Back Test Algoritmo A01, USD.CAD, 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 1.3421_ 1.3352_ 1.3284 1.3215_ 1.3146_ 1.3077 1.3009_ 1.2940_ 1.2871_ 1.2803_ 1.2734_ 05/10/16 27/06/16 18/07/16 05/08/16 25/08/16 15/09/16 26/10/16

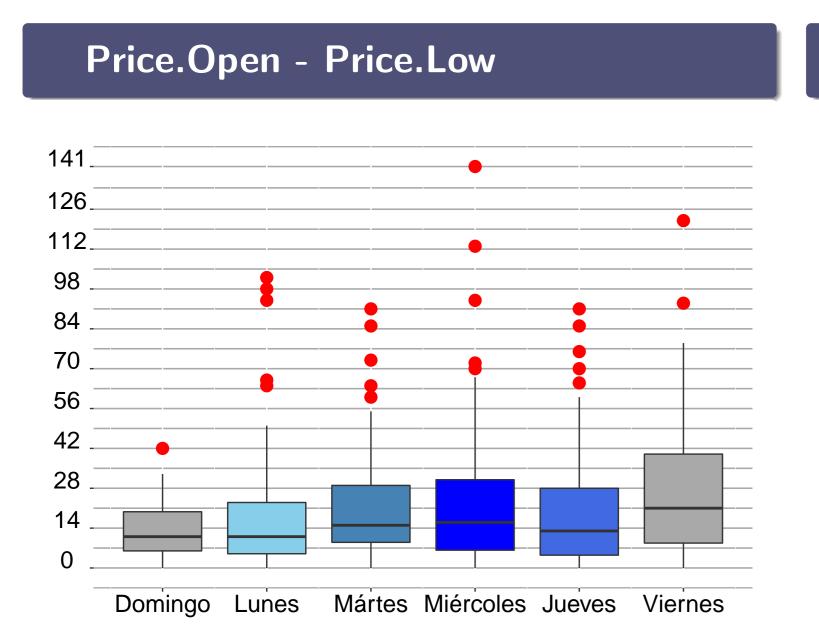
Estadística Precios (Velas) históricas

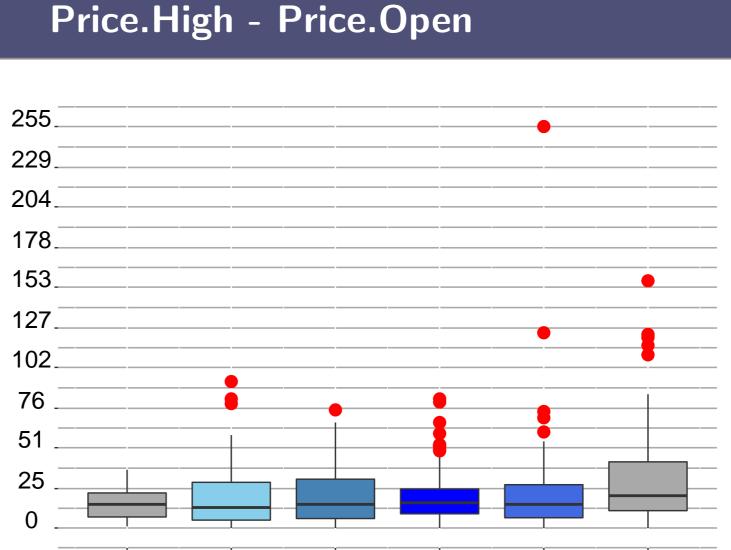
High - Open Pips Max Descontados Alcistas Max: 255 Min: 0 Mediana: 15 Variacion: 22.62

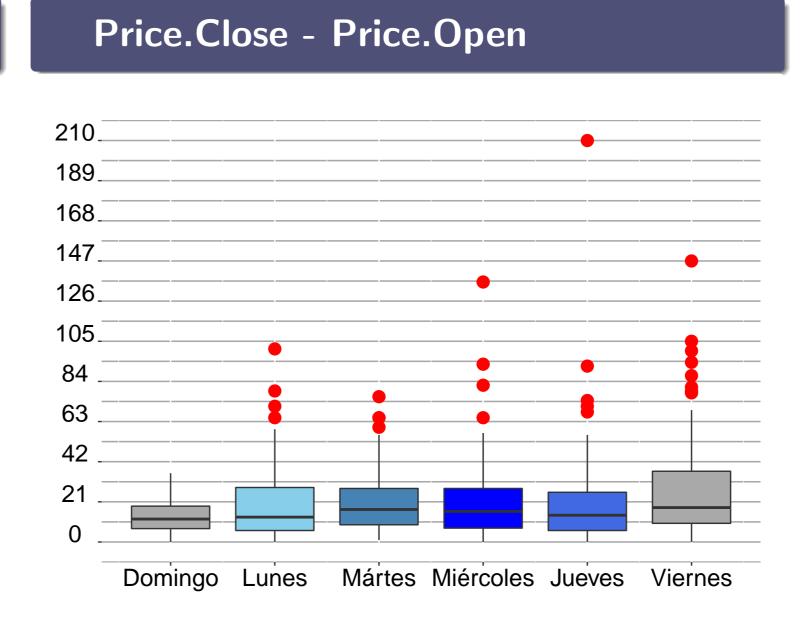
Open - Low Pips Max Descontados Bajistas Max: 141 Min: 0 Mediana: 14 Variacion: 20.15

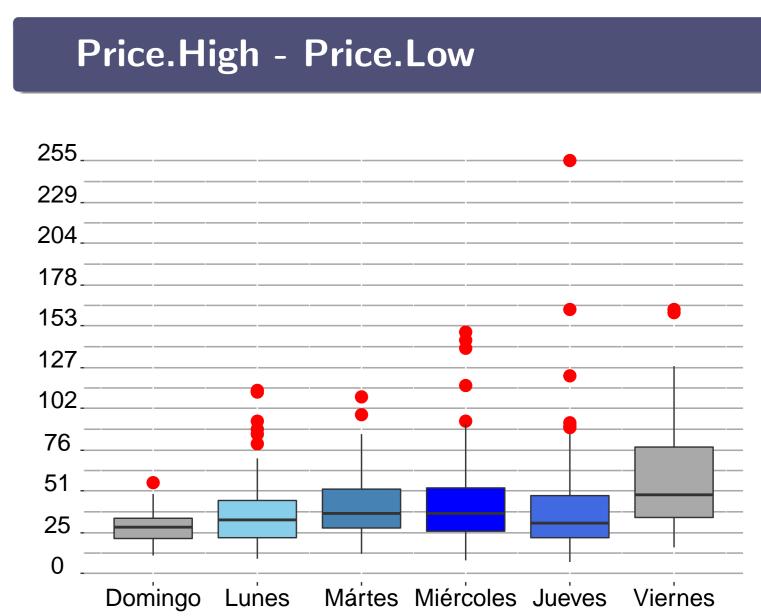
Amplitud de Vela Max Close - Open Max: 210 Min: 0 Mediana: 15 Variacion: 21.15

Amplitud de Sombra Max High - Low Max: 255 Min: 7 Mediana: 35 Variacion: 26.53









Descripción

Metodolgía 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

Mártes Miércoles Jueves Viernes

- ► Tamaño de Ventana de información: **78 Precios**
- ► Noción de parámetro info: Ultima Quincena Bursatil
- ► Lógica de Aplicación de Algorítmo: **Directo**
- ► Instrumento a Utilizar: **USD.CAD**
- ► 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	1	2	3	4
(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
Pips Generados	3,985	3,985	2,874	3,985
Perd Max Cta	3	3	-18	3
Gan Max Cta	4,025	4,025	2,914	4,025
DD Max	-305	-305	-189	-305
DU Max	700	700	680	700

- ► 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.

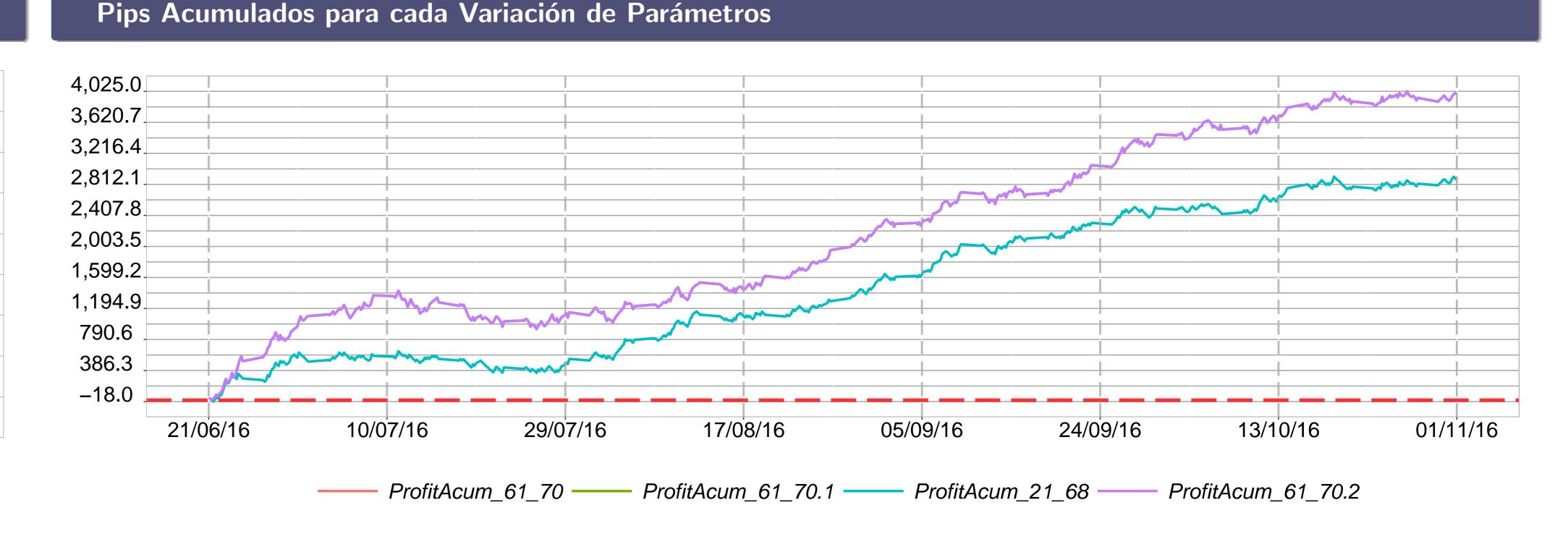


Tabla Gc Vs Pc (61,70)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	214
Perdedoras	1	129
Perdedoras	2	83
Perdedoras	3	58
Perdedoras	4	38
Perdedoras	5	23
Perdedoras	6	11
Perdedoras	7	9
Perdedoras	8	6
Perdedoras	9	4
Perdedoras	10	2
Ganadoras	0	363
Ganadoras	1	129
Ganadoras	2	51
Ganadoras	3	26
Ganadoras	4	7
Ganadoras	5	1

Tabla Gc Vs Pc (61,70)

		_
Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	214
Perdedoras	1	129
Perdedoras	2	83
Perdedoras	3	58
Perdedoras	4	38
Perdedoras	5	23
Perdedoras	6	11
Perdedoras	7	9
Perdedoras	8	6
Perdedoras	9	4
Perdedoras	10	2
Ganadoras	0	363
Ganadoras	1	129
Ganadoras	2	51
Ganadoras	3	26
Ganadoras	4	7
Ganadoras	5	1

Tabla Gc Vs Pc (21,68)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	284
Perdedoras	1	136
Perdedoras	2	73
Perdedoras	3	39
Perdedoras	4	23
Perdedoras	5	12
Perdedoras	6	3
Perdedoras	7	3
Perdedoras	8	2
Perdedoras	9	1
Perdedoras	10	1
Ganadoras	0	293
Ganadoras	1	136
Ganadoras	2	67
Ganadoras	3	42
Ganadoras	4	20
Ganadoras	5	9
Ganadoras	6	5
Ganadoras	7	2
Ganadoras	8	2
Ganadoras	9	1

Tabla Gc Vs Pc (61,70)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	214
Perdedoras	1	129
Perdedoras	2	83
Perdedoras	3	58
Perdedoras	4	38
Perdedoras	5	23
Perdedoras	6	11
Perdedoras	7	9
Perdedoras	8	6
Perdedoras	9	4
Perdedoras	10	2
Ganadoras	0	363
Ganadoras	1	129
Ganadoras	2	51
Ganadoras	3	26
Ganadoras	4	7
Ganadoras	5	1

www.tradingpal.com francisco@tradingpal.com

Back Test Algoritmo A01, USD.CAD, H4

Box Jenkins para series de tiempo financieras

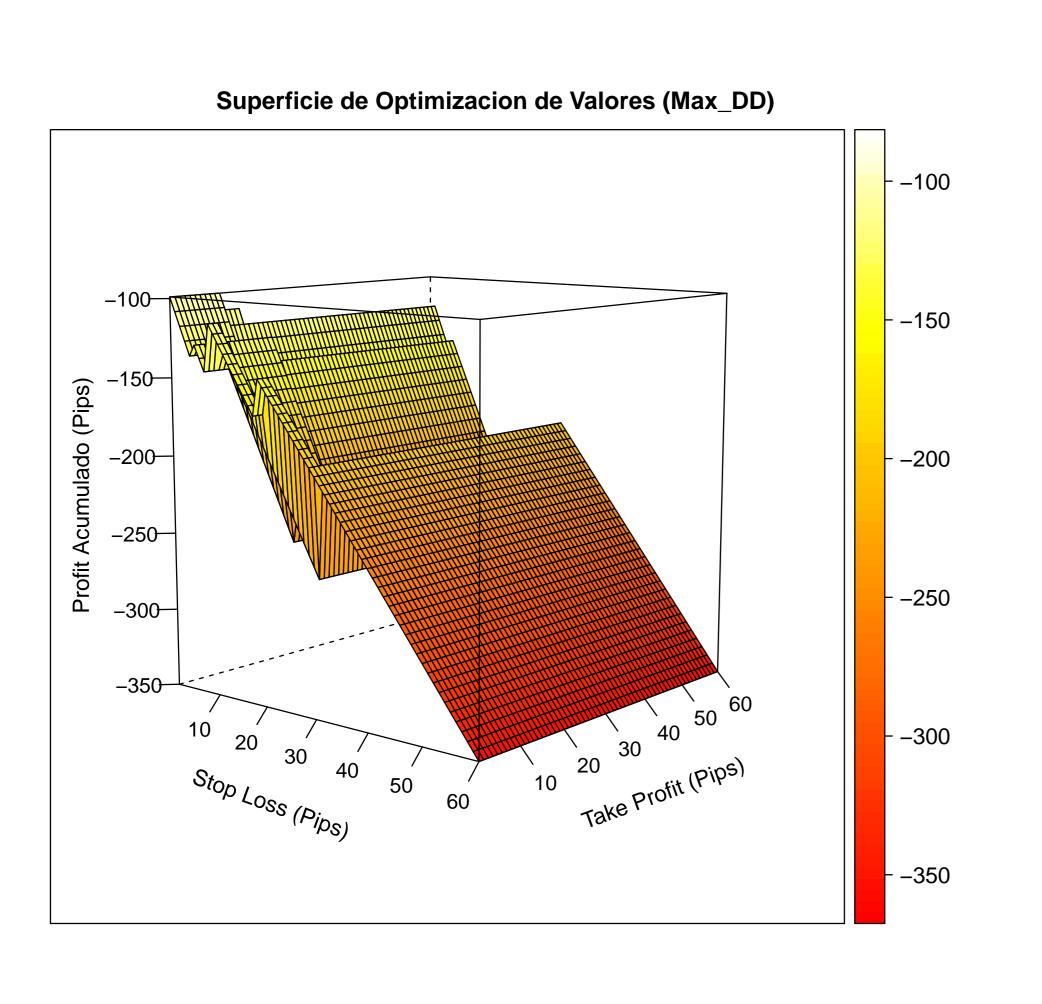
Descripción General de Datos Utilizados

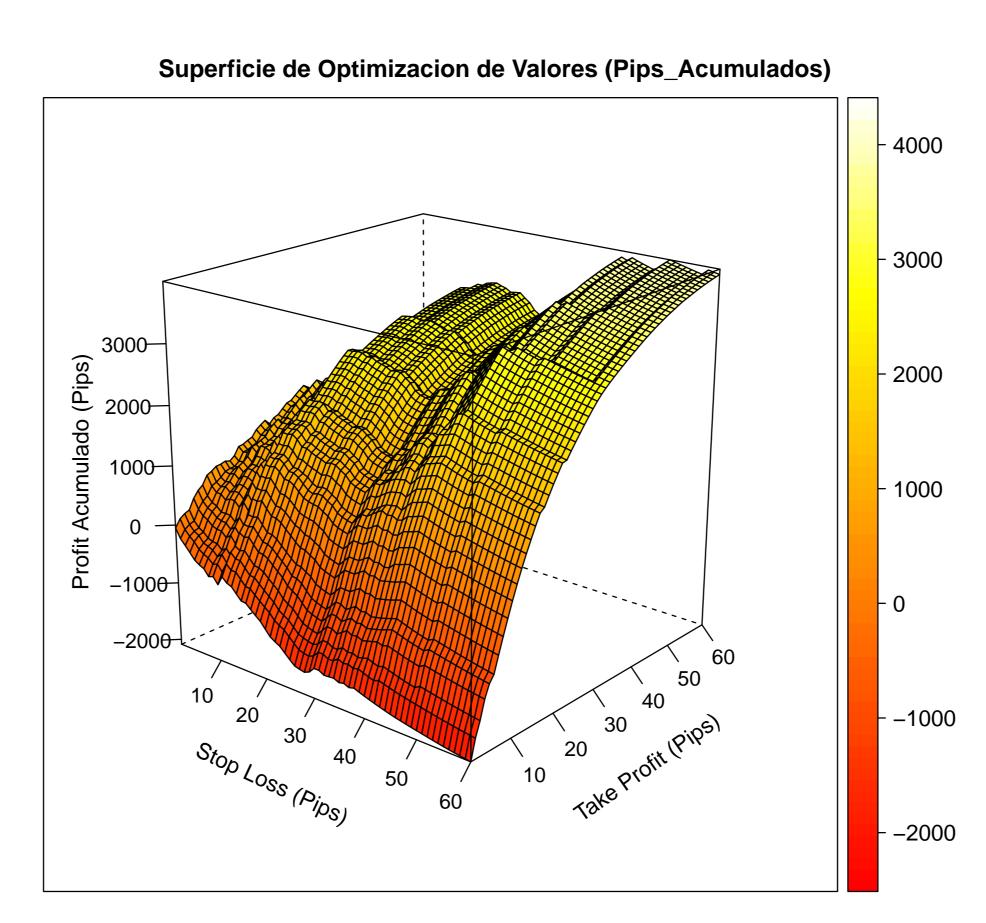
La cantidad de días de información que se utilizó fue de: **133.8**, es decir, desde la fecha: **2,016-06-20 16:00:00** hasta **2,016-11-01 11:00:00**. Debido a que la granularidad de los precios fue de: **H4** entonces la cantidad final de periodos utilizados para el modelo fue de: **577**. Durante este periodo, los periodos clasificados como *alcistas* fueron en total: **303** y los que se clasificaron como *bajistas* fueron en total: **274**. Respecto al Algorítmo A01, los periodos clasificados como *bajistas* fueron: **253** y los clasificados como *alcistas* fueron: **324**.

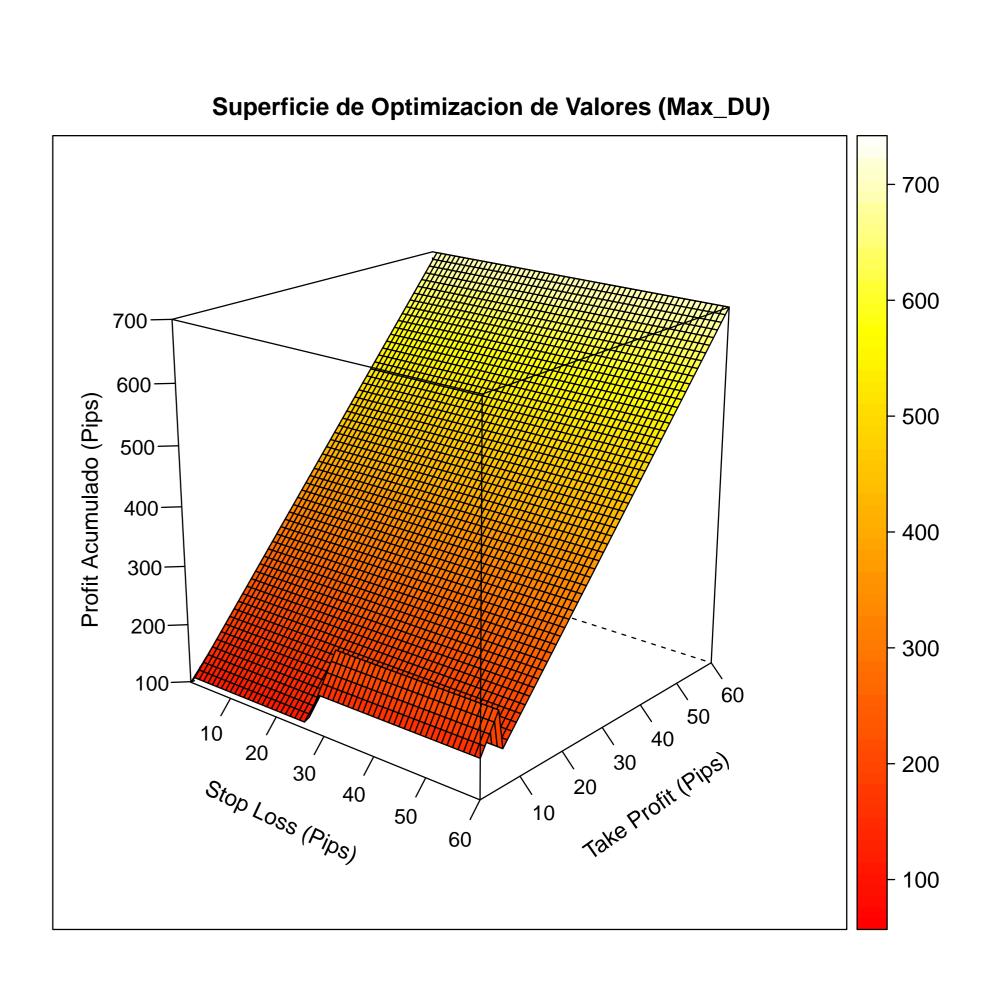


Espacio 4D Profit Acumulada

Espacio 4D MAX Draw Up







Evolución de Capital - 1.2 Lotes por Operacion 19,830.00 19,344.84 18,859.68 18,374.52 17,889.36 17,404.20 16,919.04 16,433.88 15,948.72 15,463.56 14,978.40 21/06/16 01/11/16 10/07/16 29/07/16 17/08/16 05/09/16 24/09/16 13/10/16 — ProfitAcum_61_70 —— ProfitAcum_61_70.1 —— ProfitAcum_21_68 —— ProfitAcum_61_70.2

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 22,245.00 21,517.26 20,789.52 20,061.78 19,334.04 18,606.30 17,878.56 17,150.82 16,423.08 15,695.34 14,967.60 21/06/16 10/07/16 29/07/16 17/08/16 05/09/16 24/09/16 13/10/16 01/11/16 — ProfitAcum_61_70 —— ProfitAcum_61_70.1 —— ProfitAcum_21_68 —— ProfitAcum_61_70.2

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 24,660.00 23,689.68 22,719.36 21,749.04 20,778.72 19,808.40 18,838.08 17,867.76 16,897.44 15,927.12 14,956.80 21/06/16 10/07/16 29/07/16 17/08/16 05/09/16 24/09/16 13/10/16 01/11/16 ProfitAcum_61_70.1 —— ProfitAcum_21_68 ProfitAcum_61_70.2 ProfitAcum_61_70 —

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	

www.tradingpal.com francisco@tradingpal.com