**Идея:** Тренд всегда есть, поэтому цена рано или поздно выйдет за пределы образовавшегося на данный момент ценового канала (Price channel) как минимум на ширину этого самого канала.

**Стратегия:** Открываем позиции при пробое канала в сторону пробоя (Stop-loss и Take-profit ставим на ширину канала от цены открытия), затем:

а) если цена движется далее в сторону пробоя на ширину канала – фиксируем прибыль;

б) если цена разворачивается и доходит до противоположной границы канала – закрываем позицию по Stop-loss и открываем ее в обратную сторону, удваивая лот.

Так как ценовой канал выбранной валюты изменяется со временем, мы можем устанавливать новые ордера на новых границах канала, не дожидаясь полного закрытия ордеров в ранее сформированных каналах. При этом:

- если верхняя граница канала сместилась вниз, то все установленные выше не сработавшие ордера удаляются;

- если нижняя граница канала сместилась вверх, то все установленные ниже не сработавшие ордера удаляются;

**Ограничения:**

1. Позиции всегда открываем с помощью отложенных ордеров, так как это дает выигрыш при внезапном скачке цены.
2. Отложенный ордер возможно поставить только при наличии небольшого отскока цены от границы канала.
3. После определенного количества переворотов прекращаем удваивать лот, сбрасывая его значение в начальное – Init\_Lot.

**Параметры:**

N, в барах – Глубина канала (по умолчанию – 54);

D, % – шаг для открытия ордеров (% от текущего значения канала, по умолчанию – 32);

Init\_Init\_Lot – начальный лот (по умолчанию – минимальный допустимый лот);

Max\_Init\_Lot – максимально допустимый лот, при достижении которого значение лота на «переворот» сбрасывается в начальное (Init\_Lot), а не удваивается.

Min\_Channel, в пунктах – минимальный канал для работы. Если значение канала меньше – не расставляем ордера на границах, ждем (по умолчанию – 60).

Max\_Channel, в пунктах – максимальный канал для работы. Если канал шире, то Stop-loss и Take-profit устанавливаются не на ширину канала, а на значение Max\_Channel (по умолчанию – 250).

Double\_First\_Lot – флаг, если False, то при первом перевороте лот не удваивается (по умолчанию - True).

**Алгоритмы**

Последовательно выполняются три описанных ниже этапа: (1) установка ордеров BUY; (2) установка ордеров SELL; (3) контроль выполнения ордеров и установка/удаление ордеров на переворот.

**BUY:**

1. Вычисляем текущее значение верхней границы канала.
2. Проверяем:

- канал шире, чем значение Min\_Channel;

- текущая цена позволяет установить отложенный ордер на границе канала;

- нет ордеров BUY, установленных ближе, чем D от верхней границы канала.

1. Если проверки (п.2) успешны, ставим ордер на покупку суммы Init\_Lot; при этом Stop-loss и Take-profit устанавливаются на ширину канала (но не более Max\_Channel)
2. Если удалось поставить новый ордер в п.3, то удаляем все ранее поставленные, но не сработавшие ордера BUY, находящиеся выше верхней границы канала. *Внимание: при этом нельзя удалять ордера, которые предназначены для переворота позиции по ордеру SELL – такие тоже могут быть выше верхней границы канала.*

**SELL:**

1. Вычисляем текущее значение нижней границы канала.
2. Проверяем:

- канал шире, чем значение Min\_Channel;

- текущая цена позволяет установить отложенный ордер на границе канала;

- нет ордеров SELL, установленных ближе, чем D от нижней границы канала.

1. Если проверки (п.2) успешны, ставим ордер на продажу суммы Init\_Lot; при этом Stop-loss и Take-profit устанавливаются на ширину канала (но не более Max\_Channel)
2. Если удалось поставить новый ордер в п.3, то удаляем все ранее поставленные, но не сработавшие ордера SELL, находящиеся ниже нижней границы канала. *Внимание: при этом нельзя удалять ордера, которые предназначены для переворота позиции по ордеру BUY – такие тоже могут быть ниже нижней границы канала.*

**Контроль ордеров:**

1. Отбираем все ордера, у которых сработала покупка или продажа, но активны Stop-loss и Take-profit.
2. Для отобранных ордеров устанавливаем ордер на переворот на уровне Stop-loss, удваивая лот (если Double\_First\_Lot = False, то при первом перевороте лот не удваивается).

Пример за август 2010:

Образовался канал достаточной ширины: 1.2829 / 1.2895 (сплошные синие линии); поставили ордера на покупку и продажу; затем еще один канал – 1.2828 / 1.2891 (пунктирные синие линии) с ордером только на покупку (здесь D приняли равным 5%, поэтому на продажу по 1.2828 ордер ставить нельзя). Далее для простоты отслеживали только судьбу ордеров в канале 1.2829 / 1.2895 (сплошные синие линии).

