Стакан ордеров Оанда: часть1. Описание инструмента

Это руководство, состоящее из пяти частей, должно помочь новичкам быстрее освоиться со стаканом ордеров.

В нем мы постараемся ответить на часто задаваемые вопросы, а также привести примеры использования этого инструмента на практике.
Навигация по частям:

- Стакан ордеров Оанда: часть 1. Описание инструмента.
- Стакан ордеров Оанда: часть 2. Базовые сигналы.
- Стакан ордеров Оанда: часть 3. Тонкости и фишки.
- Стакан ордеров Оанда: часть 4. Сигналы по Стакану Ордеров.
- Стакан ордеров Оанда: часть 5. Примеры комплексного анализа.

Что такое «Оанда»

Оанда – это один из крупнейших американских брокеров, предоставляющих услуги на рынке Форекс. Является членом 8 регулирующих организаций на финансовых рынках.

Клиентская база этого брокера построена таким образом, что она является репрезентативной выборкой для оценки всего рынка Форекс. Представьте себе, что Оанда – это 1% всех трейдеров на рынке. И если четверть из них захочет купить евро, с высокой вероятностью четверть из 99% остальных трейдеров также будет покупать евро.

Более простым примером будет сравнение данных Оанды с результатами экзит-полов. Как известно, параллельно с выборами всегда проводятся экзит-поллы и, обычно, результаты последних всегда близки к результатам самих выборов. А теперь представьте, что данные Оанды – это экзит-полл, а весь Форекс – это и есть выборы.

Именно понимание этого дает нам право использовать стакан ордеров от брокера Оанда в качестве источника торговых сигналов.

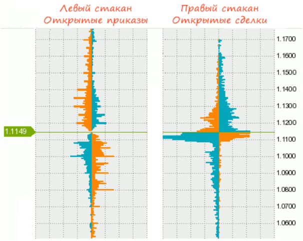
Отчет о прибыльности трейдеров, в частности и брокера Оанда.

Что такое стакан ордеров Оанда

В первую очередь, это аналог биржевого стакана, только для рынка Форекс.

В нем вы увидите сделки трейдеров, которые открыты на данный момент и уровни, где эти трейдеры выставили свои стоп-приказы.

Стаканов два, выглядят они таким образом:



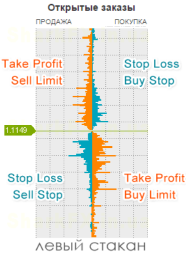
В левом стакане отображаются все отложенные сделки, в т.ч. и стоп-приказы, поэтому его еще называют **открытые приказы**.

В его левой части находятся ордера на продажу, а в правой – на покупку.

Вот наименования ордеров, которые попадают в этот стакан:

- Stop Loss, Take Profit.
- Buy Limit, Sell Limit.
- Buy Stop, Sell Stop.

Располагаются они в нем таким образом:



Если разбить по цвету, то **оранжевый цвет** – это лимитные ордера и ордера тейк профит. **Синий цвет** – это стоп лоссы и стоп ордера.

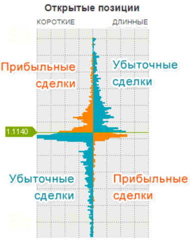
Если кто не знает, в чем разница между лимитным и стоп ордером, почитайте.

Для нас важно запомнить, что синие ордера ускоряют движение, а оранжевые замедляют.

В правом стакане отображаются открытые сделки трейдеров на текущий момент. Это сделки, которые ранее были открыты, но до сих пор еще не закрыты.

В левой части находятся сделки на продажу, а в правой – на покупку.

Схема правого стакана:



Правый стакан

В этом стакане **синий цвет** – это убыточные сделки, а **оранжевый** – прибыльные. Это важно, запомните.

А теперь оцените крутость стакана от Оанды по сравнению с обычным биржевым стаканом. Картинка.

Итак, мы определили, в чем разница между левым и правым стаканом, далее левый стакан будем называть *открытыми приказами*, а правый – *открытыми позициями*, а оба стакана вместе – просто *стаканом*.

Как формируется стакан

Новый слепок стакана формируется каждые 20 минут. Внимание! После формирования он выкладывается в общий доступ в **xx:05, xx:25, xx:45** минут каждого часа. Это означает, что часовая свечка может начаться, а первый стакан к ней появится только через 5 минут.

Нас часто спрашивают, что отображается в стакане: объемы или количество сделок. Отвечаем: в стакане Оанда отображены объемы, но в виде процентов.

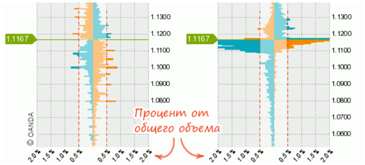
Порядок формирования стакана:

- Определяется суммарный объем по валютной паре, отдельно для приказов и для позиций.
- Сделки распределяются по округленным уровням. Например, сделки по ценам: 1.1250, 1.1251, 1.1249 в стакане Оанда отображаются на уровне 1.1250.

- Определяется процент сделок от общего объема на каждом из этих уровней.

В итоге мы получаем данные в таком виде: ценовой уровень – процент от объема. Если собрать эти уровни по порядку, получится стакан.

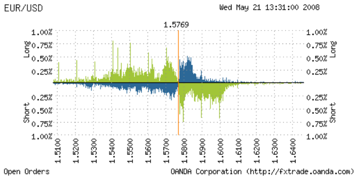
Обычно, один столбик объемов в стакане имеет от 0 до 2%. Поэтому на картинке есть сетка с шагом 0,5%:



Сетка объемов может помочь нам определить важные уровни. Например, важными можно считать уровни, объем которых превышает 0,5%. Эта зона выделена на изображении сверху.

Однако вы не должны бездумно отсеивать объемы, которые меньше 0,5%. Бывает, что и они дают полезную информацию.

Немного истории стакана. Изначально стакан Оанды был более точный, такой как на картинке ниже.



Но потом, по каким-то своим причинам, им пришлось «смазать» данные. И, как видите, сейчас погрешность может составлять от 5 до 20 пунктов. Но трейдингу это не сильно мешает и в каком-то плане даже стало легче определять уровни.

Маржинальная торговля и стакан

Маржинальная торговля подразумевает две сделки вместо одной. Сперва вы покупаете, а потом, для закрытия этой сделки, вы должны продать.

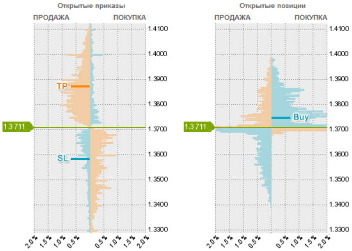
Именно за счет этого формируется связь между левым и правым стаканом. Например, если в левом стакане выбивают пачку стоп лоссов, то из правого стакана пропадет часть сделок. Но сложно сказать, какие конкретно сделки были выбиты.

Будет хорошо, если вы сами поймете, как формируется связь между этими стаканами.

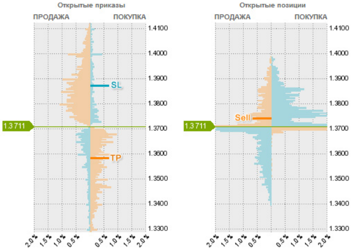
Как отобразятся ваши сделки в стакане Оанда:

1. Допустим, совсем недавно вы открыли сделку на покупку (на данный момент она в

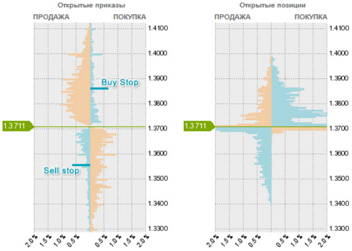
убытке) и выставили по ней стоп-приказы:



2. Открываем вторую сделку на продажу (на данный момент она в прибыли) и выставляем по ней стоп-приказы:



3. Допустим, цена движется в канале 300 пунктов, и мы выставляем Buy stop и Sell stop по обеим сторонам с целью прорыва канала:



Какие выводы вы должны из этого сделать:

- Если выбивают стоп лоссы на продажу (левый стакан), это значит, что из рынка выбили покупателей и, наоборот, если выбили стоп лоссы на покупку – из рынка ушли продавцы.

- На одну открытую сделку может приходиться два объема отложенных приказов. А если будет выставлен только стоп лосс, то один объем. А если и стоп лосс не ставить, то 0 объемов. Все это вносит небольшую погрешность в связь между стаканами.

- Наличие в стакане лимитных ордеров и стоп ордеров не означает, что они будут исполнены, если цена туда дойдет. Их можно передвинуть либо отменить. Логичным будет предположение, что стакан ордеров допускает некоторые манипуляции. Например, на фондовых рынках стакан с лимитными ордерами сильно роботизирован и его эффективность упала. К счастью, стакан Оанды таким не страдает, но манипуляции возможны.

- Новые открытые сделки в стакане появляются только, если по этим уровням прошлась цена. Открытые сделки не могут спонтанно появится где-то ниже или выше цены.

Стакан в динамике

Очень важным этапом в анализе Стакана является анализ динамики его формирования.

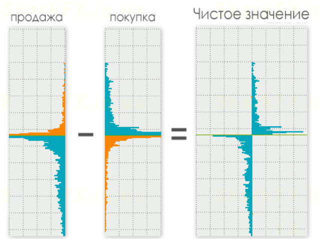
В инструменте Стакан Ордеров проведите мышкой по графику. В **левом стакане** вы заметите, как на определенных уровнях растут объемы, на других падают, а на некоторых ничего не происходит. Из этого можно сделать вывод, что если на каком-то уровне активно появляются сделки, значит уровень интересен и цена будет с ним взаимодействовать.

В **правом стакане** мы будем видеть, что на каких-то уровнях покупки закрываются быстрее, чем продажи или наоборот.

Очень ценную информацию можно извлечь, когда цена сперва сходила вверх/вниз, а потом вернулась на изначальную позицию. Если сравнить стаканы с одинаковой ценой, после каких-то манипуляций, часто становится понятным, в чем была суть этих манипуляций.

Чистое значение и масштабирование

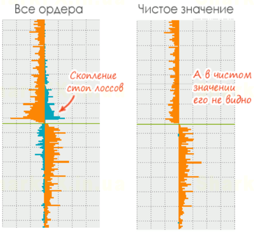
Чистое значение – это разница между продажей и покупкой. Подробнее на картинке:



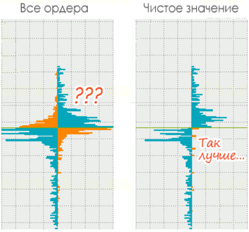
«Чистое значение» помогает находить уровни, на которых доминируют либо покупки, либо продажи.

Многие полагают, что равенство покупок и продаж (в чистом значении почти пусто) нейтрализует ценовой уровень и он перестает быть интересным. Полностью согласиться с этим утверждением мы не можем, но в какой-то степени доля правды в этом есть.

В **левом стакане** при включенном чистом значении хорошо видны «зубики» со стоп лоссами, однако их не хуже видно и без чистого значения. Бывают еще ситуации, когда, наоборот, чистое значение вредит, например:



В **правом стакане** (открытые сделки) чистое значение работает лучше. Вблизи цены правый стакан всегда выглядит «напичканным» и сложно разобрать, кто доминирует на уровнях – продавцы или покупатели. Чистое значение очень хорошо в этом помогает, убедитесь сами:



Более подробно о применении чистого значения поговорим в следующих частях руководства.

Стакан также можно увеличить, нажав на кнопочку **«Масштаб»**.

В результате диапазон охватываемых цен сократится примерно в два раза, а сами цены прорисуются более детально.

Масштаб хорошо использовать для более точного определения уровней скопления.

Конец первой части

Надеемся, что у нас получилось максимально просто донести основные принципы при работе со стаканом Оанда.

Если у вас по-прежнему остались вопросы, задавайте их в комментариях.

Следующая часть руководства.

Заметили ошибку? Пожалуйста, сообщите нам о ней.

@ 2019 fxssi .com Все права защищены

Прогнозы и аналитика

- Дневные прогнозы
- Еженедельные прогнозы
- Аналитика
- Новости форекс

Инструменты

- Current Ratio
- DOM Snapshots
- Ratios
- Order Book
- Profit Ratio pro
- Trading Activity pro
- Open Interest pro

Индикаторы MT4

- FXSSI.Sentiment.Lite
- FXSSI.OpenInterest
- FXSSI.TradingActivity
- FXSSI.Derivatives
- RoundLevels
- Better Volume
- FXSSI.TradingSessions
- FXSSI.Calendar
- Spread.Warner
- PivotPoints.All-In-One
- FXSSI.StopLossClusters
- FXSSI.CurrentRatio
- FXSSI.ProfitRatio
- FXSSI.Ratios
- FXSSI.OrderBook

Предупреждение о рисках

Торговля с использованием кредитного плеча несет высокий уровень риска. Вы можете потерять часть или все свои средства.

Используя наши сервисы, Вы соглашаетесь с тем, что наша команда не несет ответственности за возможные убытки. Мы не обещаем и не гарантируем прибыль.

Мы рекомендуем Вам получить независимую финансовую консультацию, и удостовериться в своих знаниях, прежде чем приступить к торговле.