

Double Exponential Moving Average (DEMA)

Индикатор DEMA (Double Exponential Moving Average – Двойная Экспоненциальная Скользящая Средняя). Индикатор представляет собой альтернативный метод построения экспоненциальной скользящей средней (в дальнейшем ЕМА).

Целью создания индикатора DEMA было уменьшить отставания скользящей средней от цены, которое присуще классической ЕМА индикатора Moving Average.

Формула расчета индикатора представляет собой разность удвоенной однократной ЕМА с дважды сглаженной той же ЕМА:

$$\text{DEMA (i)} = 2 * \text{EMA (i)} - \text{EMA (EMA (i))}$$

В результате полученная скользящая средняя меньше отстает от цены. Параметр у индикатора только один, это значения периода. Расчет скользящей идет по цене закрытия свечи.