



بک تست ارز دیجیتال چیست؟

بک تست ارز دیجیتال را می‌توان یک گام اساسی در بهینه‌سازی نحوه تعامل تریدرها با بازارهای مالی دانست. در واقع مزیت اصلی بک تست ارز دیجیتال این است که به شما کمک می‌کند تا متوجه شوید که آیا استراتژی مدنظر شما منطقی است و می‌تواند به طور بالقوه به کسب سود برسد یا خیر!

در واقع به کمک بک تست شما دیگر برای **کسب سود** نیازی به خطر انداختن سرمایه خویش نخواهید داشت و به کمک یک محیط شبیه‌سازی شده، قادر خواهید بود رویکرد خاصی را در **بازار ارز دیجیتال** ایجاد و همچنین بهینه‌سازی کنید.

امروزه برای انجام بک تست (Back Test)، ابزارهای مختلفی در اختیار تریدرها قرار گرفته است که با توجه به نقش کلیدی آن‌ها در کاهش ریسک معاملات بسیار مورد توجه تریدرهای حرفه‌ای بازار ارز دیجیتال هستند.

ناگفته نماند که بک تست ارز دیجیتال همچنین با کشف نحوه انجام استراتژی براساس داده‌های تاریخی، قابلیت دوام آن را نیز مورد ارزیابی قرار می‌دهد.

با توجه به نقش کلیدی بک تست ارز دیجیتال، ما در این مقاله از وبسایت کیف پول من قصد داریم تا به بررسی کامل بک تست ارز دیجیتال و نحوه کار آن بپردازیم؛ پس اگر قصد دارید با اطمینان خاطر بیشتری پا به عرصه معاملات رمز ارزی بگذارید، تا انتهای این مقاله با ما همراه باشید.

آشنایی با بک تست ارز دیجیتال

بک تست (Back testing) در واقع به این معنا است که شما **استراتژی معاملاتی** خود را بر اساس تاریخچه آن آزمایش می‌کنید؛ به عبارت دیگر این روش با آزمایش نحوه انجام این استراتژی بر اساس داده‌های تاریخی، میزان قابلیت دوام و زنده ماندن این استراتژی را به شما نشان می‌دهد.

در صورتی که نتیجه بررسی هیستوریکال دیتا نتایج خوبی را نشان دهد، **تریدرهای بازار ارز دیجیتال** می‌توانند با اطمینان خاطر بیشتری این استراتژی را در یک صرافی خرید و فروش ارز دیجیتال پیاده کنند و به کسب سود برسند.

مطلب پیشنهادی: [پامپ و دامپ چیست؟](#)

اما ممکن است به هنگام مطالعه جملات فوق این سوال ذهن شما را به خود مشغول سازد که منظور از نتایج خوب چیست؟

در پاسخ به این سوال باید بگوییم هدفی که می‌توان برای **ابزارهای بک تست ارز دیجیتال** تصور نمود از این قرار است که با تجزیه و تحلیل داده‌ها خطرات، ریسک‌ها و همچنین سودآوری بالقوه استراتژی مورد نظرتان را به شما نشان می‌دهند و هرچه میزان سودآوری استراتژی شما با ریسک و خطر کمتری همراه باشد نتایج به دست آمده خوب تلقی خواهند شد.

طبیعتاً یک ابزار بک تست درست می‌تواند در نشان دادن زمان اجرای یک استراتژی نیز مفید واقع شود و اگر نتایج به دست آمده نشان دهد که در چنین زمانی اجرای استراتژی چندان بهینه به نظر نمی‌رسد، بهتر است از اجرای آن استراتژی صرف نظر کرده یا آن را به زمان دیگری موکول نمایید، البته باید همواره شرایط و نوسانات بازاری را نیز در نظر بگیرید؛ چراکه در صورت تغییر شرایط همان استراتژی در ابزار بک تست می‌تواند نتایج متناقضی را به شما نشان دهد.

نحوه کار بک تست ارز دیجیتال



پیش فرضی که ابزارهای بک تست ارز دیجیتال، مبتنی بر آن به حیات خود ادامه می‌دهند از این قرار است که آن چه در گذشته کار کرده، به احتمال بالا در آینده نیز کارساز خواهد بود.

البته به هنگام استفاده از بک تست همواره باید به این نکته توجه کنید که همیشه اعتماد 100 درصدی به ابزارهای بک تست ارز دیجیتال نداشته باشید.

چراکه ممکن است آن استراتژی که در یک شرایط خاص موجب سودآوری شده، در یک شرایط دیگر کاملاً به صورت برعکس عمل کرده و ضررهای قابل توجهی را به شما تحمیل نماید، به همین دلیل پیدا کردن یک نمونه خوب بک تست که منطبق با شرایط فعلی بازار است بسیار حائز اهمیت بوده و کار شما را کمی دشوارتر می‌کند که علت این سختی را می‌توان در نوسانات و تغییرات کلی بازار رمز ارزها جستجو کرد.

قبل از آن که بخواهید استراتژی خود را با ابزارهای بک تست مورد ارزیابی قرار بدهید، حتماً باید این مسئله را روشن سازید که دقیقاً در اجرای این استراتژی به دنبال چه چیزی هستید!

مسئله این است که اگر بدانید که چه چیزی به دوام استراتژی شما کمک می‌کند و چه چیزی موجب نقض حیات آن می‌گردد، می‌توانید به صورت منطقی نتایج به دست آمده از بک تست را به دور از تعصب تحلیل و ارزیابی کنید.

ناگفته نماند که روش بک تستی می‌تواند به شما کمک نماید که شامل تمام هزینه‌های معامله (از برداشت گرفته تا هر هزینه احتمالی دیگر) باشد.

اصولاً **نرم افزارهای بک تست ارز دیجیتال** در دسته نرم افزارهای گران قیمت دسته بندی می‌شوند؛ چراکه این نرم افزارها امکان دسترسی به داده‌های بازار را آن هم با کیفیت بسیار بالا برای شما فراهم می‌سازند.

البته باید توجه داشته باشید که روش بک تست نیز دارای ماهیت آزمایشی است و طبیعتاً همانند تجزیه و تحلیل فنی نموداری هیچ تضمینی برای کارکرد 100 درصدی آن وجود ندارد.

برای این که راحت تر بتوانید با بک تست ارز دیجیتال ارتباط برقرار کنید به نمونه‌ای که در زیر در ارتباط با **بک تست بیت کوین** ذکر می‌کنیم، توجه نمایید:

بررسی نمونه روش بک تست ارز دیجیتال

اگر بخواهیم یک استراتژی طولانی مدت ساده برای بیت کوین را مورد بررسی قرار دهیم در حالت عادی **ترید بیت کوین** به این صورت اتفاق می‌افتد که بیت کوین را در اولین بسته شدن کندل هفتگی بالاتر از میانگین متحرک 20 هفته‌ای معامله کرده و خریداری می‌کنیم و همچنین آن را در اولین بسته شدن کندل هفتگی، زیر میانگین متحرک 20 هفته به فروش می‌رسانیم.

مسئله چنین استراتژی فقط چند سیگنال در سال تولید می‌کند که اگر بازه زمانی 2019 را مورد بررسی قرار دهیم، 5 سیگنال تولید کرده که به این صورت بوده است:

- 1- **خرید بیت کوین** در قیمت 4000 دلاری
- 2- فروش بیت کوین در قیمت 8000 دلاری
- 3- خرید بیت کوین در قیمت 8500 دلار
- 4- فروش بیت کوین در قیمت 8000 دلاری
- 5- و در نهایت خرید آن در قیمت 9000 دلاری

نتیجه چنین بک تستی نشانگر آن است که این استراتژی تا حدودی سودآور بوده است؛ اما آیا این بدان معناست که همچنان این سودآوری تضمین می‌شود؟

پاسخ به این سوال منفی است و این نتیجه فقط به آن معنا است که با نگاه کلی به چنین داده‌هایی احتمال سودآوری این استراتژی همچنان وجود دارد و بهتر است بجای بررسی یک سال، بازه زمانی بیشتری را مورد تحلیل قرار دهید تا به نتایج روشن تر و واضح تری دسترسی پیدا کنید.

بررسی بک تست دستی و خودکار



روش بک تست دستی شامل تجزیه، ترکیب و همچنین تحلیل نمودارها و داده‌های تاریخی و در نهایت قرار دادن دستی معاملات مطابق استراتژی مورد نظر شما است که در مقابل آن بک تست خودکار قرار دارد که اساساً در این روش نیز همان کار بک تست دستی تکرار می‌شود؛ اما این فرآیند به وسیله کد رایانه‌ای (با استفاده از زبان‌های برنامه نویسی همچون پایتون یا نرم افزارهای حرفه‌ای بک تست) به صورت خودکار انجام می‌شود.

غالب **تریدرهای بازار ارز دیجیتال در خرید بیت کوین** به منظور ارزیابی نحوه عملکرد استراتژی مدنظر خویش از جدول Google یا Excel کمک می‌گیرند.

در واقع چنین اسنادی همچون تست کننده‌های استراتژی عمل کرده و شامل اطلاعات مختلفی هستند. پلتفرم معاملاتی، تعداد معاملات برنده و باخت، سود خالص، کلاس دارایی، نسبت شارپ، دوره معاملات، حداکثر برداشت و غیره از این دسته اطلاعات هستند.

مطلب پیشنهادی: [ترید اتوماتیک چیست؟](#)

در واقع از نسبت شارپ به منظور بررسی احتمال بازگشت سرمایه استفاده می‌شود؛ هر چه مقدار و میزان این نسبت شارپ (Sharpe) بیشتر شود، جذابیت آن استراتژی برای سرمایه‌گذاری افزایش می‌یابد.

حداکثر افت قیمتی نیز نشان دهنده لحظه‌ای است که استراتژی معاملاتی شما در مقایسه با آخرین اوج عملکرد استراتژی، بدترین عملکرد را داشته است.

بهترین ابزار بک تست ارز دیجیتال

با توجه به اهمیت بررسی استراتژی‌های **خرید و فروش رمزارز**، ما در این مقاله از کیف پول من تلاش نمودیم تا به بررسی دقیق روش **بک تست ارز دیجیتال** بپردازیم و همان طور که در مطالب بالا مشاهده کردید، بک تست ارز دیجیتال روشی در انجام معاملات است که به کمک آن می‌توانید متوجه این مسئله شوید که استراتژی مورد نظر شما برای سرمایه‌گذاری و ترید رمزارزها تا چه میزان عملکرد خوبی خواهد داشت.

به عبارت ساده‌تر بک تست ارز دیجیتال یک مسیر روشنی از آینده استراتژی مورد نظر شما را با تحلیل داده‌های تاریخی پیش روی شما قرار می‌دهد و شما به کمک آن می‌توانید در بازار رمزارزها به معاملات بهینه دست بزنید.

عموما تریدرهایی که از ابزارهای **بک تست ارز دیجیتال** برای ارزیابی میزان دوام استراتژی‌های خود کمک گرفته‌اند کمتر از سایر معامله‌گران با خطر از دست رفتن سرمایه‌ای که برای کسب آن بسیار تلاش کرده‌اند، مواجه می‌شوند.

ناگفته نماند که اگر در ارتباط با بک تست ارز دیجیتال سوالی دارید که در این مقاله از کیف پول من به آن اشاره نشده است، می‌توانید سوال خود را در بخش نظرات مطرح کنید تا در اسرع وقت به وسیله کارشناسان ما به سوال شما پاسخ داده شود.