

# Average True Range (ATR)

**Средний истинный диапазон (ATR)** – индикатор для проведения технического анализа, который позволяет определять волатильность рынка.

## Average True Range (ATR): определение и формула

Изначально он был создан для технического анализа ситуации на товарных рынках. Ведь именно этот тип рынков отличается наибольшей волатильностью. Но сейчас этот индикатор используется на валютном и фондовых рынках. Именно с его помощью можно измерить волатильность.

Средний истинный диапазон рассчитывается по формуле:

$$ATR = \text{Moving Average}(TR_j, n)$$

где:

$Tr_j$  = максимальный из модулей трех значений  $|High - Low|$ ,  $|High - Close_{j-1}|$ ,  $|Low - Close_{j-1}|$ .

## Средний истинный диапазон: применение и недостатки

### Применение индикатора:

Как правило, используется 14-периодный ATR. Но он может быть рассчитан на различных периодах – данных за день, за неделю или месяц. Если средний истинный диапазон достигает экстремальных значений, это говорит о разворотных точках или начале нового движения. Нужно учитывать, что индикатор (впрочем, как и остальные индикаторы волатильности) не показывает направление или длительность движений. С его помощью можно определить только активность. Чем ниже значений индикатора, тем спокойнее торговая сессия. Движения цен происходят в узком диапазоне. И наоборот – чем больше индикатор, тем более интенсивная торговля происходит на рынке. Если долгое время ATR показывает низкие значения, это говорит о консолидации. Она, скорее всего, поведет за собой быстрое движение или разворот. Высокое значение среднего истинного диапазона, как правило, имеет краткосрочный характер.

**Основная концепция индикатора** – с увеличением значения среднего истинного диапазона, растет возможность разворота тренда, с уменьшением – происходит ослабление направленности тренда.

### Недостатки:

Средний истинный диапазон имеет один существенный недостаток — при большом периоде ATR обычно запаздывает, показывая прошлый уровень волатильности.