

Сетапы

Сетап – это совокупность факторов для входа в сделку.

Определение трейдером зоны поддержки или сопротивления будет недостаточным анализом для системной и прибыльной торговли. Лучшие позиции открываются в зависимости от реакции цены на такие области интереса (POI).

POI (point of interest) – ордерблок, брейкер, митигейшн блок, заполнение имбаланса.

Открытие сделки с высоким соотношением риска и прибыли, винрейтом и ожидаемой по времени отработкой может осуществляться на основе сетапов, которые часто встречаются.

У каждого инструмента и сетапа есть правила, которые определяют, когда их актуальность теряется и на какой потенциал движения можно рассчитывать.

Качественная сделка

Для открытия позиции, которая с высокой вероятностью принесет прибыль, нужно

учитывать совокупность факторов, они универсальны для каждого сетапа.

Сетап в лонг

- Восходящий тренд, потенциальный вход на формировании HL.
- Бычий моментум.
- Формирование пулов ликвидности (bsl) – причина будущей наценки актива.
- Дискаунт цены; OTE.
- Зона поддержки: OB, BB, MB, FF.
- Бычья дивергенция.
- Слом субструктуры – подтверждение сетапа в зоне интереса.
- Синхронизация со старшими таймфреймами.

Сетап в шорт:

- Нисходящий тренд, потенциальный вход на формировании LH.
- Медвежий моментум.
- Формирование пулов ликвидности (ssl) – причина будущей уценки актива.
- Премиум цены; OTE.
- Зона сопротивления – OB, BB, MB, FF.
- Медвежья дивергенция.

- Слом субструктуры – подтверждение сетапа в зоне интереса.
- Синхронизация со старшими таймфреймами.

Некоторые факторы могут не учитываться в зависимости от контекста и сетапа.

Three Drives Pattern

Бычий сетап
three drives pattern



Вход в позицию может осуществляться: после теста зоны интереса третьим минимумом; после закрепления обратно за обновленный минимум (2); после слома субструктуры от бычьего брейкера.

Основной целью выступает обновление актуального НН, если восходящий тренд не исчерпал свой потенциал.

В случае, если тренд достиг зоны сопротивления, подобный сетап может рассматриваться к первой зоне сопротивления, потому что появляется высокая вероятность смены тренда. Основной целью будет медвежий ордерблок, который был сформирован на актуальном НН, промежуточные цели для частичной фиксации – значимые пулы ликвидности.

Дополнительным фактором будет выступать наличие бычьей дивергенции. Часто можно увидеть классическую и скрытую дивергенцию при формировании одного сетапа.

Медвежий сетап

three drives pattern



Вход в позицию может осуществляться: после теста зоны интереса третьим максимумом; после закрепления обратно за обновленный максимум (2); после слома субструктуры от медвежьего брейкера.

Основной целью выступает обновление актуального LL, если нисходящий тренд не исчерпал свой потенциал.

В случае, если тренд достиг зоны поддержки, подобный сетап может рассматриваться к первой зоне поддержки, потому что появляется высокая вероятность смены тренда. Основной целью будет бычий ордерблок, который возможно был сформирован на актуальном LL, промежуточные цели для частичной фиксации — значимые пулы ликвидности.

Примеры на реальных графиках находятся в 4 методичке.

Three Tap Setup

Бычий сетап

three tap setup



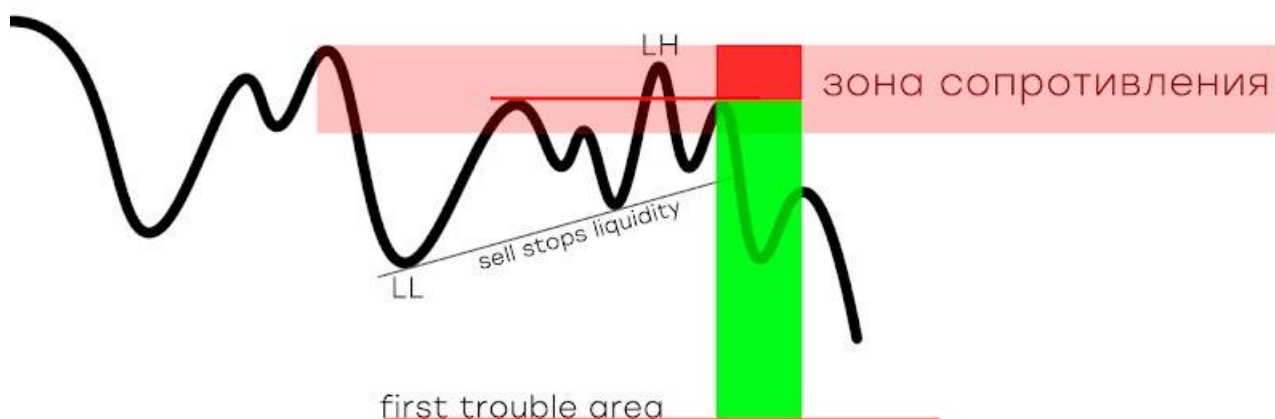
Вход в позицию может осуществляться: после теста зоны интереса вторым минимумом; после закрепления обратно за обновленный минимум (2) и возврата на тест новообразованного бычьего ордерблока; после слома субструктуры от бычьего брейкера.

Основной целью выступает обновление актуального НН, если восходящий тренд не исчерпал свой потенциал.

В случае, если тренд достиг зоны сопротивления, подобный сетап может рассматриваться к первой зоне сопротивления в рамках свинг структуры, потому что появляется высокая вероятность смены тренда. Основной целью будет медвежий ордерблок, который возможно был сформирован на актуальном НН, промежуточные цели для частичной фиксации — значимые пулы ликвидности.

Медвежий сетап

three tap setup



Вход в позицию может осуществляться: после теста зоны интереса вторым максимумом; после закрепления обратно за обновленный максимум (2) и возврата на тест новообразованного медвежьего ордерблока; после слома субструктуры от медвежьего брейкера.

Основной целью выступает обновление актуального LL, если нисходящий тренд не исчерпал свой потенциал.

В случае, если тренд достиг зоны поддержки, подобный сетап может рассматриваться к первой зоне поддержки в рамках свинг структуры, потому что появляется высокая вероятность смены тренда. Основной целью будет бычий ордерблок, который возможно был

сформирован на актуальном LL, промежуточными целями для частичной фиксации будут значимые пулы ликвидности.

Примеры на реальных графиках находятся в 4 методичке.

Trendline setup

Бычий сетап

trendline liquidity



Коррекционное движение на восходящем тренде формирует трендовую ликвидность, которая в будущем будет причиной импульсного роста. Точкой для начала роста будет выступать первая зона поддержки, и на основе неё можно открывать позицию. Также вход в позицию можно рассматривать после слома субструктуры от бычьего брейкера.

Позиция может фиксироваться частично. Первой целью выступает второй максимум, который тестирует трендовую. Второй целью –НН, где фиксируется основной объем позиции. Третьей целью будет первая зона сопротивления выше НН.

Медвежий сетап

trendline liquidity



Коррекционное движение на нисходящем тренде формирует трендовую ликвидность, которая в будущем будет причиной импульсного

падения. Точкой для начала падения будет выступать первая зона сопротивления, и на основе неё можно открывать позицию. Также вход в позицию можно рассматривать после слома субструктуры, от медвежьего брейкера.

Позиция может фиксироваться частично. Первой целью выступает второй минимум, который тестирует трендовую. Второй целью –LL, где фиксируется основной объем позиции. Третьей целью будет первая зона сопротивления выше НН.

Примеры на реальных графиках находятся во 2 методичке.

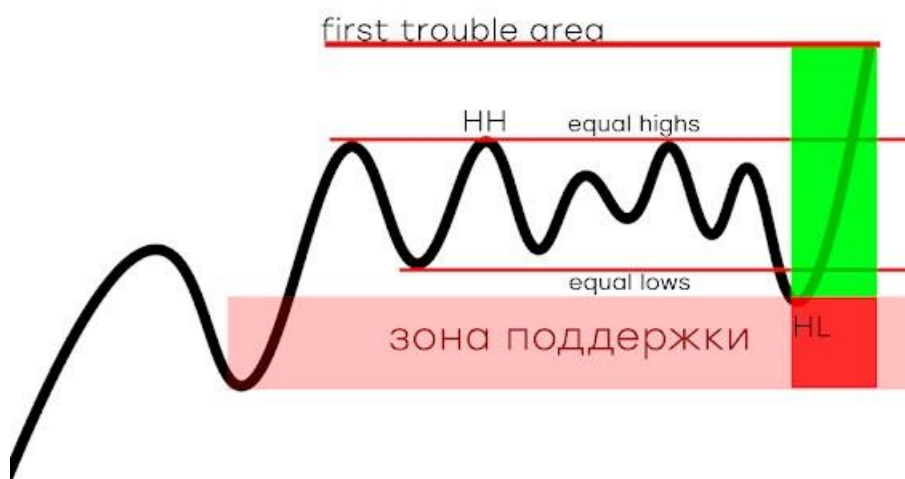
Turtle Soup

Turtle Soup / stop hunt – снятие ликвидности и разворот в противоположную сторону.

Ликвидность перед зоной интереса увеличивает вероятность отработки вашего сетапа.

Бычий сетап

turtle soup



Боковое движение, в котором образовалась ликвидность по обе стороны. Триггерной точкой, откуда может открываться позиция, выступает зона поддержки ниже равных минимумов. Часто после снятия ликвидности начинается агрессивное движение, поэтому нескольких входов в качественную сделку может и не быть.

Вторым вариантом для открытия позиции будет закрепление цены обратно в диапазон выше обновленных минимумов со стоп-лоссом за новообразованный потенциальный HL.

Первая цель, где будет фиксироваться основная часть позиции – равные максимумы на верхней границе ренджа. Второй целью

будет первая зона сопротивления выше актуального НН.



Обновление равных минимумов, тест зоны поддержки, скрытая дивергенция, дискант цены — агрессивная наценка на снятие пула ликвидности к верхней границе ренджа.

Примечание. Рендж определялся не по классическому варианту, здесь отмечены явные пулы ликвидности.



Turtle soup + trendline setup.

turtle soup



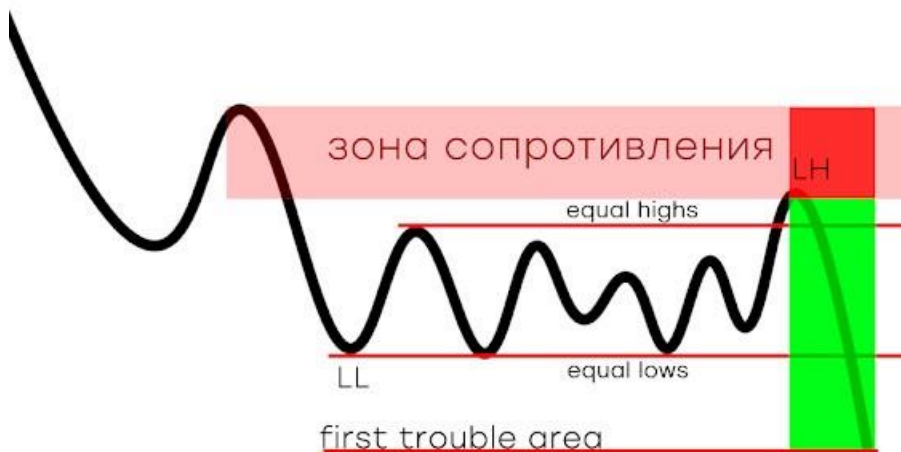
Снятие ликвидности и ложный слом структуры, после чего восходящий тренд продолжается.



При формировании структурных элементов перед зоной поддержки такие минимумы выступают ликвидностью, дополнительным фактором для рассмотрения лонг позиции в зоне интереса. В большинстве случаев их обновление не будет являться сломом структуры.

Медвежий сетап

turtle soup



Боковое движение, в котором образовалась ликвидность по обе стороны. Триггерной точкой, откуда может открываться позиция, выступает зона сопротивления выше равных максимумов. Часто после снятия ликвидности начинается агрессивное движение, поэтому

нескольких входов в качественную сделку может и не быть.

Вторым вариантом для открытия позиции будет закрепление цены обратно в диапазон ниже обновленных максимумов со стоп-лоссом за новообразованный потенциальный LH.

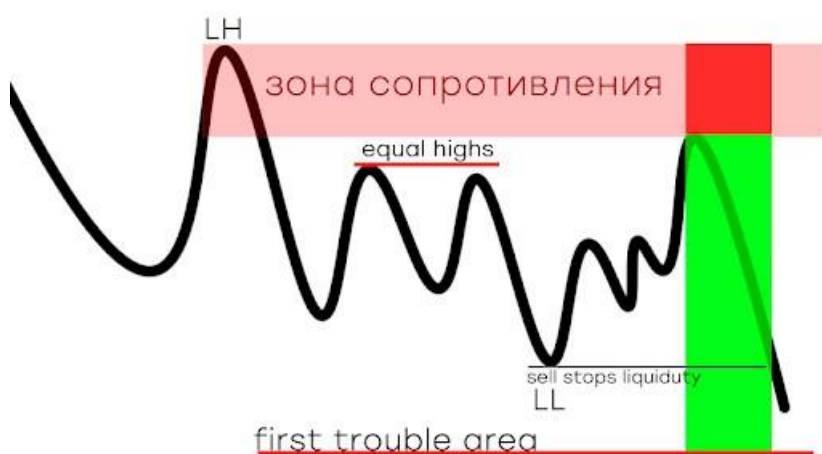
Первая цель, где будет фиксироваться основная часть позиции – равные минимумы нанижней границе ренджа. Второй целью будет первая зона поддержки ниже актуального LL.



В данном примере можно увидеть длительное боковое движение между зонами поддержки и сопротивления, в следствии чего сформировались очевидные пулы ликвидности по обе стороны торгового диапазона.

Обновление равных максимумов, тест зоны сопротивления, скрытая дивергенция, классическая дивергенция, премиум цены – уценка на снятие пула ликвидности к нижней границе ренджа.

turtle soup



Снятие ликвидности и ложный слом структуры, после чего нисходящий тренд продолжается.



Ложный слом структуры на 4Н – коррекция на дневном таймфрейме. Старшие временные рамки всегда будут в приоритете.

Больше примеров на реальных графиках находится во 2 методичке.

Dragon

Бычий сетап

Фигура классического технического анализа, которая должна формироваться таким образом:

- Боковое движение перед импульсом — голова.
- Агрессивное движение вниз — шея.
- Остановка нисходящего движения — первая лапа.
- Коррекционное движение на 60% или меньше между головой и ногой — хребет.
- Снятие ликвидности с первой лапы — формирование второй лапы. Параллельно может образоваться трендовая ликвидность(bsl), что выступит причиной будущего импульсного роста.

Вторая лапа может не снимать ликвидность с первой. Такой паттерн не будет использоваться.

dragon



Первой целью при торговле дракона будет выступать максимум хребта. На схеме его обновление будет считаться локальным сломом структуры, где будет фиксироваться часть позиции.

Второй целью выступает максимум головы, откуда нисходящее движение началось. Будет фиксироваться основная часть позиции.

Если восходящий тренд протестировал зону сопротивления, после чего началась коррекция, то основной целью будет зона сопротивления между головой и хребтом.



Медвежий сетап

dragon



Фигура классического технического анализа, которая должна формироваться таким образом:

- Боковое движение перед импульсом — голова.
- Агрессивное движение вверх — шея.
- Остановка восходящего движения — первая лапа.
- Коррекционное движение на 60% или меньше между головой и ногой — хребет.
- Снятие ликвидности с первой лапы — формирование второй лапы. Параллельно может образоваться трендовая ликвидность(ssl), что выступит причиной будущего импульсного падения.

Вторая лапа может не снимать

ликвидность с первой. Такой паттерн не будет использоваться.



В случае, если соотношение риска и прибыли будет неприемлемым для входа в позицию отзоны интереса, тогда стоит дождаться локального слома структуры и войти от митигейшн блока. В примере выше использовался консервативный стоп.

Double bottom

Один из самых распространенных разворотных паттернов, который позволяет агрессивно входить в позицию, когда цена находится в зоне интереса и второй минимум обновляет ликвидность с первого.

double bottom



Сделка может рассматриваться после обновления первого максимума; после закрепления цены выше обновленного минимума; после слома субструктуры от брейкера.



Double top

Один из самых распространенных разворотных паттернов, который позволяет агрессивно входить в позицию, когда цена находится в зоне интереса и второй максимум обновляет ликвидность с первого.

double top



Сделка может рассматриваться после обновления первого минимума; после закрепления цены ниже первого максимума; после слома субструктуры от брейкера.

BTCLUSD, 1H, BINANCE OTH54614.99 HARC54871.14 HPP54260.00 3AHP54283.25

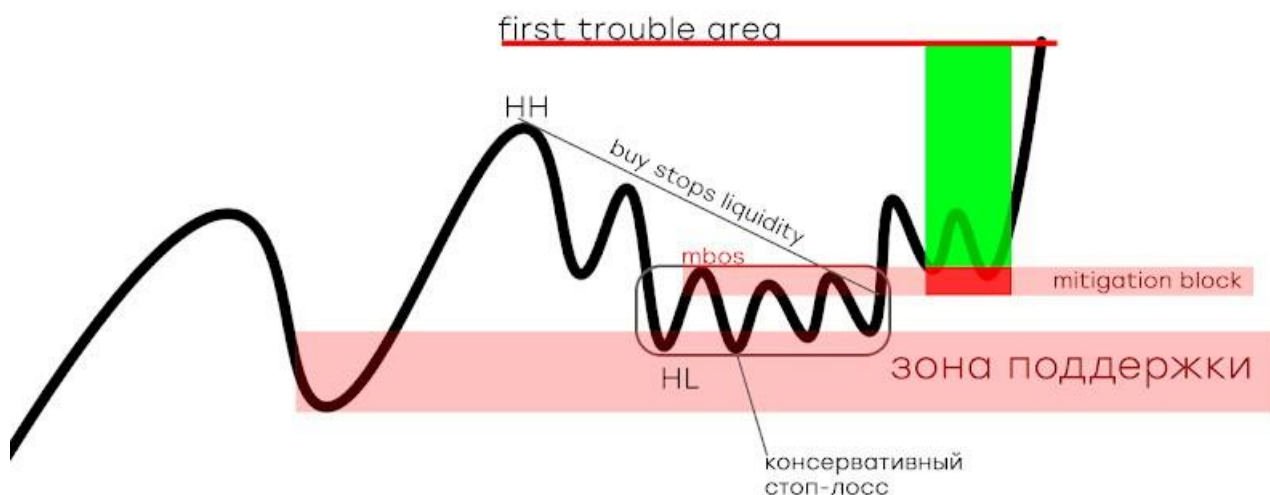


Mitigation block entry

Бычий сетап

В зоне интереса нет полноценного сетапа для входа в лонг позицию. В таком случае лучше всего подождать выхода верх из локального торгового диапазона и открывать позицию после слома субструктуры.

mitigation block entry



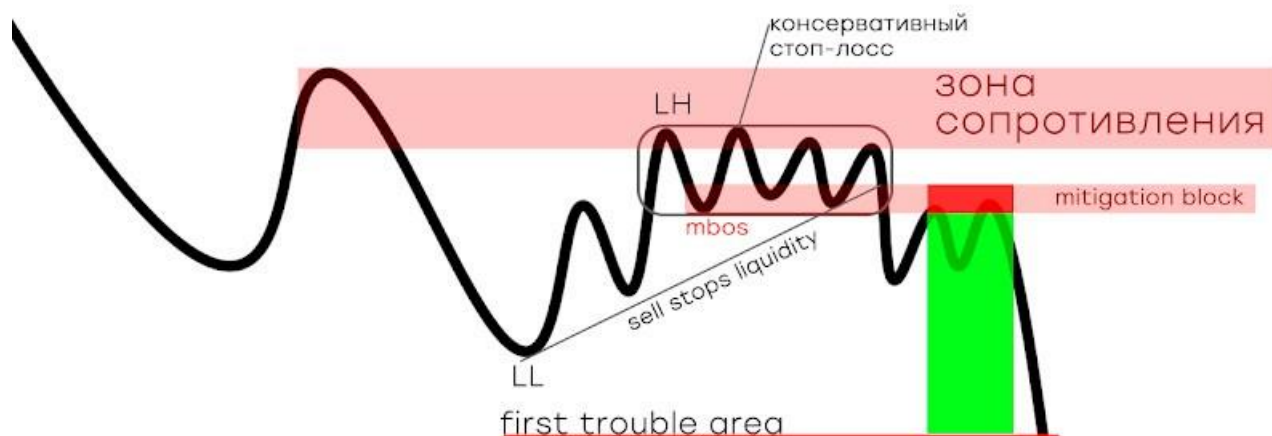
При сценарии как на схеме восходящий тренд будет агрессивно развиваться по причине сформированной трендовой ликвидности.

После выхода из консолидации, закрепления выше торгового диапазона можно ожидать тест бычьего митигейшн блока — это потенциальная точка входа перед импульсным ростом.

Медвежий сетап

В зоне интереса нет полноценного сетапа для входа в позицию. В таком случае лучше всего подождать выхода из локального торгового диапазона и открывать позицию после слома субструктуры.

mitigation block entry



При сценарии как на схеме нисходящий тренд будет агрессивно развиваться по причине сформированной трендовой ликвидности.

После выхода из консолидации, закрепления ниже торгового диапазона можно ожидать тест медвежьего митигейшн блока — это потенциальная точка входа перед импульсным падением.

Примеры на реальных графиках находятся в 3 и 7 методичках.

Breaker block entry

Бычий сетап

В зоне поддержки сформировался сетап, после чего началось восходящее движение.

Потенциальной точкой входа будет выступать бычий брейкер, который подтвердился после слома субструктуры.

breaker block entry



Подобный сетап также будет актуален, когда происходит слом свинг структуры нисходящего тренда. После теста бычьего брейкера ожидается агрессивный рост. Причиной выступит сформированная ликвидность за время сложной коррекции.

Обратите внимание. При образовании брейкера также формируется ордерблок. Всегда нужно рассматривать первую зону поддержки, в данном случае брейкер, как потенциальную область разворота. Ордерблок будет актуален

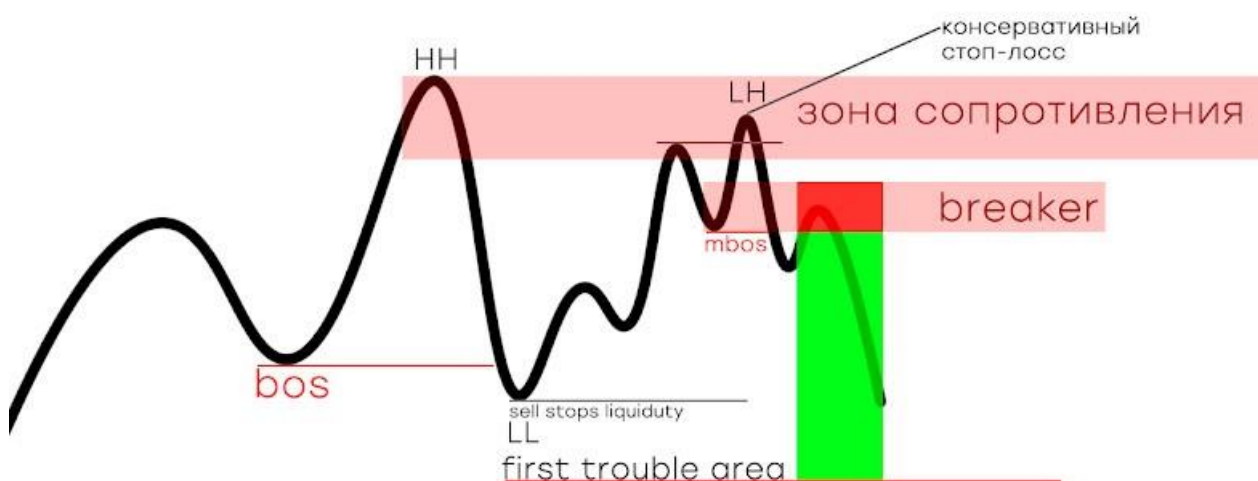
только в случае, если первая зона поддержки будет обновлена.

Медвежий сетап

В зоне интереса сформировался сетап, после чего началось нисходящее движение.

Потенциальной точкой входа будет выступать медвежий брейкер, который подтвердился после слома субструктуры.

breaker block entry



Подобный сетап также будет актуален, когда происходит слом свинг структуры восходящего тренда. После теста медвежьего брейкера ожидается агрессивный рост. Причиной выступит сформированная ликвидность за время сложной коррекции.

Обратите внимание. При образовании брейкера также формируется ордерблок. Всегда нужно рассматривать первую зону сопротивления, в данном случае брейкер, как потенциальную область разворота. Ордерблок будет актуален только в случае, если первая зона сопротивления будет обновлена.

Примеры на реальных графиках находятся в 3 и 7 методичках.

Стоп-лосс

Стоп-лосс – это ограничитель убытка.

Неспособность соблюдать систему рисков приводит к потере депозита. Трейдер, открывающий сделку без фиксированного риска, не понимает, что происходит на рынке, не уверен в своем анализе и боится ставить стоп-лосс. Он заранее знает, что открывает убыточную позицию, но надеется, что сегодня его чутье не подведет.

В первую очередь цена начнет развиваться против него, а он будет усреднять позицию. Через некоторое время, если сделка была открыта в правильном направлении, ему повезет и он сможет зафиксироваться в

безубыток или незначительный профит. Таким образом он получает адреналин и эмоции, которых не хватает в его жизни. Огромный процент убытка, который был совсем недавно, превратился в несколько процентов профита.

После получения удачного опыта рано либо поздно повторится то же самое, он все переосмыслит и выявит допущенные ошибки, вследствие раз будет стараться их не допускать. Вне зависимости от его депозита результат на дистанции будет один — ликвидация.

Большие убытки всегда начинаются с малого, просто их не контролируют. Они могут восприниматься как неудача и сопровождаются соответствующим эмоциональным и физическим состоянием.

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

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 просчитать максимальный убыток и потенциальный профит. Это дает возможность торговать системно и не опираться на одну сделку. 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.

Почему трейдеры не используют стоп-лосс?

- отсутствие теоретической базы;
- отсутствие практической базы;
- желание зарабатывать без потерь;
- наивность.

Куда поставить стоп?

Стоп-лосс должен размещаться там, где сетап, на основе которого открывается позиция, теряет актуальность. Все инструменты и сетапы имеют правила размещения стоп-лосса.

Ставить стоп-лосс на основе интуитивных способностей, непроверенных фактов, психологических уровней не требуется.

Сортировка позиций.

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.

Каждая убыточная сделка должна тщательно анализироваться. Выявление допущенных ошибок — это неотъемлемый процесс улучшения качества позиций.

Когда цена активирует стоп-лосс и разворачивается в направлении сделки — это ошибка, неправильный анализ рыночной ситуации.

Когда цена активирует стоп-лосс и продолжит движение в том же направлении — это погрешность сетапа.

Важность стоп-лосса.

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

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

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

После ликвидации состояние трейдера улучшится.

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.

win rate	risk/reward
75%	1 : 0.3
60%	1 : 0.7
50%	1 : 1
40%	1 : 1.5
33%	1 : 2
25%	1 : 3
20%	1 : 4

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

Минимальное соотношение риска и прибыли, которое рекомендуется использовать – 1:2/3.

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.

Высокий RR

Высокое соотношение риска и прибыли не будет хорошей основой для прибыльной торговли новичку. Психологически будет сложно справляться 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 RR

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 (1:2/3) – 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 1:2/3, 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

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

Прибыль достижима, не смотря на разумные потери

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

Индексы

BTC.D

Доминанция биткоина (BTC.D) — это соотношение между рыночной капитализацией BTC и общей капитализацией криптовалютного рынка.

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

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 доминанции 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 (DXU), 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.