

هنر بقا در نزدک

تالیف:

علی زارع پور

آراد کتاب

سرشناسه	: زارع پور، علی، ۱۳۷۹-
عنوان و پدیدآور	: هنر بقا در نزدک / تالیف: علی زارع پور.
مشخصات نشر	: تهران، آراد کتاب،
مشخصات ظاهری	: ۱۳۲ ص، جدول، نمودار
شابک	: ۹۷۸-۶۰۰-۱۸۶-۷۸۸-۰
وضعیت فهرست نویسی	: فیپا
موضوع	: سرمایه گذاری - تجزیه و تحلیل
موضوع	: سرمایه گذاری
موضوع	: سهام
رده بندی کنگره	: HG۴۵۲۹
رده بندی دیویی	: ۳۳۲/۶
شماره کتابخانه ملی	: ۱۰۶۱۲۱۹۶

هنر بقا در نزدک

✑ تالیف: علی زارع پور	✑ ناشر: آراد کتاب
✑ نوبت چاپ: اول ۱۴۰۵	✑ تیراژ: ۲۰۰ جلد
✑ چاپ و صحافی: صدف	✑ قیمت: ۳۹۵۰۰۰ تومان
شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۱۸۶-۷۸۸-۰	

حق چاپ برای ناشر محفوظ است. کلیه حقوق و حق چاپ متن، طرح روی جلد و عنوان کتاب با نگرش به قانون حمایت حقوق مؤلفان، مصنفان و هنرمندان مصوب ۱۳۴۸ برای انتشارات آراد کتاب محفوظ است و متخلفین تحت پیگرد قانونی قرار می گیرند.

مرکز پخش و فروش:

انتشارات آراد کتاب تلفن: ۰۶۶۹۷۵۲۸۵ - ۰۶۶۴۸۲۲۲۶ - ۰۹۳۵۳۰۶۲۴۵۸

خرید آنلاین از سایت: www.aradbook.com

این کتاب را با نهایت احترام و سپاس، به پدر و مادرم تقدیم می‌کنم؛
به پاس سال‌ها محبت، فداکاری و همراهی بی‌دریغشان.

فهرست مطالب

عنوان	صفحه
مقدمه	8
پیشگفتار	10
♦ فصل 1: آشنایی با بازار نزدک	13
سرزمین سرعت، نوآوری و نوسان	13
نزدک چیست؟	14
دو چهره‌ی مهم نزدک: Composite و Nasdaq-100	14
NQ چیست و چرا اهمیت دارد؟	15
چرا نزدک برای معامله‌گر مهم است؟	16
سهام‌های سنگین‌وزن و اثر آن‌ها بر شاخص	17
ساختار صنعتی نزدک	18
ساعات معاملات و اهمیت اوپن نیویورک	18
نزدک و اقتصاد کلان	19
جمع‌بندی فصل اول	20
♦ فصل 2: سیکل باطل الگوها	21
واقعیت سودآوری در بازارهای مالی چیست؟	30
چرا سودهای کلان، اغلب فریبنده هستند؟	31
♦ فصل 3: استراتژی سه کندل اول بازار	33
اشاره به مفاهیم مارک فیشر	35
روز بد	42
جمع‌بندی فصل سوم	45

47.....	◆ فصل 4: چارچوب اجرایی استراتژی
48.....	معماری استراتژی
50.....	بخش اول: معامله‌ی شکست اولیه
51.....	شکست‌های کاذب و فعال شدن معامله‌ی دوم
54.....	جمع‌بندی بخش اول
55.....	بخش دوم: بازگشت قیمت به محدوده سه کندل اول
57.....	شرایط فعال شدن ستاپ بازگشت به ناحیه
57.....	هم‌پوشانی میان دو بخش استراتژی
58.....	روزهای ناموفق و توالی ضررها
60.....	نگاه نهایی به سیستم
61.....	◆ فصل 5: اجرای سیستم
61.....	فوریه 2026 — بررسی روز به روز
82.....	جمع‌بندی فوریه 2026
86.....	◆ فصل 6: نتایج آزمون استراتژی
87.....	بخش اول: فلسفه‌ی آزمون
88.....	بخش دوم: روش آزمون
89.....	بخش سوم: نتایج سال 2024
89.....	ژانویه 2024 — شروع سخت
95.....	بخش چهارم: نتایج سال 2025
100.....	بخش پنجم: مقایسه‌ی دو سال
101.....	بخش ششم: مدل سود مرکب
102.....	بخش هفتم: چرا این استراتژی امروز کارآمد است؟
114.....	افزایش ریسک — شمشیر دو لبه
116.....	درباره نویسنده

- 120..... یادداشت پایانی
- 120..... آنچه این کتاب نیست
- 121..... سوگیری‌های ذهنی — دشمن پنهان هر معامله‌گر
- 122..... واریانس — چیزی که درباره‌اش حرف نمی‌زنند
- 123..... هدف من
- 124..... ارتباط با نویسنده

مقدمه

بازار شاخص‌ها یکی از پیچیده‌ترین و در عین حال شفاف‌ترین میدان‌های مالی جهان است؛ جایی که تصمیمات بزرگ، جریان نقدینگی و رفتار جمعی معامله‌گران در قالب حرکت قیمت آشکار می‌شود. در میان این شاخص‌ها، NASDAQ جایگاه ویژه‌ای دارد. این شاخص نه تنها نماینده‌ی بسیاری از شرکت‌های پیشرو در فناوری و نوآوری است، بلکه به نوعی نبض ریسک‌پذیری و انتظارات بازار جهانی را نیز نشان می‌دهد. معامله‌گری روی نزدک، به معنای مواجهه مستقیم با بازاری سریع، پویا و عمیقاً ساختارمند است.

در چنین بازاری، موفقیت به ندرت حاصل حدس، احساس یا شانس است. آنچه یک معامله‌گر را متمایز می‌کند، داشتن یک سیستم دقیق، قوانین روشن و اجرای منضبط است. من در طی چند سال مطالعه، مشاهده و آزمودن رفتار بازار نزدک، به استراتژی‌ای رسیده‌ام که طی سه سال یک تست، بارها و بارها بررسی شده و در شرایط مختلف بازار مورد ارزیابی قرار گرفته است. هدف از نگارش این کتاب، صرفاً معرفی یک روش شخصی نیست؛ بلکه ارائه‌ی یک چارچوب عملی و قابل تکرار است که هر فردی با اجرای دقیق آن، بتواند به نتایجی مشابه دست پیدا کند.

این کتاب بر این باور بنا شده که معامله‌گری موفق، بیش از هر چیز، حاصل تفکر سیستمی، انضباط ذهنی و درک رفتار قیمت است. همان‌طور که در آثار و دیدگاه‌های معامله‌گرانی چون تام هوگارد، مارک داگلاس و مارک فیشر نیز می‌توان رد پای اهمیت نظم، احتمال، ساختار و ذهنیت حرفه‌ای را دید، این کتاب نیز تلاش می‌کند معامله‌گری را از سطح پیش‌بینی‌های احساسی فراتر ببرد و به سطح یک فرآیند دقیق و قابل اندازه‌گیری ارتقا دهد.

استراتژی مطرح شده در این کتاب بر مبنای رفتار واقعی بازار نزدیک طراحی شده است؛ بازاری که در آن زمان، نوسان، نقدینگی و واکنش‌های ساختاری، همگی در شکل‌گیری فرصت‌های معاملاتی نقش دارند. آنچه این روش را متمایز می‌کند، شفافیت قوانین، دقت در تعریف شرایط ورود و خروج، و امکان بازتولید نتایج است. در واقع، اگر دو معامله‌گر با رعایت کامل قواعد این سیستم آن را اجرا کنند، انتظار می‌رود نتایجی نزدیک و قابل‌مقایسه به دست آورند.

در این کتاب تلاش کرده‌ام همه چیز تا حد امکان روشن، منسجم و کاربردی بیان شود. از منطق حرکتی نزدیک و نقش زمان در تصمیم‌گیری گرفته تا جزئیات ورود، مدیریت ریسک، و نحوه‌ی برخورد با شرایط مختلف بازار. این کتاب برای کسانی نوشته شده که به دنبال یک رویکرد دقیق و حرفه‌ای هستند؛ رویکردی که نه بر حدس، بلکه بر داده، نظم و تکرارپذیری استوار باشد.

هدف نهایی این اثر، تنها آموزش یک استراتژی نیست، بلکه ارائه‌ی یک نگاه حرفه‌ای به معامله‌گری است؛ نگاهی که در آن بازار به‌عنوان یک سیستم قابل‌فهم دیده می‌شود و معامله‌گر، به‌جای واکنش احساسی، با برنامه، انضباط و اعتمادبه‌نفس عمل می‌کند.

این کتاب دعوتی است برای ورود به سطحی بالاتر از معامله‌گری؛ سطحی که در آن تصمیم‌ها تصادفی نیستند، بلکه نتیجه‌ی یک چارچوب روشن، آزموده و دقیق‌اند.

پیشگفتار

در چند سال اخیر که سرگرم یادگیری و تجربه اندوزی در بازارهای مالی بودم، همواره یک سوال ذهنم را مشغول می کرد: چرا با این همه کتاب و محتوایی که در حوزه معامله گری وجود دارد، هنوز اکثر معامله گران نمی توانند در عمل دوام بیاورند؟

بدیهی است که روانشناسی بازار، شناخت رفتار جمعی و تحلیل نمودار، همگی مهم اند؛ اما واقعیت تلخ آن است که بسیاری از منابع موجود فقط تصویر بزرگی از نقشه بازار را پیش چشم معامله گر قرار می دهند، بی آنکه جزئیات راه و ابزارهای عبور از موانع را تشریح کنند.

بارها پیش آمده که احساس کردم مشابه یک ماجراجوی تازه کار، با قایقی کوچک به دل اقیانوس عظیم بازار رفته ام. کتاب ها و دوره های آموزشی بسیاری به من یاد دادند که در شرایط ایده آل باید چگونه عمل کنم؛ اما در طوفان های ناگهانی، در زمان هایی که بازار از کنترل خارج می شود یا رفتار خلاف انتظار نشان می دهد، احساس می کردم تنهام.

در اینجا بود که فهمیدم صرف دانستن کلیات، حتی با آموزش خوب، برای بقا کافی نیست؛ آنچه معامله گر را نجات می دهد، چارچوب دقیق قوانین و اجرای منضبط در واقعیت است.

بسیاری از آثار برجسته حوزه معامله گری – از کتاب های مارک داگلاس در باب روان شناسی ذهنی تا تحلیل های مارک فیشر در کشف ساختارهای قیمتی – هر یک قطعه ای از این پازل پیچیده را به ما می آموزند.

اما برای من، نقطه عطف زمانی رقم خورد که با روش ACD مارک فیشر آشنا شدم؛ سیستمی که با تعریف محدوده های واضح، شفافیت در قوانین ورود و

خروج، و تمرکز فوق العاده بر واقع گرایی بازار، چشمانم به دنیای جدیدی از معامله گری باز شد.

البته همان طور که فیشر خودش توصیه می کند: هر معامله گر باید یاد بگیرد سیستم را با ذهنیت و نیاز خودش شخصی سازی کند.

من با الهام از چارچوب ACD و با تکیه بر ماهیت منحصر به فرد شاخص NASDAQ، چند سال صرف تحقیق، آزمون و خطا، و بک تست های مداوم در شرایط متفاوت بازار کردم. هدفم تنها تکرار یک استراتژی نبود؛ بلکه خواستم سیستمی بسازم که ضمن اتکا به ستون های محکمی که بزرگانی چون فیشر بنیان نهاده اند، برای واقعیت های امروز بازار نزدیک هم مناسب باشد.

این کتاب محصول همین تلاش است: تلاشی برای برطرف کردن همان خلأیی که خودم و بسیاری از دیگر معامله گران احساس می کنند – فقدان یک سیستم دقیق، تکرارپذیر و آزموده، که معامله گر را نه تنها برای روزهای آرام بازار، بلکه در طوفان و تلاطم هم آماده نگه دارد.

در این مسیر، بارها دیدگاه های بزرگان دیگری نیز برای من الهام بخش بود: تام هوگارد با تاکید بر قدرت ذهن و شکست های کوچک اما آموزنده در بازار، مارک داگلاس با نگاه فلسفی اش به نظم روانی و نقش باور در موفقیت معامله گری.

همه این آموزه ها را با تجربه و تحقیقات شخصی خود ترکیب کردم تا سیستمی توسعه دهم که نه در سطح نظری، بلکه کاملاً عملی و تست شده باشد. در فصل های پیش رو، علاوه بر تشریح دقیق استراتژی طراحی شده برای NASDAQ، سعی کرده ام فلسفه، منطق و آزمون های هر بخش را شفاف توضیح دهم.

من معتقدم مسیر موفقیت در بازار مالی، جاده‌ای یک‌طرفه و ساده نیست. اما اگر معامله‌گر ابزار درست در اختیار داشته باشد – ابزاری مبتنی بر داده و نظم – می‌تواند نه تنها از اقیانوس وحشی بازار عبور کند، بلکه با اطمینان بیشتری مسیر خود را بسازد.

امیدوارم این کتاب بخشی از آن ابزار باشد و به همه کسانی که خواهان «معامله‌گری نظام‌مند و حرفه‌ای» هستند، دید و رویکرد جدیدی برای مواجهه با بازار NASDAQ بدهد.