



CYCLICAL WAVES
Discovering Order Within Chaos

Cyclical Waves

سودمندی شگفت آور ATR

تهیه کننده: میر آرمیا جلالی

تیر ۱۳۹۵

فهرست

- ۱ مقدمه
- ۲ ATR چیست؟
- ۴ استفاده از ATR برای مدیریت نقاط ورود و خروج
- ۸ اندیکاتور اختصاصی ما : پیوت های ATR
- ۱۱ استفاده از ATR برای محاسبه قدرت روند

در بسیاری از مواقع یک پلن معامله گری خوب به دلیل اجرای نامطلوب خراب می شود . گاهی ما می توانیم یک روند قوی که عوامل بنیادی قوی نیز موید آن هستند را شناسایی کنیم اما در زمانی وارد معامله می شویم که روند در حال تمام شدن است . در مواقع دیگر در حالی که ما به دنبال بهترین محل برای ورود هستیم قیمت در حال طی کردن مسیر خود به سمت هدف است.

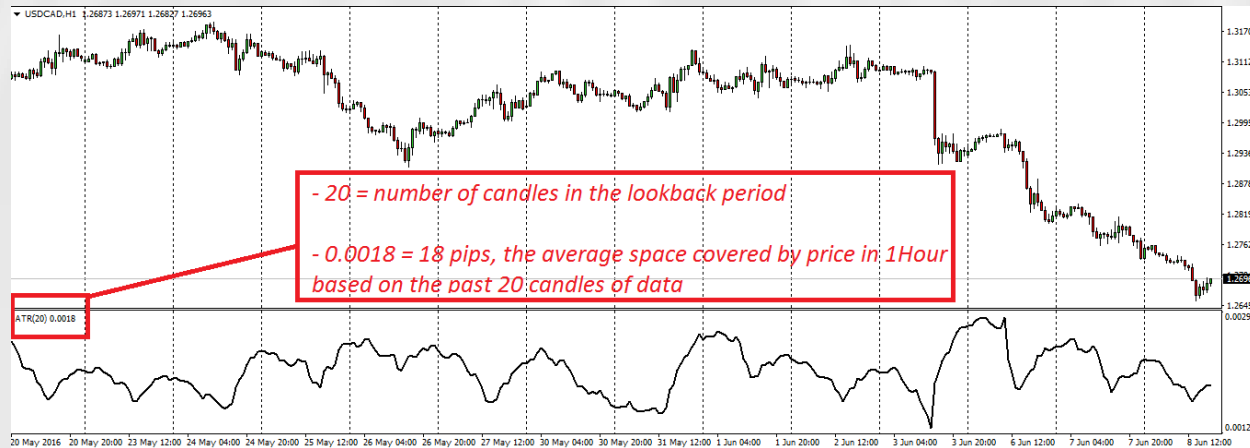
گاهی ما به درستی وارد یک حرکت خوب می شویم و در معامله می مانیم و انتظار یک حرکت چند روزه یا چند هفته ای را داریم، اما مشاهده میکنیم که قیمت بخشی یا تمام مسیری را که در جهت مورد نظر ما حرکت کرده بود را باز میگردد .

این ها موقعیت هایی بسیار آزاردهنده هستند. در این مقاله ما به بررسی این مساله خواهیم پرداخت که چگونه یک اندیکاتور ساده که بر اساس ATR طراحی شده می تواند در حل این مشکلات به صورت مستمر و منطقی به ما کمک کند .

ما به بررسی این که ATR چگونه در موارد زیر می تواند مفید باشد خواهیم پرداخت :

- I. ورود آسان تر به معاملات
- II. مدیریت کردن معاملات با خیال آسوده تر
- III. سنجیدن قدرت ترند به صورت سیستماتیک

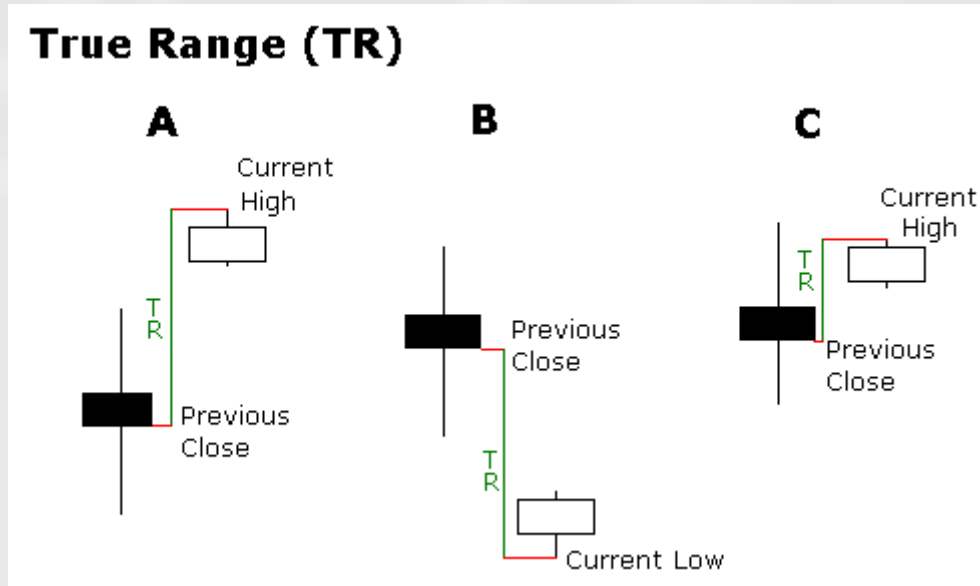
به طور ساده ATR یک نمانسج برای میزان نوسانات است . ATR به شما خواهد گفت که به طور متوسط قیمت چه میزانی در یک دوره زمانی مشخص نوسان میکند. ATR بر روی نمودار شما مشابه شکل زیر است:



مانند سایر اندیکاتورها مهم است که بدانیم ATR چگونه ساخته شده است. بیایید با TR برای یک دارایی شروع کنیم . TR نوسان قیمت دوره ای که در آن هستیم را محاسبه می کنید (حداکثر و حداقل قیمت) و همچنین آن را با محل بسته شدن قیمت در دوره قبل می سنجد.

به طور کلی TR مقدار ماکزیمم بین سه مقدار زیر است :

- I. مقدار تفاضل حداکثر و حداقل قیمتی دوره جاری
- II. قدر مطلق مقدار تفاضل حداکثر قیمت در دوره فعلی و قیمت بسته شدن در دوره قبل
- III. قدر مطلق مقدار تفاضل حداقل قیمت در دوره فعلی و قیمت بسته شدن در دوره قبل



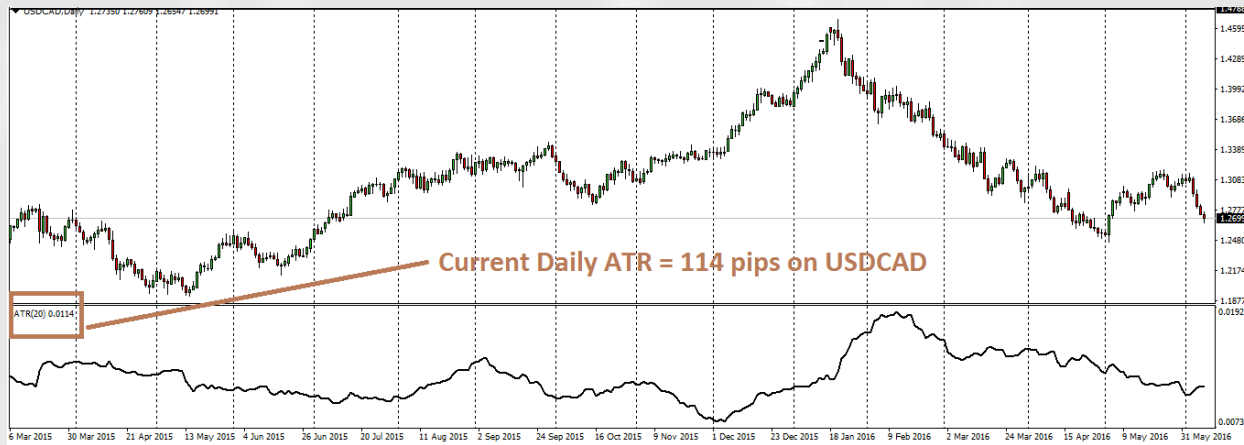
ATR به نوعی میانگن نمایی TR در دوره های قبل از دوره مورد نظر است. بعنوان مثال برای یک دوره ۲۰ روزه به شکل زیر محاسبه میشود :

$$\text{Current 20 period ATR} = [(\text{Prior ATR} \times 19) + \text{Current TR}] / 20$$

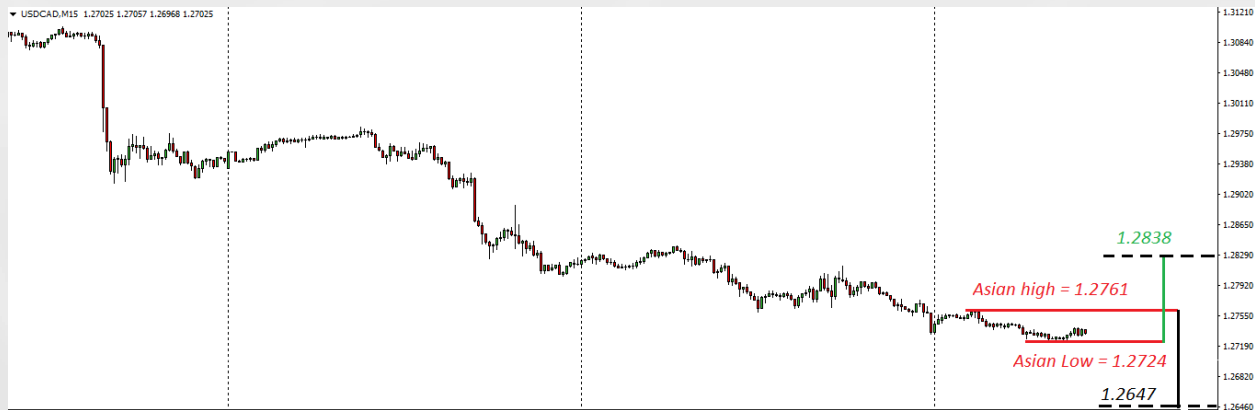
خوب بعد از این گذر ما به دنیای ریاضیات، نکته خوب این است که امروزه اکثر بروکرها ATR را به عنوان یک اندیکاتور استاندارد به صورت پیش فرض دارند، پس نیازی به انجام این محاسبات نخواهیم داشت.

استفاده از ATR برای مدیریت نقاط ورود و خروج

اکنون که ما می دانیم ATR یک نماسنج برای میزان نوسانات است، چطور از آن استفاده کنیم؟ بیاید یک مثال را بررسی کنیم:



مقدار فعلی ATR روزانه بر روی USDCAD برابر با ۰.۰۱۱۴ می باشد که معادل با ۱۱۴ پیپ است. بنابراین ما می دانیم که قیمت به طور متوسط ۱۱۴ پیپ نوسان را به طور روزانه انجام داده است. فرض می کنیم می خواهیم در ابتدای بازار لندن وارد موقعیت فروش در این جفت ارز شویم.



استفاده از ATR برای مدیریت نقاط ورود و خروج

در ساعت ۷ صبح قیمت فاصله ای معادل ۲۷ پیپ بین سقف و کف خود ایجاد کرده است که این مقدار معادل تنها ۲۳٪ از ATR روزانه می باشد . بنابراین اگر بازار بخواهد رویه گذشته خود را حفظ کند بازار باید مقدار زیادی را در ادامه روز حرکت کند .

اگر بازار بخواهد معادل صد درصد ATR نوسان داشته باشد، این پتانسیل را دارد که تا قیمت ۱.۲۴۶۷ ریزش داشته باشد (حداکثر قیمت در بازار آسیا - ۱۱۴) یا اگر بخواهد وارد فاز اصلاح شود، می تواند تا قیمت ۱.۲۸۳۸ صعود کند (حداقل قیمت در بازار آسیا + ۱۱۴) . بنابراین ما در هر روز برآوردی از اینکه قیمت به احتمال بالا در چه بازه ای نوسان می کند را داریم .

اما قیمت همیشه صد درصد ATR را حرکت نمی کند . در اکثر مواقع ما دوره هایی با مقدار نوسانات بالا یا پایین را در بازار تجربه می کنیم . به طور متوسط قیمت تمایل دارد تا معادل هفتاد درصد از ATR بیست روزه خود را حرکت کند . بنابراین در مثال ما هفتاد درصد 114 پیپ را محاسبه میکنیم که معادل با ۸۰ پیپ می شود . این به این معنی است که هدف محتمل قیمتی برای فروش میان روزی ما ۱.۲۶۸۱ است (حداکثر قیمت در بازار آسیا - ۸۰) .

مفهوم دیگر این قضیه این است که اگر ما به دنبال یک خرید هستیم و بازار پنجاه درصد از ATR بیست روزه را طی کرده است، فضای زیادی برای ادامه حرکت وجود ندارد. این قضیه مهمی به خصوص برای تریدرهای میان روزی است زیرا قیمت باید فضا برای حرکت بیشتر داشته باشد .

استفاده از ATR برای مدیریت نقاط ورود و خروج

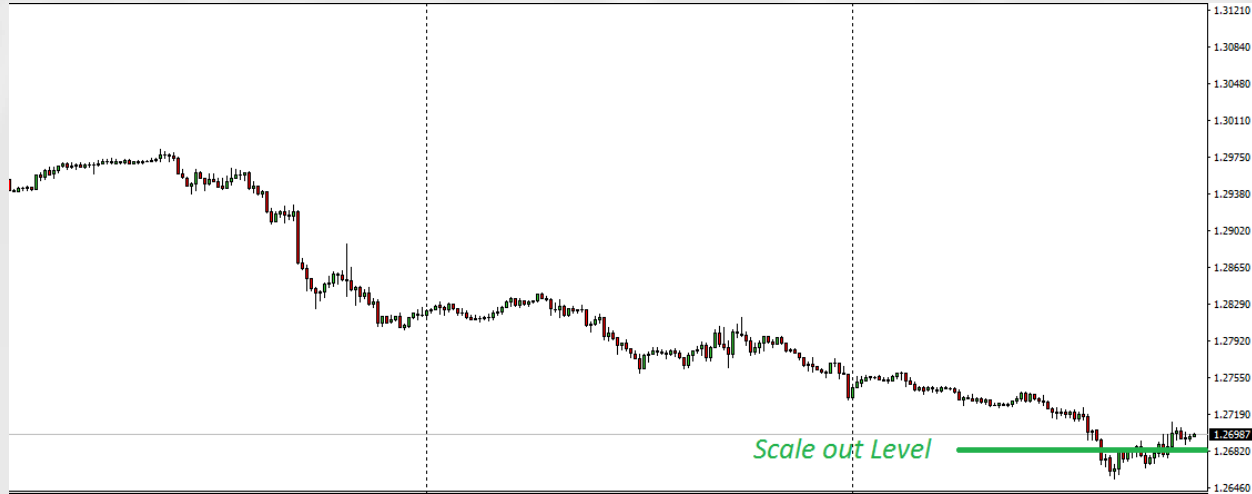


بسیاری از معامله گران به دنبال این هستند که یک رالی دیگر به دلیل این خبر در بازار لندن شکل بگیرد که به نظر انتظار منطقی ای به نظر می رسد زیرا اخبار مرتبط با بانک مرکزی و NFP تاثیر بالایی بر بازار دارند .

اما به خاطر داشته باشید که ترید کردن بازی احتمالات است . بنابراین احتمال این که قیمت یک حرکت شارپ دیگر داشته باشد چقدر است ؟ فارغ از این مساله اگر شما در بازار لندن بخواهید خرید انجام دهید استاپ لاس شما کجا خواهد بود ؟ قیمت احتمالی هدف در کجا باشد تا شما معادل ریسک خود بازده داشته باشید ؟ بنابراین با در نظر گرفتن این موارد مرتبط با مدیریت معامله این موقعیت به نظر یک معامله بعید می رسد .

استفاده از ATR برای مدیریت نقاط ورود و خروج

خوب بیایید به مثال USDCAD برگردیم . ما به دنبال فروش با حد سود 1.2681 بودیم :



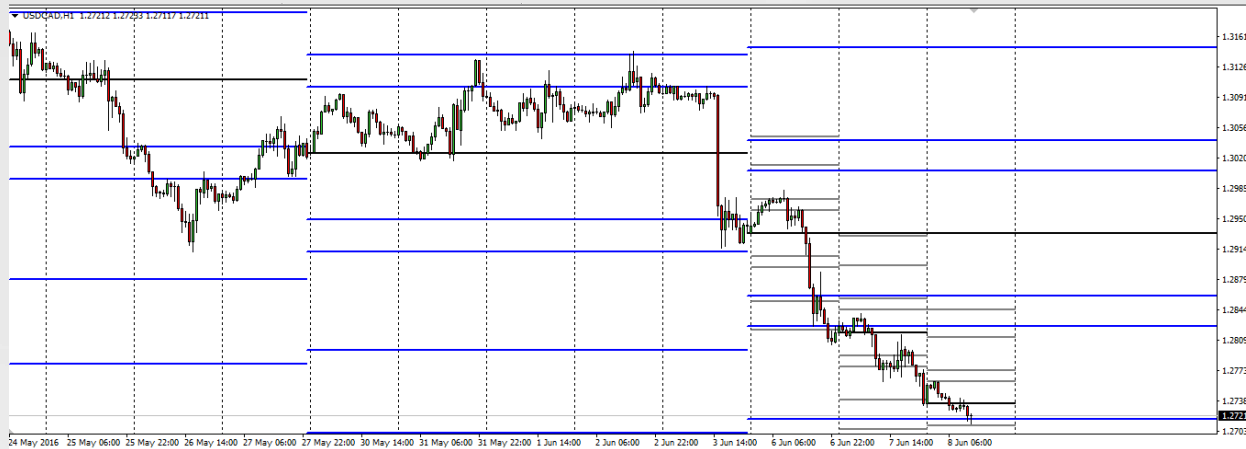
همانطور که مشاهده می کنید قیمت معادل نود و پنج درصد ATR را قبل از بازگشت طی کرده است . مانند بسیاری از موارد دیگر در بازار هفتاد درصد ATR یک مقدار قطعی نیست اما این مقدار به طور پیوسته محاسبه شده است و مواردی که درست عمل میکنند بیش از مواقعی است که عملکرد درستی نشان نمی دهد .

مساله مهم تر این است که دوری کردن از ورود به ترید هایی که حرکتی معادل پنجاه درصد ATR را انجام داده اند، داشتن هدف قیمتی که معادل با هفتاد درصد ATR است و همینطور داشتن دیدی روشن نسبت به نوسانات که همان صد درصد ATR است به ما امکان یک برنامه ریزی پیوسته را می دهند .

اندیکاتور اختصاصی ما : پیوت های ATR

تا به این لحظه احتمالا بیشتر خوانندگان به این فکر می کنند که محاسبه این مقادیر به صورت روزانه چقدر دشوار خواهد بود و اینکه در هر لحظه بتوان آگاه بود که قیمت چه مقداری از مسیر را طی کرده است .

خوشبختانه ما برای این مساله راه حلی داریم : پیوت های ATR



خطوط آبی پیوت های هفتگی هستند و خطوط خاکستری پیوت های روزانه . همواره ۴ پیوت بالا و ۴ پیوت پایین محدوده ی باز شدن قیمت هفتگی و روزانه قرار دارند .

اندیکاتور اختصاصی ما : پیوت های ATR

تمامی خطوط را استفاده کننده می تواند تغییر دهد، اما با توجه با آنچه که گفته شد سطوح منطقی برای رسم از نظر ما اینها هستند :

+100% ATR

+70% ATR

+50% ATR

+25% ATR

Weekly/Daily Open

-25% ATR



























-50% ATR

-70% ATR

-100% ATR

اندیکاتور اختصاصی ما : پیوت های ATR

بنابراین در این حالت به سادگی شما سطوح را بر روی چارت خود خواهید داشت . عکس زیر نمایی از تنظیماتی که در اندیکاتور وجود دارد را نشان میدهد :

Variable	Valore
 Pivot_Settings	PIVOT SETTINGS
 Pivot1	0.236
 Pivot2	0.35
 Pivot3	0.7
 Pivot4	1.0
 ATR_Settings	CURRENT ATR PERIOD SETTINGS
 ATR_Period_Day	22
 ATR_Period_Week	12
 ATR_Period_Month	12
 History_Settings	HISTORY ATR & PERIOD SETTINGS
 ATR_History_Period_Day	22
 History_Days	5
 ATR_History_Period_Week	12
 History_Weeks	2
 ATR_History_Period_Month	12
 History_Months	2
 Display_Settings	SHOW / HIDE PIVOTS
 Show_Daily_Pivots	true
 Show_Weekly_Pivots	true
 Show_Monthly_Pivots	false
 Show_Labels	false
 Line_Colour_Settings	LINE COLOUR SETTINGS
 line_color_CurrentOpen	■ Black
 line_Color_Daily_Pivot	■ Gray
 line_color_Weekly_Pivot	■ Blue
 line_color_Monthly_Pivot	■ Maroon

استفاده از ATR برای محاسبه قدرت روند

سودمندی های ATR با محدوده های ورود و خروج تمام نمی شود . به طور شگفت آوری ATR می تواند در شناسی قدرت یک روند نیز به ما کمک کند . برای مشخص شدن منطق این قضیه دو جفت ارز زیر را در نظر بگیرید :

AUDUSD: ATR 74 pip

GBPUSD: ATR 127 pip

اگر ما فکر کنیم که دلار آمریکا ضعیف خواهد شد و بخواهیم که قویترین روند برای ورود را انتخاب کنیم چه طور می توانیم عملکرد این دو جفت ارز را بسنجیم ؟ این دو به طور ذاتی متفاوت هستند و نوسانات متفاوتی را انجام می دهند .

برای اینکه این مقایسه ممکن شود و نتیجه گیری ما منطقی باشد ما می توانیم عملکرد نسبی آنها را بسنجیم . اما چگونه این کار را انجام دهیم ؟

ATR بیست روزه / (حداکثر قیمت در دوره فعلی - حداقل قیمت در دوره فعلی) = عملکرد امروز بر حسب درصد

استفاده از ATR برای محاسبه قدرت روند

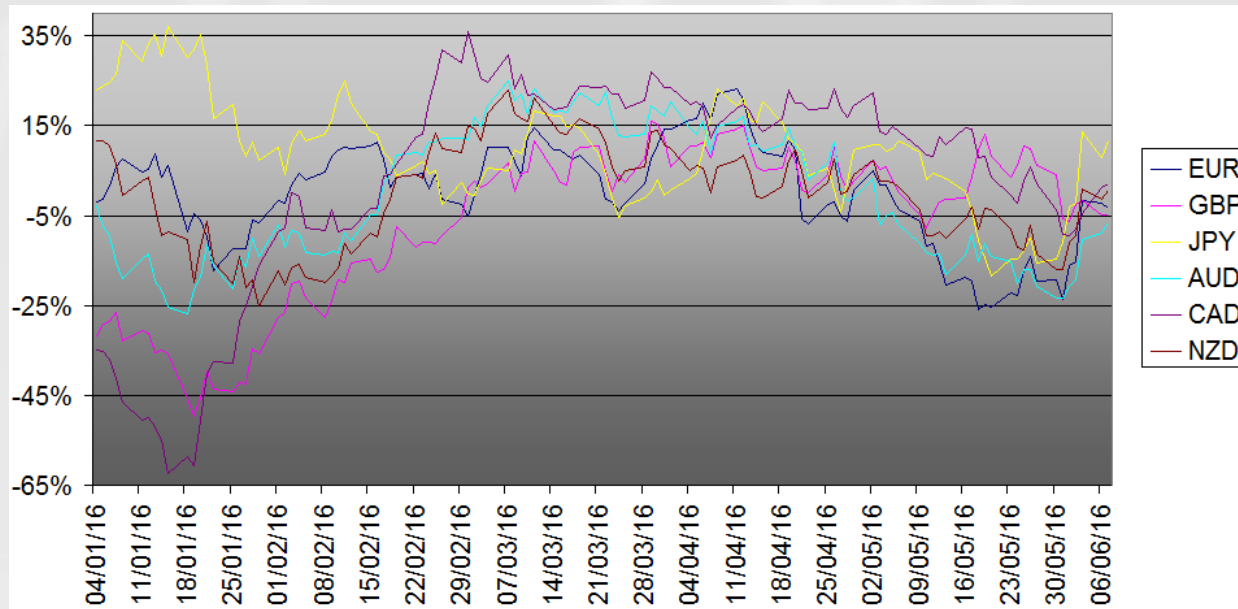
Close	Pips from extreme	As % of ATR	20 Day Average
-1	0,00704	-71%	-11%
1	0,00602	62%	-13%
1	0,00381	40%	-14%
-1	0,00553	-59%	-13%
-1	0,00601	-63%	-18%
1	0,00431	47%	-14%
1	0,0042	46%	-9%
-1	0,01065	-113%	-15%
-1	0,00155	-17%	-11%
-1	0,00325	-36%	-14%
1	0,00276	30%	-15%
-1	0,00453	-49%	-20%
1	0,00245	29%	-17%
1	0,00644	77%	-17%
-1	0,00563	-68%	-21%
1	0,00334	41%	-23%
1	0,00521	71%	-23%
1	0,00276	38%	-21%
-1	0,00412	-56%	-19%
1	0,01428	193%	-10%
1	0,00497	68%	-9%
1	0,00958	128%	-7%

در صورتی که بخواهیم قدرت روندهای صعودی را بسنجیم بزرگترین عدد نشان دهنده قویترین روند خواهد بود و برای روند نزولی کوچکترین عدد این مساله را نشان خواهد داد .

معامله گرانی که نمی توانند بر اساس ATR تفسیر مناسبی را انجام دهند تنها از مومنتوم مطلق استفاده می کنند که کار مقایسه را دشوار می کند . مومنتوم نسبی می تواند یک راه حل برای این موضوع باشد .

استفاده از ATR برای محاسبه قدرت روند

این یک چارت از مومنتوم نسبی جفت ارزهای اصلی است :



آنچه بر عهده شماست

استفاده منطقی و پیوسته از ATR می تواند در موارد زیر به شما کمک کند :

۱. دوری کردن از معاملاتی که احتمال کمی برای عملکرد مناسب را در دوره روزانه یا هفتگی را دارند .
۲. دوری از خروج زود هنگام از معاملات خوب و یا نگهداری یک معامله برای مدتی طولانی
۳. آنالیز کیفیت یک روند به صورت عینی

تمامی این مسایل برای معاملاتی پیوسته منطقی و مطمئن هستند .

با آرزوی موفقیت در سرمایه‌گذاری‌های شما

گروه Cyclical Waves

<http://www.CyclicalWaves.com/>

<https://telegram.me/Cyclicalwaves>

CyclicalWaves@Gmail.com