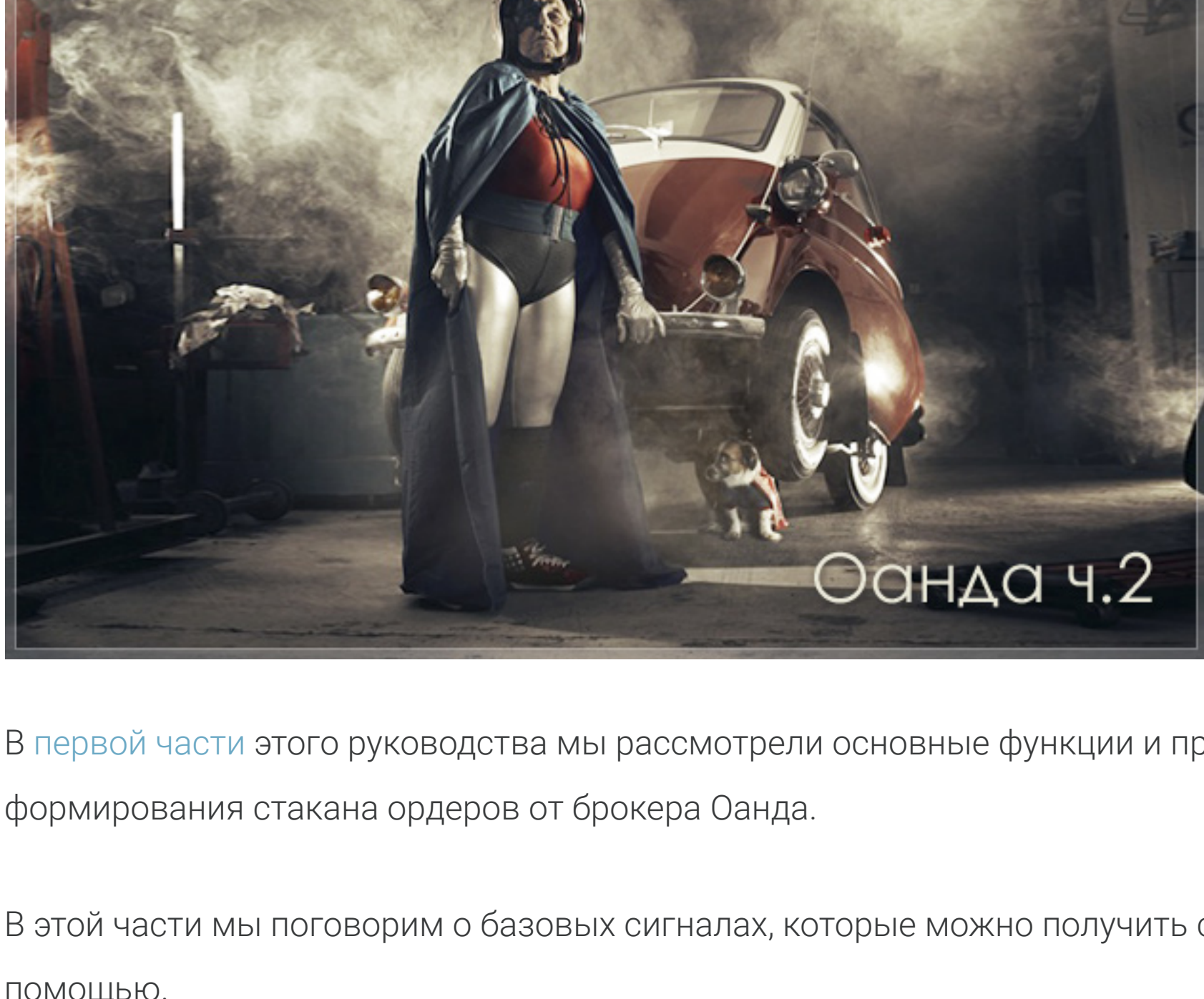


Стакан ордеров Оанда: часть 2. Базовые сигналы



В **первой части** этого руководства мы рассмотрели основные функции и принципы формирования стакана ордеров от брокера Оанда.

В этой части мы поговорим о базовых сигналах, которые можно получить с его помощью.

Всего есть 4 базовых сигнала: два для левого стакана и два для правого.

Скопление стоп лоссов (левый стакан)

Одна из древнейших легенд Форекса гласит о том, что крупные игроки охотятся за стоп лоссами мелких игроков. Неизвестно, что на самом деле происходит, возможно, стоп лоссы интуитивно ставятся на уровни, куда цена придет либо цена таки преднамеренно за ними ходит.

Но из опыта наблюдения за стаканом, можно точно сказать, что цена учитывает стоп лоссы и при первой удобной возможности их выбивает.

В стакане ордеров Оанда эти стоп лоссы очень хорошо видны:



Но не все скопления стоп лоссов являются рабочими. Есть ряд критериев, которым должно соответствовать это скопление, чтобы его можно было использовать в качестве сигнала:

- Правильная форма, как на картинке ниже. Очень важно, чтоб это было действительно скопление, а не один столбик.
- Находится возле текущей цены +/- 100 пунктов. Так сказать, первый на очереди.
- Максимальный объем в начале скопления (ближе к цене).
- Лимитные ордера (оранжевые) должны быть ниже или на уровне со стоп лоссами. Пример на картинке.
- Лимитных ордеров должно быть меньше, или примерно столько же, сколько и стоп лоссов.



Для нас не играет особой роли из каких ордеров состоит это скопление (оно может быть из стоп лоссов и из бай\селл стоп ордеров). Для рыночных драйверов эти ордера выглядят одинаково.

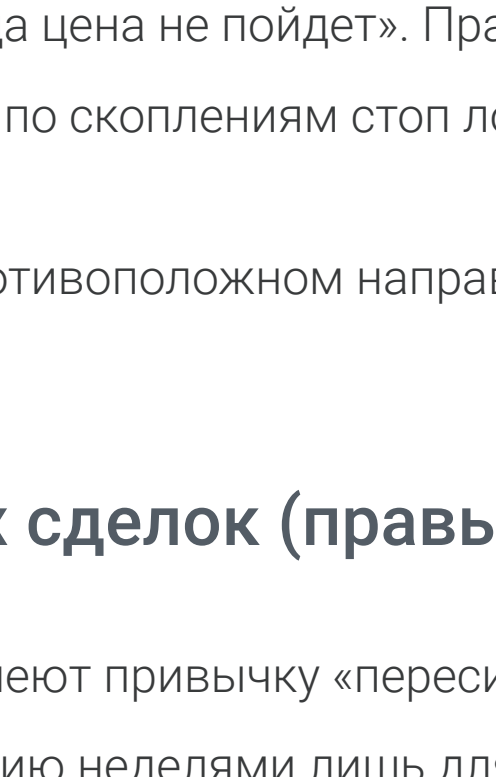
Все вышеописанное не является сигналом к развороту либо к продолжению тренда, а выступает как целевой уровень. На практике такие скопления необходимо использовать как цель сделки, выставляя на этот уровень свой тейк профит. Некоторую информацию на эту тему вы можете почерпнуть из [этой](#) статьи.

Поддержка и сопротивление (левый стакан)

В левом стакане оранжевым цветом отображены тейк профиты и лимит ордера. Сосредоточение таких ордеров вблизи цены может служить уровнем поддержки или сопротивления.

Важным условием для работы таких уровней является малое количество либо полное отсутствие стоп лоссов на этих же уровнях. Если стоп лоссы есть, значит сигнал аннулируется.

Пример уровня поддержки из практики (описание под картинкой):



- На первой картинке видно скопление, которое можно воспринимать как поддержку.
- На второй цена подошла к этой поддержке.
- На третьей видно, как цена отбилась и пошла вверх.

Эти сигналы несут характер «Куда цена не пойдет». Правда, по качеству и силе они значительно уступают сигналам по скоплениям стоп лоссов.

В целом, торговать следует в противоположном направлении от этих уровней.

Скопление убыточных сделок (правый стакан)

Не очень успешные трейдеры имеют привычку «пересидживать» убыточные сделки. Они могут держать убыточную позицию неделями лишь для того, чтобы закрыть ее по безубытку.

Такая особенность в поведении создает целые скопления из таких сделок. В свою очередь рыночные драйверы любят использовать таких «упертых» трейдеров в качестве движущей силы.

Схема проста: овец загоняют в загон (убыток), а потом стригут по полной (гонят цену против толпы). Рано или поздно «овцам» придется закрыть свою сделку по стоп лоссу либо маржин колу, и каждая из закрытых сделок будет еще сильнее толкать цену против толпы.

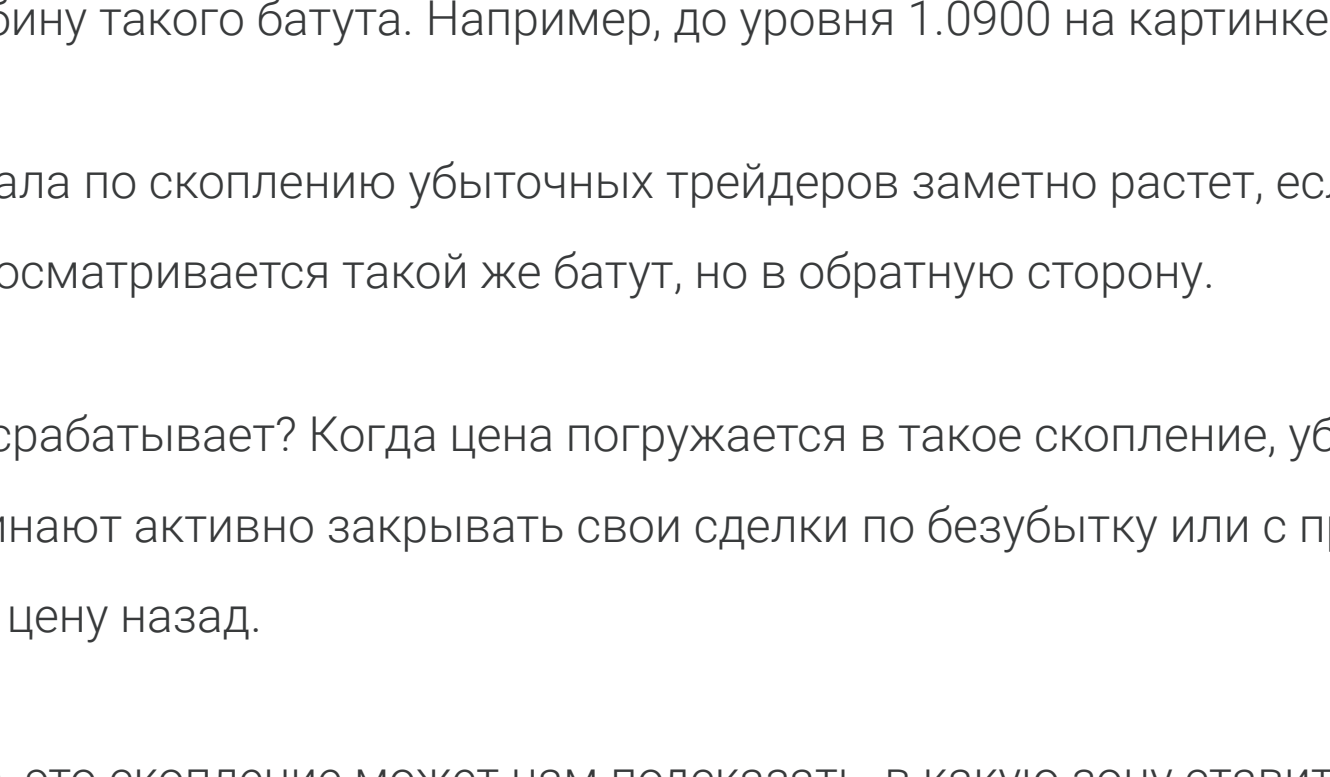
Скопление убыточных сделок отображается в стакане Оанда синим цветом:



При анализе скоплений убыточных сделок важно смотреть как «чистое значение», так и «все ордера», чтобы не упустить какую-то информацию.

Также мы можем использовать эти скопления в качестве «батута», от которого цена должна отскочить. Мы не зря написали «батут», ведь цена перед прыжком может глубоко погрузиться в это скопление, а уже набрав инерцию – прыгнуть.

Пример батута в действии:



Обратите внимание, как цена погрузилась в скопление убыточных сделок, а потом развернулась в обратную сторону. В других подобных случаях цена может погрузиться аж на всю глубину такого батута. Например, до уровня 1.0900 на картинке сверху.

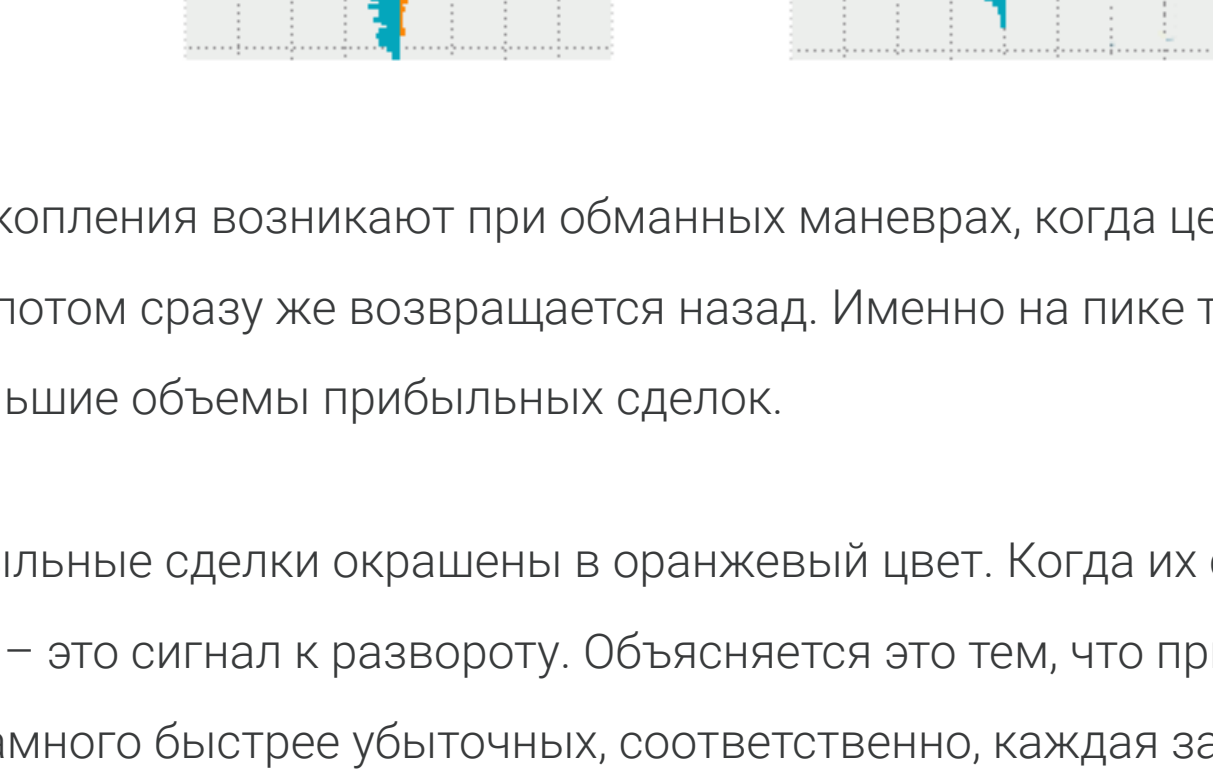
Качество сигнала по скоплению убыточных трейдеров заметно растет, если с обратной стороны не просматривается такой же батут, но в обратную сторону.

Почему батут срабатывает? Когда цена погружается в такое скопление, убыточные трейдеры начинают активно закрывать свои сделки по безубытку или с прибылью, тем самым толкая цену назад.

Кроме отскока, это скопление может нам подсказать, в какую зону ставить свои стоп лоссы:



Скопление прибыльных сделок (Правый стакан)



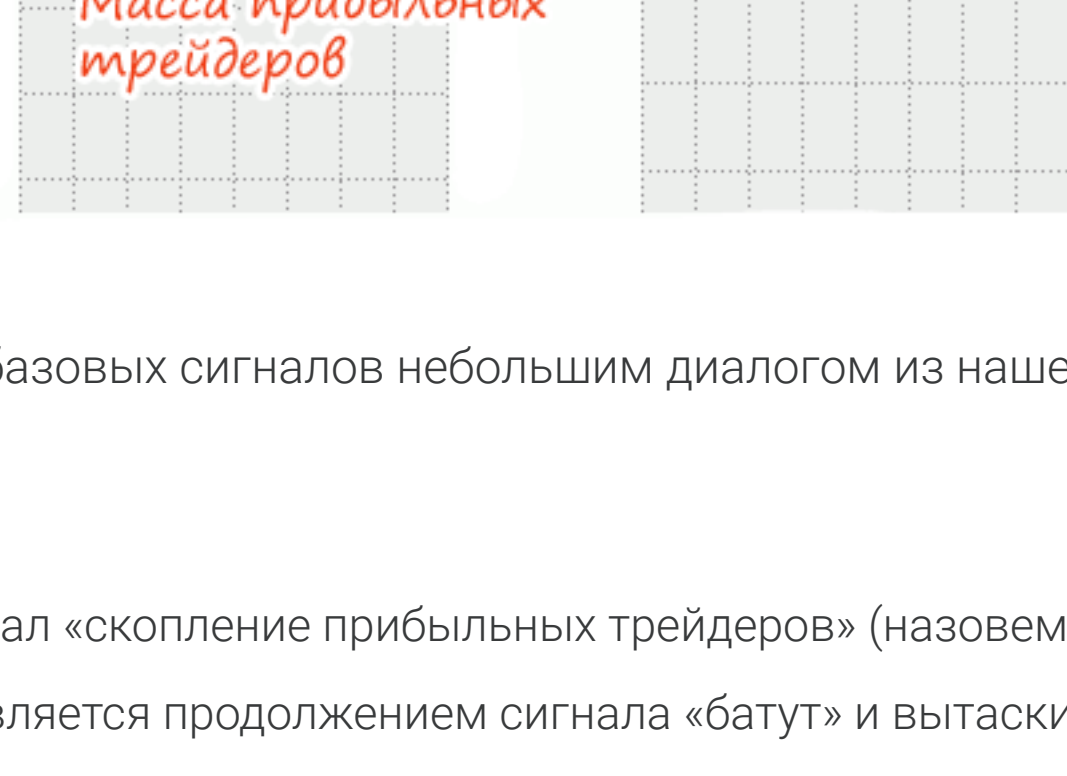
Обычно такие скопления возникают при обманных маневрах, когда цена делает рывок в одну сторону, а потом сразу же возвращается назад. Именно на пике такого рывка появляются большие объемы прибыльных сделок.

В стакане прибыльные сделки окрашены в оранжевый цвет. Когда их становится слишком много – это сигнал к развороту. Объясняется это тем, что прибыльные сделки закрываются намного быстрее убыточных, соответственно, каждая закрытая сделка будет толкать цену назад.

Как правило, масса прибыльных сделок не долго задерживается на рынке, она либо пропадает, либо цена возвращается, а сделки превращаются в убыточные.

Такие скопления хуже видны в «чистом значении», но во «всех ордерах» их четко видно. Однако скопление можно считать истинным, если оно хотя бы частично просматривается в «чистом значении».

Вот еще один пример из практики:



Закончим описание базовых сигналов небольшим диалогом из нашего скайп-чата:

– Получается, сигнал «скопление прибыльных трейдеров» (назовем его «резинка от труссов») по сути является продолжением сигнала «батут» и выталкивает цену обратно?
– Да, верно заметил. Но у резинки не всегда есть батут и, наоборот, бывает, что батута не было, а сверху нарисовалась резинка.

Что еще? Обязательно прочесть!

Учтите тот факт, что стакан Оанда следует анализировать комплексно. Нельзя открывать сделку только потому, что есть стоп лоссы. Будет хорошо, если другие сигналы указывают в том же направлении.

Часто сигналы противоречат друг другу. В начале пути в таких ситуациях лучше не лезть в рынок. Потом у вас сформируется собственный рейтинг сигналов, и вы будете точно знать, какому из сигналов в данный момент можно отдать предпочтение.

Не спешите искать точки входа, ведь стакан в среднем по одной валютной паре дает **2-3 сигнала в неделю**. При этом средние SL, TP должны быть от 40 до 100 пунктов.

Остерегайтесь новостей. И проблема не в том, что цена уйдет в другую сторону, а в том, что она может значительно отклониться от предполагаемой траектории. В итоге окажется, что вы выбрали правильное направление, но ваш стоп-приказ сработал в момент повышенной волатильности. А если вдруг вы подумаете, что его надо было отодвинуть подальше, то вы будете не правы. Об этом подробнее поговорим в следующей части.

Соблюдайте **мани-менеджмент** и не ждите 100% отдачи от сделок совершенных по стакану. Согласно [этой](#) статье, его **эффективность колеблется в рамках 55-60%**. Поэтому у вас обязательно будут убыточные сделки и довольно часто. Но, в целом, тенденция должна быть позитивной.

[К следующей части.](#)

■ Заметили ошибку? Пожалуйста, сообщите нам о ней.