

Horizon Auton Algo 擴展功能

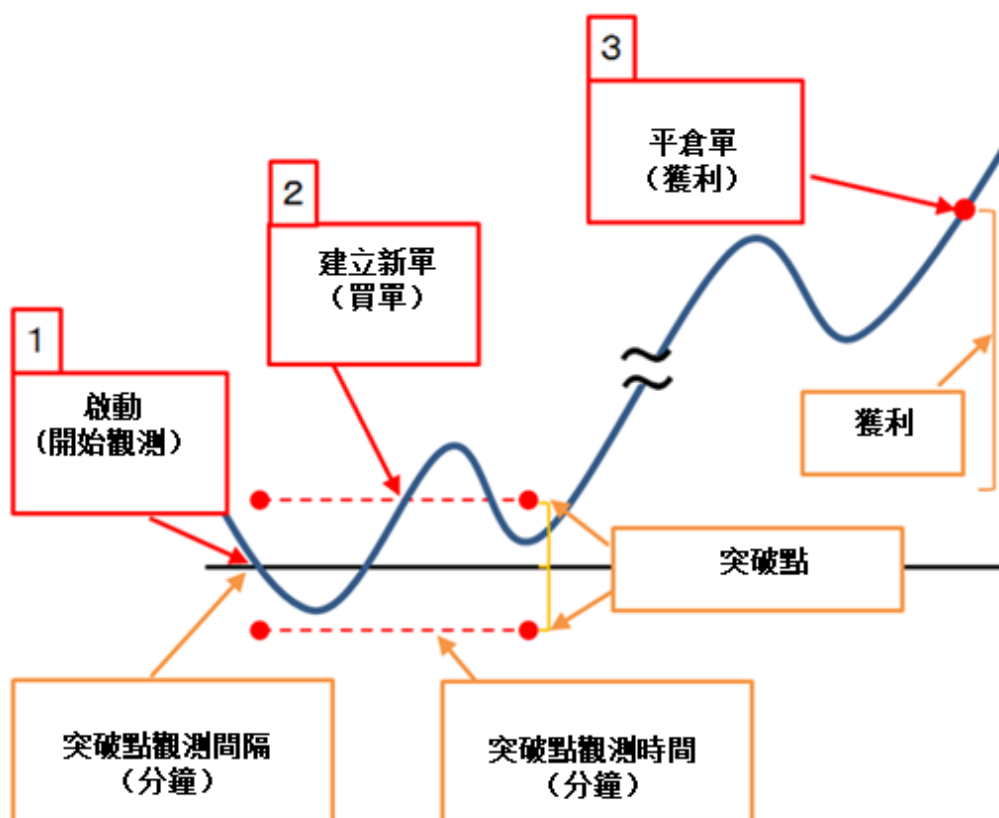
趨勢跟蹤 If Done 操作手冊

TFi (Trend Follow if Done)

概要

本擴展功能，可跟蹤趨勢（與趨勢同方向）建立新單，並設置限價平倉單及限價止損單。新單的方向，是根據事先定好的時間的行情波動方向決定的。

· 運行流程(匯率上漲的情況)



1. 啟動

每天 24 小時內，在設定的時間（例如：每間隔 60 分鐘）開始觀測匯率的波動。

2. 建立新單

根據匯率波動的方向（判斷上漲還是下跌）自動建立新單（上漲買入，下跌賣空）。

3. 平倉單

自動平倉或止損。

- 上圖是匯率上漲時的情況，下跌的時候也會運行。不同的是建立的是賣空新單。
- 可選擇新單的買賣方向，有 “只買入”、“只賣空”、以及 “買入或賣空” 這三種選項。

- 平倉單的止盈或止損，只要價格到達事先設定的值會自動成交。
- 平倉單的止盈或止損可以取消。

建立新單的條件

每天 24 小時內，在設定的時間間隔（例如每 60 分鐘）點開始觀測匯率的波動。
匯率波動到達設定值後建立新單。

•買單

記錄開始觀測的時間間隔點的匯率。如果匯率上漲，在觀測時段內到達突破點，則建立買入新單。

•賣單

記錄開始觀測的時間間隔點的匯率。如果匯率下跌，在觀測時段內到達突破點，則建立賣空新單。

平倉單的條件

•買單

一旦到達設定的止盈、止損價格，則平倉單運行。

•賣單

與買單相同。

參數

[Lots] (每次交易的訂單數)

每次交易的訂單口數。可指定 1-500 的任一整數。
Sterling 證券的外匯為例，每口交易為 1 萬貨幣單位。

[Keep Positions Maximum] (最大同時持有頭寸數)

設置同時持有頭寸數量的上限值。

未平倉頭寸的總數達到設定值後，就無法成交新單。

所有的未平倉頭寸（通過本 Algo 程式成交單、其他的 Algo 程式成交單、手動成交單）都會計入總數。以上所有頭寸的總數量達到設定值後，就無法成交新單。

假設“最大同時持有頭寸數”為 1，如果同時開啟了 2 個本 Algo 程式，那麼只要其中某個成交了新單，另一個程式的頭寸就無法成交。如果未平倉頭寸數量恢復到 0，那麼先滿足成交條件的程式建立新單。

每次的突破點觀測時間建立的頭寸數量，是由[Lots]（每次交易的訂單數）決定的。如果“最大同時持有頭寸數”是 2，那麼當下次突破條件滿足時，會成交第 2 口訂單。

[Sell Buy] (買賣種類(1=買入,2=賣空,0=買&賣))

新單有：(1)只買入、(2)只賣空、(0)買入或賣空、3 個選擇。

[TP Points] (止盈 T/P(限價平倉單))

設定當持有的頭寸盈利增加到一定程度時，將該盈利平倉。平倉的價位是以點數設置。新單成交後，該頭寸會立即被設置獲利平倉單。獲利平倉單的設置是由交易系統的伺服器發出的。因此，即使關閉運行系統的電腦，該獲利平倉單也是有效的。

點數是外匯匯率的最小單位 (1pip=10 點)。以美元兌日元為例，50 錢=500 點。

外匯交易請將此參數設置為 150 以上的整數。

取消該設置，可以輸入 0。如果設置為 0，意味著沒有設置限價。

[SL Points] (止損 S/L(倒限價平倉單))

設定當持有的頭寸虧損到一定程度時，將該虧損平倉。止損的價位以點數設置。

新單成交後，該頭寸會立即被設置止損平倉單。止損平倉單的設置是由交易系統的伺服器發出的。因此，即使關閉運行系統的電腦，該止損平倉單也是有效的。

點數是外匯匯率的最小單位 (1pip=10 點)。以美元兌日元為例，50 錢=500 點。

外匯交易請將此參數設置為 150 以上的整數。

取消該設置，可以輸入 0。如果設置為 0，意味著沒有設置倒限價。

[Measurement Time Intervals] (突破點觀測間隔 (分鐘))

設定觀測突破點的間隔分鐘數。

每天 24 小時內，按照設定的間隔 (分鐘)，開始突破點的觀測。

[Measurement Minutes] (突破點觀測時間 (分鐘))

以分鐘設置觀測突破的有效時間。

匯率只有在“突破點觀測時間 (分鐘)”內到達突破點，才會觸發新單指令。

請設置 1 以上的整數。

“突破點觀測時間 (分鐘)”請設定小於“突破點觀測間隔 (分鐘)”。

[突破點] (Break Points)

突破點，是指以開始觀測時的匯率為基準值，到建立新單之間的點差值。

假設突破點設為 200，那麼開始觀測時的匯率往上或往下走 200 點的時候，就到達突破點了。

買入新單：開始觀測時的買價+突破點以上的價位，現價買單成交。

賣空新單：開始觀測時的賣價-突破點以下的價位，現價賣單成交。

點數是外匯匯率的最小單位 (1pip=10 點)。以美元兌日元為例，50 錢=500 點。

外匯交易請將此參數設置為 10 以上的整數。

[Order Interval Minutes] (下單時間間隔 (分鐘))

新訂單成交後，到下次的新訂單成交前的時間間隔。

該功能，是為了避免當參數“最大同時持有頭寸數”設定為 2 的時候，短時間連續下單的情況。

新訂單之間的時間間隔以分鐘設定。

[Acceptable Slippage Points] (允許滑點偏差)

滑點是指下單時的報價與實際成交價格的價格差。行情波動劇烈的情況下，有發生滑點的可能，成交價可能對客戶不利、也有可能對客戶有利。

為了應對滑點，可以設定滑點的點差範圍。

點 (points) 是指外匯匯率的最小單位 (1pip=10points)。以美元兌日元為例，50 錢=500 點。

[Order Retry IntervalSeconds] (再次下新單時間間隔)

新單未能成交的情況下，至下次新單成交的時間間隔 (秒)。此處設定的秒數內，新單會停止成交。

新單未成交的情況下，會繼續判斷新單的條件是否滿足，如果滿足則新單成交。

請設置為 30 秒以上。設定秒數如果過短，同一訂單可能會重複成交。

其他說明

[共通項目 (所有 Algo 程式全部共通)]

- 本 Algo 程式只能在 Sterling 證券的 Horizon Auton 內運行。
- 本 Algo 程式，是不間斷地監控買賣 (開倉單和平倉單) 條件的，因此在執行 Algo 程式的時候，請保持交易系統在登錄狀態下。
- Horizon Auton 在週末收盤後因系統維護的原因會被強制登出。Algo 程式也會隨著登出而停止。
- Algo 程式的連續啟動週期最長為 1 周。週末會自動平倉。如果要連續使用 Algo 程式，請每週一啟動 Algo 程式。
- Algo 程序會停止的狀況 (除了在 Algo 執行畫面進行停止操作以外)，關閉 PC，或是 PC 休眠狀態時，結束 HorizonAuton (包括退出) 時，或是切換帳戶時 (從 FX 帳戶切換到商品帳戶等)。
- 本 Algo 程式，通過 Windows 的文檔管理可以進行 copy 或是改變名稱。使用改變初期值，請使用 copy 文檔。
- 在操作回溯測試的時候，請使用本公司網頁所公開的歷史數據 (以往的 1 分鐘的 rate data)。
- 本 Algo 程式的內部處理時間是日本時間減去 1 個小時為基準來運轉的。(例：日本時間 7:00/伺服器時間 6:00) 這個地方，如果是專業人士的話就時間方面的處理時有必要進行考量。
- 相當於 MT4 Magic Number 的參數，由系統隨機分配。

[單獨項目 (本 Algo 程式的單獨項目)]

- 本 Algo 程式的設置可自動應對關閉和重啟操作，當 Algo 程式重啟的時候，系統會自動確認頭寸持有狀況，維持程式的正常運行。
- 本 Algo 程式停止時，不會建立新單。每個頭寸的平倉都設有限價和倒限價。即使登出交易系統，頭寸也會被平倉。
- 本 Algo 程式，可以同其他的 Algo 程式以及手動交易一起使用。
- FX 交易時，如果設置止盈或是止損點的單邊時，設定為 150 以上。
- FX 交易時，如果同時設置止盈和止損點，建議兩者之間的差值設定為 400 以上。

- CFD 交易的止盈和止損點的最小差值，各商品間有差異。請按照交易系統顯示的限價最小值的 1.5 倍以上為標準設定。
- “時間標度” 選項不用修改。如果 “時間標度” 設置為 “Tick” 會提示出錯。只要選擇 “Tick” 以外的選項，本 Algo 程式的操作都是相同的。
- 下圖為在進行回溯測試時，未使用本公司所公開的歷史數據，用過去的價格設定 2000 點時是否有交易（參考）。

○:交易次數 1 次以上。×:無交易。

TFi	1 分鐘	5 分鐘	15 分鐘	30 分鐘	60 分鐘	4 小時
15	○	○	○	×	×	×
30	○	○	○	○	○	×
50	×	×	○	○	○	○

TFi	日	週	月	Tick
15	×	×	×	×
30	×	×	×	×
50	×	×	×	×

※根據週期會出現是否有交易的現象發生。

※根據產品或是市場的狀況會出現是否有交易的現象發生。

Algo 程式的運行方法

按以下順序運行。

- (1) 啟動 Horizon Auton。
- (2) 點擊 Horizon Auton 右上角的 “Algo 執行” 按鈕，或在 Horizon Auton 上方功能表點擊 “檢視” > “Algo 執行” 按鈕。
- (3) 點擊 “選擇 Algo” 按鈕，打開下載的擴展功能文檔。
- (4) 點擊 “指定產品執行” 使其變為藍色。
- (5) 點擊 “執行” 。
設置產品、時段等參數。
點擊 “確定” 按鈕，開始運程式。
- (6) 在運行介面可查詢到 Algo 程式的運行記錄。
- (7) 點擊 Algo 執行介面的 “停止” 按鈕，即可終止 Algo 程式。

完