

2 занятие

ОБЪЕМНЫЙ АНАЛИЗ

Контекст временных промежутков

Хочется вернуться к временным промежуткам, попросту говоря, хочется вернуться к таймфреймам.

Время – очень важный фактор в трейдинге, вспоминаем Питера Стейдлмайера и его физику рынка. Три плоскости: цена, время, объем. Так вот, к чему это я. Когда вы анализируете рынок, анализируете график на каком-то таймфрейме, следует понимать что вы анализируете конкретно этот таймфрейм, и никакой другой.

Иначе говоря, вы анализируете к примеру три графика, с тремя разными таймфреймами одного финансового актива. М1-М15-Н1. На каждом из графиков вы выделяете фазу рынка, а именно: **вертикальная фаза рынка** или **горизонтальная фаза рынка**.

Хочу подчеркнуть, **в рамках одного таймфрейма может действовать только одна фаза!** Они взаимозамещают друг друга.

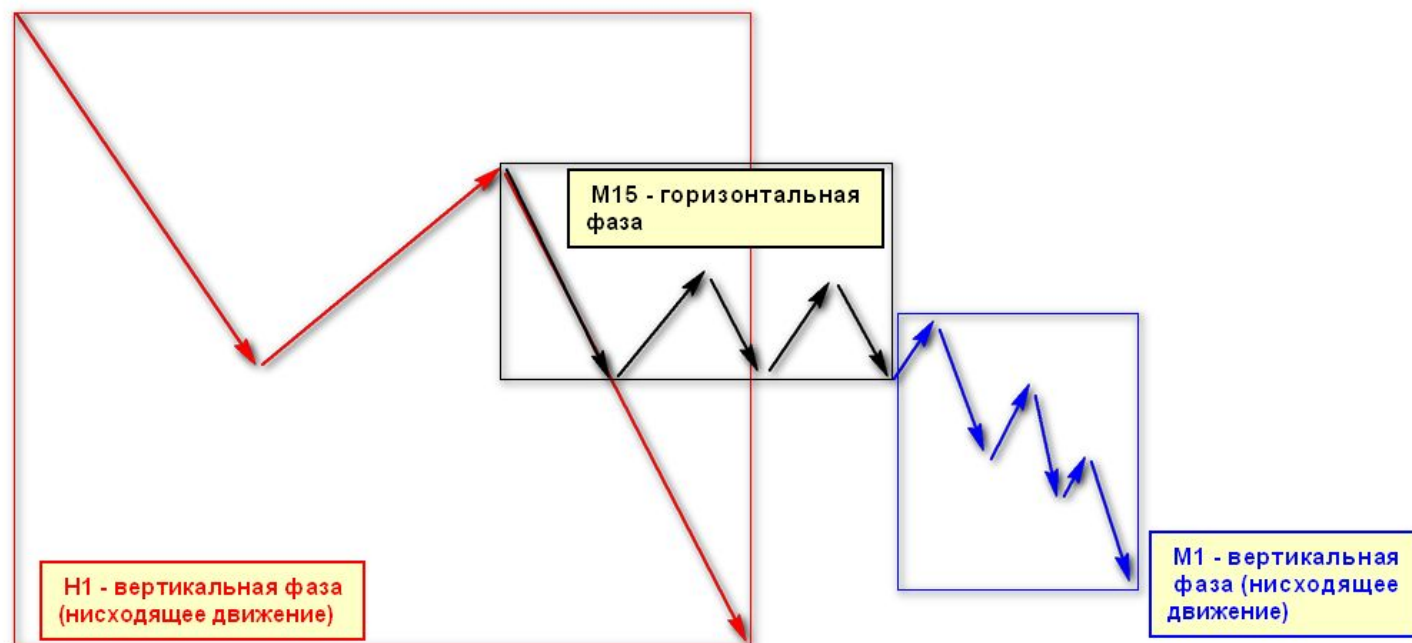
Если вы торгуете ситуацию на м1, то стопы и цели берете м1, максимум м5. Если вы торгуете ситуацию м15, то стопы и цели берете м15, не м1. Есть конечно же входы на м1 с целями h1, но следует понимать, что таких ситуаций на рынке может быть 1-2 входа за день. Поэтому когда вы торгуете, четко понимайте, какой таймфрейм вы торгуете.

Контекст временных промежутков

Н1 - красные линии

М15 - черные линии

М1 - синие линии



От объёма к объёму

Главное - уловить суть схемы, она довольно проста, в теории изложено самое основное правило, которое позволяет понять суть работы по объемам:

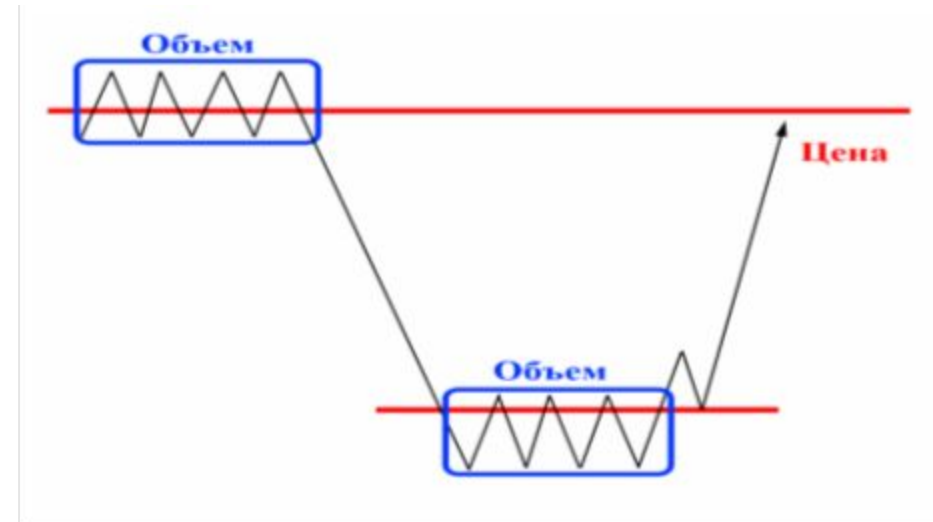
РЫНОК ДВИЖЕТСЯ ОТ ОБЪЕМА К ОБЪЕМУ.

Объем - показатель, который говорит о фиксированной заинтересованности рынка относительно каких-то цен или ценовых диапазонов.

Отсюда логика движения рынка:

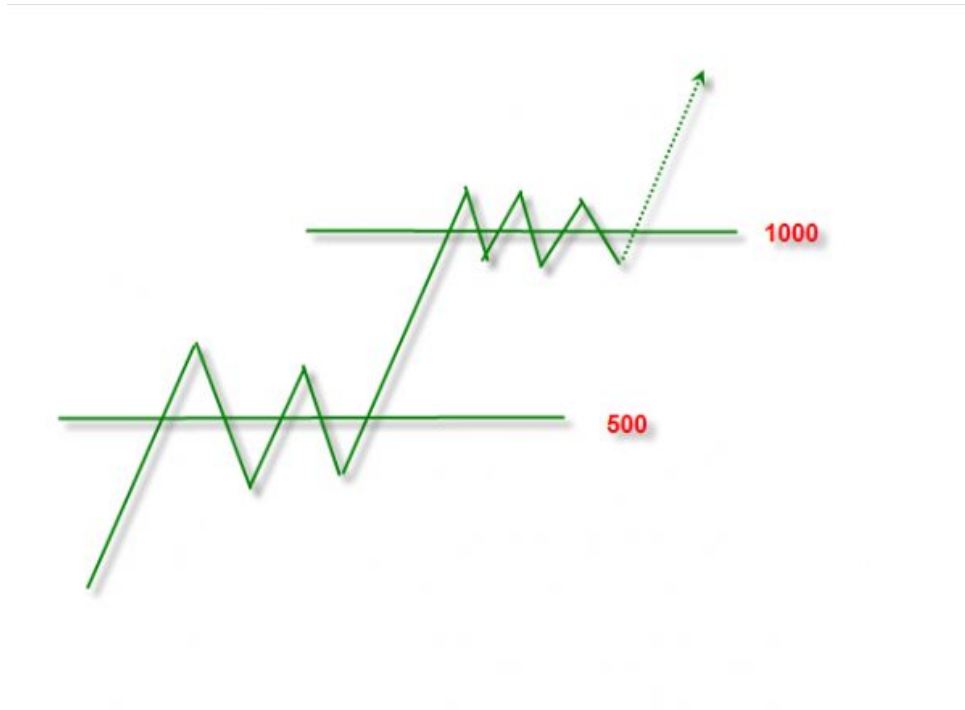
- признак сильного движения - увеличение горизонтального объема по мере движения цены,
- признак слабого движения – уменьшение горизонтального объема по мере движения цены.

То есть, если объем переносят вверх по нарастающей, значит в моменте получаем более сильный уровень, следовательно, есть интерес рынка (показатель фиксированной заинтересованности рынка) увеличивать объем вверх, гнать рынок дальше вверх. Смотреть эту динамику нужно в текущем моменте.

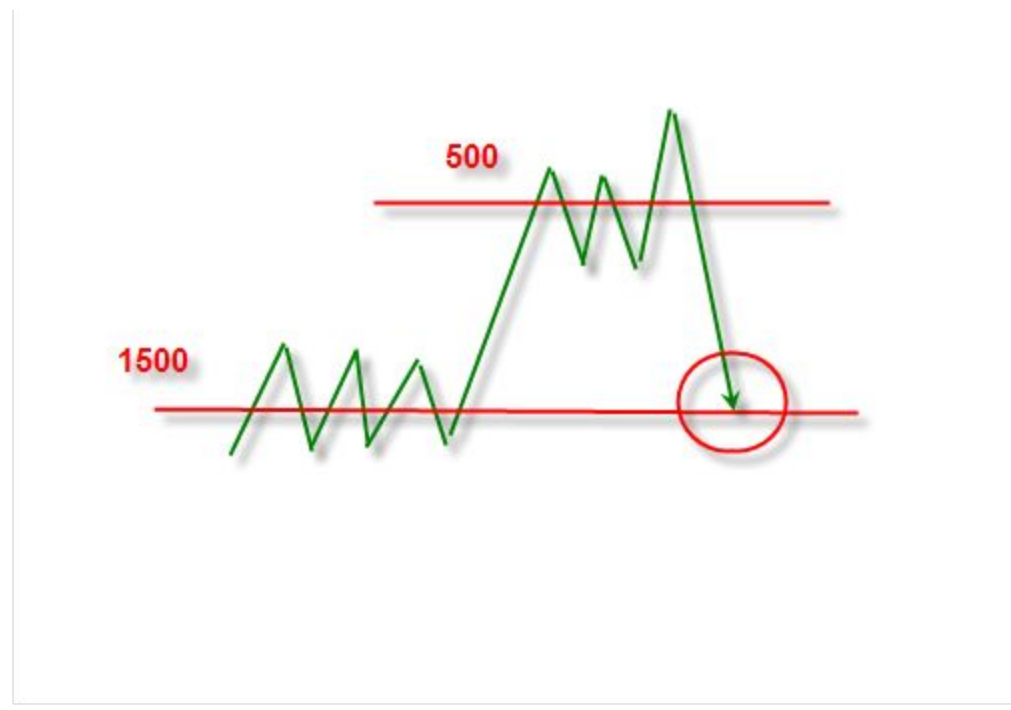


От объёма к объёму

ПРИЗНАК СИЛЬНОГО ДВИЖЕНИЯ



ПРИЗНАК СЛАБОГО ДВИЖЕНИЯ

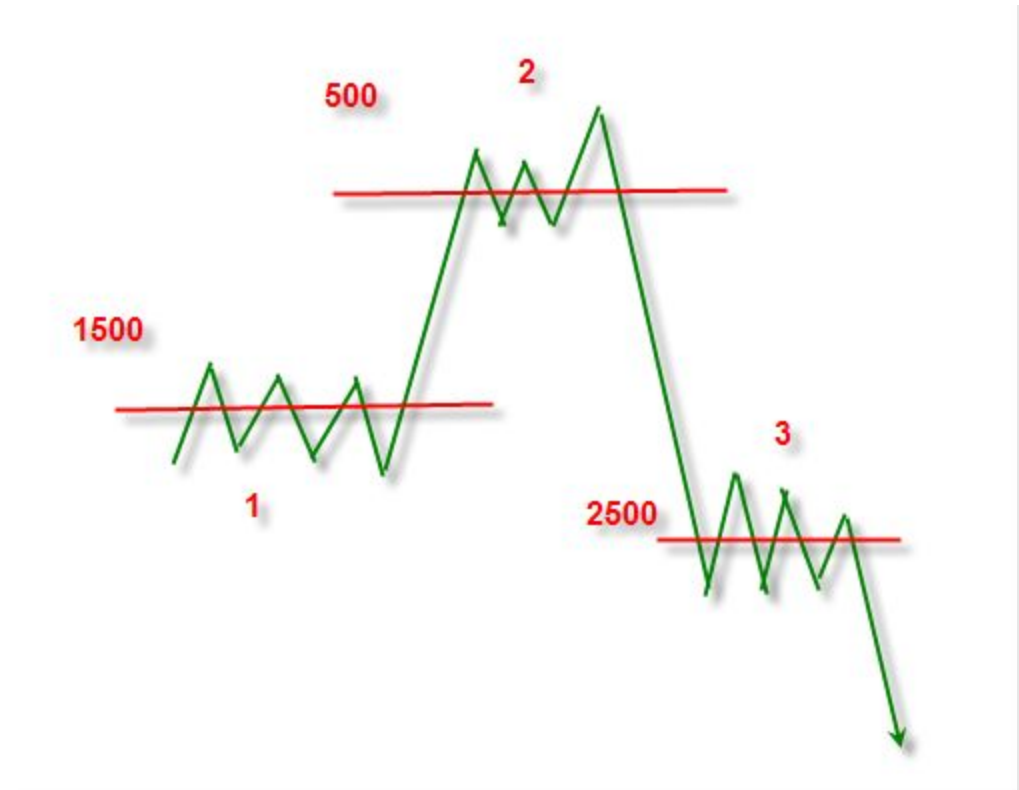


От объёма к объёму

Обратите внимание, в случае признаков слабости подтверждением является как минимум возврат к более сильном уровню, который действует на рынок как магнит в данном случае, на рисунке отмечено красным кружком. Отсюда логика ложных проколов.

Используя принцип от объёма к объёму, мы можем определить
ПЕРЕРАСПРЕДЕЛЕНИЕ ОБЪЕМА.

В точке 2 объем меньше, чем в точке 1, а в точке 3 больше чем в точке 1 и 2.



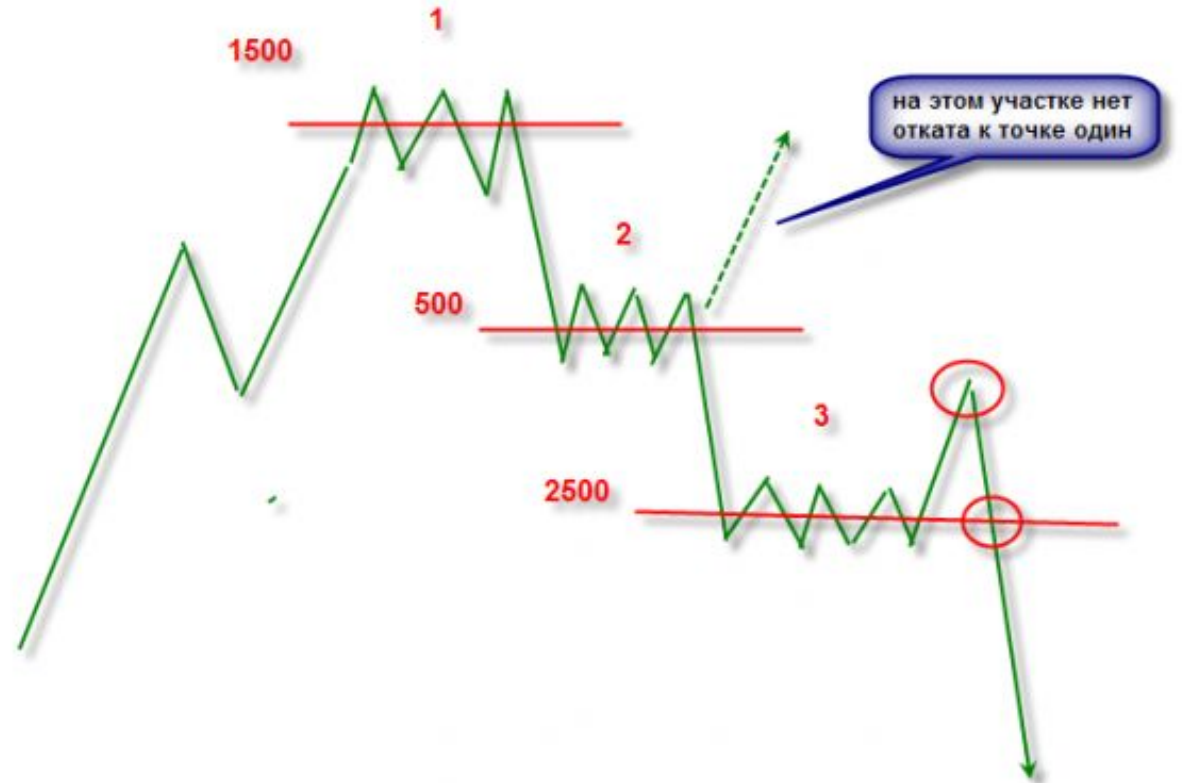
От объёма к объёму

Обратите внимание на пунктирную стрелку, суть в том, что исходя из логики объемов, рынок всегда возвращается к более сильному уровню.

В данной ситуации рынок игнорирует уровень точки 1, и идет ниже вопреки вышеописанной логике, подтверждение - наторговка БОЛЬШЕГО объема в точке 3, откат к точке 2 (меньший объем) и снова возврат к точке 3 - рынок вернулся к новому, более сильному уровню, тем самым подтвердив его силу и показав направление, в котором расторговывается объем - это принцип определения линии наименьшего сопротивления в рынке.

Запоминайте:

**ОБЪЕМ ВСЕГДА ИДЕТ ПО НАРАСТАЮЩЕЙ,
В ЭТОМ СИЛА ТЕКУЩЕГО ДВИЖЕНИЯ**



Истинные и ложные пробития уровней

Если рынок пробивает уровень, но при этом НЕ ФОРМИРУЕТСЯ новый, более сильный горизонтальный срез внутри дня выше пробитого уровня, - значит, скорее всего, будет возврат к уровню, как минимум, и завершится все ложным проколом.

Если рынок пробивает уровень и ФОРМИРУЕТ БОЛЕЕ СИЛЬНЫЙ горизонтальный срез выше (ниже, если пробитие вниз) пробитого уровня, - значит, истинный пробой.

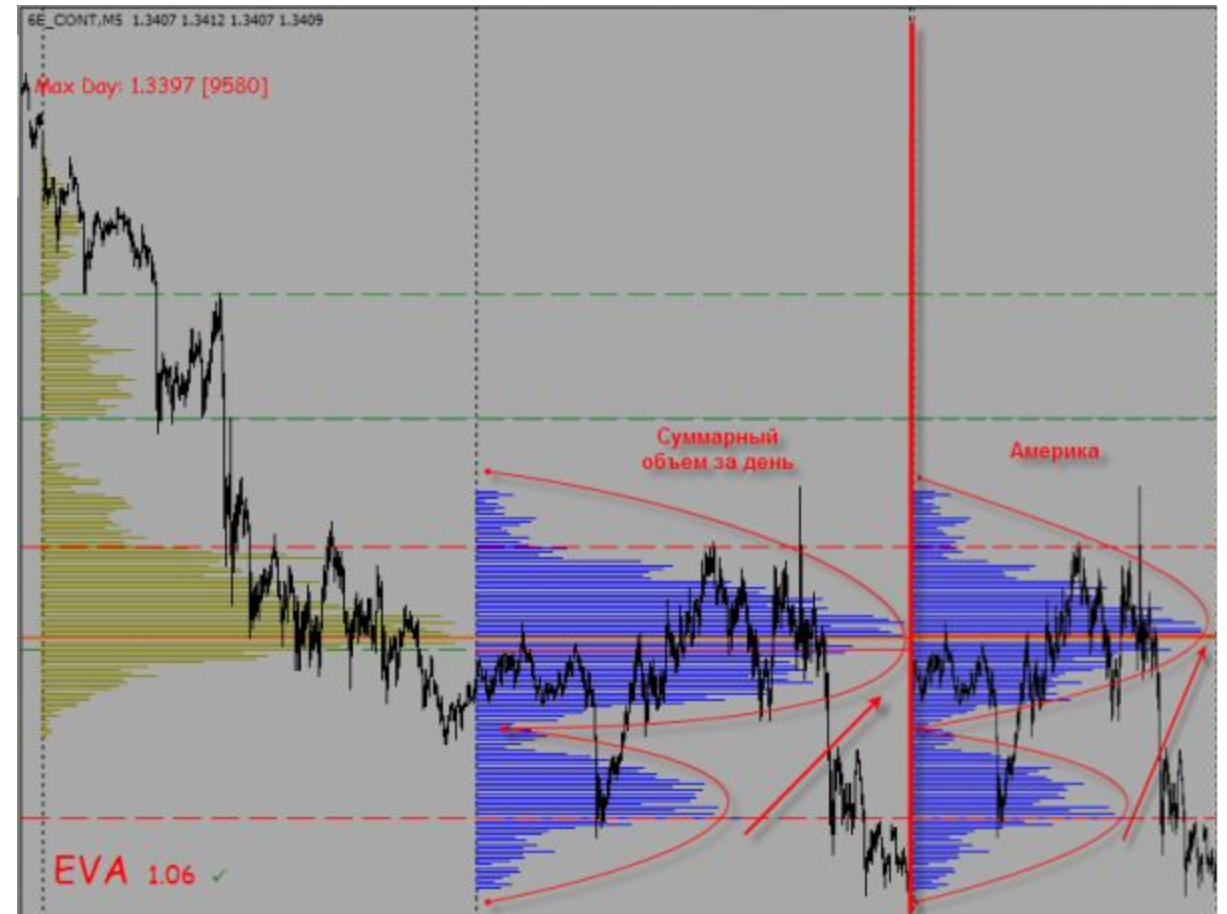
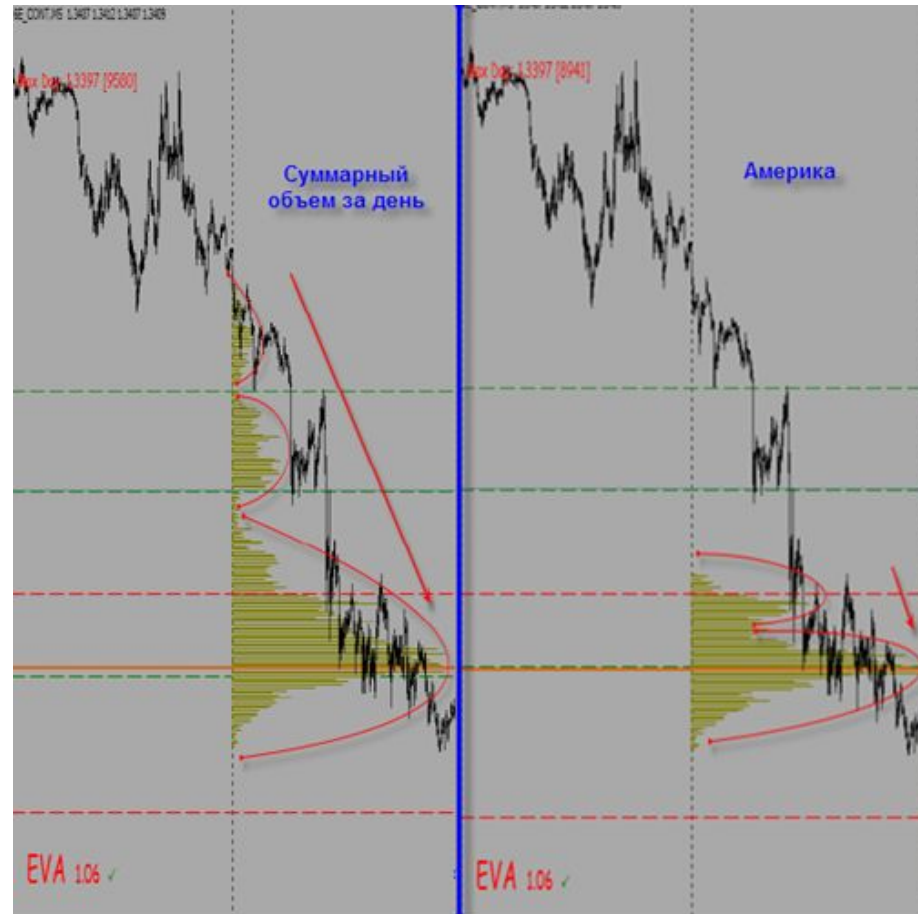
Чем сильнее контраст в новом объеме относительно прежнего, тем сильнее сигнал. Оптимальное соотношение объемов 1,5 - 2 раза, - это сигнал, оптимальный по силе.

Если идет откат без сильных вливаний, значит, движение коррекционное и большая вероятность дальнейшего хода по тренду. Реакция рынка внутри дня на ключевой, локальный уровни - расторговка читается в синтезе с этой же схемой.

Вышеописанную схему лучше всего отслеживать через динамику сессионных скоплений объема.

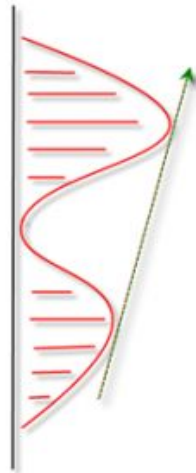
Для этого нужно **сравнить** сессионные скопления объемов между собой. Визуально они довольно легко отслеживаются и позволяют определить направление, в котором растет объем.

Признак силы тренда: СОНАПРАВЛЕННОСТЬ объемов на различных сессиях.

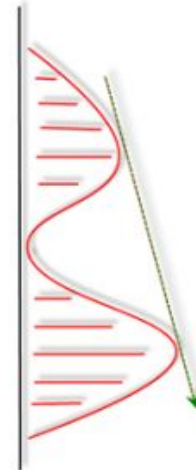


Признак слабости - РАЗНОНАПРАВЛЕННОСТЬ объемов на различных сессиях

Распределение внутри дня

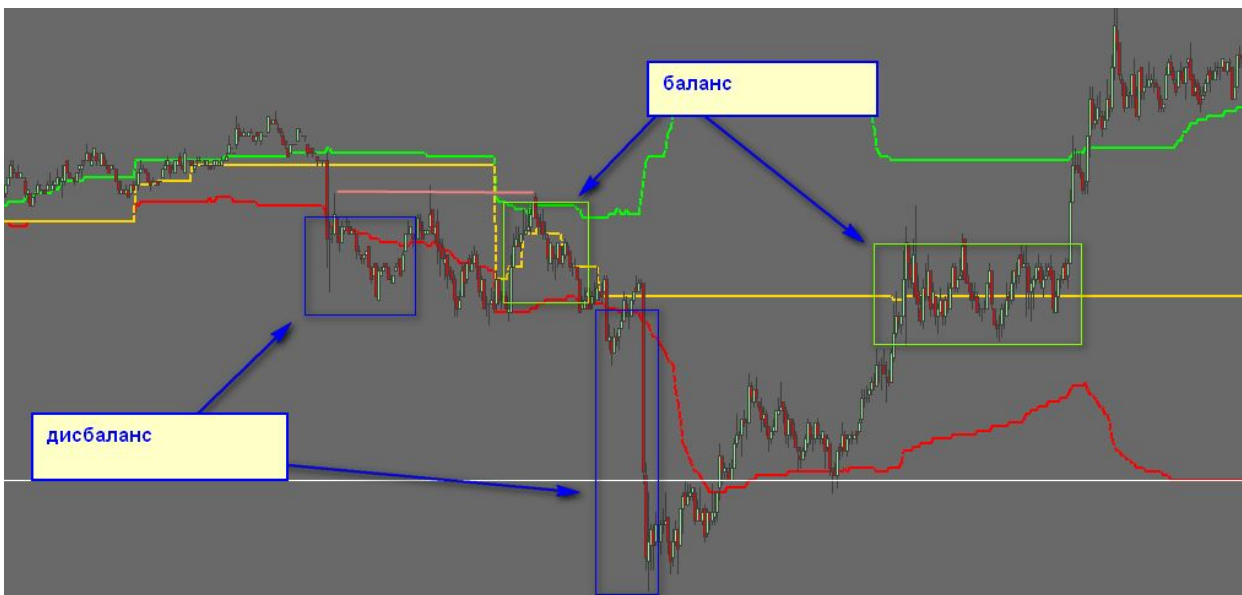


Распределение на Америке разнонаправленно
относительно внутридневного



Признак слабости тренда ↑↓ -

VWAP как фильтр баланса-дисбаланса



VWAP – то цена Volume Weighted Average Price (VWAP), которая определяется путём сложения суммы произведения объемов на цену (цена $\times$ объем) и последующим делением на общее количество объема.

Значения VWAP часто применяются в торговых роботах крупных компаний.

В данном случае мы используем VWAP как фильтр баланса – дисбаланса рынка. Собственно говоря, ничего сложного нет. Если цена находится в диапазоне красной и зеленой линии – мы наблюдаем баланс. Как только цена выходит за пределы диапазона – дисбаланс.

Тактики торговли с использованием VWAP

1. Торговля от границ VWAP внутрь диапазона.

Торгуем от границ VWAP внутрь диапазона в следующих случаях:

- флет на старшем ТФ.

- коррекция на старшем ТФ:

- 1) контр-трендовая торговля,

- 2) вход по тренду.

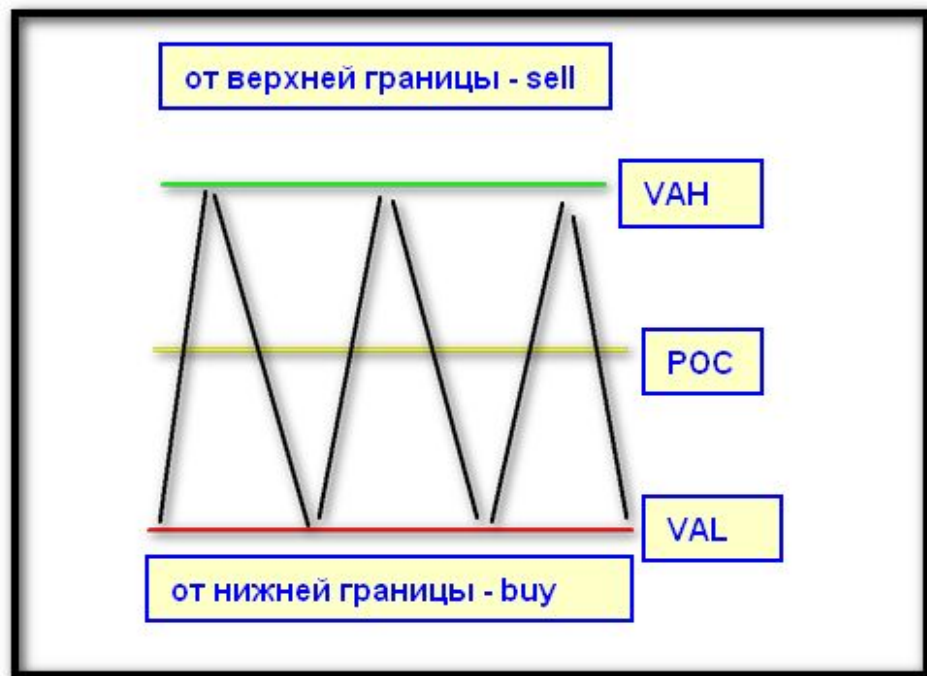
2. Торговля на пробой границ VWAP:

- по тренду;

- контр-тренд.

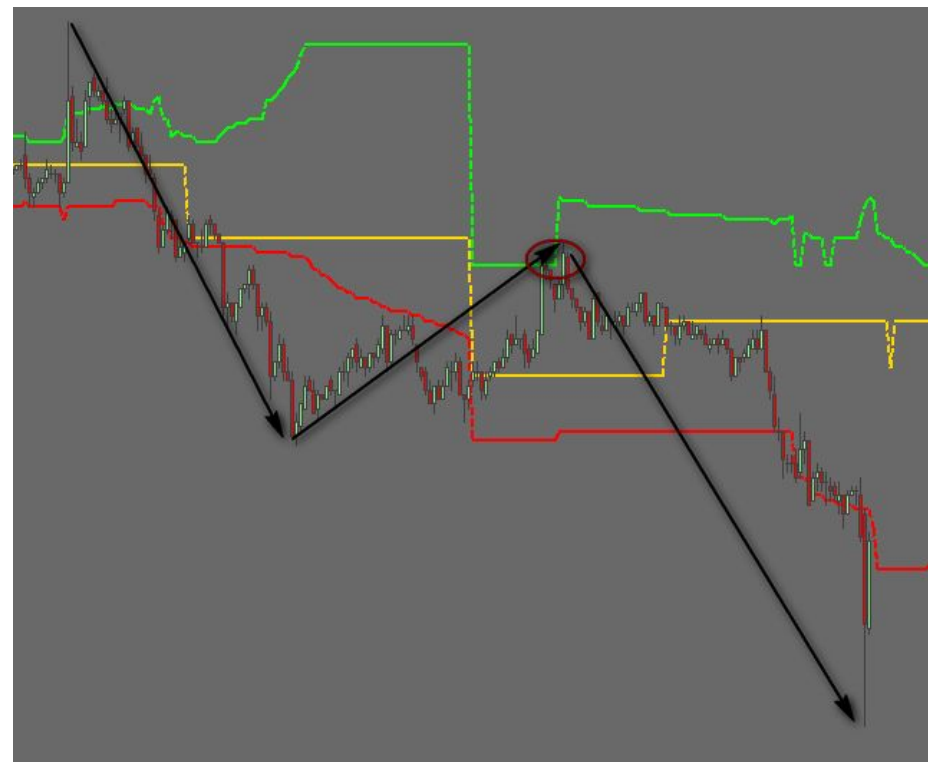
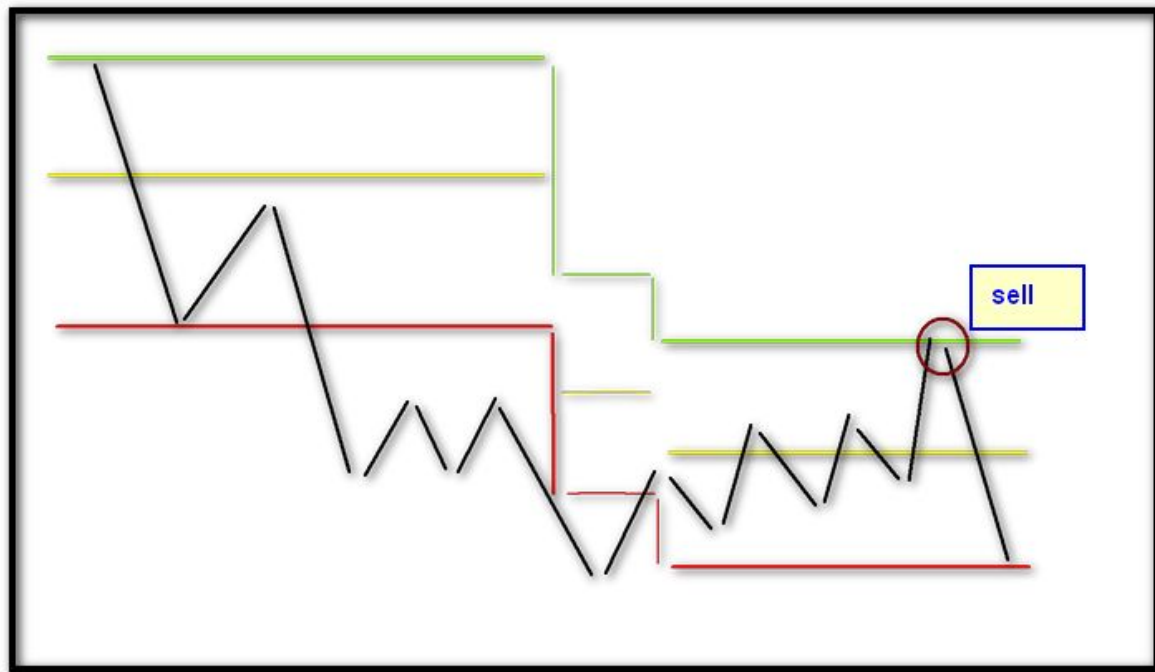
Торговля от границ VWAP

ФЛЕТ НА СТАРШЕМ ТФ



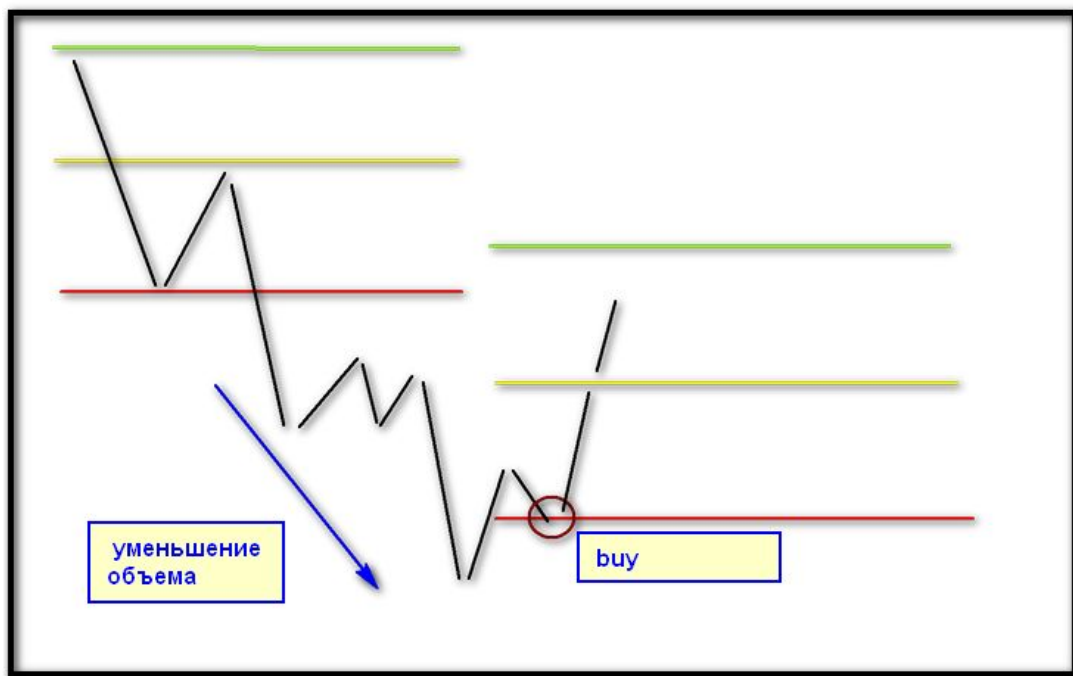
Торговля от границ VWAP

КОРРЕКЦИЯ НА СТАРШЕМ ТФ
(ВХОД В СТОРОНУ ТРЕНДА)



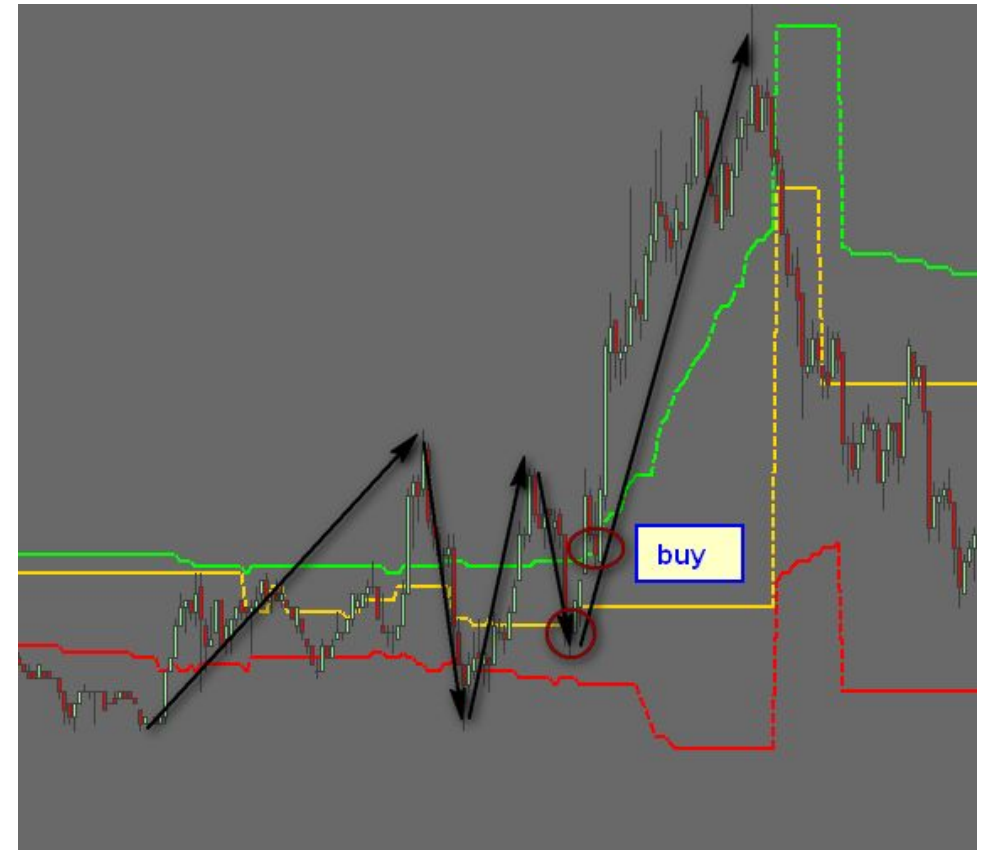
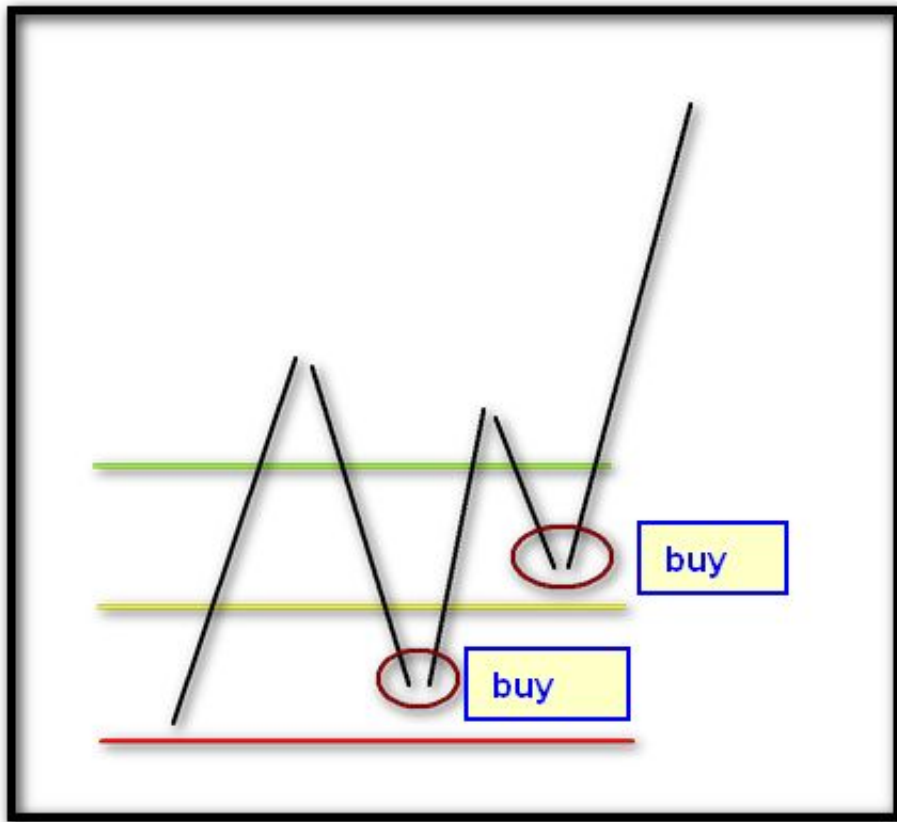
Торговля от границ VWAP

КОРРЕКЦИЯ НА СТАРШЕМ ТФ
(ВХОД КОНТР-ТРЕНД)



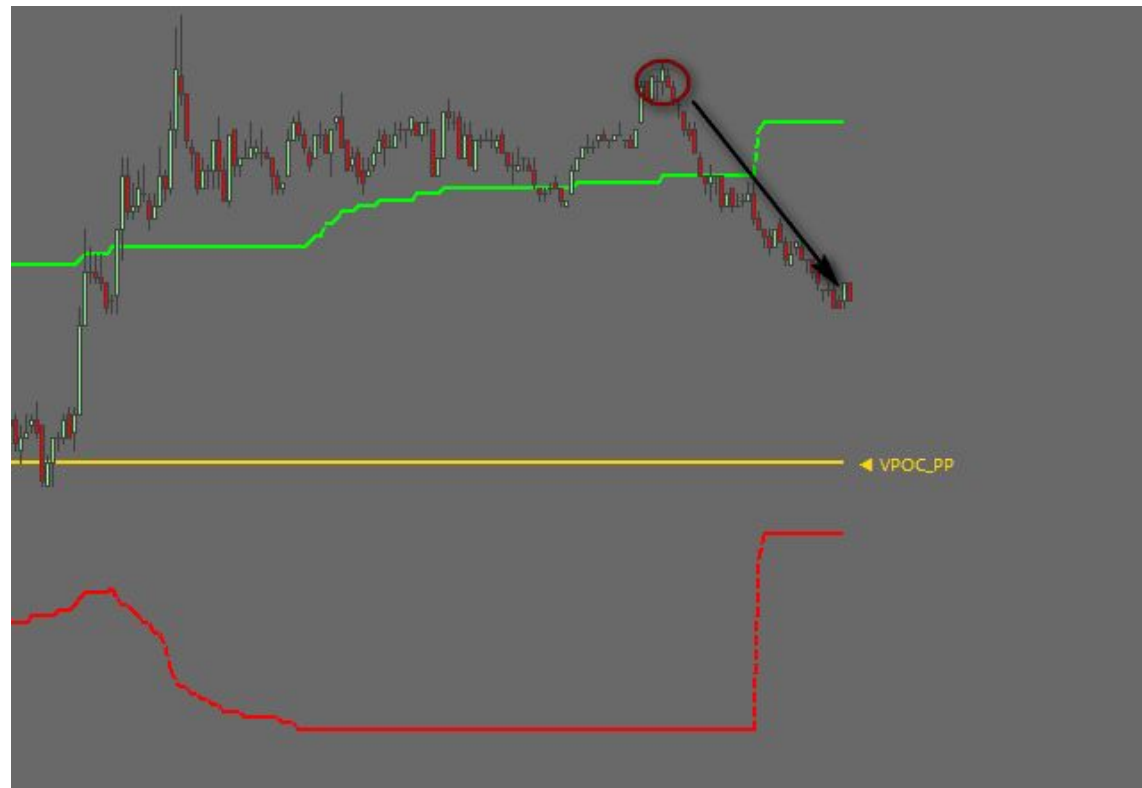
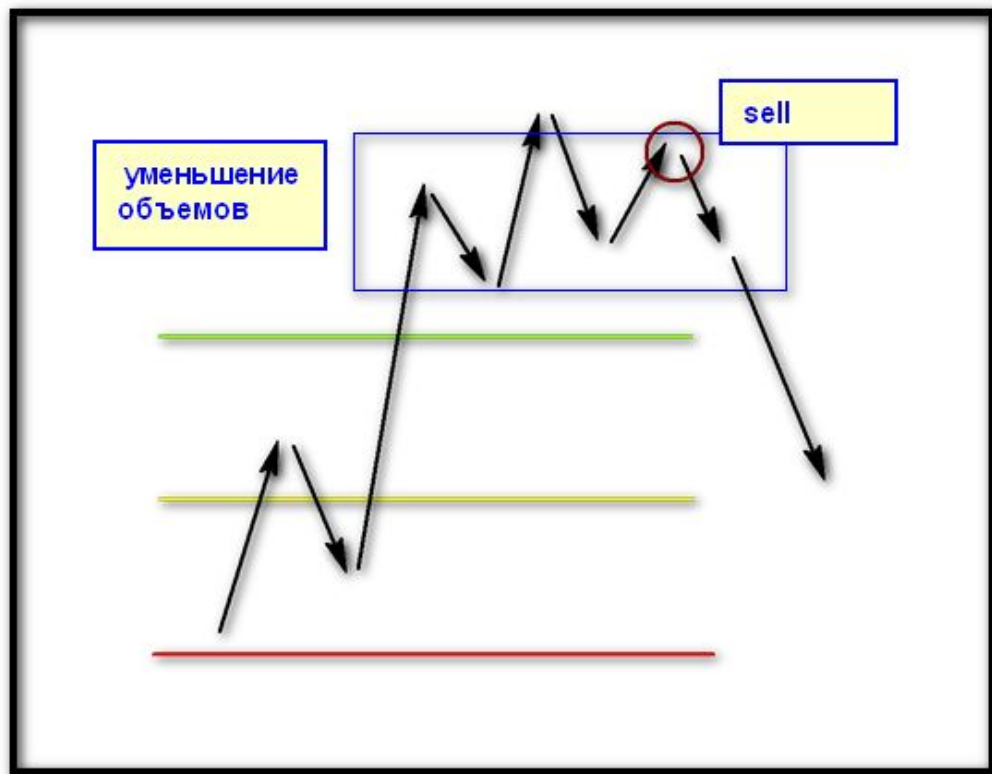
Торговля на пробой границ VWAP

ПО ТРЕНДУ



Торговля на пробой границ VWAP

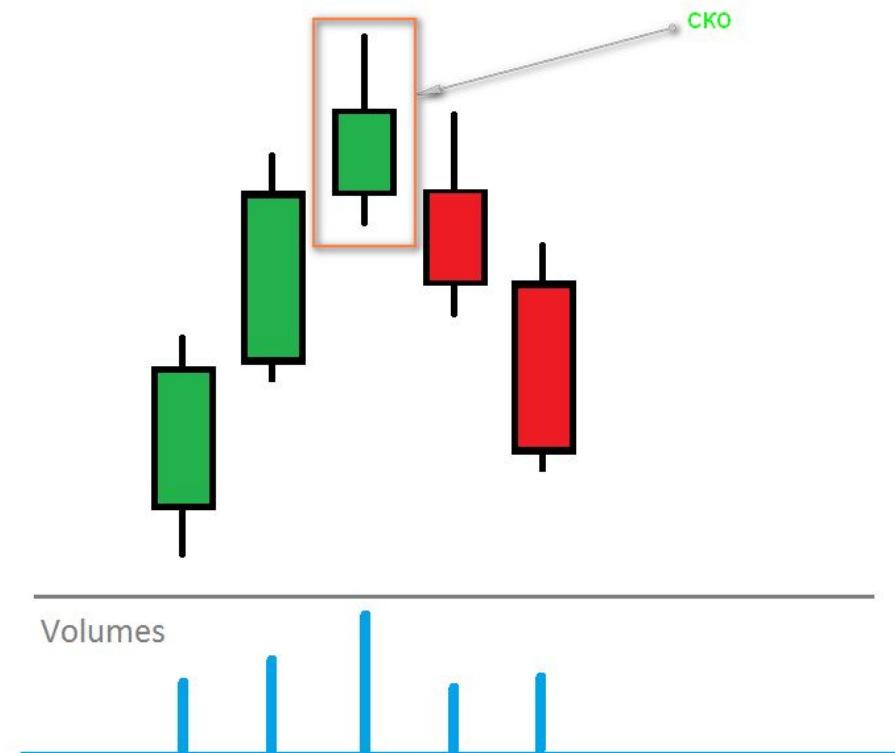
КОНТР-ТРЕНД



Свечи контрастного объема (СКО)

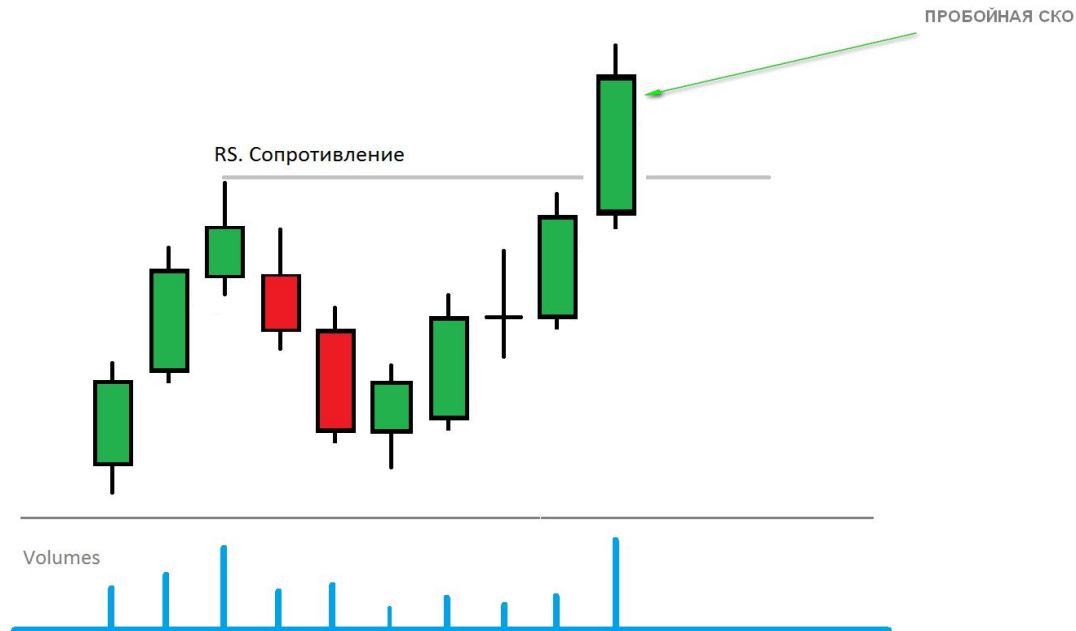
Свеча контрастного объема (СКО) – это свеча, объем которой отличается от других. Следует понимать, что важен не сам объем (количественный), а его отношение к предыдущим свечам. Объясню почему, вернемся к времени. Как мы уже знаем, существует несколько сессий: азиатская, европейская и американская. И торги на этих сессиях происходят с разными объемами. Так, на азиатской сессии объемы самые маленькие. И самые большие объемы приходятся в основном на американскую сессию.

Схематично СКО выглядит так.



Виды СКО

ПРОБОЙНАЯ СКО (ПО ТРЕНДУ)



ПРОБОЙНАЯ СКО (ПРОТИВ ТРЕНДА)



Виды СКО

ПРОБОЙНАЯ СКО (ПО ТРЕНДУ)

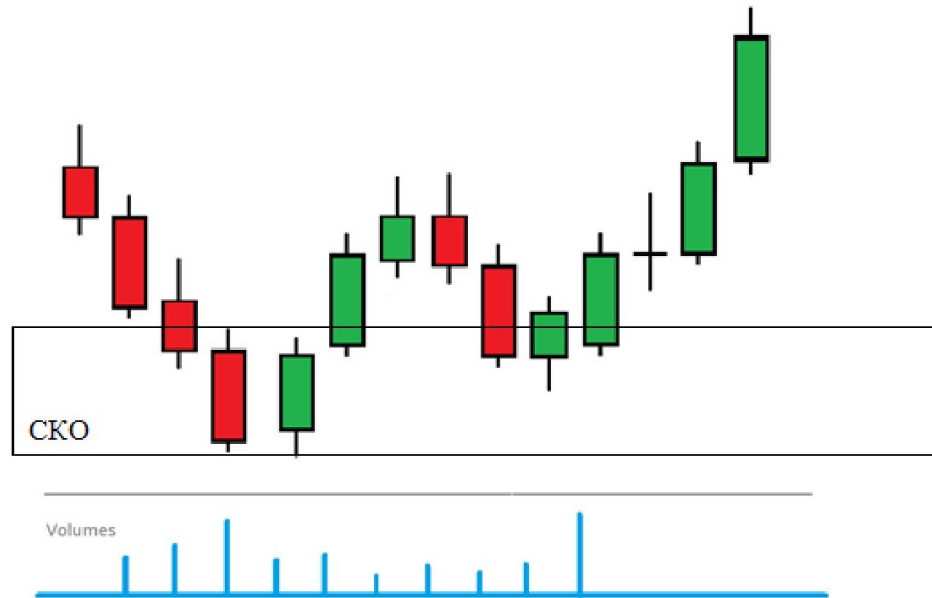


ПРОБОЙНАЯ СКО (ПРОТИВ ТРЕНДА)



Виды СКО

РАЗВОРОТНАЯ СКО (ТРЕНД
ЗАКОНЧЕН)



РАЗВОРОТНАЯ СКО (В ОТКАТЕ) ИЛИ
ЖЕ ДОБОЙНАЯ СКО



Виды СКО

РАЗВОРОТНАЯ СКО (ТРЕНД
ЗАКОНЧЕН)

РАЗВОРОТНАЯ СКО (В ОТКАТЕ) ИЛИ
ЖЕ ДОБОЙНАЯ СКО

