

Торговая стратегия "Пробой"

- С использованием тикового объема
- Скачать терминал
- Для среднесрочной торговли

Основная идея

Уровни образуются в местах, где игроки заинтересованы в покупке или продаже. То есть это цена, по которой был интерес.

Цена уровня - это справедливая цена по оценке продавца или покупателя, который принимает решение о продаже или покупке.

Уровни продаж или покупок защищаются одними игроками (возьмем в пример уровень, где были продажи) лимитными ордерами или маркет ордерами, которые отгоняют цену от средней цены набора позиции.

Есть 2 типа игроков - **статичные и динамические**. Динамичный покупатель, принимая цену за приемлемую для себя (справедливую) скупает инструмент, в то время как статичный продавец удерживает цену уровня своих продаж. В какой-то момент, такой покупатель, если он большой (или их много) может поджимать цену к уровню сопротивления статичного продавца, скупив все что тот может продать. Продавец, видя что покупатель преодолел сопротивление будет откупать свою позицию. А покупатель поддерживать движение вверх - отсюда возьмется импульс вверх.

Принципы позиционирования объема

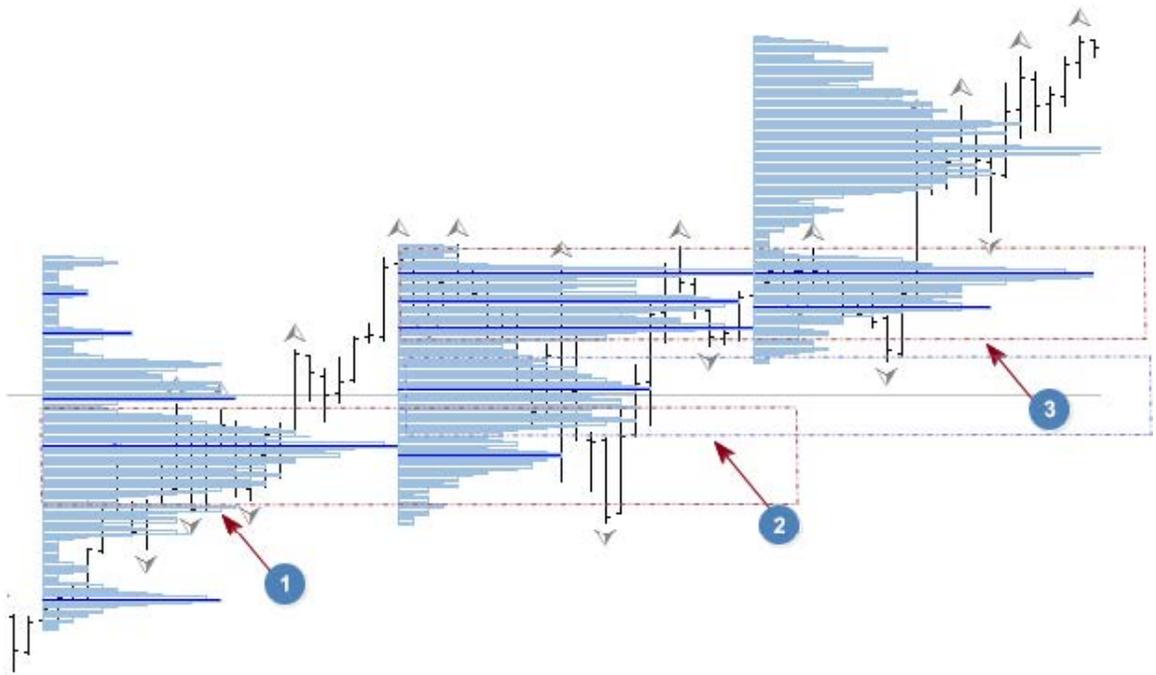
Каждое биржевое сведение ордеров имеет две стороны - это покупка и продажа. Если инициатива была у покупателя, то он купил все равно у продавца. Поэтому однобоко смотреть на объем, прошедший в продажу или в покупку, нельзя.

В случае, если продавец удовлетворил потребность инициатора сделки - покупателя, он с таким же успехом может защищать потом уровень своих продаж.

То же самое при инициативе продавца, который продает по цене спроса. Тут так же может оказаться покупатель, который просто ждал свою цену и момента, когда появится этот инициативный продавец и начнет защищать набранную позицию.

Исходя из этого, любой прошедший объем (в нашем случае всплеск активности) необходимо позиционировать. И отвечать себе на следующие вопросы:

- Где была эта активность (**High, Low или середина бара**)?
- Где в области активности точка контроля (**снизу, сверху, по середине**)?
- Где область активности по сравнению с прошлым дневным баром (**ниже, выше, внутри**)?



Проанализируем движение активности до появления данных зон активности. Ответим себе на вопросы по рисунку ниже:



1. **Где была эта активность** (High, Low или середина бара) - объем в хаях у бара начала анализа. В баре 1 объем выше чем в предыдущем по расположению. Значит игроки воспринимают высокие цены как справедливые и активны в этих областях.

2. **Где в области активности точка контроля** (снизу сверху, по середине) - основной объем бара начала анализа (разворотный) проходит внизу (относительно всего объема) цена была ниже, но не вызвала интереса у игроков - в рынке покупатель (объем сверху чаще всего шортовый, снизу лонговый).

3. **Где область активности по сравнению с прошлым дневным баром** (ниже, выше, внутри)? Активность прошлого дня выше активности прошлого бара (начало анализа) - приоритет лонг. Так как интерес двигается вверх.

В данном алгоритме нам необходимо, чтобы тиковый объем был прижат к уровню, повышались зоны активности. Зона активности у уровня будет говорить что там есть борьба.

Используемые уровни при торговле пробоя

Излом тренда с проторговкой - точка в которой преодолен последний максимум или минимум предыдущей тенденции в которой цена "стояла" длительное время.



Исторические, зеркальные уровни, где был продавец или покупатель, подтвержденные или актуальные. Проторговки.



Схематическое представление ПОДЖАТИЯ



Динамический продавец давит на цену сверху. То есть лимитными и маркет ордерами продает инструмент.

Снизу стоит покупатель, который защищает уровень своих покупок. Происходит борьба этих игроков. Образуются понижающиеся вершины. И нижнее ребро нашего треугольника имеет горизонтальное расположение. То есть у нас есть уровень.

Пробойные модели на основе горизонтального треугольника

Сильный, подтвержденный уровень дневного графика.



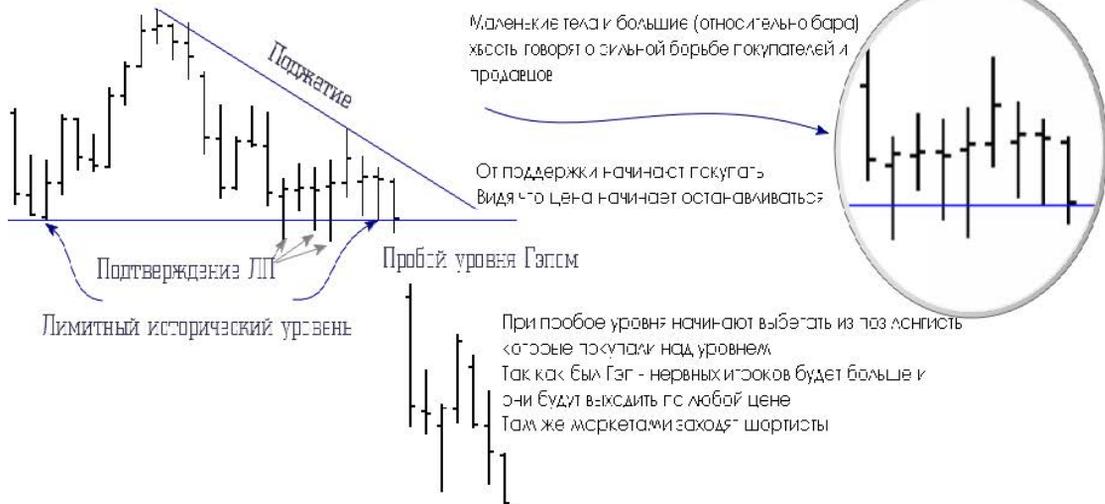
Подход к уровню небольшими барами



Возможно открытие некоторых из них с гэтом и закрытие в направлении тенденции



1. Наличие сжимающегося треугольника (поджатие)



Контртендовый лимитный уровень



Поджатие на объеме



Мы видим активность у уровня, до пробоя 2 дня подряд.
Если дневной уровень соответствует модели - можно приступать к принятию решения

Алгоритм принятия решения



Контр трендовый лимитный уровень



При пробое участвуют 2 группы игроков:
1. Шортисты, которые не понимают риск и выходят из позиций
2. Лонгисты стопы на вход которых были за уровнем
Они и создают первичный импульс

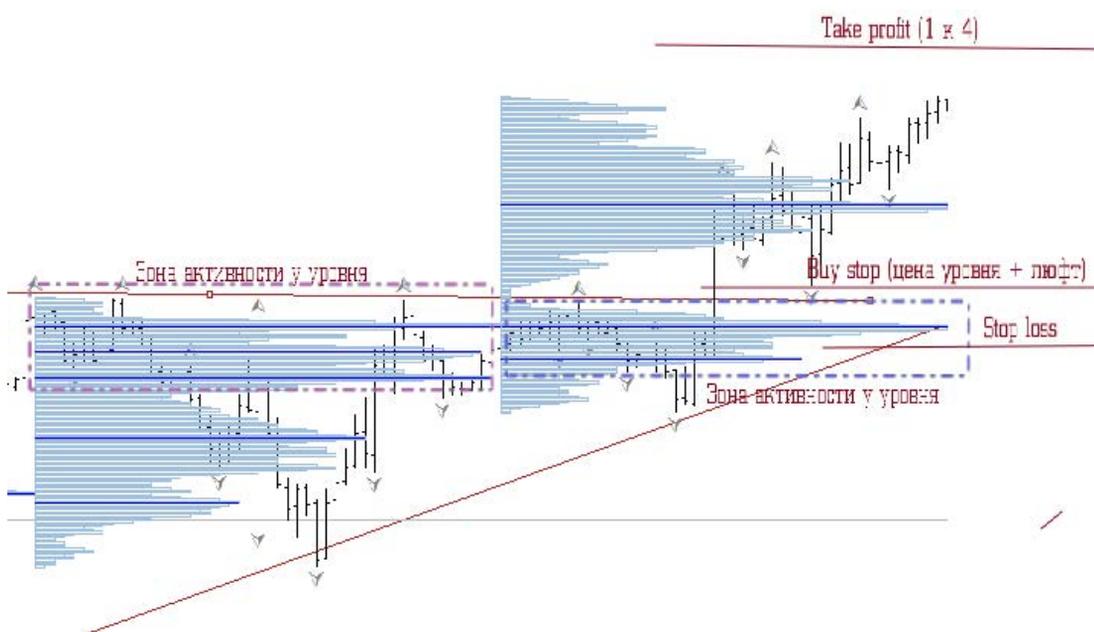
Продавцы видят сильный уровень
остановку цены на длительный период
И начинают продавать и ставить стопы за уровень
(они прячутся за этого большого игрока)
Но его раскупили или он ушел и в результате
происходит пробой уровня

- ✓ Сильный и подтвержденный.
- ✓ Стоим у уровня 5 дней или уровень подтверждался, отрабатывался на истории 3 раза.
- ✓ У уровня маленькие бары.
- ✓ АТР не пройден.

После получения подтверждения касанием и наличия зоны активности сверху - выставляем отложенный ордер типа buy (sell) stop по цене уровня + люфт (20% от стопа).

✓ Выставляем защитный приказ за зону активности, но не более чем 20 п.

✓ Выставляем Take profit 1 к 4 (в расчету на первичный импульс размером в 1 АТР в среднем).



Управление капиталом

- 1.** Максимальный Stop Loss 20 пунктов. Рекомендуемый риск на позицию 0,3 % от депозита.
- 2.** Максимальная потеря в день 0,6 %.
- 3.** Максимальное количество убыточных трейдов в день - 2 убыточных трейда.
- 4.** В не зависимости был ли у вас один хороший трейд и вы на нем заработали 1 к 3 и более - после 2 убыточных трейдов вы уходите с рынка.
- 5.** Риск на неделю 1,8 - 2%.
- 6.** Лимит убыточных сделок в неделю - 6.
- 7.** Риск на месяц не более 8 % (лимит убыточных сделок с учетом повторных заходов - 24).
- 8.** При закрытии 2 позиций в плюс - увеличиваете риск в 2 раза.
- 9.** Закрываете сделку с увеличенным лотом в плюс - повышаете объем в 2 раза и т.д.
- 10.** При получении Stop loss - возвращаете риск в определенные торговой стратегией рамки.

Мы желаем Вам
комфортной торговли
с Gerchik & Co!

