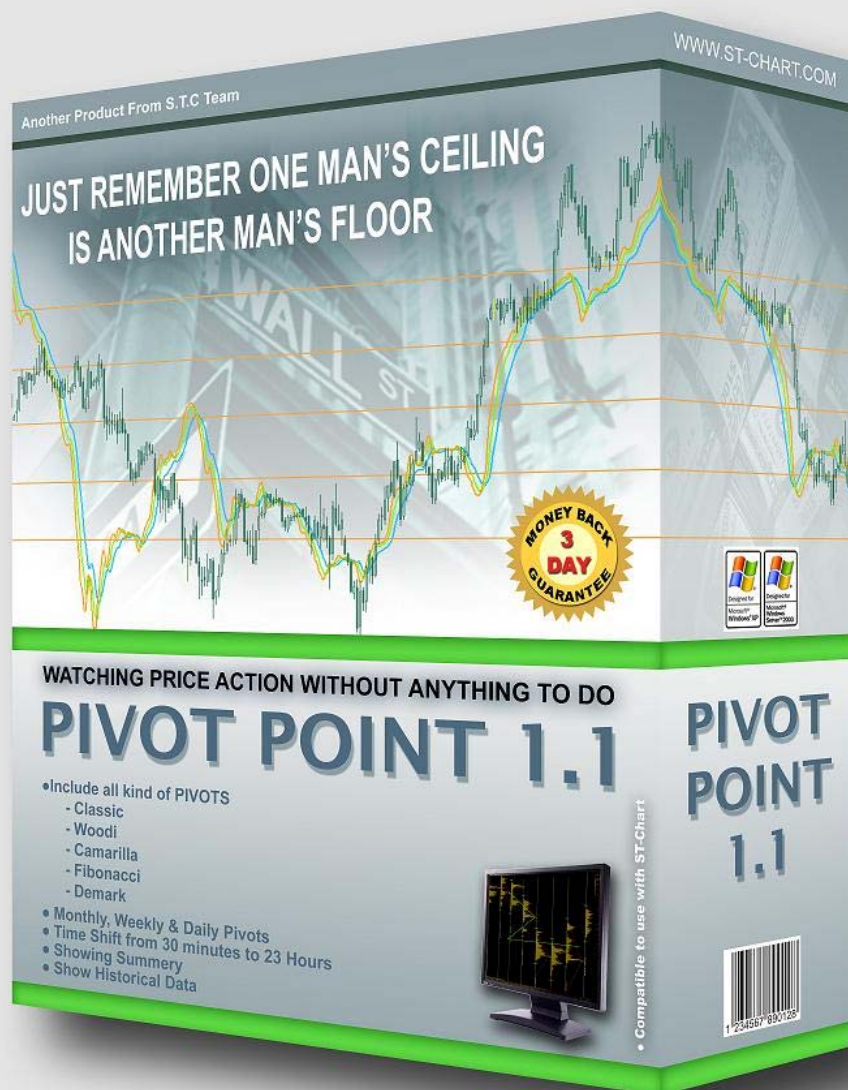


Pivot Pint 1.1

MetaTrader 4 Custom Indicator



اندیکاتور Pivot Point نسخه 1.1

• محاسبه انواع خطوط Pivot شامل :

- Classic PivotPoint
- Woodie
- Camarilla
- Fibonacci
- Demark

• قابلیت رسم خطوط روزانه ، هفتگی و ماه

• امکان انتقال محل شروع محاسبه از 30 دقیقه تا 11 ساعت بصورت بازه های نیم ساعته

• رسم خطوط مشابه در روزهای قبل به تعداد دلخواه جهت Back Test استراتژیهای مختلف

• درج خلاصه ای از وضعیت روز گذشته ، Session مشخص شده قبل و سطوح مربوطه به انتخاب کاربر

Website: www.ST-Chart.Com

Forum: www.STCT.Info or Forum.ST-Chart.Com

Customer Support: Support@ST-Chart.Com

فهرست مطالب این مجموعه

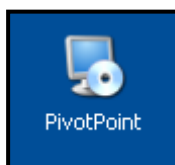
3	■ مراحل نصب اندیکاتور PivotPoint 1.1
6	■ تنظیمات و پارامترهای برنامه
9	■ معرفی خطوط Pivot
9	■ روشهای محاسبه سطوح Pivot
11	■ معرفی برخی از روشهای معامله بر اساس انواع خطوط Pivot
11	■ Pivot point Pullback (Bounce) Trading System
13	■ Pivot point Breakout Trading System
14	■ Camarilla Levels Trading System
19	■ Demark Pivot Trading System
35	■ معرفی انواع واگرایی (Divergence)

Pivot Point Manual

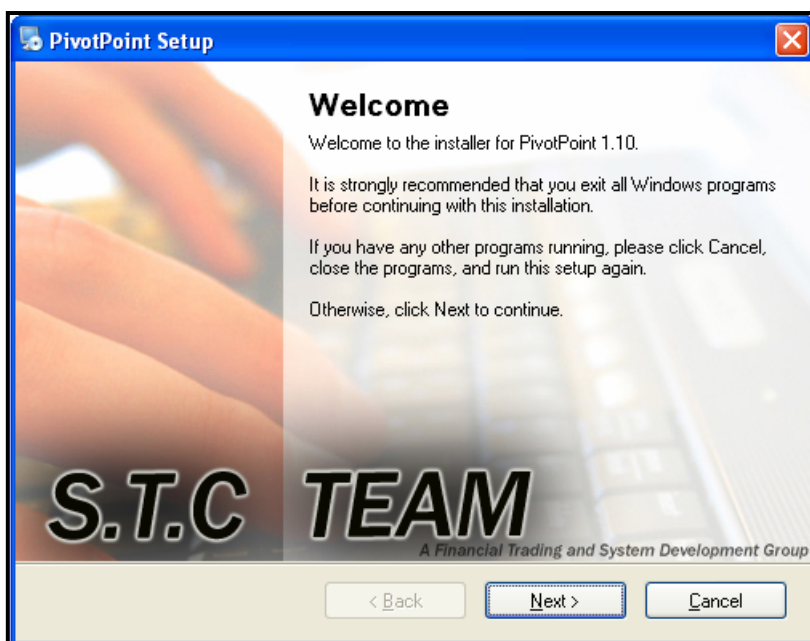
اندیکاتور PivotPoint نسخه 1.1 محصول دیگری از مجموعه STC میباشد که پاسخگوی نیاز کاربران جهت شناسایی سطوح مختلف Pivot در تایم فریم های روز ، هفته و ماه و با امکان شیفت دهی دلخواه و محاسبه سطوح در بازارهای مالی مختلف آسیا، اروپا و امریکا میباشد.

مراحل نصب اندیکاتور

1- پس از دانلود برنامه بر روی آیکون PivotPoint دوبار کلیک کرده تا Installer مربوطه اجرا شود .



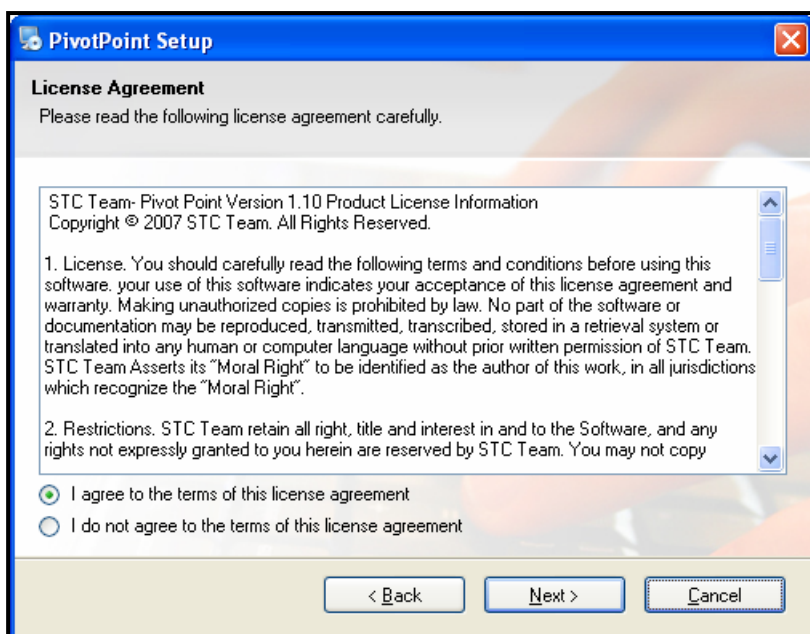
2- به PivotPoint Installer اندیکاتور خوش آمدید. جهت ادامه بر روی Next کلیک نمایید .



3- لطفا قسمت License Agreement را به دقت مطالعه و در صورت پذیرش مفاد آن گزینه

I agree to the terms of this license agreement

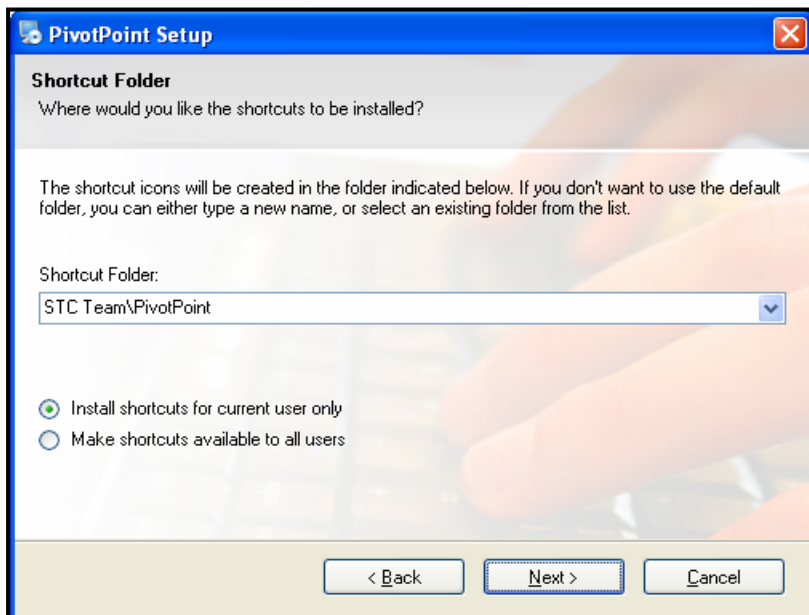
را انتخاب و جهت ادامه بر روی Next کلیک کنید.



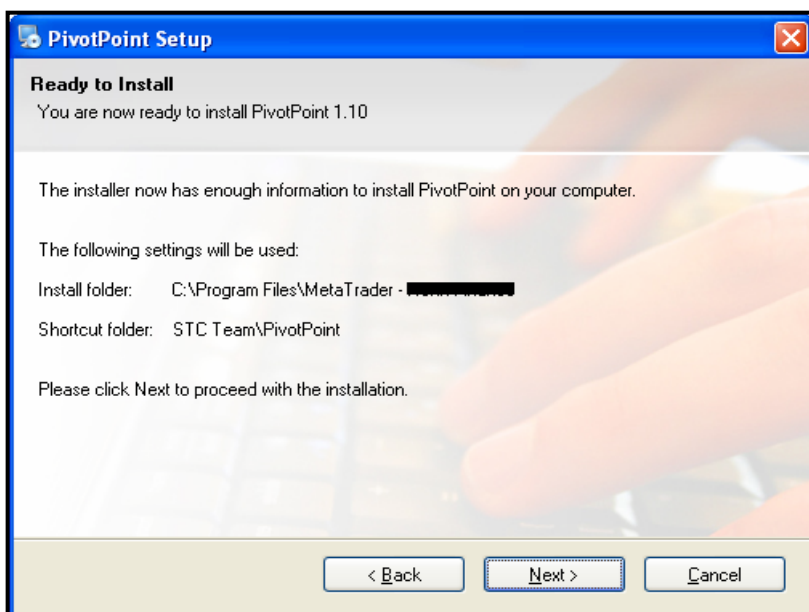
4- در این بخش مشخصات نام کاربری و نام کمپانی شما مشخص گردیده. بدون نیاز به تغییر میتوانید بر روی Next کلیک و به قسمت بعد بروید .

5- در این قسمت پوشه اصلی نرم افزار MetaTrader را با دقت تعیین نمایید .
بدیهی است در صورتی که مسیر اشتباهی را انتخاب نمایید برنامه اشتباه نصب شده و فاقد کارایی میباشد .

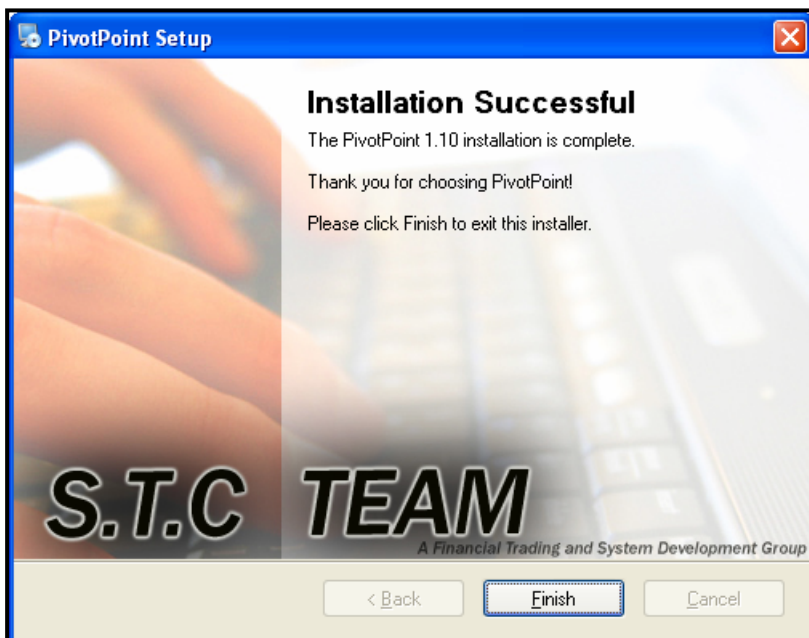
6- در این مرحله مسیر قرار گرفتن Shortcut برنامه مشخص شده است . میتوانید بدون تغییر با فشردن Next به قسمت بعد بروید .



7- در این مرحله مسیر نصب برنامه و کلید میانبر آن جهت تایید نمایش داده میشود . لطفا با دقت مسیر نصب را چک کرده و در صورت صحیح بودن بر روی Next کلیک کرده تا پروسه نصب برنامه آغاز شود .

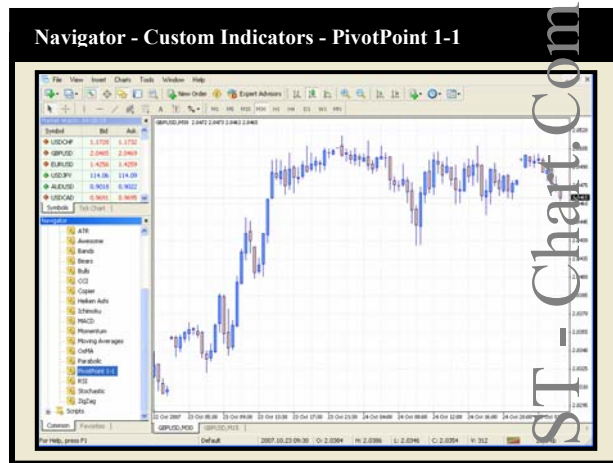


8- مراحل نصب با موفقیت به پایان رسیده است و میتوانید جهت خروج از Installer برنامه بر روی Finish کلیک نمایید .

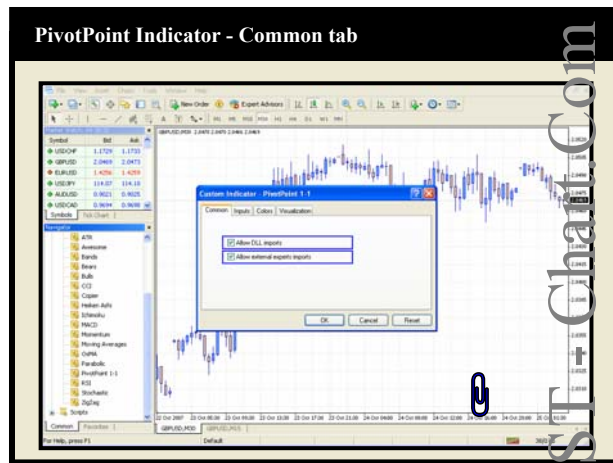


تنظیمات برنامه

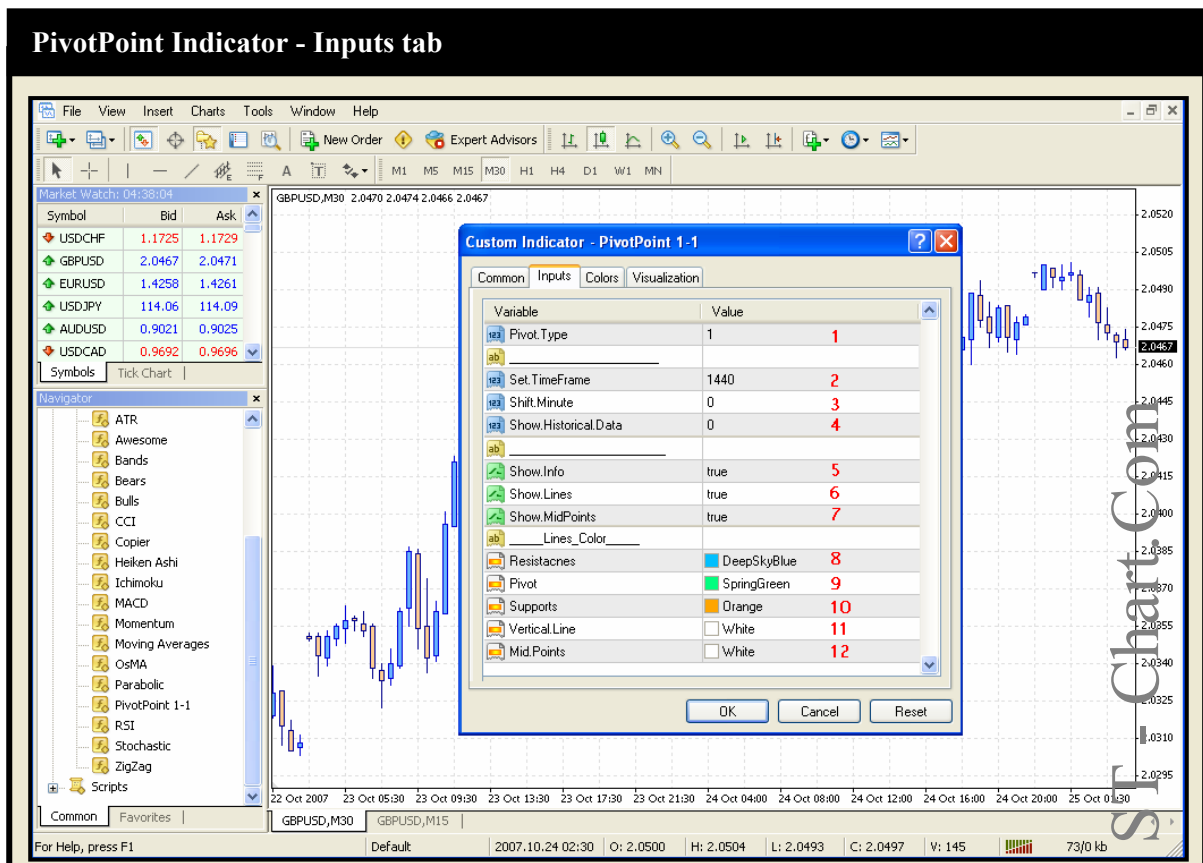
1- ابتدا از طریق منوی Navigator متا ریدر اندیکاتور PivotPoint 1.1 را یافته و جهت اجرا بر روی آن Double Click نمایید .



2- در زبانه Properties گزینه های Allow external imports و Allow DLL Imports را فعال نمایید .



3- در زبانه Inputs می توانید پارامترهای اندیکاتور را به دلخواه و به شرح زیر تنظیم نمایید :



معرفی پارامترهای برنامه**-1 Pivot.Type:**

تعیین کننده نوع خط Pivot میباشد که

- Classic Pivot -1
- Woodie Pivot -2
- Camarilla -3
- Fibonacci -4
- Demark -5

جهت انتخاب هر یک از انواع فوق عدد مربوطه را به عنوان پارامتر مشخص نمایید .

-2 Set.TimeFrame:

از طریق این گزینه میتوانید اقدام به ترسیم Pivot روزانه، هفته و ماه نمایید :

- Pivot - 1440 روزانه
- Pivot - 10080 هفته
- Pivot - 43200 ماه

در وارد نمودن اعداد فوق دقت نمایید و در صورت درج مقداری غیر از اعداد فوق با پیغام خطا مواجه میشوید .

-3 Shift Minute:

با استفاده از این ویژگی میتوانید محاسبات Pivot را بجای ساعت 00:00 به هر ساعت دلخواه منتقل نمایید و با دانستن زمان شروع بازارهای مختلف، سطوح Pivot مختص ان بازار را محاسبه و استفاده نمایید .

این گزینه امکان شیفت دهی را از 30 دقیقه تا 11 ساعت به صورت بازه های 30 دقیقه ای فراهم می آورد به همین منظور پیش از استفاده از کامل بودن data در این تایم اطمینان حاصل نمایید در غیر اینصورت خطوط شما به درستی ترسیم نخواهند شد .

-4 Show.Historical.Data:

یکی از مهمترین ابزار یک معامله گر حرفه ای بررسی روش معامله خود در گذشته با هدف ثبت و بررسی نتایج گذشته میباشد . با استفاده از این ویژگی میتوانید Pivot خاصی را از نظر نوع - تایم فریم - میزان Shift در هر تعداد روز قبل مشروط به تکمیل بودن اطلاعات تایم 30 دقیقه ترسیم و اقدام به BACK TEST نمایید .

عدد صفر تنها خطوط Pivot روز جاری را نمایش داده و با افزودن این مقدار میتوانید خطوط روزهای گذشته را نیز مشاهده نمایید .

مجددا تاکید میگردد از تکمیل و به روز بودن اطلاعات چارت 30 دقیقه نماد مورد بررسی اطمینان حاصل نمایید .

-5 Show.Info:

جهت سهولت در بررسی ، گزینه ای جهت نمایش خلاصه ای از اطلاعات مورد نیاز معامله گر در نظر گرفته شده است که با فعال نمودن آن این گزارش در سمت چپ چارت نمایش داده میشود و با غیر فعال نمودن آن حذف میگرددند .

-6 Show.Lines:

برخی معامله گران جهت تحلیل از ابزار های متعددی بر روی یک چارت استفاده مینمایند که گاهی دیدن چارت را با مشکل مواجه میسازد . با این دید که ممکن است برخی افراد تمایل به ترسیم خطوط Pivot بر روی چارت نداشته باشند این گزینه در نظر گرفته شده است که با غیر فعال نمودن ان خطوط از چارت حذف میگرددند اما محاسبات همچنان ادامه یافته و معامله گر میتواند بدون رسم خطوط نتیجه آن را از طریق گزینه Show.Info بر روی چارت خود مشاهده نماید .

:Show.MidPoints-7

جهت نمایش خطوط میانی پیوت این گزینه را بر روی True قرار دهید و در صورتی که تمایل به نمایش آنها ندارید مقدار مربوطه را به False تغییر دهید .

:Lines Color 12-8

در این بخش میتوانید رنگ دلخواه را برای هر یک از خطوط Pivot ، خطوط حمایت (Supports) ، خطوط مقاومت (Resistances) ، خطوط میانی و خط عمودی جدا کننده هر یک از Session ها را انتخاب نمایید.

تنظیم عمومی بخش مجوز استفاده از DLL ها :

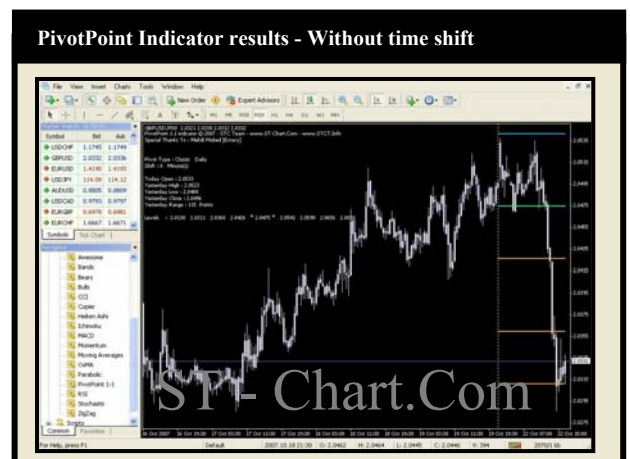
جهت سهولت در استفاده از برنامه هایی که به منابع خارجی نظیر DLL و یا کتابخانه های Mqh احتیاج دارند پیشنهاد میشود مطابق مراحل زیر تنظیمات کلی را انجام دهید تا از تکرار آن برای هر بار اجرای این برنامه ها جلوگیری شود .
از طریق نوار ابزار متا تریدر به قسمت Tools و گزینه Options (کلید میانبر Ctrl+O) رفته و وارد پنجره اختیارات شوید .



به زبانه Expert Advisors مربوط به DLL ها و منابع خارجی را مطابق تصویر زیر تنظیم نمایید .



در پایان با فشردن کلید OK اندیکاتور شروع به کار مینماید و ترسیماتی مشابه تصاویر زیر خواهید داشت .



معرفی خطوط Pivot

حتما به عنوان یک تریدر بارها از زبان تحلیلگران تکنیکال و یا تریدرهای با سابقه شنیده اید که در مورد نزدیک شدن قیمت نماد به سطوحی خاص با عنوان حمایت (Support) و یا مقاومت (Resistance) صحبت میکنند و هشدارهایی نیز به دیگران میدهند .
 هر یک از این خطوط به نوبه خود دارای اهمیت هستند زیرا سطوحی محسوب میشوند که انتظار رسیدن قیمت در حرکات اصلی بازار به آنها میرود . اما این خطوط چگونه توسط تحلیلگران محاسبه و به عبارتی از دل چارت نمایان میشوند ؟
 یکی از روشهای محاسبه سطوح حمایت و مقاومت استفاده از سطوح Pivot که در اصطلاح Pivot Points خوانده میشود میباشد .
 این روش با هدف پیش بینی سطوح حمایت و مقاومت بر اساس محاسبه محل تمرکز روند قیمت در یک بازه زمانی خاص نظیر روز ، هفته یا ماه و محاسبه سطوح دیگر براساس فواصلی خاص استوار گردیده .

روشهای محاسبه سطوح Pivot

در ادامه به بررسی شیوه های مختلف محاسبه این سطوح و فرمولهای مربوطه میپردازیم .

:Classic Pivot

متداولترین روش جهت محاسبه سطوح پیوت میباشد که براساس فرمول زیر قابل محاسبه است :

$$\begin{aligned} R4 &= P + 3 * \text{Range} \\ R3 &= P + 2 * \text{Range} \\ R2 &= P + \text{Range} \\ R1 &= 2 * P - \text{Yesterday Low} \\ P &= (\text{Yesterday High} + \text{Yesterday Low} + \text{Yesterday Close}) / 3 \\ S1 &= 2 * P - \text{Yesterday High} \\ S2 &= P - \text{Range} \\ S3 &= P - 2 * \text{Range} \\ S4 &= P - 3 * \text{Range} \end{aligned}$$

در تمام فرمولهای مربوطه به محاسبه سطوح ، P نشان اختصاری Pivot ، S نشان اختصاری خطوط حمایت و R نشان اختصاری خطوط مقاومت در نظر گرفته میشود . مقصود از Range حد فاصل بیشترین و کمترین قیمت در دوره قبل میباشد که به صورت زیر محاسبه میگردد :

$$\text{Range} = \text{Yesterday High} - \text{Yesterday Low}$$

:Woodie Pivot

در این روش بجای قیمت Close از قیمت Open روز جاری استفاده شده که مطابق فرمول زیر سایر سطوح نیز محاسبه میشوند :

$$\begin{aligned} R4 &= P + 3 * \text{Range} \\ R3 &= \text{Yesterday High} + 2 * (P - \text{Yesterday Low}) \\ R2 &= P + \text{Range} \\ R1 &= 2 * P - \text{Yesterday Low} \\ P &= (\text{Yesterday High} + \text{Yesterday Low} + \text{Today Open} + \text{Today Close}) / 4 \\ S1 &= 2 * P - \text{Yesterday High} \\ S2 &= P - \text{Range} \\ S3 &= \text{Yesterday Low} - 2 * (\text{Yesterday High} - P) \\ S4 &= P - 3 * \text{Range} \end{aligned}$$

:Camarilla

این روش در سال 1989 توسط Nick Stott معرفی شد که تا کنون فرمول اصلی محاسباتی آن در جایی ارائه نگردیده و فرمول زیر فرمولی است که در حال حاضر به عنوان روشی برای محاسبه این نوع پیوت بکار میرود .

$$\begin{aligned} R4 &= \text{Yesterday Close} + (((\text{Yesterday Close} * \text{Range}) / \text{Yesterday Low}) * 6) / 11 \\ R3 &= \text{Yesterday Close} + (((\text{Yesterday Close} * \text{Range}) / \text{Yesterday Low}) * 3) / 11 \\ R2 &= \text{Yesterday Close} + (((\text{Yesterday Close} * \text{Range}) / \text{Yesterday Low}) * 2) / 11 \\ R1 &= \text{Yesterday Close} + (((\text{Yesterday Close} * \text{Range}) / \text{Yesterday Low}) * 1) / 11 \\ P &= (\text{Yesterday High} + \text{Yesterday Low} + \text{Yesterday Close}) / 3 \\ S1 &= \text{Yesterday Close} - (((\text{Yesterday Close} * \text{Range}) / \text{Yesterday Low}) * 1) / 11 \\ S2 &= \text{Yesterday Close} - (((\text{Yesterday Close} * \text{Range}) / \text{Yesterday Low}) * 2) / 11 \\ S3 &= \text{Yesterday Close} - (((\text{Yesterday Close} * \text{Range}) / \text{Yesterday Low}) * 3) / 11 \\ S4 &= \text{Yesterday Close} - (((\text{Yesterday Close} * \text{Range}) / \text{Yesterday Low}) * 6) / 11 \end{aligned}$$

$$\text{Range} = \text{Yesterday High} - \text{Yesterday Low}$$

در بخشهای بعدی به تفصیل در مورد روشهای معاملاتی براساس انواع خطوط پیوت مخصوصا خطوط Camarilla صحبت خواهیم کرد .

Fibonacci

در این شیوه درصدهای فیبوناچی به عنوان ضرایب سطوح در نظر گرفته شده اند که به شیوه زیر محاسبه میشوند :

$$\begin{aligned} R3 &= P + \text{Range} * 1.000 \\ R2 &= P + \text{Range} * 0.618 \\ R1 &= P + \text{Range} * 0.382 \\ P &= (\text{Yesterday High} + \text{Yesterday Low} + \text{Yesterday Close})/3 \\ S1 &= P - \text{Range} * 0.382 \\ S2 &= P - \text{Range} * 0.618 \\ S3 &= P - \text{Range} * 1.000 \end{aligned}$$

$$\text{Range} = \text{Yesterday High} - \text{Yesterday Low}$$

Demark

در این روش تنها دو سطح به عنوان سطوح هدف معرفی گردیده اند که در برنامه با همان عناوین R1 و S1 مشخص میگردند و به روش زیر محاسبه میشوند :

$$\text{Range} = \text{Yesterday High} - \text{Yesterday Low}$$

Scenario 1:

$$\text{Yesterday Close} > \text{Yesterday Open} \quad P = (\text{Yesterday High} + \text{Yesterday High} + \text{Yesterday Low} + \text{Yesterday Close})$$

Scenario 2:

$$\text{Yesterday Close} < \text{Yesterday Open} \quad P = (\text{Yesterday High} + \text{Yesterday Low} + \text{Yesterday Low} + \text{Yesterday Close})$$

Scenario 3:

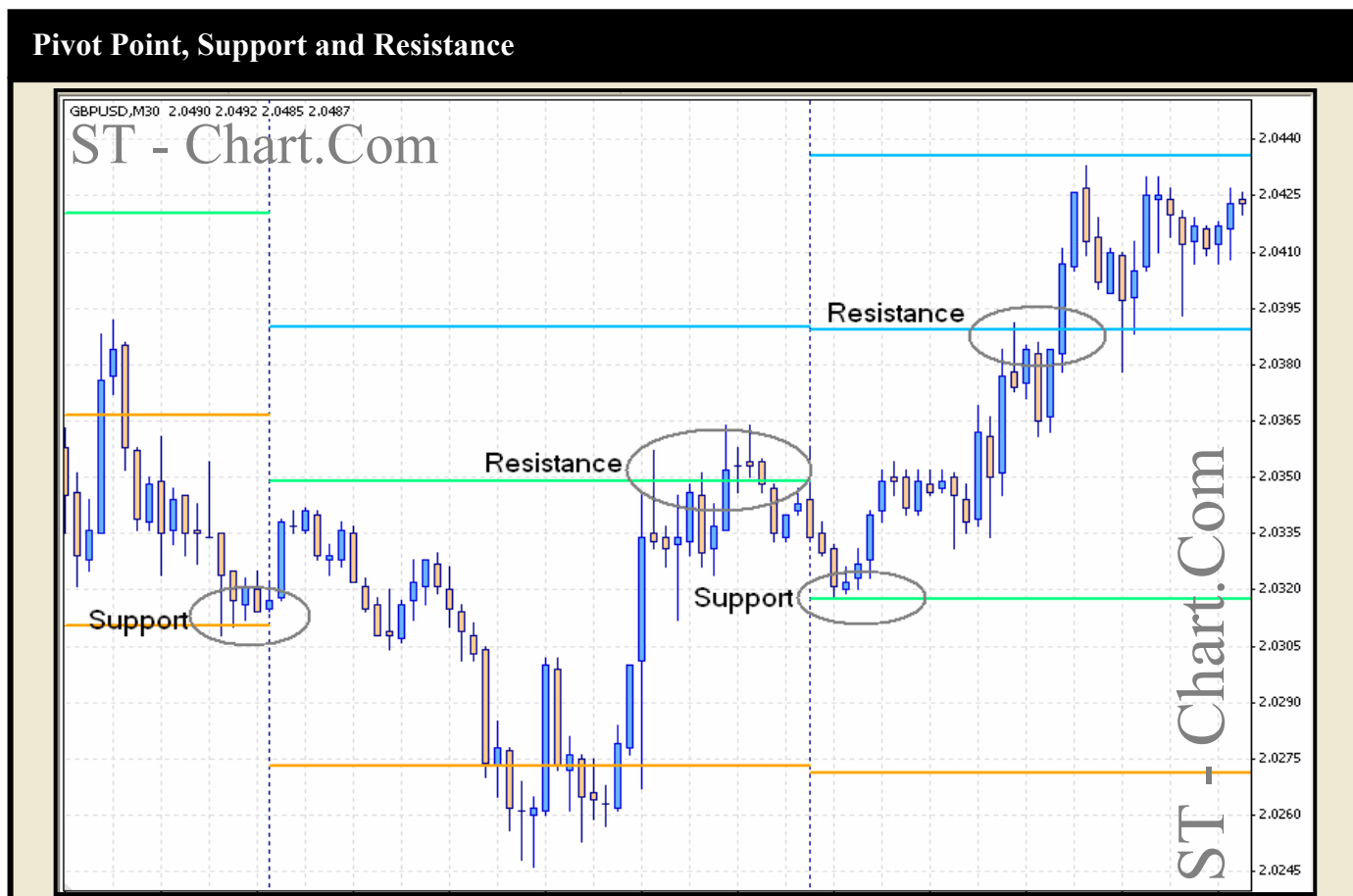
$$\text{Yesterday Close} == \text{Yesterday Open} \quad P = (\text{Yesterday High} + \text{Yesterday Low} + \text{Yesterday Close} + \text{Yesterday Close})$$

$$R1 = P/2 - \text{Yesterday Low}$$

$$S1 = P/2 - \text{Yesterday High}$$

همانطور که در صفحات قبل اشاره شد تمام روشهای محاسباتی فوق جهت شناسایی سطوح حمایت و مقاومت میباشد .

در تصویر زیر کیفیت خطوط پیوت کلاسیک به عنوان مثال در یک بازه محدود نشان داده شده است و به خاطر داشته باشید نقش هر یک از این سطوح هنگام شکسته شدن توسط قیمت از حمایت به مقاومت و برعکس تغییر میابد .



معرفی برخی از روشهای معامله بر اساس انواع خطوط Pivot

Pivot point Pullback (Bounce)

در این روش از تایم فریم های کوچک به همراه خطوط Pivot روزانه استفاده میگردد .

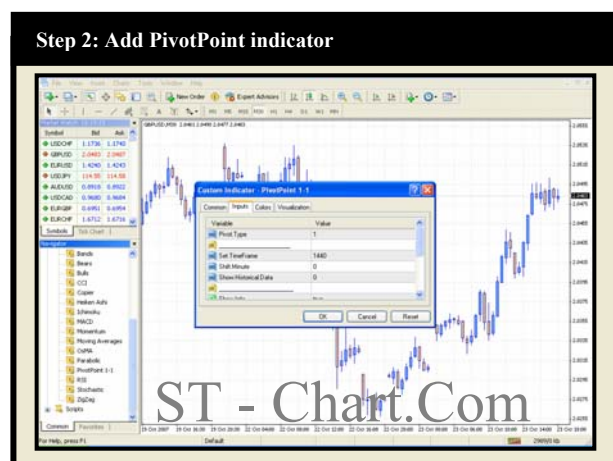
هرگاه قیمت به یکی از سطوح پیوت نزدیک میشود خصوصا اگر برای اولین بار در هر یک از جهت های صعودی یا نزولی باشد گرایش به بازگشت (Reverse) دارد و به خاطر همین بازگشت تحت عنوان سیستم معاملاتی pivot point bounce نام نهاده شده است .

برای این منظور :

1- چارت دلخواهی را برای معامله انتخاب کنید



2- اندیکاتور PivotPoint را جهت رسم خطوط پیوت روزانه ، بر روی چارت نصب نمایید .



3- روند قیمت را پیگیری نموده و زمانی که به سمت یکی از سطوح در حال حرکت می باشد در انتظار موقعیت مناسب باشید .

موقعیت مناسب جهت خرید زمانی رخ میدهد که روند قیمت در حال ساخت Low های جدید (Lower Low) و عبارتی دارای روند نزولی باشد .

موقعیت مناسب جهت فروش زمانی رخ میدهد که روند قیمت در حال ساخت High های جدید (Higher High) و عبارتی دارای روند صعودی باشد .

4- درانتظار برخورد قیمت و Touch شدن خطوط پیوت توسط قیمت و معامله در محدوده آن میمانیم .

5- برای ورود به معامله در انتظار تشکیل کندلی به نام کندل پیوت (Pivot Candle) پس از برخورد قیمت با سطوح پیوت میشویم .

کندل پیوت کندلی است که در مجموعه ای از کندلهای دارای Higher High بتواند High جدید ایجاد کند و در مجموعه ای از کندلهای دارای Lower Low بتواند Low جدید ایجاد کند .

گامهای زیر جهت ورود به معامله لازم است .

خرید :

تشکیل مجموعه ای از Lower Low ها و وجود روند نزولی

Price Bar سطح Pivot را لمس کند

Price Bar بعد نتواند Lower Low جدید ایجاد کند

Price Bar بعد سطح High بار قبلی را شکسته و به عبارتی تشکیل اولین Higher High را دهد.

فروش :

تشکیل مجموعه ای از Higher High ها و وجود روند صعودی

Price Bar سطح Pivot را لمس کند

Price Bar بعد نتواند Higher High جدید ایجاد کند

Price Bar بعد سطح Low بار قبلی را شکسته و به عبارتی تشکیل اولین Lower Low را دهد.

در تصویر زیر نمونه ای جهت فروش مشخص گردیده.



حد ضرر میتواند یکی از موارد زیر انتخاب شود :

1- سطح پیوت Touch شده باشد.

2- High کندل یا بار ورود به موقعیت فروش - low کندل ورود به موقعیت خرید

این حد ضرر براساس میزان نوسان مارکت تحت معامله ، میزان نوسان قیمت و .. قابل تنظیم است .

میتوان به جای اقدام به معامله لحظه ای از دستور خرید یا فروش Limit در سطوح حاصله استفاده نمود .

حد سود نیز سطوح بعدی پیوت موجود در روند جدید میباشد و با شکست هر یک میتوان مقداری از سود را حفظ کرده و هدف جدید را خط بعدی پیوت در نظر گرفت.

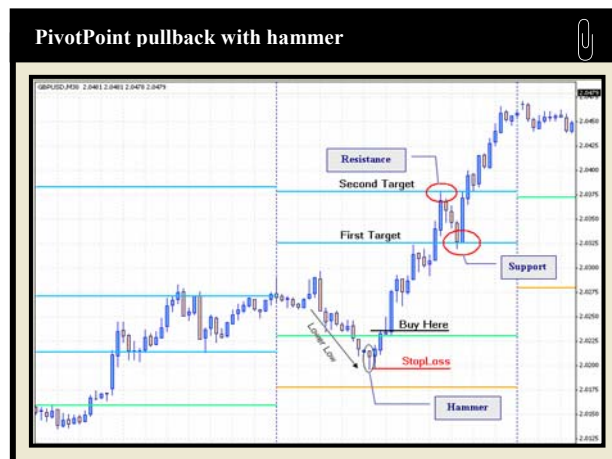
پس از ورود به معامله تنها در انتظار رسیدن قیمت به حد سود یا ضرر مانده و توصیه میشود از روشهای مختلف مدیریت پوزیشن نظیر انتقال حد ضرر به نقطه ورود

(Breakeven) استفاده از Trailing Stop و ... بر اساس تمایل و تجربه خود استفاده نمایید .

پس از پایان یک معامله میتوان در انتظار موقعیت دیگر بود و مراحل فوق را مجدداً اجرا نمود .

در روش فوق میتوان از تحلیل حالتهای کندل استیک نظیر Shooting star ، Doji ، Hanging man و ... جهت تشخیص وضعیت خریداران و فروشندگان و افزایش

دقت معامله بهره برد .

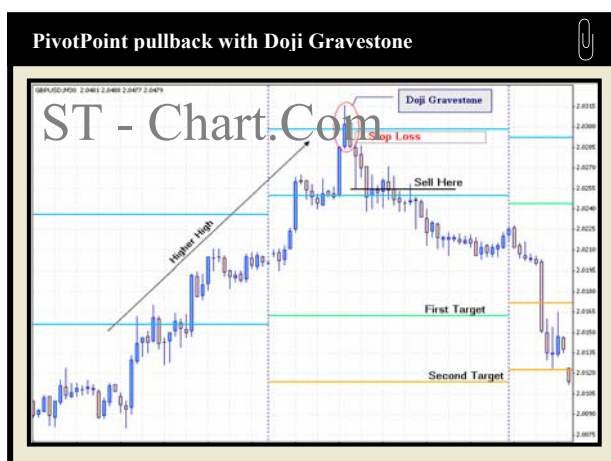
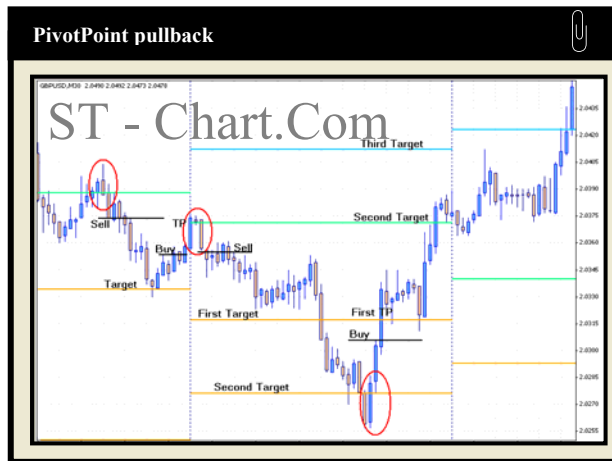


Pivot point Breakout

در این روش در انتظار برخورد و توقف قیمت در یکی از سطوح پیوت بوده و سطحی که قیمت از آن بازگشته است را به عنوان سطح Breakout در نظر گرفته . قواعد معاملاتی را میتوان مشابه Pivot point Pullback اجرا نمود. به نمونه زیر دقت نمایید .



در ادامه چند نمونه دیگر را جهت آشنایی بیشتر بررسی مینماییم .



Camarilla Levels Trading System

این خطوط که به Camarilla Equation معروف هستند بر اساس ادعای سایت www.surefiring.com و همچنین www.camarillaequation.com اولین بار توسط Nick Stott در سال 1989 معرفی شده اند. فرمول اصلی این خطوط هرگز به طور کامل منتشر نشد و در حال حاضر نیز تنها سایتهای فوق نتیجه را بصورت یک ماشین حساب آنلاین در اختیار سایرین قرار میدهند که هزینه استفاده از آن ماهانه حدود 100 دلار میباشد.

اما فرمولهای مختلفی در مورد آن ارائه شده است که هر یک ادعا داشتند بهترین نتیجه را حاصل کرده اند. در حال حاضر اندیکاتور PivotPoint براساس فرمول عام این خطوط که توضیح آن ارائه شد این خطوط را محاسبه میکند و به کاربر خود این امکان را میدهد که براساس زمانهای مختلف و همچنین رسم هیستوری کال بهترین ستینگ را یافته و از آن استفاده نماید.

در ادامه مروری بر روش معاملاتی مطرح شده بر اساس این خطوط خواهیم داشت.

اساس کار خطوط کامریلا تمایل قیمت در بازگشت به سطح تعادل است.

بعبارت دیگر هرگاه در یک روز خاص قیمت دارای نوسان زیادی بوده و فاصله میان High و Low آن روز زیاد باشد در روز بعد قیمت تمایل دارد که به سمتی خاص بازگشت نماید که در ابتدا آنرا قیمت Close روز قبل در نظر میگیرند اما کامریلا سطوح خاصی را معرفی نمود که قیمت تمایل دارد نسبت به آنها بازگشت نماید.

کامریلا براساس محاسباتی خاص و با بهره گیری از Open - High - Low - Close روز قبل 8 سطح کلیدی را محاسبه میکند.

معرفی سطوح Camarilla

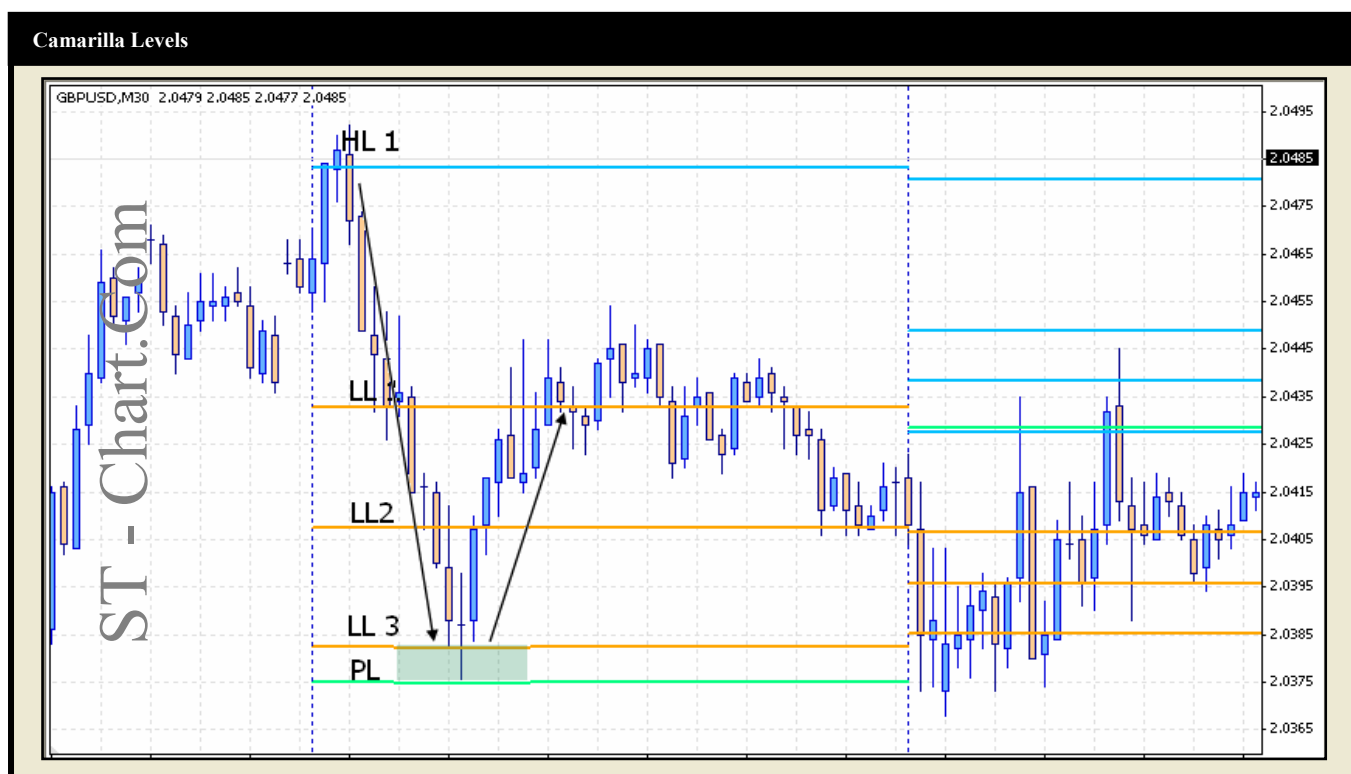
همانطور که اشاره شد فرمول خطوط کامریلا بر اساس قیمت های روز گذشته 8 سطح را محاسبه مینماید که همواره 4 سطح آن در بالای قیمت قرار گرفته که Higher Levels و به اختصار HL نامیده شده و 4 سطح آن در پایین قیمت قرار گرفته که Lower Levels و به اختصار LL نامیده شده و هر یک از 1 تا 4 شماره گذاری میشوند. مهمترین این سطوح، سطح شماره 3 (L3) و 4 (L4) هستند.

Day trader ها اعتقاد دارند قیمت چنانچه به سطوح HL3 و LL3 برخورد کند بازگشت (Reverse) خواهد نمود و بهمین جهت در نزدیکی این سطوح اقدام به انجام معامله در خلاف جهت روند جاری مینمایند. چنین روش معاملاتی به روش کلاسیک کامریلا معروف است و در این روش که در خلاف جهت ترند انجام میشود سطح 4 بعنوان حد ضرر در نظر گرفته میشوند.

در تئوری مدرن مربوطه معتقد هستند از حد ضرر کمتر و مطمئن تری استفاده شود بدین مضمون که تنها زمانی اقدام به معامله شود که قیمت به سطوح فوق برخورد کرده و بازگشت خود را در جهت صحیح آغاز نموده است. معامله گر در این جهت اقدام به معامله کرده و همان سطح 3 و کندلهای موجود در آن منطقه را بعنوان حد ضرر در نظر میگیرد زیرا اعتقاد بر این است که اگر قیمت واقعا قصد بازگشت از این سطوح و احترام به آنها را دارد نباید مجدداً به آنها نفوذ نماید.

روش دیگری که معامله گران بر اساس این خطوط از آن بهره میگیرند شکست سطح L4 میباشد. بعبارتی Breakout trading بر اساس سطوح نهایی است زیرا اعتقاد بر این است که سطوح 4 سطوحی هستند که تنها در اثر روندهای فوق العاده قدرتمند شکسته خواهند شد و حتی اخبار اقتصادی هم نمیتوانند بطور لحظه ای از آنها عبور کنند مگر آنکه واقعا پس از اعلام این شاخصها روندی جدید آغاز شود.

حد فاصل سطح 3 تا 4 نیز به منظور فیلتر نمودن نوسانات موقتی اخبار اقتصادی و .. در نظر گرفته شده است و به عبارتی منطقه بدون ترید (No Trade Zone) میباشد. در ادامه هر یک از روشهای فوق را به تفصیل بررسی مینماییم.

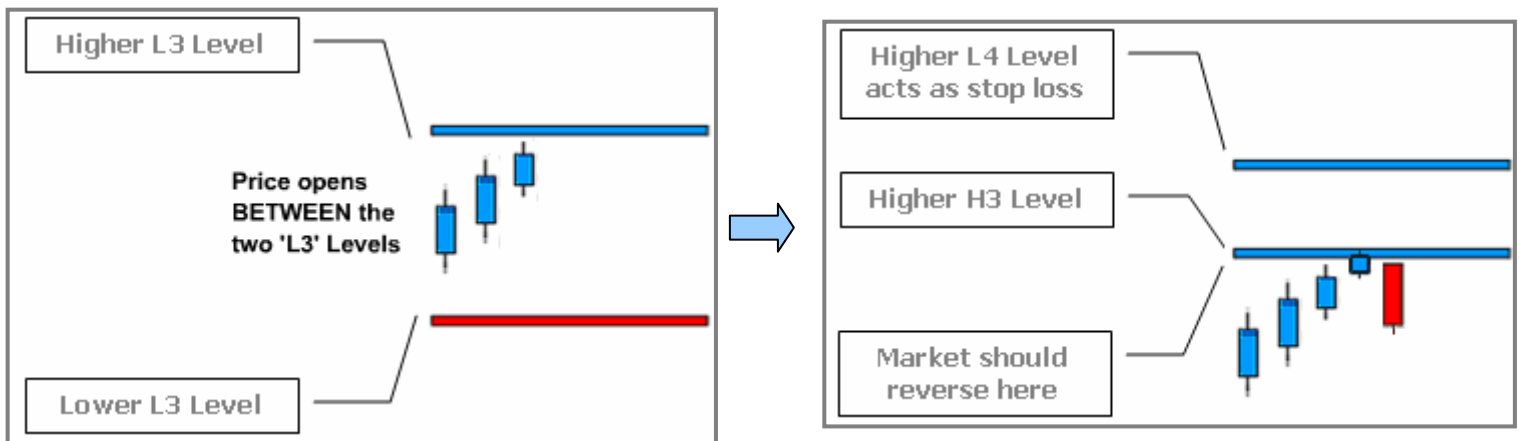


استراتژی معاملاتی بر اساس خطوط کمربلا

همانطور که اشاره شد کمربلا 8 سطح دارد که سطوح 3 و 4 در طرفین یعنی LL3 - HL3 - LL4 - HL4 دارای اهمیت ویژه ای هستند و توجه معامله گران بر روی این سطوح متمرکز است .
در واقع سطوح 3 Action و سطوح 4 Stop loss محسوب میشود . از سوی دیگر خود سطوح 4 Breakout نیز میباشد . در ادامه حالت های مختلف را بررسی مینماییم .

1- مارکت در بین سطوح 3 باز شود . (Reversal Trading)

در غالب روزها قیمت در میان دو سطح HL3 و LL3 در نوسان است . هرگاه قیمت در میان این دو بازه باشد در انتظار نزدیک شدن به سطوح فوق مینمایم . در برخورد به سطح H3 انتظار بازگشت قیمت می رود به همین جهت در خلاف جهت روند صعودی اقدام به فروش نموده . در برخورد به سطح L3 نیز انتظار بازگشت روند نزولی می رود بنابراین اقدام به خرید مینماییم .
سطوح L4 نیز به عنوان Stop loss مورد استفاده قرار میگیرند .
دقت داشته باشید در هنگام رسیدن به این سطوح قیمت باید دارای روند مشخص باشد و عبارتی با تشکیل Higher High یا Lower Low های متوالی روند مشخصی را دنبال نماید .
پیشنهاد میشود در هنگام برخورد به این سطوح پیش از اقدام به انجام معامله در انتظار تشکیل کندل پیووت باشید . همانطور که توضیح داده شد کندل پیووت کندلی است که در مجموعه ای از Higher High ها بتواند High جدید ایجاد کند و در مجموعه ای از Lower low ها بتواند Low جدید ایجاد کند و در محدوده این خطوط نیز واقع شود . تشکیل این کندل یکی از نشانه های معتبر reverse قیمت است .



2- مارکت خارج از سطوح 3 باز شود .

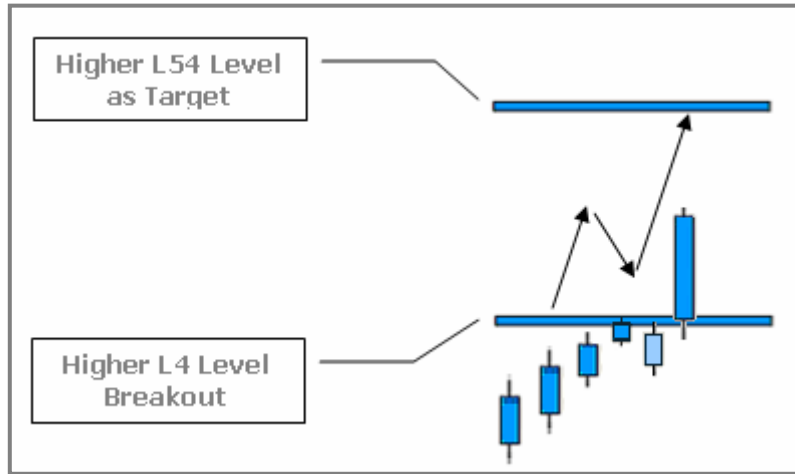
در این حالت لازم است در انتظار بازگشت قیمت به داخل محدوده سطوح 3 ماند و با ورود به این محدوده ها مانند حالتی که قیمت در داخل محدوده های L3 باز میشود اقدام به معامله نمود .
(چنین حالتی به ندرت رخ میدهد)

3- معامله هنگام شکست سطوح 4 (L4 Breakout Trading)

گفتیم سطوح 4 سطوح حد ضرر برای معاملات خلاف جهت ترند در برخورد سطوح L3 محسوب میشوند . علت این امر نیز بدان جهت است که این سطوح در روزهای عادی به سادگی شکسته میشوند و تنها در اثر شکلگیری روندهای قدرتمند این سطوح شکسته میشوند .
به همین دلیل محل شکست این سطوح بهترین منطقه برای معاملات Breakout و استفاده حرکات Sharp قیمت محسوب میشود .
در فرمول محاسبه سطوح کمربلا تنها 4 سطح محاسبه میشود اما در نسخه {b} ماشین حساب آنلاین Surefire Thing سطح پنجمی نیز محاسبه میشود که این سطح پنجم به عنوان هدف نهایی هنگام شکست L4 مطرح است . این سطح در اندیکاتور PivotPoint نیز در اختیار شما قرار دارد و میتوانید از آن بعنوان هدف معامله Breakout استفاده نمایید .

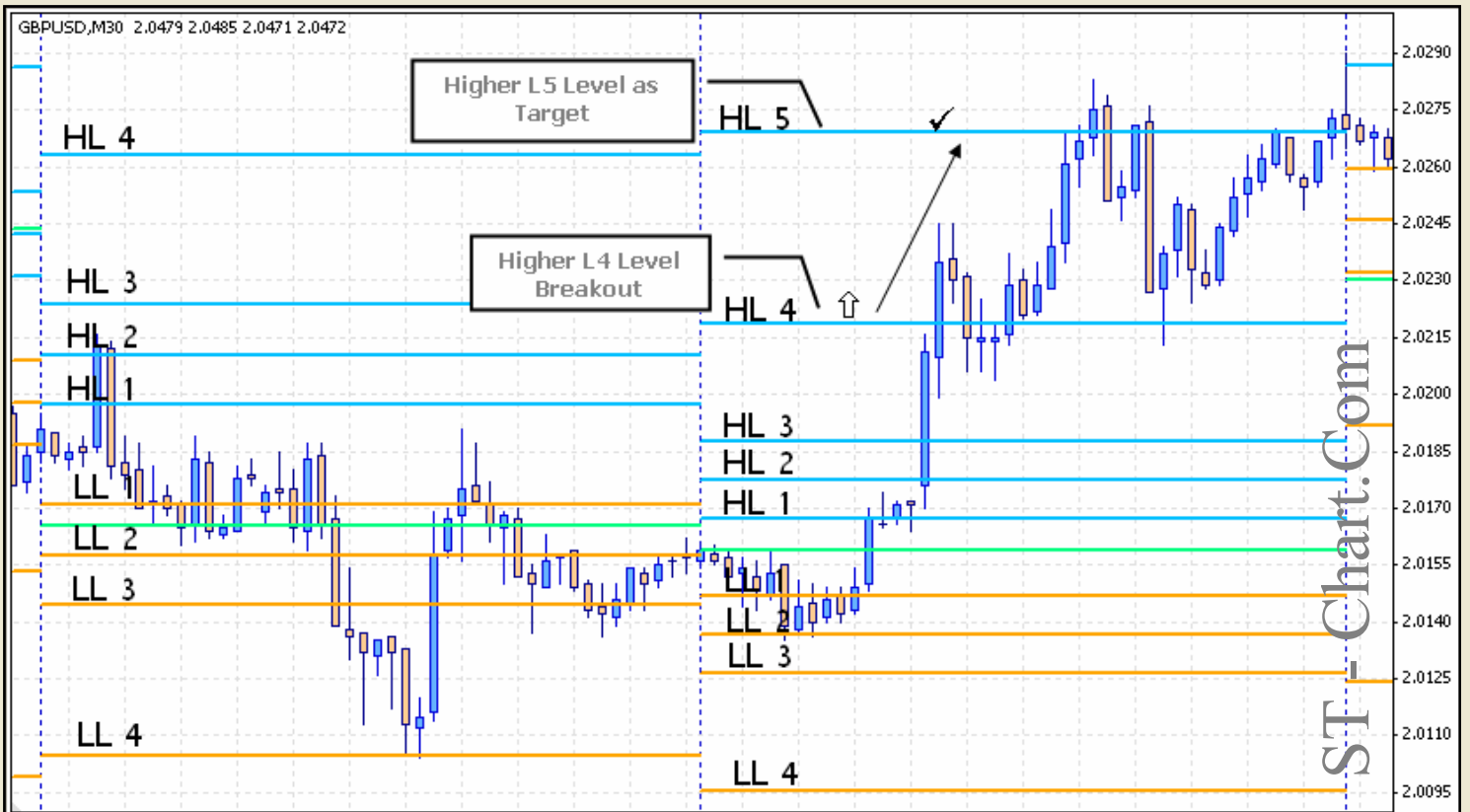
در مورد حد ضرر نیز قاعدتا باید از سطح L3 استفاده شود .

با توجه به اینکه شکست سطوح 4 تنها در اثر حرکات قدرتمند و Sharp رخ میدهد پیشنهاد میشود حد ضرر را محدود و در نزدیکی همان سطوح 4 قرار دهید .

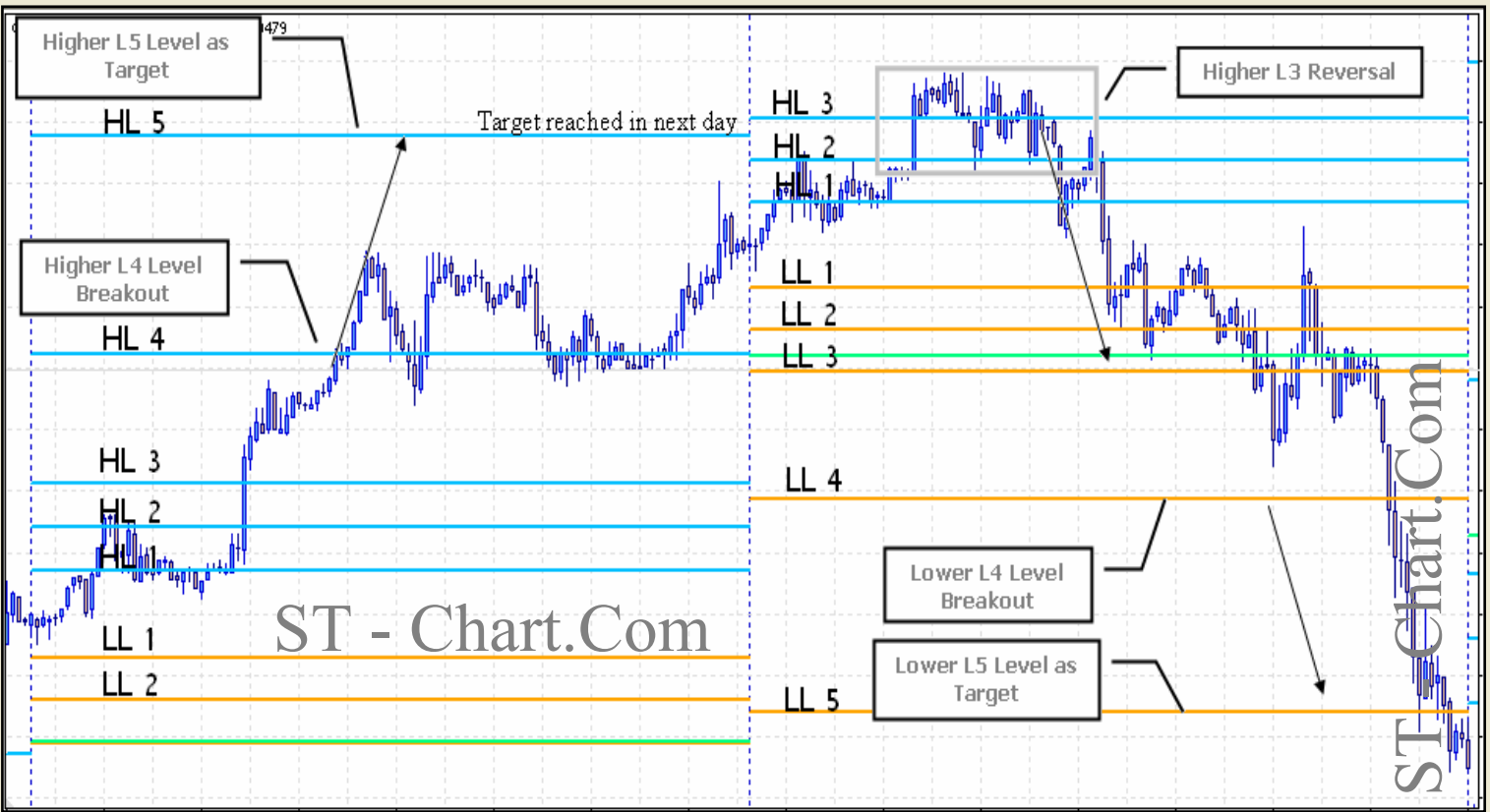


در ادامه چند نمونه را بررسی مینماییم.

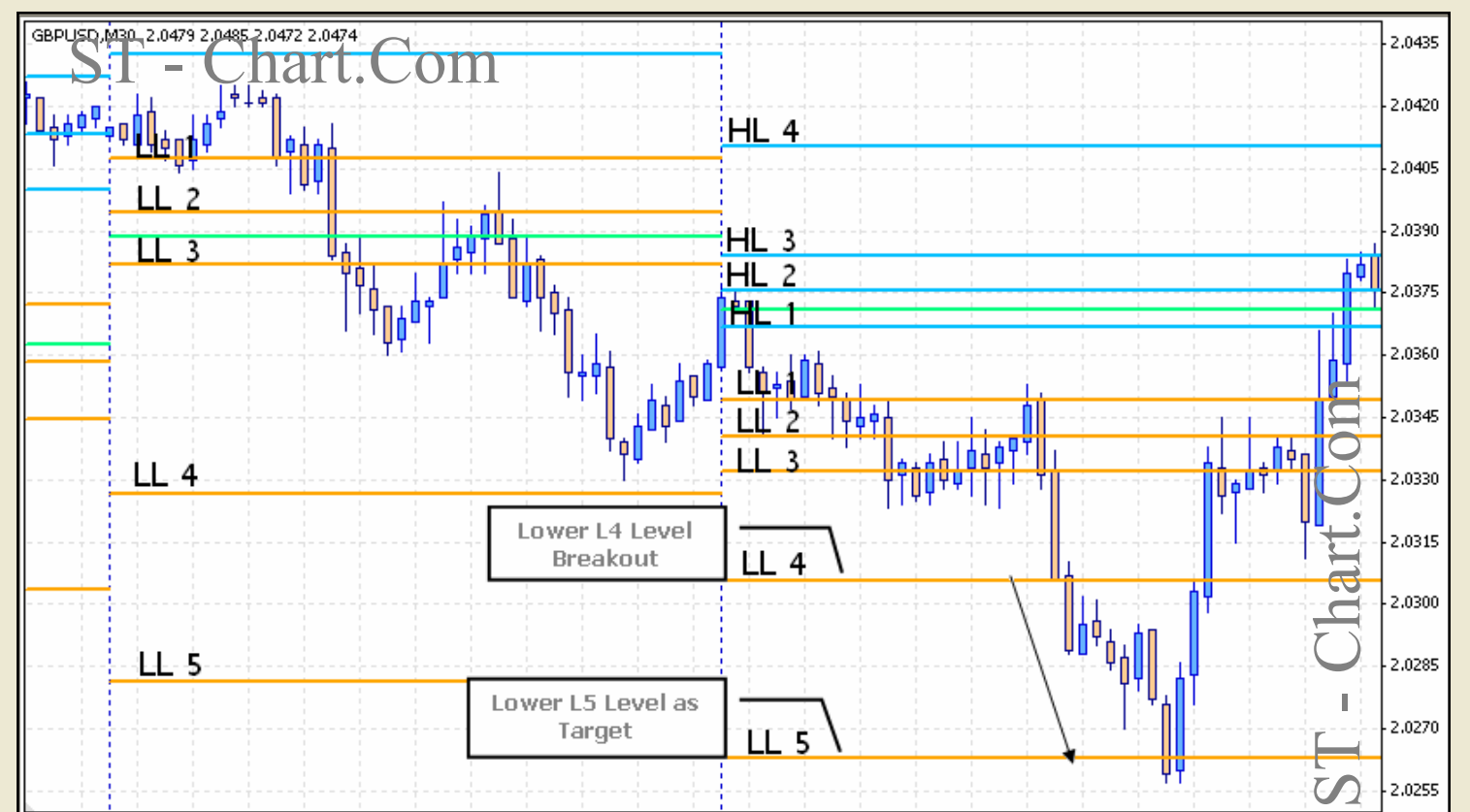
Camarilla HL 4 Breakout



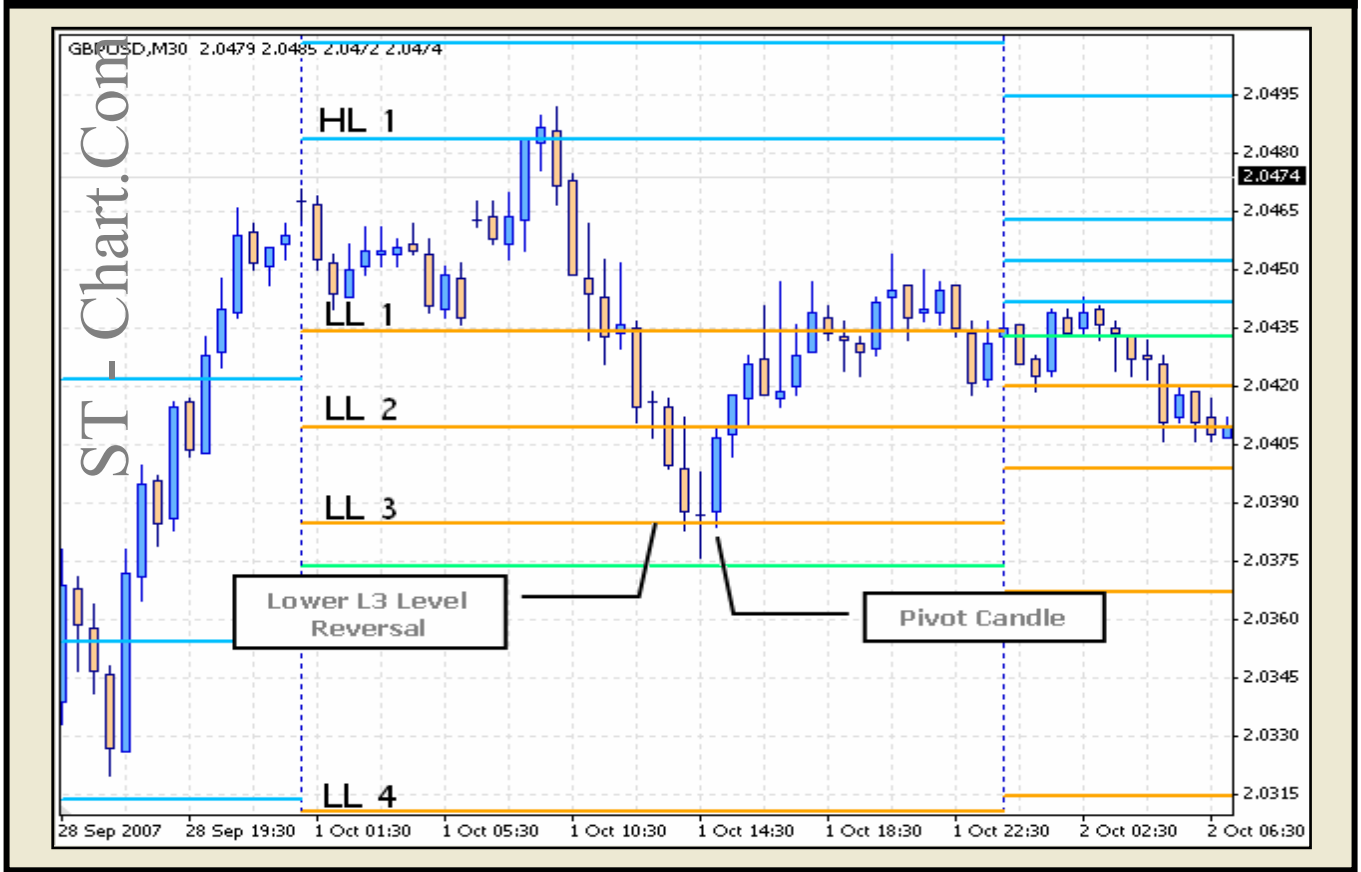
Camarilla HL 4 Breakout - HL 3 Reversal - LL 4 Breakout



Camarilla LL 4 Breakout

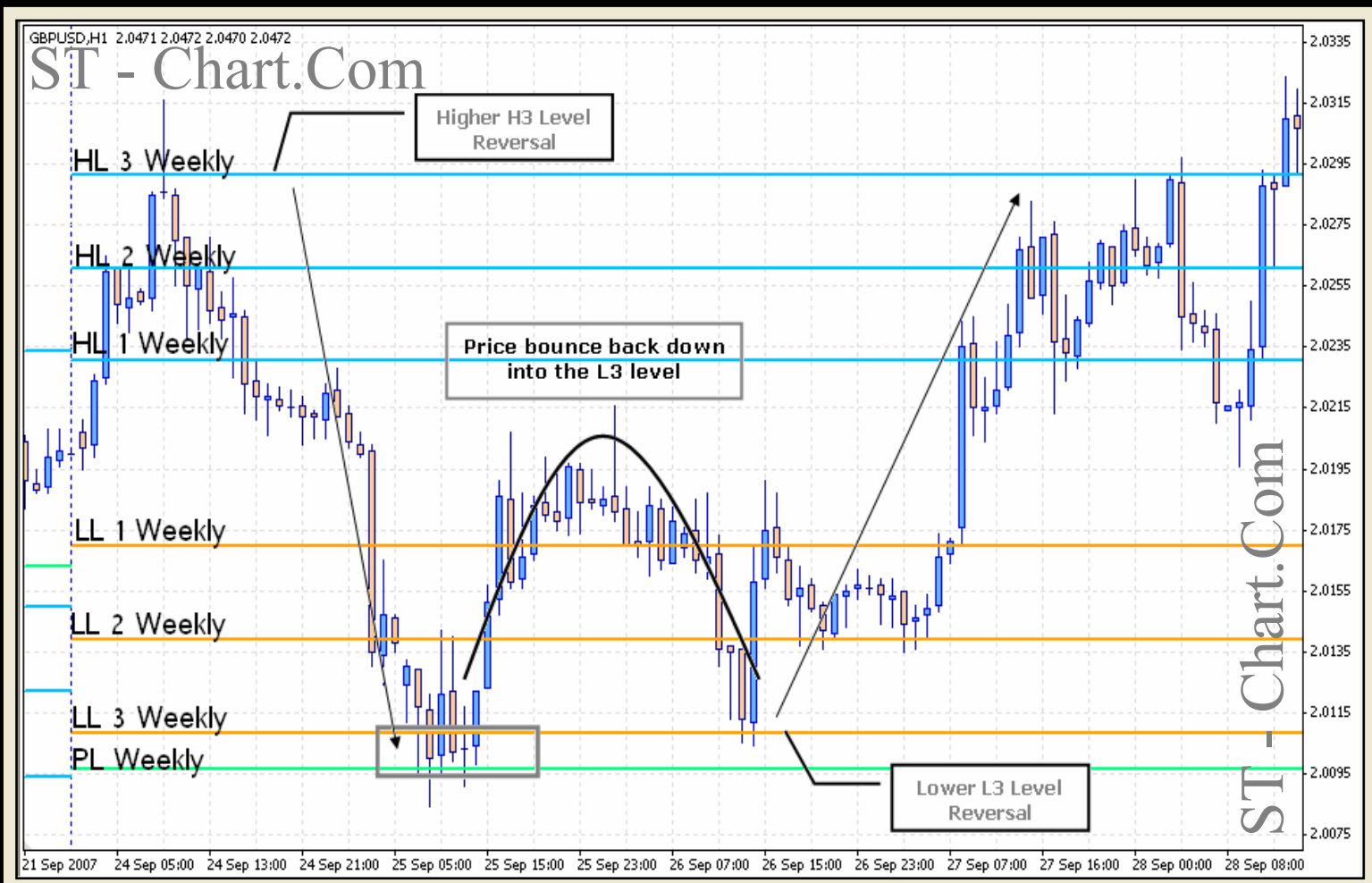


Camarilla LL 3 Reversal



Weekly Camarilla HL3 & LL3 Reversal

Important Example



Demark Pivot

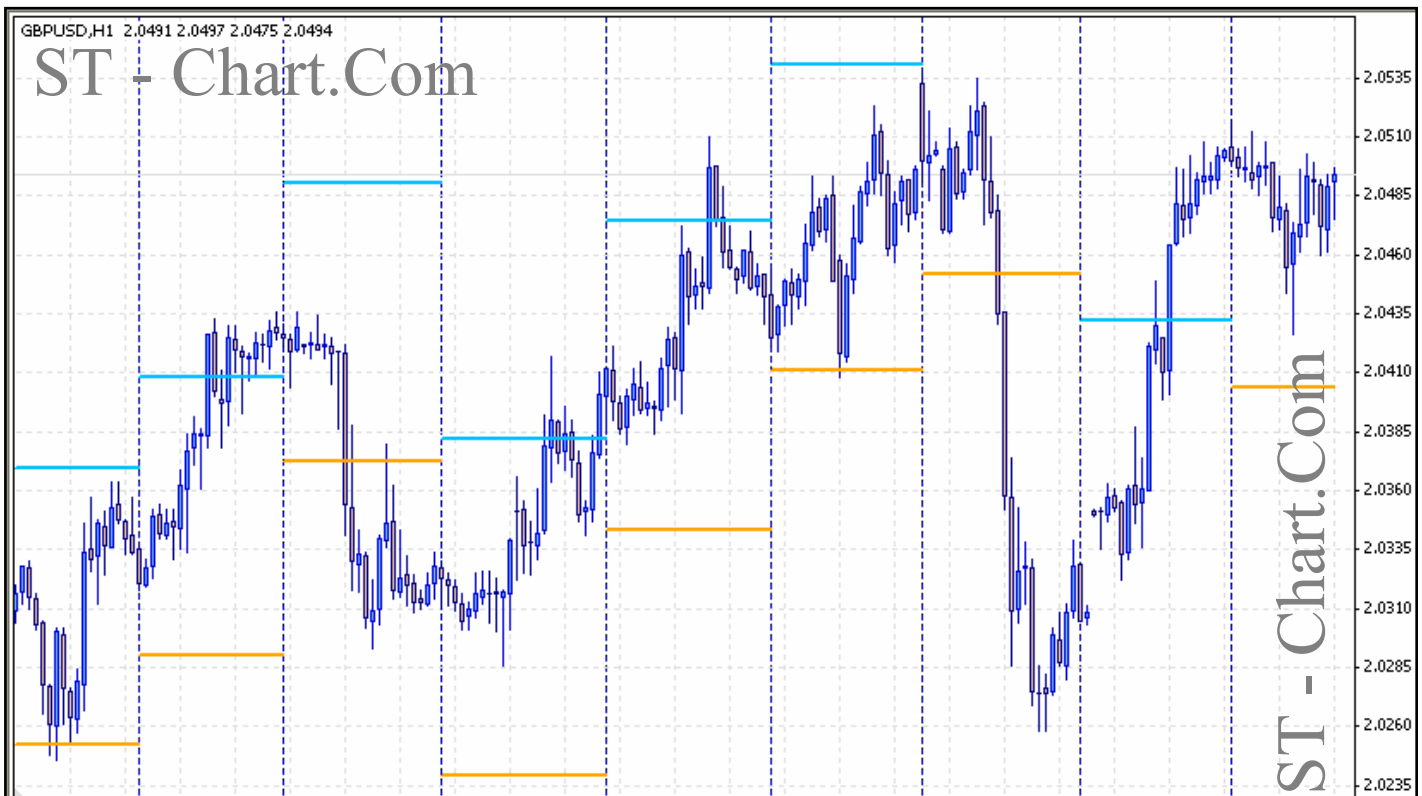
این سطوح اولین بار توسط Thomas Demark معرفی شده اند.

در مورد نحوه محاسبه توضیحات مربوطه ارائه شد و در ادامه شیوه های تحلیل و معامله با این خطوط را معرفی مینماییم .
اولین قانون را همواره به خاطر داشته باشید :

Buy when price hits the Low, Sell when price hits the High

حتما جمله خرید در کف قیمت و فروش در سقف را شنیده اید. جمله فوق نیز بر همین اصل استوار است و سقفی را که در نظر میگیرد همان سطوح R1 و S1 محاسبه شده میباشند .

تصویر زیر نمونه ای از ترسیم این خطوط توسط اندیکاتور PivotPoint را بصورت ترسیم Historical مشخص نموده است .



در هر روز که خطوط جدید رسم میشوند یک ساختار سطحی جدید شکل میگیرد که هر ساختار سطح متشکل از مجموعه ای از کندلها میشود. بررسی و تحلیل این ساختارها برای ترید اهمیت بسیاری دارند .

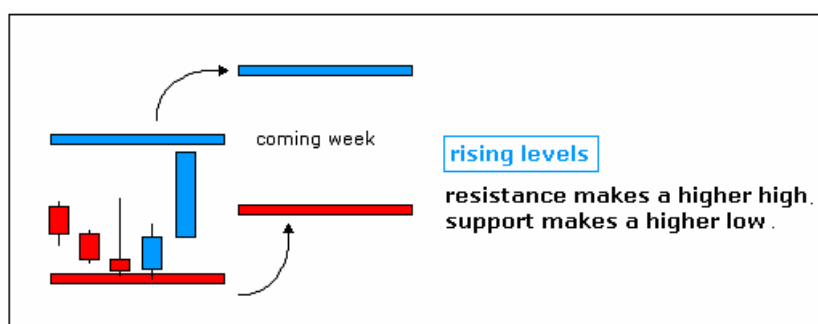
بررسی ساختار سطوح :

ساختار عادی سطوح (Regular Level Structures)

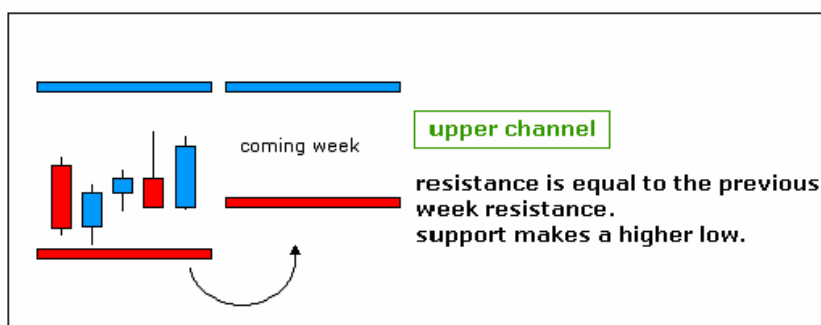
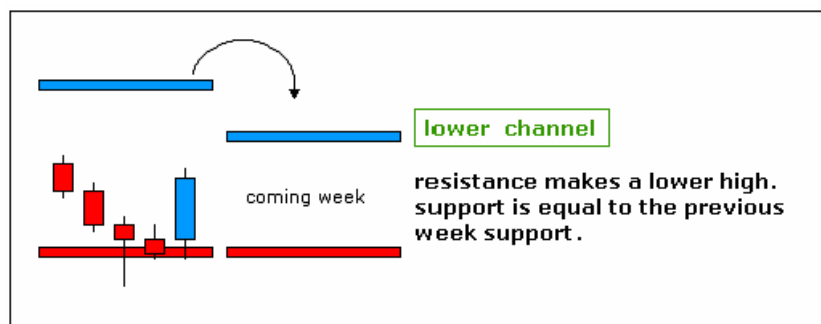
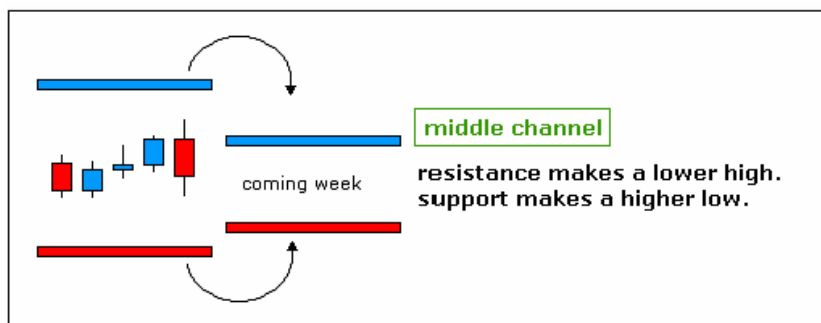
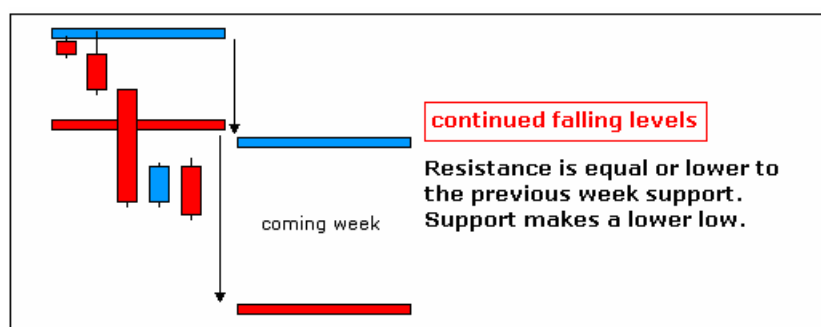
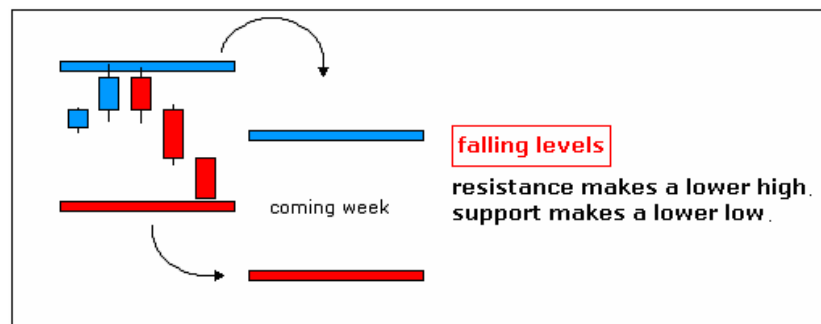
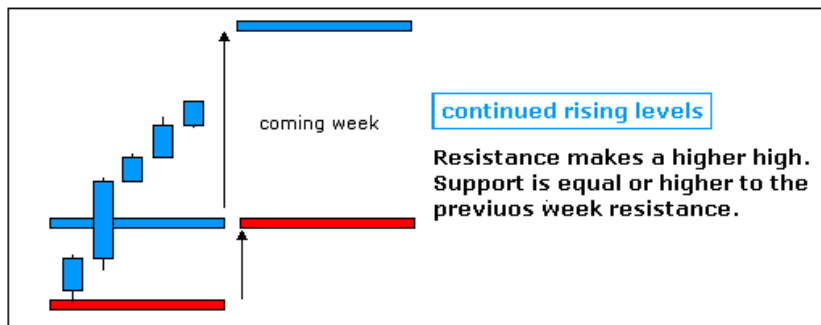
- Rising Levels
- Falling levels
- Continued Rising Levels
- Continued Falling Levels

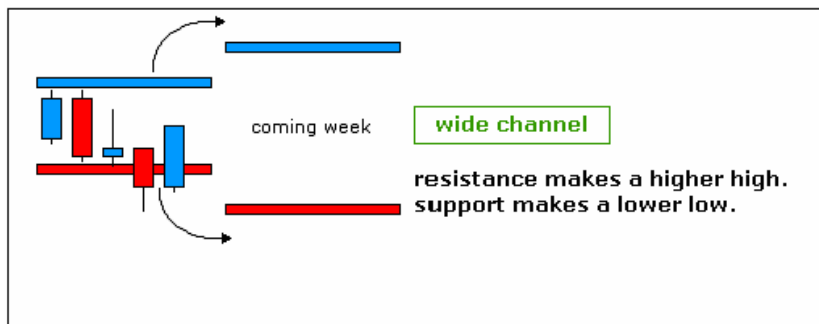
ساختار غیر عادی سطوح (Irregular Level Structures)

- Middle Channel
- Lower Channel
- Upper Channel
- Wide Channel

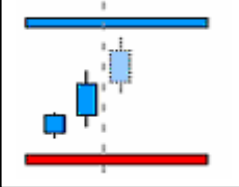
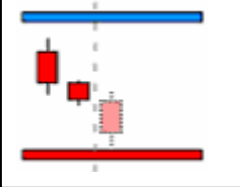
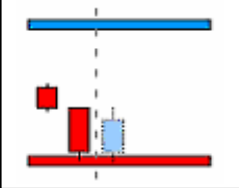
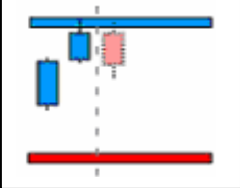
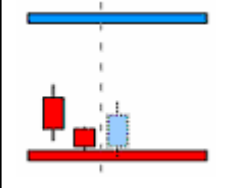
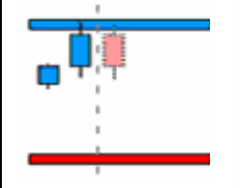
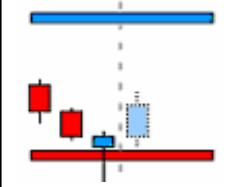
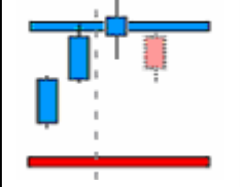
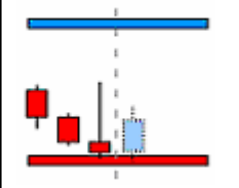


در تصاویر زیر به طور مشخص این سطوح مشخص گردیده اند.



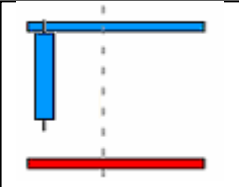


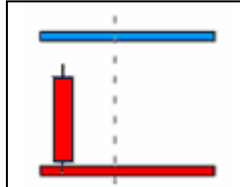
بر اساس ساختارهای مختلف سطوح استراتژی های مختلفی جهت بررسی موقعیت و انجام معاملات در پیش گرفته میشود اما در مجموع هر زمان که قیمت به یکی از سطوح High یا Low رسید لازم است به بررسی پترنهای کندل استیک بپردازیم .
 پترنهای مهمی که باید برای این هشت ساختار سطح بررسی شوند را به گروه های A-I به همراه گروه Reaching با عنوان ساختارهای کندل استیک (CandleStick Structures) تقسیم نموده ایم که در زیر به بررسی این ساختارها میپردازیم .
 اگرچه سعی شده پترنهای مهم کندل استیک را معرفی کنیم اما حتما توصیه میشود در مورد کندل استیک مطالعه جامعتری داشته باشید که کتب آقای استیو نیسون (Steve Nisson) بهترین مرجع برای این مهم است .
 نگاهی به جدول پترنهای کندل استیک می اندازیم :

	Structure A Go Long signal For the next candle		Structure F Go Short signal For the next candle
	Structure B Go Long signal For the next candle		Structure G Go Short signal For the next candle
	Structure C Go Long signal For the next candle		Structure H Go Short signal For the next candle
	Structure D Go Long signal For the next candle		Structure I Go Short signal For the next candle
	Structure E Go Long signal For the next candle	نکته : میتوان گفت ساختار F یکی از غیر عادی ترین ساختارها میباشد که اغلب شاهد تشکیل دو کندل با بدنه کوچک نزدیک به ساختار Doji یا Hammer میباشد.	

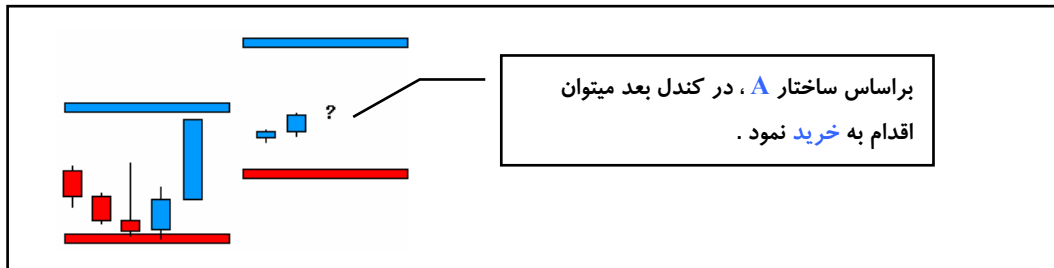
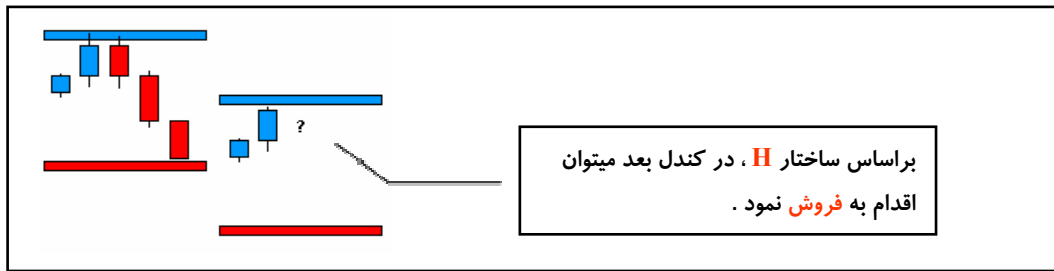
The Reaching Structure

Price reaches the High or Low level, but it doesn't fit on any of the other structures

	The Reaching Structure Go Long signal For the next candle
---	---

	The Reaching Structure Go Short signal For the next candle
--	--

با توجه به جدول فوق در میابیم که تشکیل هر یک از ساختارها چند روزی به طول می انجامد که در بازار فارکس به پتانسیل حرکت ارز ، مجموعه شاخصهای اقتصادی مهم و... بستگی دارد اما ساختار Reaching از این مقوله جداست و ممکن است در هر زمان و به سرعت رخ دهد .
 در واقع این ساختار ساختاری است که در آن قیمت به سطوح High و Low پیش بینی شده میرسد اما نمیتوان وضعیت رسیدن قیمت به این سطوح را جزو هیچ یک از حالتی 9 گانه A-I قرار داد .



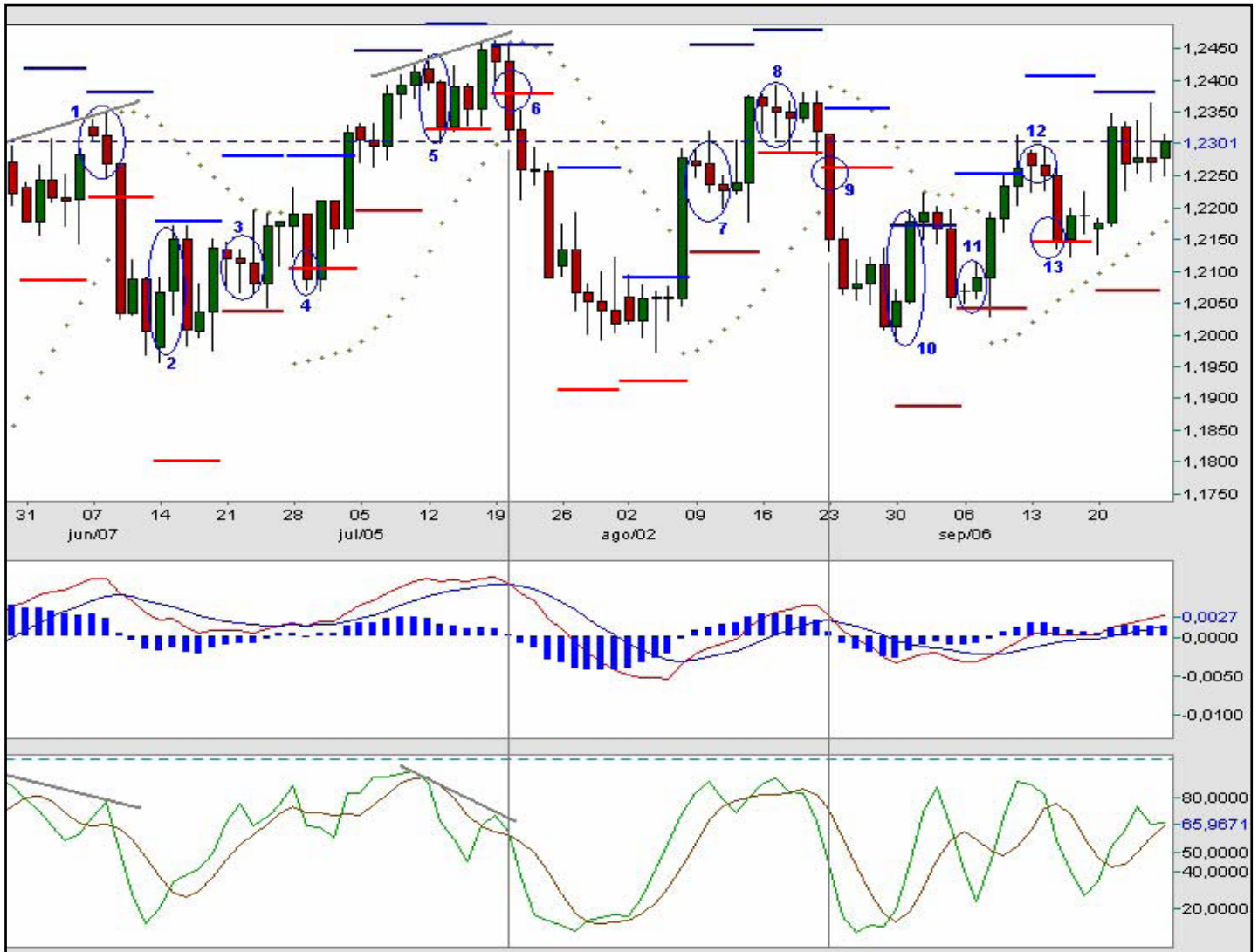
نکته بسیار مهمی که باید به خاطر داشته باشید

پترنهایی که در این مجموعه معرفی شده اند کامل نبوده و اگر چارتی را مورد بررسی قرار دهید پیدا کردن ساختارهای ارائه شده مشکل خواهد بود زیرا اولاً این ساختارها ساختارهای ایده آل هستند و در ثانی ممکن است در یک مجموعه از کندلها نهفته باشند که با داشتن اطلاعات کافی در خصوص ترکیب کندل استیک میتوان راحتتر پترنهای فوق را شناسایی نمود. از سوی دیگر ممکن است شما نیز ساختارهای کندل استیکی را بیابید که در کنار این سطوح کیفیت مناسبی داشته باشند بنابراین میتوانید با تست آنها در بازه های قبلی و اطمینان از صحت مطلب از پترنهای اختصاصی خود نیز استفاده نمایید.

تست استراتژی

در ادامه چند نمونه از تستهای انجام شده توسط آقای Demark را بررسی میکنیم و سپس به بررسی چند نمونه از چارتهای Intraday میپردازیم. لازم به ذکر است که خود دمارک خطوط را به صورت هفتگی محاسبه مینموده و تنها در چارت روزانه آنها را مورد استفاده قرار میداده و به معامله میپرداخته است. در چارتهای وی شاهد استفاده از MACD، Slow Stochastic نیز هستیم که در ادامه توضیحات کاملتری در این خصوص ارائه میشود اما اهمیت وجود این دو اندیکاتور در اخطارهای مهمی است که هنگام معامله باید به آنها دقت داشت.

در تصاویر زیر به بررسی 12 ماهه این سطوح پرداخته و در نهایت اطلاعات حاصله را از لحاظ آماری بررسی مینماییم.



ابتدا به چند نکته در خصوص این چارتهای دقت کنید :

- 1- این خطوط به صورت هفتگی در چارت روزانه رسم شده اند بنابراین هر ساختار سطح دارای 5 کندل است.
- 2- به سطوحی که به رنگ آبی مشخص شده اند اهمیت دهید.
- 3- در یک ساختار سطح مقصود از کندل 1، کندل روز دوشنبه، کندل 2 کندل روز سه شنبه و میباشد.

بررسی چارت :

- 1- دو کندل نزولی روز دوشنبه و سه شنبه با بدنه کوچک تشکیل ساختار F را داده اند. قیمت هیچ یک از سطوح حمایت یا مقاومت را لمس نکرده است بنابراین اقدام به فروش مینماییم. وجود واگرایی (Divergence) بین صعود قیمت و نزول استوکستیک تاییدی بر فروش به ما میدهد.
- 2- دو کندل صعودی با بدنه های بزرگ قیمت باز شدن این هفته تقریباً در وسط فاصله حمایت و مقاومت قرار دارد. خط حمایت لمس نشده اما کندل صعودی دوم در نزدیکی خط مقاومت و تنها با چند واحد اختلاف بسته شده است که آنرا لمس شده قلمداد میکنیم. بر اساس ساختارهای G یا H در روز بعد اقدام به فروش خواهیم نمود.
- 3- تشکیل ساختار E داده است (ساختارهای D و E را میتوان قابل اطمینان ترین ساختارها نامید). قیمت طی دو کندل اول نزول نموده و در سومین کندل تشکیل یک Inverted Hammer داده است که انرا نشانه ای جهت خرید در نظر گرفته و در روز چهارم اقدام به خرید مینماییم.

4- تشکیل ساختار Reaching Structure

در روز اول کندلی با بدنه کوچک تشکیل شده که تقریباً سطح حمایت را لمس کرده است .
 قیمت در دومین کندل نزول نمود و از سطح حمایت نیز عبور کرد . چنین ساختاری جزو هیچ یک از حالت های A-I معرفی شده نیست بنابراین آنرا ساختار reaching (تماسی) در نظر میگیریم بدین معنی که به هر حال قیمت به سطح حمایت (یا مقاومت) رسیده است .
 در ساختار reaching بر اساس قواعد معرفی شده در برخورد به حمایت اقدام به خرید کرده و در برخورد به مقاومت اقدام به فروش میکنیم مگر آنکه MACD و Stochastic بر خلاف موقعیت ترید به ما هشدار دهند .
 در این روز در کندل سوم اقدام به خرید مینماییم .

5- تشکیل ساختار B

وجود دو کندل نزولی که اولی دارای بدنه کوچکتر نسبت به دومین کندل میباشد و خط حمایت را لمس کرده است . وضعیت روز جاری خرید در سومین کندل است .

6- قیمت در این هفته در نزدیکی مقاومت محاسبه شده باز شده است و طی کندل بعد که کندل نزولی قدرتمندی بوده قیمت از سطح حمایت نیز عبور نموده و در پایان حدود 60 واحد پایین تر از سطح حمایت بسته شده است .

این ساختار را میتوان جزو reaching ها دانست زیرا به هیچیک از حالت های دیگر همخوانی ندارد.
 اما نگاهی دیگر به چارت و خط خاکستری و خط افقی رسم شده بیانداریم با توجه به وجود واگرایی میان قیمت و Stochastic و همینطور Cross در MACD که همگی دلالت بر نزول قیمت دارند میتوان در چنین شرایطی از قانون اصلی فروش در سقف و خرید در کف چشمپوشی نموده و در صورت شکست سطح حمایت اقدام به فروش و در صورت شکست سطح مقاومت اقدام به خرید نمود .

پس موقعیت 6 دو هفته هیچ موقعیت معاملاتی شکل نگرفت . در هفته اول هیچ کدام از سطوح حمایت یا مقاومت توسط قیمت touch نشد و در هفته دوم سطح مقاومت توسط سایه کندل لمس شد اما این وضعیت هیچ موقعیت معاملاتی محسوب نمیشود زیرا اولاً مقاومت توسط یک کندل نزولی ! لمس شده است در صورتی نیاز به یک کندل صعودی داشتیم و دلیل دوم آنکه این سطح تنها توسط سایه کندل لمس شده و قیمت Close کندل مذکور با این سطح فاصله زیادی دارد .
 به خاطر داشته باشید

بهترین حالت زمانی است که سطوح ما توسط بدنه کندل لمس شوند و اگر این سطوح تنها توسط سایه ها لمس شده و قیمت کلوز با سطح فاصله داشته باشد یک هشدار برای جهت عدم انجام معامله محسوب میشود .

7- در این هفته یک ساختار D تشکیل شد که به ساختار E بسیار نزدیک است . دو کندل اول کندلهایی نزولی و سومین کندل یک چکش واژگون (Inverted Hammer) ایجاد نموده است بنابراین در چهارمین کندل اقدام به خرید خواهیم نمود .

8- مجدداً تشکیل ساختار D و خرید در چهارمین کندل صورت میگیرد .

9- مشابه موقعیت شماره 6 سطح حمایت شکسته شد با این تفاوت که اینبار واگرایی جهت مشخص شدن این وضعیت و استفاده از آن ظاهر نشده است اگرچه میتوانستیم با شکسته شدن سطح حمایت با استناد به خروج استوکستیک از ناحیه اشباع خرید و عبور هیستوگرام MACD از خط صفر (تغییر جهت SAR به عنوان یک فاکتور اضافی) اقدام به فروش نماییم .

10 - تشکیل ساختار G یا H که در سطح مقاومت بسته شده است که موقعیت فروشی را شکل داد اما در سومین کندل قیمت نزول نکرد و کندلی با بدنه کوچک در بالای مقاومت تشکیل داد بنابراین ساختار ما از G یا H به I تغییر کرد و در روز چهارم اقدام به فروش نمودیم .

11- با تشکیل دو کندل صعودی با بدنه کوچک (کندل دوم فاقد بدنه است) در نزدیکی حمایت ، ساختار A شکل گرفت . در سومین کندل اقدام به خرید مینماییم .

12- تشکیل ساختار F و فروش در سومین کندل که در یک کندل قیمت بر روی سطح حمایت بسته شد .

13- در این هفته سومین کندل تشکیل یک ساختار reaching را با ترکیب دو کندل کوچک و یک کندل بزرگ بر روی حمایت داده است . با توجه به عدم وجود هیچگونه مخالفتی در MACD ، استوکستیک و عدم ظهور واگرایی میتوانیم قانون اصلی را به هدف خرید در کف اجرا نماییم و در چهارمین کندل قیمت شروع به صعود نمود .



14- تشکیل ساختار A در نزدیکی سطح حمایت . خرید در سومین کندل

15- ایجاد ساختار reaching در اولین روز هفته که با یک کندل نزولی از سطح حمایتی عبور کرده و چند pip پایین تر از آن بسته شده است . بدلیل اینکه هیچگونه هشدار نظیر واگرایی و ... وجود ندارد نمیتوان انتظار داشت که قیمت نزول خود را ادامه دهد بنابراین براساس قانون اصلی خرید در کف ، در دومین کندل اقدام به خرید مینماییم .

16- دو کندل نزولی اول باعث ایجاد ساختار B شده اند و آماده خرید در سومین کندل میشویم اما کندل سوم نیز نزول نمود با تشکیل یک hammer ساختار B به ساختار D تغییر یافت . در چهارمین کندل اقدام به خرید مینماییم .

17- مجدداً تشکیل ساختار A و خرید در سومین کندل

18- با رسیدن قیمت به سطح مقاومت در اولین کندل هفته ساختار reaching شکل گرفت و با توجه به عدم هشدار در اندیکاتورها اقدام به فروش در سقف مینماییم .

19- تشکیل ساختار D در همان هفته (رخدادی غیر عادی) و ایجاد موقعیت خرید در آخرین روز هفته نشان از خطرناک بودن این موقعیت دارد .

20- اولین کندل هفته ساختار reaching را ایجاد نمود و در کندل بعد اقدام به خرید مینماییم اما کندل بعد صعود نکرد و تشکیل یک hammer در سطح حمایت داده است و ساختار به حالت D تغییر داد در واقع بجای وجود دو کندل نزولی با بدنه کوچک جهت تشکیل ساختار D شاهد تشکیل یک کندل نزولی با بدنه ای متوسط هستیم که در پی آن یک hammer ظاهر شده است .
در سومین کندل اقدام به خرید مینماییم .

- 21- دو کندل اول تشکیل ساختار F را داده است اما کندل سوم و شکلگیری یک Inverted Hammer در نزدیکی حمایت ، ساختار به E تغییر کرد و چهارمین کندل خرید مینماییم .
- 22- در ابتدای هفته ساختار reaching با حضور یک کندل نزولی و برخورد به سطح حمایت شکل میگیرد . خرید در دومین کندل صورت میگیرد .
- 23 - در همان هفته مجددا ساختار reaching جدیدی اینبار در سطح مقاومت شکل میگرد . باید توجه داشت ساختارهای reaching در ساختارهای غیرعادی سطوح (irregular level structures) بسیار رخ میدهند .
- 24- ساختار این هفته را میتوان جزو reaching ها دانست و این در حالیست که کندل دوم هر دو سطح حمایت و مقاومت را لمس کرده است . در چنین مواردی که کندلی هر دو سطح را لمس مینماید وضعیت مشخصی برای خرید با فروش وجود ندارد .
- 25- مجددا تشکیل ساختار A
- 26- در سومین روز این هفته شاهد شکلگیری یک کندل Hammer هستیم که تداعی کننده ساختار D میباشد اما دقت کنید که کندل دوم کندل نزولی نیست !! و نمیتوان این ساختار را جزو گروه D دانست . از سوی دیگر شاهد واگرایی و MACD crossover بعد از یک دوره روند صعودی هستیم . همه این موارد هشدارهای جهت وجود موقعیت فروش هستند .
- 27- برخورد قیمت به سطح مقاومت در اولین روز هفته باعث تشکیل ساختار reaching شده و در کندل دوم اقدام به فروش مینماییم .



- 28- تشکیل ساختار reaching در چهارمین روز هفته و فروش در روز جمعه (آخرین روز هفته) موقعیت مناسبی برای معامله نمیشد .
- 29- مجددا ساختار reaching اما اینبار در اولین روز هفته با برخورد یک کندل صعودی به سطح مقاومت شکل میگیرد . در کندل بعد اقدام به فروش میشود .
- 30- اولین کندل هفته به سطح حمایت برخورد و از آن عبور کرده و چند pip پایینتر بسته میشود . چنانچه به خط عمودی خاکستری رنگ دقت کنید در همین زمان شاهد MACD crossover نزولی هستیم که پس از یک cross صعودی اشتباه در هفته گذشته رخ داده است . میتوانیم در کندل بعد اقدام به فروش نماییم .

31- با تشکیل دو کندل با بدنه کوچک شاهد ساختار A هستیم که باعث ایجاد موقعیت خرید میشود. کندل صعودی بعد در نزدیکی سطح مقاومت بسته میشود و موقعیت فروشی را برای روز چهارم ایجاد میکند.

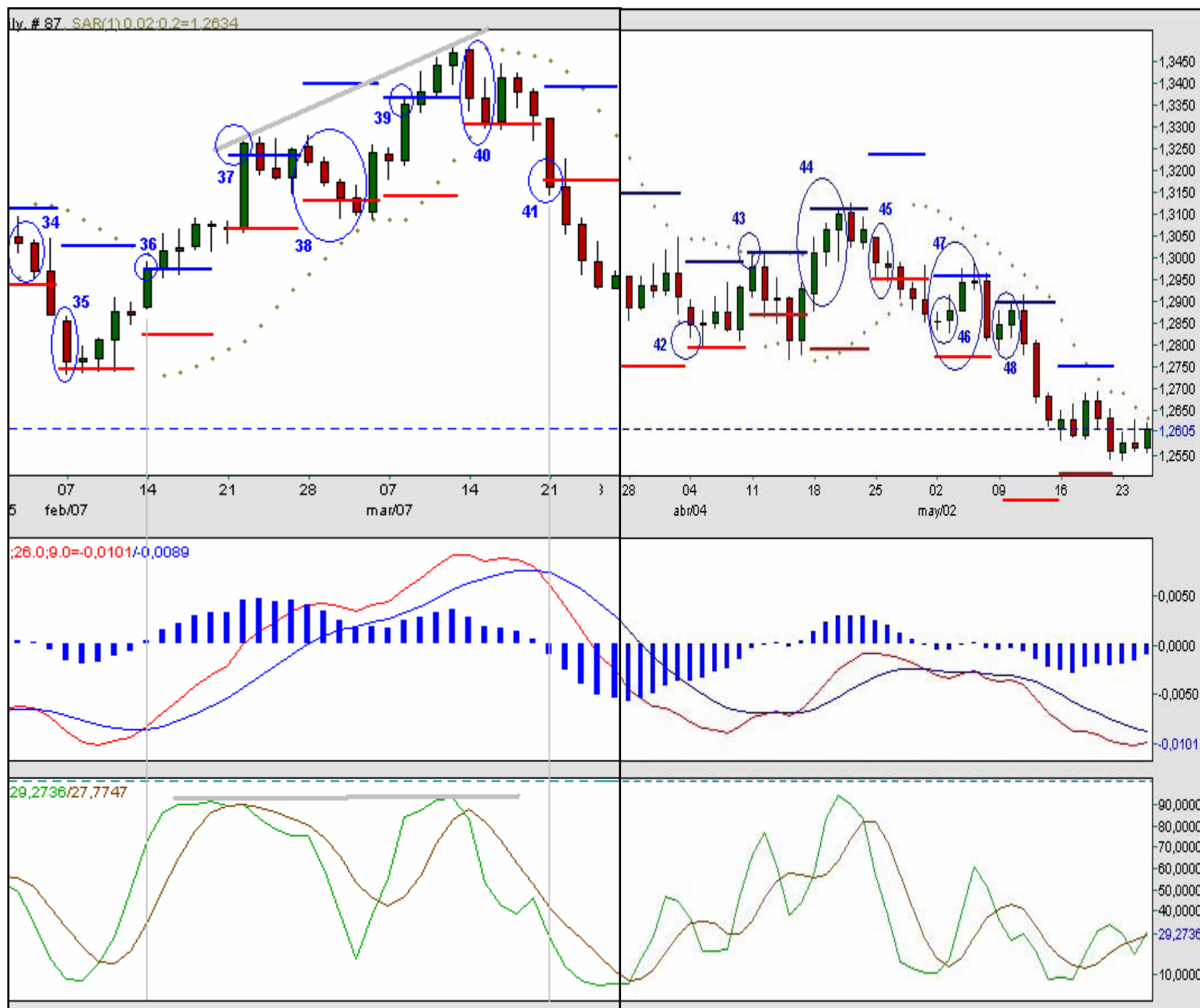
32- در اولین روز هفته شاهد شکلگیری ساختار reaching هستیم و در کندل بعد اقدام به خرید مینماییم اما شاهد هستیم قیمت در تمام هفته نزول نمود و موقعیت معاملاتی ما موقعیتی ناموفق بوده است

33- میتواند یکی از ساختارهای F یا B باشد و به جهت اینکه وضعیت کاملا مشخص نیست موقعیت خطرناکی را ایجاد مینماید. اگر موقعیت رخ داده را F در نظر گرفته و اقدام به فروش نماییم پوزشن ما ناموفق خواهد بود و متضرر میشویم و در صورتی که پوزشن را B در نظر بگیریم پوزشن موفق خواهد داشت.

با توجه به اینکه قصد داریم روند یکسال را بررسی کنیم در ادامه تنها موقعیتهای بر روی چارت مشخص خواهیم نمود و از ذکر جزئیات صرف نظر میکنیم. به چند مورد توجه نمایید:

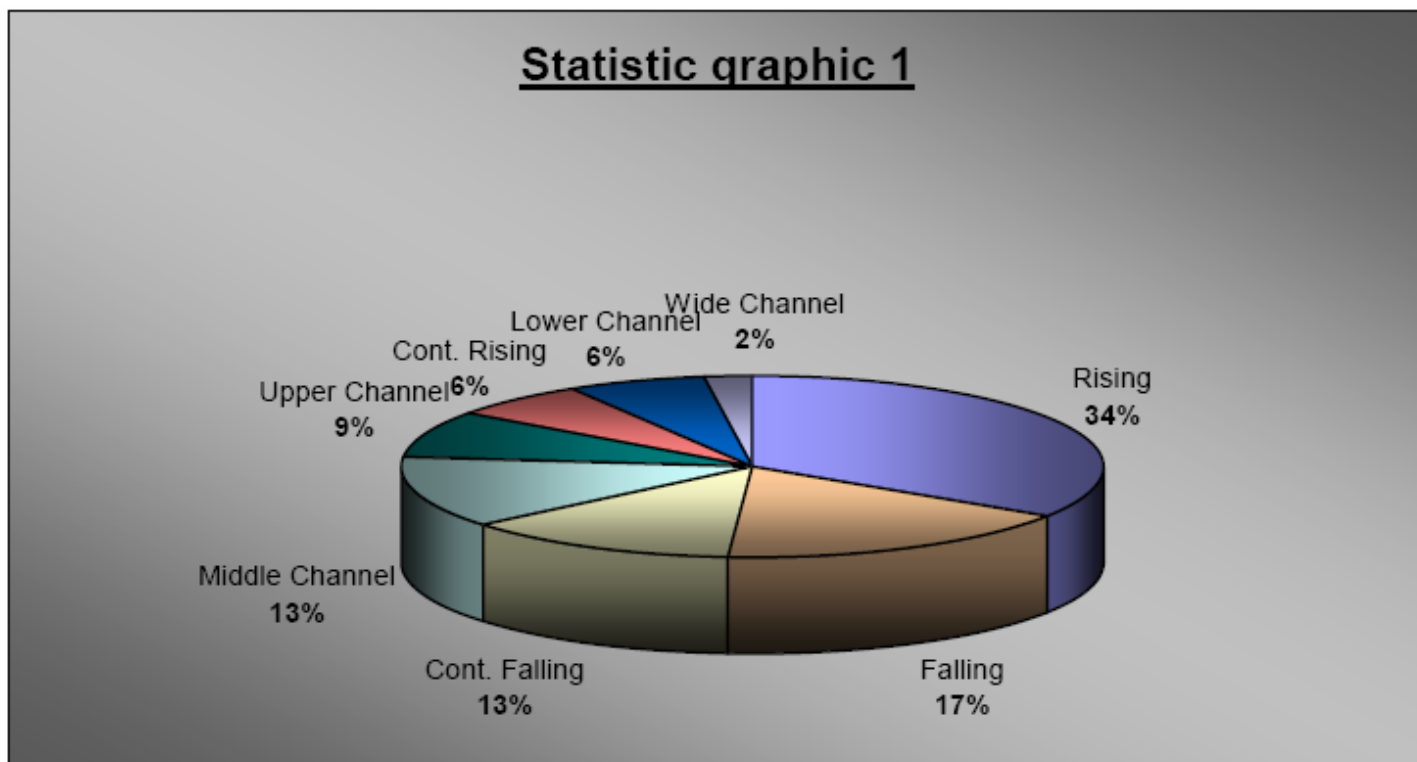
- 1- در ساختار **سطوح Rising و Continued rising** با برخورد قیمت به سطح حمایت **انتظار** موقعیت خرید را داریم.
- 2- در ساختار **سطوح Falling و Continued falling** با برخورد قیمت به سطح مقاومت **انتظار** موقعیت فروش را داریم.

2- ساختارهای **Irregular** هشدار میدهند که روند قیمت ممکن است تغییر کند مخصوصا زمانی که تحلیل این وضعیت ها با تحلیل **MACD** و **Stochastic** نیز همراه میشود.



در این قسمت به ارائه اطلاعات آماری استخراج شده از موقعیتهای 12 ماه تست شده توسط آقای Demark میپردازیم .

بررسی آماری ساختار سطوح (Level Structures Statistics)



Rising Level Structures	34 %
Falling Level Structures	17 %
Continued Falling Level Structure	13 %
Middle Channel Level Structure	13 %
Upper Channel Level Structure	9 %
Continued Rising Level Structure	6 %
Lower Channel Level Structure	6 %
Wide Channel Level Structure	2 %

بررسی آماری احتمال شکلگیری پترنهای کندل استیک (Candlestick Structures) در هریک از ساختار سطوح :

Rising Level Structure	
Candlestick structure	%
E	18
R	18
A	17
D	17
B	12
C	6
H	6
F	6
G	0
I	0

Falling Level Structure	
Candlestick structure	%
D	25
R	25
C	24
F	13
H	13
G	0
I	0
E	0
A	0
B	0

Continued Falling Level Structure	
Candlestick structure	%
H	32
A	17
G	17
I	17
R	17
B	0
C	0
D	0
E	0
F	0

Continued Rising Level Structure	
Candlestick structure	%
D	33
R	33
A	33
B	0
C	0
E	0
F	0
G	0
H	0
I	0

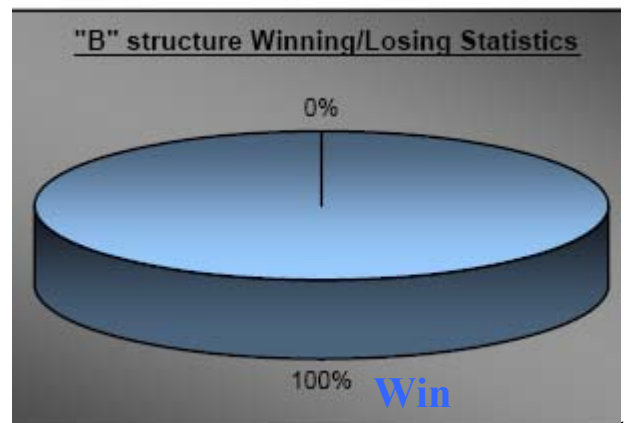
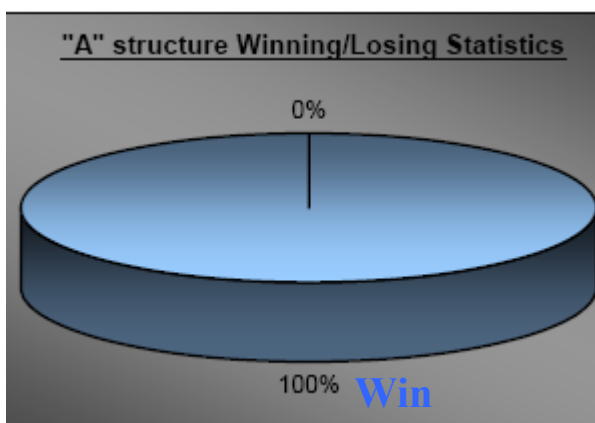
Middle Channel Level Structure	
Candlestick structure	%
R	60
C	20
F	20
A	0
B	0
D	0
E	0
G	0
H	0
I	0

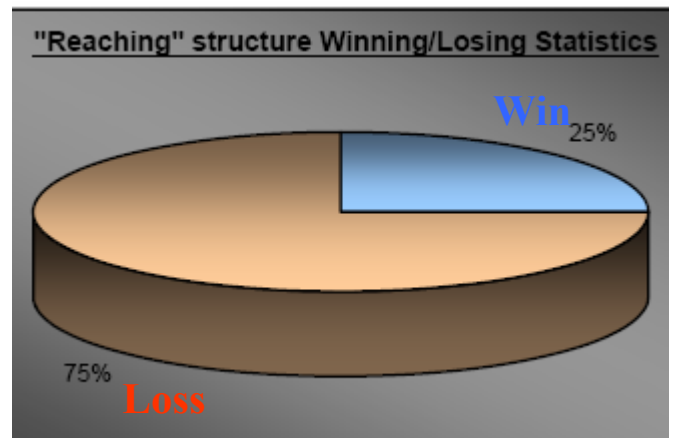
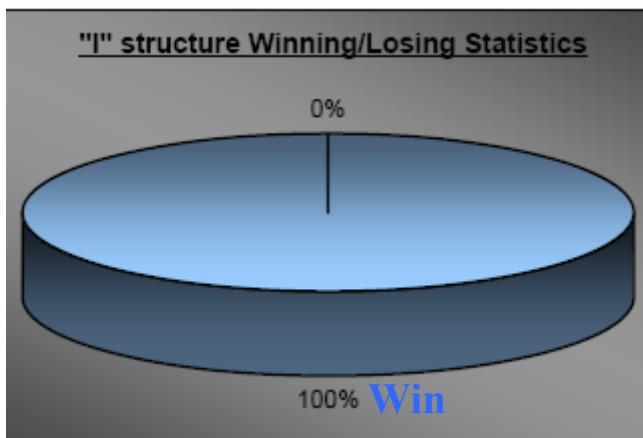
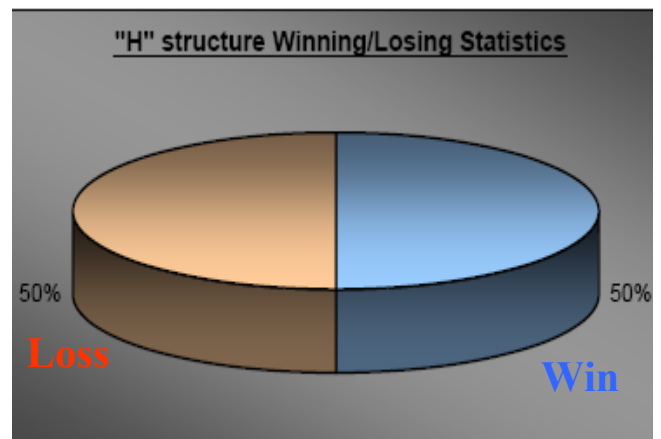
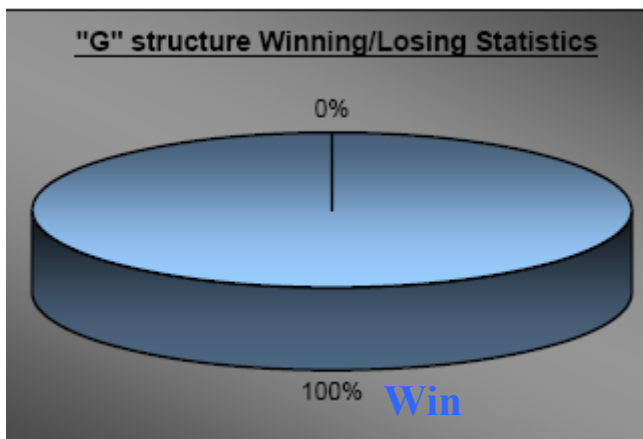
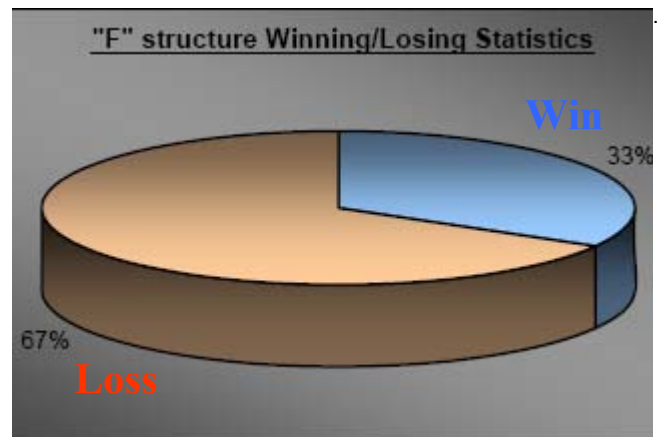
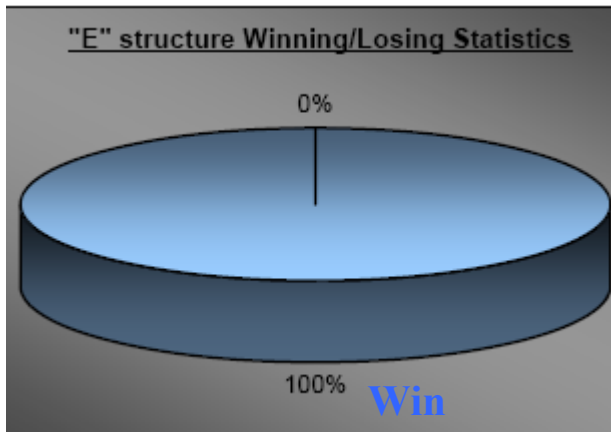
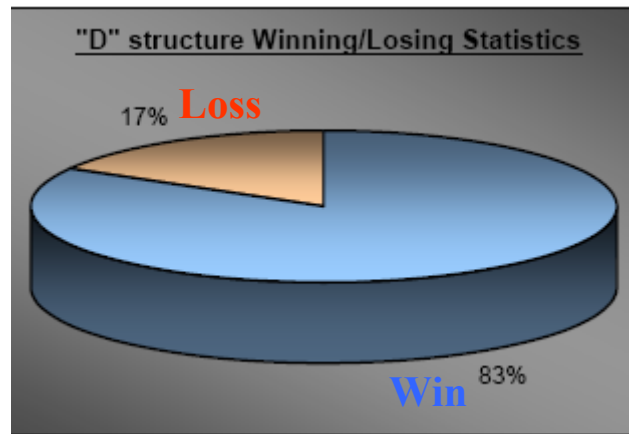
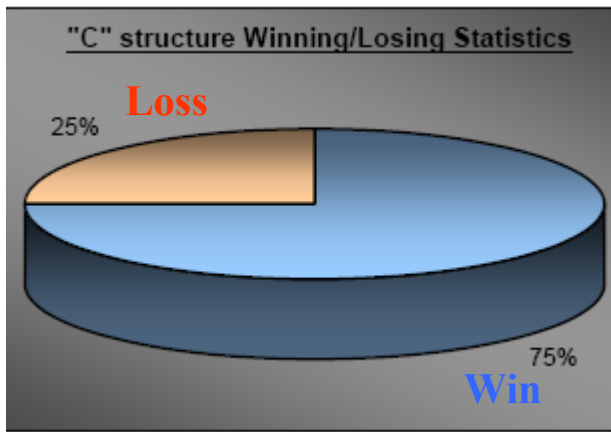
Upper Channel Level Structure	
Candlestick structure	%
R	60
B	20
C	20
A	0
D	0
E	0
F	0
G	0
H	0
I	0

Lower Channel Level Structure	
Candlestick structure	%
A	50
R	50
B	0
C	0
D	0
E	0
F	0
G	0
H	0
I	0

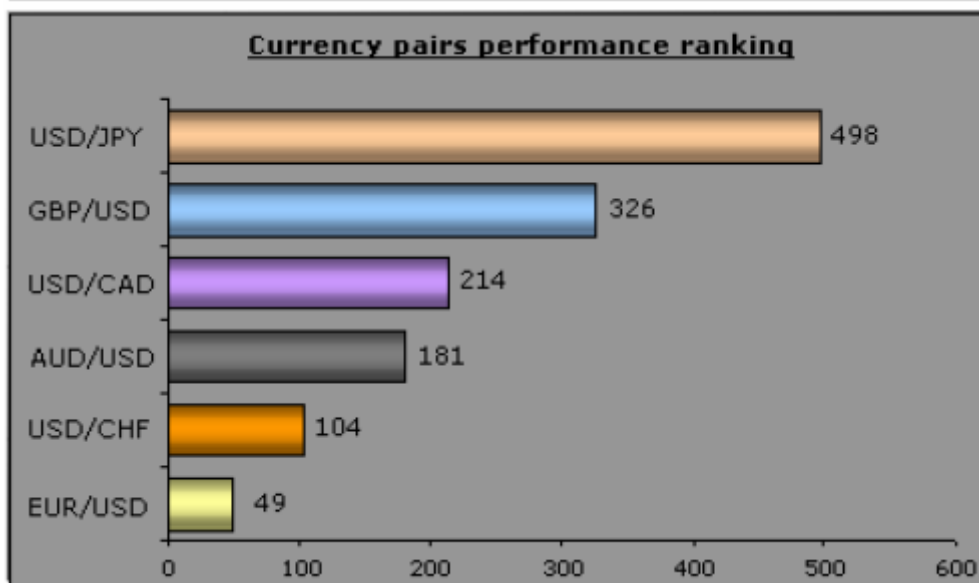
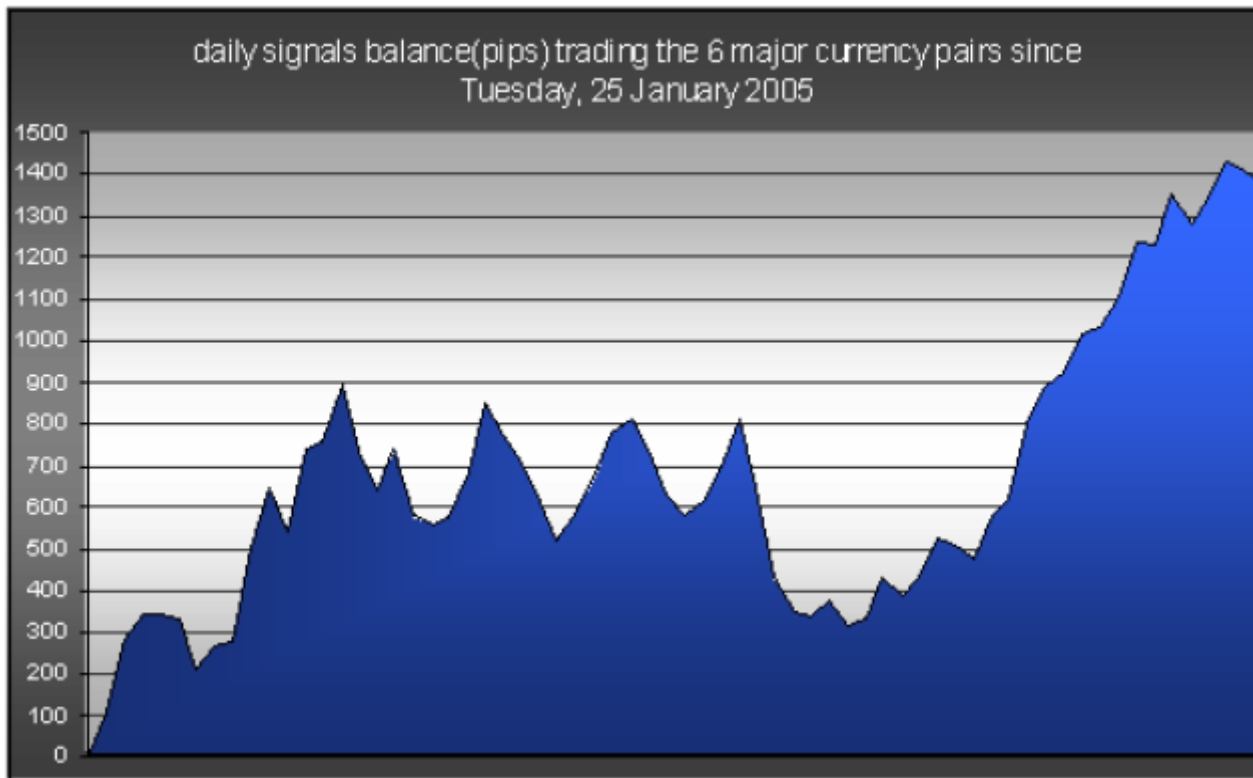
Wide Channel Level Structure	
Candlestick structure	%
C	100
A	0
B	0
D	0
E	0
F	0
G	0
H	0
I	0
R	0

بررسی آماری ساختارهای کندل استیک (Candlestick Structures)





آیا این روش ترید را واقعا میتوان بعنوان یک روش ترید مناسب در نظر گرفت و بصورت زنده نیز از آن استفاده کرد ؟ پاسخ آقای Demark مثبت است و وی به ارسال تحلیلهای خود از سال 2005 و نمودار نتایج زیر استناد میکند .



monthly average profit (pips) trading the 6 major pairs
128

maximum consecutive loss (pips) trading the 6 major pairs
-471

TP and SL (take profit point – stop loss point)

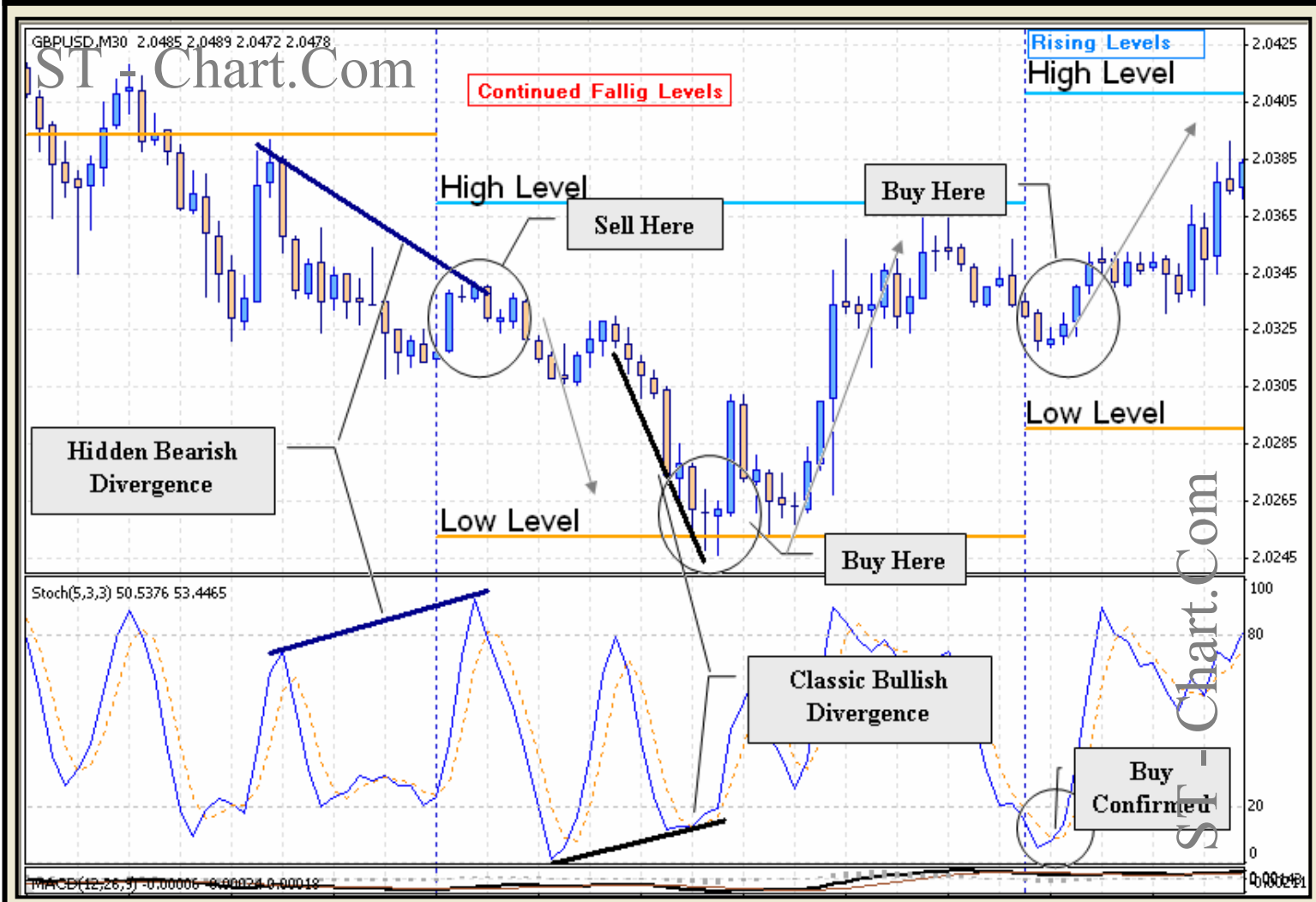
- EUR/USD.....TP 100 pips.....SL 80 pips
- GBP/USD.....TP 100 pips.....SL 80 pips
- USD/CHF.....TP 100 pips.....SL 80 pips
- USD/CADTP 100 pips.....SL 80 pips
- USD/JPY.....TP 70 pips.....SL 70 pips
- AUD/USD.....TP 70 pips.....SL 70 pips

حد سود و ضرر پیشنهادی Demark برای 6 ارز اصلی

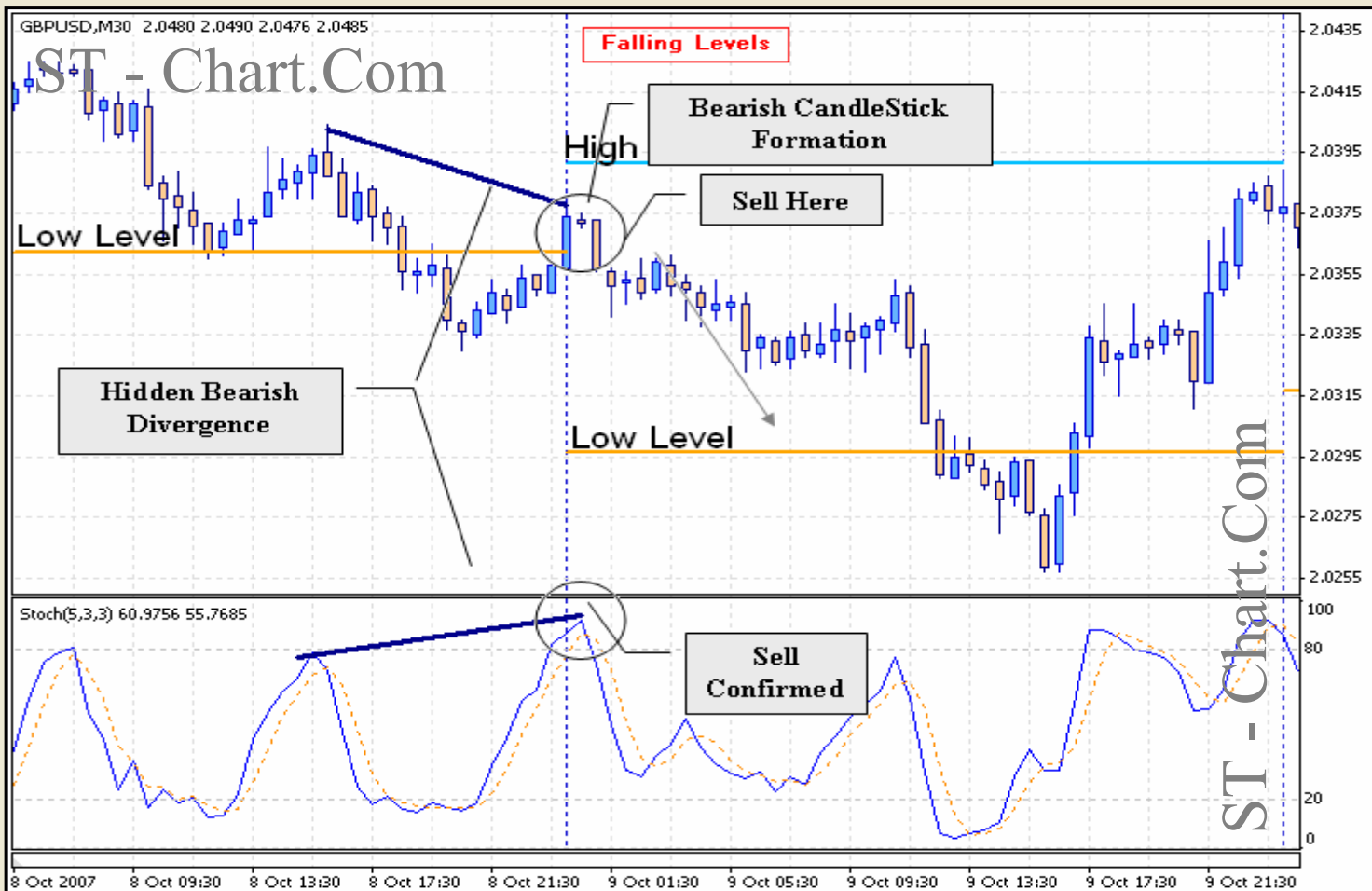
تمام پوزشنها براساس ساعت صفر (00:00:00 GMT) گرفته شده و در همین زمان در روز بعد چنانچه پوزشنی هنوز بلا تکلیف است باید بصورت دستی بسته شود .

در ادامه چند نمونه دیگر از این سطوح را مورد بررسی قرار میدهم.

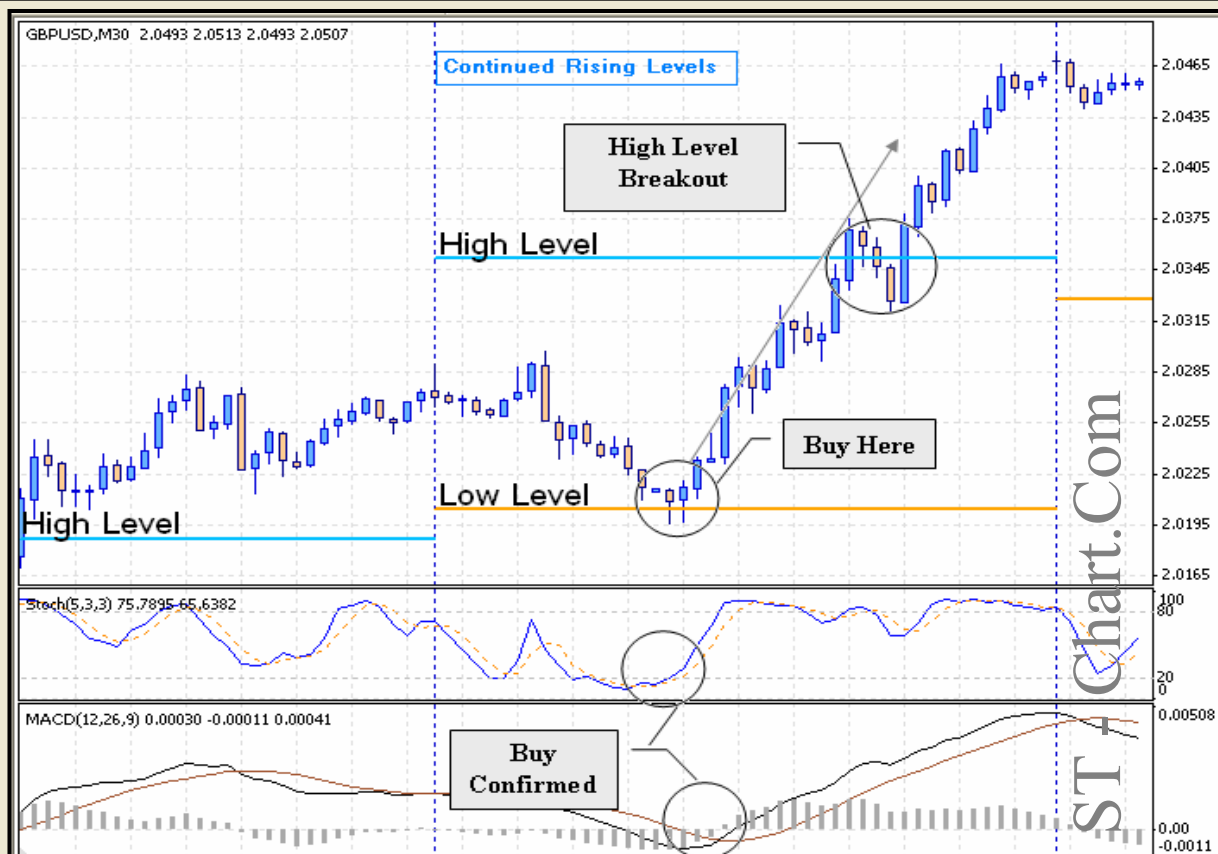
Demark Example 1



Demark Example 2



Demark Example 3



واگرایی (Divergence)

هرگاه روند افزایش یا کاهش قیمت و روند اسیلاتوری از قیمت در همان بازه در دو جهت مخالف باشد به این حالت واگرایی یا Divergence گفته میشود و هشدار است به معامله گران که روند قیمت و اسیلاتور همخوانی نداشته و به زودی شاهد اصلاح قیمت یا اصلاح روند اسیلاتور در جهت روند قیمت خواهیم بود. بطور کلی انواع واگرایی ها به چهار دسته تقسیم میشوند که در ادامه آنها را بررسی مینماییم.

Classic Bearish - 1

مشخصه این نوع واگرایی :

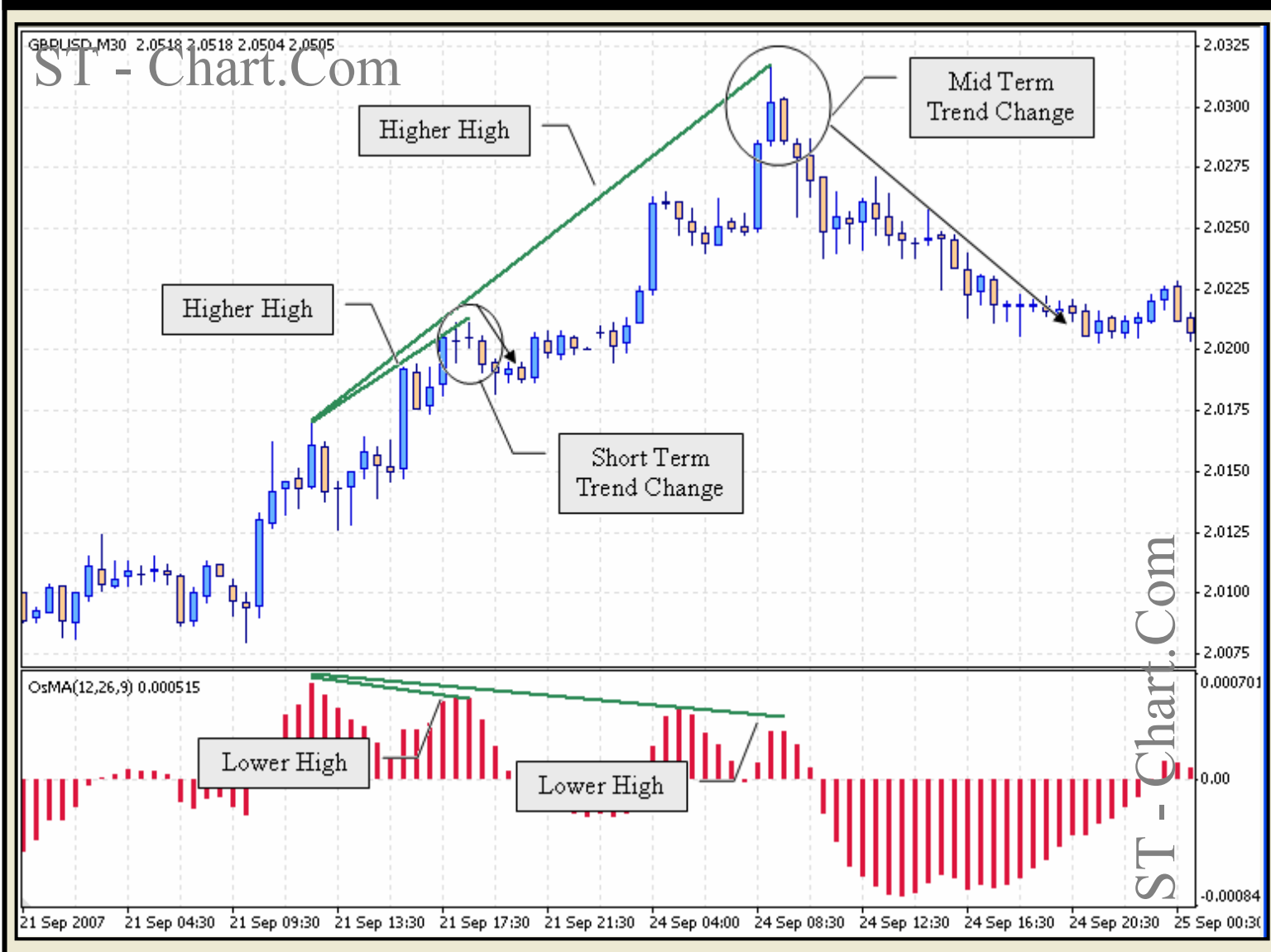
تشکیل Higher High در قیمت

تشکیل Lower High در اندیکاتور

ویژگی : مشخص کننده ضعف حرکت صعودی

هشدار است جهت تغییر ترند کوتاه مدت یا میان مدت از صعودی به نزولی

Classic Bearish Divergence



Classic Bullish -2

مشخصه این نوع واگرایی :

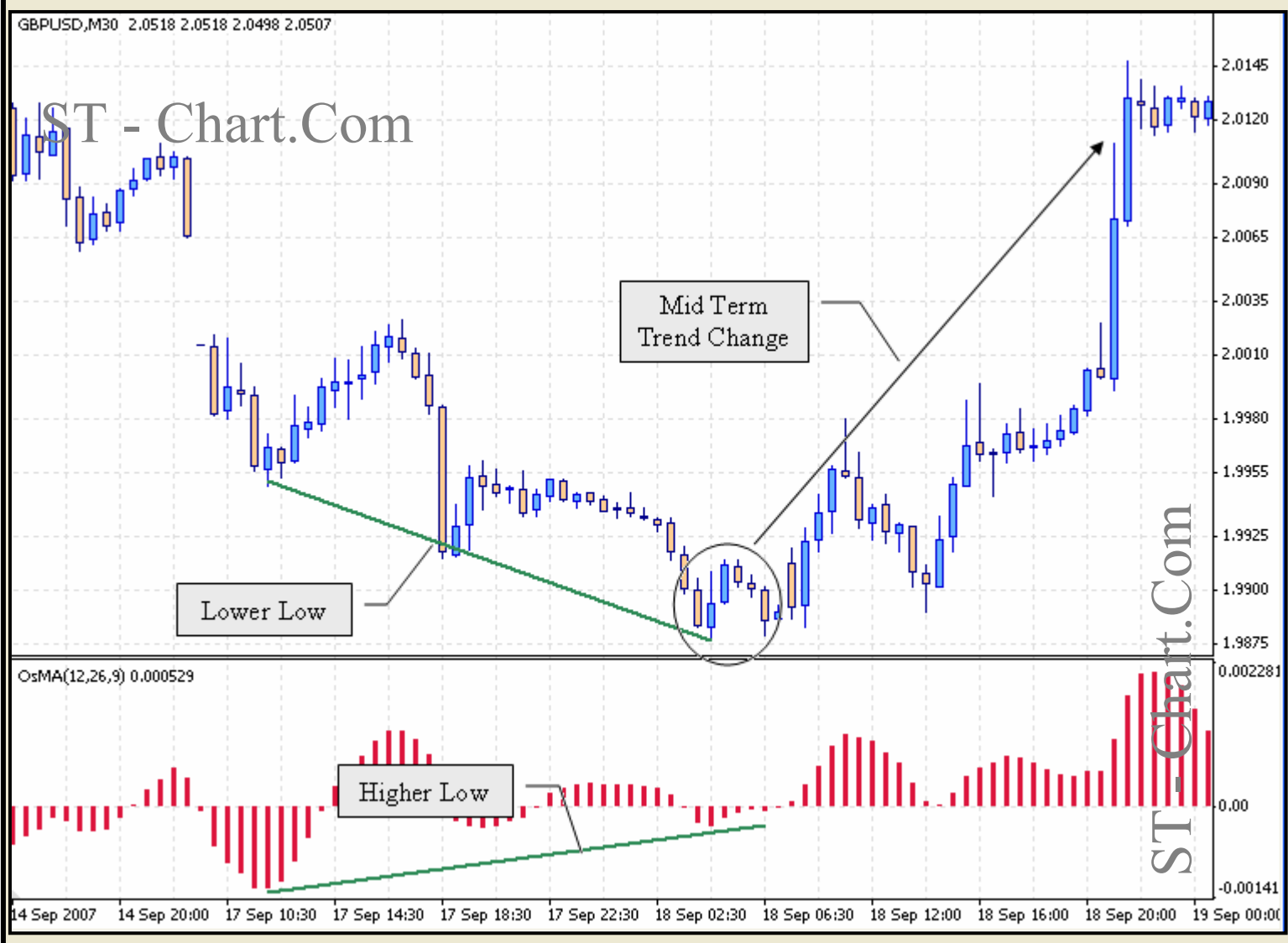
تشکیل Lower Low در قیمت

تشکیل Higher Low در اندیکاتور

ویژگی : مشخص کننده ضعف حرکت صعودی

هشدار است جهت تغییر ترند کوتاه مدت یا میان مدت از صعودی به نزولی

Classic Bullish Divergence



Hidden Bearish -3

مشخصه این نوع واگرایی :

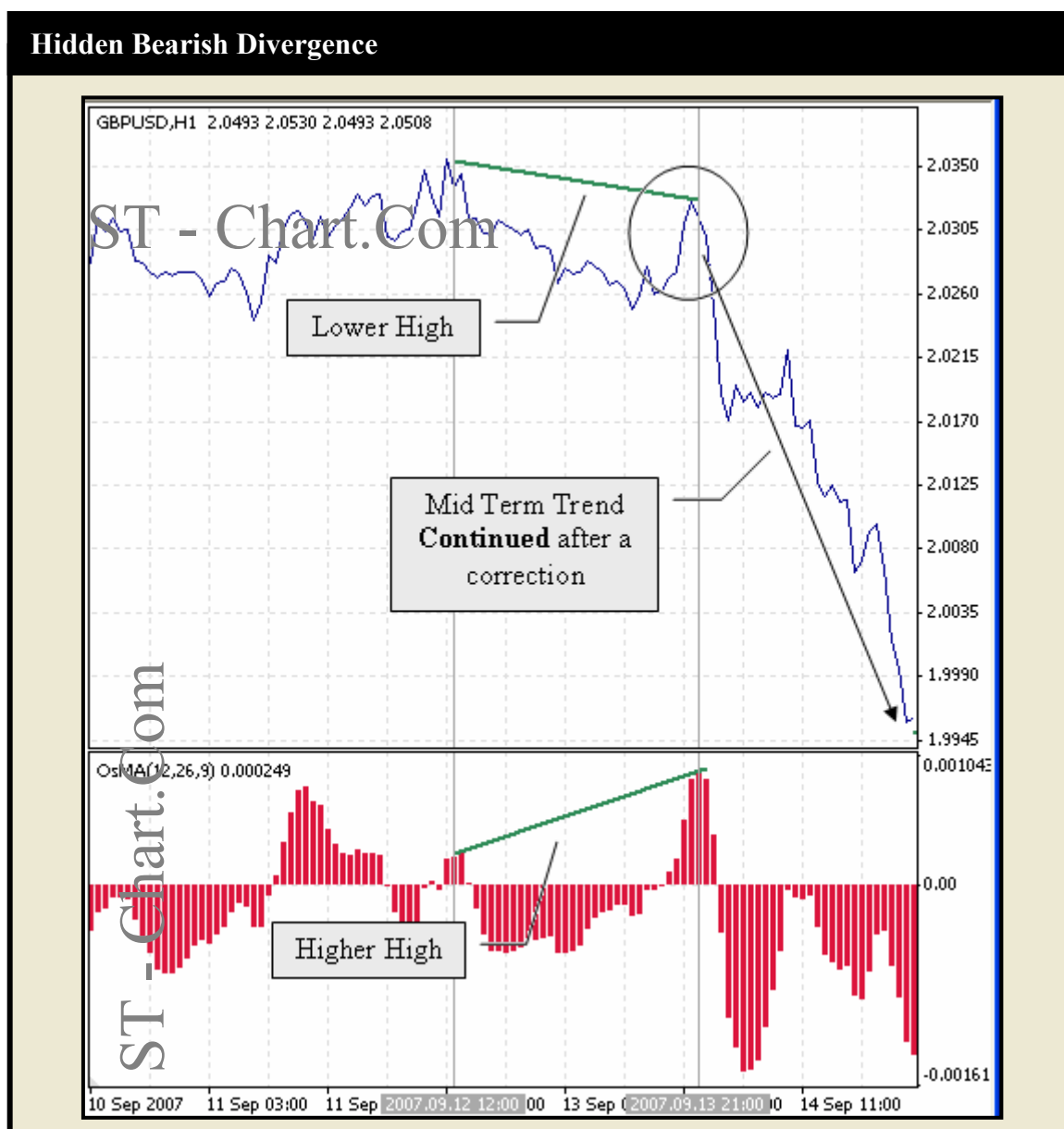
تشکیل Lower High در قیمت

تشکیل Higher High در اندیکاتور

ویژگی : مشخص کننده حرکت صعودی فریبنده

غالباً در اصلاحات یک ترند نزولی اصلی شکل میگیرد اما ممکن است در هنگام retest یک price top نیز رخ دهد .

یکی از موقعیت های مناسب برای ورود جدید و یا ورود مجدد به معامله در جهت ترند قبل میباشد .



Hidden Bullish -4

مشخصه این نوع واگرایی :

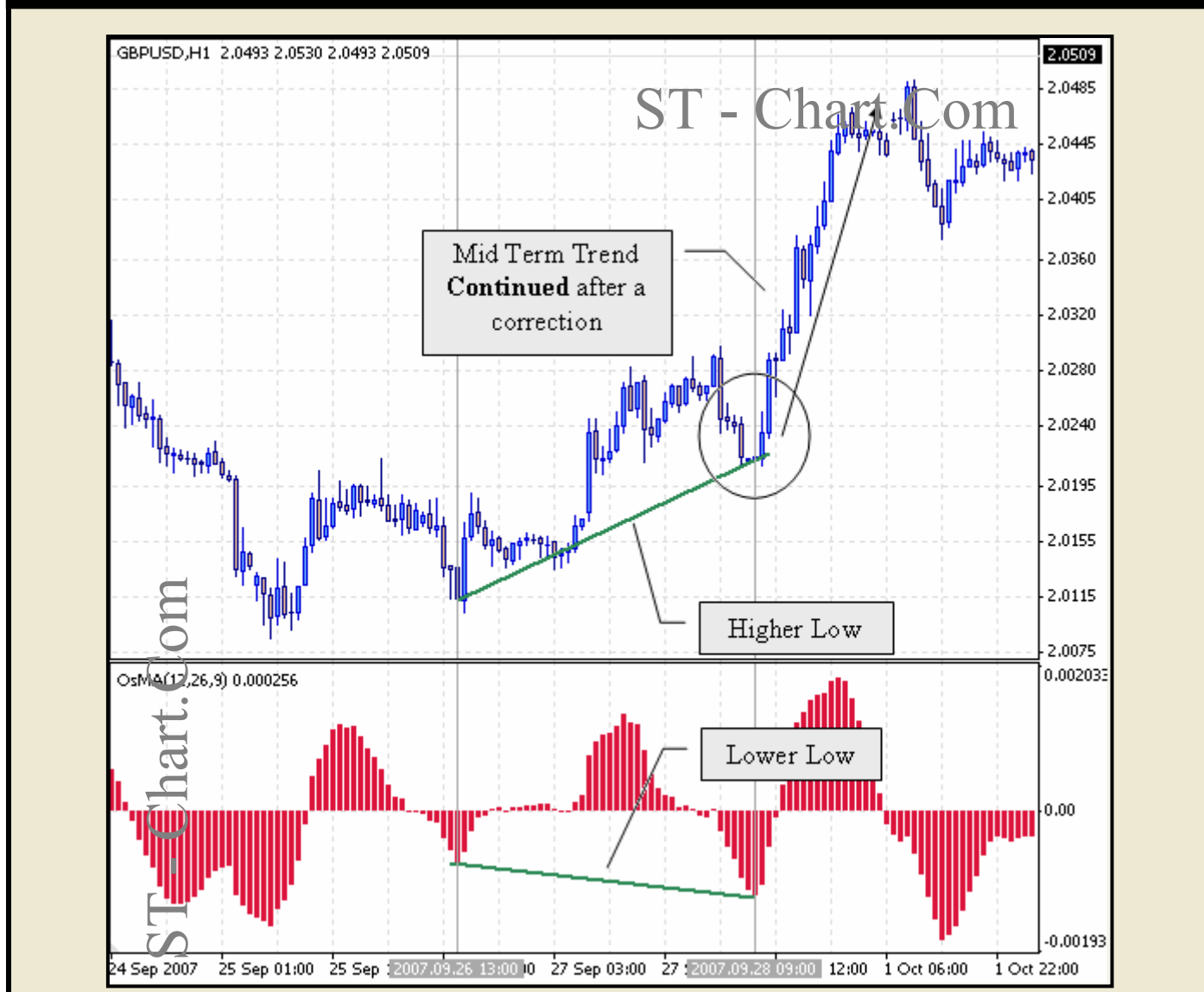
تشکیل Higher Low در قیمت

تشکیل Lower Low در اندیکاتور

غالباً در اصلاحات یک ترند صعودی اصلی شکل میگیرد اما ممکن است در هنگام retest یک price bottom نیز رخ دهد .

یکی از موقعیت های مناسب برای ورود جدید و یا ورود مجدد به معامله در جهت ترند قبل میباشد .

Hidden Bullish Divergence



در پایان به شما خاطر نشان میسازیم استراتژی های معاملاتی ارائه شده تنها جهت آشنایی با روشهایی ساده اما موثر در ترید روزانه میباشد و مجموعه اس تی سی در قبال سود یا ضرر احتمالی هیچگونه مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت .

خواننده گرامی ،
شما میتوانید سوالات و پیشنهادات خود را در انجمن گفتگوی مجموعه STC به آدرس www.STCT.Info و از طریق آدرس ایمیل Support@ST-Chart.Com و Info@ST-Chart.Com با ما در میان بگذارید .

با امید موفقیت
گروه اس تی سی