

Шлюзовой высокоскоростной скальпер

FinLancer

Руководство пользователя

Санкт-Петербург

2012 год

Оглавление

Введение 3
1. Настройка торгового робота FinLancer 4
   1.1. Клиентские настройки 4
   1.2. Настройка инструментов 6
2. Торговля роботом FinLancer 8
   2.1. Запуск в торговлю 8
   2.2. Торговая стратегия 9
3. Контакты 10
4. Лицензионное соглашение 11

Введение

Шлюзовой торговый робот **FinLancer** разработан для скальперской торговли высоколиквидными активами и подключается к высокоскоростному шлюзу Plaza II. В роботе **FinLancer** применяется стаканный и импульсный скальпинг. Скорость реагирования на ценовой импульс 100-200 миллисекунд, но не более 500 миллисекунд.

Суть стаканного скальпинга заключается в нахождении дисбаланса между объемами предложения и объемами спроса, который может привести к направленному (пусть и незначительному) движению цены в более слабую по объемам сторону.

При импульсном скальпинге позиция открывается в сторону сильного ценового импульса на рынке. Общее в стаканном и импульсном скальпинге - это быстрое реагирование на направленное ценовое движение: быстрое открытие позиции и быстрое закрытие при достижении, как правило, небольшого профита или закрытие по стопу.
Продолжительность одной сделки, в среднем, чуть менее 1 минуты. Количество сделок за сессию может исчисляться сотнями.
Когда начинается импульсное ценовое движение на рынке, то открыться руками по хорошей цене, как правило, нереальная задача. Робот **FinLancer** сможет это сделать существенно лучше и быстрее. Такое преимущество робот **FinLancer** получает за счет того, что находится на биржевом шлюзе и получает котировки цен существенно быстрее, чем другие пользователи, работающие на Quik-е.

Сильные ценовые импульсные движения обычно происходят: после преодоления ценой важных уровней сопротивления или поддержки, после выхода важной экономической статистики, если происходят важные события, после открытия зарубежных рынков и во многих других случаях.

Отслеживать момент начала импульсного движения вручную крайне трудно, а для робота это обычная задача, как только складываются условия, он моментально входит в позицию.

Трейдер может самостоятельно регулировать силу импульса и дисбаланс объема, при которых робот будет реагировать, - открывать позицию.

В роботе **FinLancer** есть контроль рисков, который оградит ваш капитал от чрезмерных потерь.

Функциональные возможности:

- Торговать фьючерсами и акциями;
- Отслеживать и входить в импульсное движение на основании динамики цены и объемов;
- Выбирать направление торговли: Long, Short, Long/Short;
- Ограничивать потери и фиксировать прибыль на заданном уровне (в пунктах), используя: стоп, профит

- Сохранять бумажную прибыль;
- Управлять реагированием на размер импульсных ценовых движений на рынке;
- Вести статистику по сделкам: Прибыль/Убыток;
- Контролировать риски на капитал.

Торговый робот **FinLancer** прошел полное комплексное тестирование и хорошо зарекомендовал себя среди трейдеров компании ИТТ и наших коллег.

1. Настройка торгового робота FinLancer

1.1. Клиентские настройки

После оплаты в вашем личном кабинете появиться архив с торговым роботом **FinLancer** (сокращенно – FL). Скачайте пакет и разархивируйте его в удобном для вас месте.

Установите робота себе на компьютер, запустив установочный файл FinLancer.exe. В некоторых случаях, если робот не запускается, а появляется окно с ошибкой, то это означает, что на вашем компьютере не установлена библиотека поддержки framework 3.5. Для устранения данной проблемы, перейдите по ссылке: http://www.microsoft.com/downloads/ru-ru/details.aspx?FamilyID=333325FD-AE52-4E35-B531-508D977D32A6 скачайте и установите пакет dotnetfx.exe

Перед запуском робота убедитесь, что у вас настроено шлюзовое соединение с **Plaza 2.** Для настройки шлюза обращайтесь к своему брокеру. У каждого брокера есть своя специфика предоставления и настройки шлюза.

При запуске робота откроется главное окно (Рис. 1.1.1)

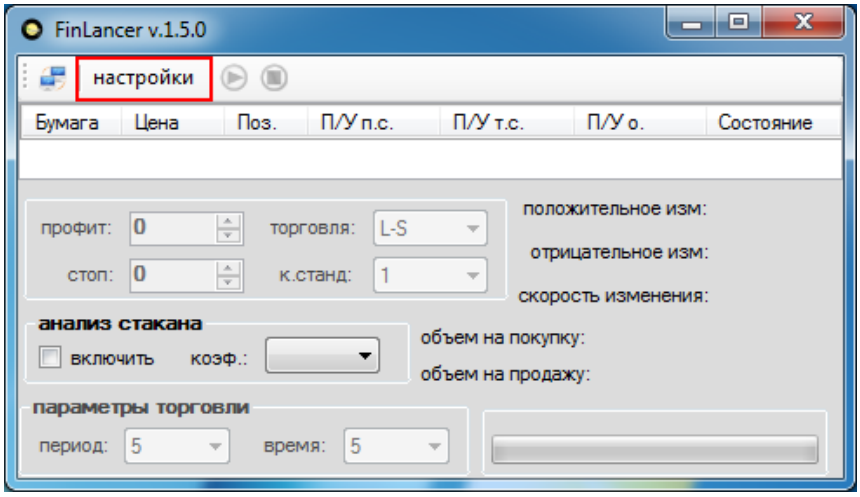


Рис. 1.1.1

Переходим к настройке робота. Нажимаем «настройки» в панели управления роботом. Перед нами открывается окно с настройками. Необходимо его заполнить поэтапно (Рис. 1.1.2).

Пользователь может по своему усмотрению добавлять [+], удалять [-] или изменять [^] инструменты. При добавлении или изменении инструмента открывается окно с настройками, которое дублирует торговые параметры (Рис. 1.1.3).

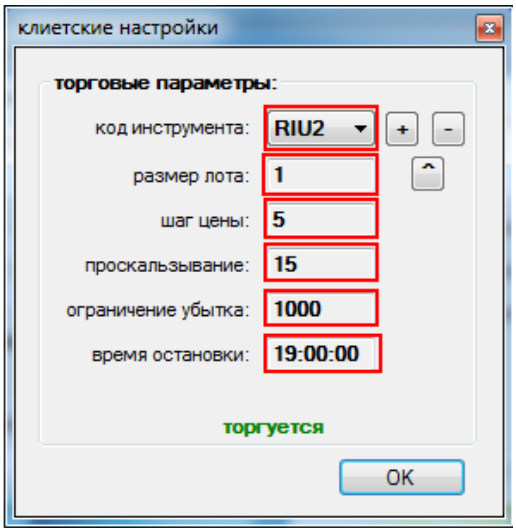


Рис. 1.1.2

Код инструмента: указывается код инструмента, который соответствует инструменту, вашего шлюза. Код инструмента у разных брокеров отображается по-разному, например, в сокращенном варианте **RIU1**, или в полном **RTS-9.12**.

Шаг цены: здесь указывается шаг цены данного фьючерса. Шаг цены у каждого инструмента свой, он указывается в Текущей таблице параметров в Quik-е.

ВАЖНО! Шаг цены может изменяться, например, у фьючерса РТС в сентябре 2012 года шаг цены был изменен с 5 до 10 пунктов.

Размер лота: необходимо указать количество контрактов, которым будет торговать робот.

Проскальзывание: данный параметр отвечает за гарантированное исполнение заявок. Проскальзывание указывается в пунктах. Чем больше проскальзывание, тем выше вероятность, что ваша заявка будет исполнена. Данный параметр устанавливается для каждого инструмента в отдельности.

Ограничение убытка (в пунктах): пользователь может ограничить убыток на торгуемый инструмент. При достижении заданного уровня убытка, робот автоматически закроет все позиции и остановит торговлю по инструменту.

В торговлю: отмечаем галочкой только те инструменты, по которым собираемся запускать робота. Отмеченные инструменты отображаются в клиентских настройках зеленым словом **“торгуется”** иначе **”не торгуется”**.

Время остановки: данный параметр указывает, в какое время робот остановит торговлю и закроет позицию по инструменту.

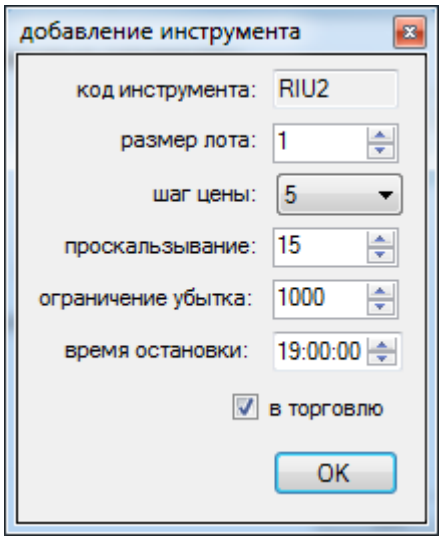


Рис. 1.1.3

ВАЖНО! Данная версия робота поддерживает только работу одного инструмента. Это связано с тем, что дополнительное добавление инструментов может сильно сказаться на скорости отправления заявок на шлюз.

1.2. Настройка инструментов

Для запуска робота нужно нажать на кнопку подключения к торговому терминалу (Рис. 1.2.1)



Рис. 1.2.1

Если настройка робота выполнена правильно, то робот отобразит в своей таблице ранее выбранные вами инструменты (Рис. 1.2.2).

На рисунке 1.2.2 видно, что робот настроен на торговлю фьючерсом на индекс РТС.

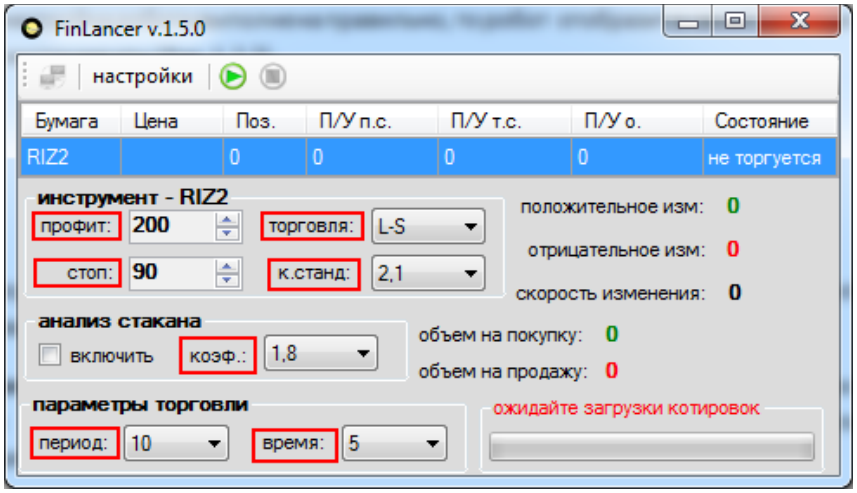


Рис. 1.2.2

Профит: задается в пунктах. Указывает на сколько пунктов выше или ниже цены открытия позиции (зависит от направления торговли) будет выставлена заявка на закрытие позиции в прибыль. Справка: ориентировочно значение профита должно быть в 2-3 раза больше чем значение стопа.

Стоп: задается в пунктах. Указывает на сколько пунктов выше или ниже цены открытия позиции (зависит от направления торговли) будет выставлена первоначальная стоп - заявка. Справка: ориентировочно значение стопа не ниже: Фьючерс РТС – 100-200, Фьючерс Сбербанка – 5-10, Фьючерс доллар-рубль – 50-100.

Торговля: выбор направления торговли: Лонг, Шорт, или универсальный Лонг/Шорт. Также пользователю доступно открытие реверсивных позиций. Реверс означает, что при сигнале робота на открытие Лонг будет открыт Шорт, при сигнале на Шорт, будет открыт Лонг.

К.станд: это первый фильтр (ценовой коэффициент), с помощью которого можно управлять чувствительностью реагирования робота на импульсные ценовые движения для заданного количества свечей. Чем меньше этот показатель, тем на меньший импульс будет реагировать робот, чем больше этот показатель, тем больше требуется импульс, чтобы робот открыл позицию. Справка: ориентировочно устанавливается не ниже значения 1,5.

Коэф.: это второй подключаемый фильтр (коэффициент объема стакана), с помощью него можно управлять чувствительностью и частотой реагирования робота на импульсные ценовые движения. Для открытия длинной позиции, нужно чтобы объем заявок на покупку был в коэф. раз больше, чем объем заявок на продажу и, наоборот, для открытия короткой позиции, нужно чтобы объем заявок на продажу был в коэф. раз больше, чем объем заявок на покупку.

Период: данный параметр указывает, какое кол-во свечей заданного таймфрейма, используется для анализа ценовой динамики и объемов в роботе.

Время: задается в секундах. Это таймфрейм для одной свечи, минимальное возможное значение - 5 сек. Робот у себя в памяти выстраивает свечи заданного таймфрейма, затем по данным свечам анализирует цену на предмет появление импульсного движения по заданным критериям.

Описание табличных значений (Рис. 1.2.2):

Бумага: код торгуемого инструмента.

Цена: текущая цена на рынке по данному инструменту.

Поз.: количество открытых контрактов.

П/У п.с.: указывается в пунктах. Подсчитывает прибыль/убыток по инструменту от предыдущей сделки.

П/У т.с.: указывается в пунктах. Подсчитывает прибыль/убыток по инструменту от текущей сделки.

П/У о.: указывается в пунктах. Подсчитывает прибыль/убыток по инструменту по всем сделкам

Состояние: параметр отображает текущее состояние по инструменту «не торгуется» – торговля по инструменту не ведется, «остановлен» – торговля по инструменту была приостановлена вручную, «ожид. Импульса» – система в ожидании входа в позицию, «лонг/шорт» – по инструменту открыта длинная или короткая позиция, «пауза» – отслеживание по инструменту приостановлено на 1 минуту.

2. Торговля роботом FinLancer

2.1. Запуск в торговлю

После того, как все настройки FL проведены, можно запускать его в торговлю. Необходимо учесть, что перед запуском инструмента в торговлю **котировки должны быть полностью загружены** (Рис. 2.1.1), индикатор должен быть полностью зеленым и иметь статус - Котировки загружены. Необходимо дождаться загрузки котировок и только после этого приступать к торговле.

Чтобы начать торговать инструментом, необходимо выделить его в таблице левой кнопкой мыши и нажать на кнопку запуска  (Рис. 2.1.1).

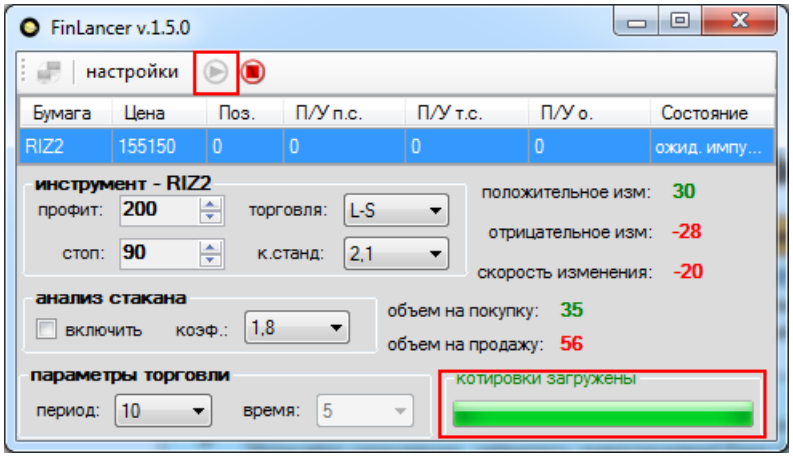


Рис. 2.1.1

В графе состояние инструмента сразу отобразится **«ожид. Импульса»,** а красная кнопка остановки торговли станет активной (Рис. 2.1.1).

Красной кнопкой можно остановить торговлю по инструменту, если в момент нажатия кнопки была открыта позиция, робот закроет ее по рыночной цене.

После закрытия позиции (по стопу или по профиту) торговый робот переходит в режим паузы, об этом свидетельствует его состояние. Пауза длится в течение 1 минуты. Это позволяет роботу пропускать хаотичное движение рынка при резких движениях цены вверх и вниз.

ВАЖНО! В связи с тем, что торговый робот анализирует таблицу всех сделок, а количество сделок за день по ликвидному инструменту достигает почти 1 млн., торговому роботу требуется определенное время, чтобы загрузить котировки и проанализировать все сделки. Иногда требуется от 5 до 10 минут на анализ (все зависит от производительности вашего ПК).

2.2. Торговая стратегия

Теперь необходимо обратиться к самому торговому алгоритму, который заложен в роботе, потому что без понимания того, как работает робот, невозможно научиться правильно им управлять.

Торговый робот FinLancer отслеживает динамику цен за определенный промежуток времени. Промежуток времени выбирается параметром **«период»,** а таймфрейм одной свечи задается параметром **«время».** При открытии позиции Лонг/Шорт торговый робот сравнивает значение текущей свечи с расчетными значениями предыдущих свечей за настроенный период и время.

В качестве расчетных значений предыдущих свечей выступают два параметра: **«положительное изм.»** и **«отрицательное изм.» -** они выводятся в интерфейс робота. Как же они рассчитываются?

Например, мы задали роботу анализировать 10 предыдущих пятисекундных свечей, в свою очередь он начинает подсчет тела (цена открытия - цена закрытия) каждой свечи. К примеру, в итоге мы получим следующий ряд: +5 -10 +8 +20 -4 -7 -2 +4 -9 -12. Т.е. по каждой свече мы видим, на какое кол-во пунктов изменилась цена, либо в положительном, либо в отрицательном направлении. Общее положительное движение составило +37 пунктов из 4-х свечей, общее отрицательное движение составило -47 пункта из 6-и свечей. Теперь подсчитаем среднее значения:

1. Положительное изм. = +37/4 = 9.25
2. Отрицательное изм. = -47/6 = -7.83

По сути, параметры: «положительное изм.» и «отрицательное изм.» являются скоростью цены.

Значение текущей свечи рассчитывается так же, как и предыдущие параметры, (цена открытия - цена закрытия) и тоже выводится в интерфейс робота и называется **«скорость изменения».**

Как было сказано выше, робот сравнивает расчетные значения предыдущих свечей с текущей свечой или другими словами текущую скорость цены с расчетной или средней скоростью за заданный «период» и «время».

Теперь опишем правила на вход в позицию:

1. Если **«скорость изменения»** >0 и **«скорость изменения»** > **«положит. Изм»** * **«к. станд»**, то робот откроет позицию Лонг.
2. Если **«скорость изменения»** <0 и **«скорость изменения»** < **«отриц. Изм»** * **«к. станд»**, то робот откроет позицию Шорт.

Выше были представлены правила входа в позицию без подключения анализа стакана. Анализ стакана представляет собой сравнение **объемов заявок на покупку** и **объемов заявок на продажу**.

Если у вас включен анализ стакана, то помимо указанных условий добавляется еще одно:

1. Для открытия позиции Лонг
   объем заявок на покупку > **объем заявок на продажу** * **«коэф.»**

2. Для открытия позиции Шорт
   объем заявок на продажу > **объем заявок на покупку** * **«коэф.»**

Благодаря скорости передачи заявок и анализу малых тайм фреймов торговый робот FinLancer не выставляет защитных приказов, т.к. он принимает решение о закрытии позиции моментально.

Выход из позиции осуществляется по заданному стопу или профиту или при достижении потерь или прибыли, указанного в роботе уровня.

Общие правила для использования робота FL:

1) Останавливать торговлю, если робот заработал заданную прибыль.
2) Не торговать больше роботом в тот день, когда он вышел на установленный размер потерь.

ВАЖНО! Робот FinLancer является достаточно сложным в освоении и настройках, так как рассчитан на опытных трейдеров.

3. Контакты

Служба технической поддержки: soft@i-tt.ru

Отдел продаж: Тел.: 8 904 631-8000, help@i-tt.ru

Желаем приятной работы!
ООО "Инвестиционные Торговые Технологии".
Россия, Санкт-Петербург

4. Лицензионное соглашение

На данное руководство пользователя распространяется действие приводимого ниже лицензионного соглашения.

ВАЖНО - ПРОЧТИТЕ ВНИМАТЕЛЬНО

Настоящее лицензионное соглашение (далее "соглашение") является юридическим документом, заключаемым между Вами (физическим или юридическим лицом) и компанией ООО «Инвестиционные торговые технологии» (далее «компания ИТТ»), являющейся производителем и исключительным правообладателем данного программного обеспечения (далее "программа" или "программное обеспечение"), относительно использования прилагаемого программного обеспечения, включающего в себя программное обеспечение, записанное на соответствующих носителях, любые печатные материалы и любую "встроенную" или "электронную" документацию, поставляемую компанией ИТТ. К программному обеспечению относятся также любые обновления и дополнения к программному обеспечению, исходно предоставленному компанией ИТТ.

Устанавливая, копируя, загружая, осуществляя доступ или иным образом используя указанную программу, материалы или документацию, Вы, тем самым, принимаете на себя условия настоящего соглашения.

Если Вы не согласны с условиями настоящего лицензионного соглашения, Вы не имеете права устанавливать или использовать данное программное обеспечение; верните его продавцу и получите обратно уплаченные деньги.

ЛИЦЕНЗИЯ НА ПРОГРАММУ

Программа защищена законами и международными соглашениями об авторских правах, а также другими законами и договорами, регулирующими отношения авторского права. Данная программа лицензируется, а не продается.

1. ЛИЦЕНЗИЯ

Компания ИТТ предоставляет Вам следующие права при условии соблюдения Вами всех положений и условий настоящего соглашения:

* Установка и использование. Разрешается установить и использовать одну копию программного обеспечения на одном компьютере, в качестве которого может выступать рабочая станция, терминал или любое другое цифровое электронное устройство (далее "компьютер").

2. ПРОЧИЕ ПРАВА И ОГРАНИЧЕНИЯ

* Запрет на публикацию сведений, предоставляемых программой. Запрещается публиковать на регулярной основе информацию на любых носителях, полученную при использовании программы без разрешения компании ИТТ.

* Запрет на вскрытие технологии, декомпиляцию и модификацию. Вам не разрешается изменять, декомпилировать, дезассемблировать, дешифровать и производить иные действия с объектным кодом программного обеспечения, имеющие целью получение информации о реализации алгоритмов, используемых в программном обеспечении, без письменного согласия на то компании ИТТ. Вы не имеете права каким-либо образом модифицировать механизм внутренней защиты программы за исключением случаев и только в той степени, когда такие действия явно разрешены действующим законодательством. Запрещается также любая модификация материалов, документации и исполняемых файлов программы без согласия компании ИТТ. Копирование и использование такого программного обеспечения, является незаконным и влечет ответственность в соответствии с законами государства, где такое копирование или использование имеют место.

* Разделение программы. Программа лицензируется как единое изделие. Запрещается отделять от нее составляющие ее части для раздельного использования на нескольких компьютерах.

* Временное пользование. Запрещается предоставлять программу во временное пользование.

* Товарные знаки. Настоящее лицензионное соглашение не предоставляет Вам никаких прав в отношении каких-либо товарных знаков или названий, принадлежащих компании ИТТ.

* Техническая поддержка. Компания ИТТ может оказывать в услуге по технической поддержке программы (далее "техническая поддержка").

* Конфиденциальность. Вы соглашаетесь с тем, что полученные от Вас в процессе регистрации данные, а также информация, сообщенная при обращении в Службу технической поддержки, могут быть использованы компанией ИТТ по ее усмотрению исключительно для внутренних нужд. Компания ИТТ гарантирует конфиденциальность полученной информации и ее недоступность третьим лицам, не являющимся сотрудниками компании ИТТ.

* Расторжение соглашения. Без ущерба для каких-либо иных прав компания ИТТ вправе прекратить действие настоящего соглашения при несоблюдении Вами его положений и условий. В этом случае Вы обязаны уничтожить все имеющиеся у Вас копии программного продукта и его составных частей.

3. ОБНОВЛЕНИЯ

Чтобы воспользоваться программным продуктом, который является обновлением, необходимо иметь лицензию на данную программу.

4. АВТОРСКОЕ ПРАВО

Все права собственности и авторские права на программу, содержание сопровождающих ее печатных материалов и любые копии программы принадлежат компании ИТТ и ее представителям. Все права собственности и авторские права на содержательную часть и в отношении ее, доступ к которой предоставляет программа, принадлежат владельцу авторских прав на данную содержательную часть и защищены законами и международными соглашениями

об авторских правах. Настоящее соглашение не предоставляет Вам никаких прав на доступ к содержательной части. Все права, не предоставленные явно настоящим соглашением, сохраняются за компанией ИТТ.

5. ОТВЕТСТВЕННОСТЬ

Данная программа имеет информационное назначение и не является предложением проводить операции на рынке ценных бумаг. Информация, в ней содержащаяся, не может рассматриваться, как предложение о покупке или продаже ценных бумаг. Мы не утверждаем, что вся приводимая программой или документацией информация абсолютно точна.

Необходимо помнить, что любые инвестиции, предлагаемые в программе, могут быть связаны со значительными рисками и, следовательно, привести к убыткам.

Ни компания ИТТ, ни кто-либо из ее представителей или сотрудников не несет ответственности за возможный ущерб, нанесенный Вам в результате использования или невозможности использования данного программного обеспечения, а также в результате проведения операций с ценными бумагами, совершенных с использованием информации, содержащейся в программе. Любое лицо, юридическое или физическое, использующее данное программное обеспечение, понимает, что несет полную ответственность за возможные негативные последствия, вызванные несовместимостью или конфликтами программы с другими программными продуктами, установленными на компьютере этого лица.

Данное программное обеспечение не предназначено и не может быть использовано в информационных системах, работающих в опасных средах либо обслуживающих системы жизнеобеспечения, в которых сбой в работе программного обеспечения может создать угрозу жизни людей или повлечь большие материальные убытки. Принимая условия данного Договора, Вы соглашаетесь, что размер ответственности компании ИТТ за возможные последствия, вызванные использованием либо невозможностью использования программного обеспечения, ни при каких обстоятельствах не будет превышать суммы, заплаченной Вами при приобретении права на использование данного программного обеспечения.