

Формула расчета однонаправленных ордеров



Чтобы рассчитать среднюю безубыточную цену по сетке ордеров, следует применить следующую формулу:

$(Or1 * L1 + Or2 * L2 + Ori * Li) / (L1 + L2 + Li) = \text{Price Average}$, где

- Or1 — цена ордера №1;
- Or2 — цена ордера №2;
- Ori — последующие цены ордеров;
- L1 — объем первого ордера;
- L2 — объем второго ордера;
- Li — объем последующих ордеров.

Произведем расчеты и узнаем по достижению какой цены, сетка ордеров выйдет в ноль, для этого:

$$(1,13201 * 0,01 + 1,12904 * 0,01 + 1,12793 * 0,01 + 1,12635 * 0,01 + 1,12568 * 0,01) / (0,01 + 0,01 + 0,01 + 0,01 + 0,01) = 1,12822$$

Выходит, как только цена дойдет до цены 1,12822, сетка выйдет в плюсовую зону и здесь либо закрываем все по нулям, либо продолжаем удерживать позиции в надежде получить прибыль.