

8. ??????? "?????????"

Ссылка на модуль: <https://my.whalepro.org/backtests/>

8.1. ?????????????? ???????

Модуль «**Бектесты**» предназначен для проведения тестирования предварительно созданных **Алертов** на промежутке истории торговой пары.

Внимание: если у вас нет созданных алертов, то этот модуль не будет работать!

Позволяет при создании бектеста выбрать до двух **Алертов** и промежутков истории до 7 лет.

При этом, если в бектесте выбрано два алерта, то проверка алертов производится отдельно друг от друга, то есть система сначала находит точки на промежутке истории, где срабатывают все условия для первого алерта, а затем находит точки для второго алерта. Таким образом, мы находим в бектесте отдельно точки для первого алерта и отдельно для второго.

Бектесты 1 + Новый бектест: 1 алерт + Новый бектест: 2 алерта

Список бектестов 2

8.2. ?????? ??? ???????

- 3 4 5
 - 6 7
 - К росту TAOUSDТ f (TAOUSDТ(f), 12h) Проведен с 2025-03-17 14:30:26 по 2025-03-17 14:30:32
 - To Price Up Покупки на фьючерсной TAOUSDТ 12h - 4 сработок алерта, 6 действий
 - Итоги по алерту:
Сумма входа: 1000\$, PNL: 23.75%
Максимальный убыток: 92.65\$ от 2025-02-04 00:00:00
Максимальный профит: 407.3\$ от 2024-11-30 12:00:00
Накопленный профит: 237.52\$
 - К падению TAOUSDТ (TAOUSDТ(f), 12h) Проведен с 2025-03-22 11:46:40 по 2025-03-22 11:46:44
 - To Price Down Продажи на фьючерсной паре TAOUSDТ. Важно: лаг 2 полных тф перед входом в продажи/слив из-за возможного дальнейшего роста. - 3 сработок алерта, 2 действий
 - Итоги по алерту:
Сумма входа: 1000\$, PNL: 30.51%
Максимальный убыток: 0\$ от 2025-02-28 00:00:00
Максимальный профит: 305.13\$ от 2025-02-28 00:00:00
Накопленный профит: 305.13\$
 - Рост и падение по TAOUSDТ (TAOUSDТ(f), 12h) Проведен с 2025-03-21 10:25:41 по 2025-03-21 10:26:06
 - To Price Up Покупки на фьючерсной TAOUSDТ 12h - 4 сработок алерта, 7 действий
 - Итоги по алерту:
Сумма входа: 1000\$, PNL: 18.94%
Максимальный убыток: 125.16\$ от 2025-02-02 00:00:00
Максимальный профит: 407.3\$ от 2024-11-30 12:00:00
Накопленный профит: 189.49\$

1 -- Кнопки старта проведения бектеста.

Поддерживаются бектесты с 1 или 2 алертами одновременно.

2 -- Список проведённых бэктестов с элементами управления.

Элементы управления:

3 -- Значок «Редактирование бэктеста»

При нажатии на кнопку открывается поле редактирования бэктеста. Важно понимать, что при редактировании и сохранении все предыдущие результаты проведённого бэктеста будут удалены, так как система будет считать отредактированный бэктест за «новый». Таким образом, редактирование бэктеста -- это просто функция более удобного запуска бэктеста с обновлёнными параметрами.

4 -- Значок «Копирование бэктеста»

При нажатии на кнопку открывается поле создания бэктеста. Эта функция полезна для того, чтобы не создавать с нуля бэктест для нового алерта, если у вас уже есть ранее созданный бэктест с настройками, которые вас устраивают.

5 -- Значок «Удаление бэктеста»

6 -- Значок «Просмотр настроек бэктеста»

7 -- Значок «Открыть график результатов бэктеста»

в.з. ?????????? ????????

Рассмотрим процесс добавления бэктеста для одного алерта.

Щёлкните на кнопку «Новый бэктест 1 алерт»

Откроется меню настройки бэктеста

Алерт

Выберите **4** ▼

Размер открытия сделки

Введите размер **5**

Лаг открытия сделки (кол-во свечей)

Введите **6**

Плечо. (Не учитывается на споте!)

1 **7** × ▼

ФИЛЬТРЫ ВХОДА В СДЕЛКУ

8 ▼

ИЗМЕНЕНИЕ ПОЗИЦИИ ПРИ ПОВТОРНОЙ СРАБОТКЕ АЛЕРТА

9 ▼

ТЕЙКИ И СТОПЫ

10

Размер изменения цены
для тейка

Введите размер

Тип числа

Выберите ▼

Размер изменения цены
для стопа

Введите

Тип числа

Выберите ▼

Условия досрочного закрытия сделки в профите

▼

Условия досрочного закрытия сделки в убытке

▼

Максимальное кол-во свечей сделки в профите

Введите

Максимальное кол-во свечей сделки в убытке

Введите

Если превышено кол-во свечей

Выберите ▼

Размер плюса в %

Введите @ screenshoter

1 -- Название

2 -- Период

3 -- Начальная, Конечная даты

Раздел Алерт

4 -- Выбор алерта

5 -- Размер открытия сделки

6 -- Лаг открытия сделки

7 -- Плечо

8 -- Раздел «Фильтры входа в сделку»

9 -- Изменение позиции при повторной сработке алерта

????????? ?????????? ??????????

Название - произвольное название бэктеста для удобства идентификации в списке.

Период - временной интервал, на котором будет проводиться бэктестирование. Можно выбрать предустановленные периоды (1 месяц, 3 месяца, 6 месяцев, 1 год и т.д.) или задать произвольный период, указав начальную и конечную даты.

Выбор алерта - выбор предварительно созданного алерта, который будет тестироваться на историческом периоде. Алерты создаются в модуле «График».

Размер открытия сделки - сумма, которая будет использоваться для открытия позиции при срабатывании алерта в бэктесте.

Лаг открытия сделки - задержка между срабатыванием алерта и открытием позиции. Позволяет моделировать реальные условия торговли, когда между получением сигнала и исполнением ордера проходит некоторое время.

Плечо - размер кредитного плеча, используемого при открытии позиций в бэктесте.

Фильтры входа в сделку - дополнительные условия, которые должны выполняться для открытия позиции помимо срабатывания основного алерта.

Изменение позиции при повторной сработке алерта - настройка поведения системы при повторном срабатывании алерта, когда позиция уже открыта. Возможные варианты: игнорировать, увеличивать позицию, закрывать текущую и открывать новую.

8.4. ??????? ??????????? ??????????

После запуска бэктеста система анализирует исторические данные и находит все точки, где срабатывают условия выбранного алерта. Для каждой такой точки моделируется открытие позиции согласно заданным параметрам, и отслеживается дальнейшее изменение цены.

Результаты бэктеста представляются в виде:

1. Графика с отмеченными точками входа и выхода из позиций
2. Таблицы со статистикой по каждой сделке
3. Сводных показателей эффективности стратегии

Основные показатели, которые можно анализировать в результатах бэктеста:

- Общая прибыль/убыток
- Процент прибыльных сделок
- Средняя прибыль на сделку
- Максимальная просадка
- Отношение риска к прибыли

Для просмотра результатов бэктеста нажмите на значок «Открыть график результатов бэктеста» в списке проведенных бэктестов.

8.5. ?????? ?????? ? ??????????

Рассмотрим пример создания и анализа бэктеста для алерта, отслеживающего всплески объема покупок на паре BTCUSDT.

1. Предварительно создаем алерт в модуле «График», который срабатывает при превышении объема покупок определенного порогового значения.
2. В модуле «Бэктесты» нажимаем «Новый бэктест 1 алерт».
3. Задаем название «Тест объемов BTC».
4. Выбираем период тестирования - последний год.
5. В разделе «Алерт» выбираем наш созданный алерт по объемам.
6. Устанавливаем размер сделки 1000 USDT.
7. Задаем лаг открытия сделки 1 час (чтобы моделировать реальную задержку реакции на сигнал).
8. Устанавливаем плечо 1x (без использования маржинальной торговли).
9. В разделе «Фильтры входа в сделку» добавляем условие, что сделка открывается только если 24-часовое изменение цены находится в диапазоне от -2% до +2% (чтобы избежать входов во время сильных движений).
10. Нажимаем «Сохранить и запустить».

После завершения расчетов анализируем результаты:

- Смотрим общую доходность стратегии
- Анализируем распределение прибыльных и убыточных сделок
- Изучаем периоды, когда стратегия работала наиболее эффективно
- На основе полученных данных корректируем параметры алерта или условия входа в сделку
- Запускаем новый бэктест с измененными параметрами и сравниваем результаты

Такой итеративный подход позволяет постепенно оптимизировать торговую стратегию и повышать ее эффективность перед применением на реальном счете.

Revision #1

Created 19 August 2025 14:01:36 by Admin

Updated 19 August 2025 14:01:51 by Admin