

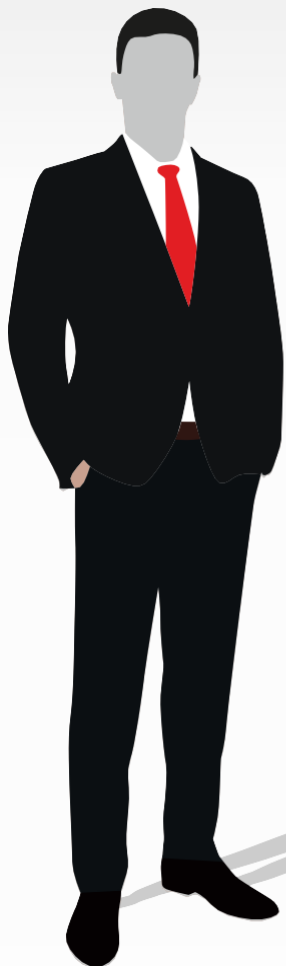
Рейтинг роботов

Лучшие из лучших

А

Прямо
к цели

Рейтинг роботов – это список роботов, которые приносят доход в текущий момент



1

Начинающим

простой и понятный сервис для запуска торговых роботов

2

Тем, у кого нет времени

сервис позволяет минимизировать время обоснованного выбора торговых роботов

3

Профессионалам

удобный инструментарий для оценки работоспособности стратегий

«**Торговые роботы**» – бесплатный встроенный модуль в терминале Альфа-Директ 4.0. Позволяет создавать новые торговые стратегии или использовать классические из базы, проверять их прибыльность на истории. Запускать роботы, которые будут автоматически совершать операции, и контролировать их.

Торговая стратегия

— это торговый алгоритм (код), записанный в виде правил, включающий условий и соответствующих им действий, которые определяют моменты совершения операций на открытие и закрытие позиции.

Робот

— это исполняемый файл, выбранной торговой стратегии, в которой заданы: инструмент, значения всех параметров и переменных, указан номер портфеля, по которому будет вестись торговля.

Робот может быть запущен в следующих режимах:

- «Советник» – тестовый режим работы робота, который предусматривает расчет сигналов и учет возможности их исполнения, но без отправки реальных торговых поручений, данный режим может быть использован для тестирования стратегии в реальном времени.
- «Робот» – автоматизированный режим работы, при котором производится расчет сигналов, а так же происходит отправка реальных торговых поручений и учет их исполнения.

1 Классические стратегии

Имя	Код	Алгоритм	Разработчик
Alfa_AMA		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_AMA_Weight		ТРЕНД	MadMan
Alfa_AO_SMA	✓	ОСЦИЛЛЯТОР (трендовый)	Alfadirect
Alfa_CCI		ОСЦИЛЛЯТОР (трендовый)	Alfadirect
Alfa_CCI_ContrTrend		ОСЦИЛЛЯТОР (контртрендовый)	Alfadirect
Alfa_CCI_PSAR		ОСЦИЛЛЯТОР (трендовый)	Alfadirect
Alfa_CCI_SO		ОСЦИЛЛЯТОР (трендовый)	Alfadirect
Alfa_EHMA		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_MA_EE		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_MA_ES		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_MA_EW		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_MA_SE		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_MA_SS	✓	ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_MA_SW		ТРЕНД	AlfaDirect
Alfa_MA_WE		ТРЕНД	AlfaDirect
Alfa_MA_WS		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_MA_WW		ТРЕНД	AlfaDirect
Alfa_MACD		ОСЦИЛЛЯТОР	Alfadirect
Alfa_MACD_Momentum	✓	ОСЦИЛЛЯТОР	Alfadirect
Alfa_MACD_SMA		ОСЦИЛЛЯТОР	Alfadirect
Alfa_Momentum_MA	✓	ОСЦИЛЛЯТОР (трендовый)	Alfadirect
Alfa_Momentum_Sign		ОСЦИЛЛЯТОР (трендовый)	AlfaDirect
Alfa_PC		ПРОБОЙ	Alfadirect
Alfa_PC_AO	✓	ПРОБОЙ	Alfadirect
Alfa_PSAR		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_Regr_PSAR		ТРЕНД	MadMan
Alfa_RegrCoef_Signal		ОСЦИЛЛЯТОР (трендовый)	Alfadirect
Alfa_RegrCoefWeight...		ОСЦИЛЛЯТОР (трендовый)	Alfadirect
Alfa_Regress		ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_Regress_Level_S...		ОСЦИЛЛЯТОР (контртрендовый)	Alfadirect
Alfa_Regress_SMA_Cross	✓	ТРЕНД	Alfadirect
Alfa_Regress_Weight		ТРЕНД	Alfadirect

2 Лучшие роботы

Имя	Тикер	Прибыль	График роста капитала
Alfa_Regress_SMA	MAGN (H1)	60,1	
Alfa_MACD	SBERP (H1)	56,6	
Alfa_MACD_Mome...	RSTI (H1)	70,8	
Alfa_SMA_RegrCoef	MAGN (H1)	61,4	
Alfa_SMA_RegrCoef	RSTI (H1)	74,9	
Alfa_MA_SW	MAGN (H1)	63,4	
Alfa_MACD_Mome...	FEES (H1)	70,9	
Alfa_SO_Signal	AFLT (H1)	71,6	
Alfa_SO_Signal_MA	GMKN (H1)	58,0	
Alfa_SMA_Signal_...	SNGSP (H1)	55,1	
Alfa_CCI	FEES (H1)	80,7	
Alfa_SO_Signal_MA	SNGSP (H1)	57,6	
Alfa_SO_Signal_MA	AFLT (H1)	57,6	
Alfa_MACD_SMA	RASP (H1)	66,2	
Alfa_SO_Signal	SBER (H1)	61,1	
Alfa_SO_Signal	SNGSP (H1)	51,0	
Alfa_SO_Signal	SNGSP (H1)	51,0	
Alfa_MA_SS	SNGSP (H1)	51,0	

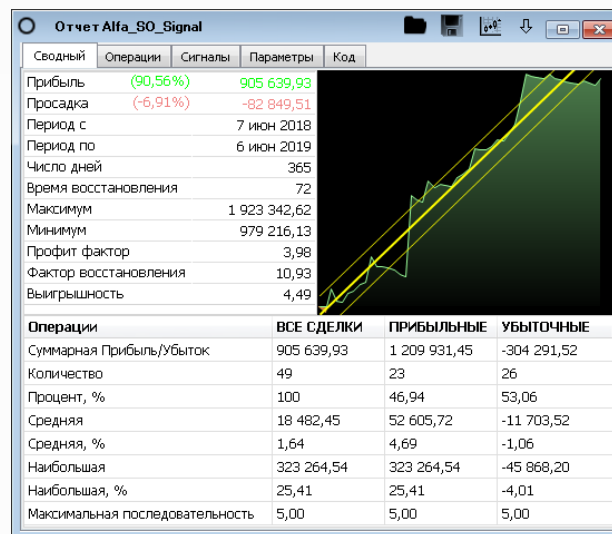
3 Запущенные роботы

Имя	Субсчет	Тикер	Рынок	Позиция	Объем	Время	Посл. Сигнал	НПУ
Alfa_AO_Signal		RSTI (H1)		-1000	EnterShort			0
Alfa_MA_SS	15813-000	RASP (H1)	МБ ЦК	10	EnterLong	12.09.17 13:08:48		0
Alfa_MACD_Momentum	15813-000	FEES (H1)	МБ ЦК	0				0
Alfa_Momentum_MA	15813-000	MOEX (H1)	МБ ЦК	-10	EnterShort	12.09.17 13:08:50		0,6
Alfa_Regress_SMA_Cross	15813-000	MAGN (H1)	МБ ЦК	100	EnterLong	12.09.17 13:08:52		2
Alfa_SO_Signal	15813-000	AFLT (H1)	МБ ЦК	-100	EnterShort	12.09.17 13:08:52		0
Alfa_SO_Signal_MA	15813-000	SBERP (H1)	МБ ЦК	100	EnterLong	12.09.17 13:08:53		31

Сообщения

Время	Текст	Робот
12.09.2017 1	Робот Alfa_Regress_SMA_Cross(268441498) создан	Alfa_Regress_SMA
12.09.2017 1	Инструмент SBERP (H1)=МБ ЦК. Робот: 100шт (162.470р.)	Alfa_SO_Signal_MA
12.09.2017 1	Совершена сделка N993796485 на покупку 100шт	Alfa_SO_Signal_MA
12.09.2017 1	Выставлена заявка N92391693581 на покупку 100шт	Alfa_SO_Signal_MA
12.09.2017 1	Открытие длинной позиции на 100шт (до максимального количе	Alfa_SO_Signal_MA
12.09.2017 1	Инструмент SBERP (H1)=МБ ЦК. Робот: 0шт (0.000р.)	Alfa_SO_Signal_MA
12.09.2017 1	100% данных получено	Alfa_SO_Signal_MA
12.09.2017 1	Инструмент MAGN (H1)=МБ ЦК. Робот: 100шт (42.705р.)	Alfa_Regress_SMA
12.09.2017 1	Совершена сделка N993796483 на покупку 100шт	Alfa_Regress_SMA
12.09.2017 1	Инструмент AFLT (H1)=МБ ЦК. Робот: -100шт (197.950р.)	Alfa_SO_Signal
12.09.2017 1	Совершена сделка N993796482 на продажу 100шт	Alfa_SO_Signal
12.09.2017 1	Открытие длинной позиции на 100шт (до максимального количе	Alfa_Regress_SMA
12.09.2017 1	Робот запущен	Alfa_SO_Signal_MA
12.09.2017 1	Открытие короткой позиции на 100шт (до минимального количе	Alfa_SO_Signal
12.09.2017 1	Инструмент AFLT (H1)=МБ ЦК. Робот: 0шт (0.000р.)	Alfa_SO_Signal

В терминале есть все, что необходимо клиенту для автоматизации торговли с помощью роботов !

РОБОТ = Стратегия + Инструмент + Параметры**1**Выбор
стратегии**2**Выбор
инструмента**3**Выбор
параметров

Для выбора лучших роботов необходимо проделывать процедуру создания и тестирования много раз!

Какое количество роботов надо проверить?Среднее кол-во
параметров в стратегии

$$40 \times 50 \times 100^2 = 20 \text{ млн}$$

Кол-во стратегии

Число акций

Среднее кол-во
значений параметров

Роботов

Полномасштабную оценку всех роботов невозможно выполнить в ручную!
Такой объем вычислений можно сделать только в автоматическом режиме.

1 уровень: тест за 1 год

Критерии фильтрации: Прибыль, Просадка, Риск/Доходность, Профит фактор, число сделок

2 уровень: тест за 3 года

Критерии фильтрации: Прибыль, Просадка



3 уровень: тест за 3 месяца

Критерии фильтрации: экспертная оценка



В результате проведенного отбора остаются только лучшие роботы

Рейтинг роботов по рынку: МБ ЦК

Макс. прибыль		Прибыль/риск		Мин. просадка
Имя	Рынок	Тикер	Прибыль	График роста капитала
		Прибыль/Риск	Просадка	
 Alfa_CCI_SO	МБ ЦК	MTLR (H1) 12,6	71,8 -11,4	
 Alfa_SO_Signal	МБ ЦК	MOEX (H...) 15,2	62,5 -5,5	
 Alfa_SO_Signal	МБ ЦК	SBER (H1) 15,8	59,0 -6,5	
 Alfa_RegrCoef_Si...	МБ ЦК	ROSN (...) 11,5	55,9 -8,5	
 Alfa_SO_Signal_MA	МБ ЦК	NLMK (H...) 9,8	46,4 -3,1	

Тестировать Создать робот

Рейтинг роботов по рынку: МБ ЦК

Макс. прибыль		Прибыль/риск		Мин. просадка
Имя	Тикер	Прибыль	Просадка	График роста капитала
Рынок	Прибыль/Риск			
Alfa_CCI_SO	MTLR (H1)	71,8	-11,4	
МБ ЦК	12,6			
Alfa_SO_Signal	MOEX (H...	62,5	-5,5	
МБ ЦК	15,2			
Alfa_SO_Signal	SBER (H1)	59,0	-6,5	
МБ ЦК	15,8			
Alfa_RegrCoef_Si...	ROSN (...)	55,9	-8,5	
МБ ЦК	11,5			
Alfa_SO_Signal_MA	NLMK (H...	46,4	-3,1	
МБ ЦК	9,8			

Тестировать Создать робот

Создание робота

Веберите субсчет, задайте сумму и нажмите кнопку создать.

Алгоритм Alfa_SO_Signal_MA
 Инструмент НЛМК ao (NLMK)
 Таймфрейм 1 час (H1)

Субсчёт 16107-000

Сумма 707

Предельная позиция робота Long: 10
 Short: -10

1 лот = 10 шт.
 Стоимость лота: 1707

Создать Отмена

Библиотека стратегий

Имя	Компиляция	Код	Алгоритм
Close+SMA	✓		ТРЕНД
CrossMA	✓		Тренд
don1	✓	🔗	
don2	✓	🔗	
ex_Alert	✓	🔗	ПРИМЕР
ex_ClosePos	✓	🔗	ПРИМЕР
ex_ImWorking	✓	🔗	ПРИМЕР
example_1Input	✓	🔗	
example_BRS		🔗	
example_CloseLimit	✓	🔗	
example_ELL		🔗	ПРИМЕР
example_ELL+BRS	✓	🔗	
example_ELL+BRS+TestOrder	✓	🔗	
example_ELL+CLL	✓	🔗	
example_ELS	✓	🔗	
example_Input	✓	🔗	

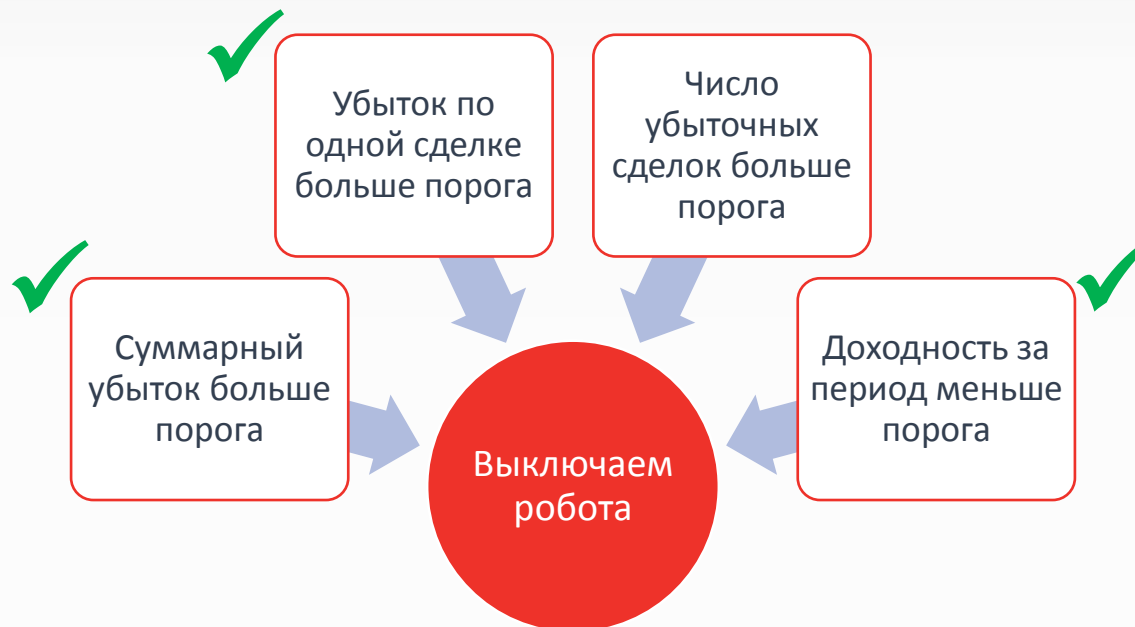
Новая стратегия **Тестировать** Оптимизировать Создать робот

Для диверсификации активов используйте 4 и более роботов



Почему в кратком списке Рейтинга роботов 5 роботов?

Для себя проведите такую аналогию :
робот - это доверительный управляющий



Перед запуском определите пороговые значения для расторжения договора с роботом

★ Диспетчер Роботов

Статус	Имя	Тикер	Позиция	Посл. Сигнал	НПУ
Тип	Субсчёт	Рынок	Объём	Время Посл. ...	Прибыль ▲
Работает	forts_Delta_MATrail_S...	SIU9 (M1)	-2	EnterShort	30,00
Робот	16107-000	ФОРТС	-128756	09.07.19 18:2...	-244,00
Работает	StepByStep_v2.1	MTLR (M3)	440	Initializatio...	-434,28
Робот	16107-000	МБ ЦК	29449,2	09.07.19 12:0...	0,00
Работает	beta_RSI+BB.1	SBER (H1)	0		0,00
Робот	16107-000	МБ ЦК	0		0,00
Работает	StepByStep.10	HYDR (M3)	42000	EnterLongL...	-129,03
Робот	16107-000	МБ ЦК	24494,4	09.07.19 11:5...	225,83
Остановле...	Alfa_MATrail.2	SRU9 (M1)	0	ClosePosition	0,00
Робот	16107-000	ФОРТС	0	09.07.19 18:1...	409,00
Работает	forts_MATrail2.1	SIU9 (M1)	-1	EnterShort	32,00
Робот	16107-000	ФОРТС	-64378	09.07.19 18:1...	720,00
Остановле...	forts_Delta_MATrail_S...	SIU9 (M1)	0	ClosePosition	0,00
Робот	16107-000	ФОРТС	0	09.07.19 17:3...	1104,00

Отчет График Остановить и закрыть позиции

- Прибыль по открытой позиции
- Прибыль по закрытым операциям с учетом комиссий

Роботы работают в терминале.

- При выключении компьютера, терминала или разрыве связи с сервером роботы перестают работать (не получают информацию и не отправляют заявки).
- При временном разрыве связи с сервером на серверах брокера остаются активными стоп заявки, выставленные роботом (учет исполнение данных заявок возможен при сохранении информации о них в терминале после его загрузки).

Позиции Роботов.

- Роботы ведут собственный учет позиции на основании только собственных сделок. Операции сделанные вручную не учитываются роботом и не меняют его позицию, т.е. робот будет совершать действия в соответствии с его позиций в диспетчере.
- Позиция по счету должна быть равна сумме позиций по роботам, если не торгуете только роботами!

Удаление робота

- При удалении робота из формы «диспетчер роботов» - он останавливается: его позиция не закрывается, только снимаются активные заявки.

Остановка робота:

- Активные заявки, выставленные роботом, снимаются.
- Записывает состояние стоп заявок.
- Робот запоминает свое состояние и останавливается.

Запуска робота:

- Робот начинает работать с состояния, которое запомнено при остановке.
- Если запустить робот на том же баре, на котором уже у него был сигнал, то он начинает формировать новые сигналы с момента закрытия следующего бара.
- Если у робота при остановке был стоп, то система предложит его восстановить на прежнем уровне.

Закреть позиции и остановить:

- Роботом подается сигнал на закрытие позиции и он появится в отчете
- Активные заявки, выставленные роботом, снимаются
- Отправляется заявка на закрытие текущей позиции

**Критическое закрытие терминала:**

- Заявки выставленные стратегией останутся в системе.
- При следующем запуске, робот найдет свои выставленные или исполненные заявки в системе, если они еще не урегулированы и находятся в таблице заявки терминала



Техническая поддержка:

+7 (495) 786-48-86

support@alfadirect.ru

- Оперативная поддержка по счету
- Ответы на базовые вопросы по роботам

Специалисты по торговым роботам:

robot@alfadirect.ru

- Помощь в создании стратегий
- Разбор ошибок



1. Открытие брокерского счета

Для клиентов Альфа-Банка - on-line открытие без посещения офиса

- [Видео как открыть счет через сайт Альфа-Директ](#)
- [Видео как открыть счет в мобильном приложении Альфа-Директ](#)
- В банковском приложении Альфа-Мобайл

Для не клиентов Альфа-Банка – открытие счета с посещением офиса

- Желательно открыть текущий счет в Альфа-Банке для удобства и скорости ввода вывода денежных средств.

2. Пополнение счета

- Можно быстро перевести деньги с текущего счета в Альфа-Банке на брокерский счет через Альфа-Клик
- [Видео как быстро перевести деньги с текущего счета в Альфа-Банке на брокерский счет через Альфа-Мобайл](#)
- [Перевод из другого банка \(реквизиты в личном кабинете\)](#)

3. Установка терминала и создание эл. подписи

- [Ссылка для установки терминала Альфа-Директ 4.0](#)
- [Видео создания электронной подписи](#)

Материалы, указанные в документе, носят информационный характер и не являются коммерческим предложением, рекомендацией или офертой по покупке, продаже, обмену или проведению любых операций, прямо или косвенно связанных с отчуждением имущества, проведением торговых, биржевых и внебиржевых сделок. Все расчеты, приведенные в документе, являются условными и приведены для описания механизма действия финансовых инструментов и процессов. АО «Альфа-Банк» оставляет за собой право вносить любые изменения и дополнения в информационные материалы и документы. Настоящий материал был предоставлен Вам на условиях конфиденциальности и не может быть передан другим лицам без согласия АО «Альфа-Банк». Данный материал распространяется исключительно для информационных целей. Распространение данного материала не является деятельностью по инвестиционному консультированию. Информация приведенная в данном материале не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией.

