

Новые индикаторы пакета FOB

(2015-03-23)

Кратко.

Распаковываем архив в MT4 в "Каталог данных".

Скачиваем свежий fob.db3 и кладем в папку "Каталог данных"\MQL4\Files\SQLite

Создаем по 2 графика на каждый инструмент D1 и H1

Для D1 выбираем шаблон fob-D1

Для H1 выбираем шаблон fob-H1

Не забываем каждое утро после 10:00 скачивать СВЕЖИЙ файл update.upd и класть в папку "Каталог данных"\MQL4\Files\SQLite. Если там такой файл уже есть - перезаписать (удалить старый). Индикатор должен обновиться сам. Подождать. Если данные не обновились (дата не сменилась на сегодняшнюю), то перед скачиванием update.upd проверить его дату, она должна быть СЕГОДНЯШНЕЙ. В крайнем случае перезапустить MT4. В выходные дни при обновлении будет указана дата следующего понедельника.

Подробно.

Индикаторы.

На данный момент в пакете FOB 3 новых индикатора (в дальнейшем просто "индикаторы", список новых индикаторов далее по тексту). Всего в пакете FOB гораздо больше индикаторов, но остальные будут поступать по мере готовности.

Индикаторы работают на следующих ТФ: M15, H1, H4, D1, W1.

Цвета индикаторов выбраны для работы на черном фоне. Вы можете поменять эти цвета для своей цветовой схемы, но в описании даются исходные цвета. При построении графиков не используется котировки самого MT4. Данные берутся с Чикагской биржи, обрабатываются, попадают в базу данных и по ним строятся индикаторы в MT4. Линии на истории никогда не меняют своего положения. Один раз сформированный уровень на определенный день всегда остается на своем месте. Данные торговцев опционами формируются утром (с 9 до 10 по МСК) и попадают в базу в виде данных за "сегодняшний" день (т.е. опционщики торговали вчера до закрытия, а данные будут отображаться на графике и действовать сегодня с утра до закрытия американской сессии). Еще раз повторяю, нарисованная утром линия не сдвинется за весь день ни сегодня ни завтра ни в будущем. Нам остается только оценивать как цена будет двигаться относительно этих линий, насколько опционщики "угадали" с направлением движения цены?

"Линия" на графике представляется в виде линии только на ТФ ниже D1 и рисуется условно от 00:00 до 23:00. На ТФ D1 и W1 данные за день представляют из себя точку соединенную с прошлым днем линией. На W1 к тому же эта точка среднее между уровнями за прошлую неделю.

На графиках возможны "дыры" в один-два дня. За эти дни по каким-то причинам не было данных. Если дыра больше одного-двух дней, то возможно ваша локальная копия базы в это время не обновлялась. Можно загрузить последнюю базу для устранения дыры.

Индикатор SIP

Этот индикатор представляет из себя 7 горизонтальных линий соединенных или нет между собой на основном графике. Любые из линий можно выключить или переключить в связанный или отдельный вид. ColorX - цвет линии X, LevX - отображать в виде отдельных горизонтальных линий (работает только на ТФ ниже D1), VisX - отображать или нет вообще на графике. tolsh0_3 tolsh4-6 - толщины первых 4-х и последних 3-х линий. "Дата начала диапазона" - с какой даты рисовать графики (ускоряет отображение, на обновление базы не влияет). "Имя локальной базы", "Имя базы для пополнения" - имена баз, лучше не трогать, но если сменить, то индикатор будет работать с другими базами, которые должны быть созданы заранее. "Проверять MySQL сервер?" если включить, то индикатор для текущего инструмента будет обновлять данные с удаленного сервера. Пока недоступно.

Пара тонких оранжевых линий (цвет "Coral") указывает "канал" настроений торговцев опционами. Обычно цена движется в этом канале. Чаще всего опционщики правильно оценивают настроение цены и в своих прогнозах сдвигают канал в сторону возможного движения цены. Но иногда цена уходит из этого канала, это значит опционщики недооценили какие-то факторы и на следующий день канал обязательно сдвинется в эту сторону. Причем обе линии канала движутся в сторону вероятного движения цены. Если сдвигается только линия которую цена пробилла, а противоположная осталась на месте или даже пошла в другую сторону (канал расширяется), опционщики в неопределенности от дальнейшего движения, надо готовится к останову движения и скорее всего к флету. Т.е. чем уже канал тем более четко опционщики понимают цену.

От этих оранжевых линий очень вероятно цена будет (в течении дня или в ближайшие дни) отбиваться. Но чаще всего цена находится возле той линии куда цена вероятнее всего будет двигаться. Т.е. на снижающемся тренде цена возле нижней линии, на повышающемся возле верхней.

Красная линия более четко указывает тренд (тонкая "Красная Линия Смены Тренда" - КЛСТ). На медвежьем тренде цена возле нижней оранжевой линии, а красная линия-КЛСТ возле верхней оранжевой (на бычьем наоборот). Если КЛСТ отлипает от верхней линии и начинает приближаться к середине канала (между нижней и верхней оранжевыми линиями), а цена при этом отлипает от нижней и начинает идти ей навстречу и даже пересекает, то это явный признак смены тренда на бычий. Он может быть успешным, если цена пробилла КЛСТ с силой, закрепилась выше нее и пошла к верхней оранжевой линии, а КЛСТ прилипла к нижней оранжевой - тренд сменился на бычий. Если цена отскочила от КЛСТ или пробилла ее вяло, топчется над ней, а сама КЛСТ не идет вниз к нижней оранжевой - смену тренда задавили и возможно продолжится медвежий или флет. (Для смены с бычьего на медвежий все наоборот).

Белая линия более "живая". Она при смене тренда раньше чем КЛСТ становится на пути цены. Если КЛСТ уже отлипла от одной границы, пришла в середину канала, то попытаться торговать пробой белой линии или пробой-отскок от нее выгоднее, чем пробой КЛСТ. При пробое КЛСТ стоплосс надо ставить сразу под КЛСТ если цена вдруг вернется обратно. Хороший разворот резко пробивает КЛСТ.

Пара толстых линий Голубая и Светло оранжевая (цвета "SkyBlue" и "LightSalmon") указывают на границы опционщиков по Call и Put. Они актуальны перед и во время экспираций опционов (обычно первые пятницы месяца). В день экспирации зона между ними показывает вероятный возврат цены после экспирации. Если только цена перед экспирацией ушла далеко от этой зоны.

Зеленая толстая линия, что-то среднее между границами Call и Put.

Лучше всего индикатор SIP накладывать на 2 графика D1 и H1. D1 можно в процессе работы переключать на W1, чтобы посмотреть на недельный настрой. H1 можно переключить на H4 или M15 для интрадей торговли или выборе лучшей точки для входа. Не забываем, что данные ЕЖЕДНЕВНЫЕ, т.е. утром уровень строится на ВЕСЬ ДЕНЬ.

Индикатор OIF

Этот индикатор показывает изменения за день в количестве ОИ фьючерсов. Обычно перед экспирацией (в течении недели) фьючерсов начинаются сбрасывания фьючерсов, чтобы после экспирации набрать новых. Если фьючерсы сбрасываются (палка вниз) между экспирациями - рынок утончается и становится непредсказуемый, лучше не торговать, т.к. цена может полететь в любую сторону - вероятность оценки движения цены снижается. Набор фьючерсов (палка вверх) говорит о приходе сильных игроков в рынок. О направлении набора фьючерсов (лонги или шорты) можно судить как и по объемам - только косвенно по результатам движения цены.

В настройках все просто. Те же пункты, что и в индикаторе SIP. Если вы обновляете через MySQL сервер, то включать обновление достаточно в индикаторе SIP, т.к. данные для них обновляются совместно.

Накладывать индикатор можно на индикатор FOB, ODK, COT или отдельно.

Индикатор STRIKE

Индикатор показывает уровни ОИ опционщиков на текущем контракте по Call и Put на сегодняшний день. Голубая линия - Call, Оранжевая линия - Put. Длина показывает количество контрактов на данном уровне. Кроме общих настроек (цвет и имена баз) есть настройка **Scale** - это коэффициент длины линий. Количество контрактов на этом уровне умножается на этот коэффициент. Для каждого инструмента и ТФ лучше подобрать свой коэффициент, чтобы показывались уровни самые важные, на которых больше всего контрактов и линии были не сильно длинными. Чтобы самый мощный уровень был не шире дня (для H1 или H4) или пары дней (для D1 или W1). **Shift** указывает вертикальный сдвиг линий (колл вверх, пут вниз), чтобы линии коллов и путов не накладывались. Для D1 можно поставить 4, для меньших ТФ 1-2. **Vert** - указывает рисовать ли вертикальную линию откуда идут уровни. Если на графике включена опция "Отображать начала периодов" и уровни идут от них, то вертикальную линию нет смысла отображать.

Поскольку уровни рисуются только на текущий день, то а следующий день вчерашние уровни будут стерты. Для D1 это не актуально, т.к. прошлые уровни сильно замусорят график. А на ТФ ниже D1 возможно кому-то захочется оставлять прошлые уровни. Для этого после подбора параметров Scale и Shift можно включить Keep. Тогда на следующий день вчерашние уровни не будут удаляться. Но чистку ненужных уровней пользователь берет на себя ("Список объектов" объекты "Call-XXX-YY", "Put-XXX-YY", где XXX это номер уровня, а YY-день). В описании уровня (можно увидеть при наведении указателя на уровень) указано количество контрактов на этом уровне (ОИ) и разница от вчерашнего (дельта ОИ).

От этих уровней цена вероятнее всего будет в течении дня или отбиваться или пробивать с силой. Понятно, что чем длиннее линия, тем больше контрактов, тем сильнее уровень сопротивляется.

Обновление локальной базы.

Индикаторы больше не будут использовать в работе файлы *.csv и *.dat. Работают они сейчас с единой локальной базой fob.db3 (далее просто "база") находящейся в каталоге Files\SQLite (возможно в дальнейшем она будет перенесена в другой каталог, но пока там).

В этой базе находятся данные по всем рабочим инструментам (список в конце) за все обработанные года (2013-2015 гг).

Поскольку новые данные появляются утром рабочего дня с 8 до 10 (иногда бывает задержка до 13-14 часов МСК), то база требует ежедневных обновлений. Можно ежедневно скачивать базу с сайта и заменять ее. Но поскольку база большая (сейчас около 500 кб) и в дальнейшем при подключении новых индикаторов, новых инструментов и загрузки новых данных она будет только расти, лучше один раз скачанную базу не трогать, а только обновлять. Если инструмент не поддерживается индикатором, то в левом верхнем углу будет написано "XXX не поддерживается" и индикатор не запустится.

Два способа обновить базу:

1. Онлайн.

В данное время пока не доступен. Но при появлении выделенного сервера баз данных это станет главным способом обновления базы.

Достаточно в SIP и STRIKE на одном из ТФ на каждом инструменте в настройках включить пункт ("Проверять MySQL сервер?").

При недоступности сервера эта опция ни на что не влияет и задержек в работе индикаторов не вызывает (надеюсь не вызывает). Но если сервер доступен, то при запуске индикатора, смене ТФ или изменении настроек индикатор проверит наличие новых данных на сервере. Если они есть, то он скачает их в базу. При невысокой скорости Инет-соединения это может притормозить работу МТ4 на несколько секунд (или даже минут, но обновление происходит только один раз в день). В дальнейшем будет отдельная программа UpdateDB.exe которая будет обновлять базу вне зависимости от того запущен или нет МТ4.

2. Оффлайн.

Пока это единственный способ обновить базу. При появлении сервера баз данных этот способ станет запасной-аварийный для обновлений.

Для обновления через файл обновлений надо с сайта ежедневно (не раньше 9:00) скачивать файл update.upd с новыми данными для базы (перед скачиванием убедитесь, что у файла на сайте сегодняшняя дата). В нем будут находиться данные для обновления базы за последние 2-3 недели до текущего дня (включительно). Этот файл нужно положить в каталог Files\SQLite (где находится база). Если база не обновлялась дольше 2-3 недель, то после обновления на графике появится "дыра" размером столько дней - сколько разница между днем последнего обновления базы и самой старой информацией в файле обновлений (не путать с дырками в один день когда просто не было данных для анализа - их закрыть нечем). Это пропуски в обновлениях можно ликвидировать только полным скачиванием свежей базы.

О том что база (для текущего инструмента и индикатора) находится в актуальном состоянии (все данные загружены) указывает в правом верхнем углу графика (ниже логотипа) дата. Если она совпадает с сегодняшней, то данные в базе актуальны. Файл update.upd можно не удалять, а заменить при следующем обновлении на следующий день новым. Когда появится программа UpdateDB.exe она сама будет обновлять базу с сервера или из уже скачанного файла update.upd. При манипуляциях с файлом update.upd (замене, удалении) не удалите саму базу fob.db3. При удалении базы вам ее придется скачать заново с сайта.

Если есть возможность обновлять и через сервер и через файл обновлений, то индикаторы (или

программа UpdateDB.exe) вначале обновит из файла обновлений, а потом проверит сервер. Дублирования обновлений не произойдет.

При наличии обновлений или при их отсутствии, индикаторы будут работать с теми данными в базе которые есть. Для работы индикаторов с историей обновление базы не требуется.

Инструменты поддерживаемые индикаторами пакета FOB:

GBPUSD

EURUSD

AUDUSD

USDCAD

USDCHF

USDJPY

XAUUSD

XAGUSD

Анаптаниум с Пандоры

Предложения по расширению списка инструментов приветствуются. Если нам это будет интересно, то список пополнится вашим предложенным инструментом. Только прежде чем предлагать инструмент убедитесь, что он торгуется на Чикагской бирже и по нему там гораздо больше чем 2 контракта (как у шекеля или рубль который вообще перестал там торговаться). Ну и поскольку хоть мы и анализируем торговлю опционами на Чигаской бирже, но торгуем на Форекс (пока), то желательно, чтобы инструмент на нем был представлен (грустно ведь определить направление движения инструмента при невозможности получить с этого профит?). Торговля по индикаторам пакета FOB представленная выше - один из вариантов использования. Есть и другие, например, на отскок и пробой уровней.

Если вы обнаружили интересные закономерности движения цены вокруг наших индикаторов — пишите - обсудим. Самым активным — бонусы.

Все коммерческие предложения в личку.

astroill@gmail.com

ЗЫ. Для хакеров. Не имеет смысла взламывать наши индикаторы. В индикаторах никаких хитростей, только код отображающий готовые данные на графике. Т.е. берем значение из базы и отображаем на графике в виде уровня. Подготовка самих данных ведется на сервере. Процесс подготовки данных автоматизирован пока на 90% и является KnowHow. Процесс подготовки данных пока скрыт от общественности, чтобы привлечь заинтересованных лиц к развитию проекта. Наша цель не зарабатывать на продаже проекта или данных от него, а заработать на Рынке используя проект.

Зачем пытаться продавать спиннинги или конструкцию катушек для спиннингов, если можно кушать рыбу пойманную на эти спиннинги?

Примеры графиков D1 и H1

