

Настройка фильтров

Фильтры нужны для того, чтобы определить момент появления повышенного объема в кластере для текущего таймфрейма, что говорит о проявлении активности и интереса.

Для каждого инструмента средние значения объема в кластере разные. Подобрать фильтры можно несколькими способами.

Первый - это подобрать фильтры на глаз, так чтобы выделялись ключевые моменты на графике. Второй - провести сбор статистики по инструменту для каждого таймфрейма. Статистика должна включать значения максимальных объемов для каждого бара на достаточном промежутке времени. Затем можно либо найти среднее арифметическое значение максимальных объемов и использовать его как фильтр, либо по нормальному распределению определить значения, которые составляют 60-70% от общего числа если считать от минимальных значений к максимальным, а все что выше использовать как фильтр.

Следует учитывать то, что для младших таймфреймов, значения фильтров следует периодически подстраивать под изменения рынка. Изменения в средних показателях объема торгов могут произойти за пол года - год, а иногда и за несколько месяцев.

Примерные значения фильтров

Ticker	TF	VolHigh	VolLow
6E	W1	15000	12000
6E	D1	7000	6000
6E	H1	2000	1900
6E	M15	1000	900
6E	M5	700	500
6E	M1	300	250
6B	W1	30000	27000
6B	D1	3000	2800
6B	H1	900	850
6B	M15	600	600
6B	M5	300	300
6B	M1	100	100
CL	W1	60000	57000
CL	D1	3500	3000
CL	H1	1300	1200
CL	M15	500	500
CL	M5	500	450
CL	M1	200	180
GC	W1	45000	42000
GC	D1	2200	2000
GC	H1	600	550
GC	M15	250	200
GC	M5	200	200
GC	M1	100	100
ES	W1	150000	145000
ES	D1	60000	55000
ES	H1	23000	20000
ES	M15	12000	12000
ES	M5	6000	5000
ES	M1	4000	4000