

Briefing EA Strategie-Tester

Version 1.0

Stand: 16.03.2018

vertraulich

Beschreibung

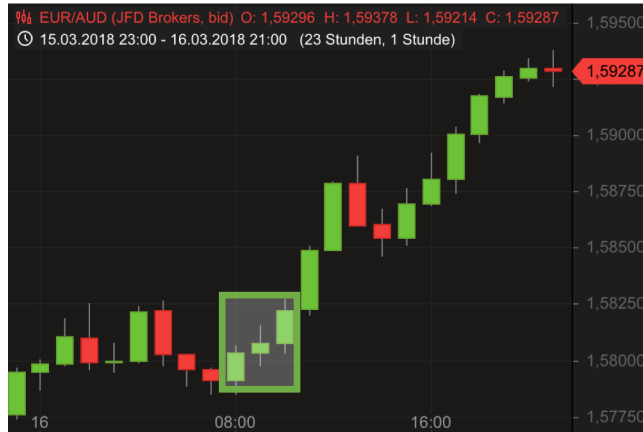
- Der Expert Advisor (EA) soll in erster Linie für den Forex-Handel genutzt werden.
- Es sollen unterschiedliche Währungspaare parallel gehandelt werden können.
- Pro Währungspaar sollen individuelle Parameter festgelegt werden können.
- Die Lot-Größe soll zunächst manuell definiert werden können.
- Es sollen unterschiedliche Zeiteinheiten gehandelt werden können.
- Pro Währungspaar soll zunächst nur 1 Position zurzeit aktiv sein.
- Der EA soll vollständig autonom ablaufen.
- **Es geht zunächst ausschließlich darum, eine lauffähige Version für den MT5 Strategie-Tester zu entwickeln.**

Eröffnen einer Position

Signal zum Eröffnen einer Position:

- In einer definierbaren Anzahl von Zeitperioden war der Schlusskurs pro Zeitperiode jeweils höher als der Eröffnungskurs (Szenario: long) bzw. jeweils tiefer (Szenario: short).
- Die Anzahl soll als Input-Variable definiert werden können.
- Diese Bedingung muss für jede einzelne betrachtete Zeitperiode zutreffen.
- Mit Start der folgenden Zeitperiode soll eine Position in dieselbe Richtung aufgebaut werden.
- Die Lot-Größe wird dabei als Input-Variable definiert.

Eröffnen einer Position - Beispiele



Position wird **long** eröffnet

- Die letzten drei Stundenkerzen gingen long.
- Die Position soll mit Start der vierten Stunden ebenfalls long aufgebaut werden.
- Die Lot-Größe soll 0,1 betragen.



Position wird **short** eröffnet

- Die letzten drei Stundenkerzen gingen short.
- Die Position soll mit Start der vierten Stunden ebenfalls short aufgebaut werden.
- Die Lot-Größe soll 0,1 betragen.



Signal zur Eröffnung ist **nicht** gegeben, da der Schlusskurs der zweiten Kerze unter ihrem Eröffnungskurs lag.

Absichern der Position – Stop Loss

- Der Stop Loss (SL) soll auf dem Tief (bei Long-Positionen) bzw. auf dem Hoch (bei Short-Positionen) der vorhergehenden Zeitperiode gesetzt werden.
- Nach Abschluss einer weiteren Zeitperiode soll der SL automatisch „mitwandern“ und wieder auf das Hoch bzw. Tief der vorhergehenden Zeitperiode nachgezogen werden.

Absichern der Position – Stop Loss - Beispiel



- SL nachgezogen nach 3h
- SL nachgezogen nach 2h
- SL nachgezogen nach 1h
- SL bei Eröffnung der **long** Position



- SL bei Eröffnung der **short** Position
- SL nachgezogen nach dem selben Prinzip

Schließen der Position – Take Profit

- Der Take Profit (TP) soll zunächst ausschließlich zeitlich gesteuert werden.
- Der TP wird dabei als Input-Variable definiert.
- Für den TP kann eine anteilige Lot-Größe definiert werden.
- Der restliche Anteil der Position wird nicht über TP geschlossen, sondern irgendwann über den SL.
- Beispiel:
 - Der TP soll 60 Minuten nach Positionseröffnung 50% der Lot-Größe schließen.
 - Es ist dabei irrelevant, ob sich der Trade dabei im Plus oder Minus befindet.

Input-Variablen

Parameter	Wert	Beschreibung
Periods_to_Start	3	Anzahl der Zeitperioden, die für das Signal zur Eröffnung der Positionen notwendig sind
Time_Period	60	Zeitintervall für eine einzelne Zeitperiode in Minuten (Wert kann ggf. auch vom Metatrader-Strategie-Tester übernommen werden. Dieser Wert soll mit dem Zeitintervall übereinstimmen, in dem gehandelt wird)
Lot	0.1	Größe der Position
TP_Time	60	Zeit in Minuten bis der TP ausgeführt wird
TP_Size	50	Anteil der Position in %, die als TP geschlossen werden soll (in diesem Beispiel werden 0.05 Lots geschlossen)