

Автостоп: тейк-профит и стоп-лимит (ММВБ/ФОРТС)

Инструкция

Екатеринбург
2012 год

СОДЕРЖАНИЕ

1. Назначение 4
Подготовка к первому запуску торгового робота 4
2. Отображение робота 6
3. Использование программы 7
3.1. Загрузка программы 7
3.2. Настройка параметров 9
3.3. Запуск робота 10
3.4. Функции, доступные в таблице 11
3.5. Удаление утилиты из Quik. 11
4. Совместное использование нескольких роботов 12
5. ЛИЦЕНЗИОННОЕ СОГЛАШЕНИЕ 13
6. КОНТАКТЫ 16

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

1. Назначение

Данное приложение предназначено для автоматического выставления тейк-профита, стоп-лимит или стоп-лимит и тейк-профит на текущую позицию. Программа сама определяет направление и размер позиции и выставляет заданные стоп-заявки, с параметрами определяемыми пользователем. Параметры, которые можно настраивать – цена активации тейк-профит, отступ и защитный спрэд. Отступ, защитный спрэд, цена активации можно выставлять как в процентах, так и в пунктах, для цены активации в Quik не предусмотрено возможность выставлять в процентах от цены сделки, в программе Avtosop_TP_SL данная возможность реализована.

Программа выставляет только один тейк-профит, либо стоп-лимит, либо одновременно может выставлять и тейк-профит и стоп-лимит, т.е. если произошло изменение позиции, то в автоматическом режиме снимается предыдущая стоп-заявка, выставленная программой, и выставляется новая на всю позицию от цены последней сделки, по данному инструменту.

Преимущества:

1. Автоматическое выставление тейк-профит, стоп-лимит или стоп-лимит и тейк-профит;
2. Позволяет выставить тейк-профит или стоп-лимит по исполнению своего стоп-приказа. Данная потребность может возникнуть когда нет возможности весь день провести перед терминалом (необходимо срочно куда-то уехать, семейные дела) находясь в текущий момент в позиции с выставленным тейк-профит, после срабатывания которого позиция может иметь противоположное направление и требуется выставить новый тейк-профит по исполнению стоп-приказа (в Quik такая возможность отсутствует);
3. Уменьшение затрат времени на выставление тейк-профит, по сравнении с ручным выставлением;
4. Работа сразу с несколькими инструментами;
5. Выставление стопа в пунктах и в процентах;
6. возможность выставлять цену активации в процентах от цены сделки, в программе.

Подготовка к первому запуску торгового робота

В программе Quik зайдите в пункт меню **Связь/Списки** выберите класс бумаги и в правой части окна уберите галочки напротив фильтра параметров (рис.1.1 – Фильтр параметров). После выполнения всех вышеперечисленных операций нажимаем «да». Если у Вас в настройках было получение данных по открытым таблицам, то программа выдаст запрос, отвечаем да.

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

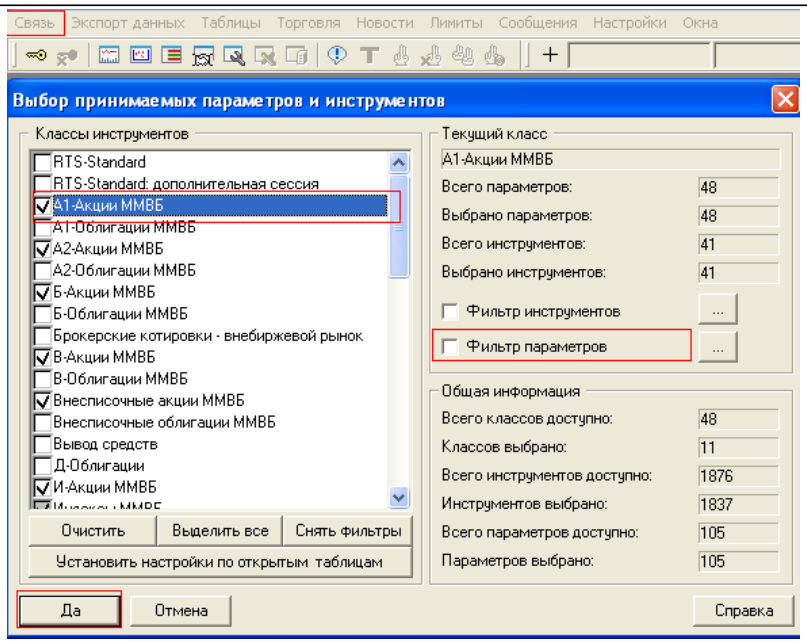


Рис.1.1 – Фильтр параметров

Для изменения настраиваемых параметров в программе, необходимо полученный от разработчиков файл в формате .qpl, открыть с помощью блокнота и изменить заложенные в программу данные по умолчанию на свои значения.

В данной программе реализованы и настраиваемы следующие переменные (все настройки производятся в разделе программы «Пользовательские настройки» – рис. 1.2):

Торговый счет и инструмент

Rowname – торговый счет фортс

Depo - счет депо

ClassCode – код класса торговой площадки, (можно посмотреть в таблице текущих параметров Quik)

Instrument – код бумаги, по которой будет вестись торговля, (можно посмотреть в таблице текущих параметров Quik)

Общие настройки

VID – выбор автостопа: SL - стоп-лимит, TP - тейк-профит, TS - стоп-лимит и тейк-профит

Настройки стоп-лимит

SPRED - защитный спред в стоп-зяавке (Цена)

Otstup - величина отступа для активации стоп-лимит

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

Настройки тейк-профит

otstup2 - величина отступа от min/max в тейк-профите

spred2 - величина защитного спреда в тейк-профите

P_A - величина, на которую выставляется тейк-профит от последней сделки по нужному инструменту Price_activation, цена активации тейк-профита

ed - единица измерения otstup2 и spred2: 1 - валюта, 0 - проценты

ВАЖНО!!! При изменении настраиваемых параметров все значения должны быть обязательно в кавычках. Выставлять отступ необходимо кратно минимальному шагу цены.

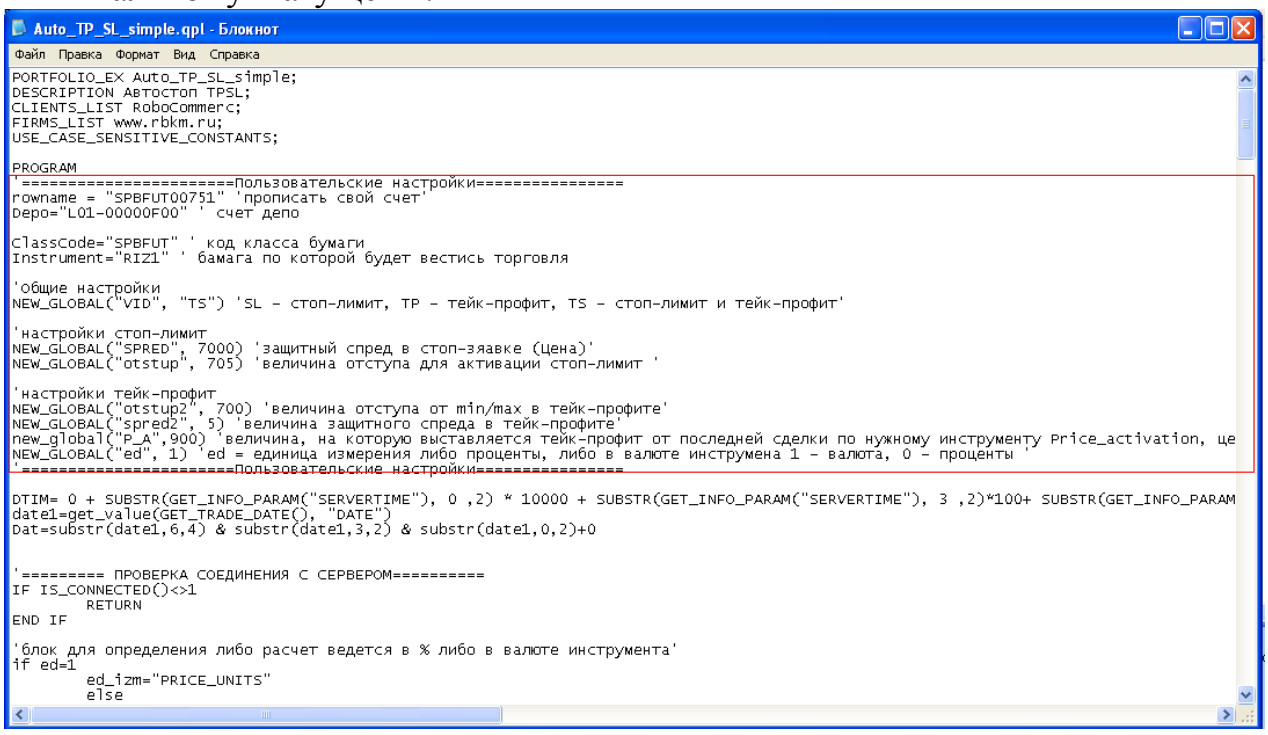


Рис.1.2 – «Пользовательские настройки»

Внимание! Робот работает только тогда, когда Ваш торговый терминал запущен и подключен к серверу брокера.

2. Отображение робота

Позиции в лонге подсвечиваются зеленым, в шорте – красным, вне позиции остается белым (рис. 2.1). Отображаемые значения:

poz – текущая позиция по инструменту;

Цена последней покупки – цена, по которой была совершена последняя покупка;

Цена последней продажи – цена, по которой была совершена последняя продажи.

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

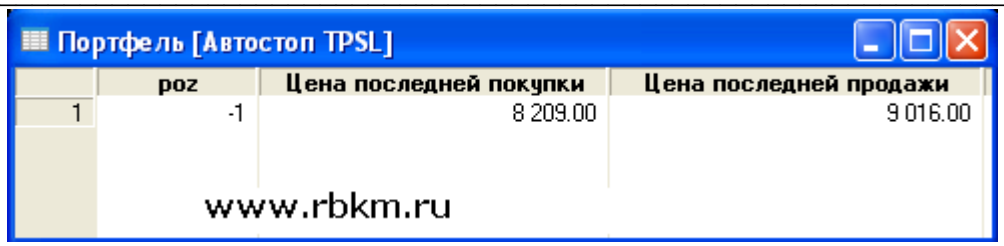


Рис.2.1 - Таблица робота в Quik

3. Использование программы

3.1. Загрузка программы

Загрузка программы выполняется выбором пункта меню программы **Таблицы/Портфели/Задать портфель**, или нажатием клавиш «Ctrl»+«F10» (рис. 3.1).

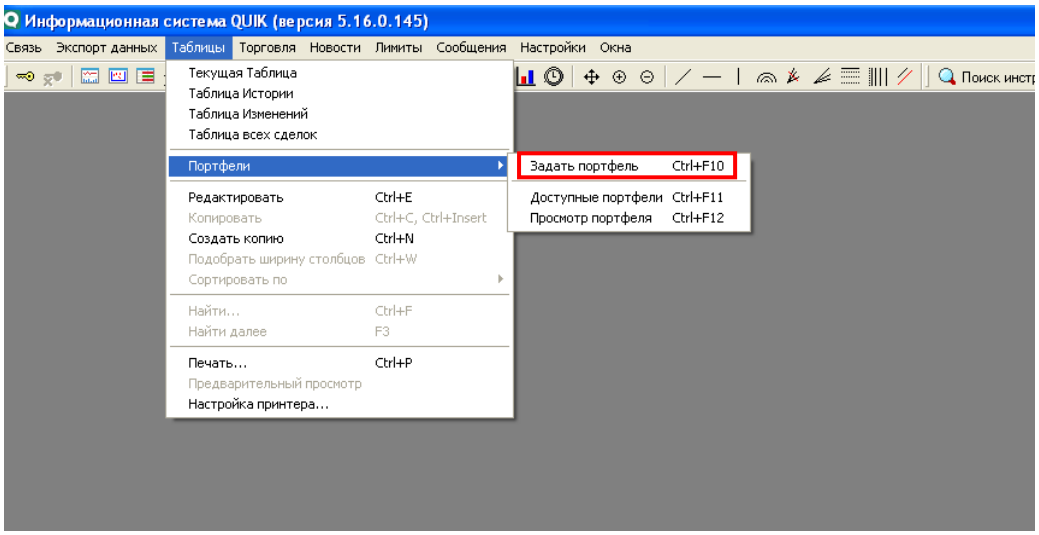


Рис.3.1 – Задать портфель

В появившемся окне, выберите загружаемый файл (рис. 3.2). Файлы имеют стандартные расширения «.qpl». После выбора нужного портфеля нажимаем открыть.

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

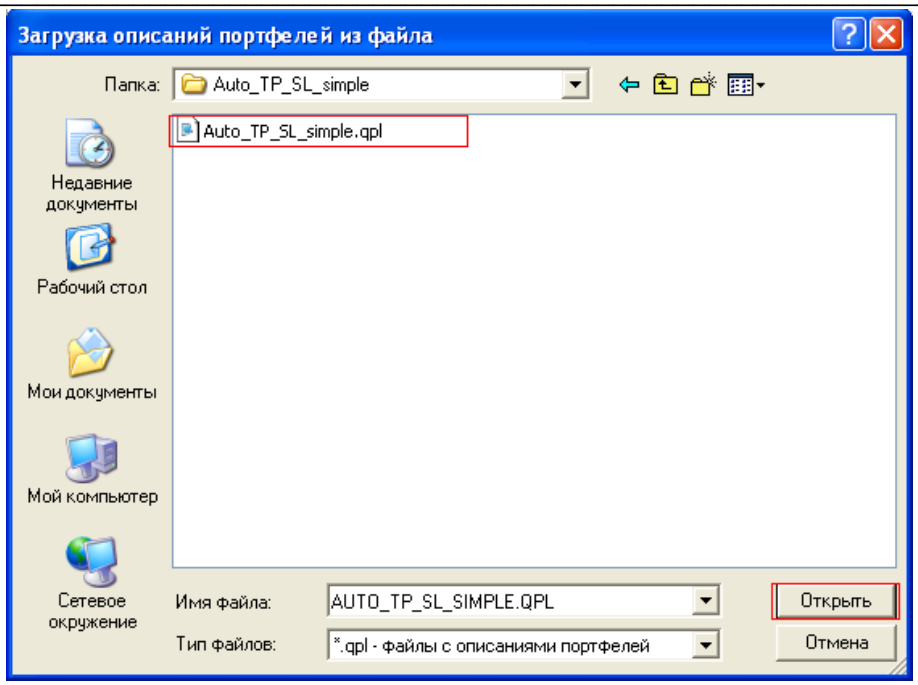


Рис. 3.2 – Окно загрузки программы в Quik

Название торгового робота появится в списке «Доступные портфели». Выбираем нужный портфель, нажимаем загрузить локально. Далее в «Окне сообщений» Quik проинформирует о том, что портфель успешно задан, закрываем появившееся окно и нажимаем выход (Рис. 3.3).

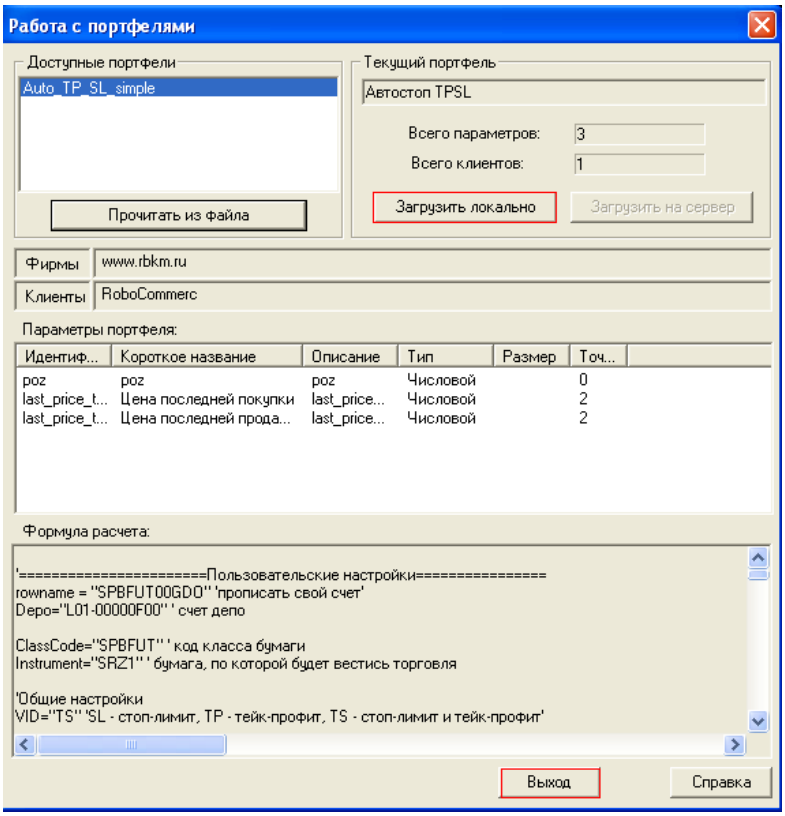


Рис. 3.3 – Окно «Работа с портфелями»

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

3.2. Настройка параметров

Этот этап определяет список обрабатываемых программ и определяет периодичность вычислений. Если программы были загружены локально, то они автоматически помечаются выбранными.

Выбор доступных программ можно сделать с помощью пункта меню Quik **Таблицы/Портфели/Доступные портфели**, или нажатием клавиш «Ctrl»+«F11» (рис. 3.4).

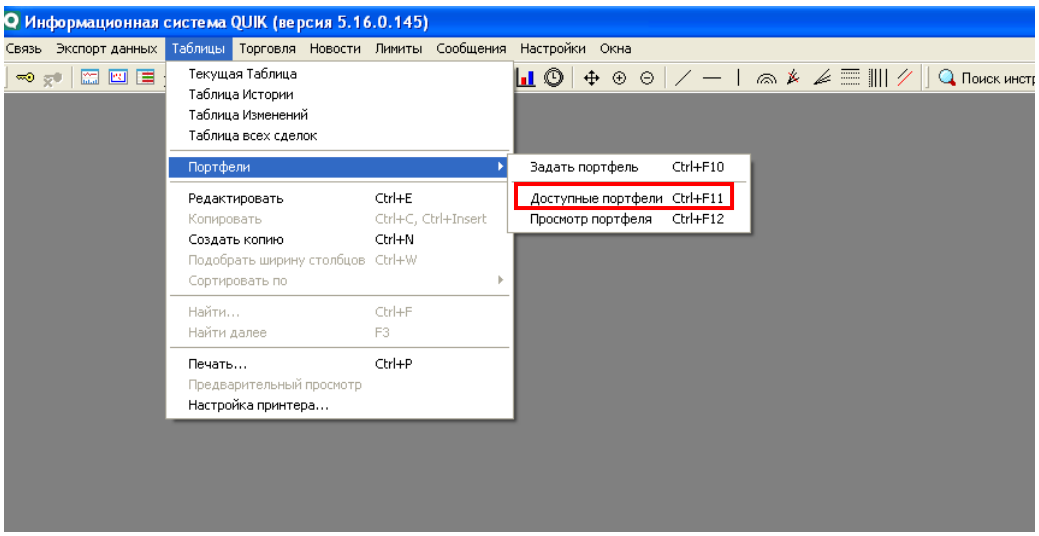


Рис. 3.4 – Доступные портфели

В появившемся окне выбираем портфель «AUTO_TP_SL_SIMPLE». Ставим период расчета равный 1 секунде и нажимаем сохранить (рис. 3.5).

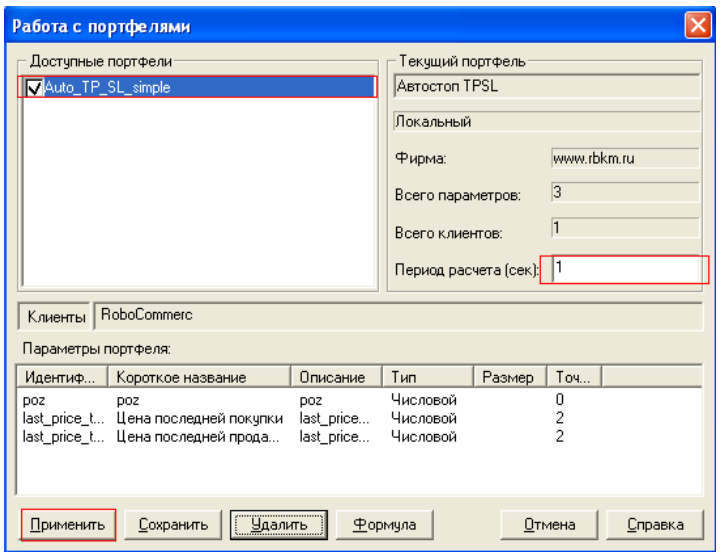


Рис. 3.5 – Окно «Работа с портфелями»

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

3.3. Запуск робота

Последний этап позволит нам запустить нашего робота.

Выбор доступных программ можно сделать с помощью Quik **Таблицы/Портфели/Просмотр портфеля**, или нажатие клавиш «Ctrl»+«F12» (Рис. 3.6).

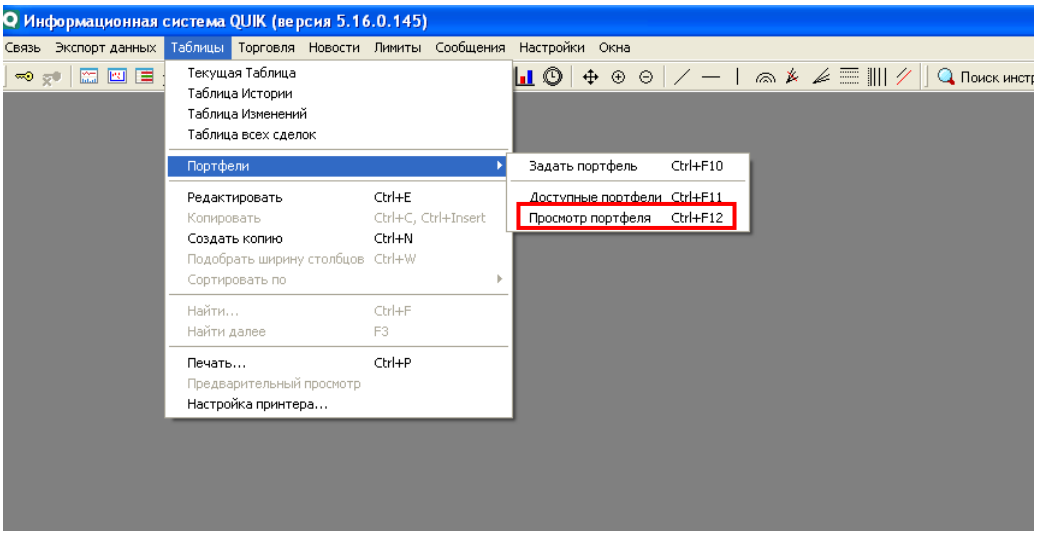


Рис. 3.6 – Просмотр портфеля

В окне «Создать таблицу для расчёта параметров портфеля», выбираем **портфель** «AUTO_TP_SL_SIMPLE», нажимаем кнопку «Добавить все», для отображения параметров на экране, и нажимаем кнопку «Да» (рис. 3.7).

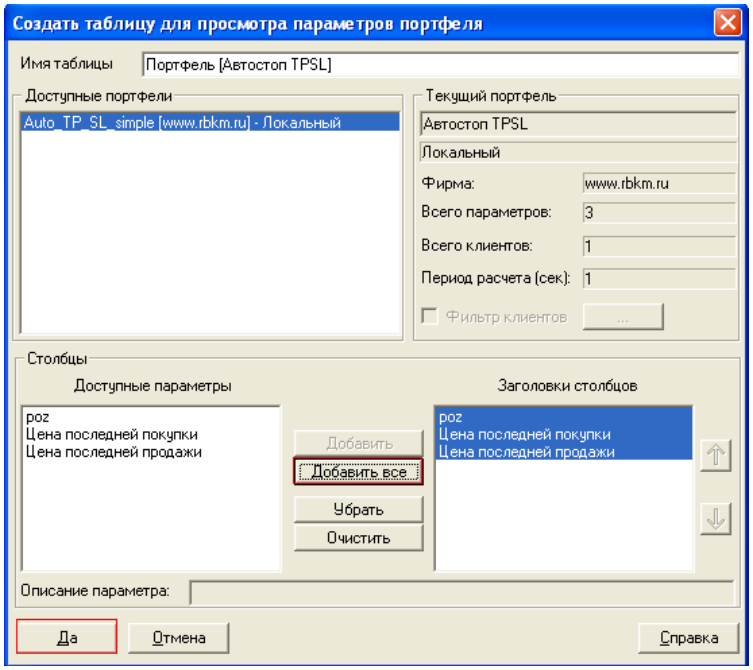


Рис. 3.7 – Окна запуска робота

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

3.4. Функции, доступные в таблице

Данные из таблицы доступны для копирования в Excel, экспорта через DDE-сервер и через ODBC.

Функции, доступные из контекстного меню таблицы (наведите курсор на таблицу и нажмите правую кнопку мыши) (рис. 3.12).

- «Приостановить расчет» – остановить вычисление параметров таблицы (при этом в таблице отображаются последние вычисленные данные);
- «Начать расчет заново» – сбросить все значения и начать расчет заново;
- «Начать расчет в режиме отладки» – сбрасывает все значения, запускает окно отладки и начинает расчет заново;
- «Сохранить описание в файл» – сохранить в текстовый файл программу, описывающую данную таблицу;
- «Посмотреть формулу» – показать в окне код программы данной таблицы;
- «Параметры портфеля» – открыть окно с параметрами программы, в том числе период расчета в секундах.

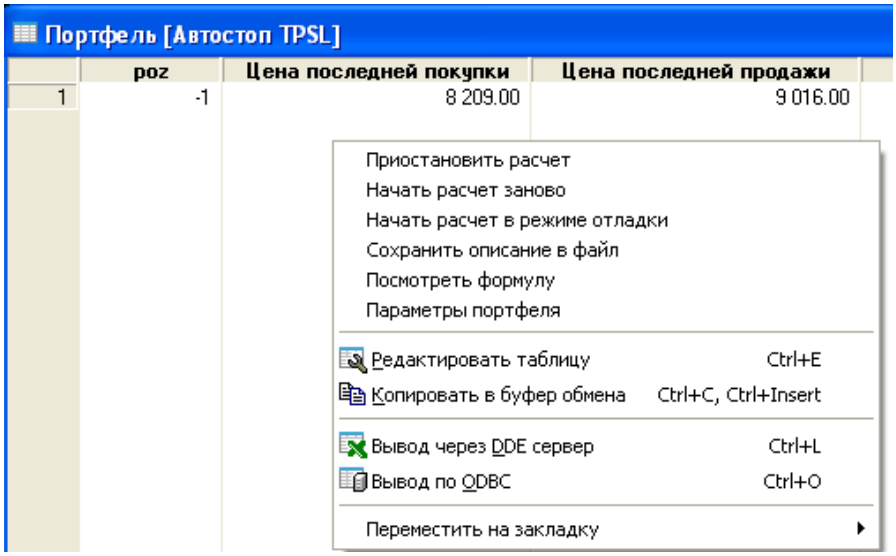


Рис. 3.12 – Меню портфеля

3.5. Удаление утилиты из Quik.

Если Вы захотите по тем или иным причинам удалить уже установленную утилиту из Quik, сделайте следующее:

1. Зайдите в список обрабатываемых программ выбором пункта меню программы Quik **Таблицы/Портфели/Доступные портфели**, или нажатие клавиш «Ctrl»+«F11».

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

2. В окне «Доступные портфели» выберите тот портфель, который хотите удалить.

3. Нажмите кнопку «Удалить», затем кнопку «Применить».

4. Удалите таблицу, созданную утилитой, из окна Quik стандартным способом – нажав крестик в правом - верхнем углу таблицы (рис. 3.13).

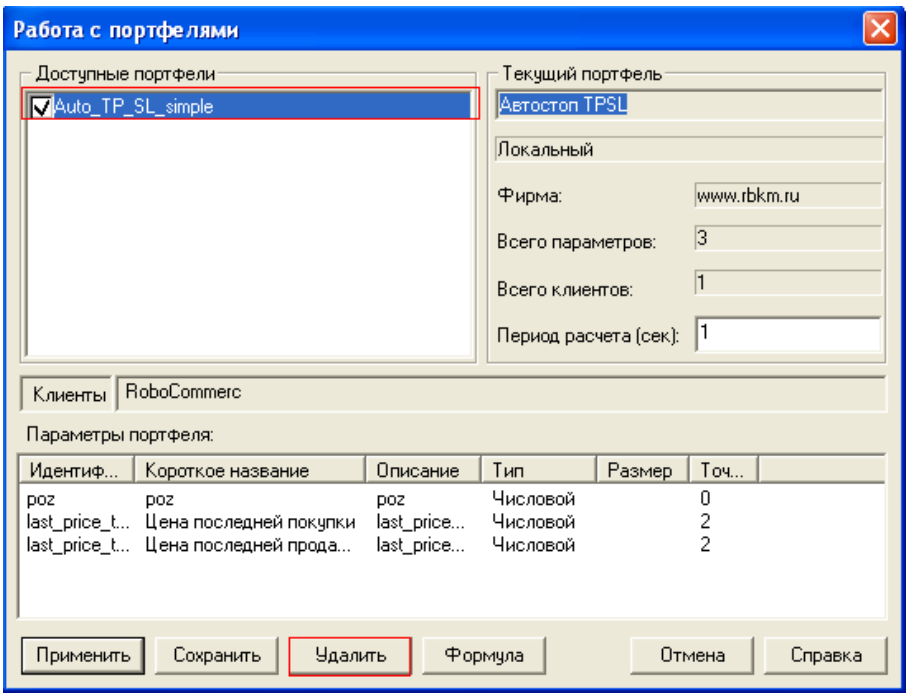


Рис. 3.13 – Удаление портфеля

4. Совместное использование нескольких роботов

Для того чтобы запустить несколько роботов одновременно, необходимо Auto_TP_SL.qpl открыть с помощью блокнота и поменять следующие поля (рис. 4.1):

PORTFOLIO_EX – задать новое название портфеля (например: заменить «AUTO_TP_SL_SIMPLE» на «AUTO_SBER»)

DESCRIPTION – задать новое название портфеля (например: заменить «Автостоп TPSL» на «AUTO_SBER»

После этого сохранить под другим именем с расширением «.qpl».

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

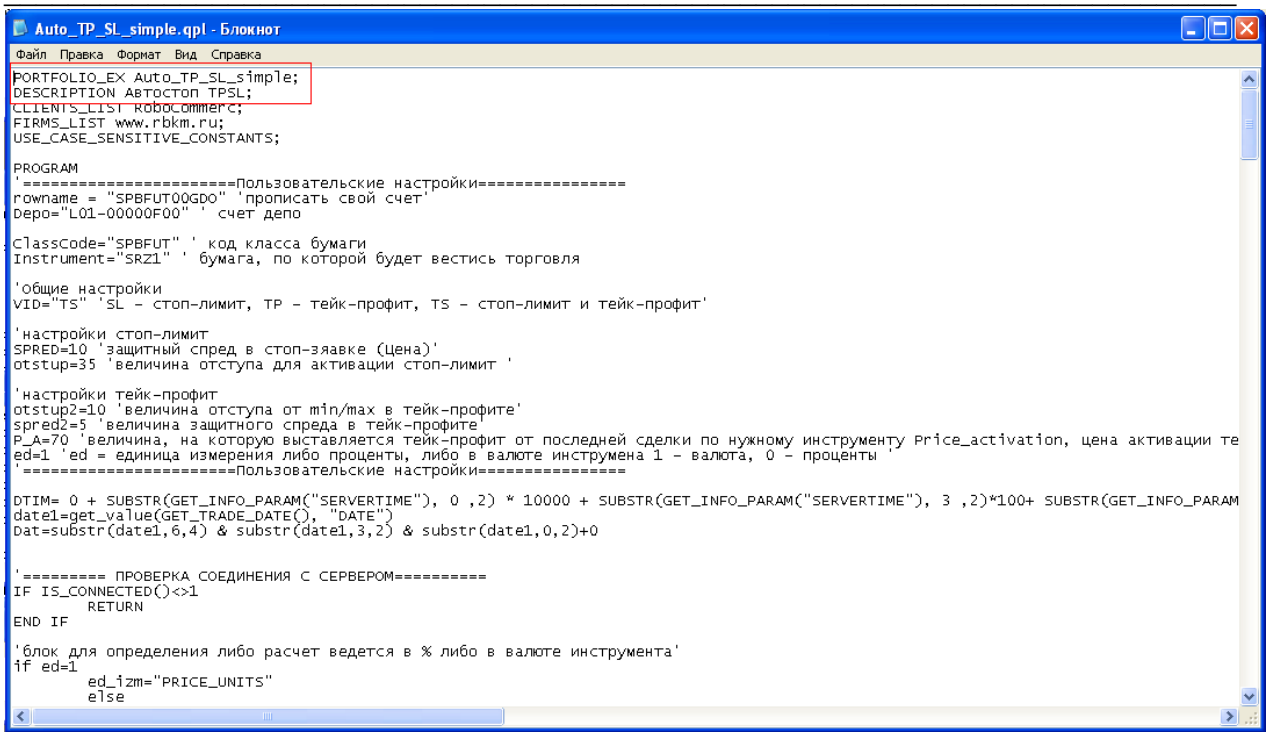


Рис. 4.1 – Код робота через блокнот

После этого проделать идентичную процедуру, что и для первого робота, но в идентификаторах на новых графиках и индикаторах ставить уже новые идентификаторы, указанные в коде программы.

5. 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 Финансовая компания «РобоКоммерцъ» (далее ООО «РобоКоммерцъ»), 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 ООО «РобоКоммерцъ». К программному обеспечению относятся также любые обновления и дополнения к программному обеспечению, исходно предоставленному ООО «РобоКоммерцъ».

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

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

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.

ООО «РобоКоммерцъ» 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 ООО «РобоКоммерцъ».*

** 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 ООО «РобоКоммерцъ». 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 ООО «РобоКоммерцъ». 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.*

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

** Товарные знаки. Настоящее лицензионное соглашение не предоставляет Вам никаких прав в отношении каких-либо товарных знаков или названий, принадлежащих ООО «РобоКоммерцъ».*

** Техническая поддержка. ООО «РобоКоммерцъ» 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 ООО «РобоКоммерцъ» по ее усмотрению исключительно для внутренних нужд. ООО «РобоКоммерцъ» гарантирует конфиденциальность полученной информации и ее недоступность третьим лицам, не являющимся сотрудниками ООО «РобоКоммерцъ».*

** Расторжение соглашения. Без ущерба для каких-либо иных прав ООО «РобоКоммерцъ» 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 ООО «РобоКоммерцъ» 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 ООО «РобоКоммерцъ».

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 ООО «РобоКоммерцъ», ни кто-либо из ее представителей или сотрудников не несет ответственности за возможный ущерб, нанесенный Вам

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.

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 ООО «РобоКоммерцъ» 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.

6. КОНТАКТЫ

Информация об изменениях в различных версиях программы, а также список других полезных утилит доступны на официальном сайте в Internet

http://www.rbkm.ru

В разделе «Форум» можно ознакомиться с ответами на распространенные вопросы пользователей, а также задать свой вопрос разработчикам или аналитикам ООО «РобоКоммерцъ».

Мы будем рады получить любые Ваши пожелания и комментарии.

Форум пользователей программы: http://forum.rbkm.ru/forum

Служба технической поддержки:

Тел. (343) 384-40-33 (доб. 3)

support@rbkm.ru

Отдел продаж:

Тел.: (343) 384-40-33 (доб. 1)

payment@rbkm.ru

Желаем приятной работы!

ООО «Финансовая компания «РобоКоммерцъ».

Россия, Екатеринбург.

Copyright © 2011 ООО “РобоКоммерцъ”. Все права защищены.