

Торговые сетапы

Торговый сетап – это совокупность факторов для открытия позиции.

Системная и прибыльная торговля обеспечивается умением трейдера комбинировать различные элементы, которые отображает график, и интерпретировать их. Отсутствие синхронизации таймфреймов и применение инструментов изолированно друг от друга сопровождаются негативными результатами для торгового счета на дистанции.

Как найти высоковероятный сетап?

- Определите направление актива.

Используйте старшие таймфреймы для формирования предвзятости касательно будущего направления цены (1D, 1W, 1M).

- Определите зону интереса в соответствии с текущим институциональным потоком ордеров.

Умные деньги полностью контролируют цену, отслеживайте их действия с помощью институциональных инструментов и следуйте за ними при открытии своих сделок.

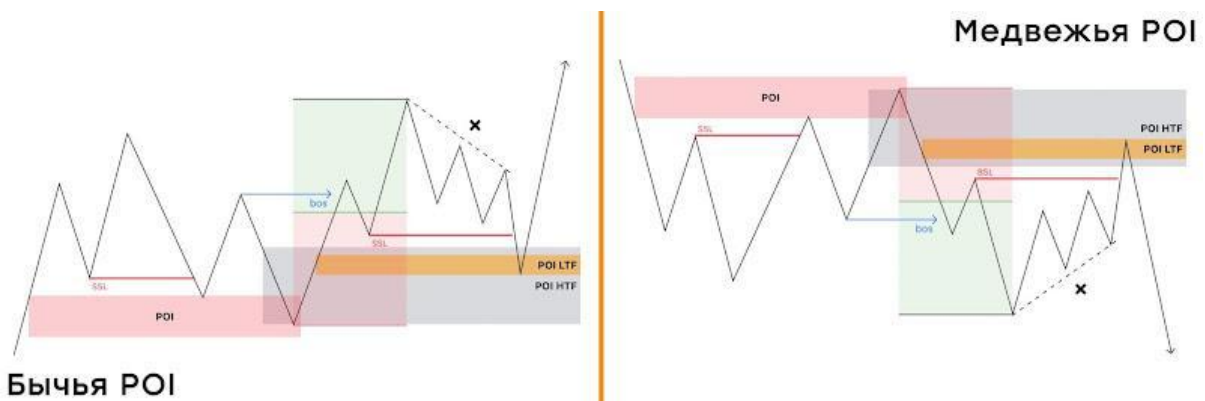
Зона интереса

Point Of Interest (POI) – область для потенциального разворота цены, где используется один из торговых сетапов для открытия позиции.

Зоной интереса могут быть:

- Order Block (OB);
- Fair Value Gap (FVG);
- Breaker Block (BB);
- Mitigation Block (MB);
- Wick.

Зона интереса определяется на старших таймфреймах и уточняется на младших таймфреймах.



Лучшие POI формируются в **дискаунт или премиум маркете от других проблемных зон.**

Ранее тестированные POI вероятнее всего не получат повторной реакции цены.

Формирование ликвидности перед POI зачастую ускоряет и увеличивает вероятность разворота цены после её теста, а её отсутствие обычно приводит к консолидации перед зоной интереса или внутри неё.

Создание ликвидности с другой стороны от POI выступает дополнительным фактором для открытия позиции от рассматриваемой зоны интереса.

Слом структуры (bos / mbos) на младших таймфреймах после теста POI является подтверждением будущей наценки или уценки актива.

Наличие скрытой дивергенции увеличивает вероятность получения реакции цены от POI.

Вышеперечисленные факторы позволяют системно открывать качественные сделки с высоким винрейтом.

Разворотные паттерны

В зоне интереса вход в позицию можно осуществлять на основе паттернов.

Основные преимущества такого подхода:

- высокое соотношение риска и прибыли;

Увеличение соотношения RR обуславливается другой точкой входа и расположением стоп-лосса.

- высокий винрейт;

Позиции открываются только на основе подтвержденных паттернов, что приносит значительно больший винрейт по сравнению с агрессивным входом сразу же при тесте POI.

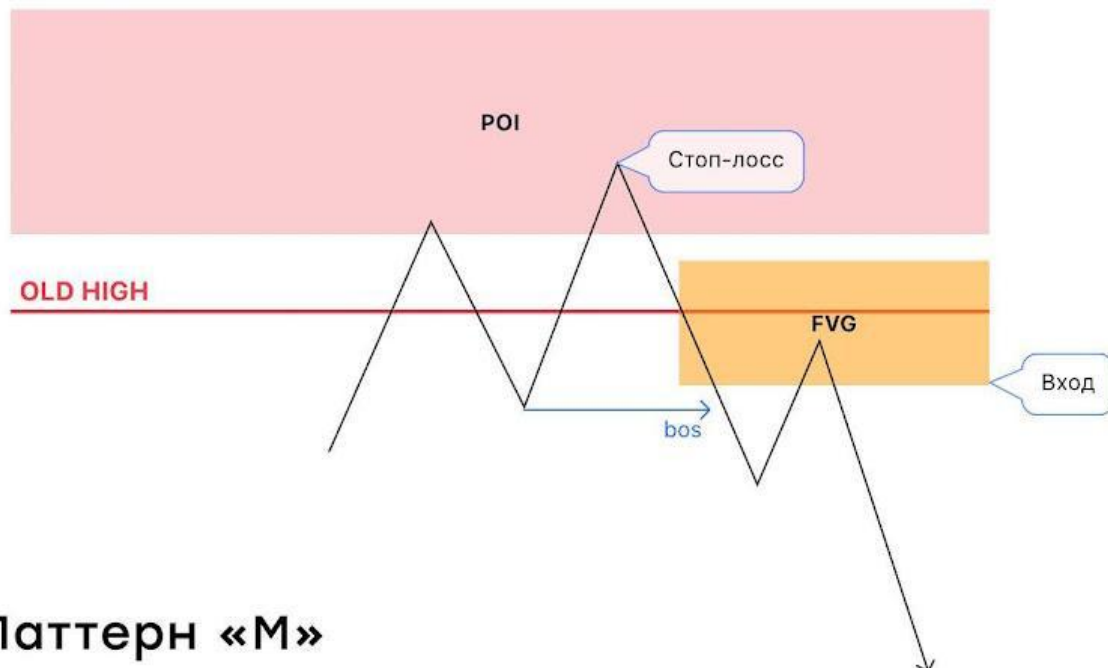
- прогнозируемое время начала развития цены в ожидаемом направлении;

Начало ценообразования в противоположном направлении от зоны интереса происходит после подтверждения паттерна (bos / mbos).

Двойная вершина / “М”

Классическая разворотная модель, включающая в себя:

- активацию стоп-лоссов на покупку;
- слом восходящей структуры;
- ребалансировку цены;



Паттерн «М»

Лимитный ордер в шорт может быть расположен в начале медвежьего имбаланса, сформировавшегося во время слома восходящей структуры.

Стоп-лосс ставится над максимумом формации.

Фиксация прибыли на нисходящем тренде может происходить при обновлении последнего LL, от которого началась коррекция, и при достижении первой проблемной области ниже него.

На восходящем тренде фиксация прибыли может происходить в рамках бычьей структуры, во время обновления краткосрочного минимума в области 50% торгового диапазона и при достижении зоны поддержки ниже него.

Двойная вершина / "M"

LTCUSD, 1h, BINANCE ОТКР123.90 МАКС124.60 МИН121.60 ЗАКР122.10

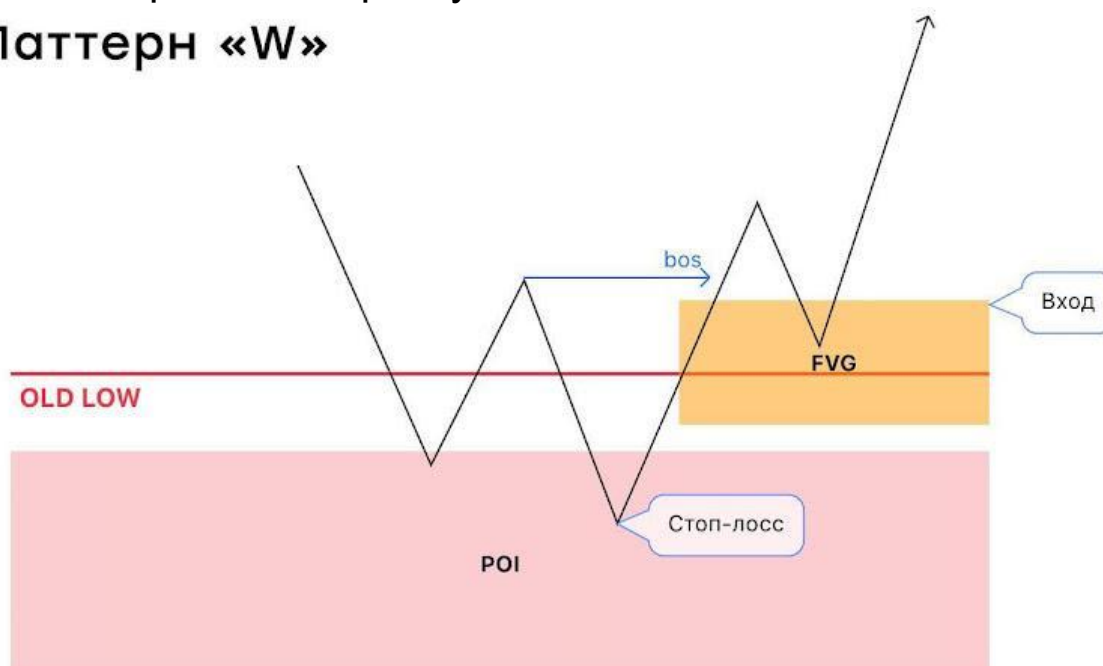


Двойное дно / "W"

Классическая разворотная модель, включающая в себя:

- активацию стоп-лоссов на продажу;
- слом нисходящей структуры;
- ребалансировку цены;

Паттерн «W»



Лимитный ордер в лонг может быть расположен в начале бычьего имбаланса, сформировавшегося во время слома нисходящей структуры.

Стоп-лосс ставится под минимумом формации.

Фиксация прибыли на восходящем тренде может происходить при обновлении последнего НН, от которого

началась коррекция, и при достижении первой проблемной области выше него.

На нисходящем тренде фиксация прибыли может происходить в рамках медвежьей структуры, во время обновления краткосрочного максимума в области 50% торгового диапазона и при достижении зоны сопротивления выше него.

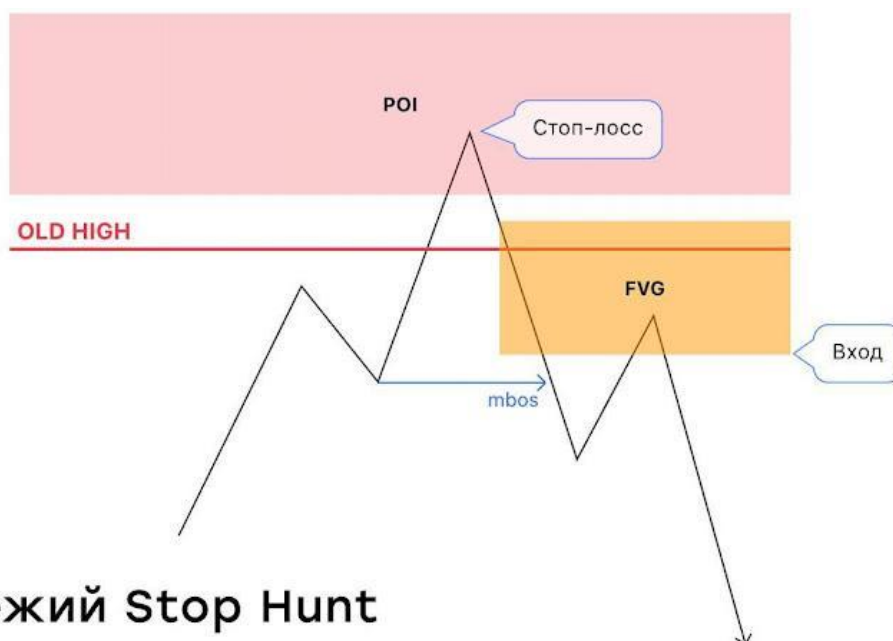
Двойное дно / "W"



Медвежий Stop Hunt

Разворотная модель, производная от паттерна "М", включающая в себя:

- активацию стоп-лоссов на покупку;
- локальный слом восходящей структуры;
- ребалансировку цены;



Медвежий Stop Hunt

Разворот цены происходит после обновления ликвидности на покупку одиночным свингом, что является основным отличием от паттерна "М".

Медвежий Stop Hunt



Лимитный ордер в шорт может быть расположен в начале медвежьего имбаланса, сформировавшегося во время слома локальной восходящей структуры.

Стоп-лосс ставится над максимумом формации.

Фиксация прибыли на нисходящем тренде может происходить при обновлении последнего LL, от которого началась коррекция, и при достижении первой проблемной области ниже него.

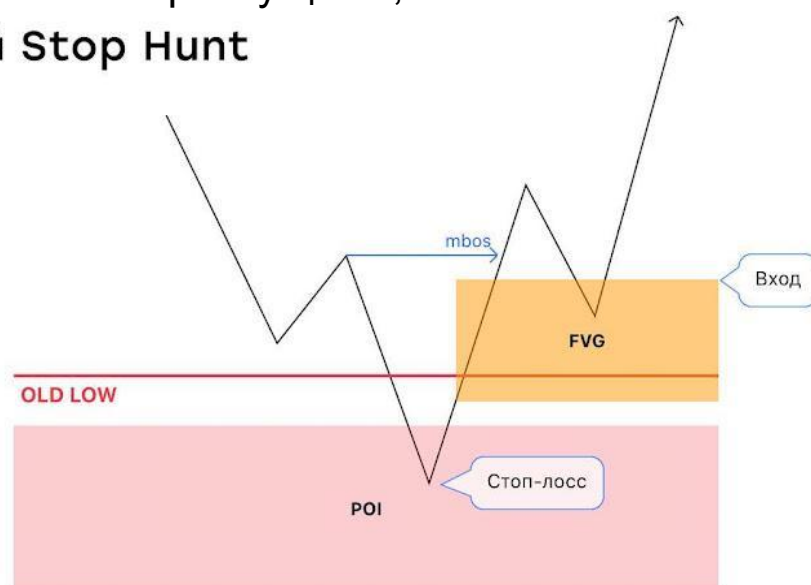
На восходящем тренде фиксация прибыли может происходить в рамках бычьей структуры, во время обновления краткосрочного минимума в области 50% торгового диапазона и при достижении зоны поддержки ниже него.

Бычий Stop Hunt

Разворотная модель, производная от паттерна “W”, включающая в себя:

- активацию стоп-лоссов на продажу;
- локальный слом нисходящей структуры;
- ребалансировку цены;

Бычий Stop Hunt



Разворот цены происходит после обновления ликвидности на продажу одиночным свингом, что является основным отличием от паттерна “W”.

Лимитный ордер в лонг может быть расположен в начале бычьего имбаланса, сформировавшегося во время слома локальной нисходящей структуры.

Бычий Stop Hunt



Стоп-лосс ставится под минимумом формации.

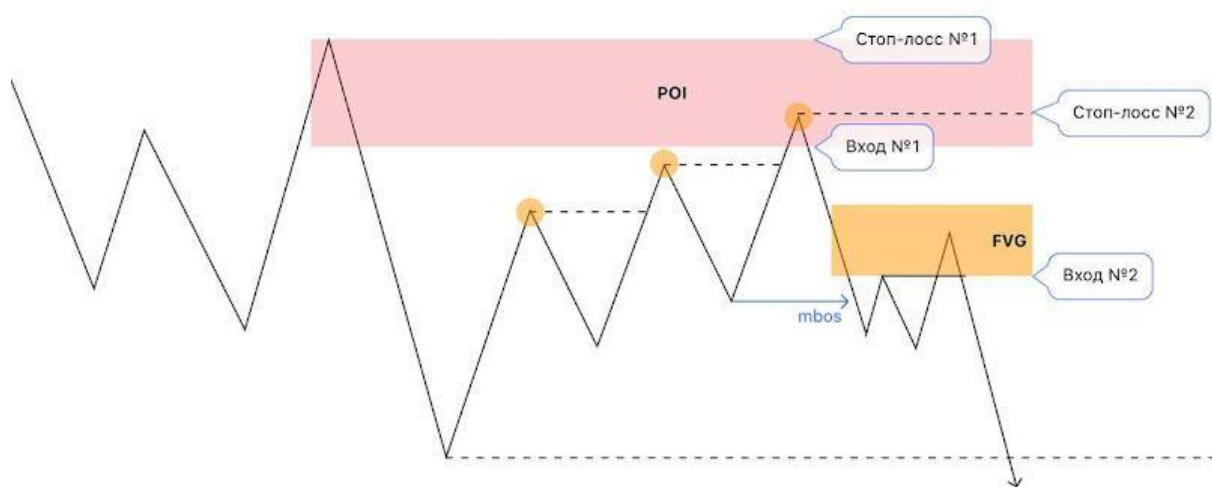
Фиксация прибыли на восходящем тренде может происходить при обновлении последнего НН, от которого началась коррекция, и при достижении первой проблемной области выше него.

На нисходящем тренде фиксация прибыли может происходить в рамках медвежьей структуры, во время обновления краткосрочного максимума в области 50% торгового диапазона и при достижении зоны сопротивления выше него.

Медвежий Three Drives Pattern

Медвежий паттерн трех движений наиболее эффективно использовать **в рамках нисходящей рыночной структуры** на завершении коррекции.

Более подробно логика паттерна "TDP" объясняется в 4 уроке.



Медвежий Three Drives Pattern

Вход в шорт позицию может происходить на формировании третьего более высокого максимума (НН). **Стоп-лосс** будет ставиться над верхней границей зоны интереса, откуда ожидается продолжение нисходящего тренда.

Вторая возможность для открытия шорт позиции появляется после слома восходящей структуры на коррекции. Ожидается обновление краткосрочного максимума и тест зоны сопротивления над ним, после чего нисходящее ценообразование продолжится.

Стоп-лосс будет ставиться над верхней границей зоны интереса, откуда будет сформирован новый более низкий максимум (ЛН) по нисходящей структуре.

Фиксация прибыли может происходить при обновлении последнего LL, от которого началась коррекция, и при достижении первой проблемной области ниже него. Формирование медвежьего паттерна трех движений часто сопровождается наличием медвежьих дивергенций, что будет выступать дополнительным фактором для поиска позиций в нисходящем направлении.

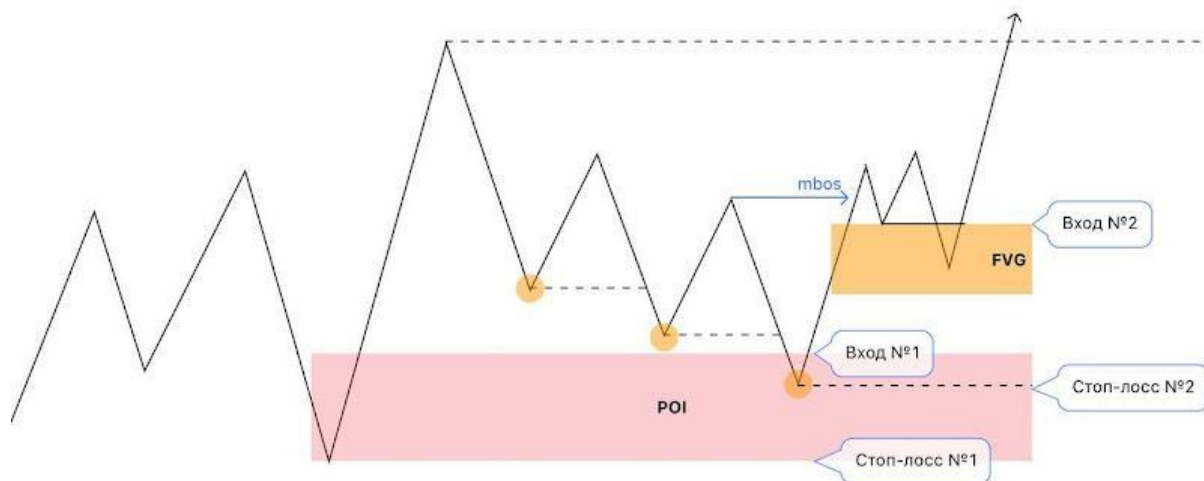
Примеры на графиках находятся в 4 методичке.

Бычий Three Drives Pattern

Бычий паттерн трех движений наиболее эффективно использовать **в рамках восходящей рыночной структуры** на завершении коррекции.

Более подробно логика паттерна "TDP" объясняется в 4 уроке.

Бычий Three Drives Pattern



Вход в лонг позицию может происходить на формировании третьего более низкого минимума (LL).

Стоп-лосс будет ставиться под нижнюю границу зоны интереса, откуда ожидается продолжение восходящего тренда.

Вторая возможность для открытия лонг позиции появляется после слома нисходящей структуры на коррекции. Ожидается обновление краткосрочного минимума и тест зоны поддержки под ним, после чего восходящее ценообразование продолжится.

Стоп-лосс будет ставиться под нижнюю границу зоны интереса, откуда будет сформирован новый более высокий минимум (HL) по восходящей структуре.

Фиксация прибыли может происходить при обновлении последнего HH, от которого началась коррекция, и при достижении первой проблемной области выше него.

Формирование бычьего паттерна трех движений часто сопровождается наличием бычьих дивергенций, что будет

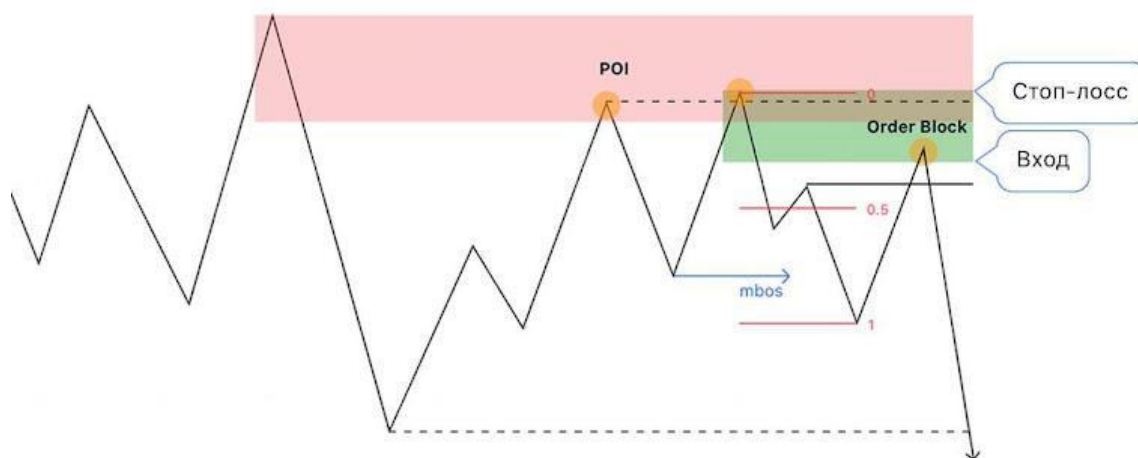
выступать дополнительным фактором для поиска позиций в восходящем направлении.

Примеры на графиках находятся в 4 методичке.

Медвежий Three Tap Setup

Медвежий паттерн трех касаний наиболее эффективно использовать **в рамках нисходящей рыночной структуры** на завершении коррекции.

Более подробно логика паттерна "TTS" объясняется в 4 уроке.



Медвежий Three Tap Setup

Вход в шорт позицию может происходить на третьем касании от медвежьего Ордер Блока. Коррекционное движение ожидается после слома локальной восходящей структуры.

Стоп-лосс будет ставиться над максимумом медвежьего Ордер Блока.

Фиксация прибыли может происходить при обновлении последнего LL, от которого началась коррекция, и при достижении первой проблемной области ниже него. Формирование медвежьего паттерна трех касаний часто сопровождается наличием медвежьих дивергенций, что будет выступать дополнительным фактором для поиска позиций в нисходящем направлении.

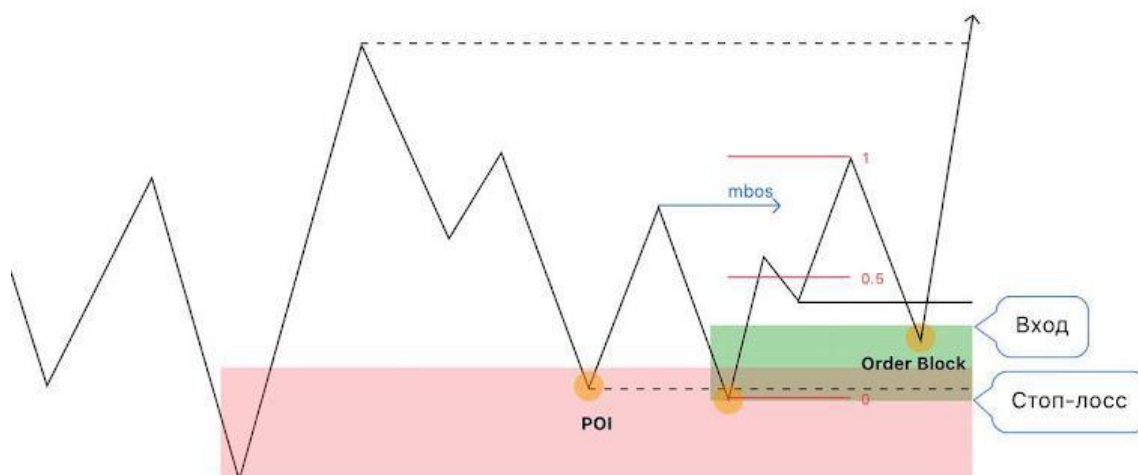
Примеры на графиках находятся в 4 методичке.

Бычий Three Tap Setup

Бычий паттерн трех касаний наиболее эффективно использовать **в рамках восходящей рыночной структуры** на завершении коррекции.

Более подробно логика паттерна “TTS” объясняется в 4 уроке.

Бычий Three Tap Setup



Вход в лонг позицию может происходить на третьем касании от Бычьего Ордер Блока. Коррекционное движение ожидается после слома локальной нисходящей структуры.

Стоп-лосс будет ставиться под минимум бычьего Ордер Блока.

Фиксация прибыли может происходить при обновлении последнего НН, от которого началась коррекция, и при достижении первой проблемной области выше него. Формирование бычьего паттерна трех касаний часто сопровождается наличием бычьих дивергенций, что будет выступать дополнительным фактором для поиска позиций в восходящем направлении.

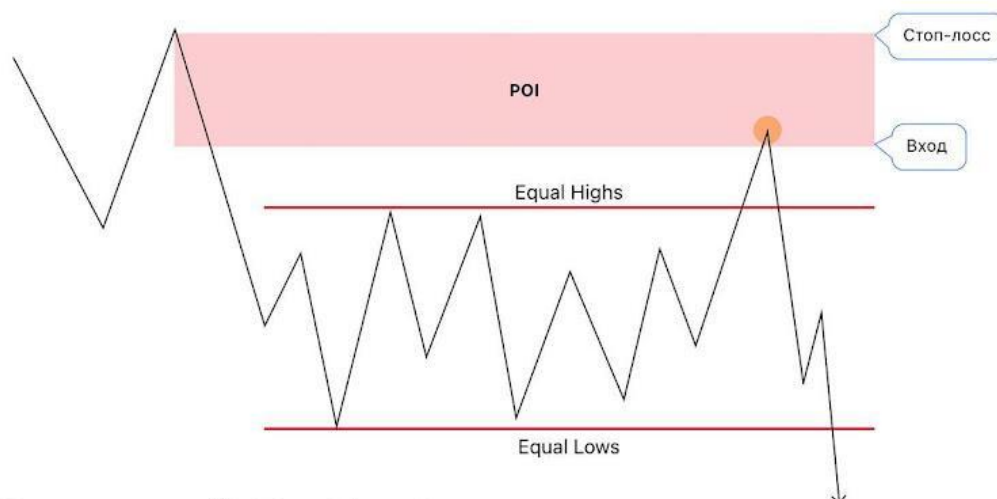
Примеры на графиках находятся в 4 методичке.

Медвежий Turtle Soup

Разворотная модель, включающая в себя:

- формирование равнозначных пулов ликвидности на обеих границах ренджа;
- активацию стоп-лоссов на покупку, расположенных выше равных максимумов;

- тест зоны интереса;
- активацию стоп-лоссов на продажу, расположенных ниже равных минимумов;



Медвежий Turtle Soup

Наличие ликвидности на покупку перед зоной сопротивления увеличивает вероятность получения незамедлительной реакции цены в нисходящем направлении после её теста.

Вход в шорт позицию может происходить после активации стоп-лоссов на покупку над верхней границей торгового диапазона на тесте зоны интереса.

Подтверждением будущей уценки актива к противоположной границе ренджа будет слом восходящей структуры на младшем таймфрейме.

Стоп-лосс будет ставиться над верхней границей зоны интереса, откуда ожидается реакция цены.

Фиксация прибыли может происходить при обновлении нижней границы ренджа и при достижении первой проблемной области ниже неё.

Медвежий Turtle Soup

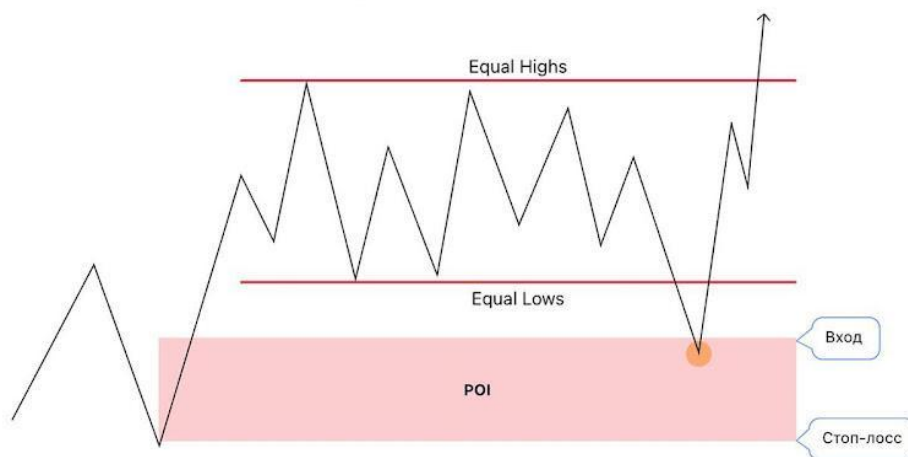


Бычий Turtle Soup

Разворотная модель, включающая в себя:

- формирование равнозначных пулов ликвидности на обеих границах ренджа;
- активацию стоп-лоссов на продажу, расположенных ниже равных минимумов;
- тест зоны интереса;
- активацию стоп-лоссов на покупку, расположенных выше равных максимумов;

Бычий Turtle Soup



Наличие ликвидности на продажу перед зоной поддержки увеличивает вероятность получения незамедлительной реакции цены в восходящем направлении после её теста.

Вход в лонг позицию может происходить после активации стоп-лоссов на продажу под нижней границей торгового диапазона на тесте зоны интереса.

Подтверждением будущей наценки актива к противоположной границе ренджа будет слом нисходящей структуры на младшем таймфрейме.

Стоп-лосс будет ставиться под нижней границей зоны интереса, откуда ожидается реакция цены.

Фиксация прибыли может происходить при обновлении верхней границы ренджа и при достижении первой проблемной области выше нее.

Формирование паттерна Turtle Soup часто сопровождается наличием дивергенций, это будет выступать дополнительным фактором для поиска позиций в направлении противоположной границы торгового диапазона.

Бычий Turtle Soup



Стоп-лосс

Существует естественная человеческая склонность защищать свои активы, и столь же естественная склонность отрицать проблемы, в которые они попали, когда совершили убыточную сделку.

Вы, как и каждый, кто начинает заниматься трейдингом, хотите побеждать. Вы ненавидите ошибаться и ненавидите проигрывать.

Это побуждает вас брать на себя больший риск, чем требуется, чтобы из раза в раз не чувствовать тяжесть поражения.

Только не смотря на то, что торговля сопряжена с риском, она вовсе не является или не должна быть слишком рискованной.

Что делает торговлю действительно рискованной, так это неправильные действия в сочетании с неправильным мышлением.

Большой риск, особенно торговля без стоп-лосса, никогда не принесет большей прибыли на дистанции.

Единственное, что может принести такая торговля – потерю депозита.

Правило 1. Всегда используйте стоп-лосс.

Треjder, открывающий сделку без фиксированного риска, не понимает, что происходит на рынке, не уверен в своем анализе и боится ставить стоп-лосс.

И он его действительно не ставит, потому что заранее знает, что сделка будет убыточной.

Стоп-лосс – это ваша страховка и возможность допустить множество ошибок, не потеряв при этом все свои сбережения.

Правило 2. Не знаете, где установить стоп-лосс, не открывайте сделку.

Стоп-лосс должен размещаться там, где сетап, на основе которого открывается позиция, теряет актуальность.

Все инструменты и сетапы имеют правила размещения стоп-лосса. Ставить его на основе интуитивных способностей, непроверенных фактов, психологических уровней не нужно.

Во многих ситуациях будущее направление цены может казаться очевидным, но стоп-лосс не будет где аргументированно разместить, либо соотношение риска и прибыли будет неприемлемым.

Такие сделки должны пропускаться.

Правило 3. Ставьте стоп-лосс как минимум по причине сохранения своего психического здоровья, если же сохранение вашего депозита вас не интересует.

Хотя на практике оказывается, что этот урок большинство усваивает только после ликвидации, я все же настоятельно не рекомендую проверять “стратегию” торговли без стоп-лосса деньгами.

Плоды многих месяцев системной торговли могут быть уничтожены за несколько эмоциональных сделок.

Торговля без стопа вынуждает трейдера постоянно наблюдать за графиком. Это часто вызывает проблемы с психологическим и физическим состоянием, что сказывается на личной жизни и повседневных делах.

Повышенная эмоциональность неопределенное количество времени и постоянные мысли про рынок в течении дня, засыпая и просыпаясь, категорически изменяют жизнь на до и после.

Желание, чтобы цена пошла в направлении открытой сделки, будет сводить к минимуму объективность дальнейшего анализа.

Соответственно в нужный момент вы не сможете принять объективное решение о том, как спасти сложившуюся ситуацию.

Правило 4. Соблюдайте первоначальный план.

Никогда не переставляйте изначально установленный стоп-лосс, пытаясь таким образом избежать его активации.

Распространенная проблема – при приближении цены к значению стоп ордера трейдеры любят отодвигать его, тем самым увеличивая риск на сделку.

Это то же самое, что торговать вообще без стоп-лосса: как долго и как далеко вы будете готовы его отодвинуть, и к каким убыткам это может привести?

Рынки не смогут вам навредить, если вы соблюдаете риск.

Правило 5. Возьмите на себя ответственность за свои же решения.

Полученный стоп-лосс свидетельствует о допущенной ошибке, которую необходимо выявить и исправить в дальнейшем.

Вы откажетесь от ошибки, если будете держать сделку без стоп-лосса, и вам случайно повезет закрыть ее хотя-бы с минимальным убытком.

Если на этот раз вам не повезет, и ваш счет будет ликвидирован, вы непременно захотите найти виновника вашего поражения.

Только кроме вас никто в этом не виноват.

Правило 6. Стоп-лосс не свидетельствует об убытках на дистанции.

Зарабатывать торговлей можно, если профессионально управлять своим капиталом. Убытки – это издержки бизнеса.

Нужно нормализировать процесс потерь и сделать его привычным делом.

Перед открытием сделки нужно всегда считать максимальный убыток и потенциальный профит. Это дает возможность торговать системно и не опираться на результат одной сделки.

В приоритете стоит результат за серию открытых позиций. Такой подход позволяет совершать ошибки.

Допущенная оплошность не повлияет значительным образом на общий результат, и не изменит ни эмоциональное, ни физическое состояние.

Соотношение риска и прибыли

Оптимальное соотношение риска и прибыли дает возможность трейдеру ошибаться и быть прибыльным даже с очень низким процентом удачных сделок.

При открытии сделки важно заранее определить, каким количеством средств вы рискуете, чтобы получить определенную сумму прибыли.

Ниже отображена реальность соотношения риска и прибыли, когда трейдер остается в безубытке.

Риск	Прибыль	Процент прибыльных сделок (Win Rate)
1	10	9%
1	5	17%
1	4	20%
1	3	25%
1	2	33%
1	1	50%
2	1	67%
3	1	75%

Серия сделок должна открываться с приемлемым соотношением риска и прибыли. Торгуя высоковероятные сетапы с оптимальным RR, трейдер имеет возможность выйти на стабильный положительный результат.

Минимальное соотношение риска и прибыли, которое рекомендуется использовать – 1:3.

При открытии четырех сделок безубыток обеспечивается наличием одной прибыльной позиции. Когда успешных сделок будет больше одной, трейдер получает прибыль. Важно учитывать, что на серию сделок не должен варьироваться риск и уменьшаться соотношение RR, если этого не предполагает система.

При частичной фиксации позиции изначальное соотношение RR должно быть выше, чтобы при закрытии сделки обеспечить ожидаемую прибыль.

Математическая вероятность

Результат в трейдинге всегда оценивается на дистанции. По этой причине не стоит судить о вашем проценте прибыльных сделок, когда вы открыли их всего несколько. Также не является показателем тотального поражения, например, четыре убыточных сделки подряд при соотношении риска и прибыли 1:3.

Ровно с таким же успехом в дальнейшем вы можете открыть четыре прибыльных сделки, таким образом стабилизируя статистику.

В каждой случайной выборке результатов сделок можно пройти через группы удач и неудач, поэтому чем раньше вы примете эту реальность, тем более психологически будете подготовлены к трейдингу с точки зрения правильного мышления.

Высокое соотношение риска и прибыли

Высокое соотношение риска и прибыли не будет хорошей основой для прибыльной торговли новичка.

Психологически сложно справиться с серией убыточных позиций и крайне низком винрейтом, который будет при такой системе.

При открытии сделок с соотношением риска и прибыли 1:10 винрейт для безубыточности должен быть 10%. Из 100 сделок достаточно открыть 10 прибыльных, тогда трейдер останется при своих.

Обычно такие сделки будут открываться либо с не аргументированным стоп-лоссом, либо с завышенными целями, либо то и другое вместе.

Определение подходящего соотношения риска и прибыли

У каждого трейдера свой темперамент и стиль торговли.

Определение лучшего соотношения риска и прибыли происходит путем тестирования и взвешивания плюсов и минусов каждого подхода.

Оптимальное соотношение риска и прибыли (1:3) – много торговых возможностей.

Среднее соотношение риска и прибыли (1:5) – среднее количество торговых возможностей.

Высокое соотношение риска и прибыли (1:10) – мало торговых возможностей.

Процент прибыли не будет зависеть от выбранной системы. Трейдеры, торгующие с RR 1:3, могут значительно больше зарабатывать, чем трейдеры торгующие с RR 1:10.

В первую очередь нужно ставить цель выйти на положительную динамику, оптимальное и среднее соотношение риска и прибыли будет лучшим вариантом.

Что происходит с торговлей, когда присутствует боязнь получить убыток?

1. Боязнь убытка способствует принятию решений на основе страха.
2. Проигрыш неизбежен – принятие решений на основе страха удерживает фокус на неблагоприятном результате.
3. Принятие решений на основе страха способствует развитию паралича трейдера или неспособности эффективно работать.
4. Капитал, которым управляет трейдер, не умеющий принимать убытки, не может приносить прибыль в долгосрочной перспективе.

Прибыль достижима, не смотря на разумные потери

1. Профессиональный управляющий капиталом понимает, что "убытки – это издержки ведения бизнеса".
2. Использование разумного управления капиталом и высоковероятных сетапов приносит значительные % прибыли.
3. Торговые сценарии, которые способствуют потенциальному соотношению вознаграждения 3:1, обеспечивают начальную основу.
4. Определение торговых сетапов, которые обеспечивают соотношение риска и прибыли 5:1 или больше – эффективное покрытие убытков.

Индексы

BTC.D

Доминация биткоина (BTC.D) – это соотношение между рыночной капитализацией BTC и общей капитализацией криптовалютного рынка.

$BTC.D = \text{капитализация BTC} \div \text{общая капитализация криптовалют}$.

Форма и направление общей капитализации следует за капитализацией биткоина. Это объясняется влиянием биткоина на криптовалютный рынок.

BTC.D	BTC	ALTS
рост	рост	падение
рост	падение	дамп
рост	рендж	рендж
падение	рост	памп
падение	падение	рендж
падение	рендж	рост

Использование доминации биткоина может помочь определить, какой сектор лучше всего торговать: биткоин или альткоины. Интерес к альт парам появляется при потенциальном пампе или дампе.

DXU

DXU – это индекс, который измеряет силу доллара США по отношению к другим валютам: евро, фунт стерлингов, швейцарский франк, йена, канадский доллар и шведская крона.

DXU имеет отрицательную корреляцию с иностранными валютами. Индекс растет, когда доллар США повышает свою стоимость. Иностранные валюты снижаются.

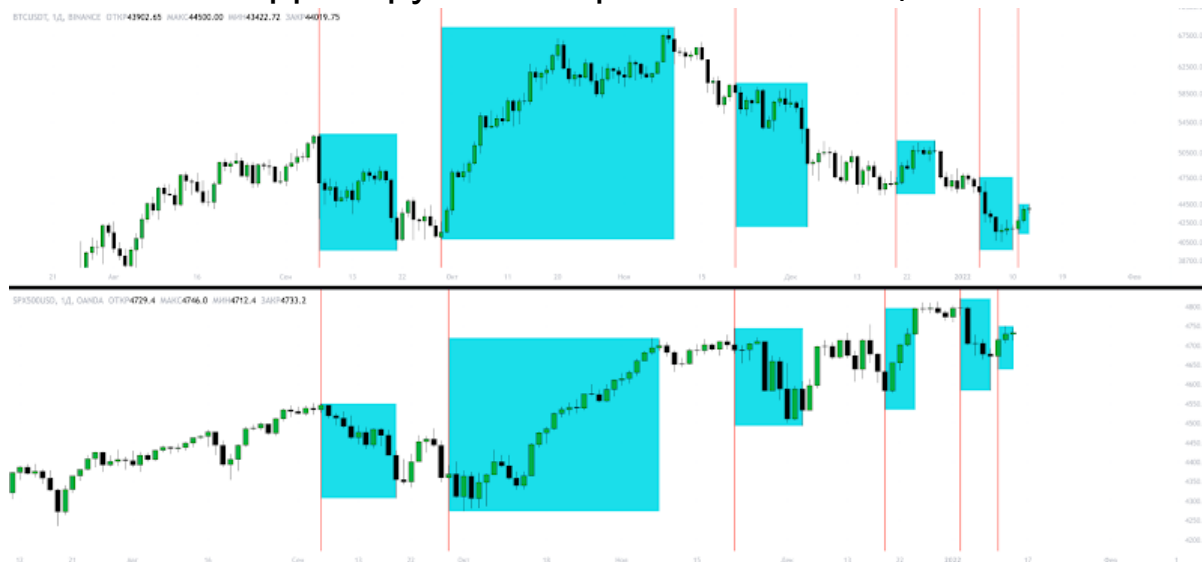
Доллар США является мировой резервной валютой и используется для определения цены многих активов, включая золото и биткоин, которые считаются товарами, поэтому между DXU и BTC существует отрицательная корреляция.

Это означает, что если доллар США растет (DXY), то высока вероятность падения BTC, и наоборот. *Между двумя активами нет идеальной отрицательной корреляции.*



S&P 500

S&P 500 – это индекс роста фондового рынка. Состоит из акций 500 крупнейших компаний, акции которых можно купить на фондовых рынках Соединенных Штатов. BTC тесно коррелирует с американскими акциями.



Наиболее сильную корреляцию можно наблюдать в периоды трендовых движений. Практически полное отсутствие взаимосвязи, когда цена консолидируется. Использование корреляции S&P 500 и DXY может быть дополнительным фактором при анализе торгуемой пары.

Задания

1. Найдите по одному примеру паттерна “W” и “M”.
2. Найдите по одному примеру бычьего и медвежьего паттерна Stop Hunt.
3. Найдите по одному примеру бычьего и медвежьего паттерна Turtle Soup.

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.