

Simple Moving Average (SMA)

Индикатор **Простое скользящее среднее** – это арифметическое среднее за определенный интервал времени. Оно показывает некую цену равновесия спроса и предложения. Чем меньше длина этого показателя, тем короче оцениваемый интервал времени. При этом индикатор будто сглаживает главные тенденции, фильтруя незначительные колебания.

Простое скользящее среднее: определение и формула

Чем меньше (короче) значение скользящего среднего, тем быстрее будет определена новая тенденция. Но при этом также будет большее количество несущественных колебаний. Соответственно, чем больше параметр индикатора – тем медленнее определится новая тенденция, но присутствовать будет меньше незначительных движений цены.

$$\text{Simple Moving Average} = \frac{\sum_{i=1}^n P_i}{n}$$

где:

P_i — Цены на рынке (обычно используются цены Close или Open, High, Low, Median Price, Typical Price).

N — основной параметр — длина сглаживания (подразумевает количество цен, которые входят в расчет скользящего). Он также носит название порядок скользящего среднего.

Применение:

Существуют общие правила для анализа простых скользящих средних. Для анализа нужно найти:

- Точки пересечения и наибольшего расхождения индикатора и графика
- Точки, которые следуют за максимальным и минимальным значением среднего (они сигнализируют о поворотных моментах)

Недостатки индикатора:

1. Основным недостатком индикатора является запаздывание. Оно очень значительно, так как при этом трейдер может опоздать вовремя открыть сделку. Чтобы уменьшить запаздывание, нужно уменьшить порядок средней, но при этом возрастет количество ложных сигналов. Выбрать правильный баланс – это главная задача трейдера.
2. В боковиках SMA показывает большое количество ложных сигналов, которые могут стать причиной потерь.
3. Нельзя использовать при входе нерыночные цены, поскольку это сильно меняет индикатор.
4. Индикатор одинаково воспринимает новые и старые цены.