

Mikołaj Pasik*

Automatyzacja tradingu na platformach handlowych

W dzisiejszych czasach trendem jest postępujący proces automatyzacji, mniej lub bardziej zauważalny w poszczególnych sektorach gospodarki. Szczególną uwagę zwraca robotyzacja procesów handlowych, inaczej mówiąc – tradingowych. Od kilku lat można zauważyć rozwój segmentu przedsiębiorstw oferujących usługi i narzędzia do automatyzacji tych właśnie procesów. W tym artykule zostanie przedstawiony proces automatyzacji handlu na giełdzie, którego egzemplifikacją jest system do tradingu na najpopularniejszej platformie transakcyjnej – MetaTrader4.

Czym jest automatyzacja handlu?

Automatyzacja tradingu polega na stworzeniu programu, który będzie samoczynnie dokonywał realizacji zleceń rynkowych¹. Takie rozwiązanie pozwala ograniczyć, a nawet czasami wyeliminować, konieczność obecności czynnika ludzkiego. Istotne jest nadzorowanie działania takiego systemu. Często można spotkać się z kontrolowaniem tego, czy pozycje są otwierane zgodnie z trendem obecnym na rynku. Ważna wydaje się również optymalizacja takiego systemu. Program podejmuje decyzje na podstawie danych umieszczonych w tzw. arkuszu. Jest to okno, gdzie są umieszczane dane, takie jak: poziom otwarcia pozycji, *take profit*, *stop loss* itp. Do zadań tradera należy między innymi wpisanie do arkusza takich danych, aby automat zarabiał i osiągał dodatnią stopę zwrotu. Poniżej przedstawiono przykładowe parametry automatu, który został zaprogramowany przez spółkę STE POLAND².

* Uniwersytet Łódzki, Wydział Zarządzania, mikolaj201@gmail.com

1 Automatyzacja tradingu, „Spekulant” 25.11.2017, <http://spekulant.com.pl/2017/11/25/automatyzacja-tradingu-i/> (dostęp: 28.12.2019), par. 4.

2 F. Jackowiak, *Schemat 1*, „Simple Trading Expert”, <https://simpletrading.expert/product/48> (dostęp: 28.12.2019).

Tabela 1. Przykładowe parametry schematu

Elite Gainer_V_1_0_3				
Testowanie	Wpisz parametry	Optymalizacja		
Zmiana	Wartość	Start	Krok	Postój
Magic Number	1	0	0	0
Dodaj komentarz	SCHEMAT 1- EURUSD - 9-17h (10-18) - (5-40k\$)			
Wybierz kierunek handlu	LONG & SHORT	LONG		LONG
Godzina otwarcia	10	22	0	0
Godzina zamknięcia	10	23	0	0
Lot Size	0.04	0.04	0.0	0.0
Gdy kapitał wzrośnie o wartość	250	100	0	0
Zwiększ pozycję Lot Size	0.02	0.02	0	0
Czy GRID po odwrotnej świecy	false	false		True
Liczba pozycji GRID	6	0		0
GRID co ile godzin	1			
Wyjście z GRID od ilu pozycji	1	0		0
Uśredniony zysk w % dla całego depozytu	5.0	3.0	0.0	0.0
Ograniczony czas, w tym dni na GRID	true	false		True
Dopuszczalny GRID do godziny, chyba że brak zgody...	20	20	0	0
Maksymalny Spread przy zawarciu pozycji	2.5	2.5	0.0	0.0
Handel w piątek do godziny	22	22	0	0
Warunek Open Trade w punktach Pips	350	40	0	0
Stop Loss w punktach Pips	99999	2600	0	0
Dla pozycji 1 druga część pozycji	100	100	0	0
Breakeven dla pozycji 1	200	20	0	0
Breakeven dla wszystkich pozycji GRID	50	50	0	0
Siatka Zleceń 1 - Lot Size	0.04	0.08	0.0	0.0
Siatka Zleceń 1 - Odległość w Pips	600	100	0	0
Siatka Zleceń 1 - Take Profit	600	150	0	0
Siatka Zleceń 2 - Lot Size	0.04	0.1	0.0	0.0
Siatka Zleceń 2 - Odległość w Pips	700	100	0	0
Siatka Zleceń 2 - Take Profit	700	200	0	0
Siatka Zleceń 3 - Lot Size	0.04	0.02	0.0	0.0
Siatka Zleceń 3 - Odległość w Pips	800	100	0	0

Siatka Zleceń 3 - Take Profit	800	250	0	0
Siatka Zleceń 4 - Lot Size	0.04	0.4	0.0	0.0
Siatka Zleceń 4 - Odległość w Pips	900	400	0	0
Siatka Zleceń 4 - Take Profit	900	300	0	0
			Otwórz	Zapisz

Źródło: opracowanie własne na podstawie: F. Jackowiak, „Simple Trading Expert”, <https://simpletrading.expert/account/elite-gainer-schemat> (dostęp: 28.12.2019).

Program firmy STE POLAND umożliwia zastosowanie tak zwanego GRIDu, czyli ustawienia kilku zleceń na równych od siebie poziomach³. Taki sposób automatyzacji najczęściej stosuje się na rynkach, takich jak: Forex, CFD, ETF-y, surowce. Jest to możliwe na platformie MetaTrader, w powyższym przypadku MetaTrader5, najpopularniejszej platformie do tradingu na świecie⁴.

Automatyzacja procesów handlowych krok po kroku

Pierwszym działaniem, od którego powinniśmy zacząć, jest wybór dostawcy usługi – firmy, która dostarcza automatyczny system transakcyjny. Może być to firma polska lub zagraniczna. Jeśli chodzi o polskich dostawców, to liderem i pionierem w zakresie dostarczania takich usług jest STE POLAND sp. z o.o. Firma oferuje automatyczny system, możliwy do ustawienia w różnych konfiguracjach (schematach). Klient może dobrać ustawienia w zależności od akceptowanego poziomu ryzyka, poziomu zaangażowanego kapitału itp. Spółka zajmuje się programowaniem, ulepszaniem automatycznych systemów transakcyjnych oraz edukacją na temat handlu na giełdzie⁵.

Aby zlecenia mogły zostać poprawnie otwierane/zamykane 24 godziny na dobę, konieczne jest uruchomienie automatu na wirtualnym serwerze, tak zwanym serwerze VPS. Dzięki temu program działa niezależnie od tego, czy nasze urządzenie, z którego korzystamy do tradingu, jest włączone. Strony, na których znajdziemy dostawców wirtualnych serwerów, to np. ArubaCloud.pl, homecloud.pl.

Ostatnim ważnym etapem jest wybór brokera, z którego mamy zamiar korzystać. Ważne, aby był to broker narzucający jak najmniejsze spready i prowizje. Powinien on umożliwiać handel za pomocą platformy MetaTrader. Doskonale nadaje się do tego największy broker pod względem liczby klientów, jakim jest

3 M. Bączkowski, *Strategia Grid Trading*, „Trader's Area”, <https://tradersarea.pl/strategia-grid-trading/> (dostęp: 28.12.2019), par. 3.

4 M. Bączkowski, *Platforma Transakcyjna MetaTrader4*, „Trader's Area”, <https://tradersarea.pl/platforma-transakcyjna-metatrader-4/> (dostęp: 28.12.2019), par. 1.

5 Tamże.

IC Markets. Posiada zarówno niskie prowizje, jak i spready. Działa on w oparciu o model ECN. Minusem jest brak polskiej obsługi, jednak w dzisiejszych czasach nie jest to duża przeszkoda⁶.

Szanse i zagrożenie automatycznego tradingu

Zaletą robotyzacji tradingu jest najczęściej zwiększenie efektywności procesu handlowego. Umożliwia to ustawienie działania automatu w niezliczonej ilości konfiguracji. Optymalizacja takiego systemu (którą umożliwia między innymi tester strategii na danych historycznych) pod kątem wartości umieszczonych w arkuszu zwiększa prawdopodobieństwo osiągnięcia dodatnich stóp zwrotu. Co więcej, idzie za tym częściowe wyłączenie czynnika ludzkiego z handlu na giełdzie. Pozwala to wyeliminować czynnik psychologiczny z tradingu, a co za tym idzie – błędy poznawcze, które popełnia trader. To pozwala na uniknięcie pułapek psychologicznych. Natomiast niewątpliwym zagrożeniem, płynącym z automatyzacji, jest zmniejszenie istotności maklera giełdowego, którego praca staje się coraz mniej ważna. Za wadę można uznać to, że program nie wykorzystuje tzw. okazji na rynku. System działa sztywno, nie bazując na wsparciach, oporach czy kalendarzu makroekonomicznym. Program może również nie zamknąć pozycji we właściwym momencie lub niekorzystnie ją przetrzymywać. Dzieje się tak, gdyż automat podejmuje decyzje według „sztywnych wytycznych”, czyli danych umieszczonych w arkuszu. System nie jest elastyczny i wymaga nadzoru ze strony tradera. Mimo pewnych wad, można mówić o innowacyjności, o czymś, nad czym warto prowadzić dalsze badania i wprowadzać udoskonalenia. Traderzy, którzy chcieliby ograniczyć przeznaczanie czasu na handel na giełdzie, powinni rozważyć wprowadzenie automatycznych systemów.

Bibliografia

- Automatyzacja tradingu*, „Spekulant” 25.11.2017, <http://spekulant.com.pl/2017/11/25/automatyzacja-tradingu-i/> (dostęp: 28.12.2019).
- Bączkowski M., *Platforma Transakcyjna MetaTrader4*, „Trader’s Area”, <https://tradersarea.pl/platforma-transakcyjna-metatrader-4/> (dostęp: 28.12.2019).
- Bączkowski M., *Strategia Grid Trading*, „Trader’s Area”, <https://tradersarea.pl/strategia-grid-trading/> (dostęp: 28.12.2019).
- Jackowiak F., *Nasza działalność*, „Simple Trading Expert”, <https://simpletrading.expert/> (dostęp: 28.12.2019).

⁶ <https://www.icmarkets.com/au/en/> (dostęp: 28.12.2019).

Jackowiak F., *Schemat 1*, „Simple Trading Expert”, <https://simpletrading.expert/product/48> (dostęp: 28.12.2019).
<https://www.icmarkets.com/au/en/> (dostęp: 28.12.2019).

Abstrakt

Artykuł prezentuje handel automatyczny na giełdzie jako pewnego rodzaju trend. W pierwszej części tekstu zostało wyjaśnione pojęcie handlu automatycznego w oparciu głównie o rynek typu Forex. Następnie przedstawiono, jak zautomatyzować handel na giełdzie, czym się kierować przy wyborze dostawcy usługi, serwera i brokera. W ostatnim rozdziale wyróżniono szanse i zagrożenia omawianego rozwiązania. Omówiono wady i zalety takiego rozwiązania, wraz z wnioskami na przyszłość.

Słowa kluczowe: trading, handel, automatyzacja, schemat, platforma