Техническое задание

Есть торговый советник на МТ4 (ACCI v.3.0.mq4), работающий на графиках, формируемых индикатором рендж-баров (RangeBarChart.mq4 + dll).

Он был конвертирован под МТ5 (ACC V3\_3.mq5). Также был написан советник формирования графиков рендж-баров через пользовательский символ (RangeBars\_3\_5.mq5).

Однако при тестировании советник открывает сделки с ценами открытия далеко выше или ниже от тела свечи.

Программист написал, что неправильно работает советник рендж-баров, что он его перепишет, но затем ушёл в игнор.

Задача 1.

Нужно исправить имеющийся советник, создающий графики с рендж-барами, написанный на MQL5.

При формировании графика по историческим данным есть участки, где график кардинально отличается от графика, формируемым индикатором рендж-баров на MQL4. При необходимости логика формирования рендж-баров может быть использована из этого индикатора.

Я знаю, что идеального совпадения графиков не может быть из-за некоторых различий цен и спредов в терминалах МТ4 и МТ5. Но это может проявляться в одной-двух свечах, а не в нескольких. Также при детальном рассмотрении есть свечи, в которых не отражено прошедшее движение цены. Примеры приведу при необходимости.

Некоторые детали.

Должен быть реализован принцип формирования графика рендж-баров, когда цена открытия бара в точности совпадает с ценой закрытия предыдущего. В имеющемся советнике уже есть режим переключения из точного совпадения в режим открытия с ценой на следующем тике (SameCloseOpen). Вроде он работает корректно.

Также есть переключатель режима BigCandle – когда в случае ценового гэпа может быть сформирована свеча большего размера, чем заданный рендж. Противоположный режим, который должен быть обязательно – это построение цепочки одинаковых свечей с заданным ренджем на гэпе.

Что заложено под режим «Максимальный сдвиг свечки в процентах» не совсем понимаю.

Пример графика с рендж-барами.



В торговом советнике под МТ5 для проверки есть простое условие открытия сделок с 660 по 680 строку (3 красных свечки, затем зелёная – сделка на покупку и наоборот). Такое же условие есть в исходном советнике под МТ4 (для сравнения).

В прилагаемых вариантах там прописана пара EURUSD и рендж 50 пипсов. Прилагаю также соответствующие настроечные сеты под МТ4 и МТ5.

Торговый советник таже использует данные индикатора WCCI-5.mq5. Но в условиях проверочного тестирования он не задействован. Прилагаю, т.к. на него есть ссылка в советнике.

Дополнения.

1. Должна быть возможность тестирования советника в тестере стратегий терминала МТ5 на рендж-барах на историческом периоде до нескольких лет.

В настройках советника рендж-баров есть запрос на количество формируемых рендж-баров.

Смысл в том, что исторических данных может быть значительно больше, чем нужный период с ренж-барами. В режиме работы советнику нужен небольшой период (количество баров). Для режима тестирования - до нескольких лет (максимум 10). Но исторических данных может быть больше (хотя я заметил, что тиковые данные на МТ5 вроде как самые ранние с 2020 года).

2. Есть вероятность, что торговый советник не будет корректно работать на правильном графике рендж-баров из-за ошибок при конвертации.

В этом случае нужна его правка или, при необходимости, новая конвертация с бюджетом в 20-30$.