸،۵) شکل گرفته اند و این مووینگ بر اساس عدد ۳ و همونطور که میدانید تمامی این اعداد , جزو اعداد سری فیبوناچی هستند ...

تفاوت دو روش chaos و NTD در نوع نگاه به ترند است که بطور خیلی خلاصه و فشرده باید گفت روش NTD برای یافتن شروع ترند و روش chaos2 برای ترید در خلاف جهت ترند است و به همین خاطر است که این دو روش مکمل هم هستند و کسی که به هر دو مسلط باشد میتواند در هر دو جهت يك روند ترید کند ...

۲- چگونه پتانسیل های ترید را تشخیص داده و بر اساس روشی دقیق آماده گرفتن پوزیشن شویم :

پس از اینکه توانستیم انواع ارز یا سهام مورد دلخواه را شناسایی و یک لیست ثابت برای بررسی و چک کردن هر روزه تهیه کنیم اصطلاحاً (Watch List) حال باید ببینیم آیا اینک پتانسیل تریدی وجود دارد ؟ (یعنی دقیقاً بر اساس ابزار و سیگنال های مشخص سیستم بتوانیم پتانسیل های صحیح و قدرتمند بازار را شناسایی کنیم)

برای اینکار از چند اندیکاتور استفاده میکنیم که عبارتند از : AO ، AC و Alligator

و تلفیق صحیح این ابزار باعث تحلیل صحیح هر وضعیت (پیدا کردن پتانسیل ترید) و یافتن پتانسیل های دقیق برای گرفتن پوزیشن (سیگنال های خرید و فروش) همینطور سیگنالهای دقیق برای خروج از پوزیشن میشود .

ابتدا مروری سریع بر خصوصیات AO و AC داشته باشیم :

Awesome : اندیکاتوری است که به ما قدرت و جهت روند را نشان میدهد و تقریباً میتوانیم تمامی روند های اصلی (به زبان البوت ویو : امواج مازور) را شناسایی کنیم همینطور این ابزار قدرتمند به ما سیگنال های بای و سل میدهد .

Accelerator : اندیکاتوری است که قدرت و سرعت " آنی " بازار را به ما نشان میدهد و همینطور اولین هشدار را در تشخیص تغییر جهت ترند در آینده نزدیک به ما میدهد در عین حال حرکات کوچک بازار را به خوبی شناسایی میکند (به زبان البوت : امواج مینور) و به ما سیگنالهای خرید و فروش میدهد ضمناً اطلاعات ارزشمندی هم در مورد زمان خروج دقیق از پوزیشن های در سود را به ما میدهد که در زمان خودش به آن میپردازیم .

Alligator : اندیکاتوری است که در موردش قبلاً زیاد صحبت کرده ایم و در اینجا و با توجه به موضوع بحث تنها به یک مووینگ جدید در آن اشاره میکنیم که در یافتن پتانسیل های ترید به ما بسیار کمک میکند :

از این به بعد زمانی که اندیکاتور الیگاتور را بر روی چارتتان می آورید یک مووینگ 3SMA را هم به چارت اضافه کنید که به ما کمک میکند با ادغام الیگاتوری با این مووینگ اضافه با دو اندیکاتور AO و AC به راحتی پتانسیل های موجود را شناسایی کنیم .

ادغام این دو اندیکاتور با اندیکاتور الیگاتور باعث میشود تا بتوانیم دقیقاً وضعیت فعلی بازار در یک ترند یا بازار رنج را شناسایی و بر اساس آن پتانسیل ، ترید خرید یا فروش را بیابیم .

دقت کنید که روشی که در حال ارایه آن هستیم بر اساس روش NTD است و نه Chaos 2 در نتیجه از بعضی تکنیکها صرفنظر میشود ، ضمناً سیستم NTD بر اساس روش کن هربرت گفته میشود و نه ویلیامز (در آینده روش کامل ویلیامز هم ارایه خواهد شد)

خوب شروع میکنیم :

همانطور که میدانید روش ان تی دی برای شکار ترند های اصلی بازار و ترند های بزرگ است پس در چارتهای اولین چیزی که برای تحلیل بدنبالش میگردیم پیدا کردن پتانسیل های " ترند " است و زمانی که یک ترند را از ابتدای شروع آن تشخیص دادیم تنها کافیست با جریان بازار همراه شویم .

خوب سوال این است که از کجا بدانیم ترندی قرار است شروع شود !

سوال خوبیست و در ادامه میبینید که در سیستم تریدینگ NTD تا چه حد این امر ساده است و در صورتیکه روش بخوبی درک شود و سپس لیستی از ارزها و یا سهام مناسب این روش تهیه شود میتوانیم بر روی سهام یا ارزهایی که حتی یکبار هم رویشان ترید نکرده ایم و با خصوصیات ذاتی آنها آشنایی نداریم به سادگی پتانسیل های ترید را پیدا کرده و با اطمینان بر روی آنها ترید کنیم...

پیش از ادامه بحث مختصری به فلسفه نوع نگاه ویلیامز به روندها بپردازیم :

ویلیامز معتقد است که قیمت همیشه آخرین چیزی است که در چارتهای تحلیلی تغییر جهت میدهد . بنابراین اگر ابزاری داشته باشیم که پیش از تغییر جهت قیمت به ما این را اطلاع دهد مانند این است که یک روزنامه اقتصادی که نتایج تحولات بازار را به چاپ میرساند و فردا چاپ خواهد شد را امروز بخوانیم !

و بی نیاز از توضیح است که خواندن روزنامه نتایج بازار , یک روز قبل از انتشارش تا چه حد کمک برای یک روز کاری خواهد بود !

ویلیامز اندیکاتور Awesome رو به همین منظور ساخت و در کتابش توضیح میدهد که چرا این اندیکاتور پیش از روند قیمت شروع به تغییر میکند . یعنی فرضاً در یک روند صعودی و در حالیکه شاهد خطوط سبز رنگ در AO هستیم که نشانه روند صعودی است ناگهان میبینیم ، نوار سبز رنگ به قرمز تغییر رنگ میدهد در حالیکه هنوز شاهدیم روند قیمت صعودی است .

با بررسی چند چارت به سادگی شما هم متوجه میشوید که همواره اندیکاتور AO پیش از "روند قیمت" تغییر جهت میدهد !

به اندیکاتور AC بپردازیم این اندیکاتور شتاب و سرعت لحظه ای بازار را با حساسیت بسیار بالا تشخیص میدهد و در نتیجه حتی سریعتر از اندیکاتور AO تغییر رنگ در نوارهای آنرا شاهد هستیم !

بقول ویلیامز بررسی اندیکاتور AC مانند خواندن روزنامه وال استریت ژورنال آنهم روزنامه ای دو روز قبل از انتشارش است !!

این خلاصه ای از نگاه و نگرش ویلیامز است او با کمک ابر کامپیوتر هایی نتایج هزاران هزار تحلیل بروی چارت را انجام و بررسی کرد تا بتواند اندیکاتور هایی را طراحی کند که سریعتر از روند قیمت تغییر جهت را تشخیص و به سادگی و راحتی آن را به ما نشان بدهند .

و حال با توجه به دانستن این اطلاعات میتوانیم حدس بزنیم که چطور ویلیامز برای پیدا کردن پتانسیل های ترید و در واقع شروع ترند های جدید از ابزارهای AO و AC استفاده میکند .

کن هربرت یک مووینگ حساس را هم به این مجموعه اضافه کرد تا بتواند به دقت بیشتری پتانسیل ترند جدید را شناسایی کند ...

بعد از این مقدمه و توضیح در مورد فلسفه نگاه ویلیامز به بازار شروع به بررسی و یافتن یک پتانسیل ترند در یک روند فرضاً صعودی میکنیم :

پس برای تشخیص پتانسیل ترندی جدید به سه ابزار AO ، AC و Alligator توجه میکنیم .

بخاطر داشته باشید فرضاً بدنبال ترندی "صعودی" هستیم : اولین سیگنال بای را اندیکاتور AC به ما میدهد یعنی اولین نوار سبز رنگ که در AC مشاهده شود نشانه و هشدار اولیه برای تغییر یک روند نزولی به روند صعودی است هر چه تعداد این نوارهای سبز رنگ افزایش یابد پتانسیل بای بیشتر میشود (همیشه AC پیش از هر چیزی تغییر رنگ میدهد)

خصوصاً اگر نوار سبز رنگ از ناحیه پایین اندیکاتور به ناحیه بالا برود (اصطلاحاً خط صفر و میانه اندیکاتور را کراس یا قطع نماید) این نشانه سیگنال مهم برای پتانسیل بای است .

در تصویر این وضعیت را برای اندیکاتور AC مشاهده میکنید (شماره ۱)

دومین سیگنال مهم برای تغییر جهت ترند در AO رخ میدهد (AC قبل از AO و AO قبل از روند قیمت تغییر جهت [تغییر رنگ] میدهد)

زمانی که نوار سبزرنگ در AO به سمت بالا تشکیل شود این سیگنال بسیار مهمی در تغییر جهت روند در آینده بسیار نزدیک است (هر چه تعداد نوارهای سبز رنگ بیشتر شود پتانسیل خرید بیشتر میشود)

با دقت به تصویر دوم ، این مطلب به سادگی قابل درک است . (شماره ۲)

سومین نشانه که دیگر تغییر روند را قطعی میکند این است که مووینگ صورتی رنگ (3SMA) مووینگ سبز رنگ را کراس (قطع) نماید .

و در این صورت تغییر روند و ترند جدید بسیار محتمل است .

کراس مووینگ ها را هم در تصاویر میتوانید مشاهده کنید (شماره ۳)

پس مرور میکنیم :

برای پیدا کردن یک پتانسیل ترند صعودی جدید (یا به عبارتی یک پتانسیل بای) به سه فاکتور در بررسی هر چارت توجه میکنیم :

- ۱- سیگنال بای (نوار سبز رنگ) در AC
- ۲- سیگنال بای (نوار سبز رنگ) در AO
- ۳- مووینگ صورتی , مووینگ سبز را به سمت بالا قطع کند

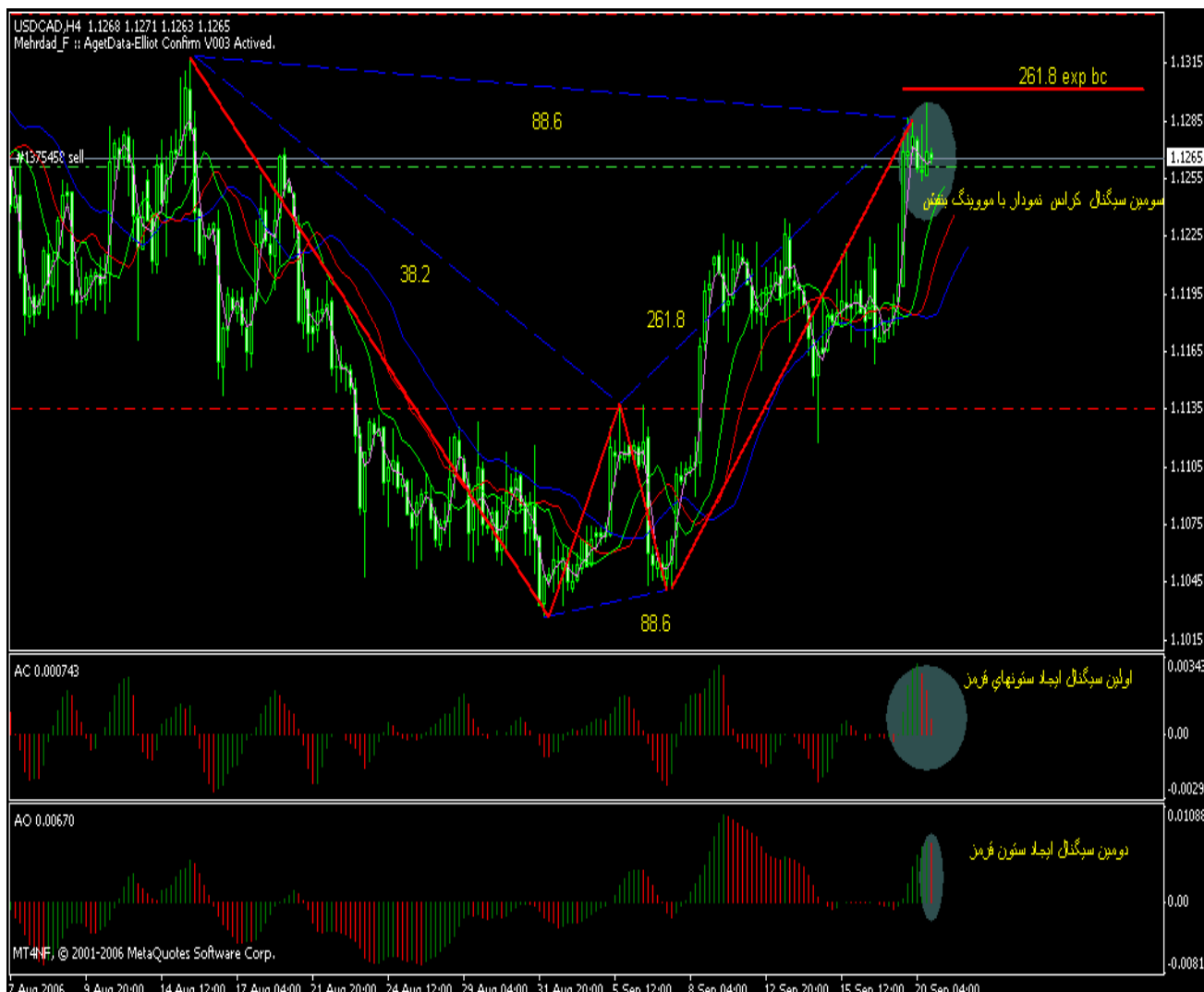
لطفا به تصاویر زیر توجه بفرمایید :

تصویر اول تشخیص پتانسیل ترند صعودی قریب الوقوع در سه مرحله و تصویر دوم نتیجه ترید است (البته فعلا هنوز تکنیک بای کردن گفته نشده است و تنها نحوه بررسی و یافتن پتانسیل بای معرفی شده است)



سوال :

آیا سیگنالهای علامت گذاری شده در شکل زیر صحیح هستند ؟



جواب :

تحلیل دقیقی است فقط دو مطلب در اینجا قابل توجه است :

۱- مووینگ صورتی رنگ هنوز مووینگ سبز رنگ را به سمت پایین کراس نکرده است .

۲- در جایی که شما به دنبال سیگنال سل هستید (با فرض اینکه پترن فیبو را در نظر نگیریم) میبایست بر اساس سیگنال های NTD یا Chaos2 ترید کنید .

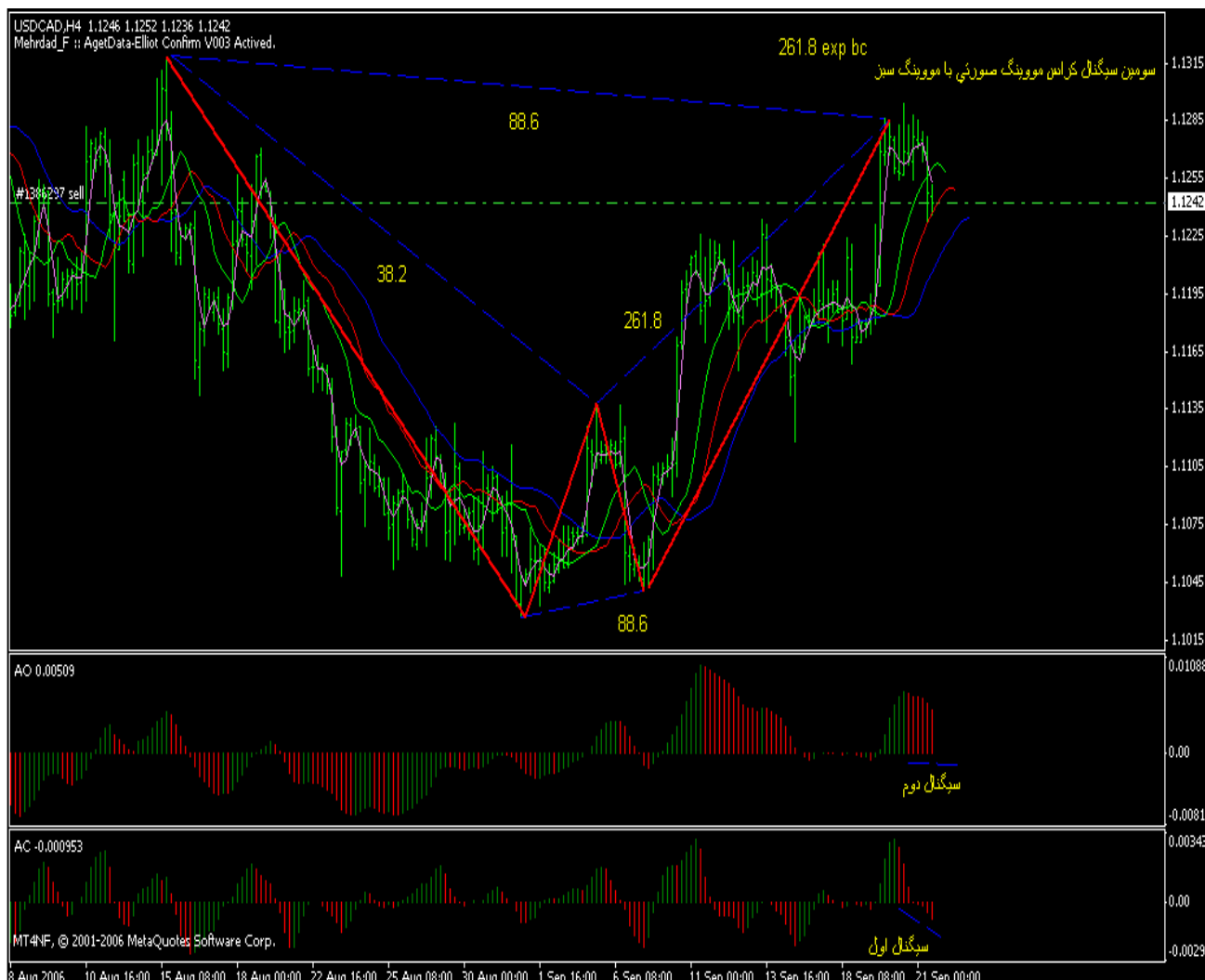
بر اساس NTD نمیتوانیم ترید کنیم چون باید خطوط الیگاتور به هم خیلی نزدیک باشند که در این مورد مبینیم اینطور نیست (در آینده نزدیک در این مورد صحبت میکنیم) در واقع در وضعیتهایی که خطوط الیگاتور از هم فاصله گرفته اند میبایست بر اساس Chaos2 سیگنال سل را پیدا کرد . که در این مورد همانطور که میدانید اولین سیگنال سل را First Wiseman به ما میدهد . بنابراین بر اساس دانای اول میتوان سل کرد .

منتهی با مینیمم لات تا از شکل گرفتن ترند مطمئن شویم و در صورتیکه ترند شروع شد سپس بر اساس سیگنالهای بعدی نظیر سیگنالهای سل AO ، AC ، ... میبایست به لات اضافه کنیم .

در صورتی هم که ترند شکل نگرفت چون با لات کمی ترید را شروع کرده ایم با ضرر بسیار اندکی هم از بازار خارج خواهیم شد .

سوال :

مطابق توضیحات بالا آیا الان دیگر سیگنال سوم هم صادر شده است ؟



جواب :

بله حالا دیگر سیگنال کراس مووینگ هم رخ داده است . شما بر اساس دانای اول میتوانستید سل کنید و بعد بر اساس روش Chaos2 بروی سیگنال سل AO میشد مجدد سل کنید در واقع دو سل داشتید و از این جا به بعد باید بسته به سیگنالهای بعدی شروع به افزایش لات کنید (البته اگر روند به همین شکل ادامه پیدا کند) و سپس بر اساس استراتژی خروج ویلیامز شروع به بستن پوزیشنهایتان کنید ، که بعدا توضیح داده خواهد شد .

سوال :

۱ - تنظیماتی که برای اندیکاتورهای الیگاتور ، AO و AC استفاده می کنید به چیست ؟
۲- شما در استفاده از این سیستم هنوز اسمی از فراکتالها نبرده اید ، اگر ممکن است بفرمایید مورد استفاده از فراکتالها در این سیستم چیست؟

جواب :

در مورد پارامترهای این دو اندیکاتور شما از همان تنظیمات پیش فرض استفاده کنید چون پیش فرضشان بر اساس سیستم تردینگ های ویلیامز تعیین شده است و در هر دو روش NTD و Chaos2 قابل استفاده هستند .

البته این اواخر ویلیامز در تحلیلهايش از يك اندیکاتور به نام Super AO یا همون SAO نام میبرد که ظاهرا دقتش از AO کلاسیک که در متاتریدر هست بیشتر است اما من تا به حال با این اندیکاتور کار نکرده ام ولی مطمئن باشید که همین AO استاندارد هم کیفیت خوبی دارد و هنوز هم قابل استفاده است !

پیش از ادامه توجه به این مطلب لازم است که:

بر اساس آن تی دی سیستم همواره این علایم را میبایست در چارتهای دنیال کنیم که خطوط الیگاتور بهم نزدیک باشند و در غیر اینصورت نمیتوان بر اساس آن تی دی ترید کرد هر چند که علایم سه گانه در آن وجود داشته باشد ...

در واقع در سیستم تریدینگ Chaos ما بر اساس خطوط از هم فاصله گرفته الیگاتور ترید میکنیم اما در آن تی دی بر اساس خطوط به هم نزدیک شده ...
وضعیت را برای پیدا کردن پتانسیل فروش در چارتهای تحلیلی (با دانستن روش بطور خلاصه) پی میگیریم:

همانطور که میدانیم برای یافتن پتانسیل ترید در روش آن تی دی نیاز به مشاهده سه سیگنال است. که عبارتند از: بروز علایمی در اندیکاتورهای AC-AO و همینطور کراس مووینگ های صورتی و سبز رنگ. خب شروع به بررسی میکنیم برای تعیین یک پتانسیل سل میبایست اولین چیز:

۱- اولین علایم شکل گیری تغییر روند صعودی یا خنثی به نزولی در اندیکاتور AC ظاهر میشود به این شکل که رنگ نوارهای آن از سبز به قرمز تغییر رنگ میدهد.

۲- دومین نشانه تغییر روند در آینده نزدیک در اندیکاتور AO ظهور میکند و رنگش به قرمز تغییر میکند و خصوصا زمانی که تغییر رنگ سبز به قرمز از بالای خط صفر این اندیکاتور به زیر خط صفر نزول کند به ما سیگنال بسیار قدرتمندی از تشکیل روند نزولی را ارایه میکند.

۳- سومین و آخرین سیگنالی که ما را تقریباً از شکلگیری روند نزولی مطمئن میکند قطع کردن مووینگ سبز رنگ توسط مووینگ صورتی رنگ است که به سمت پایین شکل میگیرد.

زمانی که هر سه این علایم در چارتهای ظهور کرد میتونیم با درصد بسیار بالایی از تغییر روند صعودی به نزولی اطمینان حاصل کرده و سپس به دنبال سیگنالهای سل و تریگرهای دقیق در چارت مذکور بگردیم.

در تصاویر زیر ابتدا مشاهده علایم سه گانه فوق را میبینیم و در تصویر بعد از آن هم شاهد نتیجه تغییر روند و روندی نزولی و قدرتمند هستیم.

در ادامه به سوال سوم پاسخ میدهیم که با فرض اینکه پتانسیل ترید خرید یا فروشی در چارتهای مشاهده شد در اینصورت نقطه دقیق ورود ما (تریگر) را چگونه تشخیص دهیم...





www.gheymatha.com

۳- پس از شناسایی دقیق پتانسیل ترید ، بر اساس روش دقیقاً نقطه ورود کجاست ؟

برای پیدا کردن نقطه دقیق ورود طبق روش هربرت ما دو راه پیش رو داریم :
یکی فرکتال و دیگری یکی از سیگنالهای سه گانه اندیکاتور AO

تعریف فرکتال پیش از این ارایه شده است منتهی چند نکته باقی میماند و آن اینکه يك فرکتال تا زمانی معتبر است که فرکتال جدیدی شکل نگرفته باشد بدین معنی که فرضاً در يك بازار رنج اگر دیدیم فرکتالی شکل گرفت اما روند ، آن را نشکست و بعد از چندین ساعت مجدداً فرکتالی در سمت راست فرکتال قدیم ایجاد شد برای گرفتن سیگنال بای (در روند صعودی) باید بر اساس مشخصات و نقطه دقیق قرار گرفتن فرکتال جدید پوزیشن بگیریم و فرکتال قبلی دیگر اعتبار ندارد .

دوم اینکه بر اساس روش هربرت میبایست دو پیپس بالاتر از نقطه High فرکتال پوزیشن بگیریم که در روش ویلیامز با يك پیپس بالاتر هم میشود پوزیشن را گرفت .
بنابراین خلاصه صحبت این شد که در روش هربرت و ویلیامز بعد از اینکه پتانسیل تریدی را شناسایی کردیم بر اساس فرکتال اولین سیگنال ورودی را میگیریم .
در روش هربرت برای ورود به يك پوزیشن تنها از دو نوع سیگنال ورودی استفاده میکنیم یکی فرکتالها و دیگری ، یکی از سه سیگنال اندیکاتور AO که موسوم به کراس خط صفر است .
در ادامه با مشاهده تصاویر بهتر به این موضوع پی خواهید برد :

در تصویر اول نحوه پوزیشن گیری بر اساس فرکتال را مشاهده میکنید .
شماره يك شناسایی يك فرکتال در بالای خطوط الیگیتور به هم نزدیک شده است (که با حرف B مشخص شده است) شماره دو خطی است که به ما نشان میدهد دقیقاً ۲ پیپس بالاتر از نقطه High در فرکتال کجاست (با این خط ممتد میتوانیم هر زمان که قیمت خواست این محدوده را بشکند در چارت به سادگی متوجه آن بشویم) شماره سه سرانجام با يك کندل صعودی روند قیمت نقطه High فرکتال را شکسته و پوزیشن ما اصطلاحاً تریگر میخورد ...

حال در تصویر دوم همین مراحل را در وضعیت پتانسیل فروش مبینیم :
برای اینکه بتوانیم سیگنال سل یا بای پیدا کنیم میبایست بر روی يك چارت که مناسب با این روش ترید باشد خطوط الیگیتوری را بیابیم که خیلی بهم نزدیک شده اند این نزدیکی به ما علایم ترند قریب الوقوع را هشدار میدهد .
زمانی که این پتانسیل شناسایی شد شروع به یافتن جدیدترین فرکتال شکل گرفته در چارت میکنیم .
و سپس دو پیپس بالاتر از نقطه High فرکتال بای / بای استاپ خود را قرار میدهیم .
در تصویر دوم همین مراحل رو در وضعیت سل مبینیم :

شماره يك :
پیدا کردن جدیدترین فرکتال موجود در چارت (دقت کنید که این فرکتال با حرف S نمایش داده شده است و ضمناً توجه دلشسته باشید که ملاک ما برای سل استاپ این فرکتال است نه فرکتال قبلی که آنهم با حرف S مشخص شده است و با شکل گیری این فرکتال جدید دیگر از اعتبار ساقط است)

شماره دو :
ترسیم يك خط ممتد از دو پیپس پایینتر از نقطه LOW فرکتال نزولی برای شناسایی لحظه نزدیک شدن روند قیمت به شکستن فرکتال .

شماره سه :
سرانجام با يك کندل نزولی حوزه فرکتال شکسته شده و پوزیشن سل استاپ ما تریگر خورده و ما وارد بازار میشویم ...



در ادامه گرفتن سیگنال های بای و سل بر اساس کراس در اندیکاتور AO را بررسی خواهیم کرد .

همانطور که گفته شد در روش هربرت دومین نوع سیگنال ورود به پوزیشن بر اساس اندیکاتور AO است . این اندیکاتور بر اساس کتاب مرجع ویلیامز سه نوع سیگنال ترید دارد اما در روش هربرت تنها از یک نوع آن استفاده میکنیم که موسوم به کراس خط صفر است .

ابتدا دقیقاً نحوه پوزیشن گیری بر این اساس را توضیح میدهم :

۱- مبنایست پرایس بار (یا بار چارت یا کندل) قبلی دقیقاً زیر خط صفر اندیکاتور بوده و پرایس بار بعدی بروی خط صفر آمده و در واقع خط صفر را قطع کند .

۲- مبنایست مووینگ صورتی رنگ مووینگ سبز رنگ را قطع نماید .

۳- زمانی که دو حالت فوق رخ داد بالای پرایس بار (دو پیپس بالاتر) بای/ بای استاپ خود را قرار میدهم .

با مشاهده تصاویر درک مفهوم به سادگی صورت میگیرد :
تصویر اول مربوط به این نوع سیگنال اندیکاتور AO است و در تصاویر بعدی نحوه گرفتن سیگنال ورودی بر اساس کراس AO را مشاهده میفرمایید .

در تصویر دوم و در شماره یک :
اندیکاتور AO به سمت بالا کراس کرده است .

شماره دو :

مووینگ صورتی مووینگ سبز را به سمت بالا کراس کرده ...

شماره سه :

دو پیپس بالاتر از پرایس بار جاری اردر بای استاپ خود را قرار میدهیم که با کندلی قدرتمند پوزیشن ما تریگر خورده و وارد بازار میشویم .

همین وضعیت برای پوزیشنهای سل نیز وجود دارد .
یعنی بر اساس کراس اندیکاتور AO سیگنال ورودی را میگیریم .

نکته :

دقت داشته باشید که رنگ پرایس بار قبل از سیگنال بای نیازی نیست حتما سبز باشد و با رنگ پرایس بار بالای خط صفر در وضعیت سیگنالهای سل حتما قرمز باشد ...

در تصویر سوم این حالت و کلا این نوع سیگنال ورود برای پوزیشن های سل قابل مشاهده است .
و سرانجام تصویر چهارم مثالی در مورد این نوع سیگنال سل است .

در شماره يك :

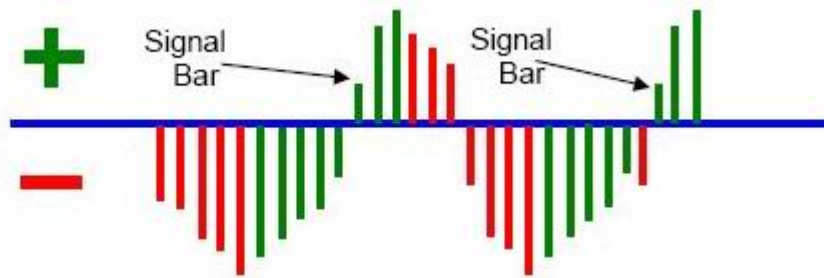
کراس در اندیکاتور AO رخ داده است .

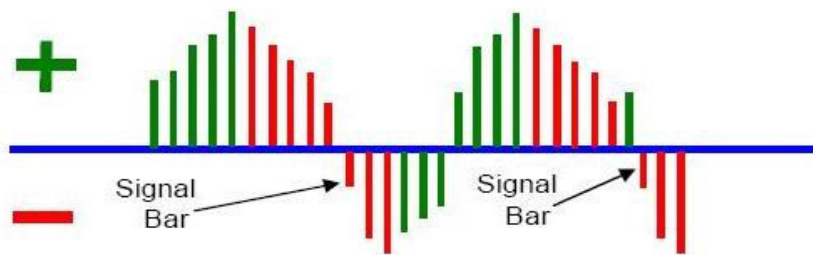
در شماره دو :

مووینگ صورتی مووینگ سبز را به سمت پایین کراس کرده است .

در شماره سه :

پوزیشن سل استاپ ما دو پیپس پایینتر از کندل قرار داشته که با کندل قوی تریگر خورده و به این ترتیب وارد بازار میشویم.





سوال :

گفته شد که در اولین ورود به پوزیشن به اندیکاتور AC نگاه کنیم و آگه دیدیم روند برگشته وارد پوزیشن بشویم ولی من در چندین سهام این مورد را تست کردم و مشاهده کردم که گاهی AC به ما نشان میدهد که روند در حال عوض شدن است ولی باز روند اصلی به مسیر خود ادامه میدهد ، پس بنابر این باید به بسته شدن کندل ها بالاتر از فرکتال ها در روند صعودی و پایین تر از فرکتال ها در روند نزولی توجه شود ، درست است ؟

جواب :

تغییر رنگ AC برای ما حتما حاکی از شروع ورود به بازار نیست ، بلکه ما بر اساس فرکتالها اولین پوزیشن را میگیریم ، منتهی بر اساس اندیکاتور AC میتوانیم زودتر از اینکه روند جهتش عوض شود و ما بخش بزرگی از ترند را از دست بدهیم متوجه شویم که روند در آینده نزدیک در حال تغییر جهت است و پیش از اینکه ترند شروع گردد آماده پوزیشن گیری در زمان مناسب باشیم .
در واقع الان اگر به همین آخرین چارتی که در بالا نشان داده شد توجه کنید ، خواهید دید که اول از هر چیز AC تغییر رنگ داده است و سپس AO و سرانجام ترند نزولی شده است .
بنابراین از AC برای اولین سیگنال ورودی استفاده نمیکنیم بلکه از آن برای شناسایی پتانسیل های قریب الوقوع تغییر جهت ترند استفاده میکنیم.

سوال :

من هنوز در مورد سیگنال ورود اول مشکل دارم...بالاخره نفهمیدم باید فقط به تمساح خوابیده و فرکتال نگاه کنم یا باید نیم نگاهی هم به اسیلاتورهای Awesome ، Accelerator و موینگ صورتی داشته باشم؟

مطلب بعدی این است که در مقایسه دو روش هربرت و ویلیامز ، آیا میشود گفت که کدام یک بهتر بوده و بر دیگری برتری دارد ؟
در واقع هربرت تنها سیگنالهای فرکتال و Awesome را میگیرد و گویی از سیگنالهای اکسلریاتور و زون و همچنین خط تعادل چشم پوشی میکند...

جواب :

بله در واقع هر دو سیگنال را بر اساس فرکتال میگیرند اما هربرت با اضافه کردن کراس صورتی رنگ به اصطلاح محکم کاری کرده است .

یعنی با اینکار تنها سیگنالهایی را میگیرد که این کراس هم در آن رخ داده است و به این شکل به ندرت فرکتالی تریگر میخوره اما بعد بازار رنج شده و پوزیشن معطل میماند .

در واقع کراس مووینگ صورتی و خط سبز آلیگاتور ، در انتخاب فرکتالی که پوزیشن بر اساس آن گرفته میشود نقش " فیلتر" را به عهده دارد . و ابزار خوب و مناسبی است ، تا جایی که حتی اخیراً دکتر ویلیامز هم از این مووینگ البته به رنگ بنفش در تحلیلهایش استفاده میکند .

در مورد سوال شما باید گفت : هربرت علاوه بر فرکتال معتقد است : در صورتیکه مووینگ صورتی کراس کرده بود میشود بر اساس سیگنال کراس AO هم وارد پوزیشن شد . یعنی اگر فرکتال تریگر خورد با سیگنال فرکتال وارد بازار میشویم و اگر AO سیگنال داد و کراس مووینگ هم رخ داد از این سیگنال برای ورود به بازار استفاده میکنیم . و در مثالهای بالا که برای سیگنالهای قابل استفاده AO آمده است مشاهده میشود که بدون اینکه فرکتالی وجود داشته باشد از سیگنال ورودی آن استفاده شده است . (نه به عنوان سیگنال ورودی دوم ، بلکه همان اولین سیگنال میباشد.)

و اما در مورد سوال بعدی شما : این سوال نیاز به بحث و تحلیل بیشتری دارد و در یک کامنت دقیقاً نمیشود به همه ابعاد آن پرداخت . اما اگر بخواهیم بطور کلی در این مورد یک مقایسه کنیم بدون اینکه وارد جزئیات و ظرایف مسئله شویم باید گفت که : به نظر میرسد روش هربرت در تایم فریم ۵ ساعته کارایی بهتری دارد و روش ویلیامز در روزانه .

اما همانطور که گفته شد این توضیح خیلی کلی است و نیاز به بحث و تحلیل بیشتری دارد. هر کدام از این روشها مزایای خاص خود را دارد و به همین دلیل است که در تکنیکهای مدیریت پوزیشن هم ، هر یک از این اساتید روشی مخصوص به خود برای افزایش سود و تحدید ضرر را دارا میباشند.

اما روش ویلیامز را مورد توجه تر است چرا که در صورتیکه ترندی پر قدرت شکل بگیرد در روش ویلیامز ما میتوانیم با ابزارهای دیگری که اشاره شد با سیگنالهای متعدد ، حجم معامله خود را افزایش دهیم. اما در روش هربرت تعیین حجم معامله تنها بر اساس سیگنالهای AO و فرکتال است .

در واقع اگر ترند حقیقتاً پر قدرت باشد ما با روش ویلیامز موفقتریم. اما اگر ترند از قدرت خیلی بالایی برخوردار نباشد روش هربرت کارایی بیشتری دارد ، چون در صورتیکه ترند خیلی قوی نباشد تعدادی از سیگنالهای متعدد ویلیامز همگی با هم Fail خواهند شد و چون تعدادشان زیاد است ، ضرر آن بیش از روش هربرت خواهد شد ... (به بیان دیگر روش ویلیامز پتانسیل سود بیشتر در قبال پذیرش ریسک بیشتر را دارد اما روش هربرت ریسک کمتر با سود کمتر را بهمراه دارد.)

به همین دلیل است که روش ویلیامز در تایم فریم روزانه که با ترند های قدرتمند تر و دراز مدت تر خصوصاً در CFD روبرو هستیم بسیار عالی جواب میدهد.

علاوه بر این روش ویلیامز در افزایش لات ، در زون و بالانس لاین نیاز به درک صحیح و تمرین کافی دارد تا دچار اشتباه و یا ندیدن سیگنال صحیح نشویم اما روش هربرت ساده تر بوده و برای کلیه سطوح قابل استفاده میباشد.

سوال :

پس این روش برای CFD بهتر جواب میدهد تا ارز درست است؟؟؟

جواب :

این روش در CFD برای بازه های زمانی طولانیتر نظیر روزانه بهتر است ، اما در فارکس بجهت ترندهای قدرتمند و سریعتری که داریم تایم فریم ۵ ساعته خیلی ایده آل است. البته به تایم فریم روزانه در فارکس هم میتوان اعتماد کرد. (تایم فریم روزانه برای تشخیص ترند های اصلی اطلاعات بسیار ارزشمندی در اختیار ما قرار میدهد.) در هر صورت شما باید خودتان تست کرده و نتیجهگیری کنید .

در هر روش تکنیکال بعد از اینکه نسبت به روش شناخت پیدا کرده و کلیاتش را درک کردید ، میبایست در نوع بازاری که مورد علاقه شماست بررسی کنید و ببینید با توجه به خصوصیات آن که بازار شما دارد ، به چه شکل باید از این روش استفاده کرد تا سود دهی بیشتری داشته باشد.

بنابراین باید کلیات را از کتب تیوریک یاد گرفت و از اینجا به بعد است که تازه کار ما شروع شده و حال باید با تستهای متعدد و وقت گذاشتن روی کار ببینیم که: جزئیات روش به چه صورت در عمل برای ما کارایی و سوددهی بیشتری دارد.

سوال :

برای من بین مطالب پتانسیل ترید و انجام ترید تفکیک بوجود آمده. به عبارتی اهمیت قسمت پتانسیل ترید را نفهمیدم برای چیست؟ چون انگار قوانین انجام ترید مشخص است و چه لزومی به شرح و تفسیر در مطلب پتانسیل ترید است؟ مطلب دیگر اینکه: در موضوع پتانسیل ترید، لزوم نگاه به AO و AC چیست؟ چون ما با کراس مووینگ صورتی و سبز قاعدتاً آنها را هم داریم و انگار همان کراس برای ما کفایت میکند.

جواب :

مزیت تحلیل پتانسیل در زمانی است که ما با بازار رنجی روبرو هستیم .
یعنی خصوصاً در مارکت CFD ما شاهدیم که گاهی ماهها فلان سهام هیچ حرکت خاصی ندارد و مدتها بدون ترند و بازار رنج است .
AO و AC به ما کمک میکنند تا از بین هزاران سهام، تنها بر روی چارتهایی متمرکز شویم که روند در آنها بر اساس ابزاری که گفتی شکل گرفته و در واقع تغییر ترند و خروج بازار از وضعیت رنج در آینده نزدیک را به ما یادآوری میکنند. (در فارکس چون با ترند، زیاد روبرو هستیم این قابلیت کمتر به کار می آید اما با بررسی چند چارت CFD بخوبی به ارزش این مطلب پی خواهیم برد.)

در واقع لزوم دیدن AO و AC به این جهت است که در يك بازار رنج درست است که ما بر اساس تیوری میبایست يك بای استاپ و يك سل استاپ بر روی چارت قرار دهیم و در واقع قیمت را محصور کنیم. اما در بازارهای رنج ممکن است که گاهی فرکتال فعال و بعد باز بازار دوباره رنج شود و یا بر عکس در جهت مخالف ترند شروع به حرکت کند .

مشاهده نوع رنگی که در AO و AC در این مواقع دیده میشود به ما کمک میکند که تنها در جهتی که این دو اندیکاتور پتانسیل شروع ترید را نشان میدهند پوزیشنهای تعلیقیمان را قرار دهیم و در نتیجه تنها در يك جهت بازار رنج پوزیشن داشته باشیم تا با نویزها و یا اخبار ناگهانی بی جهت یکی از اوردرها ما فعال نشود و سپس بازار در جهت مخالف پوزیشن ما به حرکت در آید و یا دوباره رنج شود.

سوال :

وقتی سیگنال داشتیم روی همان کندل جاری باید اوردر گذاشت؟ چون معمولاً در روشهای اندیکاتوری باید صبر کرد تا کندل بسته شود .
سوال دوم اینکه در AC فرضاً در سیگنال بای وقتی پرایس بار بالای خط صفر آمد برای ورود به بازار مقدارش مهم نیست و هر میزان که باشد کافی است ؟
سوال سوم اینکه وقتی الیگاتور بسته است باید مووینگها ترتیب خاصی داشته باشند یا هر طور که به هم گره خورده باشند قابل قبول است؟

جواب :

۱- باید صبر کرد تا وقتی که کندل بسته شود. بعد دو پیپس بالاتر يك بای استاپ و یا دو پیپس پایینترش يك سل استاپ (بسته به تحلیل) قرار میدهیم که در صورتیکه کندل بعدی نقطه ورود را رد کند پوزیشن فعال و وارد بازار میشویم ...

۲- تنها کافی است يك نوار فرضاً سبز رنگ کوچک بروی AO یا AC ظاهر گردد ...
۳- نه اهمیتی ندارد و هر چه که خطوط بهم نزدیک تر باشد پتانسیل ترید بیشتری ایجاد میگردد که در این مواقع برای بررسی دقیقتر این خطوط میتوای از Gator Oscillator هم استفاده کرد.

سوال :

در مورد فرکتال ها گفتید که: هر فرکتال باعث بی اعتباری فرکتال قبلی میشود.
حال، آیا اگر الان يك فرکتال فروش داشته باشیم و پشت سر آن يك فرکتال خرید دوباره يك فرکتال فروش دیگر آیا فرکتال خریدی که بین دو فرکتال فروش است باعث بی اعتباری فرکتال اول است یا فرکتال فروش دوم باعث بی اعتباری فرکتال اول است؟

جواب :

خیر، هر فرکتال تنها فرکتال هم رده خودش را بی اعتبار میکند، یعنی فرضاً يك فرکتال فروش تنها میتواند فرکتال فروش قبلی را بی اعتبار کند و بر روی فرکتال خرید تاثیری ندارد .
و همانطور که میدانید در اینجا نکته ای قابل توجه است و آن اینست که: برای فیلتر کردن فرکتالها تنها باید از فرکتالهایی استفاده کنیم که خارج از دهان تمساح قرار دارند.
بنابراین هر نوع فرکتالی چه خرید و چه فروش که در بین خطوط الیگاتور ایجاد شود اعتباری ندارد و نباید بر اساس سیگنال آن ترید کرد.

سوال :

آیا بین دو سیگنال ورودی که فرمودین شرط انجام هر کدام تقدم زمانی است؟ یا اینکه ما ملزم به انجام یکی از دو مکتب هستیم (یا فراکتال وشکست آن و یا سیگنال ao و مووینگ صورتی) و به دیگر مورد کاری نداریم؟

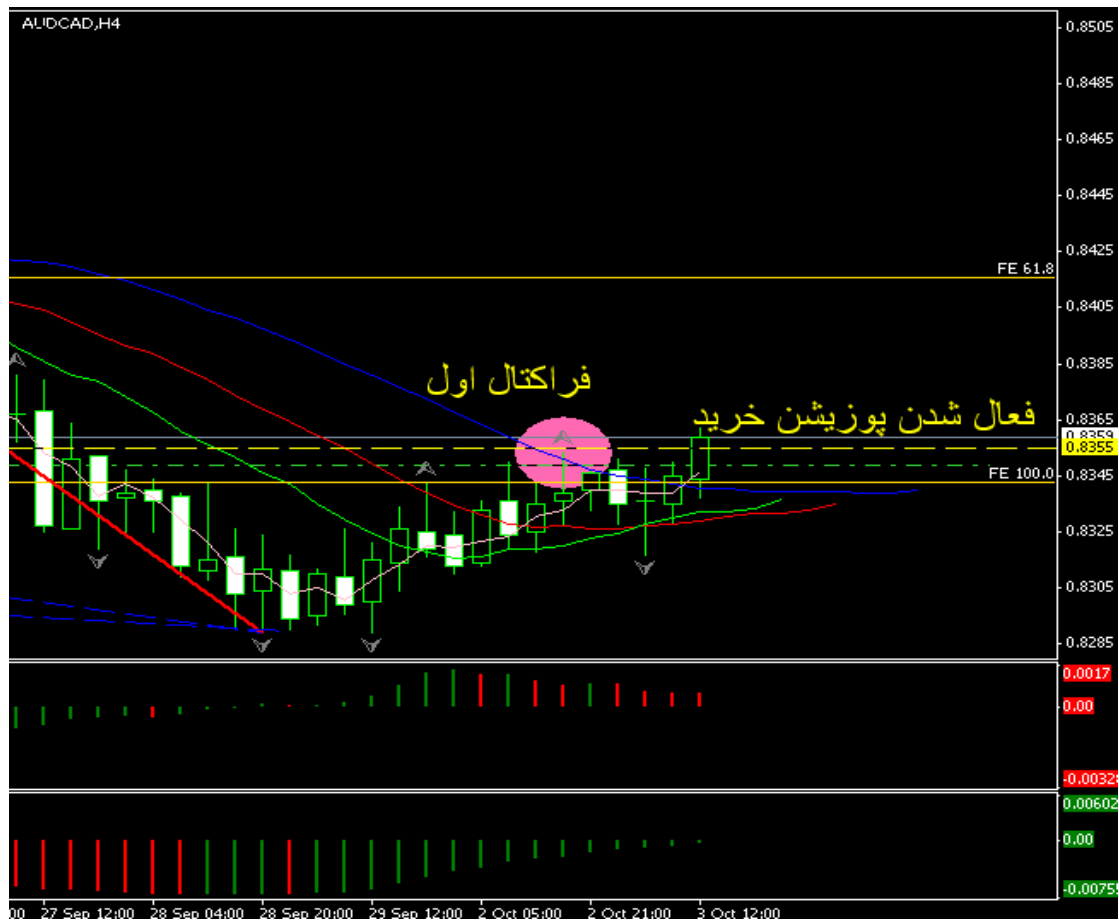
جواب :

اگر به روش هربرت ترید کنید ایشان تنها تقدم زمانی را مد نظر دارند و هر دو سیگنال را به يك اندازه معتبر میدانند. اما در روش ویلیامز حتماً باید اولین سیگنال بر اساس فرکتال باشد و سایر سیگنالهای روش که میتواند بسیار هم متعدد باشند، صرفاً بعد از اینکه توسط فرکتال وارد بازار شدیم اعتبار دارند .

البته توصیه میشود تریدر هر دو سبک را در فارکس تست و بعد انتخاب بهینه ای داشته باشد.

سوال :

پس با این اوصاف این پوزیشن باید درست باشد.



جواب :

بله منتهي این وضعیت همونه که در کامنت قبلي اشاره کرده بودم .
یعني فرکتالهایی که در دهان تمساح هستند رو بهتره که در نظر نگیریم .
البته از نظر تیوری ویلیامز میگوید که اگه نقطه کلوز کندل یا پرایس بار بالای خط قرمز باشد این فرکتال قابل قبول است اما طبیعتا فرکتال ایده ال خارج از دهان تمساح است .

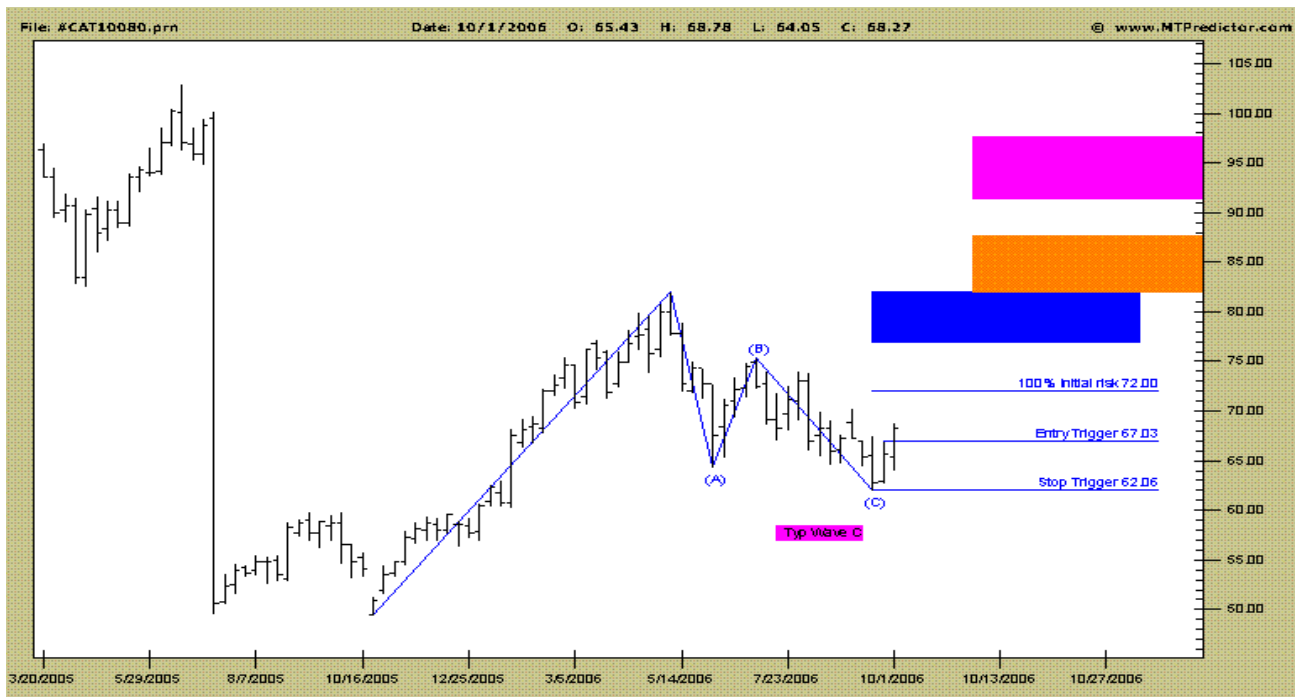
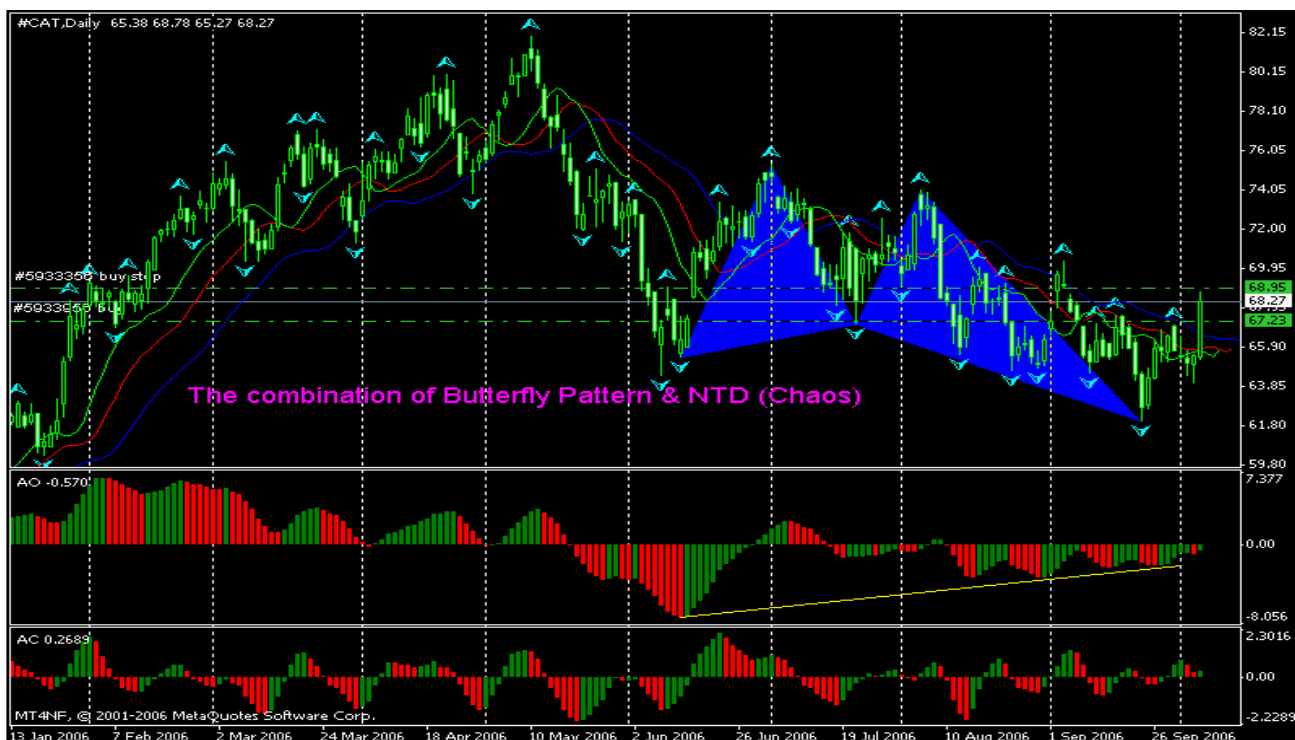
ضمنا اگر در این شرایط اگر Gator Oscillator رو نصب کنید ببینید که چه خوب فاصله کم خطوط الیگاتور رو به ما نشون میده و گاهی این اندیکاتور کمک میکنه که حتی بهتر از خود خطوط الیگاتور بتونیم وضعیت رو بررسی کنیم .

پی نوشت: همواره برای ترید بروی تایم فریم ۴ ساعته وضعیت چارت در روزانه رو بررسی نمایید و در صورتیکه الیوت مشخصی داشت حتما از اون در تحلیل دقیقتر وضعیت کمک بگیرید.

ترکیب سیستم NTD با سایر سیستمهای ترید :

همان طور که در چارت زیر میبینید ترکیب پترن های فیوناچی با سیستم NTD میتواند قدرتمند باشد. در ضمن تحلیل MTP را هم کمی با آن میشوید ترکیب کرد. عکس های زیر سهام کاتر پیلار را نشان میدهند. که در حال حاضر حدود ۱۱۰ پیپس در سود است.

سیستم تریدینگ NTD به هیچ وجه سخت نیست، ولی به دلیل نکات بسیار ریزی که در هر ترید با آن برخورد میکنیم، کمی نیاز به تمرین و تجربه دارد. در تصویر میبینید که برای ورود به پوزیشن از چندین فاکتور به صورت همزمان استفاده شده است. ابتدا پترن باترفلای، سپس گرفتن تایید از MTP و بعد دیدن Quadruple Divergence و در نهایت شکست فرکتال که سیگنال long به ما داده است. با این مثال به این نکته پی میبریم که: برای ورود به یک پوزیشن چگونه میتوان به بازار نگاه کرد.



۴- پس از گرفتن پوزیشن جدید دقیقا نقطه استاپ و خروج ما در مراحل اولیه ترید کجاست؟

با یادآوری اینکه ما بر اساس روش هربرت این نقطه را تعیین میکنیم به ادامه بحث میپردازیم :
در روش هربرت ما دو نوع استاپ اولیه داریم که عبارتند از :

۱- سه کندل پایینتر از نقطه تریدر .

۲- یک پیپس پایینتر از پایینترین مووینگ .

اما توضیح :

۱- با فرض اینکه در یک ترید خرید هستیم، یعنی دو پیپس بالاتر از فرکتال یک بای استاپ قرار داده ایم. برای تعیین میزان استاپ لاس به روش اول هربرت به تعداد سه کندل پایین میرویم و یک پیپس پایینتر از انتهای کندل سوم استاپ را قرار میدهیم .

باید دقت کرد که: منظور از سه کندل پایینتر این است که خود کندلی هم که بعنوان فرکتال محسوب شده است باید در این شمارش به حساب آورد، یعنی خود کندل علاوه دو کندل پایینتر از آن . این مطلب با مشاهده مثالهای تصویری بخوبی قابل درک است.

۲- با فرض یک روند صعودی استاپ ما یک پیپس پایینتر از پایینترین مووینگ الیگاتور قرار میگیرد. یعنی به چارت نگاه میکنیم لحظه ای که پتانسیل تریدی را تشخیص دادیم و استاپ لاسی را بر اساس آن وضعیت تنظیم کردیم حالا باید استاپ را یک پیپس پایینتر از مووینگ قرار دهیم .

معمولا این مووینگ مووینگ آبی رنگ است اما ممکن است رنگی دیگر نیز داشته باشد که زیاد مهم نیست، فقط باید به چارت نگاه کنیم و ببینیم پایینترین مووینگ ما در این لحظه کدام است و بر اساس آن یک پیپس پایینتر استاپ اولیه رو قرار دهیم .

و اینکه کدام یک از این دو روش را اولویت دهیم، تنها بستگی به وضعیت چارت دارد یعنی باید نگاه کنیم و ببینیم که آیا پایینترین مووینگ از سه کندل پایینتر هم پایینتر قرار گرفته است یا کندل ها پایینتر هستند . و هر کدام پایینتر بود آن را ملاک و استاپ را یک پیپس پایینتر از آن قرار میدهیم .

باید توجه داشته باشید که در اکثر مواقع این روش سه کندل است که پایینتر قرار میگیرد و ما استاپ اولیه را بر اساس آن تنظیم میکنیم اما چون یک سیستم تریدینگ میبایست کامل بوده و به کلیه حالات ممکنه پاسخ دقیق و واضحی داشته باشد این حالت دوم نیز که بسیار هم نادر است بررسی شده.

در حالتی نژولی هم روند کار به همین شکل است و حالا فقط باید سه کندل بالایی را در نظر بگیریم و استاپ را یک پیپس بالاتر از سومین کندل قرار دهیم .

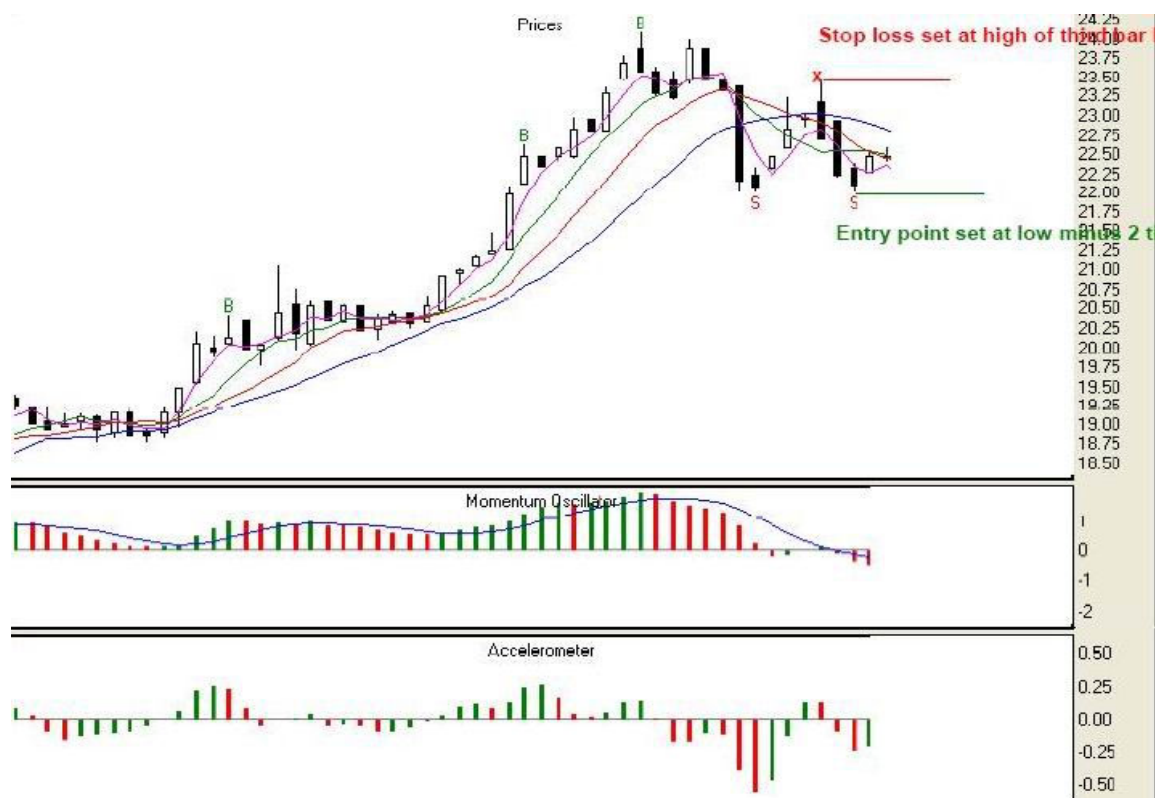
برای مووینگ هم بالاترین مووینگ ملاک ماست. و همینطور در مقایسه بین سه کندل و مووینگ هم نگاه میکنیم ببینیم کدامیک بالاتر قرار دارند .

روش بسیار ساده است و با بررسی دو مثال بخوبی مطلب قابل درک خواهد بود.

مثال اول مربوط به یک ترید خرید میباشد: زمانی که بر اساس فرکتال بای استاپ اولیه را تعیین کردیم باید بلافاصله استاپ اولیه را در پوزیشن تعیین کرده و قرار دهیم (توصیه اکید است که هیچگاه بدون استاپ کار نکنید.)
به چارت نگاه میکنیم و ببینیم که انتهای سه کندل پایینتر از کندل فرکتال، از انتهای مووینگ صورتی رنگ هم پایینتر است بنابر این استاپ ما یک پیپس پایینتر از کندل سوم میشود (دقت کنید که کندل سوم شامل کندل فرکتال هم میباشد.)



در مثال دوم با يك ترید فروش روبرو هستیم: زمانی که بای استاپ را تعیین میکنیم میبایست بلافاصله استاپ لاس هم تعیین شود که در این چارت هم میبینیم سه کندل، پایینتر از آخرین مووینگ استاپ ما يك پیپس پایینتر از کندل سوم میباشد.



سوال :

۱- برای اینکه بر اساس سیستم تریدینگ NTD وارد پوزیشن شویم دو نوع سیگنال داشتیم: ۱- با استفاده از فرکتالها، ۲- با استفاده از اندیکاتور AO ، حال این سوال پیش می آید که آیا برای باز کردن اولین پوزیشن باید این دو سیگنال هم زمان اتفاق بیفتد، یا در صورتی که هر کدام از این دو مورد ابتدا اتفاق افتاد میتوانیم بر اساس سیگنال آن وارد پوزیشن شویم؟

۲- در قسمت قبل زمانی که از تشخیص پتانسیل ترید صحبت شد ۲ شرط را اعلام شد که: یکی از آنها کراس مووینگ صورتی با سبز بود اما چرا درسیگنال ورودی که بر اساس فرکتالها ذکر گردید از کراس مووینگها اسمی برده نشد؟

۳- به نظر شما بهترین روش ترید با این سیستم به چه صورت است؟(منظور این است که: چه ابزارهای دیگری برای فیلتر کردن این سیستم مناسب هستند؟)

جواب :

۱- در روش هربرت تقدم زمانی شرط است یعنی هر کدام سریعتر ایجاد شود از همان برای ورود استفاده میکنیم.

۲- در روش هربرت برای هر دو نوع سیگنال میتوانیم از تایید این مووینگ استفاده کنیم اما در روش ویلیامز نیازی نیست و یا بهتر است بگوییم: الزامی نیست.

۳- این میتونه تا حدی سلیقه ای باشه و اساسا این سیستم میتونه بطور مستقل استفاده بشه اما بنده این روش رو حتما با پترنهای فیبوناچی و الیوت ترکیب میکنم.

سوال :

در آنجایی که گفته شد: فرکتالها نباید در دهان تمساح باشند منظور چه ناحیه ای از کندل است . آیا حتی اگر Shadowها هم با موینگهای الیگاتور برخورد کنند بهتر است که از آن فرکتال چشم بپوشیم یا ناحیه خاصی از کندل مد نظر است ؟

جواب :

ویلیامز در کتاب New Trading Dimensions در اینباره میگوید: باید نقطه کلوز فرکتال بالاتر از خط قرمز الیگاتور قرار بگیرد در نتیجه اگر شادو کندل با این خط برخورد کرده باشد اما نقطه کلوز و پایانی کندل بالاتر از خط قرمز بسته شود مشکلی نیست و میتوان بر روی سیگنال آن حساب کرد و اگر تریگر خورد صحیح است .

اما در کتاب Chaos2 نسخه ۲۰۰۴ ایشان میگویند: اگر فرکتال بالای خط قرمز هم باشد اما لحظه ای که تریگر خورد نقطه تریگر پایینتر از خط قرمز باشد نباید بر اساس این تریگر تردید کرد. همینطور اگر فرکتال پایینتر از خط قرمز باشد اما زمانی که قیمت از آن نقطه عبور میکند و اصطلاحاً تریگر میشود بالاتر از خط قرمز باشد مشکلی نیست و میتوان بر اساس آن نقطه وارد پوزیشن شد .

خلاصه بحث اینکه ظاهراً آخرین نتیجه و تحقیق ایشان به اینجا رسیده که: مهم این است که لحظه ای که فرکتال تریگر میخورد باید بالاتر از خط قرمز باشد و دیگر محل فرار گرفتن فرکتال اهمیتی ندارد. با این وجود صادقانه باید گفت: بهتر است با فرکتالهایی کار کنیم که مشخصاً بالای دهان الیگاتور باشند و یا همان روش قدیمی، که میگوید: حداقل بالای خط قرمز قرار گرفته باشند...

پاسخ به سوالات ۵ و ۶:

۵- در صورتیکه روند بازار در جهت ترید ما حرکت کرد دقیقا روش مشخصی برای جابجایی استاپ داشته باشیم (اصطلاحا تریدینگ استاپ) و بدین شکل در عین حال نباید استاپمان خیلی به روند نزدیک باشد (که به سادگی توسط قیمت لمس شده و ما را از جریان بازار خارج کند) و بتوانیم روند قیمت را با فاصله ای معقول دنبال کنیم و به این شکل ضمن اینکه شانس تعقیب روند و سود بیشتر را از دست ندهیم بتوانیم از سودهای حاصله هم محافظت کرده و مانع از بین رفتنشان شویم. (خیر خوب اینکه در این سیستم تریدینگ روش بسیار قدرتمندی به این منظور اختصاص دارد که حتما با جزئیات زیادی به آن خواهیم پرداخت.)

۶- در صورتیکه ترید در جهت موافق تحلیلیمان پیش رفت دقیقا نقطه خروج (تارگت) کجاست ؟

برای پاسخ به سوالات ۵ و ۶ شروع به بررسی یک ترید حقیقی میکنیم، از لحظه ابتدای تحلیل وضعیت پتانسیل ترید تا زمانی که پوزیشن تریدر میخورد و بعد با جابجایی استاپ روند را تعقیب میکنیم :

در چارت زیر ابتدا در یک بازار رنج فرکتالی را بالای چارت تشخیص میدهم و در نتیجه با توجه به اینکه خطوط الیگاتور به هم نزدیک هستند و فرکتال هم یکی از دو سیگنال اولیه ورود ماست (دیگر سیگنال کراس AO می باشد) یک بای استاپ دو پیس بالاتر از فرکتال قرار میدهم .

دقت داشته باشید که در بازار رنج اگه فرکتال جدیدی شکل گرفت دیگر فرکتال قبلی از اعتبار خارج و باید بر اساس موقعیت فعلی فرکتال جدید استاپ را تنظیم نمایم .

بعد از اینکه بای استاپ مشخص شد باید استاپ اولیه نیز مشخص گردد. که در این حالت برابر است با انتهای سه کندل آخری (با احتساب کندل فرکتال). باید توجه به این نکته داشت که: انتهای سه کندل پایتتر است از انتهای پایتترین مووینگ ...

در تصویر دوم زمانی را شاهدیم که کندل جدید از نقطه ورود ما به بازار عبور کرده و به این ترتیب پوزیشن فعال میگردد .

اگر دقت کنیم مشخص است که: در تصویر نقطه استاپ ما، کندل به کندل که روند پیش میرود باید جابجا شود. در این تصویر استاپ اولیه به موازات نقطه ورود با یک ضریب قرمز رنگ مشخص شده است .

حال باید با ادامه روند شروع به جابجایی استاپ نمایم چرا که میدانیم در این نوع ترید تارگت مشخصی وجود ندارد و باید تنها با روند کلی بازار همراه شد و تا جایی که قوانین استاپ اجازه دهند روند را تعقیب نموده و در نهایت با برخورد روند قیمت با استاپ از بازار خارج میشویم.





سوال :

۱- گفتید که: فرکتال جدید باعث بی اعتباری فرکتال قبلی میشود. سوال من این است که: آیا فرکتال جدید که هم جهت فرکتال قبلی است باعث بی اعتباری آن میشود یا جهت آنها مهم نیست ؟ با توجه به ۳ مثال آخری که لطف کردید در کارگاه گذاشتید اینطور برداشت کردم که در صورتی که هم جهت باشند قبلی اعتبارش را از دست میدهد .

۲- در سیستم NTD در صورت وجود پتانسیل و فرکتال هم جهت با فرکتال اوردر میگذاشتیم ولی انگار در Chouse در مورد دانای اول عکس NTD است؟! درست است؟

جواب :

در مورد سوال اول: قبلا صحبت شده بود و اینکه فرکتال جدید تنها فرکتال هم رده خود را میتواند بی اعتبار کند یعنی يك فرکتال صعودي نمیتواند يك فرکتال نزولي را بی اعتبار نماید. در نتیجه زمانی که با فرکتال صعودي قبلي يك باي استاپ قرار داده اید با تشکیل فرکتال جدید میبایست نقطه ورودتان را بر اساس موقعیت فرکتال جدید تنظیم (Modify) کنید.

اما در مورد سوال دوم: روش NTD هم جهت با فرکتال است اما همانطور که اشاره کردید در روش Chouse چون ما در خلاف جهت ترند شروع به ترید میکنیم نتیجتا بر خلاف جهت دانای اول پوزیشن میگیریم . و به این دلیل است که روش NTD برای شروع ترند و همجهتی با ترند استفاده میشود و روش Chouse برای ترید بر خلاف جهت ترند مورد استفاده قرار میگیرد . در واقع دو روش مکمل یکدیگر بوده و با تسلط به هر دو میتوان در يك سیکل کامل الیوت در هر دو جهت بازار ترید کرد.

تا اینجا نحوه بررسی وضعیت و پیدا کردن پتانسیل خرید یا فروش را در یک پتانسیل خرید بررسی کردیم اینک همین مسله را در یک وضعیت پتانسیل فروش مشاهده و بعد شروع به بررسی روش تریدینگ هربرت خواهیم کرد.

مثالی برای وضعیت فروش (Sell):

ابتدا در چارتهای مختلف به دنبال وضعیتی میگردیم که خطوط الیگاتور به هم نزدیک باشد هر چه مدت زمانی که این خطوط به هم نزدیک بوده اند بیشتر باشد (زمان طولانی تری بازار رنج بوده) شانس ایجاد ترند خیلی بیشتر میشود .

در تصویر میبینیم که با ایجاد فرکتال میبایست یک سل استاپ قرار دهیم (دقت کنید که این فرکتال با حرف S نمایش داده شده است) و باز هم دقت داشته باشید که این فرکتال جدید فرکتال قبلی (که آنهم با حرف S مشخص شده است) را بی اعتبار میکند و باید قیمت ورودی سل استاپ را بر اساس وضعیت قرار گرفتن فرکتال جدید تنظیم کنیم .

به محظ اینکه سل استاپ را تعیین کردیم باید میزان استاپ هم مشخص شود که برای اینکار دو روش داریم یا نقطه High سه کندل قبل و یا نقطه High بالاترین مووینگ ...

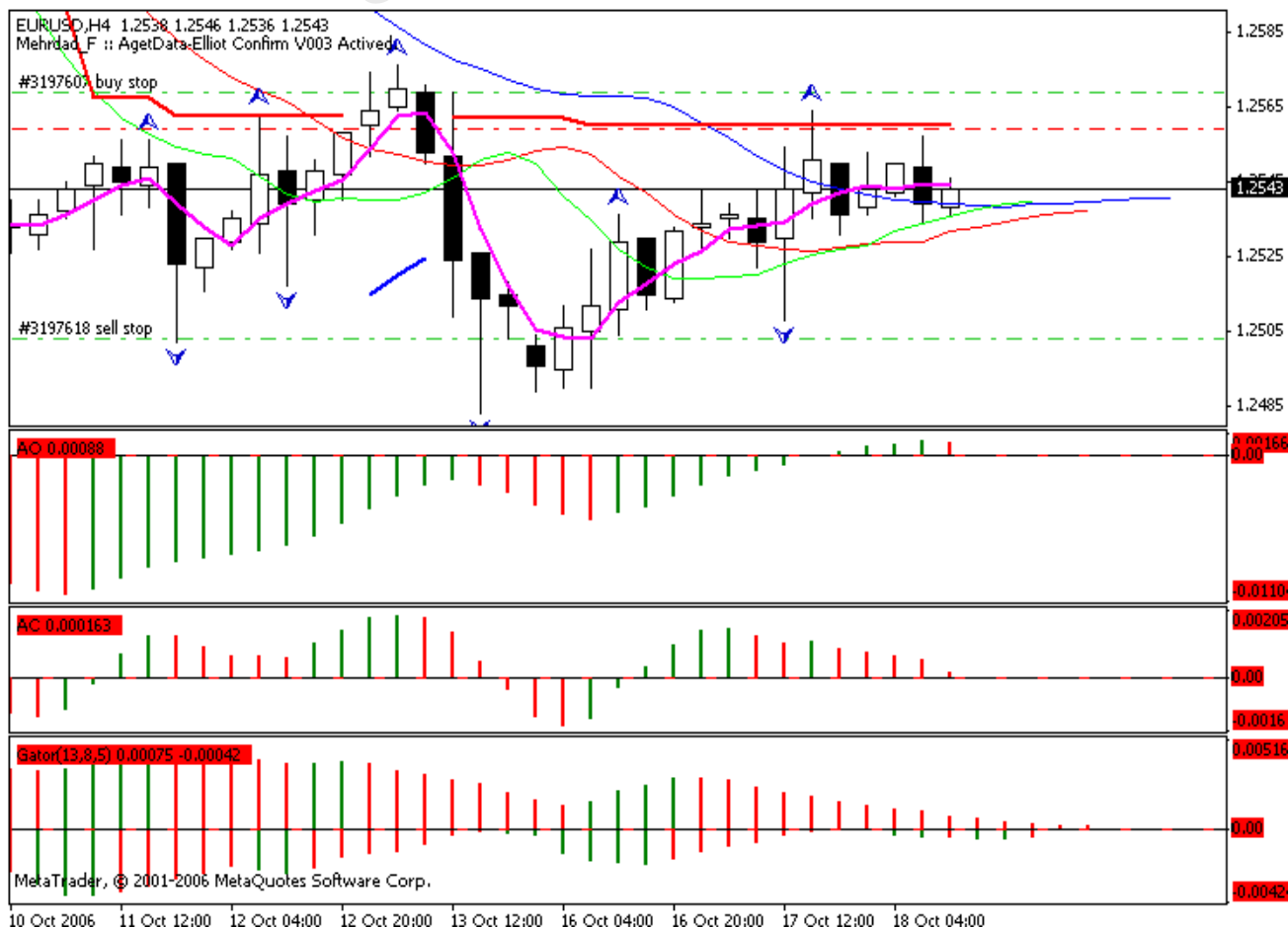
همانطور که غالباً معمول است بالاترین نقطه برای تعیین استاپ حداقل برای شروع ترید انتهای سه کندل قبل است در تصویر با یک علامت ضربدر قرمز رنگ این استاپ اولیه مشخص شده است .

دقت کنید که اگر کندل بعدی در جهت عکس حرکت کرد پوزیشن ما فعال نشده است و میتوانیم صبر کنیم تا کندلهای بعدی پوزیشن را فعال کنند و یا اینکه با شکل گیری فرکتال های جدید مجدداً قیمت ورودی سل استاپ را بر اساس موقعیت این فرکتال تغییر میدهیم...



سوال :

قبلا گفته شد که: ((برای تعیین استاپ لاس باید: با فرض اینکه در یک ترید خرید هستیم، یعنی دو پیپس بالاتر از فرکتال یک بای استاپ قرار داده ایم. برای تعیین میزان استاپ لاس به روش اول هربرت به تعداد سه کندل پایین میرویم و یک پیپس پایینتر از انتهای کندل سوم استاپ را قرار میدهم. باید دقت کرد که: منظور از سه کندل پایینتر این است که خود کندلی هم که بعنوان فرکتال محسوب شده است باید در این شمارش به حساب آورد، یعنی خود کندل علاوه دو کندل پایینتر از آن.))
آیا در عکس زیر که در هر دو مورد بای استاپ و سل استاپ خود اکستریم (high&low) کندل فرکتال از سه کندل قبل بیشتر است باید جهت استاپ لاس از اکستریمهای خود کندل فرکتال استفاده کنیم یا همان کندل سوم مد نظر است؟
به بیان واضحتر: آیا در میان ۳ کندل هر کدام اکستریم (high&low) بیشتری داشتند مد نظر است یا صرفا همان کندل سوم را باید در نظر بگیریم؟ حالا حتی اگر نسبت به دو کندل بعدی از اکستریم کمتری هم برخوردار باشد؟
یک سوال دیگر: آیا برای تنظیم استاپ لاس و همچنین نقطه ورود باید اسپرد را هم در نظر گرفت؟



جواب :

این سوالات از این جنبه جالب توجه هستند که: با اینکه در روش هربرت برای هر حالت خیلی نادر هم پیش بینیهای شده است اما این دو سوال بررسی نشده! و البته در روش ویلیامز هم به همین صورت است!!

بنابراین سعی میشود با توجه به جمیع جهات و تجربه شخصی پاسخ این سوالات داده شود: *

۱- هدف این است که: فاصله استاپ به اندازه معقولي باشد بنا براین به نظر میرسد، میبایست همان کندل فرکتال در نظر گرفته شود.

۲- در مورد اسپرد میتوان در نظر گرفت، اما چون در این سیستم بیشتر در تایم فریمهای بالا ترید میکنیم در نتیجه این حساسیت خیلی وجود ندارد و در واقع این اختلاف اسپرد بیشتر در روشهایی نظیر آمازینگ که با حرکات و نوسانات سریع بازار رو برو هستند خود را نشان میدهد و در تایم فریمهایی نظیر روزانه و ۴ ساعته محسوس نیست و مشکلی را ایجاد نمیکند کما اینکه خود من (مترجم) ۱۵ پیپس بالاتر و پایینتر از کندل فرکتال اوردرهایم را قرار میدهم و این امر مشکلی هم برای من ایجاد نمی کند ...

*این دو جواب نظرات شخصی مترجم هستند.

**** روش انجام تریلینگ جهت حفظ سود حاصله:**

بعد از اینکه پوزیشن تریگر خورد با توجه به اینکه در این روش تارگتی وجود ندارد باید بر اساس قوانینی که توضیح داده خواهد شد آنقدر تریلینگ استاپ کرد تا استاپ خورده و از بازار خارج گردیم .

حال به تشریح روش میپردازیم:

بعد از اینکه اولین استاپ بر اساس سه کندل و یا نقطه انتهایی مووینگ ها تعیین شد حال میبایست بر اساس هر کندل جدید استاپ جابجا گردد.

حال با فرض اینکه در یک پوزیشن خرید قرار داریم به تشریح موضوع خواهیم پرداخت: روش به این صورت است که استاپ همان استاپ اولیه فرض میشود و تغییر نمیکند تا زمانی که کندل بالاتراز آخرین مووینگ قرار بگیرد . در اینصورت استاپ را به پایین آخرین مووینگ منتقل میکنیم . در نگاه اول کمی پیچیده است اما اصلا اینطور نیست و با مشاهده مثال بخوبی موضوع روشن خواهد شد.

فرض میکنیم ترند شروع شده حال با هر کندلی که تشکیل و بسته میشود میبایست استاپ را به موازاتش زیر مووینگ آبی جابجا کنیم . پس تا اینجا به این صورت شد که استاپ اولیه انتهای سه کندل نزولی یا صعودی و یا انتهای آخرین مووینگ قرار میگیرد .

بعد این استاپ باقی مانده و تغییر نمیکند تا زمانی که ترند شکل گرفته یا استاپ بخورد. وقتی ترند شکل گرفت (طبق همان فرض بالا صعودی شد). زمانی که کندل ها بالاتر از مووینگ آبی (فک تمساح) قرار گرفتند استاپ را به زیر آن منتقل میکنیم. حال از اینجا به بعد هر کندلی که بسته میشود باید استاپ به موازات با آن زیر مووینگ آبی جابجا شود.

این جابجایی استاپ با تشکیل هر کندل ادامه پیدا میکند تا اینکه: در اندیکاتور AC شاهد سه کندل با رنگ مخالف روند باشیم .

یعنی در حالیکه در روند صعودی استاپ مرتباً در حال جابجایی زیر مووینگ آبی است به محظ اینکه در اندیکاتور AC سه نوار قرمز رنگ شکل گرفت استاپ به زیر مووینگ قرمز رنگ منتقل میگردد. (در واقع استاپ یک مووینگ بالاتر آمده و از آبی به قرمز نقل مکان میکند). ومجدداً جابجایی استاپ ادامه پیدا میکند، و با هر کندل جدید که تشکیل و بسته میشود استاپ جابجا میگردد. (ولی اینبار زیر مووینگ قرمز رنگ).

این روند آنقدر ادامه پیدا میکند تا اینکه در اندیکاتور AC مجدداً سه نوار قرمز رنگ تشکیل گردد، در اینصورت مجدداً استاپ یک مووینگ بالاتر می آید و به زیر مووینگ سبز رنگ منتقل میشود. بنابراین هر بار که در روندی صعودی اندیکاتور AC سه نوار قرمز رنگ را شکل داد (و عکس آن در روند نزولی سه نوار سبز رنگ) میبایست استاپ یک مووینگ جابجا شده و یک پیپس پایینتر از مووینگ قرار گیرد.

مرحله آخر جابجایی استاپ به اینصورت است که اگر در اندیکاتور AC کراس رخ داد یعنی: نوار قرمز رنگ از بالای خط صفر پایین خط صفر تشکیل شد در اینصورت استاپ به زیر مووینگ صورتی رنگ منتقل گشته و بعد با کندل های جدید آنقدر استاپ تغییر میکند (زیر مووینگ صورتی) تا سرانجام روند برگشته و استاپ زده شود و نتیجه پوزیشن مشخص گردد.

توضیح اینکه: در پوزیشنهای سل هم به همین منوال عمل می کنیم با این تفاوت که: استاپ به بالای مووینگهای مذکور منتقل میشود نه به زیر آنها و نوارها هم در این حالت باید سبز شوند تا استاپ از بالای یک مووینگ به بالای مووینگ بعدی منتقل شود.

در ادامه، این بحث تیوریک با مثالی تصویری - توضیحی در وضعیت خرید دنبال بیشتر توضیح داده خواهد شد: تصویر اول تصویری آشنا است، که پیش از این در مورد چگونگی خوردن تریگر و ورود به بازار در مورد آن توضیحاتی داده شد.

باید توجه داشت که در این مرحله استاپ، انتهای سه کندل قبل از فرکتال است، چون انتهای این کندل پایینتر از آخرین مووینگ است.

فرکتال تریگر خورده و وارد بازار میشویم، حال میبایست بر اساس هر کندل جدیدی که شکل میگیرد و با توجه به وضعیت اندیکاتور AC استاپ را جابجا کرد.

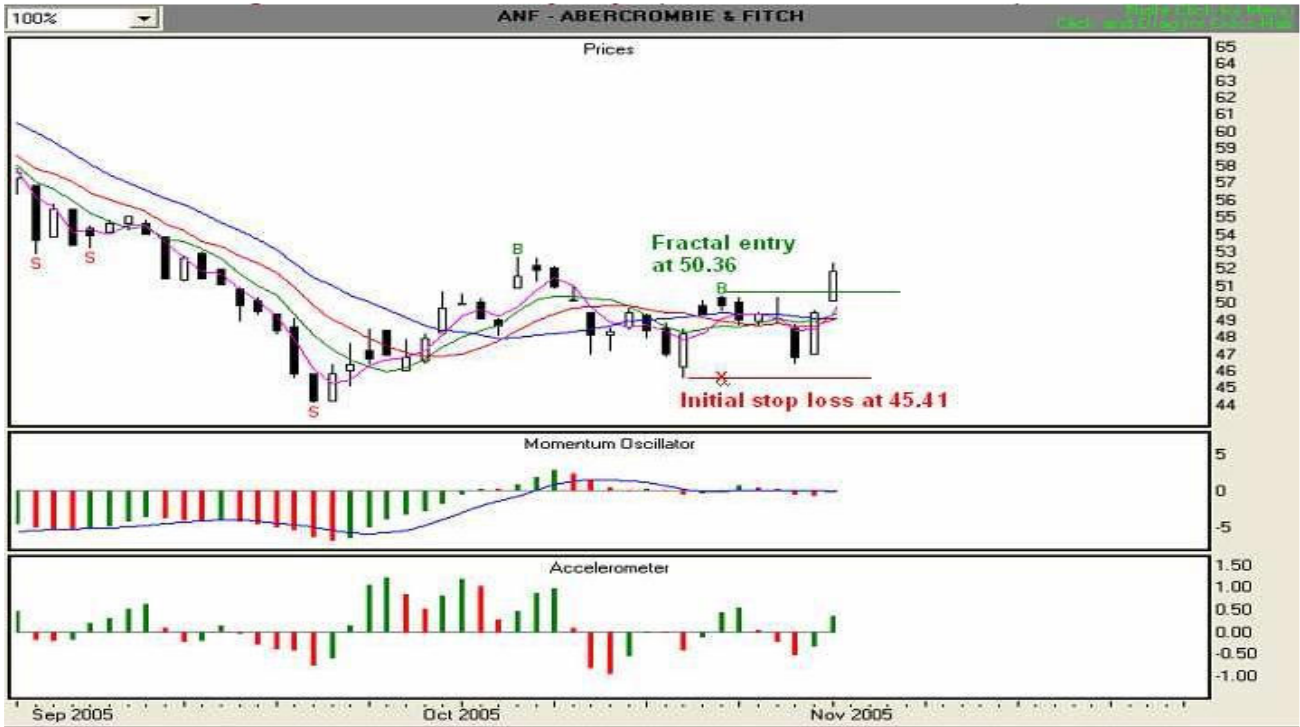
در تصویر دوم ترند شروع شده است و کندلی صعودی شکل گرفته است در صورتیکه ترند شکل نگیرد و یا پوزیشن تریگر بخورد اما روند نزولی شود تریدر با ضرر مختصری از بازار خارج میگردد. اما قدرت روش ان تی دی در این است که در ابتدا استاپ های کوچکی رخ میدهد و در نتیجه اگر ترند شکل نگیرد یا بازار رنج شود ضرر زیادی متوجه تریدر نمیشود و تنها کافی است بتواند یک ترند را گرفته و به این شکل نه تنها تمام آن ضررهای ابتدای ترند جبران میگردد بلکه در مجموع باز هم در سود خوبی را بدست خواهد آورد. در واقع در این سیستم، نسبت سود به ضرر قابل مقایسه نیست .

در تصویر دوم وقتی ترند شکل گرفت و کندل بالاتر از مووینگ آخر (آبی رنگ) قرار گرفت استاپ یک پیپس پایینتر از مووینگ آبی جایجا میشود. (استاپ های جدید در تصاویر با ضریب مشخص شده اند.)

دقت داشته باشید: که این استاپ باید به موازات کندل جدید باشد و ضمناً باید حتماً کندل بسته شود و بعد اقدام به جایجایی استاپ شود. طبیعی است که در این زمان در اندیکاتور AC نوارها همچنان سبز رنگ هستند.

در تصویر سوم کندل جدیدی شکل گرفته است استاپ به موازات با آن به زیر خط آبی رنگ منتقل میگردد. در ابتدای ترند چون خطوط الیگاتور به هم نزدیک هستند شاید انتهای خط آبی خوب واضح نباشد اما در ادامه ترند چون خط آبی از همه کندتر است خطوط دیگر در بالای آن قرار میگیرند.

در این زمان باید باز هم به اندیکاتور AC نگاه کرد، میبینید که خطوط هنوز سبز است...





در تصویر بعد دیده میشود که روند صعودی ادامه پیدا کرده است. همونطور که گفته شد بر اساس هر کندل جدیدی که شکل میگیرد استاپ به موازات با آن یک پیس پایینتر از مووینگ آبی رنگ جابجا میشود.

باید توجه داشت که: میتوان از همان ابتدا یک پیس پایینتر از مووینگ قرمز رنگ هم جابجایی استاپ داشته باشیم، چیزی که در تصاویر هم میتونیم ببینیم. اما از نظر تیوری جابجایی های اولیه استاپ ما از خط آبی رنگ شروع میشود.

حال به اندیکاتور AC دقت میکنیم و میبینیم که همچنان سبز رنگ است و در نتیجه نیازی به جابجایی استاپ به یک مووینگ بالاتر نیست.

در تصویر دوم دیده میشود که: روند هر از چند گاهی کمی نزولی شده است اما در کلیت مسئله صعودی است و بر اساس بسته شدن هر کندل به موازات با آن کندل استاپ جابجا میگردد.

این رویه آنقدر ادامه پیدا میکند تا اینکه تغییراتی در اندیکاتور AC مشاهده شود. که برای اثبات این تغییرات، یا باید سه نوار قرمز رنگ متوالی در آن تشکیل گردد، که باعث میشود استاپ یک مووینگ بالاتر بیاید. و یا اینکه مستقیماً و ناگهانی در اندیکاتور AC کراس رخ دهد که در اینصورت هم استاپ مستقیماً به زیر مووینگ صورتی رنگ منتقل میشود.

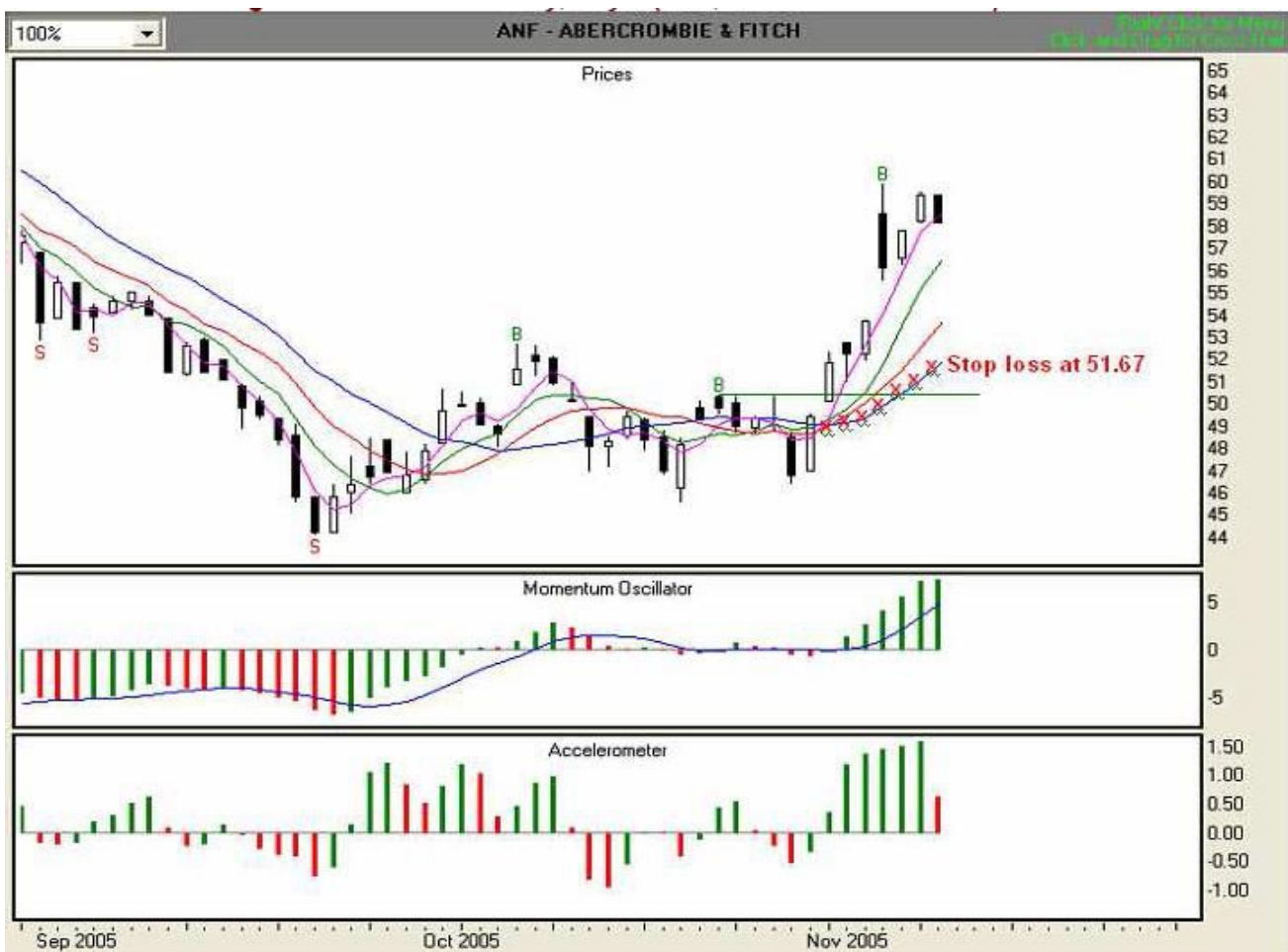
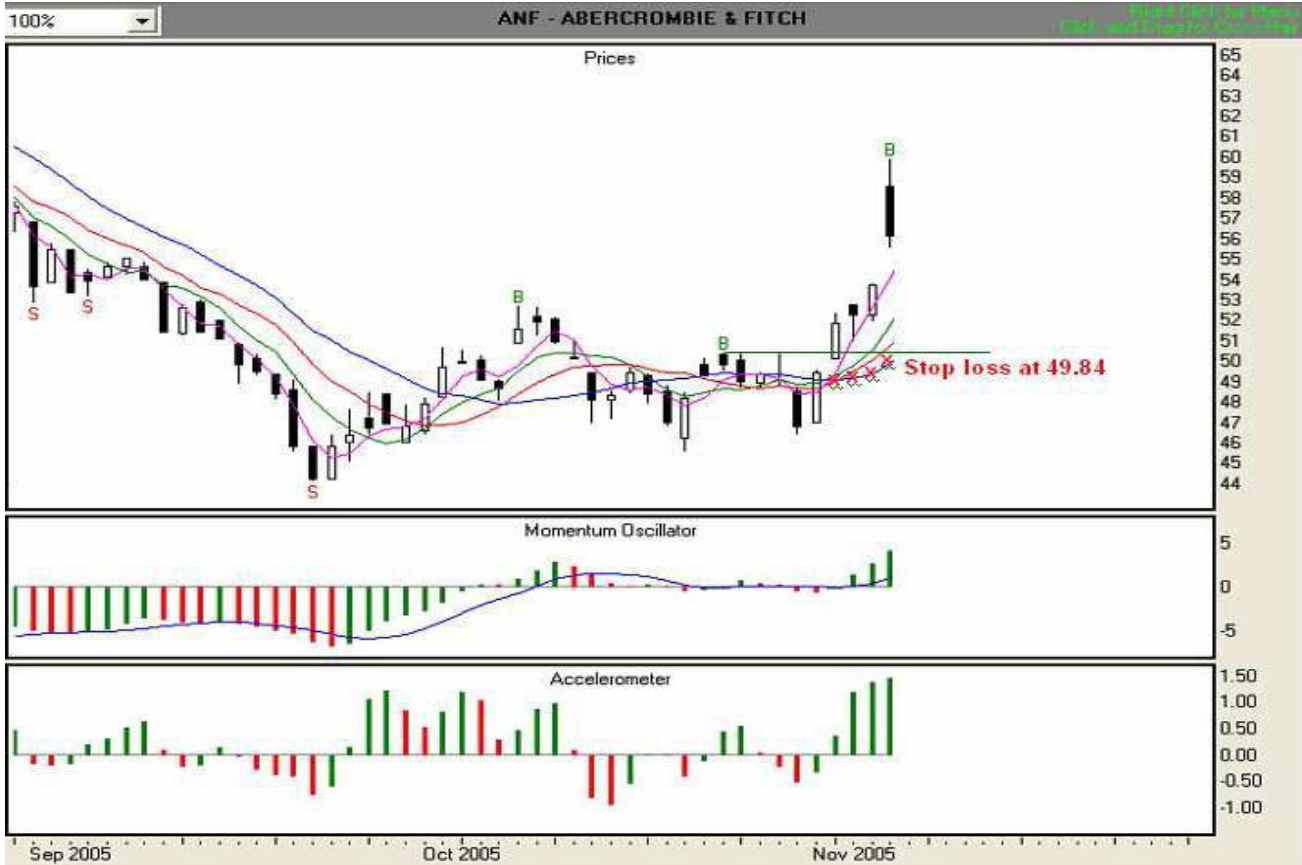
همچنین در تصویر دوم مشهود است که هر چند روند صعودی است اما اولین علائم برگشت روند در اندیکاتور AC با نواری قرمز رنگ بوجود آمده است.

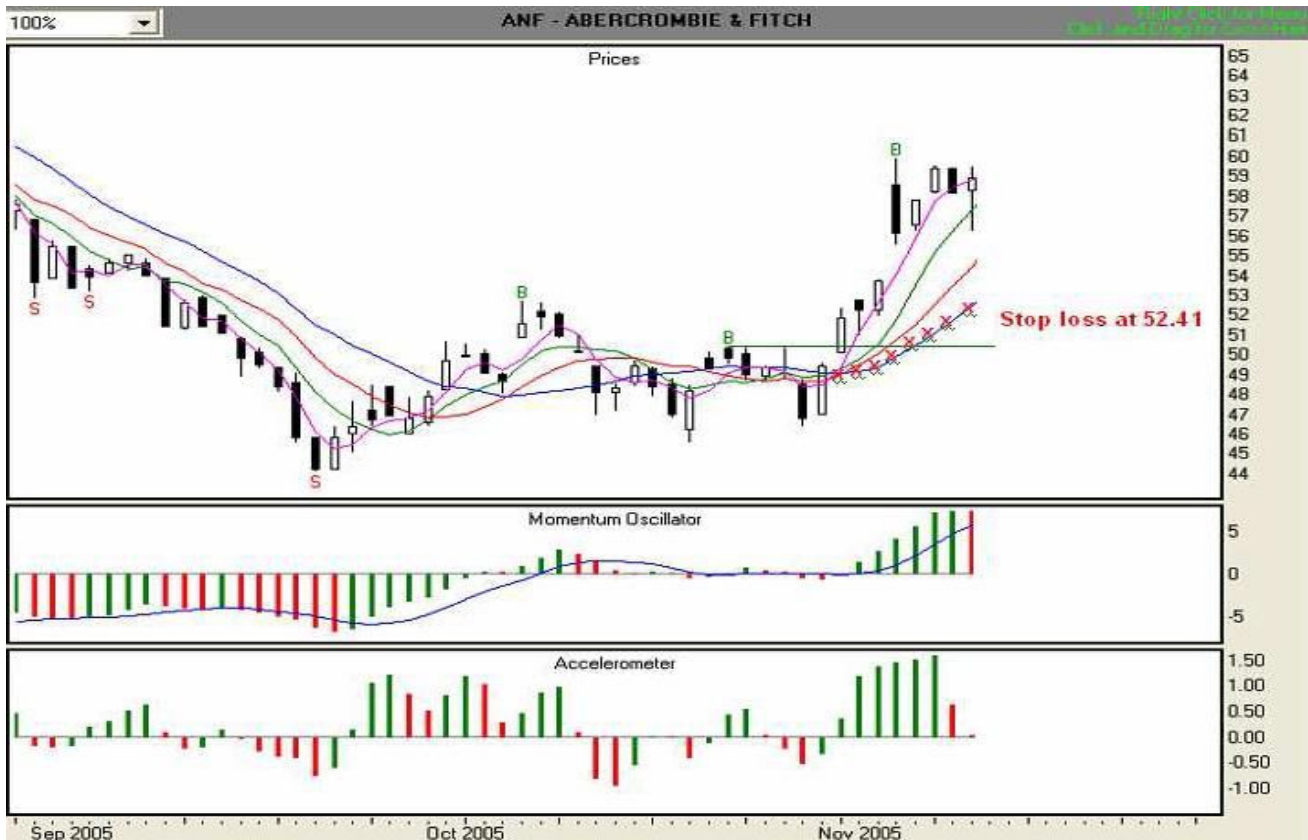
همانطور که قبلاً گفته شد: این اندیکاتور احتمال تغییر روند را از هر ابزار دیگری سریعتر هشدار میدهد و این مطلب را پیش از اندیکاتور AO گوشزد میکند.

بنابر این باید حتماً به رنگ خطوط این اندیکاتور توجه کنیم.

اما در این مثال چون در اندیکاتور AC تنها یک نوار قرمز شکل گرفته است (نه سه تا) و همینطور به این دلیل که: هنوز نوارها بالای خط صفر هستند، بر اساس این اندیکاتور تغییری در جابجایی استاپ ایجاد نمیشود. ولی با مشاهده رنگ قرمز باید به دقت ادامه روند را دنبال کرد. (این مسئله خصوصاً در ترید در تایم فریمهای کوتاه حایز بسیار اهمیت است)

دقت به این نکته هم جالب توجه است که: در تصویر سوم اولین نوار قرمز رنگ در اندیکاتور AO نیز تشکیل شده که نشونه احتمال تغییر روند در آینده نزدیک را دارد...





این روند تعقیب ترند ادامه پیدا میکند تا جاییکه در تصویر بعد در اندیکاتور AC کراس رخ میدهد.

یعنی یک نوار قرمز رنگ خط صفر اندیکاتور را به سمت پایین قطع میکند. در این حالت باید استاپ را به زیر مووینگ صورتی رنگ منتقل کرد. (و یا روی مووینگ صورتی اما ترجیحا یک پیس پایینتر از آن)

همانطور که در تصویر مشهود است، در جابجایی استاپ باید صبر کرد تا کندل بسته شده و بعد استاپ را به زیر مووینگ صورتی منتقل نمود.

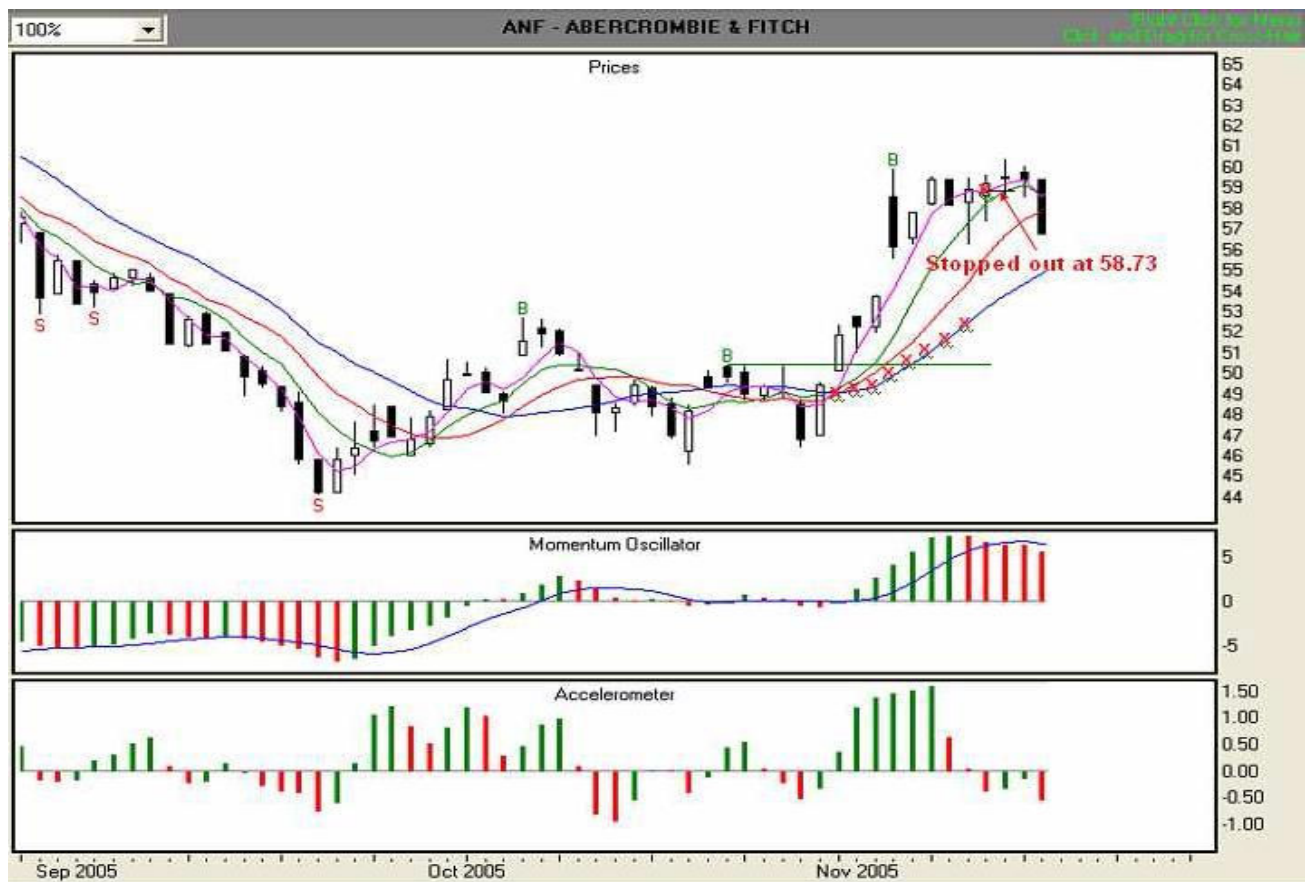
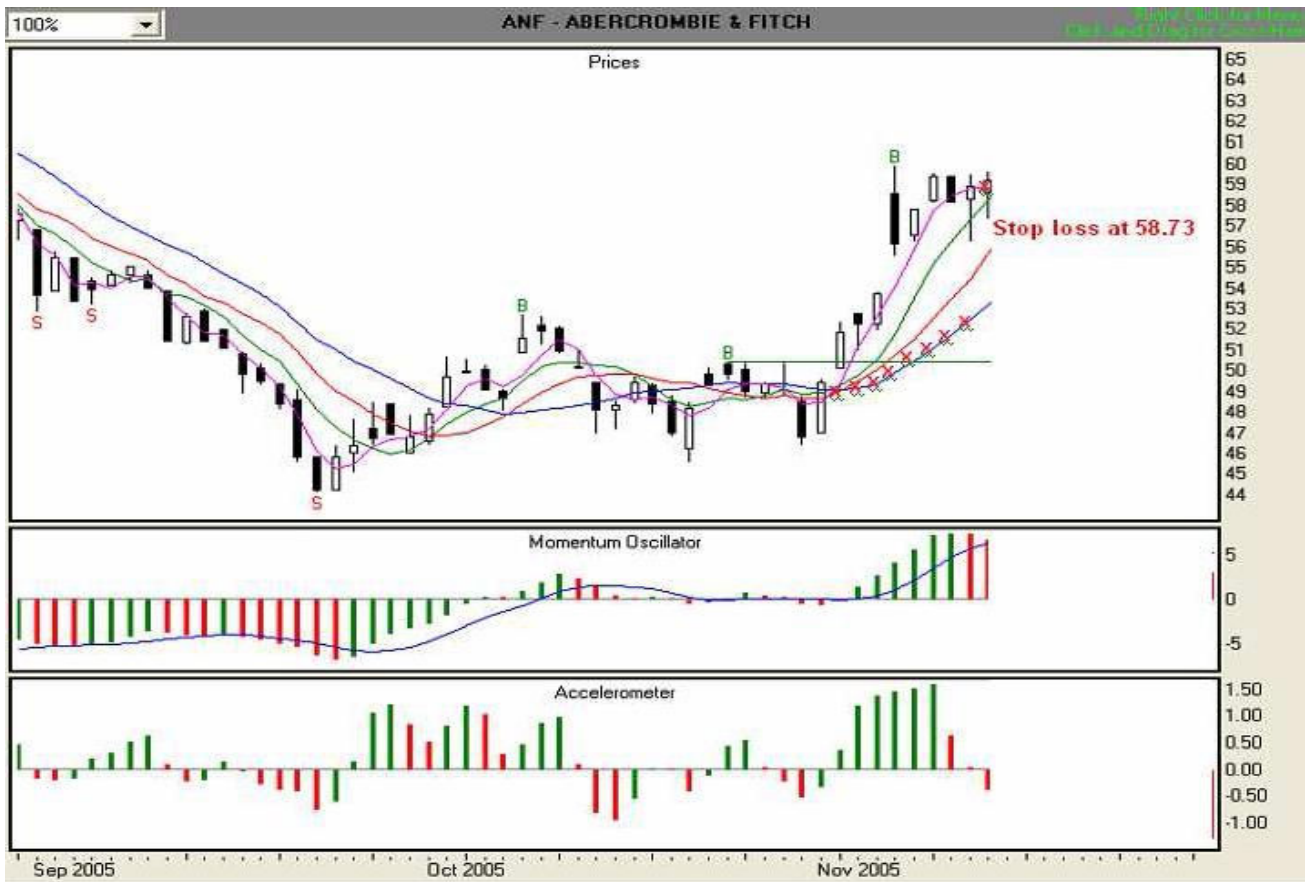
یعنی فرضا آگه کندل روزانه است بعد از بسته شدن آن و نه در زمانی که هنوز کندل امکان تغییر شکل را دارد استاپ، یک پیس پایینتر از مووینگ صورتی قرار میگیرد.

مشخص است که استاپ بسیار به روند قیمت نزدیک شده و به زودی قیمت به آن برخورد خواهد کرد. و علت اینکه استاپ تا این حد به قیمت نزدیک میشود اینست که: با توجه به علایمی که در اندیکاتور های AC و AO رخ داده است، احتمال تغییر روند بسیار زیاد شده و این عملی معقولانه است که استاپ به روند نزدیک شده تا سود بدست آمده هر چه بیشتر حفظ گردد.

سرانجام در تصویر آخر کندلی نزولی شکل گرفته و استاپ را میزند و تریدر را با سود مناسبی از بازار خارج میکند.

نکته قابل توجه در اینجا این است که: تا زمانی که استاپ نخورده است، باز با هر کندلی که بالای مووینگ صورتی رنگ تشکیل و بسته میشود مجددا استاپ به روش سابق به موازات آخرین کندل و یک پیس پایینتر از مووینگ صورتی قرار داده میشود.

برای موقعیت سل نیز همه چیز مانند همین مثال است فقط تنها تفاوتی که وجود دارد این است که: این بار در روندی نزولی به جابجایی استاپ میپردازیم.



سوال:

قبلا ذکر شد که: در این روش امکان اینکه روند شکل نگیرد و پوزیشنهای فعال شده در ابتدا استاپ بخورند وجود دارد و سپس بعد از شکل گیری روند بخاطر سود زیادی که به همراه دارد نه تنها آن ضررها را جبران کرده بلکه سود مناسبی هم به همراه خواهد داشت حال سوالی که بوجود می آید این است که: آیا روشی وجود دارد که بتوان با اطمینان از شکل گیری روند بر حجم پوزیشن افزود؟
مثلا اگر با شکست فرکتال وارد شدیم و سپس کراس 20 را داشتیم یک پوزیشن دیگر هم باز کنیم؟ در آخر آیا فقط با اتکا به این روش میتوان به ترید پرداخت؟

جواب:

هیچ روش قطعی و صد در صدی برای تعیین قطعی ترند وجود ندارد و اساسا در بازارهای سرمایه با احتمالات روبرو هستیم اما راههای زیادی هست که بتوان به احتمال بالایی تشکیل ترند پی برد یکی از بهترین آنها استفاده همزمان از الیوت است.

مثال آن مشاهده مسیر و جاده های یک منطقه از درون یک هواپیما است شخص از این طریق میتواند جهت کلی شمال، جنوب و در واقع مسیر کلی را صحیح تشخیص دهد و از مسیری کاملا اشتباه نرود اما بعد از آن باید با ابزار دقیقتری ریزه کاری های این مسیر را تحلیل و تشخیص دهد.

شما با الیوت میتوانید به نحوه موثری ترندهای قریب الوقوع را تشخیص دهید فرضا یک چارت را از دید روش ان تی دی بررسی میکنید و میبینید که خطوط الیگاتور خیلی بهم نزدیک هستند و پتانسیل ترید وجود دارد حال اینجا سوال این است که آیا ترند شکل میگیرد یا نه؟
حالا میتوان همان وضعیت را از دید امواج الیوت تحلیل کرد ...

فرض کنیم الیوت میگوید که در انتهای موج ۲ هستیم، بنابراین میتوان به سادگی تشخیص داد که ترندی قوی در پیش است و همینطور کاربرد خیلی مهم دیگر الیوت در این مواقع این است که با تشخیص اینکه فرضا انتهای موج ۲ یک روند صعودی هستیم میتوانیم تنها بای استاپ قرار دهیم و نه هم بای استاپ و هم سل استاپ به این شکل باز ۵۰٪ از سیگنالهای خطایی که ممکن است بر اساس نوسانات کوچک نزولی شکل گرفته و تریگر سل استاپ را فعال و بعد روند برگردد و صعودی شود را هم فیلتر میکنیم ...

روشهای دیگری هم برای تشخیص قریب الوقوع بودن یک ترند وجود داره اما الیوت همیشه یکی از مهمترین روشها برای گرفتن دید کلی از بازار بوده است ...

و اما در مورد سوال آخر: بله این روش یکی از قدرتمندترین روشهای ترید است. بسیار دقیق است و بی نیاز از هر ابزار دیگری و میتوان از این روش حتی بصورت مستقل استفاده کرد(استفاده از ابزارهای دیگر جهت ترید دقیقتر و پخته تر است).

در پایان به جمع‌بندی این روش می‌پردازیم :

سیستم تریدینگ NTD سیستمی قدرتمند و مبتنی بر تشخیص و ترید بر اساس ترندهای بازار است. در نتیجه طبیعتاً این سیستم در تایم فریمهای روزانه بهتر عمل میکند چرا که ترند های اصلی بازار در تایم فریمهای بالا شکل می‌گیرد و تایم فریمهای میان روز از خود استقلالی نداشته و در واقع بخشی از ترند اصلی در تایم فریمهای بالاتر هستند. (شاید تا حدی بتوان تایم فریم ۴ ساعته را مستقل دانست.)

سیستم تریدینگ NTD يك سیستم قدرتمند و دقیق است که بجهت تعریف شدن کلیه مراحل کار در آن میتوان از آن بطور مستقل استفاده کرد اما استفاده از ابزارهای مکمل نظیر امواج الیوت، الگوهای فیبوناچی، پیوت هفتگی و ... میتواند باهم به غنای تحلیلی ما کمک کرده و نقاط ورود دقیقتری را در این سیستم نمایان سازد.

از ویژگیهای بسیار ارزشمند این سیستم ارایه نوعی افزایش به حجم سرمایه در هر ترید بدون دخالت احساس و کاملاً بر اساس منطق و وضعیت بازار است که حقیقتاً این ویژگی حتی در سیستم تریدینگ های بسیار قدرتمندی نظیر پترن های فیبوناچی هم دیده نمیشود و شایان توجه خاص است.

و در نهایت اینکه تنها مشکل این سیستم این است که باید با ترند روبرو شد و در واقع برای موفقیت با این روش نیاز به شکلگیری روند میباشد. بنابراین منطقی ترین روش ترید بر اساس این سیستم این است که اولین پوزیشنی که بر این اساس گرفته میشود دارای حداقل حجم ممکن باشد تا در صورتیکه بازار رنج شد و یا به هر دلیل تحلیل اشتباه شده باشد حداقل ضرر متوجه تریدر گردد. این ضرر های کوچک مشکلی زیادی را ایجاد نمیکند، چرا که به محض اینکه ترند شکل گیرد این ضررها جبران شده و سپس نه تنها پوزیشن اولیه در ترند شکل گرفته سودی خوب را به ارمغان خواهد داشت بلکه با افزایش حجم معامله و سرمایه توسط سیگنالهای بعدی که این سیستم ارایه میکند میتوان گاهی حتی بیش از ۲ تا ۵ برابر کل ترند سود کرد !!

که این هم خود یکی از ویژگی های منحصر بفرد این سیستم است ...

و مطلب آخر اینکه کسانی که به این روش علاقه مند هستند در بازار های CFD به جهت ثبات بیشتر بازار و ترند های طولانی مدتی که شکل می‌گیرد ترجیحاً در تایم فریم روزانه و در بازار FOREX به جهت نوسانات بیشتر و اینکه با ترندهای کوتاه تر اما مستمر روبرو هستیم ترجیحاً با تایم فریمهای ۴ ساعته و ۱ ساعته ترید کنند.

در این مجموعه تلاش بر این بود که عزیزان با يك سیستم تریدینگ کامل آشنا بشوند که در آن بجوی کلیه جنبه های يك استراتژی موفق بررسی، تحلیل و برای تك تك موارد راهکارهای دقیق و موافی ارایه شده باشد. انشالله با کسب کمی تجربه در کار با این سیستم تریدینگ و همینطور اعمال يك مدیریت سرمایه ساده بتوانید تریدهای موافی داشته باشید .

به امید موفقیت همه ایرانیان در بازارهای سرمایه.

ساسان امیری

پیوستها:

* لینک کتاب NewTrading Dimensions (همین کتاب حاضر) اثر بیل ویلیامز که در سال ۱۹۹۸ نوشته شده در سایت آمازون:

http://www.amazon.com/gp/product/0471295418/sr=8-3/qid=1155563744/ref=pd_bbs_3/002-1573504-4542415?ie=UTF8

* یک لینک فارسی برای دوستانی که مایلند در مورد تیوری Chaose منابعی برای مطالعه داشته باشند:

<http://forum.sarmaye.com/technical-analysis/1665-chaos-4.html>

* منابع دیگر:

کی-آس:

<http://en.wikipedia.org/wiki/Chaos>
http://en.wikipedia.org/wiki/Chaos_Theory

تیوری فرکتال:

http://en.wikipedia.org/wiki/Fractal_geometry
<http://velorum.ballarat.edu.au/~russell/fractals/>

* یک لینک دیگر جهت دریافت همین کتاب:

<http://www.box.net/public/svopfqcqcy>

* هر چند دوستان با اندیکاتور الیوت اسیلیتور در منابع الیوت آشنایی دارند اما کسانی که مایلند تنها بروی این روش متمرکز شوند و برای شناخت بیشتر در مورد اسیلیتور الیوت نیازی به منابع دیگر نداشته باشند این لینک میتواند مفید باشد:

http://www.tradingfives.com/articles/elliott_oscillator.htm

با تشکر از دوستان عزیزم ، ساسان امیری به خاطر معرفی این سیستم قدرتمند و علی عزیز (کارلوس) که در جمع آوری این مطلب من رو بسیار کمک کردند.

Behrouz fx