

Иван Неделько

Пособие по торговле на финансовых рынках

ПРОФИЛЬ ОБЪЕМА



Лучший выбор современного трейдера

RICH HARBOUR
ANCHOR

Иван Неделько
Профиль объема

«Автор»

2022

Неделько И.

Профиль объема / И. Неделько — «Автор», 2022

Профиль объема существенно расширил возможности для трейдеров. Сегодня наверное ни один профессионал не обходится без него. Те уровни поддержки и сопротивления, что предлагает этот уникальный индикатор позволяют многократно повысить ваши шансы на успех. Торговля с помощью потока ордеров и профиля объема является неотъемлемой частью нашей торговой стратегии Запах Денег.

© Неделько И., 2022

© Автор, 2022

Содержание

Профиль объема	5
Что вы узнаете?	6
Важное замечание	8
Ценовое движение	9
Почему происходит движение цены?	10
Кто двигает цену?	12
Индикаторы	14
Как обнаружить активность организаций с помощью ценового движения	16
Боковая область ценовых движений	17
Агрессивная активность инициации	19
Полная картина	24
Какие временные рамки использовать для выявления активности организаций	25
Трейдинговые стратегии анализа ценового движения	26
Стратегия 1: Поддержка становится сопротивлением (и наоборот)	27
Стратегия 2: Открытое движение	29
Стратегия 3: АВ = CD	32
Стратегия 4: Открытая сессия	35
Стратегия 5: Открытие дня	37
Стратегия 6: Ежедневные/недельные максимумы и минимумы	38
Сильные или слабые максимумы/минимумы	41
Неудачный аукцион	48
Профиль объема	52
Где получить профиль объема	54
Конец ознакомительного фрагмента.	55

Иван Неделко

Профиль объема

Профиль объема

Уведомление о рисках

Торговля фьючерсами и валютой содержит значительный риск и подходит не каждому инвестору. Потенциально инвестор может потерять все или даже больше, чем первоначальные инвестиции. Рисковый капитал – это деньги, которые можно потерять, не подвергая опасности свою финансовую безопасность или образ жизни. Для торговли следует использовать только рисковый капитал, и только те, кто обладает достаточным рисковым капиталом, должны рассматривать возможность торговли. Прошлые результаты не обязательно являются показателем будущих результатов.

Уведомление о гипотетической эффективности

Гипотетические результаты имеют множество неотъемлемых ограничений, некоторые из которых описаны ниже. Не делается никаких заявлений о том, что любой счет достигнет или может достигнуть прибыли или убытков, аналогичных показанным; на самом деле, часто существуют резкие различия между гипотетическими результатами и фактическими результатами, достигнутыми впоследствии с помощью какой-либо конкретной торговой программы. Одним из ограничений гипотетических результатов является то, что они, как правило, составляются задним числом. Кроме того, гипотетическая торговля не связана с финансовым риском, и ни один гипотетический торговый отчет не может полностью учесть влияние финансового риска реальной торговли. Например, умение терпеть убытки или придерживаться определенной торговой программы, несмотря на торговые потери, являются существенными моментами, которые также могут негативно повлиять на фактические результаты торговли. Существует множество других факторов, связанных с рынками в целом или с реализацией какой-либо конкретной торговой программы, которые не могут быть полностью учтены при подготовке гипотетических результатов деятельности, и все они могут негативно повлиять на результаты торговли. Данная книга предназначена исключительно для образовательных целей, и высказанные в ней мнения принадлежат только автору. Все представленные сделки следует считать гипотетическими. Все операции проводятся не на реальном счете.

Что вы узнаете?

Когда я создавал эту книгу, моей целью было дать вам пособие, которое я хотел бы получить от кого-то 10 лет назад, когда я начинал. Книгу, которая сэкономит мне все время, проведенное в тупиковых ситуациях, все время, потраченное на исследования, и книгу, которая проведет меня через сложный мир трейдинга, направит меня по правильному пути и научит всем важным аспектам торговли.

В этой книге вы узнаете:

- Как работать с ценовым движением
 - Стратегии работы с ценовым движением, которые вы можете немедленно применить на практике
 - Как работает профиль объема
 - Мои любимые стратегии профиля объема
 - Как найти свой собственный стиль торговли и какие торговые инструменты лучше всего подходят для торговли
 - Как управлять торговлей в зависимости от макроэкономических новостей
 - Как проводить анализ рынка от А до Я
 - Как управлять своими позициями
 - Как правильно управлять капиталом
 - Как работать с психологией трейдинга
 - Как правильно проводить бэктесты и как начать торговать по проверенным стратегиям
 - Каковы наиболее распространенные торговые ошибки и как их избежать
 - Точные способы и правила, которые я применяю в своей торговле
- Вы узнаете обо всем этом в простой и наглядной форме с многочисленными примерами и картинками.

Почему бы мне не сохранить это в тайне?

Позвольте мне ответить на один довольно важный вопрос, который возникает у большинства людей. На самом деле, вы не были бы умным инвестором, если бы не относились к этому скептически. Дело в следующем: Зачем мне раскрывать вам свои рабочие торговые стратегии? Почему бы не держать их при себе? Почему бы не держать это в секрете, если они действительно так хороши?

Я видел очень много мошенников в этой отрасли. Так много людей, у которых нет ни финансового образования, ни сертификации, ни реальных знаний о рынках, и все же они выставляют себя в качестве «гуру». При этом их не волнует, потерпят ли неудачу люди, которые платят за их услуги, или нет. Брокерская компания, в которой я работал раньше, ничем не отличалась от других.

Лично я категорически против такой практики. Я хочу поступать по-другому и действительно помогать людям, и протягивание вам руки помощи мне несколько не повредит. Знаете ли вы, сколько людей, таких как вы и я, торгуют валютой? Сколько объема мы контролируем? Всего 3,5%. Только 3,5% дневного объема рынка Форекс контролируется розничными трейдерами (статистика Банка международных расчетов). Остальное – это различные организации.

Исходя из этого факта, помощь в трейдинге вам и другим таким же розничным трейдерам, не может оказать никакого влияния на рынок, а также не может поставить под угрозу меня и мою торговую стратегию. Поэтому я не думаю, что есть причина не делиться. Если вы хотите

учиться и готовы приложить определенные усилия для улучшения результатов своей торговли, то я с большим удовольствием поделюсь своими знаниями.

Важное замечание

Это не волшебное руководство по «быстрому обогащению». Я не буду обманывать вас и давать ложные обещания. Чтобы научиться и освоить торговлю и Профиль объема, требуется время и упорный труд. Если вы ищете волшебную формулу, вы читаете не ту книгу. Я действительно не могу давать никаких обещаний. Я покажу вам, что я делаю и что работает для меня. Вот и все. Я не могу гарантировать, что это сработает и для вас. Все люди разные, и мой стиль торговли может подойти не всем. Это факт. Но факт также в том, что это лучший торговый подход, с которым я столкнулся за свою десятилетнюю карьеру трейдера. То, чему я собираюсь научить вас в этой книге, – лучшее, что я знаю.

Итак, если вы не возражаете, что я не буду давать вам «волшебную таблетку» (так как ее не существует), тогда давайте перейдем к первой главе!

Ценовое движение

Ценовое движение – это искусство понимания голых графиков без какого-либо индикатора. Это первое, что я рекомендую изучить, прежде чем приступить к чему-либо еще. Это краеугольный камень, на который опираются все остальные аспекты, о которых я расскажу в этой книге.

Есть одна вещь, которую я делаю совершенно иначе, чем большинство существующих курсов по ценовому движению. Дело в том, что я не ищу свечные формации. Если бы я сравнил анализирование ценового движения с чтением, то свечные формации были бы лишь отдельными буквами или отдельными словами. Однако ценовые графики и рынки говорят предложениями, а не отдельными буквами или словами. По этой причине я воспринимаю движение цены как непрерывный поток, и главное, что меня интересует, – это динамика цены.

Почему происходит движение цены?

Прежде чем мы углубимся в детали и торговые установки, позвольте мне задать вам важный вопрос. Что движет ценой? Другими словами: Почему происходит движение цены? Подумайте об этом. Ваш ответ: «Потому что покупателей больше, чем продавцов (или наоборот)»? Неправильно, но не расстраивайтесь. Это распространенная ошибка, которую также часто допускают «эксперты» с телевидения или из газет в своих комментариях и статьях. Что действительно движет ценой, так это АГРЕССИЯ. Если цена растет, значит, покупатели более агрессивны. Если цена падает, то продавцы агрессивнее.

Если вы агрессивны, вы хотите купить или продать СЕЙЧАС. Если вам нужно что-то СЕЙЧАС и вы хотите быть на 100 % уверены, что получите это, вам нужно использовать РЫНОЧНЫЙ ОРДЕР. Этот тип ордера означает, что какой бы ни была цена, ваш ордер будет исполнен. Другими словами: вы размещаете РЫНОЧНЫЙ ОРДЕР, чтобы немедленно купить или продать по наилучшей доступной текущей цене.

Представьте себе ситуацию, когда есть новость, которая предполагает, что курс пары EUR/USD вырастет. Вы – трейдер хедж-фонда, и вы хотите войти в длинную позицию с лотом 1 000 (что равно \$100 000 000). К сожалению, все остальные видят эту новость, и они также видят возможность. Цена начинает стремительно расти. Вы хотите быть частью этого, и вы действительно хотите войти в свою позицию. Однако все происходит слишком быстро. Чтобы быть уверенным, что вы успеете зайти в новый тренд – вам нужно входить в торговлю с РЫНОЧНЫМ ОРДЕРОМ. Вы должны быть агрессивны. Вот демонстрация того, что произойдет:



Поскольку ваша позиция довольно большая, она не будет заполнена вся сразу. Она заполнится **быстро**, вы сможете войти в **позицию целиком**, но позиция будет **разделена** при быстром движении цены вверх. Это агрессивные участники рынка, которые своими рыночными ордерами агрессивно двигают цену вверх или вниз. Это истинная причина, по которой происходит движение цены.

В этой теме есть еще много интересного, но для понимания основной концепции этого должно быть достаточно. Запомните: **именно агрессивные покупатели/продавцы со своими агрессивными рыночными ордерами двигают цену вверх или вниз**. В этой книге я буду довольно часто говорить об агрессивности или агрессивных покупателях/продавцах.

Каждый раз, когда я буду это делать, и вы не будете уверены, о чем я говорю, просто вспомните пример, когда вы – трейдер хедж-фонда, который выходит на быстрый рынок с 1 000 лотами.

Кто двигает цену?

Хотя вопрос «кто двигает цену?» может показаться немного философским и не практичным или полезным, он чрезвычайно важен. Фактически, вся идея моей торговой системы основана на этом вопросе.

10 ведущих валютных трейдеров % от общего объема, май 2014 г.

Рейтинг	Название	Доля рынка
1	 Citi	16.04%
2	 Deutsche Bank	15.67%
3	 Barclays Investment Bank	10.91%
4	 UBS AG	10.88%
5	 HSBC	7.12%
6	 JPMorgan	5.55%
7	 Bank of America Merrill Lynch	4.38%
8	 Royal Bank of Scotland	3.25%
9	 BNP Paribas	3.10%
10	 Goldman Sachs	2.53%

Таблица справа показывает, что примерно 80% всего объема валютных операций совершается всего десятью финансовыми организациями. У них абсолютное большинство, они двигают и манипулируют ценой. Это их игра!

Это касается не только рынка Форекс. То же самое касается всех торговых инструментов. Если вы посмотрите, например, на рынок криптовалют, то увидите, что он идентичен. Неважно, что этот конкретный рынок довольно новый, все равно крупные финансовые группы доминируют, манипулируют и двигают этот рынок. На рисунке видно, что только 4,11 % адресов (финансовых групп) владеют 96,53 % всех биткоинов. С другой стороны, в нижней части рисунка вы можете увидеть небольшую долю, которой владеют розничные трейдеры (это мы). То же самое происходит с валютами, основными криптовалютами, акциями, индексами... **на рынке ВСЕГДА доминируют, движутся и манипулируют несколько крупных организаций или финансовых групп.**

Распределение капитала в Обиткойне



Как видите, мы с вами довольно малы. Мы не можем двигать цены, мы не можем манипулировать рынками, но мы можем быть прибыльными! Нам нужно только принять свою роль в этой игре. Итак, чтобы быть прибыльными, мы должны следить за большими парнями – организациями.

Как мы это делаем? Как мы отслеживаем деятельность организаций? Мы отслеживаем их с помощью ценового движения и объема. Ценовое движение и объемы дают нам подсказки о том, что делали эти организации, что они делают сейчас и что они, скорее всего, будут делать в будущем.

Индикаторы



В предыдущей главе я сказал, что мы можем предсказывать активность организаций и движения рынка с помощью анализа ценового движения и объема. Что не поможет вам в прогнозировании будущих движений рынка, так это индикаторы.

Стандартные индикаторы показывают только историческое развитие, но не могут предсказать будущие движения. Я не хочу вдаваться в математику, но если вы посмотрите, как рассчитываются самые распространенные индикаторы, то увидите, что они работают только с двумя переменными: 1. время, 2. историческая цена. Вот и все. Больше ничего. Все эти индикаторы – лишь вариации и различные визуализации времени и исторической цены. Среди них нет Святого Грааля, и все они – просто линии на ваших графиках, которые не добавляют абсолютно никакой ценности.

Так почему же тогда все эти аналитики форекс-брокеров используют все эти индикаторы? Знаете ли вы, кто такие эти аналитики? Это обычные парни, которые ходят на работу, делают свою работу, а потом идут домой. Получается, что их работа заключается в том, чтобы писать по одной глупой статье в день, чтобы кормить своих клиентов. Эти клиенты, скорее всего, все равно потеряют свои деньги, так как большинство людей в этом бизнесе так и делают. Так что эти аналитики просто дают им стимул сделать еще несколько сделок, чтобы брокер мог получить прибыль, принимая противоположные стороны сделок. Вот и все. Единственная

цель индикаторов – заставить людей чувствовать контроль над ситуацией и подтолкнуть их к более активной торговле.

Если вы используете, например, простой индикатор ЕМА (экспоненциальное скользящее среднее), чтобы определить, в какую сторону идет тренд, то я не имею ничего против. Однако если вы строите стратегии на основе индикаторов, пожалуйста, остановитесь. Это не будет работать. Поверьте мне, я испробовал оба конца этой палки. Я был тем парнем, который пере-пробовал все индикаторы и денно и нощно искал Святой Грааль. Позже я также был парнем, работающим на брокера.

Как обнаружить активность организаций с помощью ценового движения

В этой главе я хотел бы показать вам, как обнаружить области, в которых активно работали крупные финансовые институты. Эти области чрезвычайно важны, потому что они помогают нам понять, где интерес организаций был и, с большой вероятностью, будет снова. Место, которое является значимым для организаций, должно быть значимым и для нас, потому что весь наш бизнес в основном основан на следовании за большими парнями.

Есть три основных признака активности организаций, которые мы можем заметить с помощью анализа ценового движения:

- 1. Боковая область ценовых движений**
- 2. Агрессивная активность инициации**
- 3. Сильный отказ (от более высоких или более низких цен)**

Боковая область ценовых движений

Одно из самых больших различий между розничными трейдерами (то есть нами) и организациями заключается в размере торгового капитала, которым мы управляем. Организациям принадлежат огромные суммы капитала, и из-за этого у них есть проблема, которой у нас никогда не будет. Проблема заключается просто в том, что у них слишком много денег. Если они хотят незаметно открыть крупную сделку, им нужно немало времени, чтобы войти в позицию. Они намерены делать это медленно, незаметно, чтобы никто не понял, что они делают. Если им это удастся, они смогут войти в свою крупную позицию без предупреждения других участников рынка и без сильного движения цены.

Если бы, например, такое крупное учреждение, как банк Citi, начало быстро и агрессивно покупать огромное количество евро, это вызвало бы большой ажиотаж и начало тренда. В этом случае тренд не был бы их другом, потому что они не смогли бы полностью войти в свою крупную торговую позицию. По крайней мере, не по тем ценам, по которым им хотелось бы.

По этой причине организациям нужно много времени, чтобы незаметно ввести свои крупные позиции. Они пытаются казаться мелкими инвесторами, которые беспорядочно размещают на рынке множество относительно небольших позиций.

Единственный способ, которым они могут медленно и незаметно накапливать свои позиции, – это боковое ценовое движение. Там они могут отлично скрыть свою деятельность.

Поэтому в следующий раз, когда вы увидите боковой канал ценового движения, не думайте, что это глупость и что там ничего не происходит. Скорее всего, вы ошибаетесь. Боковой ценовой канал – это место, где крупные компании готовятся к действиям. Вот почему это так важно и почему это одно из первых мест, на которое я обращаю внимание при анализе любого графика.

Ниже вы можете видеть график цен, на котором я отметил все значимые области бокового ценового движения.



Сейчас я покажу вам доказательство того, что в этой зоне бокового ценового движения были накоплены большие торговые позиции. На рисунке ниже показан точно такой же график, но на этот раз с Профилем объема. Вы можете видеть, что Профиль наиболее широк в местах, где находится зона бокового ценового движения. Это означает, что большинство позиций было накоплено именно там.



Боковое ценовое движение – очень значимое место на всех временных интервалах. Неважно, используете ли вы 1-минутный график, 30-минутный, дневной или недельный. Логика всегда одна и та же, и именно поэтому она так хорошо работает на всех временных интервалах.

Чаще всего я анализирую графики на 30-минутном временном интервале (внутридневные сделки) и дневном графике (свинговые сделки)

Заключение: Ищите зону бокового ценового движения. Это весьма значимые места, потому что компании накапливают там свои позиции. Всегда следите за такими зонами, независимо от того, какой временной интервал вы используете.

Агрессивная активность инициации

Агрессивная активность инициации – это, по сути, значительное движение цены или тренд. Она вызывается агрессивными покупателями, толкающими цену выше, или агрессивными продавцами, толкающими цену ниже. Такого рода агрессивные покупки или продажи часто происходят после бокового ценового движения. Происходит это так: крупные компании наращивают свои позиции (в боковых областях), а когда они заканчивают с этим, они начинают агрессивную покупку или продажу, чтобы манипулировать ценой и двигать ее в любом направлении. Так они зарабатывают деньги. Они наращивают свои позиции медленно и незаметно, а затем начинают тренд, чтобы сделать эти позиции прибыльными.

Когда цена движется в быстром тренде, времени для размещения крупных позиций не так много.

По этой причине компаниям необходимо накапливать свои позиции до начала движения.

Ниже приведены два типичных примера зоны бокового ценового движения с последующей агрессивной активностью инициации:



Сильные зоны инициации или трендовые зоны играют важную роль, поскольку они показывают нам намерения крупных финансовых организаций. Мы не можем видеть намерения в зоне бокового ценового движения, но когда начинается тренд, мы знаем, были ли накопленные позиции этих организаций длинными или короткими.

Если после зоны бокового ценового движения наблюдается сильный восходящий тренд, то мы знаем, что позиции, которые накапливали крупные компании, были длинными. Если, с другой стороны, наблюдается боковой канал ценового движения, за которым следует агрессивная распродажа (или нисходящий тренд), то мы знаем, что накопленные позиции были короткими.

Помните, что сильные трендовые зоны или быстрые движения цен ВСЕГДА вызываются агрессивными покупателями или продавцами. Именно агрессия организаций двигает цену вверх или вниз.

Теперь вы знаете две важные составляющие информации, которую дает нам рынок и которые мы всегда должны учитывать при анализе рынка. Это

«боковое ценовое движение» и «сильная инициация». Есть еще одна важная информация, которую дает нам ценовое движение и которую я считаю действительно важной. Это «сильный отказ».

Сильный отказ (от более высоких или низких цен)

Сильный отказ от более высоких или более низких ценовых уровней – это внезапный разворот цены. Этот паттерн образуется, когда цена агрессивно идет в одну сторону, а затем быстро разворачивается и с той же агрессией и скоростью идет в другую сторону. Классическим примером может служить тип свечи под названием «пин-бар». Но пин-бар – это не единственная визуальная форма сильного отказа. Существуют много способов, как может выглядеть сильный отказ. **Общим признаком для всех сильных отказов является агрессия и внезапный разворот в обратную сторону.**

Происходит так: одна сторона рынка (например, покупатели) проявляет агрессию и двигает цену в одном направлении. Затем она сталкивается с другой стороной (например, с мощными продавцами), которая внезапно становится еще сильнее и еще агрессивнее. Таким образом, цена быстро разворачивается, и более сильная сторона берет верх. Зона, где другая сторона взяла верх, является очень важной, потому что она обозначает место, где сильные участники рынка агрессивно отказались от текущего курса действий и начали сильное встречное движение. Это место важно для нас, потому что оно, скорее всего, будет снова отстаиваться, если цена снова приблизится к нему. Оно становится новой зоной поддержки/сопротивления.



Как видите, не обязательно должен быть пин-бар, чтобы мы могли заметить агрессивный отказ. Честно говоря, мне все равно, как выглядят свечи. Единственное правило заключается в том, что должен произойти внезапный разворот. Свечные паттерны меня не волнуют. Причина в том, что на разных временных интервалах они разные. Сильный отказ должен быть виден на нескольких временных интервалах, а не только на одном. Помните, мы анализируем ценовой "поток и агрессию", а не свечные паттерны.

Потребуется некоторое время, чтобы научиться замечать и распознавать сильные отказы и отличать их от отказов, которые не столь значительны. Но через некоторое время у вас это получится, и вы будете смотреть на график и читать целые предложения, а не только отдельные буквы.

Помните, что места, где цена внезапно развернулась и изменила направление, очень важны. Мы всегда должны следить за ними в нашем анализе ценового движения.

Полная картина

Три признака активности организаций в анализе ценового движения, которые я показывал вам ранее, по сути, являются основой торгового метода, который я использую. Эти три признака являются наиболее значимыми для меня на каждом графике. Они также являются первым, что я замечаю, когда смотрю на любой график. После некоторой практики вы сможете быстро распознавать их, и весь процесс распознавания этих зон станет для вас совершенно естественным. Пока же попробуйте активно искать эти зоны. Вы должны научиться визуализировать графики в своей голове следующим образом:



По сути, вы разделяете диаграммы на отдельные области в своей голове. Каждая зона даст вам определенную информацию о деятельности организаций.

Есть несколько действительно хороших стратегий, основанных на этих формациях ценового движения. Я расскажу о них подробнее в разделе «Профиль объема» данной книги.

Какие временные рамки использовать для выявления активности организаций

Крупные финансовые учреждения работают по-разному и на разных временных интервалах. Они занимаются алгоритмической торговлей; у них есть трейдеры, которые занимаются внутрисуточной торговлей, свинг-трейдингом, трейдеры, которые занимаются долгосрочными инвестициями, у них есть люди, которые занимаются хеджированием, конвертацией валют... они просто делают все это. Крупные компании охватывают все временные рамки – от минутных до месячных. Общее для всех них, как я уже говорил, – большой объем капитала, которым они управляют. По этой причине мы можем выявить эти организации на всех временных интервалах, потому что у них одна и та же проблема на всех периодах – проблема слишком большого количества денег, которыми они управляют.

Это действительно хорошая возможность для нас, потому что мы можем использовать одну и ту же методологию и стратегии для всех временных интервалов! Все стратегии, которые я покажу вам в этой книге, могут быть применены к любому выбранному вами периоду времени. Вам просто нужно будет скорректировать цель прибыли, стоп-лосс и торговые объемы, но кроме этого, все будет одинаково, потому что организации действуют одинаково на всех интервалах.

Трейдинговые стратегии анализа ценового движения

Давайте теперь немного отойдем от теории и посмотрим на некоторые торговые стратегии, основанные на движении цены. Я использую их в качестве подтверждения своих основных стратегий. Мои основные стратегии основаны на Профиле объема и логике трейдинга компаний, о которой я говорил ранее. К этим стратегиям мы перейдем позже в разделе «Профиль объема». Сейчас я покажу вам стратегии, основанные исключительно на движении цены.

Чтобы было предельно ясно – я использую эти стратегии анализа ценового движения как подтверждения для моих основных стратегий. Например, когда моя основная стратегия (основанная на объеме) показывает мне торговый уровень, а я не совсем уверен в нем, то я пытаюсь найти какую-нибудь другую стратегию анализа ценового движения, которая подтвердит мою первоначальную торговую идею. Чем больше подтверждений я нахожу, тем лучше.

Тем не менее, если вам действительно нравится какая-либо из этих стратегий ценового движения, вы можете работать с ними как с самостоятельными стратегиями. Давайте теперь рассмотрим их по очереди:

Стратегия 1: Поддержка становится сопротивлением (и наоборот)

Это одна из моих любимых стратегий анализа ценового движения. Она работает очень хорошо (даже как самостоятельная стратегия). Я обычно могу обнаружить эту установку на графиках почти каждый день, так что возможностей для торговли с ее помощью довольно много.

Эта установка работает в обоих направлениях – **поддержка становится сопротивлением**, а также **сопротивление становится поддержкой**.

Вот как обнаружить ее и как торговать ею:

1. Чтобы определить эту установку, сначала нужно проследить, как цена резко реагирует или скачет от некоторой области на графике. Такая сильная реакция указывает на то, что в этой области была сильная поддержка или сопротивление.

2. Одной большой реакции достаточно, но две или более сильных реакций еще лучше. Таким образом, вы можете быть уверены, что была зона действительно сильной поддержки или сопротивления.

3. После обнаружения такой сильной зоны нужно подождать, пока цена пройдет ее. Вы хотите увидеть, как эта сильная поддержка или сопротивление будет прорвана.

4. Несмотря на то, что уровень поддержки/сопротивления был прорван, он по-прежнему значителен и силен. Причина в том, что преодоление такого уровня требует больших усилий и объема сильных покупателей или продавцов. Эта область будет «защищена» снова. Вот как поддержка становится сопротивлением и как сопротивление становится поддержкой.

5. Когда вы определите, что уровень поддержки становится сопротивлением (или сопротивление становится поддержкой), вы ждете, когда цена вернется в эту зону, и входите в сделку оттуда..

6. Эта установка работает на всех временных графиках. Мне лично нравится искать ее на дневных и 30-минутных графиках.

Давайте посмотрим на несколько примеров.

Первый – EUR/USD на 30-минутном графике. Цена сделала два сильных отказа от уровня, что указывает на то, что это была сильная зона поддержки. Затем цена прошла через него, что сделало его новой зоной сопротивления. Вход для короткой сделки будет после отката к этому ценовому уровню – вновь сформированному уровню сопротивления.



Ниже вы можете увидеть второй пример. Это тот же самый график, только спустя несколько часов. Вы можете видеть, что реакция на сильный уровень сопротивления, который вы видели на предыдущем рисунке, фактически снова стала поддержкой. На рисунке вы можете видеть четыре реакции на уровень – это подтверждает, что он и раньше был сильным уровнем сопротивления. Когда цена прошла его, он стал сильной зоной поддержки (снова). Идея торговли здесь та же, что и на предыдущем рисунке, только в обратном порядке. В данном случае вы видите сильное сопротивление, которое было прорвано. Вы ждете, пока цена вернется в эту зону, и оттуда открываете длинные позиции – от вновь сформированного (в данном случае восстановленного) уровня поддержки.



Стратегия 2: Открытое движение

Стратегия открытого движения основана на внезапном и сильном одностороннем движении цены. Очень важно, чтобы движение было односторонним. Это означает, что цена двигалась агрессивно и неуклонно в одном направлении.

Открытое движение чаще всего возникает после бокового ценового движения (узкий ценовой канал), или вы также можете заметить его в начале торговой сессии.

Если открытое движение возникает после бокового ценового движения, это указывает на то, что либо сильные покупатели, либо продавцы накапливали свои позиции во время бокового ценового движения, а затем начали агрессивную деятельность по покупке или продаже, чтобы сдвинуть цену.

Если вы заметили одностороннее движение цены в начале торговой сессии (в Азии, ЕС или США), это дает вам представление о том, каким будет общее направление этой торговой сессии.

Самое главное – это место, где началась активная покупка или продажа. **Если агрессивные покупатели инициируют открытое движение, то цена выстреливает вверх, а место, где открылась сильная свеча покупки, является сильной поддержкой. Если открытое движение инициируют агрессивные продавцы, то цена выстреливает вниз, а место, где открылась сильная свеча на продажу, является сильным сопротивлением.**

Первый пример ниже показывает пару EUR/USD на 30-минутном графике. Сначала было 4-5 часов бокового ценового движения. Затем цена начала одностороннюю активность по продаже – это большая красная свеча. Место, где началась большая красная свеча, является открытым движением. Вам нужно подождать, пока несколько свечей сформируются ниже открытого движения, чтобы убедиться, что рынок принял более низкие цены как место с временной справедливой стоимостью. После этого вы ждете, пока цена не вернется к началу открытого движения, и входите в сделку оттуда.



Другим примером также является пара EUR/USD на 30-минутном интервале. В данном случае вы можете видеть открытие рынка после выходных с односторонней активностью

Бывают случаи, когда открытое движение создается каким-либо макроэкономическим событием. Это довольно частое явление. Обычный сценарий – рынок, находящийся в боковом ценовом движении, внезапно превращается в рынок с сильным трендом. Не имеет значения, вызвано ли сильное инициативное движение макроэкономическими новостями или нет. Я считаю это сильной зоной поддержки/сопротивления независимо от того, что послужило причиной открытого движения.

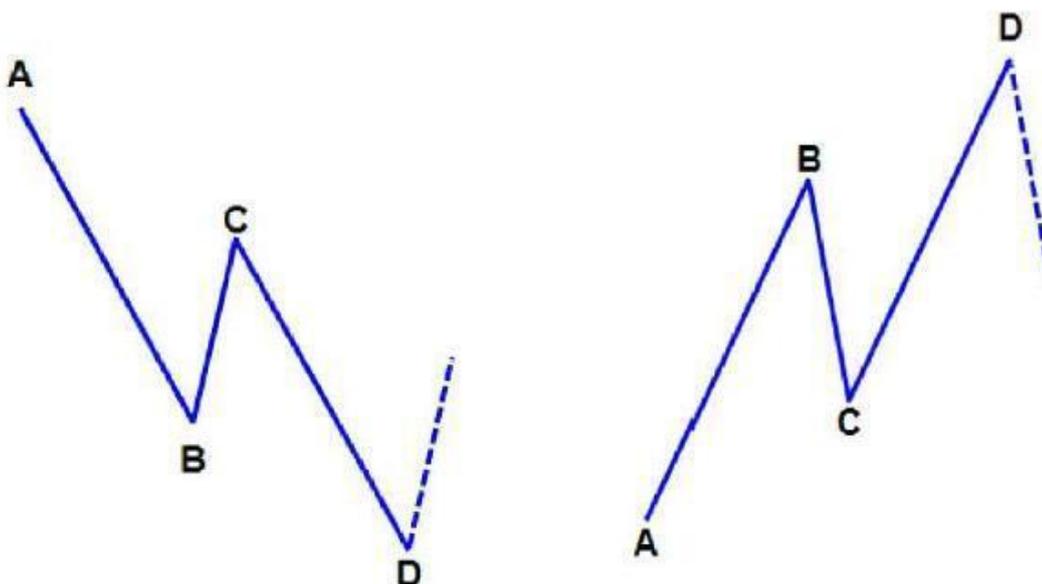
Стратегия 3: $AB = CD$

Эта стратегия немного отличается от всех других стратегий, которые я использую. Причина в том, что она основана скорее на психологии рынка, чем на активности организаций. Лично я использую ее как подтверждение моих основных стратегий (основанной на деятельности компаний и на объеме). Тем не менее, это очень хорошая стратегия, даже если вы используете ее как самостоятельную.

Основная идея заключается в том, что рынки движутся в виде волн. Максимумы/минимумы этих волн или колебаний имеют названия (A, B, C и D). Это выглядит следующим образом:

1. Расстояние от A до B – это расстояние от первой до второй точки свинга.
2. C образуется, если происходит откат хотя бы на 50 % к расстоянию от AB. Однако цена не должна проходить дальше A.
3. D расположена на таком же расстоянии от C, как A от B. Из-за этого паттерн называется $AB = CD$. Отрезок AB имеет такое же расстояние между вершинами, как и отрезок CD.
4. Если это растущий отрезок $AB = CD$, то вы входите в длинную сделку в точке D. Если это снижающийся отрезок $AB = CD$, то вы входите в короткую позицию в точке D.

Растущая формация $AB = CD$ Снижающаяся формация $AB = CD$



Для наглядности приведем растущую и снижающуюся схемы $AB = CD$.

Вы можете торговать этим паттерном практически на всех графиках. Я ищу этот паттерн на 30-минутных или 1-часовых графиках, 4-часовых графиках, дневных и недельных графиках. Обычно я не ищу этот паттерн на более низких временных интервалах, чем 30-минутные периоды.

Лучше всего измерять расстояния между точками колебаний с помощью инструмента Фибоначчи. Сначала вы размещаете инструмент Фибоначчи так, чтобы 0 % находился в точке A, а 100 % – в точке B. Затем вы убеждаетесь, что точка C составляет более 50 % от этого расстояния. После этого вы перемещаете инструмент Фибоначчи (не меняя измеренного рас-

стояния) так, чтобы 0 % находился в точке С. 100 % инструмент Фибоначчи покажет вам, где находится точка D (это место, где вы входите в сделку).

Вот как найти D в два этапа:

Шаг 1: Используйте инструмент Фибоначчи для определения значимых точек колебаний, составляющих A и B, и нахождения C ниже 50% (в случае снижающегося AB=CD):



Шаг 2: Поместите 0 % на C. Не меняйте измеренное расстояние AB. Таким образом вы найдете D, которая находится на уровне 100 %. Из этого места (D) вы войдете в короткую сделку:



Вот несколько реальных торговых примеров паттерна $AB = CD$:
Растущий $AB = CD$ (EUR/USD, 60-минутный интервал)



Снижающийся $AB = CD$ (EUR/USD, 240-минутный интервал)



Стратегия 4: Открытая сессия

Существует три торговые сессии – азиатская, европейская и американская. Название каждой сессии указывает на то, где в настоящее время торгуется большая часть денег. Продолжительность сессии определяется временем работы крупнейших финансовых бирж в данном регионе. Азиатская сессия начинается с открытия Токийской биржи, европейская сессия – с открытия Лондонской биржи, а американская сессия начинается с открытия Нью-Йоркской биржи.

Вот визуализация часов работы крупнейших бирж с веб-страницы www.forexmarkethours.com:



Очень полезно отмечать на своих графиках места, где открываются сессии. Эти места являются своего рода ориентирами, от которых рынок развивается дальше. Таким образом, вы можете определить настроение рынка на каждой торговой сессии.

Место открытия сессии является не только хорошей точкой ориентации, но и уровнем поддержки/сопротивления. Если торговая сессия начинается и цена идет вниз, то место, где открылась сессия, становится зоной сопротивления. Если, с другой стороны, сессия начинается с движения вверх, то место открытия сессии становится зоной поддержки.

Я не торгую зонами поддержки/сопротивления на основе открытия сессии как самостоятельной стратегией, но это приятное дополнение и еще одно подтверждение моей излюбленной стратегии. Помните – чем больше подтверждений уровня вы найдете, тем лучше.

На рисунке ниже показано начало американской сессии (открытие в НЙ). Когда цена опускается ниже этой зоны, место, где открылась американская сессия, становится зоной сопротивления. Существует реакция на открытие сессии, когда цена отступает назад к этой зоне.



Стратегия 5: Открытие дня

Для меня самой сильной поддержкой/сопротивлением, если говорить об открытии сессии, является место, где заканчивается один день и начинается новый (= открытие дня). Это происходит на закрытии торгов в Нью-Йорке в 17:00 по Нью-Йоркскому времени.

При использовании стратегии открытия дня вы ждете начала дня, а затем смотрите, пойдет ли цена вверх или вниз. Вы должны увидеть несколько свечей выше или ниже открытия. Если после дневного открытия цена идет вверх, то место, где открылся день, становится поддержкой. Если после дневного открытия цена идет вниз, то место, где открылся день, становится сопротивлением. Ниже показано дневное открытие с двумя хорошими внутридневными реакциями на 30-минутном графике пары EUR/USD.



Я использую эту стратегию только в качестве подтверждения моих основных стратегий, основанных на объеме. Я не торгую ею в качестве отдельной стратегии. Тем не менее, чем больше сигналов и подтверждений на торговом уровне, тем лучше.

Стратегия 6: Ежедневные/ недельные максимумы и минимумы

Максимумы и минимумы предыдущих дней или недель являются довольно значимыми зонами. Они отмечают места, где цена не смогла подняться выше или опуститься ниже. Дневной максимум показывает нам место, где покупатели остановили свою покупательскую активность, и продавцы взяли верх. Дневной минимум показывает место, где у продавцов, которые гнали цену вниз, не хватило сил или желания толкать цену ниже, и покупатели взяли верх.

Участники рынка хорошо запоминают дневные максимумы и минимумы, и такие участки часто работают как сильные зоны поддержки/сопротивления. Когда цена возвращается в зону, где был максимум или минимум предыдущего дня, все наблюдают за ней, и им интересно, будет ли эта зона преодолена или нет. Прорваться через такую сильную зону поддержки/сопротивления не так-то просто. Обычно требуется много сил (= много объема), чтобы прорваться через нее. Причина в том, что многие люди «защищают» такое место. Его защищают те, кто создал дневной максимум/минимум предыдущего дня (или несколько дней назад). Они защищают свои позиции и свои интересы.

Очевидной стратегией было бы движение в длинную позицию от минимума предыдущего дня и в короткую позицию от максимума предыдущего дня. Лично я так не торгую. Причина в том, что существует множество ложных прорывов через эти зоны С/П, и это просто не работает так успешно. Однако есть и другой способ торговли на дневных (недельных) максимумах и минимумах. Я предпочитаю именно этот способ. Он выглядит следующим образом:

Во-первых, я жду, когда будет преодолен максимум или минимум предыдущего дня (или любого прошлого дня). Это дает мне информацию о том, что мощная сила пробила сильный уровень поддержки/сопротивления. Мощная сила = сильные покупатели или сильные продавцы. Если вы помните стратегию 1: поддержка становится сопротивлением (и наоборот), то вы, вероятно, знаете, что я делаю дальше. Прорванная поддержка становится сопротивлением, а прорванное сопротивление – поддержкой.

Сценарий долгосрочной торговли: я жду, когда будет преодолен максимум предыдущего дня (сопротивление). После этого мне нужно увидеть ценовое движение выше максимума. Когда я торгую на внутрисдневных сделках, это не менее 1-3 30-минутных свечей. Для свинг-трейдинга это 1-3 дневные свечи. После этого я считаю это надлежащей поддержкой и жду, когда цена вернется к этой поддержке. Когда она возвращается, я вхожу в длинную позицию. По сути, я ищу способ войти в длинную позицию от максимума предыдущего дня. Вот два примера, оба на 30-минутном графике пары EUR/USD:



Сценарий краткосрочной торговли: В этом случае я жду, когда будет преодолен минимум предыдущего дня (поддержка). После этого я должен увидеть некоторое ценовое движение ниже минимума. После этого я рассматриваю его как надлежащее сопротивление и жду, когда цена вернется к этому сопротивлению. Когда она возвращается, я вхожу в короткую позицию. Я просто жду возможности войти в короткую сделку от минимума предыдущего дня. Вот пример на 30-минутном графике пары EUR/USD, чтобы было понятнее:



Не имеет значения, преодолет ли цена вчерашний максимум/минимум или максимум/минимум нескольких дней назад. Все это сильные зоны С/П. Однако важно, чтобы максимум/минимум не был испытан, и не образовался более высокий максимум или более низкий минимум. Если он проверяется и создается новый максимум/минимум, я больше не считаю его действительной зоной С/П.

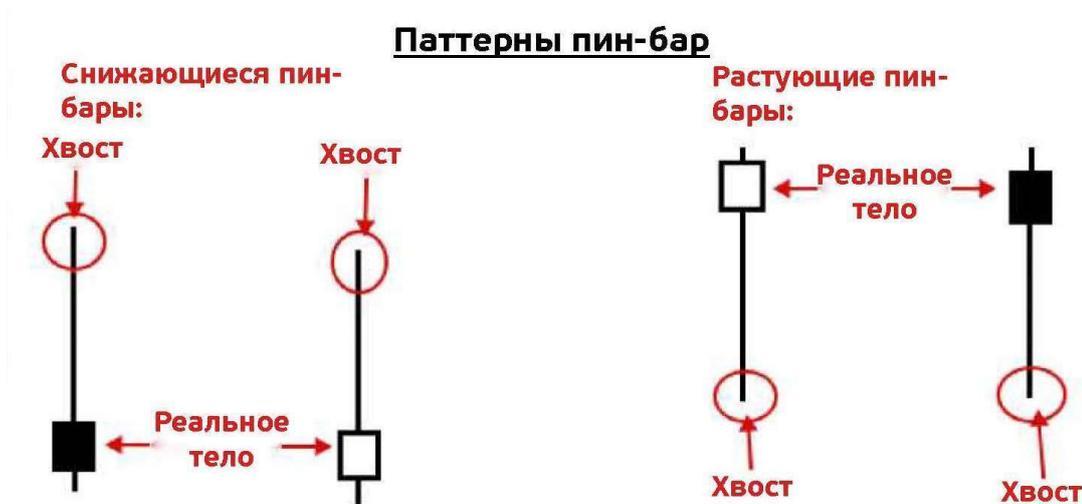
Аналогичная установка применима к недельным максимумам и минимумам. Это действительно сильные зоны поддержки/сопротивления, и я торгую на них так же, как и на дневных максимумах/минимумах.

Сильные или слабые максимумы/минимумы

Отличие сильного максимума от слабого максимума или сильного минимума от слабого минимума не является самостоятельной торговой стратегией. Однако умение отличать их друг от друга очень ценно. Фактически, в каждой сделке, основанной на моих основных стратегиях, основанных на объеме, я рассматриваю, близки ли мои уровни к сильным или слабым максимумам или минимумам. Вот что это такое:

Сильный максимум/минимум

Формирование максимумов и минимумов тесно связано с агрессией. Наиболее простой и широко известной свечой, демонстрирующей **реактивную агрессию**, является свеча **пин-бар**:



Существует больше свечных формаций, похожих на пин-бар, но вам не нужно знать их названия или определения. Общее для всех них – длинные хвосты и быстрая смена направления. Длинный хвост означает, что имела место сильная и агрессивная реакция. Именно так можно отличить сильный максимум/минимум от слабого максимума/минимума. Если есть свинг- минимум, где вы видите сильный и быстрый отказ от более низких цен, за которым следует агрессивное движение вверх, то перед вами сильный минимум. Посмотрите на пример сильного минимума:



Это не обязательно должен быть пин-бар или аналогичная свечная формация. Просто должна быть зона с явным и быстрым изменением направления. Еще один пример агрессивности вы можете увидеть здесь (сильный максимум на 5- минутном графике):



Помните, что вы ищете агрессию на максимумах/минимумах, а не какие-то конкретные свечные формации. Агрессивное изменение направления – вот что важно, а не свечная формация. Причина в том, что свечные формации различны на каждом временном интервале, но **сильные максимумы/минимумы, сформированные агрессивными игроками, обычно видны более чем на одном временном интервале.**

Слабые максимумы/минимумы

Слабые максимумы или минимумы являются полной противоположностью сильным. Такие точки свинга формировались медленно, неохотно, и не было никакой явной агрессивной активности. Слабые точки свинга можно определить по многочисленным узлам из множества свечей, которые «испытывают» какую-то зону, но нет ни одной свечи, которая бы проверяла дальше всех остальных свечей (если бы была, то это был бы признак сильной точки свинга). Если такой свечи нет, а просто много свечей проверяют одну и ту же зону, то это слабый максимум/минимум.

В приведенном ниже примере видно, как цена идет вверх, а затем разворачивается очень медленно и неохотно. В точке колебания этой зоны не видно никакой агрессии. Просто не было агрессивных продавцов, чтобы агрессивно отвергнуть более высокие цены. Это слабый максимум.



Как реализовать это в торговле:

Теперь вы знаете разницу между сильными и слабыми максимумами и минимумами. **Сильные максимумы/минимумы – это сильные зоны поддержки/сопротивления, поскольку они отмечают места на графике, где присутствовали агрессивные покупатели/продавцы.**

Слабые максимумы/минимумы – это места, где нет агрессивных участников рынка.

Я не предлагаю вам торговать на каждом сильном максимуме/минимуме, который вы видите. Я предлагаю, чтобы вы знали о них в своей торговле и адаптировали свою стратегию в соответствии с силой и агрессивностью того, как были сформированы максимумы/минимумы.

Например, представьте, что вы находитесь в длинной позиции и видите, что цена приближается к зоне, в которой находились агрессивные продавцы (сильный максимум). Зная об этом сильном максимуме, вы выходите из позиции до того, как цена достигнет этой области. Вот так вы используете знание сильного максимума для защиты своей прибыли и выхода из сделки до того, как позиция столкнется с

«опасной зоной» (= зоной сопротивления, созданной сильным максимумом). Вот пример:



Помимо сильного максимума, на картинке есть и слабый максимум. Распространенной ошибкой может быть выход в короткую позицию от этого слабого максимума или досрочный выход из длинной позиции. Цена обычно повторно проверяет слабые области, и в конечном итоге она стремится к сильным максимумам/минимумам. Слабые максимумы/минимумы – это места, через которые цена, скорее всего, прорвется. Нет причин прекращать торговлю, если цена направляется в область слабых максимумов/минимумов. Если область действительно слабая, цена, скорее всего, проверит ее и проскочит.

Позвольте мне проиллюстрировать распространенные ошибки, которые обычно совершают начинающие трейдеры:



Обычно я ищу сильные/слабые свинговые точки, когда создаю свои торговые уровни. Мне очень нравится размещать свои уровни в тех зонах, где наблюдался сильный отказ (сильный максимум/минимум). Сильный отказ отмечает агрессивных участников рынка, которые «помогут» защитить мою позицию и повести цену в нужном мне направлении. Вот пример:



С другой стороны, если я вижу слабый минимум ниже моего уровня длинной позиции или слабый максимум выше моего уровня короткой позиции, то я не принимаю сделку. Причина в том, что слабый минимум ниже уровня длинной позиции привлечет цену к испытанию ниже этого слабого минимума. Аналогичный сценарий – слабый максимум выше уровня короткой позиции. Это привлекает цену к проверке выше слабого максимума.

Вот пример уровня короткой позиции, который не так хорош, потому что над ним находится слабый максимум. Вы можете видеть, как слабый максимум притягивает цену, которая затем его преодолевает.



Причина, по которой рынок стремится проверить эти слабые свинговые точки, заключается в том, что в точке свинга не было сильного отказа, поэтому участники рынка хотят проверить, нет ли желающих торговать выше слабых максимумов (или ниже слабых минимумов). Почему рынок так поступает? Причина в том, что чем больше сделок и объема совершается, тем лучше для крупных компаний, которым нужно войти в свои позиции, а маркет-мейкеры зарабатывают больше денег на сопряжении ордеров на покупку и продажу.

Неудачный аукцион

Движение цен и торговля имеют много общего с процессом аукциона. Движение цен, по сути, представляет собой аукцион, который не имеет конца. Неудачный аукцион – это незавершенный аукцион. Это изъян, который рано или поздно будет устранен.

Представьте, что вы находитесь на обычном аукционе, например, картины. Предположим, что начальная цена составляет \$1000. За эту цену найдется 10 желающих купить. На \$1500 есть 5 покупателей, готовых заплатить. Затем цена становится все выше и выше, пока не останется только один человек – тот, кто предложил больше всех. Это пример полного и успешного аукциона.

Неудачным аукцион будет в том случае, если желающих заплатить, скажем, \$2000 будет двое, и на этом аукцион закончится. Это был бы неудачный аукцион, потому что в успешном аукционе есть только один победитель, который получает приз (например, картину).

То же самое касается и трейдинга. Я сделаю это немного проще, чем есть на самом деле, но принцип тот же самый. В торговле **всегда должен быть**

«последний парень» на вершине (или внизу) максимума/минимума колебаний. Последний, кто заключит сделку до того, как цена развернется и направится в другую сторону (и начнется новый аукцион в другом направлении). См. рисунок ниже:



На рисунке выше показан **успешный аукцион**.

Однако если аукцион не удался, то на вершине (или внизу) максимума/минимума свинга торгуется больше людей. С этого места начинается новый аукционный процесс в другом направлении, даже если предыдущий аукцион не закончился (он не был успешным). Это немного странно, потому что не было «последнего парня», который совершил бы последнюю сделку («победителя» аукциона = того, кому достанется «картина»). Таким образом, на вершине точки свинга есть несколько парней, которые, вероятно, готовы бороться за приз, но они не получают такой возможности. В этом случае аукцион не увенчан успехом, потому что у него нет одного победителя.

Неудачный аукцион – это изъян. Рынок в конце концов разберется с этим и даст тем парням, которые стоят на вершине точки свинга, шанс побороться и посмотреть, как далеко может зайти цена, пока не останется только один «победитель». Другими словами – **неудачный аукцион – это изъян, который рынок рано или поздно устранил. Неудачные аукционы работают как магнит. Если цена приблизится к такому аукциону, то, скорее всего, она проверит его и создаст новый максимум/минимум, чтобы устранить недостаток.**

Вот пример неудачного аукциона:



Неудачный аукцион = 2 (или более) свечи имеют свои минимумы на одном и том же ценовом уровне. В этой точке свинга аукцион на понижение "не удался". Несмотря на это, начинается новый восходящий аукцион.

Мы можем использовать знания о неудачных и успешных аукционах в своих интересах!

На рисунке ниже я отметил несколько неудачных аукционов. Обратите внимание, как цена реагирует на них и как она проскакивает мимо этих неудачных аукционов. Прострел цены через неудачные аукционы решает проблему недостатка рынка. **Цена, прошедшая мимо неудачных аукционов, превращает их в успешные.**

Стрелки показывают, куда двигалась цена на неудачных аукционах, чтобы превратить их в успешные.



Другая картинка – пример сделки, которую я совершил вчера:

Я находился в длинной позиции, и моя цель прибыли обычно составляла 10 пунктов (это обычный PT для моих внутрисуточных сделок). Однако вблизи моей цели прибыли произошел значительный неудачный аукцион. Я знал, что цена, скорее всего, испытает себя выше неудачного аукциона, чтобы избавиться от этого недостатка и проверить, готовы ли большие покупатели покупать выше этого уровня неудачного аукциона. Зная это, я передвинул свою цель прибыли на один пункт выше неудачного аукциона, и вместо прибыли +10 пунктов я получил прибыль +13 пунктов. Вот сделка:



Если вы – свинг-трейдер, то несколько пунктов могут показаться вам не столь значительными. Тем не менее, вы можете использовать теорию неудачного аукциона и для свинг-трейдинга и получить гораздо больше, чем +3 дополнительных пункта. Это может быть, например,

+30 пунктов в свинг-трейдинге. Самое приятное во всех этих вещах, которые я вам показываю, то, что их можно применять на всех временных интервалах и для всех видов торговли.

Есть еще один способ использовать неудачный аукцион в своих интересах. Как я уже говорил, несостоявшийся аукцион – это изъян рынка. По этой причине, когда цена приближается к нему, неудачный аукцион начинает работать как магнит. Цена движется к нему и через него, чтобы «проверить» выше/ниже неудачного аукциона, чтобы устранить недостаток. Поэтому, когда бы я ни рассматривал возможность заключения сделки, я всегда смотрю, нет ли поблизости неудачного аукциона.

Если я хочу пойти в длинную позицию, то я не хочу видеть несостоявшийся аукцион ниже уровня моей длинной позиции, потому что рынок подтолкнет цену к неудачному аукциону – для испытания ниже него. Это приведет к убыточной сделке.

Если я хочу пойти в короткую позицию, то я не хочу видеть неудачный аукцион выше моего уровня короткой позиции, потому что рынок будет толкать цену к неудачному аукциону – для проверки выше него. Это приведет к убыточной сделке.

Неудачный аукцион – это концепция, которую я использую каждый день, и я нахожу ее чрезвычайно полезной. Она помогает мне растягивать цели по прибыли, а также предотвращать неудачные сделки. Я ищу несостоявшиеся аукционы в основном на 30-минутных графиках при внутрисуточной торговле и на дневных графиках при свинг-трейдинге.

Профиль объема

Почему так важны объемы?

На мой взгляд, объемы – это самая важная информация, которую может дать нам рынок. Почему это так значимо? Потому что около 80 % всех сделок и объема совершаются только 10 крупнейшими финансовыми учреждениями (большими парнями). Они двигают и манипулируют рынками. У них есть лучшие торговые эксперты, технологии, алгоритмы, а также огромные суммы денег. Однако наличие такого количества денег – это тоже проблема. Им трудно перемещать такие суммы, инвестировать их, а также скрывать свои торговые намерения. Крупные компании не могут просто купить 100 000 лотов пары EUR/USD одним кликом. Они должны входить в свои позиции медленно, незаметно. Тем не менее, они никогда не смогут спрятаться. Их объемы всегда будут видны, и мы всегда сможем их отследить. Как? С помощью профиля объема.

В отличие от стандартных индикаторов объема, которые показывают только **объемы в момент времени**, профиль объема может предоставить гораздо более важную информацию – **объем по конкретной цене**.



Объем по изменению цены так полезен, потому что он говорит нам о том, какие ценовые уровни были наиболее важны для крупных игроков, доминирующих на рынках. Чем больше

объема накапливается на определенном ценовом уровне, тем более значимым является этот ценовой уровень.

Количество объема можно определить по толщине профиля объема. Там, где профиль широкий, накапливаются большие объемы. Там, где профиль объема тонкий, торговались только низкие объемы.

Где получить профиль объема

Вы можете получить мой индивидуальный гибкий профиль объема

Конец ознакомительного фрагмента.

Текст предоставлен ООО «ЛитРес».

Прочитайте эту книгу целиком, [купив полную легальную версию](#) на ЛитРес.

Безопасно оплатить книгу можно банковской картой Visa, MasterCard, Maestro, со счета мобильного телефона, с платежного терминала, в салоне МТС или Связной, через PayPal, WebMoney, Яндекс.Деньги, QIWI Кошелек, бонусными картами или другим удобным Вам способом.