

تحلیل و معامله‌گری در بازار ارز

اصول تحلیل‌گری بازارهای بین‌المللی (ارز، سهام، کالا و ...)

توضیح ساده و روان مفاهیم ابتدایی و کلان بازار

بررسی مفاهیم و توضیح کاربردی تحلیل تکنیکال

بررسی مفاهیم و توضیح کاربردی تحلیل فاندامنتال

بررسی مفاهیم روانشناسی، مدیریت ریسک و پول

معرفی و نحوه استفاده از استراتژی‌های آزمایش‌شده و موفق

نحوه انتخاب کارگزار مناسب و توضیح کاربردی متداول‌ترین نرم‌افزار معاملاتی

نحوه بکارگیری ابزار معامله (اندیکاتورها، نظریه‌ها، عوامل اقتصادی و سیاسی)

بیان نکات مهم و پنهان در تحلیل‌گری بازار توسط اساتید و معامله‌گران موفق بین‌المللی

مؤلف: امیر آژیر

نشر چالش

سرشناسه	:	اُزیر، امیر، ۱۳۵۹-
عنوان و نام پدیدآورنده	:	تحلیل و معامله‌گری در بازار ارز/ مؤلف امیر اُزیر.
مشخصات نشر	:	تهران: چالش، ۱۳۸۹.
مشخصات ظاهری	:	۴۰۰ص:جدول، نمودار.
شابک	:	۹۷۸-۹۶۴-۲۵۲۲-۳۳-۰
وضعیت فهرست‌نویسی	:	فیبا
یادداشت	:	چاپ قبلی: امیر اُزیر، ۱۳۸۷ (۴۰۰ص.).
یادداشت	:	دوم.
موضوع	:	ارز - الگوهای اقتصادسنجی
موضوع	:	بازار ارز
رده‌بندی کنگره	:	۳۱۳۸۹ ت ۳/۴ HG۳۸۵۲
رده‌بندی دیویی	:	۳۳۲/۴۵۶
شماره کتاب‌شناسی ملی	:	۲۰۹۶۸۹۷



www.chalesh.ir

تحلیل و معامله‌گری در بازار ارز

مؤلف: مهندس امیر اُزیر

ویراستار: صدیقه علیمردانی

طرح روی جلد: محسن غلامی

لیتوگرافی، چاپ و صحافی: فرشویه

چاپ پنجم: تابستان ۱۴۰۱

شمارگان: ۵۰۰

شابک: ۹۷۸-۹۶۴-۲۵۲۲-۳۳-۰

نشر چالش: تهران، خ انقلاب، خ ۱۲ فروردین، خ وحید نظری، پلاک ۱۰۰

فروشگاه چالش: تهران، خ انقلاب، خ ۱۲ فروردین، خ وحید نظری، پلاک ۱۰۲

تلفن: ۶۶۴۱۴۶۱۰

تلفن: ۶۶۴۱۷۴۱۵

قیمت: ۲۶۰۰۰۰ تومان

کلیه حقوق این اثر برای ناشر محفوظ است. هرگونه تکثیر و تولید مجدد آن
کلاً و جزأً بصورت چاپی، کپی، انتشار الکترونیک این اثر بدون اجازه کتبی ناشر
ممنوع و موجب پیگرد قانونی است.

www.ketab.ir

فهرست مطالب

۲۱.....	مقدمه
۲۳.....	فصل اول (مفاهیم مقدماتی)
۵۹.....	فصل دوم (کارگزار و نرم افزار)
۸۵.....	فصل سوم (تحلیل تکنیکال)
۲۵۵.....	فصل چهارم (تحلیل بنیادین)
۳۳۵.....	فصل پنجم (روانشناسی و مدیریت)
۳۷۱.....	لغت نامه

فصل اول (مفاهیم مقدماتی)

۲۵	شناخت انواع بازارهای مالی
۳۱	فارکس چیست ؟
۳۳	تاریخچه بازار فارکس
۳۵	چرا نرخ ارزها مدام تغییر می کنند ؟
۳۵	مکان مرکزی بازار فارکس کجاست ؟
۳۶	زمان شروع به کار و پایان کار در بازار فارکس چه وقتی است ؟
۳۸	فعالترین جفت ارزهای بازار
۳۹	جفت ارزهای اصلی
۴۰	جفت ارزهای غیر اصلی
۴۰	علل اصلی تبادلات پولی در این بازار چیست ؟
۴۱	چگونه اشخاص می توانند در این بازار معامله کنند ؟
۴۲	آشنایی با برخی اصطلاحات پر کاربرد معاملاتی
۴۳	برخی از مزایای معامله در بازار تبادلات ارزی (فارکس) !
۵۲	انواع سفارشات معاملاتی در بازار فارکس
۵۲	سفارشات آنی (Market Orders)
۵۲	سفارشات برای اجرای در آینده (Entry Orders)
۵۳	سفارشات بر مبنای برگشت روند فعلی
۵۳	خرید پایین تر از قیمت فعلی (Buy Limit)
۵۳	فروش بالاتر از قیمت فعلی (Sell Limit)
۵۴	سفارشات بر مبنای ادامه روند فعلی
۵۴	خرید بالاتر از قیمت فعلی (Buy Stop)
۵۴	فروش پایین تر از قیمت فعلی (Sell Stop)
۵۵	حد سود (Take/Profit = Limit)

۵۵	حد ضرر (Stop/Loss = Stop).....
۵۶	حد ضرر دنبال کننده (متحرک) (Trailing Stop).....
۵۷	سفارش هجینگ (Hedging).....
۵۸	سفارشات O.C.O (One Order Cancel the Other).....

فصل دوم (کارگزار و نرم افزار)

۶۱	کارگزار (Broker).....
۶۵	نرم افزارهای معاملاتی (Platform).....
۶۵	معرفی نرم افزار معاملاتی (MetaTrader).....
۷۰	توضیح نوار منو.....
۷۲	نوار ابزار Standard.....
۷۳	نوار ابزار Charts.....
۷۳	نوار ابزار Line Studies.....
۷۴	نوار ابزار Periodicity.....
۷۴	پنجره Market Watch.....
۷۶	پنجره Navigator.....
۷۷	پنجره Terminal.....
۸۰	انجام معامله در نرم افزار متاتریدر.....
۸۴	کلیدهای میانبر.....

فصل سوم (تحلیل تکنیکال)

۸۷	تجزیه و تحلیل فنی.....
۸۸	اساس تحلیل تکنیکال.....
۹۰	انواع نمودار.....
۹۰	نمودار خطی (Line Chart).....
۹۱	نمودار میله ای (بار) (Bar Chart).....

۹۲	نمودار شمعی (Candlestick Chart).....
۹۳	مفهوم تایم فریم (چار چوب زمانی)
۹۵	شناسایی کف ، سقف ، دره و قله در نمودار قیمت
۹۶	روندها (Trends).....
۹۷	روند بلند مدت (Long Term Trend).....
۹۷	روند میان مدت (Medium Term Trend).....
۹۷	روند کوتاه مدت (Short Term Trend).....
۹۸	حرکت رو به بالا (صعودی) (Up Trend).....
۹۸	حرکت جانبی (ساید) (Side Trend).....
۹۸	حرکت رو به پایین (نزولی) (Down Trend).....
۹۹	نحوه رسم و بکارگیری خطوط روند
۱۰۰	کانال قیمت (Channel).....
۱۰۱	نحوه رسم یک کانال قیمت
۱۰۱	سطوح حمایت و مقاومت (Support , Resistance).....
۱۰۱	سطح حمایت (Support).....
۱۰۲	سطح مقاومت (Resistance).....
۱۰۴	پشیمانی معامله گران
۱۰۵	تبدیل سطوح مقاومت و حمایت بیکدیگر
۱۰۸	الگوهای عمومی در نمودار قیمت
۱۰۸	الگوهای برگشتی
۱۰۹	الگوی دو قله (Double Tops).....
۱۱۱	الگوی دو دره (Double Bottoms).....
۱۱۱	الگوی سر و شانه (Head & Shoulders).....
۱۱۳	الگوهای ادامه دهنده
۱۱۴	الگوهای مثلث
۱۱۶	الگوی مستطیل شکل
۱۱۸	اندیکاتورهای تکنیکال
۱۱۸	اندیکاتورها براساس نوع عملکرد
۱۱۹	مقایسه اندیکاتورهای روند نما و اندیکاتورهای نوسانگر

۱۱۹	اندیکاتورها براساس سرعت عکس العمل به تغییرات قیمت
۱۲۰	میانگین متحرک (متوسط حرکتی) Moving Average (MA)
۱۲۱	میانگین متحرک ساده (SMA)
۱۲۲	میانگین متحرک نمائی (EMA)
۱۲۳	میانگین متحرک ملایم (SMMA)
۱۲۴	میانگین متحرک موزون خطی (LWMA)
۱۲۶	موارد کاربرد میانگین متحرک
۱۲۶	شناسایی روند
۱۲۷	شناسایی سطوح Support و Resistance قیمت
۱۲۸	شناسایی نقاط Breakout
۱۳۰	شناسایی تغییرات جنبش قیمت (Momentum)
۱۳۱	شناسایی فرصت‌های معامله در میانگین متحرک
۱۳۲	میانگین متحرک‌های پیشنهادی
۱۳۵	اندیکاتور سهمی وار (سار) Parabolic (SAR)
۱۳۵	سیگنال‌های خرید و فروش در SAR
۱۳۶	استفاده از SAR برای تعیین حد ضرر معاملات
۱۳۷	شاخص کانال کالا Commodity Channel Index (CCI)
۱۳۸	خط واگرایی Divergence Line
۱۳۸	واگرایی رو به بالا (مثبت) Bullish Divergence
۱۳۸	واگرایی رو به پایین (منفی) Bearish Divergence
۱۳۹	سیگنال‌های خرید و فروش در CCI
۱۴۱	شاخص قدرت نسبی Relative Strength Index (RSI)
۱۴۲	شرایط اشباع از خرید یا فروش در RSI
۱۴۳	سیگنال‌های خرید و فروش در RSI
۱۴۶	نوسانگر تصادفی (احتمالی) Stochastic Oscillator (S.O)
۱۴۷	سیگنال‌های خرید و فروش در Stochastic Oscillator
۱۴۹	میانگین متحرک همگرا/ واگرا (MACD)
۱۴۹	سیگنال‌های خرید و فروش در MACD
۱۵۲	باند‌های بولینگر Bollinger Bands (B.B)

۱۵۳	نحوه استفاده از باندهای بولینگر
۱۵۵	شاخص حرکت جهت دار میانگین ADX
۱۵۶	نحوه محاسبه ADX
۱۵۷	سیگنالهای خرید و فروش در ADX
۱۵۹	شاخص جریان نقدی Money Flow Index (MFI)
۱۵۹	شیوه های استفاده از این اندیکاتور
۱۶۱	حجم متعادل On Balance Volume (OBV)
۱۶۲	نحوه استفاده از اندیکاتور OBV در معاملات
۱۶۳	اندیکاتور (میزان جنبش آنی) Momentum
۱۶۴	کاربرد اندیکاتور جنبش آنی Momentum
۱۶۴	سیگنالهای معاملاتی با استفاده از Momentum
۱۶۸	ویلیام دلبرت گن William Delbert (W.D) Gann
۱۷۲	خط گن (Gann Line)
۱۷۳	بادبزن گن (Gann Fan)
۱۷۵	شبکه های گن (Gann Grid)
۱۷۵	فیبوناچی Fibonacci
۱۷۹	رسم Fibonacci Retracements
۱۸۰	رسم Fibonacci Time Zones
۱۸۱	رسم Fibonacci Fan
۱۸۲	رسم Fibonacci Arcs
۱۸۳	رسم Fibonacci Expansion
۱۸۶	چنگک یا کانال اندروز Andrews Pitchfork
۱۸۶	قوانین استفاده از خطوط میانه
۱۸۸	قواعد معامله براساس چنگک و خطوط شلیک اندروز
۱۸۹	موج های الیوت Elliot Waves
۱۸۹	اصول اولیه امواج الیوت
۱۹۴	عملکرد موج
۱۹۴	موج های حرکت
۱۹۴	گسترش (توسعه)

مقدمه

جهان تا به امروز شاهد تحولات گوناگونی در تمامی عرصه ها بوده است که این تغییر و تحولات نتیجه مستقیم تلاشها، فعالیتهای و اقدامات عملی بسیاری از انسانهای بزرگ در طول تاریخ می باشد. انسانهایی که کوشیده اند تا کیفیت زندگی بشر را بهبود بخشند. یکی از مهمترین این تحولات ایجاد بازارهای مالی بین المللی است که امروزه تقریباً در دسترس همگان قرار دارد. البته این امر محقق نمی شد مگر با پیشرفت فناوری ارتباطات (تلفن، فکس، اینترنت و ...) و نیز ایده های فراوانی در اکثر علوم که باعث شدند کیفیت و کمیت در عرصه اقتصاد جهانی نیز در همان راستا ارتقاء یابد.

امروزه و در پی پیشرفت علوم و فناوری ارتباطی معامله گر حتی قادر است بدون حضور در محل معامله و یا حتی مشاهده کالای مورد داد و ستد، محصولات مالی بسیاری از جمله ارزهای خارجی، کالاهایی همچون طلا و نفت و حتی سهام شرکتهای خارجی را از طریق رایانه شخصی خود معامله نموده و از مزیت های فراوان این بازارها حداکثر بهره را ببرد. از مزیت های این نوع معاملات می توان به عدم لزوم به حضور در محلی مشخص (امکان معامله حتی از منزل)، رهایی از قید زمان محدود معاملات و قوانین دست و پا گیر و امکان اخذ اعتبار معاملاتی بالا اشاره نمود. علاوه بر این، پیشرفت علوم مالی و ارتباطی نه تنها شکل و ظاهر بازارهای سنتی را تغییر داده است بلکه در بسیاری از موارد با ایجاد ابزارهای معاملاتی متنوع، مفاهیم کلاسیک معامله گری را نیز دستخوش تغییرات مهمی کرده است. البته این تغییرات آنقدر وسیع می باشد که بطور کامل نمی توان آنها در قالب یک کتاب بیان کرد. بهرحال تلاش ما در تدوین این کتاب بر این بوده است تا بتوانیم بازارهای مالی بین المللی و مخصوصاً بزرگترین و جذابترین بازار مالی که همانا "بازار تبادلات ارزی بین المللی" می باشد را به خوانندگان گرامی معرفی نموده و تا حد امکان راه یادگیری علم یا بهتر می توان گفت هنر تحلیل و پیش بینی بازار و در پی آن انجام معاملات سود ده را برای همگان هموار نماییم.

در این کتاب تلاش گردیده تا مبانی ابتدایی و همچنین مفاهیم کلی این بازار، روشهای دسترسی به بازار، انجام معامله در این بازار، انواع روشهای تحلیل بازار و نیز مسایل مربوط به روانشناسی و مدیریت ریسک و پول را به صورت ساده و روان بیان کنیم.