

ההערות במסמך הינם כלליות בלבד ולמטרת לימוד ואינם מהוות ייעוץ השקעות בשום צורה . השימוש במסמך וברובוט רק בכפוף להסכמה לנסח המשפטי המפורט בסוף המסמך

שלום לכם, בסופו של דבר המטרה של הרובוט לעבוד עם אסטרטגייה אחת על מבחר של מניות שבחרתם, כאשר הממוצע של ה FxIndex הוא הגבוה ביותר, אז כיצד תעשו זאת ?

שלב א - בחירת ניירות ערך התחלתית

נפתח רובוט בדיקות חדש - וכעת יש לנו מספר אפשרויות לבחור ולהכניס קבוצת מניות לרובוט :

1. המשתמש בוחר את המניות לפי תנאים פונדמנטליים, כלומר מניות שנבחרו על ידו או על ידי יועץ השקעות מטעמו והוכנסו לרובוט .
2. אפשרות שנייה , במידה והוא מעוניין להשקיע במדד\ים נבחרים - המשתמש יבחר על איזה מדדים ברצונו לעקוב ולהתאים את השיטה אליהם באמצעות הכנסה של ת.סל מתאימות לרובוט הבדיקות .
3. אפשרות שלישית - בחירה של מניות \ מדדים נבחרים מתוך קבוצה מובילה. כאן המשתמש בוחר קבוצת מובילה של מניות להשקעה לפי בחירתו, לדוגמא: מניות SNP, נאסדק 100 או כל קבוצת מניות אחרת .
4. אפשרות רביעית להכניס מניות מסקטור מסוים, תוך שאנחנו מתאימים את האסטרטגייה לתעודת סל שמאפיינת את קבוצת המניות בדיוק לפי השלב הבא.

שלב ב - מציאת אסטרטגיית בסיס מתאימה למדד המניות הנבחרות

לאחר שבחרתם את קבוצת המניות שלכם והכנסתם לרובוט, אנחנו נפתח רובוט בדיקות נוסף כדי לאתר את השיטה המתאימה ביותר למדד עצמו שמוביל את קבוצת המניות שבחרתם (עדיין לא לקבוצה) .

לדוגמא: אם בחרתם מניות רבות בבורסת הנאסד"ק - אז יש להכניס ת.סל שמחקה את מדד הנאסד"ק . כעת נשתמש באופטימיזר כדי למצוא אסטרטגייה שנתנה לכם את התשואה הטובה עם הסיכון הנמוך ביותר, יש להיעזר בפרמטר FxIndex לשם כך. FxIndex גבוה יותר משקף ביצועים טובים יותר .

טיפ - יש להגדיר בשלב זה סטופ לוס רחוק מאוד, וזאת מכיוון שאנחנו רוצים לבדוק כיצד האסטרטגייה מתפקדת ללא ההפרעה של הסטופ לוס

שלב ג

ניפוי מניות עם FxIndex נמוך כדי להגיע ל FxIndex ממוצע הגבוה ביותר

נחזור לרובוט הבדיקות הראשון שפתחנו ונגדיר את האסטרטגייה שמצאנו בשלב ב' לקבוצת המניות שבחרנו בשלב א'. עם אותו סטופ לוס רחוק שהגדרנו בשלב ב'.

כעת נריץ BACKTEST על כל קבוצת המניות שבחרנו ונמתין לתוצאות. אלו הם שלבי הסינון הנכונים: מחיקת כלל המניות עם תשואות הפסדיות ותשואות נמוכות. יתכן שצריך לחזור על פעולה זו מספר פעמים כי אפשר למחוק בלחיצת כפתור אחת לכל היותר 10% מהמניות ברובוט.

כאשר המטרה זה להגיע ל FxIndex ממוצע הגבוה ביותר. שימו לב - מומלץ להשאיר כ 45 מניות ברשימה לפחות כדי להגיע לאמינות גבוהה של הצלחה גם בעתיד.

שלב ד - ואחרון - ניסוי וטעייה

לאחר שבחרנו את המניות נרוץ עם ניסוי וטעייה גם עם אסטרטגיות הכניסה והיציאה וגם עם הסטופ כדי להגיע לה FxIndex הממוצע הגבוה ביותר. שלב זה יכול להיראות מתיש ביחס לשאר השלבים - אך זוהי הישורת האחרונה בהחלט שתיתן פירות למשקיע לאורך זמן. וזאת מכיוון שאסטרטגייה טובה לא משנים.

מבחר טיפים

- אם בחרנו אסטרטגייה ואנחנו נגלה לדוגמא שמתוך 100 מניות היא מתאימה רק 10 - זה אומר שהאסטרטגייה שמצאנו לא עובדת וגם כנראה לא תעבוד במציאות .
- כשמשפרים אסטרטגייה על תיק - נרצה "לנטרל" מניות מצליחות מדי עם FX-INDEX גבוהה מאוד. ולכן נמחק זמנית את אותם המניות לשלב הניסוי והטעייה עד למציאת האסטרטגייה הנכונה לשאר המניות ורק לאחר שמצאנו את האסטרטגייה הטובה ביותר נחזיר את אותם "המניות הקיצוניות" .
- ניתן למחוק בקלות מהרשימה את המניות הלא טובות באמצעות לחיצה על מחק בצד ימין למעלה ושם נבחר מחר מניות עם FxIndex הנמוכים ביותר - 10% .
- כשבחרים לעבוד על מניות באופן רחב - הגיוני לחלק את תיק המניות בפועל לפחות ל 10 מניות באחזקה בו זמנית ולא יותר מ 20. לדוגמא: לתת את הקצאת הסכום למניה כך שהרובוט יוכל להכניס כעשר עד 15 מניות בו זמנית. אם הקצינו לרובוט 20,000 דולר, נקצה לכל מניה 2,000 - 1300 דולר.
- העבר לא בהכרח מצביע על העתיד - ולכן אם מנייה בודדת הרוויחה בעבר כ 1000% לא בהכרח היא תניב שוב 1000% בעתיד, ולכן אנחנו מפזרים את האסטרטגייה למספר רב של מניות .
- ניתן להוסיף לרשימת המניות נבחרות גם מדדים נבחרים ואפילו מדדים ממונפים במידה וזה נותן תוצאות מספיקות של FxIndex
- אם נרצה לתת משקל גבוה יותר לסקטור מסויים או מדד מסויים לעומת שאר המניות - נוכל להוסיף מספר ת.סל מאותו סוג
- אפשר להשקיע בשורט באמצעות הרובוט ע"י בחירה של ת.סל שורט והרובוט ישקיע בהם בלונג .
- יש לבחון מניות עם DrawDown גבוה מ 30% כדי לבדוק אם הם רצויות בתיק של הרובוט . מניות כאלה נוטות להיות תנודתיות ולא לכל אחד יש יכולת נפשית לראות ירידות של 30% ומטה אפילו במניות בודדות.
- ברגע שבחרנו אסטרטגייה ולדעתנו עשינו "עבודה טובה" יש לתת לרובוט לעבוד מספר חודשים לפחות כדי לבצע עשרות רבות של עסקאות, התערבות ידנית ברובוט לא תתרום ואף תוביל להפסדים .

הסכמת שימוש

תוכנת FxGraph ("התוכנה"), מספקת למשתמש מידע בורסאי גולמי וכן מידע מעובד (מידע אשר מופק מנוסחאות מתמטיות המבוססות על מידע בורסאי גולמי), אותם היא אוספת ממאגרי מידע פומביים, לרבות מאתרי אינטרנט שונים בארץ ובעולם. המידע המעובד מוצג באופן אובייקטיבי מבלי שיוצרי התוכנה מבצעים לגביו ניתוח או מביעים פרשנותם או עמדתם לגביו. התוכנה מאפשרת למשתמשים בה לבצע ניתוחים סטטיסטיים המבוססים על פרמטרים מתמטיים אובייקטיביים ואינם מערבים שיקול דעת של יוצרי התוכנה. המידע והנתונים המוצגים בתוכנה אינה מהווים המלצה או הבעת עמדה כלשהיא ביחס לניירות ערך כלשהם או ביצוע פעולה כלשהיא בהם. בהתאם אין לראות בתוכנה והמידע המופק באמצעותה כייעוץ השקעות ו/או תחליף לייעוץ השקעות המתחשב בצרכיו ונתוניו האישיים של כל אדם. כל החלטת השקעה שתתקבל על ידי משתמש בתוכנה, תיעשה על בסיס שיקול דעתו הבלעדי, ואנו ממליצים על ביצוע בדיקה מקיפה לפני כל פעולה בנייר ערך כלשהוא לרבות הסיכונים הכרוכים בכך. תשומת ליבך כי פעילות בשוק ההון כרוכה בסיכונים רבים אשר את חלקם אין אפשרות לצפות מראש. על כן, השקעה בשוק ההון עשויה לגרום להפסד חלק מסכום ההשקעה ואף להפסד של כל סכום ההשקעה. יודגש כי שימוש מושכל בתוכנה עשוי לצמצם את הסיכונים הקיימים בשוק ההון, אולם אין בו כדי לבטל את כלל הסיכונים הקיימים אשר עלולים להביא להפסד של חלק או כל סכום ההשקעה ואין כל ערובה לכך שמסחר בסיוע התוכנה יישא רווח כלשהו.