

Backtest for dummies – løsningen på dine tradingproblemer

Stoler du typisk på dine mavefornemmelse, når du handler? I så fald vil du opleve, at du af og til rammer nogle gode trades, der holder din optimisme i live. Men desværre vil din tradingkonto med 100% sikkerhed blive drænet for penge over tid. En del af løsningen er såkaldt backtesting, og det handler denne artikel om. Du vil også modtage et tip om et effektivt hjælpemiddel til din backtestning.

**Få et tip, når vi ser en god børshandel i aktier og
valutaVia Messenger-app**

Backtesting vil sige, at du beskriver din handelsstrategi på en systematisk måde, og dernæst tester den i markedet via historiske data. Det vil afsløre, om din strategi har et godt fundament, eller om det er et luftkastel.

Selvom det kan lyde indlysende, så afholder mange mennesker sig fra at teste deres strategi. Men backtesting er virkelig helt essentielt, hvis du vil være i stand til konsekvent at se grønne tal på din konto.

Fordelene ved at handle på baggrund af en backtestet strategi er åbenlyse:

- Du reducerer følelserne i dine handler – du udfører dine handler uden usikkerhed
- Du opbygger en visuel hukommelse og mønstergenkendelse, der gør din egen trading mere sikker
- I backtesting-processen kan du optimere strategien, så den bliver endnu bedre

Det kræver arbejde at backteste sin strategi, og en

systematisk test involverer software- og kodningsfærdigheder. Derfor fokuserer denne artikel på manuel backtesting, der kan håndteres af alle.

Manuel backtesting – Sådan gør du

Det er helt afgørende, at du har klare regler for din strategi. Det skal præciseres i detaljer, så der ikke er nogen som helst tvivl om, hvorvidt du skal handle eller ej.

**Prøv vores gratis handelssignaler i aktier og valuta - LIVE
Via Messenger-app**

Lad os se på en simpel strategi som et eksempel:

Marked: Aktier på det amerikanske aktiemarked (NASDAQ, S&P-500 og Dow Jones)

Tidsperiode: 1-times graf på candlestick.

Købsstrategi: Køb KUN, når prisen er over det glidende gennemsnit 200 og lukker over det glidende gennemsnit 10. Det glidende gennemsnit med interval 10 skal være over det glidende gennemsnit på 200.

Exit-strategi: Luk positionen, når prisen lukker under det glidende gennemsnit 10.

Du kan tilføje flere kriterier end ovenstående, for eksempel med forskellige stop loss-niveauer, eller at du kun handler et bestemt tidspunkt på dagen. Men for at holde det enkelt, er vi tilfredse med ovenstående.

Se et eksempel nedenfor, hvor vi har testet denne strategi i en tilfældigt udvalgt aktie. Den blå linje er glidende gennemsnit 10, og den røde linje er glidende gennemsnit 200.



På ovenstående graf kan du se, at der var fire handelsmuligheder for denne strategi. Den grønne pil viser, hvornår vi købte, og den røde pil, når vi solgte. Det førte til følgende handler:

1: + 1,04 %

2: -0,15 %

3: + 2,06 %

4: -1,42 %

I alt: + 1,53% (Husk også at medregne eventuelle omkostninger såsom kurtage og spreads)

Dette er en god start til at backteste din strategi. Men fire positioner er for lille en mængde til at kunne vurdere strategiens effektivitet over tid. Der er simpelthen for stor tilfældighed involveret.

Vigtigheden af ☐mange test-handler

Handelspsykolog Mark Douglas foreslår i sin berømte bog

“Trading In The Zone” at dele handler op i portioner af 20 for at se, om der er en såkaldt “edge” i strategien. Nedenfor kan du se et eksempel på en strategi, som vi har backtestet på denne måde:

daytrader.dk

"All traders give themselves exactly what they feel they deserve. Trading is an exercise in accumulating money. Once we have learned how to trade (perceive opportunity and execute our trades), who else or what else could be responsible for how much we end up with in our equity account?"

Mark Douglas

	Date	Market	Win	Loss	Scratch	Points
9 jan	1 09 / 00	DOW			X	0
16 jan	2 22 / 30	DOW		X		-100
21 jan	3 02 / 30	DOW		X		-100
1 feb	4 03 / 30	DOW		X		-100
12 feb	5 14 / 00	DOW	X			+1400
13 feb	6 09 / 00	DOW		X		-100
14 feb	7 11 / 30	DOW			X	0
→ 18 feb	8 01 / 30	DOW		X		-100
21 feb	9 10 / 30	DOW		X		-100
25 feb	10 13 / 30	DOW			X	0
27 feb	11 13 / 30	DOW		X		-100
5 mar	12 04 / 00	DOW		X		-100
→ 12 mar	13 07 / 30	DOW		X		-100
→ 16 mar	14 05 / 30	DAX		X		-100
→ 23 mar	15 06 / 00	DAX		X		-100
→ 9 apr	16 19 / 30	DAX			X	0
10 apr	17 06 / 30	DAX	X			400
11 apr	18 22 / 30	DAX	X		X	4500
28 apr	19 19 / 30	DAX	X			+1500
	20 06 / 00	DAX		X		-100

Notes:

Sammenlagt endt strateg. (2100)

Figure 13.2 Twenty Sample Trades Worksheet.

Source: Mark Douglas, *Trading in the Zone* (New York: New York Institute of Finance/Prentice Hall, 2000).

Som du kan se på billedet, taber strategien nogle gange mange

gange i træk, men giver af og til et stort overskud, der kompenserer for tabene. Dette illustrerer tydeligt vigtigheden af ☐at have en stor "prøvestørrelse".

Vi anbefaler dog, at du tester din strategi mere end bare det. Test også i forskellige aktier og markeds klimaer, for virkelig at vurdere dens robusthed.

Den svenske multimillionhandler Kristjan Kullamägi fortæller i podcasten Chat With traders om, hvordan han gik tilbage i begyndelsen af ☐sin handelskarriere og kiggede på tusindvis af grafer for at se, hvordan hans strategi havde klaret sig historisk. Arbejdet gav ham tryghed og reducerede følelserne, fordi han dernæst vidste, hvad han kunne forvente af sin strategi.

Få et tip, når vi ser en god børshandel i aktier og valuta
Via Messenger-app

Forfin strategien

Du kan selvfølgelig tilføje flere kriterier for at forbedre strategien. Her er nogle forslag:

- Det brede aktiemarked skal være over det glidende gennemsnit på 200 for at jeg kan handle
- Jeg handler kun aktier fra den nuværende førende sektor
- Jeg handler kun i den første handelstid efter åbning

osv. osv.

Prøv at fejlfinde svaghederne i din strategi, og prøv at tilføje kriterier for at forbedre den yderligere. Men det er generelt en god idé at have færre, men effektive kriterier frem for mange.

Pas også på med såkaldt "*confirmation bias*", hvilket betyder, at du kun søger støtte, der bekræfter din hypotese. For at

undgå den fælde bør du prøve at udfordre din hypotese ved at finde årsager, der modsiger strategien.

En hjælp til back-test

Vi har her beskrevet, hvordan du nemt kan backteste en strategi. Du kan nu, efter at du klart har defineret din egen strategi, gå tilbage og se på prisgrafer og se, hvordan din strategi har klaret sig.

Ulempen ved dette er dog, at din hjerne nemt kan snyde dig, så du først ser, når strategien har fungeret godt. Det kendes som *bekræftelsesbias*.

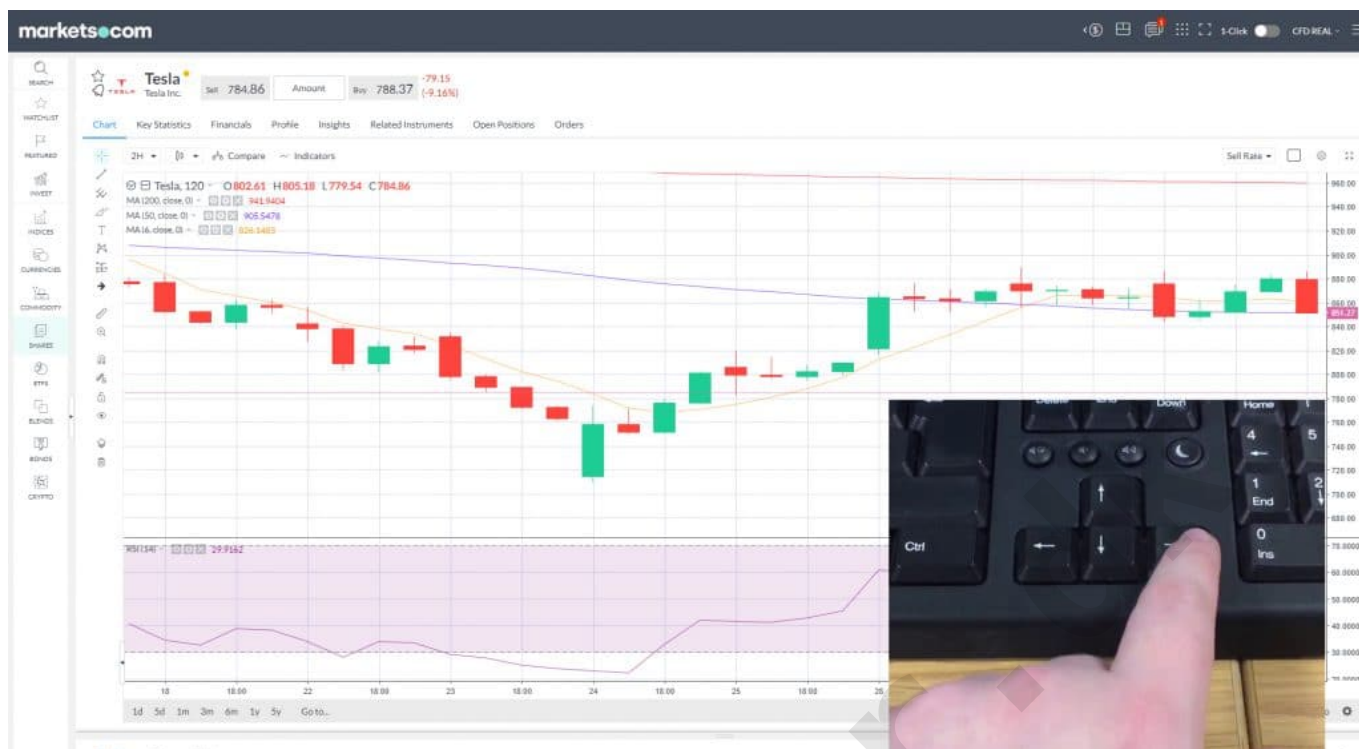
For at undgå det, er der en såkaldt "bar replay"-funktion på analyseplatformen Tradingview.com, som gør, at man kan gå historisk tilbage og gentage kursudviklingen i grafen. Dette er en utrolig hjælpsom funktion, der giver dig en stærk fornemmelse omkring kursusudviklingen, altså stort set samme oplevelse, som når du senere handler live med strategien.

Videoen nedenfor viser, hvordan funktionen fungerer.

Bar Replay-funktionen kræver et betalt medlemskab af Tradingview, men du har mulighed for at teste deres forskellige medlemskaber gratis i 30 dage. Bemærk: Vi har intet samarbejde med Tradingview, vi synes bare det er en god funktion.

En alternativ metode er, at man på Markets.com for eksempel går tilbage i tiden på grafen og derefter trykker på højre piletast for at springe frem trin for trin. Det vigtige er, at du ikke på forhånd kan se, hvordan forløbet har udviklet sig. På Markets.com kan du nemt oprette en gratis demokonto, som du kan teste din strategi på. Du kan dernæst hurtigt skifte til LIVE-account, hvis du fornemmer, at dine strategier virker.

Billedet nedenfor illustrerer, hvordan man backtester med denne metode på Markets.coms handelsplatform.



Billedet viser, hvordan du kan gå tilbage på grafen og derefter klikke på højre piletast for gradvist at springe frem i kursusudviklingen hos Markets.com. På den måde kan du se udviklingen i forløbet, uden på forhånd at vide, hvor det går hen.

Som du kan se, løser backtesting mange af de problemer, som mange tradere kæmper med. Det vil tage noget tid og kræfter fra din side, men det vil du sikkert være taknemmelig for, når du først har gjort det.

Nordic traders er en handelstjeneste, der allerede har udført backtest-jobbet for dig. Her får du, helt gratis, back-testede handelssignaler sendt til din mobil. Læs mere og tilmeld dig her.

yes

Disclaimer Headline Til orientering:

Disclaimer Text Hos daytrader.dk skaber vi gratis indhold og læringsforløb for jer brugere. Det kan vi blandt andet gøre, fordi vi indgår samarbejde med brokerne, der betaler for

omtale på siden.

daytrader.dk