

Руководство по использованию робота

BOT Stochastic

СОДЕРЖАНИЕ

1. Возможности робота.....	3
2. Стратегия.....	3
3. Условия входа и выхода	5
4. Выставление заявок	6
5. Подготовка Quik	7
5.1 Системные требования.....	7
5.2 Настройка таблиц и графиков	7
6. Настройка параметров робота.....	9
6.1 Программа для настройки робота	9
6.2 Конфигурационный файл робота	10
6.3 Работа стоп-лосс и тейк-профит	18
7. Загрузка робота в Quik.....	19
8. Описание столбцов портфеля.....	22
9. Техническая поддержка	22

1. Возможности робота

Робот **BOT Stochastic** обладает следующими возможностями:

- ✓ Полная автоматизация торговли (совершение сделок и контроль торговли)
- ✓ Возможность слежения за 10-ю инструментами одновременно
- ✓ Изменение настроек без остановки робота
- ✓ Возможность использования скользящего стоп-лосс
- ✓ Контроль числа лотов (контрактов) в торговле, что позволяет использовать его в качестве помощника, а не отдельной закрытой системы.
- ✓ Позволяет торговать на временных интервалах от 1-ой минуты до одного дня.

2. Стратегия

В основе робота **BOT Stochastic** лежит стратегия, основанная на контр-трендовом индикаторе Stochastic.

Цель осциллятора Стохастик (Stochastic) - выявление ценовых тенденций и разворотов путем слежения за положением цен закрытия внутри последней серии пиков и низов. Стохастик построен на следующей закономерности в поведении рыночной цены: при восходящей тенденции цены закрытия стремятся к верхней части ценового диапазона, а при нисходящей, соответственно, к нижней.

Робот позволяет реализовать контр-трендовую стратегию, и наилучшим образом подходит для рынков в состоянии флэта (боковом движении).



Рисунок 2.1 Отображение совершенных сделок в окне графика

Stochastic Oscillator («Стохастический осциллятор»)

Стохастический осциллятор показывает моменты, когда цена подходит близко к границе ее торгового диапазона за определенный период времени. Индикатор состоит из двух кривых: быстрой – %K, и медленной – %D.

Вычисление:

$$\%K(m) = 100 * SMA(C - LLV_n, m) / SMA(HHV_n - LLV_n, m),$$

$$\%D = MA(\%K, s),$$

где **SMA** – простая скользящая средняя (Simple Moving Average),

C – цена закрытия текущего периода,

LLV_n – минимальная цена за последние **n** периодов,

HHV_n – максимальная цена за последние **n** периодов,

m – сглаживание,

n – число периодов (обычно от 5 до 21),

s – число периодов для расчета средней скользящей.



Параметры настройки:

1. «Параметры %K»:

«Кол-во периодов» – количество периодов **n**,

«Сглаживание» – период, используемый для внутреннего сглаживания значений **%K**. Значение 1 рассматривается как сильная (быстрая) стохастика. Значение 3, принятое по умолчанию, рассматривается как медленная стохастика.

2. «Параметры %D»:

«Кол-во периодов» – количество периодов для расчета **MA**,

«Метод» – метод расчета **MA** (Simple, Exponential), по умолчанию используется «Simple»,

«Вид графика» – выбор вида графика (линии, точки, пунктир),

«Цвет линии» – выбор цвета линии.

3. Условия входа и выхода

Алгоритм работы робота представляет собой автоматическую систему слежения за значением линии Stochastic Oscillator и ценой.

Вход в длинную позицию осуществляется по следующим условиям:

1. Текущее значение быстрого стохастик больше текущего значения медленного стохастик плюс дельту разности линий индикатора.
2. Предыдущие значения быстрого стохастик больше значений медленного, соответственно (при включенной опции Кол-во баров сравнения линий больше 1).
1. Быстрый стохастик ниже зоны перекупленности (ниже верхнего уровня).

Выход из длинной позиции происходит, если выполнено, хотя бы одно из следующих условий:

1. Выполнены условия для входа в короткую позицию.
2. Выход по ордеру стоп-лосс или тейк-профит.
3. Выход в конце работы робота (при активной соответствующей опции).
4. Выход перед клирингом (при активной соответствующей опции).
5. Выход по достижению максимальных убытка или прибыли (при активной соответствующей опции).

Вход в короткую позицию осуществляется по следующим условиям:

1. Текущее значение быстрого стохастик меньше текущего значения медленного стохастик минус дельту разности линий индикатора.
2. Предыдущие значения быстрого стохастик меньше значений медленного, соответственно (при включенной опции Кол-во баров сравнения линий больше 1).
1. Быстрый стохастик выше зоны перепроданности (выше нижнего уровня).

Выход из короткой позиции происходит, если выполнено, хотя бы одно из следующих условий:

1. Выполнены условия для входа в длинную позицию.
2. Выход по ордеру стоп-лосс или тейк-профит.
3. Выход в конце работы робота (при активной соответствующей опции).
4. Выход перед клирингом (при активной соответствующей опции).
5. Выход по достижению максимального убытка (при активной соответствующей опции).