[МЕХАНИЧЕСКАЯ ТОРГОВАЯ СИСТЕМА«Mr. Profit»]

Установка, настройка и описание интерфейса МТС «Mr. Profit»

Содержание:

Принципы работы торговых роботов и описание доступных торговых стратегий	**3**
Диверсификация стратегий	**3**
Источники данных и доступные торговые площадки	**4**
Установка и необходимое ПО	**4**
Процедура настройки «Mr. Profit», для работы с терминалом Квик	**4**
Описание интерфейса	**9**
Тестирование торговых алгоритмов	**12**

Назначение и принципы торговых роботов

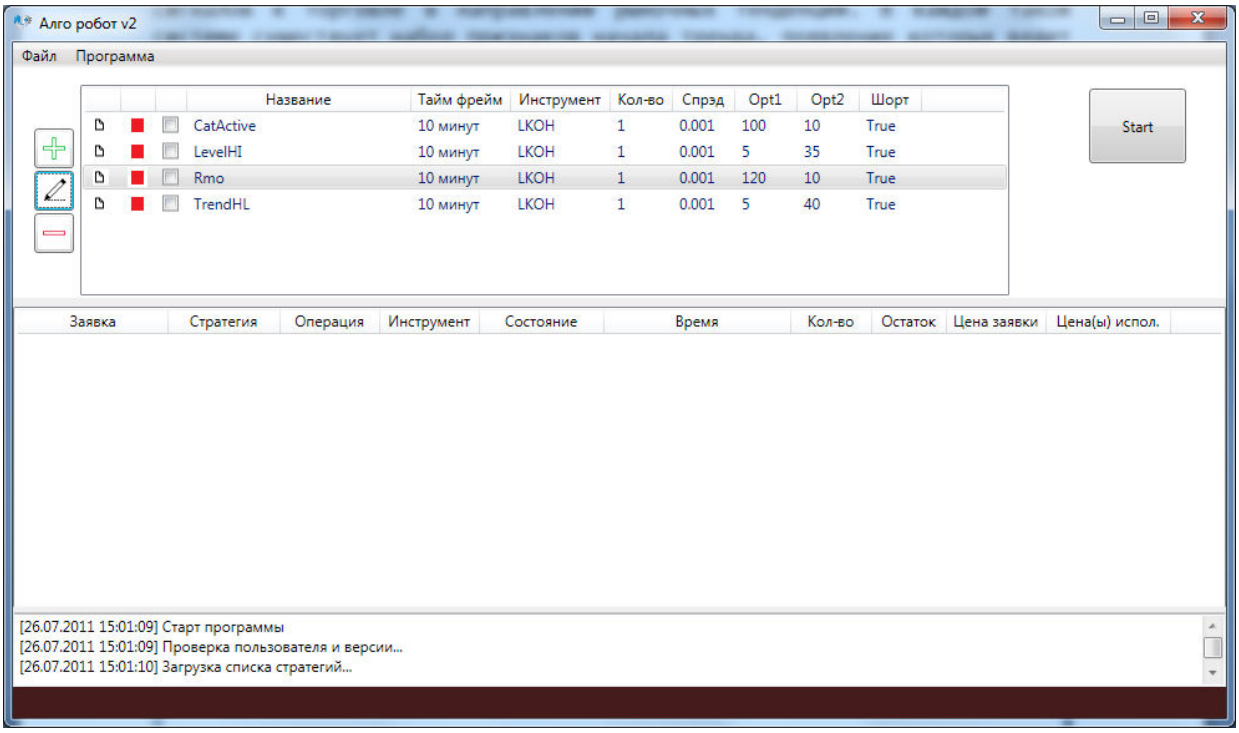
Торговые роботы являются механическими торговыми системами, которые на основании определенных алгоритмов самостоятельно осуществляют управление финансовыми потоками своих хозяев. Выбор в пользу того или иного торгового робота каждый делает самостоятельно, кто хоть один раз получил возможность убедиться в их высокой эффективности. Применения такого рода программного обеспеченья позволяет не столкнуться с типичными проблемами и трудностями трейдерских ошибок, допущенных в связи с недостатком опыта или по причине невнимательности. В чем же заключается преимущество таких роботов?

В первую очередь, нужно всегда помнить, что торговые являются программами, которые не подвергаются обычным человеческим слабостям – они просто не захотят спать или есть, им не потребуется проводить время с близкими. Торговые роботы могут в течение круглых суток во время деятельности рынка проводить его анализ и подбирать наиболее удобные моменты для проведения прибыльных сделок. Исходя из практики, следует, что применение торговых роботов валютного рынка Форекс в значительной степени автоматизирует и упрощает деятельность трейдера.

Реальная эффективность торгового робота будет напрямую зависеть от того, каким алгоритмом руководствуется программа. Достаточно часто случается так, что определенный алгоритм продолжительное время приносит достаточно большую прибыль, а через некоторое время, в результате деятельности определенных механизмов рынка, программа начинает работать только в убыток. По этой причине для того, чтобы достаточно эффективно зарабатывать рынк, следует не только уметь устанавливать и включать торгового робота, но и осознавать, насколько эффективны методы работы данной программы.

Диверсификация стратегий.

Одним из самых интересных свойств МТС «Mr. Profit» следует признать возможность неограниченного комбинирования различных торговых стратегий, ценных бумаг и используемых временных периодов (таймфреймов) между собой на одном счету. Так например на рисунке, изображена 1 бумага Лукойл – таймфрейм 10 минут), которыми управляют 4 стратегии. Итого 4 подсистемы. Также, можно добавить еще 4 подсистемы с таймфреймом 15 минут для Лукойла, диверсифицировав торговлю до бесконечности.



Источники данных и доступные торговые площадки

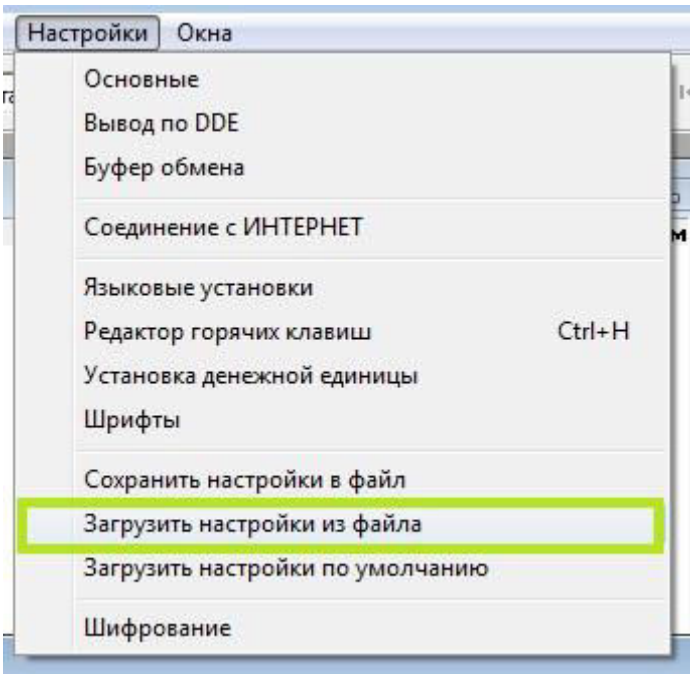
МТС «Mr. Profit» работает через торговый терминал Quik.
МТС «Mr. Profit» доступны биржи ФОРТС, РТС стандарт и ММВБ.

Установка и необходимое ПО

Для работы с роботом, вам необходимо:
1.Microsoft Windows XP SP2 или выше
2.Microsoft .NET Framework 3.5 SP1
4. Quik

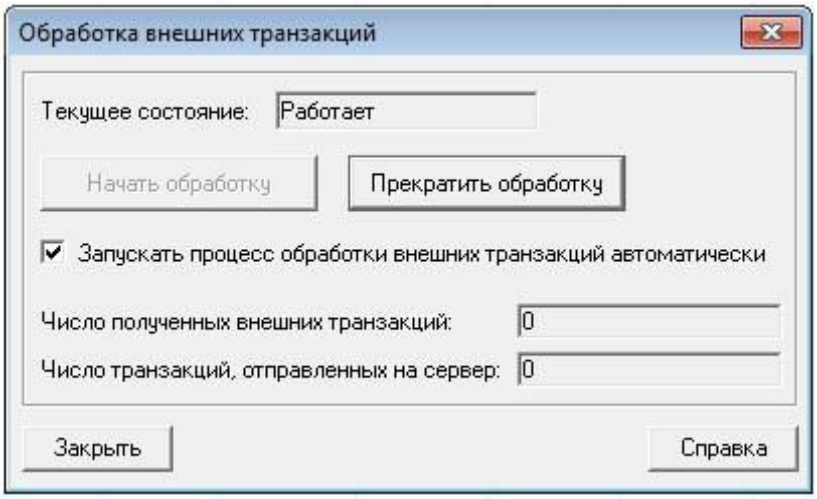
Настройки терминала Quik для работы с МТС «Mr. Profit»

Через меню | Настройки | Загрузить настройки из файла | загрузите в терминал файл настроек info.wnd, который Вы сможете получить у компании предоставляющей выход на биржу.

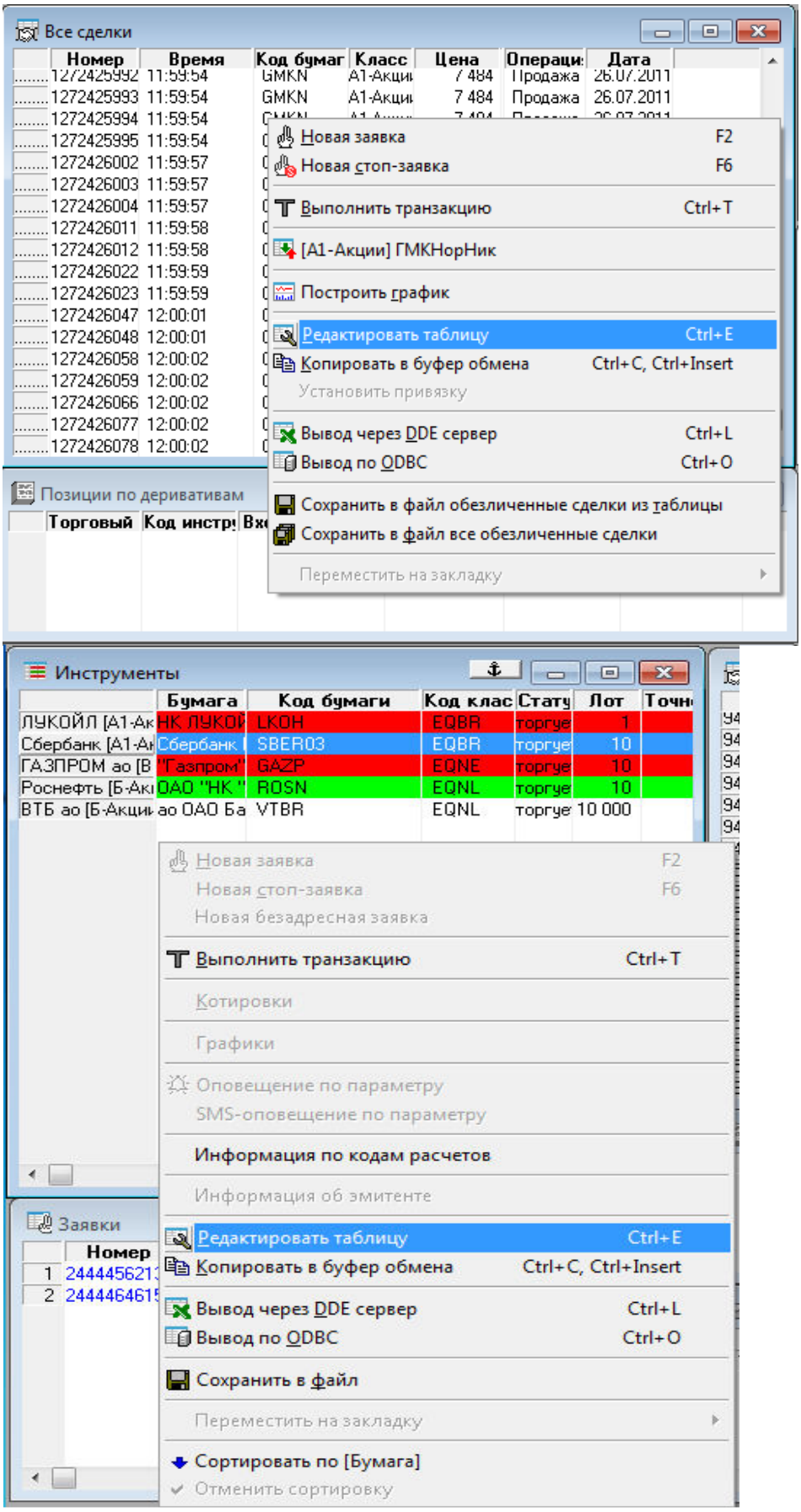


После этого проверьте правильность настроек экспорта котировок и импорта заявок.

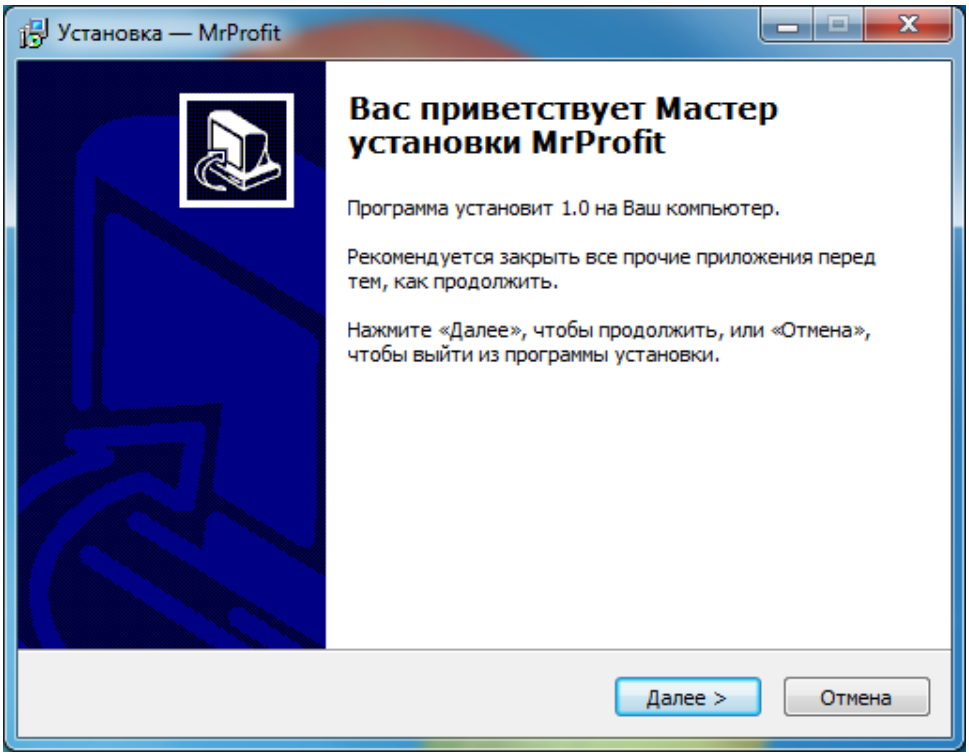
Торговля -> Внешние транзакции
□□Начать обработку
□□Запускать процесс обработки внешних транзакций автоматически (по желанию).



Далее, в окне «Все сделки» и «Инструменты» нажмите «Редактировать таблицу» и добавьте необходимые ценные бумаги.

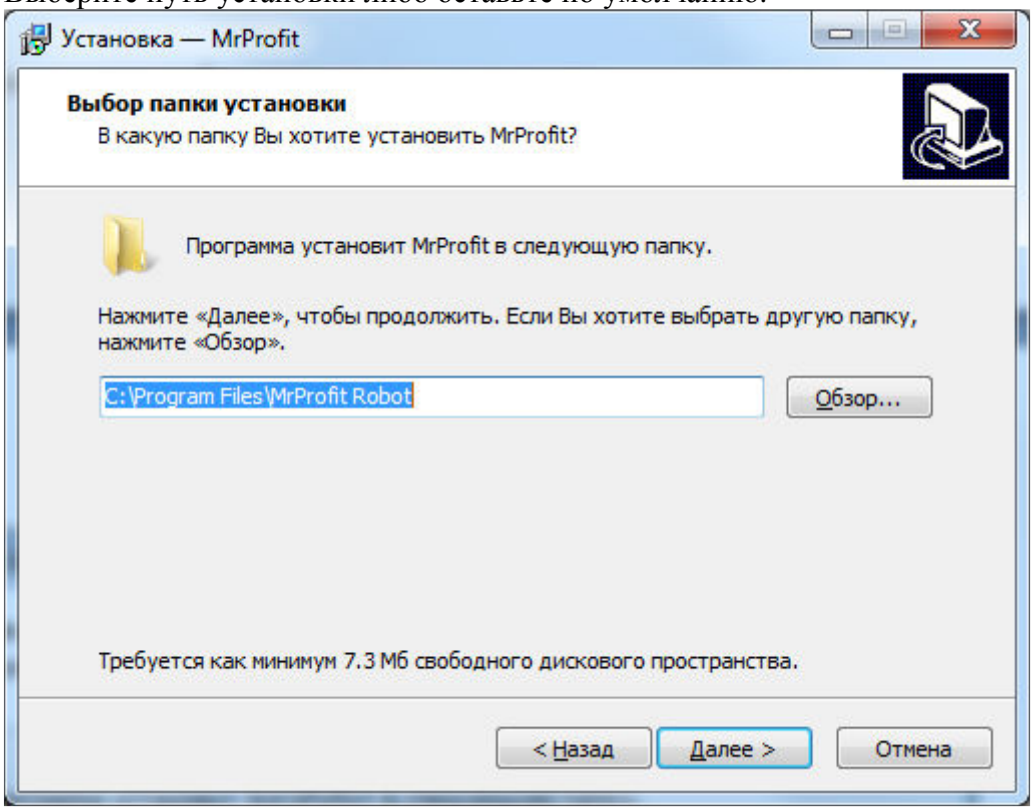


Для установки робота на ваш компьютер, запустите файл Setup_Mr. Profit.exe.

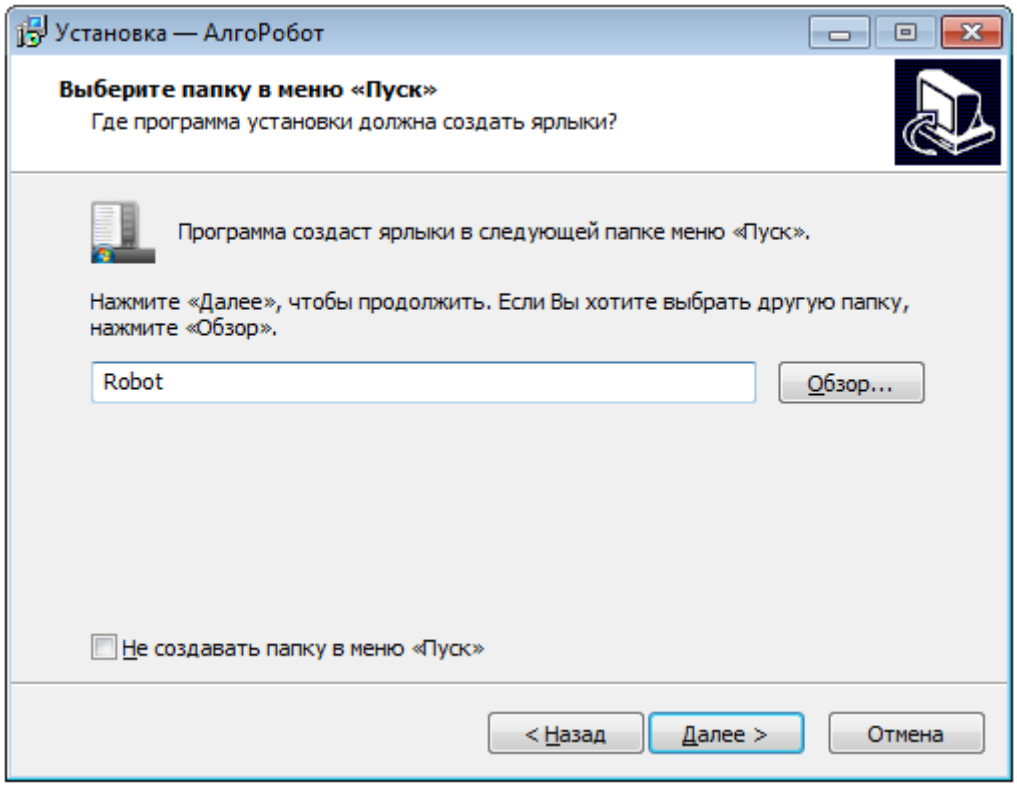


Нажмите кнопку далее.

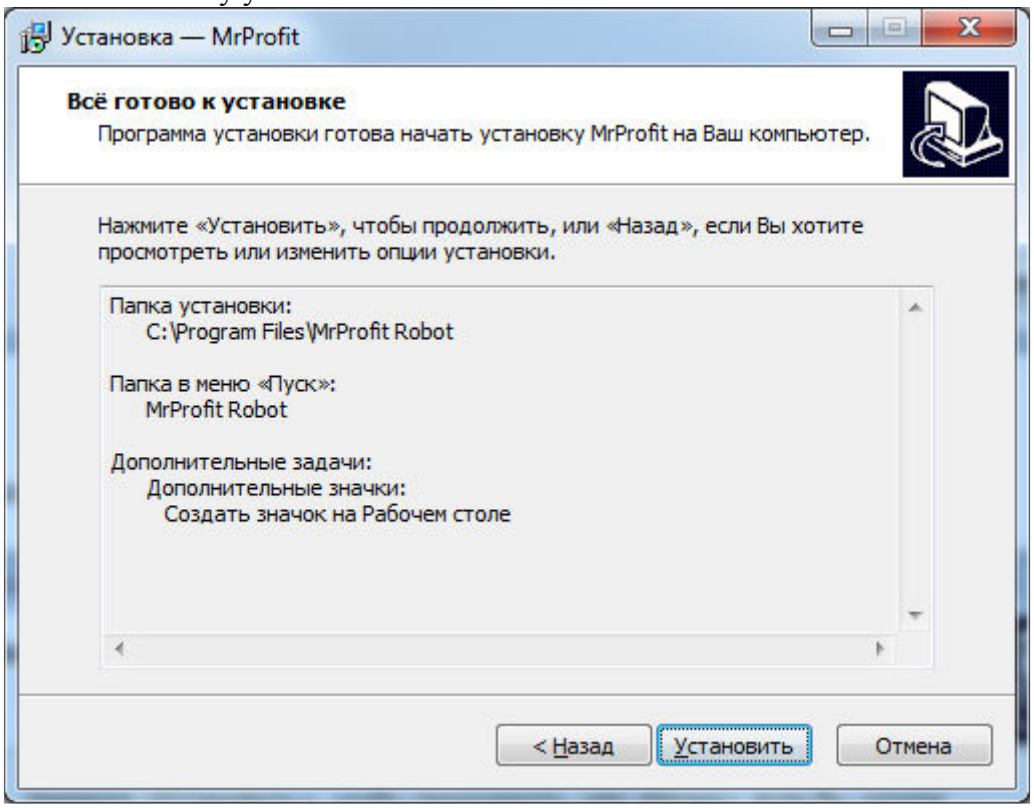
Выберите путь установки либо оставьте по умолчанию.



Выберите имя программы меню «Пуск»

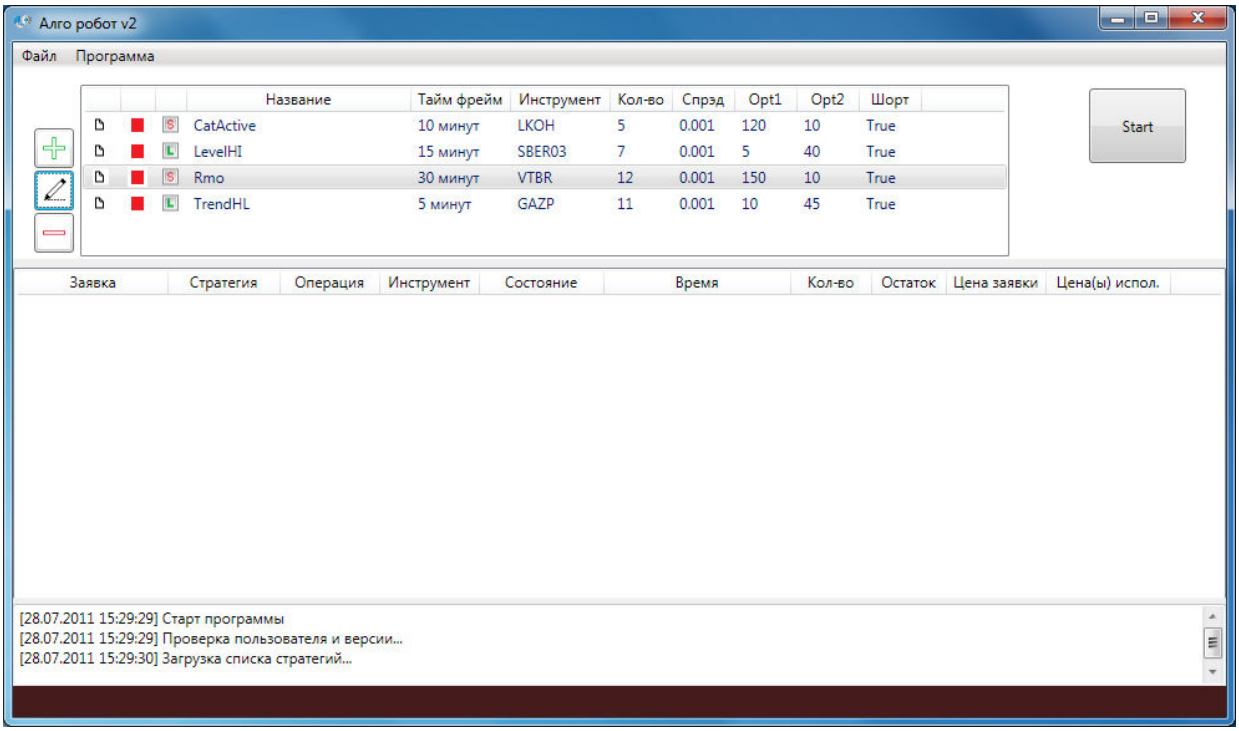


Нажмите кнопку установить



Описание интерфейса

Главное окно



В верхнем окне «Торговые алгоритмы» отображается информация о запущенных торговых стратегиях, количестве торгуемых инструментов, таймфрейме оптимизируемых параметрах, защитном спреде и позиции, которую занимает торговый алгоритм. Long (купля) либо Short (продажа). При первом старте все флажки содержат пустые поля. При отключении программы МТС запоминает положение флажков.

Внесение строки состояния торговли

Редактирование строки состояния

Удаление строки состояния

В среднем окне "Заявки" отображается информация о заявках и сделках выставленных роботом.

В окне Вы можете получить информацию о:
- «Заявка» уникальный номер заявки
- «Стратегия» название алгоритма совершившего сделку
- «Операция» купля либо продажа
- «Инструмент» Ценная бумага торгуемая роботом
- «Состояние» Исполнена либо отменена заявка

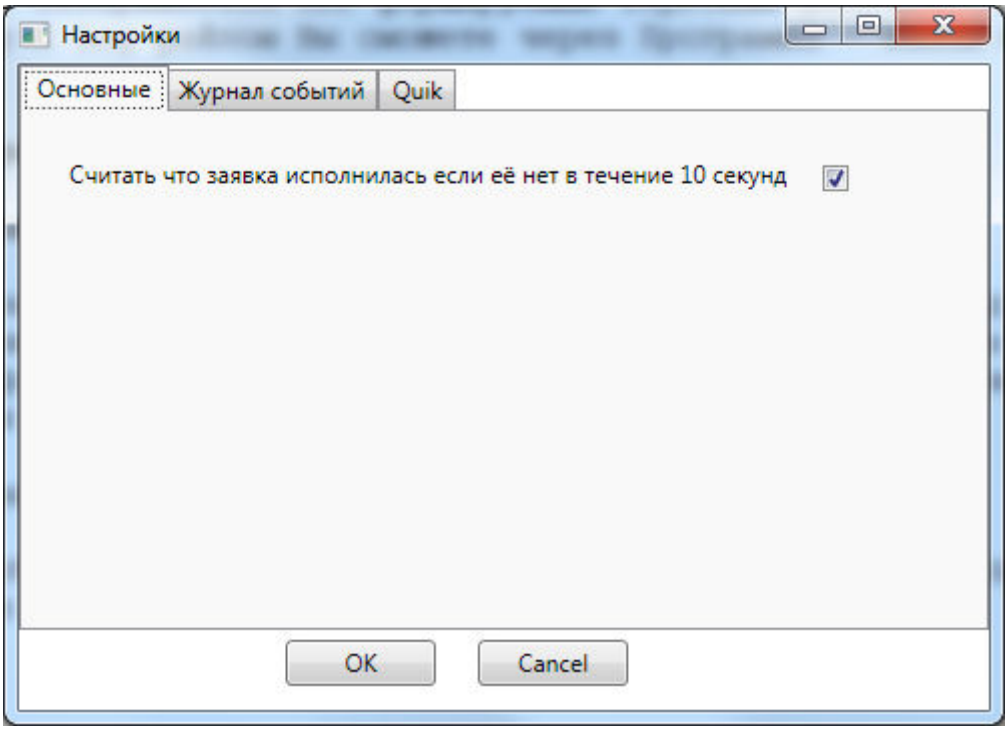
- «Время» Время выставления заявок
- «Количество» (Количество лотов\фьючерсов)
- «Остаток» количество от не исполнившейся сделки
- «Цена заявки» - цена по которой выставилась заявка
- «Цена сделки» - цена исполнения приказа

В нижнем окне отображается лог формируемый торговым роботом.
Открыть папку с Log файлом Вы сможете через Программа – Файлы журнала событий.

Раздел "Настройки"

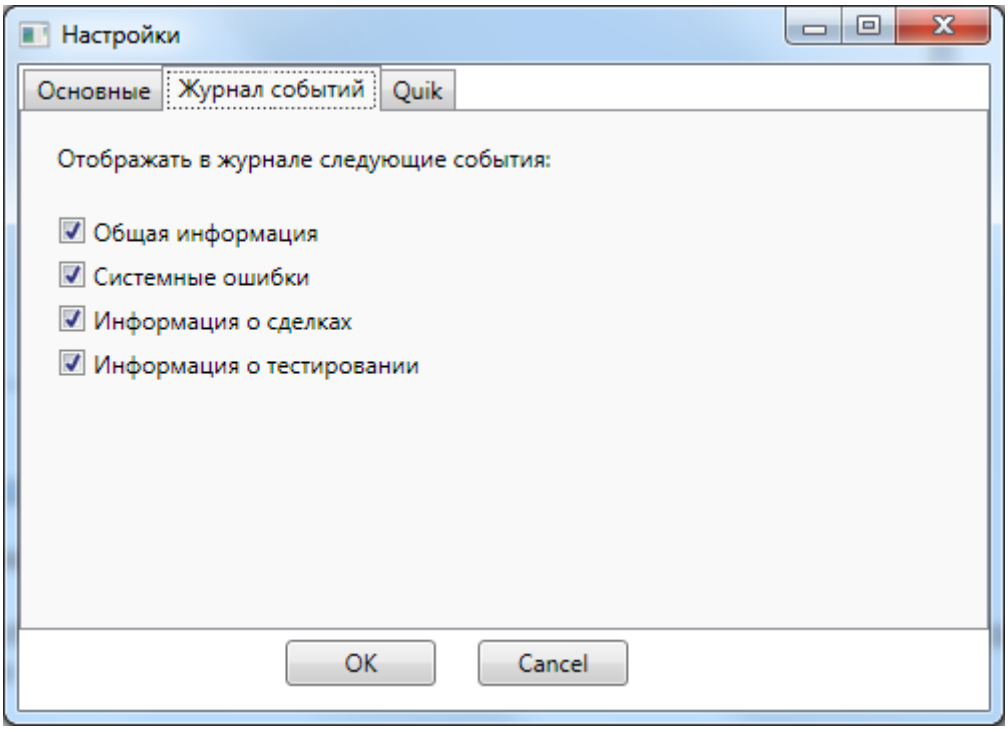
Вкладка «Основные»

Считать что заявка исполнилась если ее нет в течении 10 секунд
При выставлении заявки торговым роботом, сервер брокера иногда не присылает информацию о совершенной сделке, поэтому робот считает ее автоматически исполнившейся.

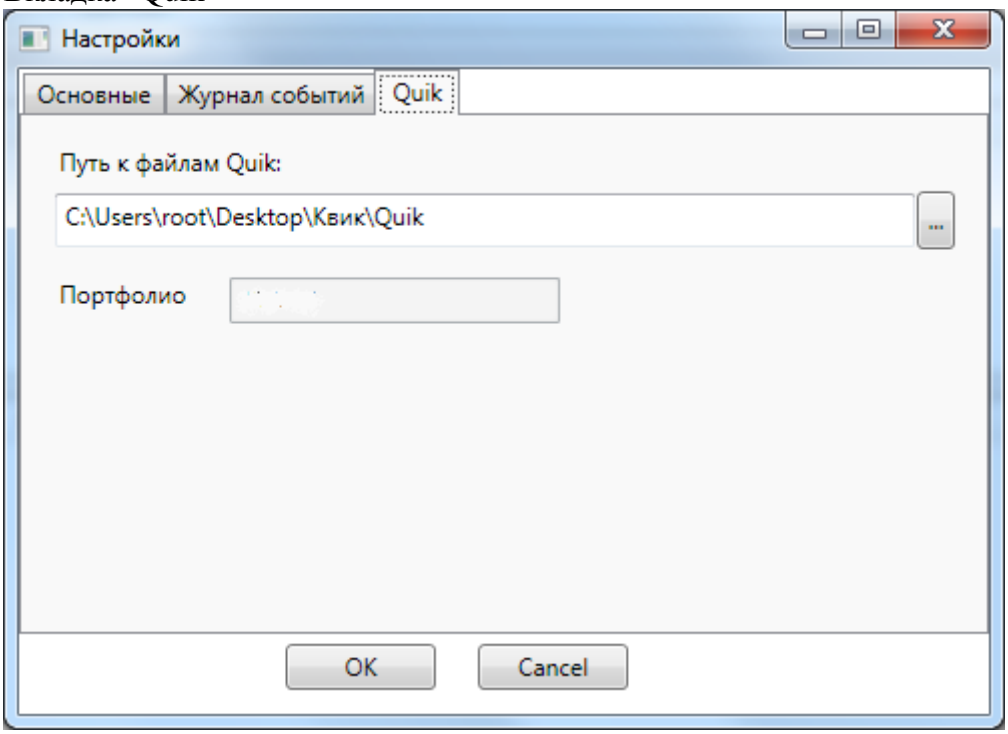


Вкладка «Журнал событий»

Во вкладке роботу можно указать какие события он должен прописывать в лог файл, а какие нет.

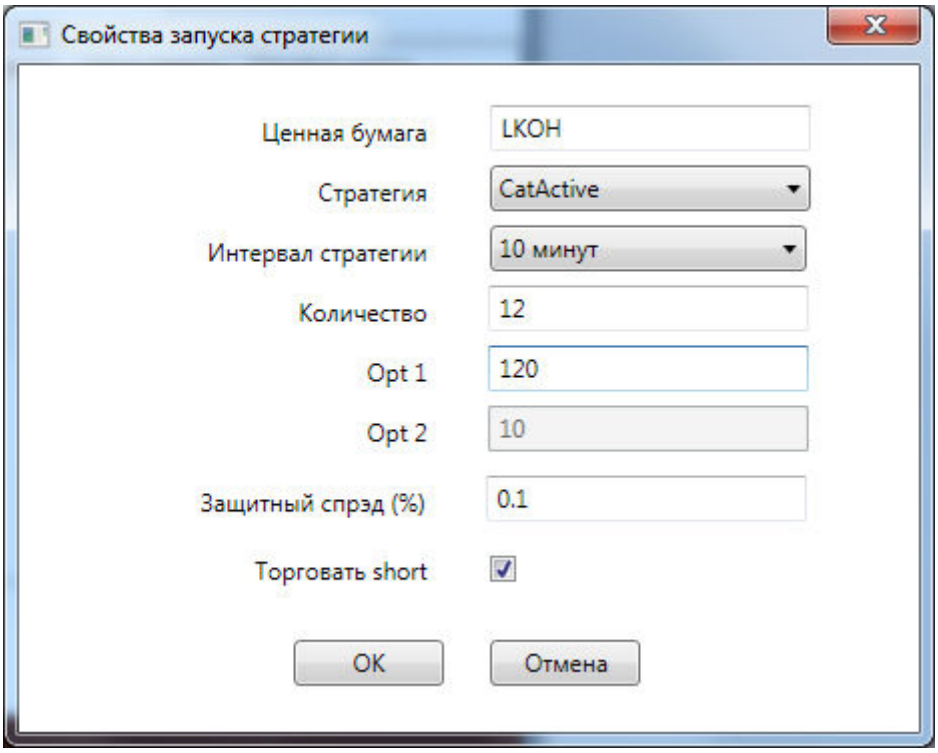


Вкладка «Quik»

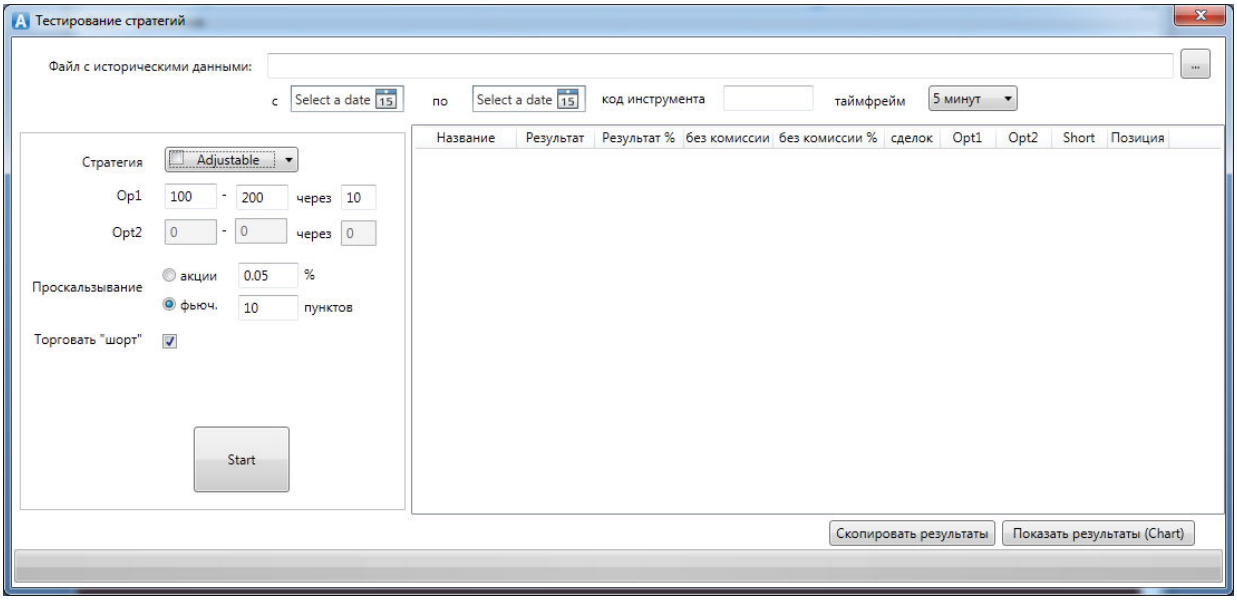


Во вкладке необходимо указать дистрибутив куда установлен торговый терминал Quik. В параметре портфолио указан Ваш торговый счет.

Кнопка в виде плюса, на главном окне торгового робота откроет окно где необходимо задать торгуемые инструменты, настроить размер, таймфрейм, выбрать стратегию, а также разрешение\запрет торговли в шорт. (См. рисунок)



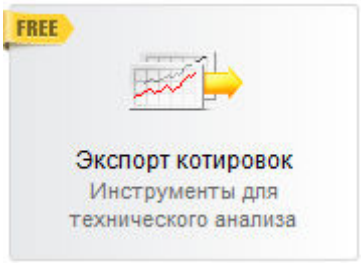
Тестирование торговых алгоритмов на истории



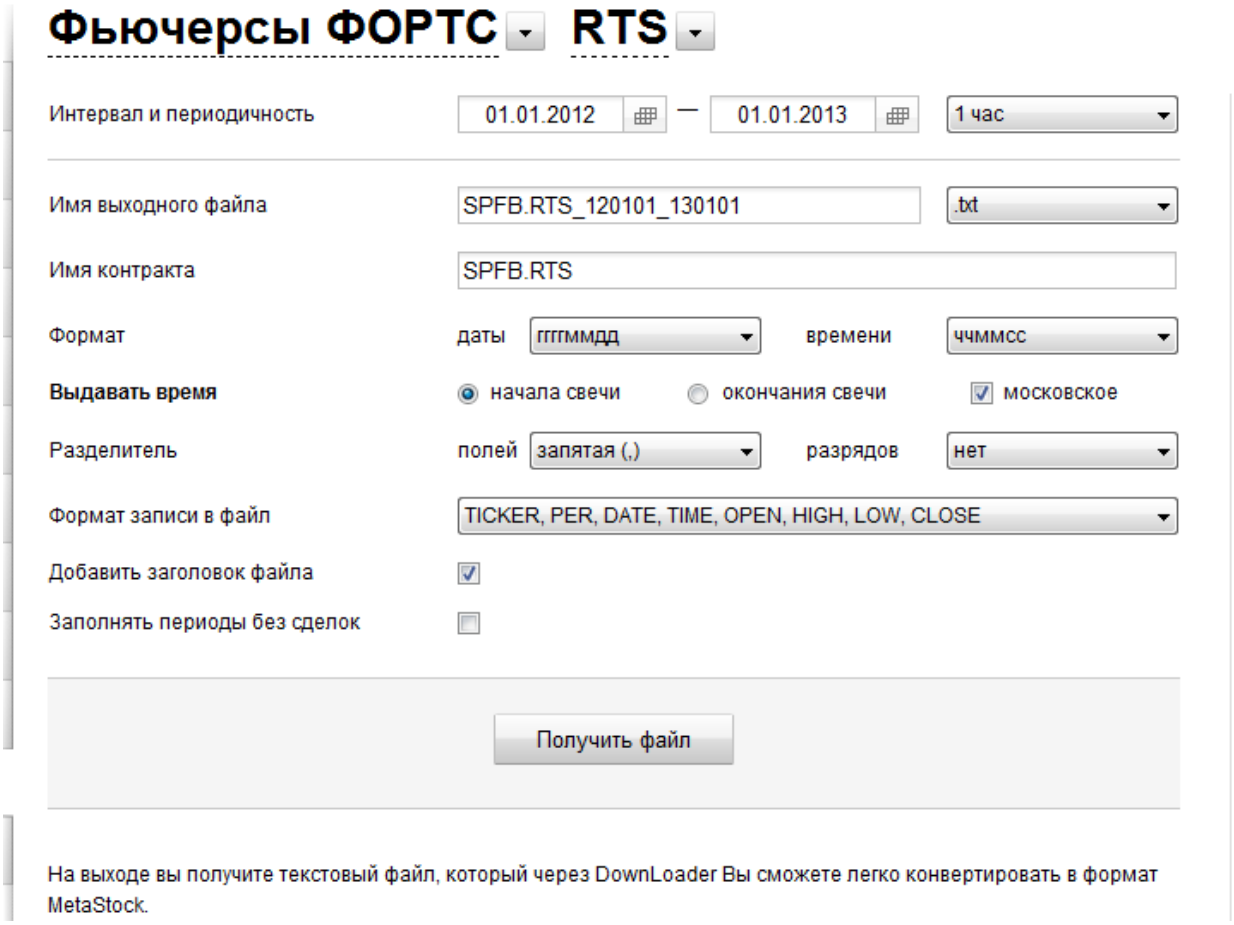
В торговом роботе заложен модуль тестирования.

Все торговые алгоритмы могут быть протестированы на определенном участке истории, результаты тестов выводятся в графическом варианте, а также переносятся в Excel файл.

Протестируем акцию Фьючерс на индекс РТС с 1 января 2012 по 1 января 2013 года.
Зайдите на страницу www.finam/.ru



Внизу страницы нажмите – Экспорт котировок

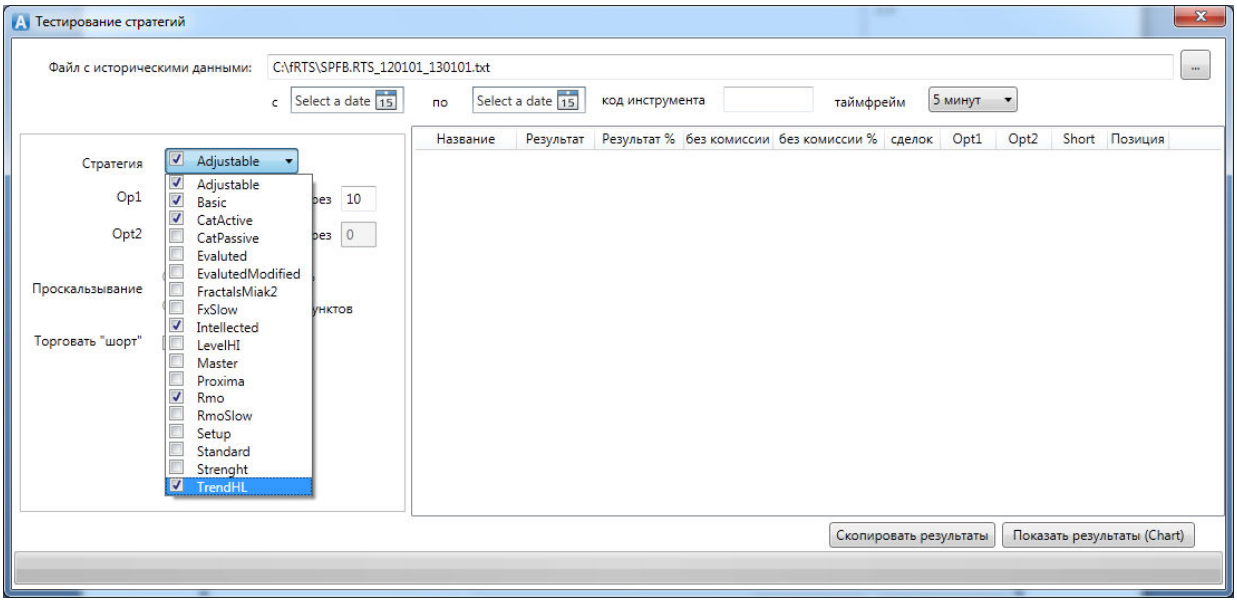


Выберите тикер RTS так как показано на рисунке, укажите интервал с 1.01.2012 по 1.01.2013 и периодичность в 1 час.

Сохраните полученную история в папке. Например C:\fRTS

В окне «Тестирование стратегий» нажмите на кнопку 

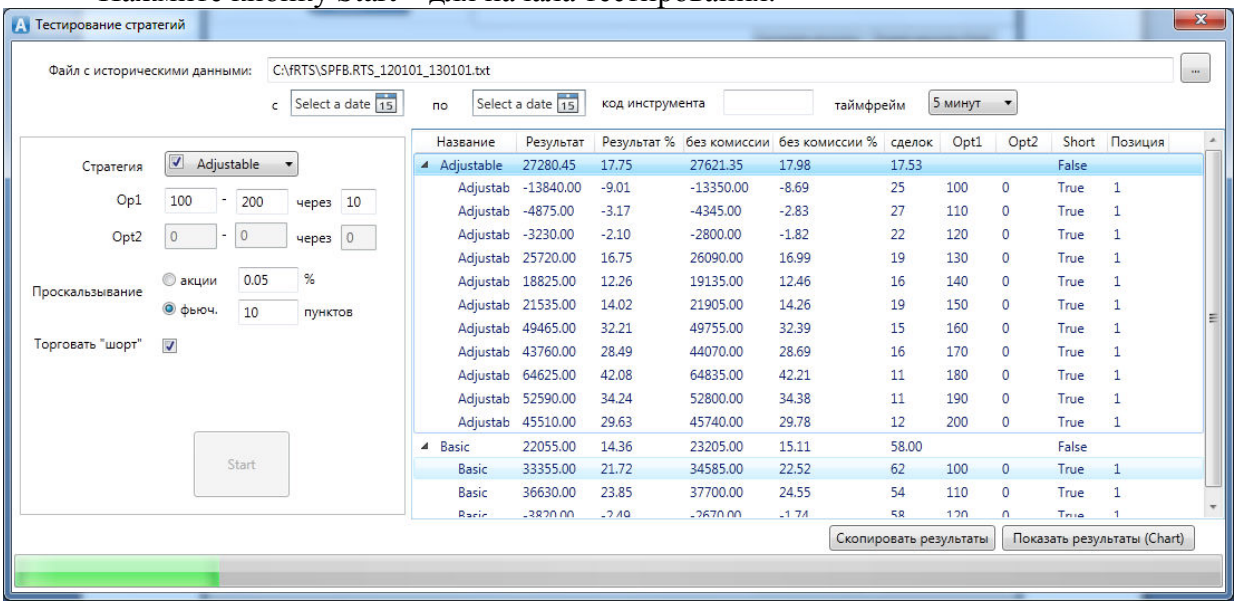
(троеточие)и укажите путь к файлу C:\fRTS.



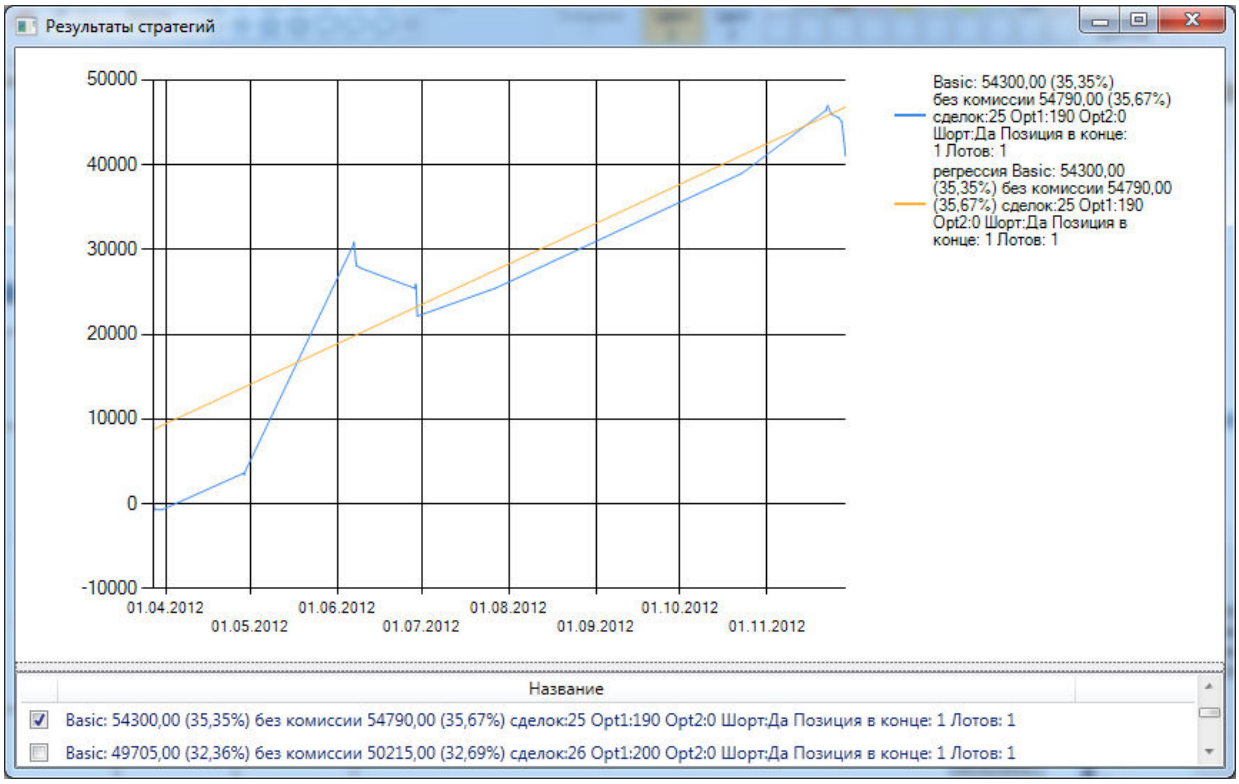
Укажите тактики, которые должны быть протестированны и при необходимости введите значение opt1 и opt2 каждого алгоритма.

Если Вы тестируете акции то введите комиссию в процентах, если фьючерсы то в пунктах. Если флажок «Торговать «шорт» не установлен, то алгоритмы будут тестировать только покупки.

Нажмите кнопку Start – для начала тестирования.



После теста алгоритма, при нажатии кнопки «Показать результаты (Chart) выводится информация в графическом варианте. Слева по шкале отображается прибыль\убыток в рублях\фьючерсах, снизу по шкале календарный период.



При нажатии на кнопку «Скопировать результаты» в буфер обмена помещаются полученные результаты, которые при необходимости можно перенести в Excel лист.

При переборе оптов достигается разная доходность.

Также тестирование возможно без скачивания файла.

В робота встроен провайдер, получащий данные с ФИНАМа.
Указав период, ценную бумагу, таймфрейм и нажав на кнопку Start, робот начнет прогон торговых тактик на истории.
Длинна выборки (истории) ограниченна 11 месяцами!

