

Relative Vigor Index (RVI)

Relative Vigor Index – впервые индикатор RVI упоминается в журнале Stocks and Commodities в 2002 году. В статье автор говорит о том, что цена закрытия бара будет выше цены открытия во время роста, обратную тенденцию он наблюдал при нисходящем рынке. И на основе данного утверждения строится индикатор RVI.

Формула Индекса Относительной Бодрости

Поскольку индикатор схож с другим осциллятором Stochastic (Стохастик), формула расчета будет подобна ему. Однако для измерения RVI необходимо сравнить уровень закрытия и уровень открытия свечи. Проще говоря, Индекс Относительной Бодрости отображает фактические изменение котировок за определенный период.

$$RVI = \frac{Close - Open}{High - Low},$$

где

Close – цена закрытия бара;

Open – цена открытия бара;

High – максимальная цены бара;

Low – минимальная цена бара.

Результат сглаживается со скользящей средней определенного периода. Таким образом удастся получить первую линию

Сам индикатор отображается в виде двух линий: зеленая имеет меньший период, чем красная, и они показывают силу бодрости движения. Красная линия считается сигнальной (см. рис. 1). Обе линии рассчитываются как симметрично взвешенные скользящие средние с разными периодами. В итоге получаем формулу:

$$RVI = \frac{\sum Average(Close_i - Open_i)}{\sum Average(High_i - Low_i)},$$

где

Average – скользящее среднее;

i – период.

Применение индикатора RVI

Главной задачей индикатора является определять вероятность изменения или продолжения тренда с помощью показателя бодрости. Проще говоря, RVI отражает, насколько уверенно движется цена в данный момент. Поскольку индикатор показывает силу рынка, его лучше не использовать при сильном тренде.

В качестве прямого сигнала можно использовать пересечение двух линий. Как уже говорилось ранее, сигналом на продажу будет являться пересечение красной линией зеленой снизу вверх. Обратная картина будет являться сигналом на покупку. Уровни стоп-лосса обычно устанавливаются чуть ниже уровня локального минимума при продажах, и чуть выше уровня локального максимума при покупках.