

Волны Эллиотта: теория и практика волнового анализа

Волновой анализ Эллиотта — проверенный инструмент, раскрывающий секреты рыночных движений через психологию толпы и фрактальные паттерны. Перед вами самый полный и понятный гайд по волновому анализу с подробными иллюстрациями, раскрывающий все аспекты теории.

В этой обучающем материале вы узнаете, как определять импульсные и коррекционные волны, освоите ключевые правила и указания для точной разметки графиков, а также научитесь строить прогнозы и находить оптимальные точки входа в сделки. Погрузитесь в волновую теорию, чтобы уверенно торговать на Форекс, криптовалютах и акциях, минимизируя риски и увеличивая прибыль!

В этой статье мы разберем:

Оглавление

Основы волновой теории Эллиотта	3
Преимущества волн Эллиотта	4
Как работают волны Эллиотта	6
Что такое волна?	7
Действующие и противодействующие волны	10
Полный ценовой цикл. Движущие и коррекционные волны	15
Волновые уровни	20
Числа Фибоначчи	22
Движущие волны	26
Импульс	27
Правила для нисходящего импульса	33
Начальный диагональник	34
Конечный диагональник	38
Коррекционные волны	42
Зигзаг	42
Волновая плоскость	47
Двойной зигзаг	51
Тройной зигзаг	56

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Двойная тройка	59
Тройная тройка	64
Горизонтальный треугольник	67
Наклонный треугольник	72
Взаимные пропорции волн по линиям Фибоначчи	75
Движущие волны. Импульс	75
Движущие волны. Начальный диагональник.....	76
Движущие волны. Конечный диагональник	76
Коррекционные волны. Зигзаг	77
Коррекционные волны. Волновая плоскость	77
Коррекционные волны. Двойной и тройной зигзаги	77
Коррекционные волны. Двойные и тройные тройки.....	77
Коррекционные волны. Сходящийся горизонтальный треугольник.....	77
Коррекционные волны. Расходящийся горизонтальный треугольник.....	77
Коррекционные волны. Наклонный треугольник.....	77
Алгоритм определения волн на графике	78
Пример 1	79
Пример 2	79
Рекомендации по изучению практической части волнового анализа	80
Торговля с использованием теории волн Эллиотта.....	81
Стратегии торговли по волнам Эллиотта.....	84
Волны Эллиотта в дневной торговле	85
Прогнозы на основе волновых паттернов	85
Индикаторы волн Эллиотта.....	85
Индикатор MACD	85
Индикатор Elliott Wave Oscillator.....	86
Индикатор Elliott Wave Prophet	88
Индикатор WATL.....	88
Как читать графики волн Эллиотта.....	88
Основные советы по использованию волн Эллиотта	89
Глоссарий по терминологии волн Эллиотта	89
Критика волнового анализа Эллиотта	92
Выводы: преимущества и недостатки волн Эллиотта	92

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Ну что ж, приступим!

Основы волновой теории Эллиотта

Волновая теория Эллиотта – это популярный метод анализа финансовых рынков. Прочитав эту статью, вы поймете суть этого метода прогнозирования, познакомитесь с его основными понятиями, научитесь понимать прогнозы аналитиков, сможете распознавать на графиках типы волн и строить прогнозы самостоятельно.



R. N. ELLIOTT, 1939
Photo: *The Financial World*

Рисунок 1.

Создателем волнового анализа является Американский Финансист Ральф Нельсон Эллиотт. В 1938 году, после 9 лет непрерывных исследований финансовых рынков, он опубликовал первую в мире книгу по волновому анализу – «Закон волн». С тех пор прошло уже более 80 лет, однако по сей день популярность волнового анализа Эллиотта продолжает возрастать среди трейдеров по всему миру. Большинство трейдеров, торгующих в прибыль, так или иначе использует в своих стратегиях волновой анализ. Кто-

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

то лишь частично, а кто-то полностью основывается на этом методе для принятия торговых решений и анализа рынка.

Суть метода заключается в следующем: рынок формирует толпа участников, взаимодействующая между собой. Эллиотт заметил, что толпа ведет себя предсказуемо и формирует на графике цены одни и те же ценовые конструкции или, другими словами, волны. Он описал и классифицировал все типы волн, которые встречаются на рынке.

Задача трейдера состоит в том, чтобы распознать, какая именно волна сейчас формируется, и насколько она была построена. Если эта задача выполнена правильно, то построить правильный прогноз и принять прибыльное торговое решение не составит труда.

Преимущества волн Эллиотта

Среди преимуществ волнового анализа трейдинга, а также среди его сильных сторон в сравнении с другими методами классического технического анализа, можно выделить несколько.

Можно анализировать рынок без какого-либо запоздания

Здесь я имею в виду, что при анализе рыночного графика с помощью каких-либо индикаторов или осцилляторов всегда есть некая задержка. То есть индикаторы и осцилляторы реагируют на рынок с опозданием, потому что они рассчитываются из исторических данных.

Поэтому, когда в рынке внезапно начинается новая тенденция, индикаторы и осцилляторы «замечают» ее лишь через некоторое время. В отличие от волнового анализа, который «готов» к появлению новой тенденции заблаговременно.

Эта возможность даёт трейдеру заранее подготовиться к перемене тенденции на рынке и принять необходимые торговые решения. С помощью этого свойства волн можно открыть позицию незадолго до появления новой тенденции, приносящей прибыль. Либо же закрыть позицию в наиболее выгодной точке. Например, закрыть продажу в самой низкой точке тренда, когда скользящая средняя находится максимально далеко от цены и указывает на наличие сильного тренда в рынке.

Никто из трейдеров и не подозревает, что тенденция вот-вот изменится и нисходящий тренд будет завершен, однако, специалист по волнам Эллиотта уже видит, что структура нисходящего импульса сформирована. Более того, в его пятой волне сформирован конечный диагональник, что указывает на скорую перемену тенденции. Поэтому он

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

закрывает позицию в наиболее выгодной точке, и рынок летит в восходящем направлении. А волновик сидит довольный, с прибылью в кармане.

Точность волновых формаций

Также среди преимуществ волнового анализа можно выделить подробность описания волновых конструкций. Например, все мы слышали о такой фигуре технического анализа как голова и плечи. На рынке существует бесчисленное множество различных фигур, которые можно так назвать. Одни будут резкие, другие протянутые во времени, в одних откаты цены глубокие, в других — мелкие. Различия есть также в структуре всех составных частей «голова и плечей». Однако в теханализе, каким бы подробным ни было описание этой фигуры, его всё равно недостаточно.

Если мы рассмотрим эту же фигуру с точки зрения волнового анализа, то увидим, что в одном случае «голова и плечи» — это волна 4 импульса, далее волна 5, а затем волны 1 и 2 следующего импульса, который начал развиваться в противоположном направлении. Тогда мы построим один прогноз, будем ждать движения в волне 3 и принимать соответствующие торговые решения.

Однако в другом случае, мы можем увидеть, что наша фигура «голова и плечи», если смотреть на неё с точки зрения волн Эллиотта, находится в завершении волны-связки X и зигзага Y. Другая же часть «голова и плечей» — это всего лишь ещё одна волна-связка XX, но недостроенная до конца. Тогда волновик будет ждать полного завершения волны XX, а затем ещё одного зигзага Z, развивающегося в том же направлении, что и волна Y.

Представитель технического анализа в этом случае мог бы обмануться, приняв формирующуюся фигуру за «голову и плечи» и ожидая движения рынка в противоположном направлении. Тогда как с точки зрения волн, формировалась лишь финальная часть тройного зигзага — таких примеров можно привести много. Всё дело в том, что конструкции фигуры или волны в волновом анализе описаны и исследованы гораздо более подробно, чем в техническом.

Здесь хочется привести пример про треугольник. В техническом анализе лишь несколько моментов сказаны о треугольниках, причём нет жестких ограничений в правилах — они лишь примерные, приблизительные. Треjder, руководствующийся обычным техническим анализом, должен сам попытаться определить, является ли формирующаяся фигура треугольником. Однако если посмотреть на правила волнового анализа касательно треугольников, мы увидим ряд просчитанных и жестких правил, которые должны выполняться в 100% случаев. Если в формирующейся фигуре не выполняется хотя бы одно из них, значит, она не может быть треугольником. Исключений здесь нет.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Такой подход ограничивает свободное мышление и позволяет более точно определить, формируется ли перед нами треугольник или нет. Также, помимо правил, мы увидим ряд указаний. Это такие наблюдения, касающиеся структуры волн, которые выполняются не всегда, но в большинстве случаев. Например, если для треугольника не выполнено указание, что одна из его подволн обычно принимает форму протяженной коррекции, это не меняет дела, волна всё равно может быть треугольником.

В волновом анализе есть ряд четких правил и указаний, которыми ограничена формирующаяся фигура. Это позволяет трейдерам уменьшить вероятность ошибки при определении волны. В обычном техническом анализе всё гораздо более расплывчато, и касательно фигур произведено меньше наблюдений, соответственно, присутствует меньше формализованных правил. Возможно поэтому бытует мнение, что волновой анализ является достаточно сложным методом.

Как работают волны Эллиотта

Все мы знаем, что рынок формируется благодаря взаимодействию между собой огромного количества участников: от мелких частных трейдеров до маркет мейкеров и коммерческих банков. Эти участники заключают между собой сделки на рынке, исходя из своих целей и задач. Благодаря этому постоянно изменяется стоимость тех или иных биржевых активов, стоимость отражается на графике, формирующемся в реальном времени, и мы получаем биржевые графики, которые видим в программах для трейдинга и анализа рынка. Они по сути отражают всё, что происходит «за кулисами» рынка.

Какая-то страна решила закупить оборудование на крупную сумму. Для этого ей нужно обменять валюту, что неминуемо отразится на графике, возможно, в виде импульса. Трейдеры могут заметить это движение и присоединиться к нему, благодаря чему будет сформирована ещё одна импульсная волна. Затем к рынку присоединятся отстающие трейдеры и участники — они получают прибыль на последнем импульсном движении, после чего начнётся откат.

Эллиотт внимательно наблюдал за ценовыми графиками и обнаружил, что, что бы ни происходило на рынке, всегда формируется один из десяти типов волн. Он описал и классифицировал их все, благодаря чему появился свод правил и указаний волнового анализа.

Трейдеру остаётся научиться применять эти правила к рыночному графику, правильно определять формирующиеся волны и, исходя из этого определения, строить прогноз. В общем, из прогноза уже вытекает соответствующее торговое решение. Так работают волны Эллиотта.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Что такое волна?

Начнем делать первые шаги в освоении волнового анализа.

Сначала разберемся с тем, что означает термин – волна. Волна – это базовое понятие волнового анализа Эллиотта, поскольку весь рынок состоит из волн, начиная от тикового и минутного таймфреймов и заканчивая месячными и более крупными таймфреймами. То есть, куда бы мы ни посмотрели на график, везде мы увидим волны.

Сначала приведем определение волны. Волна – это участок движения цены от одного изменения направления движения до другого. Чтобы было ясно, что имеется в виду, схематично изобразим участок восходящего тренда на рисунке 2.

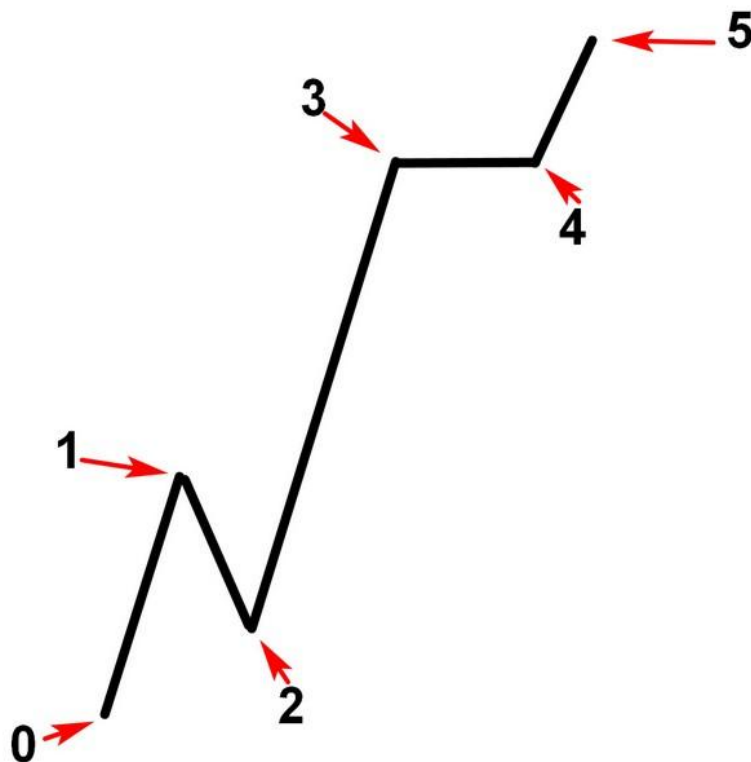


Рисунок 2

На этом рисунке мы видим активный бычий рынок, на который нанесены шесть точек: точка 0, точка 1, точка 2, точка 3, точка 4 и точка 5. Первое изменение направления движения произошло в точке 1, здесь движение цены изменилось с восходящего на нисходящее, поэтому мы можем сказать, что первая волна продолжается от точки 0 до точки 1.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

В точке номер два направление движения цены изменилось с нисходящего на восходящее, значит вторая волна, в данном случае, это участок движения цены от точки 1 до точки 2. Таким же образом, мы можем определить третью волну, находящуюся между точками 2 и 3, четвертую волну и пятую волну. Подпишем волны схематично на рисунке 3.

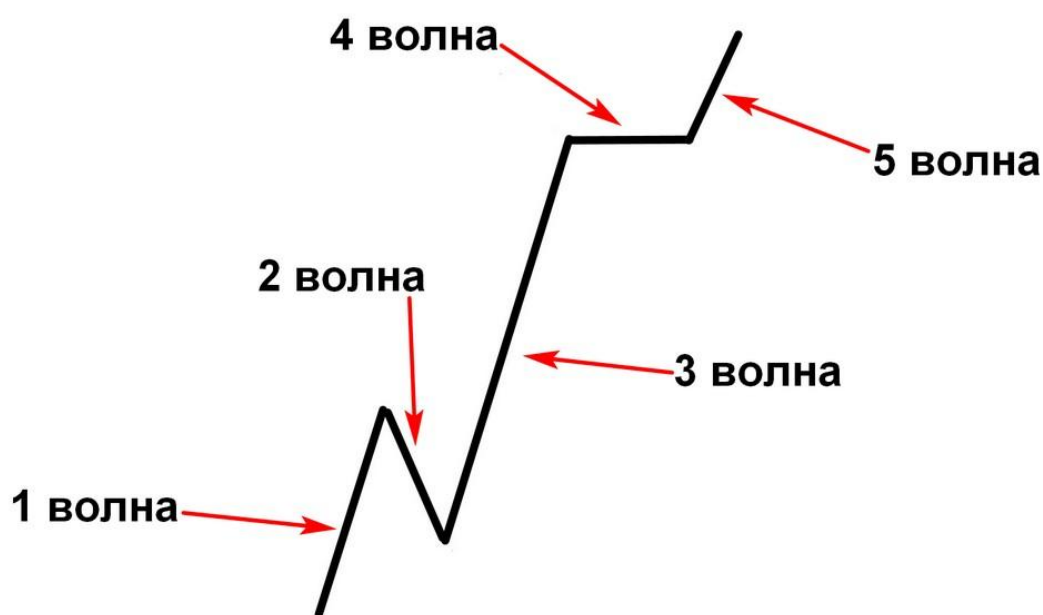


Рисунок 3.

Здесь следует запомнить один очень важный момент, в волновом анализе название волны ставится возле ее окончания. То есть, грамотно будет подписать волны так, как показано на рисунке 4.

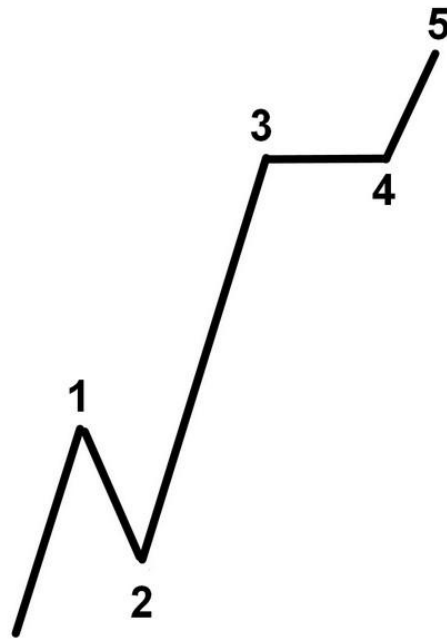


Рисунок 4.

Для лучшего понимания, рассмотрим еще нисходящий участок на рисунке 5, состоящий из трех волн: А, В и С.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

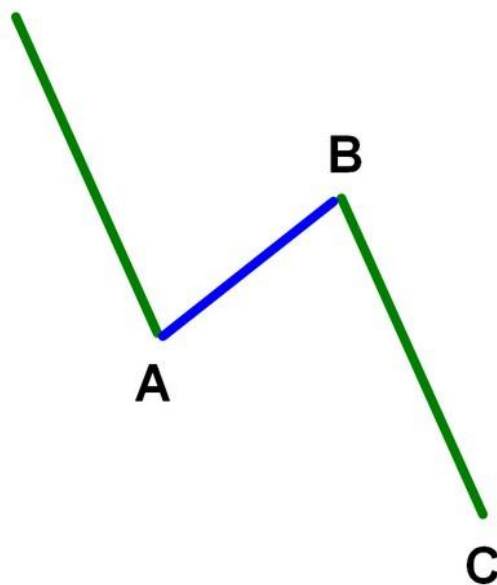


Рисунок 5.

Если речь идет о волне А, значит, имеется в виду первая нисходящая волна, которая выделена зеленым цветом. Если речь идет о волне В, значит, мы говорим о восходящей волне, которая выделена синим цветом. Если имеется в виду волна С, значит, мы говорим о второй нисходящей волне, которая выделена зеленым цветом.

Мы разобрались с тем, что такое волна, и узнали, как правильно подписывать волны на графике. Далее разберемся с остальными базовыми понятиями, которые помогут нам в проведении волнового анализа форекс на сегодня, завтра и каждый последующий день.

Действующие и противодействующие волны

Все волны на графиках по своей функции делятся на два типа: действующие и противодействующие. Чтобы понять, чем действующие волны отличаются от противодействующих, нарисуем схематично участок нисходящего тренда на рисунке 6.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

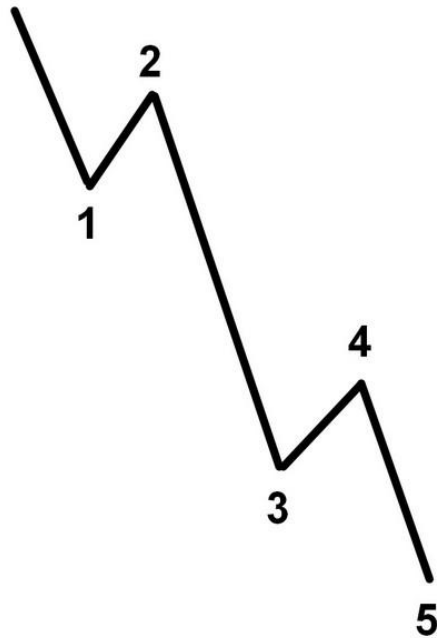


Рисунок 6.

Мы видим, что волна 1 продвигает рынок в нисходящем направлении, то есть действует на него, а волна 2 стремится создать откат в противоположном направлении, т.е. противодействует мощному нисходящему движению. Далее, волна 3 снова действует на рынок и стремится как можно дальше протолкнуть его вниз, а волна 4 противодействует этому движению и создает восходящий откат. Затем мы наблюдаем, что волна 5 вновь действует на рынок и толкает его вниз.

Таким образом, здесь можно выделить три действующие волны: 1, 3 и 5, и две противодействующие волны: 2 и 4.

Теперь приведем определения. Действующая волна – это волна, которая развивается в том же направлении, что и волна одним волновым уровнем выше. Чтобы понять, что такое волна одним уровнем выше, обратимся к рисунку 7.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

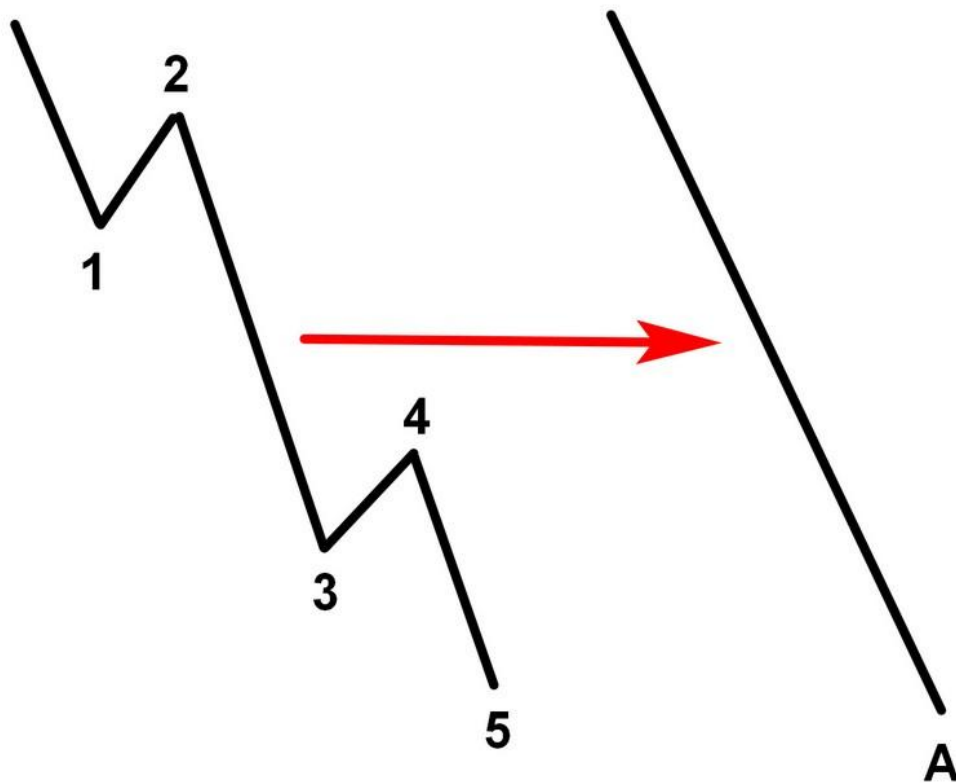


Рисунок 7.

Если мы схематично объединим все пять волн, которые указаны на рисунке 7 в одну большую волну, то получится нисходящая волна, которая на правой части рисунка названа волной А. В данном случае, волна А и является волной одним волновым уровнем выше. То есть, все действующие волны в левой части рисунка 7 – это волны, которые направлены вниз, туда же, куда и волна А. А все противодействующие волны – это те волны, которые направлены против главной волны, вверх.

Отсюда же вытекает определение противодействующей волны в волновом анализе. Противодействующая волна – это такая волна, которая направлена против волны одним волновым уровнем выше, в нашем случае – это волны 2 и 4.

Для лучшего понимания приведем схематично участок восходящего тренда А-В-С (Смотри рисунок 8).

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

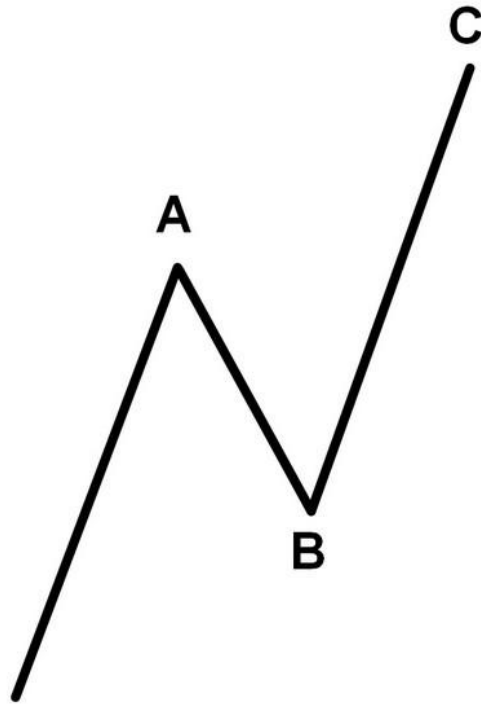


Рисунок 8.

Нетрудно догадаться, что участок состоит из трех волн, а волна одним волновым уровнем выше смотрит вверх, так как весь участок направлен вверх. Таким образом, действующие волны на этом рисунке – это волны А и С, а противодействующая волна – волна В.

Теперь ясно, как определять действующие и противодействующие волны на нисходящих или восходящих тенденциях в рамках волнового анализа рынка. Однако как быть с боковыми участками? Давайте разберемся.

Схематично изобразим боковой участок на рисунке 9.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер



Рисунок 9.

Как на нем определить действующие и противодействующие волны? Во-первых, любой сложный боковой участок можно разделить на более простые части. В нашем примере мы разделили боковой участок на три части, проведя через вершины волн W и X вертикальные линии. Теперь уже, глядя на эти три части в отдельности, легко определить, какие волны здесь являются действующими, а какие волны являются противодействующими. Первый участок направлен вверх, значит, все волны внутри этого участка, которые также смотрят вверх, являются действующими, а та волна, что направлена вниз, является противодействующей. Точно так же мы разделяем все волны на действующие и противодействующие на втором и третьем участке. На втором участке действующие волны направлены вниз, а противодействующая волна находится по центру и направлена она вверх. На третьем участке действующие волны – восходящие, а противодействующая – нисходящая.

Однако, если весь участок, указанный на рисунке 9, объединить в одну волну, то какой волной он будет, действующей или противодействующей? Как вы уже поняли, это зависит от того, в какую сторону направлена волна одним волновым уровнем выше. На рисунке 10 отобразим волну из рисунка 9 и волну одним волновым уровнем выше.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

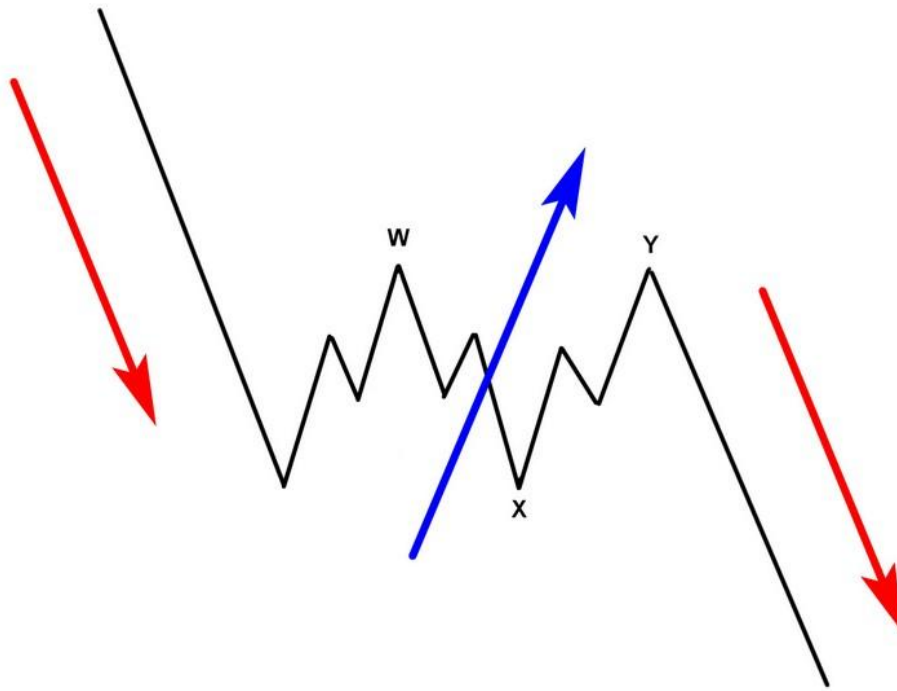


Рисунок 10.

Мы видим, что волна W-X-Y является частью более крупной тенденции, направленной вниз (на это указывают красные стрелки), и стремится создать откат в противоположном направлении, то есть вверх (на это указывает синяя стрелка). Таким образом, волна W-X-Y является противодействующей в сравнении с волной одним волновым уровнем выше.

Исходя из вышесказанного следует, что, чтобы понять, действующая волна перед нами или противодействующая, нужно сравнить направление ее движения с направлением движения волны одним волновым уровнем выше.

Теперь, когда мы разобрались с этими важными понятиями, вы поймете, о чем идет речь, когда аналитик скажет: «Посмотрите на противодействующие волны этого тренда». Введение понятий «действующие» и «противодействующие» нужны для удобной идентификации определенных участков графика.

Полный ценовой цикл. Движущие и коррекционные волны

Ранее мы выяснили, что все волны на рынке разделяются по своей функции на действующие и противодействующие. Однако кроме функции волн, существует еще понятие

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

стиля волн. Есть два стиля, в рамках которых развиваются волны: движущий и коррекционный. Волны движущего стиля всегда состоят из пяти частей, а волны коррекционного стиля состоят либо из трех волн, либо из нескольких частей по три волны, например, из двух или трех частей, которые объединяет между собой волна-связка. Для простоты волны коррекционного стиля на текущем этапе мы будем изображать состоящими лишь из трех частей.

Отообразим так называемый полный ценовой цикл. Полный ценовой цикл – это связка из движущей и коррекционной волны (Смотри рисунок 11).

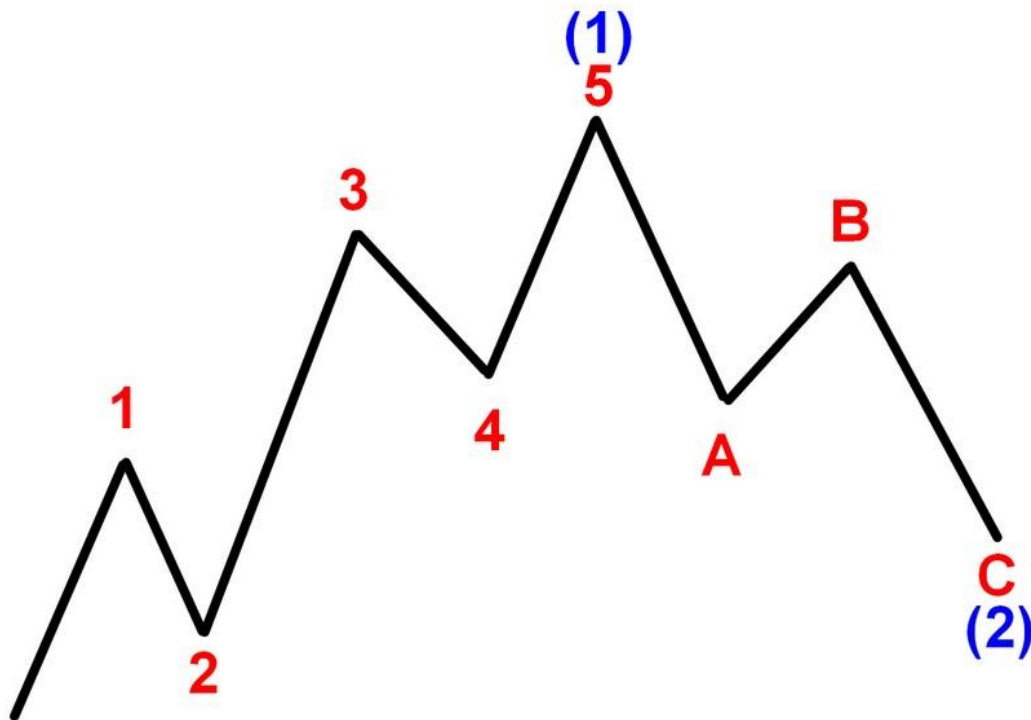


Рисунок 11

Мы видим, что восходящая волна, то есть большая движущая волна, состоит из пяти подволн, а нисходящая волна, которая является трехволновой конструкцией коррекционного стиля. Назовем движущую волну – волной (1), а коррекционную волну – волной (2).

Все волны движущего стиля всегда подписываются цифрами 1-2-3-4-5, а все волны коррекционного стиля подписываются буквами А-В-С, либо W-X-Y. Иногда используются буквы XX, Z, D и E, в зависимости от типа формируемой волны. Исходя из вышесказанного,

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

на рисунке 11 подволны движущей и коррекционной волны были подписаны буквами и цифрами красного цвета.

Обратим внимание, что начальная часть нашей фигуры, маленькие волны 1 и 2, является уменьшенной копией крупных волн (1) и (2). Поэтому, подобно крупной волне (1), маленькая волна 1 также состоит из пяти еще более мелких подволн и должна быть подписана цифрами от одного до пяти.

А маленькая волна 2, является уменьшенной копией крупной волны (2), поэтому она также развивается в коррекционном стиле и подписывается буквами А-В-С (смотри рисунок 12).

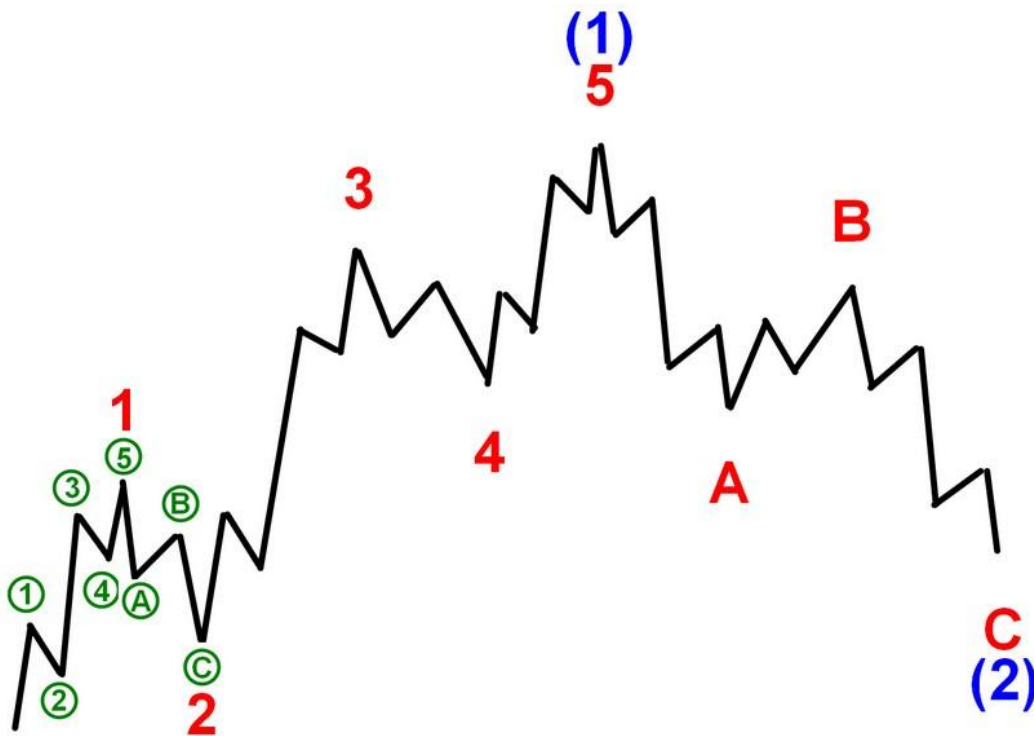


Рисунок 12

Точно так же мы можем разделить на движущие и коррекционные все остальные волны в данной модели. То есть, волна 3 является движущей и состоит из пяти подволн, а волна 4 является коррекционной и состоит из трех частей, а волна 5 вновь является движущей и состоит из пяти подволн.

Что касается нисходящего участка А-В-С, который является волной (2), то здесь отсчет начинается заново. Волна А является движущей и состоит из пяти частей, волна В является

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

коррекционной и состоит из трех частей, а волна С является вновь является движущей (смотри рисунок 13).

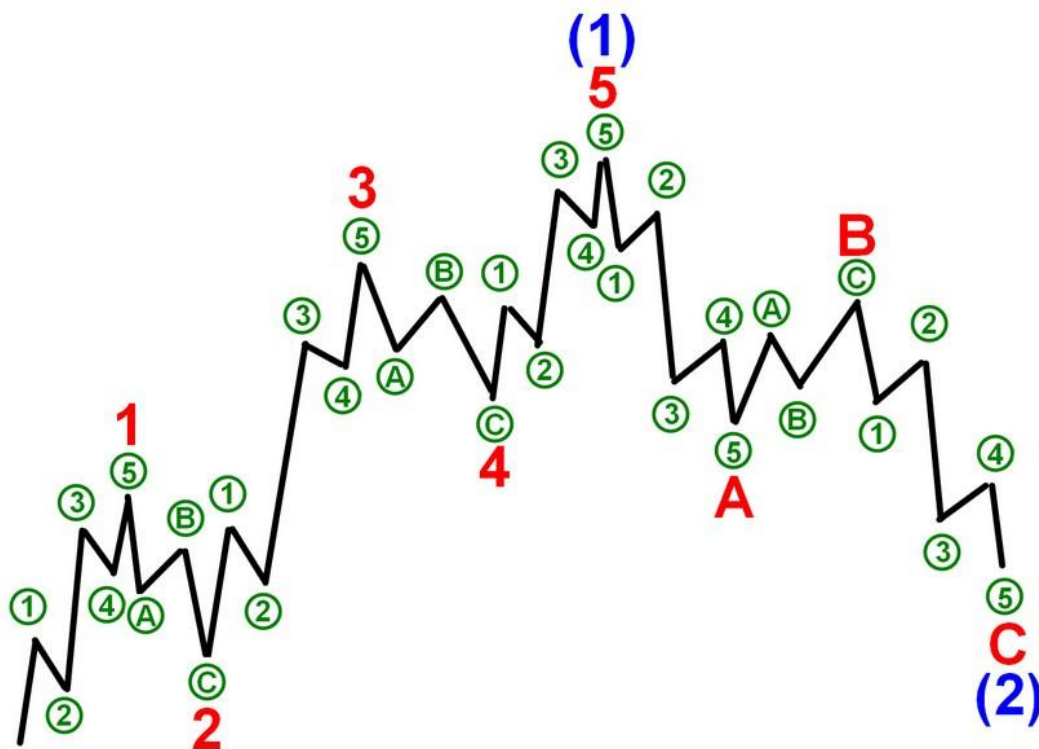


Рисунок 13

Теперь, если бы мы посмотрели на структуру самой маленькой волны 1, которая находится в левом нижнем углу графика и отмечена цифрой зеленого цвета, мы бы увидели, что эта волна также состоит из пяти подволн и развивается в движущем стиле. А самая маленькая волна 2 состоит из трех подволн и является волной коррекционного стиля.

Модель полного рыночного цикла очень хорошо показывает так называемый принцип фрактальности волн. Глядя на эту модель, мы видим, как маленькие волны, складываясь между собой, образуют точно такие же более крупные волны. И самое интересное здесь то, что все эти волны являются точной копией друг друга, разница только в размере. То есть, такие волны можно назвать подобными друг другу. Модель, указанная на рисунке 13, является фрактальной – в ней меньшее подобно большему, и наоборот.

Очень важно понять и запомнить принцип фрактальности волн, так как мы можем встретить волны с абсолютно одинаковой волновой структурой, к примеру, на минутном и дневном таймфрейме. Благодаря реализации этого принципа, мы можем производить анализ

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

графика с точки зрения волнового анализа, выбрав абсолютно любой таймфрейм. Составить прогноз можно и на ближайшие 10 минут, и на последующие 10 лет.

Теперь вернемся к нашему полному ценовому циклу. Мы можем очень кратко описать его внутреннюю структуру. Для этого достаточно сказать, что все его действующие волны сформированы в движущем стиле, а все его противодействующие волны сформированы в коррекционном стиле.

Для подтверждения вышеназванного утверждения посмотрим на рисунок 14.

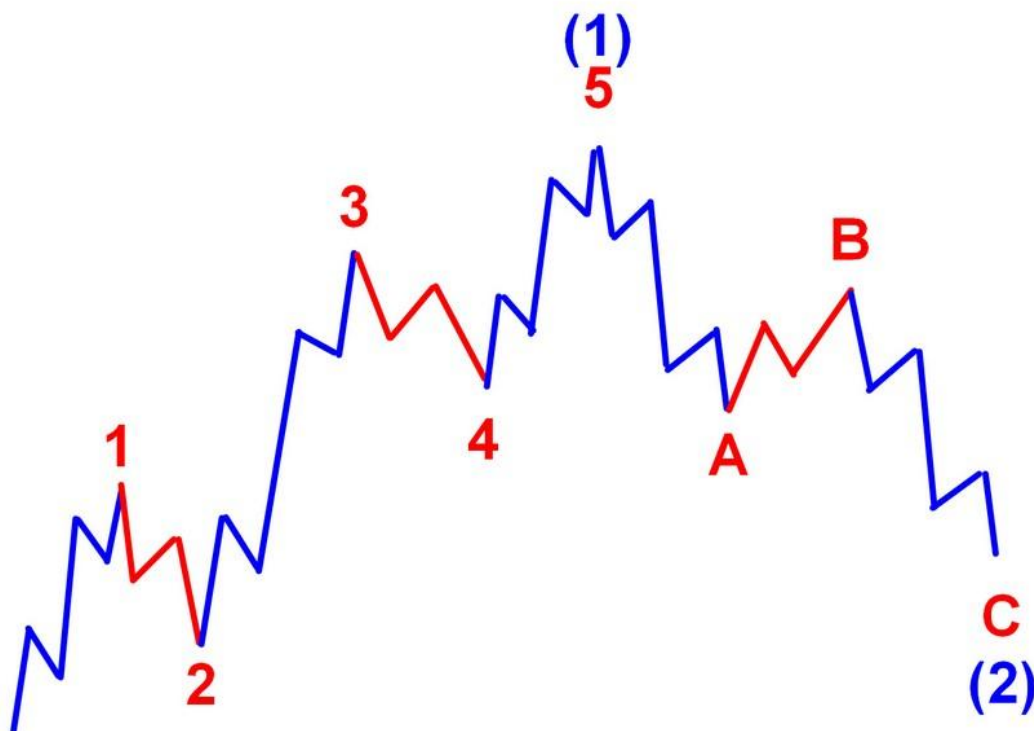


Рисунок 14.

Сначала разберемся с волной (1). Она состоит из пяти частей и поэтому является волной движущего стиля. Все действующие волны внутри этой волны, то есть волны 1, 3 и 5 также формируются в движущем стиле и состоят из пяти частей. Они отмечены на рисунке 15 синим цветом.

Все противодействующие волны внутри волны (1) состоят из трех подволн, они отмечены на рисунке красным цветом. То же самое касается и волны (2), действующие волны являются движущими и состоят из пяти частей (выделены синим цветом), а

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

противодействующая волна является коррекционной и состоит из трех частей (выделена красным цветом).

Таким образом, мы подтвердили вышесказанное утверждение о том, что все действующие волны в этой модели являются движущими, а все противодействующие волны являются коррекционными.

Важно понять следующий момент: если бы действующие волны всегда развивались в движущем стиле, а противодействующие в коррекционном, то не было бы необходимости в этих четырех терминах, хватило бы двух терминов, например, движущие и коррекционные волны. Однако существует необходимость в использовании именно четырех терминов, так как некоторые действующие волны могут развиваться как в движущем, так и в коррекционном стилях. Почему так происходит, на текущем этапе понять сложно, так как мы еще не изучили волны коррекционного стиля.

Мы рассмотрели полный ценовой цикл, принцип фрактальности волн, и ознакомились с понятиями: действующие и противодействующие волны, а также рассмотрели волны движущего и коррекционного стилей.

Теперь можно приступить к изучению типов волн. Волны движущего стиля включают в себя 3 различных типа волн, а волны коррекционного стиля включают в себя 7 различных типов волн. Таким образом, в волновом анализе существует 10 типов волн. Для каждого из этих 10 типов мы запишем набор правил и указаний в последующих частях статьи.

Волновые уровни

Из предыдущей части статьи мы увидели, что на одном и том же участке графика могут быть видны волны разной величины. Чтобы отделить разные волновые уровни друг от друга, была придумана специальная система маркировки.

Важно понимать, что нет жесткой связи между таймфреймом, на котором идентифицируется волна и ее волновым уровнем. Волна уровня Cycle может быть как на недельном, так и на часовом таймфрейме. Это зависит от того, как были названы волны одним волновым уровнем выше или волны одним волновым уровнем ниже. Первоначальную же «точку отсчета» каждый выбирает самостоятельно. Автор данной статьи, например, обычно располагает волны уровня Primary на четырехчасовом таймфрейме, а остальные волновые уровни называет, уже отталкиваясь от уровня Primary.

Волны уровня Primary обозначаются буквами и цифрами зеленого цвета в кружках (Аналогом кружков могут являться квадратные скобки). За уровнем Primary, если двигаться по убыванию, располагается уровень Intermediate, он обозначается буквами и цифрами

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

синего цвета в круглых скобках. Далее следует уровень Minor, он обозначается буквами и цифрами красного цвета без скобок. На рисунке 15 мы видим, что начинается бычий рынок, в котором видны три вышеназванных волновых уровня.

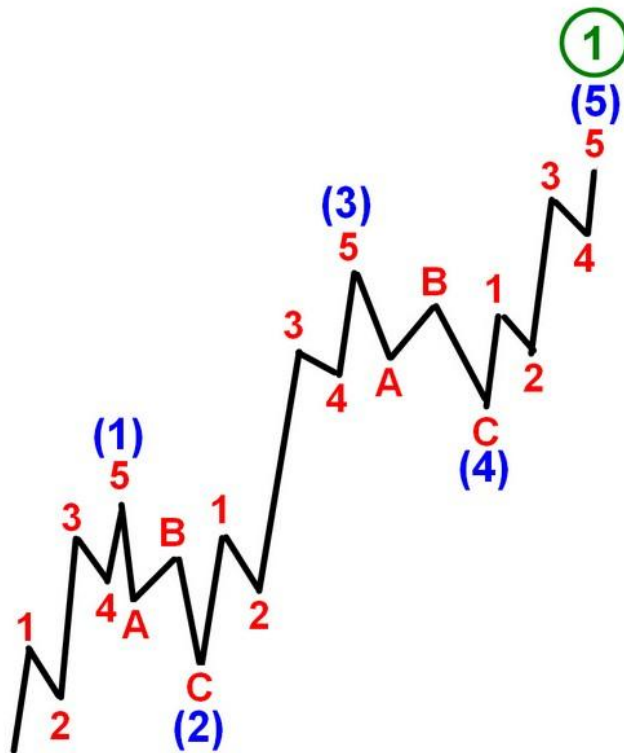


Рисунок 15.

Мы видим, что такая цветовая идентификация облегчает удобство восприятия волн на графике. Мы можем сказать, например, что четвертая волна уровня Intermediate является зигзагом А-В-С. Использовать такую схему обозначений волновых уровней очень удобно на практике, однако она требует некоторого времени, чтобы к ней привыкнуть. Ниже приведена полная схема обозначений волновых уровней или циклов.

Волновые уровни	Движущие волны	Коррекционные волны	Таймфрейм
Тысячелетние волны	1, 2, 3, 4, 5	A, B, C, D, E, W, X, Y, Z	Тысячелетний и более

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Волновые уровни	Движущие волны	Коррекционные волны	Таймфрейм
Главный волновой уровень	[I] [II] [III] [IV] [V]	[a][b][c][d][e][w][x][y][z]	Тысячелетний, вековой
Суперуровень	(I) (II) (III) (IV) (V)	(a)(b)(c)(d)(e)(w)(x)(y)(z)	Вековой, годовой
Основной	I, II, III, IV, V	a, b, c, d, e, w, x, y, z	Годовой, кварталный, месячный
Первичный	[1] [2] [3] [4] [5]	[A][B][C][D][E][W][X][Y][Z]	Квартальный, месячный, недельный, дневной
Средний	(1) (2) (3) (4) (5)	(A)(B)(C)(D)(E)(W)(X)(Y)(Z)	Месячный, недельный, дневной
Мелкий	1, 2, 3, 4, 5	A, B, C, D, E, W, X, Y, Z	Месячный, недельный, дневной, 240 min
Минутный	[i] [ii] [iii] [iv] [v]	[a][b][c][d][e][w][x][y][z]	Недельный, дневной, 480-60 min
Маленький	(i) (ii) (iii) (iv) (v)	(a)(b)(c)(d)(e)(w)(x)(y)(z)	Дневной, 480-60 min
Сверхмаленький	i, ii, iii, iv, v	a, b, c, d, e, w, x, y, z	480-60 min и меньше

Всегда соблюдается порядок цветов. За волновым уровнем, обозначенным красным цветом, следует уровень, обозначенный зеленым цветом. Затем идет синий цвет, а потом последовательность повторяется. Красный, зеленый, синий. И снова: красный, зеленый, синий. Волны зеленого волнового уровня всегда в кружках или квадратных скобках, волны синего цвета всегда в круглых скобках, а красные волны всегда без скобок. Если читатель запомнит то, что написано выше, ориентироваться в волновых уровнях станет гораздо легче, даже на начальном этапе.

Числа Фибоначчи

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

В волновом анализе рынка Форекс широко применяется математическая последовательность чисел Фибоначчи для прогнозирования величины волн.

Последовательность чисел Фибоначчи была открыта Итальянским математиком Леонардо Фибоначчи, жившим в тринадцатом веке. Впервые эта последовательность была опубликована в 1202 году в так называемой «Книге вычислений».

Последовательность вытекает из решения задачи о кроликах, которая заключается в следующем: «Сколько пар кроликов, помещенных в загон, может быть произведено за один год из одной пары кроликов, если каждая пара производит еще одну пару каждый месяц, начиная со второго». Решение этой задачи и рождает знаменитую последовательность.

Здесь мы не будем приводить шаги решения этой задачи, а сразу запишем готовый ответ. Он может быть записан в виде последовательности чисел:

1, 1, 2, 3, 5, 8, 13, 21, 34, 55, 89, 144... и так далее.

У данной последовательности есть несколько замечательных свойств, одно из них заключается в том, что если взять два соседних элемента последовательности и разделить меньший элемент на больший, то мы получим коэффициент 0.618, давно известный миру как «золотая пропорция» или «золотое сечение». Это число, называется «фи» («phi»). Например, разделим 11-ый элемент последовательности на 12-ый, т.е. 89 на 144 и получим 0.61805.

Если же разделить больший элемент на меньший, то получим обратное значение – 1.618. Например $89/55=1.618$.

Значение 1.618 (0.618) – это так называемая золотая пропорция или золотое сечение. Его гармония приятна для глаз и является важным явлением в музыке, искусстве, архитектуре и биологии.

Также из этой пропорции рождается золотая спираль, которая широко известна во всем мире, и форма которой проявляется в разных творениях природы, например, в листе папоротника, раковине улитки, в форме галактики (смотри рисунок 17).

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер



Рисунок 17.

Следующей важной особенностью последовательности Фибоначчи является тот факт, что если делить друг на друга не соседние члены последовательности, а через один или через два, тогда мы получим совсем другие коэффициенты. Например: $34/89=0.382$ (38.2%), или $55/34=1.618$ (161.8%). Отсюда и рождаются все 9 коэффициентов, которые используются для построения линий Фибоначчи. Линии Фибоначчи есть в любой программе по техническому анализу (Смотри рисунок 18).

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

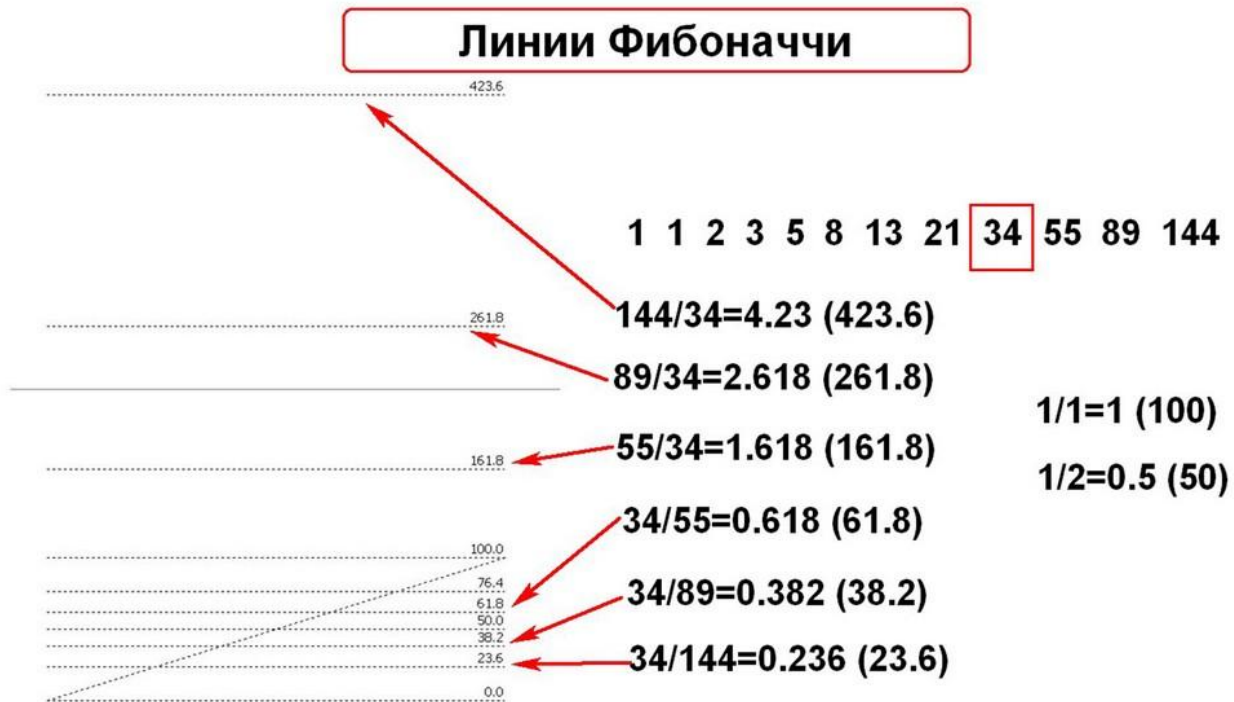


Рисунок 18.

При помощи линий Фибоначчи измеряется величина одной волны относительно другой в процентах. Например, в зигзагах волна (B) часто составляет 61.8% процент относительно волны (A). Такая ситуация продемонстрирована на рисунке 19. Измерения были произведены при помощи вышеназванного инструмента.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

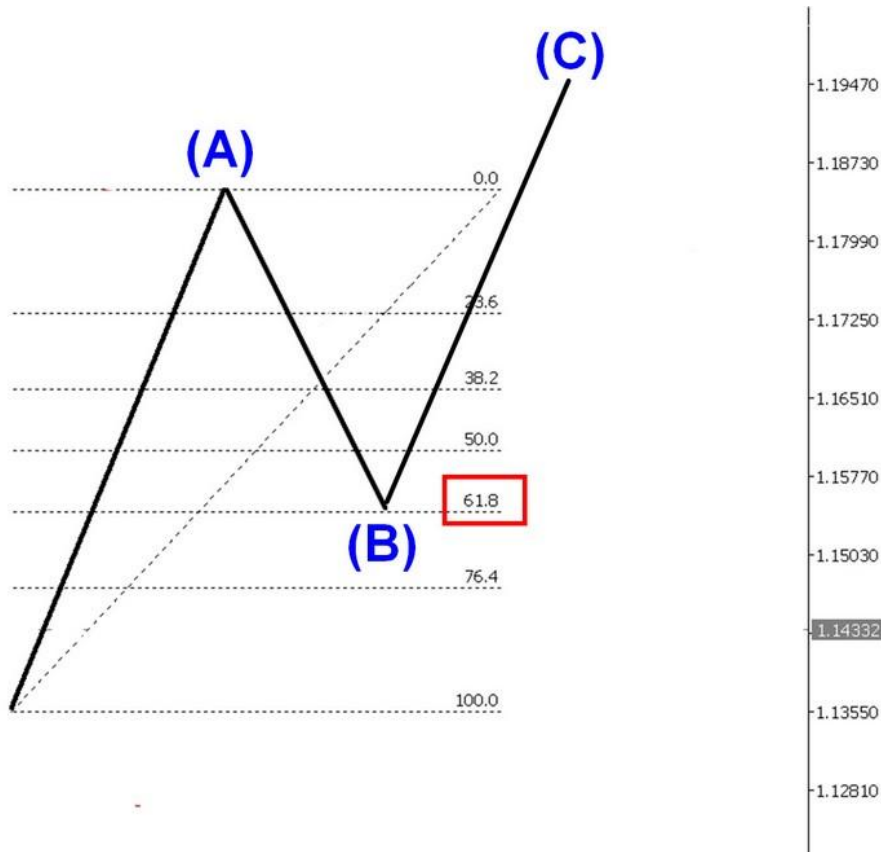


Рисунок 19.

А теперь запишем все коэффициенты, которые используются в волновом анализе для прогнозирования величины волн в процентном виде: 23.6%, 38.2%, 50%, 61.8%, 76.4%, 100%, 161.8%, 261.8%, 423.6%. К примеру, величина волны 2 обычно составляет 50% от волны 1, 61.8% от волны 1, либо 76.4% от волны 1. Зная эту статистическую закономерность и учитывая внутреннюю структуру формирующейся волны 2, можно достаточно точно определить точку ее предполагаемого завершения. Соответственно, у трейдера возникает хорошая возможность выгодно открыть торговую позицию, либо закрыть сделку, открытую ранее, по точно составленному прогнозу.

Существует достаточно обширный статистический материал, в котором собрана статистика по величине движущих и коррекционных волн. Однако, поскольку мы пока еще не познакомились со всеми типами волн, приводить эту статистику нецелесообразно. Она будет опубликована в конце статьи.

Движущие волны

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Ранее уже было сказано, что всего, с точки зрения волнового анализа, существует 10 типов волн. 3 типа волны формирующихся в движущем стиле и 7 типов волн, формирующихся в коррекционном стиле. Сейчас мы начнем изучать первый из трех типов движущих волн – импульс.

Импульс

Импульс – это самый популярный и часто встречающийся тип волны в рынке. Любые сложные коррекционные модели, при более детальном рассмотрении, можно разделить на импульсы, то есть импульс – это элементарный кирпичик. Складывая между собой такие кирпичики в различных комбинациях, мы можем получить волну абсолютно любой степени сложности. В свою очередь, любую, даже самую сложную коррекционную волну, в итоге можно разложить до элементарных импульсов.

На ум приходит аналогия с атомом в физике. Атомы, складываясь между собой в различных комбинациях, образуют все известные в природе вещества. Любое вещество можно разложить до атомов его составляющих. Так же и импульс является элементарным атомом, из которого складываются все волны на рынке.

Прежде чем приступим к записи правил, приведем схематичную модель импульса (смотри рисунок 20).

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер



Рисунок 20.

Теперь запишем набор правил для импульсов.

Правила Импульса:

1. Импульс состоит из 5 волн.
2. Волновая формула Д-К-Д-К-Д.
3. Волна 2 < волны 1.
4. Волна 3 выходит за окончание волны 1.
5. Окончание волны 4 выше окончания волны 1.
6. Волна 3 не бывает самой короткой волной в сравнении с волнами 1 и 5.

Комментарии:

Написал
Роман Онегин
Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Комментарий к правилу 1: Импульс всегда состоит из 5 волн, причем, как и все волны, формирующиеся в движущем стиле, он всегда подписывается цифрами.

Комментарий к правилу 2: Волны импульса 1, 3 и 5 формируются в движущем стиле, а волны 2 и 4 в коррекционном. Мы можем схематично отобразить эту внутреннюю структуру в виде следующей формулы: Д-К-Д-К-Д. Она означает, что, во-первых, модель состоит из пяти волн, а во-вторых, она показывает, в каких стилях формируются ее составные части. Впоследствии, мы будем называть такую форму записи волновой формулой и запишем ее для всех типов волн.

В учебниках по волновому анализу волновую формулу обычно обозначают не буквами Д и К, а цифрами 5 и 3. Но автор статьи ушел от такого обозначения, потому что обнаружил, что многих новичков это вводит в заблуждение. Если бы мы записали такую формулу для импульса в виде цифр, то она бы выглядела следующим образом 5-3-5-3-5. Новички, глядя на такую формулу, видят на втором и четвертом месте тройки, и часто делают ошибочный вывод, что на месте второй и четвертой волны импульса могут быть лишь волны состоящие из трех частей. Однако на этих местах могут стоять волны коррекционного стиля, которые состоят из пяти частей, например треугольник А-В-С-Д-Е или тройная тройка W-X-Y-XX-Z. Таким образом, цифра 3 в такой формуле лишь указывает на принадлежность волны к коррекционному стилю, но ни в коем случае не говорит о количестве волн в модели. Именно поэтому вместо цифры 3 автор статьи предлагает писать букву К, которая более точно указывает на принадлежность волны к коррекционному стилю. Такое нововведение позволит не запутаться людям, которые начинают изучать волновой анализ.

Комментарий к правилу 3: Правило 3 гласит, что величина волны 2 меньше величины волны 1. Величина волны измеряется по ее проекции на вертикальную ось. То есть, величина волны 1 – это длина вертикального отрезка, выделенного синим цветом на рисунке 21.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер



Рисунок 21.

Если случится такая ситуация, что величина волны 2 будет больше величины волны 1, значит перед нами не импульс, а какая-то другая волновая модель, либо структура волн определена неправильно.

Комментарий к правилу 4. Волна 3 всегда заходит за окончание волны 1. Это утверждение означает, что волна 3 не может завершиться ниже уровня, указанного на рисунке 22 красной горизонтальной линией.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

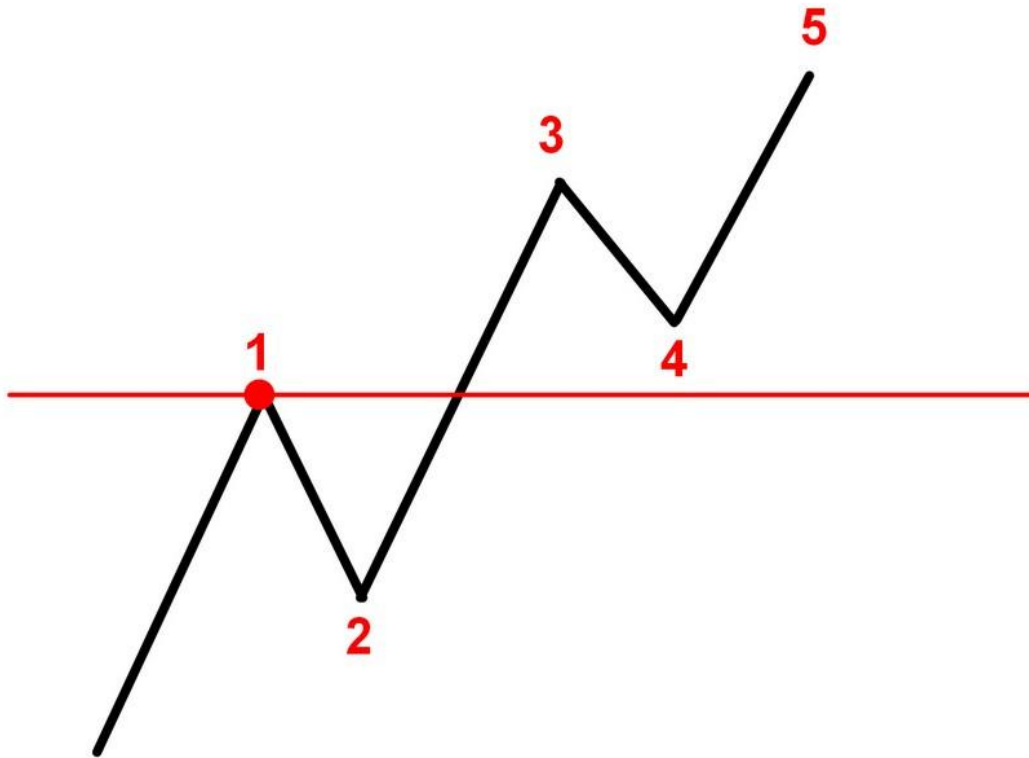


Рисунок 22.

Комментарий к правилу 5: Окончание волны 4 выше окончания волны 1. Это правило означает, что волна 4 завершается всегда выше окончания волны 1 (если мы говорим о восходящем импульсе). Хочется обратить внимание на тот факт, что при своем построении волна 4 может временно заходить ниже окончания волны 1. Чтобы было понятнее, о чем идет речь, посмотрим на рисунок 23.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

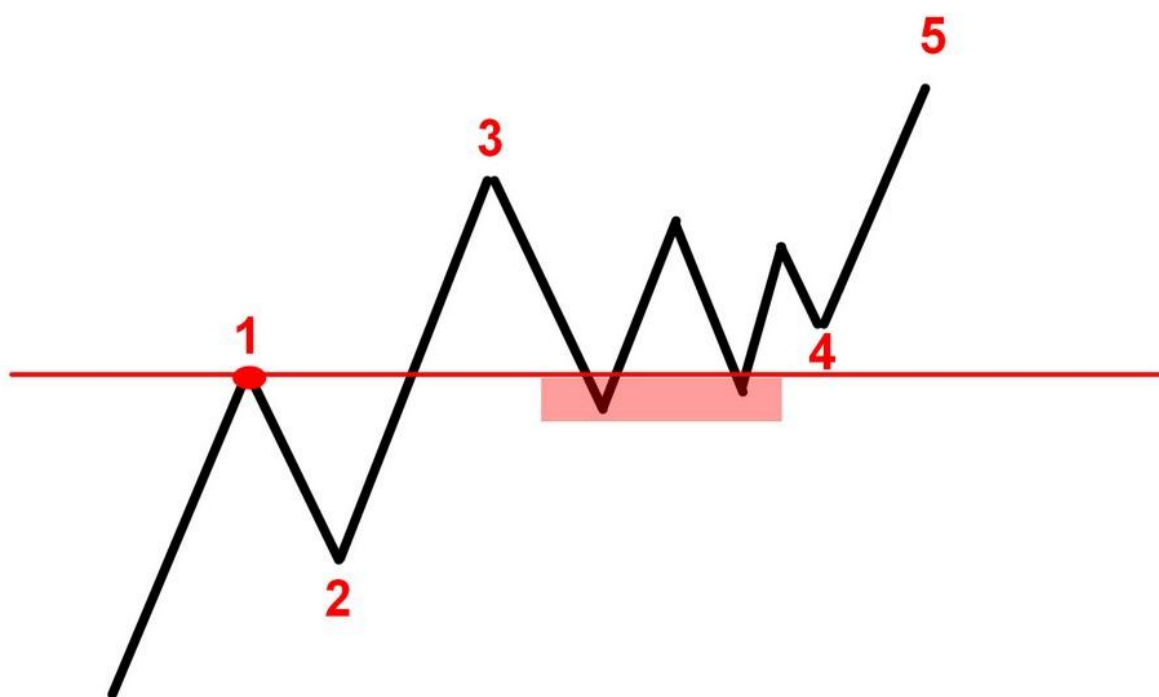


Рисунок 23.

Мы видим, что в данном случае волна 4 заходила ниже уровня красной горизонтальной линии, проведенной через вершину волны 1, однако, несмотря на это, волна 4 была завершена выше уровня красной линии. Это означает, что правила не были нарушены. Иногда на рынке встречаются такие ситуации, поэтому считать это за ошибку не нужно.

Комментарий к правилу 6: Шестое правило гласит, что третья волна не бывает самой короткой среди волн 1 и 5. Другими словами, третья волна не бывает самой короткой среди действующих волн импульса. Это правило, как и остальные правила, должно выполняться всегда, и нарушено оно быть не может. Однако, здесь можно добавить, что по статистике третья волна очень часто бывает самой крупной по величине и самой мощной среди действующих волн импульса. Торговать в третьей волне – наиболее прибыльная и безопасная стратегия. Поэтому, если трейдер научился определять на рынке третью волну, то вероятность того, что он будет торговать прибыльно очень высока.

Все вышеперечисленные правила также выполняются и на нисходящем рынке. На рисунке 24 представлен нисходящий импульс.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

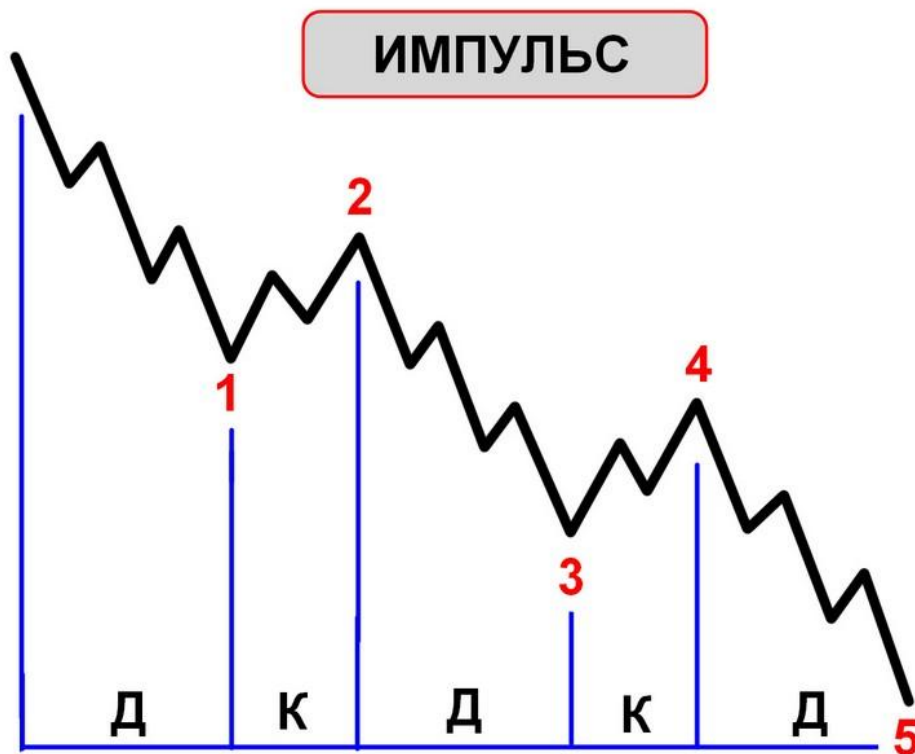


Рисунок 24.

Правила для нисходящего импульса

1. Импульс состоит из 5 волн.
2. Волновая формула Д-К-Д-К-Д.
3. Волна 2 < волны 1.
4. Волна 3 заходит за окончание волны 1.
5. Окончание волны 4 ниже окончания волны 1.
6. Волна 3 не бывает самой короткой волной в сравнении с волнами 1 и 5.

Набор правил для восходящего и нисходящего импульса практически совпадают. Разница лишь в направлении развития волны.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Начальный диагональник

В этой части статьи приступим к изучению семейства диагональников. Существуют начальные и конечные диагональники. Следует отметить, что раньше эти модели назывались диагональными треугольниками. Но потом Роберт Пректер, всемирно известный специалист по волновому анализу, убрал слово треугольник из названий диагональников, исключая путаницу среди новичков, которые иногда по ошибке относили диагональники к семейству треугольников. Я считаю, что это правильное и перспективное изменение, которое не позволит запутаться людям, изучающим волновой анализ.

В этой части изучим начальный диагональник – второй из трех типов волн, формирующихся в движущем стиле. Другое название начального диагональника – клин.

Итак, что же представляет собой начальный диагональник? Во-первых, хочется отметить, что эта модель обычно является предвестником мощного движения и появляется она всегда на месте волны 1 импульса или волны А зигзага, после которой обычно следует волна b, а затем тренд продолжается в новом импульсе, финальной части зигзага.

Если вы распознаете на графике начальный диагональник, это может стать сигналом к тому, что вскоре мы увидим мощный тренд, поэтому есть хорошая возможность для поиска точки для открытия сделки.

Далее схематично изобразим начальный диагональник на рисунке 25.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

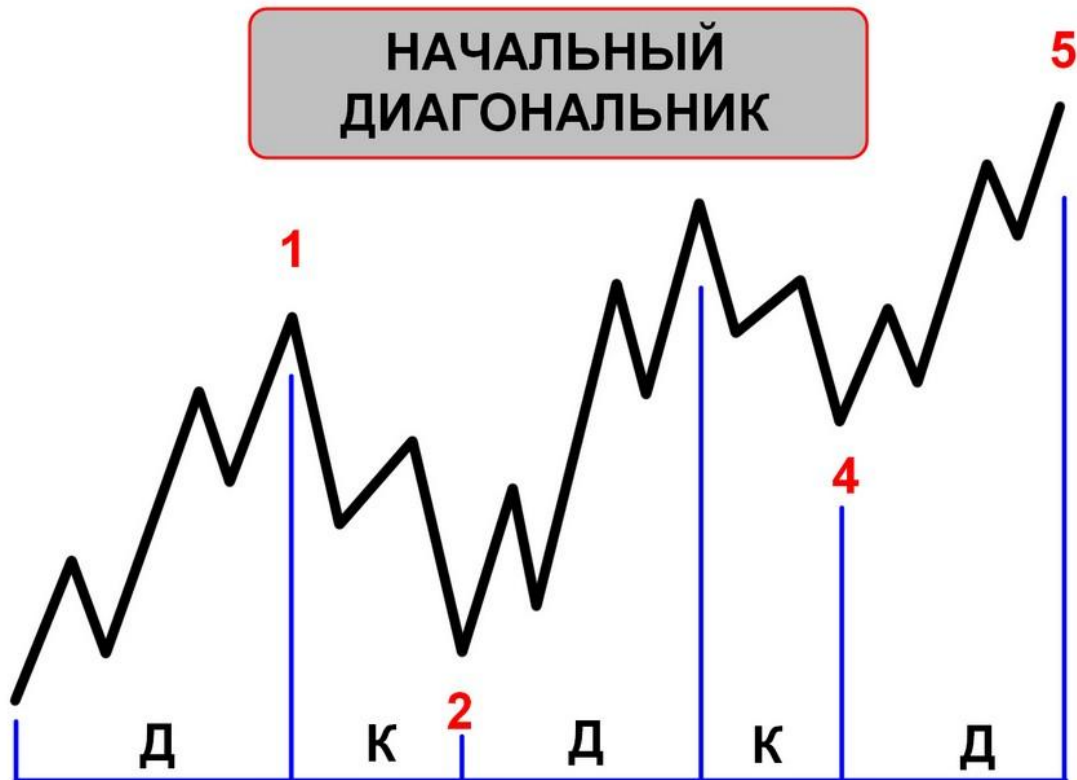


Рисунок 25.

Теперь приведем набор правил для начального диагональника.

Правила:

1. Состоит из 5 волн.
2. Волновая формула Д-К-Д-К-Д.
3. Волна 2 < волны 1.
4. Волна 3 всегда заходит за окончание волны 1.
5. Волна 4 завершается между волнами 1 и 2.
6. Волна 5 заходит за окончание волны 3.
7. Волна 3 не бывает самой короткой.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

8. Начальный диагональник располагается на месте волны 1 импульса или волны А зигзага.

Комментарии к правилам:

Начальный диагональник по своей структуре похож на импульс. Он, как и импульс, состоит из пяти волн с такой же волновой формулой. Волна 3, как и в импульсе, всегда заходит выше окончания волны 1. Однако разница с импульсом заключена в пятом правиле, согласно которому волна 4 всегда завершается между окончаниями волн 1 и 2. Схематично это правило продемонстрировано на рисунке 26.

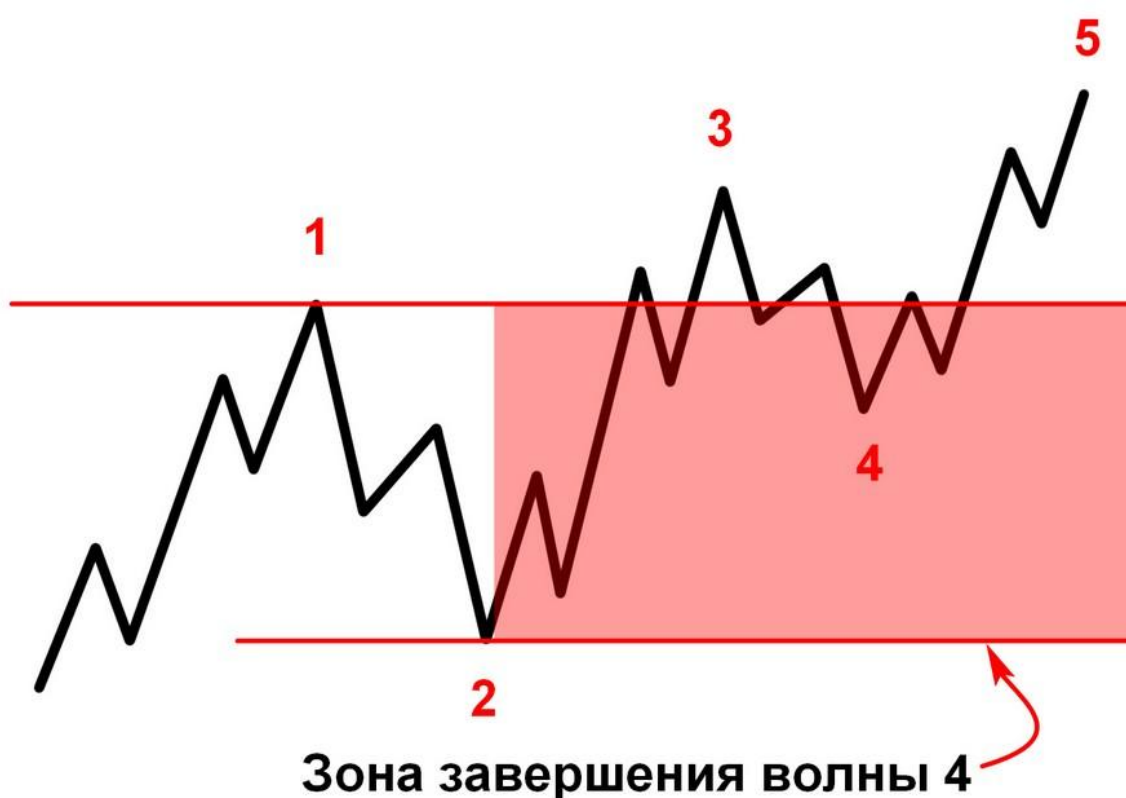


Рисунок 26.

На рисунке 26 показана зона, в которой должна завершиться волна 4. Если волна 4 завершается за пределами указанной зоны, значит перед нами не начальный диагональник, а какая-то другая модель, либо волны были определены неправильно.

Еще одно отличие начального диагональника от импульса заключается в правиле 6, согласно которому волна 5 всегда заходит выше окончания волны 3. Значит, пятая волна не

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

бывает усеченной. В правилах для импульса этот пункт вообще не оговорен, так как пятая волна никак не ограничена в своем развитии. Она может, как не дойти до окончания волны 3, в этом случае ее называют усеченной, так и пойти выше окончания третьей волны.

Далее, как и в импульсе, волна 3 начального диагональника не бывает самой короткой. Однако, в отличие от импульса клин может располагаться только на месте волны А зигзага или волны 1 импульса, и, как было сказано выше, эта модель обычно является предвестником мощного движения.

Таким образом, начальный диагональник, это волна по своим свойствам и форме похожая на импульс. Главные отличия касаются местоположения модели и зоны завершения четвертой волны.

Теперь рассмотрим нисходящий начальный диагональник. Набор правил для нисходящего начального диагональника полностью совпадает с набором правил для восходящего начального диагональника. Схема нисходящего начального диагональника показана на рисунке 27.

НАЧАЛЬНЫЙ ДИАГОНАЛЬНИК

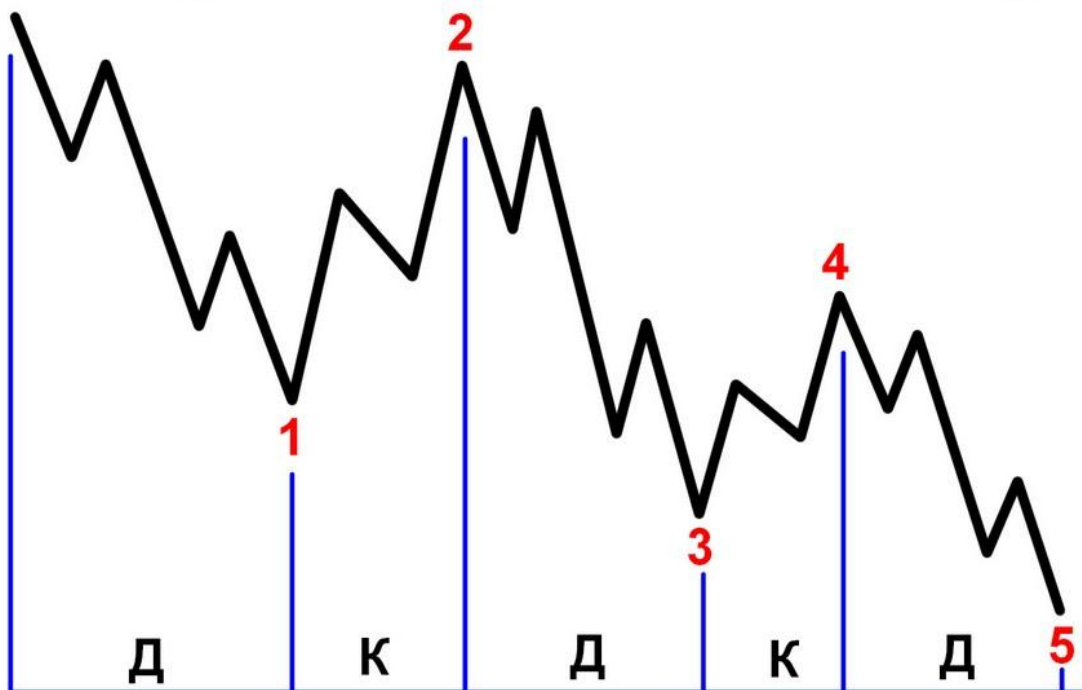


Рисунок 27.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

В заключение, хотелось бы показать, как правильно отмечать начальный диагональник на графике. От начала модели до ее конца проводятся две образующие линии. Первая линия проводится через вершины волн 1 и 3, а вторая образующая линия проводится через вершины волн 2 и 4. На рисунке 28 схематично показано, как проводятся образующие линии в восходящих и нисходящих начальных диагональниках.

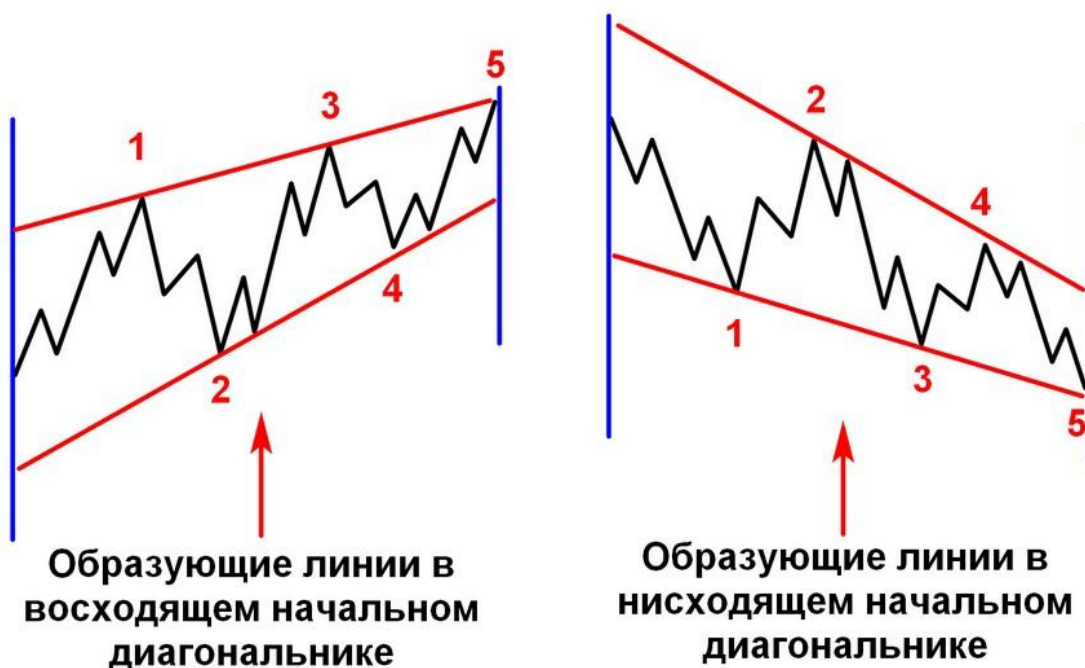


Рисунок 28.

Такое выделение начального диагональника на графике очень удобно с точки зрения практики. Когда на графике отображено очень много цифр и букв, диагональник, выделенный линиями, сразу бросается в глаза и вносит ясность в картину рынка.

Конечный диагональник

В этой части статьи мы познакомимся с конечным диагональником. Этот тип волны является последним из трех типов волн, формирующихся в движущем стиле.

Мы помним, что начальный диагональник появляется только на месте волны 1 импульса или волны А зигзага. Он часто является предвестником мощного движения.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

В противоположность этому, конечный диагональник появляется только в конце тренда, то есть на месте волны 5 импульса, либо волны С зигзага. Крайне редко конечный диагональник может появиться на месте волны С волновой плоскости. С этими коррекционными моделями мы разберемся позже.

Если вы обнаружите на рынке конечный диагональник, значит можно сделать вывод о том, что предыдущая тенденция близится к завершению и вскоре начнется развитие коррекционной волны, либо нового тренда в противоположном направлении. Поскольку конечные диагональники обычно хорошо различимы на графике, то можно достаточно точно спрогнозировать точку завершения тренда, а это можно и нужно использовать в торговле.

Далее приведем схему и запишем набор правил для конечных диагональников (Смотри рисунок 29).



Рисунок 29.

Правила:

1 Состоит из 5 волн.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

2 Волновая формула К-К-К-К-К. (1, 3, 5 волны всегда зигзаги).

3 Волна 2 < волны 1.

4 Волна 3 заходит за окончание волны 1.

5 Волна 4 завершается между окончаниями волн 1 и 2.

6 Волна 3 не минимальная.

7 Может быть на месте волны 5 импульса или волны С зигзага. Редко на месте волны С волновой плоскости.

Комментарии к правилам:

Как мы видим, набор правил для конечного диагональника похож на набор правил для начального диагональника. Основные отличия заключены в волновой формуле и местоположении модели. Волновая формула конечного диагональника, в отличие от волновой формулы импульса или начального диагональника, записывается как К-К-К-К-К. Значит, эта модель состоит из пяти волн, формирующихся в коррекционном стиле. Однако следует запомнить, что 1, 3 и 5-ая волны конечного диагональника всегда являются зигзагами. То есть все действующие волны конечного диагональника имеют структуру зигзагов.

Другое отличие конечного диагональника от начального заключается в местоположении модели. Конечный диагональник, как волна, являющаяся завершающей, может появиться только на месте волны 5 импульса или волны С зигзага. Иногда встречаются конечные диагональники в волне С волновой плоскости.

Еще одно отличие конечного диагональника от начального заключается в том, что волна 5 конечного диагональника может быть усеченной, то есть, эта волна может не доходить до горизонтальной линии, проведенной через вершину волны 3.

Обычно, автор данной статьи, при появлении конечного диагональника на ценовом графике, закрывает ранее открытые позиции, либо готовится к открытию в противоположном направлении предыдущему тренду, так как после завершения построения конечного диагональника, рынок часто стремительно летит в сторону, противоположную предыдущему тренду.

На рисунке 30 показана схема нисходящего конечного диагональника.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

КОНЕЧНЫЙ ДИАГОНАЛЬНИК

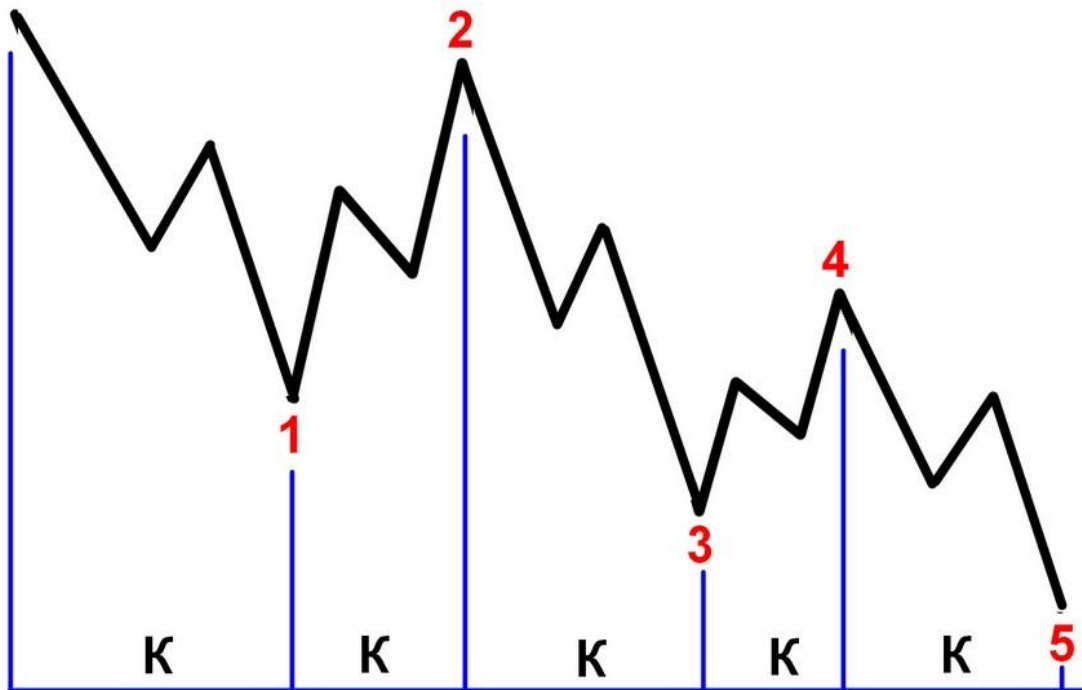


Рисунок 30.

Набор правил для нисходящего конечного диагонального движения совпадает с набором правил для восходящего конечного диагонального движения.

Что касается правильной маркировки конечного диагонального движения на графике, то она производится так же, как и в начальном диагональном движении. Проводятся две образующие линии через вершины волн 1 и 3 и через вершины волн 2 и 4. Образующие линии рисуются во всю длину волны (смотри рисунок 31).

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

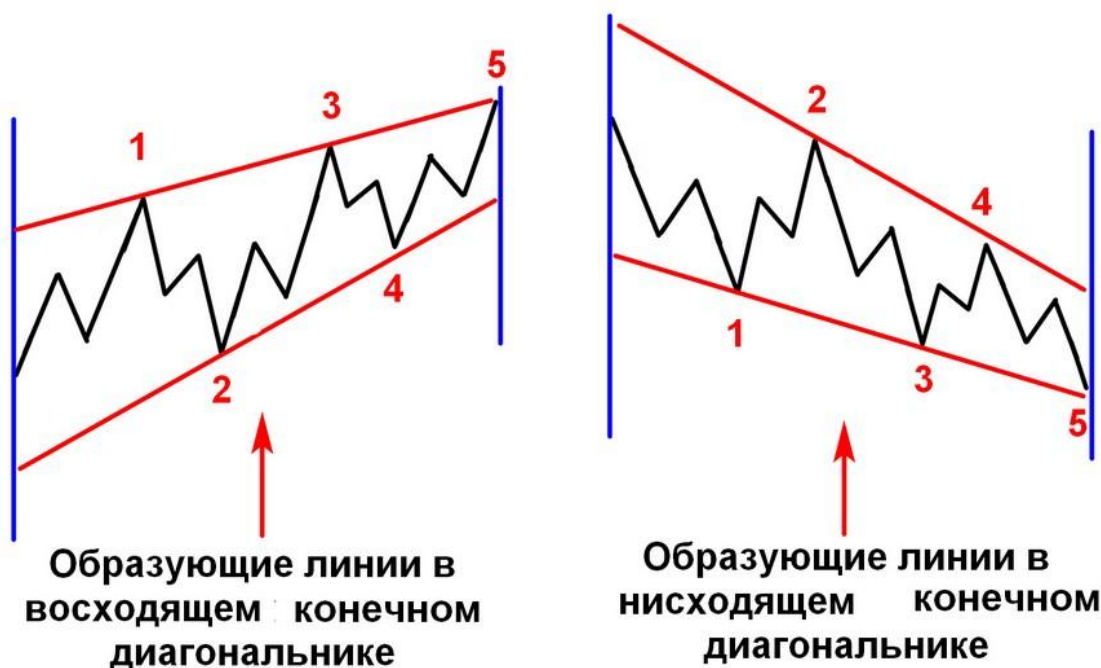


Рисунок 31.

На этом мы заканчиваем рассмотрение волн, формирующихся в движущем стиле и приступаем к рассмотрению волн, формирующихся в коррекционном стиле.

Коррекционные волны

Коррекционные волновые модели гораздо более разнообразны и сложны в изучении, чем движущие. Коррекционные волны подразделяются на ряд различных типов и имеют гораздо более сложную внутреннюю структуру, поэтому для них существует большее количество правил и указаний.

Далее мы рассмотрим 7 типов различных коррекционных волн и изучим правила и указания для них.

Зигзаг

Зигзаг стоит сразу после импульса по частоте появления на графике. Практически все коррекционные волны можно разбить на зигзаги, которые можно разложить до импульсов.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Поэтому, важно запомнить правила, так как сейчас мы будем разбирать наиболее популярную и самую часто встречающуюся коррекционную волну.

Для начала схематично отобразим зигзаг на рисунке 32.



Рисунок 32.

Правила формирования Зигзага:

1. Зигзаг состоит из 3 волн.
2. Волновая формула зигзага Д-К-Д.
3. Волна В < волны А.
4. Волна С, как правило, заходит за окончание волны А.

Указания:

1. Зигзаг, как правило, глубокая коррекция.
2. Волна А часто приблизительно равна волне С.
3. Зигзаг хорошо вписывается в канал.

Мы видим, что кроме правил, были записаны еще и указания. Чем указания отличаются от правил? Правила должны выполняться в 100% случаев, а указания – это лишь статистические закономерности. То есть, можно сказать, что указания выполняются в большинстве случаев, однако если в отдельно взятом случае какое-то указание не выполняется, это еще не значит, что структура волн определена неправильно.

Комментарии к правилам и указаниям:

Первое правило гласит, что зигзаг это трехволновая коррекция, состоящая из трех частей. Здесь следует отметить, что зигзаг, как и все остальные волны коррекционного стиля, подписывается буквами. Волна А зигзага формируется в движущем стиле, чаще всего она принимает форму импульса, но иногда она является начальным диагональником. Волна В всегда формируется в коррекционном стиле, а волна С обычно принимает форму импульса, но в редких случаях она может быть конечным диагональником.

Также хочется добавить, что, поскольку волна В формируется в коррекционном стиле, она сама может принять зигзагообразную форму.

Из правила 4 мы знаем, что волна С, как правило, заходит выше окончания волны А. Фраза: «как правило» означает, что в абсолютном большинстве случаев волна С заходит выше окончания А, но иногда она может быть усеченной.

Рассмотрим указания. Согласно первому указанию, зигзаг является глубокой коррекцией по отношению к предыдущему тренду. Глубокая коррекция – это такая коррекция, которая по своей величине больше 50% от предыдущей волны. На рисунке 33 изображена импульсная волна А и проведена горизонтальная линия через ее середину, она отделяет зону глубоких коррекций от зоны мелких коррекционных движений.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

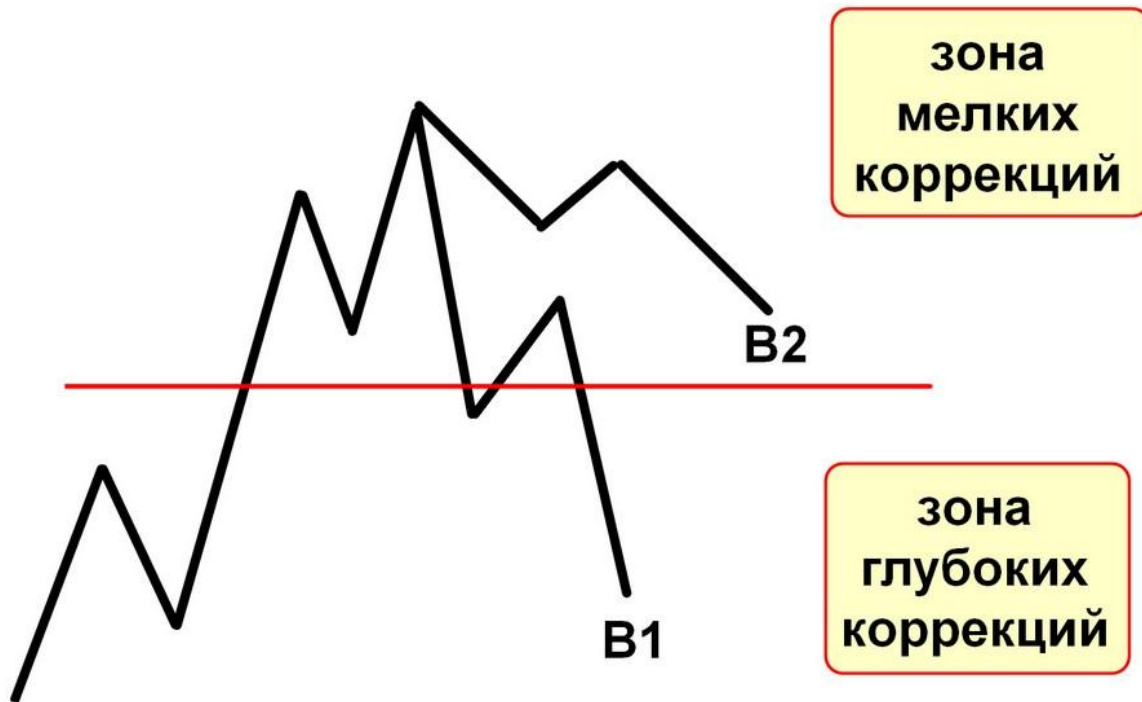


Рисунок 33.

Если коррекционная волна завершится ниже горизонтальной линии, значит коррекция считается глубокой. Например, на рисунке 33 волна B1 является глубокой коррекцией, а волна B2 является мелкой коррекцией по отношению к предыдущей восходящей волне А.

Со следующим указанием все просто. Очень часто величина волны С равна величине волны А. Иногда эти волны равны друг другу через коэффициент Фибоначчи. Другими словами, величина волны С может составлять, к примеру, 76.4% от волны А, 161.8% от волны А, либо могут быть использованы другие коэффициенты из последовательности Фибоначчи.

Последнее указание, которое гласит, что зигзаг обычно хорошо вписывается в канал, означает, что во время формирования зигзага можно построить канал и спрогнозировать точку завершения волны С. Приведем пример, чтобы показать, как это сделать.

Допустим рынок сформировал волны А и В восходящего зигзага, а развитие волны С только началось (смотри рисунок 34).

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

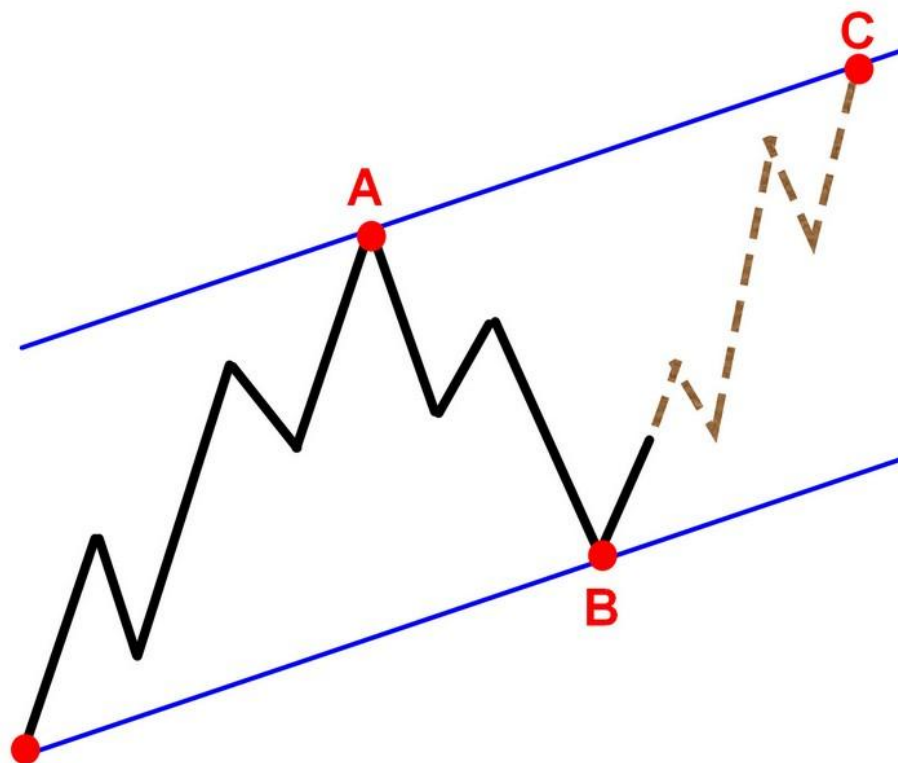


Рисунок 34.

В этот момент можно провести линию через точки начала волн А и С (на рисунке это нижняя синяя линия), затем эта линия копируется и проводится через точку окончания волны А (верхняя синяя линия). У нас получился синий канал, в котором движется зигзаг. Теперь, если продлить вверх волну С с таким же наклоном, как и у волны А до места пересечения с верхней границей синего канала, мы получим прогноз на счет величины волны С. Очень часто волна С завершается точно на границе такого канала. Это свойство зигзагов можно и нужно использовать для извлечения прибыли при торговле на финансовых рынках.

Теперь изобразим схему нисходящего зигзага на рисунке 35.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

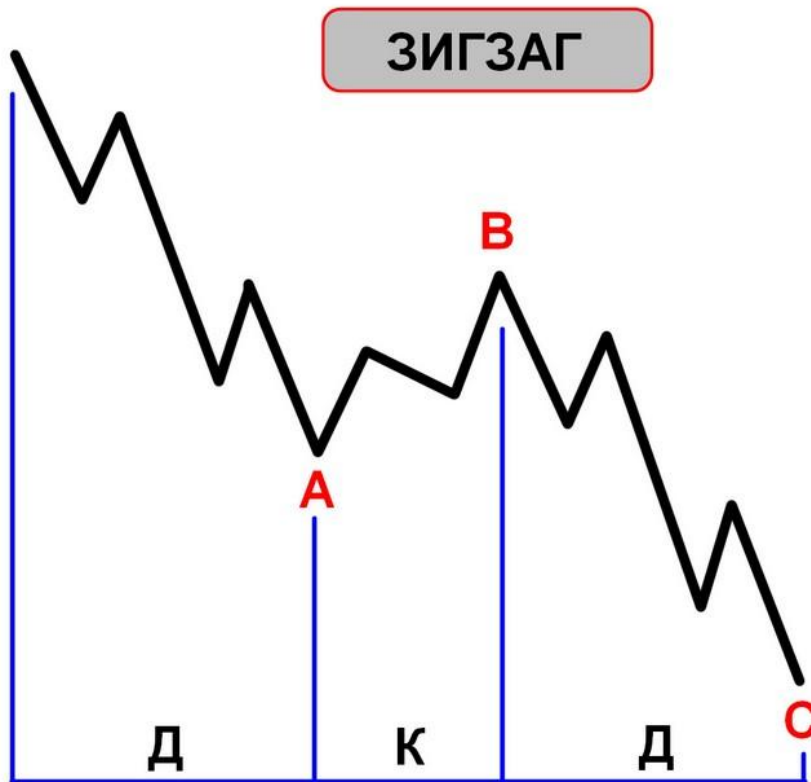


Рисунок 35.

Набор правил и указаний для нисходящего зигзага аналогичен.

Волновая плоскость

Волновая плоскость, как и зигзаг, является простой волновой моделью, состоящей лишь из трех подволн. И поскольку это простая модель, она очень часто встречается на ценовых графиках.

На рисунке 36 схематично изобразим волновую плоскость.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

ВОЛНОВАЯ ПЛОСКОСТЬ

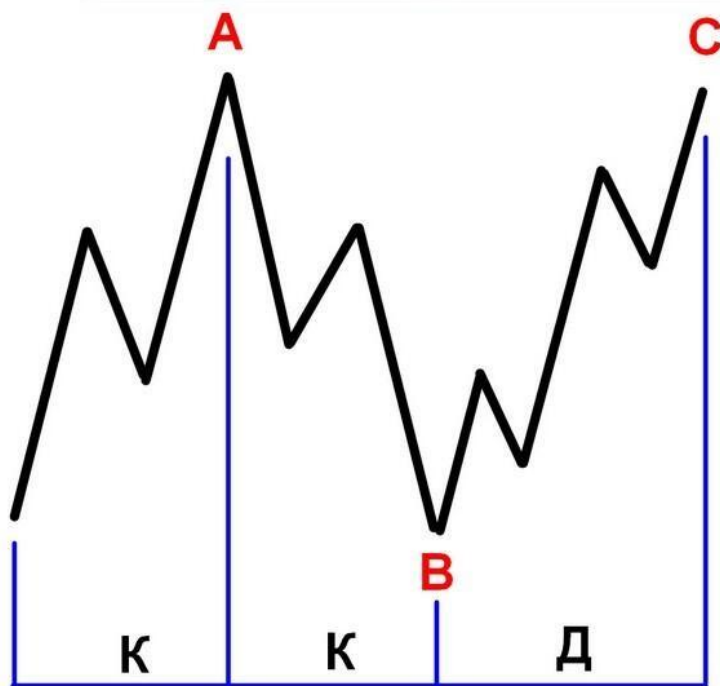


Рисунок 36.

Правила:

1. Состоит из 3 волн.
2. Волновая формула К-К-Д.
3. Волна В приблизительно равна волне А.

Указания:

1. Волновая плоскость – это, как правило, горизонтальная коррекция.
2. Существует 3 вида волновых плоскостей: стандартная, растянутая и сдвигающаяся.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Комментарии к правилам и указаниям:

Волна А волновой плоскости всегда формируется в коррекционном стиле, как и волна В. А вот волна С формируется в движущем стиле и чаще всего она принимает форму простого импульса. В редких случаях волна С принимает форму конечного диагональника. Эти свойства волновой плоскости отображены в ее волновой формуле: К-К-Д.

Что касается третьего правила, согласно которому волна В приблизительно равна волне А, то здесь можно отметить, что волна В может быть как немного больше волны А, так и немного меньше волны А, но в целом, т.к. волновая плоскость – это обычно горизонтальная коррекция, волна В формируется приблизительно такой же по величине, как и волна А.

Набор правил и указаний для нисходящей волновой плоскости аналогичен. На рисунке 37 схематично изображена нисходящая плоскость.



Рисунок 37.

Отец волнового анализа Ральф Нельсон Эллиотт выделял два вида плоскостей: стандартную, в которой все подволны приблизительно равны по величине, и нестандартную, где подволны могут сдвигаться относительно друг друга.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

А впоследствии, уже другой исследователь волнового анализа - Роберт Пректер, имея большой статистический материал, выделил три вида плоскостей. Здесь мы приведем классификацию плоскостей, которую предложил Роберт Пректер.

Первый вид плоскости – стандартная плоскость. Это такая плоскость, где все волны приблизительно равны по величине. На рисунке 38 в верхней части изображены стандартные плоскости для бычьего и для медвежьего рынков.

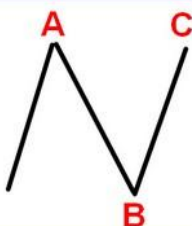
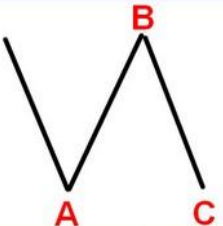
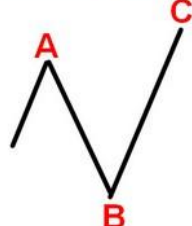
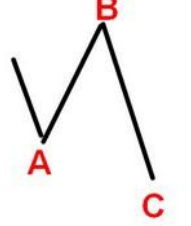
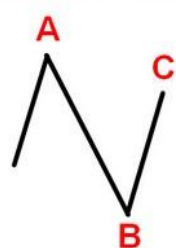
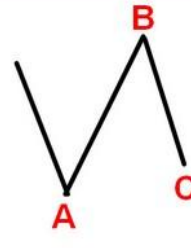
	МЕДВЕЖИЙ РЫНОК	БЫЧИЙ РЫНОК
СТАНДАРТНАЯ		
РАСТЯНУТАЯ		
СДВИГАЮЩАЯСЯ		

Рисунок 38.

Второй вид плоскости – растянутая плоскость. Растянутая плоскость – это такая фигура, где каждая последующая волна больше предыдущей. То есть, Волна В больше волны А, а волна С больше волны В. Модель как бы растягивается вверх и вниз во время построения. Такая фигура возникает, когда силы быков и медведей примерно равны и они тянут цену то вверх, то вниз, а волатильность увеличивается одновременно с этим, благодаря чему волны на рынке начинают иметь все больший размах. На рисунке 38 мы видим растянутые плоскости для бычьего и для медвежьего рынков.

И третий вид плоскости, это сдвигающаяся волновая плоскость. В такой плоскости волна В больше волны А, а волна С меньше волны В, поэтому получается сдвигающаяся модель.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Обычно такая модель формируется, когда на рынке сильны либо быки, либо медведи и они не дают сформироваться волне вбок, а сдвигают ее во время построения. На рисунке 38, в его нижней части, мы видим сдвигающиеся волновые плоскости для бычьего и для медвежьего рынков.

Таким образом, существует три вида плоскостей: стандартная, растянутая и сдвигающаяся. Это и отображено во втором пункте указаний.

Теперь уточним, чем же волновая плоскость отличается от зигзага. Зигзаг и волновая плоскость относятся к коррекционным волнам и обе эти фигуры состоят из трех подволн. Отличие их в том, что Волна А зигзага является движущей, а волна А волновой плоскости является коррекционной. И еще одно основное отличие заключено в том, что зигзаг – это, как правило, глубокая коррекция к предыдущему тренду, в рамках которой рынок может достаточно стремительно лететь вверх, либо вниз. А волновая плоскость – это боковая модель, и рынок двигается, как правило, в горизонтальном направлении во время построения этой волны.

Двойной зигзаг

Ранее мы изучили волны движущего стиля и начали разбираться с волнами коррекционного стиля. Мы рассмотрели простые коррекционные модели: зигзаг и волновую плоскость. Сейчас разберемся с тем, что такое двойной зигзаг в волновом анализе.

Как следует из названия, двойной зигзаг состоит из двух зигзагов, объединенных между собой волной-связкой (смотри рисунок 39).

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

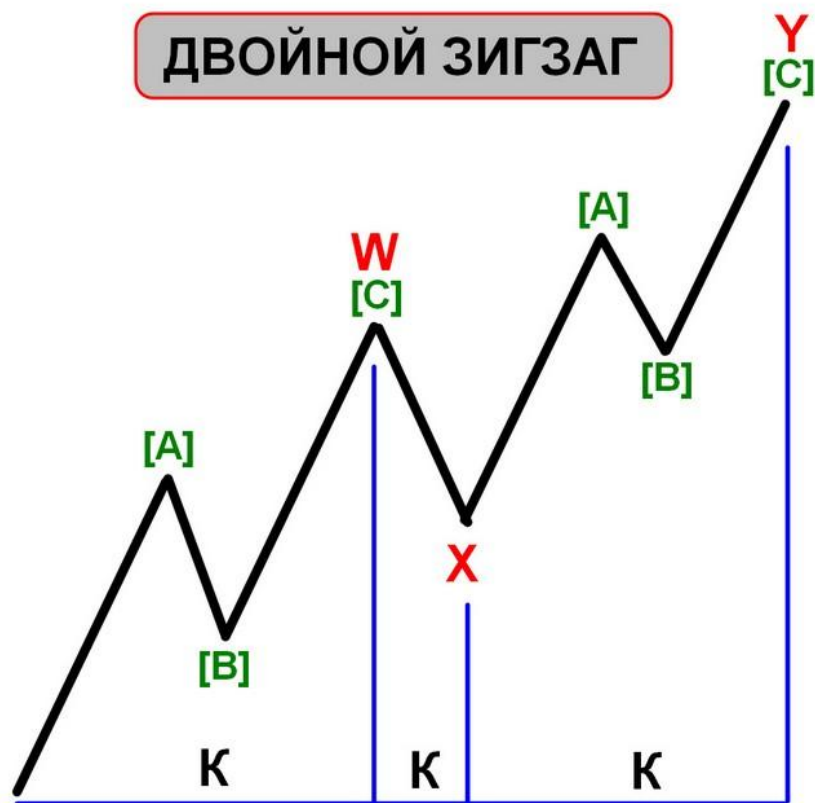


Рисунок 39.

Первый зигзаг обозначается буквой W, второй зигзаг обозначается буквой Y, а соединяет их между собой волна-связка X.

Буквами [A]-[B]-[C] подписаны подволны внутренней структуры зигзагов. Из рисунка 39 мы видим, что двойной зигзаг состоит из трех частей, которые формируются в коррекционном стиле. Поэтому запишем основные правила для двойных зигзагов.

Правила:

1. Состоит из 3 волн.
2. Волновая формула K-K-K, волны W и Y состоят из зигзагов.
3. Волна X < волны W.
4. Волна Y, как правило, больше волны X.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Указания:

1. Двойной зигзаг – глубокая коррекция.
2. Канал линейной регрессии.

Для нисходящего двойного зигзага набор правил и указаний аналогичен (смотри рисунок 40).

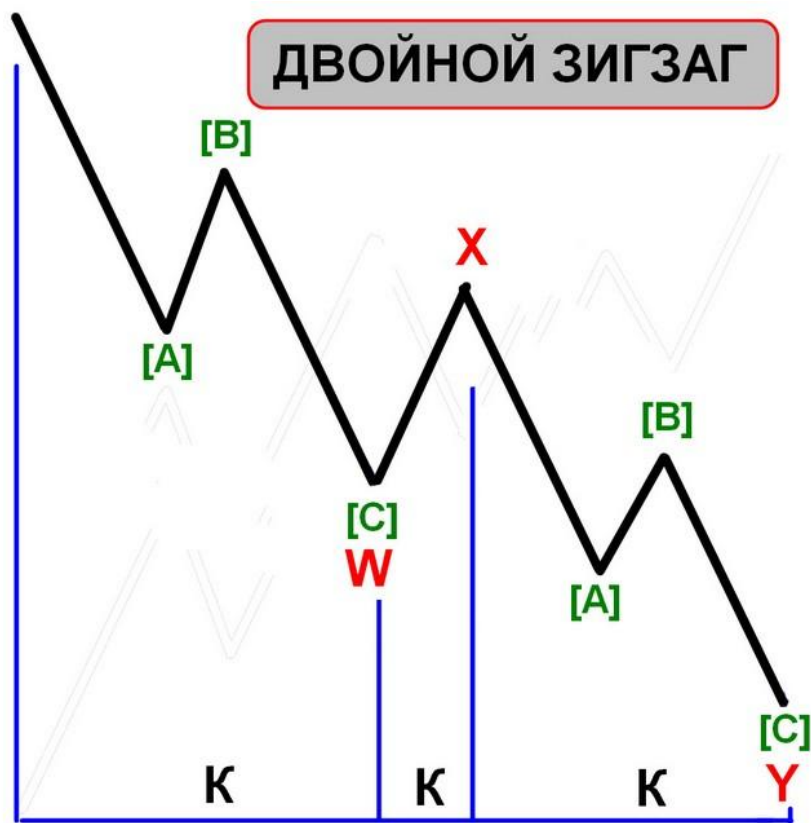


Рисунок 40.

Комментарии к правилам и указаниям:

Как и простой зигзаг, двойной зигзаг состоит из трех подволн, но на месте первой и третьей волны находятся не импульсы, а зигзаги. Поэтому в волновой формуле мы наблюдаем одни коррекционные волны. Волна X всегда меньше по своей величине, чем волна W, а вот волна Y в редких случаях может быть усеченной. Однако автор статьи встречал лишь несколько десятков случаев усеченных двойных зигзагов за все 9 лет занятий волновым анализом.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Теперь поговорим об указаниях. Вы уже знаете, что такое глубокая коррекция по отношению к предыдущему тренду. Согласно первому указанию, двойной зигзаг является глубокой коррекцией к предыдущему тренду. Хочу обратить внимание на то, что двойной зигзаг обычно появляется на графике тогда, когда простой одинарный зигзаг не справляется с задачей создать коррекцию должной величины. Схематично изобразим такую ситуацию на рисунке 41.

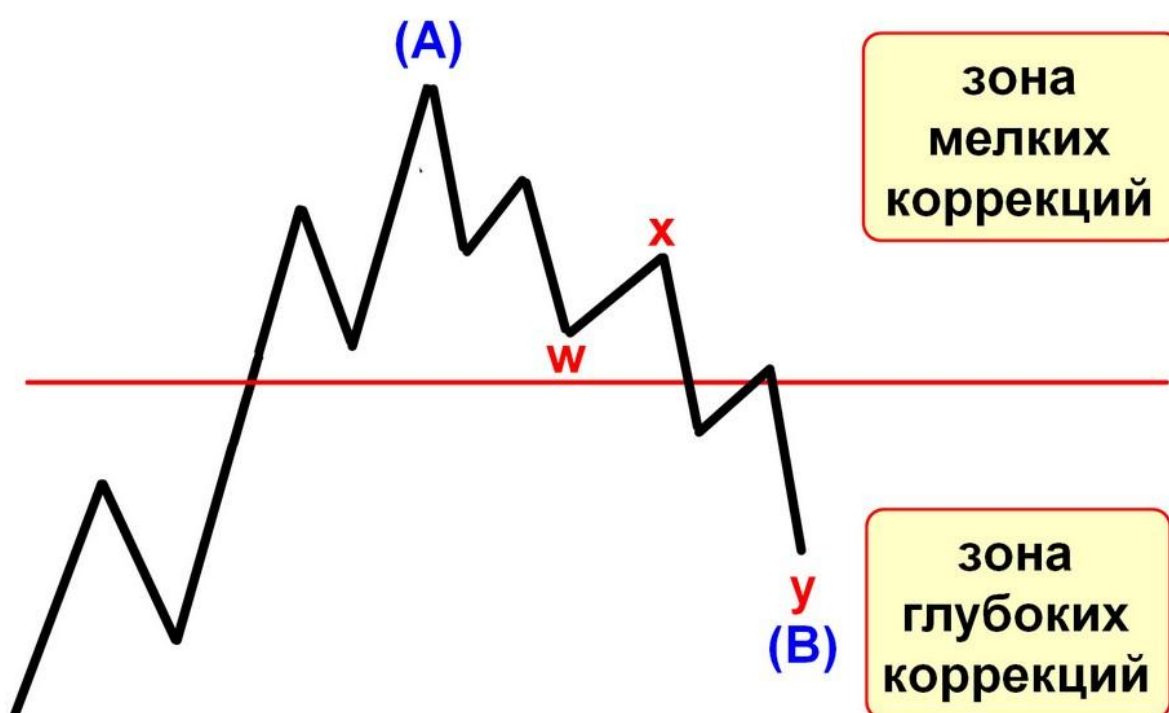


Рисунок 41.

Мы видим, что после завершения восходящего тренда (А), рынок начал формировать нисходящую коррекцию (В), первая часть которой приняла форму зигзага W. Однако, поскольку этот зигзаг не достиг зоны глубоких коррекций и завершился выше горизонтальной линии, отделяющей зону глубоких коррекций от зоны мелких коррекций, на помощь ему пришел второй зигзаг. То есть, была построена небольшая восходящая волна-связка X, после чего рынок сформировал второй зигзаг Y, который и сформировал коррекцию требуемой величины.

Таким образом, двойной зигзаг формируется в тех случаях, если одинарный зигзаг не справился с задачей сформировать глубокую коррекцию. Это свойство двойных зигзагов,

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

конечно же, можно использовать в трейдинге. Если после какого-либо тренда мы увидели коррекцию, которая приняла форму простого зигзага, однако эта коррекция не достигла значения 50% от предыдущей волны, значит можно ожидать построения небольшой волны-связки и затем формирования второго зигзага.

Что касается второго указания, то этот момент является личным наблюдением автора. Было обнаружено, что двойные зигзаги очень хорошо вписываются в канал линейной регрессии. Такой канал можно построить в любой программе по техническому анализу, так как это достаточно популярный инструмент. Канал состоит из трех линий, центральная линия, или центральная ось, рассчитывается по методу наименьших квадратов, затем, параллельно ей и на одинаковом расстоянии от нее проводятся еще две линии, которые хорошо описывают поведение двойного зигзага.

Если вы распознали на рынке первую часть двойного зигзага, например волны W и X (смотри рисунок 42), то можете построить на этом участке канал линейной регрессии, и если продлить его линии дальше, то можно спрогнозировать, в каких рамках будет двигаться волна Y.

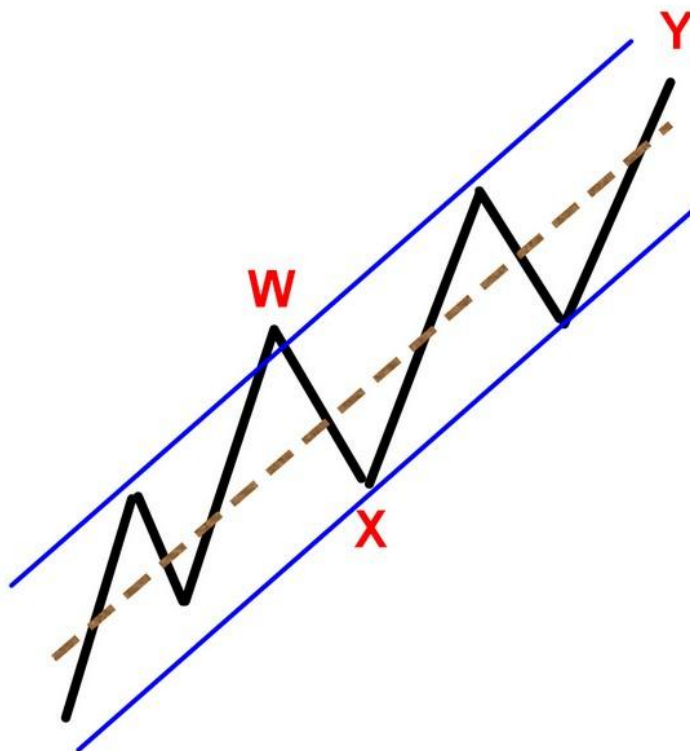


Рисунок 42.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Такое свойство двойных зигзагов очень удобно использовать в трейдинге. Например, можно открывать длинные позиции вблизи нижней границы канала линейной регрессии, а закрывать их вблизи верхней границы такого канала.

Тройной зигзаг

Как следует из названия модели, тройной зигзаг состоит из трех зигзагов, объединенных между собой волнами-связками.

На рисунке 43 изображена схема тройного зигзага.

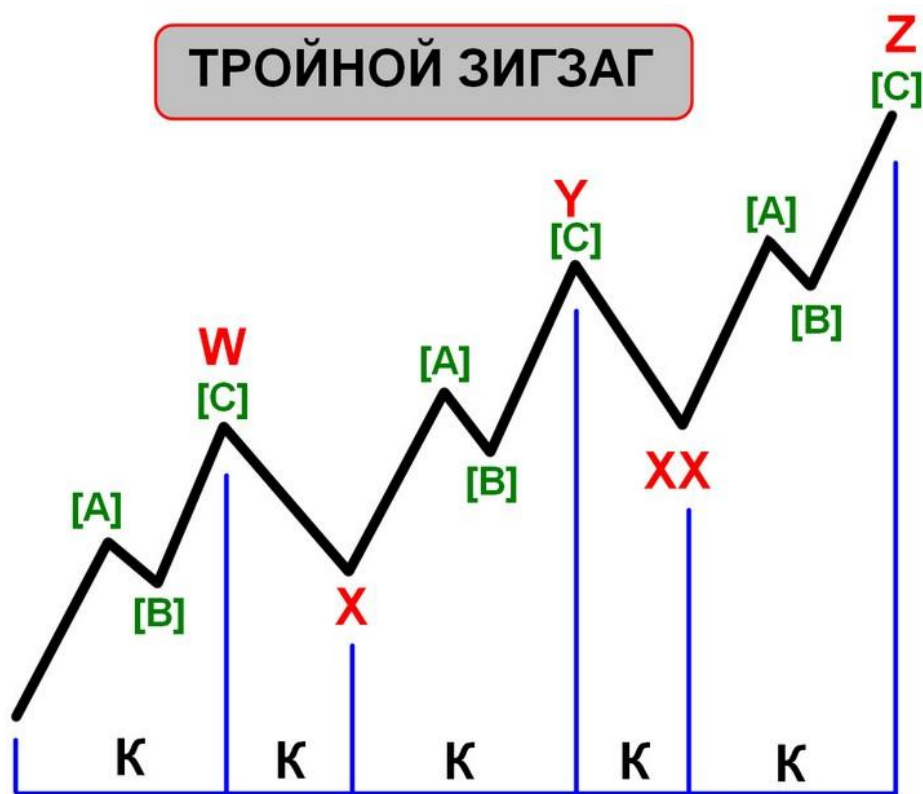


Рисунок 43.

Мы видим первый зигзаг W, второй зигзаг Y и третий зигзаг Z. И объединяют их между собой волны-связки X и XX. Волны-связки подписываются разными буквами – X и XX, чтобы исключить путаницу. На практике это очень удобно. Сами волны W, Y и Z имеют форму зигзагов, поэтому их внутренняя структура подписывается буквами [A]-[B]-[C], как мы видим на рисунке 43.

Правила:

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

1. Состоит из 5 волн.
2. Волновая формула К-К-К-К-К. W, Y, Z – как правило, зигзаги.
3. Волна X < волны W.
4. Волна Y заходит за окончание волны W.
5. Волна XX < волны Y.
6. Волна Z, как правило > волны XX.

Указания:

1. Глубокая коррекция.
2. Канал линейной регрессии.

Комментарии к правилам и указаниям:

Правила для тройных зигзагов сходны с правилами для двойных зигзагов с той лишь разницей, что в составе тройного зигзага присутствует дополнительная волна-связка XX и еще один зигзаг Z. Так же, следует помнить, что волны W, Y и Z тройного зигзага обычно сами принимают форму простых зигзагов. Слово: «обычно» означает, что в некоторых случаях эти волны могут принимать форму двойных или тройных зигзагов, но никогда эти волны не могут быть другими коррекционными моделями. Если кратко, то эти волны могут быть только зигзагами или их комбинациями.

Что касается указаний, то указания для тройных зигзагов полностью сходны с указаниями для двойных зигзагов. Тройные зигзаги являются глубокими коррекциями. Они формируются тогда, когда с задачей – сформировать глубокий откат к предыдущему тренду – не справляется ни одинарный, ни двойной зигзаги. Тогда на помощь приходит третий зигзаг Z, который присоединяется к уже построенной конструкции при помощи волны-связки XX.

Поведение тройного зигзага очень хорошо описывает канал линейной регрессии. Он строится, когда уже были построены волны W, X и Y. В этом случае достаточно легко спрогнозировать точку окончания волны-связки XX и точку завершения финального зигзага Z (смотри рисунок 44).

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

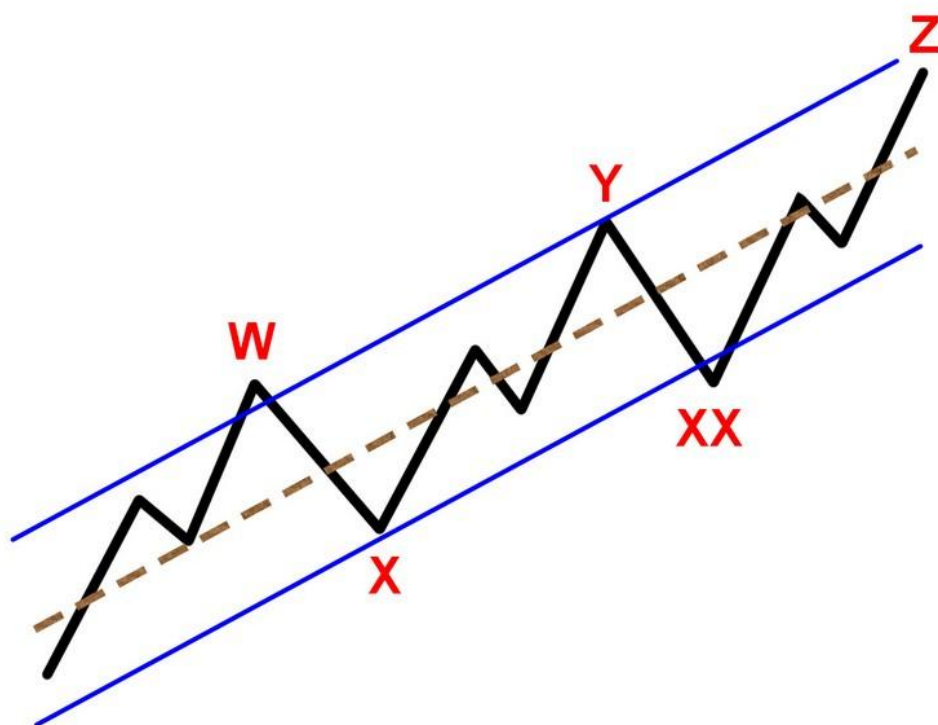


Рисунок 44.

А иногда можно пойти от обратного, если не совсем ясно, какая модель формируется, но мы видим, что она хорошо вписывается в канал линейной регрессии, можно предположить, что рынок производит построение двойного или тройного зигзага. И уже из этого делаются соответствующие выводы.

Набор правил и указаний для нисходящего тройного зигзага аналогичен. Схема нисходящего тройного зигзага показана на рисунке 45.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

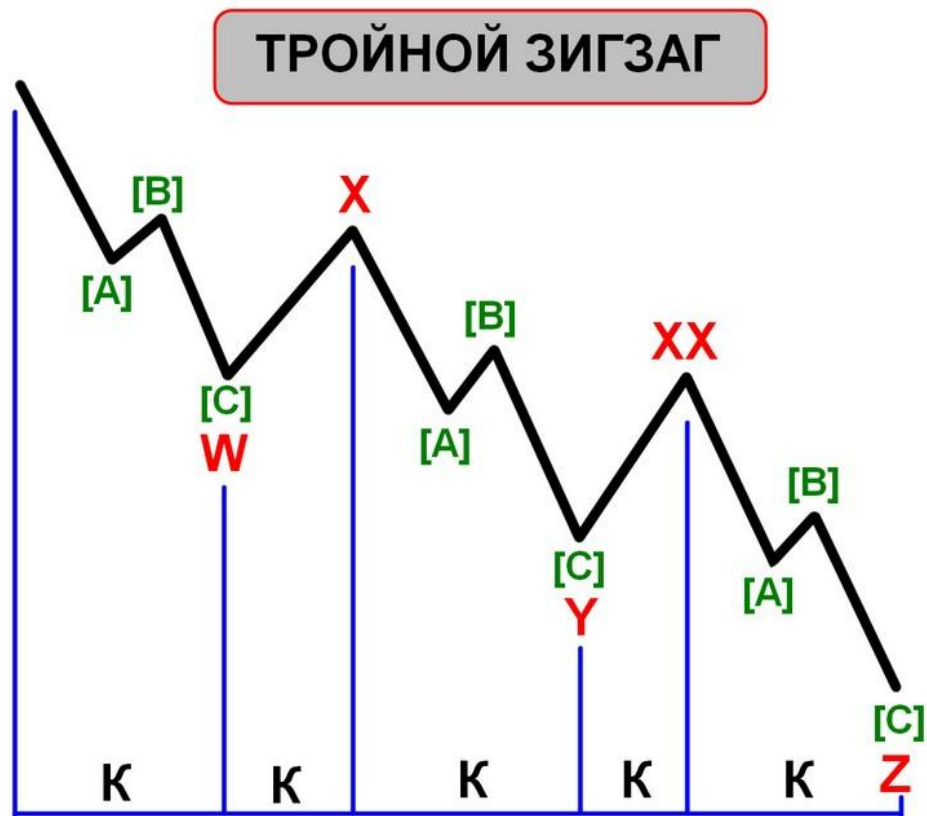


Рисунок 45.

Двойная тройка

В этой части статьи мы приступаем к изучению горизонтальных коррекционных волн. Начнем с двойной тройки.

Для начала схематично изобразим двойную тройку на рисунке 46.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер



Рисунок 46.

Как следует из названия, двойная тройка состоит из двух троек, объединенных между собой коррекционной волной связкой. Тройка – это еще одно название волны, формирующейся в коррекционном стиле. Первая тройка обозначается буквой W, вторая тройка буквой Y, а волна-связка, их соединяющая, буквой X. Как мы видим, маркировка совпадает с маркировкой двойного зигзага, однако эти две волны не нужно путать. Рассмотрим правила для двойных троек.

Правила:

1. Состоит из 3 волн.
2. Волновая формула К-К-К.
3. Волна W – не треугольник.

Указания:

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

1. Неглубокая коррекция.
2. Длительная коррекция.
3. Наклон против тренда.

Комментарии к правилам и указаниям:

Несмотря на то, что маркировка двойной тройки совпадает с маркировкой двойного зигзага, эти две волны разительно отличаются друг от друга по характеру и своим свойствам. Главное отличие заключается в том, что двойной зигзаг – это глубокая и стремительная коррекционная волна, а двойная тройка – это неглубокая и горизонтальная коррекция. Обычно двойная тройка формирует откат к предыдущему тренду не более 36%. Так же, волны W и Y двойного зигзага сами являются зигзагами или их комбинациями, а волны W и Y двойной тройки могут принимать форму любых коррекционных моделей. Исключение составляет волна W, которая не может принять форму треугольника (С треугольниками мы познакомимся позднее).

Двойная тройка, это длительная коррекционная волна. На рынке наблюдается следующая закономерность касательно коррекционных волн: чем менее глубокая коррекция по величине, тем она получается более длительной. В противоположность этому, чем глубже формируется коррекция по величине, тем она менее длительная по времени построения. Это свойство проиллюстрировано на рисунке 47.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

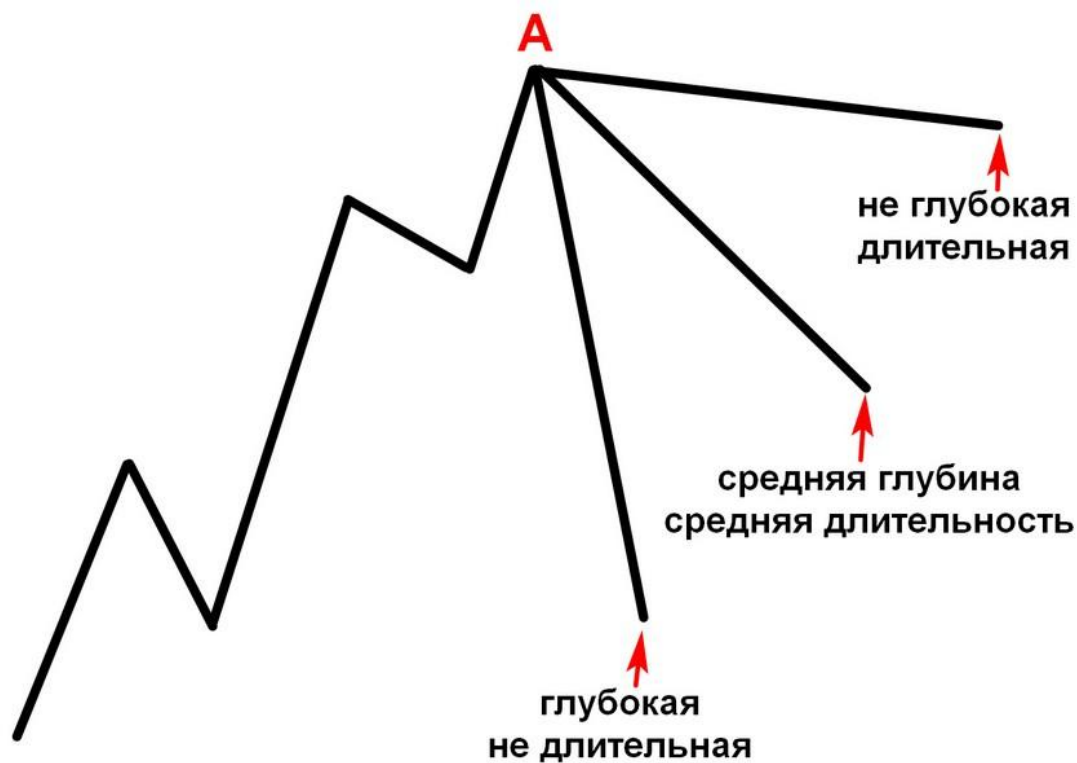


Рисунок 47.

На этом рисунке показан восходящий тренд А, к которому началось развитие коррекционной волны. Здесь показано три варианта нисходящей коррекции. Первая волна, глубокая по величине и недлительная по времени построения. Вторая волна имеет среднюю глубину, и потому длительность ее построения тоже возрастает. Эта волна имеет среднюю глубину и среднюю длительность. И самая верхняя коррекционная волна очень мелкая по глубине, но очень длительная по времени своего построения.

Это свойство рекомендуется использовать в трейдинге для прогнозирования величины коррекционной волны. Если мы видим, что рынок формирует неглубокую коррекцию, значит можно ожидать, что по времени построения она будет формироваться достаточно долго. В противоположность этому, чем стремительнее рынок корректируется в коррекционной волне, тем менее длительной будет эта волна по времени построения и тем более крупных коэффициентов по линиям Фибоначчи достигнет коррекционная волна.

Еще одно свойство двойной тройки, которое хотелось бы рассмотреть - ее наклон. Двойная тройка обычно имеет наклон против предыдущего тренда. Например, если рынок двигался в восходящем направлении, и после завершения этого тренда началось развитие двойной

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

тройки, то такая двойная тройка будет иметь наклон вниз. Это свойство продемонстрировано на рисунке 48.

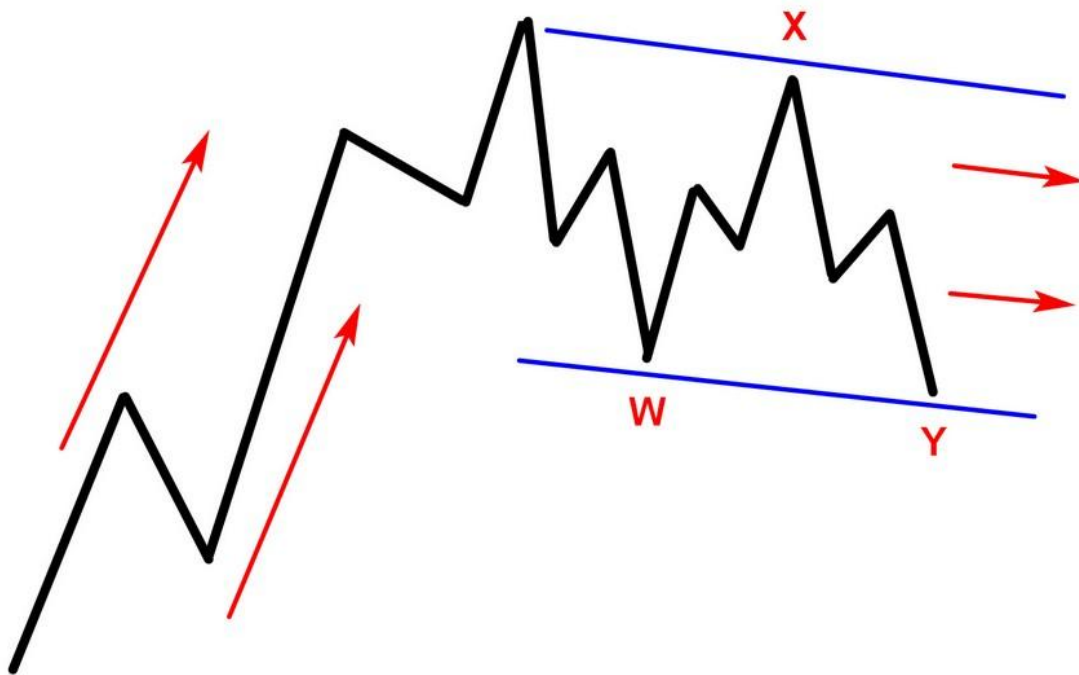


Рисунок 48.

Наклон двойной тройки определяется по наклону образующих линий, проведенных через вершины модели.

Если же двойная тройка формируется после нисходящего тренда, обычно она имеет наклон вверх.

Добавим, что двойные тройки очень часто формируются на месте четвертых волн-импульсов.

Что касается набора правил и указаний для нисходящей двойной тройки, то они аналогичны набору правил для восходящей модели. Схематично нисходящая двойная тройка показана на рисунке 49.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер



Рисунок 49.

Это еще далеко не все необходимые знания для проведения волнового анализа рынка Форекс на сегодня, завтра и каждый последующий день. В следующей части статьи перейдем к изучению тройной тройки, еще одной горизонтальной коррекционной модели.

Тройная тройка

Главное отличие тройной тройки от двойной состоит в том, что двойная тройка состоит из трех подволн W-X-Y, а тройная тройка состоит из пяти подволн W-X-Y-XX-Z.

Все подволны тройной тройки формируются в коррекционном стиле и могут принимать форму любых коррекционных моделей, кроме специально оговоренных случаев. На рисунке 50 схематично представлена тройная тройка.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

ТРОЙНАЯ ТРОЙКА

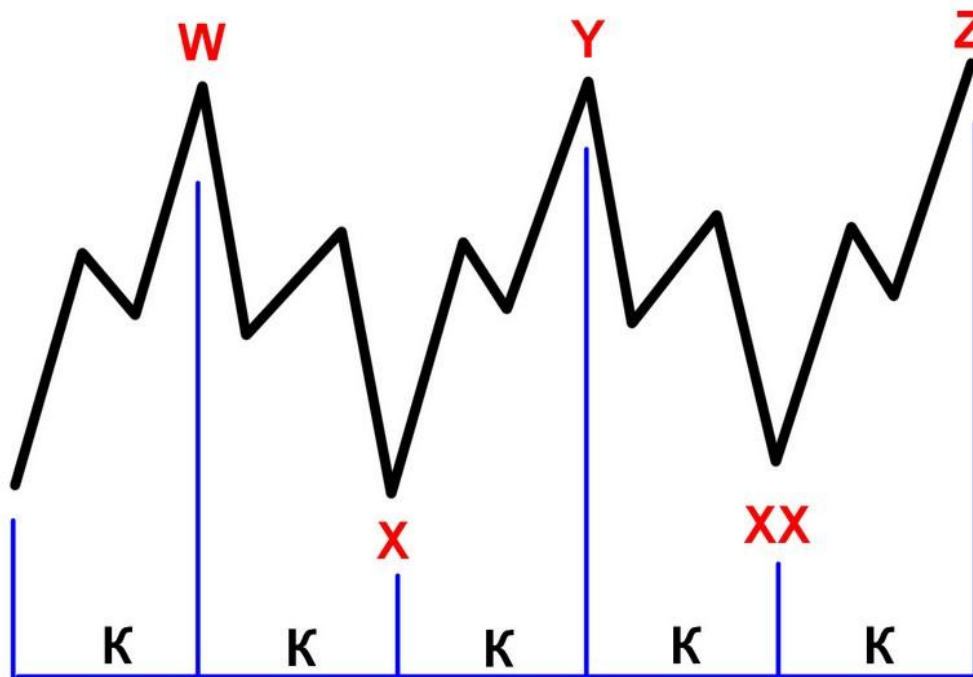


Рисунок 50.

Мы видим, что эта волна состоит из трех троек: W, Y и Z, которые объединяют между собой коррекционные волны-связки X и XX. Запишем правила и указания для тройной тройки.

Правила:

1. Состоит из 5 волн.
2. Волновая формула К-К-К-К-К.
3. Волны W, X, Y – не треугольники.

Указания:

1. Неглубокая коррекция.
2. Длительная коррекция.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

3. Наклон против тренда.

Набор правил и указаний для нисходящей тройной тройки, которая изображена на рисунке 51, аналогичен.

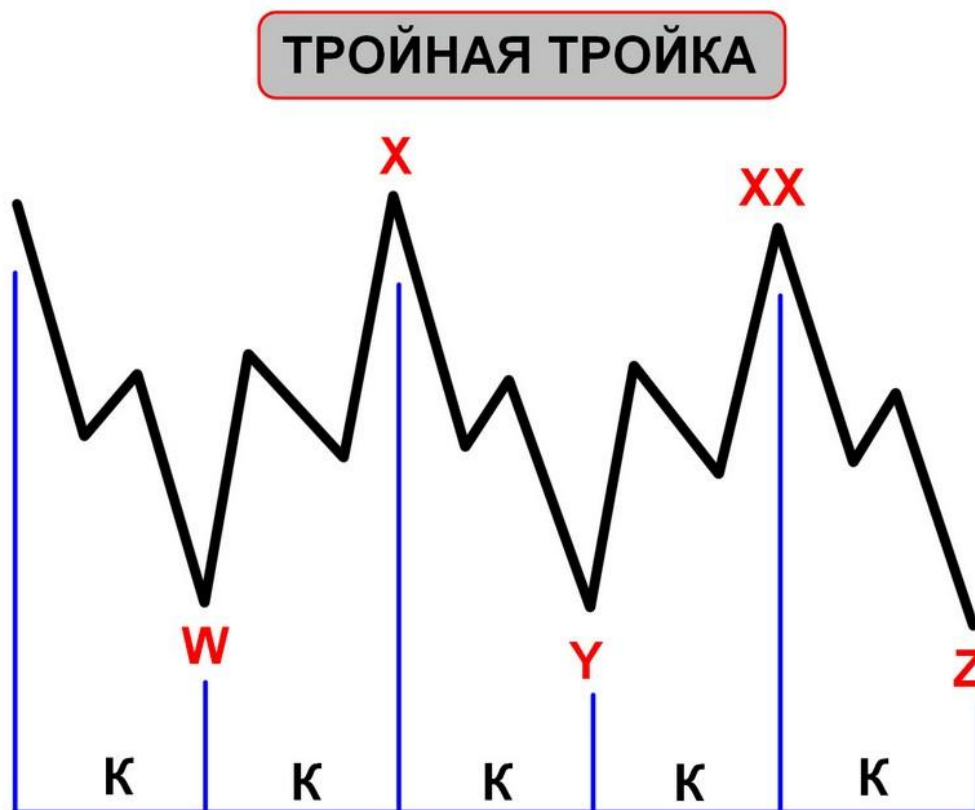


Рисунок 51.

Комментарии к правилам и указаниям:

Правила и указания для двойных и тройных троек практически совпадают. Отличия только в количестве волн и в том, что в тройной тройке волны W, X и Y не могут быть треугольниками. Но это происходит также из-за количества волн, так как треугольники всегда появляются на месте последней либо предпоследней волны в модели старшего уровня.

Тройная тройка, как и двойная, как правило является неглубокой коррекцией по отношению к предыдущему тренду, достигающему значения не более 36% от предыдущей волны.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Тройная тройка обычно является длительной коррекцией. То есть, сила рынка при построении этой волны уходит не в глубину, а в формирование длительной боковой конструкции. Причем, рынок начинает формировать тройную тройку тогда, когда была построена боковая коррекция, принявшая форму двойной тройки, но не было достигнуто требуемое значение по длительности коррекции. У рынка еще остались силы на построение коррекционной волны, поэтому начинается формирование третьей части, и так появляется конструкция, которая называется тройной тройкой.

Третье указание гласит, что тройная тройка наклоняется в сторону противоположную предыдущему тренду. То есть, если до тройной тройки мы видели восходящее направление тренда, то тройная тройка с большой вероятностью сформируется с нисходящим наклоном.

Если же тренд был направлен вниз, то тройная тройка сформируется с небольшим восходящим уклоном. Это свойство тройной тройки полезно запомнить, так как это облегчает идентификацию данной модели на графике.

Добавлю, что тройная тройка обычно имеет очень сложную внутреннюю структуру. Некоторые части тройной тройки иногда сами могут принимать форму тройной тройки, поэтому торговать внутри этой модели достаточно сложно, поскольку рынок практически никак не ограничен правилами.

Поэтому, если вы идентифицируете данную модель на графике, то лучше оставаться вне рынка до ее завершения, либо можно перейти на другие волновые уровни – разбить тройную тройку на отдельные небольшие тренды и торговать внутри них, либо наоборот уменьшить масштаб графика, чтобы тройная тройка приняла форму лишь небольшой коррекции в рамках более крупного тренда.

Горизонтальный треугольник

Многие знают, как выглядят треугольники из обычного технического анализа. Однако волновой анализ содержит гораздо более подробное описание того, как устроены эти волны и где они могут появляться. Обычно, появление треугольника несет за собой хорошую торговую возможность, так как эта модель легко различима на ценовом графике, и после ее завершения рынок обычно стремительно летит в том же направлении, в котором он двигался до появления треугольника. Это свойство очень удобно использовать в трейдинге.

Все треугольники состоят из пяти подволн, которые обозначаются буквами А, В, С, D и E. Существуют различные типы этих моделей. Все они отличаются друг от друга наклоном образующих линий. Поэтому, прежде чем мы начнем разбирать, какие треугольники встречаются в рынке, мы научимся строить образующие линии.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Чтобы понять, как строятся образующие линии, нарисуем треугольник, состоящий из волн A-B-C-D-E (смотри рисунок 52), и проведем образующие линии от начала до конца модели через вершины волн A и C и через вершины волн B и D.

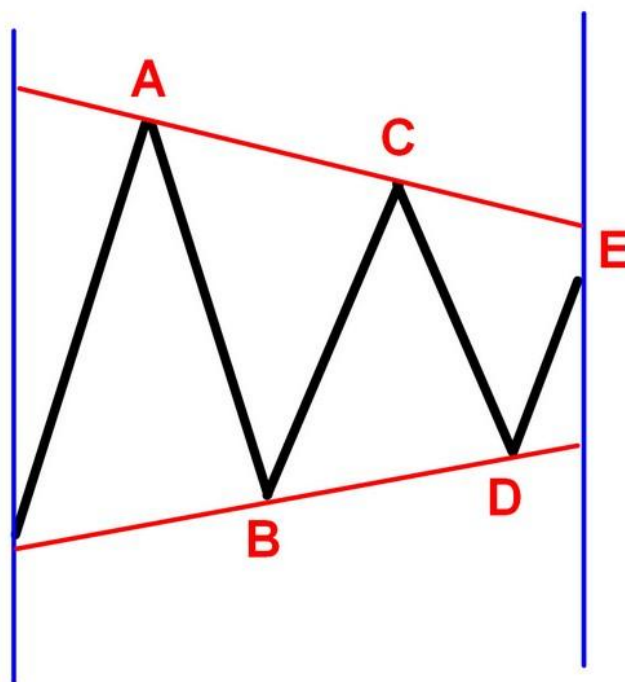


Рисунок 52.

По такому алгоритму проводятся образующие линии во всех типах треугольников.

Теперь, когда мы научились строить образующие линии, можно привести классификацию треугольников. Треугольники могут быть горизонтальными и наклонными. В этой части статьи мы изучим горизонтальные треугольники.

Горизонтальные треугольники могут быть сходящимися и расходящимися. В сходящихся треугольниках образующие линии, если их мысленно продлить вперед, будут сходиться. Изобразим схематично горизонтальный сходящийся треугольник для медвежьего и бычьего рынков на рисунке 53.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

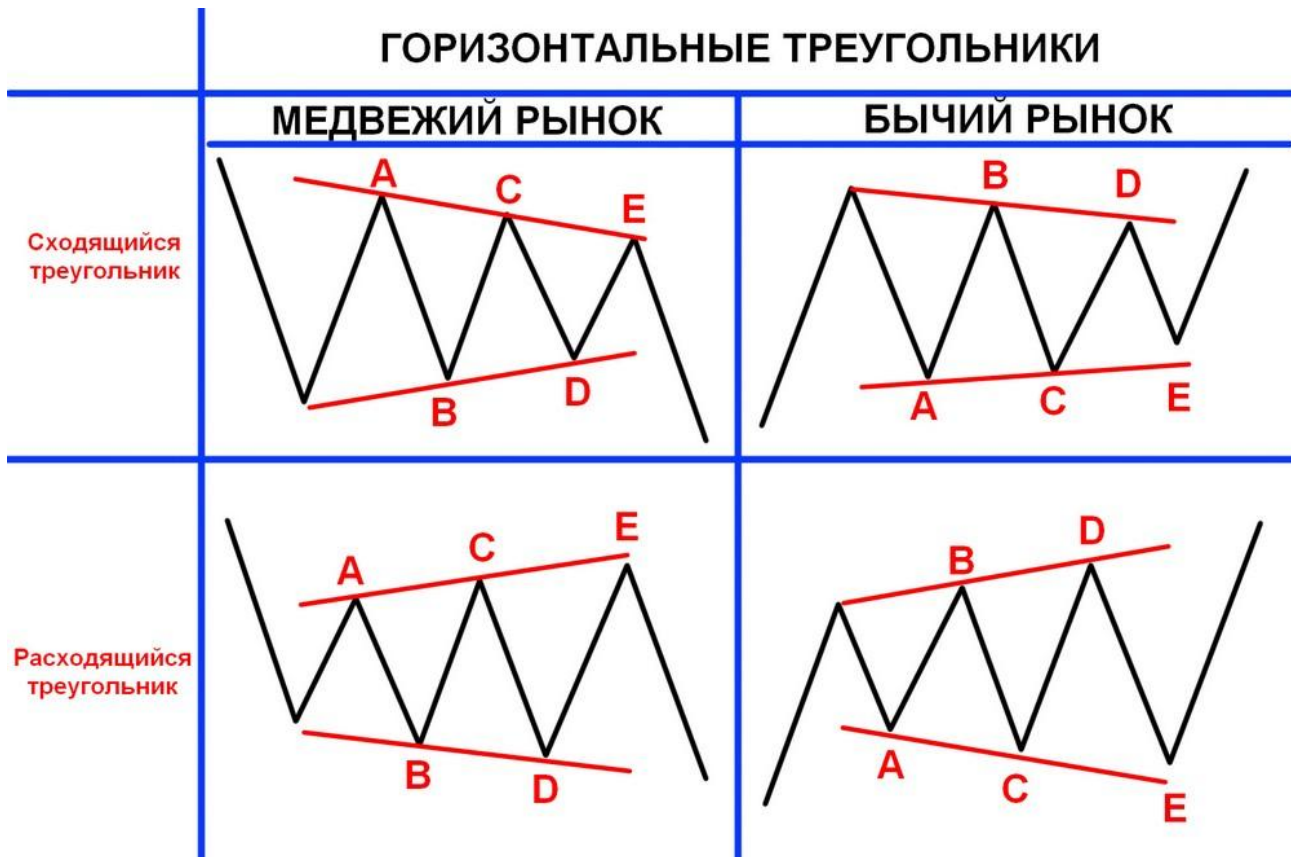


Рисунок 53.

Мы видим, что верхняя образующая линия такого треугольника наклонена вниз, а нижняя образующая наклонена вверх, эти линии сходятся, поэтому такой треугольник называется сходящимся.

В нижней строке на рисунке 53 приведены примеры расходящегося горизонтального треугольника для бычьего и для медвежьего рынков. Мы видим, что верхняя образующая линия такого треугольника направлена вверх, а нижняя образующая смотрит вниз, то есть, линии расходятся и смотрят в разные стороны.

Важный момент: одна из образующих линий сходящегося или расходящегося треугольника может быть горизонтальной.

Теперь рассмотрим набор правил для горизонтальных треугольников. Для начала разберем наиболее популярный тип горизонтального треугольника – сходящийся горизонтальный треугольник.

Правила для сходящегося горизонтального треугольника:

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

1. Состоит из 5 волн.
2. Волновая формула К-К-К-К-К.
3. Волна В – любая по величине.
4. Волна С < волны В.
5. Волна D < волны С.
6. Волна Е < волны D.
7. Может быть на месте предпоследней или последней волны в модели старшего уровня.

Указания для сходящегося горизонтального треугольника:

1. Неглубокая коррекция.
2. Длительная коррекция.

Комментарии к правилам и указаниям для сходящегося горизонтального треугольника:

Сходящийся горизонтальный треугольник состоит из 5 волн, и все они формируются в коррекционном стиле. Однако есть некоторые наблюдения относительно типов этих волн. По крайней мере 3 из 5 волн такого треугольника являются зигзагами, то есть простыми волновыми моделями. По крайней мере одна из волн треугольника принимает форму сложной коррекционной модели, например, двойной или тройной тройки.

Третье правило гласит, что волна В может быть любой по величине. Это означает, что волна В может быть как больше волны А, так и меньше волны А. В случае, если волна В формируется больше волны А, такой треугольник называют бегущим. С правилами 4, 5 и 6 все просто, они указывают на величины волн друг относительно друг друга.

Что касается седьмого правила, согласно которому треугольник может появляться только на месте предпоследней или последней волны в модели старшего уровня, его можно расшифровать следующим образом: треугольник не может появиться на месте волны 2 импульса, так как эта волна не является предпоследней или последней волной в импульсе,

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

но он может появиться на месте волны 4 импульса, так как эта волна является предпоследней частью. По аналогии с этим можно сказать, что треугольник может появиться на месте волны В зигзага, волны В волновой плоскости, волны X двойного зигзага или волн X и Y двойной тройки. Так же он может быть на месте волн XX и Z тройной тройки или на месте волны D или E в треугольнике.

По поводу указаний можно дать следующие комментарии:

Треугольник всегда является неглубокой коррекцией к предыдущему тренду, и его величина редко достигает 36% по линиям Фибоначчи от предыдущей волны. Поскольку треугольник является неглубокой коррекцией, у рынка остается много сил, которые нужно где-то реализовать. Сила рынка уходит в построение длительной фазы коррекции, поэтому треугольники – это всегда длительные коррекционные волны.

Теперь приведем набор правил для расходящегося горизонтального треугольника.

Правила для расходящегося горизонтального треугольника:

1. Состоит из 5 волн.
2. Волновая формула К-К-К-К-К.
3. Волна В – любая по величине.
4. Волна С > волны В.
5. Волна D > волны С.
6. Может быть на месте предпоследней волны, либо последней волны в тройках и треугольниках.

Указания для расходящегося горизонтального треугольника:

1. Неглубокая коррекция.
2. Длительная коррекция.

В принципе, наборы правил для сходящихся и расходящихся горизонтальных треугольников похожи. Основная разница заключена в величинах волн относительно друг друга, что и

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

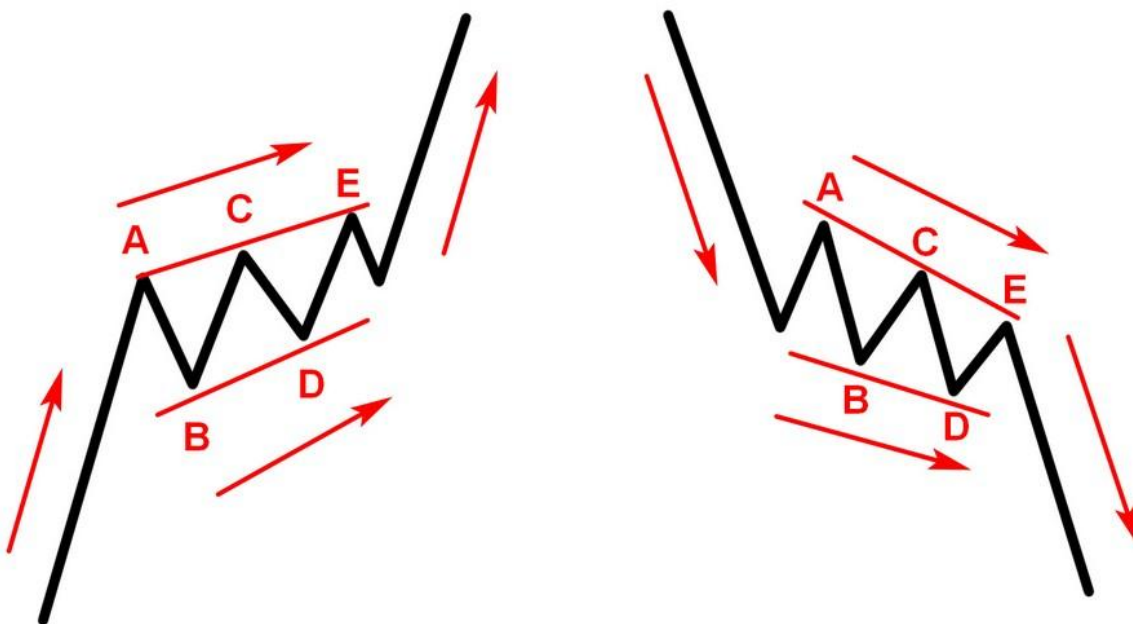
отражено в пунктах 3, 4 и 5. В остальном, правила, указания и места появления этих моделей схожи.

Наклонный треугольник

Эта модель была открыта совсем недавно по меркам истории волнового анализа. Около 10 лет назад Российские специалисты по волновому анализу нашли и опубликовали эту модель на одном из популярных форумов. Затем Дмитрий Возный, автор книги «Код Элليотта» опубликовал цикл статей, посвященных этой модели, после чего провел переписку с одним из наиболее авторитетных мировых специалистов по волновому анализу Робертом Пректером (Роберт Пректер, автор книги «Волновой принцип Эллиотта»). Пректер согласился с открытием новой модели и ей было дано название. На английском языке модель называется Skewed triangle.

Наклонный треугольник отличается от горизонтального тем, что обе его образующие линии имеют наклон в одну сторону – либо вверх, либо вниз.

На рисунке 54 приведены примеры наклонных треугольников для медвежьего и бычьего рынков.



Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Рисунок 54.

Обратим внимание на один очень важный момент: образующие линии наклонного треугольника всегда имеют наклон в направлении доминирующего тренда. Не бывает такого, что тренд восходящий, а образующие линии смотрят вниз, или же наоборот, тренд направлен вниз, а образующие линии наклонного треугольника смотрят вверх.

Чтобы проиллюстрировать вышесказанное приведем следующий пример. Нарисуем восходящий зигзаг, волна В которого принимает форму вот такой волны, похожей на наклонный треугольник (смотри рисунок 55).

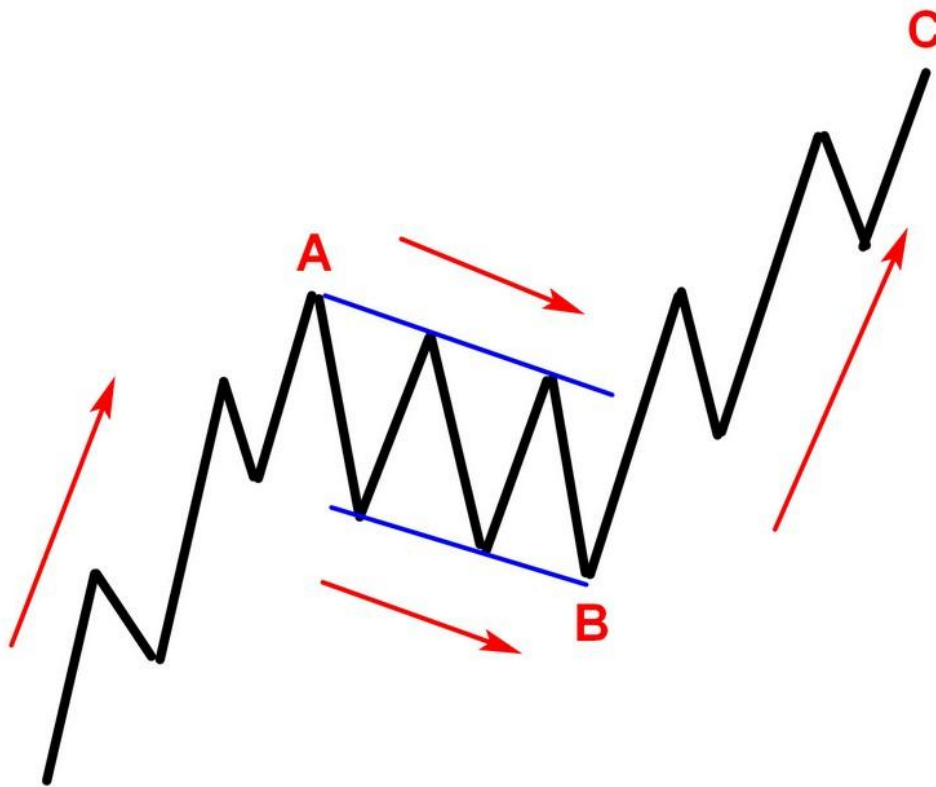


Рисунок 55.

Мы видим, что тенденция направлена в восходящем направлении, а образующие линии коррекционной фигуры направлены вниз. Если мы обозначим такую модель треугольником А-В-С-Д-Е, то это будет ошибкой. Модель, которая является боковой коррекцией, состоит из пяти подволн и имеет наклон против доминирующего тренда, является тройной тройкой и обозначается буквами W-X-Y-XX-Z.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Все вышесказанное очень важно запомнить, так как новички, да и не только новички, совершают такую ошибку и обозначают наклонные конструкции треугольниками, когда этого делать никак нельзя.

Далее поговорим о причине, почему вообще на рынке появляются наклонные треугольники. Обычно это происходит в тех случаях, когда восходящие либо нисходящие силы имеют большой потенциал, и они не дают сформироваться обычному горизонтальному треугольнику, наклоня модель в направлении тренда. В этих случаях, после завершения построения такого треугольника, рынок стремительно летит в том же направлении, что и до появления треугольника. Естественно, что такое свойство можно и нужно использовать в торговле.

Теперь рассмотрим правила и указания для наклонных треугольников.

Правила для наклонных треугольников:

1. Состоит из 5 волн.
2. Волновая формула К-К-К-К-К.
3. Волна С < волны В.
4. Волна D > волны С.
5. Волна E < волны D.
6. Образующие линии всегда имеют наклон в направлении тренда.
7. Может быть на месте предпоследней волны в модели старшего уровня.

Комментарии к правилам для наклонных треугольников:

Основное отличие наклонного треугольника от горизонтального заключается во взаимных величинах волн относительно друг друга, что отражено в правилах 3, 4 и 5. Также, в наклонных треугольниках обе образующие линии всегда смотрят в одну сторону, в отличие от горизонтальных треугольников, и их наклон всегда направлен в сторону доминирующего тренда. Еще одно отличие наклонного треугольника от горизонтального в том, что эта модель может появляться только на месте предпоследней волны в модели старшего уровня, а горизонтальный треугольник часто появляется еще и на месте последней волны в двойных и тройных тройках и треугольниках.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

К настоящему моменту мы рассмотрели все 3 типа волн, формирующихся в движущем стиле и 7 типов волн, формирующихся в коррекционном стиле. Теперь вы знаете правила для всех волновых моделей, которые встречаются в волновом анализе Форекс.

Взаимные пропорции волн по линиям Фибоначчи

Как было сказано в части 5 этой статьи, посвященной последовательности Фибоначчи, линии Фибоначчи, вытекающие из этой последовательности, помогают в прогнозировании величины волн в рамках волнового анализа рынка Форекс. В этой части приведем основные статистические закономерности, которые помогут трейдерам точнее прогнозировать точки завершения формируемых волн.

При прогнозировании величины волн следует опираться на их внутреннюю структуру, продолжительность и величину.

Любая волна может быть полностью завершена только тогда, когда:

1. Она полностью укомплектована подволнами младшего волнового уровня в соответствии с правилами волнового анализа.
2. Продолжительность ее построения должна быть визуально соразмерна другим подволнам в формирующейся модели и ее величине. Например, если формируется волна 2 импульса, она не должна быть слишком продолжительной и слишком короткой относительно волны 1. Чем глубже формируется коррекция, тем она короче по продолжительности построения. Полное понимание этого пункта приходит с опытом. Изучение рыночного графика и наблюдение за пропорциями волн помогают в навыке построения точных прогнозов.
3. Величина волны часто соответствует коэффициентам последовательности Фибоначчи. Именно поэтому линии Фибоначчи – это мощный инструмент в прогнозировании величины волн и в определении уровней для выставления ордеров.

Далее рассмотрим основные пропорции волн друг относительно друга по линиям Фибоначчи.

Движущие волны. Импульс

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

1. Волна 2 обычно 50%, 61.8%, 76.4% от волны 1.
2. Волна 3 обычно 161.8%, 200%, 261.8%, 323.6%, 423.6% от волны 1.
3. Волна 4 обычно 14.6%, 23.6%, 38.2%, но не более 50% от волны 3.
4. Волна 5 обычно 61.8%, 76.4%, 100%, 123.6%, 161.8% от волны 1 и 38.2%, 50%, 76.4%, 100% от волны 3.

Движущие волны. Начальный диагональник

1. Волна 2 обычно 50%, 61.8%, 76.4% от волны 1.
2. Волна 3 обычно 50%, 61.8%, 76.4%, 100%, 161.8% от волны 1.
3. Волна 4 обычно 38.2%, 50%, 61.8%, 76.4% от волны 3.
4. Волна 5 обычно 38.2%, 50%, 61.8% от волны 1, если волна 3 < волны 1 и 76.4%, 100%, 161.8% от волны 1, если волна 3 > волны 1.
5. Волна 5 обычно 38.2%, 50%, 61.8% от волны 3, если волна 3 < волны 1 и 76.4%, 100%, 161.8% от волны 3, если волна 3 > волны 1.

Движущие волны. Конечный диагональник

1. Волна 2 обычно 50%, 61.8%, 76.4% от волны 1.
2. Волна 3 обычно 61.8%, 76.4%, 100%, 161.8% от волны 1.
3. Волна 4 обычно 38.2%, 50%, 61.8%, 76.4% от волны 3.
4. Волна 5 обычно 38.2%, 50%, 61.8% от волны 1, если волна 3 < волны 1 и 76.4%, 100%, 161.8% от волны 1, если волна 3 > волны 1.
5. Волна 5 обычно 38.2%, 50%, 61.8% от волны 3, если волна 3 < волны 1 и 76.4%, 100%, 161.8% от волны 3, если волна 3 > волны 1.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Коррекционные волны. Зигзаг

1. Волна В обычно 50%, 61.8%, 76.4% от волны А.
2. Волна С обычно 61.8%, 76.4%, 100%, 161.8%, 200% от волны А.

Коррекционные волны. Волновая плоскость

1. Обычно волна А приблизительно равна волне В.
2. Волна С обычно 76.4%, 100%, 161.8% от волны В.

Коррекционные волны. Двойной и тройной зигзаги

1. Волна Y обычно 61.8%, 76.4%, 100%, 161.8% от волны W.
2. Волна Z обычно 61.8%, 76.4%, 100%, 161.8% от волн W и Y.
3. Волны X и XX обычно 50%, 61.8%, 76.4% от волн W и Y.

Коррекционные волны. Двойные и тройные тройки

Волны обычно стремятся к равенству по величине, потому что двойные и тройные тройки являются боковыми моделями. Приблизительные размеры волн, могут подсказать образующие линии модели.

Коррекционные волны. Сходящийся горизонтальный треугольник

Каждая последующая волна составляет 61.8%, либо 76.4% от предыдущей.

Коррекционные волны. Расходящийся горизонтальный треугольник

Каждая последующая волна составляет 123.6%, либо 161.8% от предыдущей.

Коррекционные волны. Наклонный треугольник

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

1. Волны В и D обычно составляют 123.6%, либо 161.8% от волн А и С соответственно.
2. Волны С и Е обычно составляют 61.8%, либо 76.4% от волн В и D.

Алгоритм определения волн на графике

Перед каждым трейдером, практикующим волновой анализ, стоит задача определения волн. Приведенный ниже алгоритм в этом поможет.

При определении типа волны всегда выбирайте наиболее простой вариант. Это означает, что если волну можно разметить как зигзаг или двойной зигзаг, из этих двух вариантов следует выбрать зигзаг. Часто новички рисуют очень сложные волновые конструкции, в такой ситуации очень сложно построить правильный прогноз и прибыльно торговать. Всегда следует стремиться к максимальной простоте. Главное, чтобы выполнялись все правила и указания волнового анализа. Если вы стремитесь упростить разметку, но какие-то правила из-за этого нарушаются, значит вы «достигли предела», дальше упрощать нельзя. Вы всегда должны найти такой вариант, чтобы он был максимально простым, гармоничным и пропорциональным, и чтобы все правила и указания были выполнены.

Все волны на графике можно разделить на два вида:

трендовые

боковые или горизонтальные

Если вы видите, что формируется какая-то трендовая волна, то есть, рынок стремительно летит вверх либо вниз, значит можно сделать вывод о том, что формируется либо импульс, либо зигзаг, либо двойной зигзаг.

Если же формируется боковая волна, значит формируется волновая плоскость, двойная или тройная тройка, или треугольник.

Когда вы отнесли волну к боковой либо к трендовой, остается лишь выбрать наиболее простой вариант разметки.

На рисунке 56 приведена классификация волн по направлению развития (тренд или флэт) и по возрастанию сложности (сначала простые, а потом сложные). Причем, волны приведены в порядке возрастания сложности.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

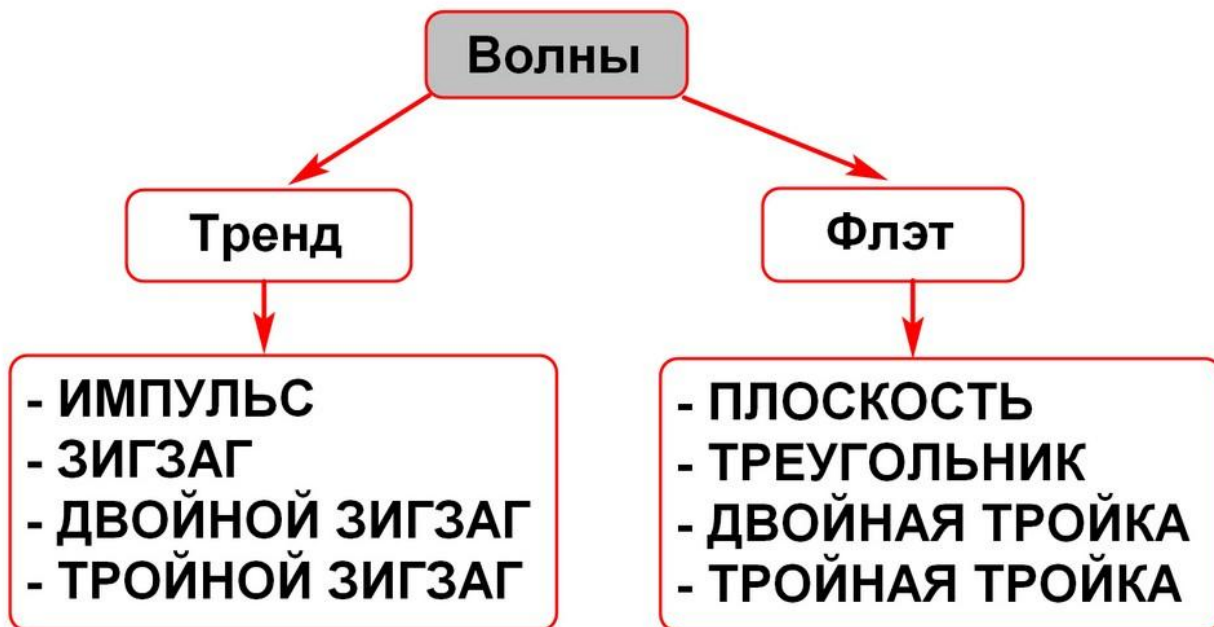


Рисунок 56.

Приведем два примера использования этой схемы.

Пример 1

Предположим, мы видим развитие трендового участка. Сразу смотрим в левую часть схемы и видим, что, скорее всего, формируется либо импульс, либо зигзаг, либо двойной или тройной зигзаг.

Сначала проверяем, возможно ли идентифицировать нашу волну как импульс? Если нет, то смотрим, может ли эта волна быть зигзагом? Если нет, то проверяем, может ли она быть двойным зигзагом? Предположим, что да. Значит, мы нашли правильный вариант.

Пример 2

Мы видим развитие бокового участка, значит можно сделать вывод о том, что формируется либо плоскость, либо треугольник, либо двойная или тройная тройка. Сначала проверяем вариант с плоскостью, если волну как плоскость идентифицировать нельзя, попробуем

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

идентифицировать ее как треугольник. Допустим, что в нашем примере подошел вариант со сходящимся треугольником. В этом случае дальше не идем, мы нашли правильный вариант.

Естественно, что здесь приведена несколько упрощенная схема определения волн, на практике все бывает гораздо сложнее, к тому же, часто приходится учитывать альтернативные варианты. Простой волновой анализ или не такой уж и простой – предстоит решить вам. Однако освоить практическую часть волнового анализа Форекс и научиться легко определять волны на графике невозможно, освоив лишь теорию и правила. Далее будут даны рекомендации по изучению практической части волнового анализа Эллиотта.

Рекомендации по изучению практической части волнового анализа

Я обучил не один десяток учеников волновому анализу Эллиотта и теперь имею некоторый опыт и видение того, как должен проходить процесс обучения.

Чтобы освоить теоретическую часть, нужно запомнить и понять все правила. Для этого подойдут статьи, видеокурсы, книги по волновому анализу.

Однако часто люди, которые посмотрели обучающие видео и изучили правила, при взгляде на рынок испытывают затруднения в определении волн. Человек сталкивается с неким барьером, который можно назвать как: «правила знаю, но при взгляде на рынок впадаю в ступор».

Самый простой и быстрый способ освоить практику волнового анализа – обратиться к специалисту по этому методу. Если вам нужна моя помощь, пишите в комментариях.

Когда вы наработаете определенный практический навык в определении волн, лучше всего перейти на другой формат работы. Вы сами идентифицируете волны на тех участках графика, которые вам дает преподаватель. Когда вы это делаете, вы активно думаете, сверяетесь с правилами, пытаетесь найти самый простой и правильный вариант, другими словами, формируете новые нейронные связи в вашем мозгу. Затем, это очень важно, проделанную работу должен проверить ваш преподаватель. Он должен вам указать, какие участки вы идентифицировали верно, а где были допущены ошибки. Так же, учитель должен либо прямо объяснить, почему ваш вариант идентификации волн является ошибочным (Нарушены правила, указания или взаимные пропорции волн), либо он должен натолкнуть вас на это понимание наводящими вопросами.

Я естественно очень надеюсь, что данный мой труд поможет вам в освоении азов, понимании волнового анализа и самостоятельном прогнозировании.

Написал

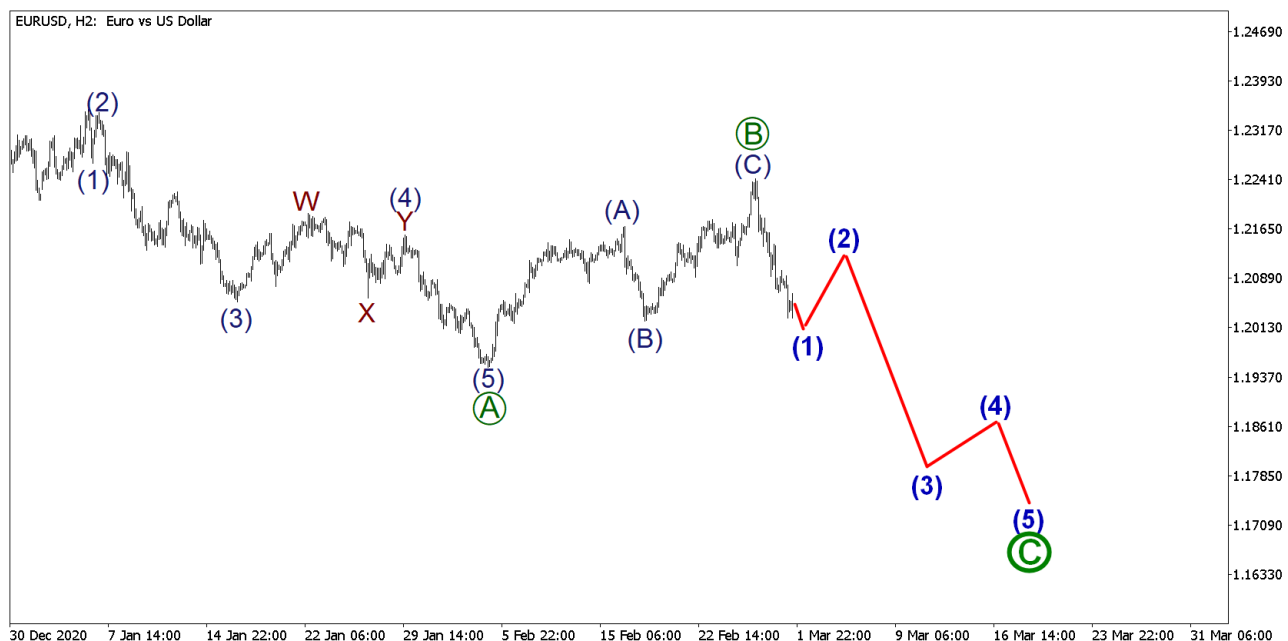
Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Торговля с использованием теории волн Эллиотта

Далее я хотел бы привести пример торговой операции с использованием волновой теории Эллиотта. Хочется отметить, что ее можно применять на различных рынках: торговля на Форекс, криптовалюты, биткоин и рынок акций — все они хорошо подходят для волн Эллиотта. Для начала мы проводим анализ рыночного графика при помощи волновой теории. Из анализа приведенного ниже графика видно, что рынок формирует нисходящий зигзаг [A]-[B]-[C], в котором были полностью построены подволны [A] и [B]. Волна [B] приняла форму зигзага, структура которого хорошо читается, поэтому вероятность того, что уже началось развитие нисходящей импульсной волны [C], достаточно высока.

Если наше понимание рынка верно, то сейчас формируется медвежий импульс (1), отмеченный цифрой синего цвета. Соответственно, после завершения волны (1) мы увидим окончание движения и восходящий трехволновой паттерн (2), который откатится на глубину, где уровень коррекции составит от 50% до 76.4% от импульса (1). Поэтому, если мы действительно увидим восходящее движение в коррекции (2), то будет целесообразно установить отложенный ордер на продажу sell limit на уровне 50% от величины импульсной волны (1). Даже можно расположить ордер чуть ниже указанного уровня, чтобы обезопасить себя, если цена дойдет в точности до этого уровня. После чего мы увидим продолжение тренда в нисходящем импульсе (3). Следует отметить, что волна (3) часто представляет из себя крупный тренд.



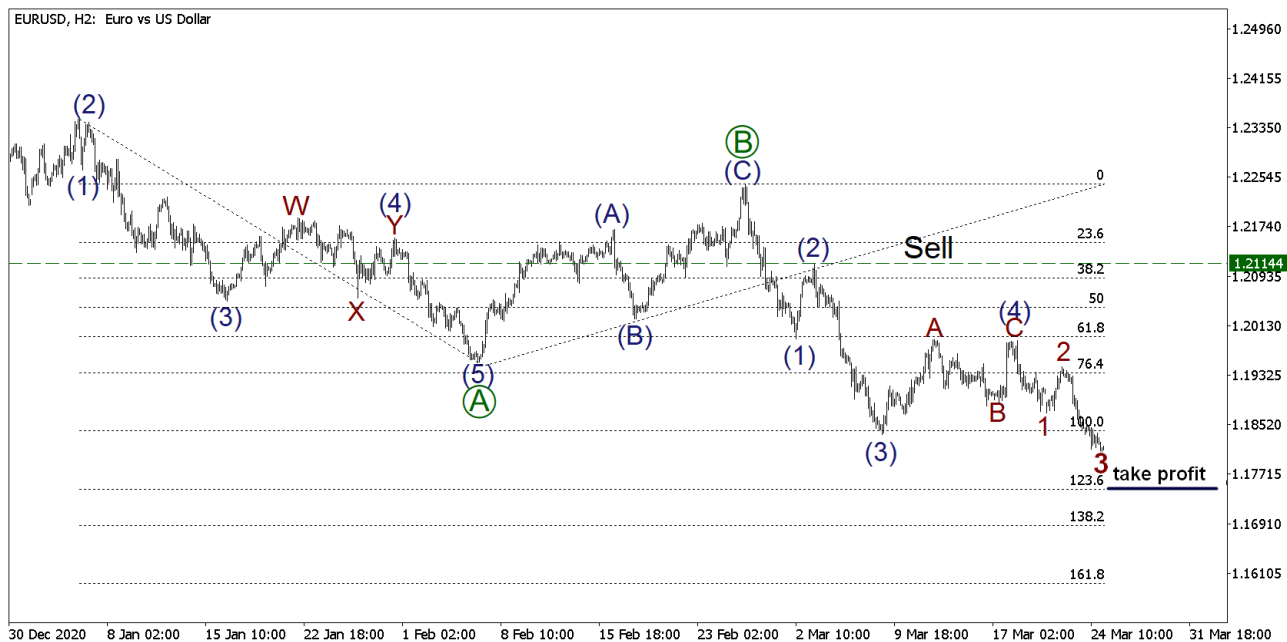
Далее мы видим на графике вот такую картину:

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Из приведенного выше графика видно, что рынок движется согласно нашим ожиданиям, формируя импульс [C]. У нас открыта продажа от уровня 1.2114, т.к. волна (2) составила ровно 50% по линиям Фибоначчи от волны (1). Такой вход в сделку можно назвать «ювелирным».



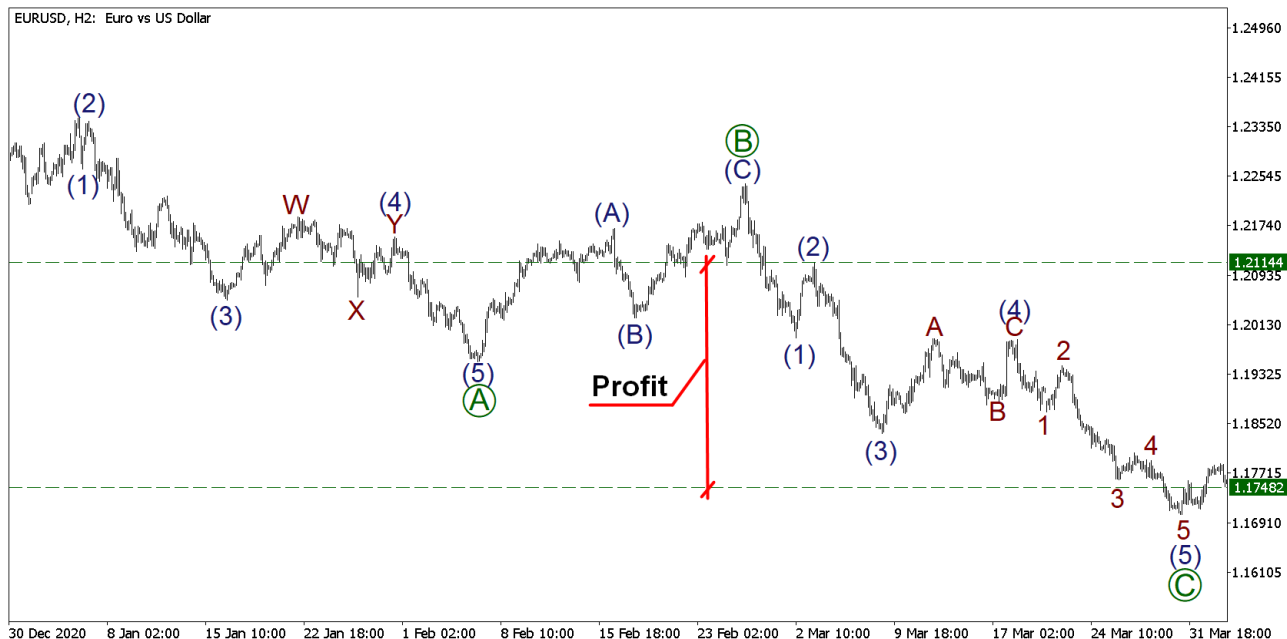
Часто в зигзагах волны [A] и [C] стремятся к равенству. Однако в данном случае мы видим, что сейчас формируется лишь волна 3, и при ее развитии величина всей импульсной волны [C] уже составляет более 100% от импульса [A]. Из этого логично предположить, что весь импульс [C] будет крупнее импульса [A] и при своем построении дойдет по крайней мере до уровня 123.6% по линиям Фибоначчи, т.е. как минимум до следующего коэффициента. В связи с этим поставим take profit, как показано на графике — на уровне 123.6%.

Теперь посмотрим, как завершилась вся эта ситуация и какая модель в итоге сформировалась в рынке.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер



Мы видим, что рынок прошёл точно по нашему плану, завершив формирование нисходящего зигзага [A]-[B]-[C] импульсной волной [C], построение которой мы успешно спрогнозировали, получив законную прибыль. Сделка на продажу была открыта на уровне верхней зелёной линии, а закрыта на уровне нижней зелёной линии. Соответственно, мы получили хорошую прибыль, величину которой видно на графике. (Надпись Profit).

Стратегии торговли по волнам Эллиотта

Существует две основные стратегии по волнам Эллиотта: разворотная и трендовая.

Первая стратегия заключается в ловле разворотов и называется «разворотной».

То есть заранее происходит прогнозирование и определение точек, где возможен разворот рынка. В данном случае не имеет особого значения его масштаб, так как сделки могут быть как краткосрочными, так и долгосрочными. Итак, если мы определили, что волна либо завершена полностью, либо почти завершена, мы открываем ордер, с целью взять прибыль на движении в противоположную сторону от того, куда ранее двигался рынок.

Вторая стратегия заключается в ловле трендов и торговле по ним и называется «трендовой». Например, мы определили, что началось формирование одной из самых мощных и стремительных волн в рынке, волны 3 импульса. В тот момент, когда мы убедились в этом, можно открывать сделку по тренду.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Есть специалисты, которые работают по первой стратегии, а есть те, кто работает по второй. Часто на практике волновики комбинируют обе стратегии, действуя в разных случаях по-разному.

Волны Эллиотта в дневной торговле

Волны Эллиотта отлично работают внутри дня на мелких таймфреймах. Чаще всего трейдеры используют таймфреймы от 5 до 30 минут для анализа графика при торговле внутри дня. При таком трейдинге нужно учитывать, что минутные таймфреймы могут формировать очень сложные и искаженные волны. Поэтому определение волн на таймфреймах меньше М5 требует значительного опыта со стороны волновика. В остальном, торговля внутри дня не имеет серьезных отличий от среднесрочного и долгосрочного трейдинга.

Прогнозы на основе волновых паттернов

По статистике, в рынке чаще всего встречаются импульсные волны. С учетом того факта, что импульсные волны являются самыми стремительными и быстрыми среди всех волн, которые есть в волновой теории Эллиотта, торговля внутри импульсов и их «ловля» является наиболее перспективной задачей для извлечения прибыли из трейдинга.

Следующей по частоте появления в рынке волной является зигзаг. Он тоже хорош для трейдинга, однако, имеет свои особенности, так как относится к волне коррекционного типа. Поэтому торговать внутри зигзага, как правило, сложнее, чем внутри импульса. Однако многие трейдеры используют этот паттерн для извлечения прибыли.

Остальные типы волн также подходят для извлечения прибыли, но работать в них лучше более опытным волновикам.

Я ежедневно пишу аналитику по криптовалютам с использованием волн Эллиотта, а так же мой коллега Алекс Геута делает еженедельные прогнозы по основным валютным парам.

Индикаторы волн Эллиотта

Чтобы правильно наносить волны Эллиотта на график, необходимо знание правил и указаний волнового анализа, а также умение применять их на настоящем рыночном графике. Некоторые трейдеры используют индикаторы, которые помогают подтвердить правильность волновой разметки.

Индикатор MACD

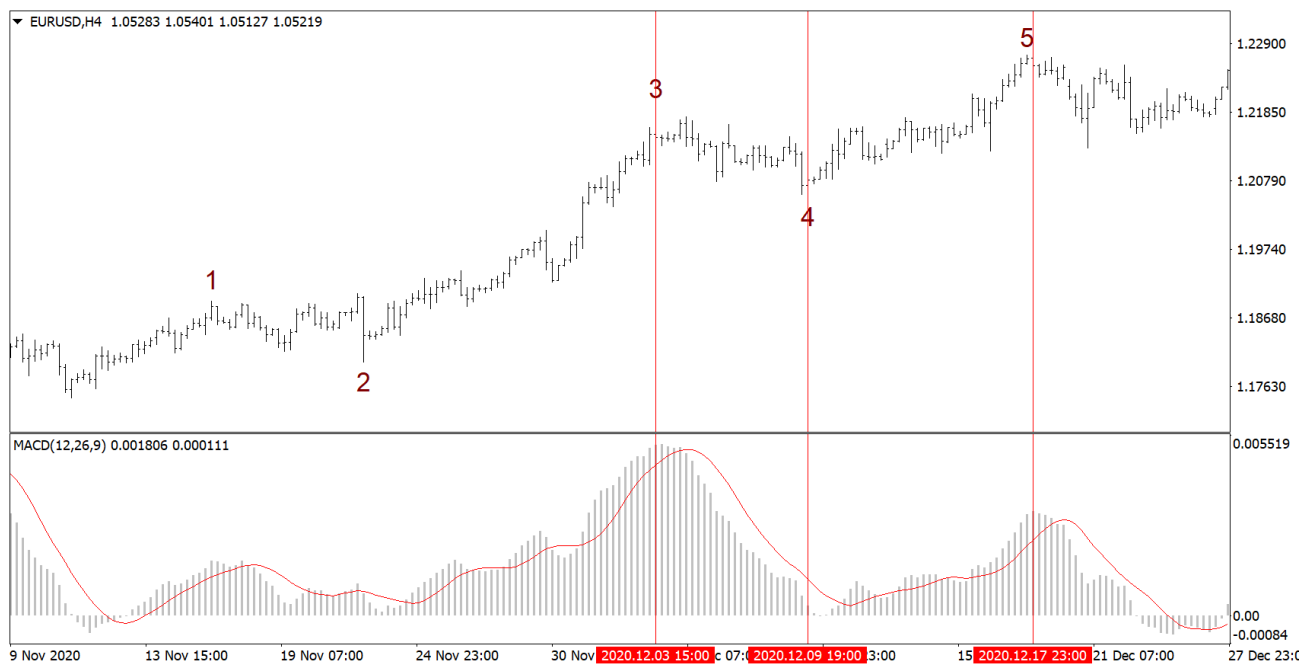
Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Этот индикатор широко популярен среди трейдеров во всём мире, его используют в рамках обычного технического анализа. Однако волновики научились применять этот индикатор для подтверждения волновой разметки. Например, Билл Вильямс предлагает использовать MACD с определенными параметрами в качестве вспомогательного инструмента для определения волн.

MACD может помочь определить окончание импульсной волны 3. Это связано с тем, что в третьей волне мы обычно видим самую сильную часть тренда, движение в этой волне наиболее стремительно. Именно поэтому экстремальные значения индикатора MACD часто соответствуют точке завершения волны 3.



На картинке выше мы видим, что максимальное значение индикатора MACD совпадает с точкой максимума, который образовала импульсная волна 3.

Затем столбики индикатора опустились к значению 0 на окончании волны 4. На это указывает средняя красная вертикальная линия.

Еще один интересный момент виден на уровне правой вертикальной линии. В этом месте цена поднимается выше в волне 5, формируя новый максимум, в то время как столбики индикатора MACD также показывают максимум, но уже локальный, более низкий, чем был на окончании импульса 3. Таким образом, индикатор MACD может помочь в определении окончаний волн 3, 4 и 5 в импульсе.

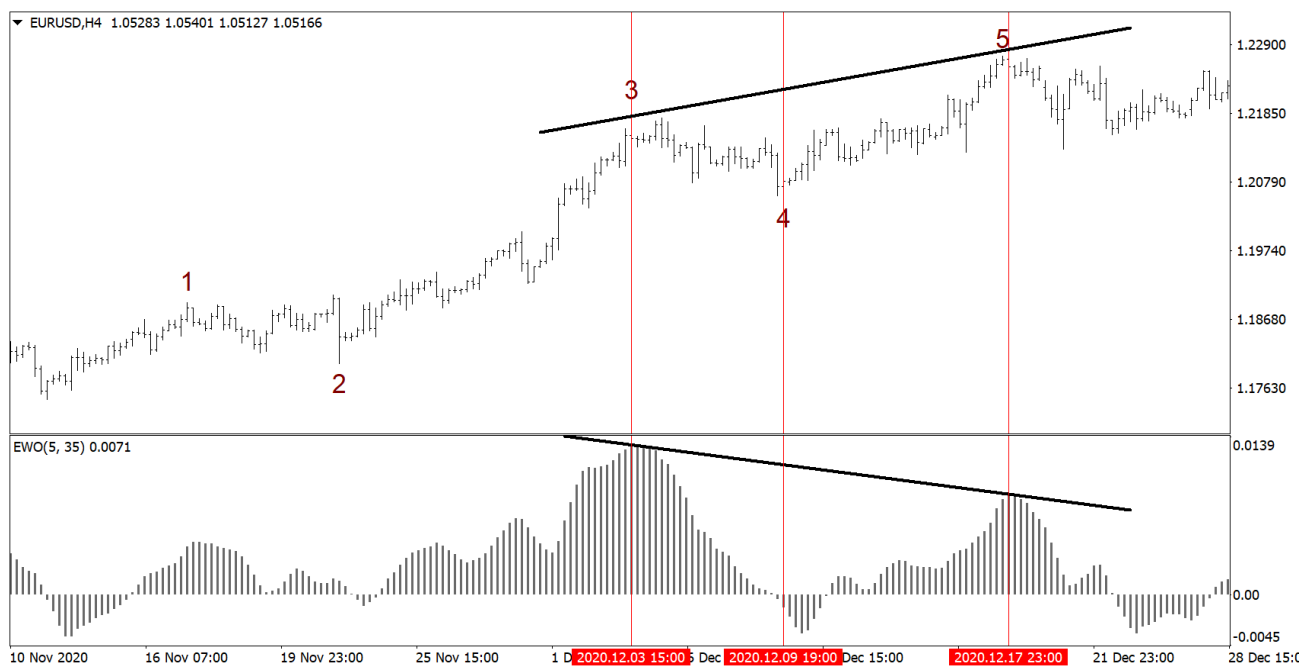
Индикатор Elliott Wave Oscillator

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Это ещё один индикатор, который может помочь в определении волн, однако по сути он является частным случаем индикатора MACD. То есть это тот же MACD, но с определенными параметрами. Так же в Elliott wave oscillator удалена сигнальная линия. Мы знаем, что гистограмма MACD получается, как результат разницы между двумя скользящими средними с разными параметрами. В Elliott wave oscillator используются скользящие средние с параметрами 5 и 35.



На рисунке видно, что этот индикатор очень похож на MACD, по сути это он и есть. Единственное отличие в том, что нельзя менять параметры расчета скользящих средних — они всегда 5 и 35. Считается, что эти значения наиболее оптимальны для подтверждения разметки.

Здесь лишь можно добавить, что пятиволновой паттерн завершается дивергенцией, которая схематично показана на графике черными линиями. Однако технические особенности применения этого индикатора точно такие же, как и MACD.

Выше были рассмотрены индикаторы, которые традиционно используются трейдерами как подтверждение правильного определения волн на графике. Также было сделано много попыток в создании индикаторов, которые могли бы сами наносить волны на график. Однако я не встречал ни одного индикатора, который мог бы самостоятельно наносить волны на график с учетом всех правил и указаний волнового анализа, поэтому пользоваться подобными программами я бы не рекомендовал. Но использовать индикаторы стандартного технического анализа в качестве помощи в определении волн, как это было показано выше — идея хорошая.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Индикатор Elliott Wave Prophet

Elliott Wave Prophet предназначен для помощи в проведении волнового анализа и, как уверяют его авторы, способен в определенной степени предсказывать дальнейшее движение цены на основе уже сформировавшихся волн. Я изучил этот индикатор, и мое мнение, что в трейдинге он не поможет, а наоборот, может только запутать.

Индикатор WATL

Индикатор Watl определяет максимумы и минимумы, что делают и обычные фракталы, а также рисует трендовые линии. Ни то, ни другое не относится к волновому анализу — рекомендовать его использование я не могу.

Как читать графики волн Эллиотта

Чтобы научиться верно читать графики волн Эллиотта, необходимо освоить правильную маркировку и нанесение волн на график.

Если перед нами стоит задача определить, какая волна сейчас формируется, следует нанести маркировку волн на график. Для этого вы можете использовать следующее пошаговое руководство:

1. Начинать маркировку рекомендуется с самого старшего доступного таймфрейма. Лучше открыть все доступные исторические данные и определить, какая фигура с точки зрения волнового анализа сейчас формируется и насколько она была завершена.
2. Промаркировать старшую фигуру и отметить её буквами или цифрами определенного волнового уровня. Предпочтение следует отдавать старшим волновым уровням, например, циклу или суперциклу.
3. Переходим на меньший таймфрейм, маркируем подволны старшей фигуры новыми буквами или цифрами волновой степени на один уровень меньше.
4. Подобным образом опускаемся до нужного нам таймфрейма, например, четырехчасового или часового. К этому моменту мы будем понимать полную картину

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

того, что формируется на графике и сможем построить прогноз, исходя из текущего определения волн.

Основные советы по использованию волн Эллиотта

Вот основные советы, которых стоит придерживаться при использовании волн Эллиотта для торговли и анализа:

- Маркировку волн производить, начиная со старшего доступного таймфрейма;
- Стремиться выбирать наиболее простой вариант маркировки;
- Следить за тем, чтобы были выполнены все правила и указания волнового анализа. Если какие-то правила не выполняются, возможно, структура волны была определена неправильно;
- В большинстве случаев окончания волн располагаются на экстремумах. Случаи усечений, безусловно, встречаются, но не так часто;
- Соблюдать порядок в маркировке и последовательности волновых степеней. Порядок в разметке — порядок в голове — прибыльная торговля.

Глоссарий по терминологии волн Эллиотта

Термин	Определение
Волновой анализ Эллиотта	Это популярный метод анализа финансовых рынков. Создателем волнового анализа является Американский Финансист Ральф Нельсон Эллиотт. В 1938 году, после 9 лет непрерывных исследований финансовых рынков, он опубликовал первую в мире книгу по волновому анализу – «Закон волн». Суть метода заключается в следующем: рынок формирует толпа участников, взаимодействующая между собой. Эллиотт заметил, что толпа ведет себя предсказуемо и формирует на графике цены одни и те же ценовые конструкции или, другими словами, волны. Он описал и классифицировал все типы волн, которые встречаются на рынке. Зная типы волн, можно распознать волну, формирующуюся на рынке, сделать прогноз и войти в прибыльную сделку.
Волна	Это участок движения цены от одного изменения направления до другого
Действующая волна	Это волна, которая развивается в том же направлении, что и волна одним волновым уровнем выше

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Термин	Определение
Противодействующая волна	Это такая волна, которая направлена против волны одним волновым уровнем выше
Движущий стиль	Волны движущего стиля всегда состоят из пяти частей
Коррекционный стиль	Волны коррекционного стиля состоят либо из трех волн, либо из нескольких частей по три волны, например, из двух или трех частей, которые объединяет между собой волна-связка
Импульс	Импульс – это самый популярный и часто встречающийся тип волны в рынке. Любые сложные коррекционные модели, при более детальном рассмотрении, можно разделить на импульсы, то есть импульс – это элементарный кирпичик. Складывая между собой такие кирпичики в различных комбинациях, мы можем получить волну абсолютно любой степени сложности. В свою очередь, любую, даже самую сложную коррекционную волну, в итоге можно разложить до элементарных импульсов.
Начальный диагональник (клин)	Фигура волнового анализа, формирующаяся на ценовом графике, которая обычно является предвестником мощного движения и появляется всегда на месте волны 1 импульса или волны А зигзага.
Усечение	В рамках импульса, пятая волна никак не ограничена в своем развитии. Она может, как не дойти до окончания волны 3, в этом случае ее называют усеченной, так и пойти выше окончания третьей волны.
Конечный диагональник	Если вы обнаружите на рынке конечный диагональник, значит близится контртренд, поэтому можно сделать вывод о том, что предыдущая тенденция скоро завершится и начнется развитие коррекционной волны, либо нового тренда в противоположном направлении.
Зигзаг	Зигзаг стоит сразу после импульса по частоте появления на графике. Практически все коррекционные волны можно разбить на зигзаги, которые можно разложить до импульсов. Зигзаг состоит из трех подволн, которые подписываются буквами.
Глубокая коррекция	это такая коррекция, которая по своей величине больше 50% от предыдущей волны

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Термин	Определение
Мелкая коррекция	это такая коррекция, которая по своей величине меньше 50% от предыдущей волны
Волновая плоскость	Волновая плоскость, как и зигзаг, является простой волновой моделью, состоящей лишь из трех подволн
Стандартная волновая плоскость	Это такая плоскость, где все волны приблизительно равны по величине
Растянутая волновая плоскость	Это такая фигура, где каждая последующая волна больше предыдущей. Такая фигура возникает, когда силы быков и медведей примерно равны и они тянут цену то вверх, то вниз, а волатильность увеличивается одновременно с этим, благодаря чему волны на рынке начинают иметь все больший размах.
Сдвигающаяся волновая плоскость	В такой плоскости волна В больше волны А, а волна С меньше волны В, поэтому получается сдвигающаяся модель. Обычно такая модель формируется, когда на рынке сильны либо быки, либо медведи и они не дают сформироваться волне вбок, а сдвигают ее во время построения.
Двойной зигзаг	Двойной зигзаг состоит из двух зигзагов, объединенных между собой волной-связкой. Первый зигзаг обозначается буквой W, второй зигзаг обозначается буквой Y, а соединяет их между собой волна-связка X.
Тройной зигзаг	Тройной зигзаг состоит из трех зигзагов, объединенных между собой волнами-связками.
Двойная тройка	Двойная тройка состоит из двух троек, объединенных между собой коррекционной волной связкой. Тройка – это еще одно название волны, формирующейся в коррекционном стиле. Первая тройка обозначается буквой W, вторая тройка буквой Y, а волна-связка, их соединяющая, буквой X. Двойная тройка – это неглубокая и горизонтальная коррекция
Тройная тройка	Главное отличие тройной тройки от двойной состоит в том, что двойная тройка состоит из трех подволн W-X-Y, а тройная тройка состоит из пяти подволн W-X-Y-XX-Z.
Горизонтальный треугольник	Все треугольники состоят из пяти подволн, которые обозначаются буквами А, В, С, D и Е. Существуют

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Термин	Определение
	различные типы этих моделей. Все они отличаются друг от друга наклоном образующих линий.
Сходящийся горизонтальный треугольник	В сходящихся треугольниках образующие линии, если их мысленно продлить вперед, будут сходиться.
Расходящийся горизонтальный треугольник	Верхняя образующая линия такого треугольника направлена вверх, а нижняя образующая смотрит вниз, то есть, линии расходятся и смотрят в разные стороны.
Наклонный треугольник	Наклонный треугольник отличается от горизонтального тем, что обе его образующие линии имеют наклон в одну сторону – либо вверх, либо вниз.

Критика волнового анализа Эллиотта

Главный минус волновой теории — ее объем. Анализ содержит большое количество правил и указаний, на освоение которых уходит много времени и усилий. Но в процессе обучения, как правило, все оказывается не так сложно.

Среди новичков распространено мнение, что волновой анализ — это субъективный метод. Все потому, что по началу разметки рынка у всех получаются разные. Со временем это проходит — опытный трейдер может провести более четкий анализ, тогда у нескольких специалистов отметки будут схожие. Это сложно отнести к недостаткам, так как решается с получением достаточного количества опыта.

Выводы: преимущества и недостатки волн Эллиотта

Преимущества использования волн Эллиотта	Недостатки использования волн Эллиотта
Дает полное понимание текущей ситуации на рынке, начиная от старшего таймфрейма и заканчивая минутным графиком	Сложная теория
Нет задержки во времени, как при использовании индикаторов — мы можем точно определить начало тренда	На начальных этапах изучения волн разметки выглядят субъективно

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Для более глубокого изучения темы рекомендую книги:

- Дмитрий Возный «Код Эллиотта. Волновой анализ рынка FOREX».
- Альфред Фрост и Роберт Пректер «Волновой принцип Эллиотта, ключ к пониманию рынка».

Волновой анализ успешно используется как для рынка акций и Форекс, так и для криптовалютных пар, и, по большому счету, подходит для любого типа финансовых активов.

Надеюсь, что мое подробное руководство по Волнам Эллиотта было вам полезно. Если у вас остались вопросы, я с удовольствием отвечу на них в комментариях под статьей!

Успехов в торговле!

FAQ по волновой теории Эллиотта

Как определить первую волну Эллиотта?

Первая волна всегда формируется в начале новых движений либо коррекций. Для того, чтобы увидеть первую волну на графике, нужно отследить точку завершения предыдущей волны — от этой точки, с большой долей вероятности, начнется первая волна. Важно посмотреть на ее внутреннюю структуру и увидеть подтверждение того, что она действительно является импульсной.

Как пользоваться индикатором волн Эллиотта?

На сегодняшний день я не встречал индикаторов, которые удовлетворительно наносили бы волны Эллиотта на график. Однако существует ряд индикаторов, применяющихся в техническом анализе, которые помогают волновикам подтвердить маркировку волн на графике. К таким индикаторам относятся, например, MACD или Elliott wave oscillator, который является частным случаем индикатора MACD. В некоторых случаях трейдеры также используют RSI или стохастик. Хотя здесь речь больше идет о комбинировании волнового и обычного технического видов анализов.

Почему волны Эллиотта работают?

Ценовые графики формируются как результат взаимодействия большого количества участников рынка. Другими словами, на образование графиков влияет толпа участников, создающая достаточный объем торгов. Один человек может вести себя непредсказуемо, но толпа ведет себя шаблонным образом. Благодаря этому на графике всегда появляется один из десяти типов волн, которые были изучены и классифицированы. Именно из-за предсказуемости толпы, волны Эллиотта работают.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Как применять теорию волн Эллиотта?

Для начала нужно определить, какой тип волны сейчас формируется и насколько эта волна завершена. Затем построить прогноз по предполагаемой точке завершения этой волны с использованием правил и указаний волновой теории.

Что такое волновой цикл Эллиотта?

Волновым циклом называют модель, состоящую из одной волны движущего стиля и одной волны коррекционного стиля. Схематично движущую волну изображают состоящей из пяти волн и подписывают цифрами 1-2-3-4-5, а коррекционную — тремя волнами и подписывают буквами А-В-С.

Как работает волновой анализ Эллиотта?

Волновой анализ изучает типы волн, формирующиеся на графике. Всего существует десять типов волн, касательно которых был сделан ряд наблюдений. Волновой анализ работает благодаря тому, что одни и те же волновые структуры формируются на разных участках графика.

Как использовать индикатор волн Эллиотта?

Индикаторы волн Эллиотта применяют для подтверждения волновой разметки. Часто так называют индикаторы обычного технического анализа, но с определёнными, оптимизированными под волны Эллиотта, параметрами.

Что такое осциллятор волн Эллиотта?

Осциллятор волн Эллиотта — это технический индикатор, который по своей сути является индикатором MACD, но с параметрами скользящих средних 5 и 35 и с удаленной сигнальной линией. Этот индикатор используют для определения окончаний волн 3, 4 и 5 в импульсе.

Работают ли волны Эллиотта для торговли внутри одного дня?

Волны Эллиотта отлично подходят для торговли внутри дня. Для этого при анализе рынка используются таймфреймы от пятиминутного до часового.

Как определить волны Эллиотта на графике?

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер

Для определения волн Эллиотта на графике нужно сначала определить волновую модель, которая формируется на самом старшем доступном таймфрейме. Затем, постепенно опускаясь от старшего таймфрейма до меньшего, расставить маркировку остальных, более мелких волн.

Как правильно строить волны Эллиотта?

Волны Эллиотта правильно строить, начиная со старшего доступного таймфрейма, постепенно опускаясь до нужного нам таймфрейма, на котором и будет вестись трейдинг. Это делается для того, чтобы видеть всю картину целиком, обзорно.

Написал

Роман Онегин

Эксперт волнового анализа и крипто-трейдер