

Технический анализ – это исследование исторической динамики рынка с целью прогнозирования дальнейшего направления движения цен.

Основа технического анализа – график!

Аксиомы технического анализа

Аксиомы технического анализа:

1. Рынок учитывает все
2. Движение цен подчинено тенденциям
3. История повторяется

Аксиомы технического анализа

Бычий тренд



Аксиомы технического анализа

Медвежий тренд



Аксиомы технического анализа

Боковой тренд



Уровни поддержки/сопротивления

Поддержка (Support) – уровень ниже текущего, при котором цены контролируются покупателями, которые не допускают их дальнейшего падение

Сопротивление (Resistance) – уровень выше текущего, при котором цены контролируются продавцами, которые не допускают их дальнейшего роста.

Уровни поддержки/сопротивления



Линия восходящего (бычьего) тренда



Линия нисходящего (медвежьего) тренда



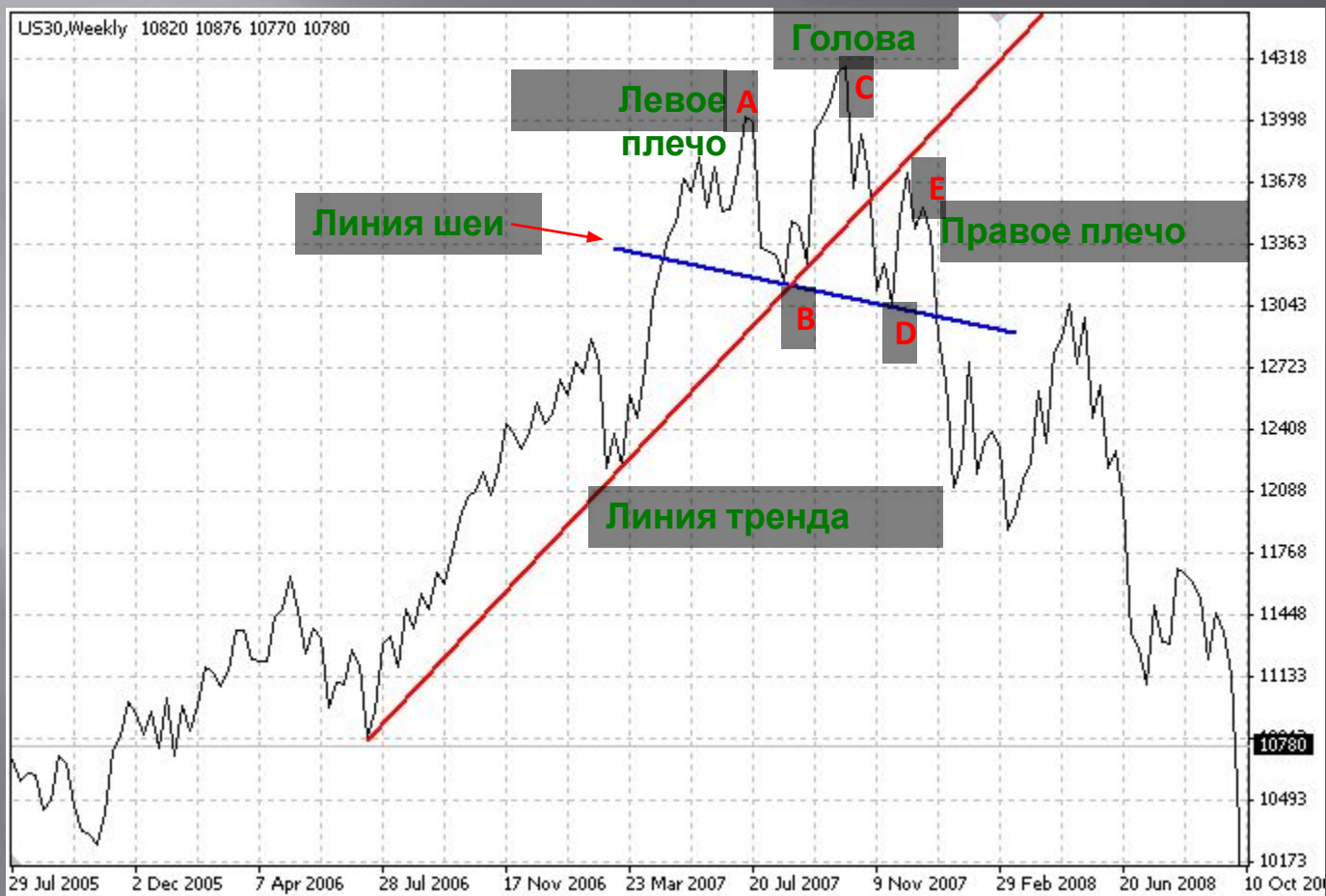
Торговый канал



Основные модели технического анализа

1. Модели разворота
2. Модели продолжения

Модель «Голова и плечи»



Графический анализ. Модели разворота

Тройная вершина



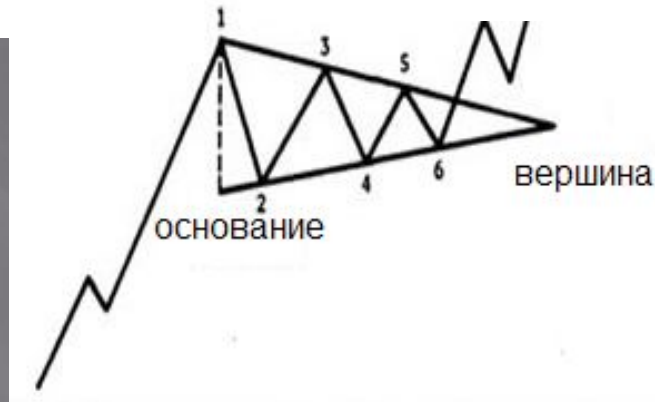
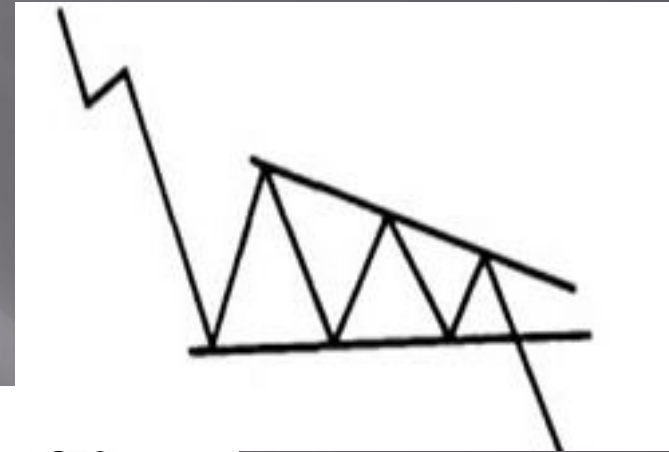
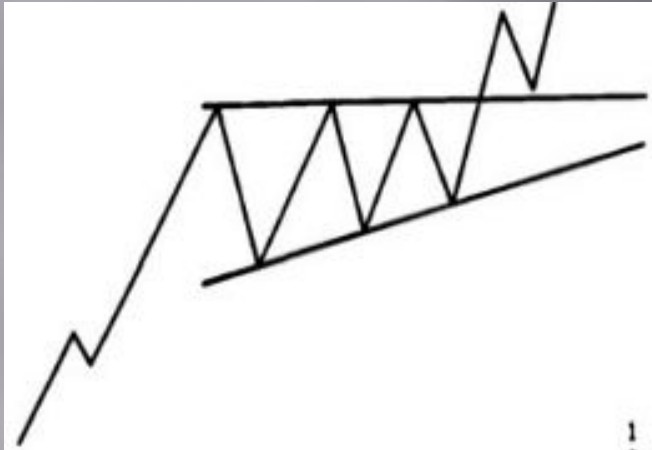
Графический анализ. Модели разворота

Двойная вершина



Графический анализ. Модели продолжения

Треугольники



Графический анализ. Модели продолжения

Треугольники



Графический анализ. Модели продолжения

Треугольники



Графический анализ. Модели продолжения

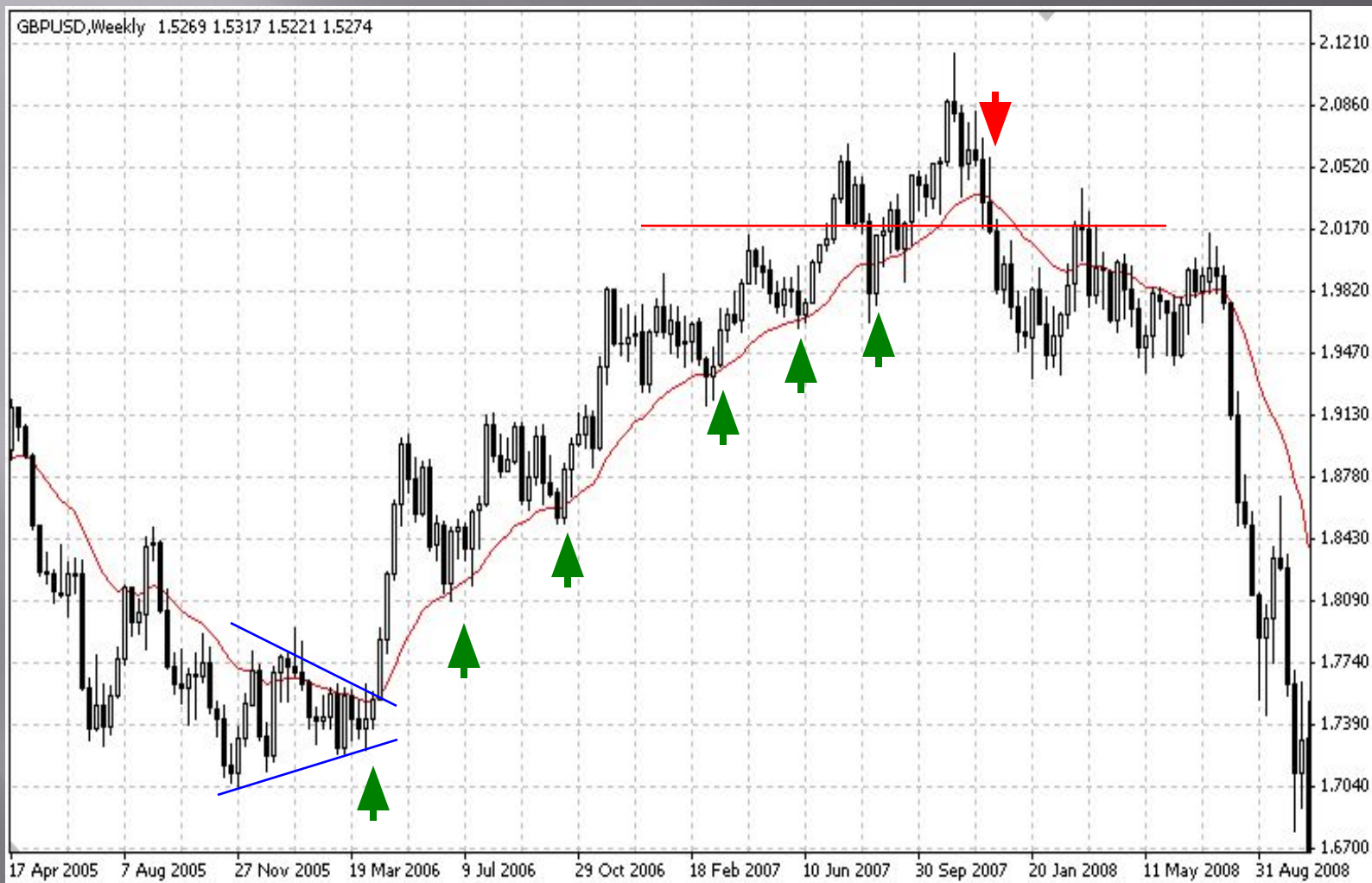
Треугольники



Математические индикаторы

1. Скользящие средние
2. Индикатор MACD

Математические индикаторы



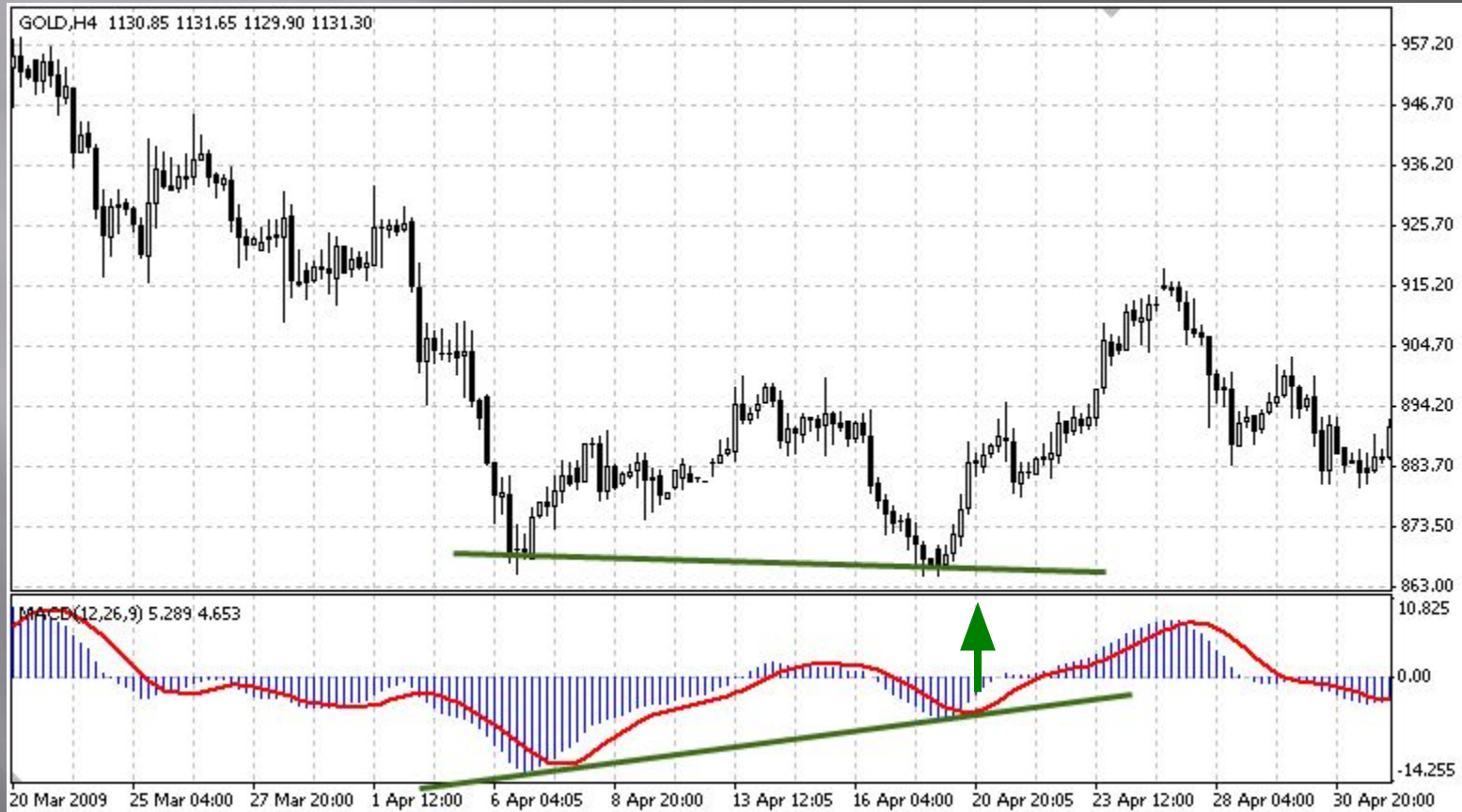
Индикатор MACD – Схождение/расхождение скользящих средних – соотношение между двумя скользящими средними цены.

Использование MACD:

- Пересечение индикатора MACD с сигнальной линией
- Состояние перекупленности/перепроданности
- Расхождения индикатора MACD с ценой

Математические индикаторы

Расхождения индикатора MACD с ценой



Числа Фибоначчи (Fibonacci)

Числа Фибоначчи (Fibonacci)

Открыл в XIII веке Леонардо Фибоначчи – итальянский математик из Пизы.

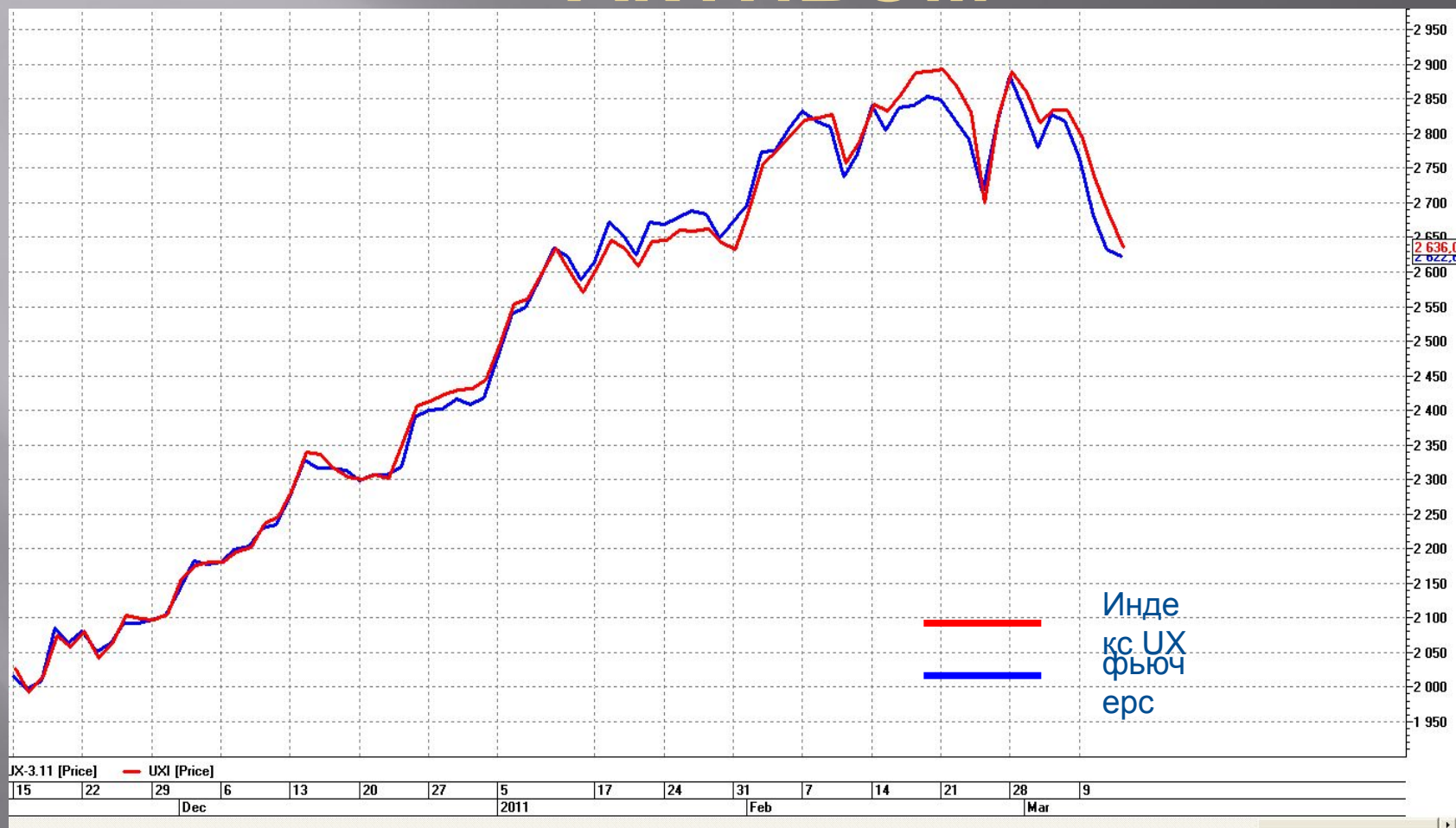
1, 1, 2, 3, 5, 8, 13, 21, 34, 55, 89, 144, ...

Числа Фибоначчи (Fibonacci).

Уровни Фибоначчи



СРАВНЕНИЕ С БАЗОВЫМ АКТИВОМ



ФЬЮЧЕРСНЫЕ СТРАТЕГИИ

- ▣ Арбитраж
- ▣ Торговля только на срочном рынке
- ▣ Хеджирование

Основные понятия

1. Гарантийное обеспечение – сумма, которую необходимо внести в качестве залога при покупке/продаже фьючерсов
2. Вариационная маржа – прибыль/убыток, которые начисляются на счет по результатам клиринга
3. Клиринг – период в течении которого биржа проводит расчеты между участниками и пересчитывает размер ГО
4. Экспирация – дата истечения фьючерса

Параметры торгового счета на срочном рынке

Ограничения по клиентским счетам #2					
Торговый счет	Лимит откр. поз.	Тек.чист.поз.	План.чист.поз.	Вариан. маржа	Накоплен. доход
Номер счета	Текущие средства	ГО под позиции и заявки	Свободные средства для дальнейших операций	Прибыль или убыток после клиринга	Прибыль или убыток до клиринга в 13:00

Позиции по клиентским счетам (фьючерсы) #2					
Код инструмента	Вход. чист. поз.	Тек. чист. поз.	Акт. покупка	Акт. продажа	
Инструмент UXM2 - фьючерс	Открытые позиции на начало дня	Открытые позиции на текущий момент	Заявки на покупку	Заявки на продажу	
UX1500BF2 - опцион	"-" проданные "+" купленные	"-" проданные "+" купленные			

Параметры торгового счета для ЕДП

Клиентский портфель								
Код клиента	Сроч. счет	Тек. активы	Ур. маржи	НаПокупНеМаржин	ГО поз.	ГО заяв.	Вариаци. маржа	
Номер счета спот	Номер счета на срочном рынке	Полная сумма средств на обоих рынках	Уровень маржи на споте с учетом позиций на срочном рынке	Сумма доступная для покупки или продажи фьючерсов и опционов	ГО под открытые позиции	ГО под заявки	Вариационная маржа	

Объем позиции при торговле фьючерсами

1. Определяем уровень на котором будем выставлять стоп.
2. Рассчитываем максимально возможные убытки по одному контракту с учетом цены открытия позиции
3. Определяем каким процентом от счета Вы готовы рискнуть в данной сделке. Например 5%.
4. Рассчитываем объем позиции:

Прогнозируем снижение рынка и продаем фьючерсы

Счет 10000 грн; Цена открытия – 1410; Стоп – 1426; Риск – 5%.

$$\frac{10000 \times 0,05}{1426 - 1410} = \frac{500}{16} \approx 31$$

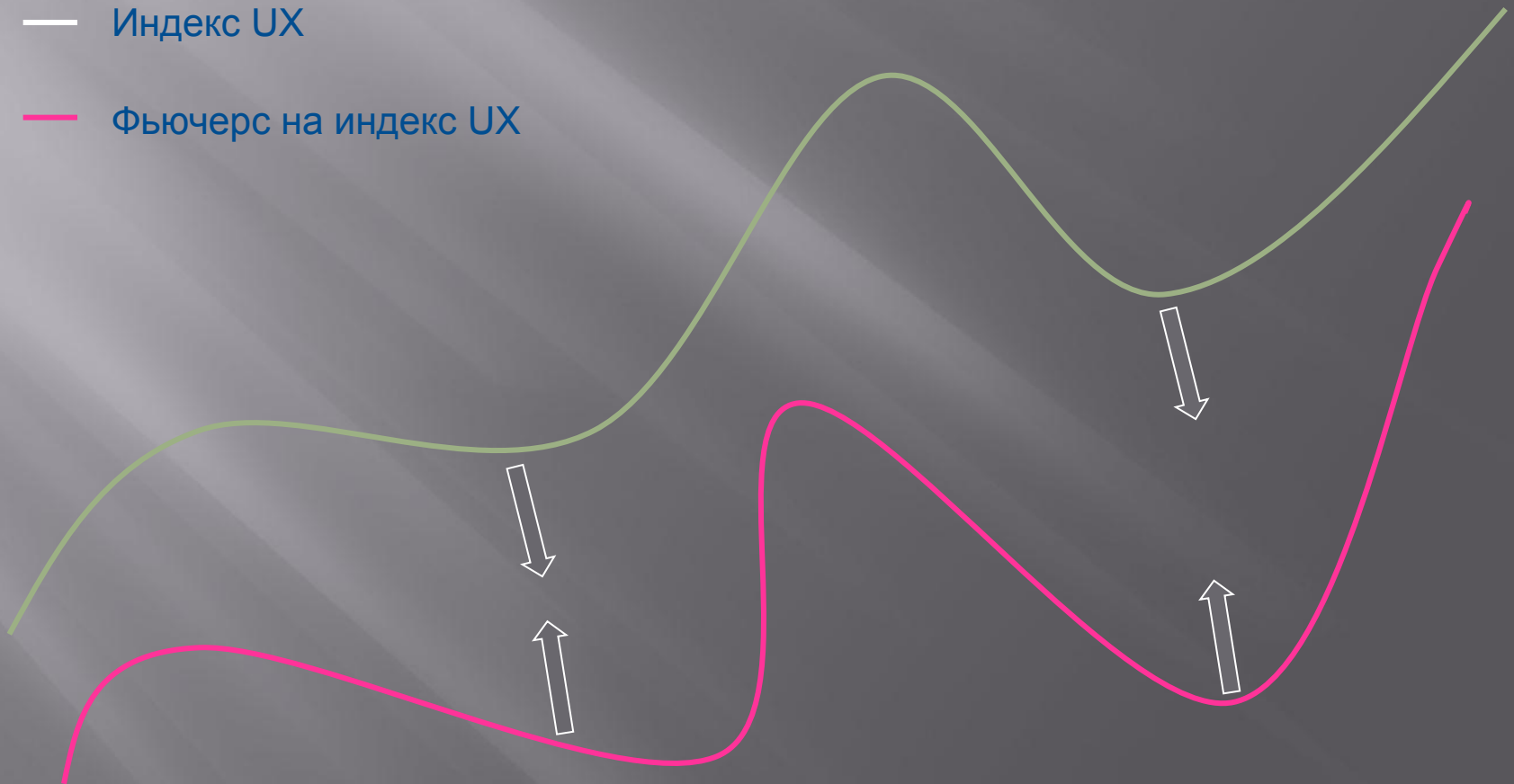
Объем позиции при торговле фьючерсами



АРБИТРАЖ

— Индекс UX

— Фьючерс на индекс UX

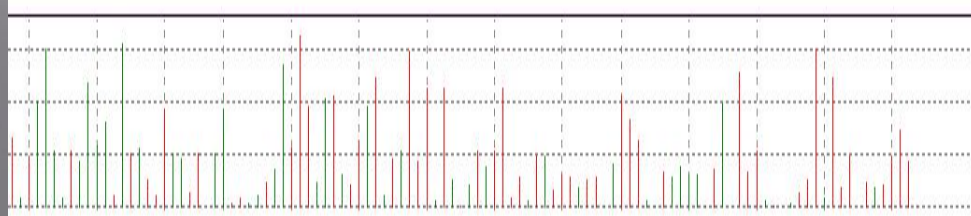


ХЭДЖИРОВАНИЕ

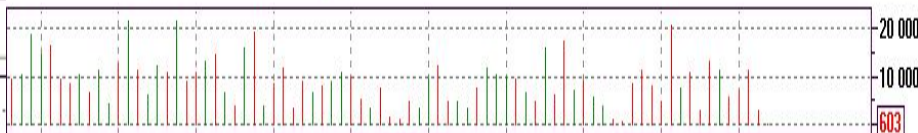
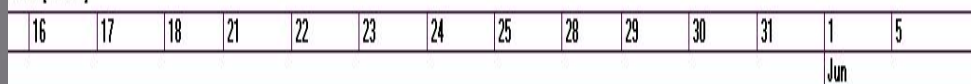


UX-6.12 [Price] — UX-6.12 [Moving Average] — UX-6.12 [Price]

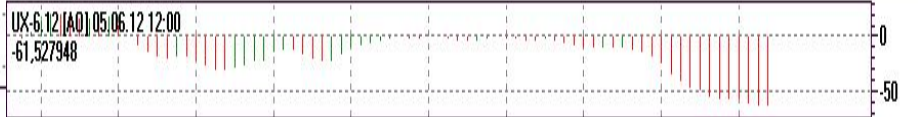
CEEN [Цена]



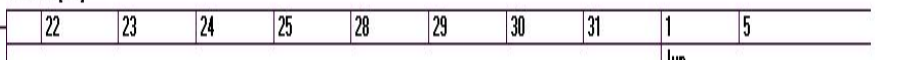
CEEN [Объем]



UX-6.12 [Volume]



UX-6.12 [AO]



Технический анализ
говорит о степени вероятности того,
что может произойти,
но не утверждает, что это произойдёт
неприменно...

Торговля по линиям тренда



Стратегия Trend Lines – это одна из мультивалютных торговых стратегий, которая основана на построениях трендовых линий, где сама цена является индикатором, который отображает ситуацию, происходящую на рынке. Эта торговая стратегия в некоторых моментах схожа со стратегией «3 касания», поэтому она очень проста в использовании и дает хорошие результаты.

В данной стратегии используются два тайм-фрейма – H1 и M5.

Первым делом анализируется график H1, а сделки совершаются на M5.

Алгоритм торговой стратегии

- 1) Необходимо определить 2 последовательные точки на тайм –фрейме H1, обозначив их например как «0 и 1», через них необходимо провести трендовую линию.
 - 2) Далее после нахождения точек «0» и «1» необходимо перейти на интервал «M5».
 - 3) После формирования минимальной точки 1, ожидаем формирования нового максимума, который обозначим, как 2.
 - 4) После того как сформировался максимум, следует дождаться коррекции цены к линии тренда, где и будет совершена покупка с помощью отложенного ордера в точке 3. Для сделок на покупки ордер следует устанавливать выше трендовой линии приблизительно на 4-7 пунктов.
 - 5) Под точку «1» размещаем стоп - лосс. Также можно его размещать на уровне под линией тренда на уровне 20-30 пунктов.
 - 6) Тейк-профит размещаем на уровне точки 2. При желании можно закрыть только часть позиции, а стоп-лосс перенести в безубыток.
- При использовании данной стратегии нужно помнить об одном важном условии, что уровень стоп лосс должен быть как минимум в два-три раза меньше размера тейк-профит.
- Если не выполняется это условие, то сделка не заключается!





Параллельные каналы

Параллельные каналы являются одними из самых распространенных и популярных графических паттернов при анализе рынка. Они предоставляют возможности для заработка, которые не зависят от расположения рынка: трендовое или не трендовое состояние, а также не зависят от выбранного временного интервала. Определить параллельные каналы можно при нахождении двух вершин и 2 минимумов. Если мы нашли такого рода канал, то смело можем использовать стратегию: ждем, когда цена достигнет верхней или нижней трендовой линии на графике, а затем определяем сетап.



Алгоритм торговой стратегии

Существует два варианта поведения цены в данной точке:

1. Цена может отскочить от границы канала, а затем продолжить свои действия уже в противоположном направлении вверх или вниз.
2. Может произойти также пробой границ канала. Цена может пробить доминирующий тренд или пробить в противоположном направлении, при этом произойдет разворот.

На графике ниже видно как цена после пятого касания, дошла лишь до середины канала и снова устремилась к нижней границе канала, что говорит о возможной смене тенденции и пробитии нижней границы.

параллельный канал

5-е касание

максимум не достигнуто



В данной ситуации входить в рынок необходимо только после появления дополнительного подтверждение - это образование более низкого максимума или превращения нижней трендовой линии из поддержки уже в сопротивление.

Короткую позицию открываем в момент, когда цена возвращается к нижней линии тренда.

Установить стоп – лосс нужно максимума бара или свечи, которая предшествовала пробоем.

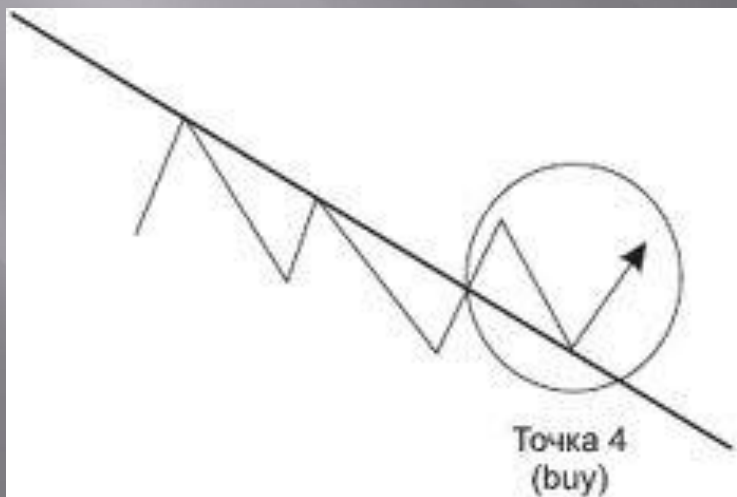
На указанном на графике уровне была определена первая цель для фиксации части прибыли. Полностью позицию можно закрывать ниже на уровне 900, в данной области также видно поддержку, т.к. ранее здесь происходил разворот тренда вверх.

На графике видно, что обе цели были достигнуты.



Контр- тренд

Открытие длинных позиций от контр – тренда при нисходящем тренде является эффективной в том случае, если цена пробивает тренд снизу вверх и закрылась выше трендовой линии. Другими словами: цена пробивает уровень сопротивления, уходит выше данного уровня и через некоторое время корректируется к нему. В данном случае линия сопротивления становится линией поддержки и является оптимальным местом для совершения покупки.



Продажа от контр - тренда.

Логичным ходом является открытие короткой позиции от контр – тренда, ранее работающего в качестве восходящего тренда. После пробития ценой вниз линия поддержки становится линией сопротивления. Этот торговый способ обладает большим эффектом, также считается действенным способом входы на продажу в рынок.





GOLD, Daily 1731.05 1732.75 1728.75 1731.85



MetaTrader 4, © 2001-2012, MetaQuotes Software Corp.

***Дякую за
увагу!***