

Backtest là gì? Top phần mềm backtest forex hiệu quả

Backtest là gì? Đây là một phần mềm có chương trình cho phép các nhà giao dịch kiểm tra thử chiến lược giao dịch của mình thông qua những dữ liệu đã có ở quá khứ. Kết quả thu được khi sử dụng công cụ backtest forex sẽ hỗ trợ trader trong việc tối ưu lại và đo lường hiệu suất chiến lược trước khi áp dụng chúng vào thị trường thực tế. Như vậy, để hiểu rõ backtesting là gì? Các công cụ backtest miễn phí có tính năng gì? Hãy cùng theo dõi bài viết sau của Forex Dictionary nhé.

Tìm hiểu về Backtesting và Forex Backtesting

Sự ra đời của backtest forex

Trước khi đi vào tìm hiểu rõ định nghĩa **backtesting là gì** hay forex backtest là gì thì đầu tiên trader hiểu sơ qua về quá trình ra đời của backtest forex.

Năm 1980, định nghĩa về việc kiểm tra lại hệ thống forex được hiểu khá đơn giản và phổ biến. Trader sẽ tiến hành thực hiện giao dịch của mình trên biểu đồ với các vị thế mua hoặc vị thế bán. Sau đó, kết quả giao dịch này sẽ được ghi vào nhật ký của trader. Ý tưởng giao dịch phần lớn sẽ xuất phát từ chính sự hiểu biết của trader với các kiến thức về các mô hình thị trường hoặc phân tích cơ bản. Đến những năm 1990, một người có thể hiển thị dữ liệu giao dịch của mình lên trên màn hình máy tính sẽ được gọi là "nhà đổi mới đầu tư".



Sự hình thành và phát triển của backtest forex

Hiện nay, quy trình backtesting cho phép người sử dụng kiểm tra kết quả trực tuyến. Đồng thời tin tưởng vào chiến lược giao dịch do chính mình đề ra trong khoảng thời gian vài ngày thế nhưng quy trình này trong quá khứ lại chiếm lấy khoảng thời gian vài tháng hoặc có thể là vài năm. Với sự tiến bộ của công nghệ, quá trình giao dịch backtest của hệ thống giao dịch đã giúp trader đơn giản hóa đi rất nhiều lần.

Quy trình backtest chiến lược giao dịch trong ngày nay được liên tục cải tiến, tuy nhiên nó không có nghĩa là lúc nào cũng tốt hơn. Những trader biết cách sử dụng sự am hiểu thị trường của mình và các tin tức kinh tế vào chiến lược backtest sẽ có kết quả giao dịch khá tốt và thu về lợi nhuận cao.

Ngược lại, nếu như trader loại bỏ sự logic đến từ kiến thức của mình và chỉ áp dụng sức mạnh tính toán vào chiến lược này thì sẽ gặp nhiều rủi ro và chịu tổn thất lớn. Có thể nói sẽ không có phần mềm có khả năng thay thế con người khi nhắc đến việc backtest chiến lược giao dịch, đặc biệt là khi con người biết cách vận dụng và sử dụng những công cụ phù hợp.

Backtesting là gì? Forex backtesting là gì?

Forex backtesting được biết đến là một chiến lược giao dịch dựa vào các dữ liệu ở quá khứ. Trader sẽ xem xét chiến lược đầu tư sẽ được hoạt động như thế nào thông qua việc sử dụng những dữ liệu ở trước đó. **Công cụ backtest forex** chính là một tập hợp những quy tắc về kỹ thuật được áp dụng đối với một tập hợp dữ liệu giá ở trước đó. Và đồng thời tiếp theo đó nó cũng sẽ phân tích lợi nhuận được tạo ra từ chiến lược forex ở một khoảng thời gian nhất định.

Tìm hiểu về backtesting trong giao dịch forex

Lý do trader forex nên backtest hệ thống giao dịch?

Sẽ có rất nhiều lợi ích mà trader forex có thể nhận về khi backtest lại hệ thống giao dịch. Chẳng hạn như:

- Hiểu sâu sắc hơn về chiến lược: Đầu tiên, việc backtest lại hệ thống giao dịch sẽ giúp các trader có thể xác định được liệu rằng những chiến lược mà mình đã chọn có mang lại nguồn lợi nhuận theo như dự kiến ban đầu hay là không.
- Thực hành: công cụ backtest sẽ hỗ trợ trader trong việc phát hiện ra những cơ hội giao dịch thông qua việc xem xét sự biến động của giá ở quá khứ và các mẫu định kỳ. Hiểu một cách đơn giản hơn, nó sẽ có công dụng giúp trader phát triển được kỹ năng phân tích kỹ thuật của chính bản thân mình.

- Tự tin: Backtesting forex sẽ giúp trader có được sự tự tin. Dựa vào cách kiểm tra các thông tin giá ở quá khứ của các trader sẽ giúp trader tích lũy thêm được rất nhiều kinh nghiệm. Nhờ vào điều này mà trader sẽ tự tin hơn khi bắt đầu tham gia vào giao dịch thật sự.

Tóm lại, những yếu tố này đến cuối cùng kết hợp lại cũng chỉ vì mục đích giúp trader gạt hái được nhiều thành công hơn nữa trong chính giao dịch của mình. Do đó, cách thức để trader có thể **backtest là gì?** Đây sẽ được xem là lúc phần mềm backtest forex phát huy được tác dụng.

Quy trình hoạt động của công cụ backtest forex

Như đã chia sẻ, công cụ backtest forex khi sử dụng sẽ được hiểu như là một chiến lược giao dịch forex dành cho một tập hợp về dữ liệu giá cũng như các giao dịch đã được xây dựng lại từ chính cách thức sử dụng dữ liệu đó. Các trader có thể sử dụng dữ liệu này để xác định mọi sai sót không được đo lường trước ở trong các chiến lược giao dịch của mình ở hiện tại. Không những thế, cũng có thể kiểm tra các chiến lược mới trước khi sử dụng chúng ở trong một thị trường trực tiếp.

Tùy vào loại phần mềm backtest forex được sử dụng mà trader có thể nhận về các chỉ số ví dụ như:

- ROE (Tổng lợi nhuận trên vốn chủ sở hữu): Chính là khoản lợi nhuận được hiển thị dưới dạng tỉ lệ % của tổng số vốn đầu tư.
- P/L (Tổng lợi nhuận và thua lỗ): Là tổng phần lợi nhuận và thua lỗ được một chiến lược tạo ra được hiển thị dưới dạng tỉ lệ % của nguồn vốn chủ sở hữu đã được đầu tư.
- Tổng tỷ lệ lãi/lỗ: Là tỉ lệ của bao nhiêu giao dịch dẫn đến thua lỗ và bao nhiêu dẫn đến lợi nhuận.
- ROE hàng năm: Tổng phần lợi nhuận được chiến lược forex tạo ra trong một năm dương lịch.
- Biến động: Là những loại điều kiện thị trường mà chiến lược của trader đang diễn ra hoạt động, xu hướng giảm và xu hướng tăng.
- Lợi nhuận điều chỉnh theo rủi ro: Tính toán phần lợi nhuận của trader liên quan đến các rủi ro đến từ chiến lược giao dịch.

Như vậy, có thể thấy toàn bộ những số liệu này sẽ cung cấp thông tin chi tiết cho trader về cách thức hoạt động của các chiến lược giao dịch forex của trader.

Những yếu tố có khả năng ảnh hưởng đến kết quả backtesting

Phần mềm backtest forex phụ thuộc vào một vài yếu tố có khả năng làm kết quả của toàn bộ quá trình bị ảnh hưởng. Đặc biệt, trader cần lưu ý đến 3 yếu tố sau đây:

Chất lượng của dữ liệu và nguồn

Đối với việc backtest, độ tin cậy và độ chính xác của dữ liệu giá sẽ đóng vai trò vô cùng quan trọng và liên quan trực tiếp đến chiến lược giao dịch của trader. Trong thị trường OTC (không kê đơn), hãy nhớ rằng các dữ liệu được tạo ra không phải lúc nào cũng bằng nhau. Ngoài ra, sàn forex trực tuyến và các ngân hàng tại cùng một thời điểm sẽ có dữ liệu giá khác nhau.



Chất lượng dữ liệu và nguồn sẽ ảnh hưởng đến kết quả của backtesting

Xác định

Khi trên cùng một tập dữ liệu được áp dụng cùng một chiến lược nhiều lần thì kết quả sẽ có sự thay đổi như thế nào?

Chiến lược backtesting cần phải được xác định 100%. Đối với một tập dữ liệu được xác định mỗi khi trader kiểm tra lại chiến lược forex sẽ cho ra kết quả tương tự nhau. Mặc dù đây được xem là một kịch bản vô cùng lý tưởng thế nhưng sẽ không thể hoàn toàn xảy ra được

Logic thực thi thương mại

Công cụ backtest forex sẽ không bao giờ là một sự đại diện hoàn toàn của một thị trường nào cả. Trader đâu đó sẽ thiếu đi một vài yếu tố quan trọng khác như độ trễ,

trượt, từ chối hoặc trích dẫn lại. Những điều này cũng vô cùng quan trọng để xem xét lại việc trader đang đánh dấu dữ liệu hay đang sử dụng dữ liệu thanh.

Trong đó, có thể dữ liệu đánh dấu sẽ cho phép mô phỏng gần với lịch sử hoàn hảo dữ liệu của trader. Quá trình sẽ bị chậm hơn nếu như bao gồm cả dữ liệu thanh. Còn đối với dữ liệu thanh, trader sẽ nhận được bốn điểm giá cho khoảng thời gian. Kết quả sẽ có độ chính xác càng cao khi khung thời gian càng dài.

Trader hãy nên lưu ý rằng dù cho công cụ backtest có là phần mềm kiểm tra tốt nhất đi chăng nữa thì lợi nhuận trong tương lai cũng sẽ không thể được đảm bảo. Trong thị trường forex, việc thanh khoản không thường xuyên là điều khá quen thuộc. Nó sẽ bị các yếu tố bên ngoài khác nhau chi phối cũng như rất khó để mô phỏng.

Hướng dẫn backtest chiến lược giao dịch

Trên thị trường hiện nay sẽ có vô vàn các **phần mềm backtest forex** và mỗi loại sẽ có cách đánh giá riêng về chiến lược giao dịch. Trong đó, backtesting được chia làm 2 loại đó là thủ công và tự động.

Chiến lược Backtesting thủ công

Đối với chiến lược backtesting thủ công, trader chỉ cần tìm lấy các dữ liệu lịch và sau đó bước qua nó. Trader có thể đi theo từng thanh dựa vào công cụ biểu đồ để quan sát hành động giá cũng như các số liệu hiệu suất diễn ra tiếp theo trên đường đi. Việc kiểm tra thủ công này sẽ bao gồm những lợi thế như sau:

- Bất kỳ ai cũng có thể thực hiện được nó.
- Khi thực hiện giao dịch, trader sẽ phát triển được sự hiểu biết về cách thức hoạt động của phần mềm giao dịch forex. Đặc biệt là biết được cần phải cải thiện điều gì và thậm chí trader có thể tự phát triển một chiến lược tự động ở sau này.
- Backtesting thủ công sẽ mô phỏng các cơ chế giao dịch trực tiếp. Ví dụ như quản lý rủi ro, thoát hoặc nhập giao dịch,...

Sử dụng phương pháp backtesting thủ công được xem là một cách vô cùng tốt trước khi trader bắt đầu tiến hành dùng phần mềm tự động. Bên cạnh đó, trong loại kiểm tra này sử dụng bảng tính excel là một phương pháp phổ biến để kiểm tra lại các chiến lược forex.

Backtest hệ thống giao dịch thông qua Excel

Nhiều trader tin rằng không cần phải là một nhà kỹ sư hay lập trình viên để kiểm tra lại chiến lược. Phương pháp này sẽ giúp trader trở lại với những điều cơ bản nhất mà bất kỳ người nào cũng sử dụng được. Các chương trình bảng tính nói chung và excel nói riêng được biết đến là một trong các cách hiệu quả nhất trong việc kiểm tra lại chiến

lược giao dịch forex miễn phí. Trader cần phải có được một nguồn dữ liệu công khai có sẵn, ví dụ như ngày / giờ, 'thấp', 'đóng', 'giá', 'mở' hoặc cao'. Nếu như thử nghiệm các chiến lược forex trong ngày thì thời gian sẽ là thành phần không thể thiếu. Để lấy được các dữ liệu này, trader có thể truy cập vào Google Finance hoặc Yahoo Finance.

Tại trường "Nhập Biểu tượng / Tên công ty", trader sẽ cần nhập biểu tượng của loại tiền mà mình có nhu cầu xem dữ liệu. Ngoài ra, trader cũng cần phải tìm phần tùy chọn trong trường "Báo giá" để nhận giá lịch sử cho biểu tượng mà mình đã chọn. Sau đó tại đây nhập phạm vi ngày. Trader kéo xuống cuối trang và nhấn vào mục "Tải xuống bảng tính". Cuối cùng, trong menu dữ liệu, trader sử dụng tùy chọn của excel tại phần "Sắp xếp" để chuẩn bị phần dữ liệu.

Sau đây sẽ là một cách tìm ngày trong tuần để mang về nguồn lợi nhuận tốt nhất. Chẳng hạn trader đang có chiến lược là mua mở và bán đóng.

- Cột A: Cột ngày
- Cột B: Giá mở
- Cột C: Giá đóng

Tiếp đến sẽ là việc sử dụng công thức để thu về kết quả tốt nhất:

- Tại cột D, trader sử dụng công thức: $= IF (WEEKDAY (\$ A2,2) = D \$ 1, \$ C2- \$ B2, "")$. Sau đó sao chép công thức này trên tất cả các cột từ cột D cho đến cột H.
- $(\$ C2- \$ B2)$: Tức là giá đóng trừ đi giá mở. Phần thực sự của báo cáo khi đó sẽ thể hiện phần lãi/lỗ.
- $("$): Phần sai của tuyên bố ở dưới dạng dấu ngoặc kép. Nó sẽ không đưa ra kết quả nào trong trường hợp ngày trong tuần không được khớp.

Công thức này sẽ có ý nghĩa nếu ngày trong tuần đã được chuyển đổi thành số từ 1 cho đến 5 để khớp với từ thứ 2 đến thứ 6 giống với các ngày trong tuần của cột này (D\$1) ở hàng đầu tiên với kết quả trả về tương ứng. Trader cũng có thể lựa chọn gồm các hàm trung bình cùng với tổng nằm ở cuối của cột "Ngày trong tuần" để tìm ra ngày có lợi nhất trong việc thực hiện chiến lược giao dịch trong thời gian dài hạn.

Chiến lược này để backtesting lại thông qua cách sử dụng tùy chọn thủ công. Trader có thể sử dụng nhiều công thức và biểu tượng có điều kiện như vậy để thử nghiệm với các chiến lược forex. Thế nhưng đây là phương pháp khá tẻ nhạt và chiếm nhiều thời gian. Đối với việc kiểm tra lại thủ công này thì trader có thể sử dụng đến một phần mềm lý tưởng khác đó là TradingView.

Hướng dẫn Backtest TradingView

Sử dụng TradingView để backtesting là gì? Nền tảng TradingView ra mắt năm 2011 được xem như là một sự lựa chọn tốt nhất dành cho **công cụ backtest** miễn phí. Đây là phần mềm phổ biến nhất hiện nay với những công cụ biểu đồ vô cùng tiên tiến. Biểu đồ và dữ liệu thời gian thực sẽ được dựa trên trình duyệt hỗ trợ nghiên cứu đến từ khắp mọi nơi có thể.

Do đó, không có thiết lập phức tạp nào nhận được sự quan tâm và không có gì để cài đặt cả. Đây được biết đến là một nền tảng xã hội, nơi mà trader có thể xem, chia sẻ hoặc cộng tác cùng với những trader khác và thậm chí là xuất bản các chiến lược giao dịch của mình lên trên các hồ sơ truyền thông xã hội như blog hoặc Twitter. Để backtesting nền tảng này, một công cụ hữu ích nhất đó chính là Tính năng phát lại thanh.

Trader có thể thực hiện theo các bước sau đây để sử dụng tính năng nhé.

- **Bật Phát lại thanh:** Nhấn vào biểu tượng "Bar Replay" như hình minh họa trên thanh công cụ ở trên đầu màn hình giao diện.



Nhấn vào biểu tượng để bật Phát lại thanh

- **Điều chỉnh phần cài đặt:** Trên biểu đồ hoạt động của trader sẽ có sự xuất hiện của một thanh công cụ mới và sẽ có thêm một đường màu đỏ dọc hiện ra tại vị trí của con trỏ. Đường màu đỏ này sẽ có công dụng đánh dấu lại khu vực được phát lại. Nếu muốn nó bắt đầu, trader chỉ cần cuộn trở lại điểm.
- **Nhấn nút Play:** Để vào chế độ phát lại, trader cần nhấn vào biểu đồ một lần. Sau đó, trader nhấn vào nút "Play" để có thể bắt đầu phát lại.



Bar Replay Feature trên nền tảng TradingView

Để có thể hiểu các biểu đồ sẽ có trạng thái, hình dạng ra sao tại một ngày nhất định thì tính năng phát lại sẽ là một công cụ hỗ trợ vô cùng lý tưởng trước khi trader quyết định áp dụng một chiến lược nhất định. Tuy nhiên, trader cần phải có đủ dữ liệu lịch sử có sẵn đối với các cặp tiền tệ mà mình kiểm tra. Bên cạnh đó, nền tảng TradingView cũng còn tồn tại một vài hạn chế như:

- Trên thực tế không có tùy chọn trong việc sử dụng biểu đồ nền nhạt.
- Biểu đồ Tương lai liên tục sẽ không hoạt động với công cụ Phát lại thanh.
- Trên một số tùy chọn biểu đồ, sẽ bị hạn chế dữ liệu lịch sử.
- Trong chế độ này sẽ không thể tạo đơn đặt hàng demo.

Chiến lược Backtest tự động

Chiến lược Backtest tự động sẽ có sự liên quan trực tiếp đến việc hình thành các chương trình tự động nhập và tự động thoát giao dịch thay mặt các trader. Chương trình này sẽ có thể lấy miễn phí trực tuyến, mặc dù đâu đó vẫn có sẵn các phiên bản cao cấp khác để mua. Công cụ này có lợi thế chính đó là loại bỏ được cảm xúc ra khỏi các hoạt động giao dịch của trader. Để nâng cao cơ hội thành công trên các chiến lược giao dịch sao chép, nhiều trader sẽ sử dụng các công cụ này.

Tuy nhiên, trader cần phải đảm bảo rằng chương trình phải có sự phù hợp với hồ sơ rủi ro và tính cách của mình. Bên cạnh đó, không phải phương thức giao dịch nào cũng đều có thể sử dụng được với chiến lược tự động.

Có thể thấy, MT4 và MT5 đều là hai nền tảng được cung cấp các công cụ backtest tự động. Đây là các sàn giao dịch điện tử đã được bảo mật và chứng minh cũng như được lựa chọn để giao dịch nhiều trong thị trường tài chính hiện nay. Trong đó, MT4 giàu chỉ số với các tùy chọn ưa thích, nhờ vào những tính năng đi kèm bổ sung giúp trải nghiệm của trader được nâng cao hơn. Trong việc kiểm tra lại FX, MT4 phổ biến với tính năng “Trình kiểm tra chiến lược” đã được xây dựng sẵn.

Phần mềm backtest forex: MetaTrader



MetaTrader 4 – chỉ báo Live Symbol Information

Trong nền tảng giao dịch MT4 có chứa “Trình mô phỏng ngoại hối – Forex Simulator” với mục đích cho phép các trader tua lại khoảng thời gian trên biểu đồ của chính mình và đồng thời phát lại thị trường vào bất cứ ngày nào. Ngoài ra, đơn đặt hàng sẽ đều có thể được đặt, đóng hoặc sửa đổi tương tự như cách mà người ta làm trong một điều kiện giao dịch trực tiếp.

So với các hình thức giao dịch forex khác cũng như các giao dịch demo, sẽ tiết kiệm được nhiều thời gian hơn với các giao dịch trên dữ liệu lịch sử. Đồng thời, có thể điều chỉnh được tốc độ của mô phỏng. Điều này sẽ giúp trader tập trung nhiều hơn với những khung thời gian quan trọng.



MetaTrader 4 – Các biểu đồ kết quả giao dịch

Backtest forex trên MT4: Forex tester

Trên MT4, một tùy chọn kiểm tra chiến lược forex nổi bật khác nữa đó chính là Forex Tester. Khác với Strategy Tester, Forex Tester sẽ không được miễn phí và nó có thể sử dụng được cho cả hoạt động giao dịch tự động và thủ công.

Backtesting tự động là phần mềm mà sẽ cung cấp cho trader những chiến lược giao dịch đã được hình thành ở trước đó. Nó sẽ bao gồm 10 chương trình thủ công với 5 cố vấn chuyên gia và 16 năm dữ liệu giá lịch sử, quản lý tiền và bảng tính toán rủi ro.

Forex Tester có các tính năng như sau:

- 5 EA dựa vào hành động giá đi cùng với các hướng dẫn chi tiết.
- 10 chiến lược giao dịch thủ công đơn giản để trader tích lũy thêm nhiều kinh nghiệm backtest.
- Có thể tải xuống bảng quản lý tiền forex trên excel.
- Với phiên bản forex tester 3, trader sẽ được phép tải xuống mọi số lượng cặp tiền tệ để thử nghiệm cùng một lúc.
- Phần mềm Forex Tester 2 và 3 sẽ đều cài đặt sẵn các phím nóng dành cho mọi chức năng để hỗ trợ việc tăng tốc thời gian đào tạo forex.
- Có các công cụ đồ họa như sóng, đường, Fibonacci cũng như hình dạng để đánh dấu và phân tích biểu đồ.

- Phần mềm giả lập Forex 3 sẽ được đồng thời sử dụng trên nhiều màn hình và cho phép sửa chữa các lỗi tức thời.



Nền tảng MT4 với các chứng năng của Forex Tester

Trong việc thiết kế các phần mềm giao dịch forex để có được lợi nhuận phù hợp nhất thì nền tảng MT4 cũng cho trader quyền được kiểm tra lại đối với những chiến lược forex dễ dàng. Sau khi nhập dữ liệu lịch sử, trader nhấn vào "Bắt đầu kiểm tra" là đã có thể bắt đầu chiến lược kiểm tra lại. Đặc biệt, tính năng "Bắt đầu kiểm tra" sẽ được chuyển thành "Dừng kiểm tra" một cách tự động.

Tại các thanh di chuyển trên biểu đồ, trader sẽ thấy ngay được điều này. Để kiểm tra chiến lược của mình, trader sẽ thông qua cách thức đặt hàng và xem chúng diễn ra như thế nào trên thị trường. Trader có thể điều chỉnh thay đổi tốc độ hoặc vẽ thêm các thanh mới nhằm mục đích điều khiển khung thời gian. Nếu như trader muốn tạm dừng và phân tích thì có thể nhấn chọn nút "Tạm dừng". Các chiến lược backtesting mới được Forex Tester cho phép lập trình bằng các ngôn ngữ như "Delphi" và "C++".

Phần mềm backtest forex NinjaTrader – Profit Finder

Đây là phần mềm được sử dụng nhằm mục đích xác định các thuộc tính lỗ và lãi của hệ thống để phát triển chiến lược giao dịch một cách hiệu quả nhất. Trader chỉ cần tiến

hành nhập dữ liệu đầu vào ví dụ như mục nhập và thoát, điểm dừng, kích thước tài khoản, mức lợi nhuận, mục tiêu lợi nhuận, giới kiểm tra lại,... Trong khi đó, hệ thống sẽ trả về các kết quả chi tiết liên quan đến tỷ lệ lợi nhuận gộp và lãi ròng.

Profit Finder sẽ có một số tính năng chính như sau:

- Hoạt động trên bất kỳ công cụ, chỉ số kỹ thuật và chiến lược nào.
- Đọc tự động các mục và thoát của giao dịch.
- Thực hiện trong vài giây với hàng loạt các tính toán phức tạp.
- Nó đem đến các cung cấp chi tiết đáng tin cậy và hữu ích về sự hiệu quả các chiến lược giao dịch, chất lượng dữ liệu và các chỉ số được sử dụng.
- Mọi vị trí đều được Profit Finder tính toán mức lãi và lỗ.

Bên cạnh các nền tảng bán lẻ như MT4 hoặc tradingview thì một số phần mềm kiểm tra ngoại hối forex khác cũng được tổ chức để xem xét.

Backtesting đến từ những tổ chức uy tín

Phần mềm backtest forex hay các **công cụ backtest miễn phí** thường sẽ được sử dụng nhiều bởi các nhà giao dịch độc quyền, các doanh nghiệp gia đình hoặc các quỹ phòng hộ. Chỉ sau khi người dùng đã mua giấy phép thì phần mềm này mới có sẵn.

Mặc dù được đánh giá là đắt đỏ, tuy nhiên họ sẽ được cung cấp trọn gói giải pháp hoàn chỉnh về việc kiểm tra lại lịch sử, thu thập dữ liệu, thử nghiệm các chiến lược forex cũng như thực hiện trực tiếp những chiến lược cao cấp ở tầng trên của những công cụ khác nhau. Bởi vì hệ thống này sẽ nhận được sự điều khiển theo sự kiện, cho nên môi trường backtesting mà chúng cung cấp khi đó sẽ được mô phỏng theo môi trường giao dịch trực tiếp ở một mức có độ chính xác cao hơn. Chẳng hạn như một vài ví dụ sau:

Deltix – QuantOffice

Deltix – QuantOffice được sử dụng vào việc phát triển trực quan, kiểm tra lại cũng như gỡ lỗi các chiến lược EMS tích hợp, C # và sử dụng Dot Net. Việc thực hành đơn hàng độc quyền thông qua các thuật toán có thể được hình thành dựa vào cách thức sử dụng các kết hợp khác nhau giữa ngày trong ngày, đánh dấu, thanh hàng ngày và các khung thời gian tùy chỉnh. Khả năng kết nối cùng với cơ sở dữ liệu cung cấp chuỗi thời gian "TimeBase" với mục đích kiểm tra lại và mô phỏng.

Deltix – QuantOffice có những tính năng nổi bật như sau:

- CEF – xử lý sự kiện phức tạp sẽ được kích hoạt thông qua việc kết nối cùng với TimeBase. Các sự kiện, 'OnBarOpen', 'OnBarC', 'OnTick' có khả năng sẽ được tạo nguồn nhằm hình thành các sự kiện phức tạp dành cho mục đích thử nghiệm.

- Phân tích hình thành một cách nhanh chóng” Được thực hiện ở toàn bộ các danh mục đầu tư và các cấp độ công cụ. Đồng thời có khả năng thiết lập các biểu đồ đặc biệt và hiển thị nhanh chóng những đầu ra của giao dịch chẳng hạn như các tín hiệu giao dịch, đơn đặt hàng, các chỉ số, thực hiện cũng như P & L có khả năng dẫn đến việc chiến lược được đánh giá và chạy lại nhanh hơn. Dữ liệu đánh dấu nhiều năm có thể sẽ được kiểm tra lại cho hàng loạt các công cụ chỉ trong vòng có vài giây.
- Các mô hình trong quá trình kiểm tra lại có thời gian hoạt động vô cùng nhanh. Các sự kiện từ TimeBase có thể được hệ thống tải trước vào bộ nhớ cache và giúp quá trình tổng thể được tăng tốc hơn.
- Việc hình thành các thanh dựa trên thời gian tùy chỉnh sẽ phải sử dụng đến các kỹ thuật phức tạp hơn. Trên TimeBase, các thanh này sẽ được lưu trữ trong khoảng thời gian thực để có thể được truy cập trong thời gian thực luôn.
- Các tham số sẽ được hỗ trợ tối ưu hóa nhờ vào việc sử dụng các cơ chế di truyền, vũ phu và năng động.
- Có thể phân loại các chiến lược thành những chiến lược phụ trong chiến lược meta. Chiến lược phụ có nên được kích hoạt không khi việc tối ưu hóa động có thể kiểm soát hơn nữa.
- Những mô hình chiến lược tối ưu hóa như hiện tại sẽ được triển khai mà không thiết kế lại rủi ro trong môi trường giao dịch sản xuất.
- Trong QuantOffice, trình mô phỏng giao dịch forex sẽ cho phép kiểm soát chính xác tất cả các giả định giao dịch. Tức là cho phép tính nhất quán cao hơn đối với lợi nhuận giữa việc kiểm tra ngược và sản xuất.
- Trader có thể hình thành nên mô hình riêng cho mình bằng C # hoặc thông qua việc tích hợp những mô hình hiện tại đang có trong C + + vào QuantScript.

QuantDEVELOPER của QuantHouse

QuantDEVELOPER là phần mềm cấp độ tổ chức cho phép người sử dụng tạo, kiểm tra lại, tối ưu hóa và khởi chạy những chiến lược định lượng có thể thực hiện được thêm ở trong môi trường giao dịch trực tiếp. Trader khi sử dụng có thể đánh giá, tăng tính hiệu quả và điều chỉnh các tham số mà mình đã chọn ở trong một chiến lược giao dịch cụ thể. Trader có thể so sánh kết quả chiến lược thông qua các thống kê hữu ích.

Phần mềm này sẽ có các tính năng như sau:

- Xây dựng được bộ điều hợp dữ liệu thị trường với độ trễ thấp.
- Thiết kế chiến lược thông qua việc tập hợp những thành phần được xác định trước.
- Nhiều chiến lược phụ được cho phép chạy theo một chiến lược meta.
- Không có kịch bản nào là bắt buộc cả.
- Có thể kiểm tra các lớp đa tài sản cũng như nhiều hệ thống kế toán tiền tệ.
- Mỗi giây sở hữu khả năng kiểm tra với hơn 500000 tích.
- Chứa backtesting theo dòng sự kiện.
- Có một thư viện rộng lớn về chỉ số kỹ thuật.

- Hỗ trợ nhiều khung thời gian, chuyển đổi và tự động thực hiện chỉ với một cú nhấp chuột từ chế độ mô phỏng chuyển sang chế độ giao dịch trực tiếp.
- Ở tất cả các cấp danh mục đầu tư đều có backtesting hệ thống giao dịch có sẵn.

Những điều cần lưu ý khi sử dụng chiến lược, công cụ backtest forex

- Để nhận biết nó sẽ dừng khi nào thì trader cần phải tìm hiểu kỹ về các thông số của hệ thống giao dịch một cách chính xác.
- Cần kiểm tra hệ thống thường xuyên dù cho nó đã được tự động hóa trong trường hợp đã có sự thay đổi đối với điều kiện thị trường.
- Chiến lược này sẽ chỉ phù hợp với khoảng thời gian dài hơn trong trường hợp nó cũng có sự phù hợp cùng với mức độ chấp nhận rủi ro của trader.
- Phương pháp backtesting này sẽ không được đảm bảo tuyệt đối là hoạt động trong giao dịch trực tiếp. Chúng sẽ phải được thử nghiệm về phía trước tương tự như các chiến lược thủ công khác.
- Trader cần có sự hiểu biết về mã hóa. Chiến lược của trader có thể bị phản tác dụng chỉ với một dấu chấm sai trong mã.
- Backtesting tự động sẽ là phương pháp hoạt động không được tốt cho toàn bộ các kế hoạch giao dịch.
- Trong môi trường giao dịch trực tiếp, phương pháp lặp đường cong thường sẽ bị thất bại.

Dù cho trader có lựa chọn chiến lược nào đi chăng nữa thì việc phân tích chiến lược cũng sẽ yêu cầu đến các kỹ năng excel có thẩm quyền.

Phần mềm backtest forex trực tuyến có những lợi ích gì?

- Ngay cả khi thị trường đang đóng cửa thì trader vẫn có thể thực hành cùng với các chiến lược giao dịch forex. Đây được xem là một cách hữu ích trong việc nâng cao kỹ năng của trader so với giao dịch trực tiếp. Trader nên giao dịch nhiều tài sản hơn nữa ở nhiều thị trường khác nhau.
- Trader sẽ có được sự tự tin nhất đối với chiến lược giao dịch của mình. Khi đã hiểu được cơ chế hoạt động của hệ thống, nhược điểm cũng như tần suất chiến thắng của nó thì trader sẽ tìm ra cho mình được một vị trí tốt hơn để kích hoạt giao dịch. Và đồng thời, trader cũng sẽ biết được đâu là thời điểm để dừng lại.

Hơn hết, trader nên thông qua một nhà môi giới đã được Cơ quan quản lý tài chính (FCA) ủy quyền, quản lý và được MiFID bảo vệ khi mở một tài khoản để có được kết quả kiểm tra thực tế nhất khi bắt đầu giao dịch.

Không những thế, trader cũng có thể hoàn toàn sử dụng đến tài khoản demo và nền tảng MT5 để backtest chiến lược giao dịch của mình.

Như vậy, vừa rồi là những chia sẻ cụ thể về **backtest là gì** của forexdictionary. Công cụ backtest mang lại khá nhiều lợi ích cho trader với các ưu điểm nổi bật. Tuy nhiên, bên cạnh đó trader cũng cần lưu ý đến một vài vấn đề như bài viết trên đã chia sẻ để sử dụng công cụ backtest miễn phí được hiệu quả hơn. Đặc biệt, trader đừng quên theo dõi ngay web forexdictionary.com để nhận các thông báo chính xác và các kiến thức bổ ích liên quan đến thị trường forex nhé.