



تحلیل تکنیکال در بورس

پژوهشی بورس هفتم: محمدطاها اسدی، علی یزدی، آرتین غلامرضایی

نمایشگاه دوره ۱۳

تحلیل نماد ها

دو روش مختلف برای تحلیل نماد ها و سهام ها وجود دارد:

۱- تحلیل فاندامنتال

۲- تحلیل تکنیکال

از زمان آغار پروژه بورس، ما تحلیل تکنیکال را آموزش دیدیم و برای تحلیل کردن نماد ها و سهام ها استفاده کردیم.

تحلیل تکنیکال

تحلیل تکنیکال یا تحلیل نموداری روشی برای تجزیه و تحلیل و پیش‌بینی قیمت آینده ورقه بهادار با استفاده از نمودارها و داده‌هایی مانند قیمت و حجم معاملات گذشته آن است. تحلیل تکنیکال بر سه فرض اساسی استوار است:

- همه چیز در قیمت لحاظ شده است، قیمت‌ها بر اساس روندها حرکت می‌کنند و تاریخ تکرار می‌شود.
- هدف تحلیلگر تکنیکال، تجزیه و تحلیل نمودارهای سهم با استفاده از ابزارها و روش‌های مختلف و پیش‌بینی رفتار آینده قیمتی سهم است.

انواع نمودارها در تحلیل تکنیکال

نمودارهای قیمتی، تغییرات قیمت یک دارایی را در طول زمان نشان می‌دهند. نمودارهای مورد استفاده در تحلیل تکنیکال انواع مختلفی دارند که عبارتند از:

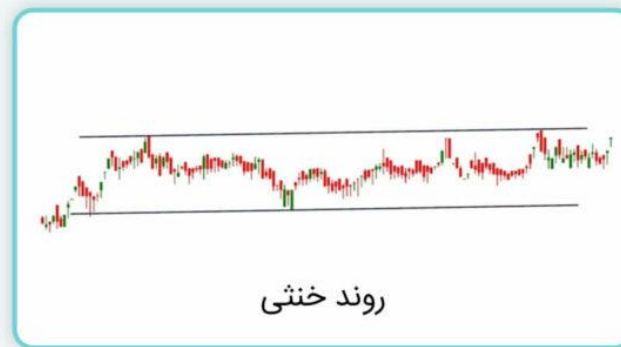
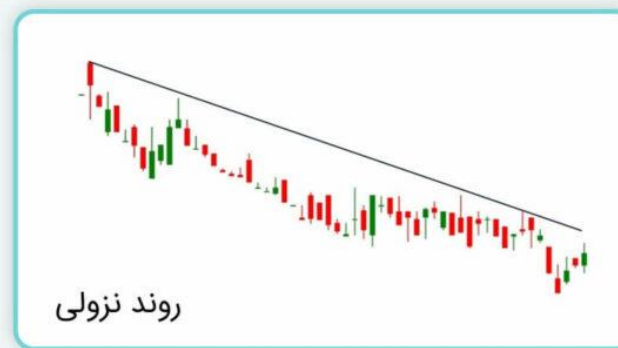
- نمودار خطی
- نمودار میله‌ای
- نمودار شمعی یا کندل استیک
- نمودار شمعی توخالی یا هالو چارت
- نمودار هیکن آشی

انواع نمودارها در تحلیل تکنیکال



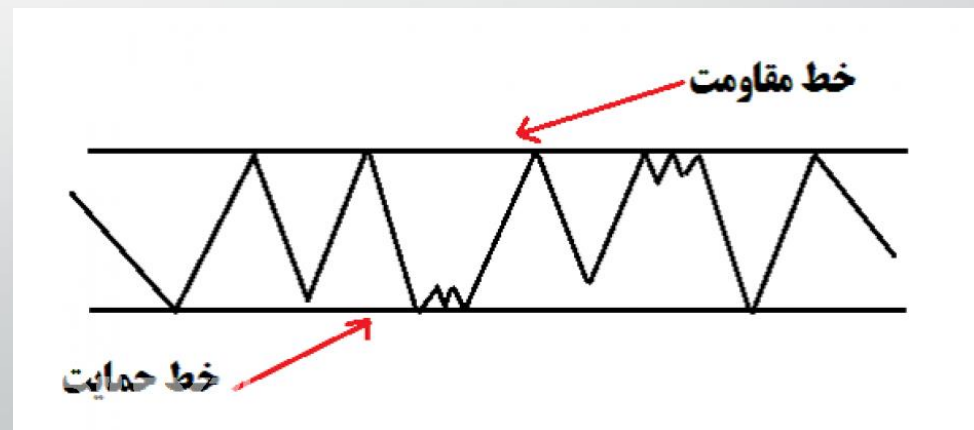
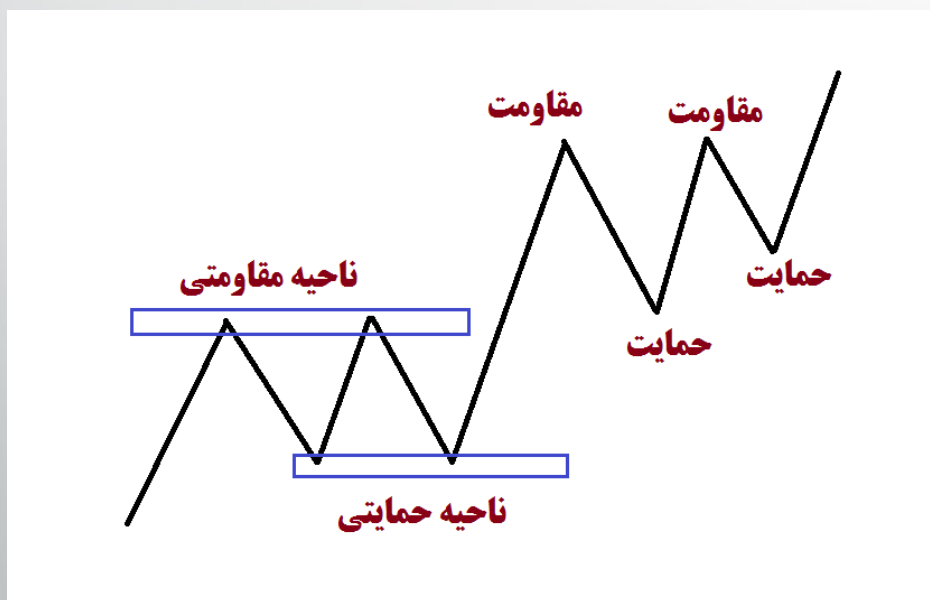
روندها

روند، جهت کلی بازار یا تغییرات قیمت یک دارایی را نشان می‌دهد. روندها به سه نوع صعودی، نزولی و خنثی تقسیم می‌شوند.



سطوح حمایت و مقاومت

حمایت و مقاومت، سطوحی هستند که انتظار می‌رود قیمت سهم نسبت به آنها واکنش نشان دهد. با رسیدن قیمت به سطح حمایتی، معمولاً با افزایش تقاضا روبه‌رو هستیم که این افزایش تقاضا موجب افزایش قیمت‌ها می‌شود. به طور مشابه، با کاهش قیمت و رسیدن به سطح مقاومت، معمولاً با کاهش تقاضا و در نتیجه کاهش قیمت روبه‌رو می‌شویم.



P/E TTM

P/E TTM بورس اوراق بهادار تهران:

EPS	
سال مالی: ۱۴۰۰/۱۲/۲۹	
تحقق سود: ۲۵۴	دوره: ۹ ماهه
سود TTM: ۴۴۹	P/E TTM: ۱۸/۰۲۴
ادامه...	

حد سود و ضرر

حد سود (Take Profit) هم به این معناست که وقتی وارد معامله‌ای می‌شویم و آن معامله در جهت دلخواه ما پیش می‌رود، باید مکانی را برای خارج شدن از آن معامله با سود در نظر بگیریم. مکان قرارگیری حد سود جایی است که احتمال می‌دهیم که معامله انجام شده مجدداً در خلاف جهت ما برگشت کند و سودمان را کاهش دهد.

حد ضرر (Stop Loss) به حد توقف زیان هم معروف است و تعریف بسیار ساده‌ای دارد: قیمتی است که وقتی سهام به آن رسید، باید آن را فروخت تا از ضرر بیشتر جلوگیری شود.

حد سود و ضرر



اندیکاتور ها

اندیکاتور، شاخصی تکنیکالی است که برای هشدار، پیش‌بینی یا تایید تحلیل استفاده می‌شود. در واقع، اندیکاتورها با استفاده از داده‌های تغییرات قیمت و حجم، عددی را محاسبه می‌کنند که می‌توان بر اساس آن، شرایط را تفسیر کرد. معامله‌گران می‌توانند با استفاده از سیگنال‌های اندیکاتورها، در مورد زمان و چگونگی باز و بسته کردن یک موقعیت، تصمیم بگیرند.

در ادامه با یکی از ادیکاتور های مهم در تحلیل تکنیکال آشنا میشویم:

اندیکاتور MACD

MACD مخفف عبارت Moving Average Convergence Divergence و به معنای همگرایی و واگرایی میانگین متحرک است. اندیکاتور MACD یکی از اندیکاتورهای پرکاربرد تحلیل تکنیکال است که با استفاده از آن می‌توان قدرت روند، جهت‌گیری روند و شتاب روند قیمت را تشخیص داد.



فیبوناچی در بورس

اعداد فیبوناچی در ابتدا بر اساس یک مفهوم ریاضی مشتق شده از قرن‌ها قبل محاسبه شدند. آنها از نسبتی ایجاد شده‌اند که توسط دنباله فیبوناچی استخراج شده است. دنباله فیبوناچی اطلاعات مورد نیاز برای فرمول‌بندی سطح حمایت و مقاومت را فراهم می‌کند. این اطلاعات می‌تواند در چارچوب مدیریت ریسک افراد استفاده شود.



Fib Retracement



Trend-Based Fib Extension



Fib Channel

Fib Retracement





Trend-Based Fib Extension





Fib Channel

بورس (بورس اوراق بهادار تهران) / سهام / اندازہ بازارهای مالی / بورس تهران
روبرانه / حادی / سود نقدی و افزایش سرمایه

1400/12/16 16:45
akbari99



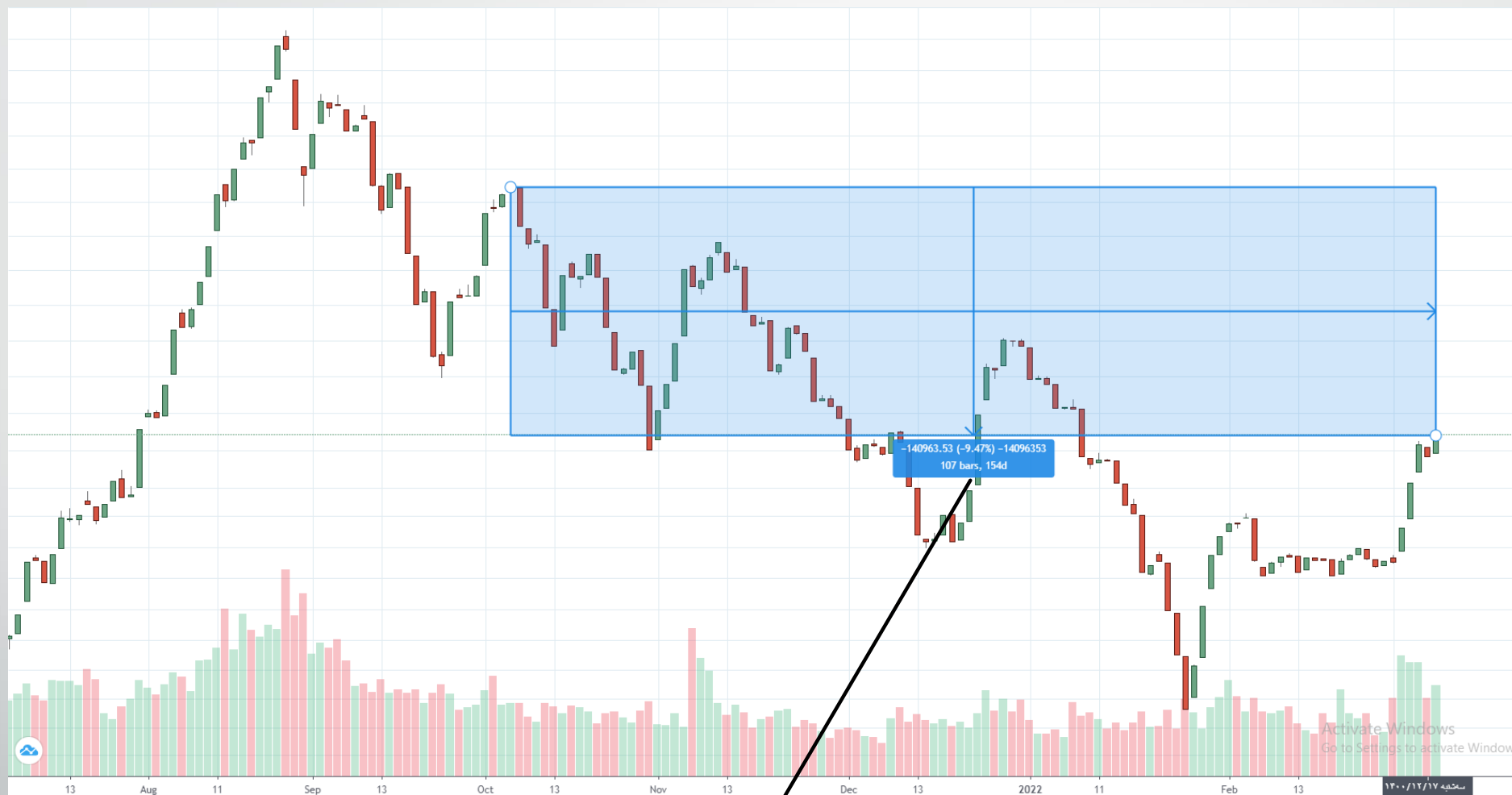
پروژه:

O	N	M	L	K	J	I	H	G	F	E	D	C	B	A	
لینک تحلیل	پتروشیمی خراسان	امین	سحرخیز	فولاد مبارکه اصفهان	زیر	ساعت معامله	تاریخ	کل پول پس از معامله	هزینه معاملات	ارزش معامله	قیمت معامله	تعداد معامله	حجت معامله	نام سهام	1
d365.com/analysis/46	0	0	0	160	0	11:16:00 AM	1400-09-10	68041.6	5558.4	926400	5790	160	1	فولاد مبارکه اصفهان	2
	0	0	0	0	0	11:17:00 AM	1400-09-10	988883.2	5558.4	926400	5790	160	-1	فولاد مبارکه اصفهان	3
d365.com/analysis/46	0	0	0	30	0	12:37:00 PM	1400-09-17	672596.8	1886.4	314400	10480	30	1	فولاد مبارکه اصفهان	4
d365.com/analysis/46	12	0	0	30	0	12:50:00 PM	1400-09-24	536557.4	811.4	135228	11269	12	1	پتروشیمی خراسان	5
	12	0	0	0	0	12:58:00 PM	1400-09-24	837739.4	1818.0	303000	10100	30	-1	فولاد مبارکه اصفهان	6
d365.com/analysis/47	12	0	14	0	0	2:02:00 PM	1400-11-13	598395.9	1427.5	237916	16994	14	1	سحرخیز	7
	12	0	0	0	0	4:55:00 PM	1400-12-16	808527.5	1268.4	211400	15100	14	-1	سحرخیز	8
	12	0	0	0	0	0		0.0	0.0	0	0	0	0	سحرخیز	9
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	10
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	11
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	12
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	13
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	14
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	15
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	زیر	16
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	17
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	زیر	18
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	سحرخیز	19
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	امین	20
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	امین	21
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	سحرخیز	22
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	23
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	فولاد مبارکه اصفهان	24
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	سحرخیز	25
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	امین	26
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	زیر	27
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	پتروشیمی خراسان	28
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	زیر	29
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	30
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	31
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	32
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	33
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	34
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	35
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	36
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	37
	12	0	0	0	0			0.0	0.0	0	0	0	0	شبنر	38

Sheet1

Explore

شاخص کل بورس ایران:



-140963.53 (-9.47%) -14096353
107 bars, 154d

ممنونم از اینکه به ما توجه کردید
امیدواریم که از این ارائه خوشتان آمده باشد

