



Previous-Day Range Fakeout (PD-Fade)

⚙ Status	Разработка
📁 Type	

Идея

Ждём ложный вынос вне максимума/минимума вчерашнего дня с небольшим запасом(процентный порог), затем возврат внутрь диапазона — берем откат к середине вчерашнего диапазона. Мини-цель ⇒ высокий win-rate.

Правила (BTCUSD, 5m/15m):

- Берём High/Low/Close вчера (UTC).
- **SHORT:** вчерашний High пробили с запасом (например, +0.25%), а текущая свеча закрылась ниже вчерашнего High → шорт лимитом на ретест High.
- **TP:** середина диапазона вчера $mid = (PDH + PDL) / 2$
- **SL:** $PDH + 0.25\%$ (или $0.8 \times ATR_{14}$) от цены входа - что ближе/проще.
- **LONG:** симметрично от вчерашнего Low (пробили ниже на -0.25%, закрылись обратно выше Low, вход лимитом на ретест Low; $TP - mid$).
- Фильтр боковика (чтобы держать ~70% win): $ADX(14) < 22$ (включается/выключается опцией).
- Тайм-стоп: 20 баров на 5m / 16 баров на 15m — закрыть по рынку.

- Размер позиции: риск г% от счёта на SL (например, 0.25-0.5%)

Требования

1. Код и идея принадлежат заказчику и не подлежат разглашению или распространению.
2. Код должен быть структурирован, читаемый и дорабатываемый.
3. Операции должны логироваться.
4. В визуальном режиме нужна графика торгуемых сетапов.
5. Скорость работы должна быть оптимизирована и быть высокой для проведения бэктестов и оптимизаций с 2020 по 2025 годы в режиме "Все тики на основе реальных данных".

Idea

We wait for a false breakout **beyond the previous day's high or low** with a small buffer (a percentage threshold), followed by a **return inside the range** — we target a pullback to the midpoint of the previous day's range. Small target ⇒ high win rate.

Rules (BTCUSD, 5m/15m):

- Use **High/Low/Close** from the previous day (UTC).
- **SHORT:** The previous day's **High** is broken with a buffer (for example, **+0.25%**), and the current candle **closes below** the previous day's High → open a short **limit order on a retest** of the High.\
- **TP:** midpoint of yesterday's range $mid = (PDH + PDL) / 2$
- **SL:** $PDH + 0.25\%$ (or $0.8 \times ATR(14)$) from the entry price — whichever is closer/simpler.
- **LONG:** symmetric to the previous day's **Low** (price breaks below by **-0.25%**, then closes back above Low → enter long with a limit order on a retest of the Low).
- **Range filter** (to maintain ~70% win rate): Use **ADX(14) < 22** — can be toggled on/off via an option.

- **Time stop:** Close the position at market after **20 bars on 5m / 16 bars on 15m** timeframe.
- **Position size:** Risk **g% of account equity** per trade based on SL (for example, **0.25–0.5%**).

Requirements

1. The code and the concept belong to the client and must **not be disclosed or distributed**.
2. The code must be **well-structured, readable, and maintainable**.
3. All operations must be **logged**.
4. In visual mode, **graphics of traded setups** must be displayed.
5. **Performance must be optimized** to ensure high speed for **backtesting and optimization from 2020 to 2025** in the *"Every tick based on real ticks"* mode.