

# "Real Market Volume"

---

ТОРГОВАЯ СТРАТЕГИЯ



## Основные идеи тоговой стратегии

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 выборе приоритетного направления торговли необходимо учитывать преодоление накопления объема и закрепление с выбросом объема.

5

При всплесках объема внутри диапазона торгуем только при выходе из диапазона. А уровень, созданный на объеме, считается самым сильным.

6

Профили за разные периоды используются для локализации однонаправленного интереса долгосрочного и краткосрочного игроков.

7

При движении цены вверх лучше учитывать в качестве сопротивлений 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) в качестве поддержек.

9

Инициатива или ее отсутствие - важный аспект анализа, который отображает профиль объема.

## Тонкости установки "плавающего" профиля

При установке "плавающего" профиля необходимо захватывать как можно больше места над и под графиком цены (100 п.). Тогда индикатор будет отображаться корректно. Это связано с учетом forward point, т.е. разницей цен фьючерса и спота.



При локальных проторговках и поиске точки входа необходимо устанавливать плавающий профиль "в будущее" или "динамический" профиль.



## Настройка графиков

### Шаблоны и настройки:

- ✓ Подготовлен шаблон с "динамическим" профилем рынка для графика D1;
- ✓ Подготовлен \*.set с настройками плавающего индикатора для быстрой загрузки на локальный график;
- ✓ Открыт таймфрейм D1 и m30;
- ✓ На график D1 нанесены необходимые уровни и перенесены на график m30;
- ✓ На графиках m30, отображенных на домашней работе, установлены 2 плавающих профиля для быстрого анализа графика с помощью передвижения индикатора на необходимые области цен.



### Общий алгоритм работы с уровнями:

1. Покупка от поддержек при наличии паттерна.
2. Покупка при пробое и закрытии бара за сопротивлением.
3. Продажа при пробое поддержки и закрытии бара ниже.
4. Продажа при наличии паттерна у сопротивления.
5. Покупка или продажа должна осуществляться только при наличии потенциала сделки не менее чем 1 к 4 и возможности постановки стопа не более чем возможный максимальный (25 пунктов).

## Визуализация

На рабочем столе лежит алгоритм с торговым планом на день, который включает в себя:

- ✓ Паттерны, которые собираемся торговать;
- ✓ Визуализацию модели точки входа;
- ✓ Место постановки Stop loss (цену постановки stop loss, если паттерн есть на графике во время подготовки торгового плана);
- ✓ Визуализацию паттерна постановки стоп-приказа, максимальный размер stop loss;
- ✓ Цель (Stop loss);
- ✓ Документ для расчета минимального Take profit в зависимости от размера Stop loss.

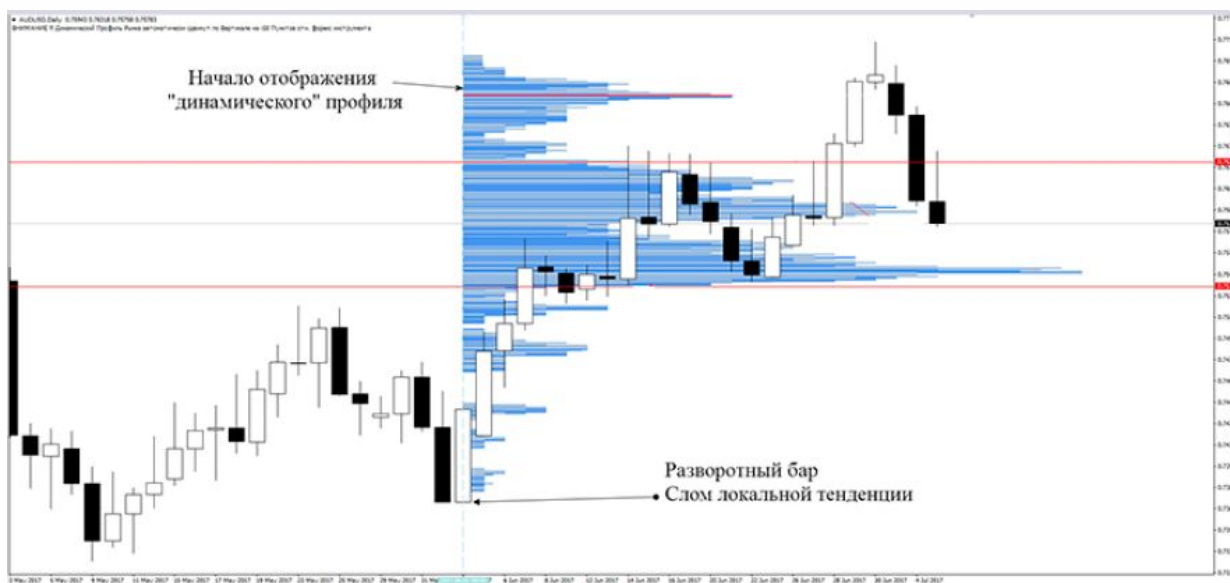


- ✓ Соотношение риск/прибыль должно быть минимум 1 к 4.
- ✓ Целью выступают 85% от зоны стоимости (минимальное соотношение риск/прибыль выдержано).
- ✓ Вход Buy limit по цене уровня. Максимальный Stop loss - 25 пунктов.
- ✓ Есть паттерн для постановки Stop loss (экстремум, с которого был обновлен максимум) - 15 пунктов. Максимальный (25 пунктов).

## Установка профиля

### 1. Определение уровней

Устанавливаем на дневной график инструмента динамический профиль (с момента слома локальной тенденции).



### 2. Установка профиля рынка на Range:

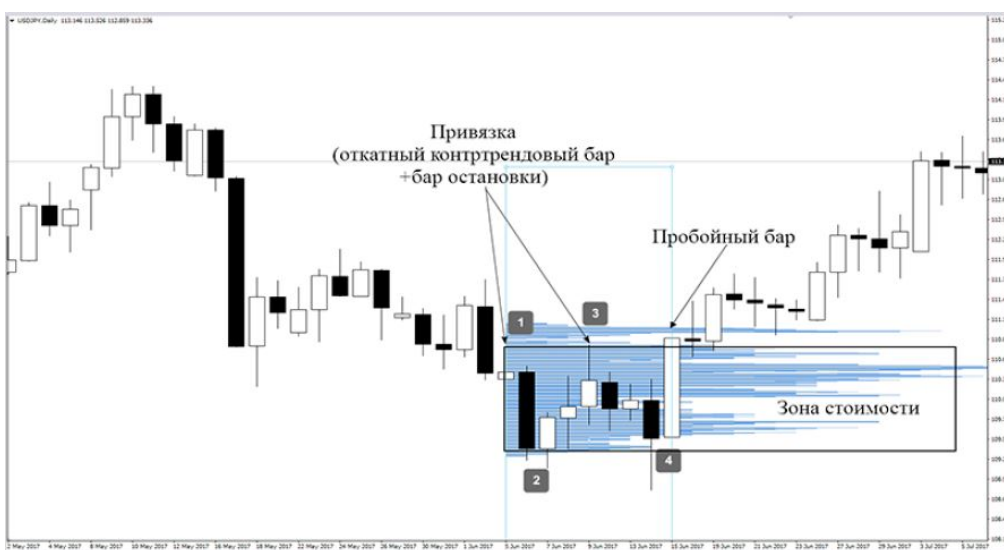
Если это тест одной и той же точки (1-2) - от контртрендового бара начала проторговки (противоположного цвета) до пробойного бара точки 3.



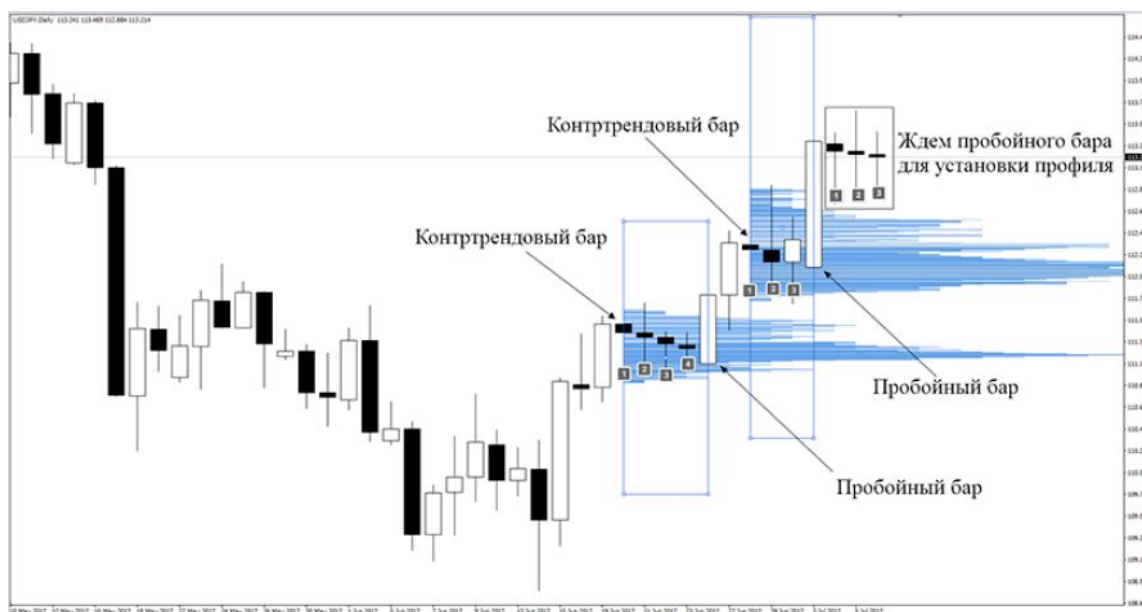
## Если это полноценный канал с 4 экстремумами:



Профиль устанавливается на начало формирования канала: контртрендовый бар первого экстремума (может быть откатный бар, как в примере) и до ее пробоя и закрытия бара выше (ниже при пробое вниз).



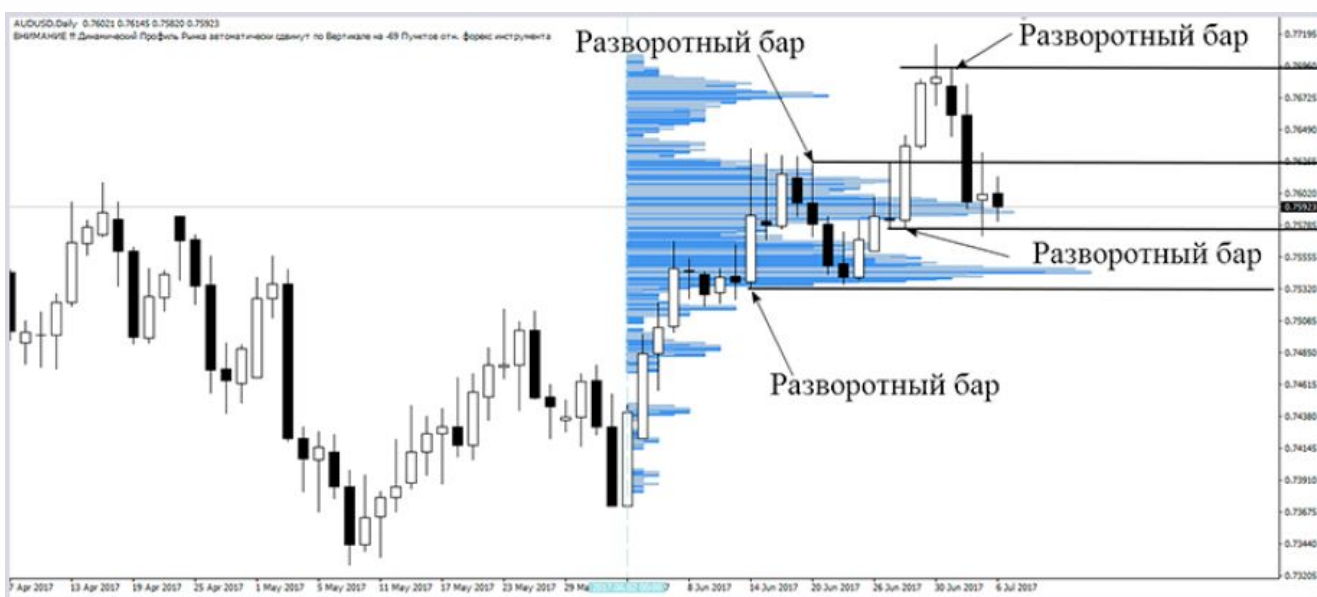
Если это узкая проторговка более 3 дневных баров (внутренние бары) - от контртрендового бара начала проторговки до пробойного бара, включая его.



## Порядок нанесения уровней

Привязка всплесков к экстремумам по следующему алгоритму:

- Уровень может быть привязан к разворотному бару (на котором была попытка разворота цены и совпадение с объемом).
- Уровень может быть привязан к бару остановки движения в случае, если именно он находится точнее всего к всплеску объема.
- Ложные пробой усиливают уровни



**Идея: сильный уровень всегда должен быть с объемом.**

От бара, по которому проведен уровень, должен быть результат в виде движения в противоположную тенденции сторону или остановки движения.

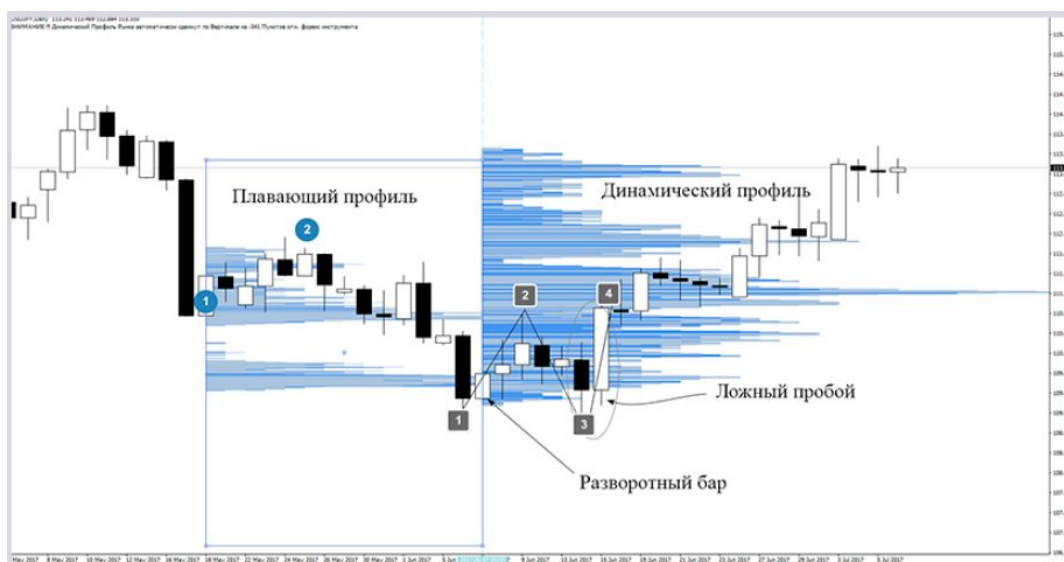
## Корректировка профиля

*В связи с возможной сменой тенденции*

### 1 вариант корректировки

При появлении формации 1-2-3-4 (обновления предыдущего экстремума) в составе тенденции:

- Вторая точка желательно должна быть повышающимся экстремумом, если это касается локального тренда вверх;
- "Динамический" профиль объема корректируется на разворотный бар;
- Добавляется "плавающий" профиль на предыдущий локальный тренд (или на ближайшие к цене экстремумы по точкам 1-2 и разворотному бару).



### Идея варианта корректировки:

При обновлении экстремума есть шанс на смену тенденции. Ложный пробой усиливает возможность разворота цены. По текущему локальному тренду будет набираться свой объем, и возможна реакция на объем предыдущего локального тренда Range или ближайших ключевых точек.

## Корректировка профиля

*В связи с возможной сменой тенденции*

### 2 вариант корректировки

При обновлении предыдущего экстремума в составе локальной тенденции:

- "Динамический" профиль объема корректируется на разворотный бар;
- Добавляется плавающий профиль на предыдущий локальный тренд от разворотного до разворотного бара.



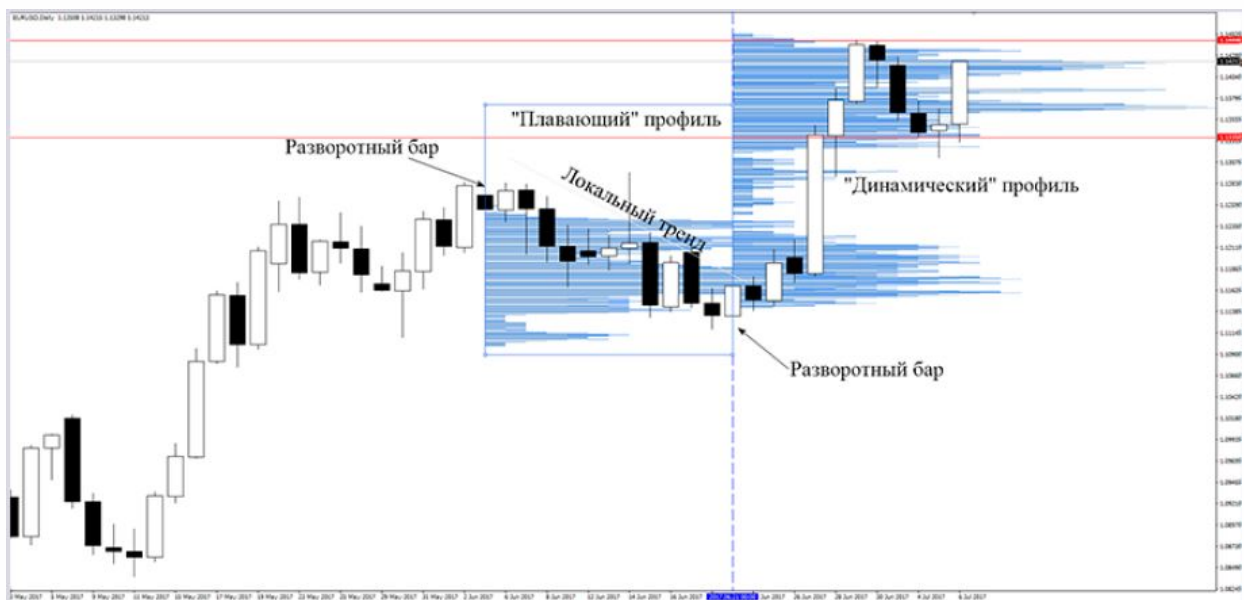
### Идея варианта корректировки:

При обновлении экстремума есть шанс на смену тенденции. По текущему локальному тренду будет набираться свой объем, и возможна реакция на объем предыдущего локального тренда или Range.

## Что делать при ложном пробое?

Смены тенденции не произошло.

- **"Динамический" профиль** перетягивается на начало текущей тенденции (обратно на предыдущее место установки) при пробое локального экстремума (зоны его стоимости) в направлении тренда.
- **"Плавающий" профиль** убирается с дневного графика.



### Идея:

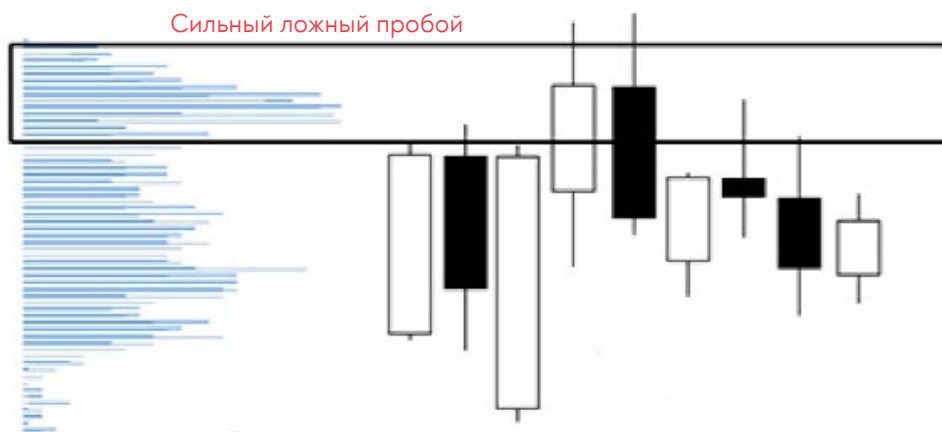
При возврате в диапазон после ложного пробоя и пробоя области накопления объема в направлении тренда очень велика вероятность продолжения локального тренда и дальнейшего накопления объема.

## Использование паттернов

*Когда не ждать закрытия бара?*

Самые сильные паттерны ложных пробоев происходят с выбросом объема и возвратом за уровень. **Вход может осуществляться при наличии точки входа в момент возврата:**

- ✓ **Обязательным элементом** торговли этого паттерна является касание уровня и простой ложный пробой до появления модели



- ✓ Ложный пробой узких проторговок (больше 3 дневных баров) - могут торговаться при возврате цены за уровень и появлении точки входа.
- ✓ Ложный пробой уровней, созданных не более месяца назад.



- ✓ В случае, если позиция направлена против основного тренда - необходимо ждать только паттерн сильного ложного пробоя после касаний (как на картинке) или сложного ложного пробоя.

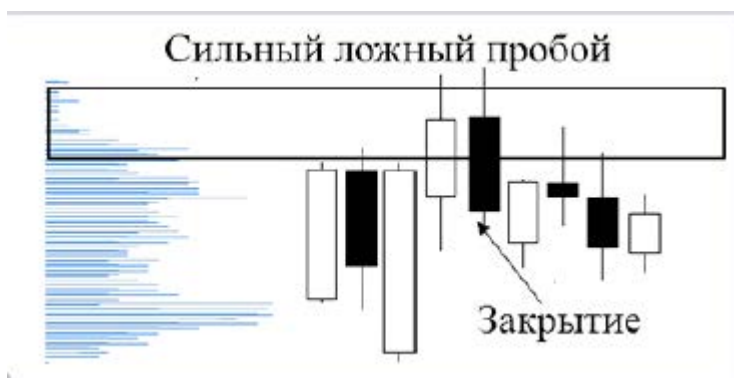
### Примечание!

Модель сложного ложного пробоя предполагает, что бар, торгующийся выше уровня, НЕ ДОЛЖЕН пробивать уровень хвостом, а быть строго над уровнем (касание допустимо).

## Использование паттернов

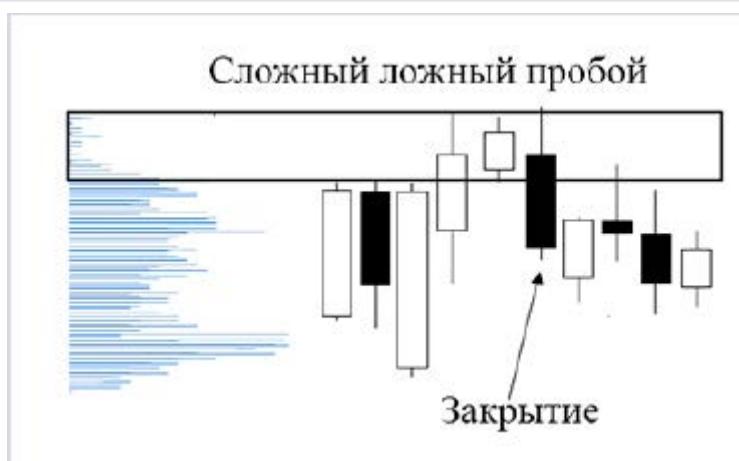
*Когда не ждать закрытия бара?*

После сильного (сложного) ложного пробоя без инициативы (без объема) необходимо ждать закрытия бара за уровнем.



### Примечание!

Модель сложного ложного пробоя предполагает несколько проторгованных выше (ниже) уровня баров. Бары, которые торгуются выше уровня, НЕ ДОЛЖНЫ пробивать уровень хвостами, а быть строго над ним (касание допустимо). В случае, если бары пробивают уровень, необходимо ждать бара, который будет полностью за уровнем, и только тогда нужно ожидать.



### Идея паттерна:

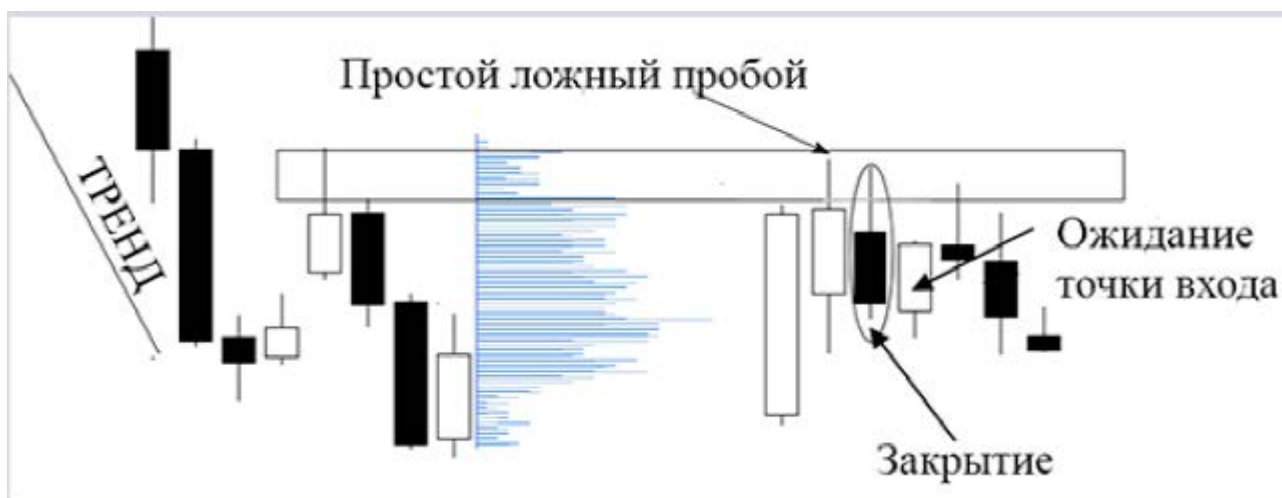
Преодоление удержания (уровня) в данном случае не вызывает интереса торговать по более высоким ценам. Это говорит о том, что цена не готова идти в ту сторону в данный момент времени.

## Простой ложный пробой

Что ждать после этой формации?

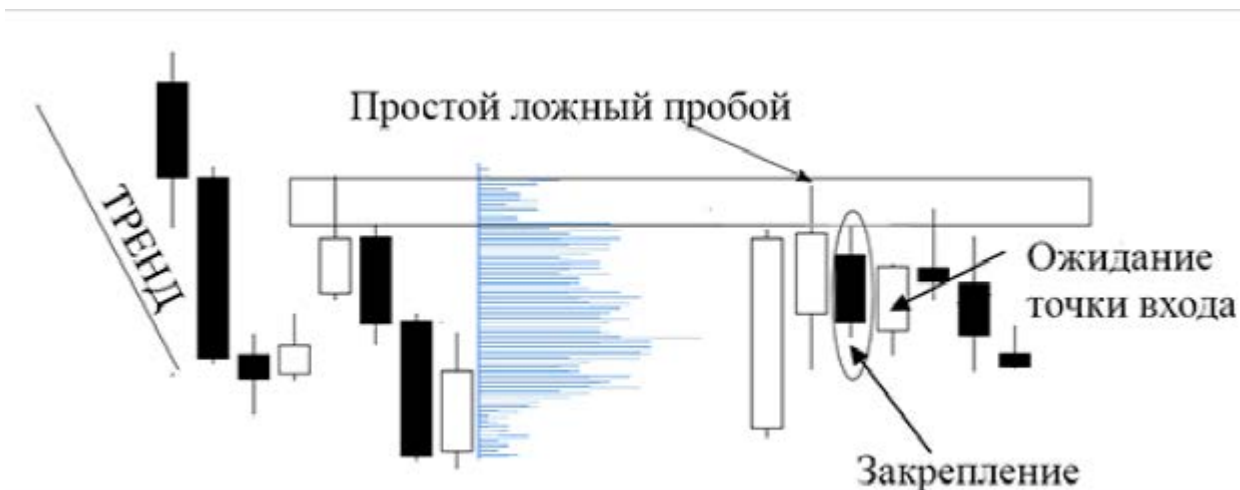
**ПОТРЕНДУ** без инициативы

Простой ложный пробой без инициативы (объема) по отношению к историческому уровню дневного графика после подтверждения касанием должен быть с закрытием второго бара за уровнем.



### Примечание!

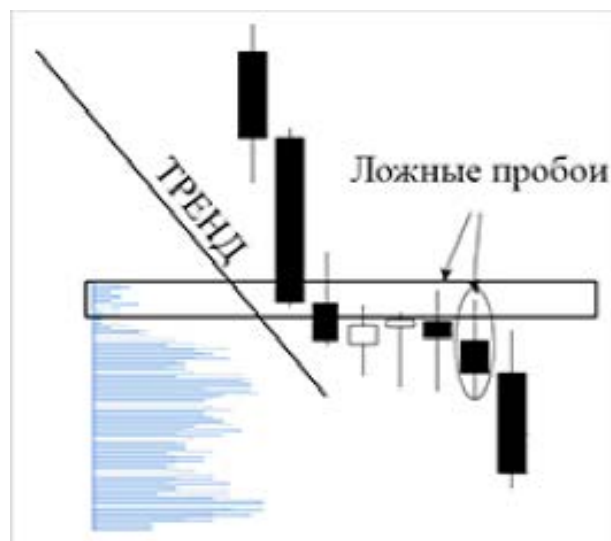
Второй бар может быть и ложным пробоем, и баром, который открылся и закрылся под уровнем.



### Создание уровня ПО ТРЕНДУ в моменте без инициативы:

Ложный пробой по отношению к бару остановки, без выхода объема при ложном пробое. Повторный ложный пробой должен закрыться за уровнем данного уровня

Ложного пробоя можно не ждать, если присутствуют 2 и более касаний одной цены барами.

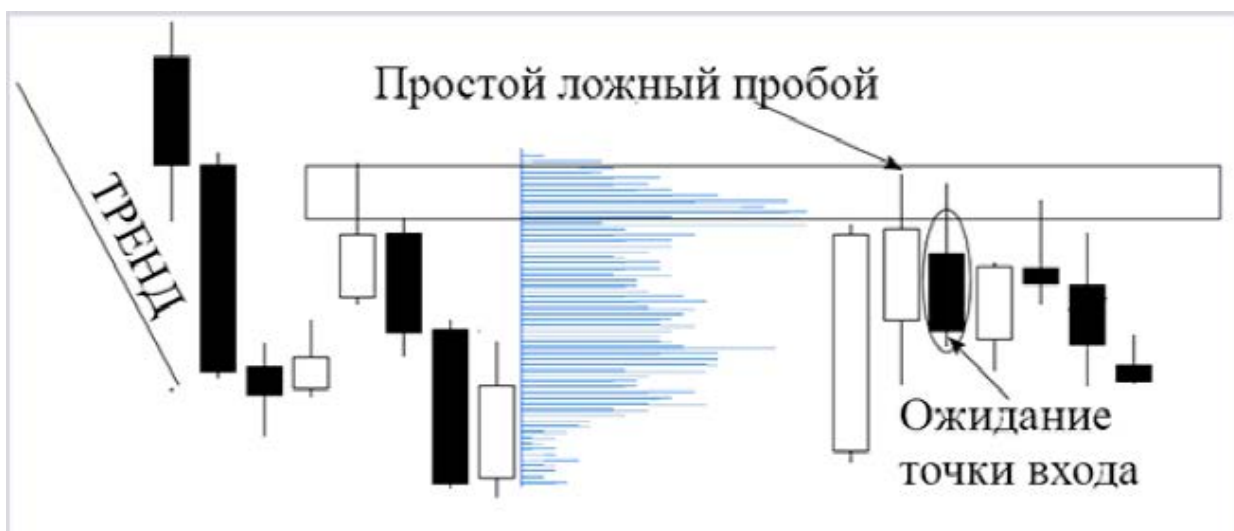


## Простой ложный пробой

Что ждать после этой формации?

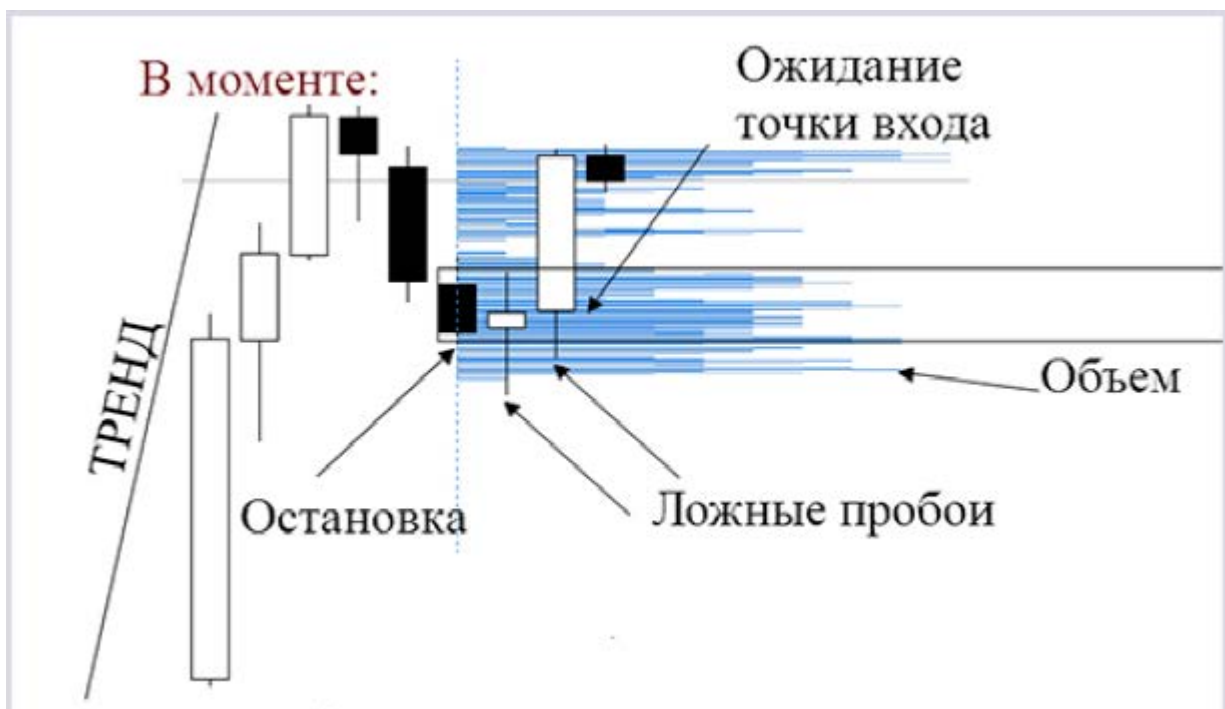
### ПО ТРЕНДУ с инициативой (объем)

Простой ложный пробой с объемом по отношению к историческому уровню дневного графика после подтверждения касанием должен быть с закрытием бара ЛП за уровнем.



ПО ТРЕНДУ с инициативой (с объемом). Уровень образован в моменте.

Ложный пробой по отношению к бару остановки, выход объема при ложном пробое, повторный ложный пробой и ожидание точки входа в моменте (без закрытия бара) после возврата.



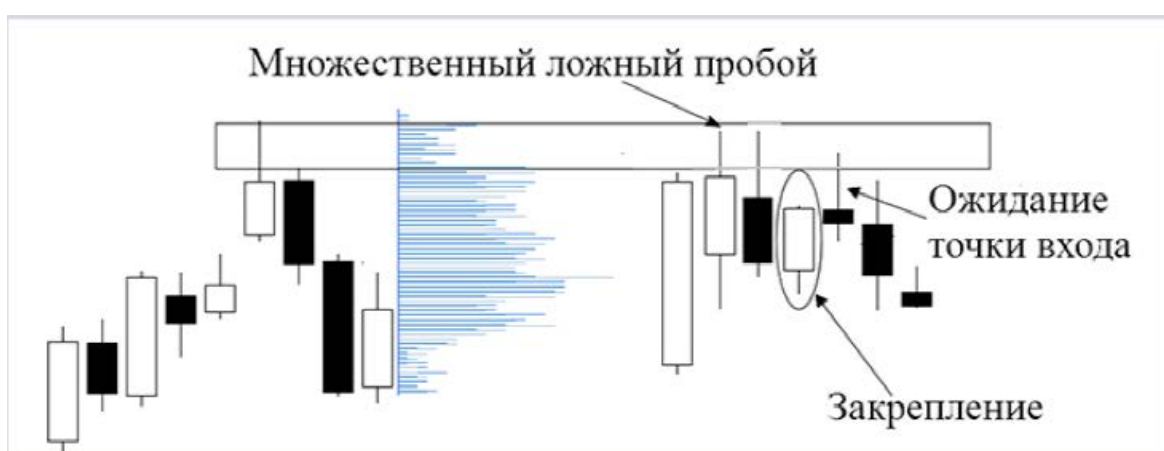
Ложного пробоя можно не ждать, если присутствуют 2 и более касаний одной цены барами.

## Простой ложный пробой

Что ждать после этой формации?

**ПРОТИВ ТРЕНДА без инициативы:**

Простые ложные пробои (минимум 2) без инициативы (объема) по отношению к историческому уровню дневного графика после подтверждения касанием должны быть с закреплением одного бара под уровнем. **Наличие 2 ложного пробоя обязательно**



### Примечание!

Если уровень образовывается в моменте – то по отношению к бару в основе должно быть минимум 3 ложных пробоя с закрытием трех под уровнем.

**ПРОТИВ ТРЕНДА с инициативой (с объемом).**



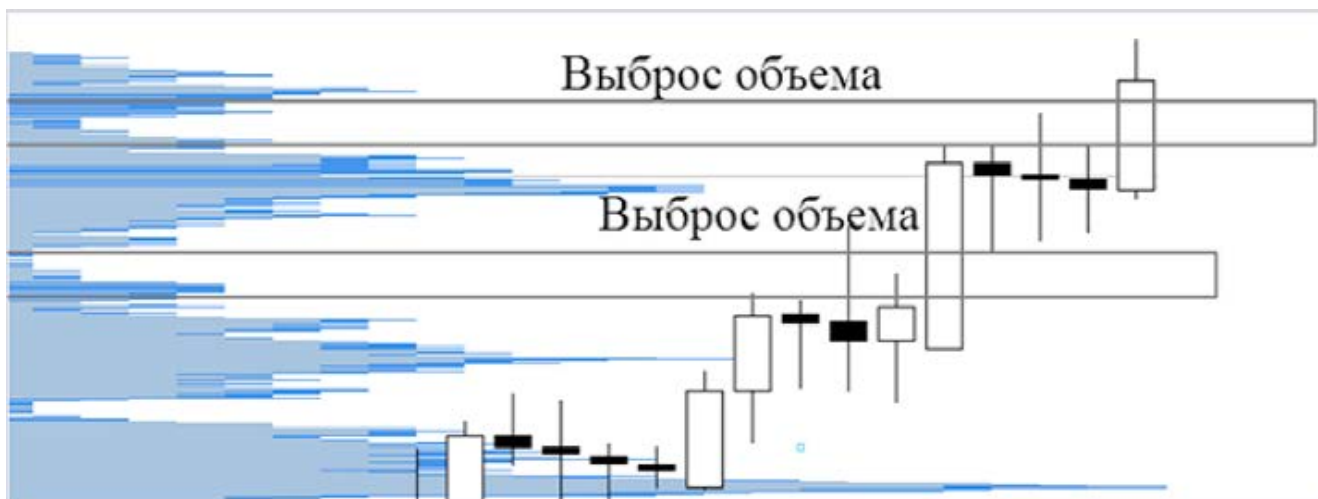
Ситуация усилит касание уровня (как в точке 3).

Ложных пробоев после касания с объемом должно быть 2 в составе экстремума. После закрытия второго ложного пробоя можно переходить к поиску точки входа.

## Использование паттернов

### *Закрытие бара над уровнем*

1. После накопления объема в проторговке более 3 дней или узком канале не шире, чем 2 АТР, бар пробивает уровень и закрывается выше с выбросом объема локально



2. После касания и ложного пробоя против тренда (остановка движения) бар закрывается в направлении тенденции и выбрасывает объем.
3. В моменте, когда 3 бара на объеме не могут преодолеть цену – поиск точки входа на 4.



**4.** При преодолении сильного уровня с удержанием цены, образованного близко к текущей цене, на объеме – вход на следующем баре. Движение до пробоя и закрытия такого уровня не должно превышать 1-1.5 АТР.

**Примечание!**

Вход должен быть только по отношению к  
подтвержденному уровню

## Подтверждение уровня

*Когда оно необходимо, а когда нет?*

Уровни, созданные около месяца назад и с которых было движение более, чем 2 АТР, должны подтверждаться:

- ✓ Касанием и простым ложным пробоем до закрытия бара за уровнем;
- ✓ Без подтверждения уровня за ним должно быть закрепление 1 баром в случае, если было движение не больше 3 АТР;
- ✓ Если движение было больше 3 АТР – необходимо ждать закрепление 2 барами за уровнем.



Уровни, созданные более 10 дней назад (до 15 дней), или уровни, с которых было движение более 2 АТР, должны подтверждаться касанием или простым ложным пробоем в обязательном порядке, не далее чем 5 дней назад до закрытия бара за уровнем.



Если уровень не подтверждается до пробоя и закрытия, необходимо ждать закрепления 1 бара за уровнем.

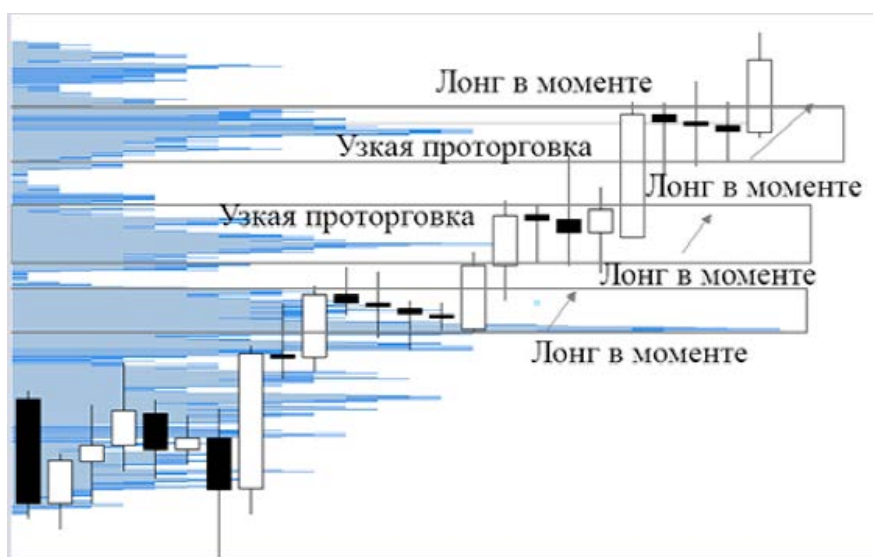


Если движение было сильным до пробоя уровня (более 3 АТР), необходимо ожидать закрепление 2 барами за уровнем.

## Подтверждение уровня: Когда необходимо, а когда нет?

Поиск точки входа при пробое в сторону тенденции (в моменте):

Уровни, созданные не более 5 дней назад, с которых было движение менее чем 1.5 АТР (узкая проторговка) при пробое и реакции на пробой локально (всплеск объема), генерируют сигнал в направлении пробоя



Поиск точки входа против тенденции:

Уровни, созданные не более 5 дней назад, с которых было движение менее чем 1.5 АТР (узкая проторговка) при пробое и закрытии бара за уровнем, генерируют сигнал об ожидании входа в позицию.



## Обратите внимание!

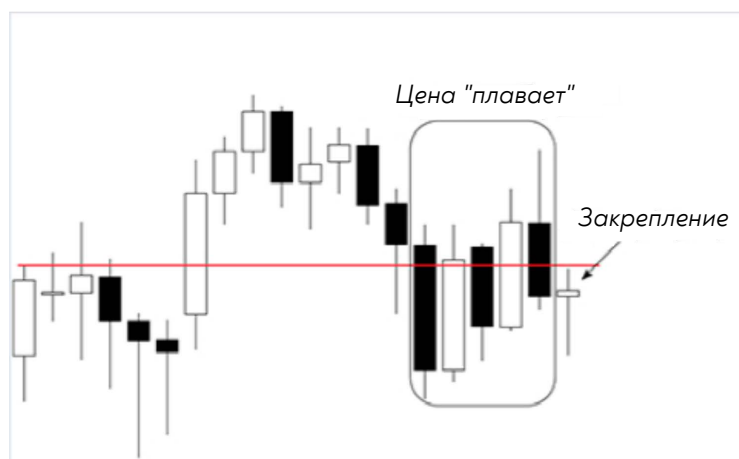
Наличие сильного или сложного пробоя с обратной стороны диапазона увеличивает шанс на пробой уровня и продолжение движения, а также слом тенденции



Отсутствие результата от ложных пробоев и возврат цены за уровень чаще всего означает продолжение движения.



Если цена «плавает» по уровню и выбивает стопы более 3 раз, нужно ждать, когда бар откроется и закроется полностью за уровнем.



## Установка профилей на м30



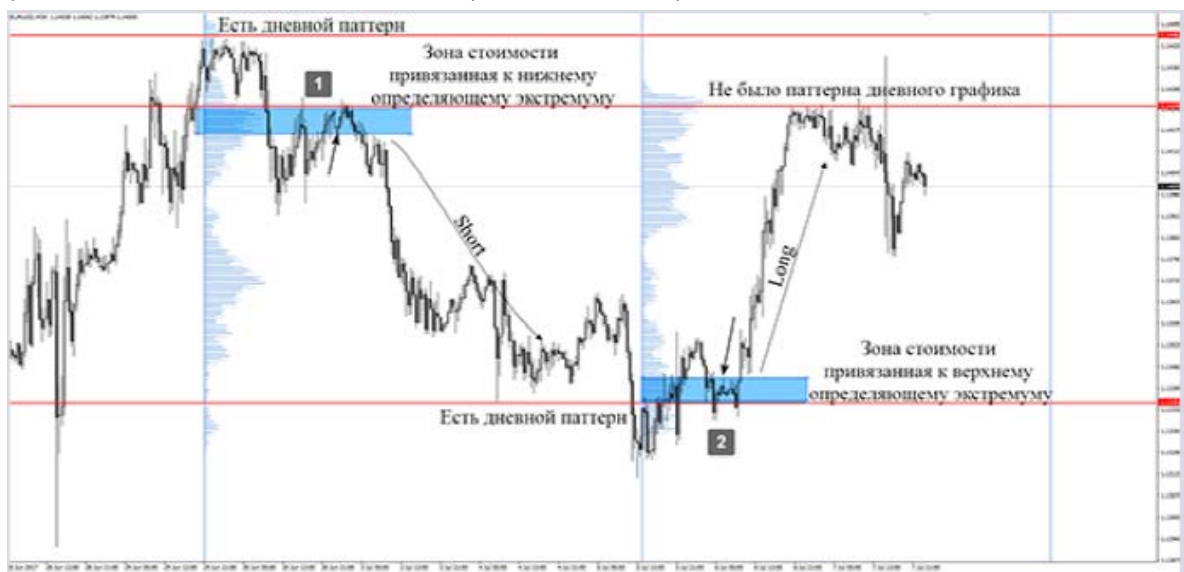
После закрытия бара ложного пробоя на разворотный бар в составе экстремума графика м30 устанавливается «динамический» или плавающий профиль с расчетом в будущие периоды.

✓ «Плавающий» профиль устанавливается на предыдущий локальный тренд, начиная от первого разворотного бара локального тренда до контртрендового бара в хвосте ложного пробоя.

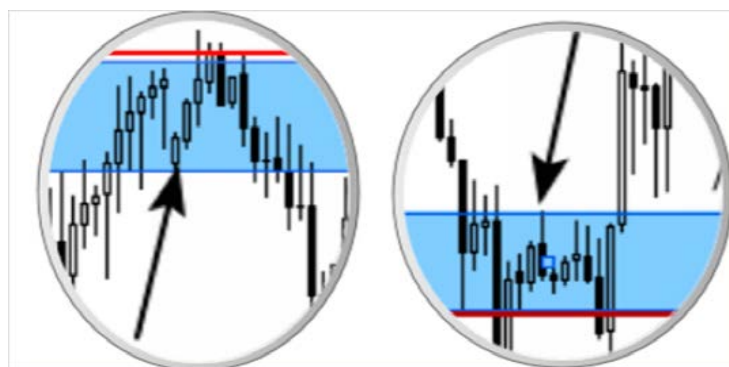
✓ При повторных ложных пробоях, закрытых выше уровня и обновляющих локальный экстремум, в составе хвостов (тел) которых есть разворотные бары, профили перетягиваются так, чтобы окончание локального тренда совпадало с профилем 1, а разворотный момент в хвосте ЛП – с профилем 2 (как на картинке).

## Привязка зон стоимости к локальным проторговкам

1. Находим локальные экстремумы в области РОС и основной зоны стоимости.
2. Проторговка должна быть явной (более 5 баров), лучше узкий канал с наличием 2 экстремумов для привязки зоны стоимости.
3. Что такое узкий канал? Это канал, не превышающий максимального размера вашего стопа. Чем он уже – тем лучше.



Посмотрим внимательнее:



Привязка к определяющим экстремумам имеет следующую логику

При поиске точки входа в длинную позицию важную роль будет играть преодоление объема и локальных уровней в направлении вверх. При продаже – наоборот.

## Поиск точки входа в покупку

1. Есть паттерн дневного графика в покупку.
2. Цена не отошла от уровня дневного графика на расстояние большее, чем 15 % от своего технического АТР.
3. Есть консолидация за дневным уровнем более 5 баров.
4. Есть накопление объема, соответственно РОС проторговки и зона стоимости
5. РОС в верхней части проторговки (желательно)
6. Привязываем границу ЗС к верхнему определяющему экстремуму, который совпадает с границей зоны стоимости
7. Ожидаем пробой.
8. После пробоя зоны стоимости 2 бара должны проторговаться над зоной стоимости.
9. После «закрепления» 2 баров над зоной стоимости выставляем лимитный ордер типа Buy limit с люфтом в 3-5 пунктов (для увеличения шанса захвата ордера)
10. Stop loss ставится за нижний экстремум зоны стоимости (не более 25 пунктов по четырехзнаку)
11. Есть запас хода до следующего уровня – должен быть более, чем 5 размеров Stop loss.
12. Take profit равен 85 % от диапазона (расстояние от уровня до уровня) и должен быть не менее, чем 1:4.

**13.** В случае, если удалось поставить короткий стоп, соотношение будет намного выше, т.к. все равно целью выступают 85 % от технического АТР

**14.** В случае, если цена прошла 2 величины стопа, а ваш ордер не исполнен, он отменяется

Рисунок графика поиска точки входа в покупку изображен ниже



## Поиск точки входа в продажу

1. Есть паттерн дневного графика в продажу.
2. Цена не отошла от уровня дневного графика на расстояние большее, чем 15 % от своего технического АТР.
3. Есть консолидация за дневным уровнем более 5 баров.
4. Есть накопление объема, соответственно РОС проторговки и зона стоимости.
5. РОС в нижней части проторговки (желательно).
6. Привязываем границу ЗС к нижнему определяющему экстремуму, который совпадает с границей зоны стоимости.
7. Ожидаем пробой.
8. После пробоя зоны стоимости 2 бара должны проторговаться под зоной стоимости.
9. После «закрепления» 2 баров под зоной стоимости выставляем лимитный ордер типа Sell limit с люфтом в 3-5 пунктов (для увеличения шанса захвата ордера).
10. Stop loss ставится за верхний экстремум зоны стоимости (не более 25 пунктов по четырехзнаку).
11. Есть запас хода до следующего уровня – должен быть более, чем 5 размеров Stop loss.
12. Take profit равен 85 % от диапазона (расстояние от уровня до уровня) и должен быть не менее, чем 1:4.

- 13.** В случае, если удалось поставить короткий стоп, соотношение будет намного выше, т.к. все равно целью выступают 85 % от технического АТР.
- 14.** В случае, если цена прошла 2 величины стопа, а ваш ордер не исполнен, он отменяется.

Рисунок графика поиска точки входа в продажу представлен ниже



## Управление капиталом

1. Максимальный Stop loss составляет 25 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 1:4 и более, после 2-х убыточных трейдов 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.



**Люфт** – зазор между зоной стоимости и выставлением лимитного ордера с целью повышения шанса на срабатывание ордера.

**Ложный пробой (ЛП)** – невозможность преодолеть уровень цены. Ложные пробои бывают только по отношению к уровню с целью набора позиции или теста интереса оппонента.

**Подтверждение уровня** – он должен быть актуален, следовательно, необходимо ждать реакцию цены при подходе к нему (касание – ложные пробои). Невозможность преодолеть уровень является подтверждением его актуальности.

**Исторический уровень** – уровень, который был создан ранее.

**Вход в моменте** – вход после появления точки входа без ожидания закрытия текущего бара.



**Покоряйте финансовый  
рынок вместе с  
Gerchik & Co,  
день за днем**

