

Rational  Answer

# Мой первый и неудачный опыт поиска торговой стратегии для Московской биржи

18 ноября 2024  0

Михаил Шардин

Когда закончил писать механизм своего торгового робота обнаружил, что самое главное всё таки не сам механизм, а стратегия, по которой этот механизм будет работать.

Первый тесты на истории показали что с доходностью и тем более с тем как доходность портфеля компенсирует принимаемый риск (коэффициент Шарпа) проблемы, но неудачный опыт тоже опыт, поэтому решил описать его в статье.

Первый и самый важный вопрос - при помощи чего проводить тесты торговой стратегии на исторических данных? В какой

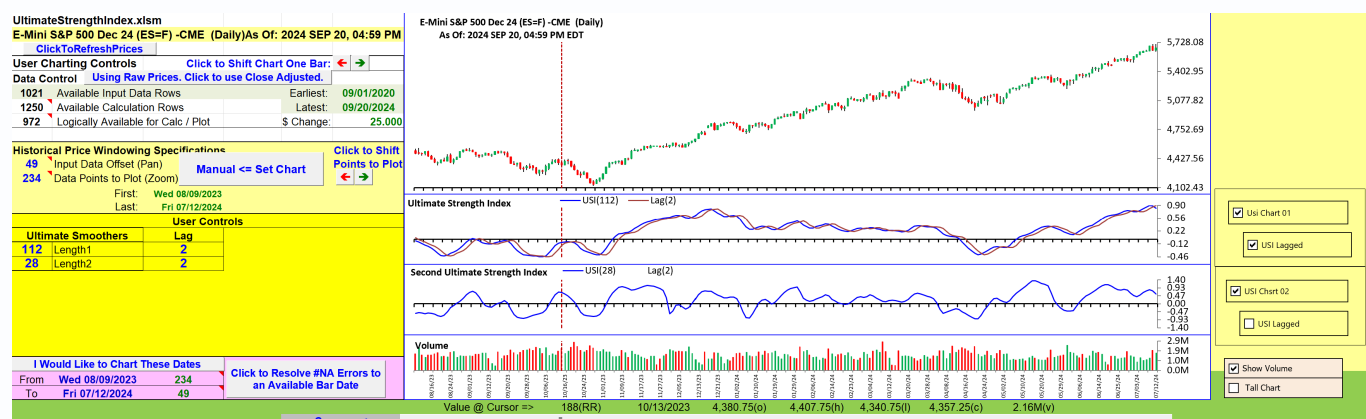


программе или при помощи какой библиотеки создавать стратегию и потом прогонять её на истории?

Раз мой торговый робот создан в среде исполнения JavaScript Node.js, то и тесты в идеале должны проводится на чём-то схожем. Но забегаю немного вперёд скажу что получилось по другому.

## Windows? macOS? Linux?

Раз сам механизм работа кросс-платформенный, то хотелось чтобы и тесты можно было проводить при помощи кросс-платформенной утилиты. Однако когда рассматривал самые популярные программы, то обнаружилось что все программы из списка только для Windows. Кроме TradingView, который является веб-сервисом и Excel – который есть и для macOS.



## Бэктестинг в Microsoft Excel

Но похоже что веб-вервис и тем более Microsoft Excel – не лучший выбор. Тем не менее вот варианты, которые я



рассматривал:

- TradeStation: комплексная торговая и аналитическая платформа; идеально подходит для построения графиков, автоматизации стратегий и бэктестинга для акций, опционов, фьючерсов и криптовалют.
- NinjaTrader: торговое программное обеспечение для фьючерсов и форекс; отлично подходит для расширенного построения графиков, бэктестинга и автоматизированной торговли.
- MetaStock: фокусируется на техническом анализе и бэктестинге с обширными инструментами для построения графиков и индикаторов, популярен среди трейдеров акциями.
- Wealth-Lab: платформа, известная расширенным бэктестингом и разработкой торговых стратегий с мощной поддержкой портфелей из нескольких активов.
- TradingView: удобная в использовании платформа для построения графиков с социальными функциями; отлично подходит для технического анализа, обмена идеями и базового бэктестинга стратегий.
- RealTest: легкое программное обеспечение для бэктестинга и разработки стратегий, известное своей скоростью и простотой, ориентированное на системных трейдеров.



- Neuroshell Trader: специализируется на прогнозном моделировании и анализе на основе нейронных сетей; идеально подходит для трейдеров, интересующихся машинным обучением.
- TSLab: платформа позволяет разрабатывать, тестировать и оптимизировать торговые системы без необходимости глубокого знания программирования.
- The Zorro Project: бесплатная, легкая и скриптовая платформа, предназначенная для автоматизированной торговли, бэктестинга и исследований, популярная среди алгоритмических трейдеров.
- и даже Microsoft Excel: универсальный инструмент для работы с электронными таблицами, часто используемый для анализа портфеля, пользовательского бэктестинга и организации данных в торговле.

Ни один из этих вариантов мне не приглянулся из-за отсутствия кросс-платформенности или этот вариант был Экселем.

## Node.js библиотеки - не смог ❌

После этого стал смотреть библиотеки для Node.js. Выбор оказался небольшой и более-менее живыми мне показались:

Grademark: <https://github.com/Grademark/grademark>  
Библиотека Node.js для бэктестинга торговых стратегий на

исторических данных.

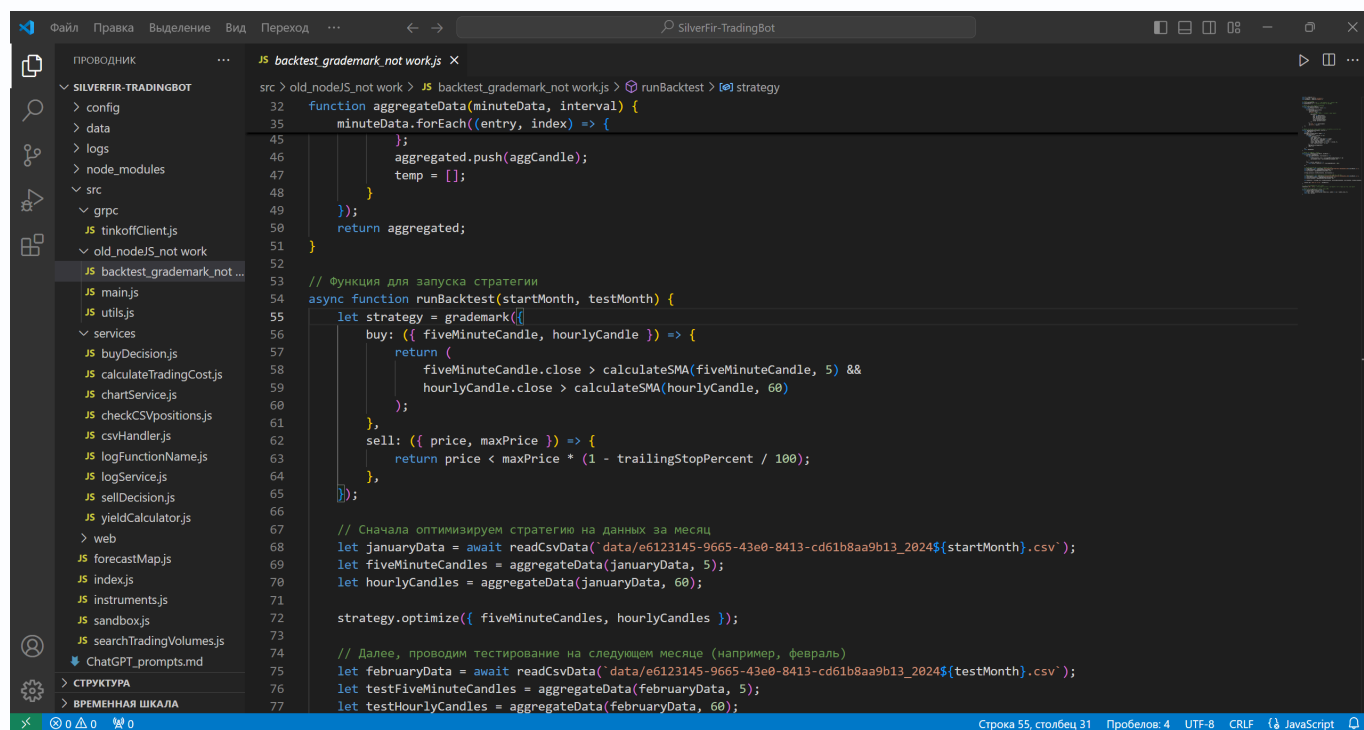
- Fugle Backtest: <https://github.com/fugle-dev/fugle-backtest-node>

Библиотека Node.js для бэктестинга стратегий торговли акциями.

- CCXT - Cryptocurrency eXchange Trading Library:

<https://github.com/ccxt/ccxt>

Библиотека Node.js для торговли криптовалютой, которая предоставляет унифицированный API для подключения и торговли на нескольких криптовалютных биржах, поддерживая как торговлю в реальном времени, так и доступ к историческим данным.



```
src > old_nodeJS_not work > JS backtest_grademark_not works.js > runBacktest > strategy
32 function aggregateData(minuteData, interval) {
35   minuteData.forEach((entry, index) => {
45     });
46     aggregated.push(aggCandle);
47     temp = [];
48   });
49 });
50 return aggregated;
51 }
52
53 // Функция для запуска стратегии
54 async function runBacktest(startMonth, testMonth) {
55   let strategy = grademark({
56     buy: ({ fiveMinuteCandle, hourlyCandle }) => {
57       return (
58         fiveMinuteCandle.close > calculateSMA(fiveMinuteCandle, 5) &&
59         hourlyCandle.close > calculateSMA(hourlyCandle, 60)
60       );
61     },
62     sell: ({ price, maxPrice }) => {
63       return price < maxPrice * (1 - trailingStopPercent / 100);
64     },
65   });
66
67   // Сначала оптимизируем стратегию на данных за месяц
68   let januaryData = await readCsvData('data/e6123145-9665-43e0-8413-cd61b8aa9b13_2024${startMonth}.csv');
69   let fiveMinuteCandles = aggregateData(januaryData, 5);
70   let hourlyCandles = aggregateData(januaryData, 60);
71
72   strategy.optimize({ fiveMinuteCandles, hourlyCandles });
73
74   // Далее, проводим тестирование на следующем месяце (например, февраль)
75   let februaryData = await readCsvData('data/e6123145-9665-43e0-8413-cd61b8aa9b13_2024${testMonth}.csv');
76   let testFiveMinuteCandles = aggregateData(februaryData, 5);
77   let testHourlyCandles = aggregateData(februaryData, 60);
```



Ответ ChatGPT по Grademark




Для Grademark набросал через ChatGPT конкретный пример использования.

## Python библиотеки - заработало!

В Python есть несколько популярных библиотек для бэктестинга торговых стратегий, рассчитанных на разные уровни сложности и типы активов. Вот найденные варианты:

- Backtesting.py <https://github.com/kernc/backtesting.py>  
Легкая, интуитивно понятная библиотека для векторизованного бэктестинга, включающая популярные индикаторы и метрики.  
 4 года не обновлялась.
- Backtrader <https://github.com/mementum/backtrader>  
Одна из самых популярных и многофункциональных библиотек для бэктестинга. Поддерживает несколько активов, таймфреймов, индикаторов и оптимизацию стратегий.
- PyAlgoTrade <https://github.com/gbeced/pyalgotrade>  
Простая библиотека бэктестинга со встроенной поддержкой технических индикаторов и создания базовой стратегии.  
 Этот репозиторий был заархивирован владельцем 13 ноября 2023 г.

 [zipline https://github.com/quantopian/zipline](https://github.com/quantopian/zipline)  
Разработанная Quantopian (теперь поддерживаемая

сообществом), Zipline — это надежная библиотека бэктестинга, ориентированная на событийно-управляемое бэктестирование, используемая профессионалами.

✗ 4 года не обновлялась.

- QuantConnect/Lean <https://github.com/QuantConnect/Lean>  
Движок с открытым исходным кодом, лежащий в основе QuantConnect; поддерживает бэктестинг и торговлю в реальном времени для нескольких классов активов.
- VectorBT <https://github.com/polakowo/vectorbt>  
Разработан для быстрого векторизованного бэктестинга и анализа стратегий непосредственно на Pandas DataFrames.
- Fastquant <https://github.com/enzoampil/fastquant>  
Удобная библиотека бэктестинга, разработанная для быстрого тестирования с минимальной настройкой, вдохновленная Prophet от Facebook.  
✗ 3 года не обновлялась.
- MibianLib <https://github.com/yassinemaaroufi/MibianLib>  
Фокусируется на ценообразовании и волатильности опционов, а не на полном бэктестинге, но полезен для стратегий, связанных с опционами.  
✗ 11 лет не обновлялась.

Сначала выбрал использовать Backtesting.py, потому что она упоминалась на многих сайтах, но уже на первоначальном этапе использования стали вылазить проблемы. Ошибка возникла из-за несоответствия в том, как новые версии pandas обрабатывают





метод `get_loc()`. Аргумент `method='nearest'` больше не поддерживается в последних версиях `pandas`. Эта проблема связана с тем, как библиотека `Backtesting.py` взаимодействует с новыми версиями `pandas`, в частности, при повторной выборке данных для построения графиков. А новой версии `Backtesting.py`, которая решает эту проблему и поддерживает последние изменения API `pandas` просто нет.

Следующий в списке был `Backtrader` – с ним и продолжил работать.

**Backtrader**

Home Documentation Articles Recipes/Resources

Welcome to backtrader!

**A feature-rich Python framework for backtesting and trading**

backtrader allows you to focus on writing reusable trading strategies, indicators and analyzers instead of having to spend time building infrastructure.

**Open Source - GitHub**

Use, modify, audit and share it. The secret is in the sauce and you are the cook. This is just the tool.

**Docs & Blog**

Check the QuickStart, the extensive documentation, in-depth topics and ideas in the blog.

**Community**

It was being abused. It may come back in the future. In the meanwhile try for example: [stackoverflow "backtrader"](#).

**Hello Algotrading!**

See a quick example of a *Simple Moving Average Crossover* strategy (long-only)

**Features**

See a quick overview of all the goodies that backtrader has to offer.

(C) 2015-2024 Daniel Rodriguez

Backtrader от Дэниел Родригес (Daniel Rodriguez)

# Идея моей торговой стратегии





Хотя считается что торговая стратегия необязательно должна быть "человекочитаемой" – это вполне может быть результат обучения алгоритма, основанного на интеллектуальных технологиях (нейросети, машинное обучение и т.п.), но я решил начать с простого.

Мои условия:

1. Торговать только в лонг (длинная позиция) – покупать акции с целью их последующей продажи по более высокой цене.
2. Торговать только 15 лучших акций по объему на Московской бирже.
3. Использовать два разных таймфрейма для тестов – это временные интервалы на которых отображается движение цен на графике финансового инструмента. Планирую использовать 5 минут и час. Это из-за того что моё АПИ медленное.

Моя торговая стратегия основана на пересечении скользящих средних двух разных таймфреймов со скользящим стоп-лоссом для продажи.

Условие покупки представляет собой комбинацию двух пересечений скользящих средних:

1. Краткосрочное подтверждение: цена закрытия на пятиминутном интервале выше пятиминутной скользящей средней.



## 2. Долгосрочное подтверждение: цена закрытия на часовом интервале выше часовой скользящей средней.

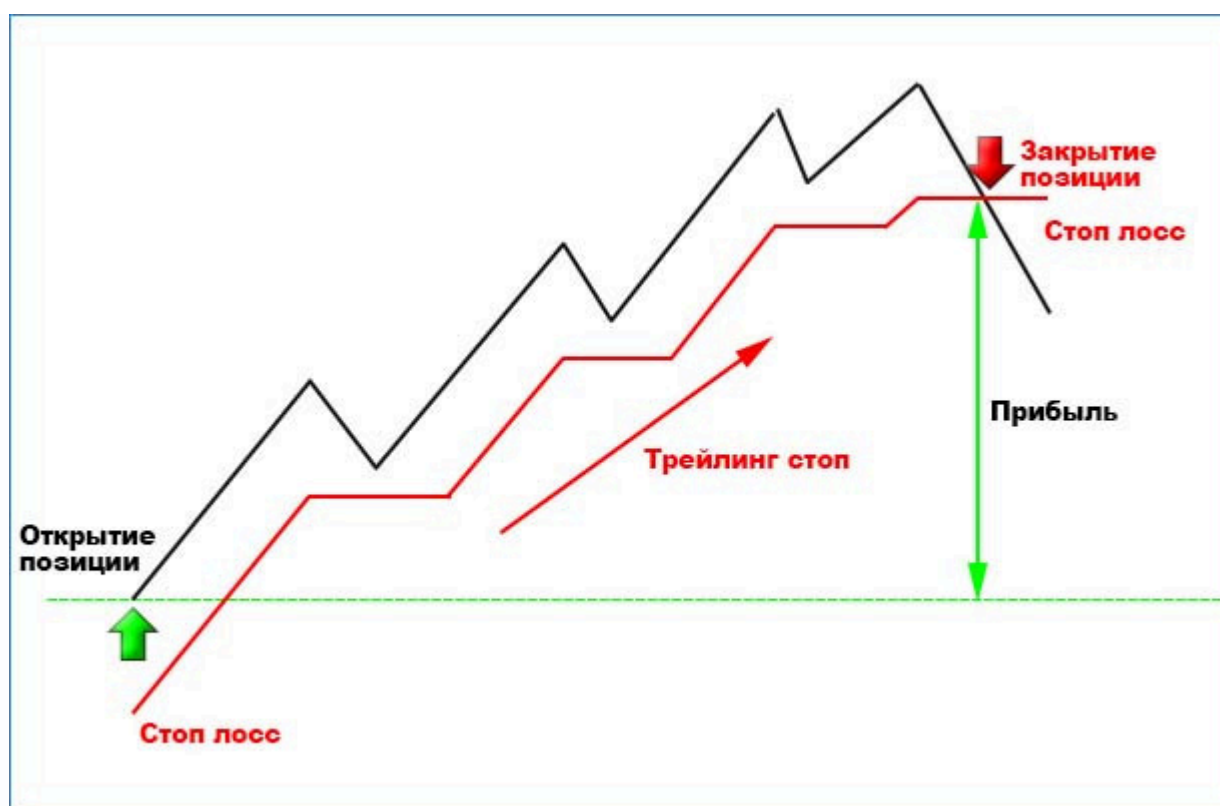


### ПАО "Сбербанк России" (SBER:MOEX): 5 минут и час

Требую выполнения обоих этих условий, гарантирую что акция будет иметь бычий импульс как на коротких, так и на длинных таймфреймах перед входом в позицию. Такое выравнивание двух таймфреймов помогает избегать покупок во время временного шума или незначительных колебаний на более коротком таймфрейме, отфильтровывая менее стабильные движения.

Условие продажи: трейлинг стоп, который предназначен для защиты прибыли и ограничения риска падения. Как работает лучше всего показано на картинке:





## Бэктестинг моей торговой стратегии с помощью библиотеки backtrader на Python

Моя, описанная выше стратегия для двух таймфреймов на нескольких бумагах, выглядит в библиотеке backtrader на Python следующим образом:

strategy0\_ma\_5min\_hourly.py:

```
import sys
sys.stdout.reconfigure(encoding='utf-8')
```

```
import backtrader as bt
```

```
# Стратегия скользящие средние на двух разных временных
интервалах
class MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy(bt.Strategy):
    params = (
        ('ma_period_5min', 30), # Период для скользящей средней на 5-
минутках
        ('ma_period_hourly', 45), # Период для скользящей средней на
часовом интервале
        ('trailing_stop', 0.03) # Процент для трейлинг-стопа
    )

    def __init__(self):
        print(f"\nРасчет для параметров: {self.params.ma_period_5min} /
{self.params.ma_period_hourly} / {self.params.trailing_stop}")

        # Создаем списки для хранения индикаторов по каждому
инструменту
        self.ma_5min = {}
        self.ma_hourly = {}

        # Для каждого инструмента добавляем скользящие средние по
разным интервалам
        for i, data in enumerate(self.datas):
            if i % 2 == 0: # Четные индексы - 5-минутные данные
                ticker = data._name.replace('_5min', '')
                self.ma_5min[ticker] =
bt.indicators.SimpleMovingAverage(data.close,
period=self.params.ma_period_5min)
            else: # Нечетные индексы - часовые данные
```



```
ticker = data._name.replace('_hourly', '')
self.ma_hourly[ticker] =
bt.indicators.SimpleMovingAverage(data.close,
period=self.params.ma_period_hourly)

# Переменные для отслеживания максимальной цены после
покупки по каждому инструменту
self.buy_price = {}
self.max_price = {}
self.order = {} # Словарь для отслеживания ордеров по
каждому инструменту

def next(self):
    # Для каждого инструмента проверяем условия покупки и
    продажи
    for i in range(0, len(self.datas), 2): # Проходим по 5-минутным
        данным
        ticker = self.datas[i]._name.replace('_5min', '')
        data_5min = self.datas[i]
        data_hourly = self.datas[i + 1]

        # Проверяем, есть ли открытый ордер для этого инструмента
        if ticker in self.order and self.order[ticker]:
            continue # Пропускаем, если есть открытый ордер

        # Проверяем условия покупки:
        # цена на 5 мин таймфрейме выше скользящей средней на 5
        мин + часовая цена тоже выше часовой скользящей средней
        if not self.getposition(data_5min): # Открываем сделку только
            # если нет открытой позиции
```

```
if data_5min.close[0] > self.ma_5min[ticker][0] and
data_hourly.close[0] > self.ma_hourly[ticker][0]:
    self.order[ticker] = self.buy(data=data_5min)
    self.buy_price[ticker] = data_5min.close[0]
    self.max_price[ticker] = self.buy_price[ticker]

    # Получаем текущий тикер и дату покупки
    buy_date = data_5min.datetime.date(0)
    buy_time = data_5min.datetime.time(0)
    print(f"{buy_date} в {buy_time}: покупка за
{self.buy_price[ticker]} для {ticker}")

# Если уже есть открытая позиция
elif self.getposition(data_5min):
    current_price = data_5min.close[0]

    # Обновляем максимальную цену, если текущая выше
    if current_price > self.max_price[ticker]:
        self.max_price[ticker] = current_price

    # Рассчитываем уровень стоп-лосса
    stop_loss_level = self.max_price[ticker] * (1 -
self.params.trailing_stop)

    # Проверяем условие для продажи по трейлинг-стопу
    if current_price < stop_loss_level:
        self.order[ticker] = self.sell(data=data_5min)
        sell_date = data_5min.datetime.date(0)
        sell_time = data_5min.datetime.time(0)
        print(f"{sell_date} в {sell_time}: продажа за {current_price}
```



для {ticker}")

# Обрабатываем уведомления по ордерам

def notify\_order(self, order):

    ticker = order.data.\_name.replace('\_5min', '')

    if order.status in [order.Completed, order.Canceled, order.Margin]:

        self.order[ticker] = None # Очищаем ордер после завершения

Сделал переключатель одиночный тест или оптимизация:

singleTest / optimization для основного файла запуска:

SingleTestOrOptimization = "optimization"

Основной файл запуска main.py:

import sys

import time

sys.stdout.reconfigure(encoding='utf-8')

from datetime import datetime

from src.data\_loader import load\_data\_for\_ticker, load\_ticker\_mapping

import pandas as pd

import backtrader as bt

import backtrader.analyzers as btanalyzers

from src.strategy0\_ma\_5min\_hourly import



MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy



```
# отобразить имена всех столбцов в большом фреймворке данных
pandas
pd.set_option('display.max_columns', None)
pd.set_option('display.width', 1000)

# Начало времени
start_time = time.perf_counter()

# Путь к JSON файлу с сопоставлениями
mapping_file = "./data/+mappings.json"

# Загрузка сопоставлений тикеров
ticker_mapping = load_ticker_mapping(mapping_file)

# Промежуточное время выполнения
total_end_time = time.perf_counter()
elapsed_time = total_end_time - start_time
print(f"Промежуточное время выполнения: {elapsed_time:.4f}
секунд.")

current_time = datetime.now().strftime("%Y-%m-%d %H-%M") #
Генерируем текущее время в формате 'уууу-мм-дд HH-мм'

# Следующая часть кода запускается только если это основной
модуль
if __name__ == '__main__': # Исправление для работы с
multiprocessing

# Создаем объект Cerebro
cerebro = bt.Cerebro(optreturn=False)
```

```
# Получаем количество бумаг в ticker_mapping.items()
num_securities = len(ticker_mapping.items())

# Рассчитываем процент капитала на одну бумагу
percent_per_security = 100 / num_securities
print(f"Процент капитала на одну бумагу:
{percent_per_security:.2f}%")

# Условия капитала
cerebro.broker.set_cash(100000) # Устанавливаем стартовый
капитал
cerebro.broker.setcommission(commission=0.005) # Комиссия 0.5%
cerebro.addsizer(bt.sizers.PercentSizer,
percents=percent_per_security) # Настраиваем размер позиций как
процент от капитала

# Для каждого инструмента добавляем оба временных интервала
for uid, ticker in ticker_mapping.items():
    print(f"Загружаем данные для {ticker}")

# Загрузка данных с таймфреймами 5 минут и час
data_5min, data_hourly = load_data_for_ticker(ticker)

# Пропуск, если данные не были загружены
if data_5min is None or data_hourly is None:
    continue

# Добавляем 5-минутные данные в Cerebro
data_5min_bt = bt.feeds.PandasData(dataname=data_5min,
```



```
timeframe=bt.TimeFrame.Minutes, compression=5)
    cerebro.adddata(data_5min_bt, name=f"{ticker}_5min")

    # Добавляем часовые данные в Cerebro
    data_hourly_bt = bt.feeds.PandasData(dataname=data_hourly,
timeframe=bt.TimeFrame.Minutes, compression=60)

    # Совмещаем графики 5 минут и часа на одном виде
    data_hourly_bt.plotinfo.plotmaster = data_5min_bt # Связываем
графики
    data_hourly_bt.plotinfo.sameaxis = True          # Отображаем на
той же оси
    cerebro.adddata(data_hourly_bt, name=f"{ticker}_hourly")

    # Переключатель одиночный тест или оптимизация
    SingleTestOrOptimization = "optimization" # singleTest /
optimization

    if SingleTestOrOptimization == "singleTest":
        print(f"{current_time} Проводим одиночный тест стратегии.")

    # Добавляем стратегию для одичного теста
    MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy

    cerebro.addstrategy(MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrateg
у,
                        ma_period_5min = 30, # Период для скользящей
средней на 5-минутках
                        ma_period_hourly = 45, # Период для скользящей
```

средней на часовом интервале

```
trailing_stop = 0.03) # Процент для трейлинг-стопа
```

# Writer только для одиночного теста для вывода результатов в CSV-файл

```
cerebro.addwriter(bt.WriterFile, csv=True,  
out=f"./results/{current_time}_log.csv")
```

# Добавляем анализаторы

```
cerebro.addanalyzer(btanalyzers.TradeAnalyzer,  
_name='trade_analyzer')  
cerebro.addanalyzer(btanalyzers.DrawDown, _name="drawdown")  
cerebro.addanalyzer(btanalyzers>Returns, _name="returns")  
cerebro.addanalyzer(btanalyzers.SharpeRatio,  
_name='sharpe_ratio', timeframe=bt.TimeFrame.Days, riskfreerate=10)  
cerebro.addanalyzer(btanalyzers.SQN, _name='sqn')  
cerebro.addanalyzer(btanalyzers.PyFolio, _name='PyFolio')
```

# Запуск тестирования

```
results = cerebro.run(maxcpus=1) # Ограничение одним ядром  
для избежания многопроцессорности
```

# Выводим результаты анализа одиночного теста

```
print(f"\nОкончательная стоимость портфеля:  
{cerebro.broker.getvalue()}")  
returnsAnalyzer = results[0].analyzers.returns.get_analysis()  
print(f"Годовая/нормализованная доходность:  
{returnsAnalyzer['rnorm100']}%")  
drawdownAnalyzer = results[0].analyzers.drawdown.get_analysis()  
print(f"Максимальное значение просадки:
```



```

{drawdownAnalyzer['max']['drawdown']}]%)

trade_analyzer = results[0].analyzers.trade_analyzer.get_analysis()
print(f"Всего сделок: {trade_analyzer.total.closed} шт.")
print(f"Выигрышные сделки: {trade_analyzer.won.total} шт.")
print(f"Убыточные сделки: {trade_analyzer.lost.total} шт.")
sharpe_ratio =
results[0].analyzers.sharpe_ratio.get_analysis().get('sharperatio')
print(f"Коэффициент Шарпа: {sharpe_ratio}")
sqnAnalyzer = results[0].analyzers.sqn.get_analysis().get('sqn')
print(f"Мера доходности с поправкой на риск: {sqnAnalyzer}")

# Время выполнения
total_end_time = time.perf_counter()
elapsed_time = (total_end_time - start_time) / 60
print(f"\nВремя выполнения: {elapsed_time:.4f} минут.")

# Построение графика для одиночного теста
cerebro.plot()

else:
    print(f"{current_time} Проводим оптимизацию стратегии.")

    # Оптимизация стратегии start_date = 2024-
10_MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy

cerebro.optstrategy(MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy
,
                    ma_period_5min=range(10, 61, 5), # Диапазон для 5-
нунтой скользящей средней

```



```

        ma_period_hourly=range(15, 61, 2), # Диапазон для
часовой скользящей средней
        trailing_stop=[0.03])           # Разные проценты для
трейлинг-стопа 0.03, 0.05, 0.07

    print(f"\nКоличество варинатов оптимизации: {(((61-10)/10 * (61-
15))/2 )}\n")

    # Добавляем анализаторы
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers.TradeAnalyzer,
_name='trade_analyzer')
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers.DrawDown, _name="drawdown")
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers>Returns, _name="returns")
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers.SharpeRatio,
_name='sharpe_ratio', timeframe=bt.TimeFrame.Days, riskfreerate=10)
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers.SQN, _name='sqn')

    # Запуск тестирования
    results = cerebro.run(maxcpus=1) # Ограничение одним ядром
для избежания многопроцессорности для оптимизации

    # Выводим результаты оптимизации
    par_list = [ [
        # MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy
        x[0].params.ma_period_5min,
        x[0].params.ma_period_hourly,
        x[0].params.trailing_stop,

        x[0].analyzers.trade_analyzer.get_analysis().pnl.net.total,
        x[0].analyzers.returns.get_analysis()['rnorm100'],
        x[0].analyzers.drawdown.get_analysis()['max']['drawdown'],

```



```

        x[0].analyzers.trade_analyzer.get_analysis().total.closed,
        x[0].analyzers.trade_analyzer.get_analysis().won.total,
        x[0].analyzers.trade_analyzer.get_analysis().lost.total,
        x[0].analyzers.sharpe_ratio.get_analysis()['sharperatio'],
        x[0].analyzers.sqn.get_analysis().get('sqn')
    ] for x in results]

```

```

# MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy
par_df = pd.DataFrame(par_list, columns = ['ma_period_5min',
'ma_period_hourly', 'trailing_stop', 'pnl net', 'return', 'drawdown', 'total
closed', 'won total', 'lost total', 'sharpe', 'sqn'])

```

```

# Формируем имя файла с текущей датой и временем
filename = f"./results/{current_time}_optimization.csv"
# Сохраняем DataFrame в CSV файл с динамическим именем
par_df.to_csv(filename, index=False)
print(f"\n\nРезультаты оптимизации:\n{par_df}")

```

```

# Время выполнения
total_end_time = time.perf_counter()
elapsed_time = (total_end_time - start_time) / 60
print(f"\nВремя выполнения: {elapsed_time:.4f} минут.")

```

```

# Общее время выполнения
total_end_time = time.perf_counter()
elapsed_time = (total_end_time - start_time) / 60
print(f"\nОбщее время выполнения: {elapsed_time:.4f} минут.")

```





В данные загрузил котировки за октябрь 2024:

AFLT\_1hour.csv

AFLT\_5min.csv

EUTR\_1hour.csv

EUTR\_5min.csv

GAZP\_1hour.csv

GAZP\_5min.csv

MTLR\_1hour.csv

MTLR\_5min.csv

RNFT\_1hour.csv

RNFT\_5min.csv

ROSN\_1hour.csv

ROSN\_5min.csv

RUAL\_1hour.csv



AL\_5min.csv

SBER\_1hour.csv

SBER\_5min.csv

SGZH\_1hour.csv

SGZH\_5min.csv

SNGSP\_1hour.csv

SNGSP\_5min.csv

UWGN\_1hour.csv

UWGN\_5min.csv

VKCO\_1hour.csv

VKCO\_5min.csv

VTBR\_1hour.csv

VTBR\_5min.csv

Время выполнения оптимизации для таких параметров  
составило 74 минуты:



```
# Оптимизация стратегии start_date = 2024-
10_MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy
cerebro.optstrategy(MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy
,
    ma_period_5min=range(10, 61, 5), # Диапазон для 5-
минутной скользящей средней
    ma_period_hourly=range(15, 61, 2), # Диапазон для часовой
скользящей средней
    trailing_stop=[0.03]) # Разные проценты для
трейлинг-стопа 0.03, 0.05, 0.07
```

```
File Edit Selection View Go Run Terminal Help
Silverfir-TradingBot.backtesting.github

EXPLORER
SILVERFIR-TRADINGBOT.BAC...
  data
  results
  src
  _pycache_
  3dchart.py
  data_loader.py
  strategy0_ma_5min_ho...
  main.py

main.py
124
125
126
127
128
129
130
131
132
133
134
135
136
137
138
139
140
141
142
143
144
145
146
147
148
149
150
151
152
153
154
155
156
157
158
159
160
161
162
163
164
165
166
167
168
169
170
171
172
173
174
175
176
177
178
179
180
181
182
183
184
185
186
187
188
189
190
191
192
193
194
195
196
197
198
199
200
201
202
203
204
205
206
207
208
209
210
211
212
213
214
215
216
217
218
219
220
221
222
223
224
225
226
227
228
229
230
231
232
233
234
235
236
237
238
239
240
241
242
243
244
245
246
247
248
249
250
251
252
253
254
255
256
257
258
259
260
261
262
263
264
265
266
267
268
269
270
271
272
273
274
275
276
277
278
279
280
281
282
283
284
285
286
287
288
289
290
291
292
293
294
295
296
297
298
299
300
301
302
303
304
305
306
307
308
309
310
311
312
313
314
315
316
317
318
319
320
321
322
323
324
325
326
327
328
329
330
331
332
333
334
335
336
337
338
339
340
341
342
343
344
345
346
347
348
349
350
351
352
353
354
355
356
357
358
359
360
361
362
363
364
365
366
367
368
369
370
371
372
373
374
375
376
377
378
379
380
381
382
383
384
385
386
387
388
389
390
391
392
393
394
395
396
397
398
399
400
401
402
403
404
405
406
407
408
409
410
411
412
413
414
415
416
417
418
419
420
421
422
423
424
425
426
427
428
429
430
431
432
433
434
435
436
437
438
439
440
441
442
443
444
445
446
447
448
449
450
451
452
453
454
455
456
457
458
459
460
461
462
463
464
465
466
467
468
469
470
471
472
473
474
475
476
477
478
479
480
481
482
483
484
485
486
487
488
489
490
491
492
493
494
495
496
497
498
499
500
501
502
503
504
505
506
507
508
509
510
511
512
513
514
515
516
517
518
519
520
521
522
523
524
525
526
527
528
529
530
531
532
533
534
535
536
537
538
539
540
541
542
543
544
545
546
547
548
549
550
551
552
553
554
555
556
557
558
559
560
561
562
563
564
565
566
567
568
569
570
571
572
573
574
575
576
577
578
579
580
581
582
583
584
585
586
587
588
589
590
591
592
593
594
595
596
597
598
599
600
601
602
603
604
605
606
607
608
609
610
611
612
613
614
615
616
617
618
619
620
621
622
623
624
625
626
627
628
629
630
631
632
633
634
635
636
637
638
639
640
641
642
643
644
645
646
647
648
649
650
651
652
653
654
655
656
657
658
659
660
661
662
663
664
665
666
667
668
669
670
671
672
673
674
675
676
677
678
679
680
681
682
683
684
685
686
687
688
689
690
691
692
693
694
695
696
697
698
699
700
701
702
703
704
705
706
707
708
709
710
711
712
713
714
715
716
717
718
719
720
721
722
723
724
725
726
727
728
729
730
731
732
733
734
735
736
737
738
739
740
741
742
743
744
745
746
747
748
749
750
751
752
753
754
755
756
757
758
759
760
761
762
763
764
765
766
767
768
769
770
771
772
773
774
775
776
777
778
779
780
781
782
783
784
785
786
787
788
789
790
791
792
793
794
795
796
797
798
799
800
801
802
803
804
805
806
807
808
809
810
811
812
813
814
815
816
817
818
819
820
821
822
823
824
825
826
827
828
829
830
831
832
833
834
835
836
837
838
839
840
841
842
843
844
845
846
847
848
849
850
851
852
853
854
855
856
857
858
859
860
861
862
863
864
865
866
867
868
869
870
871
872
873
874
875
876
877
878
879
880
881
882
883
884
885
886
887
888
889
890
891
892
893
894
895
896
897
898
899
900
901
902
903
904
905
906
907
908
909
910
911
912
913
914
915
916
917
918
919
920
921
922
923
924
925
926
927
928
929
930
931
932
933
934
935
936
937
938
939
940
941
942
943
944
945
946
947
948
949
950
951
952
953
954
955
956
957
958
959
960
961
962
963
964
965
966
967
968
969
970
971
972
973
974
975
976
977
978
979
980
981
982
983
984
985
986
987
988
989
990
991
992
993
994
995
996
997
998
999
1000

else:
    print(f"(current_time) Проводим оптимизацию стратегии.")

    # Оптимизация стратегии start_date = 2024-10_MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy
    cerebro.optstrategy(MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy,
        ma_period_5min=range(10, 61, 5), # Диапазон для 5-минутной скользящей средней
        ma_period_hourly=range(15, 61, 2), # Диапазон для часовой скользящей средней
        trailing_stop=[0.03]) # Разные проценты для трейлинг-стопа 0.03, 0.05, 0.07
    print(f"\nКонец оптимизации: ((( (61-10)/10 * (61-15))/2 ))\n")

    # Добавляем анализаторы
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers.TradeAnalyzer, _name='trade_analyzer')
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers.DrawDown, _name='drawdown')
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers>Returns, _name='returns')
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers.SharpeRatio, _name='sharpe_ratio', timeframe=bt.Timeframe.Days, riskfreerate=10)
    cerebro.addanalyzer(btanalyzers.SQN, _name='sqn')

    # Запуск тестирования
    results = cerebro.run(maxcpus=1) # Ограничение одним ядром для избегания многопроцессорности для оптимизации

    # Выводим результаты оптимизации
    par_list = [
        # MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy
        x[0].params.ma_period_5min,
        x[0].params.ma_period_hourly,
        ...
    ]

PROBLEMS OUTPUT DEBUG CONSOLE TERMINAL PORTS
4 10 23 0.03 -5826.012998 -0.000984 6.253991 108 24 84 -2.380006 -4.162218
... ..
248 60 51 0.03 -4795.729618 -0.000818 5.717055 86 21 65 -2.616582 -3.731260
249 60 53 0.03 -4430.731804 -0.000758 5.581071 84 21 63 -2.455662 -3.255305
250 60 55 0.03 -4374.374785 -0.000748 5.512912 83 21 62 -2.582423 -3.194545
251 60 57 0.03 -4337.500821 -0.000741 5.471727 80 20 60 -2.586523 -3.250970
252 60 59 0.03 -4046.760371 -0.000692 5.346015 79 20 59 -2.580299 -3.029657

[253 rows x 11 columns]

Время выполнения: 74.5854 минут.
Общее время выполнения: 74.5854 минут.
```

Модуль 3dchart.py:

```
import pandas as pd
import matplotlib.pyplot as plt
```

```
from mpl_toolkits.mplot3d import Axes3D
import numpy as np
from matplotlib.widgets import Slider
from datetime import datetime

# https://habr.com/ru/articles/857402/

# Чтение данных из CSV файла
data = pd.read_csv('./results/2024-11-12 16-12_optimization_2024-10_MovingAveragesOnDifferentTimeIntervalsStrategy.csv')

parameter1 = 'ma_period_5min'
parameter2 = 'ma_period_hourly'

# Извлечение необходимых колонок для построения графика
x = data[parameter1] # по оси X
y = data[parameter2] # по оси Y
z = data['pnl net'] # по оси Z (PNL net)

# Создание 3D-графика
fig = plt.figure()
ax = fig.add_subplot(111, projection='3d')

# Построение поверхности с использованием триангуляции
surf = ax.plot_trisurf(x, y, z, cmap='viridis', edgecolor='none')

# Подписи к осям
ax.set_xlabel(parameter1)
ax.set_ylabel(parameter2)
ax.set_zlabel('PNL Net')
```

```

# Заголовок графика
current_time = datetime.now().strftime("%Y-%m-%d %H:%M") #
Генерируем текущее время в формате 'yyyy-mm-dd HH:mm'
ax.set_title(f"3D Optimization Chart, {current_time}")

# Добавление плоскости, которая будет двигаться вдоль оси Z
# Начальное значение плоскости по оси Z
z_plane = np.mean(z)

# Плоскость - запоминаем ее как отдельный объект
x_plane = np.array([[min(x), max(x)], [min(x), max(x)]])
y_plane = np.array([[min(y), min(y)], [max(y), max(y)]])
z_plane_values = np.array([[z_plane, z_plane], [z_plane, z_plane]])

# Отображение плоскости
plane = ax.plot_surface(x_plane, y_plane, z_plane_values, color='red',
alpha=0.5)

# Создание слайдера для управления позицией плоскости по оси Z
ax_slider = plt.axes([0.25, 0.02, 0.50, 0.03],
facecolor='lightgoldenrodyellow')
z_slider = Slider(ax_slider, 'Z Plane', min(z), max(z), valinit=z_plane)

# Функция обновления положения плоскости при перемещении
слайдера
def update(val):
    new_z_plane = z_slider.val
    z_plane_values[:] = new_z_plane # Обновляем значения Z для
    плоскости

```



```

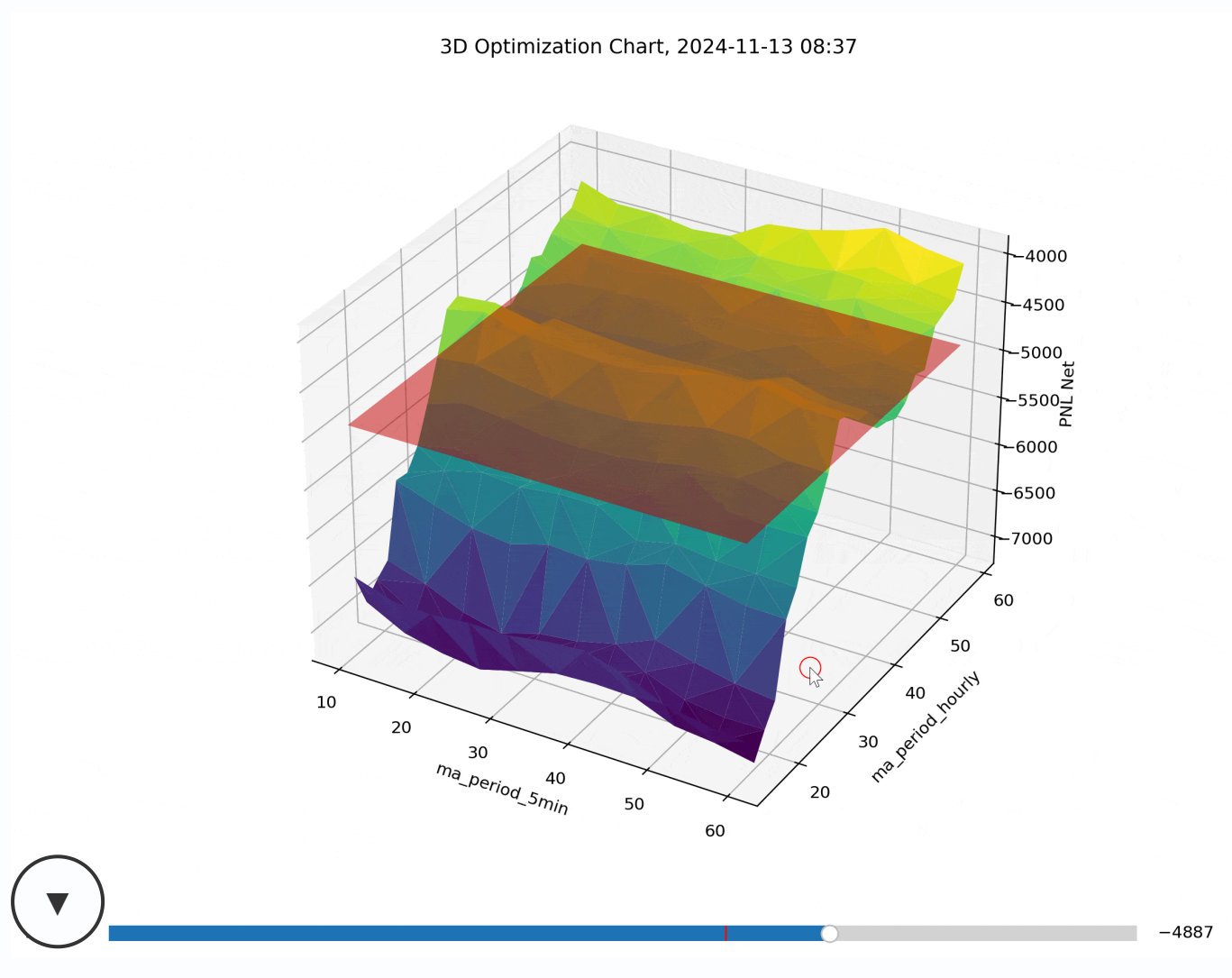
ax.collections[-1].remove() # Удаляем старую плоскость
ax.plot_surface(x_plane, y_plane, z_plane_values, color='red',
alpha=0.5) # Рисуем новую плоскость
fig.canvas.draw_idle() # Обновляем график

# Привязка слайдера к функции обновления
z_slider.on_changed(update)

# Отображение графика
plt.show()

```

Результат оптимизации в виде графика:



## Выводы из этой оптимизации

Цифры по шкале Z показывают лишь степень убытков в рублях. Они со знаком минус.

Вы можете сами полностью повторить мой опыт потому что код загружен на GitHub:

[https://github.com/empenoso/SilverFir-TradingBot\\_backtesting](https://github.com/empenoso/SilverFir-TradingBot_backtesting)

Тем не менее:

- Некоторые стратегии эффективны только в определенных рыночных условиях. Например, стратегии следования за трендом, как правило, хорошо работают на трендовых рынках, но не работают на боковых рынках.
- Курвефитинг, подгонка под историю. Не хочу вводить много параметров, чтобы этого избежать. Переобучение прошлыми данными: если стратегия хорошо работает на исторических данных, но плохо на будущих данных в режиме скользящего окна, она может быть слишком адаптирована к историческим моделям, которые не будут повторяться.
- Транзакционные затраты: хорошо, если тестирование учитывает реалистичное проскальзывание, комиссии и спреды.





# Будущие шаги - где искать прибыльные торговые стратегии

Я хочу использовать подход скользящего окна – когда данные разбиваются на более мелкие последовательные периоды например по месяцам, за которым следует период тестирования вне этой выборки. Например, оптимизация идёт на месячных данных, а тестировать уже на следующем месяце. То есть происходит сдвиг вперед: после каждого периода тестирования окно «скользит» вперед на указанный интервал, и процесс повторяется. Таким образом, каждый сегмент данных используется как для обучения, так и для тестирования с течением времени, но никогда одновременно. Это помогает проверить, что стратегия работает стабильно в меняющихся рыночных условиях.

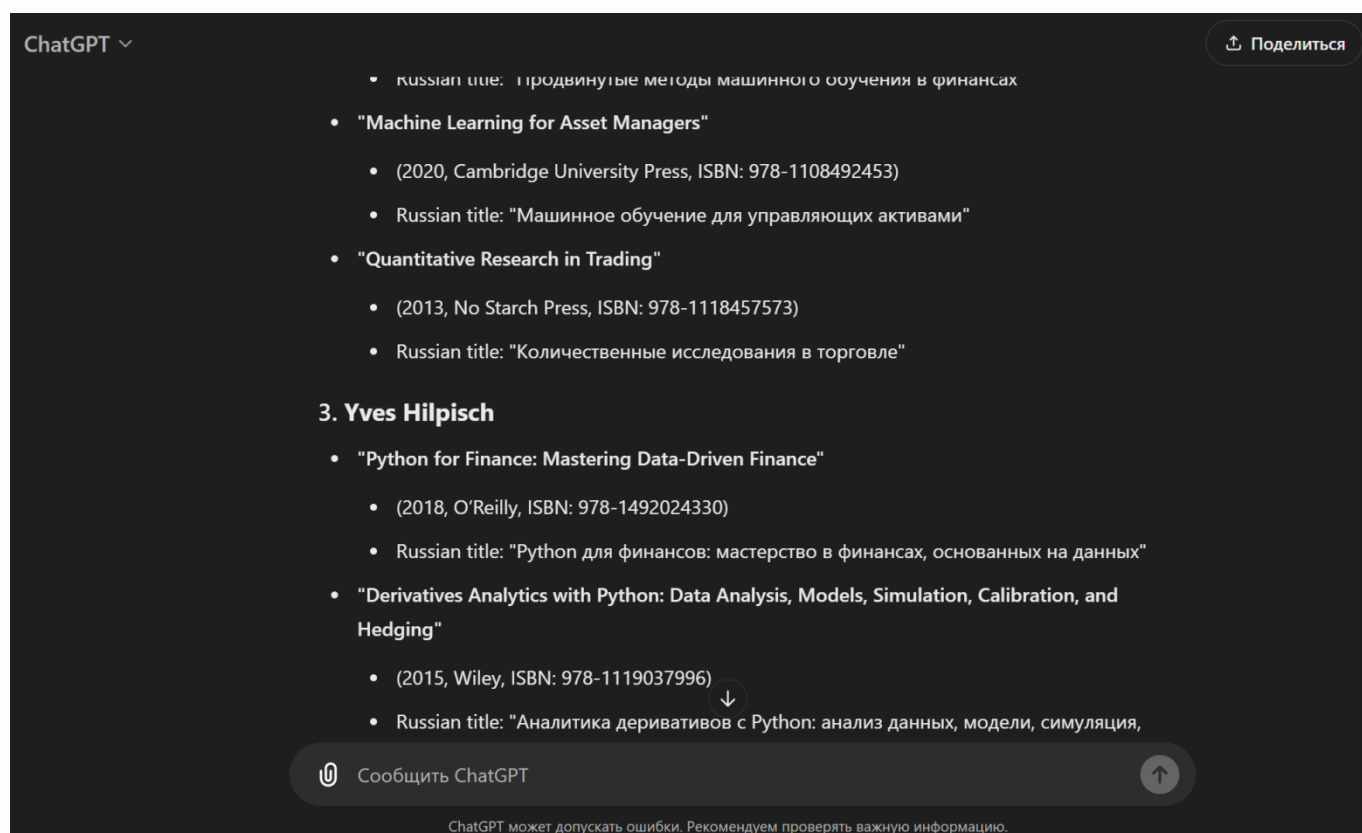
Также планирую использовать Technical Analysis of STOCKS & COMMODITIES для поиска новых идей. Их советы трейдерам доступны в открытом доступе.

А ещё планирую использовать ChatGPT, отправляя запросы вроде:

Действуй как опытный издатель. Отобрази 10 ведущих авторов в области алгоритмической торговли на рынке Америки. Для каждого автора перечисли три самые популярные книги, включая сведения о книге (дату



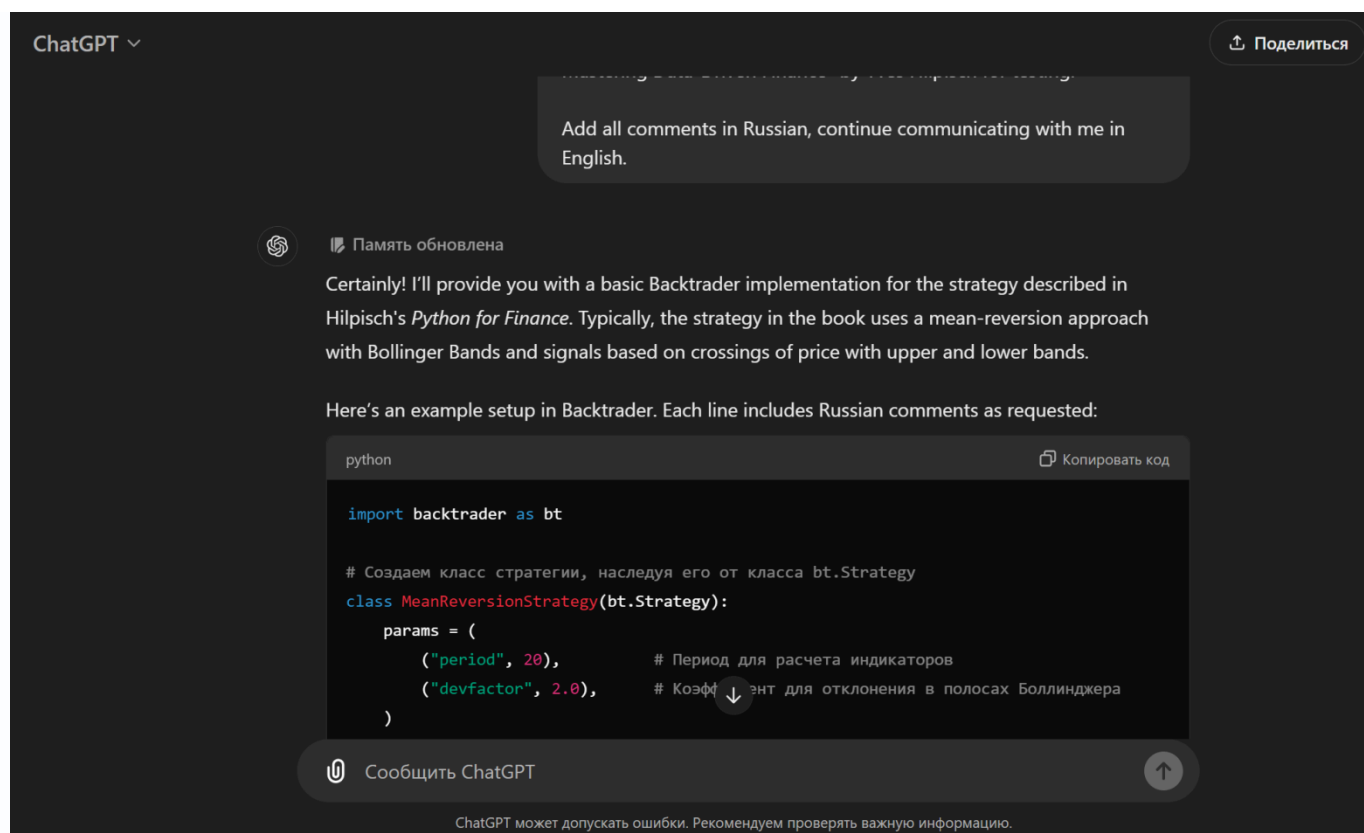
публикации, издателя и ISBN), и предоставь русские переводы для каждого названия книги.



и дальше после ответа:

Действуй как опытный пользователь библиотеки backtrader на Python. Хочу использовать торговую стратегию из книги Yves Hilpisch "Python for Finance: Mastering Data-Driven Finance" для тестов. Добавляй все комментарии на русском языке, продолжай со мной общение на английском.



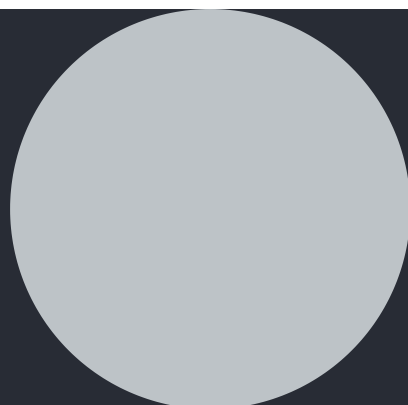


## Итоги

Несмотря на то, что первоначальный выбор стратегии на двух разных таймфреймах и сразу для 15 активов был не самый удачный – впереди ещё очень большое поле исследований и тестов.

Автор: Михаил Шардин

18 ноября 2024 г.



**Михаил Шардин** @empenoso

Частный инвестор и IT разработчик, канд. техн. наук

📍 Пермь, Россия

<https://shardin.name/>

Комментариев пока нет



Читать можно всем, но комментирование доступно только участникам Клуба.

[Что вообще здесь происходит?](#)

Войти



 · [О Клубе](#) · [Написать нам](#) · [Политика приватности](#)

CC BY-SA



[Войти](#) 

