您是一位資深專業的金融程式設計師, 熟悉 MetaQuotes Language 5 (MQL5) Meta Trader, 您知道如何編寫指標和策略, 並且了解它們在程式碼中的差異。現在的任務是將以下的編寫指示及指標轉換為策略, 再寫成一個 MetaTrader 5 (MT5) 的檔案。

編寫指示

- 1) 何時買入和何時賣出:
- 建立多頭部位(買進)。當價格收盤價低於布林帶下軌(第一個參數為 20 週期和 2 個標準差), 並且 20 週期的商品通道指數 (CCI) 達到 -80 或以下(表明超賣狀態)時, 請考慮買入。
- 建立空頭部位(賣出)。當價格收盤價高於布林帶上軌(第一個參數為 20 週期和 2 個標準差), 並且 20 週期的商品通道指數 (CCI) 達到 80 或以上(表明超買狀態)時, 考慮賣出。
- 2) 預期價格將回歸均值, 回到布林通道中軌。
- 退出多頭部位(賣出)當價格回落至中軌或觸及上軌時賣出,從而獲得預期價格反轉帶來的潛在收益
- 退出空頭部位(買入)當價格回落至中軌或觸及下軌時買入,從而獲取預期價格反轉帶來的潛在收益
- 3) 請遵循以下說明:將所有指標專用程式碼轉換為策略專用程式碼。請勿使用任何策略不支援的程式碼, 尤其是時間 週期和缺口。請在程式碼中定義這些程式碼, 使其語義與之前一致。
- 如有時間週期邏輯, 請保留。填補缺口。
- 如果指標正在繪製某些內容, 策略代碼也應繪製相同的內容, 以保留視覺效果。
- 只需設定多頭、空頭和持平。
- 您可以使用 50-100% 的資金。
- 將佣金設定為 0.1%
- 將滑點設為 0。
- 將所有其他策略設定保留為預設值(即完全不要設定它們)。

注意要點

- *輸出格式:程式碼應採用符合 MQL5 語法的格式,僅在需要時新增註解。確保程式碼段清晰地反映所提供的指令。
- * 對MQL5可以參考https://www.mql5.com/en/articles/496,《MQL5 Language REFERENCE》

https://www.mql5.com/files/pdf/mql5.pdf, 又或是參考《MQL5 Programming for Traders》by Stanislav Korotky 這本書, 又或是參考《Introduction To MetaTrader 5 and Programming With MQL5》by Rafael F. V. C. Santos 這本書, 又或是參考《Programming MQL5 for Algorithmic Trading: Definitive Reference for Developers and Engineers》by Richard Johnson 這几本書的內容去編寫MQL5

- *基於以上腳本,請加入ADX指標,使其更具獲利能力。
- *基於以上腳本,能否加入一些程式碼來管理風險並停損,從而實現利潤最大化?