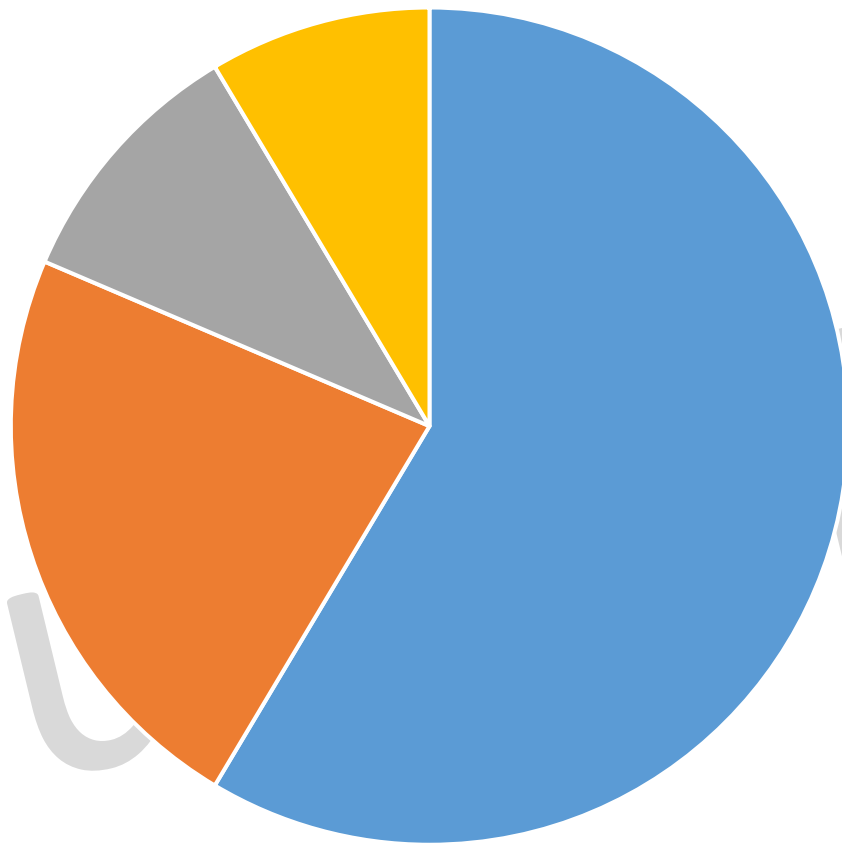




یکی از کاربردهای مارکت کپ اینه که می‌تونیم پروژه‌هایی با کاربردها و اهداف و تکنولوژی‌های مشابه رو پیدا کنیم و با جمع کردن مقدار مارکت کپ اون‌ها و مقایسه اون با مارکت کپ کل بازار (Total)، میزان اهمیت و سهم یک نوع تکنولوژی در این بازار رو بسنجیم (در واقع دامیننس یک حوزه رو با سایر حوزه‌ها بسنجیم).





مثلا می‌تونیم با جمع‌آوری ارزش بازار ارزهای دیجیتال حریم خصوصی محور یا همان Privacy Coin (مانند مورنو، دش، زی کش و ..) کل حجم سرمایه موجود در این حوزه رو بدست آورد و اون رو با کل سرمایه موجود در بازار رمزارزها مقایسه کرد و دید کلی نسبت به جایگاه و اهمیت پرایوسی کوین‌ها کسب کرد . هم چنین بالا رفتن هم زمان حجم و مارکت کپ در یک حوزه یا یک رمز ارز نشونه خوبی از رشد بنیادی اون میتونه باشه.



شت کوین - ShitCoin

شت کوین به رمزارزهایی گفته میشه که با مارکت کپ بسیار پایین ، از ارزش بنیادی بسیار پایین ، تیم سازنده بی هدف و بی برنامه ، برخوردار هست و هیچ ارزش بنیادی رو دنیای رمزارزها ایجاد نمیکند . در واقع شت کوین ها ، توکن هایی هستند که اکثر اوقات با هدف پامپ و دامپ یا سرگرمی ایجاد میشن . البته بعضی از این شت کوین ها ، در نهایت ارزش بنیادی خوبی پیدا میکنن و با استقبال عمومی مردم از شت کوین به میم کوین تبدیل میشن . میم کوین (Meme coin) به گروهی از رمزارزها گفته می شه که بر اساس ترندها و میم های اینترنتی ایجاد شدن ولی در زمینه فناوری و نوآوری در حوزه رمزارزها حرفی برای گفتن ندارند.



شت کوین - ShitCoin



چون شت کوین ها عرضه و تقاضای ناسالمی دارند سرمایه گذاری بر روی اونها از ریسک بسیار بالا و نامعقولی برخوردار هست . با این حال بعضی از اونها با رشد های چند هزار درصدی سود های بسیار بالایی به دارندگانشون دادند . **بصورت عمومی سرمایه گذاری و ترید روی شت کوین ها توصیه نمیشه .**



نماد چارت مارکت کپ کل بازار و بازار آلت کوین ها

Total

Total2

برای مشاهده و تحلیل تکنیکال نمودار مارکت کپ کل بازار در سایت تحلیل نمودار مثل تریدینگ ویو کافیست نماد Total (توتال) رو سرچ کنید. همچنین میتونید برای مشاهده نمودار مارکت کپ کل بازار به جز بیت کوین (آلت کوین ها) نماد Total2 رو سرچ کنید





دامیننس ، در لغت به معنی تسلط و یا سلطه می باشد.

سلطه یا Dominance شاخصی هست که نشون می ده چه مقدار از کل ارزش یک بازار (یا همون مارکت کپ) از ارز مورد نظر تشکیل شده . به عنوان مثال وقتی می گوئیم دامیننس بیت کوین ۳۹ درصد است یعنی از کل مارکت کپ بازار کریپتوکارنسی ۳۹ درصد آن را مارکت کپ بیت کوین تشکیل داده و بقیه آن آلت کوین ها هستند به عبارت دیگه ۳۹ درصد ارزش بازار رمزارزها را بیت کوین تشکیل داده .



SHA256

PoS

Ethereum Tokens

در تصویری که مشاهده میکنید .
وسعت هر ارز در نقشه ، نشون دهنده میزان
تسلط اون بر بازار یا همون دامیننس هست.

BTC

\$16,855.42
+2.08%

Dominance: 39.11%

ETH

\$1,220.06
+1.84%

DBFT

BNB
\$243.038
-19.01%

RPCA

XRP
\$0.351495
-13.87%

Script

DOGE
\$0.075384
-35.72%

LTC
\$68.7525

Other

DOT \$4.4777
SOL \$11.309
AVAX \$11.6835
VET \$0.22
NEAR \$1.25
BIT \$0.15
ICP \$0.55
FIL \$0.45

Ouroboros

ADA
\$0.25983

DPOS

TRX
\$0.051463

XMR
\$154.46

ETC
\$19.85

XLM
\$0.073994

EOS
\$0.11

ZEC
\$32.15

Omni Tokens

USDT
\$1.0012
+0.16%

Other Tokens

TON \$2.4035
TRAX
FLOW
USDD
CARE
BLM
BNC
TWT
WEC
MOT

Binance Tokens

BUSD
\$1.0013
+0.09%

برای تحلیل تکنیکال نمودار دامیننس در سایت تحلیل نمودار مثل تریدینگ ویو کافیه نماد یک ارز رو به همراه پسوند D. (دات دی) سرچ کنید . به عنوان مثال:

BTC.D

USDT.D

BNB.D

ETH.D



کاربرد دامیننس چیست؟

1

میزان همبستگی بیت کوین با سایر الت کوین ها

2

تشخیص بیت سیزن و الت سیزن

3

تشخیص روند کلی بازار به کمک دامیننس تتر



1 - میزان همبستگی بیت کوین با سایر آلت کوین ها

حتما تا به الان متوجه شدید که بیت کوین در هر جهتی حرکت کنه ، اکثر آلت کوین های بازار با جهت بیت کوین همسو و همراه میشن اما میزان و درصد این همراهی بین اون ها متفاوته ، دلیل این موضوع سلطه حدود ۴۰ درصدی بیت کوین بر بازار رمزارزها و شاخص شناختن اون به عنوان مهم ترین ارز بازار هست که جهت روند اکثر آلت کوین ها رو مشخص میکنه به همین جهت هست که اکثر تحلیل گران تکنیکال ، وقتی یک آلت کوین رو تحلیل میکنن به تحلیل بیت کوین هم توجه می کنند.



**باتوجه به همسو بودن آلت کوین ها با بیت کوین
چه نیازی به تحلیل آلت کوین ها وجود داره ؟**



1- میزان همبستگی بیت کوین با سایر الت کوین ها



با وجود سلطه بیت کوین بر بازار و هم جهت بودن روند بسیاری از آلت کوین ها با بیت کوین ، تحلیل آلت کوین ها امری ضروری در روند معاملات به شمار میره چون :

۱ - میزان و درصد رشد یا ریزش آلت کوین ها با بیت کوین متفاوت هست .

۲ - در شرایط خاص ، روند یک آلت کوین با بیت کوین هم جهت نیست .

۳ - در آلت سیزن ها ، آلت کوین ها سود خوبی به معامله گران خودشون میدن .



فصل آلت کوین ها – Alt Season



آلت سیزن که به معنای فصل آلت کوین ها می باشد در واقع به بازه‌ی زمانی گفته می‌شه که قیمت آلت کوین ها نسبت به بیت کوین یک رشد چشمگیر و سریعی رو داشته باشه . درواقع آلت سیزن زمانی اتفاق می‌افته که دامیننس بیت کوین به شدت نزول پیدا کنه ولی قیمت اون ریزش شدیدی نداشته باشه و عملاً سرمایه‌ها از بیت کوین به سمت آلت کوین‌ها سرازیر بشه و این باعث می‌شه که آلت کوین‌ها در اون برهه زمانی رشدهای خوبی داشته باشه.



فصل آلت کوین ها – Alt Season

BTC.D



BTC



ALTS



مدرس : مهندس فرشید میرزائی



USDT.D

افزایش دامیننس استیبل کوین تتر ، میتونه نشونه نقد شدن معامله گران و فروش دارایی هاشون باشه در نتیجه میتونیم بگیم که هرچه دامیننس تتر بیشتر میشه امکان کاهش دامیننس بیت کوین و آلت کوین ها (Total) وجود داره ، بنابر این با افزایش دامیننس تتر بازار وارد روند نزولی و با کاهش دامیننس تتر وارد روند صعودی میشه . ما با استفاده از تحلیل چارت دامیننس تتر میتونیم ، دید بهتری به روند کلی بازار داشته باشیم .



6.00%



رابطه دامیننس تر با قیمت بیت کوین

USD





تمرین منزل - تایم فریم روزانه

چارت دامیننس تتر و قیمت بیت کوین را تحلیل و مقایسه کنید



تحلیل یعنی : انجام مراحل ۵ گانه ذکر شده مباحث قبل
مقایسه یعنی : قرار دادن دو نمودار تحلیل شده در کنار هم و مقایسه ارتباط آنها با هم



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

تمرین - تایم فریم روزانه

چارت Total و Total 2 را تحلیل و با روند قیمت بیت کوین مقایسه کنید.



تحلیل یعنی : انجام مراحل ۵ گانه ذکر شده مباحث قبل
مقایسه یعنی : قراردادن دو نمودار تحلیل شده در کنار هم و مقایسه ارتباط آنها با هم





CoinMarketCap

کارگاه عملی سایت کوین مارکت کپ

CoinMarketCap.com



مدرس : مهندس فرشید میرزائی



کوین مارکت کپ (CoinMarketCap) یک مرجع رسمی و یکی از قوی‌ترین پلتفرم‌های تحلیل بنیادی و بررسی پروژه‌های رمز ارزی است که توسط برندون چز (Brandon Chez) در سال ۲۰۱۳ طراحی شد. این وب سایت با تجمیع و ردیابی قیمت، به پوشش اطلاعات طیف گسترده‌ای از رمزارزها می‌پردازد. این سایت در سال ۲۰۲۰ توسط صرافی بایننس خریداری شد.



 COIN360

کارگاه عملی سایت Coin360

Coin360.com



مدرس : مهندس فرشید میرزائی



کارگاه عملی سایت cryptobubbles

cryptobubbles.net



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

تا اینجاى فصل سه یاد گرفتیم ...



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

در ادامه مسیر چه چیزهایی رو قراره یاد بگیریم؟

انواع بازارهای مالی در جهان

8

شاخص های اندازه گیری
و سنجش ریسکها

7

سفارش و انواع آن
(حد سود و حد ضرر)

9

روش های ثبت
سفارش در OB

10

آشنایی با
محیط آزمایشی صرافی

12

تشخیص جهت قیمت و
نقطه ورود و نقطه خروج پوزیشن
معاملاتی

11



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

در ادامه مسیر چه چیزهایی رو قراره یاد بگیریم؟

مفاهیم مدیریت سرمایه

14

آموزش ژورنال نویسی و
نحوه ترید آزمایشی

13

15

آمادگی برای ورود
به صرافی ها

16

آشنایی عملی با
صرافی های متمرکز

17

آشنایی عملی با
صرافی های غیر متمرکز

18

آزمون نهایی



مدرس : مهندس فرشید میرزائی



نگاهی کلی به انواع بازارهای مالی در جهان

Financial Markets & Types In World



مدرس : مهندس فرشید میرزائی



بازار مالی (Financial Market) یک فضای فیزیکی یا پلتفرم مجازی هست که در اون امکان خرید و فروش سهام ، کالا یا سایر دارایی‌های ارزشمند فراهم شده . ماهیت چیزی که بین خریدارها و فروشندگان جابه‌جا می‌شه و چگونگی انجام اون ، نوع بازار مالی رو مشخص می‌کنه. انواع مختلفی از بازار مالی وجود داره که برخی کوچک و محدود به یک کشور و برخی نیز در سطح بین‌المللی با گردش مالی تریون‌ها دلار هستند.



ما به سه دلیل باید با انواع بازارهای مالی آشنا بشیم :

1

ورود برخی از انواع و اشکال بازارهای مالی در مقیاس جهانی
به بازار رمزارزها : مثلاً بازار Spot ، Futures ، OTC و ...

2

همبستگی و تاثیر بازارهای جهانی بر روند قیمتی بازار
رمزارزها (البته یک عیب به شمار میره)

3

شناخت جایگاه بازار رمزارزها نسبت به سایر بازارهای
مالی در جهان



7 نوع بازار مالی برتر در جهان

بازار سهام خرید و فروش سهم شرکت‌ها توسط سرمایه‌گذاران / قدیمی‌ترین و رایج‌ترین نوع بازار مالی.

بازار اوراق قرضه خرید و فروش اوراق قرضه (نوعی اوراق بهادار که شامل توافقی بین وام‌دهنده و وام‌گیرنده است).

بازار مشتقات معامله بر روی ارزش دارایی‌هایی نظیر کالا، سهام، شاخص، ارز دیجیتال.

بازار تبادل ارزهای خارجی یک بازار غیرمتمرکز برای مبادله‌ی ارز رایج کشورها / دارای بیشترین حجم نقدینگی در بین بازارهای دیگر.

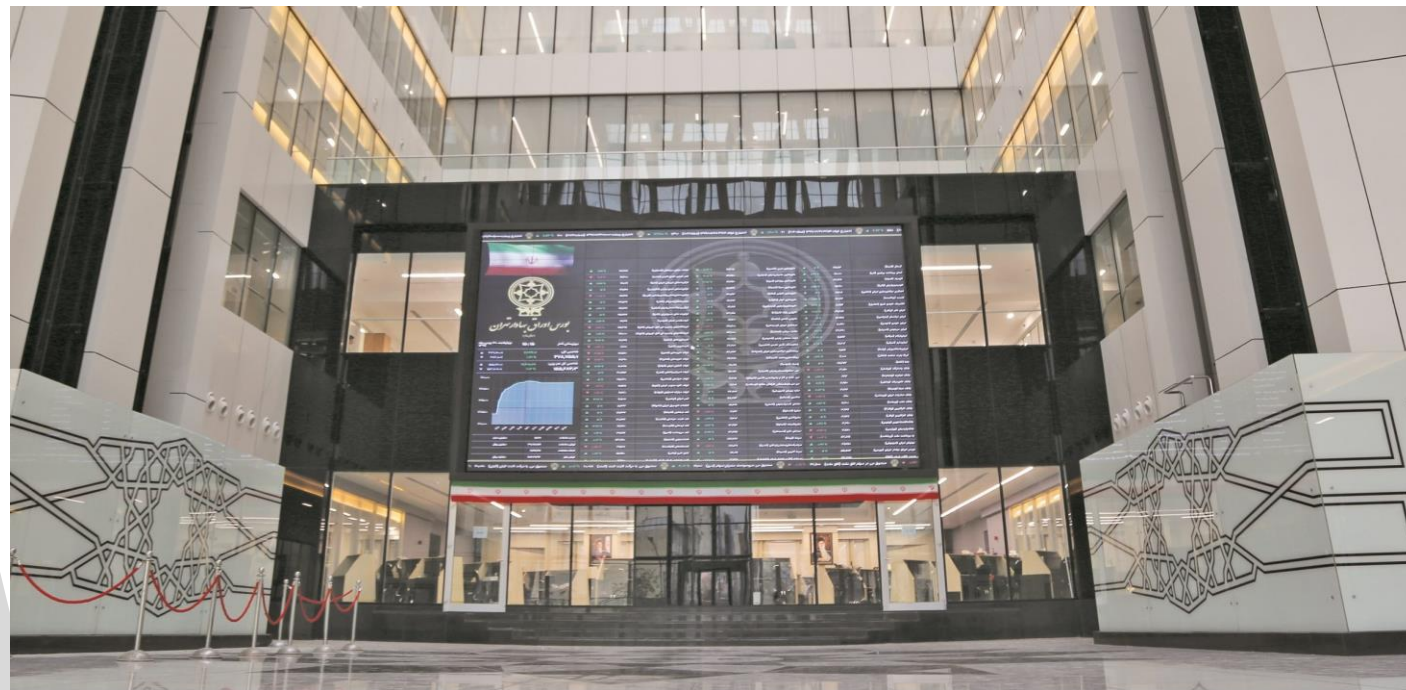
بازار کالاها محلی برای خرید و فروش کالاهای فیزیکی.

بازار OTC یک نوع بازار مالی غیرمتمرکز و الکترونیکی بدون دخالت بروکرها.

بازار رمزارزها امکان مبادله‌ی رمزارزها با یکدیگر و با ارزهای فیات.



1- بورس سهام – Stock Market



بازار سهام یا Stock Market یا همان بورس سهام از قدیمی‌ترین و رایج‌ترین انواع بازار مالی در دنیاست. در این نوع بازار، سهام شرکت‌های مشخصی توسط سرمایه‌گذارهای مختلف به صورت عمومی خرید و فروش می‌شود. هدف از فروش سهام یک شرکت، افزایش میزان سرمایه و نقدینگی شرکت‌ها برای توسعه‌ی کسب و کارشان هست.



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

عرضه اولیه سهام - IPO



زمانی که سهام یک شرکت ، اولین بار برای فروش در بازار سهام ارائه می‌شود ، یک عرضه اولیه سهام یا (IPO) برگزار می‌شود و سرمایه‌گذارانی که به فعالیت آن شرکت اعتقاد داشته باشند ، این سهام رو خریداری می‌کنند . با فعالیت شرکت و ارائه‌ی خدمات یا کالاها و توسعه‌ی اون کسب‌وکار ، به مرور ارزش سهام اون شرکت افزایش پیدا می‌کند و سرمایه‌گذارها از این راه به سود می‌رسند.



عرضه اولیه کوین یا Initial Coin Offering
یا به اختصار ICO چیست ؟



تفاوت عرضه اولیه سهام ، کوین و صرافی - ICO , IEO , IEO

در مقابل عرضه اولیه سهام ، عرضه اولیه صرافی و کوین در دنیای رمزارزها وجود دارد ، عرضه اولیه صرافی (Initial Exchange Offering) یا IEO همان طور که از نامش مشخصه ، به معنی عرضه اولیه توکن ها بر بستر یک صرافی رمزارز هست. بر خلاف عرضه اولیه سکه (ICO) که مستقیما توسط تیم یک پروژه برگزار می شه، عرضه اولیه صرافی ، توسط یک صرافی به نمایندگی از یک استارتاپ و با هدف جمع آوری سرمایه در ازای فروش توکن مدیریت می شه .



1- بورس سهام – Stock Market

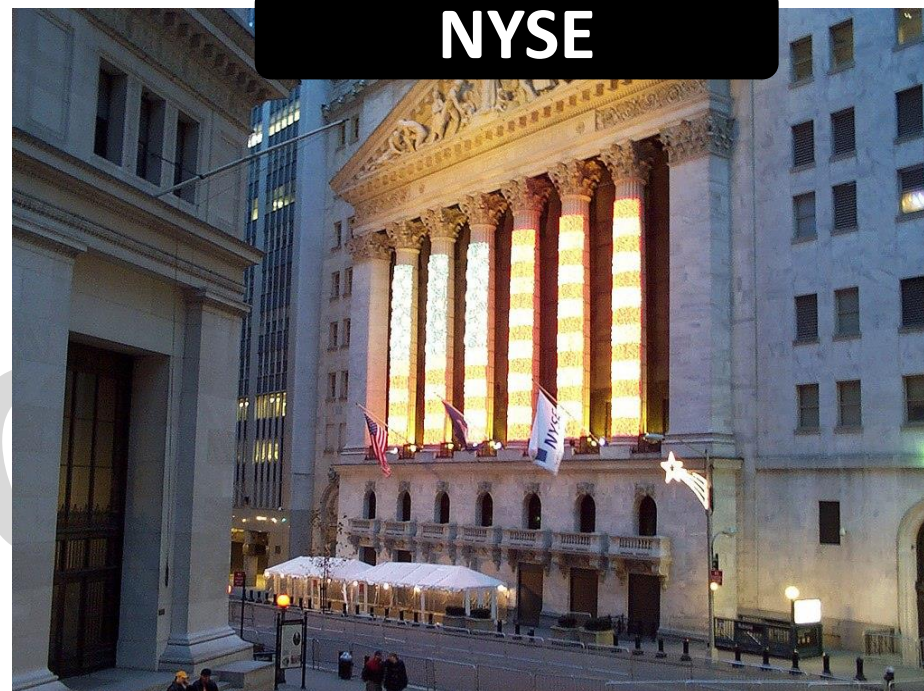
Nasdaq



بورس تهران



NYSE



بازار سهام نیویورک (New York Stock Exchange = NYSE) ، بازار سهام شیکاگو (Chicago Stock Exchange = CHX) ، بازار نزدک (Nasdaq) و بازار (IRAs) چند نمونه از بزرگترین بازارهای مالی جهان در کشور آمریکا هستند. همچنین بازار بورس اوراق بهادار تهران بزرگترین بازار سهام در کشور ایران هست که حدود ۴۵ سال قدمت دارد.



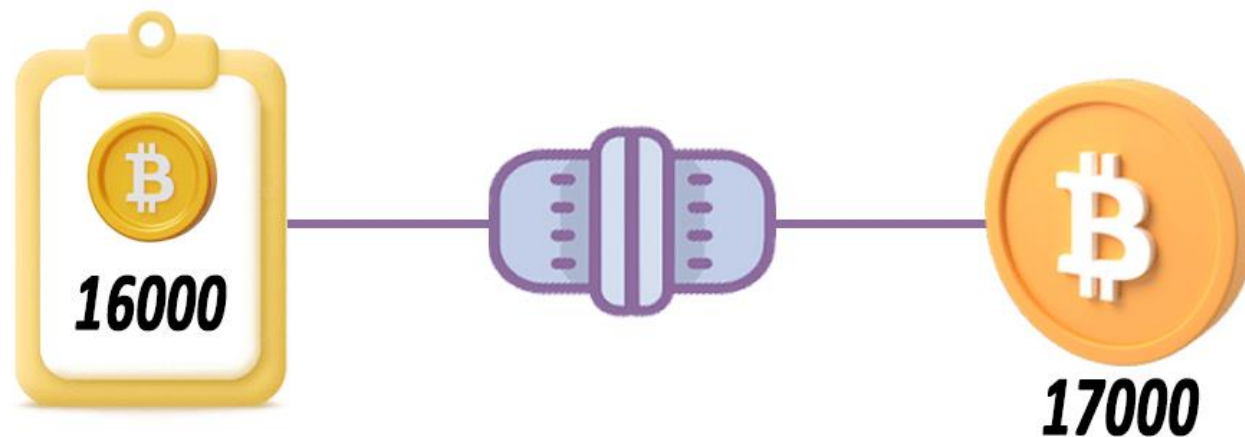
2- بازار اوراق قرضه – Bond Market



هدف از فروش اوراق قرضه، تأمین سرمایه‌ی لازم پروژه‌ها و عملیات مختلف هست. بازار اوراق قرضه این دارایی‌ها را در قالبی شبیه اسکناس ایجاد کرده و به خریدارها ارائه می‌کند. از آنجایی که فروشندگان اوراق قرضه به نوعی وام‌گیرنده و بدهکار می‌شود، به این بازار، اسامی Debt Market، Credit Market یا Fixed-income Market هم گفته می‌شود.



3- بازار مشتقات – Derivative Market



همونطور که در مبحث دارایی گفتیم ، منظور از مشتقات یا دارایی های مشتق شده ، یک قرارداد بین دو یا چند معامله گر روی ارزش یک یا مجموعه ای از دارایی های توافق شده مثل سهام ، کالا یا ... هست. در بازار مشتقات، دارایی های واقعی خرید و فروش نمی شن ؛ در حقیقت چیزی که توسط معامله گرها خرید و فروش می شه ، از ارزش یک دارایی دیگه مثل کالا ، سهام ، شاخص ، یا ارز دیجیتال مثل بیت کوین مشتق شده و قیمت اون رو دنبال می کنه . پس یک دارایی مشتق شده به تنهایی فاقد ارزش ذاتی هست و قیمت اون به ارزش یک دارایی دیگه لینک شده و مرتبط هست



3- بازار مشتقات – Derivative Market



مزیت بازار مشتقات نسبت به بازاری مثل سهام این هست که امکان شرکت در قراردادهای پیشرفته تری مثل اختیار معامله (Options Contracts) و معاملات آتی (Futures Contracts) و غیره در این بازار فراهم هست. بازار معاملات آپشن شیکاگو (CBOE) یکی از معروفترین بازار مشتقات در آمریکا هست.



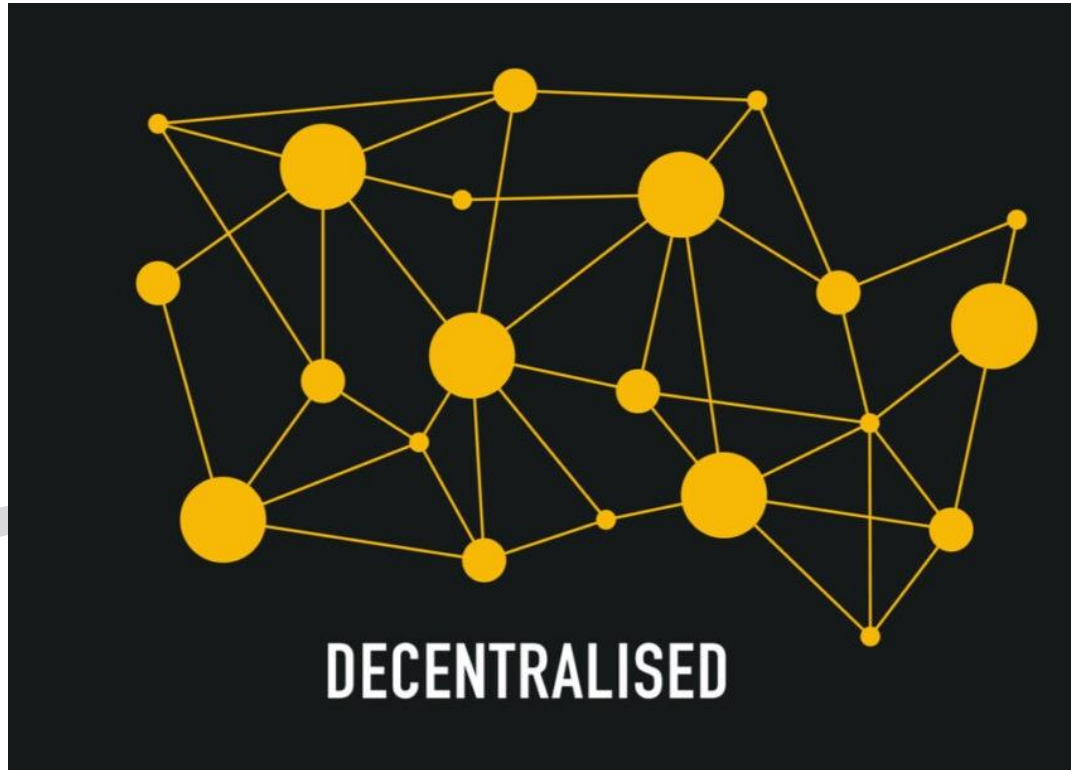
4 - بازار تبادل ارزهای خارجی - Forex



بازار تبادل ارزهای خارجی یا بورس ارز یا Foreign Exchange که با عبارت کوتاه‌شده‌ی Forex معروف شده به بازاری اشاره دارد که در اون ارز رایج کشورها مثل دلار، یورو، پوند، ین، کرون، فرانک، روبل و غیره با هم مبادله می‌شوند.



4 - بازار تبادل ارزهای خارجی - Forex



بازار تبادل ارزهای خارجی یک بازار غیرمتمرکز محسوب می‌شود و از مجموعه‌ای از سیستم‌های کامپیوتری و بروکرها در سراسر جهان تشکیل شده است. از مهم‌ترین فعالان بازار تبادل ارزهای خارجی می‌توانیم بانک‌ها، کمپانی‌های تبلیغاتی، بانک‌های مرکزی، شرکت‌های مدیریت سرمایه و صندوق‌های پوشش ریسک را نام ببریم. همچنین بروکرها (همان کارگزارها) و سایر سرمایه‌گذارها و حتی مردم معمولی هم می‌توانند در بازار فارکس فعالیت کنند و به مبادله‌ی ارز کشورهای مختلف بپردازند.



4 - بازار تبادل ارزهای خارجی - Forex



بیشترین حجم نقدینگی در بین تمام بازارهای مالی ، به بازار تبادل ارزهای خارجی یا فارکس تعلق دارد . حجم مبادلات روزانه در این بازار بیش از ۵ تریلیون دلار بوده که از مجموع مبادلات بازارهای سهام و فیوچرز بیشتر هست. بازار فارکس طبق تقویم کاری بین المللی، روزهای دوشنبه تا جمعه بصورت ۲۴ ساعته فعال هست .



4 - بازار تبادل ارزهای خارجی - Forex



در این بازار شما میتونین پول رایج کشور ها رو برای تجارت یا خرید و فروش بین المللی به هم تبدیل کنید ، همچنین میتونین با استفاده از علم تحلیل ، مثل بازار رمزارزها ، از رشد و ریزش جفت ارزهای اون ها سود کسب کنید. البته هدف بیشتر افراد در بازار فارکس کسب سود از رشد و ریزش قیمت ها با استفاده از تحلیل قیمت هست و حجم کمی به تبدیل ارزها برای مبادلات خارجی اختصاص پیدا میکنه .





بازار کالاها یا بورس کالا یا Commodities Market یکی دیگر از انواع بازار مالی هست که محلی برای خرید و فروش دارایی‌ها و کالاها با فیزیکی به حساب میاد. این دارایی‌ها در شاخه‌های مختلفی از جمله محصولات کشاورزی (مثل گندم، ذرت، سویا و ... و حتی حیوانات اهلی مثل گاو و گوسفند)، انرژی و سوخت‌های فسیلی (مثل نفت، گاز، اعتبارات نفتی و ...)، فلزات گرانبها (مثل طلا، نقره، پلاتینیوم و ...) و کالاها با سافت (مثل قهوه، پنبه، شکر و ...) خرید و فروش می‌شن.





در مقیاس کلی تر به بازار کالا ، بازار Spot یا بازار نقدی هم گفته میشه . در واقع بازار Spot یا نقدی به بازاری اطلاق میشه که خرید و فروش دارایی ها بصورت واقعی و حقیقی با پرداخت هزینه و دریافت آنی دارایی انجام میشه .



5 - بازار کالا - Commodities Market



لازم به ذکر هست بیشتر حجم معاملات مربوط به بازار کالاها عملاً در بازار مشتقات صورت می‌گیرد. زیرا معامله در بازار مشتقات آسان‌تر بوده و معامله‌گرها مسئولیت‌های کمتری خواهند داشت. مثلاً وقتی یک نفر، چند بشکه نفت در بازار کالا خریداری می‌کند، مالک واقعی آن‌هاست و باید به فکر هزینه‌های محل نگهداری و حمل و نقل آن باشد. اما چنین مسائلی در بازار مشتقات وجود ندارد و بدون نگرانی می‌توان نفت و سایر کالاها را به قیمت روز خرید و فروش کرد.



5 - بازار کالا - Commodities Market



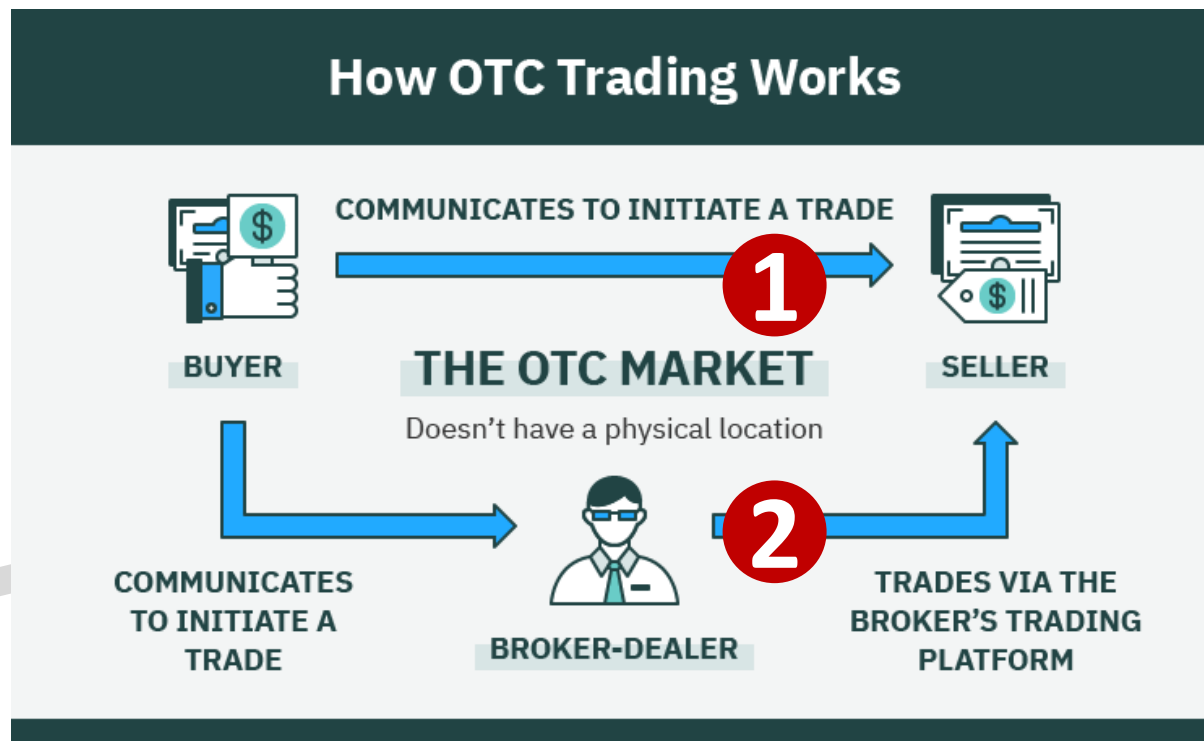
بورس کالای شیکاگو (Chicago Mercantile Exchange = CME) و بازار اینترکنتیننتال (Intercontinental Exchange = ICE) از معروف‌ترین بازارهای کالا در کشور آمریکا هستند.





فرابورس یا خارج از بازار یا بازار OTC که کوتاه شده‌ی عبارت **Over The Counter Markets** هست شکلی از انواع بازار مالی هستند که مبادلات در یک محل فیزیکی مشخص انجام نمی‌گیره ؛ بلکه به صورت الکترونیکی بوده و بدون دخالت بروکر یا صرافی ، بین خریدار و فروشنده انجام می‌شه. بیشتر معاملات مربوط به سهام، در بازار بورس سهام انجام می‌شه ؛ اما برخی سهام خاص (در بیشتر اوقات سهام کوچک‌تر و یا سهام پرریسک که شرایط لیست شدن در بازار اصلی سهام را ندارند) در این بازار معامله می‌شن .





همونطور که میبینید معاملات در دو حالت میتونه در بازار OTC انجام بشه

در حالت اول خریدار و فروشنده باهم ارتباط میگیرن و یک معامله رو انجام میدن

و در حالت دوم کارگزار یا صرافی بدون اینکه دخالتی در خرید یا فروش دو طرف داشته باشه ارتباط میان خریدار و

فروشنده رو برقرار میکنه . برای درک بهتر به نرم افزار دیوار در کشور ایران دقت کنید . دیوار بدون دخالت در

خرید و فروش یک دارایی صرفا با پخش آگهی برقرار کننده ارتباط میان دو طرف هست



Link between crypto and traditional markets tightens

Futures contract price



Source: Bloomberg
© FT

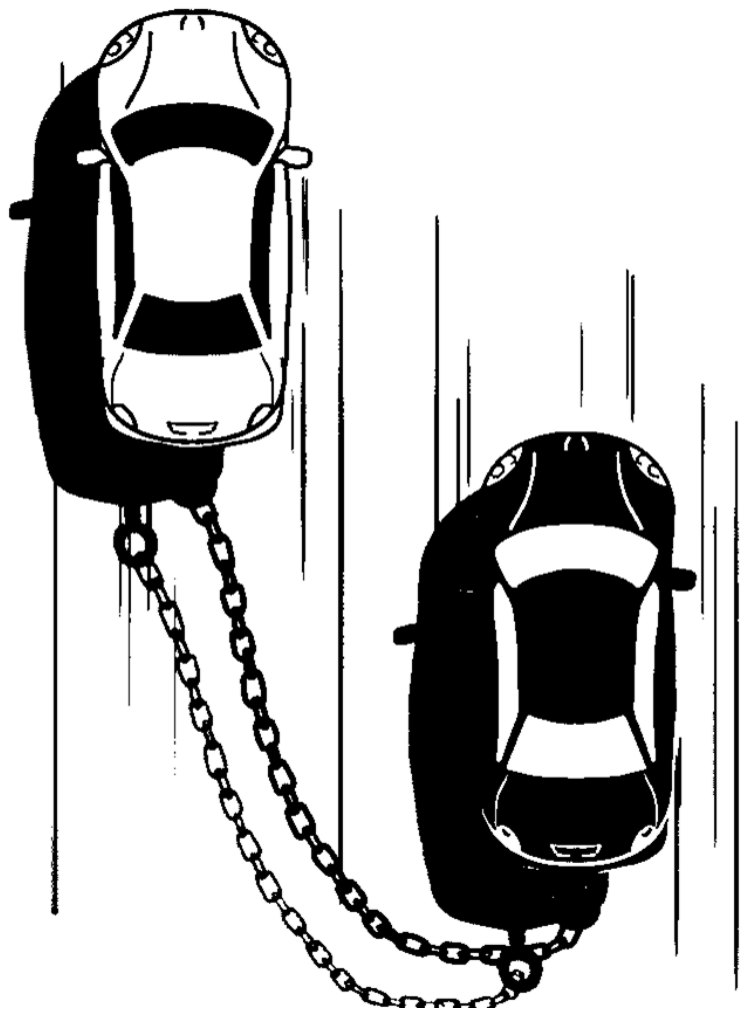
همبستگی یا وابستگی

Correlation



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

همبستگی یا وابستگی - Correlation



همبستگی یا وابستگی (Correlation) در بازارهای مالی زمانی اتفاق می‌افتد که نمودار دو دارایی گوناگون هماهنگ با همدیگر حرکت کنند یا به عبارت دیگر بی ارتباط با هم نباشند. همونطور که در بحث دامیننس اشاره کردیم، این موضوع رو به خوبی می‌تونیم در پیروی رفتار رمزارزها از بیت کوین فهمید. بیت کوین به دلیل دامیننس بالا نسبت به سایر ارزها، مثل لیدر بازار عمل می‌کنه. هنگامی که بیت کوین اوج می‌گیره اکثر آلت کوین‌ها هم با اون رشد می‌کنند و هنگامی که قیمت بیت کوین کاهش پیدا میکنه، شاهد ریزش اکثر آلت کوین‌ها هستیم.



همبستگی یا وابستگی - Correlation



حال این موضوع رو می‌تونیم در سایر بازارها هم ببینیم. به عنوان مثال در بازار کامودیتی‌ها و ارزهای فیات هنگامی که قیمت نفت مناسب هست و تقاضای جهانی برای اون خوب هست، می‌بینیم که نمودار دلار کانادا (CAD/USD) هم از اون پیروی می‌کنه و هم‌زمان با رشد صعودی قیمت نفت شاهد رشد مناسب دلار کانادا نسبت به دلار آمریکا هم هستیم.



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

ضریب همبستگی – Correlation Degree

$$-1 \leq \text{Correlation Degree} \leq 1$$

هر چي میزان همبستگی بیشتر باشه ، نسبت تاثیرگذاری نمودارها و دارایی‌ها بر یکدیگر بیشتر میشه . برای بررسی بهتر همبستگی از یک ضریب استفاده می‌کنند که به اون ضریب همبستگی گفته می‌شه . ضریب همبستگی بین اعداد -1 تا 1 هست. به عنوان نمونه اگر ضریب همبستگی یک ارز با ارز دیگه 1 باشه ، یعنی دو نمودار دقیقاً مطابق بر هم رفتار میکنند (در یک جهت و به یک اندازه) اما اگر مثلاً ضریب همبستگی 0.9 باشه در یک جهت هستند اما به یک اندازه نیستند با این حال ضریب 0.9 نشون از همبستگی شدید با اون ارز داره .



$$-1 \leq \text{Correlation Degree} \leq 1$$

در حالت متقابل اگر ضریب همبستگی 1- باشد ، نمودارها عکس یکدیگره ولی به یک اندازه حرکت می کنند و اما اگر ضریب همبستگی مثلا 0.9- باشد یعنی عکس یک دیگه حرکت میکنند ولی به یک اندازه حرکت نمی کنند .
و در حال سوم اگر ضریب همبستگی صفر باشد یعنی دو نمودار هیچ گونه همبستگی قیمتی با هم ندارند .



تمرین : علامت ضریب همبستگی را مشخص کنید

ضریب همبستگی مارکت کپ کل بازار، رمزارزها با قیمت بیت کوین

ضریب همبستگی قیمت بیت کوین با دامیننس تتر

ضریب همبستگی قیمت دلار با قیمت تتر (نسبت به ریال)

ضریب همبستگی قیمت دلار (نسبت به ریال) با قیمت بیت کوین



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

کاربرد همبستگی در بازار



همبستگی نمودارها به معامله گران کمک می‌کند تا نسبت به شاخص‌هایی که روی ترید اون‌ها تاثیر می‌گذارد آگاه باشن و موقعی که نمودار یک دارایی رو تحلیل میکنند به نمودارهای وابسته یا همبسته به دارایی خودشون هم توجه کنند. این موضوع باعث میشه تا از ضررهای احتمالی بخاطر واکنش به ارز یا دارایی وابسته جلوگیری کنند. مثلاً وقتی نمودار بیت کوین رو تحلیل میکنیم میتونیم با توجه به همبستگی معکوس نمودار بیت کوین با دامیننس تر، تحلیل بهتری روی چارت بیت کوین داشته باشیم، البته بازهم ملاک تصمیم قطعی نیست و صرفاً تایید بر تحلیل شماست!!



همبستگی بازار رمزارزها با بازارهای بزرگ جهانی



در سالهای ابتدایی که بیت کوین در حال گسترش بود، نمی توانستم نموداری با همبستگی بالا با بیت کوین پیدا کنیم. این موضوع تا این اواخر نیز ادامه پیدا کرد. بسیاری از طرفداران بیت کوین معتقد بودند که راه بیت کوین جدای از دیگر داراییها خواهد بود و بیش از پیش تأکید می کردند که بیت کوین یک ابزار ضد تورمی خواهد بود. با این حال گسترش بیت کوین و پذیرش اون توسط نهادها و مؤسسات گوناگون و همچنین سرمایه گذاری بسیاری از بانکها و صندوقهای سرمایه گذاری موجب شد تا ضریب همبستگی بیت کوین دستخوش تغییر بشه .



همبستگی بازار رمزارزها با بازارهای بزرگ جهانی



به طوری که تصمیمات اقتصادی در کشورهای بزرگ مثل آمریکا، سیاست های انقباضی و انبساطی اقتصادی در حوزه اقتصاد کلان مثل شاخص های نرخ بهره، بیکاری، تورم و ... علاوه بر اینکه بر بازارهای جهانی مثل فارکس و بازار سهام و ... تاثیر میذاره، بر بیت کوین هم تاثیر میذاره. به همین جهت هست که باید با شاخص هایی مهمی که در این حوزه برای تحلیل روند کلی بازارهای جهانی استفاده میشه آشنا باشیم تا از روند کلی بازارهای جهانی و تاثیر اون بر بازار رمزارزها مطلع باشیم.



سه شاخص مهم بازارهای مالی که بازار رمزارزها با آنها همبستگی دارد

در بازار های مالی شاخص هایی وجود دارد که به کمک اون میتونیم روند بیشتر بازارهای مالی رو بسنجیم ، از جمله مهم ترین شاخص هایی که بیت کوین با اون همبستگی دارد شاخص های زیر هستند :

1

شاخص اس اند پی ۵۰۰
Standard and Poor's Index (S&P 500)

2

شاخص نزدک
Nasdaq Index

3

شاخص داو جونز
Dow Jones Index



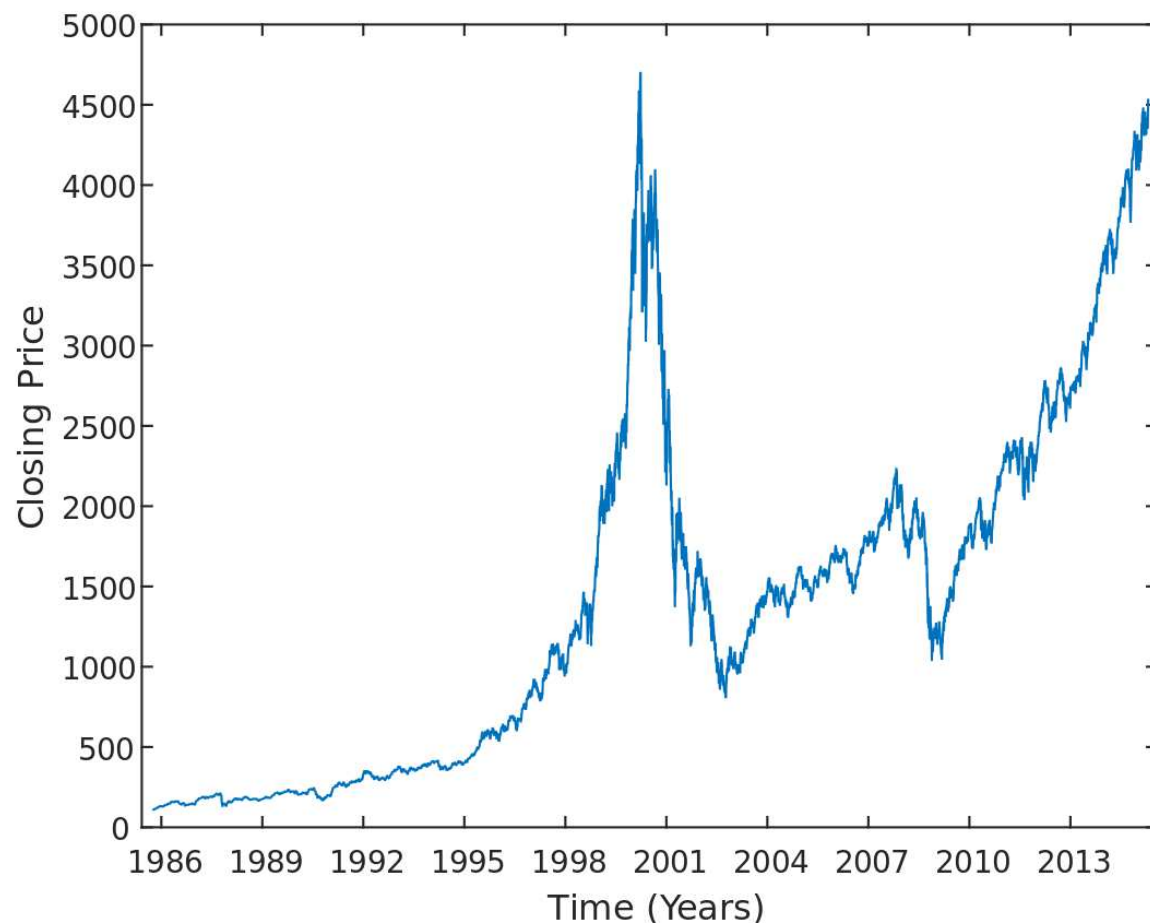
شاخص اس اند پی پونصد - S&P 500 Index



اس اند پی ۵۰۰ (S&P 500) مخفف عبارت Standard and Poor's Index فهرستی از ۵۰۰ سهام برتر در بازار بورس سهام نیویورک و نزدیک هست. از این فهرست جهت قیاس در معاملات، خرید و فروش سهام جهت ارزیابی عملکرد شرکت‌های بزرگ استفاده می‌شود. بنابر این، این شاخص روند کلی قیمت این سهام‌ها را به ما نشان می‌دهد. برای تحلیل چارت این شاخص در سایت تریدینگ ویو عبارت SPX را سرچ کنید.



شاخص نزدک - Nasdaq 100



شاخص نزدک (Nasdaq Index) ، یک معیار برای سنجش واحدهای سهام بازار بورس نزدک هست . در واقع شاخص نزدک (Nasdaq) میانگینی از فعالیت شرکت های حاضر در این بازار هست. از ویژگی های این شاخص می توانیم به امنیت شبکه ، ساعت کاری مناسب و پشتیبانی از بیت کوین اشاره کرد. برای تحلیل چارت این شاخص در سایت تریدینگ ویو عبارت NDX یا Nasdaq 100 رو سرچ کنید.

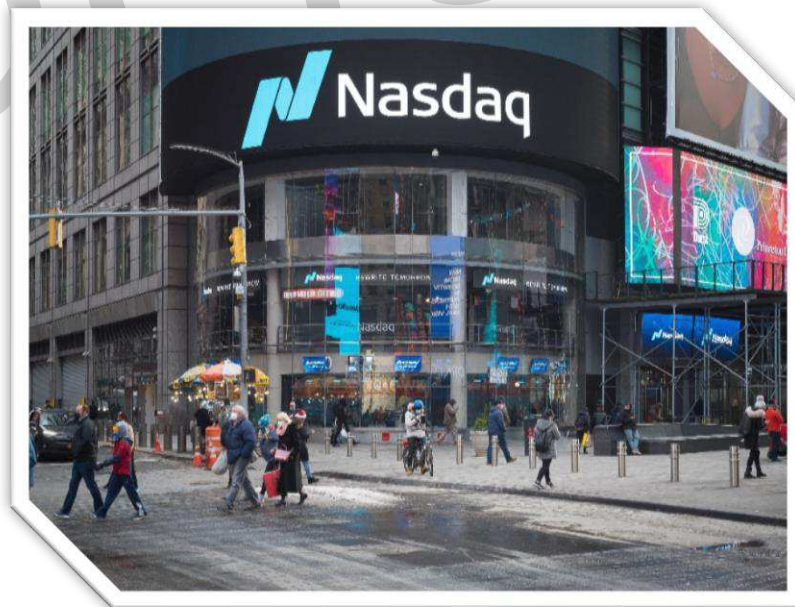


استفاده از بیت کوین در بازار نزدیک



بازار نزدیک ، اولین و مطمئن ترین بورسی هست که از بیت کوین در معاملات خودش استفاده می کنه. همین ویژگی باعث شده تا افراد زیادی به معامله در بورس نزدیک روی بیاړن.

اشتباه نکنید !! نزدیک به عنوان یک صرافی بزرگ رمزارزی نیست بلکه یک بورس سهام در بازار آمریکاست که در معاملات خودش از بیت کوین استفاده میکنه . نه یک صرافی رمزارز خارجی !!



مدرس : مهندس فرشید میرزائی

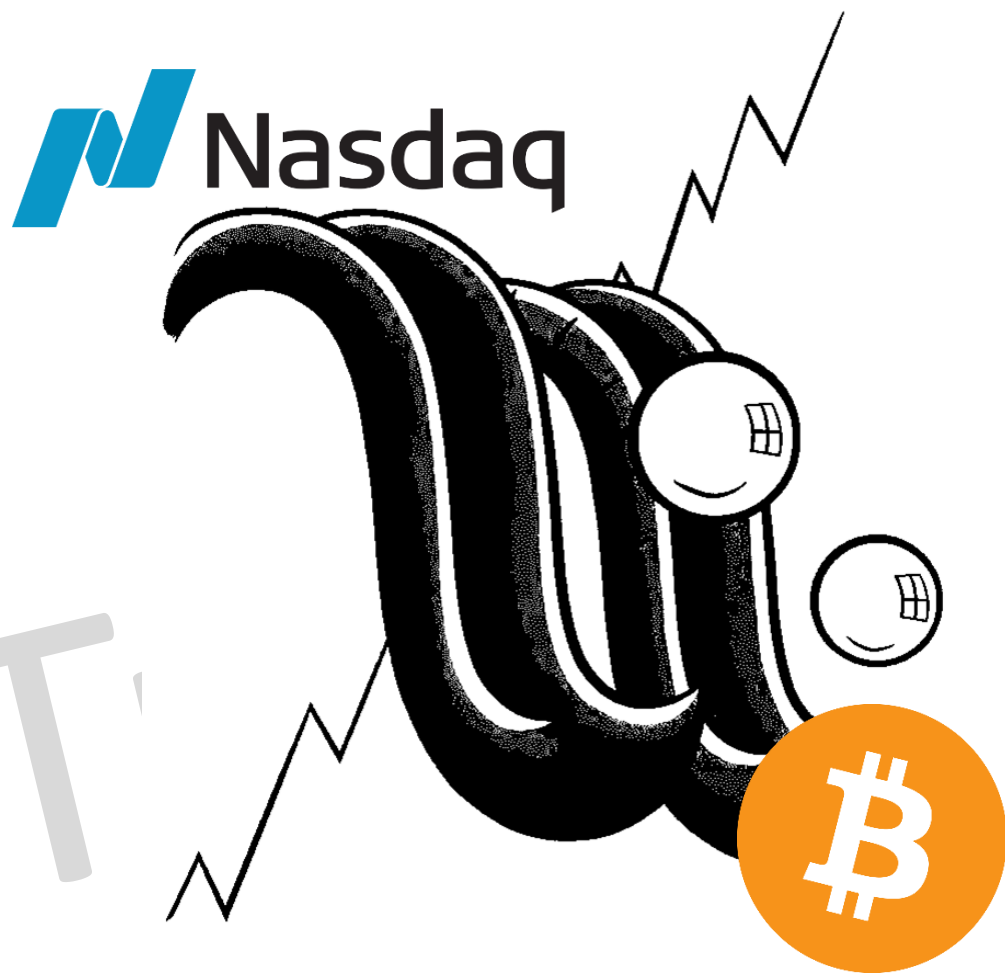
شاخص داوجونز - Dow Jones Index



شاخص داوجونز (Dow Jones Index) یک میانگین صنعتی از شاخص بورس در آمریکاست که نوسانات قیمت ۳۰ شرکت فعال در ایالت متحده آمریکا رو نشون می‌ده. سهام برندهای مشهور آمریکا که در زمینه‌های امور مالی، نفت و گاز، خدمات عمومی، کالاهای مصرفی، فناوری و مخابرات و مراقبت‌های پوستی فعالیت می‌کنند، این شاخص وزنی قیمتی رو تشکیل می‌دن. برای تحلیل چارت این شاخص در سایت تریدینگ ویو عبارت DJI را سرچ کنید.



همبستگی شدید قیمت بیت کوین با شاخص نزدک



هم اکنون بیت کوین با شاخص S&P 500 و داو جونز همبستگی دارد اما بیشتر از همه با شاخص نزدک (بورس نیویورک) همبستگی بیشتری رو ایجاد کرده ، به صورتی که بارها در طی معاملات هفتگی یا روزانه خودش ، از بازار نزدک تاثیر میگیره ، بنابر این به عنوان تاییدیه ، بد نیست در تحلیل خودتون نگاهی به این شاخص داشته باشید.



تمرین کلاس : مقایسه رفتار بیت کوین با نزدک



در سایت تریدینگ ویو ، نمودار قیمت بیت کوین و شاخص نزدک رو در تایم فریم روزانه باز کنید و یک بازه زمانی دلخواه و مشابه رو در دو نمودار در نظر بگیرید .

همبستگی بازار بیت کوین و شاخص نزدک رو در این نمودار بررسی کنید و در کلاس به گفتگو در این باره بپردازید.

- BTCUSDT
- NDX

