

Домашнее задание №3



Задание:

Необходимо придумать Mean Reversion стратегию и написать ее. Стратегия должна основываться на регулярный возврат к некоему среднему. Попробуйте подобрать параметры, которые улучшат метрики (хотя бы будут торговать в плюс :))

Дано:

- система для бектестирования
- данные
- пример простой Mean Reversion стратегии

Пример:

Вам предоставляется пример простой Mean Reversion стратегии на индикаторе RSI. Этот индикатор технического анализа определяет силу тренда и вероятность его смены, другими словами, определяет насколько перекуплен или перепродан инструмент. Стратегия заключается в том, что если уровень перекупленности или перепроданности переходят установленные значения, то мы входим в сделку, а когда достигает значения 50, выходим из сделки.

