

Стратегия "vt SMA Crossover"

Уведомление и отказ от ответственности

ВАЖНО! Обязательно прочитайте это уведомление. Покупка стратегии "vt SMA Crossover" означает ваше согласие с этим уведомлением.

1. **Риски:** Трейдинг на финансовых рынках сопряжен с риском частичной или полной потери торгового капитала.
2. **Гарантия результата:** Результаты в прошлом не гарантируют результатов в будущем.
3. **Отказ от ответственности:** Авторы стратегии "vt SMA Crossover" не несут ответственности за возможные потери, связанные с применением представленной стратегии.

* * *

Стратегия "vt SMA Crossover" распространяется среди трейдеров в следующих целях:

1. Продемонстрировать превосходство **автоматизированного** трейдинга над ручным.
2. Продемонстрировать превосходство **механического** подхода к трейдингу над дискреционным.
3. Помочь трейдеру **ускорить переход** от ручного трейдинга к автоматизированному.
4. Продемонстрировать положительные стороны **оптимизации** стратегий и преимущества глубокого **анализа** результатов оптимизаций.

Оглавление

Уведомление и отказ от ответственности	1
Что входит в пакет	2
Как работает стратегия "vt SMA Crossover"	3
Настройки стратегии	3
Как запустить стратегию в исторический тест в визуальном режиме	5
Как запустить стратегию в оптимизацию.....	7
Как проанализировать результат бэктеста или оптимизации.....	7
Как запустить стратегию в демо или лайв режиме.....	7
Соответствие параметров работа в платформе и таблицах Excel.....	9

Что входит в пакет

Для достижения поставленных целей авторы стратегии включают в пакет следующие материалы:

1. Файл стратегии для тестирования в визуальном режиме на платформе JForex – "vt_SMA_Crossover.jfx".



Рис. 1. Визуальный тест на истории – робот совершает сделки.

2. Файл стратегии для изучения в визуальном конструкторе Visual JForex – "vt_SMA_Crossover.vfs".

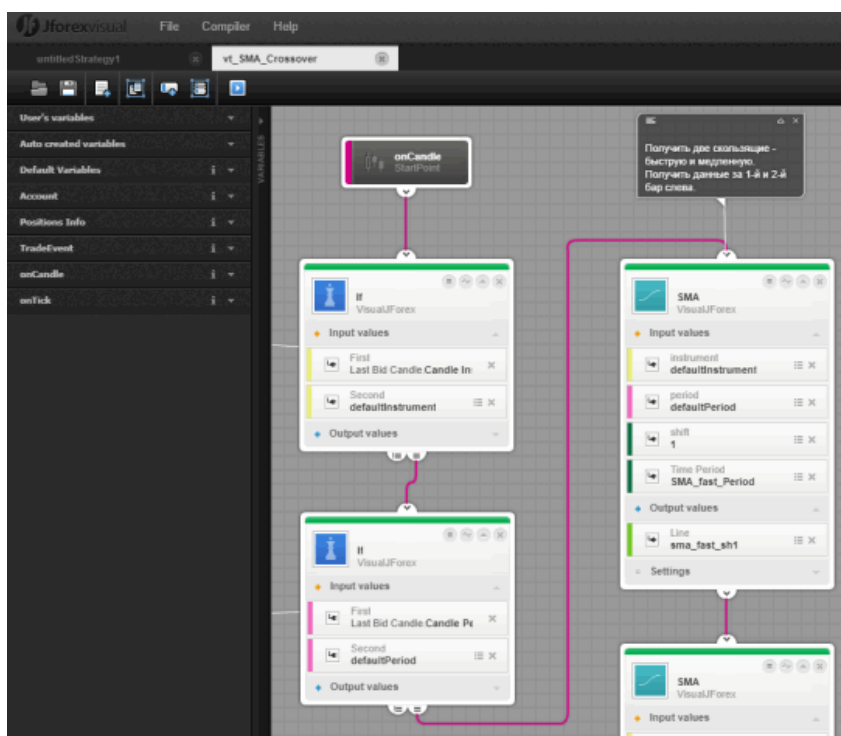


Рис. 2. Интерфейс конструктора стратегий Visual JForex.

3. Файлы Excel – это результаты оптимизации данной стратегии по валютной паре EUR/USD на исторических котировках с 2 января 2018 по 26 апреля 2019 г. (всего – 16 месяцев). Эти файлы содержат очень подробную статистику о результате каждого запуска. Всего собрано данных о **8120** запусках.

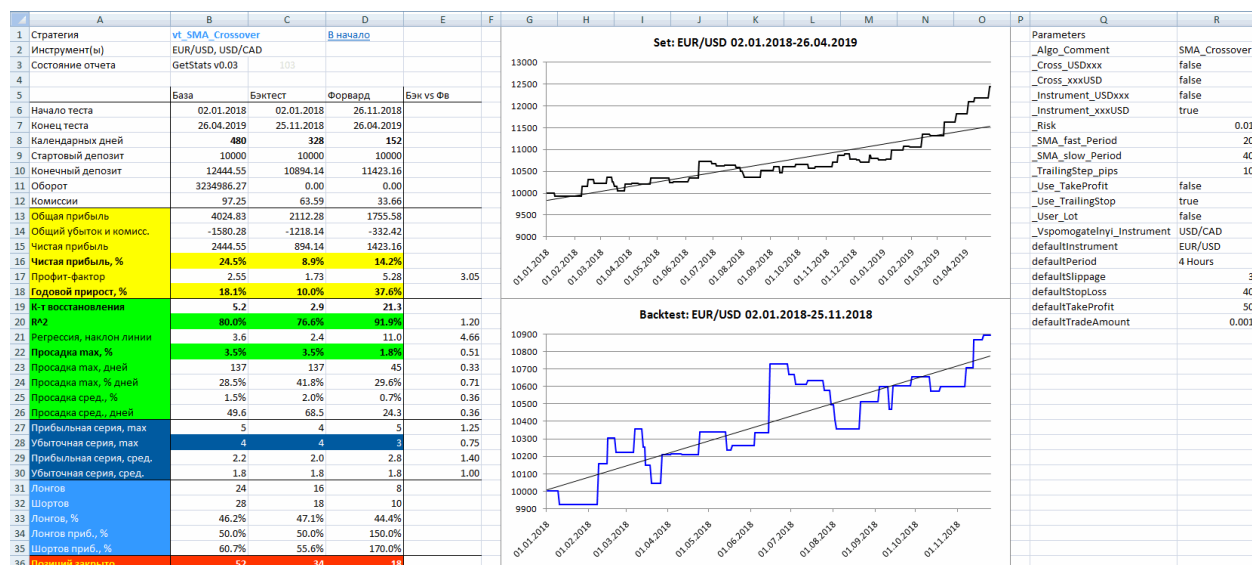


Рис. 3. Результат одного из тестов.

Как работает стратегия "vt SMA Crossover"

Стратегия совершает сделки на пересечении двух простых скользящих средних. Периоды скользящих, а также множество других настроек задает пользователь. Далее подробно о настройках.

Настройки стратегии

Для полной гибкости в работе стратегия содержит множество настроек.

- РАБОЧИЙ ТАЙМФРЕЙМ**
Выберите любой доступный таймфрейм в платформе JForex.
- РАБОЧИЙ ИНСТРУМЕНТ**
Любой инструмент из доступных, по которому совершаются сделки.
- Рабочий инструмент 1-го типа – xxxUSD**
Поставьте флажок, если ваш инструмент – валютная пара с USD в знаменателе либо акция, индекс, которые котируются в USD. В остальных настройках "Рабочий инструмент..." снимите флажки.
- Рабочий инструмент 2-го типа – USDxxx**
Поставьте флажок, если ваш инструмент – валютная пара с USD в числителе. В остальных настройках "Рабочий инструмент..." снимите флажки.
- Рабочий инструмент 3-го типа – кросс с xxxUSD**
Поставьте флажок, если ваш инструмент – валютный кросс либо индекс или CFD на акцию, которые котируются не в долларах США. Валюта, в которой они котируются, должна

образовывать пару с USD в виде "xxxUSD". Например, эта настройка подходит для рабочего инструмента EUR/GBP или CFD на акции, котирующиеся в GBP, поскольку валюта котирования образует пару с долларом в виде GBP/USD. Таким образом, GBP/USD становится вспомогательным инструментом. Обязательно укажите его в настройке ниже (№ 7). В остальных настройках "Рабочий инструмент..." снимите флажки.

6. **Рабочий инструмент 4-го типа – кросс с USDxxx**
Поставьте флажок, если ваш инструмент – валютный кросс либо индекс или CFD на акцию, которые котируются не в долларах США. Валюта, в которой они котируются, должна образовывать пару с USD в виде "USDxxx". Например, эта настройка подходит для рабочего инструмента EUR/CHF или CFD на акции, котирующиеся в CHF, поскольку валюта котирования образует пару с долларом в виде USD/CHF. Таким образом, USD/CHF становится вспомогательным инструментом. Обязательно укажите его в настройке ниже (№ 7). В остальных настройках "Рабочий инструмент..." снимите флажки.
7. **Вспомогательный инструмент (если тип 3 или 4)**
Задайте вспомогательный инструмент, если ваш инструмент 3-го или 4-го типа. См. выше.
8. **БЫСТРАЯ SMA**
Период быстрой простой скользящей средней, SMA. Должен быть меньше периода медленной SMA, иначе стратегия остановится.
9. **МЕДЛЕННАЯ SMA**
Период медленной простой скользящей средней, SMA. Должен быть больше периода быстрой SMA, иначе стратегия остановится.
10. **Включить пользовательский лот**
Поставьте галочку, если хотите указать объем сделки самостоятельно. Объем сделки по правилам использования роботов указывается в **миллионах** единиц базового актива.
11. **Пользовательский лот, млн**
Задайте ваш лот в миллионах единиц базового актива. Например, для покупки 25000 EUR/USD укажите 0.025. При выключенной настройке № 10 значение из этого поля не используется.
12. **РИСК (потеря X от капитала при стоп-лоссе)**
Укажите, какую долю от капитала вы готовы потерять при срабатывании стоп-лосса. Например, 0.01 – это 1% от капитала. Эта настройка работает при выключенном пользовательском лоте – снимите флажок в поле № 11.
13. **СТОП-ЛОСС, пп**
Задайте стоп-лосс в пунктах.
14. **Включить тейк-профит**
Поставьте флажок, если хотите использовать тейк-профит для каждой сделки.
15. **ТЕЙК-ПРОФИТ, пп**
Задайте размер тейк-профита в пунктах, если включена предыдущая настройка.
16. **Проскальзывание, пп**
Задайте проскальзывание при открытии позиции в пунктах.
17. **Включить трейлинг-стоп**
Поставьте флажок, если хотите использовать трейлинг-стоп (подтягивание стоп-лосса по мере увеличения прибыли по позиции).
18. **Трейлинг-стоп, пп (минимум 10 пп)**
Задайте размер трейлинг-стопа, если включена предыдущая настройка. Минимальный шаг отслеживания – 10 пунктов.

19. Метка позиции (если вкл. Несколько роботов)

Задайте значение комментария к позиции. Эта настройка может пригодиться только в случае одновременного запуска нескольких таких роботов на разных или одном инструменте. Для запуска каждого нового робота необходимо создать отдельный файл робота с новым именем и с разными комментариями к позиции.

Переменная	Значение
1. РАБОЧИЙ ТАЙМФРЕЙМ:	Hourly
2. РАБОЧИЙ ИНСТРУМЕНТ:	EUR/USD
3. Рабочий инструмент 1-го типа - xxxUSD:	<input checked="" type="checkbox"/>
4. Рабочий инструмент 2-го типа - USDxxx:	<input type="checkbox"/>
5. Рабочий инструмент 3-го типа - кросс с xxxUSD:	<input type="checkbox"/>
6. Рабочий инструмент 4-го типа - кросс с USDxxx:	<input type="checkbox"/>
7. Вспомогательный инструмент (если тип 3 или 4):	EUR/USD
8. БЫСТРАЯ SMA:	10
9. МЕДЛЕННАЯ SMA:	20
10. Включить пользовательский лот:	<input type="checkbox"/>
11. Пользовательский лот, млн:	0.001
12. РИСК (потеря X от капитала при стоп-лоссе):	0.01
13. СТОП-ЛОСС, пп:	30
14. Включить тейк-профит:	<input type="checkbox"/>
15. ТЕЙК-ПРОФИТ, пп:	40
16. Проскальзывание, пп:	3
17. Включить трейлинг-стоп:	<input type="checkbox"/>
18. Трейлинг-стоп, пп (минимум 10 пп):	10
19. Метка позиции (если вкл. несколько роботов):	SMA_Crossover

Рис. 4. Все параметры стратегии.

Как запустить стратегию в исторический тест в визуальном режиме

Скачайте платформу [JForex](#) от Dukascopy. Создайте демо-счет – [анкета](#).

1. Откройте платформу и перейдите во вкладку "Исторический тестер". Если ее нет, проследуйте: строка меню – "Вид" – "Исторический тестер".

2. Нажмите "Открыть" для выбора стратегии из списка.
3. Найдите файл vt_SMA_Crossover.jfx.
4. Нажмите "Открыть".
5. Поставьте флажок напротив "Режим Визуализации".

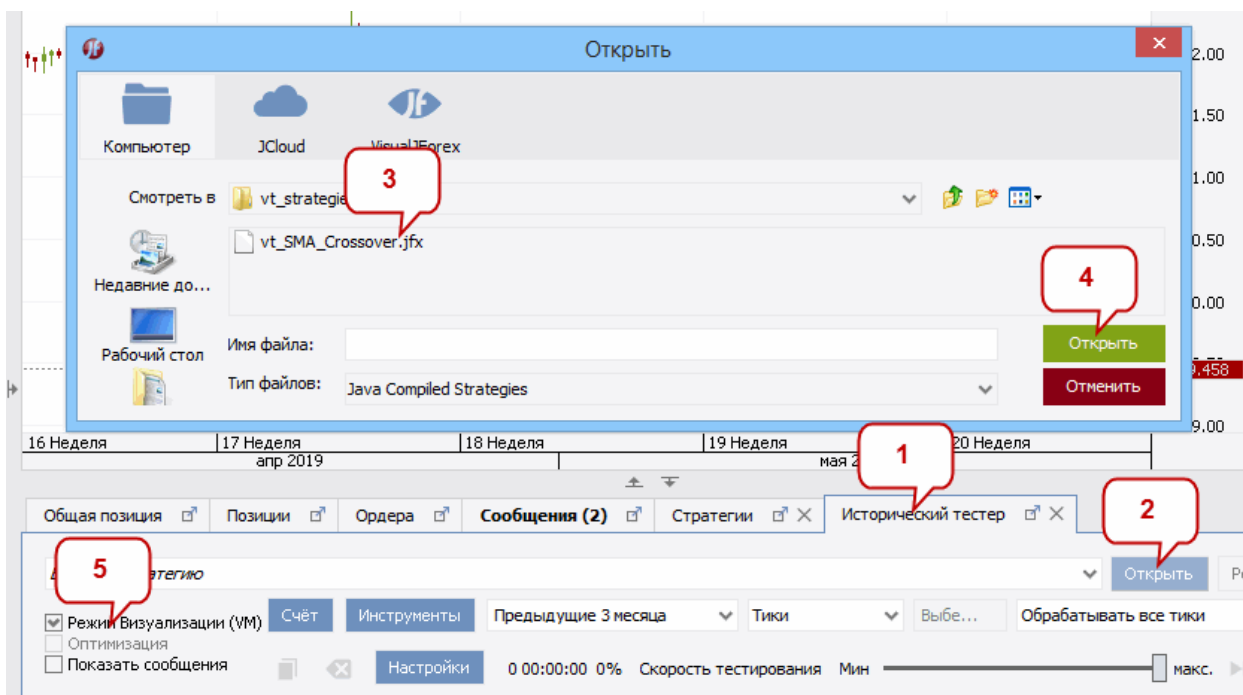


Рис. 5. Настройка теста в режиме визуализации.

6. Выберите рабочий инструмент и, при необходимости, - вспомогательный из настройки № 7.
7. Перед тестом задайте стартовый депозит.
8. Задайте окно тестирования.
9. Задайте качество тестирования. Тики – высшее качество.
10. Нажмите "Запуск".

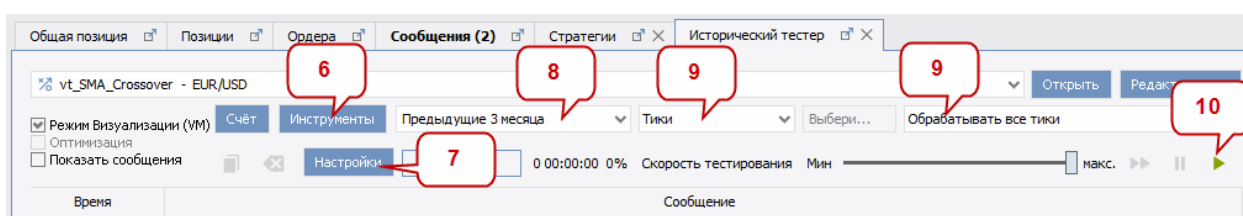


Рис. 6. Запуск теста в режиме визуализации.

11. Определите параметры стратегии и нажмите "Запустить".

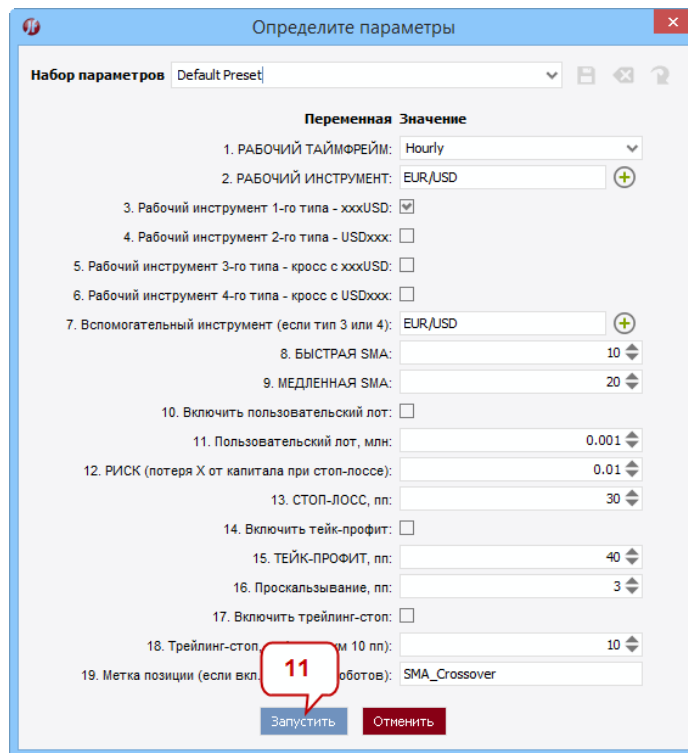


Рис. 7. Настройка параметров стратегии перед запуском.

Как запустить стратегию в оптимизацию

Запуск оптимизации мало чем отличается от запуска в визуальном режиме. См. инструкции выше и в пункте 5 задайте "Оптимизация". Пункт 9 (качество тестирования) будет неактуальным. Далее так же задайте параметры стратегии и запустите оптимизацию.

Как проанализировать результат бэктеста или оптимизации

Отчет о бэктесте или множество отчетов оптимизации можно обработать в Excel нашей надстройкой GetStats. Узнать подробнее и скачать [здесь](#).

Как запустить стратегию в демо или лайв режиме

1. Откройте вкладку "Стратегии". Если ее нет, проследуйте: строка меню – "Вид" – "Стратегии".
2. Нажмите "Открыть" – изображение папки.
3. Выберите файл стратегии vt_SMA_Crossover.jfx.
4. Нажмите "Открыть".

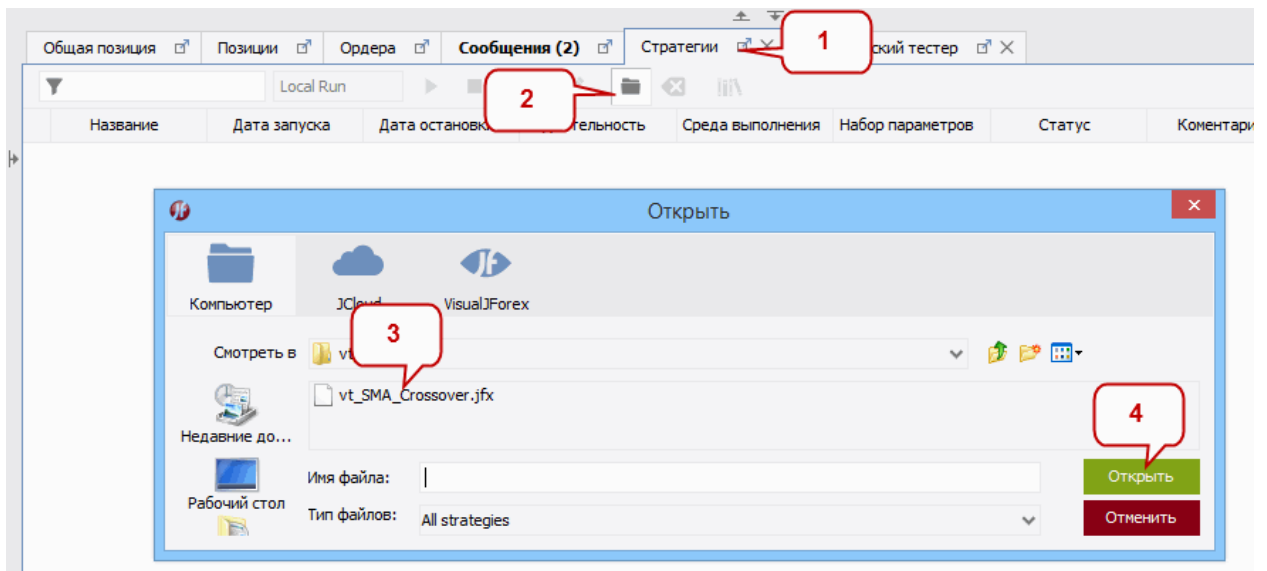


Рис. 8. Выбор стратегии для запуска в демо или лайв режиме.

5. Нажмите "Запустить". Есть 2 варианта запуска: "Local Run" – запуск на локальном компьютере, "Remote Run" – запуск на удаленном сервере Dukascopy. Выберите в окошке левее кнопки запуска.
6. Определите параметры стратегии и нажмите "Запустить".

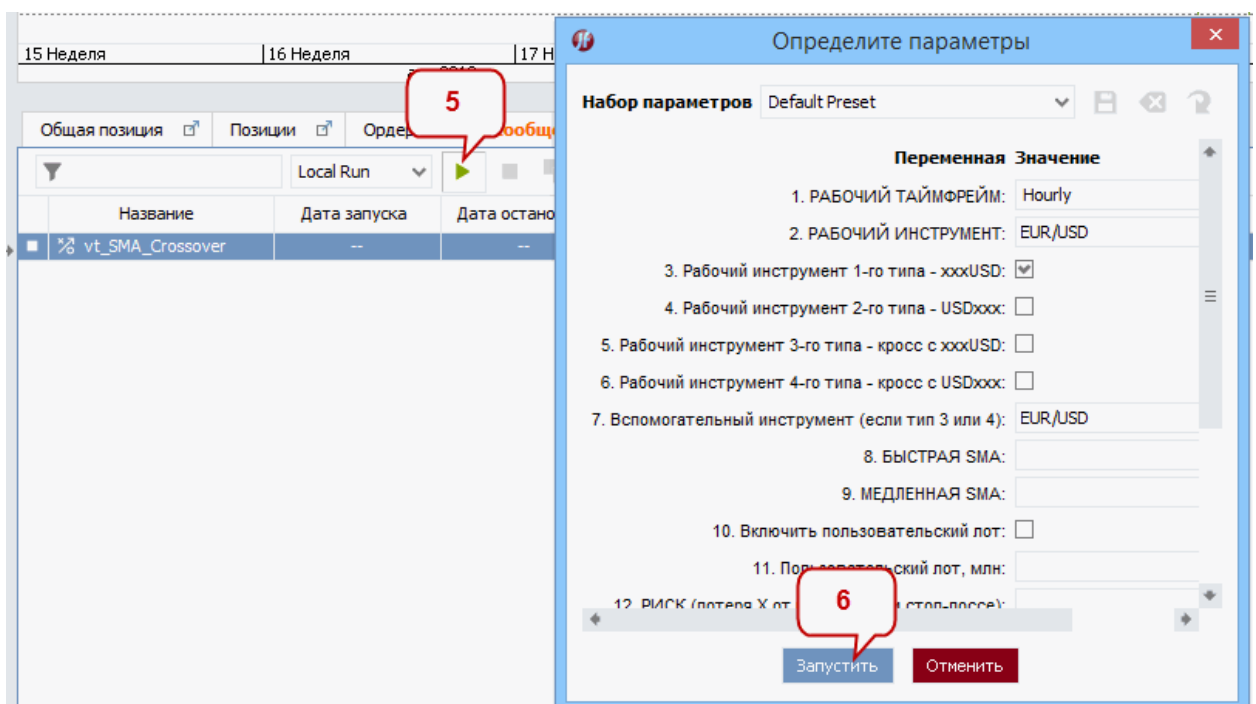


Рис. 9. Настройка параметров стратегии и ее запуск.

Соответствие параметров робота в платформе и таблицах Excel

Все 19 параметров робота при использовании в платформе имеют названия на русском языке. Однако в таблицах с результатами оптимизации и при использовании робота в конструкторе эти параметры имеют названия на английском языке.

_Algo_Comment	19. Метка позиции (если вкл. несколько роботов)
_Cross_USDxxx	6. Рабочий инструмент 4-го типа - USDxxx
_Cross_xxxUSD	5. Рабочий инструмент 3-го типа - xxxUSD
_Instrument_USDxxx	4. Рабочий инструмент 2-го типа - USDxxx
_Instrument_xxxUSD	3. Рабочий инструмент 1-го типа - xxxUSD
_Risk	12. РИСК (потеря X от капитала при стоп-лоссе)
_SMA_fast_Period	8. БЫСТАЯ SMA
_SMA_slow_Period	9. МЕДЛЕННАЯ SMA
_TrailingStep_pips	18. Трейлинг-стоп, пп (минимум 10 пп)
_Use_TakeProfit	14. Включить тейк-профит
_Use_TrailingStop	17. Включить трейлинг-стоп
_User_Lot	10. Включить пользовательский лот
_Vspomogatelnyi_Instrument	7. Вспомогательный инструмент (если тип 3 или 4)
defaultInstrument	2. РАБОЧИЙ ИНСТРУМЕНТ
defaultPeriod	1. РАБОЧИЙ ТАЙМФРЕЙМ
defaultSlippage	16. Проскальзывание, пп
defaultStopLoss	13. СТОП-ЛОСС, пп
defaultTakeProfit	15. ТЕЙК-ПРОФИТ, пп
defaultTradeAmount	11. Пользовательский лот, млн