



11 преимуществ индикатора Hurst index:

1. *Единственный* официальный анализатор для МТ4/МТ5, способный подсказывать стратегию торговли;
2. Анализатор позволяет определить, склонен ли рынок к продолжению роста (падения) после того, как показывал восходящую (нисходящую) динамику в прошлом или же имеет место большая волатильность и каждый рост (падение) компенсируется равновеликим падением (ростом).
3. Позволяет скорректировать Вашу текущую стратегию, оценивая силу установившегося тренда или периода консолидации.
4. *Hurst index* позволяет определить имеет ли место цикличность или же рынок непредсказуем и не технический анализ априори не эффективен.
5. Позволяет в 4 раза снизить риск входа на рынок в направлении, противоположенном будущей тенденции.
6. Помогает оценить тенденцию или ее отсутствие «за пределами экрана», не переключаясь на старший таймфрейм. Это неудобство часто бывает причиной неверной оценки динамики цен, когда в пределах видимости рынок показывает определенный характер движения – к примеру, падает, а на самом деле общая тенденция склонна к росту.
7. Анализатор позволяет работать на любом таймфрейме от 1М до MN при условии, что как минимум доступны последние 1000 баров истории.
8. Анализатор не требует специальных знаний в области статистики или фрактальной теории: все, что необходимо – это оценить показатель Херста, который выводится на экран, пользуясь определенным критерием (см. п. «**Как работать с анализатором Hurst index**»).
9. *Hurst index* обладает удобным и функциональным дизайном, выводя на экран советы о стратегии торговли, а также график изменения оптимизированных методом нормированного размаха логарифмических дневных доходностей, угол наклона которого указывает на величину показателя Херста.
10. Удобный интерфейс настройки программы: Вы можете указать самостоятельно желательное место индикатора на главном окне терминала, и, разумеется, в любой момент удалить анализатор после ознакомления с результатами при условии дальнейшей ненадобности.
11. Эстетичный внешний дизайн – самостоятельно задавайте цветовую гамму.

Контакты:

MQL5: www.mql5.com/ru/users/thewhisper

VK: vk.com/the.whisper

e-mail: piskarev.dmitry25@gmail.com

Tel.: +7(916) 037-43-87



Как работать с анализатором Hurst index

Существует две основные разновидности сигналов, которые подает анализатор.

- Если $0.5 < H \leq 1$, то рынок представляет собой *персистентный* временной ряд. Это означает, что имеет место эффект долговременной памяти. Вам следует иметь в виду, что при таком раскладе любое направление тенденции в настоящем с большой вероятностью сохранится в будущем. Рынок находится под влиянием закона динамики, гласящий, что система стремится сохранить свое равномерное прямолинейное движение. В нашем случае это движение – есть развивающееся направление тренда.

Чем более рассчитанный коэффициент приближается к отметке «1», тем сильнее будет выражен тренд. Не трудно понять, что значение коэффициента равное единице означает наклоненную под определенным углом прямую восходящую или нисходящую линию.

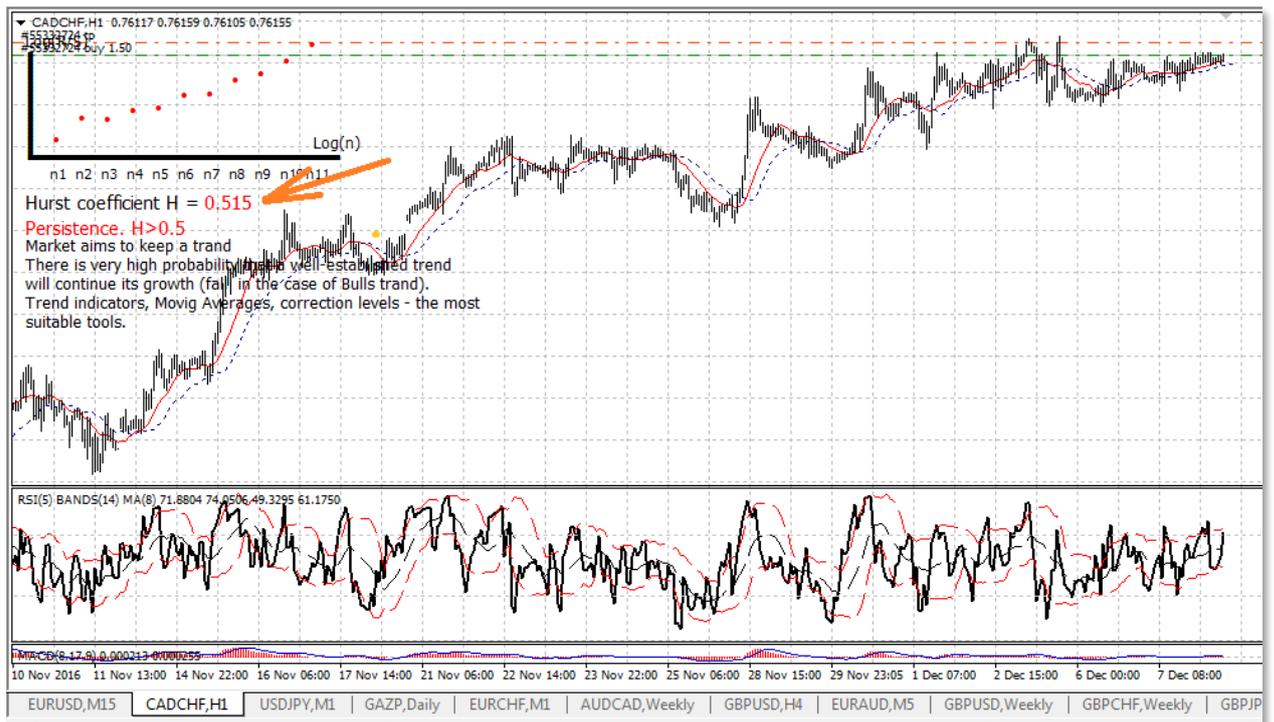


Рисунок 2. Пример расчета индикатором Hurst index показателя Херста для часового графика пары CADCHF. Это очевидно, что имеет место бычья тенденция и как следствие показатель Херста показывает персистентность временного ряда



Рисунок 3. Пара EURAUD. Таймфрейм – M5. $H=0.580$. Еще один пример персистентного временного ряда.



Рисунок 4. Коэффициент Херста равен 0.577, что подтверждается довольно устойчивой нисходящей динамикой. Но следует отметить, что число слишком приближено к критическому значению 0.5, что говорит нам о том, что тренд уже исчерпал свой основной заряд - медведи попали под прессинг быков.

Контакты:

МQL5: www.mql5.com/ru/users/thewhisper

VK: vk.com/the.whisper

e-mail: piskarev.dmitry25@gmail.com

Tel.: +7(916) 037-43-87

- Если $0 \leq H < 0.5$, то временному ряду присуще понятие *антиперсистентность*. То есть любая установившаяся на текущий момент тенденция стремится к изменению на противоположенную. Э. Петерс дал более точное определение антиперсистентности, как системы, которая проходит меньшее расстояние, чем случайная. Рынок волатилен и изменчив, но самое главное, что он под нашим контролем. Мы знаем, что любой всплеск будет практически полностью скомпенсирован и смело открываем позиции и рассчитываем область выхода и потенциальные прибыли.

Чем ближе показатель Херста к нулю, тем более ярко выражена волатильность рынка. Внешне рынок будет напоминать гармошку или сигнал пилообразной формы без ярко выраженного наклона в сторону повышения или понижения.

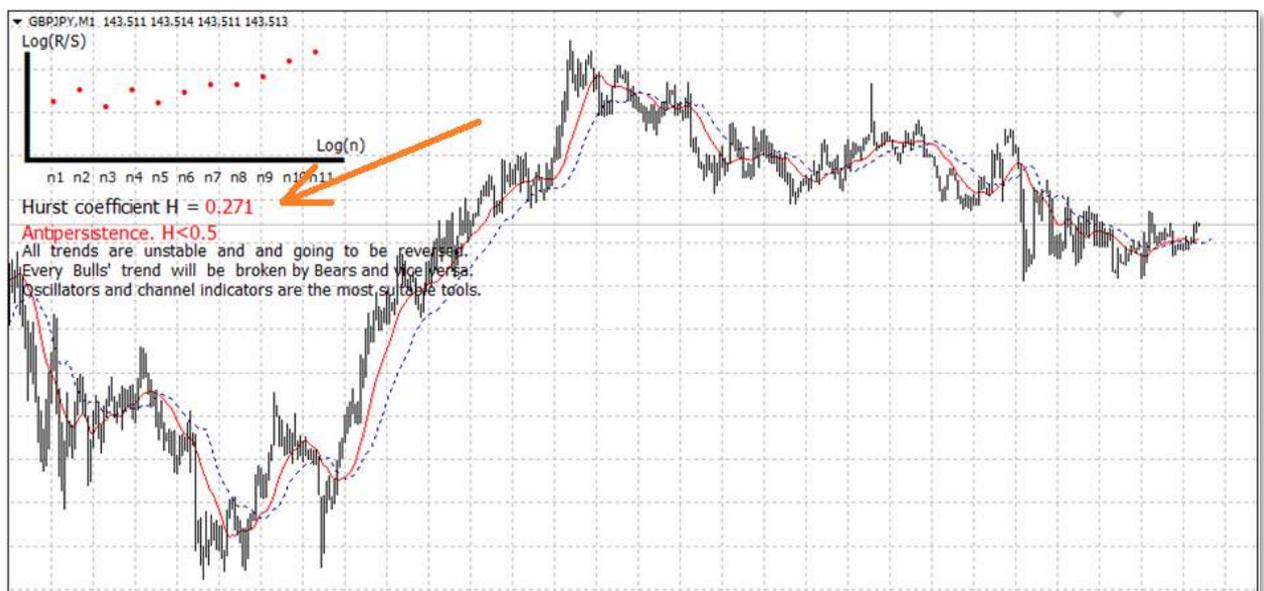


Рисунок 5. Пара GBPJPY. Таймфрейм М1. Пример антиперсистентного временного ряда. Недавнее падение компенсировано равновесным ростом. Обратите внимание, как каждый «зуб» пилообразного сигнала практически всегда компенсируется «зубом» аналогичного размера.

Окно настроек индикатора

При добавлении индикатора, появится следующее окно с первичными настройками:

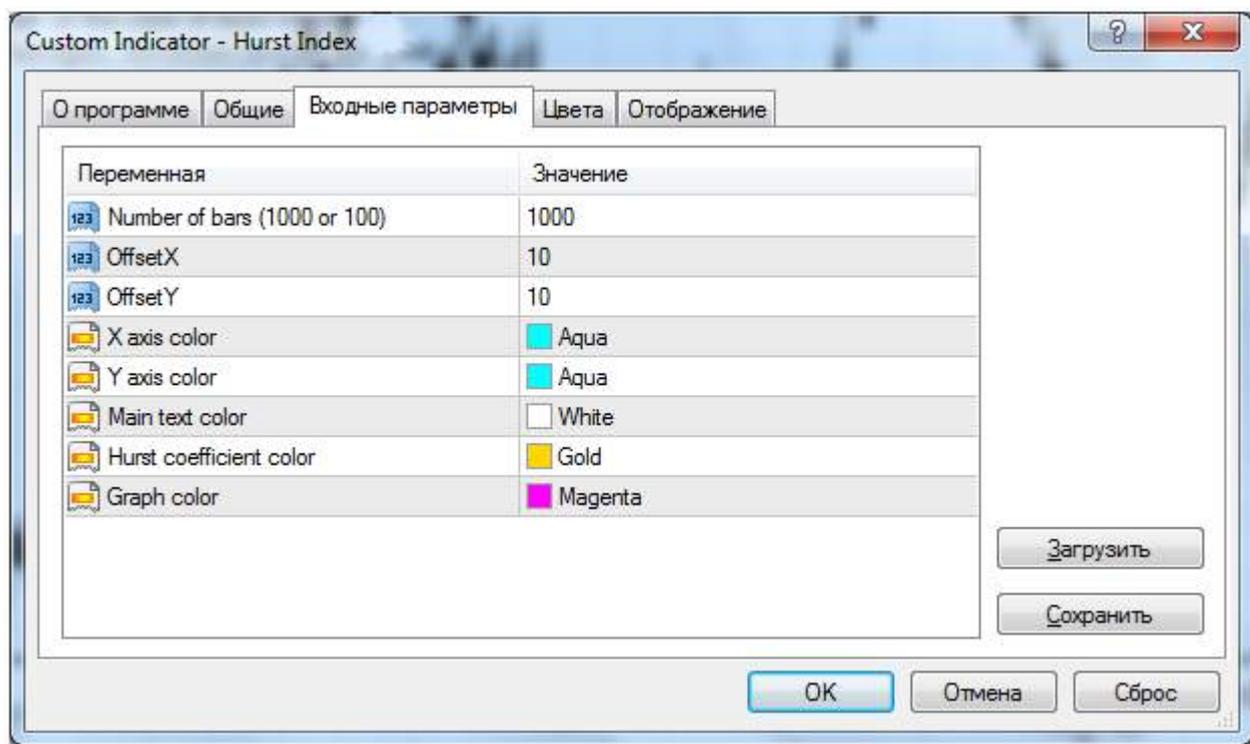


Рисунок 8. Окно настроек индикатора

Описание переменных:

- **Number of bars** (1000 or 100) – количество баров, по которым будет рассчитываться индикатор;
- **OffsetX** – смещение графика индикатора относительно горизонтальной оси. Обратите внимание, что нулевой точкой отсчета является левый верхний угол основного окна;
- **OffsetY** – смещение графика индикатора относительно вертикальной оси. Обратите внимание, что нулевой точкой отсчета является левый верхний угол основного окна;
- **X axis color** – цвет горизонтальной оси графика;
- **Y axis color** – цвет горизонтальной оси графика;
- **Main text color** – цвет текста индикатора;
- **Hurst coefficient color** – цвет отображения рассчитанного индикатором показателя Херста, H;
- **Graph color** – цвет графика;

Контакты:

MQL5: www.mql5.com/ru/users/thewhisper
VK: vk.com/the.whisper
e-mail: piskarev.dmitry25@gmail.com
Tel.: +7(916) 037-43-87

Окно индикатора

После завершения настройки параметров индикатора, нажмите кнопку «ОК». Окно индикатора появится в левом верхнем углу терминала.



Рисунок 9. Внешний вид индикатора Hurst index

Индикатор имеет 3 значимые области.

1. График зависимости логарифма от R/S и логарифма числа ,n, элементов в выборке. По известной формуле $Log(R/S) = Log(const) + H \times Log(n)$. При проведение средней линии между получившимися точками, мы получим прямую, угол которой и есть показатель Херста. Индикатор решает линейную регрессию методом наименьших квадратов и вычисляет H;
2. Значение коэффициента Херста;
3. Характеристика рынка: персистентность или антиперсистентность. Также индикатор дает рекомендацию относительно стратегии торговли, которые будут описаны в следующем разделе.

Контакты:

МQL5: www.mql5.com/ru/users/thewhisper
 VK: vk.com/the.whisper
 e-mail: piskarev.dmitry25@gmail.com
 Tel.: +7(916) 037-43-87



Какие инструменты технического анализа применимы для различных показаний Hurst index

Как Вы уже успели заметить, при различных значениях показателя Херста стоит применять разные стратегии и инструменты технического анализа.

Стратегия для $H > 0.5$

Для рынка, которому присуще определение «персистентный», наиболее эффективными инструментами анализа будут являться индикаторы тренда – скользящие средние, MACD, уровни Фибоначчи, углы Ганна.

Всегда стоит следить за откатами от основной тенденции. Во время таких ослаблений при достаточно высоком коэффициенте Херста имеет смысл ставить отложенные ордера «на пробой».

Стратегия «3 экрана Элдера» в синергии с Hurst index позволяет точнее определить значимость временного изменения направления тенденции – коррекции. Довольно часто случается так, что кажущаяся коррекция на самом деле оказалась точкой перелома тенденции. Зная вероятность перелома (а для этого существует Hurst index), мы можем несколько раз повысить точность наших рассуждений.

Стратегия для $H < 0.5$

В этом случае для рынка характерна антиперсистентность. Мы уже знаем, что это означает высокую волатильность и отсутствие ярко выраженного тренда. С некоторым допущением, мы можем констатировать, что сейчас рынок находится в фазе консолидации.

Как известно из теории технического анализа, самым лучшим инструментом на рынке, для которого характерен ценовой коридор, является осциллятор. Используйте индекс относительной силы (RSI), стохастические осцилляторы (%K, %D, %R). Кстати, линии Боллинджера будут тоже весьма эффективны.

Не забывайте про уровни поддержки и сопротивления. На антиперсистентном рынке им нет цены. Конверты и другие индикаторы канала будут очень кстати и покажут максимум эффекта.

Контакты:

МQL5: www.mql5.com/ru/users/thewhisper
VK: vk.com/the.whisper
e-mail: piskarev.dmitry25@gmail.com
Tel.: +7(916) 037-43-87





Официальное предложение клиенту



В виду своей новизны и того, что ранее продукт никогда не придавался широкой огласке и публичному предложению, а также того, что релиз в официальном магазине Meta trader4/5 назначен на третью декаду декабря, продукт до 22.12.2016 предлагается на привилегированной основе.

Приобретая продукт, покупатель получает следующие преимущества по отношению покупки в «Маркете» Meta Trader 4/5 после 22 декабря 2016 года:

1. Покупка продукта по цене **85 USD**, что на 30% дешевле будущей стоимости в «Маркете»;
2. Получение обновленных версий индикатора бесплатно и незамедлительно после разработки и отладки;
3. Бесплатные консультации и прямая поддержка от разработчика;
4. Оперативное решение проблем работоспособности;
5. Получение преимущества, попадая в первые две сотни трейдеров, принявших официальное предложение.
6. Приобретение со скидкой других продуктов разработчика – советников, анализаторов, индикаторов;
7. Доработка продуктов по Вашему усмотрению и реализация Ваших идей советников, роботов, индикаторов на льготных условиях.

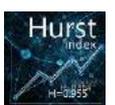
Заказ

Для оформления заказа отправьте по электронной почте сообщение с темой «Hurst index», указав при этом номер Вашего телефона по адресу piskarev.dmitry25@gmail.com или напишите разработчику личное сообщение ВКонтакте (vk.com/the.whisper) или facebook (facebook.com/dmitry.piskaryov) о желании приобретения.



Контакты:

МQL5: www.mql5.com/ru/users/thewhisper
VK: vk.com/the.whisper
e-mail: piskarev.dmitry25@gmail.com
Tel.: +7(916) 037-43-87



О разработчике

Пискарев Дмитрий – финансовый аналитик, консультант. Занимается исследованием рынка, поиском и разработкой коммерческих альфа стратегий.

Имеет одно высшее техническое образование – окончил МГТУ им. Н.Э. Баумана, неполное высшее техническое образование магистра, а также квалификацию специалиста финансового рынка по брокерской деятельности, дилерской деятельности, деятельности по управлению ценными бумагами и деятельности форекс-дилера.

Автор статей на темы формирования оптимального портфеля ценных бумаг путем анализа соотношений ликвидности, эффективности и платежеспособности компаний-эмитентов.

В торговле на бирже предпочитает нестандартные подходы, в частности синергию между фундаментальным, фрактальным и техническим анализами, и практикует новые методы прогноза, а также модифицирует старые.

Занимается разработкой торговых методик, роботов и индикаторов для платформ Meta Trader 4, Meta Trader 5 и Transaq. Для работы с большими базами данных использует специальный эконометрический пакет Matlab и MS Excel.



«Считаю, что любой анализ должен начинаться с выявления тенденций и поиском ответа на вопрос, является ли данный рынок и данный таймфрейм случайными или все-таки имеет место устойчивый процесс и прошлые изменения максимально влияют на будущее. Технический анализ невозможен без фундаментальных и статистических исследований».

Контакты:

МQL5: www.mql5.com/ru/users/thewhisper

VK: vk.com/the.whisper

e-mail: piskarev.dmitry25@gmail.com

Tel.: +7(916) 037-43-87