

**Михаил Шардин**

личный блог



19 марта 2025, 04:44

[+ Подписаться](#)

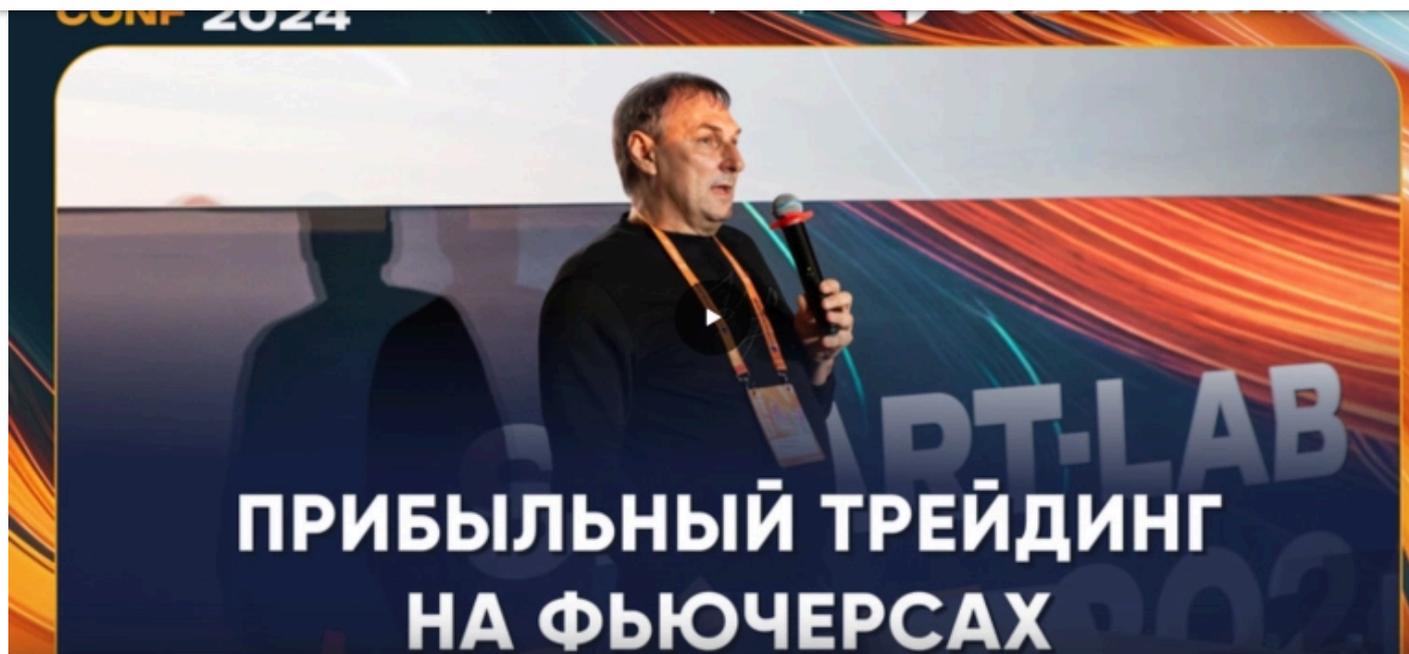
Тестировании торговой системы Александра Резвякова для фьючерсов Московской биржи с использованием Python

В этой статье расскажу о том, как воспроизвел и протестировал торговую систему для фьючерсов Московской биржи, основанную на идеях Александра Резвякова. Недавно, просматривая раздел алготрейдинга на Смартлабе, я наткнулся на видео с его выступления на конференции 2024 года под названием "[5-6 идей для построения прибыльной торговой системы на фьючерсах](#)". Меня привлекла четкость и понятность предложенных им правил торговли.

Поскольку я активно занимаюсь автоматизацией процессов и стремлюсь глубже изучить возможности Python библиотеки `backtesting.py`, мне показалось это хорошей идеей для практического применения.

Хотя я лично не знаком с Александром, полагаю, что публичное представление идеи предполагает возможность её независимого анализа и тестирования сообществом трейдеров и программистов.

Введите текст комментария



Обзор стратегии Александра Резвякова на фьючерсах

Основная идея — открывать сделки в строго определенное время и использовать структуру рынка последних дней для принятия решений.

Правила входа

- Время входа: сделки совершаются только в 10:00.

Лонг:

- Должно быть не менее трех дневных свечей в наличии.
- За последние два дня минимумы (Low) и максимумы (High) должны повышаться.
- Вероятность входа — 50%.

Шорт:

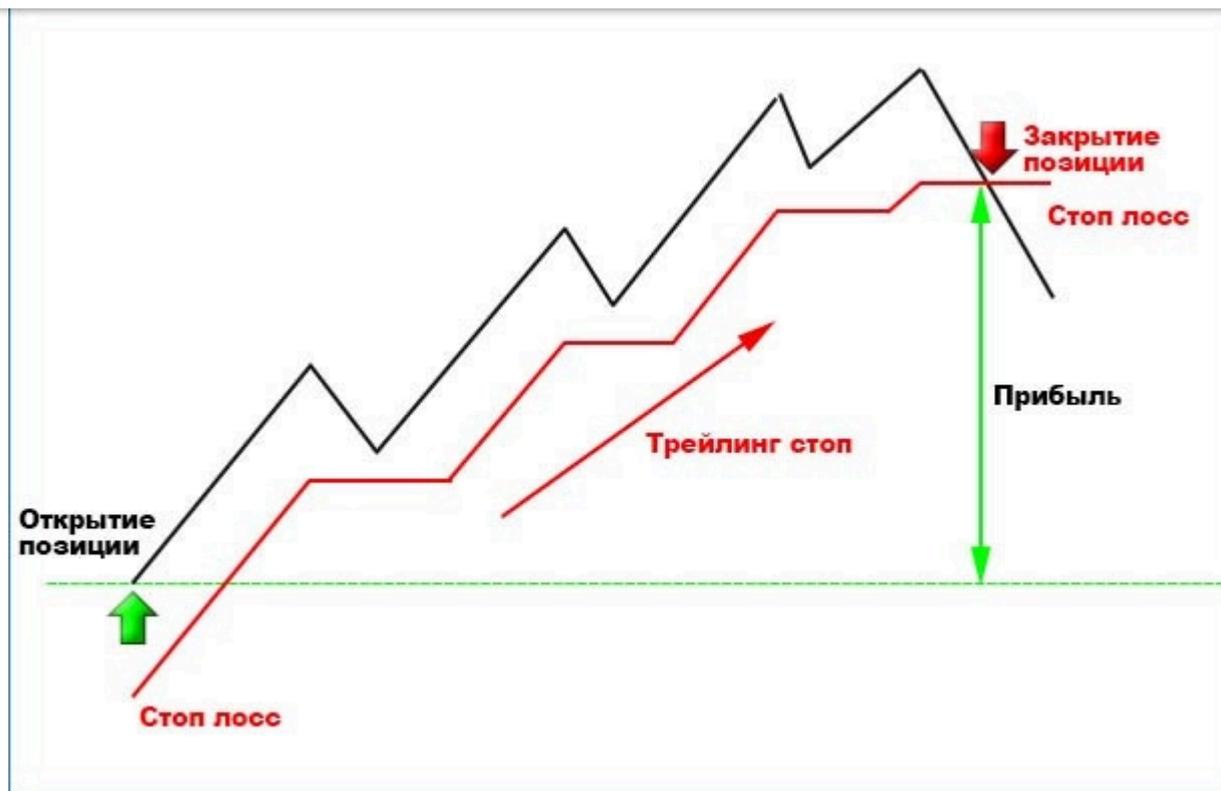
- Также минимум три дневных бара.
- За последние два дня максимумы и минимумы снижаются.
- Вероятность входа — 50%.

Правила выхода

- По времени: позиция закрывается в 20:40, независимо от результата.

По трейлинг-стопу:

- Для ЛОНГА: если цена закрытия предыдущего бара падает больше чем на 2% от уровня покупки, то продажа. Если цена закрытия бара увеличивается, то этот уровень 2% убытка отчитывается уже от этой нового максимального уровня цены закрытия бара.
- Для ШОРТА: обратно лонгу — если цена растет на определенный процент от



Для лонга

Подготовка среды для тестирования

Для реализации и тестирования стратегии Александра Резвякова я выбрал Python и библиотеку `backtesting.py`. Этот выбор обусловлен несколькими факторами: Python предоставляет гибкие возможности для работы с данными, а `backtesting.py` позволяет эффективно моделировать торговые стратегии.

```

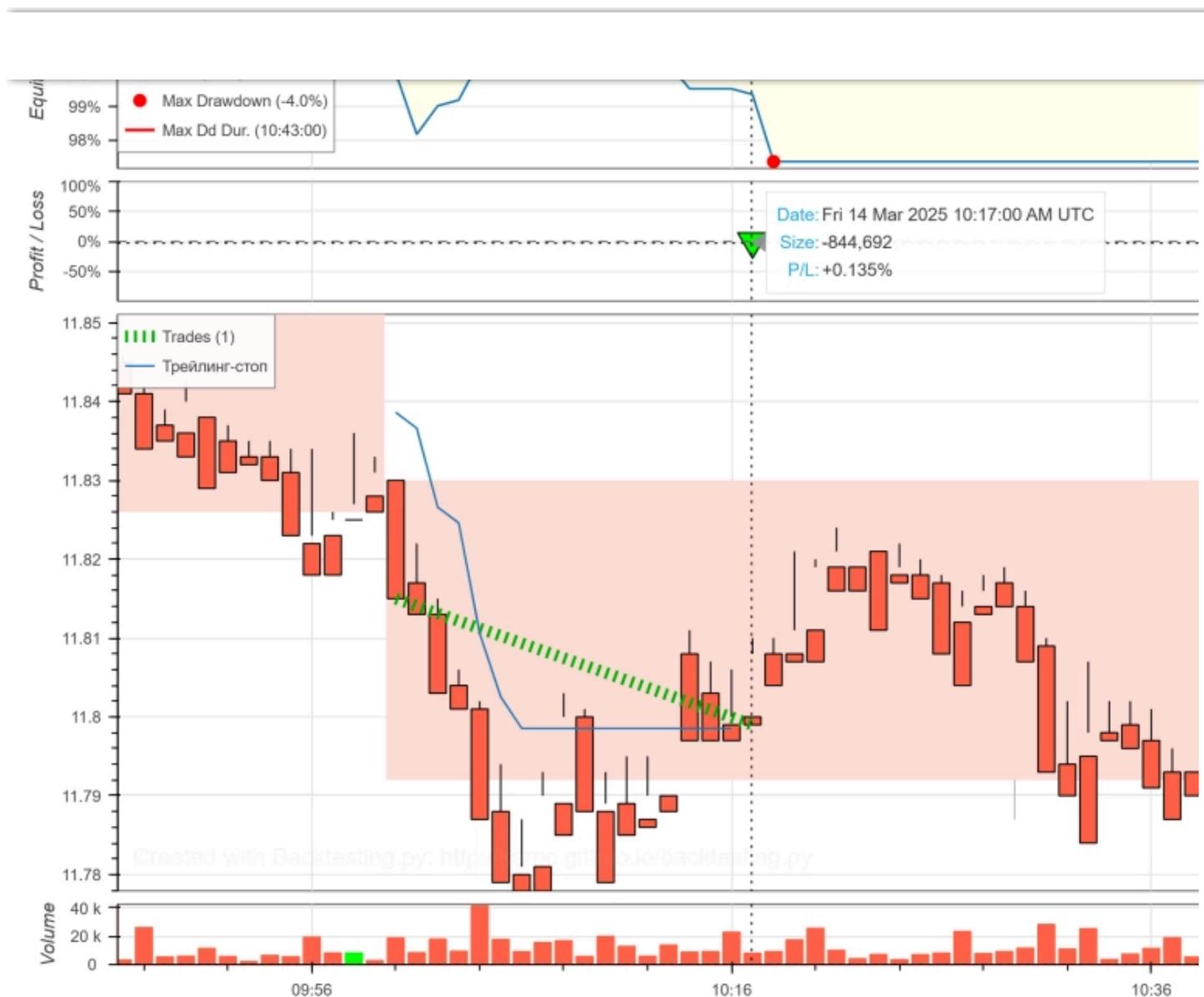
14 class RandomEntryStrategy(Strategy):
15     # Параметры стратегии
16     trail_percent = 0.002 # Процент трейлинг-стопа 2%
17     entry_probability = 0.5 # Вероятность входа и рынок 50/50
18     entry_time = "10:00" # Время для входа в позицию
19     exit_time = "20:00" # Время для выхода из позиции
20
21
22 def __init__(self):
23     """
24     Инициализация индикаторов и переменных
25     """
26     # Подготовка данных для дневных баров
27     self.daily_data = self.resample_to_daily()
28
29     # Создаем индикатор для отображения трейлинг-стопа на графике
30     # Используем тот же тип данных, что и у Close, и заполняем нулями
31     self.trailing_stops = self.I(lambda: rp.full_like(self.data.Close, np.nan, dtype=float),
32                                 overlays=True, name="Трейлинг-стоп")
33
34     # Для отслеживания, активен ли трейлинг-стоп (для правильного отображения)
35     self.is_trailing_stop_active = False
36
37     # Для хранения цены входа и максимальной/минимальной цены закрытия
38     self.entry_prices = {} # Словари для хранения цен входа по ID позиции
39     self.max_close_prices = {} # Максимальные цены закрытия для лонгов
40     self.min_close_prices = {} # Минимальные цены закрытия для шортов
41
42     # Создаем время входа и выхода как объекты time
43     self.entry_time_obj = pd.to_datetime(self.entry_time).time()
44     self.exit_time_obj = pd.to_datetime(self.exit_time).time()
45
46
47 def resample_to_daily(self):
48     """
49     Парсерирование данных в дневные бары
50     """
51     # Создаем копию данных и устанавливаем индекс как дату
52     daily_df = pd.DataFrame(index=self.data.index)
53     daily_df["Open"] = self.data.Open
54     daily_df["High"] = self.data.High

```

В своем проекте применил модульный подход, разделив функциональность на несколько основных компонентов:

- main.py – центральный модуль, запускающий весь процесс сканирования данных и бэктестирования стратегии
- resample_data_1min.py – отвечает за фильтрацию и преобразование данных, получаемых через API; выбирает только необходимый временной интервал котировок
- data_loader.py – преобразует данные из CSV-формата в структуру, пригодную для работы с backtesting.py
- backtester.py – содержит основную логику запуска и настройки бэктеста
- strategy_Random_1min.py – реализует саму торговую систему Резвякова с описанными правилами входа и выхода

Хотя в оригинальном видео Александр Резвяков рекомендовал работать на 5-минутном таймфрейме, я принял решение использовать 1-минутные свечи. Это позволяет более детально анализировать движение цены и точнее отслеживать срабатывание трейлинг-стопов. Благодаря более гранулярным данным, становится проще визуализировать и понять всю логику выхода из позиции, особенно в критических моментах, когда цена колеблется вблизи уровня стопа.



Шорт фьючерса CRH5 (CNY-3.25)

[Полный исходный код всех модулей доступен в моем репозитории на GitHub](#) для тех, кто захочет воспроизвести эксперимент или улучшить предложенную реализацию.

Реализация стратегии на Python с использованием `backtesting.py`

Вот подробное описание каждого шага с точки зрения программирования:

Подготовка данных:

Первым шагом является загрузка и предобработка исторических данных о фьючерсах. Модуль `resample_data_1min.py` отвечает за получение минутных данных с использованием API брокера (в данном случае, T-Invest API) и выборку необходимых временных интервалов. Он загружает данные из CSV-файлов, содержащих котировки, и фильтрует их по заданному диапазону дат. Ключевым моментом является функция `filter by date`, которая обеспечивает

```

1  ticker;timestamp;Open;High;Low;Close;Volume
2  CRH5;2025-03-10 05:59:00;12.123;12.113;12.123;12.112;353
3  CRH5;2025-03-10 06:00:00;12.113;12.134;12.134;12.111;19132
4  CRH5;2025-03-10 06:01:00;12.133;12.137;12.139;12.133;7061
5  CRH5;2025-03-10 06:02:00;12.136;12.125;12.141;12.125;10509
6  CRH5;2025-03-10 06:03:00;12.125;12.131;12.136;12.125;6342
7  CRH5;2025-03-10 06:04:00;12.131;12.133;12.138;12.13;3322
8  CRH5;2025-03-10 06:05:00;12.133;12.144;12.146;12.133;8200
9  CRH5;2025-03-10 06:06:00;12.143;12.141;12.144;12.136;4279
10 CRH5;2025-03-10 06:07:00;12.141;12.138;12.142;12.137;3213
11 CRH5;2025-03-10 06:08:00;12.137;12.137;12.138;12.137;1630
12 CRH5;2025-03-10 06:09:00;12.136;12.126;12.136;12.125;3562
13 CRH5;2025-03-10 06:10:00;12.126;12.125;12.129;12.125;10635
14 CRH5;2025-03-10 06:11:00;12.125;12.129;12.134;12.108;6272
15 CRH5;2025-03-10 06:12:00;12.13;12.125;12.13;12.121;2230
16 CRH5;2025-03-10 06:13:00;12.125;12.125;12.13;12.124;980
17 CRH5;2025-03-10 06:14:00;12.125;12.13;12.13;12.124;1612
18 CRH5;2025-03-10 06:15:00;12.13;12.136;12.137;12.129;5119
19 CRH5;2025-03-10 06:16:00;12.136;12.133;12.137;12.129;1528
20 CRH5;2025-03-10 06:17:00;12.133;12.131;12.133;12.13;365
21 CRH5;2025-03-10 06:18:00;12.132;12.132;12.132;12.131;482
22 CRH5;2025-03-10 06:19:00;12.132;12.131;12.132;12.13;579
23 CRH5;2025-03-10 06:20:00;12.132;12.132;12.132;12.13;456

```

Загрузка данных из CSV:

Модуль `data_loader.py` отвечает за загрузку исторических данных из CSV-файлов и преобразование их в формат, пригодный для использования с библиотекой `backtesting.py`. Функция `load_data_for_ticker` считывает данные для указанного тикера, выполняет парсинг дат и устанавливает столбец `timestamp` в качестве индекса. Это позволяет `backtesting.py` правильно интерпретировать временные ряды.

Реализация условий для входа и выхода:

В модуле `strategy_Random_1min.py` реализована основная логика торговой стратегии. Класс `RandomEntryStrategy` наследуется от класса `Strategy` из библиотеки `backtesting.py`. В методе `init` происходит инициализация необходимых параметров и индикаторов.

Метод `resample_to_daily` пересчитывает минутные данные в дневные бары, необходимые для принятия решений о входе в позицию.

В методе `next` реализуются правила входа и выхода из позиции, описанные Александром Резвяковым. Время входа строго фиксировано (10:00), а решение о входе в лонг или шорт принимается на основе анализа предыдущих двух дневных баров. Вероятность входа в

сделку устанавливается как 50%. Время выхода устанавливается на 20:40



Интерактивный HTML

Настройка трейлинг-стопов:

Для реализации трейлинг-стопов в `strategy_Random_1min.py` используются методы `update_long_position` и `update_short_position`. В этих методах вычисляется уровень трейлинг-стопа на основе текущей цены и заданного процента (2%).

Трейлинг-стоп автоматически подтягивается вверх для длинных позиций и вниз для коротких, обеспечивая фиксацию прибыли и ограничение убытков. При достижении ценой уровня трейлинг-стопа позиция автоматически закрывается.

Тестирование стратегии

Библиотека `backtesting.py` позволяет не только моделировать сделки, но и визуализировать их в интерактивных HTML-отчетах. Это помогает детально анализировать точки входа и выхода, проверять корректность реализации логики и выявлять возможные ошибки в коде.

Чтобы избежать нагромождения данных в интерактивных HTML-отчетах решил загружать данные по неделям.

Кроме того, я задал комиссию в размере 0,2%, поскольку комиссии оказывают заметное влияние на итоговую доходность:

```
<code>
```

```
bt = Backtest(
    df,
    DynamicStrategyClass
```

```

hedging=False,
)
</code>

```

Так как стратегия использует случайный вход в сделки (вероятность 50% на покупку или продажу), результаты тестирования также носят случайный характер. Однако, уже на первых тестах удалось увидеть интересные закономерности.

Вот пример удачного теста на фьючерсе NGH5:



Шорт

```
<code>
```

```

=====
🚀 Запуск бэктеста для NGH5
=====

```

📄 Технические данные (для справки):

Колонки в данных: ['ticker', 'Open', 'High', 'Low', 'Close', 'Volume']

Первые 5 строк данных:

timestamp	ticker	Open	High	Low	Close	Volume
2025-03-10 05:59:00	NGH5	4.610	4.610	4.610	4.576	8743
2025-03-10 06:00:00	NGH5	4.610	4.605	4.629	4.605	10655
2025-03-10 06:01:00	NGH5	4.605	4.592	4.607	4.592	8855
2025-03-10 06:02:00	NGH5	4.592	4.592	4.598	4.592	5293

```

Open      float64
High      float64
Low       float64
Close     float64
Volume    int64
dtype: object

```

 Запуск бэктеста...

ПРОДАЖА на 2025-03-12: Цена: 4.33, Стоп: 4.33

ВЫКУП (трейлинг-стоп) на 2025-03-12: Цена: 4.31, Стоп: 4.31, Вход: 4.33, Мин.зак

ПРОДАЖА на 2025-03-14: Цена: 4.08, Стоп: 4.09

ВЫКУП (трейлинг-стоп) на 2025-03-14: Цена: 4.02, Стоп: 4.02, Вход: 4.08, Мин.зак

 Результаты бэктеста:

 Стратегия: NGH5_RandomEntryStrategy

 Период тестирования: с 2025-03-10 05:59:00 по 2025-03-14 20:49:00

 Начальный капитал: 100,000 руб.

 Конечный капитал: 1104162.00 руб.

 Общая доходность: 10.42%

 Годовая доходность: 14652.07%

 Коэффициент Шарпа: 1.11

 Максимальная просадка: -6.51%

 Количество сделок: 2

 Процент выигранных сделок: 100.00%

 Лучшая сделка: +1.40%

 Худшая сделка: 0.44%

 Средняя продолжительность сделки: 0 days 00:40:00

 Построение графика результатов...

 График успешно построен!

```

=====
❏ Бэктест для NGH5 завершен
=====

```

```
</code>
```

некоторых случаях условия накопления позиций, тем приблизительные сделки перекрывают потери. В будущем стоит рассмотреть добавление дополнительных фильтров для входа.

Рекомендации по улучшению стратегии

Наращивание позиций в выигрышных сделках

Автор рекомендует увеличивать объем позиции в прибыльных сделках. Однако в текущей реализации теста этот момент не был учтен. Основная сложность в том, как правильно идентифицировать момент для добавления к позиции и реализовать это в `backtesting.py`.

Если у кого-то из читателей есть идеи или готовые решения, буду рад обсудить их.

Возможные улучшения стратегии

- Оптимизация трейлинг-стопа
В текущей версии трейлинг-стоп фиксирован на уровне 2%, однако более гибкий подход, основанный на волатильности актива, может улучшить результаты. Например, можно использовать ATR (Average True Range) для динамического определения уровня стопа.
- Добавление фильтров для входа
Вход в 10:00 производится без дополнительных условий, что делает стратегию чувствительной к случайным колебаниям рынка. Можно добавить индикаторы тренда (например, SMA, VWAP) или фильтры объема, чтобы подтвердить сигналы на вход.
- Добавление адаптивного модуля управления рисками
Вместо фиксированного размера позиции можно вводить динамическое управление рисками на основе максимальной просадки (drawdown) или волатильности актива.

Все эти идеи требуют детального тестирования, но их внедрение может значительно повысить эффективность стратегии.

Заключение

В рамках этой статьи я воспроизвел и протестировал торговую систему Александра Резвякова на фьючерсах Московской биржи, используя Python и библиотеку `backtesting.py`.

Несмотря на кажущуюся простоту (случайные входы в 10:00 с вероятностью 50%), стратегия показала интересные результаты благодаря четким правилам выхода из позиций: трейлинг-стопа и закрытие по времени в 20:40.

Данный опыт может быть особенно полезен начинающим алгоритмическим трейдерам.

- Во-первых, он наглядно демонстрирует, что даже базовая стратегия со случайными входами может приносить прибыль при грамотном управлении рисками.
- Во-вторых, проект служит отличным примером структурирования кода для торговых

Что касается перспектив развития, система обладает значительным потенциалом для улучшения. Добавление динамических трейлинг-стопов на основе ATR, интеграция дополнительных фильтров для входа и реализация механизма наращивания позиций в прибыльных сделках могут существенно повысить эффективность стратегии. Python и [backtesting.py](#) предоставляют все необходимые инструменты для таких экспериментов, открывая широкие возможности для дальнейших исследований и оптимизации.

Автор: Михаил Шардин

[Моя онлайн-визитка](#)

[Telegram «Умный Дом Инвестора»](#)

19 марта 2025 г.

Александр Резвяков

торговые системы

торговые роботы

трейдинг

4.7K 

 38

 68

 37



 [homeinv](#)

Михаил Шар...

 Пермь

 106  860

 с 23 января 2019

[+ Подписаться](#)

68 КОММЕНТАРИЕВ

[Сначала старые](#) 



Sergey Pavlov

19 марта 2025, 05:48

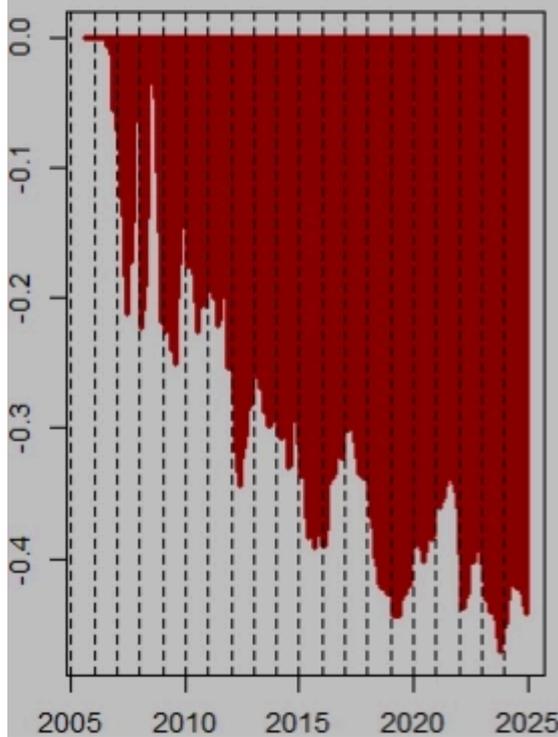
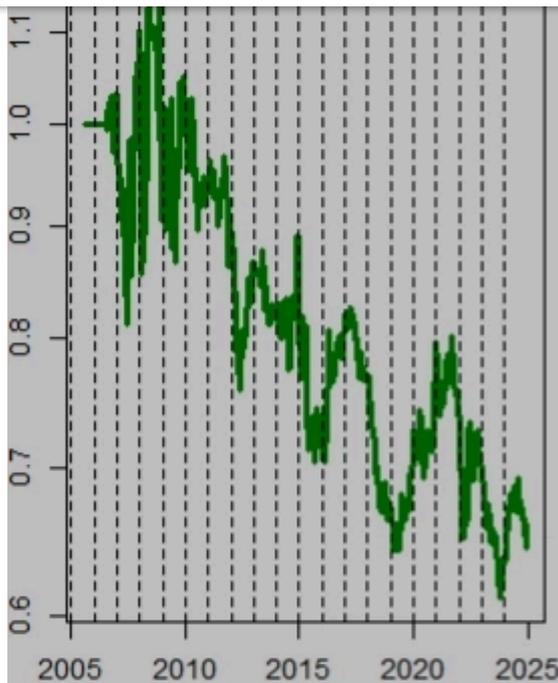


На любимой им рижке лонг (по указанным правилам входа/выхода) сливает даже без издержек:

 Jetlend

ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



Михаил Шардин

19 марта 2025, 06:11



Sergey Pavlov, так это вы на днях тестировали?



ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ

Михаил Шардин, а такой тест на истории даст возможность закрыть сделку по отрицательной цене нефти? Если даст и нарисует прибыль то это... ну сами понимаете.



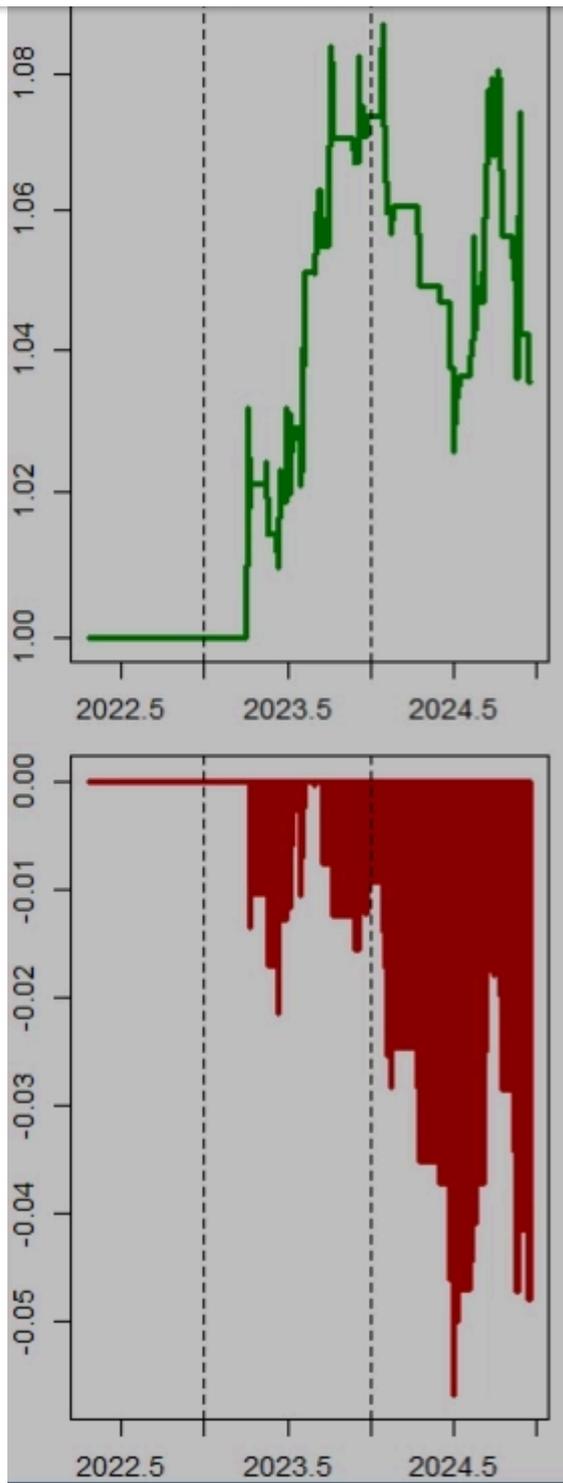
Sergey Pavlov

19 марта 2025, 05:49



ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



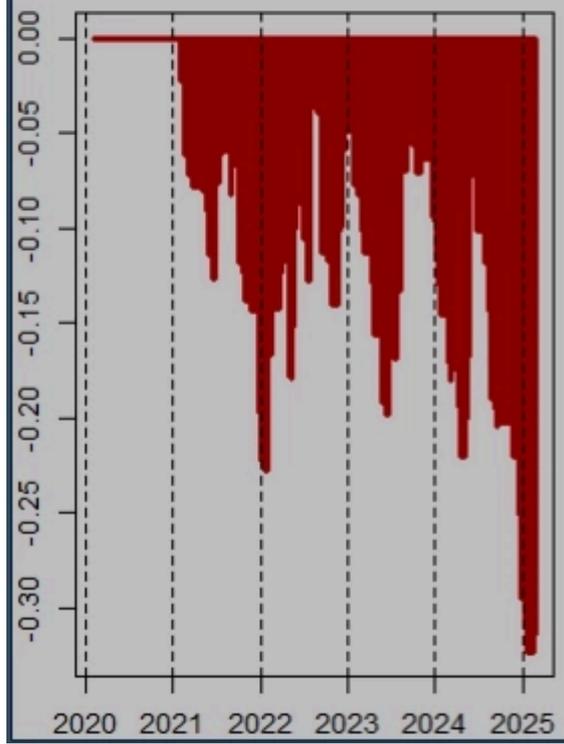
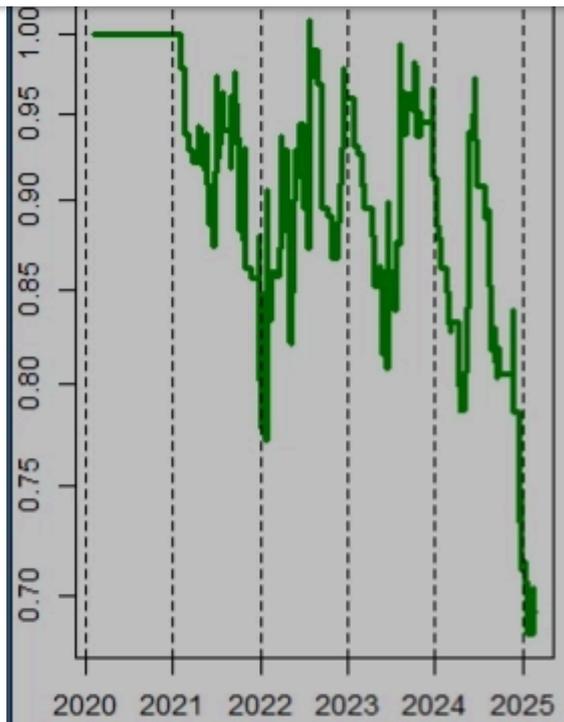
Sergey Pavlov

19 марта 2025, 05:50



ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



Михаил Шардин

19 марта 2025, 06:12



Sergey Pavlov, вы тестируете по каким-то совершенно другим правилам; в предложенной

 **ВЫХОДИТ НА IPO** ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ, ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ

**Sergey Pavlov**

19 марта 2025, 07:07



Михаил Шардин,

”
 Правила входа
 Время входа: сделки совершаются только в 10:00.
 Лонг:
 Должно быть не менее трех дневных свечей в наличии.
 За последние два дня минимумы (Low) и максимумы (High) должны повышаться.
 Вероятность входа – 50%.
 Шорт:
 Также минимум три дневных бара.
 За последние два дня максимумы и минимумы снижаются.
 Вероятность входа – 50%.
 Правила выхода
 По времени: позиция закрывается в 20:40, независимо от результата.
 ”

как написано, так и протестировал. Расчёты у меня на минутках.

**Михаил Шардин**

19 марта 2025, 07:53



Sergey Pavlov, а чем тестируете?

**Sergey Pavlov**

19 марта 2025, 08:12



Михаил Шардин, самописное в R

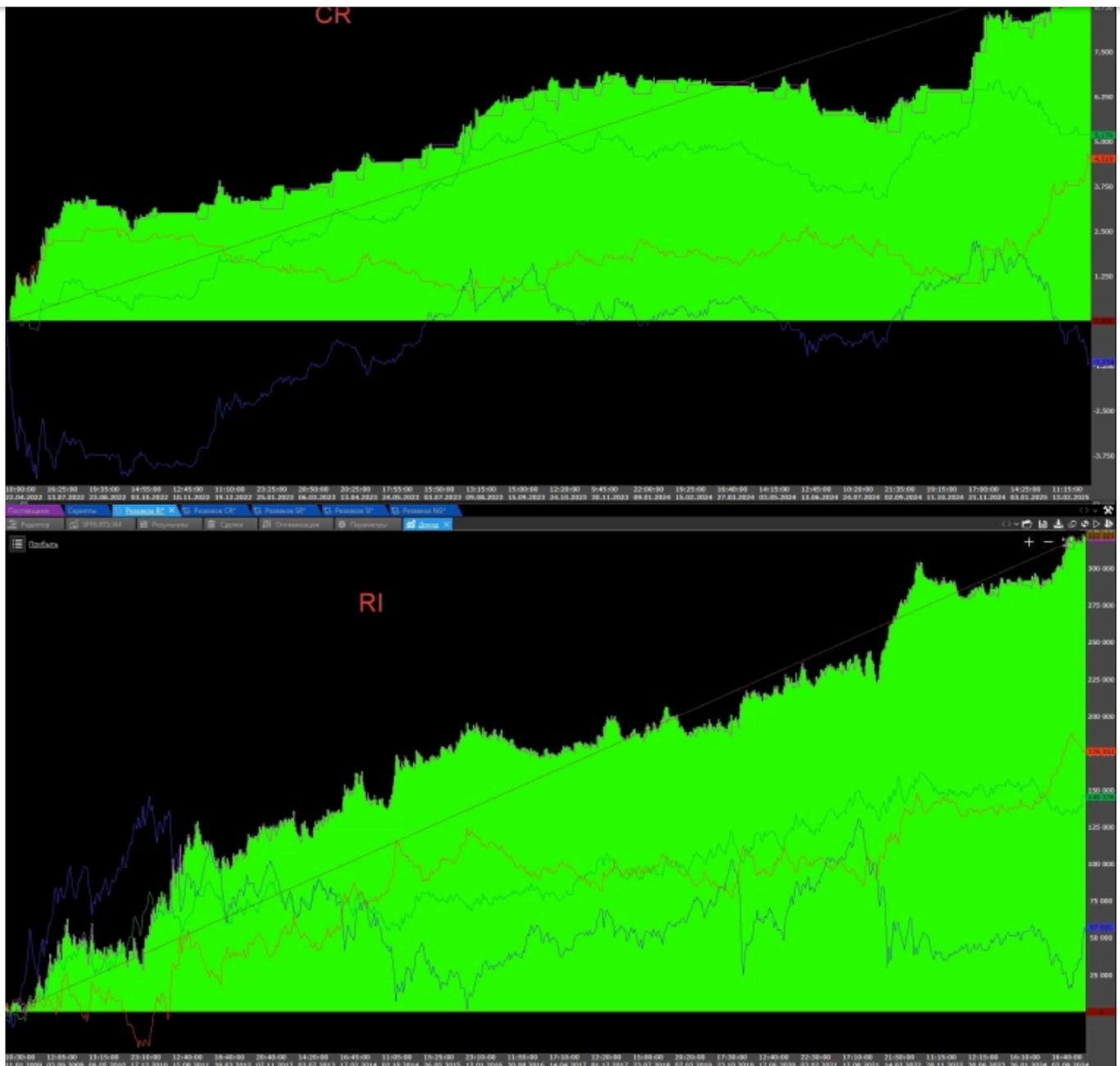
**VLTorgovie**

19 марта 2025, 14:07



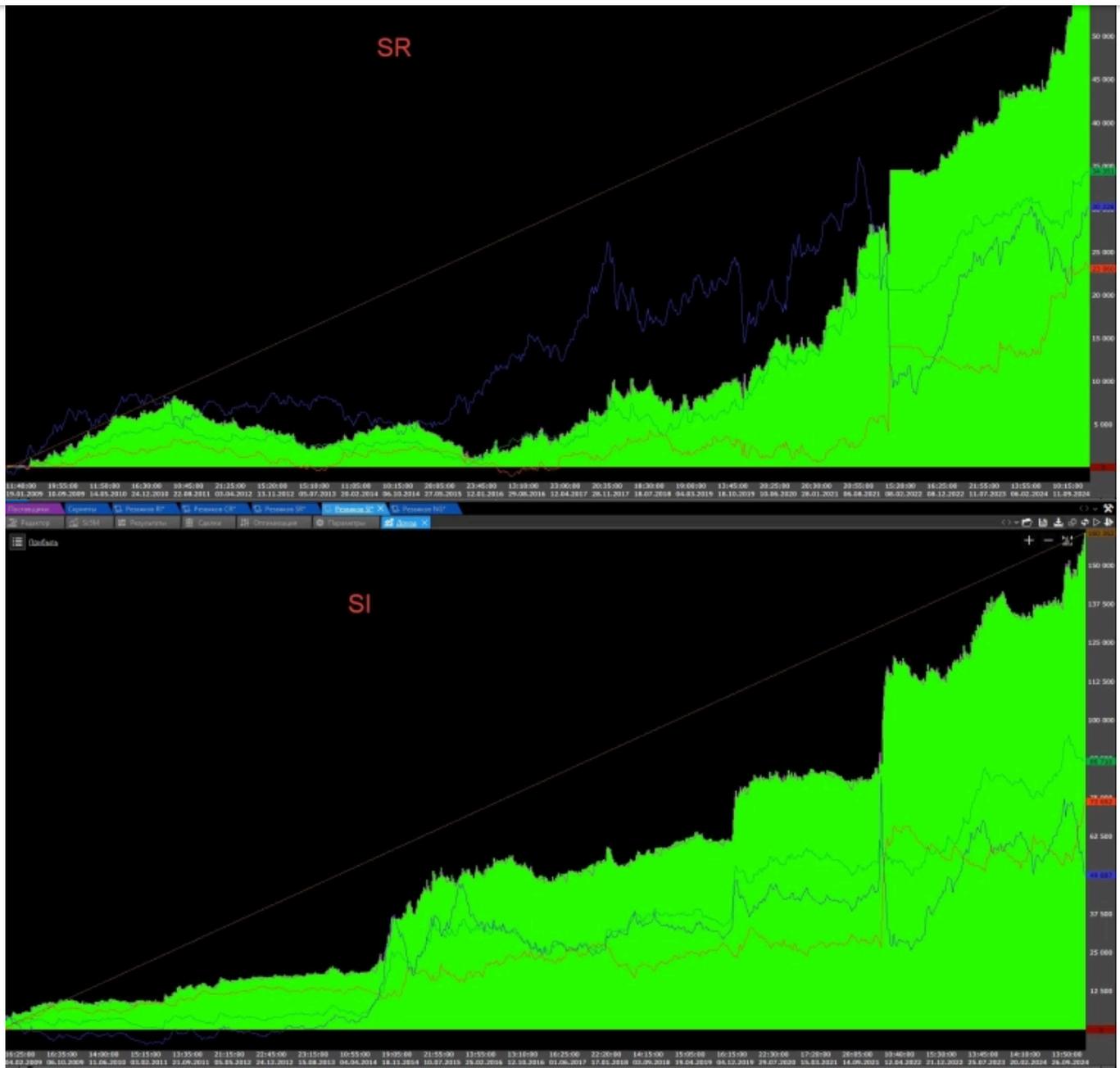
Sergey Pavlov, Изменил время входа/выхода, стоп

С комиссиями, с склейкой

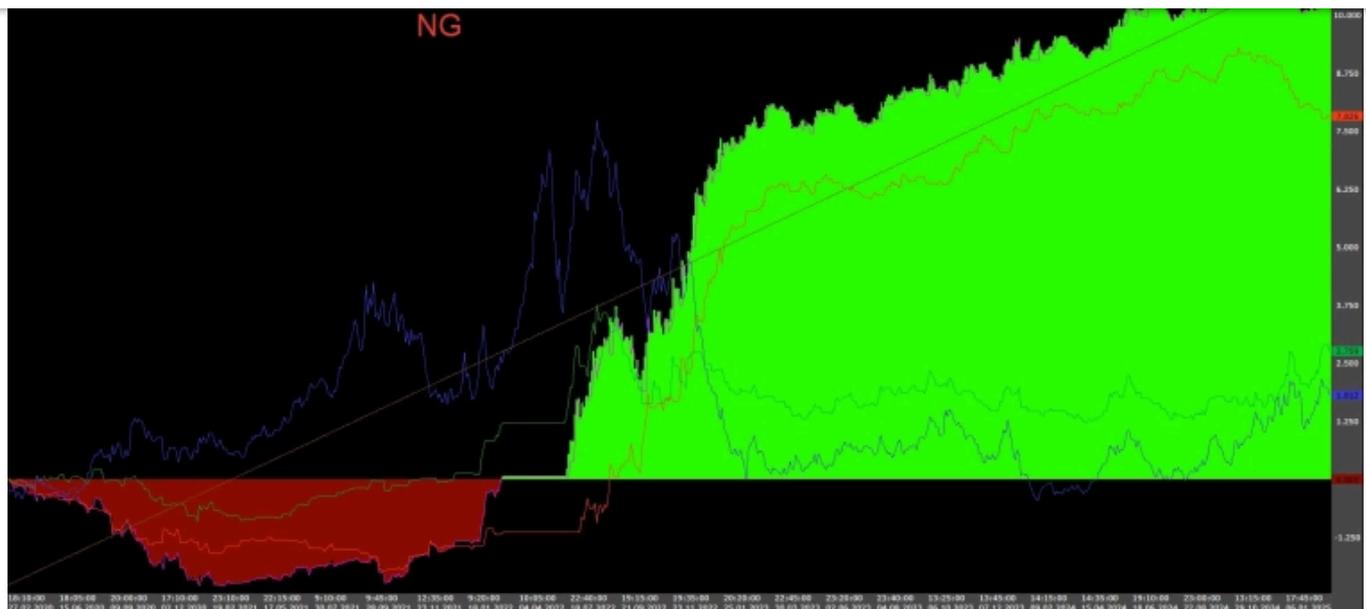


ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



Jetlend **ВЫХОДИТ НА IPO** ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ, ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



Михаил Шардин

19 марта 2025, 14:54



VLTorgovie, Вы два ответа написали с совершенно разными результатами. А где какие условия были?



VLTorgovie

19 марта 2025, 16:59



Михаил Шардин, где похуже, это как написано у вас, время входа в 10:00 (у меня стоит 10:05, т.к. в 10:00 не войдешь), и выход в 20:40 или по стопу 2% или трейл стопу 2%

А где получше, там изменено время входа и выхода и стоп в 2%

Причем в условиях не написано растущие свечи или падающие, и не понятно зачем 3 свечи, если смотрится максм и минимум последних 2-х



Jetlend

ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



VLTorgovie

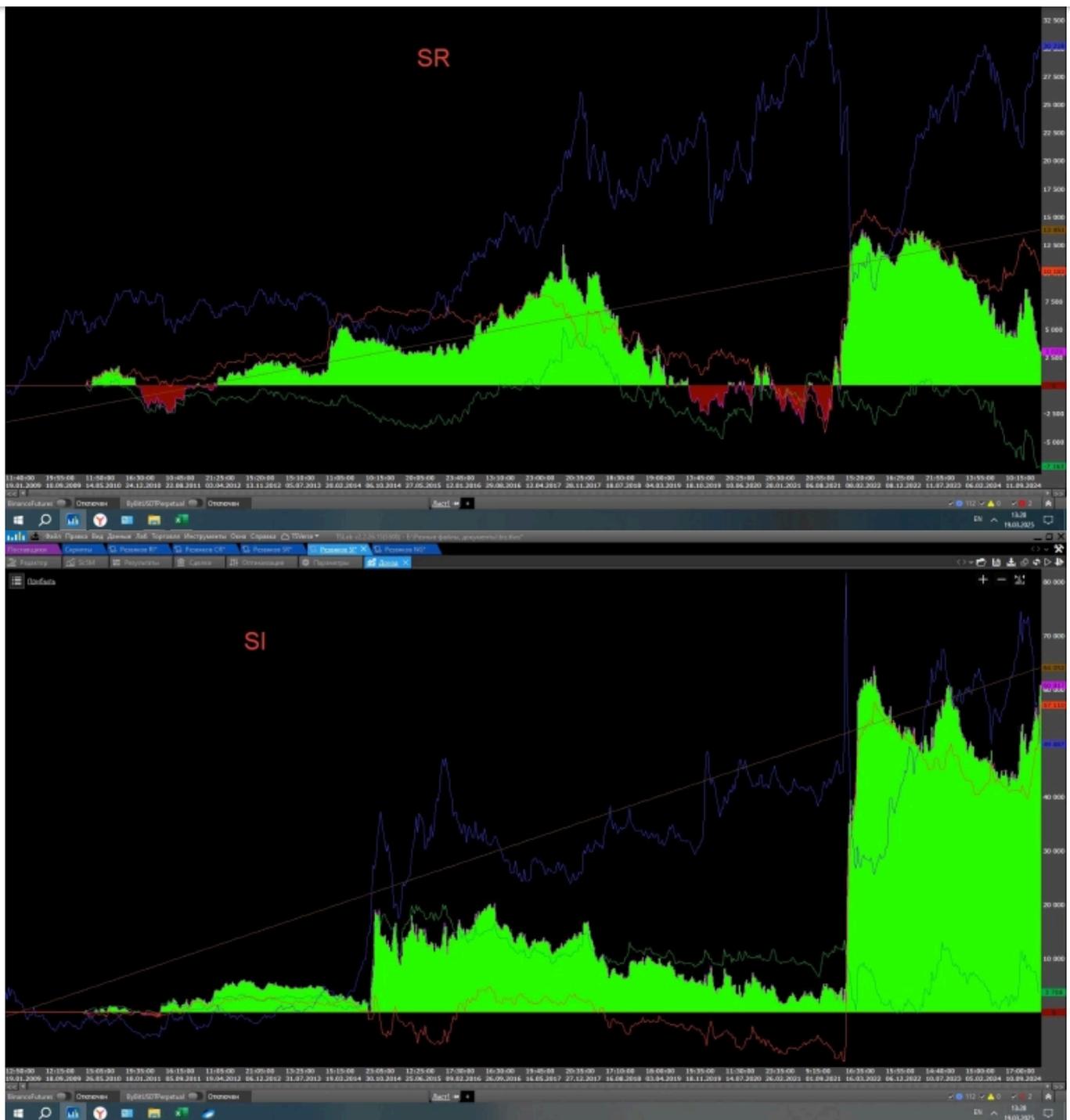
19 марта 2025, 13:38

Sergey Pavlov, собрал на скорую руку, правда стоп не от закрытия а от MFE и не дня, а текущей цены (уже есть готовый, не стал переделывать), РИ, СИ, Сбер, Газ, юань



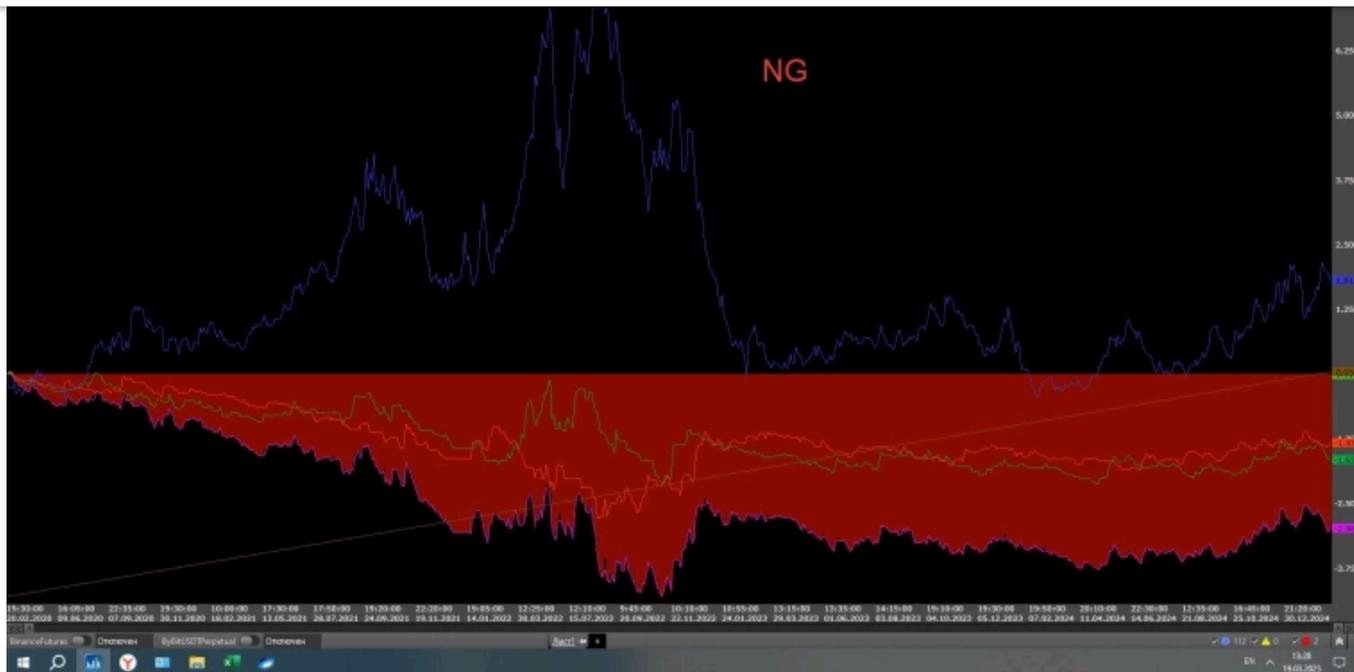
ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ, ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



Sergey Pavlov

19 марта 2025, 05:51



”  Годовая доходность: 14652.07% “

откуда вот это всё взялось?



Михаил Шардин

19 марта 2025, 07:01



Sergey Pavlov, это взялось оттуда что backtesting py пересчитал доходность двух сделок в одной неделе в году по 40 минут в годовую доходность



ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ

**Head of Algonaft'\$**

19 марта 2025, 08:06

муауча, 🎯 так это... уже курсы обучающие ждем-с 👍 от автора. А то понимаете ли питон изучил (и уже гуру алго) и никого больше за бабки не учит — это не хорошо.

**Михаил Шардин**

19 марта 2025, 08:34

Head of Algonaft'\$, прямо мастер сарказма 👍

**Head of Algonaft'\$**

19 марта 2025, 09:03

Михаил Шардин, госпаде) Да у вас 18 лет опыта! О боже! 18 лет и такой не далекий в трейдинге! Прежде чем что-то алгоритмизировать, надо понимать, что такое трейдинг и с чем его едят. Но если вы за 18 лет не поняли... то да, ваш потолок это давно не работающие стратегии инфоцыган пробовать алгоритмизировать. *ть,18 лет коту под хвост))) 🏆

**Михаил Шардин**

19 марта 2025, 09:25

Head of Algonaft'\$, поделись своей бесконечной мудростью

**Байкал** ★

19 марта 2025, 19:20

муауча, 📄

**SergeyJu**

19 марта 2025, 08:32

Ровно в 10 начинались торги, когда была только основная сессия. И многие системы КАЗАЛИСЬ прибыльными только потому, что авторы думали, что они могут войти с первой сделкой по её цене.

SergeyJu, разумно



Алекс Ч.

19 марта 2025, 13:56



Михаил Шардин, переделайте, пожалуйста, тест с входом в 10:00 по закрытию первой минутной свечи, или в 10:01 по открытию. Исключим невозможность исполнить сделку по цене открытия торговой сессии.



Михаил Шардин

19 марта 2025, 14:21



Алекс Ч., я переделал, но раз вход случайный, то и результаты когда как получаются. К тому же мне кажется её зря прямо на годах тестируют. Мне кажется это для только здесь и сейчас.



Алекс Ч.

19 марта 2025, 14:52



Михаил Шардин, тогда было бы логично тестировать не один случайный прогон, а, например, 100 и усреднять результаты. Иначе сложно будет сравнивать результаты разных вариаций стратегии между собой.



Head of Algonaft'\$

19 марта 2025, 09:04



SergeyJu, вы ему еще про мм и нерезов расскажите) откроете глаза что ли ему, за 18 лет он резвякова оптимизирует))ипати коловрати!



Михаил Шардин

19 марта 2025, 09:23



Head of Algonaft'\$, ну так просвети, о мудрейший 😄



перепадает_) без вас бы рынка не было и не было бы заработка. Спасибо вам и низкий поклон 🙏



Михаил Шардин

19 марта 2025, 09:43



Head of Algonaft'\$, как же мне повезло услышать мнение такого великого биржевого философа!



Андрей Аперов

19 марта 2025, 10:02



Head of Algonaft'\$, Дядя, не бузи) Ну побэкстестил парниш очередного товарища еще с одной стратегией «сидинихуянеделайзарабатывайдахуя»? Ну че случилось-то?.. Может у парнишы вообще цель другая и он вообще все понимает про Резвякова, а настоящая цель его: вдруг зайдут на профиль — посмотрят, а там сайт-открытка с тем как «умный дом» внедрить занедорого. Молодец — парниш! Поверх продавца воздуха свою рекламу прогонять!



SergeyJu

19 марта 2025, 10:10



Андрей Аперов, и вообще, метод научного тыка в наших условиях ничем не хуже любого другого. И имеет то реальное преимущество, что изредка срabатывает.



Head of Algonaft'\$

19 марта 2025, 10:16



Андрей Аперов, 🤖 Не ну с 18 летнем стажем и такой пустотой в коробке передач цель одна: инфоцыганить! Ибо за 18 лет можно было уже свое что-то рабочее изобрести и зарабатывать. Поэтому пока весело это все... он еще и минусует) ну прям как обиженка инфоцыганская.



OnlyHuman

19 марта 2025, 12:37



Head of Algonaft'\$, от вас пока только словесный понос, конструктива ноль. Автор показывает, как можно идею реализовать на базе Python. Для меня не так важна суть идеи, понятно, что грааль на конференции раскрывать не будут, да и не жила бы идея столько лет после публичного озвучивания. Но мне полезно увидеть общий механизм реализации. Если вам

**ulukay**

19 марта 2025, 09:32



Я считаю что в Лонг зайти надо 3.008 дневных свечей было! иначе будет коловранция оберзенции!

**SVG**

19 марта 2025, 09:55



это я удачно зашел) только вчера ковырялся в вашем коде из прошлого поста и как раз хотел эту стратегию протестировать, а тут все готовое почти правда есть желание поменять условия входа и попробовать сделать трендовуху. попробовать отыграть будущее укрепление рубля на фьючах руб-юань

**Михаил Шардин**

19 марта 2025, 10:02



SVG, код открыт пожалуйста. Если найдёте какие-то ошибки предложите пожалуйста пул реквест на гитхабе 🙏

**22022022**

19 марта 2025, 10:11



1. Две зеленые свечки и лонг.
2. Вчера зеленая — сегодня лонг.
3. Наклоны индикаторов и лонг сегодня.
4. Цена открытия > цены закрытия, и лонг.
5. Утренняя сессия растет — лонгуем основную.
6. итд....

Это всё одно и то же, системой и не пахнет. Беда в том что слишком всё логично и пусто. Т.е. каждый кто имеет хоть 5 грамм мозга додумается до такого. Я просто уверен все новички пробуют это в начале пути. Но это не система, внутри нет системы, это ковыряние на результат. В чем идея то? Её нет! Или всем пофик?

Подобные «ТС» должны пролетать мимо и без тестирования. Не стоит тратить внимание и время на подобное. Ценность нулевая.

**Михаил Шардин****ВЫХОДИТ НА IPO**

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ

Если говорить про инвестиции, та же условная идея «не класть все яйца в одну корзину» на длительном временном интервале даёт хорошие результаты.

Но если мы говорим про трейдинг из него гораздо легче вылететь если делаешь что-то не так



22022022

19 марта 2025, 11:09



Михаил Шардин, возможно Вы правы. Сам прошел через море тупых и кринжовых алгоритмов, и пока жив. Но сегодня уже есть понимание где мы самообманываемся, отсюда иммунитет.

Сразу вижу, вход/выход по времени, т.е. без стопа по деньгам, кочергааа... Это значит нужно прикручивать риск и снова крутить настройку. Крутим настройку — портим винрейт... итд.

Ну и всегда перед тем как пустить в бой ТС, спрашиваю себя, почему рынок не сможет поиметь меня? Будет сложнее меня поиметь?)) Это просто статистика или что-то еще.

Спокойнее когда кажется что есть что-то еще кроме сухой статистики.

Допускаю что это все такой же уровень абстракции, следующий уровень абстракции, и такой же бред!)))



Riskplayer

19 марта 2025, 10:35



Какая-то странная система. Сформировались условия для входа, далее подкидываем монетку и, в зависимости от результата, входим (или не входим).



Diamond

19 марта 2025, 11:14



Riskplayer, а в чем странность? Многие системы монетку подкидывают же.



George Martin

19 марта 2025, 11:35



Diamond, это вот такие системы и подкидывают) Нормальная система вин рейт ставит от 80%.



Diamond



**George Martin**

19 марта 2025, 11:49

Diamond, уберите эти заумные слова. Теоретики. Мы работаем по показателю винрейта до и после сделки. Это реальность. До, это уровень данных за определенный период. чем короче, тем выше. Суммарно откатать что-то на бэктесте, что оно не сливает под ноль, это только 50% задачи. Теперь ее нужно под текущие условия вводить. А это на машинном обучении только идет норм.

**Михаил Шардин**

19 марта 2025, 12:46

George Martin, вы имеете ввиду что вас важно не просто, чтобы стратегия показывала прибыль в долгосрочном тесте, а чтобы она имела высокий винрейт в моменте?

Какие модели ML позволяют эффективно подстраиваться под рыночные изменения и избегать устаревания стратегии?

**George Martin**

Вчера в 11:23

Михаил Шардин, синегрия двух этих показателей будет давать хороший результат. Вопрос не устаревания стратегии, она может быть одна и та же, вопрос о новых входящих данных исходя из которых вы корректируете стратегию. Я не программист. Есть сервисы, которые берут массивы данных и на машинном обучении строят исходя из цифр графические модели, где указывается в % и днях винрейт тех данных (диапазонов) которые будут рабочими. Т.е. они все считают каждый день... Перестройка момента идет постоянно. Базовые параметры это накопление ОИ, объема, колл пут саппорт итд.

**SergeyJu**

19 марта 2025, 12:45

Diamond, зачем? Мои системы не подкидывают монеток для принятия решения.

**Diamond**

19 марта 2025, 12:47

Diamond, если соотношение 5 к 1 в мою пользу, глупо еще и подкидывать монетку.



George Martin

19 марта 2025, 11:34

Riskplayer, кстати. Думал не отметит никто. Т.е. есть сетап на вход, но вероятность успеха 50%)) лол бля) это с таким же успехом монетку можно кидать как Вы отметили)



Евгений (synth-lab)

19 марта 2025, 11:18

покупка в 10:00, уже подразумевает что система сломается, вход ведь по маркету?

во вторых какая то ошибка в цифрах,

Начальный капитал: 100,000 руб.

 Конечный капитал: 1104162.00 руб.

 Общая доходность: 10.42%

100к -> 1.1 млн

и третье, самое важное, в системе отсутствует логическая составляющая, если лои за прошлые дни все выше и выше это не дает никакой альфы к будущему, ну и плюс резвякова слушать, он на конференции предлагал открывать одновременно две сделки, одну в лонг другую в шорт, а то и вообще случайные входы, если за много лет трейдинга он пришел к этому то это даже не смешно, это печально



Михаил Шардин

19 марта 2025, 11:23

Евгений (synth-lab), когда вы критикуете и это критика конструктивна это хорошо.

Но обычно вместе с критикой ждёшь и каких-то предложений



Дмитрий Овчинников

19 марта 2025, 16:37

Жуть какая-то



профит = не лучше 1:1 — это вам не удастся изменить в свою пользу (если попытаетесь улучшить ratio лосс: профит, то винрейт сразу упадет ниже 50%).
В этом отличие Системы от «подбрасывания монетки».



svgr

19 марта 2025, 22:18



Va Chen, но никаких возможностей систематически обеспечить 1:1.2 нет и быть не может.



Va Chen

19 марта 2025, 23:11



svgr, почему? Если применить некоторые «фильтры», позволяющие задетектить Моментум и его «молодость» (с достаточно высокой вероятностью), то вполне можно получить 1:1.2 (при винрейте 50%).

Правда, доходность такой системы получается не оч.большая — всего 20-30% годовых...



SergeyJu

Вчера в 08:21



Va Chen, моментум употребляют в нескольких значениях, чаще всего в контексте сравнения относительной силы акций. А «Молодость» это что-то типа производной моментума? Не поясните свое сообщение?



Va Chen

Вчера в 14:57



SergeyJu, ну, имеется ввиду первая треть высоковероятного направленного движения. У западных трейдеров встречал этот термин (young momentum).



SergeyJu

Вчера в 16:59



Va Chen, и Вы научились эту треть обнаруживать в реальном времени?



Gregori



**Михаил Шардин**

Вчера в 06:29



Gregori, Чайковский в Пермском крае?

**Gregori**

Вчера в 07:28



Михаил Шардин, да

**ves2010**

19 марта 2025, 22:16



в NGработать не будет...

т.к этот актив торгуется не в россии и российская сессия торгов и время входя-выхода не имеет никакого отношения к реальному движению NG...

более того NG это не акция а комод... т.е тренда в нем нет..

надо торговать российский актив типа сбера или газпрома... или индекс ртс

вообще резвяков говорит правильные вещи... у мя даже бот есть похожий...

который ловит в тренде локальные падения

**GOLD** ★

19 марта 2025, 22:58



подобные тесты можно смело гонять на акциях, не заморачиваясь со склейкой фьючей

питон не обязателен... для таких примитивных тестов за глаза хватит QLUА с визуализацией входов-выходов прямо на графиках QUIK

стратегия "**вход по тренду — выход по стоп-тейку с закрытием открытой сделки вечером**" способна генерировать небольшой профит в тестах на исторических данныходнако, на незнакомых данных такая стратегия генерирует **переменный результат**... проверял лично... не однократно... на разных инструментах

если кому-то нужно объяснить, что такое переменный результат, обращайтесь... лишаю иллюзий бесплатно и быстро))

**ВЫХОДИТ НА IPO**ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ



Михаил Шардин

Вчера в 07:48



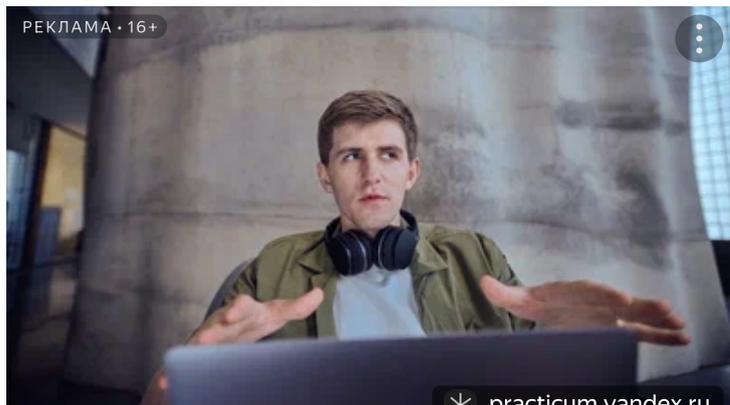
Изменил на Гитхабе — в коде была проблема с часовыми поясами. Данные из API брокера приходят в одном часовом поясе: UTC, а биржа работает в другом часовом поясе (UTC+3).



Напишите комментарий...



ОТПРАВИТЬ



Стать инженером машинного обучения с Яндекс Практикум



GB4240 Полуавтомат. ленточнопильный станок в наличии!



Установите приложение Смартлаба:



ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ, ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ

МОЕХ

Московская Биржа является спонсором ресурса smart-lab.ru

 Jetlend

ВЫХОДИТ НА IPO

ПРИСОЕДИНЯЙТЕСЬ,
ЧТОБЫ СТАТЬ ЧАСТЬЮ
УСПЕШНОЙ ИСТОРИИ