

Справка по торговой стратегии **Levels + SAR**

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.....	6
4.1 По пробую.....	6
4.2 С подтверждением	6
4.3 По проколу.....	7
4.3 По Parabolic SAR	7
5. Контакты	7

1. Краткое описание стратегии

Торговая стратегия Levels + SAR предназначена для автоматической торговли финансовыми инструментами и используется в программе FalconTrade. Стратегия основана на индикаторе технического анализа Parabolic SAR и горизонтальных уровнях поддержки и сопротивления.

Все параметры индикатора Parabolic SAR настраиваются в торговом терминале QUIK.

2. Описание используемых индикаторов и их настройка

Parabolic SAR («Параболическая система»)

Parabolic SAR («Stop and Reverse») – система определения точек разворота позиций. Индикатор строится на ценовом графике. По своему смыслу данный индикатор аналогичен скользящей средней, с той лишь разницей, что Parabolic SAR движется с большим ускорением и может менять положение относительно цены. Если цена пересекает линии Parabolic SAR, то происходит разворот индикатора, а следующие его значения располагаются по другую сторону от цены. Переворот индикатора – это сигнал либо об окончании тренда, либо о его развороте.

Системой Parabolic SAR следует пользоваться выборочно, лишь при наличии трендов. При отсутствии тренда она дает множество ложных сигналов.

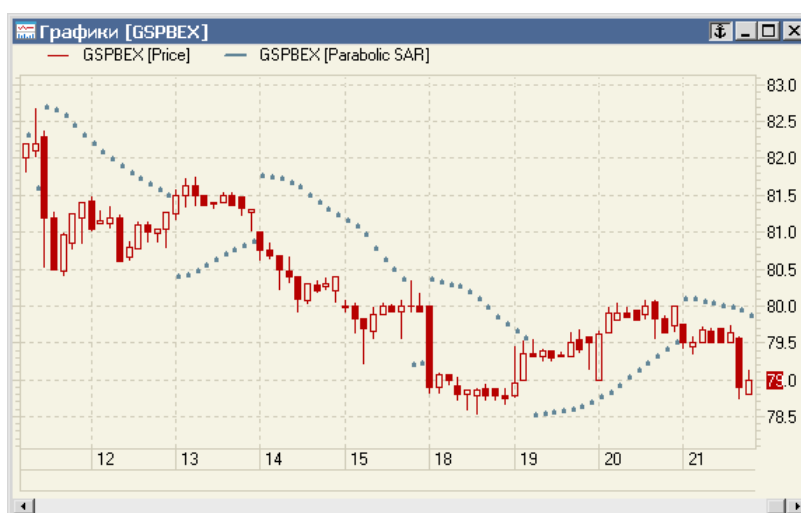


Рисунок 2.1 Линия Parabolic SAR на графике

Вычисление:

1. Для длинных позиций:
 $SAR_i = (HIGH_{i-1} - SAR_{i-1}) * AF + SAR_{i-1}$

2. Для коротких позиций:
 $SAR_i = SAR_{i-1} - (LOW_{i-1} - SAR_{i-1}) * AF,$

где $HIGH_{i-1}$ – наибольшее значение цены предыдущего периода,

LOW_{i-1} – наименьшее значение цены предыдущего периода,

SAR_{i-1} – значение SAR предыдущего периода,

AF – фактор ускорения.

Параметры настройки:

1. «Шаг» – шаг изменения цены закрытия позиции (фактора ускорения AF), рекомендуемое значение 0,02.
2. «Макс. шаг» – предельное значение шага, рекомендуемое значение 0,2.

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

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

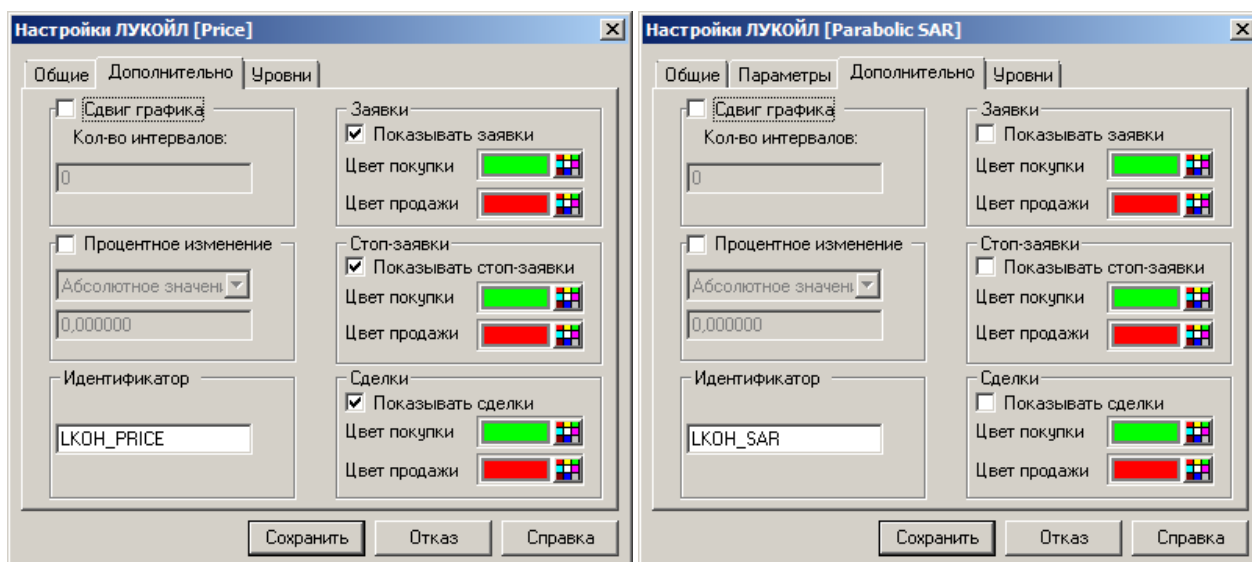




Рисунок 2.2 Окно с графиком цены и индикаторами

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) Levels + SAR ?

Идентификатор графика цены: LKOH_PRICE

Идентификатор Parabolic SAR: LKOH_SAR

Сигнал на открытие позиции: Нет

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

Выход по пересечению Parabolic SAR: Да

Снятие блокировки после стоп-заявок: 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

Вход в Лонг:

Выход из Лонга:

Вход в Шорт:

Выход из Шорта:

Значение Parabolic SAR:

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 Parabolic SAR.

Это уникальное имя индикатора Parabolic SAR, 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 проколу, По Parabolic SAR.

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, По Parabolic SAR.

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.

Выход по пересечению Parabolic SAR.

Позволяет закрывать позиции: если рыночная цена меньше Parabolic SAR, то закрывается Лонг, если рыночная цена больше Parabolic SAR, то закрывается Шорт.

Текущие значения Parabolic SAR.

При закрытии позиции по Parabolic SAR при выбранных текущих значения будет использоваться значение индикатора на незакрытом баре, иначе на предыдущем баре.

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.

Инверсия сигналов.

При включенной опции «Да» сигналы стратегии инвертируются: открытие Лонга в открытие Шорта, открытие Шорта в открытие Лонга, закрытие Лонга в закрытие Шорта, закрытие Шорта в закрытие Лонга.

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.

Поле "Вход в Лонг".

В поле выводится информация о цене, которая определяет уровень открытия Лонга.

Поле "Выход из Лонга".

В поле выводится информация о цене, которая определяет уровень закрытия Лонга.

Поле "Вход в Шорт".

В поле выводится информация о цене, которая определяет уровень открытия Шорта.

Поле "Выход из Шорта".

В поле выводится информация о цене, которая определяет уровень закрытия Шорта.

Поле "Значение Parabolic SAR".

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

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.

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

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

Заккрытие 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.

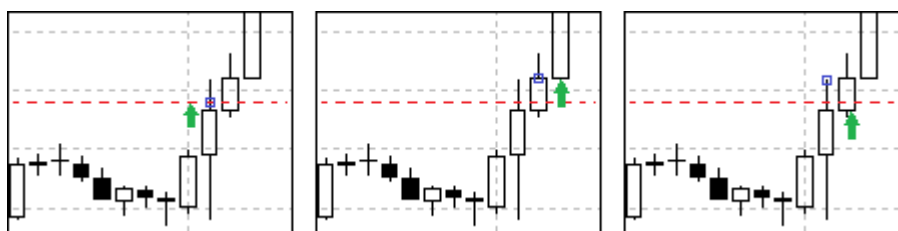


Рисунок 4.1 Способы открытия/закрытия позиции, слева на право: По пробое, С подтверждением, По проколу

4.3 По Parabolic SAR

Открытие Лонга: рыночная цена больше значения линии Parabolic SAR.

Заккрытие Лонга: рыночная цена меньше значения линии Parabolic SAR.

Открытие Шорта: рыночная цена меньше значения линии Parabolic SAR.

Заккрытие Шорта: рыночная цена больше значения линии Parabolic SAR.

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>