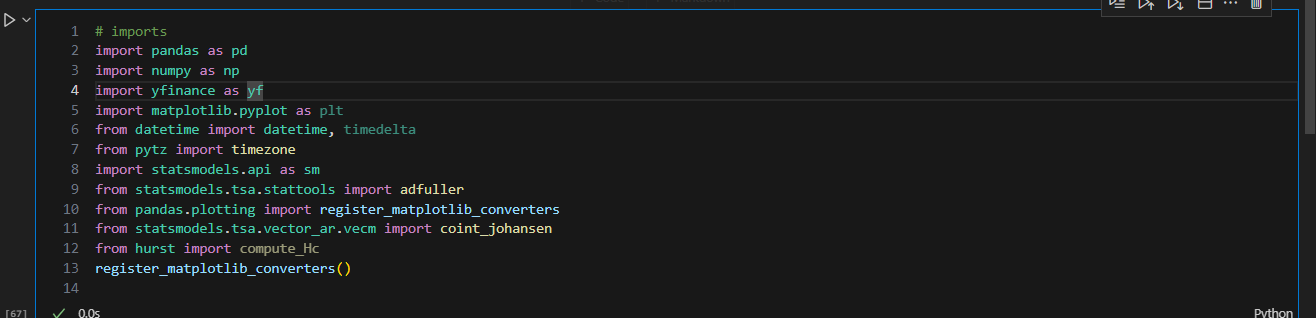
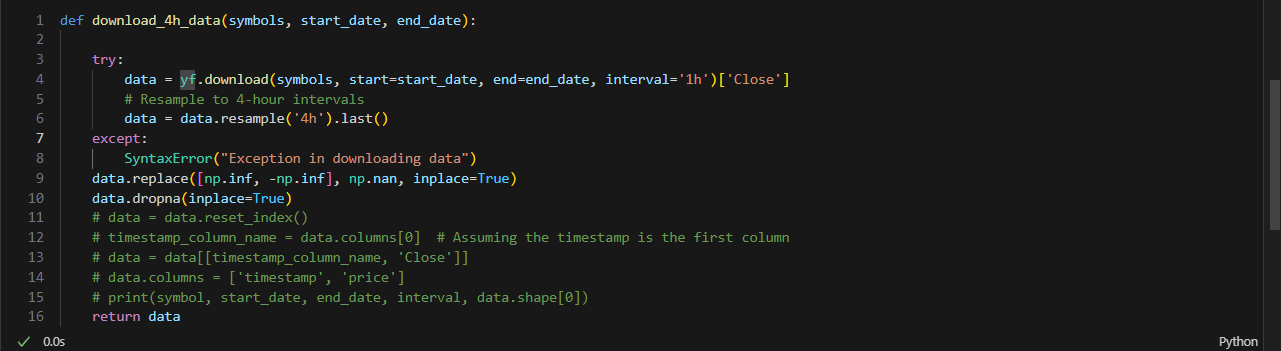
امیرعلی فرازمند

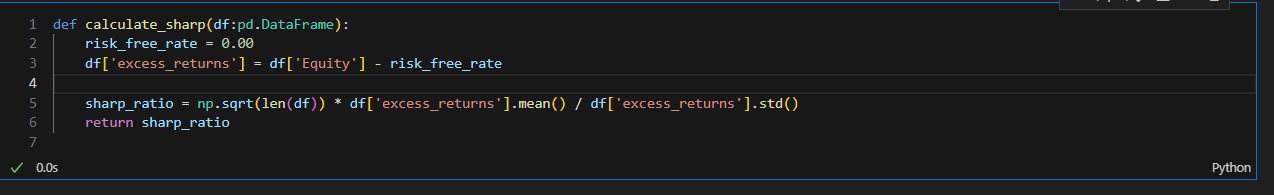
99522329

گزارش تمرین ششم



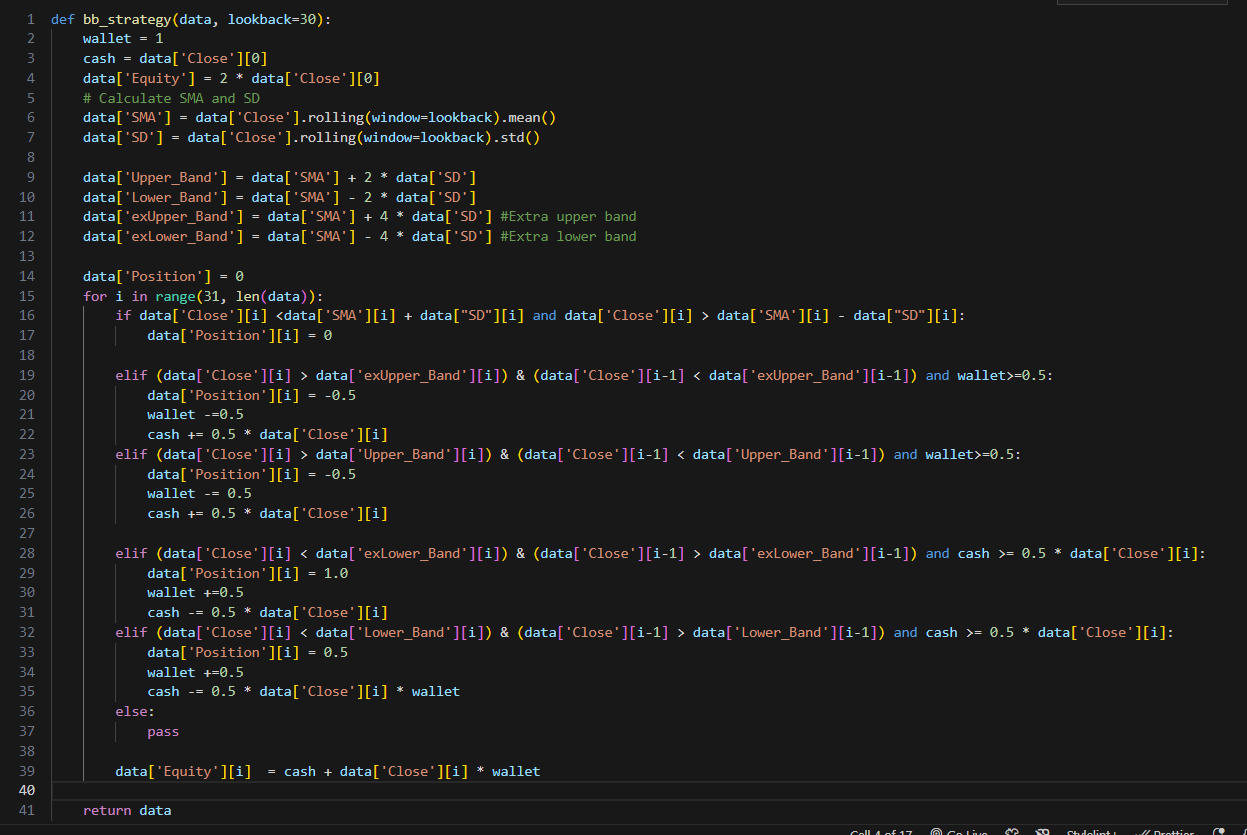
از آنجا که yahoo finance در interval های 4ساعته به ما دیتا نمیدهد، خودمان با استفاده از interval 1ساعته دیتافریم مدنظرمان را میسازیم: 

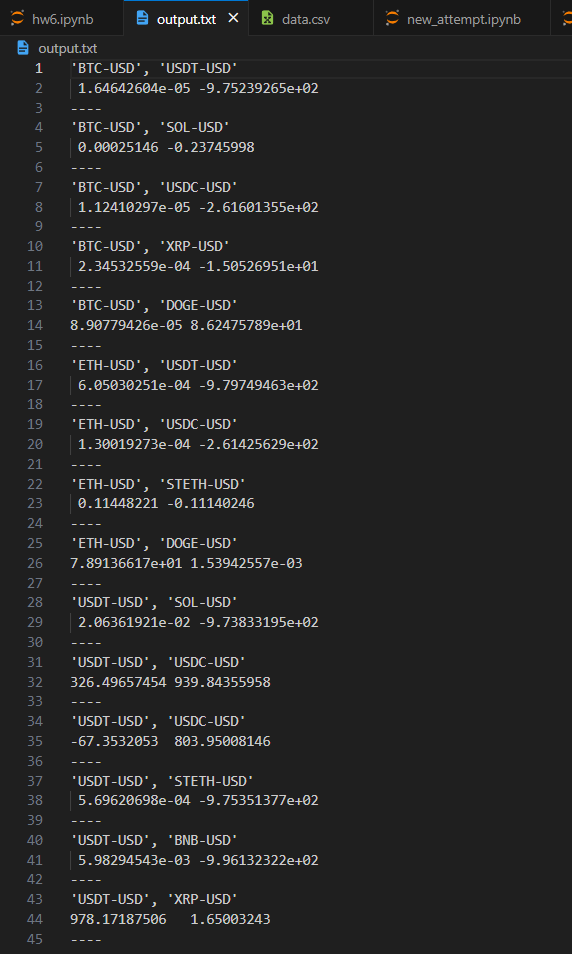
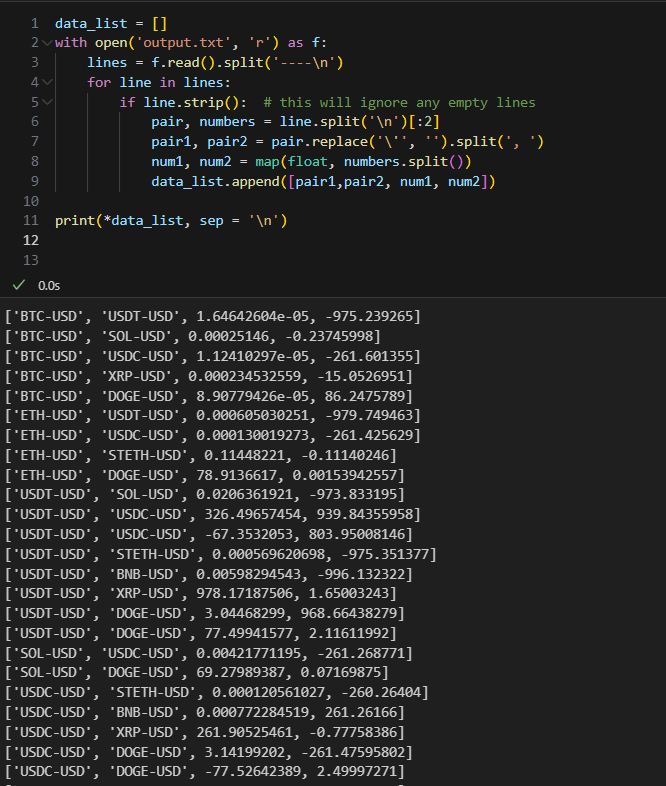
تابع محاسبه ی sharp ratio:



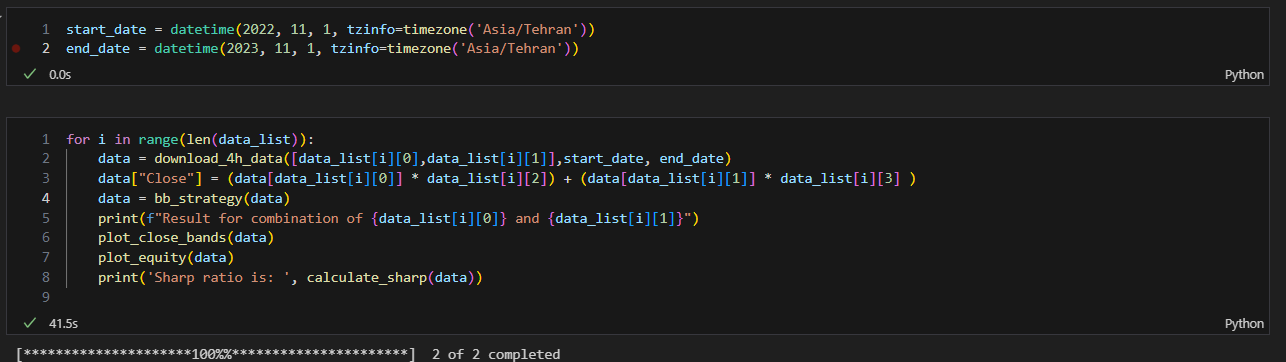
تابع های مربوط به پلات کردن دیتایی که داریم: 

تابع استراتژی گفته شده:

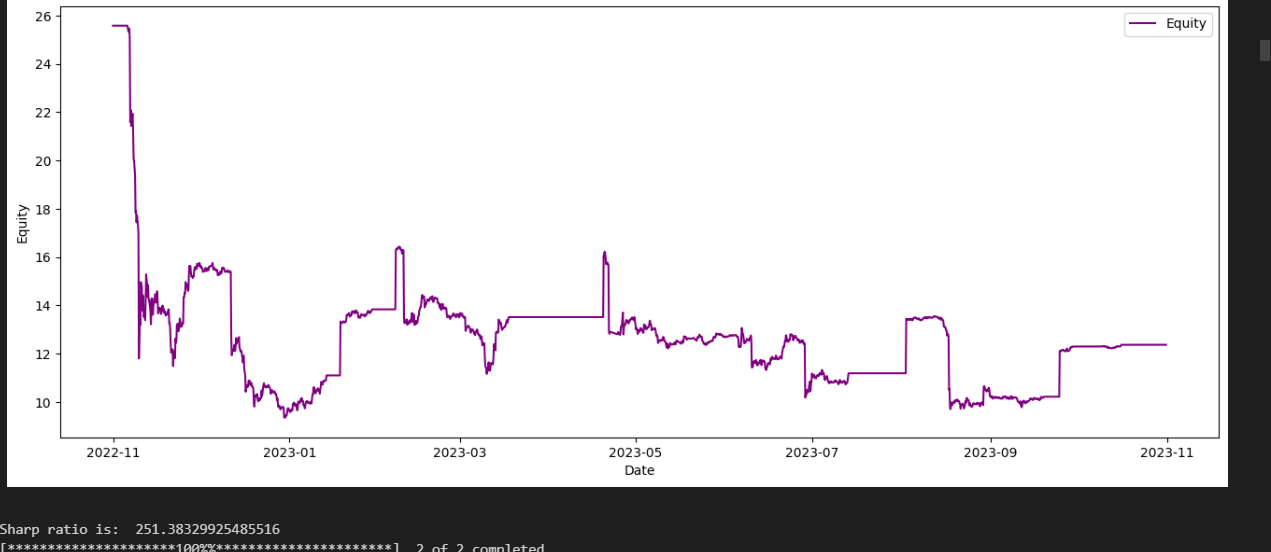
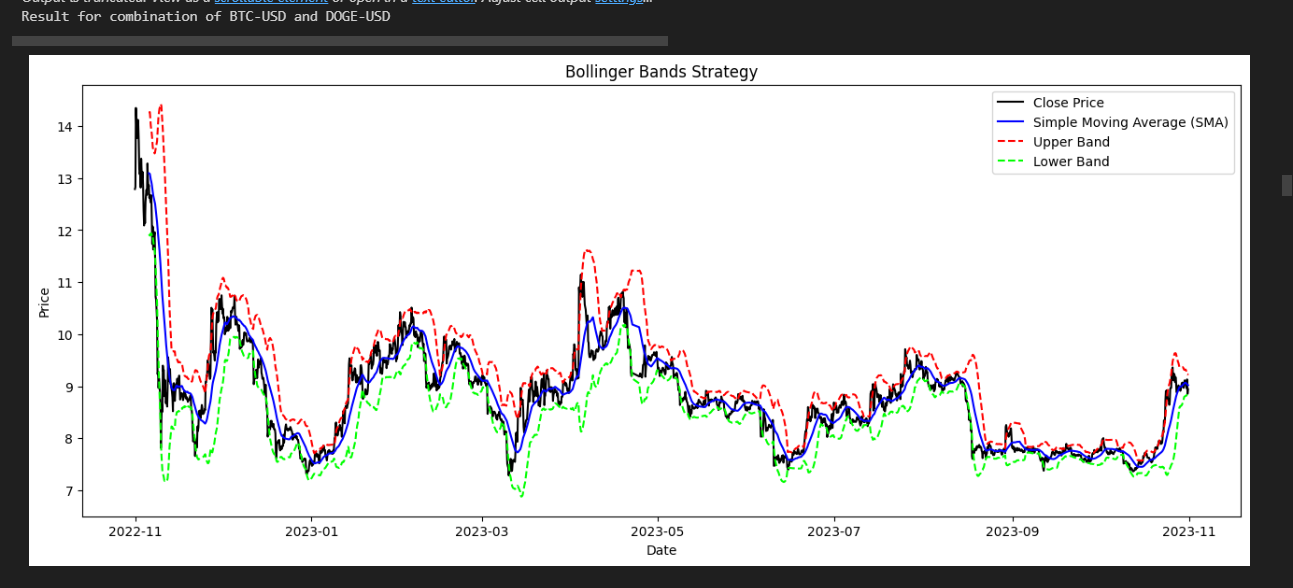
پ.ن: در ابتدای کار اندازه یک واحد از cointegratian ارزهای گفته شده در ولت داریم و یک واحد از آن هم نقد فرض میکنیم داریم.(close روز اول)

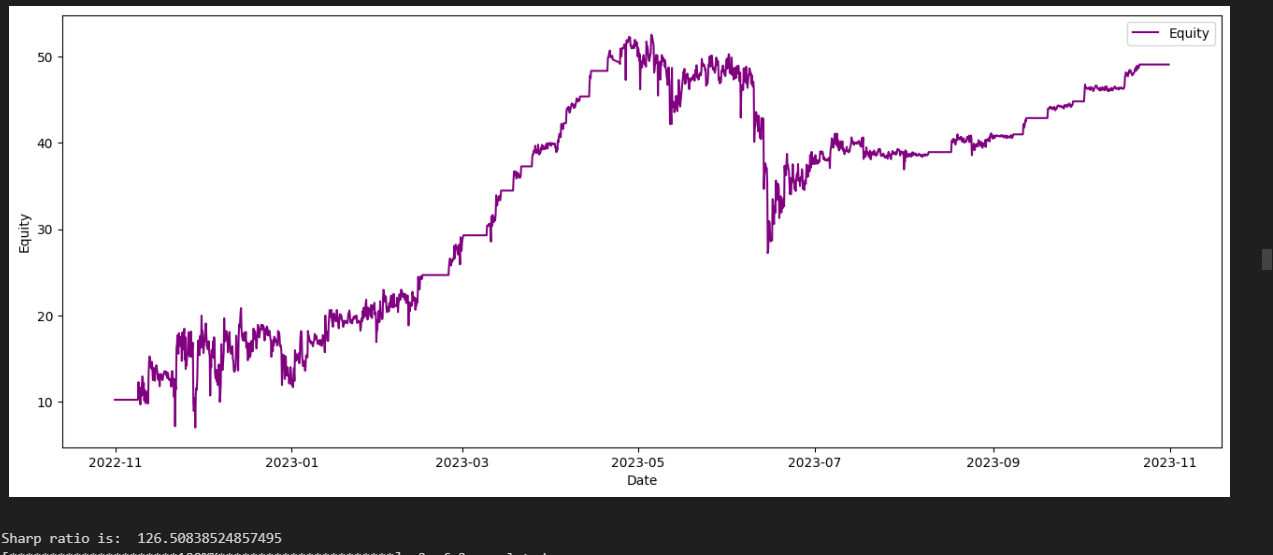
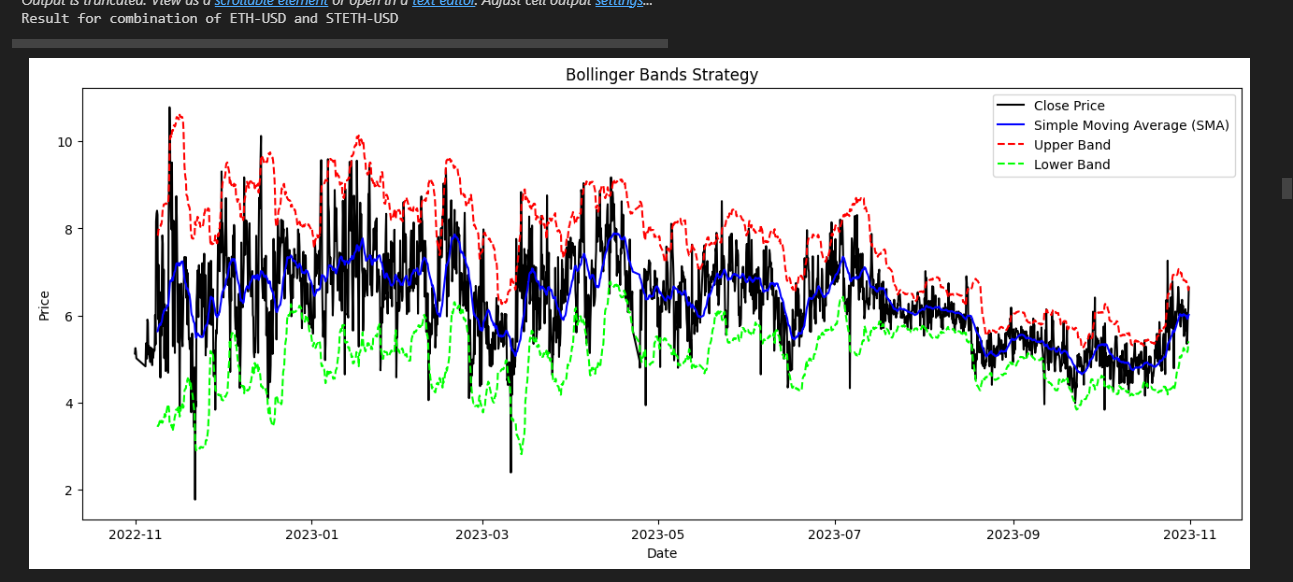
دیتای رمزارزها را اینگونه از فایل .txt که تمرین قبلی برایمان درست کرده میخوانیم: 

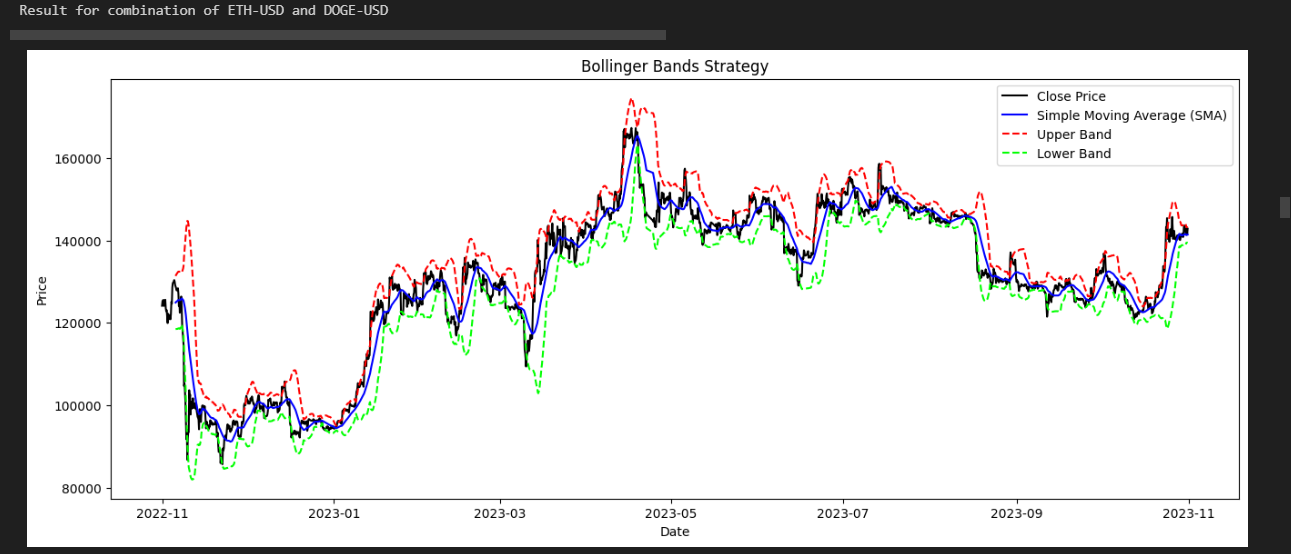
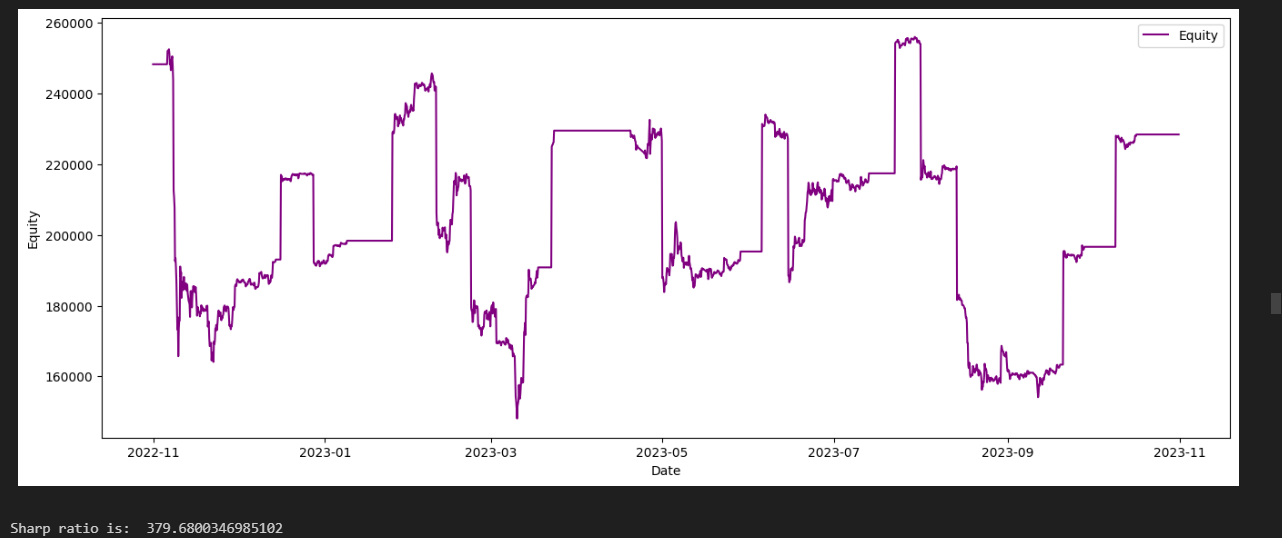
فرایند گفته شده را طی میکنیم:

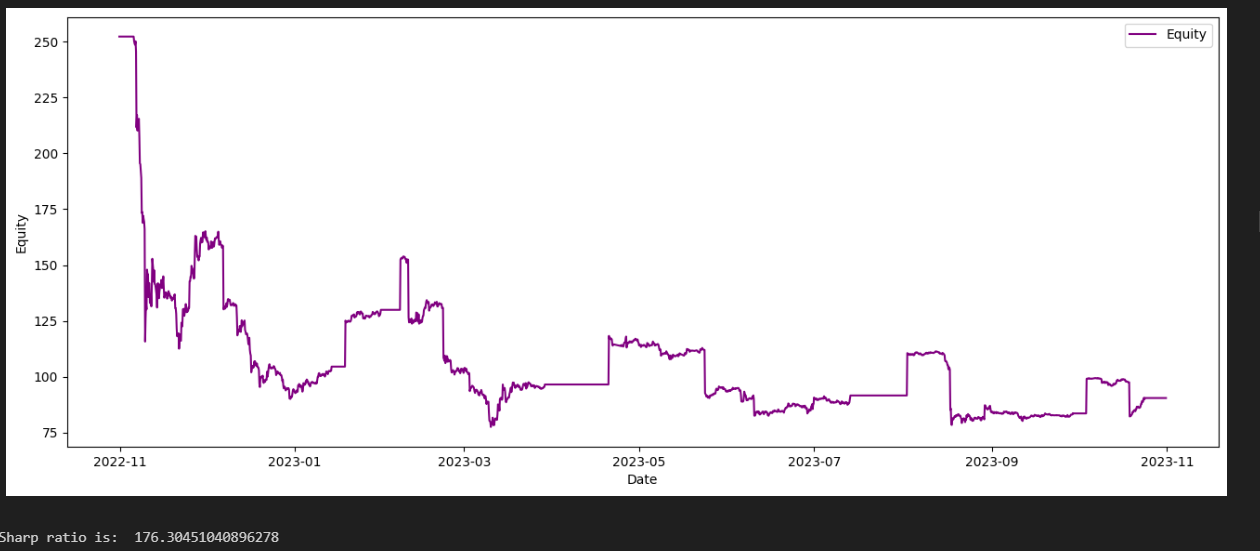
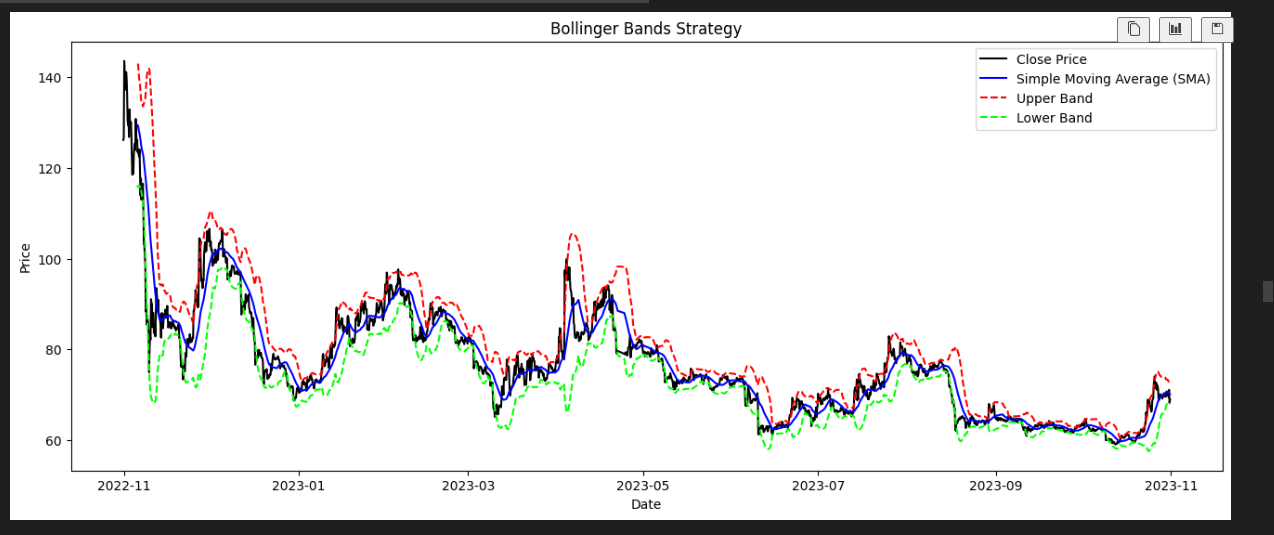


در output به ما 2 نمودار گفته شده و sharp ratio را به تفکیک میدهد که اینجا چندتا از آنها را نشان داده ایم:









منابع:

کد تمرین های قبلی

Chat-GPT