

Первая ежегодная конференция
«Валютный рынок. Делимся опытом»

Паттерны и их
применение
Отчеты СОТ
Психология торговли

werealtrade.ru

2012 год

Определение

- Паттерн (англ. pattern — образец, шаблон, система) — характерный участок временных графиков цен.
- Это сочетание необходимых и достаточных условий, при наступлении которых у трейдера может с достаточно высокой вероятностью реализоваться его статистическое преимущество на рынке.

Признаки

- Состоит из нескольких свечей;
- Формирование занимает 3-5 дней (есть исключения);
- Оптимальные графики для поиска паттернов H_1-W_1 ;
- Паттерн должен подтверждаться объемом;
- Паттерн имеет срок реализации движения (достижение тейк-профита не должно быть длительным);
- Паттерн имеет жесткую формализацию;

Условия торговли

- Стоп-лосс определяется параметрами самого паттерна (бэктестинг в помощь);
- Тейк профит определяется таймфреймом, образовавшим паттерн;
- При торговле паттерна, обязательно стоит учесть, фазу рынка на стратегическом периоде;
- Выход из сделки, только по стоп-лоссу или тейк профиту, исключение, если цена не доходит до тейк-профита 5-10 % и застревает;
- Стоп-лосс в безубыток переносится, при условии максимального удаления цены, от точки открытия позиции.

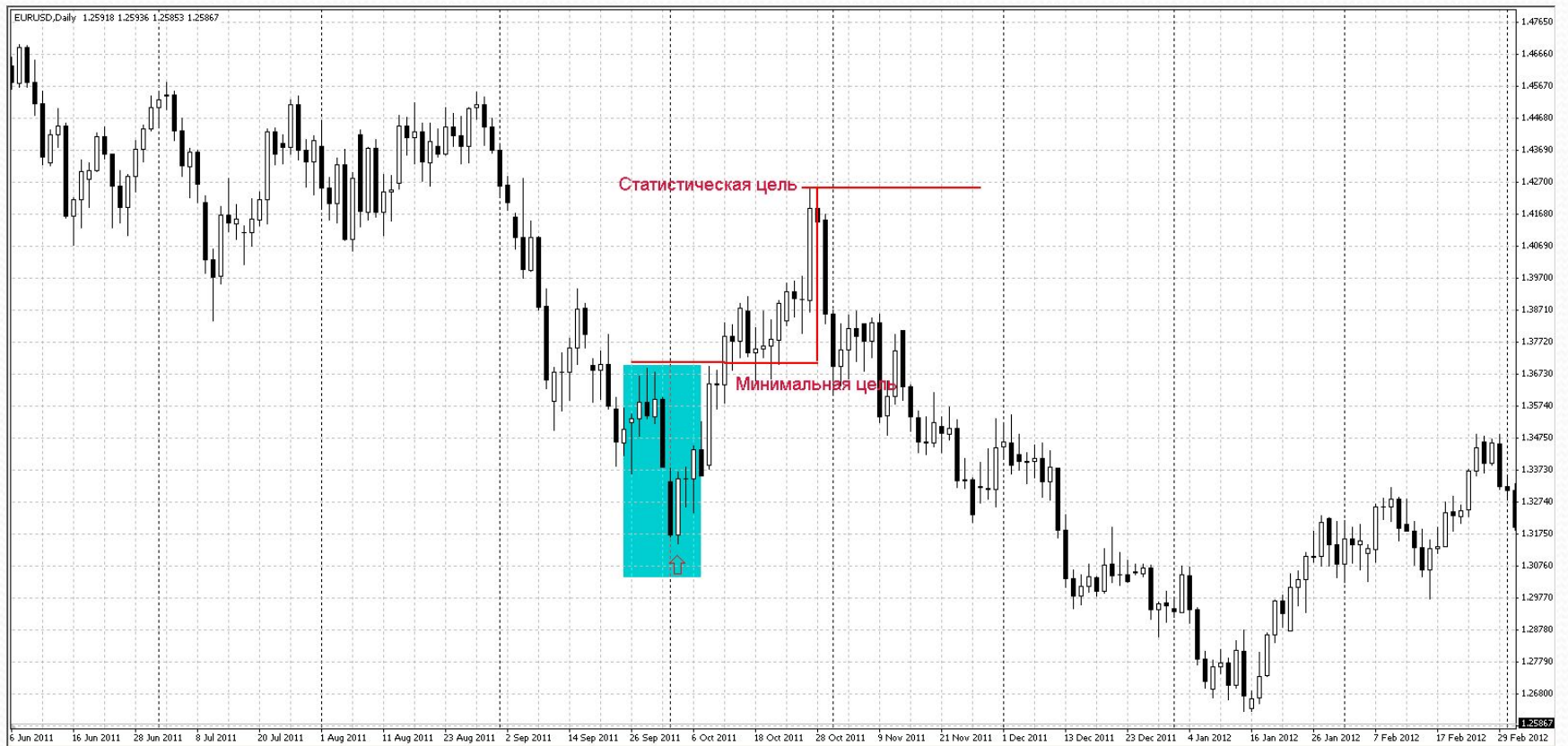
Определение фазы рынка:



Примеры:



Примеры:



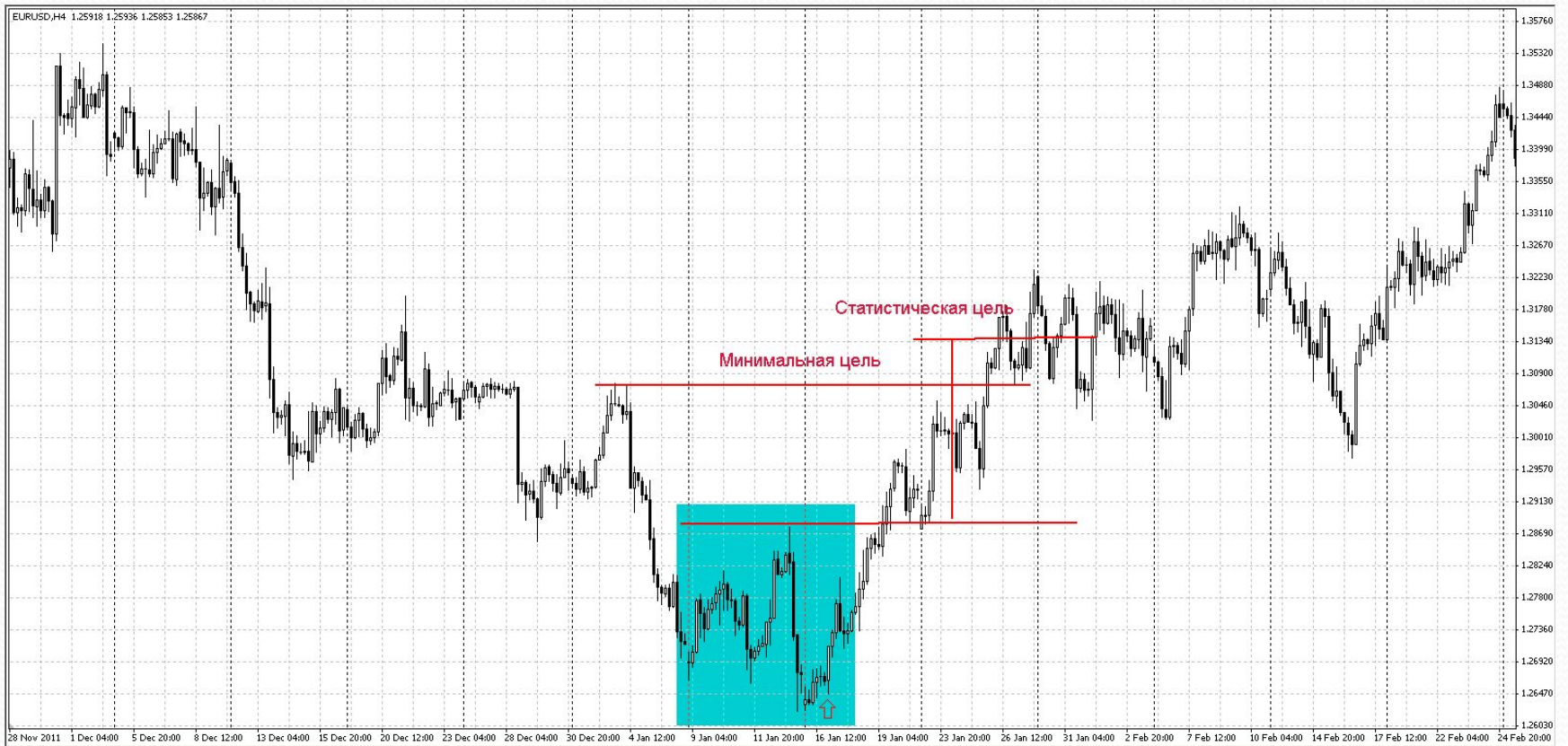
Примеры:



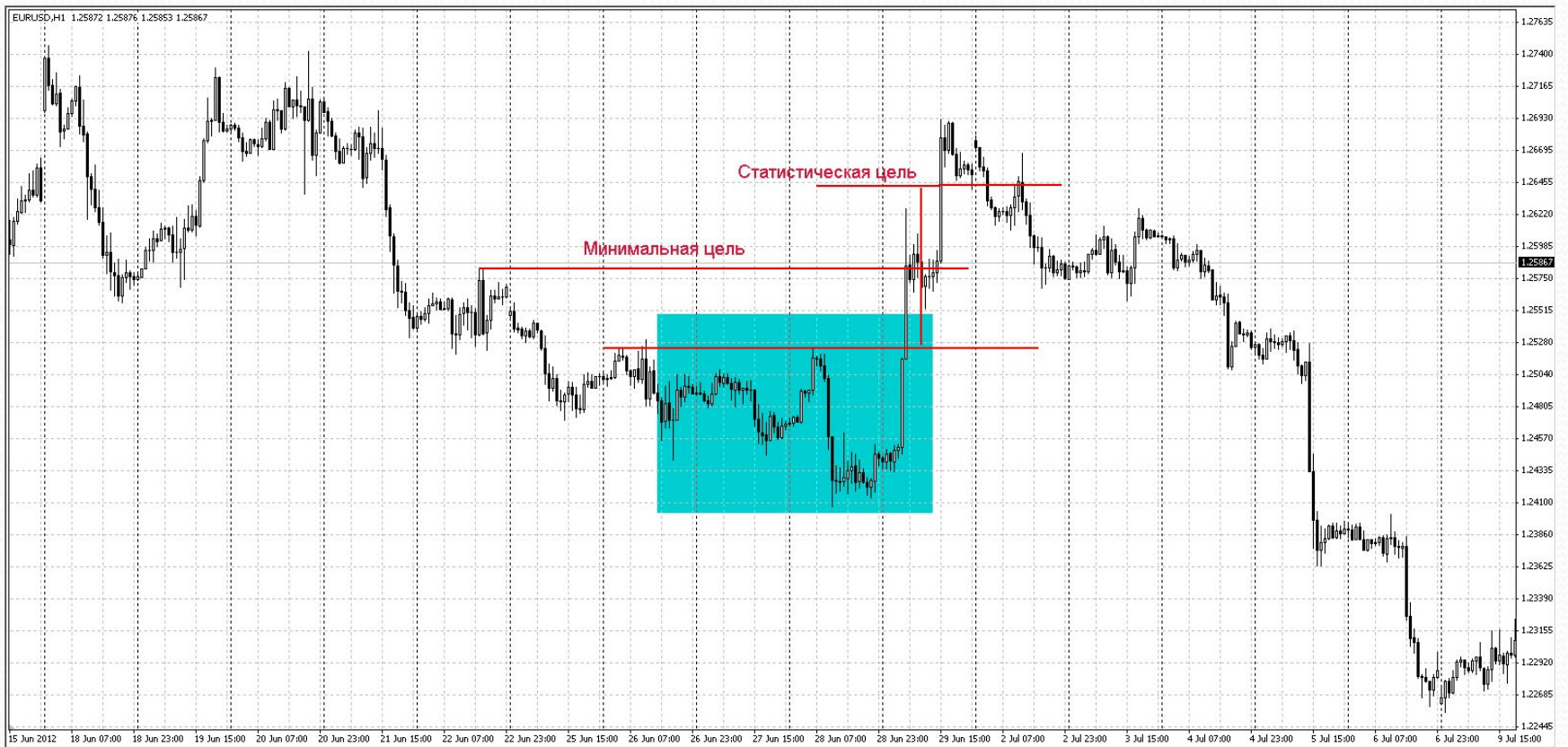
Условия формирования:

- Предшествующий нисходящий тренд, минимальное условие, во внутренней структуре должно быть сформировано 3 волны;
- Контрольный добой идет резко, вынуждая всех входить по предшествующему тренду;
- Высокий объем на пробитии минимума диапазона;
- Рост начинается не сразу, 1-2 дня идет флэт на мелких периодах (H1-H4).

Примеры:



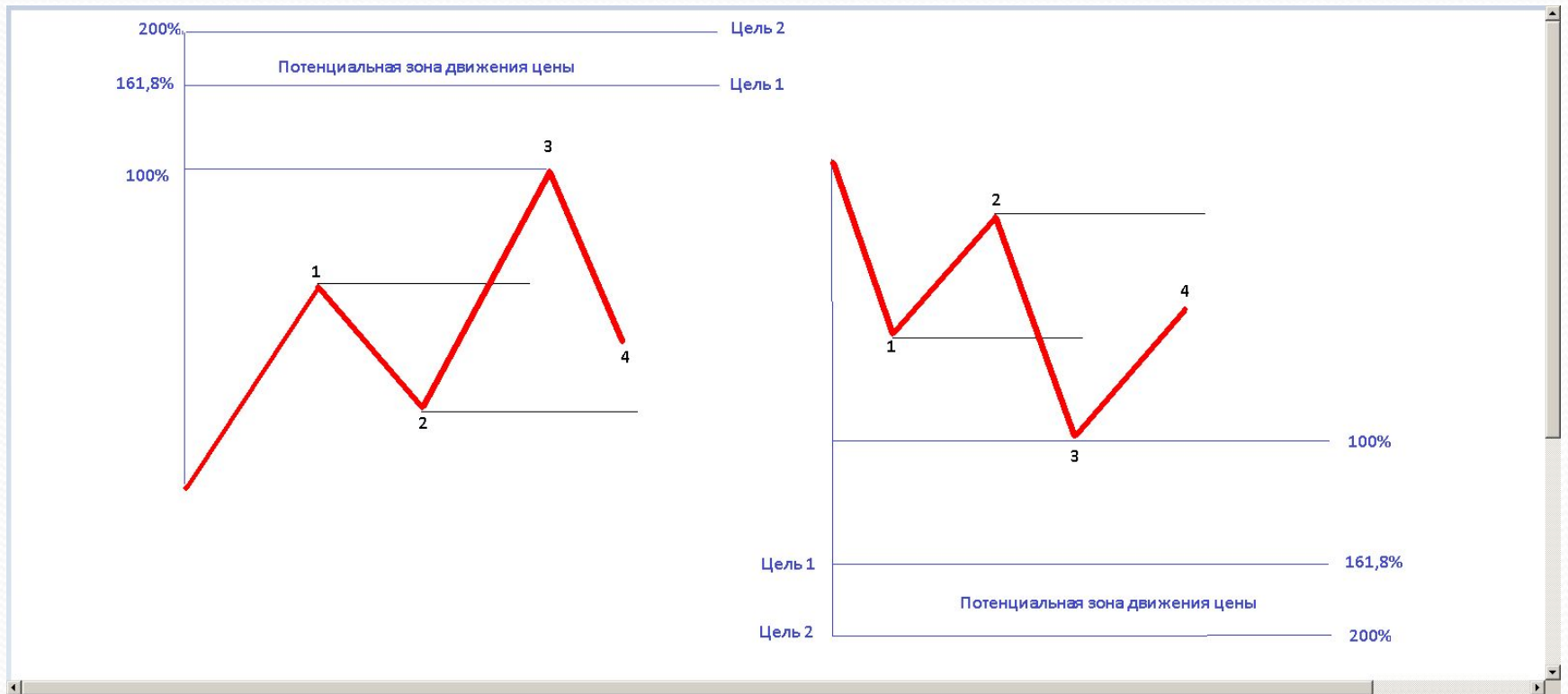
Примеры:



Условия формирования:

- Данная модель встречается 2-4 раза в год в среднем, на одном инструменте;
- Искать данную модель необходимо на H4-H1;
- Контрольный добой идет резко, вынуждая всех входить по предшествующему тренду;
- Рост начинается не сразу, цена должно «постоять» некоторое время, после пробития минимумов;
- Высокий объем на пробитии минимума диапазона;

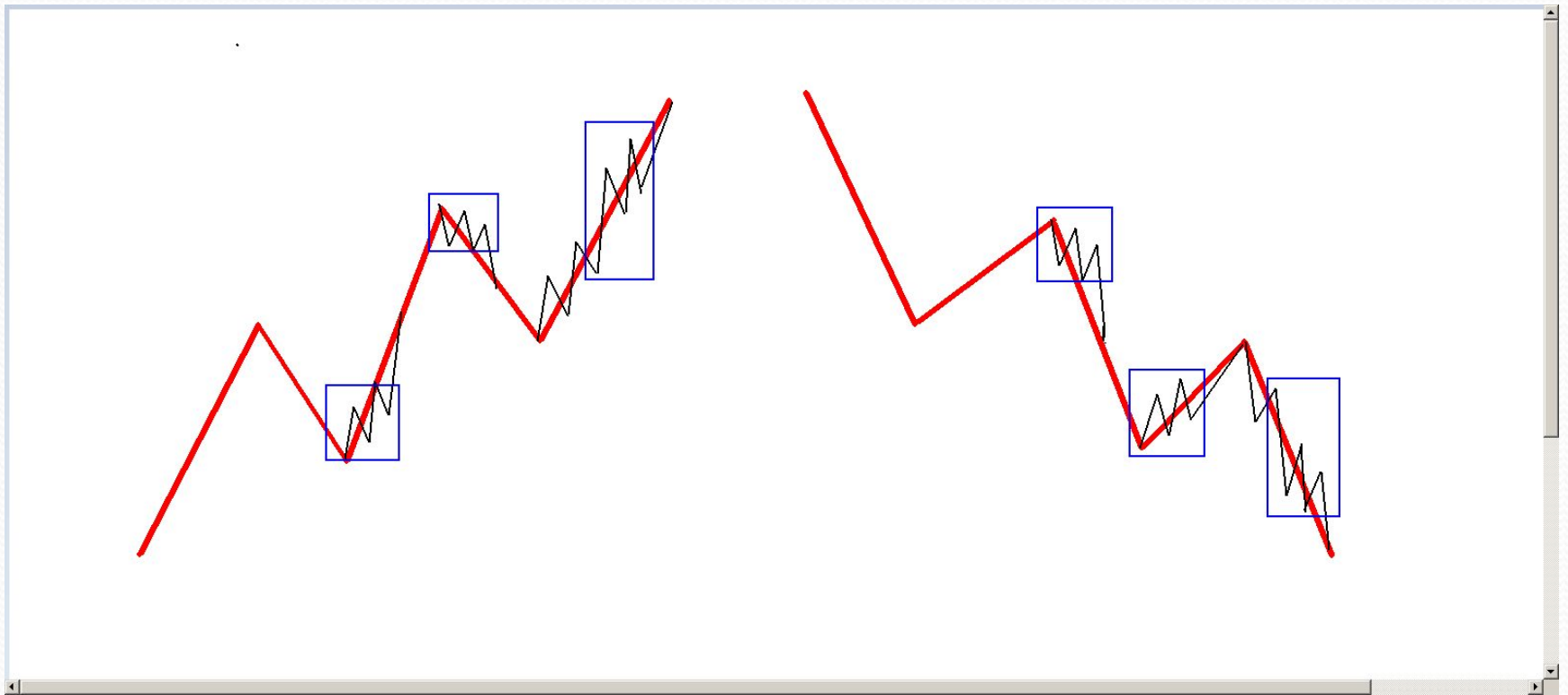
Примеры:



Условия формирования:

- Перед формированием модели, обязательно должно быть сформировано, *минимум 3 волны* (возможно и более), завершающие предшествующее движение;
- 2 волна не пробивает точку старта 1 волны;
- 3 волна обязательно должна пробить максимум/минимум 1 волны, хотя бы на 1 пункт;
- 4 волна не пробивает точку старта 3 волны;
- Сделка открывается, либо в начале 5 волны, либо на пробой максимума/минимума 3 волны;
- Стоп-лосс устанавливается под максимум/минимум 2 волны;
- Тейк-профит на 161-200 % от всей конструкции.

Примеры:



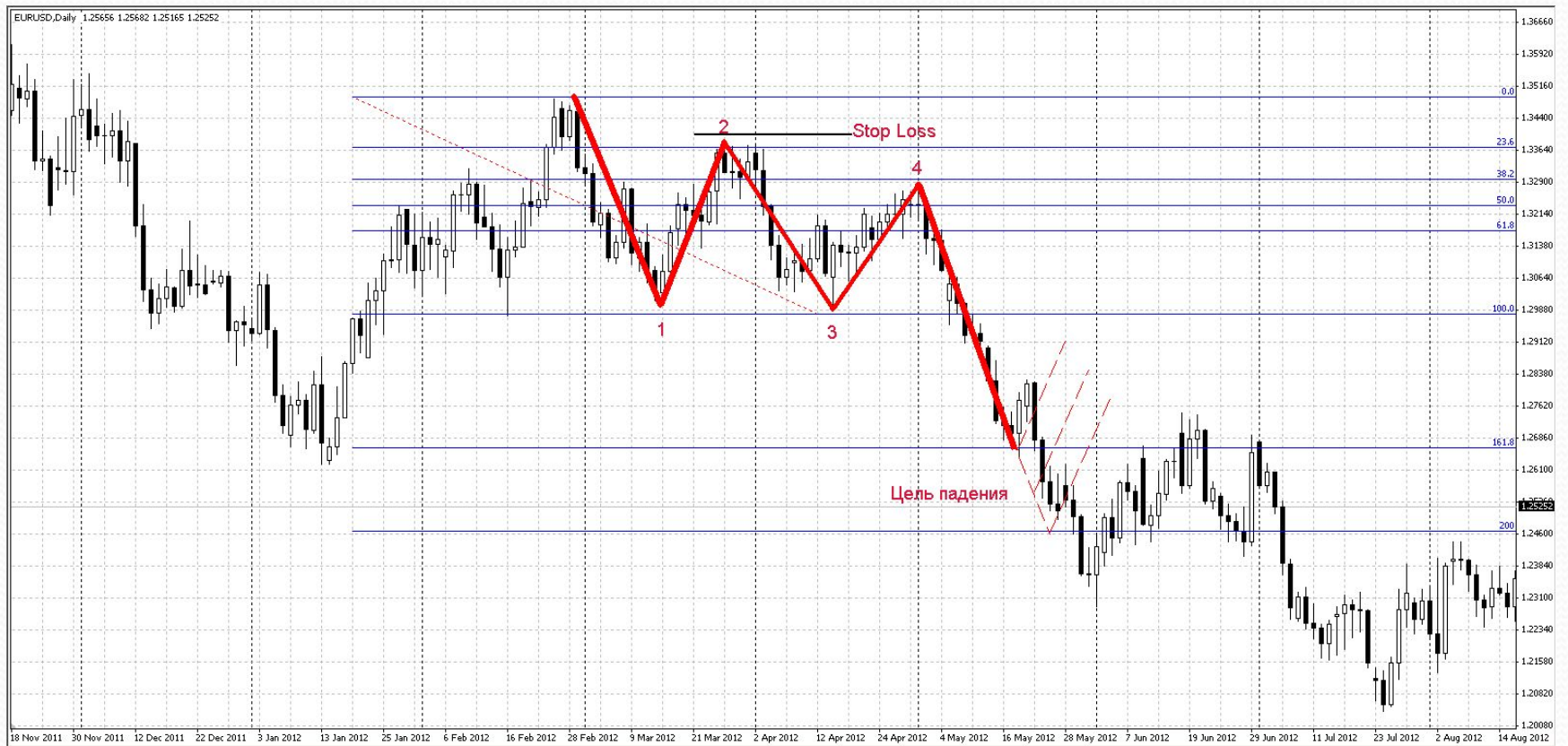
Примеры:



Примеры:



Примеры:



Commitment of Traders

- Каждую неделю Комиссия по торговле товарными фьючерсами публикует данные о покупках и продажах, совершенных за предыдущую неделю тремя группами трейдеров. Официальная публикация выкладывается на сайт www.cftc.gov
- Коммерческие трейдеры, Крупные трейдеры и спекулянты.

Операторы

- Операторы — это зачастую известные марки. В сельскохозяйственных товарах, это такие корпорации, как Pillsbury, General Mills, Cargill, Iowa Beef и Nabisco. В каждой коммерческой или финансовой области есть компании или организации, бизнес которых заключается в знании истинного экономического состояния дел — чтобы выжить и процветать — на каком-то одном конкретном рынке: на том, на котором они работают.
- Когда дело коснется абстрактных или финансовых товаров, мы встанем в одну очередь с такими компаниями, как J.P. Morgan Chase, General Motors и Microsoft, а также со всеми крупнейшими банками и брокерскими фирмами мира. Они должны хеджировать валюту процентными ставками, и делают это ежедневно настолько крупными позициями, что обязаны отчитываться перед CFTC.

Сайты, где можно посмотреть COT отчеты

- www.timingcharts.com
- www.cotbase.com
- www.barchart.com

COT

- Экстремально бычьи или медвежьи позиции операторов намекают нам на то, что делать. Очень мало информации для нас в том факте, что операторы всего лишь начали больше продавать, чем покупать, — если только это не происходит на экстремальном уровне.
- Мы увидели, что можно сделать деньги, примкнув к упомянутой группе, когда у нее крайне бычий или медвежий настрой.

Евро Net Position



Индекс COT

- Индекс COT, соотносит данные *текущей* недели с трехлетним периодом покупок и продаж операторов. Чем выше процентное отношение, скажем более 80%, тем больше покупок они сделали (т. е. тем выше их бычий настрой). Далее, когда индекс низкий, обычно меньше 20%, они не совершали больших покупок; поэтому мы можем сделать вывод, что они придерживаются негативного отношения к рынку. Это очень хорошие пороговые уровни: выше 80% рынок готв к росту, а ниже 20% — к падению.

Евро COT INDEX



Австралийский доллар COT INDEX



Пшеница COT INDEX





Спасибо за внимание!!!