

2. Доходный теханализ

2.1 Тренды

ЧТО ДАЕТ ТРЕНД?

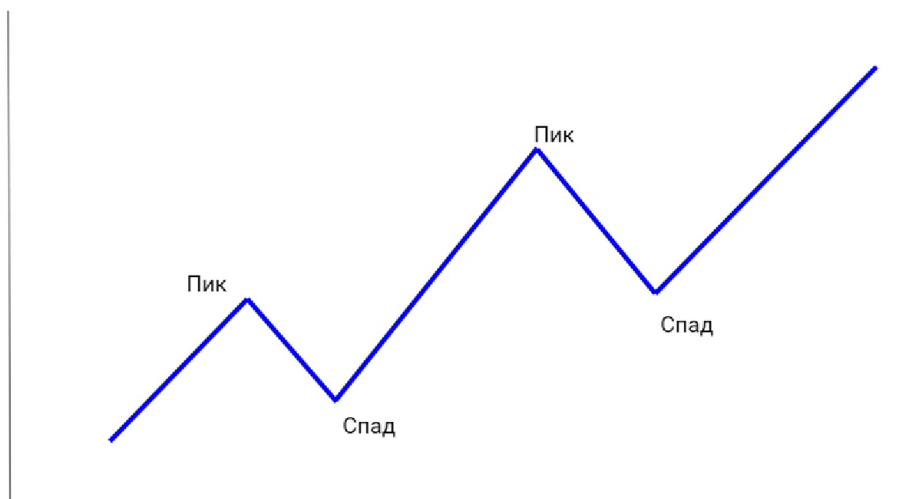
1. Защиту позиции.
2. Предупреждает об изменении движения цены.
3. Помогает максимизировать прибыль.

ТРЕНД — это направление движения рынка.

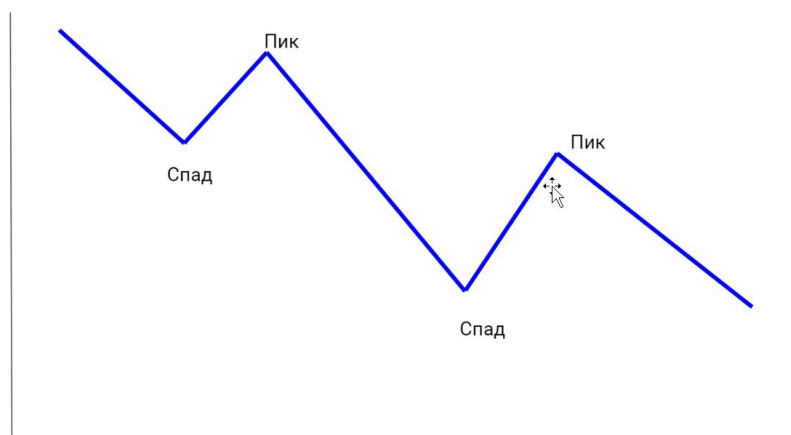
Цена движется серией зигзагов. И череда последовательных волн, с ярко выраженными пиками является определением тренда.

Направление пиков и минимальных точек образует тренд. То, куда они будут двигаться (вверх, вниз или в сторону) определит характер тренда.

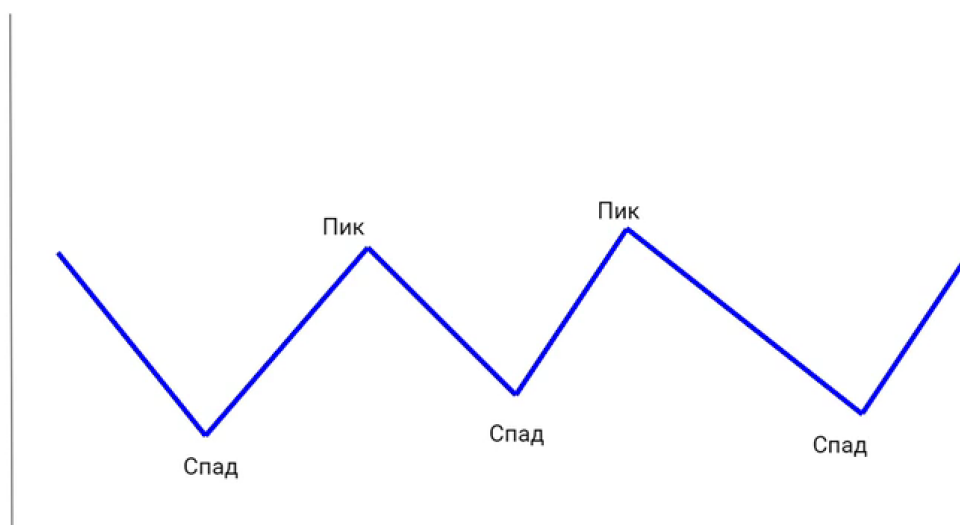
Восходящий тренд — это серия последовательно повышающихся пиков и спадов.



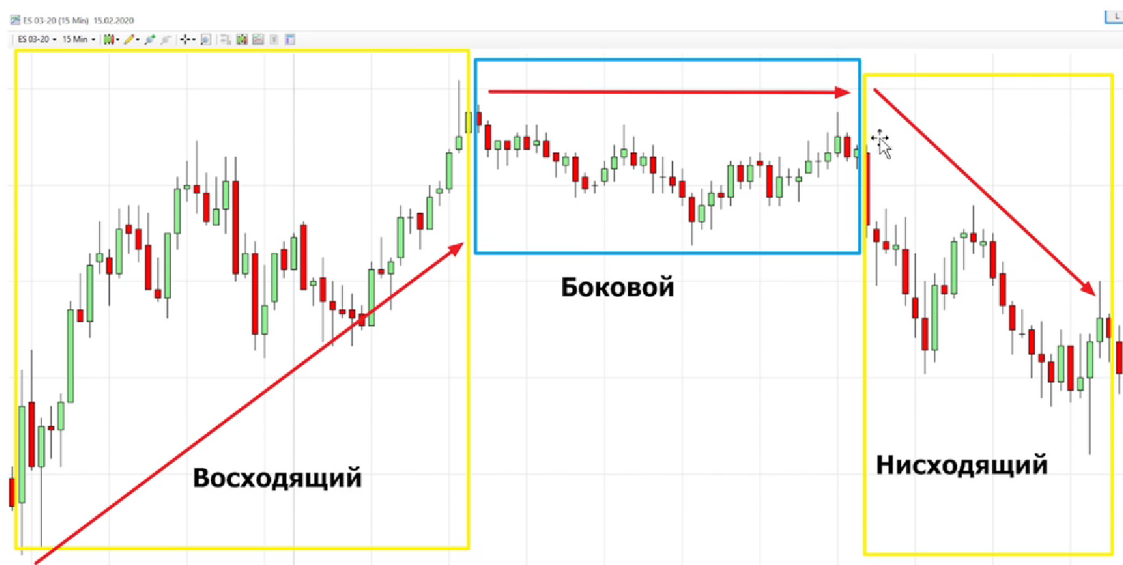
Нисходящий тренд — это серия последовательно понижающихся пиков и спадов.



Горизонтальные пики и спады — это горизонтальный или боковой тренд.



На графике эти движения выглядят таким образом:



ВИДЫ ТРЕНДА:

- Основной
- Промежуточный
- Краткосрочный

и все они взаимодействуют между собой.

Каждый тренд становится составной частью следующего, более крупного тренда. Крупный тренд состоит из более мелких трендов.

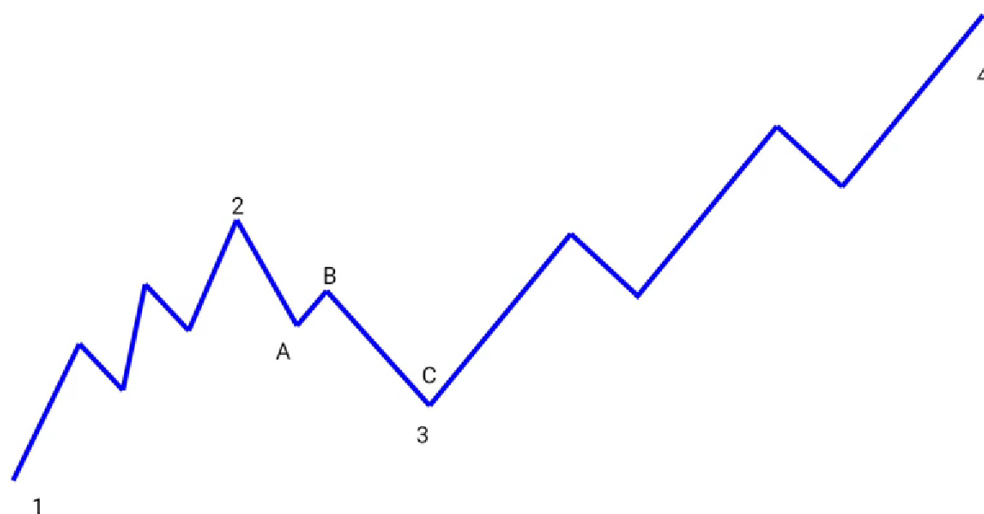
Промежуточный тренд в масштабе основного, представляет собой коррекцию.

Коррекция состоит из более мелких колебаний — краткосрочных взлетов и падений.

И все это на графике повторяется многократно.

Каждый тренд, являющийся частью следующего крупного тренда, сам состоит из небольших трендов.

Так схематично это можно отобразить на графике:



3 вида тренда: основной, вторичный и краткосрочный.

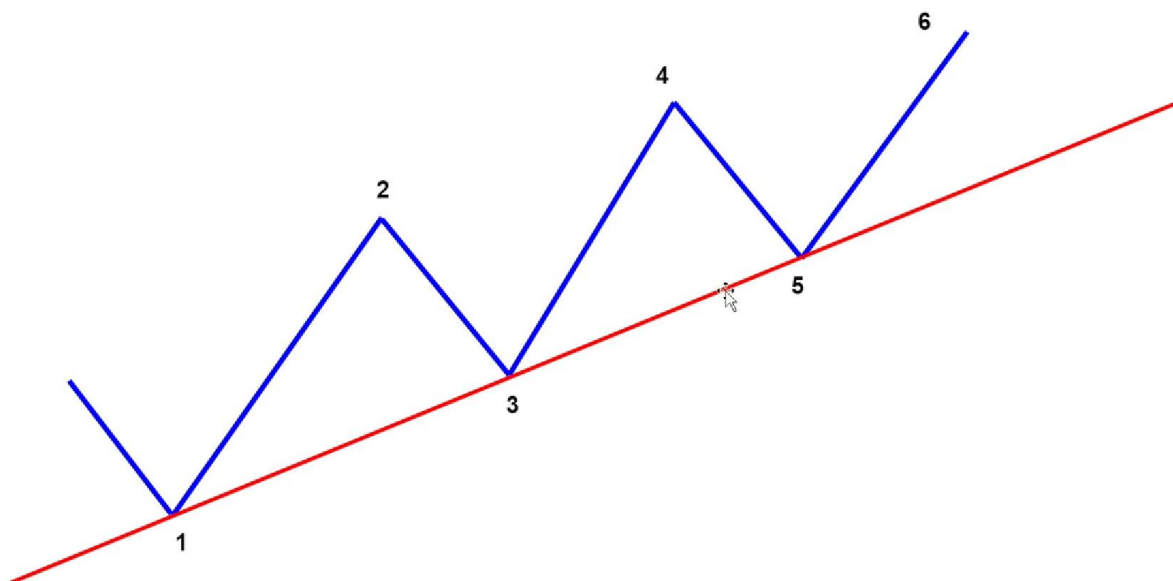
Точки 1,2,3,4 — это основной тренд.

Кривая 2-3 — вторичная коррекция в рамках основного тренда.

Каждая вторичная волна делится на краткосрочные тренды. Например, вторичная кривая 2-3 состоит из малых кривых А-В-С.

ПОСТРОЕНИЕ ЛИНИЙ ТRENDA

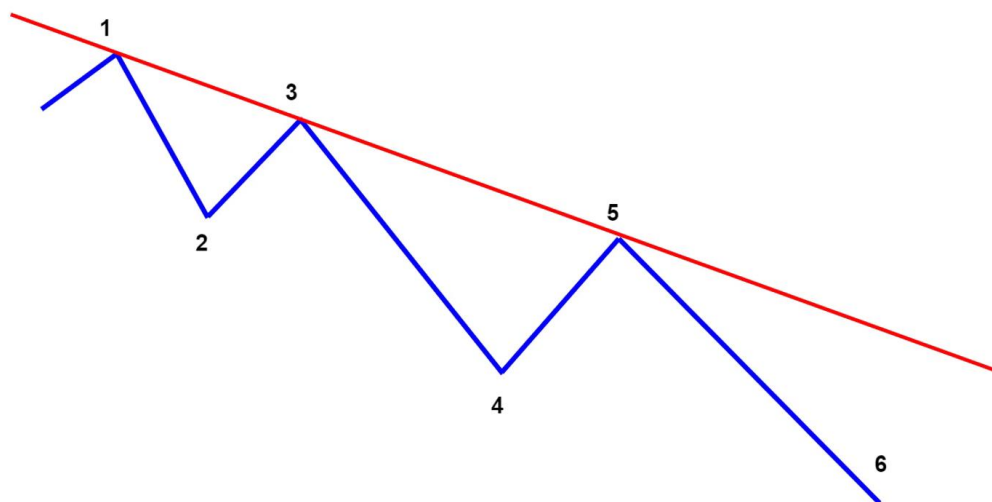
Восходящая линия тренда — это прямая, прочерченная вправо вверх через последовательно возрастающие точки спадов (возрастающие минимумы)



На графике это выглядит так:



Нисходящая линия тренда — это прямая, прочерченная вправо вниз через последовательно убывающие точки пиков (понижающиеся максимумы)



На графике это выглядит так:



Чтобы нарисовать линию тренда — необходимо выбирать минимум две точки для построения прямой.

Линии тренда можно корректировать.

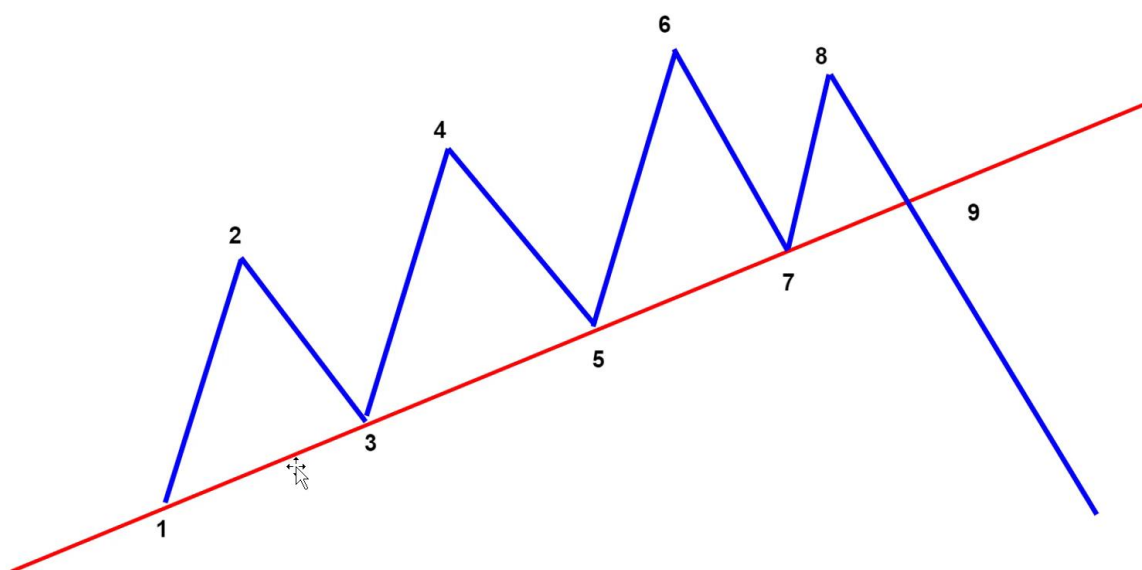
Допустимы небольшие нарушения (1-2 тика).

«Скорее всего тренд продолжит свое движение» — это базовое правило, которое трейдеры берут в расчет, когда принимают решение о том, чтобы открыть или закрыть позицию.

Принципиально важный момент — линии тренда всегда предупреждают об изменении направления движения.

Очень часто нарушение линии тренда является способом распознавания изменения направления движения.

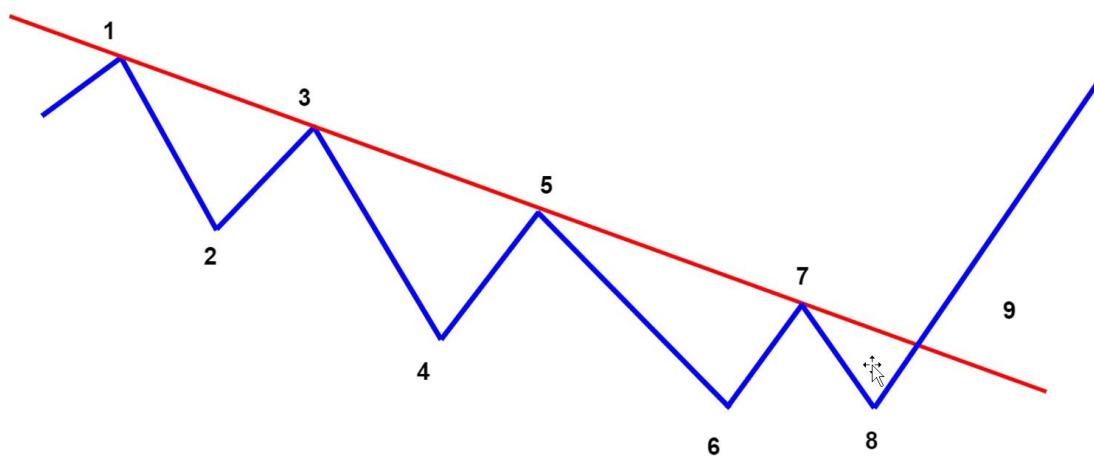
Смена тренда с восходящего на нисходящий:



Как это выглядит на графике:



Смена тренда с нисходящего на восходящий:



Как это выглядит на графике:



Когда цена нарушила линию тренда, важно задуматься о том, чтобы закрыть сделку, которая открывалась в сторону тренда либо планировать открытие сделки в противоположную сторону.

ВАЖНЫЕ ОСОБЕННОСТИ ПРИ РАБОТЕ С ТРЕНДАМИ

1. Как правило, цена нарушая линию тренда не начинает сразу идти в обратном направлении, а делает еще несколько «ложных» движений.



Как это выглядит на графике:



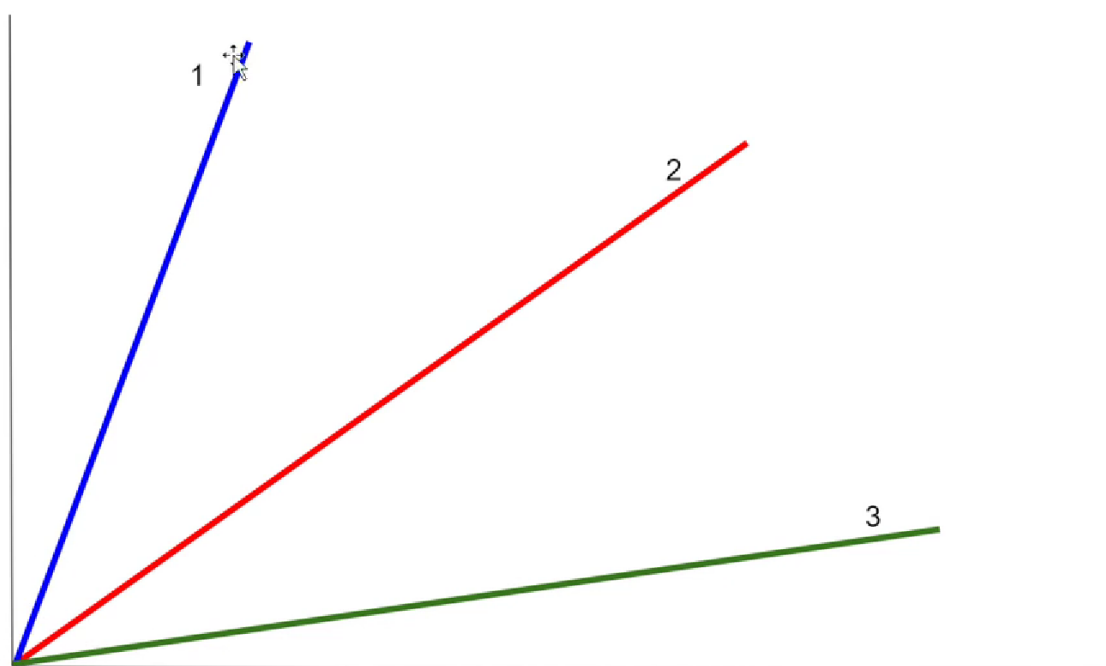
2. Крутизна трендовой линии.

В большинстве случаев наиболее значимые линии тренда идут под средним углом в 45 градусов. Скорее всего это долгосрочное движение.

Если линия тренда слишком крутая, значит цены растут слишком быстро и этот темп, скорее всего, сохраниться не долго.

Если же линия тренда слишком пологая, то это может говорить о слабости и ненадежности тренда.

Схематично это можно изобразить так:



1 — данное движение продлится не долго

2 — надежное устойчивое движение

3 — вялое затяжное движение

2.2 УРОВНИ

Зачем знать уровни?

Уровни помогают определить место входа.

По уровням видно, где пора выходить (фиксировать прибыли или убыток)

Понимание уровней учит прогнозировать дальнейшее движение опираясь на факты.

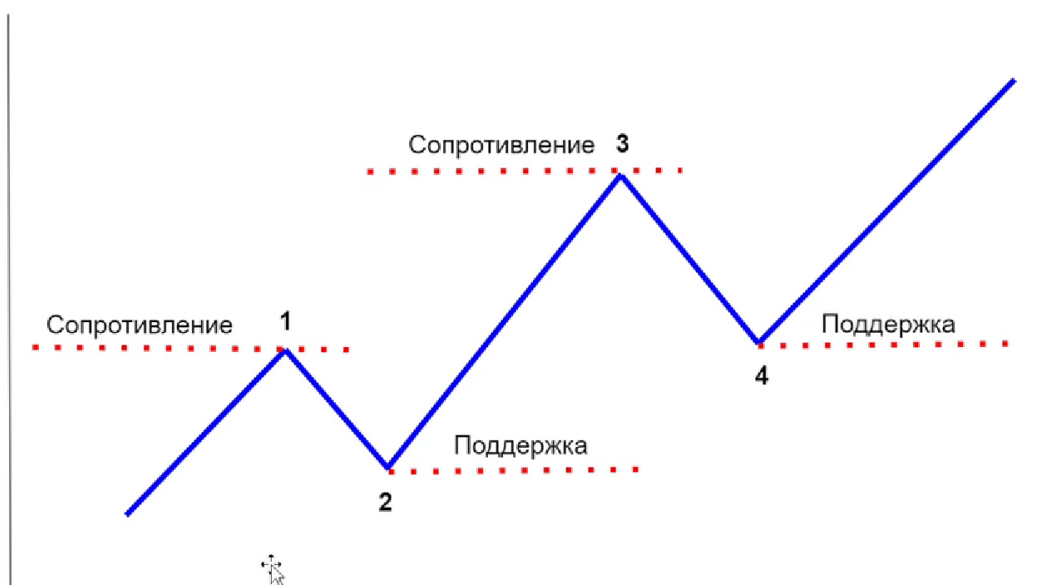
ЧТО ТАКОЕ УРОВНИ ПОДДЕРЖКИ И СОПРОТИВЛЕНИЯ?

Точки минимального уровня цен называются поддержкой.

Поддержка — это уровень или область на графике ниже уровня рынка, где покупательский спрос достаточно силен для того, чтобы перекрыть избыточное предложение. Спад прекращается и цены опять начинают расти.

Обычно уровень поддержки заранее определяется по уровню предыдущего спада.

Схематично это выглядит так:



Как это выглядит на графике:

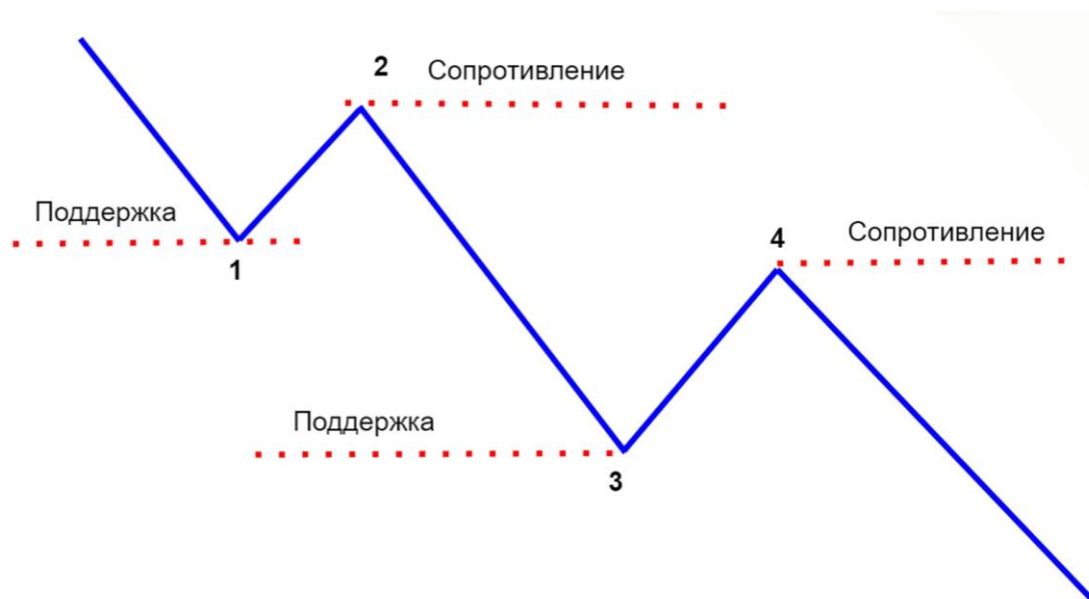


Каждое сопротивление впоследствии становится уровнем поддержки.

Сопротивление противоположно поддержке и представляет собой уровень или область цен над рынком, где предложение превышает спрос и цены падают.

Обычно уровень сопротивления определяется предыдущим пиком.

Схематично это выглядит так:

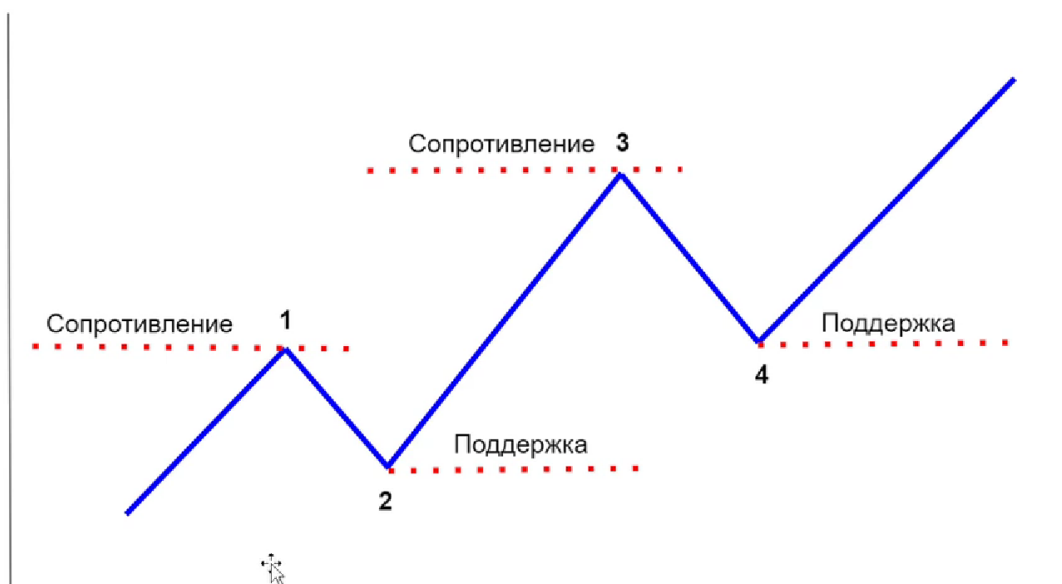


Как это выглядит на графике:



В восходящем движении уровни поддержки и сопротивления повышаются.

Каждое следующее сопротивление выше, каждая следующая поддержка выше:



В восходящем движении уровни сопротивления показывают его паузы, которые обычно удается преодолеть.

В нисходящем движении уровни поддержки не в состоянии постоянно сдерживать спад, но могут временно ему препятствовать.

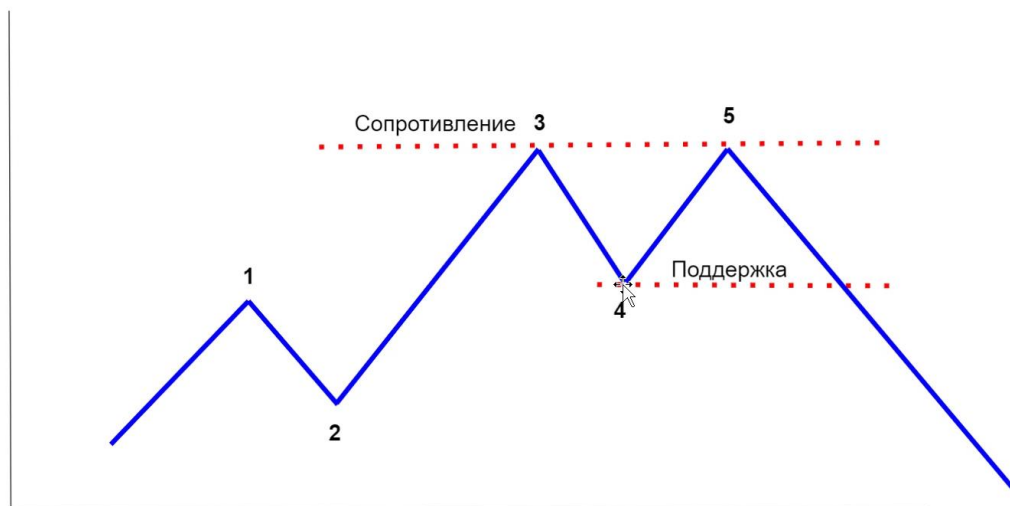
Для продолжения нисходящего движения необходимо, чтобы каждый последующий пик и спад (уровни поддержки и сопротивления) был выше предыдущего.

Если корректирующий спад достиг уровня предыдущего, то это может означать завершение восходящего тренда или, как минимум, переход к боковому движению.

Если уровень поддержки нарушен, то вероятен разворот в обратную сторону.

Каждая проверка уровня сопротивления является для тренда критическим моментом.

Пример полного изменения тренда:

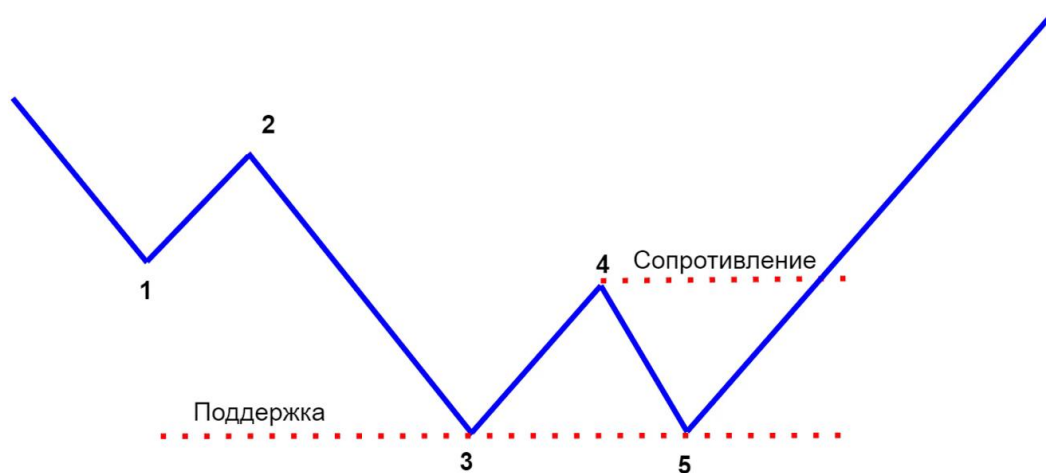


Это неспособность цен в точке 5 превысить уровень предыдущего пика (точка 3) вместе с последующим падением ниже уровня 4 (тип двойная вершина).

Как это выглядит на графике:



Пример обратного движения:



Как это выглядит на графике:



КАК УРОВНИ МЕНЯЮТСЯ РОЛЯМИ

Это самый малоизученный аспект.

Всякий раз, когда уровень поддержки или сопротивления превышает значительную величину, они меняются ролями.

Причина: психология, которая стоит за созданием уровней поддержки и сопротивления.

Цены не просто так останавливаются в точках поддержки и сопротивления — есть определенные причины. И эти причины лежат в психологии взаимоотношений участников рынка.

ПСИХОЛОГИЯ ПОДДЕРЖКИ И СОПРОТИВЛЕНИЯ

Существует несколько участников рынка:

- ◆ те, кто покупает
- ◆ те, кто продает
- ◆ неприсоединившиеся (вышел из сделки или еще не вошел в сделку)

В чем секрет психологии взаимоотношений?

Представим себе такую ситуацию: рынок растет с области поддержки.

Покупатели довольны (но жалеют, что не взяли больше), а продавцы осознали или подозревают, что они не на той стороне.

На решения, которые примут люди, влияет насколько далеко ушел рынок от уровня поддержки.

Продавцы очень надеются, что рынок вернется и они выйдут без убытков.

Неприсоединившиеся делятся на две группы: тот, кто не открывал позицию и тот, кто закрыл длинную позицию (сидят и злятся, мечтают еще об одном шансе).

Все сидят и решают покупать при следующем снижении цены — они очень заинтересованы в области поддержки.

Чем больше активность в области поддержки, тем значимее он становится.

Как определяется уровень активности:

- ♦ время, проведенное на уровне
- ♦ динамика (активность взаимодействия покупателей и продавцов)
- ♦ объем (какой объем лотов торгового инструмента там прошел)

Чем дольше период пребывания цен в области поддержки или сопротивления, тем большее значение приобретает эта область.

Может быть и обратная ситуация: цены начали понижаться и опустились ниже предыдущей области поддержки.

Все, кто купили в области поддержки, понимают, что ошиблись.

Брокеры будут требовать увеличение залога (нужно или закрываться или увеличивать средства для обеспечения).

Заявки на покупку станут заявками на продажу.

Поддержка становится сопротивлением.

Ценовые модели работают, потому, что представляют картины реальных действий участников рынка.

Графический анализ изучает психологию людей и реакцию трейдеров на меняющиеся условия рынков.

Существуют психологические причины того, почему на графике видно уровни поддержки и сопротивления. Это прямое отражение поведения участников рынка.

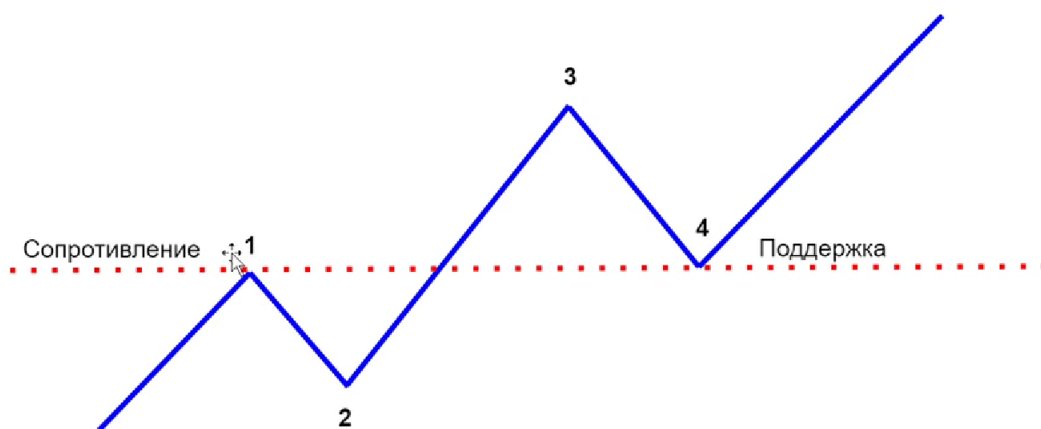
ПОДДЕРЖКА СТАНОВИТСЯ СОПРОТИВЛЕНИЕМ И НАОБОРОТ

В условиях восходящего тренда уровни сопротивления, которые были преодолены на значительную величину, становятся уровнями поддержки.

Обратите внимание, когда сопротивление в точке 1 превращено, оно становится поддержкой в точке 4.

Предыдущие пики выполняют функцию поддержки для последующих коррекций.

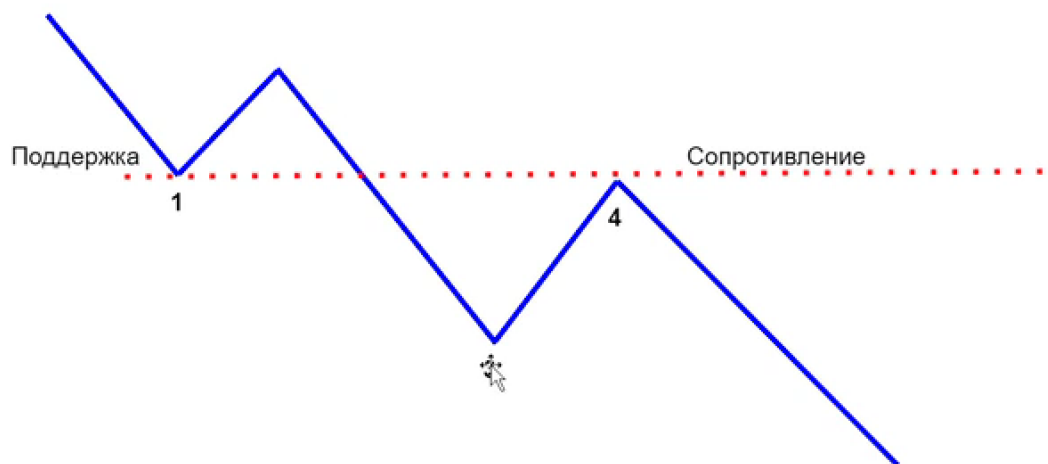
Схематично это выглядит так:



В условиях нисходящего тренда преодоленные уровни поддержки становятся уровнями сопротивления для последующих взлетов цен.

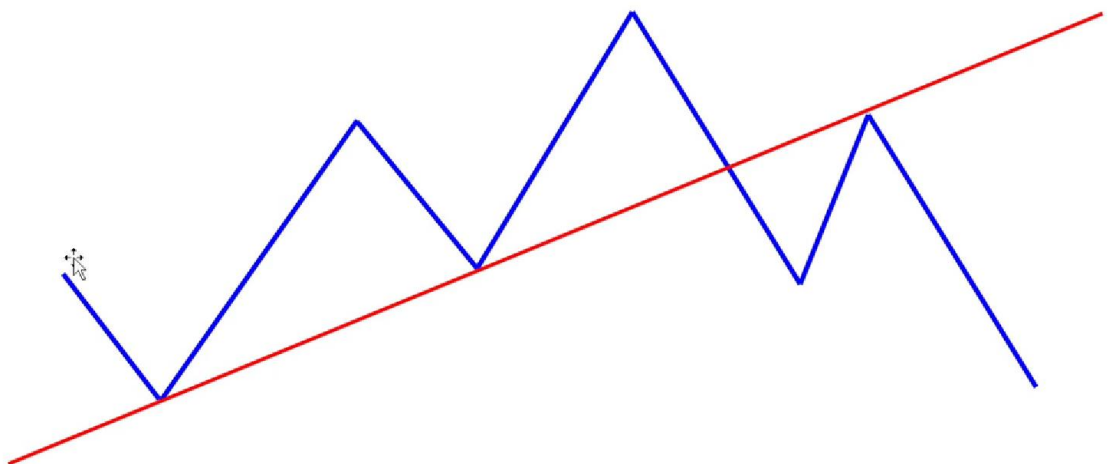
Обратите внимание, бывший уровень поддержки в точке 1 становится уровнем сопротивления в точке 4.

Схематично это выглядит так:



КАК ЛИНИИ ТРЕНДА МЕНЯЮТСЯ РОЛЯМИ

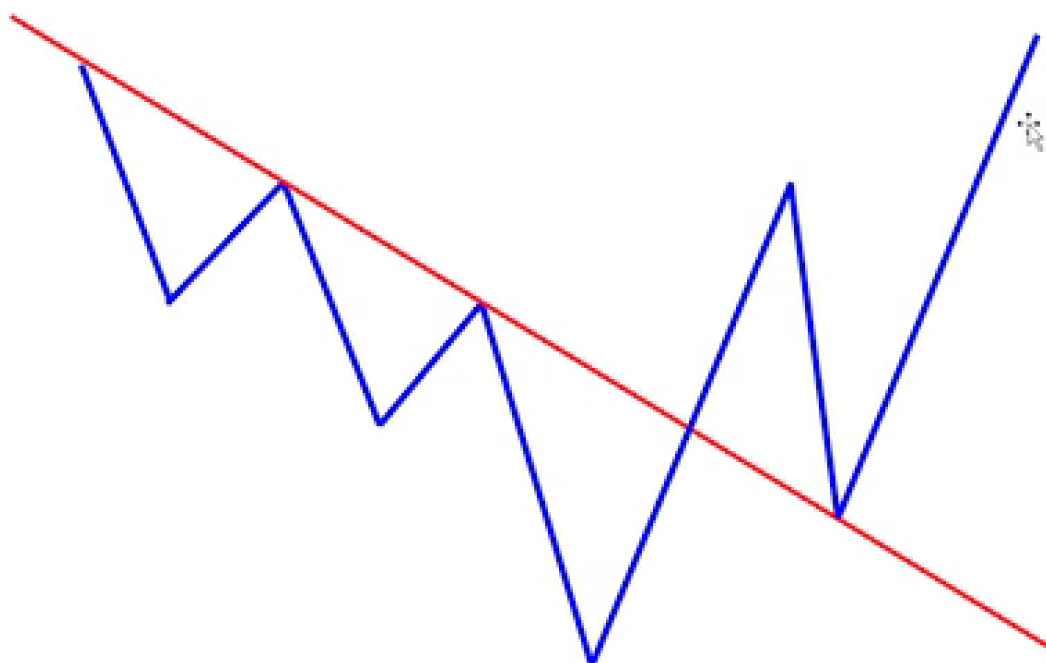
Восходящая линия тренда (линия поддержки) после существенного прорыва становится линией сопротивления:



На графике это выглядит так:



Нисходящая линия тренда (линия сопротивления), будучи нарушенной на значительную величину, превращается в линию поддержки:



На графике это выглядит так:



ВАЖНО!

ВСЕГДА СМОТРЕТЬ ГДЕ БЛИЖАЙШИЙ УРОВЕНЬ СЛЕВА!

Уровень слева помогает определить как точку входа, так и точку выхода из сделки.

Цена будет двигаться в обратном направлении скорее всего до ближайшего уровня слева.

Линии поддержки и сопротивления не всегда совпадают «копейка в копейку», как правило они представляют собой зоны (плюс-минус движение цены, где есть разбег цены в несколько тиков):



2.3 КОРРЕКЦИИ

ПРОЦЕНТНЫЕ ОТНОШЕНИЯ ДЛИНЫ КОРРЕКЦИИ

После отдельных движений цены некоторое время двигаются в обратном направлении, а затем возобновляют прежний ход (когда цена движется в тренде).

Движения против основного можно прогнозировать с помощью процентных параметров.

Правило «Эффект 50% коррекции»

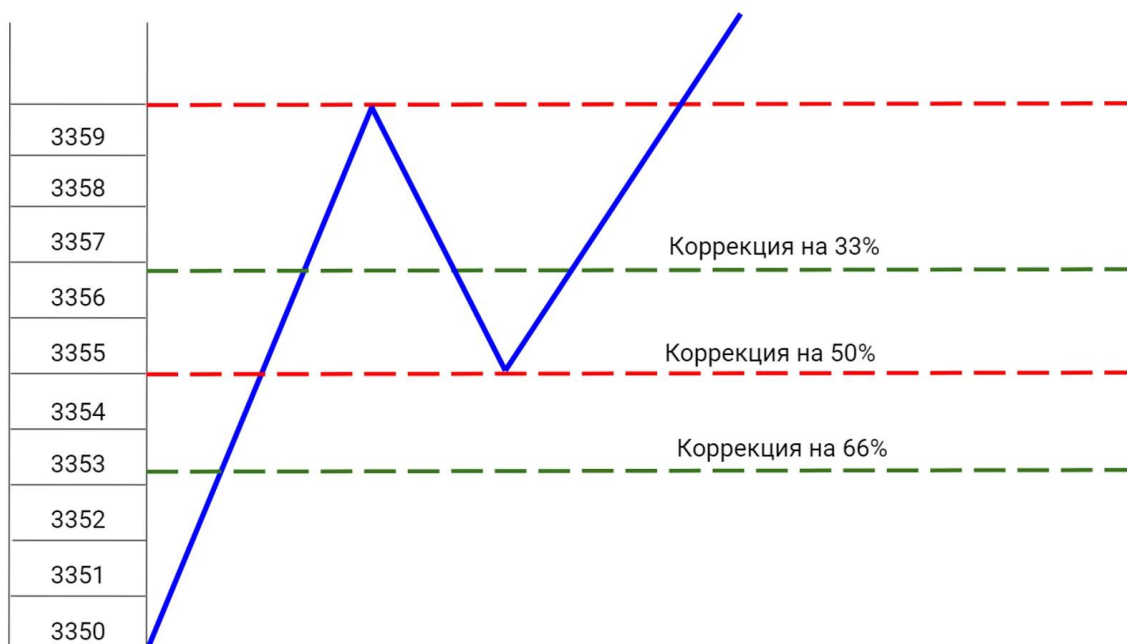
Чаще всего цена в обратном направлении движется до середины предыдущего движения.

Цены часто делают скачок назад примерно на половину длины предшествующего тренда, а затем возобновляют исходное направление.

Наиболее сильные коррекции:

- ◆ на $\frac{1}{3}$ предыдущего движения
- ◆ на $\frac{1}{2}$ предыдущего движения
- ◆ на $\frac{2}{3}$ предыдущего движения

Как это выглядит схематично:



ПРАВИЛО ЧЕРЕДОВАНИЯ

- ◆ Рынок обычно не совершает одинаковых действий два раза подряд.
- ◆ Если в последний раз образовался определенный вид вершины (или сильный сигнал), то вероятно в этот раз он не повторится.
- ◆ Правило чередования не помогает трейдеру понять что произойдет, а указывает на то, чего скорее всего НЕ БУДЕТ.
- ◆ Это правило используют для определения ожидаемого вида корректирующихся моделей.
- ◆ Корректирующиеся модели склонны к чередованию.
- ◆ Если наблюдаем простую модель сейчас, то следующая скорее всего будет сложнее.
- ◆ Не стоит ожидать повторения одной и той же ситуации два раза подряд.

ВСПОМОГАТЕЛЬНЫЙ ИНСТРУМЕНТ ДЛЯ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ДЛИНЫ КОРРЕКЦИИ

В каждом термине присутствует инструмент, который называется «Сетка Фибоначчи»

Для того, чтобы начертить сетку необходимо выбрать минимальную точку и максимальную точку на графике и при восходящем тренде растягиваем сетку от минимума к максимуму:



На данном инструменте нас интересуют коррекционные уровни:

38,2% — это $\frac{1}{3}$ предыдущего движения

50,0% — это $\frac{1}{2}$ предыдущего движения

61,8% — это $\frac{2}{3}$ предыдущего движения

С помощью сетки Фибоначчи можно брать во внимание как большие размашистые движения, так и более мелкие движения (вплоть до анализа отдельной свечи):



2.4 ВЗАИМНЫЕ КОРРЕКЦИИ

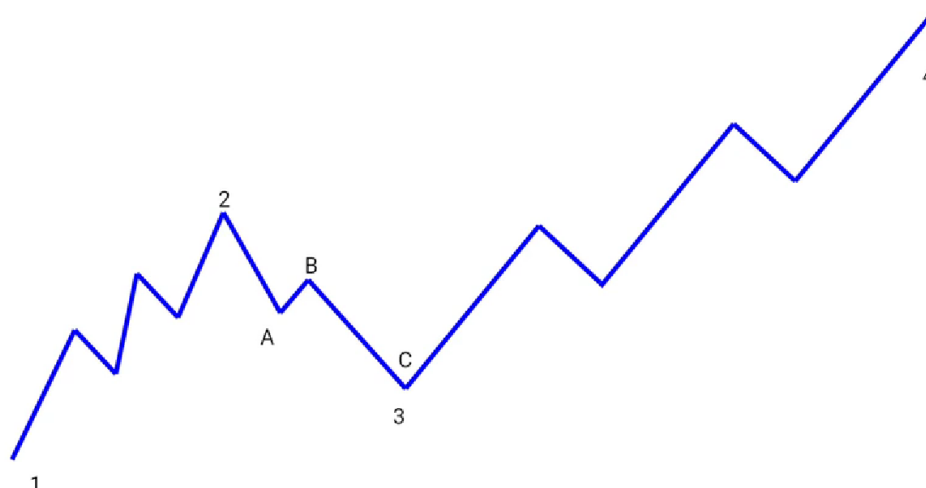
Тренды всегда взаимодействуют между собой. Иногда мы попадаем в сложные ситуации, когда кажется, что тренд должен продолжаться, а этого не происходит.

Цена разворачивается и идет против нас.

Одновременно на графике присутствует 3 вида трендов:

- ♦ основной
- ♦ промежуточный
- ♦ краткосрочный

и все они взаимодействуют между собой!



Точки 1,2,3,4 — это основной тренд вверх.

Кривая 2-3 — вторичная коррекция в рамках основного тренда.

Каждая вторичная волна делится на краткосрочные тренды. Например, вторичная кривая 2-3 состоит из малых кривых А-В-С.

Каждое движение является коррекционным по отношению к какому-то предыдущему движению.

Важно:

Учитывайте масштаб. Рассматривая движение цены на более младшем таймфрейме не забывайте смотреть движение цены на более старшем таймфрейме.

Рассматривая, например, восходящий тренд на таймфрейме M5 вполне может оказаться, что это движения всего лишь является коррекционным движением на более старшем таймфрейме M30.

Коррекции старшего таймфрейма сильнее.

Как отфильтровать коррекции?

- ◆ Ориентируйтесь на 1-2 таймфрейма.
- ◆ Не собирайте все коррекции (например выбрать только 50% размер коррекции, и коррекции по тренду).
- ◆ Анализируйте каждую сделку.

2.5 КАК ОРИЕНТИРОВАТЬСЯ КУДА ПОЙДЕТ ЦЕНА

Частые вопросы, которые беспокоят трейдера:

КАК ДАЛЕКО УЙДЕТ ЦЕНА?

Всегда обращайтесь внимание на ближайший уровень слева, запас хода (есть ли куда двигаться). У уровня цена скорее всего будет останавливаться.



Такая ситуация должна останавливать трейдера от поспешных действий.

Инструменты, которые используются для того, чтобы понять как далеко уйдет цена:

визуальная оценка

сетка Фибоначчи

ЧТО ДЕЛАТЬ СО СВЕЧНЫМИ ФАРМАЦИЯМИ?

Необходимо оценивать ситуацию в контексте, т.е. обращать внимание не на отдельно появившуюся свечу, а обращать внимание где образовалась формация (например: на сильном уровне, на изломе тренда, на уровне коррекции по сетке Фибоначчи).

Пример: шахматная фигура может быть сильной, но загнана в невыгодные условия, где у нее нет ходов.

В данном случае свечной паттерн (пин-бар) находится на важном коррекционном уровне — в этом случае данную свечу можно рассматривать как разворотную формацию:



КАК ОЦЕНИТЬ ДВИЖЕНИЕ В ЦЕЛОМ?

- ◆ Обращать внимание на масштаб (оценивать потенциал и направление движения на более старшем таймфрейме).
- ◆ Смотреть не на кусочек графика, а в целом (хотя бы текущий день).
- ◆ Не ждать глобальных разворотов без веских причин (*кажется, чувствую, может быть*).
- ◆ Оценивать ситуацию по фактам (которые уже произошли на графике прямо сейчас).
- ◆ При принятии решения найти как минимум 3 факта «ЗА» и «ПРОТИВ» планируемого решения и оценить их вес.

Контрольный список за наблюдением за собственной позицией:

- ♦ Была ли у меня хорошая идея сделки? Соответствовала ли она рыночным условиям, поведению рынка, совместима ли она с моей стратегией?
- ♦ Открыта ли сделка по хорошей цене? Дождался ли лучшей цены, сохранил ли уровень риска? Использовал ли преимущество максимально?
- ♦ Соответствовал ли размер позиции моему управлению риском? Рисковал ли я суммой, которая могла нанести непоправимый урон?
- ♦ Ясно ли я определил критерии выхода в случае ошибки? Знал ли я заранее, при каких условиях выйду, доказал ли убыток ошибочность входа?
- ♦ Следил ли я за рынком в момент сделки? активно исследовал или пассивно наблюдал за рынком? искал ли возможность увеличить или уменьшить позицию в зависимости от условий, пересматривал ли соотношение риска и прибыли?

Рекомендуется как минимум один месяц практиковать этот контрольный список вопросов.

БЕЗОПАСНОСТЬ. КАК ЕЕ СОБЛЮДАТЬ?

Существует три важных вопроса, которые обеспечат безопасность на 80%:

- ♦ Где я поставлю стоп?
- ♦ Где (исходя из стопа) будет стоять ордер на выход?
- ♦ Где я буду выходить?

Эти вопросы необходимо задавать перед тем, как войти в сделку.

Доходность в трейдинге обеспечивается благодаря хорошей торговле, а не отдельными удачными сделками.

Тактика — основывается на стратегии и определяет, что делать и когда.

Техника — это основные действия, которые вы выполняете независимо от тактики.

Если рассмотреть на примере баскетбольной команды, то:

Тактика диктует, как работает баскетбольная команда — строит защиту или играет один на один, нападает или разыгрывает сценарий.

Техника определяет основы: где находиться и как передвигаться.

В трейдинге основываясь на стратегии и тактике, мы предпринимаем правильные действия, техника гарантирует, что мы выполним эти действия правильно.

Цель: превратить каждое действие в привычный шаблон, используемый снова и снова, каждый раз одинаково.

Результативность в торговле основана на дисциплине, а не на привычке.

Вам нужно дойти до состояния, в котором вы будете открывать и закрывать сделки также, как вы умываетесь и чистите зубы по утрам.

Если заставить себя торговать также трудно, как включить овощи в рацион питания, необходимо работать над техникой.

УСИЛИЕ — это ключ к ускорению изменения.

Существуют проблемные модели поведения, которые мешают зарабатывать деньги.

Для того, чтобы устранить эти проблемные модели, нужно переместить себя в иное пространство (умственное и физическое), которое радикально отличается от вашей нормы.

Изменение не может быть достигнуто в состоянии комфорта — никогда.

Усилия — это «ДЕНЬГИ», которые вы платите за изменения.

Чем больше усилий вы вкладываете в новую модель поведения, в новую модель оценки ситуации, в новую модель принятия решений, тем больше будет результат.

Если усилий будет мало, они будут поверхностными, то не стоит ожидать грандиозных результатов и изменений в этой области.