

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

سرشناسه	:	صادقی، مسعود، ۱۳۵۹-
عنوان و نام پدیدآور	:	استراتژی معاملاتی بورس (از مبتدی تا حرفه ای) همراه با کدهای فیلترنویسی و ارائه اندیکاتورهای کاربردی / مؤلف مسعود صادقی.؛ ویراستار شیما تقوی زنونز. کرمان: امید کویر، ۱۳۹۹.
مشخصات نشر	:	۱۳۷ ص.
مشخصات ظاهری	:	۹۷۸-۶۲۲-۹۹۶۰۰-۴
شابک	:	۹۷۸-۶۲۲-۹۹۶۰۰-۴
وضعیت فهرست نویسی	:	فیبا
یادداشت	:	کتابنامه: ص. ۱۳۱-۱۳۷.
موضوع	:	سرمایه‌گذاری -- تجزیه و تحلیل
موضوع	:	Investment analysis
موضوع	:	مدیریت سبد سرمایه‌گذاری
موضوع	:	Portfolio management
موضوع	:	بورس -- ایران
موضوع	:	Stock exchanges -- Iran
رده بندی کنگره	:	HG ۴۵۲۹
رده بندی دیویی	:	۳۳۲/۶
شماره کتابشناسی ملی	:	۶۱۶۹۳۰۰



استراتژی معاملاتی بورس (از مبتدی تا حرفه ای)
همراه با کدهای فیلترنویسی و ارائه اندیکاتورهای کاربردی

مؤلف: مسعود صادقی

ویراستار: شیما تقوی زنونز

ناشر: انتشارات امید کویر

شمارگان: ۱۰۰۰ نسخه

شابک: ۹۷۸-۶۲۲-۹۹۶۰۰-۴

قیمت: ۷۵۰,۰۰۰ ریال

آدرس: کرمان، خیابان شریعتی، بعد از کوچه ۱۰، پاساژ سجاد، پلاک ۱۳۴

تلفن: ۰۳۴-۳۲۲۶۲۸۲۴ مرکز پخش: ۰۹۱۹۶۶۴۰۶۴۰۰ www.OmidKavir.ir

استراتژی معاملاتی بورس

(از مبتدی تا حرفه ای)

همراه با کدهای فیلترنویسی و ارائه اندیکاتورهای کاربردی

مؤلف: مسعود صادقی

فهرست

۹	پیشگفتار
۱۳	مقدمه
۱۷	فصل اول : سیستم معاملاتی سنجش سه گانه
۱۹	گام اول: شناسایی روند
۲۲	واگرایی و هم‌گرایی دیدگاه معامله‌گران بازار
۲۵	بهار؛ بهترین فصل خرید
۲۶	سایر ابزارهای شناسایی روند در گام اول
۲۶	گام دوم: شناسایی موقعیت‌های معامله
۲۷	شاخص قدرت خریدار و یک تناقض
۳۲	بهترین اندیکاتور کدام است؟
۳۲	بهترین شیوه تنظیم اندیکاتورها
۳۴	چرخه‌های زمانی در میانگین‌های متحرک
۳۴	کدام قیمت برای خرید ارزش مند است؟
۳۵	گام سوم: تدقیق موقعیت ورود
۳۶	تکنیک Trailing Buy stop
۳۸	تکنیک شکست محدوده بازگشایی
۴۰	تکنیک Swing entry and stop
۴۱	سیستم حرکت جنبشی
۴۵	فیلترنویسی سیستم حرکت جنبشی در نرم افزار متاستوک
۴۶	فیلترنویسی سیستم حرکت جنبشی در محیط دیده بان بازار
۴۸	فیلترنویسی ایده کولین در سایت آسان بورس

۵۱	فصل دوم : استراتژی ورود به معامله در اصلاح قیمت
۵۱	تنظیمات ورود به معامله
۵۹	حذف سیگنال‌ها در شرایط بی‌روندی
۶۱	الگوی پولبک در حمایت‌های دینامیک
۶۲	الگوی پولبک نوع I
۶۳	شرایط واکنش قیمت در الگوی پولبک نوع I
۶۴	شرایط اندیکاتور MACD در الگوی پولبک نوع I
۶۵	تدقیق نقطه ورود در الگوی پولبک نوع I
۶۶	قراردادن حد ضرر در الگوی پولبک نوع I
۶۶	الگوی پولبک در روندهای پر قدرت (پولبک نوع II)
۶۷	شرایط واکنش قیمت در الگوی پولبک نوع II
۶۸	شرایط اندیکاتور MACD در الگوی پولبک نوع II
۷۰	تدقیق نقطه ورود در الگوی پولبک نوع II
۷۰	مثال‌های خرید در الگوی پولبک
۷۱	مثال شماره ۱: شرکت مخابرات ایران
۷۲	مثال شماره ۲: شرکت دارویی لقمان
۷۵	فصل سوم : استراتژی شکست مقاومت
۷۵	استراتژی معاملاتی کانال دونکیان
۷۷	فیلتر کانال دوگانه
۷۹	فیلتر نویسی استراتژی کانال دونکیان
۷۹	استراتژی معاملاتی لاک پشت‌ها

- ۸۰ استراتژی حجم-قیمت در شکست مقاومت
- ۸۳ استراتژی حجم- قیمت در شناسایی شکست ناموفق سقف
- ۸۴ سیگنال خرید وحشت؛ بهترین موقع فروش!
- ۸۶ فیلتر شناسایی سهام برتر
- ۸۸ مدل جرال د آپل
- ۹۰ فیلتر نویسی مدل زمانی حرکت سه‌گانه
- ۹۰ مدل اندرو ابراهیم
- ۹۰ فیلتر نویسی مدل اندرو در نرم افزار متاستوک
- ۹۱ فیلتر مدل اندرو در نرم افزار دینامیک تریدر
- ۹۲ سهام ۵۰ شرکت فعال تر بورس
- ۹۵ فصل چهارم : استراتژی خرید در برگشت‌های جذاب**
- ۹۵ قوانین ورود به معامله در برگشت‌های جذاب
- ۹۶ اندیکاتور هشدار واگرایی MACD
- ۹۷ شرلوک هولمز و سیگنال سگ باسکرویل
- ۹۹ چک لیست ارزیابی سیگنال برگشت جذاب
- ۱۰۰ استراتژی حجم-قیمت در برگشتهای جذاب
- ۱۰۲ سیگنال خرید در تکنیک میانگین حجمی ارد
- ۱۰۷ فروش وحشت؛ بهترین موقع خرید!
- ۱۱۱ فصل پنجم : استراتژی خروج از معامله**
- ۱۱۱ تکنیک برداشت سود در سقف کانال قیمت
- ۱۱۲ تکنیک برداشت سود در مقاومت‌های کلیدی

۱۱۴	تکنیک برداشت سود در نسبت طلایی
۱۱۵	تکنیک خروج با فعال شدن حد ضرر پیشرو
۱۱۷	فصل ششم : مدیریت ریسک و سرمایه
۱۱۷	حد ضرر
۱۱۸	تکنیک حد ضرر نیک
۱۱۹	تکنیک حد ضرر محدوده امن
۱۱۹	برنامه محاسباتی حد ضرر در اکسل
۱۲۰	تکنیک پارابولیک سار
۱۲۲	یک مثال داغ
۱۲۴	قوانین کنترل ریسک
۱۲۴	قانون ۲ درصد
۱۲۵	قانون ۶ درصد
۱۲۵	قانون ۵ درصد
۱۲۷	پیوست ها
۱۳۱	فهرست منابع

پیشگفتار

کتابی که در اختیار دارید، چکیده مجموعه‌ای از کتاب‌های ارزشمند درباره استراتژی معاملاتی در جهت روند است که قابلیت استفاده در بازار بورس ایران را دارد. در این کتاب، به جای مثال‌های غیرملموس از سهام بازارهای جهانی، چون گوگل و اوراق قرضه آمریکا یا معاملات پنبه و رویال بانک کانادا، تکنیک‌های معاملاتی با مثال‌هایی از سهام بازار بورس ایران توضیح داده شده است.

در میان همه کتاب‌های خوبی که وجود دارد جای کتابی که در آن یک استراتژی معاملاتی از ابتدا تا انتها به طور کامل و شفاف توضیح داده شده باشد و مناسب کار در بازار داخلی ایران باشد خالی بود. کتابی که با مثال‌های شفاف و ملموس در بازار بورس ایران، گام به گام، خواننده را با اصول سیستم آشنا و هم‌ساز کند. به همین خاطر تصمیم گرفتم کتابی تا عمق جان کاربردی از استراتژی‌های معاملاتی در روند صعودی، با مثال‌هایی واقعی از بازار بورس در اختیار علاقه‌مندان قرار دهم. فصلی از کتاب نیز به معرفی استراتژی خرید در خلاف روند، اختصاص داده شده است. فصل اول کتاب چکیده مطالعه چندساله و چندین باره مجموعه ۸ تایی از کتاب‌های آقای الکساندر الدر^۱ درباره سیستم معاملاتی سنجش سه‌گانه^۲ و سیستم حرکت جنبشی^۳ است. یک استراتژی محتاطانه که طی سال‌های ۱۹۹۳ تا ۲۰۱۵ به تکامل رسیده است. سیستم معاملاتی که در جهت روند اصلی بازار و بسیار منظم، شما را از ورود به شرایط نامناسب برحذر می‌دارد؛ یک سیستم با سه لایه فیلتر سنجشی قوی برای ارزیابی بازار، سیستمی بسیار ساده و در عین حال بسیار سخت؛ ساده از این جهت که زیربنای اصلی سیستم بر پایه مفاهیم میانگین قیمت‌هاست و سخت از آن جهت که سیستم به شما نمی‌گوید چه کاری باید انجام دهید، بلکه به شما می‌گوید چه کاری نباید انجام دهید.

بر مبنای اصول این استراتژی، اندیکاتور Pullback برای شناسایی موقعیت‌های خرید و برداشت

1 Alexander Elder

2 Triple Screen System

3 Impulse System

سود در محیط نرم افزار متاتریدر طراحی و تولید شده است. این اندیکاتور با معرفی سیگنال‌های خرید و برداشت سود (و یا فروش)، امکان تغییر در مقادیر پیش فرض را داشته و شامل سیستم هشدار سیگنال می‌باشد. همچنین جهت باقی ماندن در یک روند صعودی و بهره‌مندی از حداکثر سود، بخشی با نام «مدیریت سرمایه» شامل گزینه‌های تعیین حدود برداشت سود در سقف کانال و پارامتر ریسک سرمایه جهت بالا بردن حد ضرر گنجانده شده است. مثال‌های فصل اول کتاب عموماً بر اساس سیگنال‌های صادر شده همین اندیکاتور می‌باشد.

دورویکرد اصلی برای خرید یک سهم در روندهای صعودی وجود دارد؛ رویکرد خرید در اصلاح قیمت و رویکرد خرید در شکست قیمت. در رویکرد اول که مطابق با استراتژی سنجش سه‌گانه الدر می‌باشد، ضمن شناسایی روند صعودی در بازه زمانی بزرگ‌تر، در دوره کوتاه‌تر فرصت‌های خرید در نواحی اصلاح قیمت شناسایی می‌شوند.

فصل دوم به استراتژی ورود به معامله در حرکت‌های اصلاحی و بازگشتی، شامل دو الگوی رفتاری به همراه ویژگی‌های شناختی آن‌ها می‌پردازد. همچنین جزئیات ورود به معامله و نحوه قرارگیری حد ضرر با مثال‌هایی ارائه شده است.

رویکرد دوم نیز بر مبنای شکست کانال قیمت در فصل سوم تشریح شده است. در این رویکرد برخلاف رویکرد اصلاحی، با گذر قیمت از مقاومت‌های قبلی، سیگنال خرید صادر می‌شود. در این فصل استراتژی معاملاتی کانال دونکیان با مثال‌هایی کاربردی توضیح داده شده است. در همین رابطه، اندیکاتور «Donchian Trading Strategy» توسط نگارنده طراحی و تولید شده است. مثال‌های این بخش از کتاب بر اساس سیگنال‌های صادر شده این اندیکاتور می‌باشد.

اندیکاتورهای مورد استفاده در کتاب را می‌توانید از طریق سایت www.fatarstrategy.com

تهیه کنید.

فصل چهارم کتاب رویکرد کاملاً مجزایی با سه فصل پیشین داشته و به توضیح دو مدل استراتژی خرید در خلاف جهت روند می‌پردازد. در این بخش استراتژی معاملاتی الدر بر اساس مبانی سیستم حرکت جنبشی و واگرایی در اندیکاتور و به همراه نوع خاصی از استراتژی مبتنی

برتحلیل حجم - قیمت تیم ارد^۱ با ارائه مثال هایی در محیط نرم افزار Ord Volume توضیح داده شده است.

در فصل پنجم روش ها و تکنیک های تعیین حد سود و خروج از معامله بر پایه مفاهیم کانال قیمت، نواحی حمایت و مقاومت و نسبت های فیبوناچی تشریح شده است. در تعیین موقعیت حد سود در تکنیک کانال قیمت از اندیکاتور pullback بر پایه میانگین آهسته کوتاه مدتی ۲۶ روزه و با انحراف معیار پیش فرض ۳، استفاده شده است.

یکی از مهمترین سؤالاتی که اغلب معامله گران با آن روبه رو هستند، میزان سرمایه گذاری در هر سهم با توجه به فاکتور ریسک پذیری است. کنترل ریسک و مدیریت سرمایه بخش جدانشدنی از هر معامله است که در فصل ششم قوانین کاربردی آن با مثال تشریح شده است.

استراتژی های معاملاتی سیستم های خارق العاده و جادویی نیستند که معامله با آن ها شما را از هر نوع ضرری مصون نگه دارد. واقعیت دنیای بیرونی را با جان و دل باید پذیرفت. هیچ سیستم معاملاتی ۱۰۰ درصد موفق وجود ندارد. هیچ استراتژی هوشمندی وجود ندارد.

ضرر کردن همیشه وجود دارد، فقط باید آن را محدود کنید. باهوش ترین و موفق ترین معامله گران بازار کسانی هستند که به حد ضررهای شان پایبند هستند. به قول اندرو ابراهیم^۲ « ضرر کردن مثل نفس کشیدن، طبیعی است ».

در این کتاب تا حد امکان سعی شده تا از ارائه توضیحات اضافی و تکراری مباحث تحلیل تکنیکال که در سایر کتاب ها به راحتی در دسترس همگان قرار دارد خودداری شود. کتابی که شما را سریع و بدون هیچ انحرافی به مغز استراتژی های معاملاتی وصل می کند.

1 Tim Ord

2 Andrew Abraham