

Каналы в торговле.

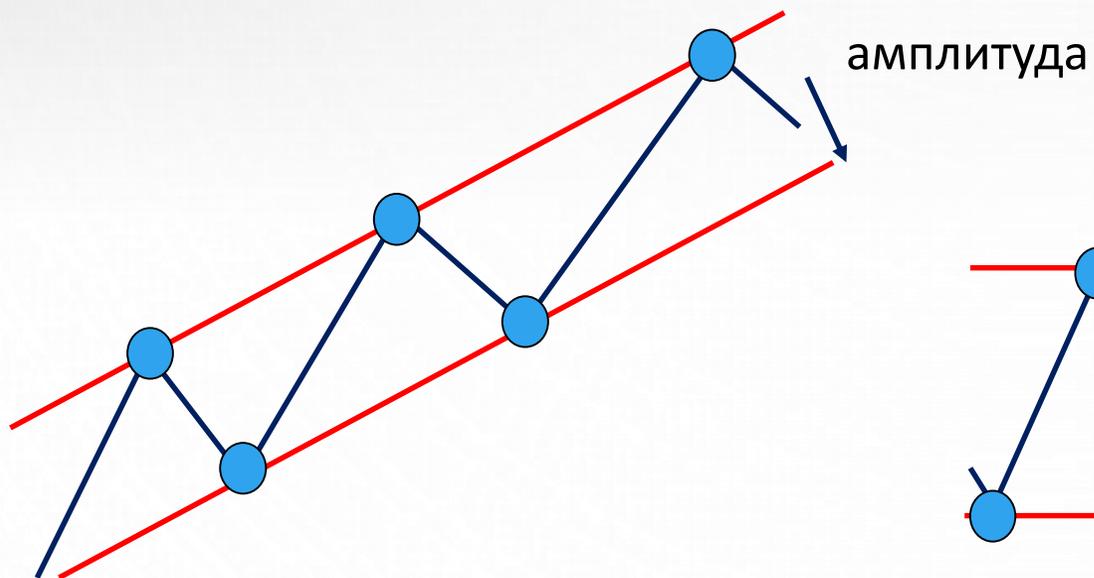
Технический анализ Part 4



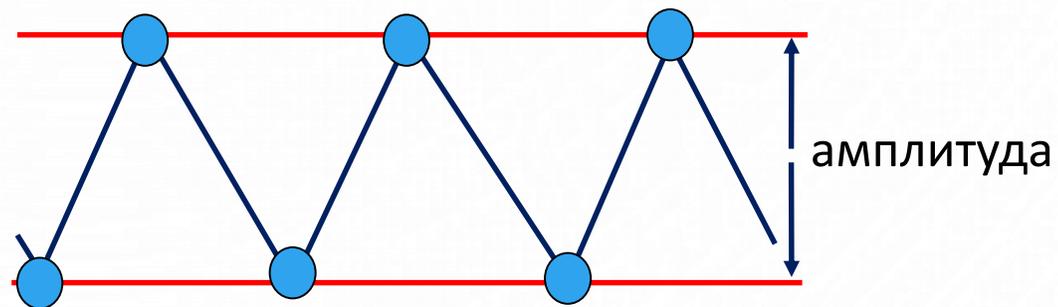
А

Прямо
к цели

Канал – модель движения цены на финансовом рынке, которая учитывает направление и амплитуду её движения.

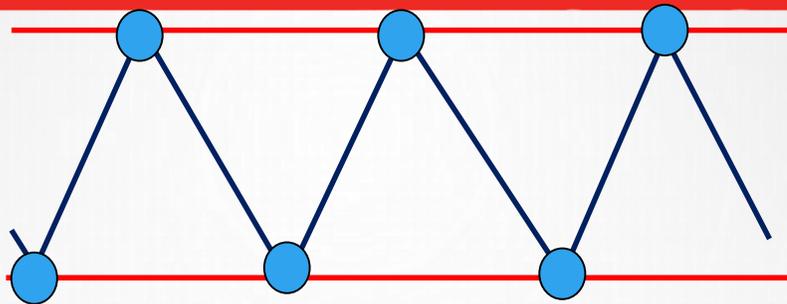


1 – Направленный канал

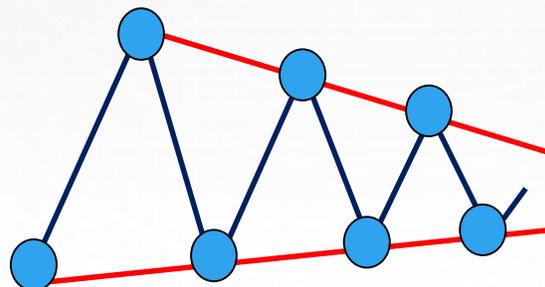


2 – Боковой канал

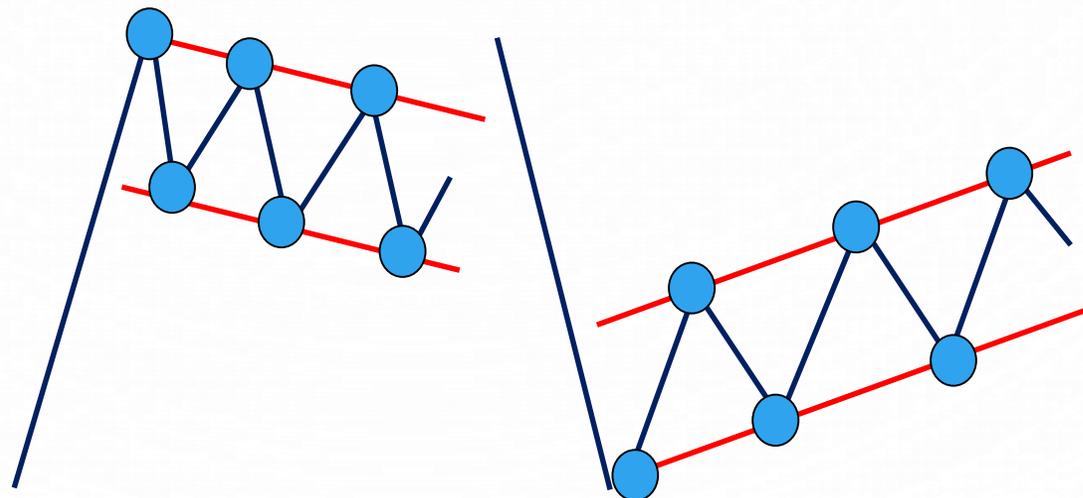
- Стандартный боковик

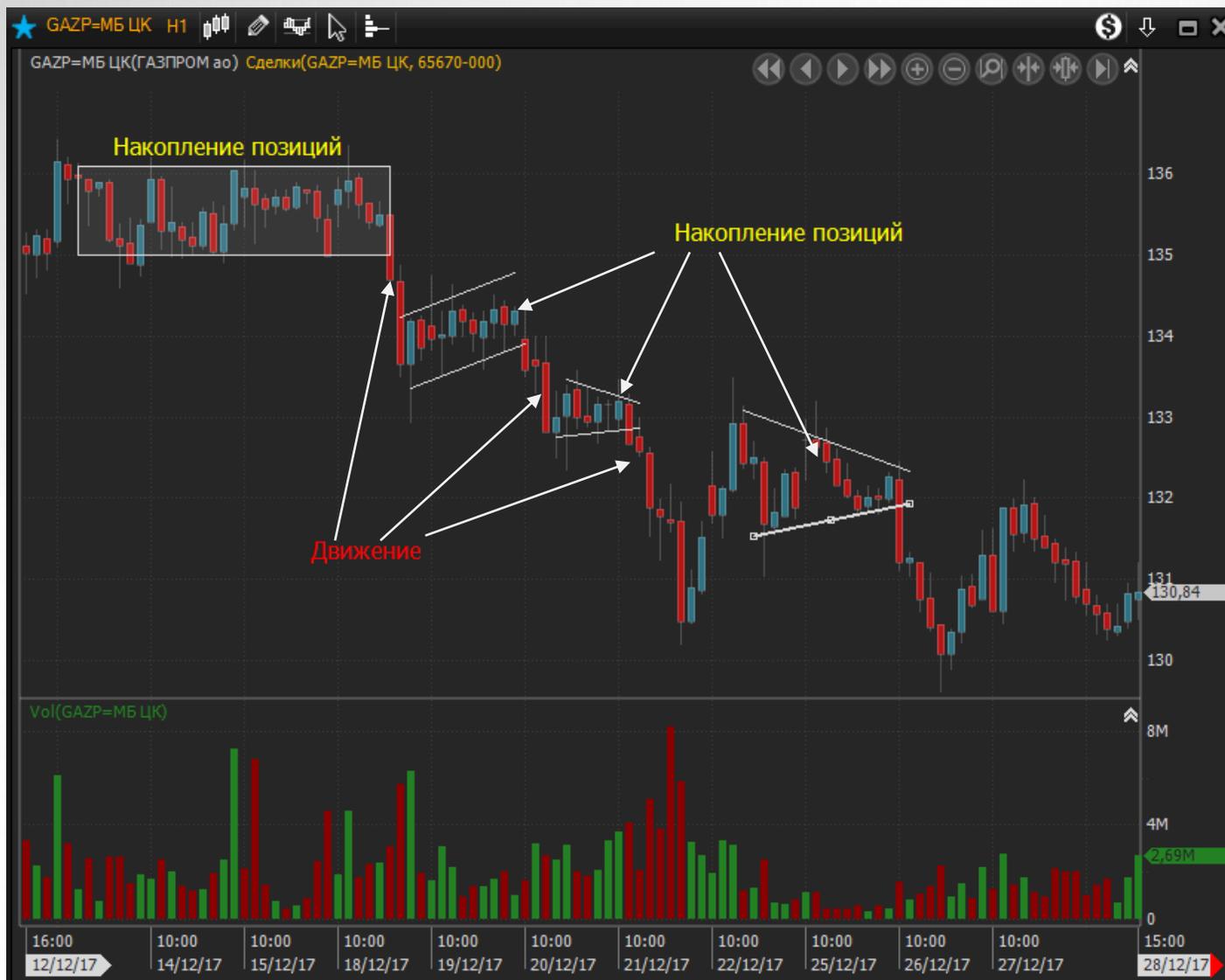


- Боковик с сужением амплитуды движения цены



- Нестандартный боковик





- В боковике происходит накопление позиций участниками
- Когда позиции набраны – идёт движение
- Часто движению способствует какой-нибудь информационный повод



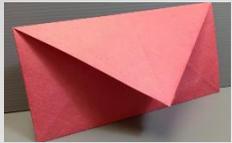
Пробой – это закрытие цены за пределами зоны накопления позиций (боковика).



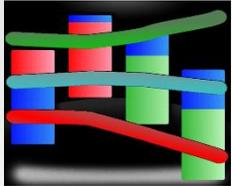
- Широкие боковики более устойчивы к сохранению текущей тенденции
- Узкие боковики менее устойчивы к сохранению текущей тенденции
- Ширина боковика проверяется расстоянием между границами боковика (широкий боковик – более 4 значений ATR)



* ATR – средний диапазон свечи с учётом ценовых разрывов.



Envelopes – ценовой конверт



Bollinger Bands – полосы Боллинджера



Price Channel – ценовой канал



Open Range – канал открытия торгов



- Покупка – пробой верхней линии
- Продажа – пробой нижней линии

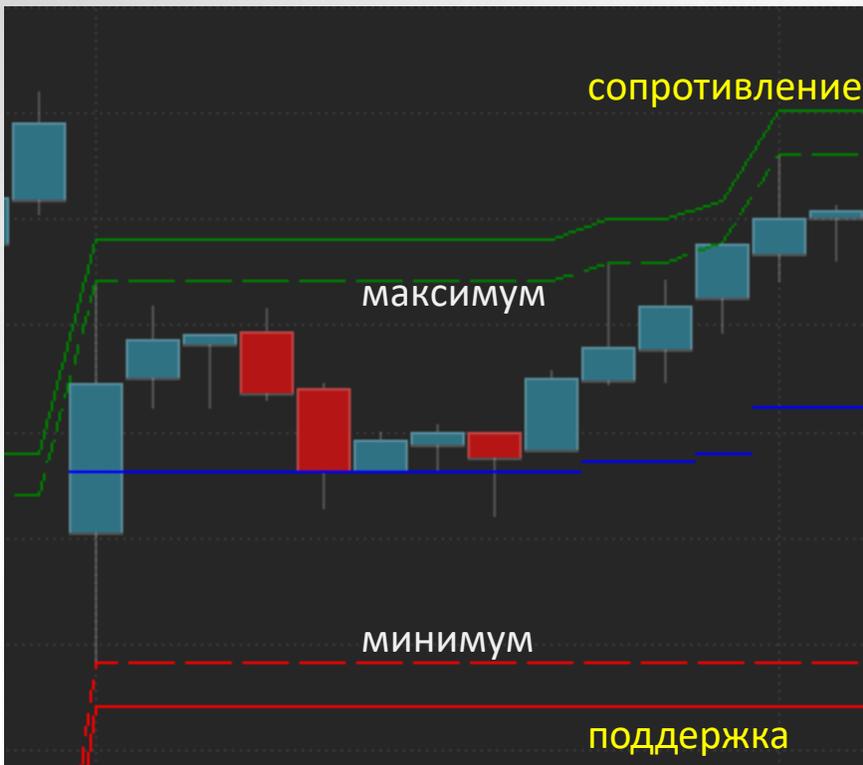


Первоначальный стоп:

1. За пробойную свечку
2. За противоположную линию канала

Альтернативный выход:

1. При достижении цели
2. При пробое противоположной линии канала



- Определяем период открытия (обычно первые 15-60 мин)
- Находим минимум и максимум в диапазоне открытия
- Строим поддержку (Минимум - Delta)
- Строим сопротивление (Максимум + Delta)

* Delta – ошибка колебаний (в %)

Delta подстраивается индивидуально под каждый инструмент.

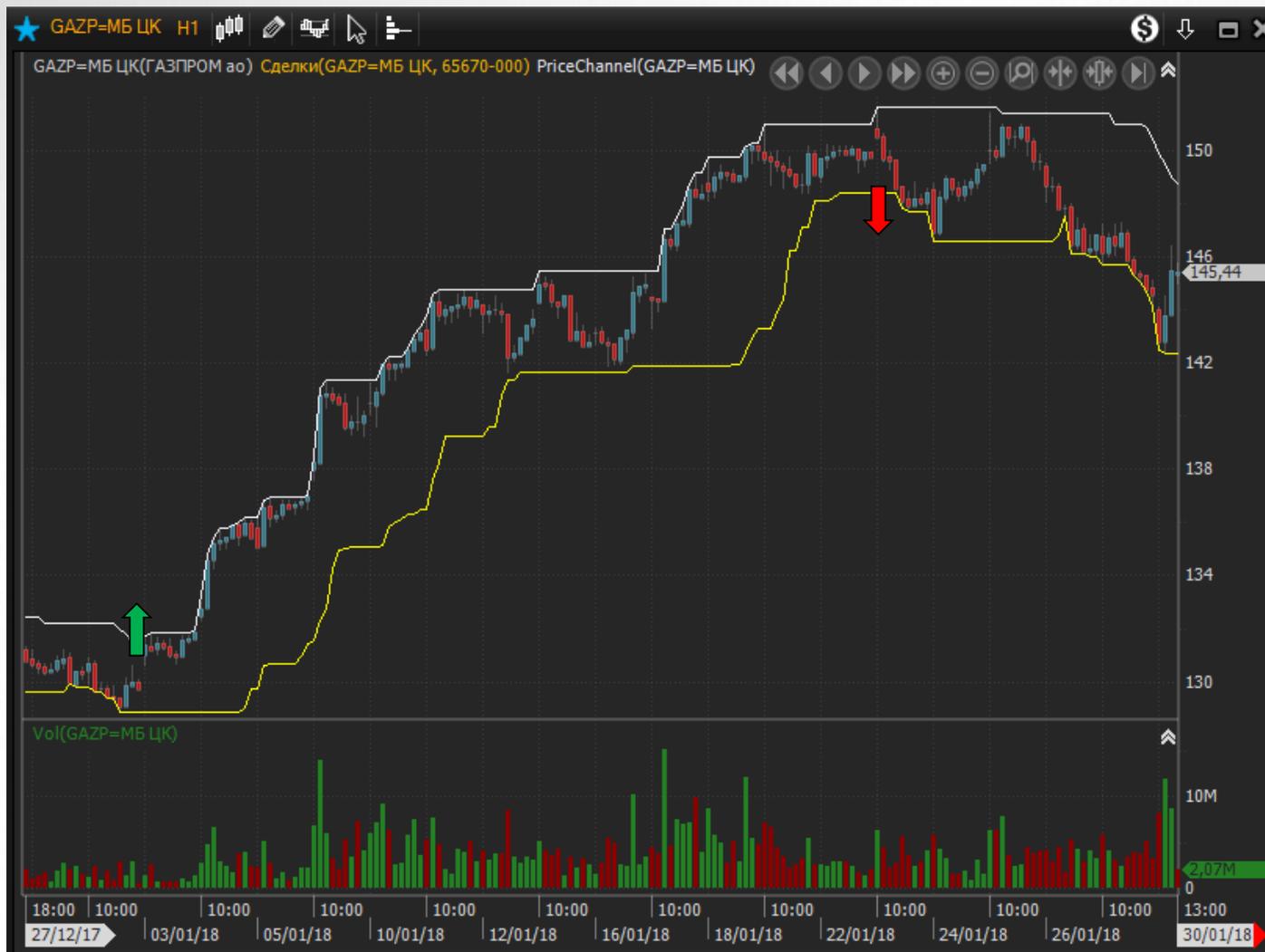




1. Использовать для торговли только ликвидные активы.
2. Параметры метода настраивать под конкретный актив : а) период диапазона открытия; б) величины закладываемых ошибок колебаний; в) варианты постановки стоп-приказов.
3. Ограничивать количество сделок в день (1 или 2 сделки в день, торговать до первой убыточной сделки и т.д.).
4. Использовать учет общего направления тенденции.
5. Против точек отсчета не торговать в узком диапазоне.
6. На пробой точек отсчета торговать при узком диапазоне или когда цена открытия текущего дня отличается от цены закрытия предыдущего дня на 0,3-0,5% .



- Пробой верхней линии – ПОКУПКА
- Пробой нижней линии - ПРОДАЖА



Первоначальный стоп:

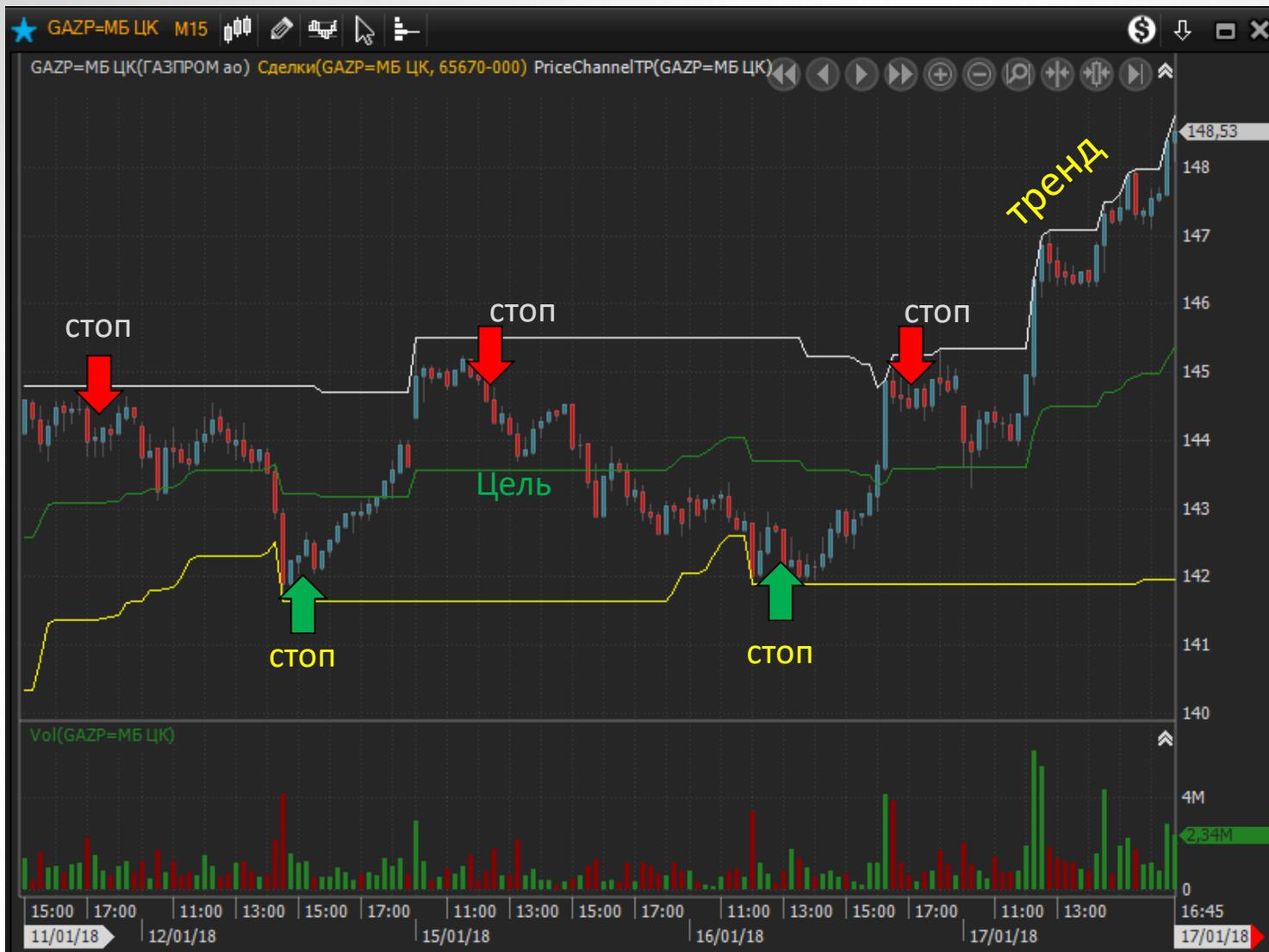
1. За пробойную свечку
2. За противоположную линию

Сигнал на выход:

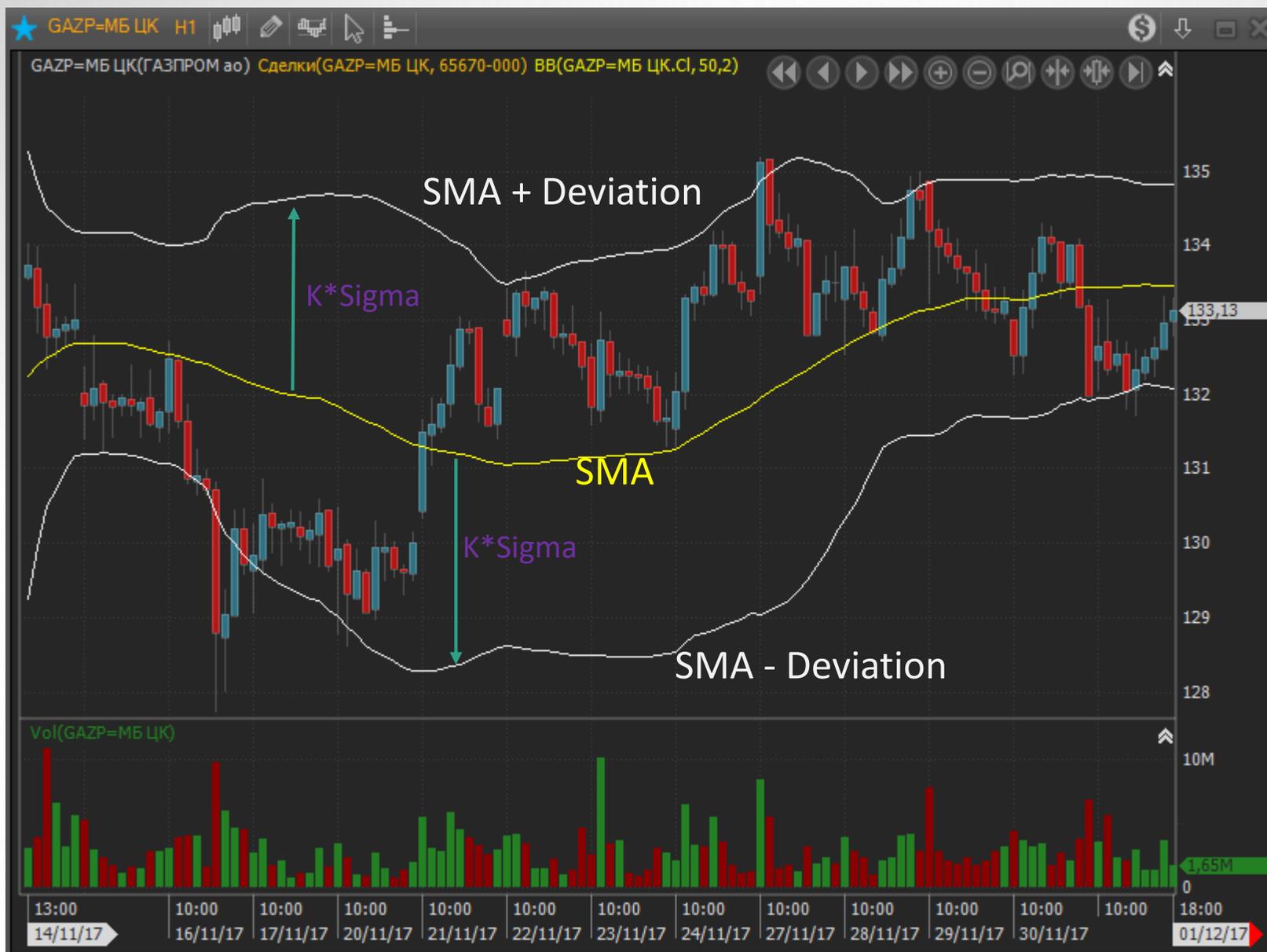
1. Достижение цели
2. Пресечение противоположной линии

Эмитент	Реверсивный подход		Фильтр тренд NRTR 4%	
	Доходность (%)	Просадка (%)	Доходность (%)	Просадка (%)
Сбербанк (параметр РС 17)	35,82	-9,25	45,42	-11,24
Газпром (параметр РС 9)	39,72	-5,3	29,81	-4,84
Роснефть (параметр РС 8)	38,21	-9,25	31,53	-9,65
МОЕХ (параметр РС 4)	44,72	-9,67	27,2	-7,24
Аэрофлот (параметр РС 10)	61,27	-13,99	36,18	-12,12
Магнит (параметр РС 4)	50,36	-9,72	32,65	-9,61
Сбербанк_П (параметр РС 30)	55,81	-7,87	58,44	-6,57

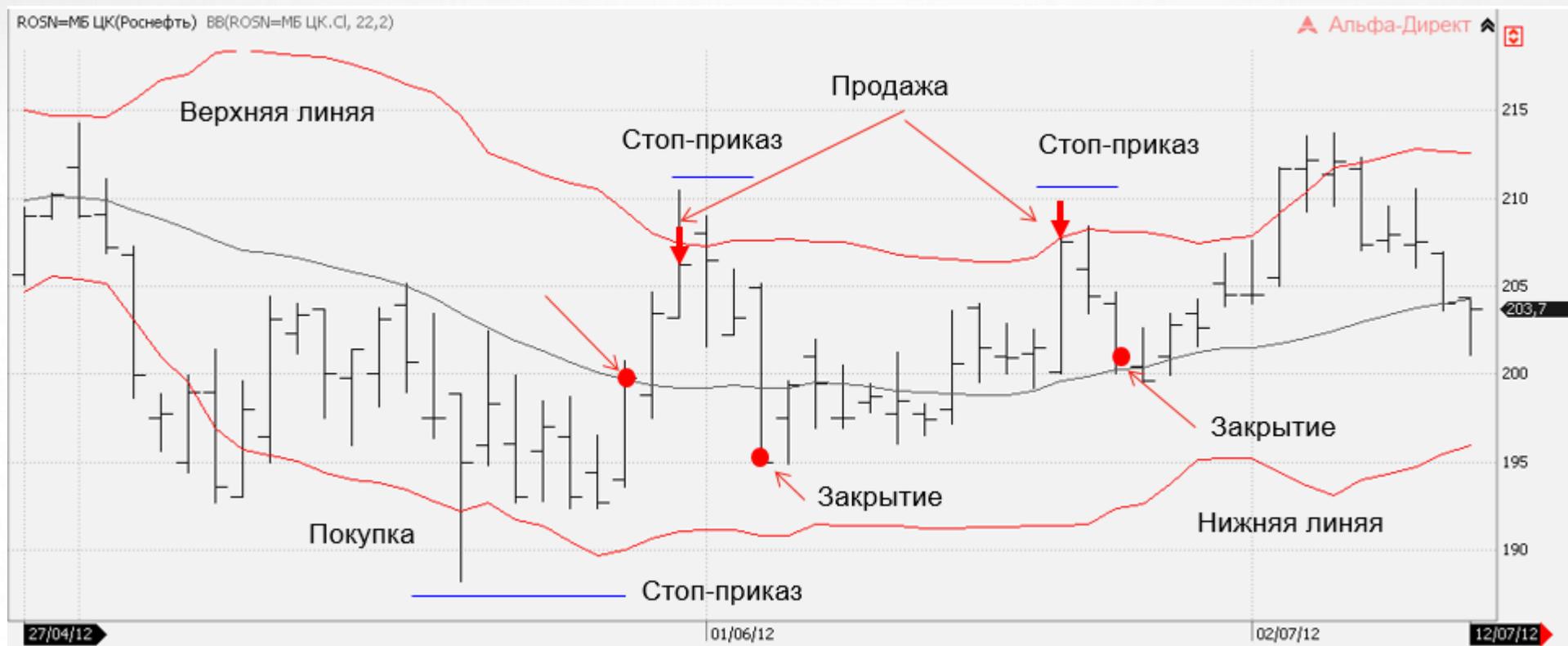
РС: Подбор параметров произведен на часовых данных с декабря 2016 по декабрь 2017 г.



- ПОКУПКА – от нижней линии
- ПРОДАЖА – от верхней линии



- минимум текущего бара ниже, а его цена закрытия и минимум предыдущего бара выше нижней линии (прокол внизу) – покупка и стоп под минимум
- цена пробила среднюю линию – закрываем позицию
- максимум текущего бара выше, а его цена закрытия и максимум предыдущего бара ниже верхней линии (прокол вверху) – продажа и стоп над максимумом
- цена пробила среднюю линию – закрываем позицию



Выход цены за пределы полос Боллинджера – предпосылка к трендовому движению

- Цена закрытия бара ниже нижней полосы – торговать от продажи
- Цена закрытия бара выше верхней полосы – торговать от покупки





Материалы, указанные в документе, носят информационный характер и не являются коммерческим предложением, рекомендацией или офертой по покупке, продаже, обмену или проведению любых операций, прямо или косвенно связанных с отчуждением имущества, проведением торговых, биржевых и внебиржевых сделок. Все расчеты, приведенные в документе, являются условными и приведены для описания механизма действия финансовых инструментов и процессов. АО «Альфа-Банк» оставляет за собой право вносить любые изменения и дополнения в информационные материалы и документы. Настоящий материал был предоставлен Вам на условиях конфиденциальности и не может быть передан другим лицам без согласия АО «Альфа-Банк». Данный материал распространяется исключительно для информационных целей. Распространение данного материала не является деятельностью по инвестиционному консультированию. Информация приведенная в данном материале не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией.

А

**Прямо
к цели**