

101

نکته در بازارهای مالی

محمدجواد حسینی

دانشجوی دکترا اقتصاد و فعال بازار سرمایه

سرشناسه حسینی، محمدجواد، ۱۳۶۸.
 عنوان و پدیدآور ۱۰۱ نکته در بازارهای مالی / تالیف: محمدجواد حسینی.
 مشخصات نشر تهران، نور علم، ۱۴۰۳.
 مشخصات ظاهری ۱۱۸ ص.
 شابک ۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۶۶۰-۲
 موضوع بورس — Stock exchanges
 سرمایه‌گذاری — Investments
 موفقیت در کسب و کار — Success in business
 شناسه افزوده سیف‌زاده، حسین، ۱۳۷۹، ویراستار.
 رده‌بندی کنگره HG ۴۵۵۱
 رده‌بندی دیویی ۳۳۲/۶۴۲

نشر نور علم و بخش قلم سینا: تهران - انقلاب - خ ۱۲ فروردین - پلاک ۲۸۶ - تلفن: ۶۶۹۵۷۰۳۱ ۶۶۴۰۵۸۸۰

و ۶۶۹۵۷۱۲۰ و ۹۱۲۳۴۶۲۸۱۱

وبسایت <https://www.modiranketab.ir> پیج اینستاگرام - @modiranketab

۱۰۱ نکته در بازارهای مالی

تالیف: محمدجواد حسینی

ویراستار و طراح جلد: حسین سیف‌زاده

ناشر: نور علم

شمارگان: ۵۰۰ جلد

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۶۶۰-۲

نوبت چاپ: اول ۱۴۰۳

چاپ و صحافی: الغدير

قیمت: ۱۳۵۰۰۰ تومان

در صورت عدم دسترسی به کتابهای این انتشارات، از طریق تماس با ۰۹۱۲۳۳۳۴۲۲۹ کتابها با پست به تمام نقاط ایران ارسال می‌شود.

تحلیل تکنیکال	۷
۱. نظریه جریان نقدینگی (Money Flow Theory)	۸
۲. تحلیل دوره‌ای (Seasonal Analysis)	۱۰
۳. همبستگی شاخص‌ها (Indicator Correlation)	۱۲
۴. تشخیص و تحلیل نقاط کلیدی با استفاده از توزیع حجم معاملات (Volume Profile)	۱۴
۵. استفاده از مفهوم کشیدگی قیمت (Price Stretching)	۱۵
۶. نسبت‌های غیرمعمول فیبوناچی (Uncommon Fibonacci Ratios)	۱۸
۸. تشخیص روندهای کاذب با استفاده از پارابولیک سار (Parabolic SAR)	۱۹
۸. استفاده از الگوهای حجمی در شناسایی دست‌کاری‌های بازار (Volume Patterns in Market Manipulation Detection)	۲۰
۹. تحلیل نسبت بازده به ریسک (Risk-Reward Analysis) در معاملات الگوریتمی	۲۲
۱۰. تحلیل با اندیکاتور انحراف معیار (Standard Deviation Indicator)	۲۴
۱۱. تشخیص نقاط اوج و کف با استفاده از ROC (Rate of Change)	۲۶
۱۳. استفاده از باندهای انحراف دوتایی (Double Bollinger Bands)	۲۸
۱۳. تشخیص جریان نقدینگی با استفاده از شاخص جریان حجمی (VWAP)	۳۰
۱۴. تحلیل قدرت روند با استفاده از ترکیبی ATR (Composite ATR)	۳۱
۱۵. استفاده از شاخص کانال کالا (CCI) برای تشخیص نقاط ورود	۳۳
۱۶. تحلیل هم‌زمان با استفاده از هیستوگرام MACD و واگرایی (MACD Histogram & Divergence)	۳۵
۱۷. تعیین نقاط کلیدی با استفاده از تحلیل گان (Gann Analysis)	۳۶
۱۸. استفاده از فیلترهای ترکیبی در تحلیل حجم (Volume Filters)	۳۸
۱۹. تشخیص شکاف‌های قیمتی (Price Gaps) و تاثیر آنها بر روند	۴۰
۲۰. استراتژی‌های معاملاتی بر پایه الگوریتم‌های یادگیری ماشین (Machine Learning Algorithms)	۴۲
تحلیل بنیادی	۴۵
فلسفه اصلی تحلیل بنیادی	۴۵
عوامل مؤثر در تحلیل بنیادی	۴۵
ابزارها و معیارهای اصلی در تحلیل بنیادی	۴۶
کاربرد تحلیل بنیادی	۴۶
نقاط قوت و ضعف تحلیل بنیادی	۴۶
۲۱. تاثیر سیاست‌های پولی فدرال رزرو (Federal Reserve Monetary Policy)	۴۷
۲۲. اثر داده‌های اشتغال (Employment Data) بر دلار	۴۸
۲۳. تاثیر شاخص تورم CPI و PPI بر دلار	۴۹
۲۴. تاثیر تراز تجاری (Trade Balance) و کسری حساب جاری (Current Account Deficit)	۵۰
۲۵. تاثیر سیاست‌های مالی دولت ایالات متحده (Fiscal Policy)	۵۱
۲۶. تاثیر بازده اوراق قرضه خزانه‌داری (Treasury Bond Yields) بر دلار	۵۲

۵۳	تأثیر روابط تجاری و تعرفه‌ها (Trade Relations & Tariffs) بر دلار
۵۴	تأثیر ریسک‌های ژئوپلیتیک (Geopolitical Risks) بر ارزش دلار
۵۵	تأثیر نرخ رشد اقتصادی و تولید ناخالص داخلی (GDP)
۵۶	تأثیر شاخص هزینه‌های مصرفی شخصی (PCE Index) بر ارزش دلار
۵۷	تأثیر سیاست‌های تجاری بین‌المللی (International Trade Policies) بر دلار
۵۸	تأثیر شاخص‌های اقتصادی منطقه‌ای و بین‌المللی (Global Economic Indicators) بر دلار
۵۸	تأثیر تراز مالی دولت ایالات متحده (Federal Budget Balance)
۵۹	تأثیر شاخص‌های اعتماد مصرف‌کننده (Consumer Confidence Index - CCI)
۵۹	تأثیر نرخ‌های بهره جهانی (Global Interest Rates) بر دلار
۶۰	تأثیر شاخص دلار آمریکا (US Dollar Index - DXY) بر تحلیل فاندامنرال
۶۰	تأثیر شاخص مدیریت خرید (PMI) بر دلار
۶۱	تأثیر شاخص‌های بازار مسکن (Housing Market Indicators) بر دلار
۶۳	تأثیر سرمایه‌گذاری خارجی مستقیم (Foreign Direct Investment - FDI) بر دلار
۶۳	تأثیر نسبت بدهی به تولید ناخالص داخلی (Debt-to-GDP Ratio) بر ارزش دلار
۶۵	امواج الیوت
۶۵	اصول اصلی نظریه موج الیوت
۶۵	ساختار و الگوهای موجی
۶۶	شناسایی و شمارش امواج
۶۶	کاربردهای نظریه موج الیوت
۶۶	نقاط قوت و ضعف نظریه موج الیوت
۶۶	۴۱. ساختار موجی در تحلیل امواج الیوت (Elliott Wave Structure)
۶۸	۴۲. تحلیل عمق و زمان امواج الیوت (Depth & Time Analysis of Elliott Waves)
۶۹	۴۳. شناسایی مثلث‌های پیچیده (Complex Triangles) در امواج اصلاحی
۶۹	۴۴. تکنیک تفکیک موج‌های محرک و موج‌های اصلاحی با استفاده از ضریب مورفی (Murphy's Coefficient)
۷۰	
۷۰	۴۵. تحلیل چندزمانه (Multi-Timeframe Analysis) برای تعیین ساختار امواج
۷۱	۴۶. شناسایی امواج ناقص (Truncated Waves) و تأثیر آنها بر شمارش موج
۷۱	۴۷. تحلیل شتاب امواج (Wave Momentum Analysis) با استفاده از شاخص‌های نوسانی (Oscillators)
۷۱	۴۸. تکنیک اندازه‌گیری موج‌های گسترده (Extended Waves)
۷۱	۴۹. تحلیل سیکل‌های پیچیده (Complex Cycles) و ساختارهای چند موجی (Multiple Wave Structures)
۷۲	
۷۳	۵۰. استفاده از کانال‌بندی چندگانه (Multi-Channeling Techniques) در امواج الیوت
۷۴	۵۱. تحلیل همبستگی بین امواج الیوت و شاخص‌های حجمی (Volume Indicators)
۷۵	۵۲. تحلیل روانشناسی بازار با استفاده از نسبت‌های پیچیده فیبوناچی در امواج الیوت
۷۶	۵۳. استفاده از اندیکاتور EWO (Elliott Wave Oscillator) برای تأیید شمارش امواج
۷۷	۵۴. تحلیل موج‌های طولانی‌مدت با استفاده از چرخه‌های چندگانه (Multiple Cycle Analysis)

۷۷	۵۵. شناسایی امواج ترکیبی نادر (Rare Combined Waves)
۷۸	۵۶. شناسایی موج‌های معکوس (Inverted Waves) در ساختار الیوت
۷۹	۵۷. تحلیل نسبت‌های فیبوناچی چندگانه (Multiple Fibonacci Ratio Analysis)
۷۹	۵۸. شناسایی الگوهای چندبخشی (Fractal Patterns) در تحلیل الیوت
۸۰	۵۹. تحلیل موج‌های جابجایی زمانی (Time Displacement Waves)
۸۱	۶۰. تحلیل الگوهای ترکیبی گسترده (Broadening Complex Patterns)
۸۲	تکنیک‌های تحلیل الگوهای ترکیبی گسترده:
۸۵	روانشناسی در معاملات
۸۵	اهمیت روانشناسی در ترید
۸۵	عوامل روان‌شناختی مؤثر در ترید
۸۷	۶۱. تفکر احتمالاتی (Probabilistic Thinking)
۸۸	۶۲. کنترل احساسات و رفتارهای هیجانی (Emotional Regulation and Impulse Control)
۸۹	۶۳. تعادل بین اعتماد به نفس و فروتنی (Balancing Confidence and Humility)
۹۰	۶۴. مدیریت سوگیری‌های شناختی (Managing Cognitive Biases)
۹۰	۶۵. استراتژی‌های مقابله با اضطراب (Anxiety Coping Strategies)
۹۱	۶۶. درک و پذیرش چرخه‌های روانی بازار (Understanding and Accepting Market Psychology Cycles)
۹۲	۶۷. مواجهه با خطای شناختی از دست دادن فرصت (Fear of Missing Out - FOMO)
۹۳	۶۸. خودآگاهی و توسعه ذهنیت رشد (Self-awareness and Growth Mindset)
۹۴	۶۹. مدیریت سوگیری در دسترس بودن (Availability Bias Management)
۹۴	۷۰. مدیریت و کنترل استرس (Stress Management and Control)
۹۵	۷۱. پذیرش مسئولیت کامل در معاملات (Taking Full Responsibility for Trades)
۹۶	۷۲. مدیریت حرص و طمع (Managing Greed)
۹۶	۷۳. پذیرش شکست و خروج بدون احساسات (Accepting Losses and Emotionless Exits)
۹۷	۷۴. توسعه صبر و انضباط معاملاتی (Developing Patience and Trading Discipline)
۹۸	۷۵. ایجاد و تقویت اعتماد به نفس (Building and Reinforcing Self-confidence)
۹۸	۷۶. مدیریت استراتژیک زیان‌های متوالی (Managing Consecutive Losses Strategically)
۹۹	۷۷. توسعه رویکرد جامع معاملاتی (Developing a Holistic Trading Approach)
۹۹	۷۸. استفاده از روش‌های مدیریت ریسک پیشرفته (Using Advanced Risk Management Techniques)
۱۰۰	۷۹. ایجاد تعادل بین زندگی شخصی و حرفه‌ای (Maintaining Work-life Balance)
۱۰۰	۸۰. پذیرش نوسانات به عنوان بخشی از بازار (Accepting Volatility as Part of the Market)
۱۰۱	مدیریت ریسک
۱۰۲	۸۱. ارزیابی عمق نقدینگی و تأثیر بر مدیریت ریسک (Assessing Market Liquidity and Its Impact on Risk Management)
۱۰۳	۸۲. استفاده از تکنیک‌های پوشش ریسک (Hedging Techniques)

۸۳	مدیریت پوزیشن سایز (Position Sizing Management)	۱۰۳
۸۴	استفاده از تحلیل سناریو (Scenario Analysis)	۱۰۴
۸۵	تعیین و اجرای حد ضرر (Setting and Executing Stop-loss Orders)	۱۰۴
۸۶	تکنیک تقسیم ریسک (Risk Parity Technique)	۱۰۵
۸۷	مدیریت ریسک با استفاده از همبستگی دارایی‌ها (Managing Risk Using Asset Correlations)	۱۰۵
۸۸	بررسی استراتژی مدیریت ریسک بر اساس چرخه‌های بازار (Risk Management Strategy Based on Market Cycles)	۱۰۶
۸۹	استفاده از تجزیه و تحلیل حساسیت (Sensitivity Analysis) در مدیریت ریسک	۱۰۷
۹۰	تعیین حد سود و مدیریت پویا (Dynamic Take-profit and Stop-loss Management)	۱۰۷
۹۱	بررسی و کنترل ریسک سیستمی و غیرسیستمی (Systematic and Unsystematic Risk Management)	۱۰۸
۹۲	تکنیک‌های مدیریت ریسک روانی (Psychological Risk Management Techniques)	۱۰۸
۹۳	استفاده از مدل‌های ارزش در معرض خطر (Value at Risk Models)	۱۰۹
۹۴	مدیریت ریسک از طریق مدل‌های پویایی نوسانات (Managing Risk with Volatility Dynamic Models)	۱۰۹
۹۵	مدیریت ریسک با استفاده از ساختار بازار (Managing Risk Using Market Microstructure)	۱۱۰
۹۶	مدیریت ریسک از طریق بهینه‌سازی سبد دارایی (Portfolio Optimization and Risk Management)	۱۱۰
۹۷	استفاده از تحلیل موجک برای مدیریت ریسک (Using Wavelet Analysis for Risk Management)	۱۱۱
۹۸	مدیریت ریسک با استفاده از استراتژی آربیتراژ (Arbitrage Strategy Risk Management)	۱۱۲
۹۹	استفاده از رویکرد ارزش زمانی ریسک (Time-Weighted Risk Approach)	۱۱۲
۱۰۰	استفاده از تحلیل آنترپی برای ارزیابی ریسک (Using Entropy Analysis for Risk Evaluation)	۱۱۳
۱۰۱	تفاوت پیش‌بینی در امور مالی و امور طبیعی	۱۱۳
۱۱۵	منابع	۱۱۵

پیشگفتار

دوستان و همراهان گرامی،

کتابی که اکنون در دست دارید، حاصل سال‌ها مطالعه و تحقیق در حوزه‌های گوناگون بازارهای مالی، تحلیل تکنیکال و بنیادی، مدیریت ریسک و روانشناسی معاملات است. هدف این کتاب، ارائه‌ی مجموعه‌ای جامع و کاربردی از مفاهیم و ابزارهایی است که به شما کمک می‌کنند بازار را از زوایای جدیدی ببینید و در مسیر معامله‌گری با دید بازتری گام بردارید. در هر فصل، تلاش کرده‌ام مطالب را به گونه‌ای ارائه دهم که هم برای معامله‌گران تازه‌کار و هم برای حرفه‌ای‌های این حوزه قابل استفاده باشد. اعتقاد دارم که درک عمیق و اصولی از رفتار بازار و مدیریت ریسک می‌تواند به موفقیت پایدار در سرمایه‌گذاری‌ها منجر شود، و این کتاب تلاشی است در همین راستا.

امیدوارم این مجموعه به شما در تحلیل دقیق‌تر، تصمیم‌گیری آگاهانه‌تر و مدیریت بهتر معاملات کمک کند و دریچه‌ای به سوی موفقیت بیشتر در بازارهای مالی برایتان باز کند.

با احترام،

محمدجواد حسینی