

Техническое задание на изготовление торгового робота Ишимоку

КвикПрофит Групп

2010 год

Суть стратегии.

Стратегия основана на техническом индикаторе Ишимоку.
Описание и особенности стратегии описаны в блоге «Технический анализ» сообщества трейдеров TradeCommunity.Ru

Основные понятия.

Альфа – некоторая переменная, может быть абсолютной или относительной.

Бычий крест Т/К – линия тенкан пересекает линию киджун снизу вверх.

Бычий крест Ц/К – график цены пересекает линию киджун снизу вверх.

Бычий прорыв (облака) – график цены пересекает верхнюю границу облака (линию тенкан или киджун)

Максимальный портфель – заданный пользователем размер позиции в лотах.

Медвежий крест Т/К – линия тенкан пересекает линию киджун сверху вниз.

Медвежий Ц/К – график цены пересекает линию киджун сверху вниз.

Медвежий прорыв (облака) – график цены пересекает нижнюю границу облака (линию тенкан или киджун)

Сила – сила сигнала по шкале 1-3. От силы сигнала зависит кол-во юнитов в сделке. Ограничение на портфель 3 юнита.

Цена-стоп – цена срабатывания стоп-заявки

Юнит – 1/3 заданного пользователем размера портфеля.

Инструменты.

Акции ММВБ

Размер позиции.

Максимальный размер позиции в лотах определяет пользователь. Главное условие – размер позиции должен быть кратный 3.

Сигналы на вход.

ЛОНГ. Вход (бычьи сигналы)

1.1 Бычий крест Т/К над облаком + чинкоу выше цены = сила 3

1.2 Бычий крест Т/К внутри облака + чинкоу выше цены = сила 2

1.3 Бычий крест Т/К ниже облака + чинкоу выше цены = сила 1

2.1 Бычий крест Ц/К над облаком + чинкоу выше цены = сила 3

2.2 Бычий крест Ц/К внутри облака + чинкоу выше цены = сила 2

2.3 Бычий крест Ц/К ниже облака + чинкоу выше цены = сила 1

3.1 Бычий прорыв + чинкоу выше цены = сила 2

ШОРТ. Вход (медвежьи сигналы)

1.1 Медвежий крест Т/К над облаком + чинкоу ниже цены = сила 3

1.2 Медвежий крест Т/К внутри облака + чинкоу ниже цены = сила 2

- 1.3 Медвежий крест Т/К ниже облака + чинкоу ниже цены = сила 1
- 2.1 Медвежий крест Ц/К над облаком + чинкоу ниже цены = сила 3
- 2.2 Медвежий крест Ц/К внутри облака + чинкоу ниже цены = сила 2
- 2.3 Медвежий крест Ц/К ниже облака + чинкоу ниже цены = сила 1
- 3.1 Медвежий прорыв + чинкоу ниже цены = сила 2

Условия для входа и объем заявки.

В зависимости от силы сигнала в заявке может указываться 1/3, 2/3 или максимальный размер портфеля.

Сила 1 = 1/3 максимального портфеля

Сила 2 = 2/3 максимального портфеля

Сила 3 = 1 максимальный портфель

Пример: Пользователь задал максимальный портфель 9 лотов ВТБ (1 лот = 1000 акций). Тогда при поступлении сигнала силой 1 – выставится заявка на 3 лота, силы 2 – 6 лотов, сила 3 – 9 лотов.

Позиция может «набираться» в несколько этапов до максимального портфеля.

Заявка на открытие позиции подается при выполнении 2х условий:

- имеется сигнал на вход;

- размер текущей позиции меньше максимального портфеля.

В ситуации, когда размер новой заявки (в случае исполнения) сделает открытую позицию больше максимального размера портфеля, размер выставленной заявки рассчитывается по формуле: максимальный портфель – текущая открытая позиция.

Пример: На момент поступления сигнала силой 2 открытая позиция была равна 6 лотам ВТБ. В данном случае мы можем отправить заявку лишь на 3 лота (9-6=3), иначе на лицо будет превышение заданного портфеля.

Сигналы на выход:

1. Стоп-лосс. Плавающий стоп-лосс (трейлинг-стоп), выставляется если с момента входного сигнала прошло 3 свечи.
 - ЛОНГ. Цена-стоп = Сенкоу2 – Альфа
 - ШОРТ. Цена-стоп = Сенкоу1 + Альфа
2. Обратные сигналы. При закрытии позиции сила сигнала не учитывается.
 - ЛОНГ. Поступление медвежьего сигнала
 - ШОРТ. Поступление бычьего сигнала

Типы заявок.

Вход в позицию – применяются рыночные заявки.

Выход из позиции – стоп-заявки и рыночные (в случае реверсной торговли).

Реверсная торговля.

При поступлении обратных сигналов заявки выставляются в двойном размере, что приводит к реверсной торговле (из лонга в шорт и наоборот).