



**Руководство по индикаторам  
Order Flow  
Профессиональная версия 1.7**

Следующий текст защищен авторским правом и не может быть распространен или изменен без письменного согласия автора..

Copyright (c) 2019, Waldo Alvarez Cañizares

<http://tradingfuturo.com>

## Использование Order Flow TradingFuturo

Этот пакет индикаторов может использоваться в самых разных торговых методологиях, начиная от скальпинга и заканчивая дневной торговлей.

Мы можем включать различные методы, такие как торговля по импульсу, свинг-торговля, разворотная торговля (откатная торговля) и СОТ-торговля. Кроме того, данный индикатор можно использовать для фильтрации точек входа и выхода из рынка, а также для выявления агрессивных и пассивных участников рынка. При этом, индикатор позволяет определять краткосрочные, среднесрочные и долгосрочные оперативные уровни.

Индикатор может использоваться в разнообразных данных от микроструктурных данных (по уровням цен или ценового тика) до макроструктурных (больших временных периодов рынка). Индикатор контролирует скорость входа каждого ордера в рынок, предоставляя очень точную и подробную информацию в каждой свече.

Технология, которая используется в индикаторе, фиксирует и отображает каждое ценовое движение в градиентных ордерах на боковых гистограммах, которые используются для определения различных паттернов. Таким образом, трейдер может более точно выбрать область для совершения успешной сделки, определяя точки входа и выхода с учетом силы рынка. Однако мы не можем гарантировать успех каждого трейдера, так как это зависит от его личной стратегии.

## Вступление

Образовательная версия TradingFuturo OrderFlow предназначена для того, чтобы представить некоторые из наиболее распространенных стратегий ручной торговли на сегодняшний день. Это не означает, что в этой версии отсутствуют инструменты для эффективной и прибыльной внутридневной торговли, поскольку она очень хорошо отражает движение цены, а также каждый ордер, поступающий на рынок. В образовательных целях эта версия соответствует минимальным требованиям для работы с этими системами. Поэтому, научившись торговать с потоком ордеров, индикатор становится важным инструментом во внутридневной торговле.

Образовательную версию можно скачать на форуме <http://tradingfuturo.com/forum>, а также шаблоны для его использования. Кроме того, там вы можете получить поддержку от нашей команды или от любого из пользователей.

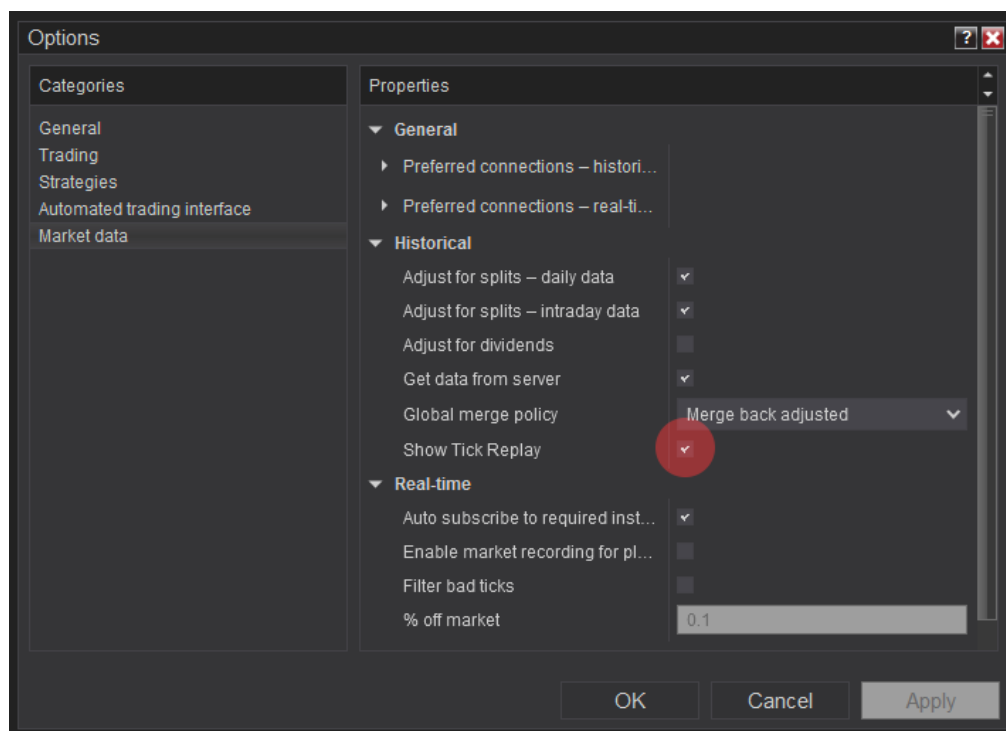
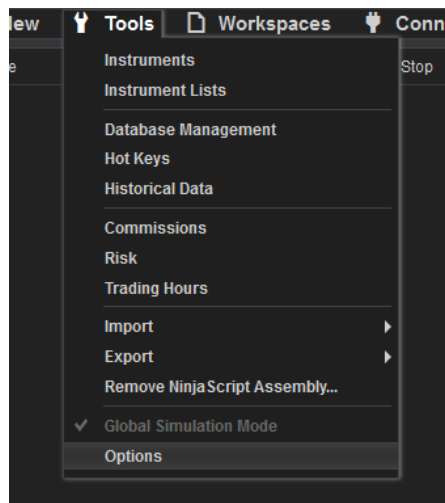
Профессиональная версия шире и позволяет повысить качество торговли. Поэтому представляет больший интерес для трейдеров, которые уже знают, как использовать эти системы и хотят сделать торговлю более качественной. Таким образом, они могут получить большую прибыль в своей деятельности.

# Index

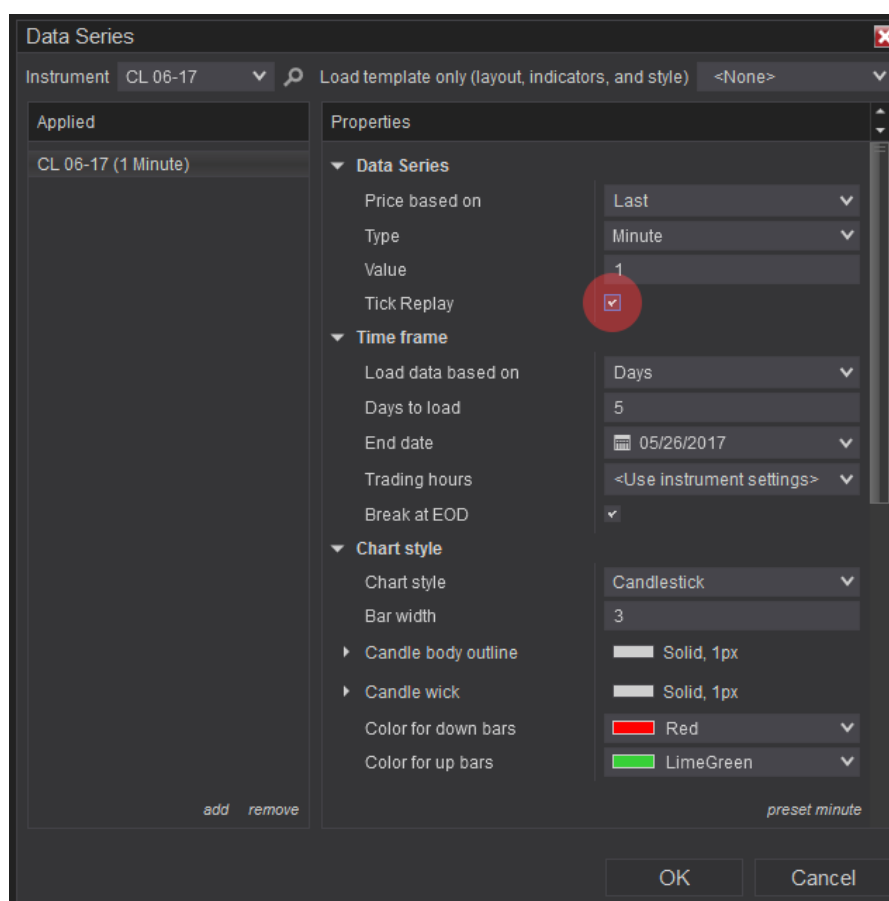
1. Конфигурация.....	5
2. Внутри графика (Свойства панели Footprint).....	7
Bid/Ask.....	8
Volume/Delta.....	8
Свойства панели Footprint.....	9
В конфигурации BidAsk ордера на покупку размещаются справа, а на продажу слева. Можно настроить цветовую диаграмму внутри индикатора, чтобы выделить цвет каждого из них. Если мы используем опцию насыщенности, у нас будет цветной градиент, который показывает сильные стороны покупок и продаж по уровням цен. В конфигурации Volume / Delta отображаются объемы и дельта импульсы уровней с каждой стороны.....	9
Индикатор закрытия и индикатор большого объема (РОС свечи или объемного кластера).....	10
Отображение COT (приверженность трейдеров).....	11
3. Свойства Delta Footer.....	11
4. Свойства Volume Footer.....	13
5. Свойства Ask и Bid Footer.....	14
6. Графические свойства Delta.....	15
7.1 Volume/Delta профиль сессии.....	16
7.2 Настройка объема / дельта-профиля.....	17
8. Книга ордеров, vROC (Объем Точки Контроля), Режим отображения дисбалансов.....	19
9. Незавершенный аукцион.....	21
10. COT Force или сила приверженности трейдеров.....	23
11. Развивающаяся область ценности.....	24

## 1. Конфигурация

Во-первых, нам нужно настроить NinjaTrader **Tick Replay**, чтобы индикатор корректно работал. Включите **Tick-Replay**, чтобы выполнить повторное заполнение данных в индикаторе Tools / Options / MarketData.

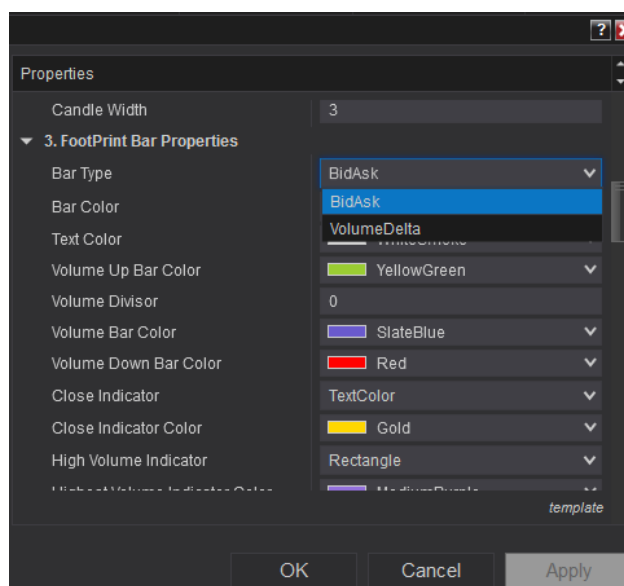


Затем нам нужно включить воспроизведение тиков на каждом открытом графике.

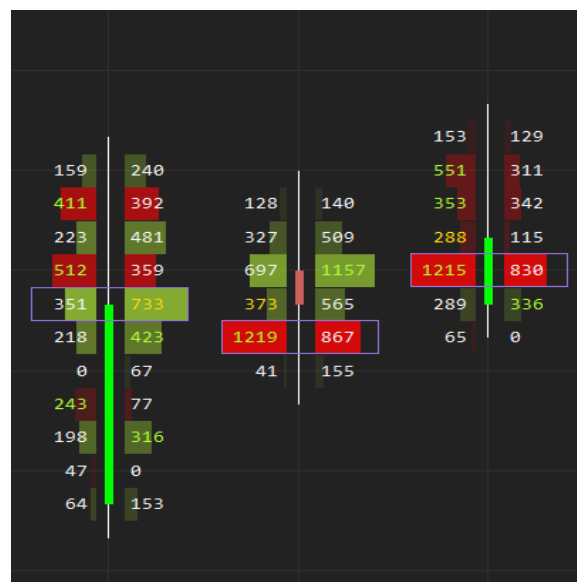


## 2. Внутри графика (Свойства панели Footprint)

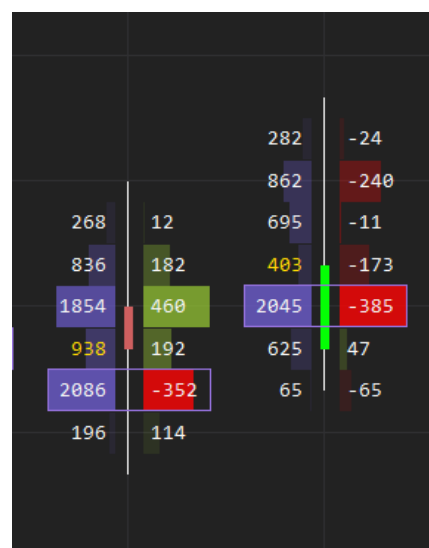
Существует два варианта построения графиков: **BidAsk** и **VolumeDelta** (для этого нужно зайти в свойства индикатора Footprint). Опция Bid/Ask отображает ордера по BID и ASK для каждого уровня. Объем/Дельта представляет объем с одной стороны, а дельта на этом уровне цен - с другой.



## Bid/Ask

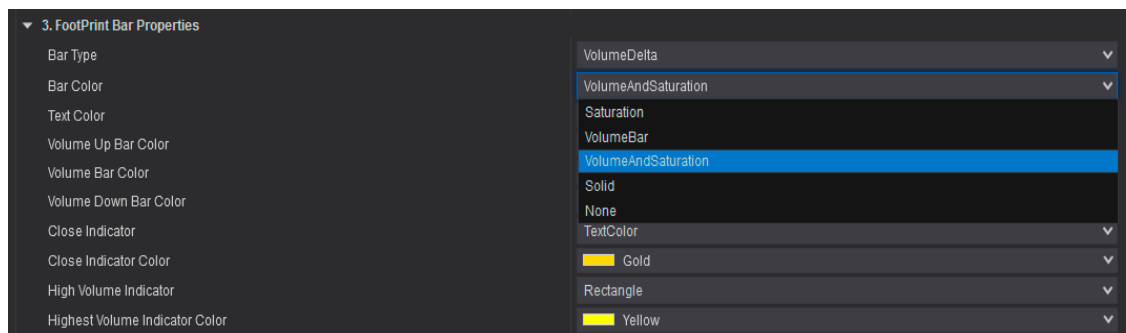


## Volume/Delta



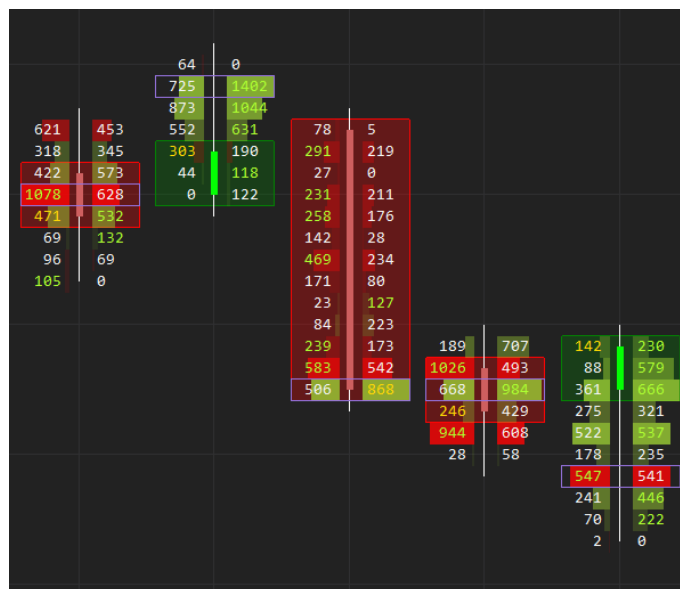


В обеих конфигурациях есть несколько параметров в свойствах панели Footprint / Color Bar.



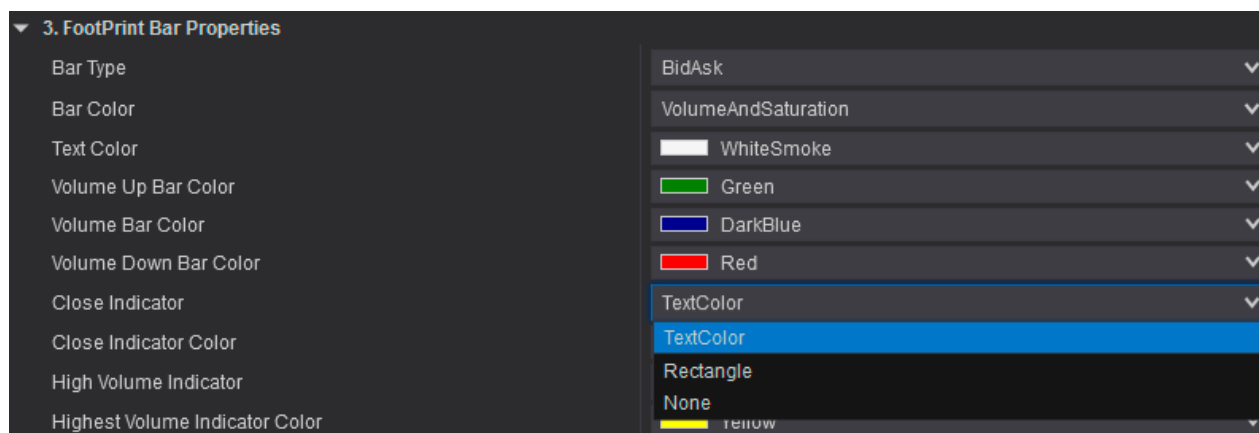
## Свойства панели Footprint

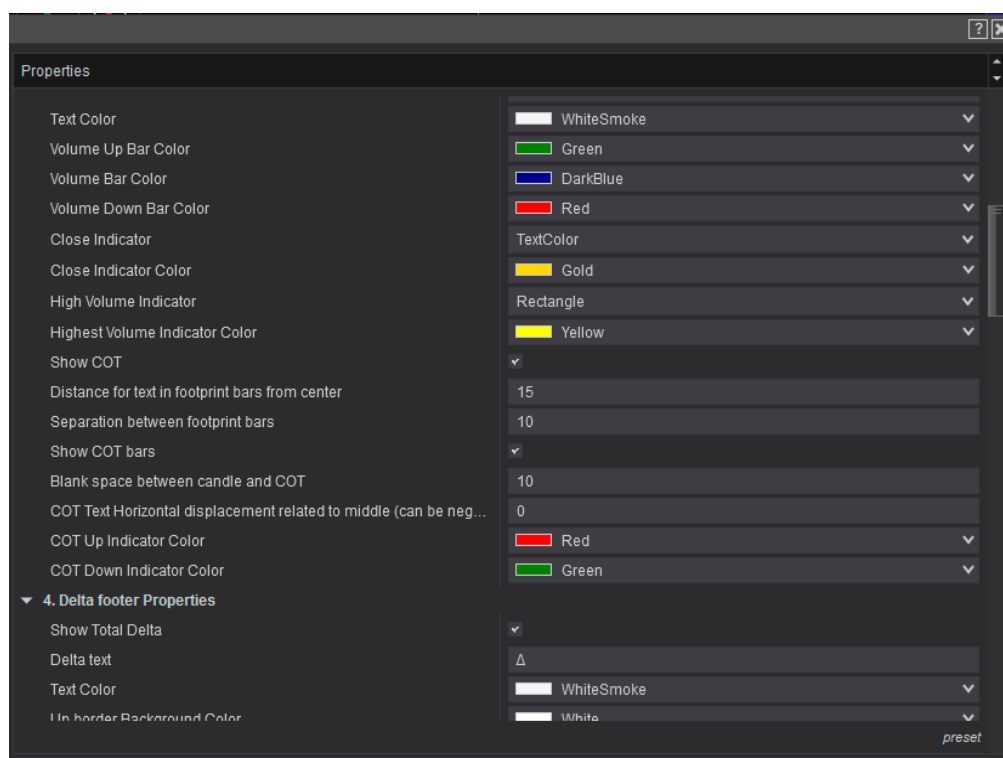
В конфигурации BidAsk ордера на покупку размещаются справа, а на продажу слева. Можно настроить цветовую диаграмму внутри индикатора, чтобы выделить цвет каждого из них. Если мы используем опцию насыщенности, у нас будет цветной градиент, который показывает сильные стороны покупок и продаж по уровням цен. В конфигурации Volume / Delta отображаются объемы и дельта импульсы уровней с каждой стороны.



У нас есть готовая конфигурация, как показано на рисунке. Мы рекомендуем пользователю загрузить ранее настроенный шаблон с нашего форума, так как его конфигурация сложна. После того, как шаблон загружен в график, трейдеры могут позже настроить основные характеристики своей торговой системы. Эта конфигурация широко используется большинством трейдеров, использующих поток ордеров. По этой причине конфигурация включена в профессиональную версию. В настоящее время каждый трейдер использует много разных торговых систем, поэтому в этих целях функционал инструмента оптимизирован для всех систем.

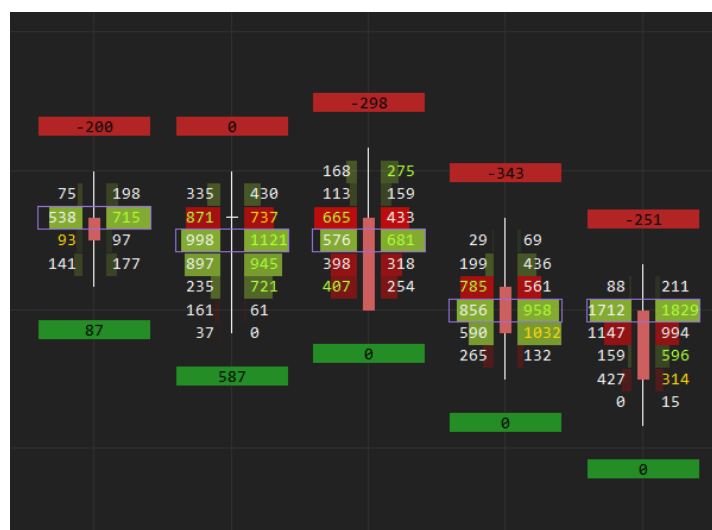
## Индикатор закрытия и индикатор большого объема (РОС свечи или объемного кластера)





## Отображение COT (приверженность трейдеров)

Приверженность трейдеров показывает нам относительную позицию трейдеров в свече. Его числовое значение является одним из наиболее важных значений силы движения цены. В качестве переменной он может указывать разворот, непрерывность и силу тренда. Все индикаторы потока ордеров на рынке основаны на подсчете ордеров по цене и времени. Поэтому эта переменная важна для выполнения этого подсчета. На следующем рисунке видны столбцы COT, показывающие значения в красных и зеленых столбцах сверху и снизу свечи.

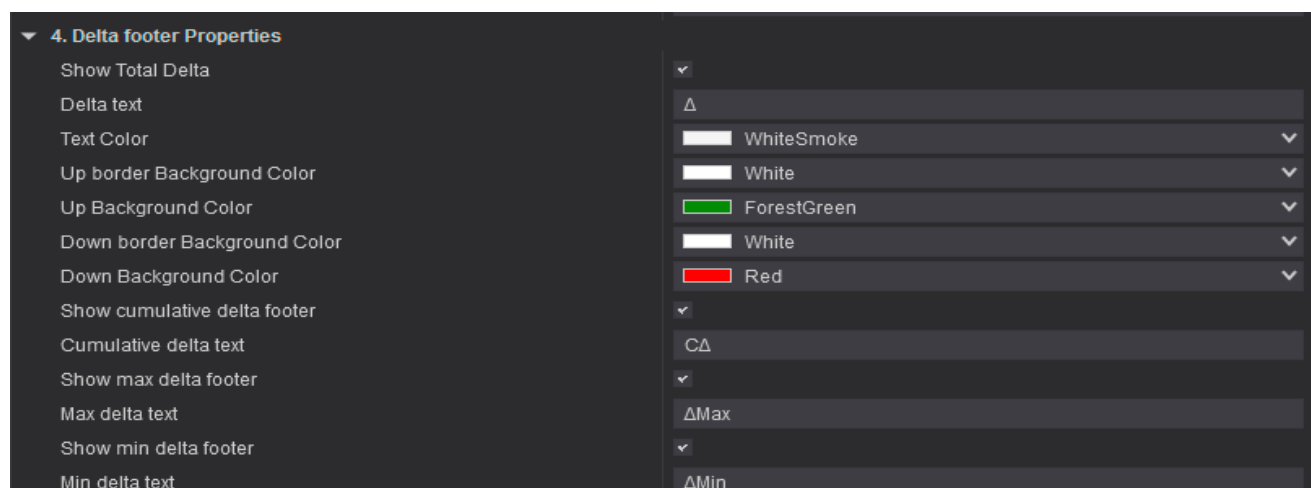


### 3. Свойства Delta Footer

С аналитической точки зрения информация о числовых значениях дельты важны. Минимальные значения дельты (нижнее значение дельты в свече), максимальная дельта (большее значение дельты в свече), накопленная дельта всей сессии, общая или чистая дельта (общая дельта) свечи и дельта завершения важны для определения относительной силы ценового движения. Например, дельта завершения служит для того, чтобы предсказать, будет ли сильным разворот или отступление от прогресса движения цены по тренду, или только незначительный разворот повторного накопления для продолжения тренда.

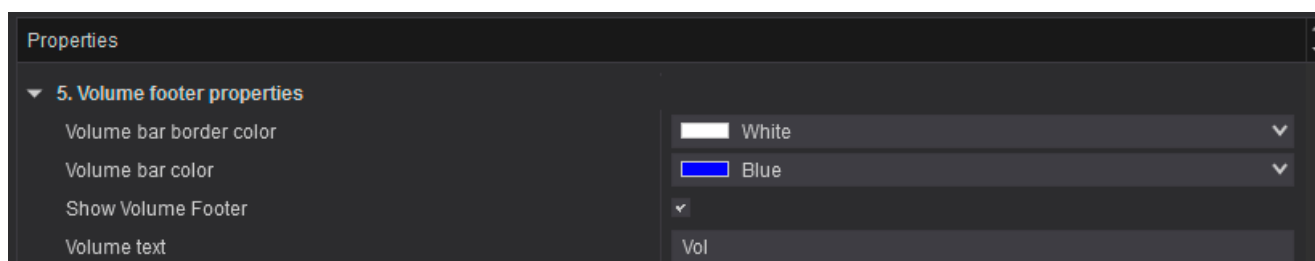
Накопленная дельта - это переменная, которая по определению должна показывать вероятное движение цены во внутрисессийной сессии. Если этого не происходит, мы находимся в состоянии дивергенции из-за расхождения между ростом цены и накопленной дельтой. Общая или чистая дельта является интересной дифференциальной переменной, поскольку она оправдывает продвижение цены, а ее знак указывает направление в потоке ордера. Расхождение между его знаком и повышением цены в свече будет указывать на такое явление как стоп объем (поглощение) или процесс профессиональной поддержки для повышения цены.

В профессиональной версии индикатора мы имеем числовое значение дельты завершения, расположенной на графике, поскольку для многих трейдеров это важный показатель. Данная дельта имеет числовое значение для определения силы продолжения движения (или разворота)



рынка. Дельта завершения - это дельта значения отката, так как в последний раз цена касалась максимума или минимума свечи, как показано на рисунке.

## 4. Свойства Volume Footer



Это просто числовое значение объема общих контрактов в свече, которое мы представляем в нижнем колонтитуле.

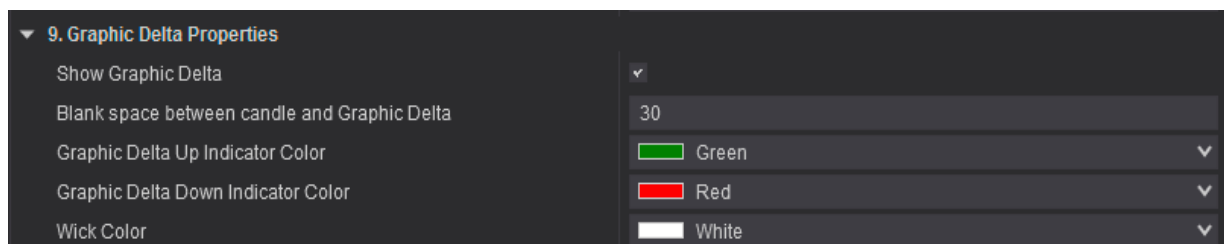
## 5. Свойства Ask и Bid Footer

The screenshot displays the 'Ask footer properties' and 'Bid footer properties' sections of the TradingFuturo settings. The 'Ask footer properties' section includes a 'Show Ask Footer' checkbox (checked), 'Ask footer bar Color' set to 'Green', 'Ask footer border Color' set to 'White', and 'Ask text' set to 'ASK'. The 'Bid footer properties' section includes a 'Show Bid Footer' checkbox (checked), 'Bid footer bar Color' set to 'Red', 'Bid footer border Color' set to 'White', and 'Bid text' set to 'BID'.

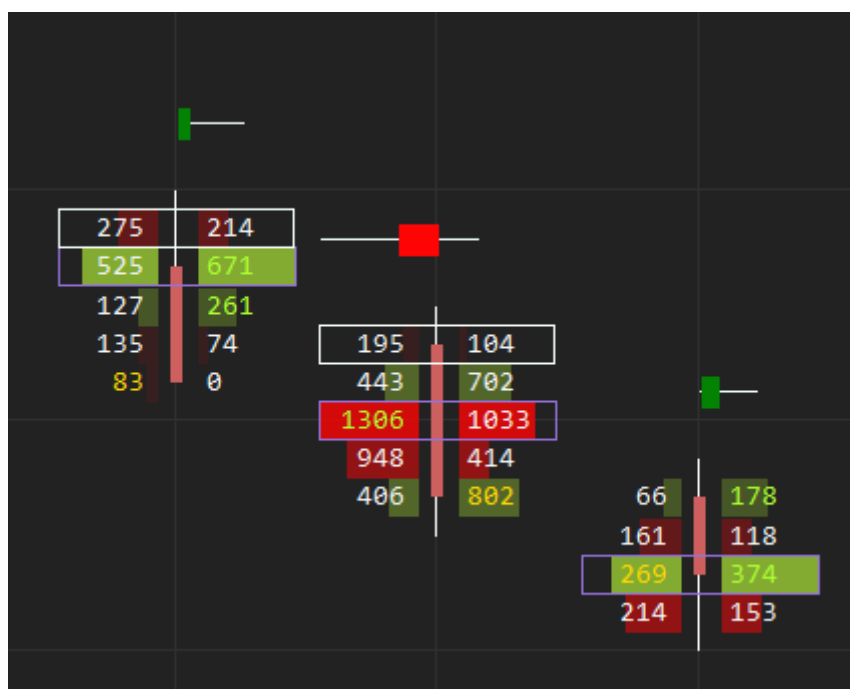
Property	Value
6. Ask footer properties	
Show Ask Footer	<input checked="" type="checkbox"/>
Ask footer bar Color	Green
Ask footer border Color	White
Ask text	ASK
7. Bid footer properties	
Show Bid Footer	<input checked="" type="checkbox"/>
Bid footer bar Color	Red
Bid footer border Color	White
Bid text	BID

Графическая конфигурация процентов покупок и продаж соответственно.

## 6. Графические свойства Delta

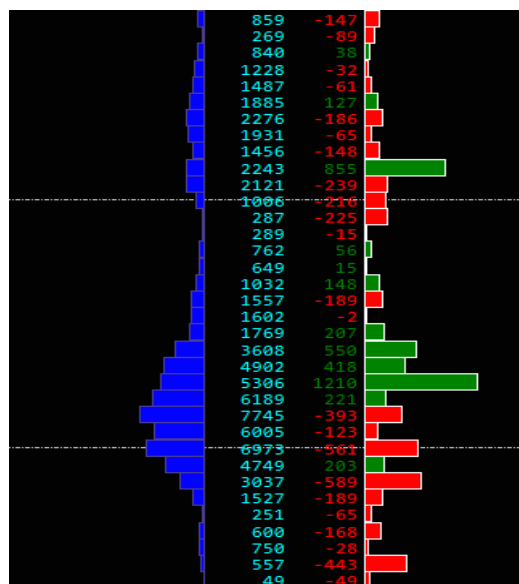


Визуальные сигналы могут помочь трейдеру, поэтому мы включаем дельты, представленные в нижней части графика и визуально над свечой. На следующем рисунке вы можете увидеть дельты, отображаемые в виде горизонтальных свечей поверх обычных свечей.



## 7.1 Voume/Delta профиль сессии

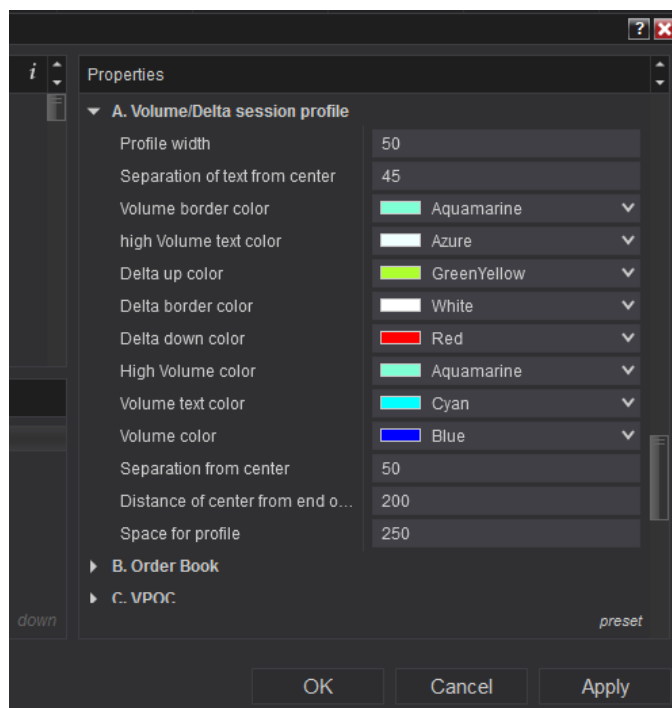
Горизонтальный дифференциал дельты представляет собой чистую дельту по уровню цен всех сессий, загруженных на график, и может дать представление о том, какие уровни цен имеют области бычьего или медвежьего значения, как показано ниже на рисунке. Наличие этой информации очень важно при открытии продаж или покупок. Его также можно использовать для фокусировки возможных уровней размещения ордеров стоп-лосс и тейк-профита.



Объемный профиль сеанса и горизонтальный дельта-дифференциал.



## 7.2 Настройка объема / дельта-профиля



В этом разделе конфигурации мы можем увидеть несколько цветов. «**Volume border color**» позволяет вам определить цвет края блоков в профиле объема. «**High volume text color**» позволяет определить цвет текста РОС профиля. Параметры «**Delta Up color**» и «**Delta Down color**» позволяют настроить цвет, если горизонтальная дельта является положительной или отрицательной соответственно. «**Delta border color**» - это цвет квадратов профиля дельты. «**High volume color**» позволяет настроить цвет РОС в профиле объема.

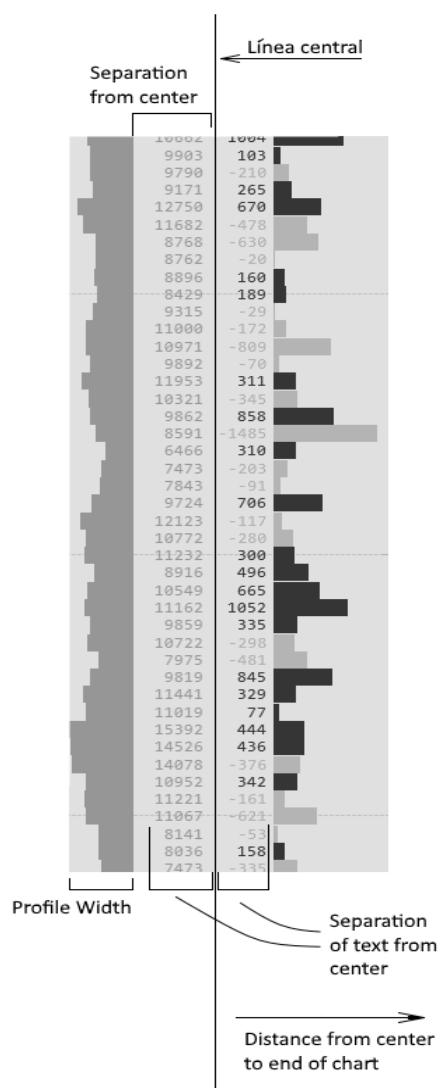
Чтобы сформировать профиль объема / дельты сессии, мы должны сначала увидеть настраиваемые части и их значение на графике.

Как вы можете видеть на рисунке ниже, этот профиль настраивается с центральной линии. Для начала посмотрим на параметр «**Distance from center to end of chart**». Этот параметр позволяет нам перемещать профиль по горизонтали, принимая за точку отсчета край конца графика. Чем больше это число в пикселях, тем левее будет размещен профиль на графике.

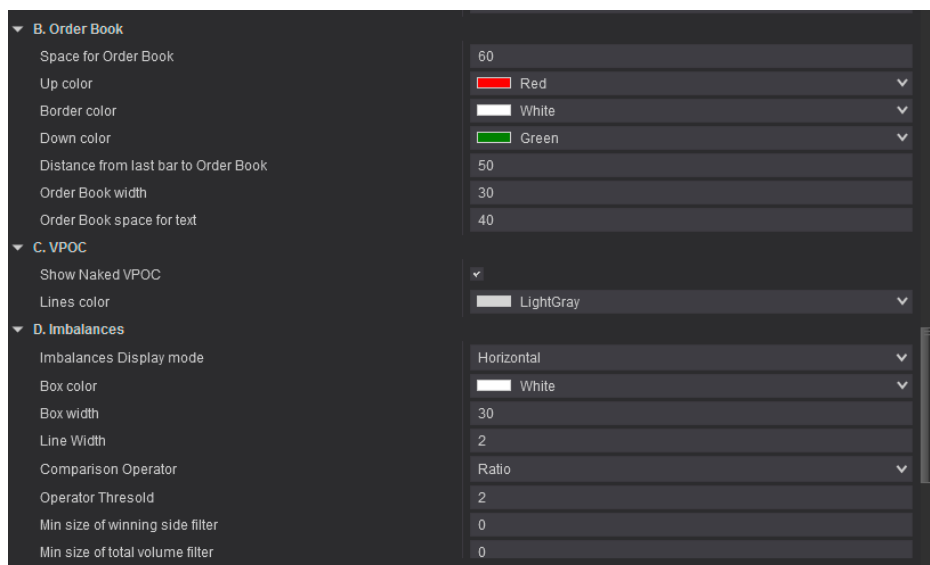
Другой параметр «**Profile width**» позволит нам определить, сколько пикселей по ширине будет иметь каждая часть профиля (обратите внимание, что для объема используется та же ширина, что и для дельты).

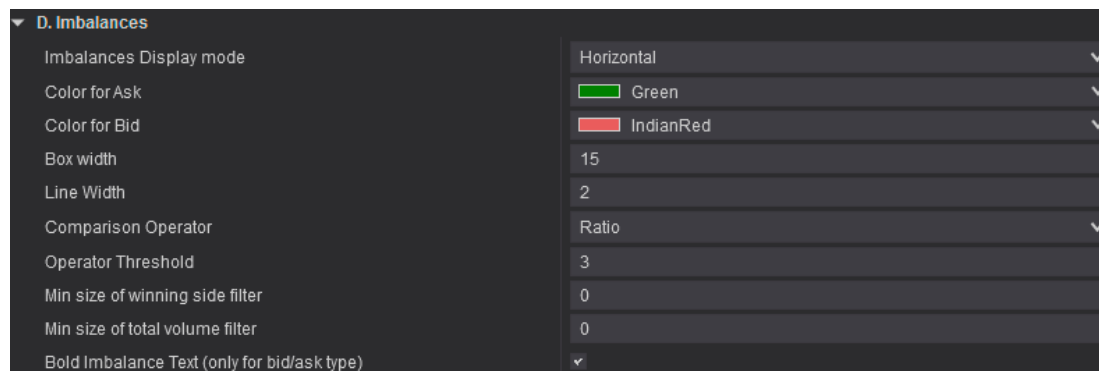
«**Separation from center**» позволяет определить границы линии между «**Profile width**» и мнимой центральной линией.

Последний параметр «**separation of text from center**» позволяет вам перемещать самый внешний край текста от этой центральной воображаемой линии к краям, делая профиль визуально более удобным.

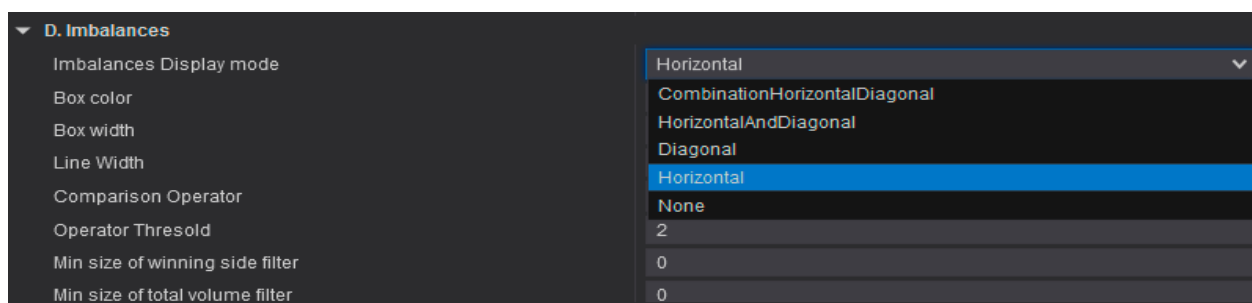


## 8. Книга ордеров, vPOC (Объем Точки Контроля), Режим отображения дисбалансов.





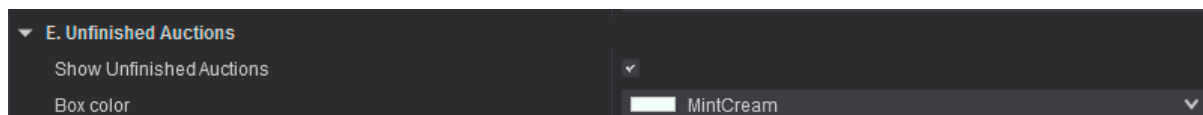
Дисбалансы имеют несколько конфигураций в соответствии с критериями трейдеров и их торговой системы.



- ✓ Color for Ask: В случае, если преобладает дисбаланс покупок, дисбаланс покажет этот цвет.
- ✓ Color for Bid: В случае, если преобладает дисбаланс продаж, дисбаланс покажет этот цвет
- ✓ Box width: Размер в пикселях поля, соединяющего Bid и Ask. Для *box width* важно выступать за пределы ширины свечи.
- ✓ Line width: Ширина линии дисбаланса в пикселях.
- ✓ Comparison Operator: Отношение или соотношение между числами в размере (Ask / Bid) и разницей - это разница или превышение между значениями Bid и Ask. Соотношение представляет собой разделение между значениями.
- ✓ Operator Threshold: Метрический порог для сравнения обоих значений.
- ✓ Min size of winning side filter: Фильтр для минимального значения. Дисбаланс отображается при превышении этого числа.
- ✓ Min size of volume filter: Минимальный фильтр объема для представления. Отображается в соответствии с минимальным значением общего совокупного объема спроса и предложения (сумма обоих).
- ✓ Bold Imbalance Text: Выделяет значения в профиле, если есть дисбаланс. Работает только для конфигурации Bid / Ask.

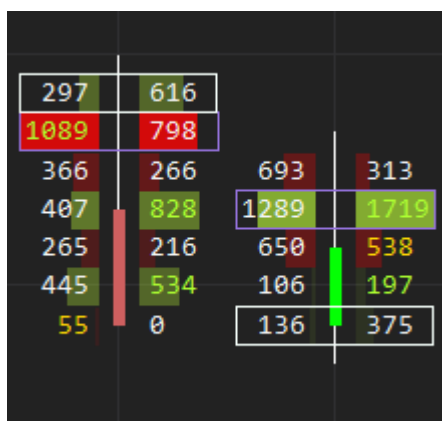
## 9. Незавершенный аукцион

Незавершенный аукцион или ожидающие ордера происходят на тех ценовых уровнях в верхней или нижней части свечи, где ни одна из сторон не проявляет интерес. Если сторона предложения на максимуме свечи выглядит пустой или равна нулю, мы наблюдаем завершённый аукцион или потерю интереса для поддержания медвежьей силы и наоборот для стороны Ask на минимуме свечи. Незавершенный аукцион часто встречается в зонах скопления большого объема.

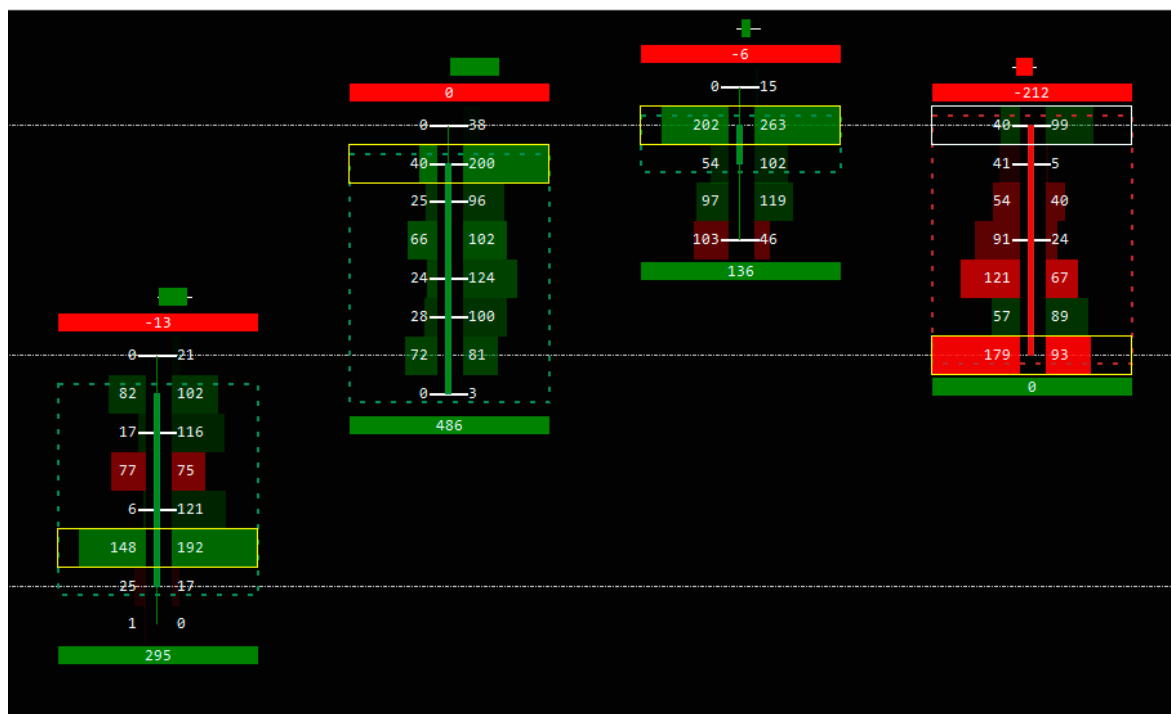


### Незавершенный аукцион

На следующем рисунке мы видим незавершенные аукционы, окруженные белым квадратом по краям свечи. Для второго не отмечено, так как цена вернулась в эту позицию.



Первые три свечи показывают «Завершенный аукцион» на самом высоком месте. В то время как последний представляет «Незаконченный аукцион». Как мы видим, в «незаконченном аукционе» свечи 4 наблюдается слияние кластеров объема свечей 2 и 3, что указывает на то, что мы находимся в области принятия цены или в месте скопления большого объема.



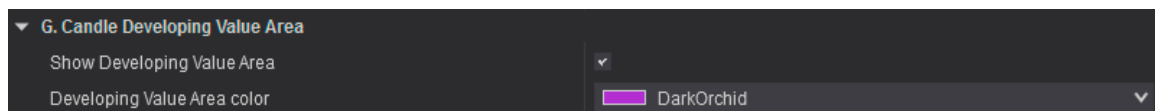
## 10. COT Force или сила приверженности трейдеров

COTForce - это индикатор силы градиентов ордеров по уровням цен или тиков. Этот индикатор может показывать, помимо прочего, микроструктуру «кривых уровней» или плотность ордеров по тикам в соответствии с фильтром, настраиваемым трейдером. По объемам ордеров на тик определенного рынка, на котором трейдер ожидает разворот рынка. Он также может показать нам объем ордеров, попавших в плохие позиции, и, следовательно, лучше сфокусировать торговлю. COT сила обычно является предпочтительным инструментом для счетчиков ордеров. Оперативные методы подсчета ордеров обычно сложны для среднего трейдера, но с помощью этого инструмента мы пытаемся преодолеть разрыв между математическими знаниями о том, как цена движется на рынках, и ее оперативным применением.



## 11. Развивающаяся область ценности

Развивающаяся область ценности (стоимости) - это новый элемент в индикаторе, который будет только в профессиональной версии. Эта модель очень репрезентативна и очень полезна для определения того, что происходит внутри свечи и для долгосрочного анализа.



В этой версии у нас есть нейтральный цвет, где дельта-значение области значений не отображается графически. Чтобы решить эту проблему, мы включили в нижнюю часть графика числовое значение дельты области ценности как сравнительный метод для определения инвестиций, разворотов, поглощений, консолидаций и кооперативных явлений.

Все эти концепции изучаются в нашем курсе Advanced Trading, в рамках которого мы тщательно анализируем происхождение этих концепций и то, как они могут использоваться трейдерами для внутридневной торговли.

На следующем рисунке мы видим площадь dValue для каждой свечи, отображаемую фиолетовым цветом для каждой свечи. Этот цвет можно настроить в зависимости от выигрышной стороны. Ширина столбцов рассчитывается исходя из ширины свечей, поэтому свечи должны быть достаточно широкими, чтобы эти столбцы могли отображаться.

