

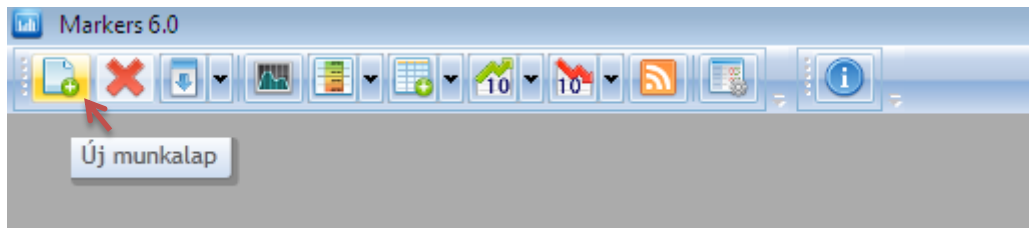
Stratégia létrehozása Markers grafikonrajzoló programban

1. RSI stratégia elkészítése

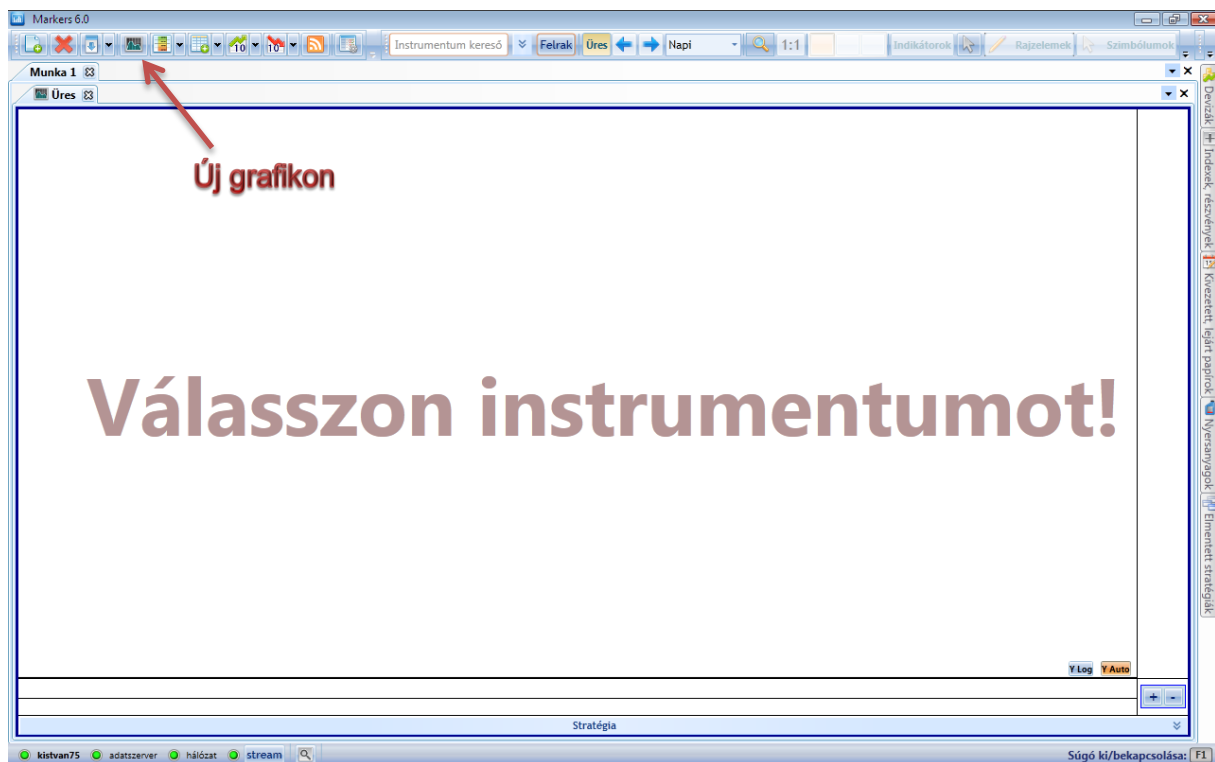
Ebben a leírásban egy egyszerű stratégiát fogunk elkészíteni, amely a méltán népszerű Relative Strength Indexet használja fel a be- és kiszállási pontok megtalálásához. Miután definiáltuk ezeket a pontokat, hozzákapcsolunk kockázatkezelési lehetőséget. Ahhoz, hogy teljes legyen a kép, meg kell adnunk hogy mennyi pénzzel kezdünk kereskedni és milyen kockázatot vállalunk fel. Ezután már konkrét kötéslistákkal és eredményekkel fogunk rendelkezni a stratégiáról. Végül további beállítási lehetőségeket, szűrési opciókat is megadhatunk majd, amellyel tovább tudjuk optimalizálni a stratégiánk eredményességét. Kezdjük is el.....

A RSI stratégia lényege: 60 perces (gyertya) grafikonon fogunk dolgozni. Long beszállót kapunk, ha az RSI(14) értéke 50 fölé zár, short beszállót, ha alá zár. A pozícióba lépés esetén mindig az adott óra szélsőárfolyamait vizsgáljuk. Long esetén a jelzés értékéül szolgáló gyertya maximuma, short esetén a jelzés értékéül szolgáló gyertya minimuma lehet a kereskedési érték. A long zárási és short zárási feltételek megegyeznek a pozíciónyitási feltételekkel, csak természetesen ilyenkor fordítva kell értelmezni, hiszen a long nyitásnak a long zárási feltétele megegyezik a short nyitási feltétellel. A kockázatkezelésnél a Fix Donchian stoppot fogjuk alkalmazni. A kereskedést mivel egy EURUSD devizapáron fogjuk bemutatni, ezért letétnek 10.000\$-t jelölünk meg és beállítjuk azt is, hogy mekkora legyen a tőkeáttétel maximális nagysága és a kezdőtőke mekkora hányadát szeretnénk kockáztatni. A tőkére vetítve a nyereségeket visszaforgatjuk.

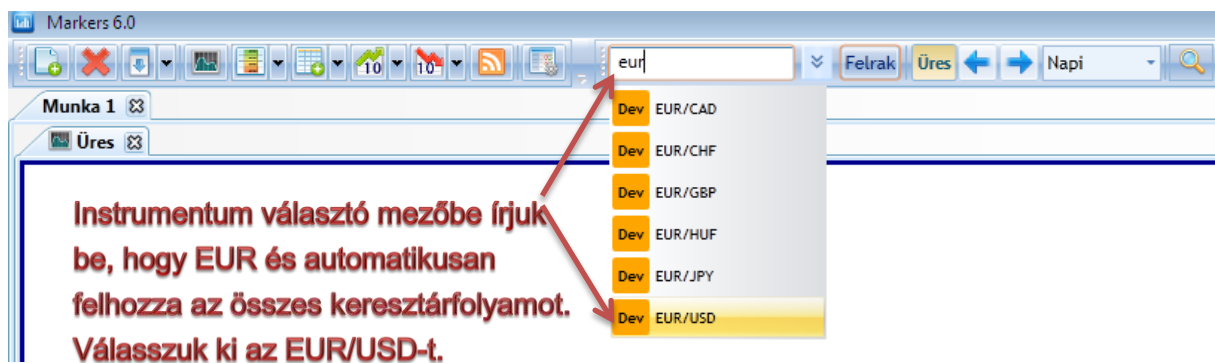
1. Az RSI trendkövető stratégia alapbeállításai
 - 1.1. Első lépés hozzunk létre egy munkalapot.



- 1.2. Kattintsunk az új grafikon ikonra



- 1.3. Válasszuk ki az instrumentumot



- 1.4. Alapból a program egy „napi” bontású gyertya diagrammot hoz fel. Amennyiben nem egyből jön az adat, rásegíthetünk a „Felrak” gombra kattintással. Egyben válasszuk ki milyen idősíkon szeretnénk stratégiát alkotni.



- 1.5. Miután rendelkezésre áll a kiválasztott grafikon, kezdjük el a stratégia felépítését.



1.6. A képernyőn alul megjelenik a modul, ahol elkészíthetjük stratégiánkat.

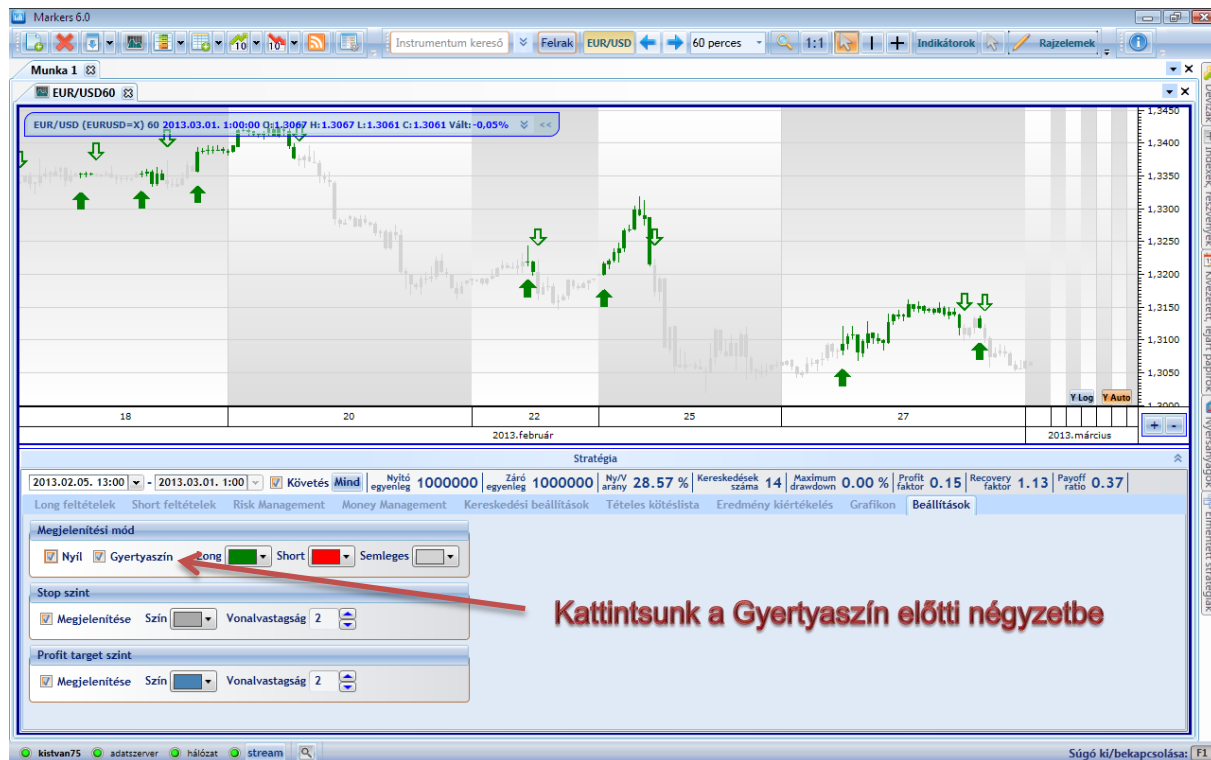


A képernyőn alul látható munkalapok valamint fogalmak leírása a Markers Sugó Pdf letölthető fájlban találhatóak meg. A programból is elérhető az F1 megnyomásával.

1.7. Állítsuk be a long feltételeket a képen látható módon



Amennyiben nem állítottunk be egy pipát a Beállítások munkalapon a megjelenítési módnál a gyertyaszín elé, akkor a grafikon az alapbeállításoknak megfelelően fog megjeleníteni. A Nyíl elé helyezett pipa bekapcsolja azt a funkciót is, hogyha longba lépünk, akkor teli zöld fölfelé mutató nyilat, majd long zárás esetén üres zöld lefele mutató nyilat fog a program kirajzolni. Érdeemes használni ezeket a funkciókat a kötések ellenőrzéséhez.



1.8. Állítsuk be a short feltételeket a képen látható módon



1.9. A Risk management fülön a kockázatkezelés beállítása következik



1.10. A Money management beállítások következnek

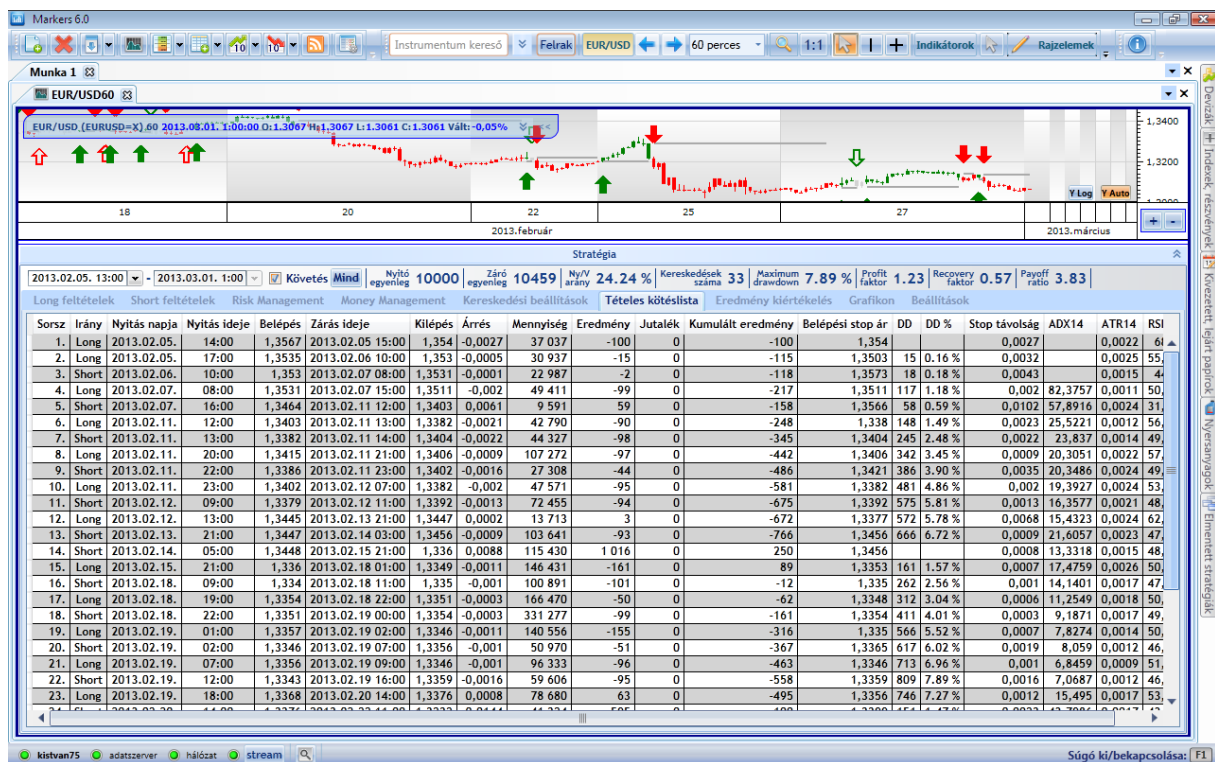


A kezdőtőkét levittük 10000-re, mert EUR/USD görbével kereskedünk, és azt feltételezzük, hogy ezt egy dollár alapú számlával tesszük, amelyen 10.000\$-t helyezünk el, így a nyereségeket és veszteségeket is \$-ban kell számolnunk. A kockázat beállításánál egy pozíción a tőkénk 1%-át kockáztatjuk.

A maximális tőkeáttétel beállítása van még hátra. Ez azt jelenti, hogy a kockázat függvényében mekkora lehet az a maximális pozíció, amit a kezdőtőke függvényében egy pozíción felvehetünk. Ez a beállítás nagyon fontos, hogy az adott bróker cég mit enged nekünk, mert különben hamis jelzéseket is kaphatunk, ha túl nagy pozíciót enged felvenni a program, miközben a pénzünk nem is lett volna elég a kötés teljesítésére. Ez a beállítás egyébként arra is szolgálhat, ha maximalizálni akarjuk az egy kötésnél felveendő pozíció mennyiségét.

1.11. Váltunk át a Tételes kötéslista munkalapra

Érdemes rátekinteni a kötésekre, mert előfordulhat, hogy valamilyen kiugró nyereséget vagy veszteséget látunk, akkor gyanakodhatunk adataibára.



Miután a kötésekre rátekintettünk, fussuk át az eredménysonon milyen adatokat látunk:

A stratégia 2013.02.05-2013.03.01 közötti időszaknak a kötéseit mutatja.

A nyitóegyenleg a beállított 10000\$ volt.

A záróegyenleg a 33db kötés eredményét mutatja.

A maximális drawdown 7,89% lett, amely igen kedvező érték

A Profit factor 1,23 értéke elfogadható

Recovery factor 0,57-es értéke nem jó

Payoff ratio 3,83 a 24,24%-os nyereség veszteség arányt elnézve, semlegesnek mondható.

Az eredmények gyors áttekintése után levonhatjuk a következtetést, hogy ezt a stratégiát érdemes lehet tovább vizsgálni. Először kezdjük az időtáv növelésével, hiszen ez az egy hónap lehet, hogy épp egy semleges állapotot mutat, miközben korábbna lehettek időszakok, amelyek jól sikerültek a stratégiát illetően, és máskor meg lehet, hogy rosszul teljesített volna. Tehát növeljük az időtávot a + jel segítségével.

2. Egyéb beállítások

2.1. Időtáv növelése a „+” jellel

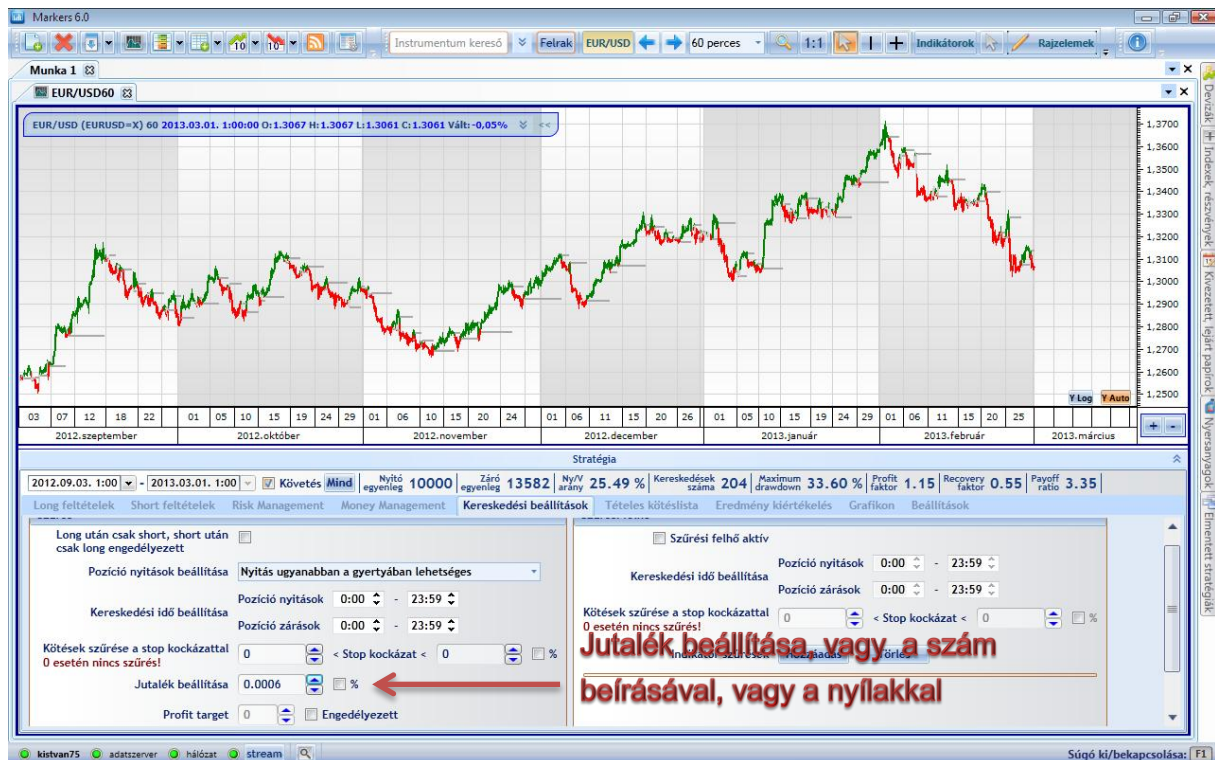


A + jel nyomogatásával behozhatjuk amennyi adatmennyiség a rendelkezésünkre áll. A program a betöltődött plussz adatmennyiséget viszont csak a „Mind” gomb megnyomása után dolgozza fel a stratégia beállításai szerint. A jobb láthatóság miatt a beállítások fülön levettem a nyílat a grafikonról.

Az eredményesség jelentősen javult, így vizsgálatainkat tovább folytathatjuk.

A kötések a 60 perces gyertyák segítségével születtek. A be és kiszállási pontok a gyertyák maximumán vagy minimumán lettek jelölve a kötéseknel. Amennyiben a valósághoz közelítő eredményt akarunk kapni, akkor a be és kiszállási pontokat rontanunk kell. Ezt a programban a jutalék beépítésével oldhatjuk meg. Mivel a forex kereskedés esetén sokszor csak a vételi és eladási láb közötti spread a költség, ezért itt a jutalék nem a klasszikus jelentését szolgálja, hanem a valós kötési helyzet imitálását. A konkrét jutalék mértékének megállapítása egyedi lehet. Az EURUSD gyakorlatilag a leglikvidebb devizapár. Véleményem szerint egy 3 pip-es rontás (1pip=0,0001) reális teljesülést feltételez. A vételi és az eladási lábat is rontanunk kell, így összesen a jutalék mértéke 0,0006 lesz.

2.2. A példában jutaléknak állítsuk be a 0,0006 értéket a „kereskedési beállítások munkalapon”



2.3. A jutalék beállítása után már csak az „Eredmények kiértékelése” és a „Grafikon” munkalapha érdemes kattintani.



Az eredmények kiértékelésénél, amennyiben nem ismerjük az adott fogalom jelentését, akkor nyomjuk meg az F1 billentyűt a Sugó használatához.

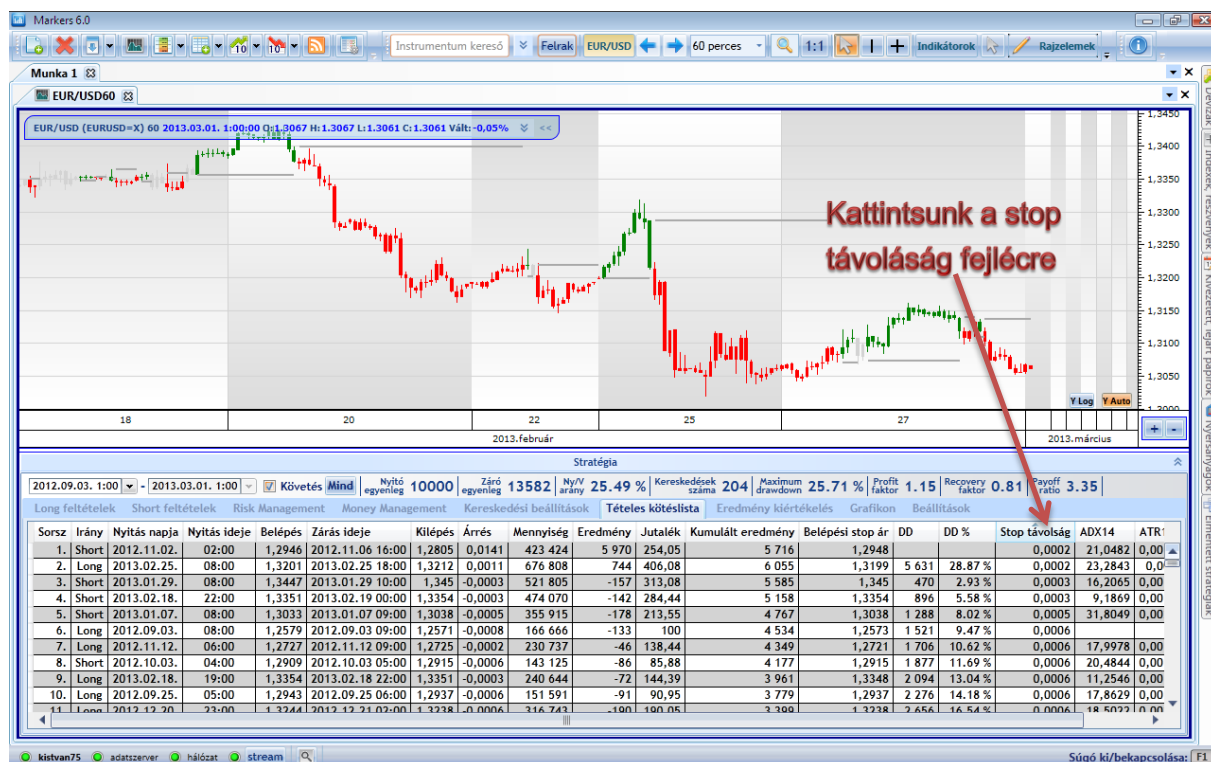
A kumulált eredmény grafikon:



3. Szűrések

A stratégia kész, a következő feladat a szűrési feltételek megvizsgálása lesz. Ezeket vesszük sorba.

3.1. Stop távolság vizsgálata

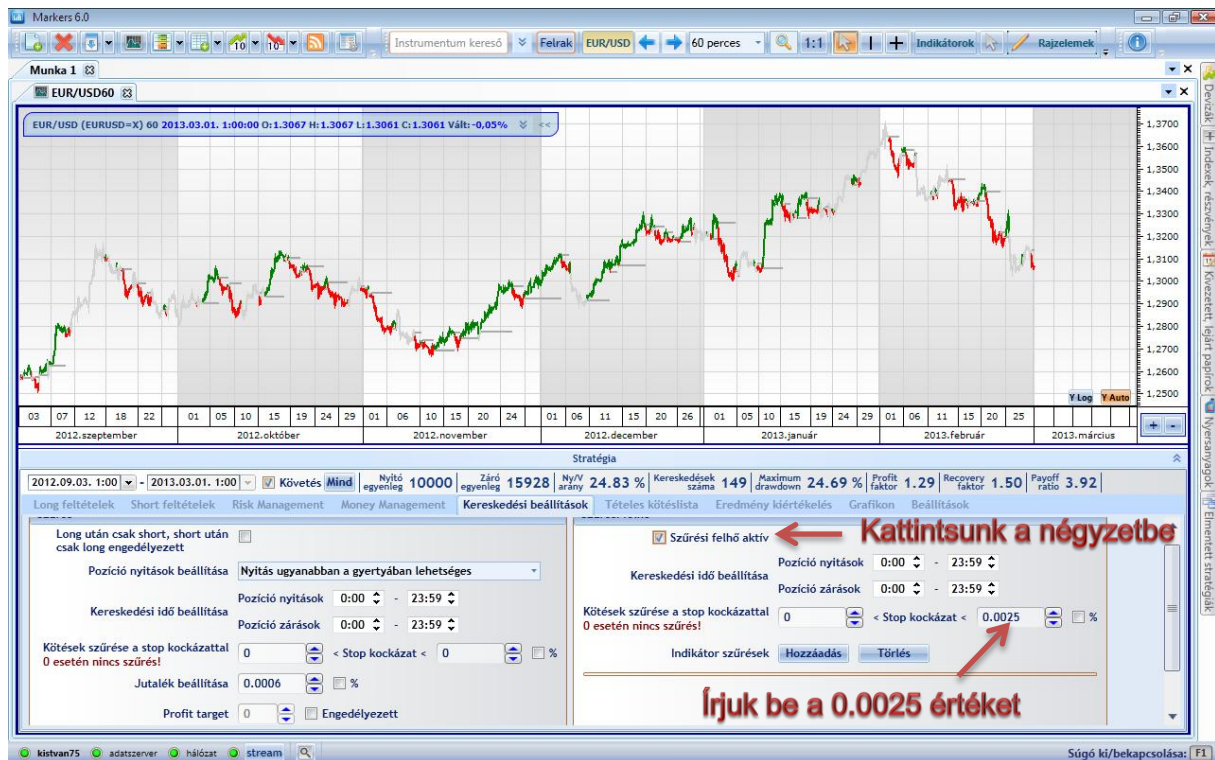


A program sorbarakja a kötéseket a stop távolság szerint a legkisebb értéktől kezdve. Ezek után kattinsunk a Grafikon munkalapra.

A stop távolság vizsgálatának célja, hogy kiderítsük, van-e összefüggés a stop távolság mérete és a kereskedések sikeressége között. A grafikonon azt láthatjuk, hogy az utolsó kb. 45 kötés már stagnálást okozott az eredményességben. A kötéslistából látható, hogy a 0,0025 pipnél nagyobb kockázatú kereskedéseket érdemes lehet kihagyni a kereskedésből.



A rossz kötések kiszűréséhez a következőt tegyük: Kattintsunk a Kereskedési beállítások munkalapra.



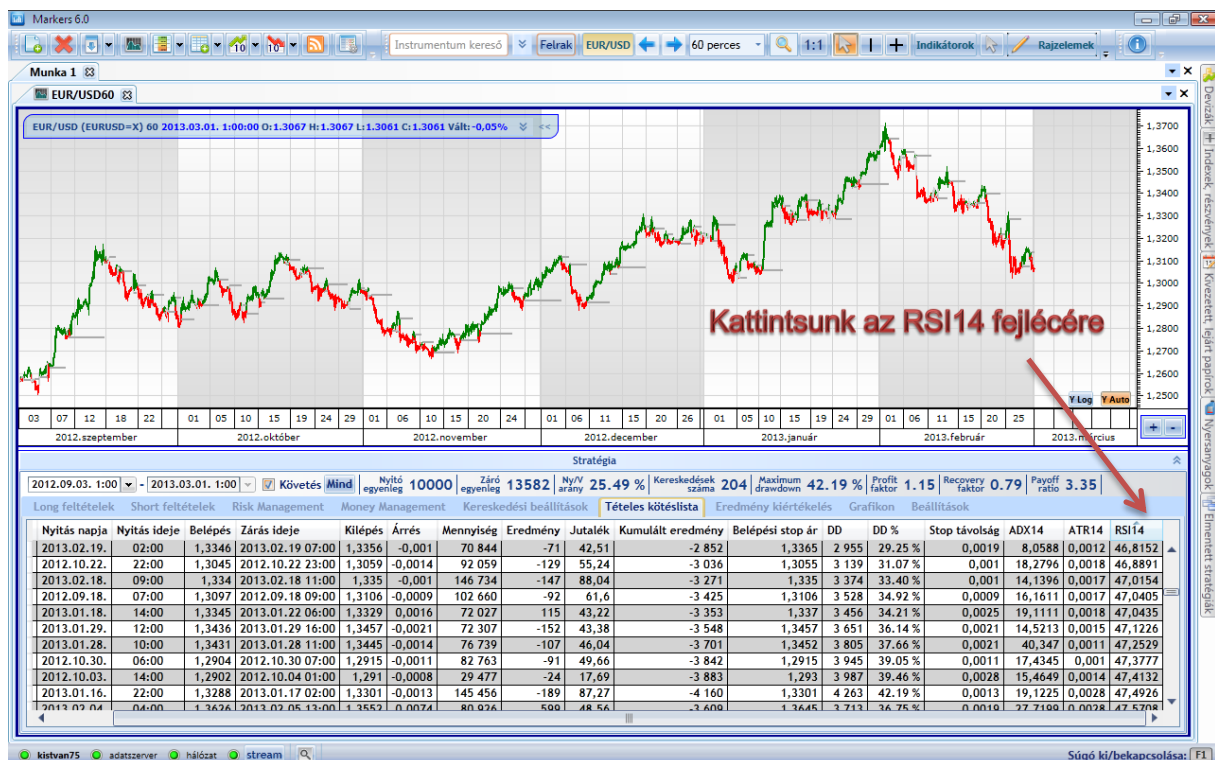
Az eredmény kicsit javult, a 13582\$ helyett 15928\$-t mutat és ami lényeges, hogy a Drawdown lejjebb esett 24.69%-ra a 33,6%-ról, ez viszont nagyon örömteli fejlemény.

A tételes kötéslistában ne feledjük el a nyitás napja szerint sorba rendezni a kötéslistát, mert így kapunk valós adatokat az eredmény kiértékelésnél.

A további szűrések vizsgálata előtt állítsuk vissza a szűrésmentes állapotot, vagyis ne legyen a szűrési felhő bekapcsolva.

3.2. Az RSI14 érték vizsgálata

Mivel RSI alapú stratégiáról van szó, ezért érdemes megvizsgálni, hogy jellemző-e milyen RSI értékek húzódnak a sikeres kereskedések mögött.



Ezek után kattintsunk a Grafikon munkalapra. Az így kialakított nyereség grafikonon sokkal szembeötlőbb, hogy vannak e jellemző értékek amiknél a stratégia látványosan nem működik.



Az eredménygörbére pillantva azt láthatjuk, hogy az első kb. 40 és az utolsó kb. 40 kereskedés összességében már nem járult hozzá aktívan a számlaméret növekedéséhez, sőt tendenciózusan ezek inkább veszteséges üzleteket hoztak. A tételes kötéslistán ha ezt megnézzük mely értékektől alakult ez ki, akkor láthatjuk, hogy a 47-es RSI alatt, míg 53-as RSI érték fölött inkább veszteséges

üzletek vannak. Amennyiben ezeket a kötéseket kiszűrjük, úgy tűnik tovább javíthatjuk a stratégia eredményességét.

Két szűrést végeztünk eddig. Az egyik a stop távolság vizsgálata volt, a másik pedig az RSI értéke. Most vigyük fel ezeket a szűréseket és nézzük meg milyen hatással van a stratégia eredményeire.

A szűrések beállítását a kereskedési beállítások munkalapon tudjuk elvégezni. Aktiváljuk a szűrési felhőt (négyzetbe pipa) és következő képen látható módon vigyük fel először a stop távolsághoz a 0,0025 értéket, majd adjuk hozzá az RSI indikátort és írjuk be elé a 47, mögé az 53-as értéket.



A kumulált nyereség görbe sokkal kisimultabb lett, nincs akkora visszaesés benne, mint korábban. A japán gyertya grafikonon fent is jól láthatóak, hogy megcsappantak a kötések.



Ezek után vessük össze a szűrések előtti és a szűrések utáni eredménykiértékelés táblázatokat.

Szűrések nélkül a következő eredmények születtek:

Összesített eredmény					
Nyitóegyenleg	10000	Záró egyenleg	13582		
Nettó nyereség	3582	Nyitóegyenlegre számított százalékos eredmény	35.82 %	Maximum drawdown	6553
Bruttó nyereség	28917	Bruttó veszteség	-25220	Maximum drawdown %	33.60 %
Kereskedések száma	204	Nyereség/veszteség arány	25.49 %	Profit factor	1.15
Nyereséges kereskedések száma	52	Veszteséges kereskedéseket száma	152	Recovery faktor	0.55
Legnagyobb nyereséges ügylet	5970	Legnagyobb veszteséges ügylet	-420	Payoff ratio	3.35
Átlagos nyereség ügyletenként	556	Átlagos veszteség ügyletenként	-166		

A stop távolság és az RSI szűrése után pedig a következő eredmények születtek.

Összesített eredmény					
Nyitóegyenleg	10000	Záró egyenleg	17435		
Nettó nyereség	7435	Nyitóegyenlegre számított százalékos eredmény	74.35 %	Maximum drawdown	3474
Bruttó nyereség	20084	Bruttó veszteség	-12573	Maximum drawdown %	16.70 %
Kereskedések száma	91	Nyereség/veszteség arány	28.57 %	Profit factor	1.60
Nyereséges kereskedések száma	26	Veszteséges kereskedéseket száma	65	Recovery faktor	2.14
Legnagyobb nyereséges ügylet	5970	Legnagyobb veszteséges ügylet	-420	Payoff ratio	3.99
Átlagos nyereség ügyletenként	772	Átlagos veszteség ügyletenként	-193		

Következtetések:

A nyereség közel duplájára emelkedett. A Drawdown is a felére esett és 20% alatt van. Az összes mutatószám azt mutatja, hogy elméletileg ez egy jó stratégia születhet ebből. Természetesen a helyzetet több dolog is árnyalja, amelyeken nem árt gondolkodni:

- A stratégiát csak kb. 200 kötés segítségével elemeztük. Ez szerintünk kevés, ilyenkor ha rendelkezésre áll próbáljunk még több adat segítségével tesztelni.

- A példa kedvéért már nem változtatunk, mi ugyanezt az adatsort vizsgáljuk még meg más szempontból is.

The screenshot shows the Munka 1.33 application window displaying the EUR/USD60 chart. The chart area has a grid background with green bars for upward price movements and red bars for downward movements. A prominent red arrow originates from the text "Kattintsunk az Nyitás Ideje fejlécre" and points directly to the "Nyitás ideje" header in the first column of the trade history table below the chart.

Ezek után nézzük meg a grafikont.



Az időbeli szűrés ebben az esetben nem sok információt hordoz. Nem jellemző, hogy melyik napszakban nyitunk pozíciót. Amennyiben erőltetnénk ezt a szűrés opciót, akkor sokkal több kötés esetén valószínűleg ki lehetne zárni bizonyos órákat, pl. a grafikon közepén erős a visszaesés, amely a délelőtti órák sikertelenségét mutatja, de nem szignifikáns az esés és kevés a kötés. Ennek következményeként elvetjük az időbeli szűrés alkalmazását. Továbblépünk az ADX szűrésre.

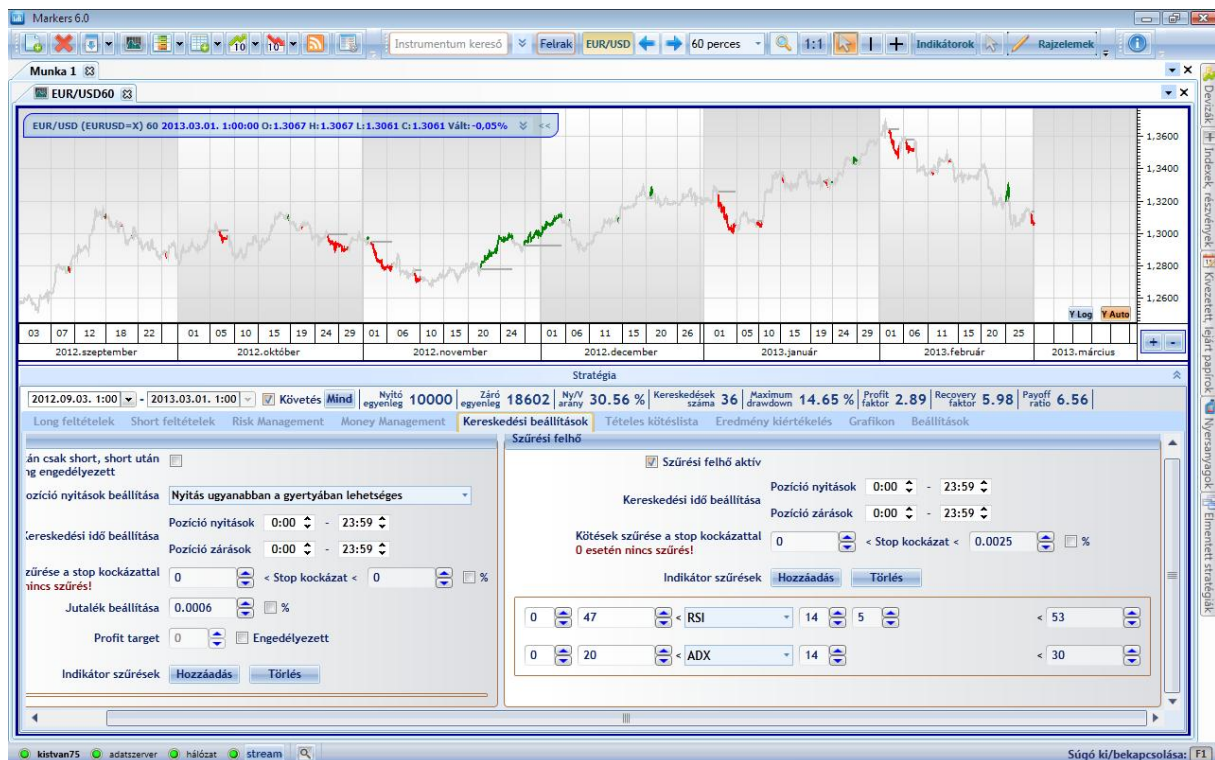
3.4. Az ADX értékének vizsgálata



Hasonlóan sorba kell rendezni az ADX14 oszlopát és rámenni a grafikonra. Ide már csak a nyereséggörbét raktuk be, mivel a folyamat mostmár ismerős lehet.

Ennek a görbéje viszont sokkal beszédesebb, mint az időbeli görbe. Egyértelmű, hogy két szélén inkább veszteségre kell számítani. A tételes kötéslistából megállapíthattuk, hogy az ADX14 a 20-30 között teljesített a legjobban.

Alkalmazzuk ezt a szűrést is és nézzük meg az eredményeket.



A három szűrési feltétel beállítása után a felső eredmény sorban máris láthatjuk, hogy tovább javult az eredményesség. A kötésszám viszont nagyon leesett.

4. Összefoglalás

A stratégia alapvetően semlegesnek indult, de bizonyos összefüggések megtalálása javított az eredményességen. Mik voltak a használható szűrések?

- Viszonylag szűk stop esetén lehetett sikert elérni.
- A stratégia long és shortfelételei az RSI14 50-es értékhez kapcsolódtak. A szűrések megmutatták, hogyha túl távol esett ettől a középértéktől az adott gyertya RSI14 értéke, akkor az nagy valószínűséggel veszteséges lett.
- A harmadik szűrési feltétel a trendidentifikáló ADX indikátorhoz kapcsolódott. A szűrési feltételek azt mutatták, ha nincs trend, vagyis az ADX 14 értéke 20 alatti, akkor oldalazásban nagyobb valószínűséggel veszít. Amennyiben 30 fölé került az érték, akkor viszont már tartott a trend és minél nagyobb volt az érték, valószínűleg egyre kisebb esély volt a nyereségre, hiszen a trend már rég megindulhatott.

Ennek a három egyszerű szűrésnek a bevezetésével radikálisan nőtt a nyereség értéke és ehhez elviselhető visszaesés is párosult. A tesztelés nagy hibája viszont a kevés adat miatti kevés kötőszám. Annak ellenére, hogy igen tekintélyes az eredmény, ez a stratégia önmagában kevés lenne egy egész számlához, de kiegészítésként vagy a sok közül egyik stratégiaként megállná a helyét, így érdemes ezt tovább hangolni, már instrumentumokon is elemezni.