

PolySigma

BTC 15-Minute Trading Course

From \$30 to \$1,000

Оглавление

Модуль 1 - Введение

- Урок 1 - Начало
- Урок 2 - Что Такое Polymarket 15-Минутки
- Урок 3 - Знакомство с курсом PolySigma : BTC 15m Polymarket
- Урок 4 - Что нужно для успеха
- Урок 5 - Путь \$30 → \$1,000
- Урок 6 - Как Проходить Курс

Модуль 2 - Структура Рынка

- Урок 1 - Как Работает Бинарный Рынок
- Урок 2 - Подразумеваемая Вероятность и Реальная Вероятность
- Урок 3 - Ценовые Неэффективности
- Урок 4 - Психология Цены Шейра
- Урок 5 - Поведение Книги Ордеров (CLOB)
- Урок 6 - Спред и Его Стоимость

Модуль 3. Математика Рынка

- Урок 1. Безубыточный винрейт (Win Rate)
- Урок 2. Ожидаемая стоимость (Expected Value)
- Урок 3. Компаундирование: 30 долларов → 1000 долларов
- Урок 4. Асимметрия риска по цене Шейра
- Урок 5. Почему 95% трейдеров терпят убытки
- Урок 6. Когда НЕ входить в сделку

Модуль 4. Лучшие индикаторы для 15 млн BTC

- Урок 1. RSI — индекс относительной силы
- Урок 2. MACD — схождение/расхождение скользящих средних
- Урок 3. VWAP — средневзвешенное значение по объему
- Урок 4. EMA 9 и EMA 21 — быстрые скользящие средние
- Урок 5. Pivots HL 10 — уровни поддержки и сопротивления
- Урок 6. Как комбинировать 5 индикаторов

Модуль 5. Сила тренда — свечной анализ

- Урок 1. Анатомия Свечи
- Урок 2. Свечи Хейкин Аши
- Урок 3. 3-свечной трендовый фильтр
- Урок 4. Паттерны силы и слабости
- Урок 5. Momentum Свечей
- Урок 6. Мультитаймфреймовый анализ

Урок 7. Свечи и 15-минутные бинарные опционы — особенности

Модуль 6. Лесенка выходов

Урок 1. Что такое «лестница выходов»

Урок 2. Уровень 90¢ — первая и главная фиксация

Урок 3. Уровни 93¢ и 95¢ — основная зона прибыли

Урок 4. Уровень 97¢ — максимальная прибыль

Урок 5. Стоп-лосс и психология

Урок 6. Практика: полный расчет лесенки

Модуль 7. Определение размера позиции

Урок 1. Почему размер важнее направления

Урок 2. Динамический подбор размера: когда больше, когда меньше

Урок 3. Масштабирование капитала: рост с сохранением баланса

Урок 4. Определение размера с учетом просадки

Урок 5. Комплексная Модель Роста

Урок 6. Правило Одной Позиции

Модуль 8. Продвинутое сигналы

Урок 1. ATR: главный индикатор волатильности

Урок 2. Полосы Боллинджера: сжатие и пробой

Урок 3. StochRSI: перекупленность и перепроданность

Урок 4. Ворота спреда Bid-Ask

Урок 5. Комбинация индикаторов: конфликтная модель

Урок 6. Режимы рынка и выбор индикаторов

Модуль 9. Психология исполнения

Урок 1. Главная Правда

Урок 2. Кластеризация убытков

Урок 3. Эмоциональный Капитал

Урок 4. Trade Journaling: Структура

Урок 5. Эффект Потери Прибыли

Урок 6. 5-минутная подготовка к сделке

Модуль 10. Динамика сессий

Урок 1. Торговые сессии: статистический обзор

Урок 2. Когда НЕ Торговать

Урок 3. Зоны ATR: как адаптироваться к волатильности

Урок 4. Макрофон: три сигнала перед началом торговли

Модуль 11. Защита капитала

Урок 1. Математика Просадки

Урок 2. Каскадная система защиты

Урок 3. Правило Двух Лоссов

Урок 4. Позиционный размер при проседании

Урок 5. Резервный капитал (70/30)

Урок 6. Защита High-Water Mark

Модуль 12. Кейсы и финал

Урок 1. Ветер перемен — x100 за несколько недель

Урок 2. Реальный рынок: как оценивать ситуацию

Урок 3. Разбор моего пути от \$100 до \$700 со 100% винрейтом — как я это сделал?

Урок 4. Как получить 64% WR, совершая всего одну сделку в день

Урок 5. Финал: Ты Дошёл

Модуль 1 - Введение

Урок 1 - Начало

Добро пожаловать в PolySigma!

Этот курс написан реальным трейдером для тех, кто ищет рабочий способ стабильно зарабатывать на Polymarket 24/7. Это самый информативный гайд, который вы только сможете найти на эту тему.

Меня зовут krajekis - я фаундер PolySigma. Я торгую BTC 15-минутки на Polymarket фулл-тайм. Я изучаю эту тему уже достаточно долго - и увидел, что реально полезных гайдов на рынке просто нет.

Поэтому я решил создать его сам. Я вложил сюда много сил и постарался затронуть каждый нюанс, который поможет вам заработать.

Ходит миф, что трейдинг - это супер сложно, и отчасти так и есть. Но я упрощу всё это для вас максимально, чтобы даже новичок пришёл к результату.

Будьте крайне внимательны и относитесь серьёзно к каждому практическому заданию - и тогда вы сможете действительно зарабатывать каждый день, как многие мои ученики.

Учись с PolySigma

От нуля до стабильной прибыли на Polymarket BTC 15-минутных рынках

13 Модулей

\$30 → \$1K

Урок 2 - Что Такое Polymarket 15-Минутки



Polymarket - это платформа предиктов, где вы покупаете бинарные шейры (YES или NO) на исход событий. Мы торгуем конкретный тип рынка: "Цена BTC будет выше/ниже X через 15 минут?"

Как это работает:

Каждые 15 минут открывается новый рынок

Вы покупаете шейр YES (BTC пойдёт вверх) или NO (BTC пойдёт вниз)

Шейр стоит от 1¢ до 99¢

Если вы правы, шейр становится 100¢. Если нет, 0¢

Вы можете продать свои шейры в любой момент в течение 15-минутки

Ваша прибыль = 100¢ минус цена покупки

Пример:

Купили YES по 62¢. BTC вырос. Шейр = 100¢. Прибыль: 38¢ на каждый шейр (+61%).

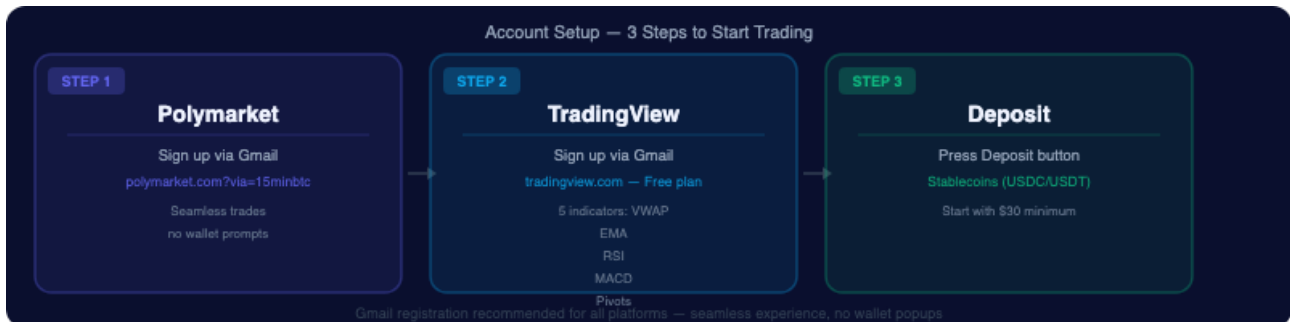
Это рынок, где можно построить системное преимущество с помощью данных, индикаторов и дисциплины. Именно этому и посвящён этот курс.

► ЗАДАНИЕ

Объясни себе своими словами: как разрешается рынок? Что происходит с шейром при WIN и при LOSE?

Урок 3 - Знакомство с курсом PolySigma : BTC 15m Polymarket

Настройка Аккаунта: Polymarket + TradingView



Шаг 1 — Polymarket: Регистрация через Gmail

Перейди по ссылке:

Нажми Sign Up → выбери Continue with Google

Gmail-аккаунт = бесшовные сделки без подтверждений кошелька

Polymarket автоматически создаёт встроенный кошелек (Embedded Wallet)

Не нужен MetaMask, не нужны seed фразы — всё в браузере

Включи 2FA в настройках аккаунта (Settings → Security) — это нужно для сделок без подписи кошелька

Готово: ты видишь дашборд Polymarket с балансом \$0

Шаг 2 — Пополнение баланса

На дашборде нажми кнопку Deposit (зелёная, вверху справа):

Через Crypto → поддерживает USDC, USDT (Любая удобная сеть)

Минимальный старт: \$30

Если нет крипты — можно пополнить картой (Moonpay, Transak)

После депозита средства появятся в течение 1-5 минут

Готово: баланс пополнен, можно торговать

Шаг 3 — TradingView: Регистрация

Перейди на

Нажми Sign up → Continue with Google (тот же Gmail)

После регистрации привяжи карту (даже \$1 — просто для верификации)

Привязка карты даёт 1 месяц бесплатно с доступом к 5 индикаторам

5 индикаторов = ровно столько нам нужно, хватает на весь курс

Шаг 4 — Настройка графика BTC



В строке поиска введи: BTCUSDT → выбери Binance → таймфрейм 1 мин
 Добавь 5 индикаторов (кнопка Indicators вверху):

#	Название	Настройки
1	VWAP Session	по умолчанию
2	EMA 9/21 with Target Price [SS] 500	по умолчанию
3	Pivots HL 10 10 10 10	по умолчанию
4	RSI	период 14, источник Close
5	MACD	12, 26, 9, источник Close

Почему именно эти 5:

VWAP — институциональный бенчмарк, цена стремится к нему

EMA 9/21 — быстрые скользящие + уровни цели

Pivots HL — уровни поддержки/сопротивления за 10 баров

RSI — фильтр перекупленности/перепроданности

MACD — подтверждение направления и силы тренда

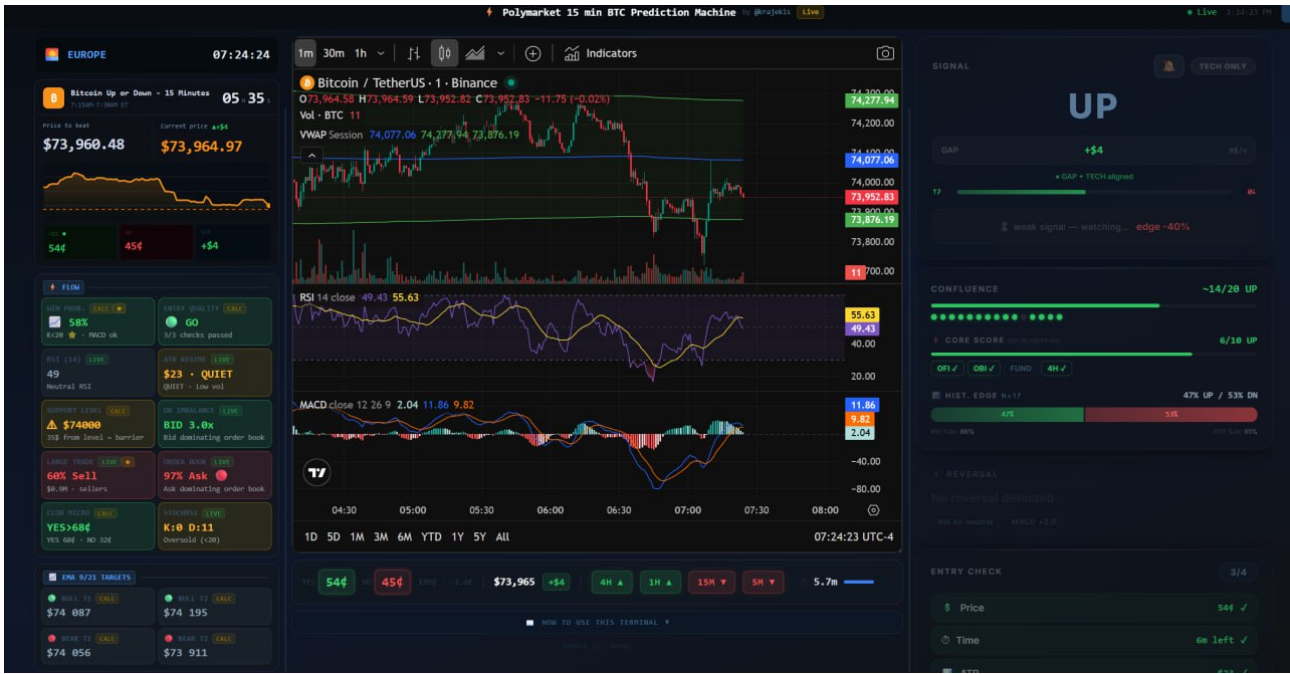
Быстрый старт — готовые сетапы по ссылке:

- RSI / MACD / ATR / EMA / Pivots - tradingview.com/chart/viDiQU1Y/
- RSI / MACD / VWAP / EMA / Pivots - tradingview.com/chart/06yO8nvY/

Открой ссылку — график загрузится со всеми индикаторами. Ничего настраивать вручную не нужно.

Настройка завершена. Можно анализировать рынок и принимать решения по курсу!

Если у вас проблемы с привязкой карты — после прохождения 12 модулей курса по умолчанию после покупки курса вам будет доступен терминал — можете просто использовать только его.



► ЗАДАНИЕ

Зарегистрируй аккаунт Polymarket и TradingView. Найди BTC/USDT на 1m и 15m графике.

Урок 4 - Что нужно для успеха

Готовность учиться и практиковаться - это не волшебная кнопка, а навык, который нарабатывается

\$30+ для старта - минимальный рекомендуемый депозит для начала торговли на Polymarket

2-4 часа в день - время, которое нужно уделять торговле и обучению

Дисциплина - следовать системе, даже когда хочется нарушить правила

Готовность к убыткам - они будут, это часть процесса. Важно уметь их контролировать

Что вы получите:

Базовые знания о BTC трейдинге

Лучшие стратегии

Как найти реальное преимущество

Советы по управлению рисками

Топ индикаторы

Практические задания к каждому модулю

20-факторную систему принятия решений

Реальные кейсы и разбор ошибок

Философия входов

► ЗАДАНИЕ

Запиши 3 качества успешного трейдера. Какое из них для тебя самое сложное прямо сейчас?

Урок 5 - Путь \$30 → \$1,000

Цель курса - провести вас от \$30 до \$1,000 шаг за шагом. Это +3,233% роста. На традиционных рынках это десятилетие. На Polymarket - 2-4 недели дисциплинированной работы.

Структура пути:

Основы (Модули 1-3): Введение, структура рынка, математика торговли

Здесь вы строите фундамент. Без него всё остальное бесполезно.

Входы и выходы (Модули 4-6): Лучшие индикаторы, свечной анализ, лесенка выходов

Здесь вы узнаете когда ТОЧНО входить и когда ТОЧНО выходить. Никаких догадок.

Риск и рост (Модули 7-10): Position sizing, продвинутые сигналы, психология, динамика сессий

Здесь вы узнаете не терять то, что заработали. Это разница между любителем и профессионалом.

Мастерство (Модули 11-13): Защита капитала, кейсы и финал, PolySigma Terminal

Здесь вы собираете всё вместе, доказываете результат и открываете доступ к живым сигналам.



► **ЗАДАНИЕ**

Посчитай сам: стартуя с \$30 и делая +5% за сделку — сколько сделок нужно чтобы
дойти до \$1,000?

Урок 6 - Как Проходить Курс

Темп: Не торопитесь. Лучше медленно и с пониманием, чем быстро и поверхностно.

Практика: Каждый модуль заканчивается заданием. Выполняйте его. Без практики теория бесполезна.

Paper Trading: Первые 1-3 дня торгуйте на бумаге (без реальных денег). Это не трусость - это профессионализм. Даже hedge-фонды тестируют стратегии перед запуском.

Журнал: Записывайте каждую сделку. Дата, цена входа, количество совпавших сигналов, результат, эмоция. Через месяц вы увидите паттерны, которые невозможно заметить без записей.

Вопросы: Если что-то непонятно - перечитайте раздел. Если всё ещё непонятно - это нормально. Некоторые концепции становятся ясными только после практики.

Дисциплина: Правила существуют не чтобы ограничивать вас, а чтобы защитить. Каждое правило в этом курсе написано на основе реального опыта - чаще всего на основе реальных потерь.

► ЗАДАНИЕ

Подпишись на PolySigma в X и покажи немного любви! :) → x.com/PolySigma

Модуль 2 - Структура Рынка

Урок 1 - Как Работает Бинарный Рынок



Почему это важно:

Каждая ошибка в трейдинге начинается с непонимания продукта. Polymarket — не казино и не букмекер. Это рынок прогнозов с CLOB (книга лимитных ордеров), где цена шейра = подразумеваемая вероятность события.

Как открывается рынок:

Каждые 15 минут, 24/7, автоматически открывается новый рынок. В момент открытия фиксируется цена BTC через оракулы (UMA) — это и есть страйк-прайс. Важно: цена на Polymarket отличается от цен на биржах. Вопрос всегда одинаковый: “Будет ли BTC выше этой цены ровно через 15 минут?” Один рынок = один вопрос = один страйк.

Ключевая концепция:

YES шейр стоит 0-100¢. Купить YES = купить вероятность того, что BTC вырастет. При разрешении: YES = 100¢ (победа) или 0¢ (проигрыш). Нет промежуточных значений. NO шейр — зеркальная позиция: если ты прав по NO, ты выигрываешь 100¢ если BTC упадёт.

Формула:

YES + NO = ~100¢ (разница = спред 1-2¢ — это и есть доход Polymarket)

Цена YES = подразумеваемая вероятность роста

YES = 62¢ означает “рынок считает вероятность роста = 62%”

Жизненный цикл за 15 минут:

Время	Фаза	Что происходит
15:00 → 10:00 до конца	Ранняя	Рынок ещё не определился. Цена прыгает. Рано входить.

10:00 → 5:00 до конца	Лучшая зона	Тренд виден, цена стабилизировалась. Лучшее время для входа.
5:00 → 1:00 до конца	Поздняя	Цена уже отражает исход. Дорого входить, мало потенциала.
0:00	Итог	Ogacle считывает цену BTC. Результат: 100¢ или 0¢.

CLOB — книга лимитных ордеров:

Polymarket работает как биржа, не как тотализатор. Ты ставишь лимитный ордер: “хочу купить YES за 62¢”. Counterparty — другой трейдер, не платформа. Это означает: ликвидность бывает разной. В тихие часы спред широкий (5-8¢), в активные — узкий (1-2¢).

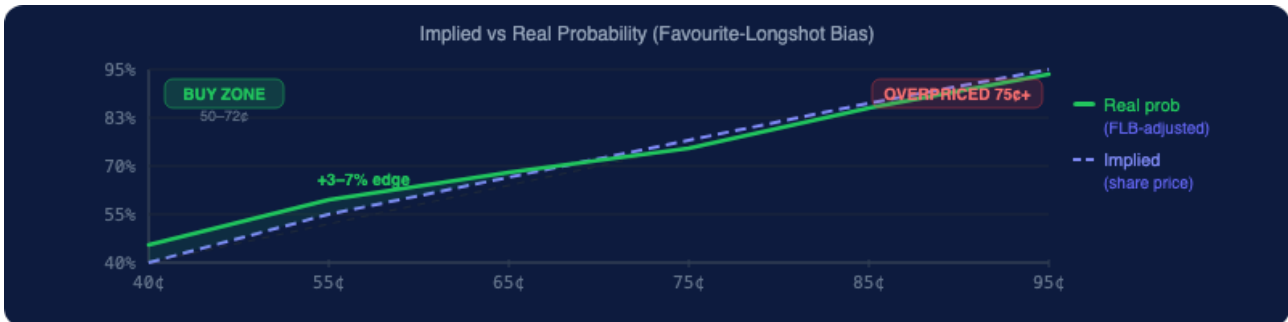
Конкретный пример:

Рынок открылся: страйк \$95,850. Сейчас минута 12, BTC = \$96,200 (+\$350 выше). YES торгуется по 68¢. Ты покупаешь YES за \$20. Через 3 минуты BTC = \$96,050 — всё ещё выше страйка. Ogacle разрешает YES = 100¢. Ты получаешь \$29.40. Прибыль: +\$9.40 (+47% за 3 минуты).

► ЗАДАНИЕ

Открой любой BTC 15-мин рынок. Запиши YES и NO цену. Сложи их — равна ли сумма 1.00?

Урок 2 - Подразумеваемая Вероятность и Реальная Вероятность



Почему это важно:

Трейдеры путают цену шейра с реальной вероятностью. Это фундаментальная ошибка. Цена = консенсус рынка, но рынок систематически ошибается в определённых ценовых зонах.

Ключевая концепция:

Favourite-Longshot Bias (FLB) - документированный эффект на предсказательных рынках. Исследования (Snowberg & Wolfers, 2010) показывают: рынки завышают вероятность очевидных исходов (шейры 85-99¢) и занижают вероятность умеренных (шейры 50-72¢).

Математика:

Цена шейра	Подразумеваемая вероятность	Реальная вероятность (FLB-adjusted)	Разница
55¢	55%	~58-62%	+3-7% в нашу пользу
65¢	65%	~67-70%	+2-5% в нашу пользу
85¢	85%	~82-84%	-1-3% против нас
95¢	95%	~91-93%	-2-4% против нас

Запомни. Зона 55-72¢ — единственный диапазон, где FLB работает в пользу покупателя. Выше 75¢ — переплачиваем за вероятность.

► ЗАДАНИЕ

Найди рынок, где YES стоит 60¢. Посчитай подразумеваемую вероятность (implied probability) и сравни с реальной вероятностью по тренду BTC.

Урок 3 - Ценовые Неэффективности



Почему это важно:

\$40М арбитражной прибыли было извлечено с Polymarket за 2024-2025 годы . Неэффективности реальны и систематичны.

Типы неэффективностей:

- Арбитраж YES+NO — Сумма обоих шейров меньше 98¢

Если YES = 60¢ и NO = 37¢, сумма = 97¢. Покупка обоих шейров гарантирует 100¢ - 97¢ = 3¢ прибыли (3.1% за 15 минут).

- Stale price после быстрых движений BTC

Когда BTC движется \$200+ за минуту, маркет-мейкеры Polymarket не успевают обновить котировки. Цена шейра отстаёт на 5-15 секунд.

- Ликвидная асимметрия — bid тоньше ask стороны

Bid сторона часто тоньше ask стороны. Крупная покупка сдвигает цену непропорционально сильно вверх.

Как использовать:

Мы не делаем чистый арбитраж (нужен \$100K+ капитал). Но мы используем stale pricing: входим в позицию когда Binance уже показывает движение, а Polymarket ещё не отреагировал.

Типичная ошибка:

Покупка шейра выше 75¢ "потому что тренд очевиден" - это ловушка. Тренд уже заложен в цену.

► ЗАДАНИЕ

Открой 3 рынка подряд. Найди тот, где сумма YES+NO отличается от 1.00 больше всего. Куда уходит разница?

Урок 4 - Психология Цены Шейра



Почему это важно:

Поведение трейдера меняется в зависимости от текущей цены шейра. Это предсказуемо и эксплуатируемо.

Поведенческая модель:

Зона 50-60¢ (Неопределённость):

Трейдеры неуверены, спреды широкие

Ликвидность низкая, но потенциал максимальный

Вход здесь = лучший risk/reward, но требует совпадения всех сигналов

Зона 60-72¢ (Наш оптимум):

Тренд начинает подтверждаться

Ликвидность растёт, спреды сужаются

Оптимальный баланс между вероятностью и потенциалом

Зона 75-85¢ (Переплата):

Тренд "очевиден" для всех

Розничные трейдеры массово входят

Risk/reward ухудшается: платишь 80¢ чтобы получить 100¢ = +25%

Зона 90-99¢ (Ловушка):

Максимальный conviction, минимальный reward

При 95¢: платишь \$95 чтобы заработать \$5 (5.3% потенциал)

Если BTC разворачивается - шейр падает с 95¢ до 5¢ за секунды

Никогда не входить выше 72¢

► ЗАДАНИЕ

Запиши цену YES-шейра каждые 2 минуты в течение одной 15-минутки. Как менялось поведение трейдеров?

Урок 5 - Поведение Книги Ордеров (CLOB)

The screenshot shows an Order Book interface with the following data:

TRADE UP	PRICE	SHARES	TOTAL
	57¢	448,50	\$909,99
	56¢	256,40	\$654,35
	55¢	782,45	\$510,77
Asks	54¢	148,93	\$80,42
Last: 51¢		Spread: 1¢	
Bids	53¢	693,91	\$367,77
	52¢	408,69	\$580,29
	51¢	886,28	\$1 032,29
	50¢	254,01	\$1 159,29

Почему это важно:

CLOB - источник информации о намерениях других трейдеров. Micro-price из CLOB предсказывает краткосрочное движение лучше, чем текущая рыночная цена.

Ключевая концепция:

Polymarket использует полноценную книгу ордеров с bid/ask уровнями.

Bid (бид) — цена, по которой покупатели готовы купить шейр. Это максимальная цена спроса.

Ask (аск) — цена, по которой продавцы готовы продать шейр. Это минимальная цена предложения.

Спред = Ask - Bid. Чем меньше спред, тем выше ликвидность рынка.

Micro-price формула:

$$\text{microPrice} = (\text{bidPrice} \cdot \text{askSize} + \text{askPrice} \cdot \text{bidSize}) / (\text{bidSize} + \text{askSize})$$

Пример (реальная книга ордеров):

Цена	Шейров	Итого
Ask (продавцы)		
57¢	448	\$909
56¢	256	\$654
55¢	782	\$510
54¢	148	\$80

Спред: 1¢	Last: 51¢	
Bid (покупатели)		
53¢	693	\$367
52¢	408	\$580
51¢	886	\$1,032
50¢	254	\$1,159

Лучший Ask = 54¢ (самый дешёвый продавец). Лучший Bid = 53¢ (самый щедрый покупатель). Спред = 1¢.

Mid-price = $(53 + 54) / 2 = 53.5¢$

Micro-price = $(53 \times 148 + 54 \times 693) / (148 + 693) = 53.82¢$

Micro-price > mid-price → объём покупателей (693 шейра на bid) больше чем продавцов (148 на ask). Давление покупателей — цена скорее вырастет.

Ловушки ликвидности:

Тонкая книга (суммарный объём < 2000 шейров на top-5 уровнях) = опасная зона. Одна крупная сделка может сдвинуть цену на 3-5¢. Не входить при тонкой ликвидности.

Правило: Проверять глубину CLOB (depth-5) перед каждым входом. Суммарный volume < 1500 шейров = пропуск сделки.

► ЗАДАНИЕ

Открой книгу ордеров (CLOB) для текущего рынка. Запиши top-5 bid и ask. Какой спред?

Урок 6 - Спред и Его Стоимость



Почему это важно:

Спред - это скрытая комиссия каждой сделки.

Ключевая концепция:

Spread = askPrice - bidPrice. На Polymarket типичный спред: 0.5-2.0¢.

Влияние на P&L:

При спреде 1¢ на вход + 1¢ на выход = 2¢ скрытой стоимости.

На сделке \$50 при входе 62¢: $2¢/62¢ = 3.2\%$ от инвестиции уходит на спред.

Когда спред расширяется:

Первые 60 секунд после открытия рынка (маркет-мейкеры устанавливают цены)

Во время быстрых движений BTC (> \$100 за минуту)

При низкой ликвидности (ночная Азия, выходные)

Bid-Ask Spread Gate:

Не входи в сделку при спреде > 3¢. При спреде 3¢+ стоимость входа/выхода съедает значительную долю потенциальной прибыли.

Практика:

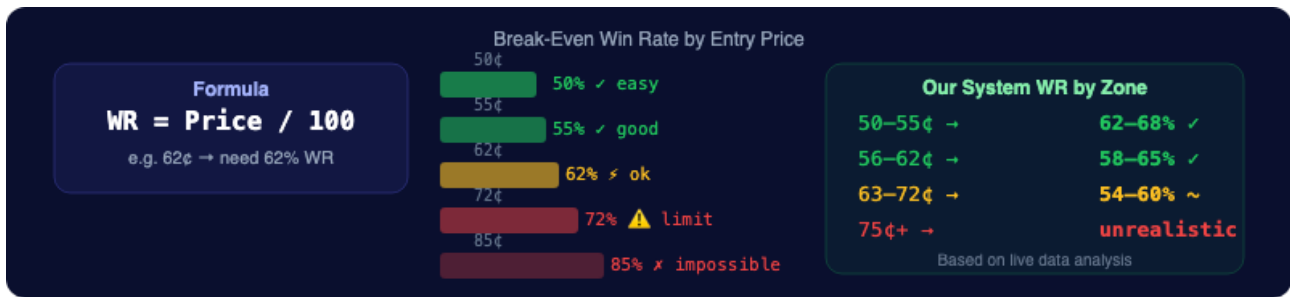
Используй лимитные ордера (не рыночные) для входа. Размещай bid на 0.5¢ ниже текущего ask. В 60-70% случаев ордер исполнится, и ты сэкономишь 0.5-1¢ на каждой сделке.

► ЗАДАНИЕ

Найди рынок со спредом > 3¢. Посчитай, сколько ты потеряешь только на спреде при входе и выходе.

Модуль 3. Математика Рынка

Урок 1. Безубыточный винрейт (Win Rate)



Почему это важно:

У каждой цены входа есть свой безубыточный винрейт. Если ваш реальный винрейт ниже этого порога, вы теряете деньги независимо от стратегии.

Формула:

Безубыточная цена WR = Цена входа / Выплата

Что такое выплата? На Polymarket за каждый шейр при выигрыше выплачивается ровно 1 доллар (= 100 центов). Это и есть выплата — фиксированная сумма за победу.

Поэтому формула всегда упрощается:

Безубыток WR = Цена входа / 100

Таблица безубыточности:

Вход	Безубыточный WR	Реально достижимый?
55¢	55%	Да, наш анализ дает результат 62–68 %
60¢	60%	Да - стандартная зона
65¢	65%	Да, при хорошем сигнале
70¢	70%	Граница — нужен очень сильный сигнал
72¢	72%	Абсолютный максимум
80¢	80%	Нет — нереалистично на 15-м уровне
90¢	90%	Нет — это математически невыгодно

Запомни

При входе на 65¢ и WR 64% ты на грани убытка. WR 68%+ = стабильный профит. Разница между «едва свожу концы с концами» и «зарабатываю» = 4% WR.

► **ЗАДАНИЕ**

Рассчитайте безубыточный уровень WR для входа по ценам 55, 65 и 80 центов. При какой цене нужен самый высокий уровень WR ?

Урок 2. Ожидаемая стоимость (Expected Value)

Expected Value — EV Calculation Step by Step

1	Entry 62¢, WR = 65%		
2	Profit = 100 - 62 = 38¢	Without stop	With -25% stop
3	Loss (w/ -25% stop) = 15.5¢	Profit 38¢	29¢
4	EV = (0.65 × 38) - (0.35 × 15.5)	Loss 62¢	15.5¢
		EV -2.85¢	+13.4¢
		✗ LOSING	✓ PROFITABLE
			Stop-loss turns negative EV → positive EV

= +13.4¢ per share ✓

Почему это важно:

EV — единственный показатель, определяющий долгосрочную прибыльность. Если EV положительный, то на дистанции вы зарабатываете. Если отрицательный, то проигрываете, даже если сейчас выигрываете. Казино приносит прибыль не потому, что всегда выигрывает, а потому, что в каждой игре EV складывается в его пользу.

Что такое EV:

Ожидаемая ценность — это средняя прибыль (или убыток) от одной сделки при бесконечном повторении. Речь идет не об одной конкретной сделке, а о системе.

Формула:

$$EV = (WR \times \text{прибыль}) - ((1 - WR) \times \text{убыток})$$

Где:

WR (Win Rate) — доля выигрышных сделок (от 0 до 1). Например, 65% = 0,65

Прибыль — сколько ты получаешь при выигрыше (в центах на шейр)

Потеря — сколько вы теряете в случае проигрыша (в центах на шейр)

Пошаговый расчёт:

Шаг 1. Определите параметры

Входной билет: 62 цента

Твой WR (win rate): 65%

Выход при победе: 100¢ (шейр разрешается в нашу пользу)

Потеря при проигрыше: 62 цента (шейр обнуляется, стоп не используется)

Шаг 2. Подсчитайте прибыль и убытки

Прибыль = 100 центов – 62 цента = 38 центов

Убыток = 62 цента (полная стоимость шейра)

Шаг 3. Подставьте значения в формулу

$$EV = (0,65 \times 38) - (0,35 \times 62)$$

$$EV = 24,7 - 21,7 = +3 \text{ цента за шейр}$$

Шаг 4. Масштабирование до нужного размера

Покупаем 80 шейров по 62 цента = 49,60 долларов

EV сделки = $80 \times 3 \text{ цента} = +\$2,40$

Это значит, что в среднем каждая такая сделка приносит 2,40 доллара.

Таблица EV для разных цен входа (WR 65%):

Вход	Прибыль	Потеря	EV/шейр	EV при 80 шейрах
50¢	50¢	50¢	+15¢	+\$12.00
55¢	45¢	55¢	+10¢	+\$8.00
62¢	38¢	62¢	+3¢	+\$2.40
72¢	28¢	72¢	-7¢	-\$5,60
85¢	15¢	85¢	-20¢	-\$16.00

Видишь закономерность? Чем дешевле шейр, тем выше EV. При цене 72 цента и WR 65% ты уже в минусе!

С лесенкой выходов (реальный трейдинг):

На практике мы не всегда получаем 100 центов. Лесенка (90/93/95/97 центов) дает средний результат ~94 цента.

Прибыль = 94 цента – 62 цента = 32 цента (а не 38 цента)

$EV = (0,65 \times 32) - (0,35 \times 62) = 20,8 - 21,7 = -0,9¢$

EV стал отрицательным! Вот зачем нужен стоп-лосс:

Со стоп-лоссом на уровне -25%:

Средняя потеря: 62 цента \times 25 % = 15,5 цента (а не 62 цента)

$EV = (0,65 \times 32) - (0,35 \times 15,5) = 20,8 - 5,43 = +15,4¢$ на шейр

Запомни

Без стоп-лосса лесенка делает EV отрицательным. Стоп-лосс — это не опция, а необходимость.

Как использовать электромобиль на практике:

Перед каждой сделкой рассчитывайте ожидаемую доходность с учетом своего кредитного плеча и стоп-лосса

Если EV отрицательный, не входите в сделку, даже если сигналы хорошие

Отдавайте предпочтение шейрам 50–72 цента — у них лучший показатель EV

Стоп-лосс увеличивает EV больше, чем высокий уровень волатильности

► ЗАДАНИЕ

Рассчитайте EV для 5 цен входа (55 центов, 60 центов, 65 центов, 70 центов, 75 центов) при коэффициенте удержания 63%. Какой вход лучше?

Урок 3. Компаундирование: 30 долларов → 1000 долларов



Почему это важно:

Линейный рост (\$10 в день) происходит медленно. Компаундинг (% от растущего баланса) — экспоненциальный.

Модель: агрессивный старт (20% → 12%), старт с \$30:

Первые 5 дней — сделки на 20 % от баланса. Это рискованно, но при небольшом депозите допустимо: в абсолютном выражении вы мало теряете, зато быстрее выходите на рабочий баланс. Входите в сделку только в том случае, если уверены в своих действиях.

День	Баланс	Сделка	Размер	Рост за день
1	\$36	\$7.20	20%	+\$6.00
2	\$43	\$8.60	20%	+\$7.20
3	\$52	\$10.40	20%	+\$8.60
4	\$62	\$12.40	20%	+\$10.40
5	\$75	\$14.90	20%	+\$12.40
7	\$99	\$11.80	12%	+\$12.90
10	\$150	\$18.00	12%	+\$19.60
13	\$228	\$27.40	12%	+\$29.80
16	\$347	\$41.70	12%	+\$45.30
19	\$528	\$63.40	12%	+\$68.90
22	\$803	\$96.40	12%	+\$104.80
24	\$1,062	\$127.40	12%	+\$138.50

Первые 5 дней (20%): только максимально уверенные сделки. Не гонись за количеством — 3–5 качественных входов лучше, чем 10 средних.

После 75 долларов переходите на стандартные 12 % — этого баланса уже достаточно для нормального компаундинга.

Как набирать +15–20 % в день:

15-минутные свечи BTC = новый рынок каждые 15 минут

8-12 сделок в день, средний профит +1,5–2 % от баланса на сделку

При WR 45% и соотношении побед и поражений 2,5:1 это вполне реально

Как масштабировать позицию с помощью баланса:

Баланс	Размер сделки (12%)	Шейров @ 55¢
\$30	\$3.60	6 шейров
\$100	\$12	22 шейра
\$300	\$36	65 шейров
\$500	\$60	109 шейров
\$1,000	\$120	218 шейров

Важное правило: размер позиции ДОЛЖЕН расти вместе с балансом. При \$30: сделка на \$3–4. При \$500: сделка на \$50–60. Если не масштабировать, рост будет линейным, а не экспоненциальным. Компаундинг работает только при реинвестировании.

Реалистичные поправки:

Не каждый день будет +15% (будут дни с -5%, -10%)

Серия из 3 убыточных сделок подряд = откат на 2 дня

Рынки BTC 24/7, лучшие сессии: Лондон (02:00–07:00 по восточному стандартному времени) + перекрытие (07:00–10:00 по восточному стандартному времени); в пятницу и воскресенье объём ниже

Реальный срок: 25–35 дней

► ЗАДАНИЕ

Если начать с 30 долларов и получать +5% за сделку, за сколько сделок можно прийти до 100 долларов? А до 1000 долларов?

Урок 4. Асимметрия риска по цене Шейра

Entry	Max Profit	Max Loss	Ratio	Verdict
55¢	+45¢ (82%)	-55¢	1:1.2	✓ Best
62¢	+38¢ (61%)	-62¢	1:1.6	✓ Good
72¢	+28¢ (39%)	-72¢	1:2.6	⚠ Limit
90¢	+10¢ (11%)	-90¢	1:9.0	✗ TRAP

At 90¢ with 85% WR: EV = (0.85×10) - (0.15×90) = 8.5 - 13.5 = -5¢ Still negative!

Почему это важно:

Не все сделки одинаковы. Цена входа определяет соотношение риска и прибыли, и это соотношение ухудшается нелинейно.

Простая логика:

Шейр при выигрыше всегда стоит 100 центов. Вы купили его за X центов — значит:

Победа: прибыль = (100 - X)¢

Поражение: убыток = X¢

Вопрос: сколько побед нужно, чтобы компенсировать 1 поражение?

Ответ: $X \div (100 - X)$

Таблица: ваш реальный риск в зависимости от цены входа:

Вход	Прибыль	Убыток	Окупаемость
55¢	+45¢	-55¢	2 победы
62¢	+38¢	-62¢	2 победы
72¢	+28¢	-72¢	3 победы
85¢	+15¢	-85¢	6 побед
95¢	+5¢	-95¢	19 побед

Пример на пальцах:

Купил шейр за 55¢. Проиграл — потерял 55¢. Следующие 2 победы дают +45¢ + 45¢ = +90¢. Ты покрыл убыток и вышел в плюс на 35¢. Это работает при нормальном коэффициенте возврата.

Теперь купил за 95¢. Проиграл — потерял 95¢. Чтобы отыгаться, нужно выиграть 19 раз подряд по +5¢. При реальном коэффициенте возврата 65% это математически невозможно.

Запомни. Чем дороже шейр, тем глубже яма после каждого проигрыша. Максимальная ставка = 72 цента. Это не вопрос вкуса, а математика.

► **ЗАДАНИЕ**

Сравним: вход за 55 центов (WR 58 %) и вход за 75 центов (WR 72 %). Какой вариант выгоднее с точки зрения электромобиля?

Урок 5. Почему 95% трейдеров терпят убытки

Why 95% of Traders Lose — Root Causes

 High Price Entry Buy at 80-99¢ "obvious" trend = negative EV	 No System "I feel it will go up" = random results	 Overtrading 20 trades/day vs 3-5 quality = fee bleed	 No Stop-Loss 95¢ → 3¢ in 60 seconds = account blown	 Revenge Trade Lost \$20 → bet \$80 back = spiral
---	---	--	---	--

✓ This course eliminates all 5. Math + System + Discipline = the winning minority.

Почему это важно:

Понимание системных причин неудач защищает от повторения чужих ошибок.

Анализ провалов:

- Торговля по высоким ценам (75–99 центов)

Розничные трейдеры покупают «когда уверены». Уверенность приходит, когда тренд очевиден = цена уже высокая. С математической точки зрения это убыточно (см. таблицу выше).

Примечание: торговля на высоких ценах математически убыточна, но при строгом соблюдении правил входа, выхода и установки стоп-лосса может приносить неплохую прибыль. Математика работает против вас, но дисциплина может компенсировать этот недостаток.

- Отсутствие системы — торговля на ощущениях без правил

«Мне кажется, BTC пойдет вверх» — это не система. Система — это набор правил с числовыми пороговыми значениями, которые можно проверить на исторических данных.

- Чрезмерная торговля — слишком много входов в рынок без чёткого сигнала

Трейдер просматривает 50 рынков в день и заходит на 20 из них. Но по-настоящему хороших возможностей — 3–5 в день. 20 входов = 15 входов без чёткого сигнала. Качество важнее количества.

- Отсутствие стоп-лосса — убыток растёт без ограничений

«Шейр на уровне 95 центов, он не может упасть до нуля». Может. И падает. BTC разворачивается — и шейр падает с 95 до 3 центов за 60 секунд.

- Торговля с целью отыгаться после серии убытков

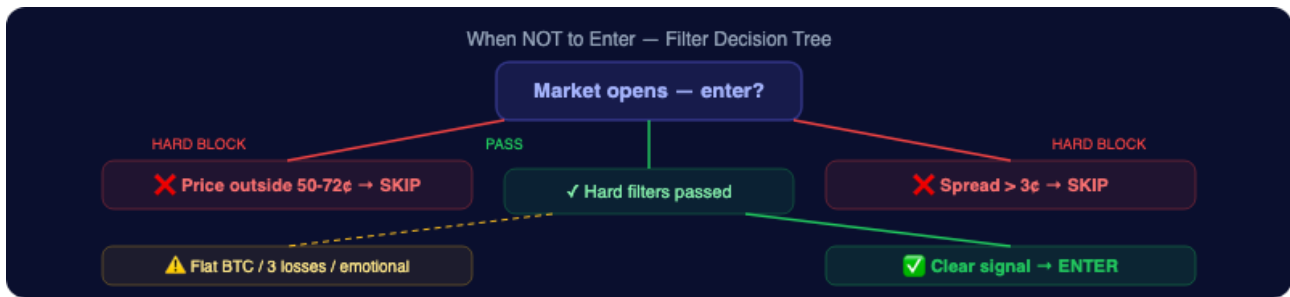
Потерял 20 долларов → вложил 40 долларов, чтобы «отыгаться» → потерял 40 долларов → вложил 80 долларов...

Общий знаменатель: отсутствие математической базы для принятия решений.

▶ **ЗАДАНИЕ**

Запишите три причины, по которым 95% трейдеров теряют деньги. Какая из них наиболее опасна для вас?

Урок 6. Когда НЕ входить в сделку



Почему это важно:

Лучшая сделка — та, которую ты НЕ открыл. Большинство трейдеров теряют деньги не из-за неудачных входов в рынок, а из-за того, что входят в рынок слишком часто и без веских на то причин. Умение пропускать сделки — это навык, который отличает прибыльного трейдера от убыточного.

Жесткие правила (нарушение = гарантированный убыток):

1. Цена шейра вне зоны 50-72¢

Это твой основной диапазон. Ниже 50 центов — слишком рискованно, рынок нестабилен. Выше 72 центов — соотношение риска и прибыли не в твою пользу (один проигрыш сводит на нет 2–3 победы). Если шейр стоит 80 центов, даже «очевидная» сделка будет убыточной с математической точки зрения.

2. Большой спред между ценами покупки и продажи

Если разница между ценой покупки и продажи > 3¢ — ты отдаёшь деньги маркетмейкеру ещё до того, как BTC двинулся. Это скрытый налог на каждую сделку. Торгуй только на ликвидных рынках.

3. Нет чёткого направления

Если ты не можешь за 10 секунд объяснить, почему курс биткоина будет расти или падать, не входи в сделку. «Мне кажется» и «может быть» — это не сигнал. Сигнал — это когда несколько факторов (тренд, объем, импульс) указывают в одном направлении.

Мягкие правила (нарушение = пониженный уровень WR):

4. Боковой тренд (флэт)

Когда за 15 минут курс BTC меняется менее чем на 30–40 долларов, это режим низкой волатильности. Цены шейров застревают на уровне около 50 центов, движения носят случайный характер. Лучше подождать, пока рынок оживится.

5. До закрытия осталось мало времени

Вход в последние 1-2 минуты = лотерея. Цена уже определена, спреды расширяются, шансы на выгодный вход минимальны.

6. Эмоциональное состояние

После 2-3 проигрышей подряд сделайте паузу. Мечь трейдеру (желание отыграться) — причина №1 крупных потерь. Ваша система работает на дистанции, одна пауза ничего не изменит.

Правило 80/20:

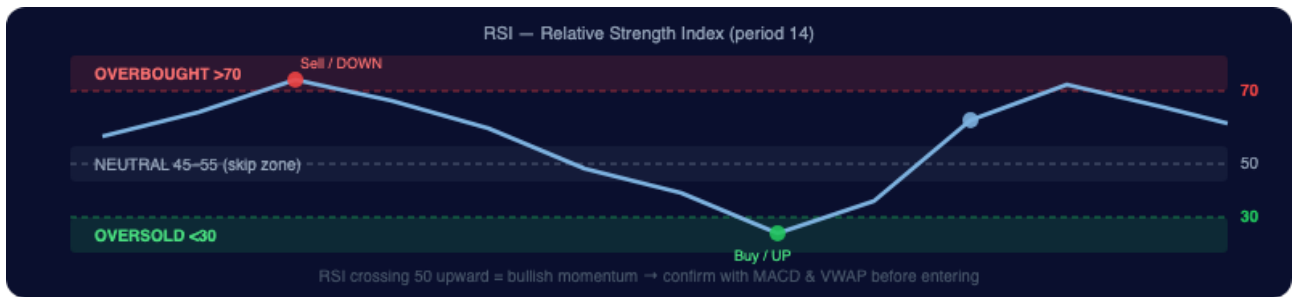
~80% рынков в течение дня — это шум. Только ~20% дают реальный профит. Из ~96 рынков в день (по одному каждые 15 минут) после фильтрации остается 8–15 хороших входов. Пропускать — это не слабость, а дисциплина.

► ЗАДАНИЕ

Возьми 5 последних рынков. Для каждого определи: прошёл бы он фильтр $EV > 0$?
Запиши цену входа и результат.

Модуль 4. Лучшие индикаторы для 15 млн ВТС

Урок 1. RSI — индекс относительной силы



Почему это важно:

RSI — самый популярный в мире индикатор импульса. Измеряет скорость изменения цены, показывая перекупленность или перепроданность актива. На Polymarket помогает определить, есть ли реальная сила движения или это просто шум.

Ключевые уровни:

- >70 — перекупленность. Рост ослабевает, возможен откат
- 50 — нейтральная зона. Четкого направления нет
- <30 — перепроданность. Падение теряет силу, возможен отскок

Разворот в экстремальных зонах:

Если RSI уже в зоне перекупленности или перепроданности — ищите разворот, а не продолжение тренда:

RSI > 70 → рост теряет силу → возможен разворот вниз → NO шейр (DOWN)

RSI < 30 → падение теряет силу → возможен разворот вверх → YES шейр (UP)

Не торопись: дождись подтверждения — разворотной свечи или выхода RSI из экстремальной зоны обратно к 50.

Оптимальный сет — реверсал от границ:

Самая простая и эффективная стратегия с использованием RSI:

RSI вошёл в зону >70 (перекупленность) → жди выход обратно ниже 70 + подтверждение MACD (гистограмма сжимается или пересечение вниз) → NO шейр (DOWN)

RSI вошёл в зону <30 (перепроданность) → жди выход обратно выше 30 + подтверждение MACD (гистограмма растёт или пересечение вверх) → YES шейр (UP)

Не входите в сделку, пока RSI находится в экстремальной зоне, — дождитесь выхода из нее. Вход на выходе + MACD = подтвержденный разворот.

Пропускная зона:

RSI между 45 и 55 — рынок в нерешительности. Не входить.

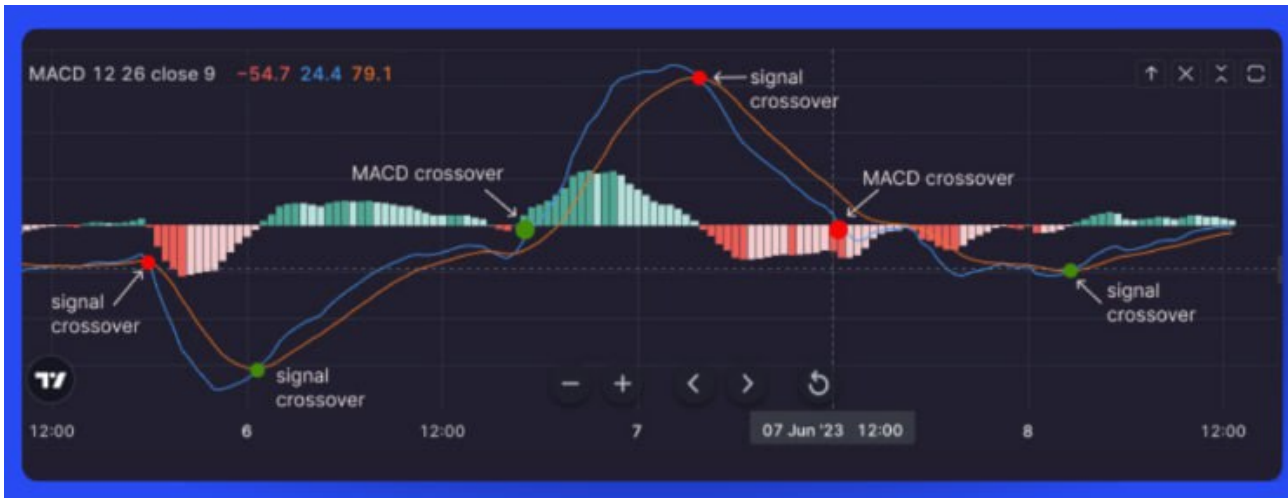
Дивергенция:

Цена достигает нового максимума, а RSI — нет → скрытая слабость → осторожно, восходящий тренд.

► ЗАДАНИЕ

Откройте TradingView. Добавьте RSI(14), MACD(12,26,9), VWAP и EMA 9/21 на 1-минутный график BTC/USDT. Найдите момент, когда все 5 индикаторов показывают одно и то же. Запишите, что показывал каждый из них.

Урок 2. MACD — схождение/расхождение скользящих средних



Почему это важно:

MACD (12/26/9) — один из самых точных индикаторов смены тренда. Он не показывает цену напрямую, а демонстрирует силу и направление импульса. На 15-минутном графике BTC Polymarket — это ваш главный фильтр: торгуйте по тренду MACD, а не против него.

Три компонента:

Линия MACD (синяя) = $EMA(12) - EMA(26)$ — быстрая реакция на цену

Сигнальная линия (оранжевая) = $EMA(9)$ от MACD — медленная, сглаживает сигнал

Гистограмма (столбики) = $MACD - Signal$ — визуально показывает силу движения

Нулевая линия — режим рынка:

MACD выше нуля → $EMA(12) > EMA(26)$ → бычий режим → предпочитай UP сделки

MACD ниже нуля → $EMA(12) < EMA(26)$ → медвежий режим → предпочитай DOWN сделки

Два типа сигналов:

Пересечение MACD/Сигнал (пересечение MACD):

Линия MACD пересекает сигнальную линию — это самый сильный сигнал:

MACD пересекает сигнал снизу вверх → бычий сигнал → ДА (вверх)

MACD пересекает сигнал сверху вниз → медвежий сигнал → НЕТ шейру (ВНИЗ)

Пересечение сигнала (пересечение нулевой линии):

Когда обе линии пересекают нулевую линию, это подтверждает смену режима.

Гистограмма — читай силу:

Столбики зеленые и растущие → импульс ускоряется вверх → сильный восходящий тренд

Столбики зеленые и сжимаются → бычий импульс ослабевает → будьте осторожны

Столбики красные и растущие (вниз) → импульс ускоряется вниз → сильный нисходящий тренд

Столбики красные и сжимаются → медвежий тренд ослабевает → будьте осторожны

Сжатие гистограммы = сигнал разворота:

Если гистограмма плавно уменьшается от бара к бару, приближаясь к нулевой линии, это предупреждает о предстоящем пересечении MACD/Signal и смене направления цены. Чем плавнее сжатие, тем надежнее сигнал. Не открывайте сделку по старому тренду — дождитесь подтверждения нового.

Для 15 млн BTC на Polymarket — тактика:

Таймфрейм	Роль
1 м	Быстрый вход — момент пересечения
5 м	Подтверждение направления
15 м	Общий контекст — куда дует ветер

Лучший вход: MACD пересек сигнал на 1-м или 5-м в первые 3–7 минут окна → входите в направлении пересечения.

Ограничение:

MACD запаздывает в боковом рынке. Проверь ATR: если BTC во флэте ($ATR < \$30$) — MACD-сигналы ненадежны. Жди движения.

► ЗАДАНИЕ

На 5-минутном графике BTC найдите последний «золотой крест» (EMA 9 пересекла EMA 21 снизу вверх). Что в этот момент показывал RSI? MACD был выше или ниже нуля? BTC был выше или ниже VWAP?

Урок 3. VWAP — средневзвешенное значение по объему



Почему это важно:

VWAP — «справедливая цена» для институциональных игроков. Банки и фонды используют VWAP в качестве ориентира. Поэтому цена BTC постоянно стремится к этому уровню.

Главный принцип:

Цена выше VWAP → бычий тренд, институциональные инвесторы покупают → YES шейры

Цена ниже VWAP → медвежий тренд, институциональные инвесторы продают → нет шейров

VWAP как магнит:

Если BTC значительно поднялся выше VWAP, ждите отката. Если опустился значительно ниже, ждите отскока.

Три сетапа:

Тренд: BTC пробил VWAP вверх + MACD зелёный + RSI > 55 = UP позиция

Фейд: BTC далеко выше VWAP + RSI > 70 = перекупленность → NO шейр

Отскок: BTC достиг нижней границы VWAP и отскочил вверх = поддержка → позиция на повышение

По сессиям:

VWAP наиболее точен в NY_OPEN (максимальный объем торгов). В азиатской сессии — использовать с осторожностью.

► ЗАДАНИЕ

Прямо сейчас проверьте 5 индикаторов на BTC за 5 минут. RSI выше/ниже 50? MACD зеленый/красный? BTC выше/ниже VWAP? EMA 9 выше/ниже EMA 21? Пробой HL10? Сколько из 5 индикаторов сходятся?

Урок 4. EMA 9 и EMA 21 — быстрые скользящие средние



Почему это важно:

EMA 9 и EMA 21 — самые быстрые инструменты для определения краткосрочного тренда. Их пересечение сигнализирует о смене направления быстрее, чем любой другой индикатор.

Четыре сценария:

Ситуация	Сигнал	Действие
EMA 9 пересекла EMA 21 снизу вверх (Golden Cross)	Бычий	YES шейр
EMA 9 пересекла EMA 21 сверху вниз (крест смерти)	Медвежий	NO шейр
EMA 9 > EMA 21, разрыв растёт	Сильный тренд	Держать позицию
EMA 9 и 21 сближаются	Тренд слабеет	Осторожно

Правило расстояния:

Большой разрыв = сильный импульс, тренд продолжится

Сужение EMA = снижение импульса, готовьтесь к пересечению

EMA параллельны и расположены близко друг к другу = боковой тренд — не входить

Для 15 млн BTC:

График на 1 минуту: время входа

5-минутный график: подтверждение тренда

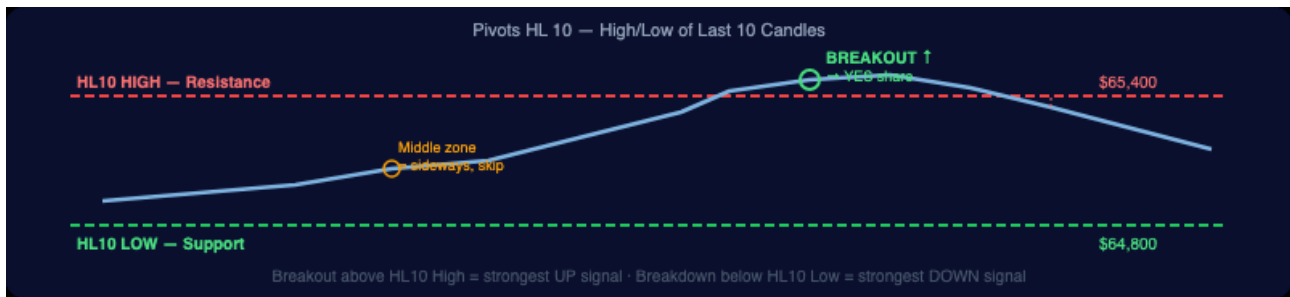
Ранний сигнал:

Пересечение ЕМА в первые 3–5 минут 15-минутного окна = ранний вход с хорошим потенциалом.

► ЗАДАНИЕ

Найдите дивергенцию RSI: цена достигла нового максимума, а RSI — нет. Что произошло с ценой в следующие 10–15 минут?

Урок 5. Pivots HL 10 — уровни поддержки и сопротивления



Почему это важно:

Уровни поддержки и сопротивления — это памятные для рынка зоны. Пробой ключевого уровня = смена баланса покупателей и продавцов = направленный сигнал с высокой вероятностью продолжения тренда.

Что такое HL 10:

HL10 High = максимальная цена BTC за последние 10 свечей = сопротивление

HL10 Low = минимальная цена BTC за последние 10 свечей = поддержка

Четыре торговых сценария:

1. Пробой вверх: BTC закрылся выше максимума HL10 с объемом → ДА, шейр
2. Пробой вниз: BTC закрылся ниже минимума HL10 → шейр отсутствует
3. Отскок от уровня поддержки: BTC коснулся минимума HL10 и отскочил вверх → ДА, шейр
4. Отскок от уровня сопротивления: BTC коснулся максимума HL10 и развернулся → НЕТ

Пример:

BTC = \$65 200. Максимум HL10 = \$65 400, минимум HL10 = \$64 800.

BTC пробил уровень \$65 400 → пробой сопротивления → шейр YES.

Ловушка:

Между уровнями HL10 Low и High = боковой тренд. Ждать пробоя. Не входить.

► ЗАДАНИЕ

Найдите дивергенцию RSI: цена достигла нового максимума, а RSI — нет. Что произошло с ценой в следующие 10–15 минут?

Урок 6. Как комбинировать 5 индикаторов



Золотое правило:

Минимум 3 из 5 индикаторов в одном направлении = вход.

Менее 3 согласованных = обязательный пропуск.

30-секундный чек-лист перед входом:

#	Индикатор	UP сигнал	DOWN сигнал
1	RSI	> 55	< 45
2	MACD	Гистограмма зелёная	Гистограмма красная
3	VWAP	BTC выше VWAP	BTC ниже VWAP
4	EMA	EMA 9 > EMA 21	EMA 9 < EMA 21
5	HL10	Пробой HL10 High	Пробой HL10 Low

Шкала уверенности:

5/5 → Максимальный размер позиции (15%)

4/5 → Стандартный размер (12%)

3/5 → Половина размера (6–8 %) или пропуск

<3/5 → Обязательный пропуск

Пример сильного UP:

RSI = 63 | MACD гистограмма зелёная | BTC выше VWAP на \$200 | EMA 9 > EMA 21 | BTC пробил HL10 High 2 мин назад

→ 5/5 → Входить с максимальным размером

Скорость:

Отрабатывайте чек-лист до автоматизма. В реальном времени у вас есть 30–60 секунд.

► **ЗАДАНИЕ**

Найдите дивергенцию RSI: цена достигла нового максимума, а RSI — нет. Что произошло с ценой в следующие 10–15 минут?

Модуль 5. Сила тренда — свечной анализ

Урок 1. Анатомия Свечи

Почему это важно:

Каждая свеча — это история борьбы между покупателями и продавцами. Умение читать эту историю дает преимущество: вы видите, кто побеждает, еще до того, как это становится очевидным для большинства.

Структура свечи:

Тело (Body) = расстояние между ценой открытия и ценой закрытия

Верхняя тень = максимум за период минус верхний край тела

Нижняя тень = нижний край тела минус минимум за период

Бычий и медвежий рынки:

Зелёная (бычья): Close > Open — покупатели победили

Красная (медвежья): Закрыть < Открыть — победили продавцы

Ключевые соотношения:

Соотношение	Значение
Тело > 60% диапазона	Сильная направленная свеча — убежденность
Тело 30-60%	Умеренное направление
Тело < 30%	Нерешительность — зона дожи
Тени >> тело	Отвержение уровня — спорная зона

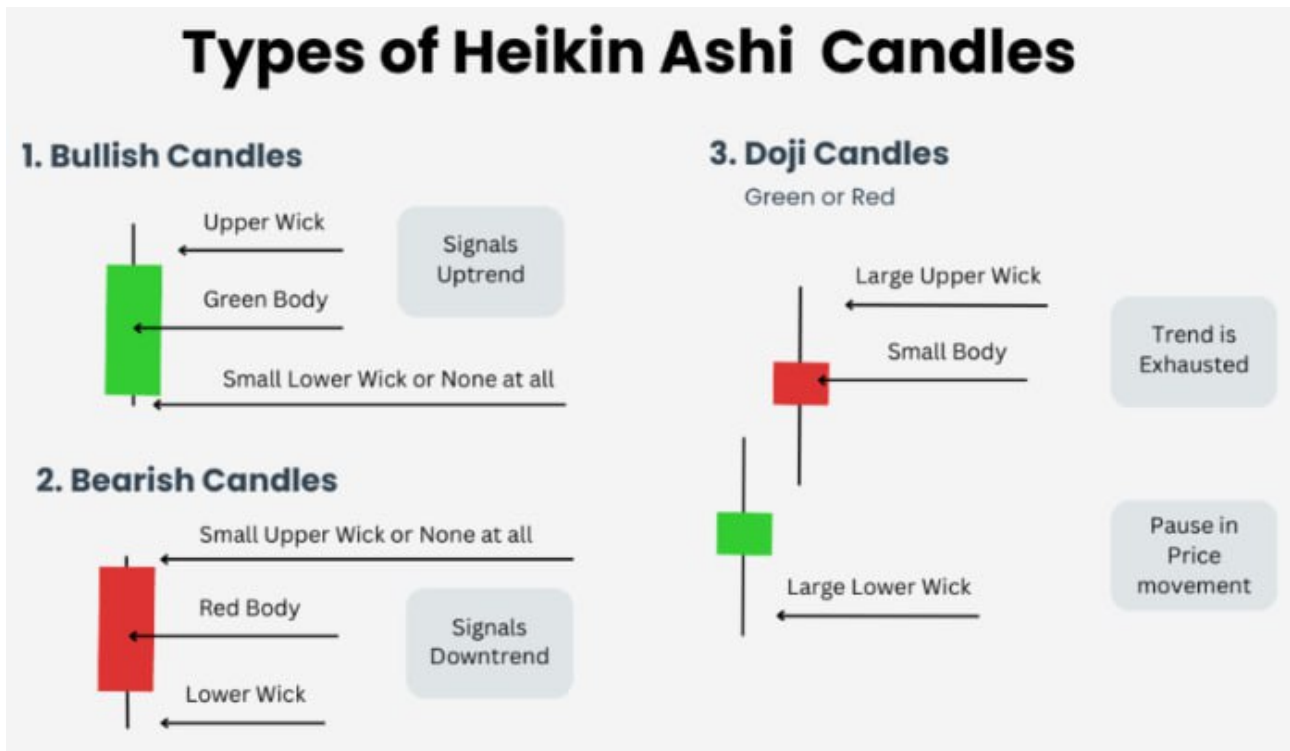
Главное правило:

Одна свеча = шум. Три свечи с большими телами подряд = реальный сигнал.

► ЗАДАНИЕ

Открой 1m BTC/USDT. Найди последний пример 3 последовательных зелёных свечей с нарастающими закрытиями и телами >40% диапазона. Что произошло в следующие 10 минут?

Урок 2. Свечи Хейкин Аши



В этой системе используются свечи Heikin Ashi, а не стандартные. Разница существенна.

Что такое Хейкин Аши:

Обычная свеча показывает точные цены — открытие, закрытие, максимум, минимум. Хейкин Аши (по-японски «средний бар») берет эти цены и усредняет их. Каждая новая свеча частично зависит от предыдущей — как скользящее среднее, только в виде свечей.

Зачем? Обычный график дергается вверх-вниз, даже когда тренд очевиден. НА сглаживает эти колебания — если цена растет, свечи будут зелеными подряд, без ложных красных.

TradingView считает все автоматически — включаешь тип графика Heikin Ashi, и готово. Важно понимать принцип: НА = сглаженные свечи, которые лучше показывают тренд.

Что искать:

Паттерн	Значение
Зеленая свеча без нижней тени	Сильный аптренд — покупатели полностью контролируют ситуацию
Красная свеча без верхней тени	Сильный нисходящий тренд — продавцы полностью контролируют ситуацию
Маленькое тело, тени по обе стороны	Тренд ослабевает — возможен разворот
Смена цвета после 2–3 свечей одного цвета	Ранний сигнал смены тренда

Почему Heikin Ashi для 15-минутного Polymarket:

Стандартные свечи на 15-минутных графиках шумные. Heikin Ashi сглаживает случайные всплески и позволяет лучше видеть, нарастает импульс или угасает. Система отслеживает

цвет HA и количество последовательных свечей одного цвета — это сигналы haColor и haCount в терминале.

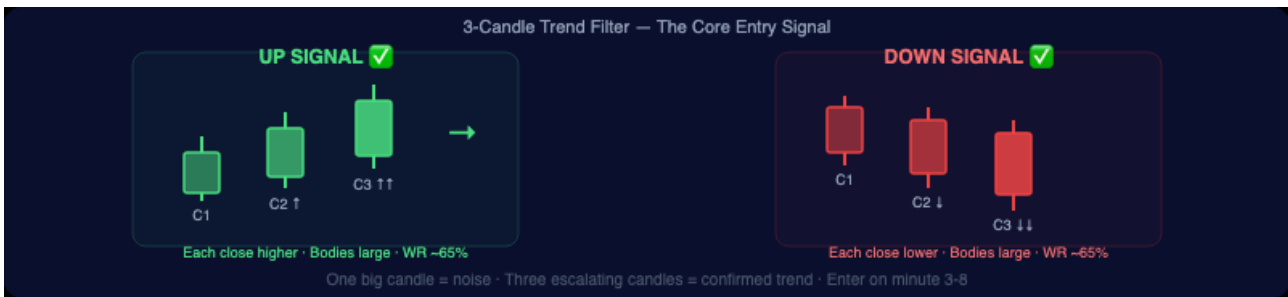
Ключевое правило:

2+ последовательных свечи H1 одного цвета без противоположной тени = подтверждение сильного тренда. Именно это проверяет система сигналов.

► ЗАДАНИЕ

Найдите на 5-минутном графике BTC паттерн «дожи» или «падающая звезда» после восходящего движения. Что произошло после этого? Был ли это сигнал к тому, чтобы пропустить восходящее движение или открыть позицию на понижение?

Урок 3. 3-свечной трендовый фильтр



Почему это важно:

Случайное движение в сравнении с устойчивым трендом — разница в последовательности. Три свечи подряд статистически значимее одной. Это основа системы входа в рынок.

Правила для UP:

- 3 зелёные свечи подряд (Close > Open)
- Каждая свеча закрывается выше предыдущей (восходящий тренд)
- Тело каждой > 40% диапазона (нет дожи)
- Тени < 50% тела (чистые свечи)

Правила для DOWN:

- 3 красные свечи подряд
- Каждая закрывается ниже предыдущей
- Те же требования к телу и теням

WR при соблюдении всех условий: ~65%

Частота сигнала:

~40–50 % 15-минутных окон дают чистый сигнал в виде трех свечей. Остальные — пропуск. Это нормально.

Типичные ошибки:

- Войти на одной большой свече → одна свеча = возможный пик
- Примите дожи за зелёную свечу → тело свечи должно быть значимым
- Не обращать внимания на тени → большая верхняя тень = покупатели получили отпор

► ЗАДАНИЕ

Проверьте согласованность таймфреймов прямо сейчас: 1 м, 5 м, 15 м, 4 ч. Все четыре показывают одно направление? Если нет, запишите, в чем конфликт и почему он возник.

Урок 4. Паттерны силы и слабости

CANDLE DECISION TABLE – You See → You Do					
CANDLE	PATTERN	WHAT IT MEANS	ACTION	SIZE	
	Big body, no wicks Full directional control		✓ ENTER	FULL	
	3 growing candles Max momentum building		● ENTER – BEST SIGNAL	MAX	
	Long upper wick (UP candle) Sellers rejecting higher prices		⚠ Reduce or SKIP	HALF or skip	
	Doji (body < 20% of range) Market indecision – no winner		✗ MANDATORY SKIP	NO TRADE	
	Small equal candles in a row Low ATR – BTC not moving		✗ MANDATORY SKIP	NO TRADE	
	Shrinking candle bodies Momentum fading		⬆ Exit at next ladder level	Take profit	

KEY RULE: Trade CONTINUATION patterns only · Reversal = SKIP · No strong candles in first 3 min = NO TRADE

Почему это важно:

Неважно, как называется паттерн. Важно, что вы делаете, когда его видите. Используйте приведенную выше таблицу как руководство по 15-минутному бинарному опциону.

Видишь → Делаешь:

Большое тело, фитилей нет — сильный направленный сигнал. Хороший кандидат для увеличения размера позиции.

3 растущие свечи подряд — максимальный импульс. Максимальный размер позиции. Лучший сигнал.

Длинный верхний фитиль на восходящей свече — продавцы препятствуют росту. Уменьшите размер позиции или пропустите сделку.

Дожи (тело меньше 20% диапазона) — нерешительность, нет победителя. Обязательный пропуск.

Несколько маленьких свечей подряд — ATR низкий, BTC не движется. Обязательный пропуск.

Уменьшающиеся тела (была большая, стала маленькая) — импульс угасает. Выход на ближайшем лестничном пролете, не ждите 97¢.

Главное правило:

Торгуй ПРОДОЛЖЕНИЕМ, а не паттернами разворота. Если за первые 3 минуты не появилось сильных направленных свечей, сделки нет.

► **ЗАДАНИЕ**

Найдите момент нарастающего импульса (каждая свеча больше предыдущей) и сравните его с моментом угасания импульса (свечи становятся меньше). Как по-разному двигалась цена BTC в следующие 5 минут?

Урок 5. Momentum Свечей



Почему это важно:

Импульс = скорость изменения цены. Нарастающий импульс указывает на продолжение тренда. Затухающий импульс — предупреждение.

Типы momentum:

Нарастающий тренд:

Каждая свеча больше предыдущей, закрывается выше. BTC набирает обороты. Тренд продолжится.

Устойчивый:

Свечи примерно одинакового размера, последовательно направлены в одну сторону. Тренд есть. Можно держать позицию.

Угасающий:

Свечи становятся короче. Тренд замедляется. Импульс иссякает. Готовьтесь к выходу.

Пауза (консолидация):

Несколько маленьких свечей после сильного движения. Рынок «переводит дух». Возможно продолжение — следите за пробоем.

Индикаторы импульса на свечах:

Тело >> тени = сильный импульс

Тело << тени = слабость, борьба

Разрыв между свечами (гэп) = ускорение, институциональный вход

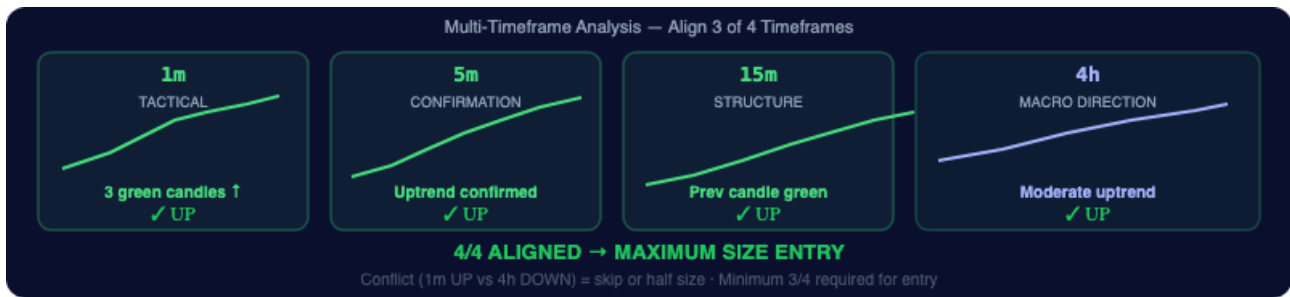
Применение для 15-минутных бинарных опционов:

В первые 5–8 минут торгов нужен импульс в твою пользу. Если BTC движется вяло, сделку не заключай.

► **ЗАДАНИЕ**

Найдите момент нарастающего импульса (каждая свеча больше предыдущей) и сравните его с моментом угасания импульса (свечи становятся меньше). Как по-разному двигалась цена BTC в следующие 5 минут?

Урок 6. Мультитаймфреймовый анализ



Почему это важно:

1-минутный восходящий тренд внутри 15-минутного нисходящего тренда — это коррекция, а не разворот. Анализ нескольких таймфреймов защищает от ложных сигналов.

Четыре таймфрейма:

Таймфрейм	Роль	Что смотрим
1 м	Тактический	Сигнал на 3-й свече, время входа
5 м	Подтверждение	Направление последних 3 свечей
15 м	Структура	Контекст предыдущей 15-минутной свечи
4 часа	Макро	Общее направление рынка

Правило согласованности:

Открывайте сделку только в том случае, если согласованы как минимум 3 из 4 таймфреймов.

Пример — сильный восходящий тренд:

1 м: 3 зелёные свечи | 5 м: восходящий тренд | 15 м: предыдущая свеча зелёная | 4 ч: бычий тренд

→ 4/4 → максимальный размер позиции

Пример — конфликт:

1 м: 3 зелёных | 5 м: восходящий | 15 м: нейтральный | 4 ч: нисходящий

→ 2/4 → пропуск или половинный размер

Чтение предыдущей 15-минутной свечи:

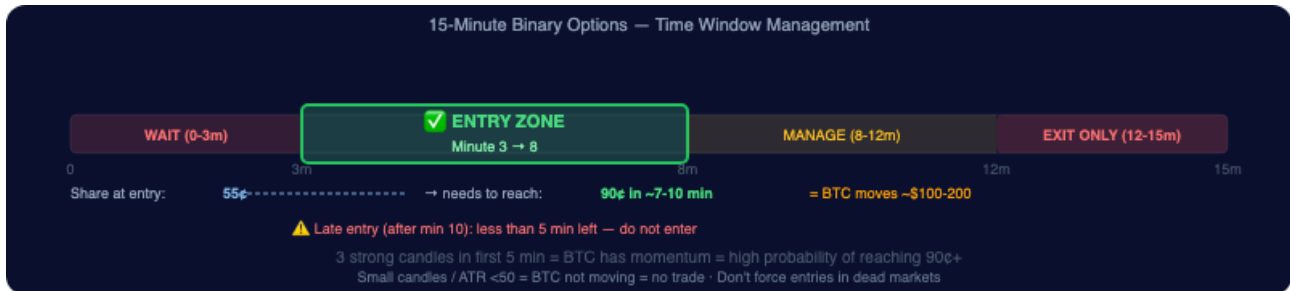
Большая зелёная 15-минутная свеча + текущая 1-минутная свеча вверх = усиление сигнала

Большая красная 15-минутная свеча + текущая 1-минутная свеча вверх = возможный отскок, будьте осторожны

► **ЗАДАНИЕ**

Найдите момент нарастающего импульса (каждая свеча больше предыдущей) и сравните его с моментом угасания импульса (свечи становятся меньше). Как по-разному двигалась цена BTC в следующие 5 минут?

Урок 7. Свечи и 15-минутные бинарные опционы — особенности



Почему это важно:

У бинарных опционов фиксированный срок действия. Даже если вы угадаете направление, это не поможет, если у вас не будет времени на реализацию прибыли.

Временной фактор:

Оптимальный вход: 3–8-я минута после открытия рынка

Зона риска: 11–15-я минута (мало времени)

Последние 2 минуты: не входить — только выходить

Признаки неподходящего рынка:

Маленькие тела свечей (ATR < 50) = BTC не двигается = нет сделки

Смена направления каждые 2-3 свечи = хаос = сделка не состоится

Длинные тени в обе стороны = спорная зона = сделка не состоится

Идеальный рынок:

Большие тела, маленькие тени

Последовательность в одном направлении

Нарастающий или устойчивый импульс

ATR > 80 (есть пространство для движения шейра)

После входа:

Если свечи начали уменьшаться и разворачиваться, импульс угасает. Готовьтесь к стоп-лоссу.

► ЗАДАНИЕ

Найдите момент нарастающего импульса (каждая свеча больше предыдущей) и сравните его с моментом угасания импульса (свечи становятся меньше). Как по-разному двигалась цена BTC в следующие 5 минут?

Модуль 6. Лесенка выходов

Урок 1. Что такое «лестница выходов»

Почему это важно:

Бинарные опционы оплачиваются в размере 100 центов (выигрыш) или 0 центов (проигрыш). Главная ловушка — дожидаться 100 центов и потерять все из-за разворота в последние 2 минуты. Лесенка решает эту проблему.

Проблема удержания до истечения срока действия:

Купил шейр YES по цене 60 центов. За 12 минут цена выросла до 94 центов. Держишь, ждешь 100 центов. В последние 3 минуты курс BTC падает. Шейр падает с 94 до 40 центов. Рынок закрывается в минусе. Ты все потерял.

Решение — «Лесенка выходов»:

Продавайте частями по мере роста цены. Фиксируйте прибыль, не давая рынку забрать ее обратно.

Четыре уровня лесенки:

Уровень	Цена	Продать	Логика
1	90¢	25% позиции	Первая фиксация — самая важная
2	93¢	33% остатка	Основная зона прибыли
3	95¢	50% остатка	Максимальная уверенность
4	97¢	Всё остальное	Финальная фиксация

Как работает лесенка на практике:

Уровень 1 (90¢): Продаете 25% от всей позиции. Осталось 75%.

Уровень 2 (93¢): Продаешь 33% от оставшихся 75%. Это еще 25% от начала. Осталось 50%.

Уровень 3 (95¢): Продаете 50% от оставшихся 50%. Снова 25% от начала. Осталось 25%.

Уровень 4 (97¢): Продаешь все — последние 25%.

→ Итог: на каждом уровне вы продаете ровно 25% от исходной позиции. Четыре равные части по четырем ценам.

Математика:

20 шейров по 60 центов = вложено 12 долларов. Полная лесенка = ~7 долларов прибыли с высокой вероятностью.

Удержание до 100 центов = 8 долларов прибыли, но есть риск получить ноль при развороте.

Принцип:

Гарантированная меньшая прибыль > лотерея с большей прибылью.

Скорость = безопасность:

Цена шейра может максимально быстро вырасти до 90–97 центов и оставаться на этом уровне долгое время. Но чем дольше вы удерживаете позицию, тем выше риск разворота. Умный трейдер стремится за минимальное время получить максимум прибыли и выйти из сделки. Время — это риск, а не друг.

► **ЗАДАНИЕ**

Возьми свой текущий баланс. Рассчитай лесенку для входа по 58 центов с размером 12%: сколько шейров? Сколько продать по 90 центов, 93 цента, 95 центов, 97 центов? Запиши как торговый план.

Урок 2. Уровень 90¢ — первая и главная фиксация

Идея проста: когда цена ваших шейров достигает 90 центов, вы продаете 25% позиции. Это первая фиксация прибыли — момент, который меняет всю сделку.

Почему это важно:

После продажи 25 % по цене 90 центов на вашем счету уже есть реальные деньги. Страх потери исчезает. Вы перестаете пялиться в экран. Остаток позиции торгуете спокойно, потому что уже в плюсе, что бы ни произошло дальше.

Как это работает — пошаговая инструкция:

Ты купил 20 шейров по 58 центов → вложил 11,60 доллара

Цена выросла до 90 центов → продаёшь 5 шейров (25%) → получаешь 4,50 доллара

У тебя осталось 15 шейров — и 4,50 доллара уже в кармане

Шпаргалка:

20 шейров → продать 5 за 90¢

30 шейров → продать 7 за 90¢

50 шейров → продать 12 за 90¢

Что происходит после продажи:

Теперь даже самый неблагоприятный сценарий сыграет тебе на руку. Даже если цена полностью вернется к уровню входа:

Уже продано: 5 шейров × 90 центов = \$4,50

Выход остатка: 15 шейров × 58¢ = \$8,70

Итого получено: \$13,20 при вложении \$11,60 = +\$1,60 прибыли (+14%)

Вот почему «безубыточный стоп» после первой фиксации на самом деле является гарантированной прибылью. Вы буквально не можете потерять деньги на этой сделке.

Ловушка, которой следует избегать:

Ты видишь 90 центов и думаешь: «Сейчас дойдет до 100 центов, подожду». Не жди. ПРОДАЙ 25%. Всегда. Без исключений. Остальные 75% продолжают работать — ты не теряешь прибыль, а фиксируешь гарантированный плюс.

Привычка:

Выставляйте лимитный ордер на продажу 25% позиции по цене 90 центов сразу после входа в сделку. До того, как начнете следить за ценой. Сделайте это действие автоматическим.

► ЗАДАНИЕ

Найдите историю любого 15-минутного бинарного опциона на BTC на Polymarket. Найдите момент, когда шейр YES достиг 90 центов. Что произошло дальше — цена поднялась до 97 центов или откатилась?

Урок 3. Уровни 93¢ и 95¢ — основная зона прибыли

После первой фиксации на уровне 25 % на отметке 90 ¢ следующие два уровня — это места, где можно получить основную прибыль. Идея проста: продавайте равными частями на каждом этапе, чтобы не пропустить пик, но и не пересидеть.

Как работает лесенка:

Разбиваешь позицию на 4 равные части (по 25%) и продаешь по одной части на каждом уровне:

Уровень	Что продавать	Пример (20 шейров)	Выручка
90¢	25 % от всего	5 шейров	\$4.50
93¢	25 % от всего	5 шейров	\$4.65
95¢	25 % от всего	5 шейров	\$4.75
97¢	оставшиеся 25%	5 шейров	\$4.85

Итого: 18,75 доллара с 11,60 доллара вложенных средств = +7,15 доллара прибыли (+62%)

Почему именно 93 и 95 центов:

При таких ценах вероятность того, что ваша сторона выиграет, составляет 93–95 %. Это высокая степень уверенности в том, что сделка сработает. Продавая по такой цене, вы фиксируете реальные деньги, пока шансы на вашу сторону высоки.

Важное решение: оставить или продать?

Когда цена достигнет 93–95 центов, обратите внимание на два момента:

Сколько времени осталось — больше 5 минут? Есть запас.

Momentum BTC — цена продолжает расти в вашу пользу?

Если оба варианта верны → пусть едет за 97 центами.

Если импульс угасает или времени мало → продавай все сейчас. Лучше синица в руках. Забрать прибыль на уровне 93 центов гораздо лучше, чем смотреть, как цена откатывается к 80 центам, пока ты ждал 97 центов.

► ЗАДАНИЕ

Считаем: вошел в сделку за 60 центов, шейр упал до 44 центов (-27%). Стоп сработал. Потеря = $(60 - 44) \times N$ шейров. Теперь представим, что стоп не был установлен: шейр упал до 5 центов. Разница в потерях = ? Это и есть ценность стоп-лосса.

Урок 4. Уровень 97¢ — максимальная прибыль

Это последний уровень лесенки — здесь вы продаете последние 25% позиции и завершаете сделку.

Почему 97 центов, а не 100:

При 97 центах вы уже получаете 97 % максимально возможной прибыли за шейр. Ждать 99–100 центов — значит сидеть на рынке последние 1–2 минуты, когда цена еще может развернуться. Если она развернется, вы можете за считанные секунды упасть с 97 центов до 70–80 центов. Дополнительные 3 цента за шейр просто не стоят такого риска.

Когда достигается показатель в 97 центов?

Обычно в последние 2–4 минуты 15-минутного окна, когда BTC сильно двигался в твою сторону на протяжении всего раунда. Не каждая сделка доходит до 97 центов — и это нормально. Продажа за 93–95 центов — тоже отличный результат.

Ключевой момент — 95 центов, и время еще есть:

Спроси себя:

BTC продолжает уверенно двигаться в мою сторону? Гэп растет? → Жди 97¢

Движение замедляется? Свечи мельчают? Гэп сужается? → Продавай все сейчас по 95¢

Последние 2 минуты — правило безопасности:

Если цена не достигла 97 центов и осталось меньше двух минут, продавай все по рыночной цене. Не рискуй. Гарантированные 94 цента гораздо лучше, чем разворот в последнюю минуту, который съест нереализованную прибыль.

Помни: цель не в том, чтобы выжать из сделки все до цента. Цель — стабильно уходить с доходностью +40–60%. Лесенка гарантирует фиксацию прибыли на нескольких уровнях, что бы ни произошло.

► ЗАДАНИЕ

Напишите 4 правила, которые вы обязуетесь соблюдать в каждой сделке. Например: «На 90¢ всегда продаю 25%. Стоп-лосс не сдвигаю. Не жду 100¢. Рассчитываю лесенку до входа». Сохраните список.

Урок 5. Стоп-лосс и психология

Стоп-лосс — железное правило:

Вошел по цене 58 центов. Цена упала до 43 центов (-26%). ВЫХОД. Немедленно. Без обсуждений.

Логика стоп-лосса -25%:

Вход 58 центов $\times 0,75 =$ стоп на 43–44 цента

Не вышел, и цена упала до 20 центов $\rightarrow -66\%$ вместо -26%

Три этапа психологической защиты:

До входа в сделку: заранее определи, по какой цене будешь закрывать убыток. Держи это в голове до входа в сделку. Когда цена достигнет этого уровня, сразу же выходи, не раздумывая.

После первой фиксации (90¢): переместите стоп на цену входа (брейк-эвен). Теперь вы не потеряете деньги.

После 95¢: Большая часть прибыли зафиксирована. Оставшиеся шейры — «бесплатная» позиция.

Четыре психологических ловушки:

«Оно вернется» — не вернется. Выходи по стопу.

«Продам все за 90 центов» — нет. 90 центов = 25%, не все.

«Подожду до 100 центов» — жадность. Бери за 97 центов.

«Сдвину стоп» — двигайте только в свою пользу (ужесточайте), никогда не расширяйте позицию, чтобы избежать убытка.

Важно: на Polymarket нельзя заранее выставить стоп-лосс. Выходить нужно вручную, продавая по рынку. Если вы зарегистрировались, как рекомендовано, и включили двухфакторную аутентификацию, сделки проходят без подтверждения кошелька, так что продажа по рынку происходит достаточно быстро.

С ростом опыта вы можете увеличивать стоп-лосс, чтобы переждать более сильные колебания цены — иногда это уместно. Но делайте это осознанно, а не в надежде на удачу.

Предпланирование:

Перед каждой сделкой пиши: «Вход: X¢. Стоп: Y¢. 90¢=N шейров. 93¢=N шейров. 95¢=N шейров. 97¢=всё».

► ЗАДАНИЕ

Напишите 4 правила, которые вы обязуетесь соблюдать в каждой сделке. Например: «На 90¢ всегда продаю 25%. Стоп-лосс не сдвигаю. Не жду 100¢. Рассчитываю лесенку до входа». Сохраните список.

Урок 6. Практика: полный расчет лесенки

Exit Ladder Calculator — \$100 Balance · 12% Position · Entry 62¢

LEVEL	FORMULA	SELL	REVENUE	PROFIT	CUMUL.
90¢ (first)	$19 \times 0.25 \rightarrow 4$ shares	4 shares	\$3.60	+\$1.12	+\$1.12
93¢	$15 \times 0.33 \rightarrow 4$ shares	4 shares	\$3.72	+\$1.24	+\$2.36
95¢	$11 \times 0.50 \rightarrow 5$ shares	5 shares	\$4.75	+\$1.65	+\$4.01
97¢ (all)	remaining 6 shares	6 shares	\$5.82	+\$2.10	+\$6.09
TOTAL		19 shares sold	\$17.89	+\$6.09	+51%

Invested: \$11.80 (19 shares x 62¢) · Calculate YOUR ladder BEFORE entering · floor() = round down shares

Почему это важно:

Расчет выходов ВО ВРЕМЯ сделки = ошибки. Расчет ЗАРАНЕЕ = четкий план без эмоций.

Формула расчёта:

Позиция (\$) ÷ цена входа = количество шейров

90¢: $\text{floor}(\text{шейры} \times 0,25)$

93 цента: $\text{floor}(\text{остаток} \times 0,33)$

95 центов: $\text{floor}(\text{остаток} \times 0,50)$

97 центов: все оставшиеся

Пример: баланс \$100, комиссия 12%:

Позиция: \$12. Цена входа: 62 цента. Шейры: $\text{floor}(12 \div 0,62) = 19$ шейров

Уровень	Формула	Продать	Выручка	Прибыль
90¢	$19 \times 0,25 \rightarrow 4$	4 шейра	\$3.60	+\$1.12
93¢	$15 \times 0,33 \rightarrow 4$	4 шейра	\$3.72	+\$1.24
95¢	$11 \times 0,50 \rightarrow 5$	5 шейров	\$4.75	+\$1.65
97¢	все	6 шейров	\$5.82	+\$2.10
Итого	19	\$17.89	+\$6.09 (+51%)	

Сравнение сценариев:

Лесенка: +\$6,09 с высокой вероятностью успеха

Удержание до 100 центов: +\$7,22, но вероятность ~65%

Удержание + разворот: -\$12 (полная потеря)

Упражнение:

Возьмите свой реальный баланс. Рассчитайте лестницу для входа по 55¢ и 65¢. Запишите точное количество шейров.

► ЗАДАНИЕ

Напишите 4 правила, которые вы обязуетесь соблюдать в каждой сделке. Например: «На 90¢ всегда продаю 25%. Стоп-лосс не сдвигаю. Не жду 100¢. Рассчитываю лесенку до входа». Сохраните список.

Модуль 7. Определение размера позиции

Урок 1. Почему размер важнее направления



Почему это важно:

Трейдер с показателем WR 70% и случайным размером позиции проигрывает трейдеру с показателем WR 60% и оптимальным размером позиции. Размер позиции — второй по важности элемент системы после фильтрации.

Ключевая концепция:

Оптимальный размер портфеля обеспечивает максимальный рост при ограничении максимальной просадки. Критерий Келли дает математический оптимум, но на практике размер портфеля составляет 50–70 % от размера портфеля по критерию Келли (дробный критерий Келли).

Критерий Келли:

$$f^* = (bp - q) / b$$

где b = чистый коэффициент (соотношение прибыли и убытка), p = WR, q = $1 - p$

Пример: WR 65 %, вход 62 цента, средний выход 90 центов

$$b = 28/62 = 0,452$$

$$f^* = (0,452 * 0,65 - 0,35) / 0,452 = (0,294 - 0,35) / 0,452 = -0,124$$

Отрицательный Kelly? Это потому что при полном лоссе (62¢) $loss > profit$ (28¢). Со стоп-лоссом (средний лосс 40¢):

$$b = 28/40 = 0,70$$

$$f^* = (0,70 * 0,65 - 0,35) / 0,70 = (0,455 - 0,35) / 0,70 = 15,0\%$$

Дробный Келли (60%): 9,0% от баланса на сделку.

► ЗАДАНИЕ

Какой максимальный размер одной сделки по правилу 20% при балансе в 100 долларов? А при балансе в 500 долларов?

Урок 2. Динамический подбор размера: когда больше, когда меньше



Почему это важно:

Фиксированный размер комиссии ("всегда 12%") не учитывает качество сделки. Идеальная сделка заслуживает большего размера комиссии. Сомнительная — меньшего.

База: 12%

Увеличить размер (+2–4 %):

Цена шейра 55–60 центов → лучший R/R, добавь 2%

Все таймфреймы согласованы (15 минут + 4 часа + дневной в одну сторону) → +2%

Сессия OVERLAP или NY OPEN → рынок активен, +1%

Уменьшить размер (-1–6 %):

2 убытка подряд → -3% при каждом последующем входе

Просадка > 10% от пика → -3%

3+ победы подряд (не жадничай) → -1%

Спред > 2¢ → -1% (выходишь дорого)

Азиатская сессия → -2% (низкий объём торгов)

ATR аномально высокий → -2% (волатильность непредсказуема)

Стоп на день:

5 убытков → торговля остановлена до следующего дня

Пример:

База 12% + цена 57¢ (+2%) + все таймфреймы согласованы (+2%) = 16%

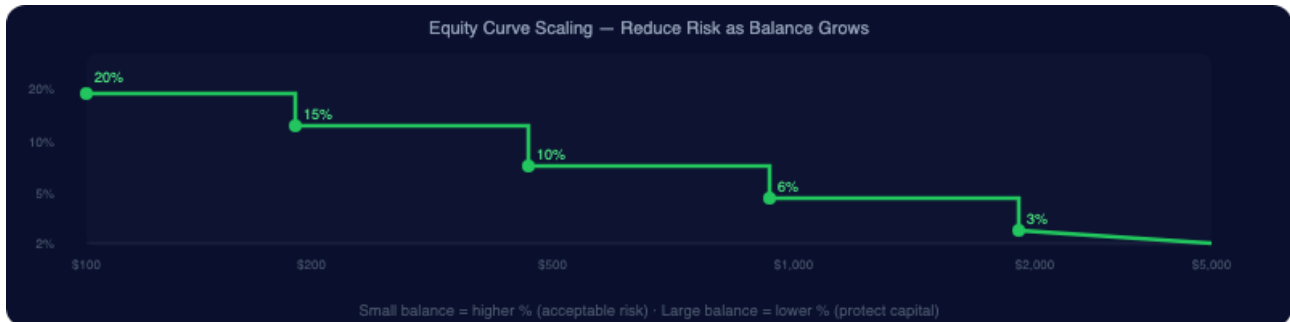
База 12% – 2 убытка подряд (-3%) – спред 3¢ (-1%) = 8%

Запомни. Размер позиции — это не фиксированное число. Это оценка качества сделки в реальном времени.

► **ЗАДАНИЕ**

Базовый размер 12 % от 300 долларов = 36 долларов. Цена шейра 57 центов (оптимально), все таймфреймы совпадают (+2 %), сессия NY OPEN (+1 %), но 2 убытка подряд (-3 %). Каков итоговый размер в процентах и долларах?

Урок 3. Масштабирование капитала: рост с сохранением баланса



Почему это важно:

При сделке на 30 долларов сделка на 6 долларов (20%) — это нормально. При сделке на 1000 долларов сделка на 200 долларов (20%) — это потенциальный убыток в размере 200 долларов. С ростом баланса меняется и психология.

Модель масштабирования:

Пример баланса	Макс. % на сделку	Макс. \$ на сделку
\$100	20%	\$20
\$300	18%	\$54
\$500	15%	\$75
\$1,000	12%	\$120

Логика снижения %:

При увеличении баланса абсолютный размер сделки растет, но процент снижается. Это защищает от катастрофических потерь при больших балансах.

Переходные периоды:

Каждый новый уровень (\$100, \$300, \$500) = первые 5 сделок с минимальным размером. Адаптация к новым абсолютным числам.

Ошибка: «У меня 800 долларов, я поставлю 200 долларов на одну сделку (25%)». При убытке это -\$200 = -25% за одну сделку. Чтобы восстановиться, нужно 33% роста.

► ЗАДАНИЕ

Ваш баланс вырос со 100 до 200 долларов. Как меняется размер сделки при масштабировании капитала?

Урок 4. Определение размера с учетом просадки



Почему это важно:

При просадке -20% для восстановления нужно +25%. Если продолжать торговать с тем же размером позиции, одна серия убытков может уничтожить счет.

Модель:

Просадка от АТН	Множитель размера
0-5%	1.0x (нормальный)
5-10%	0,8x
10-15%	0,6x
15-20%	0,4x
> 20%	Стоп-торговля. Аудит.

Пример:

Баланс АТН = \$500. Текущий баланс = \$425 (просадка -15%).

Нормальный размер при силе сигнала 10/20: 14% = \$59,50

С поправкой на просадку: $14\% \times 0,6 = 8,4\% = \$35,70$

Автоматическое восстановление:

Когда баланс возвращается к АТН → множитель возвращается к 1,0x, но постепенно (+0,1x за каждые 5% восстановления).

Психология:

Уменьшение размера при просадке = меньше стресса = лучшие решения. Это не слабость — это управление эмоциями.

► ЗАДАНИЕ

После двух лоссов подряд просадка составила 15%. Насколько нужно уменьшить размер позиции?

Урок 5. Комплексная Модель Роста



Почему это важно:

Правильный подбор размера + компаундирование = экспоненциальный рост. Неправильный подбор размера + компаундирование = экспоненциальное падение.

Реальная модель при размере 12 % — от 30 до 1000 долларов:

Старт \$30 → \$1062 за 24 дня (агрессивный старт: первые 5 дней по 20%, затем 12%)

День 1: 36 долларов | День 5: 75 долларов | День 10: 150 долларов | День 16: 347 долларов |
День 24: 1062 доллара

Компаундинг меняет ситуацию: линейный рост (10 долларов в день) = 97 дней на ту же сумму

Модель при оверсайзинге (20 % на каждую сделку):

Один неудачный день (3 убытка подряд): $-20\% \times 3 = -48,8\%$ (сложный процент)

Восстановление: необходимо +95%

Результат: даже при высоком уровне WR отдельные дни тормозят рост

Модель при занижении размера (5 % на каждую сделку):

Безопасно, но медленно

\$30 → \$1000 = ~55 дней (против ~24 дней при 12%)

Оптимальный размер: 12 % — баланс между скоростью роста и защитой от разрушительных серий убытков.

► ЗАДАНИЕ

Считай: старт — 30 долларов, +3% за сделку, 5 сделок в день. Сколько будет через неделю?

Урок 6. Правило Одной Позиции

Single Position Rule — One Active Trade at a Time

✗ 3 CONCURRENT POSITIONS

BTC-YES @58¢ · 12 shares · \$6.96 · Min 5

BTC-YES @61¢ · 10 shares · \$6.10 · Min 8

BTC-YES @59¢ · 11 shares · \$6.49 · Min 10

BTC drops → ALL 3 hit stop simultaneously

Total loss: -\$5.39 (3x exposure)

✓ ONE POSITION

BTC-YES @58¢ · 12 shares · \$6.96 · Min 5

Full focus · Monitor one trade

Execute ladder precisely

Manage momentum signals

BTC drops → only 1 at risk

Max loss: -\$1.74 (controlled)

All BTC binaries are 100% correlated · Multiple positions = same bet multiplied · Wait for full exit first

Правило:

Один вход — одна 15-минутная сделка. Не входить повторно, пока текущая позиция не закрыта.

Почему это важно:

Каждые 15 минут открывается новый рынок для торговли BTC. Твоя задача — выбрать лучший момент, войти в сделку один раз и дать ей отыграться. Многократные входы в одном окне — это хаос, а не стратегия.

Что происходит при использовании нескольких входов:

Вы платите спред дважды

Удерживаешь убыточную позицию вместо того, чтобы выйти из нее

Размер позиции растет бесконтрольно

Внимание рассеивается — вы перестаете видеть картину целиком

Правило работы:

Дождитесь своего окна входа (за 10–5 минут до конца)

Войдите один раз, указав нужный размер

Поставь стоп в голове — и придерживайся его

Следующий вход — только через 15 минут

Типичная ошибка:

«Зашёл на 8-й минуте, цена пошла против. Зайду ещё раз, когда останется 5 минут, — отыграюсь». Это не второй шанс — это удвоение потерь при том же движении BTC.

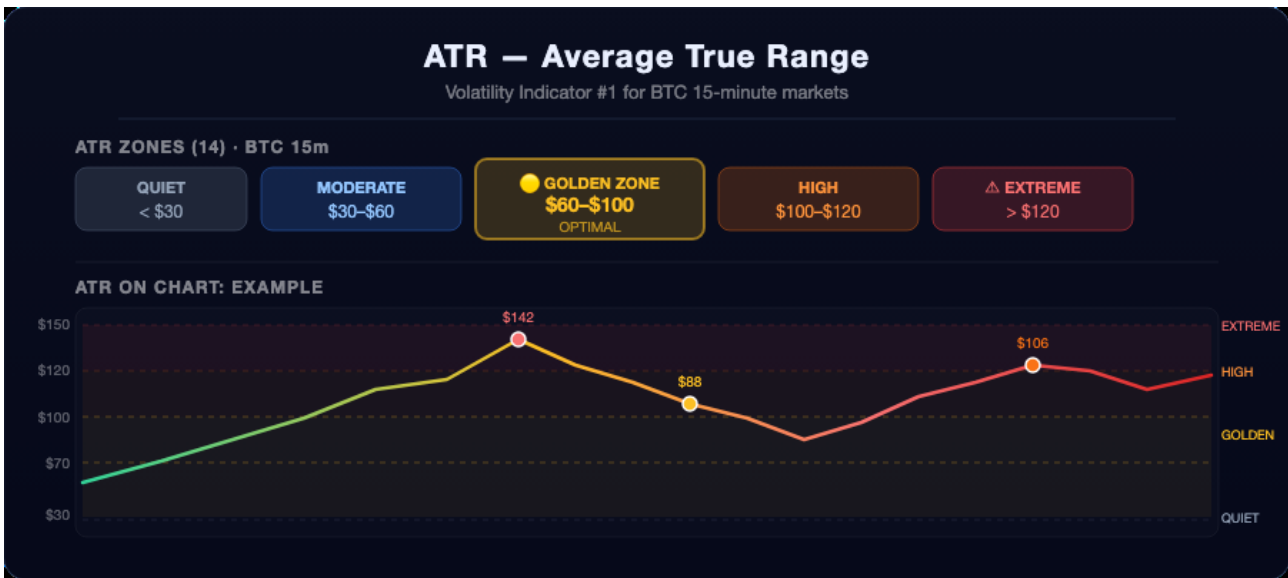
Одна позиция — полный контроль. Две — двойной риск и половина внимания.

► ЗАДАНИЕ

Почему на 15-минутках нельзя открывать две позиции одновременно? Запишите ответ.

Модуль 8. Продвинутое сигналы

Урок 1. ATR: главный индикатор волатильности



Почему это важно:

ATR (Average True Range, средний истинный диапазон) — самый важный индикатор для 15-минутных бинарных опционов на биткоин. Он показывает, на сколько долларов в среднем меняется курс биткоина за одну свечу. Без ATR вы не узнаете, жив рынок или мертв, можно ли входить в сделку.

Параметры: ATR(14) на 15-минутных свечах BTC.

Что такое ATR простыми словами:

Представьте, что вы смотрите на последние 14 свечей по 15 минут. Для каждой свечи вы определяете, насколько сильно колебался курс BTC — от минимума до максимума. Затем усредняете все 14 значений. Это и есть ATR.

Если ATR = \$80, значит, BTC в среднем меняется на \$80 каждые 15 минут. Если ATR = \$30, значит, рынок вялый и почти не движется.

Зоны ATR для BTC 15 м:

ATR	Зона	Размер позиции	Действие
< \$30	Тихий	—	Не входить
30–60 долларов	Умеренный	~10% (12% × 0,8)	Осторожно
60–100 долларов	Золотая	12% (базовый)	Оптимально
100–120 долларов	Высокий	~11% (12% × 0,9)	Осторожно
> \$120	Экстрем	~7% (12% × 0,6)	Минимум

Логика размеров:

Базовый размер — 12% от баланса. Это оптимальный размер при нормальном рынке (ATR \$60–100). При отклонениях коэффициент корректирует размер.

Спокойный рынок → не входить в сделку (нет движения = нет прибыли)

Умеренный → чуть меньше (рынок не в своей тарелке, стопы ближе)

Золотая зона → полный размер (оптимальные условия)

Высокий → немного меньше (движения крупнее, стопы шире)

Экстремальный → минимальный размер (рынок непредсказуем, высокий риск)

Пример:

Баланс \$300. ATR = \$85 (золотая зона).

Размер позиции = $\$300 \times 12\% = \36 на сделку.

Баланс \$300. ATR = \$130 (экстремальный).

Размер позиции = $\$300 \times 12\% \times 0,6 = \sim \22 на сделку.

Режим EXTREME (ATR > \$120):

Рынок в панике — движения резкие и непредсказуемые. В такие моменты даже хорошие сигналы ненадёжны. Торгуй только если сигнал очень чистый, с минимальным размером.

ATR Shift — резкое ускорение:

Если ATR за последние 4 свечи значительно выше, чем за предыдущие 4 свечи, значит, рынок только что ускорился. Лучше пропустить первую свечу нового режима и дать рынку стабилизироваться.

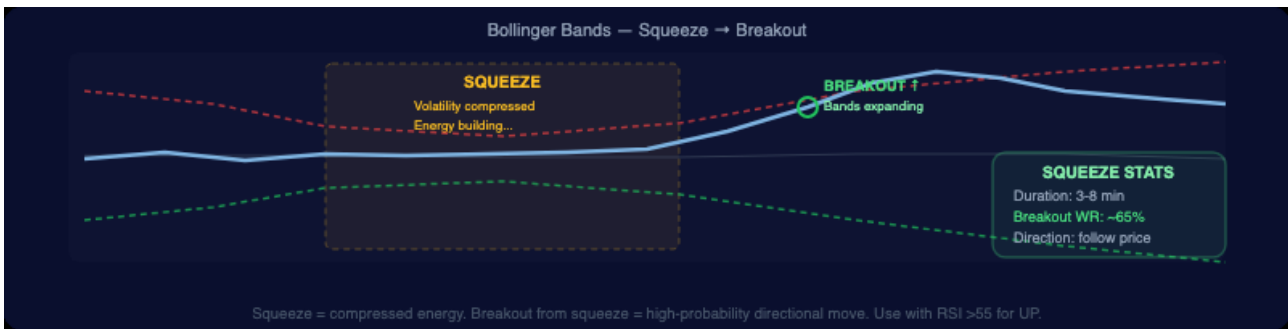
В Терминале:

Блок МЕТРИКИ → ATR (14) LIVE → текущее значение и статус зоны.

► ЗАДАНИЕ

Откройте TradingView. Добавьте ATR(14) на 15-минутный BTC. Запишите текущее значение. В какой зоне находится рынок: спокойной / умеренной / «золотой» / высокой / экстремальной?

Урок 2. Полосы Боллинджера: сжатие и пробой



Что такое полосы Боллинджера:

Это три линии вокруг цены BTC. Средняя — обычная скользящая средняя. Верхняя и нижняя — границы нормального движения. Когда цена стабильна, полосы узкие. Когда BTC начинает двигаться, полосы расширяются.

Параметры: BB(20, 2) на 5-минутных свечах BTC.

Два ключевых состояния:

Сжатие (squeeze):

Полосы очень узкие — рынок замер. BTC накапливает энергию перед рывком. Чем дольше длится сжатие, тем сильнее будет выход. Это момент ожидания, а не торговли.

Прорыв (англ. breakout):

Цена вышла за верхнюю или нижнюю полосу — движение началось:

Цена пробивает верхнюю полосу → бычий импульс → рост

Цена пробивает нижнюю полосу → медвежий импульс → ВНИЗ

Цена между полосами → нет чёткого направления

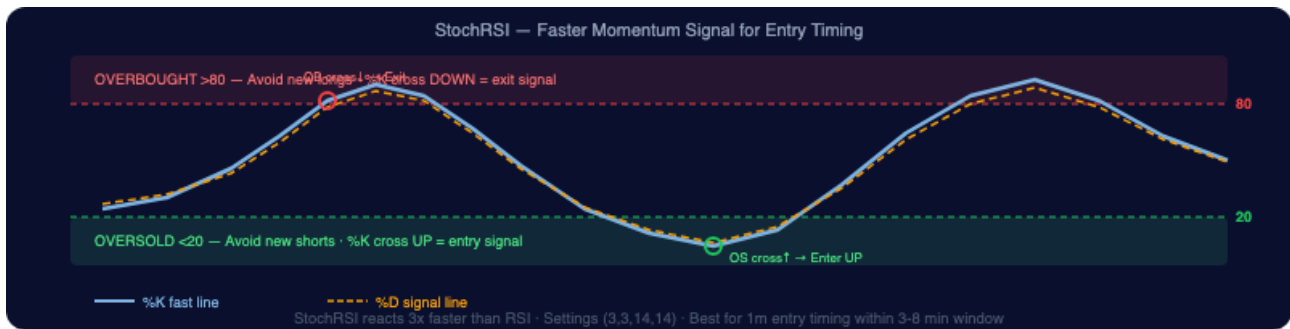
Важно:

Сквиз не означает, что BTC будет стоять на месте. Это накопление. Направление пробоя заранее неизвестно — для подтверждения смотрите на RSI и MACD. Не открывайте сделку сразу после сквиза — дождитесь самого пробоя.

► ЗАДАНИЕ

Откройте RSI (14) на 1-минутном и 5-минутном графиках BTC. Он выше или ниже 50? В зоне перекупленности или перепроданности?

Урок 3. StochRSI: перекупленность и перепроданность



Почему это важно:

Обычный RSI на 15-минутном таймфрейме слишком медленный. StochRSI = RSI от RSI, что позволяет получить более чувствительный осциллятор для микротаймфреймов.

Параметры: StochRSI(14, 14, 3, 3) на 1-минутных свечах.

Сигналы:

Стохрси	Состояние	Действие
> 80	Перекупленность	Не входить в UP. Возможен откат
20-80	Нейтральный	Другие факторы решают
< 20	Перепроданность	Не входить в позицию DOWN. Возможен отскок

Продвинутое использование:

StochRSI пересекает 80 сверху вниз → медвежий сигнал

StochRSI пересекает 20 снизу вверх → бычий сигнал

Дивергенция: цена растет, StochRSI падает → тренд слабый

Ключевая деталь:

StochRSI НЕ предсказывает направление. Он предсказывает истощение. Перекупленность не означает, что «цена пойдет вниз», — это значит, что «восходящий тренд ослабевает».

Влияние на сигнал: -1, если сигнал перекуплен для UP или перепродан для DOWN. +1 при пересечении в нашу сторону.

► ЗАДАНИЕ

Откройте MACD (12/26/9) на 5-минутном графике BTC. Линия MACD выше или ниже сигнальной? Гистограмма растет или сжимается?

Урок 4. Ворота спреда Bid-Ask



Почему это важно:

Спред — это скрытая комиссия. На Polymarket спред варьируется от 0,5 до 5 центов и более. Вход в сделку при широком спреде снижает доходность даже при правильном направлении.

Логика вентиля:

Спред	Действие
< 1.0¢	Зелёный свет. Оптимальный вход
1.0-2.0¢	Жёлтый. Вход разрешён, электромобиль снизил скорость
2.0-3.0¢	Оранжевый. Только при сильном сигнале (> 10/20)
> 3.0¢	Красный. Блокировка входа

Когда спред расширяется:

- Первые 30–60 секунд 15-минутного окна
- При быстром движении BTC (> \$100/мин)
- Во время азиатской ночной сессии
- При низкой ликвидности на Polymarket (< 1000 шейров в книге)

Стоимость спреда:

При входе 62 цента со спредом 2 цента: реальная цена = 63 цента (аск). При выходе 85 центов со спредом 1 цент: реальная цена = 84 цента (бид).

Убыток: 3 цента / 62 цента = 4,8% от инвестиций уходит на спред.

Что делать: Проверять спред ПЕРЕД каждым входом. Если спред > порога → подожди 30 секунд, перепроверь. Если всё ещё широкий → пропуск.

► ЗАДАНИЕ

Добавьте на график ЕМА 9 и ЕМА 21. Какая из них выше? Произошло ли пересечение за последние 3 свечи?

Урок 5. Комбинация индикаторов: конфликтная модель



Почему это важно:

Индикаторы часто противоречат друг другу. RSI показывает «вверх», MACD — «вниз», а EMA только что пересеклась в обратную сторону. Нужна четкая иерархия — без нее решения будут приниматься хаотично.

Иерархия (от главного к фильтрам):

ATR (14) — фундамент. Торгуем или нет и какой размер позиции выбираем.
RSI (14) — главный сигнал направления. Пересечение уровня 50 и зоны.
MACD (12/26/9) — подтверждение. Совпадает с RSI → высокая вероятность.
EMA 9/21 — тренд. Крест вверх → бычий тренд, крест вниз → медвежий.
Pivots HL — уровни. Ключевые зоны поддержки и сопротивления.
StochRSI — фильтр истощения. Предупреждает, но не запрещает.

Модель конфликта:

ATR < \$30 → не торгуем. Рынок мёртв, нет движения.
ATR > \$120 → экстрем. Размер 7% (12% × 0.6), только очень чистый сигнал.
RSI + MACD совпадают → сильный сигнал. Полный размер (12%).
RSI показывает вверх, MACD показывает вниз → конфликт. Ждать, не входить.
EMA 9 > EMA 21 → бычий фон, предпочитай UP сделки.
EMA 9 < EMA 21 → медвежий фон, предпочитай DOWN сделки.
Цена у уровня сопротивления Pivot HL → осторожно, возможен разворот вниз.
StochRSI перекуплен, но RSI + MACD за UP → входить можно, размер чуть меньше.

Лучший сетап:

Большинство индикаторов указывают в одном направлении: RSI — за направление, MACD — подтверждает, EMA — создает правильный фон, ATR — в золотой зоне. Чем больше совпадений, тем выше уверенность.

Когда не входить:

RSI и MACD в конфликте, или ATR < \$30 → пропуск. Нет ясности — нет сделки.

Правило:

Чем больше индикаторов указывают в одну сторону, тем выше уверенность. Минимум 2 подтверждения от RSI + MACD + EMA — иначе не входить.

► **ЗАДАНИЕ**

Найдите ближайший уровень Pivot High или Pivot Low. Цена сейчас находится у уровня поддержки или сопротивления?

Урок 6. Режимы рынка и выбор индикаторов

ATR Regime → Indicator Selection					
ИНДИКАТОР	ТИХИЙ <\$30	УМЕР. \$30-60	ЗОЛОТО \$60-100	ВЫСОК. \$100-120	ЭКСТРЕМ >\$120
RSI (14)	—	⚠ Осторожно	★ Отлично	✓ Хорошо	⚠ Ложный
MACD 12/26	—	⚠ Запаздывает	★ Отлично	✓ Хорошо	⚠ Запаздывает
EMA 9/21	—	✓ Слабо	★ Отлично	★ Отлично	✓ Ненадёжно
BB (20,2)	⚠ Squeeze	✓ Средне	★ Отлично	✓ Хорошо	— Хаос
StochRSI	—	✓ Средне	✓ Хорошо	★ Отлично	⚠ Ловушки
Pivots HL	✓ Слабо	✓ Хорошо	★ Отлично	★ Отлично	✓ Средне

⚠ ATR < \$30 — не торгуем ни с каким индикатором
 ★ Золотая зона \$60-100 — все индикаторы работают максимально надёжно

Почему это важно:

Один и тот же индикатор может отлично работать при ATR \$80 и давать ложные сигналы при ATR \$20. Знай, какой инструмент надежен в текущих рыночных условиях.

Эффективность по зонам ATR:

Индикатор	Тихий <\$30	Умер. 30–60 долларов	Золото — 60–100 долларов за унцию	Высокий. 100–120 долларов	Экстрем >\$120
RSI (14)			Отлично	Хорошо	Ложный
MACD 12/26		Запазд.	Отлично	Хорошо	Запазд.
EMA 9/21		Слабо	Отлично	Отлично	Ненадёж.
BB (20,2)	Сжимать	Средне	Отлично	Хорошо	Хаос
Стохрси		Средне	Хорошо	Отлично	Ловушки
Шарниры HL	Слабо	Хорошо	Отлично	Отлично	Средне

Практический вывод:

ATR < \$30: не торгуем вообще. Ни один индикатор не даёт надёжных сигналов.

ATR \$30-60: осторожно. Используйте EMA + Pivots HL, RSI и MACD могут запаздывать.

ATR \$60-100 (золото): все индикаторы работают отлично. Полный набор, полный размер.

ATR \$100-120: RSI, MACD, EMA и Pivots HL надёжны. StochRSI полезен для отслеживания истощения.

ATR > \$120: рынок непредсказуем. Только Pivots HL имеют смысл. Размер минимальный.

Как применять:

Перед каждым входом проверяйте ATR. Определите зону. Используйте только надежные для этой зоны инструменты. Не доверяйте RSI на спокойном рынке — он врет.

► **ЗАДАНИЕ**

ATR = \$85, RSI = 62 (выше 50), MACD только что пересёк вверх, EMA 9 > EMA 21. Что делать и какой размер?

Модуль 9. Психология исполнения

Урок 1. Главная Правда

Что убивает ваш эдж на 15m BTC

<p>✗ ПЛОХОЕ ИСПОЛНЕНИЕ Хорошая стратегия, нарушены правила</p> <ul style="list-style-type: none">→ Вход в неправильную минуту→ Пропущен стоп→ Revenge трейд ×2→ FOMO на высокой цене→ 15 сделок в день <p>-\$0.80 / трейд</p>	<p>✓ ХОРОШЕЕ ИСПОЛНЕНИЕ Та же стратегия, правила соблюдены</p> <ul style="list-style-type: none">→ Вход 10-5 мин до конца→ Стоп всегда выполняется→ 30 мин паузы после лосса→ Вход только при реальном эдже→ 3-5 качественных сделок <p>+\$1.30 / трейд</p>	<p>⚠ СЛАБАЯ СТРАТЕГИЯ Идеальное исполнение, нет эджа</p> <ul style="list-style-type: none">→ Не те часы (ET)→ ATR < \$30 (рынок мёртв)→ Конфликт RSI/MACD→ Без проверки ATR→ Игнор уровни Pivots HL <p>-\$0.20 / трейд</p>
---	---	---

СТРАТЕГИЯ × ИСПОЛНЕНИЕ = РЕАЛЬНЫЙ РЕЗУЛЬТАТ
У большинства есть эдж. Они уничтожают его ошибками исполнения.
Исправь исполнение сначала — потом оптимизируй стратегию.

Что на самом деле сводит на нет результат в 15 млн BTC:

Большинство трейдеров теряют деньги не из-за плохой стратегии, а из-за несоблюдения правил. Одна и та же система при соблюдении дисциплины приносит +\$1,30 за сделку. Без соблюдения дисциплины — -\$0,80 за сделку. Это не теория, а математика нарушенных правил.

СТРАТЕГИЯ × ИСПОЛНЕНИЕ = РЕАЛЬНЫЙ РЕЗУЛЬТАТ

Топ-5 причин потерь на коротких таймфреймах BTC:

1. Неправильный выбор времени для входа в сделку

Вход на 3-й минуте вместо 10-й или за 5 минут до конца — вы платите максимальную рыночную премию, когда исход еще неизвестен. Дождитесь своего окна. Каждая минута ожидания снижает риск.

2. Пропуск стоп-лосса

«Оно вернется» — самая дорогая фраза в трейдинге. На бинарном рынке цена может упасть до 0 центов. Стоп — это не опция, а правило. Решил заранее — обязательно исполни.

3. Торговля из мести

Проиграл → злость → вход без анализа → еще больше проиграл → цикл.

Решение: 30-минутный перерыв после каждого убытка. Обязательно.

4. Страх упустить выгоду из-за высоких цен

Шейр на 87 центах, BTC летит вверх, «куплю сейчас!» Математика жестока: если рынок развернется, вы потеряете более 90 % средств. Входите в сделку только в том случае, если видите реальный эдж, а не из страха что-то упустить.

5. Перетрейдинг

3-5 качественных сделок в день лучше, чем 15 случайных. Чем больше сделок, тем больше шума и меньше преимущества. Ждите только четкого сетапа.

Формула:

Хорошая стратегия + нарушение правил = убыток.

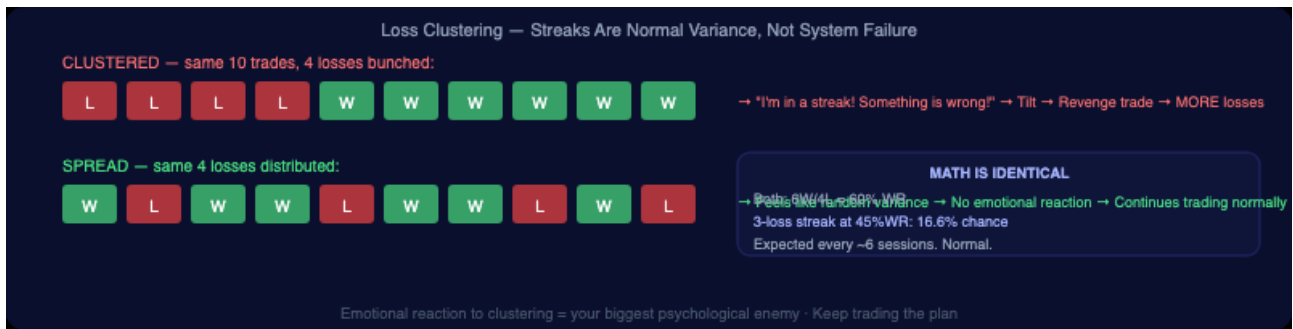
Средняя стратегия + железная дисциплина = прибыль.

Сначала исправь исполнение, а потом оптимизируй стратегию.

► ЗАДАНИЕ

Честно ответь: ты сейчас в состоянии торговать? Оцени по шкале от 1 до 10. Если меньше 6, лучше не торгуй.

Урок 2. Кластеризация убытков



Почему это важно:

Убытки распределяются неравномерно. Они приходят группами (по 3–5 подряд), потому что рыночные условия меняются, а трейдер не успевает адаптироваться.

Анализ кластеров:

При WR 65% вероятность серии убытков:

Серия	Вероятность	Ожидание на 100 сделок
2 подряд	12.25%	~12 раз
3 подряд	4.29%	~4 раза
4 подряд	1.50%	~1-2 раза
5 подряд	0.53%	~0-1 раз

Критический инсайт:

Серия из 3 убытков при WR 65% = НОРМАЛЬНО. Такое происходит примерно в 4 случаях из 100 сделок. Это не значит, что «система сломалась» — такова статистика.

Опасность:

Трейдер после трех убытков подряд: (1) увеличивает размер позиции, (2) снижает порог сигнала, (3) входит в сделку по более высоким ценам. Каждое из этих действий ухудшает ситуацию.

Протокол:

2 убытка подряд → перерыв на 1 час

3 убытка подряд → стоп на день

4+ подряд → стоп + проверка стратегии

► ЗАДАНИЕ

Вспомни свой последний проигрыш. Какие эмоции ты испытывал? Запиши 3 слова.

Урок 3. Эмоциональный Капитал



Почему это важно:

У трейдера есть два баланса: финансовый и эмоциональный. Когда эмоциональный капитал на нуле, финансовые решения приводят к катастрофическим последствиям.

Модель эмоционального капитала:

Максимум: 100 единиц (утром, после сна)

Каждый убыток: -15 единиц

Каждая победа: +5 единиц (асимметрия!)

Каждый час торговли: -5 единиц (усталость)

Конфликт/стресс вне трейдинга: -20 единиц

При эмоциональном капитале < 30:

Качество решений падает. Трейдер начинает "чувствовать" рынок вместо анализа. Revenge trading вероятен.

Правило:

Если 3 убытка за день (-45) + 4 часа торговли (-20) = эмоциональный капитал 35/100 → СТОП.

Восстановление:

Сон = полный сброс

Физические упражнения = +20

2-часовой перерыв без гаджетов = +15

Практика: Ведите эмоциональный дневник: записывайте свое состояние (от 1 до 10) перед каждой сделкой. Через месяц вы увидите корреляцию между состоянием и результатом.

▶ ЗАДАНИЕ

Запиши шкалу эмоций: 1 = паника, 5 = спокойствие, 10 = эйфория. Где ты сейчас?

Урок 4. Trade Journaling: Структура

Мы подготовили для вас готовый трейдинг-журнал — он выдан вместе с этим курсом в боте. Ведите его после каждой сделки!

Почему это важно:

Журнал — единственный инструмент, который превращает убытки в данные. Без журнала одни и те же ошибки повторяются бесконечно. После 20–30 записей начинаешь видеть закономерности: в какое время лучше всего открывать сделку, какие индикаторы действительно работают, где вы нарушаете правила.

10 примеров записей (в формате Excel):

Дата ET	Напр.	Вход	ATR	RSI	MACD	EMA 9/21	Причи на входа	Выход	P&L	Наруш
03-01 04:12	ВВЕРХ	58¢	\$82	63 ↑	Крест ↑	9>21	RSI>50 + MACD крест + EMA бычья	91¢	+\$12.4	Нет
03-01 06:34	ВНИЗ	61¢	\$74	52 →	Гист. →	9≈21	Конфл икт RSI и MACD (вошел вопрек и)	42¢	-\$4.8	Да
03-02 04:55	ВВЕРХ	55¢	\$91	68 ↑	Гист.↑	9>21	Зона RSI + с ильны й MACD + прор ыв ВВ	93¢	+\$16.2	Нет
03-02 08:21	ВНИЗ	54¢	\$88	38 ↓	Крест ↓	9<21	RSI<40 + MACD медве жий + EMA м едвеж ья	15¢	+\$18.7	Нет

03-03 05:10	ВВЕРХ	63¢	\$79	71 ↑	Гист.↓	9>21	FOMO — RSI перекуплен, MACD сжимается.	28¢	-\$9.0	Да
03-03 09:44	ВВЕРХ	59¢	\$95	55 ↑	Крест ↑	9>21	Крест RSI 50 + MACD + Pivot HL	88¢	+\$10.3	Нет
03-04 04:30	ВНИЗ	60¢	\$21	48 →	Слабый	Флэт	ATR<\$30 — нет движения (стоп вошёл)	47¢	-\$3.9	Да
03-04 07:15	ВНИЗ	56¢	\$84	44 ↓	Крест ↓	9<21	RSI<50 + MACD вниз + Pivot resistance	12¢	+\$12.3	Нет
03-05 05:50	ВВЕРХ	57¢	\$68	50 →	Гист.→	9≈21	Вошел без четкого направления RSI	40¢	-\$5.1	Да
03-05 10:02	ВВЕРХ	53¢	\$97	62 ↑	Крест ↑	9>21	RSI + MACD + EMA + ATR для золота	95¢	+\$19.8	Нет

Итог 10 сделок:** 6 ВЫИГРЫШЕЙ / 4 ПОТЕРИ | WR 60% | Выигрышей: +\$89,7 | Убытков: -\$22,8
| Чистый доход: **+\$66,9

Заметка: все 4 убытка — при нарушении правил или ATR<\$30

Еженедельный аудит (каждое воскресенье):

Сколько правил вы нарушили? (и почему)

В какое время по восточному времени WR лучше всего?

Бывают ли сделки в отместку?

Какие индикаторы действительно предсказывали исход?

▶ **ЗАДАНИЕ**

Создайте шаблон журнала: дата, сделка, эмоция до (1–10), эмоция после (1–10), заметки.

Урок 5. Эффект Потери Прибыли



Почему это важно:

Канеман и Тверски: психологическая боль от потери 50 долларов в 2,5 раза сильнее радости от выигрыша в 50 долларов. Но потеря НЕОЖИДАННОЙ прибыли еще болезненнее.

Сценарий:

Баланс: \$200 → \$280 (+40%) → \$220 (+10%). Трейдер «потерял» \$60. С рациональной точки зрения он в плюсе (+\$20). С эмоциональной — в минусе («потерял \$60 прибыли»).

Поведенческая реакция:

Увеличение размера позиции («нужно вернуть 60 долларов»)

Снижение требований к участникам («подойдет любая сделка»)

Удержание убыточных позиций («не хочу фиксировать еще один минус»)

Защита:

Правило «верхней границы»: достиг \$280 → минимальная цена \$252 (на 10% ниже исторического максимума)

Если баланс упадет до \$252 → СТОП на сегодня

Сосредоточьтесь на % роста от начального депозита, а не от максимального

Практика:





Записывай в журнал АТН и текущий баланс. Просадка от АТН > 10% → снижаем размер. Просадка > 20% → стоп + аудит.

► ЗАДАНИЕ

Посчитай: насколько возрастает желание «рисковать еще больше» после трех поражений подряд?

Урок 6. 5-минутная подготовка к сделке

5-Минутная Пре-Торговая Рутинa — Каждый раз, без исключений

 МИН 1-2 Тело 10 вдохов 4-4-6 счёта Потянуться Стакан воды ФИЗИЧЕСКИЙ СБРОС	 МИН 2-3 Установка "Я торгую систему, не эмоции." "Убыток = стоимость бизнеса." МЕНТАЛЬНЫЙ СБРОС	 МИН 3-4 Состояние Эмоц. энергия >50? Был стресс? Отвлекающие? Нет → не торгую ФИЛЬТР СОСТОЯНИЯ	 МИН 4-5: ТЕХНИЧЕСКИЙ КОНТЕКСТ Сессия ET: 03-11 оптимум? ATR сейчас: тихо / золото / экстрем? Баланс и просадка от ATH? Сколько потерь сегодня? Стоп близко? FOMC / CPI сегодня? ТОЛЬКО ПОТОМ — ОТКРЫВАЕМ ДАШБОРД
--	---	---	---

Почему это важно:

Профессиональные трейдеры не «просто открывают терминал». У них есть рутина, которая переключает мозг из повседневного режима в аналитический. Без нее вы торгуете вполсилы.

Протокол:

1-2 минуты: физическая подготовка

10 глубоких вдохов (на счёт 4-4-6)

Потянуться, расправить плечи

Стакан воды

Минута 2-3: Ментальная установка

Повторите вслух или про себя:

«Я торгую по системе, а не на эмоциях. Убытки — это стоимость бизнеса. Я не предсказываю, я управляю вероятностями».

3-4-я минута: проверка состояния

Эмоциональная энергия > 50%? Если нет → не торгую сегодня

Был ли у вас стресс или конфликт за последний час?

Есть отвлекающие факторы? (телефон, люди, шум)

4-5-я минута: технический контекст

Сессия: который сейчас час по восточному времени? В промежутке с 20:00 до 05:00, с 06:00 до 10:00 или с 15:00? Если нет, то я не торгую

ATR: тихий / умеренный / золотая середина / высокий / экстремальный?

Баланс: сколько сегодня потеряли/заработали? Какой % просадки от исторического максимума?

Дневной стоп: сколько потерь сегодня? Близко к лимиту?

Макро: будут ли сегодня публикации FOMC / CPI / NFP? Если да, то осторожный трейдинг или стоп-лосс

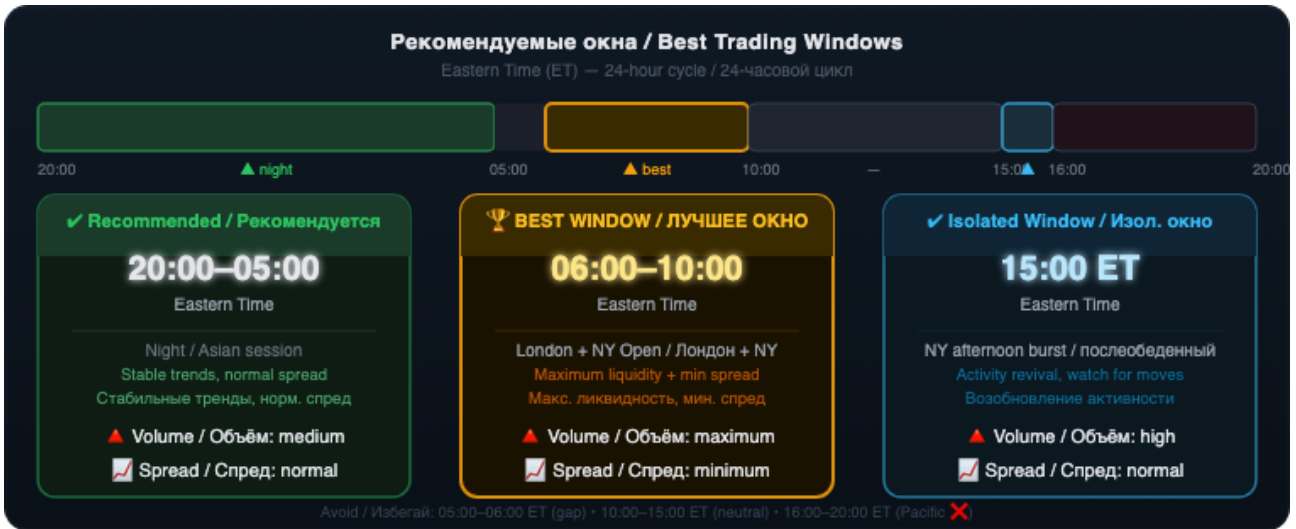
Только после этого открываем дашборд и смотрим на RSI, MACD, ATR.

► **ЗАДАНИЕ**

Запишите свой 5-минутный ритуал перед началом торговли. Что вы делаете перед первой сделкой дня?

Модуль 10. Динамика сессий

Урок 1. Торговые сессии: статистический обзор



Почему это важно:

Ликвидность, спреды и предсказуемость BTC радикально меняются в зависимости от времени суток. Торговля в «мёртвые» часы = потери на спредах и ложных сигналах.

Сеансы (по восточному времени):

Сессия	Часы ET	Объём	Спред	Качество
Ночь / Азия	20:00-05:00	Средний	Нормальный	
Лондон + NY	06:00-10:00	Максимальный	Минимальный	
NY Миддай	10:00-15:00	Средний	Нормальный	
15:00 Окно	15:00-16:00	Высокий	Нормальный	
Тихий океан	16:00-20:00	Низкий	Широкий	

Лучшие окна: 20:00–05:00 по восточному времени, 06:00–10:00 по восточному времени, 15:00 по восточному времени

Именно в этот период курс BTC наиболее предсказуем:

04:00 по восточному времени — открывается Лондонская биржа. Поступает европейский объем данных, тренды становятся более четкими

09:30 по восточному времени — открытие Нью-Йоркской фондовой биржи. Институциональные инвесторы, фьючерсы CME, максимальная ликвидность

08:00–12:00 по восточному времени — пик активности: оба рынка в силе, минимальные спреды на Polymarket

После 11:00 по восточному времени:

Лондон начинает сворачиваться, объем торгов падает, BTC входит в боковой тренд. Сигналы менее надежны.

Рекомендация:

Торгуйте с 20:00 до 05:00 по восточному времени / с 06:00 до 10:00 по восточному времени / с 15:00 по восточному времени. В остальное время — наблюдение и обучение, а не реальные сделки.

► ЗАДАНИЕ

Сейчас какое время в Восточном времени? Вы в одном из лучших временных интервалов — с 20:00 до 05:00, с 06:00 до 10:00 или с 15:00 по восточному времени? Запишите текущую сессию и оцените ее качество.

Урок 2. Когда НЕ Торговать

5 Условий Когда НЕ Торговать		
5 Absolute Stop-Trading Conditions		
#	УСЛОВИЕ / CONDITION	ПРОТОКОЛ / PROTOCOL
1	FOMC / Решение ФРС Fed Rate Decision (8x/year) Янв/Март/Май/Июль/Сентябрь/Ноябрь/Декабрь	СТОП ±2ч до и после Stop ±2h before & after cmegroup.com/fedwatch
2	CPI / NFP / PCE Macro Data (monthly, 8:30 ET) Инфляция · Занятость · Потреб. расходы	СТОП -30мин + 2ч после Stop -30min before + 2h after investing.com → High Impact + US
3	Воскресенье 21:00–23:00 ET Sunday Evening (week changeover) Переход торговых недель	Не торговать Don't trade Sunday evening Возвращайся с Пн 03:00 ET
4	ATR < \$30 более 48ч — мёртвый рынок ATR < \$30 for 48+ hours (Dead Market) Крипто-боксовик · нет движения	Жди ATR > \$40 стабильно 2ч+ Wait ATR > \$40 stable for 2h+ Потом ищи сетал · then find setup
5	Первые 5–10 мин после новостей First 5–10 min after major news (Whipsaw) Любые High Impact события	Жди 5–10 мин, проверь ATR Wait 5–10 min, check ATR Вернулось к норме → выходи · back to normal

Почему это важно:

Знать, когда НЕ торговать, не менее важно, чем знать, когда входить в сделку. Убытки в неблагоприятных условиях нельзя компенсировать с помощью технических приемов — рынком управляет внешний фактор, а не паттерны.

5 абсолютных стоп-условий:

- Комитет по операциям на открытом рынке / Решение ФРС — стоп за ±2 часа до и после:

В течение 60 минут после объявления BTC колеблется в пределах ±5–15 %. Алго-системы запрограммированы специально под это событие — технический анализ бесполезен. Заседания Комитета по операциям на открытом рынке проводятся 8 раз в год (в январе, марте, мае, июне, июле, сентябре, ноябре и декабре).

Протокол: найдите дату на FedWatch (cmegroup.com) или на investing.com → Экономический календарь. Прекратите торговлю за 2 часа до и через 2 часа после события.

- Индекс потребительских цен / количество новых рабочих мест / индекс расходов на личное потребление — макроданные публикуются каждый месяц в 8:30 по восточному времени:

Данные по инфляции (CPI) и занятости (NFP) — прямой сигнал для ФРС. Публикуются каждый месяц в 8:30 по восточному времени. В первые 5 минут BTC колеблется в диапазоне от 500 до 2000 долларов. Цена дергается в обе стороны одновременно.

Протокол: стоп за 30 минут до + 2 часа после. Фильтр в экономическом календаре → «Высокая волатильность» + флаг США.

- Вечер воскресенья (21:00–23:00 по восточному времени) — переход на новую торговую неделю:

Пересечение торговых недель — минимальная ликвидность. Маркет-мейкеры выставляют защитные спреды в размере 5–10 центов. Движения BTC без объема — любой сигнал ложный. WR в это окно исторически ниже 50%.

Протокол: не торговать в воскресенье вечером. Возвращайтесь к торговле с 04:00 по восточному времени в понедельник.

- ATR < \$30 на протяжении 48+ часов — мёртвый рынок:

Если ATR держится ниже 30 долларов в течение двух суток, значит, BTC застыл. 15-минутные движения составляют менее 20 долларов. Это меньше спреда Polymarket (2-3 цента) плюс комиссии. Нет движения = нет преимущества = гарантированные потери на спредах. WR падает до 52-55 %, тогда как безубыток при входе составляет 58 центов = 58 %.

Протокол: жди стабильного ATR > \$40 на протяжении минимум 2 часов. Только тогда ищи сетап.

- Первые 5–10 минут после выхода важных новостей — «зона качелей»:

Эффект «качелей»: алгоботы одновременно «прощупывают» ликвидность в обоих направлениях. Цена движется вверх → вниз → вверх за 2–3 минуты. RSI, MACD, EMA — все дают ложные сигналы. Шансы правильно угадать направление = 50/50.

Протокол: после любой крупной новости — ждите минимум 5 минут, а лучше 10. Затем проверьте ATR: нормализовался → можно искать сетап.

Протокол перед каждой сессией (5 шагов):

Сейчас в золотом окне 04:00–12:00 по восточному времени?

Откройте экономический календарь: какие важные события произойдут сегодня?

ATR выше 30 долларов? Если нет, не торгуйте.

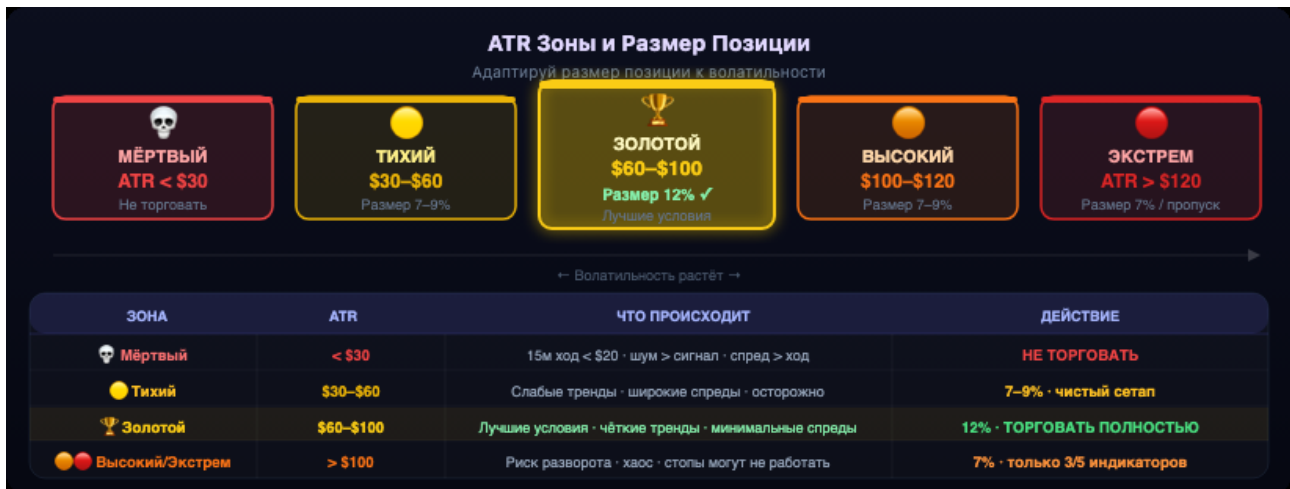
Важные новости за последние 10 минут? Подождите.

Всё чисто → ищи сет по своей системе.

► ЗАДАНИЕ

Откройте сайт [investing.com/economic-calendar](https://www.investing.com/economic-calendar). Есть ли сегодня или на этой неделе события, которые окажут значительное влияние на рынок? Запишите их время по восточному времени.

Урок 3. Зоны ATR: как адаптироваться к волатильности



Почему это важно:

ATR (Average True Range, средний истинный диапазон) — это средний ход BTC за 14 свечей в долларах. Он показывает, насколько «живой» рынок в данный момент. От уровня ATR зависит, стоит ли вообще торговать, каким объемом и насколько жесткие требования предъявлять к сетапу.

Пять зон ATR:

Зона	ATR	Что происходит	Размер позиции	Действие
Мёртвый	< \$30	Движения < \$20. Шум > сигнал	—	Не торговать
Тихий	30–60 долларов	Слабые тренды. Спреды шире	7–9%	Только чистый сетап
Золотой	60–100 долларов	Лучшие условия. Четкие тенденции	12%	Торговать полностью
Высокий	100–120 долларов	Резкие движения, риск разворота	7–9%	Согласованы только 3 из 5
Экстрем	> \$120	Хаос. Стопы не работают	7%	Пропустить или минимум

Главное правило:

ATR — это газ/тормоз для размера позиции. В золотой зоне (\$60–\$100) жми на газ. В тихой или экстремальной — тормози.

Конкретный пример:

Баланс \$200. ATR = \$45 (спокойный рынок):

Стандартный размер комиссии — 12 % = 24 доллара

ATR-адаптированный: 7% = \$14

Ждёшь $ATR > \$60$ → возвращаешься к $\$24$

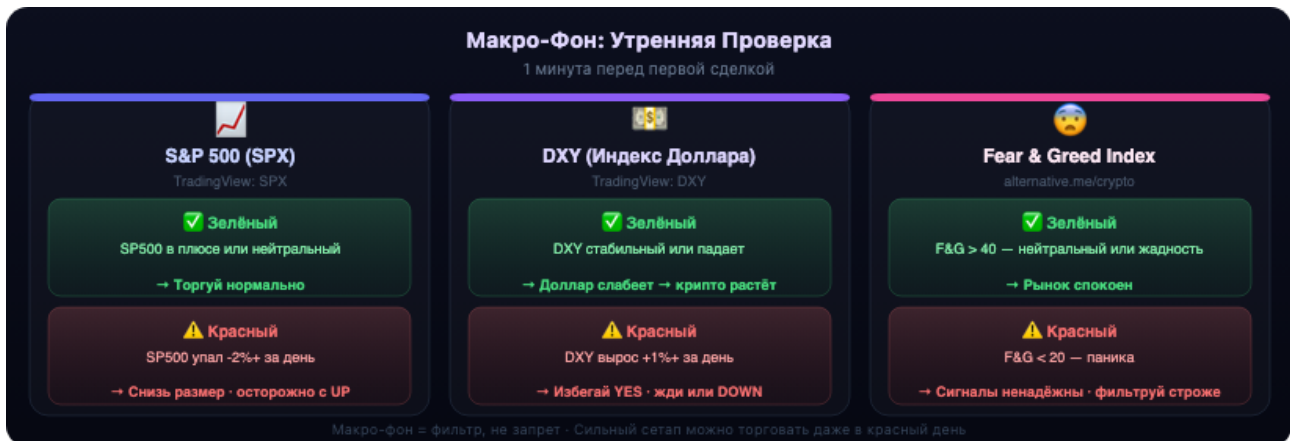
Когда не торговать вообще:

$ATR < \$30$ более 4 часов → рынок мёртв. Движения не покрывают спред Polymarket (2-3¢) + комиссии. Любая сделка = гарантированные потери.

► ЗАДАНИЕ

Посмотрите текущий ATR для BTC за 15 минут. В какой зоне он находится? Какой размер позиции оправдан?

Урок 4. Макрофон: три сигнала перед началом торговли



Почему это важно:

Биткоин торгуется не в вакууме. Когда рушится американский фондовый рынок, биткоин падает вслед за ним. Достаточно взглянуть на три индикатора утром, чтобы понять: сегодня хороший день для сделок на повышение или лучше быть осторожным.

Три ключевых индикатора:

Индикатор	Где смотреть	Что означает
S&P 500 (SPY)	Торговый обзор: SPX	SP500 -2%+ за день → BTC под давлением, падение
DXY (доллар)	Торговый обзор: DXY	DXY +1%+ → доллар сильный → BTC слабеет
Страх и жадность	alternative.me/crypto	Крайний страх < 20 → паника → осторожно, UP

Практика — утренняя проверка (1 минута):

Перед первой сделкой откройте TradingView и alternative.me/crypto/fear-and-greed-index:

Зеленый фон (хороший день):

SP500 в плюсе или в нейтральном положении → давление отсутствует

DXY стабилен или падает → доллар слабеет → криптовалюта растёт

F&G > 40 (нейтральная или жадность) → рынок спокоен

Красный фон (осторожно):

SP500 упал на -2%+ → уменьшай размер позиции, не открывай сделку на повышение без очень сильного сигнала

DXY вырос на +1%+ → избегайте шейров YES, предпочитайте DOWN или ждите

F&G < 20 (паника) → нестабильность, любые сигналы ненадежны

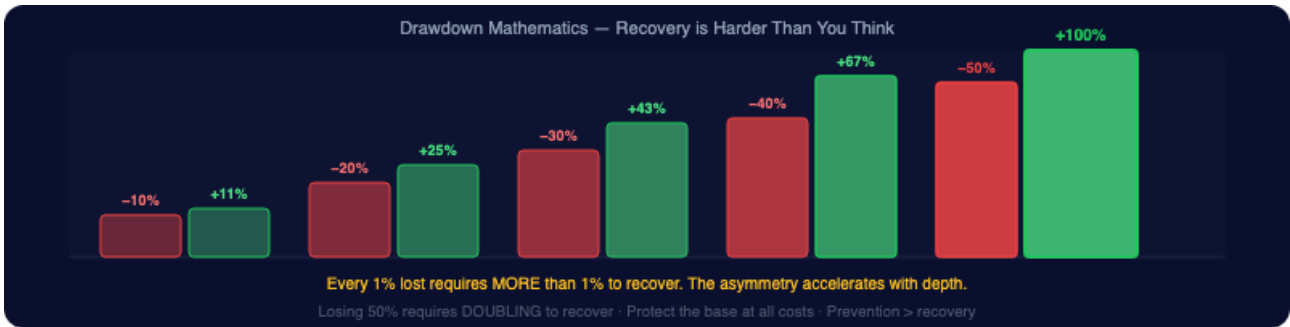
Важно: макрофон — это фильтр, а не запрет. При хорошем сет апе можно торговать даже в «красный» день. Но размер лота уменьшайте.

► **ЗАДАНИЕ**

Стоит ли сейчас торговать? Проверьте: время по восточному времени, ATR, экономический календарь, день недели.

Модуль 11. Защита капитала

Урок 1. Математика Просадки



Почему это важно:

Для восстановления каждого потерянного процента требуется БОЛЬШЕ одного процента. Асимметрия усиливается с глубиной.

Реальные показатели стратегии:

Размер позиции: 12% от баланса. Стоп-лосс: -25% от цены входа.

→ Реальные потери по сделке: $12\% \times 25\% = 3\%$ от баланса

→ Дневной стоп (5 стопов подряд): $\approx 15\%$ просадки

Таблица восстановления:

Просадка	Нужно вернуть	Дней при +2%/день
-10%	+11.1%	~6 дней
-15%	+17.6%	~9 дней
-20%	+25.0%	~12 дней
-25%	+33.3%	~15 дней
-30%	+42.9%	~19 дней

Главный инсайт:

Плохой день (5 стопов) = -12% просадки. Восстановление = 6-7 прибыльных торговых дней. Асимметрия 1:6 — предотвращение важнее прибыли.

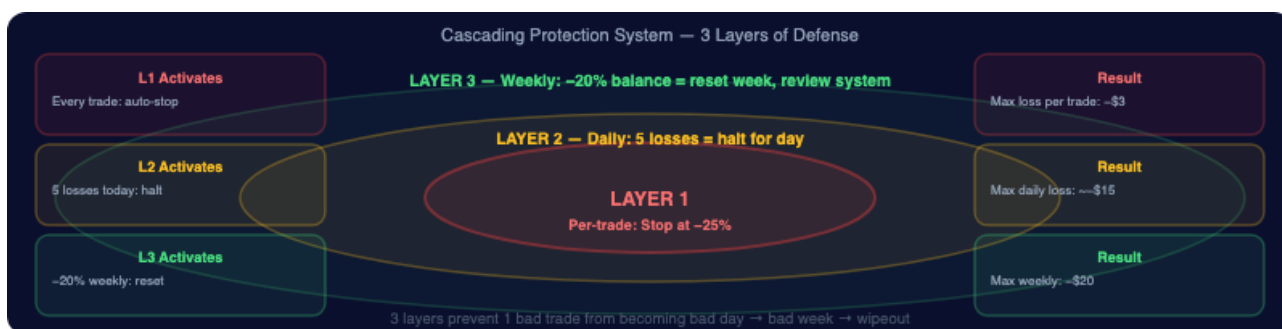
Запомни

Защита капитала > максимизация прибыли. Лучше заработать на 20% меньше за месяц, чем потерять 12% за один день.

► ЗАДАНИЕ

Подними свой журнал: после какого количества последовательных убытков ты продолжал торговать? Запиши честно.

Урок 2. Каскадная система защиты



Почему это важно:

Одного стоп-лосса недостаточно. Нужна многоуровневая система, в которой каждый уровень активируется при нарушении предыдущего.

4 уровня:

Уровень	Триггер	Действие	Возврат
1	2 лосса подряд	Пауза 30 минут	Авто
2	5 лоссов подряд	Стоп на день	Завтра
3	Недельная просадка на 20 %	Стоп на неделю	После аудита
4	-35% от ATH	Полный аудит	После фикса

Уровень 1: Tактический

После двух убыточных сделок подряд — проверьте, не изменился ли режим рынка? Были ли входы по правилам? 30-минутная пауза для сброса.

Уровень 2: Дневной

5 убыточных сделок подряд = ~11% просадки за день. Урежьте размер $\times 0,5$ на следующие 2 сделки. Или полностью остановитесь.

Уровень 3: недельный

-20% за неделю — системная проблема. Это не «еще одна попытка». Для подтверждения необходимо минимум 5 прибыльных сделок.

Уровень 4: Стратегический

-35% от исторического максимума — полный пересмотр стратегии. Вопрос: «Что я делаю не так фундаментально?»

► **ЗАДАНИЕ**

Посчитай: если у тебя на счету 50 долларов и ты получил 3 убытка подряд (по 2,4% каждый), какой реальный процент просадки у тебя будет?

Урок 3. Правило Двух Лоссов



Почему это важно:

Два убытка подряд — статистический сигнал (вероятность 12,25 % при 65 % WR). Не катастрофа, но повод проверить.

Протокол:

СТОП. Закройте дашборд

Перерыв минимум на 30 минут

Проверьте, изменился ли режим работы рынка.

Проверьте, все ли входы были выполнены по правилам? (50–72 цента, окно 5–13 минут, сессия активна)

Если правила нарушены → проблема в тебе

Если правила соблюдены → рынок изменился

Возвращайтесь с уменьшенным размером

Три убытка подряд (4,29%):

СТОП на сегодня. Без исключений. Даже если «рынок изменился» и «теперь все будет по-другому».

Математическое обоснование:

При 65% WR ожидаемые 3 убытка подряд = раз в 23 сделки. Если это произошло раньше (например, на 10-й сделке), значит, условия ухудшились.

Правило двух лоссов в боте:

Размер $\times 0,5$ после 5 лоссов подряд. Стандартное правило жестче: 2 лосса подряд = пауза.

► ЗАДАНИЕ

Настройте каскадную защиту: укажите конкретные триггеры и действия для каждого уровня.

Урок 4. Позиционный размер при проседании

BALANCE STATE	POSITION SIZE	DOLLARS/TRADE	ACTION
\$100 (normal)	12%	\$12.00	Full aggression
\$95 (-5%)	10%	\$9.50	Slight caution
\$90 (-10%)	8%	\$7.20	Reduce activity
\$85 (-15%)	6%	\$5.10	Minimum size only
\$80 (-20%)	0%	\$0.00	STOP TRADING

RECOVERY: One win at each level → restore one tier up. Back to \$100 → full 12% restored.
Keep this table open during every session · Check current balance before each trade

Почему это важно:

Продолжать торговать в полном объеме при просадке -15% = играть с огнем. Одна серия убытков может превратить -15% в -35%.

Модель на основе реального размера 12%:

Просадка	Множитель	Базовый тариф 12% →
0-5%	1.0x	12 % (норма)
5-10%	0.8x	9.6%
10-15%	0.6x	7.2%
15-20%	0.4x	4.8%
> 20%	СТОП	0%

Восстановление множителя:

Не мгновенное. +0,1x за каждые 5% восстановления баланса. При возврате к АТН = 1,0x.

Почему постепенно:

Резкое увеличение размера после восстановления → одна неудачная сделка = снова просадка. Постепенный рост = стабильность.

В боте:

Размер $\times 0,5$ после 5 лоссов подряд. Режим проверки = 6% (вместо 12%) — уменьшенный размер при неопределенности.

► ЗАДАНИЕ

Посчитайте, сколько дней нужно для восстановления после просадки на 15 % и возврата к максимуму.

Урок 5. Резервный капитал (70/30)



Почему это важно:

Разница между трейдером, который обнулится, и тем, кто восстановился, — наличие резерва.

Модель:

70% банкролла = активная торговля

30% = резерв (неприкосновенный запас)

При старте в 30 долларов:

\$21 активных

\$9 в резерве

При 100 долларах:

\$70 активных

30 долларов в резерве

Когда Использовать Резерв:

Только после каскадной защиты 4-го уровня (полный аудит)

Причина просадки выявлена и устранена

Минимум 5 прибыльных сделок с бумажными активами в качестве подтверждения

Когда НЕ Использовать:

«Надо быстрее отыграться» — нет

«Уверен, следующая сделка будет прибыльной» — нет

«Рынок изменился, теперь все будет хорошо» — нет

Резерв = перезагрузка системы, а не эмоциональная подушка безопасности.

► ЗАДАНИЕ

Примените правило 70/30: разделите текущий баланс на активную часть и резерв.

Урок 6. Защита High-Water Mark



Почему это важно:

ATH = максимально достигнутый баланс. С психологической и финансовой точки зрения это ваш ориентир.

Механика (на примере 100 долларов):

ATH = 100 долларов. Пол = 90 долларов (ATH - 10%).

Баланс падает до 92 долларов → предупреждение.

Баланс падает до 90 долларов → СТОП на день.

Новый исторический максимум в 115 долларов → Пол = 103,50 доллара.

Почему -10% Пол:

-10% от исторического максимума = 4 неудачные сделки (4 × 2,4%). Нормальная волатильность. -20% = системная проблема. Пол на -10% выявляет проблему ДО того, как она станет критической.

Взаимодействие с каскадной защитой:

HWM пол дополняет уровень 2 (дневной стоп). Может сработать раньше. Если дневной лосс -8%, но просадка от ATH уже -12%, → HWM пол ужесточается до -8%.

Практика: от 30 до 1000 долларов:

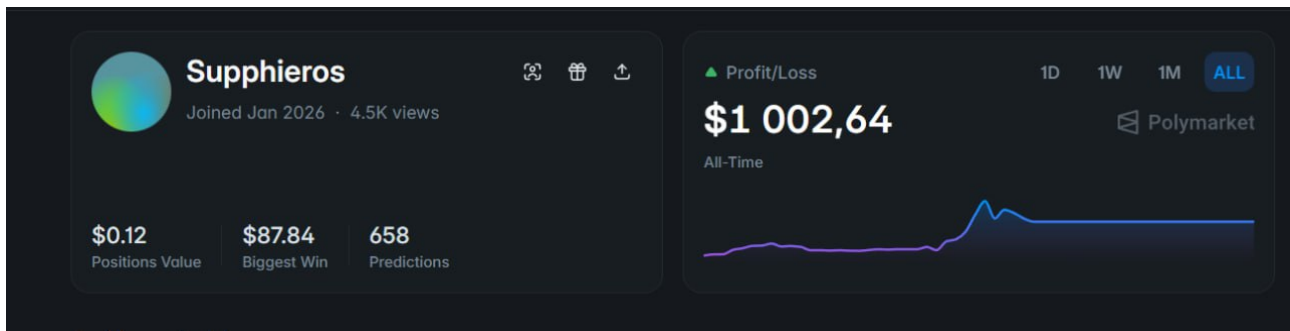
В первые недели ATH растет медленно. HWM защищает каждый заработанный доллар. При достижении отметки в 100 долларов HWM становится главным инструментом для сохранения прогресса.

► ЗАДАНИЕ

Определите свой HWM: запишите текущий ATH и установите пол на уровне -10 % от него.

Модуль 12. Кейсы и финал

Урок 1. Ветер перемен — x100 за несколько недель



История:

Мой друг собирался пойти подрабатывать на склад. Умный парень, но денег не было — жена уехала с сыном в Израиль, чтобы дать ему время подумать.

Я решил помочь и посвятил его в 15-минутки на Polymarket. Он подошел к этому серьезно — изучил материал, торговал по правилам.

Результат: 10 долларов → 2000 долларов за несколько недель.

Что пошло не так:

Потом спустил 1000 долларов — слишком поверил в себя. Начал торговать без подтверждений, входить по высоким ценам, игнорировать кулдауны. Классическая самоуверенность после первого большого успеха.

Текущий результат:

Прибыль и убытки за все время: +\$1002,64

Сделок: 658 | Крупнейшая выплата: \$87,84

Аккаунт:

Урок:

Уверенность в себе — это хорошо. Самонадеянность — губительна. Когда начинаешь думать «теперь я все знаю», это именно тот момент, когда нужно сбавить темп.

Запомни

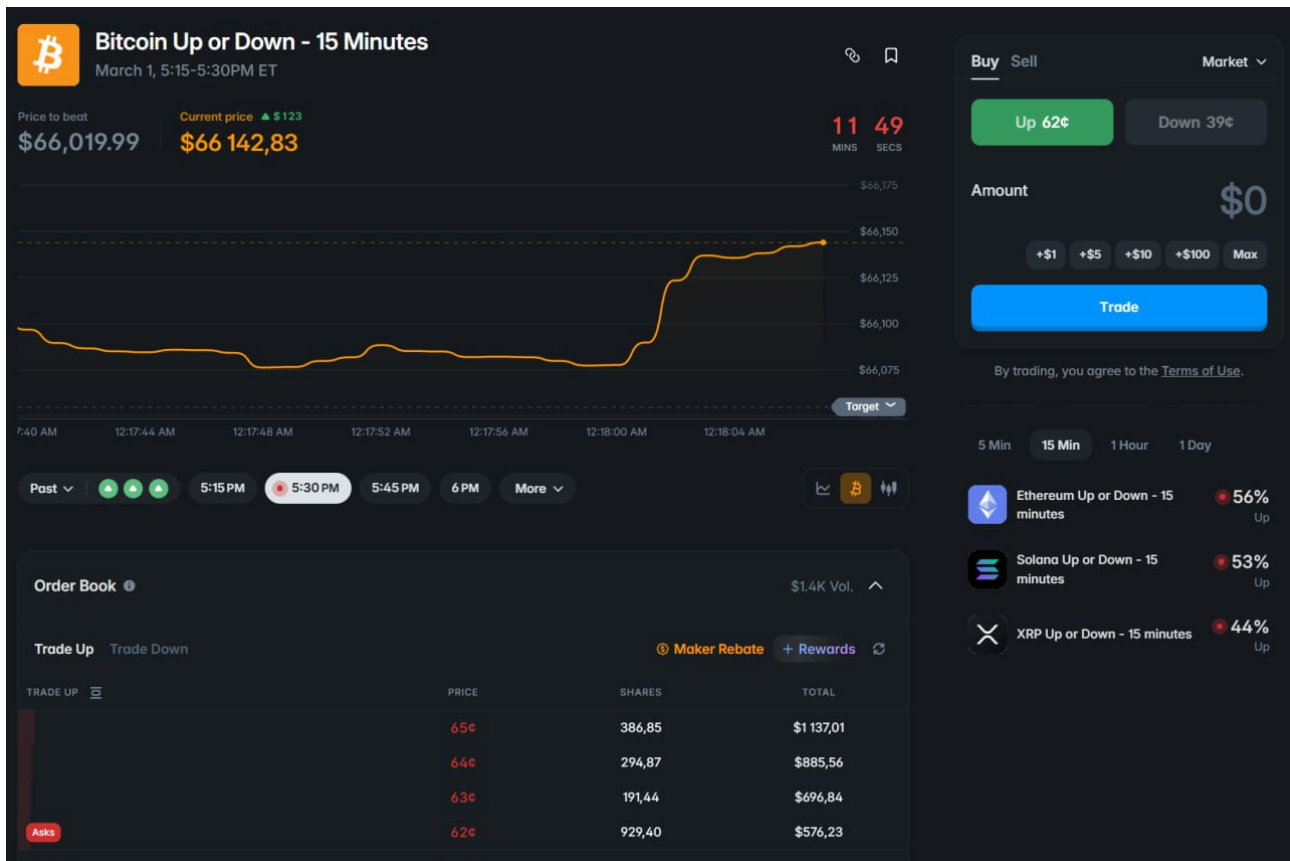
Первая тысяча дается дисциплиной. Вторая выживает только у тех, кто не забыл, откуда пришла первая.

Я уже помог многим людям. В этом курсе — всё то, что действительно работает, если относиться к этому серьёзно. Удачи.

► ЗАДАНИЕ

Прочтите историю @Supphieros. Что именно привело к убытку в 1000 долларов после успеха? Запишите два правила, которые вы почерпнете из этой истории.

Урок 2. Реальный рынок: как оценивать ситуацию



Первый взгляд — без анализа:

Посмотрите на скриншот. Даже если вы не разбираетесь в индикаторах, вы видите: BTC \$66 142 выше цели \$66 019. UP стоит 62 цента. Рынок уже показывает, куда пойдет цена. Это называется «первый взгляд» — когда ситуацию можно понять без технического анализа.

Что на скриншоте:

Рынок: рост или падение биткоина — 15 минут (1 марта, 17:15–17:30 по восточному времени)

Цель рынка: \$66 019,99

Текущий курс BTC: \$66 142,83 (+\$123 выше цели = UP лидирует)

Прошло времени: ~3:11 мин (осталось 11:49)

Цены: ВВЕРХ 62 цента | ВНИЗ 39 центов

Предыдущие 3 свечи по 15 минут:

Свеча 1: закрылась в восходящем направлении

Свеча 2: закрылась вверх

Свеча 3: закрылась в восходящем направлении

→ Тренд определен. 3 закрытия вверх подряд = подтвержденный восходящий тренд. Это само по себе уже весомый аргумент в пользу восходящего тренда.

Разбор по критериям:

Критерий	Значение	Оценка
Входная зона (50–72 цента)	62¢	В зоне
Временное окно (5–13 минут)	Прошло 3:11	СЛИШКОМ РАНЬШЕ
BTC vs цель	+\$123	Выше цели
Тренд (3 свечи вверх подряд)	3 из 3	Подтверждён
ETH / SOL / XRP	56% / 53% / 44% ВВЕРХ	Рынок в бычьем тренде

Стратегия:

Сейчас (3:11) → ЖДАТЬ. Окно входа еще не открылось — еще слишком рано.

На 5-й минуте: Если курс BTC удержится выше \$66 050:

UP в зоне 50–58¢ → Вход (идеально, лучший EV)

UP = 58–72¢ → Вход разрешен (чуть хуже EV, но все равно нормально)

UP выше 72¢ → Пропустить — слишком дорого, EV отрицательный

Почему не сейчас:

BTC только что подскочил на +\$123 — нужно дождаться подтверждения, что это не ложный импульс. В окне ввода терминал показал бы надпись «СЛИШКОМ РАНЬШЕ». Жди 5 минут.

► ЗАДАНИЕ

Посмотрите на скриншот реального рынка. Что вы видите с первого взгляда без индикаторов? Какую сторону вы бы выбрали и почему?

Урок 3. Разбор моего пути от \$100 до \$700 со 100% винрейтом — как я это сделал?

	A	B	C	D	E	F	G	H
1	\$100	\$19.08	UP	\$119.08	JAN 18 - 7:00-7:15 AM	PTB: \$95,083.02	F.P: \$95,125.21	
2	\$119.08	\$7.83	DOWN	\$126.91	JAN 18 - 7:15-7:30 AM	\$95,125.21	\$95,078.74	
3	\$126.91	\$11.02	UP	\$137.93	JAN 18 - 7:30-7:45 AM	\$95,078.73	\$95,100.12	
4	\$137.93	\$19.95	UP	\$157.88	JAN 18 - 7:45-8:00 AM	\$95,100.12	\$95,120.08	
5	\$157.88	\$15.14	DOWN	\$173.02	JAN 18 - 8:00-8:15 AM	\$95,120.08	\$95,065.37	6 min
6	\$173.02	\$9.28	DOWN	\$182.30	JAN 18 - 8:15-8:30 AM	\$95,065.37	\$95,005.37	6 min
7	\$182.30	\$43.89	DOWN	\$226.19	JAN 18 - 8:30-8:45 AM	\$95,005.37	\$94,928.75	6 min
8	\$226.19	\$4.36	UP	\$230.55	JAN 18 - 8:45-9:00 AM	\$94,928.75	\$95,121.60	5 min
9	\$230.55	\$24.5	DOWN	\$255.05	JAN 18, 4:15-4:30PM	\$95,312.62	\$95,263.99	5 min
10	\$255.05	\$7.67	UP	\$262.72	JAN 18, 4:30-4:45PM	\$95,263.99	\$95,353.89	5 min
11	\$262.72	\$43.12	UP	\$305.84	JAN 18, 4:45-5PM	\$95,353.89	\$95,388.08	4 min
12	\$305.84	\$23.2	UP	\$329.04	JAN 18, 5-5:15PM	\$95,388.08	\$95,469.60	5 min
13	\$329.04	\$33.64	DOWN	\$362.68	JAN 18, 5:15-5:30PM	\$95,469.60	\$95,413.70	6 min 91c
14	\$362.68	\$23.04	UP	\$385.72	JAN 18, 5:30-5:45PM	\$95,413.70	\$95,439.67	4 min
15	\$385.72	\$42.12	DOWN	\$427.84	JAN 18, 6-6:15PM	\$95,447.69		10 min
16	\$427.84	\$34.13	UP	\$461.97	January 19, 5:15-5:30AM ET	\$92,914.43	\$92,943.37	
17	\$461.97	\$52.72	UP	\$514.69	January 19, 5:45-6AM ET	\$92,954.59	\$93,009.40	7 min
18	\$514.69	\$21.25	UP	\$535.94	January 19, 6:30-6:45AM ET	\$92,943.31	\$93,178.07	
19	\$535.94	\$165.26	UP	\$701.20	January 20, 11:45AM-12PM	\$90,032.85	\$90,071.39	
20	\$701.20							

9 сделок. 19 побед. \$100 → \$701,20.

Дело не в везении, а в системе. Сейчас расскажу, в чем именно.

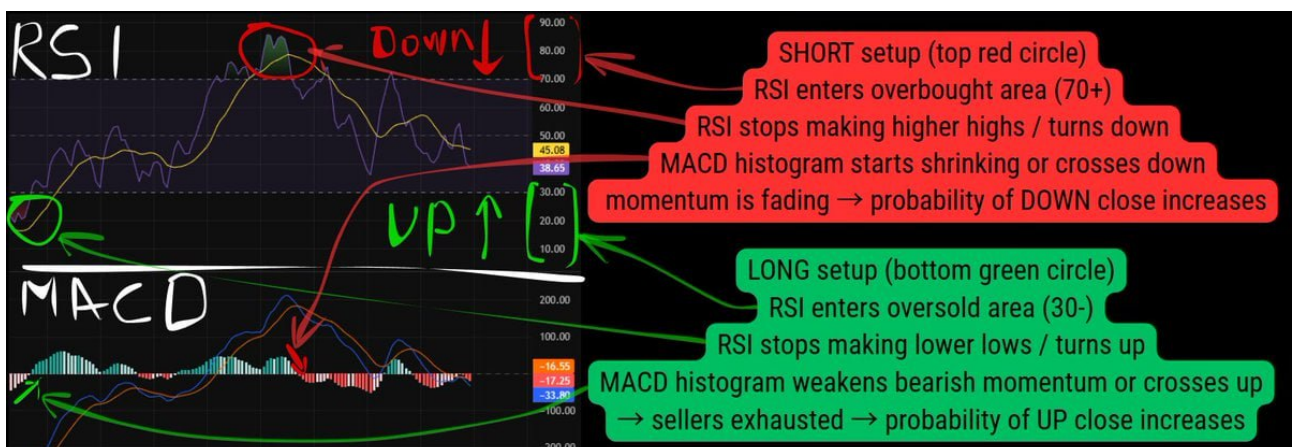
Что бы я сделал по-другому:

Я не торговал на каждой свече подряд. Я подстроился под сессию.

Сначала я оценил волатильность: в тот период курс BTC колебался плавно, без резких скачков — цена двигалась вверх или вниз достаточно ритмично и предсказуемо. Я увидел в этом возможность подстроиться под динамику рынка.

Ключевое решение: входить в рынок в последние 6–9 минут в уже сформировавшемся направлении. Не угадывать направление с нуля, а подтверждать уже очевидное движение.

Как читать RSI + MACD:



Два индикатора. Больше ничего не нужно — если правильно их считывать.

Сетап DOWN (красный кружок сверху):

RSI достиг уровня перекупленности (70+)

RSI перестал обновлять максимумы и развернулся вниз

Гистограмма MACD начала сжиматься или пересеклась снизу вверх

→ Импульс угасает. Вероятность закрытия в нисходящем тренде возрастает.

Настройка UP (зеленый кружок внизу):

RSI вошел в зону перепроданности (30–)

RSI перестал формировать новые минимумы и развернулся вверх

Гистограмма MACD ослабляет медвежий импульс или пересеклась с линией вверх

→ Продавцы истощены. Вероятность закрытия позиций по восходящему тренду растет.

Именно эти два паттерна — все, что мне было нужно. 19 раз подряд я четко их видел, заходил в игру в последние минуты, и 15-минутка заканчивалась как надо.

В чём суть:

Суть в том, чтобы после теории правильно интерпретировать происходящее на биткоине. Искать наиболее вероятные сценарии, которые ты понимаешь.

При правильном понимании рынка все превращается в веселую игру.

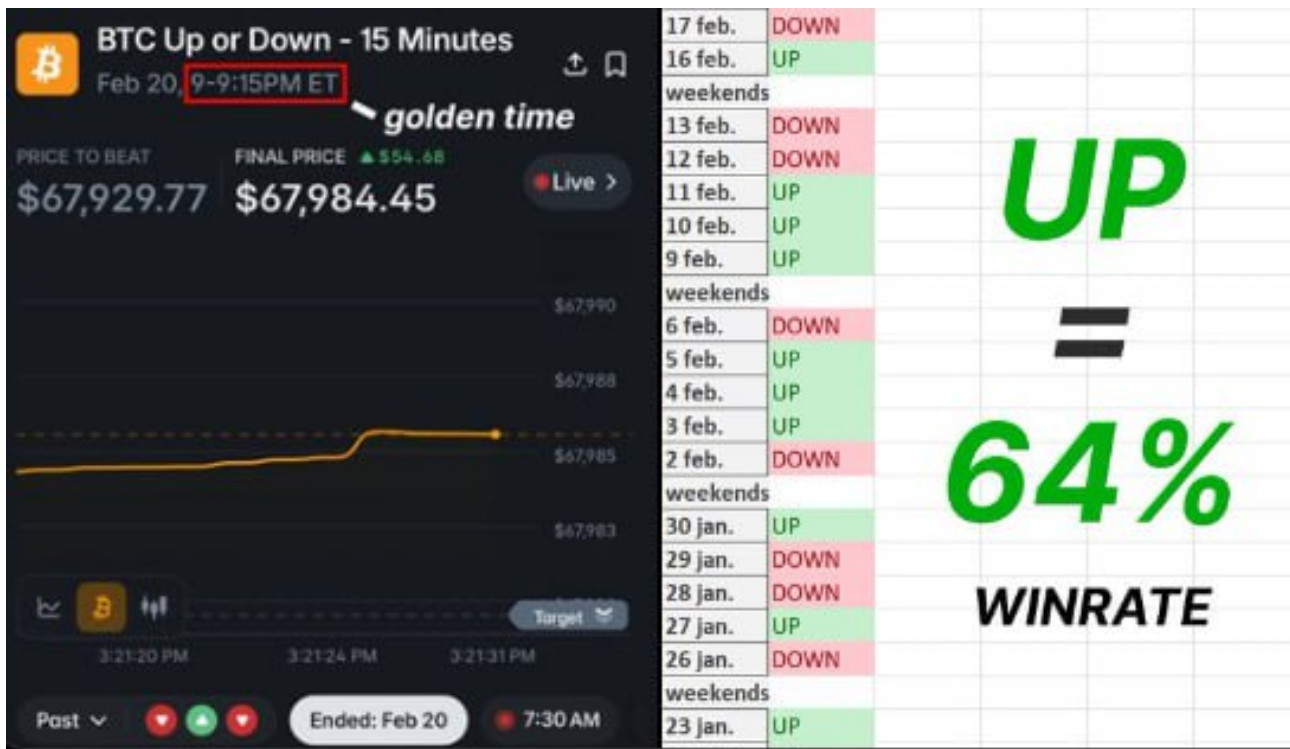
Важно: пропускайте непонятные ситуации. Резкие скачки биткоина туда-сюда — это не для нас. Нам нужны моменты, когда ситуация ясна — с учетом тех знаний, которые ты получил на этом курсе.

Адаптируйте знания к тому, что происходит прямо сейчас. Ждите понятных ситуаций. Действуйте уверенно.

► ЗАДАНИЕ

Посмотрите на скриншот RSI + MACD. Найдите на нём один нисходящий и один восходящий паттерн. Опишите своими словами, что вы видите в каждом случае.

Урок 4. Как получить 64% WR, совершая всего одну сделку в день



Тайминг — это чит-код на 15-минутных рынках BTC

По статистике, биткоин растет прямо перед открытием американского рынка. Не сильно — покупать спот было бы бессмысленно. Но на Polymarket на этом можно стабильно зарабатывать.

Купил UP на 15-минутном рынке BTC в 9:00 по восточному стандартному времени (рынок США открывается в 9:30)

Никогда не паниковал. Никогда не бросал стратегию.

Неужели всё так просто?

Я проверил все результаты торгов на рынках с 9:00 до 9:15 по восточному стандартному времени за последний месяц и получил следующие результаты:

Исход	Количество
До	16
Вниз	9
Итого Win Rate	64%

Механизм простой:

В отсутствие плохих новостей люди покупают акции на премаркете → BTC коррелирует с ними и тоже немного растет.

Неважно, будет ли открытие рынка действительно позитивным, ведь стратегия основана только на том, чтобы зарабатывать на ожиданиях толпы.

Чем меньше времени вы тратите на сделку, тем выше ваша эффективность. Запомните это и стремитесь к этому.

► **ЗАДАНИЕ**

Разберем стратегию на 9:00 утра по восточному стандартному времени. Почему именно в это время вероятность волатильности составляет 64%? Какой механизм лежит в основе движения VTC перед открытием рынка в США?

Урок 5. Финал: Ты Дошёл

STAY FOCUSED

С этими знаниями, хорошей практикой и терминалом PolySigma ты точно сможешь пройти путь от \$30 до \$1000. Это не обещание быстрых денег — это результат правильного подхода и дисциплины. Все необходимое для этого есть в этом курсе.

Чек-лист для входа в сделку:

Параметр	Значение
Время	Через 5–13 минут после запуска свечи
Цена шейра	50–72 цента (оптимально 50–58 центов)
Размер позиции	5–15 % от суммы депозита
Стоп-лосс	–25 % от цены входа · не перемещать
Лестница выходов	90 / 93 / 95 / 97¢ · по 25 % на каждом
ATR (волатильность)	\$60–\$100 = Золотая · <\$30 = пропуск · >\$120 = ЭКСТРИМ
RSI + MACD	Оба в одном направлении = уверенный вход
Тренд (1H / 4H)	Смотри старшие ролики TF · входи по тренду

Лучшие сессии для торговли (по восточному стандартному времени):

1. ЛОНДОН — с 02:00 до 07:00 по восточному стандартному времени

Лучшая сессия. Европейские трейдеры и институциональные инвесторы начинают активно торговать. BTC движется в соответствии с трендом и предсказуемо. Самый высокий процент успешных сделок. Паттерны четко прослеживаются.

2. ПЕРЕКРЫТИЕ — с 7:00 до 10:00 по восточному стандартному времени

Европа и США торгуют одновременно — максимальный объём и импульс. Сильные движения с подтверждением. Следите за ATR, волатильность может быть выше.

3. АЗИАТСКАЯ — с 19:00 до 02:00 по восточному стандартному времени

Более спокойная сессия. BTC консолидируется или совершает плавные движения. Подходит для практики — меньше резких скачков. Входите в рынок только при наличии четкого паттерна.

Дополнительно:

Пятница и воскресенье — объем торгов ниже, движение слабее. Будьте осторожны.

После выхода важных новостей (индекс потребительских цен, количество новых рабочих мест, решение Комитета по операциям на открытом рынке) — подождите 2–3 свечи, прежде чем входить в рынок.

Если за 30 минут курс BTC вырос на 200 долларов и более, значит, большая часть импульса уже учтена в цене.

► ЗАДАНИЕ

Откройте Polymarket. Найдите 15-минутный рынок BTC и проверьте каждый пункт чек-листа для входа в сделку: время, цена, размер, ATR, RSI + MACD, тренд. Входить или нет?