

# Back Test Algoritmo A01, USD.JPY, H4

## Box Jenkins para series de tiempo financieras

Precio de Cierre: 2,016-06-20 16:00:00 : 2,016-11-01 11:00:00 con periodicidad de H4



Estadística Precios (Velas) históricas

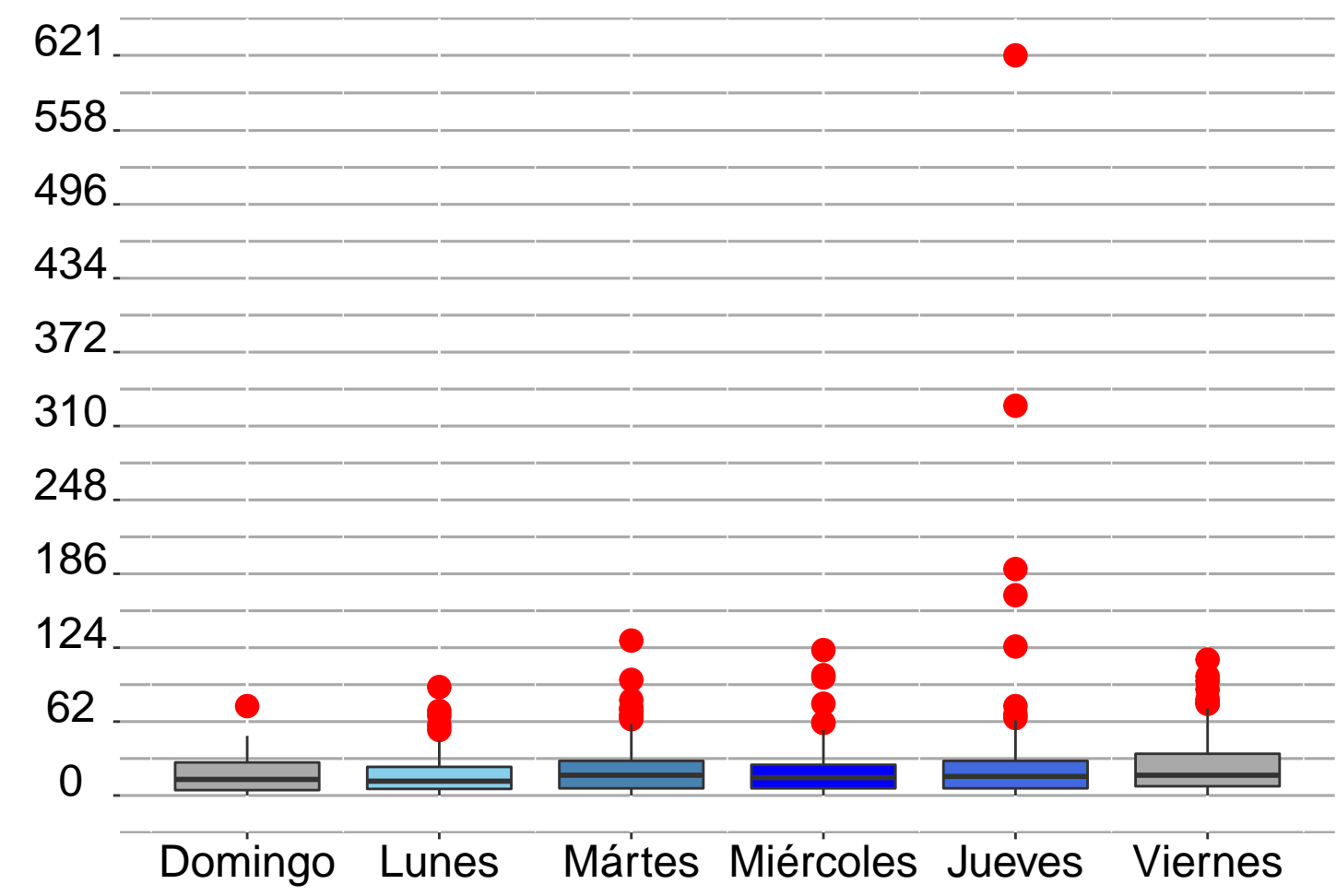
High - Open	Pips Max	Descontados Alcistas
Max: 199	Min: 0	Mediana: 16 Variacion: 22.08

Open - Low	Pips Max	Descontados Bajistas
Max: 621	Min: 0	Mediana: 15 Variacion: 36.07

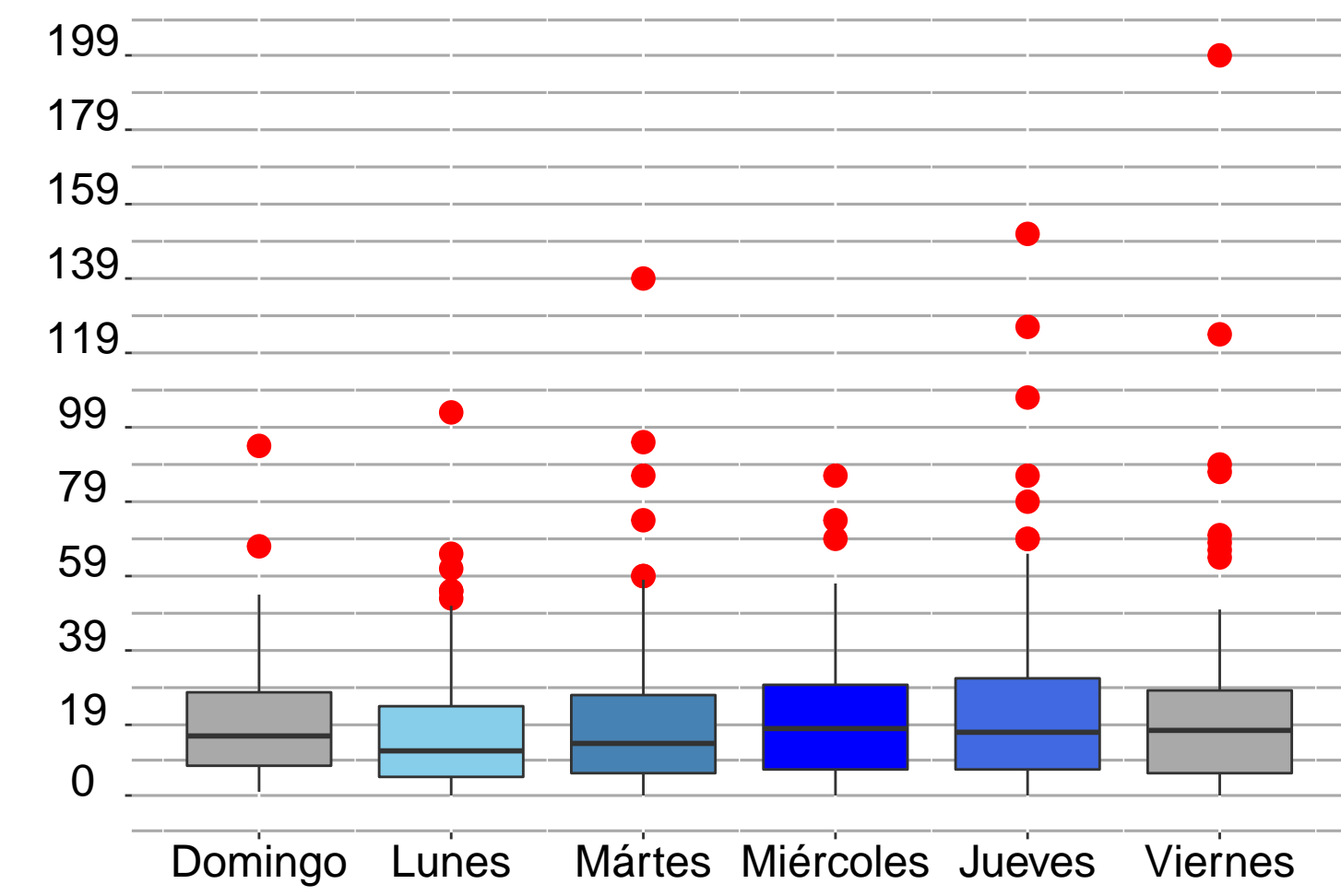
Close - Open	Amplitud de Vela Max
Max: 390	Min: 0 Mediana: 15 Variacion: 26.67

High - Low	Amplitud de Sombra Max
Max: 624	Min: 8 Mediana: 35 Variacion: 39.5

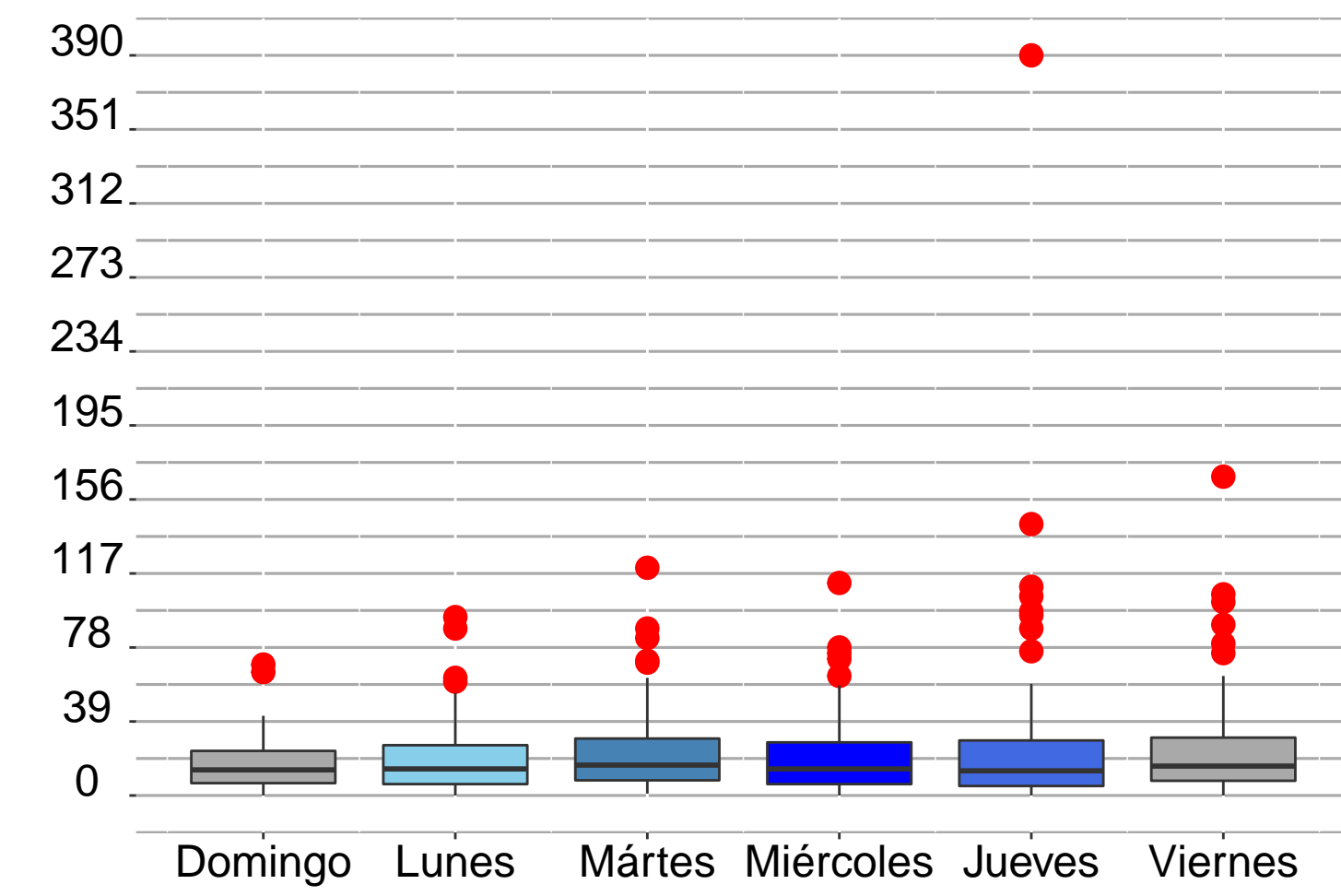
Price.Open - Price.Low



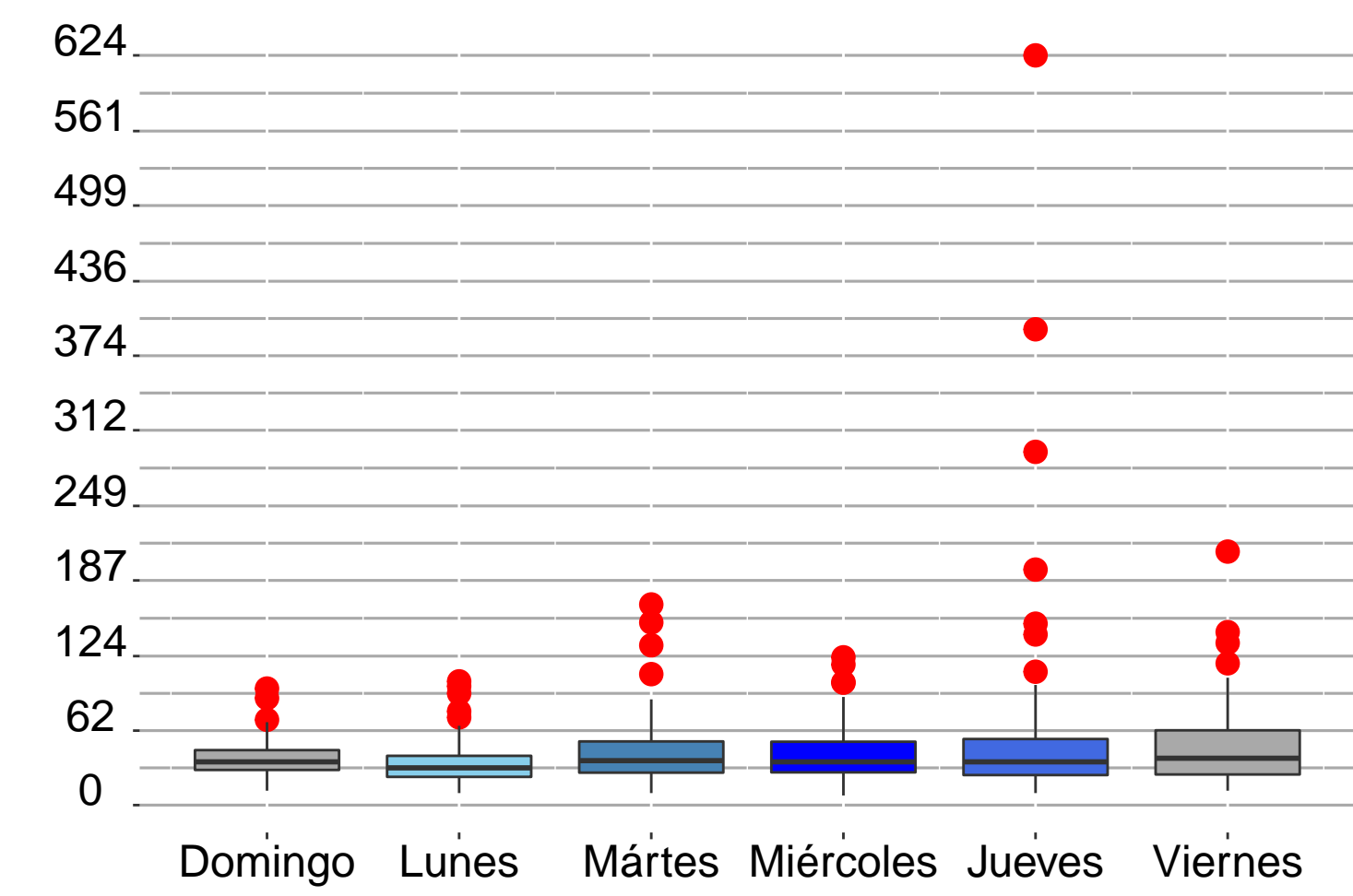
Price.High - Price.Open



Price.Close - Price.Open



Price.High - Price.Low



Descripción

Metodolgia *BoxJenkins* para series de tiempo financieras. Modelo lineal univariado que utiliza información endógena de la serie de tiempo para construir un modelo matemático con el cual realizar predicciones de valores futuros.

Datos Entrada

- Parámetros de Entrada
- Tamaño de Ventana de información: **78 Precios**
  - Noción de parámetro info: **Ultima Quincena Bursatil**
  - Lógica de Aplicación de Algoritmo: **Directo**
  - Instrumento a Utilizar: **USD.JPY**
  - Periodicidad de precios: **H4**
  - Valores de Exploración. TP: **10 : 70** y SL: **10 : 70**

Datos Salida

- Parámetros de Salida
- Predicción del signo del rendimiento
  - Take Profit
  - Stop Loss

Desempeño de los 4 mejores casos

Criterio (SL,TP)	1 (24,70)	2 (11,70)	3 (18,70)	4 (57,70)
Exito Modelo	0.57	0.57	0.57	0.57
Exito Trading	0.52	0.37	0.48	0.59
Pips Generados	3,367	2,571	3,286	2,672
Perd Max Cta	-143	22	-82	-419
Gan Max Cta	3,367	2,571	3,286	2,672
DD Max	-192	-154	-144	-285
DU Max	630	560	630	1,820

- Criterio 1: Con mayor profit final acumulado.
- Criterio 2: Con menor DrawDown registrado.
- Criterio 3: Con menor registro de minusvalía general.
- Criterio 4: Mayor Exito en Trading.

Pips Acumulados para cada Variación de Parámetros

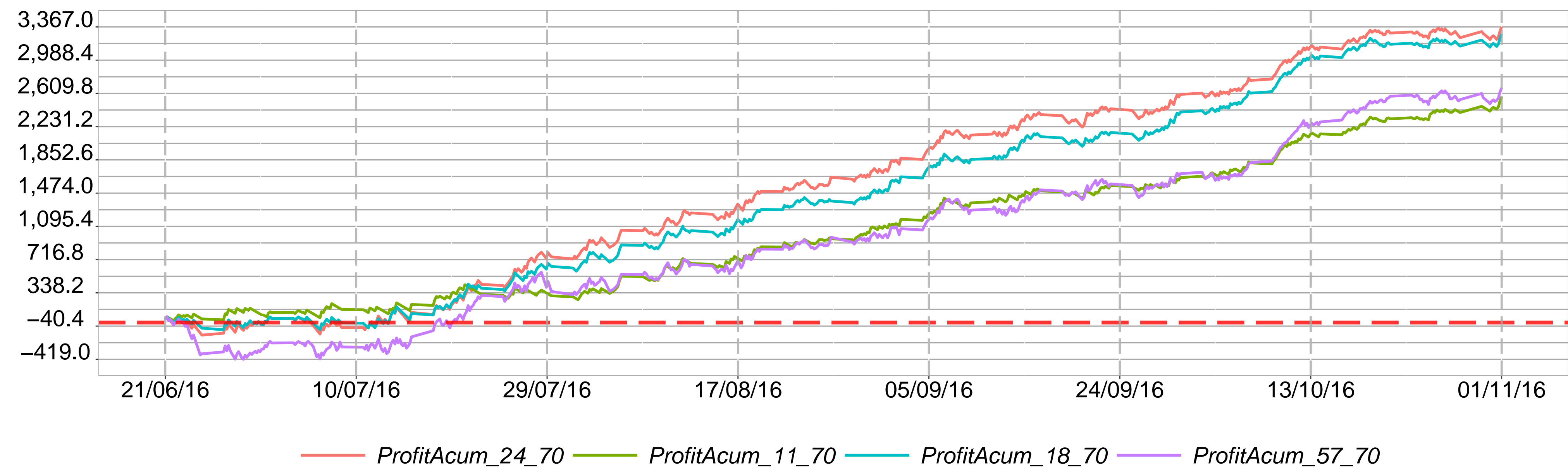


Tabla Gc Vs Pc (24,70)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	275
Perdedoras	1	150
Perdedoras	2	80
Perdedoras	3	39
Perdedoras	4	15
Perdedoras	5	9
Perdedoras	6	5
Perdedoras	7	2
Perdedoras	8	1
Perdedoras	9	1
Ganadoras	0	302
Ganadoras	1	149
Ganadoras	2	66
Ganadoras	3	30
Ganadoras	4	17
Ganadoras	5	7
Ganadoras	6	3
Ganadoras	7	2
Ganadoras	8	1

Tabla Gc Vs Pc (11,70)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	365
Perdedoras	1	135
Perdedoras	2	44
Perdedoras	3	18
Perdedoras	4	7
Perdedoras	5	3
Perdedoras	6	2
Perdedoras	7	2
Perdedoras	8	1
Ganadoras	0	212
Ganadoras	1	134
Ganadoras	2	80
Ganadoras	3	49
Ganadoras	4	34
Ganadoras	5	24
Ganadoras	6	13
Ganadoras	7	10
Ganadoras	8	7
Ganadoras	9	5
Ganadoras	10	5
Ganadoras	11	1
Ganadoras	12	1

Tabla Gc Vs Pc (18,70)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	302
Perdedoras	1	148
Perdedoras	2	63
Perdedoras	3	34
Perdedoras	4	14
Perdedoras	5	8
Perdedoras	6	4
Perdedoras	7	2
Perdedoras	8	1
Perdedoras	9	1
Ganadoras	0	275
Ganadoras	1	147
Ganadoras	2	73
Ganadoras	3	35
Ganadoras	4	24
Ganadoras	5	13
Ganadoras	6	5
Ganadoras	7	3
Ganadoras	8	2

Tabla Gc Vs Pc (57,70)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	239
Perdedoras	1	145
Perdedoras	2	80
Perdedoras	3	47
Perdedoras	4	24
Perdedoras	5	12
Perdedoras	6	7
Perdedoras	7	3
Perdedoras	8	2
Perdedoras	9	1
Perdedoras	10	1
Perdedoras	11	1
Perdedoras	12	1
Perdedoras	13	1
Perdedoras	14	1
Perdedoras	15	1
Perdedoras	16	1
Perdedoras	17	1
Perdedoras	18	1
Perdedoras	19	1
Perdedoras	20	1
Perdedoras	21	1



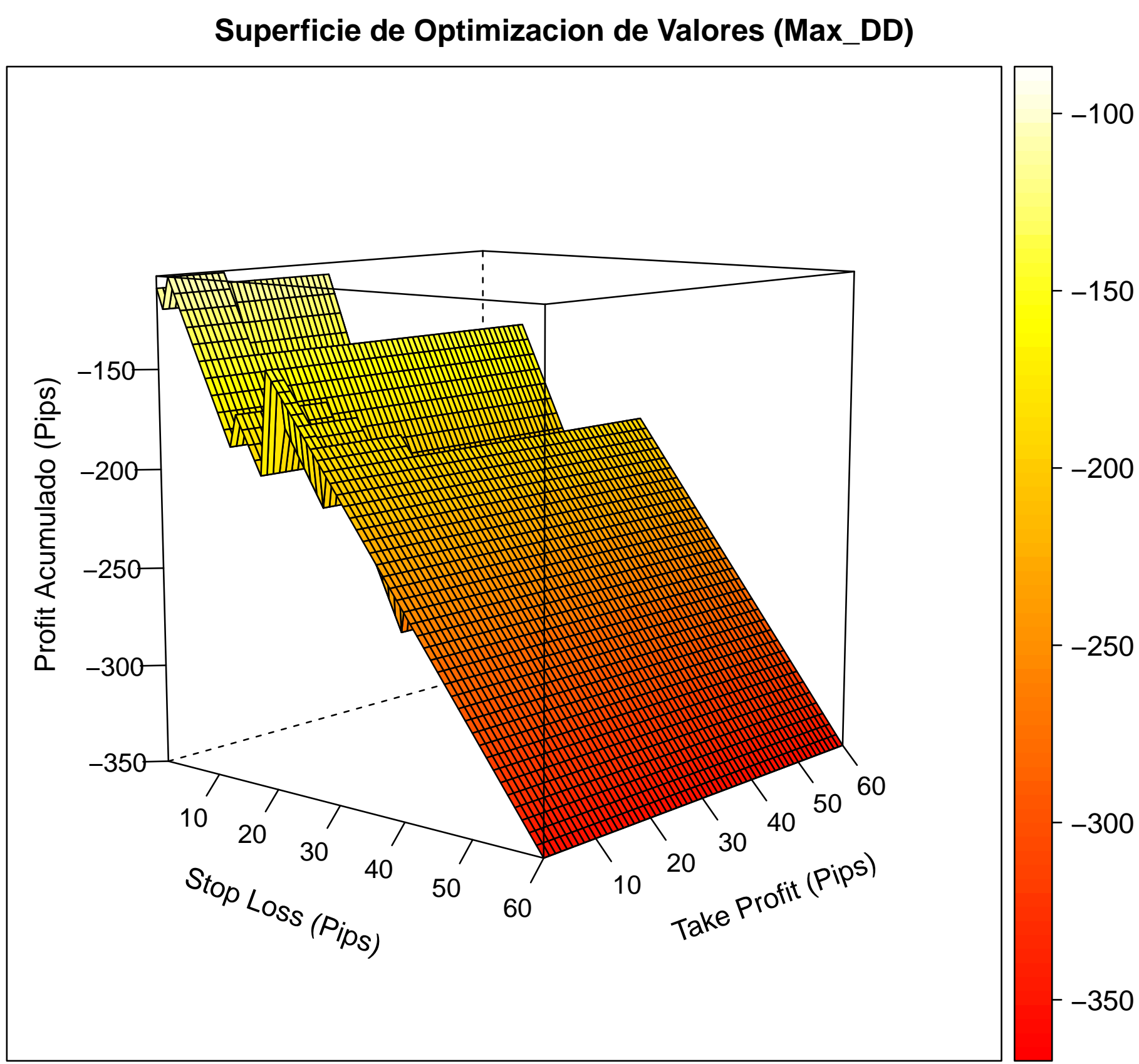
# Back Test Algoritmo A01, USD.JPY, H4

## Box Jenkins para series de tiempo financieras

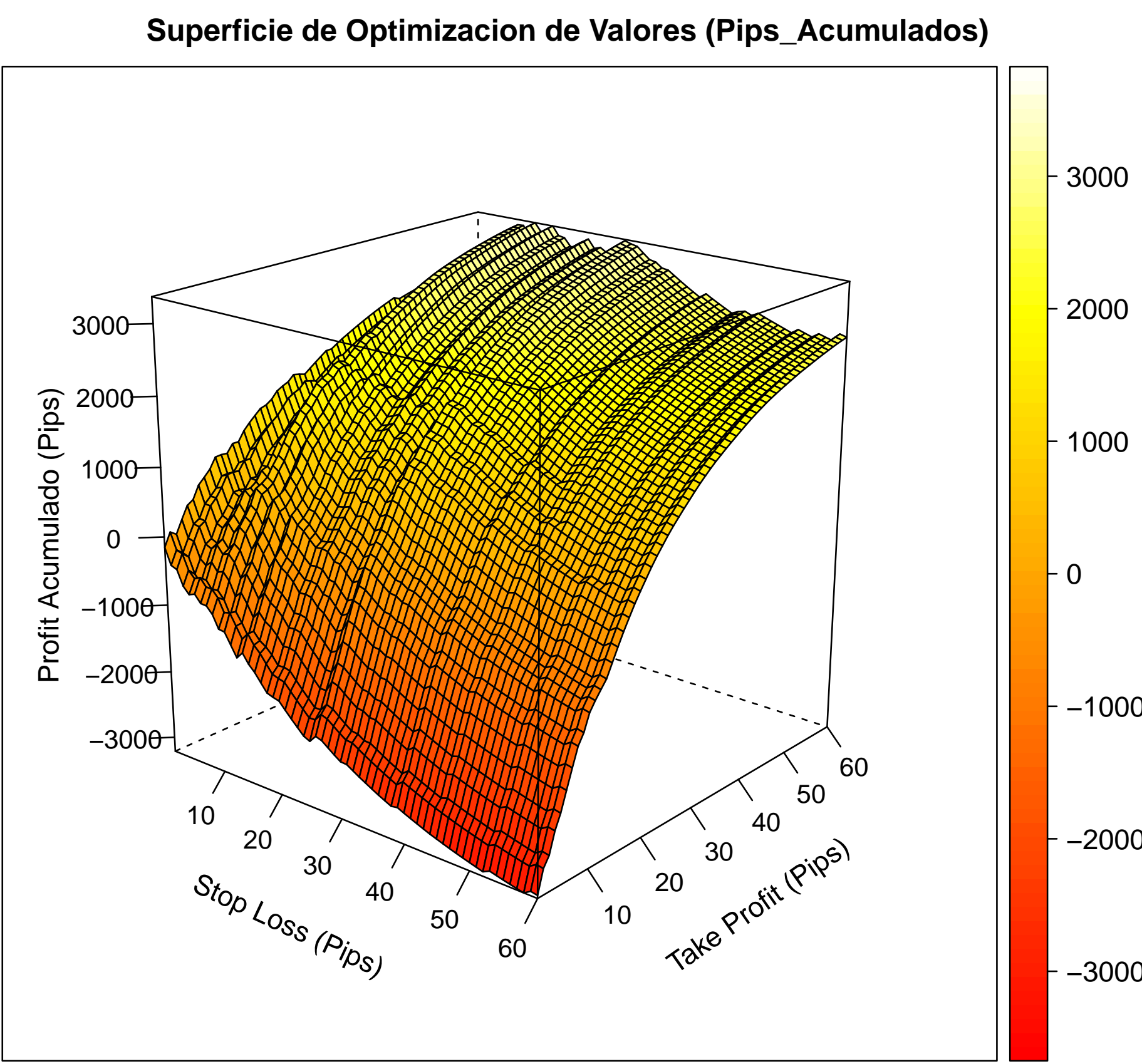
### Descripción General de Datos Utilizados

La cantidad de días de información que se utilizó fue de: **133.8**, es decir, desde la fecha: **2,016-06-20 16:00:00** hasta **2,016-11-01 11:00:00**. Debido a que la granularidad de los precios fue de: **H4** entonces la cantidad final de periodos utilizados para el modelo fue de: **577**. Durante este periodo, los periodos clasificados como *alcistas* fueron en total: **294** y los que se clasificaron como *bajistas* fueron en total: **283**. Respecto al Algoritmo A01, los periodos clasificados como *bajistas* fueron: **245** y los clasificados como *alcistas* fueron: **332**.

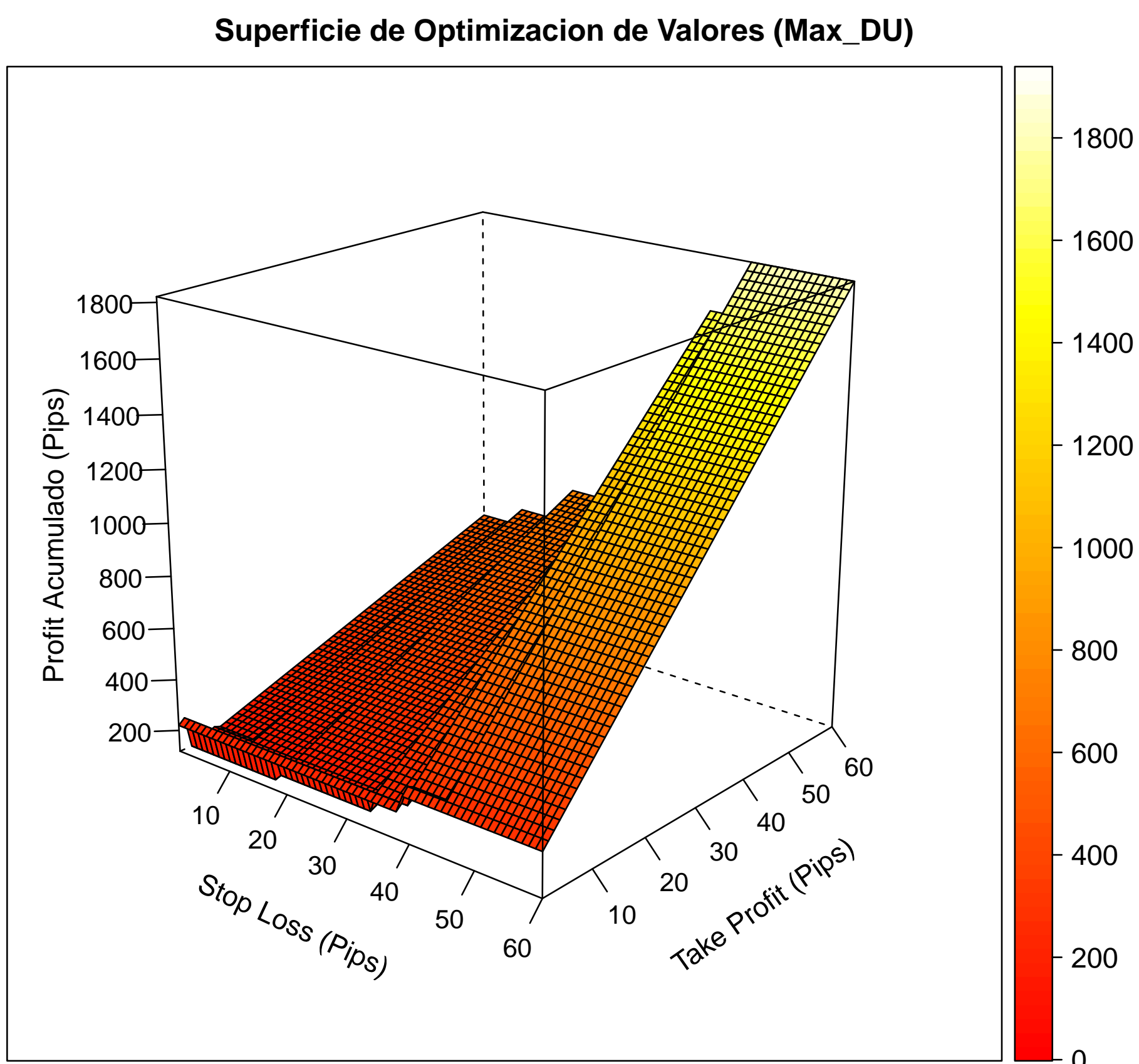
### Espacio 4D MAX Draw Down



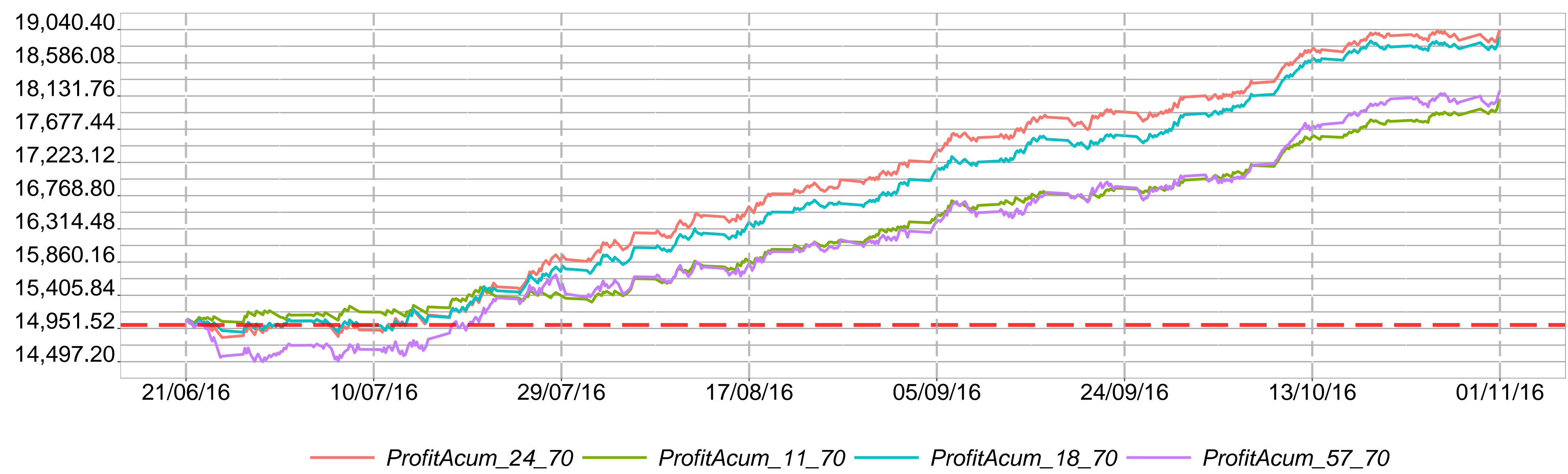
### Espacio 4D Profit Acumulada



### Espacio 4D MAX Draw Up



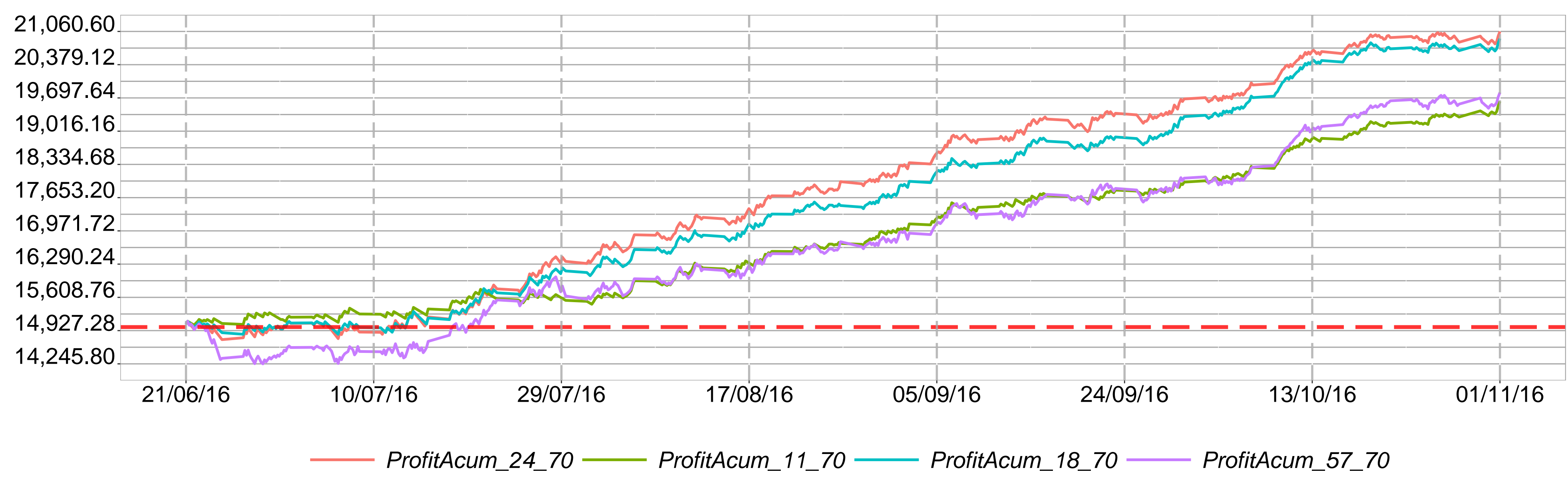
### Evolución de Capital - 1.2 Lotes por Operacion



### Cifras con 1.2 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(24,70)	(11,70)	(18,70)	(57,70)
Exito.Modelo	0.57	0.57	0.57	0.57
Exito.Trading	0.52	0.37	0.48	0.59
Ganancia (USD)	4,040.4	3,085.2	3,943.2	3,206.4
Perd Max Cta	-171.6	26.4	-98.4	-502.8
Gan Max Cta	4,040.4	3,085.2	3,943.2	3,206.4
DD Max	-230.4	-184.8	-172.8	-342
DU Max	756	672	756	2184

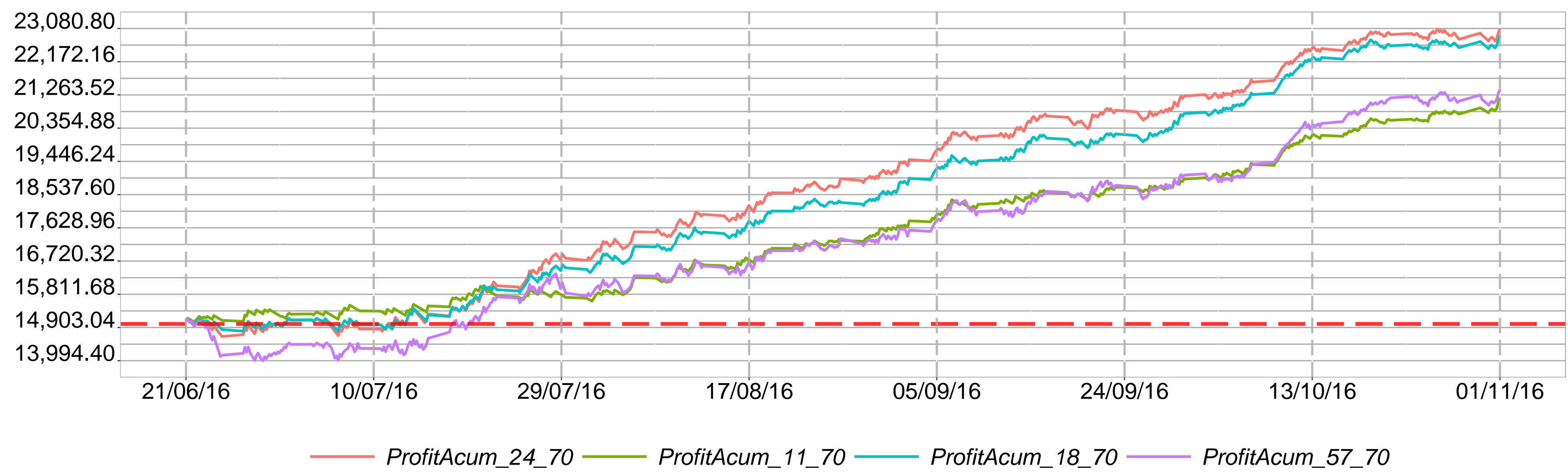
### Evolución de Capital - 1.8 Lotes por Operacion



### Cifras con 1.8 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(24,70)	(11,70)	(18,70)	(57,70)
Exito.Modelo	0.57	0.57	0.57	0.57
Exito.Trading	0.52	0.37	0.48	0.59
Ganancia (USD)	6,060.6	4,627.8	5,914.8	4,809.6
Perd Max Cta	-257.4	39.6	-147.6	-754.2
Gan Max Cta	6,060.6	4,627.8	5,914.8	4,809.6
DD Max	-345.6	-277.2	-259.2	-513
DU Max	1134	1008	1134	3276

### Evolución de Capital - 2.4 Lotes por Operacion



### Cifras con 2.4 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(24,70)	(11,70)	(18,70)	(57,70)
Exito.Modelo	0.57	0.57	0.57	0.57
Exito.Trading	0.52	0.37	0.48	0.59
Ganancia (USD)	8,080.8	6,170.4	7,886.4	6,412.8
Perd Max Cta	-343.2	52.8	-196.8	-1,005.6
Gan Max Cta	8,080.8	6,170.4	7,886.4	6,412.8
DD Max	-460.8	-369.6	-345.6	-684
DU Max	1512	1344	1512	4368