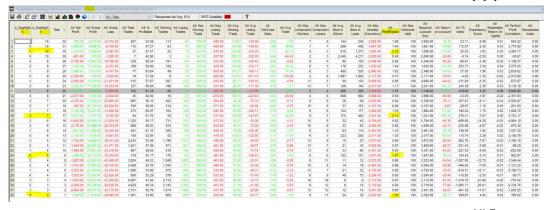
0-3 בין OPTIMIZE מצאנו על ידי שימוש באסטרטגיה עם ערכי 3,5,7,10 N מצאנו על ידי שימוש ערכי התוצאות עבור שנים 2014-2016 ברזולוציה של 5 דקות.

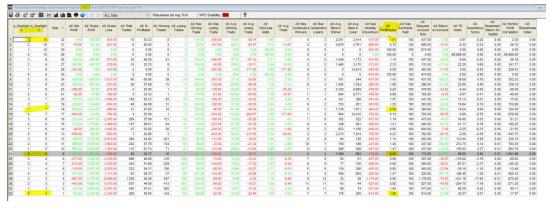
SPY •

e_SeqHig k	ht e_SeqHight	Test		Æ Net Profit	Alt Gross Proft	Alt Gross Loss	Alt Total Trades	Ait % Profitable	Alt Winning Trades	All: Losing Trades	Alt Max Winning Trade	Alt Max Losing Trade	Al: Avg Winning Trade	Alt Avg Losing Trade	Alt Win/Loss Ratio	Al: Avg Trade		Alt Max Consecutive Losers	Alt Avg Bars in Winner	Alt Avg Bars in Loser	Alt Max Intraday Drawdown	All: ProfitFactor	All: Max Contracts Held		Alt Return on Account	Alt TS Index		Pessimistic Return On	All: Perfect Profit Correlation	Alt Robustness Index
	3 10		32 7	,419.00	23,901.00	-16,482.00	242	61.57	149	92	887.00	-699.00	160.41	-179.15	0.90	30.66	12	6	135	208	-2,604.00	1.45	100	2,604.00	284.91	424.51	5.01	0.07	6,683.98	0.00
	2 10					-10,592.00	122	63.11	77	45	681.00	-893.00	197.84	-235.38	0.84	38.05	10	4	229		-3,059.00	1.44	100	3,059.00		116.85	2.32		3,670.21	0.00
	1 10		30 8		12,465.00	-4,450.00	52		35		1,475.00	-709.00	356.14	-261.76	1.36	154.13	14	6	821		-2,074.00	2.80	100	2,074.00	386.45	135.26	3.48		7,071.26	0.00
	0 10					-2,394.00	12	75.00	9		1,533.00	-1,217.00	545.11	-798.00	0.68	209.33	4	1	1,334		-2,581.00	2.05	100	2,581.00	97.33	8.76	0.18	0.02	1,997.64	0.00
	3 9		28 3			-23,982.00	387	61.50	238	148		-692.00		-162.04		8.60	- 11	6	78	141	-3,020.00	1.14	100	3,020.00	110.17	262.19	2.38	0.04	2,330.08	0.00
	2 9					-16,128.00	204	61.27	125	79	1,010.00	-696.00	158.01	-204.15		17.76	8	7	180		-4,358.00	1.22		4,358.00	83.13	103.92	1.76		1,003.18	0.00
	1 9					-7,839.00	78	61.54	48	30	1,068.00	-708.00	269.88	-261.30		65.58	6	3	477		-2,841.00	1.65	100	2,841.00	180.04	86.42	2.15		3,280.30	0.00
	0 9		25 8			-2,204.00	26	73.08	19			-653.00		-314,86			4	3	1,231	2,180	-1,199.00	4.85	100	1,199.00		134.38	3.01	0.07	8,298.02	0.00
	3 8		24 7	,909.00	36,604.00	-28,695.00	633	62.24	394		518.00	-771.00	92.90	-122.11	0.76	12.49	12	8	49	88	-2,589.00	1.28	100	2,589.00	305.48	1,203.61	8.29	0.08	7,585.68	0.00
	2 8					-23,687.00	348	61.21	213		562.00	-880.00		-175.46	0.65	1.58	8	7	87		-4,307.00	1.02		4,307.00		27.25	-0.01	0.01	58.07	0.00
	1 8		22 5	,130.00	17,728.00	-12,598.00	170	59.41	101	69	863.00	-546.00		-182.58	0.96	30.18	- 11	5	178	308	-2,555.00	1.41	100	2,555.00	200.78	202.79	3.22	0.05	4,586.95	0.00
	0 8		21 7		11,640.00	-4,290.00	48	60.42	29	19	1,569.00	-424.00	401.38	-225.79			4	3	977		-1,896.00	2.71	100	1,896.00	387.66	112.42	3.58	0.06	7,043.90	0.00
	3 7		20 5		41,046.00	-35,894.00	993	62.64	622	360	466.00	-761.00	65.99	-99.71	0.66	5.19	- 11	8	30	60	-2,749.00	1.14	100	2,749.00	187.41	1,165.71	6.44	0.05	4,790.54	0.00
	2 7		19 3	,754.00	34,577.00	-30,823.00	621	62.96	391		596.00	-761.00	88.43	-135.78	0.65	6.05	10	4	49		-3,732.00	1.12	100	3,732.00	100.59	393.30	3.19	0.04	3,086.71	0.00
	1 7		18 5	652.00	24,651.00	-18,999.00	321	60.12	193	128	770.00	-761.00		-148.43	0.86	17.61	9	5	98		-2,264.00	1.30		2,264.00	249.65	481.82	4.51	0.06		0.00
	0 7		17 4	,571.00	15,040.00	-10,469.00	108	53.70	58	50	1,841.00	-556.00	259.31	-209.38	1.24	42.32	5	6	312	424	-3,028.00	1.44	100	3,028.00	150.98	87.58	1.80	0.04	3,823.52	0.00
	3 6		16	956.00	48,154.00	-47,198.00	1,551	57.45	891	649	452.00	-694.00	54.04	-72.72		0.62	13	8	20	35	-2,459.00	1.02	100	2,459.00	38.88	346.40	0.95	0.01	814.83	0.00
	2 6		15	16.00	40,539.00	-40,523.00	1,025	60.39	619	399	469.00	-761.00	65.49	-101.56	0.64		12	8	29	55	-4,002.00	1.00	100	4,002.00	0.40	2.47	-0.61	0.00	3.01	0.00
	1 6		14 6	,106.00	33,242.00	-27,138.00	589	64.01	377		469.00	-783.00	88.18	-129.22	0.68	10.37	14	5	53	94	-2,523.00	1.23	100	2,523.00	242.01	912.39	5.98	0.06	5,912.20	0.00
	0 6		13 3	,475.00	19,398.00	-15,923.00	192	57.81	111	81	713.00	-690.00	174.76	-196.58	0.89	18.10	6	4	162	265	-2,118.00	1.22	100	2,118.00	164.07	182.12	1.93	0.03	3,063.48	0.00
	3 5		12 2		59,692.00	-57,190.00	2,654	53.09	1,409		482.00	-1,143.00	42.36	-47.26	0.90	0.94	12	9	13	19	-3,625.00	1.04	100	3,625.00	69.02	972.50	5.85	0.03	2,036.73	0.00
	2 5		11 4	,870.00	53,230.00	-48,360.00	1,734	58.13	1,008	707	471.00	-709.00	52.81	-68.40	0.77	2.81	11	11	18	31	-3,506.00	1.10	100	3,506.00	138.90	1,400.16	8.80	0.05	4,440.88	0.00
	1 5		10 .	-426.00	40,057.00	-40,483.00	1,035	59.03	611	412	452.00	-761.00	65.56	-98.26	0.67	-0.41	10	6	31		-3,498.00	0.99	100	3,498.00	-12.18	-74.41	-1.22	0.00	-91.80	0.00
	0 5		9 1	,682.00	27,239.00	-25,557.00	381	58.53	223	158	976.00	-810.00		-161.75	0.76	4.41	- 11	6	84	132	-2,836.00	1.07	100	2,836.00	59.31	132.26	0.60	0.02	1,199.11	0.00
	3 4		8	954.00	73,950.00	-72,996.00	4,455	46.80	2,085	2,279	1,062.00	-641.00	35.47	-32.03		0.21	9	12	9	10	-3,887.00	1.01	100	3,887.00	24.54	511.73	-0.46	0.01	540.77	0.00
	2 4		7 -1	,276.00	61,893.00	-63,169.00	2,997	52.05	1,560	1,387	443.00	-859.00	39.67	-45.54		-0.43	11	11	12	17	-4,781.00	0.98	100	4,781.00	-26.69	-416.35	-5.17	-0.01	-638.75	0.00
	1 4		6 .	-167.00	52,130.00	-52,297.00	1,894	55.33	1,048	825	452.00	-599.00	49.74	-63.39		-0.09	12	12	18	27	-5,054.00	1.00	100	5,054.00	-3.30	-34.63	-1.34	0.00	-14.56	0.00
	0 4		5 3	,483.00	37,477.00	-33,994.00	814	59.21	482	330	594.00	-738.00		-103.01		4.28	8	8	42	60	-2,661.00	1.10	100	2,661.00	130.89	630.89	3.84	0.04	1,927.02	0.00
	3 3		4 -1,	,812.00	92,663.00	-94,475.00	7,543	40.97	3,090	4,293	1,083.00	-641.00	29.99	-22.01	1.36	-0.24	11	18	7		-5,884.00	0.98	100	5,884.00	-30.80	-951.58	-18.00	-0.02	-291.66	0.00
	2 3		3 .	-890.00	79,829.00	-80,719.00	5,471	44.67	2,444	2,920	1,062.00	-641.00	32.66	-27.64	1.18	-0.16	10	14	8	8	-3,591.00	0.99	100	3,591.00	-24.78	-605.73	-9.66	-0:01	-136.22	0.00
	1 3		2 2		69,199.00	-67,087.00	3,647	50.48	1,841	1,739	1,082.00	-533.00	37.59	-38.58	0.97	0.58	9	10	11	13	-4,259.00	1.03	100	4,259.00	49.59	912.94	3.72	0.02	954.85	0.00
	0 3		1 5		52,362.00	-47,351.00	1,764	53.57	945	789	1,062.00	-715.00	55.41	-60.01	0.92	2.84	8	10	21	27	-3,600.00	1.11	100	3,600.00	139.19	1,315.39	9.01	0.05	4,554.29	0.00

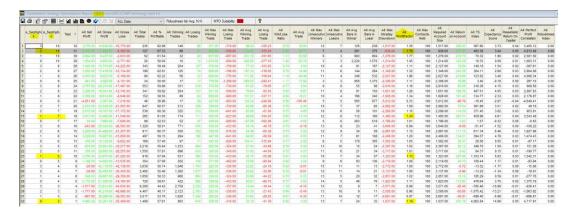
QQQ •



XLF •



XLE •



- - סמו כן, נראה שבטעות הכנסנו את היום האחרון להיות ה 30.12.16
 - ניתוח: הזוגות המנצחים (N ואז X , מסתכלים רק על (3,5,7,10 N):
 - 1,10 SPY o
 - 1,10 QQQ o
 - 0,5 XLF o
 - 2,10 XLE o
- כמובן שמספר הטריידים בכולם די קטן(במיוחד בהתחשב שהאסטרטגיה עובדת ברזולוציה של חמש דקות). אם נחכה מספיק נעשה רווחים קטנים(אנחנו מדברים על מספר די קטן של טריידים במשך שנתיים באיזור 50-150 תלוי באורך הרצף).
 - מצד שני, אם נריץ את האסטרגיה על מספר מניות במקביל זה יכול להשתלם.
- רמת הסיכון היא די נמוכה לדעתנו, כי מניות אלו(לפחות SPY) QQQ די יציבות. אז כאשר מוצאים כזה רצף ובודקים בבר הבא שהוא משנה מגמה (עולה/יורד 2 סנט תלוי מגמה) אז סביר להניח שהמניה תניב תיקון כמו שראינו בניתוח המניות.