

Sorry, the translation is not available for a while.

Мультиколлинеарность в техническом анализе.

Мультиколлинеарность - это линейная зависимость переменных, корреляция. Так, коллинеарны параллельные векторы, коллинеарны код ДНК и соответствующая молекула белка. Считается, что переменные мультиколлинеарны, если коэффициент корреляции больше 0,7.

В техническом анализе этот термин применяется для проблемы использования однотипных данных при построении индикаторов. В случае обработки одинаковых данных получаются индикаторы, которые подобны. Трейдерам требуется соблюдать известную осторожность, чтобы избежать ошибочных решений при согласованной подаче сигналов казалось бы, разноплановыми индикаторами.

По большому счету, существует пять основных показателей рыночного движения: объем и четыре характеристики ценового отрезка: открытие, закрытие, верх и низ. Остальное – лишь их комбинации и изобретательные статистические наслоения, такие как скользящие средние, конверты, учет волатильности и прочие попытки подобрать волшебный золотой ключик к секрету рыночных сокровищ. Я сам потратил два года на обсчет комбинаторных идей, варьируя показатели и время, пока не убедился в тщетности попыток отыскать единственно верную, надежную путеводную нить.

С другой стороны, нельзя сказать, что абсолютно все индикаторы одинаковы. Согласно комбинированию методов обработки данных и используемых показателей для расчета, их можно разделить на категории, чтобы не применять однотипные для вашей сигнальной системы. Вот примерная таблица такого разделения часто применяемых:

применение

общеизвестные индикаторы

индикаторы bvt

импульс (скорость изменения цены),

осцилляторы

Accelerator Decelerator (AC),

ADX (average line),

Momentum,

Rate of Change (RoC),

Relative Strength Index (RSI),

Stochastics,

TRIX

Sir

Mcs

Направление тренда

Moving Averages (MA),

Moving Average Convergence Divergence (MACD),

Price Oscillator (PO),

Parabolic SAR,

ADX (+DMI, -DMI lines),

Piano

Sum

Строп

Объем

Accumulation Distribution (A/D),

Chaikin Oscillator, Elder's Force Index,

Money Flow Index (MFI),

On Balance Volume (OBV),

Volume Oscillator (VO),

Williams' A/D

[Redacted]

[Redacted]

Уровни, конверты, каналы

Envelopes,

Bollinger Bands (BB),

Keltner Channels,

Price Channels,

[**AutoFibo**](#)

[**UD**](#)

[**EnvоАТР**](#)

Мультиколлинеарность коварна и отлично маскируется, её трудно определить.

Индикаторы могут всерьез отличаться друг от друга по вычислительному методу и выглядеть разными графически. Они способствуют избыточной информации и могут вызвать к жизни другие переменные величины, которые кажутся более важным, чем есть на самом деле. Чтобы не попасть в ловушку мультиколлинеарности, технический аналитик должен во-первых, воздерживаться от использования чрезмерного числа индикаторов, а во-вторых, учитывать простую истину, что на финансовых рынках инженерный расчет применим лишь в узких рамках сигнальных систем (об общей структуре торговых систем см. статью « [Генералы финансовых карьеров](#) »).

Большинство современных индикаторов имеют настроечные опции, которые варьируются в широких пределах. Поэтому многие из тех инструментов, которые я отнес к условной второй категории, могут быть отнесены к первой при более быстрых настройках. Лучший способ определить коллинеарность – это нанести индикаторы на график и сравнить визуально, поиграв настройками. Если разница между сигнальными значениями не превышает одной трети, то весьма вероятно, что вы маслите масло.

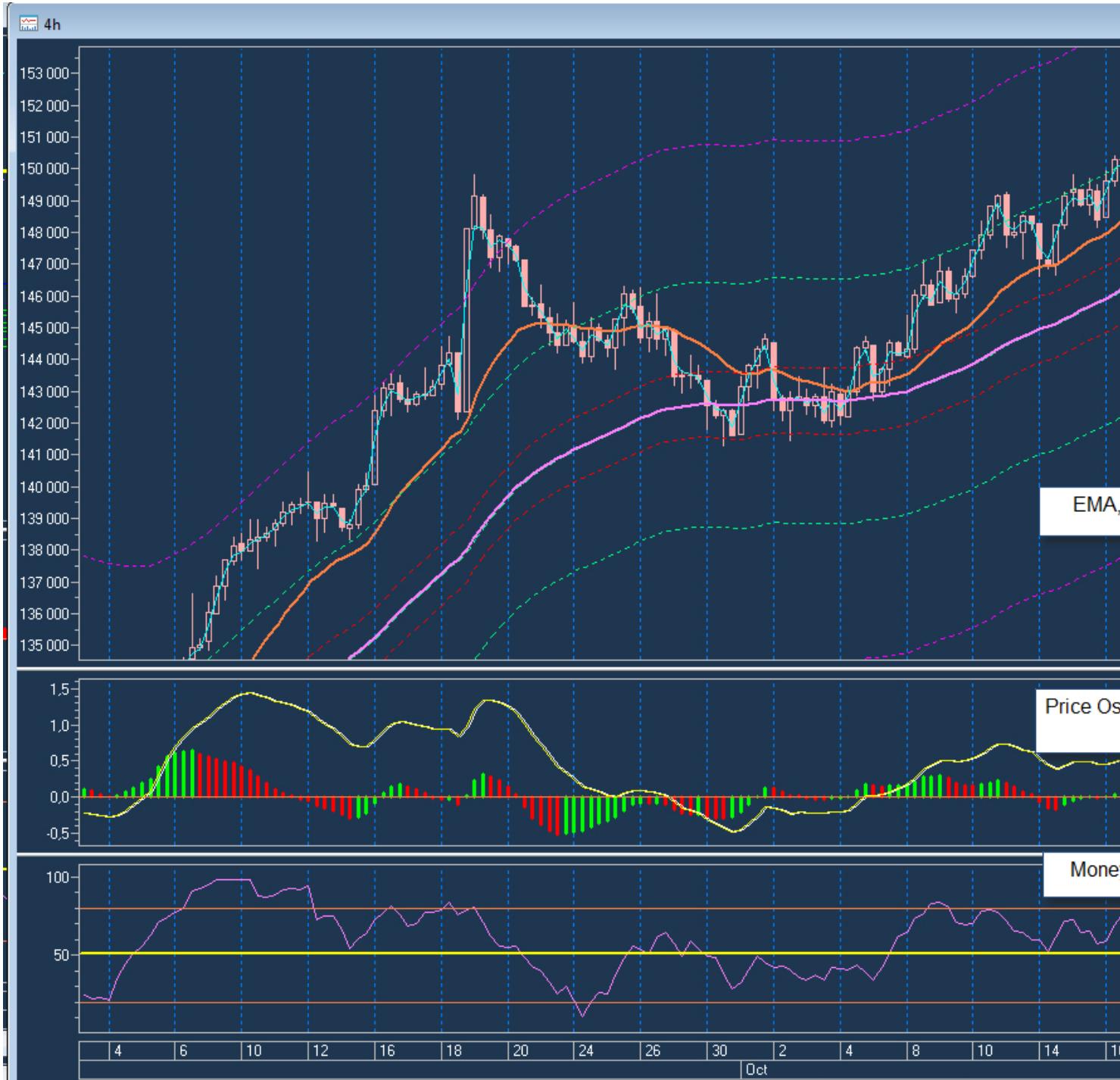
Подтверждать сигналы друг друга они будут с завидным постоянством, но нужно ли это вам? Ответ может быть положительным лишь в одном случае, - если вы практикуете набор позиции или выход из неё по частям. Настроив несколько мультиколлинеарных индикаторов на разные временные или скоростные характеристики, вы можете постепенно снижать или наращивать свой объем на рынке и, как результат, дольше оставаться в тренде (подробнее см. статью « [Накопление сигналов](#) »).

Кроме того, имеет значение, для чего именно вы используете сигнал данного конкретного индикатора, то есть к какому типу торговли вы тяготеете. Например, для скальпирования вам нужно дождаться, чтобы включились трендовые тактические индикаторы и работать в их направлении, используя осцилляторы а также объемники с быстрыми настройками (см. статью « [Размашистое движение](#) »). Для трендников подойдет та же схема, но с существенно более медленными опциями. Для фиксации прибыли в современных условиях набирают популярность конвертные (envelopes, Keltner channels) трейлинговые (parabolic SAR, Chandelier) и уровневые (Price Channels, [AutoFibo](#)) методы.

Однако в общем случае, необходимо избегать мультиколлинеарной ловушки, которая ограничивает ваше представление о рынке. Для лучшего понимания рынка и выработки

стратегической части торговой системы используйте индикаторы разных категорий, которые при правильной интерпретации дают различную информацию.

Пример использования разнокатегорийных индикаторов (fut IRTS december):



[Увеличить график](#)

06.12.13 bvt