
PRIMER PASO

Descargad el fichero de la fuente de datos (VisualChart): abris el VisualChart, cargáis el gráfico correspondiente cuyo histórico queráis bajar, y seleccionáis Archivo/ Exportar/ Gráfico a texto.

IMPORTANTE: hay tres tipos de histórico que se pueden subir al NinjaTrader: diario, minutos y ticks. Según lo que queráis, el gráfico de VisualChart para exportar tendrá que estar en 1 día, 1 minuto ó 1 tick. Si queréis importar los tres tipos de histórico tendréis que repetir la operación tres veces, una para cada tipo de histórico.

El fichero que se exporta desde VisualChart es de texto y con el siguiente formato:

Ficheros de 1 día (con un ejemplo del DAX):

<TICKER>,<PER>,<YYYYMMDD>,<TIME>,<OPEN>,<HIGH>,<LOW>,<CLOSE>,<VOL>,<OPENINT>
DX,D,19970102,0,2840.000,2868.000,2829.000,2835.500,4276,0

Ficheros de 1 minuto (con un ejemplo del EUR-USD):

<TICKER>,<PER>,<YYYYMMDD>,<TIME>,<OPEN>,<HIGH>,<LOW>,<CLOSE>,<VOL>,<OPENINT>
EURUS,I,20080101,010100,1.4585,1.4585,1.4585,1.4585,0,0

Ficheros de 1 tick (con un ejemplo del mini-SP):

<TICKER>,<PER>,<YYYYMMDD>,<TIME>,<OPEN>,<HIGH>,<LOW>,<CLOSE>,<VOL>,<OPENINT>
ES,T,20080502,08:00:11,3797.000,3797.000,3797.000,3797.000,2770,0

La versión 4.0 de VisualChart utiliza este formato de descarga. Aún no se ha comprobado si es el mismo en la versión 5.0.

SEGUNDO PASO

Hay que convertir el fichero en bruto descargado desde VisualChart, a un formato que sea legible por NinjaTrader. Para conseguirlo, utilizaremos la aplicación de conversión.

La interface de la aplicación se explica a continuación:

En Tipo de datos hay que seleccionar la opción acorde con el tipo de datos que vamos a convertir: diarios, minutos o ticks.

Hacer Clic en el botón **Origen(VC)** para explorar nuestro PC y encontrar el fichero con los datos en bruto.

Hacer Clic en el botón **Destino(NT)** para darle una ubicación y un nombre al fichero cuando esté convertido.

En **Líneas a excluir** seleccionaremos las líneas que queremos eliminar de la conversión. Normalmente será sólo la primera que suele traer los encabezados.

Con los campos de fecha **Desde** y **Hasta** podemos filtrar los datos convertidos entre un intervalo de días.

Marcando la casilla **Filtro horario** podemos activar un filtro horario con los campos **De** y **a**. Útil si por ejemplo no trabajamos con datos overnight y no queremos sobrecargar la base de datos del NinjaTrader cuando carguemos el fichero. Independientemente, el NinjaTrader permite filtrar en un chart el intervalo horario.

Finalmente pulsamos el botón **Convertir** y en unos instantes tendremos el fichero convertido.

Conversor VisualChart a NinjaTrader

Tipo de datos

☐ Ticks ☐ Minutos ☒ Diario

Desde: lunes, 01 de enero de 1900

Hasta: martes, 21 de octubre de 2008

☐ Filtro horario De: 18:49:05 a: 18:49:05

<http://www.supperia.com>

Ficheros

Origen (VC): G:\bolsa\historicos\VC\dax\daxD.txt

Destino (NT): G:\bolsa\historicos\VC\dax\daxD_conv

Líneas a excluir: 1

Convertir

TERCER PASO

Hay que asegurarse de que el activo cuyos datos queremos cargar está correctamente registrado en el NinjaTrader, antes de proceder al Import.

El Instrument Manager es el gestor de activos de la aplicación. Para poder trabajar con un activo – ya sea una acción, un futuro o una divisa – es necesario que esté correctamente configurado en el Instrument Manager.

Cuando se carga un histórico se puede hacer sobre un activo original que esté ya configurado en el Instrument Manager, con lo que sobrescribiríamos los datos existentes que coincidan en tiempo. Por ejemplo, con el fin de reparar algunos datos.

O bien se puede crear uno nuevo y cargar sobre él los datos. De este forma protegemos y reservamos los datos que pudiéramos tener cargados para el activo, a costa de duplicarlo. Un motivo para hacer esto puede ser el de confrontar distintas fuentes de datos y comprobar su coincidencia.

Vamos a seguir un ejemplo de cómo crear un activo nuevo para cargar un histórico con datos del DAX.

Ir a Tools/Instrument Manager... Clic en New.

Ahora hay que rellenar los campos que identificarán al activo. Se pueden buscar los que tenga nuestro DAX original y copiarlos, salvo el nombre.

El resultado debe ser parecido a éste. He llamado al activo VCDAX, los demás campos los he copiado de los del DAX original que ya estaban en el Instrument Manager.

The screenshot shows the 'Instrument Editor' dialog box with the 'Definition' tab selected. The fields are as follows:

- Master instrument: VCDAX
- Instrument type: Future
- Exchanges: A list of exchanges with 'Eurex' checked. Other options include ClearPort, Cme, Default, ECbot, EurexSW, EurexUS, Fta, Globex, Hkex, Hkfe, IBideal, and IBidealPro.
- Tick size: 0,5
- Currency: Euro
- Point value: 25
- Rollover period: 3
- Sim feed start price: 0,00
- Margin value: 0
- Description: VC DAX
- URL: (empty field)

Buttons at the bottom: OK, Cancel, and a Visit button next to the URL field.

En la pestaña de Miscelánea no he rellenado comisiones y sólo he completado algunos textos.

The screenshot shows the 'Instrument Editor' dialog box with the 'Misc' tab selected. It displays a table of data sources and their associated instrument names.

Source	Instrument
Yahoo	0\$ min: 0/0
Zen-Fire	0\$ min: 0/0
Symbol map	
Barchart.com	
Collective2	
ESignal	
External	VCDAX
FuturesBetting	
Gain	
InteractiveBrokers	
IQFeed	
MBTrading	
OpenTick	
Patsystems	
PFG	
Replay	VCDAX
Simulator	VCDAX
TD AMERITRADE	
TrackData	
TradingTechnologies	
Yahoo	
Zen-Fire	

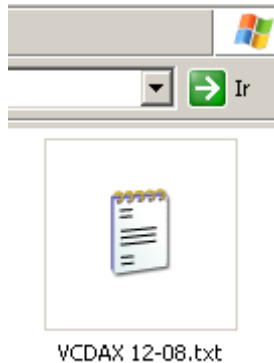
Buttons at the bottom: OK and Cancel.

Vamos saliendo pulsando OK todas las veces que aparezca.

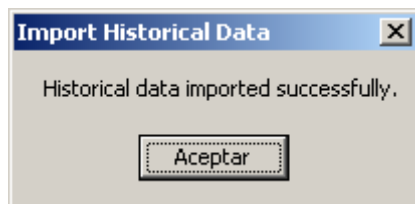
CUARTO PASO

Ahora vamos a realizar la carga del fichero con los datos diarios.

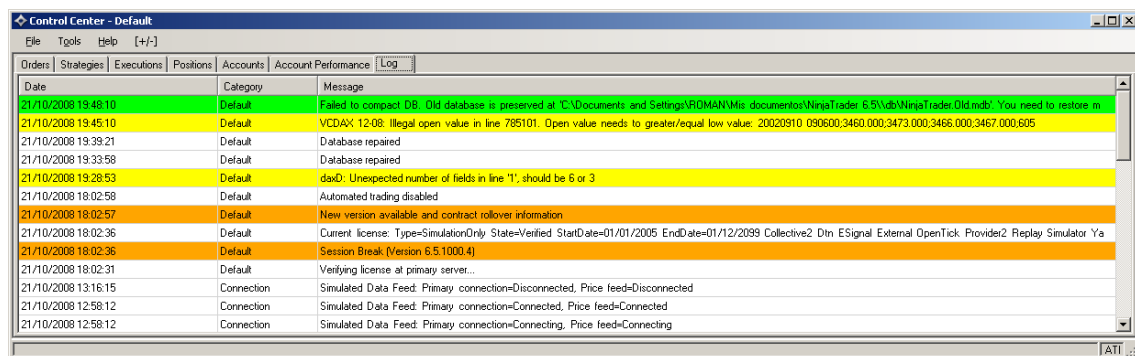
Al tratarse de un futuro, el fichero debe terminar con la fecha del vencimiento. Si fuese una acción sólo hay que poner el nombre del activo sin fecha. En nuestro caso el fichero se llamará VCDAX 12-08.txt. (Si fuese una acción, que no es el caso, sería sólo VCDAX.txt).



A continuación seleccionamos Tools/ Historical Data/ Import ... y buscamos el fichero que hemos convertido con la aplicación. La carga debería ser exitosa.



Si ocurriera algún error se puede consultar el Log para intentar hallar una solución.



Tras una carga correcta procedemos a compactar la base de datos en Tools/ Options / Miscelánea y clic en Repair DB.

Options

General Strategies Simulator Log Commission ATI Data **Misc**

Flatten positions

Time to flatten: 0:00:00

Flatten all ☐

Database Management

Repair DB Account Grps.

Reset DB Reset Instruments

Quote currencies (FX) in: Pip

Mail Setup

Support: subscriber-support@ninjatrad

SMTP (leave blank for default)

Server:

Port: 25

User:

Password:

Test...

OK Cancel

Los mismos pasos los repetiríamos para los ficheros de minutos y de ticks, si quisiéramos cargarlos.

Por último podemos añadir el activo a nuestra lista por defecto para facilitarnos el trabajo.

Instrument Manager - 113 Instrument(s)

Instrument lists: Default

ER2 03-08
ES 09-08
FDAX 09-08
FERSA
NQ 09-08
VCDAX 12-08
VCFESX 09-08
VCFESX 12-08
YM 09-08
ZB 09-08

Available master instruments

Type: Future Name: Description: Search

Name	Type	Description	Tick Size	Point Val.
TF	Future	Mini Russel 2000	0,1	100
TWS	Future	Two-Year II Swapnote II Futures	0,005	1000
UHO	Future	Heating Oil	0,0001	42000
UHU	Future	RBOB Gasoline	0,0001	42000
VCDAX	Future	VC DAX	0,5	25
VCFESX	Future	VC EURO STOXX	1	10
VWBORRAR	Future	VWBORRAR	1	10
VWEURUSD	Future	VWEURUSD	0,0001	100000
W	Future	White Sugar Futures	0,1	5
WUS	Future	White Sugar Futures	0,01	1000

New Edit Delete

Details

Exchange: Eurex Strike: 1

Expiry: 12-08 Put/Call: Call

New Delete

OK Cancel