

Справка по торговой стратегии **Ichimoku**

СОДЕРЖАНИЕ

1. Краткое описание стратегии	1
2. Описание используемых индикаторов и их настройка	1
3. Настраиваемые параметры стратегии	4
4. Условия открытия и закрытия позиций	5
4.1 По Tenkan	6
4.2 По Kijun	6
4.3 По Tenkan и Kijun	6
4.4 По облаку	6
4.5 По Tenkan и облаку	6
4.6 По Kijun и облаку	6
4.7 По границам облака	6
4.8 По направлению Tenkan	7
4.9 По направлению Kijun	7
4.10 По Ten и Kij [*]	7
4.11 По Ten или Kij [*]	7
4.12 По Ten и облаку [*]	7
4.13 По Kij и облаку [*]	7
5. Контакты	8

1. Краткое описание стратегии

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

Все параметры индикатора Ichimoku настраиваются в торговом терминале QUIK.

2. Описание используемых индикаторов и их настройка

Ichimoku («Ишимоку»)

Индикатор Ишимоку Кинко Хайо (Ichimoku Kinko Hyo) предназначен для определения рыночного тренда, уровней поддержки и сопротивления и для генерации сигналов покупки и продажи. Лучше всего индикатор работает на недельных и дневных графиках.

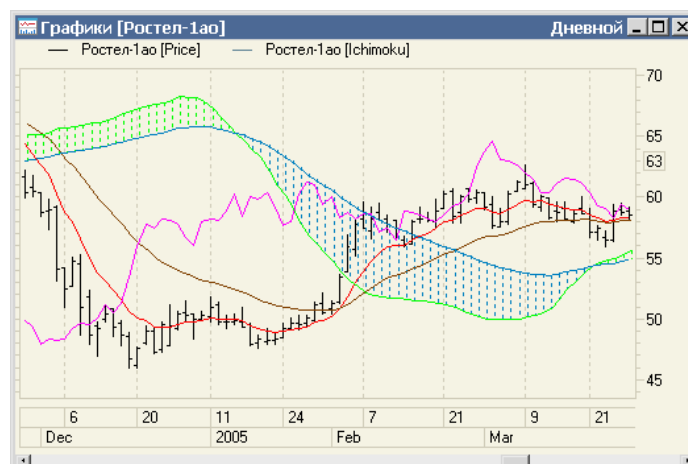


Рисунок 2.1 Линии индикатора Ichimoku на графике

При определении размерности параметров используется четыре временных интервала различной протяженности. На этих интервалах основываются значения отдельных линий, составляющих этот индикатор:

1. «Tenkan-sen» (Розовая) показывает среднее значение цены за первый промежуток времени. Tenkan-sen используется как индикатор рыночного тренда. Если эта линия растет или падает – тренд существует. Когда она идет горизонтально – рынок вошел в канал.
2. «Kijun-sen» (Красная) показывает среднее значение цены за второй промежуток времени и используется как показатель движения рынка. Если цена выше нее, цены, вероятно, будут продолжать расти. Когда цена пересекает эту линию вероятно дальнейшее изменения тренда. Другим вариантом использования Kijun-sen является подача сигналов: сигнал к покупке генерируется, когда линия Tenkan-sen пересекает Kijun-sen снизу вверх; сверху вниз – сигнал к продаже.
3. «Senkou Span A» (Голубая) показывает середину расстояния между предыдущими двумя линиями, сдвинутую вперед на величину второго временного интервала.
4. «Senkou Span B» (Зеленая) показывает среднее значение цены за третий временной интервал, сдвинутое вперед на величину второго временного интервала. Расстояние между линиями Senkou штрихуется на графике другим цветом и называется «облаком».
5. «Chinkou Span» (Коричневая) показывает цену закрытия текущей свечи, сдвинутую назад на величину второго временного интервала. Если цена находится между линиями «облака», то рынок считается нетрендовым и тогда края «облака» образуют уровни поддержки и сопротивления. Если цена находится над «облаком», то верхняя его линия образует первый уровень поддержки, а вторая – второй уровень поддержки. Если цена находится под «облаком», то нижняя линия образует первый уровень сопротивления, а верхняя – второй. Если линия Chinkou Span пересекает график цены снизу вверх, это является сигналом к покупке. Если сверху вниз – сигналом к продаже.

Параметры настройки:

1. «Tenkan» – длина периода для Tenkan-sen,
2. «Kijun» – длина периода для Kijun-sen,
3. «Senkou» – длина периода для Senkou Span A,
4. «Chinkou» – длина периода для Chinkou,
5. «Горизонтальный сдвиг» – величина сдвига Senkou Span B,
6. «Цвета линий» – настройка цвета линий.

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

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

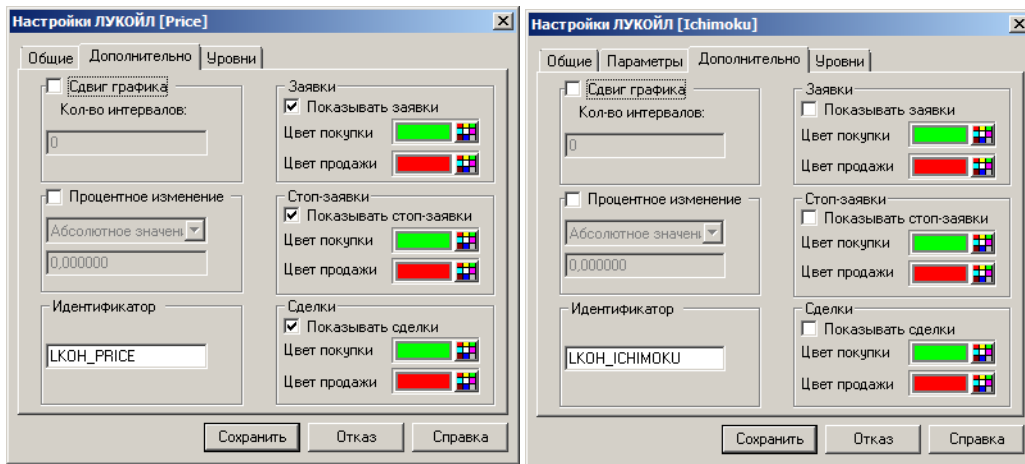


Рисунок 2.2 Окно с графиком цены и индикаторами

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

3. Настраиваемые параметры стратегии

Параметры торговли

Торговля Заявки MTC Стоп-лосс Риск Время

Стратегия (версия: 1.0.0.7) Ichimoku ?

Идентификатор графика цены: LКOH_PRICE

Идентификатор Ichimoku: LКOH_ICHIMOKU

Сигнал на открытие позиции: Нет

Сигнал на закрытие позиции: Нет

Пункты для открытия: 0

Пункты для закрытия: 0

Сделки на закрытии бара: Нет

Время до закрытия бара (секунды): 5

Торговля по текущим значениям: Нет

Выход по пробое HIGH или LOW: Нет

Защитный спред при пробое (пункты): 0

Одна сделка за один бар: Нет

Снятие блокировки сделок: Нет

Значение Tenkan:

Значение Kijun:

Значение Senkou Span A:

Значение Senkou Span B:

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 Ichimoku.

Это уникальное имя индикатора Ichimoku, 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 Tenkan, По Kijun, По Tenkan и Kijun, По облаку, По Tenkan и облаку, По Kijun и облаку, По границам облака, По напр Tenkan, По напр Kijun, По Ten и Kij [*], По Ten или Kij [*].

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

Способ закрытия позиции.

Позволяет выбрать один из следующих вариантов закрытия позиции: По Tenkan, По Kijun, По Tenkan и Kijun, По облаку, По Tenkan и облаку, По Kijun и облаку, По границам облака, По напр Tenkan, По напр Kijun, По Ten и Kij [*], По Ten или Kij [*].

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

Пункты для открытия.

Используется для линий Tenkan и Kijun. При движении цены на заданную величину в пунктах (валюте) от данных линий открывается позиция.

Пункты для закрытия.

Используется для линий Tenkan и Kijun. При движении цены на заданную величину в пунктах (валюте) от данных линий позиция закрывается.

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 (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.

Снятие блокировки сделок.

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

Поле "Значение Tenkan".

В поле выводится информация о текущем значении линии Tenkan (на незакрытом баре).

Поле "Значение Kijun".

В поле выводится информация о текущем значении линии Kijun (на незакрытом баре).

Поле "Значение Senkou Span A".

В поле выводится информация о текущем значении линии Senkou Span A (на незакрытом баре).

Поле "Значение Senkou Span B".

В поле выводится информация о текущем значении линии Senkou Span B (на незакрытом баре).

4. Условия открытия и закрытия позиций

По этим условиям программа будет открывать или закрывать позиции.

4.1 По Tenkan

Открытие Лонга: цена последней сделки больше значения линии Tenkan.

Заккрытие Лонга: цена последней сделки меньше значения линии Tenkan.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше значения линии Tenkan.

Заккрытие Шорта: цена последней сделки больше значения линии Tenkan.

4.2 По Kijun

Открытие Лонга: цена последней сделки больше значения линии Kijun.

Заккрытие Лонга: цена последней сделки меньше значения линии Kijun.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше значения линии Kijun.

Заккрытие Шорта: цена последней сделки больше значения линии Kijun.

4.3 По Tenkan и Kijun

Открытие Лонга: значение линии Tenkan больше значения линии Kijun и цена последней сделки больше значений обеих линий.

Заккрытие Лонга: значение линии Tenkan меньше значения линии Kijun и цена последней сделки меньше значений обеих линий.

Открытие Шорта: значение линии Tenkan меньше значения линии Kijun и цена последней сделки меньше значений обеих линий.

Заккрытие Шорта: значение линии Tenkan больше значения линии Kijun и цена последней сделки больше значений обеих линий.

4.4 По облаку

Открытие Лонга: цена последней сделки больше и значения линии Span A и значения линии Span B.

Заккрытие Лонга: цена последней сделки меньше и значения линии Span A и значения линии Span B.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше и значения линии Span A и значения линии Span B.

Заккрытие Шорта: цена последней сделки больше и значения линии Span A и значения линии Span B.

4.5 По Tenkan и облаку

Открытие Лонга: цена последней сделки больше значения линии Tenkan и значения линий Span A и Span B.

Заккрытие Лонга: цена последней сделки меньше значения линии Tenkan и значения линий Span A и Span B.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше значения линии Tenkan и значения линий Span A и Span B.

Заккрытие Шорта: цена последней сделки больше значения линии Tenkan и значения линий Span A и Span B.

4.6 По Kijun и облаку

Открытие Лонга: цена последней сделки больше значения линии Kijun и значения линий Span A и Span B.

Заккрытие Лонга: цена последней сделки меньше значения линии Kijun и значения линий Span A и Span B.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше значения линии Kijun и значения линий Span A и Span B.

Заккрытие Шорта: цена последней сделки больше значения линии Kijun и значения линий Span A и Span B.

4.7 По границам облака

Открытие Лонга: цена пересекла снизу вверх одну из линий Span A или Span B.

Закрытие Лонга: цена пересекла сверху вниз одну из линий Span A или Span B.

Открытие Шорта: Цена пересекла сверху вниз одну из линий Span A или Span B.

Закрытие Шорта: Цена пересекла снизу вверх одну из линий Span A или Span B.

4.8 По направлению Tenkan

Открытие Лонга: линия Tenkan изменила свое направление вверх и цена последней сделки больше значения линии Tenkan.

Закрытие Лонга: линия Tenkan изменила свое направление вниз и цена последней сделки меньше значения линии Tenkan.

Открытие Шорта: линия Tenkan изменила свое направление вниз и цена последней сделки меньше значения линии Tenkan.

Закрытие Шорта: линия Tenkan изменила свое направление вверх и цена последней сделки больше значения линии Tenkan.

4.9 По направлению Kijun

Открытие Лонга: линия Kijun изменила свое направление вверх и цена последней сделки больше значения линии Kijun.

Закрытие Лонга: линия Kijun изменила свое направление вниз и цена последней сделки меньше значения линии Kijun.

Открытие Шорта: линия Kijun изменила свое направление вниз и цена последней сделки меньше значения линии Kijun.

Закрытие Шорта: линия Kijun изменила свое направление вверх и цена последней сделки больше значения линии Kijun.

4.10 По Ten и Kij [*]

Открытие Лонга: цена последней сделки больше значений линий Tenkan и Kijun.

Закрытие Лонга: цена последней сделки меньше значений линий Tenkan и Kijun.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше значений линий Tenkan и Kijun.

Закрытие Шорта: цена последней сделки больше значений линий Tenkan и Kijun.

4.11 По Ten или Kij [*]

Открытие Лонга: цена последней сделки больше или значения линии Tenkan или значения линии Kijun.

Закрытие Лонга: цена последней сделки меньше или значения линии Tenkan или значения линии Kijun.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше или значения линии Tenkan или значения линии Kijun.

Закрытие Шорта: цена последней сделки больше или значения линии Tenkan или значения линии Kijun.

4.12 По Ten и облаку [*]

Открытие Лонга: цена последней сделки больше значений линий Tenkan, Span A, Span B и пересекает вверх либо линию Span A, либо линию Span B.

Закрытие Лонга: цена последней сделки меньше значения линии Tenkan и значения линий Span A и Span B.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше значений линий Tenkan, Span A, Span B и пересекает вниз либо линию Span A, либо линию Span B.

Закрытие Шорта: цена последней сделки больше значения линии Tenkan и значения линий Span A и Span B.

4.13 По Kij и облаку [*]

Открытие Лонга: цена последней сделки больше значений линий Kijun, Span A, Span B и пересекает вверх либо линию Span A, либо линию Span B.

Заккрытие Лонга: цена последней сделки меньше значения линии Kijun и значения линий Span A и Span B.

Открытие Шорта: цена последней сделки меньше значений линий Kijun, Span A, Span B и пересекает вниз либо линию Span A, либо линию Span B.

Заккрытие Шорта: цена последней сделки больше значения линии Kijun и значения линий Span A и Span B.

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>