

FOREX MAGAZINE

Анализ трендов с помощью индикатора Aroon

Октябрь 2006 №139/39



АНАЛИЗ ТРЕНДОВ С ПОМОЩЬЮ ИНДИКАТОРА AROON

Джастин Купер

www.investopedia.com

В 1995 году Тушар Ченде, являющийся руководителем компании "Tuscarora Capital Management" и автором книг "Новый технический трейдер" и "За пределами технического анализа" разработал индикатор Aroon для определения направления и силы тренда. Наибольшая ценность индикатора заключается в том, что он помогает трейдерам и инвесторам определить, заканчивается ли долгосрочный тренд или просто делает паузу перед другим движением. Эта статья показывает, как вычислить индикатор Aroon и применить в собственной торговле.

Вычисление индикатора Aroon

Индикатор Aroon может быть вычислен, используя следующую формулу:

Бычий = $[(N \text{ периодов} - N \text{ периодов с наивысшего максимума}) / N \text{ периодов}] * 100$

Медвежий = $[(N \text{ периодов} - N \text{ периодов с наименьшего минимума}) / N \text{ периодов}] * 100$

Если мы посмотрим внимательно на эти формулы, то очевидно, что они обе отражают, какие были недавние максимумы и минимумы. Более высокие значения индикатора Aroon указывают на более свежие максимумы и минимумы, в то время как более низкие значения указывают на менее недавние максимумы и минимумы. Кроме того, значения индикатора Aroon колеблются между уровнями 0 и 100, где более высокое значение указывает на более сильный тренд и наоборот.

Два индикатора Aroon (бычий и медвежий) также могут быть преобразованы в отдельный осциллятор, учитывающий разницу между двумя значениями бычьего (от 0 до 100) и медвежьего (от 0 до -100) индикатора. Этот осциллятор затем изменяется между значениями 100 и -100, с уровнем 0 указывающим на отсутствие какого-либо тренда.

Использование индикатора Aroon

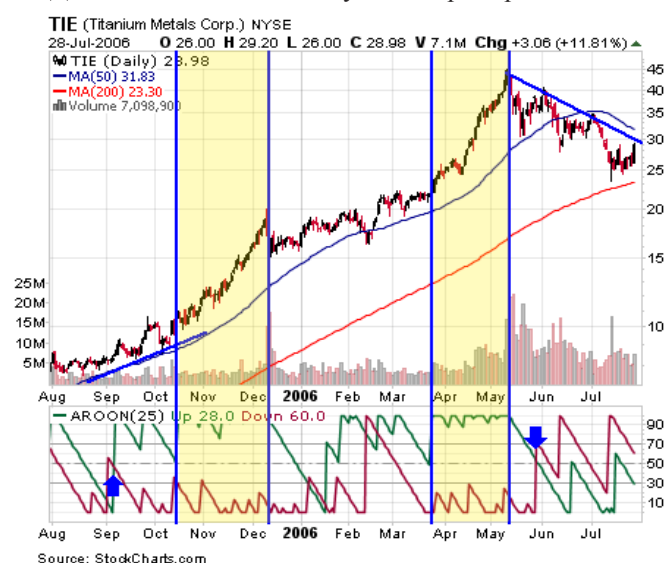
Индикатор Aroon используется, строя бычий и медвежий версии в том же самом окне или формируя единый осциллятор.

Ключевым аспектом успешного использования индикаторов Aroon является наблюдение двух вещей:

- *Индикатор движется вокруг ключевых уровней 30 и 70* - движения выше 70 указывают на сильный тренд, в то время как движения ниже 30 указывают на низкую силу тренда. Движения между 30 и 70 указывают на нерешительность рынка. Например, если бычий индикатор остается выше уровня 70, в то время как медвежий индикатор остается ниже уровня 30, определенно перед нами восходящий тренд.

- *Пересечения между бычьими и медвежьими индикаторами* - пересечения указывают на подтверждения, если они происходят между уровнями 30 и 70. Например, если бычий индикатор пересекает вверх медвежий индикатор, то это подтверждает восходящий тренд.

Давайте взглянем на следующий пример:



Дневной график TIE. Индикаторы Aroon.

В приведенном примере мы видим график акций "Titanium Metals" (TIE), которые недавно развивали сильный тренд на увеличенном спросе на титан. Обратите внимание, что, когда индикаторы Aroon были в противоположных концах барьеров 30-70, цена развивала сильный тренд. Также обратите внимание, что, когда пересечение произошло в пределах этих барьеров 30-70, это часто сигнализировало о подтверждении нового тренда.

FOREX MAGAZINE

Анализ трендов с помощью индикатора Aroon

Октябрь 2006 №139/39

Осциллятор Aroon выглядит немного проще, но обеспечивает меньше информации. Ключевые уровни для наблюдения здесь 50, 0 и -50. Когда осциллятор движется выше 50, это указывает на наличие сильного бычьего тренда. Когда он движется приблизительно в районе 0, то это указывает на отсутствие определенного тренда. И, наконец, когда он прорывается ниже уровня -50, то указывает на сильный медвежий тренд.

Давайте взглянем на тот же самый график с использованием осциллятора:



Дневной график TIE. Осциллятор Aroon.

На приведенном графике мы видим очень похожую информацию, но с отсутствием подтверждений, потому что в осцилляторе нет никаких пересечений.

Важно понять, глядя на эти графики, что индикатор Aroon запаздывает и, поэтому, не отображает резкие снижения или повышения цены. Следовательно, очень важно использовать другие методологии для выбора хорошего входа. Например, наблюдение за свечным разворотом на большом объеме является хорошим способом выйти в правильной точке в случае резкого разворота цены. Стоп-ордера, расположенные за ключевыми уровнями поддержки и сопротивления, являются другим хорошим способом управления риском.

Инвесторы могут предпочесть осциллятор, потому что он позволяет легче читать информацию и имеет тенденцию давать менее противоречивые сигналы. Между тем, активные трейдеры могут оценить дополнительную информацию, даваемую двумя отдельными индикаторами Aroon. Вы должны сами решить, какой метод работы лучше всего подходит для ваших потребностей и применять это в своей собственной торговле. Они оба предлагают превосходный способ определить, существует ли на рынке тренд и насколько сильный этот тренд.

Заключение

Индикатор Aroon будет полезен тем трейдерам и инвесторам, которые заинтересованы в определении того, существует ли на рынке тренд и насколько он устойчив. Он также может помочь трейдерам избежать неэффективного использования капитала, позволяя им искать другие возможности во время боковых рынков и держать позиции только в течение сильных трендов. Однако, важно тщательно наблюдать и анализировать ситуацию на рынке, используя другие инструменты в сочетании с индикатором Aroon, чтобы избежать основной слабости этого индикатора - запаздывание отображения резких ценовых движений.

Forex Magazine
по материалам www.investopedia.com