

# 기술적 지표

🕒 작성일시	@2022년 7월 16일 오후 11:12
🕒 최종 편집일시	@2022년 7월 19일 오후 4:16
📄 문서 유형	기술적 트레이딩
🔗 레퍼런스	<a href="https://blog.naver.com/leebisu/222807336125">https://blog.naver.com/leebisu/222807336125</a>

트레이딩은 과거 주가의 움직임이나 패턴을 통해 주식이 오를지 혹은 내릴지를 판단하는 기술적 분석에 의존하는 경우가 많으며 이럴 때 사용되는 것이 기술적 지표이다.

기술적 지표를 이용한 트레이딩 전략은 크게 추세추종 전략과 평균회귀 전략으로 나눌 수 있다.

1. 추세추종 전략: 주가가 동일한 방향으로 지속될 것이라는 베팅하며, 이동평균 등의 지표가 사용된다.
2. 평균회귀 전략: 주가가 평균으로 다시 회귀한다는 베팅하며, RSI, 볼린저밴드 등의 지표가 사용된다.

## 추세추종 - 이동평균

이동평균은 정해진 기간동안 주식의 평균 가격이다. 이동평균은 현재의 추세나 추세 역전, 혹은 저항 수준을 확인할 때 사요오딘다. 흔히 이동평균이 상승하는 상황에서 주가가 그보다 위에 있다면 상승 신호로 여겨진다. 반대의 경우 하락 신호.

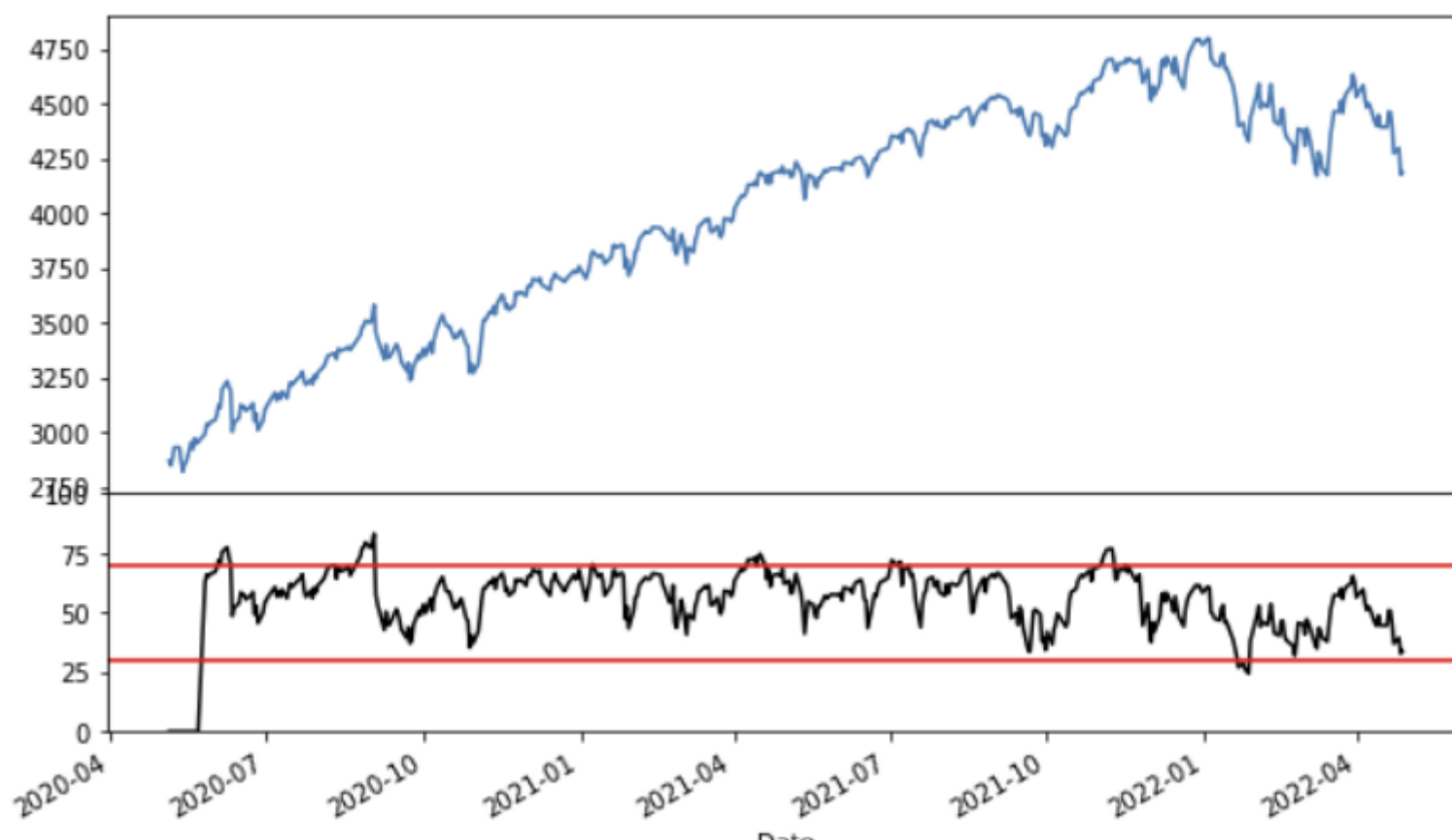
골든 크로스란 단기 이동평균선이 중장기 이동평균선을 아래에서 위로 뚫고 올라가는 현상으로 강세 신호를 나타내며, 반대로 데드크로스는 단기 이동평균선이 중장기 이동평균선을 위에서 아래로 뚫고 내려가는 현상으로써 약세 신호를 나타낸다.

## 평균회귀 - 상대강도지수(RSI)

RSI 는 대표적인 모멘텀 지표로, 일정기간 동안 주가의 상승폭과 하락폭의 크기를 비교해 상승과 하락의 상대적인 강도를 나타낸 지표이다.

- U : UP, 가격이 상승한 날의 상승폭
- D : DOWN, 가격이 하락한 날의 하락폭
- AU, AD : Average Up & Average Down
- RS : Relative Strength : AU / AD 를 통해 상대 강도를 구함 - 저항강도

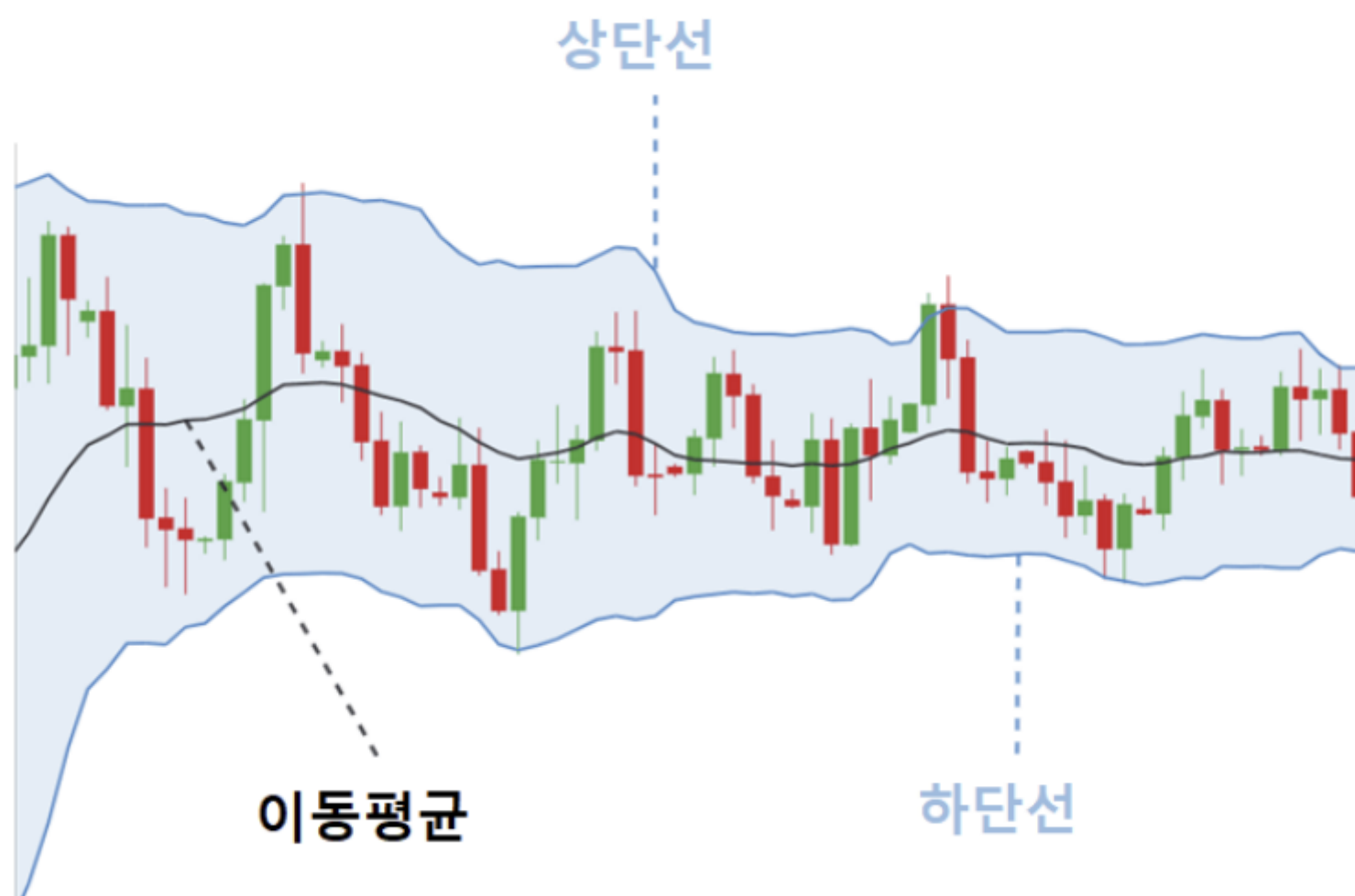
RS 값이 크다는 것은 일정기간 동안 상승한 폭이 하락한 폭보다 크다는 것을 의미하며, RSI 는 0에서 100 범위 내에서 움직인다. 일반적으로 RSI 가 70 이상일 경우 과매수 구간으로써 매도할 때로, 30 이하일 경우 과매도 구간으로써 매수해야할 때로 여겨진다. 즉 지나친 상승 뒤에는 하락할 것을, 지나친 하락 뒤에는 상승할 것을 기대한다.



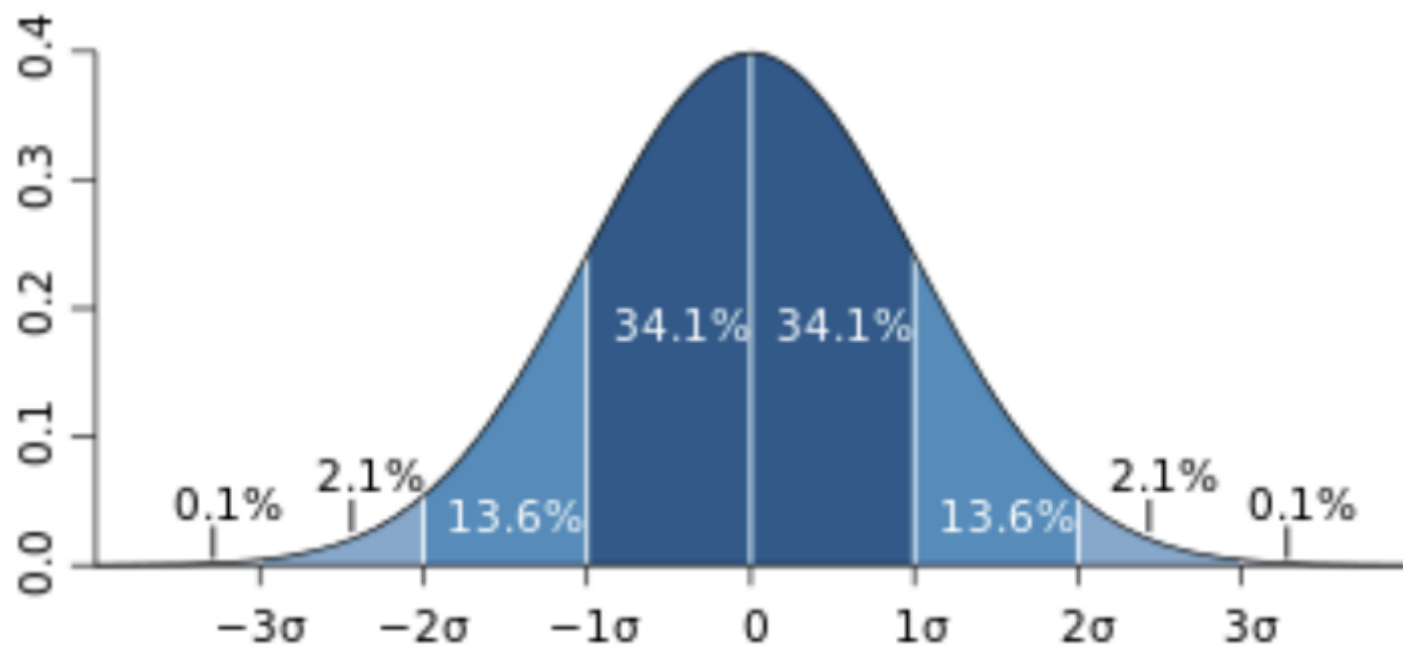
## 평균회귀 - 볼린저 밴드

볼린저밴드는 이동평균선을 중심으로 일정 표준편차를 상한선과 하한선으로 설정한 밴드이다.

- 중심 밴드 :  $n$  기간 동안의 이동평균
- 상단 밴드 : 중심 밴드 기준  $k$  표준편차 위
- 하단 밴드 : 중심 밴드 기준  $k$  표준편차 아래



이는 주가의 움직임이 정규분포를 따른다는 가정에 기초한다.



정규 분포 도메인에 있는, 주가의 움직임은 상한선과 하한선으로 구성된 밴드 내에서만 움직일 확률이 높다. 따라서 주가가 상한선 위에 있다는 것은 과매수 상태이므로 하락할 가능성이, 하단선 아래에 있다는 것은 과매도 상태이므로 상승할 가능성이 높다.

