

AIGO HACK

Valukhov Capital

Идея Алгоритма

- Основная идея решения – сигналы от пересечения скользящих средних;
- Данные – `algorack` MOEX
- Инструмент – обыкновенные акции Сбербанка
- Мы получаем сигнал на покупку, когда "Быстрая" пробивает снизу "Медленную";
- Таймфрейм - 1 час, по итогам каждого часа рассчитываем сигналы по средним;
- Если есть сигнал на покупку или продажу, делаем сделку по цене открытия следующей часовой свечи

Особенности алгоритма

Результат – 46.8%
среднегодовой
доходности

- Используем маржинальную торговлю, учёт всех комиссий и стоимости средств брокера
- Учитываем дивиденды, в зависимости от позиции на дату отсечки
- Не учитываем налоги - предположим, что торгуем на ИИС типа Б
- Период тестирования – с 1 января 2020 по 1 декабря 2023

	Значение метрики
Начальная дата	2020-01-03 10:59:59
Конечная дата	2023-11-30 18:50:08
Длина периода тестирования	1427 days 07:50:09
Время в позиции, %	99.93
Итоговая величина портфеля, руб.	439291
Максимальная величина портфеля	460350
Совокупная доходность, %	439
Доходность стратегии buy and hold, %	129
Среднегодовая доходность, %	46.79
Среднегодовая волатильность, %	37.17
Sharpe-ratio	1.02
Sortino-ratio	1.61
Максимальная просадка, %	-25.64
Calmar ratio	1.82

Сервис для инвесторов

- Идея – интерактивная платформа для тестирования алгоритмов на скользящих средних
- Учет различных параметров
- Расчёт основных метрик
- Для кого – начинающих алготрейдеров или инвесторов, которые хотят влиться в алготрейдинг и потестировать несложные стратегии
- Под капотом – взаимодействие скользящих средних

Сервис для инвесторов

Ссылка на сервис
<https://valukhovcapital.streamlit.app/>

Не является индивидуальной
инвестиционной рекомендацией!

SBER

4/4

☒ Использовать экспоненциальные средние

Введите период для быстрой средней

9

- +

Введите период для медленной средней

45

- +

Плечо в лонг

?

1,50

- +

Плечо в шорт

?

0,50

- +

Комиссия брокера за сделку, %

?

0,06

- +

Стоимость заёмных средств, %

?

17

- +

Запустить бэкстест