

بسم الله الرحمن الرحيم

مشکلات تحلیل تکنیکال و روشهای تسلط بر آنها



مترجم این اثر:

جناب آقای

...نادر اسدی...

ارائه شده در:

کانال تریگر - ها

https://telegram.me/TRIGGER_Ha

مقاله:

اجازه بدین مطلبی رو با شما در میان بگذارم:

اصلا مهم نیست که شما از چه استراتژی یا سیستمی برای ترید استفاده می کنید. همه روش های ترید می توانند برای شما پول به ارمغان بیاورند. منظورم از روش ترید یعنی روشی که شما ورود و سیگنال را تعریف می کنید. گرچه شاید این حرف اغراق آمیز باشد ولی من حاضرم پای حرفم بایستم و آن را اثبات کنم. روشی که شما چارت را می خوانید و روشی که نقاط ورود را تعریف می کنید معمولا کاری با کیفیت سیستم تان یا اینکه سود ده باشد یا نه ندارد. و این مفهوم بخصوص زمانی در مورد تحلیل تکنیکال صحبت می کنیم کاملا صحیح می باشد.

تحلیل تکنیکال و پرایس اکشن ساده و آسان بنظر می رسند. الگوها (پترن‌ها) به نظر تریدرهای بی تجربه بسیار واضح و شفاف هستند، اما حقیقت ماجرا اینست که تحلیل تکنیکال و معامله گری بر اساس پرایس اکشن یکی از سخت ترین روشهای معامله گری می باشد.

این حرف من را قبول نمی کنید؟ خیلی از صاحب نظران ممکن است نظر مخالفی با من داشته باشند ، اما اگر ادامه این مقاله را مطالعه کنید خواهید دید تحلیل تکنیکال ان طور که شما فکر می کنید نیست و خواهید فهمید که چرا سخت تر از آنست که تریدرها انتظارش را دارند.

به شما تضمین می دهم که در این مقاله ایدا بدنبال بدگویی از تحلیل تکنیکال نیستم و خودم یکی از طرفداران پر و پا قرص تحلیل تکنیکال هستم ، اما در این مقاله می خواهیم با چشمان باز دورنمای جدیدی از نحوه کار تحلیل و معامله گری تکنیکال را باهم بررسی کنیم. در واقع ما در اینجا در مورد عادت بد عوض کردن پی در پی سیستم های معامله گری می خواهیم با هم صحبت کنیم یعنی چیزی که سالهاست من تلاش دارم که تا حد امکان مانع از ان در میان تریدرها شوم.

ما در معامله گری نباید بدنبال روشهای جدیدتر و بهتر ورود باشیم، بلکه باید بدنبال ایجاد یک رویکرد معامله گری قوی باشیم که ترکیبی از همه مفاهیم و اصول معامله گری باشد و در اینجا ما می خواهیم به صورت مختصر در ای باره با هم صحبت کنیم.

تحلیل تکنیکال یک امر ذهنی است و به هر روشی می توان آن را انجام داد

این جمله ای است که تریدر های تکنیکال دوست ندارند آن را بشنوند. تریدرها تکنیکال را انتخاب می کنند چون نمی خواهند با شرایط عدم قطعیت و ذهنی بودن شرایط تریدرهای فاندامنتال روبرو شوند، درستنه؟

آیا مزیت تریدر تکنیکال بودن این نیست که شما می توانید به سادگی چند خط افقی و کانال بکشید یا الگوهای پرایس اکشنی را شناسایی کنید؟

خوب بعد از مقدمه ، می خواهیم چارتهای ذیل را با هم بررسی کنیم، همه چارتهای این مقاله USD/WTI (وست تگزاس اینترمدیت در مقابل دلار) و در تایم فریم چهار ساعته و در یک محدوده زمانی هستند ، با این تفاوت که برای تحلیل در این چارتهای از ابزارها و الگوهای پرایس اکشنی متفاوتی استفاده می شود. نقطه نظر ما هم در این بررسی ها همانطور که قبلا گفتیم این است مهم نیست که شما چه سیستم یا روشی را انتخاب کرده باشید. و اینکه سود ساز بودن یک تریدر به انتخاب نحوه ورودش به پوزیشن ارتباطی ندارد، و البته در این مورد عمیق تر می شویم.

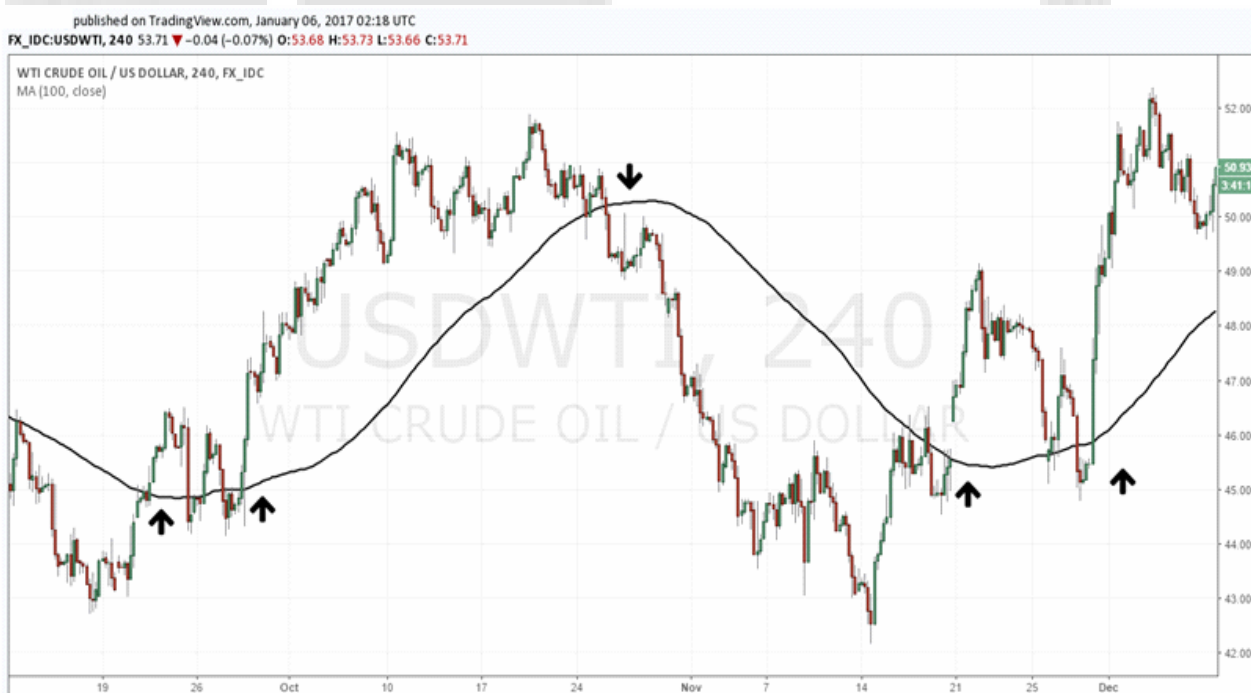
کار را با نگاه انداختن به خط روند و شکست خط روند شروع می کنیم. سیگنالی که از این روش می گیریم در بسیاری از نقاط چارت خوب و خیلی واضح است.



اما همه معامله گران خط روند را دوست ندارند و ممکن است توجهشان به الگوی سرو شانه ای جلب شود که اساسا همان سیگنال تریدر های قبل را صادر می کند.



میانگین های متحرک هم خیلی محبوبیت دارند و از کراس اور آنها با قیمت برای شناسایی و ورود به روند های بلند مدت استفاده می شود. چنانکه میبینیم این روش هم سیگنالهای خوبی صادر کرده و اگر تریدر از یک میانگین دیگر هم استفاده کند می تواند یک سیستم قطع کردن میانگین ها برای خودش بسازد.



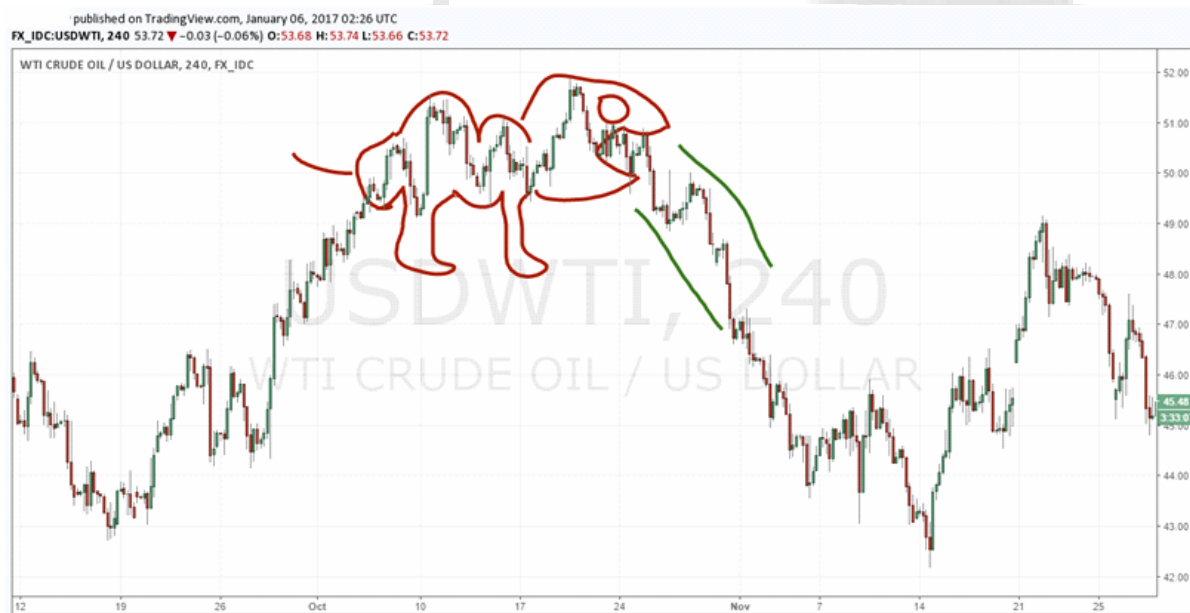
اندیکاتور استوکاستیک مومنتوم و تغییر جهت مومنتوم را تحلیل می کند. در خالصترین شکل آن، یک تریدر بدنال تقاطع دو خط استوکاستیک در سطوح 30/20 و 70/80 است. اگر به تصویر ذیل نگاه کنید. می توانیم ببینیم که اندیکاتور استوکاستیک هم می توانسته برای شناسایی فرصت های ترید بخوبی مورد استفاده قرار گیرد و می توانسته روند بلند مدت تری را بگیرد.



صد البته ، که بدون خطوط حمایت و مقاومت افقی و سوینگ های و لو محلی نمی شود حرکتی زد(برای بعضی تریدرها).و براحتی می توانید ببینید که در همان چارت به زیبایی می توان از همین مفاهیم خطوط حمایت و مقاومت افقی و سوینگ های و لو محلی بهره برد.و ما بدنال بانس قیمت در سطوح و یا شکسته شدن سطوح هستیم.



در آخر هم می توانیم یک شوخی با الگوها و ساختارهای تحلیل های تکنیکال با معرفی الگوی
استفراغ شتر (puking` camel` pattern)



پیامی برای تریدر های تکنیکال ، مشکل واقعی چیست؟

پیام واضح است، شما می توانید هر چارتی را بردارید، یک تایم فریم اتفاقی را انتخاب کنید و روی آن هر اندیکاتور یا الگوی پرایس اکشنی را پیاده کنید تا احتمالاً نقاط ورود بزرگی که منجر به ایجاد روند هایی با صد ها پیپ سود می شود را شکار کنید.

جملات بالا همانی است که ما می گوئیم ادراک غلط و لازم است یک تریدر از این درک اشتباه به منظور تصمیم گیری صحیح اجتناب کند.

اگر نگاه دقیقی به هر کدام از چارت های بالا بیاندازید، می توانید ببینید که ، گر چه نقاط ورود همه روش ها کاملاً واضح است و به نظر می رسد که تریدر ها در سود باشند، اما در زمان واقعی ترید، شرایط بسیار سخت تر خواهد بود زیرا ما به مسائلی که واقعاً مهم هستند نظیر احساسات، نحوه و زمان ورود ، مدیریت ریسک سفارش و مدیریت معامله توجه نمی کنیم.

مجدداً ، این نقطه نظر خود را برجسته می کنم که روش ترید کردن را نمی توان فقط خلاصه کرد به پیدا کردن نقاط ورود. فقط آموخته ها چنین تعریفی از روش ترید کردن دارند. خوب حالا با هم سراغ نکات مهم می رویم و می بینیم که چگونه این اجزا در سیستم معامله گری تاثیر گذارند.

احساسات (Emotions)

از آقای فومو نقل می کنم که بطور واضح می توان گفت، احساسات موضوع مهم و بزرگی در معامله گری (ترید) است و تمامی تصمیمات معامله گری ما را چه در زمانیکه ما وارد یک معامله می شویم ، چه مدیریت ریسک و مدیریت معامله ، و دست و پنجه نرم کردم با دراودان ها در طول معامله و خروج از معامله تحت تاثیر قرار می دهند.

بنابراین ، اولین کاری که لازم است انجام دهید این است که مطمئن شوید احساسات کمترین تاثیر را را در تصمیمات تان در معامله گری و ترید داشته باشد. این مورد خیلی مهمتر از این سوال است که از خود بپرسیم از چه الگو یا اندیکاتوری استفاده کنیم؟

Execution and orders نحوه اجرا و سفارش گذاری

شما چگونه یک ورود را تعریف می کنید و اردرهای حد ضرر و برداشت سود را کجا قرار می دهید. حتی بهترین ورود ها هم در مجموع اگر محل قرارگرفتن حد سود و ضرر مناسب نباشد می تواند بدون فایده بسته شود .

علتش هم مشخصه چون قیمت یا به سرعت به سمت حد ضرر می رود و آن را می زند و یا حد سود بسیار کم دیده شده و سودی بوجود نمی آید و یا بسیار دور گذاشته شده و قیمت به آن نمی رسد.

Trade management مدیریت معامله

مدیریت خرد مسئله مهمی است که در مقالات قبل به آن پرداخته ایم. بسیاری از معامله گران در دو حالت دچار سوء مدیریت می شوند. نخست در زمانیکه اجازه میدهند احساساتشان سوار کار شود و دوم زمانی یک پلن معاملاتی واقعی نداشته باشند و البته سوء مدیریت معامله هم که مشخص است چه عاقبتی دارد.

Risk management مدیریت ریسک

یک معامله گر با مدیریت ریسک و مدیریت سرمایه ناجور به راحتی بهترین روش ورود را نابود می کند. با خودتان رو راست باشید که چقدر می توانید ریسک کنید. کمترین فایده برای شما چقدر باید باشد. مشخص کردن میزان ریسک به ریوارد و لوریج یا اهرم معاملاتی مناسب ، مفاهیم بنیادینی هستند که یک تریدر قبل از ورود به معامله باید در آنها به مهارت کامل رسیده باشد.

نقش نحوه ورود و جستجوی الگوهای قیمت در عالم معامله گری این روزها خیلی جدی گرفته شده در حالیکه نقطه ورود باید نقش کوچکی در معامله گری شما داشته باشد.

مهم نیست که شما از چه سیستمی استفاده میکنید، هر روشی می تواند برای شما پولساز باشد و هر روشی می تواند پول را نابود کند. نقاط ورود ربطی با سود ساز بودن یک سیستم ندارند. در عوض، بر موارد دیگری که می تواند یک سیستم قوی را بسازد ، باید تمرکز کرد. زمانیکه یک تریدر نسبت به سایر اجزای روش معامله گری اش آگاه شود ، قادر خواهد بود به روشش معامله گری اش جور دیگری نگاه کند.

ورود در مقایسه با شش فاز یک معامله مز ناپیزی است



TRIGGER-HA

بیاید به همان درک غلط و تصور اشتباه برگردیم در واقع چیزی که بسیاری از تریدرها زمانیکه به تحلیل تکنیکال وارد میشوند فراموش می کنند. بسیاری از معامله گران دنبال کتابهای الگوهای قیمتی و حرکات مشخص قیمت هستند حال اینکه پس از مدتی بسیاری از این معامله گران با استفاده از همین الگوهای سود ساز سرمایه خودشان را از دست می دهند.

الگوهای پرایس اکشن و حرکات قیمت ناقص و ناکامل هستند و این بدین معنی است که این الگوها از قوانین کتابهایی که شما خریدید تبعیت نمی کنند. قیمت یک مفهوم فوق العاده پویا (داینامیک) است. و این موضوع خیلی اهمیت دارد که درک شود سایر معامله گران چگونه به شما اجازه ورود می دهند. هم زمان، مهم است که نواقص عدم هماهنگی حرکات قیمت را شخصی سازی کنیم و با نوسانات بعنوان حرکات طبیعی قیمت کنار بیایم تا قادر باشیم به مدیریت نقاط استاپ و مدیریت معامله پردازیم.

در قسمت چپ ، شما الگوهای موجود در کتابها را می بینید که تریدرها انتظار دارند و با وقوع آنها اقدام به ترید می کنند. اما آنچه در عمل دیده می شود اینست که قیمت به سمت استاپ روانه می شود و نوسانات زیادی را شاهد هستیم.

فلذا مجدداً می گویم ورودها و یافتن الگوها بزرگنمایی شده، کمکی به زمان ورود شما به

معامله نمی کند. بلکه هر آنچه که باید دنبال کنید اینها هستند:

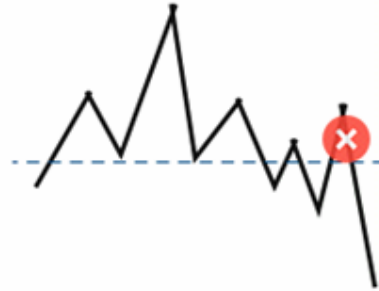
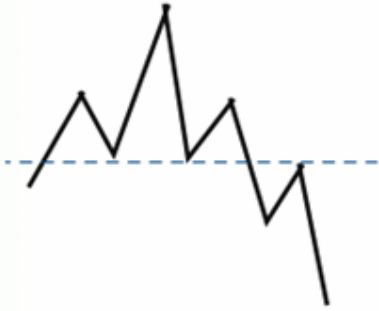
- گذاشتن استاپ در نقطه درست،
- نسبت ریسک به ریوارد،
- مدیریت معامله،
- خروج،
- مدیریت ریسک
- و غیره.

نقص حرکات قیمت

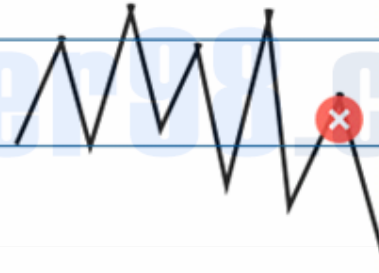
آنچه انتظار می رود (پیش بینی)

آنچه رخ می دهد (واقعیت)

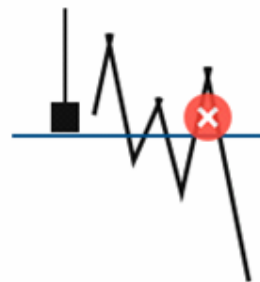
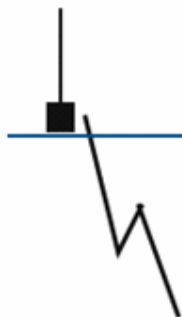
Head & Shoulders



Range Trading



Pinbar & Price Action



چرا تحلیل تکنیکال می تواند سود ساز نباشد

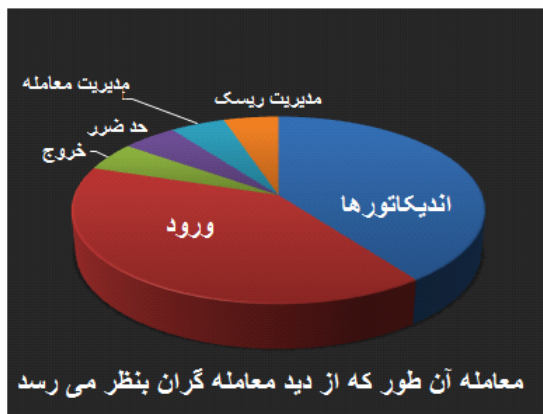
یکی از دلایلی که باعث می شود افراد قادر نباشند با استفاده از تحلیل تکنیکال پول در بیاورند، فقدان دانش در مورد اهمیت اختیار و احتیاط در معامله است. الگوهای ویژه ای مثل سر و شانه ، حمایت و مقاومت ، خطوط روند ، فنجان و دسته، امواج ایبوت ، مثلثها ، کنج ها ، پرچم ها ، (باغ وحشی از الگوهای هارمونیک) و جهش ها در ورود ، استاپ و حد سود خیلی سلیقه ای و اختیاری هستند.

معامله گران تکنیکال هر روز با سوالات ذهنی و سختی روبرو هستند. مثل:

- **شانه دوم را کجا باید بکشم؟**
 - **آیا این خط گردنه؟**
 - **خط رو باید به شادو وصل کنم یا بدنه کندل؟**
 - **مثلث از این کندل شروع میشه؟**
 - **آیا این واقعا یک کنجه؟**
 - **از کدام کندل برای رسم بالای خط روندم باید استفاده کنم؟**
 - **دسته فنجان نباید کمی بالاتر باشه؟**
 - **آیا واگرایی در مکدی واقعا تایید شده؟**
 - **آیا قیمت میانگین متحرک رو با موفقیت تست کرد یا باید منتظر کندل بعدی بمانم؟**
 - **آیا این یک بریک اوت قوی بود یا باید منتظر بمانم؟**
- و...

در این مقاله با هم در مورد این بحث کردیم که همه زمان و انرژیمان را صرف پیدا کردن بهترین راه به معامله نکنیم و به جای اینکه روی پارمترهای مهمتر سیستم معاملاتی مان باشیم دنبال جستجوی شیوه های مختلف ورود نباشیم.

من هیچ وقت ندیدم که یک تریدر موفق بخش اعظمی از وقت خودش رو صرف جستجو برای ورود بکند ، بلکه آنها بیشتر دنبال توسعه یک سیستم قوی هستند و بیشتر وقت خود را صرف مدیریت ریسک، قراردادن سفارش، مدیریت معامله، گرفتن سود و مدیریت سناریوی ریسک به ریوارد و غیره می کنند.



مهمترین نتیجه این مقاله اینست که ، نگران ورود نباشید ، دست از شکار راه های بهتر زمان ورود بردارید. به جای اینکه از این شاخه به آن شاخه بپرید یک روش انتخاب کنید و با آن کار کنید. اگر در حال حاضر ضرر ده هستید، علتش این نیست که روش ورودتان بد است.

ترفندهای ذیل به شما کمک می کند تا رویکرد معامله گری تان بهبود بخشیده و عینیت را در ترید جایگزین ذهنیت نمایید.

• قوانین ثابتی را برای خودتان قرار دهید که مشخص کنید الگوهای پرایس اکشنی را چگونه رسم کنید و آنها را به همراه الگوها چاپ کنید تا در صورت لزوم با رجوع به آنها از شرایط مطمئن شوید.

• به طور واضح تعریف کنید که شما چه الگویی را ترید می کنید و چه تفاوتی را بین یک الگوی بد با یک الگوی خوب می بینید.

• ابزار ها و اندیکاتورهایی را که می خواهید استفاده کنید را انتخاب کنید و آنها را دائما تعویض نکنید.

• از ادارک غلط اجتناب کنید و در ستاپ های گذشته بدنبال عینیت باشید.

• ورود آنقدر ها که همه فکر می کنند مهم نیست، اتفاقاتی که پس از ورود می افتد هست که یک سیستم را عالی یا نابود می کند.

• متوجه نقص و ناکاملی الگوهای معاملاتی باشید.

• تحلیل تکنیکال خیلی سلیقه ای و اختیاری است، و شما نیاز دارید که تمامی اجزای سیستم تان را بخوبی بشناسید تا از ذهنی گرایمی بودن اجتناب نمایید.

ارائه شده در:

کانال تریدرها