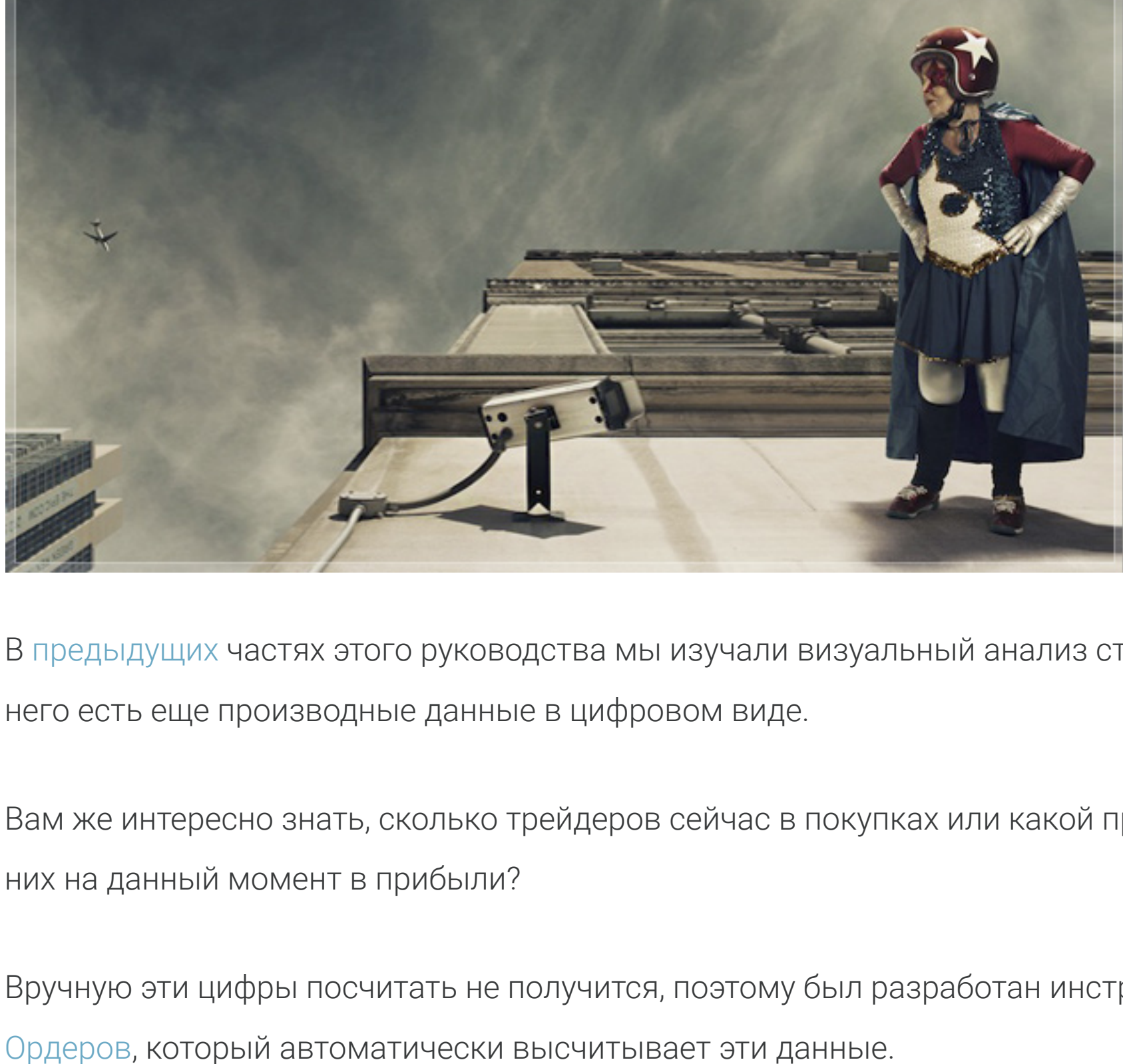


Стакан ордеров Оанда: часть 4. Сигналы по Стакану Ордеров



В предыдущих частях этого руководства мы изучали визуальный анализ стакана. Но у него есть еще производные данные в цифровом виде.

Вам же интересно знать, сколько трейдеров сейчас в покупках или какой процент из них на данный момент в прибыли?

Вручную эти цифры посчитать не получится, поэтому был разработан инструмент **Стакан Ордеров**, который автоматически высчитывает эти данные.

Описание самого инструмента вы можете почитать [здесь](#), а в этой статье мы поговорим о сигналах, которые можем получить с его помощью.

Начнем с самого главного.

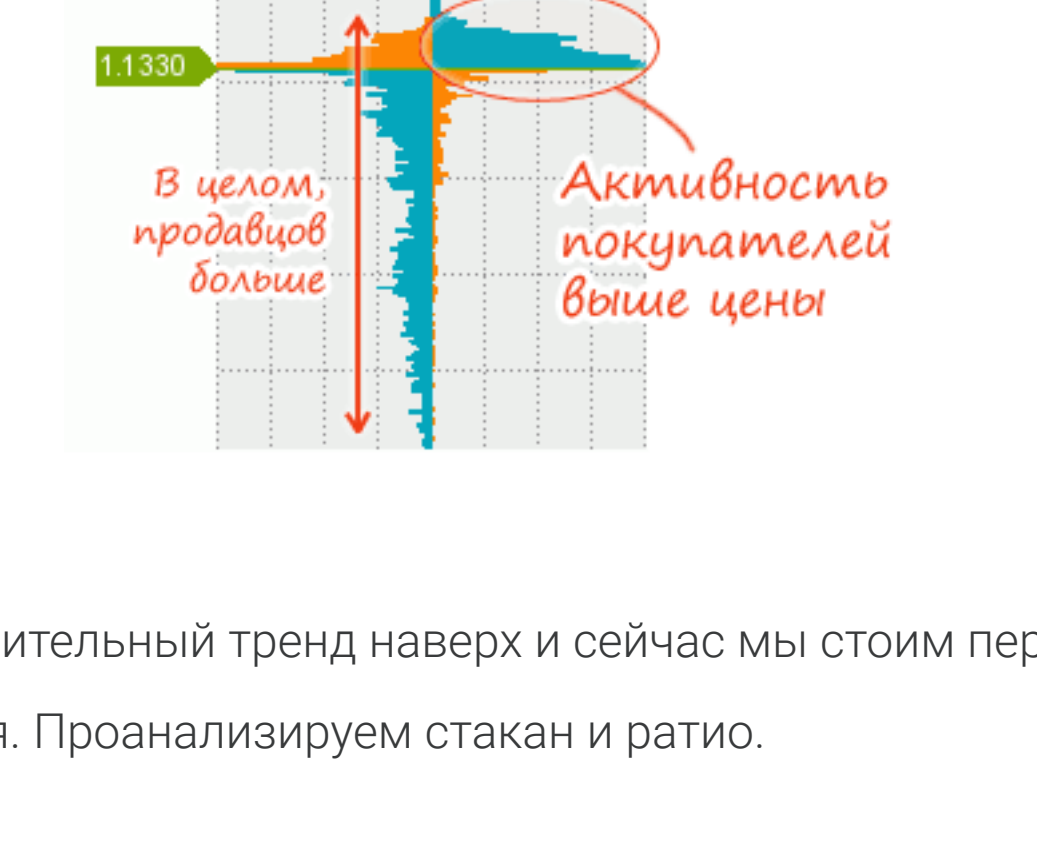
Соотношение покупок и продаж

Мы называем это ратю, от англ. ratio – соотношение.

Существует теория о том, что цена движется против мнения большинства трейдеров. Впрочем, нами это было [доказано](#).

Так вот, зная соотношение позиций трейдеров, например 40% в продажах и 60% в покупках, мы можем ожидать снижение цен на этот актив в будущем.

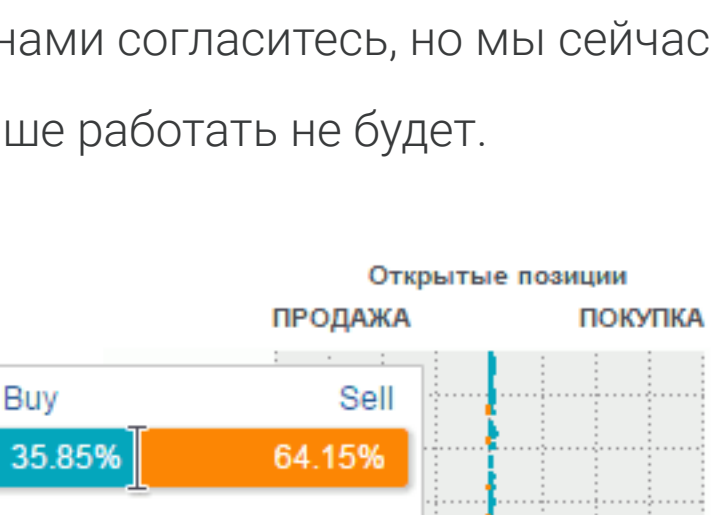
В инструменте Мини Оанда ратю отображается здесь:



Не будем задерживаться на описании самого ратю, это уже было, например, в этих статьях – [1](#), [2](#), [3](#).

В этой статье мы бы хотели остановиться на сравнительном анализе ратю и самого стакана.

То есть кроме анализа самой цифры важно еще видеть расположение этих позиций в стакане. Давайте сразу на примере:



Предыстория. Был длительный тренд вверх и сейчас мы стоим перед выбором: дальше вверх либо коррекция. Проанализируем стакан и ратю.

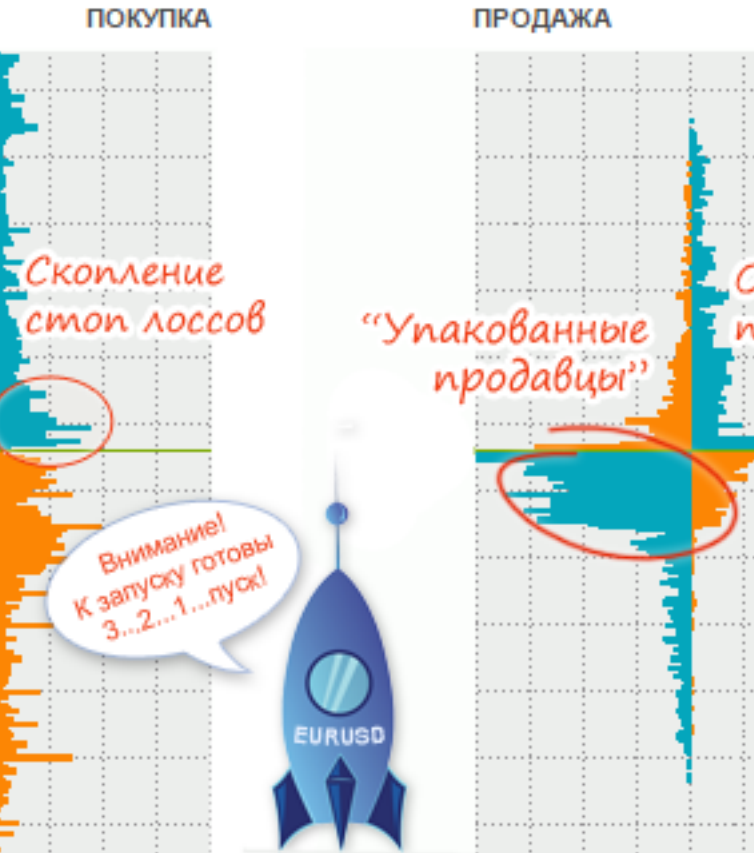
Соотношение позиций (ратю) на картинке выше сигнализирует нам о покупках, т.к. большинство трейдеров находятся сейчас в продажах. Но давайте взглянем на расстановку сил.

Что мы видим? Продавцы растянулись на всю высоту стакана, а покупатели сгруппировались чуть выше цены. При чем покупателей выше цены намного больше, чем продавцов. Это говорит о том, что тренд становится слишком очевидным и на рынке появляется много желающих «запрыгнуть в последний вагон».

А когда уже даже самый ленивый пытается заработать, цена обычно разворачивается.

В принципе, не важно, коррекция это либо разворот, но в данной ситуации цена будет стремиться вниз.

Все логично и вы, наверное, с нами согласитесь, но мы сейчас вам покажу еще одну ситуацию, когда описанное выше работать не будет.



Аналогичная ситуация, за исключением одной особенности. В первом случае выше цены находилось большинство покупателей, а здесь мы видим, что кроме скопления покупателей у нас есть еще и доминирующее скопление продавцов.

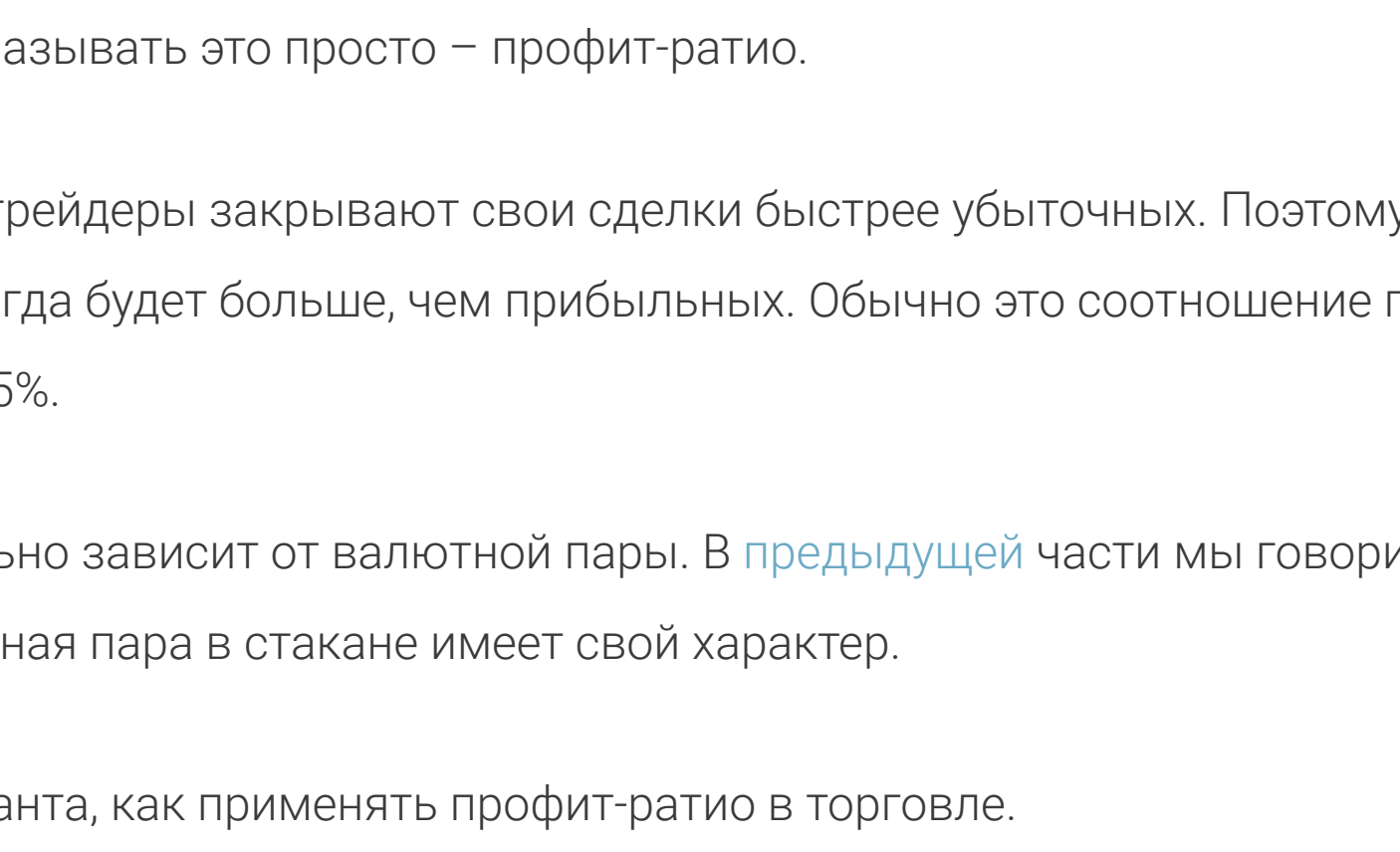
Ситуацию можно трактовать исходя из двух теорий:

- Первая, которая гласит, что толпа не дают зарабатывать. Соответственно, цена пойдет вверх, чтобы не дать продавцам закрыть плюсы.

- Вторая, классическая. Она говорит о том, что продавцы будут закрывать свои сделки покупками, тем самым толкая цену вверх.

И не важно, какой теории вы придерживаетесь, обе в данной ситуации говорят: вверх.

Ну и последняя, практически беспригодная ситуация. Мы это обычно называем так: «продавцы упакованы и ракета готовится к запуску».



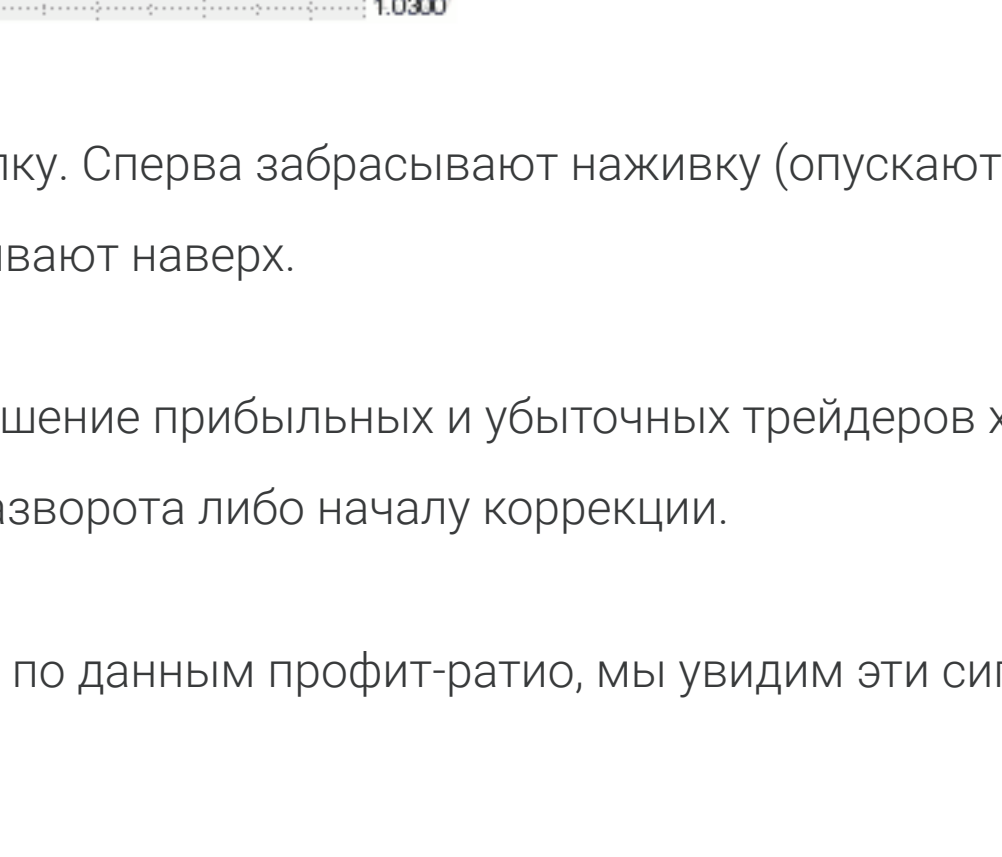
Заметьте, что также нет никаких препятствий сверху в виде навязчивых покупателей.

Ратю – это хорошо и оно работает, но бывают моменты, когда тренд переворачивается, и ратю дает ложные сигналы. Если вы будете параллельно смотреть, что показывает стакан, вы сможете отфильтровать ложные входы.

Соотношение прибыльных и убыточных трейдеров

Это соотношение между оранжевыми и синими в правом стакане. Оранжевые – прибыльные, синие – убыточные, и не важно покупки это или продажи.

В инструменте Стакан Ордеров соотношение прибыльных трейдеров к убыточным отображается здесь:



Далее будем называть это просто – профит-ратю.

Прибыльные трейдеры закрывают свои сделки быстрее убыточных. Поэтому убыточных трейдеров всегда будет больше, чем прибыльных. Обычно это соотношение примерно равно 35% к 65%.

Все очень сильно зависит от валютной пары. В предыдущей части мы говорили, что каждая валютная пара в стакане имеет свой характер.

Есть два варианта, как применять профит-ратю в торговле.

Первый – это определение моментов, когда происходит вытряхивание.

Вытряхивание – это ложное движение цены в одну сторону, с целью убрать лишних участников рынка для последующего движения в другую сторону.

Так вот, анализируя голый график сложно определить, происходит ли вытряхивание, а вот с помощью профит-ратю мы с легкостью это сделаем.

Давайте рассмотрим следующую ситуацию:



Очень похоже на рыбалку. Сперва забрасывают наживку (опускают цену вниз), а потом «подсекают» и вытаскивают наверх.

Таким образом, соотношение прибыльных и убыточных трейдеров хорошо сигнализирует точке разворота либо началу коррекции.

Если построить график по данным профит-ратю, мы увидим эти сигнальные точки в действии:



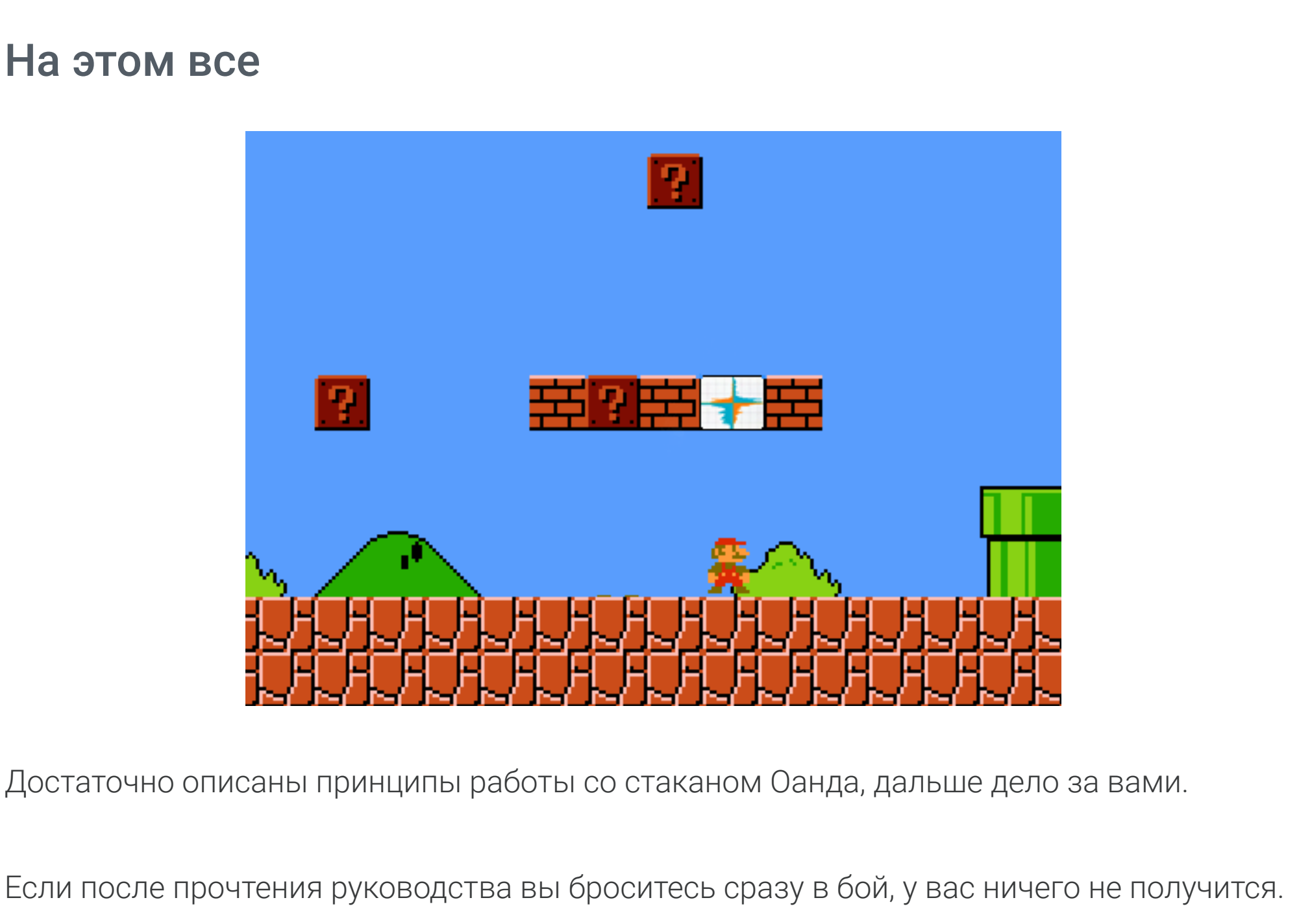
Проблема лишь в том, что неизвестно, когда будет вершина пика. В этом случае надо смотреть, что показывает стакан.

Второй вариант применения профит-ратю – это анализировать его как показатель очевидности тренда. Когда при движении цены количество прибыльных трейдеров растёт, это означает, что само движение становится слишком очевидным и скоро будет разворот.

С другой стороны, когда при движении цены процент прибыльных трейдеров падает, это означает, что толпа не воспринимает это движение и ждет возврата цены. Но возврата не будет.

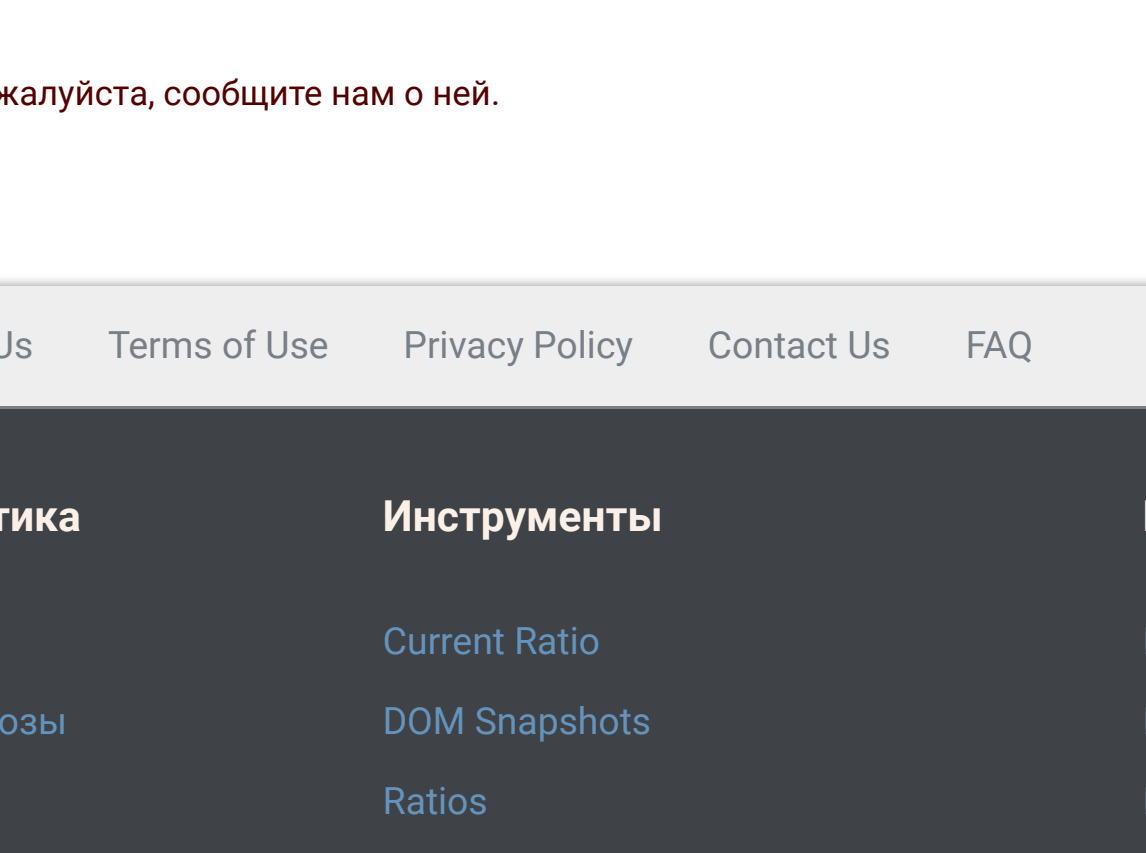
Проще говоря, когда движение ложное – процент прибыльных растёт, когда истинное – процент прибыльных падает.

Проще, чем на картинке, не объяснить:



Анализировать профит-ратю следует в инструменте Стакан Ордеров, где также можно определить пики, рост и снижение этого показателя.

Уровни



Инструмент Стакан Ордеров также имеет вспомогательные уровни:

- Середина объема (MV)** отображает уровень, на котором находится 50% от общего объема как приказов, так и сделок. Середину объема можно рассматривать как указатель тренда. Если MV ниже цены, значит тренд вверх, если MV выше цены, значит тренд вниз.

- Перекупленность (OB), Перепроданность (OS)** – уровни, на которых более 80% покупателей в прибыли для OB и 80% продавцов в прибыли для OS. Приближение цены к этим уровням говорит о возможном, но не обязательном развороте. Например, при боковике эти уровни могут хорошо работать, а если на рынке сильный тренд, они будут сигнализировать хуже.

- Гравити (GR)** – автоматически высчитанное максимальное скопление стоп лоссов. Обязательно проверяйте истинное ли это скопление, т.к. алгоритм пока еще не идеален. Как это применять на практике? Смотрите [базовые сигналы по стакану Оанда](#).

- Поддержка/сопротивление (SR)** – автоматически высчитанное максимальное скопление лимитных ордеров. Как это применять на практике – смотрите базовые сигналы.

Новички воспринимают эти уровни, как очень важную информацию, при этом не оценивают сам стакан. Это неправильно! Нельзя туло следовать черточке на графике, потому что там есть эта черточка. Также нельзя продавать, потому что там гравити вниз. Почему мы правы, читайте в [этой](#) статье.

На этом все

Достаточно описаны принципы работы со стаканом Оанда, дальше дело за вами.

Если после прочтения руководства вы броситесь сразу в бой, у вас ничего не получится. Кроме знаний нужен еще и опыт, а опыт, как известно, – это время. Не спешите и вас у все получится.

У этого руководства будет еще одна часть, но она будет посвящена примерам торговых решений.

Само руководство будет дополняться по мере появления новых функций либо из вопросов, которые вы, кстати, можете оставлять в комментариях.

Следующая часть руководства.

► Заметили ошибки? Пожалуйста, сообщите нам о ней.