

Определение тренда форекс. Анализ отклонения цены от значения скользящей средней после двухдневного изменения цены в одном направлении.

В [предыдущей статье](#) был детально рассмотрен способ **определения тренда** с помощью скользящей средней на второй день изменения цены. Теперь предположим, что цена изменяется в одном направлении два дня подряд, и нам необходимо определить продолжится ли это движение на третий день или нет. Для принятия решения будем использовать тот же алгоритм, что и раньше, только теперь будем оценивать разницу между ценой закрытия и скользящей средней не на первый а на второй день. Если разница больше определенного порога, то принимается решение о том, что на следующий день цена развернется. В противном случае прогнозируется продолжение тренда.

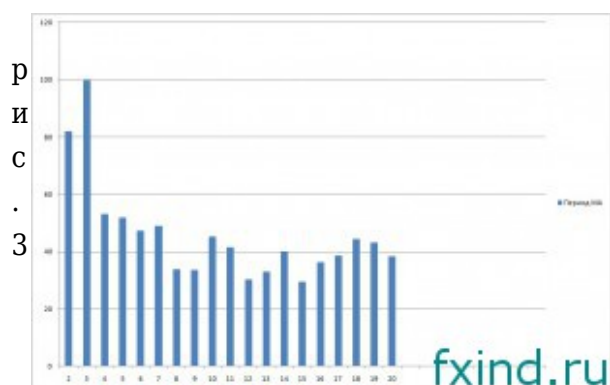


На рисунке проиллюстрирована работа алгоритма в случае разворота тренда. Доработаем [советник MetaTrader](#) таким образом, чтобы он учитывал однонаправленное изменение котировки в течении двух дней, и попробуем оптимизировать его параметры по критерию максимальной прибыли для пары eur/usd. Первый шаг — определение оптимальной разницы цены закрытия и скользящей средней для покупки и продажи:



Как и для случая **определения тренда** на второй день оптимальные значения разницы для покупки и продажи заметно разнятся. Для покупки наибольшая прибыль соответствует

разнице между ценой закрытия и скользящей средней более 35 пунктов, для продажи — 5 пунктов. Далее построим зависимость прибыли, получаемой советником, от **периода скользящей средней**:



Оптимальный период скользящей средней снова совпадает с алгоритмом определения продолжения тренда на второй день и составляет 3 дня. Отчет о работе советника с оптимизированными параметрами [тут](#). Советник снова показывает постоянную прибыль, однако, количество случаев правильного определения тренда не сильно увеличилось и составляет 54,76%. Таким образом, если мы хотим работать на таймфрейме d1, то данный метод (при соответствующей доработке) подойдет. Если же после определения тренда мы планируем открывать позиции внутри дня, опираясь на другие индикаторы (например осцилляторы), то в более чем 45% случаев высок риск потерь, так как общее направление изменения котировок будет определено не верно. Поэтому попробуем пока отказаться от скользящей средней и разработать алгоритм на основе другого индикатора, об этом в следующей статье.