

Методика торгвли по уровням Фибоначчи

В данной инструкции приведено исчерпывающее описание торговли с использованием уровней Фибоначчи, инструмента, при работе с которым

все Ваши сделки будут открываться только в направлении тренда, причем в самом начале нового импульса тогда, как сигнал любого индикатора запаздывает на 4-5 свечей;

размер SL будет минимален (не более 300 пунктов);

среднее соотношение SL к TP будет 1/5, а иногда и 1/30;

Вы не будете терять деньги при боковом движении рынка, т.к. стратегия дает сигналы только на тренде;

нет необходимости подстраивать параметры под изменяющийся рынок: «золотое сечение» работало на рынке и 5, и 10, и 50 лет назад.

СОДЕРЖАНИЕ

Теория Доу.....	3
Тренды.....	3
Ценовые каналы.....	5
Числа и уровни Фибоначчи.....	9
Правила построения сетки Фибоначчи.....	10
Правила торговли по уровням Фибоначчи.....	12

Теория Доу

Теория Доу является основной теорией, которая описывает поведение цены на рынке и позволяет давать прогнозы о дальнейшем ее движении.

Экстремумом на ценовом графике называется область, где происходит смена направления движения цены. Область, где цена меняет направление движения с восходящего на нисходящее, называется максимумом ценового графика. Соответственно, область, где цена меняет направление движения с нисходящего на восходящее, — минимумом ценового графика. Максимум и минимум на графике образуются не менее, чем тремя свечами.

Тренды

Тренд — это направление движения цены. Тренд может быть восходящим, нисходящим и боковым. Так же на рынке бывают ситуации, когда тренда нет; в этом случае можно говорить, что тренд определить нельзя.

Тренд является восходящим при соблюдении следующих условий:

1. Каждый новый минимум расположен выше предыдущего минимума.
2. Каждый новый максимум расположен выше предыдущего максимума.
3. Началом движения является минимум, а окончанием — максимум.

На рисунке 1 приведен пример восходящего тренда. Движение на рисунке 2 не является восходящим трендом, т. к. оно начинается с максимума, а заканчивается минимумом.

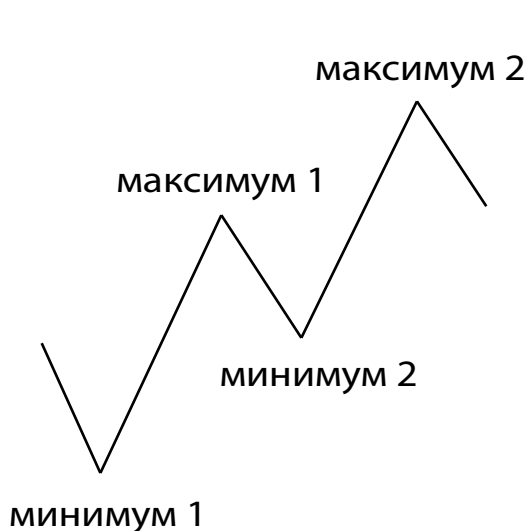


Рисунок 1

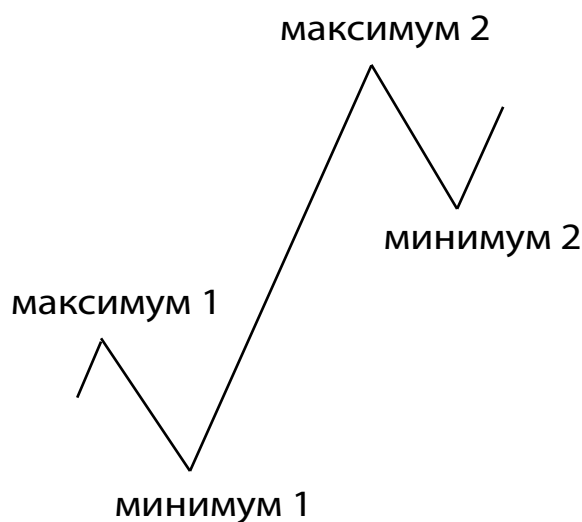


Рисунок 2

Тренд является нисходящим при соблюдении следующих условий:

1. Каждый новый максимум расположен ниже предыдущего максимума.
2. Каждый новый минимум расположен ниже предыдущего минимума.
3. Началом движения является максимум, а окончанием минимум.

На рисунке 3 приведен пример нисходящего тренда. Движение на рисунке 4 не является нисходящим трендом, т. к. оно начинается с минимума, а заканчивается максимумом.

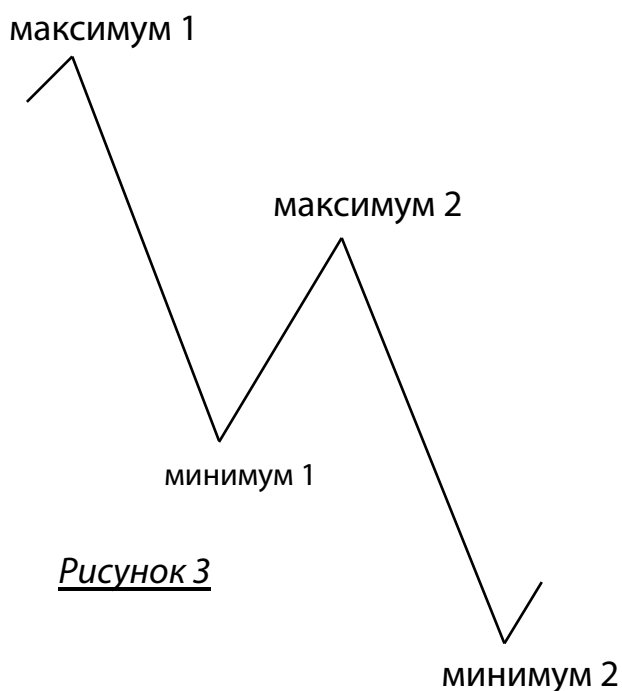


Рисунок 3

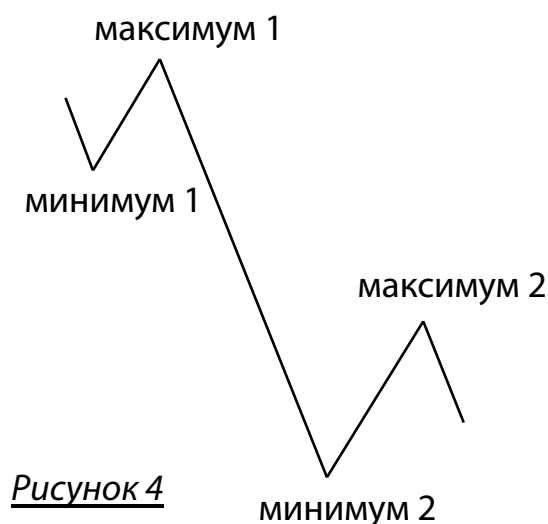


Рисунок 4

Если на графике каждый новый максимум находится примерно на одном горизонтальном уровне с предыдущим максимумом и каждый новый минимум — примерно на одном горизонтальном уровне с предыдущим минимумом, то тренд является боковым. Боковик может начинаться как с минимума, так и с максимума.

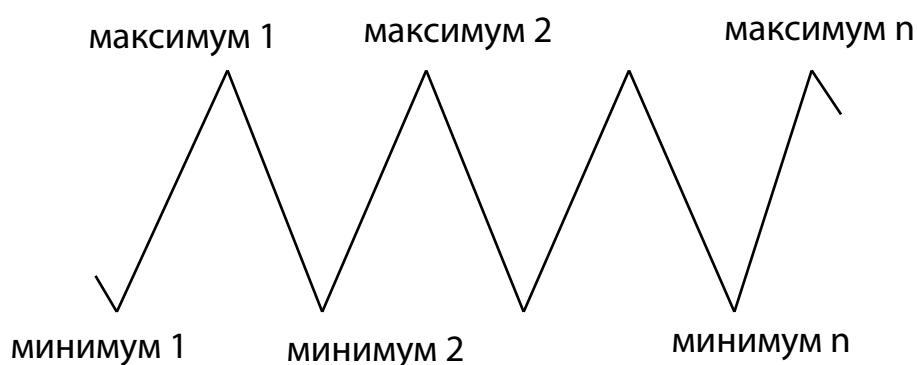
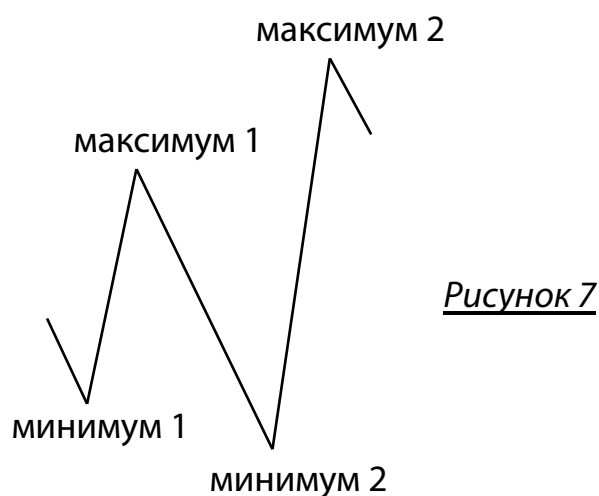
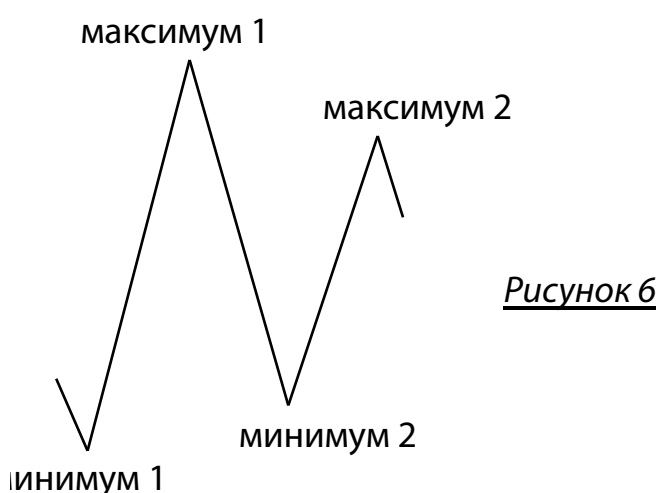


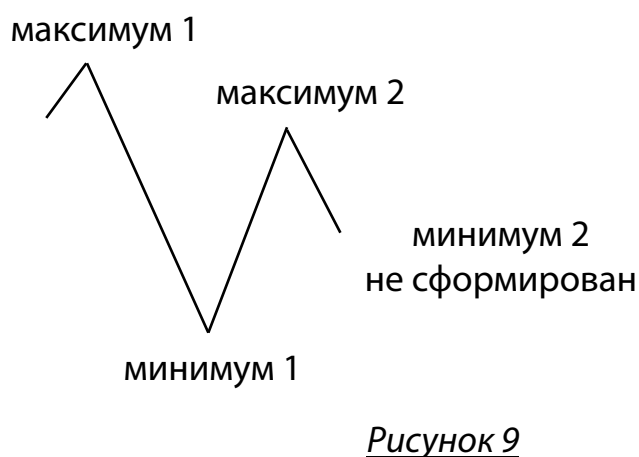
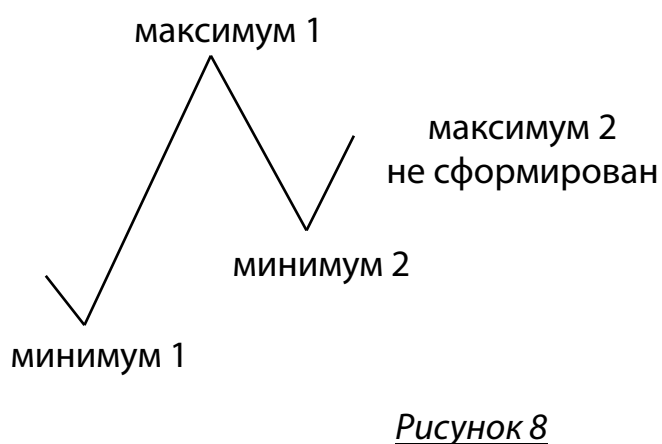
Рисунок 5

Привосходящем тренде нужно только покупать, при нисходящем — только продавать; в боковом тренде открывать сделки стоит только в направлении предыдущего тренда.

Если на графике максимумы и минимумы расположены в другой последовательности, тренда в настоящий момент нет. Примеры движений цены, не относящихся ни к одному из видов тренда, приведены на рисунках 6 и 7.



Таким образом, определить тренд можно не менее, чем по четырем точкам: двум максимумам и двум минимумам, расположенным в определенной для каждого тренда последовательностях. Если экстремумов недостаточно, определить тренд нельзя (рисунки 8 и 9).



Ценовые каналы

Линией поддержки называется линия, соединяющая два соседних минимума. Линией сопротивления — линия, соединяющая два соседних максимума. Ценовой канал — это пространство, которое образуют между собой линия поддержки и линия сопротивления.

Если ценовой канал направлен вверх, в дальнейшем следует рассчитывать на восходящий тренд. Если ценовой канал смотрит вниз, можно ожидать развитие нисходящего тренда.

На таймфреймах H1 и H4 линии поддержки и сопротивления строятся по телам свечей. На таймфреймах D1 и выше ценовой канал нужно строить по теням свечей. Для построения ценового канала достаточно трех точек на графике. Например, восходящий ценовой канал можно построить по двум минимумам и одному максимуму (рисунок 10), а нисходящий — по двум максимумам и одному минимуму (рисунок 11).

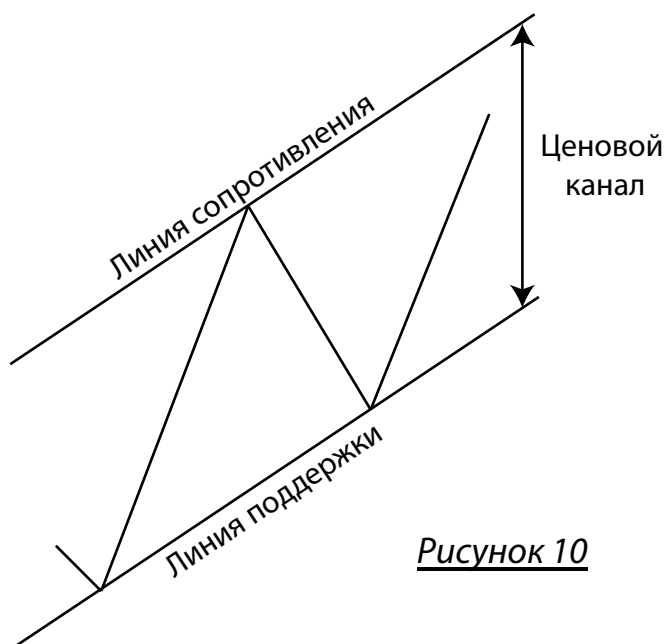


Рисунок 10

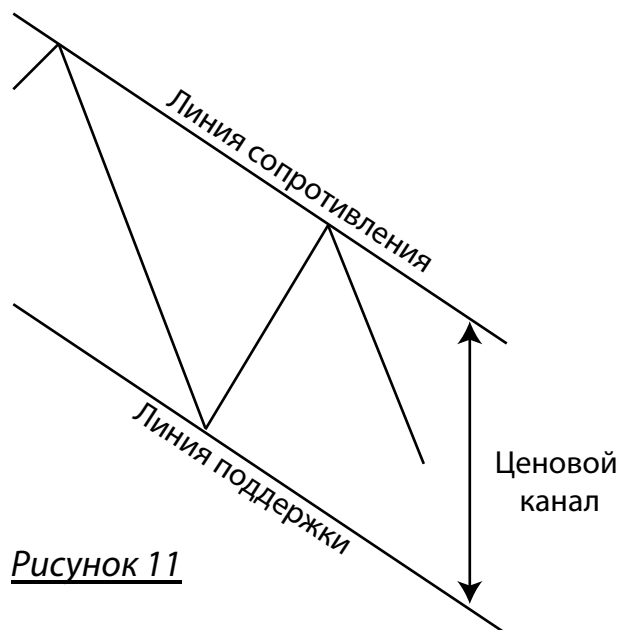
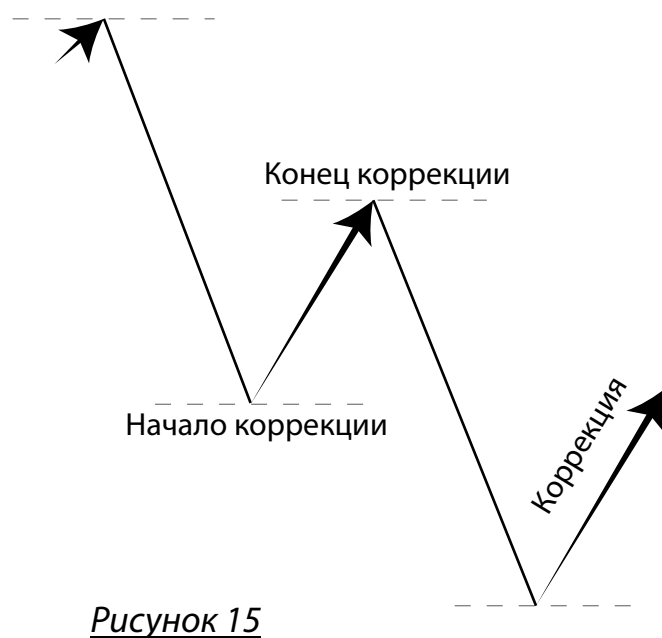
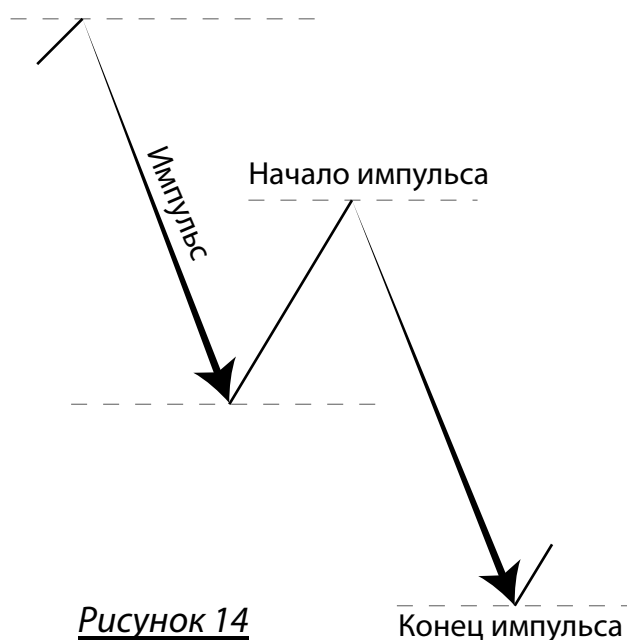
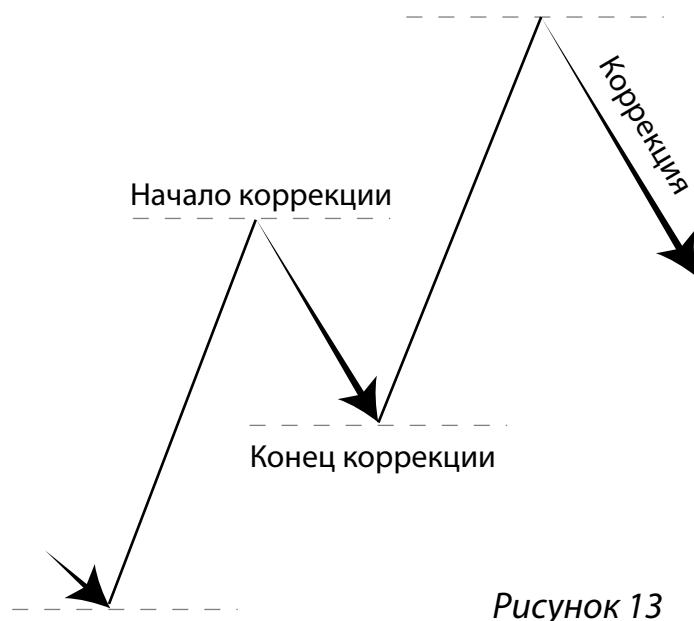
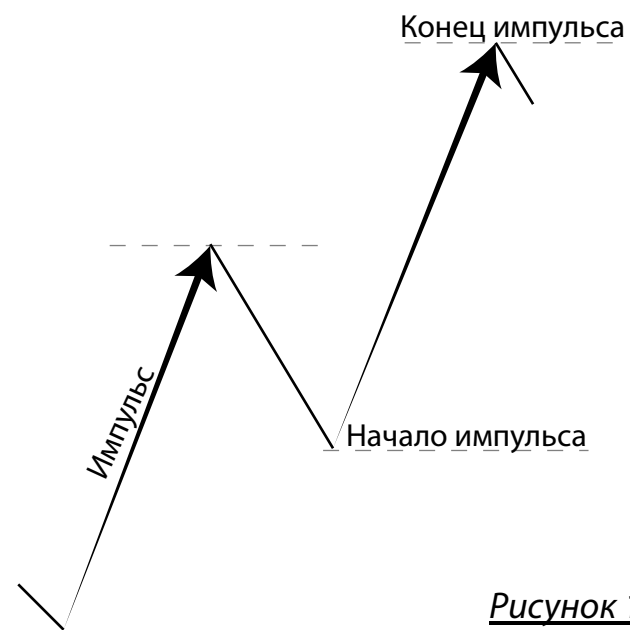


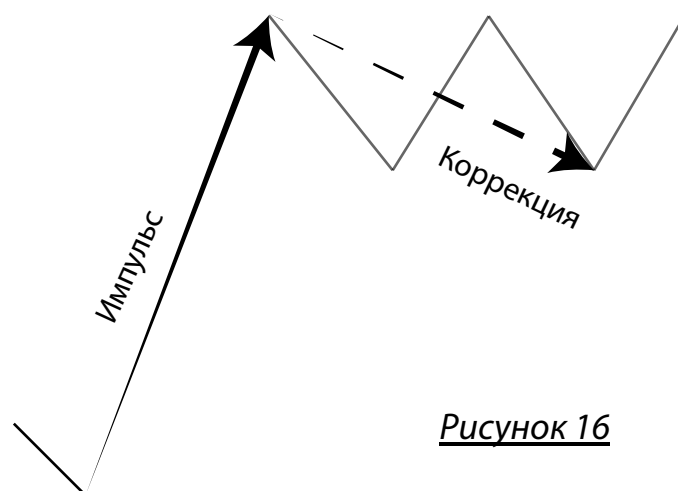
Рисунок 11

Не стоит путать восходящий ценовой канал с восходящим трендом. Если тренд является уже сформировавшимся движением, то ценовой канал — только прогнозируемым направлением дальнейшего движения. Если движение цены будет осуществляться в границах ценового канала, можно говорить о том, что прогноз оправдался и тренд подтвержден.

В ценовых каналах можно выделить импульсное и коррекционное движения. Импульсным движением (импульсом) называется движение в направлении ценового канала. Коррекционным движением (коррекцией) называется движение против направления ценового канала. Импульсное движение всегда сильнее коррекционного, т.е. за импульс цена проходит больше пунктов, чем за коррекцию. Импульс всегда чередуется с коррекцией. В восходящем ценовом канале импульс начинается внизу, а заканчивается сверху; коррекция начинается сверху и заканчивается снизу (рисунки 12 и 13). В нисходящем ценовом канале импульс начинается сверху, а заканчивается снизу; коррекция начинается внизу и заканчивается сверху (рисунки 13 и 14). На графике границами импульса и коррекции являются тени свечей. Импульсное движение длиться не менее трех свечей (в среднем около 20), коррекционное — не менее двух.



В боковом ценовом канале импульсного и коррекционного движения нет: все движения являются равнозначными. Все боковое движение можно считать коррекцией относительно предыдущего импульсного движения (рисунок 16).



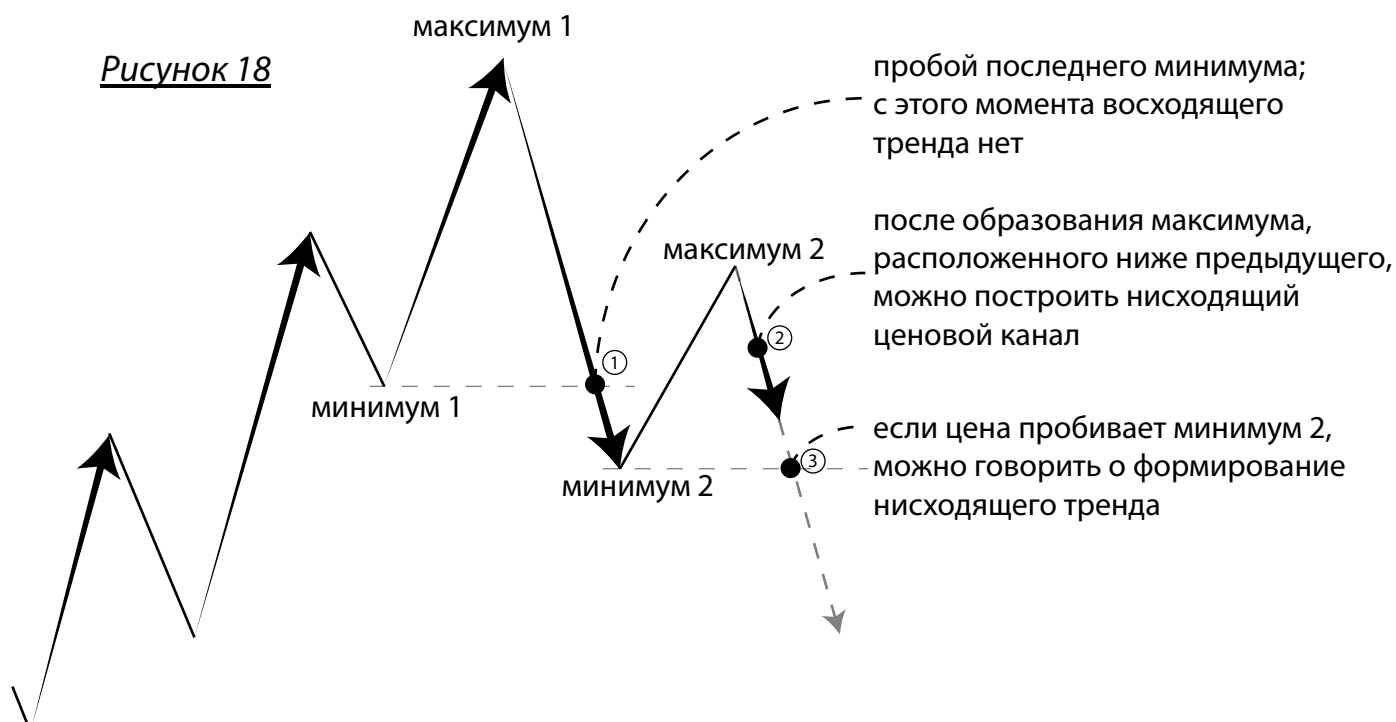
Коррекция может состоять из нескольких ценовых движений. В этом случае при движении цены в восходящем ценовом канале окончанием коррекции будет являться экстремум с наименьшей ценой, а в нисходящем ценовом канале — экстремум с наибольшей ценой. Пока цена не вышла за границы импульсного движения, можно считать, что коррекция продолжается. В этом случае обращать внимание на расположение экстремумов, строить ценовые каналы и искать тренды не нужно. Когда цена преодолевает конец предыдущего импульса, становится очевидно, что коррекция закончилась и начался новый импульс. Началом нового импульса будет являться окончание коррекции (рисунок 17).



Рисунок 17

Если высота коррекции больше высоты импульсного движения и образуются новые минимумы (на восходящем тренде) или новые максимумы (на нисходящем тренде), можно говорить о будущей смене тренда. На рисунке 18 подробно рассмотрена ситуация смены тренда. Сначала на рынке был восходящий тренд. После образования максимума 1 цена пошла вниз и в точке 1 опустилась ниже последнего минимума (минимума 1). С этого момента тренд не определен. После образования минимума 2 и максимума 2 можно построить нисходящий ценовой канал и предположить, что в дальнейшем тренд будет нисходящим. Когда цена опустится ниже минимума 2 (в точке 3), можно уверенно сказать, что тренд — нисходящий.

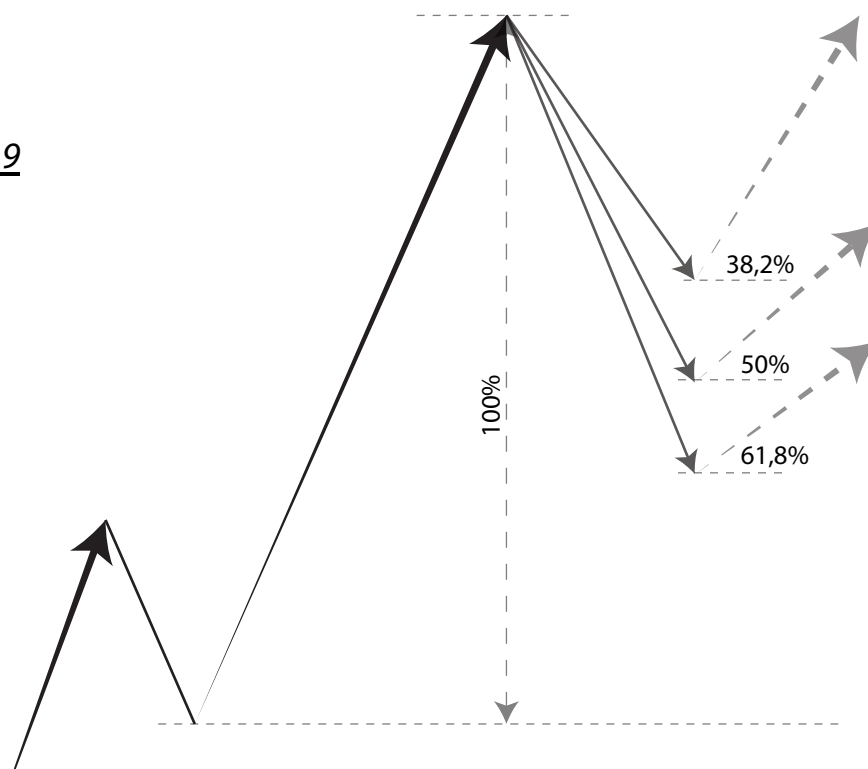
Рисунок 18



Числа и уровни Фибоначчи

Числами Фибоначчи называются элементы числовой последовательности 1, 1, 2, 3, 5, 8, 13, 21, 34, 55, 89, 144, ..., в которой каждое последующее число равно сумме двух предыдущих. Одним из свойств этой последовательности является постоянство пропорций между ее членами. Используя эти соотношения, можно спрогнозировать, где закончится коррекция и начнется новый импульс: коррекционное движение обычно составляет 38,2, 50 или 61,8 процентов от высоты импульсного (рисунок 19). Другие уровни Фибоначчи при торговле по данной стратегии не применяются.

Рисунок 19



В различных торговых терминалах инструмент для определения пропорций импульсного и коррекционного движения может называться «Линии Фибоначчи», «Уровни Фибоначчи» и «Сетка Фибоначчи» (Fibo). Линии Фибоначчи показывают возможные уровни окончания коррекции и начала нового импульса. Причем заметить разворот на рынке можно значительно раньше того момента, когда цена преодолает экстремальное значение предыдущего импульса.

Правила построения сетки Фибоначчи

1. Линии Фибоначчи набрасываются на импульсное движение, т.е. на восходящем тренде снизу вверх, на нисходящем тренде — сверху вниз.
2. Линии Фибоначчи набрасываются на законченное импульсное движение.
3. Линии Фибоначчи строятся по теньям свечей.

Пример построения линий Фибоначчи приведен на рисунках 17 и 18. Стрелка указывает направление набрасывания сетки. Уровень 100 показывает начало импульса, уровень 0 — его окончание. На уровнях 38,2, 50 и 61,8 можно ожидать завершения коррекции.

На рисунке 20 изображен график ценового движения с восходящим трендом. Красная свеча достигла уровня 61,8%. Следующая зеленая свеча закрылась выше уровня 61,8% и образовала экстремум, который сообщает об окончании коррекции и начале нового импульса.

Рисунок 20



Свеча может пересечь уровень Fibo не только телом, но и тенью. На рисунке 21 представлен график ценового движения с нисходящим трендом. Сначала зеленая, а затем и красная свеча тенью коснулись уровня 50%. После закрытия красной свечи образовался максимум. Таким образом, цена отскочила от уровня 50%, и с красной свечи началось новое импульсное движение.

Узнать о том, что цена отскочила от уровня Fibo можно только после образования экстремума, т.е. спустя одну свечу, которая называется сигнальной. Важно, что бы цена закрытия сигнальной свечи была выше уровня Fibo на восходящем тренде и ниже уровня Fibo на нисходящем тренде. Если данное условие не соблюдено, это означает, что отскок еще не произошел и нужно ждать появления свечи, которая телом пересечет соответствующий уровень. Это свеча и будет сигнальной.

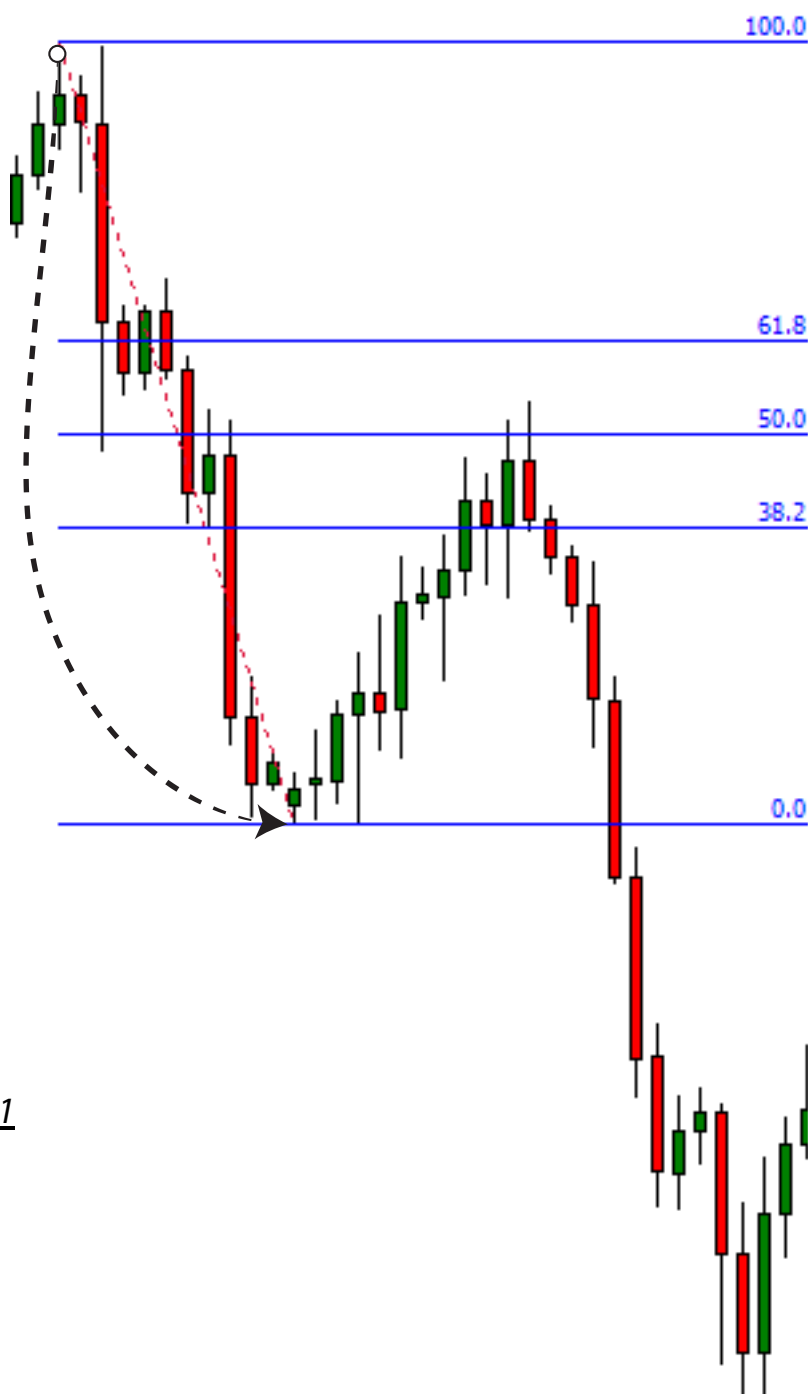


Рисунок 21

Правила торговли по уровням Фибоначчи

На рисунке 22 импульсное движение направлено вверх. После образования двух красных свечей можно предположить, что импульс закончился и началась коррекция. В этот момент на восходящее движение необходимо набросить сетку Фибоначчи. На красной свече (в точке 2) цена тенью коснулась уровня 38,2. На следующей, зеленой свече произошел отскок от уровня, т.к. свеча закрылась выше уровня 38,2. В первые секунды после открытия новой свечи нужно открывать сделку на покупку.

При торговле по линиям Фибоначчи на восходящем тренде SL ставится на последний минимум, на нисходящем — на последний максимум. SL выставляется по теням свечей.

TP можно выставить на уровень окончания предыдущего импульсного движения, т.е. на последний максимум для восходящего тренда или последний минимум для нисходящего тренда. Но, как правило, цена преодолевает значительно большее расстояние, поэтому предлагаю не ограничивать прибыль, выставляя TP. В этом случае за сделкой необходимо следить самостоятельно и закрывать её при первых признаках разворота рынка. В качестве сигнала об окончании импульса рекомендую использовать сигнал индикатора «Скользущая Хала».



Рисунок 22

Торговать по описываемой стратегии можно на таймфреймах H1, H4 и D1. Причем на рынке может иметь место ситуация, когда на разных периодах наблюдаются разные тренды. В этом случае нужно рассматривать каждый таймфрейм независимо от остальных.

Если ценовое движение, направленное противоположно импульсу, не достигло уровня 23,6, то оно не считается коррекционным. Если же такое ценовое движение пересекло уровень 23,6, но не достигло уровня 38,2, то оно является коррекционным, но сделка по данной стратегии в начале нового импульсного движения не открывается (рисунок 23).

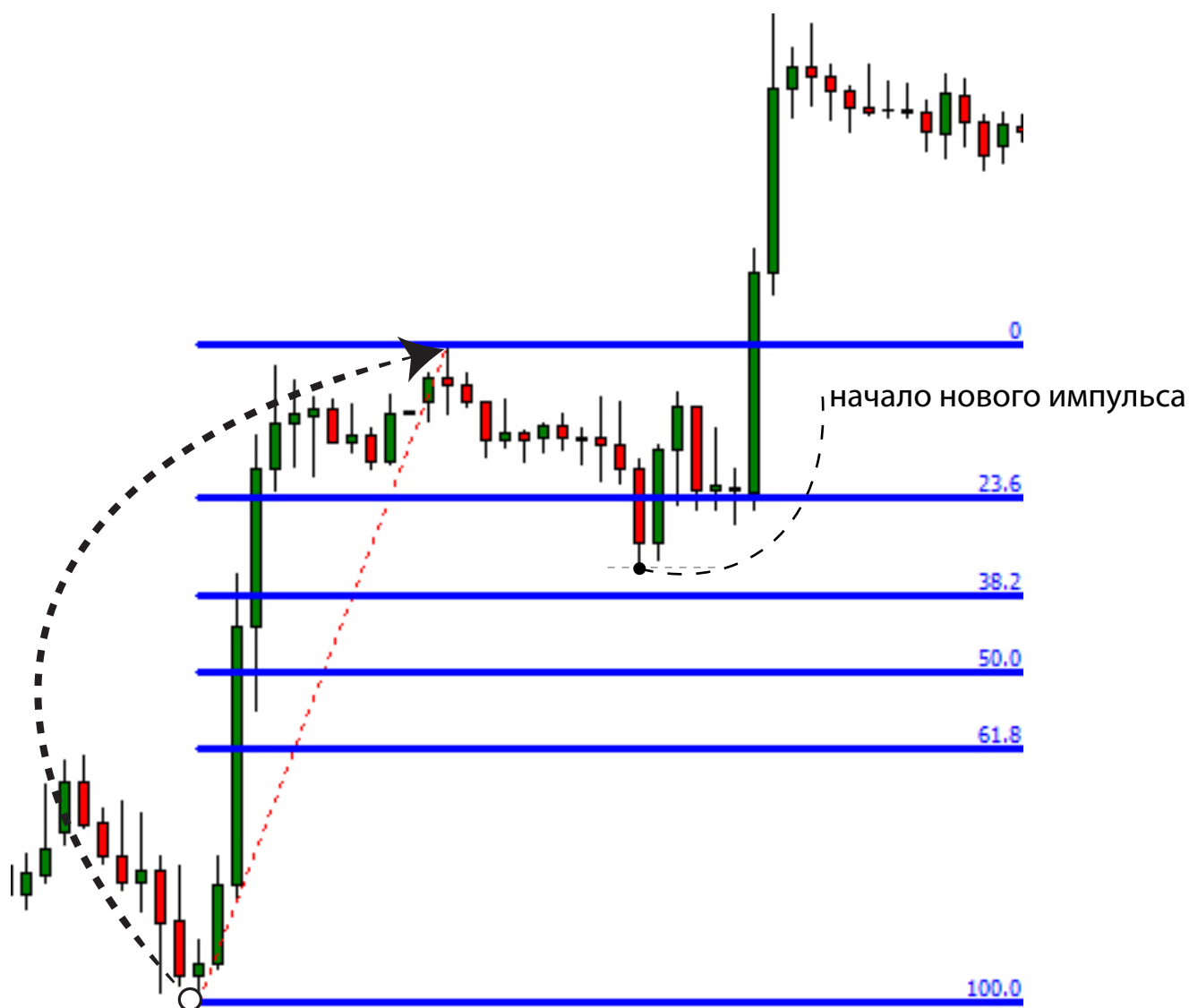


Рисунок 23

После появления нового импульсного движения сетку Fibo нужно перестроить: удалить со старого импульса и набросить на новый. Если при коррекционном движении свеча тенью пробивает уровень окончания импульсного движения, также необходимо перестроить линии Fibo на новые экстремумы.

На рисунке 24 зеленой стрелкой показано первоначальное направление набрасывания сетки Fibo. В процессе коррекции красная свеча тенью проколола уровень окончания импульса (уровень 0). После этого необходимо перестроить сетку Fibo на новый максимум (по тени красной свечи). Новое направление сетки Fibo показано красной стрелкой. После перестроения сетки необходимо открывать сделки, ориентируясь на новые уровни (рисунок 25).



Рисунок 24



Рисунок 25

Если импульсное движение длится более двух дней, сетку Fibo лучше набрасывать на периоде H4, если менее двух дней, то подойдет таймфрейм H1.

При высокой волатильности рынка на таймфрейме H1 лучше переключиться на более старший таймфрейм, где активность рынка не так заметна. Это позволит избежать ложных сигналов. На рисунке 23 приведено сравнение графиков двух таймфреймов одного и того же периода. Стрелками обозначены свечи, на которых необходимо открывать сделки. На таймфрейме H1 было открыто три сделки, две из которых оказались убыточными, на таймфрейме же H4 была открыта только одна прибыльная сделка.

Если на таймфрейме H1 распознать направление тренда не удастся, необходимо также переключиться на старший таймфрейм или подождать образования новых экстремумов.



Рисунок 26

Если при коррекционном движении свеча закрылась за уровнем 80, сетку Fibo необходимо удалить. Для построения следующей сетки необходимо дождаться образования новых экстремумов (рисунок 27).

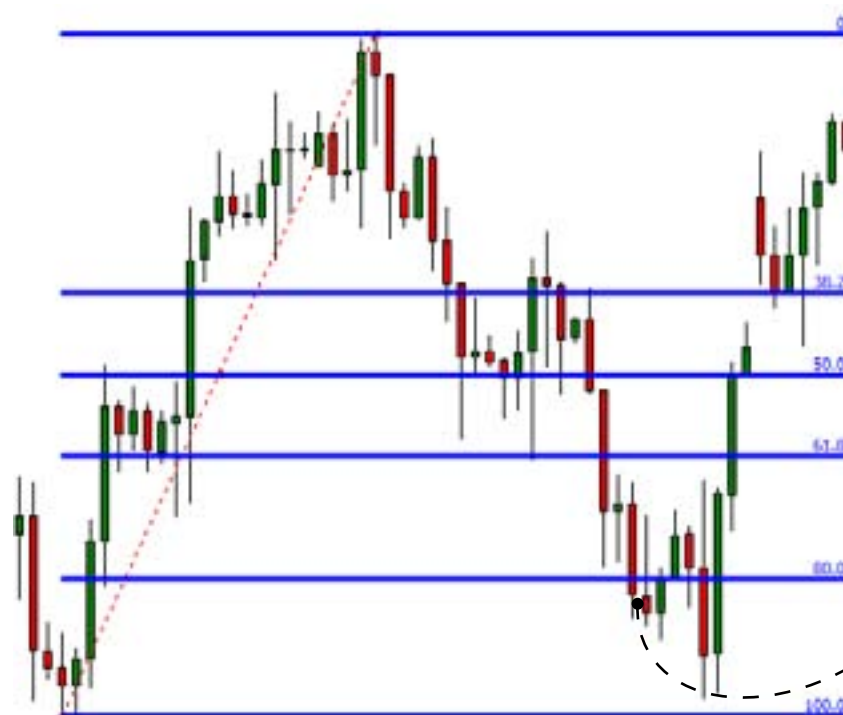


Рисунок 27

красная свеча закрылась ниже уровня 80; сетку можно удалять.

Сигнальная свеча не должна быть доджем, т.е. свечей с небольшим телом и большими тенями. При формировании доджа во время отскока сигнальной является следующая свеча после доджа. На восходящем тренде не стоит открывать сделку после свечи с большой тенью сверху (модель «повешенный»), а на нисходящем тренде — после свечи с большой тенью снизу (модель «молот»).

Для эффективной торговли с использованием уровней Fibo высота импульсного движения на валютной паре EURUSD должна составлять не менее 800 пунктов.

И, наконец, главное правило использования Fibo:

Есть тренд - набрасываем сетку. Нет тренда – ждем.