

Algoritmo WF per creazione e gestione di uno spread

Voglio scrivere un algoritmo che crei uno spread, entrando su un segnale di entrata Hourly e che costruisca lo spread sul primo segnale di entrata utile nel TF 5 minuti con trend opposto.

Voglio poi “clonare” questo algoritmo per generare uno spread opposto in modo da ottenere un Condor, figura che ha come obiettivo di generarmi una strategia con il rischio a Zero o addirittura con un minimo guadagno garantito.

Partiamo con la descrizione della Strategia per la messa a mercato dello spread ribassista **BearCallSpread** (la medesima si applicherà capovolta per la creazione dello spread rialzista **BullPutSpread**).

BeCaSp.Cond1

*Questa condizione attiva tutta la sequenza delle condizioni necessarie alla realizzazione dello spread, verifica un segnale di ingresso ribassista su tf hourly

Se $LR[H](Close,7) \text{ Cross Below } BB.Upperband[H](20,1.6,1.6,0)$ allora

- Attiva BeCaSp.Cond2
- Attiva BeCaSp.Cond3

BeCaSp.Cond2

*Questa condizione mette a mercato la componente buy dello spread, verifica un segnale di ingresso rialzista su tf 5 minuti

Se $LR[5m](Close,7) \text{ Cross Above } BB.Lowerband[5m](20,1.6,1.6,0)$ allora

- Buy Call X (tipo di ordine, es:Market)
- Attiva BeCaSp.Cond4
- Attiva BeCaSp.Cond.5

BeCaSp.Cond3

*Questa condizione disattiva la sequenza delle condizioni necessarie alla realizzazione dello spread

È vera se crossa Above a una delle due Upperband del BB hourly (Rossa o Blu)

Se $LR[H](Close,7) \text{ Cross Above } BB.Upperband[H](20,1.6,1.6,0)$

OR Se $LR[H](Close,7) \text{ Cross Above } BB.Upperband[H](20,0.83,0.83,0)$ allora

- DisAttiva BeCaSp.Cond2

BeCaSp.Cond4

*Questa condizione mette a mercato la componente sell dello spread, verifica un segnale di fine trend su tf 5 minuti oppure una perdita sull'opzione acquistata di almeno 50, ora lo spread è a mercato

Se LR[5m](Close,7) Cross Below BB.Upperband[5m](20,1.6,1.6,0)

OR Se Call X .ProfitLoss >= -50 allora

- Sell Call Y (tipo di ordine, es:Market)
- Attiva BeCaSp.Cond5

BeCaSp.Cond5

*Questa condizione deve verificare il momento in cui proteggere il mio spread, devo capire come verificare se il prezzo del sottostante supera una certa soglia (es ValoreT1),o meglio, devo decidere/impostare la soglia

Se Sottostante.Last >= ValoreT1 allora

- Attiva BeCaSp.Cond6
- Attiva BeCaSp.Cond7

BeCaSp.Cond6

*Questa condizione decide se il mio spread va chiuso perché si evidenzia una inversione di trend. Se il WF TRialH.Cond2 è Attivo e WF TRibaH.Cond2 è DISattivo (condizione ridondante ma voglio verificare che tutto funga correttamente) allora siamo in controtendenza e vado a impostare una chiusura delle posizioni cercando di sfruttare il trend che è stato rilevato.

Se TRialH.Cond2.inFunzione=1 AND TRibaH.Cond2.inFunzione=0 allora

- Buy Call Y (tipo di ordine, es:Market)
- Attiva BeCaSp.Cond8

BeCaSp.Cond7

*Questa condizione decide se proteggere il mio spread con un Roll. Se siamo ancora con WF TRialH.Cond2 off e WF TRibaH.Cond2 ON allora opto per una rollata

Se TRialH.Cond2.inFunzione=0 AND TRibaH.Cond2.inFunzione=1 allora

- Buy Call Y (tipo di ordine, es:Market)
- Sell 3 x Call X (tipo di ordine, es:Market)
- Buy 2 x Call X+5 (tipo di ordine, es:Market)
- Attiva BeCaSp.Cond9

BeCaSp.Cond8

*Questa condizione chiude vendendo la componente X dello spread, al momento più opportuno, che per me è una di queste due condizioni: fine del trend rialzista OR il prezzo dell'opzione da vendere è < prezzo di acquisto dell Call Y + 50 (questa non la so scrivere!!!)

Se LR[H](Close,7) Cross Above BB.Upperband[H](20,1.6,1.6,0)

OR Se LR[H](Close,7) Cross Above BB.Upperband[H](20,0.83,0.83,0)

OR Se Call X .ProfitLoss >= -50 (condizione da scrivere diversamente!!!)allora

- Sell Call X (tipo di ordine, es:Market)
- Scrivi ("Strategia Chiusa")

BeCaSp.Cond9

*Questa condizione deve verificare se rimango in trend ribassista o si inverte il trend, oppure se supero seconda soglia di rischio (es ValoreT2; quindi passo alla chiusura (NB potrei fare ancora un roll ma è sono una strategia a scopo "Educativo) NB dovrei anche verificare di avere le opzioni prima di operarci!!!

Se TRialH.Cond2.inFunzione=1 AND TRibaH.Cond2.inFunzione=0 OR

Se Sottostante.Last >= ValoreT2 allora

- Buy 2 x Call X (tipo di ordine, es:Market)
- Sell 2 x Call X+5 (tipo di ordine, es:Market)
- Scrivi ("Strategia Chiusa")

Variante della Condizione 1

Queste due condizioni combinate hanno lo stesso effetto della condizione 1

BeCaSp.Cond1a

*Questa verifica che la LR si trovi sopra alla BB Upper

Se LR[H](Close,7) Cross > BB.Upperband[H](20,1.6,1.6,0) allora

- Attiva BeCaSp.Cond1B

BeCaSp.Cond1b

*Questa verifica che in seguito la LR si trovi sotto alla BB Upper (ok, cross Above effettuato)

Se LR[5m](Close,7) < BB.Lowerband[5m](20,1.6,1.6,0) allora

- Buy Call X (tipo di ordine, es:Market)
- Attiva BeCaSp.Cond2

- Attiva BeCaSp.Cond.3

Indicatori di Trend

In questa sezione imposto due WF che mi evidenziano la presenza di trend Ribassista e trend Rialzista su tf hourly

Sequenza di monitoraggio Trend Rialzista:

TRialH.Cond1

*Questa condizione attiva la condizione che mi evidenzia la presenza di trend rialzista su tf hourly, NB va eseguita all'infinito!!! (giusto?)

Se LR[H](Close,7) Cross Above BB.Lowerband[H](20,1.6,1.6,0) allora

- Attiva TRialH.Cond2
- Attiva TRialH.Cond3

TRialH.Cond2

*Questa condizione viene testata per verificare Trend rialzista hourly e non fa nulla, è un semplice SEMAFORO, attivato o disattivato

TRialH.Cond3

*Questa condizione disattiva la condizione 2 se termina il trend rialzista

È vera se crossa below a una delle due Upperband del BB hourly (Rossa o Blu)

Se LR[H](Close,7) Cross Below BB.Upperband[H](20,1.6,1.6,0)

OR Se LR[H](Close,7) Cross Below BB.Upperband[H](20,0.83,0.83,0) allora

- DisAttiva TRialH.Cond2

Sequenza di monitoraggio Trend Ribassista:

TRibaH.Cond1

*Questa condizione attiva la condizione che mi evidenzia la presenza di trend rialzista su tf hourly, NB va eseguita all'infinito!!! (giusto?)

Se LR[H](Close,7) Cross Below BB.Upperband[H](20,1.6,1.6,0) allora

- Attiva TRibaH.Cond2
- Attiva TRibaH.Cond3

TRibaH.Cond2

*Questa condizione viene testata per verificare Trend ribassista hourly e non fa nulla, è un semplice SEMAFORO, attivato o disattivato

TRibaH.Cond3

*Questa condizione disattiva la condizione 2 se termina il trend rialzista

È vera se crossa above a una delle due Lowerband del BB hourly (Rossa o Blu)

Se LR[H](Close,7) Cross Above BB.Lowerband[H](20,1.6,1.6,0)

OR Se LR[H](Close,7) Cross Above BB.Lowerband[H](20,0.83,0.83,0) allora

- DisAttiva TRibaH.Cond2

NB domandone: cosa succede

- a) Se attivo un WF già attivo ?
- b) Se disattivo un WF già spento ?

Presumo nulla ma ...