

On Balance Volume (OBV)

Индикатор Балансовый Объем разрабатывался для использования на товарных рынках.

Индикатор On Balance Volume: определение и формула

On Balance Volume на сегодняшний день остается одним из первых индикаторов для определения положительных или отрицательных денежных потоков. Индикатор был построен на простой идее – изменение объема предшествует изменению цен. Он достаточно прост в расчетах и это его дополнительное преимущество.

Балансовый Объем рассчитывается добавлением объема за определенный интервал времени, если цены закрылись в плюсе и отниманием объема – если цены закрылись в минусе.

Так, когда текущая цена закрытия больше вчерашней цены закрытия, то новое значение OBV будет равняться сумме прошлого значения индикатора с объемом текущего временного периода. Формула будет иметь следующий вид:

$$OBV_i = OBV_{i-1} + Volume$$

Когда текущий уровень цены меньше предыдущей цены закрытия, новый OBV будет рассчитываться как разница:

$$OBV_i = OBV_{i-1} - Volume$$

где:

OBV i — On Balance Volume за текущий период;

OBV i-1 — On Balance Volume за предыдущий период;

VOLUME i — объем текущей свечи.

Фактически **On Balance Volume** измеряет скорость изменения цен и объемов. В его основе лежит принцип – его изменение предшествует изменению цены. Эта теория имеет право на существование, поскольку резкое изменение объема может действительно являться показателем изменения цен. Такая ситуация возможна, потому что крупные институциональные инвесторы (фонды, торговые дома и прочие) вкладывают в актив тогда, когда отдельные трейдеры еще продолжают продажи. В этом случае при спадающей цене возможен рост объема и последующий рост цены. Таким образом, объем покупок может быть движущей силой для роста цен.

Через определенное время можно наблюдать обратное явление – крупные инвесторы продают актив, а отдельные трейдеры еще покупают.

Именно в таких ситуациях индикатор замечательно показывает основные моменты для разворотов трендового движения. То есть рост линии индикатора говорит или о подтверждении тренда (если индикатор соответствует цене) или говорит о будущем развороте (если направление цены и индикатора OVB расходятся).

Как правило, Балансовый Объем используют для подтверждения сигналов других индикаторов. В анализе значение он не играет роли. Для трейдера важно только направление индикатора.

Если график цены движется быстрее **On Balance Volume**, это является сигналом того, что тренд не подтвержден объемом, а, значит, возможно, скорое достижение максимума или минимума.

Основной сигнал индикатора – это смена тенденции. Принято считать, что индикатор намного раньше показывает потенциальные изменения цен. Но при этом очень важно учитывать особенности использования **On Balance Volume**.

Главный недостаток индикатора – большое количество ложных сигналов. Кроме этого, на валютном рынке в его расчете используется тиковый объем, поэтому OBV советуют использовать только на внутридневных графиках.