

Справка по торговой стратегии **Bollinger Bands**

СОДЕРЖАНИЕ

1. Краткое описание стратегии	1
2. Описание используемых индикаторов и их настройка	1
3. Настраиваемые параметры стратегии	3
4. Условия открытия и закрытия позиций	5
4.1 По верхней	5
4.2 По средней	5
4.3 По средней (реверс)	5
4.4 По нижней	5
4.5 По пробую	5
4.6 По границам	5
5. Контакты	6

1. Краткое описание стратегии

Торговая стратегия Bollinger Bands предназначена для автоматической торговли финансовыми инструментами и используется в программе FalconTrade. Стратегия основана на индикаторе технического анализа Bollinger Bands.

Все параметры индикатора Bollinger Bands настраиваются в торговом терминале QUIK.

2. Описание используемых индикаторов и их настройка

Bollinger Bands («Полосы Боллинджера»)

«Полосы Боллинджера» строятся в поле графика цены и представляют собой каналы с шириной, пропорциональной стандартному отклонению цен. Ширина полос зависит от устойчивости рынка – полоса расширяется при нестабильности рынка и сужается при более устойчивых ценах.

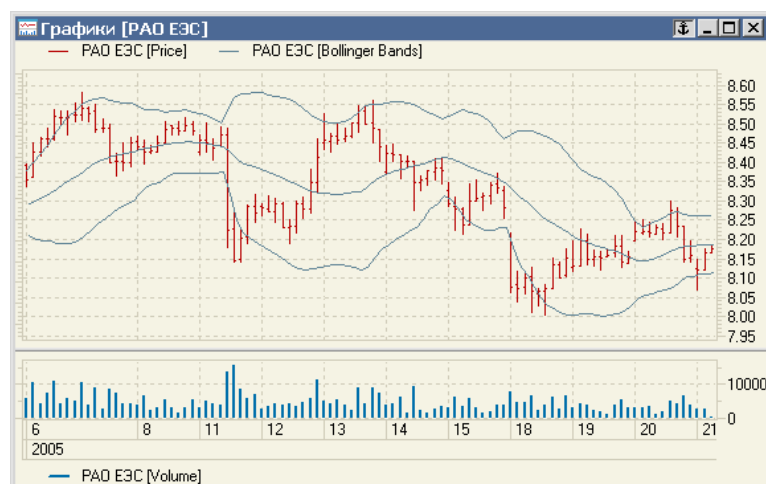


Рисунок 2.1 Линии Bollinger Bands на графике

Вычисление:

$BBLower = MA(P,N) - k * StDev(P,N)$ – нижняя ограничительная линия,

$BBMiddle = MA(P,N)$ – средняя скользящая,

$BBUpper = MA(P,N) + k * StDev(P,N)$ – верхняя ограничительная линия,

где P – цена,
 N – число периодов для расчета средней скользящей,
 k – число стандартных отклонений.

Параметры настройки:

1. «Кол-во периодов» – количество периодов N для расчета MA ,
2. «Отклонения» – число стандартных отклонений (k),
3. «Метод» – метод расчета MA (Simple, Exponential, Vol.Adjusted, Smoothed), по умолчанию используется метод «Simple»,
4. «Поле цены» – используемое для P значение цены интервала (Open, High, Low, Close, Median, Typical), по умолчанию принимается «Close».

Стратегия в своей работе использует данные, полученные с графика цены и линии индикатора Bollinger Bands, в связи, с чем необходимо для каждого инструмента создать график цены и добавить к нему соответствующий индикатор. Графики цены и индикаторов могут быть в разных окнах с разными временными интервалами.

Пример последовательности действий для графика цены (баров) и Bollinger Bands:

- 1) Кликните правой клавишей мыши на графике баров и выберите "Параметры ...".
- 2) Перейдите на вкладку "Дополнительно" и в поле "Идентификатор" укажите название графика цены из настроек робота, например, LKOH_PRICE.
- 3) Нажмите "Сохранить". График цены настроен.
- 4) Далее на открытом графике цены и объема кликните правой клавишей мышки и выберите "Добавить график (Индикатор)".
- 5) В появившемся окне найдите Bollinger Bands и нажмите "Да".
- 6) Измените параметры индикатора на вкладках "Общие" и "Параметры" или оставьте их равными значениям по умолчанию.
- 7) Перейдите на вкладку "Дополнительно" и в ячейке "Идентификатор" укажите уникальное имя индикатора Bollinger Bands на латинице из настроек робота, например, LKOH_BB, как показано на рисунке ниже.
- 8) Нажмите "Сохранить". График настроен.

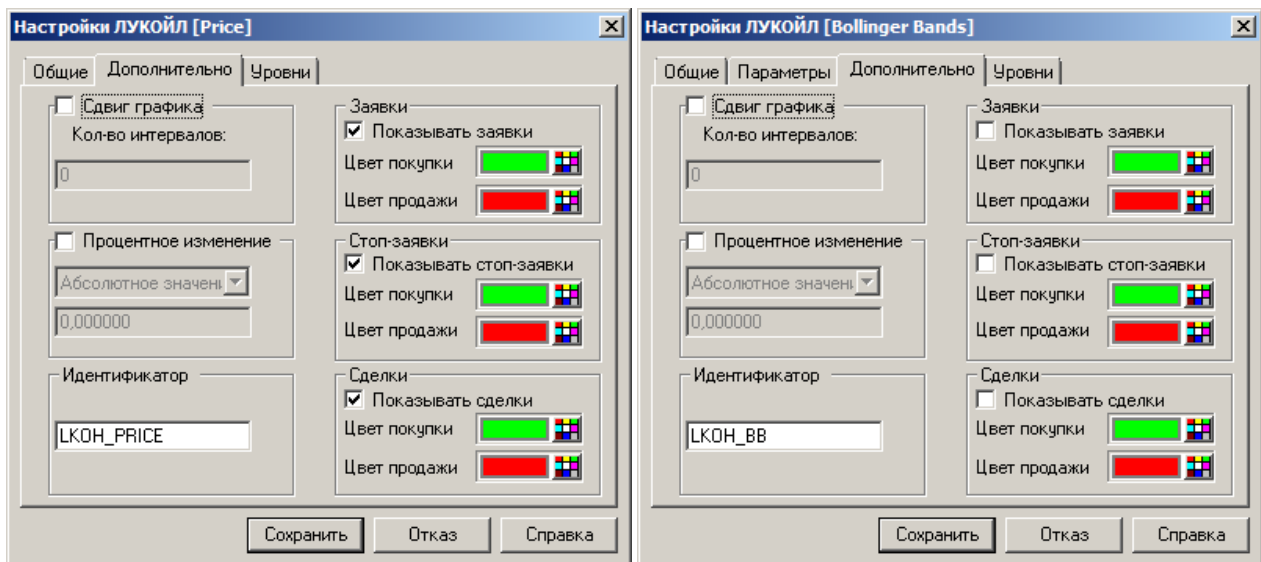




Рисунок 2.2 Окно с графиком цены и индикаторами

Такие же действия необходимо произвести для всех остальных используемых стратегией индикаторов.

3. Настраиваемые параметры стратегии

Параметр	Значение
Стратегия (версия: 1.0.0.7)	Bollinger Bands
Идентификатор графика цены:	LKOH_PRICE
Идентификатор Bollinger Bands:	LKOH_BB
Сигнал на открытие позиции:	Нет
Сигнал на закрытие позиции:	Нет
Сделки на закрытии бара:	Нет
Время до закрытия бара (секунды):	5
Торговля по текущим значениям:	Нет
Выход по пробоем HIGH или LOW:	Нет
Защитный спред при пробое (пункты):	0
Одна сделка за один бар:	Нет
Снятие блокировки сделок:	Нет
Значение верхней линии:	
Значение средней линии:	
Значение нижней линии:	

Рисунок 3.1 Список доступных опций

Идентификатор графика цены.

Это уникальное имя графика **цены**, присвоенное ему в параграфе 2. Уникальные имена графиков цен и индикаторов не должны повторяться.

С целью упорядочения имен, можно воспользоваться следующей системой. Уникальное имя состоит из 2-х частей: 1-ая часть – код инструмента (тикер), 2-ая часть – краткое обозначение индикатора. Следуя данной системе, для обыкновенных акций ЛУКОЙЛ можно создать следующее уникальное имя для графика цены: LKOH_PRICE.

Идентификатор Bollinger Bands.

Это уникальное имя индикатора Bollinger Bands, присвоенное ему в параграфе 2.

Стратегия будет использовать данные, получаемые с индикатора с заданным именем.

Способ открытия позиции.

Позволяет выбрать один из следующих вариантов открытия позиции: По верхней, По средней, По нижней, По пробую, По границам.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

Способ закрытия позиции.

Позволяет выбрать один из следующих вариантов закрытия позиции: По верхней, По средней, По нижней, По пробую, По границам.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

Сделки на закрытии бара.

Опция позволяет совершать сделки в момент закрытия текущего бара, т.е. робот не будет дожидаться закрытия бара и открытия следующего, а откроет (закроет) позицию на последних секундах текущего бара. Возможные варианты: «Нет» - опция не активна, «Открытие» - активна только при открытии позиции, «Закрытие» - активна только при закрытии позиции, «Открытие и Закрытие» - активна и при открытии и при закрытии позиции.

Время до закрытия бара (секунды).

Используется при активной опции совершения сделок на закрытии бара. Время, измеряемое в секундах, до закрытия текущего бара, с учетом которого будут отправляться заявки. Например, закрытие бара будет в 12:00:00, а установленное время = 10 сек, тогда заявка будет отправлена, начиная с (12:00:00 – 10 сек) = 11:59:50. Не рекомендуем задавать меньше 2 сек и больше временного интервала баров на графике.

Торговля по текущим значениям.

При активной опции ("Да") для условий открытия и закрытия позиций используются текущие значения индикаторов на незакрытом баре, иначе значения на предыдущих барах.

Выход по пробую HIGH или LOW.

При активной опции ("Да") во время открытия позиции робот запоминает LOW и HIGH предыдущего бара. Если открыт Лонг и рыночная цена станет ниже LOW, то робот выйдет из Лонга. Если открыт Шорт и рыночная цена станет выше HIGH, то робот выйдет из Шорта.

Защитный спрэд при пробое (пункты).

Используется опцией «Выход по пробую HIGH или LOW» и задает число пунктов (валюту), которое цена должна пройти после пробоя HIGH или LOW, чтобы появился сигнал на закрытие позиции.

Одна сделка за один бар.

Позволяет совершать в течение одного бара только одну сделку на открытие позиции, закрытие позиции возможно в следующих случаях: а) за 5 секунд до закрытия бара, если для этого поступил сигнал о закрытии, б) по стоп-заявкам, с) вручную.

Снятие блокировки сделок.

Снимает блокировку сделок после исполнения стоп-заявок, если нет открытых позиций и условий для открытия какой-либо позиции.

Поле "Значение верхней линии".

В поле выводится информация о текущем значении верхней линии индикатора Bollinger Bands (на незакрытом баре).

Поле "Значение средней линии".

В поле выводится информация о текущем значении средней линии индикатора Bollinger Bands (на незакрытом баре).

Поле "Значение нижней линии".

В поле выводится информация о текущем значении нижней линии индикатора Bollinger Bands (на незакрытом баре).

4. Условия открытия и закрытия позиций

По этим условиям программа будет открывать или закрывать позиции.

4.1 По верхней

Открытие Лонга: рыночная цена больше верхней линии.

Закрытие Лонга: рыночная цена пересекла верхнюю линию сверху вниз.

Открытие Шорта: рыночная цена пересекла верхнюю линию сверху вниз.

Закрытие Шорта: рыночная цена больше верхней линии.

4.2 По средней

Открытие Лонга: рыночная цена больше средней линии.

Закрытие Лонга: рыночная цена меньше средней линии.

Открытие Шорта: рыночная цена меньше средней линии.

Закрытие Шорта: рыночная цена больше средней линии.

4.3 По средней (реверс)

Открытие Лонга: рыночная цена меньше средней линии.

Закрытие Лонга: рыночная цена больше средней линии.

Открытие Шорта: рыночная цена больше средней линии.

Закрытие Шорта: рыночная цена меньше средней линии.

4.4 По нижней

Открытие Лонга: рыночная цена пересекла нижнюю линию снизу вверх.

Закрытие Лонга: рыночная цена меньше нижней линии.

Открытие Шорта: рыночная цена меньше нижней линии.

Закрытие Шорта: рыночная цена пересекла нижнюю линию снизу вверх.

4.5 По пробую

Открытие Лонга: рыночная цена больше верхней линии.

Закрытие Лонга: рыночная цена меньше нижней линии.

Открытие Шорта: рыночная цена меньше нижней линии.

Закрытие Шорта: рыночная цена больше верхней линии.

4.6 По границам

Открытие Лонга: рыночная цена пересекла нижнюю линию снизу вверх.

Закрытие Лонга: рыночная цена пересекла верхнюю линию сверху вниз.

Открытие Шорта: рыночная цена пересекла верхнюю линию сверху вниз.

Закрытие Шорта: рыночная цена пересекла нижнюю линию снизу вверх.

5. Контакты

Благодарим Вас за выбор продукта компании mycreditcard.ru

По всем вопросам Вы можете обращаться к нам, отправив письмо на адрес infodesk@mycreditcard.ru

Официальный сайт компании

<http://www.mycreditcard.ru>