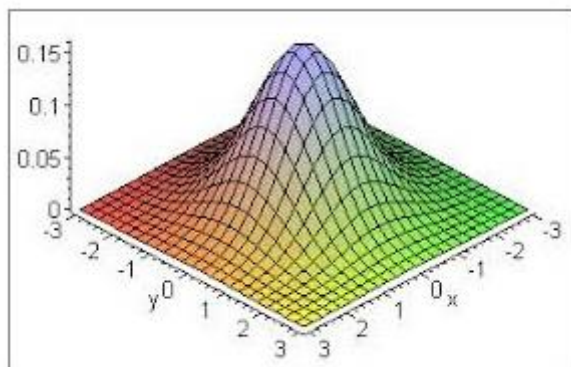


Диверсификация экземпляров советника:

Советник на каждой паре работает в нескольких экземплярах с немного разными параметрами. Это делается для того чтобы каждый экземпляр советника входил в рынок и выходил из рынка немного в разное время. Зачем это нужно?

Поиск оптимальных параметров любого советника сводится к построению многомерной функции распределения с поиском экстремума. Визуально в двухмерном измерении (при изменении двух параметров) функция выглядит примерно так.



Где вертикальная ось это эффективность советника, чем выше вертикальная точка, тем лучше подобраны параметры советника. Ошибочно предполагать, что найдя такую функцию распределения эффективности советника в зависимости от параметров, нужно использовать одну пару настроек соответствующих наивысшей точке функции распределения.

Правильно использовать множество точек из найденной оптимальной области в которой функция распределения превышает определенный порог эффективности.

С точки зрения советников на форексе это означает, что практически всегда использовать множество экземпляров советника с немного отличающимися параметрами лучше, чем один экземпляр советника с параметрами, которые алготрейдер считает «идеальными».

В советнике TLAP CAPITAL варьируемыми параметрами являются периоды анализа истории от 20 до 1000 предыдущих (15)30 минутных свечей и принципы выставления тейкпрофитов. Визуально на графике разные входы и разные выходы выглядят следующим образом.



Таким образом при любой рыночной ситуации мы получаем усредненный результат работы роботов, а не один единственный вариант, который может получиться очень хорошим или очень плохим, потому что на рынке котировка не дошла до какого-то уровня 3 пункта и цена развернулась.

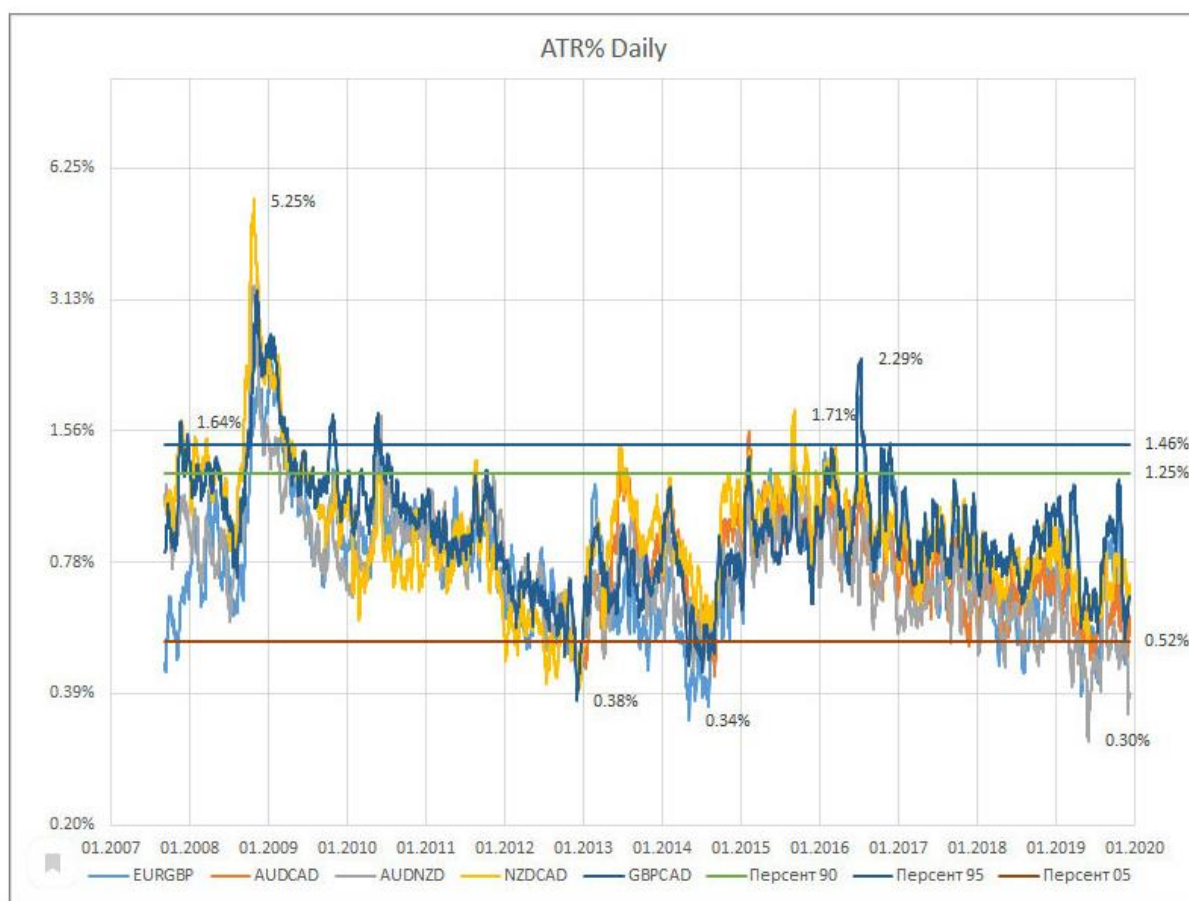
Плавающий диапазон сетки ордеров:

Как я писал выше, в советнике используется сетка ордеров, что довольно обычное дело для отбойных торговых систем. Но важный момент расчёта цены при которой откроется следующая позиция заключается в том, что нет какого либо фиксированного уровня который должна пройти цена, чтобы открылся следующий ордер. В зависимости от волатильности рынка рассчитывается цена следующего ордера. Если волатильность высокая, то ордера открываются реже. Если волатильность низкая, то ордера открываются чаще. Опять же, советник смотрит на рынок, а не использует зашитые в него жесткие параметры.

Проблемы низкой и высокой волатильности:

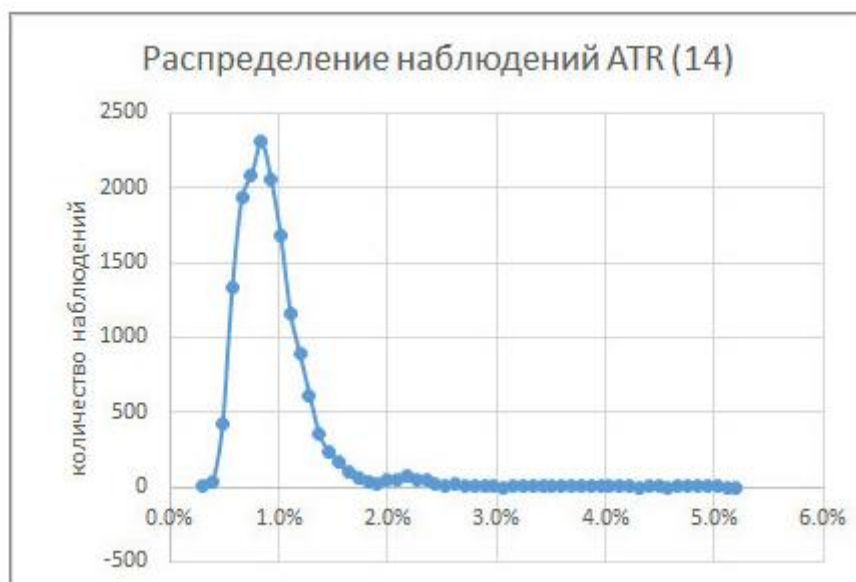
Избыточно высокая волатильность на рынках это проблема для отбойных систем, так как размах хождения рынка возрастает. Ярчайшим примером высокой волатильности на рынке форекс стал кризис 2008 года.

Для определения волатильности курсов валют я использую стандартный на рынке технически индикатор ATR (14) на дневном графике приведенный к процентным значениям (далее ATR%). Он показывает средний дневной размах хождения рынка. Ниже график ATR для основных пар советника TLAP CAPITAL и для потенциальных пар.



Что мы видим на этом графике? Видим, что в целом общей динамике волатильности на рынке следуют все валютные пары. При этом 90% волатильность всех пар находится в диапазоне от 0,52% до 1,46% (от 50 пунктов до 150 пунктов). В целом это соответствует нашим представлениям о том, что в среднем колебания на рынке форекс составляют примерно 1% в день (но по факту чуть ниже = 0,8%).

Интересно посмотреть график распределения наблюдений индикатора волатильности ATR.



В TLAP CAPITAL встроено ограничение работы советника на критичных значениях волатильности.

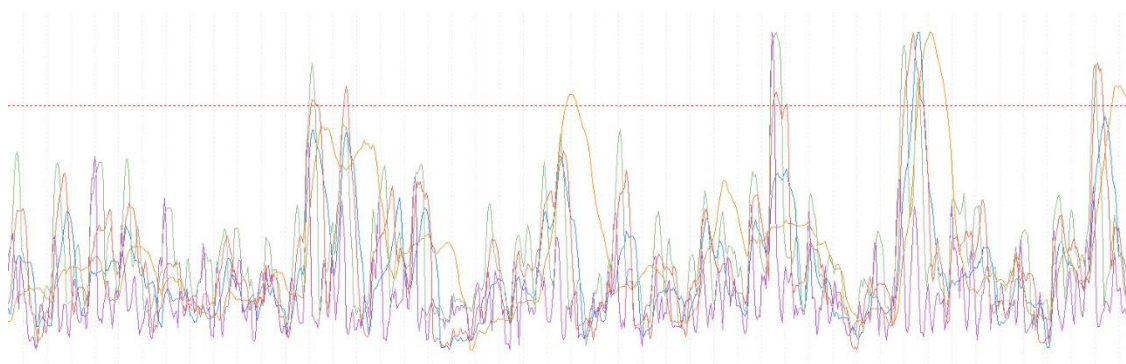
Так же преимуществом данной торговой стратегией является то, что если отключить всех пугающий мартингеил, то она всё равно остаётся очень прибыльной!

Преимущества режима Algorithm 15:

1-Универсальные параметры под несколько пар, что не дает подгонки под историю.

2-Необходим малый депозит, что дает лучшую прибыль при сложном проценте.

Торговля основана на вычислении канала среднего движения торговой пары, и при сильном отклонении от него, мы торгуем на возврат. Распределение всей позиции идет по сигналам от разных временных периодов. Каждая позиция закрывается при возврате к своим средним значениям. При очень сильном отклонении, которое происходит очень редко, мы усиливаем позиции в 2.5 раза, чтоб взять от рынка ещё больше прибыли.



Пример входов и выходов:

