

Справка по торговой стратегии **Price Channel**

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.....	4
4.1 По пробую.....	4
4.2 С подтверждением	5
4.3 По проколу.....	5
4.4 По средней.....	5
5. Контакты	5

1. Краткое описание стратегии

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

Все параметры индикатора Price Channel настраиваются в торговом терминале QUIK.

2. Описание используемых индикаторов и их настройка**Ценовой канал (Price Channel)**

Индикатор Price Channel представлен двумя граничными линиями: верхняя – ценовой максимум за N периодов, нижняя – ценовой минимум за N периодов. Линии канала можно интерпретировать как динамические линии поддержки и сопротивления. Средняя линия отображает среднее арифметическое между ними.

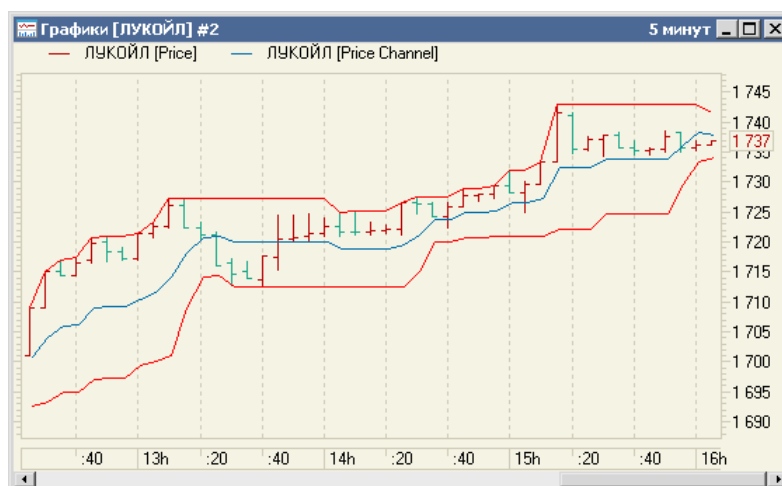


Рисунок 2.1 Линия Price Channel на графике

Вычисление:

$PCh_i = \max([H_{i-n}; H_i])$ – верхняя линия (сопротивления)

$PCl_i = \min([L_{i-n}; L_i])$ – нижняя линия (поддержки)

$PCm_i = (PCh_i + PCl_i) / 2$ – средняя линия

где $i \geq n$

Параметры настройки:

1. «Кол-во периодов» – количество периодов (n), по умолчанию – «10»,
2. «Цвет иррег» – цвет верхней линии,

3. «Цвет» – цвет нижней линии.

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

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

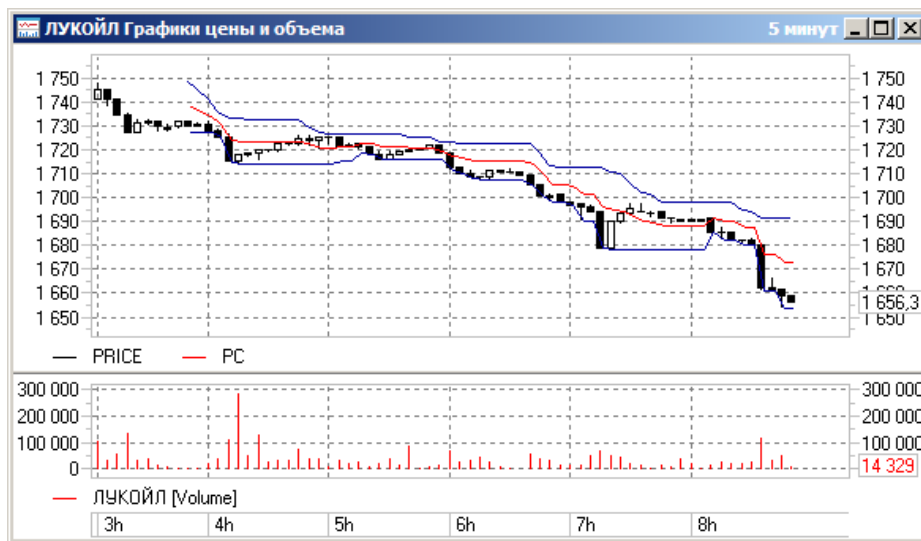
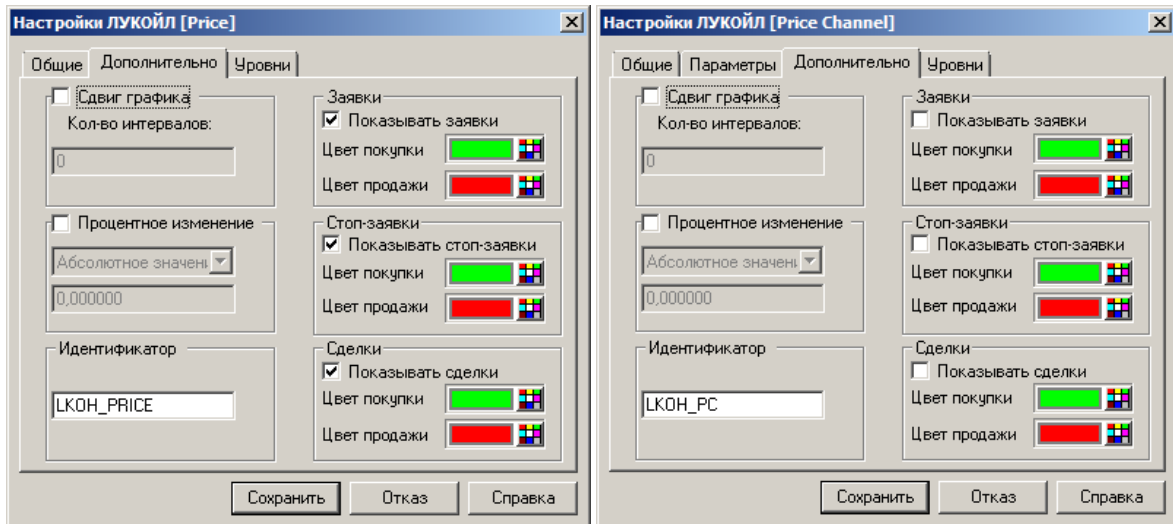


Рисунок 2.2 Окно с графиком цены и индикаторами

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

3. Настраиваемые параметры стратегии

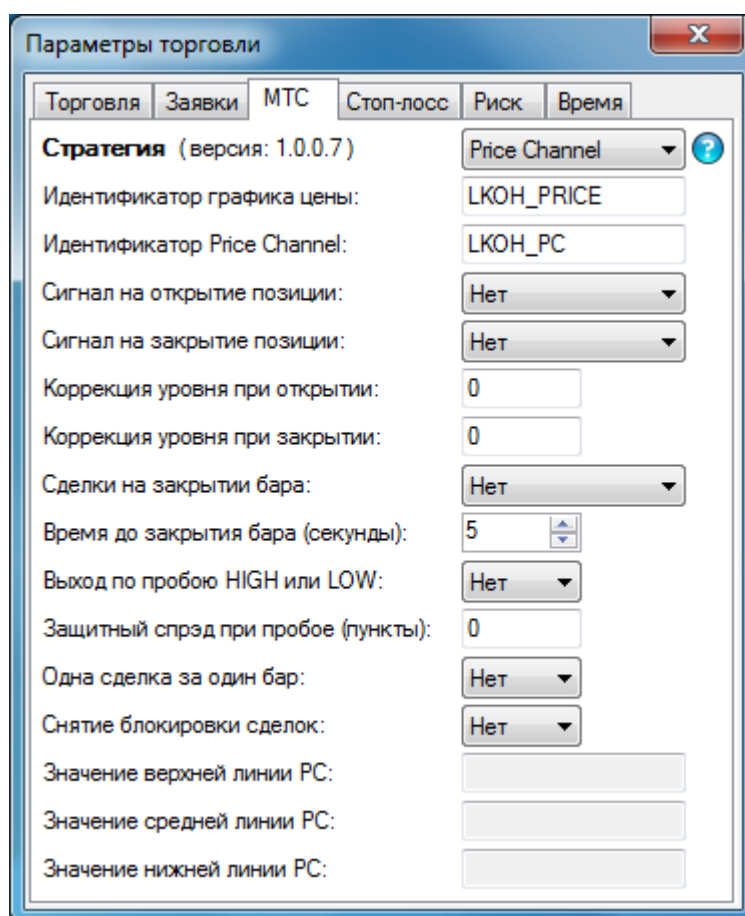


Рисунок 3.1 Список доступных опций

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 Price Channel.

Это уникальное имя индикатора Price Channel, 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 средней.

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 средней.

Подробнее об этих параметрах будет описано в параграфе 4.

Коррекция уровней при открытии (в валюте).

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

Коррекция уровней при закрытии (в валюте).

Используется при закрытии позиции. После преодоления ценой уровня закрытия позиции и прохождения ценой этой величины будет закрыта соответствующая позиция.

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.

Снятие блокировки сделок.

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

Поле "Значение верхней линии PC".

Значение верхней линии индикатора Price Channel.

Поле "Значение средней линии PC".

Значение средней линии индикатора Price Channel.

Поле "Значение нижней линии PC".

Значение нижней линии индикатора Price Channel.

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 верхнюю линию Price Channel.

Закрытие Лонга: как только рыночная цена становится меньше нижней линии Price Channel.

Открытие Шорта: как только рыночная цена становится меньше нижней линии Price Channel.

Закрытие Шорта: как только рыночная цена превышает линию Price Channel.

4.2 С подтверждением

Открытие Лонга: цена закрытия предыдущего бара больше верхней линии Price Channel.

Закрытие Лонга: цена закрытия предыдущего бара меньше нижней линии Price Channel.

Открытие Шорта: цена закрытия предыдущего бара меньше нижней линии Price Channel.

Закрытие Шорта: цена закрытия предыдущего бара больше верхней линии Price Channel.

4.3 По проколу

Открытие Лонга: максимальная цена предыдущего бара больше верхней линии Price Channel.

Закрытие Лонга: минимальная цена предыдущего бара меньше нижней линии Price Channel.

Открытие Шорта: минимальная цена предыдущего бара меньше нижней линии Price Channel.

Закрытие Шорта: максимальная цена предыдущего бара больше верхней линии Price Channel.

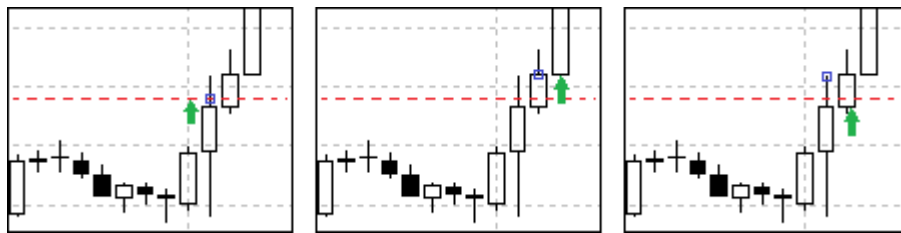


Рисунок 4.1 Способы открытия/закрытия позиции, слева на право: По пробую, С подтверждением, По проколу

4.4 По средней

Открытие Лонга: цена закрытия предыдущего бара больше средней линии Price Channel.

Закрытие Лонга: цена закрытия предыдущего бара меньше средней линии Price Channel.

Открытие Шорта: цена закрытия предыдущего бара меньше средней линии Price Channel.

Закрытие Шорта: цена закрытия предыдущего бара больше средней линии Price Channel.

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>