Cách backtest chiến lược giao dịch:

+ Chiến lược giao dịch là :

-, Chiến lược 1 – MA20 cắt lên MA50 và giá đang trên đường trung bình dài hạn MA200: Nếu đường MA20 cắt lên đường MA50 và giá cổ phiếu hiện tại đang ở trên đường MA200 và ở phiên liền trước đường MA20 đang nhỏ hơn đường MA50 thì tôi sẽ và mua

và đợi đến khi đường MA20 cắt xuống đường MA50 thì tôi bán ra (Lưu ý rằng: Khi bán ra giá cổ phiếu vẫn đang trên đường MA200)

-, Chiến lược 2 – MA50 cắt lên MA200 ( giao cắt vàng khi buy và giao cắt tử thần khi bán)

Cách Backtest:

Tính Return = ((Giá ở ngày Sell – Gía ở ngày buy)/ giá ở ngày Buy) \*100

Hãy in ra màn hình Bảng Backtest chứa các thông tin của các tín hiệu:

+ Thời gian mua: Chứa Datetime của thời điểm mua của tín hiệu đó

+ Thời gian bán: Chứa Datetime của thời điểm bán của tín hiệu đó

+ Giá mua: Chứa giá mua của tín hiệu đó

+ Gía bán: Chứa giá bán của tín hiệu đó

+ Return: Return của tín hiệu đó

Hãy in ra màn hình cho tôi các cột cho bảng kết quả Backtest sau:  
+ Số tín hiệu : Đây là cột chứa số cặp tín hiệu mua bán. Ví dụ trong Backtest chiến lược có 10 lần ra tín hiệu mua khi đường MA20 cắt lên MA50 và giá cổ phiếu đang ở trên MA200 và tương ứng với đó là 10 lần bán ra đóng vị thế khi giá MA20 cắt xuống MA50 => Số tín hiệu = 10

+ % tín hiệu lãi: Đây là cột chứa số cặp tín hiệu mua bán đã ghi nhận lãi (tức Return của tín hiệu đó là >0%). Ví dụ có 10 tín hiệu nhưng có 6 tín hiệu trong đó là Return > 0% => %tín hiệu lãi =60%

+% tín hiệu lỗ: Đây là cột chứa số cặp tín hiệu mua bán đã ghi nhận lỗ (tức Return của tín hiệu đó là <0%). Ví dụ có 10 tín hiệu nhưng có 4 tín hiệu trong đó là Return < 0% => %tín hiệu lỗ = 40%

+ Trung bình return của các tín hiệu lãi: Đây là cột chứa giá trị trung bình Return của các tín hiệu lãi. Ví dụ có 10 tín hiệu đưa ra, 6 tín hiệu là tín hiệu lãi với Return lần lượt lượt là +10%, +15%, +12%, + 20%, +50%, +200% => Trung bình return của các tín hiệu lãi = +51,2%

+ Trung vị return của các tín hiệu lãi: Đây là cột chứa giá trị trung vị của các tín hiệu lãi. Ví dụ có 10 tín hiệu đưa ra, 6 tín hiệu là tín hiệu lãi với Return lần lượt lượt là +10%, +15%, +12%, + 20%, +50%, +200% => Trung vị return của các tín hiệu lãi = +17,5%

+ Trung bình return của các tín hiệu lỗ: Đây là cột chứa giá trị trung bình Return của các tín hiệu lỗ. Ví dụ có 10 tín hiệu đưa ra, 4 tín hiệu là tín hiệu lỗ với Return lần lượt lượt là -20%, -70%, -10%, -5% => Trung bình return của các tín hiệu lỗ = -26,3%

+ Trung vị return của các tín hiệu lỗ: Đây là cột chứa giá trị trung vị Return của các tín hiệu lỗ. Ví dụ có 10 tín hiệu đưa ra, 4 tín hiệu là tín hiệu lỗ với Return lần lượt lượt là -20%, -70%, -10%, -5% => Trung vị return của các tín hiệu lỗ = -15%

**+ Chiến lược 3 – RSI giảm xuống <31 và giá hiện tại đang ở trên MA200 :**

Nếu RSI của ngày hôm đó <31 và giá hiện tại đang ở trên MA200 thì mua vào và đợi đến khi giá <MA200 thì bán.

Lần này chiến lược bảng Backtest sẽ in ra:

+ Thời gian mua: Chứa Datetime của thời điểm mua của tín hiệu đó

+ Thời gian bán: Chứa Datetime của thời điểm bán của tín hiệu đó

+ Số ngày giao dịch nắm giữ: Bằng Datetime của thời điểm bán trừ đi Datetime của thời điểm mua của tín đó

+ Giá mua: Chứa giá mua của tín hiệu đó

+ Gía bán: Chứa giá bán của tín hiệu đó

+ Return: = ((Giá ở ngày sell – Gía ở ngày buy)/ giá ở ngày Buy) \*100

+ Return T+3: Tức là = return giá sau 3 ngày giao dịch sau so với ngày mua. Ví dụ Ngày mua vào là “**2007-11-15” (Ngày T) ở giá 22 000 tương ứng với ngày đó thì những ngày giao dịch tiếp theo lân lượt là “** 2007-11-16” sau đó nghỉ 2 ngày cuối tuần trước khi đến ngày tiếp theo nữa là “ 2007-11-19” và giá ở ngày “2007-11-20” ( Tức ngày T+3 so với ngày T) thì giá đang ở 24 000 => Return T+3 = +9,1%.

+ Return T+ 10: Tức là Return T+10 so với ngày (Phiên giao dịch) mua hiện tại. Tức là ví dụ ngày mua là “2007-11-15”( Ngày T) ở giá 22 000 và 2007-11-29 (tức T+10 so với ngày T tại vì thứ 7, chủ nhật cổ phiếu không giao dịch) giá cổ phiếu ở mức 20 000 => Return T+10 = (20 000- 22000)/22000 = -9,1%

+ Return T+60: Tức là Return T+60 so với ngày (Phiên giao dịch) mua hiện tại. Tức là ví dụ ngày mua là “2007-11-15”( Ngày T) ở giá 22 000 và 2007-02-19 (tức T+10 so với ngày T tại vì thứ 7, chủ nhật cổ phiếu không giao dịch) giá cổ phiếu ở mức 20 000 => Return T+60 = (20 000- 22000)/22000 = -9,1%

+ Return T+180: Tức là Return T+180 so với ngày (Phiên giao dịch) mua hiện tại. Tức là ví dụ ngày mua là “2007-11-15”( Ngày T) ở giá 22 000 thì đến ngày T+180 giá cổ phiếu ở mức 20 000 => Return T+180 = (20 000- 22000)/22000 = -9,1%

+ Return T+360: Tức là Return T+360 so với ngày (Phiên giao dịch) mua hiện tại. Tức là ví dụ ngày mua là “2007-11-15”( Ngày T) ở giá 22 000 thì đến ngày T+360 giá cổ phiếu ở mức 20 000 => Return T+360 = (20 000- 22000)/22000 = -9,1%

Ngoài ra , ở 2 hàng cuối của Bảng này tôi muốn hiện trung bình và trung vị giá trị của các cột: Số ngày giao dịch nắm giữ, Return, Return T+3, Return T+ 10, Return T+60, Return T+180, Return T+360, còn của các cột khác tạm thời để trống.

Bên cạnh đó, hãy thống kê cho tôi thêm các số liệu sau:

+ Số tín hiệu : Đây là cột chứa số cặp tín hiệu mua bán. Ví dụ trong Backtest chiến lược có 10 lần ra tín hiệu mua khi đường MA20 cắt lên MA50 và giá cổ phiếu đang ở trên MA200 và tương ứng với đó là 10 lần bán ra đóng vị thế khi giá MA20 cắt xuống MA50 => Số tín hiệu = 10

+ % tín hiệu lãi: Đây là cột chứa số cặp tín hiệu mua bán đã ghi nhận lãi (tức Return của tín hiệu đó là >0%). Ví dụ có 10 tín hiệu nhưng có 6 tín hiệu trong đó là Return > 0% => %tín hiệu lãi =60%

+% tín hiệu lỗ: Đây là cột chứa số cặp tín hiệu mua bán đã ghi nhận lỗ (tức Return của tín hiệu đó là <0%). Ví dụ có 10 tín hiệu nhưng có 4 tín hiệu trong đó là Return < 0% => %tín hiệu lỗ = 40%

+ Trung bình return của các tín hiệu lãi: Đây là cột chứa giá trị trung bình Return của các tín hiệu lãi. Ví dụ có 10 tín hiệu đưa ra, 6 tín hiệu là tín hiệu lãi với Return lần lượt lượt là +10%, +15%, +12%, + 20%, +50%, +200% => Trung bình return của các tín hiệu lãi = +51,2%

+ Trung vị return của các tín hiệu lãi: Đây là cột chứa giá trị trung vị của các tín hiệu lãi. Ví dụ có 10 tín hiệu đưa ra, 6 tín hiệu là tín hiệu lãi với Return lần lượt lượt là +10%, +15%, +12%, + 20%, +50%, +200% => Trung vị return của các tín hiệu lãi = +17,5%

+ Trung bình return của các tín hiệu lỗ: Đây là cột chứa giá trị trung bình Return của các tín hiệu lỗ. Ví dụ có 10 tín hiệu đưa ra, 4 tín hiệu là tín hiệu lỗ với Return lần lượt lượt là -20%, -70%, -10%, -5% => Trung bình return của các tín hiệu lỗ = -26,3%

+ Trung vị return của các tín hiệu lỗ: Đây là cột chứa giá trị trung vị Return của các tín hiệu lỗ. Ví dụ có 10 tín hiệu đưa ra, 4 tín hiệu là tín hiệu lỗ với Return lần lượt lượt là -20%, -70%, -10%, -5% => Trung vị return của các tín hiệu lỗ = -15%