

Начало работы

Знакомство

Всем доброго времени суток, меня зовут Александр, Санчо, я занимаюсь трейдингом уже пятый год. Мной используется наиболее эффективная и прогрессивная концепция для торговли – Smart Money, что и будет изучаться в этом курсе.

Предоставленные материалы зададут правильный вектор развития в этом ремесле. У вас появляется возможность сформировать свою уникальную торговую систему, с помощью которой вы сможете получать позитивные результаты на дистанции.

Процесс обучения разделен на текстовые и видео материалы. В методичках есть краткие разъяснения по каждой теме, что может использоваться для начального ознакомления с концепцией умных денег. Концентрацию информации вы увидите на конференциях, которые проходят два раза в неделю, и в записанных видео уроках. Работа в чате также играет немаловажную роль. Так как человека обычно формирует общество, обитание среди трейдеров поможет вам значительно быстрее улучшать своё мастерство в трейдинге. Проявляйте активность, задавайте вопросы, делитесь своими идеями и проявляйте инициативу.

Бэктест и применение полученных знаний на практике — это отдельный этап, который и будет в основном формировать вас как трейдера. Именно при работе с графиком вы будете закреплять пройденные материалы, вырабатывать и улучшать свои навыки.

Процесс обучения не ограничивается одним месяцем. Доступ ко всем привилегиям остается навсегда, рекомендую их использовать столько времени, сколько вам понадобится.

Общие понятия концепции Smart Money

Что подразумевается под умными деньгами?

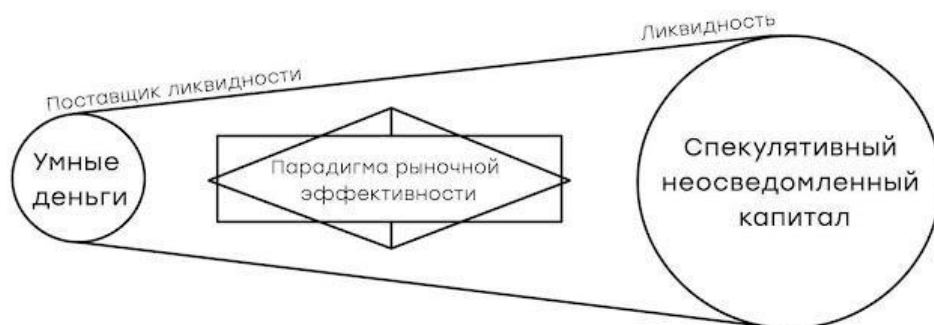
Умные деньги — это крупные участники рынка, имеющие достаточные объемы, чтобы оказывать влияние на цену.

Это небольшая группа, в которую входят банки и крупные фонды.

Каждое движение до мельчайшей детали контролируется. Это делается с помощью искусственного интеллекта, программы, которая доставляет цену на определенные значения.

Уникальные алгоритмы, которые опускают и поднимают цену, эффективны, потому что они знают поведение людей, которое неизменно будет основываться на страхе и жадности.

На схеме отображена парадигма рыночной эффективности. Подробнее об этом рассказывается во втором видео уроке.



По другую сторону находится большинство трейдеров, около 95%, включая нас — это не информированные деньги. В такую группу входят ритейл трейдеры и небольшие фонды.

Резиденты такой группы считают, что из-за их численности они двигают рынок. Но на самом деле розничный сектор не может оказывать никакого влияния на цену.

Обуславливается это низкими объемами: большая группа в денежном эквиваленте не так уж велика, как может показаться. Крупные объемы, способные это делать, находятся в небольшой группе — умных денег.

Ритейл трейдеры слишком малы и составляют только небольшой процент обращаемых денег на рынке (~5%), поэтому основной целью для умного капитала всегда выступают фонды.

Что подразумевается под торговлей по концепции Smart Money?

Следование за крупными участниками рынка. С помощью институциональных инструментов вы сможете идентифицировать и отслеживать действия умных денег.

Концепция Smart Money становится популярной, это может быть причиной, почему она перестанет работать?

Никакая концепция, включая Smart Money, не дает возможности торговать со 100% винрейтом, всё из-за субъективности анализа отдельной рыночной ситуации. Трейдеры получают прибыль на дистанции из-за следования своим же правилам при анализе графика и открытии сделок, соблюдения соотношения риска и прибыли и контроля риска. Концепция анализа не является гарантом прибыльности трейдера. Только системный подход и самодисциплина дадут возможность стабильно получать прибыль.

Пока на рынке будет ликвидность, до тех пор концепция будет эффективна в применении.

Как эффективно обучаться?

Ознакомьтесь со всеми текстовыми и видео материалами перед началом конференций. Все инструменты используются вместе друг с другом, изолированно они не будут эффективно работать.

Основной упор нужно делать на тему, которая будет рассматриваться на предстоящей конференции.

Выполняйте задания в конце каждой методички, это поможет закрепить пройденный материал и выявить допущенные ошибки на конференциях.

Проводите работу на истории при прохождении каждой темы. Для этого можно использовать симулятор рынка.

Рекомендую уделять на каждую тему не менее 100 часов.

Не беспокойтесь насчет времени, доступ ко всем привилегиям остается навсегда, поэтому если вы не успеваете освоить определенную тему, вы сможете это сделать со следующей группой.

Практикуйтесь анализировать график и открывать позиции в реальном времени. Рекомендую использовать тренировочный депозит (\$100 - \$500) или пониженный риск, например 0.1% от вашего счета, до тех пор, пока не появятся стабильные результаты.

Старайтесь понять логику использования каждого инструмента, не торгуйте только на основе каких-либо паттернов – это не принесет ожидаемых результатов.

Платформа для анализа графиков

Анализ графиков – это процесс, который вы делаете на ежедневной основе. Вам нужен удобный и функциональный сервис. Лучшее, что вы сможете найти – это TradingView.

У сервиса есть бесплатная версия, и также платные подписки, которые дают некоторые дополнительные функции. Мной используется подписка Premium. С характеристиками каждой подписки и условиями вы сможете ознакомиться на сайте tradingview.com.

Журнал сделок

Ведение статистики и фиксирование каждой сделки дает возможность проводить анализ допущенных ошибок,

выявлять недостатки своей торговой стратегии и подводить итоги недели/месяца/квартала и так далее.

Треjder, системно повторяющий ранее допущенные ошибки, заведомо пришёл терять деньги. Вы должны налаживать систему и быть дисциплинированным уже в начале своего пути, такой подход даст возможность быть прибыльным на дистанции.

Для ведения журнала мной используется платформа notion.so:

Один из вариантов журнала сделок.

Журнал сделок

Default view +										Filter	Sort	Q	...	New ▾
🏷️ Coin	📅 Date	☰ Direction	📍 Killzone	⚡ Risk	⚡ RR	⚡ Result	☑ Win rate	🕒 Before	🕒 After	+	...			
BTC (M)	August 17, 2022	Short	LO KZ	2%	4.5	7.5%	☑	https://www.tradingview.com/x/sZsYsLfb/	https://www.tradingview.com/x/JKXNRccL/					
BTC (L)	September 13, 2022	Short	LO KZ	2%	5		☐	https://www.tradingview.com/x/bWXmOFWQ/						
+ New														
COUNT 2				AVERAGE 4.75		SUM 7.5%		CHECKED 50%						

Показанный пример даёт возможность быстро вносить все необходимые данные касательно вашей позиции. Основная информация отображается на графиках.

Для большей информативности можно добавить ещё один раздел “Describes”, в котором будут записываться причины открытия сделки, ваши рассуждения, действия, предпринимаемые по уже открытой сделке.

Объяснение аббревиатур:

Coin – торговая пара, тип ордера: BTC (Market / Limit).

Date – день открытия сделки.

Direction – направление позиции: long / short.

Killzone – время открытия позиции: AO KZ / LO KZ / NYO KZ / LOC KZ. В случае, если сделка открывалась вне оптимального времени для торговли, поле не заполняется.

Risk – максимально допустимый убыток: 0.5% / 1% / 2%.

RR – соотношение риска и прибыли: 4 / 5 / 5.7.

Result – полученный результат: +4% / -1%.

Winrate – фиксация прибыльных и убыточных сделок.
Before – график после открытия позиции или выставления лимитного ордера.

After – график после закрытия позиции.

Вы можете персонализировать свой журнал сделок, изменив или добавив некоторые детали. Необходимое время на создание подобной таблицы — 5 минут.

В конце каждой недели и месяца я провожу анализ всех позиций, которые были открыты в течении текущей недели или месяца. Основной целью является выявление допущенных ошибок и поиск способов их недопущения в дальнейшем.

Ведение журнала сделок является первым шагом к началу системной торговли и развитию самодисциплины.

Человек, не сумевший замотивировать себя фиксировать свои действия для их дальнейшей оценки, с большой вероятностью не сможет соблюдать поставленные перед собой правила при анализе графика и открытии позиций, что всегда будет приводить к негативным результатам на дистанции.

Swing High и Swing Low

Свинг – это ценовой максимум или минимум перед движением в противоположную сторону.

Существуют трех свечные и пяти свечные свинги.

Трех свечные свинги

Swing High образовывается при формировании трех последовательных свечей, где средняя свеча формирует пик восходящего движения, имея две свечи по сторонам от неё с более низкими максимумами.

Цвет свечей не имеет значения, тени всегда должны учитываться.



Swing Low образовывается при формировании трех последовательных свечей, где средняя свеча формирует пик нисходящего движения, имея две свечи по сторонам от неё с более высокими минимумами.

Обычно такие максимумы и минимумы отображают структурные элементы младшего таймфрейма, когда пяти свечные свинги используются для определения структурных элементов рассматриваемого таймфрейма:

Пяти свечной свинг

BTCUSDTPERP, 1h, BINANCE ОТКР20196.3 МАКС20241.6 МИН20058.0 ЗАКР20065.2...



Трёх свечной свинг

USDТ BTCUSDТ, 1h, BINANCE ОТКР20204.36 МАКС20252.90 МИН20060.34 ЗАКР20071.64



Пяти свечные свинги

Swing High образовывается при формировании пяти последовательных свечей, где третья свеча формирует пик восходящего движения, имея по две свечи по сторонам от неё с более низкими максимумами.

swing high

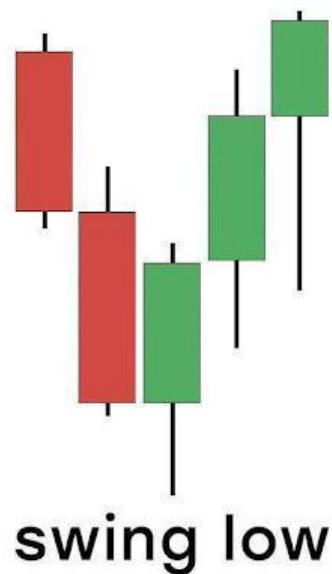
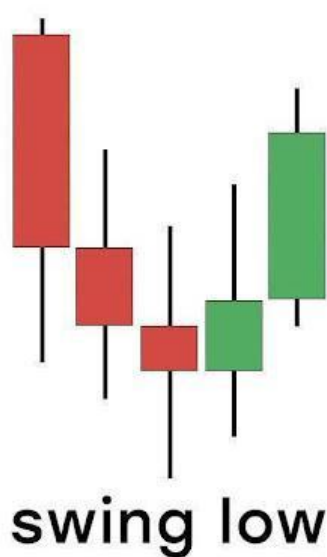


swing high



Пяти свечные максимумы всегда выступают структурными элементами рассматриваемого таймфрейма (swing / sub / minor).

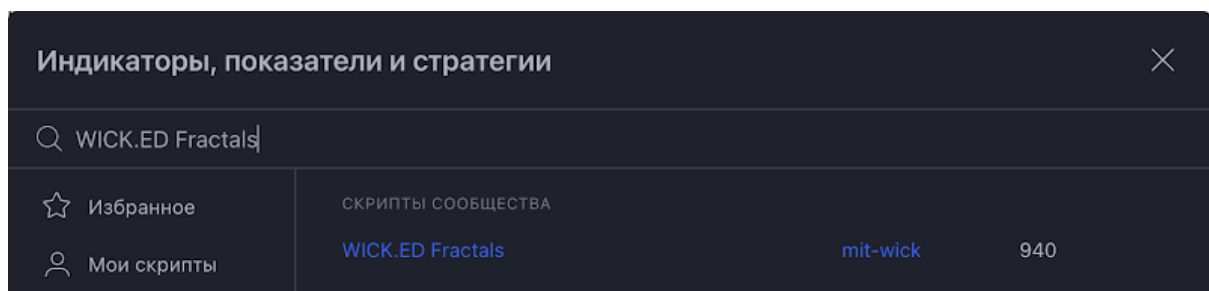
Swing Low образовывается при формировании пяти последовательных свечей, где третья свеча формирует пик нисходящего движения, имея по две свечи по сторонам от неё с более высокими минимумами.



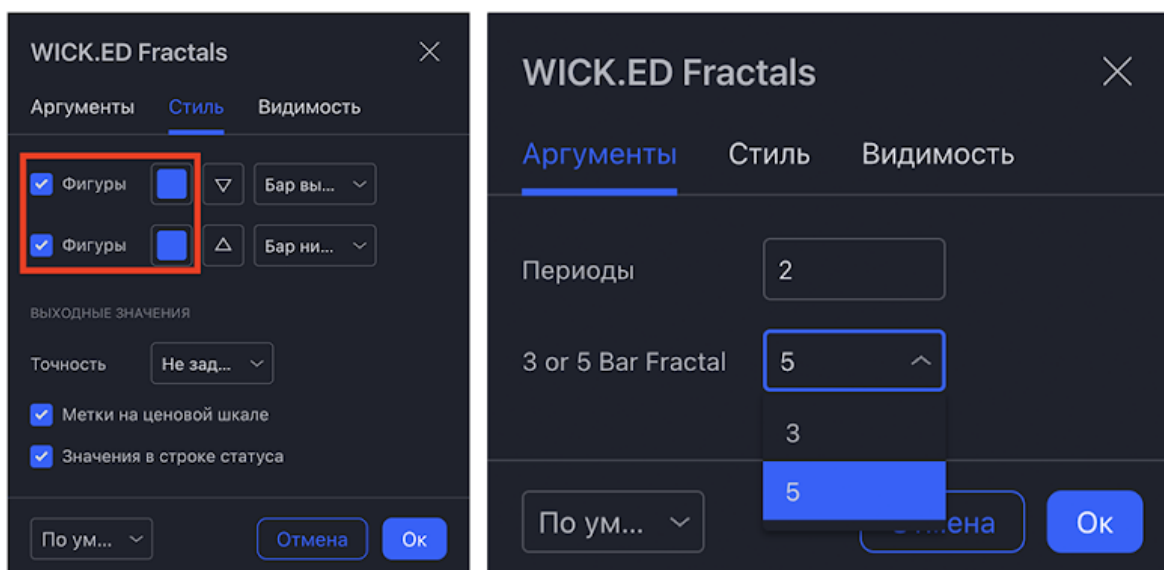
Пяти свечные минимумы всегда выступают структурными элементами рассматриваемого таймфрейма (swing / sub / minor).

Визуально пяти свечные свинги всегда выглядят как явные впадины и вершины, их достаточно просто определить без подсчета свечей, но в любом случае рекомендую проверять себя, чтобы избежать ненужных ошибок.

Чтобы упростить поиск необходимых свингов, рекомендую использовать индикатор, который будет определять их вместо вас: «**WICK.ED Fractals**».



На графике с белым фоном необходимо зайти в настройки индикатора и во вкладке «стиль» изменить цвет фигур со светлого на темный.



А во вкладке «Аргументы» установите, какие свинги индикатор должен отображать: с тремя свечами или пятью («3 or 5 Bar Fractal»). **Нужно установить значение «5».**



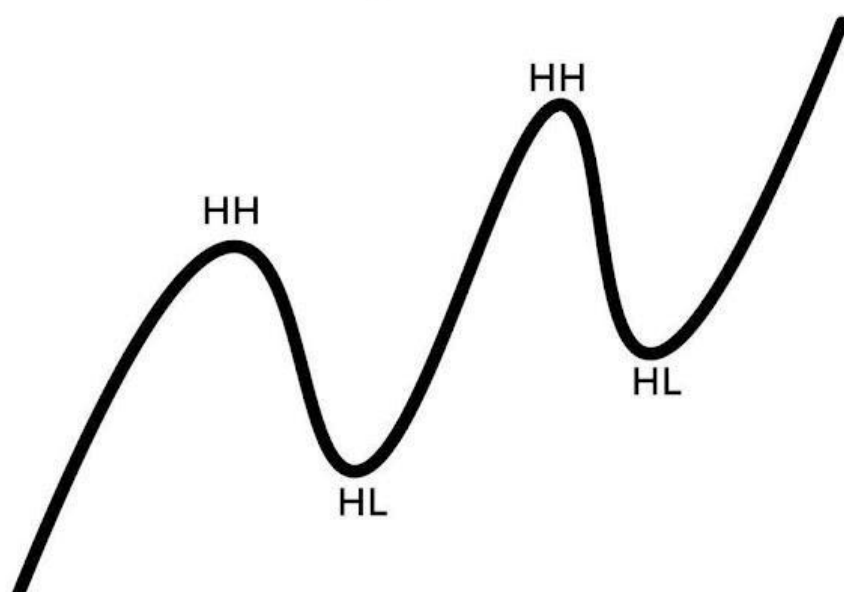
Структура рынка

Структура рынка – это последовательность максимумов и минимумов. Позволяет определить тренд и потенциальное движение цены в дальнейшем.

Тренд – это общее направление движения цены по пути наименьшего сопротивления. Задача трейдера – определить тренд и торговать в гармонии с ним.

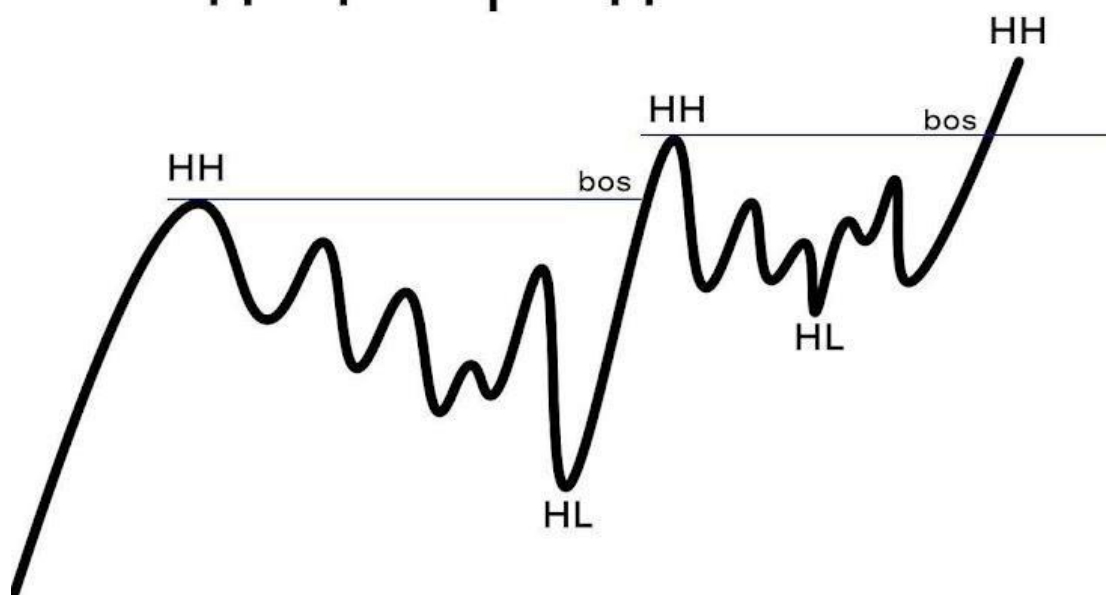
Рынок может находиться в трёх состояниях: восходящий тренд (бычий); нисходящий тренд (медвежий); боковое движение (флэт).

восходящий тренд



Состоит из повышающихся максимумов (**H**igher **H**igh) и минимумов (**H**igher **L**ow). Формирование максимума обычно будет импульсным, а минимума – коррекционным (см. LoE).

восходящий тренд



Подтверждением HL будет обновление (bos) предыдущего НН. Для определения структурных элементов обращайте внимание на пяти свечные максимумы и минимумы.

В данном случае под аббревиатурой “bos” подразумевается подтверждение HL.

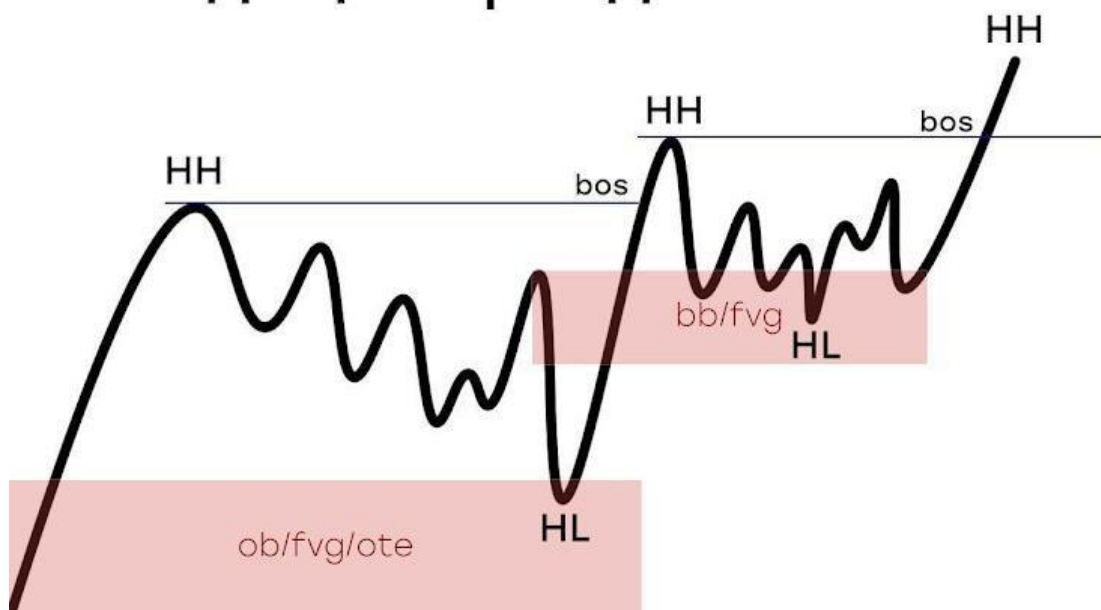
DXU, 1D, TVC ОТКР114.020 МАКС114.472 МИН113.332 ЗАКР114.159



Задача трейдера — работать в соответствии с общим направлением цены. После формирования более высокого максимума (НН) с большой вероятностью начнется коррекция, которая образует более высокий минимум (НЛ) — это возможность для входа в лонг позицию с целью обновления предыдущего НН.

Формирование НЛ

восходящий тренд



Структуру нужно использовать в совокупности с другими инструментами, в первую очередь с зонами поддержки и сопротивления: Order Block, Breaker Block, Mitigation Block, Fair Value Gap.

Более высокий минимум (HL) должен формироваться от зоны поддержки, в этот момент будет актуально рассматривать лонг позиции с целью обновления предыдущего HH.



Минимум, отмеченный красным, не был образован от видимой зоны поддержки, поэтому после активации стоп-лоссов на покупку и теста зоны сопротивления он будет выступать первоначальной целью для нисходящего

ценообразования, после чего восходящий тренд может продолжиться.

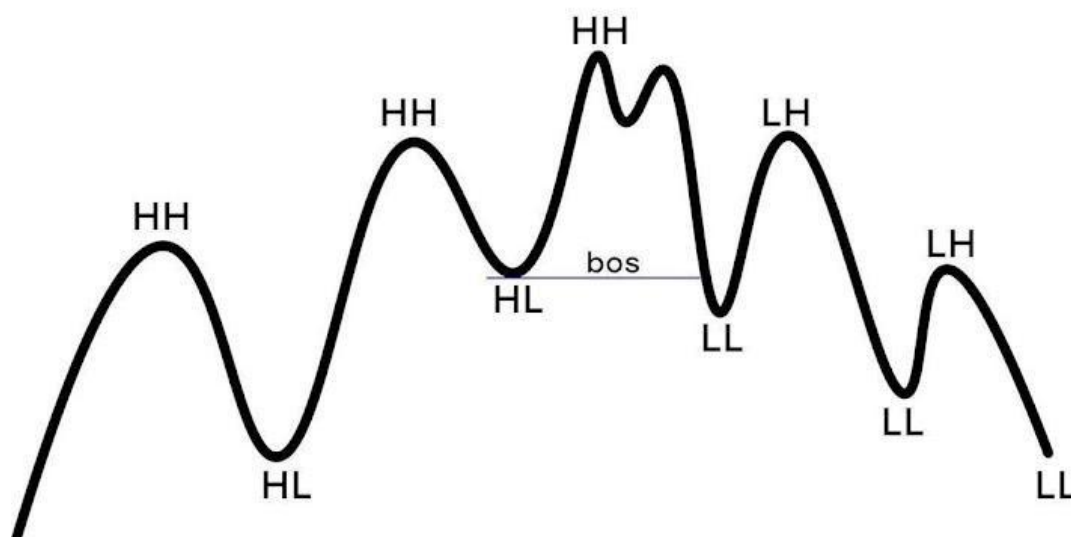
Слом восходящего тренда

Обновление подтвержденного HL будет являться сломом бычьего тренда, после чего последует формирование более низкого минимума (LL).

Слом структуры позволяет открывать позиции на зарождении противоположной структуры. То есть появляется возможность открыть сделку на формировании LH в зоне сопротивления.

bos - break of structure

слом структуры восходящего тренда



Тренд подтверждается при формировании трёх структурных элементов: HH – HL – HH для восходящего тренда, LL – LH – LL для нисходящего тренда.



После обновления подтвержденного HL цена сформировала три структурных элемента: LL, LH, LL. Таким образом нисходящий тренд подтвердился, и в случае, если на основе старших таймфреймов вы предвзяты по-медвежьи, наиболее оптимальным вариантом будет рассматривать шорт позиции.

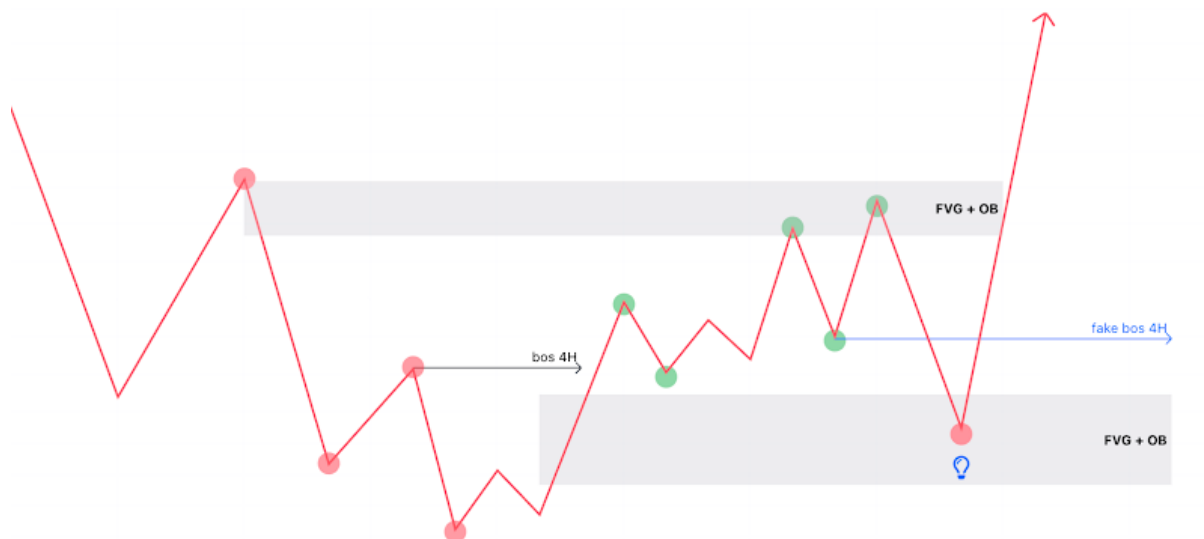
Ложный слом структуры восходящего тренда

Обычно встречается на коррекции старшего таймфрейма. Цена всегда стремится обновить локальную ликвидность на продажу, которая находится возле 50% торгового диапазона или в дискант маркете.

Таким образом, когда например на 1D таймфрейме формируется HL, тогда на младших таймфреймах, начиная с 4H, структура может смениться с восходящей на нисходящую.

Схематический пример: восходящая структура 4H таймфрейма была сломана в момент коррекции структуры 1D таймфрейма, после чего восходящее ценообразование продолжилось.

Обновленные минимумы могли формироваться от локальных зон поддержки, в любом случае во всех подобных ситуациях ожидается их обновление.



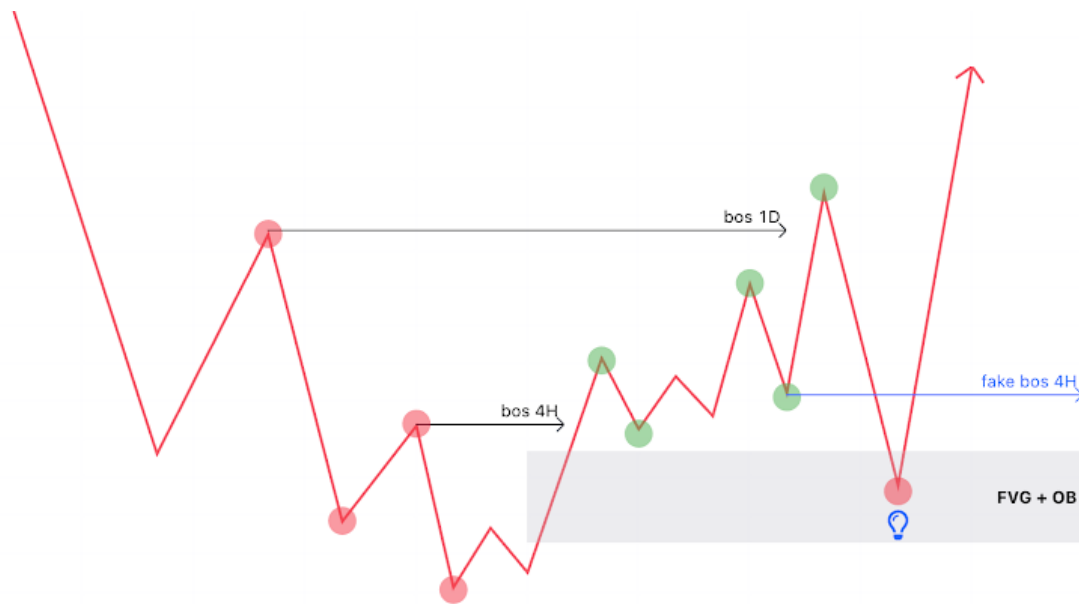
Цена может сформировать несколько нисходящих структурных элементов перед продолжением восходящего тренда. На старшем таймфрейме по-прежнему будет формироваться структурный HL.



На коррекции 4Н таймфрейма была сломана восходящая структура 1Н и всех меньших таймфреймов.

Начало подобной коррекции обычно происходит перед снятием значимого пула ликвидности на покупку и после теста зоны сопротивления.

Второй распространенный сценарий встречается после обновления старого максимума и теста зоны сопротивления:



После смены дневной структуры с нисходящей на восходящую началась глубокая коррекция, на которой образовался более высокий минимум (HL) 1D структуры. В этот момент обновлялись краткосрочные минимумы, которые были сформированы перед зоной поддержки возле 50% дневного торгового диапазона или в дискант маркете.

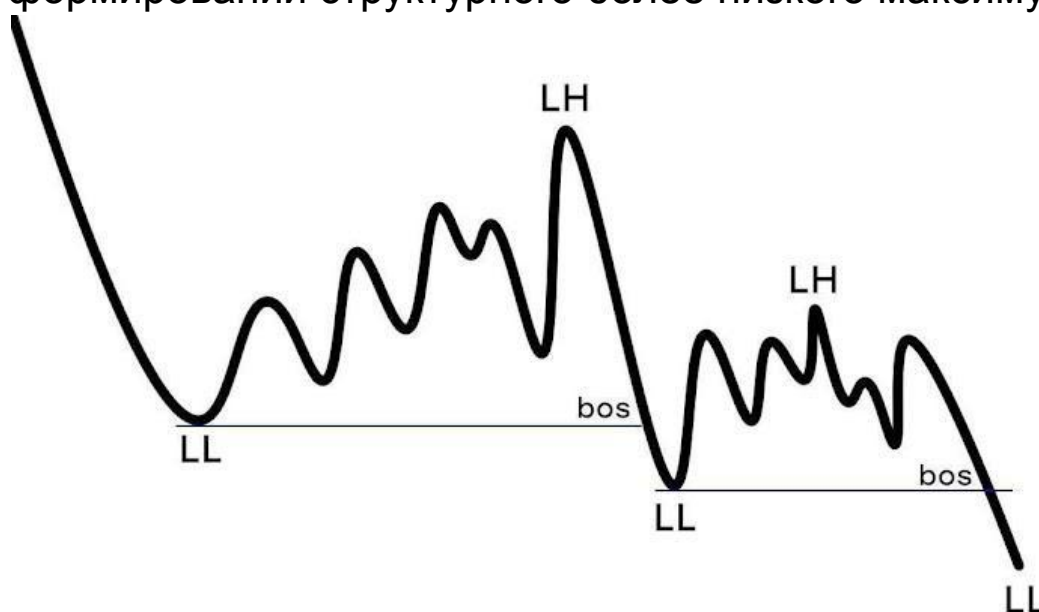


После обновления старого максимума и ребалансировки цены началась глубокая коррекция, на которой произошла смена 4H структуры. На 1D таймфрейме сформировался более высокий минимум в дискант маркете от зоны поддержки. Восходящее ценообразование продолжилось.



Состоит из понижающихся минимумов (**Lower Low**) и максимумов (**Lower High**). Формирование минимума обычно будет импульсным, а максимума – коррекционным (см. LoE).

Лучшие возможности для открытия шорт позиций будут при формировании структурного более низкого максимума (LH).



нисходящий тренд

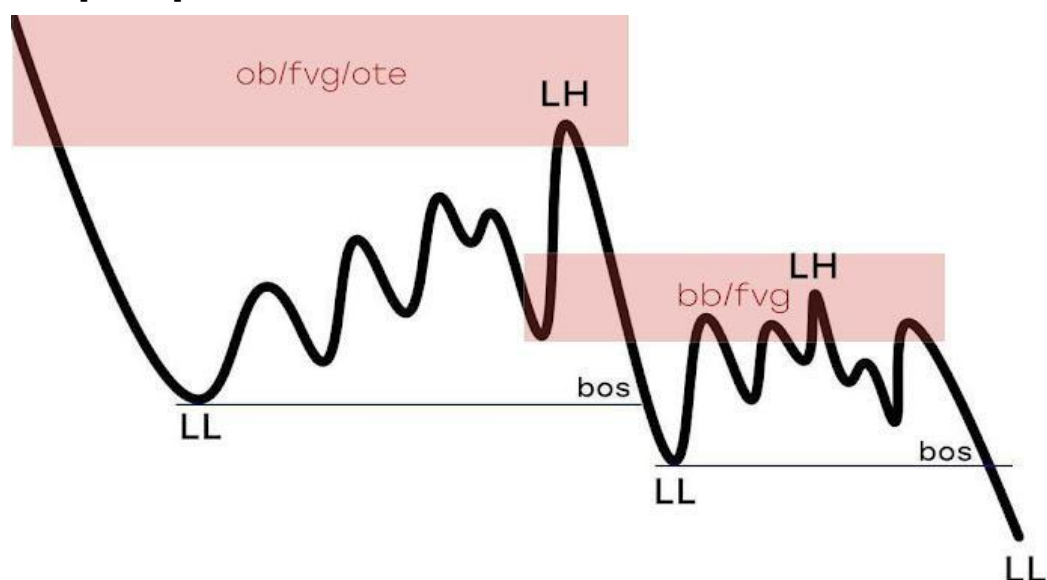
Подтверждением LH будет обновление (bos) предыдущего LL. Для определения структурных элементов обращайте внимание на пяти свечные максимумы и минимумы.

В данном случае под аббревиатурой “bos” подразумевается подтверждение LH.



Задача трейдера — работать в соответствии с общим направлением цены. После формирования более низкого минимума (LL) с большой вероятностью начнется коррекция, которая образует более низкий максимум (LH) — это возможность для входа в шорт позицию с целью обновления предыдущего LL.

Формирование LH



нисходящий тренд

Структуру нужно использовать в совокупности с другими инструментами, в первую очередь с зонами поддержки и

сопротивления: Order Block, Breaker Block, Mitigation Block, Fair Value Gap.

Более низкий максимум (LN) должен формироваться от зоны сопротивления, в этот момент будет актуально рассматривать шорт позиции с целью обновления предыдущего LL.

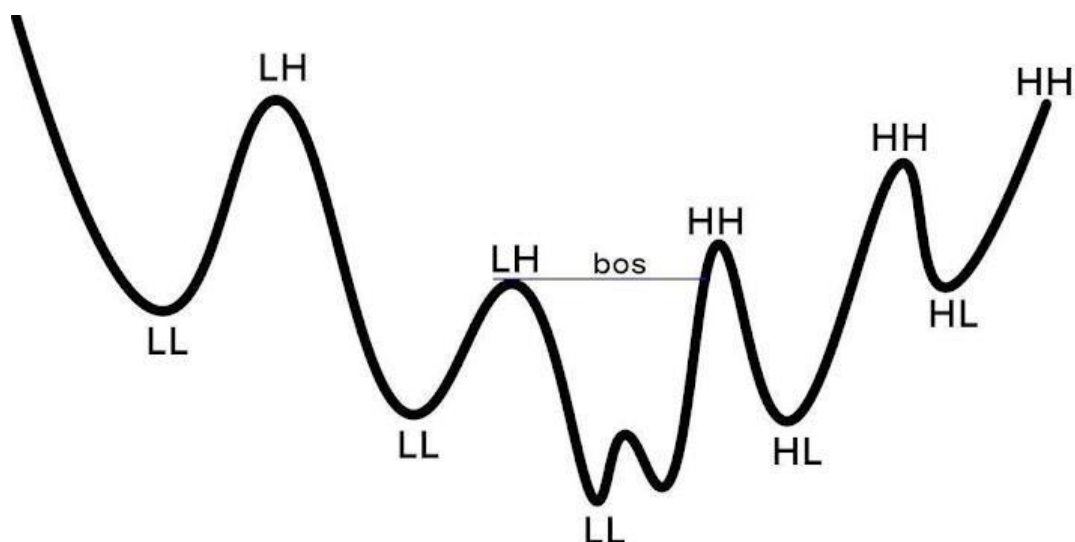


Слом нисходящего тренда

Обновление подтвержденного LN будет являться сломом медвежьего тренда, после чего последует формирование более высокого максимума (HN).

Слом структуры позволяет открывать позиции на зарождении противоположной структуры. То есть появляется возможность открыть сделку на формировании HL в зоне поддержки.

bos - break of structure



слом структуры нисходящего тренда

EURUSD, 4H, FOREX.com OTKP1.01417 МАКС1.01444 МИН1.01047 ЗАКР1.01437



После обновления подтвержденного LH цена сформировала три структурных элемента: HH, HL, HH. Таким образом восходящий тренд подтвердился, и в случае, если на основе старших таймфреймов вы предвзяты по-бычьей, наиболее оптимальным вариантом будет рассматривать лонг позиции.

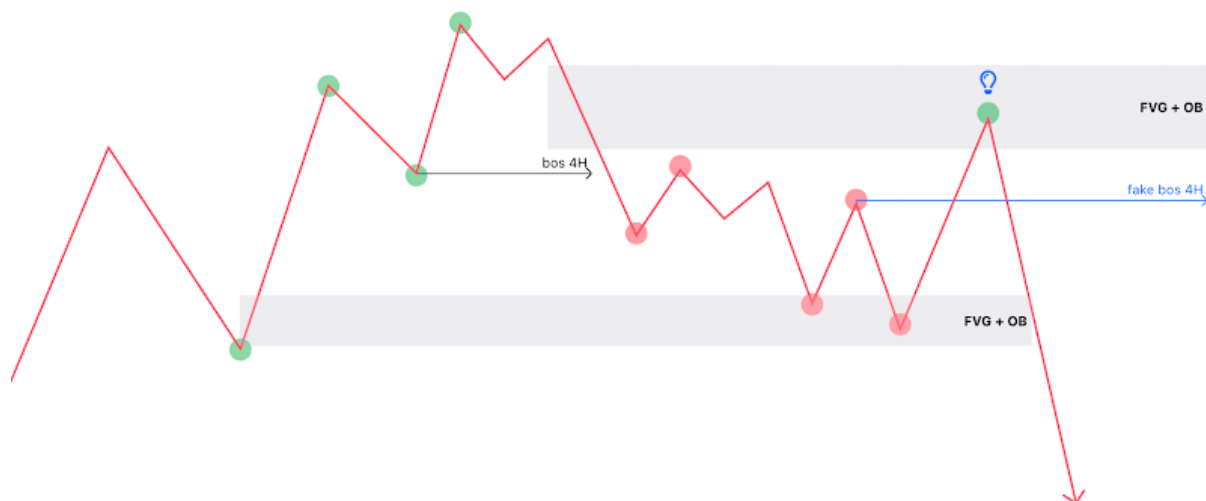
Ложный слом структуры нисходящего тренда

Обычно встречается на коррекции старшего таймфрейма. Цена всегда стремится обновить локальную ликвидность на покупку, которая находится возле 50% торгового диапазона или в премиум маркете.

Таким образом, когда например на 1D таймфрейме формируется LH, тогда на младших таймфреймах, начиная с 4H, структура может смениться с нисходящей на восходящую.

Схематический пример: нисходящая структура 4H таймфрейма была сломана в момент коррекции структуры 1D таймфрейма, после чего нисходящее ценообразование продолжилось.

Обновленные максимумы могли формироваться от локальных зон сопротивления, в любом случае во всех подобных ситуациях ожидается их обновление.



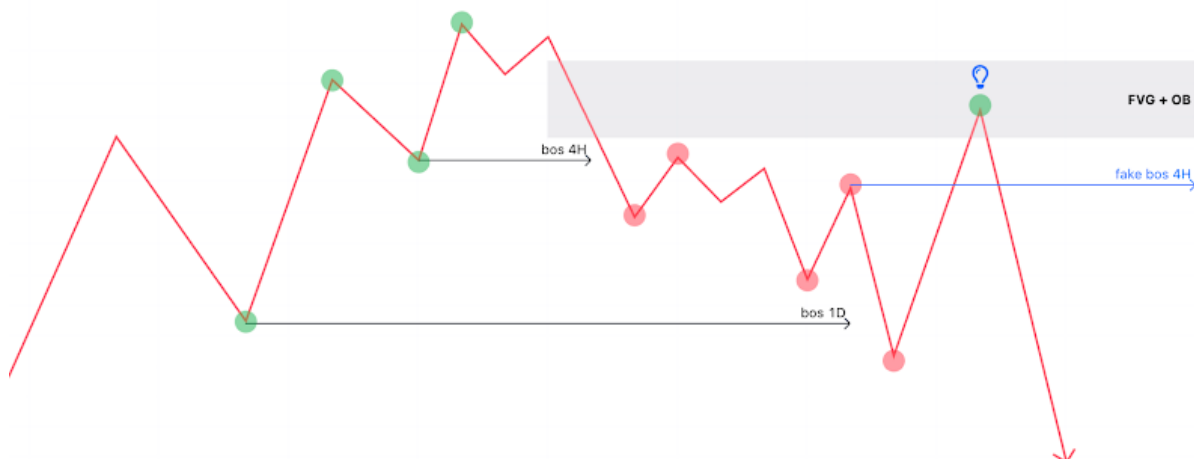
Цена может сформировать несколько восходящих структурных элементов перед продолжением нисходящего тренда. На старшем таймфрейме по-прежнему будет формироваться структурный LH.



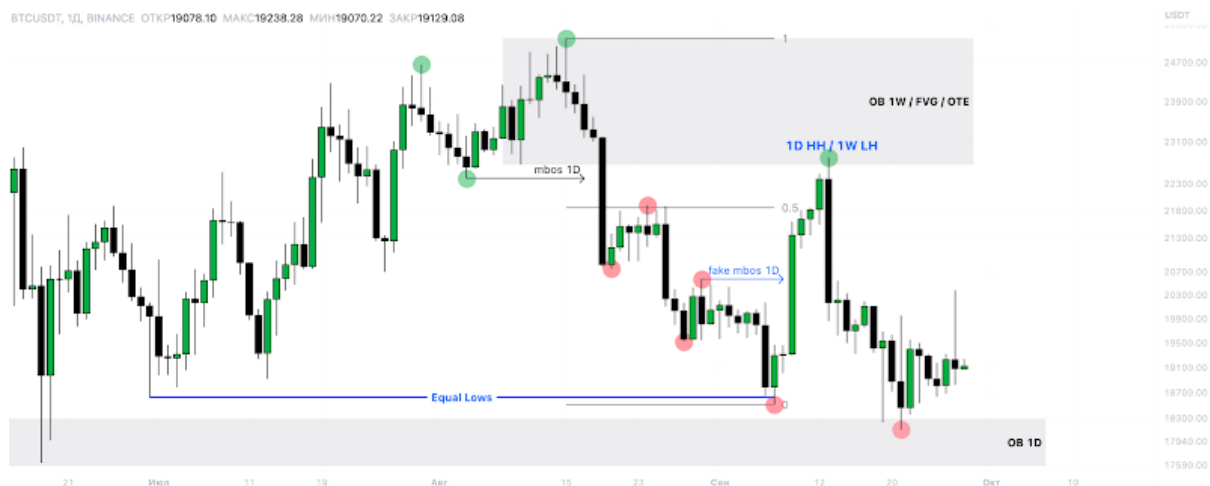
На коррекции 1D таймфрейма была сломана нисходящая структура 4H и всех меньших таймфреймов.

Начало подобной коррекции обычно происходит перед снятием значимого пула ликвидности на продажу и после теста зоны поддержки.

Второй распространенный сценарий встречается после обновления значимого пула ликвидности на продажу и теста зоны поддержки:



После смены дневной структуры с восходящей на нисходящую началась глубокая коррекция, на которой был образован LH 1D структуры. В этот момент обновлялись краткосрочные максимумы, которые были сформированы перед зоной сопротивления возле 50% дневного торгового диапазона или в премиум маркете.



После обновления равных минимумов и теста зоны поддержки началась глубокая коррекция, на которой произошла смена 1D структуры. На 1W таймфрейме сформировался более низкий максимум (LH) в премиум маркете от зоны сопротивления. Нисходящее ценообразование продолжилось.

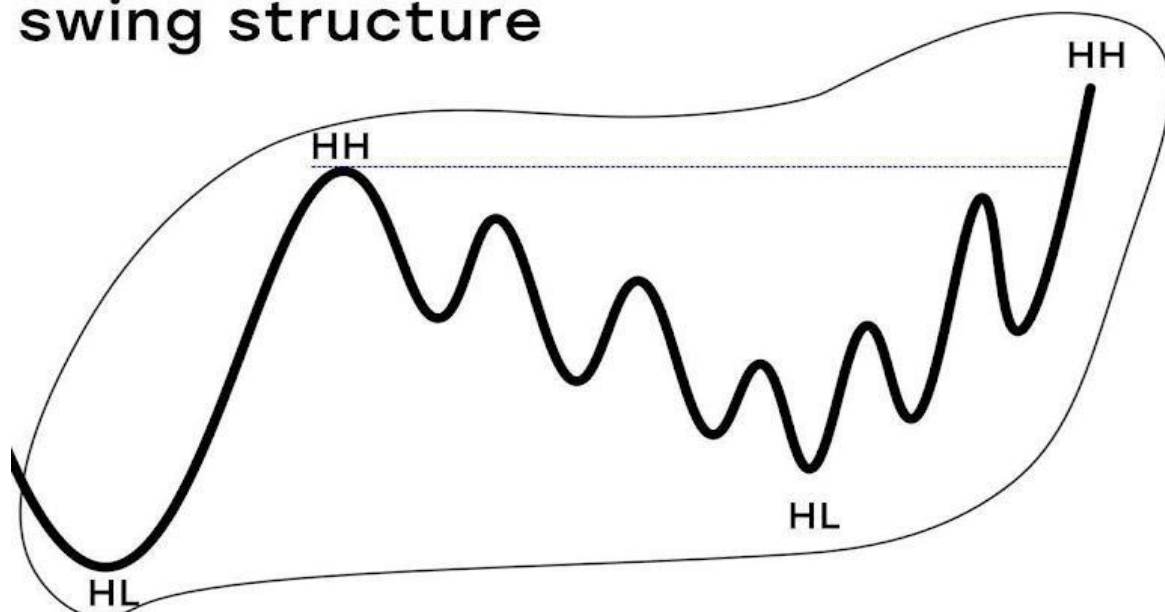
Ложный слом структуры зачастую будет импульсным, в большинстве случаев можно увидеть закрепление телом свечи над bos во время ложного слома нисходящего тренда, и под bos во время ложного слома восходящего тренда.

Типы структуры

Свинг структура (swing structure) – значимые структурные элементы, которые формируются в сторону общего направления цены.

Восходящий тренд

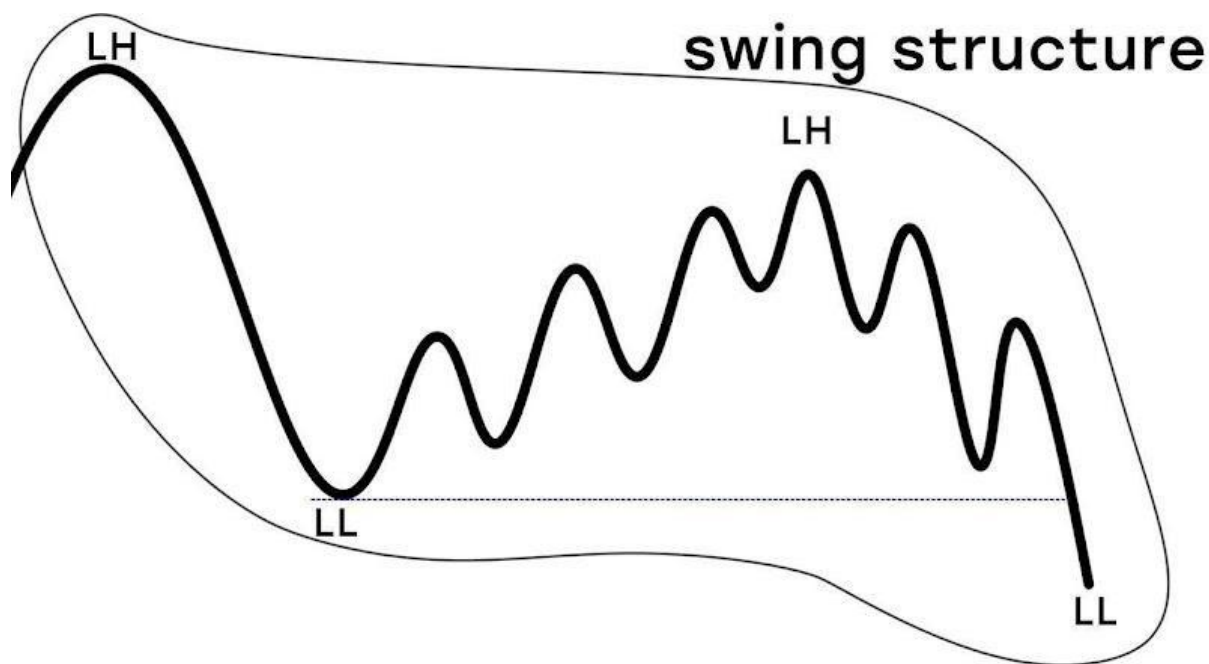
swing structure



BTCUSD, 1D, BINANCE ОТКР49066.76 МАКС54356.62 МИН48753.44 ЗАКР54001.39



Определены пять свечные свинги: более высокие максимумы (HH) формируются после обновления предыдущего HH, а более высокие минимумы (HL) формируются выше предыдущего подтвержденного HL.
Нисходящий тренд



Определены пять свечные свинги: более низкие минимумы (LL) формируются после обновления предыдущего LL или подтвержденного HL, а более низкие максимумы (LH) формируются ниже предыдущего подтвержденного LH или HH, если происходила смена тренда, как в этом случае.

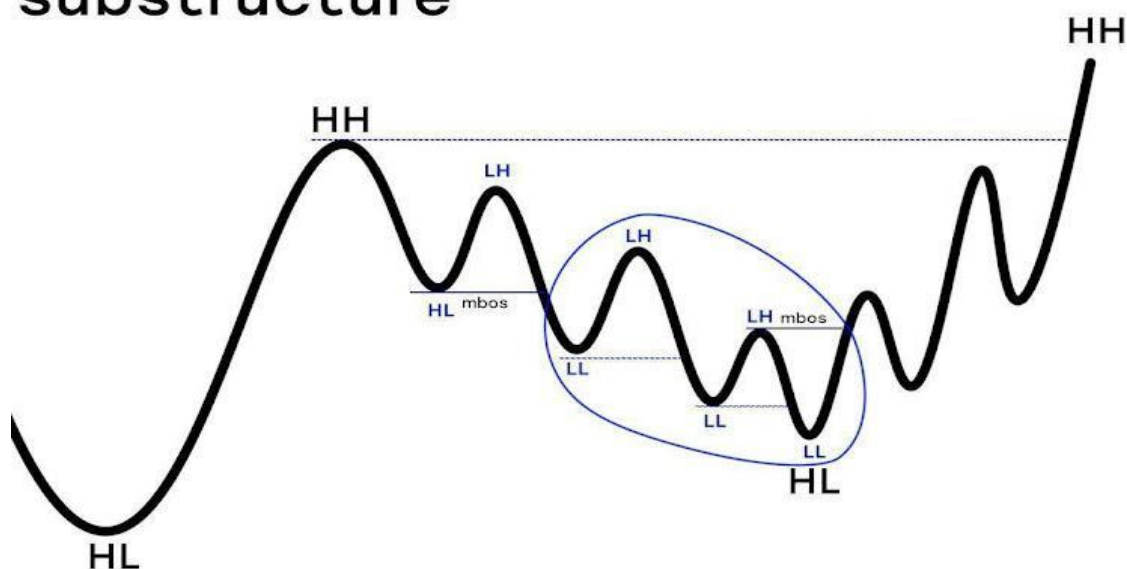
Не каждый пяти свечной свинг является свинг структурой. Свинг структура есть на каждом таймфрейме.

Внутренняя структура делится на суб структуру (substructure) и майнор структуру (minor structure) – это максимумы и минимумы, которые формируются внутри свинг структуры.

Суб структура – это коррекционные свинги, которые формируют HL для восходящей свинг структуры и LH для нисходящей свинг структуры.

mbos – слом внутренней структуры (minor bos)

Восходящий тренд substructure



Суб структура отмечена синим цветом, она всегда будет нисходящей, когда свинг структура восходящая.

Обратите внимание, что это пять свечные свинги, которые формируются между HL и HH по свинг структуре.

После слома свинг структуры с нисходящей на восходящую они будут формироваться между последними LL и HH.

Используется на одном таймфрейме: свинг, суб и майнор структура определяются на одном таймфрейме.

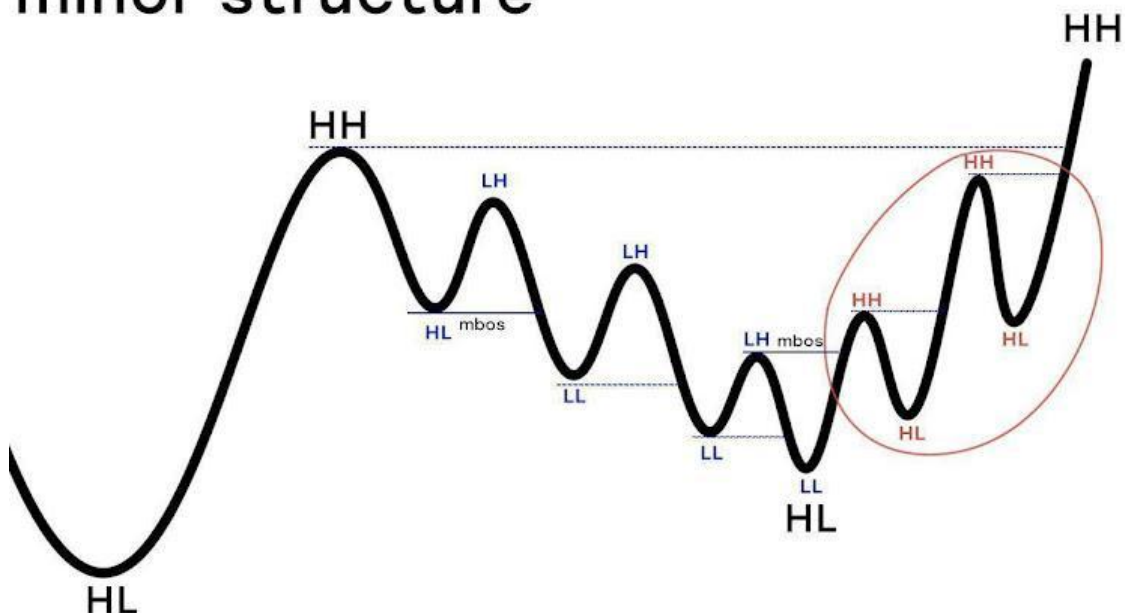
Суб структура не является обязательным критерием формирования свинг структурных элементов.



minor structure – это максимумы и минимумы, которые формируются в направлении свинг структуры. Когда свинг структура восходящая, майнор структура также будет восходящей, цена будет двигаться в сторону последнего HH, откуда началась коррекция.

Майнор структура не является обязательным критерием формирования свинг структурных элементов.

**Восходящий тренд
minor structure**

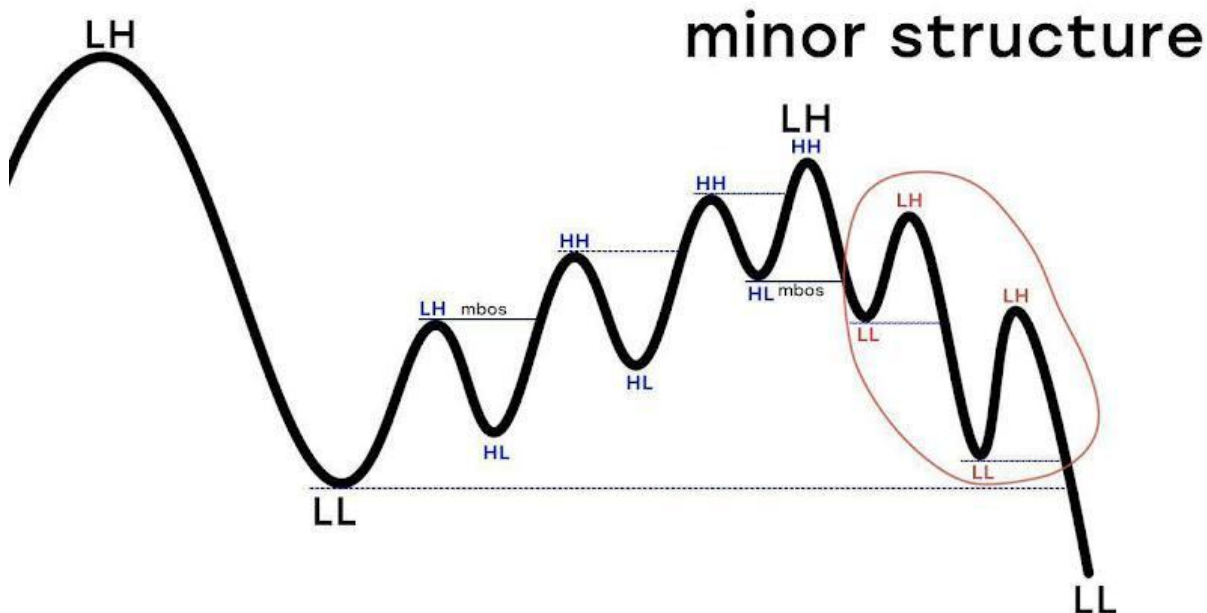




Майнор структура отмечена оранжевым цветом.

Суб структура сменяется на майнор структуру, когда происходит обновление LH, от которого был сформирован последний LL по суб структуре.

Нисходящий тренд



Когда свинг структура нисходящая, майнор структура также будет нисходящей, цена будет двигаться в сторону последнего LL, откуда началась коррекция.

Майнор структура может сформироваться без суб структуры.



Суб структура сменяется на майнор структуру, когда происходит обновление HL, от которого был сформирован последний HH по суб структуре.



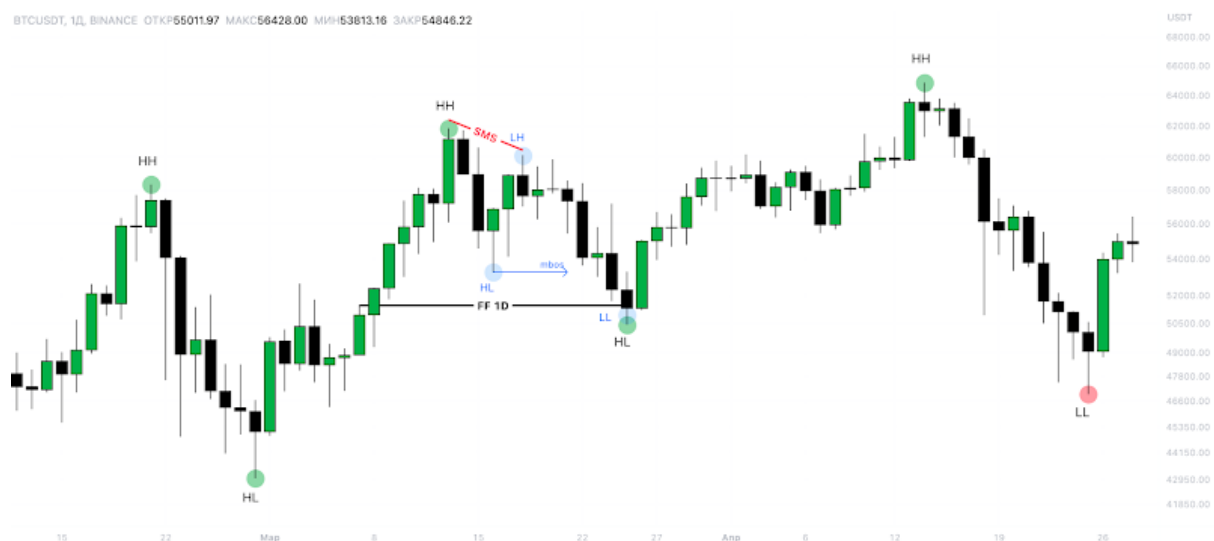
Рекомендую выбрать один из показанных примеров и проработать его на собственном графике.

Failure Swing (SMS)

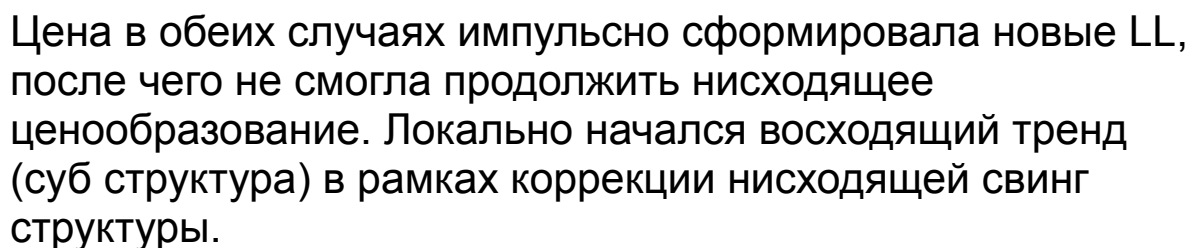
При неудачном свинге (SMS – shift in market structure) первичный тренд не может достичь новых максимумов при восходящем тренде или новых минимумов при нисходящем тренде. Это может говорить про начало коррекционного движения (substructure).

Схематический пример: цена импульсно сформировала новый HH, после чего не смогла продолжить восходящее ценообразование. Локально начался нисходящий тренд

failure swing (sms)



Аналогичный пример с нисходящей свинг структурой:



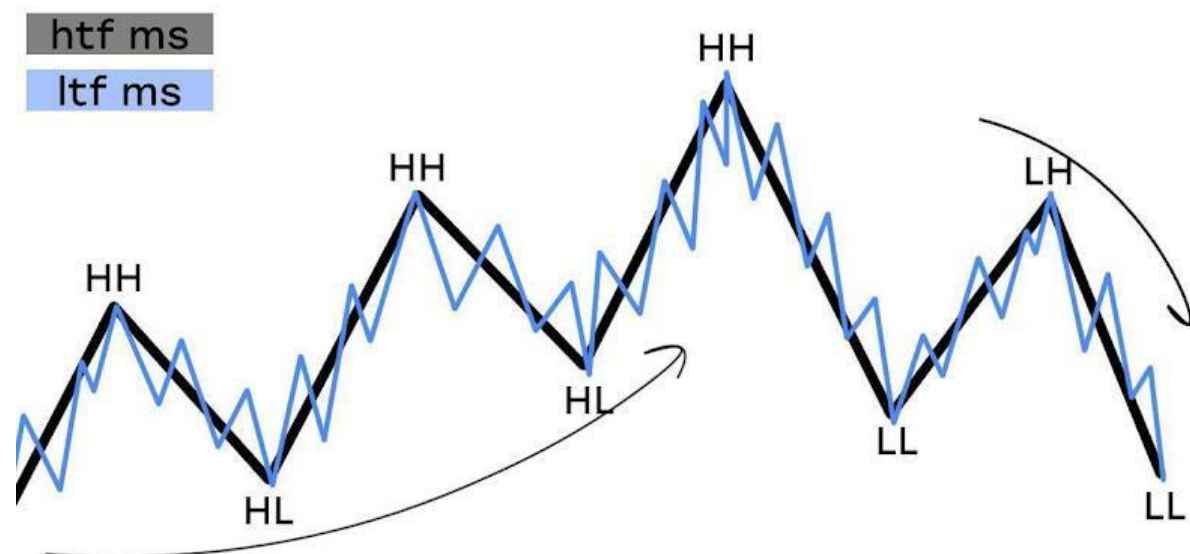
Эффективное использование структуры возможно при анализе графика со старших таймфреймов к младшим, это даст возможность корректно определить вероятное будущее направление цены.

Старшие таймфреймы всегда будут в приоритете, на них должен основываться анализ младших таймфреймов. Старайтесь открывать 80% сделок по тренду, и только 20% против него.

Основные таймфреймы:

1 месяц — 1 неделя — 1 день — 4 часа — 1 час

мульти-таймфрейм структура



Младшие таймфреймы отображают ценообразование на старших. Рынок фрактален. Когда цена начинает формировать HL на 1W, то вероятнее всего на 1D, 4H, 1H тренд сменится на нисходящий, а потом, когда коррекция на недельном таймфрейме закончится, структура на младших таймфреймах снова сменится и будет в синхроне.

Фибоначчи

Уровни коррекции Фибоначчи используются для определения потенциала коррекции, а также для выставления целей после её завершения.

Сетка Фибоначчи лучше всего работает, когда рынок находится в тренде. На восходящем рынке цель трейдера — определить потенциал коррекции, где сформируется HL, и там рассматривать точку входа в лонг позицию. На нисходящем тренде нужно определить потенциал

коррекции, где сформируется LH, и также искать точку входа в шорт позицию.

Правила работы:

- Определите тренд и работайте в соответствии с ним.
- Для определения потенциала коррекции для восходящего тренда используйте сетку снизу вверх.

Для определения потенциала коррекции для нисходящего тренда используйте сетку сверху вниз.

- Найдите Swing High и Swing Low для корректного использования инструмента.

1. Для восходящего тренда сетка Фибоначчи протягивается от HL к HH.

После слома нисходящего тренда от LL к HH.

2. Для нисходящего тренда сетка Фибоначчи протягивается от LH к LL.

После слома восходящего тренда от HH к LL.

Настройки для коррекционных движений:

0.5 – справедливая цена (equilibrium).

0.62; 0.705; 0.79 – зона OTE (optimal trade entry).

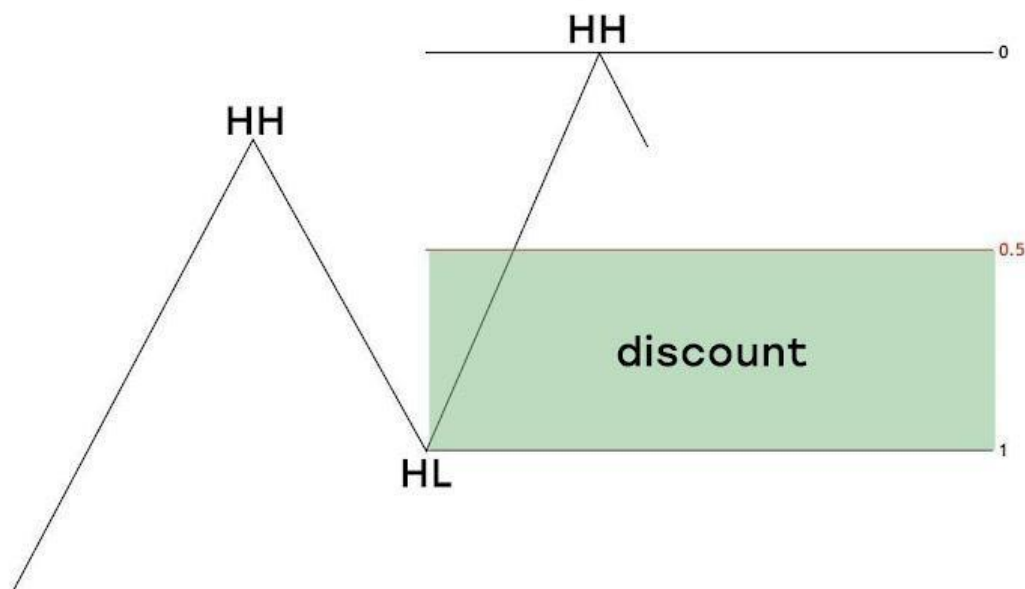
В отличие от стандартных значений это —

модифицированная версия с наиболее высоким математическим ожиданием разворота цены.

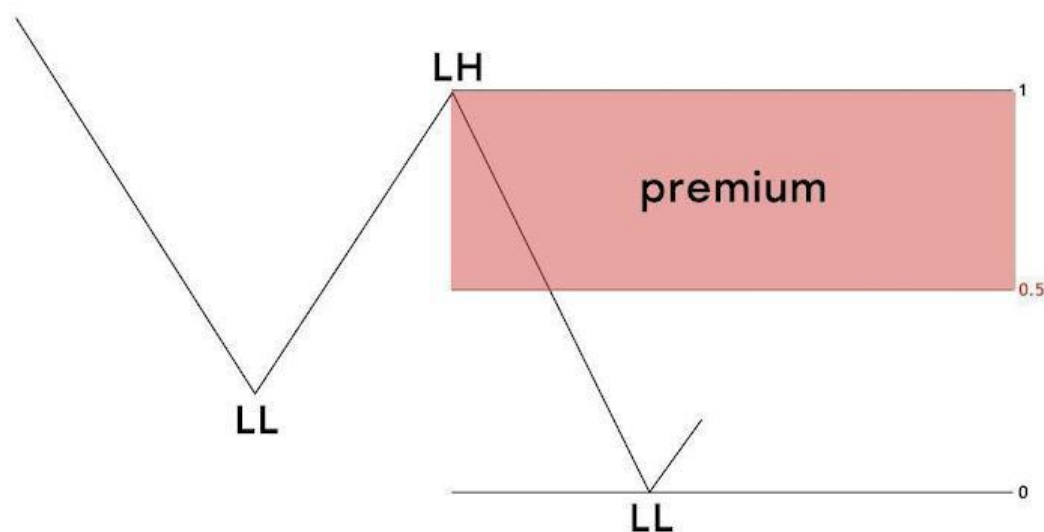
Для открытия позиции нас всегда интересует поведение цены выше либо ниже значения 0.5. Умные деньги всегда будут стремиться покупать со скидкой в дискаунте и продавать с наценкой в премиуме.

Поэтому для открытия позиции в шорт мы всегда смотрим цену выше 0.5, что считается премиум ценами. А для открытия лонг позиций мы смотрим поведение цены ниже 0.5, что считается дискаунт ценами.

фибоначчи дискаунт

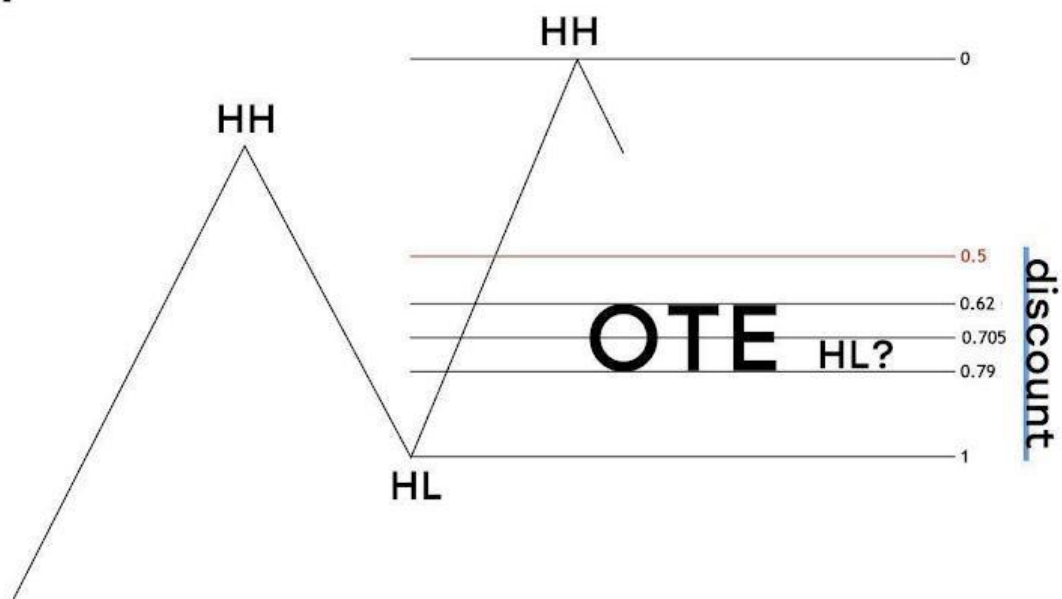


фибоначчи премиум

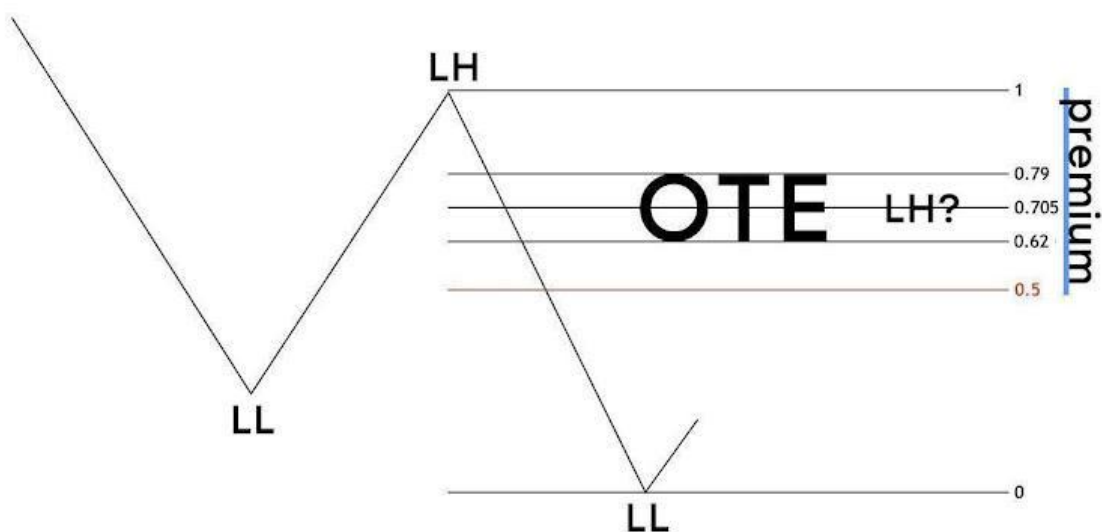


Зона ОТЕ – это расширенная сетка, которая всегда находится в премиум маркете, когда вы ищите шорт позиции, или в дискаунт маркете, когда вы ищите лонг позиции. Данные уровни выступают областью для оптимальной точки входа.

фибоначчи оте



фибоначчи оте



Коррекция восходящего импульса.



Линии Фибоначчи сами по себе не выступают уровнями поддержки или сопротивления. Торговать только на основе них не актуально. Цена разворачивается от конкретных областей, которые отображены на графике.
Коррекция восходящего импульса.



Цена может выходить за пределы ОТЕ, это не отменяет актуальности сетапа, HL по прежнему формируется в дисконт маркете.
Коррекция восходящего импульса.



Не во всех случаях цена корректируется в зону ОТЕ: при достижении зоны поддержки на уровне 50% (equilibrium) или немного ниже него уже может начаться разворот, потому что этот момент уже предполагает начало покупок или продаж умными деньгами.
Коррекция нисходящего импульса.



Коррекция нисходящего импульса.



Возьмите за правило открывать позиции только после коррекции в премиум или дискант маркет, а остальные возможности пропускать.

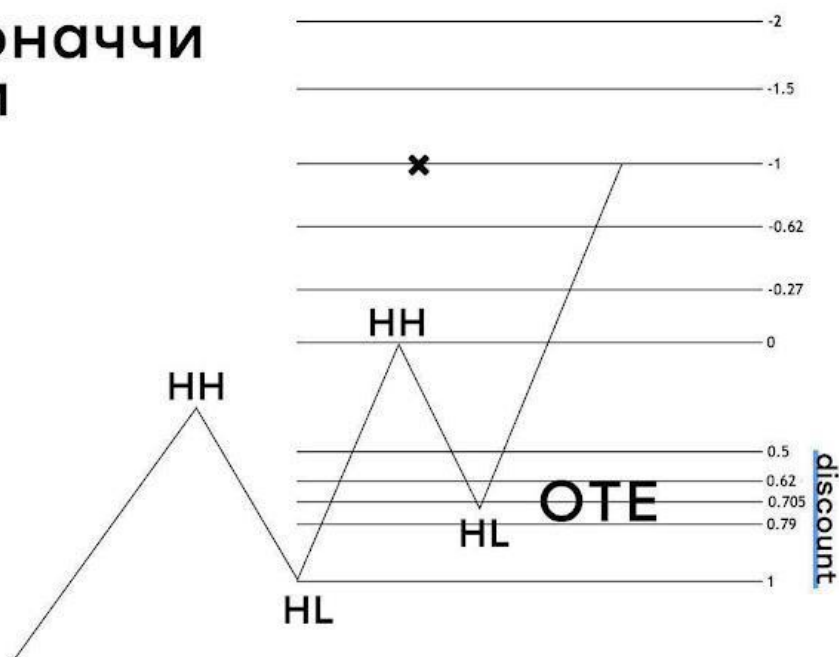
Тейк-профит по Фибоначчи

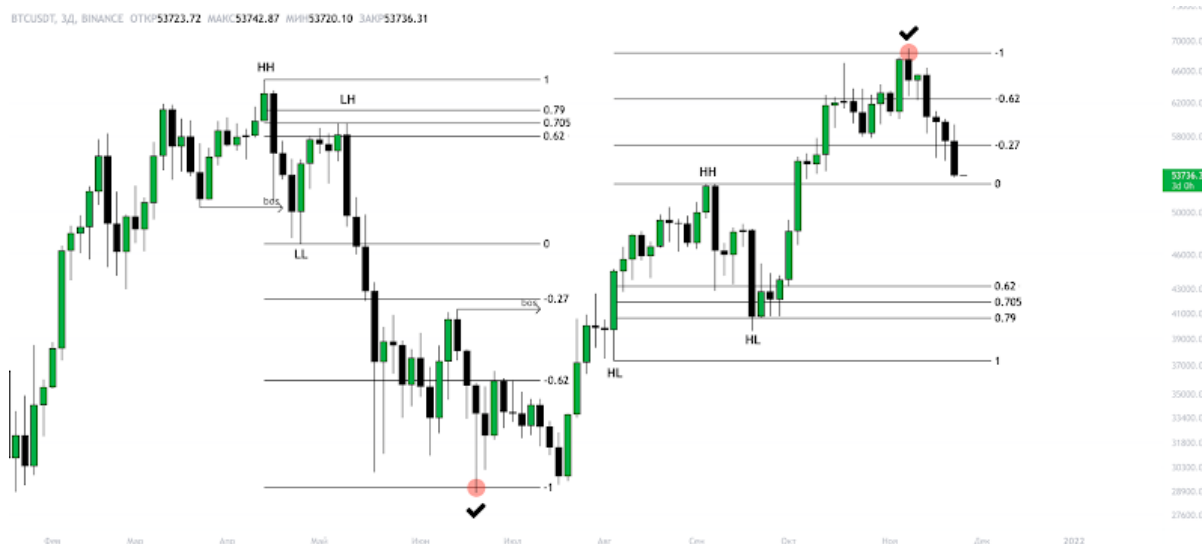
Для того, чтобы определить, где вы будете фиксировать прибыль, вы можете использовать отрицательные значения.

Настройки для выставления тейков:

- 0.27 – тейк 1
- 0.62 – тейк 2
- 1 – тейк 3 или закрытие позиции
- 1.5 / -2 – тейк 4

фибоначчи тейки





Отрицательные значения Фибоначчи можно эффективно применять в каждой сделке, но старайтесь отдавать приоритет графику для определения более точных зон, откуда цена может развернуться.

Закон силы (LoE)

Закон силы (Law of Effort) позволяет определить импульсное и коррекционное движение.

Время, затраченное на формирование импульса (НН/ЛЛ), должно быть меньше, чем время, затраченное на формирование коррекции (НЛ/ЛН).

Цена должна коррекционно подходить к вашей зоне интереса – это будет служить дополнительным фактором для входа в позицию, значит импульс на вашей стороне. Бычий импульс.

BTUSD, 4h, BINANCE ОТП53723.72 МАКС54641.99 МИН53610.00 ЗАКР53969.00



Цене потребовалось 10 баров для формирования нового HH — импульс. Коррекционному движению потребовалось 29 баров.
Медвежий моментум.

BTUSD, 1d, BINANCE ОТП53723.72 МАКС54641.99 МИН53610.00 ЗАКР53953.00



Импульсное движение вниз заняло 11 баров, была сломана бычья структура. Коррекционному движению потребовалось 15 баров для формирования LH — хороший признак для поиска точки входа в шорт позицию на основе сетапа.

Риск — менеджмент

Торговля без правил управления рисками превращается в азартную игру, шансов выиграть в которой в конечном итоге у вас нет.

Даже при наличии навыка прогнозировать больше половины движений рынка вы можете остаться убыточным без надлежащего риск-менеджмента, потому что все равно не сможете избежать ошибок и потерь. Они неизменно будут происходить даже спустя много лет торговли. Все потому, что ни одна торговая система не сможет предоставить вам 100% вероятность отработки сделок. К тому же, человеческий фактор никто не отменял: нет никаких гарантий того, что на протяжении всей вашей торговой карьеры вы будете действовать как робот, исключая любое влияние эмоций или спешки на открытие сделок.

Риск – это вероятность потери денег. И до тех пор, пока вы будете продолжать открывать позиции, он никуда не денется.

Если вы хотите брать на себя большой риск – сыграйте в казино: в трейдинге вы не должны брать на себя больше рисков, чтобы больше заработать. Это стандартное заблуждение новичков: они рискуют слишком многим, чтобы заработать слишком мало. Большой риск в скором времени обязательно приведет вас к потере всего депозита.

Если вы хотите полностью избавиться от риска – прекратите торговать: даже при соблюдении всех когда-либо придуманных правил управления капиталом вероятность потерять останется всегда.

Ваша задача – принять разумные меры безопасности для минимизации потерь.

Когда вы научитесь контролировать свой риск и потери, у вас появится шанс стать прибыльным.

В чем заключается система управления рисками?

В создании простого набора правил, которые вы должны внедрить в свою торговлю, для контроля средств, которые

потенциально могут быть потеряны из-за ошибок в анализе или из-за чрезмерного влияния эмоций на вашу торговлю. *Вы можете оказаться неправы в своих ожиданиях касательно дальнейшего движения цены, но не имеете права ошибиться в управлении рисками.*

Правила управления рисками:

1. Всегда используйте стоп-лосс.

Это правило может показаться для вас очевидным, и я уверен, что вы о нем непременно осведомлены.

Тем не менее большинство трейдеров считает заманчивой идею позволить себе некоторую снисходительность, когда цена выходит за пределы точки входа.

В этот момент эмоции наиболее сильны, и соблазн временно убрать стоп-лосс (хорошо, если он вообще был) возрастает.

Предлог предсказуем: “меня сейчас по-любому выбьет по стоп-лоссу, и цена пойдет в ожидаемом направлении. Пока что убери его, чтобы зря не терять деньги.”

И результат тоже предсказуем: если сегодня в таком случае вам повезет, и ваша позиция не будет ликвидирована, то рано или поздно из-за такой игры вы потеряете весь свой депозит.

Активация стоп-лосса означает признание вашей идеи недействительной. Почему вы рассчитываете на то, что если вы убрали его один раз, то в случае, если цена все же вернется к точке входа, вы вернете его на место? Ведь за то время, пока цена двигалась в противоположном вашим ожиданиям направлении, вы испытали большой спектр эмоций. Вы серьезно рассчитываете, что после всего пережитого в нужный момент вы будете готовы принять запланированный убыток?

До тех пор, пока ваш стоп-лосс не будет достигнут, придерживайтесь своего первоначального плана и принимайте потери, которые вы считали разумными до того, как в дело вмешались эмоции.

2. Устанавливайте стоп-лосс только на основе анализа, никогда не открывайте позицию, если не знаете, в каком месте его установить.

Установка стоп-лосса в случайном месте – повышенная вероятность его активации.

Вход в сделку должен основываться только на конкретном сетапе. У каждого сетапа есть зона выставления стоп-лосса. Нет сетапа – нет сделки.

3. Используйте умеренный риск на сделку.

Рекомендованный риск на сделку для начинающих трейдеров – 1%. Это означает, что в случае активации вашего стоп-лосса вы потеряете только один процент от депозита.

Риск 1% не означает, что нужно открывать сделку на 1% от своего депозита. Размер позиции считается для каждой сделки индивидуально.

Начальный депозит: \$ 10 000

Кол-во убыточных сделок	Риск: 1%	Риск: 2%	Риск: 5%	Риск: 10%	Риск: 20%	Риск: 50%	Риск: 100%
1	9900,00 \$	9800,00 \$	9500,00 \$	9000,00 \$	8000,00 \$	5000,00 \$	0,00 \$
2	9801,00 \$	9604,00 \$	9025,00 \$	8100,00 \$	6400,00 \$	2500,00 \$	0,00 \$
3	9703,00 \$	9411,90 \$	8573,80 \$	7290,00 \$	5120,00 \$	1250,00 \$	0,00 \$
4	9606,00 \$	9223,70 \$	8145,10 \$	6561,00 \$	4096,00 \$	625,00 \$	0,00 \$
5	9509,90 \$	9039,20 \$	7737,80 \$	5904,90 \$	3276,80 \$	312,50 \$	0,00 \$
6	9418,80 \$	8858,40 \$	7350,90 \$	5314,40 \$	2621,40 \$	156,25 \$	0,00 \$
7	9320,70 \$	8681,30 \$	6983,40 \$	4783,00 \$	2097,20 \$	78,13 \$	0,00 \$
8	9227,40 \$	8507,60 \$	6634,20 \$	4304,70 \$	1677,70 \$	39,06 \$	0,00 \$
9	9135,20 \$	8377,50 \$	6302,50 \$	3874,20 \$	1342,20 \$	19,53 \$	0,00 \$
10	9043,80 \$	8170,70 \$	5987,40 \$	3486,80 \$	1073,70 \$	9,77 \$	0,00 \$
11	8953,40 \$	8007,30 \$	5688,00 \$	3138,10 \$	859,00 \$	4,88 \$	0,00 \$
12	8863,80 \$	7847,20 \$	5403,60 \$	2824,30 \$	687,20 \$	2,44 \$	0,00 \$
13	8775,20 \$	7690,20 \$	5133,40 \$	2541,90 \$	549,80 \$	1,22 \$	0,00 \$
14	8687,50 \$	7536,40 \$	4876,70 \$	2287,70 \$	439,80 \$	0,61 \$	0,00 \$
15	8600,60 \$	7385,70 \$	4632,90 \$	2058,90 \$	351,80 \$	0,31 \$	0,00 \$

В случае, если у вас случится череда проигрышей – допустим, 5 потерь подряд – с умеренным риском в 1% на каждую сделку в сумме вы потеряете немного меньше 5% своего депозита.











(Расчет одного процента ведется от имеющейся после убытка суммы)

Если же ваш риск на сделку будет составлять 10%, после пяти убыточных сделок подряд вы потеряете практически половину вашего депозита.

Восстановить стартовый капитал после череды убыточных сделок с большим риском на каждую станет испытанием.

В таблице ниже можно заметить, что при потере 5% депозита (примерно 5 убыточных позиций) понадобится заработать всего 5,3% прибыли – это одна-две прибыльных позиции.

Но если вы будете завышать риск и потеряете, допустим, 50%, то вам понадобится заработать 100% от депозита, который у вас останется к тому моменту.

Убыток, %		Прирост до возвращения стартового капитала, %	
5%			5,3%
10%			11,1%
20%			25%
30%			42,9%
40%			66,7%
50%			100%
60%			150%
70%			233,3%
80%			400%
90%			900%

4. Используйте фиксированный процент риска, но не фиксированную сумму для входа в позицию.

Размер позиции зависит от вашего риска и длины стоп-лосса, он является индивидуальным для каждой сделки и каждый раз считается отдельно.

Далее мы рассмотрим, как рассчитывать объем позиции для входа.

5. Используйте одинаковый риск для своих позиций

Это не относится к разным стилям позиций: скальп, интрадей, свинг. В данном случае риск может варьироваться, но не превышать 5%.

На начальных этапах рекомендуется всегда использовать риск 1% или меньше.

В таблице ниже приведен пример результата, который вы можете получить, выбирая риск отдельно для каждой сделки. Вне зависимости от вашей уверенности в вероятности положительной отработки риск на сделку должен быть один.

Сделка 1	Потенциальный убыток: 1%	Потенциальная прибыль: 3%	Результат: +3%
Сделка 2	Потенциальный убыток: 1%	Потенциальная прибыль: 3%	Результат: +3%
Сделка 3	Потенциальный убыток: 1%	Потенциальная прибыль: 3%	Результат: +3%
Сделка 4	Потенциальный убыток: 1%	Потенциальная прибыль: 3%	Результат: -1%
Сделка 5	Потенциальный убыток: 1%	Потенциальная прибыль: 3%	Результат: -1%
Сделка 6	Потенциальный убыток: 1%	Потенциальная прибыль: 3%	Результат: +3%
			Общий результат: ~ +10%

Сделка 1	Потенциальный убыток: 1%	Потенциальная прибыль: 3%	Результат: +3%
Сделка 2	Потенциальный убыток: 0,5%	Потенциальная прибыль: 1,5%	Результат: +1,5%
Сделка 3	Потенциальный убыток: 0,5%	Потенциальная прибыль: 1,5%	Результат: +1,5%
Сделка 4	Потенциальный убыток: 3%	Потенциальная прибыль: 9%	Результат: -3%
Сделка 5	Потенциальный убыток: 5%	Потенциальная прибыль: 15%	Результат: -5%
Сделка 6	Потенциальный убыток: 0,5%	Потенциальная прибыль: 1,5%	Результат: +1,5%
			Общий результат: ~ -0,5%

6. Не открывайте две одинаковых сделки

Две одинаковых сделки, открытых на основании одного сетапа, увеличивают ваш риск в два раза. Это касается активов, коррелирующих между собой.

Если вы нашли хорошую совокупность факторов для открытия сделки на двух торговых парах, выберите для открытия позиции ту пару, на которой сетап с большей по вашему мнению вероятностью отработает.

7. Старайтесь открывать позиции с RR не меньше трех

Соотношение риска и прибыли (Risk Reward) – оценка потенциальной прибыли в сделке по отношению к заложенному в нее риску.

Например, соотношение риска и прибыли 1:3 говорит о том, что рискуя потерять один процент при активации стоп-лосса трейдер может заработать три процента от своего депозита.

В таком случае вам не нужно быть правым в каждой сделке: достаточно быть прибыльным в одной из 3 сделок. *Вы можете быть прибыльным и с соотношением риска и прибыли 1:1 или 1:2, но для этого потребуются больше усилий.*

Если вы готовы ради заработка одного процента рисковать одним процентом, вам нужно помнить, что для положительного результата как минимум 6 из 10 сделок должны быть прибыльными.

Высокое соотношение риска и прибыли также не гарантирует прибыльность. Вы можете открывать сделки с соотношением риска и прибыли 1:6 и больше, оставаясь при этом убыточным.

		Процент прибыльных сделок (Win rate)							
		20%	30%	40%	50%	60%	70%	80%	90%
Соотношение риска и прибыли (RR)	1:1	Убыток	Убыток	Убыток	Безубыток	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль
	1:2	Убыток	Убыток	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль
	1:3	Убыток	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль
	1:4	Безубыток	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль
	1:5	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль	Прибыль

Сам по себе процент выигрышных сделок (Win Rate) тоже

ничего не значит. Вы можете иметь 80% винрейт и нести убытки, и также наоборот.

Приведу примеры:

ВИНРЕЙТ: 30%, RR:3, РИСК 1%	
Прибыль	Убыток
30% сделок 3 из 10	70% сделок 7 из 10
Средняя прибыль: \$30	Средний убыток: \$10
Общая прибыль: \$90	Общий убыток: \$70
Чистая прибыль: \$20	Профит: 2%
Торговый счет: \$1000 Процент прибыльных сделок (Win Rate): 30% Соотношение риска и прибыли (Risk Reward): 1:3	

ВИНРЕЙТ: 30%, RR:5, РИСК 1%	
Прибыль	Убыток
30% сделок 3 из 10	70% сделок 7 из 10
Средняя прибыль: \$50	Средний убыток: \$10
Общая прибыль: \$150	Общий убыток: \$70
Чистая прибыль: \$80	Профит: 8%
Торговый счет: \$1000 Процент прибыльных сделок (Win Rate): 30% Соотношение риска и прибыли (Risk Reward): 1:5	

ВИНРЕЙТ: 30%, RR:5, РИСК 2%	
Прибыль	Убыток
30% сделок 3 из 10	70% сделок 7 из 10
Средняя прибыль: \$100	Средний убыток: \$20
Общая прибыль: \$300	Общий убыток: \$140
Чистая прибыль: \$160	Профит: 16%
Торговый счет: \$1000 Процент прибыльных сделок (Win Rate): 30% Соотношение риска и прибыли (Risk Reward): 1:5	

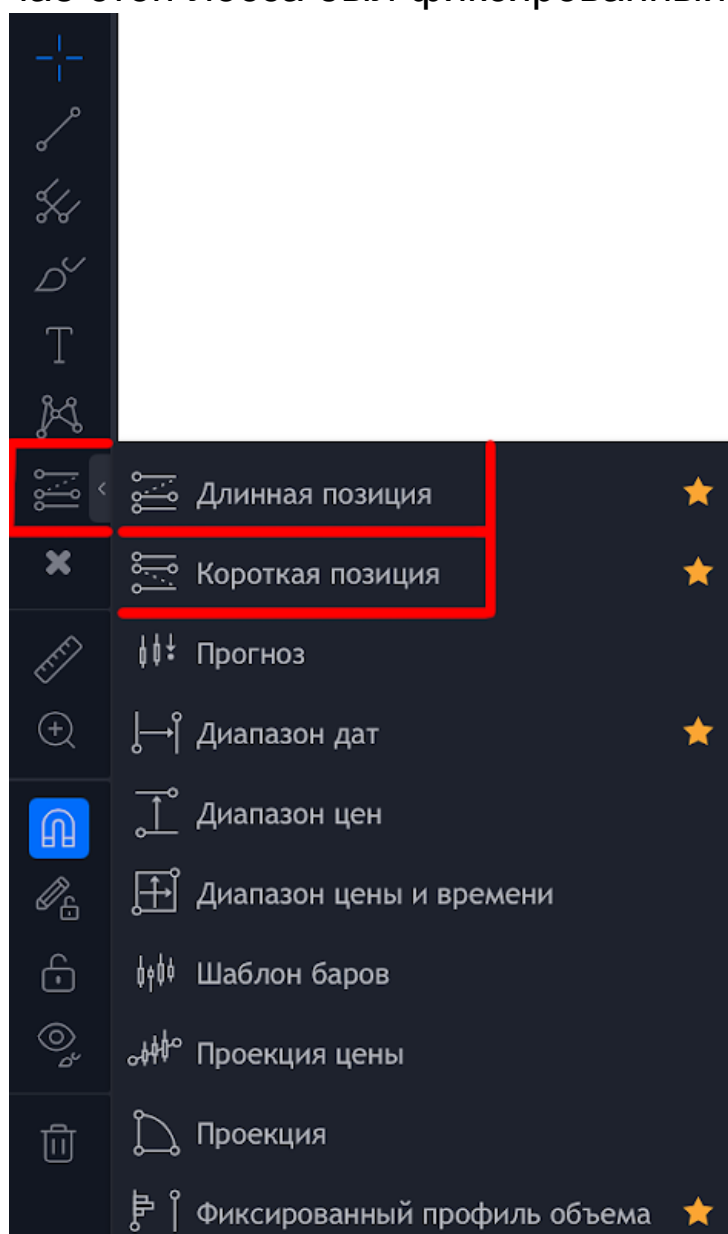
ВИНРЕЙТ: 50%, RR:5, РИСК 2%	
Прибыль	Убыток
50% сделок 5 из 10	50% сделок 5 из 10
Средняя прибыль: \$100	Средний убыток: \$20
Общая прибыль: \$500	Общий убыток: \$100
Чистая прибыль: \$400	Профит: 40%
Торговый счет: \$1000 Процент прибыльных сделок (Win Rate): 50% Соотношение риска и прибыли (Risk Reward): 1:5	

При правильном подходе к открытию каждой сделки вы с высокой вероятностью будете прибыльным.
Риск-менеджмент, как и поиск факторов для входа в сделку, требует применять совокупность правил для открытия позиции. Только при соблюдении всех вышеперечисленных

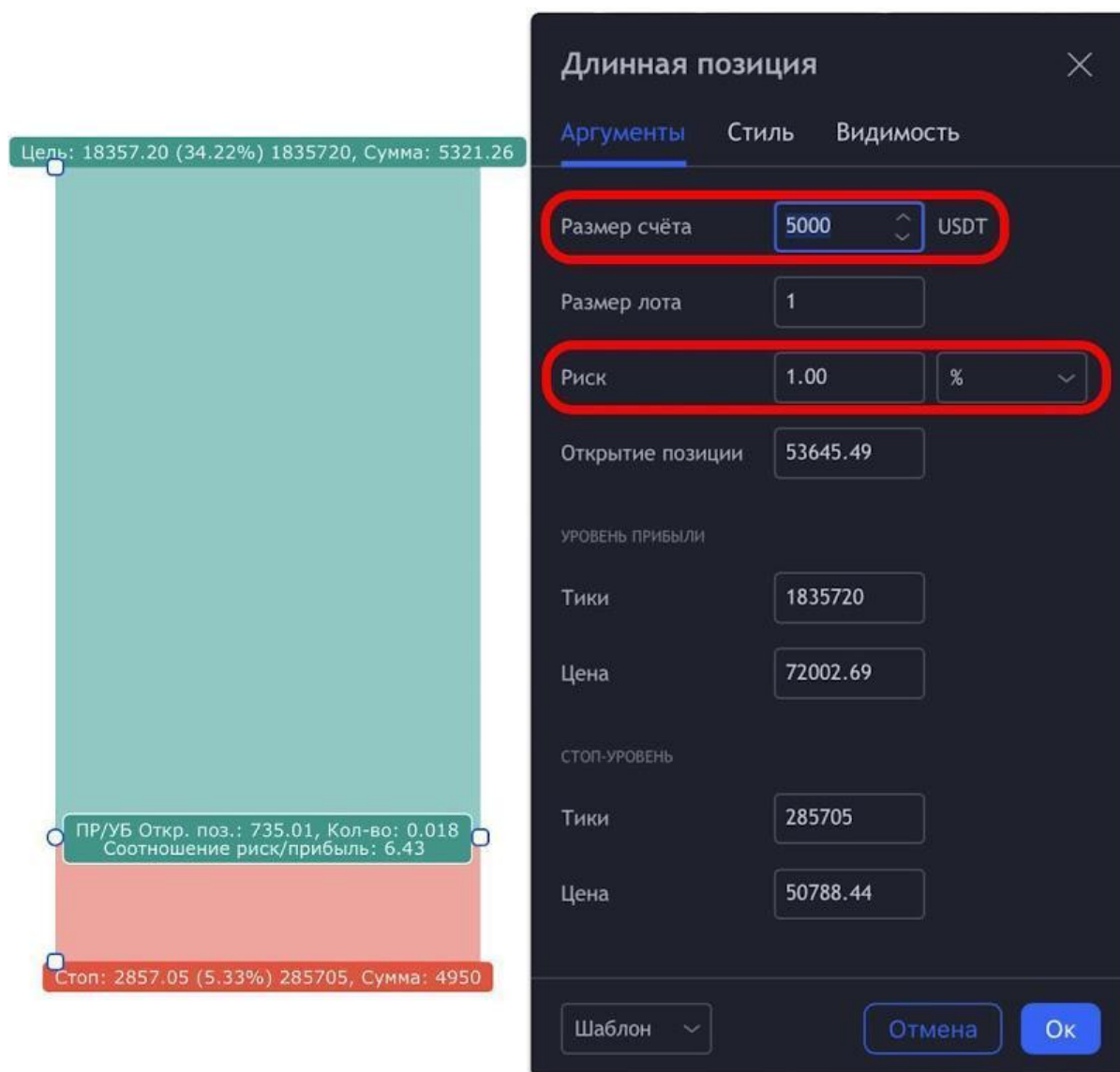
предписаний вы сможете добиться стабильного результата на дистанции.

Как считать RR и открывать позицию с фиксированным стопом.

Для этого можно использовать платформу TradingView. Нам нужно определить, на какой объем нужно войти в сделку, чтобы в случае стоп-лосса был фиксированный убыток.



В выделенном поле выбираете направление вашей позиции. В этом инструменте есть встроенный калькулятор, который дает всю информацию, которая вам понадобится.



После того, как вы выбрали длинную или короткую позицию, нажмите на неё два раза – откроются настройки. Заходите в панель «Аргументы».

И теперь чтобы узнать объём, на который нужно входить в позицию, вы должны вписать данные: размер счёта и желаемый риск, а на графике настроить вашу точку входа и стоп-лосс.

Эти значения вы можете изменять в любой момент – это быстро и удобно.

Кредитное плечо не влияет на данные расчеты.



Когда вы вписали все данные, вы можете навести курсор на этот инструмент, и увидите информацию касательно вашей сделки.

«Кол-во» – показывает нужный объем позиции в зависимости от вашего стопа. Вам нужно войти в лонг на 0.018 BTC и поставить стоп туда же, где показано на графике. В таком случае, если цена пойдет против вас, то убыток будет 1%, как мы и настраивали.

«Соотношение риск/прибыль» – показывает потенциал вашей сделки. На скриншоте RR:5.16 – это означает, что вы рискуете 1%, а в потенциале можете заработать 5%.


«Сумма» – внизу и вверху показывается, как изменится ваш депозит в зависимости от движения цены.

Задания

1. Найдите по одному примеру восходящего и нисходящего тренда. Отметьте свинг, суб, майнор структуру.
2. Найдите по одному примеру смены бычьего и медвежьего тренда.

3. Найдите пример коррекции в зону ОТЕ.

Выполненные задания по оформлению должны быть похожи на примеры, которые были показаны в этой методичке. Также график должно быть хорошо видно, показывайте крупный план.

Задания скидывайте в PDF файле в Telegram. В канале “SDT Education  Mentorship” в день проведения конференций будет появляться напоминание о соответствующем уроке, в комментариях под которым нужно присылать задания.

Отмечайте на своих графиках только нужную информацию к заданию. Найдите качественные примеры, которые хорошо отработали. Изучите, в каком контексте используемый инструмент лучше всего работает.

Подготовьте заранее перед конференцией интересующие вас вопросы.