



> silavetra.com РЕКЛАМА

«Первый лу Скидки до 5

Оставьте свою почту

Получить скидку



Горячее

Лучшее

Свежее

Подписки

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

empenoso 10 дней 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. 😊





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:

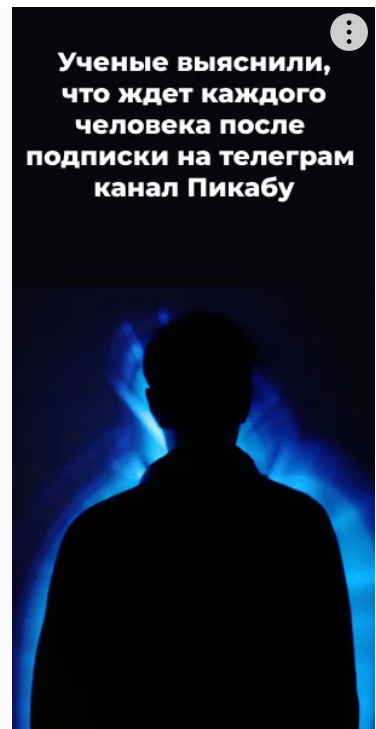
- ♦ **Стоп-лосс** — фиксированный 10% вниз от входа.
- ♦ **Трейлинг-стоп** на основе ATR (чтобы фиксировать прибыль и не вылетать раньше времени).

🤖 Автоматизация тестов

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

Файлы:

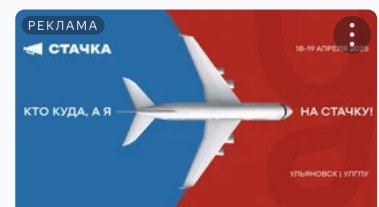
- [data_loader.py](#) — качаем котировки с Мосбиржи.



Топ прошлой недели

- Kerbis
2 поста
- MaximVeter
6 постов
- alex.carrier
16 постов

[Посмотреть весь топ](#)



ul25.nastachku.ru

Присоединяйся к сообществу на «Стачке»

от 14 000 ₽



[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.

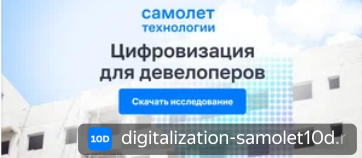
✉️ Лучшие посты недели

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.

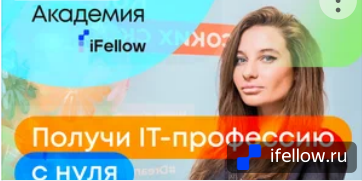
РЕКЛАМА · 16+



Скачайте новое исследование о Цифровизации стройки



РЕКЛАМА · 16+



Стань тестировщиком бесплатно. И получи работу сразу!



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

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

Мобильное прил



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 3.8K

Поддержать

Эмоции



РЕКЛАМА

Дом Кинетика –
квартиры в Кондратово
от 3,5 млн ₽

Квартиры от 3,5 млн.₽ с качественной
отделкой под ключ в престижном...

kinetika-dom.rqch.ru



Программирование на python

822 поста • 11.9К подписчика

Добавить пост

Подписаться

...

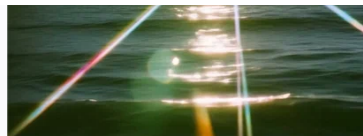
Правила сообщества

Публиковать могут пользователи с любым рейтингом. Однако!

Приветствуется:...

[Подробнее](#) ▾

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



> [silavetra.com](#)

«Первый луч» в Си
ветра — Скидки
до 50 000Р

Оставьте свою почту и мы
расскажем вам первым
о выгодной цене

Только четыре дня

С 27 по 30 марта

Возможность частичной
оплаты

[Получить скидку](#)



