

به نام خدا

امیر محمد کمیجانی 99522032

استراتژی 2 : supertrend – rsi

توضیح کوتاه از اندیکاتور supertrend :

این اندیکاتور برای تشخیص روند بازار و پیدا کردن نقاط ورود و خروج بر اساس آن میباشد. دارای مقدار ATR میباشد که نشان دهنده نوسانات بازار میباشد. مقدار supertrend که در کد هم آنرا خواهید دید خطی است که نشان دهنده این اندیکاتور است و ما بر اساس آن وارد معاملات خواهیم شد؛ هنگامی که قیمت بالاتر از این خط باشد وارد پوزیشن long میشویم و هنگامی که قیمت پایین تر باشد وارد پوزیشن short میشویم.

توضیحات کد :

بخش اول:

ابتدا بازه زمانی که می‌خواهیم را از کاربر دریافت میکنیم

سپس تنظیمات هر دو اندیکاتور را در هر دو بخش می‌گیریم البته مقادیر این تنظیمات هم جوری در نظر می‌گیریم که به صورت input باشند.

شرایط خرید در هر دو اندیکاتور را در نظر می‌گیریم و با هم and میکنیم (برای ترکیب) همچنین شرایط فروش هم به همین صورت میباشد.

سپس شرایط خارج شدن از معامله را در اندیکاتور supertrend مدنظر قرار میدهیم و از معامله خارج میشویم.

بخش دوم:

همانند توضیحات استراتژی قبل، این بار از تایم فریم های مختلف 4 ساعته و 1روز استفاده میکنیم و اندیکاتور های مورد نظر را در این تایم فریم ها استفاده و شرایط آنها را بررسی میکنیم و ترکیب اندیکاتور ها را این بار تحت این تایم فریم ها مورد بررسی قرار میدهیم. همانند قبل ابتدا تنظیمات دو اندیکاتور را انجام میدهیم.

سپس به سراغ تنظیمات تایم فریم میرویم و تایم فریم های 4 ساعته و 1روزه را مورد استفاده قرار میدهیم.

برای کنترل بیشتر ورود و خروج معاملات برای بر آورده کردن شرط از or استفاده میکنیم تا اگر از یکی از تایم فریم ها سیگنال خروج گرفتیم از معامله خارج شویم.

مقایسه و تحلیل:

با استفاده از روش کار در چند تایم فریم به طور کلی میتوان به نتایج بهتری رسید البته میزان تغییرات آن کم میباشد. در عکس هایی که قرار داده ام تغییرات حدود 18 درصد میباشد که به دلیل کاستومایز کردن مقادیر initial cap , order size میباشد که باعث میشود دیگر مقادیر مانند sharp ratio , profit factor افزایش پیدا کنند. به طور کلی بعد از تست کردن مقادیر زیاد و متنوع میتوان گفت استفاده از تایم فریم های مختلف کنترل بهتری در ورود به معامله را به ما میدهند و میتوانند باعث افزایش net profit شوند البته این مورد همیشگی نیست و بارها تجربه کردم که نتیجه عکس هم داشته است.

در نتیجه میتوان گفت استفاده از چند تایم فریم میتواند کمک حال باشد اما در همه شرایط صادق نیست. مثلا اگر استراتژی ما خوب باشد و تعداد معاملات خوبی را بتوانیم انجام دهیم و موفق باشیم با اعمال کنترل بیشتر روی معاملات میتوانیم باعث کاهش net profit شویم که در این استراتژی بار ها این موارد را دیدم.

منابع:

<https://trendspider.com/learning-center/supertrend-indicator-a-comprehensive-guide>

<https://www.youtube.com/watch?v=XOXjJZOIkE&t=532s>

<https://courses.theartoftrading.com/pages/multiple-timeframe-moving-average-in-pine-script>