

Справка по торговой стратегии **Fractals**

## 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 пробую .....	5
4.2 С подтверждением .....	5
4.3 По тренду .....	5
4.4 По уровню 2-х .....	5
4.5 По уровню 3-х .....	5
5. Контакты .....	5

## 1. Краткое описание стратегии

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

Все параметры индикатора Fractals настраиваются в торговом терминале QUIK.

## 2. Описание используемых индикаторов и их настройка

### Fractals («Фракталы»)

Индикатор «Фракталы» включает в себя серию из нескольких последовательных свечей и имеет две разновидности:

- «Фрактал вверх» – это серия из минимум пяти последовательных свечей, в которой перед средней свечой и за ней находятся свечи, чьи максимумы не выше, чем у средней свечи.
- «Фрактал вниз» – это серия из минимум пяти последовательных свечей, в которой перед средней свечой и за ней находятся свечи, чьи минимумы не ниже, чем у средней свечи.

На графике фракталы имеют значения **High** и **Low** и отмечены стрелками вверх или вниз.

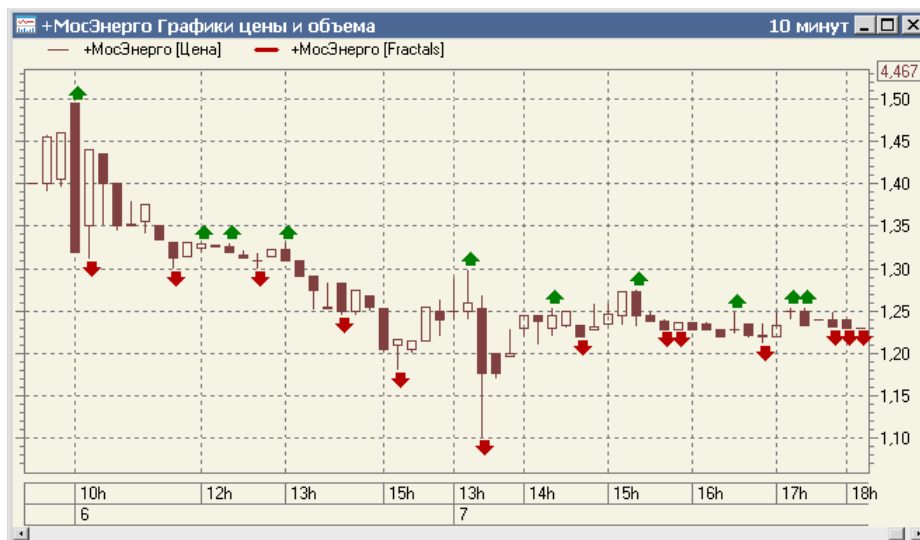


Рисунок 2.1 Индикатор Fractals на графике

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

- 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 Fractals 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 Fractals на латинице из настроек робота, например, LKOH\_FRACTALS, как показано на рисунке ниже.
- 8) Нажмите "Сохранить". График настроен.

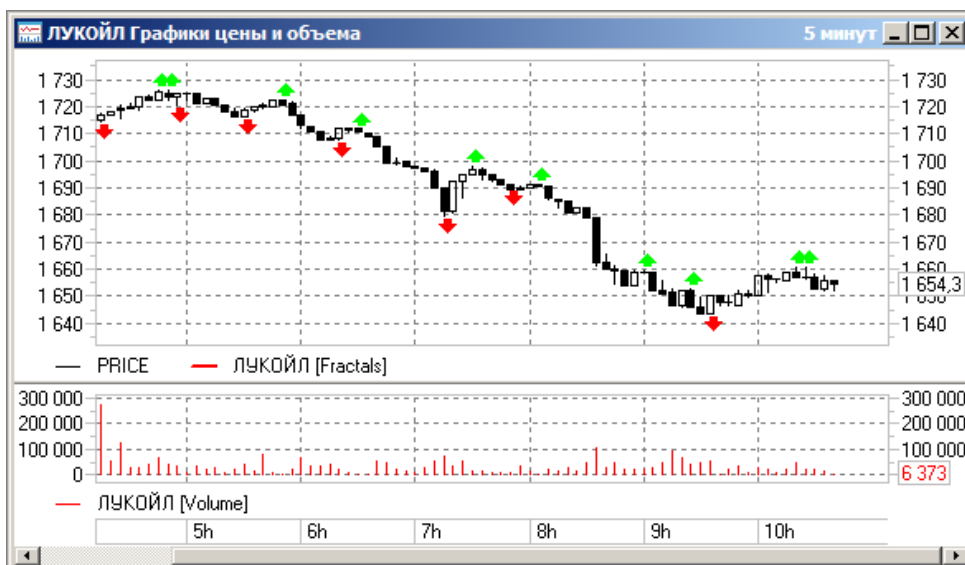
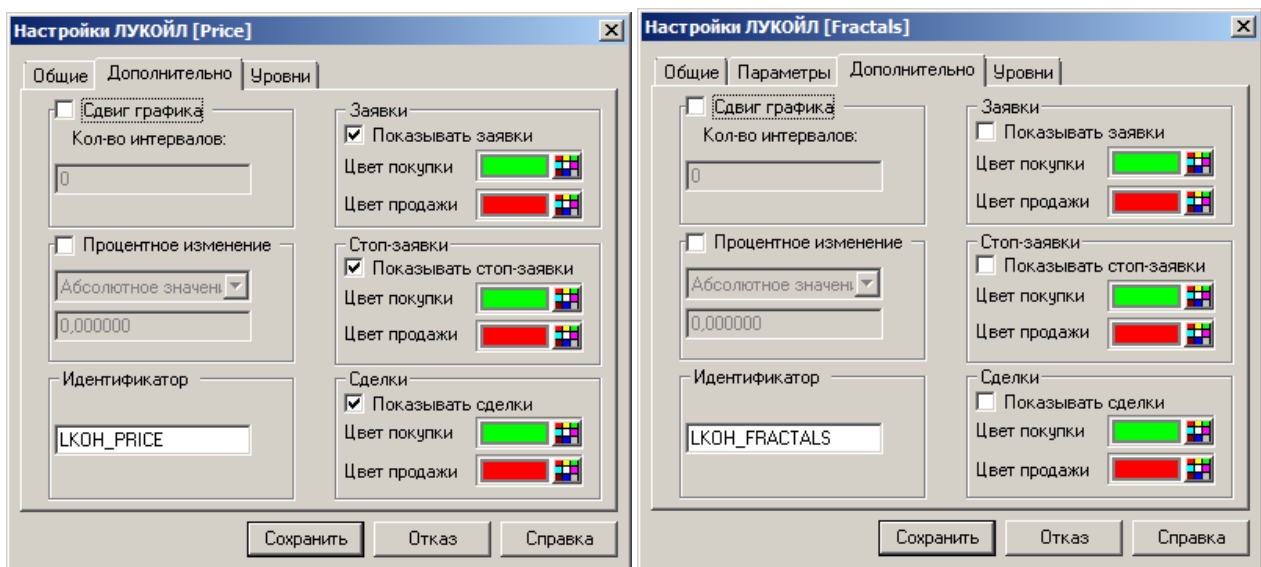


Рисунок 2.2 Окно с графиком цены и индикаторами

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: LКOH\_PRICE.

#### Идентификатор Fractals.

Это уникальное имя индикатора Fractals, 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 пробую, С подтверждением, По тренду, По уровню 2-х, По уровню 3-х.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

#### Способ закрытия позиции.

Позволяет выбрать один из следующих вариантов закрытия позиции: По пробую, С подтверждением, По тренду, По уровню 2-х, По уровню 3-х.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

**Пункты для открытия.**

При движении цены на заданную величину в пунктах (валюте) от значения индикатора Fractals открывается позиция.

**Пункты для закрытия.**

При движении цены на заданную величину в пунктах (валюте) от значения индикатора Fractals позиция закрывается.

**Подтверждение для Fractals.**

Используется для подтверждения формирования фрактала, т.к. в QUIK фрактал появляется еще на текущем баре, не дожидаясь его закрытия. Активная опция ("Да") позволяет использовать только полностью сформировавшиеся фракталы.

**Снятие блокировки после стоп-заявок.**

Опция «Да» позволяет убирать блокировку сделок в том направлении, в котором была закрыта позиция после срабатывания стоп-заявки. Например, был закрыт Лонг по тейк-профит, тогда после того как рыночная цена станет меньше ближайшего фрактала вверх, появится возможность повторно открыть Лонг. Для Шортов наоборот – цена должна стать больше ближайшего фрактала вниз.

**Выход по цвету свечей.**

Опция «Да» позволяет закрывать позицию по «цветности» предыдущих двух свечей. Так, если открыт Лонг, а предыдущие две свечи «черные» (цены закрытий меньше цен открытий), то позиция закроется. Если открыт Шорт, а предыдущие две свечи «белые» (цены закрытий больше цен открытий), то позиция также закроется.

**Тейк-профит от уровня пробоя.**

Опция «Да» позволяет закрывать позицию по встроенным условиям тейк-профит. Если рыночная цена «ушла» от уровня пробоя на заданную величину (размер тейк-профит), то стратегия сгенерирует сигнал на закрытие позиции.

**Размер тейк-профит в валюте.**

Задаёт величину, на которую должна измениться рыночная цена относительно уровня пробоя, чтобы поступил сигнал на закрытие позиции. Измеряется в валюте (пунктах).

**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.

**Выход по пробоем 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 пробоем HIGH или LOW» и задает число пунктов (валюте), 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.

**Поле "Значение Fractals вверх".**

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

**Поле "Значение Fractals вниз".**

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

#### **4. Условия открытия и закрытия позиций**

По этим условиям программа будет открывать или закрывать позиции.

##### **4.1 По пробую**

Открытие Лонга: рыночная цена превысила значение индикатора Fractals вверх.

Закрытие Лонга: рыночная цена стала ниже значения индикатора Fractals вниз.

Открытие Шорта: рыночная цена стала ниже значения индикатора Fractals вниз.

Закрытие Шорта: рыночная цена превысила значение индикатора Fractals вверх.

##### **4.2 С подтверждением**

Открытие Лонга: цена закрытия предыдущего бара больше значения индикатора Fractals вверх.

Закрытие Лонга: цена закрытия предыдущего бара меньше значения индикатора Fractals вниз.

Открытие Шорта: цена закрытия предыдущего бара меньше значения индикатора Fractals вниз.

Закрытие Шорта: цена закрытия предыдущего бара больше значения индикатора Fractals вверх.

##### **4.3 По тренду**

Открытие Лонга: Последний фрактал вверх больше предыдущего вверх и последний фрактал вниз больше предыдущего вниз.

Закрытие Лонга: Последний фрактал вверх меньше предыдущего вверх и последний фрактал вниз меньше предыдущего вниз.

Открытие Шорта: Последний фрактал вверх меньше предыдущего вверх и последний фрактал вниз меньше предыдущего вниз.

Закрытие Шорта: Последний фрактал вверх больше предыдущего вверх и последний фрактал вниз больше предыдущего вниз.

##### **4.4 По уровню 2-х**

Открытие Лонга: рыночная цена превысила последние 2 значения индикатора Fractals вверх.

Закрытие Лонга: рыночная цена стала ниже 2-х последних значений индикатора Fractals вниз.

Открытие Шорта: рыночная цена стала ниже 2-х последних значений индикатора Fractals вниз.

Закрытие Шорта: рыночная цена превысила последние 2 значения индикатора Fractals вверх.

##### **4.5 По уровню 3-х**

Открытие Лонга: рыночная цена превысила последние 3 значения индикатора Fractals вверх.

Закрытие Лонга: рыночная цена стала ниже 3-х последних значений индикатора Fractals вниз.

Открытие Шорта: рыночная цена стала ниже 3-х последних значений индикатора Fractals вниз.

Закрытие Шорта: рыночная цена превысила последние 3 значения индикатора Fractals 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](mailto:infodesk@mycreditcard.ru)

Официальный сайт компании

<http://www.mycreditcard.ru>