

Домашнее задание №2



Задание:

Необходимо придумать трендовую стратегию и написать ее. Стратегия должна определять тренды, заходить в long в начале восходящего тренда или в short в начале нисходящего. А также выходить при развороте. Попробуйте подобрать параметры, которые улучшат метрики (хотя бы будут торговать в плюс :))

Дано:

- система для бектестирования
- данные
- пример простой трендовой стратегии

Пример:

Вам предоставляется пример простой трендовой стратегии на 2 sma. Идея заключается в том, что у 2 индикаторов разные периоды, у одной больше, у другой меньше. Первая дольше реагирует на изменения, а вторая быстрее. Гипотеза: когда “быстрая” пересекает “медленную” снизу -> восходящий тренд, а если сверху -> нисходящий.

