

# 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. M1-M15-H1. 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.

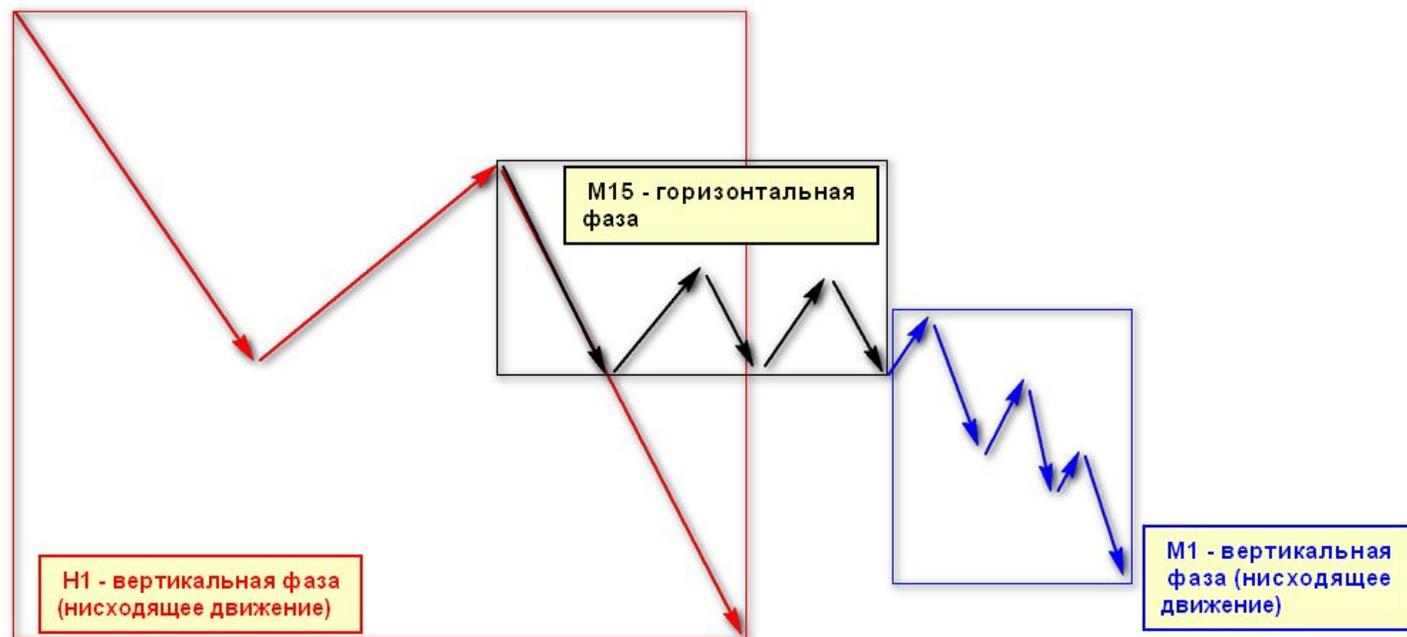
Если вы торгуете ситуацию на m1, то стопы и цели берете m1, максимум m5. Если вы торгуете ситуацию m15, то стопы и цели берете m15, не m1. Есть конечно же входы на m1 с целями h1, но следует понимать, что таких ситуаций на рынке может быть 1-2 входа за день. Поэтому когда вы торгуете, четко понимайте, какой таймфрейм вы торгуете.

# Контекст временных промежутков

H1 - красные линии

M15 - черные линии

M1 - 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:

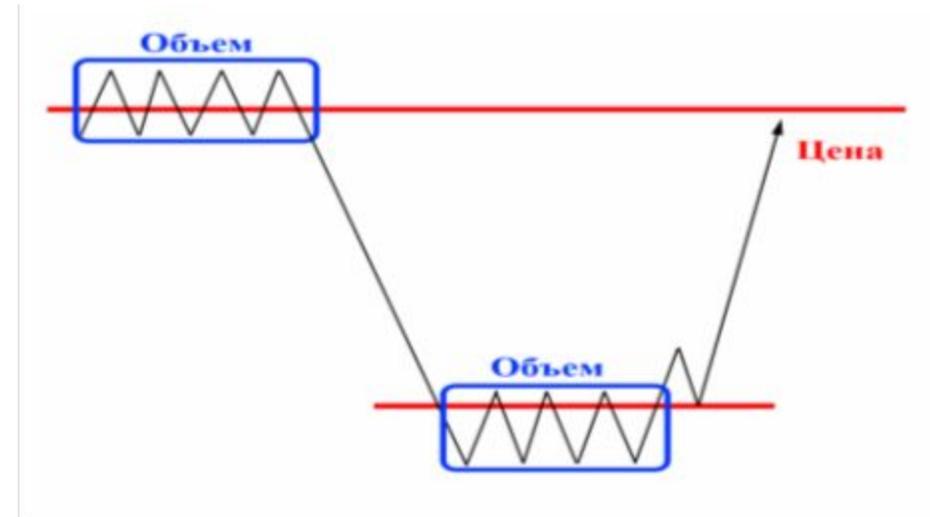
## РЫНОК ДВИЖЕТСЯ ОТ ОБЪЕМА К ОБЪЕМУ.

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

### *Отсюда логика движения рынка:*

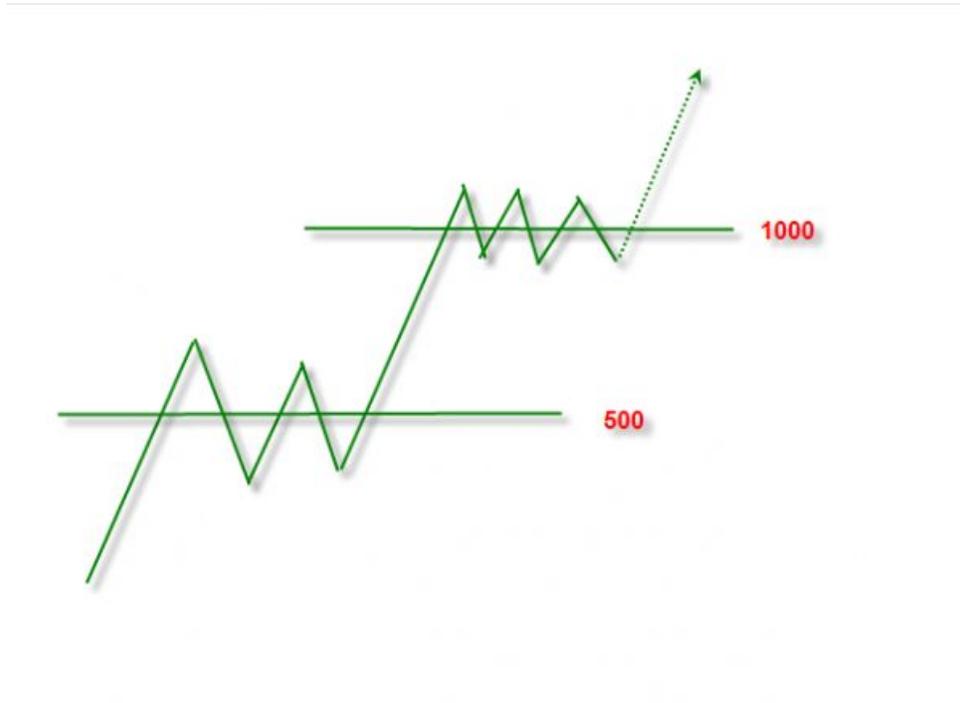
- признак сильного движения - увеличение горизонтального объема по мере движения цены,
- признак слабого движения – уменьшение горизонтального объема по мере движения цены.

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.

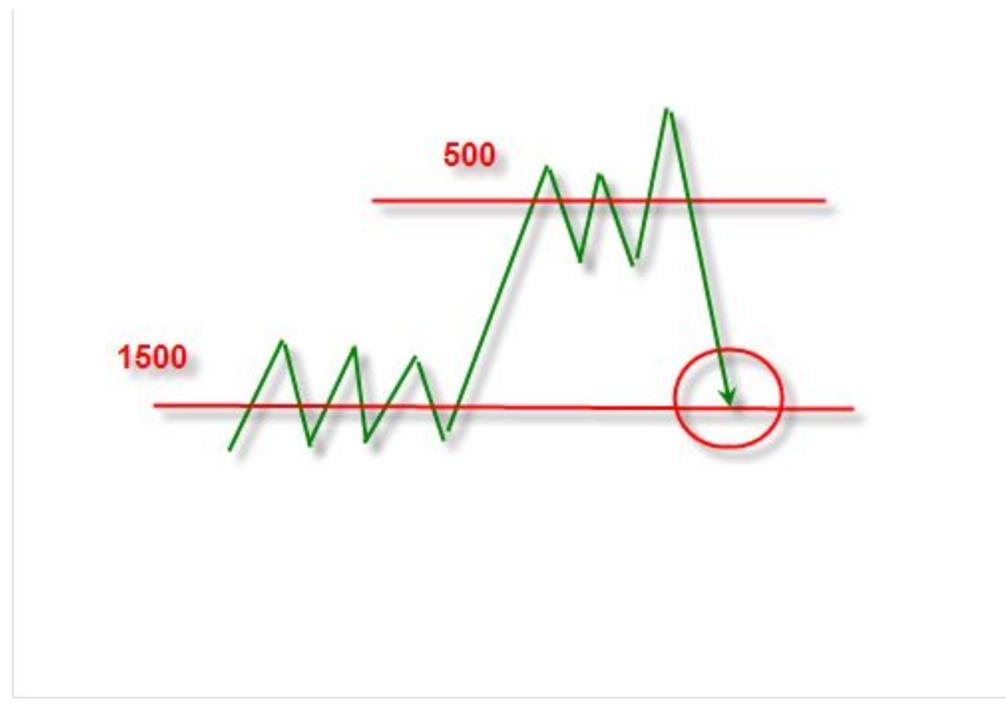


# От объёма к объёму

ПРИЗНАК СИЛЬНОГО ДВИЖЕНИЯ



ПРИЗНАК СЛАБОГО ДВИЖЕНИЯ

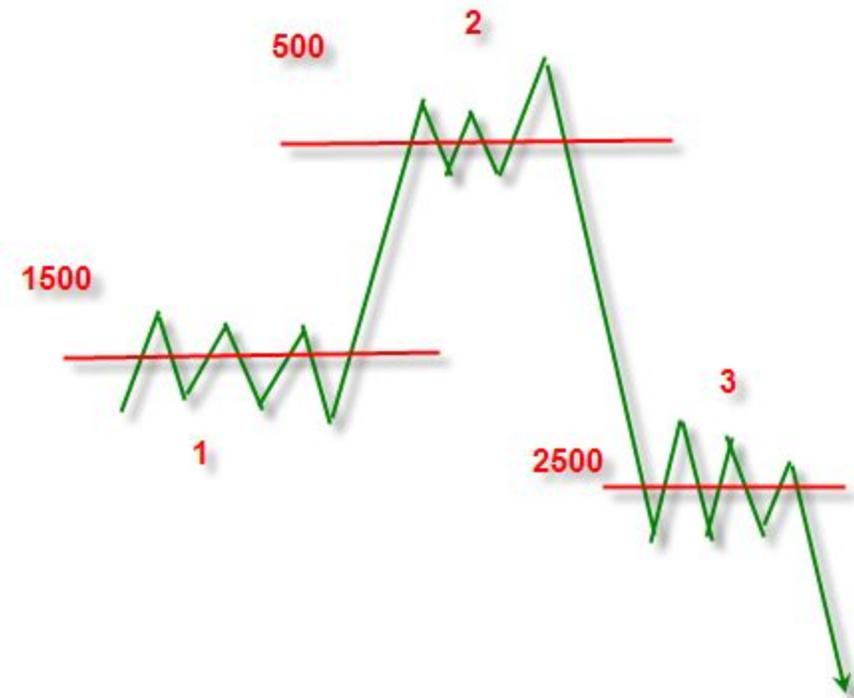


# От объёма к объёму

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.



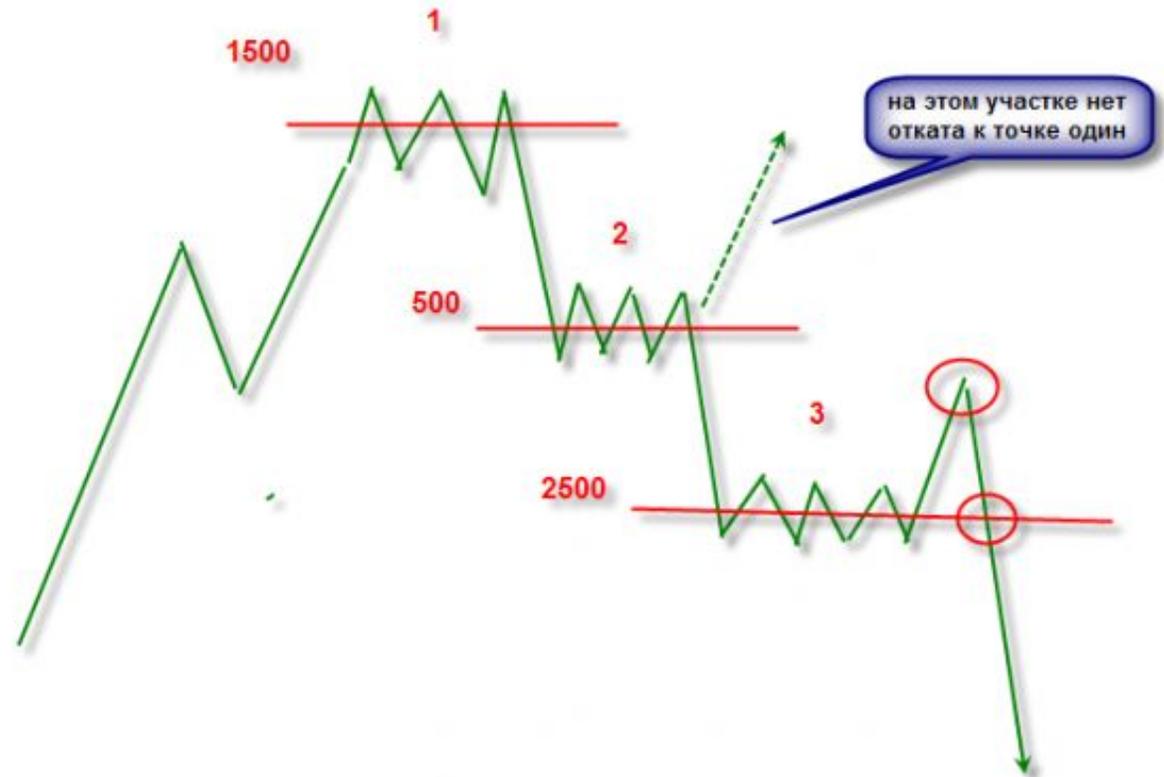
# От объёма к объёму

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.

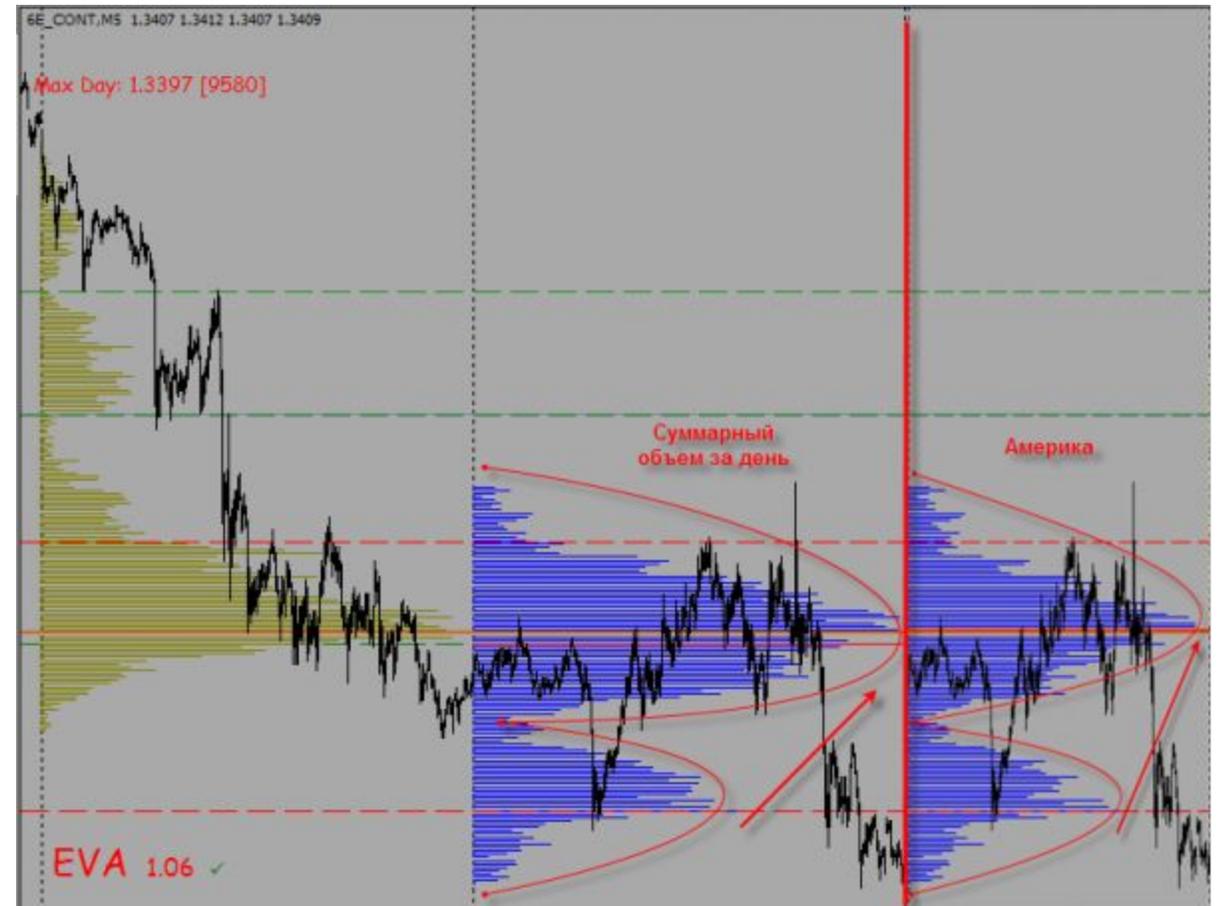
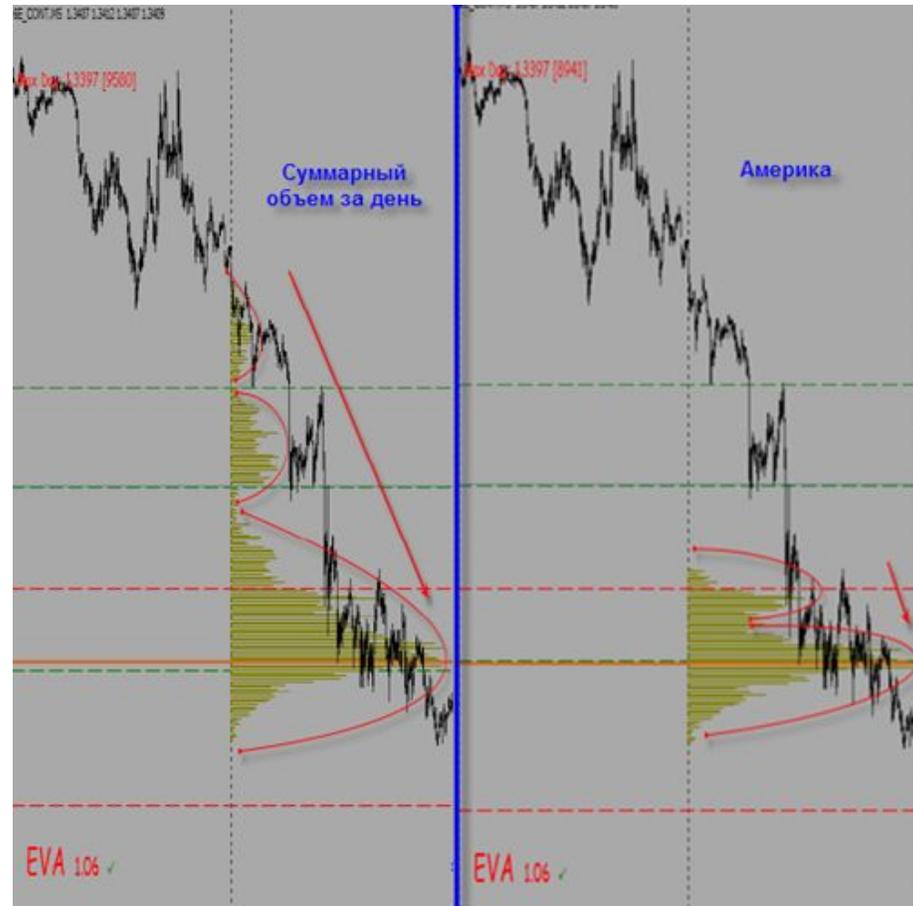
Чем сильнее контраст в новом объеме относительно прежнего, тем сильнее сигнал. Оптимальное соотношение объемов 1,5 - 2 раза, - это сигнал, оптимальный по силе.

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.

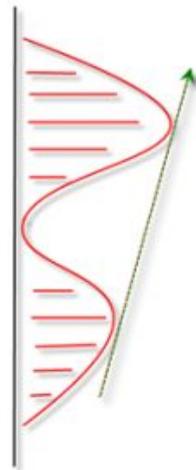
# Признак силы тренда: СОНАПРАВЛЕННОСТЬ объемов на различных сессиях.



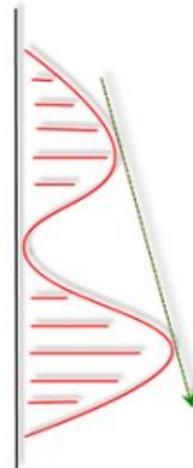
# Признак слабости - РАЗНОНАПРАВЛЕННОСТЬ объемов на различных сессиях

---

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.

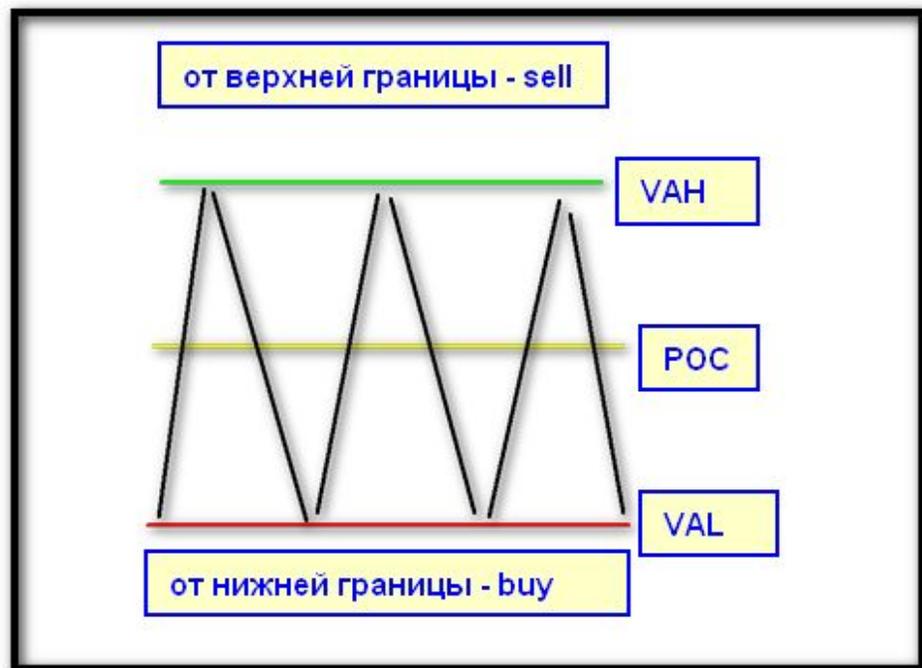
2. Торговля на пробой границ VWAP:

- по тренду;

- контр-тренд.

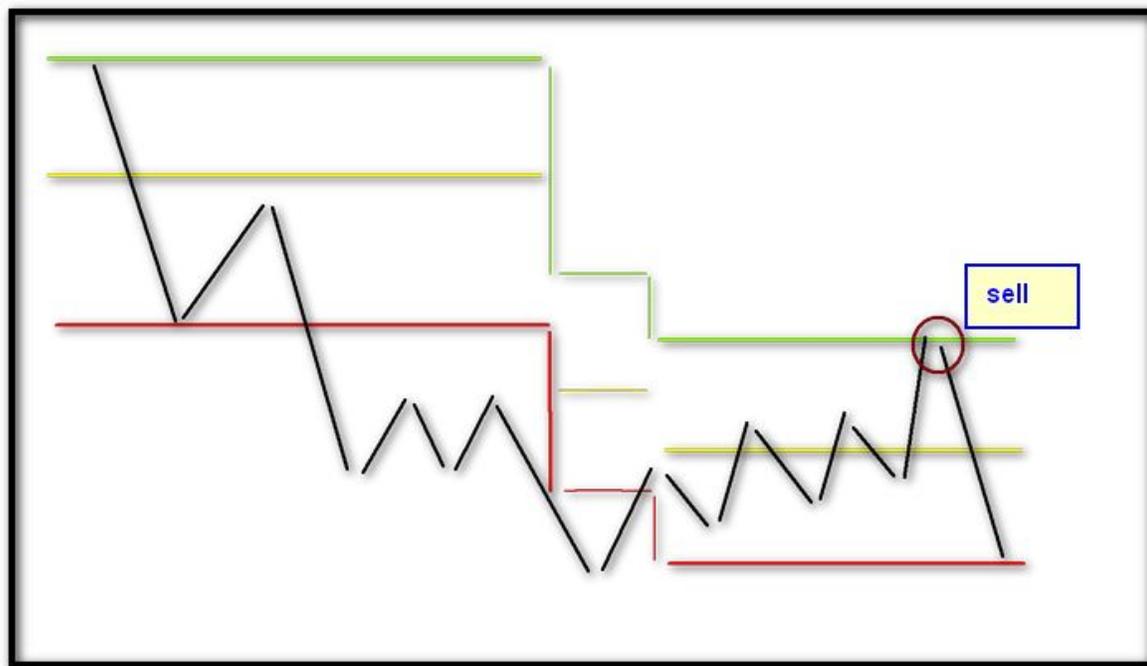
# Торговля от границ VWAP

ФЛЕТ НА СТАРШЕМ ТФ



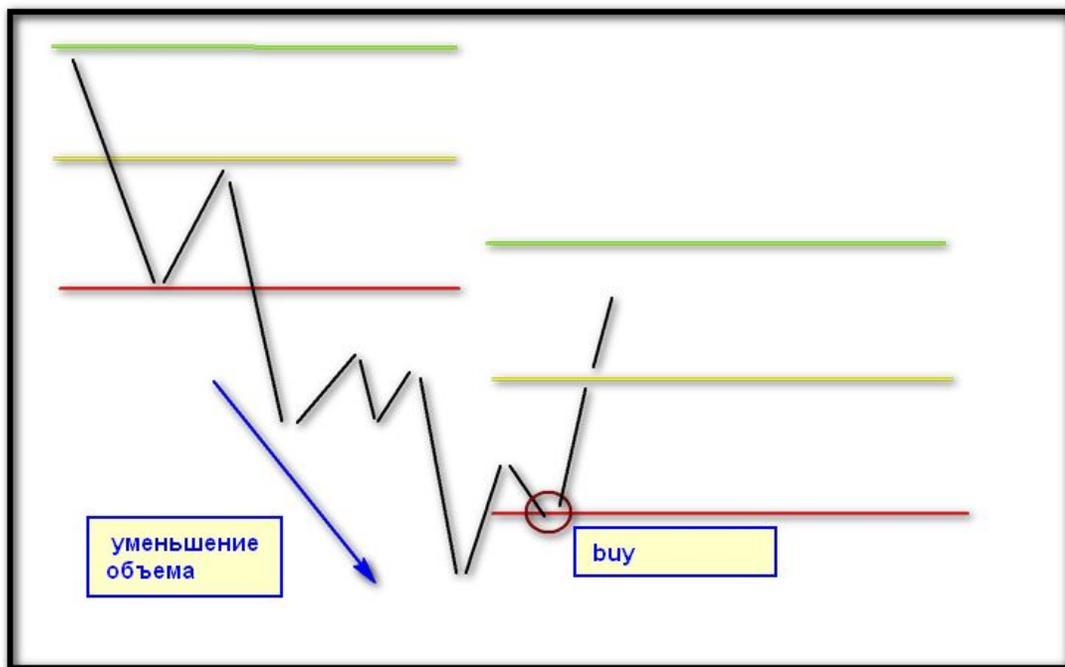
# Торговля от границ VWAP

КОРРЕКЦИЯ НА СТАРШЕМ ТФ  
(ВХОД В СТОРОНУ ТРЕНДА)



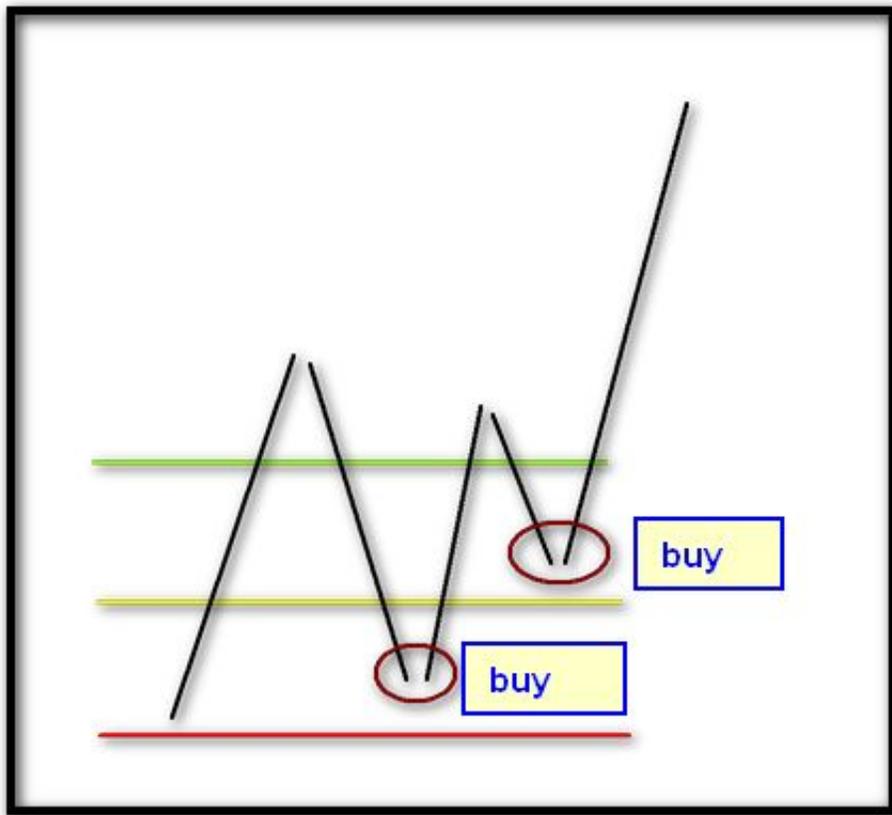
# Торговля от границ VWAP

КОРРЕКЦИЯ НА СТАРШЕМ ТФ  
(ВХОД КОНТР-ТРЕНД)



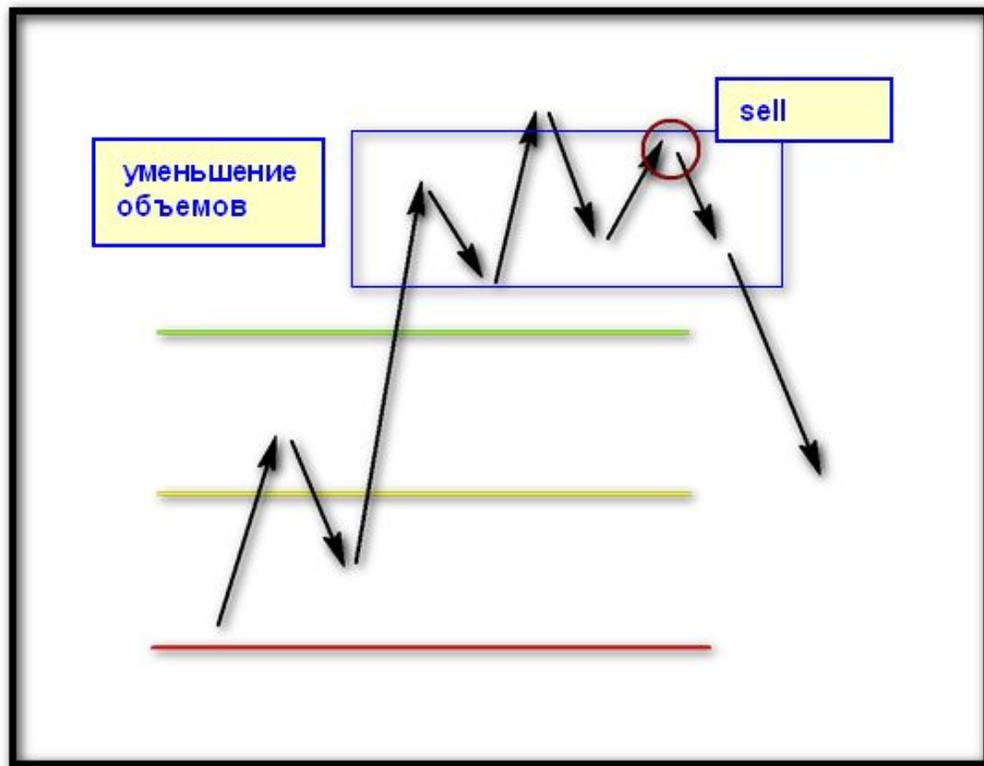
# Торговля на пробой границ VWAP

ПО ТРЕНДУ



# Торговля на пробой границ VWAP

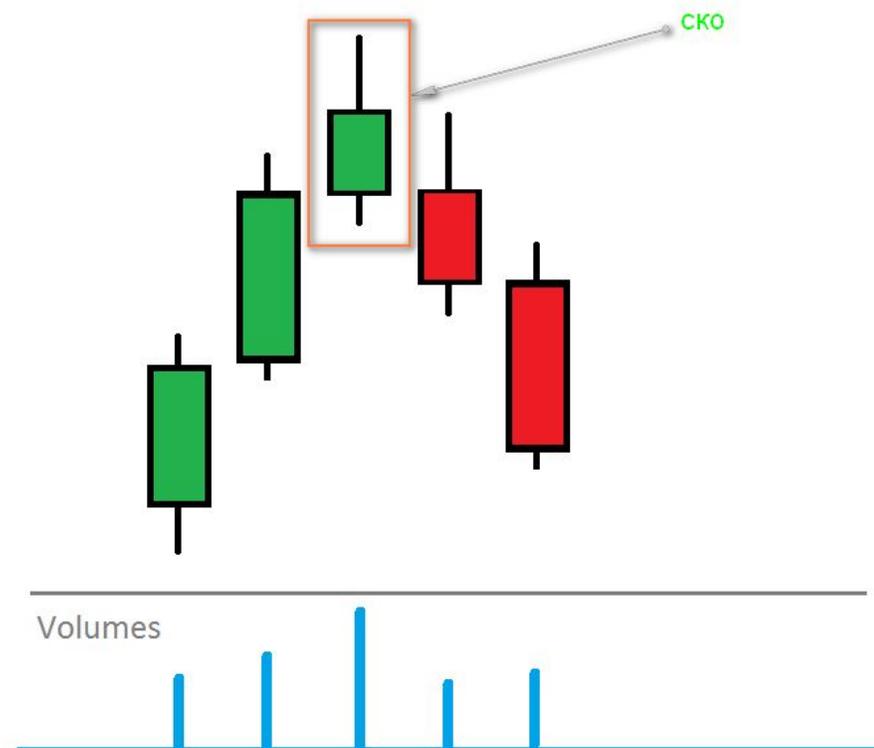
КОНТР-ТРЕНД



# Свечи контрастного объема (СКО)

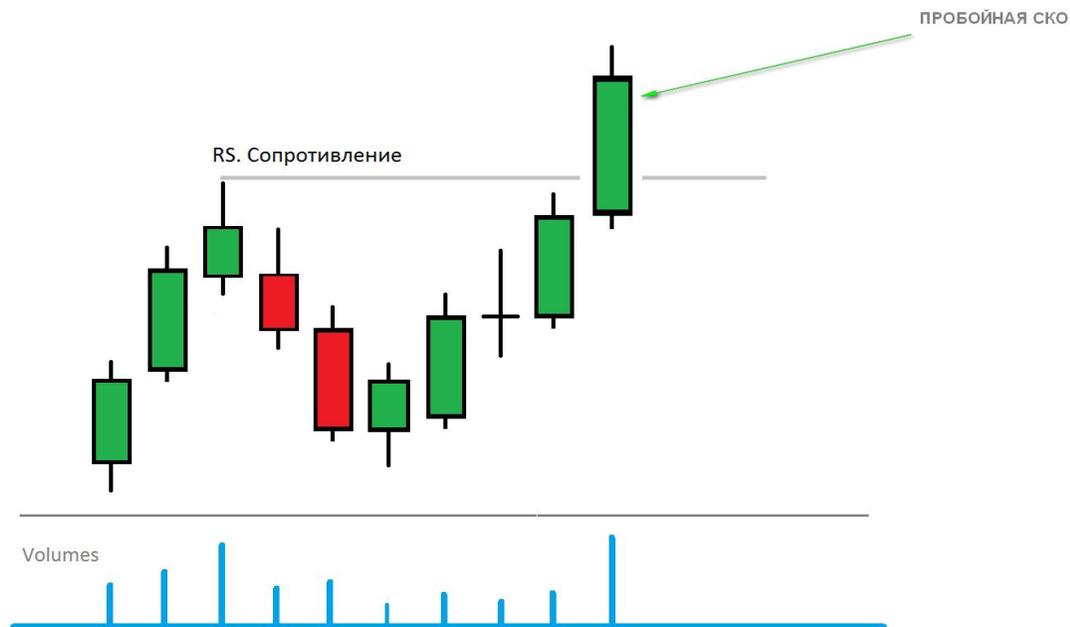
**Свеча контрастного объема (СКО)** – это свеча, объем которой отличается от других. Следует понимать, что важен не сам объем (количественный), а его отношение к предыдущим свечам. Объясню почему, вернемся к времени. Как мы уже знаем, существует несколько сессий: азиатская, европейская и американская. 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)

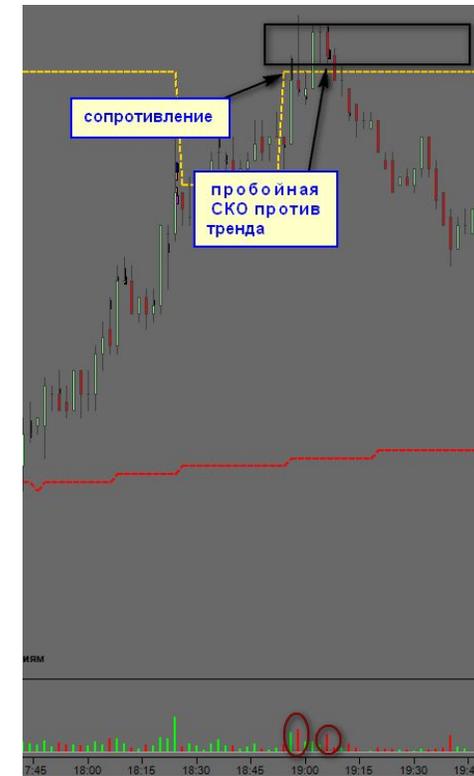


# Виды СКО

ПРОБОЙНАЯ СКО (ПО ТРЕНДУ)



ПРОБОЙНАЯ СКО (ПРОТИВ ТРЕНДА)

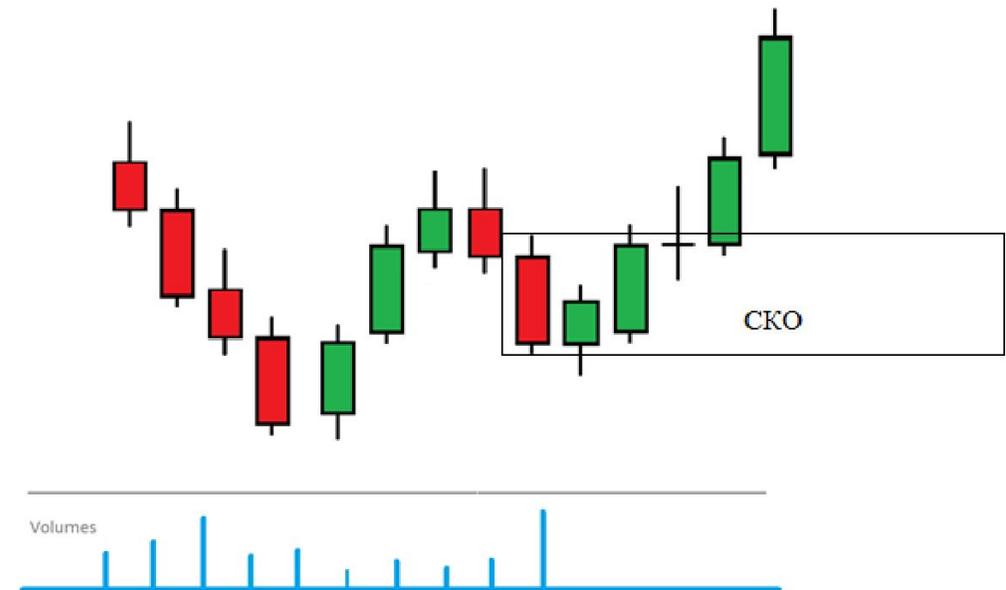


# Виды СКО

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

