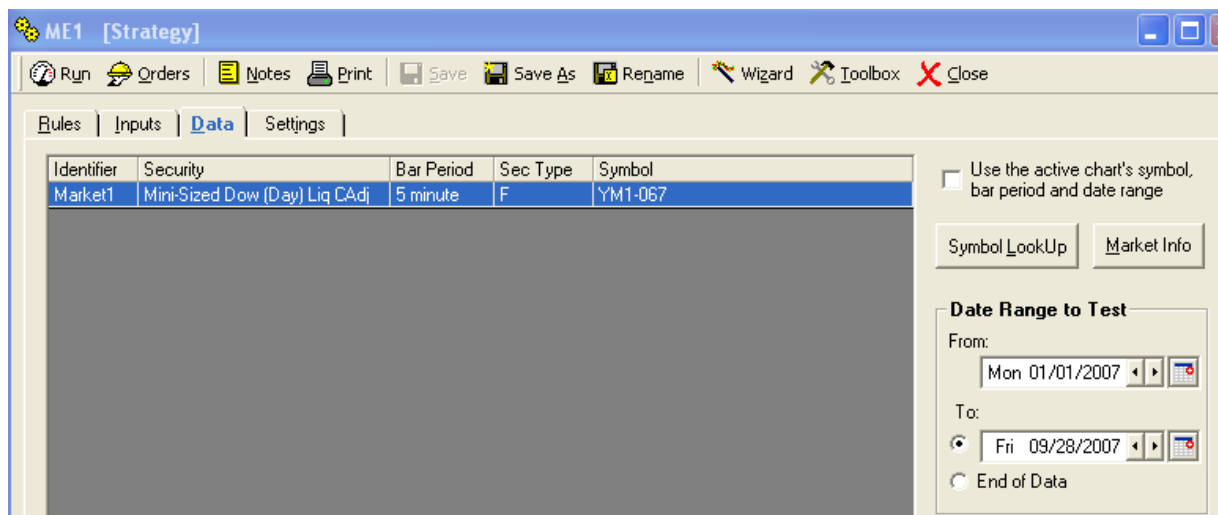


jsem tu nový, tohle fórum sleduju příležitostně a až dosud jsem tak nějak neměl o čem napsat a jak se říká přispět tak i svojí troškou do mlýna. Předesílám na úvod že prozatím ještě neobchoduju naživo ale rád bych to v blízké budoucnosti napravil. A právě zde je moment, o kterém bych rád napsal pár řádků. Je to takovej můj mini příběh o tom jak jsem vyšel, šel,..upadl, šel, upadl, upadl a šel a kam až jsem zatím došel ☺

Takže, o trading se aktivně zajímám asi rok. Ze začátku hlavně hodně četba, sbírání a skládání informací, prostě klasika. Hodně se mi jako nástroj líbí Genesis TN Platinum a jeho TradeSense. Kdysi jsem objektivě programoval, takže přechod nebyl až tak dramatický. S mým profilem coby obchodníka je to horší, protože věřím jak na mechanické systémy tak i na diskreční přístup což nevím jestli je zcela normální, ale nějak to zatím neřeším. Diskreční přístup mi přijde že rozhodně ano, dostat grafy do hlavy, ale ve finále je to stejně soubor nějakých pravidel, které když to, co je mezi ušima (mozek) uvidí, tak zavelí jdi do pozice, protože říká se, že úspěšný trader = cvičená opice bez emocí ☺ takže, vrací mě to na začátek, že je to o způsobu a přístupu jak přesně dokážu popsat ten či onen moment v trhu abych mohl prostě příště až se ten stejný zase objeví říct, hele hele to je ten a ten „pattern“ a tím si i otestovat jeho pravděpodobnost úspěchu na ose času a co dokáže nadělit a co sebrat. Když uvážím že opravdu nikdo nemůže s naprostou jistotou říct kam půjde Next Bar, pak už mi jen fakt zůstává ta pravděpodobnost a správný money management okořeněno 60ti % dávkou psychologie. A právě tohle mě u mechanického systému osobně velmi vyhovuje, že mi vlastně nastavuje zrcadlo v tom, že vidím jak dobře nebo nedobře jsem to, co jsem viděl v grafech popsal a jaký to mělo výsledky. No a pokud bude právě mnou „dobře popsáno a otestováno“ vím, že počítač už pak dál chybu neudělá a nezapomene, stejně jako trh. Hodně dám na pravidlo: „dělej to pořád stejně“ a pravděpodobnost a money management to dodělá za tebe. Faktem je, že všechno má rub i líc a beru i to, že jak se říká sjet si vlnku naživo a ne v režimu „auto pilota“ má hodně do sebe. Ale proč i v tomhle nepoužít trochu diverzifikaci a jet odděleně třeba oboje, s tím, že přeci jen člověk má takovej jako lepší pocit, že tam v rohu něco tiká, a hlídá mi ty životní náklady ☺ a jestli na trhu není čirou náhodou příležitost takového ražení, tě to bije do očí ze vzdálenosti 2 metrů.

ať to není jen písmo, přiložím pár obrázků z posledních mých testů ☺

jsem začátečník a proto moje volba padla na pomalejší trh YM1-067 TF 5min:



jako simulaci komisních poplatků jsem střílel \$30 viz. níže a vstupy jsou vždycky s 2 kontrakty.

ME1 [Strategy]

Run Orders Notes Print Save Save As Rename Wizard Tools

Rules Inputs Data **Settings**

Fees
Commission/Slippage fees to be paid for futures: per contract round-turn
Commission/Slippage fees to be paid for stocks: per transaction

Number of Shares
When trading stocks, trade: shares per transaction

Allow Entries to Reverse
 Allow entries to reverse an open position

Limit Order Fills
 When backtesting, consider a limit order to be filled only if the market trades through the limit price

Bars Required to Test
The number of bars required to test this strategy (for example, if a 50 bar moving average is used in your strategy then the number entered here must be at least 50).

Estimated Length of Longest Trade
The estimated length (in bars) of your longest trades (for example, if the longest trade generated by this strategy may be up to 1 year in duration and you are testing daily bars, then the number entered here must be at least 255).

Pyramiding
 Allow Pyramiding: multiple entries into same position
(for example, if already in a long position, additional long signals can be taken)
Maximum number of open entries per position:

snažil jsem se to moc nepřeoptimalizovat, nevím jak moc dobře se mi to podařilo 😊 jen po prvním průchodu jsem vyšel z průměrných hodnot MAE/MFE abych jak jsem si říkal nebyl úplně mimo mísu. Myslím si, že každý trh je v tomhle asi svůj a tak nějak jsem mu to nechtěl na sílu brát. Když se to pustí na Backtest za období posledního roku (víc zatím nemám data) vypadá to takhle: (... zkušenější prominou, jestli to příliš drásá do očí, začátek je vždycky prostě jen začátek)

Summary - All Trades

Overall

Total Net Profit:	\$8,950	Profit Factor (\$Wins/\$Losses):	2.30
Total Trades:	76	Winning Percentage:	60.5%
Average Trade:	\$118	Payout Ratio (Avg Win/Loss):	1.50
Avg # of Bars in Trade:	47.18	Z-Score (W/L Predictability):	-3.6
Avg # of Trades per Year:	104.0	Percent in the Market:	23.8%
Max Closed-out Drawdown:	-\$1,380	Max Intraday Drawdown:	-\$1,410
Account Size Required:	\$2,490	Return Pct:	359.4%
Open Equity:	\$0	Kelly Ratio:	0.3420
Current Streak:	2 Wins	Optimal f:	0.31

Winning Trades

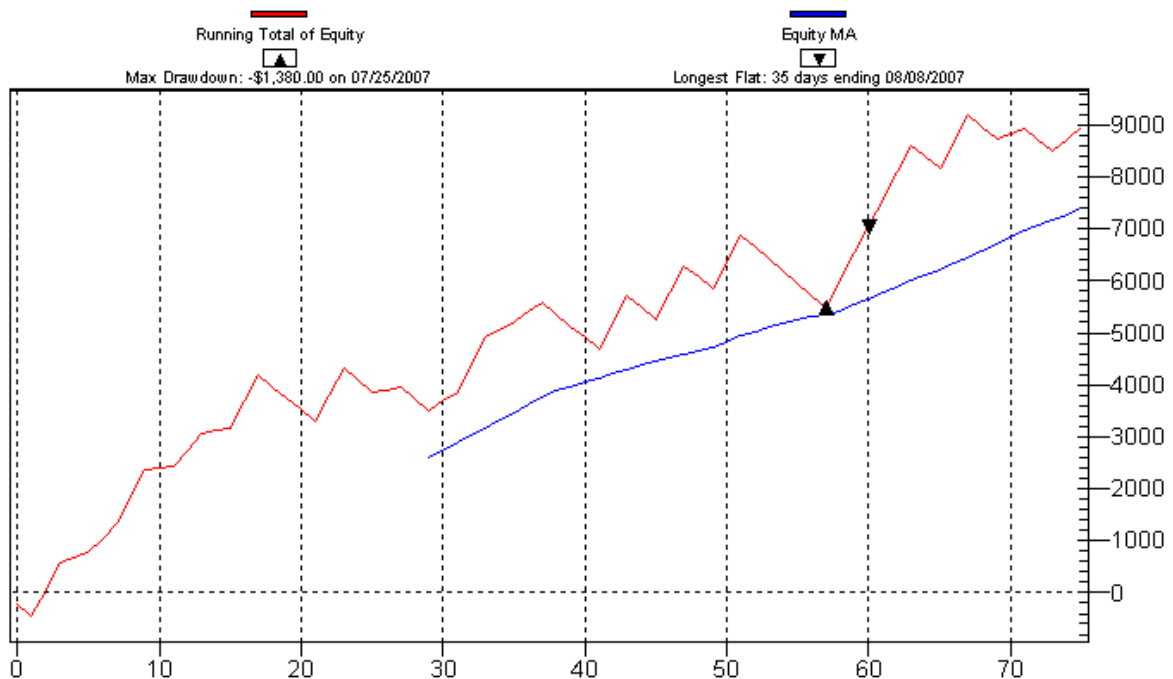
Total Winners:	46
Gross Profit:	\$15,840
Average Win:	\$344
Largest Win:	\$520
Largest Drawdown in Win:	-\$220
Avg Drawdown in Win:	-\$117
Avg Run Up in Win:	\$409
Avg Run Down in Win:	-\$117
Most Consec Wins:	16
Avg # of Consec Wins:	4.18
Avg # of Bars in Wins:	64.22

Losing Trades

Total Losers:	30
Gross Loss:	-\$6,890
Average Loss:	-\$230
Largest Loss:	-\$230
Largest Peak in Loss:	\$190
Avg Peak in Loss:	\$67
Avg Run Up in Loss:	\$67
Avg Run Down in Loss:	-\$230
Most Consec Losses:	6
Avg # of Consec Losses:	2.73
Avg # of Bars in Losses:	21.07

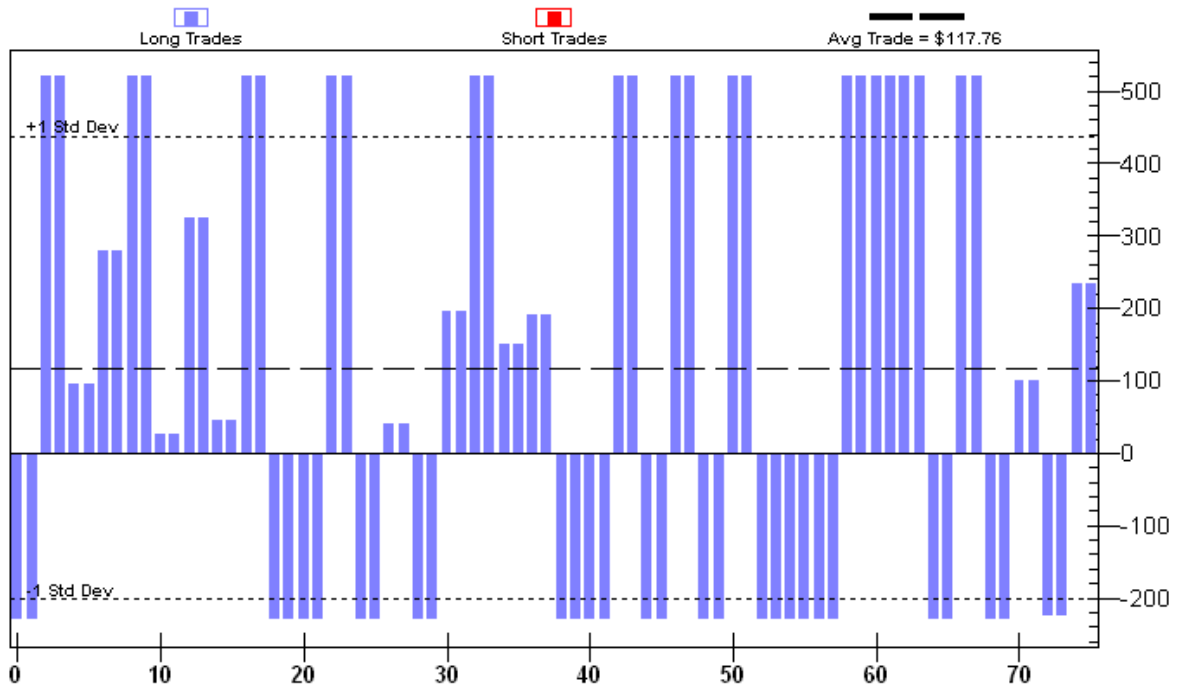
ekvita je sice zubatá, a asi i přílišná, ale leze nahoru ☺

Equity Curve



z pohledu jednotlivých obchodů to potom vypadá takhle:
(celé to je teda postaveno zatím jen na stranu Long...)

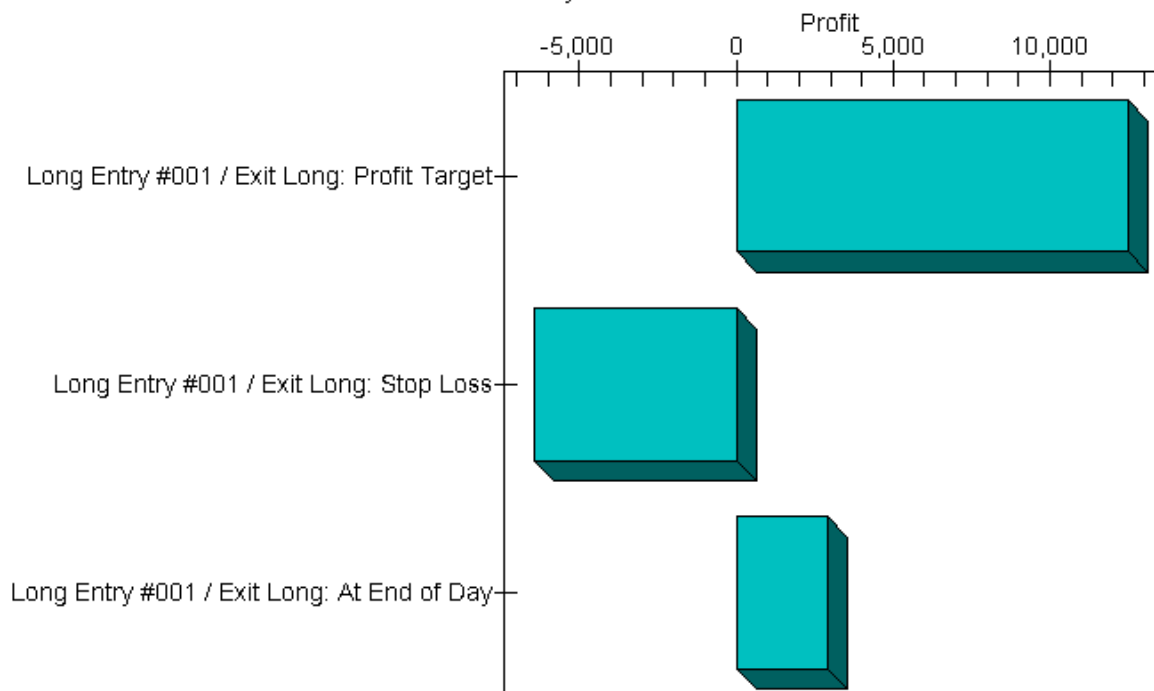
Profit Per Trade



a ještě z pohledu „výkonnosti a nebo nevýkonnosti“ vstupů a výstupů:

By Entry/Exit Signal

by Profit



no a to je vše,... kam jsem zatím došel a teď právě přichází to závěrečné dilema ☺

poleze takhle ekvita i v reálu ?... celou strategii beru jako „motor“ který nějak jede, nebo nejede a k jeho diagnostice slouží ukazatele typu RRR, Win%, Avg Trade,.. respektive je vůbec z pohledu pravděpodobnosti šance že by právě tahle strategie s těmito parametry mohla vůbec v reálu fackčit? jasně, odpověď nepřijde dřív než se to vyzkouší, což plánuju udělat, ale přece jen zkušené oko může pomoci a poradit jak to líp přežít, za což bych byl opravdu moc vděčný.

ambice samozřejmě říkají víc a houšť a větší kapky, ale vím, že nic nevím a proto pro začátek, nechat se ošlehat v obličeji trhem, mi bude stačit pokrýt své obyčejné životní náklady, zcela nijak nevybočující z normálu, abych si tak nějak mohl koupit svůj čas, který bych potom dál jako reinvestici mohl věnovat tradingu ☺ protože bez toho to prostě nejde a já pro sebe beru trading spíš jako svým způsobem životní styl, se kterým si dokážu představit i zestárnout ☺ na rozdíl od jiných profesí v dnešní době...

Jde mi především o myšlenku, jestli ta jako princip pracuje správně.

Ztráty jsou nezbytné, fajn, beru to, ale jak je co nejefektivněji zminimalizovat? Protože když připustím že jsou opravdu to jediné co můžu ovlivnit, nic jiného asi ani nezbyvá .Jedna moudrá myšlenka říká že není důležité jestli mám nebo nemám pravdu, ale kolik mě to bude stát, když ji mít nebudu. A s tím úzce z mého pohledu souvisí i to jak dlouho to ustojím, že ? ☺

Protože v mém okolí neznám nikoho, kdo by si po sdělení že se zabývám tradingem nepoklepal na čelo, přirozeně by mě zajímal názor zkušenějších traderů, kteří tyhle porodní bolesti mají už za sebou ☺ no a třeba tohle i zároveň někomu v podobné situaci rovněž pomůže, nebo inspiruje k něčemu dalšímu, a o to si myslím že jde především,...

jamal