

Moving Average Envelopes (MAE)

Индикатор **Конверты скользящих средних** – это использование при анализе две или больше средних. Такие соединения они образуют конверты скользящих средних, новый инструмент для определения движений цен. При этом чем точнее Вы сможете угадать цикл колебаний курса. Если же Вы построите индикатор с существенным сдвигом от правильного курса, данные нельзя будет использовать при анализе. Поэтому важно использовать подходящие соединения скользящих средних.

Moving Average Envelopes (MAE): формулы

Конверты скользящих средних обычно состоят из трех полос:

Верхняя полоса:

$$\text{Moving Average Upper Band} = \text{Moving Average} + (K/100) \times \text{Moving Average}$$

где K — процент от цены, на который скользящая смещается вверх

Нижняя полоса:

$$\text{Moving Average Lower Band} = \text{Moving Average} - (N/100) \times \text{Moving Average}$$

где N — процент, на который скользящая средняя смещается вниз.

Применение конвертов скользящих средних

Общие правила использования комбинаций скользящих средних:

- Найдите точки пересечения скользящих средних
- Найдите точки самого большого расхождения средних
- Учитывайте общее направление движения скользящих средних.

Методы применения конвертов:

1. Сначала подберите коэффициент смещения. После этого можно использовать верхнюю скользящую среднюю как линию сопротивления, а нижнюю – как линию поддержки. Таким образом, некоторые трейдеры начинают продавать у верхней линии и покупать у нижней. Но при этом важно учитывать новости рынков, которые могут повлиять на пробой линии тренда.

2. Пробой можно использовать для определения развития движения. При этом покупка будет осуществляться, когда цена пересекает скользящую среднюю вверх, а после этого также верхнюю полосу конверта. Обратная ситуация (пересечение скользящей вниз и нижней полосы конверта) сигнализирует о продаже. Так удастся избежать многих ложных сигналов. Нужно учитывать, что при настоящем тренде на рынке, трейдер должен быть особенно внимательным, так как сигнал будет поступать позже .

3.Трейдеры могут использовать фильтры. Это могут быть временный фильтры (пауза на 1-3 дня) или фильтры-индикаторы (в том числе конверты).

4.Существует также метод тройного пересечения, в котором используются четырех, девяти и восемнадцатидневные скользящие средние (на валютном рынке). Впервые е предложил Р. Аллен в 1972 году. При восходящем тренде выше будет располагаться самое короткое среднее – четырехдневное, ниже – самое длинное восемнадцатидневное. При нисходящем тренде – наоборот. В случае использования этого метода сигналом изменения тренда является последовательное пересечение между собой всех трёх скользящих средних.

Рекомендуется:

- *1-дневный график цен* — 8-13; 8-21; 1-55; 1-89;
- *1-часовой график цен* — 1-34; 34-55; 1-144; 8-89;

Не рекомендуется использовать — 55-89.

- *менее чем 15-минутный график цен* — 34-144; 1-144; 1-55.

При использовании других индикаторов может наблюдаться большое количество ложных сигналов.

Основная дилемма остается даже в случае использования конвертов – **оптимальный баланс между ложными сигналами и заторможенностью индикатора.**