

Książka stanowi kompendium oscylatorów i wskaźników analizy technicznej, a także średnich ruchomych. Przedstawione zostały podstawy systemów transakcyjnych. Liczne przykłady, ukazują zastosowanie wskaźników i oscylatorów do analizowania wykresów cen aktywów, notowanych na rynkach finansowych.

Krzysztof Borowski

dr hab. prof. SGH. Ukończył Wydział Fizyki UW (nagroda Dziekana za najlepszą pracę magisterską na Wydziale Fizyki) oraz Finanse i Bankowość, a także zarządzanie i marketing w Szkole Głównej Handlowej. W 2002 r. uzyskał stopień doktora nauk ekonomicznych, a w 2012 r. stopień doktora habilitowanego w Kolegium Zarządzania i Finansów Szkoły Głównej Handlowej. Na stanowisku profesora nadzwyczajnego SGH jest zatrudniony od maja 2012 r. Od kilkunastu lat jest związany z rynkiem kapitałowym, na którym pracował jak makler i doradca inwestycyjny. Zdobył bogate doświadczenie zawodowe zarówno na rynku krajowym, jak i zagranicznym. Oprócz analiz fundamentalnych jest autorem ponad 12 tys. analiz technicznych dostępnych w internecie. Członek Komitetu Indeksów Giełdowych i Komitetu ds. Instrumentów Udziałowych przy GPW. W 2013 r. otrzymał tytuł najlepszego analityka technicznego za 2012 r. przyznany przez „Gazetę Giełdy Parkiet”. W 2012 r. został nagrodzony przez Komitet Nauk o Finansach Polskiej Akademii Nauk za wybitne osiągnięcia w dziedzinie finansów. Trzykrotnie uplasował się w rankingu TOP 10 najlepszych wykładowców SGH. Jest wykładowcą Szkoły Giełdowej (GPW – Instytut Rynku Kapitałowego), specjalistycznych szkoleń organizowanych przez „Gazetę Giełdy Parkiet”, a także studiów doktoranckich i podyplomowych na SGH. Autor ok. 90 publikacji z zakresu bankowości i finansów, członek Polskiego Stowarzyszenia Finansów i Bankowości.

Spis treści:

Wstęp

Rozdział 1. Średnie ruchome i ich zastosowanie w analizie technicznej

- 1.1. Podstawowe rodzaje średnich ruchomych
- 1.2. Sygnały kupna i sprzedaży oraz poziomy wsparcia i oporu generowane przez średnie ruchome
- 1.3. Bardziej zaawansowane sposoby kalkulacji i zastosowania średnich ruchomych
 - 1.3.1. Średnie tęczowe i ich zastosowanie
 - 1.3.2. Średnia ruchoma Hulla
 - 1.3.3. Średnie ruchome Guppy’ego
 - 1.3.4. Fraktalna adaptacyjna średnia ruchoma (Fractal Adaptive Moving Average – FRAMA)
- 1.4. Koperty cenowe
- 1.5. Wstęgi Bollingera
- 1.6. Kanały Keltnera
- 1.7. Wstęgi Starc

Rozdział 2. Popularne wskaźniki i oscylatory cenowe

- 2.1. Oscylator MACD (Moving Average Convergence/Divergence)
- 2.2. Wskaźnik Momentum
- 2.3. Wskaźnik Rate of Change (ROC)
- 2.4. Indeks siły względnej (Relative Strength Index – RSI)
- 2.5. Indeks siły relatywnej (Relative Strength Comparative Index – RSC)
- 2.6. Parabolic SAR (Stop and Reversal)
- 2.7. Oscylator stochastyczny (Stochastic)
- 2.8. Williams %R
- 2.9. Wskaźnik ruchu kierunkowego (Directional Movement Index – DMI)
- 2.10. Commodity Channel Index (CCI)
- 2.11. Average True Range (ATR) – przeciętna wartość rzeczywistego zasięgu
- 2.12. Oscylator Ultymatywny (Ultimate Oscillator)
- 2.13. Temperatura rynku

Rozdział 3. Zaawansowane wskaźniki i oscylatory cenowe

- 3.1. A/D
- 3.2. Aroon (wskaźnik i oscylator)
- 3.3. Candlestick Indicator – CI
- 3.4. Chande Momentum Oscillator (CMO)
- 3.5. Directional Trend Index (DTI)
- 3.6. Filtr wertykalno-horyzontalny (Vertical Horizontal Filter – VFH)
- 3.7. Higher High Lower Low Stochastic (HHLLS)
- 3.8. Indeks Masy (Mass index)
- 3.9. Know Sure Thing (KST)
- 3.10. Nachylenie linii regresji (Linear Regression Slope – LRS)
- 3.11. Premier Stochastic Oscillator – PSO
- 3.12. Qstick
- 3.13. Q-indicator i B-indicator
- 3.14. R²
- 3.15. Random Walk Index (RWI)
- 3.16. Range Expansion Index (REI)
- 3.17. Range Indicator (RI)
- 3.18. Relative Momentum Index (RMI)
- 3.19. Relative Volatility Index (RVI)
- 3.20. Tick Volume Indicator (TVI) oraz TRIX
- 3.21. Trend Detection Index (TDI)
- 3.22. True Strength Index (TSI)
- 3.23. Wskaźnik dysparytetu (Disparity index)
- 3.24. Zig Zag

Rozdział 4. Wskaźniki i oscylatory wolumenowe

- 4.1. Akumulacja/Dystrybucja (A/D)
- 4.2. Akumulacja/Dystrybucja Williama (A/DW)
- 4.3. Herrick Payoff Index – HPI
- 4.4. Indeks cenowo-wolumenowy (Price and Volume Trend – PVT)
- 4.5. Index popytu (Demand index)
- 4.6. Indeks przepływu środków pieniężnych (Money Flow Index – MFI)
- 4.7. Indeks przyływu środków pieniężnych Chaikina (Chaikin Money Flow)

- 4.8. Indeks trendu wolumenu (Volume Trend Indicator – VTI)
- 4.9. Indeks wolumenu negatywnego (Negative Volume Index – NVI)
- 4.10. Indeks wolumenu pozytywnego (Positive Volume Index – PVI)
- 4.11. Market Facilitation Index (MFLI)
- 4.12. Oscylator Chaikna (Chaikin A/D Oscillator)
- 4.13. Oscylator Klingera (Klinger Oscillator – KO)
- 4.14. Oscylator wolumenowy
- 4.15. Równowaga wolumenu (On Balance Volume – OBV)
- 4.16. Slow Volume Strenght Index (SVSI)
- 4.17. Swoboda ruchu (Ease of Movement – EOM)
- 4.18. Średnia ruchoma z wolumenu obrotu
- 4.19. Warszawski indeks techniczny (Warsaw Technical Index – WTI)
- 4.20. Wskaźnik Orda

Rozdział 5. Zastosowanie transformaty Fishera

- 5.1. Zwykła transformata Fishera
- 5.2. Odwrotna transformata Fishera (OTF)
- 5.3. Odwrotna transformata Fishera i oscylator RSI

Rozdział 6. Przykład optymalizacji długości średnich ruchomych w złotym krzyżu

Zakończenie i uwagi końcowe
Bibliografi