

Рендж

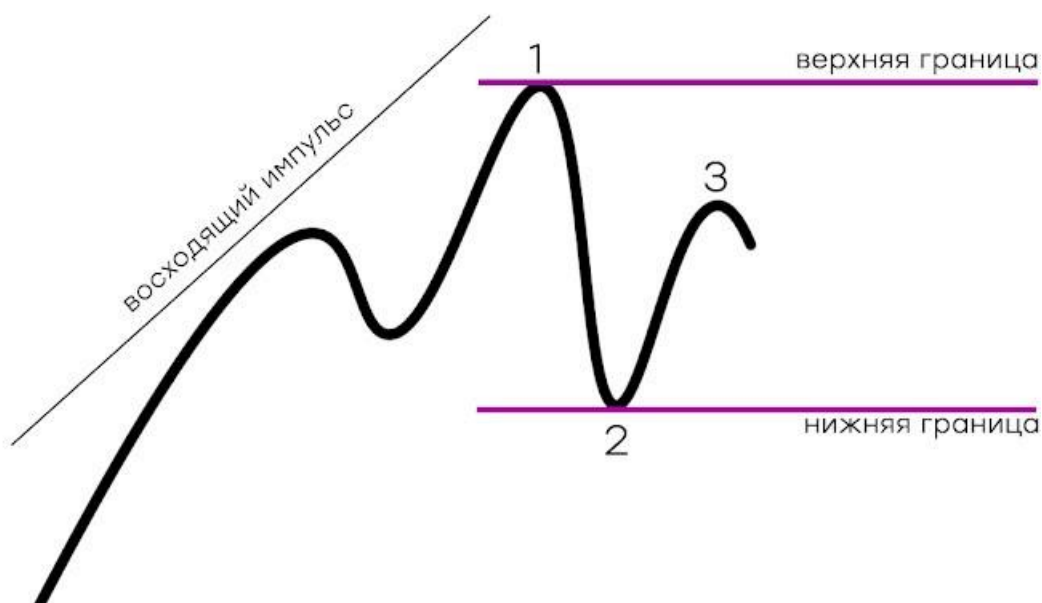
Рендж (консолидация, торговый диапазон, коридор) — это боковое движение цены между двумя границами. Большую часть времени (~80%) рынок находится в боковике.

Определение ренджа

Образование ренджа происходит после импульсного движения цены либо длительного трендового движения.

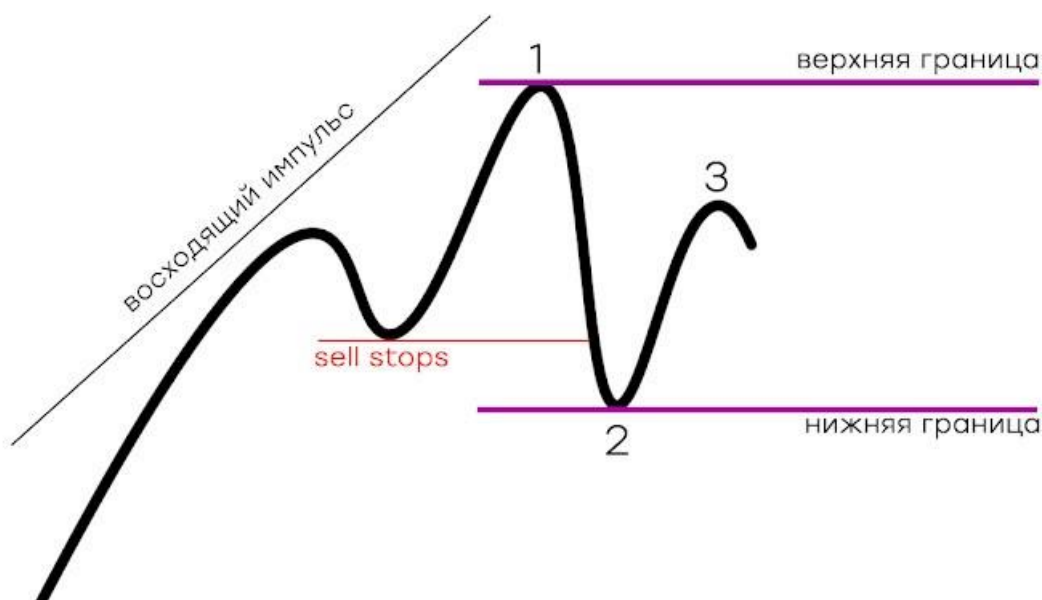
На восходящем тренде верхняя граница ренджа формируется импульсом вверх, после чего начинается движение в противоположную сторону, которое определяет нижнюю границу будущего торгового диапазона.

формирование ренджа



Когда верхняя и нижняя граница определены, первым признаком для работы в рендже будет третье движение. Цена должна торговаться между ними.

формирование ренджа



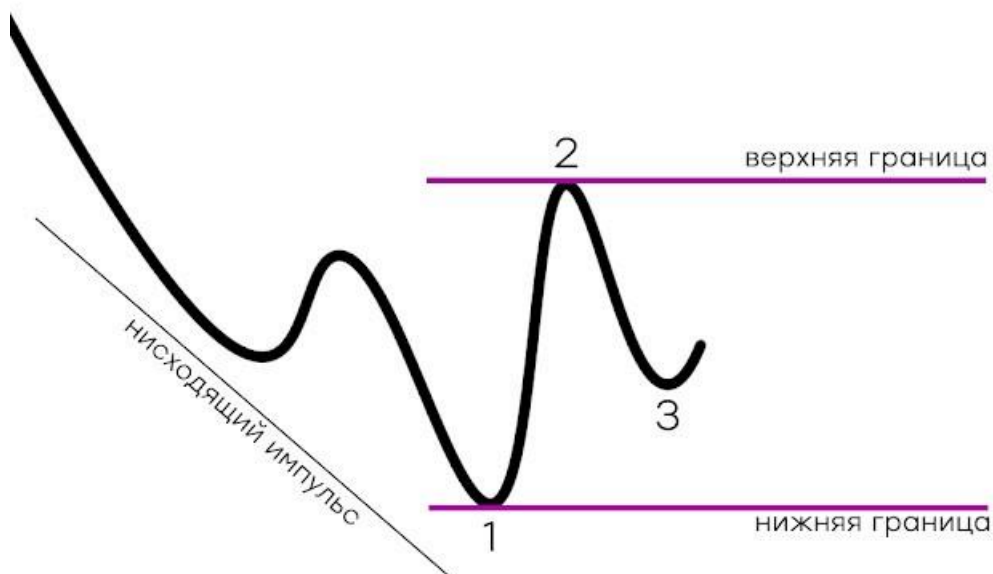
В большинстве случаев движение, противоположное импульсу (2), снимает локальную ликвидность. На рассматриваемом таймфрейме это будет сломом структуры. **Это не является обязательным фактором.**



Пример формирования потенциального ренджа после восходящего импульса.

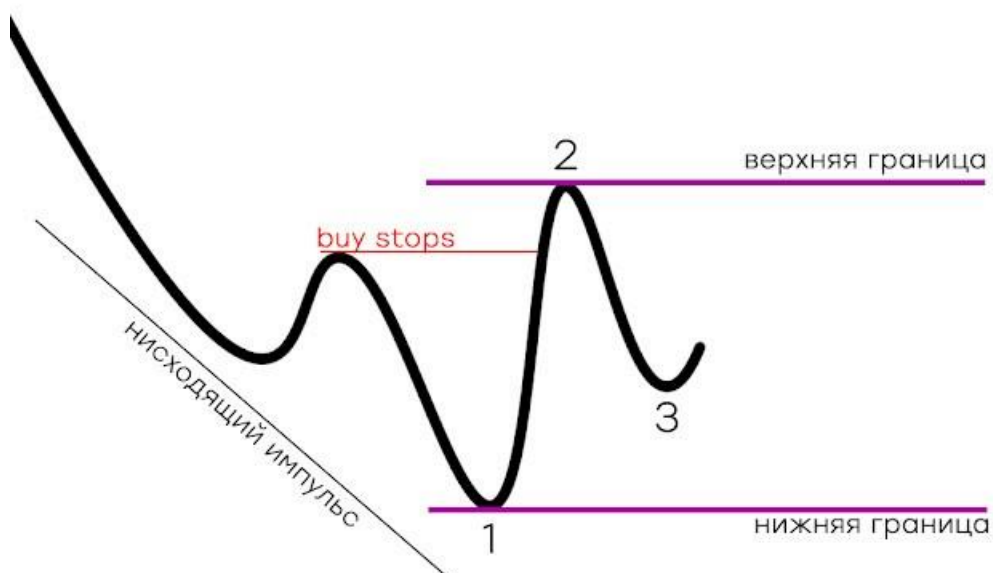
На нисходящем тренде нижняя граница ренджа формируется импульсом вниз, после чего начинается движение в противоположную сторону, которое определяет верхнюю границу будущего торгового диапазона

формирование ренджа



Когда верхняя и нижняя граница определены, первым признаком для работы в рендже будет третье движение. Цена должна торговаться между ними.

формирование ренджа



В большинстве случаев движение, противоположное импульсу (2), снимает локальную ликвидность. На рассматриваемом таймфрейме это будет сломом структуры. **Это не является обязательным фактором.**



Пример формирования ренджа после нисходящего импульса.

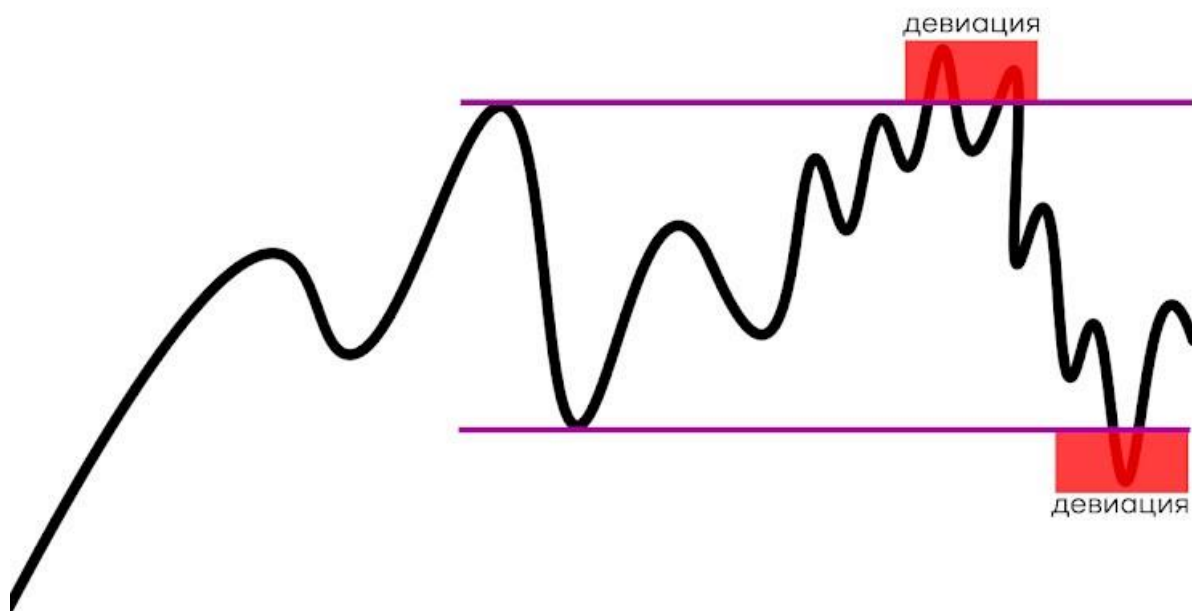
Примечание: обычно рендж формируется первыми тремя свингами. Если на выбранном вами таймфрейме движение, противоположное импульсу (2), формирует восходящий или нисходящий тренд, то проверьте более старший таймфрейм для точного определения второй границы ренджа.

Торговля в рендже

Лучшие позиции будут открываться после девиаций у границ торгуемого диапазона либо за ними.

Девияция – выход цены за пределы ренджа. Создается для сбора и формирования ликвидности путем манипуляции ценой. После срабатывания стоп-лоссов за максимумом или минимумом диапазона происходит разворот цены в противоположную сторону.

подтверждение ренджа



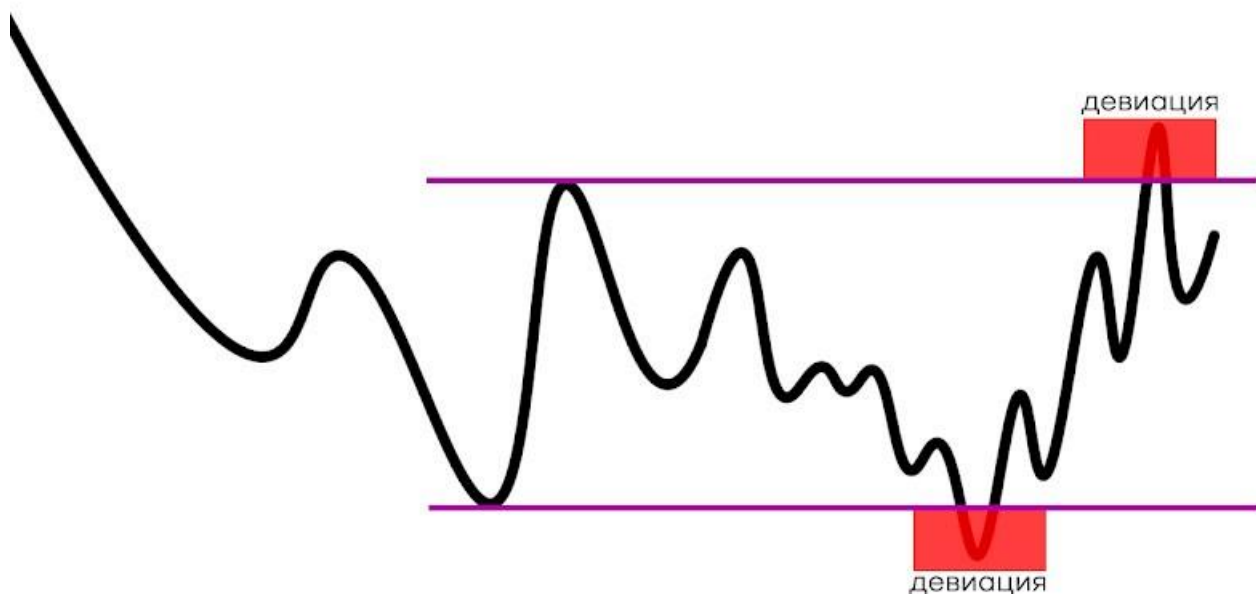
Рендж подтверждается после двух девиаций.
Третьей девиацией будет считаться выход цены за одну из имеющихся девиаций.



Пример девиации сверху торгового диапазона и закрепления цены обратно в нём. Ожидается нисходящее движение к нижней границе.

Девиация сверху приводит к девиации снизу.

подтверждение ренджа



Рендж, сформированный после нисходящего импульса, также подтверждается двумя девиациями.



Пример девиации снизу торгового диапазона и закрепления цены обратно в нём. Ожидается восходящее движение к верхней границе.

Позиции в этих двух примерах открываться не будут, потому что цена не тестирует зоны интереса и не заполняет дисбаланс.

Открытие позиции:

Теория

- **Девияция с одной из сторон и тест зоны поддержки или сопротивления (ОВ / ВВ / МВ / FF).**

Сделка может открываться, основываясь на зоне интереса, откуда ожидается реакция. Стоп будет ставиться за зону п/с. Целью выступает противоположная граница ренджа.

- Девияция с одной из сторон и тест зоны поддержки или сопротивления (ОВ / ВВ / МВ / FF), **закрепление обратно в торговый диапазон.**
- Сделка может открываться агрессивно, когда свеча, которая снимает ликвидность и тестирует зону интереса, закрывается внутри ренджа. Стоп-лосс ставится за максимум девиации. Целью выступает противоположная граница ренджа.

- Сделка может открываться от новообразованного ОВ, ВВ, МВ внутри диапазона. Стоп-лосс ставится за зону интереса, на основе которой рассматривается вход.

Зачастую цена возвращается к границе пробитого ренджа перед движением в противоположную сторону – тест ОБ.

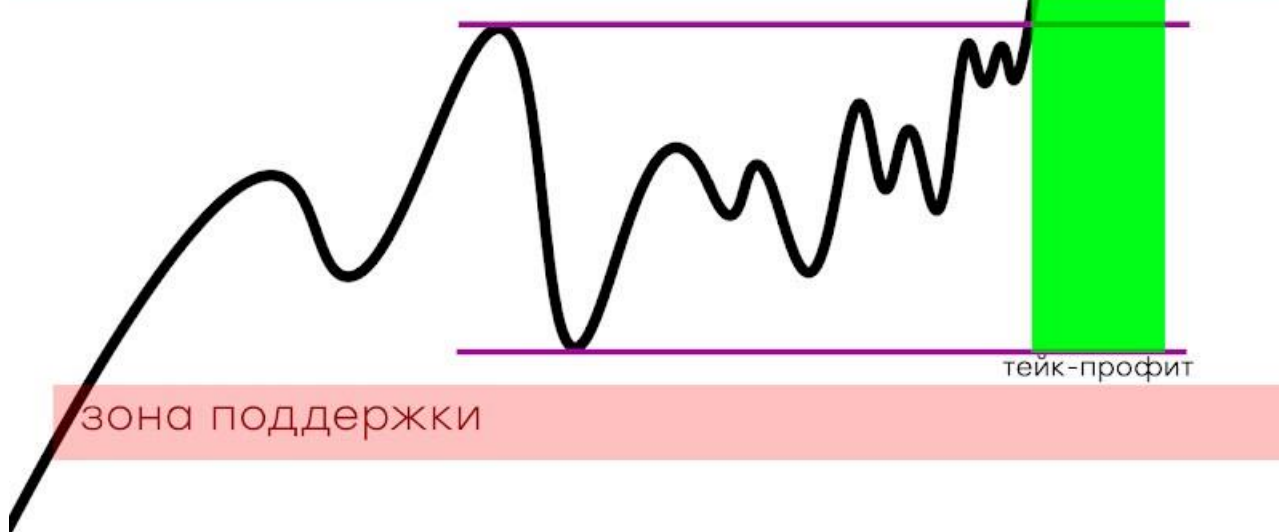
Когда происходит локальный слом структуры, появляется возможность открыть позицию на ретесте ВВ или МВ.

Сильным дополнительным фактором выступает дивергенция.

Примеры

работа в рендже

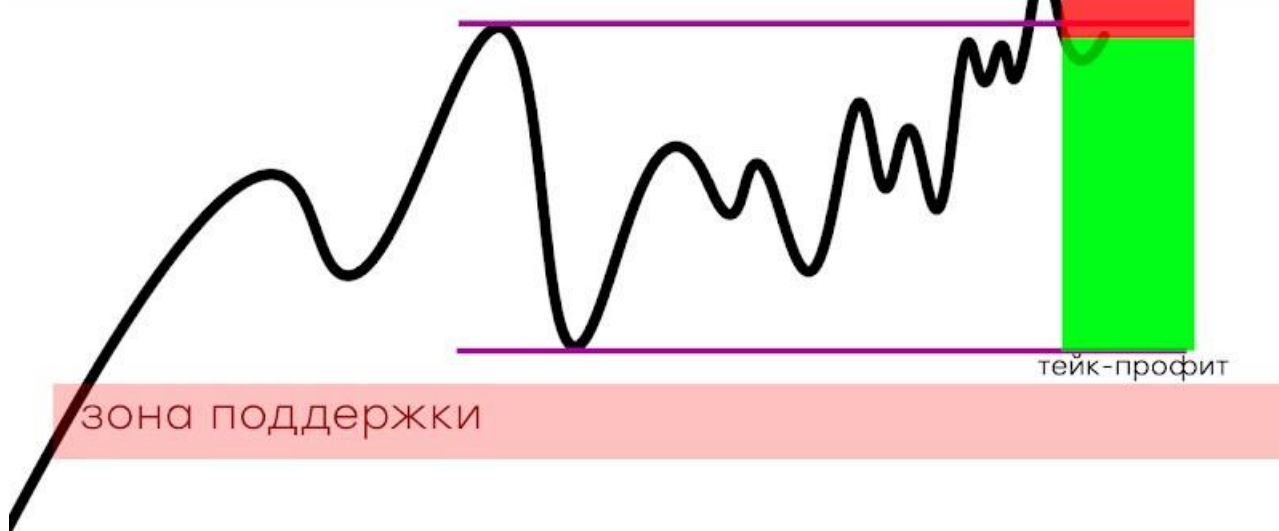
зона сопротивления



- Пример открытия позиции на девиации после теста зоны сопротивления.

работа в рендже

зона сопротивления



- Пример открытия позиции после девиации, теста зоны сопротивления и закрепления обратно в рендже.



Пример открытия позиции после локального подтверждения (mbos) от брейкера.
 Стоп-лосс ставится за него. Целью выступает нижняя граница диапазона.

работа в рендже

зона сопротивления

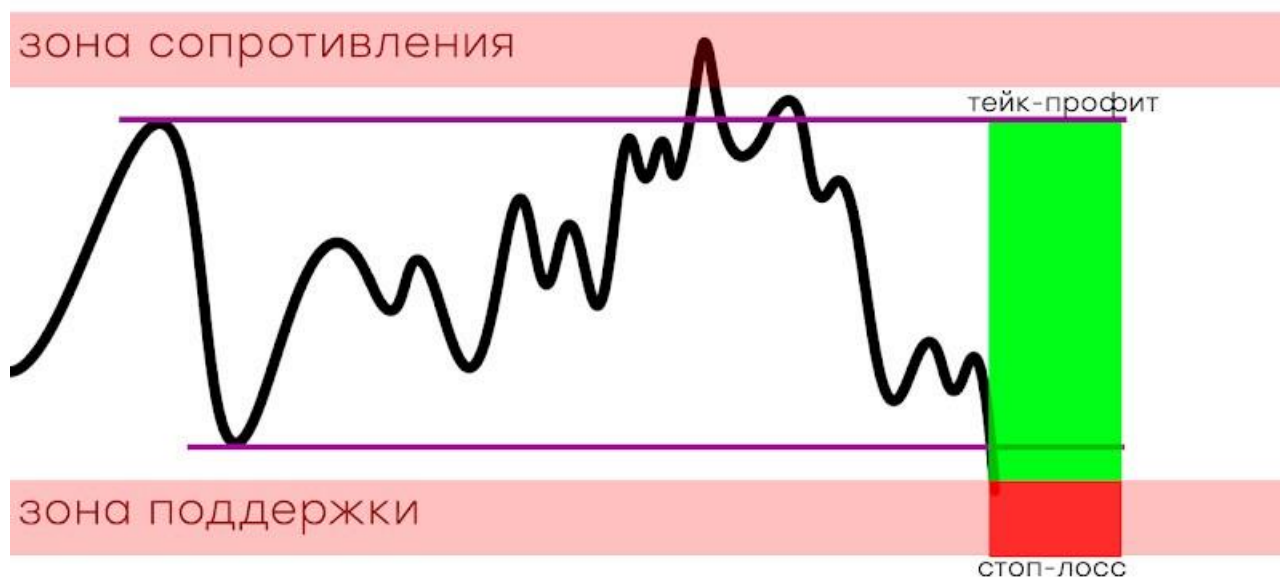


зона поддержки

После девиации снизу и теста зоны поддержки с закреплением обратно в торговый диапазон ожидается восходящее движение к верхней границе ренджа.

Финальный выход из ренджа зачастую происходит по тренду.

работа в рендже



- Пример открытия позиции на девиации после теста зоны поддержки. Целью выступает верхняя граница ренджа, там находится медвежий ордерблок. В случае, если он уже тестирован, целью будет выступать первая зона сопротивления в диапазоне верхней границы.

работа в рендже

зона сопротивления



- Пример открытия позиции после девиации, теста зоны поддержки и закрепления обратно в рендже.

BNBUSDT, 4H, BINANCE @TP461.4 MARK468.9 MIN448.2 MAX468.2



Варианты открытия позиции после девиации снизу. Верхняя граница ренджа выступает целью, но цена с высокой вероятностью может развернуться от отмеченного ордерблока,

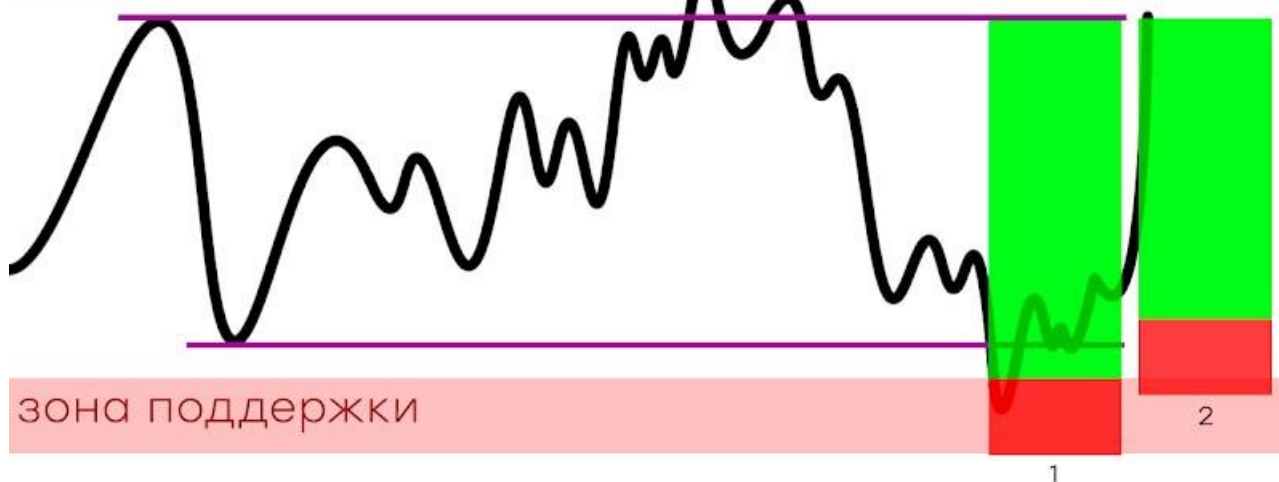
поэтому на нём должна фиксироваться основная часть позиции.



Цена возвратилась на тест бычьего ордерблока, после чего начался локальный восходящий тренд. В данном случае свинг структура медвежья, и от медвежьего ордерблока, то есть тени свечи, которая снимала ликвидность с верхней границы ренджа, могла рассматриваться шорт позиция.

работа в рендже

зона сопротивления



После двух девиаций цена часто выходит из торгуемого диапазона. На данном этапе можно начинать рассматривать Вайкоффа для определения будущего движения цены.

Еще несколько примеров:



На графике тот же диапазон, который рассматривался на предыдущих скриншотах. В

рендже сформировался рендж - это распространенное явление, которое вы можете встретить и на таймфрейме основного ренджа, и на младших временных рамках, что происходит гораздо чаще.



Открытие позиции на девиации снизу могло рассматриваться, но только по первой вариации, от тестируемой зоны интереса. При закреплении обратно в диапазон соотношение риска и прибыли было меньше двух, поэтому второй вариант открытия позиции пропускался.

BHBUSD, 4H, BINANCE OTHP500.3 MAX501.8 MIN490.0 ЗАП494.4



После девиации сверху цена достигла верхней границы основного диапазона. Можно ожидать формирование дистрибуции без UTAD. Первичной целью будет выступать нижняя граница выделенного диапазона, основная часть позиции может фиксироваться на 50% тени свечи, которая выходила за нижнюю границу ренджа.

BHBUSD, 4H, BINANCE OTHP491.3 MAX491.3 MIN460.0 ЗАП469.3



Вход в позицию мог осуществляться по первому и второму сценарию, которые были показаны выше.

Пример после нисходящего импульса:



На девиации снизу позиция не должна рассматриваться, потому что цена не протестировала зону интереса, на основе которой мог рассматриваться вход. Одна девиация не является фактором для открытия сделки.

Можно предположить, что цена начнет развиваться в восходящем направлении к верхней границе ренджа, но **вход в сделку должен пропускаться** либо рассматриваться после локального подтверждения (mbos).



На девиации сверху цена протестировала зону интереса – это брейкер, на основе которого открывалась позиция. Ниже рассматриваемого диапазона находятся равные минимумы, они могут выступать целью для такой сделки, но основная позиция будет фиксироваться на нижней границе диапазона (от 50% до 80%).



На старшем таймфрейме цена находится в восходящем тренде, это сложная коррекция,

которая вероятнее всего подходит к завершению. На графике схема аккумуляции №1, вторая девиация является спрингом.



Позиция может рассматриваться по двум показанным ранее вариациям входа с целью достижения верхней границы ренджа. Либо же с целью обновления текущего **НН** старшего таймфрейма, но даже с учетом этого рекомендуется частично фиксировать позицию на верхней границе диапазона.



PS. Цена вышла с торгового диапазона и продолжила восходящий тренд.

Вайкофф

Схемы Вайкоффа актуально рассматривать после двух девиаций. Они отображают, что делает умный капитал: накапливает, перенакапливает или распределяет, 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 ВС.

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?

Аккумуляция

- Манипуляция минимумами.
- Бычьи дивергенции. Учитывайте минимумы SC, ST(B) и Spring.
- Формирование диапазона накопления отзоны поддержки.
- Формирование пулов ликвидности (BSL) — это причина будущего восходящего движения.
- SOS – подтверждение схемы наповышенных объемах.

Дистрибуция

- Манипуляция максимумами.
- Медвежьи дивергенции. Учитывайте максимумы BC, UT и UTAD.
- Формирование диапазона распределения от зоны сопротивления.

- Формирование пулов ликвидности (SSL) — это причина будущего нисходящего движения.
- SOW — подтверждение схемы наповышенных объемах.

Высоковероятный сетап

Факторы для открытия качественной сделки:

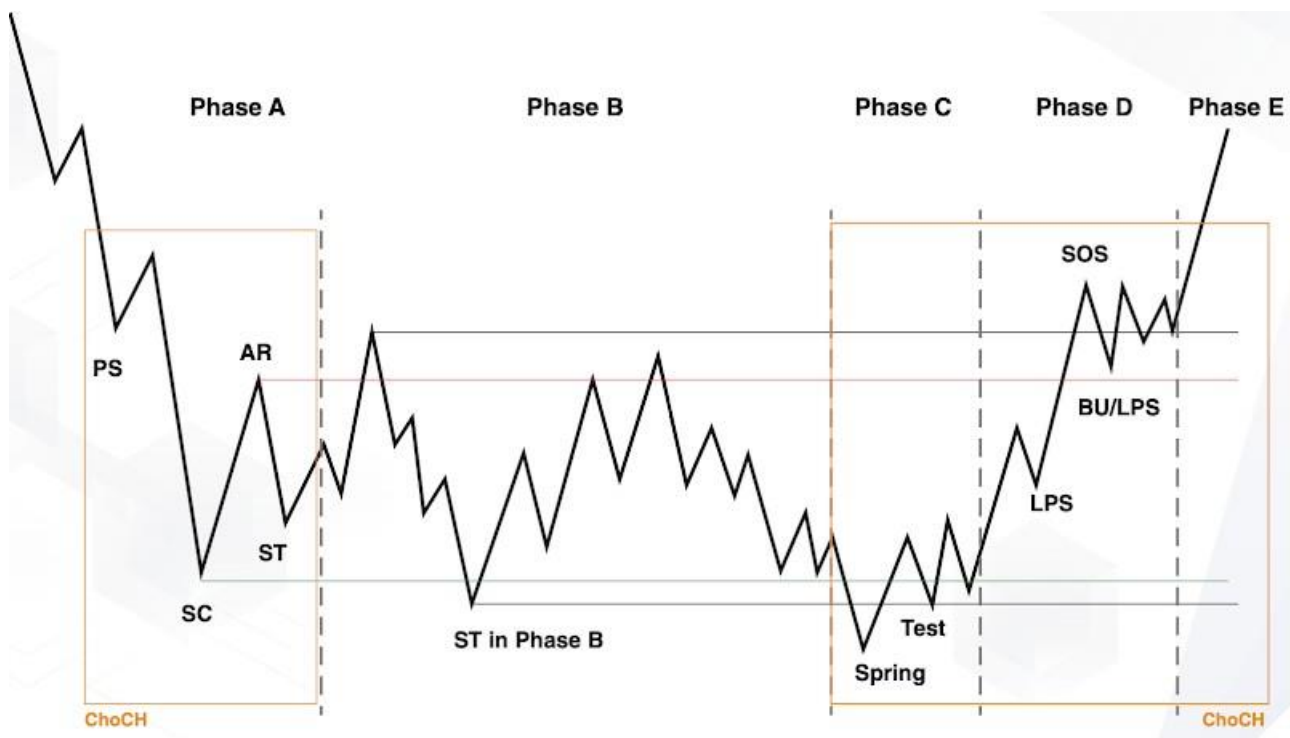
Аккумуляция / ре-аккумуляция

- Восходящий тренд, аккумуляция в рамках коррекции и формирования HL.
- Бычий моментум (LoE).
- Дискаунт зона.
- Манипуляция минимумами у зоны поддержки.
- Бычья дивергенция.
- Формирование пулов ликвидности (BSL).
- Цена должна иметь потенциал для продолжения восходящего движения. Основная зона интереса восходящего тренда ещё не достигнута.
- Слом субструктуры – подтверждение схемы.

Дистрибуция / ре-дистрибуция

- Нисходящий тренд, распределение в рамках коррекции и формирование LH.
- Медвежий моментум (LoE).
- Премиум зона.
- Манипуляция максимумами у зоны сопротивления.
- Медвежьи дивергенции.
- Формирование пулов ликвидности (SSL).
- Цена должна иметь потенциал для продолжения нисходящего движения. Основная зона интереса нисходящего тренда ещё не достигнута.
- Слом субструктуры – подтверждение схемы.

Аккумуляция тип 1



Пример аккумуляции с учетом факторов высоковероятного сетапа.

В большинстве случаев схема накопления №1 начнёт формироваться перед зоной

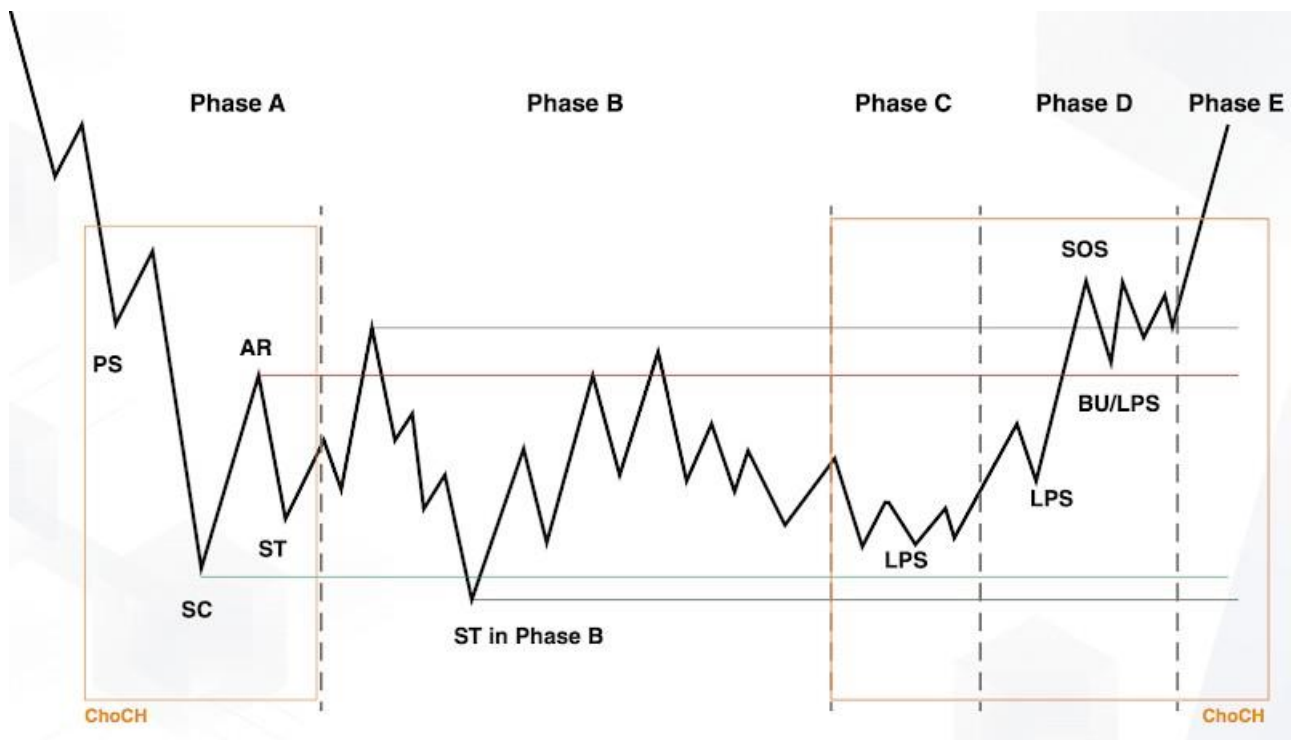
поддержки, а её тест будет на третьем минимуме (Spring / Shakeout).



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 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.



Ре-аккумуляция тип 2



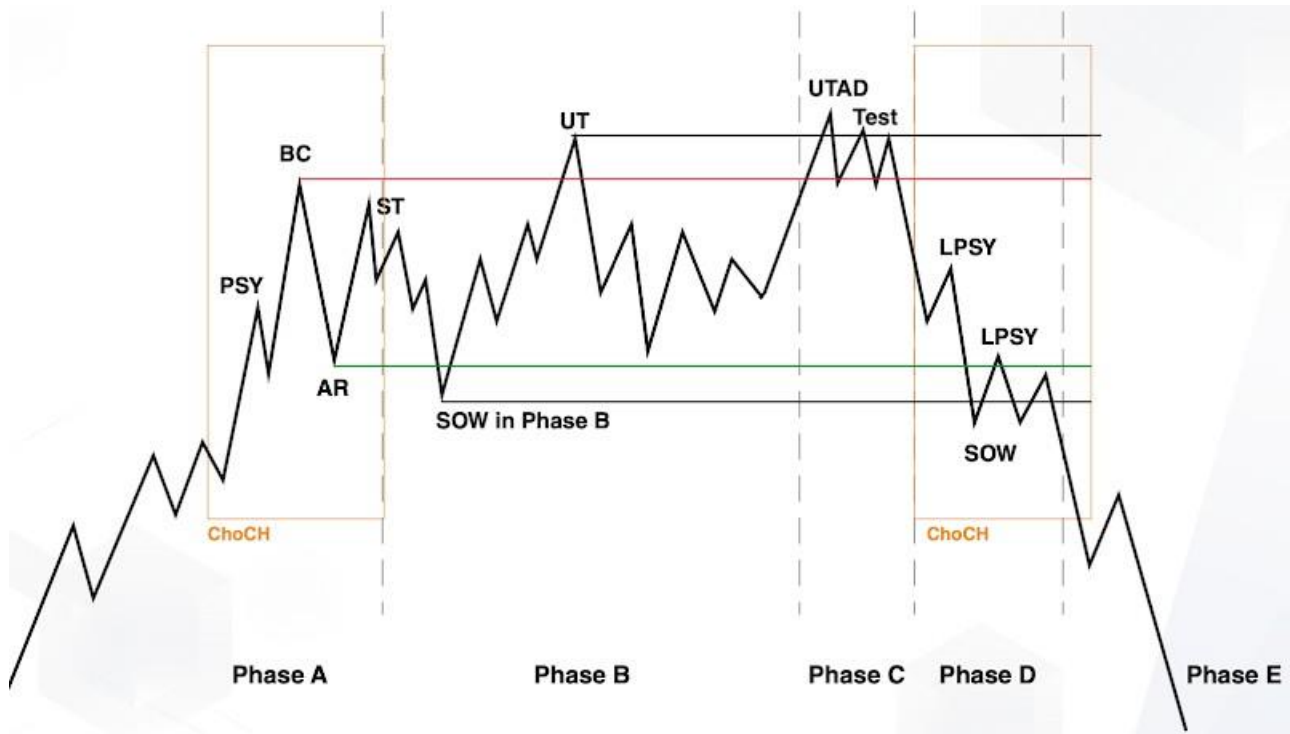
В двух примерах показана скрытая бычья дивергенция. Классической дивергенции не было, это распространенное явление.



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



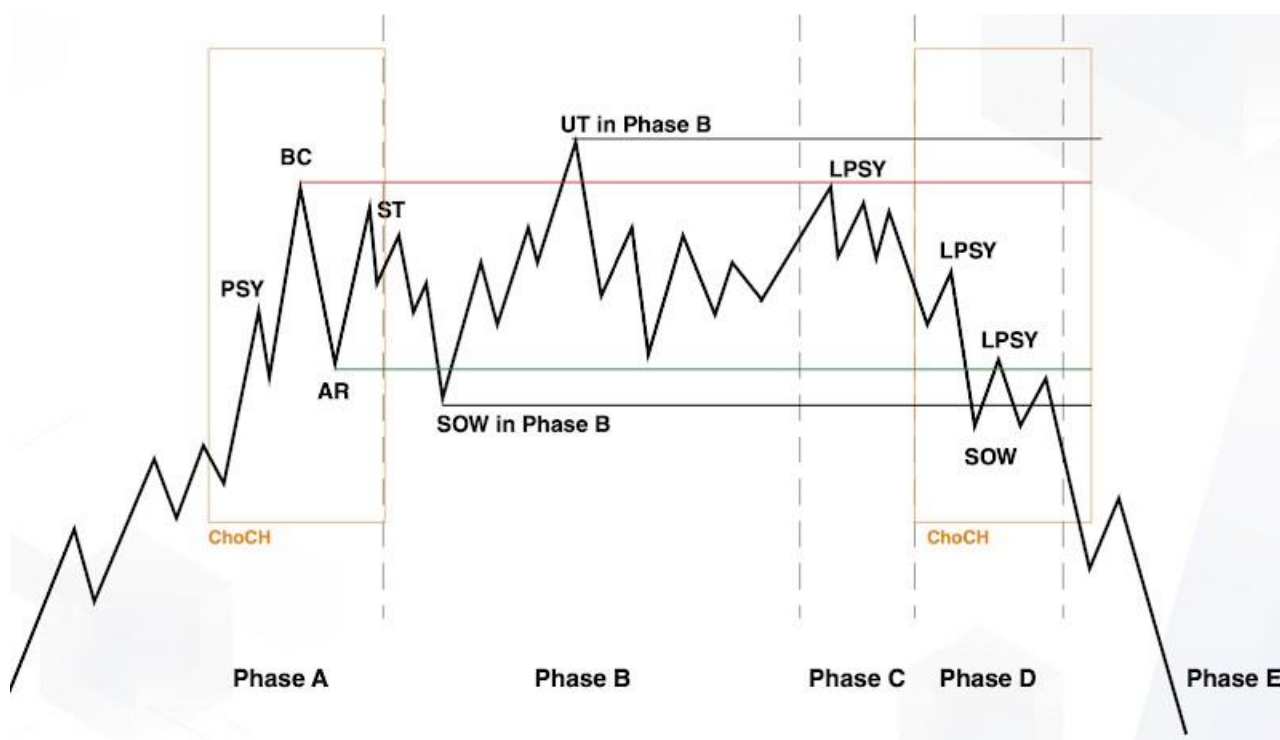
Последовательность событий “Sow in B” и “UT” может варьироваться.



Пример 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





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.



Ре-дистрибуция тип 2



Ложная аккумуляция

Ложные схемы вы будете встречать чаще, чем истинные. Чем меньше факторов высоковероятного сетапа вы учитываете, тем

больше шанс того, что вы смотрите не на аккумуляцию, а на ре-дистрибуцию.



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



Контекст, в котором формируется потенциальная
“аккумуляция”.



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



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

Ложная дистрибуция также будет встречаться крайне часто, как и ложная аккумуляция. Учитывая факторы высоковероятного сетапа, вы сможете с высокой точностью определять будущее движение цены.



Трейдеры, торгующие по схемам Вайкоффа, видят здесь дистрибуцию – они открывают

шорт позиции, на самом деле не аргументированные и заранее убыточные.



Трейдеров, открывающих шорт позиции, оставили вне рынка. Цена стремится перекрыть дисбаланс и протестировать зону сопротивления, только тогда начнется нисходящее движение. На данном этапе это можно рассматривать как полноценную дистрибуцию.

SUBRUSD1, 1M, BINANCE, STRIP7,119, MAJCT7,143, MIN7,023, MAX7,028



Схема без контекста ничего не будет стоить и не должна применяться.