

Анализ EUR за период 01.01.05-04.02.05

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Попробуем изучить ситуацию с EUR, сложившуюся на 04.02.2005. К рассмотрению принимаем период с сентября 2004 года по февраль 2005, а упор делаем на период коррекции с начала января.

1.

Итак, первая иллюстрация. Для удобства я рассмотрел сначала 12-часовой график, зачем - часовой.



На основе «формальных» принципов построения Скоростных линий Фибоначчи (СЛФ) на график нанесены два веера – восходящий и нисходящий. Исходный тезис при построении таков: находим такой размах и такую коррекцию, чтобы после построения веера на их основе вторая линия не пересекалась ценами во временном диапазоне между ними. Конечно, кто-то вправе изменить этот принцип и сначала работать с третьей линией (или с первой), но мне удобнее работать со второй, потому что тогда появляется линия-ориентир вверх и линия-ориентир вниз.

Сразу – по поводу моментов появления вееров. Ясно, что зеленый веер можно было построить уже в октябре 2004. Более того, на фоне ноября-декабря вы могли нанести дополнительный набор СЛФ, ориентируясь, например, на импульс и коррекцию второй половины-октября. И это было бы правильно, потому что фактически изменилась скорость роста цены – она выросла.

Возникает вопрос: почему я не стал этого делать, а оставил лишь зеленый веер. Дело в том, что я рассматриваю текущую ситуацию и то, что было в ближайшем прошлом (в январе). А в этом контексте все линии непостроенного мною веера были бы уже пробиты, то есть оказались бы на экране лишними.

Красный веер мог быть построен только лишь после того, как цена ударилась в бардовый уровень 38.2%, отлетела вверх и пошла снова вниз. Почему? Просто потому, что для построения СЛФ нужны две базовые точки. В случае «трендового» построения СЛФ этими базовыми точками являются точка начала импульса (в данном случае нисходящего с начала января) и точка окончания коррекционного движения к этому импульсу (конец первой трети января). Веер построен опять же таким образом, чтобы его вторая линия являлась трендовой.

Также на рисунке вы видите коррекционные уровни от размаха, начавшегося в сентябре 2004 и закончившегося в конце декабря 2004. Посмотрите, как красиво после резкого хода вниз цена легла на уровень 38.2%, сформировав первый коррекционный рывок от четырехмесячного хода вверх! С учетом временной длительности импульса и его ценового масштаба можно было ожидать, что этот коррекционный уровень окажет на цену свое воздействие – затормозит ее, а то и отбросит ее вверх.

Таким образом, есть два веера, и есть уровень. Но важный для нас вопрос заключается в том, кто же из этих инструментов «более прав» - кто станет явной преградой для цены?

2.

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

Рассмотрим две новых иллюстрации уже в часовом масштабе. На первой показаны веера «крупным планом». На второй добавлен набор расширений.

2.1.



Обращаю внимание: при смене масштаба веера не перестраивались, поэтому вы видите погрешность. Мораль: внимательнее относитесь к построениям вееров. Смена временного интервала сказывается на их положении. Конечно, для нас было бы идеально, если бы хоть на часах, хоть на 3-часовках, хоть на 12-часовках веер проходил бы через одни и те же точки, но это нереально. За возможность работать с разными временными структурами мы платим терпимостью по отношению к незначительным расхождениям в положении вееров. И еще уточнение: понятно, что с уровнями таких проблем не возникает, потому что они не являются плоскостными фигурами, связывающими цену и время.

2.2.

Смотрим на новые коричневые уровни, которые нанесены на график. Узнаете?



Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

Правильно, это в данном случае статичные расширения от сильного часового рынка вниз, произошедшего в начале 02 января 2005 года. Обратите внимание – именно статичные!

Я не раз обращал внимание в классе на то, что при работе на часах – то есть при расстановке целей – целесообразно использовать классические расширения, учитывающие коррекцию. Это делает цели менее амбициозными («гарантированными»), тем более, что мы «включаем» в поиск не только 161.8%, а еще 100% и 61.8%, то есть снижаем планку. И речь шла именно о целях на ближайшую перспективу, определяемых с учетом того, что часовой рынок склонен к метанию.

Вместе с тем, мы сохраняем право использовать статичные расширения для определения перспектив длительных ходов, если они случатся. Это уместно еще и потому, что в действительности в зависимости от ситуаций отрабатываются как классические, так и статичные расширения, а при срабатывании статичных расширений основная линейка классических (61.8%, 100%, 161.8%) достигается автоматически. В этом контексте, используя указанный импульс в начале января, можно было построить статичный набор расширений и обратить свое внимание на положение уровня 261.8%. Он очень близок к зеленой верхней линии восходящего веера, стартовавшего в сентябре! Таким образом, вы фактически еще в начале января могли обнаружить взаимосвязь между зелеными и мощными СЛФ и скромным январским импульсом. И пренебрегать таким «совпадением» событий было бы неправильно. Подобные совпадения говорят о том, что рынок действует «по инструкции» - как и раньше, ищет оптимальную цену.

Конечно, знание того, что есть зона совпадения СЛФ и уровней, еще не гарантирует, что на пути к этой зоне не произойдет каких-то существенных коррекций, а то и разворота. Но все же знание – сила.

Что касается промежуточных коррекций, то с одной стороны в ваших руках есть важный инструмент ограничения убытков – ордер «стоп-лосс», а с другой – возможность и право войти в рынок повторно после коррекции, если есть основания считать, что тренд продолжится.

3.

Следующая иллюстрация – развитие событий после достижения ценой зоны Сочетания. Я называю зоной Сочетания такую зону, а точнее – область, которая образована уровнем Фибоначчи и линией СЛФ.



Теперь мы видим, что действительно уровень 261.8% и зона Сочетания стали серьезными препятствиями для движения цены вниз.

Мне кажется интересным тот факт, что после достижения уровня цена начала сильно осциллировать (колебаться), но не «как попало», а вокруг линии веера. Кажется, что линия веера «не отпускает» цену от себя – с 20-х чисел января до начала февраля локальный тренд был направлен вдоль верхней зеленой линии веера.

В целом же сформировалось нечто, похожее на коридор. Если быть более точным, то до первых чисел февраля это был слегка восходящий канал, но последнее нисходящее движение к минимальному уровню цены за период, отраженный на иллюстрации, преобразовал скромно восходящий канал в коридор.

Для нас как для специалистов по АКРФ очевидно, что верхняя граница коридора должна быть в районе какого-то из коррекционных уровней от последнего явного движения цены вниз. Так и случилось – она находится около 38.2%-50%. Нижняя граница – минимум цены. Раз коридор определился, надо с ним работать.

Вариантов работы с коридором всего два: трейдер либо ждет прорыва верхней или нижней границы (это будет сигналом Намерения!), либо переходит на более низкий интервал и пытается заработать на движении от одной границы коридора к другой. Поскольку в данном случае демонстрируется часовой график, второй

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

способ оставим за рамками исследования, а вместо этого подумаем, что же происходит внутри коридора и что же может произойти в будущем.

4.

Рассмотрим иллюстрацию «коридор крупным планом».



Во-первых хочу обратить ваше внимание на то, что я в классе называл «болтанкой». Нисходящее движение цены с 12.01 по 20.01 в своем завершении имеет нисходящий импульс, видимый на представленной иллюстрации слева. После его формирования цена опять вернулась к его началу (ход больше 61.8% от этого импульса), а затем опять упала больше чем на 61.8% от размера хода вверх, после чего начала расти. Налицо явная неопределенность – рынок думает, что дальше делать.

В этот период было бы уместно либо затаиться (если вы не в рынке) и ждать формирования сигнала. Намерения, например, прорыва какой-либо стороны треугольника, формирование которого уже началось, либо подтянуть стопы или закрыться, чтобы не испытывать судьбу.

При работе с фигурами и особенно на часах нужно быть готовым к тому, что они могут корректироваться рынком. На данной картинке я вижу следующий порядок формирования фигур: сначала формировался не совсем симметричный, но близкий к нему треугольник (прорыв верхней грани оказался ложным); затем рынок «передумал» рисовать симметричный треугольник и сделал его восходящим (ровная верхняя граница); затем треугольник отработался (после точки Н прорвана нижняя грань); а в итоге из всего этого примерно к 16:00 пятницы сделан неподтвержденный коридор (цена дошла к минимуму с 20 января). Неподтвержденным я называю коридор потому, что еще нет явного отбоя от нижней границы вверх (форс-мажорная свеча, возникшая в связи с новостями и собравшая все стопы, сначала росла вверх, а только потом ударилась в возможную границу коридора, поэтому она не является отбоем). Одновременно нет и явного пробоя уровня минимума цен, отвергающего коридор. Следовательно, коридор возможен, и ближайшее будущее покажет.

5.

А теперь заглянем в будущее, чтобы понять, куда идет цена. Это становится возможным потому, что, во-первых, все сказанное выше было создано в указанную пятницу до 16:00 GMT, а дописываю анализ в субботу, когда все пошли гулять в зимний лес.



К закрытию пятницы (к 21:00 GMT) сложилась ситуация, отраженная на рисунке.

Пробитие нижней грани треугольника оказалось корректным сигналом. Если абстрагироваться от форс-мажорной свечи, то в целом все хорошо. Построив классические расширения от импульса и коррекции, обозначенных красным, мы могли расставить цели. Цель 61.8% представляет интерес с точки зрения анализа пересечений Фибо-инструментов между собой и с прочими линиями (уровни+СЛФ, СЛФ+СЛФ, трендовые линии+уровни) – именно в точке пересечения стороны треугольника и уровня 61.8% произошел пробой треугольника.

Пока что нет четкого понимания, каким образом и можно ли вообще использовать это свойство точек пересечения играть роль временных ориентиров, но я бы рекомендовал на такие факты внимание обращать, чтобы в будущем их проанализировать.

Цель 100% была четко отработана.

Далее цена двинулась к 161.8%, пройдя большую часть из намеченного пути.

С уважением,

Алексей Кияница

О "срывании стопов" и странных длинных тенях (100% коррекции)

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Объясняя, почему иногда появляются длинные тени и казалось бы умеренная коррекция, например, 61.8%, превращается в коррекцию 100%. Итак, что это такое и кто виноват...

Маркет-мейкеры работают с серьезными дорогими информационными системами, в которых отражаются предложения и спрос. К ним имеют доступ и просто крупные участники торгов.

Условно, предложение и спрос отражаются так: справа повыше - кто, что и сколько хочет продать, а слева пониже - кто, что и сколько хочет купить. Это и есть ордера на покупку и продажу. Если появляется покупатель "с рынка", который окажется напротив соответствующего по цене ордера на продажу, то их "сведут" и сделка состоится, но остальные ордера останутся стоять. Так вот, это называется "стаканом". В этом "стакане" видно, что многие (или немногие) поставили свои ордера по такому-то курсу.

Для маркет-мейкера, если он действительно решил провести маневр и получить дополнительную прибыль, купив совсем дешево, чтобы потом продать дорого, возникает вопрос: "как добраться к нужному уровню цен через всю очередь". Дело в том, что обычно действует правило очереди - чья очередь подошла,

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

того и исполняют. Соответственно, маркет-мейкер должен удовлетворить всех, чтобы добраться до интересующего его курса. А "все" - это, естественно, в том числе и все, кто ставил стопы - смотрят-то и "все", и маркет-мейкер в одну сторону... Проблема этих "всех" в том, что они попались под руку :) - но для биржевой системы их стоп - это все равно, что заявка на совершение сделки. Проблема же маркет-мейкера в том, что не может он сам выкупить все стопы - мир большой, и сколь бы мощный ни был маркет-мейкер, вряд ли он пожертвует всем, что нажито непосильным трудом, ради дополнительных 40 пунктов.

В итоге, маркет-мейкеру нужно "замутить" такую операцию, в результате которой цена стала бы падать сама.

Естественно, маркет-мейкер просчитывает, а много ли хлопот и затрат его ожидает на этом пути и принимает решение о том, идти на риск или не идти. Тяжела жизнь маркет-мейкера. Но если он сможет обеспечить падение цены и в итоге добираться до чего-то очень лакомого, что сдвигает "эффективный курс" открытия усредненной позиции в явно более прибыльную сторону, значит, операция удалась. Маркет-мейкер начинает покупать, все понимают, что они зря продавали - тоже начинают покупать, и цена стартует вверх ракетой.

Маркет-мейкеру хорошо, он теперь может купить себе мороженное. Кто-то из заблудших, но успевших опомниться выживет. А тела павших с поля кто-нибудь уберет...

А вот логика действий маркет-мейкера - пошагово в мыслях:

1. Я на 1.2780, курс ползет вверх, буду покупать 100 миллионов...
 2. А могу ли купить дешевле и без больших хлопот???
 3. О, на 1.2740 есть крупный стоп на продажу от банка "Крутые парни" на сумму 100 миллионов! Поглядим, кто круче... Но, если по существу, то мне надо выкупить у них эти 100 миллионов, тогда я выкуплю их на 40 пунктов лучше.
 4. Так-так... Перед "парнями" очередь, они стоят в ней на продажу стопами 155-е по счету только в моей информационной системе. А по миру таких еще ого-го сколько... Значит, нужно миру помочь удовлетворить заявки на продажу всех, кто имеет статус очередников... царствие им небесное и прости нас Господи, но они сами виноваты, что под руку суются со стопами... А что бы предпринять?
 5. НАЧНУ-КА Я ПРОДАВАТЬ - ЦЕНА И УПАДЕТ ВСЛЕД МОИМ ПРОДАЖАМ.
 6. О, цена покатила... как же я их всех напугал..
 7. О, а вот и ордер "Крутых парней".
 8. Выкупил у "Крутых парней" их 100 миллионов. Эх, парни...
 9. Ну вот, ошалели все от такого поворота событий. Поняли, что дно-то снижено искусственно... А вот и цена пошла вверх...
 9. У меня теперь 100 миллионов, из которых 100 - от "Крутых парней", а еще я вот по пути 100 куплю.
 10. Вот и ладненько...
- С уважением,
Алексей Кияница

Временная решетка Фибоначчи

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Работа со временем

В этой небольшой статье я хотел бы рассказать вам про еще один «недокументированный» инструмент Анализа Коррекций и Расширений Фибоначчи. Назовем его так: «Временная решетка Фибоначчи» (в слове «временная» ударение на «а»).

На сегодняшний момент вы уже, надеемся, знаете о том, что время – субстанция столь же важная, что и сама цена. Согласитесь, например, что работая на 3-часовом графике трейдер вряд ли согласится ждать полгода до момента окончания коррекции, чтобы открыть позицию. Для нас идеальными условиями работы были бы такие условия, когда мы бы знали, что в день и час X начнется коррекция, а день и час Y начнется новое трендовое движение, которое закончится в день и час Z.

Скоростные линии являются инструментом, который в некоторой степени открывает перед трейдером информацию о ценовых движениях во времени. Они фактически являются трендовыми линиями, показывающими минимально возможную скорость трендового роста цены на определенном участке при текущих условиях. Соответственно, на восходящем рынке трендовая линия – это линия поддержки, на нисходящем рынке – линия сопротивления.

Идею работы со временем можно реализовать также и с применением временной решетки Фибоначчи. В отличие от СЛФ, временная решетка не связывает цену и время – она показывает только возможные важные моменты по времени. Но вы все же вправе попытаться найти на плоскости важные точки – те, где линии

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

временной решетки пересекаются с уровнями Фибоначчи. Часто складывается такая ситуация, что именно там цена надолго затормаживается и начинает корректироваться или наоборот, начинает трендовое движение.

Иллюстрирую идею на рисунках.



Рис. 1. EUR H, временная решетка и Фиб-узлы

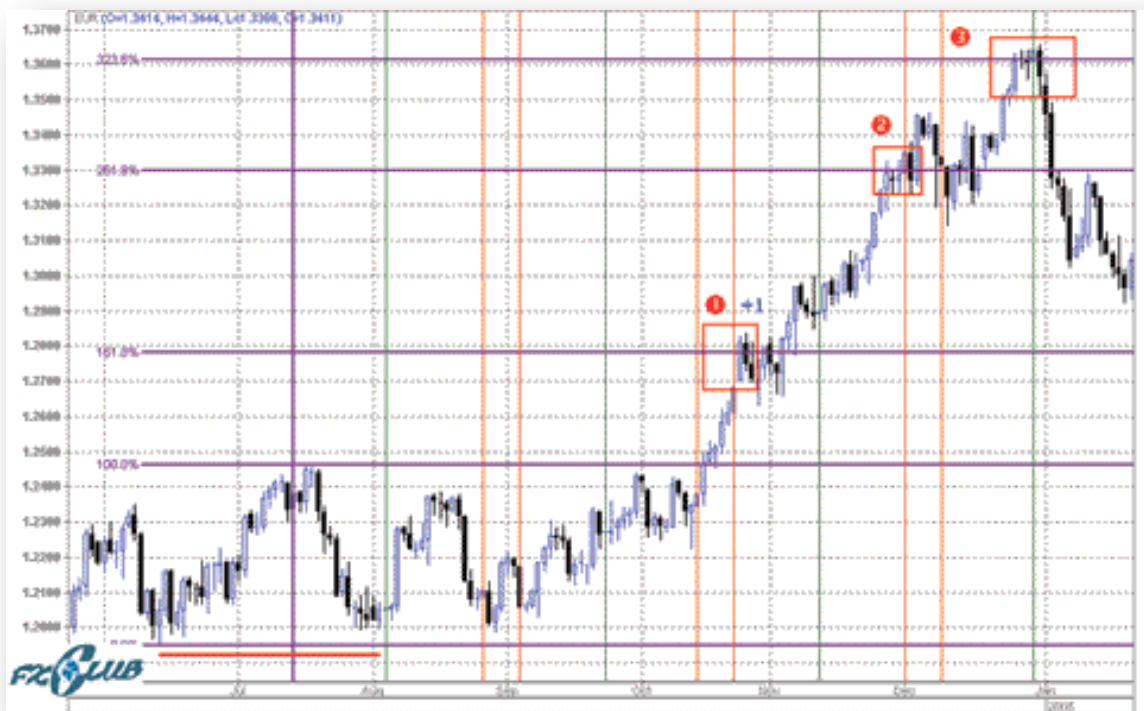


Рис. 2. EUR D, временная решетка и Фиб-узлы

Идея построения

Идея построения временной решетки заключается в следующем:

- находим трендообразующий импульс (ТОИ, в нашем классе мы обсуждали, что это такое);
- считаем «полным циклом» период времени от начала ТОИ до конца коррекции после него; берем продолжительность цикла (без выходных) за 100 процентов;

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

- откладываем вправо временные ориентиры, добавляя к окончанию коррекции временные периоды 38.2, 61.8, 100, 138.2, 161.8, 200, 238.2 и 261.8 процентов; при расчете придется производить округление: например, если ТОИ = 100 свечей, то свеча «161.8%» рассчитывается как $100 + 61.8 = 100 + 62 = 162$ от начала ТОИ.
- считаем, что, возможно, именно полученные вертикали станут важными временными ориентирами для развития ценового движения – «целевыми днями»;
- ожидаем, что очередное движение может закончиться (начаться) около вертикали целевого дня, что подразумевает право цены на погрешность.

Реальность

Реальность такова, что так же, как и с уровнями Фибоначчи, при работе с временной решеткой четко отрабатываются не все цели. Вероятно, это связано с изменением условий, вынуждающих рынок корректировать план движения цены. Однако, наличие даже таких ориентиров – значительно лучше, чем их отсутствие.

Решетка не говорит нам ничего на предмет того, что конкретно произойдет в определенный момент – начнется трендовое движение или коррекция. В свете этого нужно стремиться к тому, чтобы сопоставлять недавние прошлые события, касающиеся развития тренда, с текущим положением цены на временной оси и с разнообразными возможностями развития событий.

Построение в программе RUMUS

На текущий момент автоматическое построение, аналогичное построению уровней Фибоначчи, невозможно. Но все будет. Надеюсь, мне удастся «пролоббировать» наши с вами интересы с таким расчетом, чтобы летом инструмент уже был введен в очередную версию. Раньше, наверное, не получится, так как программисты сейчас заняты другими вопросами.

Исследования

В процессе работы с решеткой и исследования ее свойств необходимо стремиться к поиску закономерностей, связанных, вероятно, с пересечением линий решетки с уровнями Фибоначчи или СЛФ, со статистикой, показывающей наиболее частые соответствия между ориентирами по цене и по времени, корректировкой рынком ранее действовавшего плана.

«Мысль вдогонку»

Что такое «коррекция цены»? Это изменение цены в сторону, противоположную предшествовавшему ей движению. Одна из моделей говорит, что на коррекционных уровнях рынок производит измерения доходности. Другая версия может быть такой: рынок как бы понимает, что посредством ранее произведенного импульсного скачка он забросил цену слишком далеко, и перед началом нового ценового движения нужно принять «исходную позицию», адекватную текущим условиям. После достижения коррекционного уровня цена начинает трендовое движение.

А может ли существовать коррекция по времени? Да. Именно ее в чистом виде мы наблюдаем, когда наблюдаем явно боковое движение. Рынок как бы понимает, что сейчас еще рановато делать рывок и ждет удобного момента. Но вот момент близок: «...еще немного – и... поехали!»

С уважением,
Алексей Кияница,
16.03.2005

Пример анализа EUR – 7, 8, 9 МАРТА 2005

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Подготовлена еще одна глава – новый пример работы по EUR. Надеемся, этот пример еще ярче продемонстрирует потенциал Анализа Коррекций и Расширений Фибоначчи. Безусловно, ситуации бывают разные, и описанная в примере оказалась не из плохих или чересчур сложных. :) И можно было бы поговорить о том, что "часто реальность сложнее!" и так далее. Однако, что есть, то есть. Как-нибудь в будущем напишу материал про что-нибудь, предполагающее абсолютно невнятные перспективы и непонятное развитие событий. А пока...

Валютная пара – EUR. Высшая Временная Структура – дни. Нормальная Временная Структура – часы. Мы работаем на НБС в том направлении, куда цена идет на ВВС, и считаем это жестким условием.

23.02.2005, закрытие дня, СЛФ.

Построены Скоростные линии Фибоначчи (рис. 11.1). На графике виден кусочек восходящего веера, нанесенного по базовым точкам 03.09.2003 и 03.08.2004, а также веера, построенного по точкам сентября 2004 и февраля 2005.

Видно, что цена, с одной стороны, достаточно резко прорвала верхнюю линию «длинного» веера, а с другой стороны, приблизилась к верхней линии «короткого веера. Хотя мы официально рассматриваем веера как трендовые ориентиры (в данном случае – поддержку), все равно примем сей факт во внимание.

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи



Рис. 11.1. Дата - 23.02.2005, закрытие дня, СЛФ.

23.02.2005 – 07.03.2005, закрытие дня 07.03.2005, индикаторы.

Рисунок 11.2 – построены стандартные индикаторы MACD и Stochastics. Для дневного графика выбраны параметры MACD 22/66/22, связанные с естественными месячными циклами. Судя по индикатору MACD, дневной тренд направлен вверх. Stochastics показывает, что дневная коррекция окончена, а цена продолжила движение вверх в направлении тренда.



Рис. 11.2. Дата - 23.02.2005 – 07.03.2005, закрытие дня 07.03.2005, индикаторы.
07.03.2005, закрытие дня, дневные уровни Фибоначчи.

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

Здесь, на рисунке 11.3, изображены коррекционные уровни Фибоначчи от нисходящего импульса АВ и восходящего импульса ВF. Наблюдаем, что цена с некоторым недоходом приблизилась к уровню F2(AF) и именно здесь произвела торможение. Не удивительно, что наблюдается Коррекция.

После точки F цена упала почти до F1(BF), хоть и с небольшим недоходом, после которого ценой был осуществлен рынок вверх (предпоследняя свеча). О чем это говорит? Сила быков чрезвычайно велика, и они настолько спешат, что даже не позволили цене формально коснуться уровня 38.2%(BF), развернув ее вверх. После рывка – 07.03.2005 – цена вновь остановлена (черная свеча справа).



Рис. 11.3. Дата - 07.03.2005, закрытие дня, дневные уровни Фибоначчи.

07.03.2005, часовой график, последний явный импульс и коррекция после него.

Переходим на часовой график – рисунок 11.4. Внутренняя структура дневной свечи 04.03.2004 и свечи 07.03.2004 видна справа: первая представлена чрезвычайно сильным толчковым Движением, вторая – продолжительной Коррекцией до уровня F1(LM). Если Движение MN действительно окажется Коррекцией, цена должна активно пойти вверх. Маленькая Коррекция – это большая сила (в данном случае, у быков).



Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

Рис. 11.4. Дата - 07.03.2005, часовой график, последний явный импульс и коррекция после него.
08.03.2005, часовой график, индикаторы, ситуация 1.

Поскольку мы привыкли пользоваться индикаторами (они дают нам формальные рекомендации относительно направления работы), наносим на часовой график MACD-12/72/24 и Stochastics-8/3/3. Индикаторы изображены на рис. 11.5.

Но здесь мы впервые обращаем внимание на странный момент: MACD показывает тренд вниз, но, во-первых, явный рывок цены после ее двухсуточного топтания на месте вряд ли может быть случайным; во-вторых, Коррекция слаба; в-третьих, чуть ниже цены располагаются два очередных коррекционных уровня (F3/50% и F2/61.8%). Ранее мы говорили о том, что индикаторы дают формальные сигналы, показывающие направление Движения цены, и ими нужно руководствоваться, потому что это облегчает жизнь. Но все же иногда не стоит следовать «букве закона» слепо, если наблюдаются явные противоречия. Формальности и индикаторы – это человеческое изобретение, а рынок человека не слушает. Текущая ситуация с таким непослушанием и связана.

Давайте вспомним, что такое MACD. Это – разница двух скользящих средних, причем преобразованная при помощи дополнительной скользящей. Если цена после толчкового восходящего Движения долго, нудно и совсем не резко падает, то MACD будет уменьшаться, а его сигнальная линия будет реагировать на изменения даже несколько позже быстрой. В итоге в некоторый момент – просто исходя из математических законов – произойдет пересечение быстрой и сигнальной линий MACD. Но Коррекция-то слабая! И она говорит о силе быков. Соответственно, работать вниз стоит только в том случае, если решили работать формально (что тоже не всегда хорошо), или если будут пробиты очередные коррекционные уровни – 50% и 61.8% (а они – совсем рядом). А сейчас просто ждем, что будет дальше, то есть, изменится ли мнение индикатора. Это может произойти либо вследствие развития ценового Движения вверх в самое ближайшее время, либо после повторного тестирования уровня 38.2% или первичного отбоя от тех же 50%(LM или NM).



Рис. 11.5. Дата - 08.03.2005, часовой график, индикаторы, ситуация 1.
08.03.2005, часовой график, индикаторы, ситуация 2.

Выше мы рассуждали об MACD и вот... Показания MACD изменились! «Тренд вниз» был «случайностью» (рис. 11.6). Точнее, Коррекция была слишком продолжительной по отношению к длине импульсного движения, что ввело MACD в заблуждение. Конечно, можно предположить, что и следующее Движение будет некрасивым и нестандартным, что сведет на «нет» все наши рассуждения, противоречащие формальному сигналу индикатора. Можно поговорить и о том, что «...как же так! Нужна система!». Но ведь, во-первых, сформулированная выше позиция имеет под собой основание: «MACD не может абсолютно корректно реагировать на все нестандартные ценовые ходы». А, во-вторых, система наша все-таки в действии. Просто мы иногда позволяем себе воздерживаться от резких движений, тем более, если явно видны факторы, говорящие об очень туманных перспективах необоснованных действий. В данном случае таких факторов было два: соотношение продолжительности Импульса и Коррекции, а также близость двух очередных Коррекционных уровней.

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи



Рис. 11.6. Дата - 08.03.2005, часовой график, индикаторы, ситуация 2.

08.03.2005, часовой график, индикаторы, уровень открытия позиции.

Раз ситуация разрешилась, ищем возможность работать вверх. Тренд на ВВС направлен вверх, тренд на НВС – тоже вверх. Последняя свеча черная, что говорит о продолжающихся попытках медведей вернуть цену вниз. Однако же пять последних свечей на правом краю графика выглядят как намек на очень скромный треугольник (Намерение?). Если бы вы сейчас взглянули на 5-минутные свечи, то увидели бы, как он красив! (Попробуйте сделать это сами – 8 марта, примерно с 9 до 14 часов.) В свете этого и в связи с тем, что красоту свою треугольник демонстрирует все-таки на ПнВС, предлагаем поступить так: прорывом вверх будем считать прорыв уровня максимума четвертой справа свечи. В контексте НВС это будет означать смещение вверх текущего Фокуса (смотрите рисунок 11.7).

Итак, открываем позицию вверх на 1.3263 (можно было даже взять запас размером 5-7 пунктов на случай случайного прокола, но давайте оставим так; указана цена BID; реальное открытие будет по цене ASK с учетом спреда).

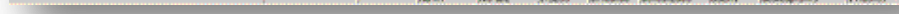
Цели определим с помощью Классических Расширений от Импульса LM с учетом Коррекции MN. Целями будут уровни:

- СОР 1.3278 (он нам не интересен, так как прорыв уровня открытия будет началом нового восхождения после импульса N-Опен, и, скорее всего, приведет к более серьезному движению);
- ОР 1.3342;
- ХОР 1.3445.



08.03.2005, часовой график, стоп-лосс («Stop») и осциллятор Бестрендовости.

Исходя из размера импульса N-Open, определяем положение ордера «стоп-лосс». Он обозначен как «Stop» на рисунке 11.8. Этот ордер разместим на уровне F1 от импульса N-Open (1.3229). Предполагаем, что прорыв Фокуса является достаточным основанием для того, чтобы ставить ордер не очень далеко.



08.03.2005, часовой график, достижение цели ОР и «Перебежка».

Рисунок 11.9 – сработал ордер на открытие позиции на 1.3263. Резкое толчковое Движение вывело цену



11. *Journal of the American Medical Association*, 2000; 283: 2689-2694.

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

08.03.2005, часовой график, «Перебежка» и достижение цели ХОР .

После сдвига Фокуса из точки Р еще выше, ордер на ограничение убытков превращаем в ордер «stop-trade», который теперь защищает нас от потери прибыли. Ставим его на предыдущий коррекционный уровень 38.2% (1.3303). Обозначение уровня ордера на рисунке 11.10 – «Stop 2».

Чуть позже, когда к концу 09.03.2005 формируется новый Импульс, вновь передвигаем стоп ордер. Но в силу малой величины последнего Импульса оставляем его не под F2, а под самым началом Импульса, то есть, на уровне 1.3326. Обозначение – «Stop 3».

10.03.2005 наблюдаем достижение ценой Цели ХОР на уровне 1.3445. Закрываем позицию. Доход без учета спреда равен $1.3445 - 1.3263 = 0.0182$, то есть 182 пункта. При минимальном лоте по EUR/USD – это 182 доллара США. К 8-му Марта эти деньги были бы очень кстати. Кто считает по-другому?



Рис. 11.10. Дата - 08.03.2005, часовой график, «Перебежка» и достижение цели ХОР .

С уважением,
Алексей Кияница

О сигнале Намерения рынка и АКРФ - GBP, 3Н, 20.03.2005

Учебными материалами для этого курса являются:

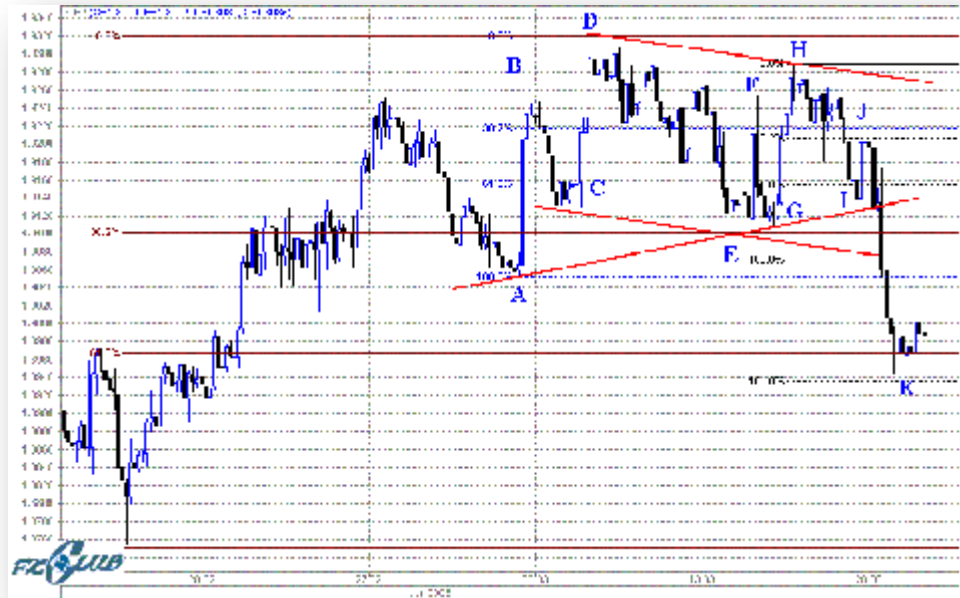
1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Уважаемые господа,

В этой небольшой статье хотелось бы продемонстрировать то, каким образом можно распознавать сигналы намерения.

Посмотрите, пожалуйста, на рисунок – здесь изображен GBP, трехчасовой график. В течение двух недель мы наблюдали тренд вверх, а затем еще две недели – «болтанку». «Болтанку» масштаба трендового движения мы реально могли зафиксировать в районе точки Е, когда цена опустилась ниже 61.8% от AD. До этого момента еще была надежда на продолжение движения вверх.

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи



В точке E, по мере развития движения EF вверх, мы могли построить две линии – CE и AE. Из них нам и приходится теперь выбирать, на которую ориентироваться.

Как уже замечалось, основная цель в режиме «болтанки» – 61.8%, не больше. Причина в том, что неопределенность может вылиться в любую из графических фигур. Если будет «голова и плечи» - сопровождение позиции, возможно, поможет (если была открыта позиция). Если будет треугольник, то вероятнее всего очередной размах кончится где-то на уровне 61.8%. Соответственно, достижение ценой точки F и преодоление неотраженной здесь цели недалеко за уровнем 61.8% от DE – этап почти закономерный. Минус данной реакции в Ом, что уж больно она скоротечная – две свечи. Вероятно, если копнуть новости, там что-нибудь найдется, но мы пока не будем заостряться на этом.

После F – снижение к точке G. Но пока точки G не было, мы еще не понимаем, какая же из линий – AE или CE окажется реальной трендовой. Когда сформировалась точка G – приняли за трендовую линию AE. Точка G сработала как подтверждение. А если еще и учесть, что 24.02.2005 цена опиралась почти на эту же линию, то ценность CE еще немножко вырастает.

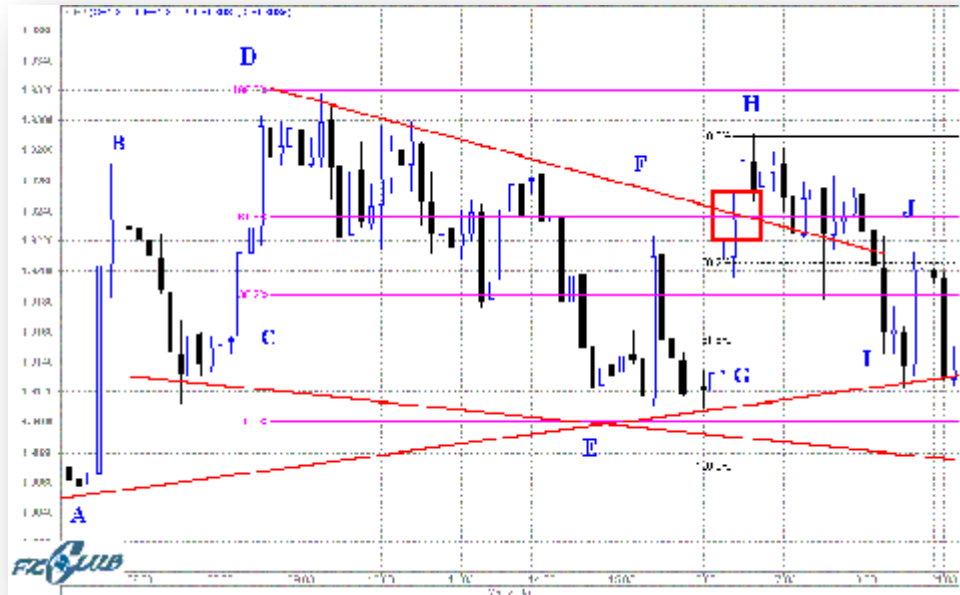
Далее – еще одно подтверждение в точке I. К этому моменту уже явно видны две стороны треугольника – CE и DH. В процессе движения от точки I к точке J цена решает, куда дальше двигаться. Выбор сделан в пользу движения вниз.

Движение вниз завершилось в зоне Согласия между коррекционным уровнем 61.8% месячного движения и классическим расширением XOP 161.8% от DE (с учетом коррекции EH).

Можно было сказать: «Находясь в точке G, мы могли построить трендовую линию DF. Как с этим?» - Ответ может быть следующим:

Тогда бы вы увидели, что достижение этой линии с целью прорыва (?) соответствует повторному достижению уровня коррекции 61.8% от импульса DE. Вас бы, возможно, спасло от ложного открытия понимание того, что вот-вот возможно окончание коррекции, поскольку существуют недоходы и проколы. Также, если бы в этой достаточно неопределенной ситуации вы бы отказались от работы по ордерам на пробой линии DF, а ждали бы окончания после точки H легкой трендоподтверждающей коррекции, то к моменту ее появления (свеча 17.03, 21:00) уже бы заподозрили появление треугольника с верхней гранью DH, что вас простимулировало бы открываться вверх как минимум (и все-таки) после пробития линии DH.

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи



С уважением,
Алексей Кияница

Анализ EUR на начало сентября 2006

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

EUR, с начала века и до наших дней :) - до сентября 2006 года.

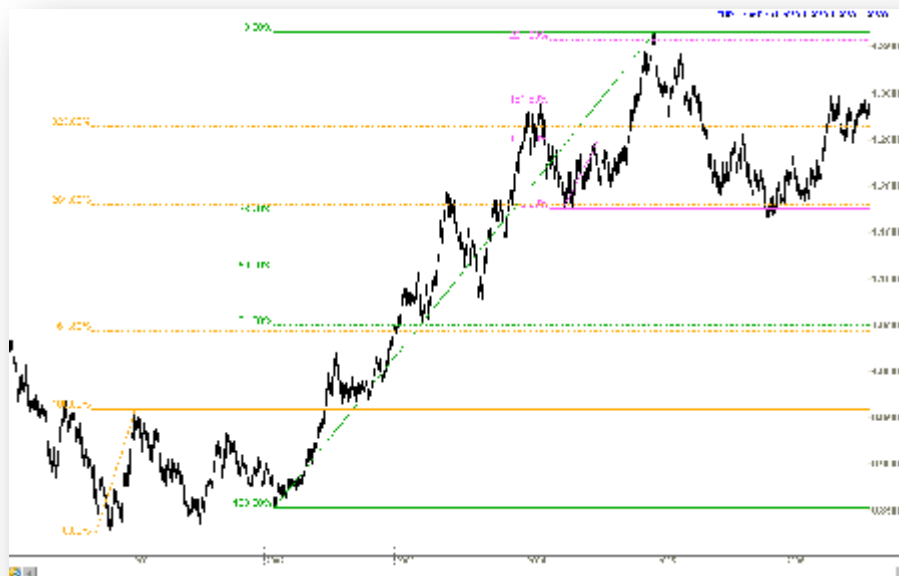


Рис. 1

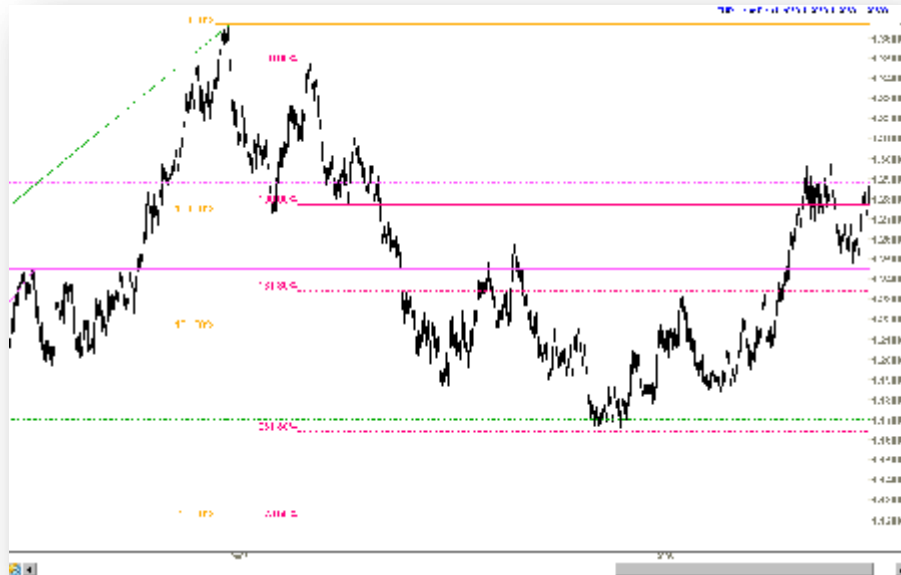


Рис. 2

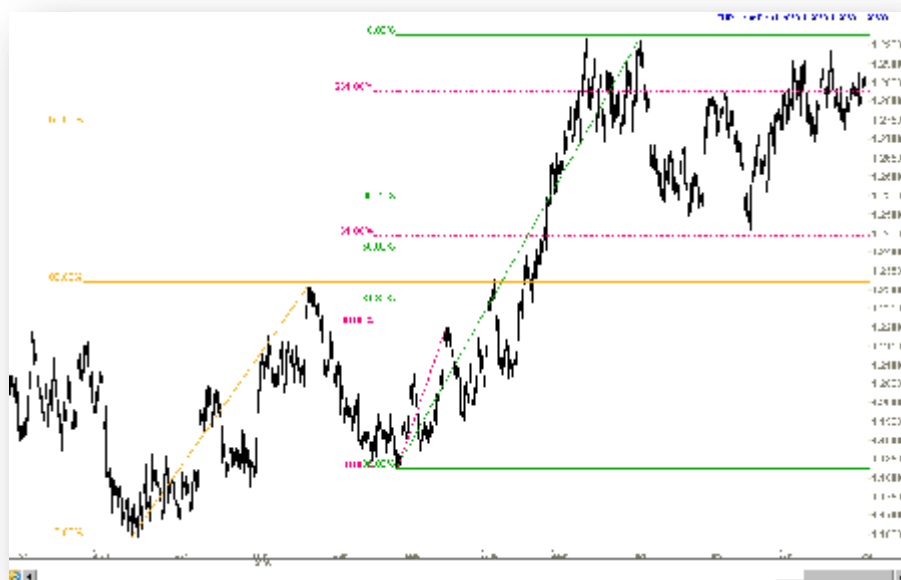


Рис. 3

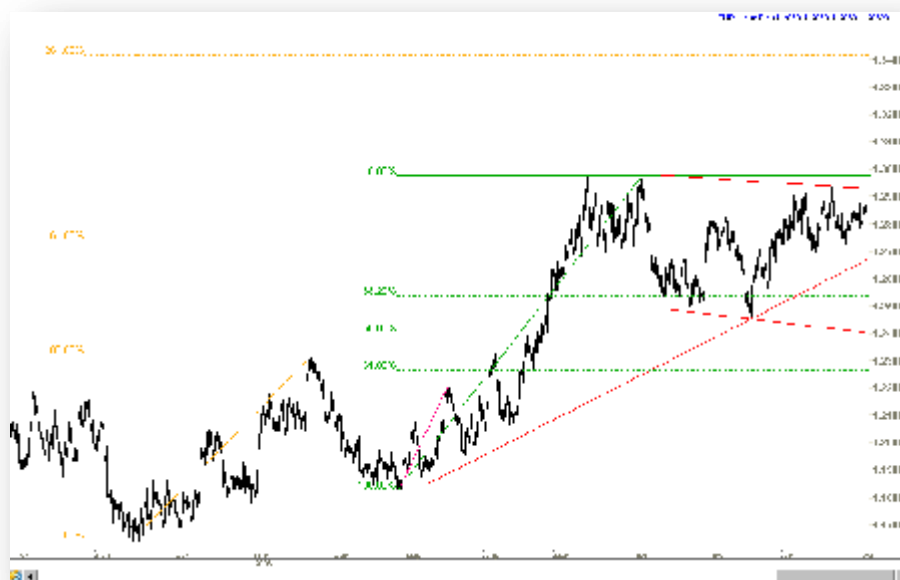


Рис. 4

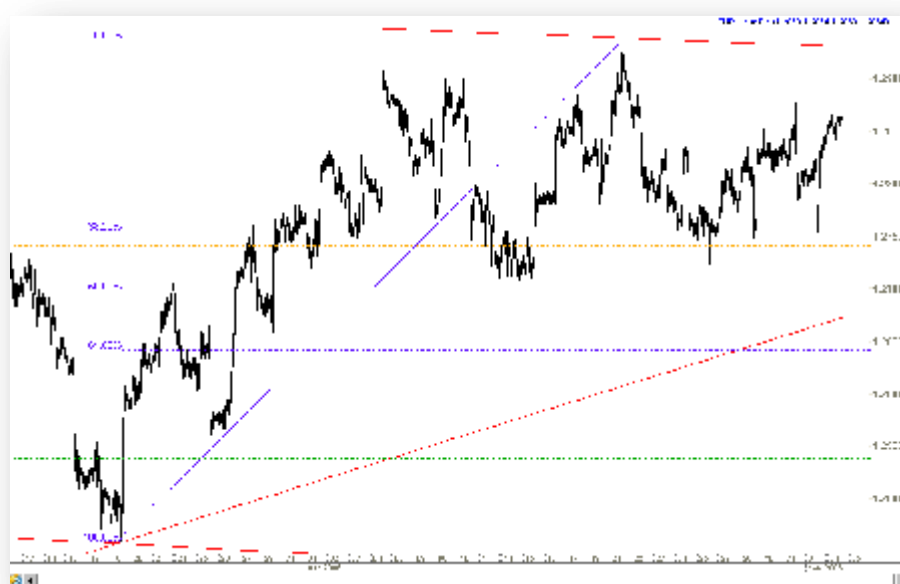


Рис. 5

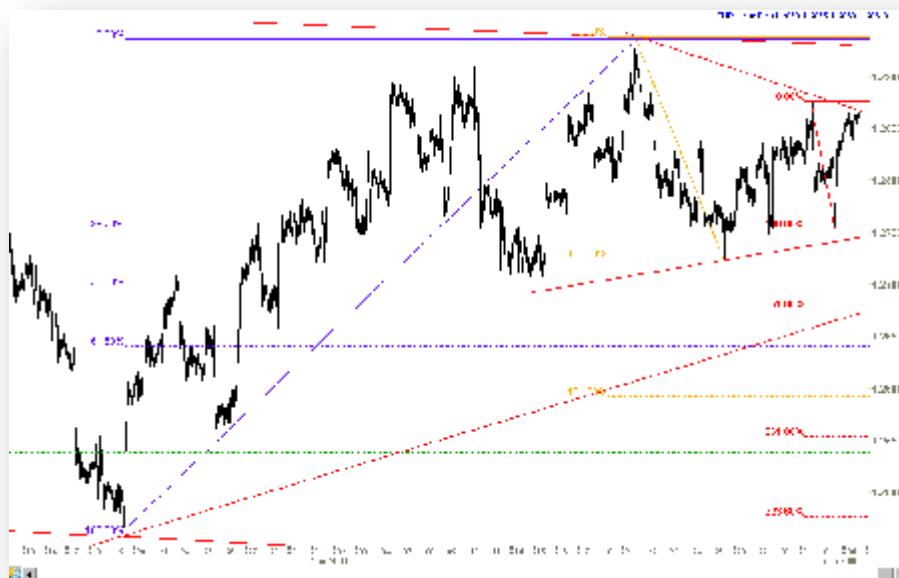


Рис. 6

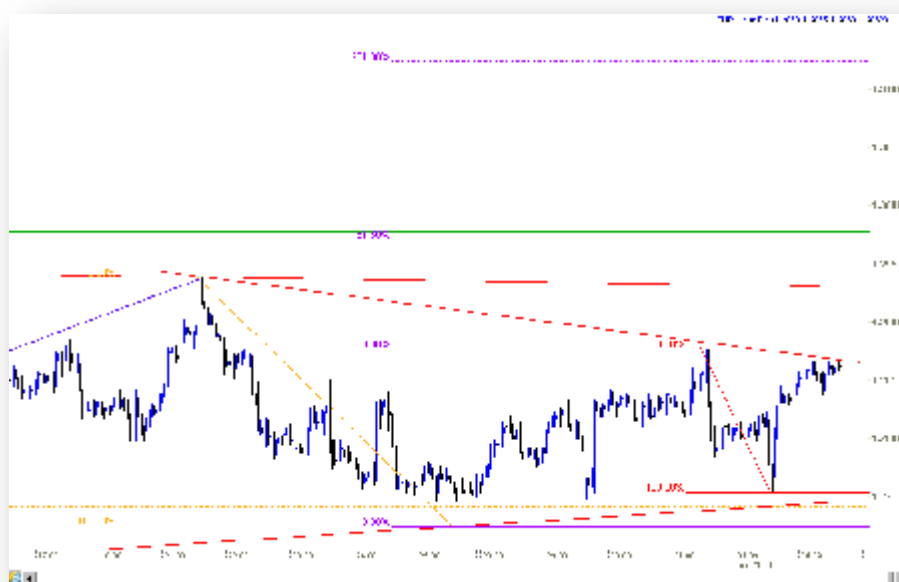


Рис. 7

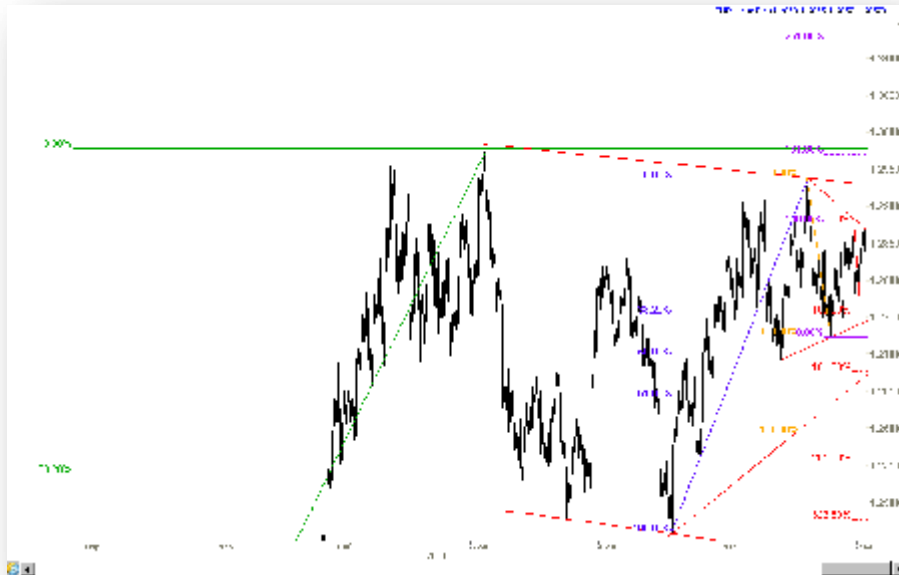


Рис. 8

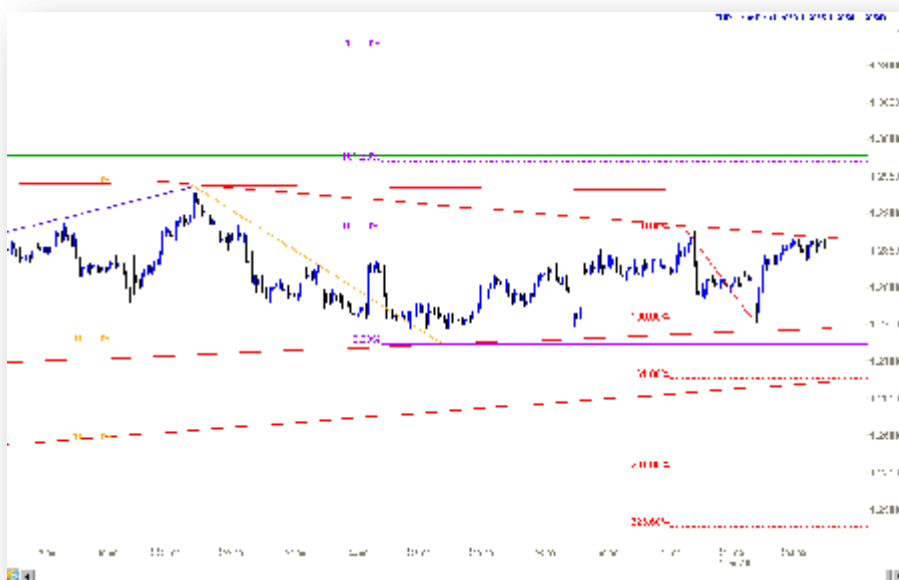


Рис. 9

Осциллятор Бестрендовости: смысл и формула для RUMUS

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Смысл осциллятора Бестрендовости

Осциллятор Бестрендовости (в "рабочей" терминологии класса - "БТР") предназначен для фильтрации моментов входа ("еще можно" - до 65% / "уже нельзя" - после 65%), а также для определения моментов закрытия позиций (в случаях, когда цены демонстрируют резкие скачки, близкие к максимальным за достаточно представительный более ранний период; полное или частичное закрытие на уровнях 70%, 80%, 90%).

Осциллятор Бестрендовости сравнивает текущую цену закрытия и величину скользящей средней с периодом 7, сдвинутую на 3 периода вперед. Математический смысл его в том, что он показывает величину

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

текущего рывка в сравнении с тремя-четырьмя максимальными за некоторый период. Представительными периодами являются: для часовых графиков - месяц, для дневных - полгода.

Идея использования осциллятора Бестрендовости кроется в тезисе о том, что вряд ли скачок цены "на этот раз" будет столь большой, что виртуальный уровень 100% будет преодолен осциллятором. Соответственно, если осциллятор Бестрендовости приближается к своим уровням 80-90% или к 100%, сам бог велел либо не открываться, либо закрывать позиции, потому что наверняка начнется коррекция (естественно, если мы хотим оставить позицию открытой в надежде на развитие тренда, то должны как минимум застраховать прибыль ордером стоп-трейда).

Если БТР меньше 65%, то потенциал хода у цены еще существует - лимиты не выбраны. :) Конечно, все может повернуться вообще против нас, но все же идея срабатывает - если 65% еще не достигнуто, еще какой-то ход наблюдается. А если БТР пересек 65%, то считаем, что начался период опасности и лишних позиций не открываем.

Формула осциллятора Бестрендовости для программы RUMUS

```
p1=inparam("Period",1,100,7);
p2=inparam("Sdvig",0,100,3);
bestr=c-Ref(Mov(C,p1,S),-p2);
bestr;
0;
```

Первый параметр p1 - период скользящей средней, а второй p2 - сдвиг скользящей средней.

Расшифровка формулы: от цены закрытия вычитаем значение средней mov(c,p1,s) с периодом p1, сдвинутое оператором ref(...,-p2) на период p2 вправо.

Последние две строки выводят осциллятор и нулевую линию на экран.

Чтобы создать индикатор Бестрендовости, следует нажать мышкой справа от "спадающего списка" индикаторов специальную кнопку, выглядящую как книжечка. Далее нажать "NEW". Откроется окно, куда надо ввести вверху название (например, "BTR"), а внизу вставить приведенную формулу.

Ну а если создавать индикатор не хочется, ищите в списке встроенных индикаторов индикатор "fx_TrendLess". На самом деле это почти то же самое, просто вместо цены CLOSE (первая составляющая нашей разности) можно использовать целую скользящую среднюю. Но поскольку нам нужна именно цена CLOSE, в индикаторе fx_TrendLess просто ставим параметры "1,7,0,3", где 7 и 3 - параметры сдвинутой скользящей, а 1 и 0 - это скользящая с параметрами 1 и 0, что соответствует цене CLOSE.

Пользуйтесь на здоровье.

О разнице между RSI, Stochastics, "классическим" индикатором Бестрендовости и fx_TrendLess

Разница между RSI, Stochastics, "классическим" индикатором Бестрендовости и fx_TrendLess в формулах.

Нам нужно, чтобы наш ненормированный между 0 и 100 осциллятор показывал отрыв цены от текущего значения сдвинутой скользящей.

Формулы RSI или Stochastics таковы, что эти индикаторы оказываются математически заперты в диапазоне 0-100, поэтому они нас и не вполне устраивают в качестве средств для определения реальных зон перекупленности и перепроданности. Проблема описана в книге: индикатор может медленно расти от 70 до 95, а цена в это время проходит еще 500-700 пунктов, и это при том, что в процессе движения индикатора от 50 к 70 цена прошла 150-250 пунктов.

Нормальный индикатор Бестрендовости полностью нас устраивает для того, чтобы определять, насколько сильно было движение за последние 10 свечек (7+3), так как он ненормированный и выражается в абсолютной величине - в пунктах, соответствующей реальным скачкам. Если движение было сильно в сравнении с представительными движениями периода, то осциллятор Бестрендовости достигнет своих 80-90% от "виртуального" уровня 100%, построенного по его реальным максимумам. Это и есть сигнал на закрытие позиции или подтягивание стопов.

Отличие fx_TrendLess от осциллятора Бестрендовости в том, что там разница цены и средней делится в итоге на значение средней. Таким образом, разница сравнивается с текущей величиной средней. В силу математических причин, довольно скромное изменение знаменателя сильно на вид fx_TrendLess не влияет, и последний оказывается похож на осциллятор Бестрендовости, только имеет другую размерность.

Да, fx_TrendLess бывает похож на RSI в том смысле, что указывает на движения в одни и те же моменты. В принципе, и осциллятор Бестрендовости похож на них в этом плане. Но привожу пример ситуации, когда RSI этим индикаторам проигрывает (по следам реальной иллюстрации на рынке): RSI показал, что цена только-только вошла в зону перекупленности. А в это время и fx_TrendLess, и осциллятор Бестрендовости показали, что это резкое вхождение в зону является СИЛЬНЫМ СКАЧКОМ. Мы же в итоге можем сделать вывод, что после него, вероятно, будет коррекция (естественно, если осциллятор Бестрендовости вошел в свою "виртуальную" зону 70-100%). Кстати, по ходу дела хочется заметить, что иногда на RSI дивергенции нет, а на осцилляторе Бестрендовости или fx_TrendLess ее можно увидеть, и это намекает нам на скорый разворот.

В общем, можно сделать вывод:

Осциллятор Бестрендовости в его классической форме (разница закрытия и средней) и его братец fx_TrendLess хорошо показывают резкие СКАЧКИ ЦЕН. Именно отсюда возникает возможность использовать факт достижения (!) их 80-90-процентных уровней от "виртуального" уровня 100%, построенного по их собственным максимумам (читайте книгу), как факт подачи сигнала на закрытие позиции в преддверии начала коррекции. Цитата классика меня: "Хорошее движение бесконечным не бывает". :)

С уважением,

Алексей Кияница

Фибо-уровни в программе RUMUS

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Ниже привожу формулу уровней Фибоначчи для программы RUMUS.

Внимание! Нюанс данной формулы в том, что она работает с конкретным временным циклом (я установил период 50 - вы можете его изменять), а не с реальным конкретным размахом. Воспринимайте формулу как наиболее простой способ запрограммировать уровни. Можно запрограммировать построение уровней и таким образом, чтобы компьютер сам, например, искал импульс, не меньший определенного минимального размера и с предшествующей ему коррекцией. Как только формула у меня появится, выложу здесь. Если кто-то делает это раньше - прошу делиться. :)

С уважением,

Алексей Кияница (говорящий стихами).

Формула Фибо-уровней для конкретного временного цикла

```
// Fibo Levels 50
hvr=hv(h,50);
lvr=lv(l,50);
realimp=hvr-lvr;
// Расчет уровней
f0=ref(hvr-0.0*realimp,-1);
f1=ref(hvr-0.382*realimp,-1);
f2=ref(hvr-0.618*realimp,-1);
f3=ref(hvr-0.500*realimp,-1);
f4=ref(hvr-1.000*realimp,-1);
// Вывод на экран
f0;
f1;
f3;
f2;
f4;
```

ТрендоОбразующие Импульсы и Статичные Расширения

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Статичные Расширения следует строить не абы как, а от определенных Трендообразующих импульсов (ТОИ).

В классе я указывал, что, по моим текущим оценкам, за ТОИ для тренда вверх нужно в первую очередь брать именно первый восходящий импульс, с которого началось движение цены вверх (я описываю ситуацию на примере восходящего движения). Его "восходячесть" определяется наличием восходящих минимумов, пусть даже есть и нисходящие максимумы (вспомните треугольник - это яркий пример). Как правило, за ТОИ следует глубокая коррекция, хотя бывают и исключения. И еще один момент - чаще всего ТОИ будет находиться в рамках структуры Намерения (треугольника, например, опять же, или головы и плеч).

Второй (следующий за ТОИ) импульс может принимать следующие формы: он либо внутренний для трендоподтверждающего рывка, выходящего за пределы структуры Намерения и сопровождающегося малой коррекцией после него, либо сам является трендоподтверждающим импульсом (ТПИ). ТПИ - это такой импульс, который подтверждает силу в данном случае быков, выведших цену за пределы структуры Намерения, и сопровождается малой коррекцией после него.

Если строить Расширения по внутреннему размаху структуры Намерения, то, возможно, мы занижим цели. Это не так страшно, как ожидать, что тренд еще будет долгим, оценивая его по Расширениям от ТПИ, вышедшего далеко за пределы структуры Намерения.

На самом деле, нельзя дать 100-процентных гарантий того, что отработается строго "формальный" ТОИ и что цели, выставленные по ТПИ, не подтвердятся. Иногда приходится учитывать и разные варианты. Но разница между вариантом формального ТОИ и вариантом использования иного размаха в качестве ТОИ в том, что в первом случае есть яркое формальное правило, облегчающее нашу задачу, а во втором - есть

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

вероятность, что наши цели будут слишком далекими, мы будем слишком оптимистичны (рынок же нас тогда поставит на место), а время уйдет.

Резюме: Начинать искать цели тогда, когда уже есть с чем работать. Считайте за ТОИ первый импульс, имеющий глубокую коррекцию, если такой есть. Лучше ошибиться в том, где закончится тренд, и закрыться раньше, чем открываться, считая, что до целей еще далеко.

Если основной ТОИ таков, что цели от него самого очень далеки, работайте со внутренним Размахом.

P.S.

В книге издания марта 2005 года про ТОИ не пишется, поэтому на эту информацию обратите особое внимание. Там берется общий случай, когда коррекция меньше 38.2% - и в этом случае рекомендуется строить статичные расширения. Мы несколько откорректировали видение и теперь сообщаем вам об этом. Построение статичных расширений по импульсу с малой 38,2%-коррекцией с точки зрения прогнозирования длины тренда уместно только на том импульсе, который играет функцию ТПИ и является первым среди себе подобных. Этот импульс обычно соответствует "импульсу выхода" из структуры Намерения. В силу того, что его фокус недалек от фокуса ТОИ с глубокой коррекцией, то оценка по ТПИ может оказаться действующей. Однако минус работы с целями по ТПИ в том, что размер ТПИ может быть и существенно больше, чем ТОИ - и тогда, возможно, будет упущена прибыль. Поэтому и рекомендую работать в первую очередь с ТрендоОбразующим импульсом (ТОИ).

И еще момент: иногда трейдеры делают ошибку, пытаясь строить статичные расширения по импульсам с малой коррекцией, возникающим в области завершения тренда. Возможно, конечно, они не имеют выбора, потому что не знают, в отличие от нас, где можно ждать сильного торможения цены. Но в любом случае это ошибка: цена не пойдет туда, куда она не должна идти, как бы громко мы ей это ни приказывали, и искусственное отодвигание нами целей 261.8%/323.6%, не связанное с ТОИ, к позитивным результатам привести не может.

С уважением,
Алексей Кияница.

MACD как индикатор для отслеживания Тренда и его связь с АКРФ

Учебными материалами для этого курса являются:

1. Книга "Уровни Фибоначчи: там, где лежат деньги";
2. Микрофильмы продолжительностью более 6 часов (см. раздел "Видео"; просмотр возможен только при соединении с сетью Интернет на скорости не менее 256 кбит/сек);
3. Несколько статей в разделе "Учебные материалы";
4. Материалы форума, где уже обсуждалось очень многое (пользуйтесь поиском по ключевым словам!).

Часто спрашивают, какие параметры MACD использовать для работы. Обсудим этот вопрос.

Для начала – короткий тезис о смысле индикатора. Итак, помните, что индикатор MACD – это не «гуру», который даст вам точные указания о направлении Тренда, а просто отстающий от цен показатель. Его работа будет хорошей тогда, когда вы сами поймете, что он должен показывать, и подберете приемлемые для ваших целей параметры.

Итак, какие же могут быть наши цели? Вот примеры целей и предложения по параметрам индикатора MACD:

- отслеживание двух-трехсуточных «длинных» трендов на часовых графиках – длинный MACD-12/72/24 или MACD-24/72/24 (24/72/24 работает хуже, он был предложен в книжке, но лучше – 12/72/24);
- отслеживание «коротких» внутридневных трендов на часовых графиках – короткий MACD-6/36/6 или MACD-12/72/6 (сигналы аналогичные, но 6/36/6 нагляднее);
- отслеживание «длинных» двух-трехмесячных трендов на дневных графиках – MACD-22/66/22;
- отслеживание «коротких» трендов на дневных графиках – MACD-15/22/10, например.

Для остальных Временных Структур параметры подбирайте сами.

Приведенные параметры подбирались самым грамотным способом – «на глаз» с учетом естественных циклов и просто кратных частей периодов, потому что так проще запоминать. Они делают MACD настолько оперативным (запаздывающим), чтобы было комфортно работать именно автору строк. Ничто в наших строках не есть догма. Будет острое желание – можете изменить параметры, но делайте это только в том случае, если сами для себя имеете обоснование того, что смена целесообразна.

Но когда же нужен короткий, а когда длинный MACD?

Длинный MACD:

- для отслеживания значимых трендов на Нормальной ВС (важно!);
- для отслеживания глобальных тенденций на Повышенной ВС («справочная информация»).

Короткий MACD:

- для отслеживания коротких тенденций на Повышенной ВС (они либо сопоставимы со «значимыми» на НВС, либо больше последних; например, на днях MACD показал короткую тенденцию длиной 1 неделя, но одна внутренняя значимая часовая была 2,5 суток);

Курс 4 Анализ коррекций и расширений Фибоначчи

- для подтверждения сигналов Stochastics на Повышенной ВС (не думаю, что это нужно использовать, но нужно знать: по-моему, например, короткий дневной MACD сильно похож на Stochastics по моментам подачи сигналов и мог бы подтверждать сигналы Stochastics).

И еще один момент: когда MACD подает сигналы и как он связан с Анализом Коррекций и Расширений?

Ответ простой: Он подает сигналы тогда, когда происходит отбой, а отбои чаще всего происходят от уровня Фибоначчи. Следовательно, MACD даст сигнал только ПОСЛЕ отбоя от уровня Фибоначчи. Вот почему важно контролировать в первую очередь ситуацию с точки зрения АКРФ, а не с точки зрения отстающих индикаторов. Индикаторы – всего лишь способ скинуть ответственность со своих плеч на плечи бессловесных безобидных линий. Умно мы называем это так: «индикаторы – это способ формализовать свои действия до такой степени, чтобы либо использовать сигналы для подтверждения своих догадок относительно состояния рынка по Фибоначчи, либо в ряде случаев принимать решения по простому сигналу индикатора без учета АКРФ».

Примечание: У всех должна быть мечта. У нас с Л.В. Братухиным – формализовать торговлю по АКРФ таким образом, чтобы индикаторы в ней отсутствовали вообще. А пока – сосуществуем с ними в одном мире.

И наконец, позволю себе предложить уважаемым Студентам **воспользоваться функцией поиска в форуме дистанционного класса и по ключевому слову "MACD" найти** статьи, где обсуждалась тема применения индикаторов.

С уважением,

Алексей Кияница