7 способов, которыми врёт бэктест

и проверка на минуту для каждого. Бесплатный чек-лист от Backtest Reality Check Kit.

1. Он знает будущее. `shift(-1)`, центрированные скользящие окна, деление на максимум за всю историю, сделка по той же цене закрытия, по которой построен сигнал. Код от ИИ делает так молча.
Проверка: удалите все свечи после дня t и пересчитайте. Если сигнал в день t изменился, код подглядывает в будущее.

2. Вы забыли, сколько вариантов перепробовали. 1 000 стратегий «по монетке» на биткоине 2018–2026: лучшая показала 47,6% годовых и Шарп 1,09. Умения ноль.
Проверка: посчитайте все варианты, включая отброшенные, и используйте deflated Sharpe ratio. Нужна вероятность от 0,95.

3. Вы не отложили данные, которых стратегия не видела. Если при подборе использовались все годы истории, проверки нет вообще.
Проверка: уберите в сторону последние 30% истории и посмотрите на них один раз. Ухудшение нормально: сохранить половину Шарпа — хороший результат.

4. Комиссии из фантазии. 200 сделок в год по 0,1% за вход и выход — это около 40% от размера позиции в год на издержки.
Проверка: удвойте комиссии. Если преимущество исчезло, его и не было.

5. Слишком мало сделок. 12 прибыльных сделок ничего не доказывают.
Проверка: не меньше 30 сделок, и прибыль не сосредоточена в 2–3 из них.

6. Один удачный период рынка. Многие «крипто-боты» — это просто бычий рынок 2020–2021.
Проверка: результат по годам; уберите лучший год; walk-forward против «купил и держи» за те же годы.

7. Одинокий пик. Скользящие 50/200 работают, а 45/200 и 55/200 нет? Это шум, а не преимущество.
Проверка: сдвиньте каждый параметр на шаг. Соседние варианты тоже должны работать.

Хотите все семь проверок автоматически? Backtest Reality Check Kit запускает их одной командой на крипте, американских акциях и форексе: стенд на Python с out-of-sample, walk-forward, deflated Sharpe, бутстрэпом и детектором «будущего», 12 промптов-скептиков для ИИ и гайд «Как не слить депозит».

backtestrealitycheck.com/ru

Только в образовательных целях. Не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией. Примеры на открытых исторических данных, носят иллюстративный характер. Торговля связана с риском потери средств.