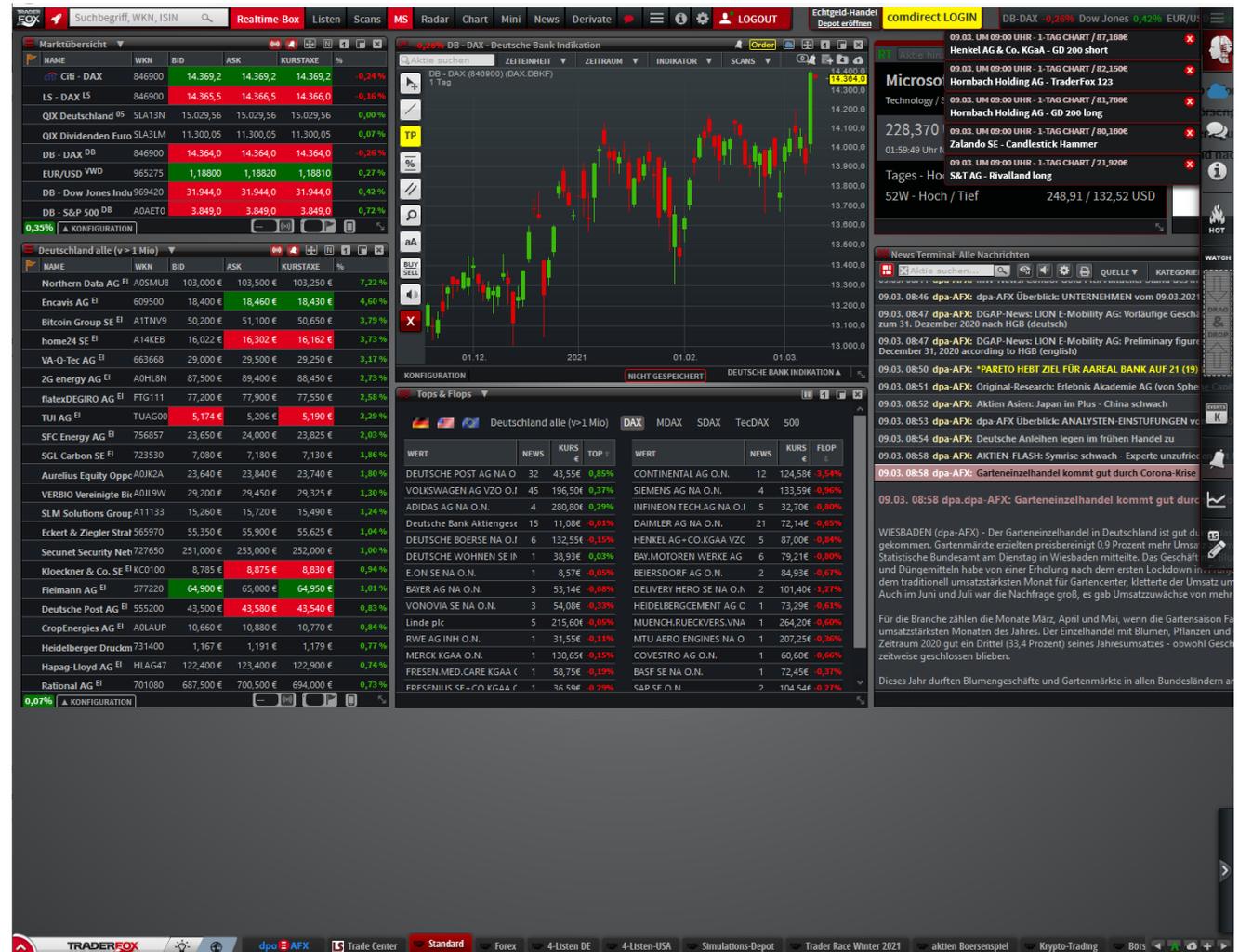


Entwickler-Konferenz

Serie - Die wichtigsten Indikatoren (Teil 2): Volatility Channel Index (VCI) und ATR

Referent: Martin König

Registriere Dich gratis für unser Trading-Desk auf <https://www.traderfox.de>



VCI – Volatility Channel Index

- Die einzige Quelle ist ein Link zu Tradingview
 - <https://www.tradingview.com/script/J13jZeYt-Volatility-Channel-Index-m59/>
- Es ist ein Sub-Indikator, welcher aus 2 Werteserien besteht
 - 1) Ein CCI auf den ATR
 - 2) Ein CCI auf den TR
- CCI bedeutet Commodity Channel Index
- ATR bedeutet Average True Range
- TR bedeutet True Range

CCI - Commodity Channel Index

- Oszillator, der Werte bewegt sich um einen Nullwert
- $CCI > 100$: Ein lokales Hoch wird gebildet
- $CCI < -100$: Ein lokales Tief wird gebildet
- Divergenzen zum Kursverlauf erkennen



CCI - Commodity Channel Index

$$\text{CCI} = \frac{\text{Typical Price} - \text{MA}}{.015 \times \text{Mean Deviation}}$$

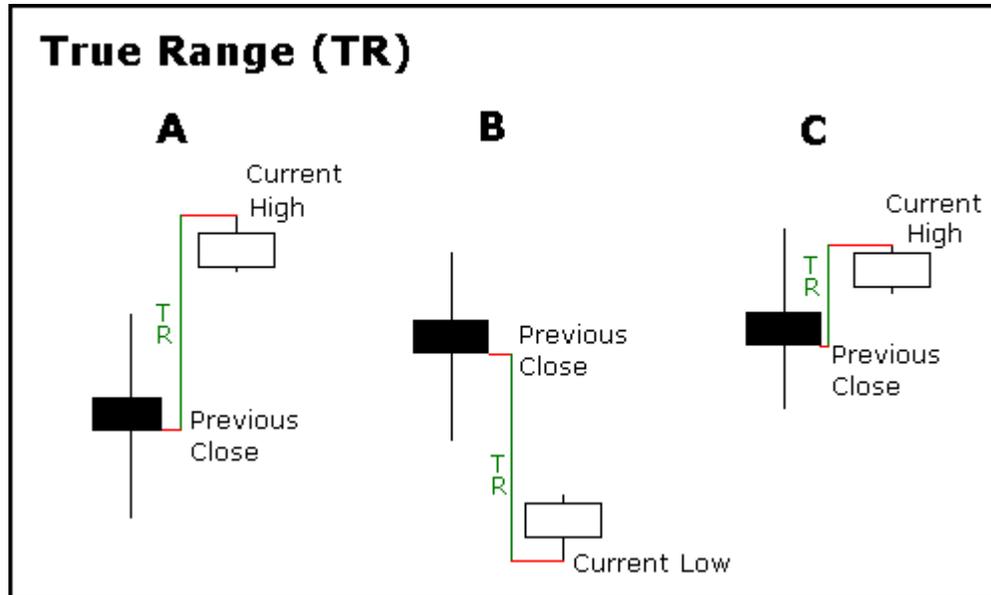
$$\text{Typical Price} = ((\text{High} + \text{Low} + \text{Close}) \div 3)$$

P = Number of Periods; MA = Moving Average

$$\text{Moving Average} = \left(\sum_i^P \text{Typical Price} \right) \div P$$

$$\text{Mean Deviation} = \left(\sum_i^P |\text{Typical Price} - \text{MA}| \right) \div P$$

ATR / TR – Average True Range



$$TR = \text{Max}[(H - L), \text{Abs}(H - C_P), \text{Abs}(L - C_P)]$$

$$ATR = \left(\frac{1}{n}\right) \sum_{(i=1)}^{(n)} TR_i$$

where:

TR_i = A particular true range

n = The time period employed

CCI - Commodity Channel Index

```
var sma_of_atr = this.tf_calculator.tf_sma( this.tf_period_cci_atr, data.atr );  
var mean_of_atr = this.tf_calculator.tf_deviation( this.tf_period_cci_atr, sma_of_atr, data.atr );  
  
var cci_of_atr = [];  
for ( var i = 0; i < data.atr.length; i++ ) {  
    cci_of_atr.push( ( data.atr[i] - sma_of_atr[i] ) / ( 0.015 * mean_of_atr[i] ) );  
}
```