



**Для оценки ситуации** на Американских рынках Нефти, Природного Газа, Золота и Хлопка используем следующие **индикаторы технического анализа**:-

**William %R** (параметры:- 5)

**MACD Histogram** (параметры:- 15 – 2 – 2)

**Fast Stochastic** (параметры:- 25 – 5), на некоторых платформах просто Stochastic

**Slow Stochastic** (параметры:- 160 – 2 – 4 – 3)

**CCI** (Commodity Channel Index; параметры:- 90)

**TRIX** (Triple Exponential Average Indicator; параметры:- 7)

При желании можно также добавить следующие:-

Line Oscillator (параметры:- 2 – 90 – 3)

Moving Average (параметры:- 1 – 4 – 200)

MACD (параметры:- 7 – 15 – 2)

RSI (параметры:- 15 – 3)

Momentum (параметры:- 25 – 5)

ASI (Accumulation Swing Index; параметры:- 5)

Parabolic (параметры:- 30 – 30 – 300)

DMI (параметры:- 7)

Oscillator (параметры:- 3 – 15)

В первую очередь для исследования ситуации на выбранных Американских сырьевых рынках фьючерсов по помесечным и понедельным графикам **проверяем наличие на рынке долгосрочной тенденции движения цены и на какой стадии она (тенденция) находится**, а затем в сформированную таблицу каждые 15–20 минут заводим данные в виде направления движения индикаторов технического анализа (в основном, Быстрого и Медленного Стохастика). В случае складывающейся по временным интервалам в приведённой выше таблице интересной для входа в рынок ситуации – переходим к анализу 10-, 5- и 1-минутных графиков. Если они также подтверждают данную ситуацию – входим в рынок. Момент входа в рынок хорошо подсказывают пересечения линий Скользящего Среднеарифметического соответствующих параметрам 1 (MA1) и 4 (MA4); особенно, когда линия более длительного периода (MA4) сначала широко отклонилась от более короткого периода (MA1), а затем стала резко пробивать сверху вниз или снизу вверх соответственно, но не с боку, линию более короткого периода (MA1); при этом движение линии Индекса по Сырьевому Каналу (CCI) должно подтверждать направление пробоя, совпадая с ним.

**Для входа в рынок в длительную позицию** необходимо, чтобы значения всех индикаторов по всем временным графикам находились бы на экстремальных значениях – максимальных (вход в рынок продаж), минимальных (вход в рынок покупкой).

**Выход из длительных позиций** по 30-минутному или почасовому графику на экстремальных соответствующих значениях индикаторов. Момент выхода из рынка хорошо подсказывают пересечения линий Скользящего Среднеарифметического соответствующих параметрам 1 (MA1) и 4 (MA4) по ранее описанному принципу; а также экстремальные пиковые значения (0 или 100) индикатора Процент Сопротивления Уильяма (William %R).

Долгосрочные тенденции на рынке появляются не так уж часто. Если работать только по долгосрочным тенденциям, то может быть ситуация, когда после работы с такой тенденцией следующую тенденцию придётся ждать месяц-два, а то и три. Когда долгосрочная тенденция движения цены на издыхании – достаточно сложно давать прогноз на всю торговую сессию. Необходимо чётко следить за ситуацией на рынке в случае открытой ранее позиции. Если ранее открытая позиция была закрыта до этой поры, но при этом есть желание поработать на данном рынке, то лучше всего ориентироваться в такой ситуации на внутрисуточную торговлю.

**В случае движения рынка в боковом направлении** (при наличии так называемого боковика) оптимальная работа возможна лишь **внутрисуточными кратковременными операциями**. Для этой цели опять же по графикам с крупными временными интервалами исследуется ситуация, а решение о моменте входа и выходе из рынка анализируется **по 5-минутным и принимается по 1-минутным графикам**. Технология входа и выхода аналогична ранее описанной, то есть по экстремальным значениям индикаторов. При кратковременных входах в рынок непрерывно отслеживается происходящая ситуация с целью принятия своевременного решения и выходе из рынка; ни в коем случае не спускать ситуацию на самотёк.

#### **Примечания:-**

Тенденции на рынках нефти, природного газа и золота внутри одной торговой сессии длятся приблизительно 4–8 часов, начинаясь в среднем около 16 часов по Московскому времени в Зимний период. Хотя достаточно часто разворотные тенденции формируются после 17:23, когда рынки достигают своих суточных пиков предшествующей тенденции. В таких случаях можно кратковременно входить в рынок с первой или второй свечи

сформировавшейся на графике непродолжительной тенденции движения цены и удерживать позицию 4–5 часов до окончания тенденции на почасовом графике.

На сильных и стремительных провалах или подъёмах, как правило, на 1- и 5-минутных графиках может происходить дальнейший провал или подъём соответственно. Но если на 5-минутном графике произошло чересчур резкое и значительное падение или взлёт цены, а за ним мгновенный отскок или откат до точки начала такого первоначального движения и ещё далее (практически на значение первоначального падения или взлёта), то ещё как минимум три 5-минутки цена будет продолжать движение в новом выбранном направлении, прежде чем начнётся движение к точке отсчёта.

Когда %K – основная линия Быстрого Стохастика на графиках разных временных интервалов уходит в резкий и далёкий отрыв от %D – второстепенной линии – следует ждать краткосрочного отскока или отката соответственно.

Если на графике с меньшим временным интервалом индикаторы остаются на экстремальных значениях, а цена продолжает движение в выбранном направлении, необходимо отслеживать ситуацию по графикам с более длительным временным интервалом. Такое встречается на рынках со стремительными движениями цены вследствие каких-либо фундаментальных факторов, в том числе и свершившихся событий.

По мнению некоторых аналитиков, корреляция между парой USD/EUR и нефтью составляет порядка 75%, то есть при ослаблении Доллара США нефть растёт в цене и наоборот. Эту тенденцию нарушают лишь какие-то существенные фундаментальные факторы, геополитические и форс-мажорные обстоятельства, связанные с Американским рынком нефти, например, ураганы в Мексиканском Заливе, взрыв танкера в Нигерии, ремонт нефтепровода из Канады и тому подобное.

Во время неотапительного сезона в США нефть и газ при отсутствии каких-либо раздражителей – фундаментальных факторов, геополитических и форс-мажорных обстоятельств, связанных с Американскими рынками нефти и газа, – в большинстве случаев движутся разнонаправлено.

Перед выходом еженедельных статистических данных по соответствующему рынку, например, по нефти в 18:30 по Московскому времени в Среду, или по газу в 18:30 по Московскому времени в Четверг, лучше не находиться в открытой по этим рынкам позиции. В течение нескольких минут колебания цены могут осуществляться в самых резких (иногда до  $\pm 1\ 000$  Долларов на одном контракте) и стремительных (от 1–3 до 10 минут) изменениях. Причём, если принимать стартовый уровень изменения за некий ноль, то эти изменения могут происходить сначала на повышение до  $+1\ 000$ , а затем – на понижение до  $-1\ 000$  Долларов (суммарный диапазон 2 000) на одном контракте, и наоборот. Этими действиями так называемые Местные (Locals) и хэдж фонды сбивают стопы новичков или мелких торговцев в обоих направлениях движения цены. Рынок же может затем перейти в боковик.

В дни выхода, а точнее в момент выхода ежемесячной статистики по Nonfarm Payrolls лучше не держать открытых позиций по золоту и нефти. Слабые данные провоцируют значительные и скоростные изменения цен на эти виды сырья. Например, не оправдавшие прогноз и неожиданно низкие данные по Nonfarm Payrolls на уровне в 18 000 новых рабочих мест за 10 минут обвалили нефть с 98.80 до 95.60 ( $-2.20$  USD/barrel), а золото за эти же 10 минут подскочило в цене с 1 527.0 до 1 539.3 ( $+12.3$  USD/ounce). Не оправдавшие прогноз еженедельные данные по Initial Claims, выпускаемые по Четвергам в 16:30 по Московскому времени, также могут вызвать аналогичные изменения.

По мнению некоторых аналитиков корреляция между парой USD/EUR и золотом составляет порядка 75%, то есть при ослаблении Доллара США золото растёт в цене и наоборот. Эту тенденцию нарушают лишь какие-то существенные фундаментальные факторы, геополитические и форс-мажорные обстоятельства, связанные с Американским рынком золота.

В целом данные по Nonfarm Payrolls служат неким драйвером поведения курса валютной пары USD/EUR в течение следующего месяца, а еженедельные значения публикуемых Initial Claims корректируют поведение этой пары в недельном формате.

Время Московское – в Нью Йорке –7 часов (в летнее время), –8 часов (в зимнее время).

В силу того, что торги перешли в электронную форму и проводятся практически (за исключением технических перерывов) круглосуточно, сутки можно образно разделить на Азиатскую, Европейскую и Американскую торговые сессии. Во время Азиатской и Европейской сессий биржевые дельцы больше действуют мозгами, опираясь на логику, и цены в этой связи меняются незначительно и не хаотично; а в Американскую сессию биржевые дельцы больше действуют задним местом, опираясь на эмоции, и цены в этой связи меняются значительно и хаотично. Во время Азиатской и Европейской сессий даже при всех экстремумах технических индикаторов на 5-, 10-, 30-минутных, 1-часовых графиках отскоки или откаты носят незначительный характер, например, по нефти каждый из них в большинстве случаев не превышает изменения, эквивалентного 180 Долларам на одном контракте; во время Американской сессии эти значения увеличиваются в разы. В Пятницу после 22:45 часов по Московскому времени в сторону наметившихся тенденций происходит крайне вялое движение цен и при этом очень мизерными шагами, а зачастую и вовсе прекращается.

### **Временные пики активности:-**

15:40 (иногда 14:40) – 18:15 и 20:15 – 23:15 (Время Московское – в Нью Йорке –7 часов (летом), –8 часов (зимой))  
Иногда рынок активен и в период с 18:15 по 20:15 (Время Московское; смотри выше), но это бывает редко.  
В Пятницу после 23:00 (Время Московское; смотри выше) – активность нулевая.

### **Сезонные факторы на Американском рынке энергоносителей:-**

ОТОПИТЕЛЬНЫЙ СЕЗОН – с 01 Октября по 31 Марта

СЕЗОН ПИКНИКОВ – с конца Мая (День Поминования) по начало Сентября (День Труда)

СЕЗОН КОНДИЦИОНИРОВАНИЯ – с 01 Июня по 31 Августа

СЕЗОН УРАГАНОВ В АТЛАНТИКЕ – с 01 Июня по 30 Ноября (пик в середине Сентября)

ПЛАНОВЫЕ СЕЗОННЫЕ РЕМОНТНЫЕ РАБОТЫ НА ГПЗ И НПЗ:-

(i) с Февраля по начало Мая

(ii) Сентябрь – Октябрь

ФАЗА НАКОПЛЕНИЯ ПРИРОДНОГО ГАЗА В ХРАНИЛИЩАХ – с Марта–Апреля по начало Октября

### **Лимиты Прибыли и Убытка (для внутрисуточных операций) на один фьючерс:-**

LOSS LIMIT – \$200

PROFIT LIMIT – min \$100

Резать убытки не раздумывая, при достижении лимита убытка и отрабатывать их, и ни в коем случае не ждать пока они ещё больше возрастут в ожидании их возможного уменьшения.

Никогда не жалеть о 'прошедшем мимо поезде'. Обязательно будут ещё и не раз. Ждать и просчитывать с помощью анализа отправление 'нового поезда'.