

Технический анализ

Скользящие средние

Moving average

Скользящие средние *Moving Average - МА*

Основные типы

1. *Простые*
2. *Взвешенные*
3. *Экспоненциальные*
4. *Сглаженные*

Определение МА

- Простые скользящие средняя (МА) (**simple**)-вычисляется путем сложения и усреднения набора чисел.
- Взвешенные скользящие средние (**weighted**)- каждой из цен анализируемого промежутка времени придает вес, в соответствии с объемами сделок, совершенными в данный промежуток времени.
- Экспоненциальные скользящие средние (**exponential**)- умножение цены на вес. Но и учитывают весь диапазон цен.

Moving Average

Типы средних

Экспоненциальная скользящая средняя



Moving Average

Типы средних

Простая скользящая средняя



Moving Average

Типы средних



Moving Average

Типы средних



Moving Average



Simple
Exponential
Smoothed
Linear Weighted

Простая
Экспоненциальная
Сглаженная
Линейно-взвешенная



Цель скользящих средних

Торговые системы скользящих могут использовать как единственную МА так и любое количество МА в различных комбинациях.

Определять время начало новой тенденции, а также предупреждать о ее завершении или повороте.

Показатель МА не прогнозирует динамику цен, а только реагируют на нее и сигнализирует о начале новой тенденции, только после того, как она появилась.

Одна скользящая средняя

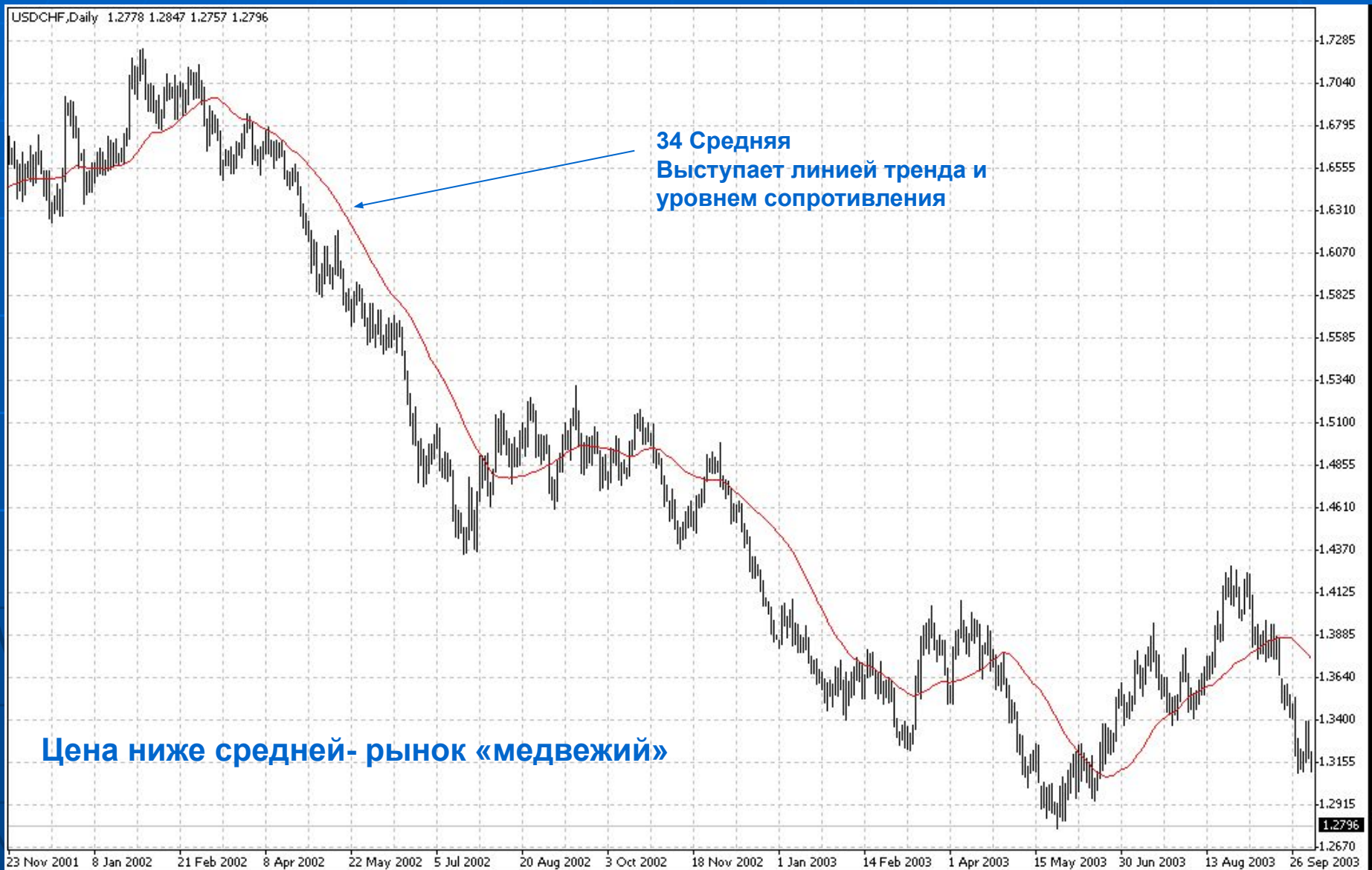
Простейшей и часто наиболее эффективной скользящей средней является **одиночная МА(12)**.

Цена выше средней рынок «бычий»

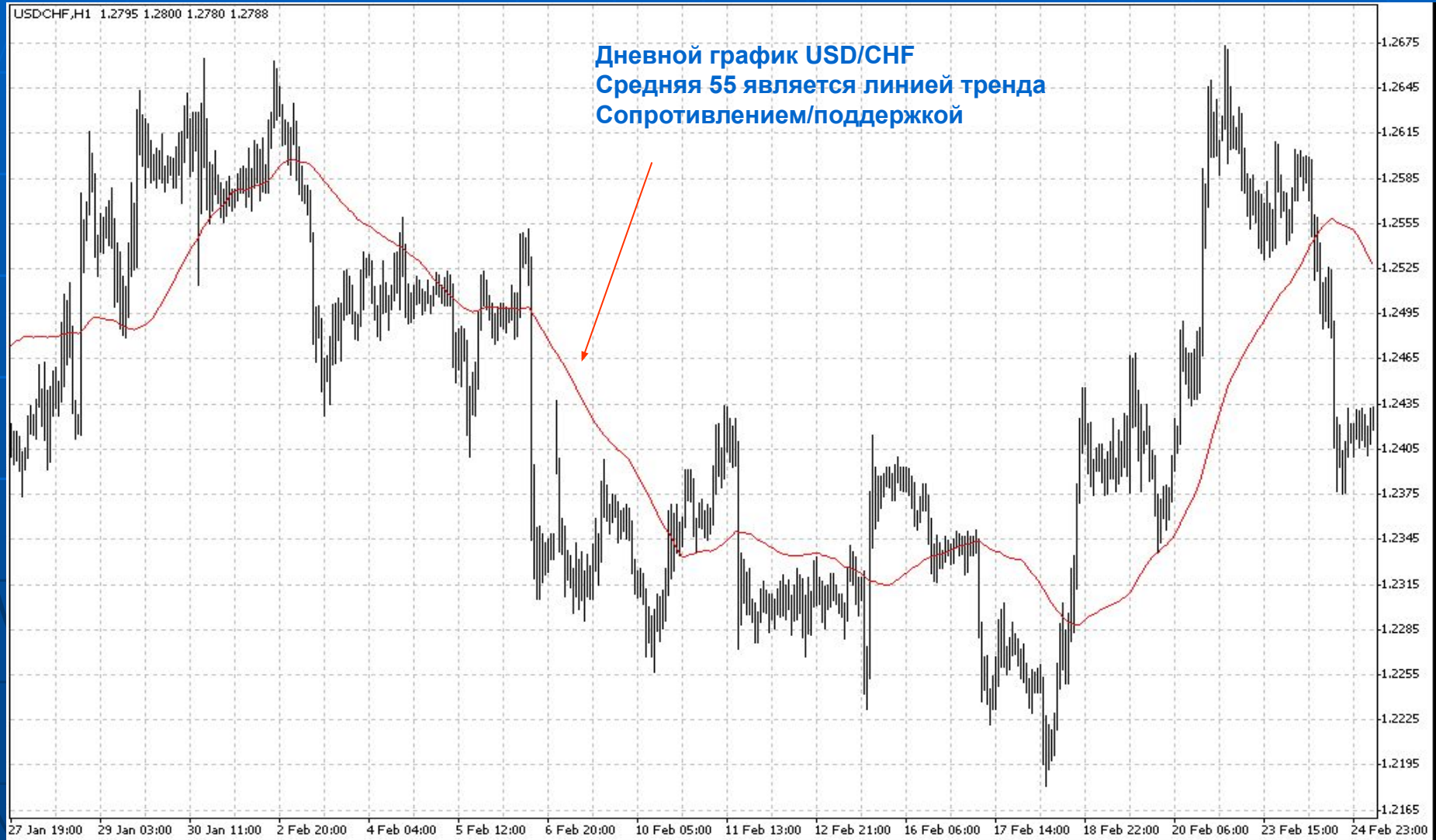


Она наиболее полезна в качестве индикатора тренда, чем как инструмент торговли.

Скользящие средние



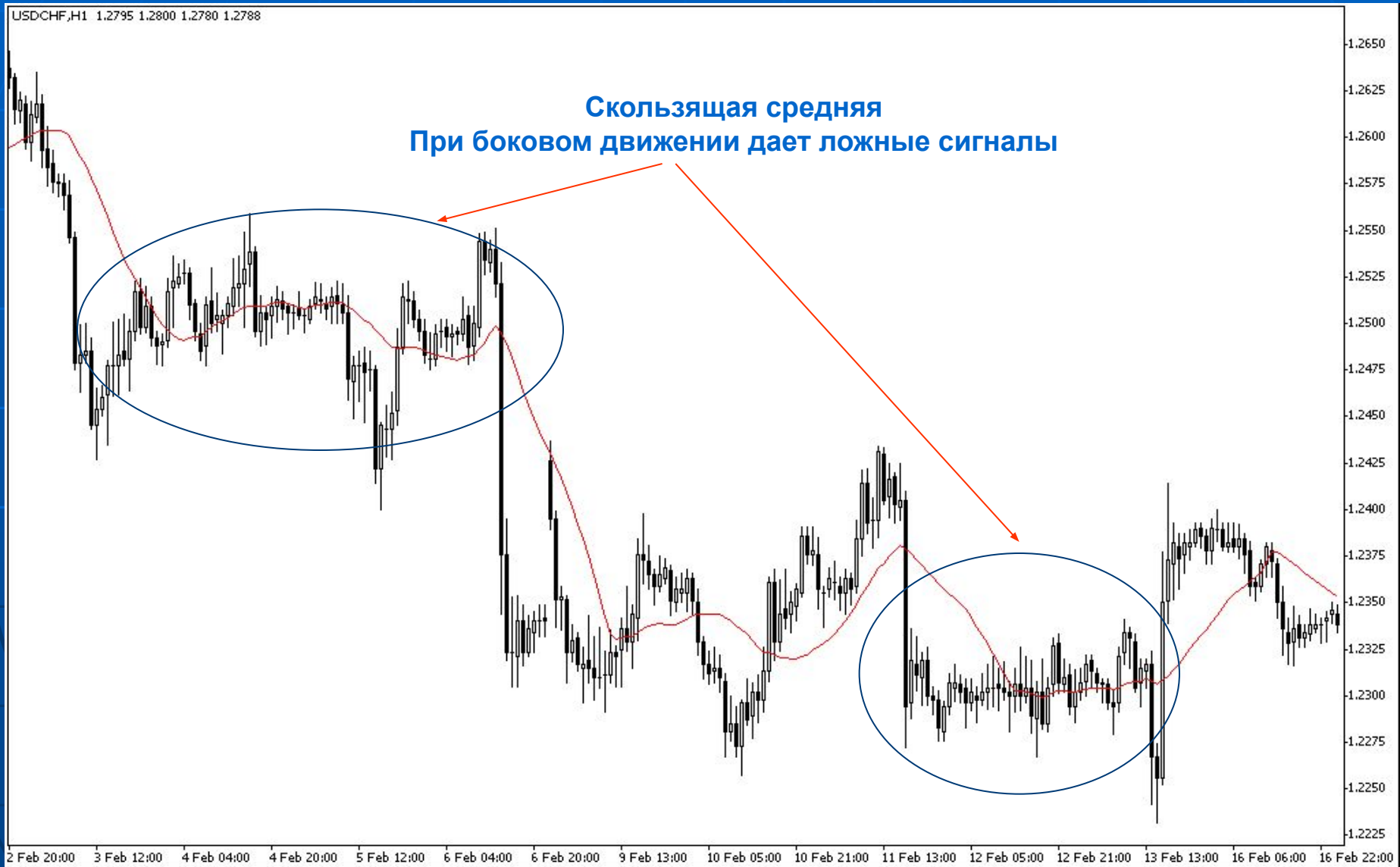
Скользящие средние



Скользящие средние



Скользящие средние



Двойные скользящие средние

Они обычно состоят из более продолжительной средней **20**, которая служит для определения тренда, и более краткосрочной средней **5**, которая дает торговые сигналы на пересечении с более долгосрочной средней.



Тройные скользящие средние

Наиболее популярной является применяемый 4 -9 -18 -дневной метод.



Четыре скользящие средние

Две самые длинные МА 20 – 40
используются строго как
идентификатор тренда.

Две более коротких МА 5 – 12
Используются для задания времени
вхождения и выходов.



Торгуем исключительно в направлении тренда

Смещенные скользящие средние *DMA- Displased Moving Averages*

Скользящие средние всегда находятся на удалении от рынка.

Устранить это можно используя смещение средней на несколько баров вперед.

Обычно величина смещения такая же как и порядок средней.

Многие предпочитают сокращать длину смещения.

Часто используется как метод краткосрочной торговли.

Смещенные скользящие средние DMA- Displased Moving Averages



Смещенные скользящие средние DMA- Displased Moving Averages

Это 3-дневная скользящая
средняя, смещенная на три
дня



**DMA работают лучше
всего на крутых трендах**

Смещенные скользящие средние DMA- Displased Moving Averages

Величина сдвига не обязательно должна совпадать с величиной, используемой в скользящей средней



Смещенные скользящие средние

Наиболее встречаемое нами применение DMA заключается в использовании их в качестве краткосрочного индикатора тренда (торгуем на разворотах внутри тренда, определяемого DMA)

Используйте DMA для определения тренда и затем покупайте на впадинах или продавайте на тиках, когда они расположены около средней



Нахождение фильтра

Фильтры делятся на две категории: **ценовые** и **временные** фильтры.

Ценовой – обычно означает оттягивание вхождения в торговлю до того момента, когда цена удовлетворит дополнительному критерию.

(один из методов: дождитесь закрытия в направлении нового тренда)

Временной – используют выжидание определенного количества временных периодов после пересечения перед вхождением в торговлю в новом направлении.

Скользящие средние Ценовой Фильтр



Скользящие средние Временной Фильтр

