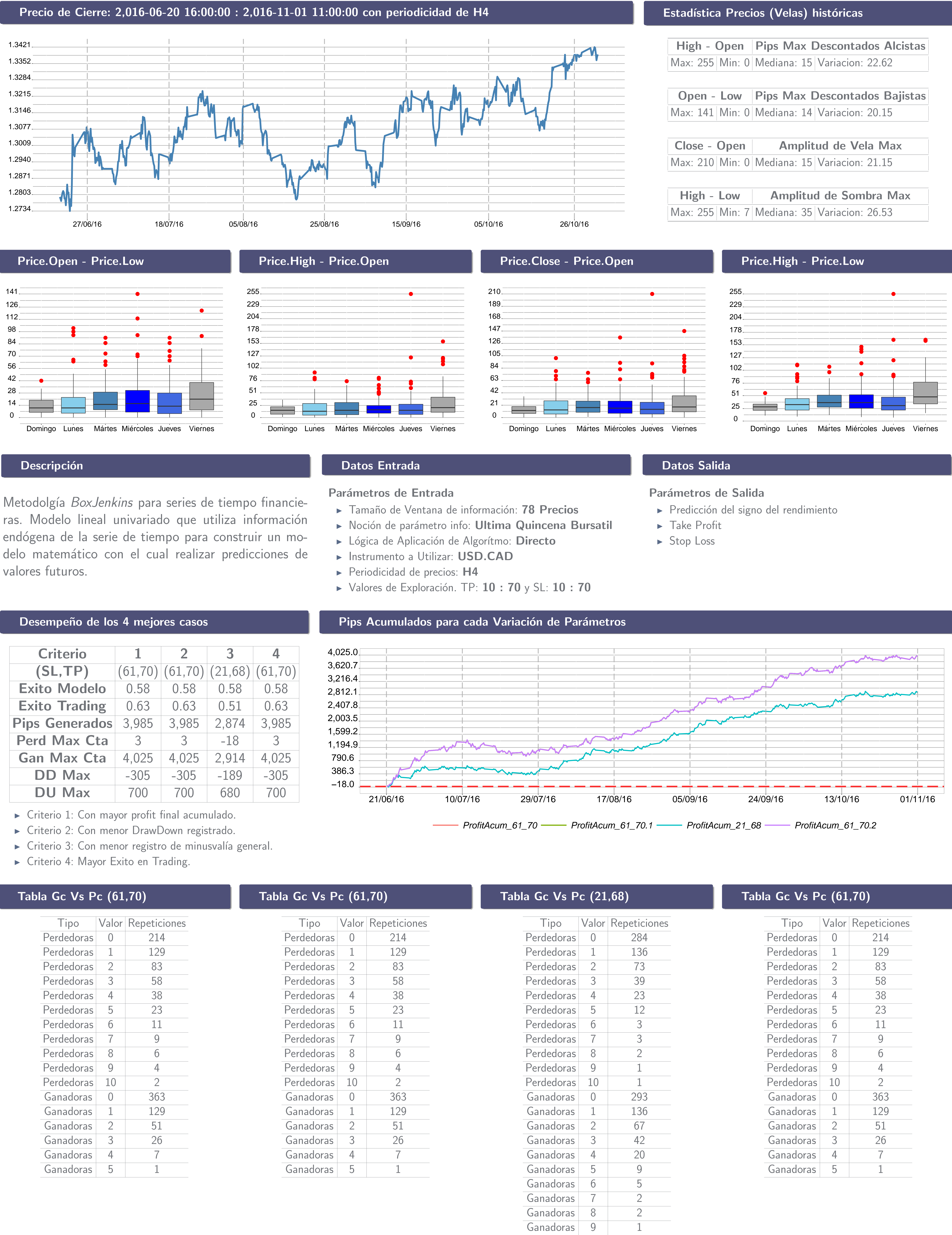


Back Test Algoritmo A01, USD.CAD, H4

Box Jenkins para series de tiempo financieras



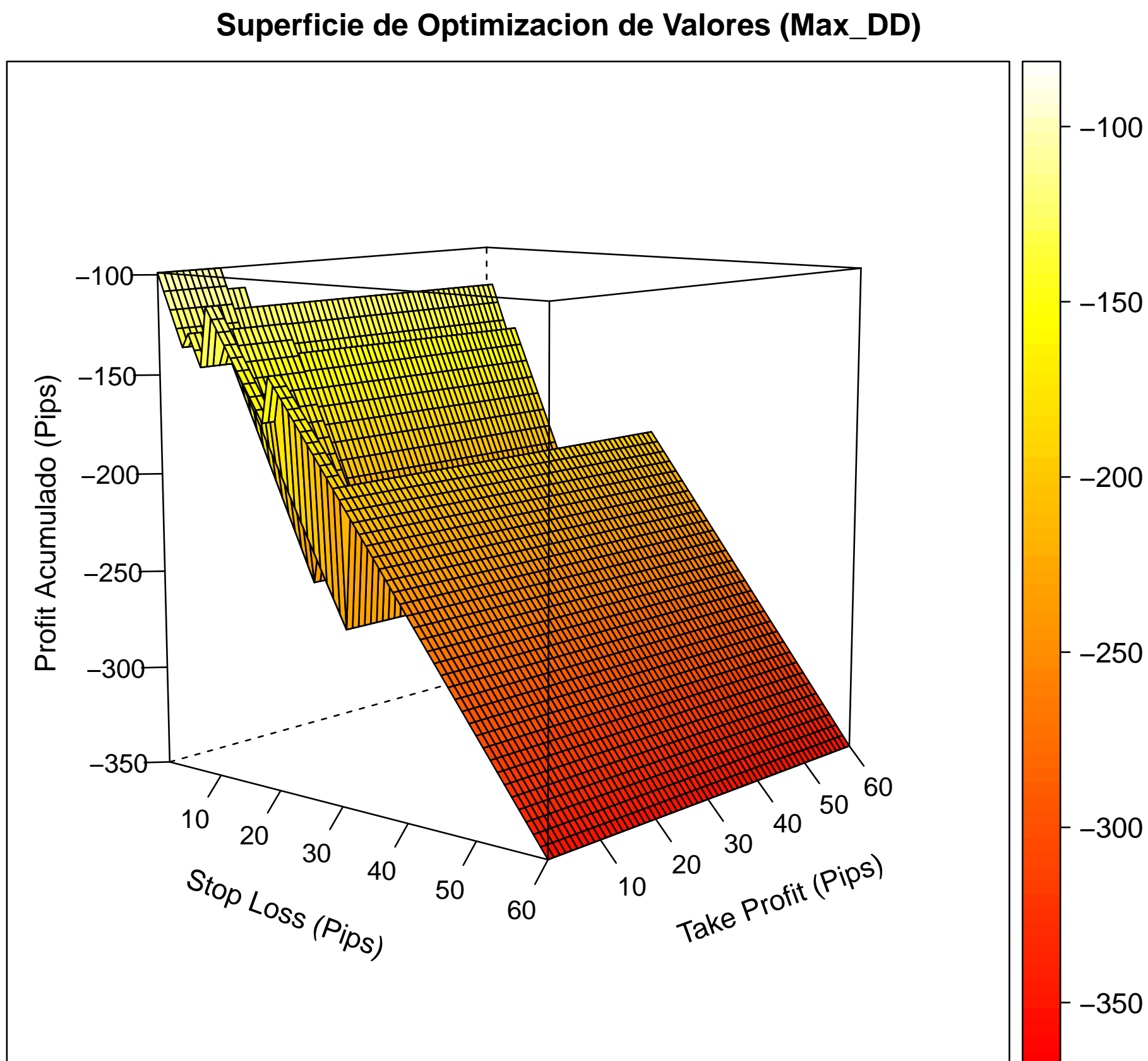
Back Test Algoritmo A01, USD.CAD, H4

Box Jenkins para series de tiempo financieras

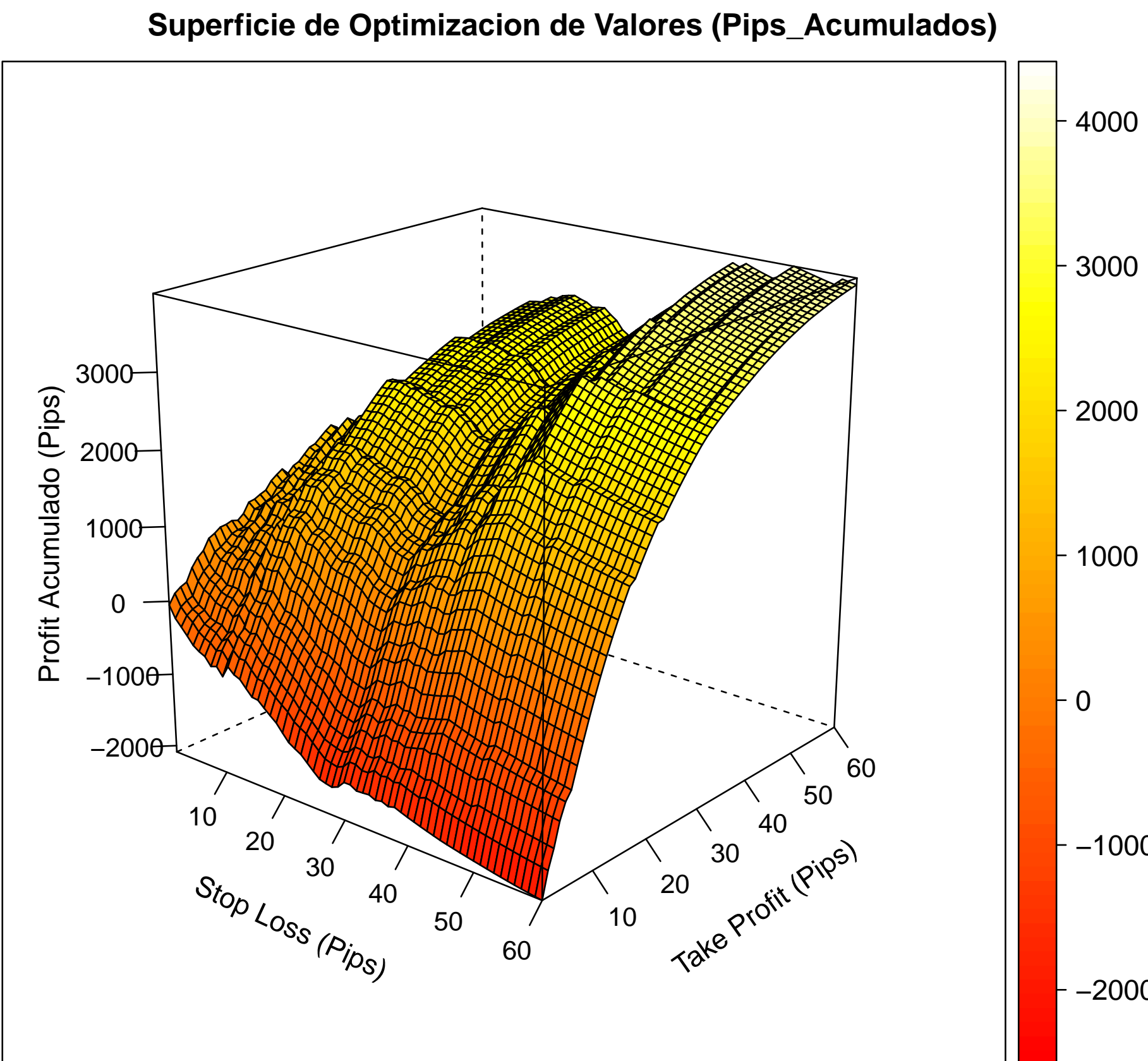
Descripción General de Datos Utilizados

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: **303** y los que se clasificaron como *bajistas* fueron en total: **274**. Respecto al Algoritmo A01, los periodos clasificados como *bajistas* fueron: **253** y los clasificados como *alcistas* fueron: **324**.

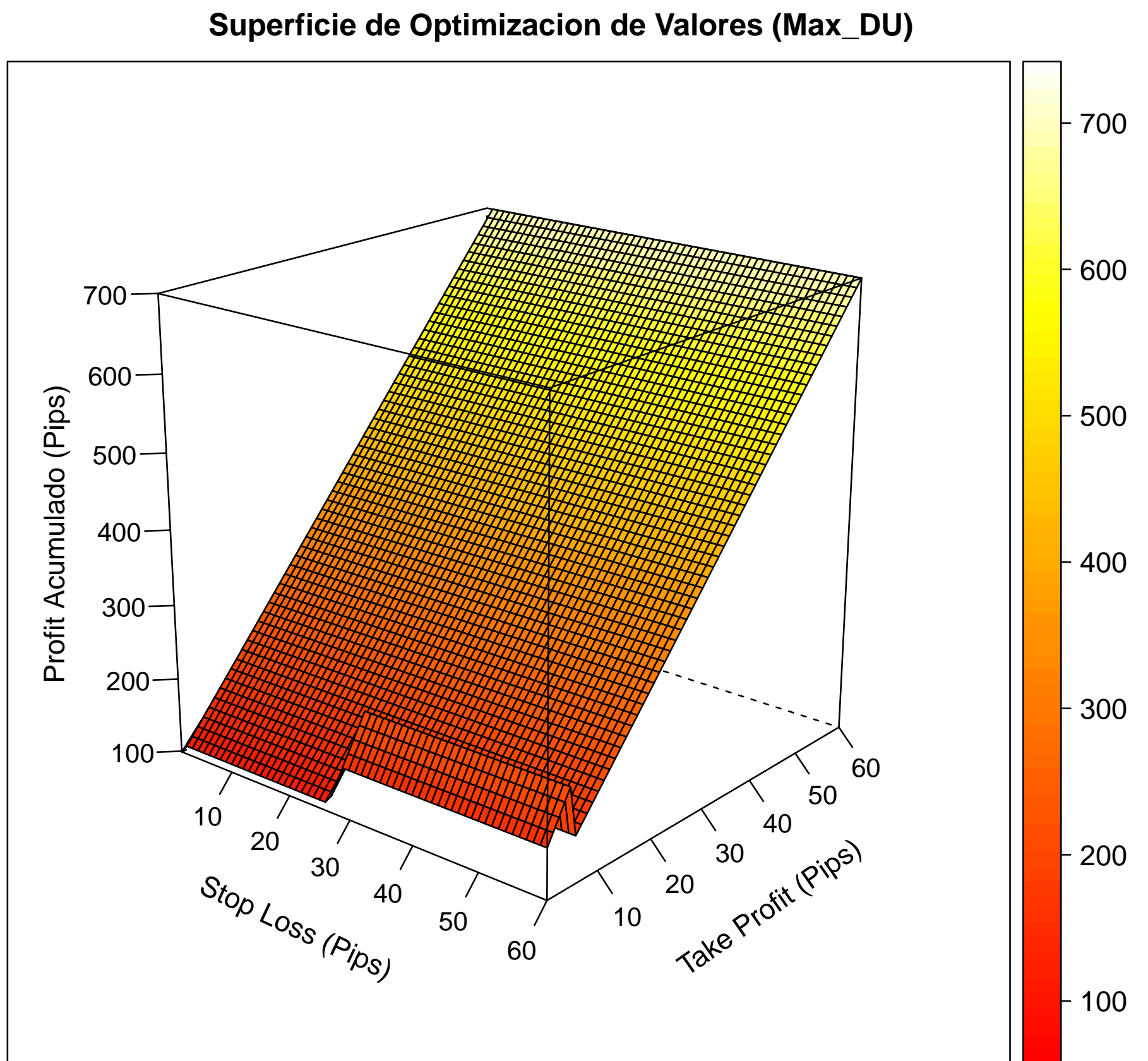
Espacio 4D MAX Draw Down



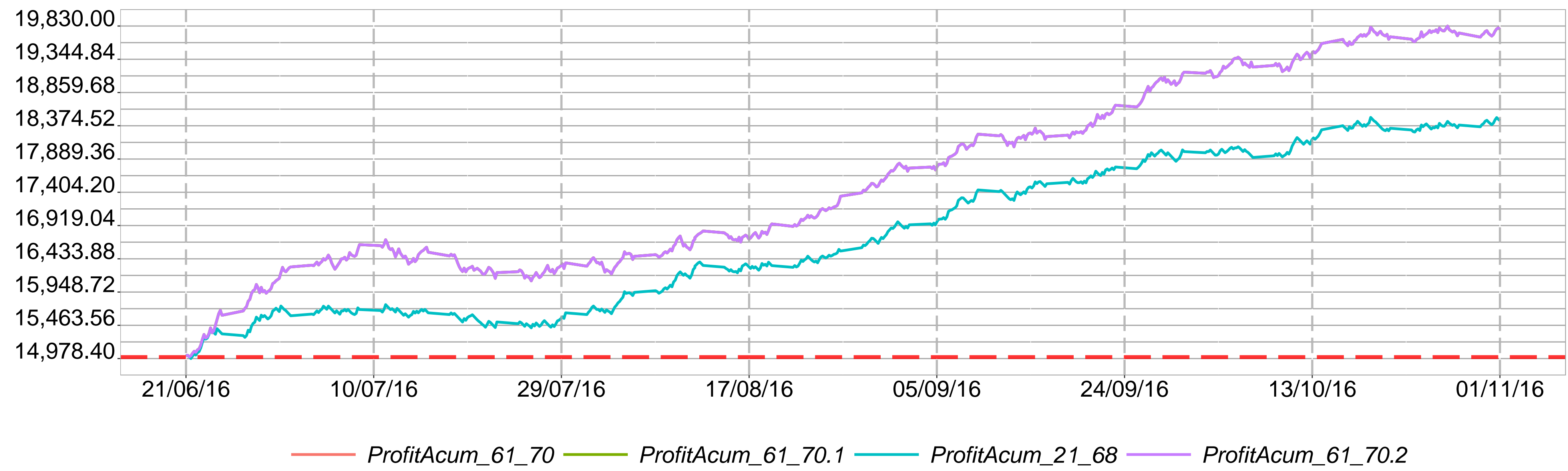
Espacio 4D Profit Acumulada



Espacio 4D MAX Draw Up



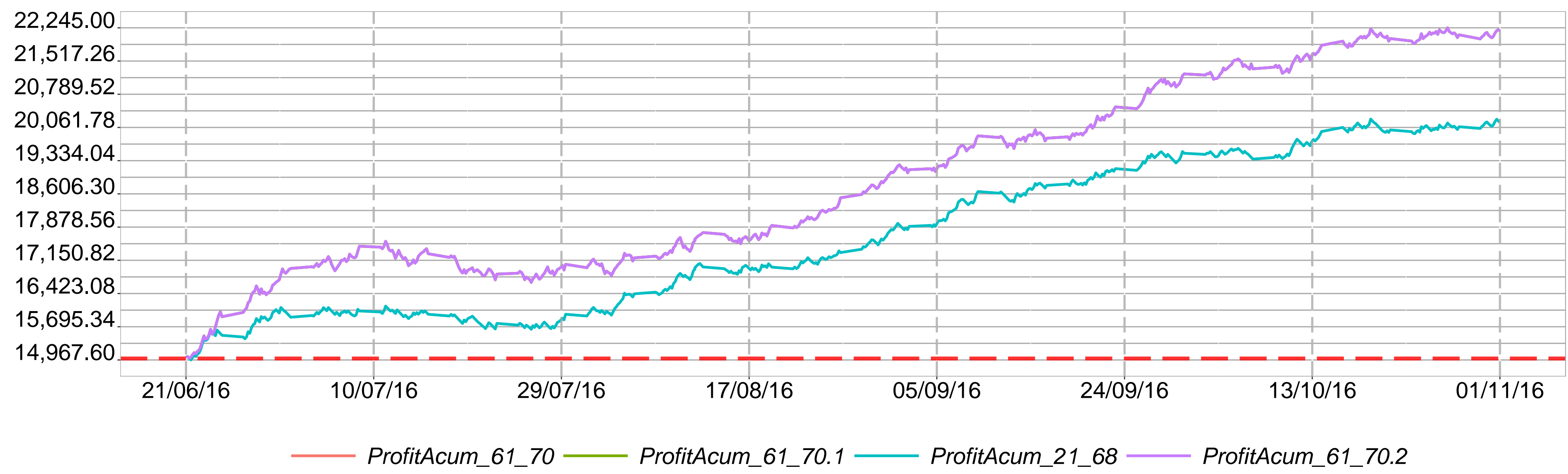
Evolución de Capital - 1.2 Lotes por Operacion



Cifras con 1.2 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(61,70)	(61,70)	(21,68)	(61,70)
Exito.Modelo	0.58	0.58	0.58	0.58
Exito.Trading	0.63	0.63	0.51	0.63
Ganancia (USD)	4,782	4,782	3,448.8	4,782
Perd Max Cta	3.6	3.6	-21.6	3.6
Gan Max Cta	4,830	4,830	3,496.8	4,830
DD Max	-366	-366	-226.8	-366
DU Max	840	840	816	840

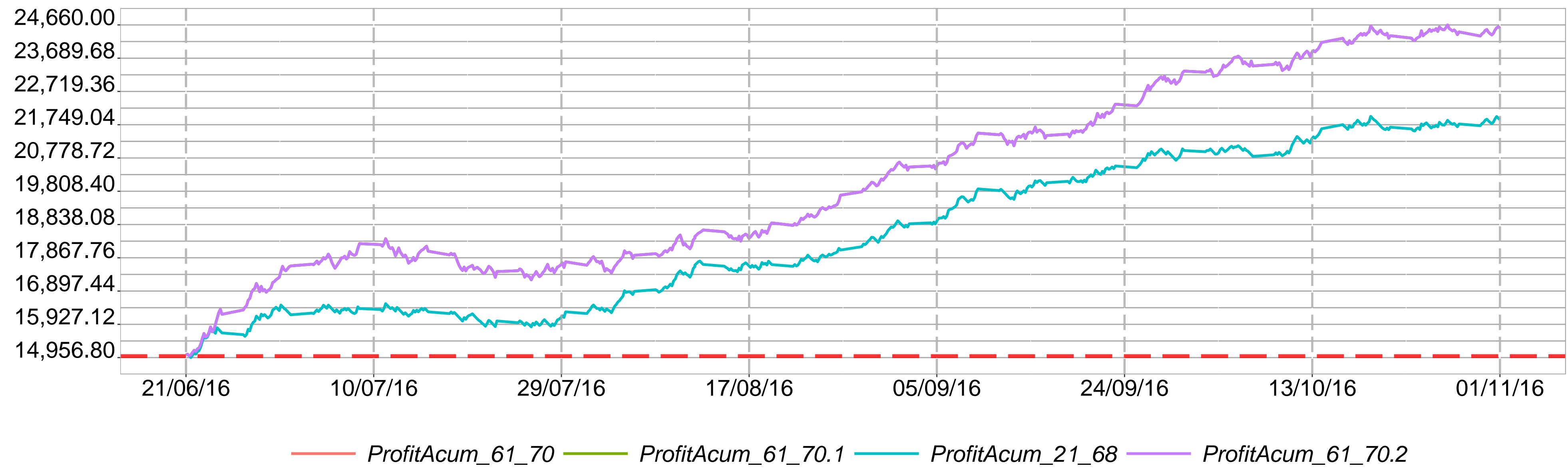
Evolución de Capital - 1.8 Lotes por Operacion



Cifras con 1.8 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(61,70)	(61,70)	(21,68)	(61,70)
Exito.Modelo	0.58	0.58	0.58	0.58
Exito.Trading	0.63	0.63	0.51	0.63
Ganancia (USD)	7,173	7,173	5,173.2	7,173
Perd Max Cta	5.4	5.4	-32.4	5.4
Gan Max Cta	7,245	7,245	5,245.2	7,245
DD Max	-549	-549	-340.2	-549
DU Max	1260	1260	1224	1260

Evolución de Capital - 2.4 Lotes por Operacion



Cifras con 2.4 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(61,70)	(61,70)	(21,68)	(61,70)
Exito.Modelo	0.58	0.58	0.58	0.58
Exito.Trading	0.63	0.63	0.51	0.63
Ganancia (USD)	9,564	9,564	6,897.6	9,564
Perd Max Cta	7.2	7.2	-43.2	7.2
Gan Max Cta	9,660	9,660	6,993.6	9,660
DD Max	-732	-732	-453.6	-732
DU Max	1680	1680	1632	1680