

Характеристика торговой системы

- ✓ Торговая платформа: MetaTrader4;
- ✓ Торговые инструменты: различные;
- ✓ Период: 4Н.
- ✓ Объем сделок: 7 различных вариантов управления капиталом и их комбинации;
- ✓ Используемые индикаторы: индикаторы измерения цикличности, индикаторы волатильности, индикаторы средней длины тренда.

Возможности торговой системы

Торговая система DAY_TRADER может работать в двух торговых режимах:

1 РЕЖИМ **ONLY TREND**

торговля только по тренду. Вход в рынок осуществляется в направлении глобального и краткосрочного тренда.

2 РЕЖИМ **ACTIVE TRADE**

активная торговля. Торговля осуществляется в направлениях краткосрочных тенденций.

Все торговые системы работают по закрытию предыдущего бара, что исключает проблемы несоответствия результатов тестирования и результатов реальной торговли.

Торговая система DAY_TRADER фильтрует множество ошибок, посылаемых торговым сервером брокера, и не прекращает корректно работать в такой ситуации: эксперт обрабатывает присланное сообщение о неисправности и самостоятельно принимает решение о дальнейших своих действиях.

Вы всегда будете в курсе того, что на данный момент делает эксперт на вашем счете, т.к. всю необходимую информацию он выводит на экран торговой платформы.

Пользовательские настройки эксперта

- **Slippage** – Максимальное возможное отклонение от отправленной цены экспертом при открытии сделки на стороне брокера.
- **PauseBeforeTrade** – Данный параметр используется в том случае, если на счете работает более одного эксперта. Если последняя торговая операция (у любого эксперта, использующего библиотеку) прошла меньше, чем количество секунд назад, указанных в данном параметре, то эксперт будет ждать их истечения.
- **MaxWaitingTime** – максимальное время (в секундах), которое эксперт будет ждать завершения операции.
- **Allow_Info** – включение/выключение вывода информации о работе эксперта на экран. (True – разрешено).
- **Allow_LogFile** – включение/выключение вывода информации в личный лог-файл эксперта (... \MetaTrader 4\experts\files_ExpertLogs\DAY_TRADER(Символ, Период)\год.месяц.день.txt).
- **Allow_TradeLogFile** - включение/выключение вывода информации в лог-файл торговых операций (... \MetaTrader 4\experts\files\logs_TradeLog\год.месяц.день.csv).
- **Allow_ErrorMail** – включение/выключение режима отправки короткого сообщения об ошибке на электронную почту. Настройка почтового сервиса производится в настройках программы MetaTrader4.
- **Allow_ErrorLogFile** – включение/выключение режима записи подробного отчёта об ошибке в текстовый файл (... \MetaTrader 4\experts\files_ErrorLogs\DAY_TRADER(Символ, Период)\год.месяц.день.txt).
- **EnglishInfo** – включение/выключение режима вывода информации на английском языке.
- **Font_Size_Variant** - вариант размера шрифта для вывода информации на экран. Может быть от 1 до 10 (при разрешении 1280*960 оптимальное значение 4-5).
- **Standart_Color** - цвет "нейтральной" (т.е. обычной, не критической) информации.
- **Warning_Color** - цвет информации об ошибках.
- **Price_Up_Color** - цвет, ассоциирующийся с подъемом цены (а также с длинными позициями, сигналами на покупку, и т.д.).
- **Price_Down_Color** - аналогично Price_Up_Color для понижения цены.

Настройки управления капиталом

В эксперте встроено несколько вариантов управления капиталом. Также вы самостоятельно можете подобрать оптимальные параметры для работы эксперта с помощью оптимизатора.

- **LotSizeVariant** - номер варианта управления капиталом.
- **StartLot** - начальный размер лота (для LotSizeVariant 0-5).
- **AddLot** - размер приращения лота (для LotSizeVariant 1 и 2).
- **KLot** - коэффициент прибавки (для LotSizeVariant 3 и 4).
- **MaxRisk** – процентная часть депозита, которой можно рисковать (для LotSizeVariant 5, 6, 11-17, 31-37).
- **TrueProfitPoints** - сумма (в пунктах), больше которой прибыль позиции будет считаться прибылью, меньше которой будет считаться убытком (для LotSizeVariant 1-4).
- **BalanceUse** – процентная часть баланса, которая будет задействована экспертом. Если планируется торговать одновременно несколькими экспертами, то для расчета используйте формулу:

$$D_i = 100/N$$

где

D_i – полученный процент от депозита;

N – количество экспертов, одновременно работающих на данном счете.

Т.е. для 3-х экспертов 33, для 4-х - 25, и т.д. (для LotSizeVariant 5, 6, 7, 11-17, 31-37).

Возможные значения LotSizeVariant:

- 0 - фиксированный размер лота (задаётся переменной StartLot);
- 1 - если предыдущая сделка прибыльная (прибыль больше TrueProfitPoints пунктов), размер лота увеличивается на AddLot (или уменьшается, если AddLot меньше 0), если убыточная (прибыль меньше TrueProfitPoints пунктов), то размер лота устанавливается на уровне StartLot;
- 2 - если предыдущая сделка убыточная, размер лота увеличивается на AddLot, если прибыльная, то размер лота устанавливается на уровне StartLot;
- 3 - если предыдущая позиция прибыльная, размер лота увеличивается в AddLot раз, если убыточная, то размер лота устанавливается на уровне StartLot;
- 4 - если предыдущая позиция убыточная, размер лота увеличивается в AddLot раз, если прибыльная, то размер лота устанавливается на уровне StartLot;
- 5 - размер лота выбирается таким образом, чтобы максимальный убыток от открытой позиции (в случае срабатывания ордера StopLoss) составил MaxRisk процентов от депозита;

6 - размер лота рассчитывается как процент от баланса. Параметр управляется переменной MaxRisk. Например, для пары eurUSD: при Балансе \$1 000 и MaxRisk = 10 сделка откроется 0.1 лотом; при балансе \$15 000 и MaxRisk=5 - 0,8 лота;

7 - размер лота рассчитывается по формуле:

$$L = 1\% \text{ от баланса} / \text{среднюю амплитуду движения цены на последних 20-ти барах} * 0,4.$$

11-17 - алгоритмы работы эксперта соответствуют вариантам 1-7, при этом размер лота рассчитывается аналогично варианту 5 (т.е. возможный максимальный убыток не превысит MaxRisk % от общего баланса);

21-27 - алгоритмы работы эксперта соответствуют вариантам 1-7, размер лота не может уменьшаться;

31-37 - алгоритмы работы эксперта соответствуют вариантам 1-7, при этом размер лота рассчитывается аналогично варианту 5 и не может уменьшаться. Т.е. если лот будет больше предельного значения, рассчитанного по варианту 5, то он уменьшится до данного предела, если же он будет меньше, чем предыдущий лот, то будет приравнен его предшествующему значению.

100-128 – используются все варианты (удобно для оптимизации).

Таблица соответствия:

100 - 0			
101 - 1	108 - 11	115 - 21	122 - 31
102 - 2	109 - 12	116 - 22	123 - 32
103 - 3	110 - 13	117 - 23	124 - 33
104 - 4	111 - 14	118 - 24	125 - 34
105 - 5	112 - 15	119 - 25	126 - 35
106 - 6	113 - 16	120 - 26	127 - 36
107 - 7	114 - 17	121 - 27	128 - 37

Параметры торговой стратегии

- **Robot** – переключение режимов работы эксперта;
 1 - ONLY TREND
 0 - ACTIVE-TRADE
- **LTrend** – параметр, необходимый для определения глобального тренда. Значение от 0,90 до 0,99.
- **STrend** – параметр, необходимый для настройки краткосрочной тенденции. Значение от 0,2 до 0,9.
- **VCicle** – параметр цикличности валютной пары.
- **StopLoss** – уровень ограничения убытков для каждого ордера.
- **Profit** – уровень минимальной возможной прибыли. Используется в совокупности с коэффициентом волатильности.

⦿ Настройка системы:

Ни для кого не секрет, что каждая валютная пара имеет свои характеристики, такие как волатильность, цикличность, корреляция в отношении других финансовых инструментов и т.д. Поэтому в данной торговой системе доступны настройки, позволяющие подобрать оптимальные параметры для определения тренда любого финансового инструмента, а также параметр для работы с цикличностью валютной пары и уровнем рисков в зависимости от волатильности исследуемого инструмента.

Для того, чтобы правильно настроить систему для работы на том или ином финансовом инструменте, необходимо провести оптимизацию указанных параметров. Это необходимо делать тщательно, чтобы не получить нестабильные данные, которые в будущем не позволят прибыльно работать эксперту.

⦿ Пример алгоритма оптимизации:

1. Первоначальная оптимизация параметров системы происходит на промежутке времени, который заканчивает не текущей датой, а более ранним периодом. Например, датой годовой давности.
2. После получения отчета оптимизации с выборкой лучших параметров, необходимо протестировать выбранные значения на промежутке времени, который заканчивается текущей датой.
3. Если прибыльность системы ниже первоначального теста, то такие параметры отбрасываются, если прибыль возросла, то данные параметры считаются оптимальными.
4. Все параметры торговой стратегии должны быть оптимизированы. Мы рекомендуем присылать запросы нашим специалистам на получение оптимальных параметров эксперта для интересующей вас валютной пары.