



UNITED TRADERS

UT PROP SCALPING

Система обучения профессиональных трейдеров



UNITED TRADERS

Стратегии и паттерны

Хорошая торговая стратегия, в идеальном случае, должна быть основана на понятной количественной идее.

Правильный скальпинг основан на ситуациях, которые могут быть описаны количественно.

Разбор “Сайза” - самая количественная из всех)

Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Основным и самым главным определяющим фактором сайза является наличие крупной заявки в стакане Level 2

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	49.99	35	NASD	50.00	988
EXB	49.99	33	EXB	50.00	766
EDGX	49.99	33	EDGX	50.00	766
NASD	49.99	16	NQPX	50.00	625
PACX	49.99	15	PACX	50.00	346
BATS	49.99	12	BATS	50.00	346
EDGA	49.99	12	NQPX	50.01	35
NQBX	49.99	10	EXB	50.01	33
NQPX	49.98	35	EDGX	50.01	33
EXB	49.98	21	NASD	50.01	16
EDGX	49.98	21	PACX	50.01	15
NASD	49.98	16	BATS	50.01	12
PACX	49.98	15	EDGA	50.01	12
BATS	49.98	12	NQBX	50.01	10
EDGA	49.98	12	NASD	50.02	10

Сайз должен стоять в нескольких ECN с общим количеством заявок, как минимум в 10 раз больше, чем в остальных уровнях!

Условия разбора

1. В момент разбора сайза - брать надо по цене уровня.
2. Входить в разбор сайза необходимо на рыночные точки 3. Таким образом получается, что для наиболее удачного разбора сайза необходимо чтобы его касались не менее 2-х раз.
3. Первый импульс после разбора сайза принимаем кратным последнему откату перед разбором (X).

Разбор сайза BID



Основным и самым главным определяющим фактором сайза является наличие крупной заявки в стакане Level 2

Сайз должен стоять в нескольких ECN с общим количеством заявок, как минимум в 10 раз больше, чем в остальных уровнях!

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	50.00	988	NASD	50.01	35
EXB	50.00	766	EXB	50.01	33
EDGX	50.00	766	EDGX	50.01	33
NASD	50.00	625	NQPX	50.01	16
PACX	50.00	346	PACX	50.01	15
BATS	50.00	346	BATS	50.01	12
EDGA	50.00	12	NQPX	50.02	35
NQBX	50.00	10	EXB	50.02	33
NQPX	49.99	35	EDGX	50.02	33
EXB	49.99	21	NASD	50.02	16
EDGX	49.99	21	PACX	50.02	15
NASD	49.99	16	BATS	50.02	12
PACX	49.99	15	EDGA	50.03	12
BATS	49.99	12	NQBX	50.03	10
EDGA	49.99	12	NASD	50.03	10

Условия разбора

1. В момент разбора сайза - брать надо по цене уровня.
2. Входить в разбор сайза необходимо на рыночные точки 3, так как для наиболее удачного разбора сайза необходимо чтобы его касались не менее 2-х раз.
3. Первый импульс после разбора сайза принимаем кратным последнему откату перед разбором (X).

Разбор сайза в ленте



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Основным и самым главным определяющим фактором сайза является наличие крупной заявки в стакане Level 2

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	49.99	35	NASD	50.00	988
EXB	49.99	33	EXB	50.00	766
EDGX	49.99	33	EDGX	50.00	766
NASD	49.99	16	NQPX	50.00	625
PACX	49.99	15	PACX	50.00	346
BATS	49.99	12	BATS	50.00	346
EDGA	49.99	12	NQPX	50.01	35
NQBX	49.99	10	EXB	50.01	33
NQPX	49.98	35	EDGX	50.01	33
EXB	49.98	21	NASD	50.01	16
EDGX	49.98	21	PACX	50.01	15
NASD	49.98	16	BATS	50.01	12
PACX	49.98	15	EDGA	50.01	12
BATS	49.98	12	NQBX	50.01	10
EDGA	49.98	12	NASD	50.02	10

Сайз должен стоять в нескольких ECN с общим количеством заявок, как минимум в 10 раз больше, чем в остальных уровнях!

Условия разбора

1. В момент разбора сайза - брать надо по цене уровня.
2. Входить в разбор сайза необходимо на рыночные точки 3. Таким образом получается, что для наиболее удачного разбора сайза необходимо чтобы его касались не менее 2-х раз.
3. Первый импульс после разбора сайза принимаем кратным последнему откату перед разбором (X).

Разбор сайза BID



Основным и самым главным определяющим фактором сайза является наличие крупной заявки в стакане Level 2

Сайз должен стоять в нескольких ECN с общим количеством заявок, как минимум в 10 раз больше, чем в остальных уровнях!

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	50.00	988	NASD	50.01	35
EXB	50.00	766	EXB	50.01	33
EDGX	50.00	766	EDGX	50.01	33
NASD	50.00	625	NQPX	50.01	16
PACX	50.00	346	PACX	50.01	15
BATS	50.00	346	BATS	50.01	12
EDGA	50.00	12	NQPX	50.02	35
NQBX	50.00	10	EXB	50.02	33
NQPX	49.99	35	EDGX	50.02	33
EXB	49.99	21	NASD	50.02	16
EDGX	49.99	21	PACX	50.02	15
NASD	49.99	16	BATS	50.02	12
PACX	49.99	15	EDGA	50.03	12
BATS	49.99	12	NQBX	50.03	10
EDGA	49.99	12	NASD	50.03	10

Условия разбора

1. В момент разбора сайза - брать надо по цене уровня.
2. Входить в разбор сайза необходимо на рыночные точки 3, так как для наиболее удачного разбора сайза необходимо чтобы его касались не менее 2-х раз.
3. Первый импульс после разбора сайза принимаем кратным последнему откату перед разбором (X).

Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS

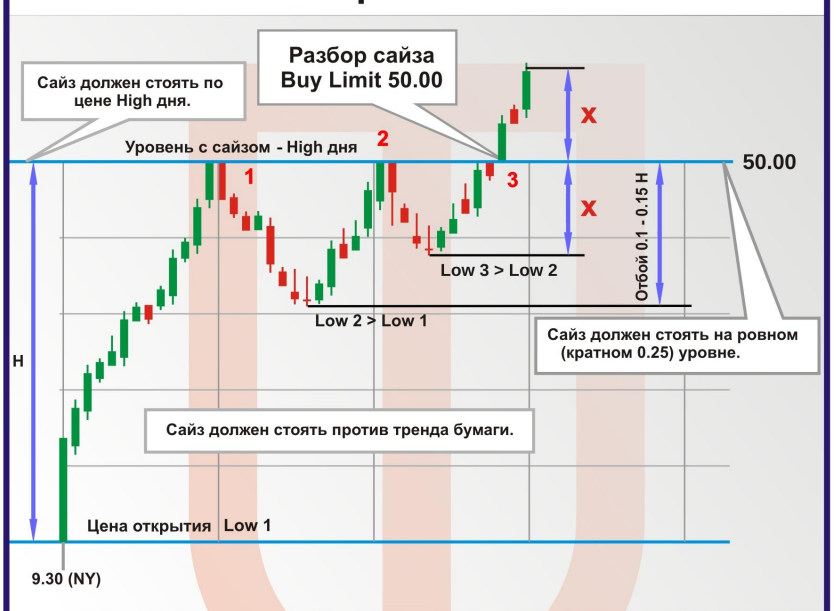


Стратегии и паттерны

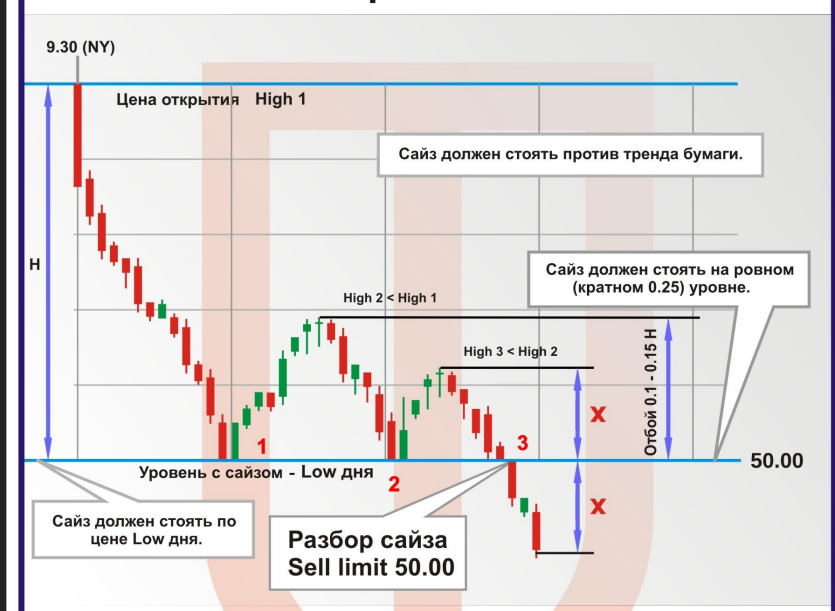


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS

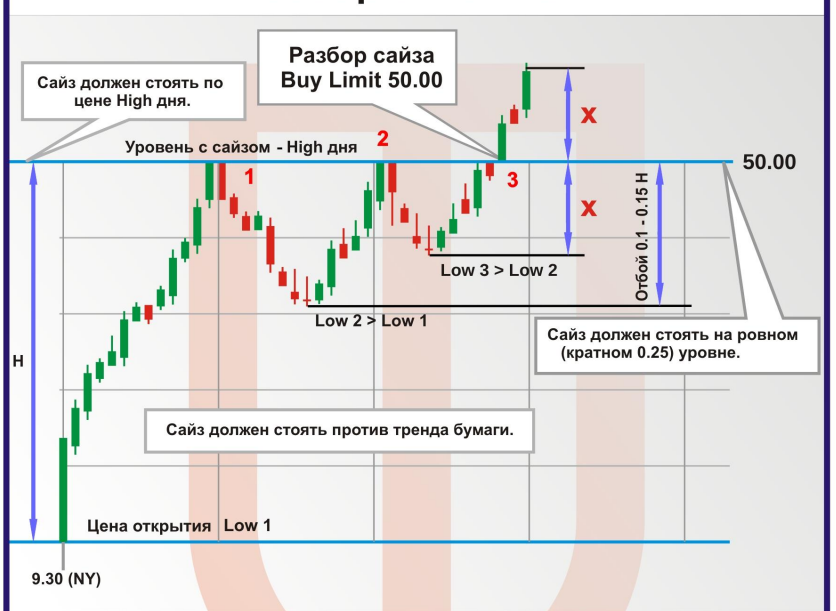


Стратегии и паттерны

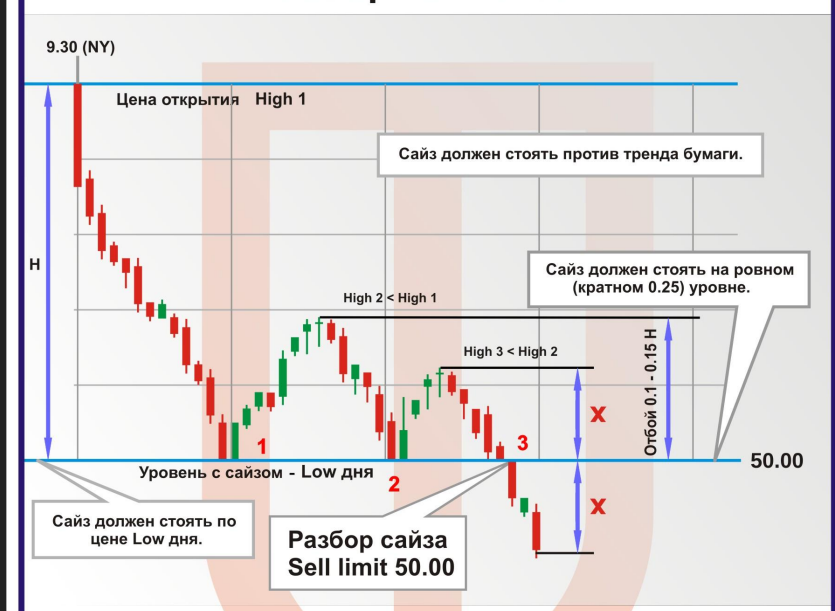


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



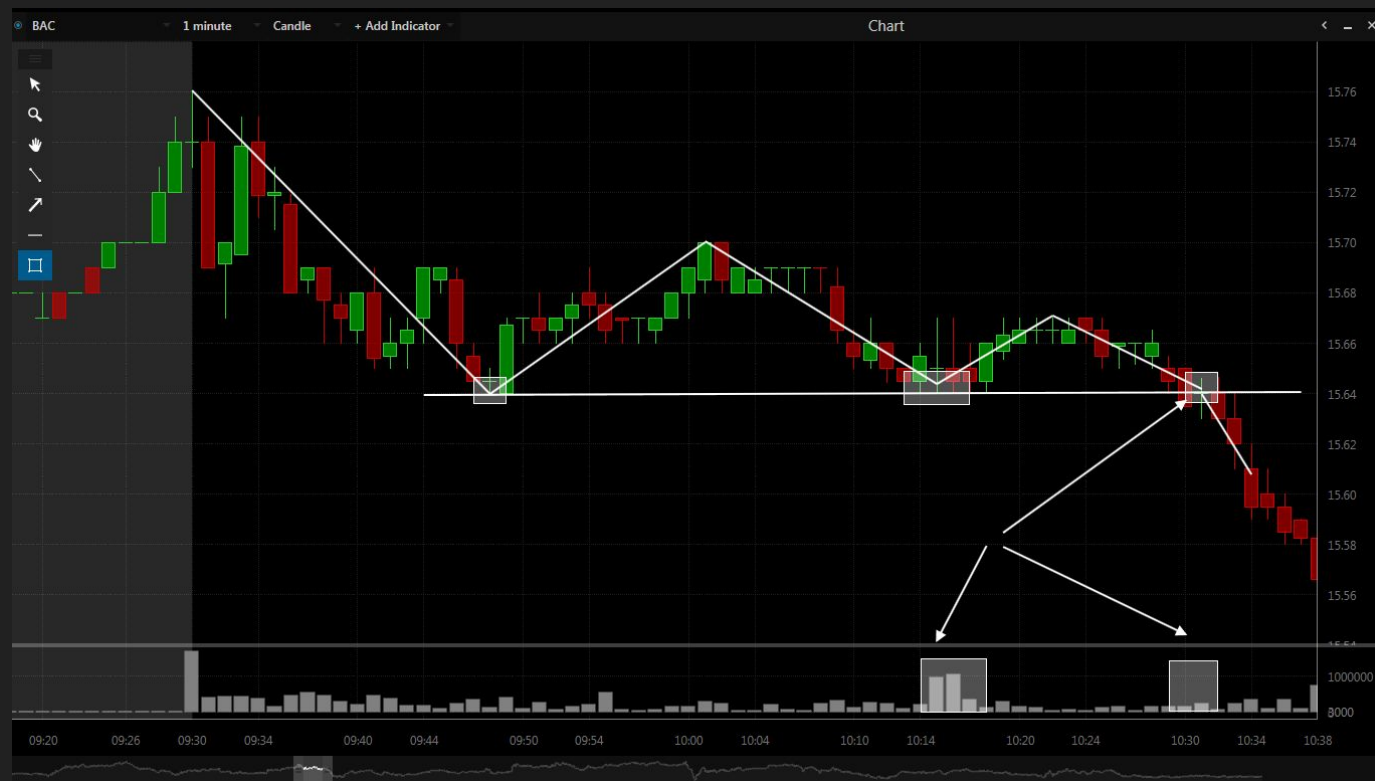
UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS

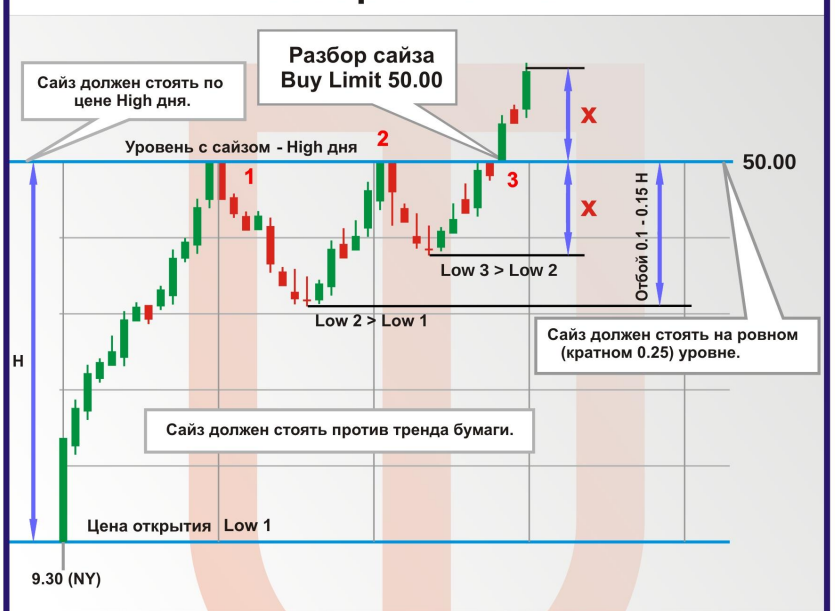


Стратегии и паттерны

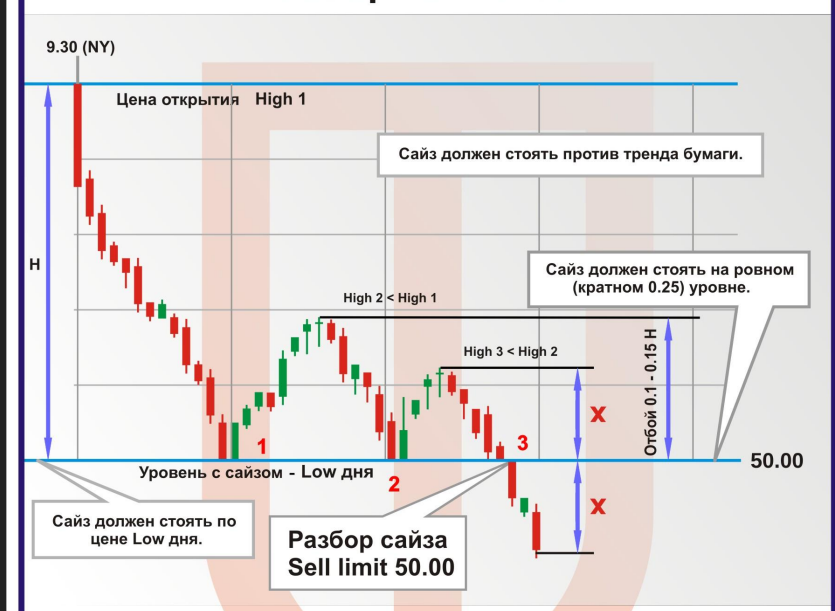


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS

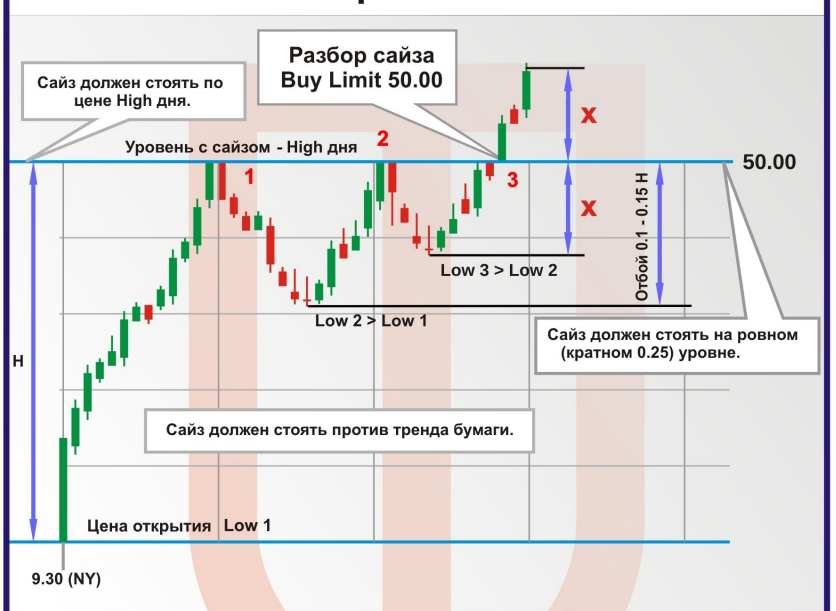


Стратегии и паттерны

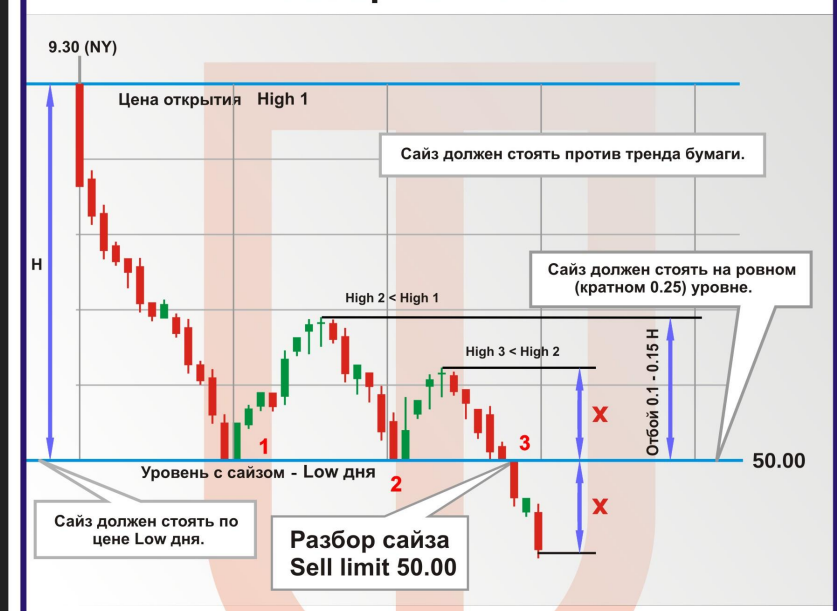


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны

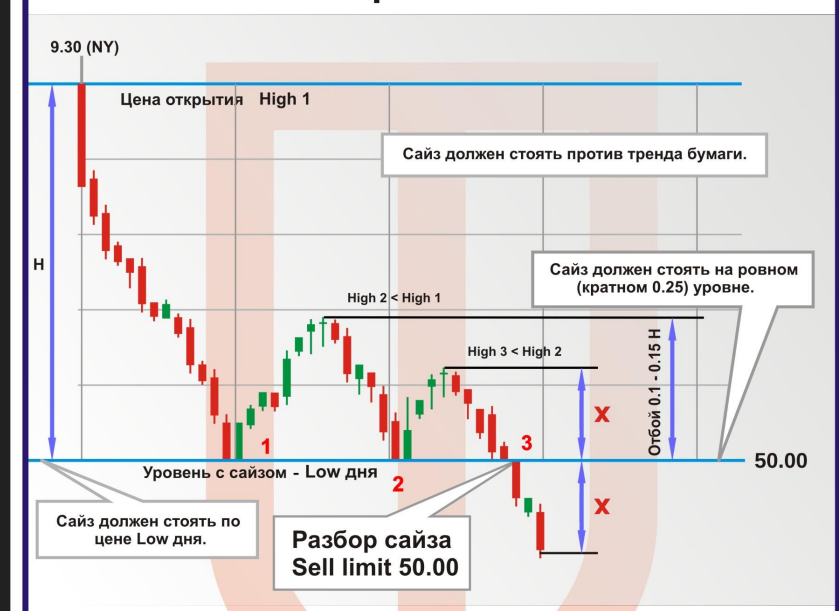


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS

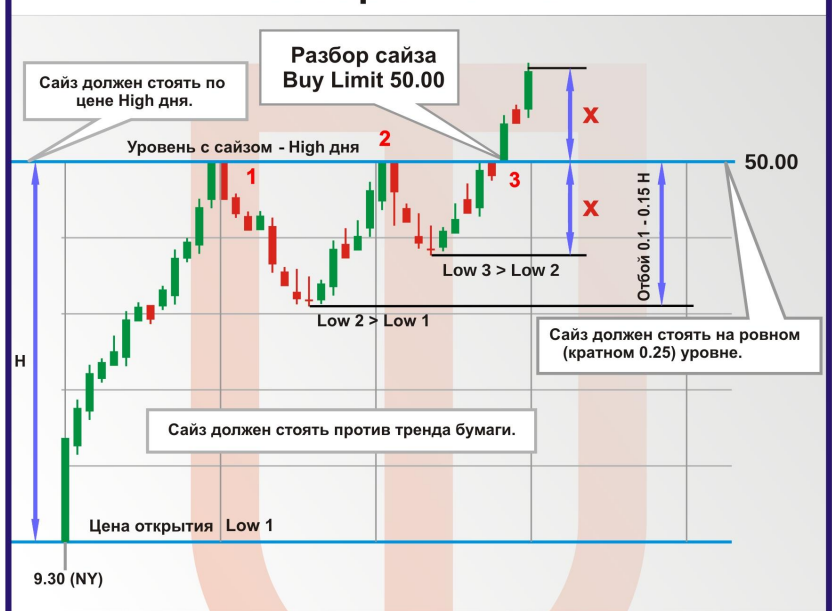


Стратегии и паттерны

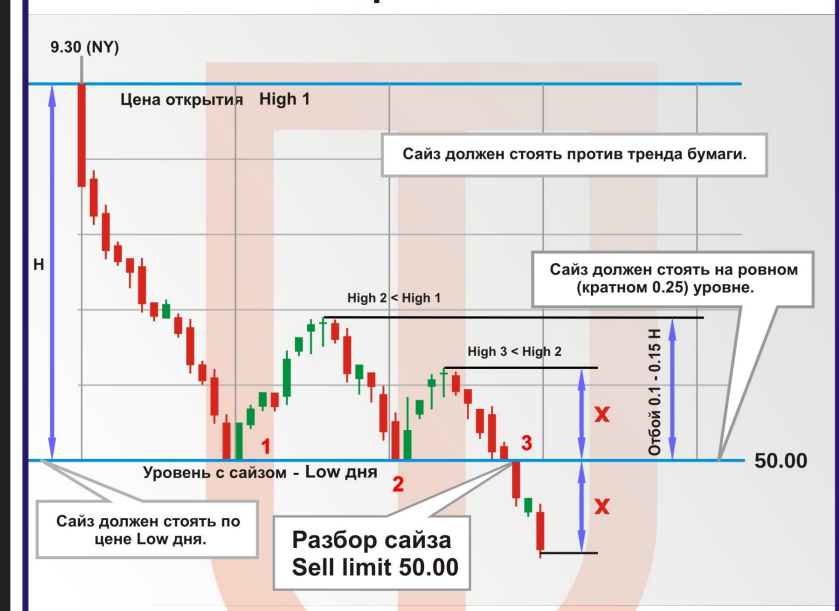


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



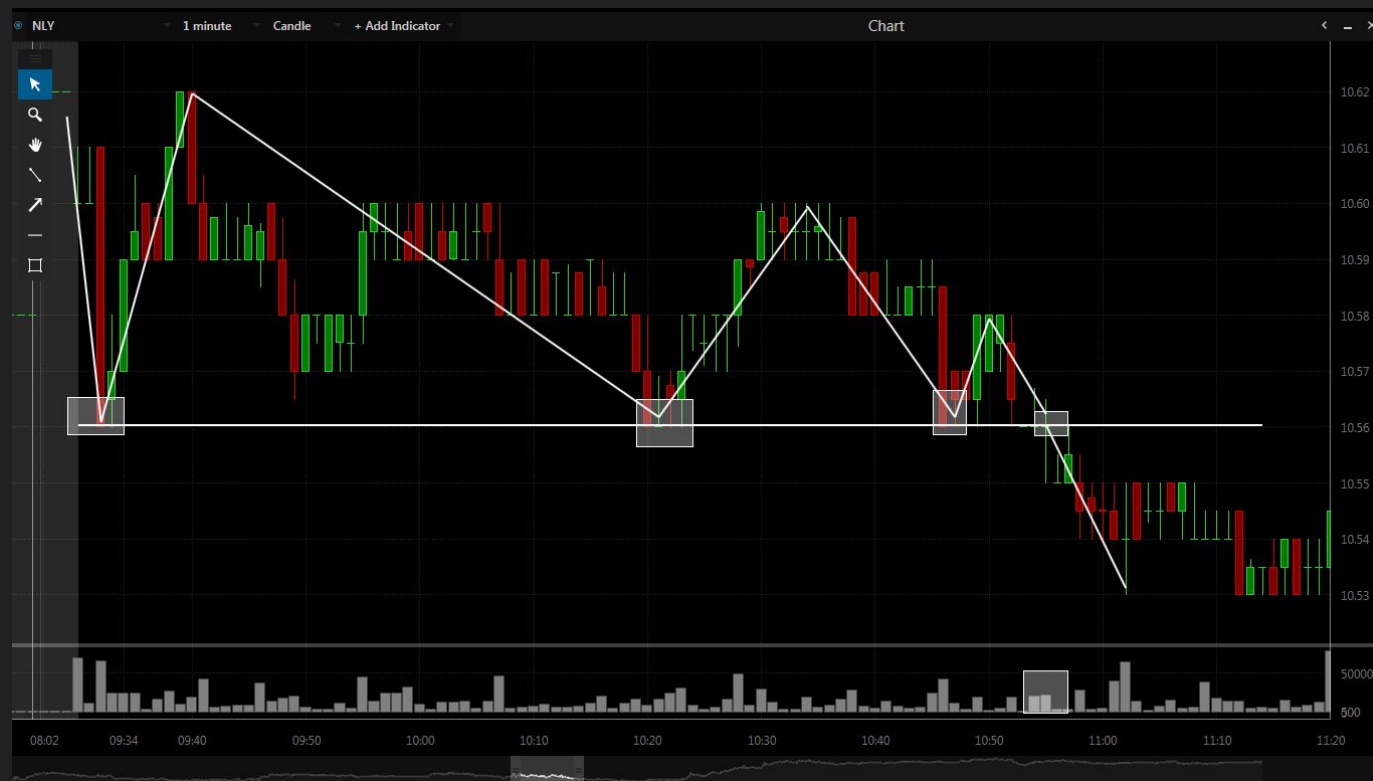
UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS

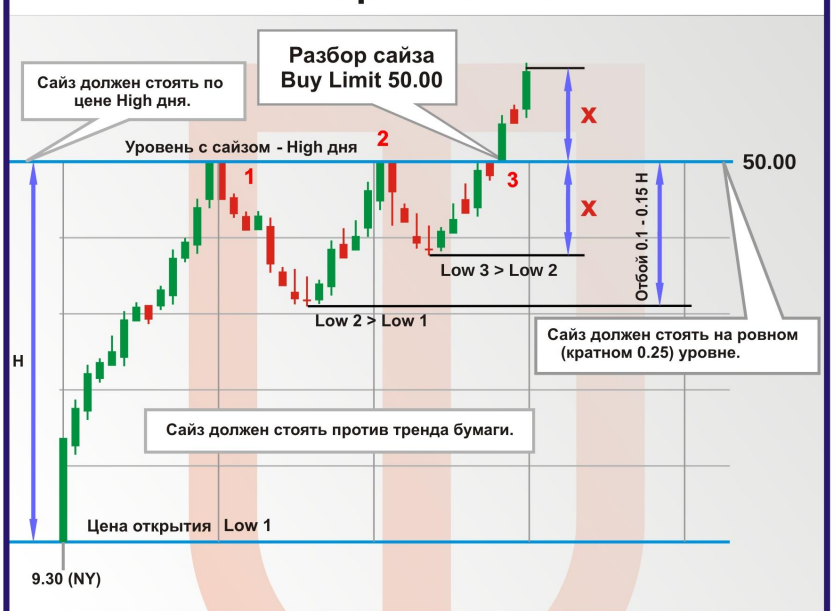


Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS

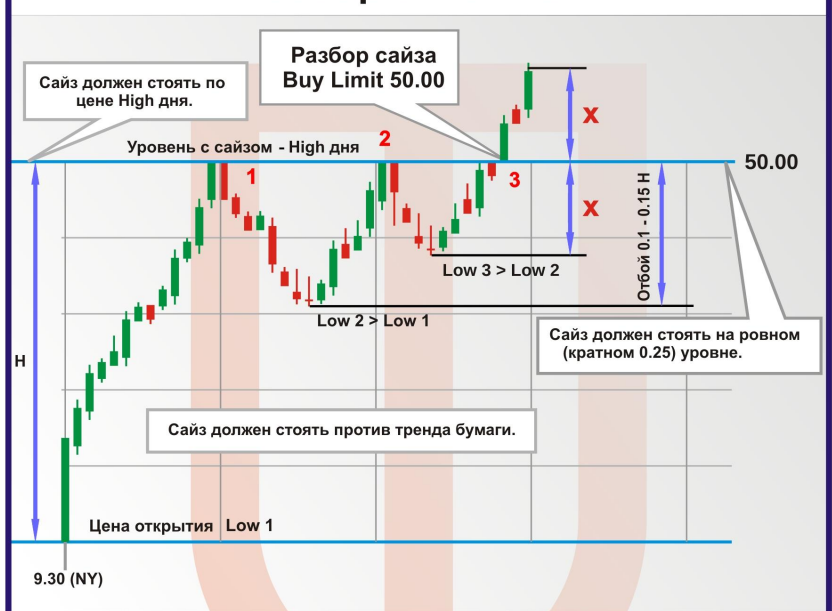


Стратегии и паттерны

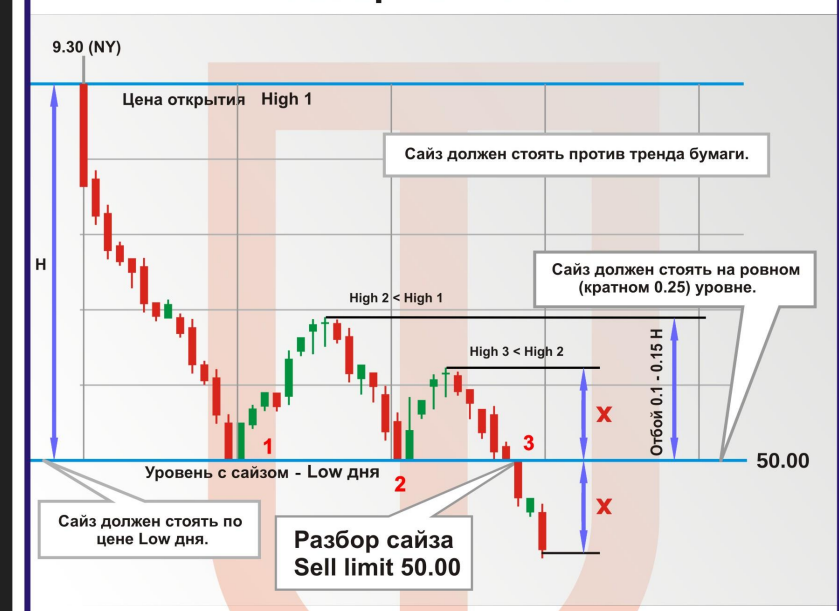


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS

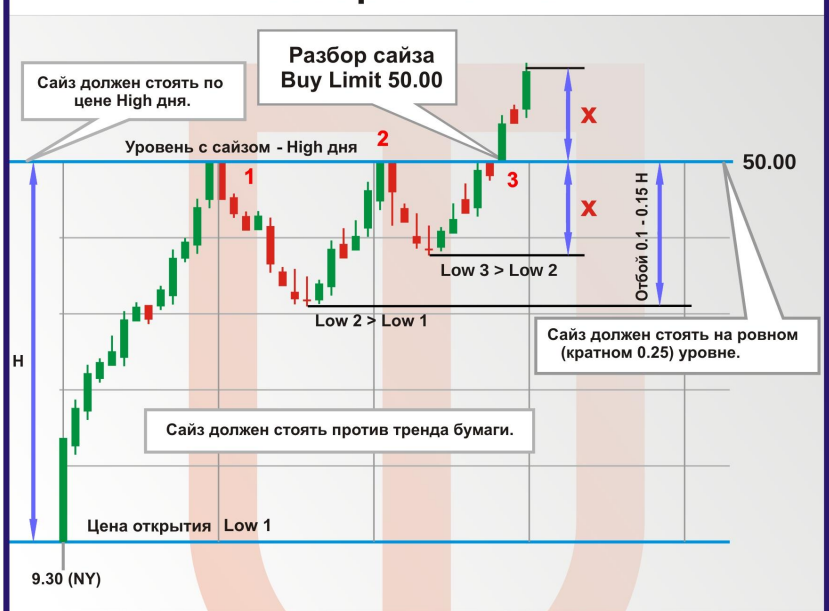


Стратегии и паттерны

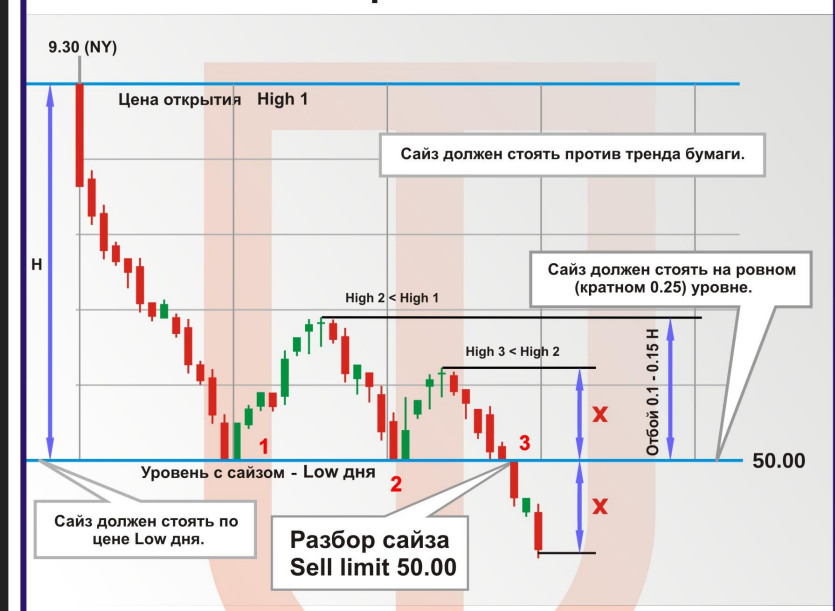


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны

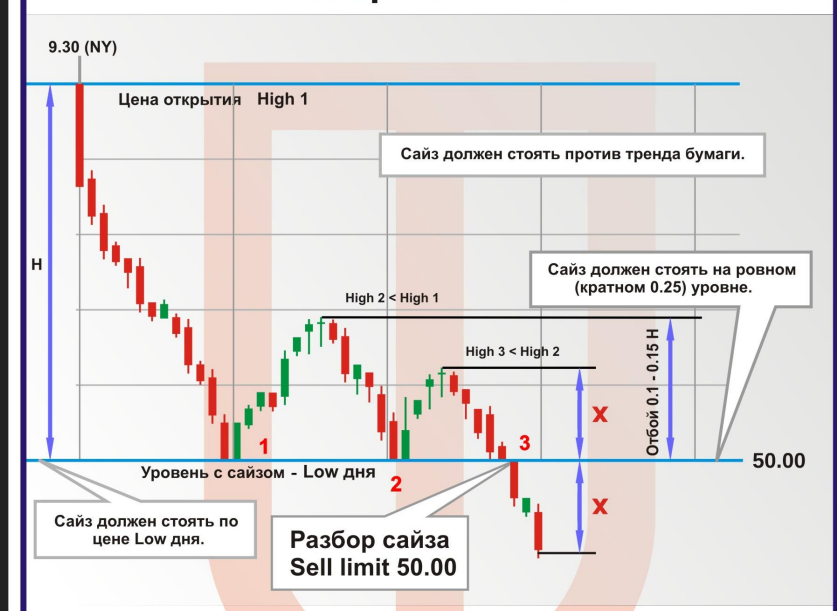


UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Разбор сайза BID



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Примеры паттернов



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS

Разбор сайза ASK



Основным и самым главным определяющим фактором сайза является наличие крупной заявки в стакане Level 2

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	49.99	35	NASD	50.00	988
EXB	49.99	33	EXB	50.00	766
EDGX	49.99	33	EDGX	50.00	766
NASD	49.99	16	NQPX	50.00	625
PACX	49.99	15	PACX	50.00	346
BATS	49.99	12	BATS	50.00	346
EDGA	49.99	12	NQPX	50.01	35
NQBX	49.99	10	EXB	50.01	33
NQPX	49.98	35	EDGX	50.01	33
EXB	49.98	21	NASD	50.01	16
EDGX	49.98	21	PACX	50.01	15
NASD	49.98	16	BATS	50.01	12
PACX	49.98	15	EDGA	50.01	12
BATS	49.98	12	NQBX	50.01	10
EDGA	49.98	12	NASD	50.02	10

Сайз должен стоять в нескольких ECN с общим количеством заявок, как минимум в 10 раз больше, чем в остальных уровнях!

Условия разбора

1. В момент разбора сайза - брать надо по цене уровня.
2. Входить в разбор сайза необходимо на рыночные точки 3. Таким образом получается, что для наиболее удачного разбора сайза необходимо чтобы его касались не менее 2-х раз.
3. Первый импульс после разбора сайза принимаем кратным последнему откату перед разбором (X).

Разбор сайза BID



Основным и самым главным определяющим фактором сайза является наличие крупной заявки в стакане Level 2

Сайз должен стоять в нескольких ECN с общим количеством заявок, как минимум в 10 раз больше, чем в остальных уровнях!

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	50.00	988	NASD	50.01	35
EXB	50.00	766	EXB	50.01	33
EDGX	50.00	766	EDGX	50.01	33
NASD	50.00	625	NQPX	50.01	16
PACX	50.00	346	PACX	50.01	15
BATS	50.00	346	BATS	50.01	12
EDGA	50.00	12	NQPX	50.02	35
NQBX	50.00	10	EXB	50.02	33
NQPX	49.99	35	EDGX	50.02	33
EXB	49.99	21	NASD	50.02	16
EDGX	49.99	21	PACX	50.02	15
NASD	49.99	16	BATS	50.02	12
PACX	49.99	15	EDGA	50.03	12
BATS	49.99	12	NQBX	50.03	10
EDGA	49.99	12	NASD	50.03	10

Условия разбора

1. В момент разбора сайза - брать надо по цене уровня.
2. Входить в разбор сайза необходимо на рыночные точки 3, так как для наиболее удачного разбора сайза необходимо чтобы его касались не менее 2-х раз.
3. Первый импульс после разбора сайза принимаем кратным последнему откату перед разбором (X).

Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS



Стратегии и паттерны





UNITED TRADERS

Стратегия отбой от “сайза”

При особых условиях, при первом подходе акции к уровню с сайзом, можно заработать, взяв позицию в направлении движения от этого уровня. Стратегия называется ФронтРаннинг (Front Running) или торговля “от сайза”.

Стратегии и паттерны



UNITED TRADERS

Отбой от сайза Bid

Основным и самым главным фактором при выборе данной стратегии является наличие крупной заявки в стакане Level 2

Сайз должен стоять в нескольких ECN с общим количеством заявок, как минимум в 10 раз больше, чем в остальных уровнях!

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	50.00	988	NASD	50.01	35
EXB	50.00	766	EXB	50.01	33
EDGX	50.00	766	EDGX	50.01	33
NASD	50.00	625	NQPX	50.01	16
PACX	50.00	346	PACX	50.01	15
BATS	50.00	346	BATS	50.01	12
EDGA	50.00	12	NQPX	50.02	35
NQBX	50.00	10	EXB	50.02	33
NQPX	49.99	35	EDGX	50.02	33
EXB	49.99	21	NASD	50.02	16
EDGX	49.99	21	PACX	50.02	15
NASD	49.99	16	BATS	50.02	12
PACX	49.99	15	EDGA	50.03	12
BATS	49.99	12	NQBX	50.03	10
EDGA	49.99	12	NASD	50.03	10



Условия отбоя.

1. Сайз должен стоять на ровном (кратном 0.25) уровне.
2. Отбой сайза происходит в точке 1.
3. Сайз может стоять рядом с ценой открытия.
4. Вероятность отбоя в точке 1 значительно повышается, если акция подходит к уровню впервые за свою историю.
5. Быстрый первый подход к сайзу в течении дня ($H > 2\%$) также рассматриваем на отбой.

Отбой от сайза Ask

Основным и самым главным фактором при выборе данной стратегии является наличие крупной заявки в стакане Level 2

Сайз должен стоять по цене High дня.

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	49.99	35	NASD	50.00	988
EXB	49.99	33	EXB	50.00	766
EDGX	49.99	33	EDGX	50.00	766
NASD	49.99	16	NQPX	50.00	625
PACX	49.99	15	PACX	50.00	346
BATS	49.99	12	BATS	50.00	346
EDGA	49.99	12	NQPX	50.01	35
NQBX	49.99	10	EXB	50.01	33
NQPX	49.98	35	EDGX	50.01	33
EXB	49.98	21	NASD	50.01	16
EDGX	49.98	21	PACX	50.01	15
NASD	49.98	16	BATS	50.01	12
PACX	49.98	15	EDGA	50.01	12
BATS	49.98	12	NQBX	50.01	10
EDGA	49.98	12	NASD	50.02	10



Условия отбоя.

1. Сайз должен стоять на ровном (кратном 0.25) уровне.
2. Отбой сайза происходит в точке 1.
3. Сайз может стоять рядом с ценой открытия.
4. Вероятность отбоя в точке 1 значительно повышается, если акция подходит к уровню впервые за свою историю.
5. Быстрый первый подход к сайзу в течении дня ($H > 2\%$) также рассматриваем на отбой.

Пример торговли “от сайза”



UNITED TRADERS





UNITED TRADERS

Обратное движение после разбора сайза

Обратное движение после разбора сайза ASK



1. При закреплении за уровнем, на котором был разобран сайз, входим по цене Bid 49.99
2. Вход можно осуществить как с удалением ликвидности, так и с добавлением, т. е. можем ударить по рынку по цене 49.99 или выставить заявку по цене 50.00 и ждать своей очереди, экономя при этом на спреде и комиссиях (если вам, конечно, дадут по этой цене).
2. Выходим по целям 1 и 2, частями.

Обратное движение после разбора сайза BID



1. При закреплении за уровнем, на котором был разобран сайз, входим по цене офера (Ask) 50.01
2. Вход можно осуществить как с удалением ликвидности, так и с добавлением, т. е. можем ударить по рынку по цене 50.01 или выставить заявку по цене 50.00 и ждать своей очереди, экономя при этом на спреде и комиссиях (если вам, конечно, дадут по этой цене).
3. Выходим по целям 1 и 2, частями.

Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS



Примеры



UNITED TRADERS

