

آموزش رایگان اندیکاتور

stochastic

خان بورس

فهرست مطالب

اندیکاتور استوکاستیک (Stochastic) چیست؟

اندیکاتور استوکاستیک چه کاربردی دارد؟

تشخیص نواحی اشباع خرید و فروش

تقاطع دو خط مهم در اندیکاتور استوکاستیک

تشخیص واگرایی

افزودن اندیکاتور استوکاستیک به چارت متاتریدر

ترکیب اندیکاتور استوکاستیک با ابزارهای معاملاتی دیگر

استفاده از اندیکاتور RSI در کنار استوکاستیک

ترکیب استوکاستیک با سطوح پرایس اکشن

اندیکاتور استوکاستیک چه مزایا و معایبی دارد؟

سخن پایانی

چه می‌شد اگر اندیکاتور و ابزاری وجود داشت که مناسب‌ترین زمان و قیمت خرید یا فروش جفت‌ارزها را به ما اطلاع می‌داد؟

البته که چنین اندیکاتوری وجود ندارد و وجود تغییرات زیاد و نوسانات در بازار فارکس، مانع از آن می‌شود که بتوانیم به صورت صددرصدی در مورد سودها و زیان‌ها و اهداف قیمتی خود صحبت کنیم.

خوشبختانه وجود اندیکاتورها به ما کمک می‌کند تا نقاط عطف احتمالی قیمت را تشخیص داده و فرصت‌های معاملاتی را از دست ندهیم. پس به عنوان یک معامله‌گر و سرمایه‌گذار وظیفه شما این است که صحت و کیفیت سیگنال‌های ارائه شده توسط اندیکاتورها را تعیین نموده و تصمیم بگیرید که کدام سیگنال‌ها ممکن است برای استراتژی معاملاتی شما مناسب باشند. در این مقاله تصمیم داریم در مورد اندیکاتور استوکاستیک که یکی از محبوب‌ترین اندیکاتورها در بین معامله‌گران است صحبت کنیم.

نکات کلیدی این مقاله

- استوکاستیک یک اندیکاتور مومنتوم است که سرعت و جهت حرکت قیمت را بررسی می‌کند؛
- از این اندیکاتور برای تشخیص نواحی اشباع خرید و فروش استفاده می‌شود؛
- دو مولفه اصلی اندیکاتور استوکاستیک خطوط $K\%$ و $D\%$ هستند، که تقاطع آن‌ها می‌تواند به عنوان سیگنال خرید یا فروش در نظر گرفته شود؛
- یکی از مهم‌ترین کاربردهای اندیکاتور استوکاستیک در تشخیص واگرایی است؛
- احتمال ارائه سیگنال اشتباه در بازارهای دارای روند قوی وجود دارد که می‌توان آن را با ترکیب سایر ابزارهای تحلیل تکنیکال کاهش داد.

اندیکاتور استوکاستیک (Stochastic) چیست؟

اندیکاتور استوکاستیک یک ابزار تحلیل تکنیکال کاربردی و محبوب در بین معامله‌گران بازارهای مالی، به ویژه فارکس است که در سال ۱۹۵۰ توسط جورج لین توسعه یافت. استوکاستیک در دسته اندیکاتورهای مومنتوم قرار می‌گیرد و برای تشخیص و شناسایی سرعت و قدرت حرکت قیمت استفاده می‌شود.

همچنین استوکاستیک بین دو عدد ۰ و ۱۰۰ نوسان می‌کند و یک اسیلاتور به شمار می‌آید و با مقایسه قیمت بسته شدن یک جفت‌ارز با محدوده قیمتی آن در یک دوره زمانی مشخص (معمولاً ۱۴ روزه)، اطلاعات جالبی در مورد رفتار قیمت ارائه می‌دهد. معامله‌گران از این ابزار معاملاتی برای دریافت سیگنال‌های ورود و خروج بهره می‌برند.

اندیکاتور استوکاستیک چه کاربردی دارد؟

اندیکاتور استوکاستیک کاربردهای زیادی دارد و از ابزارهای اصلی در پلتفرم معاملاتی معامله‌گران به شمار می‌رود. تریدرها از این اندیکاتور به تنهایی و یا در کنار اندیکاتورهای دیگر، برای تایید ورود به معاملات خود استفاده می‌کنند. در این قسمت به مهم‌ترین موارد استفاده استوکاستیک اشاره می‌کنیم:

تشخیص نواحی اشباع خرید و فروش

نوسان اندیکاتور استوکاستیک بین اعداد صفر و صد، آن را به ابزاری مفید برای تشخیص شرایط اشباع خرید و فروش در بازار فارکس تبدیل کرده است. تنظیمات اندیکاتور برای محدوده‌های اشباع خرید و فروش، به صورت پیش‌فرض روی اعداد ۲۰ و ۸۰ قرار دارد. قرار گرفتن اندیکاتور در ناحیه زیر ۲۰ و بالای ۸۰ به ترتیب به معنای اشباع فروش و اشباع خرید است. با این حال، قرار گرفتن در این نواحی همیشه نشان‌دهنده تغییر روند نخواهد بود. روندهای بسیار قوی می‌توانند شرایط اشباع خرید و فروش را به مدت طولانی‌تر حفظ نمایند و لازم است معامله‌گران به تغییرات موجود در اندیکاتور استوکاستیک، به چشم سرخ‌هایی برای تصمیم‌گیری معاملات خود استفاده کرده و منتظر تغییر روند قیمت در آینده باشند.



تقاطع دو خط مهم در اندیکاتور استوکاستیک

به طور کلی اندیکاتور استوکاستیک از دو خط $K\%$ و $D\%$ تشکیل شده است. خط K که به آن fast stochastic می‌گویند، قیمت‌های یک جفت‌ارز را در یک دوره زمانی مشخص بررسی کرده و یک دامنه قیمتی معرفی می‌کند. خط D یا slow stochastic، میانگین متحرک ساده خط K است که تحت عنوان خط سیگنال نیز شناخته می‌شود.

تقاطع این دو خط، به عنوان سیگنال معاملاتی در نظر گرفته می‌شود و می‌تواند نشان‌دهنده تغییر روند باشد.

زمانی که خط K سیگنال (D) را از پایین و به سمت بالا قطع کند، سیگنال خرید صادر می‌شود و زمانی که آن را از بالا به سمت پایین قطع کرده و در واقع زیر خط سیگنال قرار بگیرد، سیگنال فروش صادر خواهد شد.



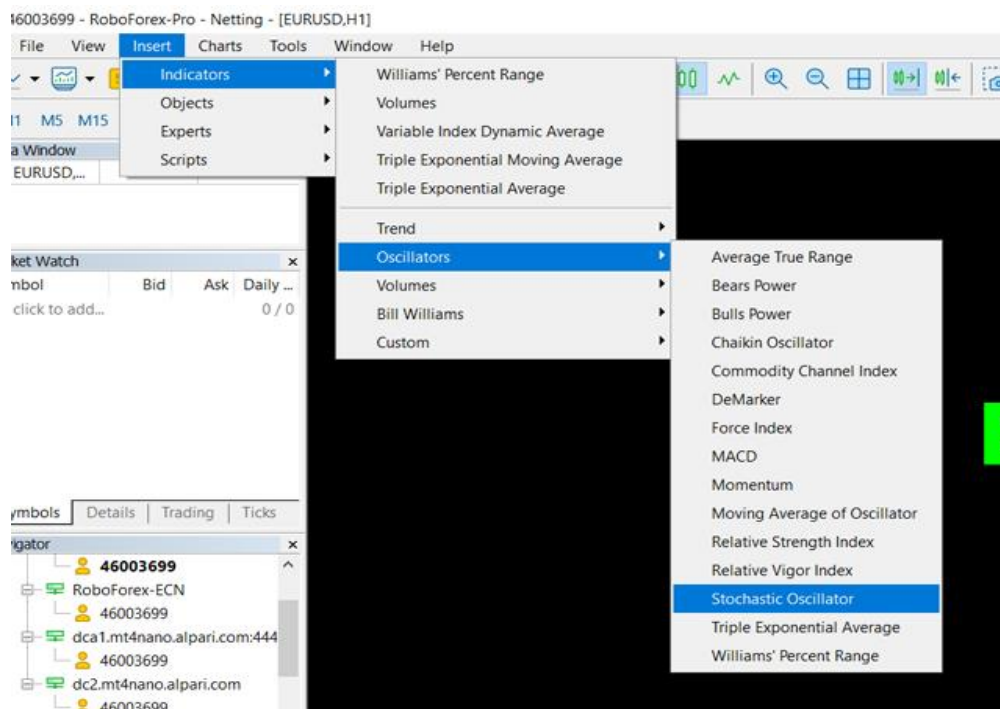
تشخیص واگرایی

یکی دیگر از کاربردهای جالب اندیکاتور استوکاستیک، استفاده از آن برای تشخیص واگرایی است. به این حالت که واگرایی بین اندیکاتور استوکاستیک و نمودار قیمت، نشانه تغییر روند خواهد بود. به عنوان مثال هنگامی که در روند نزولی، قیمت به پایین‌ترین سطح خود می‌رسد یا به اصطلاح کف پایین‌تر می‌زند اما اندیکاتور، کف بالاتری نسبت به کف قبلی تشکیل می‌دهد، ممکن است به این معنی باشد که قدرت فروش رو به اتمام بوده و یک روند صعودی در حال شکل‌گیری است.



افزودن اندیکاتور استوکاستیک به چارت متاتریدر

برای اینکه اندیکاتور استوکاستیک را به پلتفرم معاملاتی خود اضافه کنید، کافیست یک مسیر ساده را طی نمایید. برای این کار وارد صفحهٔ متاتریدر خود شده و به ترتیب روی Insert، Indicators، Oscillators و در نهایت روی Stochastic Indicator کلیک کنید تا اندیکاتور به چارت شما اضافه شود.



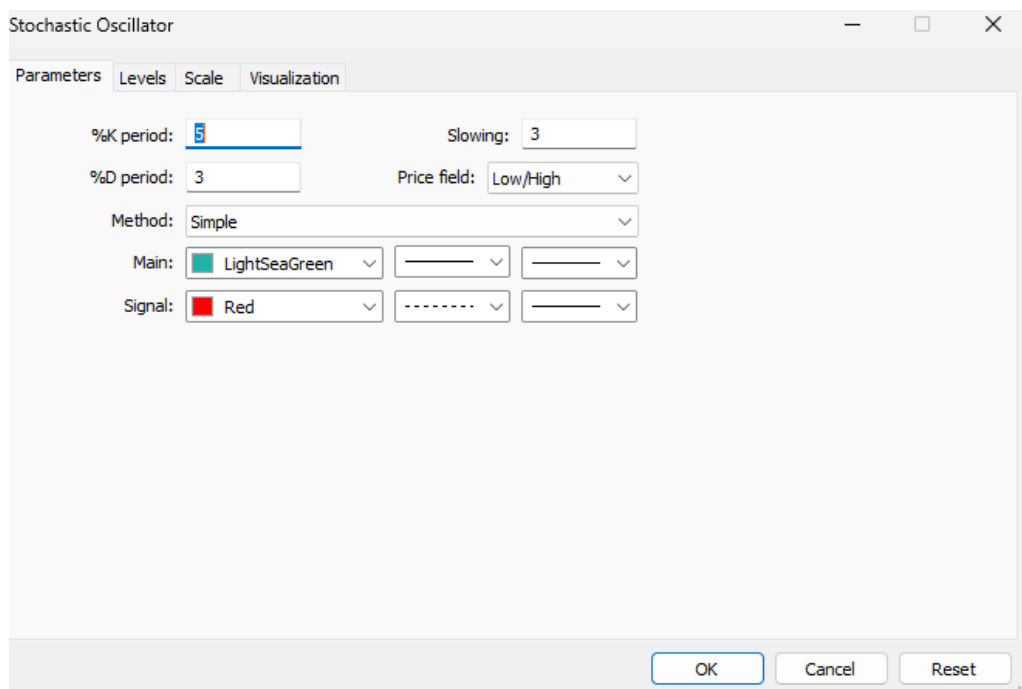
برای تنظیمات اندیکاتور استوکاستیک لازم است سه مولفه اصلی را در نظر بگیرید:

عدد K : نشان دهنده سرعت تغییرات قیمت است و معمولا به صورت پیش فرض روی عدد ۱۴ قرار دارد.

عدد D : میانگین متحرک خط K را نشان می دهد و معمولا روی عدد ۳ قرار دارد.

Slowing : معمولا روی عدد ۳ قرار دارد و باعث هموارسازی خط D می شود.

معامله گران می توانند با توجه به سبک معاملاتی خود و با کسب تجربه، این اعداد را تغییر دهند.



ترکیب اندیکاتور استوکاستیک با ابزارهای معاملاتی دیگر

همانطور که قبلا نیز اشاره شد، معامله گران می توانند از ترکیب اندیکاتور استوکاستیک با ابزارهای دیگر به نتایج مطلوب تری دست پیدا کنند.

هنگام ترکیب اندیکاتورها بهتر است از دو نوع اندیکاتور کاملا متفاوت استفاده کنیم تا نتیجه معامله بهتر شود.

مهم است که روش های مختلف را آزمایش کرده و ترکیبی را که با سبک معاملاتی شما سازگارتر است پیدا کنید. همچنین فرقی نمی کند با چه ابزار و روش هایی معامله می کنید، اصول مدیریت ریسک را در معاملات خود به کار ببندید و قبل از اجرای هر استراتژی در معاملات واقعی خود، بک تست بگیرید تا از صحت روش، اطمینان حاصل نمایید.

استفاده از اندیکاتور RSI در کنار استوکاستیک

برای مثال ترکیب اندیکاتور استوکاستیک با RSI، یک ابزار معاملاتی حساس تر و دقیق تر ارائه می‌دهد که عملکرد سریع تری دارد و در نتیجه سیگنال‌های معاملاتی بیشتری نیز ارائه می‌دهد. این دو ابزار معاملاتی در کنار هم درک جامع تری از وضعیت بازار و قدرت و جهت حرکت ارائه خواهند داد.

لازم به ذکر است که سیگنال‌های بیشتر همیشه هم مفید نخواهند بود و این موضوع می‌تواند باعث سردرگمی معامله‌گر و خطا شود. پیشنهاد می‌شود از ترکیب این دو اندیکاتور در بازارهای پرریسک و پرنوسان، با احتیاط استفاده نمایید تا ریسک معاملات خود را به کمترین مقدار ممکن برسانید.

زمانیکه اندیکاتور استوکاستیک سیگنال اشباع خرید یا فروش صادر می‌کند، با دریافت همزمان این سیگنال از اندیکاتور RSI، که صحت سیگنال استوکاستیک را تایید می‌کند، می‌توانیم با اطمینان خیلی بیشتری منتظر فرصت‌های معاملاتی خرید یا فروش باشیم.

ترکیب استوکاستیک با سطوح پرایس اکشن

ترکیب اندیکاتور استوکاستیک با سطوح پرایس اکشنی، مثل سطوح حمایت و مقاومت نتایج قابل توجهی را به همراه دارد. نواحی حمایت و مقاومت، سطوحی هستند که قیمت در گذشته به آن‌ها واکنش نشان داده و یا در عبور از این نواحی با مشکل مواجه شده است. با بررسی سیگنال اندیکاتور استوکاستیک در نزدیکی این سطوح، معامله‌گران قادر خواهند بود، بازگشت قیمت و یا شکست سطوح را تشخیص دهند.

برای مثال اگر استوکاستیک در ناحیه اشباع خرید باشد و قیمت به یک سطح مقاومت قوی نزدیک شود، این موضوع می‌تواند به عنوان تایید و نشان‌دهنده یک بازگشت روند و فرصتی برای باز کردن پوزیشن معاملاتی فروش باشد.

اندیکاتور استوکاستیک چه مزایا و معایبی دارد؟

شاید بتوان گفت بزرگترین مزیت استفاده از اندیکاتور استوکاستیک این است که می‌تواند به شما در پیش‌بینی احتمال تغییر روند قیمت کمک کند و زمان کافی برای تجزیه و تحلیل بازار و آماده شدن برای ورود به معامله را در اختیارتان قرار دهد. از طرفی این اندیکاتور، ساده و قابل درک بوده و برای همه معامله‌گران به خصوص تریدرهای مبتدی مناسب خواهد بود.

درست مثل تمام ابزارهای معاملاتی دیگر، اندیکاتور استوکاستیک نیز بدون ایراد نیست. بزرگترین عیب استوکاستیک این است که در بازارهای بدون روند و رنج، عملکرد ضعیفی دارد و می‌تواند سیگنال‌های ضعیف و نادرستی صادر نماید.

یک راه حل برای رفع این مشکل، در نظر گرفتن روند اصلی به عنوان یک فیلتر خواهد بود، به این صورت که سیگنال‌ها فقط زمانی معتبر هستند که در جهت روند اصلی صادر شوند.

همچنین می‌توانید از اندیکاتورهای دیگر در کنار استوکاستیک برای گرفتن تایید قوی تر استفاده نمایید.

سخن پایانی

در پایان لازم است بگوییم که اندیکاتورها، داده‌های قیمت و حجم معاملات را با توجه به فرمول‌های مشخص ارزیابی می‌کنند و خروجی را در قالب نمودار به شما ارائه می‌دهند. اندیکاتور استوکاستیک نیز یکی از ابزارهای معاملاتی محبوب در بین تریدرها است که مومنتوم قیمت را ارزیابی کرده و به ما در شناسایی روند بازار و سرعت و قدرت آن کمک می‌کند. در این نوشته از سایت **خان بورس** به معرفی این اندیکاتور جذاب پرداختیم و در مورد روش‌های معامله با استوکاستیک صحبت نمودیم. همچنین تعدادی از روش‌های استفاده از آن را در ترکیب با ابزارهای معاملاتی دیگر برشمردیم.

اگر شما نیز تجربه مثبتی از ترکیب استوکاستیک با اندیکاتورها و سبک‌های دیگر را دارید، خوشحال می‌شویم در بخش نظرات با ما به اشتراک بگذارید.

سوالات متداول در مورد اندیکاتور استوکاستیک

کدام اندیکاتورها بهترین ترکیب را با استوکاستیک دارند؟

در حالت کلی ترکیب این اندیکاتور با ابزارهای معاملاتی دیگر نتیجه مطلوب‌تری ارائه می‌دهد و ترکیب آن با اندیکاتور RSI نیز نتیجه بهینه‌تری خواهد داشت.

آیا سیگنال‌های معاملاتی استوکاستیک معتبر هستند؟

از آنجاییکه اندیکاتورها با داده‌های قدیمی بازار فارکس کار می‌کنند، احتمال خطا در سیگنال‌های آن‌ها وجود دارد. بهتر است معامله‌گران از اندیکاتورها برای تایید استراتژی‌های معاملاتی خود استفاده کنند و مدیریت ریسک و سرمایه را فراموش نکنند.

آیا قرار گرفتن اندیکاتور در ناحیه اشباع خرید، برای ورود به معامله فروش کافی است؟

اگر با صدور این سیگنال، همزمان خط K و D کراس دهند و خط K خط D را از بالا به سمت پایین قطع کرده و در زیر آن قرار بگیرد، سیگنال به نسبت معتبرتری صادر شده است.

آیا می‌توانم از اندیکاتور استوکاستیک در تریدینگ ویو استفاده کنم؟

بله. استوکاستیک یکی از **بهترین اندیکاتورهای تریدینگ ویو** است و معامله‌گران می‌توانند به سادگی از آن استفاده کنند.