

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

«Υπολογισμός Απόκλισης από τη σειρά ρευστότητας»

Για κάθε πράξη της σειράς στην οποία γίνεται υπολογισμός της απόκλισης από τη σειρά ρευστότητας:

- Γίνεται ανεύρεση της πιο κοντινής **προηγούμενης** στη σειρά ρευστότητας συναλλαγής, που θα πρέπει να απέχει το μέγιστο ως το βήμα χρόνου (10'), και υπολογισμός της διαφοράς των τιμών τους.
- Γίνεται ανεύρεση της πιο κοντινής **επόμενης** στη σειρά ρευστότητας συναλλαγής, που θα πρέπει να απέχει το μέγιστο ως το βήμα χρόνου (10'), και υπολογισμός της διαφοράς των τιμών τους.
- Στην περίπτωση που βρεθούν οι παραπάνω συναλλαγές γίνεται υπολογισμός της σταθμισμένης απόκλισης των τιμών τους βάση του παρακάτω τύπου:

Απόκλιση= [(τιμή συναλλαγής - τιμή της πιο κοντινής προηγούμενης στη σειρά ρευστότητας συναλλαγής) + (τιμή συναλλαγής - τιμή της πιο κοντινής επόμενης στη σειρά ρευστότητας συναλλαγής)] * όγκος συναλλαγών στη σχετική σειρά / 2
--

- Στην περίπτωση που βρεθεί μόνο **προηγούμενη** ή μόνο **επόμενη** συναλλαγή γίνεται υπολογισμός της σταθμισμένης απόκλισης τιμών βάση του παρακάτω τύπου:

Απόκλιση= [(τιμή συναλλαγής - τιμή της πιο κοντινής προηγούμενης στη σειρά ρευστότητας συναλλαγής)] * όγκος συναλλαγών στη σχετική σειρά

ή

Απόκλιση= [(τιμή συναλλαγής - τιμή της πιο κοντινής επόμενης στη σειρά ρευστότητας συναλλαγής)] * όγκος συναλλαγών στη σχετική σειρά

Η τελική απόκλιση τιμών υπολογίζεται ως:

Απόκλιση = Άθροισμα αποκλίσεων/Άθροισμα του όγκου συναλλαγών στη σειρά
--