

В погоне за объемом

АНАЛИЗ СДЕЛОК КРУПНЫХ ИГРОКОВ
С ПОМОЩЬЮ WALL STREET TRADER

Практическое руководство по торговле
ТОМ СКОЛЛАНД | 2018

Оглавление

Как Использовать Систему? Стратегии На Основе Полученных Данных.....	2
Обозначения	2
Что Поможет Для Определения Уровней?.....	11
Как Пользоваться Версией Wall Street Trader Pro	13
Пример Анализа На Базе Самой Простой Версии WallStreetTrader Basic.....	14
Пример Анализа На Основе Данных New Buys / Sales Exit / New Sales / Buys Exit.....	17
Пример Анализа На Основе Данных Preparation For A Trend / Global Trend / Preparation For Buys / Preparation For Sales / Preparation Direction	20
Пример Анализа На Основе Всех Данных.....	28

Как Использовать Систему? Стратегии На Основе Полученных Данных

Обозначения

Big Money Activity

Очень важный показатель, который показывает время и место, где крупный игрок нашел на рынке ликвидность для открытия очень крупных позиций. Такие места очевидно могут быть очень сильными уровнями поддержки или сопротивления для текущего или нового, зародившегося здесь, тренда.

Ежедневно на рынке происходит торговля между различными участниками торгов. Но бывают дни, когда на рынке видно присутствие крупного игрока, маркетмейкера. Объемы таких игроков обычно двигают рынок. Но важно то, что как правило крупный игрок старается открывать позиции в одном направлении, и далее управляет своей позицией по ходу торгов в течение торговых дней. Кроме того крупный игрок старается защищать свои позиции и не пускать рынок против них. По отчетам или графикам COT обычно видно, какой из крупных игроков на рынке является самым активным: на одних рынках толкать цену могут хедж фонды, а на других - например своп дилеры.

Крупного игрока достаточно сложно вычислить на рынке, однако есть алгоритмы, по которым его можно отследить: активность по открытию новых позиций, размер позиций, количество скрытых позиций в стакане (айсберг ордера), количество одновременно открываемых позиций на фьючерсах и форвардах, опционах; количество внебиржевых сделок, скорость их открытия, и однонаправленность; а так же приход на рынок "глупых денег" в очень большом количестве, когда эти деньги можно использовать для открытия противоположных сделок крупным игроком. С помощью нашего сервиса Вам не придется делать это самостоятельно, производя ресурсоемкие вычисления, и Вы сможете видеть присутствие крупного игрока наглядно в виде шкалы его активности.

Обычно крупный игрок появляется на рынке, когда складываются хорошие фундаментальные предпосылки для роста или падения рынка. Он может появиться на рынке перед важными экономическими событиями. Так же он может войти в рынок в ситуациях, когда на рынке наблюдается ажиотаж со стороны различных спекулянтов, чтобы удовлетворить их спрос (для примера, подобная ситуация была в 2014 году по паре USD/RUB где рынок развернулся после того, как на него пришел крупный игрок и продал большое количество долларов за рубли, удовлетворив тем самым невероятный спрос спекулянтов. Так же крупный игрок нередко появлялся на рынке при переходе фьючерсных контрактов с одного на другой, когда крупный игрок вынужден закрывать позиции на истекающем контракте, и открывать на новом. В таких случаях зачастую бывает, что, например, в первые 2-3 дня на новом контракте рынок например падает, и при этом видно что в рынок входит крупный игрок, открывая большое количество продаж. После чего в течение следующих дней/недель/месяцев рынок может долгое время падать. Пример - ситуация на фьючерсе евро в том же 2014 году в июне (будет рассмотрена на примере наглядно ниже).

Preparation for a trend

Скорость открытия новых позиций крупными игроками. Может быть сигналом к тому, что скоро вырастет волатильность на рынке.

Данный показатель высчитывается исходя из двух факторов: спешка крупного игрока по открытию новых позиций, и их размер. Обычно, когда крупный игрок начинает быстро входить в рынок, и на повышенных объемах, это свидетельствует о том, что сразу же после этого или на следующий день нас может ожидать очень быстрое движение рынка/начало нового тренда/быстрое продолжение текущего, и так далее. Подобное поведение может происходить так же за день до выхода важных новостей, экономических показателей, таких как Nonfarm Payrolls и прочих.

Возможная стратегия для данного случая - это покупка волатильности. Когда мы видим сильную подготовку к тренду, то это означает что волатильность на рынке скоро сильно повысится. И можно купить индексы волатильности по данному торговому инструменту.

Иногда при очень большой активности таких крупных игроков можно реализовывать стратегию опционного спреда (на инструментах с высокой волатильностью). Например, Вы не знаете куда пойдет рынок, но видите, что волатильность готова вырасти. Вы можете купить сразу два опциона, один put и другой call. В результате чего при резком скачке рынка на следующий день один из опционов у Вас сгорит, а другой даст прибыль.

Но нужно помнить, что данные стратегии работают, если день не был волатильным. Если день был волатильным, значит сигнал показателя скорее всего уже отработан в рынке. Это примечание для случаев, если Вы используете End of Day данные, а не смотрите таблицу онлайн.

Показатель подготовки тренда высчитывается в двух вариантах - в абсолютных величинах и относительных. Абсолютная величина основывается на точных значениях появившихся на рынке объемов крупного игрока. Относительный показатель сравнивает этот объем с общим объемом рынка за день, и показывает это в виде процента.

Как видите, у нас есть несколько "сильных" дней с Big Money Activity.

Далее мы видим что крупный игрок в течение этих дней пассивно открывал новые сделки на Sell - смотрите область 1.

И более того, 19 июня 2017 мы видим что крупный игрок даже закрывал сделки на Buy, притом это были впечатляющие объемы - область 2.



Подобные ситуации хороши для торговли, т.к. содержат в себе сильные однонаправленные сигналы. За счет того что величина Big Money Activity большая, и объемы сделок однонаправленны. Или практически однонаправленны, как в данном случае, потому что 12 июня все-таки часть сделок была в покупку.

Однако в целом, хотя тренд по индексу и был глобально возрастающим, однако подобные сильные продажи крупного игрока, и закрытие позиций в Buy все-таки сдвинули в итоге рынок вниз.

Стоит так же не забывать, в какие именно дни происходит подобная крупная активность. Так как в данном конкретном примере ситуация прилась на время, когда по индексу истекал старый контракт EPM2017 и новые сделки открывались на контракте EPU2017. До этого тренд был повышательный, и крупные игроки были в покупках. Поэтому логично что 19 июня 2017 года (область 2) они закрывали именно покупки, т.к. у них на руках были именно они. Поэтому для нас более интересен тот факт, что новые сделки они открывали именно в продажу, уже на очевидно новом контракте.

Переход с одного контракта на другой так же объясняет большие значения в колонке Big Money Activity, т.к. в дни перехода с контракта на контракт все крупные игроки вынуждены

в кратчайшие сроки закрывать свои старые позиции и открывать новые на новых контрактах.

Global Trend

Показывает направление сделок крупных позиционных игроков на рынке по дальним контрактам, форвардам и опционам.

Preparation for Buys / Preparation for Sales

Дни, когда крупные трейддеры (такие как хедж фонды, большие компании) начинают входить в рынок по дальним контрактам, форвардам и опционам. Здесь Вы можете увидеть направление их сделок (в бай или селл). Важно учесть, что это могут быть сделки как по фьючерсам, так и по форвардам, опционам, ОТС, и так далее. И цены покупок или продаж могут существенно отличаться от текущих цен на рынке. Поэтому данный показатель позволяет узнать лишь о готовящейся остановке тренда. Либо о готовящейся поддержке тренда в случае его коррекции.

Например, если рынок растет, но мы видим продажи, это будет означать, что крупные игроки скорее всего определили для себя границу текущего тренда (либо очередную остановку в нем) где то выше по рынку.

Кроме того данные сделки могут открываться крупными игроками для хеджирования текущих позиций в рынок, и это нужно иметь в виду. На каких то рынках будет легко ориентироваться по данному показателю, чтобы увидеть начало окончания тренда заранее. Но на каких то рынках этот показатель вообще не будет влиять на рынок.

Примечание: на данном примере видно, что рынок готовился к будущим покупкам (Preparation Direction показал "зеленую" активность), и так совпало что на рынке произошли крупные сделки (Big Money Activity показал большие значения). Значит ли это что они являются покупками? Ответ: нет. Т.к. Preparation Direction не обязательно связан с текущими сделками на рынке (Big Money Activity), а обычно направлен на будущие сделки.



Preparation Direction

Это суммарный показатель для Preparation for Buys и Preparation for Sales. Показывает суммарное направление новых открываемых сделок крупных трейдеров.

Данный показатель отображает общее настроение рынка в течение времени. Он рассчитывается исходя из количества крупных открываемых сделок на рынке, и их направленности. Очень хорошо отображает общий тренд на рынке. Если в основном все дни зеленого цвета, и дни красного цвета встречаются редко, значит в целом на рынке присутствуют быки. И наоборот, если на рынке в основном присутствуют дни с красными показателями индикатора, а дни с зеленым цветом (и когда таких дней подряд очень мало), то рынок распродается на некоторые периоды времени вперед (обычно это от 1-2 недель и более).

Кратко говоря, индикатор становится интересен, когда на рынке появляются идущие друг за другом дни одного и того же цвета. Это говорит о поддержке крупными игроками определенного тренда на рынке.

Данный индикатор говорит о том, что крупный игрок начал довольно активно скупать или распродавать свои позиции. Чаще всего это бывает перед самым разворотом рынка. В случае если Вы видите показатели зеленого цвета, значит происходит выкупание, в случае с красными показателями - распродажа.

Эти данные очень хорошо применять вкупе с показателем Big Money Activity, т.к. в случае если крупный игрок входит на рынок с крупным объемом, будет проще оценить направление его сделок. Пример:

Перед Вами август 2017 года по фьючерсу E-mini SP500: Обратите внимание на дни: 1, 2, 3, 4 - после продолжительного падения рынка появились покупки на рынке. Покупки не были большими - они были такими, какими позволяла ликвидность рынка. Затем, в дни A и B ликвидность рынка увеличилась, и крупный игрок смог зайти в рынок достаточно большой позицией, и в день C он сильно добавил своих позиций. Не сложно догадаться что позиции были на покупку.



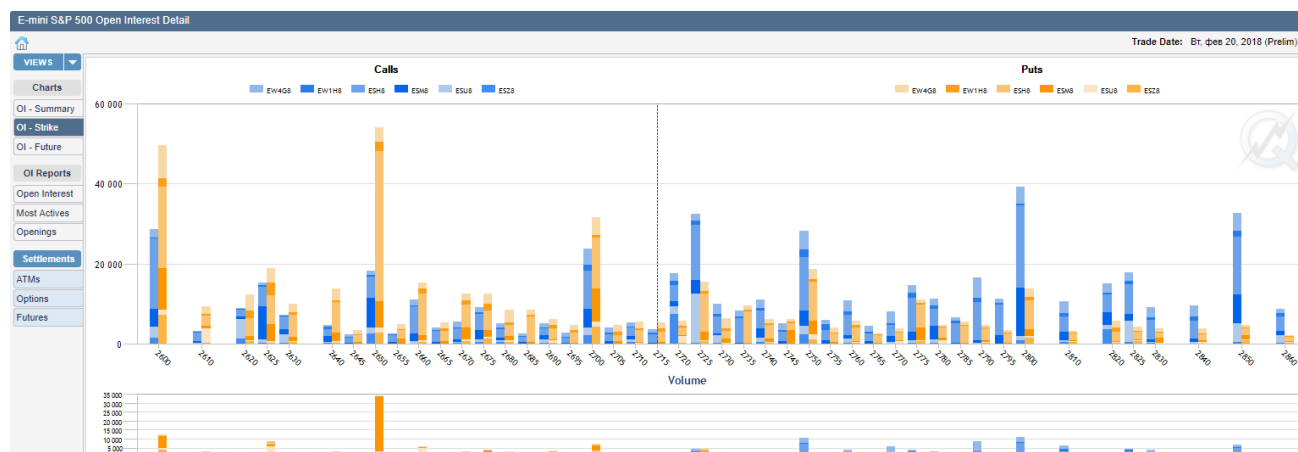
Поэтому можно взять уровни дней с большими входами крупного игрока за основу для будущих сделок, чтобы встать с ним в формирующийся бычий тренд. В чем суть таких уровней? Дело в том, что мало знать что крупный игрок покупает, ведь трейдеру важно войти в рынок с маленькой просадкой, т.к. трейдер ограничен в деньгах в отличие от крупного игрока. Поэтому лучше входить на тех же значениях, где крупный игрок открывал крупные позиции, потому что вряд ли он захочет пускать рынок ниже них.



Что Поможет Для Определения Уровней?

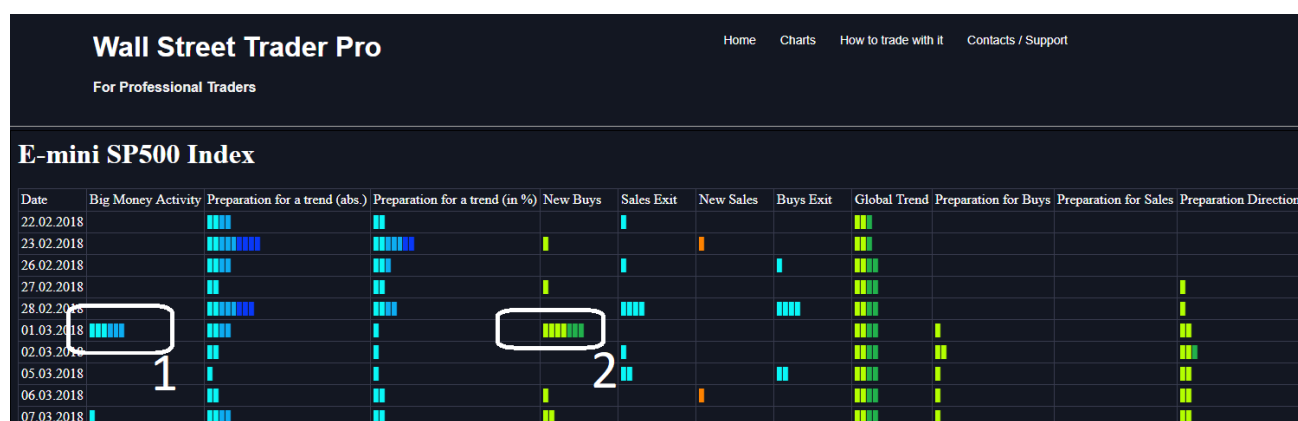
Замечено, что дни с крупной торговой активностью больших игроков появляются вблизи ценовых уровней с большим открытым интересом по опционам. Отследить такие уровни можно в торговых платформах (например, таких как CQG QTRADER) или на специализированных сайтах типа QuickStrike.

Рассмотрим как это работает на примере. Возьмем 20 февраля 2018 года по индексу e-mini S&P 500:



На страйке 2650 появился достаточно крупный объем, и открытый интерес по данному страйку так же очень высок. Поэтому при появлении крупной активности большого игрока вблизи этого уровня можно будет опираться на данную цену для формирования собственных торговых позиций.

На данный момент цена падала, и действительно, при подходе к данному уровню на следующий день появился крупный игрок (область 1). Который пассивно открывал сделки Buy в достаточно больших объемах (область 2):



После этого рынок рос, добавляясь к своей позиции 7 марта:



Данные в QuickStrike в бесплатной версии выходят с задержками, поэтому если Вам нужен вариант с онлайн обновлением данных, лучше использовать платформу QTRADER. В компании AMP FUTURES платформа QTRADER предлагается бесплатно. Либо Вы можете купить платформу QTRADER непосредственно в CQG.com - на данный день цена за платформу составляет \$50 ежемесячно. Так же нужно будет оплачивать стоимость котировок.

Как Пользоваться Версией Wall Street Trader Pro

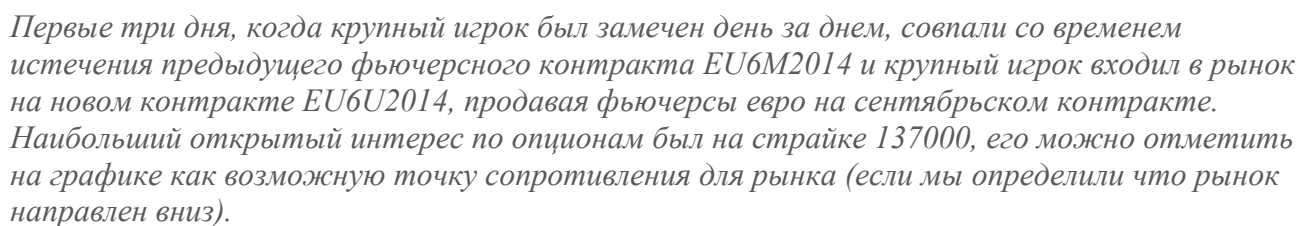
Вся информация в системе делится на два блока. Первый - это текущие сделки. И второй - подготовка к будущим.

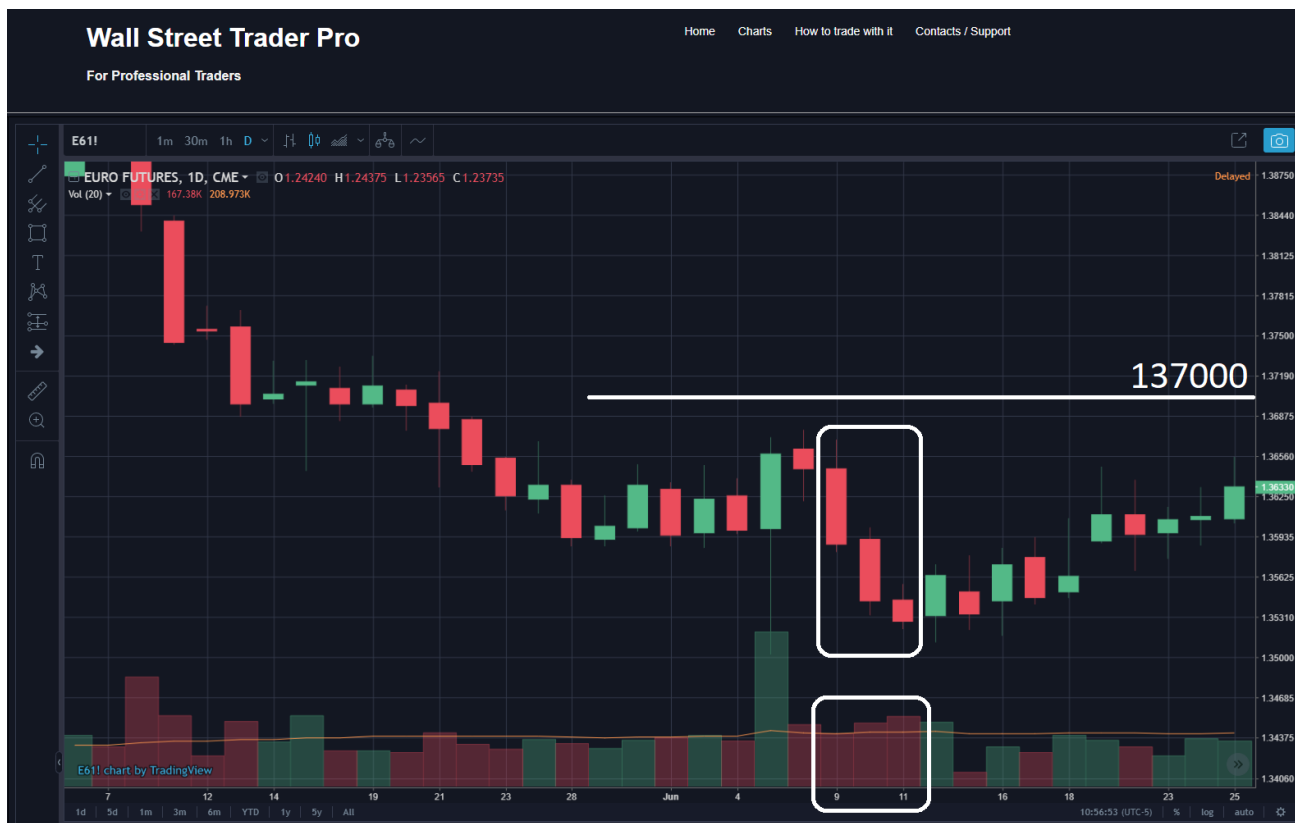
К первому блоку относятся показатели Big Money Activity / New Buys / Sales Exit / New Sales / Buys Exit.

Ко второму блоку относятся параметры Preparation for a trend / Global Trend / Preparation for Buys / Preparation for Sales / Preparation Direction.

Для анализа ситуации и принятия решения достаточно и первого блока. Однако для полной картины рекомендуется использовать оба.

Пара евродоллар, начало июня 2014 года. На рынке появился крупный игрок, который активно продавливал рынок вниз.





И как мы видим, именно оттуда цена затем и падала. Притом видно, как крупный игрок добавлял к своей позиции:

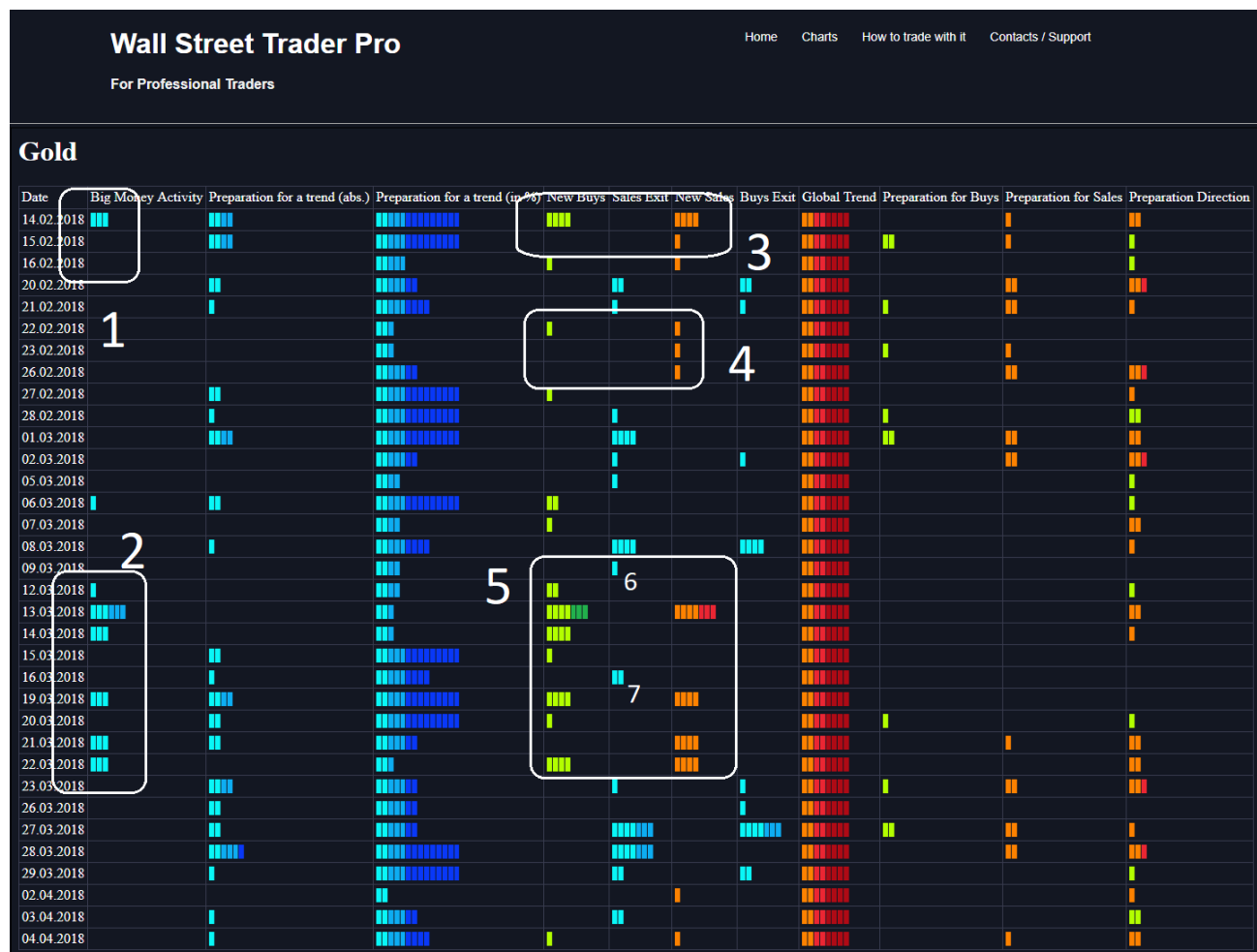


На разных рынках присутствуют разные крупные игроки. Есть рынки, где игроки активно входят в рынок маркет ордерами. Есть рынки, где они поглощают позиции других игроков пассивно. Так или иначе, когда крупные игроки собирают свою позиции, в итоге мы получаем уровень цен, который будет защищен крупным игроком. Далее мы рекомендуем использовать методы volume spread analysis, фундаментальный анализ, технический анализ, и другие методы, чтобы постараться определить направление входа крупного игрока, чтобы понимать в какую сторону нужно входить. Так же смотрите колонки Preparation for Buys и Preparation for Sales, т.к. на некоторых рынках в случае затяжных серий покупок или продаж можно будет легко определить куда сформировался очередной крупный объем из колонки Big Market Activity.

Пример Анализа На Основе Данных New Buys / Sales Exit / New Sales / Buys Exit

Возьмем для примера золото. Сегодня 5 апреля 2018 года. Как нужно делать анализ?

Мы начинаем с самой первой колонки, смотрим нет ли за последнее время сильной активности крупных игроков. Например, такое время было в самом начале картинки - точка 1. И совсем недавно - точка 2:



Затем когда мы видим что в рынок заходили именно крупные игроки, можно посмотреть в какую сторону они входили.

На точке 3 видно, что входили они в обе стороны. Однако на следующий день они входили только в продажи. Что говорит о том, что позиция в целом набирается именно в шорт:



Более того на точке 4 видно, что крупные игроки открывали еще новые продажи, в течение трех дней.

После чего с 28 февраля по 5 марта они выходили из продаж, фиксируя прибыль. Что говорит о возможном приближении места разворота на графике. Что мы впоследствии и увидели в первой колонке, начиная от 12-13 марта, когда увидели новую сильную активность крупных игроков.

Как видно на точке 5, это открывались новые позиции, с направлением покупок. Более того, судя по точкам 6 и 7 (которые показывают закрытие старых продаж), помимо открытия новых покупок, крупные игроки избавлялись от старых продаж до конца.

В итоге такие ситуации в большинстве случаев разыгрываются ростом рынка:

For Professional Traders



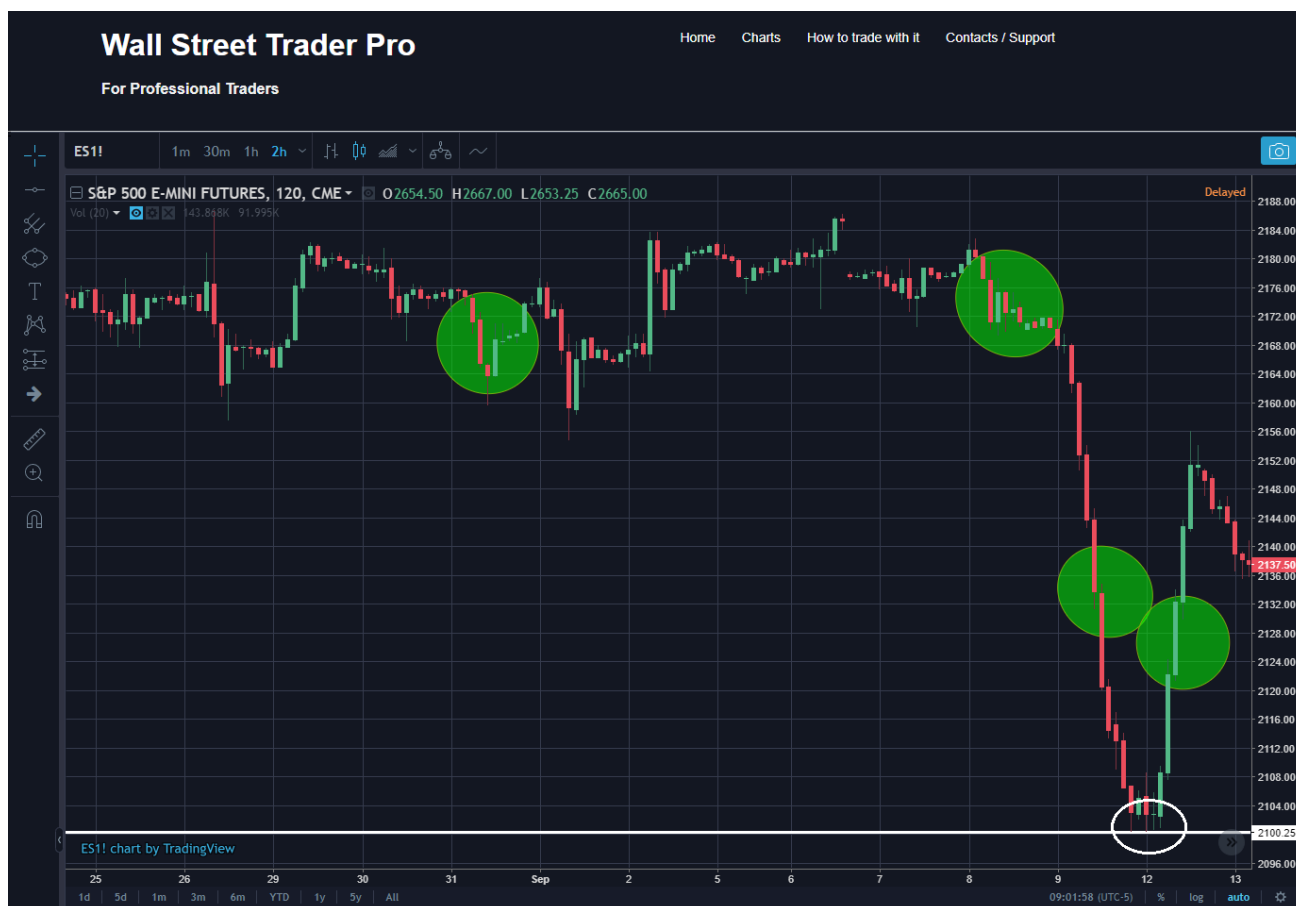
Пример Анализа На Основе Данных Preparation For A Trend / Global Trend / Preparation For Buys / Preparation For Sales / Preparation Direction

Давайте рассмотрим на примере. Откройте основной экран системы WallStreetTrader Pro по E-mini S&P 500:

Здесь мы видим проявление большой активности крупного игрока на рынке дважды в течение двух недель:



По всей видимости хедж фонды покупали фьючерсные контракты, форварды и опционы на дальних контрактах в больших объемах. Отметим на графике дни, когда данные покупки были большими:

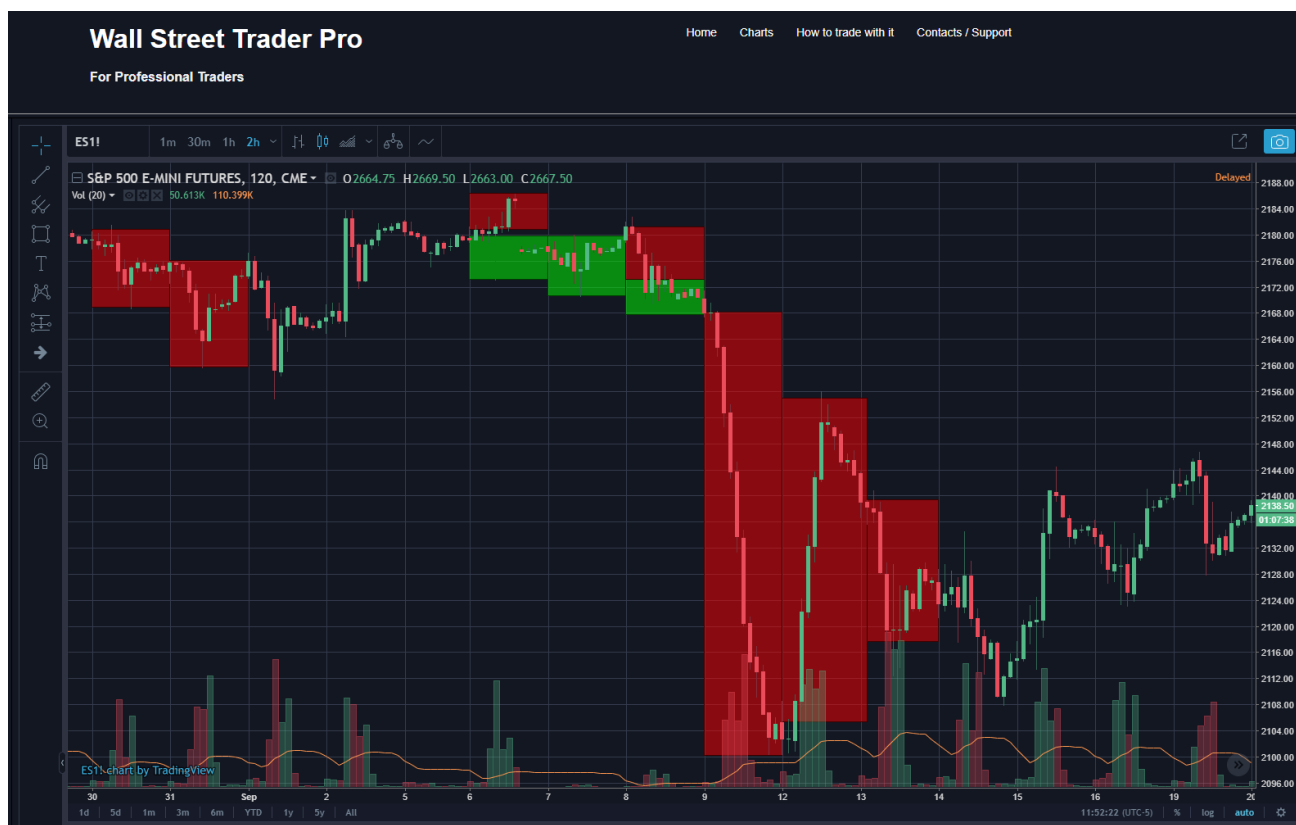


Максимальный открытый интерес был на страйках 2050 и 2010.

Поскольку данные Big Money Activity показали нам набор крупной позиции именно около 2010 уровня цены, то ее можно взять как основу для входа в рынок в сторону покупок.

И как мы видим, рынок действительно пошел затем вверх, и именно от этого уровня.

На графике это выглядело следующим образом:



Почему так произошло? Эти продажи могут обозначать что крупный игрок обозначил себе место для остановки данного восходящего движения (вызванного тем что крупный игрок уже имел покупки на фьючерсах 6, 7, 8 сентября 2016 и покупал на дальних контрактах, а так же форвардах и опционах), и кроме того хочет увидеть рынок ниже. Зачем ему это нужно? Может быть как то поменялась ситуация в мире? Что заставило крупного игрока, который приготовился к крупному росту рынка, немного продать?

И действительно, открыв новости мы увидим что Англия похоже собралась совершить Брексит.



Brexit



All

News

Images

Videos

Books

More

Settings

Tools

Any country ▾

14 Sep 2016 – 17 Sep 2016 ▾

Sorted by relevance ▾

All results ▾

Clear

Truth, lies and trust in the age of Brexit and Trump | Business | The ...

<https://www.theguardian.com/.../truth-lies-and-trust-in-the-age-of-brexit-and-trump> ▾

16 Sep 2016 - Even outright lies spoken in a nationally broadcast interview go unchallenged, as if Trump were indeed entitled to his own facts. The leaders of the UK's campaign to withdraw from the European Union enjoyed a similar advantage in the run-up to June's Brexit referendum.

EU states set to veto any Brexit deal threatening free movement ...

<https://www.theguardian.com/.../eastern-bloc-countries-will-uphold-citizens-rights-to-l-...> ▾

17 Sep 2016 - Four European countries will veto any Brexit deal restricting their citizens' rights to work in Britain. Photograph: Daniel Leal-Olivas/PA. Four central European countries are prepared to veto any Brexit deal agreed between the UK and the European Union that restricts their citizens' rights to live and work in Britain, the prime ...

Brexit was a revolt against liberalism. We've entered a new political ...

<https://www.theguardian.com/commentisfree/2016/.../brexit-liberalism-post-liberal-ag-...> ▾

15 Sep 2016 - In Britain, the arrival of Theresa May in Downing Street in the wake of the Brexit vote is the most striking example of this shift. May is not an economic liberal like Margaret Thatcher or a social liberal like David Cameron. In fact, liberalism of any kind seems almost a marginal consideration in her thinking and her policy making ...

No 'Brexit effect' in latest jobs data - BBC News

www.bbc.co.uk/news/business-37360153 ▾

14 Sep 2016 - Employment was "resilient" before and after the EU vote, despite predictions of an economic shock, analysts said. Kallum Pickering, an economist at Berenberg, said: "Although it is still early days, the UK labour market is yet to show any Brexit effect for the period immediately before and after the June 23 vote."

Brexit: Cameron 'blocked' civil service talks with Leave campaigners ...

www.bbc.co.uk/news/uk-politics-37360386 ▾

14 Sep 2016 - David Cameron told civil servants they could not talk to Leave campaigners in advance of the Brexit vote about their plans, the UK's top mandarin has said. Sir Jeremy Heywood said the prime minister had imposed a "red line" on any talks in the run-up to the vote.

Brexit to Cost European Union Billions - SPIEGEL ONLINE

www.spiegel.de > English Site > Europe > European Union ▾

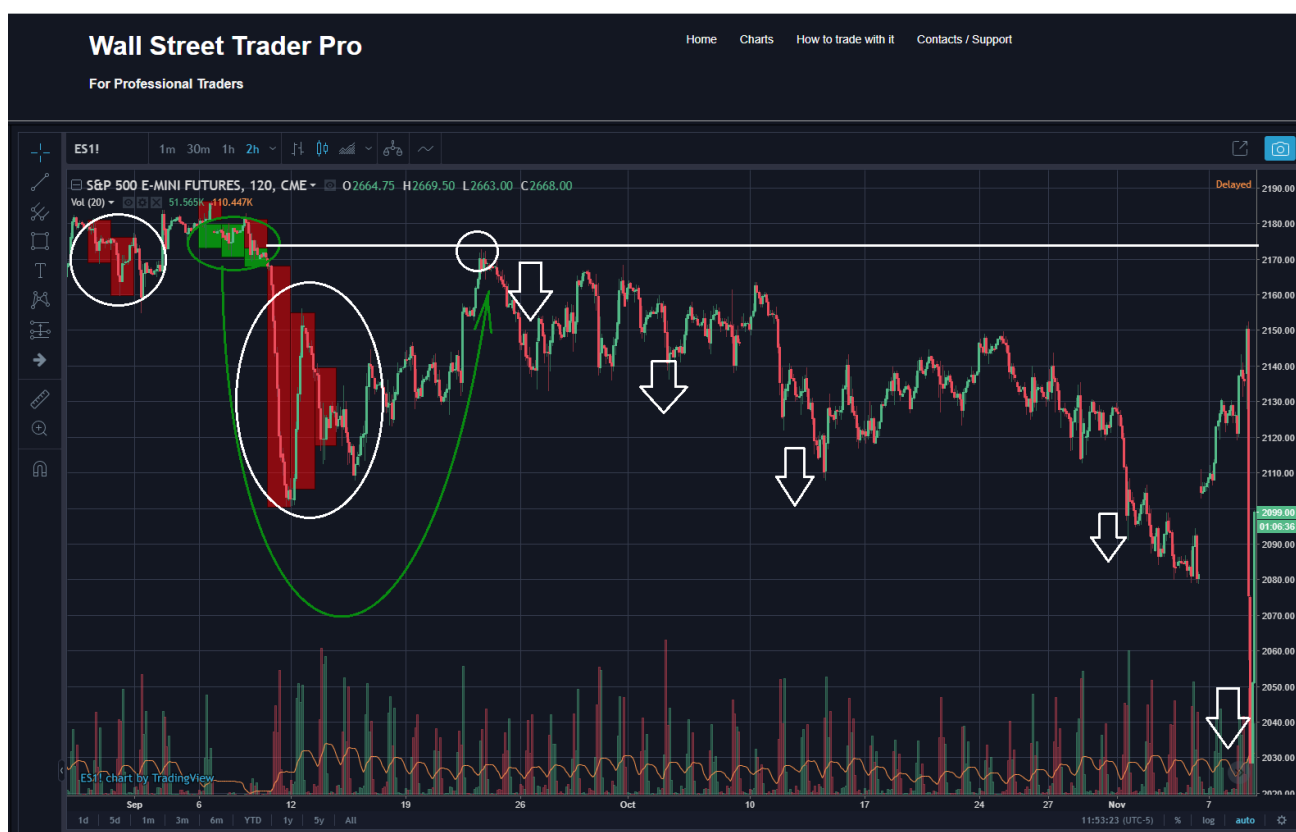
14 Sep 2016 - At a summit in Bratislava this week, the EU wants to set the course for its future without Britain. One important issue is likely to be ignored by European leaders: The fact that Brexit is going to be expensive for Europe, especially for Germany.

Impact of Brexit on the equalities agenda inquiry - UK Parliament

<https://www.parliament.uk/...a.../impact-of-brexit-on-equalities-agenda-16-17/> ▾

Вот почему крупные деньги хотят поучаствовать в грядущей распродаже рынка. Но учитывая что в начале они планировали покупать и часть их позиции была в Буи, логично предположить, что крупный игрок постарается сделать так чтобы рынок немного отрос, и они могли закрыть свои покупки, после чего можно было бы обвалить рынок. Либо наоборот обвалить рынок, и потом закрыть свои покупки, вызвав рост рынка.

Поэтому далее рынок действительно немного отрос, после чего пошел вниз, уже к дате объявления Brexit:



Это был один из примеров анализа рыночных данных, через призму позиций крупных игроков, поэтому Вы можете смотреть на рынок под углом движения цен под действием крупных позиций "умных денег", благодаря системе WallStreetTrader, и лучше понимать как устроена торговля.

Основа нашей платформы это тоговые дни с сильной активностью крупных трейдеров, которые отмечаются в колонке Big Money Activity. Такие дни являются критическими для рынка. Т.к. в них крупный игрок формирует свою торговую позицию, и логично предположить, что затем он будет стараться защитить ее.

Для понимания направления открываемой крупным игроком позиции желательно использовать три вида анализа. Первый это пассивная активность крупного игрока (колонки New Buys / Sales Exit / New Sales / Buys Exit). Второй это активные крупные сделки - это анализ крупных объемов на рынке, вызванных маркет ордерами (методы volume spread analysis) - они видны по самому графику и приводились в примере с евродолларом от 2014 года. И третий - это Preparation Direction.

Очень важно понимать что такие индикаторы как *Global Trend*, *Preparation for Buys*, *Preparation for Sales*, *Preparation Direction* показывают сделки крупных игроков на дальних фьючерсных контрактах, либо торговые операции с форвардами, опционами. Это означает что Вы не должны сразу же покупать, если увидите покупки. Ведь цены их сделок из данной колонки могут отличаться от цен текущего фьючерсного контракта. И Вы должны дождаться, пока они не попадут в диапазон цен на рынке с большой ликвидностью, где и смогут полностью сформировать свою торговую позицию. Такие дни и хороши для входа в рынок, чтобы попасть в тренд в самом его начале. Определить такие дни можно за счет индикатора *Big Money Activity*. И желательно учитывать уровни опционов (страйки с большим открытым интересом).

Поэтому для формирования хорошей стратегии торговли очень важно найти несколько дней с очень крупными однонаправленными покупками или продажами в колонке *Preparation Direction*, и после этого ждать появления крупных объемов в колонке *Big Money Activity*. Это будет говорить о том, что именно здесь крупные игроки и сформировали свою торговую позицию. И теперь Вы можете предполагать ее направление исходя из колонок *Preparation Direction*, а так же пассивных и/или активных сделок крупных игроков, и иметь уровень для входа в надвигающийся тренд (анализируя уровни страйков по опционам и дни с крупными позициями больших игроков).

Рассмотри на примере по графику нефти:



Эллипсами отмечены показания дни покупок или продаж крупных игроков из колонки *Preparation Direction*. Прямоугольниками отмечены дни, когда крупному игроку удавалось найти ликвидность на рынке для формирования своей позиции (данные из колонки *Big Money Activity*).

Как происходит работа. Мы находим день, а лучше дни, с ярко выраженными покупками или продажами в *Preparation Direction*. Затем ждем дни с формированием основной позиции. И параллельно смотрим уровни страйков опционов с большим открытым интересом на них. Обычно около них и происходит активный набор позиций крупным игроком.

Суть проста. Если мы увидели на рынке покупки (по колонке *Preparation Direction*), то мы обязательно должны искать дни с крупной позицией ниже чем появились покупки. Рынок развернется только после того, как крупные игроки наберут желаемый объем покупок.

Та же самая логика преследуется и для продаж. Если мы увидели на рынке большое количество продаж, то стоит искать точку входа на продажу именно выше данных дней, которые показали нам продажи крупных игроков.

Если Вы находите на рынке совпадение сразу всех следующих условий, то это может быть сигналом для входа в рынок в новый тренд:

- 1) Однонаправленный тренд, в котором начинается коррекционное движение.*
- 2) Однонаправленные фон покупок или продаж, противоположный тренду. Например если тренд вверх, а коррекция идет вниз, то мы должны увидеть покупки (по колонке Preparation Direction).*
- 3) Приближение к опционным уровням с большим открытым интересом на них.*
- 4) Появление дней с крупной торговой активностью больших игроков около этих уровней (по колонке Big Money Activity)*
- 5) Определение направления сделок по пассивной активности крупного игрока (колонки New Buys / Sales Exit / New Sales / Buys Exit) либо по активной торговле (маркет ордерами, определяемыми по графику методами volume spread analysis. Если это направление будет совпадать с Preparation Direction то это будет мощным сигналом к тому, что здесь произойдет пауза коррекции, и можно будет открыть сделки по тренду.*

Пример Анализа На Основе Всех Данных

Теперь, когда Вы познакомились с разными видами данных в системе Wall Street Trader, можно рассмотреть, как происходит анализ, используя все доступные данные системы.

В начале мы ищем рынок исходя из второго блока данных, пытаясь найти устойчивый тренд, и начало больших покупок или продаж в колонке Preparation Direction.

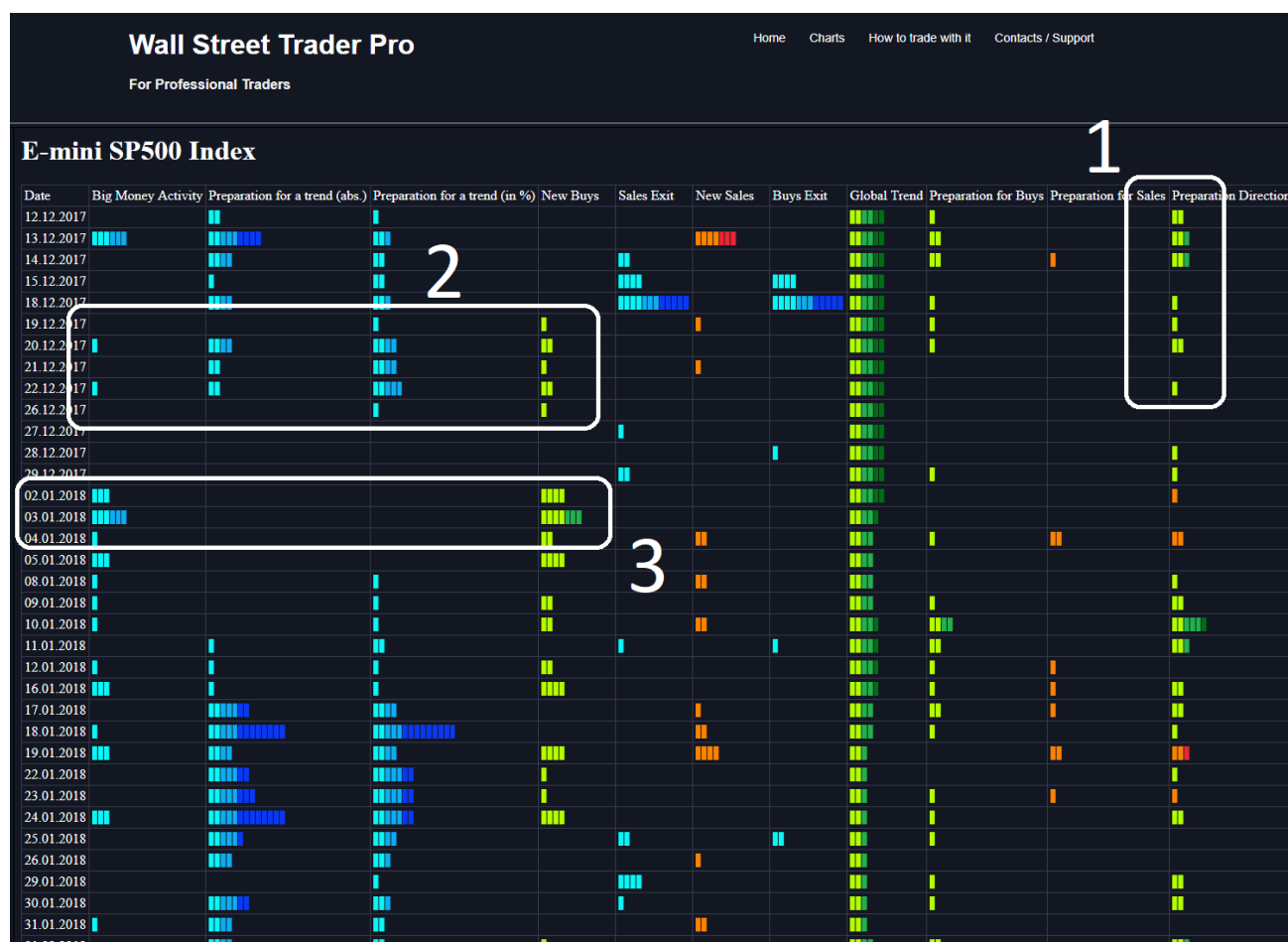
После того как такое место будет найдено, мы должны дождаться открытия позиций на рынке по данному направлению. И обязательно ниже рынка если мы ждем покупки, либо выше, если ждем продажи (например если общий тренд в покупку, то мы ждем снижения рынка, при котором в колонке Preparation Direction будут видны большие покупки. Далее мы должны дождаться входа крупных игроков на рынок - смотрим колонку Big Money Activity. И далее мы смотрим колонки New Buys, Sales Exit, New Sales, Buys Exit. Там мы должны увидеть, что крупные игроки открывают позиции на рост рынка, и закрывают противоположные - т.е. продажи. В таком случае мы будем понимать, что общий тренд рынка наверх. Мы будем понимать где крупный игрок нашел ликвидность в низу рынка, и откуда собирается толкать рынок наверх. Обычно рынок начинает быстро расти после высоких показателей колонки Preparation for a trend. Давайте рассмотрим на примере. Откройте основной экран системы WallStreetTrader Pro.

Рассмотрим конец 2017 года по индексу E-mini S&P 500:

Общий тренд на рынке был бычьим. Однако с середины декабря рынок буквально топтался на месте.



Судя по Preparation Direction крупные игроки готовились к покупкам - смотрите область 1.



Поэтому нужно было дождаться времени, когда они смогли бы найти себе достаточно ликвидности на рынке, чтобы войти в рынок.

Им удалось немного купить 20 и 22 декабря, и совсем немного - в другие дни - смотрите область 2.

После чего настали дни хороших покупок - 2 и 3 января - отмечено на области 3. Что ознаменовало собой настоящее новогоднее январское ралли.

И если посмотреть на колонку New Sales то было видно, что продаж на рынке не было.

Именно так и выглядит хорошая ситуация для того, чтобы присоединиться к тренду, и открыть новые позиции на рынках сторону быков.

Отметим на графике дни с покупками и дни с продажами:



Если говорить про открытый интерес на опционах, то очень большие значения открытого интереса были на уровне 2670.00 (страйк). Можно отметить этот уровень на графике.

Как мы увидим далее, рынок после этого рос с данного уровня:



По подобной схеме можно анализировать и другие рынки.

Однако не забывайте, что результаты в прошлом не гарантируют повторения достижений в будущем, поэтому будьте осторожны. Рекомендуется опираться на ситуации с ясным и понятным рынком, когда все данные достаточно очевидны.