Libertex

Сентябрь 2019

ТОРГОВАЯ СИСТЕМА АЛЬФА. ВВЕДЕНИЕ.

Libertex

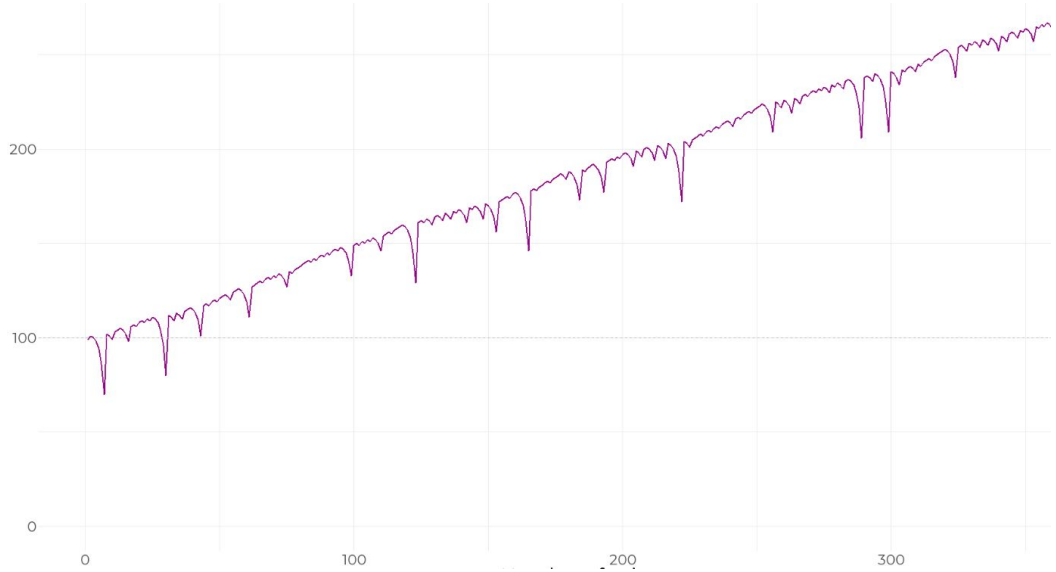
Словарь

Стратегия	Подход основанный на правилах алгоритм принятия решений о покупке или продаже финансовых активов
Бектест	Позволяет трейдеру моделировать торговую систему, используя исторические данные для генерации результатов и анализа риска и прибыльности, прежде чем рисковать каким-либо фактическим капиталом
Коэф Шарпа	Коэффициент, который помогает лучше понять возврат инвестиций по сравнению с их риском. Должно быть больше 1 для хороших стратегий
Торговые издержки	Расходы, понесенные при покупке или продаже финансовых активов (комиссионные, свопы, спреды)
Просадка	Разница между пиком баланса и последующем минимумом

Libertex

Реалистичные ожидания

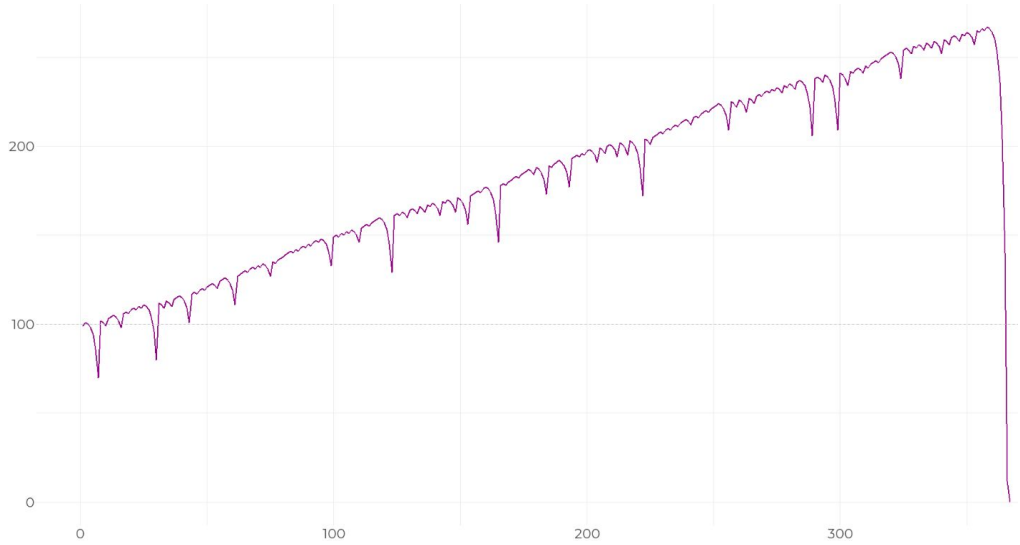
Если вы ожидаете, что одна стратегия на одном активе может произвести такую кривую капитала, то скорее всего вы в этой индустрии новичок



Libertex

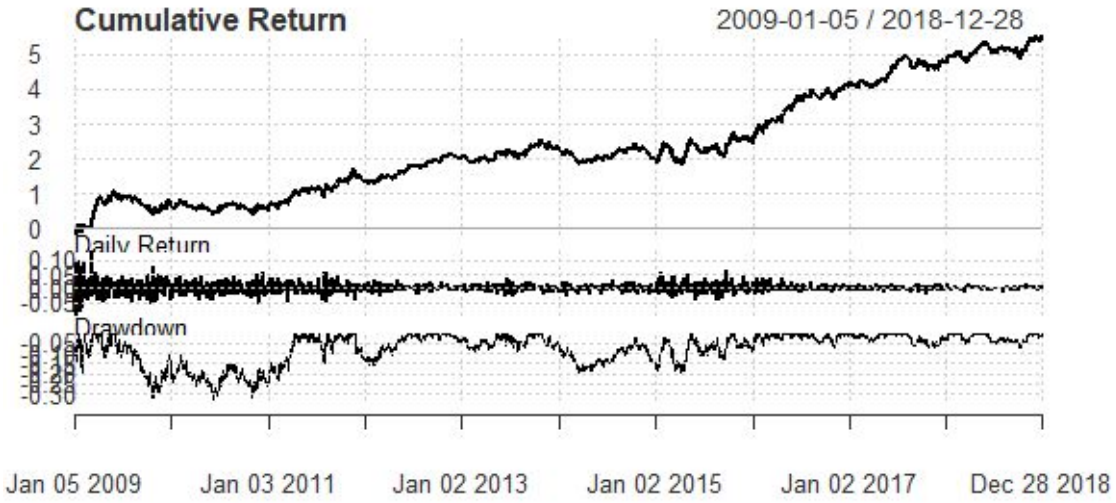
Реалистичные ожидания

Это может случится с каждой стратегией



Стратегия 1

Пример бэктеста одной из стратегий (стратегия 1).



Sharpe Ratio = 0.8

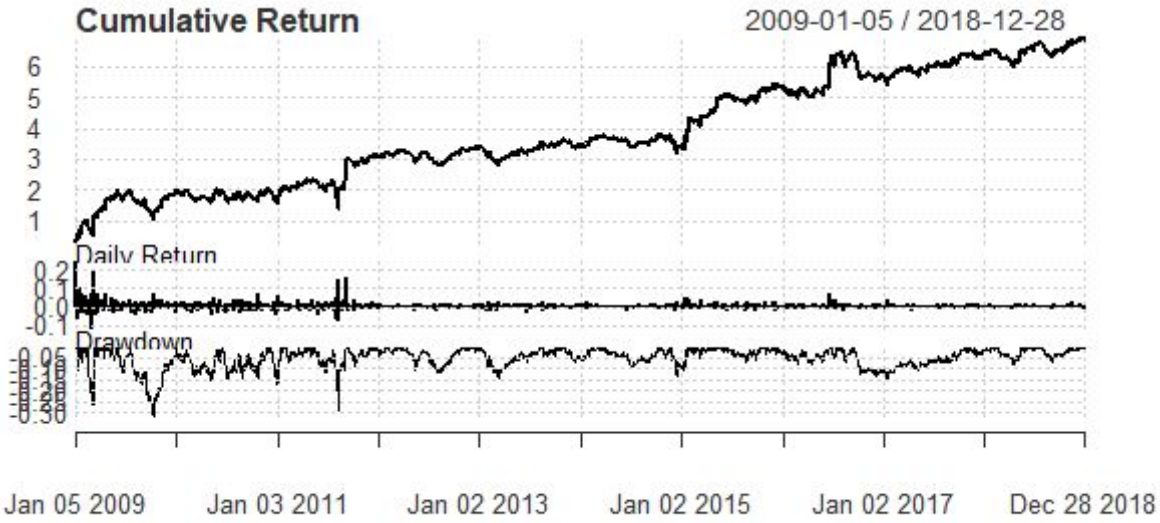
Стратегия долгий период (больше 1 года) находилась в просадке.

Ничего особенного, чтобы бежать увольняться со своей работы и планировать пенсию.

Как это можно улучшить?

Стратегия 2

Пример бэктеста одной из стратегий (стратегия 2).



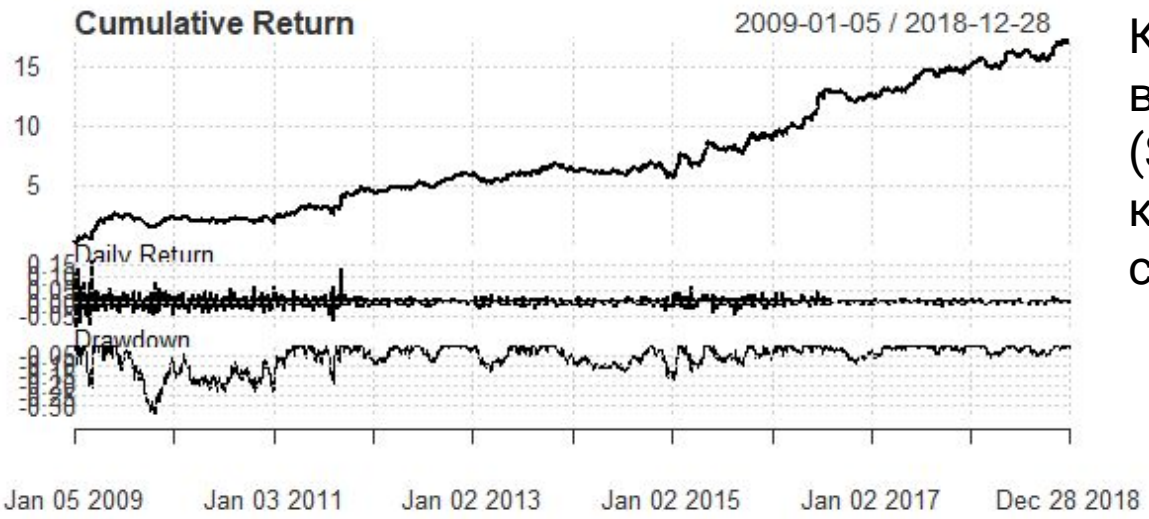
Sharpe Ratio = 0.9

Лучше чем стратегия 1, но все еще не достаточно хорошо

Как это можно улучшить?

Стратегия 1 + Стратегия 2

Комбинация первой и второй стратегии = **синергетический эффект**



Коэффициент доходности к волатильности/риску (Sharpe Ratio) после вычета комиссионных вырос и составил 1.3.

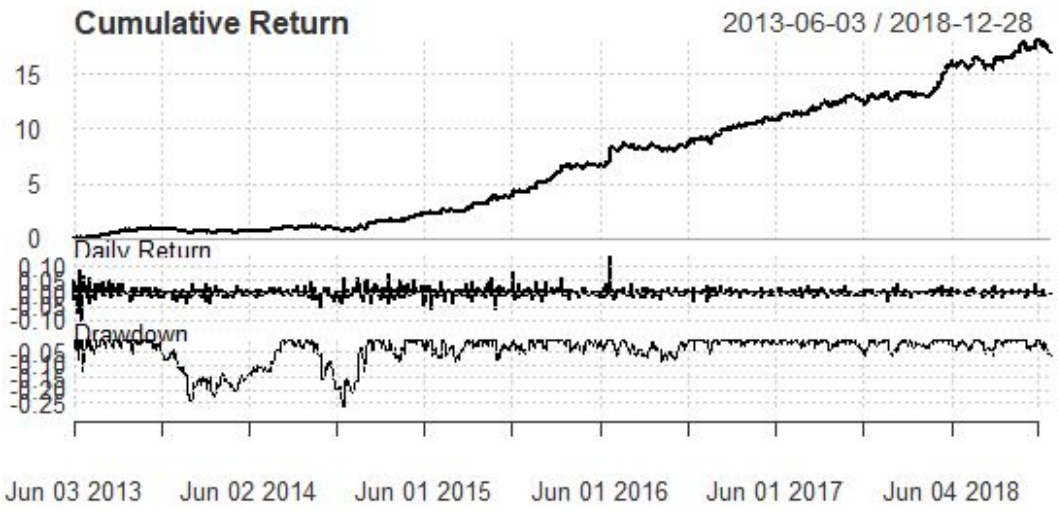
Все что мы сделали это **скомбинировали две *независимые*** стратегии.

Как это можно улучшить? = “Добавьте больше стратегий”

Libertex

Масштабируем эффект

Стратегия 1 + Стратегия 2 + Стратегия 3 + Стратегия 4 = Sharpe Ratio 2.6.



Мы добились этого после ***комбинации четырех простых, посредственных стратегий****. По отдельности они не были чем то особенным с коэффициентом Шарпа ниже 1.*

Альфа

Стратегия 1 + Стратегия 2 + … + Стратегия N =

Альфа

Диверсификация

Используйте больше:

- Активов
- Стратегий
- Таймфреймов

Альфа

Стратегия Альфа - это комбинация *не связанных* между собой торговых стратегий, с логическими и доказанными концепциями, диверсифицирующих торговлю по различным активами и таймфрейм.

Ротация

- Добавляем новые стратегии с логикой и концепцией
- Отправляем на свалку те стратегии, которые потеряли свой блеск

ТОРГОВАЯ СИСТЕМА АЛЬФА. ПОДКЛЮЧЕНИЕ.

Libertex

Условия подключения

Стоимость подключения к торговой системе Альфа: **бесплатно**, условием является достаточность средств на депозите**: 1500$ на депозите** (сигналы на почту и доступ к каналу Telegram

Потенциальная годовая доходность (историческая): 60% годовых
Потенциальная годовая просадка (расчетная): 30%
При достижении предельного уровня просадки половина убытка может быть возмещена инсентивом.

Тестовое подключение: 2 недели

Проверка подключений и достаточности капитала: раз в полгода (июль и январь).
Если депозит ниже $1000, клиент будет отключен от системы Альфа.