

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

Подробнее

pikabu

Горячее

Лучшее

Свежее

...



Используйте аккаунт Яндекса для входа на сервис

Безопасный вход без дополнительной регистрации на сайте

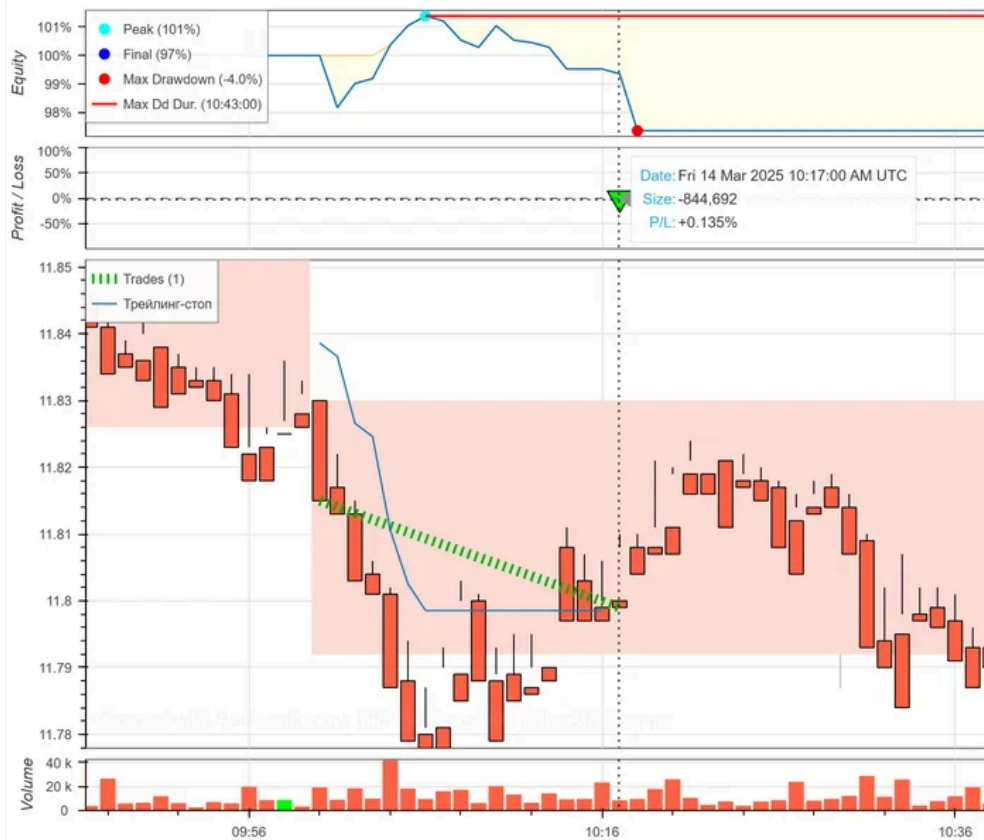
Войти с Яндекс ID

empenoso 5 месяцев назад

Алготрейдинг для начинающих: проверяю на Python работает ли система случайных входов для фьючерсов

💡 Для ЛЛ:

Я протестировал торговую систему для фьючерсов Московской биржи, основанную на идеях Александра Резвякова. Основная суть: сделки открываются в 10:00, используются дневные бары, выход - по времени (20:40) или по трейлинг-стопу. Я реализовал это в Python с библиотекой [backtesting.py](#), код доступен на GitHub. Теперь подробнее для тех, кто хочет разобраться.



Воспроизведение и тестирование стратегии Александра Резвякова на фьючерсах

Войти

Логин

Пароль

Войти

Создать аккаунт

Забыли пароль?

или продолжите с

Войти с Яндекс ID

Войти через VK ID

Промокоды

Работа

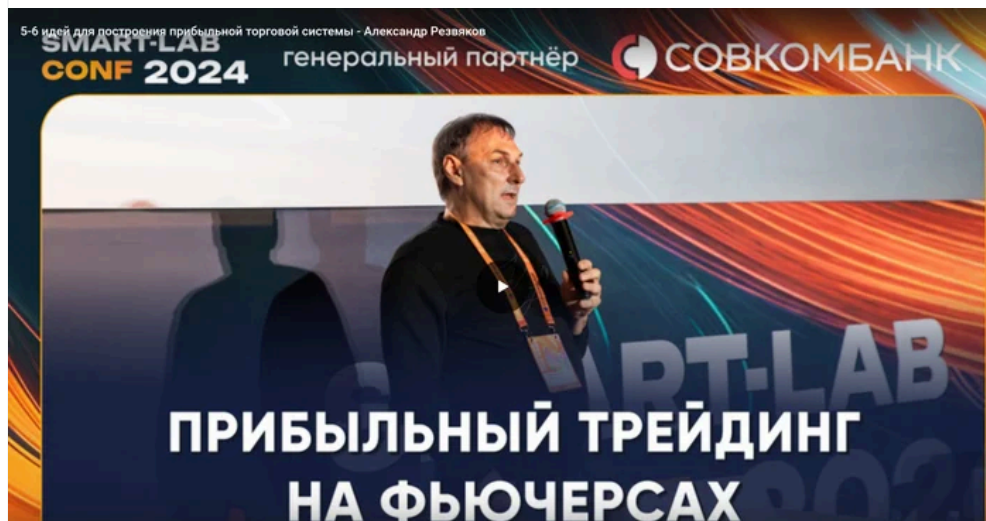
Курсы

Реклама

Игры

Пополнение Steam

Недавно я наткнулся на выступление Александра Резвякова на конференции 2024 года "5-6 идей для построения прибыльной торговой системы на фьючерсах". Его система меня зацепила своей простотой и логичностью. Я решил воссоздать её, протестировать и проверить, насколько она эффективна.



✓ Основная идея стратегии

1. **Вход** в сделку строго в 10:00.
2. **Лонг**, если за последние два дня минимумы и максимумы росли.
3. **Шорт**, если последние два дня минимумы и максимумы снижались.
4. **Выход** из позиции либо:
 - По времени (20:40);
 - По трейлинг-стопу (движение цены на 2% от максимума для лонга, от минимума для шорта).
5. Дополнительно можно увеличивать объем позиции при успешных сделках.

🌐 Подготовка среды

Для тестирования я использовал **Python** и библиотеку **backtesting.py**. Разбил проект на модули:

- **main.py** – запускает процесс тестирования;
- **resample_data_1min.py** – фильтрует минутные данные из API брокера;
- **data_loader.py** – загружает данные из CSV в нужном формате;
- **backtester.py** – логика бэктеста;
- **strategy_Random_1min.py** – реализация стратегии.

Реклама

Жизнь по вызову

Эротическая драма, Крим
сериал

СМОТРЕТЬ



Пикабу Игры

+1000 бесплатных
онлайн игр

Магический мир

Мидкорные, Ролевые, Три в
ряд

Играть

Хотя в видео рекомендовали 5-минутные свечи, я взял **1-минутные** – так проще отследить срабатывание трейлинг-стопов.

Реализация стратегии в Python

1. Загрузка данных

Минутные котировки обрабатываются и фильтруются по нужному диапазону.

2. Преобразование данных

CSV-файлы конвертируются в формат, понятный [backtesting.py](#).

3. Логика входа/выхода

В 10:00 проверяются два последних дневных бара. Если условия выполняются – вход в лонг/шорт с вероятностью 50%. Выход в 20:40 или по трейлинг-стопу.

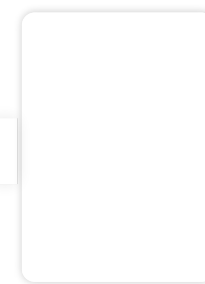
➔ Тестирование и результаты

Запуск бэктеста с параметрами:

```
bt = Backtest( df, DynamicStrategyClass, cash=1_000_000, commission=0.002, margin=0.1,  
# Маржа 10% trade_on_close=True, hedging=False, )
```

Так как вход случайный (50%), результаты тоже рандомные. Но уже на первых тестах видно, что стратегия даёт интересные закономерности.

Реклама



Клиника сч

Драма, Мелод

..
сериал

СМОТРЕ

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.

Пример сделки на фьючерсе NGH5:

🚀 Запуск бэктеста для NGH5 ⏳ ПРОДАЖА на 2025-03-12: Цена: 4.33, Стоп: 4.33 ✅
ВЫКУП (трейлинг-стоп) на 2025-03-12: Цена: 4.31

🔧 Код в открытом доступе

Если хотите воспроизвести или улучшить стратегию – код на [GitHub](#). Готов обсудить идеи и улучшения!

Автор: Михаил Шардин

🔗 [Моя онлайн-визитка](#)

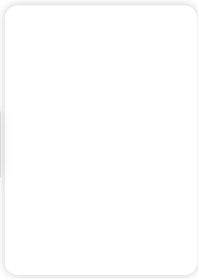
📱 [Telegram «Умный Дом Инвестора»](#)

19 марта 2025 г.



💬 6 👁 3.2K 💾 🔄 💰

Реклама



Одна жизнь
Триллер, Мис
фильм
СМОТРЕ

Помощь
Кодекс Пикабу
Команда
Пикабу
Моб.
приложение

Правила
соцсети
О
рекомендация
х
О компании

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



РЕКЛАМА

domclick.ru



999 000 ₽
Уютная квартира в Перми, 10.7 кв. м.
на Закамской, 42



2 900 000 ₽
Уютная квартира в Перми, улица
Борчанинова, 1

[Все комментарии](#) [Автора](#)

Раскрыть 6 комментариев

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

● — ■ —
—
—
—
—
—
—

● — ■ —
—
—
—
—
—
—

● — ■ —
—
—
—
—
—
—

