

Стакан ордеров Оанда: часть 3. Тонкости и фишки



Продолжаем разбираться со стаканом ордеров Оанда.

Предыдущая часть была посвящена базовым сигналам, которые мы можем получить, используя стакан.

В этой части мы поговорим о тонкостях и особенностях работы со стаканом. Этой информации вы нигде не найдете, т.к. это наш личный опыт.

Также не уверены по поводу возможности применения этих знаний с другими подобными стаканами, но все может быть.

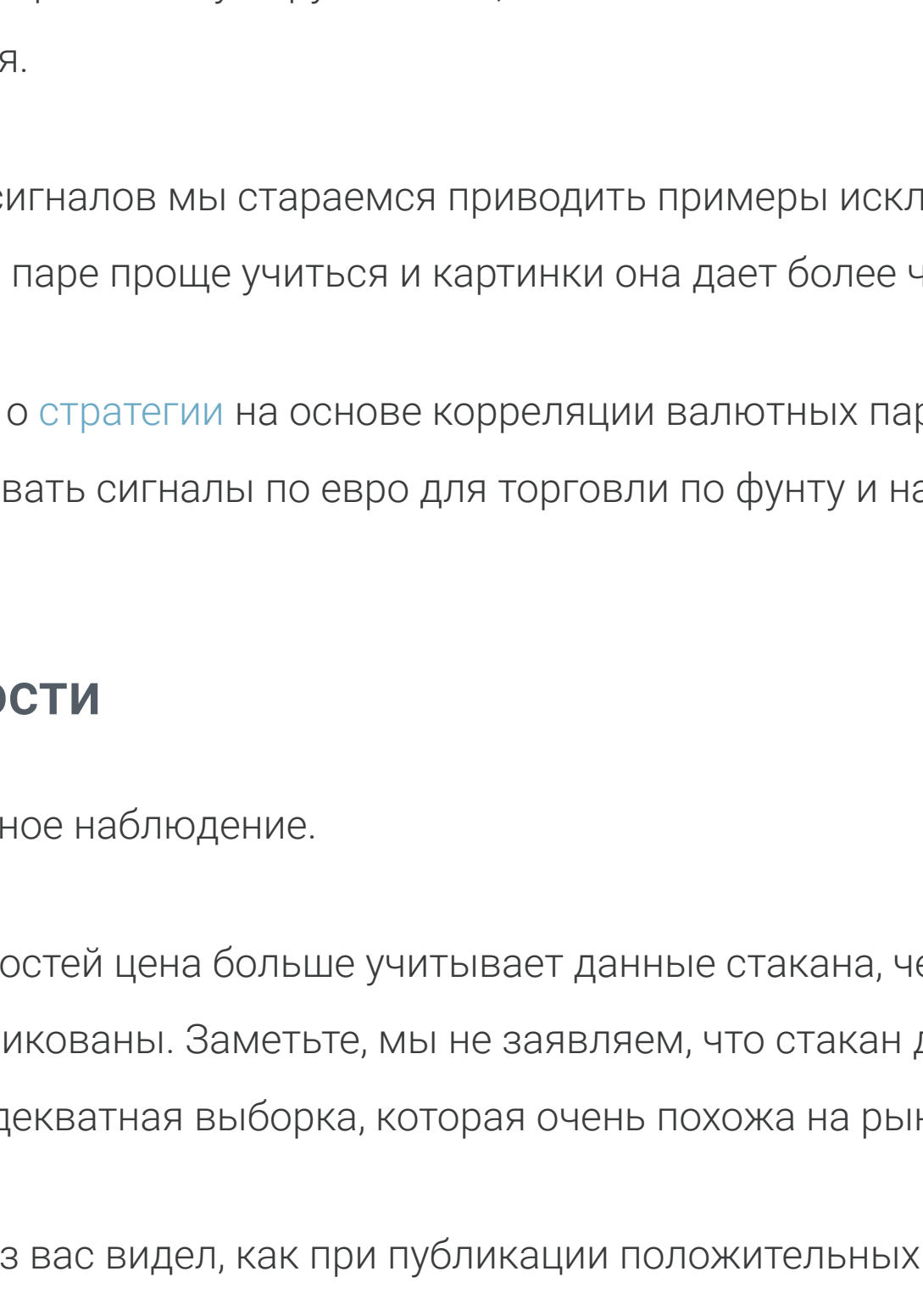
Стакан разный на всех парах



Каждая валютная пара в стакане выглядит и сигнализирует по-разному. Скорее всего, это связано с ликвидностью и популярностью этих пар.

Неликвидные пары, такие как на этой картинке, очень сложно анализировать. Это связано с репрезентативностью выборки. Так как объемы очень маленькие, будут часто возникать отклонения от общей статистики. Представьте себе, что по паре GBP/CHF у брокера Оанда торгует всего 20 трейдеров. Это очень мало, поэтому высока вероятность того, что сделки этих трейдеров не будут похожи на среднестатистические сделки.

Какие пары ликвидные, а какие нет? Сравнивая объемы торгов на всех парах, можно определить ликвидные, среднеликвидные и неликвидные пары. Давайте сравним:



Если построить график по качеству сигналов по этим парам, то он будет иметь примерно такой же вид, как и тот, что сверху. То есть EUR/USD дает наиболее точные сигналы, а GBP/CHF – самые «косые».

Кроме всего этого, сигналы формируются и выглядят по-разному. Фунт отличается от евро, а евро от ауди и т.д. Сомневаемся, что получится это описать, проще будет, если вы сами понаблюдаете за парами, а через некоторое время у вас сформируется собственное представление о каждой паре.

Есть еще ряд пар, которые находятся под воздействием интервенций, больше всего это относится к USD/JPY. Ее проблема заключается в том, что сигналы по стакану Оанды часто игнорируются, а то и вовсе отрабатывают наоборот. На данный момент мы не рекомендуем анализировать эту пару с помощью стакана. Возможно, со временем ситуация поменяется.

Кстати, в описании сигналов мы стараемся приводить примеры исключительно по EUR/USD. На этой паре проще учиться и картинки она дает более четкие.

Также не забывайте о стратегии на основе корреляции валютных пар. Вы можете с легкостью использовать сигналы по евро для торговли по фунту и наоборот.

Стакан и новости

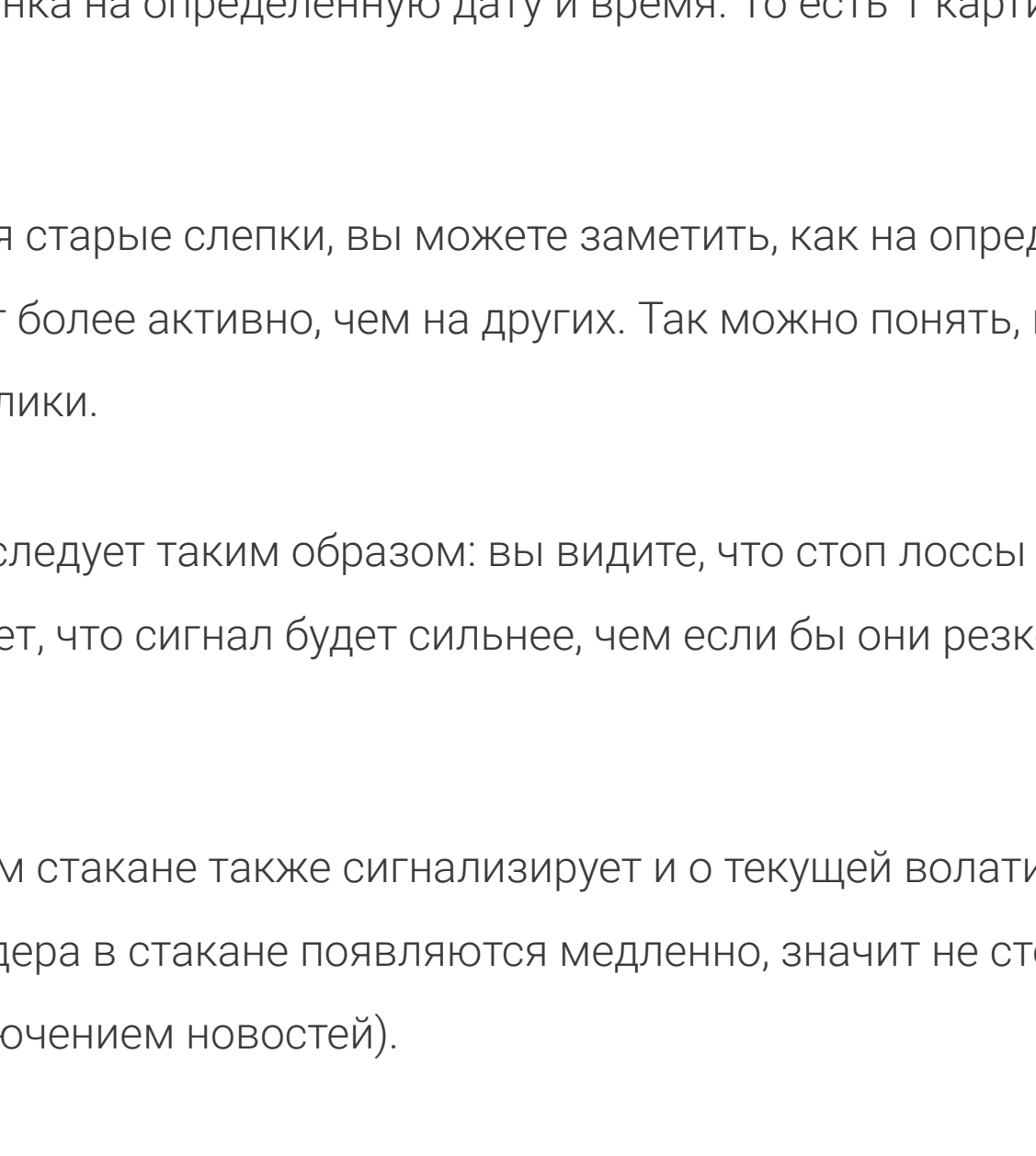
Еще одно очень важное наблюдение.

При публикации новостей цена больше учитывает данные стакана, чем те данные, которые были опубликованы. Заметьте, мы не заявляем, что стакан двигает цену, просто в нем отображена адекватная выборка, которая очень похожа на рынок в целом.

Наверное, каждый из вас видел, как при публикации положительных новостей цена падала вниз.

Дело в том, что фундаментальные новости имеют долгосрочный эффект, который не всегда заметен, а то, что происходит в момент публикации новости, это краткосрочные спекуляции на повышении волатильности. Суть таких спекуляций, наверное, всем понятна. Вот и получается, что стакан вполне применим для торговли на новостях.

Чтоб далеко не ходить, вот вам картинка:



Иногда складывается впечатление, что стакан, как и весь рынок в целом, подготавливает к важным новостям. Не то чтобы трейдеров заставляют открывать сделки. Просто в какой-то момент смотришь на слепок стакана и думаешь: «Ох! Как шас их прокатят». В большинстве случаев так и происходит.

Но можно ли заработать, торгуя по стакану на новостях? Пока вы только изучаете стакан, лучше не пробовать. Скорее всего, вас вынесет по стоп лоссу либо вы сами не заметите как, но окажетесь в группе убыточных трейдеров. Кроме того, высокая волатильность не дает выставить адекватные стоп-приказы.

Это то, что касается открытия сделки до публикации новости. А вот что будет, если открывать сделки спустя 10-15 минут после публикации?

В этом случае у вас есть неплохие шансы. Смотрите обновленный слепок стакана после публикации и, если там есть сигнал(ы), вперед в бой.

Анализ в динамике

Очень важно анализировать динамику формирования стакана.

Именно для этого в стакане Оанда можно водить мышкой по графику и у вас будут отображаться старые слепки стакана.

Слепок – это картинка на определенную дату и время. То есть 1 картинка – это и есть слепок.

Так вот, анализируя старые слепки, вы можете заметить, как на определенных уровнях объемы возникают более активно, чем на других. Так можно понять, какие уровни интересны для публики.

Использовать это следует таким образом: вы видите, что стоп лоссы накапливались плавно, это означает, что сигнал будет сильнее, чем если бы они резко возникли на одном из слепков.

Активность в самом стакане также сигнализирует и о текущей волатильности. Если новые сделки и ордера в стакане появляются медленно, значит не стоит ожидать резких движений (за исключением новостей).

После окончания американской сессии стакан и вовсе вымирает. Сами понимаете, Оанда – американский брокер. Можно предположить, что ночные движения стакан предсказывает так себе.

Умная сделка и вброс

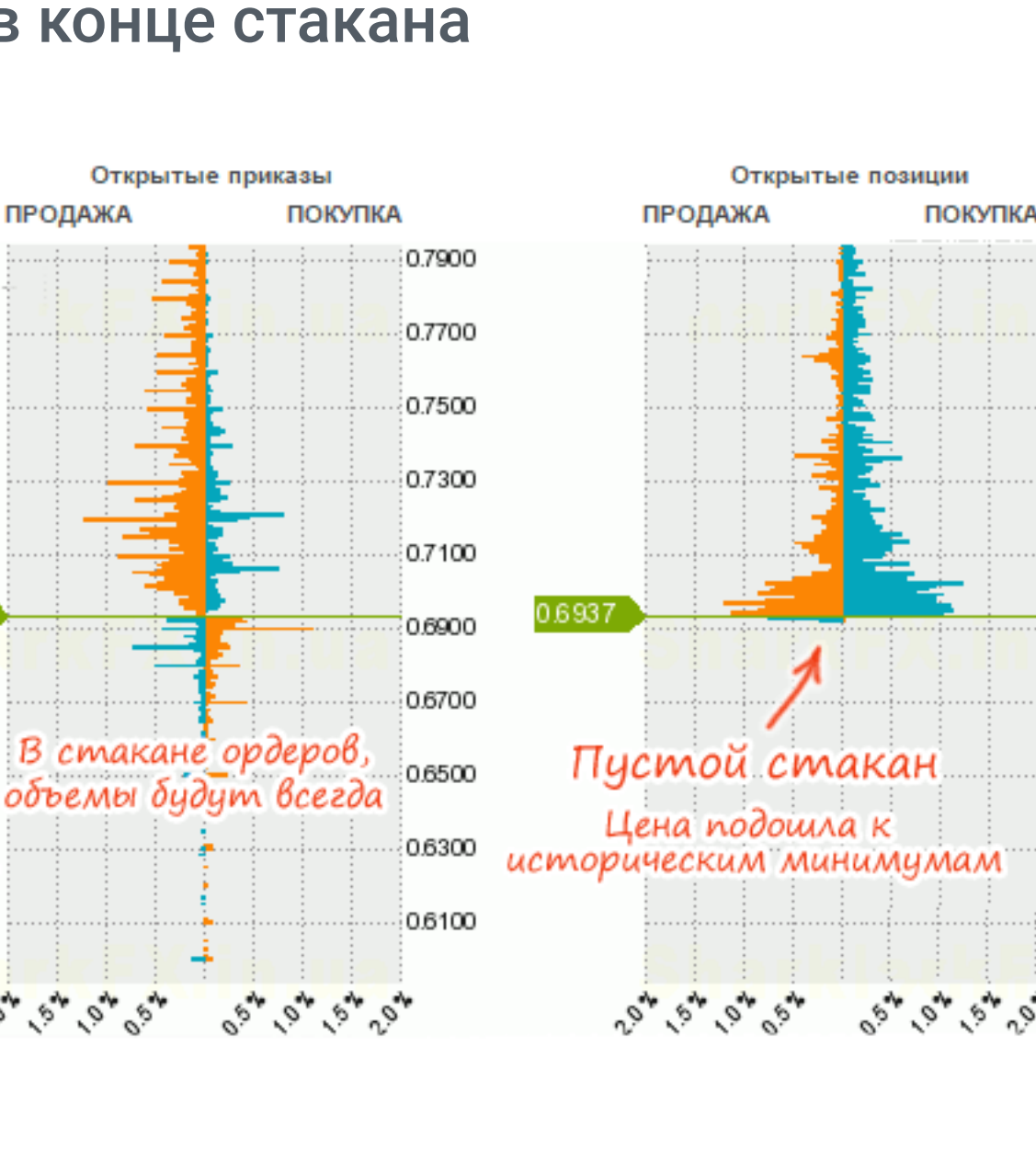
Умная сделка – это сделка клиента Оанды, который открыл ее с крупным объемом (>100 лот). Для открытия такой сделки депозит должен быть примерно \$200 000. И, как мы уже упоминали в этой статье, чем больше депозит, тем прибыльнее трейдеры торгуют.

Соответственно, если трейдер рискует таким объемом, значит он знает, что делает, поэтому в большинстве случаев его сделка будет успешной.

Но как определить умную сделку в стакане?

У нее есть одна особенность – она появляется в стакане моментально. То есть на предыдущем слепке ее нет, а на текущем уже есть. Также примечательно и объем этой сделки, он должен быть более 1,5%.

Вот как она выглядит:



В данном случае у сделки есть и SL, и TP, но может быть такая ситуация, что будет только один из стоп приказов – либо SL, либо TP.

Выявление таких сделок поможет правильно расставить цели либо закрыть сделку, если она оказалась ошибочной. В конце-концов, можно попробовать скопировать сделку такого трейдера, если цена не ушла слишком далеко.

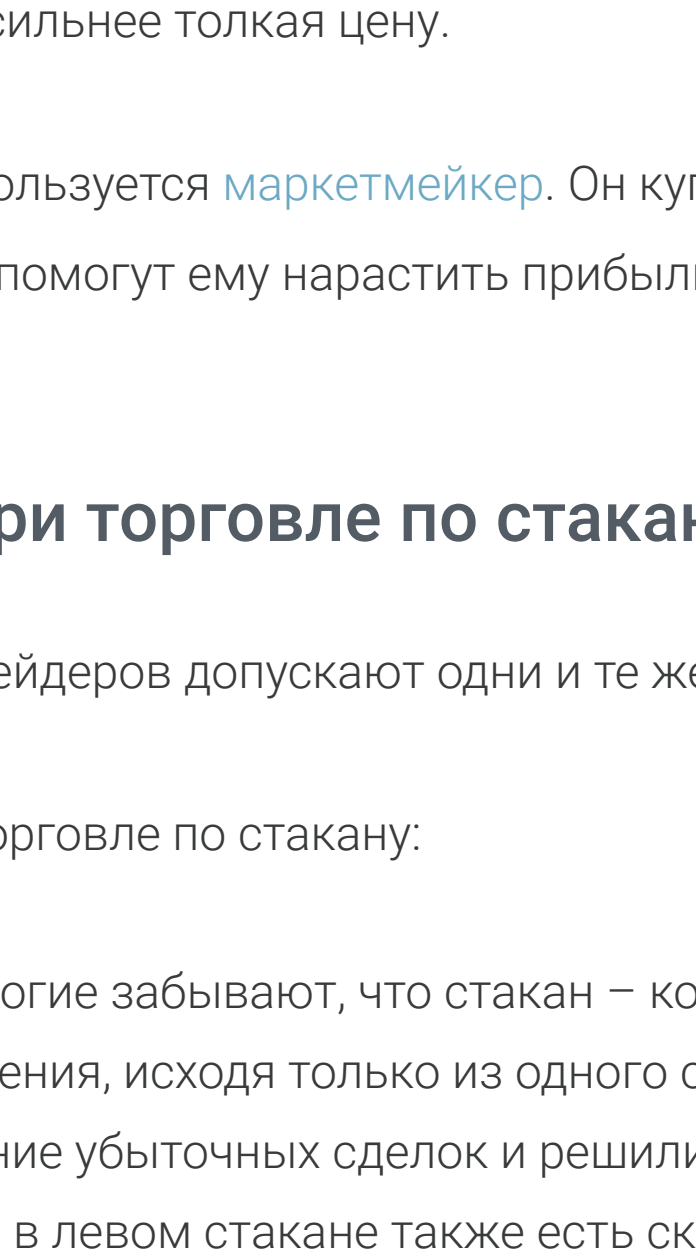
Заметьте, что сигнал от умной сделки противоречит базовым сигналам по стакану. Поэтому, если вы вовремя не заметите умную сделку, вы можете войти в рынок с целью на стоп лосс этой сделки. Как вы понимаете, ничем хорошим это не закончится.

В целом, такие сделки появляются не часто и не стоит строить свою стратегию исключительно на них, но знать об их существовании крайне важно.

Кроме умных сделок еще можно встретить вбросы объема. Суть их примерно такая же, как и у умной сделки. Вам кажется, что на уровне есть много лимитных ордеров, но на самом деле вас дурачат и цена не отреагирует на них должным образом.

Вбросы определяются по тому же принципу, что и ложная сделка. Сперва пусто, потом много объема. Кроме того, они могут пропадать, а потом опять появляться, а также они не расположены на конкретном уровне.

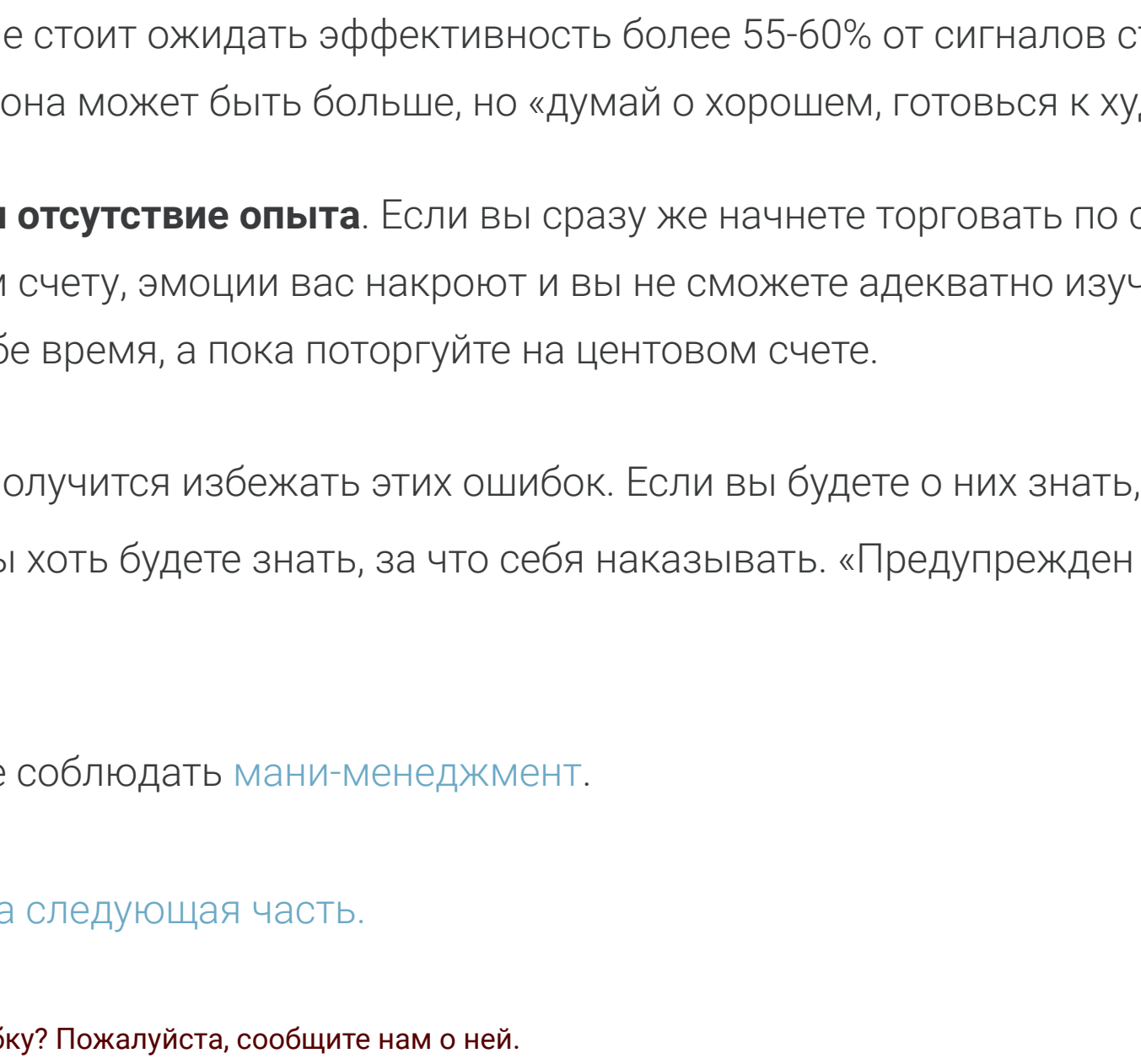
Пример ложных объемов:



Чаще всего вбросы встречаются на менее ликвидных парах.

При анализе стакана ложные объемы следует игнорировать.

Про пустоту в конце стакана



Случается так, что цена подходит к границам стакана, где уже нет открытых сделок и очень мало открытых ордеров.

Обычно это признаки продолжительного тренда либо сильного импульса.

Пугаться таких ситуаций не стоит. Цене свойственно пробивать исторические минимумы.

Как себя вести в таких ситуациях? Не ловить откаты, а работать по тренду (в сторону пустоты).

В целом, ничего особенного здесь нет. Мы упомянули об этом для того, чтобы у вас не возникали такие мысли: «О, конец стакана, сейчас будет разворот».

Почему чистое значение правого стакана всегда убыточно

Правый стакан действительно, всегда убыточен если высчитать чистое значение.

Так происходит по причине поведенческой закономерности – трейдеры быстрее закрывают прибыльные сделки, чем убыточные. Сами вспомните, как быстро вам хочется закрыть прибыльную сделку, и как долго вы держите убыточную.

Но что нам это дает?

Эти скопления убыточных трейдеров являются топливом для будущего движения. Если цена поглотит против них, им придется закрывать свои сделки, тем самым еще сильнее толкая цену.

Таковыми ситуациями обычно пользуется маркетмейкер. Он купит вначале движения, а дальше убыточные трейдеры помогут ему нарастить прибыль.

Основные ошибки при торговле по стакану

Большинство начинающих трейдеров допускают одни и те же ошибки.

Итак, основные ошибки при торговле по стакану:

- Комплексный анализ.** Многие забывают, что стакан – комплексный инструмент и принимают торговые решения, исходя только из одного сигнала. Например, вы увидели отличное скопление убыточных сделок и решили этим воспользоваться, но при этом не заметили, что в левом стакане также есть скопления стоп ордеров, которое противоречит первому. Вывод: смотрите оба стакана и проверяйте все сигналы.
- «Вижу то, чего нет».** Это особенно станет популярным после прочтения этого руководства. Вы начнете всматриваться в стакан в поисках чего-либо из описанного выше. Обычно такое лечится временем.
- «Цена должна».** Цена ничего не должна. Даже если стакан говорит продавать, это не означает, что цена обязательно пойдет вниз. Если вы помните, в этой статье мы указывали рамки эффективности для различных закономерностей. Так вот, не стоит ожидать эффективности более 55-60% от сигналов стакана. Конечно, она может быть больше, но «думай о хорошем, готовься к худшему».
- Эмоции и отсутствие опыта.** Если вы сразу же начнете торговать по стакану на реальном счете, эмоции вас накроют и вы не сможете адекватно изучать стакан. Дайте себе время, а пока поторгуйте на центовом счете.

Не у многих получится избежать этих ошибок. Если вы будете о них знать, то при их нарушении вы хоть будете знать, за что себя наказывать. «Предупрежден – значит вооружен».

Не забывайте соблюдать мани-менеджмент.

Опубликована следующая часть.

► Заметили ошибку? Пожалуйста, сообщите нам о ней.