

روند صعودی پرستاب: تحلیل قدرت و مومنتوم

قدرت روند (ADX)

۶۱.۴۷

ADX در ۷ روز گذشته از ۵۱.۹ به بالای ۶۱ جهش کرده که نشان دهنده ورود روند به فاز بسیار قدرتمند است.

مومنتوم (RSI)

۸۷.۲۵

RSI برای بیش از ۱۰ روز متوالی در ناحیه اشباع خرید قرار دارد. هرچند روند آن صعودی است، اما شیب افزایش آن نسبت به هفته قبل کندتر شده که می‌تواند نشانه اولیه خستگی خریداران باشد.

نوسانات (ATR)

۲۰۲.۴۱

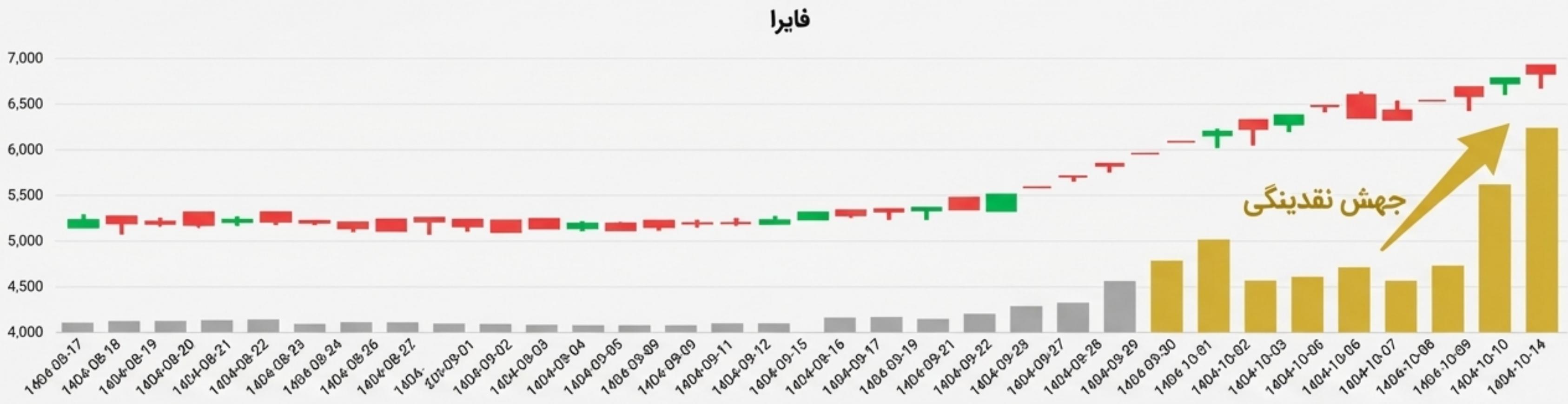
ATR با رشد شدید به بالاترین سطح خود در دو ماه اخیر رسیده که بیانگر افزایش ریسک و نوسانات شدید در بازار است.

فایرا



یک روند صعودی قدرتمند و پرستاب که در منطقه اشباع خرید و نوسانات بالا قرار دارد.

تایید با نقدینگی: آیا حجم معاملات، این صعود را تغذیه می‌کند؟



نمودار: رشد قیمت به صورت پله‌ای و همزمان با جهش‌های معنادار در حجم
حجم معاملات رخ داده است.



تاریخچه: تحلیل سری زمانی حجم نشان می‌دهد که ورود نقدینگی در ماه اخیر
یک رویداد آماری کمنظیر و مثبت است و صرفاً یک افزایش عادی نیست.



تابلو: این حجم بالا با قدرت خریدار حقیقی بالا (نسبت خریدار به فروشنده)
همراه است که نشان می‌دهد تقاضای خرد و حقیقی موتور اصلی این حرکت
است.



تحلیل آماری حجم معاملات

حجم آخرین روز (۱۴۰۴-۱۰-۱۴): ۲۷۷ میلیون سهم
میانگین حجم ۶۰ روزه: ۷۸.۵ میلیون سهم
انحراف معیار حجم ۶۰ روزه: ۸۵.۷ میلیون سهم



حجم معاملات روز آخر، بیش از ۳ انحراف معیار بالاتر از میانگین تاریخی است. این یک
رویداد آماری نادر (Outlier) است که نشان‌دهنده ورود نقدینگی استثنایی و عزم قوی
خریداران می‌باشد.

نقشه میدان نبرد: شناسایی و اعتبارسنجی حمایت‌ها و مقاومت‌ها

فایرا



نقاط تصمیم‌گیری حیاتی در مقاومت ۶۶۸۰ و حمایت ۵۷۲۰ تعریف شده‌اند.

سه آینده محتمل: وزن دهی سناریوها بر اساس شواهد

سناریوی صعودی

سناریوی نوسانی

سناریوی اصلاحی

۶۵%

۲۵%

۱۰%

فایرا

فایرا

فایرا



منطق:

قدرت روند ($ADX > 60$)، تایید حجم استثنایی، و جریان پول حقیقی، همگی به نفع ادامه حرکت هستند. این محتمل‌ترین سناریو است.

تریگر: شکست قدرتمند و تثبیت قیمت بالای سطح مقاومت ۶۶۸۰.

منطق:

اشباع خرید شدید در RSI و کشیدگی زیاد قیمت از میانگین‌ها، احتمال یک دوره استراحت و نوسان برای هضم رشد اخیر را افزایش می‌دهد.

بازه: حرکت قیمت در محدوده بین حمایت ۶۶۸۰ و مقاومت ۵۷۲۰.

منطق:

این سناریو کمترین احتمال را دارد اما با توجه به شتاب بالای رشد، در صورت از دست رفتن حمایت کلیدی، می‌تواند شدید باشد.

تریگر: شکست حمایت داینامیک در ۵۷۲۰ (میانگین متحرک ۲۰ روزه).

با احتمال غالب ۶۵٪، سناریوی اصلی ادامه روند صعودی پس از شکست مقاومت است.

نقشه اقدام: ۶ استراتژی بهینه برای پروفایل‌های مختلف

هدف اول	حد ضرر	نقطه ورود	استراتژی	پروفایل
۷۳۰۰ (R/R > 2)	(ATR * 1.5 - ۶۳۹۰) (ورود - ۶۳۹۰)	تبیت بالای ۶۷۰۰	خرید در شکست (Breakout Buy)	حقيقی ریسک‌پذیر
۷۳۰۰ (R/R > 2)	(ATR * 1.5 - ۶۳۹۰) (ورود - ۶۳۹۰)	بازگشت به ۶۷۰۰ پس از شکست	خرید در پولبک (Pullback Buy)	حقيقی متعادل
۶۴۰۰ (نزدیک مقاومت)	۵۴۹۰ (زیر حمایت کلیدی)	نزدیک به ۵۸۰۰	خرید از حمایت (Support Buy)	حقيقی ریسک‌گریز
<hr/>				
۷۱۰۰ (هدف کوتاه‌مدت)	۶۳۹۰ (مدیریت ریسک فعال)	بالای ۶۷۰۰	مشارکت در شکست (Momentum Trade)	حقوقی کوتاه‌مدت
۷۵۰۰ (هدف میان‌مدت)	۵۶۹۰ (زیر حمایت EMA20)	حدوده ۶۰۰۰	انباشت در اصلاح (Accumulate on Dips)	حقوقی میان‌مدت
اهداف بالاتر	زیر ۵۵۰۰ (حمایت ساختاری)	هر اصلاح مثبت	خرید پله‌ای (Scaling In)	حقوقی بلند‌مدت

منطق حد ضرر: مقادیر حد ضرر بر اساس ترکیبی از سطوح کلیدی (اسلاید ۳) و نوسان‌پذیری روزانه ($\approx 202 \text{ ATR} \approx 6.6\%$) واحد از اسلاید ۱ محاسبه شده‌اند تا از خروج‌های هیجانی جلوگیری شود.

منطق نقاط ورود: نقاط ورود مستقیماً از تریگرهای تعریف شده در سناریوی محتمل (صعودی با احتمال ۶۵٪) در اسلاید ۴ استخراج شده‌اند.

حکم نهایی: امتیاز جذابیت و اصول مدیریت ریسک

پروتکل مدیریت ریسک

حد ضرر نهایی

مهمترین سطح برای مدیریت ریسک، حمایت داینامیک ۵۷٪ است. هرگونه معامله خرید باید حد ضرری پایین‌تر از این سطح داشته باشد تا از ریسک سناریوی اصلاحی در امان بماند.

اندازه موقعیت (Position Sizing)

با توجه به ATR بالای ۲۰۰ واحد، پیشنهاد می‌شود اندازه موقعیت معاملاتی به نصف میزان معمول کاهش یابد تا ریسک به ازای هر معامله (ریال در معرض خطر) در سطح استاندارد باقی بماند.

کارت امتیاز جذابیت



- روند صعودی واضح و تایید شده
- قدرت روند عالی ($ADX > 60$)
- تایید با حجم و نقدینگی استثنایی
- سناریوی محتمل با وزن بالا (۶۵٪ صعودی)
- سطوح کلیدی حمایت/ مقاومت به خوبی تعریف شده
- ریسک: اشباع خرید شدید ($RSI > 85$)
- ریسک: کشیدگی بسیار بالا از میانگین‌های متحرک
- ریسک: نوسانات بسیار بالا و فزاینده ($ATR > 200$)

امتیاز بالا به دلیل همسویی قدرتمند روند، مومنتوم و حجم است. کسر ۱.۵ امتیاز به دلیل ریسک‌های ناشی از اشباع خرید و نوسانات بالاست که نیازمند مدیریت دقیق هستند.