

Справка по торговой стратегии **Levels**

СОДЕРЖАНИЕ

1. Краткое описание стратегии	1
2. Описание используемых индикаторов и их настройка	1
3. Настраиваемые параметры стратегии	2
4. Условия открытия и закрытия позиций	4
4.1 По пробую	4
4.2 С подтверждением	4
4.3 По проколу	4
5. Контакты	5

1. Краткое описание стратегии

Торговая стратегия Levels предназначена для автоматической торговли финансовыми инструментами и используется в программе FalconTrade. Стратегия основана на пробое ценовых уровней, образованных максимальными и минимальными ценами баров.

2. Описание используемых индикаторов и их настройка

Стратегия не использует в своей работе какие-либо индикаторы. Для получения уровней поддержки и сопротивления достаточно графика цены.

Стратегия в своей работе использует данные, полученные с графика цены, в связи, с чем необходимо для каждого инструмента создать график цены. Графики цены и индикаторов могут быть в разных окнах с разными временными интервалами.

Пример последовательности действий для графика цены (баров):

- 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.

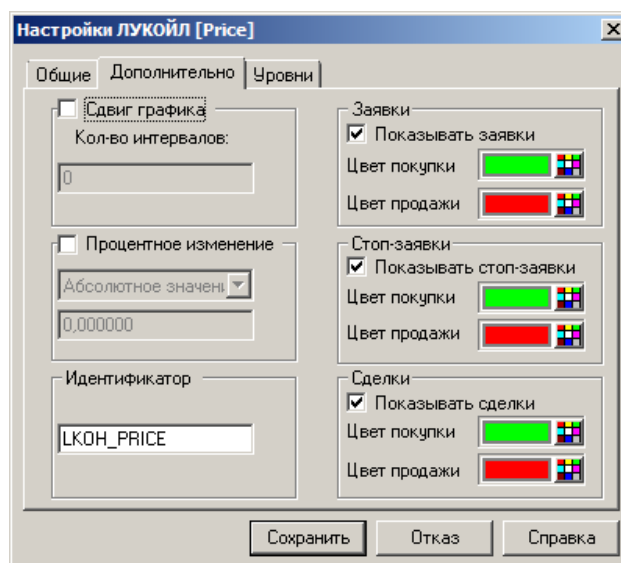




Рисунок 2.2 Окно с графиком цены и индикаторами

3. Настраиваемые параметры стратегии

Торговля	Заявки	MTC	Стоп-лосс	Риск	Время
Стратегия (версия: 1.0.0.7)					
Идентификатор графика цены:			Levels		
Сигнал на открытие позиции:			LKOIL_PRICE		
Сигнал на закрытие позиции:			Нет		
Формирование уровней:			Из мин и макс		
Кол-во баров для входа в Лонг:			20		
Кол-во баров для выхода из Лонга:			10		
Кол-во баров для входа в Шорт:			20		
Кол-во баров для выхода из Шорта:			10		
Дельта коррекции уровней (в валюте):			0		
Снятие блокировки после стоп-заявок:			Нет		
Сделки на закрытии бара:			Нет		
Время до закрытия бара (секунды):			5		
Одна сделка за один бар:			Нет		
Вход в Лонг:					
Выход из Лонга:					
Вход в Шорт:					
Выход из Шорта:					

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.

Способ открытия позиции.

Позволяет выбрать один из следующих вариантов открытия позиции: По пробую, С подтверждением, По проколу.

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 проколу.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

Формирование уровней.

Позволяет выбрать расчет уровней поддержки и сопротивления из максимальных и минимальных цен баров или из их цен закрытий.

Количество баров для входа в Лонг.

Из числа заданных баров будет выбираться наибольший максимум и после превышения рыночной цены этого максимума будет открыта длинная позиция.

Количество баров для выхода из Лонга.

Из числа заданных баров будет выбираться наименьший минимум и после того, как рыночная цена станет ниже этого минимума, будет закрыта длинная позиция.

Количество баров для входа в Шорт.

Из числа заданных баров будет выбираться наименьший минимум и после того, как рыночная цена станет ниже этого минимума, будет открыта короткая позиция.

Количество баров для выхода из Шорта.

Из числа заданных баров будет выбираться наибольший максимум и после превышения рыночной цены этого максимума будет закрыта короткая позиция.

Дельта коррекции уровней в валюте.

Используется при открытии позиции. После преодоления ценой уровня открытия позиции и прохождения ценой этой величины будет открыта соответствующая позиция.

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 HIGH второго бара станет меньше HIGH третьего бара, появится возможность повторно открыть Лонг. Для Шортов наоборот – HIGH второго бара должен стать меньше HIGH третьего бара.

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 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.

Поле "Вход в Лонг".

Значение ценового уровня, после превышения ценой которого открывается длинная позиция.

Поле "Выход из Лонга".

Значение ценового уровня, который определяет закрытие длинной позиции после того, как рыночная цена станет ниже этого уровня.

Поле "Вход в Шорт".

Значение ценового уровня, который определяет открытие короткой позиции после того, как рыночная цена станет ниже этого уровня.

Поле "Выход из Шорта".

Значение ценового уровня, после превышения ценой которого закрывается короткая позиция.

4. Условия открытия и закрытия позиций

По этим условиям программа будет открывать или закрывать позиции.

4.1 По пробую

Открытие Лонга: как только рыночная цена превышает уровень открытия Лонга.

Закрытие Лонга: как только рыночная цена становится ниже уровня закрытия Лонга.

Открытие Шорта: как только рыночная цена становится ниже уровня закрытия Шорта.

Закрытие Шорта: как только рыночная цена превышает уровень открытия Шорта.

4.2 С подтверждением

Открытие Лонга: цена закрытия предыдущего бара больше уровня открытия Лонга.

Закрытие Лонга: цена закрытия предыдущего бара меньше уровня закрытия Лонга.

Открытие Шорта: цена закрытия предыдущего бара меньше уровня открытия Шорта.

Закрытие Шорта: цена закрытия предыдущего бара больше уровня закрытия Шорта.

4.3 По проколу

Открытие Лонга: максимальная цена предыдущего бара больше уровня открытия Лонга.

Заккрытие Лонга: минимальная цена предыдущего бара меньше уровня открытия Лонга.

Открытие Шорта: минимальная цена предыдущего бара меньше уровня открытия Шорта.

Заккрытие Шорта: максимальная цена предыдущего бара больше уровня закрытия Шорта.

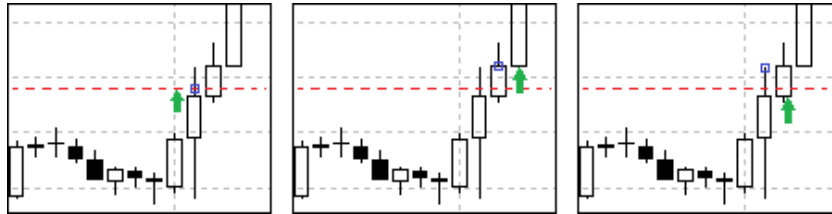


Рисунок 4.1 Способы открытия/закрытия позиции, слева на право: По пробую, С подтверждением, По проколу

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>