

День 3 — Механика рынка: стакан, лента, кластера (как «видеть деньги»)

ЖЕСТКАЯ ПРАВДА

- 1) Ты торгуешь не «картинки», а заявки. Цена двигается, когда рыночные ордера встречаются с лимитными в стакане; сделка происходит по очереди исполнения, а последняя совершённая сделка формирует цену. Если ты этого не видишь — ты гадаешь, а не торгуешь.
- 2) Главный след крупного игрока — «плотность» (стенка лимитов). Большие заявки в DOM — это реальные деньги, которыми можно торговать: от них цена часто отскакивает, а при «разъедании» стенки — выстреливает на стопах тех, кто стоял против движения.
- 3) Кластера и лента — подтверждение намерений. Кластера показывают, сколько объёма исполнилось по каждой цене (фактически «стакан исполненных заявок»), а лента — текущий темп и дисбаланс рыночных принтов «здесь и сейчас».
- 4) Деньги делаются только в «активе в игре». Нужен высокий относительный объём (RVOL) и направленное движение; в боковике матожидания нет.

КОНКРЕТНЫЕ ШАГИ (пошаговый план)

Шаг 1. Разложи рабочие окна правильно

- График 1-5 мин + объём (для контекста и уровней).
 - DOM (стакан) — видишь глубину, спред, «плотности» по ценам.
 - Лента (Time & Sales) — поток рыночных принтов: скорость, размер, сторона.
 - Кластера (footprint по ценам) — где именно прошёл объём.
- Принцип: контекст (уровень) → наличие денег (плотность) → намерение (ускорение принтов) → исполнение.

Шаг 2. Пойми язык DOM (стакана)

- Лимитные ордера ждут свою цену; формируют очереди по уровням.
 - Рыночные ордера «бьют» по лучшей встречной цене; именно они двигают цену, съедая лимитную ликвидность.
 - Сделка = пересечение рыночного и лимитного; цена = последняя сделка.
 - Спред — зазор между лучшим бидом и аском: важен для входа/выхода и проскальзывания.
- Как «слышать» стакан:
- Инерция уровня: чем толще очередь лимитов — тем сложнее её «съесть».
 - Подпитка: стенку «едят», но она восстанавливается — признак реального интереса.
 - Отмена: стенка «мигает/убегает» — часто фейк (спуф), осторожно с отскоком.

Шаг 3. Определи «плотность» (стенку денег)

- Эмпирика: значимая плотность — от ~\$500k в долларовом выражении (объём × цена). Ниже — эффект часто шумовый.
 - Места силы:
- 1) Первый отскок от плотности (цена не подходила ранее).
 - 2) Разъедание плотности: когда рыночный спрос/предложение её «проедают» и запускают пробой на стопах.

Шаг 4. Лента (Time & Sales) как триггер

- Смотри ускорение принтов и средний размер: серия покупок/продаж «по рынку» прижимает цену к стенке/уровню.
- Дисбаланс: у стенки на бид сыпятся продажи — жди пробоя вниз; у стенки на аск —

пробоя вверх.

— Паузы/вялость: отсутствие агрессора у стенки — высокий шанс отскока.

Шаг 5. Кластера (footprint) — где исполнилось по ценам

— Идея: кластера показывают, где прошёл объём — постфактум подтверждая отскок/пробой, и дают зоны для тейков/перезаходов.

— На крипте кластера полезны умеренно, но видеть, что стенку съели именно здесь и сколько, — ценно. Это буквально «стакан исполненных заявок».

Шаг 6. Два базовых сетапа

Сетап А: Отскок от плотности (первое касание)

Смысл: цена подходит к значимой стенке впервые; нет признаков агрессивного «проедания».

Фильтры:

— Инструмент — актив в игре (RVOL↑, есть ход).

— Плотность реальная (не «мигает»), стоит $\geq \$500k$.

— Лента вялая у уровня (нет серий агрессивных ударов против тебя).

План входа/выхода:

1) Вход лимитом за стенкой (чтобы получить цену).

2) Стоп — за стенкой на несколько тиков (если её съедают — признаём не правоту).

3) Тейк — у следующей ликвидности/уровня; часть — фикс, часть — трейлинг кластерами.

Логика: ты покупаешь/продаёшь ликвидность, у тебя явная опора (стенка денег).

Сетап В: Разъедание стенки → пробой на стопах

Смысл: стенку долго «едят», потом она пропадает — агрессор ломает уровень и запускает лавину стопов.

Фильтры:

— Уровень тестировался; на финальном подходе — серия агрессивных принтов в ленте.

— В кластерах на уровне — масса исполнений (подтверждение съеденной стенки).

План входа/выхода:

1) Вход по рынку/лимитом в сторону пробоя сразу после «проглатывания» стенки.

2) Стоп — за остатком объёма/за уровень (короткий).

3) Тейк — к следующей зоне ликвидности/там, где толпа ставила стопы.

Логика: заработок — это чьи-то стопы; тыходишь туда, где они массово срываются.

Шаг 7. Фильтр «Актив в игре»

— Относительный объём (RVOL) высокий; на низком RVOL любые точки — лотерея.

— Есть направление/ажиотаж: кто-то «выкупает по любой цене» — спрос выше терпения продавцов.

— На BTC в боковике возможностей мало; на монетах с меньшей капитализацией при тех же деньгах «шум = тренд», там чаще есть «игра».

Шаг 8. Практикум: тренируй «глаз» (ежедневные дриллы)

1) 15 минут DOM-наблюдения: отметь 10 стенок, где цена отскочила / пробила. Запиши: размер (в \$), поведение ленты, итог движения.

2) 10 минут ленты: найди 5 ситуаций, где серия принтов у уровня предшествовала пробоем; отметь длительность «раскачки».

3) 10 минут кластеров: открой footprint и найди уровни, где «исполнено много» — это будущие зоны интереса/тейки.

4) 5 минут «актива в игре»: выбери 3 монеты с высоким RVOL и направлением. Коротко

объясни «почему там есть деньги».

Шаг 9. Интеграция рисков

- На отскоке: стоп за плотностью; если стенку не подпитывают — выходи быстро.
- На пробое: стоп за уровень; не «догони» вход — лучше пропусти.
- На тихом рынке (низкий RVOL) — не торгуй; размечай уровни/стенки для «боевых» часов.

Шаг 10. Что считать и как улучшать

- Таблица плотностей: цена, размер (\$), исход (отскок/пробой), «держалась ли» стенка, была ли подпитка.
- Лента-триггеры: длительность и «плотность» серий (сколько принтов за N секунд у уровня).
- Кластера-зоны: где исполнилось «много», что цена сделала дальше.
- Раз в неделю — видеоразбор 10 ситуаций: что было видно заранее в DOM/ленте/кластерах.

ЗАДАНИЕ (сделай сегодня)

- 1) Карта DOM: 3 скрина — «чистый» стакан; стакан с яркой плотностью; момент разъедания. Подпиши, что видно в ленте и чем кончилось.
- 2) 10 плотностей → исход: зафиксируй 10 «стенок» (в \$): было ли подпитывание, отскок или пробой, какой триггер в ленте заметил. Выделяй $\geq \$500k$ как «значимые».
- 3) 5 пробоев через разъедание: отметь вход, стоп за уровень, целевой тейк (следующая ликвидность).
- 4) Мини-дрилл «лента за 10 минут»: в «боевое» время включи запись и вслух комментируй ленту у уровня; потом пересмотри и оцени исход.
- 5) Отчёт (1 страница): где было проще — отскок или пробой и почему; где ошибся в чтении DOM/ленты/кластеров; что изменишь в чек-листе на завтра.

ИТОГ

Ты учишься видеть деньги: ликвидность (DOM), агрессию (лента), подтверждение объёма (кластера) и контекст (график/объём). Без этого скальпинг — гадание. С этим — управляемая система входов и рисков.