

УДК 336.761

ИЗМЕРЕНИЕ ЦЕНОВОГО КАНАЛА С ПОМОЩЬЮ ПОЛОС БОЛЛИДЖЕРА ИНДЕКСА ТРЕХ ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНЫХ БАРОВ

Юрьев С.Р. (Гимназия 642)

Научный руководитель – аспирант Юрьев Р.Н. (Университет ИТМО)

Введение. Уменьшение ценового канала показывает на сильные движения цены ценной бумаги. Есть много способов найти ценовой канал, в этой работе будет использоваться индекс трех последовательных баров и полосы Боллинджера в процентах.

Основная часть. Создание точного ценового канала — трудная задача, поэтому мы будем использовать два простых индикатора технического анализа: RSI — Relative strength index, индекс относительной силы, Bollinger bands — полосы Боллинджера (в процентах) и математическое сравнение модулей размеров баров. Для математического сравнения модулей размеров баров мы вычитаем цену закрытия бара из цены его открытия. Модуль полученной разности — это размер бара. Если 3 последовательных размера бара меньше предыдущего значения бара, то это сигнал первого индикатора уменьшения ценового канала. Это первый способ вычисления изменения ценового канала, к которому для повышения точности были добавлены индикаторы RSI [2] и Bollinger bands [1]. Индикатор ценового канала реализован на языке Pine script на площадке TradingView [3]. Индикаторы технического анализа RSI и Bollinger bands доступны в библиотеке языка Pine script, поэтому их вычисления мы разбирать не будем. Уменьшение ценового канала на основе Bollinger bands рассчитывается следующим образом. Мы получаем 3 последних значения за 3 последовательных бара. Если 3 последних значения уменьшаются, то это второй способ вычисления изменения ценового канала. RSI – дополнительный индикатор для увеличения точности индикатора. Если RSI меньше 50 процентов, то шанс положительного роста больше. В результате объединения всех параметров мы получаем прогнозы. Сильная сторона такого прогноза — сигналы в 70-80% случаев дают верные прогнозы перед сильным ростом цены. Слабая сторона — иногда уменьшение ценового канала указывает на падение цены.

Выводы. Были разобраны способы получения ценового канала и устройства индикатора изменения ценового канала. Были разобраны сильные и слабые стороны индикатора.

Список использованных источников:

1. Линии Боллинджера. [Электронный ресурс]. URL: https://ru.wikipedia.org/wiki/%D0%9B%D0%B8%D0%BD%D0%B8%D0%B8_%D0%91%D0%BE%D0%BB%D0%BB%D0%B8%D0%BD%D0%B4%D0%B6%D0%B5%D1%80%D0%B0 (дата обращения: 07.02.2024).
2. Индекс относительной силы. [Электронный ресурс]. URL: https://ru.wikipedia.org/wiki/%D0%98%D0%BD%D0%B4%D0%B5%D0%BA%D1%81_%D0%BE%D1%82%D0%BD%D0%BE%D1%81%D0%B8%D1%82%D0%B5%D0%BB%D1%8C%D0%BD%D0%BE%D0%B9_%D1%81%D0%B8%D0%BB%D1%8B (дата обращения: 07.02.2024).
3. Справочник по языку Pine Script. [Электронный ресурс]. URL: <https://ru.tradingview.com/pine-script-reference/v5/> (дата обращения: 07.02.2024).
4. Швагер, Д. Технический анализ. Полный курс. М.: Альпина Паблишер, 2001.