

Стратегия трейдинга от красного к зеленому

Описание стратегии

Образование гэпов на открытии торговой сессии позволяет нам создать простую и эффективную стратегию “От красного к зеленому”, что в классике также называют как “торги гэперами”.

Гэпперы в нашем случае это бумаги компаний, которые образуют значительные расстояния между ценой закрытия предыдущего торгового дня и ценой открытия текущего.



Рис. Гэп на графике S&P 500, таймфрем 5 минут. [Источник](#)

Для трейдера технического анализа уровень закрытия предыдущего торгового дня является мощным сопротивлением или поддержкой. Поэтому трейдеры могут торговать в их сторону при наличии растущего объема. Это значит что если со старта торгов мы наблюдаем ценовой разрыв, в большинстве случаев цена будет стремиться к его закрытию.

Если на открытии рынка цена образовала гэп и открылась выше чем уровень последней сделки вчера, тогда динамика торгов будет стремиться от “зеленой свечи к красной”, то есть идти вниз. Если на открытии рынка цена окажется ниже уровня последней сделки предыдущего дня, то динамика торгов при растущих объемах будет стремиться “от красного к зеленому”, то есть расти вверх.

Образование гэпов свойственно так называемым “акциям в игре” (stocks in play). Повышенные объемы торгов в этих бумагах из-за происходят из-за более пристального рыночного внимания чем обычно, причины этому могут быть совершенно разные:

выход отчетности, важная макростатистика сектора, прогнозы руководства по выручке или переоценка справедливой стоимости от покрывающих аналитиков.

Перед тем как перейти к практическим примерам давайте условимся. Для того чтобы не возникало путаницы между цветами и названием, в обоих случаях будем называть стратегию “От красного к зеленому”.

Пример “От красного к зеленому”

Рассмотрим практический пример стратегии в акции Apple (AAPL).

На открытии рынка цена образовала большой гэп вниз. После закрытия первой пятиминутной свечи мы видим подтверждение повышенных объемов, поэтому по результатам формирования второй пятиминутной свечи цены получаем точку входа в рынок по \$135,24. Устанавливаем стоп за уровень day low \$134,35 и целимся по прибыли на перекрытие гэпа к планке \$138,28.



Рис. График акций Apple, таймфрейм 5 минут. [Источник](#)

По итогам формирования свечей мы видим что на перекрытие гэпа в целом объемы в бумаге AAPL были в среднем в 2,5 раза выше обычных, чем мы и смогли успешно воспользоваться.

Пример “От зеленого к красному”

Теперь взглянем на отражение предыдущего примера, формацию “От зеленого к красному”.

Со старта торгов в акциях Uber (UBER) образовался гэп вверх при повышенном объеме, по итогу формирования второй пятиминутной свечи мы получили точку входа в рынок по цене \$32,80. Стоп устанавливаем за day high и круглый уровень на планку \$33,04, по прибыли целимся на перекрытие гэпа к \$32,10.

После открытия короткой позиции мы видим несколько ретестов уровня открытия сделки и дальнейшее движение вниз, на повышенных объемах в сторону закрытия гэпа.



Рис. График акций Uber, таймфрейм 5 минут. [Источник](#)

На практике перекрытие гэпов сверху-вниз “От зеленого к красному” встречаются реже, но это не значит что вы не сможете найти интересные сделки по риск-доходности в этой формации.

Выводы

Теперь резюмируем стратегию и обсудим некоторые нюансы при торгах “От красного к зеленому”:

1. Чаще всего акции с гэпами встречаются в *stocks in play*. Поэтому при составлении *watchlist* на предстоящий торговый день нужно внимательно посмотреть на бумаги со свежими новостями.
2. При перекрытии гэпа снизу-вверх можно рассмотреть для точки входа длинную позицию, в расчете что движение на повышенных объемах сохранится.
3. Стоп лосс устанавливаем после второй свечи за максимум или минимум торгового дня, ближайший технический уровень или круглую цифру +3-4 пункта.
4. Если цена проходит 60% от намеченной цели, то можно перенести стоп позицию в безубыток.

На практике стратегия “От красного к зеленому” может работать в акциях Uber и Apple, но быть совсем неэффективной в AMD или Intel, все индивидуально от инструмента к инструменту. Поэтому перед применением стратегии желательно собрать статистику, посмотреть график инструмента за последние 7-10 дней и изучить в нем перекрытия гэпов.