

Независимые рекомендации по настройке PIAviser

В этой небольшой статье я постараюсь предоставить основной минимум необходимой информации о гибкой настройке PIAviser. Советы и рекомендации указанные ниже не относятся к настоящим рекомендациям о настройке советника для получения сигналов на покупку/продажу ЦБ и других инструментов. Достоверность генерации сигналов во многом зависит от взгляда трейдера на рынок как таковой.

Итак начнем, надеюсь все трейдеры работая с PIAviser осознали, что PIAviser это механическая, формализованная торговая система, имеющая четкие торговые алгоритмы, на основе которых программа «генерирует» торговые рекомендации на покупку и продажу акций и фьючерсных контрактов. Она помогает пользователю вести и анализировать свою инвестиционную и спекулятивную деятельность на фондовом и срочном рынке. А каждая механическая ТС имеет функции оптимизации и PIAviser не исключение, в PIAviser есть параметры которые могут оптимизировать заложенный в него торговый алгоритм, причем оптимизация возможна для каждой отдельной ЦБ. Подчеркну, что все ниже изложенное относиться только к акциям т.к. с другими инструментами я не работаю. Поняв суть процесса оптимизации трейдеру не составит труда сделать настройки ТС для любых других инструментов (валюта, фьючерсы, товары, индексы).

Думаю, логичнее начать поэтапно:

1. Выбор ЦБ которые будут использоваться при инвестировании и/или спекуляции(Список доступных ценных бумаг состоит из 24 высоколиквидных акций и 8 фьючерсных контрактов, которые торгуются на Московской Межбанковской Валютной Бирже (ММВБ) и в Российской торговой системе (РТС) в секции FORTS, а также индекса ММВБ.)
2. Выбор торговой тактики
 - а) инвестирование с умеренным риском (с фиксированием убытков).
 - б) инвестирование с повышенным риском (без фиксирования убытков).
 - с) спекулятивная с умеренным риском (только длинные позиции).
спекулятивная с повышенным риском (длинные и короткие позиции).
3. Тестирование ТС на отдельно взятой ЦБ
4. Изменение параметров и переменных торговой системы на отдельно взятой ЦБ (если это необходимо исходя из результатов тестирования)
5. Оптимизация работы (если это необходимо исходя из результатов тестирования)
6. Повторное тестирование и анализ результатов тестирования(сравнение результатов с результатами тестирования до оптимизации).

Самым сложным этапом считаю процесс тестирования и оптимизации. Конечно, он требует усидчивости и навыков, но эти усилия с лихвой окупятся при дальнейшей работе. Поэтому этот процесс нуждается в детальном рассмотрении, который постараюсь описать. Пример приведу по акциям Сбербанка. Допустим после процесса тестирования результаты оставляли желать лучшего из 20 сделок 4 – прибыльные и 16 – убыточные, максимальная просадка счета (MDD) составила до 41,87%, чистая прибыль в процентах к начальному капиталу (NP%) составила до -34,77% , а годовая доходность (YP%) составила до -18,19%. Результаты не из лучших, попробуем поменять значение коэффициента K4 с

28% на 35% (коэффициент K4 определяет месторасположение важного психологического уровня сопротивления и поддержки.). И снова проведем тестирование и вот результаты улучшились и появилась хоть не большая, но прибыль из 32 сделок 18 – прибыльные и 14 – убыточные, максимальная просадка счета (MDD) снизилась до 21.8% (было 34,77%), чистая прибыль в процентах к начальному капиталу (NP%) составила до 4,77% , а годовая доходность (YP%) возросла до 8,19%.

Хотя я не жадный, но попробуем улучшить результаты изменив следующие пять коэффициентов (K1 – K5), которые влияют на чувствительность торговой системы при открытии позиции. Процесс настройки может занять достаточно много времени т.к. подбор наиболее оптимальных значений коэффициентов требует от трейдера перебрать большое количество вариантов. Но результаты будут оправданы. Раскрывать значения по коэффициентам не могу по понятным всем причинам, а вот результаты подгонки приведу. Из 13 сделок (двухсторонних сделок) 9 – прибыльные и 4 – убыточные, максимальная просадка счета (MDD) снизилась до 1,87% (было 21,8%), чистая прибыль в процентах к начальному капиталу (NP%) выросла до 54,77% (было 4.77%), а годовая доходность (YP%) возросла до 53,19% (было 8,19%). существуют в программе и другие коэффициенты, но при настройке коэффициентов важно помнить, что изменение коэффициентов должно быть последовательным.

Совет, не начинайте менять другие коэффициент, не получив прежде желаемый результат от настройки предыдущего. При этом вам следует найти такой диапазон данного коэффициента, при изменении значений внутри которого, эффективность системы остается относительно постоянной. Обязательно оценивайте, как работает набор коэффициентов за последний год. Со временем характер ценовой динамики может меняться. Это может происходить из-за прихода на рынок новых сильных участников или из-за ухода с рынка старых ведущих участников, а также из-за смены торговых тактик участниками и др. Бывает так, что торговые тактики, которые прекрасно работали год или два назад, сейчас работают хуже или совсем плохо. Поэтому, и инвестору и трейдеру нужно постоянно меняться вслед за рынком, чтобы зарабатывать.

Оценить качество «генерируемых» сигналов и получить сведения для настройки коэффициентов, можно, изучив реестр убыточных сделок. Если вас не устраивает качество открытия позиции, то попробуйте изменить коэффициенты с K1 по K6, а также K21, K22, K23.

Основная группа коэффициентов (с K7 по K20) используется для определения размеров защитных приказов. Общий принцип по настройке коэффициентов таков: чем выше волатильность рынка, тем больше размер коэффициента. Если вам не нравится качество закрытия позиции, то вы можете указать другие значения защитных коэффициентов (с K7 по K20) или изменить торговую тактику с помощью включения/выключения «тэйк-профитов».

На этом, пожалуй, и закончу свою статью. Всем желаю успехов, как в торговле, так и в настройке PIAdviser.

Андрей Лапкин,
частный трейдер