

*Корсаков Александр Васильевич,
студент бакалавриата,
физико-математический факультет,
Рязанский государственный университет имени С.А. Есенина,
Россия, г. Рязань
e-mail: aleksandar_95@mail.ru*

ПРИНЦИПЫ И ИНСТРУМЕНТЫ ТЕХНИЧЕСКОГО АНАЛИЗА

***Аннотация:** В статье рассматриваются основные принципы и инструменты для технического анализа на бирже. Чтобы создать имитационную модель, необходимо понимать какие бывают инструменты, как и когда их использовать. Кроме этого, нужно понимать, принципы по которым работает технический анализ, так как это очень специфичная и сложная сфера деятельности, которая не дает 100% прогноз, а дает лишь направление, в котором должен следовать или не следовать трейдер. В данной статье разберем, каким инструментам можно доверять в техническом анализе, а каким нельзя.*

***Ключевые слова:** макроэкономические индикаторы, осцилляторы, технический анализ, фондовая биржа, скользящая средняя.*

*Alexander Korsakov,
bachelor student,
faculty of physics and mathematics,
Ryazan state University named after S.A. Yesenin,
Russia, Ryazan*

PRINCIPLES AND TOOLS OF TECHNICAL ANALYSIS

***Abstract:** The article discusses the basic principles and tools for technical analysis on the exchange. To create a simulation model, you need to understand what tools are available, how and when to use them. In addition, you need to understand the principles by which technical analysis works, since this is a very specific and complex field of activity, which does not give a 100% forecast, but only gives the direction in which the trader should follow or not follow. In this article, we will analyze which tools can be trusted in technical analysis, and which can not.*

***Key words:** macroeconomic indicators, oscillators, technical analysis, stock exchange, moving average.*

Технический анализ появился в конце 19 века. Главные деятели, положившие начало этому направлению это: Ч. Доу, Дж. Мерфи, У. Ганн, Р. Прихтер, Р. Эллиотт.

Технический анализ сам по себе ничто иное, как аналитика роста и падения цен на рынке, с целью дать достоверный прогноз последующего направления движения цен. В основе лежат временные ряды, объем торгов и другие стилистические данные.

Принципы технического анализа.

В настоящее время на рынке очень много новичков, которые не имеют достаточного опыта и квалификации, но при этом они используют индикаторы. Это в свою очередь стимулирует движение тренда в направлении, которое показал индикатор.

Но стоит помнить, что технический анализ не может гарантировать 100% предсказания тренда. Это всего лишь способ оценить текущую ситуацию на рынке и с помощью логических умозаключений инвестор должен сам принять решение о покупке или продаже.

Можно выделить три принципа технического анализа:

1) Макро- и макроэкономические факторы отражены в объеме и цене бумаги.

Дж. Мерфи считал, что «рынок учитывает все»[1, с. 38]. И целью анализа не является узнать почему изменился тренд, а принимает факт того, что рынок изменился.

2) Исторические тенденции повторяются.

В основе этого принципа лежит неизменность информации, которая является одним из главных критериев принятия решения инвесторами.

3) Движение цен подчинено тенденциям.

Данный принцип также базируется на работах Дж. Мерфи и говорит о том, что все финансовые инструменты взаимосвязаны [2, с 132].

Инструменты технического анализа можно разделить на 2 класса:

Графический анализ и компьютерный анализ.

Для графического анализа характерно выделять на графике паттерны, для определения движения цены.

К графическим инструментам относятся тресковые линии, графские фигуры (треугольник, флаг, «плече и голова» и т.п.), а также уровни поддержек.

Для компьютерного анализа характерно определять движение цен с помощью индикаторов и осцилляторов. Индикатор представляет собой функцию, которая построена на исторических данных торгов (цен или объема).

Индикаторы тренда, в свою очередь, делятся следующим образом:

«Простые средние».

Простые скользящие средние, которые являются средним арифметическим цен за t дней.

Взвешенные скользящие средние, которые присваивают вес каждому из значений цены. Значение веса коэффициента тем больше, чем ближе индекс дня к окончанию.

Экспоненциальные скользящие средние, которые также присваивают вес ценам, но не каждой цене, а цене из заданного интервала.

«Сложные средние»

MACD – схождение расхождение скользящего среднего. Для данного метода необходимо взять две скользящие средние с периодами 12 и 26 дней.

Огибающие линии, которые состоят из скользящих средних, которые находятся на определенном расстоянии от главной скользящей средней.

Полосы Боллинджера, которые состоят из огибающих линий, которые находятся на расстоянии равном числу стандартных отклонений.

PCU или канал цен, который представляет собой коридор вокруг скользящего среднего.

Осцилляторы.

Если на рынке тренд боковой (не растущий и не падающий), то используются осцилляторы.

Осцилляторы показывают на сколько рынок перепродан или перекуплен, и показывают расхождение в ценах актива и индикатора.

Momentum (индикатор момент) – индикатор который показывает отношение цены закрытия за действующий период к цене за прошлый период.

CCL (индекс торгового канала) — показывает нормализованный график индикатора Momentum.

RSI (индекс относительной силы) — индикатор, который следует за ценой.

MFI (индекс денежных потоков) — индикатор схож с RSI, но не учитывает объем торгов, а только определяет интенсивность денежных потоков.

Ultimate Oscillator (окончательный осциллятор) — осциллятор показывает взвешенную сумму трех осцилляторов за различные периоды времени.

PCR (процент сопротивления) — индикатор который оценивает расстояние от экстремума цены за определенный период.

FI (индекс силы) – произведение разности цен текущего и прошедшего дня к объему торгов за текущий день.

Получается, что методами технического анализа можно предсказывать тенденцию и разворот, но стоит помнить, что это не гарантировано.

Список литературы:

1. Мерфи Джон Дж. Межрыночный анализ. Принципы взаимодействия финансовых рынков. М.: «Альпина Паблишер», 2012. 298 с.

2. Мэрфи Джон Дж. Технический анализ фьючерсных рынков. Теория и практика. М.: «Альпина Паблишер», 2011. 610 с.