



UNITED TRADERS

UT PROP SCALPING

Система обучения профессиональных трейдеров



UNITED TRADERS

Лекция #5

Знакомство с акциями

Характеристики инструментов для торговли

Типы графиков и их анализ

Сервис отбора акций finviz.com и stock-watcher.com

Создание учебного листа акций



UNITED TRADERS

Скальпера интересуют
технические характеристики
акций, а не фундаментальные
характеристики компании.





UNITED TRADERS

Характеристики инструментов

Ликвидность - возможность быстрой реализации актива по рыночной цене в полном объеме.

Стакан ордеров дает полное представление о ликвидности акции.

The screenshot shows a trading interface window titled "Level2". At the top, there is a dropdown menu with the letter "T" highlighted. Below it, there are fields for "Side" (set to "SELL"), "Order Type" (set to "Limit"), "0 lots", and "0 shares". A "Send" button is on the right. Below these are fields for "Destination", "Price" (set to "41.31 \$"), and "Stop Price" (set to "41.31 \$"). The main part of the window is a table of market makers (MM) with columns for Bid, Size, MM, Ask, and Size. The table lists various market makers and their respective bid and ask prices and sizes. At the bottom, there are summary statistics: "Qty: 0", "LFT: 0.00", "Gross: 0.00", "Net: 0.00", "Fees: 0.00", and "Position: 0".

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NYSE	41.30	31	NYSE	41.31	67
BAB	41.30	10	NQPX	41.31	61
BATS	41.30	10	NSDQ	41.31	19
NSDQ	41.30	8	PACX	41.31	19
EXB	41.30	5	EAB	41.31	15
EDGX	41.30	5	EDGA	41.31	15
PACX	41.30	4	BYX	41.31	8
BAB	41.29	19	NQBX	41.31	8
EXB	41.29	13	BAB	41.31	7
NQBX	41.29	3	BATS	41.31	7
BYX	41.29	2	EDGX	41.31	5
EAB	41.29	2	EXB	41.31	5
EDGA	41.29	2	NSX	41.31	2
NQPX	41.29	1	BAB	41.32	11
BAB	41.28	15	EXB	41.32	10
EXB	41.28	15	EAB	41.32	2
EAB	41.28	6	EXB	41.33	18
BAB	41.27	16	BAB	41.33	17
EXB	41.27	9	EAB	41.33	2
EAB	41.27	1	BAB	41.34	18
BAB	41.26	13	EXB	41.34	4
FXR	41.26	9	RAR	41.35	15

Qty: 0 LFT: 0.00 Gross: 0.00 Net: 0.00 Fees: 0.00
Position: 0

Характеристики инструментов



UNITED TRADERS

Неликвидная акция

CLNT		Level2			
Side	Order Type	0 lots	Display Qty		
SELL	Limit	0 shares	0 shares		
Destination		Price	Stop Price		
ASUROUX		1.03 \$	1.03 \$		
MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
EDGX	1.01	3	NSDQ	1.03	5
EXB	1.01	3	EXB	1.05	13
EXB	1.00	58	EDGX	1.05	13
PACX	1.00	13	BAB	1.05	2
BAB	1.00	1	BATS	1.05	2
BATS	1.00	1	BAB	1.06	1
BAB	0.99	1	BAB	1.07	1
EXB	0.99	0	BAB	1.08	1
EXB	0.98	40	BAB	1.09	1
BAB	0.97	2	BAB	1.11	100
NSDQ	0.96	22	EXB	1.15	18
BAB	0.96	1	EXB	1.16	21
BAB	0.95	1	EXB	1.17	21
EXB	0.941	15	EXB	1.18	23
EAB	0.93	4	EAB	1.18	2
EDGA	0.93	4	EDGA	1.18	2
EXB	0.90	15	BAB	1.18	1
EAB	0.8585	2	BYX	1.18	1
BAB	0.8585	1	PACX	1.19	83
BYX	0.8585	1	EXB	1.19	22
EXB	0.8585	1	EXB	1.25	18
EAB	0.7676	2	EXB	1.26	5
BAB	0.7676	1	EAB	1.27	3
EXB	0.7676	1	BAB	1.27	2
Qty: 0 LFT: 0.00 Gross: 0.00 Net: 0.00 Fees: 0.00					
Position: 0					

Ликвидная акция

CHK		Level2			
Side	Order Type	0 lots	Display Qty		
SELL	Limit	0 shares	0 shares		
Destination		Price	Stop Price		
		6.06 \$	6.06 \$		
MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NYSE	6.06	123	NYSE	6.07	163
EDGX	6.06	49	PACX	6.07	138
EXB	6.06	49	NSDQ	6.07	98
PACX	6.06	49	EDGX	6.07	82
NSDQ	6.06	46	EXB	6.07	82
BAB	6.06	44	BAB	6.07	66
BATS	6.06	44	BATS	6.07	66
EAB	6.06	18	NQPX	6.07	21
EDGA	6.06	18	EAB	6.07	20
BYX	6.06	15	EDGA	6.07	20
NQBX	6.06	14	BYX	6.07	1
NQPX	6.06	11	CHK	6.07	1
EXB	6.05	110	NQBX	6.07	1
BAB	6.05	73	EXB	6.08	117
EAB	6.05	9	BAB	6.08	65
CHK	6.05	1	EAB	6.08	9
BAB	6.04	193	EXB	6.09	61
EXB	6.04	134	BAB	6.09	60
EAB	6.04	70	EAB	6.09	6
BAB	6.03	226	EXB	6.10	89
EXB	6.03	162	BAB	6.10	76
EAB	6.03	29	EAB	6.10	5
BAB	6.02	232	BAB	6.11	74
EXB	6.02	93	EXB	6.11	58
Qty: 0 LFT: 0.00 Gross: 0.00 Net: 0.00 Fees: 0.00					
Position: 0					

Сверхликвидная акция

SIRI		Level2			
Side	Order Type	0 lots	Display Qty		
SELL	Limit	0 shares	0 shares		
Destination		Price	Stop Price		
		4.18 \$	4.18 \$		
MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	4.17	3949	NQPX	4.18	3731
EXB	4.17	3944	EXB	4.18	3038
EDGX	4.17	3944	EDGX	4.18	3038
PACX	4.17	2012	PACX	4.18	2311
NSDQ	4.17	1568	BAB	4.18	2150
EAB	4.17	1203	BATS	4.18	2150
EDGA	4.17	1203	NSDQ	4.18	1621
BYX	4.17	1197	AMEX	4.18	609
BAB	4.17	1034	EAB	4.18	392
BATS	4.17	1034	EDGA	4.18	392
NQBX	4.17	671	BYX	4.18	374
AMEX	4.17	368	NQBX	4.18	202
NSX	4.17	2	NSX	4.18	2
EXB	4.16	1791	CHK	4.18	1
BAB	4.16	961	EXB	4.19	1689
EAB	4.16	577	BAB	4.19	1092
EXB	4.15	1078	EAB	4.19	700
BAB	4.15	696	EXB	4.20	1312
EAB	4.15	412	BAB	4.20	699
EXB	4.14	817	EAB	4.20	393
BAB	4.14	513	EXB	4.21	1224
EAB	4.14	338	BAB	4.21	499
EXB	4.13	814	EAB	4.21	338
BAB	4.13	528	EXB	4.22	1738
Qty: 0 LFT: 0.00 Gross: 0.00 Net: 0.00 Fees: 0.00					
Position: 0					



UNITED TRADERS

Характеристики инструментов

Неликвидная акция:

Большой спред

Малая плотность ордеров на уровне (до 2000 акций)

Некоторые уровни не заполнены

Практически отсутствуют ECN, которые платят за удаление ликвидности

График “рваный”, нет выраженных технических характеристик (откат, разворот, тренд, уровень), волатильность крайне высокая

CLNT

Level2

> - x

Side

Order Type

0 lots

Display Qty

SELL

Limit

0 shares

0 shares

Send

Destination

Price

Stop Price

ASUROUX

1.03 \$

1.03 \$

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
EDGX	1.01	3	NSDQ	1.03	5
EXB	1.01	3	EXB	1.05	13
EXB	1.00	58	EDGX	1.05	13
PACX	1.00	13	BAB	1.05	2
BAB	1.00	1	BATS	1.05	2
BATS	1.00	1	BAB	1.06	1
BAB	0.99	1	BAB	1.07	1
EXB	0.99	0	BAB	1.08	1
EXB	0.98	40	BAB	1.09	1
BAB	0.97	2	BAB	1.11	100
NSDQ	0.96	22	EXB	1.15	18
BAB	0.96	1	EXB	1.16	21
BAB	0.95	1	EXB	1.17	21
EXB	0.941	15	EXB	1.18	23
EAB	0.93	4	EAB	1.18	2
EDGA	0.93	4	EDGA	1.18	2
EXB	0.90	15	BAB	1.18	1
EAB	0.8585	2	BYX	1.18	1
BAB	0.8585	1	PACX	1.19	83
BYX	0.8585	1	EXB	1.19	22
EXB	0.8585	1	EXB	1.25	18
EAB	0.7676	2	EXB	1.26	5
BAB	0.7676	1	EAB	1.27	3
EXB	0.7676	1	BAB	1.27	2

Qty: 0

LFT: 0.00

Gross: 0.00

Net: 0.00

Fees: 0.00

Position: 0



UNITED TRADERS

Характеристики инструментов

Ликвидная акция:

Малый спред (до 5 ¢, в зависимости от цены)

Высокая плотность ордеров на уровне (свыше 2000 акций)

Все уровни заполнены

Присутствуют ECN, которые платят за удаление ликвидности

График без обрывов, технические характеристики присутствуют в полном объеме, умеренная волатильность

CHX

Level2

Side

Order Type

0 lots

Display Qty

SELL

Limit

0 shares

0 shares

Send

Destination

Price

Stop Price

6.06 \$

6.06 \$

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NYSE	6.06	123	NYSE	6.07	163
EDGX	6.06	49	PACX	6.07	138
EXB	6.06	49	NSDQ	6.07	98
PACX	6.06	49	EDGX	6.07	82
NSDQ	6.06	46	EXB	6.07	82
BAB	6.06	44	BAB	6.07	66
BATS	6.06	44	BATS	6.07	66
EAB	6.06	18	NQPX	6.07	21
EDGA	6.06	18	EAB	6.07	20
BYX	6.06	15	EDGA	6.07	20
NQBX	6.06	14	BYX	6.07	1
NQPX	6.06	11	CHX	6.07	1
EXB	6.05	110	NQBX	6.07	1
BAB	6.05	73	EXB	6.08	117
EAB	6.05	9	BAB	6.08	65
CHX	6.05	1	EAB	6.08	9
BAB	6.04	193	EXB	6.09	61
EXB	6.04	134	BAB	6.09	60
EAB	6.04	70	EAB	6.09	6
BAB	6.03	226	EXB	6.10	89
EXB	6.03	162	BAB	6.10	76
EAB	6.03	29	EAB	6.10	5
BAB	6.02	232	BAB	6.11	74
EXB	6.02	93	EXB	6.11	58

Qty: 0

LFT: 0.00

Gross: 0.00

Net: 0.00

Fees: 0.00

Position: 0

Характеристики инструментов



UNITED TRADERS

Сверхликвидная акция:

Видимый спред 1 цент, но большая часть сделок проходит внутри него (0,5 ф)

Крайне высокая плотность ордеров на уровне (свыше 25 000 акций)

Все уровни заполнены

Большое количество заявок в ECN, которые платят за удаление ликвидности

График очень ровный, ярко выраженные уровни, минимальная волатильность

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	4.17	3949	NQPX	4.18	3731
EXB	4.17	3944	EXB	4.18	3038
EDGX	4.17	3944	EDGX	4.18	3038
PACX	4.17	2012	PACX	4.18	2311
NSDQ	4.17	1568	BAB	4.18	2150
EAB	4.17	1203	BATS	4.18	2150
EDGA	4.17	1203	NSDQ	4.18	1621
BYX	4.17	1197	AMEX	4.18	609
BAB	4.17	1034	EAB	4.18	392
BATS	4.17	1034	EDGA	4.18	392
NQBX	4.17	671	BYX	4.18	374
AMEX	4.17	368	NQBX	4.18	202
NSX	4.17	2	NSX	4.18	2
EXB	4.16	1791	CHX	4.18	1
BAB	4.16	961	EXB	4.19	1689
EAB	4.16	577	BAB	4.19	1092
EXB	4.15	1078	EAB	4.19	700
BAB	4.15	696	EXB	4.20	1312
EAB	4.15	412	BAB	4.20	699
EXB	4.14	817	EAB	4.20	393
BAB	4.14	513	EXB	4.21	1224
EAB	4.14	338	BAB	4.21	499
EXB	4.13	814	EAB	4.21	338
BAB	4.13	528	EXB	4.22	1738

Qty: 0 LFT: 0.00 Gross: 0.00 Net: 0.00 Fees: 0.00
Position: 0

Характеристики инструментов



UNITED TRADERS

Неликвидная акция

CLNT

Level2

Side

Order Type

0 lots

Display Qty

SELL

Limit

0 shares

0 shares

Send

Destination

Price

Stop Price

ASUROUX

1.03 \$

1.03 \$

MM

Bid

Size

MM

Ask

Size

EDGX

1.01

3

NSDQ

1.03

5

EXB

1.01

3

EXB

1.05

13

EXB

1.00

58

EDGX

1.05

13

PACX

1.00

13

BAB

1.05

2

BAB

1.00

1

BATS

1.05

2

BATS

1.00

1

BAB

1.06

1

BAB

0.99

1

BAB

1.07

1

EXB

0.99

0

BAB

1.08

1

EXB

0.98

40

BAB

1.09

1

BAB

0.97

2

BAB

1.11

100

NSDQ

0.96

22

EXB

1.15

18

BAB

0.96

1

EXB

1.16

21

BAB

0.95

1

EXB

1.17

21

EXB

0.941

15

EXB

1.18

23

EAB

0.93

4

EAB

1.18

2

EDGA

0.93

4

EDGA

1.18

2

EXB

0.90

15

BAB

1.18

1

EAB

0.8585

2

BYX

1.18

1

BAB

0.8585

1

PACX

1.19

83

BYX

0.8585

1

EXB

1.19

22

EXB

0.8585

1

EXB

1.25

18

EAB

0.7676

2

EXB

1.26

5

BAB

0.7676

1

EAB

1.27

3

EXB

0.7676

1

BAB

1.27

2

Qty: 0

LFT: 0.00

Gross: 0.00

Net: 0.00

Fees: 0.00

Position: 0

Ликвидная акция

CHK

Level2

Side

Order Type

0 lots

Display Qty

SELL

Limit

0 shares

0 shares

Send

Destination

Price

Stop Price

6.06 \$

6.06 \$

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NYSE	6.06	123	NYSE	6.07	163
EDGX	6.06	49	PACX	6.07	138
EXB	6.06	49	NSDQ	6.07	98
PACX	6.06	49	EDGX	6.07	82
NSDQ	6.06	46	EXB	6.07	82
BAB	6.06	44	BAB	6.07	66
BATS	6.06	44	BATS	6.07	66
EAB	6.06	18	NQPX	6.07	21
EDGA	6.06	18	EAB	6.07	20
BYX	6.06	15	EDGA	6.07	20
NQBX	6.06	14	BYX	6.07	1
NQPX	6.06	11	CHK	6.07	1
EXB	6.05	110	NQBX	6.07	1
BAB	6.05	73	EXB	6.08	117
EAB	6.05	9	BAB	6.08	65
CHK	6.05	1	EAB	6.08	9
BAB	6.04	193	EXB	6.09	61
EXB	6.04	134	BAB	6.09	60
EAB	6.04	70	EAB	6.09	6
BAB	6.03	226	EXB	6.10	89
EXB	6.03	162	BAB	6.10	76
EAB	6.03	29	EAB	6.10	5
BAB	6.02	232	BAB	6.11	74
EXB	6.02	93	EXB	6.11	58

Qty: 0

LFT: 0.00

Gross: 0.00

Net: 0.00

Fees: 0.00

Position: 0

Сверхликвидная акция

SIRI

Level2

>

-

x

Side

Order Type

0 lots

Display Qty

SELL

Limit

0 shares

0 shares

Send

Destination

Price

Stop Price

4.18 \$

4.18 \$

MM	Bid	Size	MM	Ask	Size
NQPX	4.17	3949	NQPX	4.18	3731
EXB	4.17	3944	EXB	4.18	3038
EDGX	4.17	3944	EDGX	4.18	3038
PACX	4.17	2012	PACX	4.18	2311
NSDQ	4.17	1568	BAB	4.18	2150
EAB	4.17	1203	BATS	4.18	2150
EDGA	4.17	1203	NSDQ	4.18	1621
BYX	4.17	1197	AMEX	4.18	609
BAB	4.17	1034	EAB	4.18	392
BATS	4.17	1034	EDGA	4.18	392
NQBX	4.17	671	BYX	4.18	374
AMEX	4.17	368	NQBX	4.18	202
NSX	4.17	2	NSX	4.18	2
EXB	4.16	1791	CHX	4.18	1
BAB	4.16	961	EXB	4.19	1689
EAB	4.16	577	BAB	4.19	1092
EXB	4.15	1078	EAB	4.19	700
BAB	4.15	696	EXB	4.20	1312
EAB	4.15	412	BAB	4.20	699
EXB	4.14	817	EAB	4.20	393
BAB	4.14	513	EXB	4.21	1224
EAB	4.14	338	BAB	4.21	499
EXB	4.13	814	EAB	4.21	338
BAB	4.13	528	EXB	4.22	1738

Qty: 0

LFT: 0.00

Gross: 0.00

Net: 0.00

Fees: 0.00

Position: 0

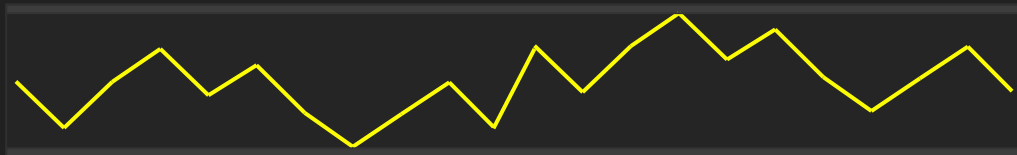


UNITED TRADERS

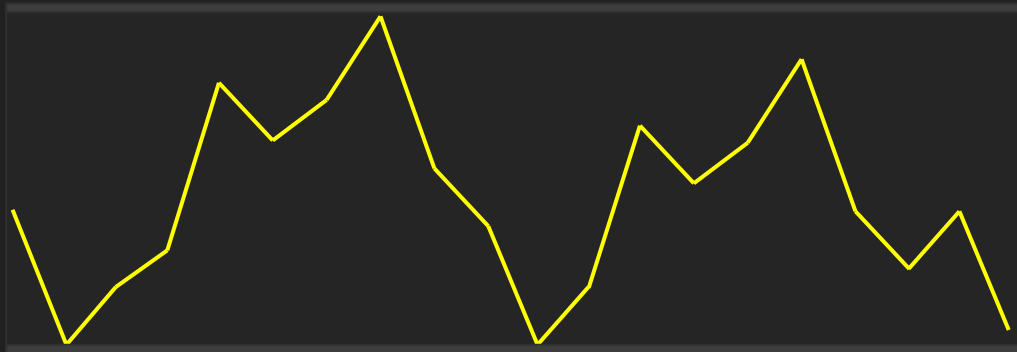
Характеристики инструментов

Волатильность

- изменчивость цены, “мера **риска**”.



Сколько трейдер может заработать или потерять в единицу времени.



Сильно зависит от новостного фона “по рынку” и по акции.



UNITED TRADERS

Характеристики инструментов

Дневная волатильность - средняя величина изменения цены в % за сессию, рассчитывается за период в 10-50 дней.

Формула: $((\text{High}/\text{Low}) - 1) * 100$

Большая часть акций, входящих в S&P 500, имеет дневную волатильность в пределах 1-3%.

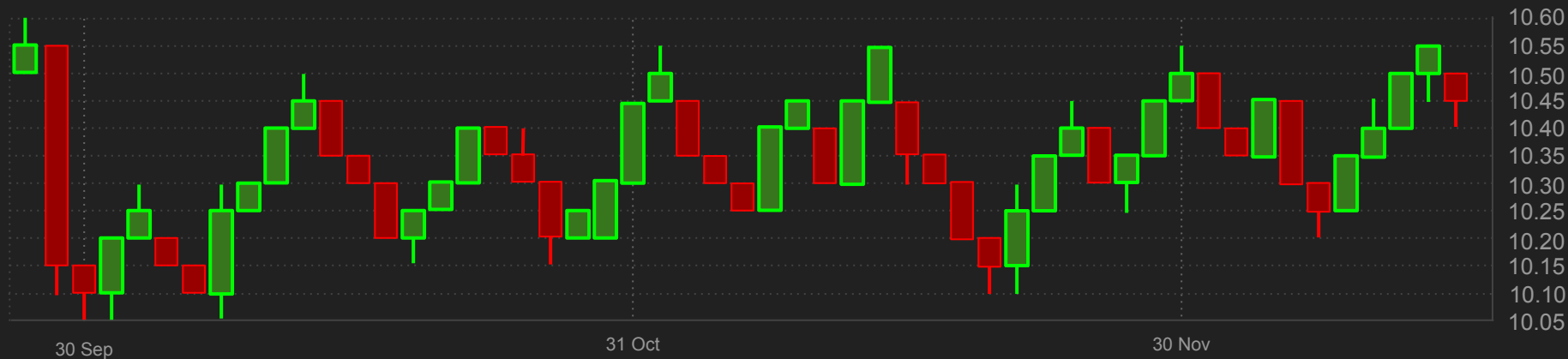
Чем дешевле акция, тем она более волатильнее в % (чаще всего).



Характеристики инструментов



UNITED TRADERS



Характеристики инструментов



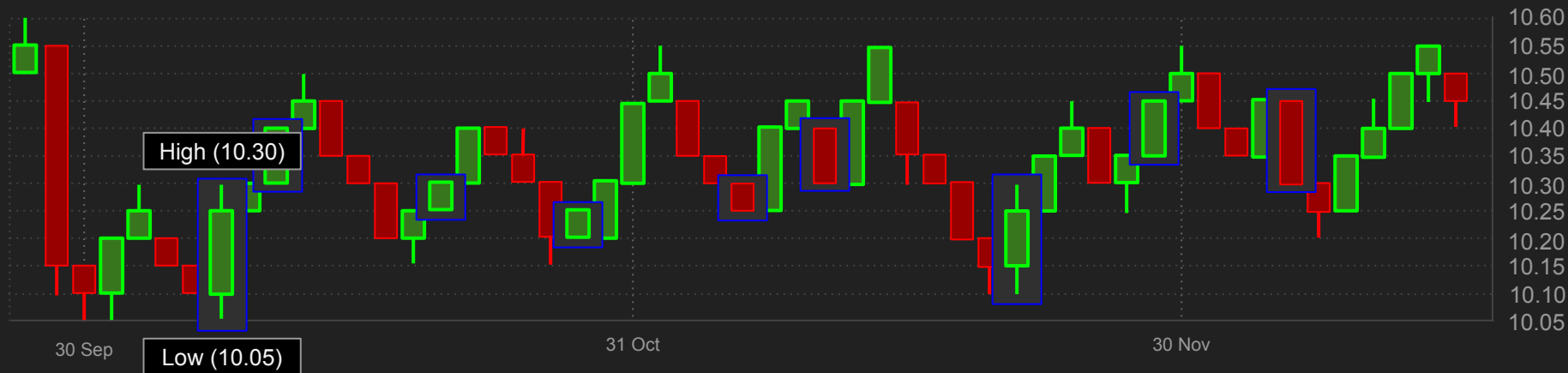
UNITED TRADERS





UNITED TRADERS

Характеристики инструментов



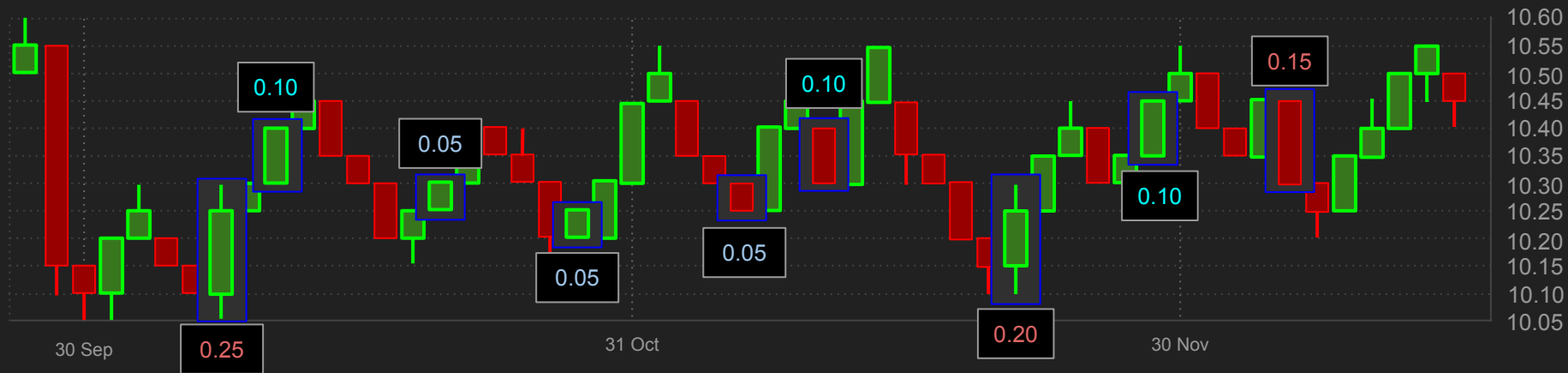
High-Low

$$10.30 - 10.05 = 0.25$$

Характеристики инструментов



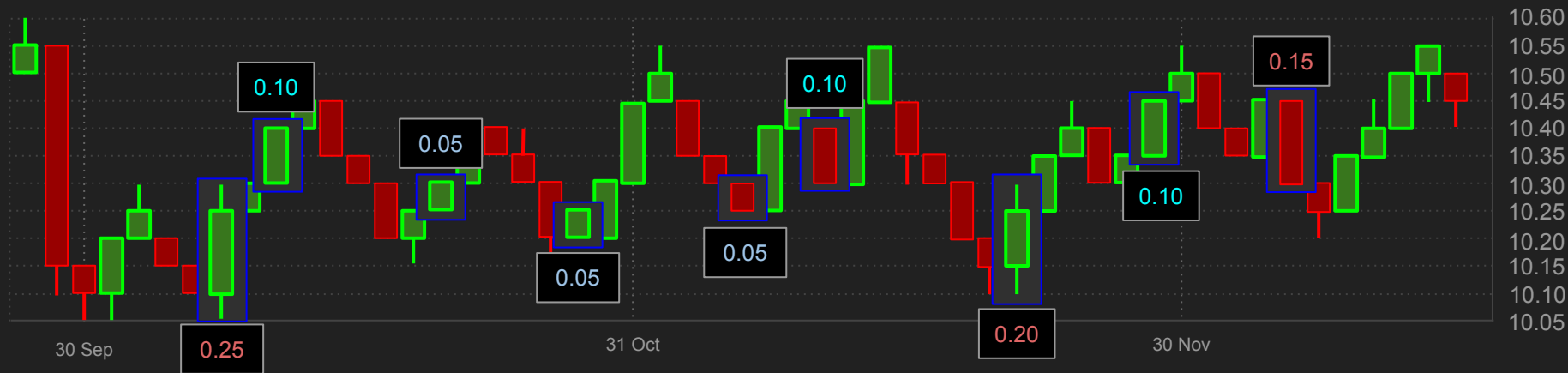
UNITED TRADERS





UNITED TRADERS

Характеристики инструментов



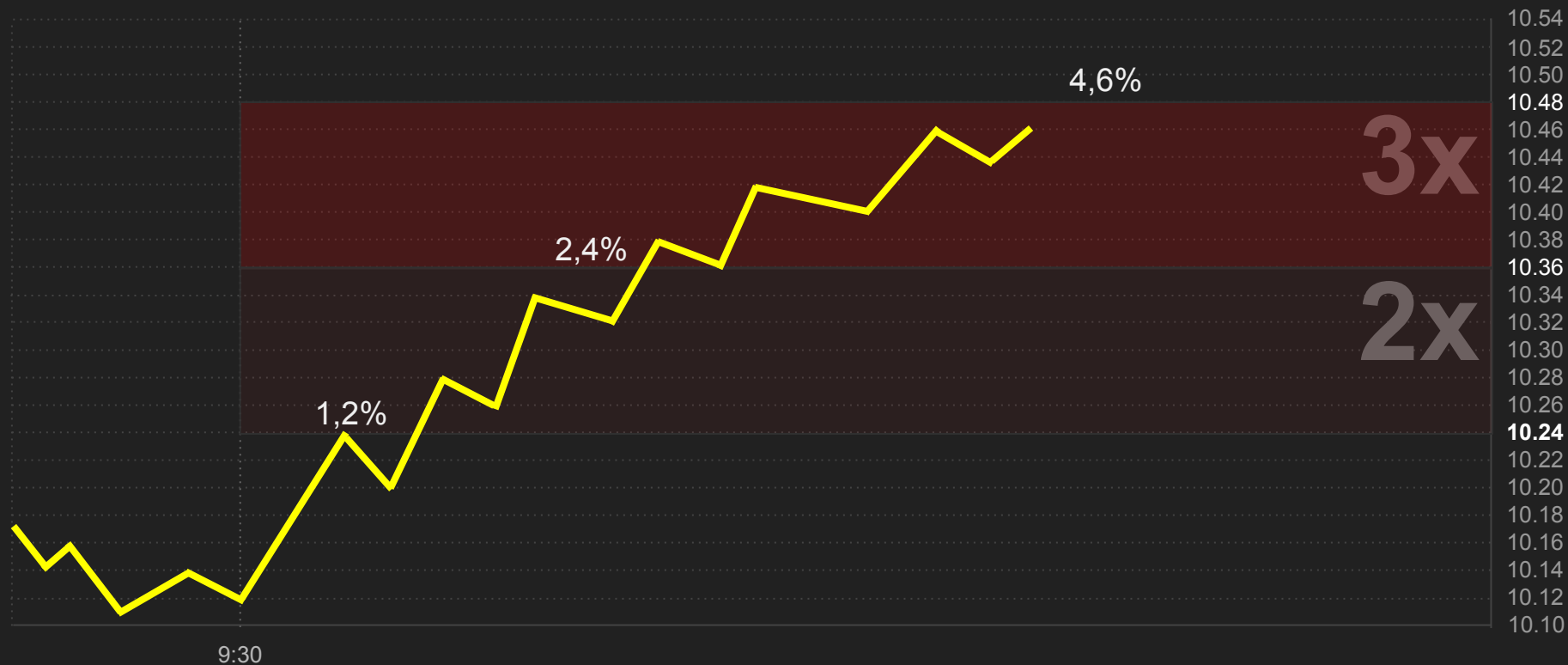
$$(0.25+0.20+0.15+0.10+0.10+0.10+0.05+0.05+0.05) / 9 = 0.12$$

$$(0.12/10.25) \times 100 = 1,17\%$$

Характеристики инструментов



UNITED TRADERS



Характеристики инструментов



UNITED TRADERS

Внутридневная волатильность

- средняя величина изменения цены в **центах** за единицу времени (текущий таймфрейм), достаточно последних 20 свечей.

Это ключевой параметр для определения риска/прибыли для акции в случае скальпинга.



Характеристики инструментов



Характеристики инструментов



Характеристики инструментов





UNITED TRADERS

Характеристики инструментов

Ликвидность и волатильность тесно связаны с ценой акции.

Как правило, чем ниже цена акции, тем она волатильней.

Ликвидность слабо связана с ценой, прямой зависимости между этими характеристиками нет.

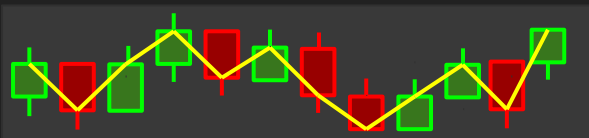
Относительно важный параметр - **объем акции**, тесно связан с ликвидностью и используется при отборе акций.



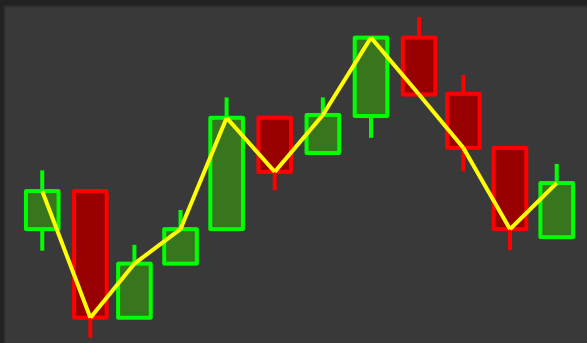
UNITED TRADERS

Характеристики инструментов

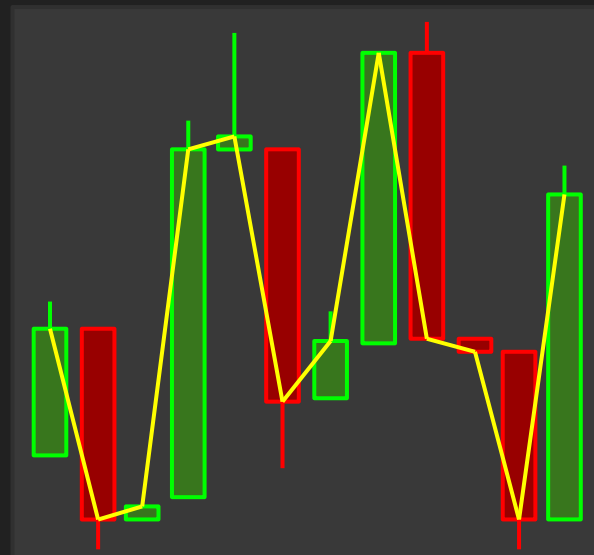
Не волатильная акция



Волатильная акция

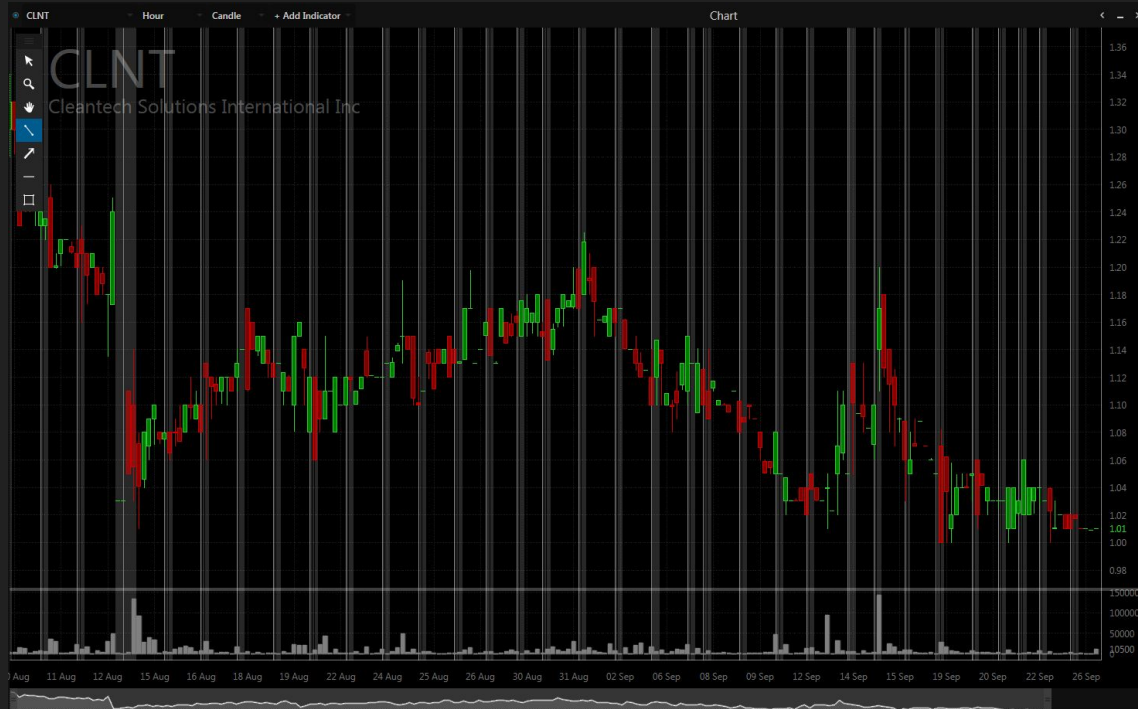


Сверхволатильная акция



Характеристики инструментов

Сверхволатильная акция

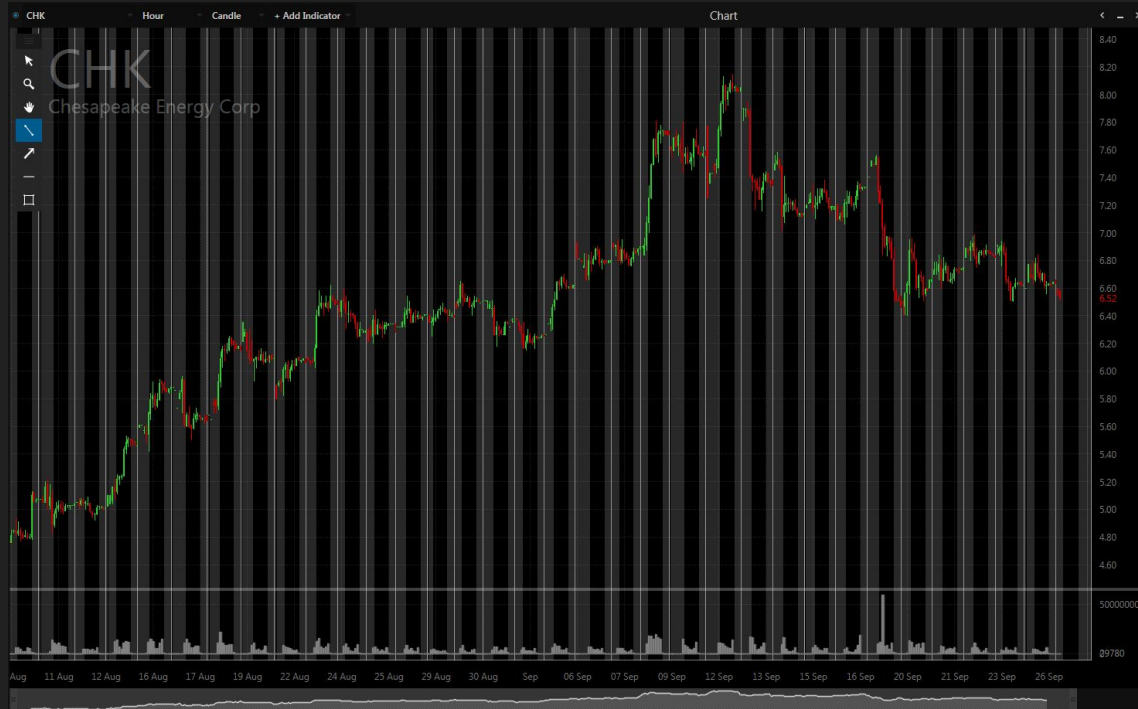


Характеристики инструментов



UNITED TRADERS

Волатильная акция

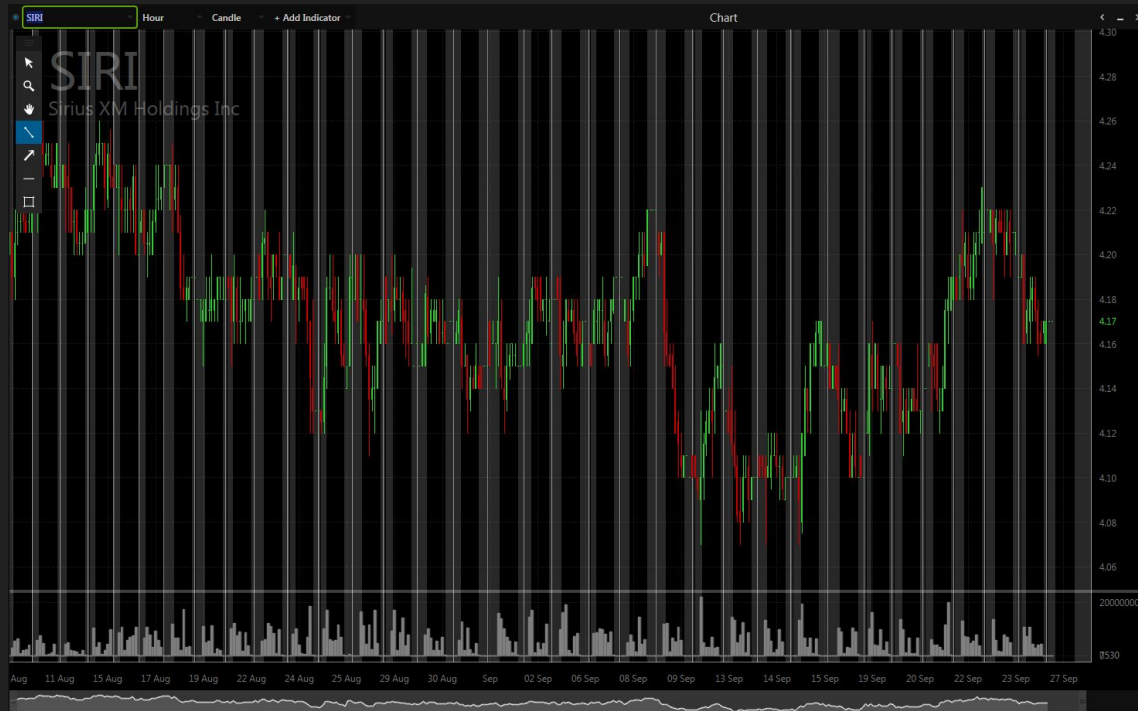


Характеристики инструментов



UNITED TRADERS

Не волатильная акция





UNITED TRADERS

Характеристики инструментов

Сверхволатильная акция:

Часто бывает неликвидной (не всегда)

Внутридневная волатильность
свыше 10 \$, дневная - свыше 10%

Как правило, цена такой акции в
пределах 0,5 - 5\$



Характеристики инструментов



UNITED TRADERS

Волатильная акция:

Как правило, ликвидна

Внутридневная волатильность
свыше 5 ф, дневная от 2 до 5%

Таких акций на рынке большинство



Характеристики инструментов



UNITED TRADERS

Не волатильная акция:

Сверхликвидна

Внутридневная волатильность не превышает 2 ¢, дневная от 1 до 2%

Таких акций на рынке не много, на них сложно активно зарабатывать, но они идеальны для обучения.

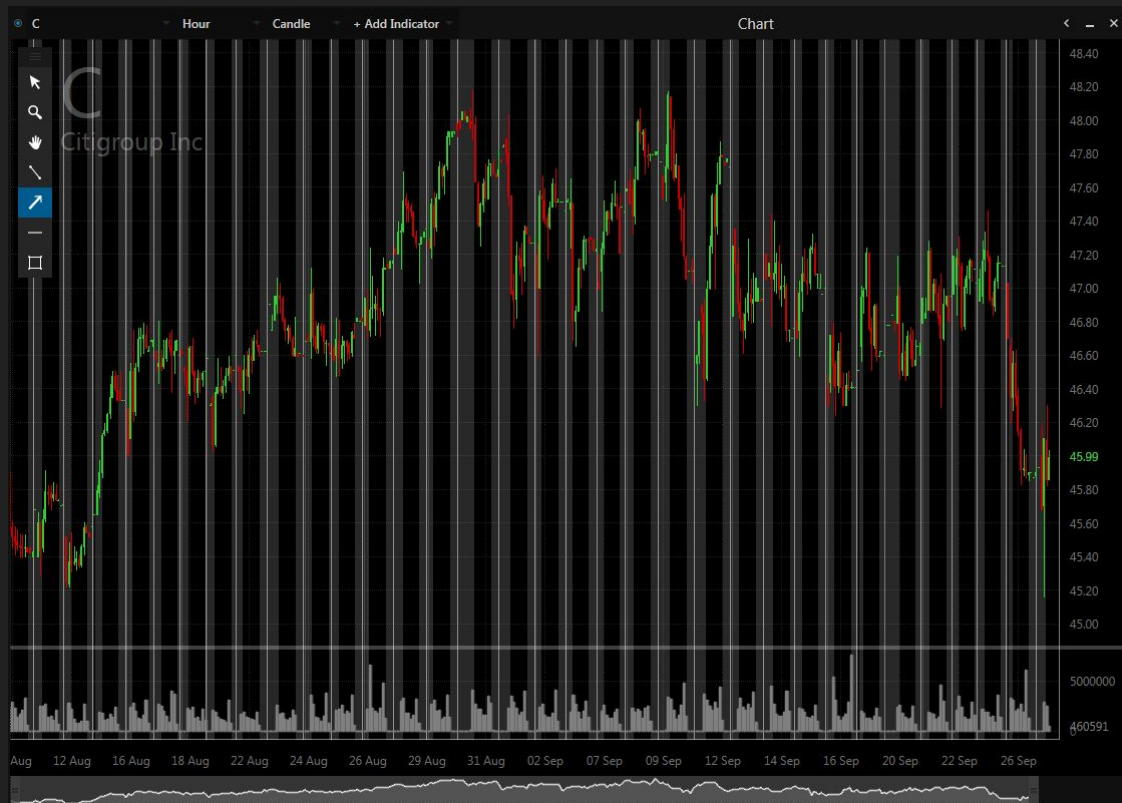


Типы графиков и их анализ



С
Ликвидная
Волатильная
Минутный график

Типы графиков и их анализ



С
Ликвидная
Волатильная
Часовой график

Типы графиков и их анализ



С
Ликвидная
Волатильная
Дневной график



UNITED TRADERS

Типы графиков и их анализ

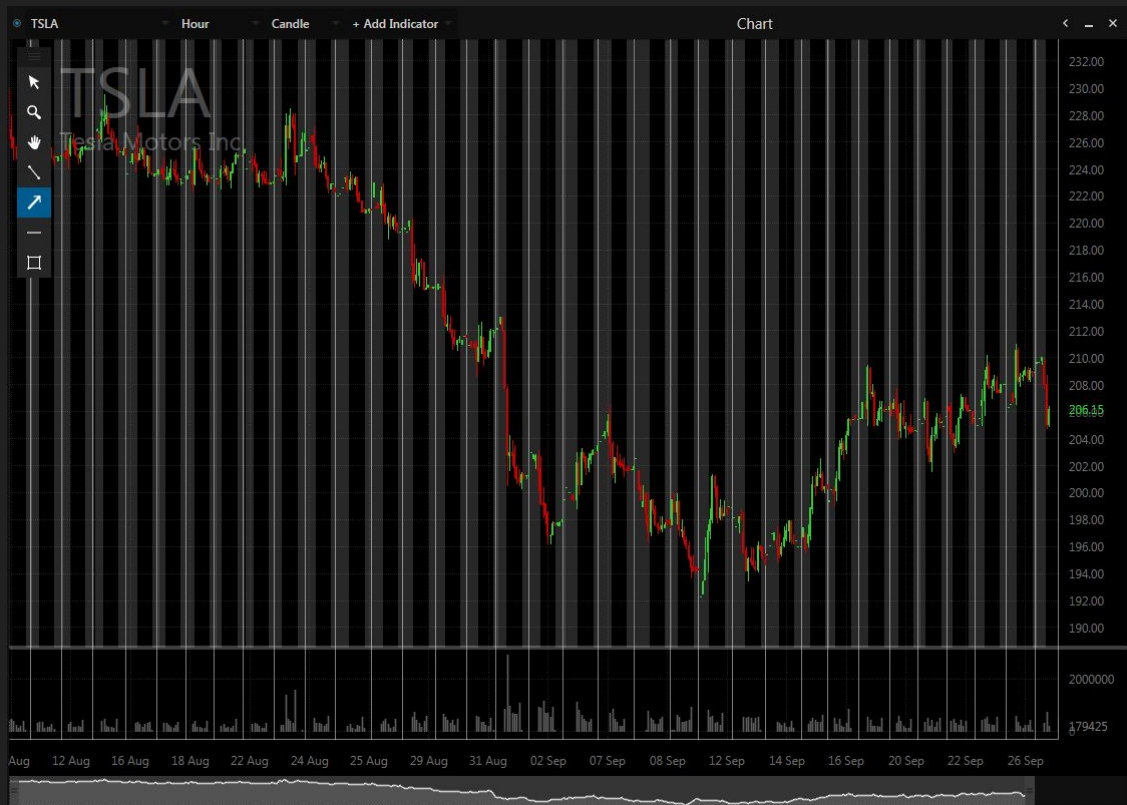


TSLA
Ликвидная
Волатильная
Минутный график



UNITED TRADERS

Типы графиков и их анализ



TSLA
Ликвидная
Волатильная
Часовой график

Типы графиков и их анализ



TSLA
Ликвидная
Волатильная
Дневной график

Сервисы отбора акций



UNITED TRADERS

finviz.com

stock-watcher.com

