

АНАЛИЗ ФОНДОВОГО РЫНКА С ПОМОЩЬЮ ИНДИКАТОРА «УДИВИТЕЛЬНЫЙ ОСЦИЛЛЯТОР»

Рейзенбук К.Э.

научный руководитель докт. техн. наук, профессор Пимонов А. Г.
ФГБОУ ВПО "Кузбасский государственный технический университет
имени Т.Ф. Горбачева"

Фондовый рынок, он же рынок ценных бумаг, представляет собой совокупность денежного рынка и рынка капиталов в области торговли фондовыми инструментами, удостоверяющими имущественные права их владельцев на различные виды товаров этих рынков. Это институт или механизм, сводящий вместе покупателей (предъявителей спроса) и продавцов (поставщиков) фондовых ценностей.

Работа на финансовых рынках предполагает вероятностную оценку будущих событий. Абсолютно точное предсказание динамики цен в течение какого-либо периода времени является нерешенной задачей. Причинами непредсказуемого поведения рынка могут быть несовершенство понимания процесса, недостаток информации или ее неопределенность. Создано множество теорий, в которых описаны закономерности изменения цены и стратегии поведения участников рынка.

Теория детерминированного хаоса в последнее время является одним из самых модных подходов к исследованию рынка. Сейчас зачастую хаос определяют как крайнюю непредсказуемость постоянного нелинейного и нерегулярного сложного движения, возникающую в динамической системе.

Следует отметить, что хаос не случаен, несмотря на свойство непредсказуемости. Более того, хаос динамически детерминирован (определен), он подчиняется своим закономерностям. Согласно теории хаоса, если говорить о хаотичном движении цены, необходимо иметь в виду не случайное движение цены, а упорядоченное особенным образом движение. Если динамика рынка хаотична, то она не случайна, хотя и непредсказуема.

Удивительный осциллятор (АО – *astounding oscillator*) является одним из индикаторов теории детерминированного хаоса и наилучшим индикатором движущей силы на фондовых рынках. По существу, это 34-периодное простое скользящее среднее, которое вычитается из 5-периодного простого скользящего среднего, изображенное в виде гистограммы. Он точно говорит, что происходит в текущий момент времени с движущей силой рынка. Трейдер вполне может добиться успеха, торгуя на фондовых рынках, используя только лишь этот осциллятор.

Зеленым цветом окрашивается любой столбец гистограммы, который выше предыдущего столбца. В красный цвет окрашивается столбец гистограммы, который ниже предыдущего столбца. Это позволяет очень легко наблюдать изменение движущей силы. Все, за чем необходимо следить, – это за изменением текущей движущей силы рынка.

Удивительный осциллятор образует три типа сигналов: «блюдец», «пересечение нулевой линии» и «два пика».

Выше нулевой линии образуются сигнал на покупку «блюдец», сигнал на продажу «два пика» и сигнал на покупку «пересечение нулевой линии».

Сигнал на покупку «блюдец» образуется тогда, когда гистограмма меняет направление с нисходящего на восходящее (рисунок 1).

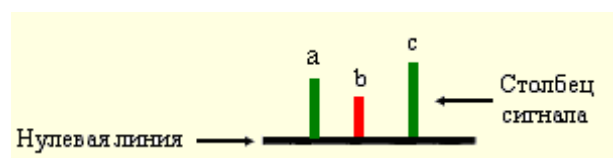
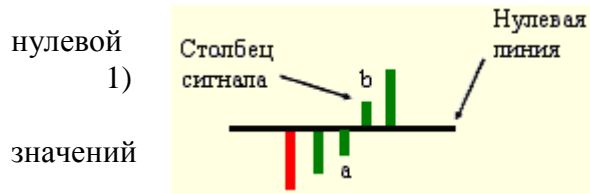


Рисунок 1 - Сигнал на покупку «блюдец»

Стоп-ордер на покупку устанавливается на одно минимальное

изменение цены выше максимума ценового бара, который соответствует первому, наиболее высокому, столбцу «с» гистограммы.



нулевой
1)
значений

Сигнал на покупку «пересечение линии».

Сигнал на покупку образуется, когда гистограмма переходит от отрицательных к положительным значениям. Это

происходит тогда, когда гистограмма пересекает нулевую линию.

Рисунок 2 - Сигнал на покупку «пересечение нулевой линии»

2) Стоп-ордер на покупку должен быть размещен на одно минимальное изменение цены выше, чем максимум ценового бара, который соответствует первому столбцу гистограммы, который пересек нулевую линию (рисунок 2).

Чтобы образовать этот сигнал, необходимы только два столбца.

Сигнал на продажу «два пика». При использовании сигнала на продажу «два пика» продажа осуществляется, когда гистограмма находится выше нулевой линии.

1) Этот сигнал образуется, когда есть пик, направленный вверх (самый высокий максимум) выше нулевой линии, за которым следует другой направленный вверх пик, который ниже (меньшее положительное число, поэтому оно находится ближе к нулевой линии), чем предыдущий восходящий пик.

2) Гистограмма должна находиться выше нулевой линии между двумя пиками. Если гистограмма пересекает нулевую линию между пиками, сигнал на продажу является недействительным.

3) Каждый новый пик гистограммы должен быть ниже (меньшее положительное число, которое находится ближе к нулевой линии), чем предыдущий пик.

Перед сигналом на продажу «два пика» будет формироваться сигнал на покупку «блюдец» (рисунок 3).

Ниже нулевой линии образуются сигнал на продажу «блюдец», сигнал на покупку «два пика» и сигнал на продажу «пересечение нулевой линии»

Сигнал на продажу «блюдец» противоположен сигналу на покупку «блюдец». Ниже указаны основные моменты, которые необходимо помнить.

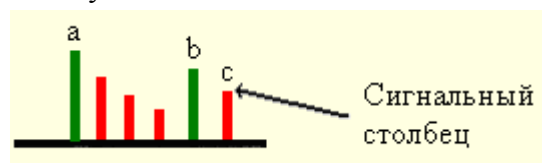


Рисунок 3 - Сигнал на продажу «два пика»

1) Этот сигнал образуется тогда, когда гистограмма изменяет свое направление с восходящего (со столбца «а» к «b»), как на рисунке 4) на нисходящее (со столбца «b» на «с»).

2) Для образования сигнала на продажу «Блюдец» необходимы, как минимум, три столбца.

3) Стоп-ордер на продажу помещается на одно минимальное значение ниже минимума ценового бара, который соответствует первому нисходящему столбцу (столбец «с» на гистограмме).

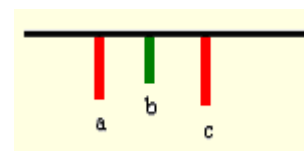


Рисунок 4 – Сигнал на продажу

Чтобы образовался сигнал на продажу «блюдец», все столбцы должны быть ниже нулевой линии.

Используя сигнал «пересечение нулевой линии» гистограммы, следует продавать, когда гистограмма пересекает нулевую линию (рисунок 5).

1) Сигнал на продажу образуется, когда гистограмма переходит от положительных значений к отрицательным. Это происходит тогда, когда гистограмма пересекает нулевую линию.

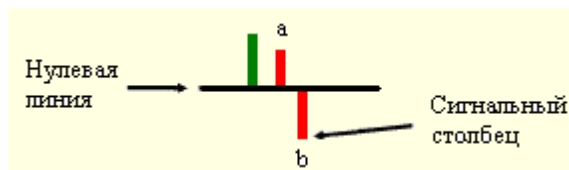


Рисунок 5 – Сигнал на продажу

2) Стоп-ордер на продажу должен быть на одно минимальное изменение цены ниже, чем минимум ценового бара, который соответствует первому столбцу, пересекающему нулевую линию.

Требуется только один столбец, пересекающий нулевую линию, чтобы образовался сигнал на продажу.

Сигнал на покупку «два пика».

1) Сигнал образуется, когда есть направленный вниз пик (самый низкий минимум), находящийся ниже нулевой линии, за которым следует другой направленный вниз пик, который выше (отрицательное число, меньшее по абсолютному значению, поэтому оно находится ближе к нулевой линии), чем предыдущий пик, смотрящий вниз.

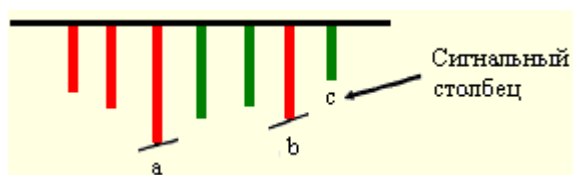


Рисунок 6 – Сигнал на покупку «два пика»

2) Гистограмма должна находиться ниже нулевой линии между двумя пиками. Если гистограмма пересекает нулевую линию между пиками, сигнал на покупку не действует. Однако создается сигнал на покупку «пересечение нулевой линии».

3) Каждый новый пик гистограммы должен быть выше (меньшее по модулю отрицательное число, которое находится ближе к нулевой линии), чем предыдущий пик (рисунок 6).

4) Если формируется дополнительный, более высокий пик (который ближе к нулевой линии) и гистограмма не пересекла нулевую линию, то образуется дополнительный сигнал на покупку.

Это единственный сигнал на покупку, образующийся ниже нулевой линии.

Нужно подчеркнуть: не надо продавать при помощи сигналов удивительного осциллятора, если текущий столбец гистограммы зеленого цвета, и не покупать при помощи сигналов удивительного осциллятора, если текущий столбец гистограммы красного цвета.

Важно помнить, что не стоит использовать сигналы АО до тех пор, пока не появится первый фрактал на покупку за пределами пасти аллигатора.

Удивительный осциллятор является простым и элегантным индикатором, но в тоже время трейдер вполне может добиться успеха, торгуя на фондовом рынке только с его помощью.

Список литературы:

- 1) Fritz Robert. The Path of Least Resistance. – Ballantine Books, 1989. – 365с.
- 2) Найман Эрик Л. Малая Энциклопедия трейдера. – М.: Альпина Бизнес Букс, 2007. – 402 с.
- 3) Бэбкок Брюс. Теория хаоса и рыночная действительность [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.math-economics.tut.su/text/20.htm> , свободный.