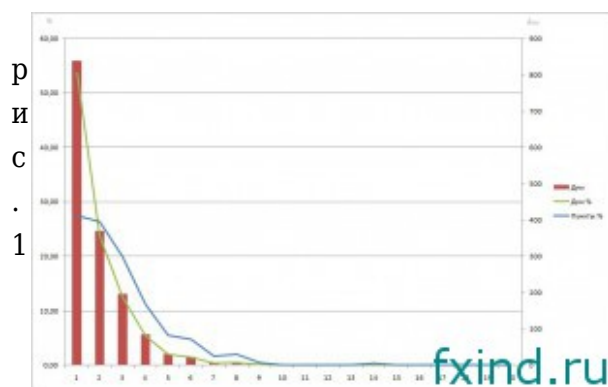


Тренд. Определение понятия.

Основная задача трейдера — придерживаться тренда, тогда он сможет заработать. Но как его выявить? Многие игроки на рынке Forex играют внутри дня, равняясь на дневной тренд. Давайте попробуем дать определению тренду, чтобы в дальнейшем попробовать его определить с помощью индикаторов.

Для начала обратимся к интернету. Самое разумное определение, найденное по запросу «Что такое тренд?», на мой взгляд, следующее: «Тренд — закономерность, характеризующая общую долгосрочную тенденцию в изменениях показателей временного ряда.» Временной ряд в нашем случае — последовательность изменения цены. Т.е. из всего набора изменений цены мы хотим найти такие участки (серии дней), внутри которых цена растет или снижается, желательно, на определенное количество пунктов. Проанализируем изменение пары eur-usd (таймфрейм d1) с 1999 по 2010 год и построим распределение, отражающее зависимость частоты появления серий от их длины (без учета знака) рис.1.



На рис. 1 представлены 3 зависимости:

- общее количество серий определенной длины (дни);
- процент серий разной длины от общего количества (дни %);
- количество пунктов, на которые изменилась цена в течении серий разной длины в процентах (пункты %).

Видно, что более 50% серий обладают длительностью 1 день. При этом в эти дни происходит менее 30% изменений. То есть, более 70% изменений цены происходят в периоды серий 2 дня и более. Обращает на себя внимание так же тот факт, что на долю серий длиной 2 и 3 дня приходится примерно равное количество пунктов изменения. Вплоть до серий длиной 5 дней, их количество снижается примерно вдвое с каждым днем. Это говорит о том, что для серий до 5 дней длиной вероятность, что на следующий день движение цены продолжится в том же направлении составляет 0,5. Получается, что вероятность встретить серию из 4-х дней составляет $0,5$ (после первого дня) \times $0,5$ (после второго) \times $0,5$ (после третьего) = $0,125$. Соответственно если цена росла 3 дня подряд, то на 4-ый она зафлеться или развернется с вероятностью $1 - 0,125 = 0,875$.

Итак, с точки зрения извлечения прибыли трендом для пары eur-usd можно считать серии, в

рамках которых цена изменялась в одном направлении в течении двух и более дней. Таким образом определение тренда сводится к тому, чтобы сказать будет ли завтра цена двигаться в том же направлении или развернется. Попробуем найти такие индикаторы, который с достаточной точностью будут говорить продолжится ли движение на следующий день или нет. Очевидно, что для серий 2-3 интересны индикаторы, которые покажут продолжится движение или нет. А для больших серий нужны индикаторы, определяющие зафлетиться тренд или развернется. Об этом в следующих постах.