

دوره آنلاین تکنیکال پیشرفته فارکس

JNBN

سخنران: جناب آقای مهندس طلایی



جلسه سوم

JNIRN

سخنران: جناب آقای مهندس طلایی



مباحث درسی جلسه ۳

ابر ایچیموکو

ADX

JNIRN

اندیکاتور ایچیموکو

ایچیموکو کینکو هیو از دسته اندیکاتورهای شناسایی روند بازار Market Trend محسوب می شود و می تواند در یک نگاه کوتاه به چارت در کمترین زمان ممکن تصویر خوبی از روند و قدرت روند را در اختیار معامله گر قرار دهد.

ایچیموکو یک نوع نمودار است و نباید مثل اندیکاتور با آن برخورد کرد. معامله گران معمولاً از اندیکاتورها برای راحتی کار استفاده می کنند و تنها تحلیلی که از اندیکاتورهای تکنیکال به دست می آید، سیگنال خرید/ فروش یا سیگنال های مشابه مثل سیگنال تغییرات قدرت روند است. ایچیموکو یک نمودار است و بایستی آن را تحلیل کرد. هر کدام از اجزا نمودارهای ابری اطلاعات جدید و مهمی را در اختیار معامله گر قرار می دهند.

با توجه به تاخیر در صدور سیگنال، معمولاً ایچیموکو برای تایید سیگنال و تشخیص روند مورد استفاده قرار می گیرد.



اجزا نمودارهای ابری در اندیکاتور ایچیموکو هم عبارت‌اند از:

- ۱- تنکانسن Tenkan Sen (میانگین متحرک کوتاه یا قرمز رنگ)
- ۲- کیجون سن Kijun Sen (میانگین متحرک بلند یا آبی رنگ)
- ۳- چیکو اسپن Chikou Span (نمودار خطی قیمت یا خط سبز رنگ)
- ۴- سنکو ای Senkou A (خط قهوه ای- برآورد ۲۶ کندلی میانگین‌های تنکن سن و کیجون سن)
(سن)
- ۵- سنکو بی Senkou B (خط یاسی- برآورد ۲۶ کندلی میانگین اوج و کف قیمتی ۵۲ کندل
اخیر)
- ۶- کندل های شمعی

اندیکاتور ایچیموکو عملاً در سه بازه به بررسی نمودار قیمت می پردازد

۱- بررسی گذشته که توسط خط چیکو اسپن (سبز) انجام می شود. (۲۶ کندل قبل)

۲- بررسی حال که توسط دو خط تنکانسن (قرمز) (۹ کندل قبل) و کیجون سن (آبی) (۲۶ کندل) انجام می شود.

۳- بررسی آینده که توسط سنکو اسپن A (قهوه ای) و سنکو اسپن B (یاسی) انجام می شود.

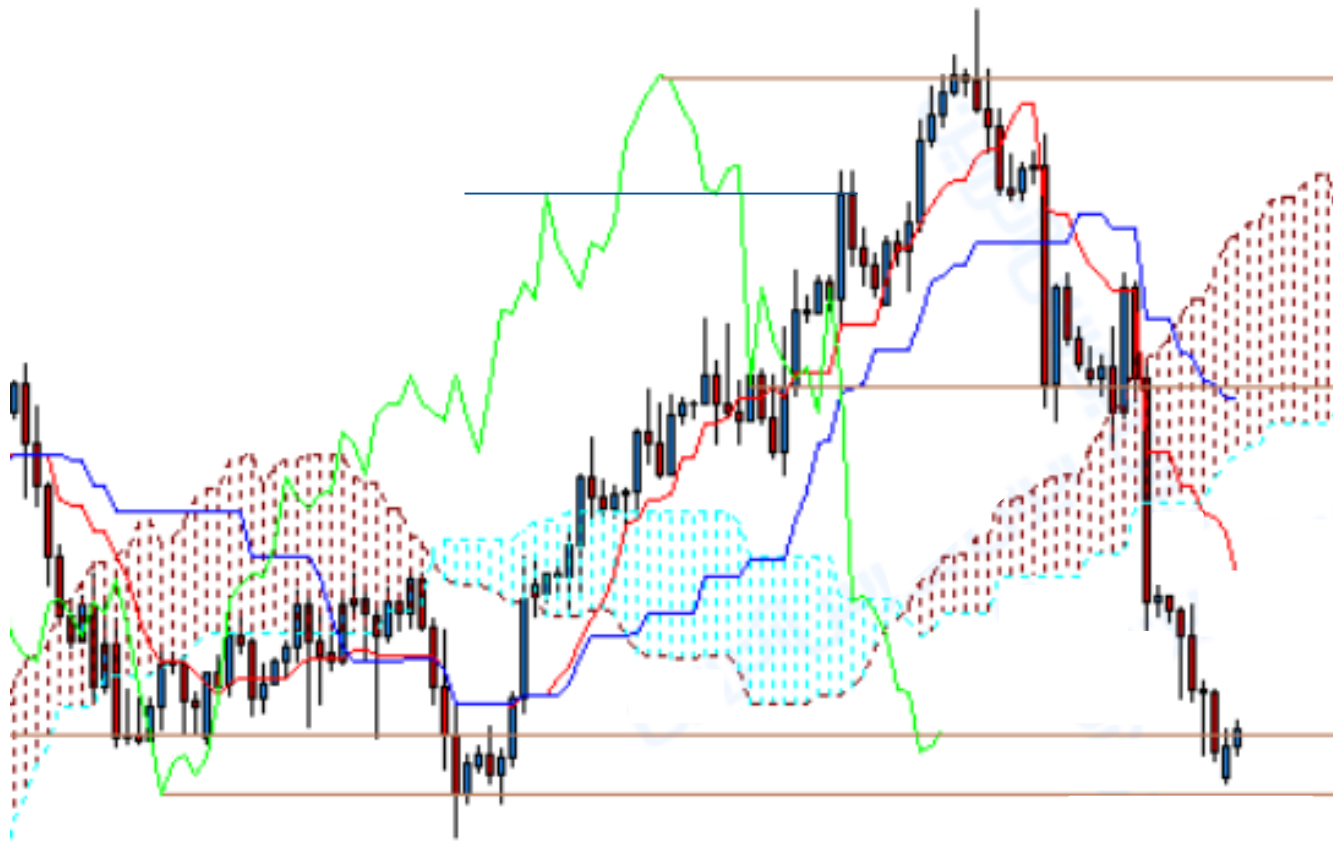
JNIRN

چیکو اسپن

چیکو اسپن یا همان نمودار خطی قیمتی، به تنهایی بخش تاریخی بازار را نشان می‌دهد. بخشی که قیمت فعلی را با قیمت‌های گذشته مقایسه می‌کند و معمولاً نشانگر روند و قدرت روند است. معمولاً چیکو اسپن را با رنگ سبز نشان داده می‌شود. در چیکو اسپن به نکات زیر باید دقت داشت:

- اگر چیکو اسپن بالای نمودار قیمتی باشد، روند صعودی است.
- اگر چیکو اسپن زیر نمودار قیمتی باشد، روند نزولی است.
- اگر چیکو اسپن به نمودار قیمتی نزدیک شده باشد، روند رنج است.

قله ها و حفره های قیمتی چیکو اسپن، سطوح مقاومت و حمایت قوی برای بازار هستند. نمودار قیمت خود برای چیکو اسپن در زمان برخورد حکم حمایت، مقاومت را دارد. بهتر است از ایچیموکو در روند رنج، خصوصاً در تایم فریم پایین استفاده نشود.



سخنران: جناب آقای مهندس طلایی

میانگین متحرک کوتاه یا تنکانسن (Tenkan Sen)

این میانگین متحرک نشانگر حرکات قیمتی کوتاهمدت بازار است. معمولاً برای نمایش این میانگین متحرک از رنگ قرمز استفاده می‌کنیم.

اگر قیمت بالای تنکانسن باشد روند صعودی و زیر آن باشد روند نزولی است. تنکانسن باید با روند بازار در یک جهت باشد و هر چه شیب بیشتری داشته باشد، قدرت روند هم قوی‌تر خواهد بود.

اگر تنکانسن افقی باشد، در این صورت روند کوتاهمدت بازار خنثی خواهد بود. تنکانسن نیز حمایت و مقاومت محسوب می‌شود و شکست آن می‌تواند حرکتی در روند ایجاد کند.

JNIRN

اگر قیمت و تکناسن نزدیک یکدیگر باشند، آنگاه روند به آرامی و بدون نوسان شدیدی ادامه خواهد یافت. اما اگر قیمت از میانگین متحرک کوتاه فاصله زیادی بگیرد، به احتمال زیاد شاهد بازگشت بازار به سمت میانگین متحرک خواهیم بود. در این حالت می‌توان گفت که بازار بیش از حد از وضعیت تعادلی فاصله گرفته و اصطلاحاً بازار در وضعیت اشباع خرید/فروش قرار گرفته است و یا در حال شکل‌گیری قله و حفره است.

JNBN

میانگین متحرک بلند یا کیجون سن (Kijun Sen)

کیجون سن نشانگر حرکات قیمتی میان مدت بازار است. به همین دلیل مورد توجه اکثریت معامله‌گران قرار می‌گیرد. معمولاً کیجون سن را با رنگ آبی نشان می‌دهند.

اگر قیمت بالای کیجون سن باشد، روند صعودی و زیر آن باشد روند نزولی است. شیب بیشتر این خط هم نشان قدرت بازار دارد.

افقی شدن کیجون سن هم به معنی رنج شدن بازار است.

کیجون سن نیز حکم حمایت مقاومت را دارد، مثلاً در موج‌های اصلاحی ممکن است حمایت یا مقاومت تنکاسن شکسته شود و در کیجون سن مورد حمایت یا مقاومت قرار گرفته و مسیر قبلی روند ادامه یابد.

شکست کیجون سن به معنی حرکتی عمیق خواهد بود. در روندهای قوی، نرخ رشد قیمت و کیجون سن تقریباً ثابت است. زمانی که قیمت فاصله زیادی از کیجون سن بگیرد، این احتمال وجود دارد که شاهد بازگشت معکوس بازار باشیم.

سنکو اسپن A

این خط در تنظیمات اولیه متاتریدر با رنگ قهوه ای نشان داده شده است.

سنکو اسپن B

این خط به رنگ یاسی است.

این دو خط تشکیل ابر کومو را می دهند.

JNBN

به ظاهر ابر کومو پیچیده و سخت به نظر می رسد، که با کمی زمان به راحتی قابل استفاده است. در ابر کومو هر چند رنگ ابر می تواند وضعیت سنکو A و سنکو B نسبت به یکدیگر را نشان دهد، اما برای تحلیل بازار از رنگ آن استفاده نمی کنیم. و باید دقت داشت که بازار روند دار باشد.

در تحلیل ابر کومو دو بررسی از نظر زمانی صورت می گیرد. یکی موقعیت قرار گیری نمدار قیمت نسبت به اب کومو که به روند فعلی معروف است و دیگری موقعیت قرار گیری دو سنکو نسبت به هم در بازه فعلی زمانی که قیمت بالای ابر کومو باشد روند صعودی و اگر در زیر قرار گیرد روند نزولی است. زمانی که قیمت در داخل ابر باشد نیز روند رنج است. و در بازه آتی اگر سنکو A بالای سنکو B باشد روند صعودی و در حالت عکس نزولی است. اگر هر دو خط در یک سطح باشند نشان از روند رنج دارد.

اگر ابر کومو صعودی است و هر دو خط سنکو A و B به سمت بالا هستند نشان از این دارد که انتظار بازار صعود قوی است.

در حالت فوق اگر سنکو B افقی باشد انتظار بازار صعود ملایم است.
و نهایتاً اگر ابر کومو صعودی و سنکو A نزولی و سنکو B افقی باشد، انتظار صعودی ضعیف وجود دارد. در این حالت امکان برگشت بازار و شکل گیری قله زیاد است.
عکس حالت های فوق در روند نزولی، انتظار بازار از قدرت روند در آینده را نشان می دهد.
اگر خط سنکو B افقی باشد، محدوده حمایت یا مقاومت قوی قابل مشاهده است و هر چه طول خط افقی سنکو B بلندتر باشد، قدرت حمایت یا مقاومت هم قوی تر خواهد بود.
قله ها و حفره هایی که توسط سنکو A تشکیل شده اند، حمایت یا مقاومت قوی بازار هستند.
فضای بین سنکو A و سنکو B ابر کومو نشانگر میزان نوسانات بازار است. هر چه ضخامت ابر آتی کومو بیشتر باشد، می توان انتظار نوسانات بیشتر بازار را داشت.

هر چه ضخامت ابر کومو بیشتر باشد، یعنی شکستن آن کار سختی خواهد بود. و اگر ضخامت کم باشد احتمال شکست آن هم بیشتر خواهد بود.



بهتر است ابر ایچیموکو با توجه به تاخیر، برای بررسی قدرت و جهت روند مورد استفاده قرار گیرد. از همین رو در سطوح حمایتی مقاومتی با دیدن الگوهای شمعی میتواند در کنار این اندیکاتور یک استراتژی را ایجاد کند. همچنین از پرایس اکشن نیز در کنار ابر ایچیموکو استفاده می شود.

JNBN

اندیکاتور میانگین حرکت جهت‌دار یا ADX

این اندیکاتور تکنیکال برای ارزیابی روند بازار استفاده می‌شود. اینکه بازار روند دار است یا بازار بدون روند، اولویت اول معامله‌گر در استفاده از این اندیکاتور تکنیکال است. بعد از تأیید روند دار بودن بازار و با توجه به وضعیت دو بخش دیگر اندیکاتور، سیگنال معاملاتی صادر می‌شود. هم چنین ADX قدرت روند بازار را هم مشخص می‌کند. سیستم میانگین حرکت جهت‌دار از سه بخش اصلی تشکیل شده است:

۱- شاخص حرکت جهت‌دار میانگین (ADX): این شاخص برای تشخیص نوع بازار (روند دار یا بدون روند) به کار می‌رود.

شاخص حرکت مثبت (DI+): این شاخص قدرت حرکات صعودی را نشان می‌دهد.

شاخص حرکت منفی (DI-): نشانگر قدرت حرکات نزولی است.

این اسیلاتور با دوره ۱۴ و در محدوده ۰ تا ۱۰۰ نوسان می‌کند.

اندیکاتور ADX دارای دو جهت افزایشی یا کاهشی است. اگر ADX افزایشی باشد، بدین معنی است که بازار روند دار است و اگر ADX کاهشی باشد نشانگر بازار بدون روند است.

هر چند این شاخص بین ۰ تا ۱۰۰ نوسان می‌کند ولی به ندرت به بالای خط ۷۵ عبور می‌کند. اگر ADX زیر خط ۲۵ باشد، می‌توان گفت که قدرت روند فعلی بازار ضعیف و به احتمال زیاد بازار بدون روند است. مقادیر بالای ۲۵ تا ۵۰ نشانگر وجود روند در بازار است. مقادیر بین ۵۰ تا ۷۵ نشانگر روند قوی و مقادیر بین ۷۵ تا ۱۰۰ واحد هم نشانگر یک روند بسیار قوی است.

توجه کنید که اگر ADX خط ۲۵ را به صورت صعودی قطع کند، بدین معنی است که بازار در حال خروج از حالت خنثی و ورود به یک روند جدید (صعودی یا نزولی) است. به همین ترتیب اگر ADX به زیر خط ۵۰ عبور کند، نشانگر این است که بازار می‌خواهد از حالت روند دار قوی خارج شود.

ADX به وضوح نشان می‌دهد که روند فعلی بازار تقویت و یا تضعیف می‌شود. اگر قله‌های ADX نسبت به هم بالاتر باشند، به معنای تقویت روند فعلی خواهد بود. هنگامی که قله‌های ADX پایین‌تر تشکیل شوند، به معنای کاهش قدرت روند است.

خط مثبت DI قدرت حرکت صعودی و خط منفی DI قدرت حرکت نزولی را محاسبه می‌کند. برای سیگنال یابی در بازار باید وضعیت این سطوح را نسبت به هم مقایسه کنیم. هنگامی که $DI+$ بالاتر از $DI-$ است، قیمت در حال افزایش است و ADX قدرت حرکت صعودی را نشان می‌دهد. هنگامی که $DI-$ بالاتر از $DI+$ باشد، قیمت در حال کاهش است و ADX هم قدرت حرکت نزولی را اندازه می‌گیرد. هم چنین می‌توان گفت، زمانی که ADX، خطوط $DI+$ و $DI-$ را در جهت نزولی قطع کند و پایین‌تر از این دو خطوط قرار گیرد، یک بازار بدون روند یا خنثی ظاهر می‌شود.

سیگنال‌های معاملاتی

به طور کلی شاخص میانگین حرکت جهت‌دار یا ADX دو سیگنال خرید و فروش صادر می‌کند:

سیگنال خرید

سیگنال خرید زمانی صادر می‌شود که خط $DI+$ از پایین به بالای خط $DI-$ عبور کند. اما این سیگنال زمانی معتبر است که شاخص ADX یکی از وضعیت‌های زیر را داشته باشد:

شاخص ADX بین دو خط DI قرار بگیرد.

مقدار ADX بزرگتر از ۲۵ باشد.

اگر شاخص ADX زیر هر دو خط DI باشد، باید تشکیل کف بدهد و به سمت بالا بازگردد.

شاخص ADX بالاتر از خط منفی DI و شیب آن صعودی باشد.

سیگنال فروش

سیگنال فروش زمانی صادر می‌شود که خط منفی DI از پایین به بالای خط مثبت DI عبور کند و تنها زمانی این سیگنال معتبر خواهد بود که شاخص ADX یکی از وضعیت های زیر را داشته باشد:

شاخص ADX بین دو خط DI قرار بگیرد.

مقدار شاخص ADX بزرگتر از ۲۵ باشد.

شاخص ADX زیر هر دو خط DI باشد و تشکیل کف بدهد و به سمت بالا بازگردد.

شاخص ADX بالاتر از خط مثبت DI و شیب آن صعودی باشد.



سپاس از حسن توجه شما و آرزوی موفقیت روز افزون

JNIRN