

ТЕХНИЧЕСКОЕ ЗАДАНИЕ

на создание автоматизированной торговой система «SWAN»

Описание

Основой системы является волновой анализ с применением сетки Фибоначчи и обязательного риск-менеджмента.

При появлении точки входа определяются уровни Stop loss/ Take profit, на основании которых рассчитывается объем открываемой сделки.

Точка входа

Определение точки входа (далее – ТВХ) осуществляется по следующим критериям:

1. Определение тренда;
2. Подтверждение тренда;
3. Появление формации – ТВХ.

1. Определение тренда

Тренд считается восходящим если цена пробила локальный максимум – основание первой волны (O). См. рис.1

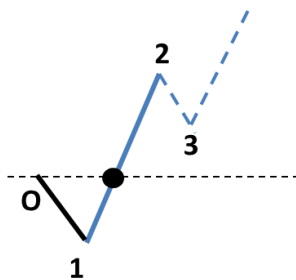


рис.1

Тренд считается нисходящим если цена пробила локальный минимум – основание первой волны (O). См. рис.2

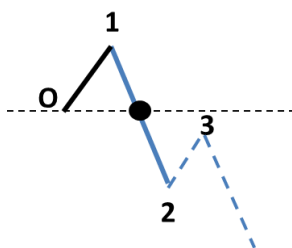


рис. 2

2. Подтверждение тренда

Тренд считается подтвержденным если цена пробила максимум/ минимум (вершину/ основание) 2 волны. См. рис. 3, 4

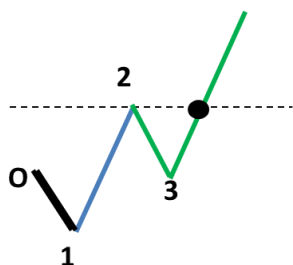


рис. 3

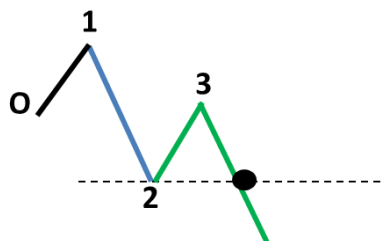


рис.4

При этом если цена во время формирования 3 волны пробивает максимум/ минимум (вершину/ основание) 1 волны тренд считается неподтвержденным.

3. Появление формации – ТВХ

Формацией считается ситуация, когда цена 5 волной пробивает максимум/ минимум 4 волны. Это и будет являться **Точкой входа**. См. рис.5, 6

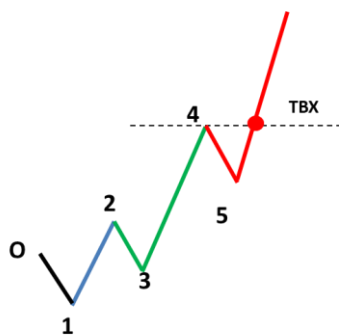


Рис.5

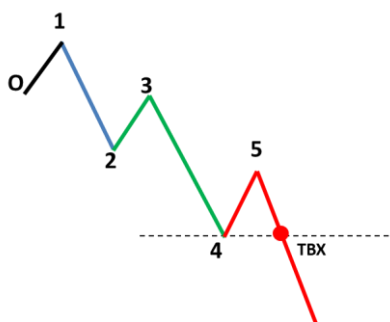


Рис.6

Если цена 5 волной пробивает вершину/ основание 3 волны, такая формация считается несостоявшейся и следует искать другую формацию с учетом определения и подтверждения тренда.

Уровни Stop loss / Take profit

Уровнем Stop loss сделки будет являться основание/ вершина 3 волны.

Для определения уровня Take profit используется сетка Фибоначчи.

При этом:

- уровнем 0.0 сетки Фибоначчи будет max/min 3 волны;
- уровнем 100.0 сетки Фибоначчи будет основание/ вершина 4 волны;
- уровнем Take profit выставляется в соотношении 3:1, 2:1, 1:1 (опционально) к уровню Stop Loss.

Пример сделки на графике



Риск менеджмент

При расчете объема сделки учитывается размер Stop loss, что бы в случае его срабатывания убыток составил 1% от депозита (опционально).

Условия открытия сделки (чек-лист)

Условия открытия сделки определяются с помощью сетки фибо и задаются опционально.

В чек-листе 5 условий открытия (будут указаны дополнительно).

Визуализация

Параметры сделки: волны, ТВХ, s/l, t/p – должны отражаться на графике

Оповещение

При открытии сделки sms и e-mail оповещение