

Automatyczne strategie inwestycyjne (EA) od A do Z

1) Wprowadzenie do automatycznych strategii inwestycyjnych

- dlaczego potrzebujemy EA (expert advisor)

2) Niezbędne elementy dobrej automatycznej strategii inwestycyjnej

- sygnał wejścia / wyjścia
- kontrola ryzyka (SL, TP, R/R ratio)
- zabezpieczanie i realizacja zysku (BE, PC, wyjście dolarowe, czasowe)
- filtry (trend – oparty na sma dziennej, czasowy – oparty na godzinach największej zmienności)

3) Backtester MT4

- omówienie różnic między dostępnymi modelami testów (every tick, open prices, control points)
- krótki opis algorytmu generycznego
- tester wizualny – praktyczne przykłady zastosowania (ocena nowej strategii inwestycyjnej, wykrywanie luk w danych, kontrola działania wskaźników)
- interpretacja raportu z testu strategii

4) Optymalizacja EA

- omówienie procesu optymalizacji w MT4 od strony technicznej
- poszczególne etapy optymalizacji parametrów strategii
- problem przeoptymalizowania (dostosowanie strategii do szumu panującego na rynku zamiast do właściwego układu, który chcemy wykorzystać)
- potwierdzenie wyników testów przez technikę „out of sample”
- interpretacja wyników optymalizacji

5) Strategie półautomatyczne

- czym się różnią od pełnych automatów
- praktyczny przykład wykorzystania strategii półautomatycznej w oparciu o linię (wsparcia, oporu, trendu, kanału, median line, zniesienia Fibonacciego)

6) Budowa i kontrola portfolio

- łączenie wielu strategii
- dobór właściwej wielkości pozycji, dywersyfikacja ryzyka
- dodawanie kolejnych strategii do portfolio (kontrola maksymalnego obsunięcia i zysku)
- interpretacja kształtu krzywej kapitału, wyłączanie i ponowne włączanie strategii wchodzących w skład portfolio

7) Zakup EA przez Internet

Dlaczego doskonały wynik z przeszłości nie pokrywa się z wynikiem rzeczywistym po włączeniu strategii.