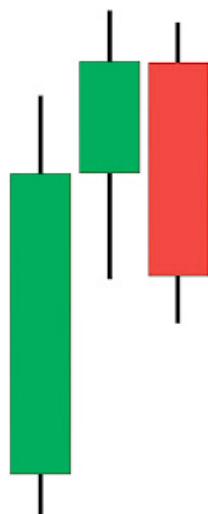


Базовые понятия

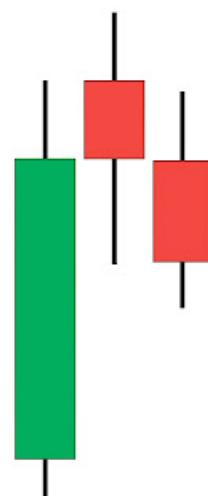
Как определить Swing High и Swing Low ?

Swing High формируется тремя свечами. Самая высокая свеча посередине, и по одной свече слева и справа.

swing high

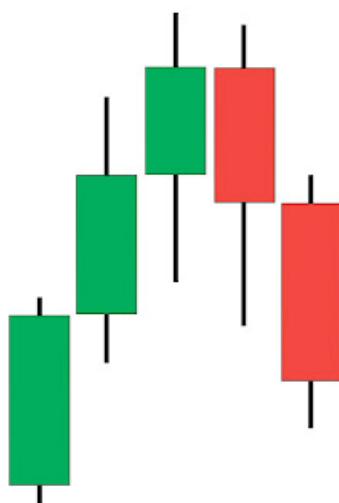


swing high

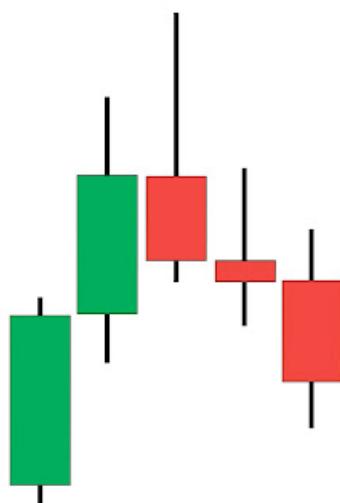


Более очевидные и значимые свинги формируются пятью свечами. Самая высокая свеча посередине, и по две свечи слева и справа.

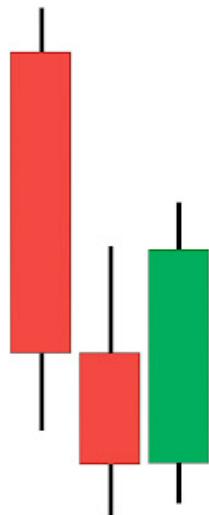
swing high



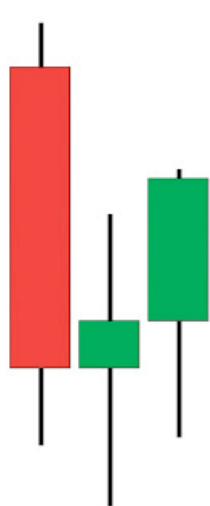
swing high



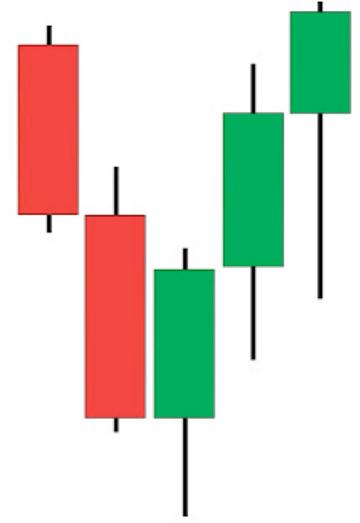
Swing Low формируется тремя и пятью свечами. Самая низкая свеча посередине, и по одной/две свечи слева и справа.



swing low



swing low



Использование показанных способов вместе не будет ошибкой. Проведите бектест на истории перед применением.

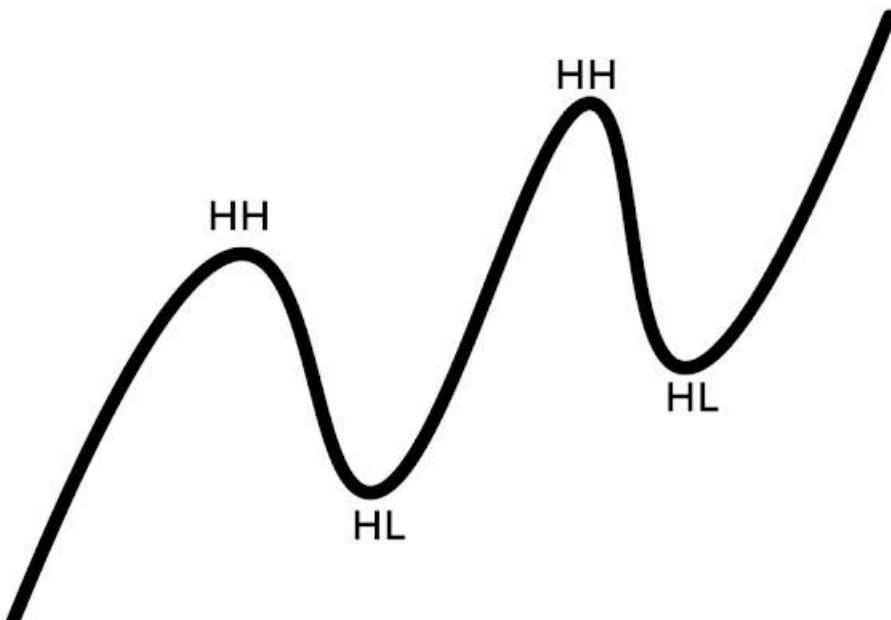
Структура рынка

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.

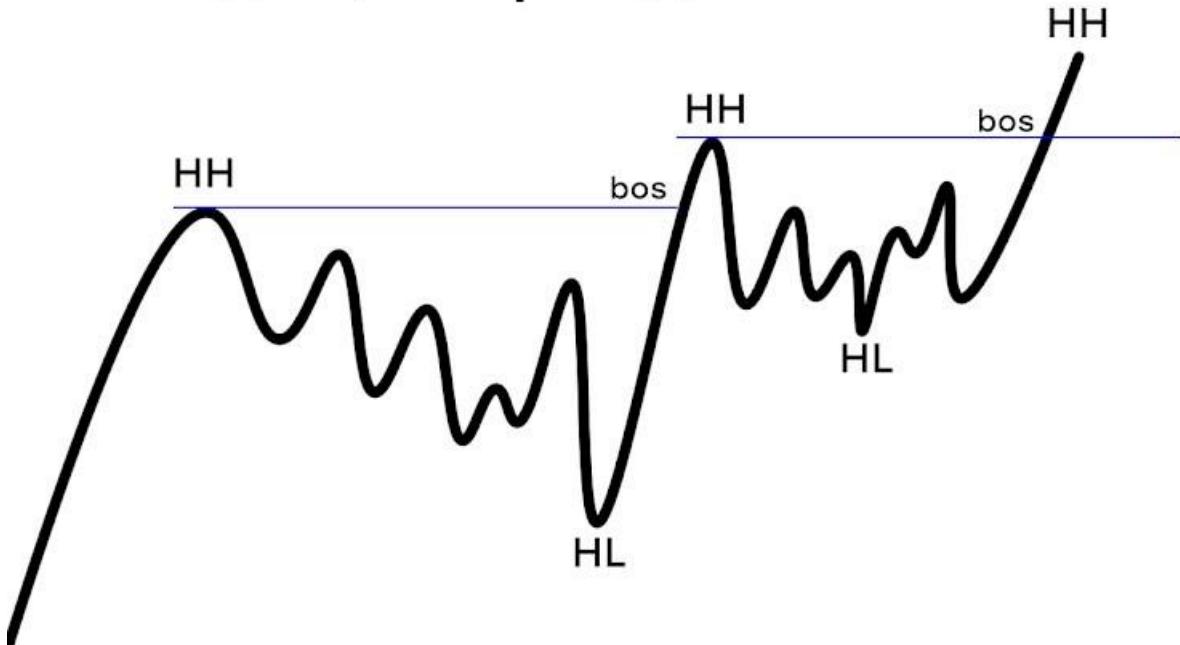
Рынок может находиться в трёх состояниях: восходящий тренд (бычий); нисходящий тренд(медвежий); боковое движение (флэт).

восходящий тренд



Состоит из повышающихся максимумов (**Higher High**) и минимумов (**Higher Low**). Формирование максимума будет импульсным, аминимума – коррекционным (см. LoE).

восходящий тренд

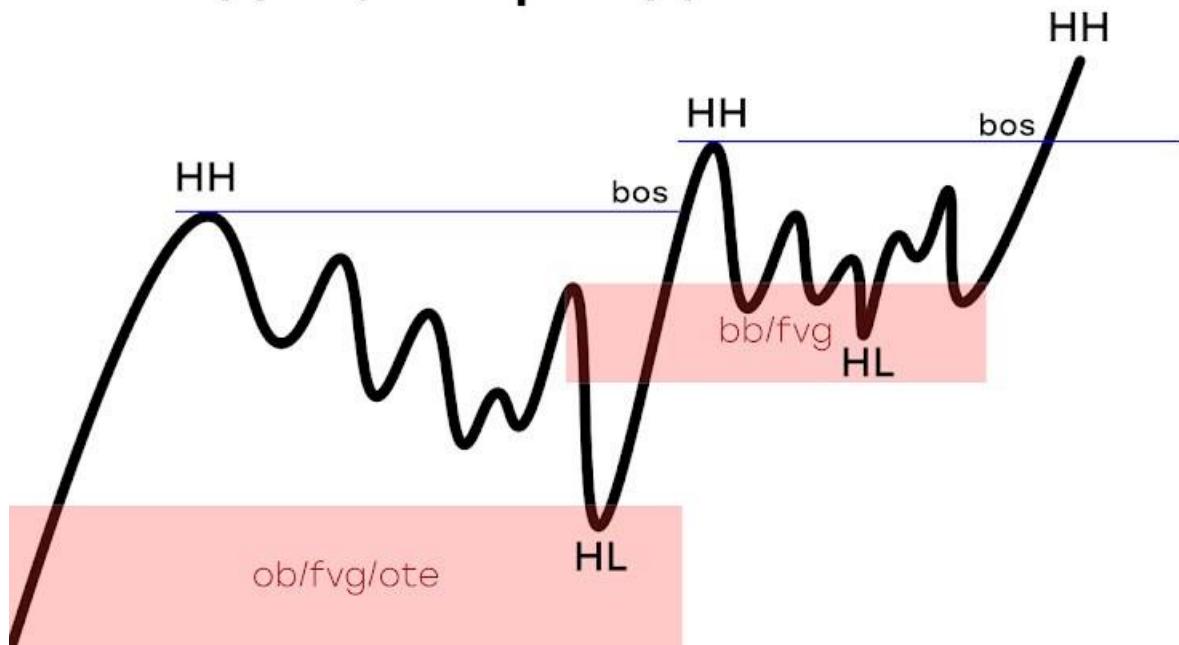


Подтверждением HL будет обновление (bos) предыдущего HH. Для определения структурных элементов обращайте внимание на свинг хай и лои.



Задача трейдера работать в соответствии со общим направлением цены. После

формирования более высокого максимума с большой вероятностью начнется коррекция, которая образует более высокий минимум – это возможность для входа в свинг лонг позицию с целью обновления следующего НН. **Формирование HL восходящий тренд**

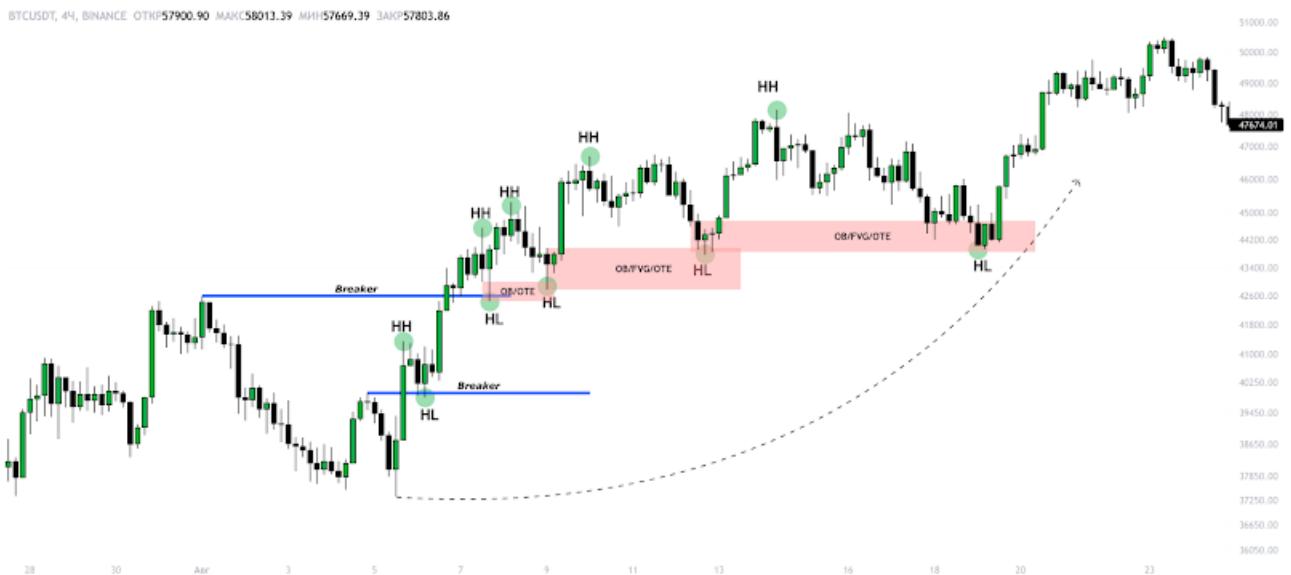


Структуру нужно использовать в совокупности с другими инструментами – зоны поддержки / сопротивления, имбаланс, ликвидность, дискаунт / премиум зоны.

Более высокий минимум должен формироваться от зоны поддержки, тогда он будет интересен для открытия лонг позиции на его формировании. В первом примере на схеме тестируется ордерблок и заполняет имбаланс в дискаунт зоне.

На втором примере HL был сформирован от брейкера, на заполнении имбаланса. А также в этом диапазоне был Three Tap Setup, который можно было использовать, после слома субструктуры.

Пример бычьего потока ордеров (orderflow). Каждый более высокий минимум (HL) был сформирован от зоны поддержки, после этого цена развивалась в направлении тренда. На каждом из показанных HL можно было открывать качественную лонг позицию.



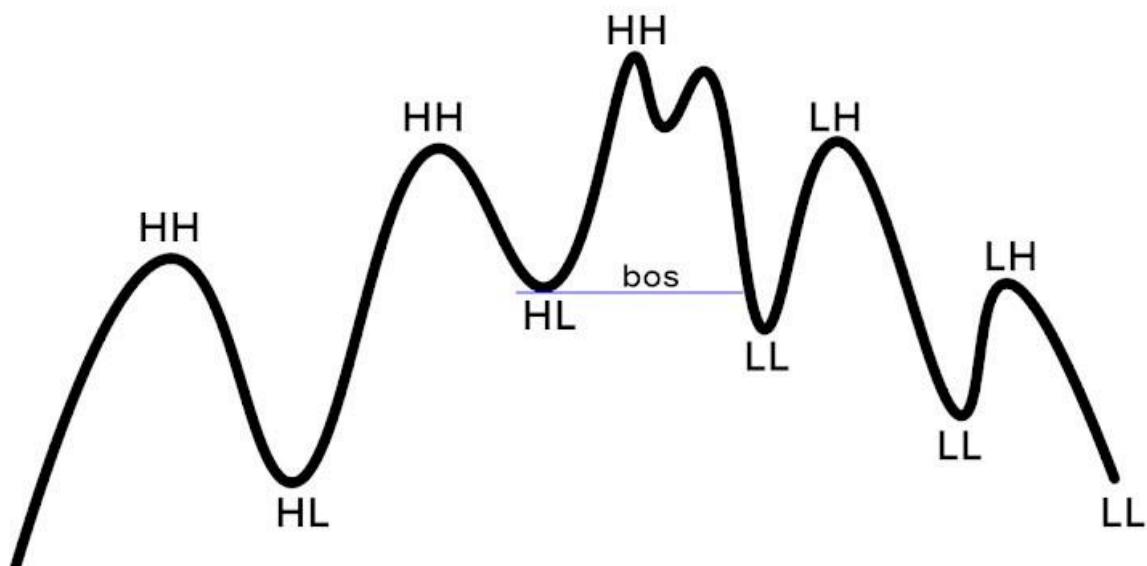
Слом восходящего тренда Обновление подтвержденного HL будет считаться сломом бычьего тренда и формированием более низкого минимума (LL),

после этого ожидается развитие нисходящего тренда.

Слом структуры позволяет открывать позиции на зарождении противоположной структуры. То есть, у вас появляется возможность открыть сделку на формировании LH.

Формирование LH является ключевым элементом. Цена должна протестировать зону сопротивления, сформировать сетап и начать нисходящий тренд. Исходя из ценообразования на данном этапе вы можете узнать, был ли слом истинным.

СЛОМ СТРУКТУРЫ ВОСХОДЯЩЕГО ТРЕНДА



Тренд подтверждается при формировании трёхструктурных элементов: HH – HL – HH для

восходящего тренда, LL – LH – LL для нисходящего тренда.

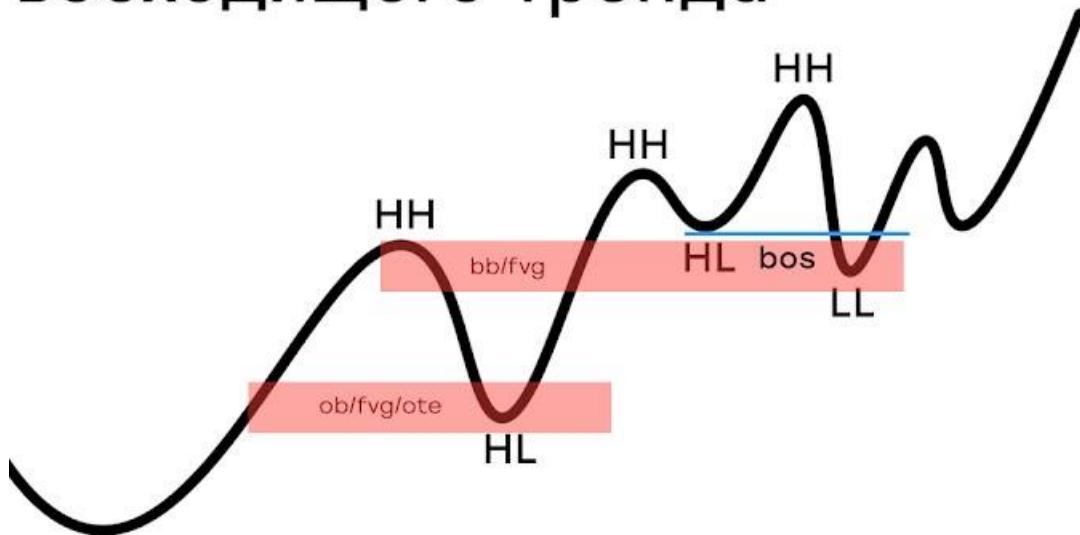
bos - break of structure



После обновления HL был сформирован LL, LH, LL – тренд сменился.
Каждый показанный HL был образован от локальных зон поддержки, которых не видно на дневном таймфрейме.
Такие минимумы считаются пулом ликвидности.

Ложный слом структуры восходящего тренда

фейк слом структуры восходящего тренда



При обновлении HL, который не был сформирован от зоны поддержки, допускается продолжение восходящего тренда, особенно если пробитие было тенью свечи, и после этого был тест зоны поддержки.



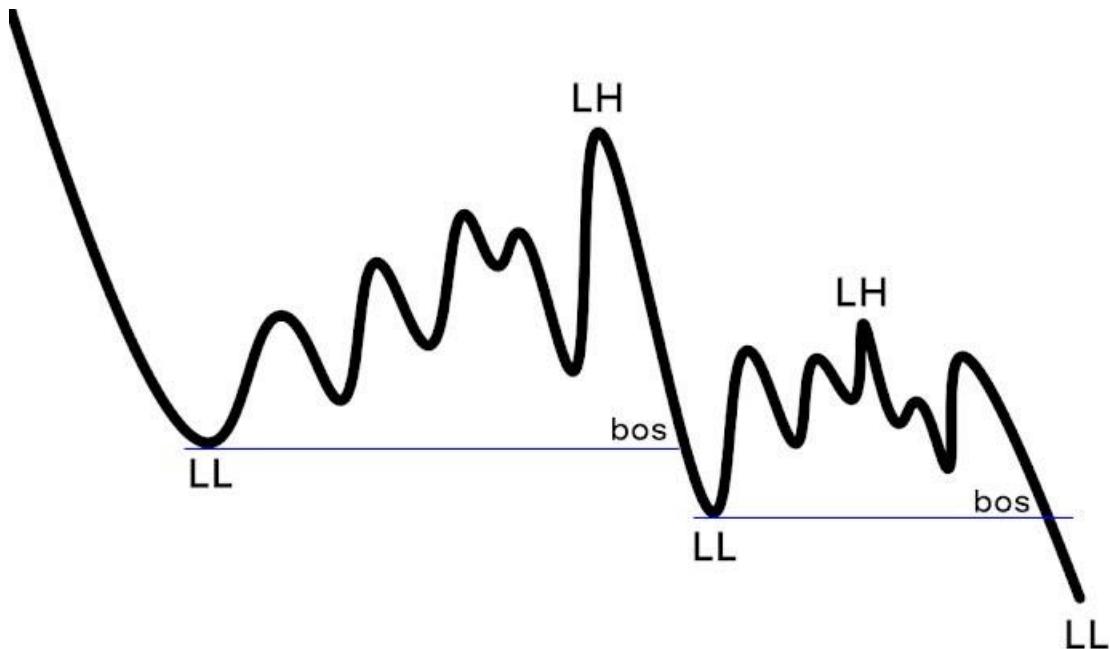
Более высокий максимум, который был обновлен, сформировал равные минимумы (EQL) и не протестировал ближайшую область поддержки – это будет выступать магнитом для цены.

Обновление отмеченного HL было тенью свечи, это будет повышать вероятность ложного слома в таком контексте. Цена продолжила двигаться в бычьем тренде.



Состоит из понижающихся минимумов (Lower Low) и максимумов (Lower High). Формирование минимума должно быть импульсным, а максимума — коррекционным.

Открытие шорт позиции лучше всего рассматривать на формировании LH в премиум зоне.



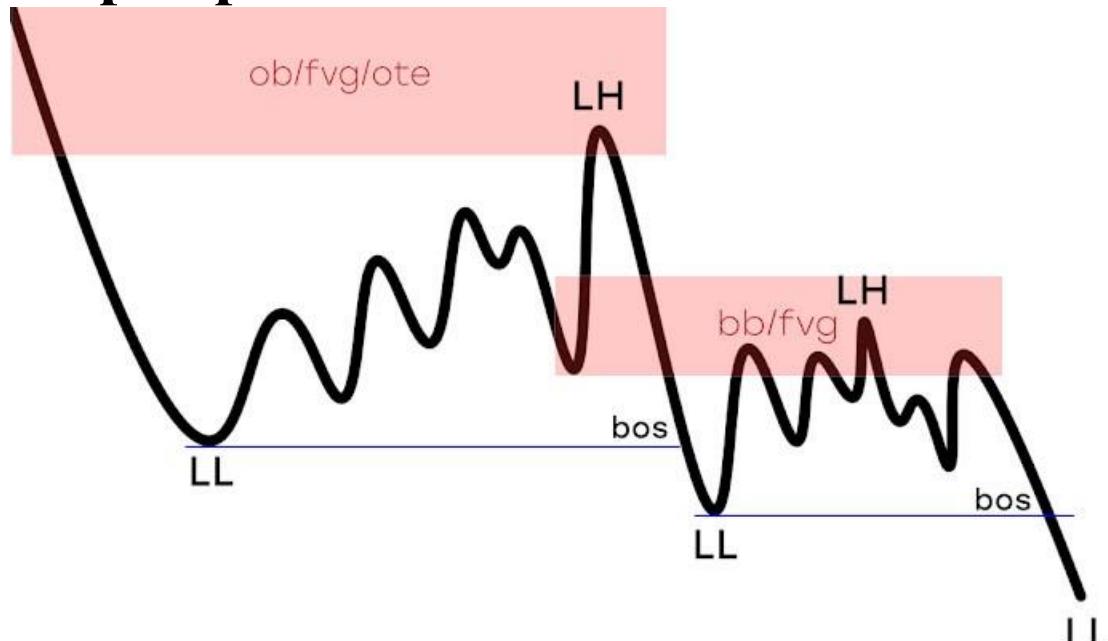
Нисходящий тренд

Подтверждением более низкого максимума (LH) будет обновление более низкого минимума (LL).



Когда цена тестирует область сопротивления в премиум зоне, можно рассматривать шорт позиции на основе сетапа, который в ней скорее всего сформируется. Общее направление цены нисходящее.

Формирование LH

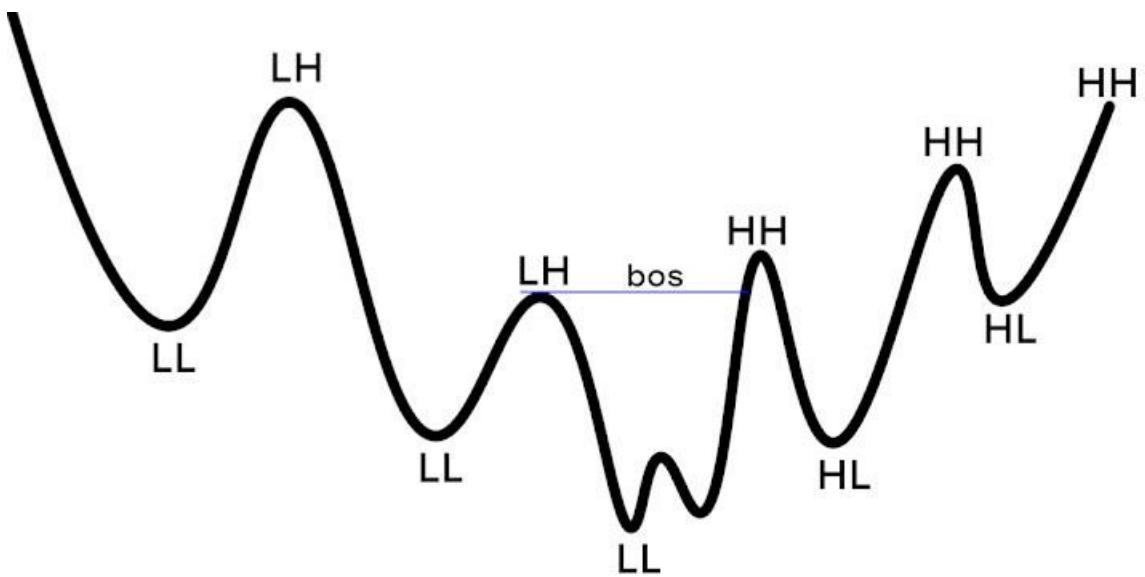


нисходящий тренд

Более низкий максимум (LH) формируется от зоны сопротивления – OB/VB/MB с имбалансом. И это практически всегда происходит в премиум зоне. Дополнительным фактором для разворота будет наличие пула ликвидности перед зоной сопротивления, к примеру равные максимумы (EQH).



Слом нисходящего тренда



слом структуры нисходящего тренда

Нисходящий тренд будет сломан при обновлении подтвержденного более низкого

максимума (LH), после этого ожидается начало восходящего тренда.

Определение слома структуры дает возможность торговать на зарождении нового тренда. После слома нисходящей структуры вам будет интересно рассматривать открытие лонг позиций на формировании более высокого минимума (HL).

Higher Low — ключевой элемент. Определите потенциал коррекции между LL и HH: зона поддержки / имбаланс / дисконт, и ждите сигнала в этой области для заключения сделки. Исходя из ценообразования на данном этапе вы можете узнать, был ли слом истинным.



Нисходящий тренд на дневном таймфрейме был сломан после обновления LH. Цена сформировала более высокий максимум (НН), после чего началась коррекция в зону OTE, на ретест ордерблока, и заполнения имбаланса на недельном таймфрейме.

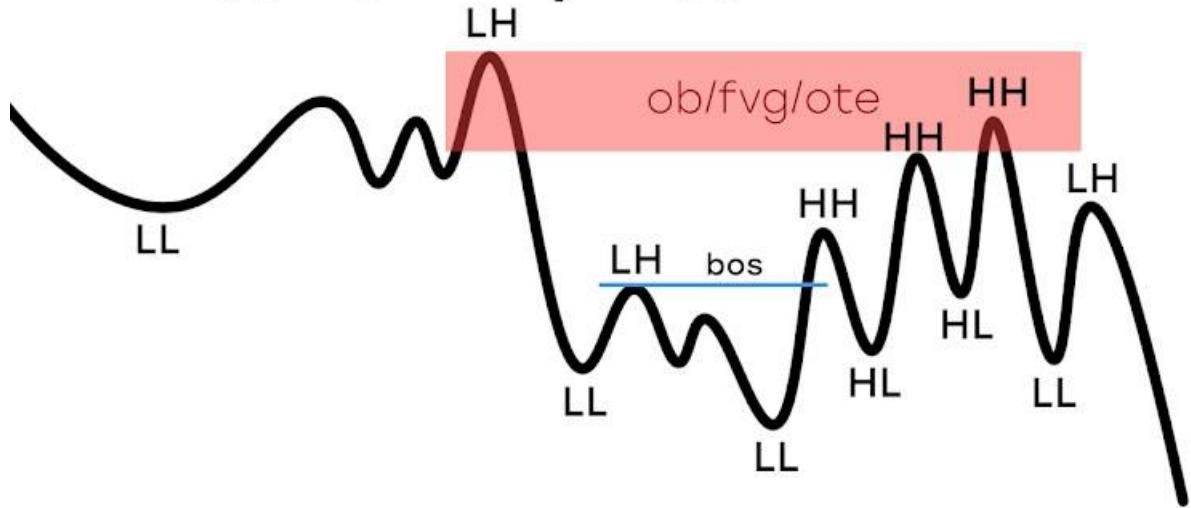
Обновление предыдущего НН подтверждает восходящий тренд, после чего цена сформировала более высокие максимумы и минимумы.

Ложный слом структуры нисходящего тренда

При обновлении LH, который не был сформирован от зоны сопротивления, допускается продолжение нисходящего тренда, особенно если пробитие было тенью свечи, и после этого был тест зоны сопротивления.

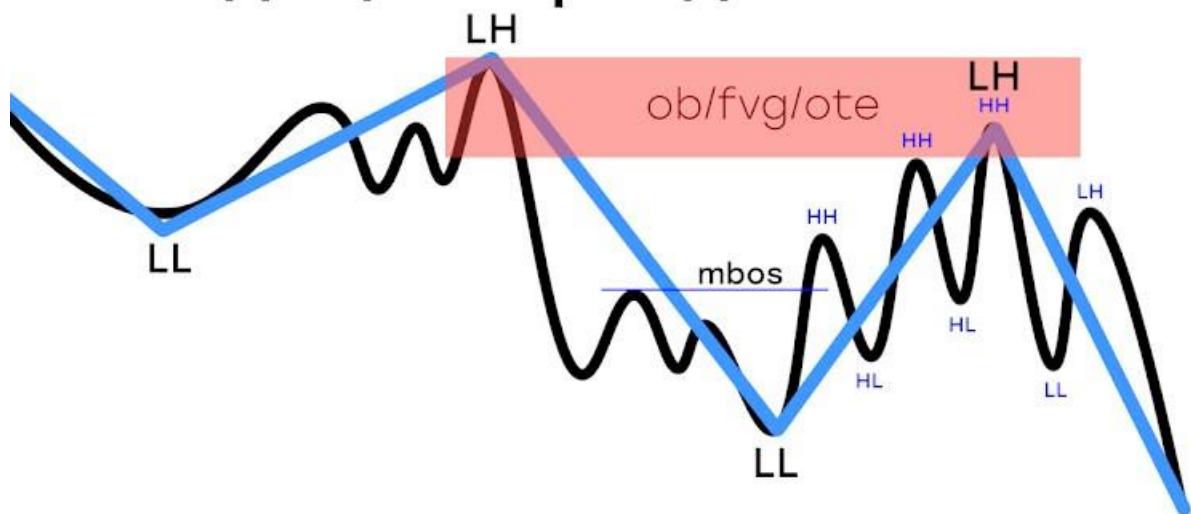
Схема с ложным сломом структуры на бычьем тренде работает аналогично и на медвежьем, только в обратную сторону.

фейк слом структуры нисходящего тренда



После обновления отмеченного LH начался восходящий тренд. Цена протестировала зону сопротивления, и эти три более высоких максимума можно воспринимать за Three Drives Pattern. Цена продолжила двигаться в сторону общего направления цены.

фейк слом структуры нисходящего тренда



Можно предположить, что на старших таймфреймах тренд выглядел иначе, и локально сформировалась восходящая структура в рамках коррекции к зоне сопротивления.



Обновленный LH не был сформирован от какой-либо зоны сопротивления — это пул ликвидности перед основной зоной сопротивления в текущем диапазоне.

Цена медленно двигалась в одном диапазоне, манипулируя максимумами и формируя большое количество ликвидности ниже для дальнейшего движения.



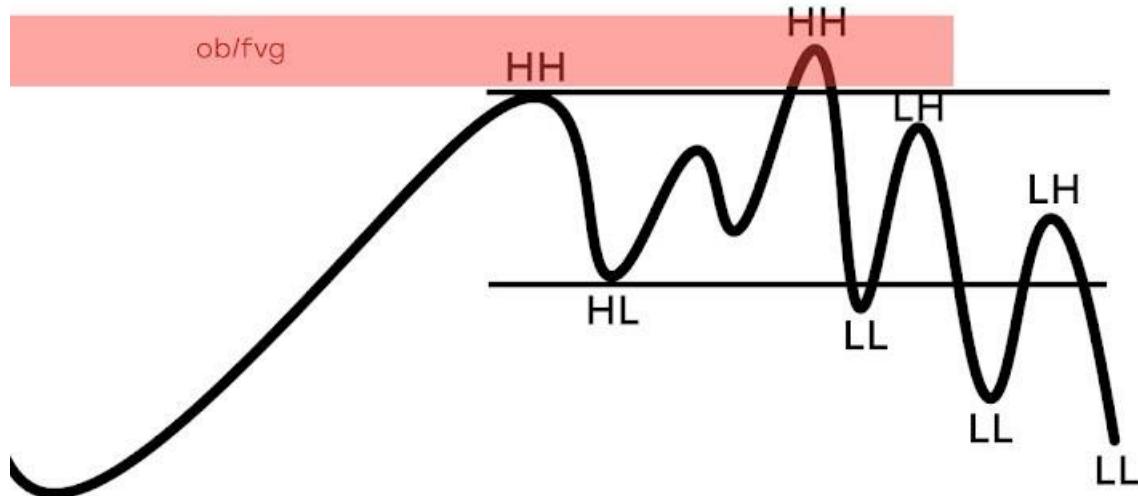
На младших таймфреймах в зоне сопротивления сформировался медвежий Three Drives Pattern, что могло выступать фактором для открытия шорт позиции, учитывая контекст данной ситуации.

Боковое движение (см.рендж)

Рынок входит в стадию консолидации после импульсного движения цены. Крупный оператор распределяет или накапливает позицию.

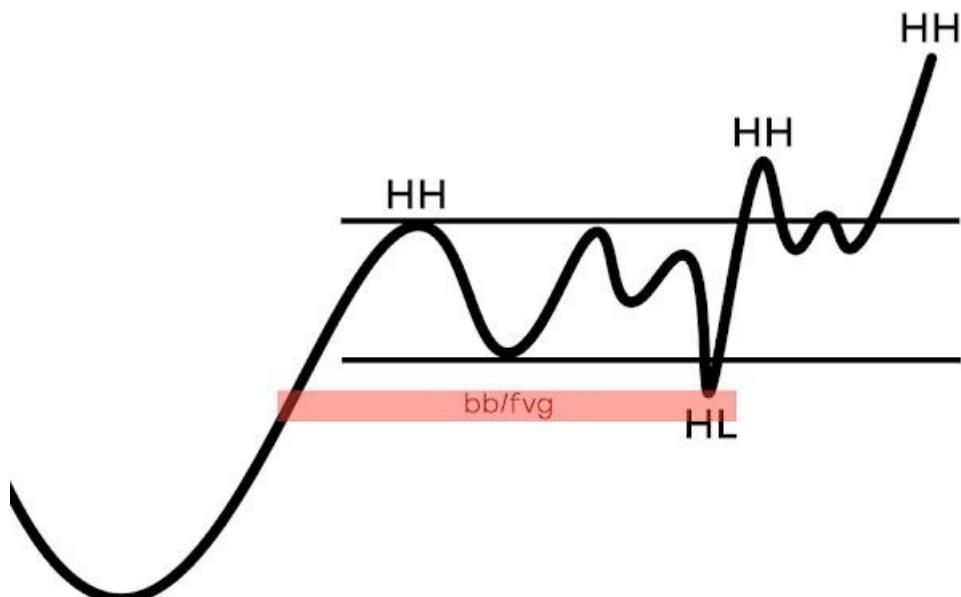
Цена большую часть времени находится в боковом движении, и в большинстве случаев выход из флэта будет в сторону общего направления цены. Но вы должны правильно учитывать контекст и ценообразование внутреннего для высокой вероятности определения направления выхода цены сrendжа.

КОНСОЛИДАЦИЯ



Цена сформировала новый НН на старших таймфреймах, и началась коррекция, а на младших — нисходящий тренд соответственно.

КОНСОЛИДАЦИЯ

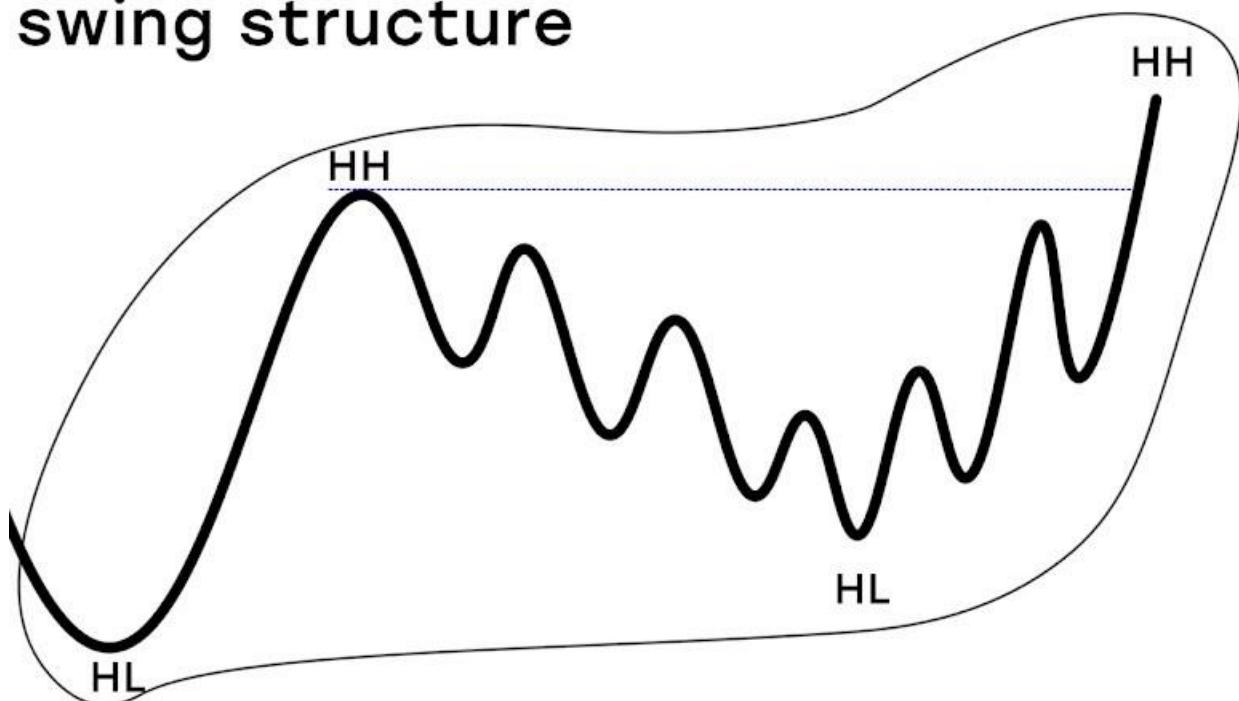


Пример ре-аккумуляции от зоны поддержки и выход из ренда в сторону общего направления цены.

Типы структуры

swing structure – значимые структурные элементы, которые формируются в сторону общего направления цены.

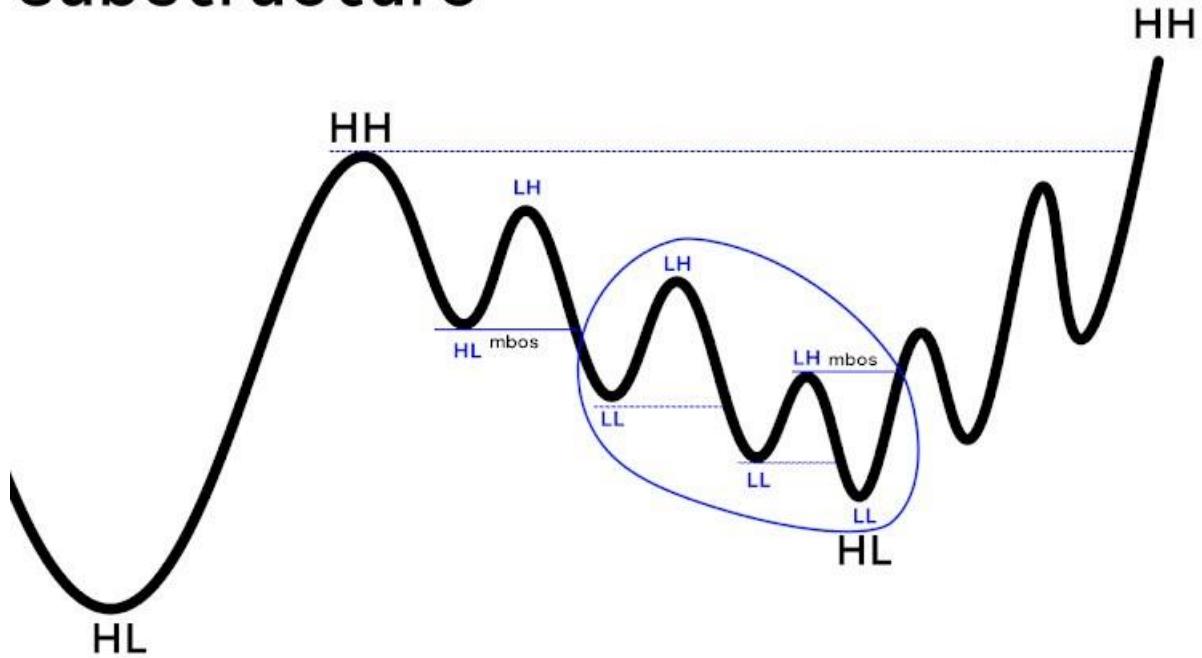
swing structure



substructure – коррекционные свинги, которые формируют свинг **HL** для восходящего тренда, свинг **LH** для нисходящего тренда.

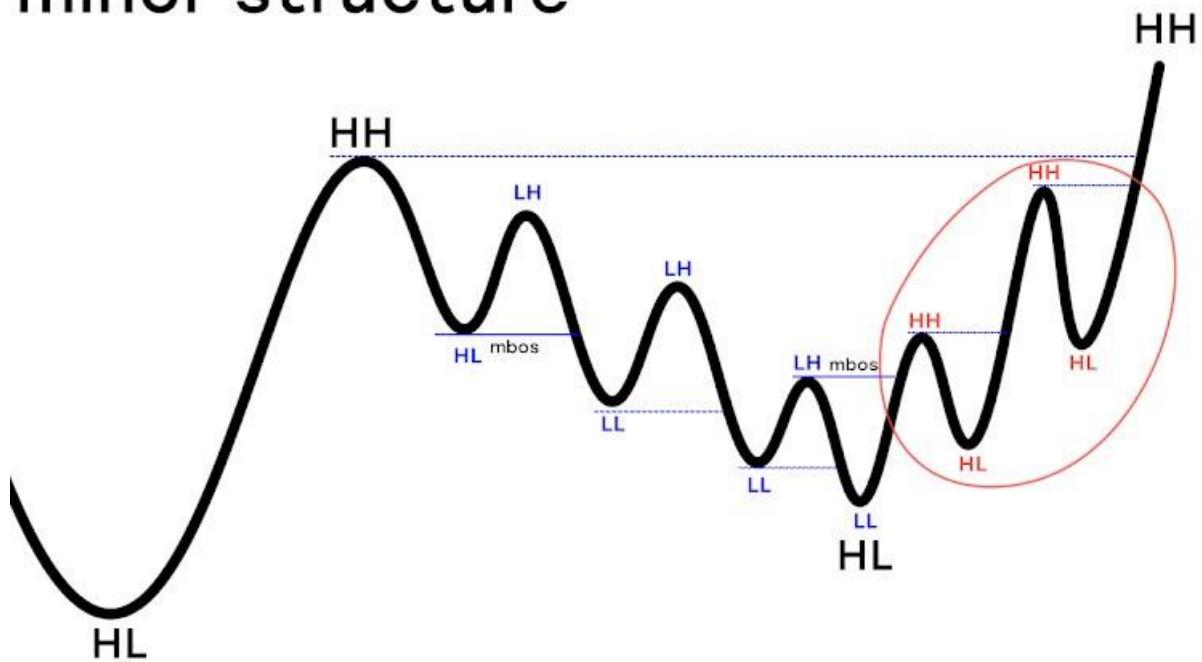
mbos – minor bos

substructure



minor structure – свинг хай и лои в сторону общего направления тренда внутри свинг структуры.

minor structure





Субструктура сменяется на майнер структуру, когда происходит обновление LH, от которого был сформирован LL для нисходящего тренда. И после обновления HL, от которого был сформирован HH, для восходящего тренда.

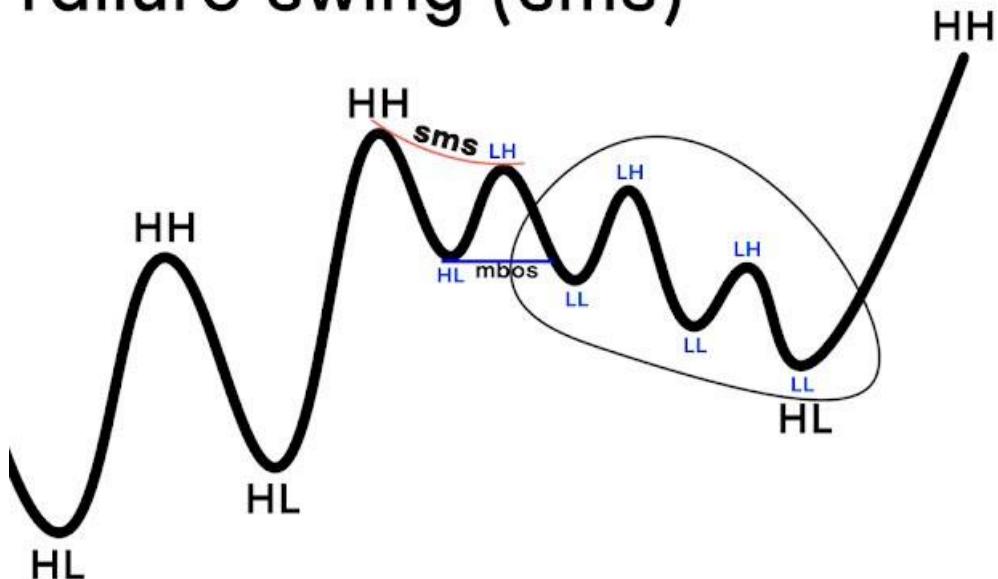
Failure Swing (SMS)

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 движение и локально начался нисходящий тренд (субструктура) в

рамках коррекции и формирования более высокого минимума от какой-либо области поддержки в дискаунт зоне.

failure swing (sms)

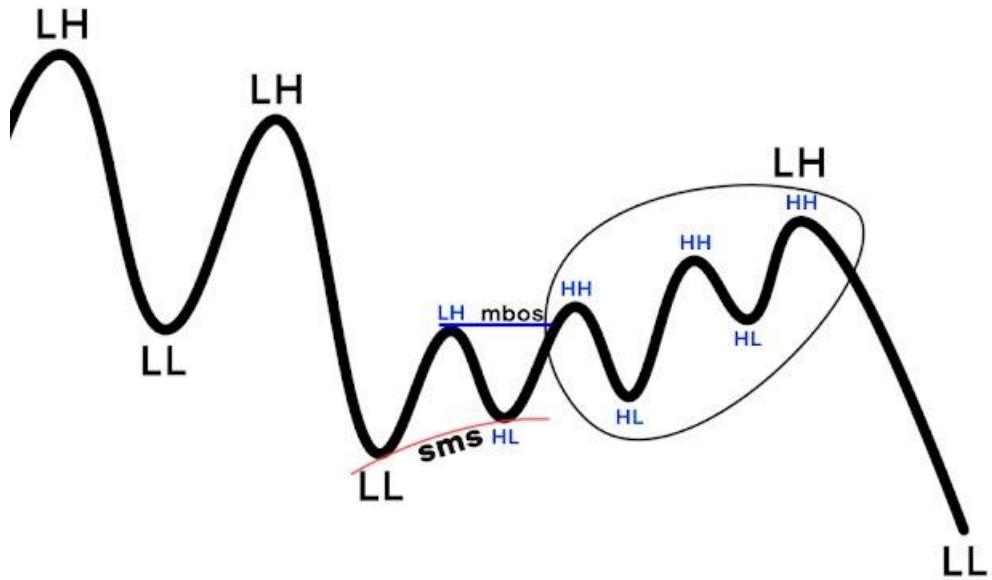


Общее направление актива восходящее. Цена не смогла обновить предыдущий НН, и начался локальный нисходящий тренд (субструктура) с целью перекрытия имбаланса и тестом зоны поддержки, после чего восходящий тренд продолжился.



Аналогичный пример с нисходящей свингструктурой.

failure swing (sms)



Таймфреймы

Эффективное использование структуры возможно при анализе графика со старших таймфреймов к младшим.

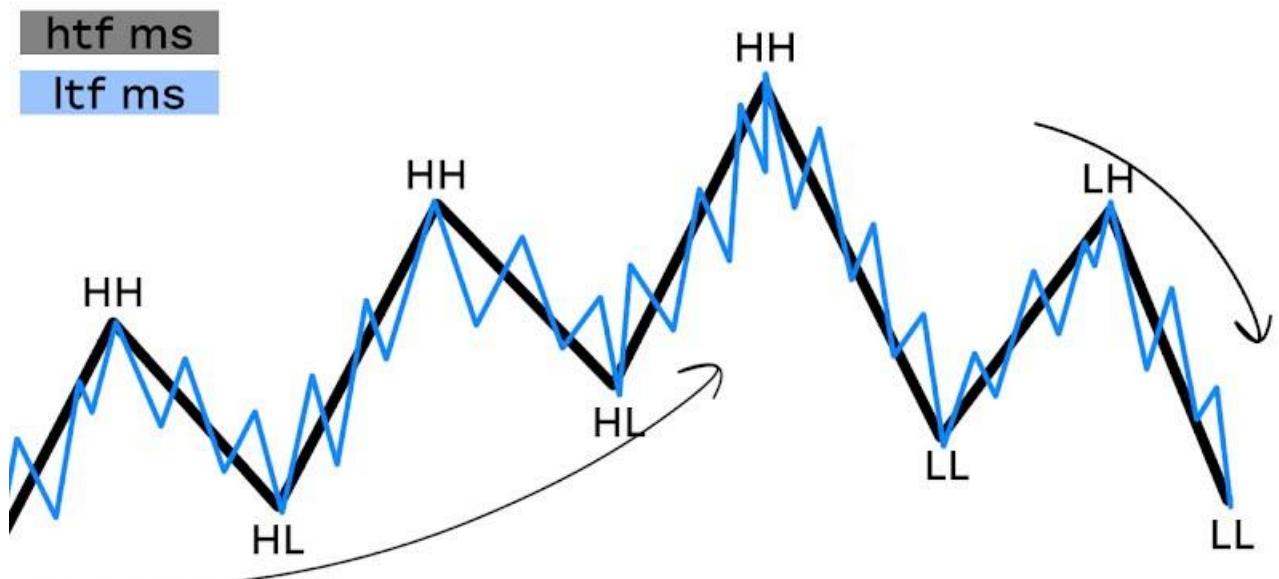
Вам достаточно провести анализ на пятитаймфреймах, чтобы определить общее направление цены на HTF и LTF. Старшие таймфреймы всегда будут в приоритете.

Основные таймфреймы:

1 месяц — 1 неделя — 1 день — 4 часа — 1 час (интрадей)

15м – 5м – для входа в позицию

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, цена протестирует область поддержки, структура на основных таймфреймах снова будет в синхроне.

BTC 1H.



Анализ структуры сугубо на младших таймфреймах всегда делает из трейдера заложника ситуации. Чем младше таймфрейм, тем чаще меняется тренд.

На графике отображен часовой нисходящий тренд. Будет правильно работать при

формировании нового LH с целью обновления старого LL?

Правильно, если работать в синхроне состаршими таймфреймами.

BTC 4H.



На дневном таймфрейме цена двигается в бычьем тренде, на четырехчасовом был сформирован новый НН, и сейчас цена корректируется в зону ОТЕ – формируется HL.

Следовательно общее направление цены восходящее – приоритетнее искать лонг позицию, чем работать в текущем диапазоне от нового **LН** на часовике.

BTC 4H.



Определение структурных элементов и слома структуры

Первый метод – консервативный

определение структуры: тело свечи

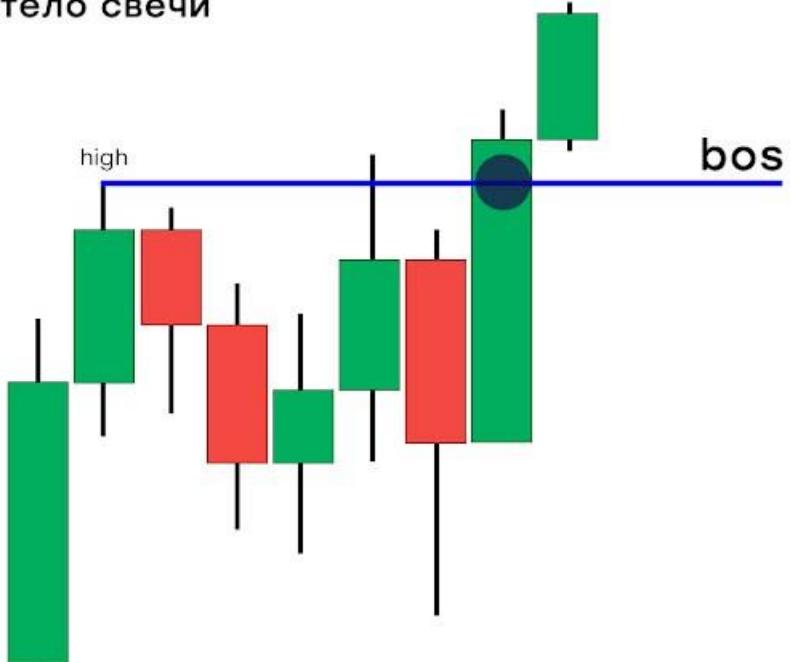
слом структуры: тело свечи



Второй метод – умеренный

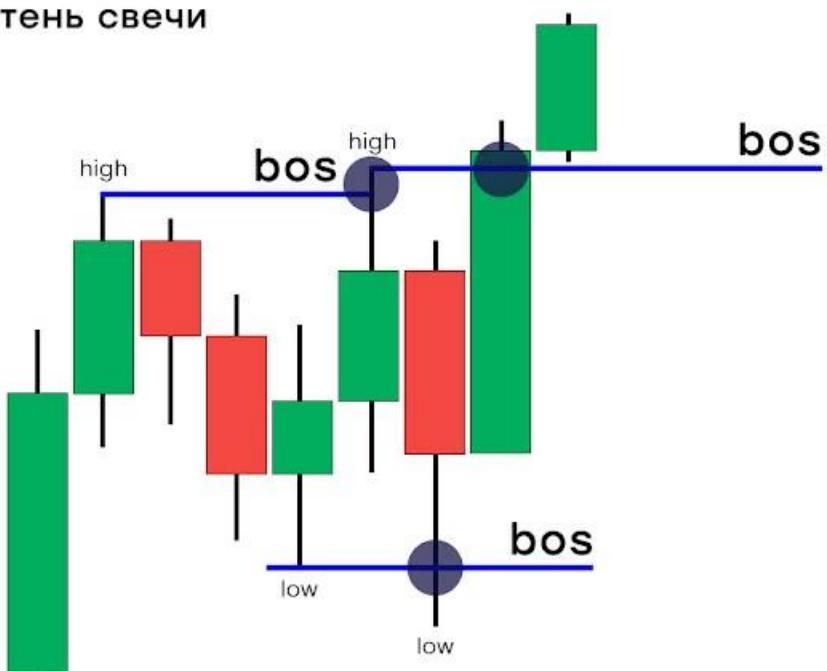
наиболее распространенный

определение структуры: тень свечи
слом структуры: тело свечи



Третий метод – агрессивный

определение структуры: тень свечи
слом структуры: тень свечи



Лично я использую третий метод, но предполагаю, что для некоторых из вас он будет слишком сложный, потому что такой

подход позволяет реализовывать очень многовозможностей, но из них будет так же много ложных сигналов, которые вы можете неправильно интерпретировать в зависимости от контекста.

Второй метод самый распространенный среди трейдеров. Это что-то среднее между первым и третьим типом. Вы будете открывать меньше позиций, но они будут более аргументированы и качественны.

Я рекомендую провести бектест и определить лучший тип определения структурных элементов и слома структуры конкретно для вас. Все три метода отлично работают, у всех есть свои недостатки и преимущества.

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 НН к
LL.

Настройки для коррекционных движений:

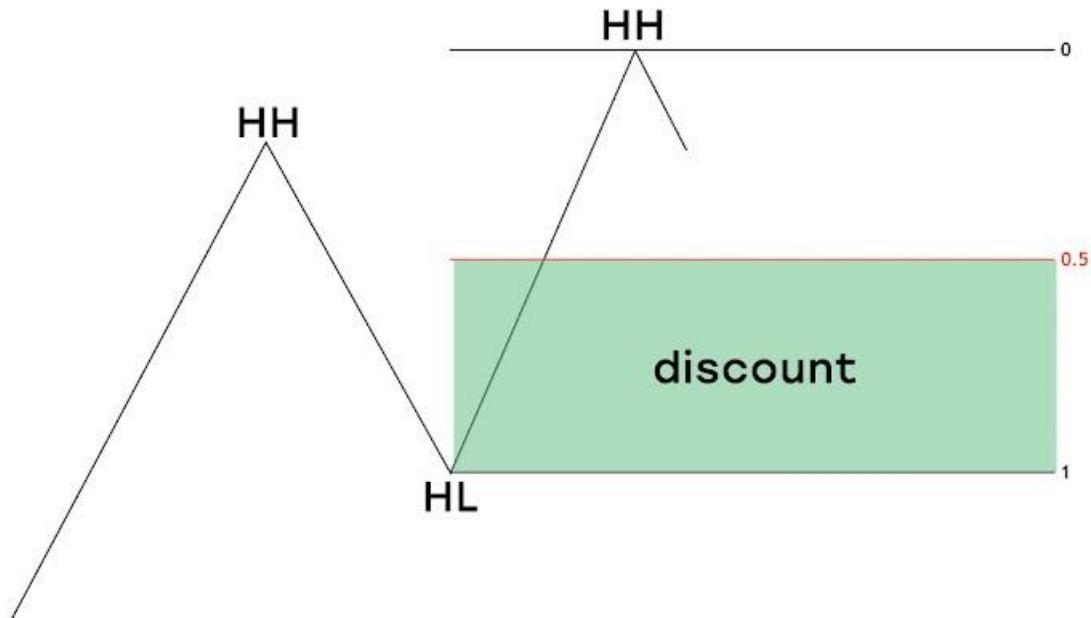
0.5 – справедливая цена (equilibrium).
0.62; 0.705; 0.79 – зона ОТЕ (optimal trade entry).

В отличие от стандартных значений – это модифицированная версия с наиболее высоким математическим ожиданием разворота цены.

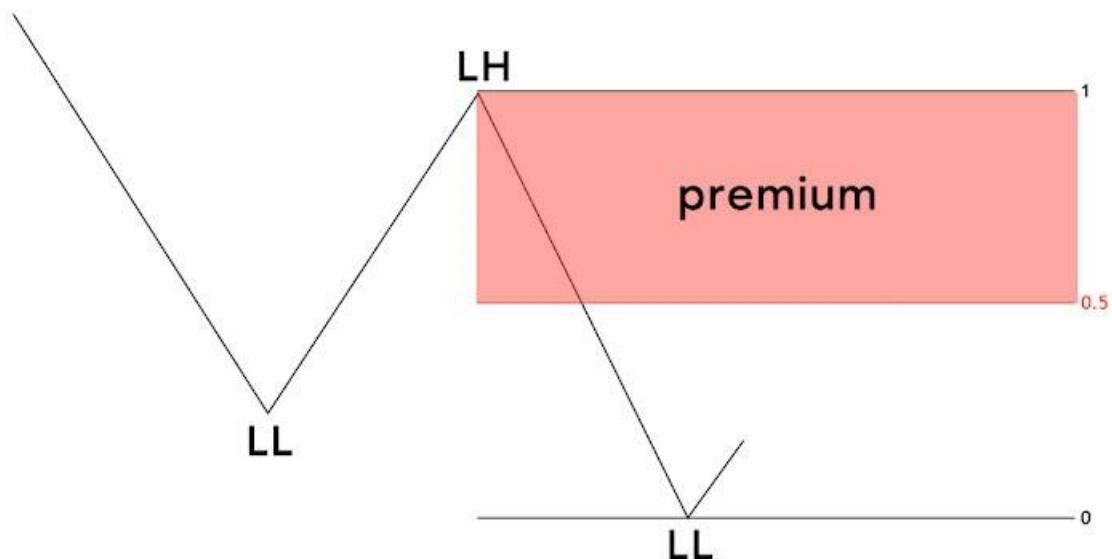
Для открытия позиции нас всегда интересует поведение цены выше либо ниже значения 0.5.

Для открытия позиции в шорт мы 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

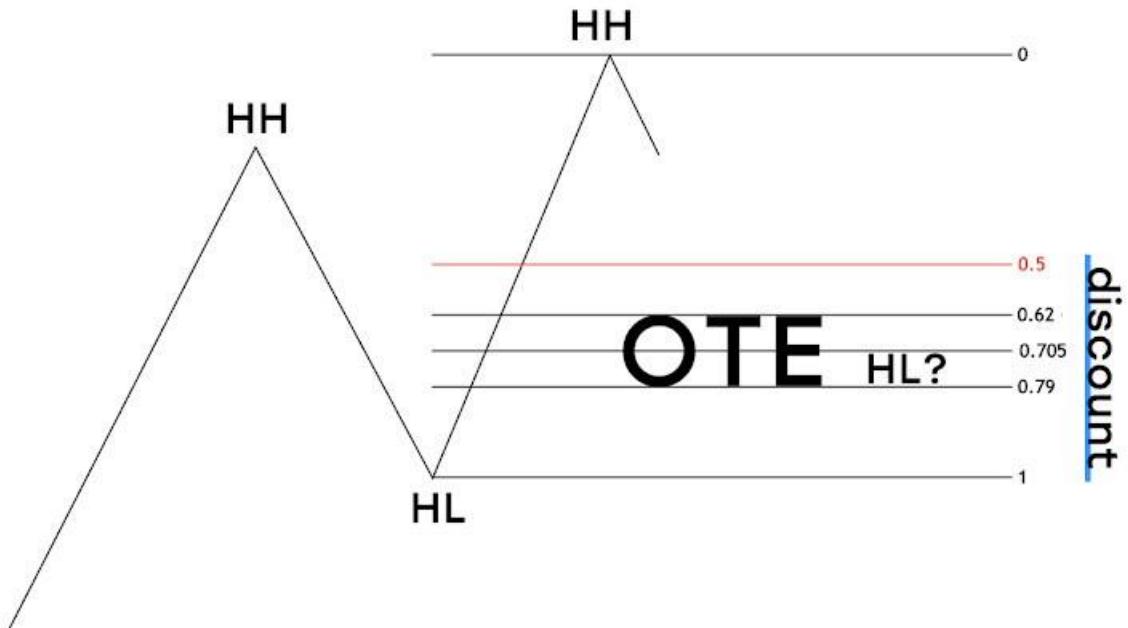


фибоначчи премиум

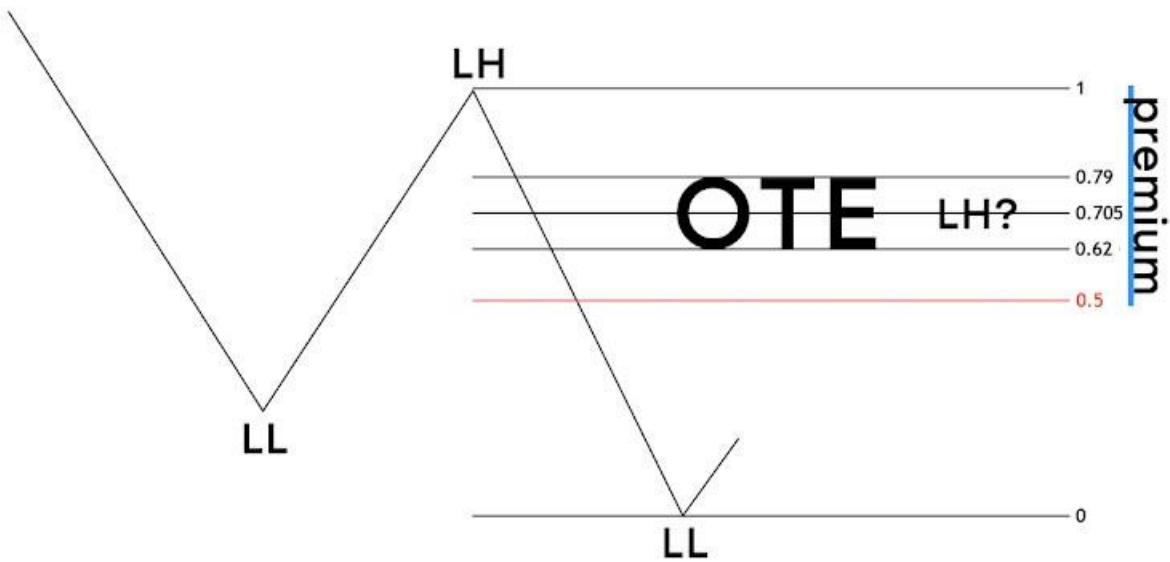


Зона ОТЕ – это расширенная сетка, которая всегда находится в премиум зоне, когда вы ищете шорт позиции, или в дискаунт зоне, когда вы ищете лонг позиций. Данные уровни выступают зоной оптимальной точки входа.

фибоначчи оте



фибоначчи оте



Примеры:

Коррекция восходящего импульса.



Линии Фибоначчи сами по себе не выступают уровнями поддержки или сопротивления. Цена разворачивается от специфических областей, которые отображены на графике.

Коррекция восходящего импульса.



Выход за пределы ОТЕ – это норма, зона поддержки была ниже, это ничего не меняет, и цена сформировала **HL** в дискаунте.

Коррекция нисходящего импульса.



Коррекция нисходящего импульса.



Тейк-профит по Фибоначчи

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

Настройки для выставления тейков:

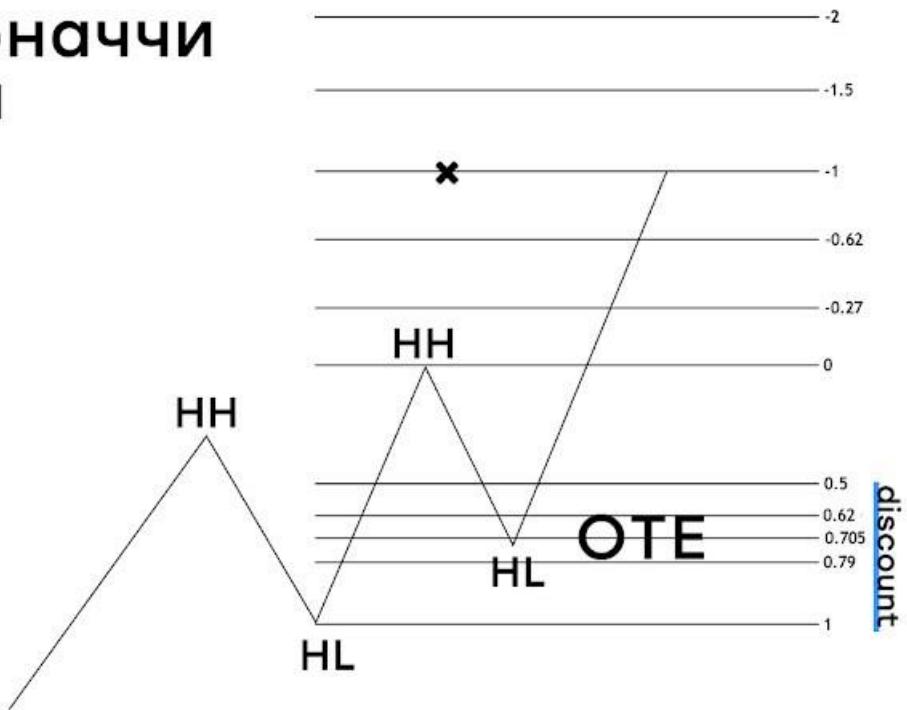
-0.27 – тейк 1

-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 (HH/LL), должно быть меньше, чем время, затраченное на формирование коррекции (HL/LH).

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

Бычий моментум.



Цене потребовалось 10 баров для формирования нового НН – импульс. Коррекционному движению потребовалось 29 баров.

Медвежий моментум.



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

Ограничение убытков — это правильный подход к каждой сделке. Выучить теорию при каких факторах входить в позицию недостаточно, чтобы быть прибыльным трейдером.

Вы должны понимать, что не существует инструментов, которые работают со 100% винрейтом, да и вы не можете работать на 100%, не имея достаточного опыта и знаний.

Ошибки — это нормально, без них не получится, они присутствуют в любом деле. Если вы открываете позицию без стопа, то вы рискуете всем депозитом, чтобы заработать несколько процентов — это смешно. Поэтому при открытии любой позиции вам нужно закладывать определенный риск на эту сделку.

Соотношение риска и прибыли (Risk Reward) — это основной инструмент при входе в позицию. Перед тем, как открыть позицию, у вас есть возможность рассчитать допустимый убыток на сделку относительно вашей стратегии и потенциальную прибыль.

Трейдинг — это не казино, здесь нужен системный подход и самодисциплина.

Рекомендую открывать позиции с соотношением риска и прибыли как минимум 1 к 3. Таким образом вам не нужно быть правым в каждой сделке. Достаточно быть прибыльным в одной из 3 сделок.

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

Приведу примеры:

RR – это соотношение риска и прибыли. RR:3 означает открытие позиции 1 к 3.

РИСК – МЕНЕДЖМЕНТ

WIN	LOSS	ТОРГОВЫЙ СЧЕТ: 1000\$
30%	70%	ВИНРЕЙТ: 30%
3 ИЗ 10	7 ИЗ 10	RR: 3
СРЕДНИЙ ПРОФИТ: 30\$	СРЕДНИЙ УБЫТОК: 10\$	РИСК НА СДЕЛКУ: 1%
В СУММЕ: 90\$	В СУММЕ: 70\$	СРЕДНИЙ ПРОФИТ: 30\$
ЧИСТАЯ ПРИБЫЛЬ : 20\$	ПРОФИТ: 2%	СРЕДНИЙ УБЫТОК: 10\$

РИСК – МЕНЕДЖМЕНТ

WIN	LOSS	
30%	70%	ТОРГОВЫЙ СЧЕТ: 1000\$
3 ИЗ 10	7 ИЗ 10	ВИНРЕЙТ: 30%
СРЕДНИЙ ПРОФИТ: 50\$	СРЕДНИЙ УБЫТОК: 10\$	RR: 5
В СУММЕ: 150\$	В СУММЕ: 70\$	РИСК НА СДЕЛКУ: 1%
ЧИСТАЯ ПРИБЫЛЬ : 80\$	ПРОФИТ: 8%	СРЕДНИЙ ПРОФИТ: 50\$
		СРЕДНИЙ УБЫТОК: 10\$

РИСК – МЕНЕДЖМЕНТ

WIN	LOSS	
30%	70%	ТОРГОВЫЙ СЧЕТ: 1000\$
3 ИЗ 10	7 ИЗ 10	ВИНРЕЙТ: 30%
СРЕДНИЙ ПРОФИТ: 100\$	СРЕДНИЙ УБЫТОК: 20\$	RR: 5
В СУММЕ: 300\$	В СУММЕ: 140\$	РИСК НА СДЕЛКУ: 2%
ЧИСТАЯ ПРИБЫЛЬ : 160\$	ПРОФИТ: 16%	СРЕДНИЙ ПРОФИТ: 100\$
		СРЕДНИЙ УБЫТОК: 20\$

РИСК – МЕНЕДЖМЕНТ

WIN	LOSS	
50%	50%	ТОРГОВЫЙ СЧЕТ: 1000\$
5 ИЗ 10	5 ИЗ 10	ВИНРЕЙТ: 50%
СРЕДНИЙ ПРОФИТ: 100\$	СРЕДНИЙ УБЫТОК: 20\$	RR: 5
В СУММЕ: 500\$	В СУММЕ: 100\$	РИСК НА СДЕЛКУ: 2%
ЧИСТАЯ ПРИБЫЛЬ : 400\$	ПРОФИТ: 40%	СРЕДНИЙ ПРОФИТ: 100\$
		СРЕДНИЙ УБЫТОК: 20\$

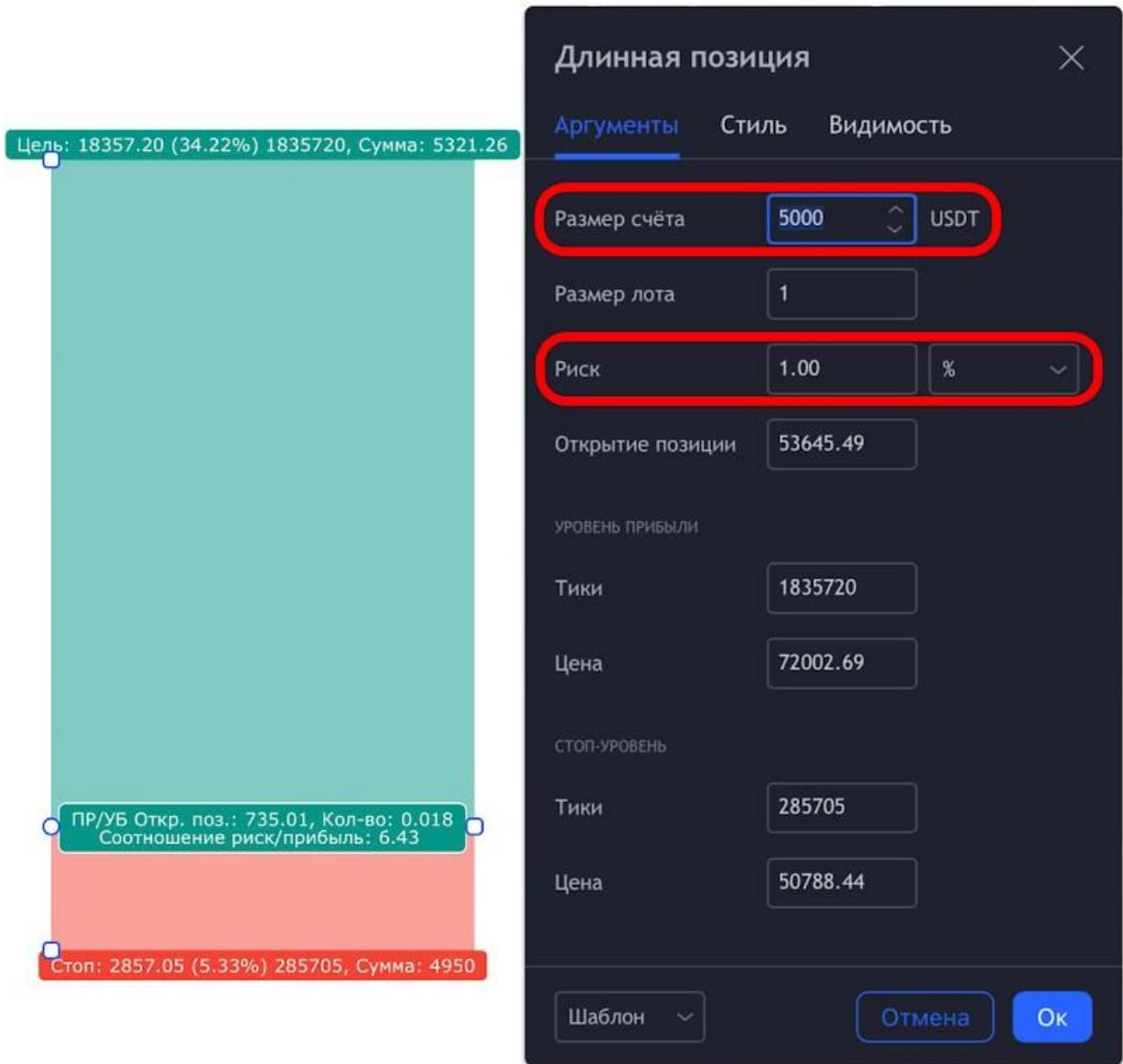
При правильном подходе к открытию каждой сделки вы с высокой вероятностью будете прибыльным. Определите приемлемый риск на сделку и соблюдайте риск-менеджмент.

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.

- Длинная позиция ★
- Короткая позиция ★
- Прогноз
- Диапазон дат ★
- Диапазон цен
- Диапазон цены и времени
- Шаблон баров
- Проекция цены
- Проекция
- Фиксированный профиль объема ★

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



После того, как вы выбрали длинную или короткую позицию, нажмите на неё два раза — откроются настройки. Зайдите 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.



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

«Кол-во» – показывает нужный объём 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.