

Indikátory založené na objemu

Jedním z hlavních ukazatelů v tržních transakcích se považuje Objem transakcí. Objem transakcí charakterizuje aktivitu účastníků trhu, sílu a intenzitu. Na trhu při stabilním vzestupném trendu objem se zvyšuje v době růstu kotací a se zmenšuje při poklesu ceny. Totéž probíhá při sestupném trendu, objem se zvyšuje při poklesu ceny a se zmenšuje, kdy cena stoupá. Jedním z hlavních vlastností objemu je v tom, že ten vždy předbíhá cenu. Na trhu Forex, zpravidla, nejsou možnosti zobrazit přímý objem transakcí, proto se buduje indikátor tzv. "Volume", odrážející počet změn ceny během jednoho baru. tento indikátor zobrazuje aktivitu cenových změn a se považuje, že tato aktivita dobře koreluje s reálným objemem transakcí.



Technické indikátory: Akumulace/Distribuce (AD)

Akumulace/Distribuce založeny na objemu obchodů je indikátorem, vytvořený pro zobrazení hromadných peněžních přílivů a odlivů pomocí srovnání cen zavření s odpovídajícími maximy a minimy.

Linie akumulace/distribuce se používá při potvrzení trendu nebo odhalení příznaků její slabosti.

Potvrzení trendu:

- zestupný trend se potvrzuje rostoucími hodnotami indikátoru;
- Sestupný trend se potvrzuje klesajícími hodnotami indikátoru.

Výskyt příznaků divergence:

- Příznakem slabosti vzestupného trendu je situací, když růst ceny se nepotvrzuje do nového maxima odpovídající dynamikou indikátoru, je možné otočení dolů;
- Příznakem slabosti sestupného trendu je situací, když pokles ceny se nepotvrzuje do nového minima odpovídající dynamikou indikátoru, je možné otočení nahoru.



VÝPOČET

$$A/D(t) = [(((C - L) - (H - C)) / (H - L)) \times Vol + A/D(t-1)],$$

kde:

A/D(t) – aktuální hodnota indikátoru;

A/D(t-1) – předchozí hodnota indikátoru;

H – aktuální maximum;

L – aktuální minimum;

C – cena zavření;

Vol – objem.

On Balance Volume (OBV)

Bilanční objem je kumulativním ukazatelem založený na ukazateli objemu obchodů a odrážející vztah mezi prováděným objemem transakcí a pohybem ceny aktiva.

Bilanční objem se používá pro potvrzení trendu a vyhledávání možných bodů otočení ceny.

Potvrzení trendu:

- Vzestupný trend se potvrzuje rostoucími hodnotami indikátoru;
- Sestupný trend se potvrzuje klesajícími hodnotami indikátoru

Objevení příznaků divergence:

- Příznakem slabosti vzestupného trendu je situace, kdy růst ceny do nového maxima nepotvrzuje odpovídající dynamikou indikátoru, je možné otočení nahoru;
- Příznakem slabosti sestupného trendu je situace, kdy pokles ceny do nového minima nepotvrzuje odpovídající dynamikou indikátoru, je možné otočení nahoru.



VÝPOČET

$OBV(t) = OBV(t-1) + Vol$, если $C(t) > C(t-1)$;

$OBV(t) = OBV(t-1) + Vol$, pokud $C(t) > C(t-1)$;

$OBV(t) = OBV(t-1) - Vol$, pokud $C(t) < C(t-1)$;

$OBV(t) = OBV(t-1)$, pokud $C(t) = C(t-1)$,

kde:

t – aktuální doba;

t-1 – předchozí doba;

C – cena zavření;

Vol – objem

Objem (Volume Indicator)

Ukazatel objemu obchodů je instrumentem technické analýzy odrážející aktivitu investorů za určitou dobu.

Indikátor se obvykle používá s analýzou pohybu ceny aktiva pro potvrzení síly trendu nebo zjištění příznaků její slabosti a takto pro určení možného otočení cen.

Potvrzení trendu:

- Rostoucí objemy obchodů v podmínkách zvýšení cen potvrzuje býčí trend;
- Rostoucí objemy obchodů v podmínkách poklesu cen potvrzuje medvědí trend.

Příznak slabosti trendu:

- Pokles aktivity na obchodech může být příznakem pochyby investorů ve pokračování trendů. V případě růstu cen a současného poklesu objemů poptávka na aktivum při větším cenám může zmizet.



VÝPOČET

Objem = počet transakcí za určitou dobu.