

FalconTrade

2.0

Стратегия Levels/SAR

СОДЕРЖАНИЕ

1	Настройка графиков	5
2	Опции стратегии.....	6
3	Сигналы стратегии.....	8

ПЕРЕЧЕНЬ ТАБЛИЦ

Табл. 2.1 – Опции стратегии	6
Табл. 3.1 – Сигналы стратегии.....	8

ПЕРЕЧЕНЬ РИСУНКОВ

Рис. 1.1 – Присвоение графику индикатора Parabolic SAR идентификатора	5
Рис. 3.1 – Способы открытия/закрытия позиции, слева на право: По пробую, С подтверждением, По проколу	8

1 НАСТРОЙКА ГРАФИКОВ

Для использования стратегии необходимо на графике QUIK добавить графики индикаторов соответствующих условий и присвоить им идентификаторы из настроек стратегии.

Последовательность действий для индикатора Parabolic SAR.

1. На открытом графике цены (баров) кликните правой клавишей мыши и выберите **Добавить график (Индикатор)**.
2. В появившемся окне найдите Parabolic SAR и нажмите **Добавить**.
3. Измените параметры индикатора на вкладках **Свойства** и **Параметры** или оставьте их равными значениям по умолчанию.
4. Перейдите на вкладку **Дополнительно** и в поле **Идентификатор** укажите уникальное имя индикатора Parabolic SAR на латинице из настроек стратегии, например, GAZP_SAR, как показано на рисунке ниже.
5. Нажмите **ОК**. График индикатора настроен.

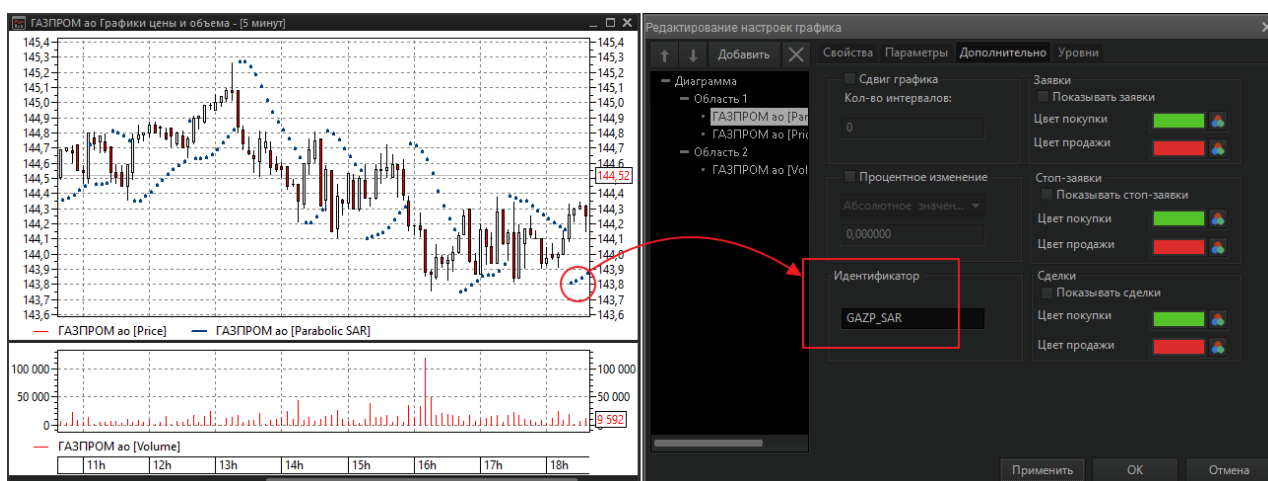


Рис. 1.1 – Присвоение графику индикатора Parabolic SAR идентификатора

2 ОПЦИИ СТРАТЕГИИ

В стратегии доступны дополнительные опции, влияющие на сигнал стратегии. Описание опций в Табл. 2.1.

Табл. 2.1 – Опции стратегии

Опция	Описание
Формирование уровней	<p>Выбор расчета уровней поддержки и сопротивления из цен свечей. Возможные значения:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Из мин и макс – уровень поддержки определяется как минимальное значение из минимумов свечей, уровень сопротивления – как максимальное значение из максимумов свечей; • Из цен закрытий – уровень поддержки определяется как минимальное значение из закрытия свечей, уровень сопротивления – как максимальное значение из закрытия свечей; • Из откр и закр – уровень поддержки определяется как минимальное значение из открытия и закрытия свечей, уровень сопротивления – как максимальное значение из открытия и закрытия свечей.
Количество свечей для входа в Лонг	Число свечей, определяющих период для расчета уровня открытия Лонга (сопротивление)
Количество свечей для выхода из Лонга	Число свечей, определяющих период для расчета уровня закрытия Лонга (поддержка)
Количество свечей для входа в Шорт	Число свечей, определяющих период для расчета уровня открытия Шорта (поддержка)
Количество свечей для выхода из Шорта	Число свечей, определяющих период для расчета уровня закрытия Шорта (сопротивления)
Дельта коррекции уровней в пунктах	<p>Коррекция полученного уровня на заданную дельту в пунктах. В условиях стратегии используются скорректированные значения уровней:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Уровень открытия Лонга + Дельта; • Уровень закрытия Лонга - Дельта; • Уровень открытия Шорта - Дельта; • Уровень закрытия Шорта + Дельта.
Выход по пересечению Parabolic SAR	<p>Закрытие позиции по индикатору Parabolic SAR:</p> <ul style="list-style-type: none"> • если рыночная цена меньше Parabolic SAR, то закрывается Лонг; • если рыночная цена больше Parabolic SAR, то закрывается Шорт.

Опция	Описание
Текущие значения Parabolic SAR	При закрытии позиции по Parabolic SAR при выбранных текущих значениях будет использоваться значение индикатора на последней незакрытой свече, т.е. как только цена пересекает индикатор, иначе по значениям предыдущей закрытой свечи

3 СИГНАЛЫ СТРАТЕГИИ

В стратегии доступны сигналы, описанные в Табл. 3.1.

Табл. 3.1 – Сигналы стратегии

Сигнал	Описание
По пробую	Покупка. Last Price > Уровень (как только рыночная цена превышает уровень) Продажа. Last Price < Уровень (как только рыночная цена становится ниже уровня)
С подтверждением	Покупка. CLOSE > Уровень (цена закрытия предыдущей свечи больше уровня) Продажа. CLOSE < Уровень (цена закрытия предыдущей свечи меньше уровня)
По проколу	Покупка. HIGH > Уровень (максимальная цена предыдущей свечи больше уровня) Продажа. LOW < Уровень (минимальная цена предыдущей свечи меньше уровня)
По Parabolic SAR	Покупка. $CLOSE_{[i]} > Parabolic SAR_{[i]}$ Продажа. $CLOSE_{[i]} < Parabolic SAR_{[i]}$

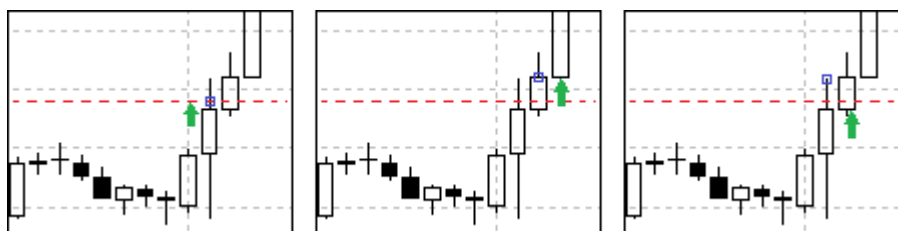


Рис. 3.1 – Способы открытия/закрытия позиции, слева на право: По пробую, С подтверждением, По проколу