Plan badań

Analiza premii wysokich obrotów na GPW w Warszawie od 2002.

Podstawowe parametry:

* okres referencyjny: 20 dni (z ew. rozszerzeniem na 10 i 50);
* okres inwestycji: 5 dni (z ew. rozszerzeniem na 1, 2, 3 i 10).

Etap I

1. Na podstawie danych dziennych obrotów wyznaczyć dni, w których obroty są większe niż w okresie referencyjnym. Uwzględnić tylko te przypadki, gdy w okresie referencyjnym są wszystkie dane. Wynik: plik z wartościami ilorazów obrót/max(obrót) w dniach kiedy obrót>max(obrót). Postać pliku: najlepiej analogiczna jak pliku z obrotami.
2. Na podstawie cen zamknięcia obliczyć stopy zwrotu strategii opartej na efekcie wysokich obrotów. Wartości stóp zwrotu przypisać do dnia zakończenia inwestycji.