

• עשינו בדיקת פרמטרים מ0.2 עד 4 בקפיצות של 0.1

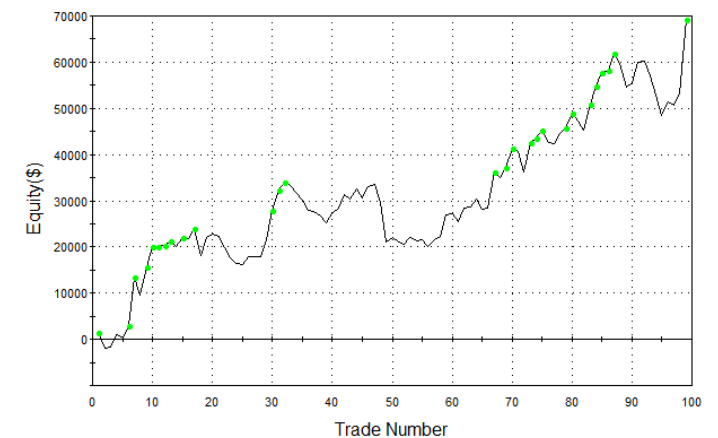
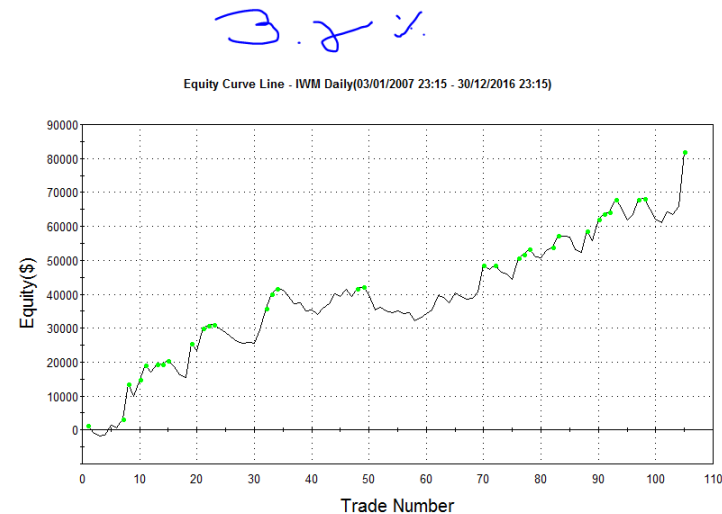
	LAdaptivev _STOPLOS	Test	All Net Profit	All Gross Profit	All Gross Loss	All Total Trades	All % Profitable	All Winning Trades	All Losing Trades	All Max Winning Trade	All Max Losing Trade	All Avg Winning Trade	All Avg Losing Trade	All Win/Loss Ratio	All Avg Trade	All Max Consecutive Winners	All Max Consecutive Losers	All Avg Bars in Winner	All Avg Bars in Loser	All Max Intraday Drawdown	All ProfitFactor	All Max Contracts Held	All Required Account Size	All Return on Account	All TS Index	All Expectancy Score	All Estimated Return On Capital	All Perfect Profit Correlation	All Robustness Index
1	4.0	39	75,770.00	157,440.00	-81,670.00	104	52.88	55	49	16,040.00	-8,360.00	2,862.55	-1,666.73	1.72	728.56	5	7	9	5	-15,195.00	1.93	1,000	15,195.00	498.65	274.26	1.03	0.66	69,765.92	0.00
2	3.9	38	78,730.00	160,960.00	-82,230.00	104	52.88	55	49	16,040.00	-8,360.00	2,826.55	-1,678.16	1.74	757.02	5	7	9	5	-15,095.00	1.96	1,000	15,095.00	521.56	286.86	1.08	0.69	72,533.87	0.00
3	3.8	37	79,170.00	160,960.00	-81,790.00	104	52.88	55	49	16,040.00	-8,360.00	2,926.55	-1,669.18	1.75	761.25	5	7	9	5	-14,985.00	1.97	1,000	14,985.00	528.33	290.58	1.09	0.69	72,995.60	0.00
4	3.7	36	80,970.00	161,320.00	-80,350.00	104	53.85	56	48	16,040.00	-8,360.00	2,880.71	-1,673.96	1.72	778.56	5	5	9	5	-14,885.00	2.01	1,000	14,885.00	543.97	304.62	1.12	0.71	75,250.27	0.00
5	3.6	35	81,480.00	161,320.00	-79,840.00	104	53.85	56	48	16,040.00	-8,360.00	2,880.71	-1,663.33	1.73	783.46	5	5	9	5	-14,785.00	2.02	1,000	14,785.00	551.10	308.62	1.13	0.71	75,793.75	0.00
6	3.5	34	78,960.00	161,320.00	-82,360.00	104	53.85	56	48	16,040.00	-8,360.00	2,880.71	-1,715.83	1.68	759.23	5	5	9	5	-14,675.00	1.96	1,000	14,675.00	538.06	301.31	1.06	0.69	73,058.03	0.00
7	3.4	33	79,570.00	161,320.00	-81,750.00	104	53.85	56	48	16,040.00	-8,360.00	2,880.71	-1,703.13	1.69	765.10	5	5	9	5	-14,575.00	1.97	1,000	14,575.00	545.93	305.72	1.07	0.70	73,710.22	0.00
8	3.3	32	84,500.00	161,560.00	-77,060.00	104	54.81	57	47	16,040.00	-4,520.00	2,834.39	-1,639.57	1.73	812.50	5	4	8	5	-11,265.00	2.10	1,000	11,265.00	750.11	427.56	1.20	0.74	79,222.76	0.00
9	3.2	31	81,930.00	162,180.00	-80,250.00	105	53.33	56	49	16,040.00	-4,520.00	2,896.07	-1,637.76	1.77	780.29	4	5	8	4	-11,185.00	2.02	1,000	11,185.00	732.50	410.20	1.16	0.72	78,708.20	0.00
10	3.1	30	74,740.00	158,050.00	-81,310.00	106	52.83	56	50	16,040.00	-4,520.00	2,786.61	-1,626.20	1.71	705.09	4	5	8	4	-11,725.00	1.92	1,000	11,725.00	637.44	356.97	1.04	0.65	69,541.64	0.00
11	3.0	29	75,200.00	157,470.00	-82,270.00	107	53.27	57	50	16,040.00	-4,520.00	2,762.63	-1,645.40	1.68	702.80	4	4	8	4	-11,565.00	1.91	1,000	11,565.00	650.24	370.64	1.04	0.66	70,287.09	0.00
12	2.9	28	73,630.00	155,920.00	-82,290.00	107	52.34	56	51	16,040.00	-4,520.00	2,784.29	-1,613.53	1.73	688.13	4	5	8	4	-11,405.00	1.89	1,000	11,405.00	645.59	361.53	1.03	0.64	68,558.82	0.00
13	2.8	27	73,710.00	155,920.00	-82,210.00	107	52.34	56	51	16,040.00	-4,520.00	2,784.29	-1,611.96	1.73	688.88	4	5	8	4	-11,245.00	1.90	1,000	11,245.00	655.49	367.08	1.03	0.64	68,579.21	0.00
14	2.7	26	73,340.00	154,270.00	-80,930.00	107	52.34	56	51	16,040.00	-4,520.00	2,754.82	-1,596.86	1.74	685.42	4	5	8	4	-12,025.00	1.91	1,000	12,025.00	609.90	341.54	1.04	0.64	67,522.13	0.00
15	2.6	25	74,540.00	154,270.00	-79,730.00	107	52.34	56	51	16,040.00	-4,520.00	2,754.82	-1,563.33	1.76	686.64	4	5	8	4	-11,645.00	1.93	1,000	11,645.00	640.10	358.46	1.08	0.65	68,925.55	0.00
16	2.5	24	71,970.00	153,960.00	-81,990.00	108	50.00	54	54	16,040.00	-4,520.00	2,851.11	-1,518.33	1.88	686.39	4	6	8	4	-10,775.00	1.88	1,000	10,775.00	667.94	360.68	1.06	0.62	67,215.64	0.00
17	2.4	23	57,580.00	145,560.00	-87,980.00	109	47.71	52	57	16,040.00	-4,520.00	2,799.23	-1,543.51	1.81	528.26	4	6	8	3	-13,915.00	1.65	1,000	13,915.00	413.88	215.17	0.78	0.49	49,217.93	0.00
18	2.3	22	62,500.00	148,100.00	-85,600.00	111	47.75	53	58	16,040.00	-4,520.00	2,794.34	-1,475.86	1.89	563.06	4	6	8	3	-15,615.00	1.73	1,000	15,615.00	400.26	212.14	0.91	0.53	51,610.40	0.00
19	2.2	21	59,580.00	145,650.00	-86,070.00	112	47.32	53	59	16,040.00	-4,520.00	2,748.11	-1,458.81	1.88	531.96	4	6	8	3	-15,095.00	1.69	1,000	15,095.00	394.70	209.19	0.86	0.51	46,041.36	0.00
20	2.1	20	61,620.00	146,010.00	-84,390.00	112	48.21	54	58	16,040.00	-4,520.00	2,703.89	-1,455.00	1.86	550.18	4	6	8	3	-14,695.00	1.73	1,000	14,695.00	419.33	226.44	0.90	0.53	48,549.45	0.00
21	2.0	19	65,110.00	146,010.00	-80,900.00	112	48.21	54	58	16,040.00	-4,520.00	2,703.89	-1,394.83	1.94	581.34	4	6	8	3	-14,155.00	1.80	1,000	14,155.00	459.98	248.39	1.01	0.56	53,261.98	0.00
22	1.9	18	67,250.00	146,010.00	-78,760.00	112	48.21	54	58	16,040.00	-4,520.00	2,703.89	-1,357.93	1.99	600.45	4	6	8	3	-13,995.00	1.85	1,000	13,995.00	480.53	259.49	1.09	0.58	56,078.85	0.00
23	1.8	17	55,540.00	137,330.00	-81,790.00	113	46.02	52	61	16,040.00	-4,520.00	2,640.96	-1,340.82	1.97	491.50	4	6	8	3	-22,605.00	1.68	1,000	22,605.00	245.70	127.76	0.85	0.47	31,112.55	0.00
24	1.7	16	40,820.00	123,470.00	-82,650.00	114	45.61	52	62	10,550.00	-4,520.00	2,374.42	-1,333.06	1.78	358.07	4	6	7	3	-20,925.00	1.49	1,000	20,925.00	195.08	101.44	0.65	0.34	25,520.27	0.00
25	1.6	15	41,000.00	121,760.00	-80,760.00	114	44.74	51	63	10,550.00	-4,520.00	2,387.45	-1,281.90	1.86	359.65	4	6	7	3	-19,485.00	1.51	1,000	19,485.00	210.42	107.31	0.68	0.34	26,478.70	0.00
26	1.5	14	40,910.00	120,270.00	-79,360.00	114	42.98	49	65	10,550.00	-4,520.00	2,454.49	-1,220.92	2.01	358.86	4	7	7	3	-20,475.00	1.52	1,000	20,475.00	199.80	97.90	0.72	0.34	25,282.01	0.00
27	1.4	13	26,830.00	108,260.00	-81,430.00	114	41.23	47	67	6,870.00	-4,520.00	2,303.40	-1,215.37	1.90	235.35	4	7	7	3	-21,855.00	1.33	1,000	21,855.00	123.90	58.23	0.47	0.21	15,812.28	0.00
28	1.3	12	21,580.00	104,460.00	-82,880.00	114	38.60	44	70	6,870.00	-4,520.00	2,374.09	-1,184.00	2.01	189.30	4	9	7	3	-21,205.00	1.26	1,000	21,205.00	101.77	44.78	0.36	0.16	11,428.73	0.00
29	1.2	11	23,840.00	104,820.00	-80,980.00	115	39.13	45	70	6,870.00	-4,520.00	2,329.33	-1,156.86	2.01	207.30	4	9	7	3	-19,895.00	1.29	1,000	19,895.00	119.83	53.92	0.42	0.18	14,350.84	0.00
30	1.1	10	15,250.00	95,700.00	-80,450.00	115	36.52	42	73	6,870.00	-4,520.00	2,278.57	-1,102.95	2.07	132.61	4	10	7	2	-26,465.00	1.19	1,000	26,465.00	57.62	24.20	0.22	0.10	2,009.70	0.00
31	1.0	9	12,530.00	92,290.00	-79,760.00	116	35.34	41	75	6,870.00	-4,520.00	2,250.98	-1,063.47	2.12	108.02	4	12	6	2	-27,815.00	1.16	1,000	27,815.00	45.05	18.47	0.15	0.07	567.72	0.00
32	0.9	8	10,310.00	87,810.00	-77,500.00	116	34.48	40	76	6,870.00	-4,520.00	2,195.25	-1,019.74	2.15	88.88	4	12	6	2	-25,805.00	1.13	1,000	25,805.00	39.95	15.98	0.10	0.05	494.42	0.00
33	0.8	7	13,320.00	87,630.00	-74,310.00	116	34.48	40	76	6,870.00	-4,520.00	2,190.75	-977.76	2.24	114.83	4	12	6	2	-24,255.00	1.18	1,000	24,255.00	54.92	21.97	0.19	0.08	2,442.82	0.00
34	0.7	6	8,480.00	81,860.00	-73,380.00	117	33.33	39	78	6,870.00	-4,520.00	2,098.97	-940.77	2.23	72.48	4	12	6	2	-23,385.00	1.12	1,000	23,385.00	36.26	14.14	0.05	0.04	-309.17	0.00
35	0.6	5	-2,570.00	68,590.00	-71,160.00	117	30.77	36	81	6,870.00	-4,520.00	1,905.28	-878.52	2.17	-21.97	3	12	6	2	-23,465.00	0.96	1,000	23,465.00	-10.95	-3.94	-0.31	-0.06	-1,502.15	0.00
36	0.5	4	-870.00	68,950.00	-69,820.00	118	29.66	35	83	6,870.00	-4,520.00	1,970.00	-841.20	2.34	-7.37	3	12	5	2	-23,095.00	0.99	1,000	23,095.00	-3.77	-1.32	-0.26	-0.05	-417.14	0.00
37	0.4	3	-3,300.00	64,390.00	-67,690.00	119	28.57	34	85	6,870.00	-4,520.00	1,893.82	-796.35	2.38	-27.73	2	12	5	2	-21,645.00	0.95	1,000	21,645.00	-15.25	-5.18	-0.37	-0.07	-1,700.37	0.00
38	0.3	2	-11,530.00	55,120.00	-66,650.00	119	21.85	26	92	6,870.00	-4,520.00	2,120.00	-724.46	2.93	-96.89	2	14	5	2	-26,595.00	0.83	1,000	26,595.00	-43.35	-11.27	-0.73	-0.15	-8,973.27	0.00
39	0.2	1	-12,820.00	51,380.00	-64,200.00	119	21.01	25	94	6,870.00	-4,520.00	2,055.20	-682.96	3.01	-107.73	2	12	5	2	-24,505.00	0.80	1,000	24,505.00	-53.32	-13.08	-0.83	-0.16	-9,710.12	0.00

• הגרף שלNetProfit/MaxDrawdown

- הפרמטר הכי טוב בגרף הוא 3.3 אבל בחרנו ב3.2 כי הוא יותר יציב (שני הדוחות המלאים – בלי סטופ לוס ועם 3.2% נמצאים באקסל)

	Stop 3.2%	No stop
Total Net Profit	81930\$	79220\$
Profit Factor	2.02	2%
Total Number of Trades	105	104
Long Trades	74	73
Short Trades	31	31
Percent Profitable	53.33%	53.85%
Winning Trades	56	56
Return on Initial Capital	81.93%	79.22%
Annual Rate of Return	6.24%	6.08%
RINA Index	198.63	151
Percent of Time in the Market	24.01	26.12%
Max. Drawdown (Intra-day Peak to Valley)	-13550\$	-16120
as % of Initial Capital	13.55%	16.12%
Net Profit as % of Drawdown	604.65%	491.44%
Account Size Required	10210\$	13640\$

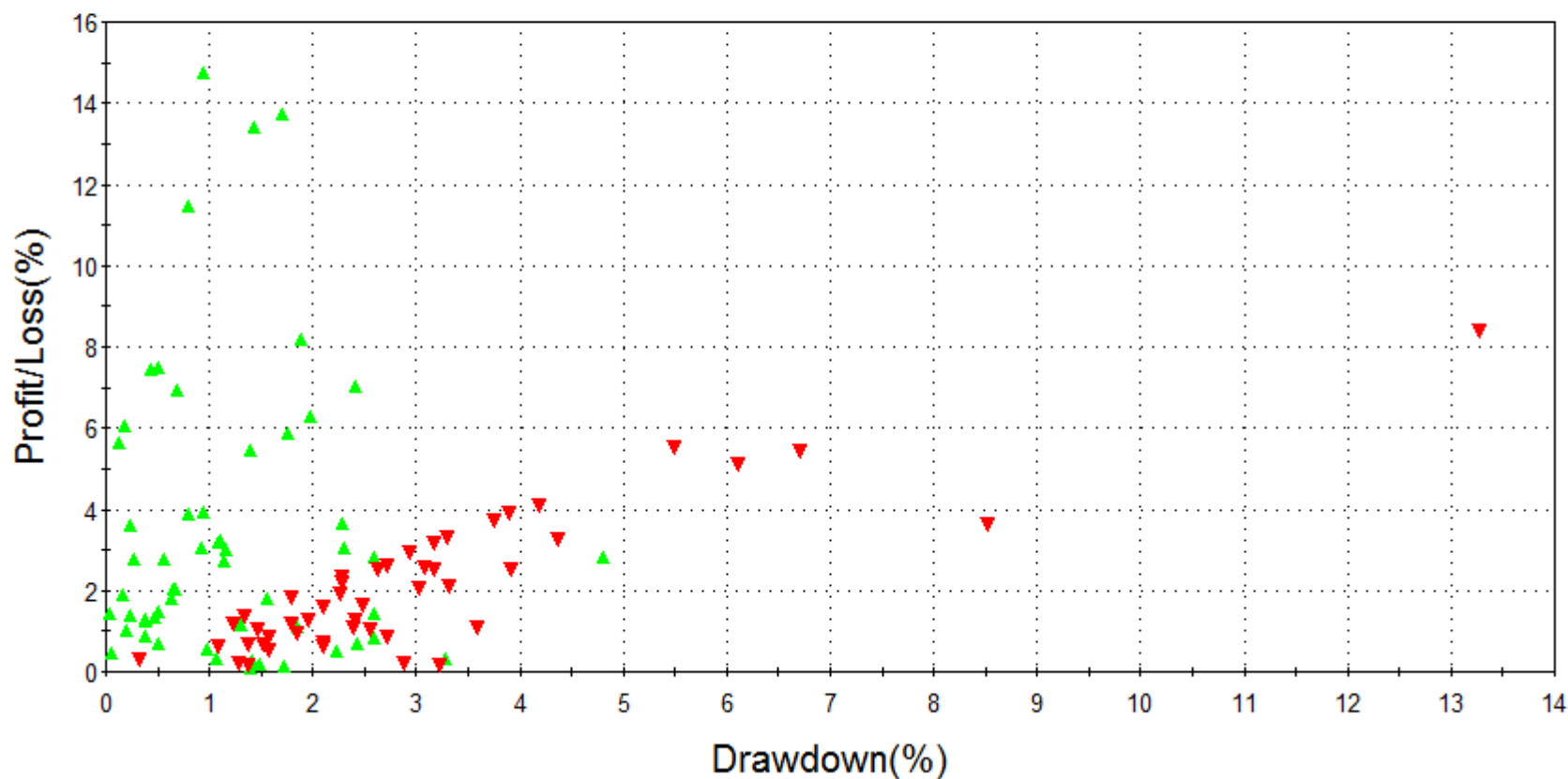
השוואה בין גרפי ה Equity, עם סטופ 3.2% משמאל ובלי מימין:

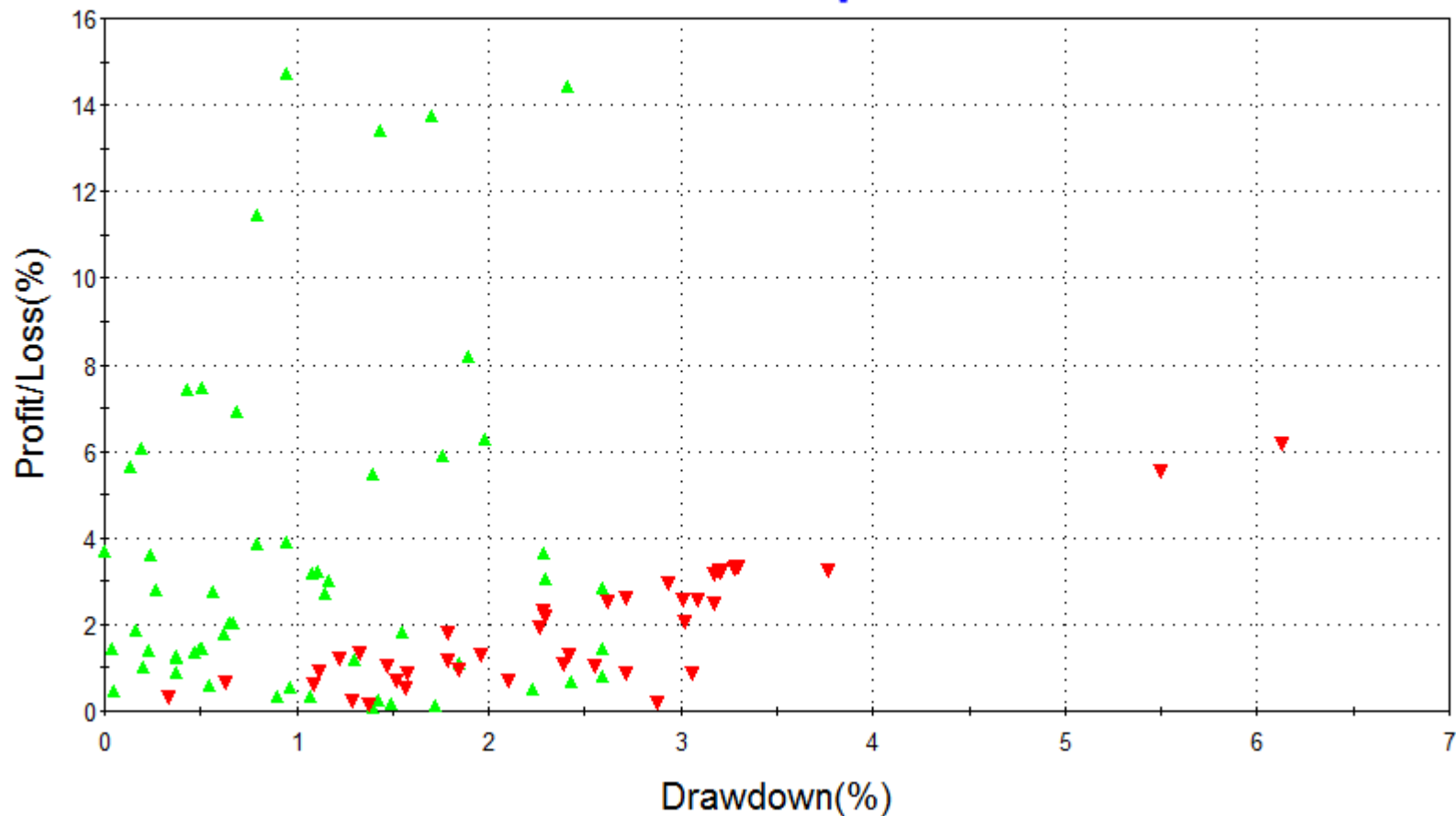


- שוב, הגרפים מאוד דומים אך ניתן לראות "התכווצות" בגרף משמאל. התכווצות זו כתוצאה מהסטופ לוס. בסעיף B קיצרנו לו את היכולת להבחין בתחילת מגמה שלילית לנו ואפשרנו לו לברוח בפחות ברים. עכשיו אמרנו לו שהוא יכול לברוח אם ירדנו 3.3% בלי קשר לברים. לכן נותרנו פחות חשופים לא רק בשינוי מגמה אלא גם בשינוי חד. השינוי הכי גדול ומשמעותי שעשינו הוא מזעור הDRAWDOWN שלנו. קיבנו כמעט אותה תשואה (חמשת אלפים יותר) אבל מזערנו משמעותית את הסיכון שלנו מ16 אלף ירדנו ל13 אלף. כתוצאה מכך גודל החשבון ירד גם כן משמעותית, אחוזי הNETPROFIT ביחס לDRAWDOWN גדלו ב150%, RINA אינדקס טיפס מ151 ל200.

No Stop

Maximum Adverse Excursion Percent - IWM Daily(03/01/2007 23:15 - 30/12/2016 23:15)





- השוואה : ניתן לראות שללא StopLoss אנחנו מקבלים הרבה טריידים (11) עם drawdown של מעל 3.5% בעוד שלאחר הוספת ה StopLoss אנחנו מקבלים רק 3 טריידים כאלה. כלומר בכמעט 10% מהטריידים שלנו אנחנו חווים נפילה גדולה מאוד בתוך התחום שבתוך ה min-bars.
- ניתן לראות בגרף שלושה מקרים שבהם ה drawdown היה גדול מהרף שהצבנו. הנחנו שזה יכול להתקיים בשלושה מצבים:
 - Slippage - עד שהפקודה משוגרת ומבוצעת במלואה המחיר של נייר הערך ממשיך לנוע לרעתנו.
 - תנועה חדה post או pre-market - בגלל שהפקודות שאנחנו מבצעים קורות רק בשעות המסחר אם מניה נעה בחדות מחוץ לשעות המסחר אנחנו נבצע את ההגנה רק בפתיחת היום הבא.
 - תנועה חדה במהלך יום הקנייה – מכיוון שה StopLoss נקבע רק בבר שאחרי הקנייה אנחנו חשופים לירידות במהלך אותו הבר.

כשניתחנו את הפוזיציות ראינו שפוזציה אחת עברה את הStopLoss בגלל תנועה בתוך יום הקנייה ושתיים בגלל תנועה חדה מחוץ לשעות המסחר.