

Condizioni di esecuzione dei sistemi di trading automatici

Condizioni applicabili a tutti gli strumenti

Avvio dei sistemi di trading: la prima posizione può essere aperta dal sistema non prima dell'apertura della barra successiva alla barra in corso al momento dell'avvio del sistema.

Parametro grandezza massima posizione: il parametro "grandezza massima posizione", che va impostato nella finestra ProOrder prima dell'avvio del sistema, ha la precedenza sui quantitativi per acquisto/vendita indicati nel codice del sistema. Per esempio, se il suo codice presenta un'istruzione di acquisto di 3 lotti, e che la grandezza massima della posizione è limitata a 1, l'ordine di acquisto di 3 lotti sarà ignorato. Allo stesso modo, se il suo codice presenta un'istruzione di acquisto di 1 lotto, seguita da un'istruzione di vendita allo scoperto di 3 lotti, l'ordine di vendita sarà ignorato e resterà in posizione di 1 lotto all'acquisto. È consigliabile verificare il parametro "grandezza massima della posizione" prima di avviare un sistema di trading.

Istruzioni temporali quando invia un sistema di trading a ProOrder, il fuso orario associato alla strategia è quello predefinito nel mercato dello strumento finanziario (in modo predefinito il fuso del suo computer). Le istruzioni temporali "intraday" utilizzate dal codice della sua strategia sono coinvolte:

"Time" and similar functions ("Hour", "Minute")

"OpenTime" and similar functions ("OpenHour", "OpenMinute")

"FlatAfter" and "FlatBefore"

"IntradayBarIndex" (azzerata all'apertura del mercato nel fuso orario selezionato)

Le istruzioni temporali in unità di tempo giornaliero sono invece sempre nel fuso orario del mercato:

DOpen, DHigh, DLow, DClose

"Date" and similar functions ("Year", "Month", "Day")

"DayOfWeek" e "Days"

Dati del week-end: i dati del week-end sono presi in considerazione per i mercati che sono aperti durante il week-end.

Mercati chiusi: Se il suo sistema di trading cerca di piazzare un ordine quando il mercato è chiuso, l'ordine sarà piazzato all'apertura del mercato.

Capitale insufficiente: se l'esposizione totale è superiore al capitale totale, i diversi sistemi di trading utilizzeranno il capitale secondo la logica "primo arrivato, primo servito".

Arresto dei sistemi di trading: la politica d'arresto dei sistemi di trading può essere definita nelle preferenze del trading automatico (Trading/ Preferenze / Preferenze del trading). Quando un sistema è interrotto, ProOrder può:

Cancellare automaticamente tutti gli ordini in attesa piazzati dal sistema e chiudere tutte le posizioni precedentemente aperte del sistema

oppure

Mantenere tutti gli ordini in attesa e tutte le posizioni aperte

Se modifica manualmente un ordine o una posizione piazzata dal sistema di trading automatico, ProOrder interrompe il sistema di trading. In questo caso:

Le posizioni e gli ordini connessi alle posizioni piazzati dal sistema di trading saranno mantenuti, indipendentemente dall'eventuale politica di interruzione dei sistemi di trading impostata nelle Preferenze.

Gli ordini in attesa (non connessi alle posizioni) saranno mantenuti o annullati seconda le preferenze indicate.

Arresto automatico del sistema di trading dovuto alla data di scadenza del sistema: tutti i sistemi di trading hanno una data di validità comune. Se non clicca sul tasto "Prolunga" prima di questa data, ProOrder può interromperli automaticamente. Può visualizzare la data di validità sulla finestra ProOrder (espressa nel fuso orario del computer) e prolungare la validità dei suoi sistemi di trading tramite il pulsante "Prolunga" nella parte inferiore della finestra ProOrder quando un sistema di trading è in esecuzione. La durata di ogni prolungamento può essere configurata all'interno della linguetta "Trading automatico" nella finestra "Preferenze del trading".

Arresto automatico dovuto al numero di ordini: ProOrder può interrompere un sistema di trading se la quantità massima di ordini piazzati nell'arco di una giornata è raggiunta. Può impostare tale quantità nella linguetta "Trading automatico" della finestra "Preferenze del trading". Se la somma degli ordini in attesa e degli ordini eseguiti dal sistema dalle 22.30 ora di Londra (23.30 ora di Roma) è superiore alla quantità scelta nella linguetta "Trading automatico" il sistema sarà automaticamente interrotto. Gli ordini in attesa includono gli ordini processati e non eseguiti, rigettati o cancellati.

La regola si applica ad esempio alle istruzioni "Set stop" o "Set Trailing stop" o "Set target" fino a quando l'ordine

corrispondente non è stato cancellato, rigettato o eseguito.

Inoltre, 3 diversi ordini limite o 3 diversi ordini stop che non sono stati cancellati, rifiutati o eseguiti conteranno come 3 ordini in attesa. Questo è vero se i 3 ordini sono sullo stesso livello di prezzo o su livelli di prezzo diversi.

Se scegli per esempio un livello di stop di 7 ordini e dall'apertura del mercato 5 ordini sono stati eseguiti con un dato sistema di trading e questo sistema ha una posizione aperta e 2 ordini in attesa (uno "set target" e uno "set stop") e il sistema ha bisogno di inviare un ordine supplementare a mercato: questo 8° ordine non sarà inviato (5+2+1 raggiunge il livello stop), questo sistema di trading sarà interrotto con i suoi ordini in attesa cancellati prima, e poi la sua posizione chiusa.

Nota sulla quantità massima di ordini: Se un sistema di trading ha una posizione +1 e la inverte (-1), verranno contabilizzati 2 ordini: uno per fermare la posizione lunga e uno per aprire una posizione corta.

Arresto automatico di un sistema dovuto ad un rifiuto di un singolo ordine: se un ordine è rifiutato per uno dei seguenti motivi, ProOrder effettuerà 10 tentativi per piazzare l'ordine:

Errore nell'esecuzione dell'ordine

La conferma dell'esecuzione dell'ordine non è stata ricevuta in tempo

Un ordine precedentemente piazzato sullo stesso strumento non è ancora stato processato dal broker.

Per qualsiasi altro errore (o se l'ordine non è stato eseguito durante i 10 tentativi) la strategia viene interrotta e ProOrder applicherà, qualora è possibile, le impostazioni di arresto (mantenere o cancellare le posizioni e gli ordini in attesa).

Sistemi automatici di trading multipli sullo stesso strumento: è possibile eseguire sistemi automatici di trading multipli sullo stesso strumento. In questo caso, la sua posizione complessiva sullo strumento sarà la somma delle posizioni di ogni sistema di trading ad un dato orario. Per esempio, se 2 sistemi di trading automatici sono in corso di esecuzione sullo stesso strumento finanziario, il sistema A ha una posizione lunga di 2 ed il sistema B ha una posizione corta di 1, la sua posizione netta sarà lunga 1. Può verificare la posizione globale dal menù "Trading" > "Portafogli". Se più sistemi di trading sono in corso di esecuzione su uno stesso strumento ed è impossibile interromperne uno di questi a causa di un margine insufficiente, tutti i sistemi di trading su questo strumento saranno interrotti.

Ore di trading personalizzate: Una volta che il sistema di trading è stato aggiunto a ProOrder le ore di trading personalizzate associate alla strategia sono quelle predefinite nel mercato dello strumento finanziario. Questa impostazione sarà applicata ad ogni avvio del sistema. Gli indicatori usati nel sistema saranno calcolati sulla base unicamente di date durante le ore di trading personalizzate. Invece, gli obiettivi e gli stop piazzati dal sistema possono essere attivati in orari diversi.

Gli ordini Limite e Stop piazzati con le istruzioni "AT <price> LIMIT" and "AT <price> STOP" potranno essere eseguiti durante le ore di trading personalizzate a meno che un ordine di questo tipo sia piazzato sull'ultima barra delle ore di trading personalizzate. In questo caso, sarà piazzato sulla prossima apertura normale di mercato (ore di trading personalizzate).

Gli ordini piazzati con le istruzioni nel codice "SET TARGET", "SET STOP" e "SET STOP TRAILING" possono essere ancora eseguiti al di fuori delle ore di trading personalizzate se il mercato è aperto.

Gli orari di trading impostati quando il sistema è avviato non possono essere cambiati quando è in esecuzione. Se desidera cambiare gli orari di trading presi in considerazione con il sistema, è necessario prima di tutto interrompere il sistema, poi cambiare le ore di trading dello strumento, poi inviarlo nuovamente a ProOrder prima di avviarlo.

[Chiudi](#)