

Горячее

Лучшее

Свежее

Подписки



Войти

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. 🤖



### Войти

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:

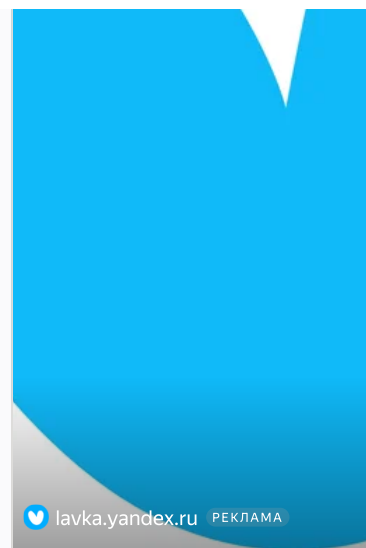
- ♦ **Стоп-лосс** — фиксированный 10% вниз от входа.
- ♦ **Трейлинг-стоп** на основе ATR (чтобы фиксировать прибыль и не вылетать раньше времени).

### 🤖 Автоматизация тестов

🔧 Код выложен на [GitHub](#), можете глянуть.

Файлы:

- [data\\_loader.py](#) — качаем котировки с Мосбиржи.



lavka.yandex.ru РЕКЛАМА

[Подробнее](#)

### Топ прошлой недели

- ZaTaS**  
4 поста
- SergVaders1999**  
5 постов
- prapor35**  
2 поста

[Посмотреть весь топ](#)



arbadstroy.ru

**Строительство домов в КП «Мельница»**

**от 5 500 000 ₽**

✦ Проект бесплатно!

Дома «под ключ»

[Узнать больше](#)

### 📧 Лучшие посты недели

Рассылка Пикабу:  
отправляем самые  
рейтинговые материалы за 7  
дней 🔥

Укажите

[Подписаться](#)

- `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!

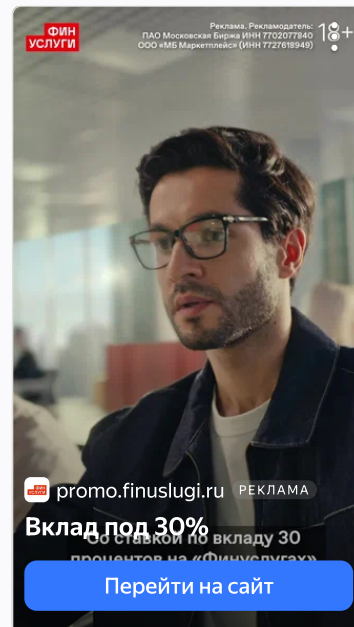
## 📊 Бэктестим стратегию

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.

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



Новости Пикабу  
Помощь  
Кодекс Пикабу  
Реклама  
О компании

Команда Пикабу  
Награды  
Контакты  
О проекте  
Зал славы

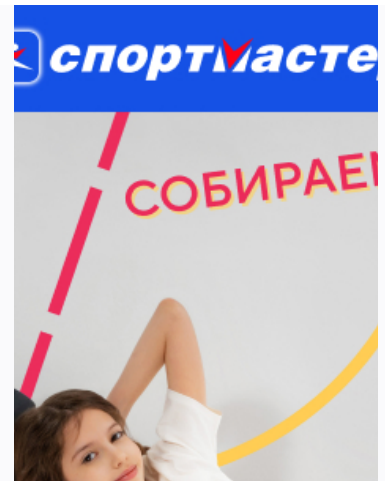
Промокоды  
Скидки  
Работа  
Курсы  
Блоги

Купоны Мегамаркет  
Купоны AliExpress  
Купоны М.Видео  
Купоны YandexTravel  
Купоны Lamoda

Мобильное приложение



AMA



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»](#)



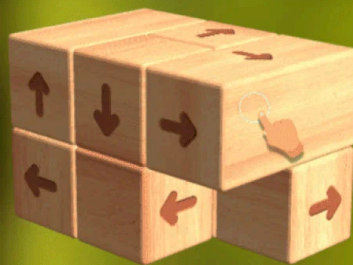
💬 0 👁 4K 📄 ➦

₽ Поддержать

Эмоции

Попробуйте дойти  
до центра куба

Играть



Программирование на python

843 поста • 11.9K подписчиков

Добавить пост

Подписаться

...

#### Правила сообщества

Публиковать могут пользователи с любым рейтингом. Однако!

Приветствуется:...

[Подробнее](#) 

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