

Back Test Algoritmo A01, GBP.JPY, H4

Box Jenkins para series de tiempo financieras

Precio de Cierre: 2,016-07-03 16:00:00 : 2,016-11-01 11:00:00 con periodicidad de H4



Estadística Precios (Velas) históricas

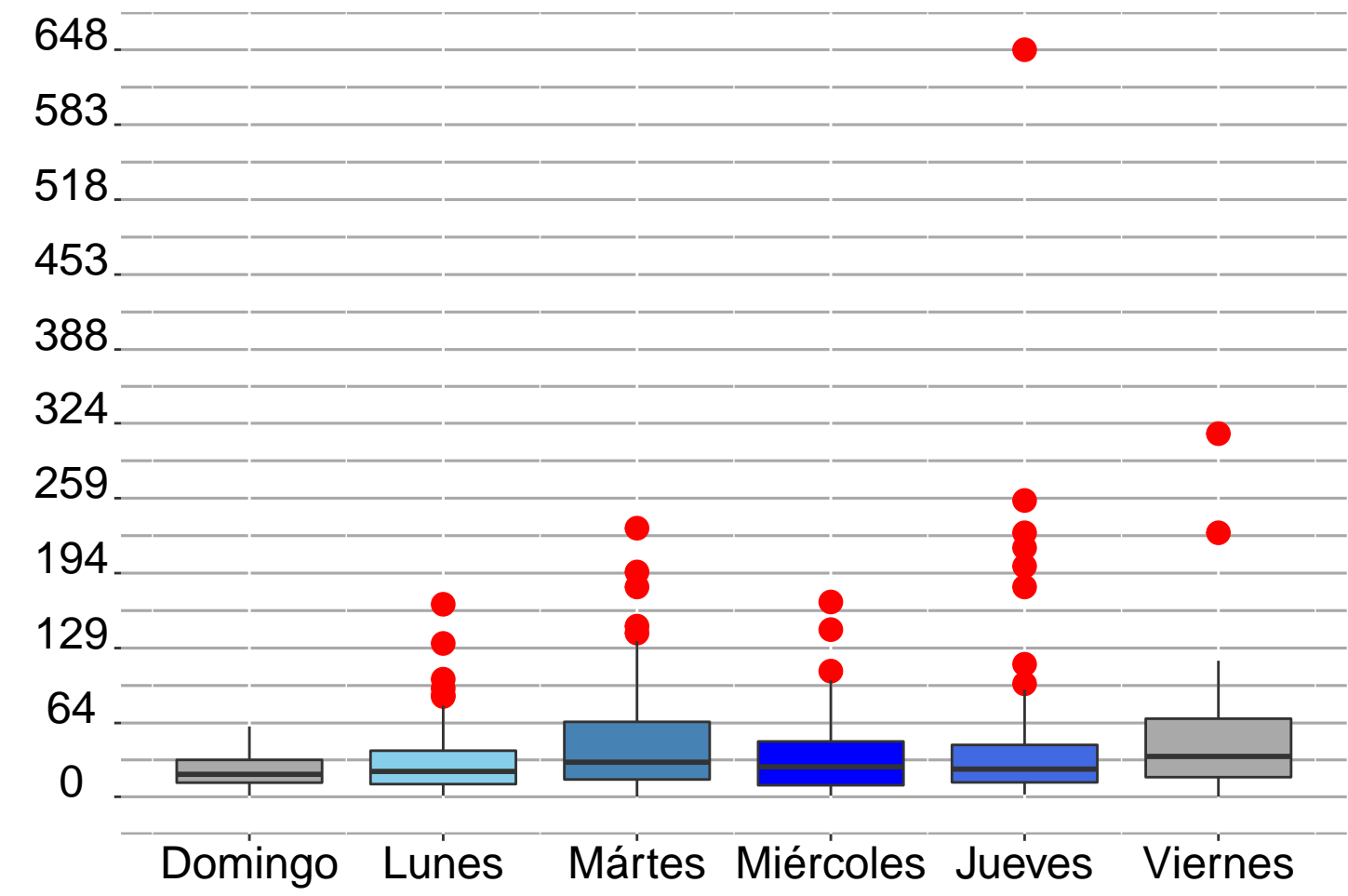
High - Open	Pips Max	Descontados Alcistas
Max: 254 Min: 0	Mediana: 24	Variacion: 36.73

Open - Low	Pips Max	Descontados Bajistas
Max: 648 Min: 0	Mediana: 26	Variacion: 47.58

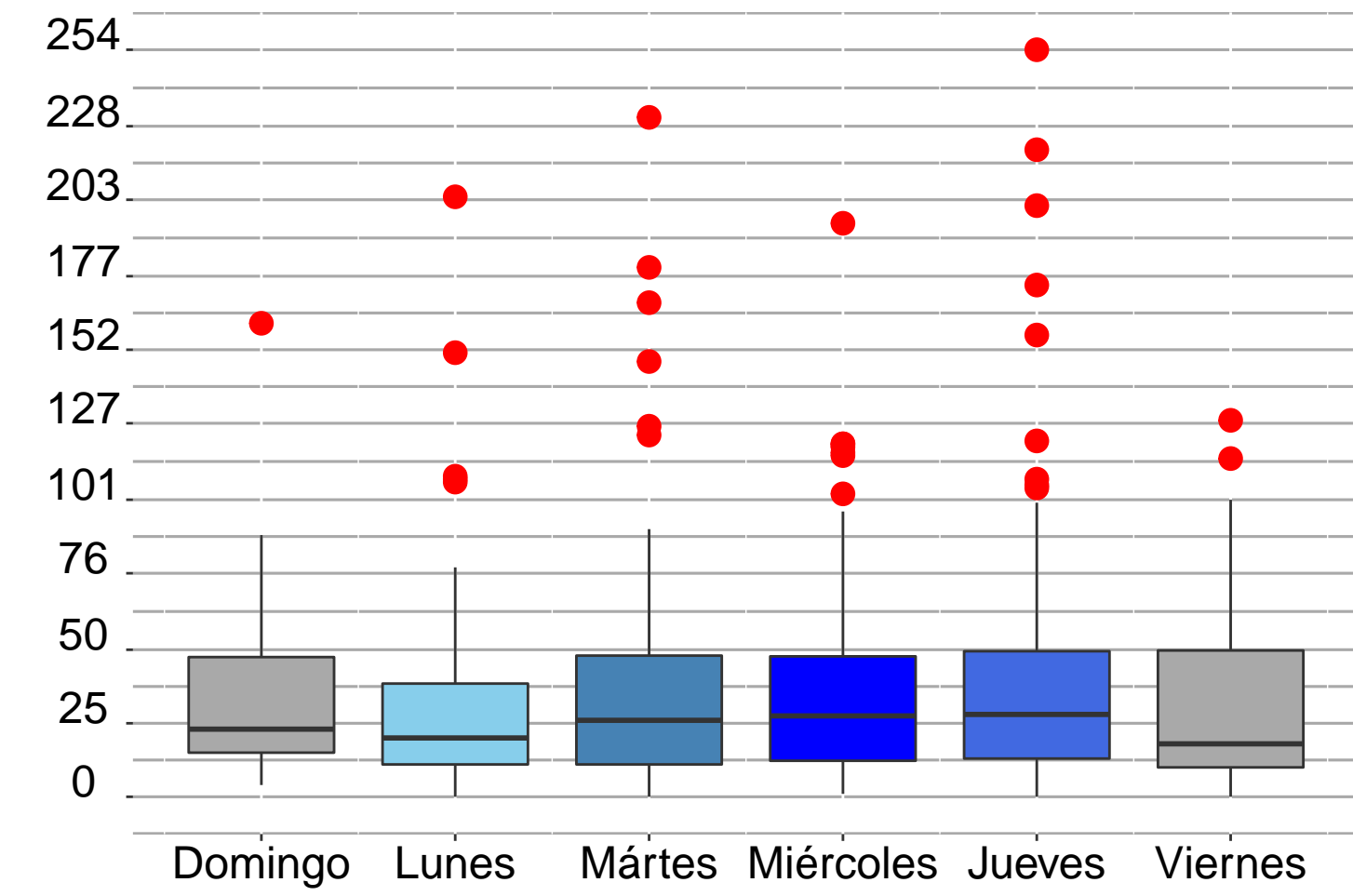
Close - Open	Amplitud de Vela Max
Max: 261 Min: 0	Mediana: 23 Variacion: 37.07

High - Low	Amplitud de Sombra Max
Max: 656 Min: 15	Mediana: 61 Variacion: 54.28

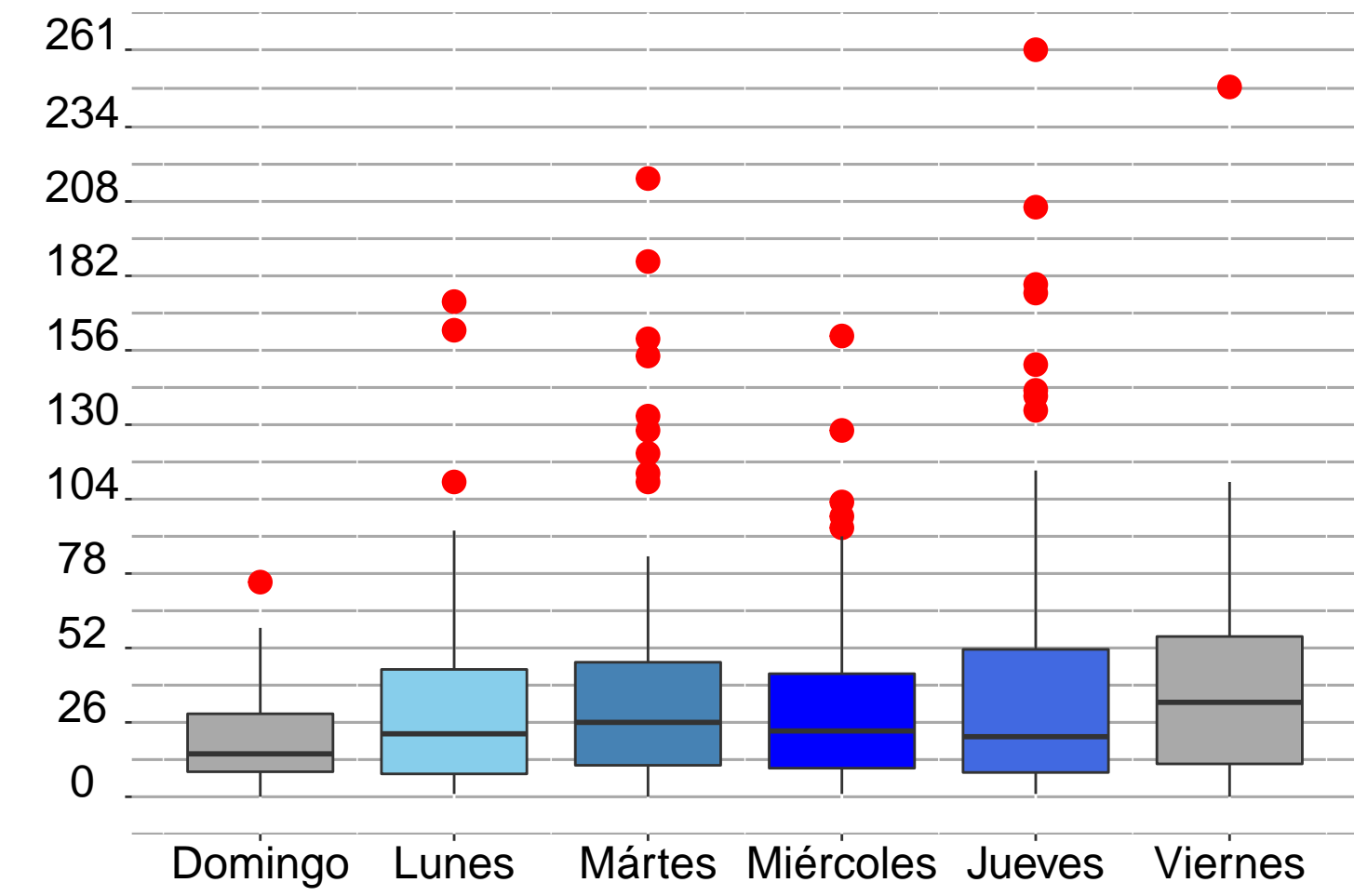
Price.Open - Price.Low



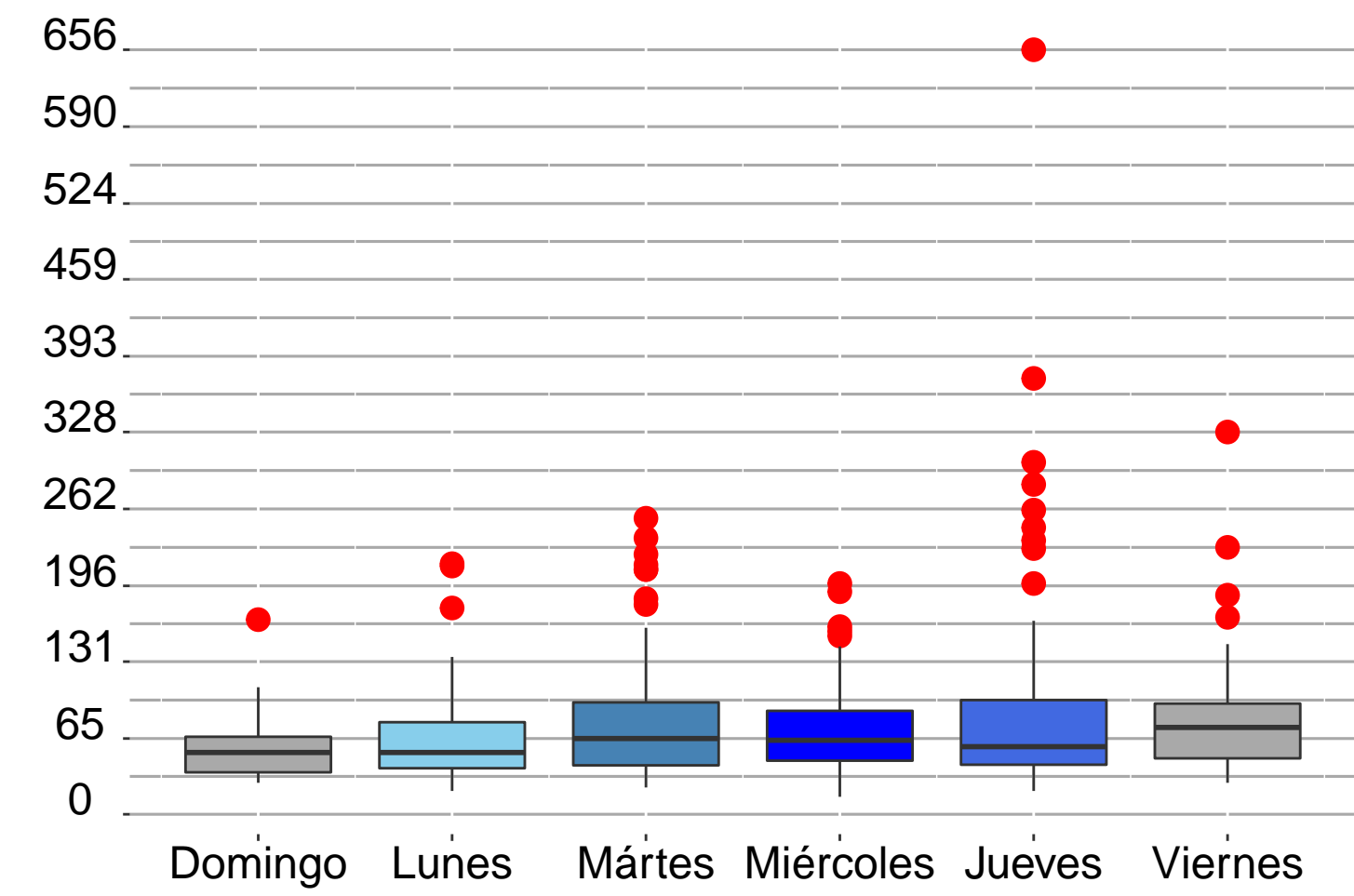
Price.High - Price.Open



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: **132 Precios**
 - Noción de parámetro info: **Ultimo Mes Bursatil**
 - Lógica de Aplicación de Algoritmo: **Directo**
 - Instrumento a Utilizar: **GBP.JPY**
 - Periodicidad de precios: **H4**
 - Valores de Exploración. TP: **15 : 75** y SL: **15 : 75**

Datos Salida

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

Desempeño de los 4 mejores casos

Criterio (SL,TP)	1 (41,75)	2 (35,75)	3 (26,75)	4 (75,75)
Exito Modelo	0.64	0.64	0.64	0.64
Exito Trading	0.55	0.53	0.44	0.62
Pips Generados	4,364	4,205	2,798	4,254
Perd Max Cta	-95	-26	-206	-80
Gan Max Cta	4,364	4,205	2,798	4,328
DD Max	-369	-315	-234	-450
DU Max	600	600	450	750

- 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

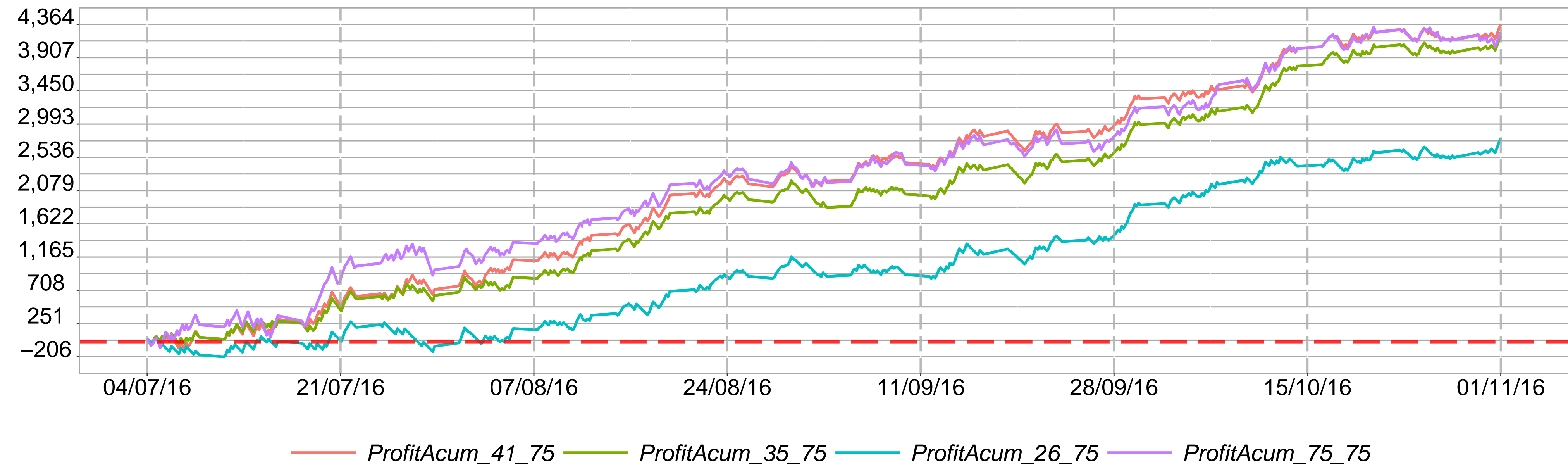


Tabla Gc Vs Pc (41,75)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	235
Perdedoras	1	126
Perdedoras	2	71
Perdedoras	3	40
Perdedoras	4	23
Perdedoras	5	15
Perdedoras	6	7
Perdedoras	7	4
Perdedoras	8	2
Ganadoras	0	288
Ganadoras	1	125
Ganadoras	2	56
Ganadoras	3	30
Ganadoras	4	12
Ganadoras	5	6
Ganadoras	6	3
Ganadoras	7	1
Ganadoras	8	1
Ganadoras	9	1

Tabla Gc Vs Pc (35,75)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	248
Perdedoras	1	128
Perdedoras	2	67
Perdedoras	3	35
Perdedoras	4	21
Perdedoras	5	13
Perdedoras	6	6
Perdedoras	7	3
Perdedoras	8	2
Ganadoras	0	275
Ganadoras	1	127
Ganadoras	2	61
Ganadoras	3	31
Ganadoras	4	13
Ganadoras	5	7
Ganadoras	6	4
Ganadoras	7	2
Ganadoras	8	2
Ganadoras	9	1

Tabla Gc Vs Pc (26,75)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	295
Perdedoras	1	120
Perdedoras	2	52
Perdedoras	3	29
Perdedoras	4	16
Perdedoras	5	8
Perdedoras	6	3
Ganadoras	0	228
Ganadoras	1	119
Ganadoras	2	65
Ganadoras	3	44
Ganadoras	4	26
Ganadoras	5	16
Ganadoras	6	12
Ganadoras	7	6
Ganadoras	8	4
Ganadoras	9	3

Tabla Gc Vs Pc (75,75)

Tipo	Valor	Repeticiones
Perdedoras	0	201
Perdedoras	1	115
Perdedoras	2	77
Perdedoras	3	51
Perdedoras	4	33
Perdedoras	5	20
Perdedoras	6	12
Perdedoras	7	8
Perdedoras	8	4
Perdedoras	9	1
Ganadoras	0	322
Ganadoras	1	114
Ganadoras	2	47
Ganadoras	3	25
Ganadoras	4	8
Ganadoras	5	5
Ganadoras	6	2

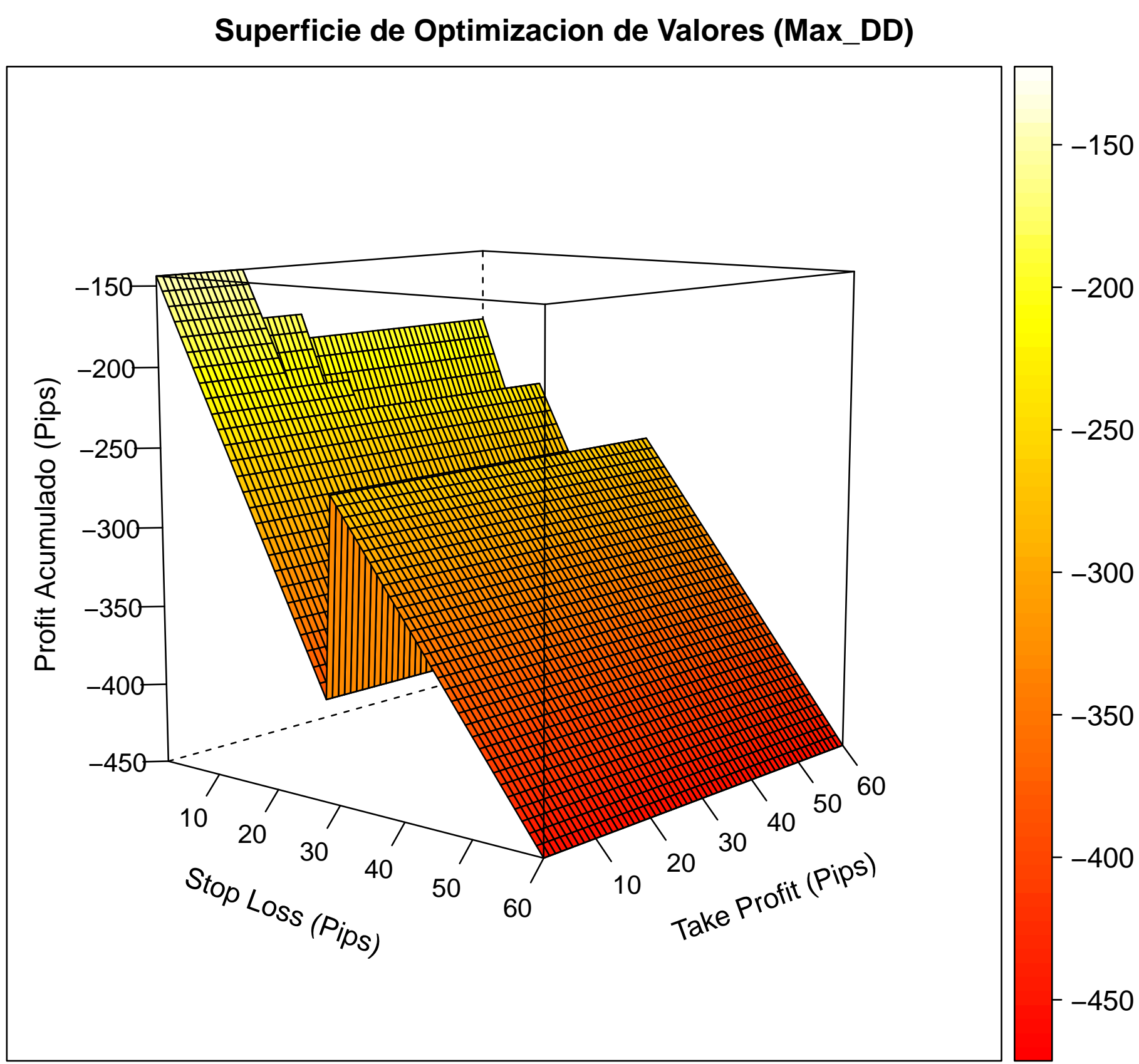
Back Test Algoritmo A01, GBP.JPY, H4

Box Jenkins para series de tiempo financieras

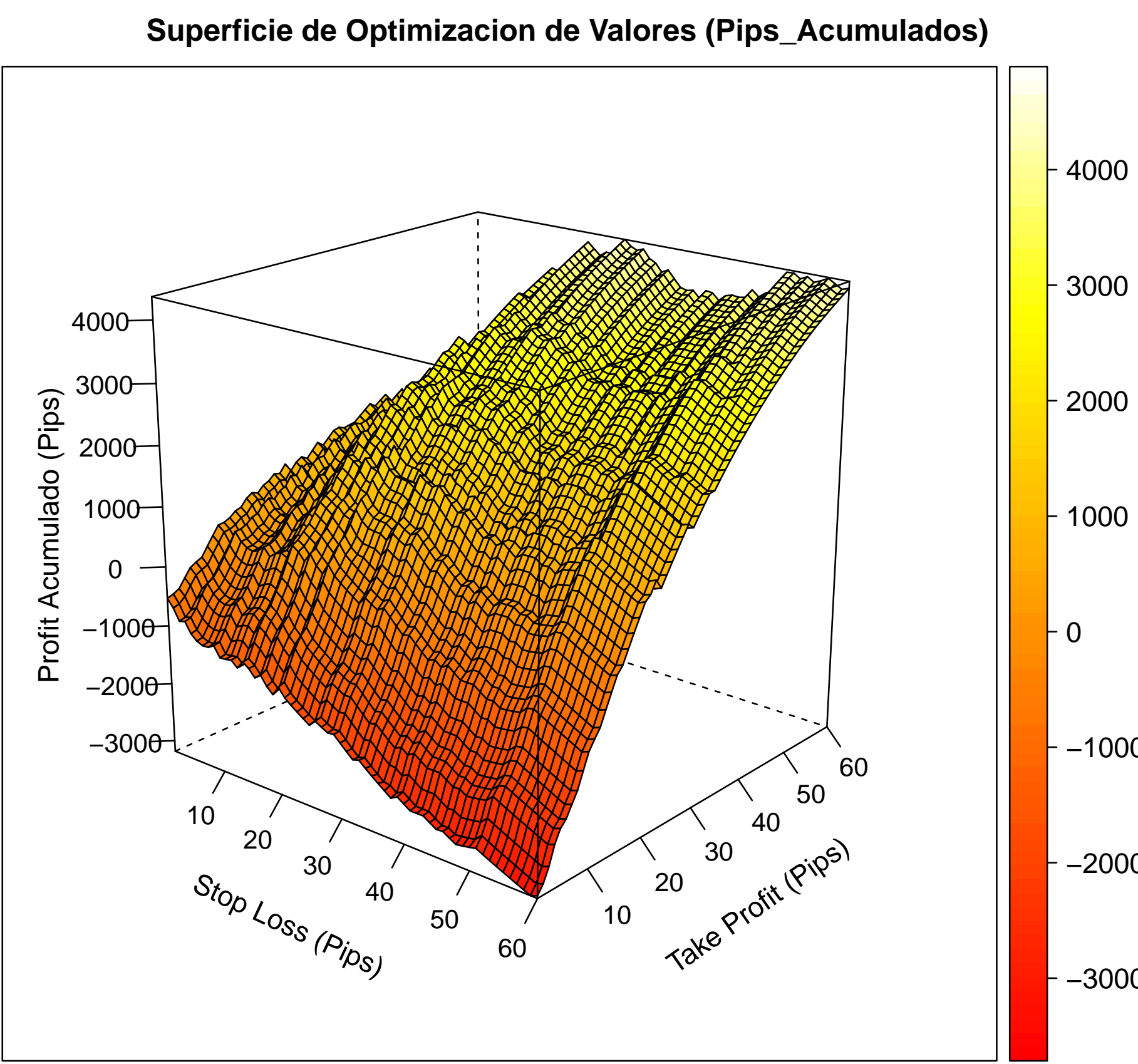
Descripción General de Datos Utilizados

La cantidad de días de información que se utilizó fue de: **120.8**, es decir, desde la fecha: **2,016-07-03 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: **523**. Durante este periodo, los periodos clasificados como *alcistas* fueron en total: **250** y los que se clasificaron como *bajistas* fueron en total: **273**. Respecto al Algoritmo A01, los periodos clasificados como *bajistas* fueron: **198** y los clasificados como *alcistas* fueron: **325**.

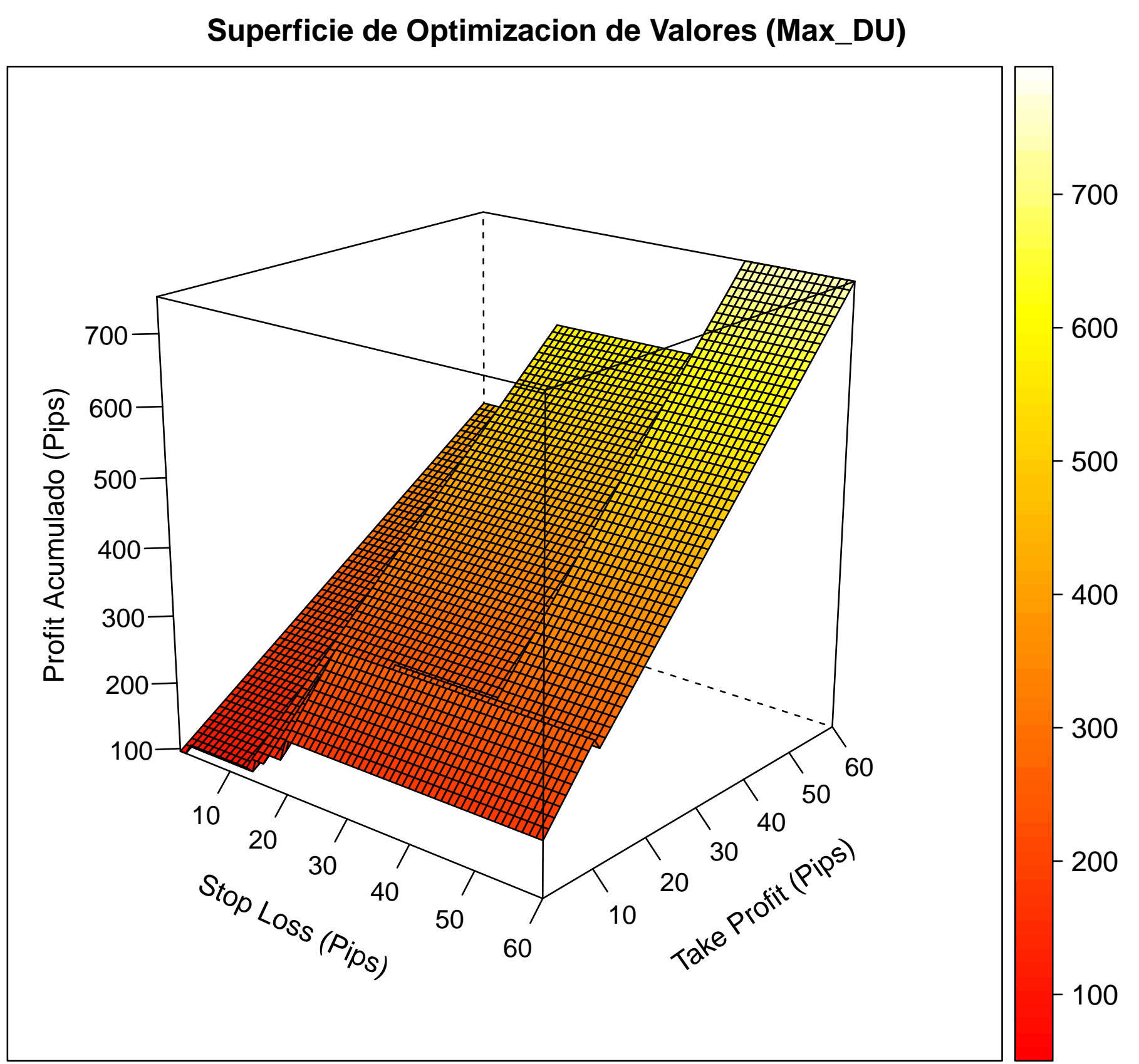
Espacio 4D MAX Draw Down



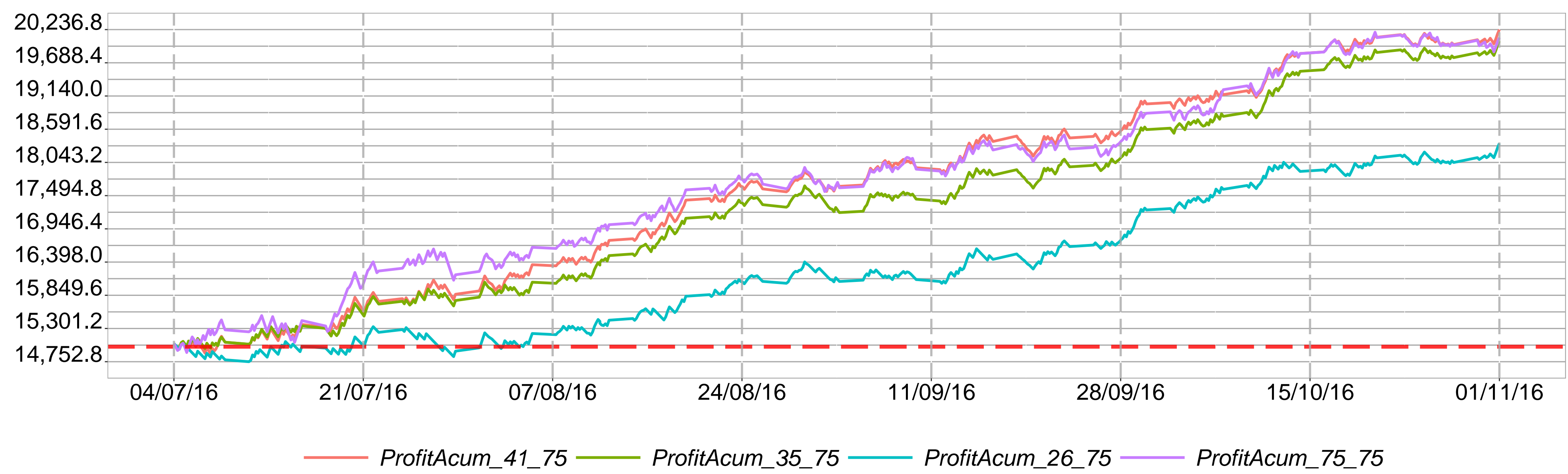
Espacio 4D Profit Acumulada



Espacio 4D MAX Draw Up



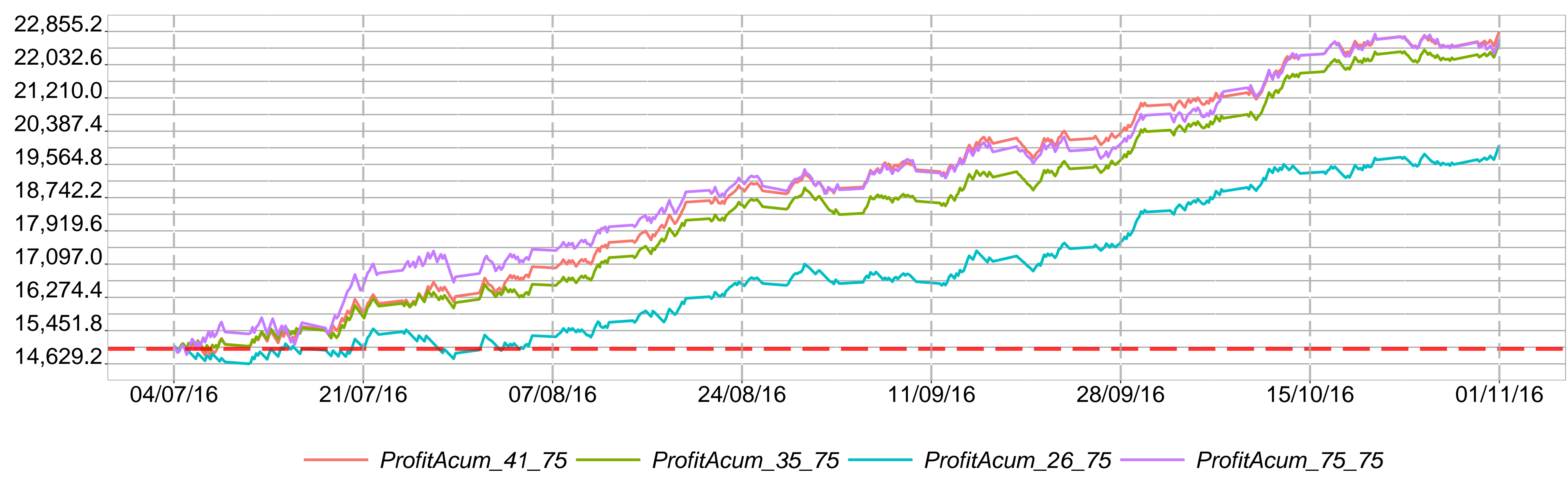
Evolución de Capital - 1.2 Lotes por Operacion



Cifras con 1.2 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(41,75)	(35,75)	(26,75)	(75,75)
Exito.Modelo	0.64	0.64	0.64	0.64
Exito.Trading	0.55	0.53	0.44	0.62
Ganancia (USD)	5,236.8	5,046	3,357.6	5,104.8
Perd Max Cta	-114	-31.2	-247.2	-96
Gan Max Cta	5,236.8	5,046	3,357.6	5,193.6
DD Max	-442.8	-378	-280.8	-540
DU Max	720	720	540	900

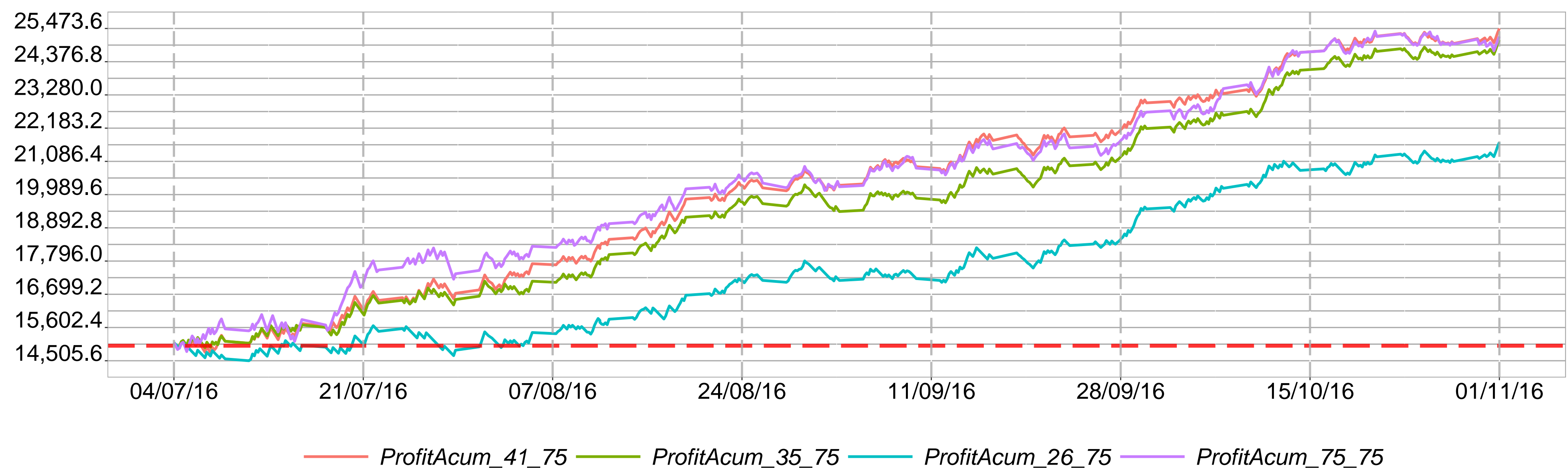
Evolución de Capital - 1.8 Lotes por Operacion



Cifras con 1.8 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(41,75)	(35,75)	(26,75)	(75,75)
Exito.Modelo	0.64	0.64	0.64	0.64
Exito.Trading	0.55	0.53	0.44	0.62
Ganancia (USD)	7,855.2	7,569	5,036.4	7,657.2
Perd Max Cta	-171	-46.8	-370.8	-144
Gan Max Cta	7,855.2	7,569	5,036.4	7,790.4
DD Max	-664.2	-567	-421.2	-810
DU Max	1080	1080	810	1350

Evolución de Capital - 2.4 Lotes por Operacion



Cifras con 2.4 Lotes por Operacion

Parametros	C1	C2	C3	C4
(SL,TP)	(41,75)	(35,75)	(26,75)	(75,75)
Exito.Modelo	0.64	0.64	0.64	0.64
Exito.Trading	0.55	0.53	0.44	0.62
Ganancia (USD)	10,473.6	10,092	6,715.2	10,209.6
Perd Max Cta	-228	-62.4	-494.4	-192
Gan Max Cta	10,473.6	10,092	6,715.2	10,387.2
DD Max	-885.6	-756	-561.6	-1080
DU Max	1440	1440	1080	1800