

# Systemtest der Backtestingsoftware

Team Noctua

March 28, 2013

## 1 Algorithmen

nkd sind minutebars

spx sidn daily

compq daily

Parameter der BTS:

Capital \$ 100.000

Transaction Fee \$1

Price Premium \$0

Order Sizes 321123

Round Lot Size 100

## 1.1 SMA gegen Preis

Komponente	Parameter
Preis	-
SMA	90

Bei diesem Algorithmus wird der SMA auf die gegebene Menge an Bars berechnet. Schneidet der Preis den SMA von unten ( $SMA > \text{Preis}$ ) ist dies ein Kaufsignal, sinkt allerdings der Wert des Preises unter den des SMAs ist dies ein Verkaufssignal.

Kenndaten	\$SPX	\$COMPQ	\$NKD
Net Worth [\$]			
Portfolio Performance [%]			
Sharpe Ratio			
Mean Deviation of Portfolio Performance [%]			
Mean Deviation of Equity Price [\$]			
Return on Investment [%]			
Number of Good Trades			
Gain From Good Trades [\$]			
Number of Bad Trades			
Loss From Bad Trades [\$]			
Ratio of Good Trades			



Figure 1: Testbild

### Interpretation

Interpretation von den Sachen die ich seh. Interpretation von den Sachen die ich seh. Interpretation von den Sachen die ich seh. Interpretation von den Sachen die ich seh. Interpretation von den Sachen die ich seh. Interpretation von den Sachen die ich seh. Interpretation von den Sachen die ich seh. Interpretation von den Sachen die ich seh.