

Стратегия PrCh/2*Env

Март 2015

Индикатор ценового канала (Price Channel)

Параметр: N – заданное количество свечей перед текущей, включая ее.

$PrCh (High) = \text{Max} (N \text{ свечей});$

$PrCh (Low) = \text{Min} (N \text{ свечей});$

$PrCh (Medium) = [PrCh (High) + PrCh (Low)] / 2;$

При задании сдвига на M свечей: учитываются свечи от M+1 до N+M от текущей (если текущую считать первой)

Индикатор конверт (Envelope)

Параметры: количество периодов (N), тип расчета скользящей средней, отклонение K (в процентах), используемая цена.

$Env (Medium) = EMA_n$

$Env (High) = EMA_n (1 + K/100);$

$Env (Low) = EMA_n (1 - K/100).$

Стратегия с использованием индикаторов PriceChannel и Envelope (условное название PrCh/Env)

Базовый интервал: 5 мин.

Индикаторы: PrCh (48, сдвиг 4); Env1 (SMA(40); K=0,2; Open/Typical),
Env2 (SMA(40); K=0,4; Open/Typical)

Обозначение: P – текущая цена

Параметры: R – ограничение для стопа (рекомендуется 0,5-0,7%)

RI – 500-600 п; GZ – 80 p; SR – 60p; LK – 100p; VB – 20 p.

Основные идеи: ловля колебаний рынка вокруг скользящей средней при
отсутствии направленного движения с закрытием позиции по стопу при выходе
из торгового диапазона.

Перенос позиции через клиринги: да.

Перенос позиции через ночь: нет.

Стратегия с использованием индикаторов PriceChannel и Envelope (условное название PrCh/Env)

Позиции не могут открываться и быть открыты, если

Цена закрытия свечи $> \text{PrCh (High)}$

или Цена закрытия свечи $< \text{PrCh (Low)}$

Позиции вновь могут открываться, если текущая цена пересекает значение PrCh (Medium)

Открытие позиции Long, если $P \leq \text{Env 1 (Low)}$

Заккрытие позиции : Env2 (High)

При частичном закрытии переоткрытие позиции Long, если снова $P \leq \text{Env1 (Low)}$

Стоп: уровень $\text{PrCh (Low)} - 200\text{п}$ или закрытие свечи ниже PrCh (Low) с соблюдением ограничения R на размер стопа

Открытие позиции Short, если $P \geq \text{Env1 (High)}$

Заккрытие позиции в диапазоне: Env2 (Low)

При частичном закрытии переоткрытие позиции Short, если снова $P \geq \text{Env1 (High)}$

Стоп: уровень $\text{PrCh (High)} + 200\text{п}$ или закрытие свечи выше PrCh (High) с соблюдением ограничения R на размер стопа

Использование индикатора Average True Range (ATR) для определения параметров стратегии

Базовый интервал: 5 мин.

Индикатор: ATR (1000) – средний размер свечи 5-мин. примерно за 1 неделю торгового времени.

Размер SL = $ATR(1000) * 2$.

$D = ATR(1000) / Price$, Price – текущая цена инструмента.

Ширина бОльшего конверта = $D * 1.5$

Ширина меньшего конверта = $D * 0.75$ (вариант: D)