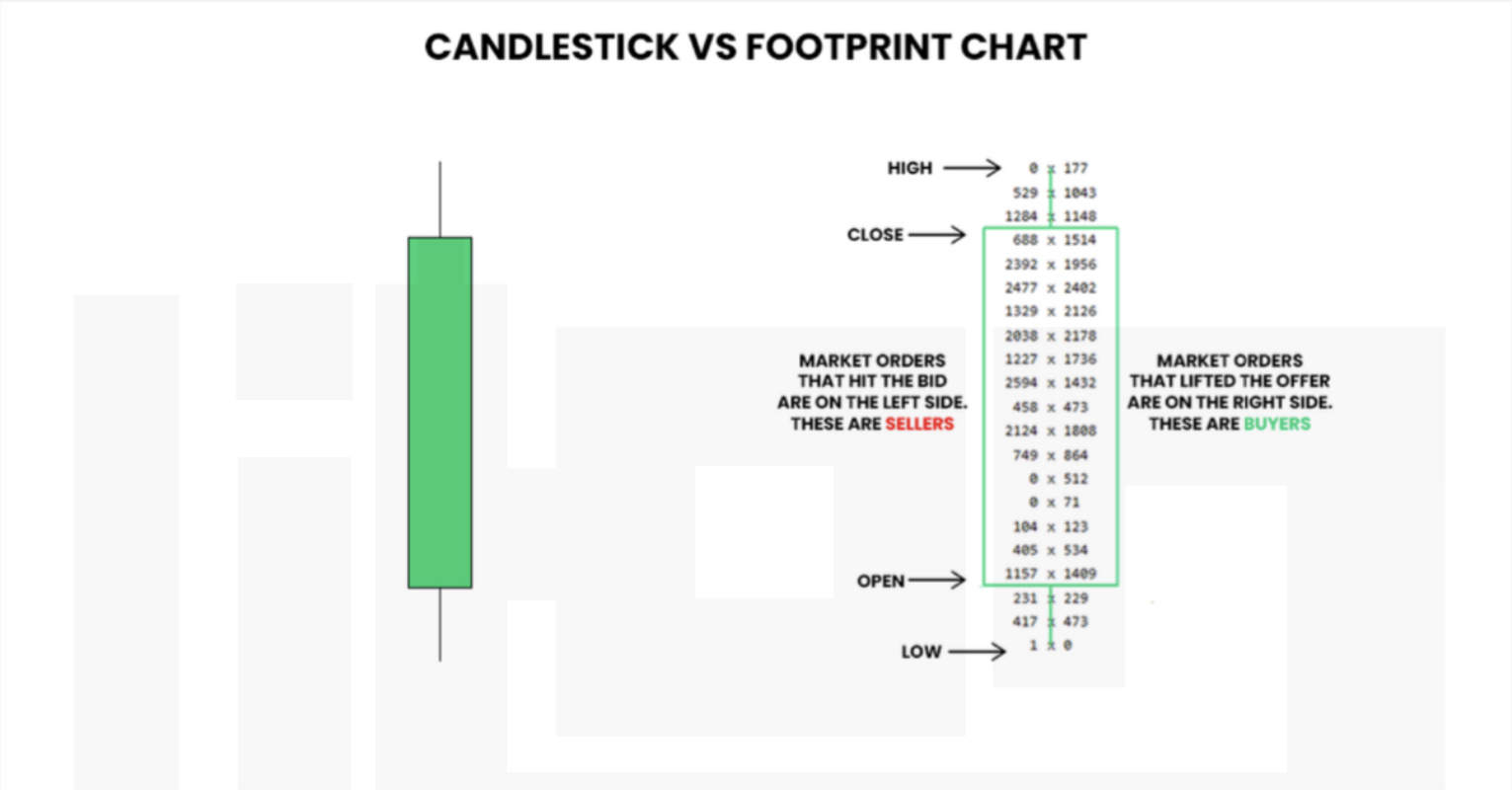
شرح أداة Footprint في التداول: دليل شامل

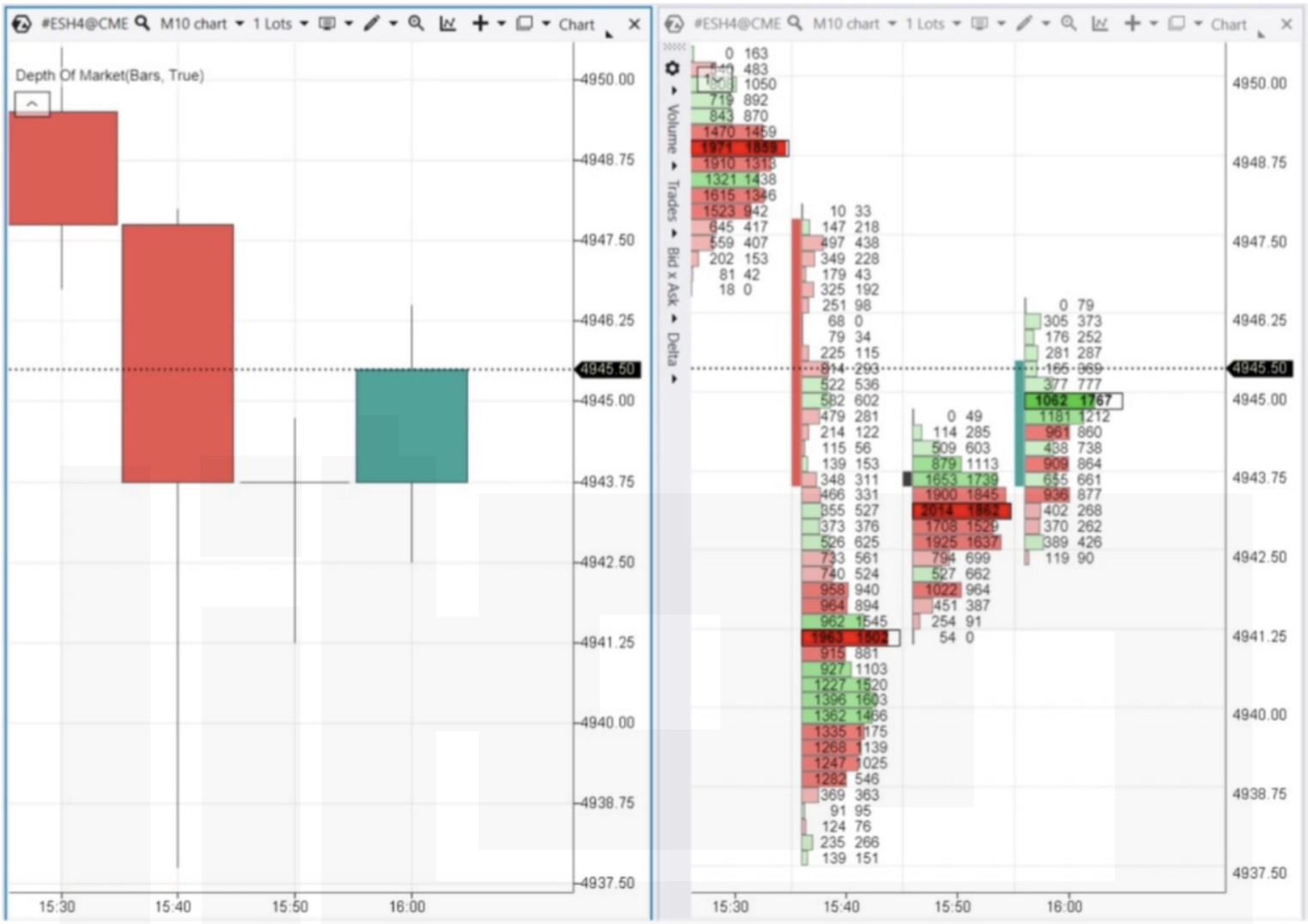
تعريف أداة الفوت برنت (Footprint)



أداة الفوت برنت (Footprint) هي نوع متقدم من الرسوم البيانية المستخدمة في تحليل الأسواق المالية، تعرض تفاصيل أحجام التداول عند كل مستوى سعري خلال فترة زمنية محددة . يُطلق عليها أحيانًا اسم الكلستر (Cluster)، حيث يمثل كل كلستر خلية تحتوي على معلومات التداول عند سعر معين. يتيح الفوت برنت للمتداولين "النظر داخل الشمعة" نفسها، وليس مجرد رؤية الأسعار الأربعة التقليدية (الافتتاح، الأعلى، الأدنى، الإغلاق) كما في الشموع اليابانية . أي أنه يكشف حجم التداول المنفذ (عدد العقود أو الأسهم المتداولة) عند كل سعر، مع تمييز صفقات الشراء وصفقات البيع المنفذة.

يمثل الفوت برنت صورة مفصّلة لتدفّق الأوامر في السوق. فهو التمثيل البياني لدفتر الأوامر (Order Book) (أوامر البيع والشراء) ، حيث يعرض حجم أوامر الشراء وأوامر البيع التي تم تنفيذها لحظيًا (كل نقطة سعرية) بدقة عالية . بشكل خاص، تظهر أداة الفوت برنت أوامر العدوانيين (Aggressive Orders) – الذين ينفذون أوامر سوق وتأخذ سيولتهم مباشرة – ولا تُظهر أوامر السلبيين (Passive Orders) الذين يضعون أوامر محددة بانتظار من ينفذها . والسبب في ذلك أن الأوامر العدوانية (أوامر السوق) هي التي تحرك السعر عبر ضرب الأوامر المقابلة، وبالتالي فهي التي تُسجل على مخطط الفوت برنت، في حين أن الأوامر السلبية لا تظهر إلا عندما يتم تنفيذها.

باختصار، يعطي مخطط الفوت برنت للمتداول صورة أشبه بأشعة X-Ray لحركة السوق ويكشف ماخلف الستار. بدلاً من الاكتفاء بمعرفة أين تحرك السعر من خلال شمعة خضراء او حمراء فقط، يمكن بواسطة الفوت برنت معرفة كيف تحرك السعر عند كل مستوى: هل كان بالحجم الكبير من المشترين أم البائعين؟ كم حجم التداول الذي حدث فعليًا عند كل سعر؟ هذه المعلومات تزوّد المتداول بأفضلية (Edge) واضحة على من يكتفي بالنظر إلى الرسوم التقليدية ، لأنها تساعده في فهم التوازنات والاختلالات بين العرض والطلب في الوقت الحقيقي واتخاذ قرارات مدروسة بناءً على ذلك.



الفرق بين الفوت برنت والشموع اليابانية

شكل 1: مخطط يوضح هيكل الشمعة اليابانية الصاعدة (يسار) والهابطة (يمين) – يعرض سعر الافتتاح والإغلاق وأعلى وأدنى سعر والظلال.

تعرض الشموع اليابانية المعلومات الأساسية لحركة السعر (أسعار الافتتاح، الإغلاق، الأعلى، الأدنى) خلال فترة زمنية، وقد يظهر معها حجم التداول الكلي للفترة. لكن مخطط الفوت برنت يذهب أبعد من ذلك بكثير، إذ يكشف تفاصيل ما يحدث داخل الشمعة نفسها. في الشمعة اليابانية التقليدية نرى فقط نتيجة المعركة بين المشترين والبائعين (من خلال شكل الشمعة ولونها)، أما في الفوت برنت فنرى سجل تلك المعركة بالتفصيل. يقول أحد المصادر أن الفوت برنت يمكن تشبيهه بالانتقال من صورة ضبابية إلى شاشة عالية الوضوح 4K – فهو يُبقيك مواكبًا لكل تطور في تداولات السوق .

بشكل عملي، يعرض مخطط الفوت برنت داخل كل شمعة أرقامًا على اليسار وأخرى على اليمين: تشير الأرقام على الجانب الأيسر إلى كميات العقود التي تم بيعها عند ذلك السعر (أي أوامر بيع نفذت على سعر الـBid)، فيما تشير الأرقام على الجانب الأيمن إلى كميات العقود التي تم شراؤها عند ذلك السعر (أي أوامر شراء نفذت على سعر الـAsk) . على سبيل المثال، إذا رأيت في خلية السعر "749 × 864" فهذا يعني أنه عند ذلك السعر تم بيع 749 عقدًا (ضُربت 749 وحدة على سعر الطلب/الشراء bid) وفي المقابل تم شراء 864 عقدًا (رفعت 864 وحدة على سعر العرض/البيع ask) . في المقابل، الشمعة اليابانية العادية لن تخبرك بشيء عن هذه التفاصيل الدقيقة الداخلية – فهي ستظهر فقط ربما أن السعر مر بهذا المستوى وربما تشكل ذيل علوي أو سفلي حسب حالة السعر، لكنها لن تفصح عن حجم المشترين مقابل البائعين ابدا.

وبذلك، يختلف الفوت برنت عن الشموع اليابانية في أنه ثنائي المحور للمعلومات: المحور السعري (الرأسي) يحتوي أيضًا على بعد إضافي هو حجم التداول موزعًا بين الشراء والبيع عند كل سعر. الشموع اليابانية تعرض نتيجة الصراع (أين أغلق السعر بالنسبة لافتتاحه وأعلى وأدنى)، أما الفوت برنت فيعرض تفاصيل الصراع ذاته. هذا يعني أنه أثناء تكوّن الشمعة، يمكن للمتداول بالفوت برنت رؤية أين يتركز الشراء القوي وأين يتركز البيع القوي لحظيًا، واتخاذ قرارات فورية على أساس تلك المعلومات بدلًا من الانتظار حتى تغلق الشمعة ومعرفة النتيجة متأخرًا.

لنضرب مثالًا بسيطًا للتوضيح: تخيّل شمعة مدتها 5 دقائق ارتفع سعرها من 100 إلى 105 ثم أغلق عند 104. الشمعة اليابانية سترينا جسمًا أخضر (صاعد) مع ظل علوي بسيط من 105 إلى 104. لكن مخطط الفوت برنت لن يكتفي بذلك – بل قد نرى مثلًا أنه عند الأسعار بين 103 و104 تم تداول كميات كبيرة على جانب الشراء مقارنة بالبيع، بينما عند 105 (أعلى سعر) ربما نجد أنه لم يتم إلا عدد قليل جدًا من الصفقات هناك. هذه التفاصيل تساعد في تفسير الحركة: ربما يعني ذلك أن الزخم الشرائي كان قويًا حتى 104 ثم توقف عند 105 لغياب مشترين جدد (وهو ما نسميه إجهاد الشراء أو مزاد منتهي). هذه استنتاجات لا يمكن الحصول عليها من الشمعة وحدها.

باختصار، الفرق الجوهري هو أن الشموع اليابانية تعرض أين تحرك السعر، بينما الفوت برنت يعرض كيف تحرك السعر. وهذا يجعل الفوت برنت أداة أقوى في يد المحلل لأنها تربط السعر بالحجم وتظهر توازنات القوى بين المشترين والبائعين عند كل مستوى سعري .

استخدام أداة الفوت برنت في التحليل اللحظي (Scalping)

يعتبر الفوت برنت أداة مفضلة لدى المتداولين اللحظيين وذوي الإطار الزمني القصير (مثل سكالبينج – المضاربة السريعة). والسبب في ذلك أنه يعبر بأفضل شكل عن حركة السوق في الفترات الزمنية القصيرة جدًا . في التداول اللحظي، كل تغير طفيف في دفة العرض والطلب مهم، ومخطط الفوت برنت يكشف هذه التغيرات فور حدوثها. تستطيع مثلًا أن تلاحظ على الفوت برنت ظهور حجم شراء مفاجئ وكبير عند مستوى معين قبل أن يتحرك السعر مباشرة، مما قد ينبهك إلى فرصة دخول خاطفة قبل أن يلاحظها الآخرون الذين يتابعون الرسوم التقليدية.

من خلال الفوت برنت، يمكن للمتداول اللحظي رؤية الاختلالات اللحظية بين قوى الشراء والبيع. فإذا رأى مثلًا اختلالًا إيجابيًا (أي أن حجمًا كبيرًا من عمليات الشراء ضربت أسعار العرض دون أن يقابلها بيع مماثل) فإن ذلك قد يعني قوة شرائية لحظية يمكن استغلالها للدخول في صفقة شراء سريعة. وعلى العكس، إذا رأى اختلالًا سلبيًا كبيرًا (بيع مكثف مقابل شراء ضئيل) فقد تكون إشارة على ضغط بيعي سريع. هذه القراءة في الوقت الحقيقي تمنح أفضلية خاصة للسكالبّر الذي يبحث عن نقاط دخول وخروج سريعة بأقل مخاطرة.

ميزة أخرى مهمة للسكالبينج هي أن الفوت برنت يسمح للمتداول باتخاذ القرار أثناء تكوّن الشمعة وليس بعدها . في سكالبينج، التأخير قد يعني ضياع الفرصة، لذا فمعرفة من يسيطر – المشترون أم البائعون – في هذه اللحظة قد يكون الفارق بين صفقة ناجحة وفاشلة. باستخدام الفوت برنت، يمكن مراقبة تغير دلتا الحجم لحظيًا (صافي شراء – بيع)؛ فإذا بدأنا نرى تغير الدلتا إلى الإيجابية بشكل متسارع فهذا دليل دخول مشترين أقوياء الآن، وقد يكون قرار الشراء اللحظي مبررًا قبل أن ترتفع الأسعار أكثر. بالمقابل، الشموع اليابانية على نفس الإطار قد لا تعطي أي إشارة سوى بعد إغلاق الشمعة حيث يكون التحرك قد حدث بالفعل.

من المهم الإشارة إلى أن قراءة الفوت برنت ليست سهلة تمامًا وتتطلب ممارسة. في التداول السريع، سيكون على المتداول اتخاذ قرارات خاطفة بناءً على أرقام تتدفق أمامه، لذلك التدرّب المسبق واكتساب الخبرة أمر ضروري. يوصي الخبراء بأن يبدأ المتداول بدراسة مخططات الفوت برنت على بيانات تاريخية (أيام سابقة) لفهم الأنماط التي تسبق التحركات المهمة، ومن ثم استخدام محاكيات أو خاصية الـReplay إن وجدت على المنصة لإتقان قراءة تدفق الأوامر كما لو كان في الوقت الحقيقي . بهذه الطريقة، عندما ينتقل المتداول إلى السكالبينج الحي باستخدام الفوت برنت، يكون أكثر استعدادًا وسرعة في الاستجابة للإشارات اللحظية التي تظهر أمامه.

وخلاصة القول، الفوت برنت مناسب جدًا للتحليل اللحظي والسريع لأنه يكشف نبض السوق الداخلي في كل لحظة. المتداول السريع يستطيع بفضله تحديد مستويات الدعم والمقاومة اللحظية (من خلال أماكن تركز الحجم أو الـPOC لكل شمعة) وتحديد ما إذا كان الاختراق حقيقيًا أم مجرد اختراق وهمي بناءً على أحجام التداول المصاحبة له. هذا النوع من المعلومات يمكن أن يحسن دقة وفعالية استراتيجيات السكالبينج بشكل ملحوظ .

المفاهيم الأساسية في الفوت برنت: Bid × Ask، POC، Delta

لفهم قراءة الفوت برنت بشكل صحيح، هناك مصطلحات أساسية يجب الإلمام بها، وأهمها: الـBid والـAsk لكل سعر، نقطة التحكم POC، والدلتا Delta.

- أسعار الـBid والـAsk: في عمق السوق، الـBid هو سعر الطلب (الذي يضعه المشترون للشراء) والـAsk هو سعر العرض (الذي يطلبه الباعة للبيع). في مخطط الفوت برنت، لكل مستوى سعري داخل الشمعة يظهر رقمان بصورة Bid × Ask. الرقم على اليسار يمثل حجم التداول الذي تم عند ذلك السعر على الجانب البيعي (أي عدد العقود التي تم بيعها عند سعر الـBid لهذا المستوى)، والرقم على اليمين يمثل حجم التداول الذي تم على الجانب الشرائي (عدد العقود التي تم شراؤها عند سعر الـAsk) .

ملاحظة:

في دورة البنكرز نتعمق بشكل تفصيلي لاستراتيجيات حميدان الحصرية والخاصة للتداول باستخدام الفوت برنت لم يتم ذكرها هنا.

تواصل معانا لمعلومات اكثر عن دورة البنكرز.

https://wa.me/message/LTTEE2YWODKTF1

HAMAIDAN FX