

Справка по торговой стратегии **CCI****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 значению	5
4.2 По переходу	5
4.3 По направлению	5
4.4 По уровням	5
4.5 По диапазону	5
5. Контакты	5

1. Краткое описание стратегии

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

Все параметры индикатора CCI настраиваются в торговом терминале QUIK.

2. Описание используемых индикаторов и их настройка**CCI («Индекс товарного канала»)**

«Индекс товарного канала» (Commodity Channel Index – CCI) измеряет отклонение цены инструмента от его среднестатистической цены. Высокие значения индекса указывают на то, что цена необычно высока по сравнению со средней, а низкие – что она слишком занижена. Несмотря на название, применим не только к товарам, но и к финансовым инструментам.

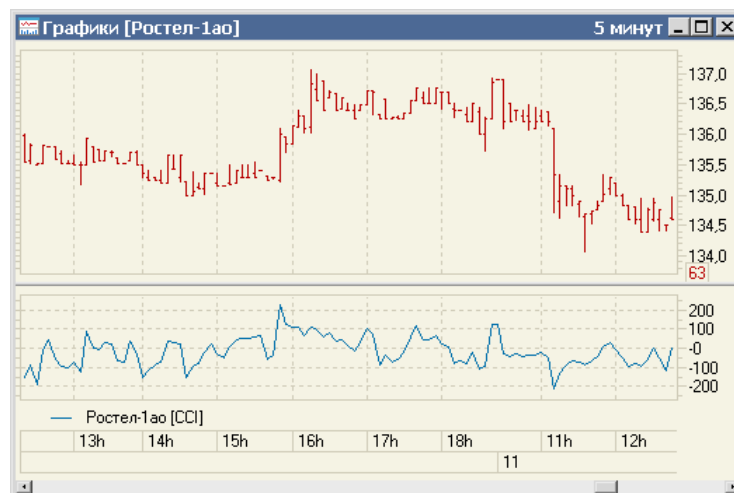


Рисунок 2.1 Линия CCI на графике

Вычисление:

$$CCI = (TP - SMA (TP, N)) / (MD * 0.015)$$

где $MD = \frac{SUM (ABS (SMA (TP, N) - TP_i))}{N}$ – вероятное отклонение,

$TP = (HIGH + LOW + CLOSE) / 3$ – типичная цена,

SMA – простое скользящее среднее,

N – количество периодов.

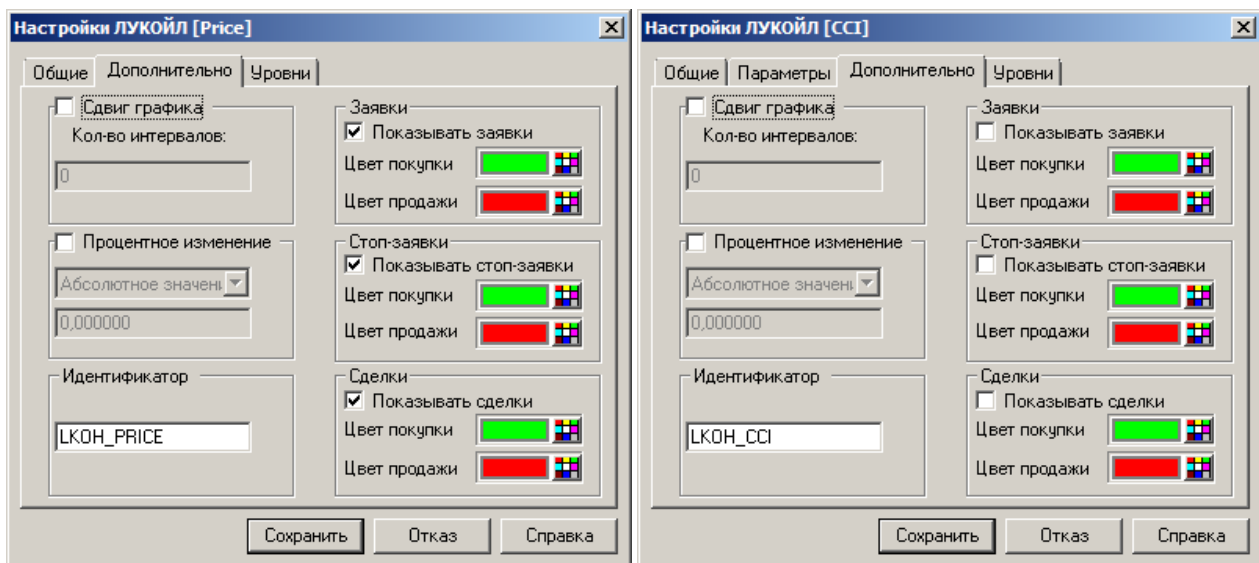
Параметры настройки:

1. «Кол-во периодов» – количество периодов **N** для расчета MA,
2. «Метод» – метод расчета **MA** (Simple, Exponential, Vol.Adjusted, Smoothed), по умолчанию используется метод «Exponential».

Стратегия в своей работе использует данные, полученные с графика цены и линии индикатора CCI, 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 CCI:

- 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 CCI 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 CCI на латинице из настроек робота, например, LKOH_CCI, как показано на рисунке ниже.
- 8) Нажмите "Сохранить". График настроен.



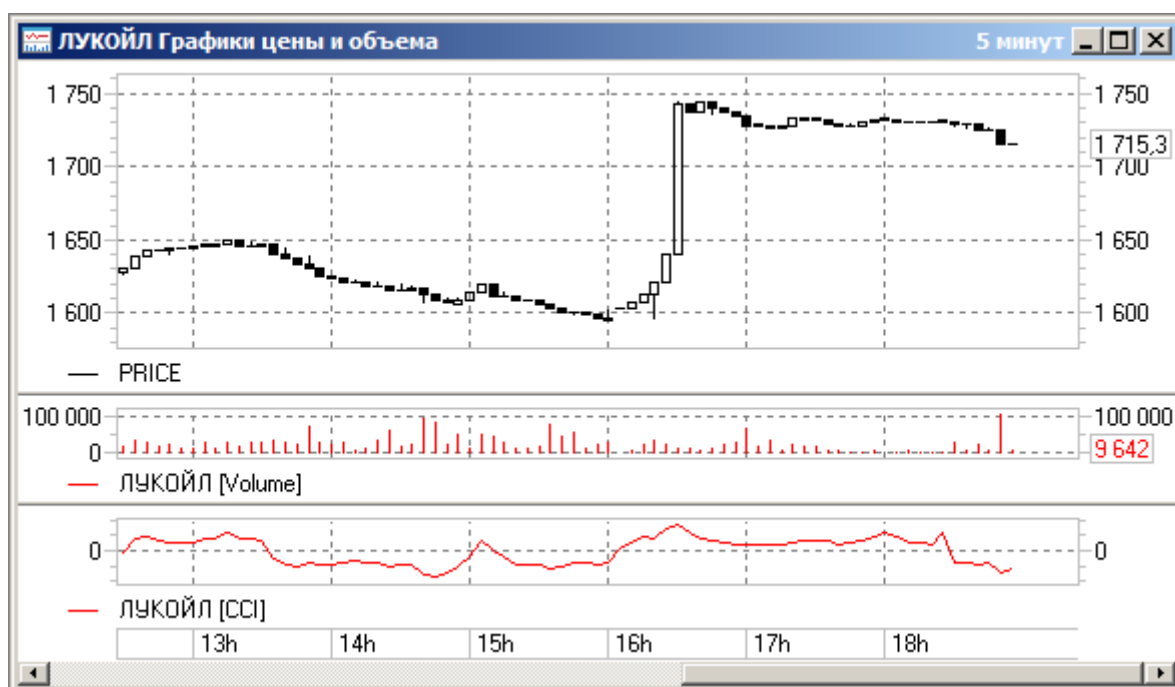


Рисунок 2.2 Окно с графиком цены и индикаторами

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

3. Настраиваемые параметры стратегии

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 CCI.

Это уникальное имя индикатора CCI, 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 значению, По переходу, По направлению, По уровням.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

Способ закрытия позиции.

Позволяет выбрать один из следующих вариантов закрытия позиции: По значению, По переходу, По направлению, По уровням.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

Верхний уровень CCI.

Используется в стратегии "По уровням". После пересечения линией индикатора CCI этого уровня открываются или закрываются позиции.

Нижний уровень CCI.

Используется в стратегии "По уровням". После пересечения линией индикатора CCI этого уровня открываются или закрываются позиции.

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 пробое 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 пробое 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 CCI".

В поле выводится информация о текущем значении индикатора CCI (на незакрытом баре).

4. Условия открытия и закрытия позиций

По этим условиям программа будет открывать или закрывать позиции.

4.1 По значению

Открытие Лонга: значение индикатора CCI больше 0.

Закрытие Лонга: значение индикатора CCI меньше 0.

Открытие Шорта: значение индикатора CCI меньше 0.

Закрытие Шорта: значение индикатора CCI больше 0.

4.2 По переходу

Открытие Лонга: линия индикатора CCI пересекает 0 снизу вверх.

Закрытие Лонга: линия индикатора CCI пересекает 0 сверху вниз.

Открытие Шорта: линия индикатора CCI пересекает 0 сверху вниз.

Закрытие Шорта: линия индикатора CCI пересекает 0 снизу вверх.

4.3 По направлению

Открытие Лонга: текущее значение линии CCI больше предыдущего значения CCI.

Закрытие Лонга: текущее значение линии CCI меньше предыдущего значения CCI.

Открытие Шорта: текущее значение линии CCI меньше предыдущего значения CCI.

Закрытие Шорта: текущее значение линии CCI больше предыдущего значения CCI.

4.4 По уровням

Открытие Лонга: значение линии CCI больше верхнего уровня CCI.

Закрытие Лонга: значение линии CCI меньше нижнего уровня CCI.

Открытие Шорта: значение линии CCI меньше нижнего уровня CCI.

Закрытие Шорта: значение линии CCI больше верхнего уровня CCI.

4.5 По диапазону

Открытие Лонга: линия индикатора CCI пересекает 0 снизу вверх.

Закрытие Лонга: значение индикатора CCI меньше 0 или на предыдущем баре значение CCI больше верхнего уровня, а текущее значение CCI меньше предыдущего.

Открытие Шорта: линия индикатора CCI пересекает 0 сверху вниз.

Закрытие Шорта: значение индикатора CCI больше 0 или на предыдущем баре значение CCI меньше нижнего уровня, а текущее значение CCI больше предыдущего.

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>