

سلسله مباحث آموزشی AutoTrading

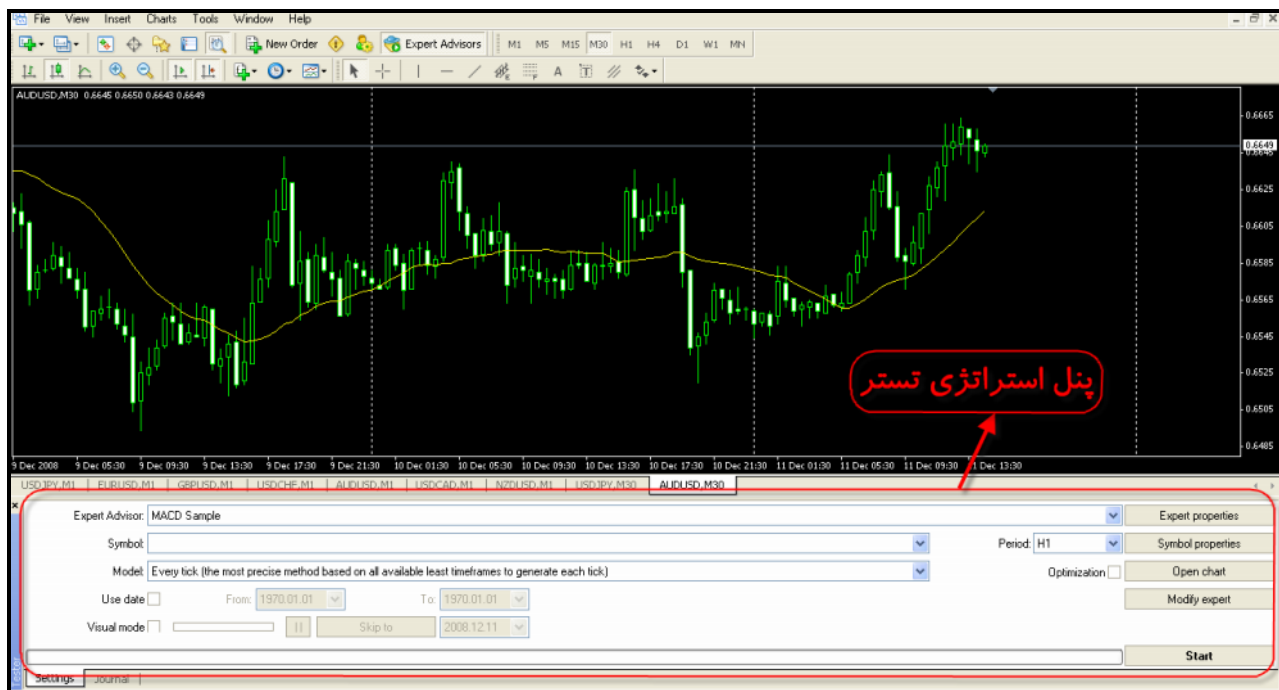
مقاله شماره 1:

نحوه بک تست گرفتن از یک اکسپرت

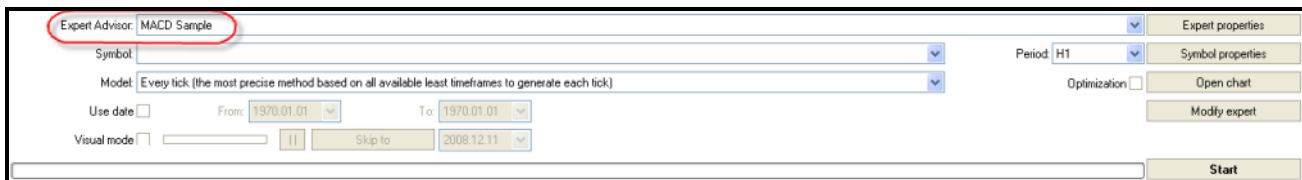
سید امیر بابک تیموریان (AmirBabak)

فرض کنید می خواهیم از یکی از اکسپرت های پیش فرض متا، مثلاً اکسپرت MACD Sample بک تست (BackTest) بگیریم.

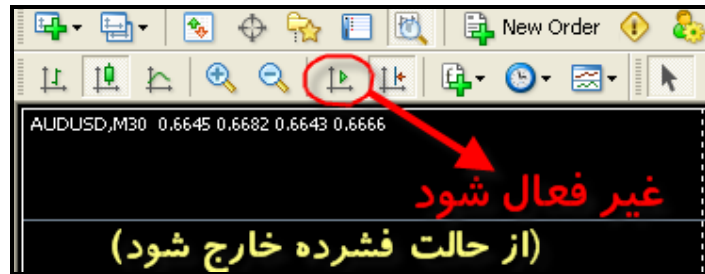
1- در محیط متا، دکمه های Ctrl+R را می فشاریم تا پنل Strategy Tester ظاهر شود.



2- از فیلد Expert Advisor این پنل، نام اکسپرت مدنظر را انتخاب کنید. (مثلاً MACD Sample)

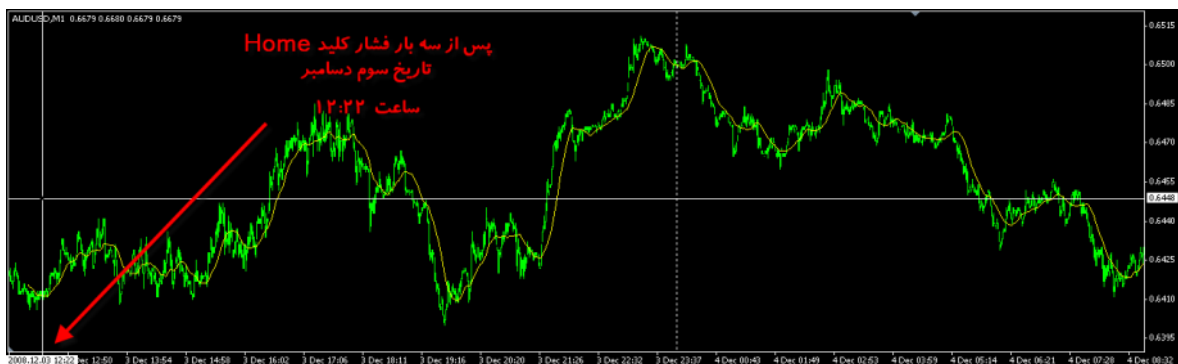


3- لازم است بدانید که برای حاصل شدن یک BackTest مطمئن، میبایست دیتا چارت موجود ما در تایم فریم یک دقیقه (M1)، مینا قرار گیرد. برای ایمنطور به تایم M1 چارت مدنظر رفته و اولین کاری که می کنیم اینست که آیکون Auto Scroll را غیر فعال کنیم.

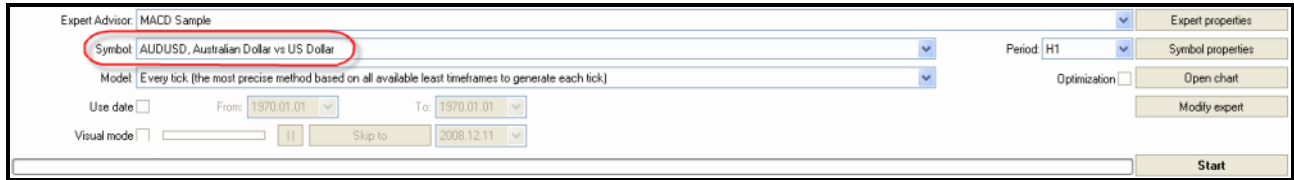


4- سپس تا جایی که سرور بروکر میتواند، با فشار دکمه Home روی کیبرد، دیتا چارت M1 را Load کنید. (ممکن است مجبور شوید، دست کم 30 بار دکمه Home را بفشارید!! تا جایی که دیگر دیتایی Load نشود)

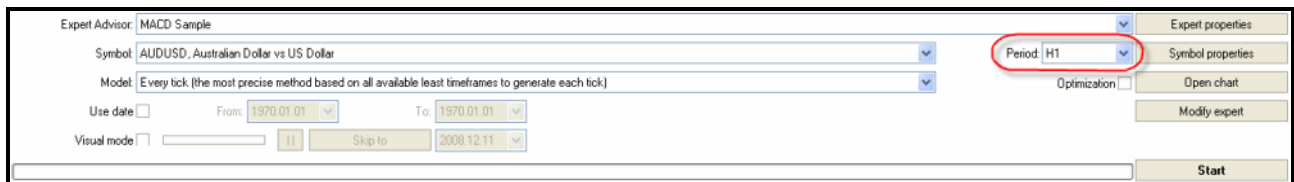
نکته: پس از هر بار فشار کلید Home، صبر کنید تا دیتا چارت جدید Load شود، سپس مجدداً این دکمه را بفشارید. (ترجیحاً چارت را بسیار ریز (Zoom Out) کنید تا با هر بار فشار Home، دیتا چارت سریعتر Load شود)



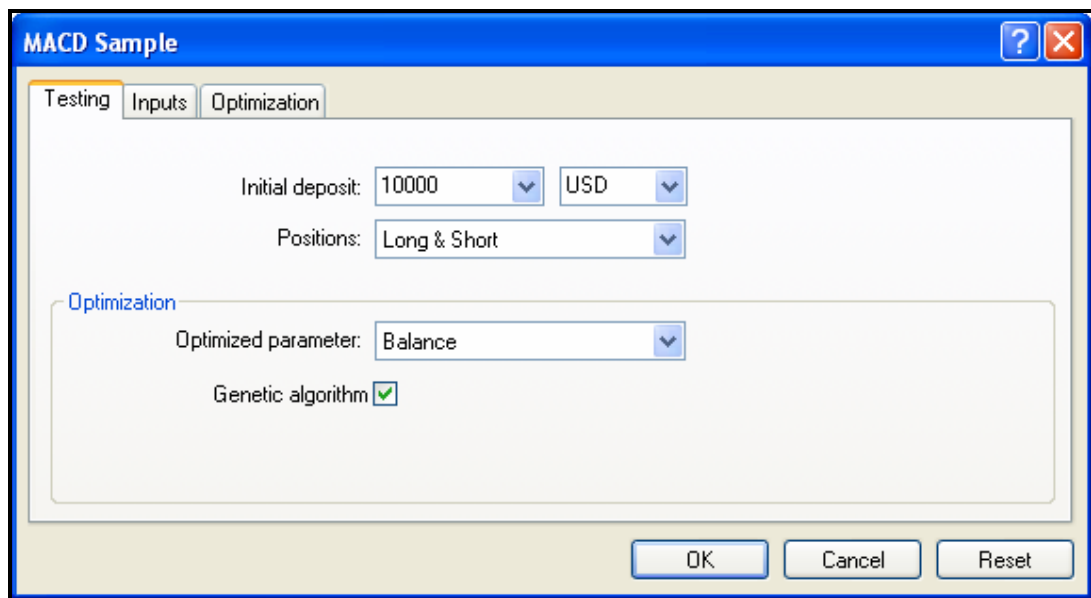
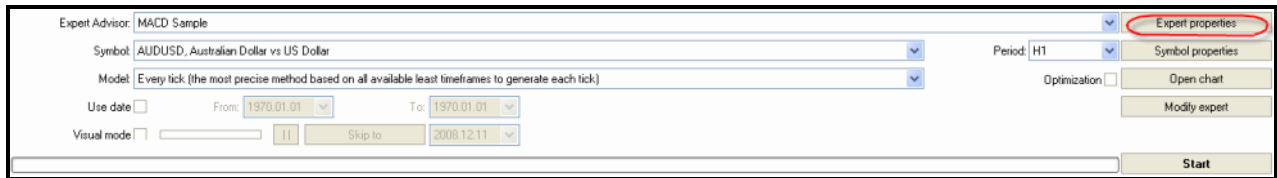
5- پس از لود کردن دیتا چارت M1، در پنل Strategy Tester، و از فیلد Symbol، چارت مدنظر خود که دیتای M1 آنرا کاملتر نموده بودید را انتخاب کنید.



6- سپس تایم فریم مدنظر خود برای تست را از فیلد Period مشخص کنید.
نکته: تمام تایم فریمهای موجود، از دیتا چارت M1 ساخته خواهند شد.



7- روی دکمه Expert Properties کلیک کنید تا پنجره مربوطه گشوده شود.



این پنجره دارای سه Tab است:

الف) تب Testing

- فیلد Initial Deposit: سرمایه اولیه برای شروع بک تست

- فیلد Positions: مشخص میکند که فقط معاملات خرید (Long) لحاظ شود، یا فقط فروش (Sell) و یا هر دو با هم لحاظ شوند (Long & Short)

- فیلدهای Optimized Parameter و Genetic Algorithm مربوط به مبحث بهینه سازی است و فعلاً مورد بحث ما نمی باشند.

ب) تب Inputs

Variable	Value	Start	Step	Stop
<input type="checkbox"/> TakeProfit	50	50	0	0
<input type="checkbox"/> Lots	0.1	0.1	0	0
<input type="checkbox"/> TrailingStop	30	30	0	0
<input type="checkbox"/> MACDOpenLevel	3	3	0	0
<input type="checkbox"/> MACDCloseLevel	2	2	0	0
<input type="checkbox"/> MATrendPeriod	26	26	0	0

در این تب تمام پارامترهای اکسپرت که قابل تغییر در نظر گرفته شده است، در اختیار قرار میگیرد. مثلاً ممکن است بخواهید در بک تست، TakeProfit شما، 150 باشد، نه 50. لذا میتوانید این پارامتر را بدلتخواه خود تغییر دهید.

نکته: به ستونهای Start، Step و Stop دست نزنید، که مربوط به مبحث بهینه سازی بوده و ربطی به مبحث این جلسه ندارد.

ج) تب Optimization (فعلاً مورد بحث ما نمی باشد)

8- پس از Ok این پنجره، به پنل استراتژی تستر بر میگردد. در فیلد Model، سه گزینه داریم:

الف) گزینه Every Tick (وابسته به تیک های نوسانی پایینترین تایم فریم موجود یعنی M1)

ب) گزینه Control Points (وابسته به تیک های نوسانی یک تایم پایینتر)

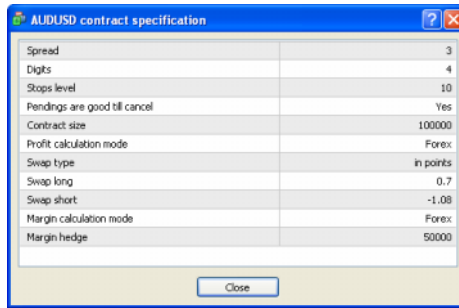
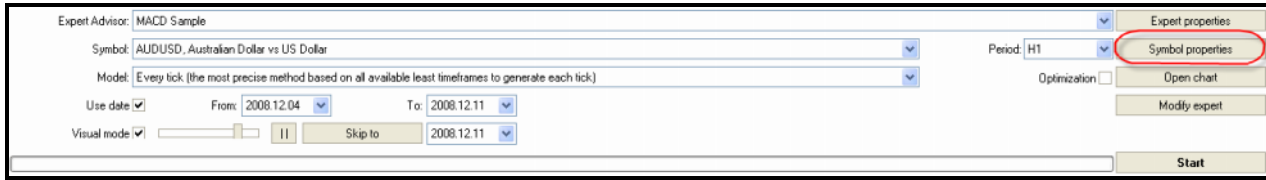
ج) گزینه Open Prices Only (وابسته به کلوز کندل - در هر تایمی که هستیم)

مطمئن ترین گزینه و در عین حال کند ترین بک تست، مربوط به مدل Every Tick میباشد. آنرا انتخاب میکنیم.

9- تیک گزینه Use Date را می زنیم و با توجه به دیتا چارت Load شده M1 خود، فیلد From را پر میکنیم. مثلاً 2008.12.04
در فیلد To نیز، روی عبارت Today کلیک میکنیم تا تاریخ امروز را بعنوان خط پایان بک تست ثبت کند.

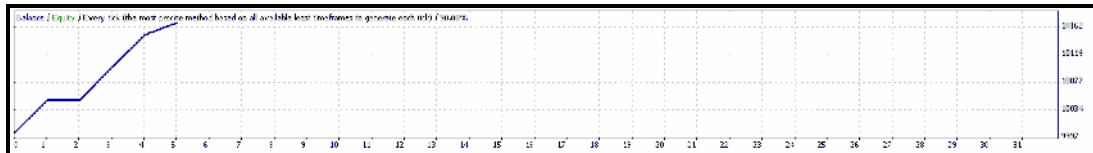
10- در فیلد Visual Mode مشخص میکنید که آیا عملیات بک تست بصورت ویژوالی و مشاهده کردنی باشد یا فقط نتیجه بک تست اعلام شود. چنانچه خواستید عملیات بک تستینگ را با چشم خود مشاهده کنید، تیک این گزینه را بزنید. با اینکار نوار لغزان روبروی آن نیز فعال شده که توسط آن میتوانید سرعت مشاهده بک تست را تغییر دهید. در بخش Skip To نیز مشخص میکنید که چنانچه به تاریخ معین رسیدید، عملیات ویژوال بک تست، متوقف شود.

11- با کلیک بر روی دکمه Symbol Properties، جزئیات (مانند اسپرد، حداقل سطح استاپ و ...) نماد معاملاتی خود (در اینجا AUDUSD) را مشاهده خواهید نمود.



12- با فشار دکمه Modify Expert نیز وارد محیط Meta Editor میشویم که میتوان دست به تغییراتی بر روی اکسپرت زد.

13- در نهایت روی دکمه Start کلیک میکنیم تا عملیات بک تست شروع شود.
نتیجه حاصله:



Bars in test	1120	Ticks modelled	43062	Modeling quality	98.00%
Mismatched charts errors	1				
Initial deposit	10000.00				
Total net profit	168.70	Gross profit	168.70	Gross loss	0.00
Profit factor		Expected payoff	33.74		
Absolute drawdown	8.00	Maximal drawdown	73.00 (0.72%)	Relative drawdown	0.72% (73.00)
Total trades	5	Short positions (won %)	3 (100.00%)	Long positions (won %)	2 (100.00%)
		Profit trades (% of total)	5 (100.00%)	Loss trades (% of total)	0 (0.00%)

