

шествование в расслабленную атмосферу  
и для всех, кто не в отпуске!

Играть



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 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. 😊

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&amp;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

Лето - это деревня

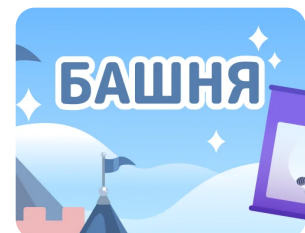
Реалити  
сериал

СМОТРЕТЬ



**Пикабу Игры**

+1000 бесплатных  
онлайн игр



**Башня**

Аркады, Строительство, На ловкость

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!

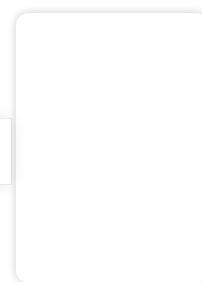
## 📊 Бэктестим стратегию

Пример кода на [backtesting.py](#):

## 🤖 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.

Реклама



Аты-баты, ш  
солдаты...  
Драма, Военн  
фильм

СМОТРЕТЬ

### Топ прошлой недели

- AlexKud  
45 постов
- Wiredoctor  
2 поста
- user11065836  
8 постов

[Посмотреть весь топ](#)



### Лучшие посты недели



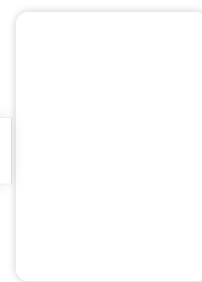
Рассылка Пикабу:  
отправляем самые  
рейтинговые материалы за 7  
дней 🔥

Укажите

[Подписаться](#)

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

Реклама



Меморист  
Фэнтези, Три  
сериял

СМОТРЕТЬ

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

👁 5.4K



РЕКЛАМА

domclick.ru

**1 300 000 ₽**

Купить комнату 83 м², Пермь, ул.  
Монастырская

**10 990 000 ₽**

Квартира 107 кв. м, Пермь, Пушкинская  
улица, 142

**Программирование на python**

873 поста • 11.9K подписчиков

[Добавить пост](#)[Подписаться](#)[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](#)

### Правила сообщества

Публиковать могут пользователи с любым рейтингом. Однако!

Приветствуется:...

[Подробнее](#) ✓

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

● ————— ■ —————

—————

—————

—————

—————

—————

—————

● ————— ■ —————

—————

—————

—————

—————

—————

—————

● ————— ■ —————

—————

—————

—————

—————

—————

—————

