

دورة مكثفة

الدرس الخامس
مؤشرا ستوكاستك وخطوط بولينجر

(أ) التداول مع ستوكاستك

التداول مع ستوكاستك

ما هو ستوكاستك؟

• يعتبر ستوكاستك مؤشراً يعمل جيداً في الأسواق المحددة. [i]

ما هي مهمته؟ يندرج ستوكاستك في خانة مؤشرات التذبذب - أي أنه يقيس انحراف معدل (سعر) زوج من العملات عن مستوياته الطبيعية. يعطي ستوكاستك، مثل كافة مؤشرات التذبذب، إشارات في حال كان شراء/بيع زوج من العملات مبالغاً فيه. من هنا، يعمل هذا المؤشر جيداً ضمن الأسواق غير الموجهة، وهو يتقلب بين مستوى أعلى (المقاومة) وآخر أدنى (الدعم).

المعالم. يشتمل ستوكاستك بشكل عام على ثلاثة معالم يجدر بالمستخدم تحديدها : $K\%$ و $D\%$ وعدد الفترات الزمنية. إليك أحد الإعدادات المستخدمة بصورة واسعة في إطار تلك المعالم :

• 5 في ما يخص $K\%$

• 5 في ما يخص $D\%$

• 3 في ما يخص عدد الفترات الزمنية

$K\%$ هو خط التحرك السريع الذي يقيس القوة النسبية للموجودات، على غرار مؤشر RSI . أما $D\%$ ، فيُعد متوسطاً متحركاً لـ $K\%$ ، وبالتالي هو خط أبطأ بكثير.

إدخالات مختلفة. يتطلب ستوكاستك السريع إدخالين فقط هما عادةً 5 و 5. أما ستوكاستك البطيء فيتطلب إدخالاً ثالثاً يتمثل في عدد الفترات الزمنية المستخدمة في اتخاذ متوسط متحرك لخط $D\%$ السريع. خلافاً لمؤشر $MACD$ (الذي يستخدم عادةً أرقام 12 و 26 و 9) أو RSI (الذي يستخدم الرقم 14)، يضم ستوكاستك البطيء عدداً من الإعدادات الشائعة التي يمكن استخدامها. ويعتبر 5 و 3 و 8 إعداداً مستخدماً بصورة عامة. يعتمد المتداولون المحافظون الذين يريدون الحصول على عدد أقل من الإشارات، على إعداد 15، 3 و 3، فيما يعتبر 8، 5 و 5، 5، 3 إعدادين أكثر مخاطرة يناسبان المتداولين الذين يطلبون إشارات سريعة. ولا بدّ للمتداولين أن يأخذوا بعين الاعتبار مسألة الاختيار ما بين الدقة والسرعة عند تحديد الإدخالات التي سيستخدمونها في مؤشرات ستوكاستك.

كيفية استخدام ستوكاستك في مجال التداول بالعملات

• يمكن استخدامه مثل RSI لتحديد المستويات المبالغ في شرائها/بيعها

• يمكن استخدامه في موجة تقاطع، على غرار المتوسطات المتحركة

• يُستخدم للكشف عن حركات التباعد التي تشير إلى حالات ضعف محتملة في التوجّهات

التقاطع عندما يتجاوز $K\%$ خط $D\%$ (أي عندما يتجاوز الخط السريع الخط البطيء)، قد يعتبر ذلك فرصة للتداول. ويمكن للمتداولين الدخول في مراكز عبر اتباع اتجاه $K\%$.

المبالغة في الشراء/البيع. احرص على أن يكون خطأ $K\%$ و $D\%$ فوق/تحت مستويي 80/20. ففي حال كانا فوق 80، قد يشكل ذلك فرصة جيدة للبيع، بحيث يكون الموجود مبالغاً في شرائه وبحيث يُتوقع عودته إلى مستوى طبيعي.

ومن جهة أخرى، في حال تمّ تسجيل مستوى ما تحت 20، يكون السهم مبالغاً في بيعه - وبالتالي قد تشكل تلك فرصة ممتازة للشراء بما أن السوق المحددة تشير إلى عودة زوج من العملات إلى سعر أكثر "طبيعية".



التباعد. يمكن أيضاً استخدام الستوكاستك لتحديد متى لا يجدر الدخول في مركز. على سبيل المثال، إذا بدأ توجه ما قوياً، يمكن للمتداولين الاستعانة بالستوكاستك للتأكد من وجود تباعد بين حركة الموجود وخطوط ستوكاستك. وفي حال كان سعر زوج من العملات متجهاً نحو الأعلى بشكل حاد وسجل ارتفاعاً إضافياً، في حين لم يعرف الستوكاستك أي ارتفاع جديد مسجلاً حتى حركة تنازلية، فيعني ذلك أن التوجه ضعيف وأن الأسعار قد تعود وتنخفض. ويستطيع المتداولون المحافظون درس حركة التباعد باعتبارها تحذيراً يمنعهم من وضع تداول مبني على سرعة التحرك، فيما يمكن للمتداولين الذين يميلون أكثر إلى المخاطرة استخدام التباعد كإشارة للدخول في مركز قبل أن يبدأ التوجه باتخاذ حركة عكسية.



ستوكاستك بطيء مقابل ستوكاستك سريع. هناك نوعان من الستوكاستك : البطيء والسريع. يعرض هذان النوعان الخطين نفسيهما، ويمكن دراستهما بالطريقة نفسها في ما يخص حركات التقاطع والتباعد وحالات المبالغة في الشراء/البيع. أما الفرق هنا فيكمن في الشكل المسطح الذي يتخذه خط %D الخاص بالستوكاستك البطيء عبر اعتماد المتوسط المتحرك لخط %D الخاص بالستوكاستك السريع. وهذا ما يجعل الستوكاستك البطيء أكثر دقة على صعيد إشارات التداول التي يصدرها رغم كونه أكثر بطءاً في التفاعل مع تحرك سعر السوق.

(ب) ستوكاستك : عمليات تداول تاريخية

ستوكاستك : عمليات تداول تاريخية

فيما يلي مثالان عن كيفية استخدام الستوكاستك لتنفيذ عملية تداول مربحة. لاحظ كيف أن الرسم البياني الأول يستخدم حركات التقاطع كإشارات، فيما يعتمد الرسم الثاني على حركات التباعد. وبما أن التباعد لا يعتبر مؤشراً دقيقاً على صعيد التوقيت، يمكن استخدام القمة المزدوجة كنقطة دخول.





ج) ستوكاستك : سؤال اليوم

يعطي الستوكاستك إشارة بيع أو شراء عندما ينزل الخطان إلى ما تحت الـ 20 أو يرتفعان إلى ما فوق الـ 80. ما هو تفسيرك للتقاطع الحاصل في هذا الإطار؟ هل برأيك هو مهم بما يكفي لتنفيذ تداول على أساسه؟ تذكر ما يظهره المؤشر هنا عندما يتخطى الخط السريع الخط البطيء وادرس الستوكاستك في العدد اللازم من الرسوم البيانية قبل اتخاذ قرارك.

و) خطوط بولينجر

خطوط بولينجر

ما هي خطوط بولينجر؟

. إنه مؤشر محدد ممتاز يقيس الانحراف المعياري انطلاقاً من المتوسط المتحرك.

تم تطويره على يد جون بولينجر، ويشتمل على ثلاثة خطوط :

- . متوسط متحرك (غير موجود في معظم رزم رسوم البيانات)
- . خط أعلى مع انحرافين معياريين فوق المتوسط المتحرك
- . خط أدنى مع انحرافين معياريين تحت المتوسط المتحرك

تعتبر خطوط بولينجر مؤشراً يعمل بصورة ممتازة في الأسواق المحددة - أي أنها تعمل جيداً عندما لا تخضع السوق لاتجاه معين وعندما تتحرك بين حد أعلى (المقاومة) وحد أدنى (الدعم). وتعمل خطوط بولينجر على أساس أن سعر زوج من العملات يفترض أن يتحرك باتجاه معدل الوسطي، وبالتالي عندما ينحرف كثيراً - بمعدل انحرافين معياريين - لا بد له أن يعود إلى متوسطه المتحرك.

المعلومات: انحراف معياري من 2 ومتوسط متحرك من 20 (محفوف عادة).

كيفية استخدامه :

سوق محددة.

يعدّ التداول بواسطة خطوط بولينجر سهلاً للغاية في الأسواق المحددة : فيرتكز على البيع عند الخط الأعلى والشراء عند الخط الأسفل. لاحظ كيف أن الخطوط تكون أفقية تقريباً عندما تتحرك السوق في إطار محدد. وهنا تحديداً تتميز حركات التحول عند الخطوط بالفعالية الأكبر.



تجاوزات في معدل التذبذب.

عندما تتقلص خطوط بولينجر (أي أن عرضها يضيق)، هي تعكس تقلصاً في معدل التذبذب وتبيّن أن التداول يحصل ضمن نطاق أضيق. وعادةً يتقلص معدل التذبذب مباشرة قبل أن تسجل السوق تجاوزاً كبيراً في أسعارها. من هنا، يجب أن يرى المتداولون في تقلص التذبذب - الذي تعكسه خطوط بولينجر الضيقة - إشارة تدل إلى أن السوق قد توشك على تسجيل تجاوز مهم في أسعارها.



يظهر الرسم البياني الوارد أعلاه أن الخطوط قد تقلصت إلى حد كبير قبل حدوث تجاوز. وعندما تبدأ الخطوط بالتوسع نحو الخارج، يكون ذلك مؤشراً للدخول في اتجاه تحرك السعر. بالتالي وكما يظهره الرسم، إذا كان السعر عند أعلى الخطوط وبدأت هذه الأخيرة بالتوسع، تكون تلك إشارة للشراء.

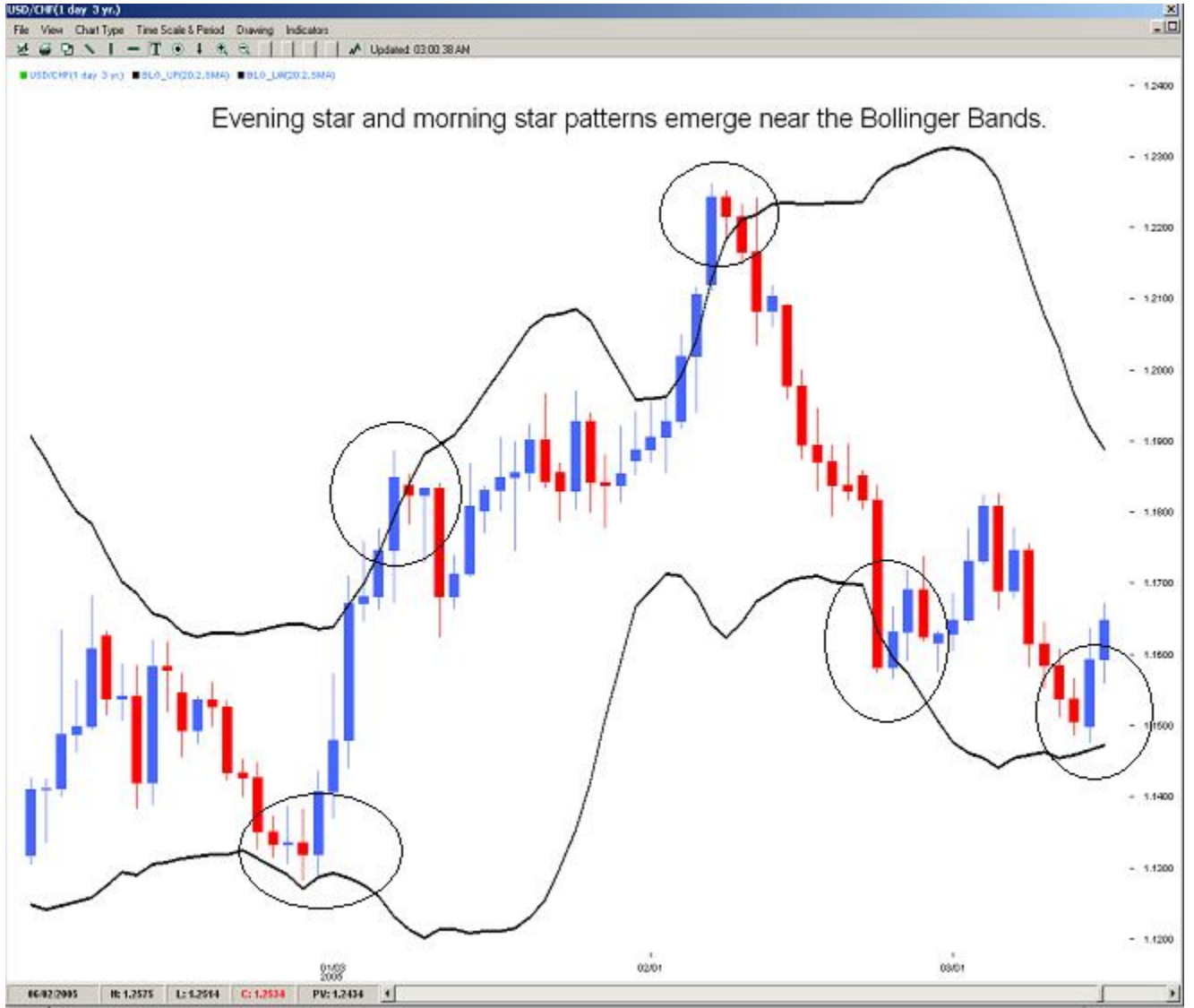
(ز) خطوط بولينجر : عمليات تداول تاريخية

خطوط بولينجر : عمليات تداول تاريخية

يظهر الرسمان البيانيان الواردان أدناه كيفية استخدام المتداولين لخطوط بولينجر للمشاركة بصورة فعالة في الأسواق المحددة. لاحظ أهمية الشموع اليابانية في التأكيد على تحول التوجه.



ما أن تصل الشموع اليابانية إلى المستوى الأدنى لخطوط بولينجر في هذا الرسم البياني اليومي للباوند البريطاني/الدولار الأمريكي حتى نرى مجدداً ارتفاعاً إلى الخط الأعلى. ونلاحظ أيضاً هبوطاً إلى الخط الأدنى، فيما يظهر مخطط نجمة الليل Evening Star عند الخط الأعلى.



ويظهر مخطط نجمة الصباح Morning Star عند الخط الأسفل من هذا الرسم البياني للدولار الأميركي/الفرنك السويسري قبل تقلب في حركة السعر مع عودة إلى الخط الأعلى. وفي وقت لاحق، مع وصول السعر إلى الخط الأعلى، تظهر نجمة المساء والمطرقة المعكوسة Reverse Hammer قبل تحرك باتجاه الخط الأسفل.

(ح) فرض حول خطوط بولينجر : وضع تداول

فرض : ضع تداولاً بالاستناد إلى مؤشر خطوط بولينجر. برّر هذا الخيار عبر إخبارنا عن تداولك وعن سبب وضعك إياه. يمكنك، حسب الرغبة، تحميل صورة عن الرسم الذي كنت تنتظر إليه، فهذا سيساعدك في التبرير للصف عن سبب وضعك التداول.