

شاخص های روند

شاخص روند یکی از اصلی ترین ابزارهای تحلیل تکنیکی است که در بازار فارکس مورد استفاده معامله گران قرار می گیرد. به دلیل مقاومتی که این دسته از شاخص ها در برابر تغییر وضعیت دارند، اغلب در خلال یک بازار روندی به منظور تشخیص جهت حرکت قیمت مورد استفاده قرار می گیرند. اکثر شاخص های این گروه حاصل محاسبه میانگین دسته های قیمتی یا گرد کردن آنها هستند. از آنجائیکه شاخص روند یک شاخص تاخیری محسوب می شود، در زمان گذشته و در زمان حال تعیین کننده روند است. به کمک شاخص های روند می توان از بسیاری از سیگنال های اشتباه دوری کرد و پیدایش یک روند جدید در بازار را پیش بینی کرد.



Average Directional Index (ADI) Indicator



شاخص هدایتی میانگین (ADX) یک اندیکاتور تحلیل تکنیکی است که توسط ولز ویلدر (Welles Wilder) توسعه داده شد. این اندیکاتور بوسیله مقایسه اختلاف بین دو کف با دو سقف، قدرت روند را تخمین می زند و حرکات احتمالی قیمتی بیشتر را تخمین می زند.

ADX یک شاخص ترکیبی است که حاصل محاسبه شاخص سبز رنگ هدایتی مثبت (DI+) و شاخص قرمز رنگ هدایتی منفی (DI-) می باشد اما تمامی اینها باید برای تحلیل روند مورد استفاده قرار گیرند.

بطور کلی اعتقاد بر این است که این شاخص (که به شکل خطی پر رنگ نشان داده می شود)، قدرت روند کنونی را بازتاب می دهد:

- اگر ADX صعود کند (معمولاً بالاتر از 25) نشان دهنده قدرت روند بازار خواهد بود - اگر شاخص ها با روند همراه شوند، بیش از پیش مفید خواهند شد.

- اگر ADX پایین بیاید نشان می دهد که توسعه روند با تردید مواجه است. اگر ADX زیر رقم 20 باشد ممکن نشان دهنده وجود روند خنثی باشد. در این صورت نوسانگرها بیشتر مفید خواهند بود.

ممکن است استفاده از سیستم معامله ای پیچیده ADX نیاز به سیگنال های تأیید کننده بیشتری پیدا کند:

- گر DI+ (خط سبزرنگ) بالاتر از DI- (خط قرمز رنگ) برود، یک سیگنال خرید شکل گرفته است.
- اگر DI- (خط قرمز رنگ) بالاتر از DI+ (خط سبزرنگ) برود، یک سیگنال برای فروش شکل گرفته است.

محاسبه

در فرمول بالا:

DI+ - برابر است با شاخص هدایتی مثبت

DI- - برابر است با شاخص هدایتی منفی

میانگین حرکتی (MA)



”میانگین حرکتی“ یک ابزار تحلیل تکنیکی است که میانگین قیمت بر یک دوره زمانی تعریف شده را نشان می دهد و برای هموار کردن نوسانات قیمتی از آن استفاده می شود و در آخر جهت و قدرت روند را تعیین می کند

”میانگین حرکتی“ بسته به شیوه میانگین گیری به میانگین حرکتی ساده (SMA)، میانگین حرکتی هموار شده (SMMA) و میانگین حرکتی نمایی (EMA) تقسیم بندی می شود.

معمولاً تحلیل منحنی های میانگین حرکتی شامل مبانی زیر می شود:

- جهت منحنی میانگین حرکتی بازتاب دهنده غلبه روند بر یک دوره زمانی است.
- میانگین مربوط به دوره زمانی کم، سیگنال های اشتباه بیشتری می دهد در حالیکه میانگین دوره زمانی بالا پخته تر عمل می کند.
- برای افزایش (یا کاهش) میزان حساسیت منحنی، باید دوره میانگین را کاهش (یا افزایش) داد.
- منحنی های میانگین در محیط روند بیشتر مفید هستند.

مقایسه میانگین حرکتی با حرکات قیمت:

- اگر قیمت، منحنی میانگین حرکتی صعودی اش را از پایین قطع کند، یک سیگنال قوی خرید محسوب می شود، و اگر قیمت، منحنی میانگین حرکتی نزولی اش را از بالا قطع کند، یک سیگنال قوی فروش محسوب می شود.
- اگر قیمت، منحنی میانگین حرکتی نزولی اش را از پایین قطع کند، یک سیگنال ضعیف خرید محسوب می شود، و اگر قیمت، منحنی میانگین حرکتی صعودی اش را از بالا قطع کند، یک سیگنال ضعیف فروش محسوب می شود.
- مقایسه منحنی میانگین حرکتی های دوره های مختلف زمانی:
- اگر یک منحنی صعودی مربوط به دوره زمانی کم از پایین یک منحنی صعودی مربوط به دوره زمانی بالا را قطع کند، یک سیگنال قوی خرید محسوب می شود، و اگر یک منحنی نزولی مربوط به دوره زمانی کم از بالا یک منحنی نزولی مربوط به دوره زمانی بالا را قطع کند، یک سیگنال قوی فروش محسوب می شود.
- اگر یک منحنی صعودی مربوط به دوره زمانی کم از پایین یک منحنی نزولی مربوط به دوره زمانی بالا را قطع کند، یک سیگنال ضعیف خرید محسوب می شود، و اگر یک منحنی نزولی مربوط به دوره زمانی کم از بالا یک منحنی صعودی مربوط به دوره زمانی بالا را قطع کند، یک سیگنال ضعیف فروش محسوب می شود.

محاسبه

$$SMA = \text{Sum} (\text{Close} (i), N) / N$$

در فرمول بالا:

Close (i) - قیمت بسته شدن کنونی

N - دوره زمانی میانگین

$$EMA(t-1) + (K \times [\text{Close}(t) - EMA(t-1)]) = EMA(t)$$

در فرمول بالا:

t - قیمت جاری

$$K = 2 / (N + 1)$$

N - دوره زمانی میانگین گیری

میانگین حرکتی نوسانگر (OsMA)



”میانگین حرکتی نوسانگر“ (OsMA) یک ابزار تحلیل تکنیکی است که اختلاف بین یک نوسانگر (MACD) و میانگین حرکتی اش (خط سیگنال) را بازتاب می دهد.

نقاط حداکثر یا حداقل تابع:

- اگر OsMA از پایین به بالا رود، می تواند علامتی باشد از تغییر روند به سمت صعود.
 - اگر OsMA از بالا به پایین رود، می تواند علامتی باشد از تغییر روند به سمت ریزش.
- قطع محور صفر:
- اگر OsMA بالاتر از صفر برود (مشابه زمانی که MACD از پایین خط سیگنال اش را قطع کند) یک سیگنال خرید ایجاد می شود.
 - اگر OsMA به زیر صفر برود (مشابه زمانی که MACD از بالا خط سیگنال اش را قطع کند) یک سیگنال فروش ایجاد می شود.

محاسبه

$$\text{OsMA} = \text{MACD} - \text{سیگنال}$$

اندیکاتور سهموی (Parabolic)



این اندیکاتور به عنوان یک ابزار برای تجزیه و تحلیل گرافیکی، دارای برخی از محدودیت‌ها نیز می باشد، و ممکن است سیگنال‌های غلط (در حال تغییر پویایی بازار) بدهد.

تایید روند

- قرار گرفتن زیر نمودار قیمت، اندیکاتور روند صعودی را تأیید می کند.
- قرار گرفتن بالای نمودار قیمت، اندیکاتور روند نزولی را تأیید می کند.

مشخص کردن نقاط بستن پوزیشن‌ها

- اگر قیمت زیر اندیکاتور روند صعودی قرار گیرد تأیید به بستن پوزیشن‌های بلند است.
- اگر قیمت بالای اندیکاتور روند نزولی قرار گیرد تأیید به بستن پوزیشن‌های کوتاه است.

اهمیت سیگنال با استفاده از عامل شتاب تعیین می شود. هر زمانی که قیمت بسته شدن بالاتر از قیمت قبلی باشد در یک روند صعودی، و پایین تر از قیمت قبلی باشد در یک روند نزولی، عامل شتاب افزایش می یابد. اعتقاد بر این است که اندیکاتور قابل اعتماد است، زمانی که قیمت و حرکت اندیکاتور موازی باشند و کمتر قابل اعتماد است اگر آنها همگرا باشند.

محاسبه

$$P(t) = P(t-1) + AF \times (EP(t-1) - P(t-1))$$

در فرمول بالا:

$P(t)$ - ارزش فعلی اندیکاتور

$P(t-1)$ - ارزش اندیکاتور در دوره های قبل

AF - عامل شتاب، به طور کلی افزایش با گام 0.02 در فاصله [0.02, 0.2]

$EP(t-1)$ - حداقل / حداکثر قیمت در دوره های قبلی