

Поток ордеров

Автор:

[Иван Неделько](#)

Поток ордеров

Иван Неделько

Торговля с использованием потока ордеров в настоящее время очень популярна. И не спроста. Этот метод действительно позволяет достигать великолепных результатов. А сочетание с основной торговой стратегией "Запах Денег" существенно повышает Ваши шансы на успех. Что вы узнаете? Цель данной книги - дать вам точную, пригодную для немедленного применения информацию, не тратя ваше время на ненужные подробности и пустяки. Это та книга, которую я хотел бы иметь, когда начинал учиться торговать с помощью потока ордеров.

Иван Неделько

Поток ордеров

Уведомление о рисках

Торговля фьючерсами и валютой содержит значительный риск и подходит не каждому инвестору. Потенциально инвестор может потерять все или даже больше, чем первоначальные инвестиции. Рисковый капитал – это деньги, которые можно потерять, не подвергая опасности свою финансовую безопасность или образ жизни. Для торговли следует использовать только рискованный капитал, и только те, кто обладает достаточным рисковым капиталом, должны рассматривать возможность торговли. Прошлые результаты не обязательно являются показателем будущих результатов.

Уведомление о гипотетической эффективности

Гипотетические результаты имеют множество неотъемлемых ограничений, некоторые из которых описаны ниже. Не делается никаких заявлений о том, что любой счет достигнет или может достигнуть прибыли или убытков, аналогичных показанным; на самом деле, часто существуют резкие различия между гипотетическими результатами и фактическими результатами, достигнутыми впоследствии с помощью какой-либо конкретной торговой программы. Одним из ограничений гипотетических результатов является то, что они, как правило, составляются задним числом. Кроме того, гипотетическая торговля не связана с финансовым риском, и ни один гипотетический торговый отчет не может полностью учесть влияние финансового риска реальной торговли. Например, умение терпеть убытки или придерживаться определенной торговой программы, несмотря на торговые потери, являются существенными моментами, которые также могут негативно повлиять на фактические результаты торговли. Существует множество других факторов, связанных с рынками в целом или с реализацией какой-либо конкретной торговой программы, которые не могут быть полностью учтены при подготовке гипотетических результатов деятельности, и все они могут негативно повлиять на результаты торговли. Данная книга предназначена исключительно для образовательных целей, и высказанные в ней мнения принадлежат только автору. Все представленные сделки следует считать гипотетическими. Все операции проводятся не на реальном счете.

Что вы узнаете?

Цель данной книги – дать вам точную, пригодную для немедленного применения информацию, не тратя ваше время на ненужные подробности и пустяки. Это та книга, которую я хотел бы иметь, когда начинал учиться торговать с помощью потока ордеров. Вот что вы можете узнать:

- Выбор правильной торговой платформы для трейдинга с потоком заказов
- Платформа NinjaTrader 8 – введение
- Выбор правильного программного обеспечения для потока ордеров

- Где взять данные для потока ордеров
- Лучшие инструменты для торговли с потоком ордеров
- Поток ордеров – о чем он нам говорит
- Поток ордеров – особенности
- Как настроить рабочее пространство для работы с потоком ордеров
- Поток ордеров – торговые установки
- Поток ордеров – настройки подтверждения
- Как использовать поток ордеров для определения тейк-профита и стоп-лосса
- Как использовать поток ордеров для управления торговлей
- Как найти сильные поддержки и сопротивления на рынке с помощью профиля объема
- Как сочетать поток ордеров с профилем объема

Все это в понятной форме с большим количеством картинок и примеров.

Важное замечание

Прежде чем мы перейдем непосредственно к делу, я должен сказать вам, что это не волшебное руководство по «быстрому обогащению». Поток ордеров -это фантастический инструмент, а стратегии, которые я собираюсь вам показать, являются лучшими проверенными стратегиями, которые я знаю. Но само по себе это не сделает вас великим трейдером. Точно так же, как покупка нового автомобиля Ferrari не сделает вас лучшим водителем. Вам нужно

практиковаться, и вам нужен практический опыт. Вы должны уделить время и энергию тому, чтобы научиться торговать с потоком ордеров самостоятельно! Практическому опыту нельзя научиться по книге!

Итак, если вы не возражаете, что я не буду давать вам «волшебную таблетку» (так как ее не существует), тогда давайте перейдем к первой главе!

Настройка потока ордеров

Платформа для трейдинга NinjaTrader 8

Торговая платформа, которую я использую для работы с потоком ордеров, -это NinjaTrader 8. Я использую NinjaTrader 8 уже много лет и очень рекомендую ее.

Существенным преимуществом NinjaTrader 8 является то, что она является бесплатной. Да, так и есть. В ней есть бесплатный режим, в котором нет никаких ограничений и включены все ее функции. У меня еще не возникало причин переходить на платную версию, что говорит о том, насколько хороша бесплатная версия.

Кроме того, все индикаторы, которые я разработал для платформы NinjaTrader 8 (профильма объемов, VWAP и поток ордеров), работают и в бесплатной версии.

Я делаю так: провожу анализ на платформе NinjaTrader 8, но когда дело доходит до заключения сделок, я делаю это на другой платформе у своего брокера.

Существует небольшой список брокеров, которых можно подключить к NinjaTrader 8 и торговать прямо с этой платформы, но, на мой взгляд, есть брокеры лучше и дешевле, чем те, которые поддерживаются NinjaTrader 8. По этой причине я использую NT8 только для построения графиков, а сделки заключаю в другом месте. Это может показаться недостатком, но я считаю, что возможность самостоятельно выбирать брокера того стоит.

Вот несколько полезных ссылок для вас:

Скачать платформу NinjaTrader 8: ninjatrader.com

Другие торговые платформы

Меня постоянно спрашивают, может ли поток ордеров работать на платформе Metatrader 4. Хотя это возможно, существует слишком много ограничений и проблем. МТ4 – это программное обеспечение более чем 15-летней давности, и пытаться работать на нем с потоком ордеров – это все равно что ставить двигатель от Ferrari в старый, полуразбитый бюджетный автомобиль, думая, что с ним вы начнете выигрывать гонки.

Многим также нравится использовать TradingView для построения графиков. Это прекрасная платформа, но, к сожалению, вы не можете запускать на ней поток ордеров.

Есть и другие платформы для построения графиков; одна из самых известных (помимо NinjaTrader) – Sierra. Однако эта платформа не бесплатна; для ее использования необходимо вносить ежемесячную плату.

Подача данных для потока ордеров

Поток ордеров показывает все исполненные ордера на покупку и продажу, торгуемые на бирже. Чтобы увидеть эти ордера, вам нужен отличный канал данных, который предоставляет вам данные Bid и Ask. Такие данные часто называют данными «Уровня 1».

Существуют также данные «Уровня 2», но они вам не понадобятся. Данные 2го уровня включают глубину рынка, которую поток ордеров не использует (это полезно, например, только при чтении ленты).

Поскольку поток ордеров лучше всего использовать на централизованных рынках, я предлагаю вам использовать его с фьючерсными данными. Рекомендуемый мною поставщик данных – CQG.

CQG – Подача данных по фьючерсам

Вы можете получить бесплатное пробное подключение к каналу передачи данных здесь: niniatrader.com/FreeLiveData

Срок действия пробного подключения CQG истечет через некоторое время, и тогда у вас будет два варианта. Первый вариант – создать новую пробную версию, используя другой адрес электронной почты. Второй вариант – начать платить ежемесячную плату за передачу данных.

Я не думаю, что есть лучший способ получить бесплатные данные о фьючерсах в любом месте без ограничений.

Если вам нужно подключение для какого-то конкретного торгового инструмента, то лучший способ – написать напрямую в службу поддержки NinjaTrader и рассказать им, что вам нужно. Они помогут вам с любыми вопросами и дадут вам цену на подключение конкретного канала данных.

Обычно они отвечают быстро, и в целом они очень полезны. Вы можете связаться с ними по электронной почте здесь: platformsupport@niniatrader.com

Где получить поток ордеров

Если вы поищете в Интернете, вы обнаружите множество вариантов программного обеспечения для потока ордеров. Цена варьируется от 100 до 5 000 долларов, а некоторые стоят даже больше!

Давайте сначала поговорим о дешевых. Как и ко многим вещам в этом мире, здесь также применимо следующее: «Покупаешь дешевое – получаешь дешевое». Если вам удалось купить поток ордеров за \$100 где-то в интернете, не ждите, что его функциональность будет на высоте. Также не стоит ожидать помощи или обслуживания от поставщика программного обеспечения.

Другая крайность – это программное обеспечение потока ордеров за тысячи долларов. По моему опыту, они полны множества наворотов и опций, которые настоящему трейдеру не нужны. Они существуют только для того, чтобы оправдать высокую цену. Кроме того, по моему опыту, такое программное обеспечение часто разрабатывается кодерами, которые не являются настоящими трейдерами. Они не знают, что на самом деле нужно трейдеру. Эти ребята обычно кодируют любую функцию, которая приходит им в голову (полезную или нет), и добавляют ее в свое программное обеспечение. Таким образом, их поток ордеров выглядит полным крутых функций, чтобы оправдать более высокую цену.

Идеальное решение – получить программное обеспечение для потока ордеров от настоящего трейдера, который разработал его, работая рука об руку с разработчиком программного обеспечения.

Когда я работал над своим потоком ордеров, я следил за двумя вещами: Во-первых, ядро потока ордеров должно работать на 100%, быть хорошо оптимизировано и поддерживать работу с различными торговыми инструментами. Во-вторых, все уникальные функции моего потока ордеров должны быть полезными и нужными в реальной торговле. В моем программном обеспечении нет лишних функций или добавленных индикаторов «черного ящика», о которых никто толком не знает, что они делают и как рассчитываются. Я действительно горжусь специальными функциями, которые мы встроили в программное обеспечение, и мне не терпится показать их вам далее в этой книге!

С какими инструментами вы можете торговать с помощью потока ордеров?

Поток ордеров лучше всего использовать для дневной торговли. Наиболее популярными рынками являются:

Валютные фьючерсы / Форекс

- Фьючерсы на индексы (S&P 500, Nasdaq, Dow Jones, DAX...)

- Нефть, металлы (золото)

- Акции

Я использую поток ордеров в основном для валютных фьючерсов. Как я уже говорил, я делаю свой анализ на NinjaTrader 8, используя валютные фьючерсы. Затем я заключаю сделки с моим брокером на рынке Форекс спот.

С какого торгового инструмента следует начать?

Я рекомендую начать только с одного торгового инструмента, например, 6Е (фьючерс на евро), и сосредоточиться исключительно на нем. Причина в том, что каждый торговый инструмент ведет себя по-разному. У каждого инструмента или рынка разный средний объем торгов, разное время, когда он наиболее активен, разная реакция и т.д. Чтобы освоить один инструмент, требуется много времени!

Профессиональные дневные трейдеры часто фокусируются только на одном торговом инструменте, который они освоили и которым торгуют. Когда я начинаю, я не вижу преимущества в выборе многих рынков, так как это только усложнит процесс обучения.

Я фокусируюсь в основном на 6Е (фьючерс на евро). Именно здесь я чувствую себя наиболее комфортно и именно здесь у меня самые лучшие результаты торговли.

Поток ордеров: Форекс в сравнении с фьючерсами

«Почему мы должны использовать фьючерсы вместо Форекс?» Это хороший вопрос, который мне задают довольно часто.

Разница между ними заключается в следующем:

Фьючерс: Централизованный, что означает, что все на планете видят одну и ту же цену и объемы сделок. Самое главное, что фьючерсы позволяют нам видеть, какой объем был продан по Бид и Аск.

Форекс: Децентрализован, что означает, что только люди, использующие одного и того же поставщика данных, видят одни и те же цены и объемы. Данные от каждого поставщика данных могут немного отличаться. Не слишком сильно, но разница есть. Главный недостаток фьючерсов заключается в том, что поставщики данных Форекс не могут различать Бид и Аск (а если могут, то плохо справляются). Поэтому лучшее, что вы можете получить, это общий объем (= сумма Бид и Аск).

Общие объемы (Бид + Аск)

Перенос торговых уровней с валютных фьючерсов на Форекс

Поскольку я провожу анализ на валютных фьючерсах, но затем заключаю сделки на рынке Форекс, мне необходимо перенести уровни поддержки/сопротивления с фьючерсов на Форекс.

Перенос уровней с фьючерсов на евро и австралийский доллар на EUR/USD и AUD/USD (Форекс) довольно прост. Вы помещаете два графика рядом друг с другом, визуальнo сравниваете, а затем переносите уровень слева направо. Найти уровень довольно просто, потому что корреляция практически 100 % (графики выглядят одинаково).

Перенос уровней становится более сложным с фьючерсами на канадский доллар, японскую йену и швейцарский франк, поскольку корреляция составляет -100 %, что означает, что графики являются обратными. Кроме того, один пункт на фьючерсах не равен одному пункту на Форекс. С фьючерсами на CAD, JPY и CHF я

все еще передаю уровни «визуально», но вам нужно представить, что график Форекс перевернут. Это требует некоторого времени и усилий, чтобы делать это несколько раз в день, но с некоторой практикой вы сможете делать это быстро. Это очень похоже на обучение езде на велосипеде: как только ваш мозг освоит это, он сможет это делать!

Поток ордеров – участники рынка

Большинство людей приходят в замешательство, когда впервые открывают график потока ордеров. В этом нет ничего постыдного. Поток ордеров показывает так много информации, что легко запутаться, если не знать, что искать! Не волнуйтесь, к тому времени, когда вы закончите эту книгу, вы сможете читать поток ордеров без проблем :)

Для начала разберем основные моменты, например, что показывает поток ордеров и как его читать.

Пассивные и активные (агрессивные) участники рынка

Чтобы понять, что происходит на графике потока ордеров, сначала нужно понять одну фундаментальную вещь: различие между пассивными и активными участниками рынка. Возможно, это звучит как слишком много теории, но эта информация жизненно важна. Если вы не уверены, что поняли ее с первого раза, пройдите по ней еще раз. Если вы не поймете этот момент сейчас, то потом потеряетесь. Готовы? Поехали!

Пассивные участники рынка

Пассивные участники рынка – это трейдеры, которые входят в свою сделку с лимитным (отложенным) ордером.

Они не гонятся за рынком. Они ждут, пока цена сама придет к ним, а затем заключают сделки только по той цене, которая им нужна (или лучше).

Каждый субъект на рынке может быть пассивным участником. Неважно, кто это – банк, пенсионный фонд, фонд хеджирования или частный трейдер вроде нас с вами. Это просто каждый, кто входит в сделку с лимитным ордером. Если вы размещаете лимитный ордер в своей торговой платформе, вы являетесь пассивным участником рынка.

Когда цена достигает лимитного ордера, который вы разместили на рынке, ордер исполняется, и вы входите в сделку (вы только что открыли торговую позицию). Эта торговая позиция будет отображаться на следе потока ордеров.

Если вы открыли ДЛИННУЮ позицию с лимитным ордером, то она появится на стороне БИД (слева).

Если вы открыли КОРОТКУЮ позицию с лимитным ордером, то она появится на стороне АСК (справа).

Пока все хорошо? Теперь все станет немного сложнее:

Активные участники рынка

Активные участники рынка – это трейдеры, которые заключают свои сделки с помощью рыночных ордеров. Если вы нажимаете рыночный ордер на покупку или продажу, то вы являетесь активным участником рынка. Ваша позиция будет немедленно заполнена.

Неважно, где в данный момент находится цена, неважно, где именно будет заполнена сделка, агрессивные участники просто хотят войти. Сейчас! Даже

если это означает риск проскальзывания (сделка не откроется точно по той цене, по которой они нажали кнопку покупки/продажи).

Рыночный ордер полезен в ситуациях, когда нет времени ждать, пока вся ваша позиция заполнится именно по той цене, которую вы хотели. Например, такое может произойти при быстром движении цены, которое вы не хотите пропустить.

Если вы открываете ДЛИННУЮ позицию с рыночным ордером, она появится на стороне БИД (справа).

Если вы открываете КОРОТКУЮ позицию рыночным ордером, она появится на стороне АСК (слева).

Активные и пассивные в одном графике

Различие между пассивными и агрессивными участниками рынка – вот что приводит многих людей в замешательство. Это основная причина, по которой они не могут правильно использовать поток ордеров и не могут заработать на нем деньги, поэтому я подчеркиваю важность этого момента!

Позвольте мне привести еще две картинки, которые подведут итог. Если вы не уверены на 100% в том, где пассивные и агрессивные трейдеры отображаются на следах, то я советую вам распечатать эти картинки так, чтобы вы могли видеть их во время торговли.

На рисунке ниже показаны два одинаковых следа и два варианта их интерпретации.

Позвольте мне свести все это в одну картинку, которая суммирует все это:

На картинке выше написано вот что:

- БИД: Показывает агрессивных продавцов и пассивных покупателей.
- АСК (предложение): Показывает агрессивных покупателей и пассивных продавцов.

Если вы поняли это, то ваш первый вопрос, вероятно, будет таким, «Как я могу узнать, является ли номер, который только что появился в БИД, номером пассивного продавца или агрессивного покупателя?»

Боюсь, что ответ вам не понравится, поскольку нет способа узнать это с абсолютной уверенностью!

Хорошая новость заключается в том, что в этой книге я научу вас, как сделать разумную оценку, которая позволит вам сделать правильное предположение в большинстве случаев. Не во всех случаях – я не обучаю магии, как я уже предупреждал вас.

Больше перспектив (БОНУС)

Чтобы представить все в более широком масштабе, позвольте мне показать вам еще одну вещь. Возможно, вы видели некоторые индикаторы профиля объема с двумя цветами, и разработчики говорили вам, что один цвет показывает продавцов, а другой – покупателей. Например, вот этот:

Если кто-то говорит вам подобное, то он явно не знает, о чем говорит.

Исходя из того, чему я вас только что научил, вы теперь знаете, что когда объемы появляются в БИД, это могут быть как агрессивные продавцы, так и пассивные покупатели. А когда объемы появляются в АСК, это могут быть как агрессивные покупатели, так и пассивные продавцы! Если кто-то говорит вам,

что «зеленый» означает покупателей, а «красный» – продавцов, он говорит вам полуправду.

Поток ордеров – Описание основного графика

В этой главе я собираюсь описать стандартное программное обеспечение потока ордеров и описать его основной интерфейс. Вы можете использовать полученные сведения для большинства распространенных программных потоков ордеров, так как ядро должно быть одинаковым для каждой из них.

Следы

Поток ордеров не показывает стандартные свечи, но он показывает СЛЕДЫ.

След показывает не только значения открытых, высоких, низких и закрытых позиций, как это делают обычные свечи, но и ордера, которые были выставлены в пределах этой свечи.

Ордера выставляются на Бид или на Аск Когда ПОКУПАТЕЛЬ заключает длинную сделку (с рыночным ордером), его позиция отображается на стороне АСК. Когда ПРОДАВЕЦ заключает короткую сделку (с рыночным ордером), его позиция отображается на БИД.

Вот как строится график потока ордеров:

Зеленые/красные ячейки

Внутри каждого следа есть зеленые или красные ячейки.

Ячейка ЗЕЛЕНАЯ, если число в Аск больше числа в Бид.

Она КРАСНАЯ, если Аск больше, чем Бид.

Проще говоря, это отражает соотношение сил покупателей и продавцов.

Однако, как вы узнали из предыдущей главы, это не всегда так, и здесь есть много других нюансов. Но для простоты изложения давайте оставим эту часть и вернемся к ней, когда будем говорить о стратегиях потока ордеров.

Обычно (не всегда), растущие следы преимущественно зеленые (более сильные покупатели), а снижающиеся следы преимущественно красные (более сильные продавцы)).

Узлы большого объема (HVN)

Возможно, самым важным местом в любом следе является узел большого объема. Он представляет собой место, где торговались самые высокие объемы, место, где компании были наиболее активны. Он обозначен черным контуром, что делает его легко заметным с первого взгляда.

Если на одной и той же цене в двух или более последовательных следах есть больше узлов большого объема, то моя собственная программа потока ордеров выделит их желтым цветом. Подобные ценовые уровни представляют собой зоны поддержки/сопротивления.

Дельта

Под каждым следом (место может меняться в зависимости от используемого программного обеспечения) есть число, которое является либо зеленым, либо красным.

Зеленый цвет (положительный) – это когда больший объем исполняется по Аск (во всем диапазоне).

КРАСНЫЙ (отрицательный) – когда больший объем исполняется по Бид (во всем объеме).

Это, по сути, говорит вам о том, кто сильнее в данном фьючерсе – покупатели или продавцы. Растущие следы имеют положительную дельту (ЗЕЛЕНЫЙ). Снижающиеся следы обычно имеют отрицательную дельту (КРАСНЫЙ). Это справедливо в основном для движущихся рынков.

Если происходит ротация, то здесь нельзя так сильно полагаться на этот показатель. Причина в том, что во время ротации крупные учреждения обычно вступают в торговлю как рыночными, так и отложенными ордерами. Они комбинируют эти два типа ордеров, пытаясь скрыть свои истинные намерения.

Что должно привлечь ваше внимание, так это когда вы видите растущий след с отрицательной дельтой или снижающийся след с положительной дельтой.

Растущий след с отрицательной дельтой говорит вам следующее: Цена растет, но продавцы входят в короткие позиции, и они сильнее покупателей.

Снижающийся след с положительной дельтой говорит следующее: Цена падает, но покупатели входят в свои длинные позиции, и они сильнее продавцов.

Оба эти сценария являются предупреждением о возможном развороте цены (развороты цены следуют за дельтой).

ПРИМЕР: Расхождение цены и дельты

Приведу пример сделки, которую я совершил пару дней назад по фьючерсам на евро:

1. Я определил сильный уровень сопротивления на паре EUR/USD с помощью профиля объема. Я опубликовал этот уровень сопротивления неделю назад на своем сайте.
2. Я ждал почти неделю, пока цена достигнет этого уровня сопротивления.
3. Когда это произошло, в течение всего дня наблюдался сильный восходящий тренд. Было бы рискованно входить в короткую сделку от сопротивления против этого сильного восходящего тренда. По этой причине я использовал свою программу потока ордеров, чтобы точно определить, когда вокруг этого сопротивления начали появляться продавцы.
4. В потоке ордеров я посмотрел на инструмент 6E 12-20, который является фьючерсом на EUR. Он на 100% коррелирует с парой EUR/USD (Форекс), на которой я размещаю свои трейды. Причина, по которой я смотрел на фьючерсы, заключалась в том, что мне нужно было видеть отдельные объемы Бид x Аск и Дельту (которую Форекс не показывает).
5. Когда цена достигла сопротивления на основе объема, между ценой и дельтой возникло значительное расхождение. Цена росла, а дельта падала! Это означало, что, хотя цена росла, сильные и агрессивные продавцы входили в рынок все больше и больше! Это одно из моих любимых торговых подтверждений, поэтому я вскочил в короткую позицию.
6. Я довольно легко взял тейк-профит в 10 пунктов. Я не хотел пытаться взять больше, потому что евро находился в сильном восходящем тренде. Торговать в короткие позиции против сильного восходящего тренда рискованно, поэтому лучше было взять меньшую прибыль и выйти из сделки.

Вот что я увидел, когда вошел в короткую сделку (цена растет, дельта отрицательная).

* КСТАТИ. На этом рисунке показаны следы с общим объемом (сумма Бид + Аск).

Такова была реакция:

В этой сделке было еще кое-что, о чем я не буду упоминать для простоты. Я хочу, чтобы вы сосредоточились на расхождении между растущей ценой и падающей дельтой. Именно это и предсказало разворот цены.

Резюме по следам

Панель в нижней части графика потока ордеров показывает сводку по каждому следу.

Вы можете настроить ее так, как вам удобно, чтобы показывать только ту информацию, которая необходима для вашей стратегии. Лучше всего не иметь слишком много итоговой информации и сосредоточиться только на самом важном.

Вот картинка, на которой показана вся панель сводок:

Такая панель является вполне стандартной для многих программных продуктов потока ордеров. Разработчики любят хвастаться тем, сколько полезных вещей она показывает. Правда в том, что вам не понадобятся все эти функции, поскольку они отвлекают от более важных аспектов. Лично я использую только показатели дельты, кумулятивной дельты и объема. Это дает мне быструю вводную информацию:

Конец ознакомительного фрагмента.

Купить: https://tellnovel.com/ru/nedel-ko_ivan/potok-orderov

Текст предоставлен ООО «ИТ»

Прочитайте эту книгу целиком, купив полную легальную версию: [Купить](#)