

Markers stratégia építő program leírása

A program felépítése

A stratégia építő modult a grafikon alatt találjuk. Két részt érdemes elkülöníteni. Az első a felső sor, ahol a majdani stratégiáról találunk majd statisztikai adatokat. A második maga a stratégia építő rész, ahol megadhatjuk a kívánt feltételeket. A modulban munkalapok vannak, amelyeken különböző a stratégiaalkotás szempontjából fontos választható tulajdonságok vannak.



1. Statisztika fejléc

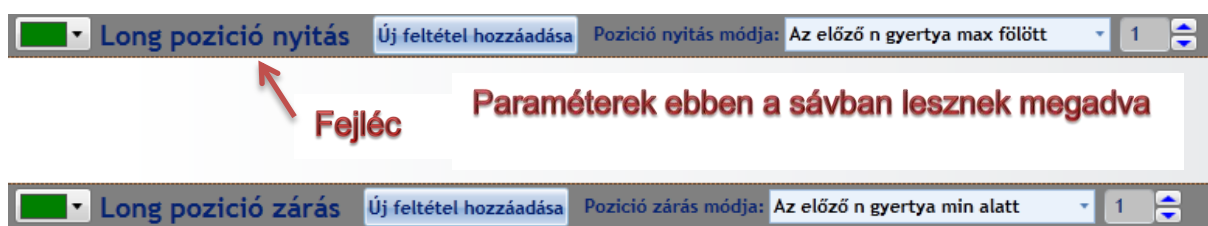


A statisztikák állandó megjelenítése szükségszerű és célszerű lett a program létrehozása során, mert a stratégia alkotás folyamata alatt egyből információkkal rendelkezünk a végeredményekről, így nem kell fölöslegesen a munkalapok között szörfölni és információkat keresni arról, hogy vajon működőképes e a stratégia.

Részletes statisztikát majd az eredménykiértékelés fülön találunk, így csak a legfontosabb néhány mutatót raktuk fel ebbe a sorba. Részletes fogalmi magyarázatok a 8. alatt találhatóak meg.

2. Long feltételek:

A long feltételek munkalap két részből áll. A fejlécből és a parametrizálható részekből.



2.1. Fejléc

A long pozícionytás szöveg előtt található színes téglalap, azt jelenti, hogy a grafikonon fent zöld teli gyertyával fognak megjelenni a long jelzés utáni gyertyák.

Új feltétel hozzáadása: Ennek a gombnak a megnyomása után a tudunk az alatta lévő sorokban stratégiát alkotni. Részletek a 3.2. alatt.

Pozíció nyitás módja: Itt kétfajta választási lehetőség van:

- *A következő gyertya nyitójában:* Long pozícióba lépés a jelzést követő gyertya nyitóárán teljesül. A kötéslistában a nyitóár adata fog megjelenni.
- *Az előző n gyertya maximuma fölött:* Amikor jelzést kapunk választhatunk egy olyan megbízás típust, amely azt kezeli, hogy a jelzésként szolgáló gyertya maximuma fölé teszi a long nyitási jelzést. Amennyiben nem teljesül, akkor is fenntartja a megbízást, mindaddig, amíg a long feltételek igazak. (pl. ha az érték 1, akkor a jelzésként szolgáló gyertya teteje fölé teszi mindig a stop vételi megbízást. Amennyiben ez 2, akkor az utolsó két gyertya maximumára teszi a megbízást. Ezzel azt lehet elérni, hogy fölösleges kötések ki fogunk hagyni, valamint jobb beszállásokat lehet vele elérni.
- Fontos különbség, hogy a long pozíció zárása részben alul, az előző n gyertya minimuma alatt-ra változott a választási lehetőség, pusztán azért, mert long zárása esetén értelmetlen lenne a nyitáshoz használt maximum kiválasztási lehetőség.

2.2. A stratégia feltételeinek megadása (Long pozíció nyitása, long pozíció zárása)

Amennyiben elkezdünk stratégiát alkotni, a long feltételek kitöltése esetén mindenképp meg kell adni long zárási feltételt is, amely lehetőleg értelmes legyen, különben azt tapasztalhatjuk, hogy a grafikus felületen megnyitja a long pozíciót, de nem zárja le végig. Ez nem hiba, a program mindig azt csinálja, amit mi parancsolunk neki.

Csoport	Indikátor	Paraméterek	i érték	Reláció	Jelzés alapja	Indikátor	Paraméterek	i érték		
0	MACD	12 26 9	Normal	i - 0	>	Indikátor	MACD átlag	12 26 9	Normal	i - 0

Csoport	Indikátor	Paraméterek	i érték	Reláció	Jelzés alapja	Indikátor	Paraméterek	i érték		
0	MACD	12 26 9	Normal	i - 0	<	Indikátor	MACD átlag	12 26 9	Normal	i - 0

Az ábrán az MACD és az MACD Átlag segítségével hozunk létre jelzéseket.

- *Indikátor kiválasztása:* A jelzés alapjául itt kell megadni, hogy milyen indikátort alapján szeretnénk long jelzést generálni.
- *Paraméterek:* Az adott indikátorhoz tartozó paraméterek alapbeállításokkal jelennek meg és itt változtathatóak.
- *i érték:* Az adott gyertyára vonatkozó feltételt jelent. Amennyiben felemeljük 1-re, akkor a jelzéshez képest egy gyertyával korábbi gyertyával számol. Ha 5-re, akkor a jelzéshez képest 5-tel korábbi gyertyával számol.
- *Reláció:* Az összehasonlítás alapjául szolgál
- *Jelzés alapja:* kiválasztható, hogy Indikátor, Árfolyam, Érték alapon akarjuk-e hasonlítani az első oszlopban megadott indikátort.
 - Indikátor: Kiválaszthatóak a felsorolt indikátorok, amelyeket hasonlíthatunk az első oszlopban megadotthoz.
 - Az árfolyam: Vannak olyan indikátorok, amelyeket az árfolyamhoz is hasonlíthatunk (pl. mozgóátlagok)
 - Érték: Ezt akkor érdemes kiválasztani, ha az első oszlopban megadott indikátort az indikátor által behatárolható valamilyen értékhez hasonlítjuk (pl. RSI 70 fölött túladott és szeretnénk, ha akkor eladási pozíciót vegyünk fel.)

3. Short feltételek:

A short feltételek munkalap szintén két részből áll.

3.1. Fejlécek

A short pozíciónyitás szöveg előtt található színes téglalap, azt jelenti, hogy a grafikonon fent piros teli gyertyával fognak megjelenni a short jelzés utáni gyertyák.

Új feltétel hozzáadása: Ennek a gombnak a megnyomása után tudunk az alatta lévő sorokban stratégiát alkotni.

Pozíció nyitás módja: Itt kétfajta választási lehetőség van:

- *A következő két gyertya nyitójában:* A következő gyertya nyitóárán teljesül a megbízás.
- *Az előző n gyertya minimuma alatt:* Amikor jelzést kapunk választhatunk egy olyan megbízás típust, amely azt kezeli, hogy a jelzésként szolgáló gyertya minimuma alá teszi a short nyitási jelzést, de amennyiben nem teljesül, akkor is fenntartja a megbízást, mindaddig, amíg a short feltételek igazak. (pl. ha az érték 1, akkor a jelzésként szolgáló gyertya minimuma alá teszi mindig az eladási megbízást. Amennyiben ez 2, akkor az utolsó két gyertya maximumára teszi a megbízást. Ezzel azt lehet elérni, hogy fölösleges kötések ki fogunk hagyni, valamint jobb beszállásokat lehet vele elérni.
- A short pozíció zárása részben alul, az „előző n gyertya minimuma alatt” -ra változott a választási lehetőség, pusztán azért, mert short zárása esetén értelmetlen lenne a nyitáshoz használt minimum kiválasztási lehetőség.

3.2. A stratégia feltételeinek megadása (Short pozíció nyitása, short pozíció zárása)

Amennyiben elkezdünk stratégiát alkotni, a long feltételek kitétele esetén mindenképp meg kell adni long zárási feltételt is, amely lehetőleg értelmes legyen, különben azt tapasztalhatjuk, hogy a grafikus felületen megnyitja a long pozíciót, de nem zárja le végig. Ez nem hiba, a program mindig azt csinálja, amit mi parancsolunk neki.

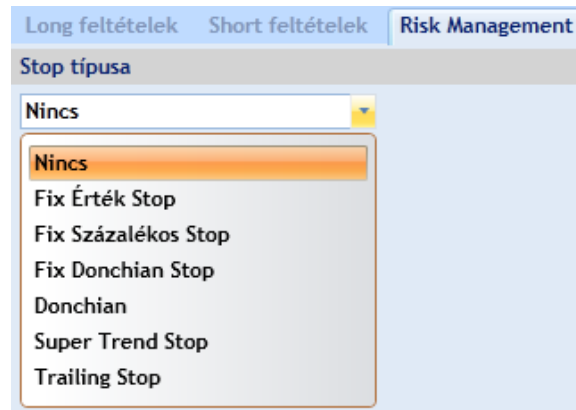
Csoport	Indikátor	Paraméterek	i érték	Reláció	Jelzés alapja	Indikátor	Paraméterek	i érték
0	SMA	21	0	>	Indikátor	SMA	9	0

Csoport	Indikátor	Paraméterek	i érték	Reláció	Jelzés alapja	Indikátor	Paraméterek	i érték
0	SMA	21	0	<	Indikátor	SMA	9	0

Az ábrán az Egyszerű Mozgóátlag 21 és 9 egységes átlagából csináltunk short nyitási és zárási jelzéseket.

- *Indikátor kiválasztása:* A jelzés alapjául itt kell megadni, hogy milyen indikátort alapján szeretnénk short jelzést generálni.
- *Paraméterek:* Az adott indikátorhoz tartozó paraméterek alapbeállításokkal jelennek meg és itt változtathatók.
- *i érték:* Az adott gyertyára vonatkozó feltételt jelent. Amennyiben felemeljük 1-re, akkor a jelzéshez képest egy gyertyával korábbi gyertyával számol. Ha 5-re, akkor a jelzéshez képest 5-tel korábbi gyertyával számol.
- *Reláció:* Az összehasonlítás alapjául szolgál
- *Jelzés alapja:* kiválasztható, hogy Indikátor, Árfolyam, Érték alapon akarjuk-e hasonlítani az első oszlopban megadott indikátort.
 - Indikátor: Kiválasztható, bármely indikátort, amit hasonlíthatunk az első oszlopban megadotthoz.
 - Az árfolyam: Vannak olyan indikátorok, amelyeket az árfolyamhoz is hasonlíthatunk (pl. mozgóátlagok)
 - Érték: Ezt akkor érdemes kiválasztani, ha az első oszlopban megadott indikátort az indikátor által behatárolható valamilyen értékhez hasonlítjuk (pl. RSI 70 fölött túladott és szeretnénk, ha akkor eladási pozíciót vegyünk fel.

4. Risk management



- 4.1. Fix érték stop: A stop beállítása négy részből áll. Először beállíthatjuk az érték oszlopot, amely magának a stopnak a nominális értékbeállítását jelenti. A T gyertyáig él oszlopban azt állíthatjuk be, hogy ez a stop hány gyertya ideig éljen. pl. Amennyiben azt szeretnénk, hogy ez a stop ne változzon, akkor állítsuk 1000-re. A váltás oszlopban csak egy pipát tudunk tenni. Ezzel azt tudjuk elérni, hogy fix stop érték bizonyos számú gyertya után trailing stopra vált. A trailing stop azt jelenti, a stop értéke követőre vált. Hogy mennyi gyertya után kövesse azt beállíthatjuk a donchian stop értékénél. Nézzünk meg egy példát:
EURUSD 60 perces grafikonon Érték:0.002 (20pip), T gyertyáig él: 10, Váltás: pipa, Donchian: 2
Ez azt jelenti, hogy long esetén 20 pippel lejjebb, short esetén 20 pippel följebb indul a stop. Amennyiben az 10db 60 perces gyertya eltelik, akkor a stop értéke átvált követő stopra, és a utolsó 2 gyertya alját vagy tetejét vizsgálja az iránytól függően.
- 4.2. Fix százalékos stop: A stop beállítása szintén négy részből áll. Először beállíthatjuk az érték oszlopot, amely magának a stopnak a százalékos értékbeállítását jelenti. A T gyertyáig él oszlopban azt állíthatjuk be, hogy ez a stop hány gyertya ideig éljen. pl. Amennyiben azt szeretnénk, hogy ez a stop ne változzon, akkor állítsuk minél nagyobbra. A Váltás oszlopban csak egy pipát tudunk tenni. Ezzel azt tudjuk elérni, hogy fix százalékos stop érték bizonyos számú gyertya után trailing stopra vált. A trailing stop azt jelenti, a stop értéke követőre vált. Hogy mennyi gyertya után kövesse azt beállíthatjuk a donchian stop értékénél. Nézzünk meg ugyanazon példát:
EURUSD 60 perces grafikonon Érték:0.5%, T gyertyáig él: 10, Váltás: pipa, Donchian: 2
Ez azt jelenti, hogy long esetén 0,5%-al lejjebb, short esetén 0,5%-al följebb indul a stop értéke az adott gyertya long esetén minimuma, short esetén maximumához képest. Amennyiben a 10db 60 perces gyertya eltelik, akkor a stop értéke átvált követő stopra, és a utolsó 2 gyertya alját vagy tetejét vizsgálja az iránytól függően.
- 4.3. Fix Donchian stop: A stop beállítása ugyanaz, mint az előzőeknél. Először beállíthatjuk az érték oszlopot, amely magának a stopnak a Donchian értékbeállítását jelenti. A Donchian gyakorlatilag a Highest high, Lowest low indikátorok értékei, amelyek az n számú korábbi gyertya lokális mélypontjait vagy tetőpontjait jelenti. A T gyertyáig él oszlopban azt állíthatjuk be, hogy ez a stop hány gyertya ideig éljen. A Váltás oszlopban csak egy pipát tudunk tenni. Ezzel azt tudjuk elérni, hogy fix százalékos stop érték bizonyos számú gyertya után trailing stopra vált. A trailing stop azt jelenti, a stop értéke követőre vált. Hogy mennyi gyertya után kövesse azt beállíthatjuk a donchian stop értékénél. Nézzünk meg ugyanazon példát:
EURUSD 60 perces grafikonon Paraméter: 20, T gyertyáig él: 10, Váltás: pipa, Donchian: 2
Ez azt jelenti, hogy long esetén az előző 20 gyertya alja, short esetén 20 gyertya teteje lesz a kiinduló stop. Amennyiben az 10db 60 perces gyertya eltelik, akkor a stop értéke átvált követő stopra, és az utolsó 2 gyertya alját vagy tetejét vizsgálja az iránytól függően.
- 4.4. Donchian: Ez az indikátor másnéven a Highest high, Lowest low indikátorok által rajzolt csatorna. A két vonal megadja a vizsgált időperiódusú grafikonon (pl.60perces) az utolsó n számú gyertya maximumát vagy minimumát és ezt használja stop szintnek.

4.5. Super trend stop: A super trend stop az ATR indikátor segítségével fog stop szintet generálni. Az ATR indikátor

4.6. Trailing stop (követő stop): Egyszerűen megadhatjuk itt, hogy a stop szint az árfolyamtól hány %-ra helyezkedjen el. A százalék mindig az aktuálisan kiválasztott instrumentum árfolyamától függ, ahhoz viszonyítja a százalék értékét és vonja le vagy adja hozzá az iránytól függően. Long esetén a mindenkori maximum árfolyamból fogja levonni a stop értéket, shortnál pedig a jelzés utáni legalacsonyabb árfolyamhoz adja hozzá a megadott értéket.

5. Money management:

- **Kezdőtőke:** Itt adhatja meg azt az összeget, amellyel szeretné kimutatni a stratégia eredményességét. Amennyiben alatta a kockázat beállítása megadásánál a „kezdőtőke x%-át választja meg, akkor a kezdőtőkéből fogja kalkulálni a program az egy pozíción felvehető kockázatot az első kötésnél. (pl 10000\$-os kezdőtőkénél az 1% 100\$ kockázatot jelent. A \$ mértékegységnek csak szimbolikus jelentőség van a példában, ha Ft-ban akarnánk ezt kifejezni, akkor ténylegesen nagyobb összeget kellene beírni a kezdőtőke sorába, mert 10000Ft-tal elkezdni a kereskedést sok értelme nincs.
- **Kockázat beállítása:** Választhatjuk azt, hogy Kezdőtőkével kereskedünk, Fix darabszámmal kereskedünk vagy a Tőke x%-os kockázattal kereskedhető lehetőséget.
 - Kezdőtőkével kereskedő: Ekkor a program a kezdőtőkét fogja elosztani a belépési árfolyammal, és így kalkulálja a darabszámot.
 - Fix darabszámmal kereskedő: minden kötésnél ugyanazzal a darabszámmal számol.
 - Tőke x%-os kockázattal kereskedő: A kumulált nyereség oszlopból folyamatosan kalkulálja azt a darabszámot, amelyet ha felvesz a stratégia, akkor nem fog többet veszíteni, mint amennyit megadtunk. Nagyon fontos, hogy ezt az opciót csak akkor választhatjuk ki, ha a Risk management fülön kiválasztottunk valamilyen stop fajtát. Csak ennek az opciónak a választásakor fog megjelenni a maximálisan tőkeáttétel beállítási lehetősége is. Ezt annak függvényében kell alkalmazni, hogy a bróker cég mit enged meg nekünk, pl. (max 200-szoros tőkeáttétel) vagy akkor, ha egy instrumentumban maximalizálni akarjuk a befektetendő pénzt. Gondoljunk bele, hogy kereskedünk 10 féle instrumentummal. Ebben az esetben ha mind a tíz pozíciót meg akarjuk nyitni, akkor nem lehet 20-szoros tőkeáttételt engedni egy pozícióra. természetesen ennek az esélye kicsi, de számolni kell vele.

6. Kereskedési beállítások

Két fontos részből áll. Mindkét oldalon majdnem ugyanazon feltételek adhatók meg, de mégis mást jelentenek.

A bal oldalon amennyiben megadunk egy szűrési feltételt, akkor a program minden gyertyában megnézi, hogy teljesülnek e a feltételek.

A jobb oldalon található szűréseket be kell kapcsolni a Szűrési feltételek elé tett pipával és csak akkor aktívak a jobb oldali feltételek. Nagyon fontos megjegyezni a két oldal közötti különbséget. A szűrési felhőben megadott feltételek kizárólag a stratégia által generált kötéslistát szűrik meg. Tehát a bal oldalon minden gyertyát vizsgálunk, a jobb oldalon a már kész listával dolgozunk tovább. Ez azért fontos különbség, mert számos stratégiánál hatékonyabb már a kész kötésekkel dolgozni, mint

minden egyes gyertya tulajdonságát összevetni a sikerességgel. Mivel két feltételtől eltekintve a többi ugyanaz, ezért a fogalmakat egyszer írjuk csak le.

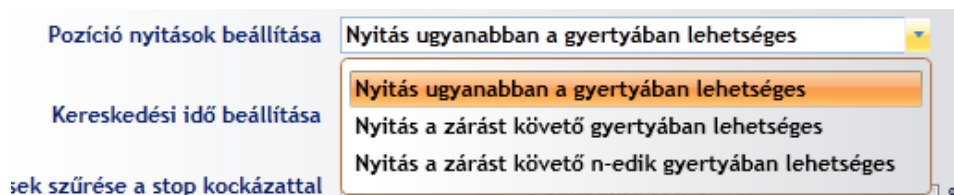
A bal oldalon találhatóak kizárólag a következők:

6.1. Long után csak short, short után csak long engedélyezett. Léteznek olyan stratégiák, amelyeknél előny biztosít az, hogyha nem engedjük meg azt, hogy egymás után ugyanabba az irányba vehessen fel pozíciókat a stratégia, mert mindig a kezdeti belépés a legnagyobb sikerrel kecsegtető, és minél később lép be, annál nagyobb a veszteség esélye.



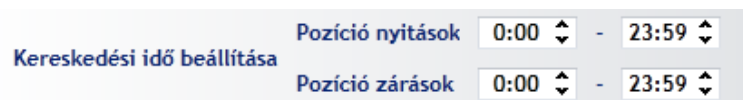
6.2. Pozíció nyitások beállítása:

- *Nyitás ugyanabban a gyertyában engedélyezett:* A zárást követően még ugyanabban a gyertyában nyithat új pozíciót.
- *Nyitás a zárást követő gyertyában lehetséges:* A zárást követően megvárjuk, hogy bezáródjon az adott gyertya és csak a következőtől keresi az újabb pozíciónyitási lehetőséget.
- *Nyitás a zárást követő n-edik gyertyában lehetséges:* A zárást követően megvárjuk, hogy bezáródjon az adott gyertya és csak az n-ediktől keresi az újabb pozíciónyitási lehetőséget.



Mindkét oldalon használandó szűrések leírása:

6.3. Kereskedési idő beállítása: ez egy szűrési feltétel, amelyben csökkenthetjük a kereskedésre szánt időintervallumot. Be lehet állítani a nyitások és külön a zárások időintervallumát.



6.4. Kötések szűrése a stop kockázattal: A belépési ár és a stop ár különbségére szűrhetünk. Amennyiben túl tág a stop, akkor rendszerint veszteséges kereskedésekre számíthatunk.



6.5. Jutalék beállítása: Amennyiben használjuk (ajánlatos) akkor realisabb képet kaphatunk a valós nyereségekről.

Kétféle beállítási lehetőség van. Az egyik a %-os, a másik a nominális érték szerint. Amennyiben nincs pipa a négyzetben, akkor nominális értékekkel számolhatunk (pl. devizák esetében)



6.6. Profit target: Csak akkor lehetséges használni, ha van be van valamilyen stoppolási mód állítva. A stop értékének az x-szeresét adja hozzá vagy vonja le az iránytól függően.

6.7. Indikátor szűrések: Itt kell kiválasztani és hozzáadni az indikátort a beállításokkal együtt.

7. Tétéles kötéslista:

- **Sorszám:** A stratégia eredményei listázásra kerülnek. A kötésszám szempontjából fontos adat.
- **Irány:** Egy kereskedés nyitásának iránya. Az adott sorban a zárása is megtalálható.
- **Nyitás napja:** Csak az év.hó.nap kiírása történik meg ebben az oszlopban.
- **Nyitás ideje:** Az instrumentum ábrázolásánál megadott időperiódusnak megfelelő belépési idő szerint listáz. A kiírt időpont mindig az adott kötés időintervallumának a kezdetét jelöli meg. Tehát, ha egy kötés órás grafikonon 9.31 perckor történik, az a listában 9.00 jelzéssel fog megjelenni.
- **Belépés:** A belépési árfolyamot jeleníti meg az adott stratégia feltételeinek megfelelően.
- **Zárás ideje:** A kilépés idejét tartalmazza év, hó, nap, óra, perc felbontásban. A zárási idő, mindig az adott kötés időintervallumának a kezdetét jelöli meg. Tehát, ha a zárás egy órás grafikonon 16.31 perckor történik, az a listában 16.00 jelzéssel fog megjelenni.
- **Kilépés:** A zárási árfolyamot jeleníti meg.
- **Árrés:** A belépési ár és a zárási árfolyam különbsége. Amennyiben mínusz, az a kötés eredménytelenségét jelzi.
- **Mennyiség:** A pozícióként felveendő darabszámot jelöli.
- **Eredmény:** Minden lezárt kötés végösszegét mutatja.
- **Jutalék:** A pozícióként fizetendő jutalékot jeleníti meg. A megadásnál mindig duplán számoljunk, vagyis ne csak a beszállási lábra, hanem a zárási lábra is számítsuk fel. PI 0,3% jutalék esetén a táblázatba a 0,6%-ot használjuk, így kapunk valósághoz közelítő eredményt.
- **Kumulált eredmény:** A kötések vannak összegezve. Rendkívül fontos mutató, hiszen eldönti, hogy a stratégia életképes vagy sem.
- **Belépési stop ár:** Amennyiben a stratégia megalkotásnál a Risk management fülön belül stop kerül megadásra, akkor a táblázatban is megjelenik az az árszint, amelynél a pozíciózárásra kerül. Ez az alapja a mennyiség kalkulálásának is, amennyiben stop kockázatot is használunk.
- **Drawdown (DD):** A pénzünkhez viszonyított mindenkori legnagyobb visszaesés nominálisan kifejezve.
- **Drawdown% (DD%):** A pénzünkhez viszonyított mindenkori legnagyobb visszaesés százalékosan kifejezve. Egy stratégia megalkotásnál elengedhetetlen megvizsgálni, hogy pénzünk növekedése közben, milyen visszaeséseket kell elszenvednünk, ha a stratégia veszít. Ezt ki-ki magának kell meghatározni. Mi azon a véleményen vagyunk, hogy a 20%-nál nagyobb visszaesés már komolyan megterhelheti a kereskedő idegrendszerét, ezért a visszamenőleges adatokon, ha ennél nagyobb DD+-ot tapasztalunk, akkor csökkentjük a kockázat mértékét (pl. 2%-ról 1,5%-ra, vagy 1%-ra) és minden bizonnyal a DD% is csökkenni fog. Érdemes az általunk elviselhető tartományig csökkenteni az egy pozíción felveendő kockázatot, mert teszteléseknél sokkal könnyebben átsiklik a befektető ezeken a számokon, majd élesben jelentősen megnő a idegeskedési faktor, mert mind időben, mind mértékekben eltérhet a még elviselhető veszteségsorozat. Kezdjük biztonságosan, majd ha már van nyereség lehet növelni a kockázatot.
- **Stop távolság:** A Belépési ár és a Belépési stop ár különbségének az abszolútértéke. Kiváló szűrési feltétel, stratégia kialakításnál elengedhetetlen megvizsgálni. Általánosságban elmondható, hogyha túl tág a stop, akkor azok a kereskedések nem szoktak sikeresek lenni.
- **ADX14:** a listában szintén azért szerepel, mert kiváló szűrési feltételeket szokott eredményezni. Érdemes növekvő sorba rendezni és ezáltal a Grafikon fülre kattintva láthatjuk, hogy vannak-e olyan értékek, amelyeknél nagy valószínűséggel veszteséges lesz a pozíció.
- **ATR14:** Ez is kiváló szűrési feltételeket szokott eredményezni, abból kifolyólag, hogy ez egy volatilitást mérő indikátor. Általában jól behatárolható volatilitási sávban szoktak a stratégiák működni, így érdemes megvizsgálni a belépések milyen környezetben születtek meg. Állítsuk növekvő sorba és szintén kattintsunk a Grafikon fülre, azért, hogy megállapítsuk vannak-e olyan értékek, amelyeknél nagy valószínűséggel veszteséges lesz a pozíció.

- *RSI14*: Mint momentum indikátor a legismertebb. Szűrési feltételként is jól működik, így hasonlóképpen rendezzük növekvő sorba, majd a Grafikon fülre kattintva láthatjuk, hogy vannak-e olyan értékek, amelyeknél nagy valószínűséggel veszteséges lesz a pozíció.

8. Eredmény kiértékelés:

- *Nyitóegyenleg*: Az összeg, amennyivel a kereskedést elkezdjük.
- *Záró egyenleg*: Az adott időszak végére mennyi pénzzel rendelkezünk.
- *Nettó nyereség*: A záróegyenleg és a nyitóegyenleg különbsége adja.
- *Nyitóegyenlegre számított %-os nyereség éves szinten*: A %-os hozamot adja meg.
- *Bruttó nyereség*: Kizárólag a nyereségeket összegezzük.
- *Bruttó veszteség*: Kizárólag a veszteségeket összegezzük.
- *Kereskedések száma*: Az összes lezárt pozíció száma. Egy kereskedésnek számít ugyanazon pozíció vétele és eladása.
- *Nyerő/Vesztő arány*: A nyereséges kereskedések száma / veszteséges kereskedések száma
- *Nyereséges kereskedések száma*: Összegezzük a nyereséges kereskedéseket számát és nem összegét.
- *Veszteséges kereskedések száma*: Összegezzük a veszteséges kereskedések számát és nem összegét.
- *Legnagyobb nyereséges ügylet*: Az összes nyereséges kereskedés közül a legnagyobb.
- *Legnagyobb veszteséges ügylet*: Az összes veszteséges kereskedés közül a legnagyobb.
- *Átlagos nyereség ügyletenként*: Az összes nyereséges kereskedés osztva a nyereségesek számával.
- *Átlagos veszteség ügyletenként*: Az összes veszteséges kereskedés osztva a veszteségesek számával.
- *Maximum Drawdown*: A legnagyobb elszenvedett veszteségsorozat.
- *Maximális DD (%)*: A legnagyobb százalékos DD, ez nem biztos, hogy a legnagyobb DD összegéből jön ki, mert fontos, hogy mennyi volt a kiinduló összegünk.
- *Profit Factor (szinonima Profit/Loss Ratio)*: Ezt az értéket a bruttó nyereség / bruttó veszteség abszolút értéke adja. Ha ez az érték kisebb, mint egy, akkor a rendszerünk veszteséges. Az olyan rendszer, aminél ez a szám 2 fölött van, jónak mondható. Minél nagyobb a szám, annál jobb.
- *Recovery Factor (szinonima Reward/Risk Ratio)*: Recovery Factor egyenlő a Nettó Profit abszolút értéke osztva Maximális Drawdown-nal. Recovery Factornak jellemzően nagyobbak kellene lennie egynél. Az egészséges Recovery Factor egy jelzés, hogy kereskedési rendszerünk legyőzheti a maximális drawdown-t.
- *Payoff Ratio*: Ezt az értéket úgy kapjuk meg, hogy az Átlagos profitot osztjuk az Átlagos veszteség abszolút értékével. Minél magasabb ez a szám annál jobb, de össze kell hasonlítani a nyerő kereskedések százalékával, hiszen egy 50%-os nyerő/ veszteséges aránynál megfelelő a kettő érték, míg, mondjuk egy 30% / 70% aránynál, nem hiszen ekkor a 30%-on elér nyereség éppen csak fedezi a jóval több veszteséges kereskedést. Ilyen nyerő veszteséges aránynál csak a 3 vagy 4 fölötti Payoff Ratio megfelelő.

9. Grafikon:

A grafikonon a kumulált nyereség oszlop van ábrázolva. A szűrések beállításánál nagymértékben támaszkodhatunk a nyereség görbe alakjára. Segítségével szűréseket tudjuk optimalizálni. Szintén könnyebben lehet szemléltetni grafikonon azt, hogy a stratégia mennyire független a piaci körülményektől, a drawdown értéke mennyire kirívó a görbén.

10. Beállítások:

Megjelenítési mód

Nyíl Gyertyaszín Long █ Short █ Semleges █

Stop szint

Megjelenítése Szín █ Vonalvastagság 2

Profit target szint

Megjelenítése Szín █ Vonalvastagság 2

10.1. Megjelenítési beállítások:

Amennyiben bepipáljuk a Nyíl melletti mezőt, akkor a jelzéseknél attól függően, hogy milyen pozíciót nyitottunk long esetén a gyertyák alá alapbeállításban egy felfele zöld nyíl kerül, short esetén a gyertyák fölé egy lefele mutató piros nyíl kerül.

Gyertyák színe: Ez a beállítás nemcsak a jelzés, hanem az egész pozícióban végigköveti a gyertya színét attól függően, hogy long vagy short ügylet került nyitásra. Rendkívül szemléletes, ezért könnyebb a stratégiát is tesztelés előtt vizuálisan áttekinteni.

10.2. Stop szint beállítások:

Lehetőségünk van beállítani, hogy egyáltalán megjelenjen-e a stop szint. Emellett ennek a színe és vonalvastagsága módosítható még.

10.3. Profit target szint beállításai

Ennek a beállítása a kereskedési beállítások munkalapon kiválasztott profit target jelzést ábrázolására vonatkozik.

11. Stratégia mentése

Nyomjuk meg a jobb egérgombot a grafikonon. A mentési funkció csak a felső részen működik a stratégiaépítő alsó részen nem tudjuk elmenteni a beállításokat. Megjelenik egy panel, ahol kattintsunk a Stratégia mentése gombra.



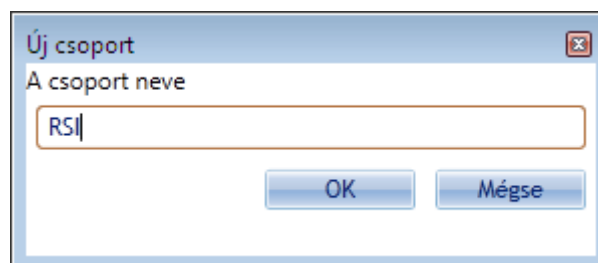
11.1. Stratégia mentése az alapértelmezett listába.

Megjelenik egy új panel, amelyen beírhatjuk a stratégia nevét.



The screenshot shows a dialog box titled "Stratégia mentése alapértelmezett listába". It contains a text input field with the text "RSI stratégia EURUSD". Below the input field is a dropdown menu labeled "Létrehozás itt" with a downward arrow. A button labeled "Új csoport" is located below the dropdown menu. At the bottom of the dialog box are two buttons: "Mentés" and "Mégse".

Ezután kattintsunk az „Új csoport” gombra. Írjunk be egy tetszőleges könyvtárnevet. Pl. ide az RSI-t írtuk, mert ez alá szeretnénk az összes olyan instrumentum beállításait menteni, amelyeken egy RSI alapú stratégiát szeretnénk futtatni.




The screenshot shows a dialog box titled "Új csoport". It contains a text input field with the text "RSI". At the bottom of the dialog box are two buttons: "OK" and "Mégse".

11.2. Alapértelmezett lista

A csoportokat úgy célszerű kialakítani, hogy később könnyen tudjuk azonosítani a stratégiát és az ahhoz rendelt instrumentumokat.

Amennyiben sok stratégiát akarunk kezelni, akkor vagy a stratégiák szerint csinálunk fő könyvtárakat, vagy az adott általunk figyelt instrumentumokat jelöljük meg fő könyvtárnak és ezekhez rendeljük a stratégiákat az egyedi beállítások szerint. A jobbra található ábrán már előre felvett könyvtárakat és az általunk megadott RSI stratégia besorolását láthatjuk.

Az elmentett stratégiákat elérhetjük a jobbra lent. Ez a panel már akkor előjön, ha egérrel ráállunk. Le is fixálhatjuk a panel jobb felső sarkában található  jelre kattintva.uk

A különböző elmentett beállításokat úgy tudjuk a grafikonra rakni, ha a stratégia nevére állva bal egeret lenyomva tartjuk és ráhúzzuk a grafikonra. Ekkor a korábban a grafikonon lévő beállítások az újra cserélődnek.



11.3. Stratégia törlése



12. Időtáv beállítása

A statisztika fejléc bal oldalán állítható be az időtáv.

2013.03.06. 6:30 - 2013.03.15. 0:15 Követés Mind

Az első két boxban a kezdő és végdátumot tudjuk állítani. Ekkor a stratégia csak a beállított időértékek között fogja a stratégiát futtatni.

Követés: Amennyiben bepipáljuk, akkor a végdátumot nem tudjuk állítani, mert folyamatosan az aktuális új adatokkal frissíti az időtávot. Ezt a funkciót akkor használjuk, ha élesben kereskedünk és a jelzésekre hagyatkozunk.

Mind: Ez a funkció akkor érdekes, ha a grafikonon a +, - gombokkal megnöveljük az időtávot, vagyis nagyobb grafikonrészletet jelenítünk meg, attól még a program csak a beállított időszávon belül értelmezi a jelzéseket. Amennyiben rákattintunk a „mind” gombra, akkor a grafikonon látható összes adatra kiszámolja a jelzéseket a program. Ez a funkció gyorsítja a stratégia végigfuttatását hosszabb időintervallumokon, és elkerülhető az időtáv állíthatósága.

13. Exportálás excelbe

Amennyiben tovább akarunk dolgozni az adatokkal, akkor a Tételes kötéslista munkalapon nyomjunk egy jobb egeret és kattintsunk a megjelent Exportálás Excelbe gombra.

Sorsz	Írány	Nyitás napja	Nyitás ideje	Belépés	Zárás ideje	Kilépés	Árrés	Mennyiség	Eredmény	Jutalék	Kumulált	Belépési	DD	DD %	Stop távolság	ADX14
1.	Short	2012.09.11.	07:00	1,2772	2012.09.11 09:00	1,2779	-0,0007	71 428	-50	12,86	-93	1,2779			0,0007	
2.	Long	2012.09.13.	14:00	1,2911	2012.09.13 15:00	1,29	-0,0011	45 032	Exportálás Excelbe		169	1,29	77	0,77 %	0,0011	-181,9
3.	Short	2012.09.17.	22:00	1,3094	2012.09.17 23:00	1,3109	-0,0015	27 468	-41	16,48	-227	1,3112	134	1,35 %	0,0018	21,95
4.	Long	2012.09.17.	23:00	1,3109	2012.09.18 04:00	1,3093	-0,0016	27 307	-44	16,38	-287	1,3091	194	1,96 %	0,0018	20,47
5.	Short	2012.09.18.	06:00	1,3099	2012.09.18 10:00	1,3114	-0,0015	32 569	-49	19,54	-356	1,3114	263	2,65 %	0,0015	14,72
6.	Long	2012.09.19.	11:00	1,3075	2012.09.19 12:00	1,3026	-0,0049	26 951	-132	16,17	-504	1,3057	411	4,15 %	0,0018	27,76
7.	Short	2012.09.20.	00:00	1,3046	2012.09.20 02:00	1,3055	-0,0009	52 949	-48	31,77	-583	1,3055	490	4,95 %	0,0009	20,73
8.	Long	2012.09.20.	03:00	1,3055	2012.09.20 04:00	1,3046	-0,0009	59 071	-53	35,44	-672	1,3047	579	5,84 %	0,0008	18,28
9.	Short	2012.09.20.	04:00	1,3046	2012.09.21 08:00	1,2992	0,0054	46 814	253	28,09	-447	1,3056	354	3,58 %	0,001	17,3
10.	Long	2012.09.21.	08:00	1,2992	2012.09.21 10:00	1,2975	-0,0017	28 198	-48	16,92	-512	1,2975	419	4,23 %	0,0017	25,57
11.	Long	2012.09.21.	20:00	1,3003	2012.09.21 21:00	1,2982	-0,0021	22 673	-48	13,6	-573	1,2982	480	4,85 %	0,0021	16,5

Akkor érdemes ezt a funkciót használni, ha több stratégia eredményeit szeretnénk elemezni. Ekkor elég egymás után kimásolni a kötéslistákat és időben sorrendbe rendezve kaphatunk adatokat, amelyeket az excel eszközeivel kell elemeznünk. Ajánlott a kumulált eredményst kiszámítani a be és kiszállási jelek, valamint a mennyiségek segítségével és ezt ábrázolva egy excelbe épített grafikonnal, máris információkat kapunk a kialakított portfólió teljesítményéről.