

Индикатор профиля рынка «Market profiler»

Основан на реальных
биржевых данных.



[Скачать терминал.](#)

Скачать индикатор.

Содержание:

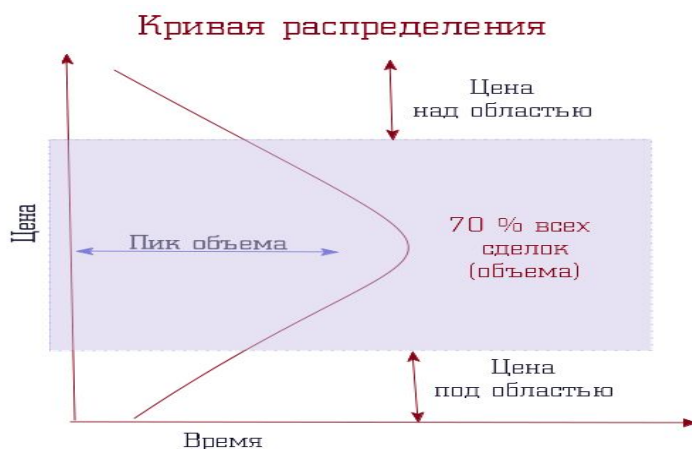
1. Что такое профиль рынка?
2. Для чего может использоваться профиль рынка?
3. Практическое применение.
4. Принципы позиционирования объема.
5. Как определить давление со стороны игроков?
6. Покупатели и продавцы. Как понять, кто в рынке?

Что такое профиль рынка?

Профиль рынка представляет собой отображение связи между ценой и объемом, то есть показывает накопление объемов на графике. Ежедневно рынок движется в определенном ценовом диапазоне, это может быть какой-либо канал или проторговка.

Как известно, рынок Форекс – это рэнджевый рынок. Данный рэндж отображается профилем рынка как value area (зона стоимости или зона справедливой цены) – это баланс (равновесие), где торгуют и покупатели и продавцы, которые готовы проводить сделки по этим ценам, т.е. в данном диапазоне.

В балансе обычно присутствует одинаковое количество продавцов и покупателей, поэтому цена оттуда никуда не двигается. Там происходит накопление или распределение актива (так называемая борьба). Профиль рынка отображает всплески объемов в этом ценовом диапазоне в виде всплесков горизонтального объема, а накопления – в виде так называемого колокола. Самая популярная методика анализа рыночного профиля – это анализ 70% зоны накопления объема.



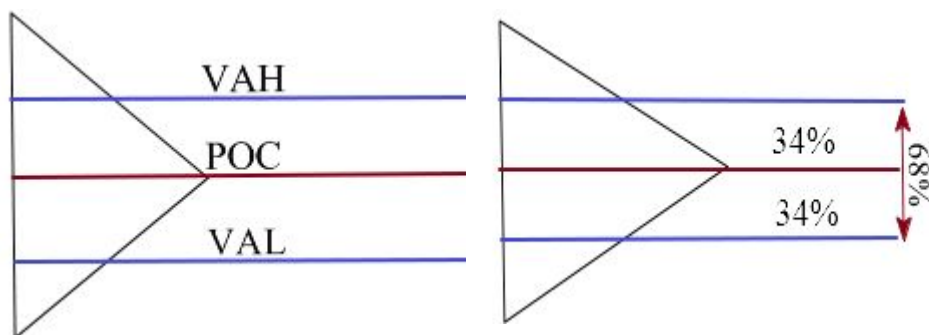
Рыночный профиль – это не простой индикатор. Он поможет вам интерпретировать всплески объемов в определенных областях и диапазонах, находить области, в которых игроки проявляют наибольшую активность, что отражается на объемах сделок.

Профиль рынка дает понимание того, кто контролирует рынок на данный момент, и есть ли связь остановок движения с набором объема или его распределением. Существует такое понятие как «зона ценности» – это диапазон, где игроки приняли цену за справедливую и в данный момент готовы по ней торговать. Эта зона имеет для участников рынка приоритет на графике цены.

Самый большой пик в зоне стоимости – это точка контроля (Point Of Control). Другое ее название – «мода» цены, т.е. популярное место торговли, где активнее всего проводились сделки, и их объем достиг наибольшего значения.

Зона наибольшего накопления объема в профиле называется колоколом.

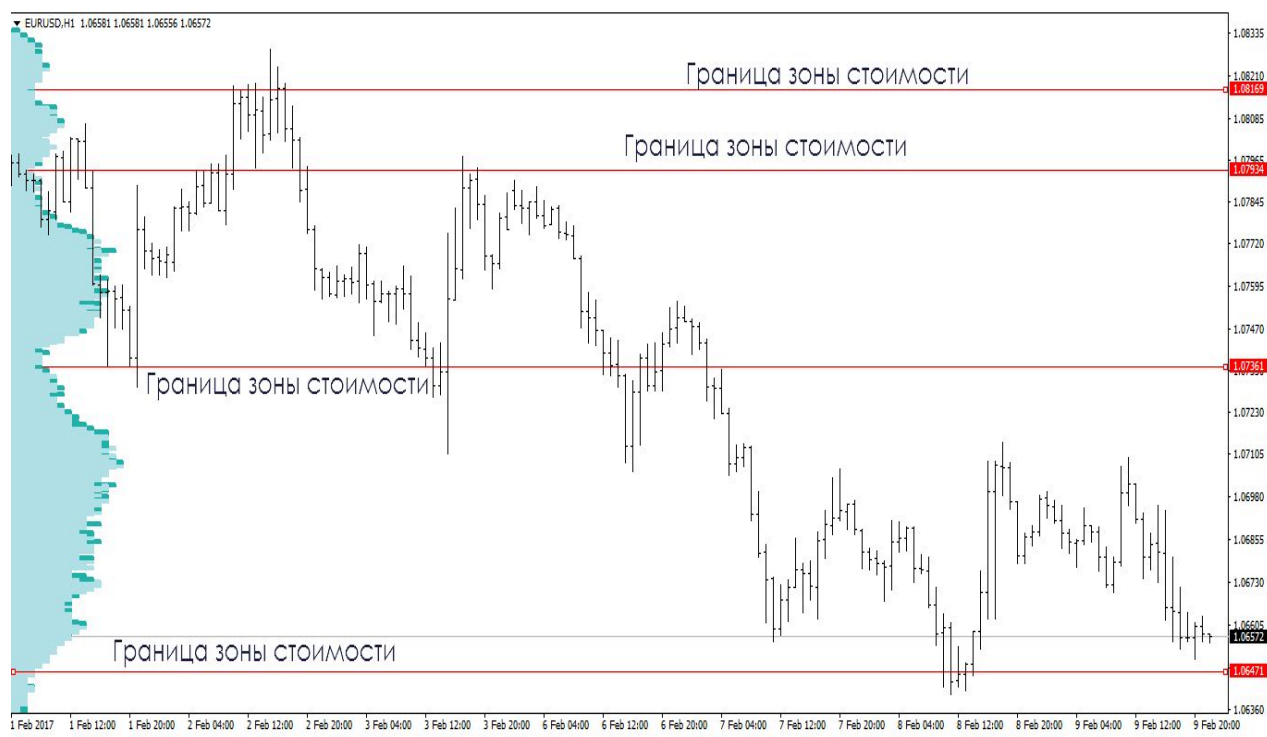
Для обозначения верхней границы зоны стоимости используется аббревиатура VAH (Value area High), для нижней – VAL (Value area low).



Для чего может использоваться профиль рынка?

Границы зон стоимости, построенные на основе рыночного профиля, используются многими трейдерами как уровни поддержки и сопротивления.

Зона стоимости должна охватывать колокол (выпуклую область) с точкой контроля в ней. Анализируемой областью активности будет являться диапазон с наибольшим пиковым объемом.



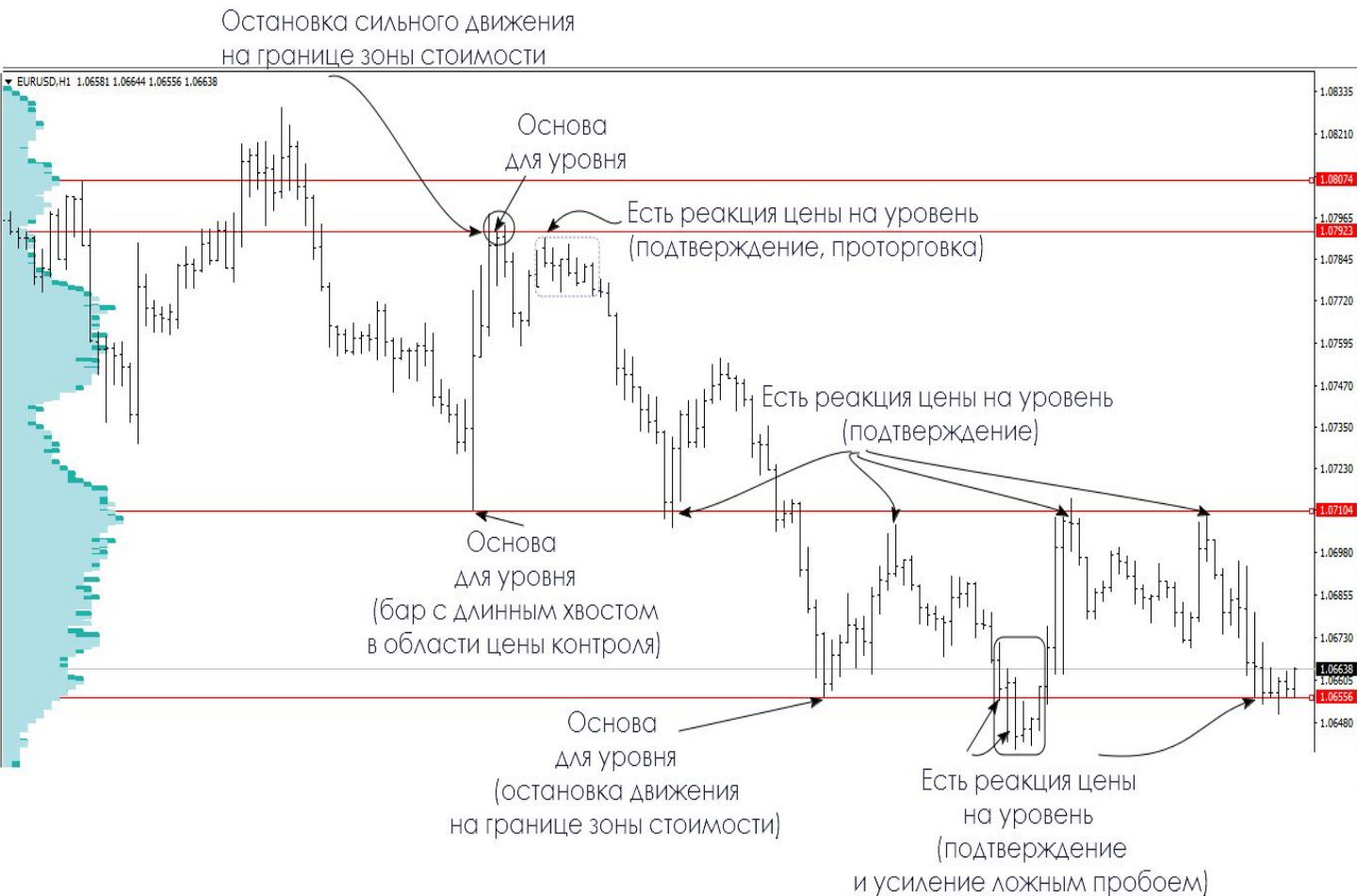
Цена контроля (Point of control)

Цены контроля – это цены, по которым прошло самое большое количество объема в зоне стоимости. Эти цены также могут выступать в качестве поддержки и сопротивления.

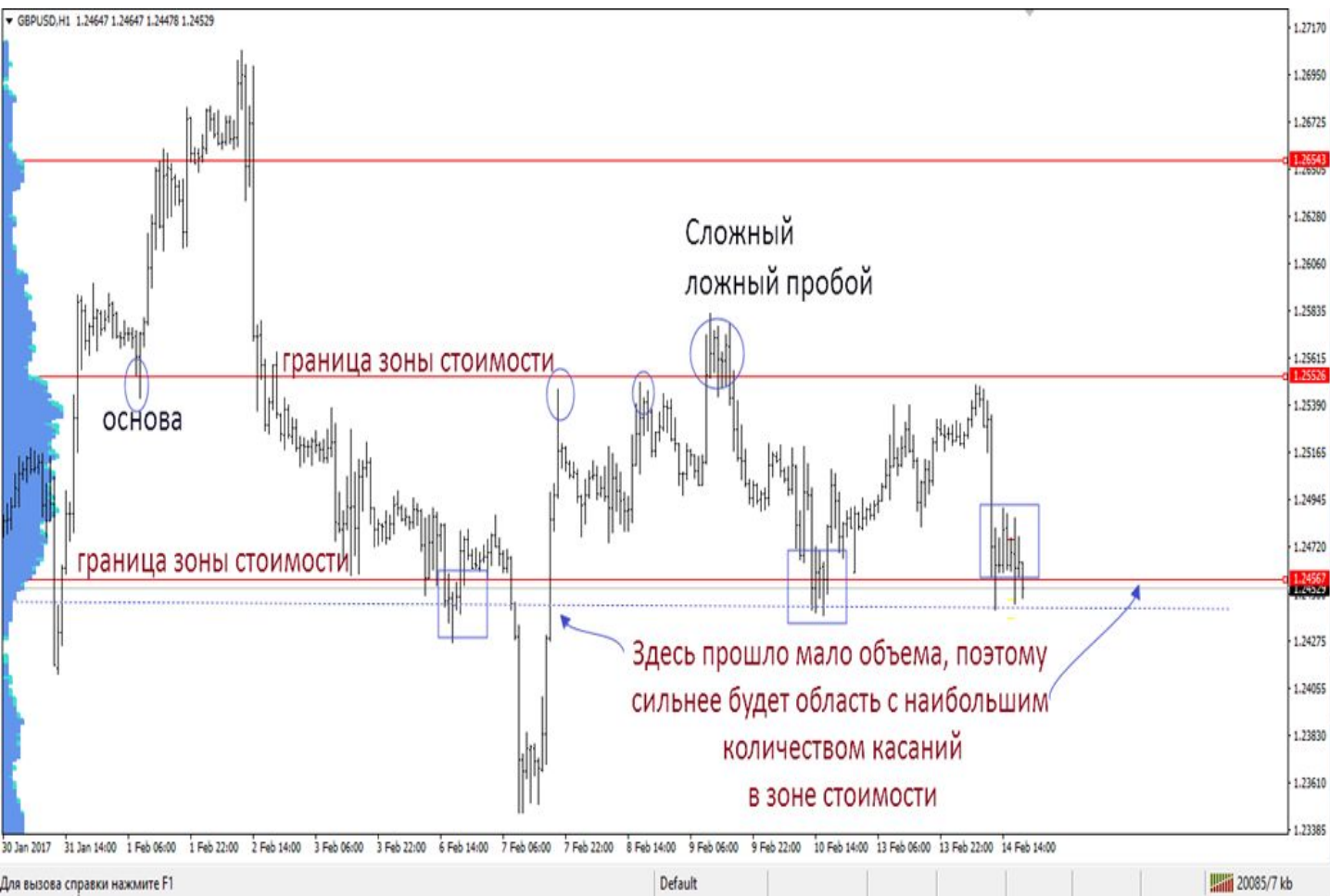


Данный профиль лучше использовать для того, чтобы подтвердить значимость того или иного локального экстремума, который мы будем брать за основу для проведения уровня.

Например:



Еще один пример сильных экстремумов с объемом:



Принципы позиционирования объема

Каждое биржевое сведение ордеров имеет две стороны – покупку и продажу. Даже если инициатива была у покупателя, то приобретение он сделал все равно у продавца. Поэтому однобоко смотреть на объем, прошедший в продажу или покупку, нельзя. В случае, если продавец удовлетворил потребность инициатора сделки (покупателя), то позднее он с таким же успехом может защищать уровень своих продаж. То же самое можно сказать в случае инициативы продавца, который продает по цене спроса.

Тут также может оказаться покупатель, который просто ждал свою цену и момента, когда появится инициативный продавец и начнет защищать набранную позицию.

Исходя из этого, любой прошедший объем необходимо позиционировать, т.е. желательно торговать при выходе из зоны стоимости.

Также стоит обращать внимание на месторасположение цены контроля в зоне стоимости. Если она сверху, то, вероятнее всего, мы имеем дело с продавцом.

Стоит учитывать то, что профили рынка – это динамические индикаторы, которые работают по принципу накопления объема и распределяют его по всему анализируемому периоду.

Давление продаж или защита уровня?

Идея заключается в том, что уровень, который отрабатывался неоднократно, может продавливаться потоком продаж или покупок. Это так называемый проталкивающий объем. Проторговка над/под уровнем при торговле отбоев может быть отфильтрована с помощью показателей профиля объема.



Низкая цена в зоне стоимости привлекает больше покупателей, высокая цена привлекает обе категории игроков

Продавцы оказывают давление для того, чтобы пробить уровень. И в результате анализа мы получаем неплохое движение внутри следующего торгового дня.

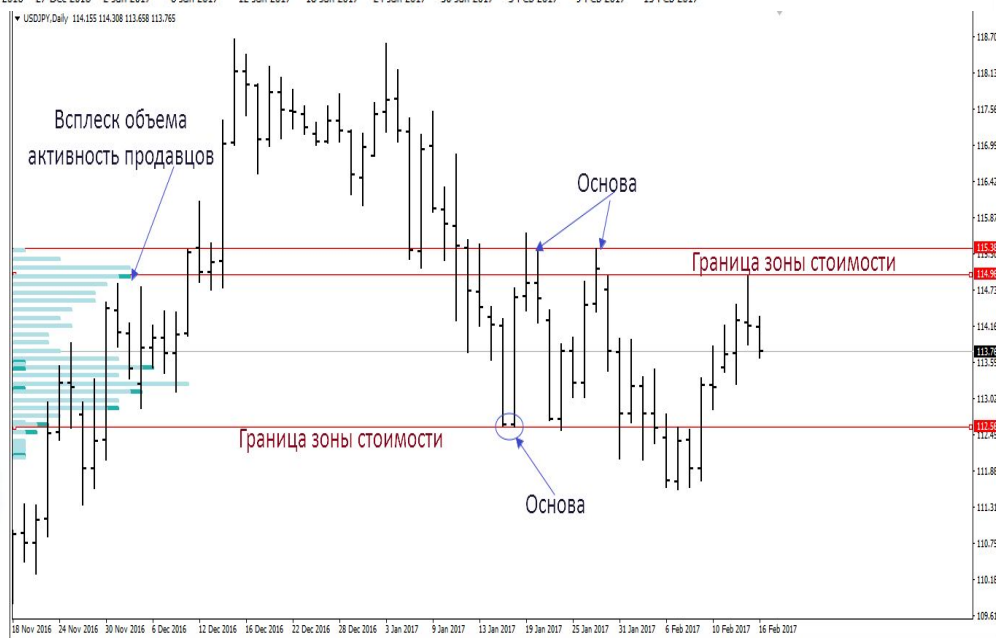


В соответствии со своим стилем торговли вы могли бы искать точку входа в короткую позицию более смело, имея подтверждение в виде реального объема продавцов. Его величину отображает профиль рынка.

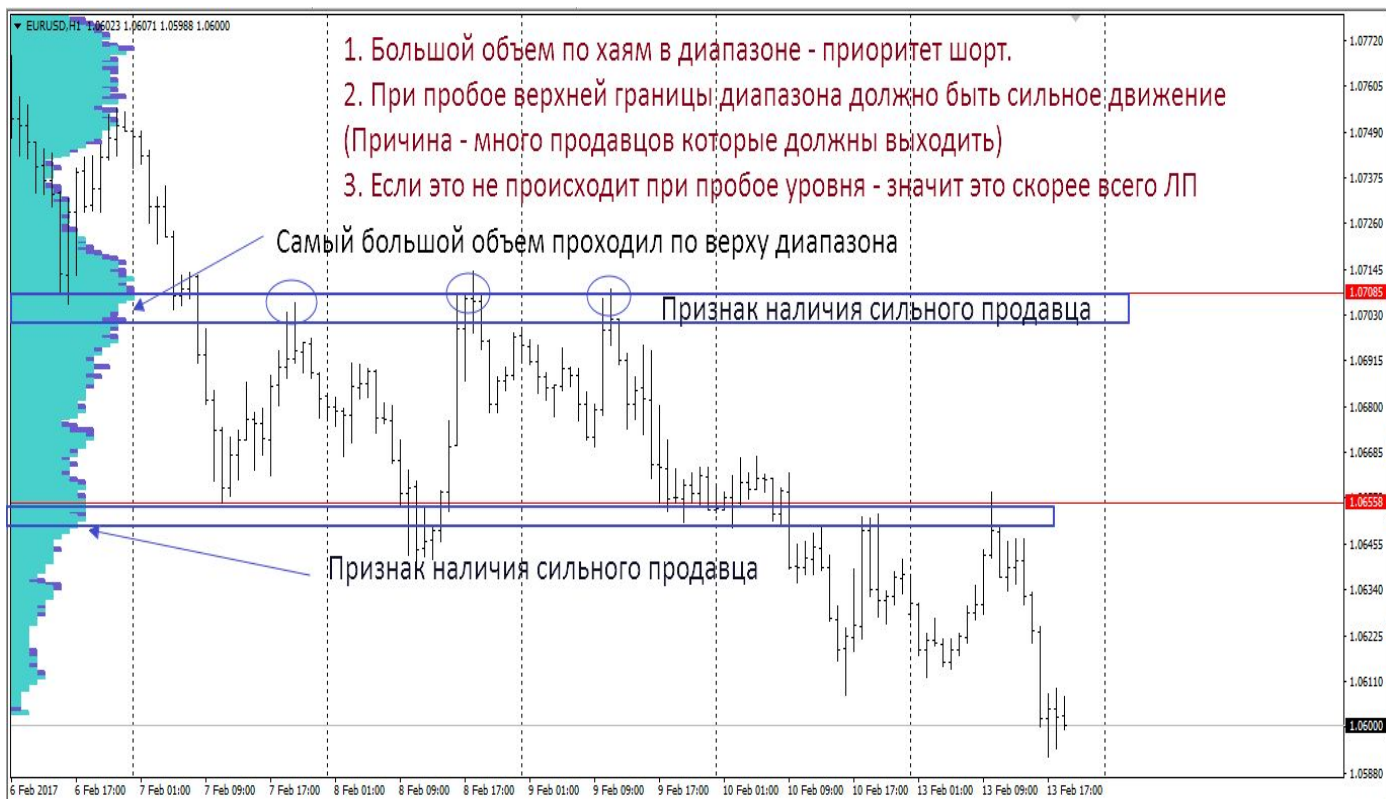
С помощью профиля объема вы можете подтвердить свои дневные и локальные уровни, усилить их значимость при совпадении цены уровня с всплесками объема или границей зоны стоимости.



Сильные уровни
создаются только
большими
деньгами

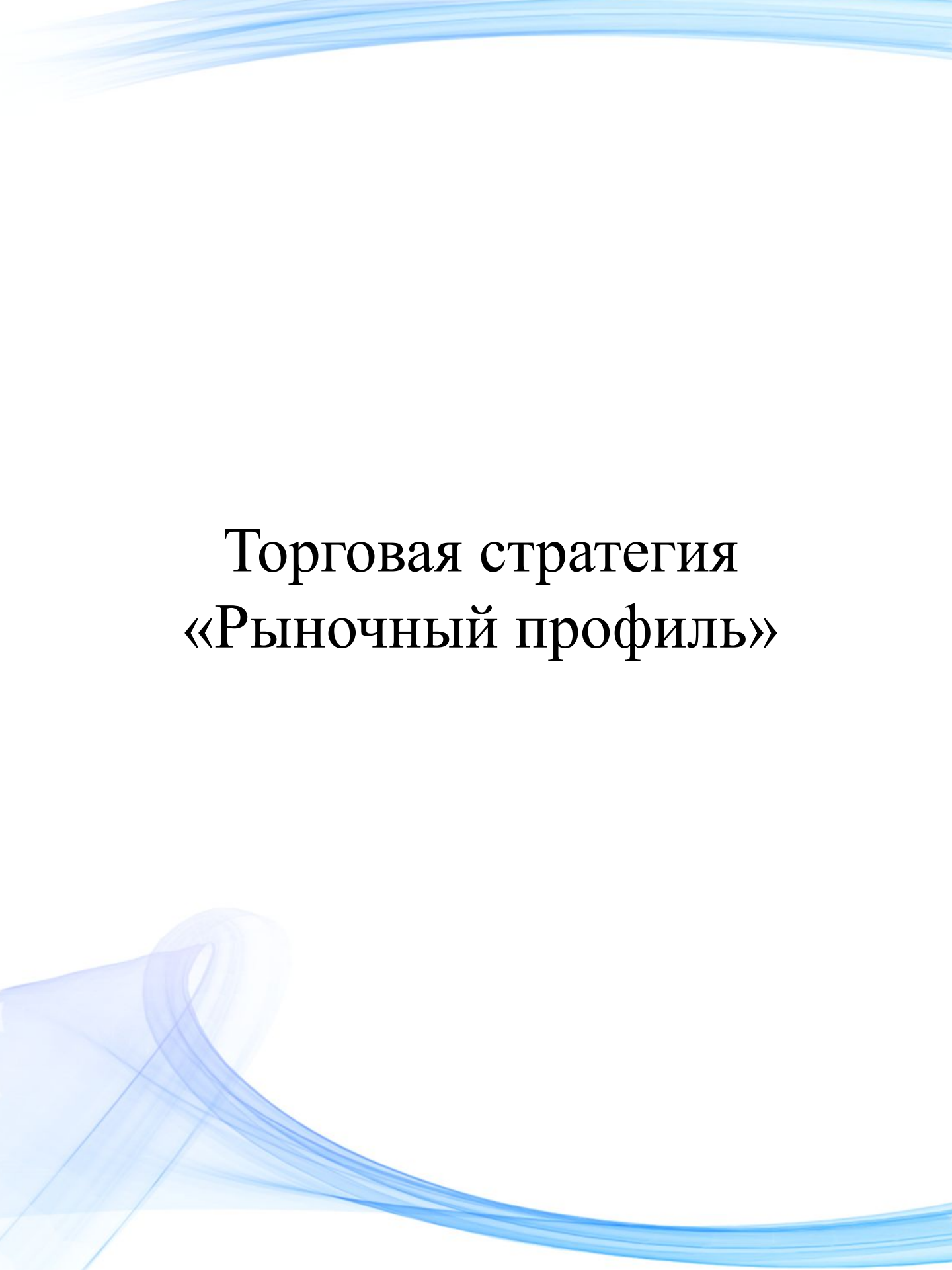


Признаки наличия крупного покупателя или продавца в диапазоне



Повышенный интерес игроков к определенному уровню доказывает, что он сильный. Также это является сигналом того, что, скорее всего, там есть игрок с какой-либо стороны, более заинтересованный, чем его оппонент.

Почему? Вряд ли умные деньги будут покупать в high и продавать в low. Соответственно, если мы имеем повышенный интерес в high, то чаще всего это означает продажи, а когда наблюдаются всплески объема над уровнем, то, вероятнее всего, это покупательская активность.



Торговая стратегия «Рыночный профиль»

Основные идеи торговой системы:

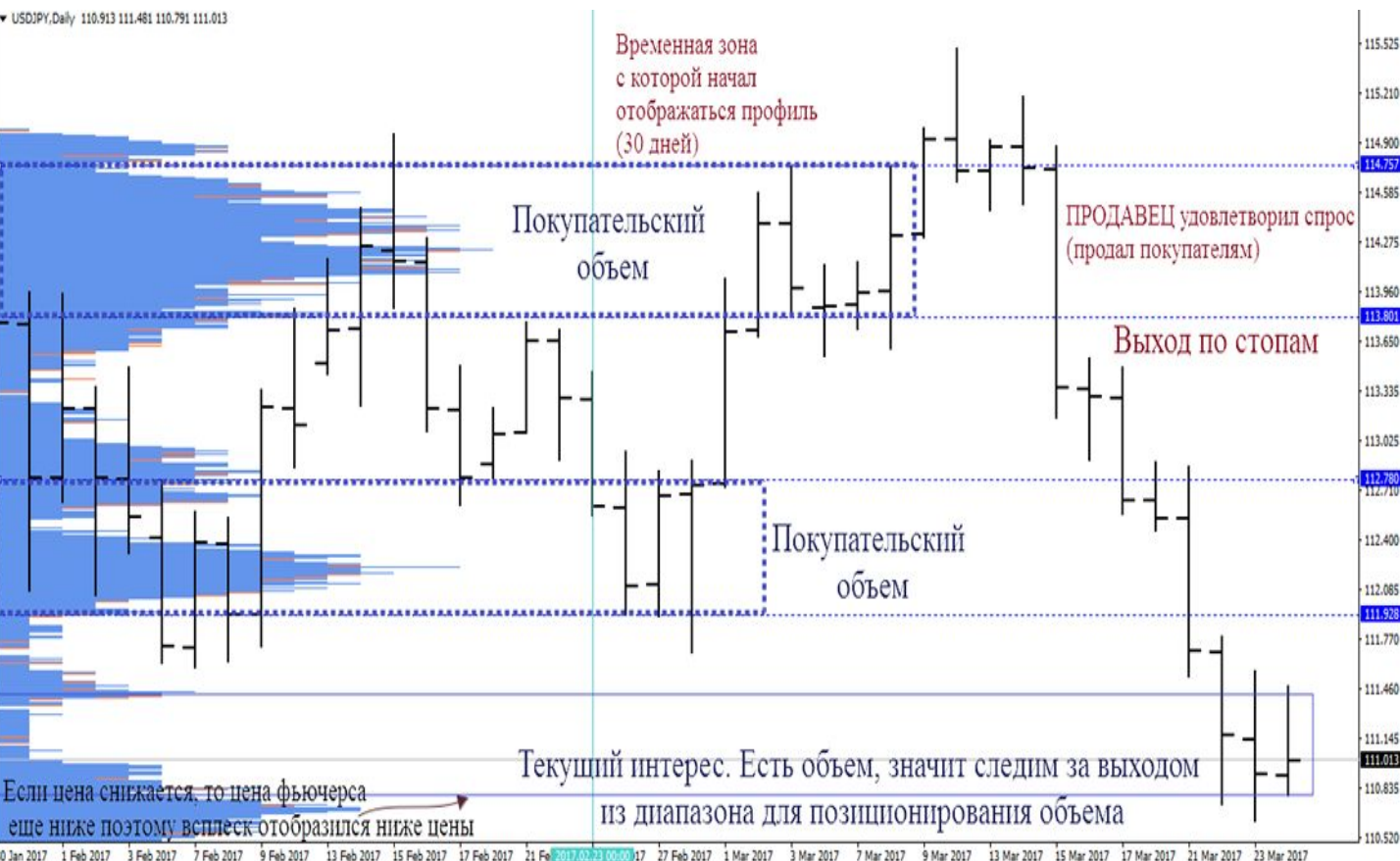
1. Всплески объемов в движении не считаются важными, т.к. в этом случае они зачастую являются фиксацией прибыли (и) или убытков.
2. Основное внимание стоит обращать на объемы проторговок или на остановки движения в течение хотя бы 2-3 дней.
3. Большой всплеск на той или иной границе диапазона позволяет предположить, кто на данный момент контролирует рынок. Соответственно, можно торговать от границы.
4. При всплесках объема внутри диапазона торгуем только при выходе из диапазона.
5. Профили за разные периоды используются для локализации однонаправленного интереса долгосрочного и краткосрочного игроков.
6. Уровень, созданный на объеме, считается самым сильным.
7. При движении цены вверх лучше учитывать объемы, которые позиционировались как продажные (после них цена пошла вниз).
8. При снижении цены лучше учитывать уровни объемов, которые позиционировались как покупочные (после них цена пошла вверх).

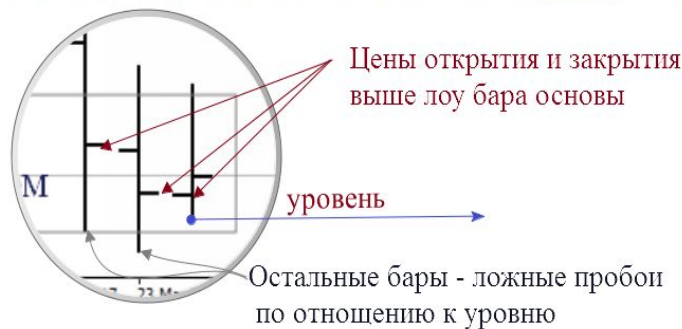
Уровень, где объемы позиционировались как продажные, будет выступать сопротивлением при повышении цены, потому что она, скорее всего, остается для продавца критической. Средняя цена на всю позицию продавца также может оказать сопротивление росту. Необходимо наблюдать за реакцией на уровень.



Уровень, где объемы позиционировались как покупочные, будет выступать поддержкой при снижении цены, т.к. она может быть критической для покупателя.

Уровни, выступающие границами текущего диапазона торгов, при наличии всплеска объема (текущая зона стоимости) требуют позиционирования.





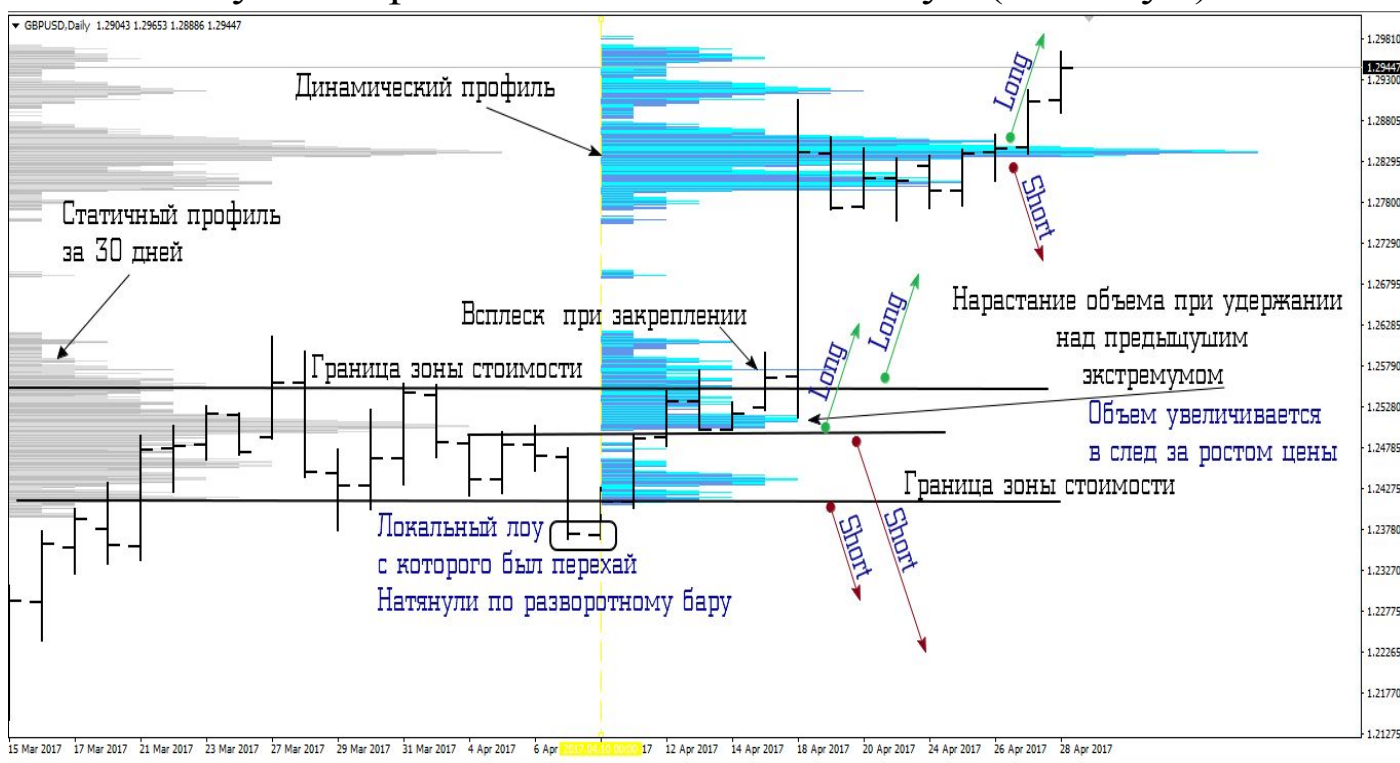
Разберем это на примере. При выходе из прошлой зоны стоимости мы видим всплеск объема на барах остановки. Точка контроля в области low. Почему здесь? Текущая котировка фьючерса отличается от котировки рынка Форекс. Если рыночная цена падает, то котировка находится еще ниже. Поэтому смотрим область и рисуем уровень по самому высокому low бара в области всплеска. Или, если выразиться еще точнее, – по low бара в составе экстремума, который прячет все тела. И верхнюю границу зоны стоимости проводим таким же образом. Торговать следует в направлении тенденции – от верхней границы в шорт, при пробое нижней границы в шорт.

На слом тенденции нет запаса хода: близко предыдущая зона стоимости, в которой продавец удовлетворил спрос покупателей, и можно будет удерживать цену ниже этой области.

При анализе профиля за 30 дней мы можем увидеть отличные уровни. Но, если задуматься, то накопление объема за месяц может оказаться неактуальным в данный момент, поэтому мы включим в анализ динамический профиль. И посмотрим всплески объема на текущий момент в областях исторических сопротивлений и поддержек. А если быть точной, то профиль текущего движения (волны) или проторговки.

Варианты «натяжения» динамического профиля:

1. На точку с которой был обновлен максимум (минимум)

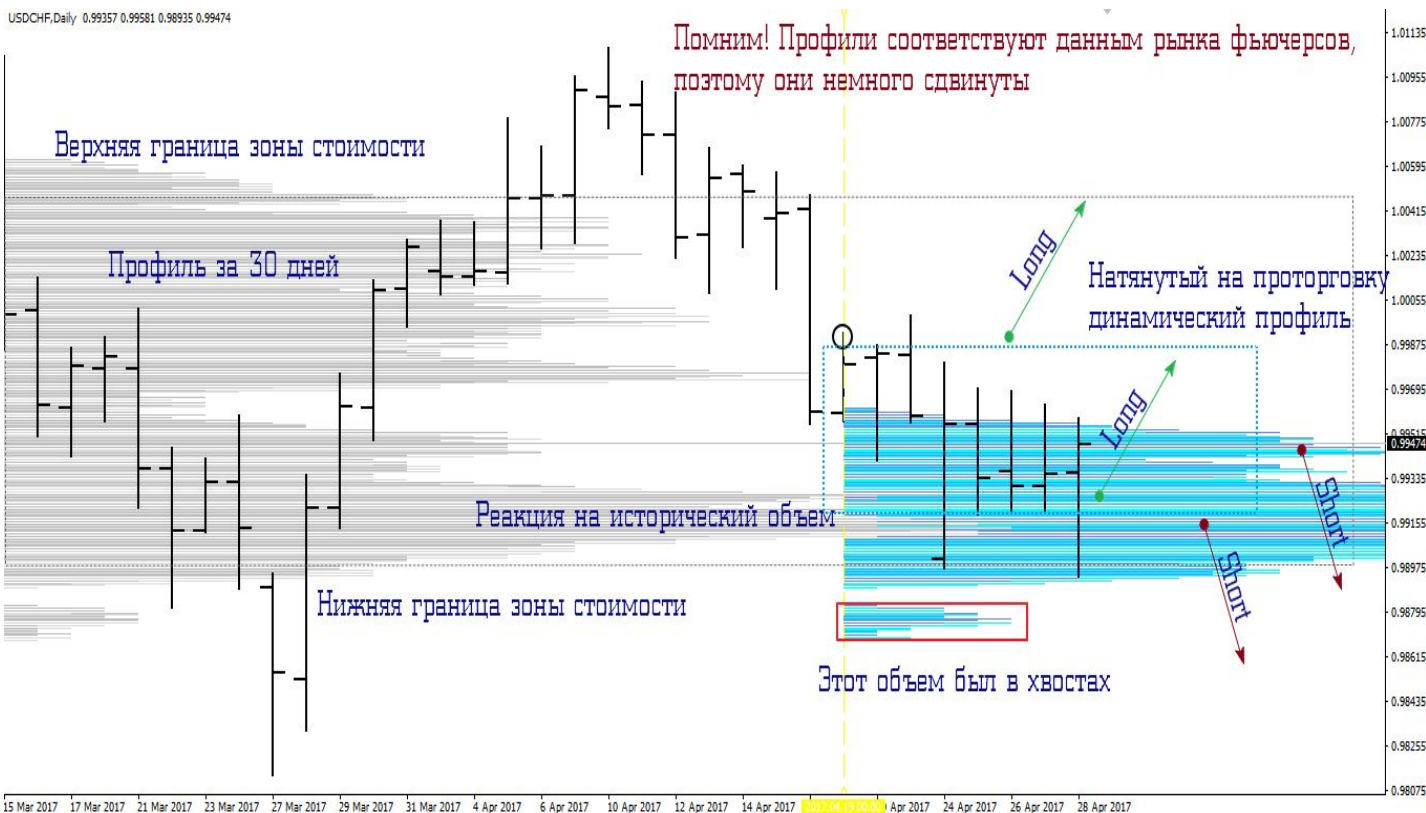


2. Отслеживаем, где по отношению к профилю 30 дней идет накопление объема и как шагает объем.

- Увеличивается ли инициатива при росте цены есть ли объем при удержаниях и при пробое уровня (границы зоны стоимости)

2. Динамический профиль натягивается на начало проторговки и накапливает данные по объему

USDCHEF, Daily 0.99357 0.99581 0.98935 0.99474



Набор позиции и объем в проторговке должен позиционироваться или торговаться предпочтительно в направлении тенденции

Основные принципы:

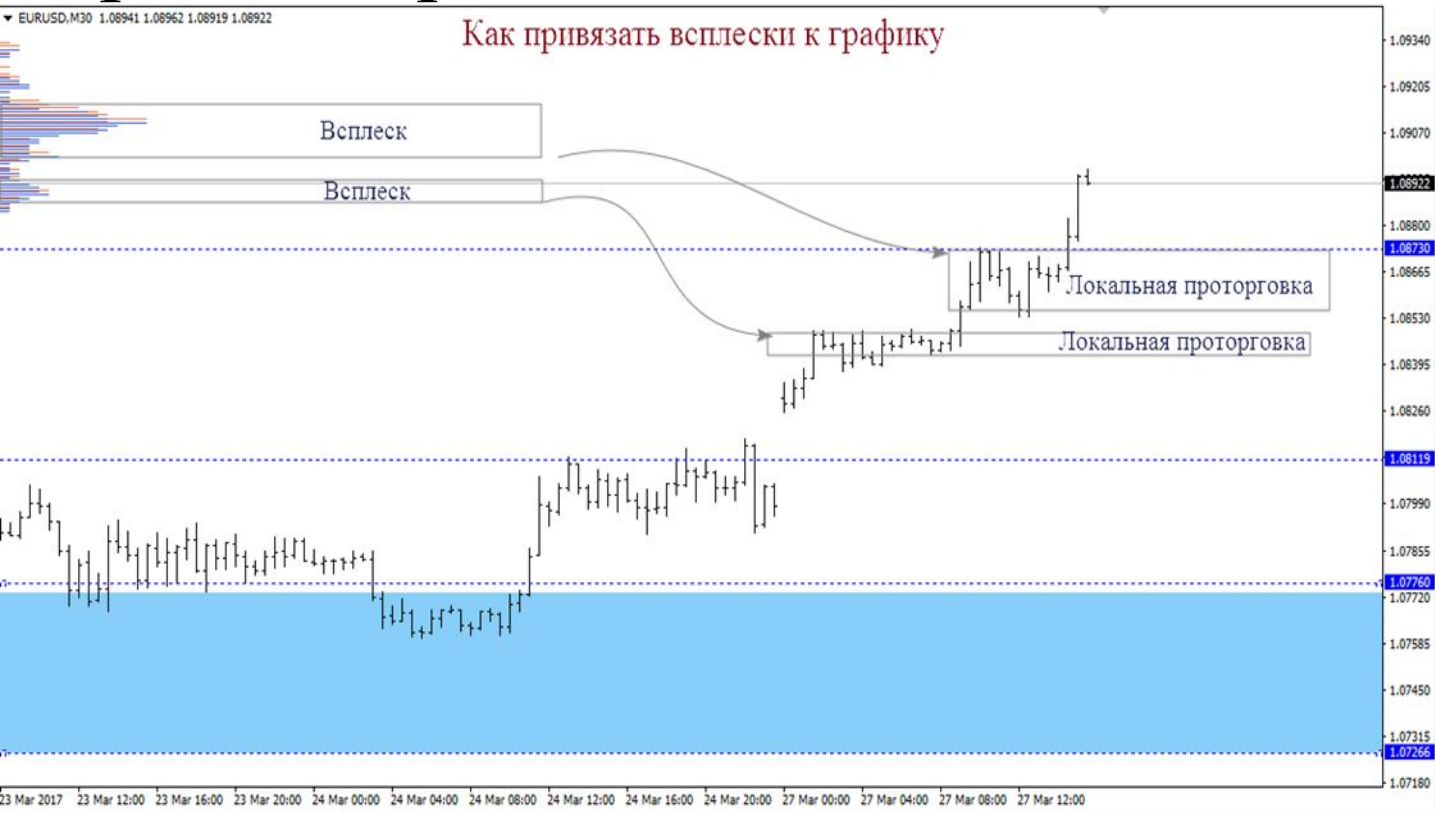
1. Торгуем реакцию на уровни.
2. Торгуем только актуальные уровни (те, на которые в данный момент реагирует цена в виде всплесков объема).
3. При снижении цены (тренд вниз) торгуем при пробое исторических поддержек и от текущих сопротивлений.
4. При росте цены (тренде вверх) торгуем пробой исторических сопротивлений и текущих поддержек.

Как привязать объем к локальной проторговке на примере профиля за 1 день?

Возьмем график фьючерса на евро/доллар и профиль за последние сутки.



А теперь посмотрим график пары евро/доллар

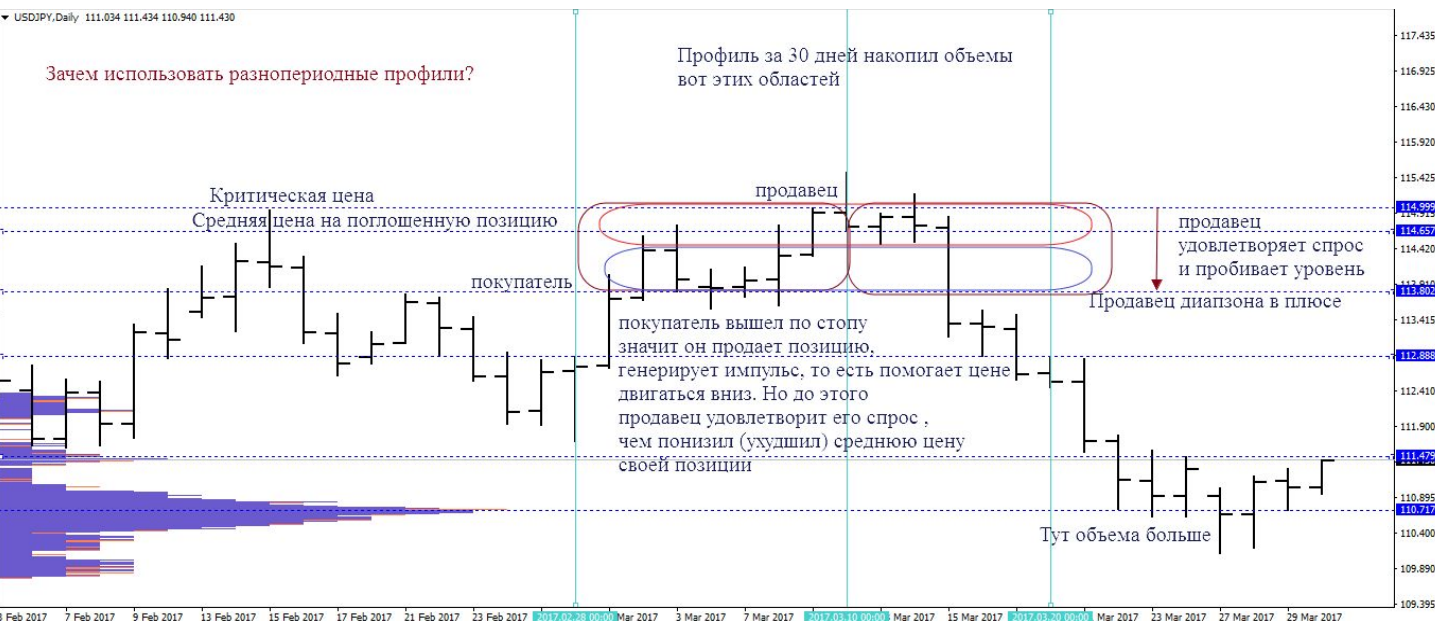


Видите разницу в ценах? Отсюда и отличия в отображении профиля на валютных парах, а данные для него берутся с реальных показателей по объемам фьючерсов.

Смотрите, как отработал диапазон с локальным объемом около дневного уровня



Для чего нужно использовать профили за разные периоды?



1

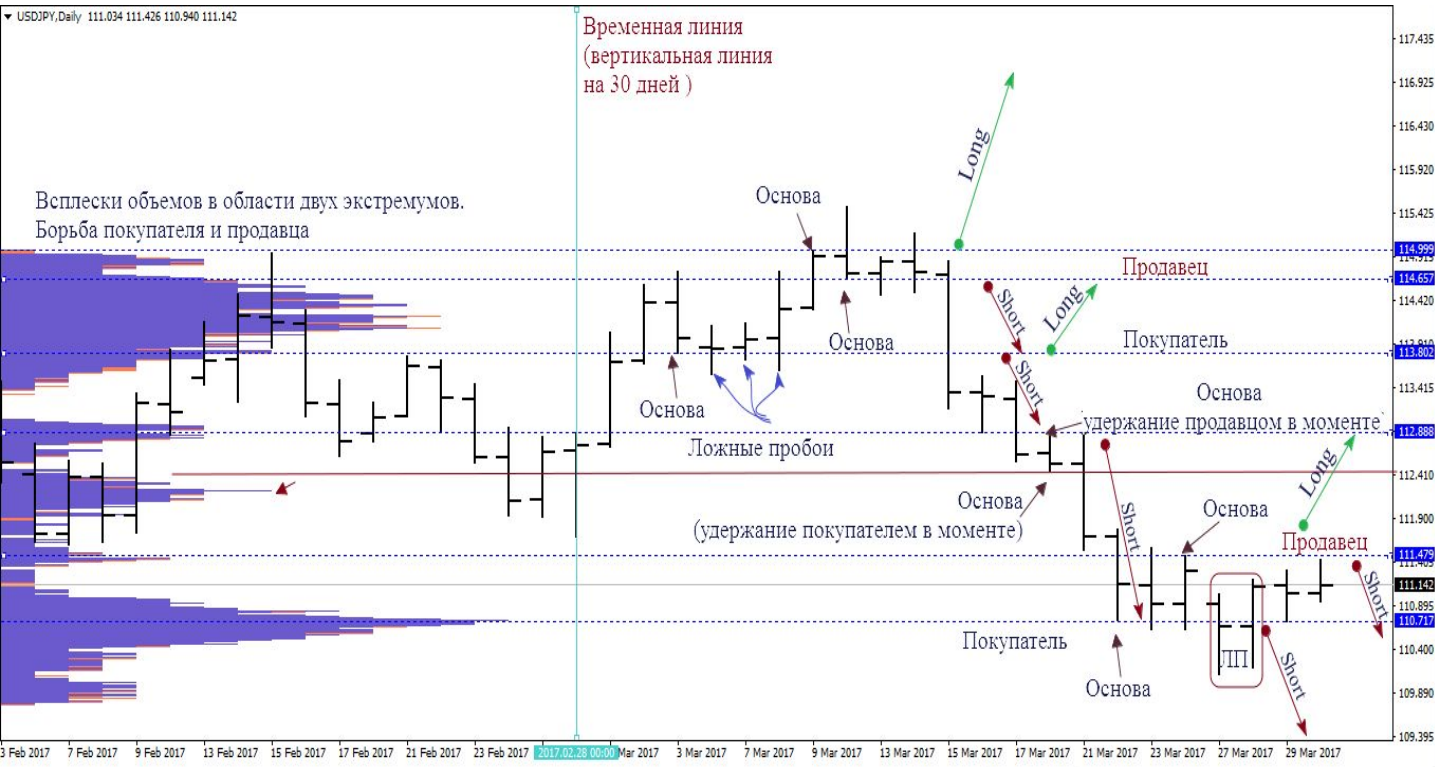
При возврате к области продавца нужно обращать внимание на реакцию цены и объема
цена может реагировать на уровень где был покупатель по причине защиты прибыльной позиции
цена может реагировать на среднюю цену позиции



Интересы долгосрочного игрока, в идеале, должны совпадать с текущим интересом

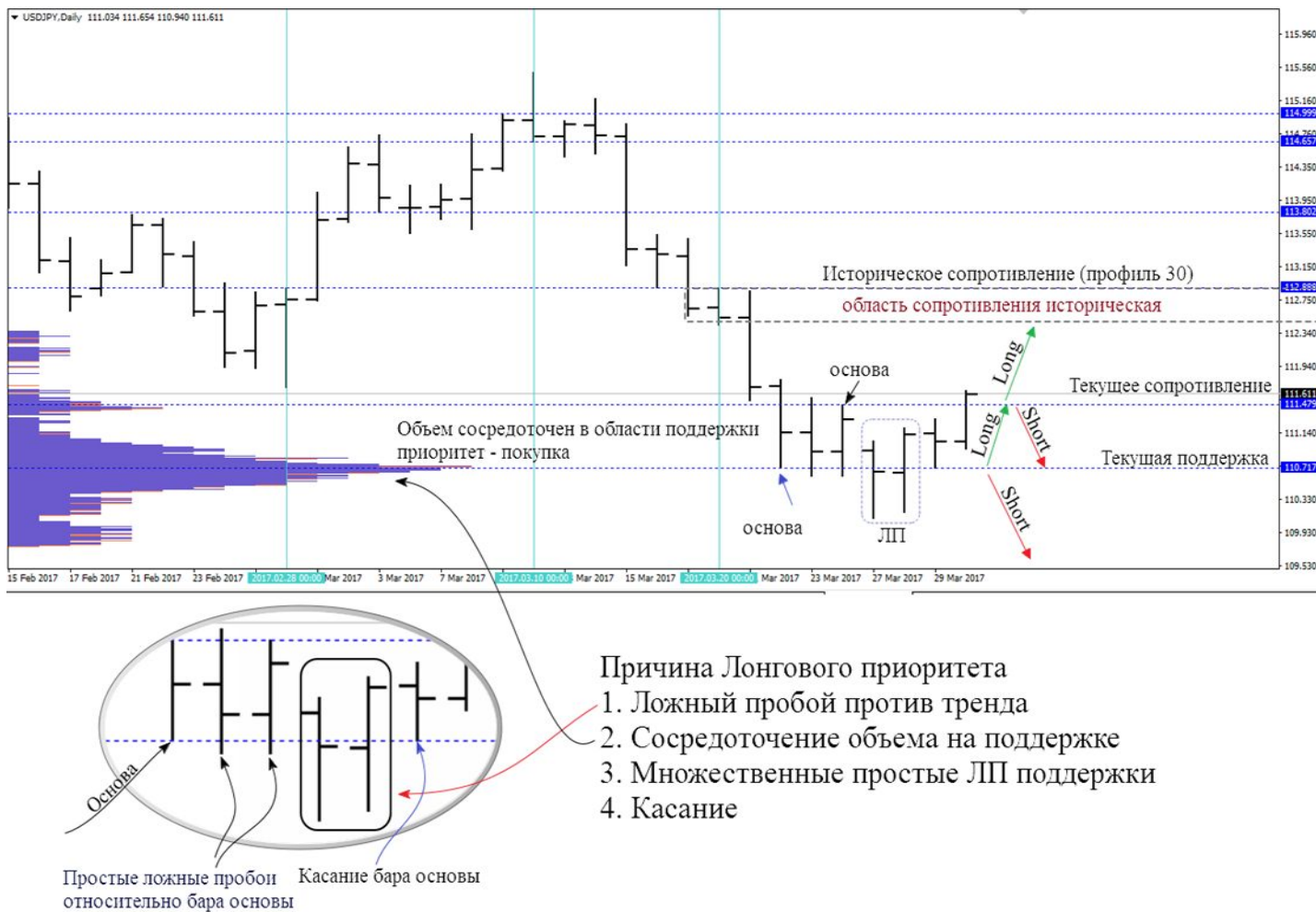
Алгоритм

1. Ставим на график инструмента профиль за 30 дней.
2. Отмечаем временную линию (вертикальную) для определения момента, с которого индикатор начинает накапливать данные (месяц назад).

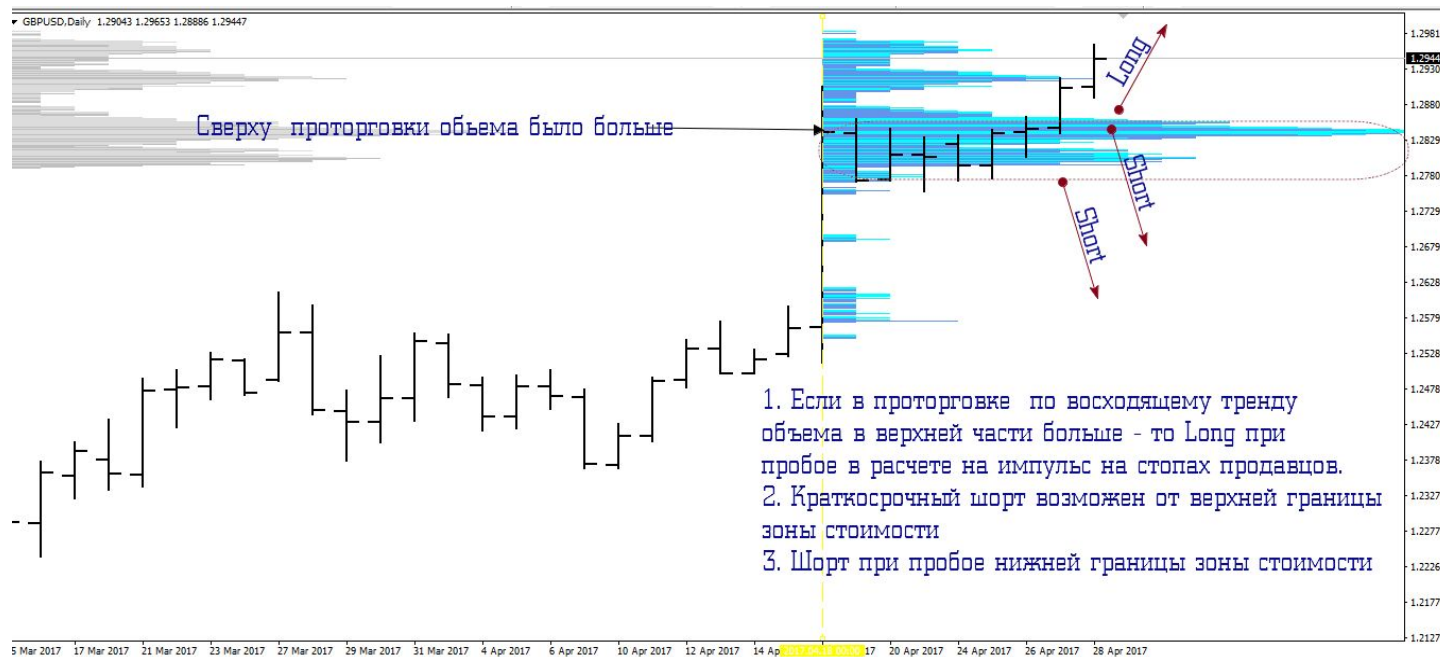


3. Порядок анализа дневных уровней с периодом профиля 30 дней:
 - Привязка всплесков к экстремумам.
 - Сверху продавцы – будут выходить по стопам при пробое верхнего уровня (верхней границы канала), что сгенерирует движение в Long.
 - Снизу покупатели – будут выходить из позиций при пробое нижнего уровня, что с высокой вероятностью сгенерирует движение в Short.
 - Если цена возвращается после пробоя и закрытия обратно в диапазон и закрепляется, то это означает ложный пробой.

Например Профиль 10 дней для отражения текущей ситуации



Динамический профиль:



5. Общий алгоритм работы с уровнями:

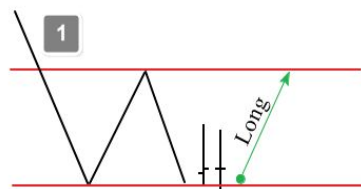
- Покупка от поддержек.
- Покупки при пробое и закреплении за сопротивлением.
- Продажа при пробое сопротивления.
- Продажа при реакции на сопротивление.

6. Учитывать самые большие пики объема внутри диапазонов

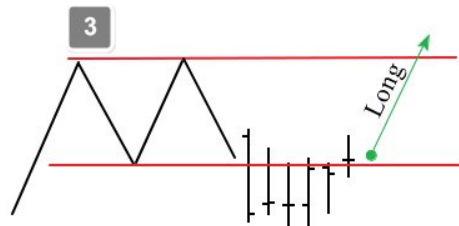
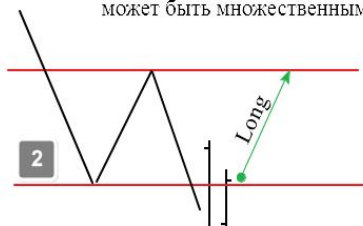
- Где объем?
- Какая тенденция?

Паттерны дневного графика относительно уровней

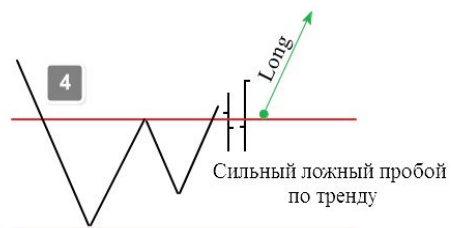
На покупку



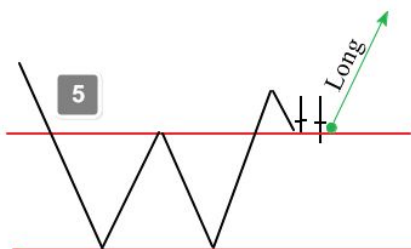
Простой ложный пробой
может быть множественным



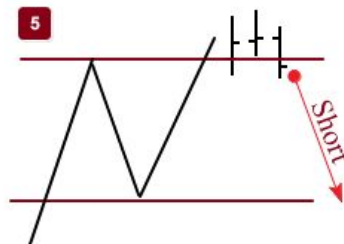
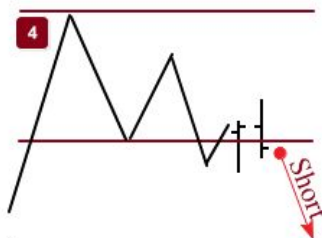
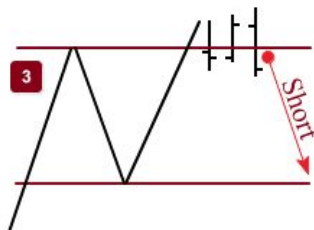
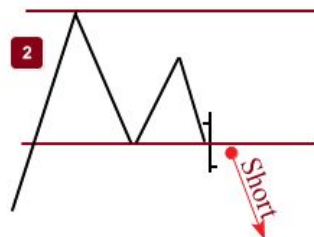
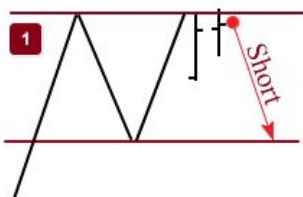
Сложный ложный пробой



Сильный ложный пробой
по тренду



На продажу



Ищите только

Сильные формации.

Актуальные уровни.

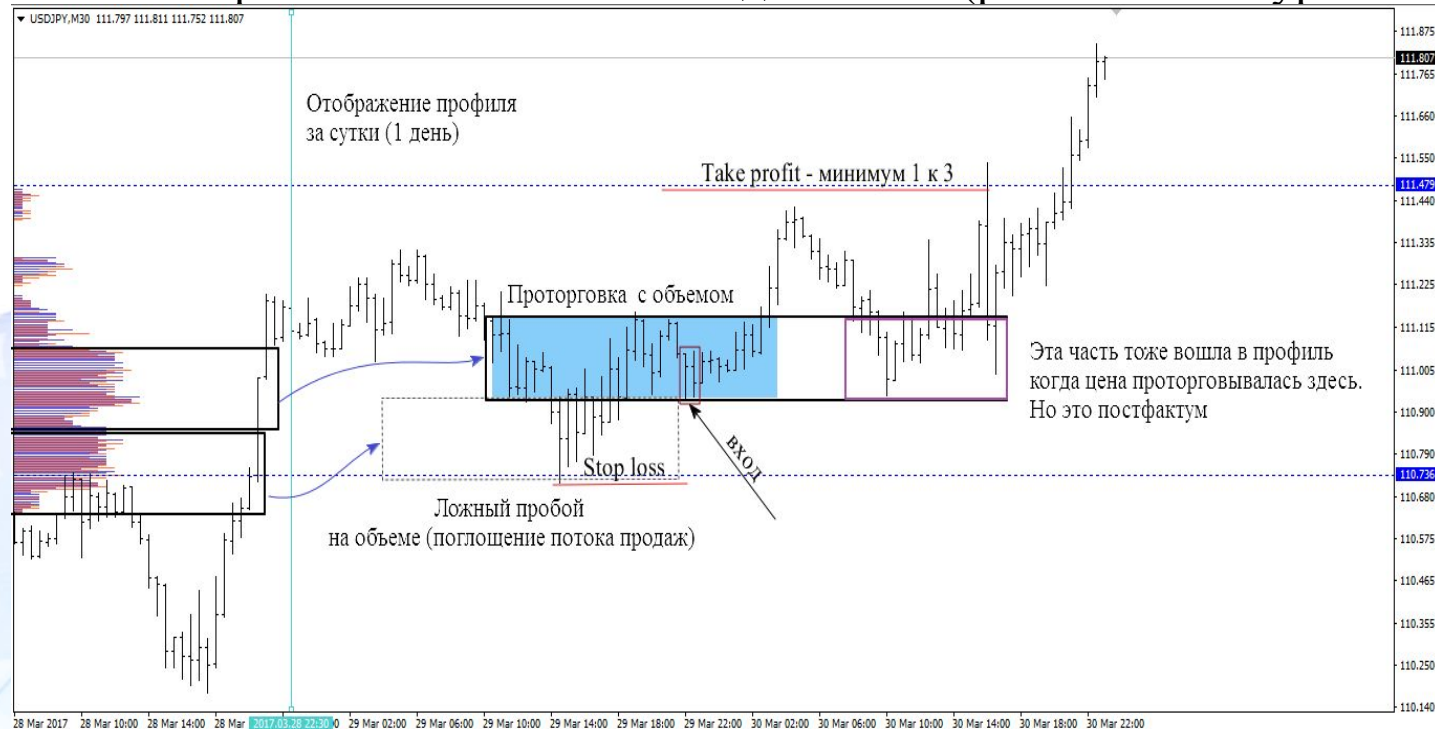
Поиск точки входа в покупку

1. Есть паттерн дневного графика в покупку.
2. Цена не отошла от уровня на расстояние большее, чем 15 % от своего технического АТР.
3. Есть запас хода до следующего уровня более, чем 4 размера стопа.
4. Имеется узкая консолидация на объеме (динамический профиль за сутки или статичный).
5. Сильный (двумя барами) или сложный (n-ным количеством баров) ложный пробой верхней границы консолидации, желательно на объеме.
6. Возврат в область консолидации.
7. Вход осуществляется лимитным ордером Buy limit.
8. Ордер выставл



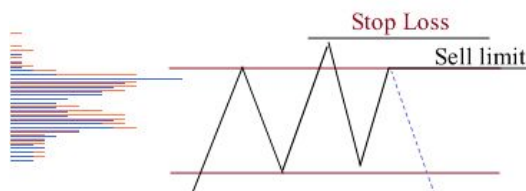
9. Stop loss за ложный пробой.

10. Take profit составляет 80% от диапазона (расстояние от уровня



Поиск точки входа в продажу

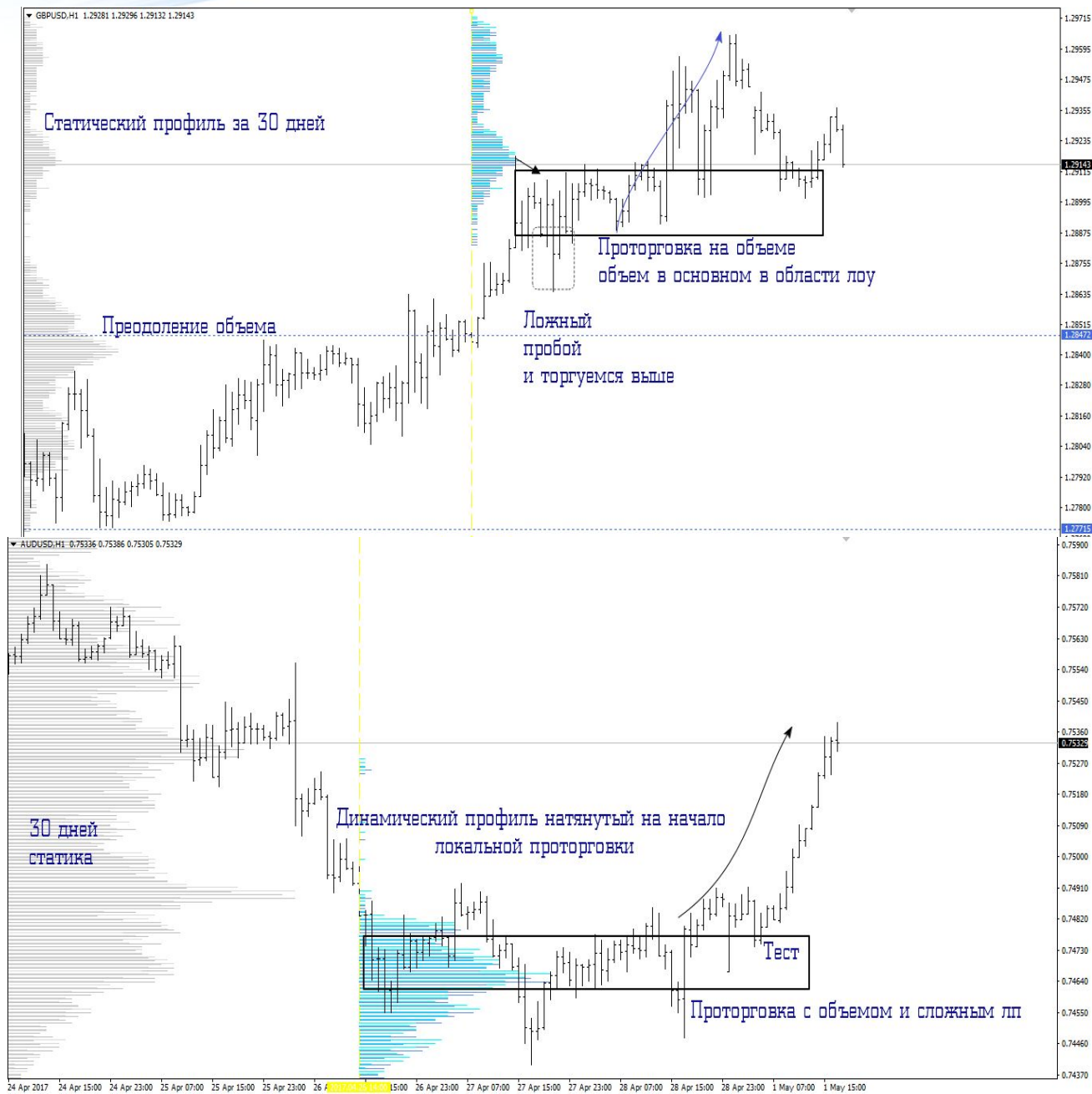
1. Есть паттерн дневного графика в продажу.
2. Цена не отошла от уровня на расстояние большее, чем 15 % от своего технического АТР.
3. Есть запас хода до следующего уровня более, чем 4 размера стопа.
4. Имеется узкая консолидация на объеме (динамический профиль за сутки или статичный).
5. Сильный (двумя барами) или сложный (n-ным количеством баров) ложный пробой нижней границы консолидации, желательно на объеме.
6. Возврат в область консолидации.
7. Вход осуществляется лимитным ордером Sell limit.
8. Ордер выставляется после теста границы локальной консолидации.



9. Stop loss за ложный пробой.

10. Take profit составляет 80% от диапазона (расстояние от уровня





Пример точки входа с 2
видами индикаторов

Управление капиталом

1. Максимальный Stop Loss составляет 20 пунктов. Рекомендуемый риск на позицию – 0,3 % от размера депозита.
2. Максимальная потеря в день – 0,6 %.
3. Максимальное количество убыточных трейдов в день – два.
4. Независимо от того, был ли у вас один хороший трейд, и вы на нем заработали 1:3 и более, после 2-х убыточных трейдов вы уходите с рынка.
5. Риск на неделю – от 1,8 до 2%.
6. Лимит убыточных сделок в неделю – 6.
7. Риск на месяц – не более 8 % (при этом лимит убыточных операций с учетом повторных заходов составляет 24).
8. При закрытии двух позиций в плюс увеличиваете риск в 2 раза.
9. Если закрываете сделку с увеличенным лотом в плюс, то повышаете объем в 2 раза и т.д.
10. При получении Stop loss – возвращаете риск в рамки, определенные торговой стратегией.



Мы желаем Вам
комфортной
торговли!