

Почему наклонные подсопроты лучше работают на индикаторах

Некоторые авторы справедливо указывают на то, что при высокой волатильности не работают наклонные линии трендов (то есть, наклонные линии поддержки и сопротивления) на ценовых графиках. Если выразиться точнее, то они нарушаются ценой, не успев образоваться. Поэтому структурировать данные графически в таких рыночных условиях с помощью наклонных подсопротов можно с трудом и любой прогноз, скорее всего, будет неряшлив.

В своей работе я опираюсь на наклонные трендовые линии на индикаторах, как более надёжный прогностический метод. Причем замечаю, что их можно использовать для большинства известных типов обработки поступающих ценовых данных, т.е для тех, которые мы обычно открываем в отдельном окне. Ещё я исключаю из рассмотрения скользящие средние, а также различного рода конверты, каналы и огибающие на их основе. Кроме того, это моя экспертная оценка, - не оценивал достоверность моих рассуждений статистически и математически.

Итак, почему же наклонные линии работают на индикаторах лучше? Скорее всего, дело в цикличности изменения значений индикаторов. Чаще всего, они представляют собой изменение показателей в виде колебательного процесса от 0 до 100 (например, стохастики, RSI), либо от 0 до какой-либо величины с постепенным затуханием (ADX, ATR), либо из отрицательной зоны в зону положительных значений и обратно с нулевой осью (MACD, CCI) или колеблются, имея осью значение 100 (Momentum). Словом, осцилляторная реакция на ценовое возмущение, говоря словами физики. Недаром многие из них носят ещё название осцилляторов.

При достижении граничных значений упомянутых индикаторов, их реакция по определению становится более замедленной, затухает и не реагирует на случайные ценовые движения, которые обычно нарушают визуальный ряд на основном графике. Однако, при устойчивых сигналах изменения вектора поступающих данных, индикатор реагирует объективно-четко, указывая на разворот, даже если нам очень хочется продолжения праздника. Ведь мы стоим по тренду, не так ли?

Так же, при резких повторяющихся движениях численных значений инструмента в одну и ту же сторону, любой индикатор залегают в дрейф и вытягивается горизонтально, пересекая трендовые линии, тем самым заранее сигнализируя о грядущем изменении обстановки. Цена может и продолжить своё направленное движение, как ни в чём ни бывало, однако мы получаем как минимум хороший сигнал о сокращении размера позиции.

Для своевременного выхода из позиции для меня имеет значение точное определение разворотных ситуаций при направленном движении цены, а также, с другой стороны, важно не реагировать на возможный ценовой шум для того, чтобы дольше оставаться в выигрышной сделке. Этим целям и отвечает проведение наклонных линий поддержки-сопротивления на индикаторах, так как они дают возможность: во-первых, не реагировать на случайные ценовые выбросы, оставаясь в позиции, а во-вторых, постепенно покидать сделку, фиксируя прибыль и снижая риск при волатильных движениях рынка, которые опасны своей непредсказуемостью.

10.11.2010 г. *bvt*