

# Справка по торговой стратегии **Parabolic SAR**

## 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 пересечению.....	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 Parabolic SAR.

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.

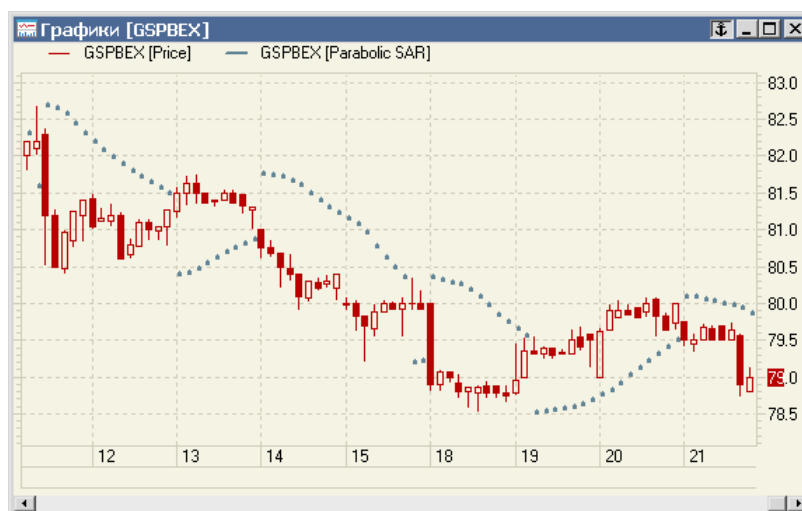


Рисунок 2.1 Линия Parabolic SAR на графике

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.

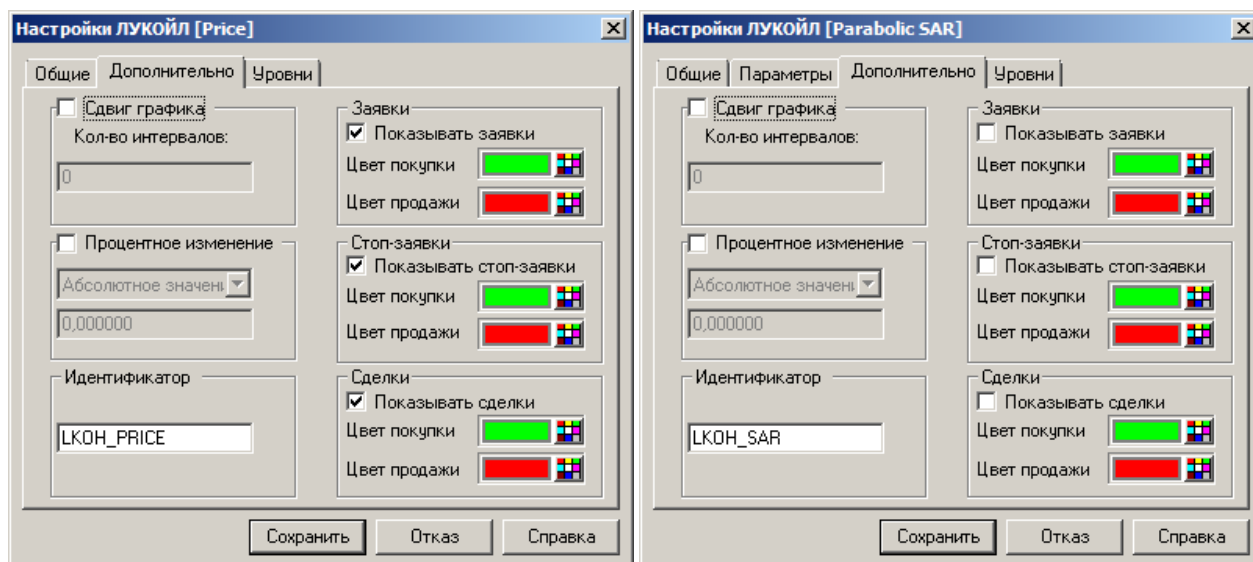




Рисунок 2.2 Окно с графиком цены и индикаторами

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

### 3. Настраиваемые параметры стратегии

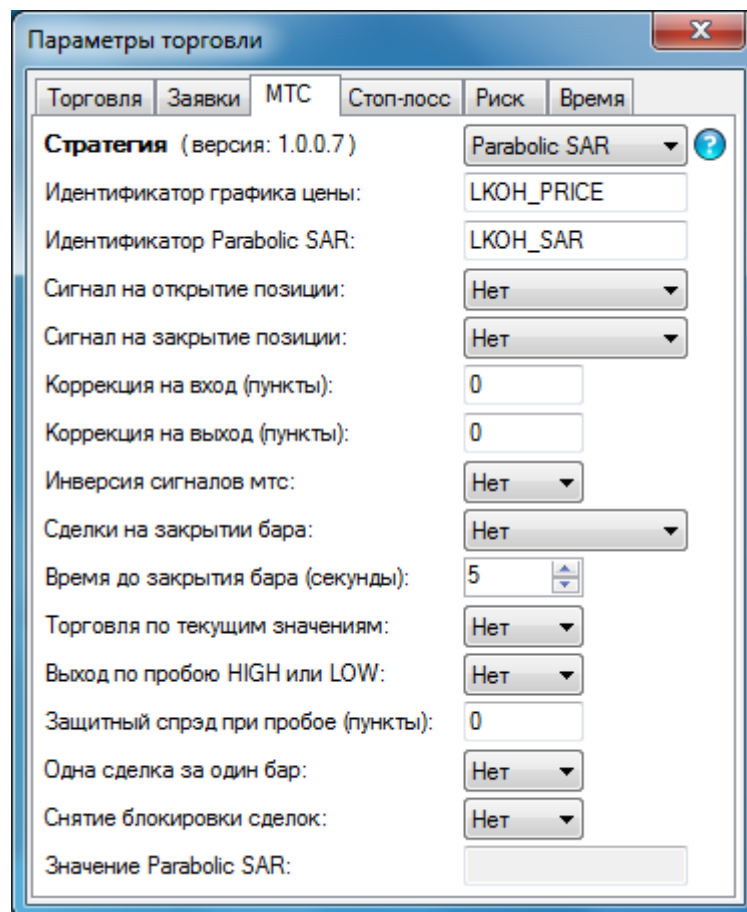


Рисунок 3.1 Список доступных опций

**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.

**Сигнал на открытие позиции.**

Позволяет выбрать один из следующих вариантов открытия позиции: По значению, По пересечению.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

**Сигнал на закрытие позиции.**

Позволяет выбрать один из следующих вариантов закрытия позиции: По значению, По пересечению.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

**Коррекция на вход (пункты).**

При движении цены на заданную величину в пунктах (валюте) от значения Parabolic SAR в момент пересечения его ценой открывается позиция.

**Коррекция на выход (пункты).**

При движении цены на заданную величину в пунктах (валюте) от значения Parabolic SAR в момент пересечения его ценой позиция закрывается.

**Инверсия сигналов мтс.**

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 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 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 значению**

Открытие Лонга: рыночная цена выше линии Parabolic SAR.

Закрытие Лонга: рыночная цена ниже линии Parabolic SAR.

Открытие Шорта: рыночная цена ниже линии Parabolic SAR.

Закрытие Шорта: рыночная цена выше линии Parabolic SAR.

##### **4.2 По пересечению**

Открытие Лонга: в момент пересечения ценой линии Parabolic SAR снизу вверх.

Закрытие Лонга: в момент пересечения ценой линии Parabolic SAR сверху вниз.

Открытие Шорта: в момент пересечения ценой линии Parabolic SAR сверху вниз.

Закрытие Шорта: в момент пересечения ценой линии Parabolic SAR снизу 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>