



ICT MENTORSHIP HANDBOOK

کانال : @TOBEATRADER



گردآورنده : محمد کریمی کیا



IT'S ALL ABOUT TIME AND PRICE

تشکر می‌کنم از:

جناب آقای یعقوب فریدونی برای طراحی جلد

جناب آقای عبدالزهره شاهینی برای تایپ فصل‌های سوم، چهارم، پنجم و نصف ششم

سرکار خانم نفس عزیزاده برای تایپ فصل هفتم

جناب آقای محمد لطفی برای تایپ فصل‌های هشتم، نهم، دهم، یازدهم، دوازدهم و نصف ششم

جناب آقای ایمان پوررنجبر برای تصویرگذاری و ویرایش اولیه فصل‌های اول، دوم، سوم، چهارم، پنجم، هفتم و هشتم

جناب آقای بهنام خواجوی برای ویرایش کلی و تصویرگذاری فصل‌های ششم، نهم، دهم، یازدهم و دوازدهم

جناب آقای محمدرضا قهرمانی برای ویرایش نهایی فصل‌های اول، دوم، سوم، چهارم، پنجم، هفتم و هشتم

و از تیم ترجمه دوره آی سی تی @ICT_Translate که قدم بزرگی برای جامعه تریدری ایران برداشتند.

فهرست

1	مقدمه
3	فصل صفر
14	فصل اول
29	فصل دوم
39	فصل سوم
49	فصل چهارم
68	فصل پنجم
93	فصل ششم
111	فصل هفتم
142	فصل هشتم
166	فصل نهم
187	فصل دهم
204	فصل یازدهم
212	فصل دوازدهم

در بازارهای مالی دیدگاه‌ها و سبک‌های مختلفی برای بررسی چارت و کسب سود پدید آمده است. یکی از این سبک‌ها که فقط با چارت خالی و قیمت سر و کار دارد پرایس اکشن است. در دیدگاه پرایس اکشن نیز روش‌های مختلفی وجود دارد که یکی از آن‌ها سبک ICT که توسط جناب آقای مایکل هادلستون توسعه یافته است. این سبک دیدگاه کاملاً متفاوتی نسبت به سبک‌های مطرح بازارهای مالی دارد و دیدگاه گردانندگان آن بازارها را که پول‌های درشتی در انواع بازارها صرف می‌کنند تا سودهای بزرگ کرده و پول معامله‌گران خرد را بردارد به ما می‌دهد.

در بازارهای مالی دسته بندی دیگری از نحوه ترید وجود دارد. بعضی از روش‌ها توصیه به ترید در پایان اصلاح دارند، برخی دنبال برگشت‌های قیمت اند و برخی با شکست سطوح وارد مارکت می‌شوند. روش آی سی تی بیشتر دیدگاه اول و دوم را جدا یا ترکیب با هم در پیش گرفته و از روش سوم نه به عنوان ورود بلکه به عنوان تارگت‌های خروج در سود استفاده می‌کند تا همانند مارکت میکرها سودهای خود را در آن نواحی نقد کند.

ما در این سبک سعی بر پیدا کردن نقاط و سطوح مناسب برای ورود داریم تا هم زودتر وارد سود شده و هم استاپ مناسبی داشته تا برآیند مطلوبی داشته باشیم. همه مباحث در این سبک علاوه بر قیمت بر زمان نیز تمرکز دارد تا اجزای چارت تکمیل شود. در این کتاب دوره منتورشیپ سال ۲۰۱۶ خلاصه شده است.

در فصل صفرم به برخی مفاهیم مهم و همچنین مفاهیمی که پیش‌نیاز دوره است و برخی از موارد آن در دوره رایگانی که تحت عنوان Market Maker Primer در یوتیوب به عنوان پیش‌نیاز منتورشیپ قرار داده شده است می‌پردازیم. از فصل اول وارد دوره اصلی منتورشیپ شده و در این فصل دیدگاه اولیه‌ای از چگونگی فکر کردن همانند مارکت میکر را بدست می‌آوریم. این دیدگاه در طول دوره به مرور تکمیل خواهد شد.

در فصل دوم به اهمیت مدیریت سرمایه در این شغل و روانشناسی ترید بر این اساس می‌پردازیم.

در فصل سوم دیدگاه تکمیل‌تر شده و شناسایی رد پاهایی از مارکت میکر را در چارت یاد خواهیم گرفت.

در فصل چهارم مهم‌ترین سطوحی که می‌توانیم در چارت روی آن‌ها ترید کنیم را یاد می‌گیریم.

در فصل پنجم به لانگ ترم تریدینگ یا معاملات بلند مدت از نظر زمانی و همچنین موارد مهمی مثل تمایلات فصلی و آرایه PD می‌پردازیم.

در فصل ششم سویینگ تریدینگ را یاد خواهیم گرفت.

در فصل هفتم شورت ترم تریدینگ و رنج‌های هفتگی که ابزار بسیار کارآمد و جالبی است را یاد می‌گیریم.

در فصل هشتم و نهم به دی تریدینگ یا معاملات روزانه و اسکالپینگ خواهیم پرداخت. همچنین رنج روزانه، انواع

ساعت‌های معاملات و سشن‌های هر روز و نحوه استفاده از آنها، چهار روش گام حرکتی برای پیدا کردن کف و سقف روز، چندین ستاپ برای این دو سبک و کارهای روزمره‌ای که مایکل برای معاملات روزانه خود انجام می‌دهد را یاد خواهیم گرفت.

در فصل دهم به معامله بر روی سهام، شاخص‌ها، اوراق قرضه و کالاها پرداخته شده که در این کتابچه بخش‌هایی که در ایران قابل معامله هستند را قرار داده‌ام. گزارشات تعهد معامله‌گران و سشن‌ها در شاخص‌ها را در این فصل یاد می‌گیریم. در فصل یازدهم به بحث مگاترید می‌پردازیم. در این فصل نیز فقط بازار ارزها را قرار داده‌ام و بقیه موارد را می‌توانید از دوره فرا بگیرید.

در فصل دوازدهم نیز جمع‌بندی کل مطالب دوره منتورشیپ و تحلیل مولتی تایم بازار از تایم فریم ماهیانه تا پنج دقیقه را یاد خواهیم گرفت.

این کتاب بهتر است همراه دوره خوانده شود مخصوصاً قسمت‌هایی که در آن چارت بررسی شده است باید بارها دیده شوند. سعی بر این بوده که مطالب مهم هر قسمت بصورت خلاصه نوشته شود. در هر فصل چک لیست مناسبی توسط مایکل گفته شده که میتوان از آنها استفاده کرد.

در آخر هر فصل نیز تمرین مناسبی قرار داده شده که با انجام دادن آن‌ها می‌توانید گام موثری در یادگیری بردارید. از آن تمرین‌ها عکس بگیرید و در آرشیو خود نگه دارید.

توجه کنید که این کتاب **کاملاً رایگان** در کانال تلگرامی [@ToBeATrader](https://t.me/ToBeATrader) در اختیار همه قرار داده شده است و حقوق آن کاملاً محفوظ است.

با آرزوی موفقیت برای جامعه تریدری پرایس اکشن ایران.

محمد کریمی‌کیا



Developing Your Institutional Perspective On Price Action In Technical Analysis.



فصل صفر

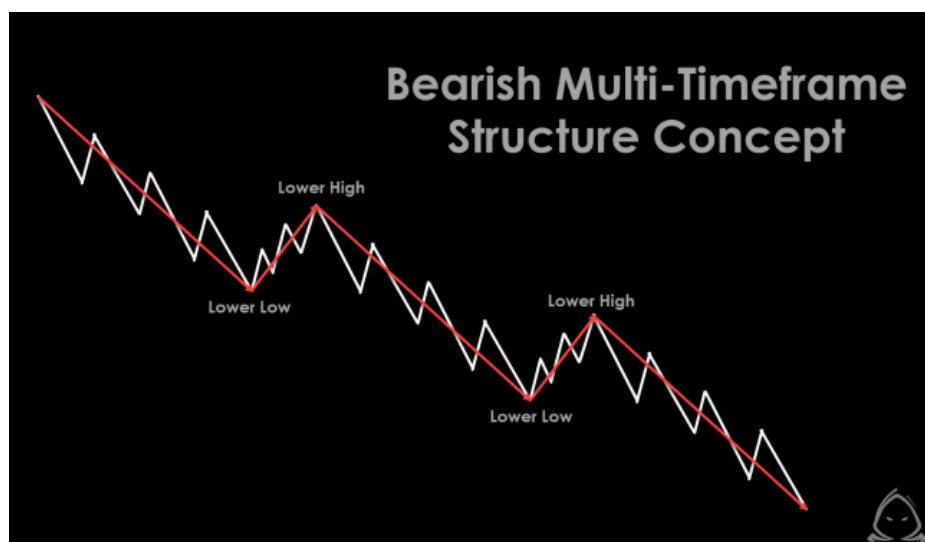
ورود به دنیای پرایس اکشن و آی سی تی

برای آشنایی با این روش بهتر است ابتدا با برخی مفاهیم آشنا شویم. بعضی از این مفاهیم در دوره مارکت میکر پریمر که پیش‌نیاز منتورشیپ می‌باشد، صحبت شده است.

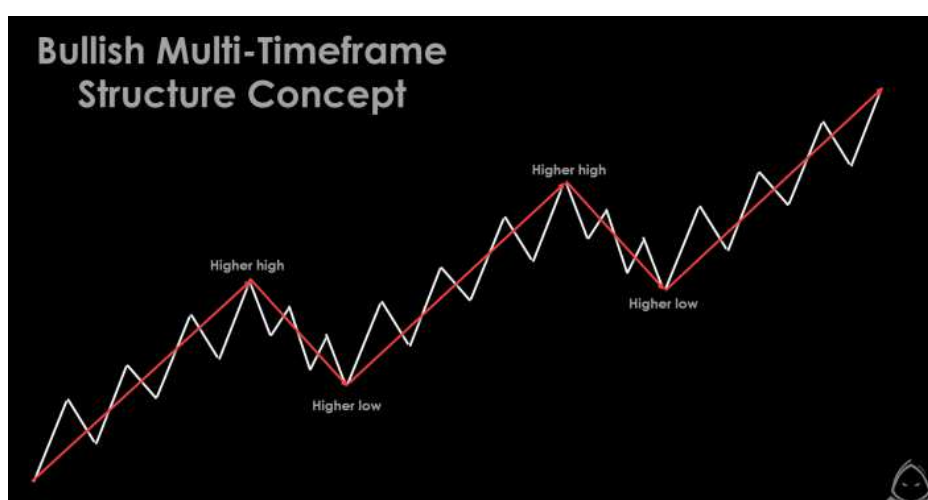


ساختار مارکت : Market Structure

به نحوه شکل‌گیری و حرکت مارکت به صورت روندی ساختار مارکت می‌گوییم. دیدگاه‌های مختلفی از این ساختار وجود دارد که آن‌ها را می‌خواهیم بررسی کنیم. دقت کنید که در شرایط مختلف این ساختارها بوجود می‌آیند و همگی قابل استفاده‌اند. این ساختارها بصورت فرکتالی یا تو در تو نیز حرکت می‌کنند که برای تحلیل و ترید مولتی تایم فریم قابل استفاده است.



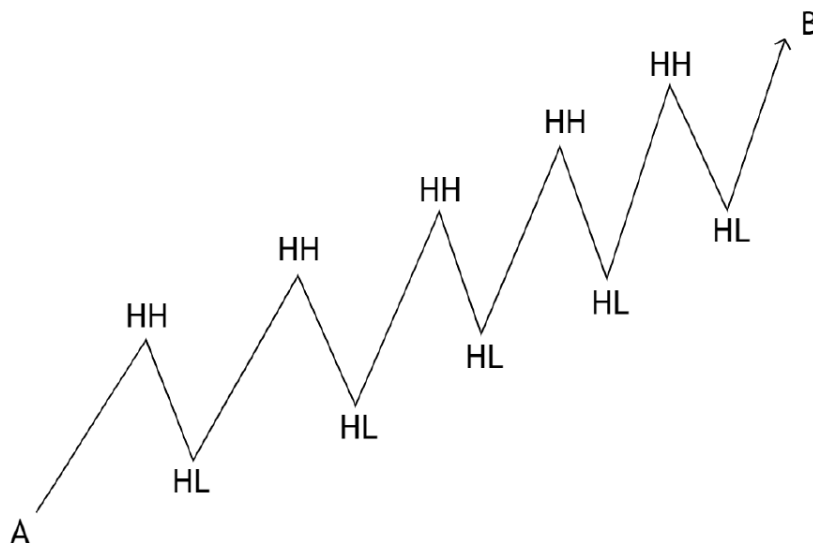
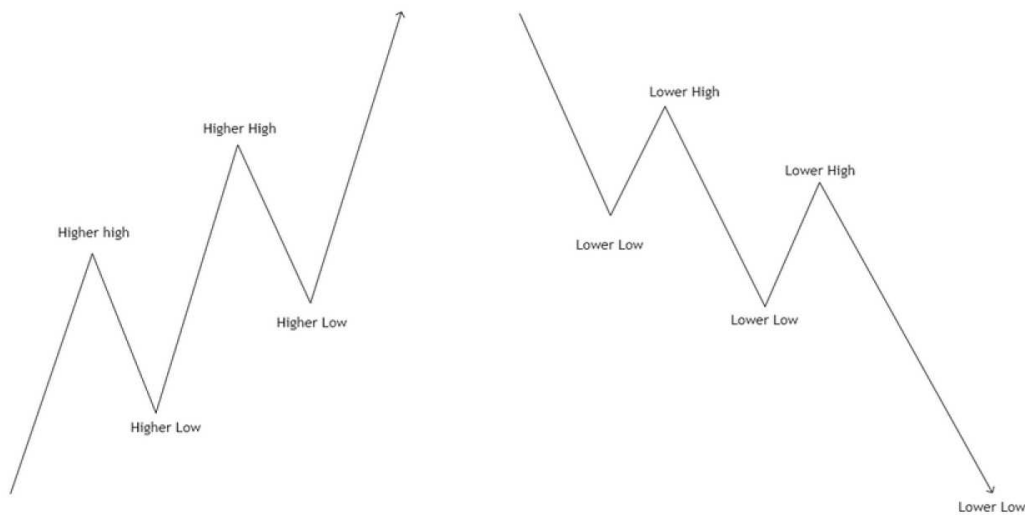
به این نکته نیز دقت کنید که همواره قیمت و مارکت خیلی شکیل و دقیق همانند شماتیک‌ها حرکت نمی‌کنند و برای پیدا کردن و دیدن آن‌ها تمرین بسیار زیادی لازم است.

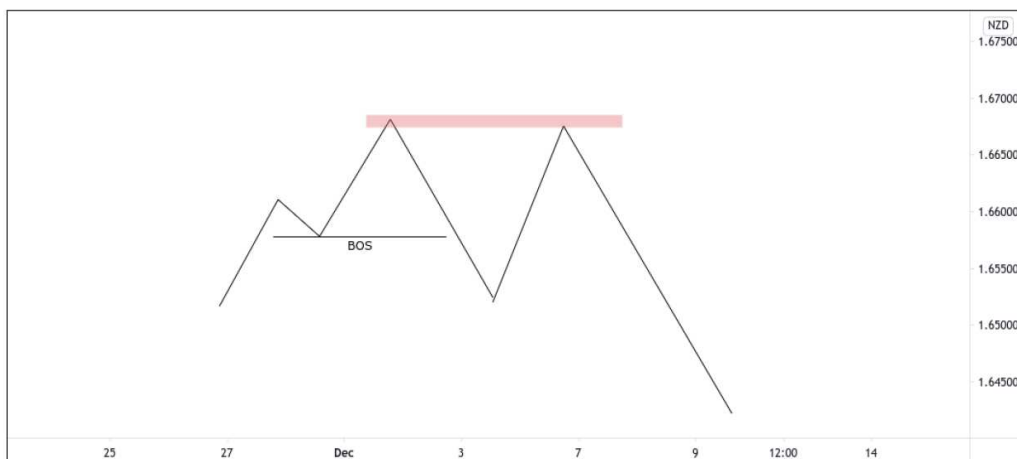
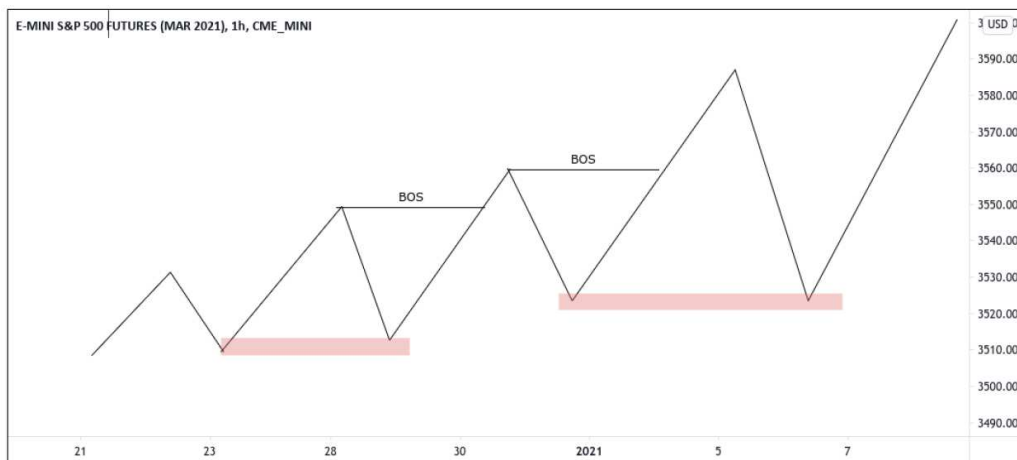
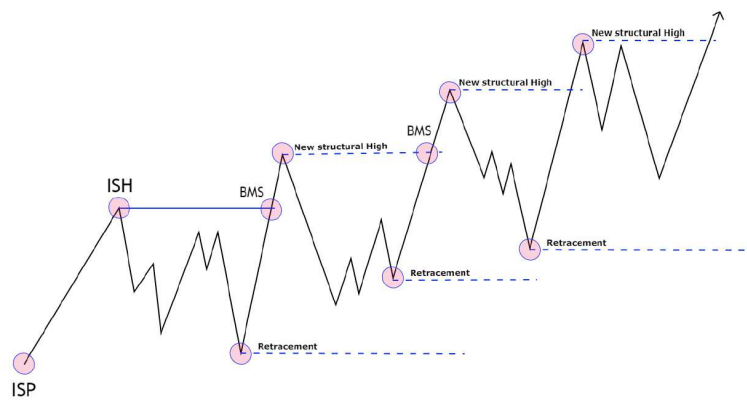
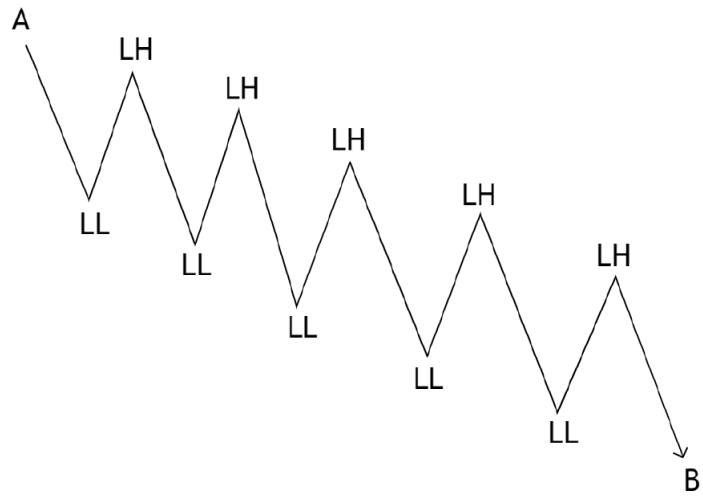


ساختار مارکت از دیدگاه کلاسیک:

در یک حرکت صعودی سقف‌ها بالاتر از یکدیگر و کف‌ها بالاتر از یکدیگر هستند. در حرکت نزولی نیز سقف‌ها و کف‌ها پایین‌تر از هم هستند. هنگامی که مثلاً در یک روند صعودی سقف قبلی شکسته می‌شود ادامه حرکت تایید می‌شود و هنگامی که کف قبلی شکسته می‌شود هشدار تغییر و چرخش روند داده می‌شود. به هر دوی این اتفاق‌ها شکست ساختار یا Break of Major Structure یا Break of Structure یا به اختصار BOS یا BMS گفته می‌شود. در حالت کلاسیک اصلاح‌ها ساده دیده می‌شوند و در درون آن‌ها حرکت ساختاری روندی دارد.

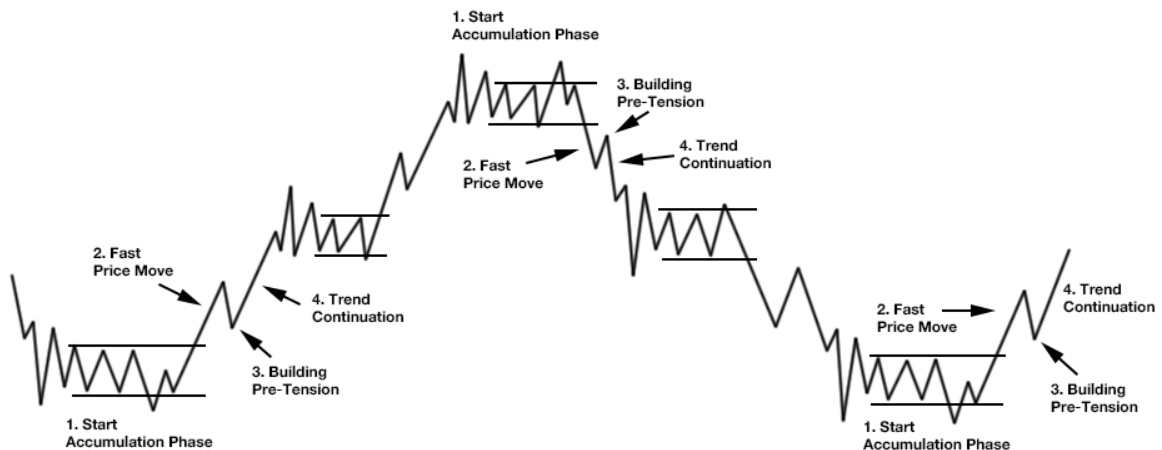
Standard Market Structure





ساختار مارکت از دیدگاه وایکف:

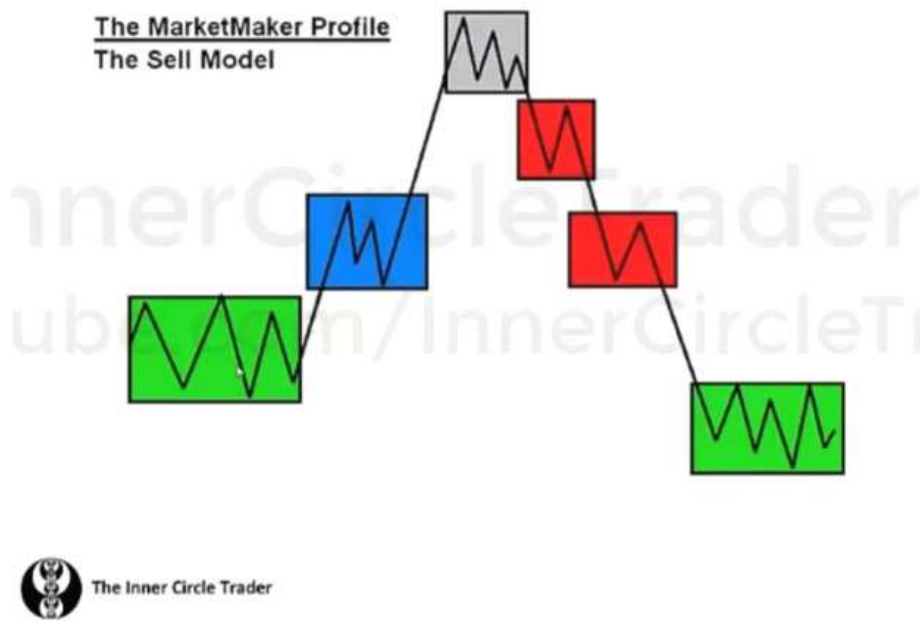
در این دیدگاه همانند کلاسیک سقف‌ها و کف‌های جدید تشکیل می‌شوند اما اصلاح‌ها و چرخش روند پیچیده‌تر هستند و ناحیه سایدی از قیمت را بوجود می‌آورند. معمولاً بالا و پایین این نواحی استاپ‌های تریدرها توسط مارکت میکر هانت می‌شود و بعد در جهت خود حرکت می‌کند.



دو ساختار صحبت شده هم می‌توانند جدای از هم و هم می‌توانند ترکیبی از هم دیده شوند. در چارت ما همواره دیدگاهمان ساختار کلاسیک است مگر اینکه ساختار وایکف را مشاهده کنیم.

ساختار مارکت از دیدگاه ICT:

این ساختار بیشتر شبیه الگویی از مارکت است چون دقیقاً با همان شکل و جایگاه بوجود می‌آید.



این ساختاری است که مارکت میکر خیلی انجام می‌دهد. به مثال زیر توجه کنید:



استفاده از ابزار فیبوناچی ریتریسمنت برای ورود بهینه:

بیشتر اصلاح‌های داخل روند بیش از ۵۰ درصد حرکت ایمپالس اتفاق می‌افتند. برای ریسک به ریوارد بهتر میتوان اصلاح‌هایی که زیر فیبو ۶۸ درصد اتفاق می‌افتند را ترید کرد و از بقیه صرف نظر کرد. به ناحیه بین ۶۸ تا ۷۹ درصد ناحیه ورود بهینه یا Optimal Trade Entry یا به اختصار OTE می‌گوییم که علاوه بر ریسک به ریوارد مناسب، احتمال رسیدن قیمت نیز به آن نواحی زیاد است. درصد ۷۰/۵ نیز که حد وسط دو عدد قبلی است را به ابزار خود اضافه می‌کنیم.

درصدهای ابزار فیبو سبک آی سی تی بدین صورت است:

First TP - Scaling -----0.000

62% -----0.620

Sweet Spot OTE ----- 0.705

79% -----0.790

Equilibrium -----0.500

100 -----1.000



تعاریف:

در دوره به چند اصطلاح اشاره شده که به تعریف آنها می‌پردازیم. این تعاریف و ساختارها بصورت دقیق‌تر در سبک وایکف بررسی شده‌اند اما دانستن تعاریف آنها خالی از لطف نیست. در زبان فارسی تعریف و کلمه دقیق و مناسبی برای این عبارات در نظر گرفته نشده است و سعی بر این است که این عبارات دقیق تعریف شوند.

Accumulation یا تجمیع:

به درجا زدن قیمت برای جمع‌آوری سفارشات گفته می‌شود. بعد از این درجا زدن قیمت حرکت صعودی پیدا می‌کند. حتما باید قبل از درجا زدن نیز حرکت نزولی باشد.

Re-Accumulation یا باز-تجمیع:

به درجا زدن قیمت برای جمع‌آوری سفارشات گفته می‌شود. بعد از این درجا زدن قیمت حرکت صعودی پیدا می‌کند. حتما باید قبل از درجا زدن نیز حرکت صعودی باشد.

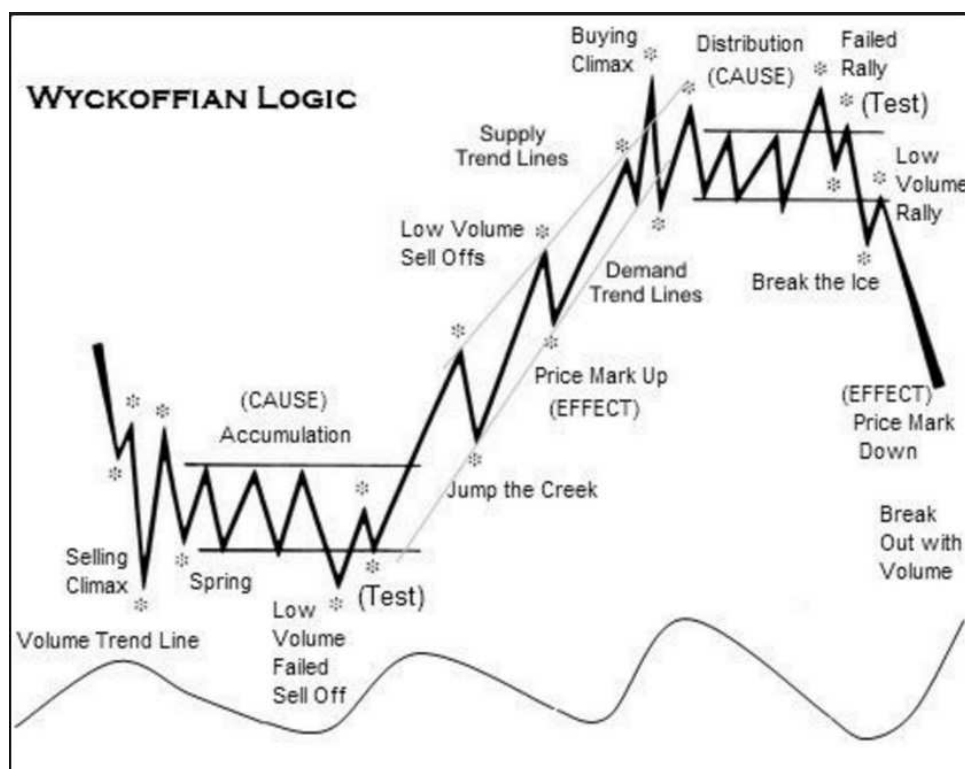
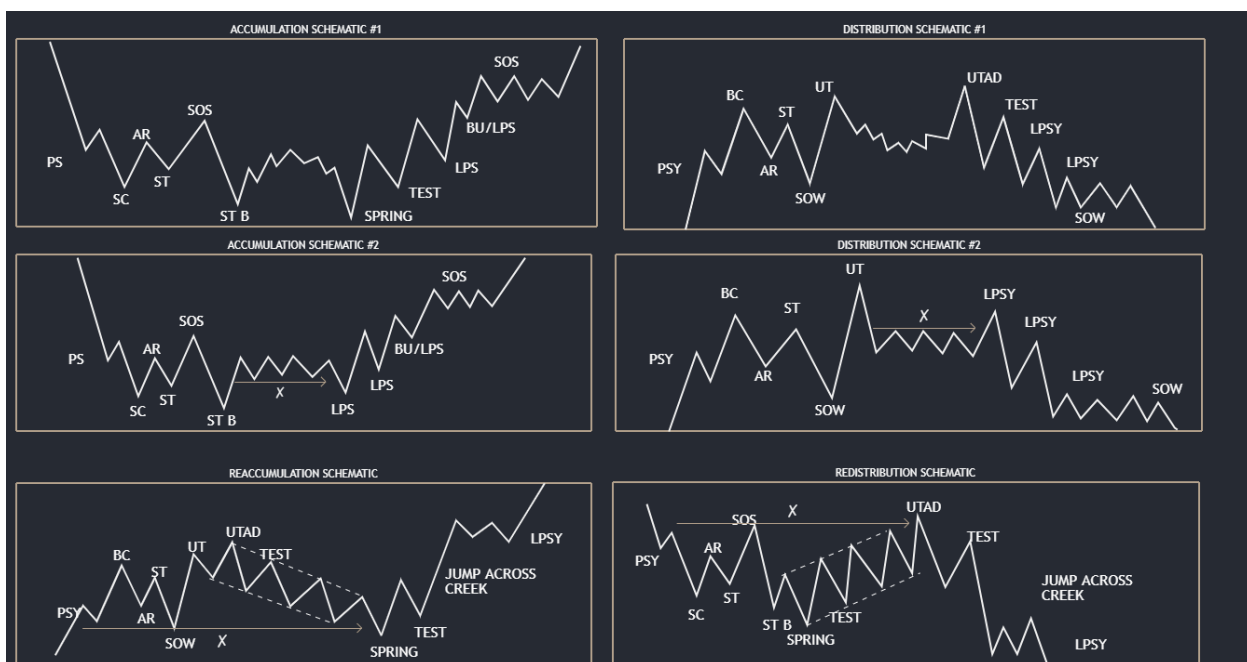
Distribution یا توزیع:

به درجا زدن قیمت برای جمع‌آوری سفارشات گفته می‌شود. بعد از این درجا زدن قیمت حرکت نزولی پیدا می‌کند. حتما باید قبل از درجا زدن نیز حرکت صعودی باشد.

Re-Distribution یا باز-توزیع:

به درجا زدن قیمت برای جمع‌آوری سفارشات گفته می‌شود. بعد از این درجا زدن قیمت حرکت نزولی پیدا می‌کند. حتما باید قبل از درجا زدن نیز حرکت نزولی باشد.

برای درک بهتر به تصاویر زیر دقت کنید:

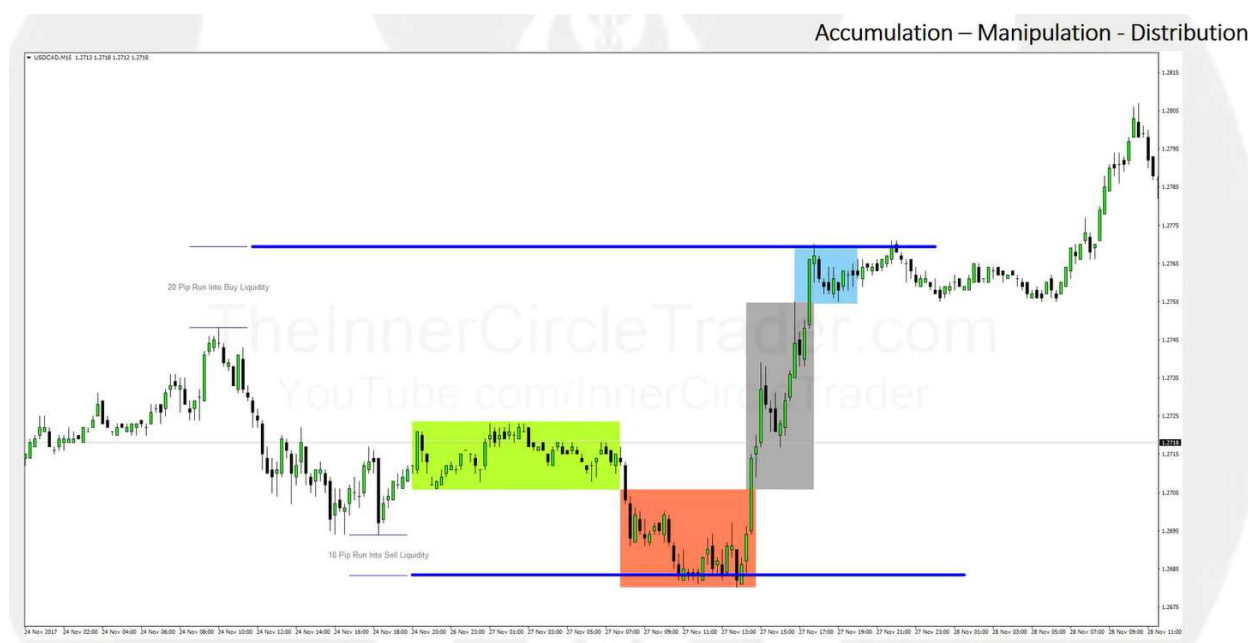


Manipulation یا دستکاری:

به حرکت خلاف جهت مارکت می‌گویند. هنگامی که مثلا در اول روز یا اول هفته یک حرکت صعودی داریم و بعد از آن حرکت اصلی نزولی است، به حرکت اول دستکاری می‌گوییم. جلوتر یک دستکاری قیمت را با اسم سویینگ جودا خواهیم شناخت.

: P03

در ابتدای شروع روز یا هفته معمولا مارکت یک توزیع یا تجمیع انجام می‌دهد، سپس یک دستکاری قیمت را شاهد هستیم و بعد حرکت اصلی انجام می‌شود. به این سه حرکت که خیلی تکرار می‌شوند P03 یا Power of Three می‌گوییم. در فصل های آتی بیشتر درمورد این موضوع بحث خواهیم کرد. به مثال زیر دقت کنید:



تمرین

ساختار مارکت را در گذشته ۵ جفت ارز و در هر کدام ۴ تایم فریم بررسی کنید. انواع ساختار را در آن‌ها بررسی کرده و نام‌گذاری کنید.

از هر توزیع، باز توزیع، تجمع و باز تجمع ۱۰ نمونه پیدا کنید.

با بررسی ۱۰۰ روز گذشته ۵ جفت ارز دلخواه، در هر روز یا هفته ساختار PO3 را بیابید.

دقت کنید که تمرین هر فصل حداقل به یک هفته تمرین و بررسی نیاز دارد. از تمام تمرین‌های خود عکس گرفته و در پوشه‌ای در سیستم خود ذخیره کنید.

ICT Monthly Mentorship

September 2016 – ICT Pdf Collection

September Study Notes

Copyright 2016 TheInnerCircleTrader.com All Rights Reserved

This presentation is intended for paid members of The ICT Monthly Mentorship only & permission is not given to resell, host or share for public or paid viewing apart from mediums associated with ICT.

ICT Monthly Mentorship – September Study Notes

فصل اول – ماه سپتامبر

مبانی آی سی تی



درس 0

زمان بندی بازار بر اساس ساعت محلی نیویورک:

۰۰:۰۰ یا ۱۲ نیمه شب: باز شدن نیویورک و شروع ربات ها

۲ صبح تا ۵ صبح: کیل زون لندن

۷ صبح تا ۱۰ صبح: کیل زون نیویورک

۱۴ تا ۱۵: بسته شدن بازارهای مالی مهم در آمریکا

این ساعت ها را به وقت محلی خود تنظیم کنید و خوب بخاطر بسپارید چون بسیار کاربردی هستند.

نکته: هنگام بررسی و تطبیق ساعت هایی که در دوره بیان میشود با وقت محلی خودتان، در نیمه اول سال یا نیمه دوم سال دقت کنید. ممکن است در تغییر ساعت در فروردین یا شهریور، ساعت ها به وقت محلی شما تغییر کنند.

Kill Zone یا کیل زون

به ۳-۴ ساعت اول هر سشن در بازار های جهانی گفته می شود، که اکثر روزها با شروع شدن سشن و در بازه زمانی این کیل زون ها یک حرکت خلاف جهت بازار انجام می دهند، تا هم استاپ اوردها را بزنند، و هم تریدرها را فریب بدهند.

نکته: بازار معمولا در کیل زون لندن سقف یا کف کندل روزانه را تشکیل می دهد، و کف یا سقف دیگر کندل روزانه معمولا در ساعت ۱۰ صبح تا ۱۲ ظهر به وقت نیویورک تشکیل خواهد شد.

Order Block یا اوردر بلاک

کندل یا کندل هایی قبل از شروع حرکت اصلی و با مومنتوم. این کندل ها خلاف جهت حرکت اصلی می باشند، و برای فریب دادن تریدرها و جمع کردن سفارشات از آنها استفاده می شود. قیمت در آینده که میرسد به آنها ما احتمال تغییر جهت حرکت را داریم و بر مبنای آنها ترید می کنیم.

درس 1

بازار به طور کلی دارای ۴ حرکت و شکل قرار می‌گیرد:

۱- اکسپنشن یا حرکت Expansion

۲- ریتریسمنت یا اصلاح Retracement

۳- ریورسال یا بازگشت Reversal

۴- کانسالیدیشن یا تثبیت یا درجا زدن Consolidation

نکته: بازار همواره در حال تبدیل شدن این ۴ حرکت به همدیگر هست، و شروع آنها همیشه از کانسالیدیشن است. بعد از کانسالیدیشن هم همیشه اکسپنشن داریم.

نکته: برای ترید ما همیشه منتظر اکسپنشن می‌مانیم تا بازار به ما بگوید که چه کار قرار است بکند. بعد از آن منتظر کانسالیدیشن یا ریتریس می‌مانیم. به عبارتی باید بدانیم کجای بازار قرار داریم، از کجا آمده و به کجا می‌رود.

جریان سفارشات به طور کلی در ۴ حالت خودش را نشان می‌دهد:

۱- کندل های اوردر بلاک که خود به چند دسته تقسیم می‌شوند Order Blocks OB

۲- شکاف ارزش بازار Fair Value Gap FVG — خلاء نقدینگی Liquidity Void LV

۳- استخر نقدینگی LP Liquidity Pools — استاپ هانتینگ ها Stop Run

۴- تعادل قیمتی Equilibrium Eq



اکسپنشن یا Expansion

حرکت سریع قیمت از یک تعادل Eq را اکسپنشن می‌گویند. یک اوردر بلاک درون این حرکت است. برای ترید منتظر برگشت قیمت به اوردر بلاک می‌مانیم.



ریتریسمنت یا Retracement

برگشت و اصلاح قیمت از جایی که ازش حرکت اکسپنشن را داشته است. برای دیدن ریتریسمنت دنبال FVG یا LV می‌گردیم.



ریورسال یا Reversal

قیمت خلاف جهت اصلی خودش حرکت می‌کند و چرخش قیمتی را شاهد هستیم. در جهت جدید حرکت قیمتی خوبی دارد. معمولاً این حرکت بعد از زدن استاپ‌ها توسط مارکت میکر انجام شده و جهت خودش را عوض می‌کند. برای دیدن ریورسال بالای سقف یا کف‌های گذشته مارکت دنبال LP می‌گردیم.



کانسالیديشن یا Consolidation

بازار رنج شده و حرکت مشخصی ندارد. نشونه‌ی تعادل یا Eq. است. مارکت میکر اوردر هایش را پر می‌کند. اگر بعدش حرکت با مومنتومی داشتیم ۵۰ درصد ناحیه کانسالیديشن منتظر ورود برای ترید هستیم.



درس ۲

در ابتدای این جلسه در خصوص پول هوشمند و کنترل بازار توسط بانک ها صحبت شده، و مردمی که در این بازار وارد می شوند فکر می کنند، که با ترید های آنها بازار بالا و پایین می شود. در صورتی که با پول هوشمند و اینتربانک ها روند بازار کنترل می شود.

سوینگ جودا یا Judas Swing :

به حرکت فریب دهنده خلاف جهت اصلی بعد از سشن آسیا که برای جمع کردن استاپ های تریدرها و فریب دادن آنها گفته می شود. این حرکت در اکثر روزها در مارکت رخ داده و ما در انتهای آن در جهت حرکت اصلی وارد بازار می شویم.



در طول شبانه روز حرکت های بازار در تایم های مشخصی دیده می شود:

اکسپنشن: سوینگ جودا

ریتریسمنت: سشن نیویورک

ریورسال: سشن لندن

کانسالیديشن: سشن آسیا

بازار به صورت روزانه، در اکثر روزها، حرکت های مشخصی را به ترتیب انجام می دهد:

تعادل و رنج قیمتی - > حرکت معکوس - > حرکت با مومنتوم - > برگشت یا اصلاح - > درجا زدن قیمت

شروع بازار همیشه با کانسالیدیشن است. بعد از آن همیشه اکسپنشن است و اکسپنشن میتواند به حالت ریورسال و ریتریسمنت برود و نمیتواند به کانسالیدیشن برگردد.



درس ۳

تمرین:

روزانه تا ۳۰ روز از بازار در چند جفت ارز دلخواه عکس گرفته و بازار را بررسی کنیم:

در تایم دیلی ۹ ماه گذشته معلوم باشد.

در تایم ۴ ساعته ۳ ماه گذشته معلوم باشد.

در تایم ۱ ساعته ۳ هفته گذشته معلوم باشد.

در تایم ۱۵ دقیقه ۴ روز گذشته معلوم باشد.

در این تمرین دنبال چه بگردیم؟

کجاها بازار حرکت شارپ داشته است.

سقف و کف هایی که هنوز زده نشده است.

سطوح کلاسیک بازار.

سقف و کف در چه روزی از هفته شکل گرفته و داخل کدام کیل زون می باشد.

آخرین سقف ها و کف های دیلی و ۴ ساعته.

کف و سقف های کندل های روزانه در چارت ۱۵ دقیقه و مشخص کردن روزهای هفته.

بعد از مشخص کردن این نواحی در آینده بازار واکنش به این نواحی را مشاهده کنید.

درس ۴ و ۵

تعادل قیمتی یا Eq

به بازگشت قیمت بعد از حرکت ایمپالس یا اکسپنشن به ۵۰ درصد آن حرکت را تعادل می‌گوییم. این مقدار را با ابزار فیبوناچی بدست می‌آوریم. این قیمت معمولاً فرصت مارکت برای ورود به بازار است که قیمت منصفانه‌ای را برای ما قرار می‌دهد. معمولاً قیمت مدت زیادی در این ناحیه نمی‌ماند. وقتی قیمت به این ناحیه رسید می‌توانیم مارکت را در تایم‌های پایین‌تر بررسی کنیم. برای ورود به اطلاعات بیشتری نیاز داریم که در آینده آنها را یاد خواهیم گرفت.



ارزان یا Discount

به بازگشت قیمت بعد از حرکت صعودی به زیر ۵۰ درصد آن تخفیف می‌گوییم. یا به عبارتی در یک رنج مشخص هر قیمتی زیر ۵۰ درصد یا ناحیه تعادلی باشد را ارزان می‌گوییم. این عبارت نسبی است و در هر تایم فریم یا رنج قیمتی متفاوت است.



گران یا Premium

به بازگشت قیمت بعد از حرکت نزولی به بالای ۵۰ درصد آن گران می‌گوییم. یا به عبارتی در یک رنج مشخص هر قیمتی بالای ۵۰ درصد یا ناحیه تعادلی باشد را گران می‌گوییم. این عبارت نسبی است و در هر تایم فریم یا رنج قیمتی متفاوت است.



نکته: وقتی مطمئن هستیم بازار گاوی هست ولی کفی در گذشته زده شده آن قطعا استاپ هانتر (سوپ لاکپشت) است و ما در جهت صعودی ورود می‌کنیم.

نکته: وقتی مطمئن هستیم بازار خرسی هست ولی سقفی در گذشته زده شده آن قطعا استاپ هانتر (سوپ لاکپشت) است و ما در جهت نزولی ورود می‌کنیم.

درس ۶

Liquidity Void یا LV یا خلا نقدینگی

نواحی ای که قیمت از آنجا در یک جهت خاص حرکت با مومنتوم بدون اصلاح داشته، و انتظار داریم در برگشت قیمت آن نواحی دوباره توسط قیمت دیده شود. این حرکت معمولا کندل ها با شندهای کم و بدنه بزرگ هستند.



Fair Value Gap یا FVG یا شکاف ارزش بازار

نواحی ای از قیمت که قیمت در اصلاح به سطح نزدیک خودش نرسیده، و در آینده که قیمت به آن می‌رسد انتظار پر شدن آن را داریم.



Liquidity Pools یا استخر نقدینگی

نواحی بالایی سقف ها یا پایینی کف ها که معمولا تریدرها استاپ های ضرر یا استاپ های ورود به معامله را در آنجا می گذارند. بانک ها با کشاندن قیمت به آنجا حجم سفارشات خود را پر می کنند یا سفارشات قبلی خود را می بندند.



درس ۷

نقدینگی: به حد ضرر و یا اوردرهای ورود پشت پیوت ها نقدینگی می‌گوییم.

Liquidity Runs یا جمع آوری نقدینگی

مارکت میکر همواره برای پر کردن سفارشات خود دنبال استاپ های خرده تریدرها و همچنین موسسات می‌رود. ما با دیدگاه استاپ هانتینگ شدن انواع سطوح کلاسیک و برگشت آنها می‌توانیم وارد معامله شویم.

انواع نقدینگی در روندها

وقتی روند می‌چرخد، در روند قبلی دو حالت ممکن است اتفاق افتاده باشد، یا قیمت حرکت شارپی داشته یا بصورت روندی سقف و کف ایجاد کرده است. در حالت اول چون پیوت های قله/دره ایجاد نشده مقاومتی و لیکویدیتی کمی برای رسیدن به اول روند قبل دارد، اما در حالت دوم سقف و کف ها با لیکویدیتی همراه هستند و می‌توانند جلوی حرکت را بگیرند. به حالت اول Low Resistance Liquidity Runs و به حالت دوم High Resistance Liquidity Runs گفته می‌شود.



درس ۸

به طور کلی بازار در ۳ بازه زمانی در طول شبانه روز حرکت معکوس انجام می‌دهد و یا می‌چرخد

۱- ساعت ۰۰:۰۰ جهانی یا GMT

۲- اوپن یا کیل زون لندن

۳- اوپن یا کیل زون نیویورک

نکته: ما با بدست آوردن حرکت اصلی بازار با تحلیل مولتی تایم در انتهای این حرکات فریب دهنده خلاف روند وارد بازار می‌شویم.



تمرین

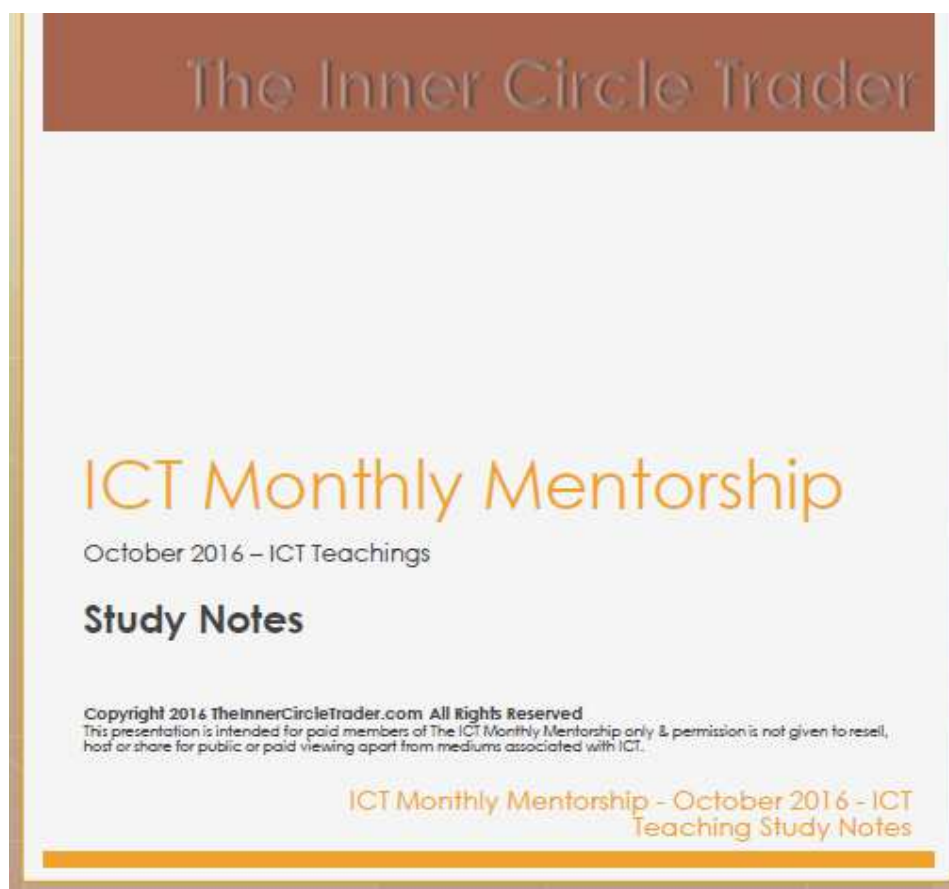
در ۲۰ روز گذشته در ۵ جفت ارز دلخواه کیل زون‌ها و ساعت‌های مهم را علامت زده و رفتار قیمت را در آن زمان‌ها بررسی کنید.

در ۵ جفت ارز نواحی ارزان و گران را مشخص کنید.

۲۰ مدل از انواع نقدینگی‌ها را پیدا کنید.

از نواحی مهمی که در درس ششم بررسی شده، از هرکدام ۲۵ عدد در گذشته چارت پیدا کنید و واکنش قیمت را به آن‌ها بررسی کنید.

از تمامی تمرینات خود عکس بگیرید و در سیستم خود نگهداری کنید. اگر تحلیل در بازار لایو داشتید قبل و بعد از حرکت قیمت از آن عکس بگیرید.



فصل دوم – ماه اکتبر

مدیریت سرمایه



درس 1 و 2

نحوه ترید:

وقتی قیمت به ناحیه تحلیلی ما رسید (به طور مثال اوردر بلاک صعودی)، به یک تایم پایین تر رفته و منتظر تشکیل اوردر بلاک جدید در جهت اوردر بلاک تایم بالاتر می مانیم و بعد از پوشش اوردر بلاک تایم پایین با کندل رنگ مخالف، در مرکز بدنه، اوپن و یا شدو نزدیک اوپن اوردر بلاک تایم پایین اوردر لیمیت ست می کنیم و استاپ را پشت کندل اوردر بلاک یا نزدیک کلوز کندل قرار می دهیم.



نکته: وقتی قیمت از وسط کندل اوردر بلاک رد شد، احتمال شکست آن سطح زیاد می‌شود. پس میتوان پر ریسک‌تر عمل کرده، استاپ پوزیشن را در مرکز بدنه اوردر بلاک تایم پایین قرار داد.



درس 3

نکته: با مدیریت سرمایه مناسب و گرفتن هفته ای ۵۰ پیپ یا ۱۰ درصد سود ماهیانه نیز می‌توان رشد کرد. این به این معنی نیست که با این روش نمی‌توان بیشتر از ماهیانه ۱۰ درصد سود گرفت. می‌توان با پایین‌تر بردن تایم فریم (در صورت تحمل روانی سرعت مارکت و وقت کافی و سرعت تصمیم‌گیری مناسب) یا بیشتر کردن ابزارها و جفت ارزهایی که معامله می‌کنیم سود بیشتری کسب کنیم.

درس 4

نکته: اگر نتوانیم ضرر را در معاملات تحمل کنیم در بلند مدت نمی‌توانیم سود کنیم. ضرر جزئی از این بازار است و باید بتوانیم آن را تحمل کرده و بپذیریم. نباید در بلند مدت ضررها تاثیر بدی روی ما بگذارند و باعث بشوند تا تریدهای ما از روی ترس باشد. اگر مدیریت ریسک صحیح و نسبت ریوارد به ریسک مناسب و وین ریت معمولی داشته باشیم ضررها نمی‌توانند آسیبی به حساب معاملاتی ما برسانند. ما حتی با وین ریت ۳۰ درصد با ریوارد به ریسک ۳ و ۱ درصد ریسک در هر ترید و ۱۰ ترید سود ده هستیم (بدترین شرایط ولی با ریوارد به ریسک نسبتا مناسب). حال اگر وین ریت ۵۰ درصدی و ریوارد به ریسک ۵ داشته باشیم با ۱۰ ترید چقدر سود می‌کنیم؟ ۷۰ درصد وین ریت چطور؟ ریوارد ۱۰ چطور؟ پس ترسی از ضرر نداشته باشیم.

درس 5

فرض کنید در یک ترید استاپ خوردیم، چه می‌کنیم؟ اگر بازار در جهت دیدگاه ما پیش رفت باید در فرصت بعدی که به ما می‌دهد وارد شویم. نباید استاپ قبلی تاثیری روی ترید بعدی بگذارد و چون مقدار معقولی در ترید قبلی ریسک کرده‌ایم جبران آن راحت خواهد بود.

نکته: اگر سوینگ تریدر هستیم و آخر هفته (اواخر روز جمعه) است و در ضرر هم هستیم بهتر است، پوزیشن را ببندیم.



درس 6

نکته: برای معامله گر شدن حتما باید پلن معاملاتی یا تریدینگ پلنی داشته باشیم که همه چیز بصورت صفر و یکی و با جزییات کامل در آن نوشته شده باشد. بعد از دوره ۱۲ ماهه میتوانیم پلن را برای خود بنویسیم.

نکته: از تریدای خود حتی در دمو میتوانیم بعد از حرکت بازار عکس گرفته و نگه داریم.

نکته روانشناسی: تریدرهای تازه کار دوست دارند همان لحظه که چارت را باز میکنند وارد معامله شوند. این طرز فکر اشتباه است و باید صبر را در خود تقویت کنیم.

روش بدست آوردن تریدهایی با ریوارد به ریسک بالا (این مباحث به طور کامل در جلسه ها و ماههای آتی درس داده خواهد شد. اینجا صرفا دید بهتری به ما می دهد).

Big Picture Perspective (حداقل ۲ مورد باید یک جهت را به ما نشان دهند)

1. Macro Market Analysis

- a. Inflationary Market
- b. Deflationary Market

2. Interest Rate Analysis (تغییر نرخ بهره کشورها و فاصله زیاد بین نرخ بهره دو کشور)

- a. Higher Rates (نرخ بهره بالاتر)
- b. Lower Rates (نرخ بهره پایین تر)
- c. Unexpected Change (تغییرات ناگهانی نرخ بهره)

3. Intermarket Analysis (تحلیل بین بازاری)

- a. CRB Index – Commodities (شاخص سی آر بی)
- b. USDX (or DXY) – US Dollar Index (شاخص دلار)

4. Seasonal Influences (تمایلات فصلی)

- a. Bullish Seasonal Tendencies (تمایلات فصلی صعودی)

b. Bearish Seasonal Tendencies



Intermediate Perspective (حداقل ۲ مورد باید یک جهت را به ما نشان دهند)

1. Top-Down Analysis (تحلیل مولتی تایم - حداقل یک سطح باید در یکی از تایمهای اصلی باشد)
 - a. Monthly Chart Analysis (تحلیل چارت ماهیانه)
 - b. Weekly Chart Analysis (تحلیل چارت هفتگی)
 - c. Daily Chart Analysis (تحلیل چارت روزانه)
2. COT Data (گزارش تعهد معامله گران که به صورت هفتگی منتشر می شود)
 - a. Bullish Hedging by Smart Money
 - b. Bearish Hedging by Smart Money
 - c. Extreme Level Historically
3. Market Sentiment (سنتیمنت بازار)
 - a. Extreme Market Bullishness
 - b. Extreme Market Bearishness

Short Term Perspective (هر سه مورد باید در یک جهت باشد - از هر مورد یک گزینه کافی است)

1. Correlation Analysis (تحلیل همبستگی جفت ارزها)
 - a. USDX (or DXY) SMT Analysis
 - b. Correlated Pair SMT Analysis
2. Time and Price Theory (تئوری زمان و قیمت)
 - a. Quarterly Effect (تاثیرات ۳ ماهه)
 - b. Monthly Effect (تاثیرات ماهانه)
 - c. Weekly Range (رنج هفتگی)
 - d. Daily Range (رنج روزانه)
 - e. Time of Day (ساعت روز)

Interbank Price Delivery Algorithm IPDA

- a. Institutional Order Flow (جریان سفارشات)
- b. Liquidity Seeking (دنباله روی نقدینگی)
- c. Market Efficiency Paradigm (استفاده از دیدگاه مارکت میکر)

نکته: معمولا بیگ پیکچر و اینترمدیت را اول هفته و قبل از شروع بازار داریم. شورت ترم را روزنه بدست می آوریم و کار اصلی ما قبل از ترید کردن این است.

نتیجه: برای ترید با ریوارد به ریسک های بالا به ۷ مورد از موارد اشاره شده نیاز است. بعد از این ۷ مورد به دنبال ستاپ برای ترید می گردیم.

درس 7

نکته: مارکت میکر در سطوح تایم بالا الگوهای ادامه دهنده مثل فلگ ها (یا پرچم) را تشکیل می‌دهد، تا تریدرها خلاف جهت مارکت میکر وارد شده و اوردر آنها را پر کنند. بهتر است با تحلیل مولتی تایم سطوح تایم‌های بالاتر را بدست آورده و تا شکست کامل سطح همچنان دید برگشت در این سطوح را داشته باشیم تا به تله نیوفتیم.



درس 8

نکته: مارکت میکر در بعضی مواقع یک ناحیه رنج از قیمت درست می‌کند و برای ادامه حرکت ابتدا استاپ‌های سمت مخالف را می‌زند تا سفارشات بیشتری در ادامه جهت پر کند و سود بیشتری از یک حرکت ایمپالس بکند. پس ما حتی اگر در این شرایط استاپ هم خوردیم، با فرصت ورود مجددی که مارکت به ما می‌دهد بدون ترس یا خشم و با مدیریت ریسک و سرمایه دوباره وارد می‌شویم.



تمرین

- 1- سطوحی که در فصل قبل بدست آوردید را همانند درس اول این فصل بررسی کنید.
- 2- اهداف مدیریت سرمایه خود را مشخص کنید.



The Inner Circle Trader

ICT Monthly Mentorship

November 2016 –

ICT Mentorship November Study Notes

Copyright 2016 TheInnerCircleTrader.com All Rights Reserved

This presentation is intended for paid members of The ICT Monthly Mentorship only & permission is not given to resell, host or share for public or paid viewing apart from mediums associated with ICT.

ICT Monthly Mentorship - November 2016 -
ICT Study Notes

فصل سوم – ماه نوامبر ردپای مارکت میکر



درس 1

نکته: قبل از هر چیز باید بدانیم با توجه به پول اولیه ترید و صبر و تمرکز و وقت، کدام تایم فریم برای ترید مناسب ماست. در این درس به معرفی انواع روش های ترید با توجه به تایم فریم می پردازیم و در هر ماه دوره آموزشی یکی از آنها را بررسی می کنیم.

نکته: دقت کنید که تحلیل ها همیشه از تایم بالاتر از تایم ورود شروع می شود، تا دید بهتری نسبت به جهت حرکت داشته باشیم و سطوح مهم تایم های بالاتر را در نظر بگیریم.

انتخاب تایم فریم :

- تایم ماهیانه: پوزیشن تریدینگ
- تایم ویکلی: سویینگ تریدینگ
- تایم دیلی: شورت ترم تریدینگ
- تایم زیر ۱ ساعته: دی تریدینگ
- تایم زیر ۵ دقیقه: اسکالپینگ

انواع ستاپ ها با توجه به تایم فریم مناسب شما:

(ترید در جهت ویکلی و مانسلی) Trend trader

Swing trader (ترید در حرکت های دیلی)

(ترید چرخش روند در ناحیه های مهم تر) Contrarian trader

Short term (ترید در رنج های ویکلی)

Day trader (تا ساعت ۱۴ به وقت نیویورک معامله بسته می شود)



درس 2

نکته: حجم اصلی معاملات انجام شده در بدنه ی کندل ها و در انتهای سووینگ ها می باشد و شادوها از اهمیت زیادی برخوردار نیستند.

#این قسمت بررسی چارت است و مهم است.

درس 3

نکته: مارکت میکر همیشه از سطوحی که در آنها ورود داشته محافظت می کند، تا وارد ضرر زیادی نشود. همواره نیز سطوح تایم های بالاتر از محافظت بیشتری برخوردار هستند و میتوانند سطوح تایم های پایین تر را تحت تاثیر قرار دهند. به طور مثال مارکت میکر برای بالا نگه داشتن قیمت و پر کردن حجم فروش خود مقداری پوزیشن خرید باز می کنند. این اتفاق ممکن است به شکل آوردن بلاک دیده شود. بعدا که قیمت به آن ناحیه می رسد اوردرهای خرید خود را می بندد و دوباره قیمت شروع به ریزش می کند. این اتفاق همواره در حال رخ دادن است و به شکل های مختلفی که در آینده آن ها را یاد خواهیم گرفت دیده می شود.

نکته: مارکت میکر همواره در تلاش است تا نقدینگی پشت پیووت ها را ببلعد. برای اینکار در جهت صعودی نقدینگی زیر پیووت ها را جمع می کند و به بالا می رود تا در بالای پیووت های گذشته پوزیشن های خود را ببندد و تسویه کند تا در سطوح پایین تر دوباره بخرد. این اتفاق در حرکت صعودی نیز برقرار است.

نکته: مارکت میکر در ساعت های خاصی از روز حرکات مشخصی دارد تا هم باعث ورود نقدینگی به مارکت شود و هم تریدرها را فریب دهد تا نقدینگی آنها را جذب کند. این موارد را در فصل های آتی یاد خواهیم گرفت.

درس 4

در این قسمت یک نمونه تحلیل از تایم مانسلی بررسی می‌شود.

در تایم فریم مانسلی سه کندل آخر های، لو، اوپن و کلوز دارای اهمیت می باشند. و بطور مشابه در تایم فریم مانسلی اولین کندل رنگ مخالف حرکت و کندل رنگ مخالف آخر که بالاتر یا پایین تر از کل کندل باز شده است (معمولا اوپن ها دارای اهمیت بیشتری می باشند). این نوع دیدگاه و تحلیل برای حالتی که قیمت بین دو پیوت یا بین دو اوردربلاک درگیر است بسیار خوب عمل می کند.



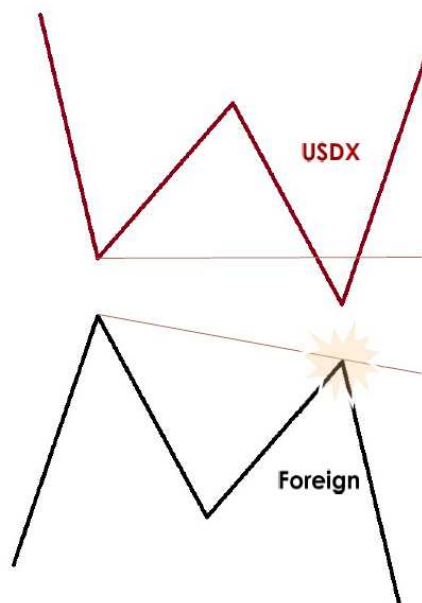
درس 5

تحلیل ابزارهای همبسته و دیدن رد پای مارکت میکر با Smart Money Tool

واگرایی SMT : یکی از روش‌های تشخیص استاپ هانتینگ مارکت میکرها بررسی چارت روی ابزارهایی که با هم همبستگی دارند است. برای اینکار به دنبال تفاوت بین دو ابزار همبسته می‌گردیم، به این صورت که اگر دو ابزار همبستگی مثبت داشته باشند، اگر یکی از ابزار سقف جدید زد اما دیگری در همان دو بازه زمانی نتوانست سقف جدیدی بزند یا اگر ابزار اول کف جدید زد اما دیگری نتوانست در همان دو بازه زمانی کف جدیدی بزند می‌گوییم یک واگرایی SMT رخ داده و مارکت میکر سقف جدید یا کف جدید را برای جمع آوری سفارشات آن ابزار ایجاد کرده است. به عبارتی دیگر این دو ابزار همدیگر را تایید نمی‌کنند. بهترین نوع بررسی این واگرایی، بررسی آن روی سطوح تایم های بالا برای پیدا کردن سریع‌تر چرخش مارکت است چون این اتفاق در آن نواحی بیشتر دیده می‌شود.

واگرایی روی شاخص دلار آمریکا: با استفاده از شاخص دلار آمریکا یا USDX میتوان جفت ارزهایی که یک طرف آنها دلار آمریکا است را با واگرایی SMT مورد بررسی قرار داد. همچنین ابزارهای دیگر مثل اوراق قرضه را می‌توان بررسی کرد که بعداً در این مورد صحبت می‌کنیم.

نکته: با اندیکاتور OverLayChartLine در متاتریدر ۴ می‌توان چارت خطی یک ابزار را روی ابزار دیگر انداخت و واگرایی SMT را بررسی کرد.



به مثال زیر دقت کنید:



درس 6

تحلیل کلان اقتصاد با نمودار

یکی از مهم‌ترین چیزهایی که برای اقتصاد مهم است، تورم و نرخ بهره آن کشور است. برای بررسی تغییرات احتمالی نرخ بهره ما می‌توانیم نمودارهای اوراق قرضه را مشاهده کنیم. تغییرات این نمودار رابطه معکوسی با نرخ بهره و شاخص دلار دارند (نرخ بهره و شاخص دلار آمریکا رابطه مستقیم دارند) یعنی اگر اوراق صعودی باشد نرخ بهره و شاخص دلار نزولی است.

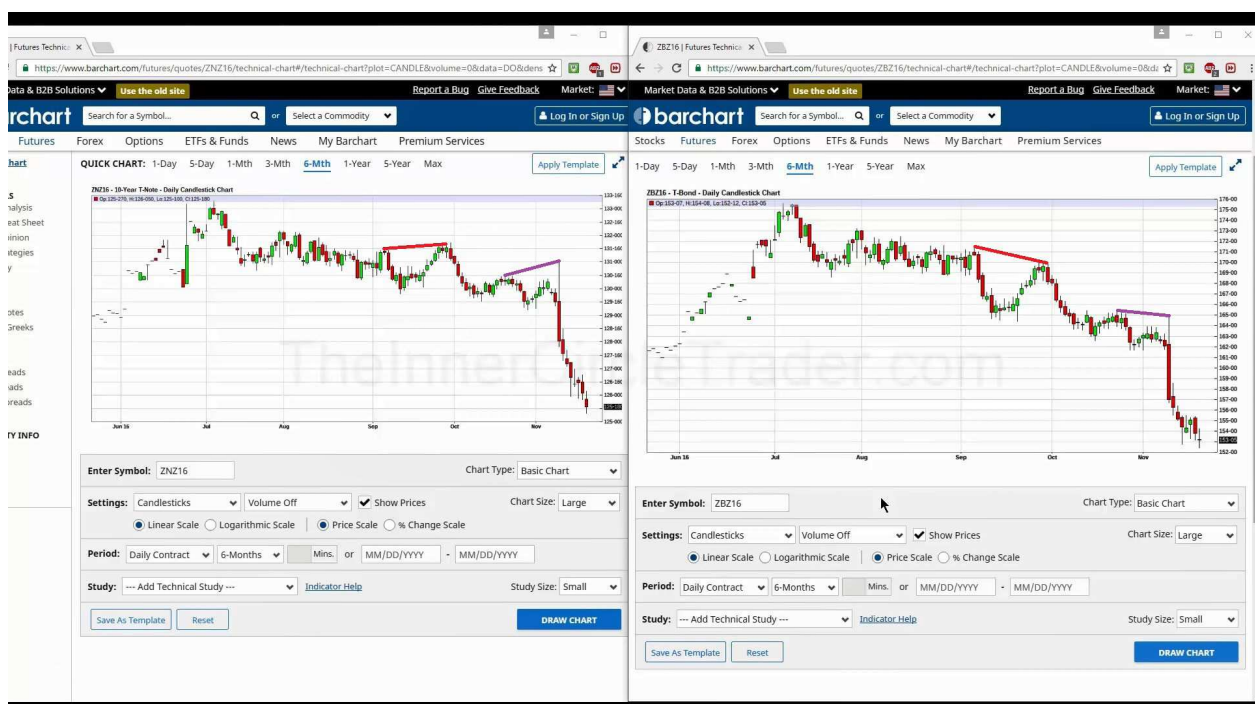
INTEREST RATE ↓ – USDX ↓ – T-BOND ↑

T- BOND ↓ – INTEREST RATE ↑ – USDX ↑

نکته: برای دیدن نمودارها می‌توان از سایت بار چارت استفاده کرد.

[barchart.com](https://www.barchart.com)

نکته: در تایم فرم دیلی برای داشتن دیدگاه ۳ تا ۶ ماهه و نرخ بهره 2BZ16 T-BOND D1 ایجاد دیدگاه می‌کند. هر ۳ تا ۴ ماه یک تغییر در نوع حرکت قیمت بوجود می‌آورد که می‌تواند این حرکت برگشت یا کانولیدیشن باشد.



زمانیکه T-BOND در حال ساخت سوینگ‌های می باشد ، انتظار می‌رود که شاخص دلار سوینگ لو بسازد و برعکس . پس می‌توان یکی دیگر از کاربرد واگرایی SMT را در اینجا ذکر کرد .

باید به این نکته هم توجه کرد که ZN216 10 YEAR T-NOTE D1 در بازه ی ۱۰ ساله می‌باشد، با این نمودار نیز دید سه تا ۶ ماهه می‌توان گرفت.

با مقایسه USDX و T-NOTE و T-BAND می‌توان واگرایی SMT را مشاهده و بررسی کرد، تا چرخش محتمل قیمت را دید.



درس 7

خط روند حيله ماركت ميكرو:

می‌دانیم که ربات‌ها بیشتر با قیمت کار می‌کنند و به دنبال تغییر قیمت برای رسیدن به سطوح و نقدینگی هستند. عامل دومی که در چارت بررسی می‌کنند زمان است و تغییر همزمان این دو در پیوت‌ها باعث ساخت روند می‌شود. در دیدگاه کلاسیک خط روند عامل مهمی محسوب می‌شود، اما این خطوط همچنان می‌توانند نادیده گرفته شوند، چون ربات‌ها آن خطوط روند شیب‌دار را نمی‌بینند و بر اساس آنها ترید نمی‌کنند مخصوصاً در سطوح تایم‌های بالاتر یا در ریتریس‌های عمیق بازار این خطوط به راحتی نقض می‌شوند، ولی همچنان بازار به روند خود ادامه می‌دهد. برای دیدن مثال‌های نادیده گرفته شدن خط روند کافی است چارت را بررسی کنید یا مثال‌های این قسمت را بررسی کنید.

درس 8

الگوی سر و شانه حيله ماركت ميكرو:

الگوی سر و شانه نیز یکی از الگوهای محبوب علاقه‌مندان به سبک کلاسیک پرایس اکشن است. این الگو به راحتی می‌تواند نقض شود و عمل نکند مخصوصاً در رسیدن به سطوح مهم و تشکیل الگو در جهت شکست آن می‌تواند تریدرها را به راحتی به اشتباه بیاندازد.



تمرین

- 1- ۲۰ نمونه واگرایی SMT بیابید.
- 2- نمودارهای اوراق قرضه را با شاخص دلار مقایسه کنید.



The Inner Circle Trader

ICT Monthly Mentorship

December 2016 – ICT Study Notes

December Study Notes

Copyright 2016 TheInnerCircleTrader.com All Rights Reserved

This presentation is intended for paid members only of The ICT Monthly Mentorship & permission is not given to resell, host or share for public or paid viewing apart from mediums associated with ICT.

ICT Monthly Mentorship – Not For Public Distribution -
TheInnerCircleTrader.com

فصل چہارم – ماہ دسامبر

نواحی مهم تکنیکالی



درس 1

تاثیر نرخ بهره بر روی ارزها

نرخ های بهره تنها عواملی هستند که بازار را حرکت می دهند، تغییراتشان برای ما مهم است و اگر جفت ارزها را ترید می کنیم اختلاف نرخ بهره بین دو ارز مبنای مهمی است که در جلسات آتی بحث خواهد شد.

۳ گانه نرخ بهره که مهم ترین ابزار ما در تحلیل تکنو-فاندامنتال هستند. این ابزارها را بصورت تکنیکالی و از سایت بارچارت بررسی می کنیم.

A) 30 years bond – key long term interest rate

اوراق ۳۰ ساله برای بررسی بلند مدت

B) 10 years note – intermediate term interest rate

اوراق ۱۰ ساله برای بررسی میان مدت

C) 5 years note – short term interest rate

اوراق ۵ ساله برای بررسی کوتاه مدت

ما به پرایس اکشن این ۳ نمودار اوراق، و ارتباطشون باهم نگاه می کنیم و همچنین واگرایی SMT را روی آنها بررسی می کنیم.

نکته:

Failure Swing خیلی به مهم است، برای بررسی جریان سفارشات اگر در این ۳ نمودار (درس ۱ ماه Jan)، الگوی Failure Swing بود، نشان دهنده ی حرکات پول هوشمند است. به عبارتی باید سقف ها و کف ها همدیگر را تایید کنند. فقط کافیست یکی از آنها هماهنگ با دوتای دیگر نباشد. مثلاً یکی از آنها سقف جدیدی بزند ولی دوتای دیگر قله پایین تری در نمودار داشته باشند. اگر این اتفاق بیافتد احتمالاً یک شیفت توی نرخ بهره خواهیم داشت و اگر توی USDX در ناحیه ی مهمی بودیم آن دید را تایید می کند. پس ۴ تا نمودار را با یکدیگر مقایسه می کنیم. سه نمودار اوراق و یک نمودار شاخص دلار آمریکا.



بهترین مواقع بررسی این چهار نمودار کی است؟

وقتی قیمت(در ابزاری که قصد ترید آن را داریم و ارتباط مستقیم و یا غیر مستقیمی با اقتصاد آمریکا دارد) به ناحیه قیمتی مهمی رسید مثل (FVG , Liquidity Void , Liquidity Pool , Order Blocks) می‌رویم ۳ گانه نرخ بهره و USDX را بررسی می‌کنیم که رد پای اسمارت مانی را پیدا کنیم.



درس 2

ساختار نقدینگی و رسیدن قیمت به آنها:

بازار در حالت کلی یا داخل یک رنج مشخصی است یا گذشته ای ندارد که تحلیل را مشکل می کند. در درون رنج هم خود شامل یک موج ایمپالس می شود که سقف و کف آن خارج رنج آن محسوب می شود. این تعریف ممکن است در هر تایم فریم رنج خاص و ظاهری متفاوت داشته باشد. اگر گذشته نزدیکی در چارت نداشتیم، باید با تغییر زوم یا تایم فریم چارت گذشته مناسبی برای بررسی چارت مهیا کنیم. حال به بررسی چارت از نظر داخل و خارج رنج می پردازیم:

خارج رنج : قیمت تمایل دارد در خارج رنج کجاها را ببیند؟

در یک رنج قیمت همیشه بالای سقف ها یا بالای رنج اوردرهای خرید (برای ورود یا ضرر) و پایین کف ها یا زیر رنج اوردرهای فروش (برای ورود یا ضرر) وجود دارد.

مارکت میکر دنبال این نواحی می گردد تا اوردرهای خودش را پر و تکمیل کند.

این نواحی می توانند با مقاومت های بالا یا با مقاومت های پایین باشند. یعنی بین آن سقف یا کف تا قیمت جاری سطوح و قله و دره مینوری باشد یا نباشد.

داخل رنج : قیمت تمایل دارد در داخل رنج کجاها را ببیند؟

Gap risk : قیمت به جایی که ترید خیلی کم یا اصلا انجام نشده بر می گردد. و تمایل دارد دوباره داخل آن رنج معامله صورت گیرد. دو مورد مهمی که این اتفاق در آنها رخ می دهد FVG ها و LV ها هستند و قیمت تمایل زیادی در پر کردن رنج آنها دارد. اوردر بلاک ها در داخل رنج دیده می شوند تا دوباره در آنها معامله انجام شود. این اوردر بلاک ها یا نزدیک سقف و کف هستند یا در ادامه روند دیده می شوند. باقی اوردر بلاک ها در قسمت های بعدی همین ماه معرفی می شوند.

مایکل خودش اینگونه ترید می کند: در لیکوئیدیتی های داخل رنج وارد می شود و خارج از رنج ها خارج می شود. ممکن است خارج شدن در لیکوئیدیتی سطوح مینوری باشد.

با نواحی جریان سفارشات تایم بالا مشخص می کنیم در تایم پایین بازار قصد دارد کدام سقف و کف ها را بزنه و لیکوئیدی آنها را جمع کند.

وقتی جهت تشخیص داده شد (مثلا صعودی) با استاپ هانتینگ کف یا اوردر بلاک سمت ارزان وارد می شویم.

درس 3

انتخاب اردر بلاک:

در این درس راهنمایی برای انتخاب اردربلاک گفته می‌شود. حالت صعودی توضیح داده شده و برای تمرین و مرور حالت نزولی را خودتان بررسی کنید.

اوردربلاک صعودی:

نزدیک ساپورت (حمایت) باشد، پایین‌ترین کندل، نزولی و بیشترین رنج رو از اوپن تا کلوز داشته باشد.

تایید اردر بلاک :

وقتی با کندل های بعدی اردر بلاک از سقف کندل اوردربلاک رد می‌شود تایید می‌شود. ترجیحا این عبور باید با مومنتوم خوبی باشد و حداقل یک برابر کندل رد شود. بهترین حالت این است که ۲ یا ۳ برابر کندل از بالای آن رد شود.

ورود :

وقتی قیمت بر می‌گردد به اردر بلاک (اوپن یا شدو نزدیک به اوپن) می‌توانیم ریسک ورود داشته باشیم.

استاپ:

زیر اردر بلاک یا زیر ۵۰ درصد بدنه هم می‌توان استاپ قرار داد. برای علت این موضوع تعریف Mean Threshold را ببینید.

اصلا مهم نیست قیمت به سطح حمایت برسد یا از آن رد شود، وقتی اردر بلاک تایید شود ترید می‌کنیم.

تارگت ها

: دنبال سقف های گذشته می‌گردیم چون وقتی مارکت میکر دنبال نقدینگی پشت آنهاست ما نیز با آن خارج شویم (یا می‌توان نصف پوزیشن را روی سقف ها بست و بقیه را تریل کرد).

Mean Threshold:

به وسط (وسط از اوپن تا کلوز) کندل اوردربلاک می‌گوییم. قیمت معمولا این ناحیه را رد نمی‌کند.

تشخیص جهت حرکت با لیکوئیدیتی

اگر هر سه تایم ماهیانه، هفتگی و روزانه نزولی باشند:

توی اصلاح و بالا رفتن قیمت در تایم های زیر ۴ ساعته وارد می شویم. یعنی در نواحی گران رنج دنبال سل هستیم.

OB , FVG , LV ها جاهای مناسبی برای سل هستند .

اگر هر سه تایم ماهیانه، هفتگی و روزانه صعودی باشند:

توی اصلاح و پایین رفتن قیمت در تایم های زیر ۴ ساعته وارد می شویم. یعنی در نواحی ارزان رنج دنبال بای هستیم.

OB , FVG , LV ها جاهای مناسبی برای بای هستند .

همیشه تایم بالاتر مهم تر است، اگر MN صعودی بود توی W سل نمی کنیم.

بهتره روی اردر بلاک تمرکز کنیم که قیمت بعدش دو یا سه برابر (حداقل) طول بدنه اردر بلاک حرکت کرده است.

این قسمت تحلیل مولتی تایم دارد. برای جمع بندی می توان ویدیو این قسمت از دوره را بررسی کنید.

در ادامه انواع اوردربلاک ها و سپس موارد دیگر تکنیکالی تدریس می شود.

درس 3 قسمت 1

میتگیشن بلاک MITIGATION BLOCK

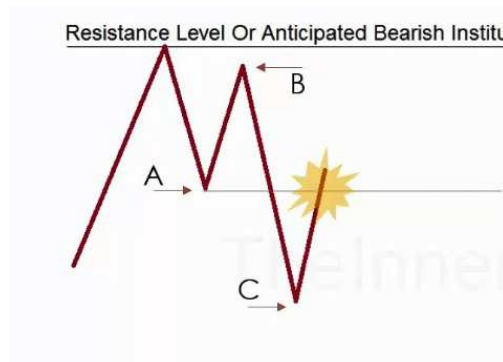
MIT. block داخل Failure Swing ها وجود دارند(به جلسه Jan 1.5 مراجعه کنید).

میتگیشن بلاک: الگوهای W و M نزدیک سقف یا کف در داخل خود یک کندل دارند، بطور مثال در الگوی M که نزدیک مقاومت شکل می‌گیرد آخرین کندل نزولی وسط M (یا بین دو قله و داخل دره کندل خاصی است) که قیمت به آن کندل بر می‌گردد.

همچنان که قیمت نزولی شد توی کف ها آخرین کندل نزولی می‌شود MIT Block و لوی کندل مهم می‌شود و کل بدنه ، استاپ نیز پشت کندل MIT Block قرار می‌گیرد.

تمام موارد بالا برای الگوی W و روند صعودی نیز حاکم است.

تاکید می‌شود این کندل در Failure Swing رخ می‌دهد.



درس 3 قسمت 2

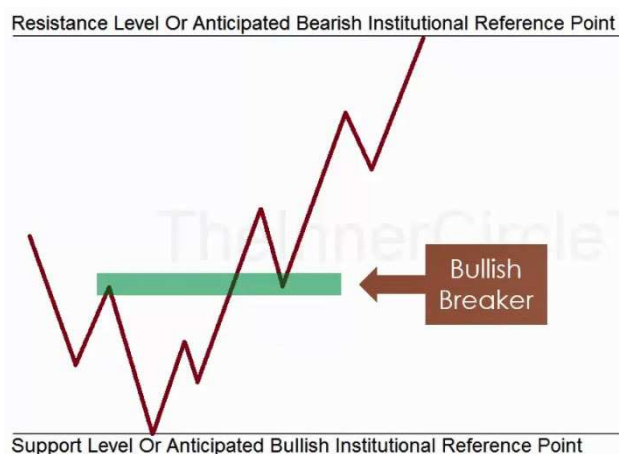
برکر بلاک BREAKER BLOCK

BREAKER BLOCK داخل Stop Runs ها وجود دارند (به جلسه Jan 1.5 مراجعه کنید).

برکر بلاک: الگوهای W و M نزدیک سقف یا کف در داخل خود یک کندل دارند، بطور مثال وقتی به حمایتی می‌رسیم و

قیمت صعودی می‌شود و آخرین سقف خودش را می‌شکند (الگوی W)، برگشت به اون سقف مهم است، کندل بریکر صعودی توی آخرین سقفی که شکست شده را در نظر می‌گیریم. رنگ کندل هم جهت با روند جدید است.

تمام موارد بالا برای الگوی M و روند نزولی نیز حاکم است.





درس 3 قسمت 3

ریجکشن بلاک REJECTION BLOCK

در سقف ها یا کف ها وقتی یک کندل با شدوی بلند داریم (می تواند چند کندل با شدوی بلند باشد) قیمت تمایل دارد بدنه آن کندلها را رد کرده و به شدوی آنها برسد. این برخورد می تواند با شدو و مومنتومی باشد یا کندل داخل آن شدوها بسته شود. به آن کندل با شدوی بلند یا مجموعه کندلها با شدوی بلند ریجکشن بلاک می گوئیم. جهت کندل های ریجکشن بلاک مهم نیست و فقط شدوها مهم اند.

Rejection Block



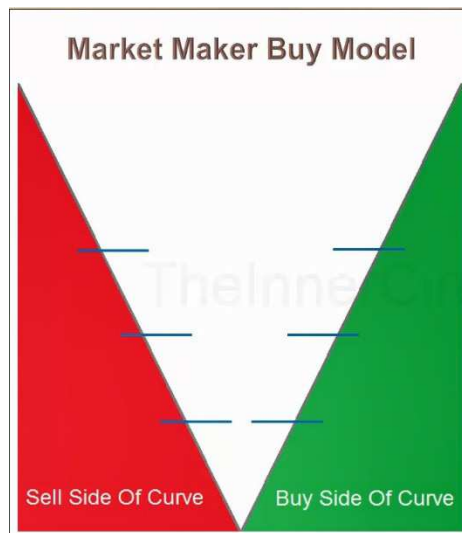
Price Pushes Above The
Previous Highest Candle Body



درس 3 قسمت 4

ریکلیمد بلاک RECLAIMED BLOCK

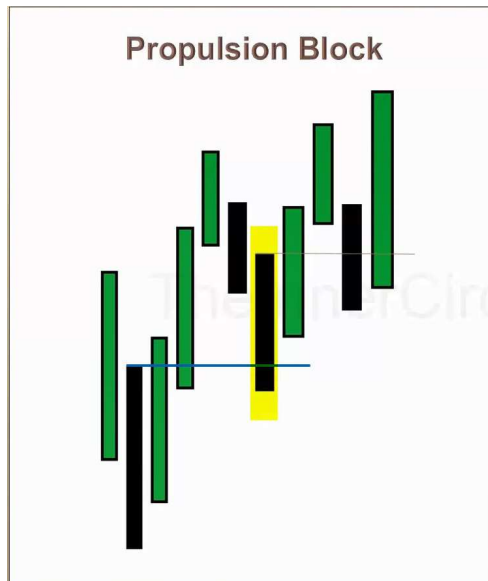
هنگامی که قیمت تغییر روند را تجربه می‌کند، در داخل قله ها یا دره‌هایی که قیمت در روند گذشته از آنها رد شده کندلی هم جهت همان روند وجود دارد، که قیمت پس از تغییر جهت و روند به آنها واکنش می‌دهد.



درس 5 قسمت 5

پروپالشن (پیشران) بلاک PROPULSION BLOCK

اوردربلاکی که در یک روند خودش به یک اوردربلاک دیگه ای واکنش داده و قیمت دوباره به آن واکنش می دهد ، بهتر است وسط این کندل دیده نشود. قیمت بهش می رسد سریع واکنش می دهد.



درس 3 قسمت 6

VACCUUM BLOCK وکیوم بلاک

گپی که باعثش خبر باشد و در این قیمت هیچ معامله ای انجام نشده باشد. قیمت بعد از گپ به سرعت به آن رسیده و پرش می‌کند و سپس تغییر مسیر می‌دهد .



درس 4

استخر نقدینگی LIQUIDITY POOL

به بالای سقف ها و پایین کف ها گفته می شود که حد ضررها یا پوزیشن های استاپ ورود پشت آنها هستند.

باید خودمان را جای دیگر تریدرها بگذاریم که تشخیص دهیم این استاپها کجا قرار دارند.

توی سقف ها و کف ها می توانیم انتظار داشته باشیم که قیمت برود و استاپ ها را بزند و به ناحیه ی خاصی برسد، ما آنجا ترید می کنیم در جهت حرکت جدید.



درس 5

LIQUIDITY VOID

خلاء نقدینگی LV: به حرکت یک جهته و با مومنتوم که بازار بر می‌گردد و دوباره در آن ناحیه معامله صورت می‌گیرد. کندل‌های این حرکت معمولاً بزرگ و با شدو کم می‌باشند. بعد از پر شدن این ناحیه نیز می‌توانیم انتظار چرخش را داشته باشیم.



درس 6

Fair Value Gap

شکاف ارزش بازار FVG: قسمتی از کندل با مومنتوم که توسط دو کندل قبل و بعد خودش پوشش داده نشده یا به عبارتی LV که توی تایم بالا می بینیم. گپ قیمتی محسوب می شود. معمولاً نزدیک پیوت ها تشکیل می شود، کندل شارپ رو در نظر می گیریم و کندل های چپ و راستش که آن را پر نکردند و قیمت تمایل دارد گپ را پر کند. در ناحیه شکست سطوح کلاسیک نیز تشکیل می شود، این گپ ممکن است کلاسیک هم دیده شود، یعنی خالی باشد یا فاصله کلوز تا اوپن بعدی زیاد باشد.



درس 7

بررسی واگرایی مومنتومی توسط اوسیلاتورها - Momentum Div. Phan- tom

از واگرایی معمولی به هیچ وجه استفاده نمی‌کنیم. این نوع واگرایی بیشتر اوقات کار نمی‌کنن. در بررسی گذشته چارت هم هنگامی که چارت را بررسی می‌کنیم فقط آنهایی را که عمل کرده اند را می‌بینیم که درصد کمی را تشکیل می‌دهد.

واگرایی مخفی (هیدن دایورجنس یا واگرایی دنبال کننده روند) اگر با پرایس اکشن ترکیب شود کاربردی است و می‌توان از آن استفاده کرد.

مایکل از استوکستیک با این تنظیمات استفاده کرد:

Stoch---->14 , 2 , 3

درس 8

حقه مارکت میکر: سقف/کف دوقلو Double Top/Bot

بدون در نظر گرفتن تحلیل و سطوح در تایم های بالاتر به هیچ وجه فقط رو این الگو ترید نمی کنیم، چون ممکن است تارگت را ندهد و برگردد به پشت الگو تا استاپ ها را جمع آوری کند.

مایکل در اینجا از کف دو قلو به عنوان گام حرکتی استفاده می کند و اندازه طول الگو به پشت الگو انتقال می دهد تا جمع آوری استاپ ها و چرخش قیمت را ببیند. به مثال زیر توجه کنید.



تمرین

- 1- سه نمودار اوراق را بصورت روزانه بررسی کنید.
- 2- ۲۰ مورد از انواع اوردربلاک‌ها و دیگر سطوح پیدا کنید.





January 2017

ICT Mentorship

Long Term Analysis – Study Notes
Implementing Macro Analysis

فصل پنجم – ماه ژانویه

معاملات بلند مدت و نحوه عملکرد الگوریتم جابجایی قیمت بانک‌ها

این ماه منتورشیپ مهمترین فصل دوره می‌باشد

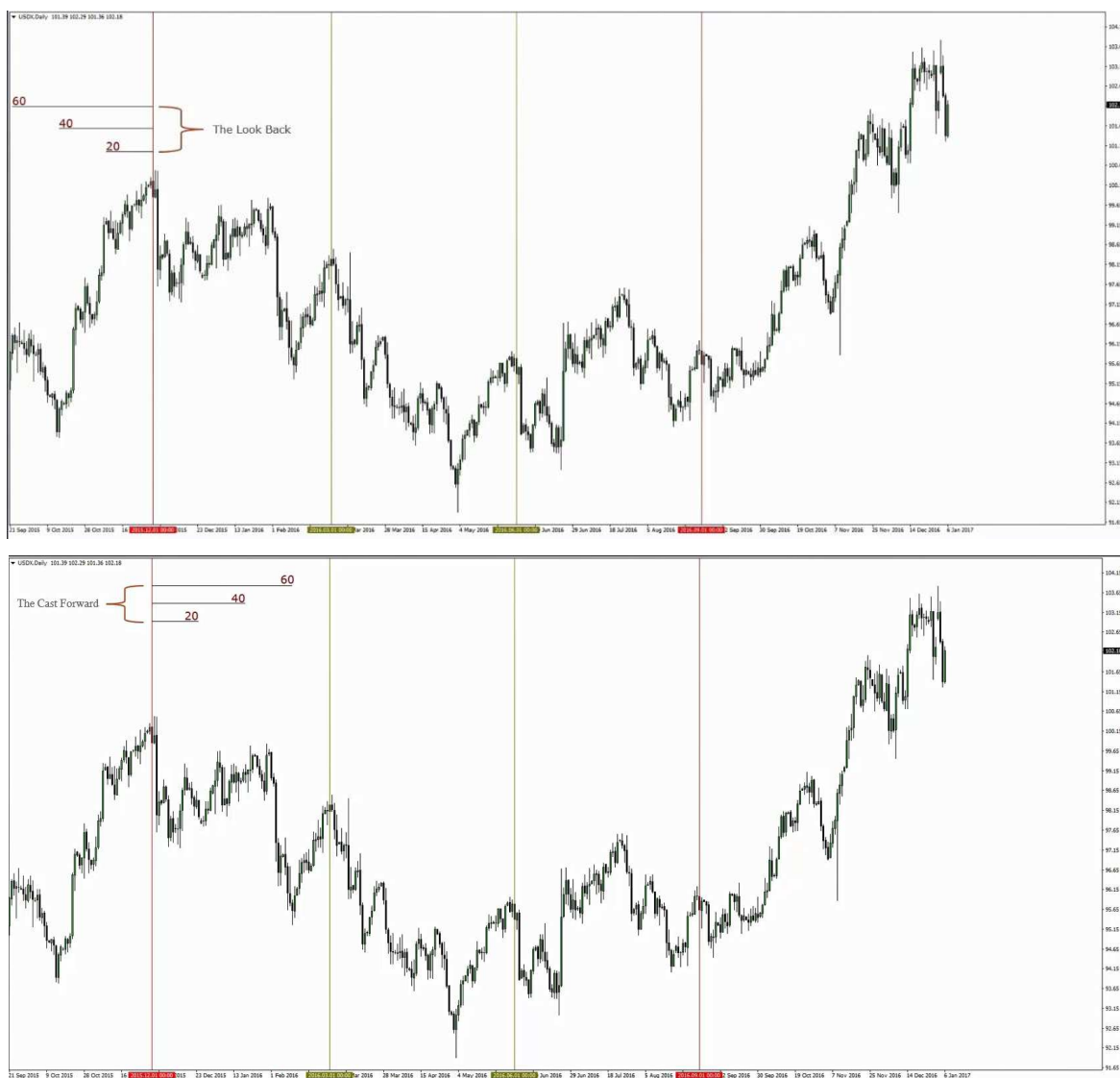


درس 1 قسمت 1

IPDA DATA RANGE & QUARTERLY SHIFTS

رنج داده IPDA :

هر سه تا چهار ماه یک شیفت در مارکت رخ می دهد ، یا روند تغییر می کند یا ساید می شود (اگر حرکت شارپ باشد احتمال بیشتر بعدش کانسالیديشن می شود). روش به این صورت است که ابتدا اول هر سال را مشخص می کند و سپس ۳ ماه ۳ ماه یا ۴ ماه ۴ ماه چارت را تقسیم می کند. این کار را روی جفت ارزهای مختلف امتحان کنید تا متوجه این تغییرات شوید.



از JAN تا JAN استفاده می‌کنیم و بعد با گذشته کالیبره‌اش می‌کنیم. از ماه الان نه، از ماه قبل شروع می‌کنیم، از روز اولش به چپ نگاه می‌کنیم ۶۰ روز قبل ۴۰ و ۲۰ روز قبل، چون دیتای سه ماه گذشته برای الگوریتم خیلی مهم است و اول دنبال آن نقاط می‌رود. آن ۲۰ ۴۰ ۶۰ روز همان روزهای تریدی باشند و نه روزهای تقویمی. ۶۰ ۴۰ و ۲۰ روز بازگشتیم به عقب دنبال سقف‌ها و کف‌های قبلی می‌گردیم یا اگر شادو بلند داشت آن را هم می‌توانیم در نظر بگیریم چون استاپ‌ها و لیکوئیدیتی پشت آن‌ها هست و بازار تمایل دارد برود و آن‌ها را جمع کند

داخل این محدوده ۲۰ ۴۰ ۶۰ روز دنبال OB ها و LV ها و FVG ها و سقف و کف‌ها باید بگردیم ، هرکدام واضح تر باشد مهم‌تر است و هنگامی که این ها را پیدا کردیم آینده را می‌بینیم.

نقطه ی مبدا حرکت علاوه بر ابتدای ماه تغییر فاز، می‌تواند روزی که در حال ترید هستیم و یا ابتدای ماهی که در آن قرار داریم در نظر گرفته شود.

مثال : اگر امروز ۶ ژانویه هست ما از اول دسامبر شروع می‌کنیم و مبدا ما می‌شود. اگر مارکت قبل از این نزولی بود دنبال سقف‌ها می‌گردیم و اگر صعودی بود دنبال کف‌ها چون لیکوئیدی پشت این‌ها است.

هنگامی که این روزها و ۳ تا ۴ ماهه را گرفتیم باید جلو را نگاه کنیم و منتظر واکنش و شیفت مارکت توی ۲۰ تا ۶۰ روز بعدش می‌مانیم و اگر آخرین شیفت ۴۰ روز قبل بود ما ۲۰ روز آینده‌اش را می‌گیریم یا اگر آخرین شیفت ۲۰ روز قبل بود ما ۴۰ روز آینده‌اش را می‌گیریم ، این کار را ادامه می‌دهیم که سه ماه ما کامل بشود ، این روش را باید خیلی تمرین کنیم. می‌توانیم از ۱ ماه قبل از تغییر شیفت در بازار نگاه کنیم برای تمرین کردن.

- BM به معیار ما برای واگرایی SMT مثل شاخص دلار USDX می‌گوییم.
- UL به ابزاری که تریدش می‌کنیم مثل جفت ارزها می‌گوییم.

جمع آوری قیمت برای صعود توسط اسمارت مانی:

- + BM یک کف پایین تر بسازد اما UL کف بالاتر بسازد (همبستگی مثبت).
- مثلا USDX یک کف پایین تر بسازد اما USDCHF کف بالاتر بسازد.
- + BM یک سقف پایین تر بسازد اما UL کف پایین تر بسازد (همبستگی منفی).
- مثلا USDX یک سقف پایین تر بسازد اما GBPUSD کف پایین تر بسازد.
- + BM یک سقف بالاتر بسازد اما UL کف بالاتر بسازد (همبستگی منفی).
- مثلا USDX یک سقف بالاتر بسازد اما EURUSD کف بالاتر بسازد.

جمع آوری قیمت برای نزول توسط اسمارت مانی:

- + BM یک سقف بالاتر بسازد اما UL سقف پایین تر بسازد (همبستگی مثبت).
- مثلا USDX سقف بالاتر بسازد اما USDJPY سقف پایین تر بسازد.
- + BM یک کف بالاتر بسازد اما UL سقف بالاتر بسازد (همبستگی منفی).
- مثلا USDX یک کف بالاتر بسازد اما AUDUSD سقف بالاتر بسازد.
- + BM یک کف پایین تر بسازد اما UL سقف پایین تر بسازد (همبستگی منفی).
- مثلا USDX یک کف پایین تر بسازد اما NZDUSD سقف پایین تر بسازد.

درس 1 قسمت 2

OPEN FLOAT & QUARTERLY SHIFT

FOMC : کمیته مرکزی بازار باز آمریکا که نرخ بهره را تصمیم گیری می کند.

Open float : مطالعه چگونگی حرکت قیمت برای پیدا کردن لیکوئیدیتی در سقف ها و کف ها (به ما در جهت حرکت لانگ ترم و تشخیص جهت کندل دیلی کمک می کند).

برای جمع آوری بای استاپ ها و سل استاپ ها به چه نقاط دیگری نیز می توانیم نگاه کنیم:

بای استاپ ها:

+ بالای سقف های کوتاه مدت تر (ماهانه یا هفتگی)

+ بالای سقف 3 ماه اخیر

+ بالای سقف 6 ماه اخیر

+ بالای سقف 12 ماه اخیر

سل استاپ ها:

+ زیر کف های کوتاه مدت تر (ماهانه یا هفتگی)

+ زیر کف 3 ماه اخیر

+ زیر کف 6 ماه اخیر

+ زیر کف 12 ماه اخیر





درس 1 قسمت 3

کاربردهای دیگر IPDA:

برای ترید در فارکس خیلی مهم هست که بازار فیوچرز را مد نظر قرار بدهیم چون قراردادهای فیوچرز مشخص هستند و حجم اصلی قابل محاسبه می باشد و قابلیت تحلیل با حجم کمک می کند تا تحلیل بهتری از مارکت داشته باشیم. بررسی سه ماه اخیر در بازار فیوچرز در چارت دیلی و پیدا کردن تغییر فاز در این چارت مهم است و به ما کمک می کند که بفهمیم کدام اردر بلاک ها و لیکوئیدیتی ها می خواهند دیده شوند.

پس در بازار فیوچرز هر ارز، تغییر فازها (تغییر روندها) در ۳ ماهه اخیر چارت دیلی، مارکت میکر را روی آن ارز نشان می دهد. حدودا هر سه ماه یک تغییر فازی در فیوچرز داریم که از آن برای بهینه کردن تحلیل استفاده می کنیم (منظور همان بازه های ۲۰ ۴۰ و ۶۰ روزه می باشد).

در هر نقطه ای از چارت فیوچرز تغییر فاز رویت شد از ابتدای همان ماه تغییر فاز علامت زده و مبنا اول همان ماه هستش زیرا ربات ها بر مبنای اول هر ماه اطلاعات جمع آوری می کنند .

نکته:

چرا ما از IPDA استفاده می کنیم؟ چون هیچ چیزی در بازار تصادفی نیست و تمام حرکات برنامه ریزی شده و حتما قرار است توسط ربات ها اتفاق بیافتد.

اگر IPDA تمام لیکوئیدیتی ۶۰ روز گذشته را مصرف کرده باشد به سرعت به سمت سقف یا کف های بعد از ۶۰ روز رفته تا سفارشات خود را پر کند .

اگر از ابتدای همراه تغییر شیف ۲۰ ۴۰ ۶۰ روز به سمت آینده بررسی کنیم ممکن است حدود تغییر جهت را به ما بدهد. برای استفاده از سطوح ۲۰ ۴۰ ۶۰ باید در نظر داشت که سطوح تایم های بالاتر مثل ویکلی از ارجعیت بیشتری برخوردارند.



نکته:

در بازار فیوچرز چگونه تغییر فاز را حدود ۳ ماهه را تشخیص دهیم؟ در سطوح مهم تایم بالای دیلی اگر انتظار تغییر حرکت داشتیم و قیمت به سطح رسید باید خط Open Interest رو زیر نظر گرفت. (Open Interest: تعداد کل پوزیشنهای باز لانگ و شورت می باشد که زیر نمودار فیوچرز از سایت بارچارت قابل مشاهده است). اگر Open Interest بیشتر از ۱۵ درصد تغییر ناگهانی انجام بدهد یک نشانه برای تغییرات روند است. نشانه این است که بانک یا همان لیکوئیدیتی پروایدر (تامین کننده نقدینگی بازار فیوچرز بانکها هستند) تمایل به داشتن پوزیشن باز ندارد زیرا قیمت قصد تغییر جهت دارد و ماندن پوزیشنها در خلاف جهت منطقی نیست.



نتیجه: مارکت در تایم دیلی دنبال سقفها و کفها رفته تا لیکوئیدیتی رو جمع آوری کند و این کار را با تغییر فاز هر سه یا ۴ ماه انجام می دهد .

درس 1 قسمت 4

OPEN FLOAT LIQUIDITY POOL

کاری که باید انجام داد این است که مشخص کنیم استخر نقدینگی یعنی استاپ شرکت‌های سرمایه گذاری بزرگ کجاست (همانوط که می‌دانیم بانک ها حجم نقدینگی زیادی پشت سقف‌ها و کف‌های گذشته را می بینند و دنبال آن حرکت می کنند) .

اوپن فلوت OPEN FLOAT : از تغییر فاز مارکت مبدا را مشخص می‌کنیم، گذشته را به ۲۰ ۴۰ ۶۰ روز قبل تقسیم می‌کنیم سپس درون این بازه ها بالاترین سقف و پایین‌ترین کف مارکت مهم‌ترین نقاط برای جمع آموری استاپ‌ها برای مارکت میکر هستند .



از 20 OPEN FLOAT روزه می‌توان برای اسکالپ و دی تریدینگ استفاده کرد.



الگوی استاپ هانتینگ سقف یا کف های قبلی در کتاب STREET SMART گفته شده است. برای مطالعه بیشتر به آن مراجعه کنید.

الگوی استاپ هانتینگ خود به تنهایی می‌تواند مورد استفاده قرار گیرد یا در صورت دلخواه با OPEN FLOAT ترکیب گردد.



اگر مارکت میکر در حال جمع آوری کفها بود مارکت حالت نزولی دارد منتها وقتی اولین سقف جمع آوری سفارشات شد احتمالا تغییر فاز ۳ ۴ ماهه داریم. (عکس آن برای بازار صعودی صادق است)

تمام این حالات برای بازار فیوچرز صادق است که Open Interest نیز اضافه می‌شود تا دید بهتری بدهد و استاپ هانت را با تغییر ناگهانی تایید کند.

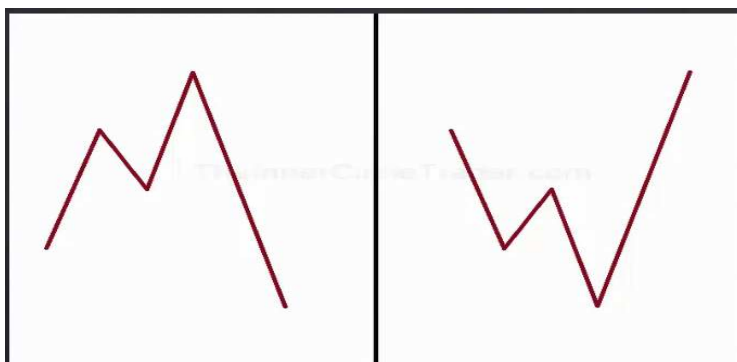
درس 1 قسمت 5

INSTITUTIONAL SWING POINT

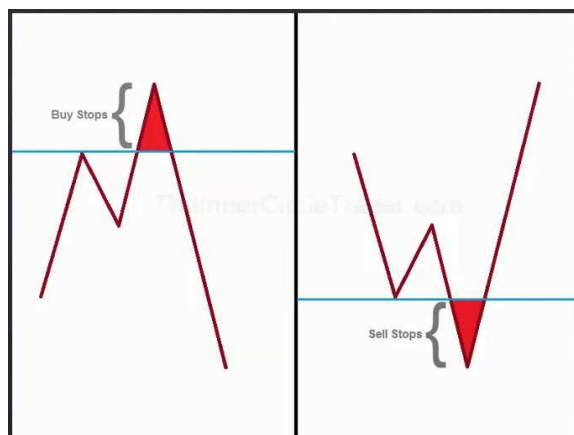
دو مدل سوینگ در بازار که خیلی متداول هستند Stop Run و Failure Swing هستند.

Stop Run

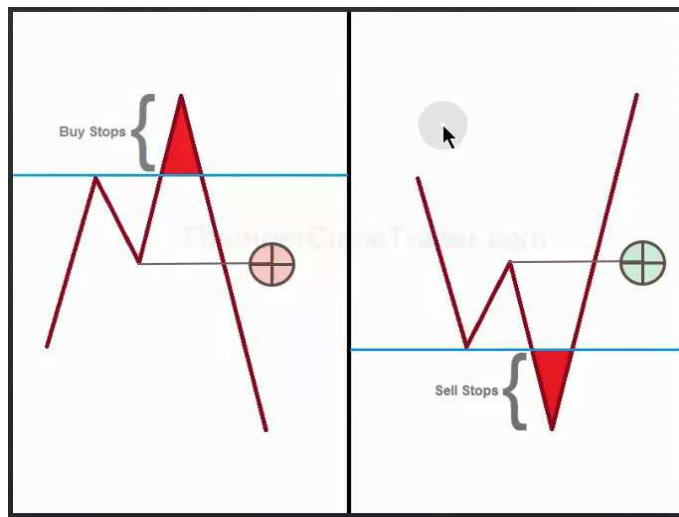
نام دیگر این سوینگ بریکر Breaker نیز می باشد که درون این سوینگها Order Block , Reclaimed Block , Breaker Block وجود دارد .



این مدل سوینگ در حالت صعودی ابتدا یک سقف جدید می زند و سپس کف قبل را رد می کند و در حالت نزولی از کف قبلی عبور می کند که شکست کف معمولا با مومنتوم همراه است و سپس سقف خود را رد می کند (از نظر مایکل این دو نوع سوینگ مهم ترین و واضح ترین الگوهای بازار هستند).

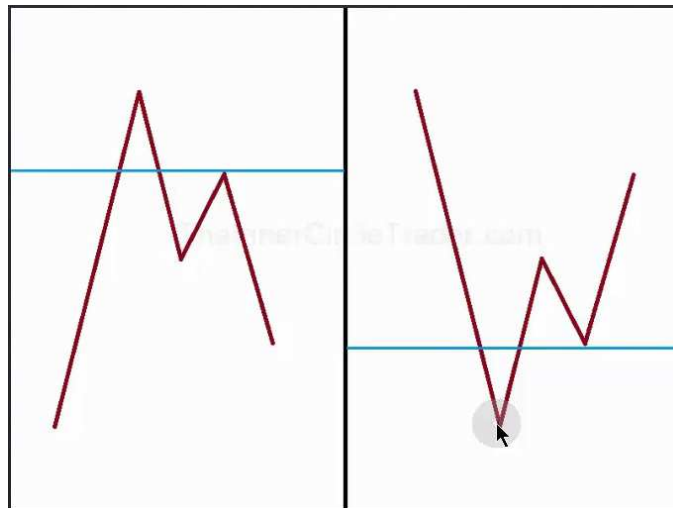


سقف دوم به ناحیه ی مهمی از تایم بالا می رسد که در صورت تشخیص آن ناحیه می توان انتهای ترین نقطه را برای برگشت ترید کرد. یکی از ناحیه های ترید ما در آینده دره بین دو قله می باشد.

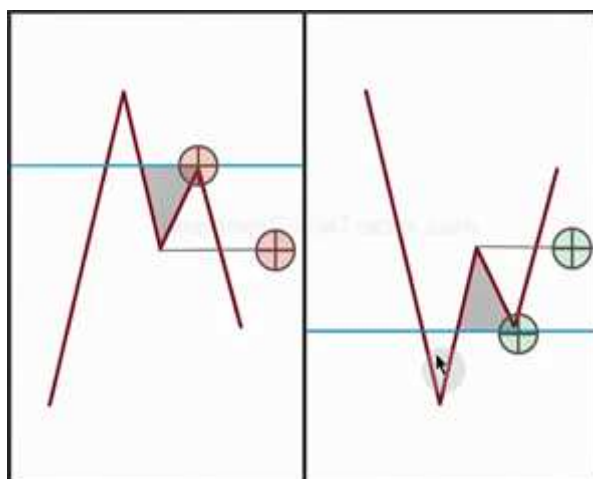


Failure Swing

وقتی قیمت به یک حمایت یا مقاومت برخورد می‌کند اردرهای آن سطح جمع آوری شده و قیمت سریع برگشته و تشکیل سوینگ می‌دهد، می‌توان در اصلاح روی نقطه ی گذشته وارد شده تا جهت جدید را بگیریم.



در این الگو Order Block و Mitigation Block روبرو می‌شویم. در این حالت قیمت در ابتدا به ناحیه ی مهمی رسیده و برگشت ایجاد می‌شود. در برگشت به قله یا دره مابین یا همان کندل Mitigation Block می‌توانیم دوباره ترید کنیم.



درس ۲ قسمت 1

Using 10 years yields in HTF analysis

دو چارت زیر و رابطه آنها با شاخص دلار برای ما مهم است:

10 Years Treasury Prices --- barchart.com

10 Yield Treasury Yields --- investing.com

این دو چارت رابطه ی معکوسی با هم دارند اگر یکی از آنها صعودی باشد دیگری نزولی خواهد بود. رابطه آنها با دلار بدین صورت است:

USD/DXY صعودی < -- > Yields صعودی < -- > Treasury Price نزولی





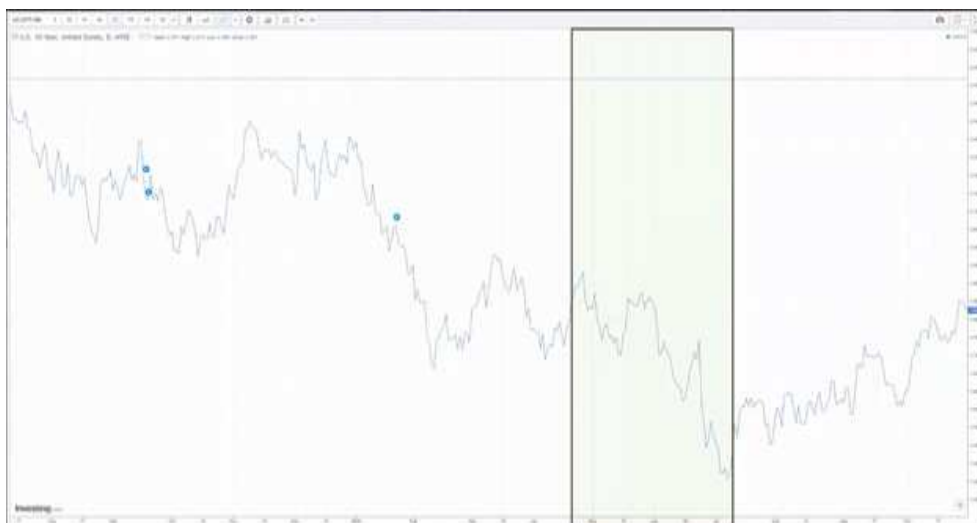
در 10 YEARS NOTE چارت تمایل دارد در ماه‌ها و فصل‌های مختلف سال وضعیت خود را حفظ کند بطور مثال در سپتامبر هر سال نزولی باشد و این تمایلات در چارت و محتویات این ماه دوره موجود است و اگر ارتباط‌های بالا برقرار نبود ما در یک کانسالی‌دیشن بزرگ تر هستیم و بازار روندی ندارد .

درس ۲ قسمت 2

نکته:

اگر Years Note 10 رو با USDX مقایسه کنیم در صورتیکه بین سقف‌ها و کف‌های متناظر واگرایی SMT ببینیم تاییدی بر تحلیل ما می‌باشد.

ترکیب مطلب بالا با تغییر فازهای ۳ ۴ ماهه مارکت می‌تواند نشانه‌های خوبی در جهت تایید به ما بدهد.



درس 2 قسمت 3

تغییرات نرخ بهره و اختلاف آنها بین ارزها

نرخ بهره کشورهایی که در یک طرف جفت ارزهایی هستند که در فارکس وجود دارند حائز اهمیت هستند.

اطلاعات نرخ بهره را بطور خلاصه از سایت FXSTREET.COM می‌توان دید.

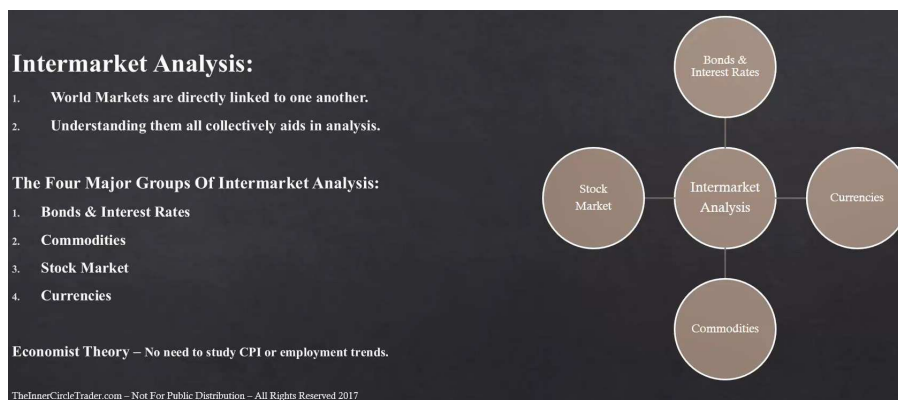
CENTRALBANKS	CURRENTINTERESTRATE	NEXTMEETING	LASTCHANGE
SWISS NATIONAL BANK	-0.75 %	Mar 16, 08:30 GMT	Jan 15, 09:30 GMT
BANK OF JAPAN	-0.1 %	Jan 31, 02:00 GMT	Jan 29, 03:00 GMT
EUROPEAN CENTRAL BANK	0 %	Mar 9, 12:45 GMT	Mar 10, 12:45 GMT
RESERVE BANK OF NEW ZEALAND	1.75 %	Feb 8, 20:00 GMT	Nov 9, 20:00 GMT
BANK OF CANADA	0.5 %	Mar 1, 15:00 GMT	Jul 15, 14:00 GMT
RESERVE BANK OF AUSTRALIA	1.5 %	Feb 7, 03:30 GMT	Aug 2, 04:30 GMT
FEDERAL RESERVE	0.75 %	Feb 1, 19:00 GMT	Dec 14, 19:00 GMT
BANK OF ENGLAND	0.25 %	Feb 2, 12:00 GMT	Aug 4, 11:00 GMT

برای پیدا کردن جفت ارزهایی که روند خوبی دارند می‌توانیم از اختلاف بین نرخ بهره بین کشورها استفاده کنیم بدین صورت که ارزی که کشورش نرخ بهره بالایی دارد در مقابل کشوری که نرخ بهره کمتری دارد قرار داده و ارز خود را انتخاب می‌کنیم. این تنها عامل فاندمنتالی است که بازار را تکان می‌دهد و برای ترید کردن ما از مباحث تکنیکالی استفاده می‌کنیم و این اختلاف بهره فقط جفت ارزی که قرار است خوب حرکت کند را به ما نشان می‌دهد و این ابزاری است برای کسانی که در تایم بالا ترید می‌کنند و همچنین راهنمایی برای تریدرهای روزانه .

درس 3

تحلیل بین بازاری

تحلیل بین بازاری می تواند ۴ بازار رخ بدهد : ۱- اوراق قرضه ۲- بازار ارز ۳- کومودیتی ها ۴- بازار بورس و سهام
این بازارهای مالی خیلی با همدیگر مرتبط هستند.



تحلیل های بین بازاری راهنمای یک بازار برای تعیین جهت یک بازار دیگر است:

- معمولاً اوراق قرضه و سهام با یکدیگر حرکت می کنند.
- کومودیتی ها خلاف جهت اوراق قرضه حرکت می کنند.
- ارزها هم تحت تاثیر کومودیتی ها هستند که جلوتر راجع به آنها بحث می کنیم.

رابطه شاخص دلار با DXY/USDDX با ابزارهای دیگر

- شاخص دلار خلاف جهت کومودیتی ها حرکت می کند و برعکس.
- شاخص دلار خلاف جهت محصولات کشاورزی حرکت می کند و برعکس.
- شاخص دلار هم جهت با بازار سهام آمریکاست.
- شاخص دلار با ارز کشورهای کومودیتی محور خلاف جهت هم حرکت می کنند.

CRB Index (Commodity Research Bureau Index) ---> crbtrader.com

USD < -- > GOLD رابطه معکوس

GOLD < -- > AUD , NZD رابطه مستقیم

OIL < -- > CAD رابطه مستقیم

DOW < -- > Nikkei Index < -- > USDJPY رابطه مستقیم

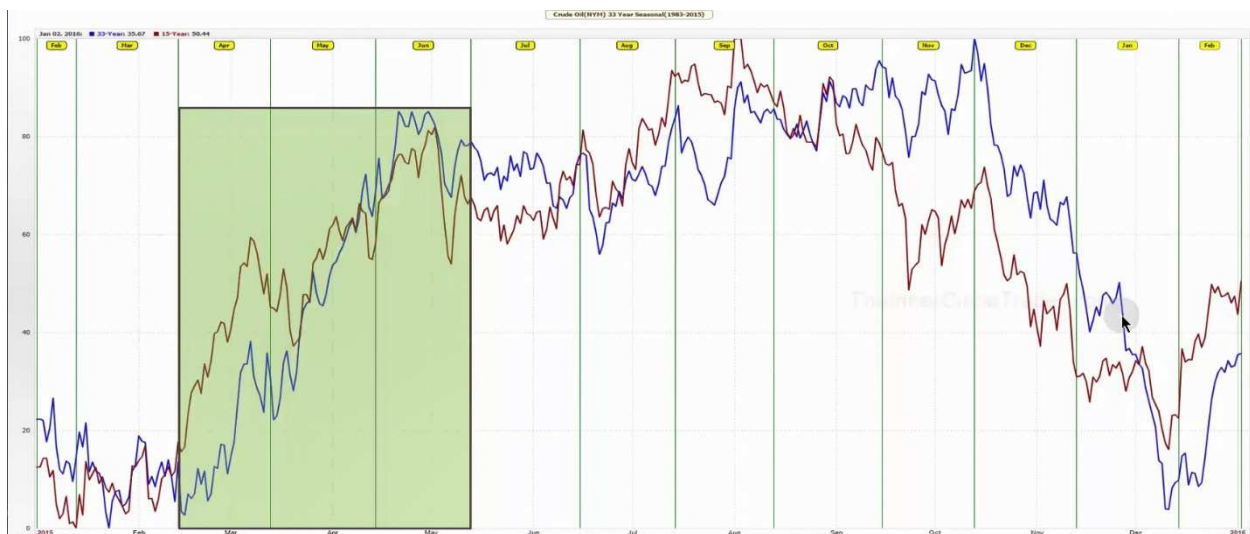
YIELD < -- > رابطه مستقیم با ارزش کشور

GOLD < -- > USDCAD رابطه معکوس

درس 4

SEASONAL TENDENCIES تمایلات فصلی:

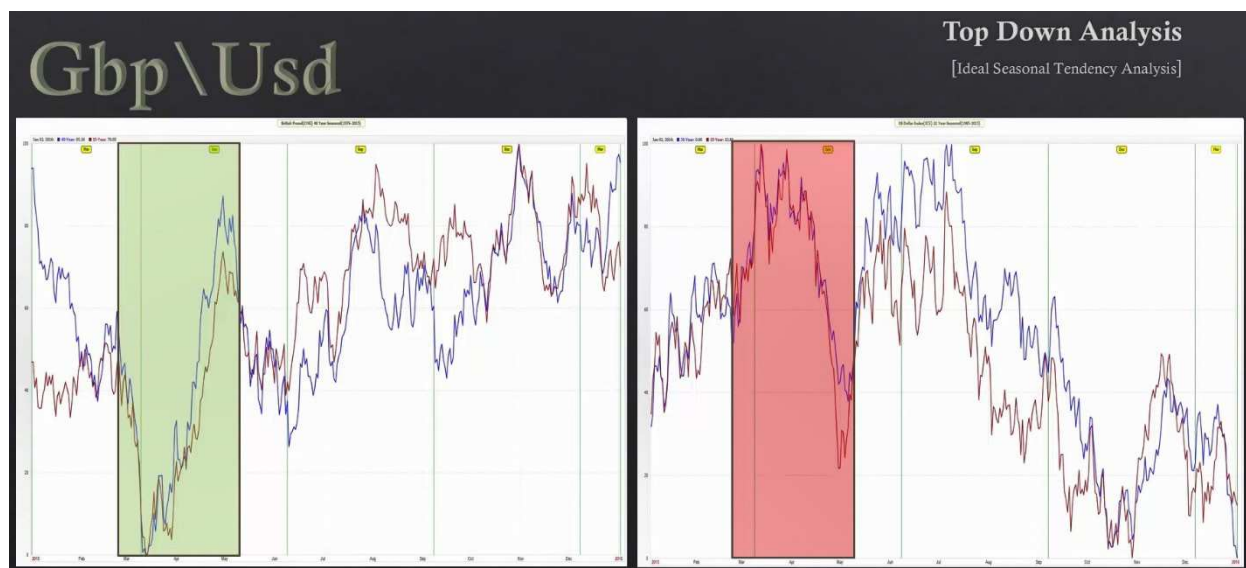
یک نمودار که میانگین حرکات شاخص ابزار یا ارز را طی سال های گذشته در یک سال بصورت فصلی نشان می دهد تا راهنمای ما باشد برای جهت احتمالی آن ابزار در هر فصل. این نمودار در یک فایل زیپ همراه دوره می باشد. این فقط یک ابزار دیگر برای کمک به ماست و چون طی سالهای گذشته مثلا فصلی صعودی بوده حتما قرار نیست در آینده نیز صعودی باشد. فقط یکی از ابزارهایی است که در قسمت ۶ ماه OCT معرفی شده است. از این ابزار در تحلیل بین بازاری نیز استفاده می شود بطور مثال از نفت برای ارز دلار کانادا. این ابزار از بازار فیوچرز آمده است.

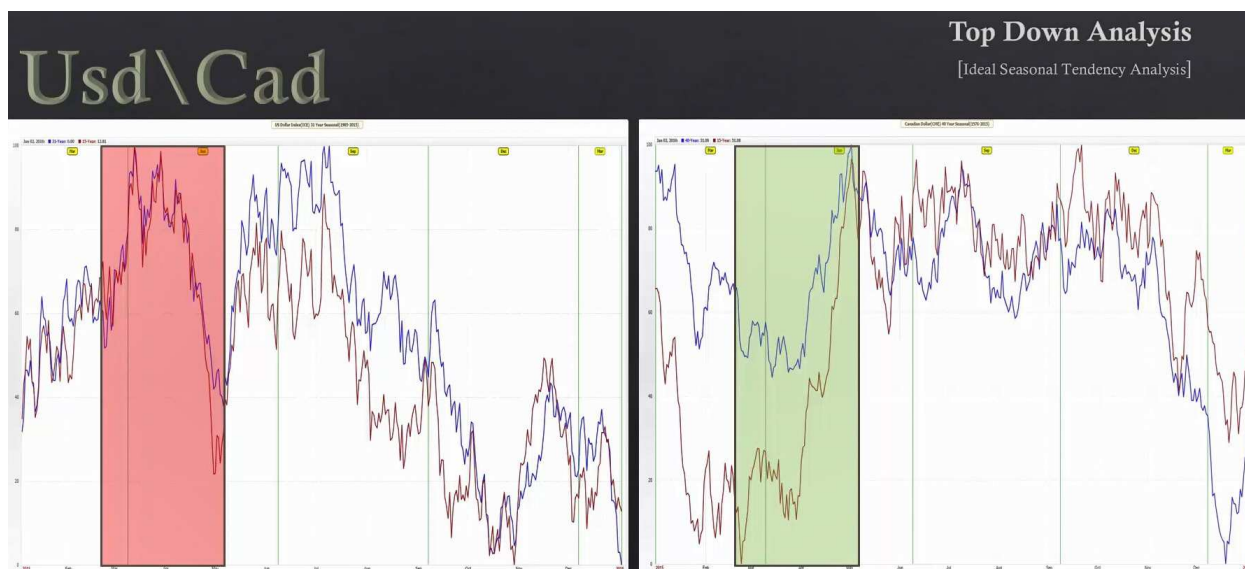




نحوه استفاده به این صورت است که اگر در فصل جهت دار و روندی بودیم به یکی از ابزارهایی که در ماه اکتبر معرفی شد جهت تایم بالای مارکت را اضافه می‌کنیم که صعودی است یا نزولی و اگر بدون روند بود این ابزار را در آن فصل و آن ارز تاثیر نمی‌دهیم .

بهترین استفاده از این در جفت ارزها بدین صورت هست که هر دو ارزی که در جفت ارز مشخص می‌کنیم جهت دار باشند و حتما خلاف جهت هم باشند.





درس 5

مدیریت سرمایه در تایم بالا و انتظارات آن:

وقتی در تایم بالا ترید می‌کنیم حدکثر ۳۰ درصد سرمایه را درگیر می‌کنیم و بر اساس آن ۳۰ درصد ریسک ۱ یا ۲ درصدی خود را در نظر می‌گیریم برای استاپ و حد ضرر قرار دادن. صبور بودن در تایم بالا خیلی اهمیت دارد و ترید هایی که ریوردهای بالای ۳ رو دارند برای ورود انتخاب می‌کنیم .

تریدری که پوزیشن ترید می‌کند ریوارد معقول سالیانه را در نظر می‌گیرد و تعداد ترید های کمی دارد . بطور مثال تریدی دارند با ۲۰۰ پیپ استاپ و حداقل ۶۰۰ پیپ تارگت ، استاپ را عجولانه جابجا نمی‌کنیم و ممکن است مدت زیادی در ضرر باشیم. در نواحی که احتمال برگشت را می‌دهیم تارگت را گذاشته و بعد از اصلاح از آن نواحی می‌توان دوباره وارد ترید شد.

درس 6

آرایه PD: وقتی بازار بین دو سقف و کف حرکت می‌کند و در نواحی نزدیک به کف قیمت را ارزان در نظر می‌گیریم و در نواحی نزدیک به سقف قیمت را گران.

معمولا قیمت از یک ناحیه ارزان DISCOUNT به یک ناحیه گران PREMIUM و از ناحیه گران به یک ناحیه ارزان در حرکت است.

ابتدا نمودار ماهیانه را بررسی می‌کنیم اگر در تعادل باشیم نزدیک‌ترین سطح را در نظر می‌گیریم و اگر نبود به سطح بعد رفته مثلا ممکن است Mitigation Block نداشته باشیم و Breaker Block اولین سطح ما باشد.

سطوح به ترتیبی که وجود دارد در شکل زیر دیده می‌شوند:

Daily Premium

Old High\Low
Rejection Block
Bearish Orderblock
Fair Value Gap
Liquidity Void
Bearish Breaker
Mitigation Block

Equilibrium

Mitigation Block
Bullish Breaker
Liquidity Void
Fair Value Gap
Bullish Orderblock
Rejection Block
Old Low\High

Daily Discount

Monthly Premium

Old High\Low
Rejection Block
Bearish Orderblock
Fair Value Gap
Liquidity Void
Bearish Breaker
Mitigation Block

Bearish Premium Arrays

Equilibrium

Mitigation Block
Bullish Breaker
Liquidity Void
Fair Value Gap
Bullish Orderblock
Rejection Block
Old Low\High

Bullish Discount Arrays

Monthly Discount



Weekly Premium

Old High\Low
Rejection Block
Bearish Orderblock
Fair Value Gap
Liquidity Void
Bearish Breaker
Mitigation Block

Equilibrium

Mitigation Block
Bullish Breaker
Liquidity Void
Fair Value Gap
Bullish Orderblock
Rejection Block
Old Low\High

Weekly Discount

اگر یکی از سطوح مثلا در قسمت ارزان چارت باشد قیمت به آن لول واکنش داده و به سمت اولین ناحیه گران که تا بحال دیده نشده است می رسد .

به شکل بالا که ترتیب سطوح را نشان می دهد آرایه PD می گویند .

آرایه ی PD برای تایم فریم های ویکلی و دیلی و پایین تر نیز قابل استفاده است .

آرایه ی PD در تایم بالا مهم تر از تایم های پایین تر هستند و ممکن است باعث تغییر روند در تایم پایین تر شود .

هرگاه یک آرایه PD تایم پایین شکست به آرایه PD یک تایم بالاتر نگاه می کنیم .

این قسمت مهم است.



درس 7

استفاده از اردر استاپ برای ورود به مارکت :

وقتی بطور مثال برای خرید تصمیم گیری شد (در تایم بالا) هر کندل نزولی که تشکیل می شود می توان اردر بای استاپ را در اوپن آن کندل نزولی قرار داده و حد ضرر را پشت سوینگ قبل، اگر چند کندل نزولی پشت سر هم تشکیل شد آخرین کندل برای ما اهمیت دارد ، برای ورود در چند نقطه نیز می توان از این روش بهره جست .

استفاده از اردر لیمیت برای ورود :

بطور مشابه در روش قبل با این تفاوت که روی کلوز کندل خلاف جهت اردر لیمیت گذاشته می شود .

درس 8

مدیریت پوزیشن در پوزیشن تریدینگ

برای حالت صعودی (در حالت نزولی تمامی موارد عکس هستند) :

- استاپ لاس زیر کف ۴۰ روزه معاملاتی گذشته تریل شود
- به اینکه می خواهید با استاپ وارد پوزیشن شوید یا با لیمیت دقت کنید
- به آرایه PD در تایم دیلی دقت کنید
- به تغییر فاز ۳ یا ۴ ماهه دقت کنید
- تارگت بر اساس آرایه PD تایم های ویکلی و مانسلی باشد
- به تغییرات نرخ بهره هر دو ارز در طول ترید دقت کنید
- تحلیل بین بازاری را حتما در نظر بگیرید
- به تمایل حرکت جفت ارزها در فصل های مختلف دقت شود (Seasonal Tendency) .

این قسمت مهم است.

تمرین

- 1- ار هر مدل سوپینگ ۵۰ نمونه پیدا کنید.
- 2- 5 سال گذشته 5 جفت ارز را از نظر حرکات IPDA و تغییر فاز ۳ - ۴ ماهه بررسی کنید.
- 3- نمودار Open Interest پنج ارز را بررسی کنید.
- 4- تغییرات نرخهای بهره را زیر نظر بگیرید.
- 5- در تحلیل بین بازاری، ابزارهایی که متناسب هم حرکت می کنند را در ۱۰ سال اخیر در تایم فریم روزانه بررسی کنید.
- 6- نمودار تمایلات فصلی را بررسی کرده حرکات ۵ جفت ارز را در ۱۰ سال اخیر با آن مقایسه کنید.
- 7- در نواحی ارزان و گرانی که در فصول قبل بدست آورده اید آرایه های PD را مشخص کنید.



February 2017
ICT Mentorship
Swing Trading – Study Notes

Copyright 2017 TheInnerCircleTrader.com All Rights Reserved

This presentation in video, image capture or printed version is intended for paid members only of The ICT Monthly Mentorship & permission is not granted to resell, host or share for public or paid viewing apart from mediums associated with those of TheInnerCircleTrader.com or Michael J. Huddleston.

فصل ششم – ماه فوریه
سوئینگ تریدینگ



درس ۱

شرایط ایده ال برای سوينگ تريدينگ

سوينگ تريدينگ: پيدا كردن منظم حركت‌های بازار كه مدت پوزيشن بيشتر از دو هفته طول بكشد.

هدف از سوينگ تريدينگ: گرفتن حركت‌های ماركت در مدت بيش از دو هفته.

ارز يا ماركت مشخصی برای سوينگ تريدينگ وجود ندارد و حركت‌های بزرگ بين ماركت‌ها و ارزها در طول سال جابجا می‌شوند، معمولاً هر سه ماه يك فرصت مناسب برای سوينگ تريدينگ بوجود می‌آيد.

از ماركت‌هایی كه در سه ماه اخير حركت قابل توجهی نداشته‌اند دوری كنيد.

در چارت‌های ماهيانه و هفتگی حالت ماركت (ماركت پروفایل) را خوب بررسی كنيد.

ماركت پروفایل از حالت‌های مختلف به يكدیگر تبديل می‌شوند (كانسالیديشن، روندی، برگشتی يا ريورسال)، در حالت روندی حركت می‌تواند اكسپنشن يا ريتريسمنت باشد.

اگر می‌خواهيم حركت‌های سوينگی خوبی از بازار بگيريم بايد به دنبال بازار روندی باشيم، حتی اگر يك بازار رنج و تميز ديده شد دليل بر داشتن تريد جهت دار مناسب نمی‌باشد.

بايد يك دسته از ابزارها و جفت ارزهایی كه در تايم فریم ماهيانه و هفتگی شرایط روندی مناسبی دارند را در واچ لیست خود داشته باشيم.

در سوينگ تريدينگ ما دنبال ستاپ‌های خوب در تايم فرم ماهيانه و هفتگی و روزانه بوده و ورود در تايم ۴ ساعته صورت می‌گيرد.

حتماً نيازى نيست برای ورود در انتهای‌ترین قيمت وارد شد، زیرا امکان اشتباه را بالا برده، بهتر است با تشخيص جهت و به دنبال آن درون روند تايم بالا وارد شده تا احتمال موفقيت بيشتر گردد.



درس ۲

عناصر یک سوینگ تریدینگ موفق

- 1- روند واضح در تایم بالا
- 2- جریان سفارشات تایم بالا مشخص باشد، یعنی بتوان تشخیص داد که قیمت قرار است نزولی باشد یا صعودی
- 3- اختلاف نرخ بهره دو ارز آن را تایید کند
- 4- گزارش cot آن را تایید کند. (انتخابی)
- 5- در چارت تایم‌های ماهیانه و هفتگی و روزانه آرایه‌های PD سمت مخالف واضح و قابل بررسی باشند.
- 6- تمایل فصلی ارزها (SEASONAL TENDENCY) هم جهت باشد. (انتخابی)
- 7- تحلیل بین بازاری جهتی که در نظر گرفتیم را تایید کند.

اگر به این موارد پایبند باشید می‌توانید سوینگ‌های خوبی را شکار کنید، اما ممکن است بدون موارد بالا نیز سویینگ خوبی دیده شود.

از SMT هم می‌توان کمک گرفت، مثلاً روی EURUSD در کف پایین‌تر ترید خرید انجام شود، در صورتیکه در شاخص دلار سقف پایین‌تر دیده و یا جهت مخالف. (برای SMT به قسمت NOV 5 و JAN 1.1 مراجعه شود)

قوانین مشخص سوینگ تریدینگ مثل فیلتر عمل کرده و حتی اگر ستاپی دیده شد که یکی از قوانین را نداشته باشد، قطعاً ترید نخواهیم کرد. بعد از مهیا بودن شرایط قوانین مدیریت ریسک و سرمایه، بررسی می‌کنیم.

تمرین: فرصت‌های معاملاتی چطور بوجود می‌آیند، چه زمانی باید وارد معامله شد، حد ضرر و حد سود کجا باید باشد، چه زمانی حد ضرر را جابجا می‌کنیم، قوانین سوینگی شما چیست؟ (این موارد در قسمت های بعدی توضیح داده خواهد شد)

درس ۳

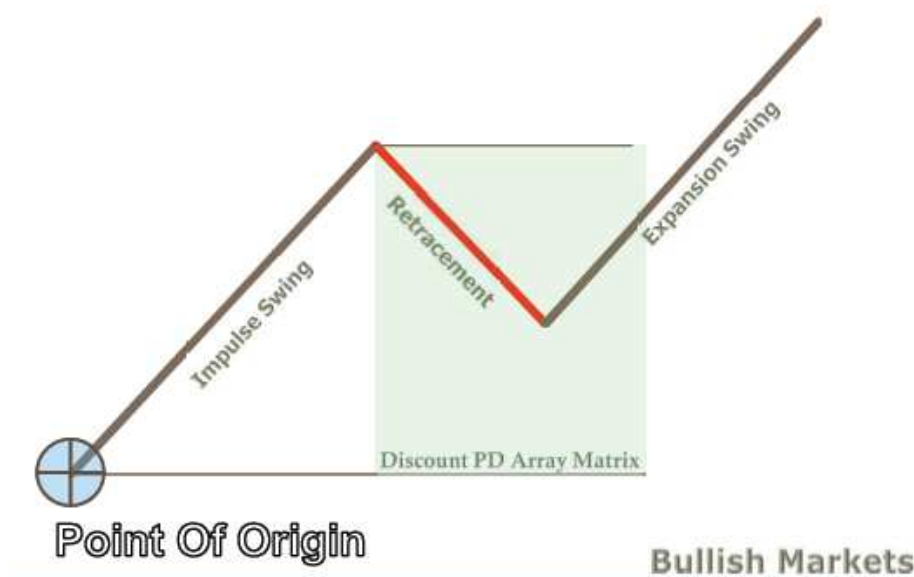
سوینگ تریدینگ کلاسیک

وقتی شرایط مارکت را در نظر می‌گیریم، به این که بازار قرار است خودش را به کجا برساند دقت می‌کنیم، روند چه صعودی باشد چه نزولی، آرایه‌های PD که آخرین بار قیمت به آن رسیده و برگشت داده شده و آرایه‌های PD که در سمت مقابل وجود دارند و قیمت قصد دارد خودش را به آن نواحی برساند، مد نظر قرار داده شود.

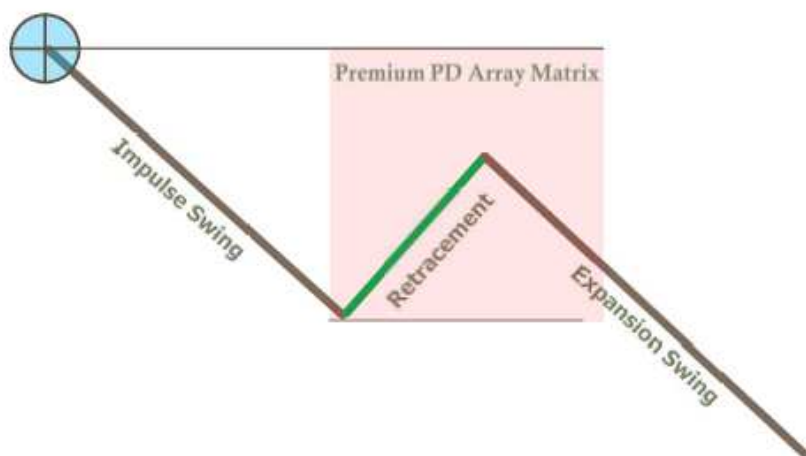
قیمت معمولاً بین دو ناحیه قرار دارد، آرایه‌های PD در قسمت خرید یا ارزان و آرایه‌های PD در قسمت فروش یا گران هستند. این آرایه‌ها باید از تایم ماهیانه تا ۴ ساعته برای سوینگ تریدینگ در نظر گرفته شوند. باید بررسی شود در آرایه خرید PD هر تایم کجای بازار هستیم و قرار است قیمت به کجا برود، بهترین شرایط برای ترید آن است که بازار در هر ۴ تایم فرم بالا به آرایه‌ی PD یک سمت مثلاً فروش رسیده باشد تا برآیند حرکت آینده مارکت و همچنین ریسک به ریوارد مناسبی داشته باشیم.

کانسپت کلی

هم جهتی مارکت با تمایلات فصلی، نرخ بهره، COT و تحلیل بین بازاری. مارکت سقف‌های جدید یا کف‌های جدید می‌زند و سقف‌ها یا کف‌های قبلی خود را رد می‌کند، ما حرکت ایمپالس اول را که در تایم بالا دیدیم صبر می‌کنیم تا انتهای اصلاح و آنجا وارد پوزیشن می‌شویم. در مورد حرکت خلاف جهت ماه آخر دوره صحبت می‌شود، وقتی که قیمت در حال اصلاح است آرایه PD را جستجو کرده تا بهترین نقطه برای ورود باشد، آرایه‌های در حرکت‌های ایمپالس برای گرفتن یک حرکت اکسپنشن به ما کمک می‌کند.



Point Of Origin



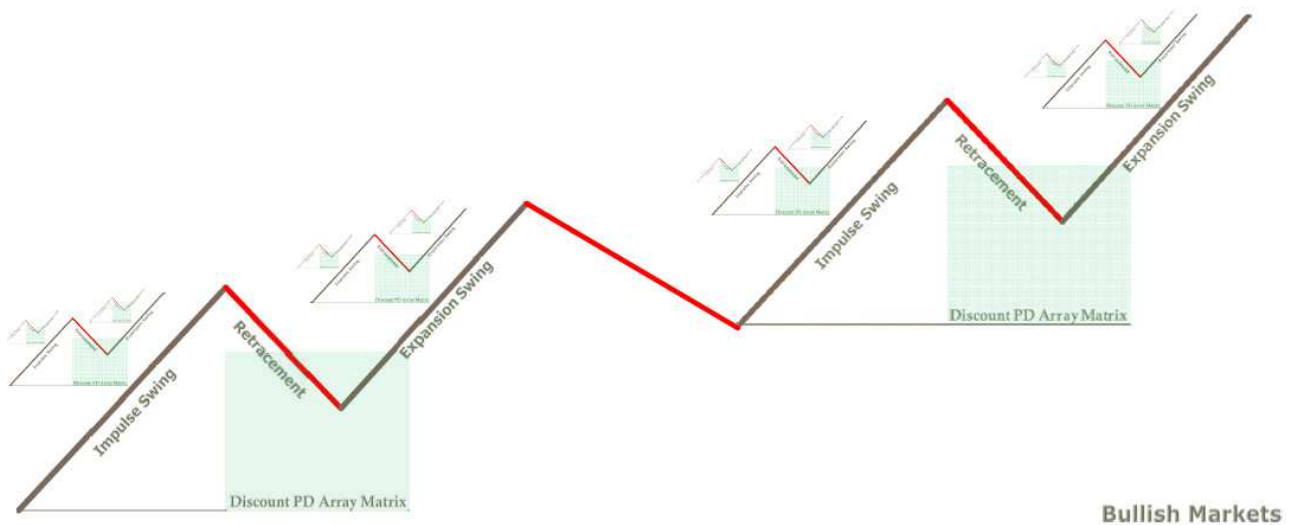
Bearish Markets

رویه سوینگ تریدینگ

۱. ۱۸-۹ ماه اخیر را در تایم ماهانه و هفتگی بررسی می کنیم تا از وجود روند مطمئن شویم.
۲. آرایه های PD در تایم ماهانه را مشخص می کنیم. در حرکت صعودی ارزان ها و نزولی گران ها مهم است.
۳. اگر آرایه های PD در اصلاح جلوی قیمت را گرفته اند، باید ببینیم آرایه های سمت مخالف کجا هستند.
۴. وقتی به آرایه PD ماهیانه رسیده بود، به تایم هفتگی برویم و آنجا آرایه ها را بررسی کنیم.
۵. اگر آرایه PD هفتگی جلوی قیمت را گرفته بود، سمت مخالف آن آرایه را بدست می آوریم.
۶. اگر به آرایه PD هفتگی رسید به تایم روزانه می رویم.
۷. آرایه های فعال تایم روزانه را بدست می آوریم. (سمت اصلاح)
۸. وقتی آرایه PD روزانه رسید، می رویم به تایم فریم H4 و آنجا آرایه ها را بدست می آوریم.
۹. اگر مثلاً حرکت صعودی را می خواستیم بگیریم، روی تمام آرایه PD تایم H4 خرید می کنیم و در آرایه تایم های بالاتر مقداری از پوزیشن خود را می بندیم.

• اگر نقض شد چکار باید انجام بدهیم (استاپ خوردیم)

۱. روی آرایه بعدی در تایم H4 ترید می‌کنیم.
۲. اگر دیگر H4 آرایه نداشت به تایم بالاتر مراجعه می‌کنیم.
۳. در آرایه‌های بعدی ۵۰ درصد پوزیشن اولیه ترید می‌کنیم.
۴. رد شدن از آرایه‌های PD تایم H4 در جهت مخالف و ایجاد آرایه جدید در جهت موافق نشانه خوبی از ادامه حرکت دلخواه ماست.



درس ۴ و ۵

سوئینگ تریدینگ با احتمال موفقیت بالا در بازار صعودی (گاوی)

- در تایم ماهیانه آرایه‌های PD در سمت ارزان مارکت که احتمال برگشت قیمت را دارند در نظر می‌گیریم.
- در تایم هفتگی و روزانه نیز آرایه‌های PD سمت ارزان بازار را برای خرید در نظر می‌گیریم.
- در تمامی تایم فریم‌ها کندل‌های نزولی حکم حمایت را برای ما دارند.

❖ بررسی حالت های مختلف

A. اگر هر سه تایم MN و W و D1 صعودی بودند:

روی تمام آرایه‌های PD سمت ارزان تایم‌های D1 و H4 خرید می‌زنیم.

B. MN و W صعودی و D1 نزولی باشند:

روی آرایه PD سمت ارزان تایم D1 که بالا یا داخل آرایه ارزان W قرار دارد خرید می‌کنیم، یا در آرایه PD ارزان قیمت

تایم H4 که بالا یا داخل آرایه PD ارزان W یا D1 قرار دارد خرید می‌کنیم.

اگر الگو سوئینگ STOP RUN روی سقف تایم روزانه بود، به هیچ وجه روی آرایه ارزان تایم D1 ترید نمی‌کنیم و منتظر

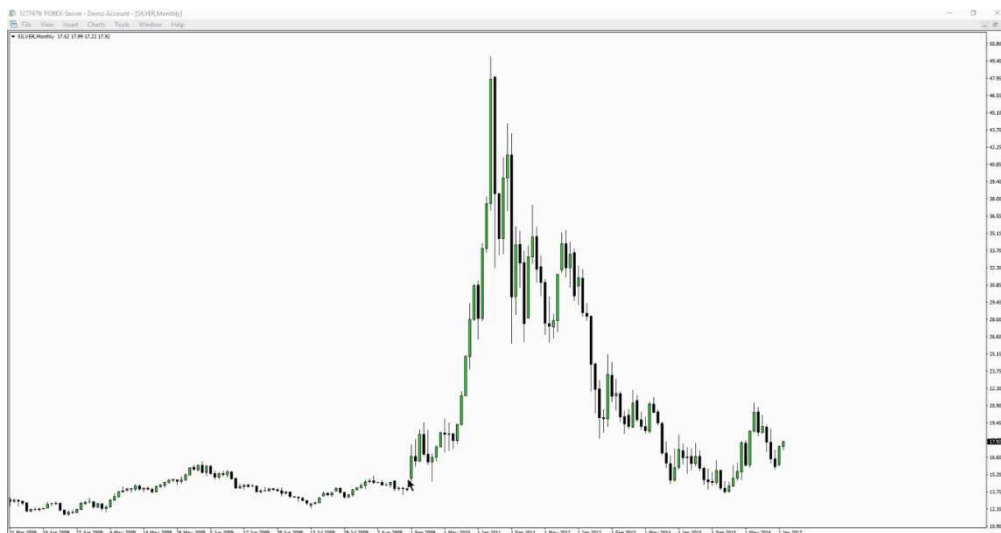
سطوح تایم بالاتر می‌مانیم.

C. ماهیانه صعودی W و D1 نزولی:

روی آرایه ارزان D1 که بالا یا داخل آرایه ارزان MN است، خرید می‌کنیم.

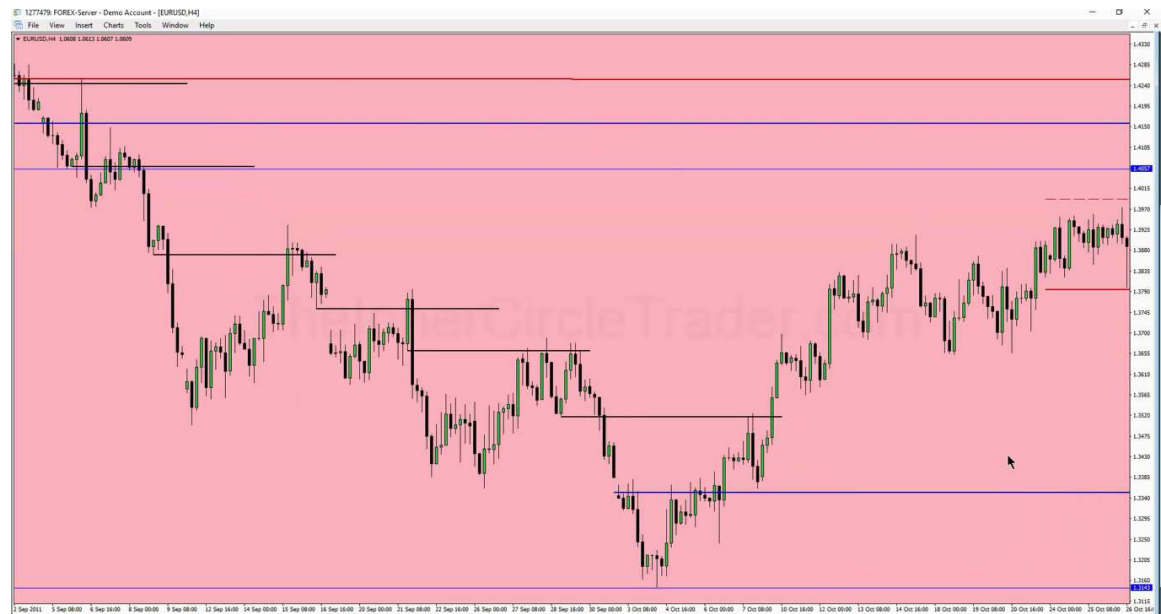
روی آرایه PD ارزان H4 که روی آرایه ارزان WK یا داخل آرایه ارزان MN است، خرید می‌کنیم.

اگر الگوی سوئینگ STOP RUN روی سقف WK دیدیم، در سمت ارزان WK آرایه PD را به هیچ وجه خرید نمی‌کنیم.



نکته: برعکس تمامی موارد بالا برای بازار نزولی (خرسی) نیز برقرار است.





درس ۶

کاهش ریسک و افزایش ریوارد در سوئینگ تریدینگ

کاهش ریسک: قبل از ترید باید درصد ریسک خود را مشخص کنیم، منطقی هم باید باشد. بهتر است روی سطوح MN و WK ترید کنیم و ورود ما در ساعت ۴ ساعته باشد. حداقل ریوارد به ریسک سه باشد و دنبال بالاتر باید باشیم تا برآیند مناسبی داشته باشیم.

افزایش ریوارد: سطوح تایم‌های بالاتر را برای ترید انتخاب کنید، با اینکار ریواردهای بالای ۱۰ هم می‌توانید بگیرید. معمولاً بین ۴ تا ۶ هفته یک یا دو سوئینگ خوب می‌توان گرفت.



تمرین: دو موقعیت خرید و دو موقعیت فروش برای سوئینگ تریدینگ روی گذشته هر چارتی که می‌خواهید پیدا کنید و آن‌ها را بررسی کنید.

درس ۷

نکات مهم برای پیدا کردن مارکتی که حرکت با مومنتوم دارد

۱. بررسی تمایل تمام ابزارهایی که می‌خواهیم در آن‌ها ترید کنیم و ساختار آن‌ها (صعودی نزولی)
۲. بررسی تحلیل بین بازاری و تاثیرات آن‌ها یا حتی واگرایی SMT بین آن‌ها
۳. بررسی گزارشات COT و برنامه‌های هج کننده‌ها
۴. بررسی نمودار OPEN INTEREST (درس JAN1.3)
۵. بررسی تمایل فصلی ابزارها
۶. بررسی نواسانات و فیلتر کردن آن‌ها تاییدی باشد برای نکات قبلی، یا اگر بازار رنج شده بود دنبال حرکت روندی با نواسانات بالا باشیم.
۷. بررسی وجود اخبار اقتصادی مهم پیش رو
۸. بررسی سنتیمنت بازار (با اندیکاتور %R Williams یا بررسی سایت‌های خبری)

درس ۸

ستاپ های میلیون دلاری

۱. اول تمایلات فصلی را بررسی می‌کنیم و اگر شرایط مناسب بود ادامه می‌دهیم.
 ۲. بعد از آن ۴ بازاری که وجود دارد را بررسی می‌کنیم تا ببینیم کدام روندی است یا درجا می‌زند. بازار سهام، فارکس، کومودیتی و اوراق (در این بازار کریپتوکارنسی تدریس نشده است اما مباحث تکنیکالی در آن بازار نیز قابل اجراست)
 ۳. تحلیل بین بازاری انجام می‌دهیم.
 ۴. بعد از انتخاب کامل ابزار ترید تحلیل مولتی تایم را از ماهیانه شروع می‌کنیم.
 ۵. سپس ستاپ‌های ترید را بررسی می‌کنیم.
 ۶. در اخر مدیریت ترید شامل ریسک و پوزیشن را انجام می‌دهیم.
- توجه کنید اگر یک مرحله مناسب نبود در این روش ادامه نمی‌دهیم و ترید نمی‌کنیم.



GCJ17 - Gold - Daily Candlestick Chart



تمرین

- 1- شرایط سویینگ تریدینگ در ۵ جفت ارز و در ۱۰ سال گذشته بررسی کنید.
- 2- اگر به این سبک ترید می‌کنید چک لیست مناسب را آماده کنید.



March 2017

ICT Mentorship

Short Term Trading Study Notes

فصل هفتم - ماه مارس

معاملات کوتاه مدت و رنج هفتگی



درس 1

ترکیب رنج هفتگی-ماهیهانه

مایکل به این سبک ترید می‌کند و روش کامل استراتژی نیز آخر این فصل به اسم One Shot One KiLL یا OSOK آموزش داده می‌شود.

شورت ترم تریدینگ:

- بازیودن معاملات بین چند روز تا یک هفته
- از چارت‌های ماهانه و هفتگی برای پیدا کردن ستاپ استفاده می‌شود.
- درجهت رنج هفته جاری یا آتی ترید انجام می‌شود.
- دانستن رنج هفتگی خیلی مهم است.
- هم در بازار ترندی می‌توان ترید کرد و هم در بازار رنج.
- فقط تریدهای خیلی واضح روی چارت گرفته می‌شود
- از نظر مایکل این روش بیشترین احتمال موفقیت را دارد.
- استفاده مستمر از ستاپ‌های ثابت می‌تواند موقعیت‌های فراوان برایمان فراهم کند.

قبل از ورود به این فصل باید ۲ فصل قبل + آرایه PD را به خوبی یاد گرفته باشید.

نکته:

همیشه مارکت از یک آرایه PD ارزان به یک آرایه PD گران می‌رود و یا برعکس یعنی از گران به ارزان. همچنین همیشه وقتی بطور مثال از یک آرایه PD تایم هفتگی برگشته، به آرایه PD همان تایم هفتگی یا تایم بالاتر خودش را می‌رساند و در جهت خلاف روند آرایه PD تایم‌های پایین‌تر را رد می‌کند.

در شورت ترم تریدینگ از تایم ماهیهانه تا H4 را با آرایه PD تحلیل می‌کنیم در تایم H1 وارد معامله می‌شویم. بهترین فرصت معاملاتی زمانی است که در آرایه PD در تمام تایم فریم‌ها هم جهت باشند تا ترید مطمئن تری داشته باشیم.



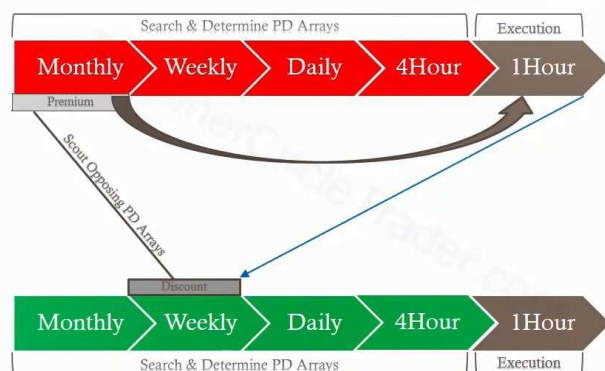
HTF Sequence:

Shorting Opportunities -

- Monthly Chart Sell Program
- Weekly Chart Sell Program
- Daily Chart Sell Program
- 4Hour Chart Sell Program
- 1Hour Chart Sell Program

Buying Opportunities -

- Monthly Chart Buy Program
- Weekly Chart Buy Program
- Daily Chart Buy Program
- 4Hour Chart Buy Program
- 1Hour Chart Buy Program



نکته:

اگر در سطوح یا آرایه PD تایم بالا ترید می‌کنیم، اولین تارگت آرایه PD سمت مخالف یک تایم پایین‌تر است و ما باید قسمتی از پوزیشن را ببندیم و اجازه رشد به ترید بدهیم. ممکن است در این مسیر تعداد زیادی موقعیت معاملاتی ایجاد شود که همه آن‌ها را می‌توانیم ترید کنیم.

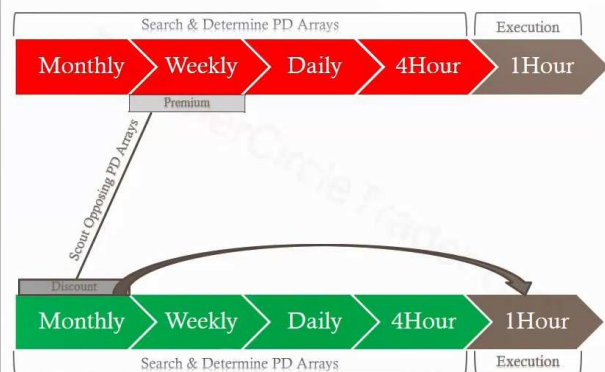
HTF Sequence:

Shorting Opportunities -

- Monthly Chart Sell Program
- Weekly Chart Sell Program
- Daily Chart Sell Program
- 4Hour Chart Sell Program
- 1Hour Chart Sell Program

Buying Opportunities -

- Monthly Chart Buy Program
- Weekly Chart Buy Program
- Daily Chart Buy Program
- 4Hour Chart Buy Program
- 1Hour Chart Buy Program



نکته:

OSOK تریدی است که مثلاً روی سطح آرایه PD سمت ارزان مارکت در تایم هفتگی و تارگت اولین سطح گران در تایم روزانه است. ورود همچنان در تایم یک‌ساعته می‌باشد. این روش معمولاً یک ترید در هفته به ما می‌دهد.

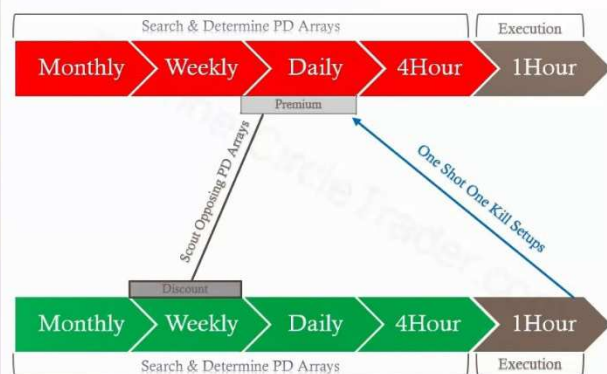
HTF Sequence:

Shorting Opportunities

- Monthly Chart Sell Program
- Weekly Chart Sell Program
- Daily Chart Sell Program
- 4Hour Chart Sell Program
- 1Hour Chart Sell Program

Buying Opportunities -

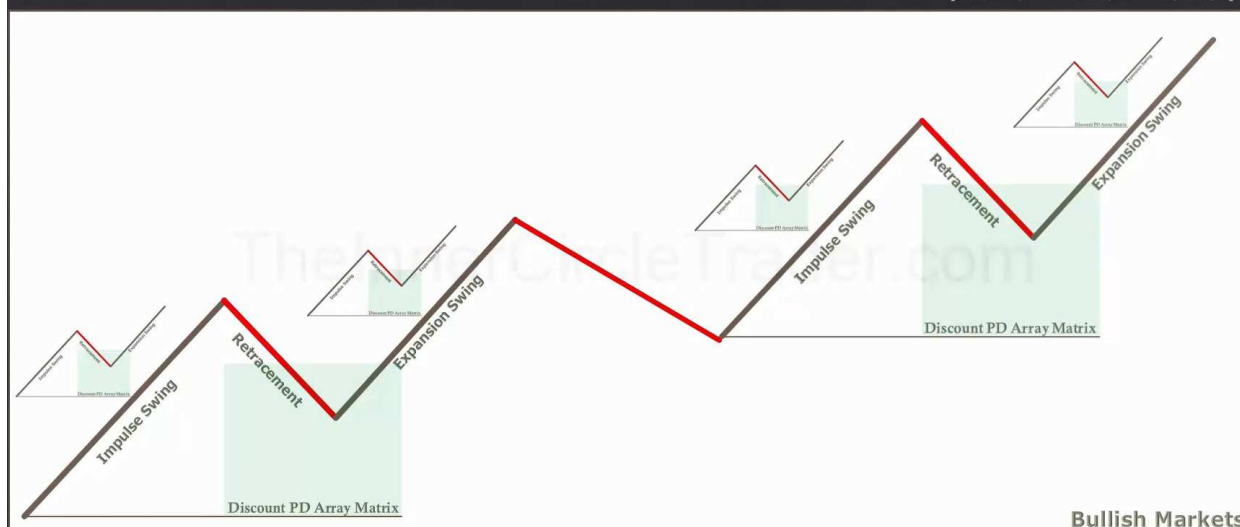
- Monthly Chart Buy Program
- Weekly Chart Buy Program
- Daily Chart Buy Program
- 4Hour Chart Buy Program
- 1Hour Chart Buy Program



The Swing Trade Progression:

Short Term Trading Model

[Combining HTF Monthly & Weekly Ranges]



باید از مفاهیم قبلی مثل تمایل فصلی، نرخ های بهره، COT و تحلیل بین بازاری که یاد گرفتیم کمک بگیریم تا بتوانیم تائیدیه ای برای روند مارکت بگیریم.

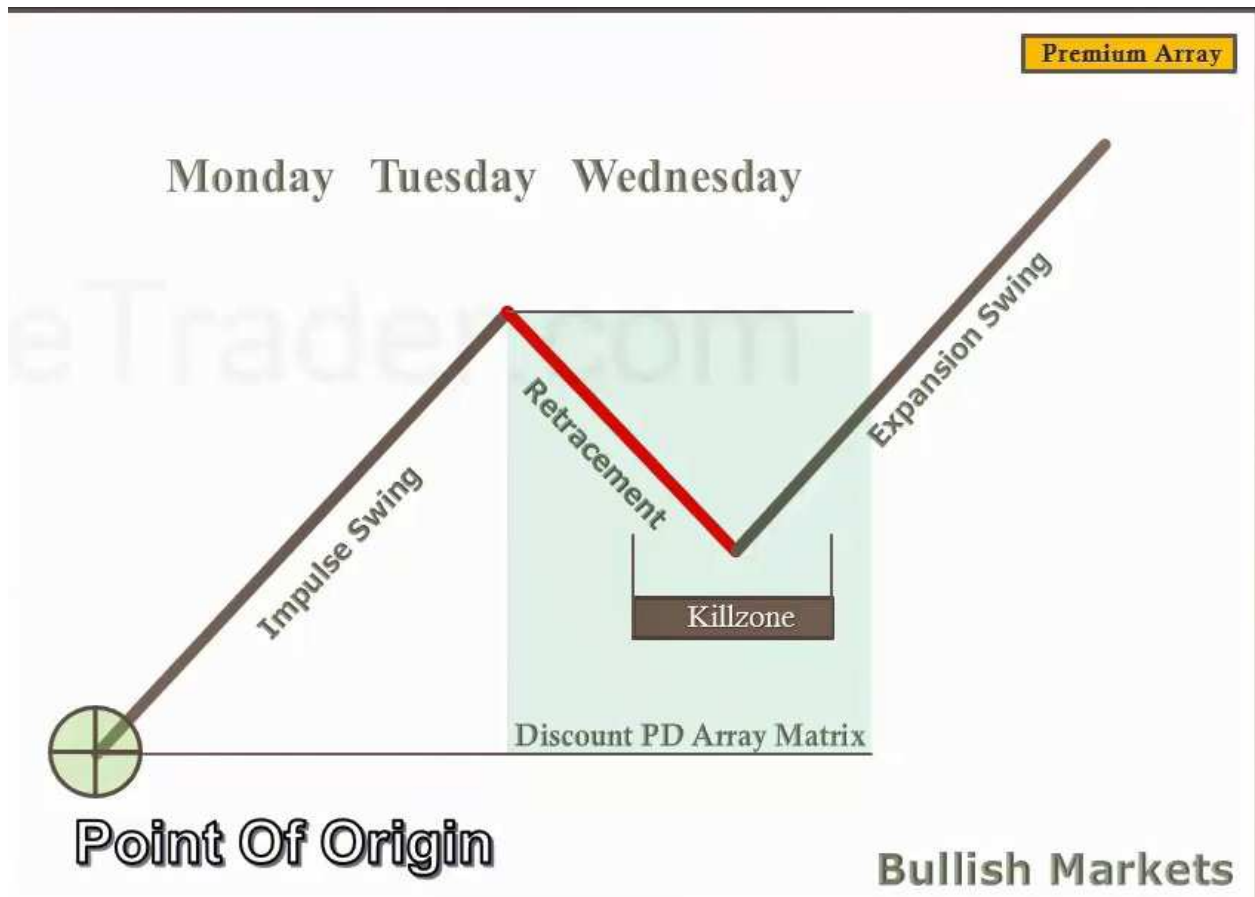
یکی از حالت هایی که میتواند در طول هفته اتفاق بیفتد:

دوشنبه و سه شنبه حرکت ایمپالس باشد، سه شنبه تا چهارشنبه یک ریتریس داشته باشیم و چهارشنبه به بعد یک حرکت اکسپنشن باشد که این حرکت برای ترید خیلی خوب است. البته باید آرایه PD و کیل زون را هم در نظر بگیریم.

رنج ماهیانه: هر ماه ۴ یا ۵ هفته است. ما با تحلیل روی تایم ماهانه و بدست آوردن آرایه های PD و تخمین جهت فرضی و بررسی هر هفته آن جهت، تصمیم به ترید می گیریم.

رنج هفتگی: سقف و کف و آرایه ها جهت هفتگی را همانند ماهیانه در نظر می گیریم و با آن حرکت های کندل دیلی را تخمین می زنیم.

اگر در روند صعودی، سقفی که بین دوشنبه تا چهارشنبه ایجاد می‌شود در پنجشنبه یا جمعه رد شود، نشان دهنده یک روند پر قدرت است که تمایل زیادی دارد به سطوح بالاتر برسد. برعکس این قضیه نیز برای روند نزولی برقرار است.



درس 2

ساختارهای رنج هفتگی

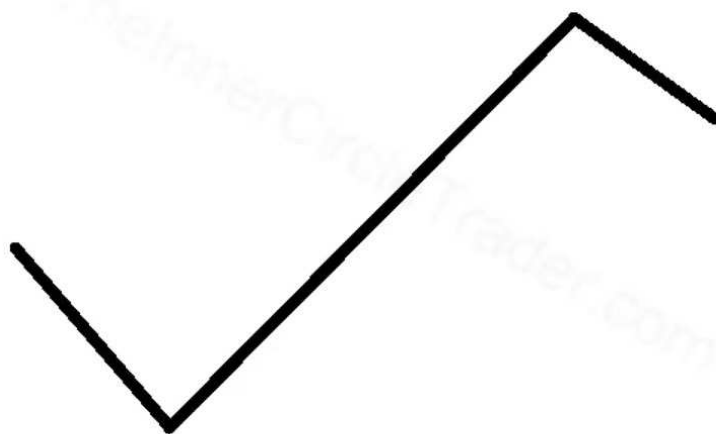
رنج هفتگی: به تغییرات قیمت در طول هفته رنج هفتگی گویند. این الگوها اکثر هفته‌ها اتفاق می‌افتند. این ساختارها نیاز به دقت و تمرین زیاد دارند ولی بسیار موثر و مهم‌اند.

رنج کلاسیک هفتگی:

+حالت صعودی: قیمت در دوشنبه خلاف جهت حرکت می‌کند تا به یک ناحیه ارزان در سه شنبه برسد. سپس حرکت اصلی خود را در جهت اصلی شروع می‌کند و کف هفته را تشکیل می‌دهد.

برای تشخیص زودهنگام این الگو باید نواحی ارزان تایم بالا را در نظر بگیریم و مطابق الگو در قیمت و زمان مناسب حرکت را تشخیص دهیم. چرخش سه شنبه هم در کیل زون لندن یا نیویورک رخ می‌دهد. پنج شنبه به انتهای حرکت صعودی خود رسیده و در جمعه اصلاح می‌کند. پنجشنبه سقف هفتگی رخ می‌دهد.

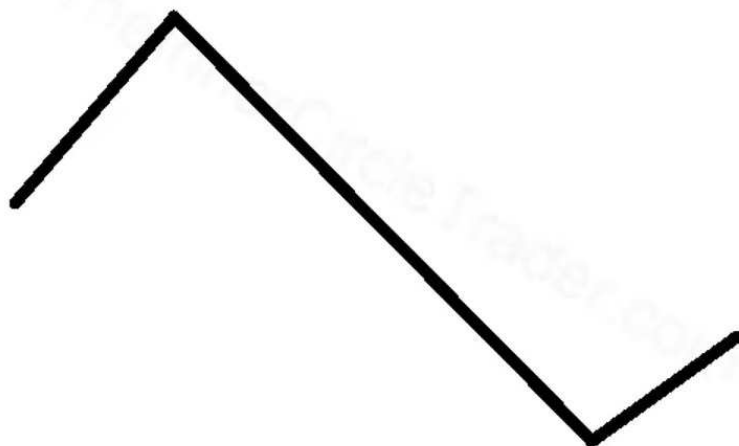
Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



+حالت نزولی: قیمت در دوشنبه خلاف جهت حرکت می‌کند تا به یک ناحیه گران در سه شنبه برسد. سپس حرکت اصلی خود را در جهت اصلی شروع می‌کند و سقف هفته را تشکیل می‌دهد.

برای تشخیص زودهنگام این الگو باید نواحی گران تایم بالا را در نظر بگیریم و مطابق الگو در قیمت و زمان مناسب حرکت را تشخیص دهیم. چرخش سه شنبه هم در کیل زون لندن یا نیویورک رخ می‌دهد. پنج شنبه به انتهای حرکت نزولی خود رسیده و در جمعه اصلاح می‌کند. پنجشنبه کف هفتگی رخ می‌دهد.

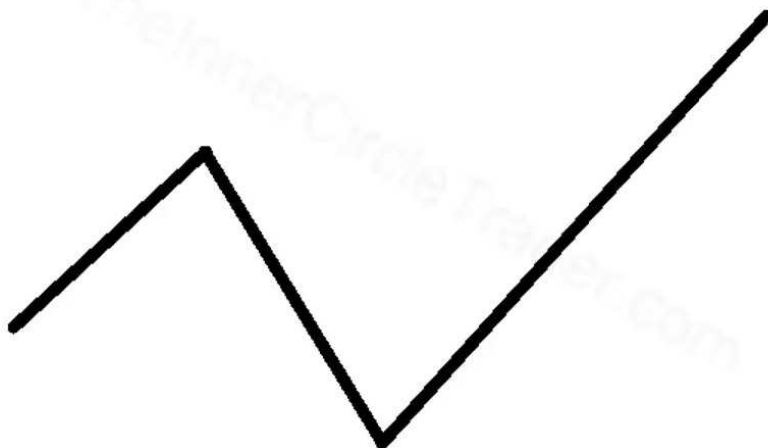
Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



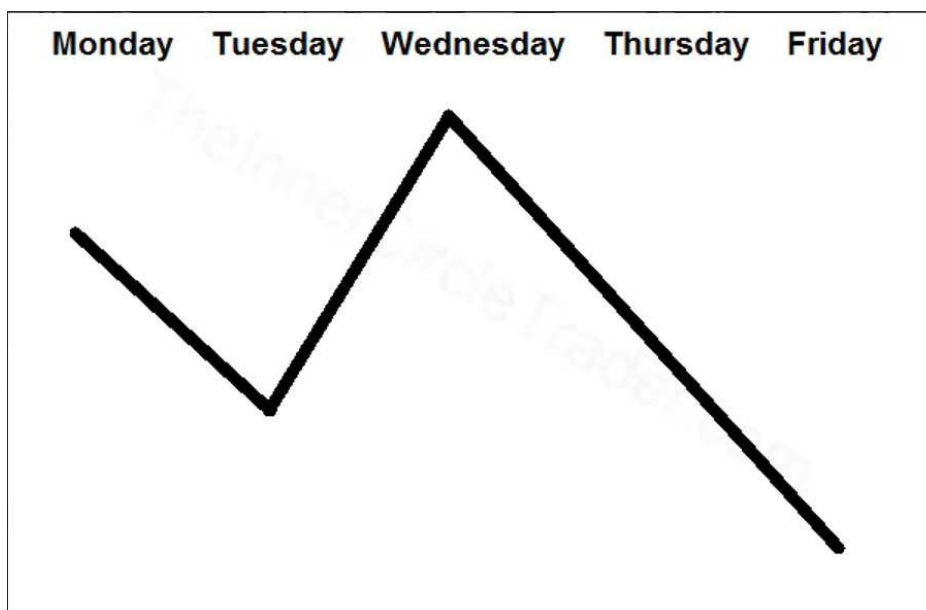
رنج؛ چرخش در چهارشنبه:

+حالت صعودی (چهارشنبه کف قیمتی هفته): دوشنبه بازار صعود و در سه شنبه نزول می‌کند تا در چهارشنبه به یک ناحیه ارزان تایم بالاتر برسد. بعدش حرکت صعودی اصلی را شروع می‌کند و تا جمعه ادامه می‌دهند.

Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

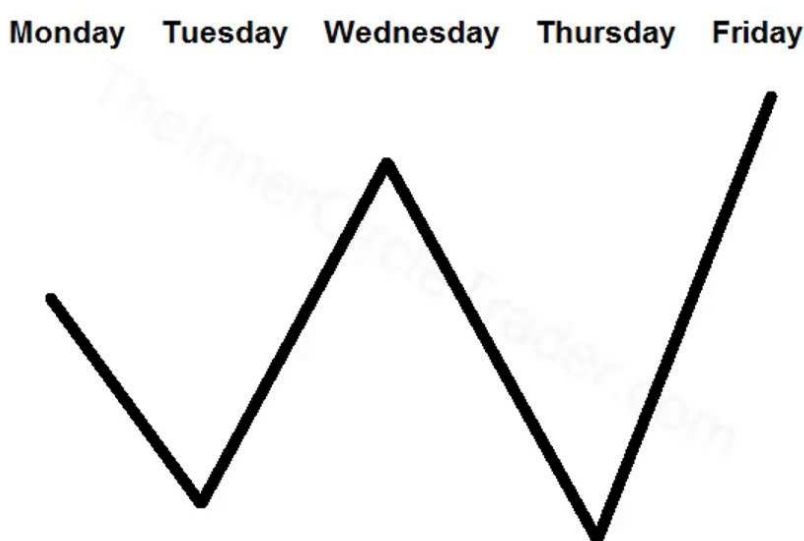


+حالت نزولی (چهارشنبه سقف قیمتی هفته): دوشنبه بازار نزول و در سه شنبه صعود می کند تا در چهارشنبه به یک ناحیه گران تایم بالاتر برسد. بعدش حرکت نزولی اصلی را شروع می کند و تا جمعه ادامه می دهند.

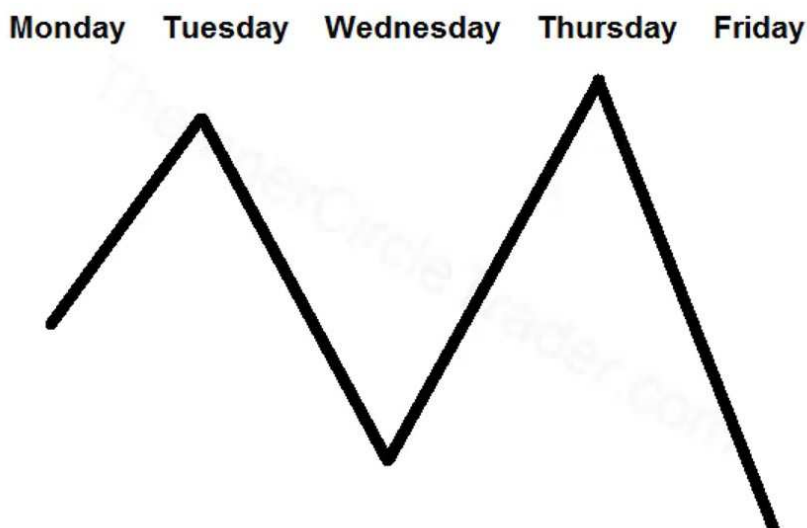


رنج؛ چرخش در حالت سایدوی و حرکت در پنج شنبه:

+ حالت صعودی: بازار از دوشنبه تا چهارشنبه در یک ناحیه مشخص حرکت می کند و سه شنبه یک کف را تشکیل می دهد. سپس در چهارشنبه کف قبلی را استاپ هانتینگ می کند و بعد یک حرکت صعودی تا جمعه انجام می دهد. سطح ارزان تایم بالاتر در پنجشنبه دیده می شود و معمولا اواخر سشن نیویورک این اتفاق می افتد (هنگام خبر).

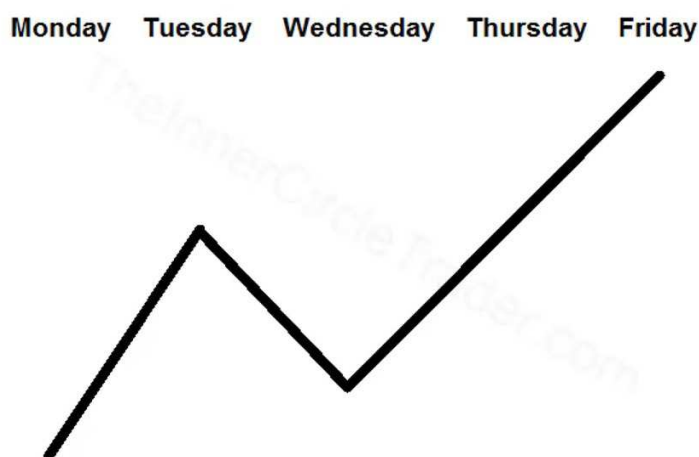


+حالت نزولی: بازار از دوشنبه تا چهارشنبه در یک ناحیه مشخص حرکت میکند و سه شنبه یک سقف را تشکیل میدهد. سپس در چهارشنبه سقف قبلی را استاپ هانتینگ میکند و بعد یک حرکت نزولی تا جمعه انجام می‌دهد. سطح گران تایم بالاتر در پنجشنبه دیده می‌شود و معمولا اواخر سشن نیویورک این اتفاق می‌افتد (هنگام خبر).



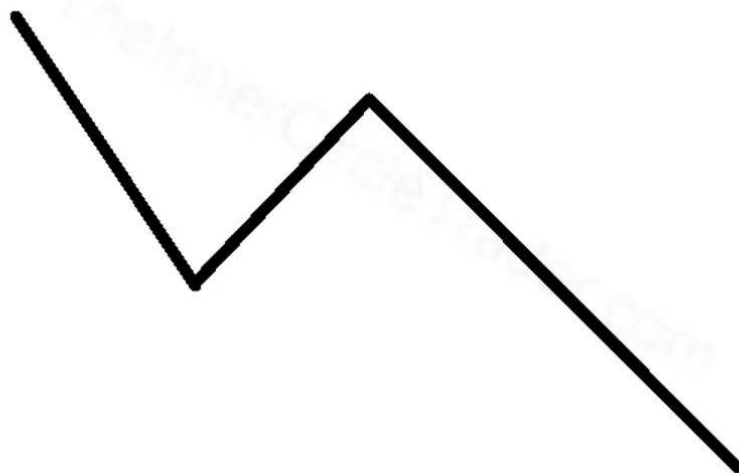
رنج؛ ساید و رالی در وسط هفته:

+ حالت صعودی: دوشنبه تا چهارشنبه رنج می‌شود و از چهارشنبه تا جمعه حرکت در جهت روند دارد. وقتی تازه از سطح ارزان مارکت حرکت کرده و دنبال سطوح گران می‌روند این رنج هفتگی رخ می‌دهد.



+ حالت نزولی: دوشنبه تا چهارشنبه رنج می‌شود و از چهارشنبه تا جمعه حرکت در جهت روند دارد. وقتی تازه از سطح گران مارکت حرکت کرده و دنبال سطوح ارزان می‌روند این رنج هفتگی رخ می‌دهد.

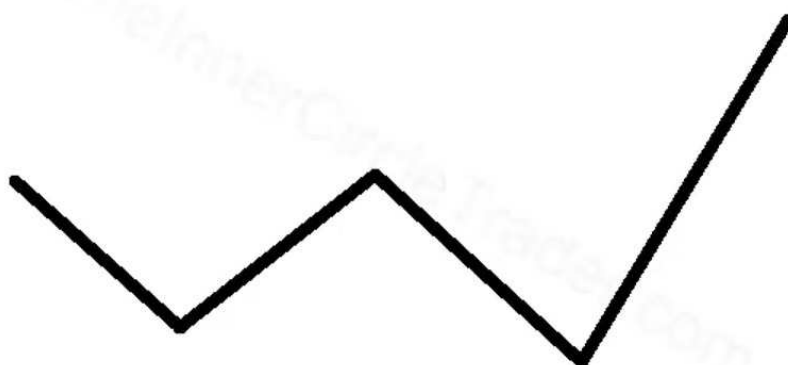
Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



رنج: حرکت در جمعه (احتمال اتفاقش خیلی کمتر و رنج دوشنبه تا پنجشنبه خیلی کوچک است)

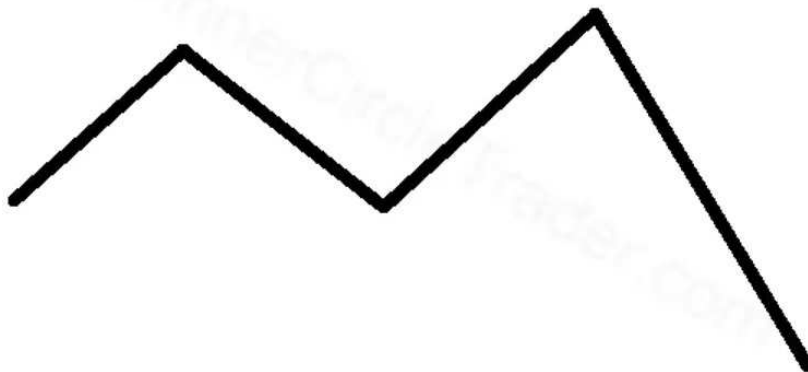
+ حالت صعودی: از دوشنبه تا پنجشنبه رنج می‌شود و جمعه حرکت صعودی زیادی اتفاق می‌افتد. معمولا خبر NFP باعث این حرکت می‌شود.

Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



+ حالت نزولی: از دوشنبه تا پنجشنبه رنج می‌شود و جمعه حرکت نزولی زیادی اتفاق می‌افتد. معمولا خبر مهم و NFP باعث این حرکت می‌شود.

Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



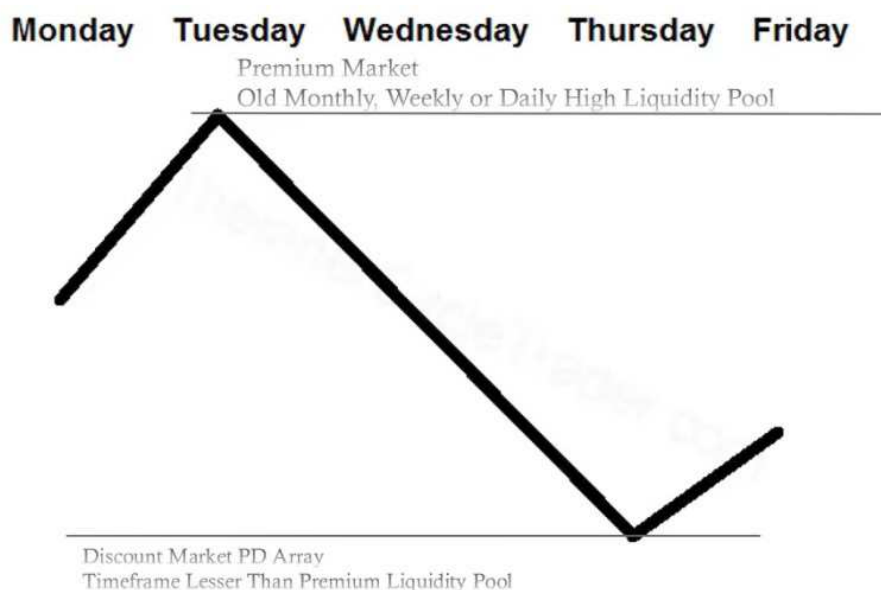
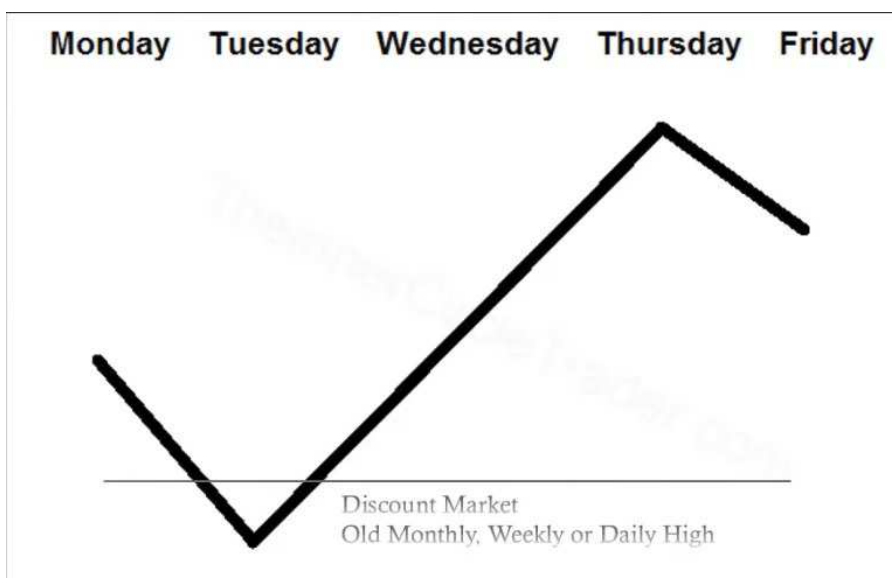
برای پیدا کردن این حرکت های رنج هفتگی بازار را در طول هفته در تایم یک ساعته بررسی کنید. در گذشته چارت تمرین زیاد باید داشته باشید تا دید بهتر نسبت به این الگوها پیدا کنید.

درس 3

الگوهای دستکاری قیمت توسط مارکت میکر و بررسی آن در رنج هفتگی
این بررسی برای حالت صعودی رنج های هفتگی است. حالت نزولی دقیقاً برعکس است.

رنج کلاسیک هفتگی:

حالت اول: سه شنبه به یک استخر نقدینگی تایم بالا (ماهیهانه، هفتگی یا روزانه) ناحیه ارزان می‌رسد و پنجشنبه به یک آرایه PD ناحیه گران که تایم فریم پایین‌تر از ناحیه ارزان سه شنبه دارد می‌رسد.



حالت دوم: سه شنبه به یک ناحیه ارزان تایم بالا می‌رسد و پنجشنبه به یک آرایه تایم پایین‌تر در ناحیه گران یا فیو ۱/۲۷ یا ۱/۶۸ می‌رسد.

Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

Premium Market PD Array Or Fib Extension 1.27 – 1.68 – Symmetrical Swing
Timeframe Lesser Than Discount Old High



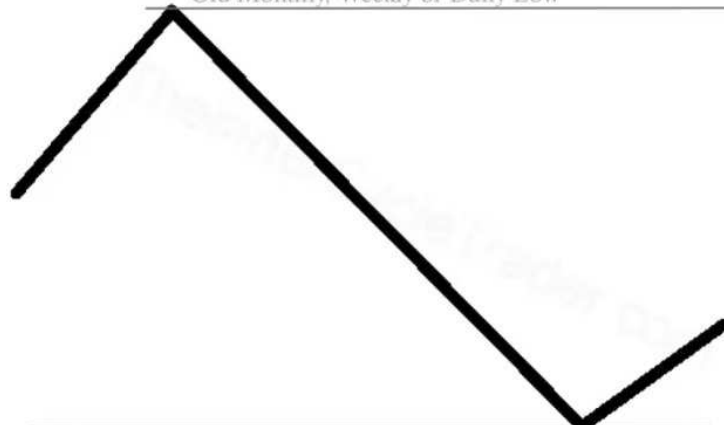
Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

Premium Market PD Array Or Fib Extension 1.27 – 1.68 – Symmetrical Swing
Timeframe Lesser Than Bullish Orderblock



Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

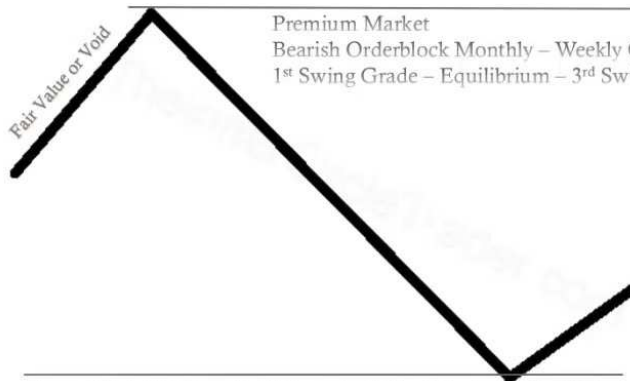
Premium Market
Old Monthly, Weekly or Daily Low



Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

Fair Value or Void

Premium Market
Bearish Orderblock Monthly – Weekly Or Daily
1st Swing Grade – Equilibrium – 3rd Swing Grade



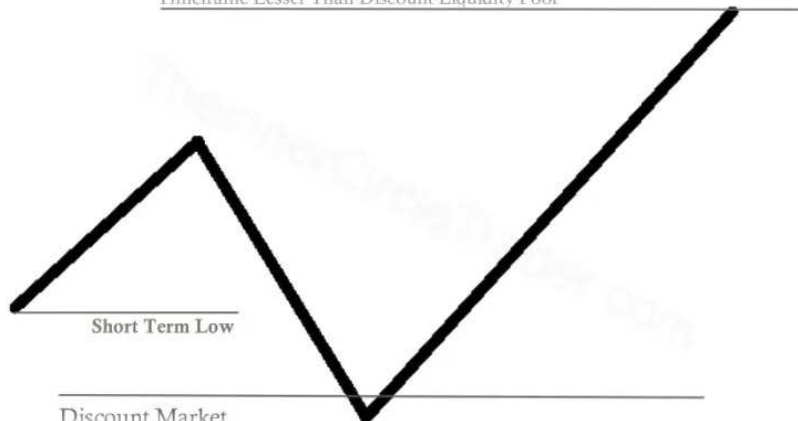
Discount Market PD Array Or Fib Extension 1.27 – 1.68 – Symmetrical Swing
Timeframe Lesser Than Bearish Orderblock

رنج: چرخش در چهارشنبه:

حالت اول: چهارشنبه کف دوشنبه را میزند و به استخر نقدینگی تایم بالا می‌رسد. جمعه به ناحیه گران که تایم آن پایین‌تر از استخر نقدینگی‌ای که چهارشنبه رسید است.

Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

Premium Market PD Array
Timeframe Lesser Than Discount Liquidity Pool

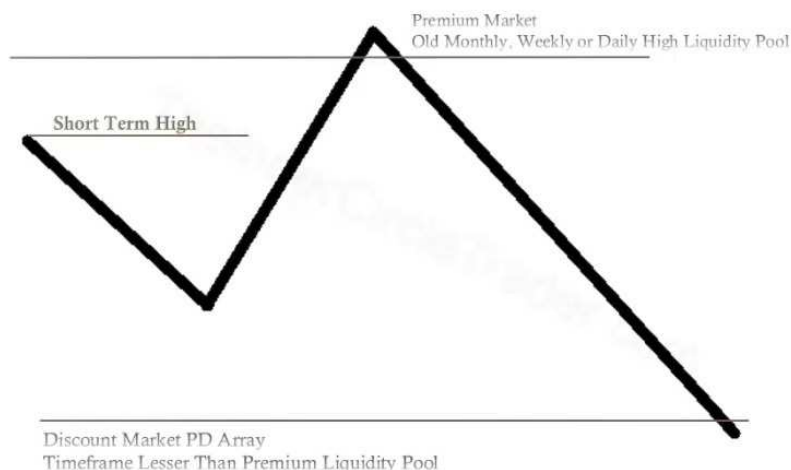


Short Term Low

Discount Market
Old Monthly, Weekly or Daily Low Liquidity Pool

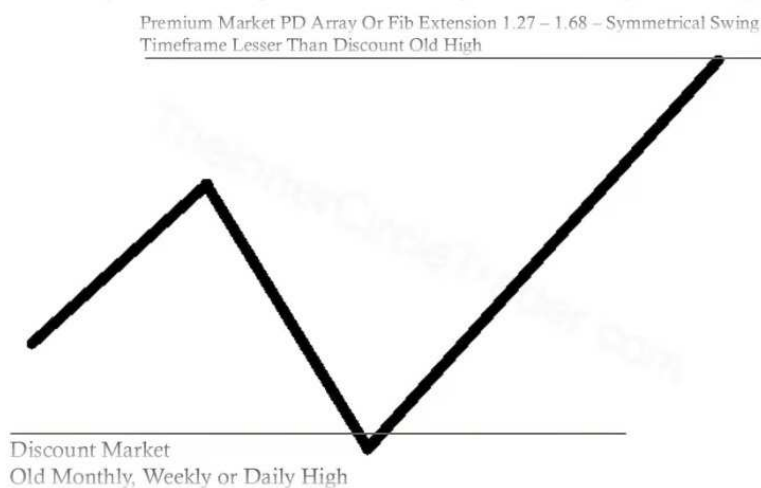


Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



حالت دوم: چهارشنبه به یک ناحیه ارزان می‌رسد و جمعه به یک آرایه PD یا فیبو اکستنشن ۱/۲۷ یا ۱/۶۸ موج قبل می‌رسد. سطح جمعه تایم پایین‌تری دارد.

Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

Premium Market

Old Monthly, Weekly or Daily Low



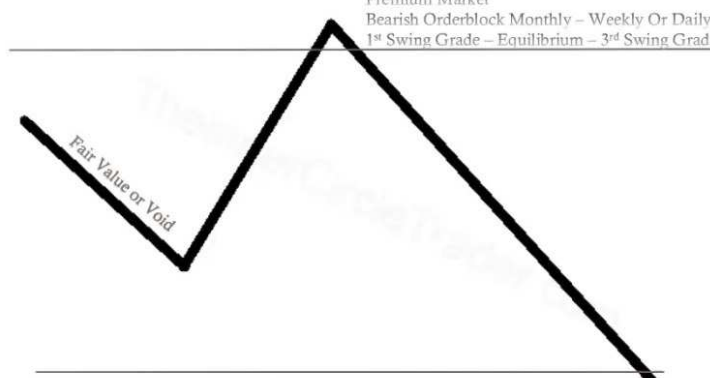
Discount Market PD Array & Or Fib Extension 1.27 – 1.68 – Symmetrical Swing
Timeframe Lesser Than Premium Old Low

Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

Premium Market

Bearish Orderblock Monthly – Weekly Or Daily

1st Swing Grade – Equilibrium – 3rd Swing Grade

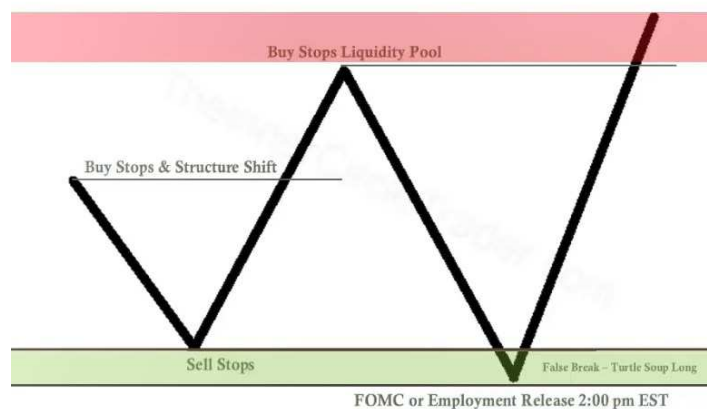


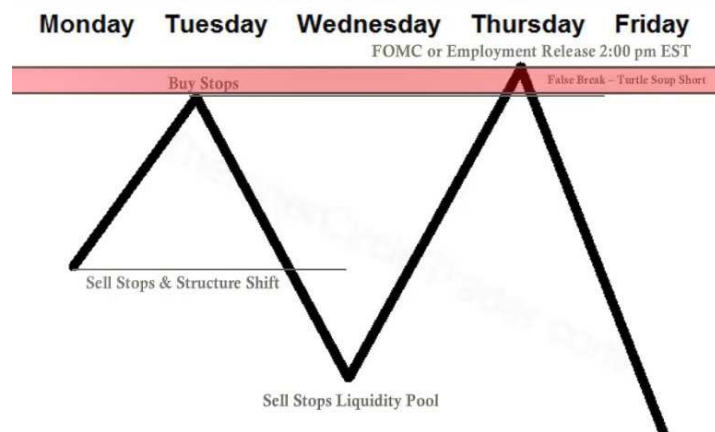
Discount Market PD Array Or Fib Extension 1.27 – 1.68 – Symmetrical Swing
Timeframe Lesser Than Bearish Orderblock

رنج:

چرخش در حالت ساید و حرکت در پنجشنبه : چهارشنبه سقف دوشنبه را رد می کند. پنجشنبه یک استاپ هانت کف دوشنبه و جمعه سقف چهارشنبه را رد می کند.

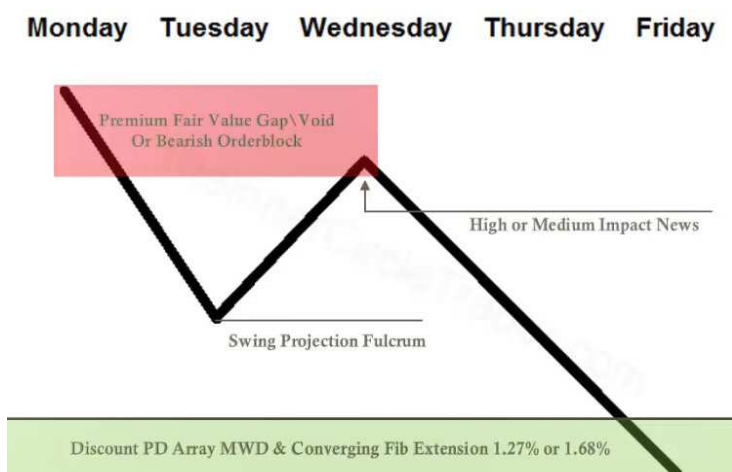
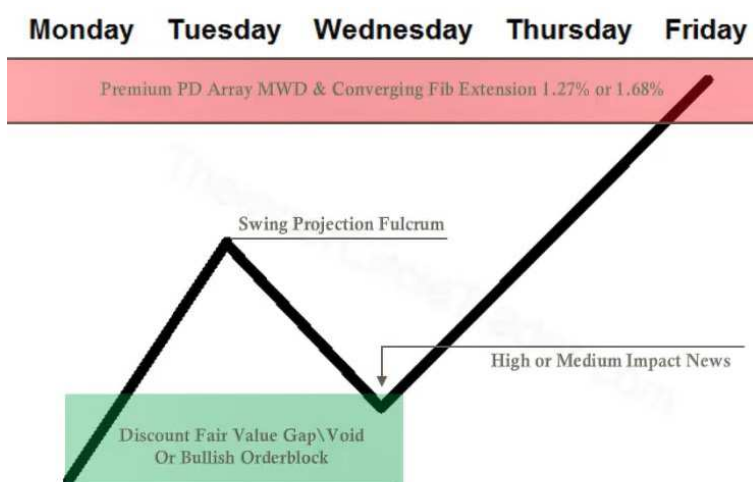
Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



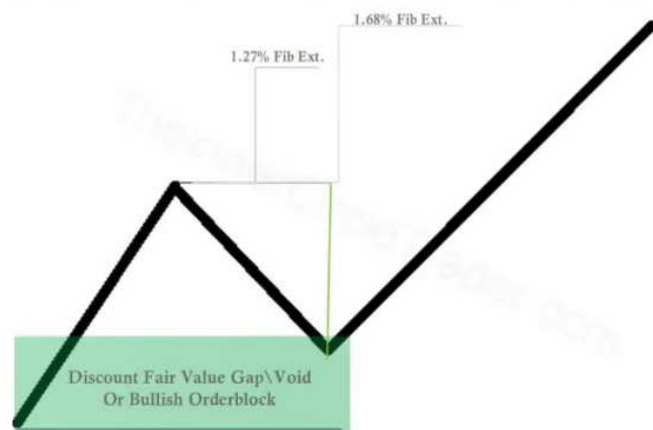


رنج: ساید و رالی در وسط هفته

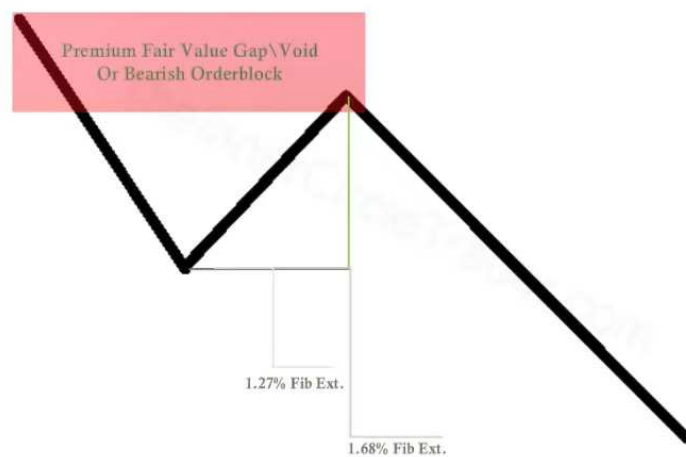
دوشنبه یک ناحیه می‌سازد و چهارشنبه به آن واکنش داده تا جمعه روند صعودی ادامه پیدا می‌کند تا به سطوح تایم بالاتر یا به فیبو ۱/۲۷ یا ۱/۶۸ برسد.



Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday

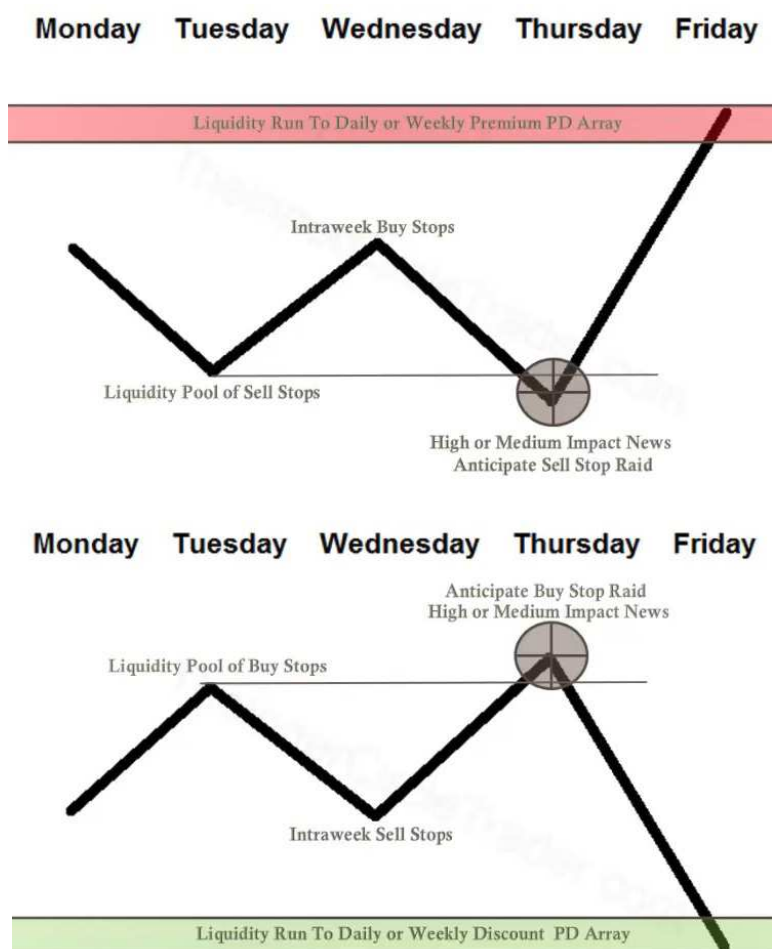


Monday Tuesday Wednesday Thursday Friday



رنج: حرکت در جمعه:

خبری مهم در پنجشنبه باعث ایجاد یک استاپ هانت در کف سه شنبه شده و تا سطح تایم بالا در ناحیه گران می‌رود. انتهای جمعه نیز می‌تواند برگشت داشته باشد.



درس 4

ترکیب IPDA و آرایه PD برای تشخیص جمع آوری نقدینگی

IPDA به زمان مربوط می‌شود و آرایه PD به قیمت. پس ترکیب این دو دیدگاه خوبی از حرکت قیمت در زمان به ما می‌دهد. IPDA با نگاه کردن به ۲۰-۴۰-۶۰ روز گذشته و دیدن نقدینگی و دنبال کردن آنها تا ۲۰-۴۰-۶۰ روز آتی دیدگاه حرکتی به ما در زمان مشخص می‌دهد. در روزهای آتی قیمت می‌تواند به هر المانی از آرایه PD خود را برساند. باید در چارت ببینیم که در ناحیه ارزان و گران کدام یک از آرایه های PD وجود دارد تا بدانیم قیمت کدام جهتی می‌خواهد حرکت کند.

برای ترکیب این دو باید ابتدا ۲۰ روز گذشته را بررسی کنید و تمام آرایه های PD آن را ببینیم سپس به ۴۰ روز گذشته نگاه کنیم و تمام آرایه های PD آن را ببینیم. به همین ترتیب برای ۶۰ روز گذشته این کار را انجام می‌دهیم. مثلاً اگر قیمت در حال صعود است باید نواحی یا آرایه های PD سمت گران مارکت را در نظر بگیریم. مثلاً از آرایه‌ها هیچکدام جز یک سقف بدون اردربلاک در جهت قیمت نمانده که به آن پیشتر نرسیده باشد. ما انتظار این را داریم که قیمت به دنبال آن نقدینگی های اردر خرید برود.

اگر این دیدگاه ترکیب زمان و قیمت را داشته باشیم، می‌توانیم رفتار ربات های بانک را در نظر بگیریم.





درس 5

Low resistance liquidity runs در کانسالیوشن ها

می‌دانیم قیمت از یک ناحیه ارزان به یک ناحیه گران و برعکس حرکت می‌کند. همچنین یاد گرفتیم که برای شورت ترم تریدینگ سطوح را با زمان ترکیب کنیم. حال اگر قیمت در تایم روزانه بین یک سقف و کف حرکت کرد در کانسالیوشن قرار دارد. (برای دید بهتر در تایم ماهیانه چند کندل آخر کنار هم و نه به امتداد هم قرار داشته باشند). در این حالت تمامی سطوح قیمت مشخص و قابل بررسی است. در یک رنج مشخص سقف و کف اصلی را با یک فیبو نصف می‌کنیم و سپس نیمه بالا و پایین را با فیبو تقسیم می‌کنیم. حال ما ۴ ناحیه قیمتی داریم که می‌خواهیم آنها را بررسی کنیم. قیمت اگر بین دو ناحیه باشد ناحیه بالایی گران و ناحیه پایینی ناحیه ارزان چارت ماست. و ما با بررسی آن در تایم پایین‌تر (اینجا ۴ ساعته) می‌توانیم سطوح مینوری را بررسی کنیم. یا حتی می‌توانیم باز هم قیمت را تقسیم کنیم تا رنج ۸ قسمت شود.







درس 6

Low resistance liquidity runs در روندها

در روندها نیز تمامی مباحث زمان و قیمت که در آن بحث شد وجود دارد. همچنان IPDA دنبال سطوح ۳ ماه گذشته است و آرایه های PD دنبال خواهند شد. ولی علت روند شدن بازار خالی کردن سفارشات مارکت میکر است. مثلاً مارکت میکر مقدار زیادی موقعیت خرید در یک آرایه PD سمت تخفیف تایم بالا داشته و حالا باید قیمت را بالاتر ببرد تا تریدرها ترغیب به خرید شوند تا به آنها بفروشند. اینکار با روندی شدن بازار رخ می دهد و تا زمانی اتفاق خواهد افتاد که موقعیت های خرید تسویه شده و موقعیت های جدید سمت مخالف باز شوند.

برای در حالت روندی استراتژی OSOK مایکل که در تایم H4 ورود دارد خیلی مناسب است. می توان سطوح را دید و بازار را با تقسیم هفتگی بررسی مناسب کرد. می توان در اصلاح ها روی سطوح (آرایه های PD) در جهت روند وارد شد. به راحتی می توان از حرکات هفتگی ۱۰۰ پیپ در هفته روی هر جفت ارز گرفت.

- استفاده از آرایه های PD مخصوصاً H4 می تواند کمک بسیاری به ما برای تخمین زدن رنج هفتگی و همچنین جهت کندل روزانه بکند. بعد می توان به H1 رفته تا با بررسی سطوح مخصوصاً میتیگیشن بلاک ها و برگر بلاک ها نواحی مناسب جهت ورود یافت و رنج هفتگی را ترید کرد.

- 30 تا 50 درصد ساختار رنج هفتگی تا کلوز کندل چهارشنبه شکل می گیرد. پس اگر تا آن موقع تریدی نداشتید می توانید با رنج هفتگی ترید کنید اما اگر بازار ترندی بود و حرکت کرده بود انتظار خود را از حرکت کاهش دهید.



درس 7

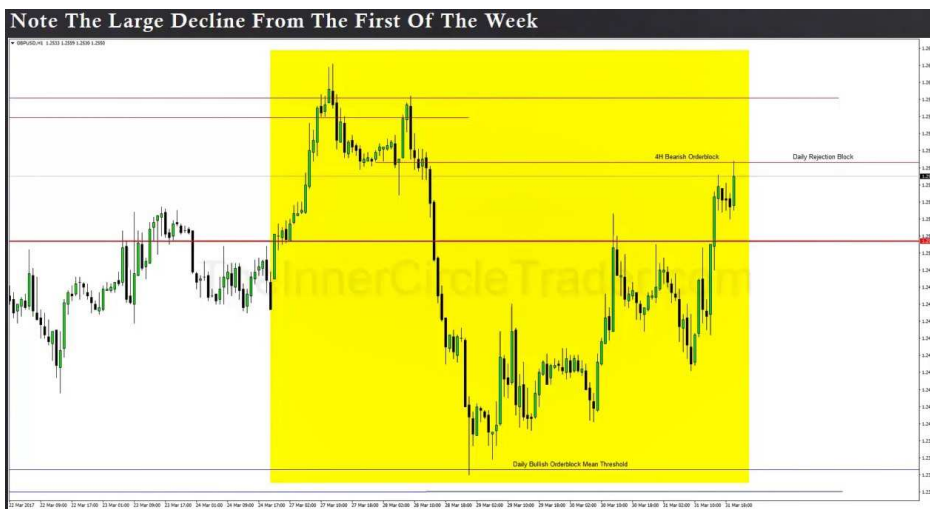
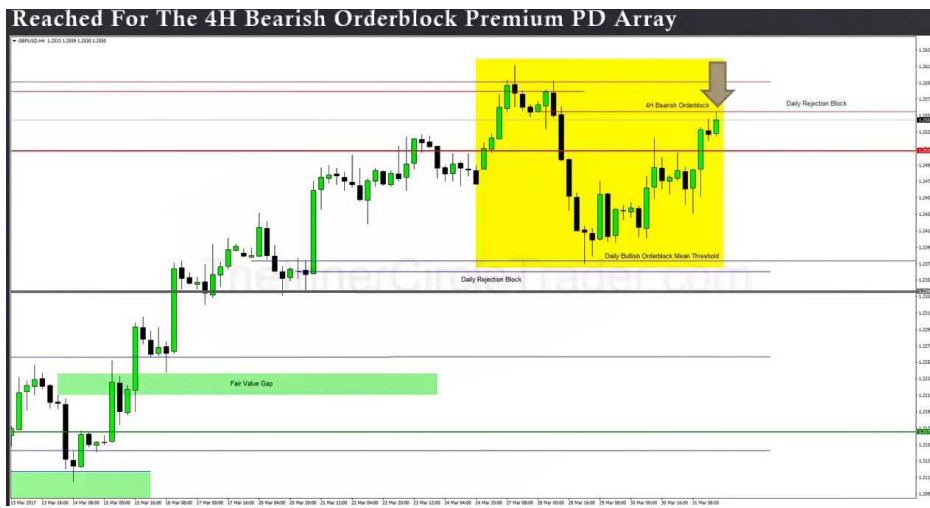
چرخش میان هفته ای

- هر موقع که دوشنبه تا سه شنبه حرکت با مومنتوم زیادی داشتیم و بازار خودش را به یک سطحی می‌رساند نشان دهنده این است که تمایل زیادی به چرخش روند دارد. حرکت بین دوشنبه و سه شنبه باید با مومنتوم و بزرگ باشد. حتما در روند چرخش رخ نمی‌دهد ولی احتمال بسیار بالایی دارد. باقی آن هفته نیز می‌تواند آن حرکت با مومنتوم را پر کند و سقف یا کف هفته در سه شنبه یا چهارشنبه باشد.

- تفکر اینکه من تریدر چون اسکالپر هستم فقط به تایم 5 دقیقه یا 1 دقیقه نگاه کنم اشتباه است. حتما باید تایم های بالاتر را نگاه کرد تا سطوحی که با سطوح پایین تر روی هم می‌افتند یا سطوحی که از تایم بالاتر هستند در مقابل سطوح تایم پایین تر قرار میگیرند باید بررسی شوند چون همیشه سطوح تایم بالاتر قوی تر هستند و برای ما اولویت دارند و اگر تایم های بالاتر را بررسی نکرده باشیم ممکن است دیدگاه اشتباهی پیدا کنیم.

این قسمت مهم است.





درس 8

استراتژی OSOK

ملزومات استراتژی OSOK :

- (۱) دانستن شرایط ماکرو و تمامی اطلاعات از ابزار ترید که در ماه JAN درس داده شد.
- (۲) بررسی IPDA و آرایه PD
- (۳) شرایط پوزیشن تریدینگ و سوئینگ تریدینگ و شورت ترم تریدینگ را بدانیم
- (۴) شرایط رنج هفتگی و P03
- (۵) شرایط میان روزی به سبک ICT (فصل ۸ و ۹) برای ورود
- (۶) روز هفته: ۷۰ درصد اوقات سقف یا کف هفته بین دوشنبه تا چهارشنبه رخ می‌دهد.
- (۷) استفاده از فیبوناچی، سطوح و لیکوئیدیتی پشت سقف و کف ها برای تارگت گذاری
- (۸) زمان ترید در روز و کیل زون ها
- (۹) تمایل فصلی و تائید آن روی ابزاری که ترید می‌کنیم.
- (۱۰) بررسی گزارشات COT و تحلیل آن
- (۱۱) ترکیب مباحث درس داده شده در این قسمت مهم است و مباحث دی تریدینگ باقی مانده را در فصل های آینده بررسی می‌کنیم.



رویه استراتژی One Shot One Kill:

- (۱) فاز ۳-۴ ماهه ای که داخل آن هستیم و فاز احتمالی بعدی را تخمین می‌زنیم (ماه JAN)
- (۲) بررسی سطوح (آرایه PD) در تایم‌های بالا و بررسی آن در بعد زمان (IPDA) (ماه JAN)
- (۳) بررسی اختلاف نرخ‌های بهره روی جفت ارزها یا بررسی نمودارهای اوراق و شرایط آن‌ها (روندی است یا خیر)
- (۴) بررسی ارزها در تمایلات فصلی
- (۵) تحلیل روند و سویینگ‌ها از تایم بالا تا H1
- (۶) رنج هفتگی‌ای که قرار است رخ بدهد را در نظر می‌گیریم
- (۷) دستکاری قیمت توسط مارکت میکرو و خلاف جهت حرکت کردن آن را در نظر می‌گیریم.
- (۸) رنج و قیمت ارزان و گران را روی چارت مشخص می‌کنیم.
- (۹) دنبال شرایطی می‌گردیم که احتمال حرکت شارپ یا با مومنتوم خوبی را داشته باشد. (چه در انتهای اصلاح به یک ناحیه رسیده باشد چه درجا بزند)
- (۱۰) بررسی COT و نمودار OPEN INTEREST برای دیدن تحرکات اسمارت مانی
- (۱۱) در نظر گرفتن Low resistance liquidity runs با آرایه PD سمت مخالف
- (۱۲) استفاده از فیبو و ترکیب با آرایه PD سمت مخالف
- (۱۳) تأییدیه گرفتن با تحلیل بین بازاری در صورت امکان

تمرین

- 1- در یک سال گذشته یک جفت ارز، چرخش‌ها و اصلاح‌های آن را در روزهای هفته بررسی کنید. به ساختار مارکت نیز دقت کنید.
- 2- در یک سال اخیر ۵ جفت ارز، رنج هفتگی را با الگوهای درس ۳ بررسی کنید.
- 3- اگر به این سبک نرید می‌کنید چک لیست خود را آماده کنید.



فصل هشتم - ماه آوریل دی تریدینگ



درس 1

ملزومات دی تردینگ یا معاملات روزانه

در این سبک ترید به دنبال معامله کردن داخل یک کندل روزانه هستیم. این روش خیلی سخت تر از روش های دیگر است و به دقت و مهارت بیشتری در تکنیکال نیاز دارد. هر روز معاملاتی لزوماً مناسب برای تردینگ نیست. تنها در شرایط مطلوب از این روش استفاده می کنیم. می توانیم برای تریدهای بیشتر ابزارها و جفت ارزهای بیشتری را به صورت روزانه بررسی کنیم. معمولاً دو ستاپ کلی وجود دارد که یاد خواهیم گرفت. مفاهیم این فصل برای اسکالپ (ماه بعد) ضروری است. هدف اصلی دی تردینگ گرفتن شصت و پنج تا هفتاد درصد رنج روزانه است. معمولاً رنج کندل روزانه نزدیک به میانگین رنج کندل ها در پنج روز گذشته (5 ADR) می باشد. البته بعضی روزها رنج کندل روزانه دو یا بیشتر از دو برابر میانگین است که آن را هم بررسی خواهیم کرد. ما با تشخیص تقریبی جهت کندل روزانه در همان روز با معیارهایی که گفته خواهد شد در جهت جریان سفارشات ترید خواهیم نمود.

نکته:

ایده آل ترین حالت در ترید روزانه انجام معامله در جهت تایم فریم ویکلی یا همان هفتگی است. هر چه سطوح تایم بالاتر ترید روزانه را تایید کند بهتر می باشد (چون احتمال موفقیت را افزایش می دهد). استاپ ها در این مدل کوچک و محدود هستند. این روش می تواند که در تایم های بالاتر مخصوصاً سبک معاملاتی ماه اخیر کمک کند تا هم ورود مناسب تری داشته باشیم و هم استاپ کوچکتری تا ریسک به ریوارد را بهینه تر کنیم و به راحتی ریوارد به ریسک های دو رقمی بگیریم.

نکته:

نباید در یک روز معاملاتی تعداد زیادی پوزیشن باز کنیم چون دو ستاپ کلی داریم و فقط همان ها را معامله می کنیم.

از آرایه PD و IPDA استفاده خواهیم کرد. در روز اخبار NFP و FOMC اصلاً تریدی انجام نمی دهیم.



برای تردینگ به چه عواملی باید دقت کنیم:

۱. جریان سفارشات تایم بالا: شامل سطوح و ارایه PD در تایم روزانه و بالاتر.
۲. IPDA به دنبال لیکوئیدیتی پشت پیوت‌ها می‌رود.
۳. در جهت کندل هفتگی‌ای که در آن در حال ترید هستیم.
۴. روز هفته.
۵. ساعت روز مثل کیل زون‌ها (این عامل بسیار با اهمیت است).
۶. اکسپنشن‌های بزرگ برای رنج بیشتر کندل دیلی.

ساعت روز:

- **اوپن و کیل زون لندن:** بهترین موقع برای ترید است. سقف و یا کف روزانه در این موقع احتمالا قرار می‌گیرد.
- **اوپن و کلوز نیویورک:** راحت‌ترین برای ترید است. که علت آن را جلوتر متوجه می‌شویم. تنها زمانی این سشن‌ها رو ترید نمی‌کنیم که بازار در سشن لندن هشتاد درصد ADR را حرکت کرده باشد.
- **کلوز لندن:** مایکل تمایلی به آموزش این استراتژی ندارد چون سود کمی دارد ولی می‌توانید این استراتژی را در دوره‌های قدیمی یاد بگیرید.
- **کلوز نیویورک:** ساعت ۱۴ نیویورک تا ۱۵ نیویورک بازار تموم شده می‌بینیم.
- **اوپن آسیا:** بعضی روزها ممکن است سقف و کف در این تایم اتفاق بیوفتد مخصوصا در ارزهای استرالیا و ین ژاپن.
- **ظهر لندن:** بین ساعت پنج تا هفت به وقت نیویورک، بازار آرام‌تر شده تا حرکت بعدی را در نیویورک انجام دهد.

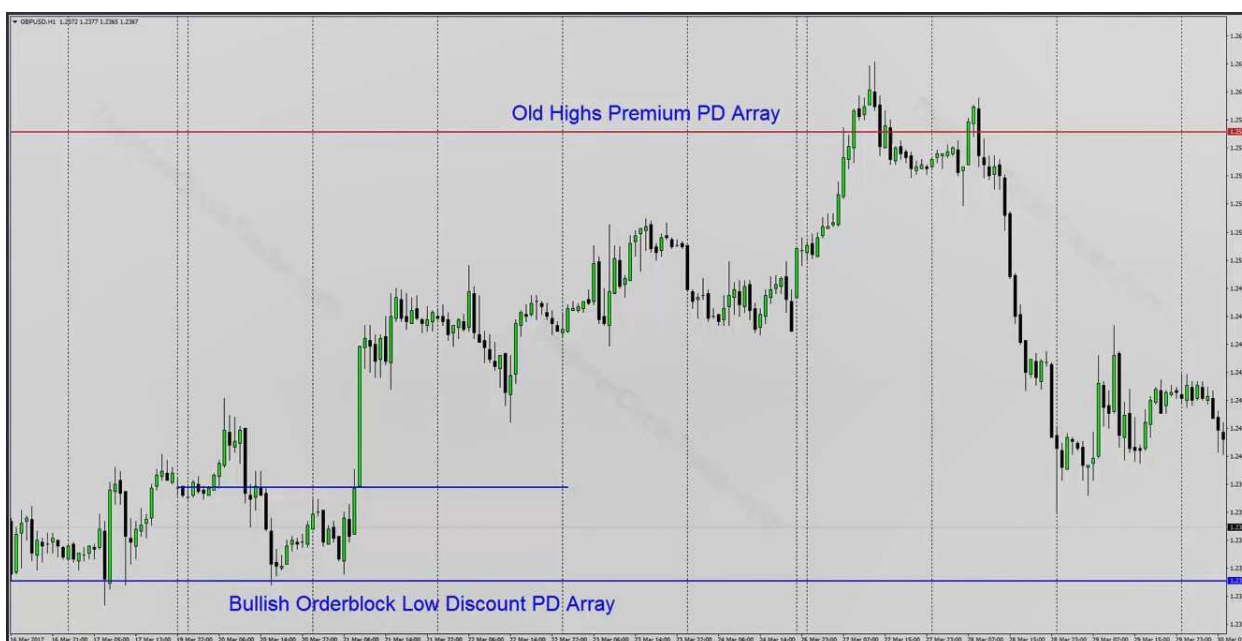
روز هفته : هر روز معمولا شکل خاصی می گیرند:

- **یکشنبه:** رنج کمی دارد و خیلی از بروکرها بسته اند پس ترید نمی کنیم.
- **دوشنبه:** معمولا رنج کمی دارد. اگر به ناحیه رسیده بود احتمال حرکت زیاد است و ممکن است سقف یا کف هفته شود.
- **سه شنبه:** روز خوبی برای ترید است. احتمالا سقف یا کف هفته را تشکیل دهد مخصوصا در کیل زون لندن.
- **چهارشنبه:** خیلی ایده آل است چون با بررسی سه شنبه و دوشنبه ایده های خوبی می توان گرفت.
- **پنجشنبه:** این نیز مناسب است اما باید مراقب باشیم چون می تواند چرخش روند را با ایجاد سقف و کف هفته شکل دهد.
- **جمعه:** معمولا رنج کمی دارد اما اگر تا پنجشنبه به سطوح نزدیک نرسیده باشد ممکن است اکسپنشن داشته باشیم.

رنج هفتگی: اوپن و کلوز ویکی خیلی مهم است و در وسط هفته می تواند راهنمای ما برای جهت روند باشد. اوپن ویکی را تا پنجشنبه ادامه می دهیم چون ممکن است در پنجشنبه ریورسال داشته باشیم.



برای اوپن هفته حالت کلاسیک را نیز می توانیم داشته باشیم. مثلا در حالت نزولی ابتدا به بالاتر از اوپن رفته و سپس نزول اصلی رخ دهد.



درس 2

رنج روزانه :

به حرکات داخل کندل روزانه رنج روزانه می‌گوییم.

نکته:

برای دیدن حرکات رنج روزانه می‌توانیم در تایم فریم‌های زیر یک ساعته یا H1 با زدن دکمه ترکیبی CTRL+Y در متاتریدر صفحه را به کندل‌های روزانه تقسیم کنیم. این بازه‌ها برای خرده تریدرهاست. زمان ترید بانک‌ها متفاوت است و ما باید با دید آن‌ها به بازار نگاه کنیم:



رنج آسیا : از زمان ۲۰ تا ۲۴ به وقت نیویورک رنج سیاست و بازار معمولاً درجا می‌زند.

کیل زون لندن به روش ICT : از ساعت ۱ تا ۵ به وقت نیویورک، کیل زون لندن است. بازار در این تایم سقف یا کف روزانه را تشکیل می‌دهد.

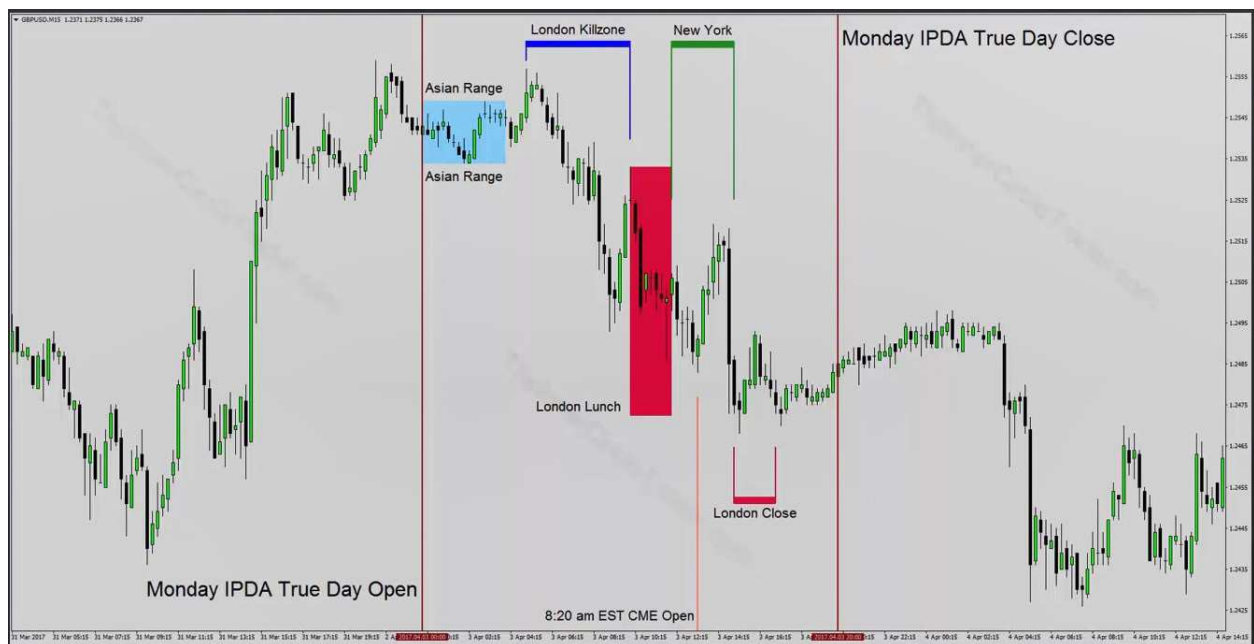
کیل زون نیویورک به روش ICT : از ساعت ۷ الی ۱۰ به وقت نیویورک می‌باشد.

کلوز لندن به روش ICT : از ساعت ۱۰ تا ۱۲ به وقت نیویورک.

روز واقعی برای الگوریتم‌های IPDA : از ساعت ۱۵ تا ۲۴ به وقت نیویورک که روز واقعی برای ربات‌ها است.

اوپن CME : ساعت ۸:۲۰ (هشت و بیست دقیقه) به وقت نیویورک.

ظهر لندن: فاصله بین کیل زون لندن و کیل زون نیویورک. ساعت ۵ تا ۷ به وقت نیویورک مارکت حرکت کمی می‌کند.



درس 3

گام ترید بانک مرکزی CBDR - Central bank dealers Range

برای گام‌های حرکتی روش‌های مختلفی در بازار استفاده می‌شود مانند استفاده از فاصله بین یک سقف تا کف مهم یا استفاده از بازه قیمتی اسیا. یکی از این روش‌ها را که در حین درس یاد خواهیم گرفت به اسم CBDR می‌شناسیم.



- استفاده از گام‌های حرکتی معمولاً به این صورت است که بازه قیمتی را بدست آورده و آن بازه را به صورت انحراف معیاری قرار داده و احتمال می‌دهیم بازار با ضریبی از آن گام حرکتی از آن رنج حرکت کند تا سقف یا کف‌ای تشکیل دهد. برای مثال اگر بازه ۵۰ پیپ را بدست آورده باشیم از آن بازه انتظار حرکت به اندازه‌ی ضریبی از ۵۰ پیپ را داریم یعنی می‌گوییم بازار ۵۰ پیپ یا ۱۰۰ پیپ یا ۱۵۰ پیپ و یا بیشتر، بالاتر یا پایین‌تر سقف یا کف را تشکیل می‌دهد. حال این سقف و کف اگر برای قسمتی از روز باشد آن را اندازه‌گیری می‌کنیم و حدود سقف و کف کندل و رنج روزانه را بدست خواهیم آورد. شروع اندازه‌گیری آن گام‌ها نیز از همان جایی خواهد بود که آن رنج گام حرکتی اولیه بدست آمده است.
- برای بیشتر روزهای نزولی ۳ برابر انحراف معیار یا همان رنج CBDR به سمت بالا برای بدست آوردن سقف روز، و برای روزهای صعودی ۳ برابر انحراف معیار به سمت پایین برای بدست آوردن کف روز می‌رویم.
- برای روزهای ایده آل این انحراف معیار ۲ برابر می‌شود.
- انحراف معیار ۴ برای زمانی است که بازار با خبر مهمی در سشن لندن مواجه می‌شود.

رنج CBDR : بازه قیمتی بین ساعت ۱۴ تا ۲۰ به وقت نیویورک رنج CBDR می‌گوییم. این بازه شش ساعته را در کندل‌های H1 بررسی می‌کنیم. بهتر است این رنج زیر ۴۰ پیپ باشد (ترجیحا ۲۰-۳۰ پیپ).



رنج‌های بزرگتر باعث می‌شود آن روز معاملاتی حرکت کمتری در بازار باشد. این رنج در تایم فریم ۱ ساعته هم می‌تواند از نوک شادوهای آن کندل در نظر گرفته شود و هم می‌توان شدوها را نادیده گرفت و از بدنه کندل‌ها، رنج را محاسبه کرد. وقتی جهت حرکت کندل دیلی را تخمین زدیم، در جهت مخالف آن، رنج CBDR را با انحراف معیارهای مختلف قرار می‌دهیم تا سقف یا کف همان روز را محاسبه کنیم. هدف استفاده از CBDR برای پیدا کردن سقف روز یا کف روز است. برای روزهای نزولی سقف را و برای روزهای صعودی کف را بدست می‌آوریم.



درس 4

در درس قبل یاد گرفتیم با رنج CBDR و انحراف معیار رنج آن سقف یا کف روز را بدست بیاوریم. این سقف یا کف خلاف جهت حرکت اصلی بود. نمونه این حرکت سوینگ جودا است که ما می‌توانیم با این مفاهیم انتهای آن را بدست آوریم. علاوه بر این روش می‌توانیم از آرایه PD هم کمک بگیریم و این دو را با هم ترکیب کنیم. مایکل بیشتر در تایم فریم H1 رنج را بدست آورده و شدوها را معمولا در نظر نمی‌گیرد.

برای بدست آوردن سمت دیگر رنج کندل روزانه یعنی سمت دیگر جهت حرکت و روند کندل دیلی مراحل زیر را انجام می‌دهیم:

ابتدا سمت مخالف جهت را طبق جلسه قبل بدست می‌آوریم. سپس تعداد انحراف معیار به علاوه خود باکس CBDR یک رنج جدید و بزرگتر می‌شود. مثلا اگر ۲ انحراف معیار خلاف جهت حرکت کرده بود با خود رنج CBDR ما یک رنجی ۳ برابر CBDR داریم که از آن به عنوان گام حرکتی تارگت استفاده می‌کنیم. دقت کنید این روش برای تارگت گذاری مناسبتر است و دقیق نیست. چون رنج ما سه برابر CBDR است به اندازه ۳ برابر باکس بزرگتر در جهت حرکت قیمت اندازه‌گیری می‌کنیم. این حرکت معمولا در بازه‌ی کلوز لندن به پایان می‌رسد و ما پوزیشن خود را می‌بندیم. همچنان از آرایه PD نیز می‌توانیم کمک بگیریم. دقت کنید که در انتهای بازه‌ی کلوز لندن بهتر است بیشتر پوزیشن را ببندیم حتی اگر به تارگت ما نرسیده بود. به مثال‌های زیر توجه کنید:



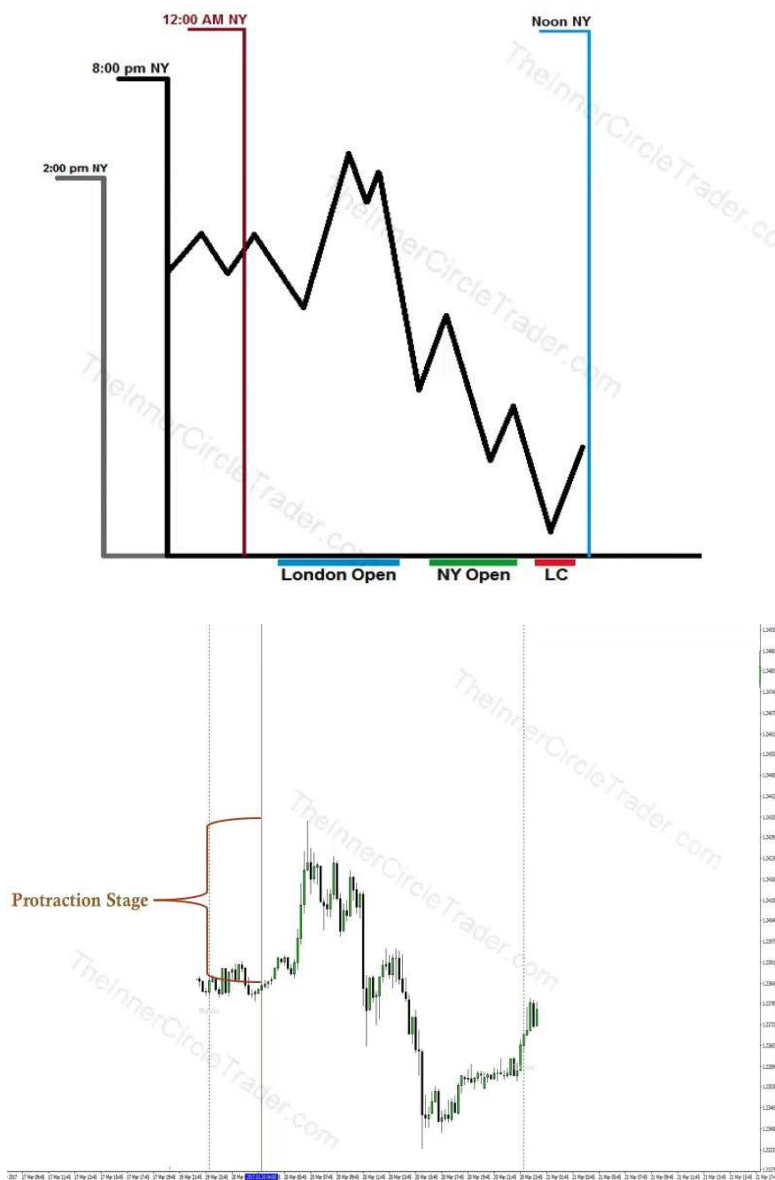
برای استفاده از CBDR بهتر است هم جهت کندل دیلی را تخمین بزنیم و هم بازه CBDR زیر ۴۰ پیپ باشد. به این نکته هم توجه کنید که برای هر روز معاملاتی از CBDR روز قبل استفاده می‌کنیم چون رنج امروز تشکیل نشده است.



درس 5

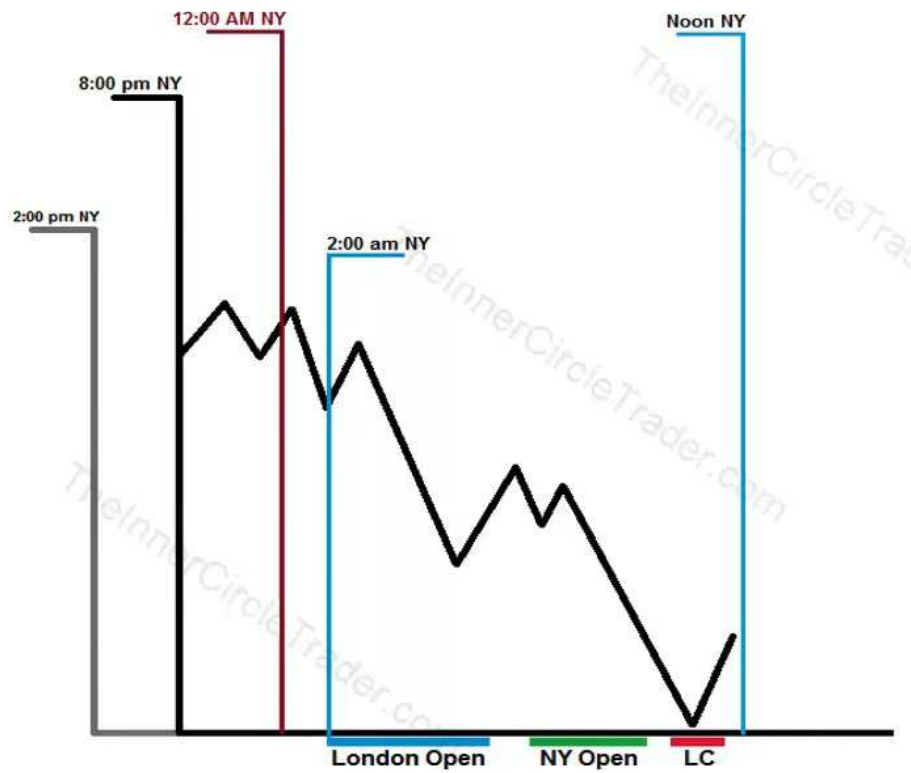
ساختار های متداول رنج یک روز

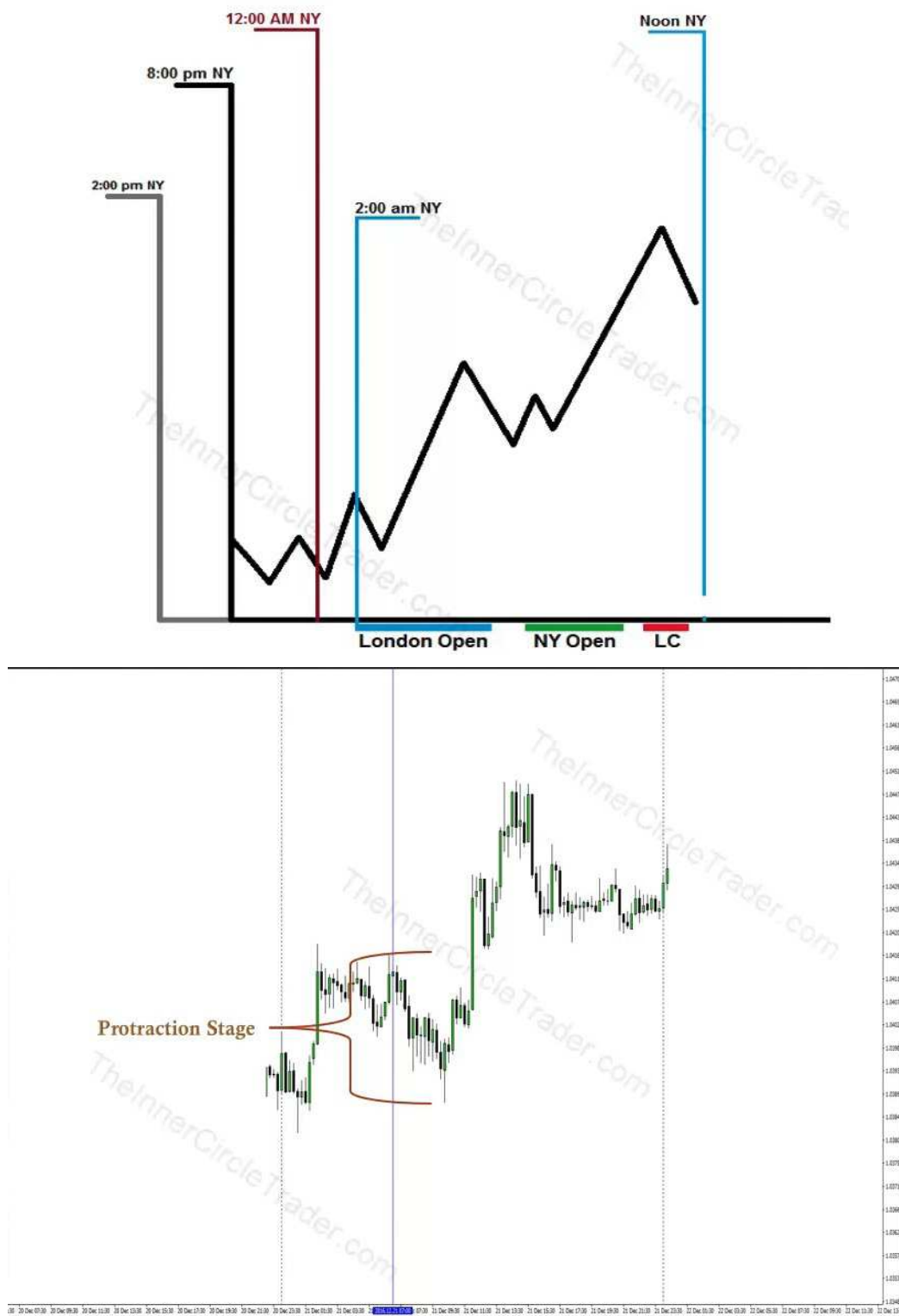
رنج کشیده لندن: در این رنج ابتدا در کیل زون لندن یک حرکت خلاف جهت داریم و بعد از چرخش تا انتهای کلوز لندن حرکت ادامه پیدا می کند. CBDR زیر ۴۰ پیپ می باشد رنج اسیا زیر ۳۰ پیپ می باشد. چرخش خلاف جهت از حدود ساعت ۲۴ تا حدود دو صبح به وقت نیویورک است. سوئینگ جودا بین ۱ تا ۲ برابر انحراف معیار CBDR است. در این رنج ها با چرخش در کیل زون لندن ترید می کنیم یا با اصلاح و رسیدن به یک ناحیه در کیل زون نیویورک وارد پزیشن می شویم.



رنج تاخیر خورده لندن: در این رنج قیمت قبل از شروع کیل زون از رنج خارج شده و در ساعت ۲ صبح به وقت نیویورک یک حرکت اصلاحی کوچک به سمت رنج دارد. بعد از آن که ادامه حرکت اصلی را می‌دهد. عدد و رنج CBDR در اینجا مهم نیست. جهت حرکت را باید بدانیم. اگر در آن اصلاح کوچک وارد نشدیم در اصلاح بعدی روی سطوح می‌توان ترید کرد.







نکته: تنها تنها با این رنجها به راحتی میتوان ترید کرد. ممکن است بعضی روزها فرصت ورود ندهد ولی مشکل نیست و فقط در شرایط مطلوب ترید می‌کنیم.

درس 6

در چه مواقعی در سشن لندن ترید نمی‌کنیم

چه روز هایی ترید در سشن لندن ایده آل نیست؟!

- اگر روز قبل بیش از ۲ برابر ADR حرکت کرده باشد چون احتمالاً رنج می‌شود.
- بعد از سه کندل صعودی پشت سر هم یا سه کندل نزولی پشت هم در جهت آن ۳ کندل ترید نمی‌کنیم.
- فردای خبر FOMC ، اگر خبر باعث حرکت بزرگی شده باشد.
- روز خبر NFP.
- روزی که فردای آن تعطیلات زیاد یا تعطیلات مناسبتی (مثل عید کریسمس) داریم.
- تعداد اخبار مهم در آن روز خیلی زیاد باشد برای آن جفت ارز.
- در روزی که در سشن لندن هیچ خبری نباشد نیز دقت می‌کنیم.

برای دی تریدینگ خوب باید دنبال چه باشیم؟!

- CBDR کمتر از ۵۰ پیپ باشد. اگر بیشتر بود در سشن لندن ترید نمی‌کنیم.
- رنج آسیا کمتر از ۴۰ پیپ باشد.
- اگر مارکت در ساعت ۲۰ به وقت نیویورک یک حرکت صعودی یا نزولی زیاد داشته باشد.
- اگر رنج آسیا یا رنج CBDR درجا نزده بودند و روندی بودند ترید نمی‌کنیم .
- کوچک بودن رنج آسیا به معنای اجازه برای گذاشتن اوردر تریدرهایی که با بریک اوت ترید می‌کنند.(در این شرایط ترید بهتری داریم).
- اگر از ساعت ۲۰ نیویورک بازار روندی بود لندن حرکت خوبی ندارد وبازار نامفهوم است.
- اگر سشن لندن نامفهوم بود در نیویورک ترید می‌کنیم.
- بهترین نوع بازار کانسلیدیشن بعد سوئینگ جودا و بعد ریورسال است.

این قوانین برای این است که ترید بهتر، مطمئن تر و حرکت مناسب تری داشته باشیم. ممکن است روزی باشد که همچنان با نقض این قوانین بازار حرکت خوبی کرده باشد. اما با قوانینی ترید می‌کنیم که اطمینان بیشتری به ما بدهد تا لبه (EDGE) مناسبی داشته باشیم. هیچ آموزش دیگری به ما نمی‌گوید در چه مواقعی بهتر است ترید نکنیم!

شرایط ایده آل برای کیل زون لندن چیست؟

- چارت دیلی به خوبی به آرایه‌های PD واکنش بدهد.
- مارکت به تازگی از یک PD حرکت کرده ولی هنوز به بعدی نرسیده (ناحیه تایم‌های بالا).
- وقتی مارکت سعی می‌کند در چارت دیلی خودش رو به سطوح برساند، ترید در آن جهت مناسب است.
- وقتی مارکت در روزهای اخیر خیلی از ADR فراتر نرفته. احتمال حرکت شارپ بیشتر است.

نکته: از مطالبی که گفته شد برای خودتان چک لیست تهیه کنید و هر روز بر اساس آن ترید کنید.

درس 7

ستاپ‌های دی تردینگ با احتمال موفقیت بالا

چه عواملی باعث می شود دی تردینگ احتمال موفقیت بالایی داشته باشد؟

- در جهت تایم روزانه و چهار ساعته ترید کنیم.
- وقتی H4 و D1 صعودی یا نزولی بود:
- از رنج کف تا سقف دیروز بعد اصلاح وارد شویم.
- از رنج کف تا سقف سشن نیویورک دیروز بعد اصلاح وارد شویم.
- از استاپ هانت کف دیروز استفاده کنیم (برای حالت صعودی) یا از استاپ هانت سقف دیروز استفاده کنیم (برای حالت نزولی)
- روی سطوح ارزان یا گران تر تایم بالاتر دقت کنیم.



کی به دنبال خرید باشیم(برعکس موارد فروش است)

۱. در فاز های ۳-۴ ماهیانه صعودی خرید کنیم(واجب نیست) یا در جهت ۳-۴ ماهه بعدی که احتمالا صعودی است.
۲. بعد از واکنش چارت دیلی به یک سطح ارزان تا وقتی قیمت تمایل دارد خودش را به یک سطح گران برساند.
۳. ایده ال ترین روزها برای خرید در روز دوشنبه و سه شنبه و چهارشنبه است.
۴. بررسی CBDR و رنج آسیا و تلاش برای گرفتن کف روزانه در ساعت ۲ تا ۴ نیویورک.
۵. خرید در محدوده ی ۱ یا ۲ برای انحراف معیار CBDR و ترکیب ان با ارایه های PD تخفیف.
۶. ورود در تایم فریم های M5 و M15 .



کجا به دنبال خرید باشیم؟ (برعکس موارد فروش است)

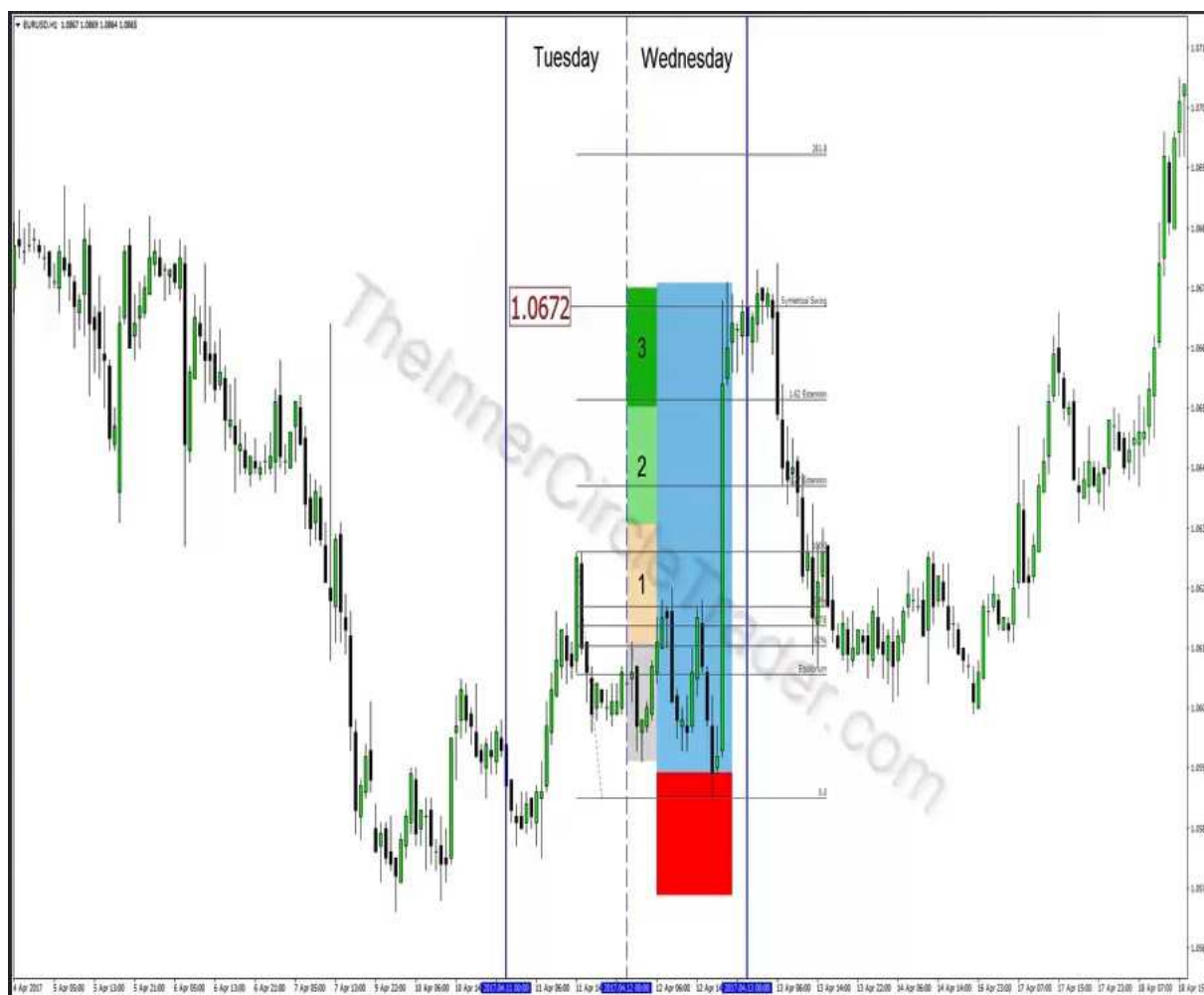
توجه: این ستاپ‌ها بسیار خوب است و مایکل با این‌ها دی تریدینگ می‌کند.

- A. پنج پیپ زیر رنج آسیا.
- B. روی FVG ای که زیر یک کف است.
- C. اوردرد بلاک صعودی زیر یک کف یا زیر روز قبل (خیلی قوی).
- D. اگر خیلی مطمئن به صعود هستیم یک انحراف معیار زیر CBDR داخل یک آرایه تخفیف.
- E. بعد از پر کردن LV یک کف را رد کرده.
- F. بعد از حرکت خلاف جهت در ساعت ۲۴ تا ۲ صبح با آرایه PD.
- G. بعد از یک حرکت صعودی بعد از ساعت ۲۴، خرید از یک اصلاح داخل OB صعودی در M15 یا M5.
- H. 1 یا ۲ انحراف معیار رنج آسیا زیر آن با یک آرایه تخفیف.
- I. اگر یک کف ۲ بار زده شود و حرکت صعودی خوبی رخ ندهد، برای دفعه بعد از استاپ هانتینگ کف خرید می‌کنیم.



برای خرید حد ضرر را چگونه قرار دهیم (برعکس موارد برای فروش است)

- A. حد ضرر را زود جا به جا نکنید.
- B. اگر از ترکیب CBDR و ارایه PD استفاده می‌کنیم حد ضرر ۳۰ پیپ.
- C. اگر از حرکت زیر رنج آسیا استفاده می‌کنیم حد ضرر ۴۰ پیپ.
- D. اگر از هر مدل استاپ هانتینگ استفاده می‌کنیم حد ضرر ۳۰ پیپ.
- E. اگر از اصلاح بعد حرکت روی اوردر بلاک استفاده می‌کنیم حد ضرر ۱۰ پیپ زیر کف روز.
- F. اگر بعد از ۲ بار زدن کف ترید می‌کنیم حد ضرر ۳۰ پیپ زیر کف روز.
- G. اگر با ستاپ‌های دیگر ترید می‌کنیم حد ضرر به اندازه ۵۰ درصد ADR زیر کف رنج آسیا.



حد سود و تیک پرافیت به چه صورت باشد(برعکس موارد برای فروش)

- A. بعد از ۲۰-۳۰ پیپ سود همیشه مقداری از حجم خود کم کنید.
- B. به ازای هر ۲ برابر انحراف معیار رنج آسیا یا CBDR مقداری از حجم خود را کم کنید.
- C. 5 تا 15 پیپ بالای سقف قیمتی روز قبل مقداری از حجم را کم کنید.
- D. در ۵۰ درصد رنج H1 مقداری از حجم خود را کم کنید.
- E. همیشه تا ADR 60 تا 80 درصد حجم را خالی کنید.
- F. اگر سقف هفته گذشته را رد کرد مقداری از حجم را کم کنید.
- G. اگر سقف ماه گذشته را رد کرد مقداری از حجم را کم کنید.
- H. بعد از ۵ صبح نیویورک مقداری حجم را کم کنید.
- I. مقداری از حجم را در اوپن نیویورک یا ۷ صبح خالی کنید چون ممکن است چرخش رخ دهد.
- J. بین ۱۰ تا ۱۱ نیویورک مقداری را خالی کنید.
- K. اگر با یکی از موارد بالا به یک ارایه PD رسیدید کمی از آن را خالی کنید.



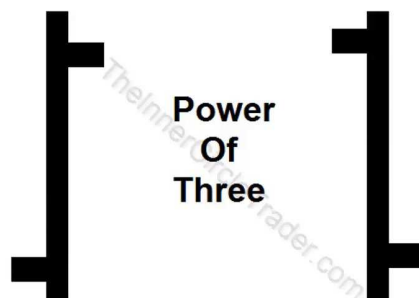
نکته: تمامی شرایط خروج بالا همزمان با هم رخ نمی‌دهند، تنها زمانی که این شرایط بودن حجم خود را کم کنید.

درس 8

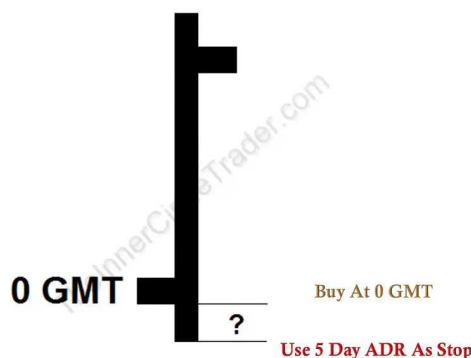
ترکیب معاملات روزانه و ورود تایم‌های بالاتر

می‌توانیم برای ترید در تایم‌های بالا از ورود به سبک دی‌تریڈینگ استفاده کنیم. نیازی به کیل زون لندن نیست و از جهت کندل دیلی استفاده می‌کنیم

P03: در یک کندل نزولی دیلی اوپن صعود و نزول اصلی رخ می‌دهد. در صعود نیز اوپن نزول و حرکت صعودی را داریم. معمولاً یک برگشت و حرکت خلاف جهت داریم و بعد حرکت اصلی را شاهد هستیم.



دو اوپن برای ما مهم است. اوپن کندل در ساعت صفر GMT و اوپن روز اصلی در ساعت ۲۴ نیویورک برای دی‌تریڈینگ بیشتر تمایل ما برای ترید و گرفتن فاصله بین اوپن و کلوز کندل دیلی است. حتی اگر نخواهید در کف یا سقف کندل دیلی ورود کنید می‌توانید در برگشت به اوپن کندل آن را هم بگیرید. آگه هم به تازگی به یک ناحیه مهم تایم دیلی رسیده و می‌خواهیم برگشت روند را بگیریم، اما به سبک دی‌تریڈینگ ورود داشته باشیم می‌توانیم برای اطمینان بیشتر استاپ خود را به اندازه 5 ADR) زیر اوپن کندل قرار دهیم. یا حتی رو اوپن کندل نیز می‌توانید اردر بداریم. این روش خوبی است اگر در لندن نمی‌توانید ترید کنید.



تمرین: در چند هفته گذشته چارت را بررسی کنید و ستاپی که گفته شد را ببینید. قیمت به یک سطحی از تایم دیلی رسیده و برگشته و در سمت جدید حرکت چقدر نسبت به اوپن کندل، خلاف جهت حرکت کرده و این مقدار چه نسبتی با 5 ADR دارد. سه مثال پیدا کنید.

تمرین

- 1- در بیست روز معاملاتی دو جفت ارز تمام زمان‌های روز را که در این فصل یاد گرفتیم مشخص کنید.
- 2- در تمرین قبل رنج CBDR را مشخص کرده و سقف یا کف روز را با آن مشخص کنید.
- 3- چک لیست ورود و خروج پله‌ای خود را بنویسید.



May 2017

ICT Mentorship

ICT Amplified Daytrading & Scalping

Study Notes

Copyright 2017 TheInnerCircleTrader.com All Rights Reserved

This presentation in video, image capture or printed version is intended for paid members only of The ICT Monthly Mentorship & permission is not granted to resell, host or share for public or paid viewing apart from mediums associated with those of TheInnerCircleTrader.com or Michael J. Huddleston.

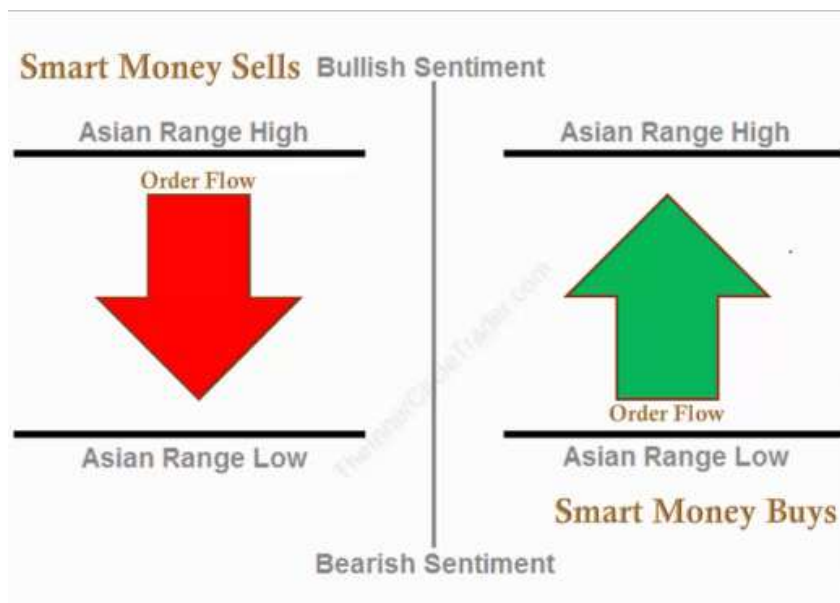
فصل نهم – ماه می
دی تریدینگ و اسکالپینگ



درس ۱

تأثیر سنتیمنت

مارکت میکر تمایل دارد ابتدا بعد از رنج آسیا یک حرکت خلاف جهت ایجاد کند تا تریدرها در آن جهت وارد پوزیشن شوند. معمولاً تریدرهای که با شکست وارد می‌شوند از این روش در رنج آسیا ضرر می‌کنند. سپس مارکت میکر پوزیشن اصلی خود را وارد می‌کند و بازار می‌چرخد تا سود خود را از بازار بگیرد.



درچه شرایطی خرید مناسب است؟(برعکس موارد برای فروش صادق است)

1. IPDA خود را به تازگی به یک آرایه PD روزانه یا H4 سمت ارزان رسانده باشد.
2. فاصله تا آرایه بعدی ما مهم است. اگر کم بود و ریسک به ریوارد مطلوب نبود ترید نمی‌کنیم. (تایم D1 & H4)
3. قیمت زیر اوپن و رنج آسیا می‌رود.
4. زیر رنج آسیا به یک آرایه در تایم M15 برسد. در این آرایه زیادی نمی‌ماند و سریع حرکت می‌کند.
5. سنتیمنت در منطقه‌ی بیش فروش باشد.



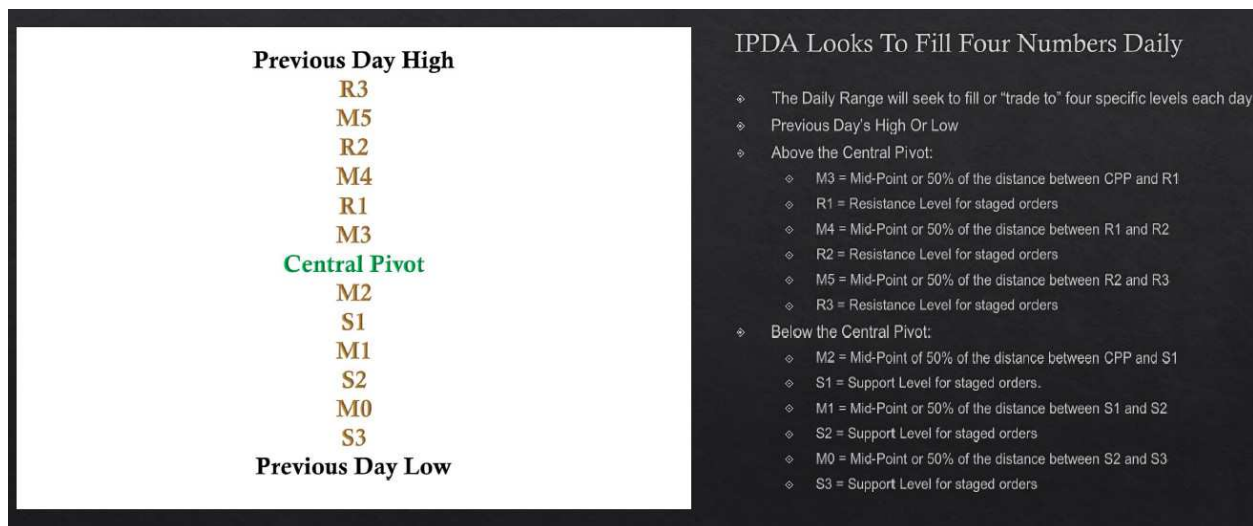
برای بررسی سنتیمنت مارکت در نواحی بیش فروش و یا بیش خرید میتوان از اندیکاتور William %R با پریود ۱۰ یا ۱۴ یا ۲۰ استفاده کرد. ابتدا باید اندیکاتور را با گذشته چارت تنظیم کنید.



درس ۲

پر کردن اعداد در انواع رنج

- **خطوط پیوت پوینت:** در کلاسیک از یک سری خطوط در تایم فریم‌های مختلف استفاده می‌شود که به آن‌ها پیوت پوینت می‌گویند. این خطوط روز قبل را به چند قسمت تقسیم می‌کنند. تریدرها روی چرخش در آن خط‌ها دنبال ترید می‌گردند. اما ما به روش دیگری از آنها استفاده می‌کنیم. این خطوط در ناحیه‌ی زیری حمایت‌ها یا خط‌های S در ناحیه بالایی خط مقاومت یا R در انتهای هر سمت سقف و کف روز قبل و در وسط پیوت مرکزی را دارد. بین هر خط در فاصله‌ی ۵۰ درصد آنها یک خط به اسم M از صفر تا ۵۰ قرار می‌دهیم و به عبارتی تعداد خطوط را زیاد می‌کنیم. سپس از آن‌ها به عنوان تارگت استفاده می‌کنیم نه به عنوان نقطه‌ی ورود در چرخش‌ها. رنج روزانه معمولاً حداقل چهار عدد از این خطوط میان که اضافه کردیم (به علاوه پیوست مرکزی) را می‌بیند، چون دنبال نقدینگی تریدرهایی که روی این برگشت‌ها ترید می‌کنند است. شمارش‌ها هم بدین صورت است که مثلاً روزی که نزول در پیش داریم، قیمت خود را به خط R2 رسانده و سپس نزولی می‌شود. انتظار داریم در مسیر چهار خط بعدی در جهت نزولی دیده شود. البته ممکن است بیشتر از چهار خط دیده شود. اما ما مقداری را روی چهار می‌بندیم و مابقی را باز می‌گذاریم. دقت کنید که در کلوز لندن تقریباً تمام پوزیشن‌ها باید بسته شود.



- یکی دیگر از روش‌های تارگت گذاری استفاده از رنج CBDR به اندازه چهار برابر (با خود رنج) است. در اینجا نقطه‌ی ورود ملاک نیست و فقط تارگت گذاری ملاک است.
مثلا در یک روز صعودی و در یک کفی وارد شدید و انتظار دارید قیمت بعد از رد کردن رنج CBDR، سه گام دیگر نیز حرکت کند.



- روش سومی که میتوان برای تارگت گذاری استفاده کرد، رنج آسیا است. مشابه حالت قبلی انتظار داریم به اندازه رنج آسیا ۴ برابر (با خود رنج) حرکت کند.



- روش چهارم استفاده از رنج فلوت FLOUT است. این رنج به اندازه نصف قیمت حرکت مارکت بین ساعت ۱۵ تا ۲۴ به وقت نیویورک است. دقت کنید که نصف یا ۵۰ درصد این رنج ملاک گام حرکتی ماست. مثل حالت‌های قبلی انتظار حرکت تا ۴ گام را داریم اما نصف اولیه را در شمارش گام‌ها حساب نمی‌کنیم. این رنج را می‌توان مثل CBDA از شدوهای کندل H1 یا از بدنه‌های آن‌ها گرفت.



حال برای تارگت گذاری از کدام رنج استفاده می‌کنیم؟

قطعا ابتدای روز نمی‌دانیم کدام دقیق‌تر عمل می‌کند و نیازی نیز نداریم. در ابتدای سشن لندن بیشتر نقطه ورود مهم است تا تارگت اما با گذشت زمان در شروع سشن نیویورک دید ما بهتر می‌شود.

اول از همه باید مشخص کنیم که قیمت به کدام آرایه PD می‌خواهد برسد و به کدام واکنش می‌دهد. آن حرکت خلاف جهت از اوپن کندل را اندازه‌گیری کرده و به اندازه ۴ گام به سمت مخالف می‌رویم. هر کدام از ۴ اندازه گام حرکتی به آن نزدیک‌تر بود آن تارگت ماست. دقت کنید کمی از پوزیشن را باز می‌گذاریم تا اگر ادامه حرکت داد سود آن را نیز بگیریم. و همه پوزیشن را در کندل کلوز لندن می‌بندیم. اگر این گام‌ها روی هم بیفتند یا با ADR(5) روی هم بیفتند (۲ یا بیشتر) ناحیه خیلی مهمی برای تارگت می‌شود.



درس ۳

روزی ۲۰ پیپ کافی است!!!

هر روز برای ترید مناسب نیست اما اکثر اوقات می شود حداقل ۲۰ پیپ سود از بازار گرفت. در این درس ۲ روش اسکالپ برای گرفتن ۲۰ پیپ گفته می شود.

۱. روش اول: روی کراس های ین ژاپن ، دلار استرالیا و دلار نیوزلند جواب می دهد.

بازه زمانی ترید از شروع آسیا تا ساعت ۲۴ به وقت نیویورک است. اگر روند نزولی بود قیمت با استاپ هانتر سقفی که در اواخر سشن نیویورک ایجاد شده به حرکت ادامه می دهد. می توانیم در آن ناحیه وارد شویم. استاپ و تارگت هر دو ۲۰ پیپ هستند. در روند صعودی نیز در کف اواخر نیویورک می توان ترید کرد. بررسی چارت و ورود در چارت M5 است.

به مثال ها توجه کنید:







2. **روش دوم:** روی همه جفت ارز ها جواب می‌دهد. در سشن نیویورک تا ساعت ۱۰ صبح به وقت نیویورک قیمت از یک کف یا سقف کوچک رد شده و بر می‌گردد. این حرکت در جهت حرکت اصلی روند گرفته می‌شود در تایم فریم M5 است و استاپ و تارگت ۲۰ پیپ است. لندن یک سقف و کف ای را ساخته و حالا در حال ریترس است. ما در آن انتهای اصلاح همسو با حرکت لندن وارد می‌شویم.

به مثال‌ها توجه کنید:



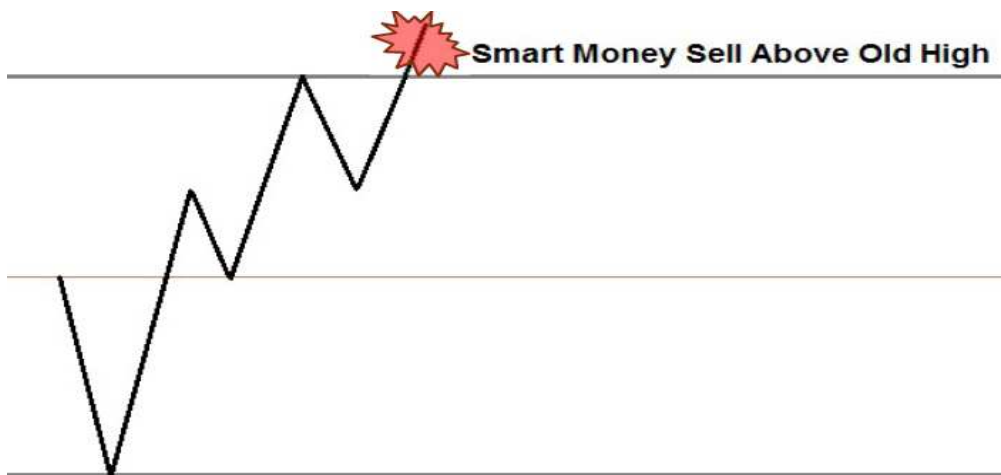
درس ۴

ترید در بازار رنج

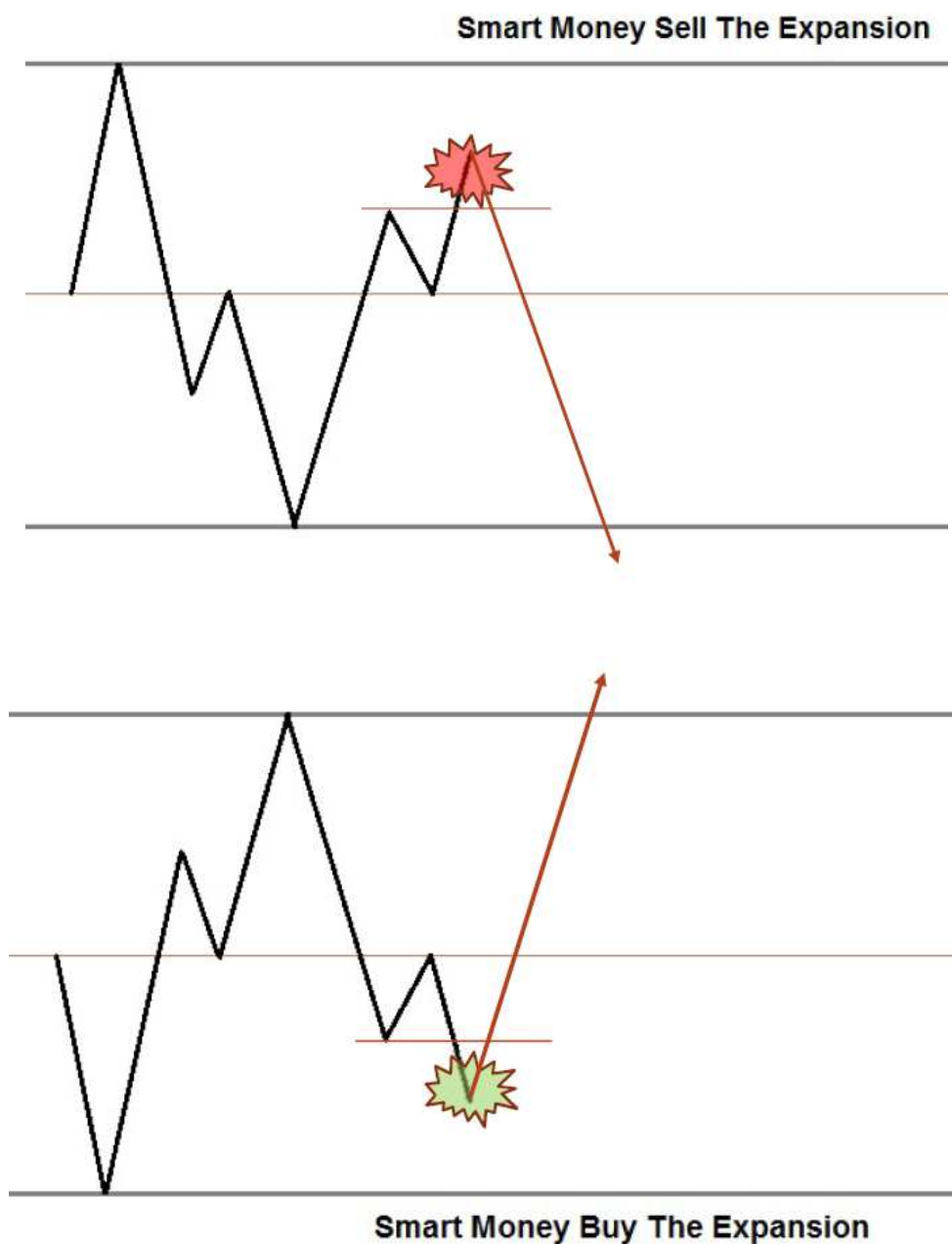
در بازار رنج چه می‌گذرد؟ فرض کنید در یک بازار سایید در دیلی یا H4 هستیم تریدرها و بانک‌ها چگونه ترید می‌کنند؟

۱. تریدرها به دنبال شکست روند و گرفتن ادامه حرکت هستند اما بانک‌ها با نشان دادن شکست جعلی سفارشات خود را جمع می‌کنند.

۲. تریدرها زیر سقف‌ها می‌فروشند و بالای کف‌ها می‌خرند در حالی که بانک‌ها بالای سقف‌ها می‌فروشند و زیر کف می‌خرند!



۳. تریدرها به دنبال حرکتهای اکسپنشن داخل رنج می‌گردند اما بانک‌ها آن را ایجاد می‌کنند تا جهت حرکت از دید آن‌ها تعیین کنند.

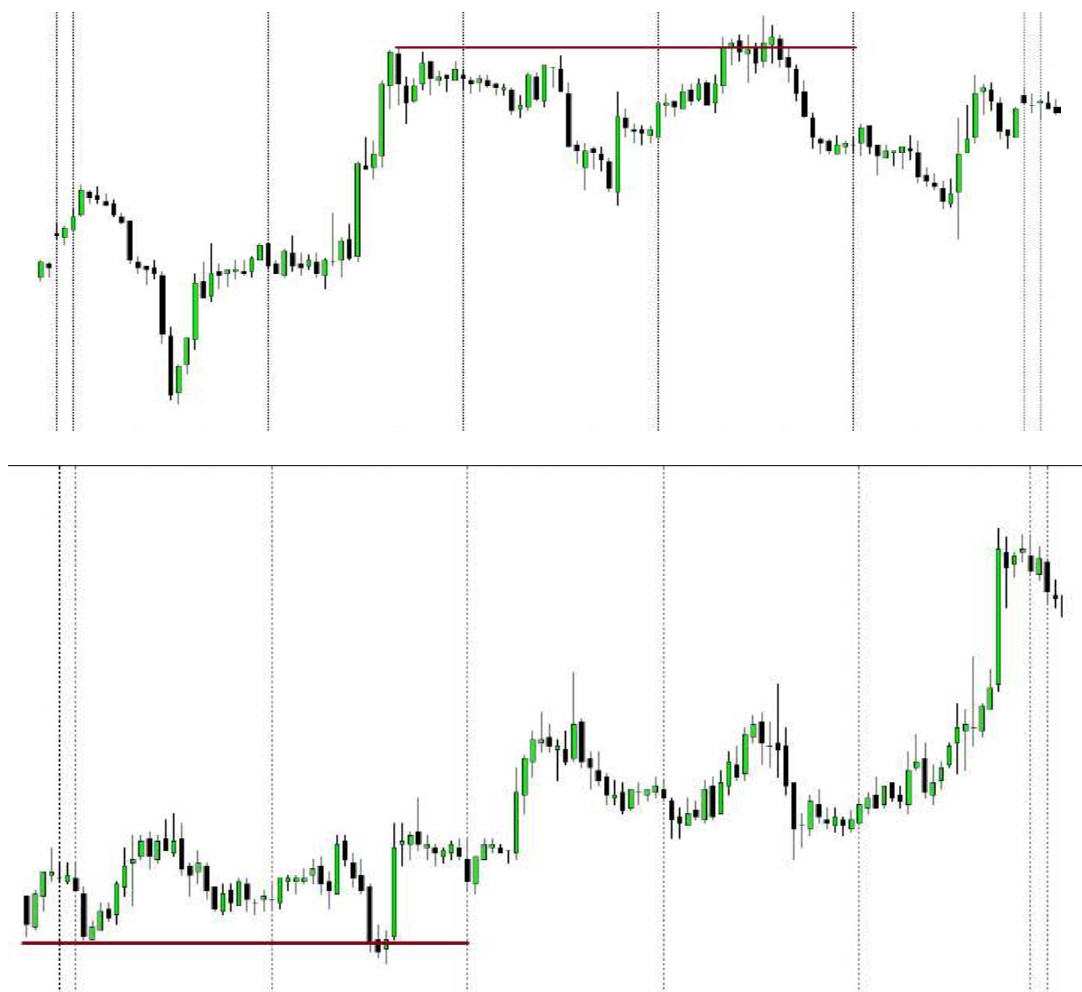


درس ۵

ترید در برگشت ها

❖ هشت نوع برگشت که می‌شود با اطمینان با آن ترید کرد: (هر کدام می‌تواند یک ستاپ باشد)

۱. استاپ هانتر سقف روز قبل (تمرین فصل یک)
۲. استاپ هانتر کف روز قبل (تمرین فصل یک)
۳. استاپ هانتینگ سقف میان هفته
۴. استاپ هانتینگ کف میان هفته
۵. استاپ هانتینگ سقف یک یا دو هفته قبل (به هر کدام نزدیک‌تر بود)
۶. استاپ هانتینگ کف یک یا دو هفته قبل (به هر کدام نزدیک‌تر بود)
۷. ریورسال سشن نیویورک
۸. چرخش کلوز لندن





دقت کنید که این برگشت‌ها بهتر است یا به سطح تایم بالاتر یا همان تایم رسیده باشند تا مطمئن بتوان ترید کرد. یا می‌توان با دو حالت failure swing یا stop run ترید کرد.

این قسمت مهم است.

ستاپ BB (ستاپ نون و کره! اسکپ کل رنج روزانه)

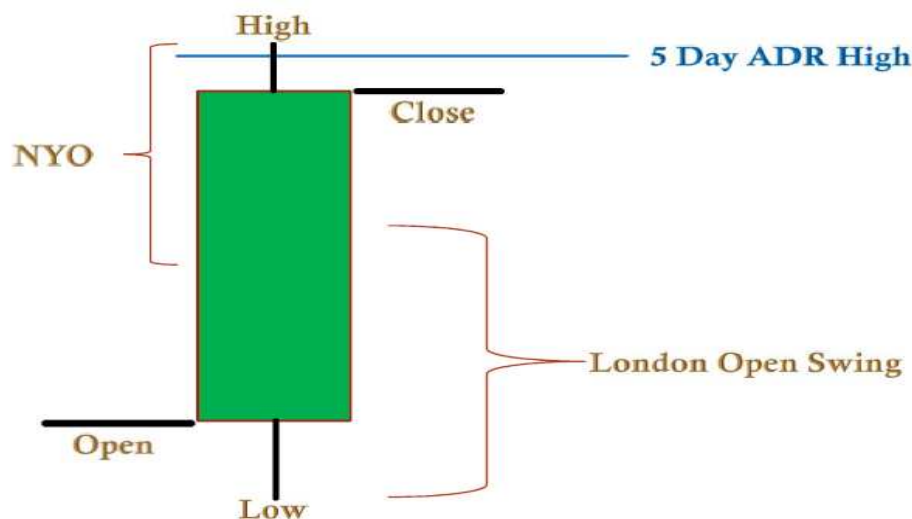
قسمت شش تمامی حالات برای کندل دیلی صعودی و در قسمت هفت تمامی حالت برای کندل دیلی نزولی گفته شده است. در این قسمت ستاپ های کندل نزولی گفته شده و حالت معکوس را برای صعودی در نظر بگیرید:

- ربات ها در نزول یکی از این ۲ کار را انجام می دهند:

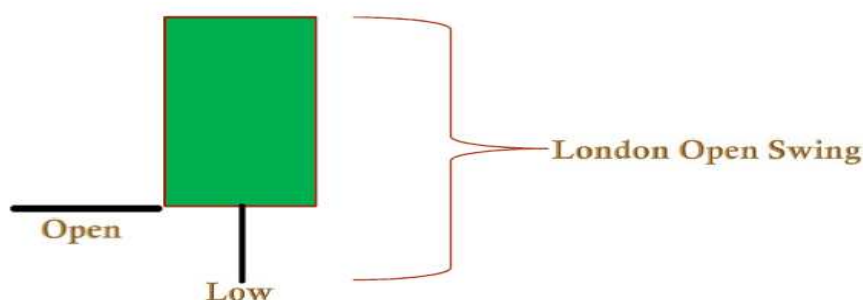
۱. ابتدا از یک سقف سفارشات تریدرها را جمع می کند و به ناحیه آرایه ارزان می رود تا تسویه کنند.
۲. قیمت را بالا می برند تا به ناحیه هایی با قیمت بهتر برای فروش برسند و بعد از پر کردن سفارشات خود به ناحیه ارزان می رود.

حالا می توانیم با دو روش بالا در رنج روزانه اسکپ کنیم:

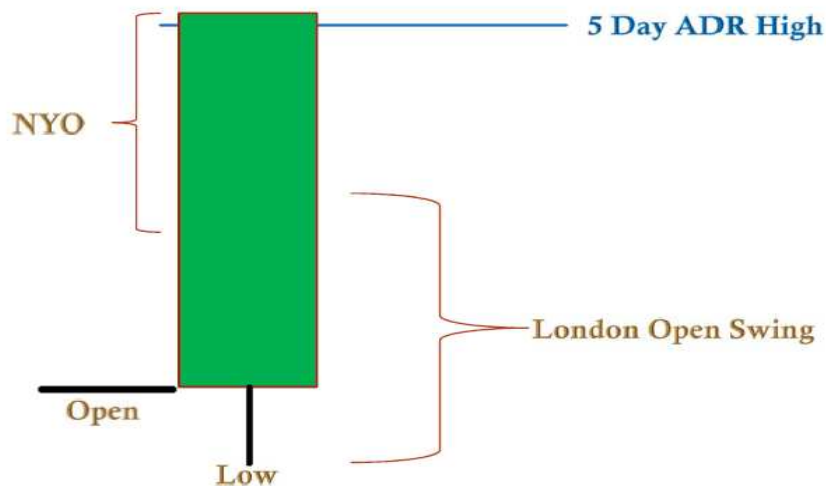
در هر دو روش : کمتر از دو ساعت پوزیشن باز می ماند. تایم فرم M5 و تارگت بین ۱۵ تا ۳۰ پیپ است . معمولا در هفته بیش از ۱۵ ستاپ، در روز بیشتر از ۲ ستاپ و در هر سشن یک ستاپ مشاهده می شود . در سشن آسیا، لندن و امریکا و همچنین کلوز لندن این ستاپ ها قابل ترید هستند که جلوتر در این جلسه در مورد آن ها صحبت می کنیم. ریسک به ریوارد ۱ را ترید می کنیم و ریسک حداکثر ۱ درصد باید باشد. البته ریوارد می تواند بیشتر هم شود که با مدیریت پوزیشن می توان از آن سود کرد. دقت کنید که این روش در همه ساعات در نظر گرفته شوند اما بهترین اسکپ ها برای ستاپ هایی که داخل کیل زون ها هستند می باشند.



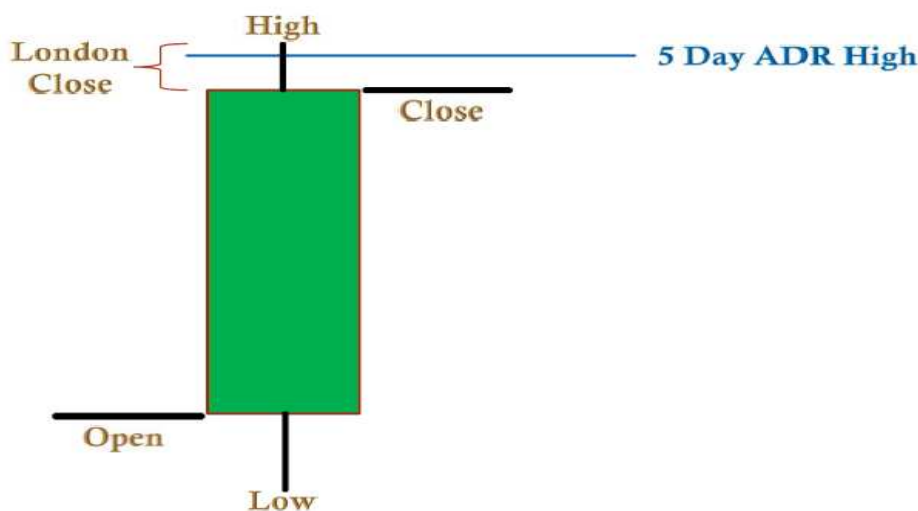
اوپن لندن: وقتی جهت کندل دیلی و روند تایم بالا نزولی است انتظار ما ایجاد یک سقف در کیل زون لندن است. بعد از ساعت 24 GMT یا ۲۴ نیویورک یک حرکت خلاف جهت به سمت بالا داریم که می‌توان از اوپن کندل یا زیر آن تریدش کرد. اگر سوئینگ جودا شد نیز حرکت بیشتری می‌توان گرفت. مارکت در ساعت ۵ تا ۷ صبح نیویورک یک اصلاح دارد که آن را نیز می‌توان گرفت.



سشن نیویورک: وقتی جهت حرکت لندن مشخص شد ما می‌توانیم با آن در سشن نیویورک ترید کنیم مگر اینکه در لندن (5 ADR) رسیده باشد یا به یک تخفیف مهم رسیده باشد. به ساعت 8:20 (هشت و بیست دقیقه) نیویورک (اوپن CME) برای دیدن سوئینگ جودا نیویورک دقت کنید. تارگت (5 ADR) یا سطح ارزان پیشه رو است. اگر قبل از ساعت ۱۰ نیویورک (5 ADR) دیده شد بیشتر پوزیشن را می‌بندیم و بقیه را برای گرفتن باقی حرکت باز می‌گذاریم.



کلوز لندن: بین ساعت ۱۰:۳۰ صبح تا ۱۳ به وقت نیویورک اگر قیمت به ۵ ADR رسیده بود انتظار یک چرخش در قیمت را داریم. بهتر که قیمت ۵ ADR خیلی بیشتر حرکت کرده باشد دنبال failure swing در چارت M5 و یک اوردر بلاک صعودی هستیم. استاپ ۱۰ پیپ زیر کف روز و تارگت ۲۰ تا ۳۰ درصد طول حرکت آن روز از کف می باشد. این ستاپ خیلی سخت پیدا می شود چون ممکن است بازار به حرکت خود ادامه دهد. بهتر است که تارگت و استاپ صعود ۲۰ پیپ باشد.



اوپن آسیا: روی اوپن یا صفر GMT می‌توان سل کرد با تارگت ۱۵-۲۰ پیپ و حتما کل پوزیشن روی تارگت بسته شود. این ستاپ پر ریسک تر است.



نکات در مورد ADR : هر روز حتما نباید بازار به اندازه ADR حرکت کند. وقتی که ADR زیر ۶۰ پیپ هست و یا حرکت و روند جدیدی شروع شده یا نزدیک یک سطح هستیم و خبر مهم داریم انتظار زیاد شدن رنج آن روز را داریم. بهتر است که ADR در اوپن نیویورک دیده نشده و تا کلوز به آن برسد اما اگر در اوپن نیویورک ADR رسیدیم احتمالا آن روز خیلی بیش از ADR حرکت داشته باشیم.

درس ۸

مراحل روزمره دی تریدینگ و اسکالپینگ

توجه: این قسمت خیلی با اهمیت است.

برای دی تریدینگ یا اسکالپینگ، این مراحل را هر روز می‌توان طی کرد:

- A. بررسی تقویم اقتصادی.
- B. دقت به اخبار کیل زونها با تأثیر زیاد و متوسط.
- C. بررسی جریان سفارشات تایم دیلی شاخص دلار.
- D. بررسی آرایه‌های PD در شاخص دلار در بازه زمانی IPDA.
- E. شاخص دلار از یک ناحیه ارزان حرکت می‌کند یا گران.
- F. روی جفت ارزی که خبر مهمی دارد می‌توان تمرکز کرد تا حرکت بیشتری گرفت.
- G. جریان سفارشات آن جفت ارز را در چارت پیدا کنید.
- H. آرایه‌های PD در آن جفت ارز را در بازه زمانی IPDA بدست آورید.
- I. جفت ارز از یک ناحیه مهم حرکت می‌کند؟
- J. آرایه‌های PD جفت ارز در H4 را بدست آورید.
- K. آرایه‌های PD جفت ارز در H1 را بدست آورید.
- L. نقطه قیمتی ۲۴ GMT را بدست آورید.
- M. به نیمه شب نیویورک، انواع گام‌های حرکتی ۴ گانه را بدست آورید. PIVOT POINT ، FLOUT ، ASIA، CBDR.
- N. قیمت نیمه شب نیویورک را علامت بزنید.
- O. دنبال آرایه‌های PD M5 و M15 و ترکیب آنها با گام‌های حرکتی بگردید.
- P. سناریوهای مختلف میان روزی را در نظر بگیرید.
- Q. از گام‌های حرکتی ۴ گانه به علاوه ADR برای انتهای روز استفاده کنید.

تمرین

- 1- در بیست روز معاملاتی دو جفت ارز ابتدا و انتهای هر روز را با رنج CBDR بدست آورید.
- 2- در بیست روز معاملاتی دو جفت ارز ابتدا و انتهای هر روز را با رنج Flout بدست آورید.
- 3- در بیست روز معاملاتی دو جفت ارز ابتدا و انتهای هر روز را با رنج آسیا بدست آورید.
- 4- در بیست روز معاملاتی دو جفت ارز ابتدا و انتهای هر روز را با رنج پیوت پوینت بدست آورید.
- 5- بیست نمونه از هر ستاپ اسکالپ گفته شده پیدا کنید.
- 6- چک لیست مناسب برای خود بنویسید.



June 2017

ICT Mentorship

Study Notes

Copyright 2017 TheInnerCircleTrader.com All Rights Reserved

This presentation in video, image capture or printed version is intended for paid members only of The ICT Monthly Mentorship. A permission is not granted to resell, host or share for public or paid viewing apart from mediums associated with those of TheInnerCircleTrader.com or Michael J. Huddleston.

فصل دهم – ماه ژوئن

تحلیل نمودار COT و شناخت حرکت‌های شاخص‌ها



استفاده از COT به روش ICT:

داده‌های خام گزارش COT که قرار دادهای هفتگی در معاملات فیوچرز را نشان می‌دهد از سایت CFTC.GOV قابل استخراج است.

JAPANESE YEN - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE							Code-097741		
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 05/30/17									
NON-COMMERCIAL			COMMERCIAL		TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS		
LONG	SHORT	SPREADS	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	
(CONTRACTS OF JPY 12,500,000)							OPEN INTEREST:		213,727
COMMITMENTS									
43,404	95,679	4,941	143,450	76,426	191,795	177,046	21,932	36,681	
CHANGES FROM 05/23/17 (CHANGE IN OPEN INTEREST:							2,429)		
1,484	2,103	596	146	1,959	2,226	4,658	203	-2,229	
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS									
20.3	44.8	2.3	67.1	35.8	89.7	82.8	10.3	17.2	
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS:							120)		
37	36	20	28	37	76	82			

از داده‌های COT ما تنها به پوزیشن‌های لانگ و شورت Commercial نگاه می‌اندازیم، اختلاف لانگ و شورت را محاسبه می‌کنیم تا برآیند معاملات را به دست آوریم.



برای استفاده بهتر می‌توانیم از سایت بارچارت استفاده کنیم. در این چارت ما روی تایم فریم دیلی از اندیکاتور Net Traders Po- sition Line Chart استفاده می‌کنیم. حداقل به اندازه‌ی یک سال دیتا نیاز داریم تا در چارت دیده شود. روی اندیکاتور خط قرمز رنگ یا همان Commercial برای ما مهم است. بالای صفر یا پایین صفر بودن این خط به معنای برابری خرید و فروش‌های آنها است. اگر بالای صفر باشد یعنی پوزیشن لانگ بیشتری دارند و اگر زیر آن باشند یعنی پوزیشن‌های شورت بیشتری دارند. بالا یا پایین خط صفر بودن دلیل بر صعود یا نزولی بودن بازار نیست چون بانک‌ها هیچ می‌کنند یا در روند صعودی می‌فروشند تا حجم بالای خود را پرکنند.



برای تحلیل ما ابتدا چارت ۶ تا ۱۲ ماهه COT را با اندیکاتور گفته شده به نرم افزار Paint می‌بریم. سپس اگر اندیکاتور بالای خط صفر بود (یا پایین خط صفر بود) سقف و کف آن ناحیه بالای خط صفر (یا پایین خط صفر) را مشخص می‌کنیم. سپس در ۵۰ درصد بین سقف و کف ای که بدست آوردیم یک خط افقی می‌کشیم. هر جا آن بازه بالای خط ۵۰ درصد بود نشانه‌ی خرید و هر جا پایین زیر آن خط بود نشانه‌ی فروش بانک‌ها است.





مثال دوم:





نکته: اگر عدد اندیکاتور به سقف یا کف تاریخی ۲ یا ۳ یا ۴ ساله رسیده باشد احتمال خیلی زیادی به چرخش روند می‌دهیم. توجه کنید ما همچنان از آرایه‌های PD نیز استفاده می‌کنیم. بهترین حالت ترید زمانی است که آرایه PD با تحلیل COT در یک جهت باشند.

شاخص‌ها:

شاخص S&P500 E-mini که با نام ES شناخته می‌شود در ساعت ۹:۳۰ تا ۴ بعد از ظهر به وقت نیویورک معامله می‌شود.

شاخص‌ها به صورت قراردادی و سه ماهه اجرا می‌شوند و هر قرار داد یک کد مخصوص دارد. ماه مارچ کد H ماه ژوئن کد M ، ماه سپتامبر کد U و دسامبر Z می‌باشد. به طور مثال E-mini در ماه سپتامبر ۲۰۱۷ به صورت ESU17 نوشته می‌شود. این قراردادها بصورت فیوچر هستند و نقدی آنها با حرف y نمایش داده می‌شوند. مثل ESY00. هر پوینت نیز ۵۰ دلار است.

S&P 500 E-Mini Sep '17 (ESU17)					
2,448.75 +1.25 (+0.05%) 17:45 CT [GBLX]					
2,448.50 x 84 2,448.75 x 73					
ALL FUTURES CONTRACTS for Tue, Jun 20th, 2017					
Set Alerts Watchlist					
Intraday Main View					
Contract	Last	Change	Open	High	Low
+ ESY00 (Cash)	2,453.46	+20.31	2,442.55	2,453.82	2,441.79
+ ESU17 (Sep '17)	2,448.75	+1.25	2,447.75	2,449.00	2,447.50
+ ESZ17 (Dec '17)	2,446.50	+1.50	2,445.25	2,446.50	2,445.25
+ ESH18 (Mar '18)	2,443.25s	+16.45	2,432.75	2,446.25	2,432.75

بیشترین حجم معمولا در ساعت‌های ۹:۳۰ تا ۱۰ صبح به وقت نیویورک و روز واقعی از ساعت ۹/۳۰ تا ۱۶ به وقت نیویورک است. دقت داشته باشید که مارکت ۲۴ ساعته است اما برای دی تریدینگ این بازه زمانی یعنی تنها سشن نیویورک مناسب ترید است. بین ۹:۳۰ تا ۱۰:۳۰ رنج اوپن ما است.

دقت کنید که ساعت سایت بارچارت با نیویورک متفاوت است.



نکته: شاخص‌های نزدک و داو جونز نیز از تمامی قواعد گفته شده پیروی می‌کنند.



نکته: روی شاخص‌های می‌توان حجم را دید و روی آن‌ها تحلیل کرد.



:AM Trend

سقف و یا کف در شاخص‌ها می‌تواند در ساعت ۹:۳۰ تا ۱۰:۳۰ تشکیل شود و سپس تا ساعت ۱۲ به وقت نیویورک انجام دهد که به این AM Trend می‌گوییم. این AM Trend می‌تواند بر خلاف جهت سشن لندن باشد و یا ادامه دهنده آن. برای درک این حرکت در شاخص‌ها بهتر است گذشته چارت را به خوبی بررسی کنید.



ESM17 - S&P 500 E-Mini - 15 Minute Candlestick Chart



ESM17 - S&P 500 E-Mini - 15 Minute Candlestick Chart



YMM17 - Dow Indu 30 E-Mini - 15 Minute Candlestick Chart





نکته: بین داوجنز، نزدک، S&P می‌توان برای تایید از واگرایی SMT نیز استفاده کرد. می‌توان از سقف‌ها و کف‌هایی که بین ساعت ۵ تا ۹:۳۰ نیویورک تشکیل می‌شوند برای واگرایی SMT استفاده کرد.



:PM Trend

بعد از ظهر نیویورک بین ساعت ۱۳ تا ۱۶ یک حرکت دیگری رخ می‌دهد که به آن PM Trend می‌گوییم. این حرکت می‌تواند خلاف جهت صبح باشد یا آن در جهت باشد. اکثراً این حرکت ساعت ۱۴ شروع شده و در بین ساعت‌های ۱۵ تا ۱۶ سمت دیگر سقف یا کف روز شکل می‌گیرد.



ESM17 - S&P 500 E-Mini - 15 Minute Candlestick Chart



ESM17 - S&P 500 E-Mini - 15 Minute Candlestick Chart



YMM17 - Dow Indu 30 E-Mini - 15 Minute Candlestick Chart



NQM17 - Nasdaq 100 E-Mini - 15 Minute Candlestick Chart



در تایم ۱۲ تا ۱۵ نیویورک نیز می‌توان واگرایی SMT را در شاخص‌ها بررسی کرد.



تمرین

- 1- گزارشات COT پنج سال گذشته ۵ جفت ارز را مطابق روش گفته شده بررسی کنید.
- 2- رفتار روزانه شاخص‌ها را در یک سال گذشته بررسی کنید. بین آنها بیست واگرایی پیدا کنید.



July 2017

ICT Mentorship

ICT Megatrades
Study Notes

Copyright 2017 TheInnerCircleTrader.com All Rights Reserved

This presentation in video, image capture or printed version is intended for paid members only of The ICT Monthly Mentorship & permission is not granted to resell, host or share for public or paid viewing apart from mediums associated with those of TheInnerCircleTrader.com or Michael J. Huddleston.

فصل یازدهم – ماه جولای
مگاترید



به تریدهایی که بین سوئینگ ترید و پوزیشن ترید هستند می‌گوییم. حرکت این تریدها سریع و زیاد است.

استفاده از تغییر فاز ۳-۴ ماهه خیلی مهم است. می‌توان از تمایلات فصلی استفاده کرد. (اما فاکتور اصلی نیست) شاخص دلار نیز شرایط را باید تایید کند. برای مگا ترید بهتر می‌باشد روی جفت ارزهای اصلی یا Major کار کنیم. به بازار فیوچر ارزها دقت می‌کنیم.

تحلیل قدرت نسبی:

اگر می‌خواهیم ارزی را از این روش بررسی کنیم تمام جفت ارزهای آن را بررسی می‌کنیم. به طور مثال اگر انتظار داریم دلار ضعیف شود و سقف و کف‌های پایین‌تر بزند باید باقی جفت ارزها نیز در همان جهت و دیدگاه حرکت کنند و هر کدام بیشتر و بهتر حرکت می‌کند قدرت نسبی بیشتری دارد.





پیدا کردن مگا ترید:

- (a) ابتدا در بازار فیوچر دنبال ارزهایی می‌گردیم که در حال قوی شدن یا ضعیف شدن باشد.
- (b) سپس جفت ارزهای مرتبط را پیدا می‌کنیم و در صورت امکان با شاخص دلار تطبیق می‌دهیم.
- (c) جفت ارزهای لیدر را پیدا می‌کنیم و یک یا دوجفت ارز خوب را برای ترید نگه می‌داریم.



به مثال زیر دقت کنید:

ابتدا ارزها را بررسی می‌کنیم:







سپس جفت ارز خود را انتخاب می‌کنیم:





تمرین

- 1- ۵ مگاترید در گذشته چارت بیابید.
- 2- اگر به این سبک ترید می‌کنید چک لیست خود را آماده کنید.





August 2017

ICT Mentorship

Top Down Analysis
If Then Conditions

Copyright 2017 TheInnerCircleTrader.com All Rights Reserved

This presentation in video, image capture or printed version is intended for paid members only of The ICT Monthly Mentorship & permission is not granted to resell, host or share for public or paid viewing apart from mediums associated with those of TheInnerCircleTrader.com or Michael J. Huddleston.

فصل دوازدهم – ماه آگوست
جمع بندی و تحلیل مولتی تایم فریم



تحلیل تاپ دان:

مثال‌های این ماه از خود دوره دیده شود. هر قسمت یک مثال کامل دارد.

ماه‌یانه تا هفتگی:

بعد از بسته شدن کندل ماه‌یانه می‌توان تحلیل را از این تایم شروع کرد.

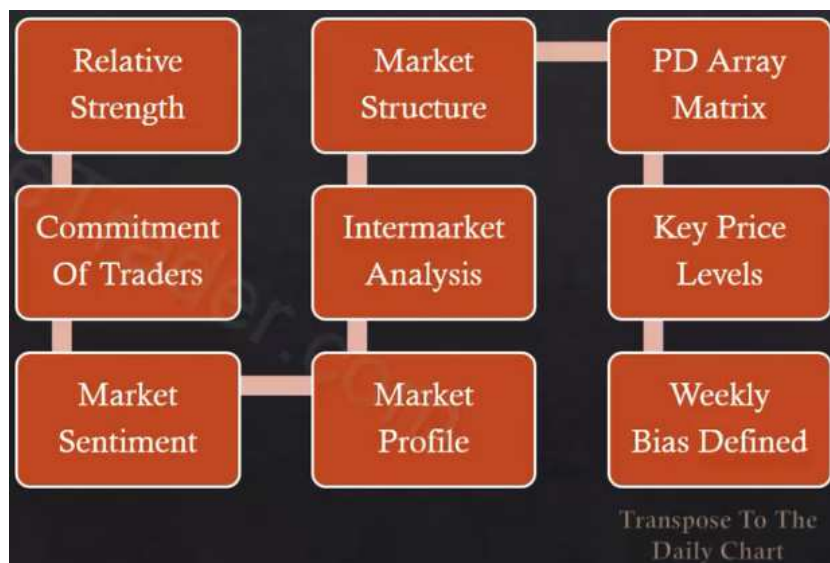
مراحل تحلیل:

۱. ابتدا تمایلات فصلی را بررسی می‌کنیم. این ابزار در همه‌ی ماه‌ها کاربرد ندارند، اما در ماه‌هایی که حرکت بخصوصی دیده شود می‌توان با اطمینان خوبی از آن‌ها استفاده کرد.
۲. بعد به تغییر فازهای ۳-۴ ماهه نگاه می‌کنیم. این تغییر فازها ممکن است باعث چرخش یا استراحت روند بشوند و در موارد کمی ادامه همان روند قبلی را طی کنند.
۳. سپس به اختلاف نرخ بهره دقت می‌کنیم چون می‌دانیم تنها عامل فاندمنتالی که کل بازار را تکان می‌دهند نرخ‌های بهره هستند. اگر در سهام نیز معامله می‌کنیم به نمودارهای اوراق قرضه نگاه می‌کنیم.
۴. در ماه‌های اخیر بازار چگونه بوده؟ روندی بوده یا درجا می‌زد؟ به حالت یا روند مارکت دقت می‌کنیم.
۵. تحلیل بین بازاری در صورت امکان انجام می‌دهیم. بازارها هم‌سو با هم حرکت می‌کنند یا خیر؟ اگر هم‌سو بودند دیدگاه حرکتی را تایید می‌کنند.
۶. ساختار مارکت را بررسی می‌کنیم که سقف‌ها و کف‌ها چگونه‌اند و همین‌طور واگرایی SMT داریم یا خیر.
۷. آرایه PD را بررسی می‌کنیم. مارکت در حالت ارزان است یا گران؟
۸. نقاط و نواحی مهم قیمتی را پیدا می‌کنیم برای ورود یا تارگت. اعداد قیمتی رند شوند.
۹. حرکت و جهت کندل ماه‌یانه را تخفیف می‌زنیم.
۱۰. تحلیل را به تایم فریم هفتگی می‌بریم.



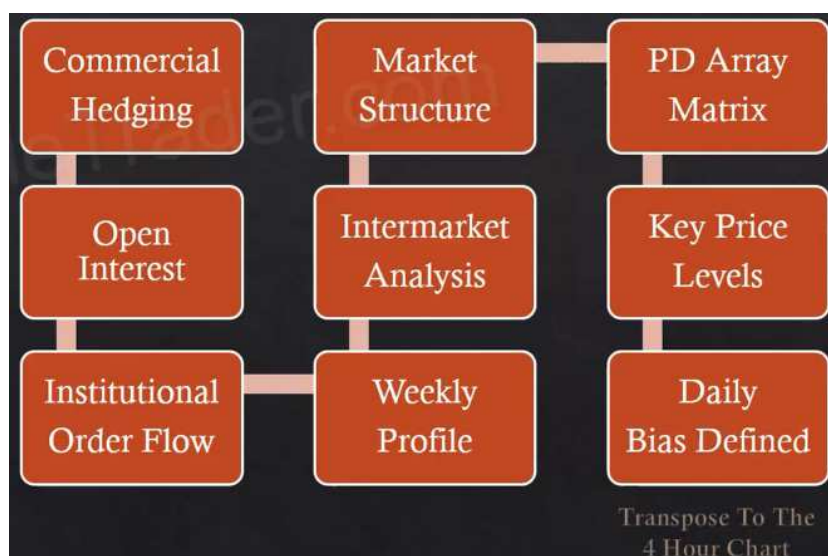
هفتگی تا روزانه:

۱. ابتدا تحلیل قدرت نسبی را انجام می‌دهیم.
۲. گزارشات COT را تحلیل می‌کنیم.
۳. تحلیل سنتیمنت بازار با اندیکاتور گفته شده یا بررسی سایت بلومبرگ، WSJ ، BSRRONS و INVESTORS BUSSINESS .DAILY
۴. ساختار مارکت را بررسی می‌کنیم که روندی است یا خیر؟
۵. تحلیل بین بازاری را در تایم فریم‌های هفتگی انجام می‌دهیم.
۶. ساختار مارکت را در نظر سطوح و جریان سفارشات و SMT بررسی می‌کنیم و آرایه‌های PD را علامت می‌زنیم و سطوح مهم تر را مشخص می‌کنیم.
۷. جهت کندل هفتگی را تخمین می‌زنیم تا به تایم فریم روزانه برویم.



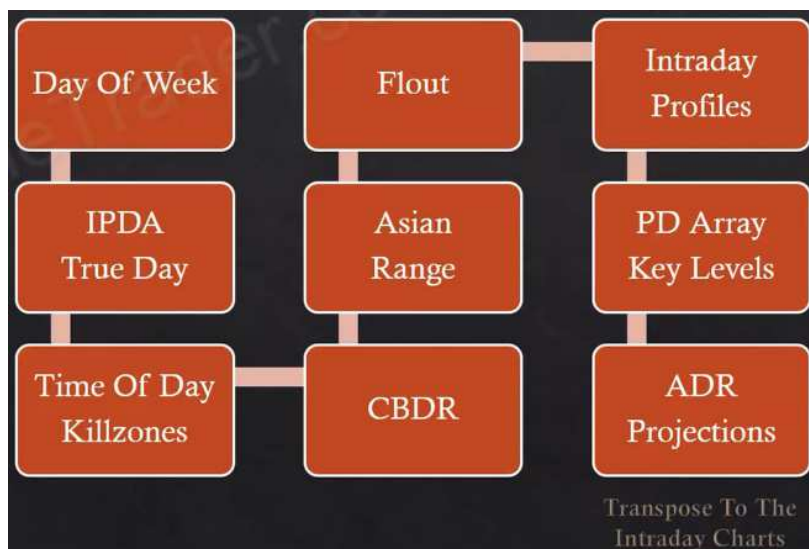
روزانه تا چهار ساعته:

۱. بررسی هج‌ها در گزارشات COT در تایم دیلی.
۲. بررسی نمودار Open Interest.
۳. بررسی جریان سفارشات.
۴. احتمال و تشخیص رنج هفتگی.
۵. تحلیل بین بازاری و همچنین تحلیل بین جفت ارزهایی که همبستگی دارند.
۶. بررسی ساختار مارکت، صعودی و یا نزولی بودن آن.
۷. بررسی ارایه‌های PD در نواحی ارزان و گران.
۸. سطوح مهم را بدست آوریم.
۹. تشخیص جهت کندل دیلی و رفتن به تایم ۴ ساعته.



چهار ساعته تا پنج دقیقه:

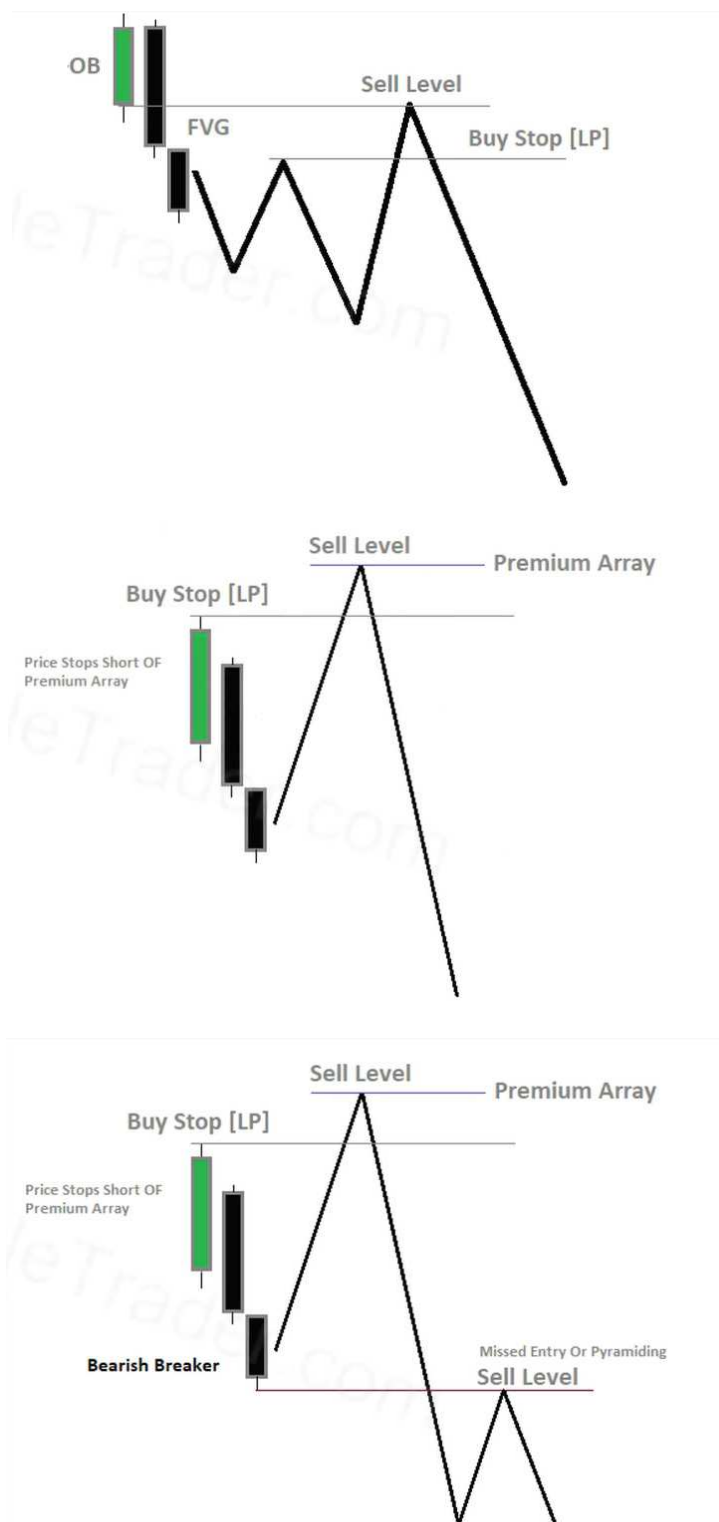
۱. در چه روزی در هفته هستیم؟ رنج هفتگی چگونه است.
۲. بدست آوردن زمان روز واقعی.
۳. کیل زون ها را در نظر می گیریم.
۴. CDBR و حدود سقف و کف روز را با آن بدست آوریم.
۵. رنج آسیا و حدود سقف و کف روز را با آن بدست آوریم.
۶. Flout و حدود سقف و کف روز را با آن بدست آوریم.
۷. حرکت رنج روز چگونه می تواند باشد؟ سوئینگ جودا داریم؟
۸. ارایه های PD و سطوح مهم را مشخص می کنیم.
۹. سطوح ADR را مشخص می کنیم.
۱۰. می توانیم به تایم های ۱۵ و یا ۵ دقیقه برویم و ستاپ ها را بررسی کنیم و ترید کنیم.



پترن‌ها و ستاپ‌های ترید مهم:

حالت‌های صعودی:

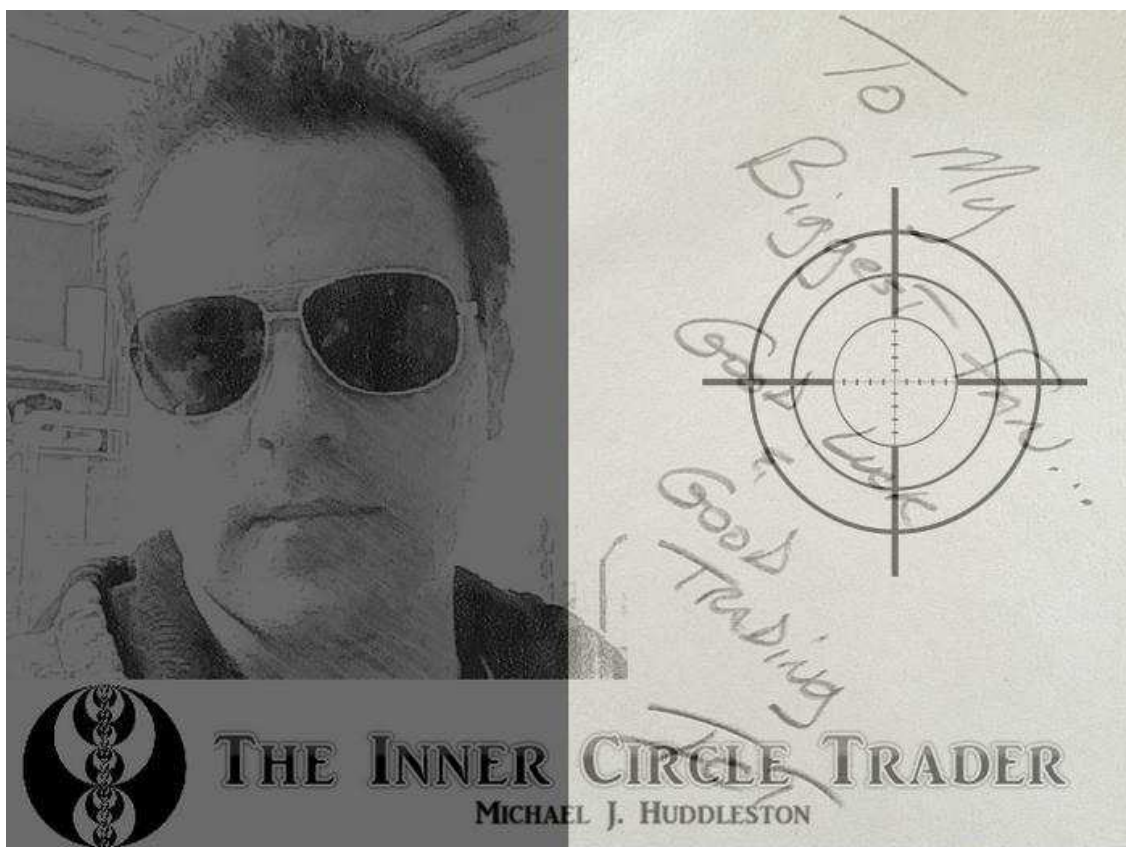




تمرین

- 1- روزی ۱۰ جفت ارز تحلیل مولتی تایم انجام بدهید. آن‌ها را هر روز بررسی کنید.
- 2- ستاپ‌های آخر فصل را در چارت پیدا کنید. از هر مورد ۲۰ نمونه کافی است.
- 3- پلن معاملاتی خود را بنویسید.





برای مطالب بیشتر به کانال ما مراجعه کنید

@TOBEATRADER

TOBEATRADER@YAHOO.COM

