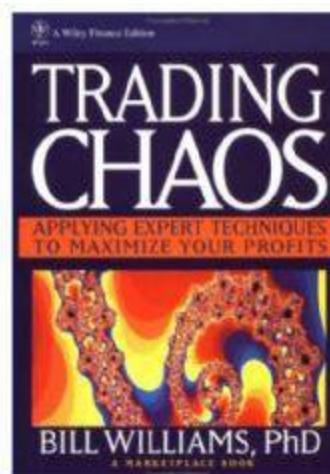




به نام خدا

ترجمہ کتاب تریدینگ کی اس نوشته بیل ویلیامز



به قلم تووانی : دانیال ارجمند
مطرح شده در سایت :
Fxtraders

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

فصل اول

مارکت مشکل شما نیست، مشکل شما اینست که مارکت را بعنوان مشکل می‌بینید. سود دهی مارکت توسط اندیکیتورها و روش‌های مختلف میسر نیست. چون از ابزار پارامتریک برای دنیای غیر پارامتریک (مارکت) استفاده می‌کند. ترید خوب از سر، سرجشمه نمی‌گیرد. بلکه از روده و قلب می‌آید. شما نیاز به بینش و حساسیت به نیازهایتان و نیاز مارکت و بنای محکمی از حس‌های معمول دارید. ترید موفق بر اساس دانش شما از ساختار زیربنائی مارکت و خودتان است. نحوه کارکرد مغزتان شما را برندہ یا بازندہ می‌کند. پند قدیمی می‌گوید: اول خودت را بشناس و سپس مارکت را. زمانی که من ترید را شروع کردم، بیش از \$6000 صرف کتابها و مجلات کردم. چون باور داشتم که اینها کار می‌کند. سپس من متوجه شدم نویسندهای این مجلات با توصیه‌های خودشان ترید نمی‌کنند. ترید مشکل نیست، و می‌تواند خیلی سود ده باشد. یاد بگیرید به خودتان منکی باشید. اگر از کسانی که موفق نبودند سوال کنید چرا ترید را کنار گذاشتند، جواب خواهد داد چون نتوانستند مارکت را پیشگوئی کنند.

هیچ کس نمی‌توان، اگر شما فکر می‌کنید که می‌توانید یاد بگیرید، خودتان را جزو ۹۰٪ افراد غیر موفق قرار می‌دهید. من در عرض ۳۵ سال ترید یاد گرفتم که آینده مثل گذشته نیست.

رمز موفقیت چیست؟

بutterin بلن‌های ترید معمولاً اشتباہ هستند. اکثر تریدرها هرگز این را کشف نمی‌کنند. تریدرهای ناموفق دنبال سیستمی هستند که مطمئن و قابل اعتماد باشد و به آنها بگوید چه بکنند. و هر چه کمتر می‌یابند بیشتر دنبالش می‌گردند. همه از تحلیل تکیکال و فاندامنتال استفاده می‌کنند، اما ما نه. چون تمام تحلیل‌های تکیکال بر اساس این منطق اشتباہ که آینده مثل گذشته است پایه‌ریزی شدند.

برخی حقایق غیر معمول: یک سناریو تبیک:

اکثر تریدرها شروع‌های متوالی دارند که به پایان شاد منتهی نمی‌شود. آنها مطمئن هستند که موفقیت درست در کنارشان هست.

شما به مارکت نگاه می‌کنید با این فکر که سریعاً پول زیادی بدست خواهید آورد بدون اینکه روی آن کار کنید. و این از گزارش‌های دوستان و بروکر و ... از سودهای کلان ناشی می‌شود و شما از ضرر هیچ نمی‌شنوید. بالاخره شما طاقت ندارید. تشننے این موفقیت هستید. ترید اول شما سود کمی می‌دهد. با ترید دوم فکر می‌کنید در عرض شش هفته پولتان دو برابر با حتی بیشتر می‌شود. و رؤای شما به زندگی‌تان وارد می‌شود و شاید با کانزاس تماس بگیرید برای کاتولوگ هواپیما.

ترید بعدی ضرر می‌کنید و تریدهای دیگر هم همینطور. از دوست‌تان سوال می‌کنید که چه شده. او می‌گوید که کسادی مختص‌الحصی است، کاهگاهی اتفاق می‌افتد. متأسفانه ضرر ادامه پیدا می‌کند و بالآخر شما شکست را قبول می‌کنید. دوست شما خبره است و موفق است.

حالا حتی اگر شما متحمل ضرر هم شده باشید، مزه موفقیت را هم چشیدید. شما می‌دانید سود کلان ممکن است اما آسان نیست.

سپس شما مجلات، گزارش‌ها را می‌خوانید و برنامه‌های فینانسیال تلویزیون را نگاه می‌کنید. تمام زندگی‌تان درباره ترید است حتی زمانی که به چیز دیگری فکر می‌کنید. شما از امکانات، بد را انتخاب کردید.

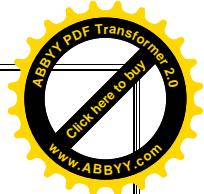
با انکا بخودتان ترید کنید و به دوست‌تان نگوئید و با دانستن این نکته که مطالب زیادی هست که باید یاد بگیرید. سپس برنامه سینیاریو بدست‌تان می‌رسد که تمام سوالات شما را پاسخ می‌دهد و از شما یک تریدر می‌سازد. و توصیه‌های زیادی برای ثبت نام دریافت می‌کنید. شما ثبت نام می‌کنید.

سخنرانان از سودهای خود برایتان می‌گویند و اینکه شما نیاز دارید در نشریات آنها ثبت نام کنید، خط فاکس آنها را بگیرید. اینها همه هزینه کمی برای شما دارد و سود زیادی برای شما دارد.

کار کردن با متخصص خوب است، کسانی مثل Futures magazine و The Wall Street Journal. این‌ها تریدرهای واقعی هستند. شما نشریات را می‌خرید و آنها می‌گویند این را بخر و آنرا بفروش، برخی را شما نمی‌فهمید. به هر حال نمی‌خواهید ضرر کنید و می‌خواهید در سود بمانید. اکثر تریدها خوب کار می‌کند و شما مطمئن به نشریات سینیار می‌شوید. سپس روز بزرگ فرا می‌رسد. خط فاکس فریاد می‌زند:

این است آن! یک فرصت بزرگ!

این آخرین شانس ما هست. این مثل خریدن طلا در \$35 یا Stock در \$800 است. بزغاله‌هایتان را بفروشید و مزمعه‌تان را گرو بگذارید. و هر چه دارید سرمایه‌گذاری کنید. شما دست‌پاچه هستید، اما شما باید سود کلان بکنید. تمام سرمایه‌تان را وارد مارکت می‌کنید و تا دیر نشده خرید می‌کنید، اما قیمت کاهش می‌یابد. با معلم تریدتان تماس می‌گیرید، او می‌گوید درست همان است که انتظارش را داشتیم، فرصت خوبی برای خرید است. قیمت همچنان پائین می‌آید. دپرس می‌شوید. فکر می‌کنید توصیه‌ها را اشتباہ فهمیدید، او متخصص است، او می‌داند چکار می‌کند. نشریات همچنان به اینکه چطور ثروتمند شوید ادامه می‌دهند. با خود فکر می‌کنید، احتمال دارد زود خرید کردم و نیاز دارم به توصیه‌های اساسی. شما نا آرامتر از آن هستید که در استراتژی بمانید.



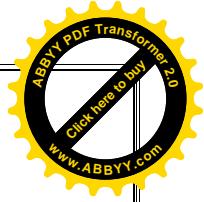
ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

بالا و پائین رفتن:

الان شما خیلی محتاط شدید، تنها مشکل شما این است که بطور مداوم سود نمی‌کنید. تصمیم می‌گیرید وارد Trading Pool شوید، جائی که بنظر می‌رسد ریسک کمتری دارد. یکی را که سایقه موفق دارد انتخاب می‌کنید. متاسفانه اقتصاد ضعیف می‌شود و Pool ضرر می‌دهد. این اولین سال ضرر در 10 سال گذشته است.

دیای ترید به دنیای شگفت‌انگیز فیوجر خوش آمدید. جائی که قابل پیش‌بینی نیست. وقتی که شما امیدتان را به توصیه‌ها، سیستم‌ها و ... از دست دادید، بالاخره شروع می‌کنید به کنترل ترید خودتان. و متوجه می‌شوید که کسی در مارکت ترید نمی‌کند، ما همه سیستم‌های اعتقدای شخصی خودمان را ترید می‌کنیم. ترید یک بازی سایکولوژیک است. استراتژی‌های اکنومیک، فاندامنتال، مکانیکال، یا تکنیکال اکنراً کار نمی‌کند. مارکت کامپیوتر نیست و توسط کامپیوتر فهمیده نمی‌شود. در کل، نیاز به استراتژی و تاکتیکی است که با آن خودمان و مارکت را بفهمیم. ما یاد گرفتیم که ساختار زیرینائی بازتابی از ساختار زیرینائی هر ترید است. همه تلاش‌ها، برای هماهنگ کردن ساختار زیرینائی خودمان که معمولاً قابل دیدن نیست با مارکت است. بطور خلاصه بگوییم، آنچه که مارکت می‌خواهد، تمام نایمیدی‌های ما می‌منشأ دارد، انتظارات ما برآورده نمی‌شوند. وقتی که خواسته ما خواسته مارکت است، و خودمان را با مارکت وفق دهیم. ما نایمید نمی‌شویم، با این روش استرس پائین است. و ما وارد ساختار سایکولوژیک No Risk و مفرح می‌شویم. اگر ترید مفرح نباشد، اشتباہ می‌کنیم و تنها معلم ما که مارکت است، همیشه به ما می‌گوید چه چیز اشتباہ است و خطای ما کجا است.

یافتن استعداد ترید خودتان در این کتاب من به شما نشان خواهم داد که چطور در این دنیای نامطمئن ترید، مطمئن سود کنید، بدون اضطراب، و بدون نیاز به پیش‌بینی‌ها، سیستم‌ها، نگاه کردن به FNN، یا خودن ژونال و الاستریت برای صحابه. من نمی‌توانم گارانتی کنم که با روش من سود کنید یا حتی از این ایده‌ها نتیجه بگیرید. من اعتقاد دارم که می‌توانم به شما کمک کنم که حداقل استفاده را از استعداداتان، بلندپروازی‌تان و علاقه‌تان به ترید ببرید. چون مارکت قابل پیش‌بینی نیست، ما باید از روشی برای ترید استفاده کنیم که نیازی به پیشگوئی نداشته باشد. مشخصه مارکت انرژی است. و انرژی همیشه مسیری را که مقاومت کمتری دارد طی می‌کند. تصور کنید رودخانه از کوه پائین می‌آید. آب در بستر رودخانه حرکت می‌کند چون مقاومت کمتر است. مسیر حرکت آب بستگی به بستر رودخانه دارد. اکثر روش‌های ترید سعی در تعیین مسیر حریان آب دارند بجای همراه شدن با بستر. ساختار زیرینائی مارکت فیوجر، فرکتال است. و با استفاده از علم بی‌نظمی (Chaos)، بهتر شناخته می‌شود. شما کتاب‌های پیشتری را می‌خوانید، مثل Wizards The New Market و Market Wizards. داستان‌های زیادی می‌گویند که تریدرهایی که ضرر می‌کنند، سیستم ترید ندارند. و از یک روش بروش دیگر می‌روند.



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

فصل دوم (درک مارکت)

درک مارکت
اگر شما در هر وضعیتی که هستید، آنچه را که دیگران می بینند، ببینید می توانید بگوئید شما نماینده فرهنگتان و قربانی آن هستید.

هدف: درک اینکه مارکت فوجر واقعًا چگونه کار می کند و چرا اکثریت تریدرها ضرر می کنند.
در هندوستان شاگردی بود که می خواست هدایت شود. او خانواده اش را ترک کرد تا معلم مناسب را برای راهنمائی اش پیدا کند. او در جایگاه یک معلم توقف کرد و از او روش هدایت شدن را سؤال کرد. معلم گفت، هدایت شدن واقعًا ساده است. تمام آنچه که نیاز دارید اینست که به خانه رفته، جلوی آنیه برای 30 دقیقه نشسته و از خودت بازهای و بارها پرس من کیست؟ شاگرد پاسخ داد آن نمی تواند اینقدر ساده باشد. معلم جواب داد او بله ساده است. اما اگر شما راه دیگری را می خواهید چندین معلم در این خیابان است. شاگرد تشکر کرده و براهیش ادامه می دهد. و به معلم دوم می رسد با همان سؤال. معلم جواب می دهد او، کاملاً مشکل است وقت زیادی می خواهد. باید به افرادی با این ذہنیت در آشرام (Ashram) بیرونی دی (Sava) انجام دهی. سوا پعنی عاری از نفس پرستی. بنابراین شما بدون مزد کار می کنید.

شاگرد هیجان زده شد. این معلم با ذهنیت شاگرد از هدایت شدن پیشتر سازگار بود. او همیشه شنیده بود که آن مشکل است. معلم به شاگرد گفت که تنها شغل باز در آشرام، تمیز کردن اسطبل کاوهای است. اگر شاگرد واقعًا برای هدایت شدن جدی است، معلم احاجیه می دهد که مدفع حیوانات را جمع کند و مسئول تمیز نگهداشت اسطبل کاوهای باشد. شاگرد قبول کرد و احسان اطمینان می کرد که باید در مسیر درست قرار گرفته باشد. بعد از 5 سال شاگرد در باره هدایت شدن بی تاب شد و نزد معلم آمد و گفت من 5 سال بدون شکایت و تأخیر کارم را انجام دادم، آیا فکر می کنید زمان آن رسیده که من هدایت شوم؟ معلم جواب داد، بله من اعتقاد دارم شما آماده هستید. به خانه بروید و هر شب در آنیه خودت را نگاه کرده و برای 30 دقیقه از خودت پرس من کیست. شاگرد شکفت زده گفت این را معلم دیگری 5 سال قبل به من گفت. معلم گفت او راست گفته، این داستان در مورد ترید نیز صادق است. سود کردن در ترید کاملاً ساده است. توجه کنید نگفتم آسان است. یک دنیا تقاضت بین مفهوم ساده و آسان است. نگاه کردن در آنیه بمدت 30 دقیقه کار ساده ای است، اما پرسیدن یک سؤال بازها و بازها و یافتن پاسخ آسان نیست. بعنوان سایکولوژیست اعتقاد دارم انسانها دو تمایل فطری دارند:

1. ما تمایل داریم که هر چیز را که می بینیم بیش از حد پیچیده اش کنیم.
 2. ما بدیهیات را نمی توانیم ببینیم.
- برای اکثر تریدرها مارکت یک حیوان وحشی خطرناک است. و منطق آنها چنین است که "آن را بگیر قبل از اینکه آن تو را بگیرد." آنها مارکت را بصورت دنیانی که اگر نخوری می خورنت می بینند.

ساده بودن تمام مارکتها هر بازار کالا توسط مردمی ایجاد می شود که توافق در قیمت و عدم توافق در ارزیش کالا دارند. بالانس مطلفی بین قدرت آنها که می خواهند بخوبی و بفروشنند وجود دارد. بازارهای کالا جانی است که خیلی سریع بالانس می شود. قبل از اینکه شما و من و تریدرها متوجه عدم بالانس شویم. اگر سناریوی بالا درست باشد، ما به این نتیجه گیری ساده و مهم می رسیم که ما اطلاعاتی که از طریق مارکت می رسد را بدون سؤال قبول می کنیم. اولین چیزی که باید از جعبه ابزارمان دور ببریزیم Bullish و Bearish است. اگر مارکت کارش را خوب انجام دهد پس چیزی تحت عنوان Bullish و Bearish را می تواند وجود داشته باشد. آنها که اطلاعات Bull - Bear را می فروشنند، آنها را از تریدرها بیست آوردن. برای مثال اگر 75٪ صعود گزارش کنند، این به این معنی است که تمام Bear ها را در نظر نگرفتند. مارکت قبل از افزایش قیمت نمی تواند حتی 50.01 درصد هم Bullish داشته باشد.

اگر Bullish و Bearish وجود ندارد، به این معناست که چیزی بعنوان خرید هیجانی و فروش هیجانی هم وجود ندارد. اجازه بدھید دو مفهوم متناقض را برسی کنیم:

1. خرید در کف و فروش در سقف
2. برای سود کردن در جهت ترند ترید کنید.

این دو جمله بطور مطلق غیرقابل انطباق است.

جاده خطرناک رسیدن به استقلال مادی تریدرهاست که به بروکرها، عنوانی روزنامه ها، ژورنال، Wall Street و منابع مشابه توجه نمی کنند خیلی موفق ترند. در ترید رسک وجود دارد، و مثل رانندگی می ماند. شما هر روز رانندگی می کنید و از خطر در امان می مانید. چون اگاهی و تجربه بدست آورید. اگر شما مارکت را بفهمید و تجربه داشته باشید، ترید خطرناک تر از رانندگی روز یک شنبه نیست.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

فصل سوم

تئوری Chaos: یک مدل تازه برای ترید قلب شما خیلی منظم کار می‌کند و اگرنه شما می‌میرید. اما مغز شما خیلی بی‌فائده است و اگرنه تشنج می‌کنید. این نشان می‌دهد که بی‌نظمی، Chaos منجر به سیستم پیچیده می‌شود. مغز انتخاب کرده که ناپایدار باشد.

هدف: فهم بهتر Chaos و هندسه فرکتال پارادیگم ریشه یونانی دارد و به معنی مدل یا پترن است. از پارادیگم ما دنیا را می‌فهمیم. آن مثل آب است برای ماهی. پارادیگم دنیا را به ما توضیح می‌دهد و کمک می‌کند رفتار را پیش‌کوئی کنیم. پارادیگم فیلتری است که از طریق آن دنیا را می‌بینیم. آن درک ما از واقعیت است. و چون واقعیت ما را تشکیل می‌دهد، ندرتاً به آن توجه می‌کنیم و سوال می‌کنیم. ما هرگز دنیا را مستقیماً نمی‌بینیم، ما همیشه از طریق فیلتر پارادیگم می‌بینیم. کل را نمی‌بینیم، فقط تکه‌هایی را می‌بینیم. همه اینها برای مارکت هم درست است. مارکت مثل غار است اگر فریاد بزنید "آنالیز تکیکال"، اکو بازگشتی بطرف شما "آنالیز تکیکال" خواهد بود. وقتی ما در وسط یک مدل هستیم، تصویر مدل‌های دیگر مشکل است. برای مثال تصور کنید سال 1968 Leader و شما Leader جهانی ساعت‌سازی را در سال 1980 پیش‌کوئی می‌کنید. شما می‌کوئید سوئیس. چون چندین سال است که در مارکت ساعت، از همه پیشی گرفته است. اما عوض شدن مدل از ساعت‌های مکانیکی به الکترونیک اتفاق می‌افتد. ژاپن مدل جدید را تشخیص داده و از اکثر بازارهای جهانی ساعت جلو می‌زند. سوئیس با ماندن در مدل قدیمی، سهم خودش را از بازار در سال 1968 که بیش از 90% بوده از دست داده و به زیر 10٪، طی سال 1980 رسید. با تغییر مدل تمام قوانین تغییر می‌کند. و با مدل اشتیاه حتی عمل‌های صحیح کار نمی‌کنند. مدل شخصی ما روشی که ما اطلاعات را تجزیه و تحلیل کرده و پاسخ می‌دهیم را کنترل می‌کند. احساس و نگاه شما به مارکت بعد از 10 بار متواتی ضرر با نگاهتان بعد از 10 بار سود متواتی خیلی متفاوت خواهد بود.

علم Chaos یک مدل تازه و خیلی مناسب‌تری از دنیا، مارکت، و رفتار شخصی خودمان می‌دهد.

CHAOS و دنیای شخصی ما انسان‌ها عادت داریم مفاهیم و ارزارهای خیلی مهم را اشتیاه نامگذاری کنیم. برای مثال ما ذهن (نیمکره چپ) را هوشیار می‌نامیم، در حالیکه آن تنها قسمتی از مغز ما است که ناهوشیار می‌شود یا می‌خوابد. قسمت دیگر مغز ما بطور مداوم کار می‌کند. مشابه‌ای فیزیک این علم جدید را Chaos نامید که اساساً اشتیاه است. Chaos به اتفاقی بودن اشتاره نمی‌کند، دقیقاً بر عکس آن درست است. درجه بالائی از نظم است. که اتفاقی بودن و Stimuli اصول تشکیل‌دهنده آن هستند تا علت و اثر در مدل نیوتن و افلاطیس. چون طبیعت و مغز انسان هر دو Chaotic هستند، پس مارکت نیز بعنوان قسمتی از طبیعت و انعکاسی از انسان Chaos است. منحنی توزیع نرمال، یکی از عمومی‌ترین علوم طبیعی است، و می‌توان بعنوان ابزار ترید در مارکت استفاده کرد. قیمت‌های بازار کالا بسادگی در مدل زنگ شکل (Bell Shape) قرار نمی‌گیرد. با وجود این شبیه به خط ساحل یا بستر رود است. هر تغییر قیمت اتفاقی و غیر قابل پیش‌بینی است. اما توالی تغییرها مستقل از مقیاس است: منحنی روزانه و ماهانه تغییرات قیمت کاملاً مطابق است. ما محصول chaos هستیم. حتی مغز ما، یک قسمت (نیمکره چپ) در جستجوی پایداری و قسمت دیگر (نیمکره راست) بدنبال Chaos است. ما (خودمان، بدن، شخصیت، و همه) نتیجه تداخل مدیرانه پایداری و Chaos هستیم. Chaos بستر تلاقی بین Yin / Yang / Sفید / سیاه، اینجا / آنجا، حالا / بعداً، یا ایجاد ما است. در مارکت، Chaos، متغیر در مقابل ترند است. در رفتار تریدر، یعنی سود بردن و ضرر کردن. یعنی خوابیدن و راه رفتن، یعنی کشت و برداشت.

مغز ما هم رفتار متفاوت بسته به جریان ارزی نشان می‌دهد. گاهی پایدار است، مثل جریان رود آرام، وقتی ترید می‌کنید، مغز اغلب آشفته است، مثل جریان رود متلاطم. بر طبق نقشه منطقی خطی معمول ما، حقیقت در پایداری است. به این معنی که دانش هرگز تغییر نمی‌کند. بنابراین سود کمی از استراتژی‌هایی که برای معاملات از Chaos استفاده می‌کنند عاید می‌شود.

در منطق غیر خطی موقت بودن پایداری، امری بدیهی است. و Chaos برای همیشه است. تحقیقات ما نشان داده که ذهن ما، در مارکت منعکس می‌شود. هر دو مخلوط استدانه‌ای از Chaos و پایداری است. Prigogine نوشتہ است: مخلوق Chaos است.

پایداری و chaos همچنین بصورت فعالیت خطی و غیر خطی تعریف می‌شود، فعالیت شامل رشد، تولید، و حتی فکر کردن است. اگر ما دنیا را از دید نیمکره چپ می‌ساختیم، رودهای مستقیم، ابرهای گرد، و کوههای مخروطی داشتیم. طبیعت از منبع غیر خطی سرچشمه می‌گیرد. فراورده‌های ساخت بشر مثل زیان، از نیمکره چپ ناشی می‌شود و بنابراین دیجیتال و خطی است. ما سیستم تریدمان را به همان روشی که زیان را ایجاد کردیم، ساختیم و درست همچنانکه زیان در شرح طبیعت موفق نیست، سیستم ترید خطی نیز در شرح و سود گرفتن از مارکت موفق نیست. بخارط داشته باشید Chaos ما را به اینجا رسانده و ما را به جائی که می‌خواهیم بروم، خواهد رساند.

هندسه فرکتال علم Chaos بطورقابل توجهی بیشتر از یک تکنیک تازه ترید است. آن یک راه جدید دیدن دنیایمان است. تئوری Chaos اولین روشی است که در مدل‌سازی اشکال پیچیده (زنده و غیر زنده) و جریان‌های متلاطم با متدولوژی حسابی موفق بوده است. هندسه فرکتال یکی از ارزارهای علم Chaos است که برای مطالعه پدیده‌هایی است که فقط از نظر هندسه افلاطیس و

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

حساب خطی بی نظم است. غیر خطی بودن زمانی مشخص می شود که قدرت نتیجه، چندین برابر قدرت علت است. از دنیای نیوتن و اقليدیس حساب خطی شامل آمار ایجاد شده که بصورت منحنی توزیع نرمال تعريف می شود. این فهم ما را از طریق دور ریختن اجزائی که ما فکر می کنیم غیر ضروری برای سیستم است، آسان می کند. کلمه کلیدی غیرضروری است. در دنیا واقعی این غیر ضروری های دور ریخته شده مشخصه اساسی این سیستمها هستند.

چرا اغلب هندسه بصورت سرد و خشک شرح شکل ابر، کوه، خط ساحلی و درخت نیست. طول خط ساحل را با هندسه اقلیدسی نمی توان اندازه گرفت. چون طول نامحدودی در یک فضای محدود دارد. برای اندازه گیری اجسام طبیعی که بی قاده هستند، از فرکتال یا عبارتی بهتر از بعد کسری (Fractional Dimension) استفاده می شود. بعده کسری، درجه ناهمواری یا نامنظمی سیستم را نشان می دهد. مندلبروت متوجه شد که بعد کسری یک جسم نامنظم با هر درجه ای از بزرگنمایی ثابت است. عبارتی نظمی در همه بی تظمی ها وجود دارد. زمانی که ما به پترن یکسان باشیم در چارچوب های زمانی مختلف تشکیل شود. چارت یک دقیقه حاوی همان پترن فرکتال است که چارت ماهانه دارد. این "Self - Similarity" که در چارت دیده می شود، نشان می دهد که عمل مارکت خیلی نزدیک به مدل رفتار نجراست تا رفتار اکونومیک، فاندامنتال، مکانیکال، یا تکنیکال.

مندلبروت همچنین متوجه شد که تشابه نزدیکی بین اعداد فرکتال، رود می سی سی بی و قیمت کتان در تمام طول مدت مطالعه که شامل جنگ های جهانی، سیل، خشکسالی و حواتد بد مشابه می شد وجود دارد. عمق این مشاهده که نمی تواند اغراق باشد. این به این معنی است که مارکت یک فونکسیون غیر خطی نچراست نه یک فونکسیون خطی فیزیک کلاسیک، و این توضیحی است برای دلیل شکست 90٪ تریدرهایی که از آنالیز تکنیکال برای ترید استفاده می کنند. آنالیز تکنیکال نه تنها براساس این فهم اشتباہ که آینده مثل گذشته است بنا شده، بلکه از تکنیک خطی غیر مناسب برای ترجیه یاد می گیرد که مارکت توسط مجموع فعلی های توربولانس ایجاد شده و یک پدیده غیر خطی است. هر ترید با کمی

فرکتال با استفاده از فرایندی به نام تکرار توسط کامپیوتر تولید شد. بهم پیوستگی یک تکرار غیر سیستماتیک است. اضافه کردن چیزهایی به چیزهای دیگر و این چیز بزرگتر را به چیزهای دیگر اضافه کردن است. ساده ترین مدل Iteration (تکرار) مجموع توالی ها است که اعداد فیبوناچی گفته می شود. توالی با صفر شروع می شود و اولین دو ترمی که اضافه می شود "یک" و "یک" است. یک را به صفر اضافه کنید جواب یک است. یک دوم را اضافه کنید جواب دو است. از این به بعد دو تا عدد آخر را با هم جمع کنید. دو و سه می شود پنج. پنج و سه می شود هشت. توالی به همین ترتیب ادامه پیدا می کند. خاصیت این تکرار این است که هر عدد دقیقاً ششصد و هجده هزارم، برابر عدد بعدی است. دنیا پر از رابطه های ششصد و هجده هزارم، می باشد. پترن های تخمیری گل ها اعداد فیبوناچی است. انقباض عضله قلب دقیقاً ششصد و هجده هزارم، برابر مدت استراحت است. یک مثال شخصی ناف انسان است که درست در ششصد و هجده هزارم، طول شخص قرار دارد.

هندسه فرکتال و مارکت فرکتال همانطوری که گفته شد به معنی بعده کسری است. تصور کنید شما به یک توب نخی 3 اینچی از فاصله 200 باردی نگاه می کنید. بصورت یک نقطه دیده می شود، که بعدی ندارد. وقتی نزدیک می شوید متوجه می شوید که توب نخی است و سه بعد دارد. وقتی خیلی نزدیک می شوید، می بینید از یک نخ دراز تشکیل شده که فقط یک بعده دارد. با استفاده از عدسی و نگاه دقیق تر می بینید که نخ سه بعدی است. بنابراین بسته به دیدتان، صفر بعدی، سه بعدی، یک و سیس سه بعدی می بینید. آنچه را که در مارکت می بینید کاملاً بستگی به دید یا مدل شما دارد. در حقیقت دید رایج شما مدل شماست. اگر شما دید خطی داشته باشید شما هرگز مارکت واقعی را نمی بینید. فرکتال همچنین بی نظمی را اندازه می گیرد. هرچه مارکت بی نظمتر و متناظمتر باشد، اعداد فرکتال بزرگتر خواهد بود. اعداد فرکتال قسمتی از حرکت، همیشه در نقطه برگشت حداقل خواهد بود. بنابراین تمام تغییرات ترنز مارکت همراه با اعداد فرکتال بزرگتر از Bars است که منجر به تغییر ترنز می شود. درخت فرکتال نقطه ای را که هندسه فرکتال تغییر را اندازه گیری می کند، نشان می دهد. هر شاخه شیدن درخت، هر انحراف در رود، هر تغییر جهت در مارکت یک نقطه تصمیم است. این نظریه، فاکتور قاطع کشف فرکتال موج الیوت است.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

فصل چهار

تعریف ساختار زمینه‌ای شما و اینکه این ساختار چطور بر سود و ضرر شما تاثیر می‌گذارد.

نتوری ذن از تغییر وجودی: من تغییر می‌کنم نه با سعی برای چیز دیگر شدن از آنچه که هستم، من تغییر می‌کنم با آگاه شدن کامل از آنچه که من هستم.

هدف:

فهمیدن انرژی مارکت، ساختار ساخت، و نوع ساختار زیربنایی همچنانکه گفته شد، chaos پراساس پدیده‌های طبیعی است. یکی از یافته‌های مندلبروت این است که بعد کسری (Fractal) رودخانه شبیه مارکت است. این نشان می‌دهد که مارکت بیشتر فونکسیونی از طبیعت است تا اینکه فرآیند طراحی شده توسط نیمکره چپ باشد.

اصول مطالعه انرژی مارکت 1. انرژی همیشه مسیری را که کمترین مقاومت را دارد طی می‌کند. مارکت شبیه رودخانه است. همچنانکه از هر دقیقه از ترید عبور می‌کند، کمترین مقاومت را انتخاب می‌کند. در مارکت، شما از تریدی که در ضرر است زمانی خارج می‌شوید که درد از دست دادن یک دلار بیشتر قویتر از درد گفتن این نکته باشد که شما اشتیاه ترید کردید. مسیر با مقاومت کمتر دوباره پیروز است.

2. مسیر با کمترین مقاومت همیشه با ساختار زمینه‌ای و معمولاً ناپیدا تعیین می‌شود. رفتار رود بستگی به ساختار زمینه‌ای بسته رود دارد. اگر بستر رود عمیق و پهن باشد، رود به آرامی پائین می‌اید. اگر بستر رود کم عمق و باریک باشد، رود سریع حرکت می‌کند. رفتار رود را می‌توان با بررسی دقیق بستر رود پیش‌بینی کرد. فرض کنید حالا می‌خواهید به حمام بروید. شما احتمالاً از یک یا چند اتفاق با در می‌گذرید. چرا بطور مستقیم از طریق دیوارها عبور نمی‌کنید؟ چون شما باید گرفتید که در آن صورت آسیب می‌بینید. در طی مسیر به حمام، شما احتمالاً از این مطلب اگاهی ندارید که رفتار شما را آرشینتکتی که مکان اتفاق‌ها و درها را طراحی کرده تعیین می‌کند. اتفاق‌ها، ساختار زمینه‌ای شما هستند.

به همین صورت ساختار زمینه‌ای زندگی شما روش تریدتان را مشخص می‌کند. صرفنظر از آگاه بودن یا نیوتن شما از این ساختار، آن رفتار واکنش شما را نسبت به حرکت مارکت تعیین می‌کند. (فصل 9). تریدهایی که بطور مرتب ضرر می‌دهند، بایستی ساختار زمینه‌ای شان را تغییر دهند. اگر شما فقط تغییرات سطحی ایجاد کنید، چیزی واقعاً تغییر نکرده است. تغییرات دائمی فقط زمانی ایجاد می‌شود که ساختار زمینه‌ای تغییر کند. فصل 6 تا 10 ساختار زمینه‌ای مارکت را ارزیابی می‌کند و به شما نشان می‌دهد چطور هر تغییر در این ساختار را تشخیص دهید. فصل 11 و 12 کمکتان می‌کند، ساختار شخصی خودتان را بشناسید. زمانی که ساختار شخصی شما با مارکت هم‌تراز باشد، شما در مسیر با کمترین مقاومت قرار دارید و بزنده‌اید. یعنوان یک ترید همیشه بدانید کی سعی می‌کنید برعلیه مسیر کم مقاومت باشید. تنش بلافضله در ذهن و بدن‌تان ایجاد می‌شود. اگر شما در باره ترید تنش داشته باشید، نمی‌توانید در مسیر رود شنا کنید. وقتی باد بگیرید که ساختار زمینه‌ای مارکت را تعیین کنید، با رفتار مارکت آرامش خواهید داشت و بسادگی مثل یک بروانه شناور شوید.

3. این ساختار زمینه‌ای و معمولاً ناپیدای همیشگی را می‌توان کشف و تغییر داد. اکثر تریدهای سعی می‌کنند مارکت را با استفاده از Bucket Bailing تغییر دهند. این کار غیر ممکن است. با وجود این با رفتار به بالا تا منبع رود، ممکن است با حرکت دادن چند صخره مسیر جریان آب را تغییر داد. گاهی تغییر جزئی در علت سبب تغییرات بزرگ در رفتار می‌شود. شما می‌توانید جریان زندگی و تریدتان را تغییر دهید. برای اینکه این تغییر بسادگی صورت گیرد و دائمی باشد، شما باید روی ساختار زمینه‌ای‌تان کار کنید، نه رفتاری که از این ساختار نتیجه شده. هر زمان که یک ساختار متفاوت و تازه را برای ترید بکار ببرید، کل نیروی ترید شما مثل جریان رود، جنبش را می‌سازد و کمک می‌کند که نتایج دلخواه‌تان را بدست آورید. مفاهیم اساسی که از این سه اصول نتیجه می‌شود عبارتند از: شما می‌توانید باد بگیرید که ساختاری که تریدتان را پیش می‌برد را تشخیص دهید و تغییر دهید. و آنچه را که واقعاً از مارکت می‌خواهید بدست بیاورید.

ساختار چیست؟

هر ساختار چهار جز دارد:

1. قسمت اصلی

2. طرح

3. منبع قدرت

4. هدف

تمام ساختارها حاوی حرکت و تمايل به سمت حرکت هستند. این، به این معنی است که آنها تمايل دارند تغییر حالت دهند. برخی ساختارها تمايل بیشتری به حرکت دارند. در یک ساختار ایستا اجزا تمايل دارند که از یکدیگر جلوگیری کنند. در یک ساختار کمتر ایستا اجزا تمايل دارند که حرکت آسان‌تر را اجازه می‌دهند. صندلی چرخدار تمايل بیشتری برای حرکت دارد تا



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

صلدی راحتی، و صندلی راحتی تمایل بیشتری به حرکت دارد تا یک ساختمن. در هر مورد ساختار زمینه‌ای تمایل به حرکت را تعیین می‌کند. این ساختار که معمولاً دیده نمی‌شود در همه جا زندگی ما وجود دارد و بویژه در هر تغییر واکنش ما به تغییر مارکت، قوی عمل می‌کند. فکر کردن به اجزا جداگانه، فهمیدن و سپس ارتباط دادن آنها به هم، "فهمیدن، ساختار است" شناسائی قالب یعنی برقراری ارتباط بین حوادث، ساختار رفتار را تعیین می‌کند. ساختار تعیین می‌کند که هر چیز چگونه رفتار کند. ساختار هر میدان مبارزه رفتار را در مبارزه تعیین می‌کند. ساختاری که بیشترین تأثیر را در نتایج ترید شما دارد، ترکیبی است از خواسته‌ها، باورها، فرضیات، آرزوها، و بیشتر از همه فهم شما از ساختار مارکت و خودتان.

مطالعه ساختار مستقل و کاملاً متفاوت از مطالعه سایکولوژی است. با وجود این یک رابطه قوی وجود دارد. برای بکار بردن درک ساختار و این اصول در ترید دو بینش لازم است:

بینش اول: اکثر ما تمایل داریم که طبیعت را ندیده بگیریم و بطور ساده آنرا بعنوان صحنه‌ای برای فعالیت‌های مهمترمان در نظر بگیریم، تریدرها بر طبق ساختار زمینه‌ای عمل می‌کنند که کل زندگی آنها برآن اساس است. "زمان معلم بزرگی است، اما متأسفانه تمام شاگردانش را می‌کشد".

بینش دوم: برخی ساختارها تایج بیشتر و متفاوت‌تری ایجاد می‌کنند. ساختار قادر شخصیت هست. برخی ساختارها منجر به درد می‌شود، صرفنظر از اینکه چه کسی در این ساختار است، اکثر تریدرها کوشش می‌کنند که رفتارشان را تغییر دهند بجای اینکه ساختار زندگی‌شان را تغییر دهند. "شما نمی‌توانید ساختار را گول بزنید". برخی ساختارها سرنوشت نهائی را تعیین می‌کنند و برخی دیگر بسادگی نوسان می‌کنند.

ساختار نوع اول ایجاد رفتار عمل ۱ عکس العمل، عقب و جلو، ۸ شکل می‌کند. یک رفتار دلخواه باعث یک رفتار غیر دلخواه منضاد می‌شود. یک مثال ساده پاندول است. اکثر تریدرها در ساختار نوع اول گیر افتاده و ترید می‌کنند. برای استاتاپ کم دارد در ترید هستید و می‌خواهید محافظه کارانه با استاتاپ کم عمل کنید. به خودتان می‌گویند که نیاز به یک استاتاپ کم دارد بنابراین اگر ترید شما اشتباه باشد، خیلی ضرر نمی‌کنید. مارکت ترتیب نرمال دارد که استاتاپ، شما را از ترید خارج می‌کند و سپس در جهت ترید شما حرکت می‌کند. شما ضرر را آنالیز می‌کنید و به این نتیجه می‌رسید که استاتاپ را بطور غیر معمول دورتر از نقطه ورود بوده. شما باید به مارکت منطقه‌ای را برای حرکت در نظر بگیرید، در ترید بعدی استاتاپ را بطور غیر معمول دورتر از نقطه ورود آنالیزان تصمیم می‌گیرید که استاتاپ کم بگذارد.

اکثربت تریدرهای متضرر در این استراتژی عقب و جلو گیر افتاده‌اند. ساختار نوع اول ما را مردد می‌کند و درست مثل پاندول عمل می‌کنیم. هر زمانی که شما نتایج یکسان را بازها و بازها بدست آورید، شما در این ساختار گیر افتاده‌اید. اگر شما سیگار را ترک کردید و هنوز می‌خواهید، اگر نوشیدن را ترک کردید و هنوز می‌خواهید، یا می‌خواهید سود کنید و ضرر می‌کنید، شما در ساختار نوع اول هستید.

ساختار نوع دوم به نظام ذاتی چیزها توجه کنید. بجای مقابله، با آن کار کنید. سعی برای تغییر آنچه که هست، فقط باعث مقاومت می‌شود. اساس ساختار نوع اول در نیمکره چپ مغز است. ساختار نوع دوم در قسمت خلاق مغز قرار دارد. ساختار نوع اول کوشش می‌کند مسئله (جلوگیری از ضرر) را حل کند. اما ساختار نوع دوم امکانات تازه‌ای را فراهم می‌کند. بجای حل مسئله، نتایج را بوجود می‌آورد. وقتی شما در حل مسئله موفق هستید، به این معنی است که مسئله‌ای ندارید. و هنوز ممکن است به نتیجه دلخواه‌تان (سود کردن بطور مداوم) ترسیده باشید. کلید کار اینجا است. در روش حل مشکل، مسیر با کمترین مقاومت باعث حرکت از بد به بهتر و دویاره به بد است.

بزرگرین و مهمترین مسائل زندگی اساساً غیر قابل حل است. اما فقط فرع هستند مثل گوشت اضافه. اینها را نمی‌شود حل کرد اما در مواجهه با یک انگیزه زندگی تازه و قویتر، کمرنگتر می‌شوند. ساختار نوع دوم، دنیاگی دیگری است که همه‌چیز بطور اتوماتیک برای رسیدن به اهدافتان کار می‌کند

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

فصل پنجم

ماہیت مارکت: نیار برای نقشہ خوب
هدف: مطالعه مراحل کلی از مبتدی تا پیشرفته و بکار بردن آنها برای تریدر موفق شدن.

راہ سود بردن: یکی از مشکلات یادگیری ترید این است که توالی منظمی وجود ندارد که ترید مبتدی را از نادانی به دانش و از ضرر به سود پایدار برساند. برنامه هایی که در حال حاضر در دسترس هستند، الفای ترید را یاد می دهند و شامل ایندیکاتورها هستند. هیچ کدام از اینها تریدرهای پایدار خوب ایجاد نمی کند. با وجود این یک برنامه 5 مرحله ای از مبتدی تا پیشرفته وجود دارد. برای نواختن پیانو، عالم نتها را یاد می گیرید. و برای ترید، خواندن زبان مارکت را یاد می گیرید.

سطح مبتدی

هدف: ضرر نکردن در حالیکه تجربه کسب می کنید.

ابزار: windows and air bag OHLC,volum, (market facilitation index) MFI, profitunity

در علوم مشخصه اینکه هر چیزی در این دنیا مجزا از هم بوده و قابل شمارش و طبقه بندی است. در این سطح، زبان مارکت مغز است. و بالاخره اینکه هر چیزی در این دنیا مجزا از هم بوده و قابل شمارش و طبقه بندی است. ما مارکت کندل به کندل نگاه می کیم. ما فقط روی دو کندل آخر تمرکز می کیم. دید اول ما فهمیدن رفتار مارکت است. ما یاد می گیریم چطور تعیین کنیم که چه کسی مارکت را بیش می برد. و یاد می گیریم ترند را تشخیص دهیم. اکثر تریدرهای مبتدی بدنیال سیستم مکانیکی هستند که آنها را نروتمند کنند. اگر شما بفهمید که واقعاً مارکت چگونه کار می کند، می فهمید که مارکت برای تحریب هر سیستم مکانیکال موفق کار می کند. تمام سیستم های مکانیکی می میرند. آنها ایزارهای خطی هستند و نمی توانند بطور دقیق و کافی مارکت غیر خطی را شرح دهند. نقشه ای که مبتدی ها استفاده می کنند عموماً قیمت ها را مقایسه می کند. و چون قیمت اثر است نه علت، پس این ابزار محکوم به شکست است. برای مدتی سیگنال خوب ایجاد می کنند، اما سود دهی پایدار ندارند. اینها ایزارهای خطی هستند و نمی توانند بطور دقیق مارکت غیر خطی را توصیف کنند. اکثر مبتدی ها مقدار زیادی انرژی صرف می کنند و متعاقب این شادی معمولاً افسردگی است.

ترید واقعاً یک شغل حقه بازی است نسبت به آنچه که بیش بینی می کردم. هر زمان که یک قدم جلو می گذارید، به نظر می رسد ان یک قدم عقب می گذارد. به همین علت اکثر تریدرهای مبتدی، ترید را ترک می کنند. همچنانکه شما مطالعه میکروسکوپی (دیدن فقط دو کندل مجاور) رفتار مارکت را ادame می دهید، به این واقعیت می رسید که مارکت چگونه کار می کند. و به این نتیجه می رسید که مارکت محصول طبیعت است نه اکونومی، فاندامنتال، و یا تکنیکال. مثل مهارت در دوچرخه سواری است تا بقدر کافی زمین نخوردید، اصول بالانس داخلی را یاد نمی گیرید. در سطح مبتدی شما بالانس مارکت را یاد می گیرید.

سطح دو: مبتدی پیشرفته

هدف: بدست آوردن بول بطرور مداوم براساس یک قرارداد.

موج الیوت و فرکتال

در مارکت مثالهای نقشه های سطح 2، فرکتال و موج الیوت است. از مقایسه دو کندل مجاور هم به دید وسیع تر 140 کندل یا بیشتر رسیدیم.

در این نقطه تمام تریدرها به یک وضع بفرنگ می رسند. آیا انگیزه ترید بقدر کافی قوی است تا بر نامیدی موقتی تجربیات یادگیری مارکت غلبه کند؟ درست مثل جاذیه که باعث افتادن از دوچرخه شده و کمک می کند بالانس را یاد بگیرید، با ضرر در مارکت در باره خودتان و نقطه بالانس مارکت یاد می گیرید. فرکتال و موج الیوت ساختار زمینه ای مارکت را نشان می دهند. موج الیوت کتاب راهنمای حرکت رو به بالا و پائین مارکت است. ترید مثل شروع ساختن یک چیز تازه است. اولین چیزی که شما می خواهید تولید یک محصول با کیفیت است. اگر شما تولید را افزایش دهید قبل از اینکه کیفیت داشته باشید، مشتری های خود را از دست می دهید. زمان افزایش تولید فقط بعد از داشتن کیفیت است. در مارکت کیفیت سود کردن بطور مداوم براساس یک روش است. مبتدی های پیشرفته به این سوددهی رسیدند. حرکت بعدی به سطح بالاتر رسیدن است، جائی که براساس چند اصول ترید می کنند. و مهارت های یادگرفته شده در سطح 1 و 2 اتوماتیک می شود. در این سطح، تریدر به افزایش سود از طریق سرمایه گذاری (ROI) تمرکز می کند بجائی سود بردن به ازای هر معامله.

سطح 3: ترید شایسته

هدف: به حداقل رساندن ROI کل توسط ترید با سرمایه متعدد, Spread, و نوشتن فرصت ها

ابزار: Trading Profitunity Trading Partner And Profitunity Planned

در این سطح دانشجوی پیانو دقیقاً نت نوشته شده را می رند. در ترید ماهر شدن به معنی افزایش ROI کل است. شما متن مارکت را دقیقاً می خوانید. وقتی مارکت می گوید خرید، خرید می کنید؛ وقتی فروش گفت، فروش می کنید؛ وقتی گفت ترید نکن، نمی کنید. شما بخور نمیر زندگی می کنید. به عبارتی شما از ایزاری که برایتان سود ایجاد می کند استفاده نمی کنید. سطح سه دنیای دیگر را به روی شما باز می کند. مشخصه این در تاریخ، انقلاب صنعتی است، وقتی که فرصت های شغلی



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

جدیدی بخاطر درک جدیدی از تولید و اکونومی باز شد. در ریاضیات این سطح با جبر که حل مسائل با مقادیر نامعلوم را امکان پذیر می‌سازد، مشخص می‌شود. این ابتدای شروع فهم Chaos است. سطح سه آنچه را که اکثر مردم "علت" می‌نامند بجای اثر، مونیتور می‌کند.

ابزار ترید در این سطح شامل طرح ترید سودده که حداقل انعطاف و سود را با بررسی ساختار زمینه‌ای و ناپیدایی مارکت بدست می‌دهد، می‌باشد. در این سطح وارد ریتم شده و رقص را شروع می‌کنید با آهنگی که مارکت بطور رایج می‌نوازد. همچنین این امکان را می‌دهد که بفهمیم آیا آنلاین اشتباہ یا دور از دسترس است. اگر اشتباہ است، استراتژی مناسب توقف و برگشت است. اگر دور از دسترس است، بهترین استراتژی خارج شدن است.

هدف ترید طرح ریزی شده بر سود، به حداقل رساندن سود برای یک حرکت ویژه و اجازه دادن به مارکت (بجای سیستم قراردادی) برای تعیین استراتژی مناسب می‌باشد.

ابزار اولیه دیگر در این سطح Profitunity Trading Partner است. هدف از این ابزار در نظر گرفتن اولویتها و اضافه کردن مناسب‌ترین اندازه‌گیری‌ها برای محافظت از معامله ترید است. مهارت در استفاده از این ابزار امکان آنالیز کامل را در هر چارت امکان‌پذیر می‌سازد و در 10 تابیه یا کمتر می‌دانید در هر کنسل چه باید بکنید: خرید، فروش، اضافه کنید، توقف، و برگشت یا خارج شوید. در سطح سه، شما یاد می‌کنید قادر شوید ارزیابی درست و فوری از هر مارکت داشته باشید. ساعات زیادی برای آنلاین مارکت صرف نمی‌کنید. در این سطح همینشه از ساختار زمینه‌ای مارکت آگاهی دارید. علت فروش کاسته‌های موسیقی و ایجاد سود این است که خواننده دقیقاً آنچه را که نوشته شده نمی‌خواند، او احساسش را اضافه می‌کند. بزرگترین جهش در کل پنج مرحله پیشرفت از مبتدی تا پیشرفته بین سطح سه و چهار است. در سطح چهار درک مستقیم یادگرفته شده و یا احساس باطنی در باره مارکت دارید که معمولاً خیلی دقیق است. شما ساختار خودتان را دستکاری می‌کنید تا با ساختار مارکت هماهنگ باشد. در سطح چهار سود کردن، مسیر با حداقل مقاومت می‌شود.

**سطح چهار: تریدر ماهر
هدف: ترید با سیستم اعتقادی خودتان**

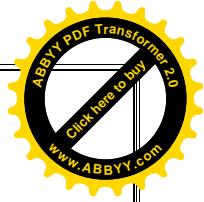
ابزار: نیمکره چپ، مرکز (Core)، نیمکره راست (سیم‌کشی مغز)

در این سطح موسیقیدان قادر به ارتباط احساس با زبان موسیقی است. احساس از طریق انگشتان نوازنده به کلیدهای پیانو، که امواج صدا را ایجاد می‌کند ترجمه می‌شود و هیجانات شنونده را بر می‌انگیرد. در ترید، شما سیستم اعتقادی خودتان را ترید می‌کنید (ساختار شما با ساختار مارکت در یک ریف قرار می‌گیرد) و لذت شما نه تنها از سود، بلکه از رضایت احساسی شما از همگام بودن با مارکت ایجاد می‌شود. در این سطح به این واقعیت می‌رسید که هیچ‌کس مارکت را ترید نمی‌کند و هر کس سیستم اعتقادی فردی خود را ترید می‌کند. در این سطح یاد می‌گیریم و کارمی‌کنیم با بدن شخصی و ساختار مغزی خودمان.

**سطح پنج: تریدر کارشناس
هدف: ترید کردن حالات ذهنی**

ابزار: حالات متفاوت ذهنتان (نرم‌افزار بیولوژیکی)

در این نقطه ما به این درک میرسیم که تا حالا فقط در رویا بودیم. در سطح پنج، هر چیزی اساساً اطلاعات است. و هدف ما در هماهنگی با این اطلاعات پیدا کردن اینکه ما کیستیم، می‌باشد. در این سطح ترید "بازی" است، هر چیزی مهم و تعلیم دهنده است. ما خودمان و مارکت را می‌فهمیم و این فهم باعث کنترل پیشتری از هردو می‌شود. در سطح پنج، ما عمیقاً وارد دنیای Chaos می‌شویم. در ورزش Zone نامیده می‌شود. درجه بالائی از نظم است، اتفاقی بودن وجود ندارد. آنچه که ما در سطح یک تا سه اتفاقی بودن می‌نامیم، ناشی از عدم آگاهی و فهم ماست. برای دسترسی سریع به هر سطح، به طریق زیر جدول‌بندی می‌شود.



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

Level	Objective	Tools
1. Novice	To not lose money while gaining experience	OHLC, volume, MFI, Profitunity windows and air bag
2. Advanced beginner	To make money consistently on a one-contract basis	Elliott wave and fractals
3. Competent	To maximize the total ROI	Profitunity Trading Partner and Profitunity Planned Trading
4. Proficient	To trade your own belief systems	Left hemisphere, core, right hemisphere (brain wiring)
5. Expert	To trade your states of mind	Your own various states of mind (biological software)

فصل ششم

سطح یک: تریدر مبتدی راه طبیعت ساده و آسان است، اما انسان ترجیح می‌دهد پیچیده و مصنوعی کند. «Tzu Lao»

هدف: شروع خواندن خود مارکت، بجای خواندن نظر مردم در باره مارکت در این فصل، ما به فاندامنال نگاه می‌کنیم که برای شروع فهم مارکت و ترید ضروری است. بهترین راه اینست که هر نکته و هر تفصیل را بعنوان تجربه یادگیری در نظر بگیریم. همچنانکه گفته شد، هیجان زیادی در شروع ماجراها تاره وجود دارد. ما انرژی زا (Germination Energy) می‌نامیم، ماجراها مارکت شما متفاوت از دیگران خواهد بود. من در سمبیارهایم می‌گویم که ترید کردن عادی‌ترین سایکوتراپی در دنیا است. ترید کالا نه تنها پول به حساباتان می‌آورد، بلکه هیجان، سرگرمی، و درک را به زندگی‌تان می‌آورد.

تریدرهای مبتدی وقتی وارد پوزیشن می‌شوند بطور تیپیک اطلاعات بیشتری از آنچه که در دسترس دارند، می‌خواهند. اگر شما تمام اندیکاتورها و اطلاعات دنیا را در اختیار داشته باشید، بطور مطلق 100 درصد دمدمی (Ambivalent) هستید. خصوصیات مارکت بطور برابر تقسیم می‌شود بین فشار خرید و فشار فروش. بنابراین اطلاعات بیشتر پاسخ نیست. پاسخ اطلاعات درست بشکل صحیح است.

در این فصل شما یاد خواهید گرفت چه کسی این نمایش را که مارکت نامیده می‌شود پیش می‌برد. چه کسانی سود می‌برند و مهمنت اینکه آنها چه می‌کنند. همچنین یاد خواهید گرفت که چطور تعیین کنند، راهی را که مارکت می‌رود. اولین چیزی که ما باید دور بریزیم برای ترید سودده، این عقیده است که ما می‌توانیم بر مارکت تأثیر بگذاریم. تنها انتخاب ما دنبال کردن است و ما می‌خواهیم مطمئن شویم که بیش برندۀ‌های مارکت را دنبال می‌کیم. وقتی من می‌گویم شما یاد خواهید گرفت چه کسی مارکت را پیش می‌برد، به تریدرهایی اشاره دارم که بزرگترین معامله را دارند. دانستن نام آنها مهم نیست، اما دانستن اینکه آنها چه کار می‌کنند، خرید و فروش در حجم‌های زیاد اهمیت زیاد دارد و فهمیدن انتخاب‌ها و عملکردشان، آنطور که اکثر تریدرهای فکر می‌کنند مشکل نیست.

اجازه بدھید با واحد اصلی ترید شروع کنیم، یک کندل در چارت. اطلاعاتی که مارکت به ما می‌دهد، OHLC ، حجم معاملات، و زمان است. کلید فهمیدن رابطه بین قیمت بار و بسته شدن در مقایسه با قیمت H و L است.

Open قیمت باز شدن به ما می‌گوید نقطه بالا نسیان خرید ارها و فروشندہ‌ها در نقطه باز شدن پریود است علی‌رغم تایم فریم مورد استفاده.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

High به ما می‌گوید بالاترین نقطه‌ای که Bull قیمت را بالا می‌برد. Bull می‌خواهد که قیمت بالاتر از قله کندل حرکت کند و سود بیشتری را ایجاد کند. همیشه نقطه مقابله بالانس وجود دارد که Bull از جریان خارج می‌شود و یا آنقدر قوی می‌شود که پیشرفت را متوقف می‌کند. این خواسته فروشنده‌ها است چون با هر تیک افزایش مارکت ضرر می‌کند.

Low به ما می‌گوید قیمت دقیقی که فروشنده‌ها خارج می‌شوند و خریداران حرکت رو به پائین را پس می‌گیرند. Close به ما می‌گوید تمام نقاط بالانس اساسی در انتهای پریود کجا قرار دارد. اگر تایم فریم درازمدت باشد (روز، هفته، ماه)، قیمت بسته شدن همچنین به ما می‌گوید جائی که جمعیت تریدکننده‌ها به بالانس می‌رسند و قیمت را ترک می‌کند.

چهار قیمت فوق به ما اطلاعات حیاتی زیادی می‌دهند، اما مهمتر حرکت نقطه بالانس است. من پی بردم که راحتترین، ساده‌ترین، و پرسودترین روش تقسیم کندل به سه قسمت مساوی است. سپس ما یک روش ساده می‌خواهیم تا آنچه را که در یک پریود زمانی مشخص اتفاق می‌افتد، تعیین کند. بطور قراردادی عدد اول برای قیمت بازشدن و عدد دوم برای قیمت بسته شدن در نظر می‌گیریم. این اعداد بسته به اینکه قیمت باز و بسته شدن در کدام قسمت از کندل اتفاق می‌افتد، تعیین می‌شود. برای مثال اگر قیمت باز شدن و بسته شدن در یک‌سوم فوکانی کندل باشد، کندل 1 - 1 گفته می‌شود. اگر هردو در یک‌سوم تختانی باشد، کندل 3 - 3 گفته می‌شود. هرجا شما 1 - 1 یا 3 - 3 دیدید، در %85 موارد جهت مارکت در 1 تا 5 کندل بعدی عوض خواهد شد. این دانش به تنهائی نتیجه تریدتان را می‌تواند تغییر دهد. این بینهایت برای ترید اینترادی (Intraday) مفید است.

از نظر سایکلوزی دو کندل 1 - 1 و 3 - 3 رفتار نوع (نژدیک شدن - دور شدن) است. آنها باز می‌شوند، در یک جهت حرکت می‌کنند و دوباره به نژدیکی جانی که شروع کرده بود برمی‌گردند. نتیجه جرکت کمتر جهت‌دار است. همچنین اطلاعات با ارزشتری را می‌توان از این کندل بدست آورد. دقیقاً می‌گوید چه کسی سود می‌برد و در طی قسمت‌های مختلف این پریود زمانی چکار می‌کنند. برای مثال در کندل 1 - 1 در قسمت اول فروشنده‌ها در سود هستند و در طی قسمت پدیده خریدارها در سود هستند. ما همچنین می‌دانیم که در انتهای پریود چه کسی سود می‌کند. خریدارها سود می‌کنند. چرا؟ چون کندل در یک‌سوم انتهائی بسته شد. بر عکس اینها برای کندل 3 - 3 صحیح است.

کندل 2 - 2 برخلاف کندهای قبلی به ما نمی‌گوید چه کسی در زمان بسته شدن کندل در سود است. این کندل اطلاعات کمی می‌دهد و ما آن را خنثی می‌نامیم، که اصطلاحاً Spinning Top یا دوجی نامیده می‌شود. این کندل نشان می‌دهد که نه خریدارها و نه فروشنده‌ها در این پریود کنترل ندارند.

کندل صعودی بصورت 1 - 3، 1 - 2 و 2 - 3 دیده می‌شود. شکل 5 - 6. کندل 1 - 3 بیشترین اطلاعات را به ما می‌دهد. آن به ما می‌گوید که خریدارها در کل پریود کنترل دارند. و این می‌تواند روز ترندزدار باشد. کندل 2 - 3 حداقل اطلاعات را می‌دهد، خریدارها توanstند قیمت را بیشتر از باز شدن بینندن، اما فروشنده‌ها قیمت را به زیر قیمت حداکثر رسانند. و ما نمی‌توانیم مطمئن باشیم در پایان پریود چه کسی سود برده است.

کندل نزولی بصورت 2 - 1، 3 - 2 و 3 - 1 دیده می‌شود. شکل 6 - 6. بیشترین اطلاعات را کندل 3 - 1 می‌دهد که فروشنده‌ها در سراسر پریود در سود هستند. کندل 3 - 2 اطلاعات کمتری می‌دهد و فروشنده‌ها در سود هستند. کندل 2 - 1 حداقل اطلاعات را می‌دهد و ما نمی‌دانیم در پایان پریود خریدارها یا فروشنده‌ها در سود هستند.

نقطه مهمی که از این بررسی‌ها درک می‌شود این است که هر کندل بطور واضح عکس العمل خریدارها و فروشنده‌ها را که باعث حرکت نقطه بالانس در طی پریود می‌شود نشان می‌دهد.

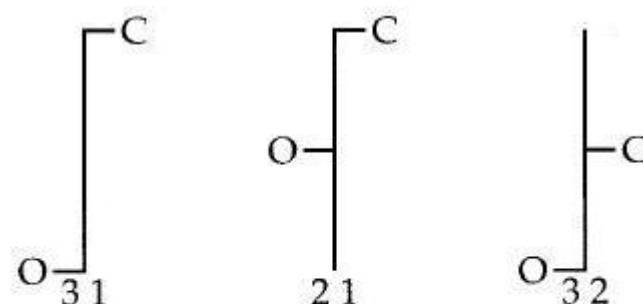


Figure 6-5 Climbers: 3-1, 2-1, and 3-2.

حرکت درازمدت

ما نیاز به اطلاعات ثانوی داریم تا ارزیابی ما را از عمل مارکت محدود بکند: ترند فوری کدام است؟ از فوری منظور من مقایسه کندل قبلی در همان پریود است. برای مثال در پریود پنج دقیقه، ما در کل ده دقیقه صحبت می‌کنیم. اگر نقطه وسط کندل فعلی بالای قله کندل قبلی باشد، ترند صعودی است و با علامت مثبت (+) نشان می‌دهیم. اگر نقطه وسط داخل کندل قبلی باشد، "0" نشان می‌دهیم و همچنانی می‌نامیم بدون ترند واضح. و اگر نقطه وسط زیر کندل قبلی باشد، ما با (-) نشان

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

داده و نماینده ترند نزولی است. شکل 7 - 6. حالا ما می دانیم چه کسانی سود می کنند و چکار می کنند. و حالا با دانستن اینکه ترند فوری جی است، ترند طولانی تر را بفهمیم.

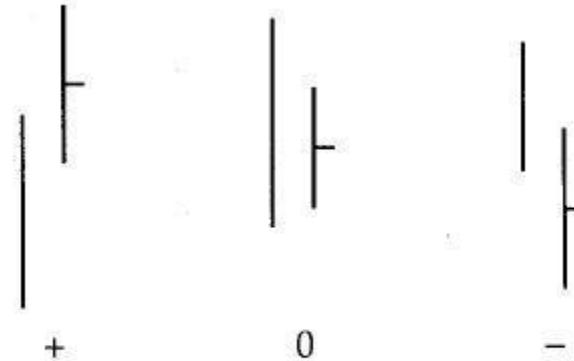


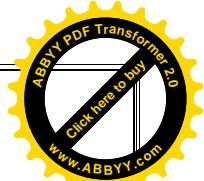
Figure 6-7 Determining the immediate trend.

ترند آن است که در ابتدای شروع ترند صعودی خرد کنید. برای این منظور لازم است به چگونگی تشکیل ترند نگاه کنیم، در واقعیت ترند در خارج از فلور (Floor) تشکیل می شود بجای اینکه مثل گذشته در فلور تشکیل شود. کلید حجم است. تنها اطلاعات ما از مارکت Volum Tick، زمان، و قیمت است. حجم تیک، تعداد دفعات تغییر قیمت در یک پریود مشخص است. آن تعداد سرمایه‌ای که ترید می شود نیست. مطالعات نشان داده که تفاوت عمدہ‌ای بین رابطه حجم واقعی و حجم تیک وجود ندارد. ما از حجم تیک استفاده می کنیم و می توانیم فرض کنیم که آن نماینده حجم واقعی است.

در این مبارزه دو ویژگی اساسی وجود دارند: بروکرهای فلور و لوکال. بروکرهای فلور نسانی هستند که سفارشات را می پذیرند. آنها حقوق، کمیسیون و یا ترکیبی از این دو را می گیرند، که عموماً آنها پول خود را وارد مارکت نکرند. بروکرهای لوکال پا پول خوشان ترید می کنند. اگر آنها قیمت خوب بدست نیاورند، پول خود را از دست می دهند. بنابراین بروکرهای لوکال باید ترید بهتری از فلور باشند. لوکالها باید خودشان تصمیم بگیرند ولی فلورها تصمیمات دیگران را دنبال می کنند. کار لوکالها ساختن مارکت با گرفتن طرف دیگر ترید است. آنها عمولًا با پوزیشن‌های درازمدت میانه‌ای ندارند. ما در آموزش خصوصی خودمان چندین لوکال داریم که برای بعضی از آنها 10 دقیقه درازمدت است. بخارت داشته باشید که ترند در نتیجه عمل فلورها است تا لوکالها. چون وظیفه اصلی لوکالها گرفتن سمت دیگر بیرون از اینها است، آنها هیچ Future در ترید با یکدیگر ندارند. آنها بعد از پول شما هستند. دوباره کلید ما به فهم عمل در میازه (Pit) حجم تیک است. لوکالها مقادیر مهمی از ترید را با دیگر لوکالها ندارند و ترند با Outside Paper تشکیل می شود. بنابراین ما باید بدانیم که کی و به چه مقدار Outside Paper به فلور می آید. این توسط تغییر در حجم تیک مشخص می شود. اگر حجم کندل فعلی بیشتر از کندل قبلی باشد، یعنی اوردرهای بیشتری از بیرون به فلور می آمد. قبیل از اینکه ترند شروع شود، باید حجم زیادی به فلور بیاید. همیشه افزایش در حجم مقدمبر افزایش در مومنتوم، و تغییر مومنتوم قبل از تغییر ترند است. قبیل از اینکه هر کدام از اینها شروع شود، صدها با حتی هزاران تصمیم باید توسط تریدرهای بیرون گرفته شود، کسانی که فکرشان را در برابر مارکت تغییر می دهند. اولین تغییرات، تصمیم‌هایی هستند که در ذهن تریدرهای خارج از فلور است. سپس تصمیم آنها در تغییر در حجم تیک منعکس می شود. بعدها آن تغییر در مومنتوم و نهایتاً ترند ایجاد می شود. هدف ما گرفتن در اولین 10% هر تغییر در ترند، و خارج شدن در 10% آخر ترند است. اگر شما بتوانید اینکار را بکنید شما ثروتمند می شوید. دوباره برای تأکید، اولین کلید تغییر در حجم تیک است.

قانون پرکنیکال در ترید داخل روز به این صورت است: تفاوت یک تیک کافی است. اگر ما با چارت روزانه ترید می کنیم، + 10 درصد تفاوت مهمی در حجم است. در چارت روزانه، ما باید 110% حجم روز قبل را (+)، حجم 90% یا کمتر (-) و بین 91 و 90% را حجم برابر در نظر بگیریم. تنها زبانی که مارکت صحبت می کند عبارت است از تیک، حجم، و زمان.

اینکس تسهیل کننده مارکت زمانی که حجم تیک بالا رفت ما Outside Paper بیشتری داریم و زمانی که پائین می آید، ما می دانیم که Paper Outside بازیابی دقيق اثرات این تغییر در حجم بر مارکت است. دانستن اینکه چقدر تغییر کرده کافی نیست، بلکه بیشتر مهم است که بدانیم چطور مارکت به تغییرات حجم واکنش می دهد. حجم سنگین‌تر همیشه به این معنی نیست که مارکت حرکت خواهد کرد. وظیفه اصلی مارکت یافتن نقطه بالانس تنها زمانی حرکت خواهد کرد که در آردرهای آمده تعامل به یکطرف (Bias) وجود داشته باشد. بنابراین ما به یک پیداکننده بیاز داریم، پیداکننده‌های بیاز هم در مارکت ترندار و هم در رنج کار می کنند. سود کردن در ترند نسبتاً ساده است. مساله نگهداشت تن سود در زمان رنج است. در زمان رنج ترید مثل گیر کردن در گل است. و در زمان ترند، مثل راندن در شنیز. بنابراین ما از این اندیکیتور بنام فاکتور گل یاد می کنیم؛ هرچه گل بیشتر باشد مارکت اهسته حرکت خواهد کرد. سپس Tic Mileage نامیدیم، چون ما تغییر قیمت



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

به ازای هر تیک را اندازه می‌گیریم. و بالاخره بنام ایندکس تسهیل‌کننده مارکت (MFI) نامیدیم. در حال حاضر این ایندکس استفاده جهانی دارد و بعنوان اندیکاتور استاندارد در چندین سیستم آنالیز تکنیکال استفاده می‌شود. این ایندکس خیلی ساده است. عکس اول از سمت راست. با شکستن فرمول بصورت زیر می‌توانید ببینید که MFI اندازه‌گیری تغییر قیمت به ازای هر تیک است. عکس دوم از سمت راست.

با مقایسه این فرمول با فرمول اینشتین $E = mC^2$ می‌توانیم ثابت کنیم؛ عکس سوم از سمت راست. در ترید جرم برابر است با حجم، انرژی برابر است با حرکت قیمت. آیا اینشتین موافق است؟ من نظری ندارم، اما بکار بردن آن در ترید طنز آمیز است.

ما تغییرات مؤثر را در قیمت به ازای هر تیک می‌سنیم. این اعداد هیچ ارزش مطلقی ندارند. ارزش آنها در مقایسه این اعداد با MFI قابلی است. برای مثال اگر MFI کندل جاری 0.541 باشد، قادر مقایسه با کندل چارت دیبور با همان ارزش نیست. ما MFI را در رابطه با عمل بلافاصله قبلی مارکت در نظر می‌گیریم. ما می‌خواهیم بدانیم که آیا تسهیل حرکت قیمت مارکت کمتر یا بیشتر است. MFI تمایل بازار را به حرکت قیمت اندازه می‌گیرد. من نمی‌توانم بر ارزش این اندیکاتور تأکید بیشتری بکنم.

نسبت به استوکاستیک، RSI یا هر اندیکاتور مونتموت دیگر عمل مارکت را صحیح‌تر اندازه می‌گیرد. اندازه‌گیری MFI از اینکه مارکت به ازای هر تیک مقدار حرکت می‌کند، توصیف بی‌نهایت دقیقی از کارائی مارکت در طی این کندل بخصوص دارد. اگر MFI جاری بزرگتر از قبلی باشد، حرکت قیمت به ازای هر تیک بیشتر است و تسهیل حرکت قیمت در طی زمان بزرگتر است. ما فقط MFI کندل جاری را با کندل قبلی مقایسه می‌کنیم. این به ما این اجازه را می‌دهد که تعیین کنیم این پریود زمانی فرصت ترید کمتر یا بیشتر را فراهم می‌گیرد.

مزیت بزرگ روش سودده این است که هیچ پیچیده‌آل نیست. MFI بطور مداوم بر یک مبنای نسبی در ولایتی جاری مارکت تعیین می‌کند. بنابراین همچنانکه شخصیت مارکت در طول زمان تعییر می‌کند، MFI و وابستگی‌های مختلف آن هم تعییر می‌کند.

اجازه بدهید آنچه را که یاد گرفتیم جمع‌بندی بکنیم:

1. چه کسی مارکت را پیش می‌برد (خریدارها یا فروشنده‌ها)
2. مارکت به چه سمتی حرکت می‌کند.

3. مارکت برای تسهیل حرکت قیمت در طی زمان (MFI) چه کار می‌کند.

تمام این اطلاعات با یک ثابتی با یکدیگر در تداخل هستند. و حالات مختلف مارکت و فرصت‌های مختلف ترید را نشان می‌دهند. سپس ما می‌توانیم فاکتورهای بالا را برای افزایش قدرت فهم و آنالیز ما از عمل مارکت با هم ترکیب کنیم.

ترکیب MFI با حجم

تعییر حجم ما را قبل از شروع ترند آگاه می‌کند، و MFI نشان می‌دهد که مارکت چگونه به این افزایش یا کاهش حجم واکنش نشان می‌دهد. با ترکیب این دو فاکتور باهم، ما می‌توانیم تصویر واضح و دقیقی از عمل مارکت بدست بیاوریم. ما از حجم دوبار استفاده خواهیم کرد، اما به دو روش:

1. ما از حجم خام که با حجم تیک مشخص می‌شود استفاده می‌کنیم.
2. ما از حجم در محاسبه MFI استفاده می‌کنیم.

دریچه‌ای برای سود دریچه‌ای برای سود بیشتر از فقط یک فرصت است. با ترکیب دو فاکتور حجم و MFI در کل چهار امکان ترکیب، امکان موفقیت شما خیلی بهتر می‌شود و ما آن را سود بردن می‌نامیم بجای فرصت.

من اندیکاتوری را برای هر یک از ترکیب‌ها طراحی کردم که دقیقاً آنچه را که در مارکت Broad اتفاق می‌افتد و واکنش‌ها در Pit را شرح می‌دهد. ما یک به یک به آنها نگاه می‌کنیم. عکس چهارم از سمت راست.

$$MFI = \frac{\text{Range (High - Low)}}{\text{Volume}}$$

$$\frac{\text{Range}}{\text{Volume}} = \frac{\Delta \text{ Price}}{\text{Tick}}$$

$$C^2 = \frac{E}{m} = \frac{\text{Range}}{\text{Volume}}$$

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

Tick Volume/MFI Combinations

Indicator

1. + Tick volume and + MFI	Green (++)
2. - Tick volume and - MFI	Fade (- -)
3. - Tick volume and + MFI	Fake (- +)
4. + Tick volume and - MFI	Squat (+ -)

سیز (افزایش حجم تیک و افزایش MFI)

ما این کندل را سیز می‌نامیم چون چراغ سبزی برای حرکت مارکت است. حرکت قبلاً اتفاق افتاده است. تصور کنید شما در ساحل شرقی هستید و بدنیال کشتی هستید که بطرف غرب می‌رود. دو راه متفاوت برای پیدا کردن کشتی مناسب دارید. اول، شما بدنیال کشتی‌هایی هستید که مسیرش به سمت غرب است، با این فرض مسلم که آن بالآخره به سمت غرب خواهد رفت. وقتی شما یکی را یافته‌ید، در ماشین زیبا و راحتان می‌نشینید و منتظر رفتمن می‌شوید. انتخاب دوم شما ممکن است این باشد که در انتهای غرب محوطه بایستید و بداخل اولین کشتی که از محوطه خارج می‌شود پیرید. انتخاب دوم می‌تواند "سیز" باشد. کشتی قبلاً شروع به حرکت کرده است. سیز ممکن است خطرناک باشد. شما مطمئن نمی‌خواهید در مقابل آن بایستید، که دقیقاً مثل آن است که مخالف کندل سیز ترید کنید.

سیز سیگنال Breakout است و بقیتين استراتژی فوری شما رفتمن با جهتی که مارکت می‌رود است. سیز سه چیز را مشخص می‌سازد:

1. تریدرهای (Players) زیادی وارد مارکت شده‌اند (افزایش حجم)
2. رسیدن تریدها در سمت حرکت مارکت Biased Hesitant
3. (افزایش MFI) The price movement is picking up speed as it goes

(کاهش حجم تیک و کاهش MFI) Fade

زمانی دیده می‌شود که مارکت نفس می‌کشد یا علاقه‌اش را از دست می‌دهد. محو متضاد سیز است؛ هر دو حجم و MFI (حرکت قیمت) کم است. مارکت فیوجر یک مارکت مزایده است، و کسانی که پیشنهاد می‌دهند علاقه‌شان را از دست می‌دهند. اگر من این کامپیوترا به مزایده بگذارم، اکثر مردم بلاfaciale \$100 پیشنهاد می‌دهند. با این نوع جواب، من قیمت را بالا می‌برم. بطور قابل توجهی تعداد کمتری \$1000 پیشنهاد می‌دهند، و من مطمئن هستم هیچ کس \$5000 نمی‌دهد. همچنانکه قیمت بالا و بالاتر می‌رود، شرکت کنندگان بیشتر و بیشتری علاقه‌خود را از دست می‌دهند. اغلب قله اولین موج در موج الیوت، قله محو (Fade) دارد؛ عمل‌ها زیاد نیست، و شور مارکت کم کم تحلیل می‌رود. خیلی مهم است که مناطق محو را مشخص کنیم، چون شروع حرکت بزرگ هستند. بنابراین در اکثر موقعی که مارکت بیشترین Boring (لانه کردن) را دارد، دقیقاً زمانی است که تریدرهای خوب گوش بزنگ هر علامتی از ایجاد مومنتوم هستند.

(کاهش حجم تیک و افزایش MFI) Fake

ما وضعیتی داریم که MFI افزایش می‌یابد، به این معنی که مارکت خودش را با حرکت قیمت در طی زمان تسهیل می‌کند اما توسط افزایش حجم از خارج از Pit حمایت نمی‌شود. بنابراین تسهیل کمتر قوی است، که با کاهش حجم خام مشخص می‌شود. به هر دلیل مارکت حجم کمتری را نسبت به کندل قبلي کسب کند. در عمل مارکت قبل از Takeoff مارکت قست. تا اینکه این وضعیت بلاfaciale با افزایش حجم دنبال شود. Fake ممکن است احتمالاً توسط لوکال‌ها دستکاری شود. لوکال‌ها کنترل موقعیتی دارند. چون حجم عمدہ‌ای از Outside Paper به داخل Pit می‌آید. علامتی از دستکاری Pit است و بایستی با درجه بالائی از شک بررسی شود. لوکال‌ها حس می‌کنند که حرکت در طی سکون در عمل Pit حتمی است. این تنها زمانی است که لوکال‌ها قادر کافی برای زدن استاب شما دارند. آنها اگر ممکن باشد مارکت را در خلاف جهت حرکت مورد انتظار می‌گیرند برای بدست آوردن موجودی و گرفتن سمت دیگر اوردرهای که پیش‌بینی می‌شود به Pit بیاید. آنها موجودی خود را می‌سازند و بنابراین می‌توانند در رالی بعدی بفروشنند یا در نزول بعدی خرید کنند.

(افزایش حجم تیک و کاهش MFI) Squat

"قویترین پتانسیل ساختن پول از چهار پنجره سودده هستند. حقیقتاً تمام حرکت‌ها با Low & High Squat" بعلاوه یا منهای یک کندل در همان پریود پایان می‌یابد. بعارتی تمام ترندهای مهم با یک Squat در یکی از سه کندل قله یا ته پایان می‌یابد. این آنالیز یک روش بالقوه مؤثر را برای گرفتن شروع ترند فراهم می‌سازد. در حالیکه تمام ترندها در یک Squat پایان می‌یابند، تمام اسکووات‌ها پایان ترند نیستند. اسکووات غالباً در وسط موج سه الیوت و در تریس فیبوناچی و خطوط گان دیده می‌شود. (فصل 7) چنانچه اگر ترند آخر را پایان ندهد، یک "Measuring Squat" (شبیه Squat) می‌شود و

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

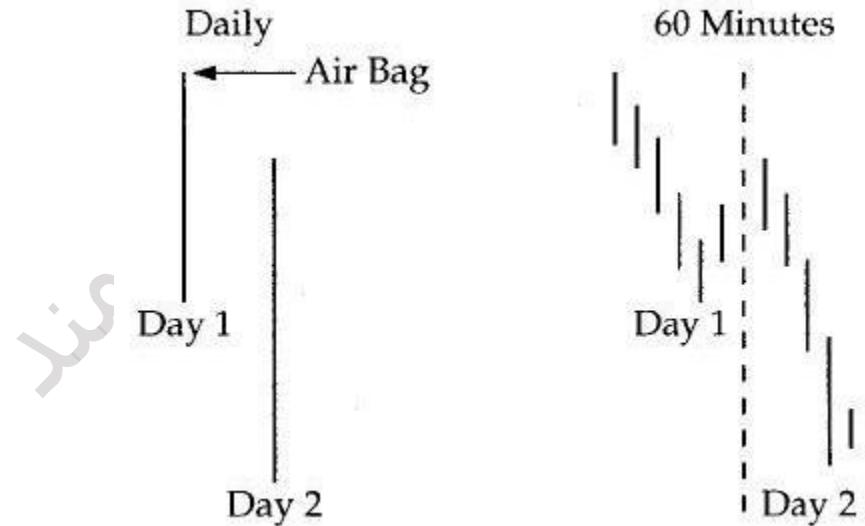
اینکه حرکت جاری چقدر ادامه خواهد یافت. این به ما یک منطقه تارگت را می‌دهد، جائی که ما می‌توانیم بدنیال اسکوآت دیگر باشیم که ممکن است پایان ترند باشد.

اسکوآت‌ها معمولاً با حجم تیک بزرگتر و MFI کمتر و اما نه همیشه با رنج کمتری نسبت به کندل قبلی مشخص می‌شوند. اگر شما در چارت کوتاه‌مدت ترید می‌کنید (اینترادی)، یک دید خلاصه برای اسکوآت‌ها رنج یکسان یا کوچکتر با یک حجم تیک بیشتر (در مقایسه با کندل قبلی) خواهد بود.

اسکوآت‌آخرين مبارزه Bears و Bulls ، با لاتهای خرید و فروش با حداقل حرکت قیمت است. تقریباً تقسیم مساوی بین تعداد و جذب Bull وجود دارد. یک جنگ واقعی اتفاق می‌افتد و مبارزه برابری در Pit است. من این را اسکوآت می‌نامم. چون بنظر می‌رسد مارکت چمباتمه زده و آماده است که یک سمت که اغلب در جهت عکس ترند جاری است بپرد. مارکت حجم قابل توجهی را به بالا یا پائین حرکت کرده، و حالا سیلی از خریداران یا فروشندها در مارکت هستند. حجم افزایش می‌یابد، ترند متوقف می‌شود و حرکت قیمت حقیقتاً متوقف می‌شود. کلید اینجا است که حرکت قیمت در حجم بالاتری متوقف می‌شود. یکی از دو نیروی متضاد (خریداران در مقابل فروشندها) برند خواهد شد، و معمولاً شیوع اسکوآت‌ها این امکان را به شما می‌دهد که بفهمید این اسکوآت‌ها ادامه ترند یا یک اسکوآت برگشت ترند است.

کیسه هوا: محافظت در برابر حوادث بد من 45 سال است که راننده‌گی می‌کنم و هرگز اتفاق نیافرده که خودم باعث تصادف شوم، با این توصیف شما ممکن است نتیجه بگیرید که من راننده دقیقی هستم و حداقل محافظت را در راننده‌گی لازم دارم. در طی این 45 سال دو بار سرم به شیشه جلو اتومبیل برخورد کرده که در هر دو مورد در صندلی مسافر در سمت راست نشسته بودم و راننده در مسیر مناسب و با سرعت کمتر از حد می‌راند. هر دو تصادف توسط راننده مبت که در جهت مخالف و در مسیر غلط می‌آمد اتفاق افتاد. از این تجربه من هرگز ماشینی نمی‌خرم که کیسه هوا دو تا نداشته باشد. گاهی اوقات مارکت مثل راننده مبت عمل می‌کند، و شما کیسه هوای محافظت را لازم دارید. اگر شما ترید خودتان را بطور دقیق محافظت کنید، شما ممکن است یک ردیف طولانی از ضرب را داشته باشید بدون اینکه مجبور باشید ترید را ترک کنید. خوشبختانه مارکت یک تکنیک عالی می‌دهد. مارکت می‌تواند به پنج پریود زمانی متفاوت که رابطه ثابت و مشابهی را با هم دارند بشکند. ما با پریود ماهانه شروع می‌کیم، هر ماه شامل 4.3 هفته، هر هفته شامل پنج روز، هر روز شامل 5 پنج الی شش ساعت ترید، هر ساعت ترید شامل چهار (پانزده دقیقه) یا شش (ده دقیقه) کندل می‌باشد. هر پریود زمانی تقریباً یک پنجم پریود بالاتر و تقریباً پنج برابر پریود پائین‌تر از خود است. ما کیسه هوا را یک تیک بالا یا پائین Low / High دوین کندل قبلی در یک پریود زمانی خیلی بالاتر (یا کندلی قبلی) که هر دو Lower Low و Lower High با Higher Low Higher و Higher High می‌دارد قرار می‌دهیم. به تصویر توجه نمائید.

اگر کیسه هوا شما بالا است، یعنی اینکه در صورت رسیدن مارکت به آن شما تمایلی برای فروش ندارید. اگر کیسه هوا شما پائین است، یعنی اینکه در صورت رسیدن مارکت به آن شما تمایلی برای خرید ندارید. اکثر مواقع شما قبل از اینکه مارکت به کیسه هواستان برسد، سیگنال برگشتی یا ورود بدست می‌آورید.



گذاشتن همه چیز باهم در سطح یک ما حالا ابزاری در دست داریم که می‌تواند ما را از صفر و ضرر به سمت سود پایدار سطح یک برساند. وقتی شما این فصل را بفهمید، اطلاعات زیادی را نسبت به 90% تریدرها دریاره ساختن سود از مارکت دارید. شما خواهید فهمید که حجم، حرکت مارکت را کنترل می‌کند و ترند از فلور می‌آید.

شما ابزار اساسی در اختیار دارید که عمل مارکت و مقادیر اطلاعات زیادی را که مارکت هر دقیقه به ما می‌دهد را بصورت قابل فهم و آسان ترجمه می‌کند شما همچنین می‌دانید چطور حجم ورودی را آنالیز کنید و چطور از ارزیابی خیلی دقیق واکنش MFI استفاده کنید. شما می‌دانید که با ترکیب حجم تیک خام و MFI، ابزار بهتری برای فهمیدن عمل مارکت و احتمال حرکت بعدی در اختیار دارید. برای مثال اگر کندلی که بررسی می‌کنید در یک سوم فوقانی باز و در یک سوم تحتانی بسته شود، مارکت به طرف پائین حرکت کرده است. اگر نقطه وسط کندل جاری بالای رنج کندل قبلی باشد، ترند فوری را بصورت منها (-) نشان می‌دهیم. اگر حجم تیک در مقایسه با کندل قبلی افزایش یابد، حجم (+) و MFI کمتر از کندل قبلی باشد، MFI (-) و در کل به این فرم نشان می‌دهیم: (- + 13 -) از این طرح ما می‌فهمیم که ترند نزولی است. فروشنده‌ها در سراسر این پریود زمانی در سود هستند، و تا پایان پریود در سود خواهند بود و پنجه سودده اسکوآت است. بطور ایده‌آل ما بایستی آماده برگشت و رفتن به خرید باشیم. تصویر پیوست را مشاهده نمائید.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

ترند صعودی (+)، کندل فعلی در یک سوم تحتانی باز و در یک سوم فوقانی بسته شده (31)، و افزایش حجم داریم (+) و MFI بیشتر از کندل قبلی (+). شرح ما از این کندل به این صورت است: (+31++) تصویر پیوست شده در کامنت قبلی مشاهده نمائید. تفاوت مهم این و مثال قبلی این است که خریدارها در سراسر این کندل در سود هستند و پنجره سودده سیز است. بطور ایدهآل ما بایستی قلّاً در صحنه در طرف خرد باشیم، بویژه زمانی که ما یک کندل اسکوات پنج کندل قبل از کندل سیز جاری داشتیم، این کندل "Go With" است و ما می‌خواهیم با آن بمانیم تا زمانی که مارکت چیز دیگری بگوید.

سؤالات زیر برای مرور است. قبل از رفتن به سطح دو شما باید قادر باشید به آسانی به آنها پاسخ دهید.

1. چطور شما می‌توانید بگوئید چه کسی در یک پریود زمانی مشخص در سود است؟
2. در کد کندل کدام عدد باز و یا بسته شدن را نشان می‌دهد؟
3. دو کندل نهائی کدامها هستند و چه اطلاعاتی را در مورد ادامه ترند به ما می‌دهند؟
4. کندل خنثی چه اطلاعاتی را به ما می‌دهد؟
5. کدامیک از کندل‌های صعودی بیشترین و کدامیک کمترین اطلاعات را به ما می‌دهد؟
6. کدامیک از کندل‌های نزولی بیشترین و کدامیک کمترین اطلاعات را به ما می‌دهد؟
7. ترند در کجا تشکیل می‌شود و چگونه تشخیص می‌دهید؟
8. بطور واضح توضیح دهید چرا MFI برای سود بردن خیلی با ارزش است.
9. چهار پنجره‌ها همراه با افزایش حجم است؟
10. کدام از چهار پنجره سودده بیشترین ارزش را برای شما بعنوان تریدر دارد؟ چرا؟ این نوع از پنجره کجا دیده می‌شود؟
11. کدامیک از چهار پنجره سودده بیشترین ارزش را برای شما بعنوان تریدر دارد؟ چرا؟ این نوع از پنجره کجا دیده می‌شود؟

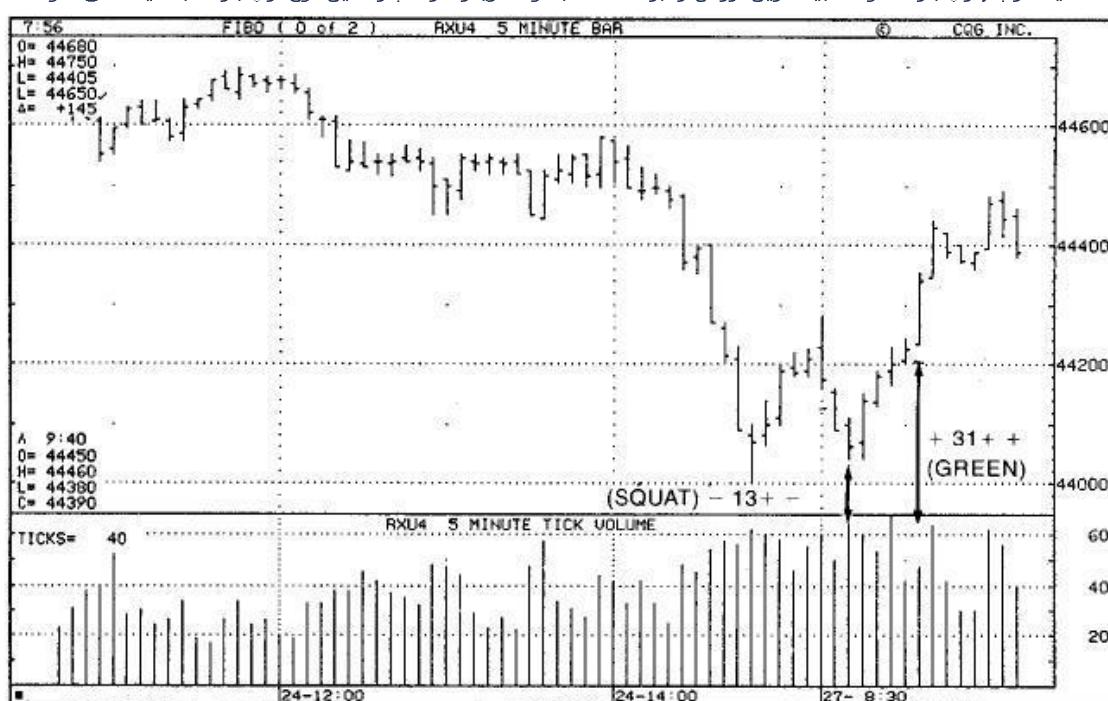


Figure 6-10 A + 13 + – squat bar and a + 31 + + green bar.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

فصل 7

سطح دو: مبتدی پیشرفته

اهداف:

1. فهمیدن ارتباط بین MFI و شمارش موج الیوت.
2. استفاده از MACD سودمند برای خارج شدن از ایهام شمارش موج الیوت.

قیلاً گفتیم که انرژیزا یا همیشه منجر به ورود به تجربه تازه می‌شود. وقتی آنها متوجه می‌شوند که بیشتر از آنچه فکر می‌کردند درگیر شدند، اکثر تریدرهای تازه کار دلسرد می‌شوند و هرگز به آنچه که باید برسند نمی‌رسند. در سطح دو شما به این ارتباط بحرانی می‌رسید. آیا شما دلسرد شدید و به این نتیجه رسیدید که کسی از مارکت پول بدست نمی‌آورد؟ یا چسیدید به مارکت و سود برده؟ در این سفر از سطح 1 به سطح 5 با برخی ابزارهای قدرتمند آشنا می‌شویم.

در سطح یک، هدف ما ماندن در مارکت و از دست ندادن پول در حین کسب تجربه است. در سطح دو، با استی بطور پایدار از مارکت پول بدست بیاورید. در سطح دو دیدمان را وسیع می‌کنیم. در حالی که برای آنالیز موج الیوت، حداقل باید 100 کندل و حداقل 140 کندل را در نظر بگیریم. زمانی که از ترید براساس طرح سودده استفاده می‌کنیم، می‌توانیم هر تعداد کندل را بررسی کنیم.

اول، موج الیوت را بررسی می‌کنیم. سپس به آنالیز مارکت می‌رسیم و به ساختار زمینه‌ای موج الیوت نگاه می‌کنیم. این ساختار از علم جدید Chaos و بیوژه از فرکتال موج الیوت می‌آید. بعد از نگاه کردن به موج الیوت، ترید را در دنیا واقعی ساده خواهیم کرد. شما احتمالاً شنیده باشید که اگر دو الیوت کار را باهم در یک اتفاق با یک چارت بگذارید، آنها با نه شمارش مختلف بیرون خواهند آمد. این برای شما با روش سودده اتفاق نمی‌افتد. تقریباً هر محله‌ای این تیز که موج الیوت آنقدر ذهنی است که ارزش ترید ندارد، را چاپ می‌کند. فکر آشغال! من سعی می‌کنم هر تریدری را به اتفاق ترید بیاورم و با من یک روز ترید کند. آن ترید اعتقدادتش را از دست می‌دهد. مشکل اساسی این است که تعداد کمی از تریدرهای درک می‌کند و می‌دانند چطور جائی را که ما در شمارش هستیم، تست کنند. هر الیوت کاری یک شمارش خوب بعد از مشخص شدن واقعیت می‌دهد. تریدرهای نیاز به شمارش موج جاری دارند که قابل اطمینان و دقیق باشد. این ایزار دقیق در سطح دو در دسترس است. بعد از توضیح تئوریک ساده با مثالهای واقعی کار خواهیم کرد.

یکی از چیزهایی که تمام تریدرهای با آن موافق هستند، لزوم زمان مناسب برای ترید سودده است. در بیش از 35 سال ترید فعال، من روشنی را ندیدم که صحت تعیین زمان تکیک من را زیر سؤال ببرد. با ترکیب شمارش دقیق موج الیوت و فهمیدن آنچه واقعاً در مارکت اتفاق می‌افتد (بنجره سودده) و با آنالیز فرکتال خودش (On Top) هر دقیقه به دقیقه (یا روز به روز، در تایم فریم ارجح خودش) باشند. روش سودده در آنالیز موج یک اندازه‌گیری کمی و کیفی از خطر هر ترید فراهم می‌کند. دانستن اینکه کجا موج الیوت قرار دارد، دانشی به شما می‌دهد که خرافات، حدسیات، آگوهای افسانه‌ها را کنار می‌گذارید و اساس اینکه مارکت چگونه خودش را آشکار می‌کند بدست می‌آورید. برخی تریدرهای حتی با این دانش، قادر بالانس هیجانی - منطقی لازم برای ترید موفق هستند. برای اکثر تریدرهای مدیریت هیجانی مشکل ترین مانع برای ترید سودآور می‌باشد. (فصل 10 و 11)

هدف ما در این فصل ساختن شبکه‌ای است که نشان بدهد چرا و چگونه مارکت کار می‌کند. یاد گرفتن موج سواری مارکت شبیه موج سواری دریا است. هر چه موجی که سوار بر آن هستید بزرگتر باشد، شانس بیشتری دارید که خشک بماند. گاهی غوطه خوردن در آب قیمتی است که برای این ورزش پرداخت می‌کنید. تمام موج سوارهای می‌دانند که اغلب اوقات به دریا می‌افتد و "هیولا" را می‌بینند. و بیشتر باد می‌گیرند که رفتار هر موج را بخوانند. هر چه بیشتر درک کنید چگونه انرژی را که در هر ترید "هیولا" وجود دارد، استفاده و پراکنده کنید، اطمینان بیشتری در موقعیت‌های غیرمنتظره خواهد داشت.

موج الیوت

دلیل اولی که در فهم موج الیوت جالب است، اینست که بهترین اندیکیتوری است که جای شما را در حرکت مارکت نشان

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

می‌دهد. خواندن مارکت مثل اینستکه سعی کنید بفهمید شهر نیویورک چطور عمل می‌کند. شما می‌توانید یک روز با هریک از پنج پرزیدنت هر ایالت وقت صرف کنید، تا عمق آنچه را که در هر ایالت در هر زمان اتفاق می‌افتد را بفهمید. روش دیگر گرفتن هلیکوپتر و دیدن کل شهر از بالای مرکز ترید جهانی است. روش سودده قابل مقایسه با مصاحبه عمقی است: ما آنچه را که در "زنگی" هر بازار کالا در زمان حاضر اتفاق می‌افتد را می‌فهمیم. موج الیوت ما را به ارتفاع بالاتر می‌برد و دید وسیع‌تری از چگونگی عمل مارکت نشان می‌دهد. موج الیوت آنالیز ساختار زمینه‌ای مارکت است و فرکتال ساختار زمینه‌ای موج الیوت است. موج الیوت انتخاب قله و ته است. بطور طبیعی، این برای سلامتی مالی تاثر خطرناک است.

ریتمهای اساسی موج الیوت توالی موج شامل یک ریتم اساسی از "5" تصحیح شده با "3" می‌باشد. این توالی ثابت می‌ماند و مهم نیست چه درجه‌ای از موج آنالیز می‌شود. این ریتم موج تا زمانی که حداقل مقدار حجم ترید وجود داشته باشد، قابل مشاهده است. به عنوان یک قانون سرانگشتی ما از حداقل متغیر 20 تیک به ازای هر پریود زمانی استفاده می‌کنیم. اگرچه توالی الیوت می‌تواند اغلب در پریود کوتاه‌تر با حجم خیلی کمتر برای مثال در چارت 1 دقیقه نیز دیده شود. فرم پترن خیلی مهمتر از تایمفریم است. موج ممکن است منسیط با فشرده (از نظر زمان و قیمت) شود، اما فرم زمینه ثابت می‌ماند. حرکت خودش را در جهت اولیه در یک سری از 5 موج که 1 تا 5 نامگذاری می‌شوند، آشکار می‌کند. حرکت 5 موج بطور نرمال با حرکت 3 موج در جهت مخالف تصحیح می‌شود. الیوت، شماره‌های 1 تا 5 "را موج‌های کاردینال" نامید. Prechter و Frost "Impulse Waves" را برای موج 1، 3، و 5 عمومی کرد. موج‌های اصلاحی با حروف کوچک مشخص می‌شوند. چنانچه در شکل اول از سمت راست می‌بینید، موج اول با موج 2، و موج 3 با موج 4 تصحیح می‌شود. سپس موج 5 با توالی 3 موج تصحیح می‌شود که A - B - C نامیده می‌شود. بعد از اینکه توالی 5 موج کامل شد، معمولاً یک موج با "درجه بزرگتر" یا بخشی از موج بزرگتر می‌شود. حرکت کامل موج از 1 تا 5 توالی موج بلندتر بعدی را کامل می‌کند. بنابراین حرکت از موج 1 تا 5، موج 1، 3، و 5 را کامل می‌کند و توالی C - A - B - C، موج 2 و 4 را کامل می‌کند. شکل دوم از سمت راست.

مشخصات موج‌های مختلف قواعد اصلی تئوری موج ساده است، اما کاربرد این قوانین اکثر دانش آموزان این تئوری را می‌ترساند. با استفاده از اندیکیتورهای سودده که در فصل قبل توضیح داده شد، این کار ساده، مختص، و دقیق خواهد بود. یکی از بزرگترین لذت‌های من در ترید نگاه کردن به شمارش موج شما که درست آنچه را که پیش‌بینی می‌کنید را نشان می‌دهد، می‌باشد. اکثر رابطه‌هایی که اکثر الیوت‌کاران توضیح می‌دهند، در واقع تمایلات بوده و نه دائمی و نه دقیق هستند. بعلاوه این رابطه‌ها در طول زمان تغییر می‌کنند. درست زمانی که شما شروع به شمارش می‌کنید، آنها تغییر می‌کنند که ما این مشکل را حل کردیم. قبل از توضیح راه حل، اجازه بدھید موج‌های مختلف و روابط بین آنها را بررسی کیم. دوباره من باید تأکید کنم که برخی مفاهیم آنالیز موج الیوت که به ما دقیق‌تر نشان می‌دهد اعتماد ما به اندیکیتورهای سودده است که تداخلات مارکت را در همان لحظه نشان می‌دهد.

موج اول همیشه یک حرکت تغییر ترند است. تریدرهای اول که وارد ترند جدید می‌شوند همیشه برنامه سایکولوژیکی "Have Fun" که در فصل 12 شرح داده شده، اجرا می‌کنند. شروع موج 1 (که پایان موج 5 یا پایان موج C یا E است که از سمت منضاد می‌آید) همراه با دایورجنس در اوپسیلاتور MFI خواهد بود. وقتی ما تمام اندیکیتورها را با هم داشته باشیم، انتظار حرکت شارپ را از ته (قله) داریم. این ممکن است نقطه صفر (تکنیک PPT در سطح 3، فصل 9) باشد که به ما امکان ترید و سود بیشتر را می‌دهد. بهترین راه برای پیش‌بینی و هدف‌گذاری موج 1 بررسی ساختار داخلی و موج‌های با درجه کوچکتر است. به تایمفریم کوچکتر نگاه کنید؛ برای مثال، به توالی 5 موج داخل موج 1 در حال تشکیل نگاه کنید. شکل سوم از سمت راست.

سپس چک کنید:

1. دایورجنس
2. منطقه تارگت
3. فرکتال
4. اسکووات
5. تغییر اندیکیتور مومنتوم

ما اینها را پنج گلوله بزرگ می‌نامیم چون تقریباً همیشه ترند جاری را می‌کشند.

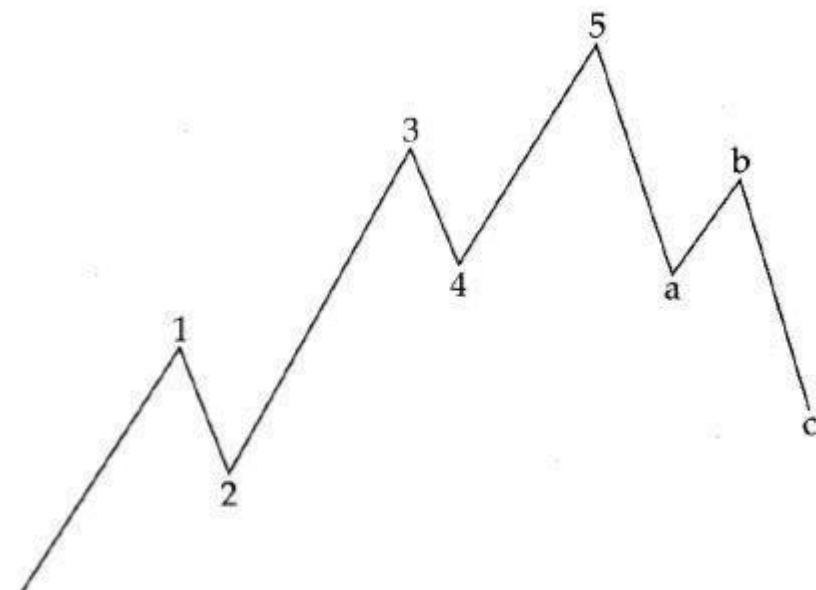


Figure 7-1 Diagram of waves 1–5 with an a-b-c correction.

①, ③ or ⑤

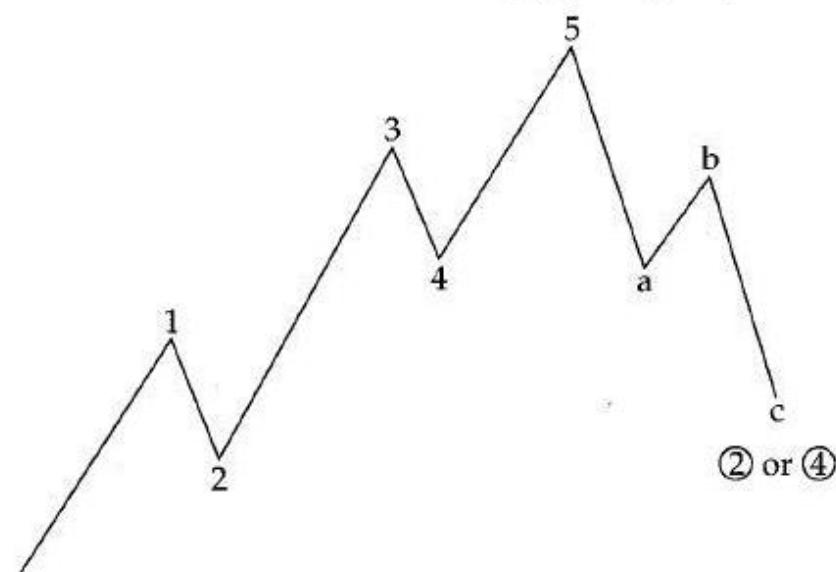


Figure 7-2 A 5-wave sequence with a 3-wave correction can be part of another wave of larger degree.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

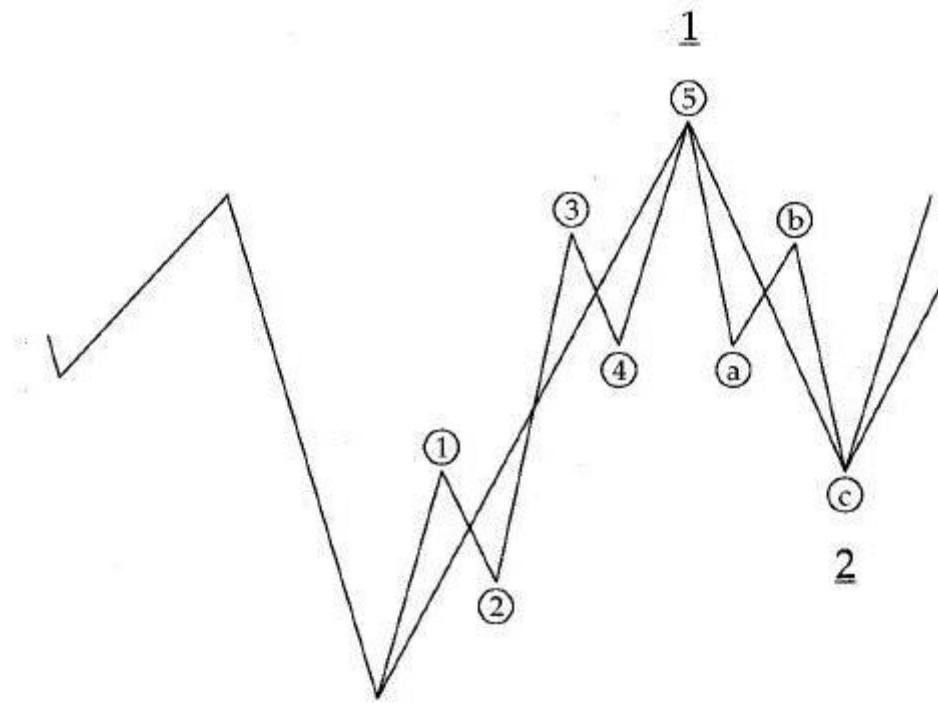


Figure 7-3 Characteristics of wave 1.

موج 2 زمانی که موج اول پایان می‌یابد، ما در انتظار دومین موج در جهت عکس هستیم. موج دوم توسط فروش (خرید) تازه ایجاد می‌شود، برخلاف موج چهارم که توسط سود کردن (خروج از خرید یا فروش) ایجاد می‌گردد. تارگت موج 2 توسط روابط فیبوناچی و شمارش داخلی موج تعیین می‌شود. معمول‌ترین تارگت برای پایان موج 2 بین 38.2 و 61.8 درصد موج 1 است. (شکل اول از سمت راست) در حدود سه چهارم موارد موج 2 در این ناحیه پایان می‌یابد و فقط در یک ششم موارد بیش از 61.8 درصد رتریس می‌کند. اگر موج 2 در کمتر از 38.2 درصد تصحیح پایان یابد، معمولاً تصحیح بی‌قاعده داشته است. (شکل دوم از سمت راست) پس موج 2 با فروش تازه در یک ترند صعودی (با خرید در ترند نزولی) توسط تریدرهایی که در مارکت نیستند و تشخیص نمی‌دهند که این حرکت رو به بالا موج 1 در جهت تازه است ایجاد می‌شود. (فصل 9 یافتن نقطه صفر) این تریدرهای فکر می‌کنند که موج 1 تصحیح دیگری در حرکت نزولی است بنابراین آنها در قله موج 1 اندام به فروش می‌کنند. این دلیل رفتار متفاوت موج 2 از موج 4 است که یک موج سود گرفتن می‌باشد. تریدرهایی که با سود در مارکت هستند برای خارج شدن از مارکت زمان بیشتری صرف می‌کنند تا تریدرهایی که تازه وارد شدند. این بی‌نهایت برای تعیین دقیق پایان موج 2 مهم است. بزرگ‌ترین فرصت سود بردن به ازای واحد زمان در موج 3 اتفاق می‌افتد، که عموماً سریع‌تر حرکت و مسافت بزرگ‌تر را طی می‌کند.

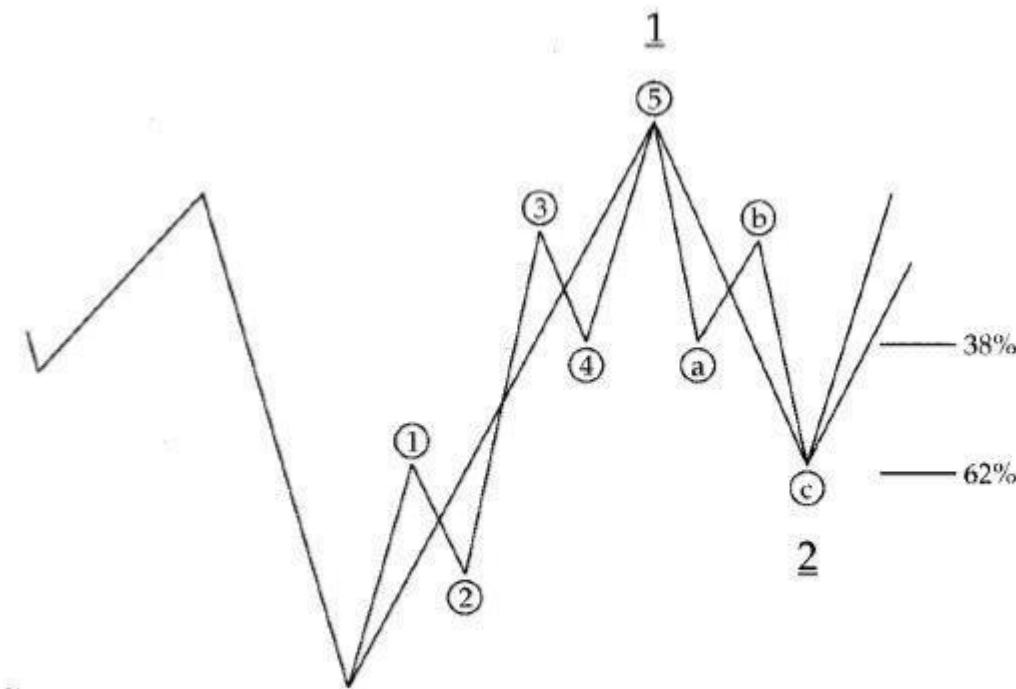


Figure 7-4 The most common retracement of wave 2.

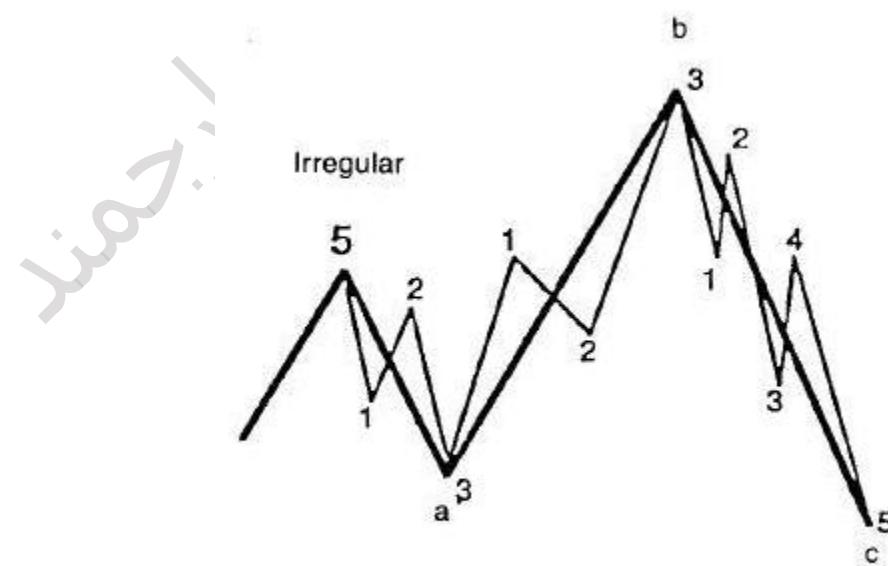


Figure 7-11 Irregular correction.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

موج 3 Robert Prechtor موج 3 را اعجایب دیدنی نامید. موج 3 امکان سود زیادی را می‌دهد. وقتی ما به سطح 5 (فصل 12) برسیم، ویژگی‌های سایکلولوژیک موج 3 را آنالیز خواهیم کرد. یک روش برای شناسائی موج 3، شب آن است. که عموماً نسبت به موج 1 تندتر (از تغییر قیمت تندتر می‌گذرد) است. گاهی موج 3 تقریباً عمودی دیده می‌شود. (شکل 1) و می‌تواند با موج 5 (Sell - Off) اشتباہ شود. اگر حرکت سریع و قوی حجم کمتری داشت، معمولاً Blow - Off است. در طی موج 3، زمینه اکونومیک از حرکت حمایت می‌کند (برای موج 1 این موضوع صادق نیست). دلایل فاندامنتال شروع می‌کند اندیکیتورهای تکنیکال را Pileatop کردن. اینها زمان‌های بی‌اندازه سودده براي بودن در مارکت هستند و پر کردن واگن در این موج‌ها امری ضروری است. بهترین تارگت اولیه برای طول موج 3 بین 1 و 1.62 برابر طول موج 1 است. ندرتاً موج 3 کوتاه‌تر از موج 1 است. و اغلب طولانی‌تر از 1.62 برابر طول موج 1 خواهد بود. بهترین راه برای تعیین کردن پایان موج 3 رفتن به تایم فریم کوچکتر و استفاده از تلاقی 5 گلوله بزرگ برای پایان موج 5 از اندیکیتور موج 3 می‌باشد. این 5 گلوله بزرگ عبارتند از:

1. دایورجنس در اوسیلاتور MFI
2. قرار گرفتن داخل منطقه تارگت
3. تشکیل فرکتال در قله (ته)
4. یک اسکوات در یکی از سه کندل بالاترین (پائین‌ترین)
5. تغییر در جهت مومنتوم در روی

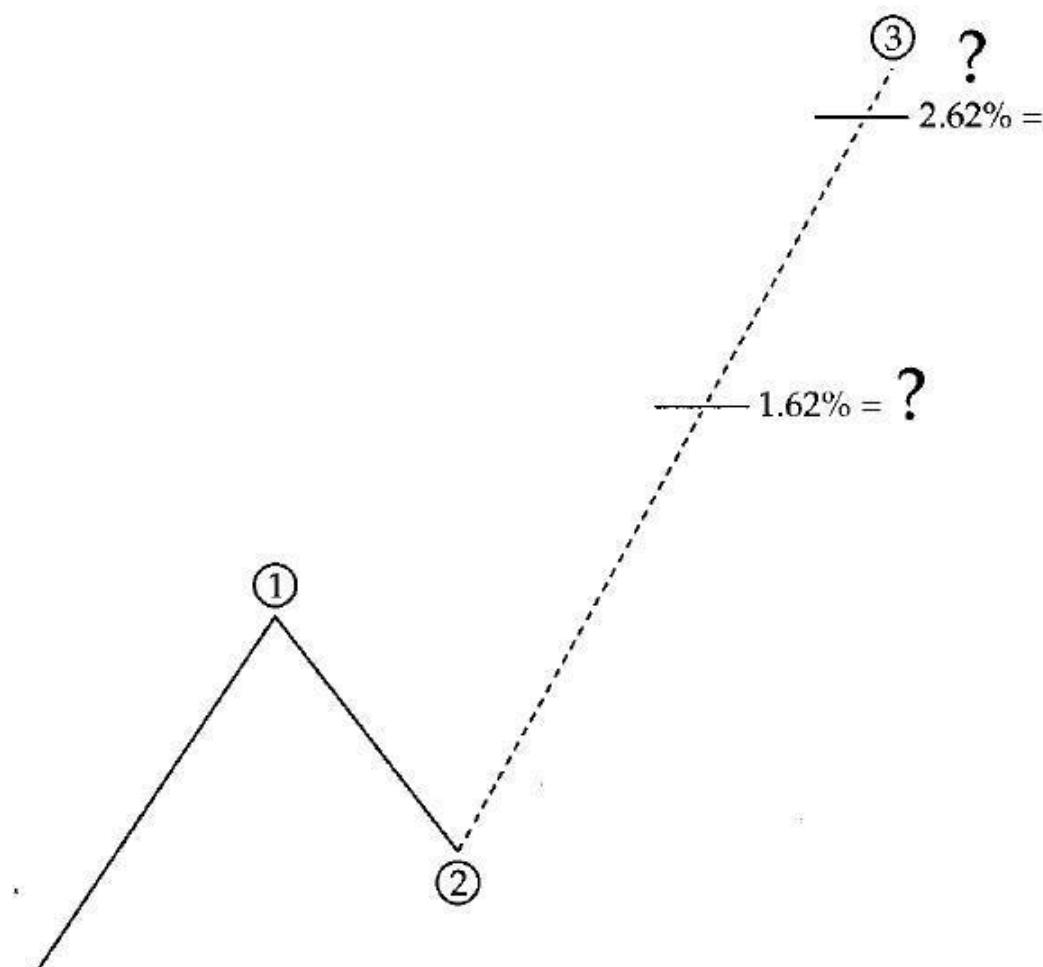


Figure 7-5 Characteristics of wave 3.

موج 4 وقتی موج 3 قوی تمام شد، تریدرها سودشان را وصول می‌کنند. اکثر تریدرهای ماهر، قبلاً در ترند بودند، و بنابراین سود فراوانی برده‌اند. مشخصه موج 4 کاملاً متفاوت از موج 2 است. الیوت این تفاوت را قانون تناوب نامید؛ اگر موج 2 ساده است،

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

موج 4 پیچیده خواهد بود، و برعکس. یک تصحیح ساده معمولاً بصورت زیگزاگ است. اگر موج 2 ساده باشد، موج 4 تصحیح پیچیده از یک طرف دارد (مسطح، نامنظم، سه‌گوش، درخت دوائی یا سه‌تائی). تحقیقات نشان داده که ۸۵٪ تمام Whiplash در موج 4 دیده می‌شود. اگر شما به آسانی نتوانید بفهمید در کدام شماره از موج هستید، خیلی احتمال دارد که در موج 4 باشید. اگر شما بیزار شدید و دیدید در موج 4 هستید، بهترین استراتژی اینست که دوباره به رختخواب برگردید. با وجود این چندین بازار کالا است که در چارت ماهانه برای سالها در موج 4 است. من نمی‌خواهم بمدت طولانی در بستر بمانید. بعلاوه اگر بتوانیم پایان موج 4 را تعیین کنیم، ما فرصت بزرگی برای سود در موج 5 خواهیم داشت. درصد رتریس در موج 4 کاملاً با موج 2 متفاوت است. (تصویر پیوست) عموماً تصحیح موج 4 خیلی طول می‌کشد، اغلب تا ۷۰٪ کل توالی موج 5 از نظر زمانی. عموماً موج 4 به اندازه (از نظر قیمت) موج 2 رتریس نمی‌کند. دوباره، این موج توسط وصول سود ایجاد می‌شود نه توسط ورودهای تازه به مارکت. عموماً شما شاهد افت شدید در حجم، ولایتی، Option Premiums، و اندیکاتور مومنتوم هستید. فقط در حدود یک ششم موارد موج 4 کمتر از ۳۸٪ موج 3 رتریس می‌کند. متحمل ترین تارگت بین ۳۸.۲ و ۵۰ درصد است. در نگاه به موج 4 یادآور می‌شویم که قانونی که شکسته نمی‌شود اینست که موج 4 هرگز به زیر قله موج 1 نمی‌رود. در ترید واقعی، شما خواهید دید که در برخی از موارد قانون درست نیست.

در آنالیز موج 4 برای بدست آوردن منطقه خوب برای ترید موج 5، از روابط فیبوناچی استفاده کنید و بدنبال ۵ گلوله بزرگ در تایمفریم کوچکتر داخل موج C از موج 4 باشید. مطمئن باشید که شما بین کنسل ۱۰۰ و ۱۴۰ در موج C موج 4 هستید. شما می‌توانید تعداد را از دستکاری تایمفریم در چارت بدست آورید. بار دیگر، پنج گلوله بزرگ عبارتند از:

1. دایورجنس MFI
2. قرار گرفتن در منطقه تارگت
3. فرکتال
4. اسکووات
5. تغییر مومنتوم در MACD

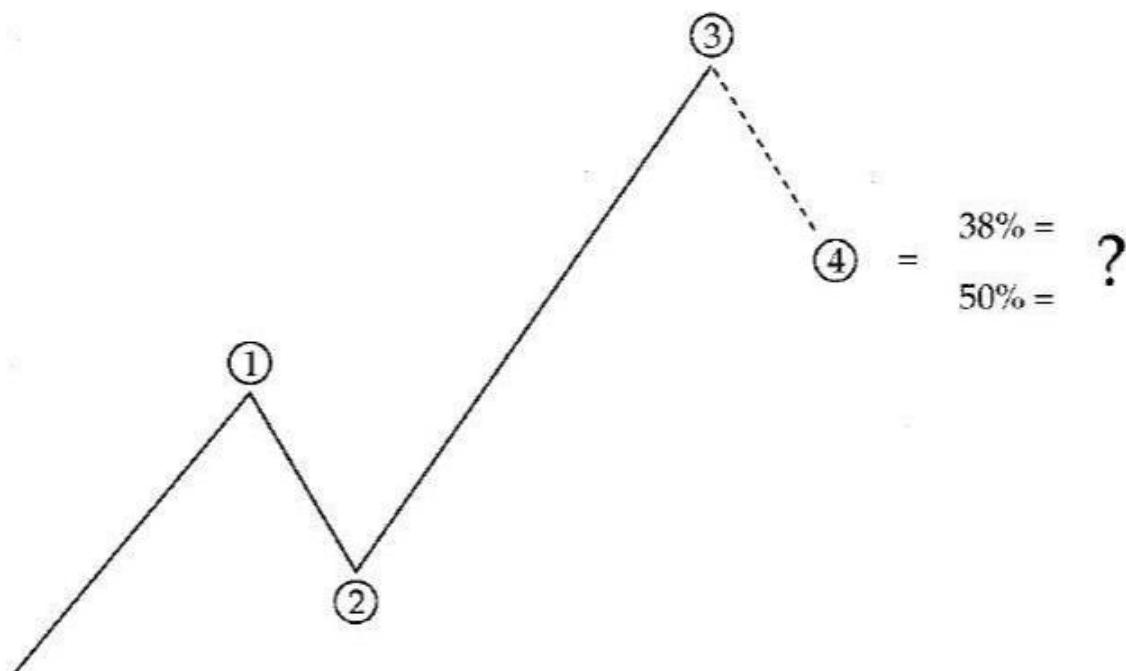


Figure 7-6 Wave 4 retracements.

موج 5 که در شکل سمت راست می‌بینید، آخرین تقلیل تریدرها برای ایجاد High و یا Low قیمت است. این به اندازه موج 3 خوشابند و جذاب نیست. عموماً شبی خط قیمت کمتر از موج 3 است. تریدرها ماهر از این قیمت جدید برای بدست آوردن سود استفاده می‌کنند در حالیکه غیر ماهرها هنوز در ترنده هستند. پایان موج 5 با متدهای مختلفی که قیلاً گفته شد، محاسبه می‌شود. وقتی متدهای مختلف تارگت را در یک منطقه محدود تعیین کردند، اعتبار بالا می‌رود و ما می‌توانیم نقطه ترمینال موج 5 را پیش‌بینی کنیم. طول موج 5 از ته موج 4 اندازه گرفته می‌شود، بنابراین تارگت نهائی را نمی‌توان تا پایان موج 4 تعیین کرد. (فصل بعدی، ترکیب اسیلاتور MFI با موج الیوت نیاز به موج 4 را به حداقل می‌رساند).

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

یکی از دقیق‌ترین تعیین کننده‌های پایان موج 5 منطقه تارگت است. این متند بی‌نهایت مفید و سودده است. تفاوت قیمت بین شروع موج 1 و پایان موج 3 را اندازه بگیرید. سپس این مقدار را به ته موج 4 اضافه کنید. 61.8 درصد طول نقاوت را بدست آورده و به ته موج 4 اضافه کنید. در اکثر مواقع موج 5 بین دو عدد پایان می‌یابد. می‌توانید دقت را با استفاده از همان روش داخل موج پنجم از موج 5 افزایش دهید. این به شما حتی منطقه تارگت کوچکتر را می‌دهد. بطور نرم‌المنطقه کوچکتر از موج 5 داخل موج 5 بزرگتر، داخل منطقه تارگت بزرگتر از موج با درجه بزرگتر قرار می‌گیرد. سپس با اضافه کردن اندیکاتور سودمند فرکتال و اسکووات، بعلاوه دایورجنس بین موج 3 و موج 5، شما می‌توانید نقطه وصول سود و نقطه ورود خیلی دقیق را بدست بیاورید. حرکت کامل موج 1 تا 5 معمولاً ردیف‌های بالاتر خسته شدن توالی موج را کامل می‌کند. بنابراین حرکت از موج 1 تا موج 5، موج 1، موج 3، و موج 5، و توالی C - A - B - موج 2 یا موج 4 را کامل می‌کند. (شکل سمت چپ)

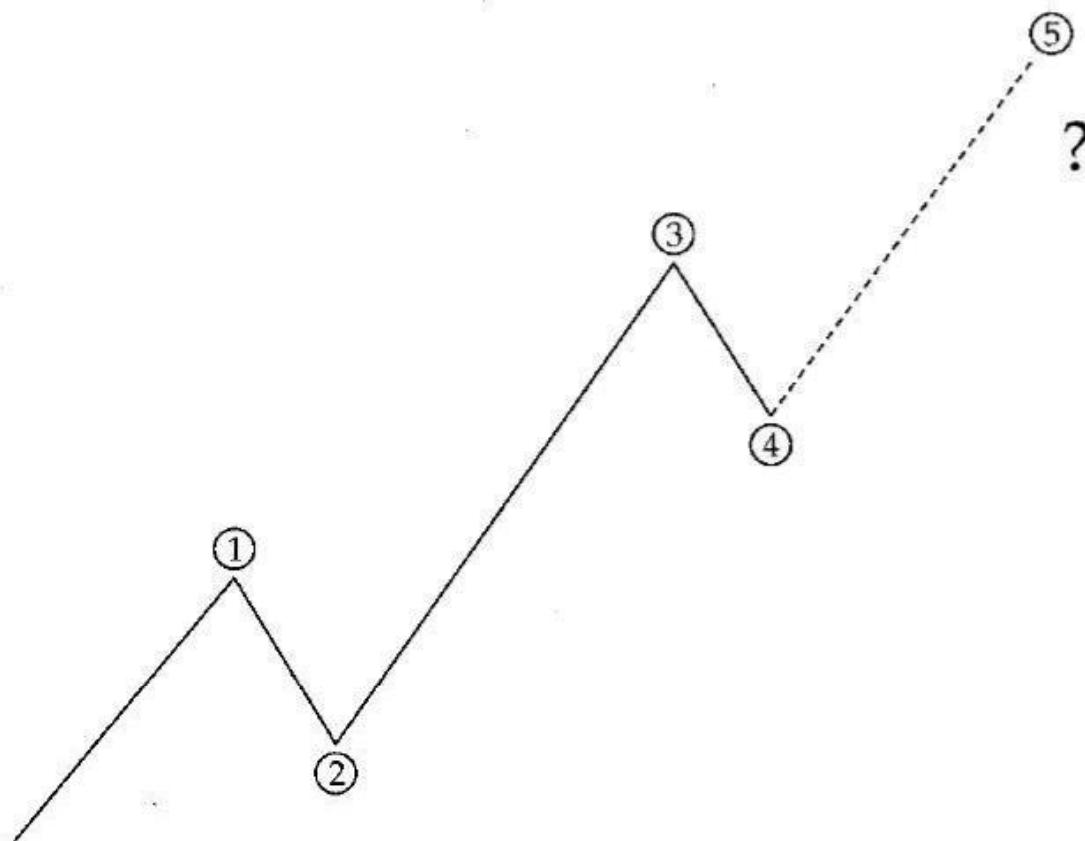


Figure 7-7 Characteristics of wave 5.

ترجمہ کتاب تریدینگ کی اس

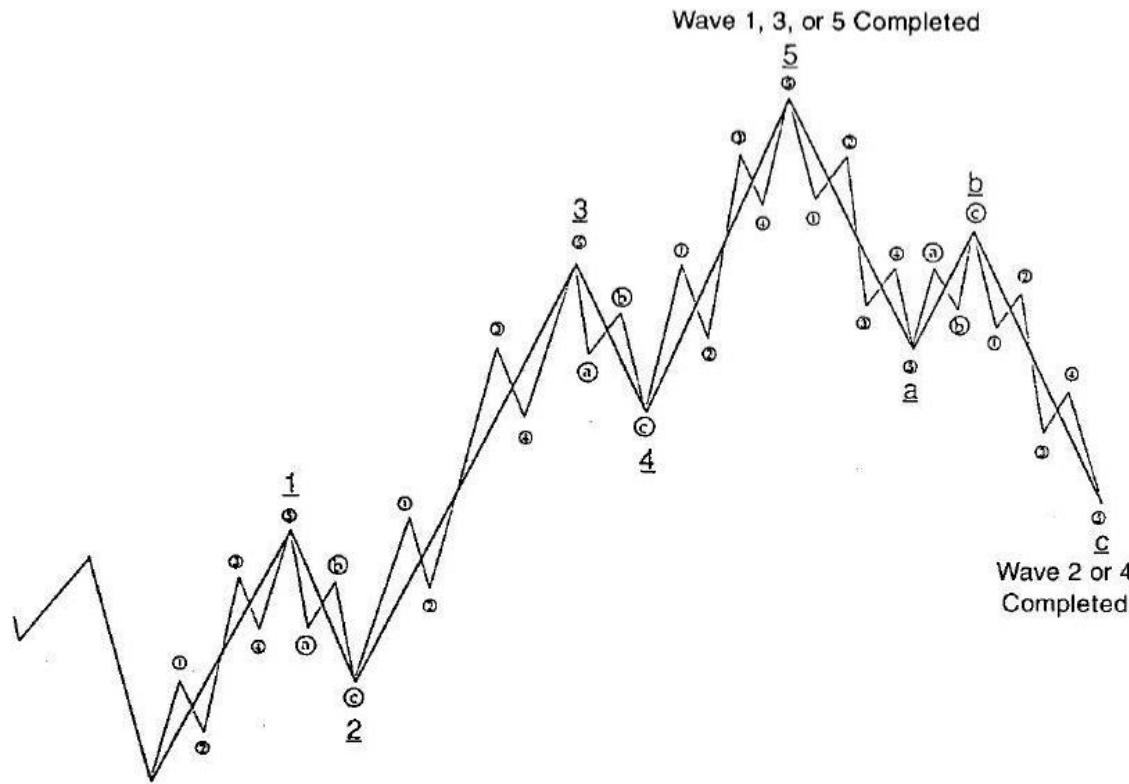


Figure 7-8 Impulse and corrective waves of various degrees.

تصحیح
بطور نرمال بصورت ساده و پیچیده طبقہ بندی می شود. سادہ به تصحیح زیگزاگ، و پیچیدہ به هر چیز دیگر گفته می شود. در سه موج اصلاحی A - B - C صرف نظر از اینکه ساده یا پیچیده باشد، موج B همیشه حاوی سه موج است، و موج C همیشه حاوی پنج موج است. موج A ممکن است حاوی سه یا پنج موج باشد. اگر شامل 5 موج باشد، یعنی تصحیح از نوع زیگ زاگ خواهد بود و اگر شامل سه موج باشد، خیلی محتمل است که صاف، نامنظم، یا مثلث باشد.

تصحیح ساده (زیگزاگ)
وقتی پنج از موج A تمام شد، موج B بطور نرمال بیشتر از 61.8 درصد طول موج A رتریس نمی کند. (شکل اول از سمت راست) در موارد نادر ممکن است تا 75 درصد تصحیح شود. چون موج C مشخصات موج سه را دارد، می تواند یک فرصت ترید بوده باشد. اگر موج B بین 50 و 61.8 درصد موج A پایان یابد، به فرکتال و اسکووات نگاه کنید برای تائید ورود برای ترید موج C. سپس موج C را درست مثل دیگر توالی های پنج موجی ترید کنید. از پنج گلوله بزرگ برای وصول سود در پایان موج C از موج 4 استفاده کنید و برگردید برای ترید موج 5 در جهت مخالف.

- تصحیح پیچیده
سه نوع تصحیح پیچیده وجود دارد:
1. تصحیح صاف (شکل دوم از سمت راست)
 2. تصحیح نامنظم (شکل سوم از سمت راست)
 3. تصحیح مثلث (شکل چهارم و پنجم از سمت راست)

در تصحیح صاف، هر موج تقريباً يكسان (برابر) است. اگر موج B از قله موج A خر فراتر رود، شما می توانيد مظنون به تصحیح نامنظم باشید. تصحیح مثلث، پتنن پنج موجی دارد که A - B - C - D - E می شود. آنها عموماً در توالی بعد از آخرين توالی موج 4 یا موج B اتفاق می افتدند. وقتی مثلث در موج 4 دیده شود، قیمت تمایل دارد در جهت موج ايمپالس 3 که در حال تصحیح است، بپرداز. (شکل دوم از سمت چپ) وقتی مثلث در موج B، دیده شود، قیمت تمایل دارد در جهت موج تصحیح که در حال تصحیح است بپرداز. (شکل سمت چپ)

ما مشخصات و شکل تبییک موج های ايمپالس و تصحیحی را بررسی کردیم. بعد ازاً احتیاج به تکنیک ساده و سودده برای ورود به ترید داریم تا پیش بینی آنالیز دقیق ساختار موج را به حد اکثر برساند.

ترجمہ کتاب تریدینگ کی اس

Wave a of a zigzag pattern is always five waves.

Therefore, if five waves can be identified in wave a, expect a tradable zigzag pattern to materialize.

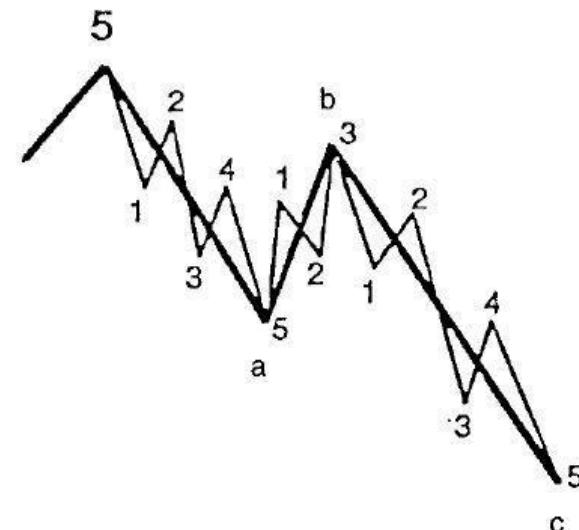


Figure 7-9 Simple (zigzag) correction.

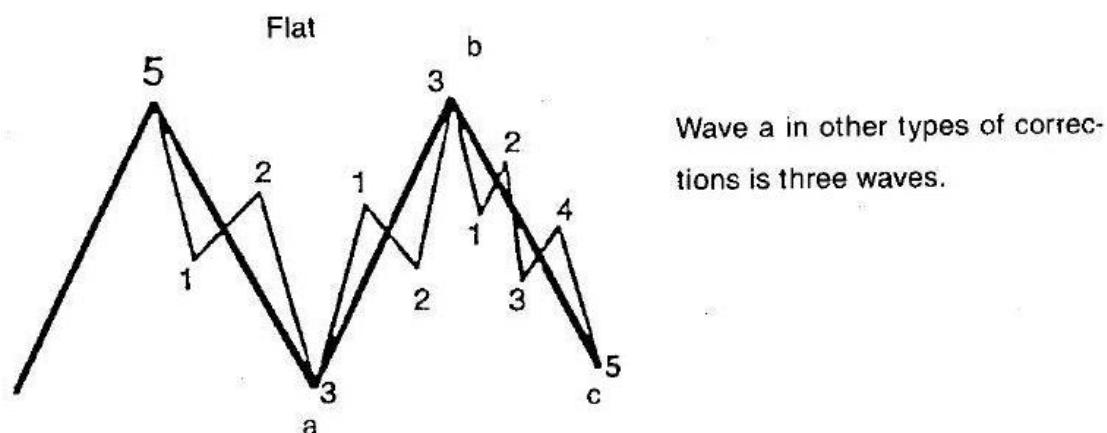


Figure 7-10 Flat correction.

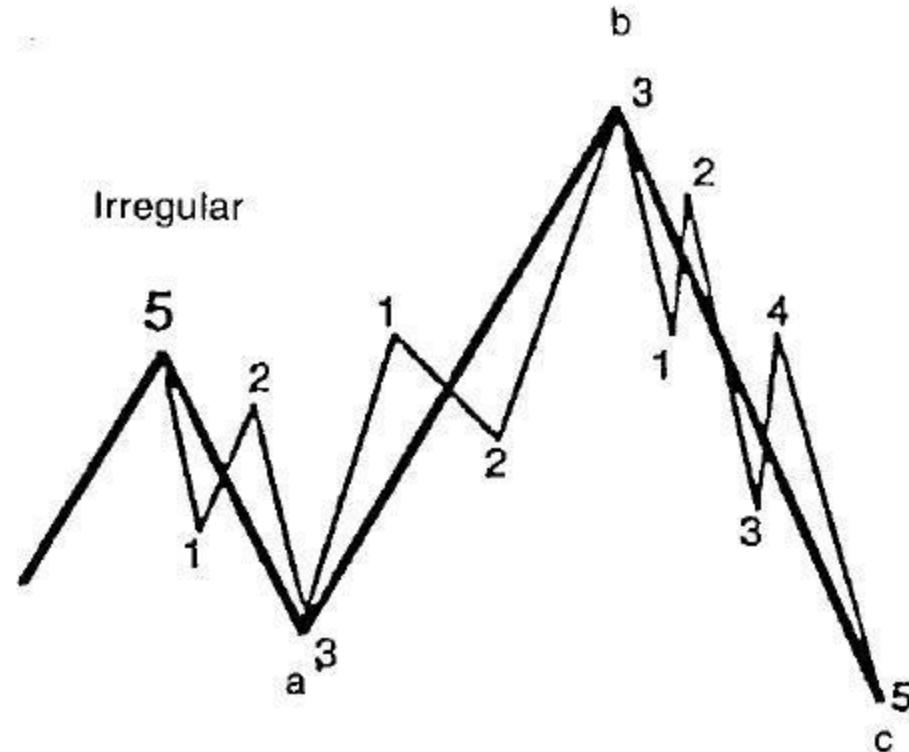
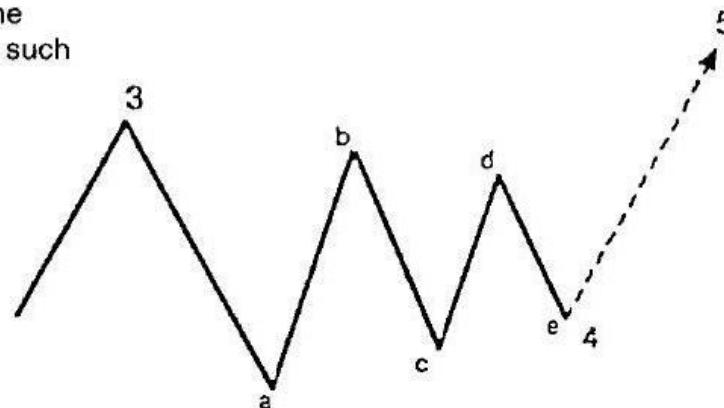


Figure 7–11 Irregular correction.

ترجمہ کتاب تریدینگ کی اس

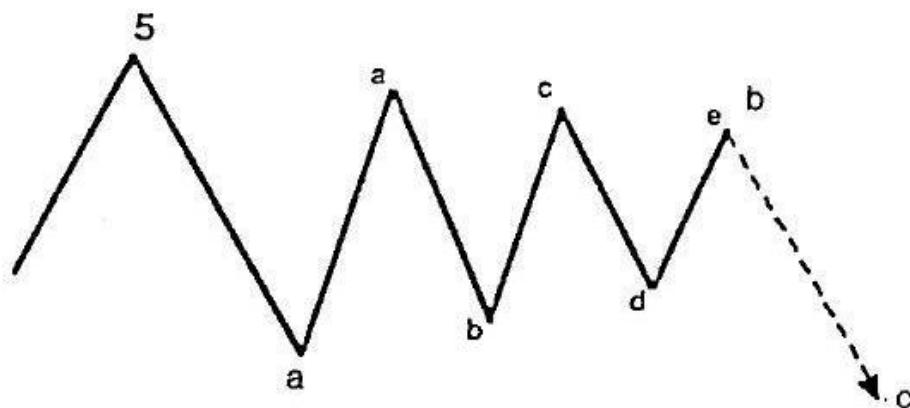
Triangle corrections are five wave patterns labeled a-b-c-d-e.

Triangles usually occur in the next to last wave sequence, such as wave 4 or wave b.



When triangles occur in wave 4, prices tend to shoot out in the direction of the impulse wave 3 being corrected.

Figure 7–12 Wave 4 triangle correction.



When triangles occur in wave b, prices tend to shoot out in the direction of the correction wave a being corrected.

Figure 7–13 Wave b triangle.

خارج شدن از ابهام موج الیوت
من ناتوانی در شمارش موجهای الیوت را به فقدان دانش یا تجربه نسبت می‌دهم. چندین چیز درباره موج الیوت مرا ناراحت

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

می‌کند. اول، الیوت کاران خودشان بطور دقیق شمارش نمی‌کنند؛ آنها تغییر قیمت را که موج را پوشش می‌دهد، شمارش همانند موجی که در شکل 1 از سمت راست نشان داده شده، موجی که دو واحد ارتفاع و دو واحد طول (بعد زمان) دارد همانند موجی که دو واحد ارتفاع دارد و ده واحد طول دارد شمارش می‌شود. یک چیز قطعی است؛ درحالی‌که هر دو بصورت دو واحد ارتفاع شمارش می‌شوند، یک نوع مارکت نیستند. ارتفاع موج همیشه در محور عمودی شمارش می‌شود، و فاکتور زمان در نظر گرفته نمی‌شود. وقتی فاکتور زمان شمارش می‌شود، هر موج یک زاویه قائمه تشکیل می‌دهد. (شکل 2 از سمت راست) با مطالعه این موضوع، من متوجه شدم که رابطه‌ای بین منطقه ایجاد شده توسط تغییر قیمت و زمان هر موج وجود دارد. این مطالعه در اوایل سال 1980 انجام گرفت و از ماشین حساب دستی برای محاسبه این مناطق استفاده می‌کردم. من فهمیدم، اگر منطقه زیر موج 1 را به منطقه موج 2 اضافه کنید. پاسخ شما رابطه فیبوناچی (معمولًا 61.8 درصد) به منطقه موج 3 دارد. پس با کم کردن منطقه موج 4 از منطقه موج 3، شما به انتهای منطقه موج 4 را رابطه فیبوناچی می‌رسید. (صفحه 120 کتاب)

با این آگاهی من از نرم‌افزار کامپیوتری برای محاسبه و بیش‌بینی پایان موج بعدی استفاده می‌کنم. وقتی قیمت شروع و پایانی موج 1 و تعداد کندل در تایم‌فریمی که ترید می‌کنیم (معمولًا کندل یک ساعته) را وارد می‌کنیم، کامپیوتر سه تارگت زمان - قیمت را برای پایان موج 2 محاسبه می‌کند. همچنین براساس احتمالات به ترتیب ردیف می‌کند.

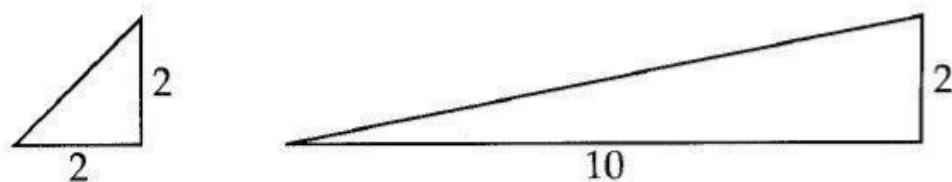


Figure 7-14 Two units high vs. two units wide (left), and two units high vs. ten units wide (right).

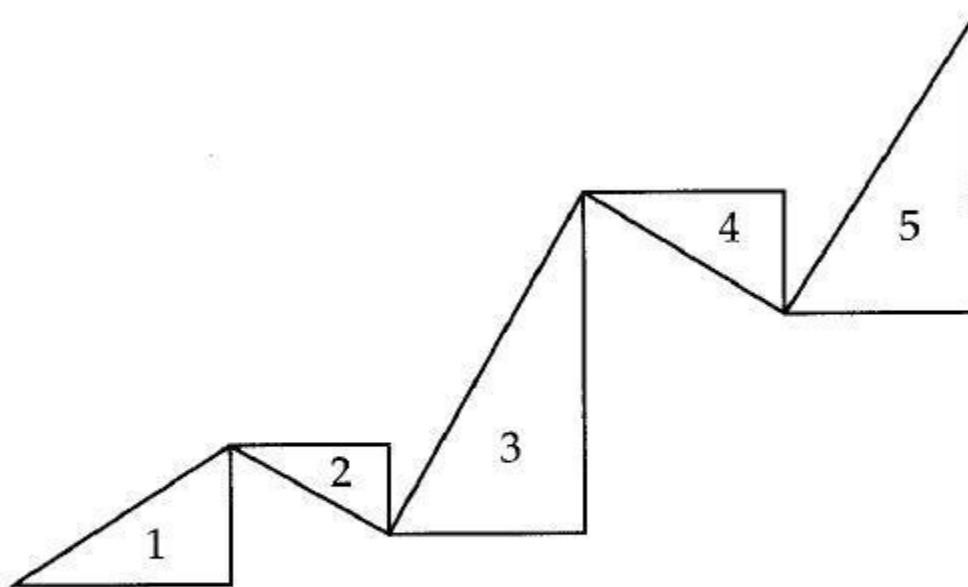
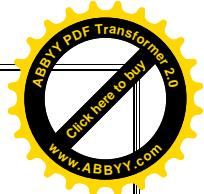


Figure 7-15 Areas beneath the Elliott Waves.



ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

ترکیب MFI با موج الیوت همانطور که قبلاً گفته شد، یکی از اندیکاتورهای کلیدی که ما برای ترید سودده استفاده می‌کنیم MFI است. این اندازه‌گیری اساسی چگونگی مؤثر بودن حجم ترید جاری در حرکت قیمت در طی زمان است. این اندیکاتور تیک شمار است. هر چه بالاتر باشد، تغییر قیمت برای هر واحد حجم بیشتر است. ما می‌خواهیم پولمان را وقتي وارد مارکت بکنیم که قیمت سریعترین حرکت را داشته باشد، تا حداکثر سود را بکنیم. MFI همانطورکه در فصل ششم توضیح داده شد، رنج تقسیم بر حجم است. و پاسخ با پریود زمانی قبلی مقایسه می‌شود. بعد از اینکه سالها با این اندیکاتور کار کردم، متوجه شدم رنج‌های متفاوت در هر موج الیوت وجود دارد.

اکثر تریدرها حتی الیوت کاران حرفه‌ای، گاهی از شمارش موج‌ها در چارت قیمت بار می‌مانند. من راحتتر، دقیق‌تر، و کمتر ذهنی تر موج‌ها را بپیدا و شمارش می‌کنم. فکر بعدی من محاسبه MFI در هر موج، با میانگین گرفتن کندلهای MFI و سپس مقایسه میانگین‌های مختلف برای موج‌های مختلف می‌باشد. من دقیقاً آنچه را که انتظار داشتم، بپیدا کردم. میانگین MFI در موج 3 بالاترین است. در موج 1 و موج 5 این میانگین کمتر است. واضح است که بین قیمت در انتهای موج 5 و میانگین MFI برای موج 5 دایورجنس وجود دارد. اگرچه قیمت در پایان موج 5 بالاتر از پایان موج 3 است، میانگین MFI برای موج 5 کمتر بوده و ایجاد دایورجنس می‌کند. (تصویر پیوست) این دایورجنس یک اندیکاتور پیشرفت‌های برای پایان این سری از ایمپالس‌ها است و تغییر ترند را پیشگوئی می‌کند. با داشتن مجموعه‌ای از پارامترها، ما قادر به ترید با آنها یا ساختن اندیکاتور برای برای تعیین تفاوت بین MFI در هر موج خواهیم بود. این با MFI بطور موفق انجام می‌شود. MFI یک اندیکاتور مومنتوم واقعی در زمان حال است.

اکثر اندیکاتورهای "Off The Shelf" مثل استوک‌های استیک، RSI، ومثال آن، مومنتووم را مقایسه نمی‌کنند. آنها قیمت را با قیمت X کندل قبل مقایسه می‌کنند. آنها میزان عمل قیمت در داخل موج 5 را که داخل موج 3 است، مقایسه نمی‌کنند. بنابراین اندیکاتورهای خیلی قدیمی که امروزه توسعه تریدرها استفاده می‌شود بطور ثابتی پایان ترند را نشان نمی‌دهند، که قاطع‌ترین اطلاعات در ترید است.

Tom Joseph، محقق عالی در تکنیک‌های ترید، یک اندیکاتور مومنتووم خیلی مؤثر را ایجاد کرده است. او مووینگ اوریج 35 را از SMA 5 قدرت جاری مارکت و مووینگ اوریج 35 قدرت مومنتووم را در پریود طولانی تر نشان می‌دهد. اگر اعداد را به اسیلاتور 34/5 تغییر دهیم، ما بی‌نهایت به تفاوتی که در MFI برای هر موج پیدا می‌کنیم نزدیک خواهیم شد. برای مثال، در نظر بگیرید شما الان در موج 3 هستید. مووینگ اوریج 5 میزان حرکت در داخل موج 3 را نشان می‌دهد. این میزان تغییر، مثل MFI، تندتر از هر زمان دیگر در توالی موج الیوت حرکت می‌کند. مووینگ اوریج 35 میزان حرکت یا MFI داخل موج 1 و 2 را نشان می‌دهد. این میزان از تغییر خیلی آهسته‌تر از میزان پریود 5 است و تفاوت بزرگی را بین دو مووینگ اوریج ایجاد می‌کند. موج 3 بالاترین پیک را در اسیلاتور 34/5 ایجاد می‌کند. در طول سال‌ها، ما با این اسیلاتور به چند روش کار کردیم.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

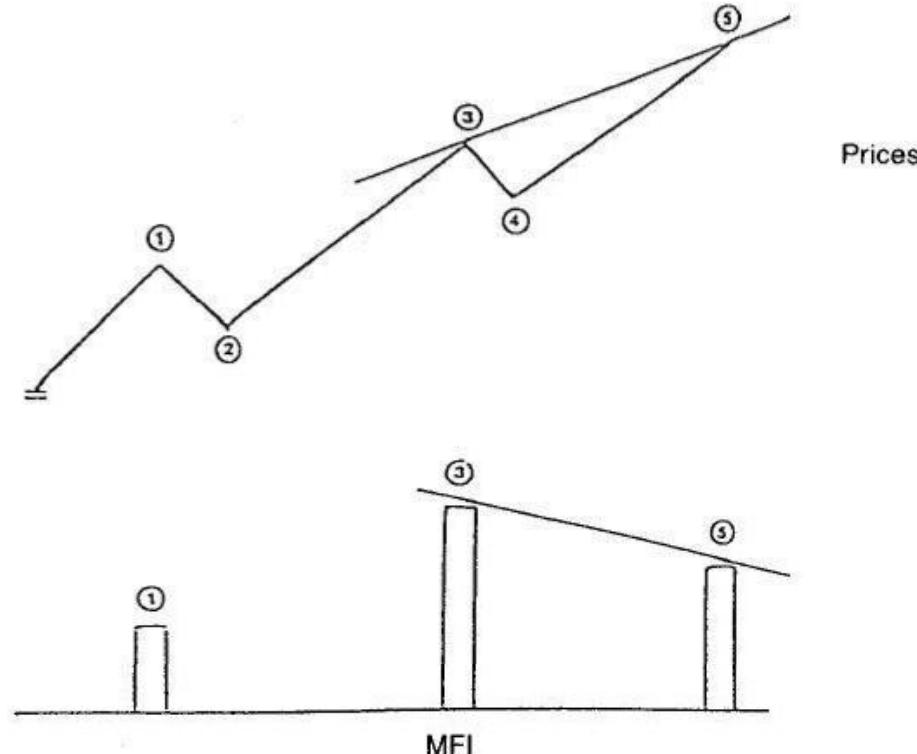


Figure 7-16 Average MFI divergence between wave 3 and wave 5.

ما فهمیدیم که با اضافه کردن موبینگ اوریج با پریود 5 به اسیلاتور الیوت، اسیلاتور به Macd تغییر می‌کند. این موبینگ اوریج "خط سیگنال" یا اندیکیتور ریتم مارکت خواهد بود. (فصل نهم) و به ما تائید بیشتری را برای ترید می‌دهد. آن یک اندیکیتور رهبر است و دقیقاً جائی که مارکت شروع به تمام کردن جریان می‌کند را نشان می‌دهد. این سیگنال قبل از اینکه تغییر جهت (مومنتوم) در قیمت قابل مشاهده باشد اتفاق می‌افتد. 5 Macd 5/34/5 سودده بطور ثابتی به ما می‌گوید که بایستی در کدام طرف مارکت باشیم.

چهار استفاده اولیه برای Macd 5/34/5 سودده وجود دارد:

1. تعیین قله موج 3
2. تعیین پایان موج 4، یا نزدیکترین نقطه به پایان موج
3. جستجوی پایان ترند و قله موج 5
4. سیگنال فوری جهت مومنتوم جاری، یا جهتی از مارکت که تریدها می‌خواهد ترید کنند.

تعیین قله موج 3 در توالی 5 موج، هر دو میانگین Macd 5/34/5 Mfi و Macd 5/34/5 در قله موج 3 به پیک می‌رسند. (تصویر پیوست) اگر ما اسیلاتور 34/5 بشکل هیستوگرام در چارت قرار بدهیم، به آسانی کنلی که در آن پیک اتفاق می‌افتد را می‌توانیم تعیین کنیم. چون تمام اسیلاتورها اندیکیتور تأخیری هستند، پیک موج 3 بالاترین (پائین‌ترین) قیمتی خواهد بود که 1 تا 5 کنل قبل از پیک اسیلاتور اتفاق می‌افتد. بلاfaciale بعد از پیک، هیستوگرام زیر خط سیگنال حرکت می‌کند. خط سیگنال موبینگ اوریج 5 از خود اسیلاتور هست. در این صورت، در گرفتن هر پوزیشن بای دقت کنید: مومنتوم جریان را تمام کرده است. اگر در بای هستید، شما ممکن است که در موج 4 بمانید یا سودتان را وصول کنید و منتظر باشید تا این اسیلاتور حداقل نیاز به تلاقي موج 4 را نشان دهد.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

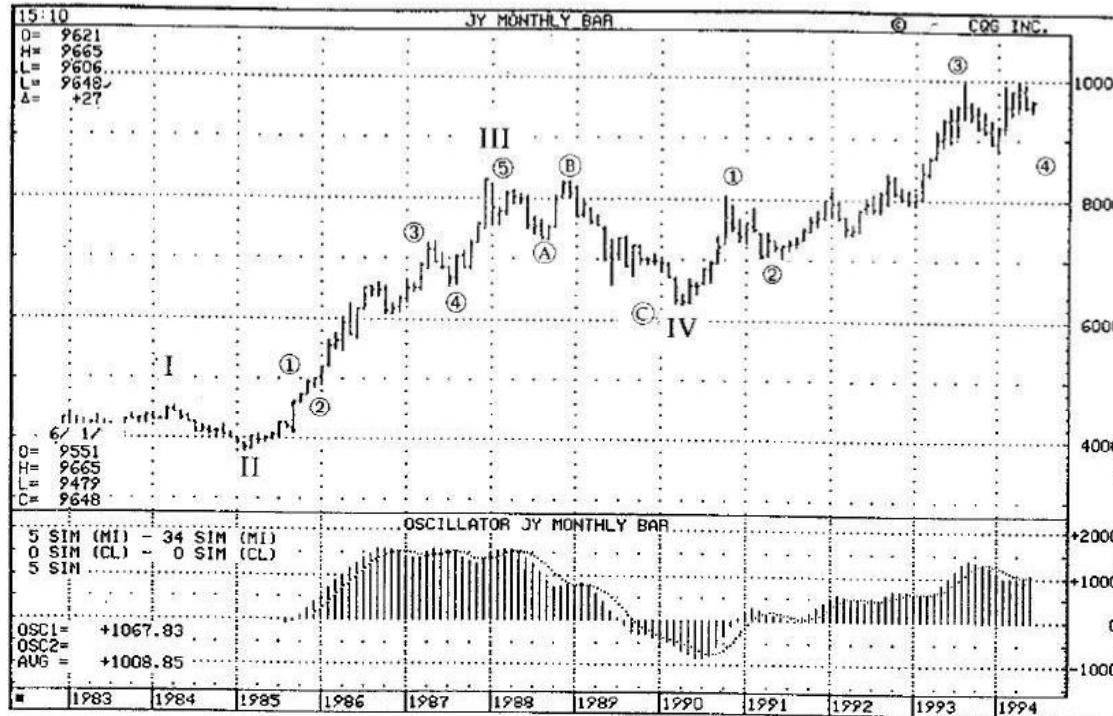


Figure 7-17 The 5/34/5 profitunity MACD peaking on wave 3.

تعیین پایان موج 4 بعد از پایان موج 3، اسیلاتور با رتیس موج 4 برمی‌گردد. هیستوگرام به زیر خط سیگنال می‌افتد، این به ما می‌گوید که اینجا منطقه خوبی برای ورود به پوشش باشد نیست. با وجود این، ما باید یکی از مهمنترین مطالب را اینجا بیاوریم. 5/34/5 اندیکتور خیلی دقیقی برای موج الیوت است، که به فهم چگونگی کار این اندیکتور مکم می‌کند. و همیشه موج الیوت را اندازه می‌گیرد. سؤال اینجاست: کدام درجه از موج الیوت؟ تحقیقات ما نشان داده که برای دقیقترین اندازه‌گیری، موج تحت بررسی بایستی از 100 تا 140 کندل تشکیل شده باشد. اگر ما به توالی موج با کمتر از 100 کندل نگاه کنیم، موج MACD الیوت با درجه بالاتر را اندازه می‌گیرد. و اگر تعداد کنдел‌ها بیشتر از 140 باشد، MACD موج الیوت با درجه کوچکتر را اندازه می‌گیرد. یعنوان مثال، تصویر سمت راست چارت یک ساعته یعنی زبان را نشان می‌دهد، در بررسی حرکت از نقطه X به Y، ما به ترید سودده بعدی نگاه می‌کنیم. در نظر بگیرید شما برای لحظه‌ای در مارکت نبودید. بنظر می‌رسد در 6 روز اخیر موج 5 رو به بالا حرکت کرده است.

1. اولین سوال اینست: آیا مطمئن هستید که موج 4 تمام شده؟ اگر تعداد مناسب کندل (100-140) را در نظر بگیرید، MACD جواب قطعی را به شما می‌دهد. از نقطه X به نقطه Y فقط 33 کندل وجود دارد. توجه کنید، MACD در نقطه A به بیکم می‌رسد اما خط صفر را در نقطه B قطع نمی‌کند. چون ما فقط 33 کندل در چارت یک ساعته داریم و باید حداقل چهار برابر چارت را کوچکتر کنیم به چارت 15 دقیقه (تصویر سمت چپ) تا جواب دقیقتری بگیریم. این تصویر همان ارز را در 15 دقیقه نشان می‌دهد که شامل 102 کندل بین نقطه X و Y است. دو نکته مهم در بررسی این چارت وجود دارد: 1. خط صفر را در نقطه R قطع می‌کند، یعنی حداقل لزوم برای تلاقي موج 4. بنابراین، در اوایل روز در نهم ژوئن، ما بدنبال منطقه خوب برای ورود به باشیم.
2. این چارت اطلاعات حیاتی در مورد آنچه که در بین نقطه P و Q اتفاق افتاده، می‌دهد. دایورجنس وجود دارد، اما اسیلاتور به صفر نرفته است. این نشان‌دهنده است که نقطه P موج 3 از موج 3، و نقطه Q موج 5 از موج 3 است. این داشش شما را از شایع‌ترین اشتباه الیوت کاران: یعنی شمردن موج 3 داخل موج 3 یعنوان پایان موج سوم، و سپس شمردن موج 5 از موج 3 یعنوان رفعه بزرگتر از موج 5 محافظت می‌کند. وقتی این اتفاق می‌افتد، الیوت کاران در نقطه 4 سل می‌کنند. مارکت موج 4 را تمام می‌کند و با خاطر اشتباه در شمارش "Creamed" می‌شود.

ترجمہ کتاب تریدینگ کی اس

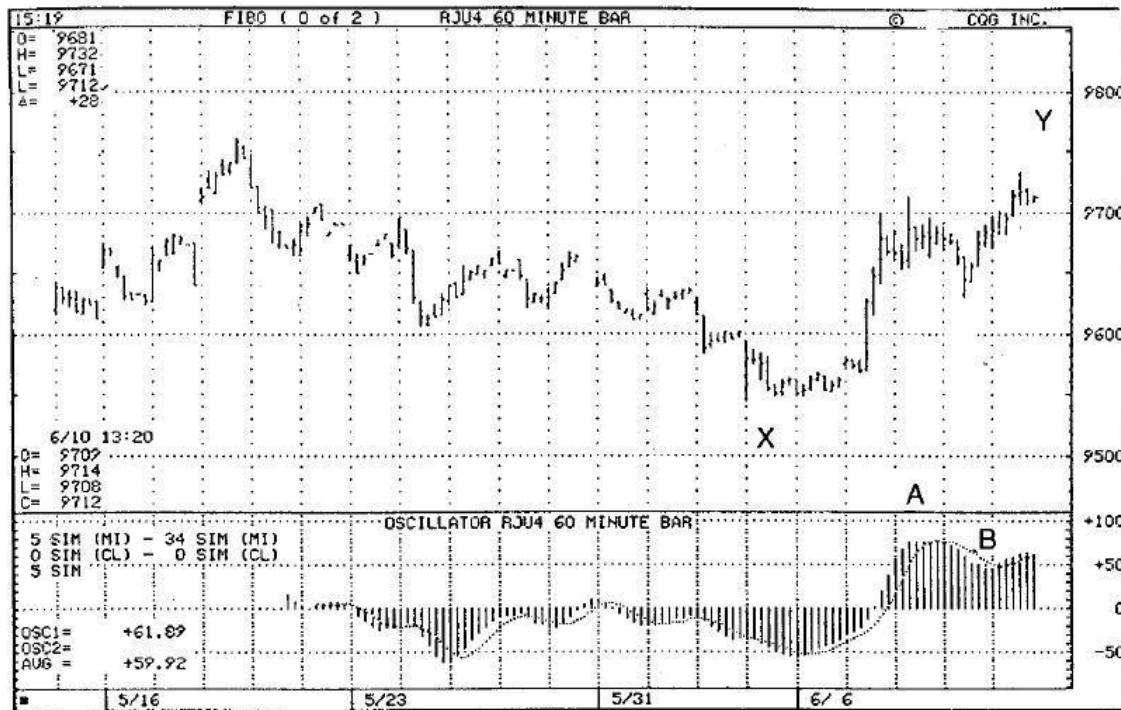


Figure 7-18 Japanese yen, hourly chart.

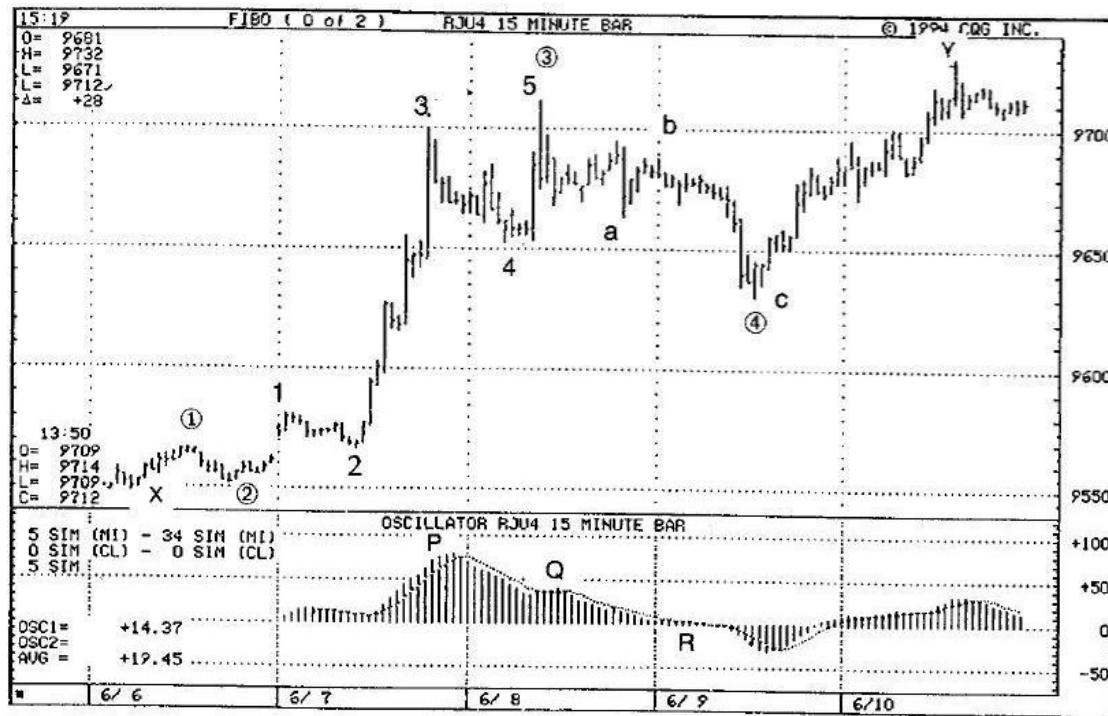


Figure 7-19 Japanese yen, 15-minute chart.

با در نظر گرفتن اینها شما منطقه خوب را براساس قطع خط صفر پیدا می کنید و تعداد کندل مناسبی را برای شمارش دارید، و آماده هستید که وصول سودتان را برنامه بزی کنید. برای شمارش دقیقت موجها بین نقطه 4 و 5، ما باید از چارت 5 دقیقه

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

استفاده کنیم تا تعداد کافی کندل برای شمارش موج 5 از موج 5 داشته باشیم. در تصویر سمت راست می‌توانیم ببینیم که در توجه کنید، و Macd چهارمین موج از موج 5 هستیم. ما کمترین نیاز را برای موج 4 از موج 5 داریم (به فقط خط صفر توسط می‌توانیم منطقه تارکت برای پایان موج 5 را تخمین بزنیم. این سه چارت (تصاویر کامنت قبلی و تصویر سمت راست) ارزش مطالعه دقیق را دارند. اگر شما این مطالب را کامل بفهمید، می‌توانید سودتان را به حداقل و ریسکتان را به حداقل برسانید. ورود و خروج شما اعتمادی در شما ایجاد می‌کند که می‌توانید به سطح بالاتر ترید کنید.

با خاطر داشته باشید، وقتی شما توالی موج را در تعداد مناسبی (100-140) کندل برای شمارش در نظر بگیرید، می‌توانید زمانی را که حداقل نیاز برای تلاقي موج 4 است را تعیین کنید، یعنی وقتی که اسیلاتور خط صفر را قطع کند. یک نکه مهم در اینجا اینست: فقط خط صفر توسط اسیلاتور بعد از پیک موج 3 نشان‌دهنده حداقل نیاز به تلاقي موج 4 است. این به این معنی نیست که موج 4 تمام شده، و برای ترید تا بعد از اینکه اندیکاتور خط صفر را قطع کند، زود خواهد بود. برای افزایش دقت ورود اگر در مثلث است (ترید E یا ۵ نگاه کنید) باید موج آخر C - B - A به ترید در پایان موج 4، به تصحیح مثلث یا داخل موج کوچکتر نگاه کنید.

روش دیگر برای پیش‌بینی پایان موج 4 نگاه کردن به زمان فیبوناچی است. ابتدا فاصله زمانی بین پیک موج 1 و 3 را اندازه بگیرید. سپس این فاصله را در دو نسبت فیبوناچی ضرب کنید. اکثر موج‌های 4 در بین 38.1 و 61.8 برابر طول موج 1 تا موج 3، وقتی از ته موج 2 اندازه گرفته شوند، تمام می‌شوند. گذاشتند تمام اینها با هم منطقه تارکت عالی هم از نظر زمان و هم از نظر قیمت، برای پایان یافتن موج 4 فراهم می‌کند. (تصویر دوم)

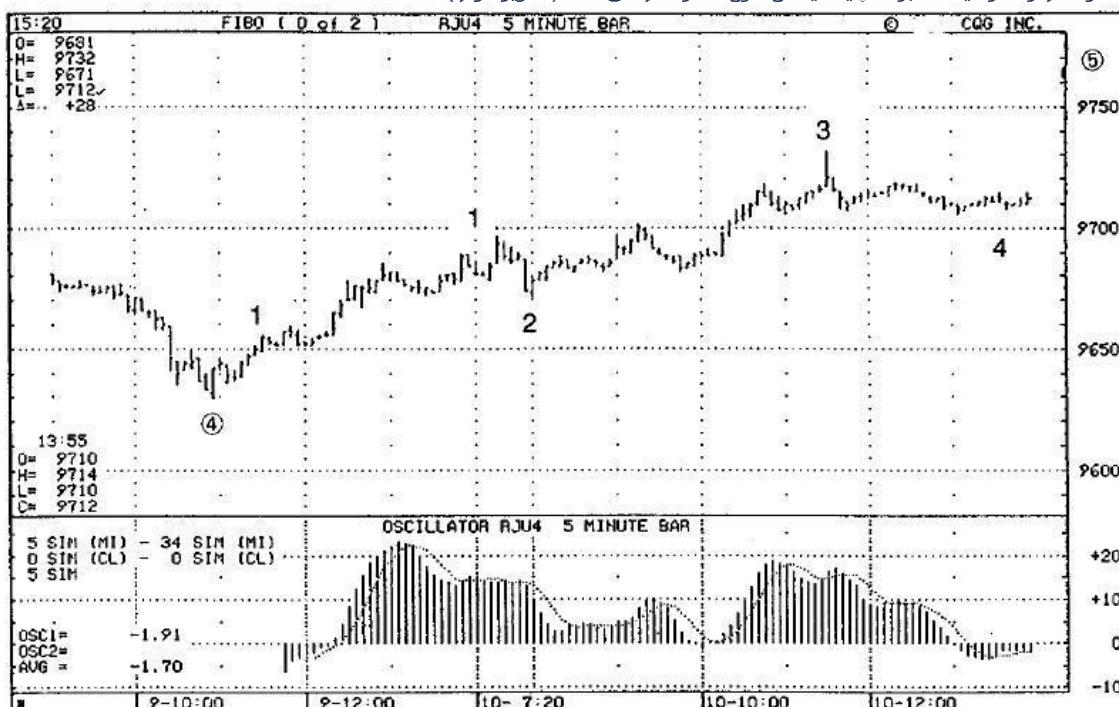


Figure 7-20 Japanese yen, 5-minute chart.

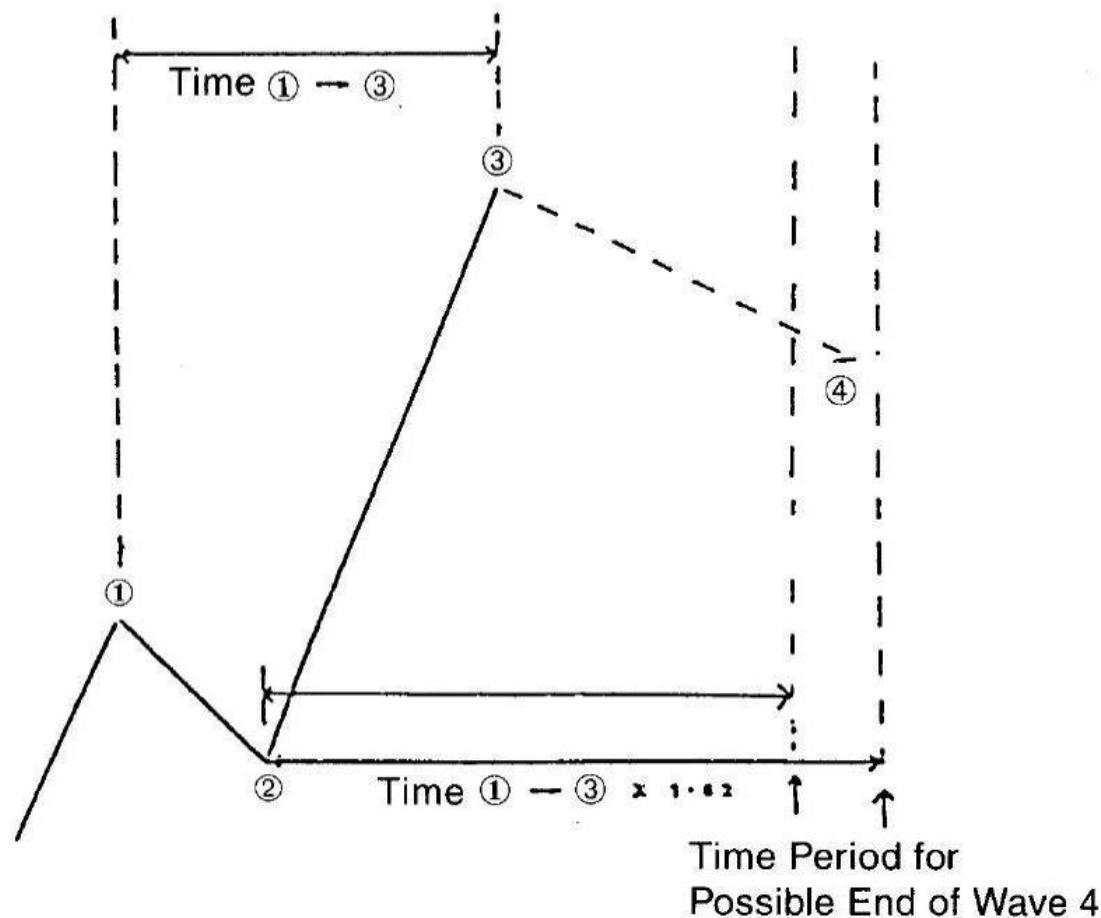


Figure 7-21 A timing model for estimating the end of wave 4.

یافتن پایان ترند و قله موج 5 بعد از پایان یافتن موج 4 و شروع موج 5، می‌توانیم تارگت پایان این توالی 5 موج را تخمین بزنیم. اول، فاصله قیمت را از شروع موج 1 تا پایان موج 3 اندازه بگیرید. این اعداد را به پایان موج 4 اضافه کنید. سپس 62 درصد این فاصله را علامت بزنید. بین این دو عدد (62 درصد و 100 درصد فاصله قیمت از شروع موج 1 تا پایان موج 3، که به شروع موج 4 اضافه شده است)، بهترین تارگت برای پایان موج 5 است. بعداً، 5 موج را داخل موج 5 شمارش کنید. اندازه‌گیریهای بالا را برای هر 5 موج داخل موج 5 تکرار کنید. این منطقه تارگت کوچکتر را برای کامل شدن موج 5 و موج 5 از موج 5 می‌دهد (شکل 1). بخاطر داشته باشید که تمام ترندها در دایورجنس بین high و low اوسیلاتور در پایان موج 5 تمام می‌شوند.

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

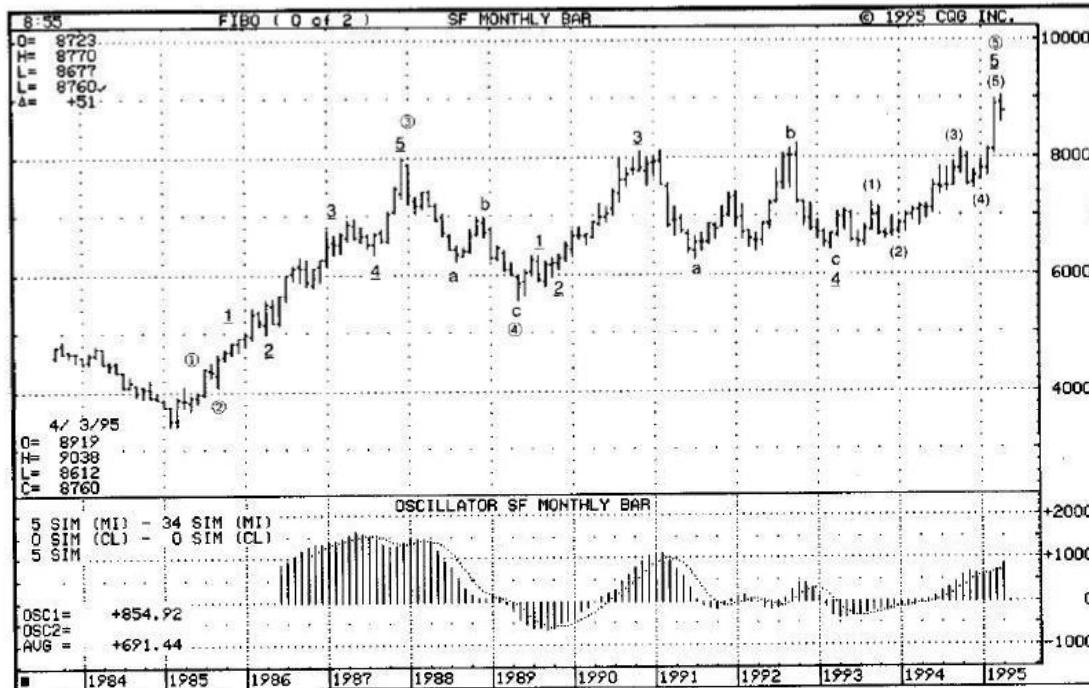


Figure 7-22 The end of wave (5) of wave 5 of wave ⑤.

تعیین فوری جهت مومنتوم جاری اینجا ما باید ابتدا موقعیت نسبی بین هیستوگرام 34/5 اوسلاتور و خط سیگنال (خط سیگنال میانگین متحرک ساده با پریود 5 از اوسلاتور 34/5 است). را تعیین کنیم و سپس فقط در جهت مومنتوم جاری ترید کنیم. (شکل 1). این تکنیک حساس‌ترین و دقیق‌ترین فیلتر برای اندازه‌گیری تغییر مومنتوم است. اگر هیستوگرام زیر خط سیگنال باشد، ما فقط سل می‌گیریم. اگر هیستوگرام بالای خط سیگنال باشد، ما فقط باک می‌گیریم. برای افزایش دقت در شمارش موج به جزئیات بیشتری نیاز داریم. وقتی تعداد کندل (100-140) صحیح باشد و دایورجنس بینیم که به خط صفر نزفته است، آنچه که ما می‌بینیم پیک موج 3 داخل موج 3 بزرگتر است. Macd رتریس خواهد کرد (اما نه به خط صفر)، سپس برگشته و ایجاد دایورجنس می‌کند، به این معنی که آن موج 5 از موج 3 است و بنابراین پیک موج 3 بزرگتر در آن نقطه است. مکرراً، شایعترین اشتیاه الیوت‌کاران این است که پیک موج 5 داخل موج 3 بزرگتر را پایان موج 5 می‌دانند. براساس این خطاب، آنها پوزیشن تازه‌ای را در خلاف جهت می‌گیرند و تکمیل شدن موج 5 واقعی را ناتمام کذاشته و متوقف می‌کنند. بعداز اتمام موج 5 داخل موج 3 بزرگتر، Macd به خط صفر بر می‌گردد برای نشان دادن اینکه حداقل نیاز برای دیدن موج 4 بزرگتر است. موج 4 اغلب نزدیک پایان موج 4 داخل موج 3 بزرگتر تمام می‌شود. اگر این نقطه نزدیک رتریس معمول فیبوناچی باشد، ارزش بیشتری به این تارگت می‌دهد. با کسب مهارت در ترید با Macd، می‌توانید استوک‌هاستیک، Rsi، اندیکتور مومنتوم و ابزارهای مشابه را کنار بگذارید. این پترن دایورجنس بارها هر روز در بازارهای کالا اتفاق می‌افتد.

ترجمہ کتاب تریدینگ کی اس

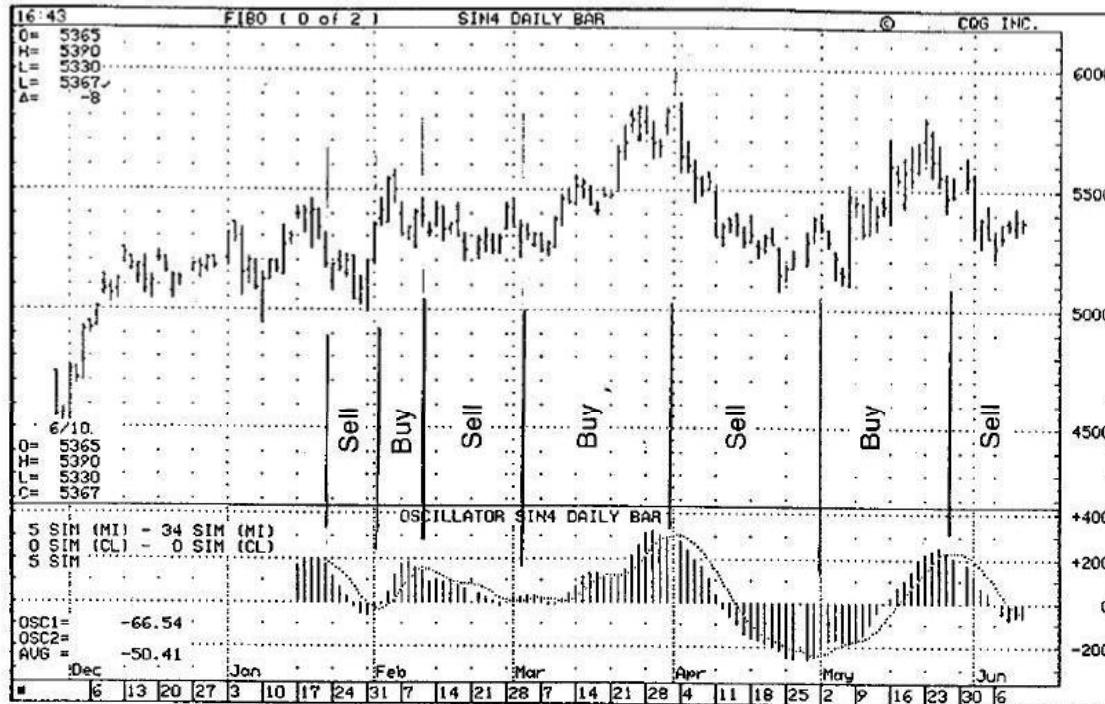


Figure 7–23 Determining the immediate market momentum.

خلاصه در این فصل ما موج الیوت را بر اساس ریتم اساسی جریان مارکت بررسی کردیم. سپس مشخصات هر موج را به تنهایی آنالیز کردیم و ابزاری را برای خارج شدن از ابهام در شمارش موج در اختیار گذاشتیم. ما بر چهار استفاده Macd 5/34/5 در فصل بعدی، ساختار زمینه‌ای موج الیوت، که فرکتال است را بررسی خواهیم کرد. ما یاد خواهیم گرفت چطور موج الیوت را ترید کنیم، حتی اگر ندانیم دقیقاً در کدام شماره هستیم

1. سه قانون شکست نایابیز موج الیوت کدامند؟ کدامیک اغلب شکسته می‌شود؟
2. کدامیک از سه موج تصحیحی بایستی حاوی سه موج باشد؟ کدامیک بایستی حاوی پنج موج باشد؟ کدامیک حاوی سه یا پنج موج است؟ اگر آن پنج موج داشته باشد، نوع تصحیح چگونه خواهد بود؟
3. شایعترین (بنابراین قابل انتظارترین) نسبت فیبوناچی در موج c از تصحیح (a) زیگزاک، (b) صاف، و (c) نامنظم کدام است؟
4. بهترین راه ترید در تصحیح مثلث کدام است؟
5. مشخصات موج‌های 1، 2، 3، 4، و 5 را شرح دهید.
6. کدام اوسيلاتور بيشترین هماهنگی را با MFI دارد؟
7. کدام مزیت MFI امکان استفاده بیشتری از MACD نسبت به یک اوسيلاتور می‌دهد؟
8. کدام اطلاعات حیاتی را خط سیگنال در 5/34/5 MACD می‌دهد؟
9. چهار اطلاعات مهم که MACD برای تیرهای دراز مدت و کوتاه مدت می‌دهد، کدامند؟
10. در چه تعداد از دایورجنس‌ها اکثر ترندوها تمام می‌شوند؟

استفاده از فرکتال و لوریج او گفت: "بیا لیه پرتگاه"
آنها گفتند: "ما می‌ترسیم"
او گفت: "بیا لیه پرتگاه"
آنها گفتند: "ما می‌ترسیم"
او گفت: "بیا لیه پرتگاه"
آنها آمدند
او هل داد
آنها پرواز کردند.
" Guillaume Appolinaire"
اهداف:

1. فهمیدن و تشخیص و ترید کردن پترن‌های شروع کننده و حساس فرکتال

ترجمه کتاب تریدینگ کی اس

2. فهمیدن اینکه چگونه لوریج سیگنال ترید می‌دهد یا ترید بالقوه را کنسل می‌کند. تریدرهای بازار کالا و فروشنده‌های سیستم، مهارت بدست آوردن و بکار بردن هر سیستم تازه را برای ترید دارند. اکثر اوقات، این پیشرفت‌ها سودده نیستند و یک سرگرمی کدرا هستند. در گذشته مارکت از فرمهای مختلف اندیکاتورهای تکنیکال گذرد که یا از بین رفتند یا استفاده نمی‌شوند، چون سودده نیستند.

مارکت یا فرکتال رفتاری، تغییر رفتاری باز را نشان می‌دهد. وقتی شما تصمیم می‌گیرید از تریدی که در ضرر است خارج شوید، جائی که شما خارج می‌شوید کاملاً قابل پیش‌بینی است. شما زمانی خارج خواهید شد که در از دست دادن یک دلار بیشتر، شدیدتر از درد گفتن اینکه اشتیاه کردید باشد. آن نقطه فرکتال رفتاری است. فرکتال همچنین زمانی که شما تلفن را برمهی دارید و به بروکر می‌گوئید اوردر بگذارد دیده می‌شود. فرکتال رفتاری زمانی که تصمیم می‌گیرید این کتاب را بخوانید تا اینکه کارهای دیگری انجام دهید انفاق می‌افتد. تصمیم برای ترید همیشه یک فرکتال رفتاری است. برای ترید سودده ما نیاز داریم که فرکتال رفتاری توهه تریدرهای را تشخیص داده و تغییرات مشرف را در تمایل مارکت بفهمیم. سپس ما می‌توانیم اوردر خود را قبیل یا در اوایل شروع ترند تازه قرار دهیم. ما می‌توانیم فرکتال سایکولوژیکی خودمان را در تمایل شخصی بررسی کنیم، و فرکتال جامعه‌شناسی مارکت را از روی چارت آنالیز کنیم.

پترون شروع کننده فرکتال پترون فرکتال در چارت (در هر تایم فریم) شامل حداقل پنج کندل متواالی است. کندل وسط باید higher (با low) نسبت به دو کندل قبلی و بعدی باشد. شکل 1 از سمت راست:

توجه به محدودیت‌های ذیل مهم است:
1. اگر قله کندل برابر وسط یا قله (ته) کندل باشد، عنوان یکی از 5 کندل شمرده نمی‌شود. چون (higher low) lower high نسبت به کندل وسط ندارد.

2. دو فرکتال مجاور ممکن است در کندل سهیم باشند.
در شکل 1 به پترون A توجه کنید، این فرکتال بالا است و با ⁸ نشان داده می‌شود. پترون B هم فرکتال بالا است، اما همچنین فرکتال پائین است. به این علت که دو کندل قبلی و بعدی کندل "inside" هستند. در پترون C هر دو فرکتال بالا و پائین را داریم که در کندل‌ها سهیم هستند. پترون D برای تشکیل فرکتال بالا به شش کندل نیاز دارد. چون کندل پنجم قله برابر با قله قبلی دارد.

در فرکتال بالا، ما فقط به قله کندل نگاه می‌کنیم. در فرکتال پائین، ما فقط به ته کندل توجه می‌کنیم. وقتی که مارکت حرکت صعودی به طرف بالا دارد، قله تشکیل می‌دهد و سپس نزول می‌کند با دو کندل که قله پائینتری دارد، این مارکت تصمیم فرکتال دارد. شکل 2 از سمت راست. مارکت به نقطه A صعود می‌کند و به هر دلیل برمی‌گردد پائین. باقیستی مارکت دوباره طرف بالا حرکت کند و سپس از نقطه A بگزند، پترون نشان می‌دهد که مارکت نظرش را عوض کرده و تصمیم گرفته از تصمیم قبلی اش که توقف در نقطه A بود دست بردارد. یک تیک بالای نقطه A محل خرید است. هر توالی پنج کندل که در آن کندل وسط بلندتر از (یا پائین‌تر) دو کندل قبل و بعد باشد، فرکتال تشکیل می‌دهد، و وقتی فرکتال تشکیل شد، فرکتال باقی می‌ماند. در طی عمرش، این فرکتال چندین رل بازی می‌کند. از زمانی به زمان دیگر می‌تواند فرکتال استارت، سیگنال، یا استتاب باشد. رلی که فرکتال بازی می‌کند بستگی به محلی که در توالی حرکت رو به بالا یا پائین مارکت قرار می‌گیرد دارد.

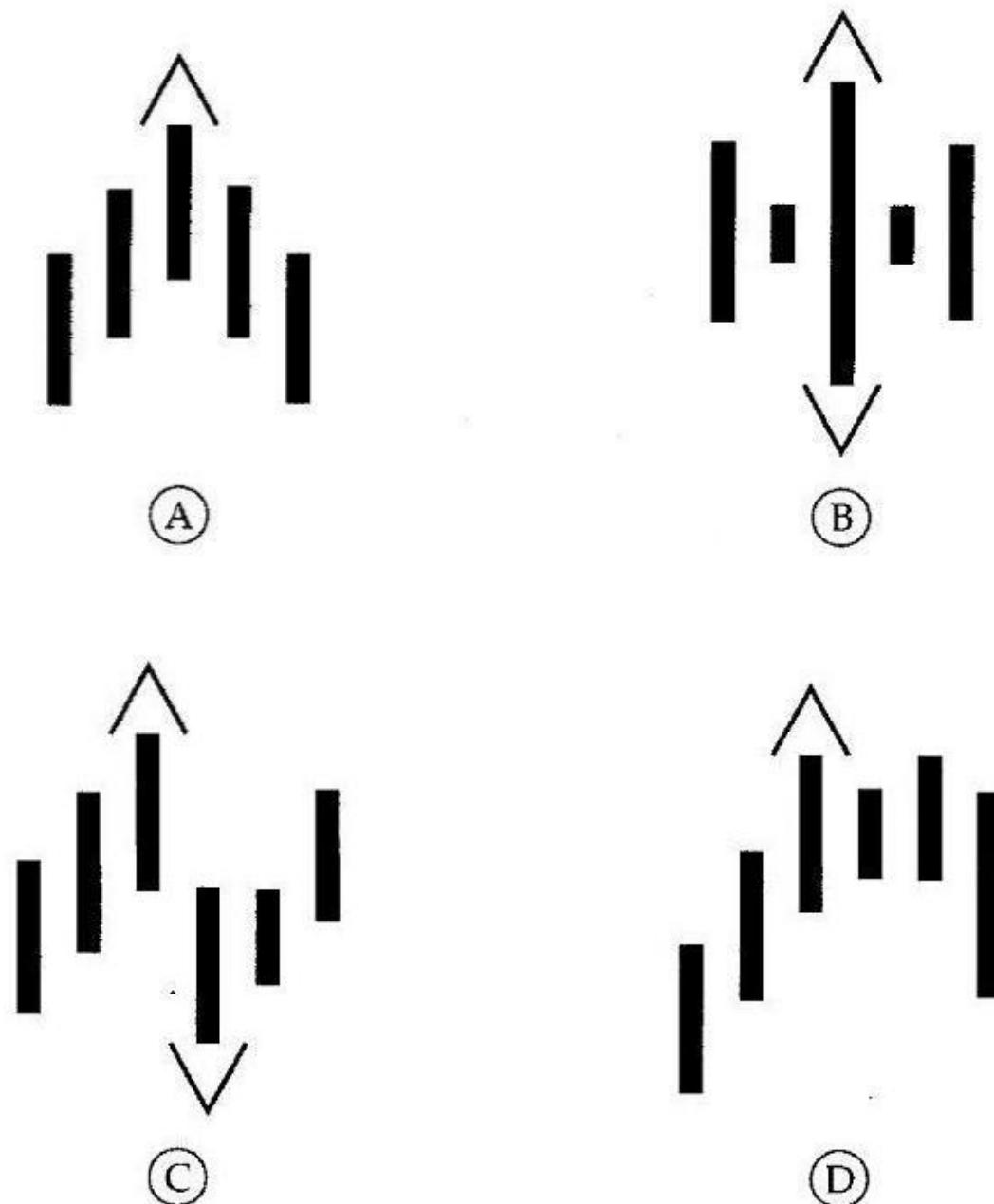


Figure 8-1 Examples of initiating fractals.