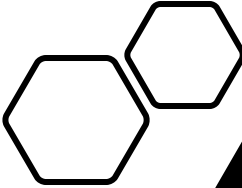


BACKTESTING

A decorative graphic consisting of three hexagons: two small white hexagons with black outlines at the top left, and a larger solid black hexagon to their right. A thin black line connects the right side of the solid hexagon to the top-left corner of a large, empty white hexagon with a black outline on the right side of the slide.

Joanna Grunwald,
Marta Kałużna,
Sebastian Jachimek,
Wojciech Wojnar

Motywacja

CPI (pot. inflacja)
zmiana (%) do analogicznego miesiąca poprzedniego roku

	2017	2018	2019	2020
Styczeń	1.7	1.9	0.7	4.3
Luty	2.2	1.4	1.2	4.7
Marzec	2.0	1.3	1.7	4.6
Kwiecień	2.0	1.6	2.2	3.4
Maj	1.9	1.7	2.4	2.9
Czerwiec	1.5	2.0	2.6	3.3
Lipiec	1.7	2.0	2.9	3.0
Sierpień	1.8	2.0	2.9	2.9
Wrzesień	2.2	1.9	2.6	3.2
Październik	2.1	1.8	2.5	3.1
Listopad	2.5	1.3	2.6	
Grudzień	2.1	1.1	3.4	

Podstawowe stopy procentowe NBP

Stopa procentowa:	Oprocentowanie	Obowiązuje od dnia
Stopa referencyjna ¹⁾	0,10	2020-05-29
Stopa lombardowa	0,50	2020-05-29
Stopa depozytowa	0,00	2020-05-29
Stopa redyskontowa weksli	0,11	2020-05-29
Stopa dyskontowa weksli	0,12	2020-05-29

Dane

Źródło: stooq.pl

Format: .csv

Rodzaj: OHLCV

Przekształcenia: zależne od
testowanej strategii

(głównie różne statystyki
dotyczące cen zamknięcia,
zmienności w ciągu dnia
itp.)

Ticker	Date	Open	High	Low	Close	Volume
CDR	1994-08-02	8.2789	8.2789	8.2789	8.2789	347109
CDR	1994-08-03	9.0931	9.0931	9.0931	9.0931	325196
CDR	1994-08-04	9.9950	9.9950	9.9950	9.9950	355499
CDR	1994-08-08	9.0931	9.0931	9.0931	9.0931	263619
CDR	1994-08-09	10.7320	10.7320	10.7320	10.7320	135441
CDR	1994-08-10	10.1230	10.1230	10.1230	10.1230	156263
CDR	1994-08-11	9.9170	9.9170	9.9170	9.9170	127846
CDR	1994-08-16	10.5360	10.5360	10.5360	10.5360	81439
CDR	1994-08-17	11.0650	11.0650	11.0650	11.0650	82459
CDR	1994-08-18	9.9560	9.9560	9.9560	9.9560	54547
CDR	1994-08-22	10.3300	10.3300	10.3300	10.3300	105020
CDR	1994-08-23	9.5050	9.5050	9.5050	9.5050	68436
CDR	1994-08-24	9.2990	9.2990	9.2990	9.2990	75990
CDR	1994-08-25	8.3575	8.3575	8.3575	8.3575	64062
CDR	1994-08-29	9.0538	9.0538	9.0538	9.0538	88751
CDR	1994-08-30	9.0146	9.0146	9.0146	9.0146	57584

«

grudzień 2020

»

ndz.	pn.	wt.	śr.	czw.	pt.	sob.
29	30	1	2	3	4	5
6	7	8	9	10	11	12
13	14	15	16	17	18	19
20	21	22	23	24	25	26
27	28	29	30	31	1	2
3	4	5	6	7	8	9

2020-12-04

Proszę podać datę początku symulacji

2020-12-04

Proszę podać datę końca symulacji

2020-12-04

WYBIERZ INDEKSY:

☒ WIG20

☐ MWIG40

☐ SWIG80

ZAKTUALIZUJ SKŁAD INDEKSÓW

PRZYCISK

WYBIERZ STRATEGIE:

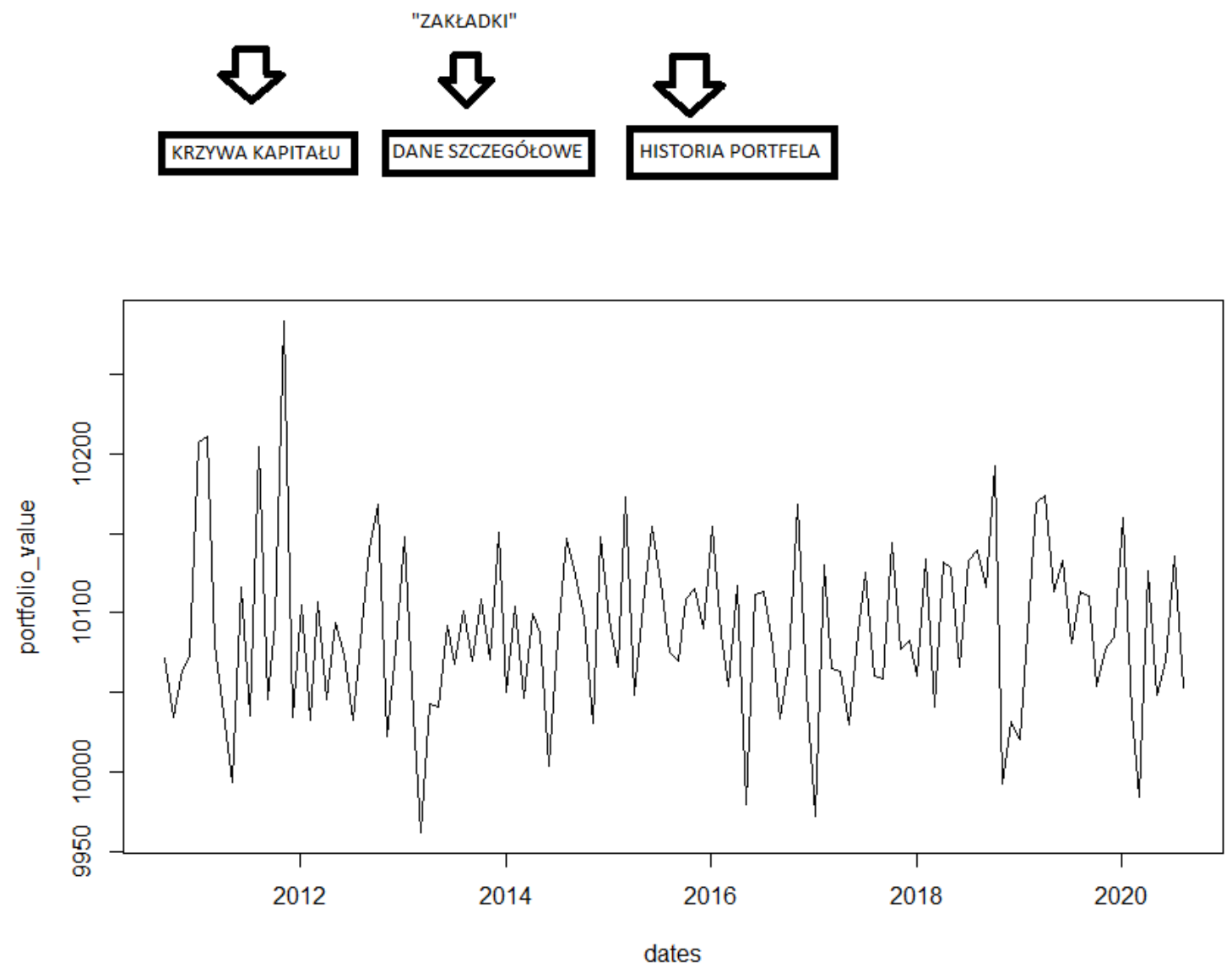
☐ MOMENTUM

☐ XD

ROZWIJANA LISTA

PARAMETRY STRATEGII:

ZAŁĘŻĄ OD STRATEGII



Plan:

- Pobieranie danych z bazy,
- Implementacja strategii,
- Stworzenie 'środowiska' do testowania oraz:
 - Wykres krzywej kapitału,
 - Generowanie tabelki z podsumowaniem,
 - Historii transakcji

Źródła

- <https://www.nbp.pl/home.aspx?f=/dzienne/stopy.htm>
- <https://stat.gov.pl/>
- https://natallijen.shinyapps.io/projekt_1_02/