

تحلیل تکنیکال کلاسیک

سهیل کلاهچی فر

تحلیل گر و معامله گر بازارهای مالی

تحليل تکنیکال چیست؟



• بررسی آماری

• عرضه و تقاضا

• وضعیت گذشته

ورودی‌های تحلیل تکنیکال



• قیمت

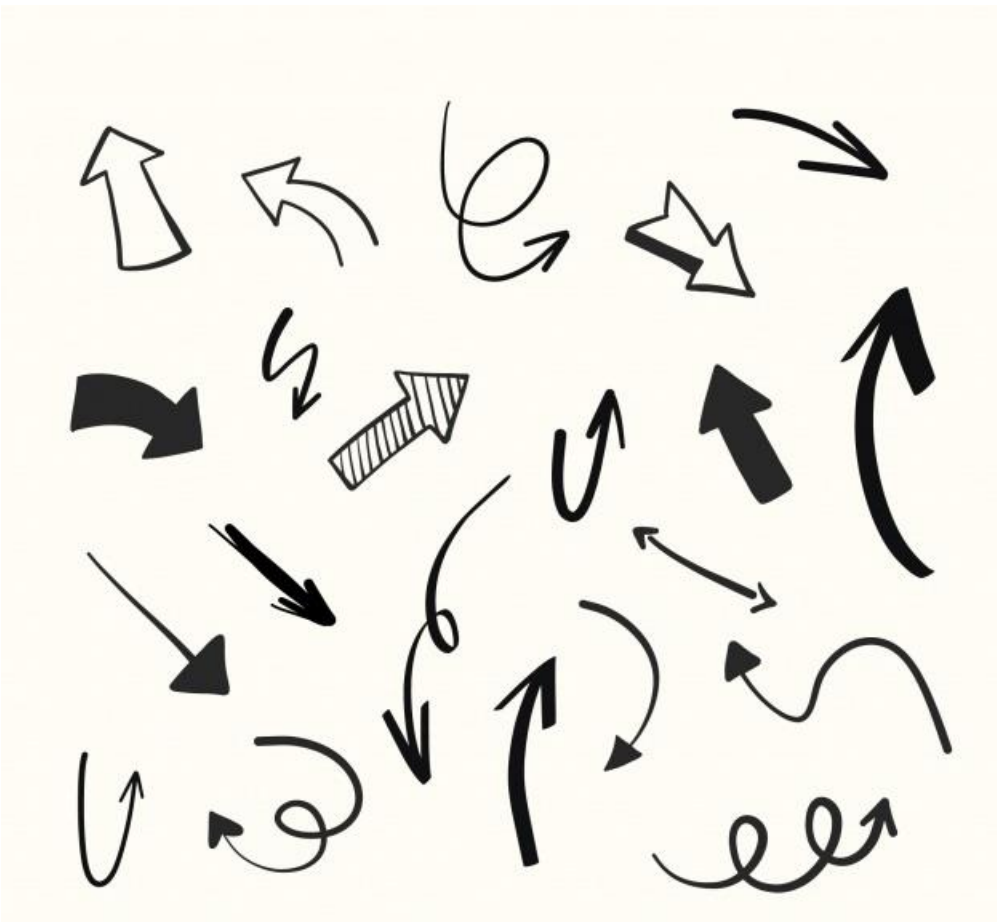


• زمان



• حجم

هدف تحلیل تکنیکال

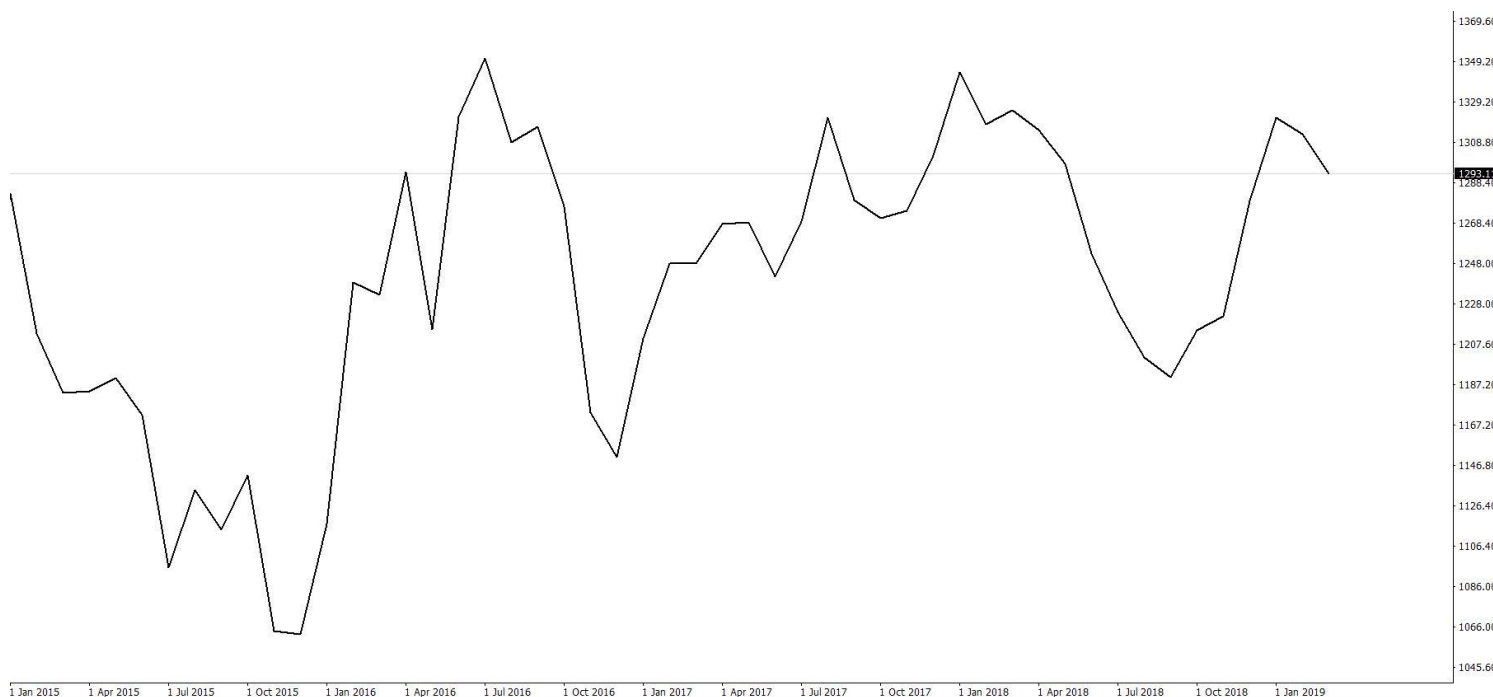


• تشخیص جهت

• معامله در جهت

انواع نمودار

• قیمت بر حسب زمان

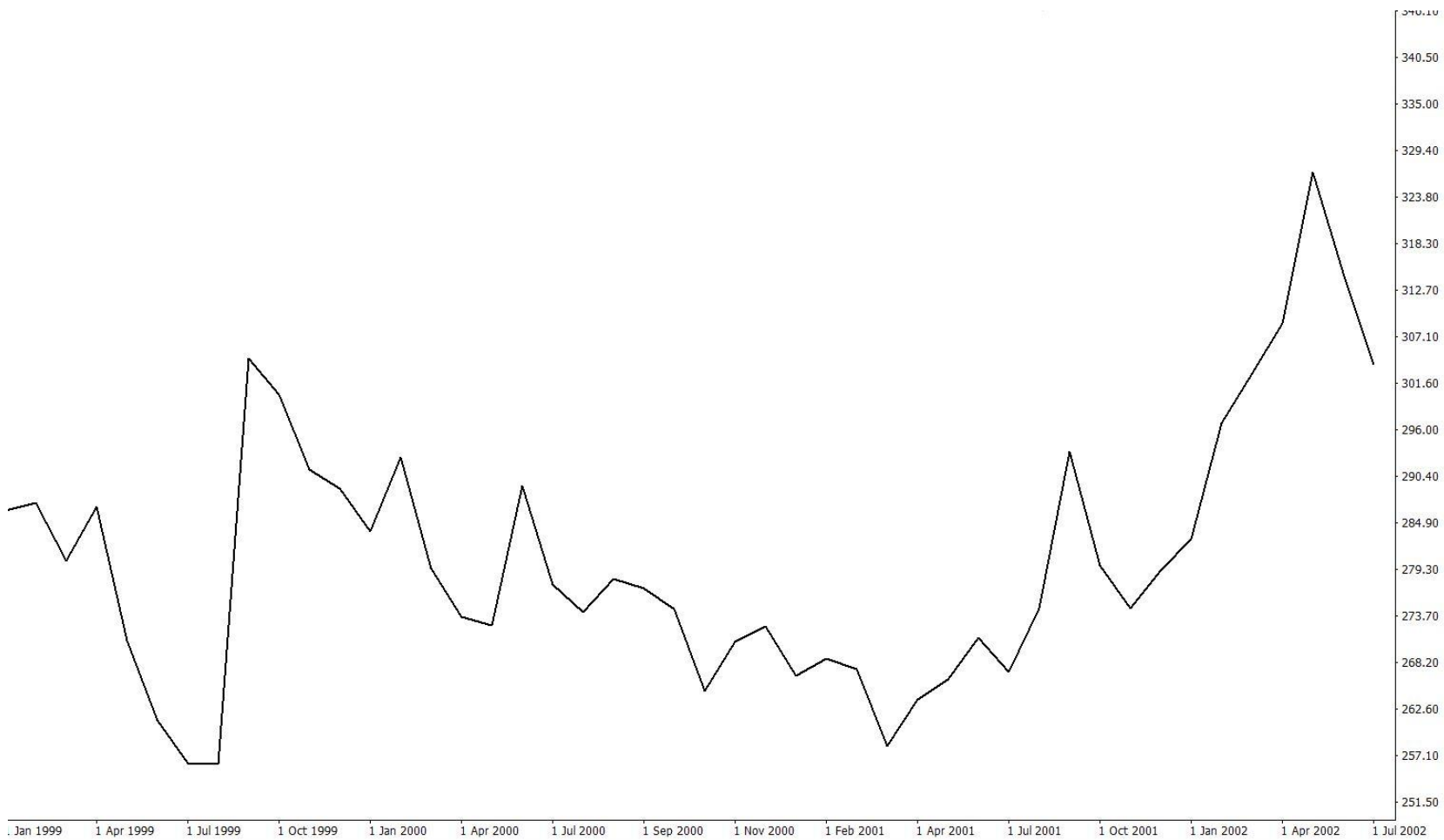


• خطی

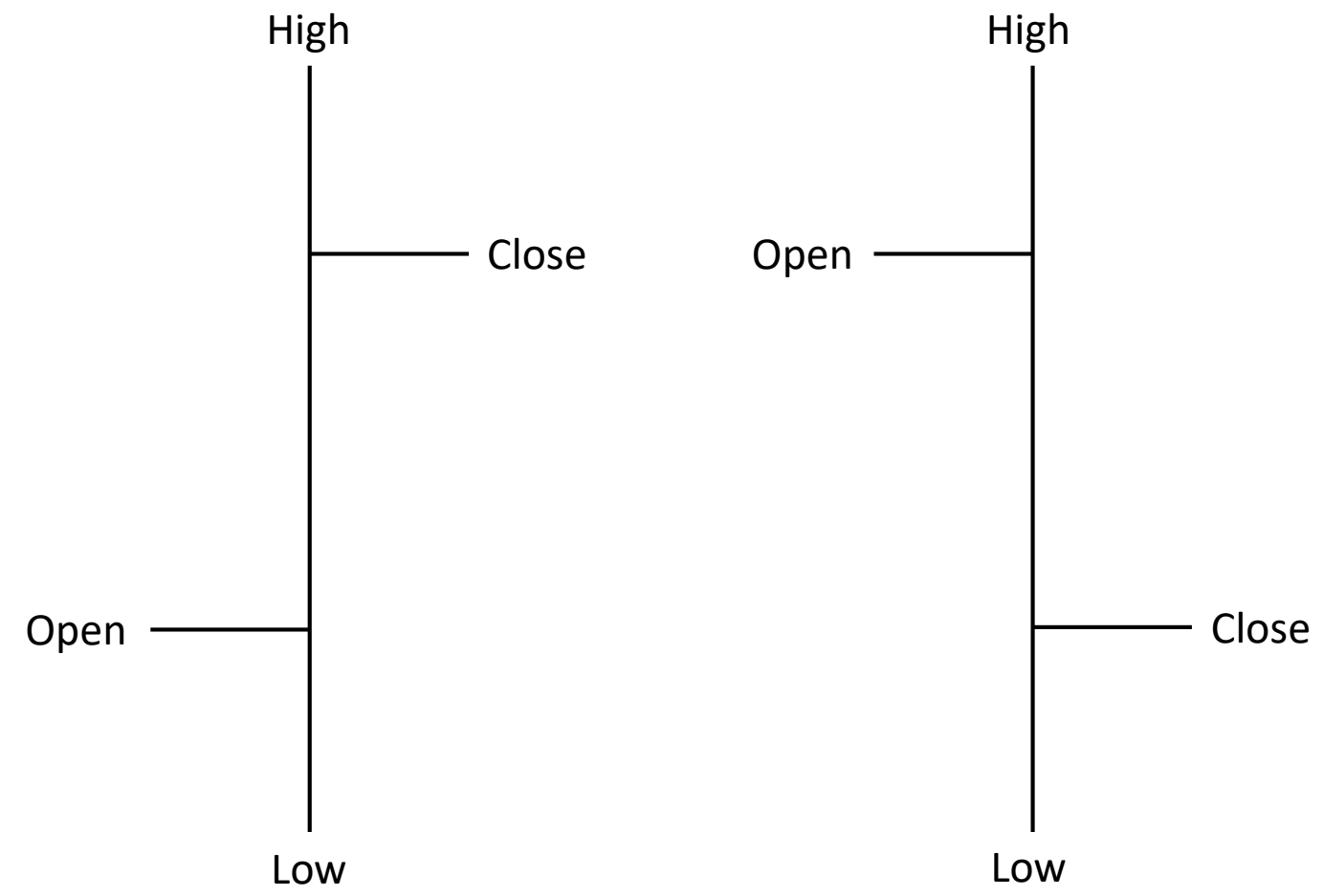
• میله‌ای

• شمعی

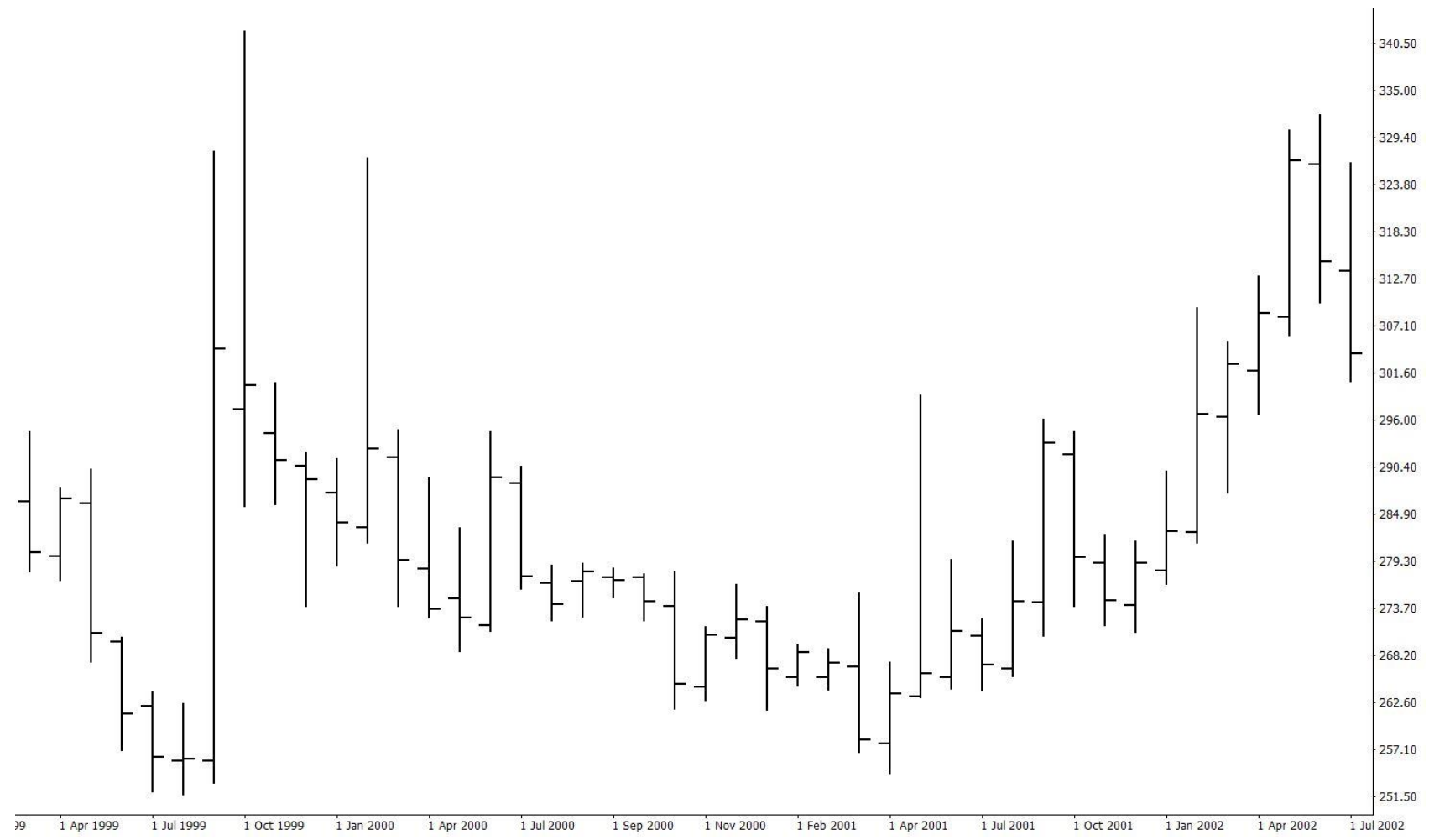
نمودار خطی



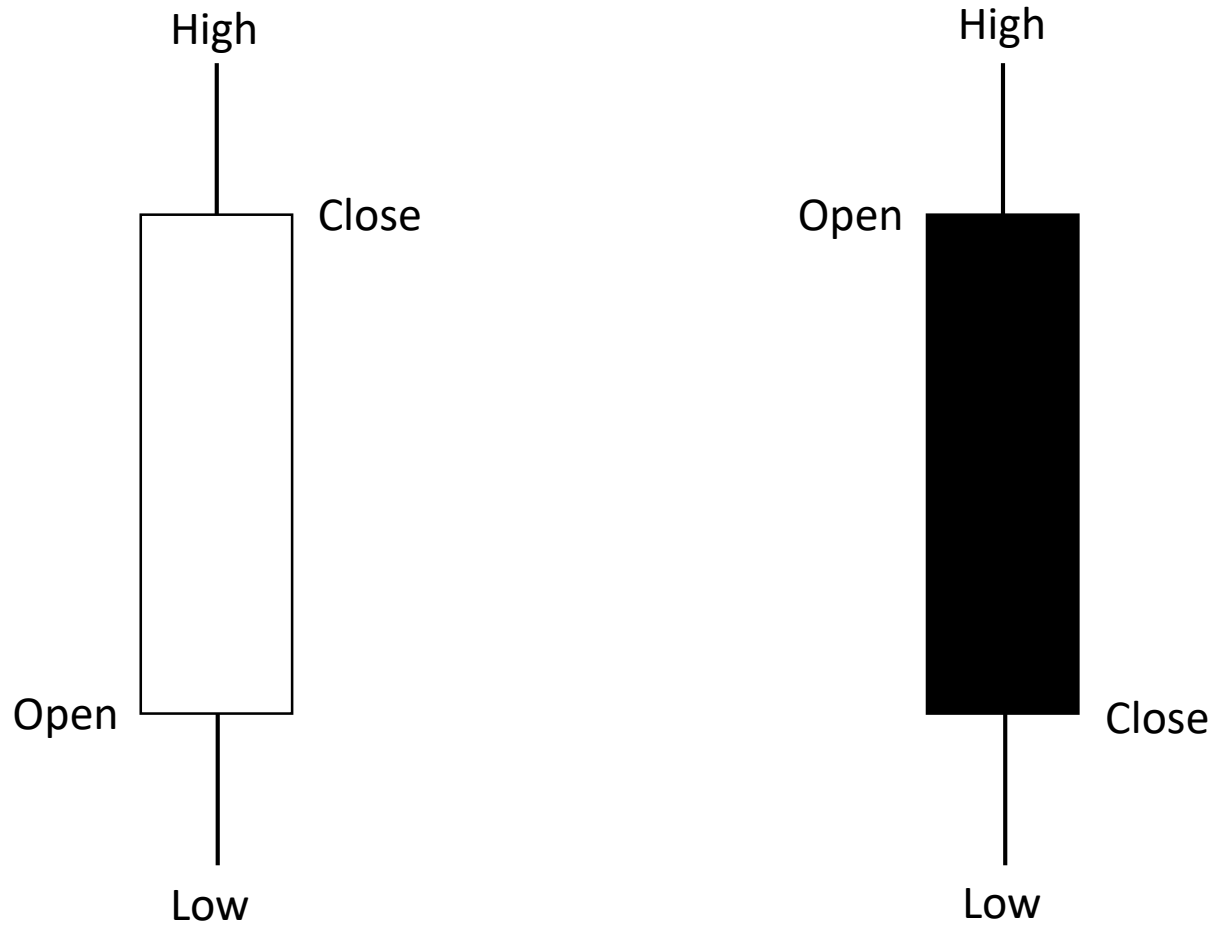
نمودار میله‌ای



نمودار میله‌ای



نمودار شمعی



نمودار شمعی



حمایت و مقاومت

- حمایت : سطحی که انتظار افزایش تقاضا داریم.
- مقاومت : سطحی که انتظار افزایش عرضه داریم.
- تبدیل سطوح

انواع روند

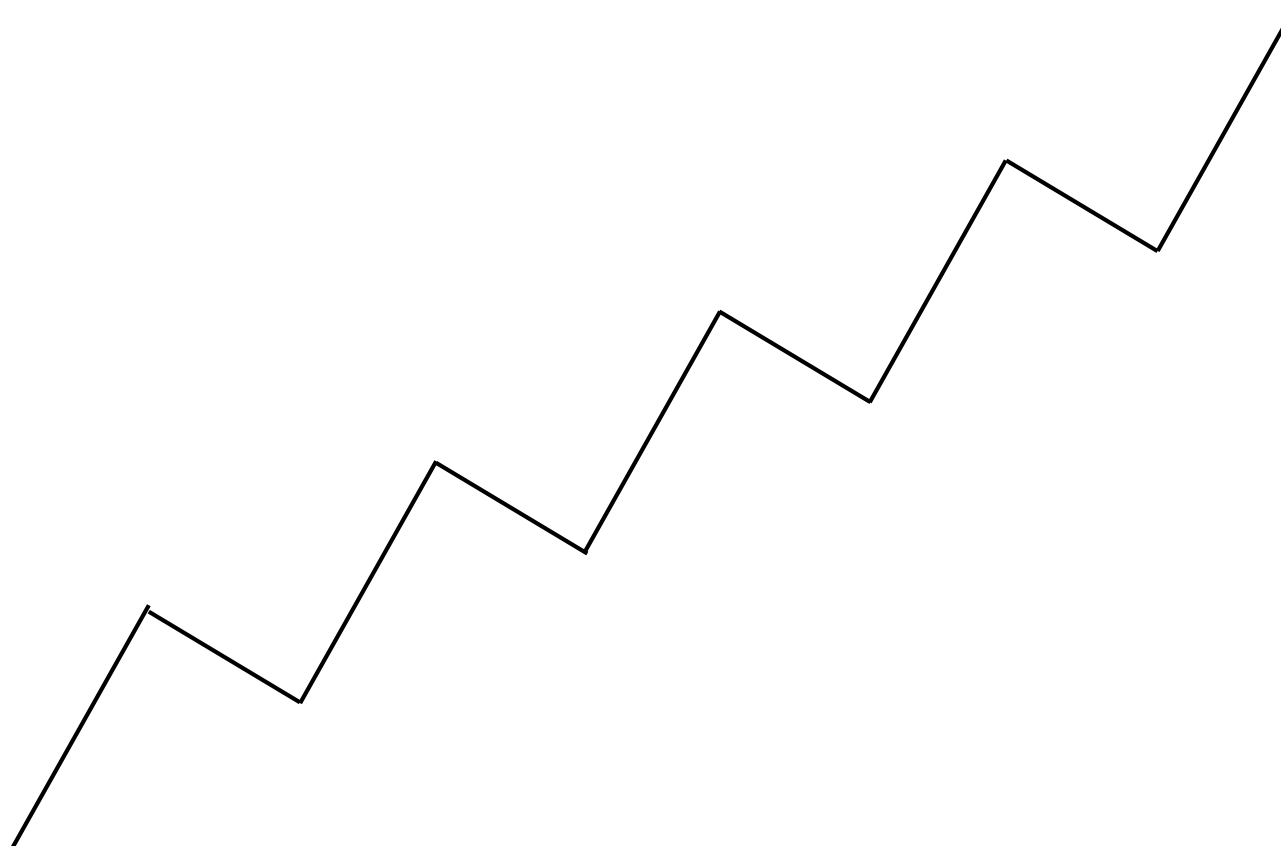


• صعودی

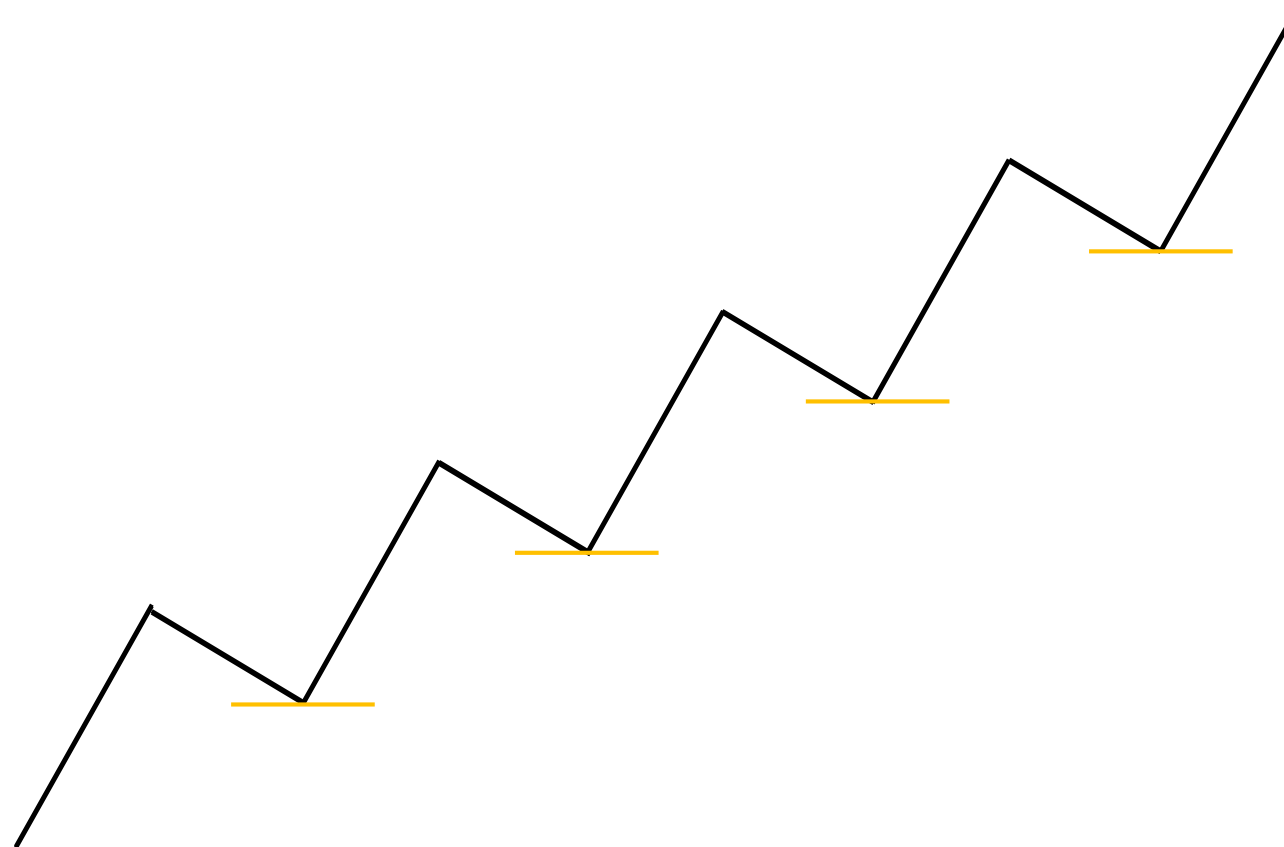
• نزولی

• خنثی

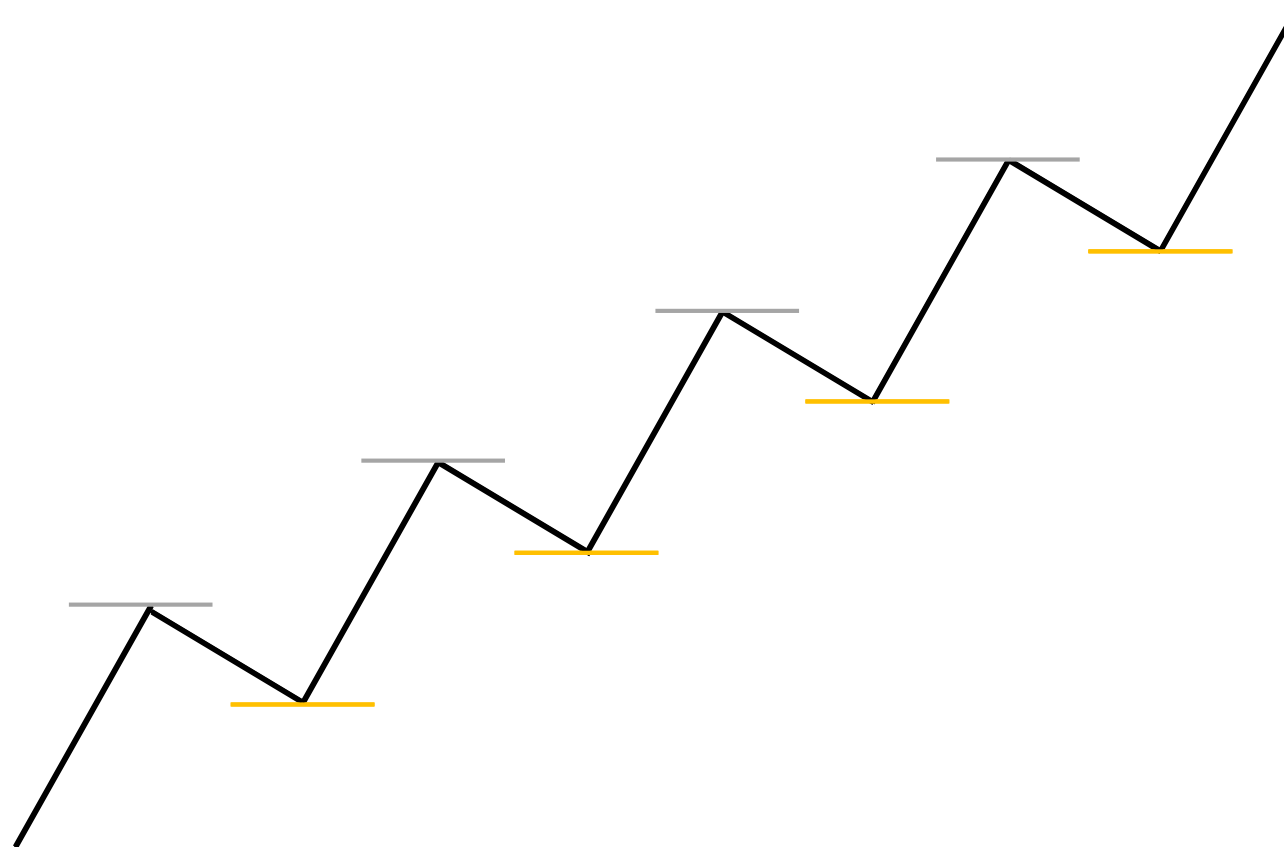
روند صعودی



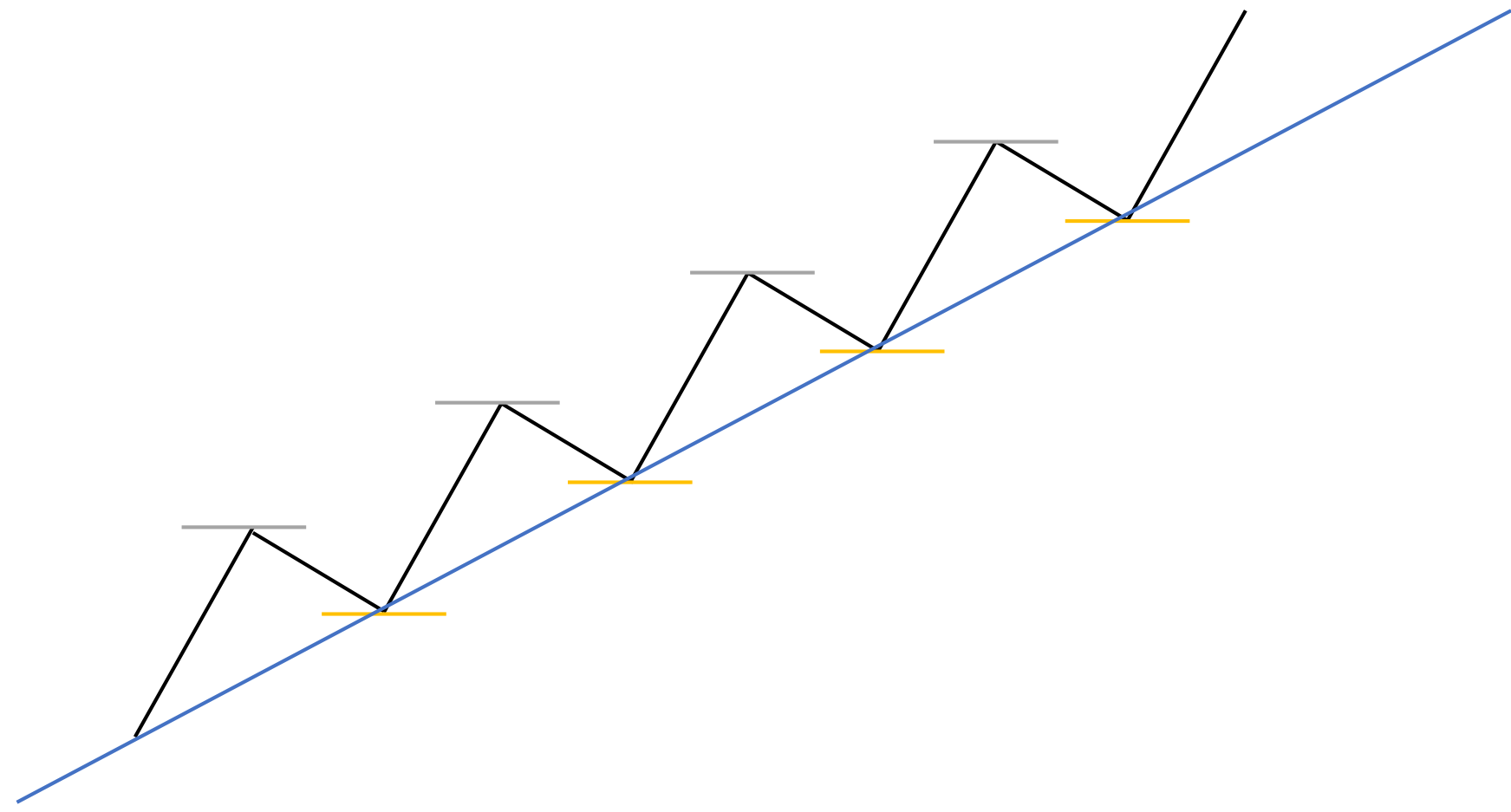
روند صعودی



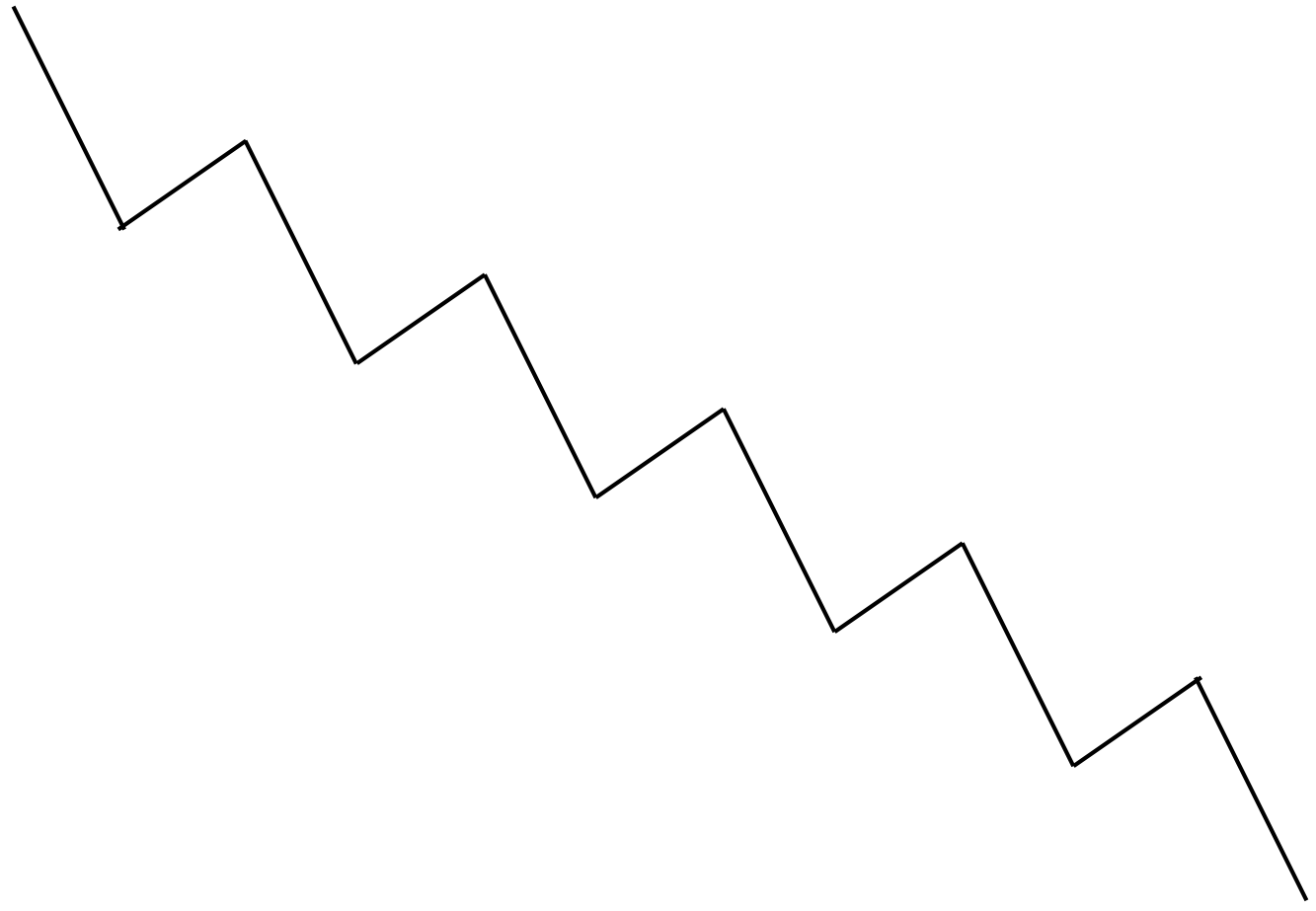
روند صعودی



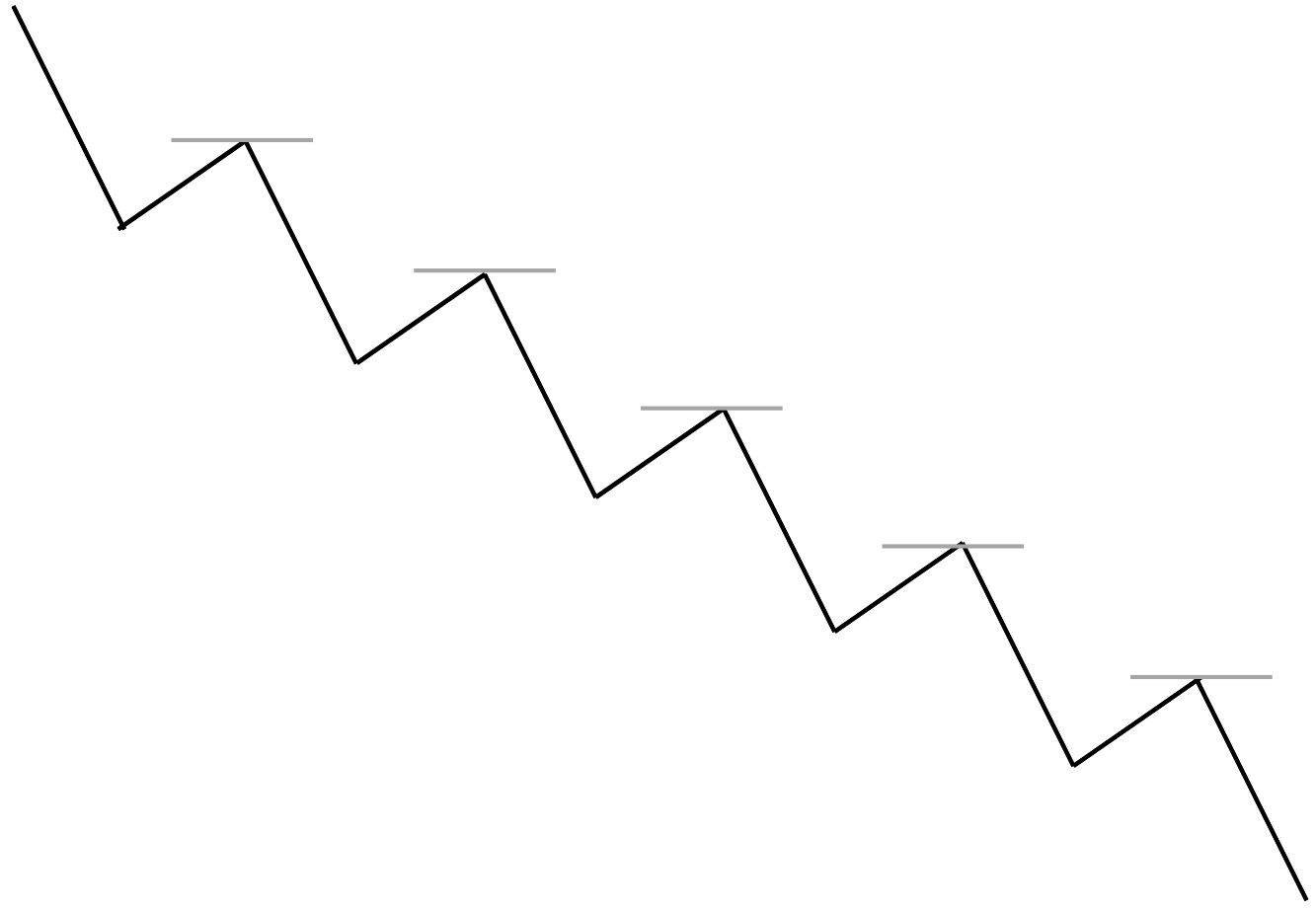
روند صعودی



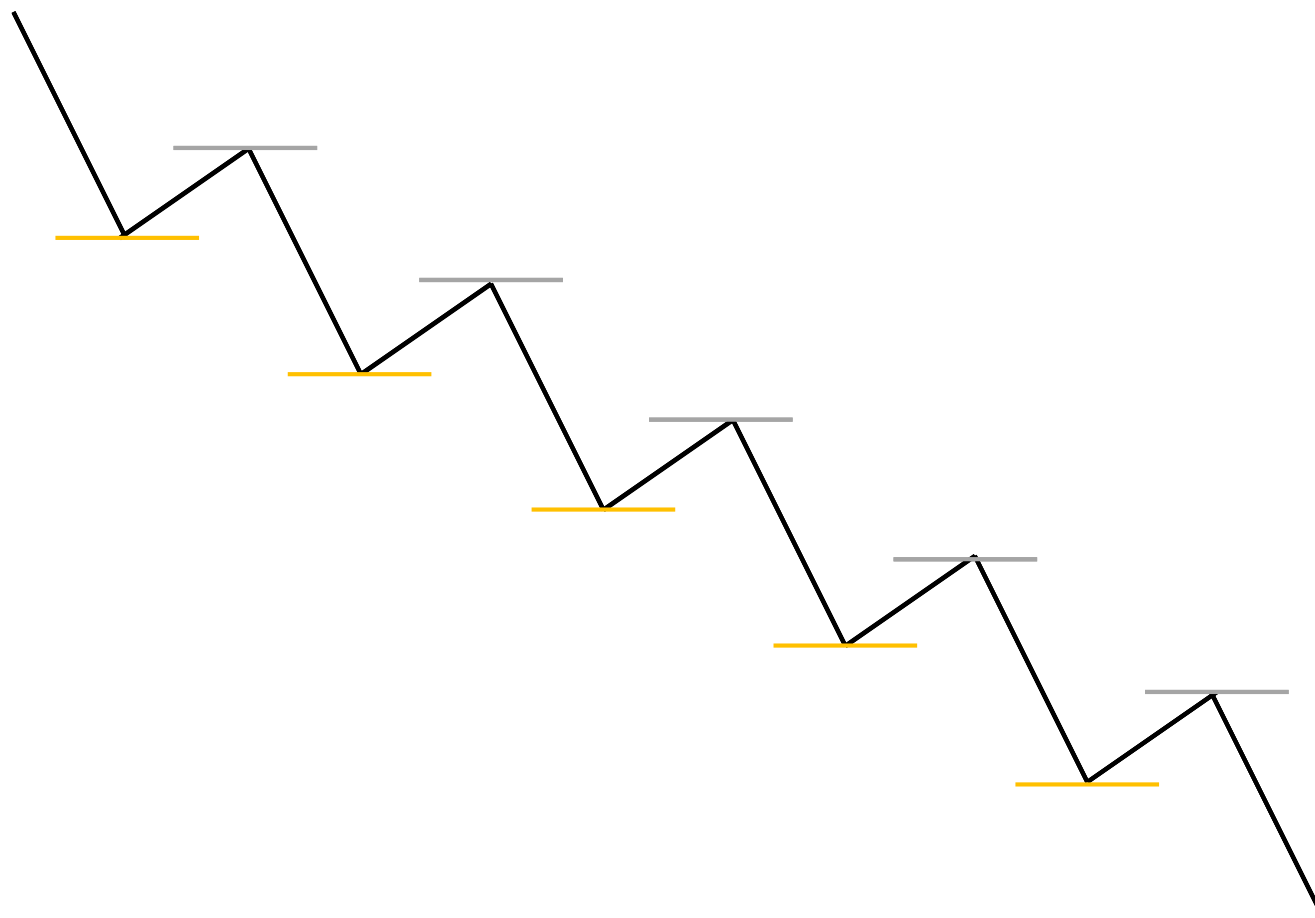
روند نزولی



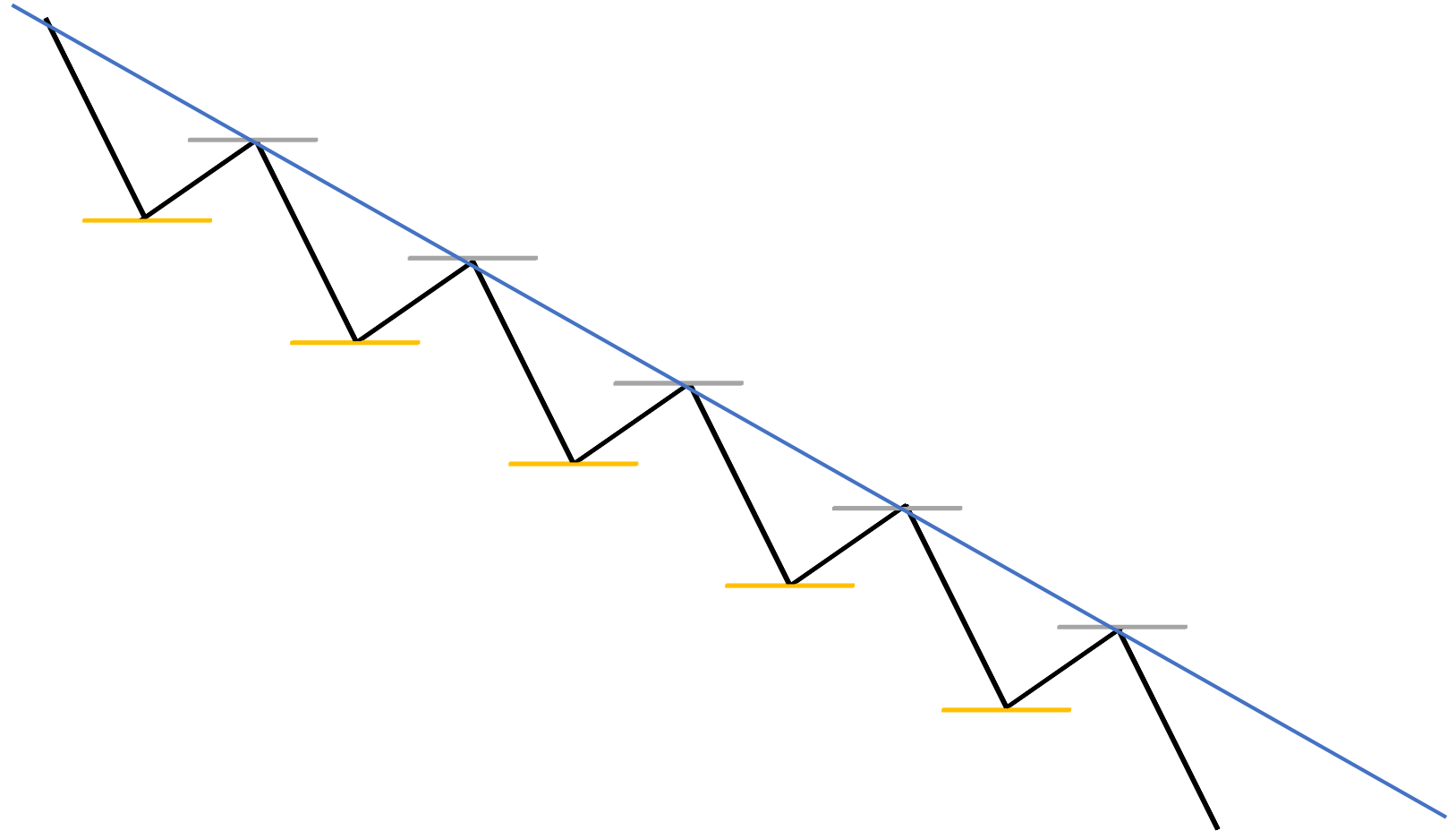
روند نزولی



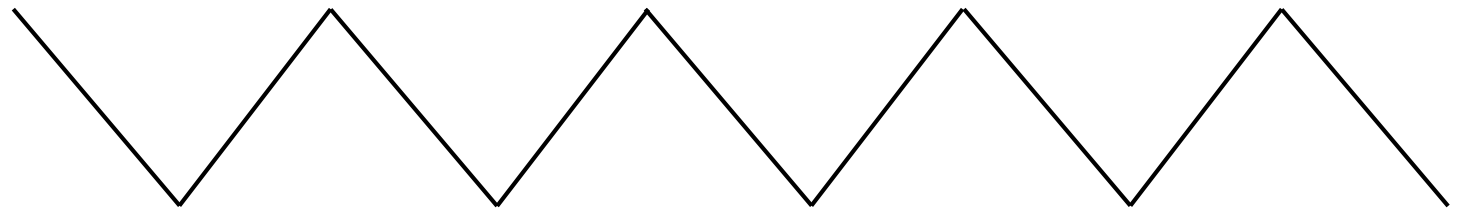
روند نزولی



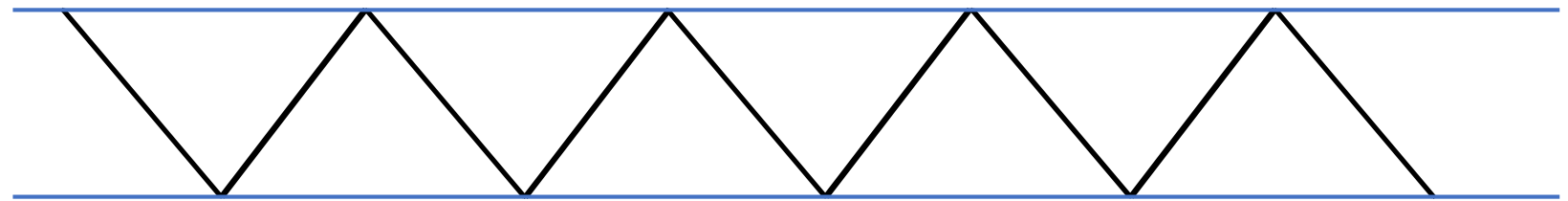
روند نزولی



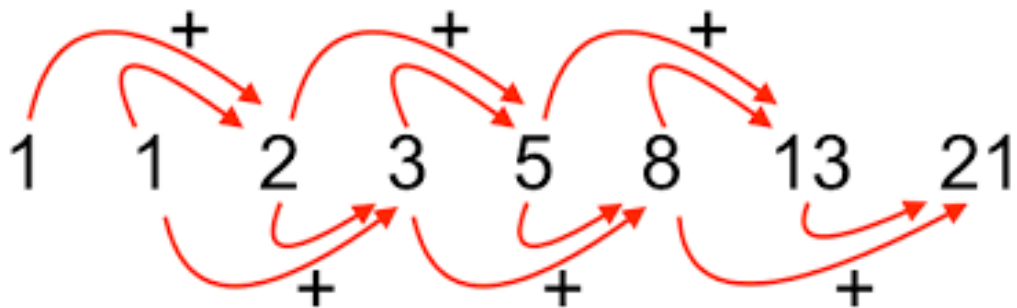
روند خنثی



روند خنثی



فیبوناچی



- اصلاحی
 - گسترشی
 - سه نقطه‌ای
- قیمتی :

- اصلاحی
 - گسترشی
 - سه نقطه‌ای
 - TCR
- زمانی :

فیوناچی اصلاحی



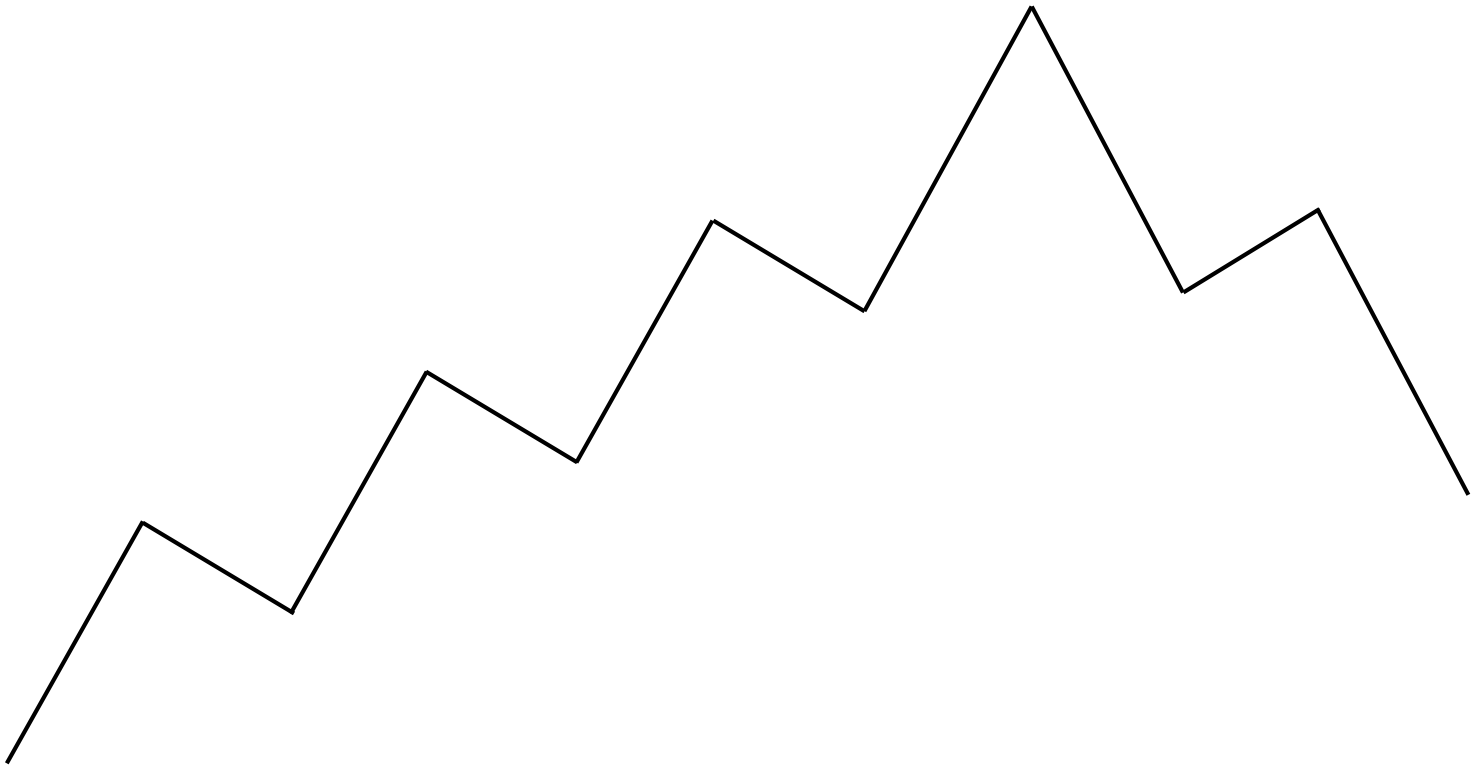
الگوها



- برگشتی
- ادامه دهنده

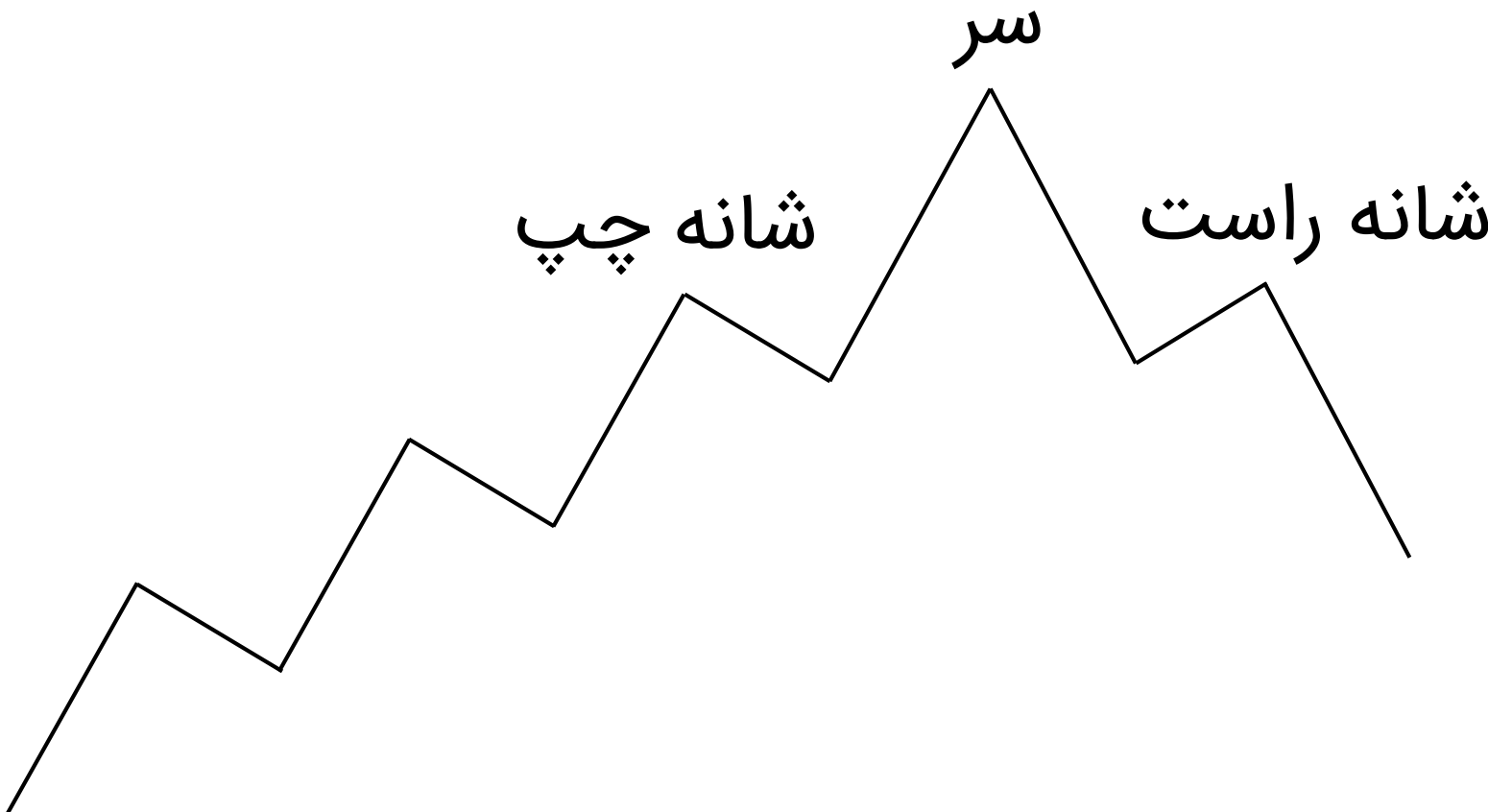
الگوهای برگشتی

• سروشانه



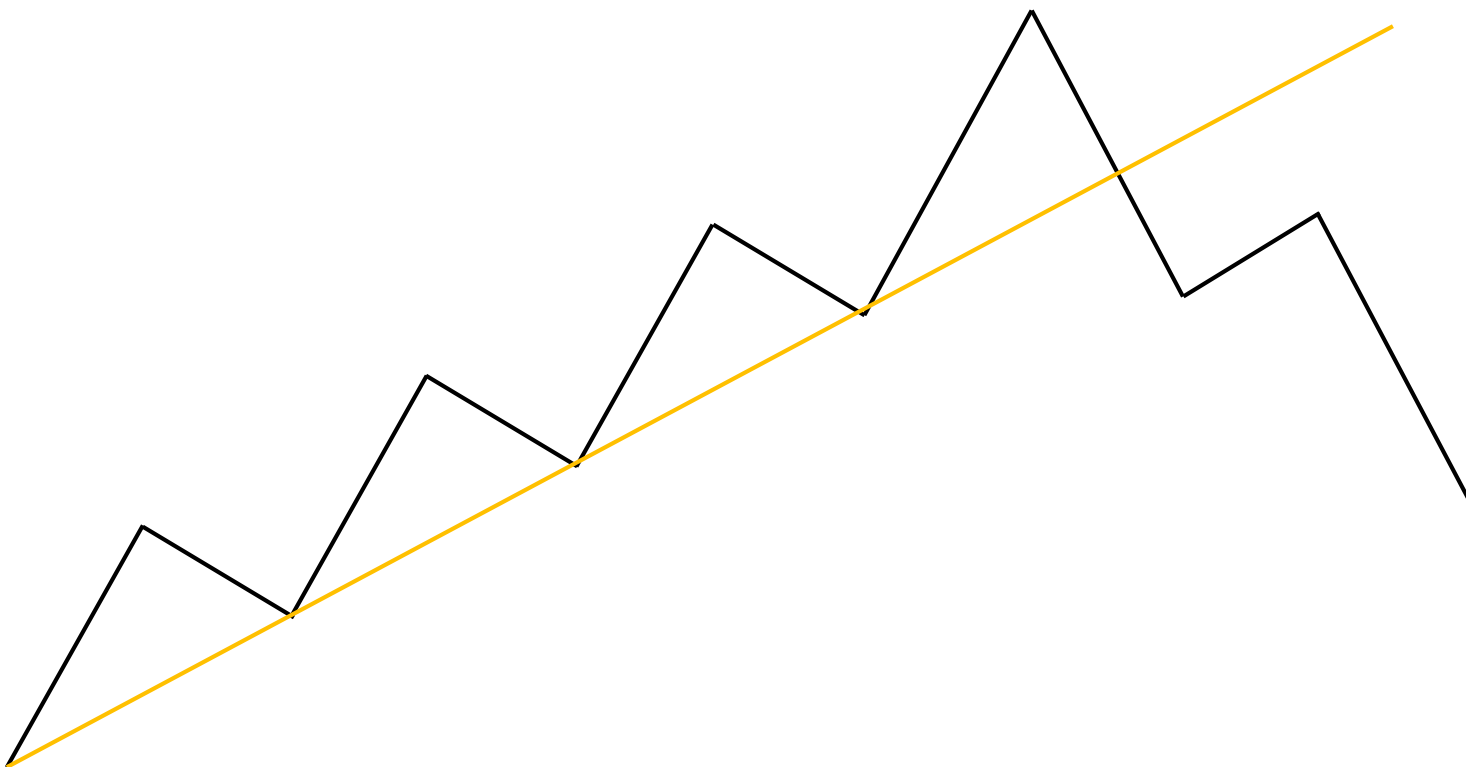
الگوهای برگشتی

• سروشانه



الگوهای برگشتی

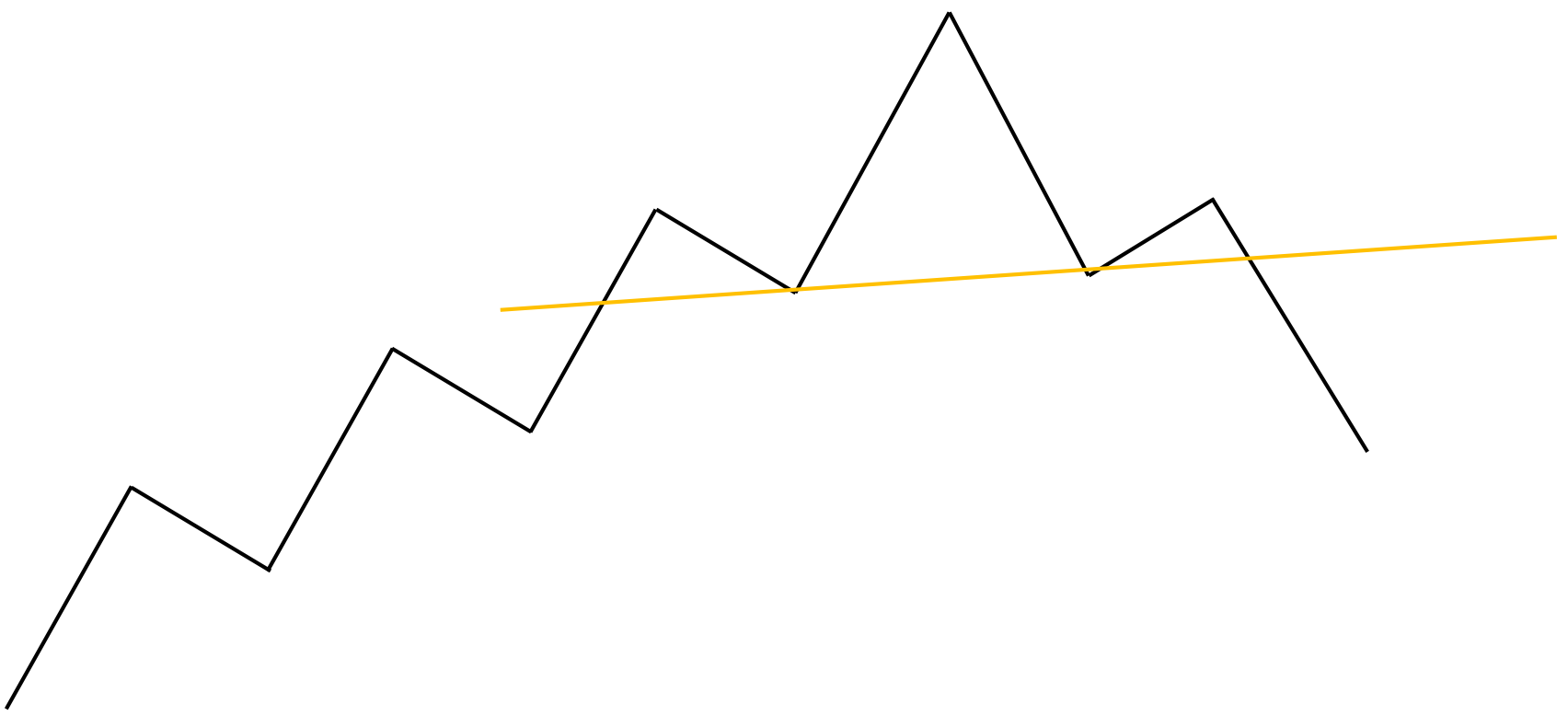
• سروشانه



الگوهای برگشتی

• سروشانه

خط گردن

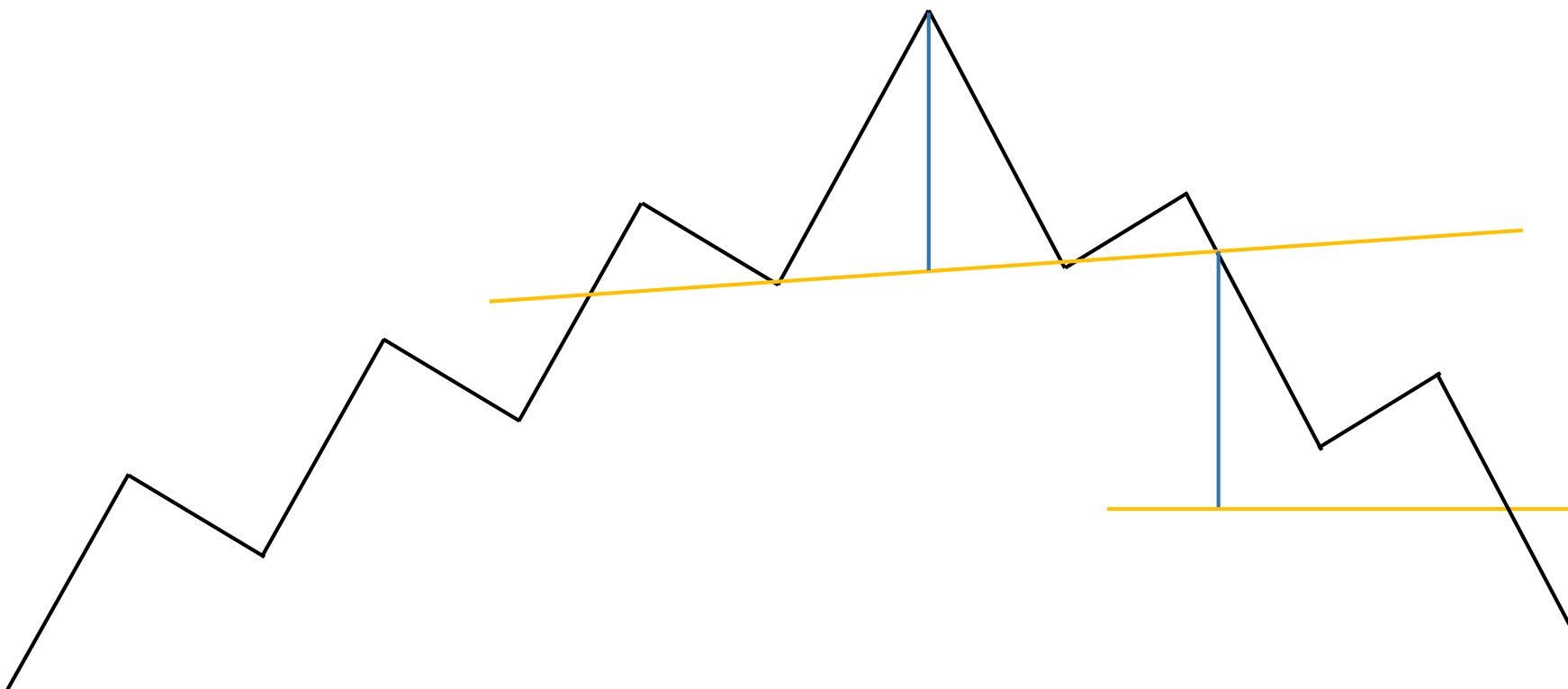


الگوهای برگشتی

• سروشانه

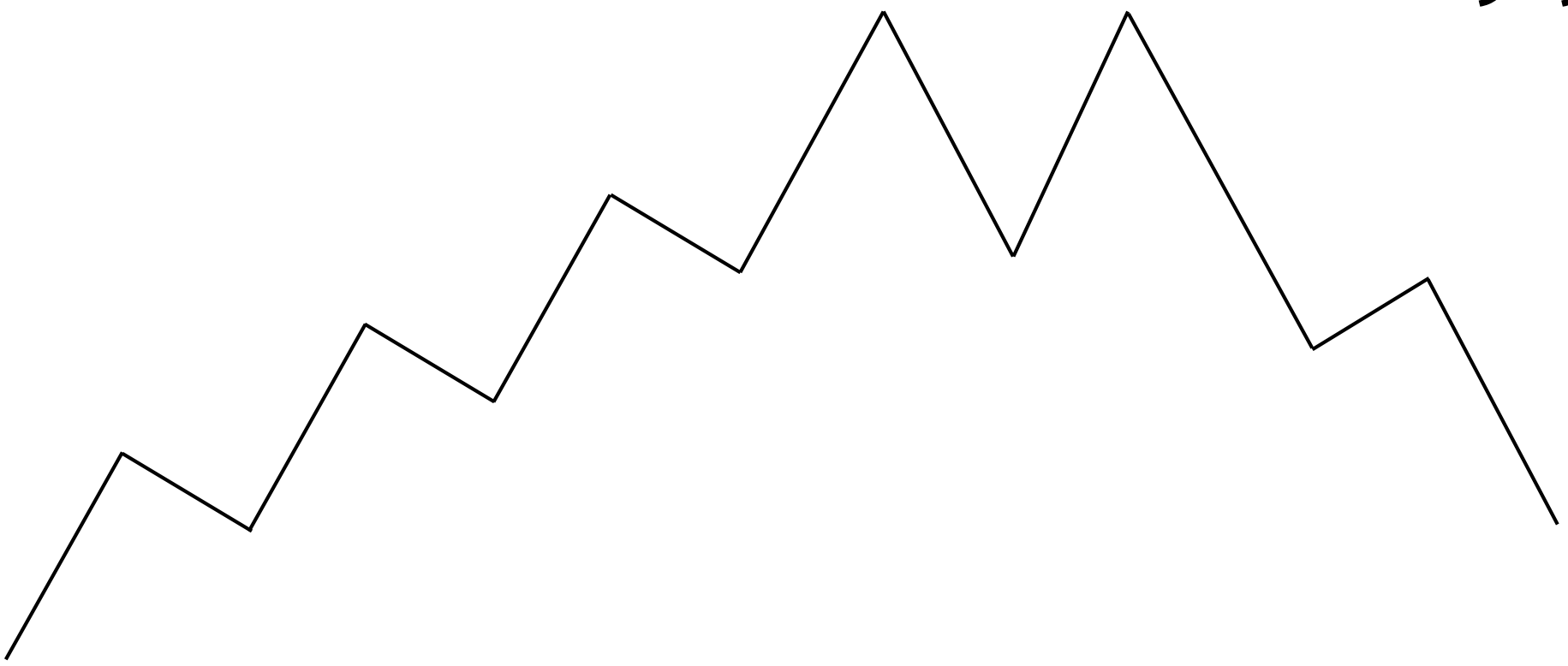
خط گردن

هدف



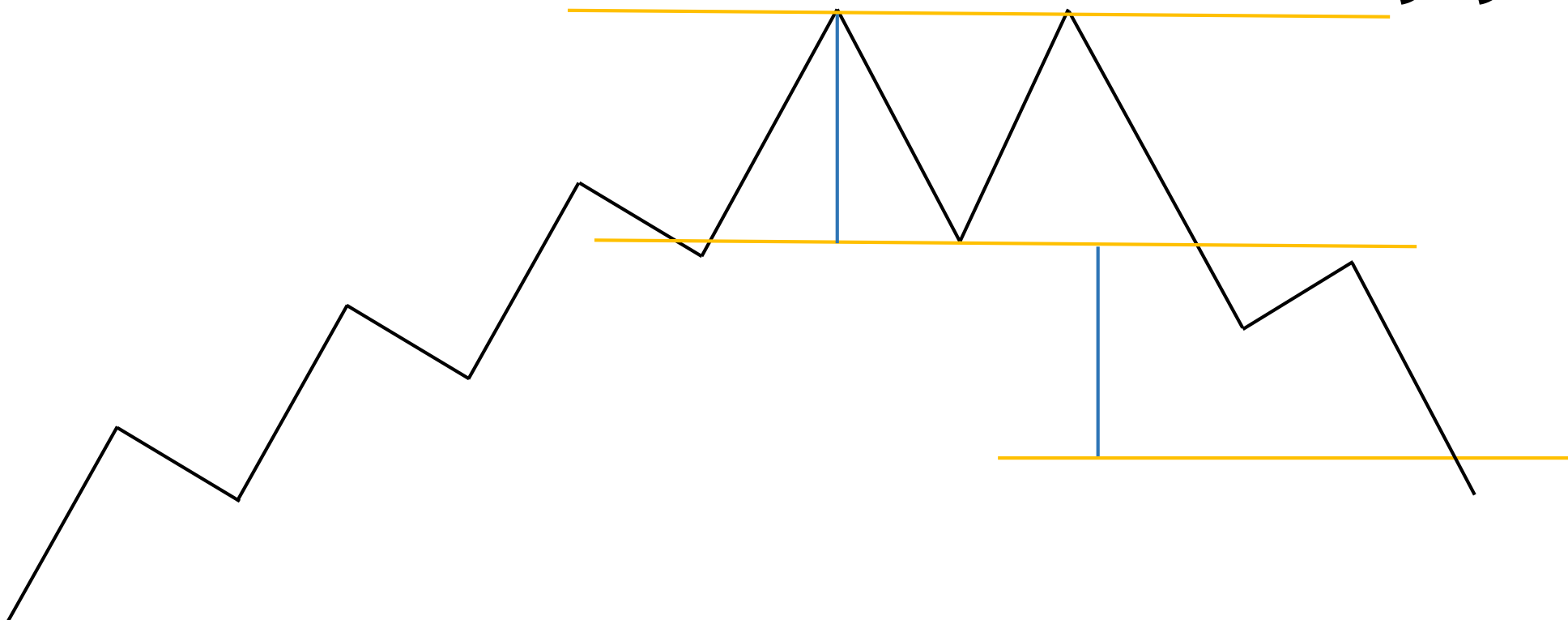
الگوهای برگشتی

• سقف دوقلو



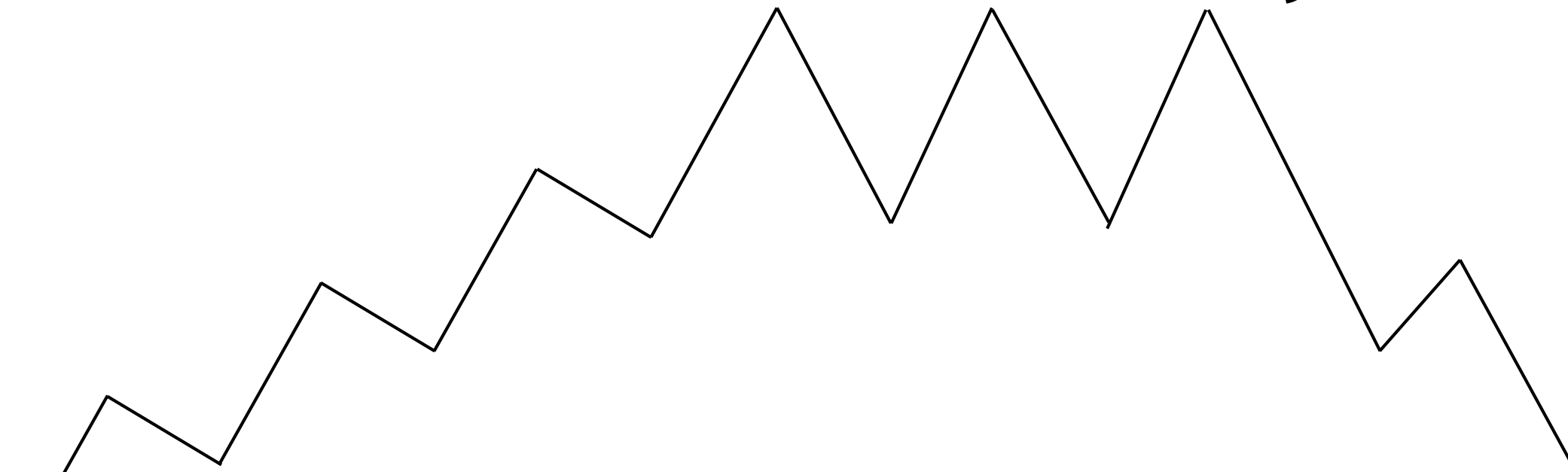
الگوهای برگشتی

• سقف دوقلو



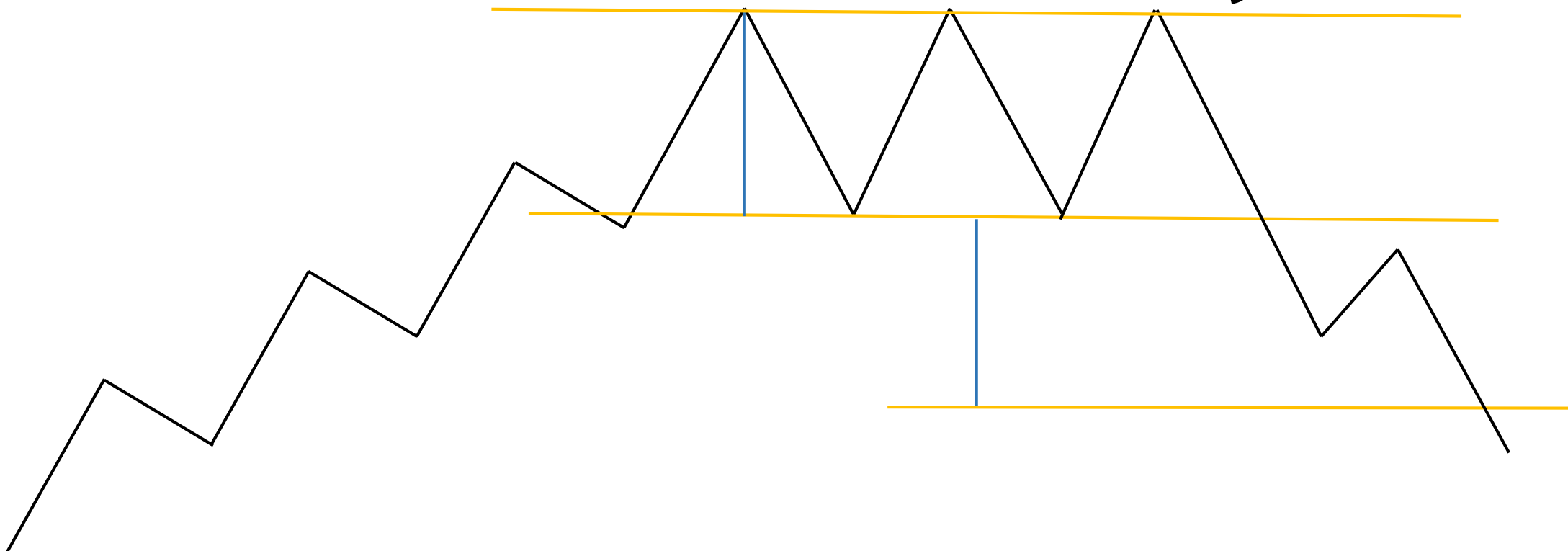
الگوهای برگشتی

• سقف سه قلو



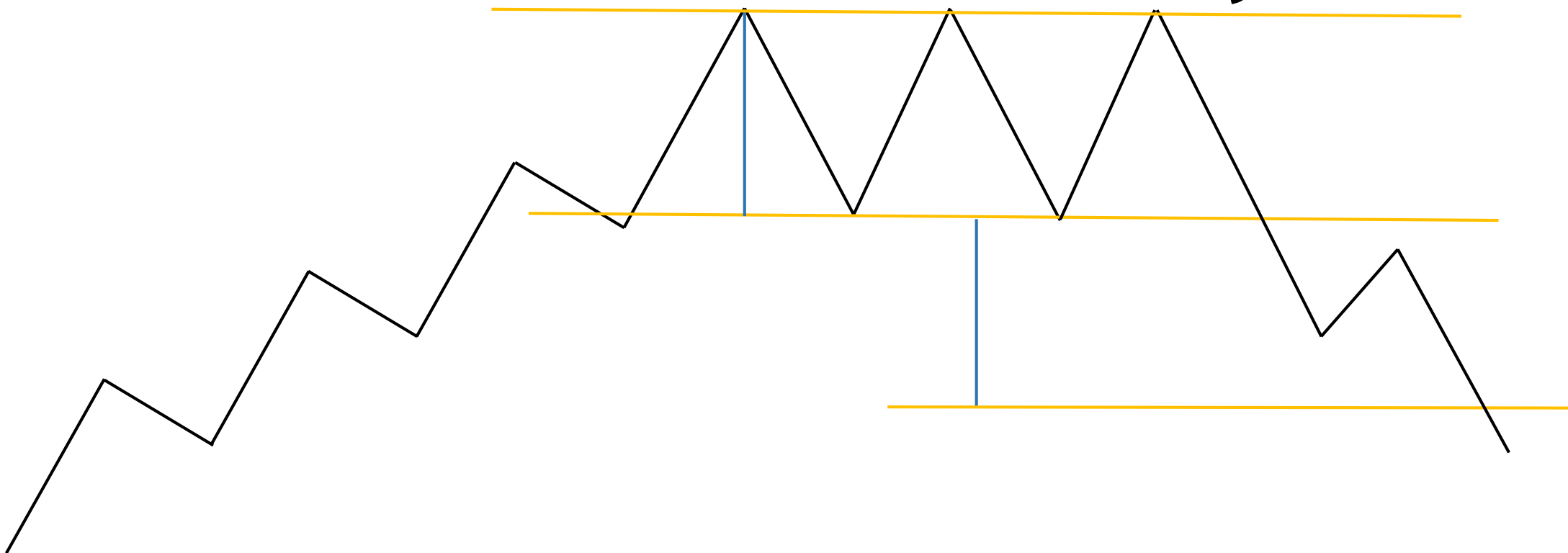
الگوهای برگشتی

• سقف سه قلو



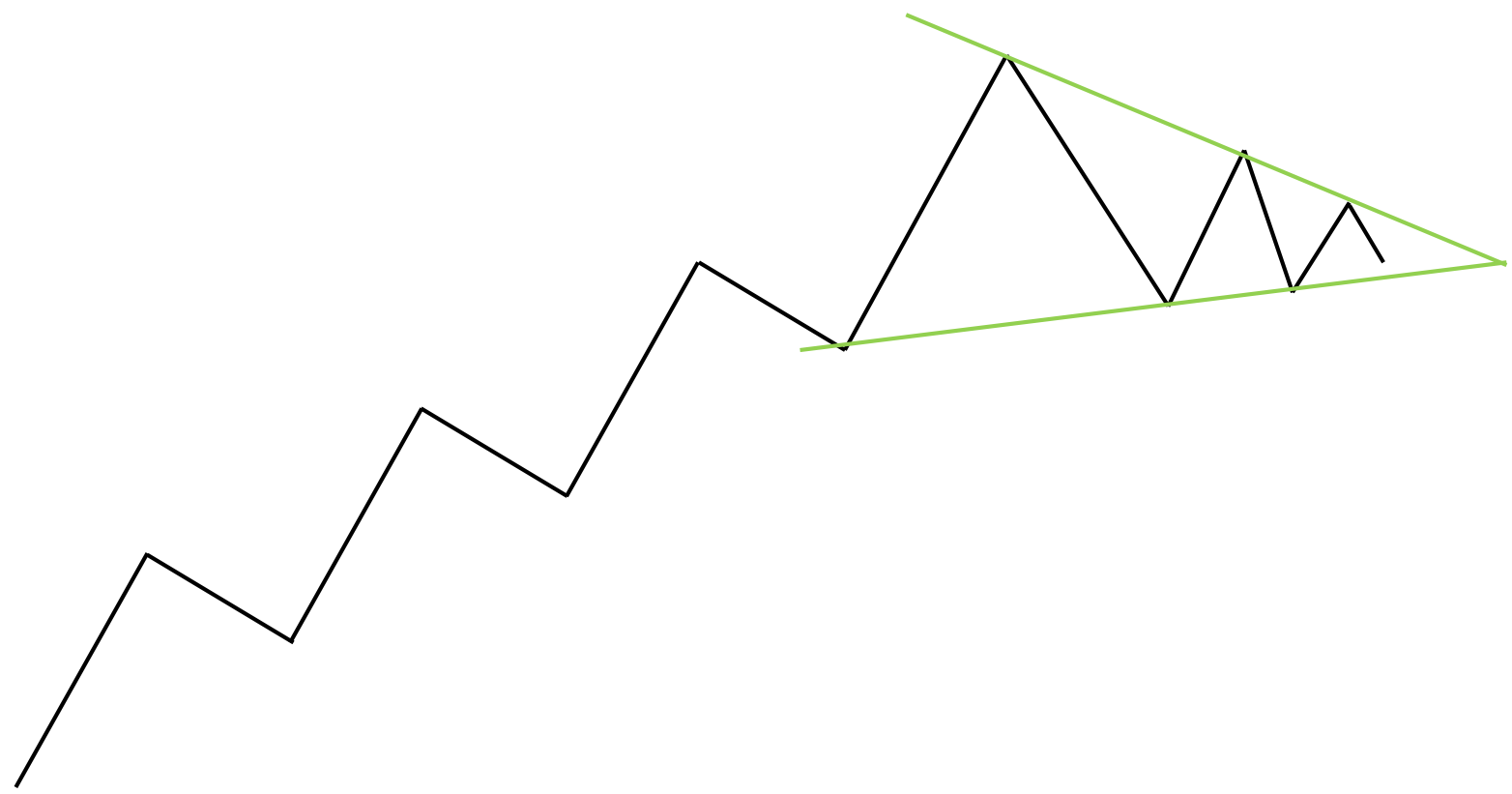
الگوهای برگشتی

• سقف سه قلو



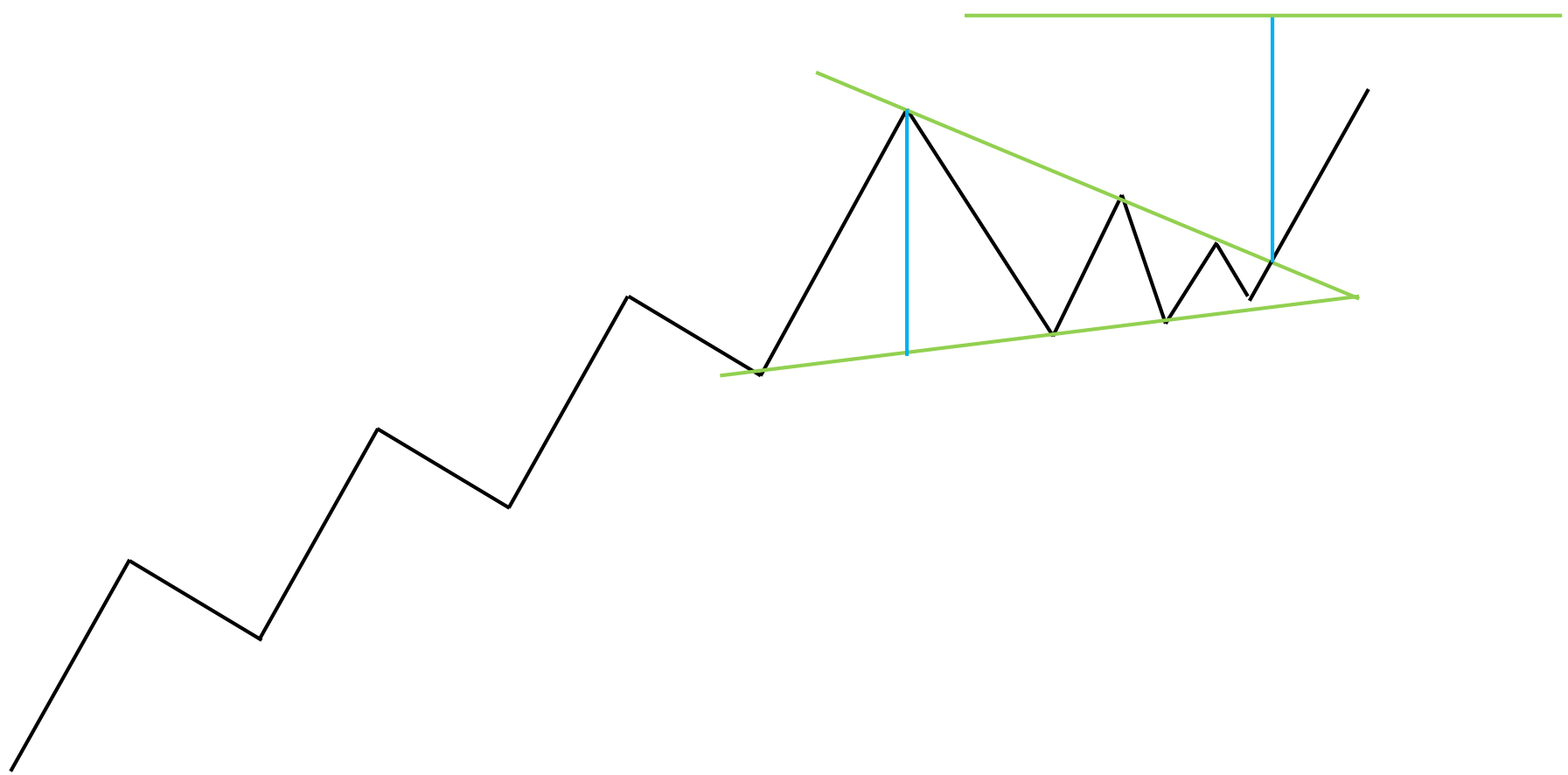
الگوهای ادامه دهنده

• مثلث



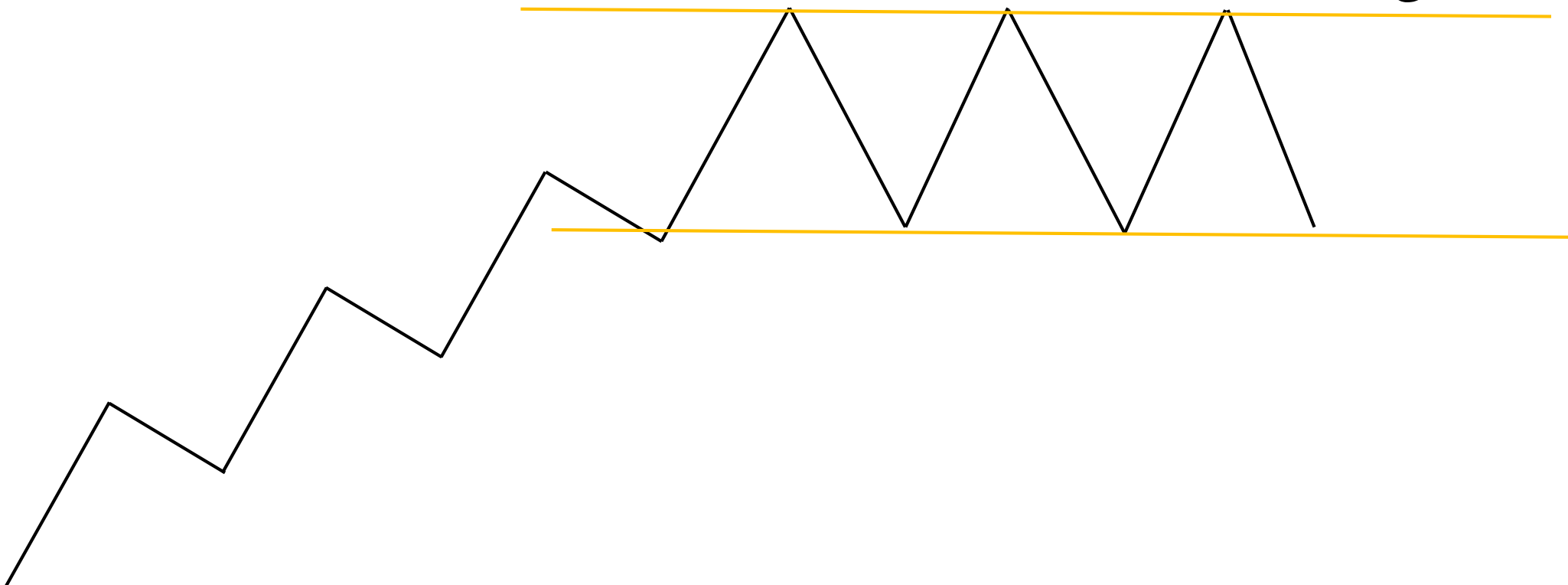
الگوهای ادامه دهنده

• مثلث



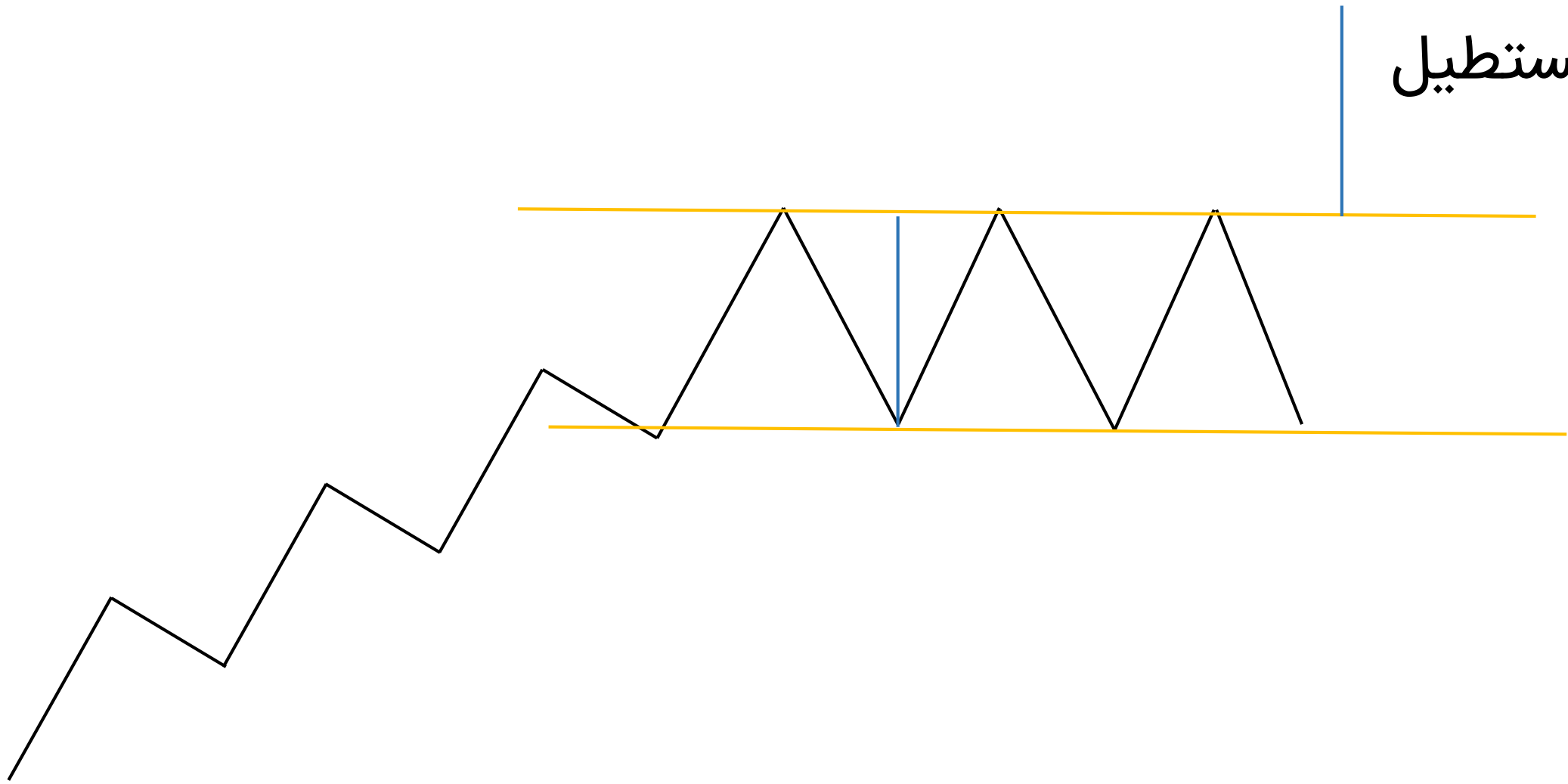
الگوهای ادامه دهنده

• مستطیل



الگوهای ادامه دهنده

• مستطیل



اندیکاتور چیست؟

• فرمول

Handwritten mathematical notes and diagrams illustrating various concepts:

- Binomial Distribution:** $P(X=k) = \binom{n}{k} p^k q^{n-k}$
- Probability Density Function:** $E(x) = \sum_{x=k} ne^{-p(x-k)^2}$
- Area Calculations:** $\int \frac{dx}{\cos^2 x} = \tan x + C$, $\int \frac{dx}{\sqrt{a^2-x^2}} = \arcsin \frac{x}{a} + C$
- Calculus and Limits:** $\lim_{x \rightarrow 0} \frac{\sin x}{x} = 1$, $\lim_{x \rightarrow \infty} \frac{1}{x} = 0$
- Trigonometric Identities:** $\sin^2 \alpha + \cos^2 \alpha = 1$, $\sin(2\alpha) = 2 \sin \alpha \cos \alpha$
- Logarithmic Properties:** $\log \frac{x}{y} = \log x - \log y$
- Series and Sums:** $\sum_{k=0}^n kx^k$, $\sum_{k=0}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k}$
- Diagrams:**
 - A bar chart with three bars labeled A, B, and C.
 - A coordinate system showing a shaded area under a curve.
 - A diagram of a circle with various angles and radii.
 - A diagram of a triangle with sides and angles labeled.

میانگین متحرک

- میانگین داده‌های بازار در بازه زمانی مشخص
 - ساده (Simple)
 - وزنی (Linear Weighted)
 - نمایی (Exponential)
 - سطحی (Smoothed)

MACD

- شاخص واگرایی و همگرایی میانگین متحرک
- اختلاف دو میانگین متحرک نمایی
- میانگین متحرک کند و تند (12 و 26 دوره‌ای)
- خط سیگنال 9 دوره‌ای
- فاز مثبت و منفی نسبت به سطح صفر

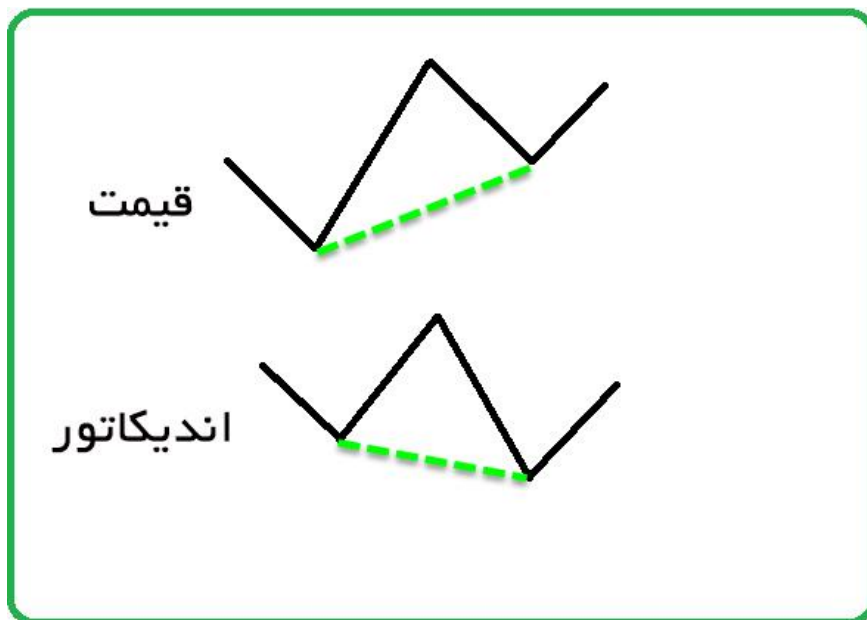
RSI

- سنجش سرعت تغییرات قیمت
- بازه صفر تا 100
- RS برابر است با مقدار میانگین افزایش قیمت‌ها در طی یک دوره مشخص تقسیم بر مقدار میانگین کاهش قیمت‌ها در همان دوره:

$$RSI = 100 - \frac{100}{1 + RS}$$

واگرایی‌ها

- جهت مخالف نسبت به جهت قیمت



- مثبت و منفی

- HD و RD

- ابزار پتانسیلی

نوار بولینگر

- شدت تغییرات قیمت
- حالت استاندارد: میانگین متحرک 20 دوره‌ای با انحراف استاندارد 2
- حالت کوتاه‌مدت: میانگین متحرک 10 دوره‌ای با انحراف استاندارد 1.5
- حالت بلندمدت: میانگین متحرک 50 دوره‌ای با انحراف استاندارد 2.5



استوکستیک

- در روند صعودی Close نزدیک به High است و برعکس
- بیشتر برای معامله‌گران کوتاه مدت
- %K مقدار شاخص
- %D میانگین متحرک بر روی %K
- معمولاً سه دوره‌ای

$$\%K = \frac{(C - L)}{(H - L)} \times 100$$

Parabolic SAR

- بر اساس حرکت قیمت به صورت هندسی
- ابزار مناسب برای حد زیان دنبال شونده



Parabolic SAR

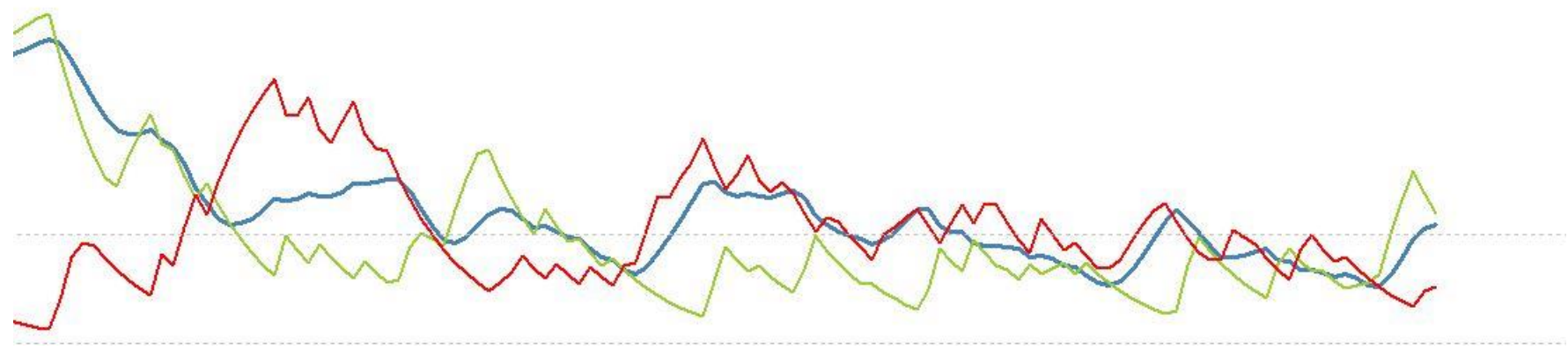
ATR



- میانگین نواسانات
- Volatility
- جهت مشخص نمی کند
- سیگنال نمی دهد

ADX

- جهت و قدرت حرکت
- بین صفر و صد
- بالای 30 یعنی روند وجود دارد
- DI+ و DI-



Momentum

- یک محور افقی (معمولاً صفر یا صد)
- قدرت حرکت بازار

$$Momentum_i = \frac{C_i}{C_{i-n}} \times 100$$

CCI

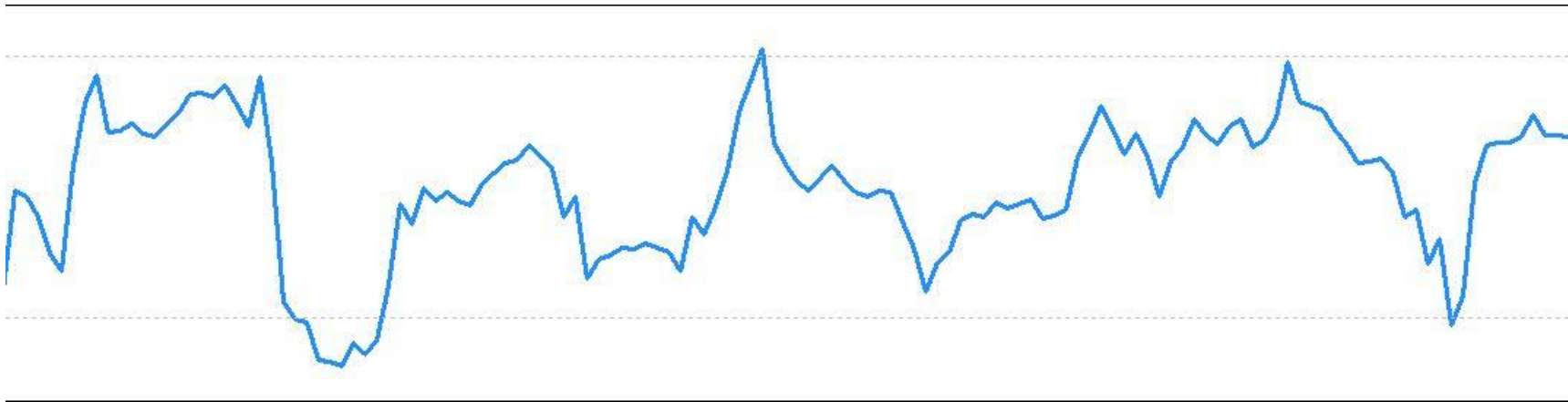
- سطح +100 و -100
- سطح +200 و -200 در حالت 20 دوره‌ای

$$TP_i = \frac{H_i + L_i + C_i}{3}$$

$$CCI_i = \frac{TP_i - SMATP_i}{0.15MD_i}$$

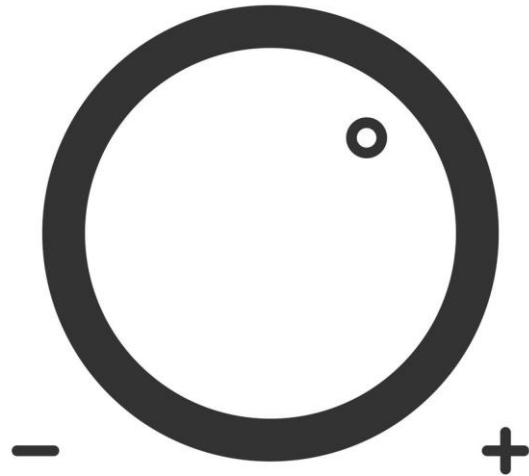
MFI

- حجم معاملات دخیل است
- قدرت جریان پول
- سطح 20 و 80
- واگرایی‌ها

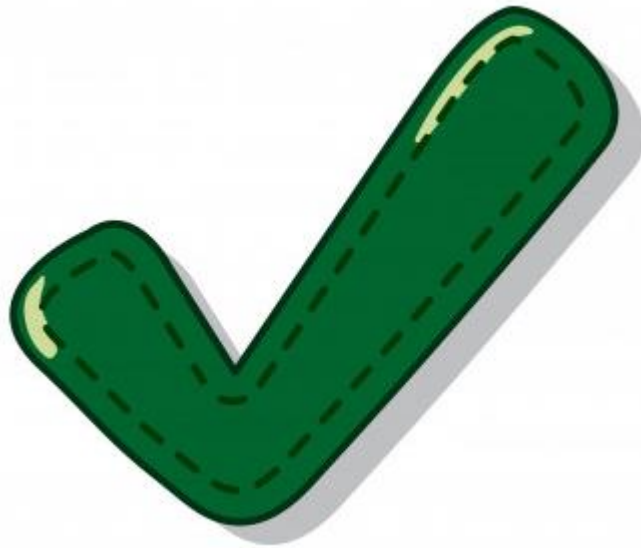


OBV

- رابطه بین حجم معاملات و تغییرات قیمت
- تاخیر ندارد
- حجم تجمعی
- خطوط روند
- واگرایی‌ها



موفق و پرسود باشید



Telegram ID: @asa_plus