

Финансовая грамотность начинается с того, чтобы просто знать то, что происходит.
Это самое простое.

Подробнее



Горячее

Лучшее

Свежее

...



empenoso 6 месяцев назад



Программирование на python

Тестируем торговую стратегию с крутым индикатором Джона Ф. Элерса на Python

🔥 Введение

Знаете, что бесит в торговле? Запаздывающие индикаторы! Пока он показал сигнал — рынок уже улетел 🚀. Поэтому я решил протестировать индикатор Джона Элерса, который обещает предсказывать движение цены без лагов. Ну, почти. 🤔



SBER

Почему именно Python? Потому что:

- Он бесплатный (в отличие от каких-нибудь TSLab или MetaTrader, где без лицензии как без рук).
- [backtesting.py](#) — мощный инструмент, который позволяет не только тестировать стратегии, но и визуализировать результаты.
- [aiomex](#) — загружаем котировки с Мосбиржи без плясок с бубном вокруг брокеров.

📌 Кстати, [backtesting.py](#) вдруг ожил после 4 лет без обновлений! Видимо, автор решил, что мир не готов терять такую штуку. 😊



Используйте аккаунт Яндекса для входа на сервис

Безопасный вход без дополнительной регистрации на сайте

Войти с Яндекс ID

Войти

Логин

Пароль

Войти

Создать аккаунт

[Забыли пароль?](#)

или продолжите с



Войти с Яндекс ID



Войти через VK ID



Промокоды



Работа



Курсы



Реклама



Игры



Пополнение Steam



S&P 500 E-Mini Futures

💡 В чем фишка индикатора Элерса?

Классическая скользящая средняя (SMA) — это как запоздалый друг, который вечно приходит на вечеринку, когда все уже уходят. Элерс придумал **Projected Moving Average (PMA)**, которая использует регрессию для предсказания движения цены.

Формула простая: $PMA = SMA + Slope * Length / 2$

Где Slope — наклон линии тренда. Но это еще не все! Мы прогнозируем сам PMA:

$PredictPMA = PMA + 0.5 * (Slope - Slope[2]) * Length$

📊 Когда PredictPMA пересекает PMA, это сигнал на вход или выход!

🎯 Как работает стратегия?

Вход в длинную позицию (покупка):

- ✅ Цена на **недельном** графике выше **50-недельной** PMA.
- ✅ Цена на **дневном** графике выше **50-дневной** PMA.
- ✅ **10-дневная** PMA выше **50-дневной**.

Выход из позиции:

- ♦ **Стоп-лосс** — фиксированный 10% вниз от входа.
- ♦ **Трейлинг-стоп** на основе ATR (чтобы фиксировать прибыль и не вылетать раньше времени).

🤖 Автоматизация тестов

🔧 Код выложен на **GitHub**, можете глянуть.

Файлы:

- [data_loader.py](#) — качаем котировки с Мосбиржи.

Реклама

Контур

Экипировка для вашего бизнеса

Экстерн — для зада бухгалтерии, а для об документами онлайн

Диадок

Пикабу Игры
+1000 бесплатных
онлайн игр



Симулятор войны: 1985
Мидкорные, Стратегии,
Симуляторы

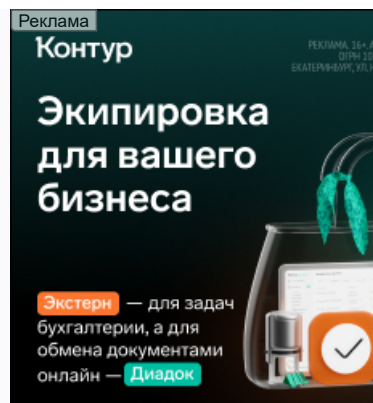
Играть

- [scanner.py](#) — фильтруем ликвидные бумаги.
- [strategy.py](#) — сама стратегия.
- [backtester.py](#) — прогоняем бэктест.
- [main.py](#) — связываем всё вместе.

💡 Такой подход делает код удобным и масштабируемым!

📊 Бэктестим стратегию

Пример кода на [backtesting.py](#):



Топ прошлой недели

- SpongeGod
1 пост
- Uncleyogurt007
9 постов
- ZaTaS
3 поста

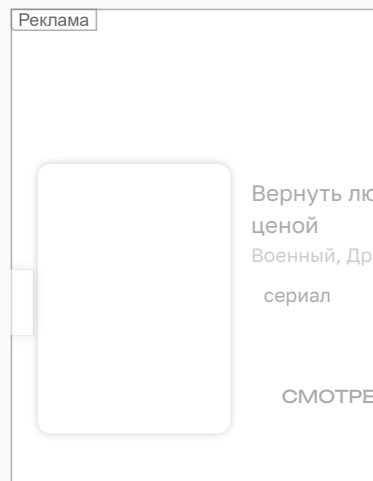
[Посмотреть весь топ](#)

📧 Лучшие посты недели

Рассылка Пикабу:
отправляем самые
рейтинговые материалы за 7
дней 🔥

Укажите [Подписаться](#)

Нажимая кнопку
«Подписаться на рассылку»,
я соглашаюсь с [Правилами](#)
[Пикабу](#) и даю согласие на
[обработку персональных](#)
[данных](#).



🤖 Что нам скажет статистика?

- 📈 **Общая доходность (%)** — заработала стратегия или слила депозит?
- 📉 **Максимальная просадка (%)** — насколько больно было держать сделку.
- 📊 **Коэффициент Шарпа** — насколько стратегия адекватна.
- ✅ **Процент прибыльных сделок** — хотя бы 50%?
- ⌚ **Средняя продолжительность сделки** — сколько держим позицию.

СПБ Биржа (тикер SPBE)

🚀 Итоги тестирования

Результаты загружены на GitHub в виде HTML-отчетов. Спойлер: некоторые акции показали отличные результаты, другие... ну, скажем так, стратегия требует доработки. 😊

🔥 Если хотите видеть больше подобных экспериментов — жмите подписаться!

Автор: Михаил Шардин

🔗 [Моя онлайн-визитка](#)

📱 [Telegram «Умный Дом Инвестора»](#)



💬 0 👁 6.4K 📄 🔄 💰

РЕКЛАМА

Ароматизация дома и квартиры при помощи аромашин

[aroma-profi.com](#)

Подберём ароматы и аромашину для Вашего дома и квартиры.

[Узнать больше](#)



Программирование на python
885 постов • 11.9K подписчиков

[Добавить пост](#)

[Подписаться](#)



Помощь
Кодекс Пикабу
Команда Пикабу
Моб. приложение

Правила соцсети
О рекомендациях
О компании

Промокоды Биг Гик
Промокоды Lamoda
Промокоды МВидео
Промокоды Яндекс Директ
Промокоды Отелло
Промокоды Aroma Butik
Промокоды Яндекс Путешествия
Постила
Футбол сегодня



Правила сообщества

Публиковать могут пользователи с любым рейтингом. Однако!

Приветствуется:...

[Подробнее](#) ✓

Чтобы оставить комментарий, необходимо [зарегистрироваться](#) или [войти](#)

● ————— ■ —————

—————

—————

—————

—————

—————

—————

● ————— ■ —————

—————

—————

—————

—————

—————

—————

● ————— ■ —————

—————

—————

—————

—————

—————

—————

