

ВЫБИРАЙ

УЗНАТЬ БОЛЬШЕ

Рекламодатель - АНО "Центр мониторинга и за...

[Горячее](#) [Лучшее](#) [Свежее](#) [Подписки](#)

empenoso 2 месяца 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

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:

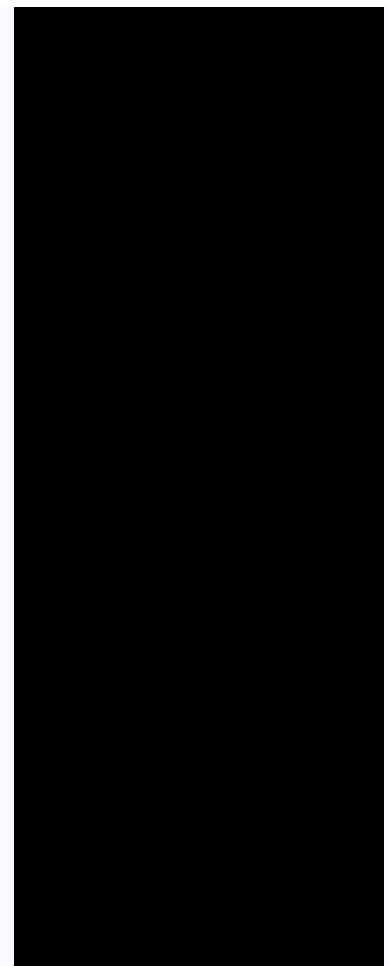
- 💎 **Стоп-лосс** — фиксированный 10% вниз от входа.
- 💎 **Трейлинг-стоп** на основе ATR (чтобы фиксировать прибыль и не вылетать раньше времени).

🤖 Автоматизация тестов




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

Файлы:

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



Топ прошлой недели

-  Oskanov
10 постов
-  AlexKud
40 постов
-  MeniazovutMariia
14 постов

[Посмотреть весь топ](#)



РЕКЛАМА • 16+ sde.perm.ru

Высшее образование без отрыва от работы? Да! Идёт набор от 24 000 Р

[Узнать больше](#)

- [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.

✉️ Лучшие посты недели

Рассылка Пикабу:
отправляем самые
рейтинговые материалы за 7
дней 🔥

Укажи

Подписаться

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

ФИН
УСЛУГИ

Реклама. Рекламодатель:
ПАО Московская Биржа ИНН 7702077840
ООО «МБ Маркетплейс» (ИНН 7727618949)

promo.finuslugi.ru

РЕКЛАМА

Вклад под 30%

Перейти на сайт

Новости Пикабу
Помощь Награды
Кодекс Пикабу
Реклама О проекте
О компании Зал славы

Промокоды	Купоны Мегамаркет
Скидки	Купоны AliExpress
Работа	Купоны М.Видео
Курсы	Купоны YandexTravel
Блоги	Купоны Lamoda

Мобильное приложение



РЕКЛАМА



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 👁 4K 📄 ➦

₽ Поддержать

Эмоции



🔗 септик-пермь.рф

Простейшая канализация на даче!

Септики от 32400 руб! Срок службы 50 лет! Официально! Акция!

Узнать больше



🏠 [aira.ru](#)

Модульный дом AIRA MODUL Премиум 39 м²

Узнать больше



Программирование на python

847 постов • 11.9K подписчика

Добавить пост

Подписаться



Правила сообщества

K2 CLOUD

0+

Бесплатный перенос 1С в K2 Cloud

Готовое облако для размещения систем 1С от 50+ пользователей



Публиковать могут пользователи с любым рейтингом. Однако!

Приветствуется:...

[Подробнее](#) 

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







