

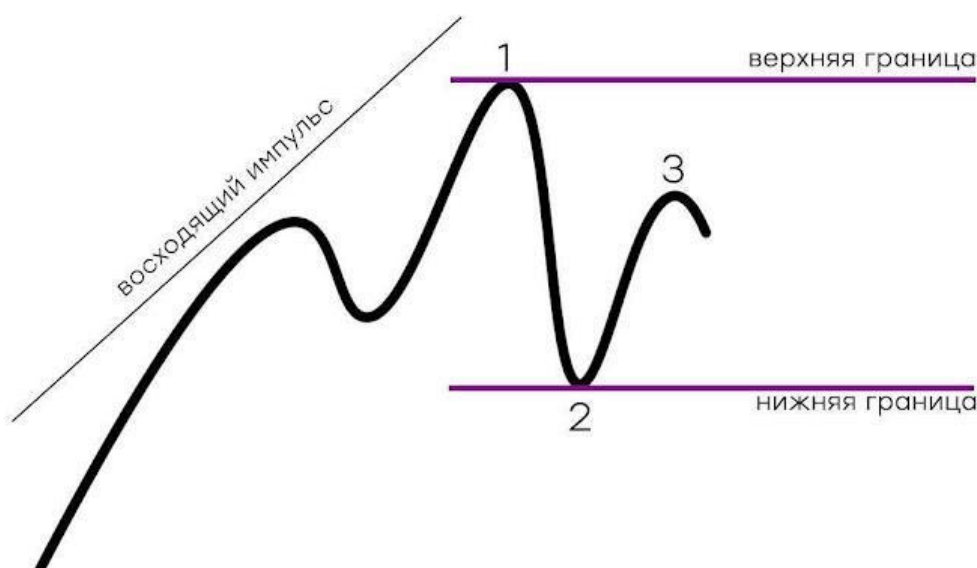
## Рендж

**Рендж** (*консолидация, торговый диапазон, флет*) – это боковое движение цены, которое возникает с целью формирования новой ликвидности выше и ниже текущей рыночной цены, которая будет использоваться для заполнения ордеров умного капитала. Рынок основную часть времени (~80%) находится во флете.

### Определение ренджа

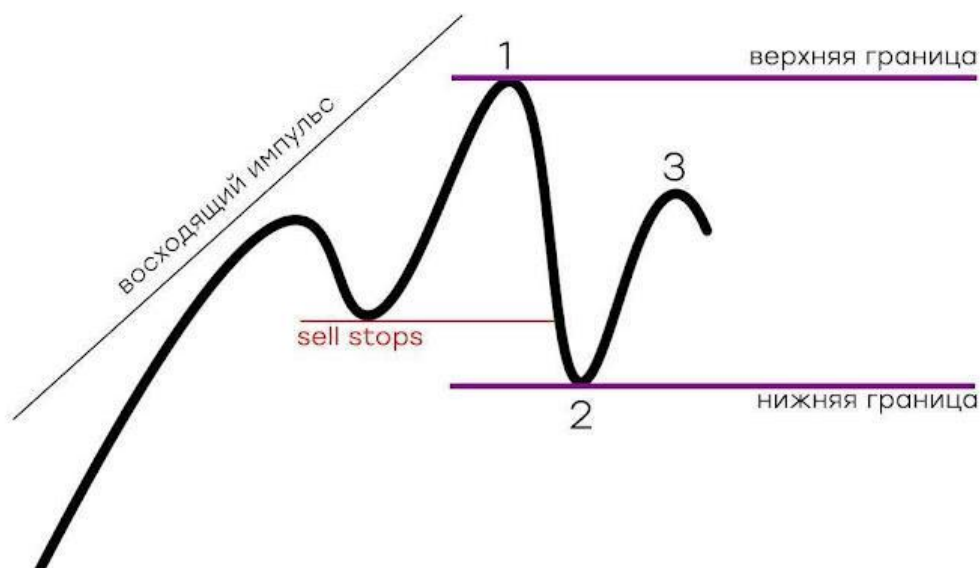
Рендж образуется после импульсного движения цены.

### формирование ренджа



**После восходящего импульса** сначала формируется верхняя граница ренджа, после чего начинается краткосрочная коррекция, которая определяет нижнюю границу будущего торгового диапазона. Следующим элементом начальной конструкции ренджа выступает третий свинг, он должен сформироваться между уже определенными границами, что будет являться внутренним структурным элементом.

# формирование ренджа



Обновление краткосрочной ликвидности на продажу во время противоположного восходящему импульсу движения выступает дополнительным критерием при формировании ренджа.

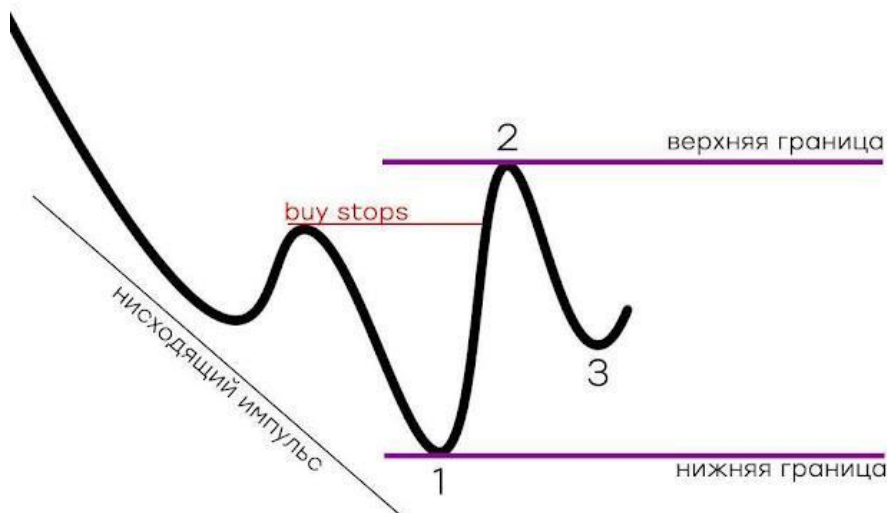
*Формирование ренджа после восходящего импульса*



При достижении зоны сопротивления в премиум маркете цена начала консолидироваться, что является частым событием перед сменой направления актива.

*Границы ренджа обозначаются с помощью инструмента "коррекция по Фибоначчи". Настройки: 0, 0.5, 1.*

# формирование ренджа



**После нисходящего импульса** сначала формируется нижняя граница ренджа, после чего начинается краткосрочная коррекция, которая определяет верхнюю границу будущего торгового диапазона.

Следующим элементом начальной конструкции ренджа выступает третий свинг, он должен сформироваться между уже определенными границами, что будет являться внутренним структурным элементом.

Обновление краткосрочной ликвидности на покупку во время противоположного нисходящему импульсу движения выступает дополнительным критерием при формировании ренджа.

*Формирование ренджа после нисходящего импульса*



## Торговля в рендже

Наиболее значимыми элементами ренджа являются его границы.

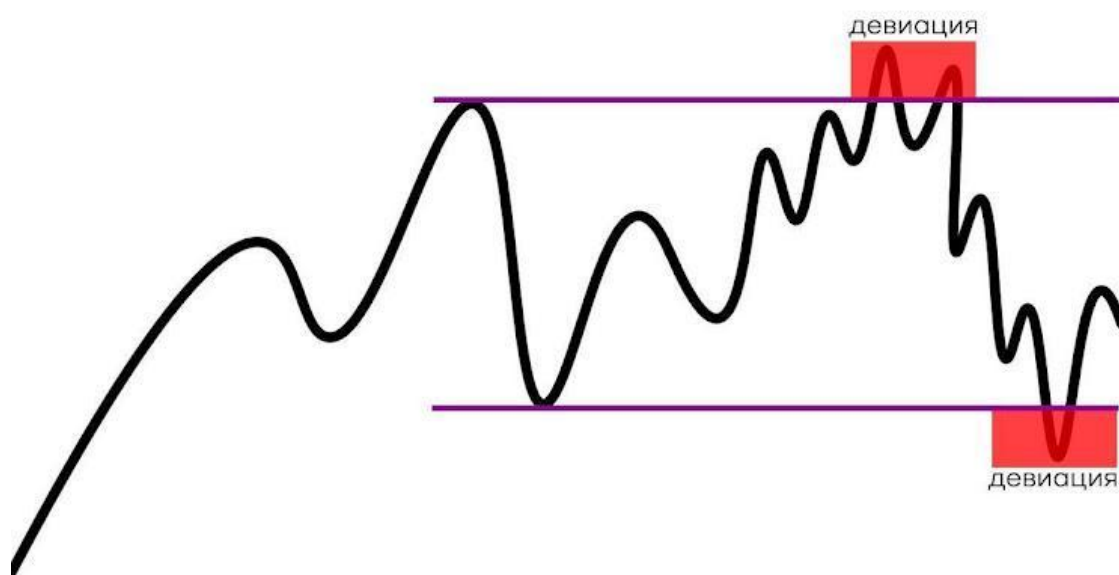
Во время консолидаций трейдеры, открывая позиции, размещают свои стоп-лоссы на покупку над верхней границей ренджа и стоп-лоссы на продажу под его нижней границей. Подобная концентрация ликвидности на одном уровне используется умным капиталом для открытия или закрытия своих позиций.

Лучшие возможности для открытия сделок появляются после девиаций.

**Девиация** – выход цены за границы ренджа. Создается для сбора и формирования ликвидности путем манипуляции ценой. После активации стоп-лоссов за максимумом или минимумом торгового диапазона происходит разворот цены в противоположную сторону.

*Рендж после восходящего импульса. Создание противоположных девиаций*

### подтверждение ренджа



Второй девиацией с одной стороны торгового диапазона считается обновление экстремума первой девиации.

*Пример девиации сверху*

BNBUSDT, 4h, BINANCE ОТКР503.2 МАКС518.9 МИН491.0 ЗАКР493.2 -10.0 (-1.99%)



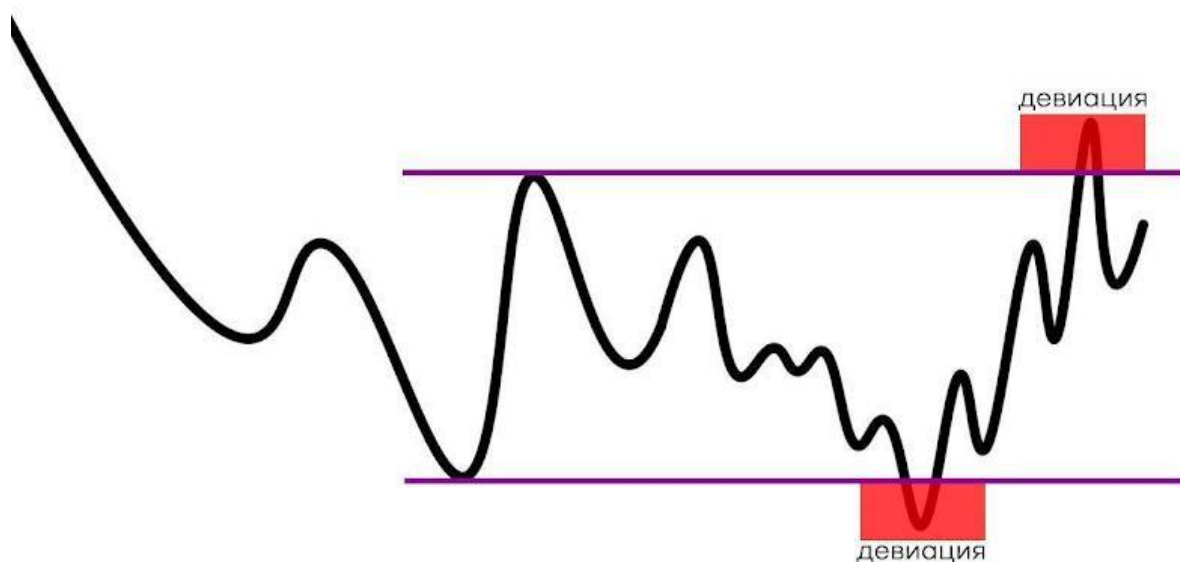
Зачастую после обновления ликвидности на покупку над верхней границей ренджа цена начинает двигаться в противоположном направлении, к нижней границе.

**Девияция сверху приводит к девииции снизу.**

Позиции в нисходящем направлении актуально рассматривать в случае, если рендж был сформирован в зоне сопротивления или цена её протестировала на девииции.

*Рендж после нисходящего импульса. Создание противоположных девииций*

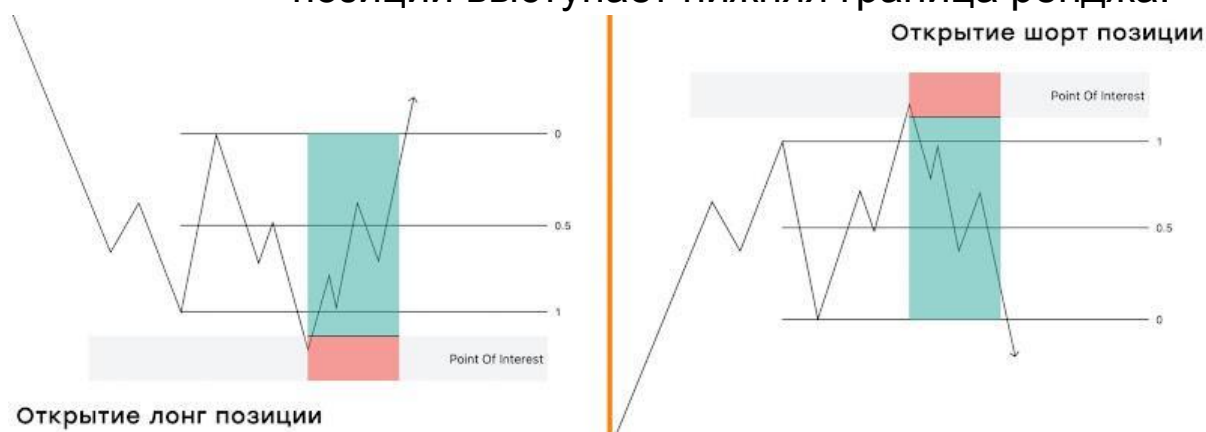
**подтверждение ренджа**



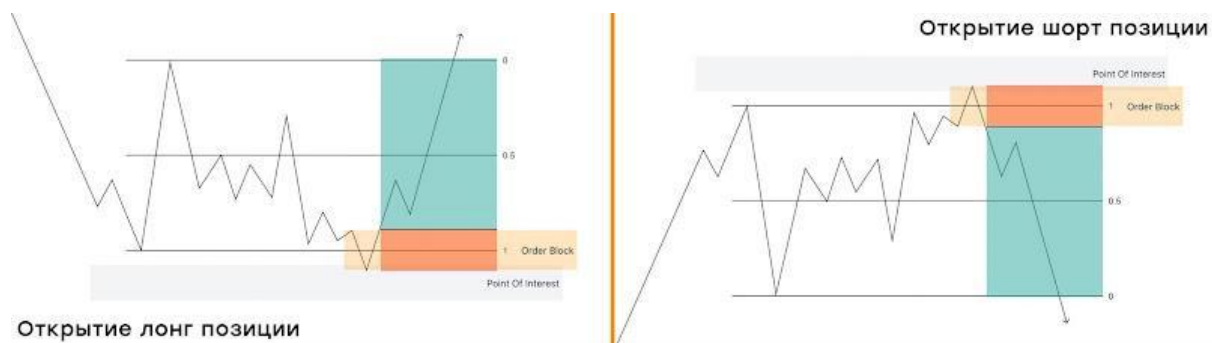
**Открытие позиции**

- Вход на девииции

- **Сделка в восходящем направлении**  
открывается под нижней границей ренджа в момент теста зоны поддержки, откуда ожидается разворот. Стоп-лосс ставится под зону интереса, а основной целью такой позиции выступает верхняя граница ренджа.
- **Сделка в нисходящем направлении**  
открывается над верхней границей ренджа в момент теста зоны сопротивления, откуда ожидается разворот. Стоп-лосс ставится над зоной интереса, а основной целью такой позиции выступает нижняя граница ренджа.

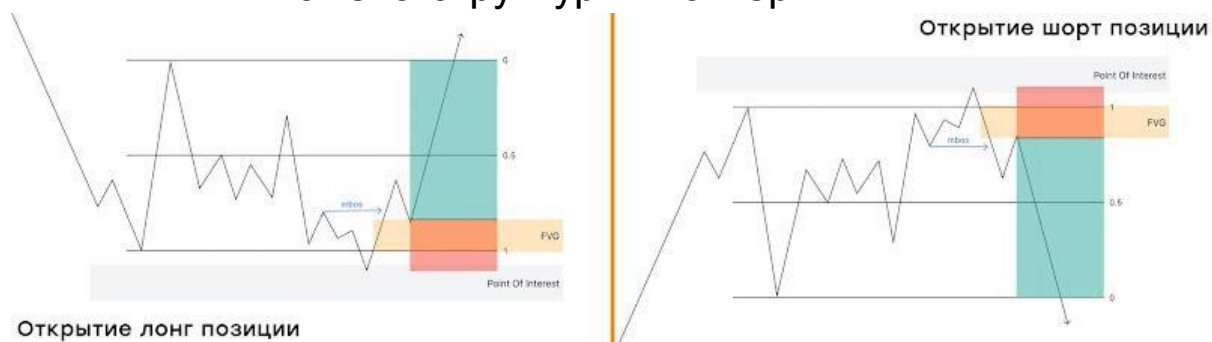


- **Вход после возврата в рендж**
  - **Сделка в восходящем направлении**  
открывается после подтверждения бычьего Ордер Блока, который был сформирован на девиации снизу, стоп-лосс ставится под него, а основной целью лонг позиции выступает верхняя граница ренджа.
  - **Сделка в нисходящем направлении**  
открывается после подтверждения медвежьего Ордер Блока, который был сформирован на девиации сверху, стоп-лосс ставится над ним, а основной целью шорт позиции выступает нижняя граница ренджа.



- **Вход после слома структуры**

- **Сделка в восходящем направлении**  
открывается после локального слома структуры на формировании нового HL. Зоной интереса выступает бычий имбаланс, образовавшийся во время импульсного роста, на котором произошла смена структуры. Паттерн “W” / “W2”.
- **Сделка в нисходящем направлении**  
открывается после локального слома структуры на формировании нового LH. Зоной интереса выступает медвежий имбаланс, образовавшийся во время импульсного падения, на котором произошла смена структуры. Паттерн “W” / “W2”.



Достижение противоположной границы ренджа после девиации не гарантирует закрепление обратно в торговый диапазон, цели могут быть амбициознее, в зависимости от контекста.

*Открытие шорт позиции после локального слома структуры*



### Открытие лонг позиции после возврата в рендж



### Открытие шорт позиции после слома свинг структуры (TTS)



Формирования ренджа в другом рендже является частым явлением, которое вы можете встретить и на таймфрейме основного ренджа, и на более младших временных рамках.



## Вайкофф

Схемы Вайкоффа актуально рассматривать после двух девиаций. Они отображают, что делает умный капитал: накапливает, перенакапливает или распрепределяет, перераспределяет актив.

**Накопление (accumulation)** – крупный оператор начинает накапливать актив для дальнейшей наценки и получения прибыли. Это переход активов от – «слабых рук» к «сильным рукам».

**Распределение (distribution)** – процесс, с помощью которого крупный оператор распределяет (продает) прибыльные позиции. Это переход активов от «сильных рук» к «слабым рукам».

**Перенакопление (re-accumulation)** – процесс повторного накопления – полностью идентичен процессу накопления. Единственная разница между ними заключается в том, как структура начинает развиваться. В то время как диапазон накопления начинается с остановки медвежьего движения, диапазон повторного накопления начинается после остановки восходящего движения.

**Перераспределение (re-distribution)** – это диапазон, который исходит из медвежьего тренда, за которым следует новый медвежий тренд. На большом медвежьем рынке может происходить несколько фаз перераспределения. Это пауза, которая обновляет значение для развития еще одного нисходящего движения.

**Схемы Вайкоффа используются для определения направления будущего движения и момента выхода из торгового диапазона.**

**События:**

**Аккумуляция**

**Фаза А.** Остановка тренда, формирование ренджа.

**PS** (Preliminary Support) – предварительная поддержка. Первый этап замедления трендового нисходящего движения.

**SC** (Selling Climax) – кульминация продаж. Формирование нижней границы будущего торгового диапазона.

**AR** (Automatic Rally) – автоматическое ралли. Реакция после кульминации продаж, формирования верхней границы торгового диапазона.

**ST** (Secondary Test) – вторичный тест. Один или несколько тестов SC.

**Фаза В.** Накопление позиции, формирование ликвидности для будущего движения.

**UA** (Upthrust Action) – снятие ликвидности с AR.

Незначительный признак силы. Может не сформироваться, не является ключевым событием.

**ST in B** (Secondary Test in phase B) – снятие ликвидности с SC, формирование новой ликвидности.

**Фаза С.** Последняя манипуляция перед началом восходящего движения.

**Spring** – снятие ликвидности с ST in B перед наценкой.

Характеризуется пониженными объемами. Может не сформироваться.

**Shakeout** – альтернатива спрингу. Снятие ликвидности с ST in B. Характеризуется импульсным выходом за пределы ренджа на значительное расстояние по сравнению со спрингом. Может не сформироваться.

**Test** – после закрепления обратно в диапазон цена возвращается на тест Spring или Shakeout. Появляется первая возможность для входа в позицию перед наценкой актива.

**Фаза D.** Начало восходящего движения. Повышение объемов. Возможности для входа в позицию после подтверждения перед наценкой актива.

**SOS** (Sign of Strength) – признак силы. Идентифицируется через слом структуры, является подтверждением аккумуляции.

**LPS** (Last Point of Support) – последняя точка поддержки. Формирование свинг лоя после слома структуры, зачастую цена тестирует новообразованный брейкер или митигейшн блок, после чего происходит выход из ренджа и начинается тренд (ралли).

**Фаза Е.** Следствие консолидации – трендовое движение.

## **Дистрибуция**

**Фаза А.** Остановка тренда, формирование ренджа.

**PSY** (Preliminary Supply) – предварительное предложение. Первый этап замедления трендового восходящего движения.

**BC** (Buying Climax) – кульминация покупок. Формирование верхней границы будущего торгового диапазона.

**AR** (Automatic Reaction) – автоматическая реакция.

Движение в обратную сторону после кульминации покупок, формирования нижней границы торгового диапазона.

**ST** (Secondary Test) – вторичный тест. Один или несколько тестов BC.

**Фаза В.** Распределение позиции, формирование ликвидности для будущего движения.

**mSOW** (minor Sign Of Weakness) – снятие ликвидности с AR. Незначительный признак слабости. Может не сформироваться, не является ключевым событием.

**UT** (UpThrust) – снятие ликвидности с BC. Формирование новой ликвидности.

**Фаза С.** Последняя манипуляция перед началом нисходящего движения.

**UTAD** (UpThrust After Distribution) – повышение после распределения. Снятие ликвидности с UT перед уценкой. Характеризуется пониженными объемами. Может не сформироваться.

**Test** – после закрепления обратно в диапазон цена возвращается на тест UTAD. Появляется первая возможность для входа в позицию перед уценкой актива.

**Фаза D.** Начало нисходящего движения. Повышение объемов. Возможности для входа в позицию после подтверждения перед уценкой актива.

**SOW** (Sign Of Weakness) – признак слабости.

Идентифицируется через слом структуры, является подтверждением дистрибуции.

**LPSY** (Last Point of Supply) – последняя точка сопротивления. Формирование свинг хая после слома структуры, зачастую цена тестирует новообразованный брейкер или митигейшн блок, после чего происходит выход из ренджа и начинается нисходящий тренд.

## **На что обращать внимание?**

Факторы для открытия качественной сделки:

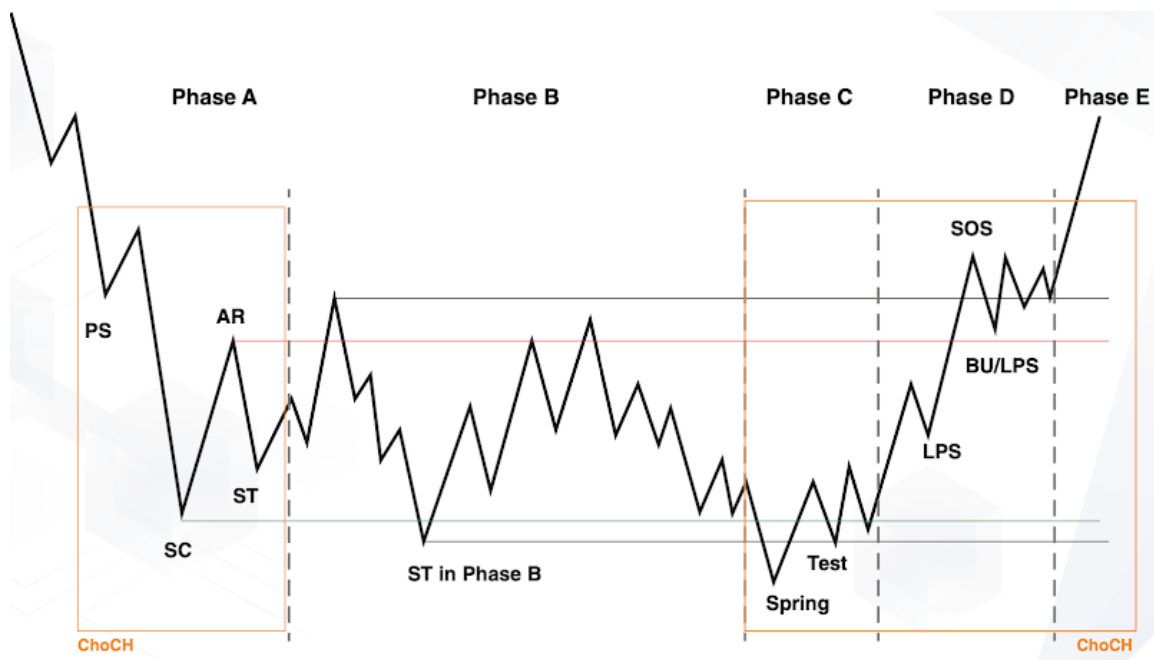
### **Аккумуляция / ре-аккумуляция**

1. Бычья предвзятость на основе старших таймфреймов.
2. Дискаунт маркет.
3. Манипуляция минимумами у зоны поддержки.
4. Бычьи дивергенции.
5. Формирование пулов ликвидности на покупку.
6. Слом нисходящей структуры – подтверждение схемы (SOS).

### **Дистрибуция / ре-дистрибуция**

1. Медвежья предвзятость на основе старших таймфреймов.
2. Премиум маркет.
3. Манипуляция максимумами у зоны сопротивления.
4. Медвежьи дивергенции.
5. Формирование пулов ликвидности на продажу.
6. Слом восходящей структуры – подтверждение схемы (SOW).

## **Аккумуляция тип 1**



### Пример аккумуляции первого типа



**В большинстве случаев схема накопления №1 начнёт формироваться перед зоной поддержки, а её тест будет на третьем минимуме (Spring / Shakeout).**

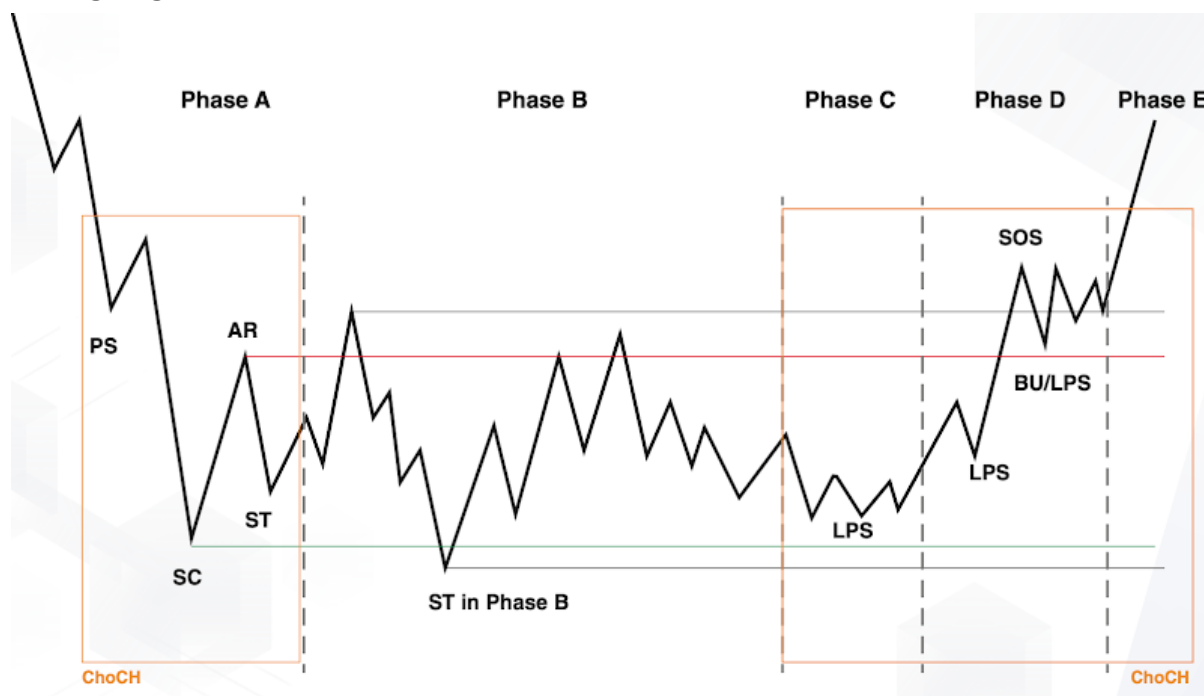
*Пример аккумуляции первого типа*



Пример схемы накопления, когда ниже неё нет зоны поддержки. В таком случае вход в позицию лучше всего рассматривать после mbos на тесте (test) сформированного ОБ (Spring) либо после bos на формировании lps.

**Последовательность событий “st (b)” и “ua” может варьироваться.**

## Аккумуляция тип 2



*Пример аккумуляции второго типа*



Пример высоковероятного сетапа, в котором сформировалась ре-аккумуляция на test'e, она отмечена мелким шрифтом.

**В большинстве случаев схема накопления №2 начнёт формироваться в зоне поддержки.**

## Ре-аккумуляция тип 1

Ре-аккумуляция идентична аккумуляции кроме начала развития торгового диапазона. Схему аккумуляции можно увидеть после нисходящего импульса, а схему ре-аккумуляции – после восходящего импульса.

*Пример ре-аккумуляции первого типа*



## Ре-аккумуляция тип 2

*Пример ре-аккумуляции второго типа*



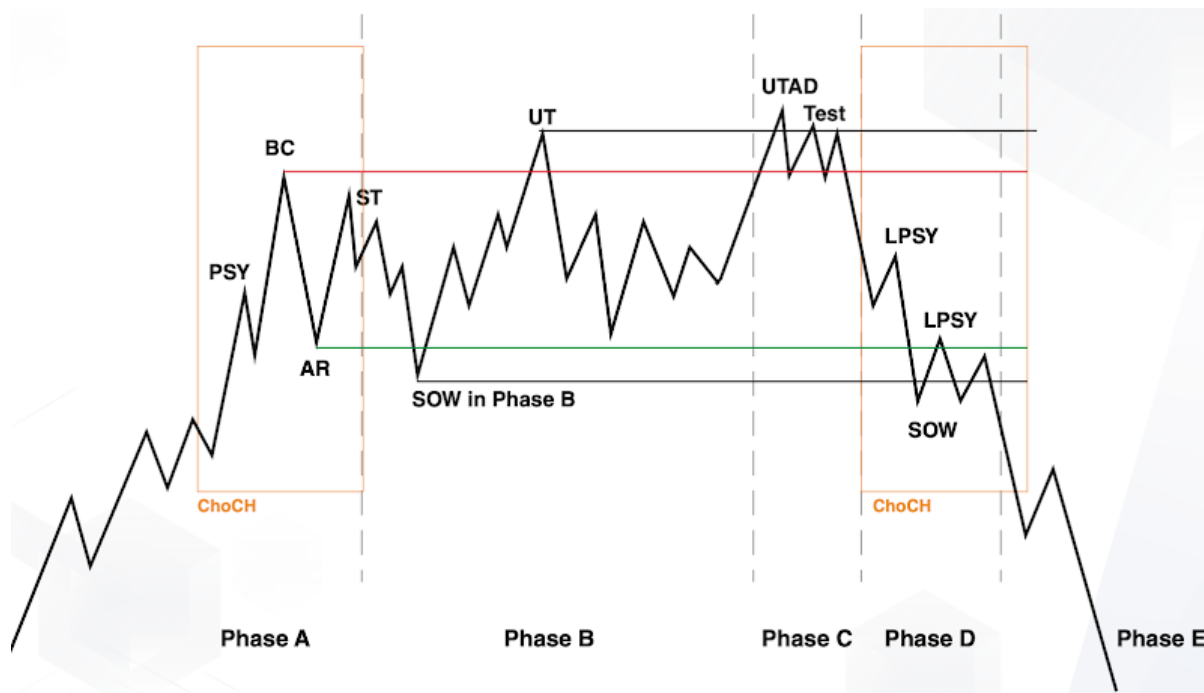
В двух примерах показана скрытая бычья дивергенция. Классической дивергенции не было, это частое явление. *Пример ре-аккумуляции второго типа*



Пример ре-аккумуляции с последующей локальной ре-аккумуляцией после ST (b). Коррекционное нисходящее движение перед снятием ликвидности с нижней границы ренджа – это причина такого агрессивного восходящего движения.

## Дистрибуция тип 1





**Последовательность событий “Sow in B” и “UT” может варьироваться.**

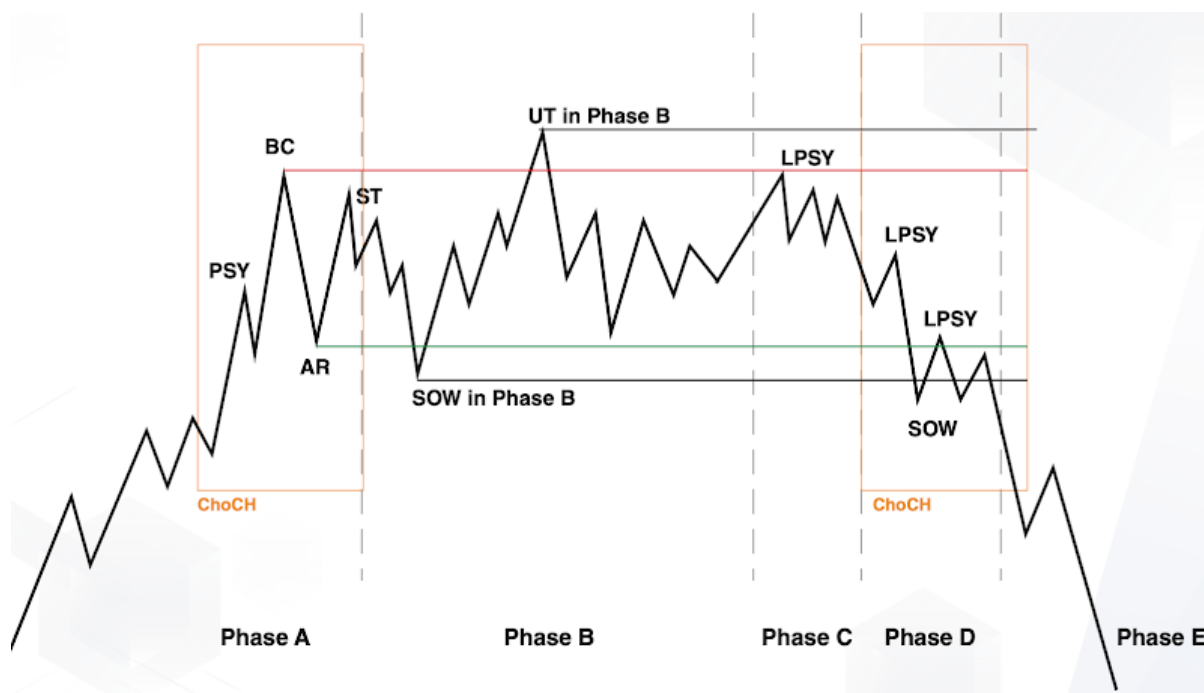
*Пример дистрибуции первого типа*



Пример схемы распределения, когда выше неё нет зоны сопротивления. В таком случае вход в позицию лучше всего рассматривать после mbos на тесте (Test) сформированного ОБ (UTAD) либо после bos на формировании LPSY.

**В большинстве случаев схема распределения №1 начнёт формироваться перед зоной сопротивления, а её тест будет на третьем максимуме (UTAD).**

## Дистрибуция тип 2



### Пример дистрибуции второго типа



**В большинстве случаев схема распределения №2 начнёт формироваться в зоне сопротивления.**

## Ре-дистрибуция тип 1

Ре-дистрибуция идентична дистрибуции, кроме начала развития торгового диапазона. Схему дистрибуции можно увидеть после восходящего импульса, а схему ре-дистрибуции – после нисходящего импульса.

## Пример ре-дистрибуции первого типа



## Ре-дистрибуция тип 2

### Пример ре-дистрибуции второго типа



## Ложная аккумуляция

Ложные схемы Вайкоффа встречаются чаще, чем истинные.

Учитывая факторы для открытия качественной сделки, вы значительно увеличиваете шансы для правильной интерпретации конкретной консолидации.

*Пример аккумуляции первого типа*



Приведенный пример явно отображает аккумуляцию первого типа, если обращать внимание только на схему, не учитывая контекст. Вероятнее всего вы бы открыли лонг позицию с амбициозными целями.

*Контекст в котором формируется аккумуляция первого типа*

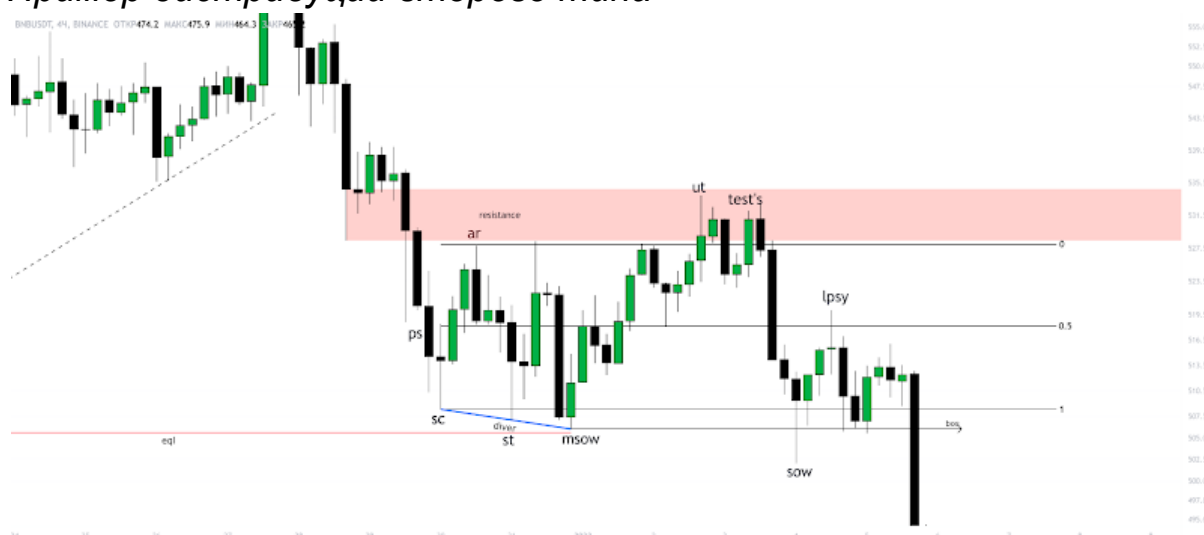


*Пример дистрибуции второго типа*



Как на самом деле должна рассматриваться эта схема с учетом контекста, и ее отработка.

*Пример дистрибуции второго типа*



Если внутри диапазона не был сформирован третий свинг, то свип ликвидности с нижней границы ренджа будет рассматриваться как ST.

**Контекст всегда играет большую роль, чем сама схема.**

## Ложная дистрибуция

Учитывая факторы для открытия качественной сделки, вы значительно увеличиваете шансы для правильной интерпретации конкретной консолидации.

*Пример дистрибуции первого типа*

SUSHISDT, 1H, BINANCE ОТКР 9.308 МАКС 9.232 МИН 9.923 ЗАКР 9.938



Трейдеры, торгующие по схемам Вайкоффа, видят здесь дистрибуцию. Они открывают не аргументированные шорт позиции.

*Пример ложной дистрибуции первого типа*

SUSHISDT, 1H, BINANCE ОТКР 10.245 МАКС 10.299 МИН 9.901 ЗАКР 9.923



Разворот в нисходящем направлении ожидается после теста зоны сопротивления.

Трейдеров, открывающих шорт позиции, оставили вне рынка. После четвертого переоя это можно рассматривать как полноценную дистрибуцию, ожидая начала уценки актива.

*Пример ложной дистрибуции первого типа*



Когда вы будете рассматривать схемы без контекста, вы чаще всего будете открывать позиции слишком рано или в неверном направлении.


Три перелоя не означают, что цена должна расти, как и три перекая не выступают гарантией будущего падения цены.

**Контекст, в котором формируется любая схема Вайкоффа, является самым важным элементом.**

## Задания

1. Найдите по одному примеру формирования ренджа с двумя девиациями после восходящего и нисходящего импульса.
2. Найдите по одному примеру аккумуляции и дистрибуции первого типа.
3. Найдите по одному примеру аккумуляции и дистрибуции второго типа.
4. Найдите по одному примеру ложной аккумуляции и дистрибуции первого или второго типа.

**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 интересные вас вопросы.