

DeMarker (DM)

Индикатор Демарка (другие названия – DeMarker, ДеМаркер) разработал Томас Р. Демарк. Первый раз описание индикатора было опубликовано в книге автора «Технический анализ – новая наука». Целью создания индикатора было определение перекупленности и перепроданности. При этом DeMarker должен был избежать основных недостатков традиционных показателей. Его основная цель — определить максимумы и минимумы рыночных цен. При этом он также учитывает спрос на актив и меру риска.

Индикатор Демарка (DeMarker): определение и цены

Целью создания индикатора было определение перекупленности и перепроданности. При этом DeMarker должен был избежать основных недостатков традиционных показателей. Его основная цель — определить максимумы и минимумы рыночных цен. При этом он также учитывает спрос на актив и меру риска.

Суть индикатора в том, что он определяет зоны цен, которые сопутствуют максимальным или минимальным значениям. DeMarker сравнивает максимумы текущего периода и максимумы предыдущего. Его также считают осциллятором, у которого ключевые уровни находятся около 0,3 и 0,7. При этом само значение индикатора Демарка колеблется от 0 до 1.

Расчет индикатора DeMarker:

Сначала рассчитывают $DeMax_i$ по формуле ниже. Этот показатель определяет, насколько максимум актуального бара больше прошлого.

$$\text{Если } High_i > High_{i-1}, \text{ то } DeMax_i = High_i - High_{i-1}, \text{ иначе } DeMax_i = 0$$

Рассчитывают $DeMin_i$. Этот показатель характеризует, на сколько минимум актуального бара меньше прошлого.

$$\text{Если } Low_i < Low_{i-1}, \text{ то } DeMin_i = Low_{i-1} - Low_i, \text{ иначе } DeMin_i = 0$$

где:

$HIGH_i$ — максимальная цена текущего бара;

LOW_i — минимальная цена текущего бара;

$HIGH_{i-1}$ — максимальная цена предыдущего бара;

LOW_{i-1} — минимальная цена предыдущего бара;

Рассчитывают индикатор Демарка по формуле:

$$DeMarker_i = \frac{Sma(DeMax, N)}{Sma(DeMax, N) + Sma(DeMin, N)}$$

где:

Sma — простое скользящее среднее;

N — количество периодов, которые используются для расчета скользящих средних.

Исходя из этой формулы, индикатор определяют так: когда максимальное значение текущей свечи больше максимума прошлой, учитывается разница между этими значениями. Если же максимальное значение текущей свечи меньше прошлой, принимают разницу между этими значениями за ноль.

Соответственно рассчитывают минимальные значения: когда минимум свечи меньше предыдущей, разница между ними учитывается, когда больше – принимается за ноль.

В результате, индикатор Демарка равняется скользящей средней от разницы максимальных значений, которая делится на сумму скользящих от разниц максимумов и минимумов.

Индикатор Демарка (DeMarker): применение и недостатки

DeMarker обычно используется для определения зон перекупленности и перепроданности. Также многие трейдеры используют дивергенции этого показателя.

1. Зона перепроданности находится выше 0,7. Вход в эту зону сверху вниз является сигналом на продажу.

2. Зона перекупленности находится ниже 0,3. Сигналом на покупку является пересечение этого уровня снизу вверх.

3. Использование дивергенций. Дивергенции – это расхождения в показателях индикатора и графика цены. Когда текущий максимум цены больше прошлого, а максимум индикатора меньше – это говорит о смене тренда и является сигналом на продажу. Если же цена демонстрирует минимум ниже прошлого, а индикатор минимум выше прошлого, это сигнал на покупку. Трендовые линии на индикаторе Демарка также используются в техническом анализе. Когда трендовые линии пробивают максимум или минимум это также является сигналом пробития.

4. Использование фигур (треугольник, факел и т.д.) на графике также применяется по классическим законам.

К основным недостаткам DeMarker относят недостатки остальных индикаторов – хорошие сигналы он показывает для циклов, которые соответствуют длине осциллятора. Но при несоответствии длины индикатора циклу показатель может подавать ложные сигналы.