**Raport 1/AB z badania rynku EURJPY**

TEWI 07.05.2013

1. **Wykonawca:**

Aneta Bera

1. **Rynek:**

EURJPY próbkowany co 1h.

Dane z bossa.pl. Ulokowane w m-pliku o nazwie EURJPY.m zawierającym macierz o nazwie C o 65000 wierszach (okres ponad 7 lat) i 5 kolumnach: świeca OHLC i wolumen. Koniec danych – dnia 07.05.2013

1. **Wyniki testów**

Sprawdzono dla danych jak wyżej cztery skrypty S1a, S1a, S1b, S1c, S1d. Wszystkie cztery skrypty testowano dla tego samego przedziału szeregu czasowego rozpoczynając od świecy pocz=60000 i kończąc na świecy kon=65000 (5000 najnowszych świec).

Każda zmienna zwrotu po jednej świecy miała inna nazwę nawiązująca do nazwy kwadrantu odpowiednio Ra, Rb, Rc, i Rd a krzywe zysku skumulowanego były oznaczone jako sumRa, sumRb, sumRc, sumRd.

Obliczano:

Zysk skumulowany na końcu szeregu czasowego sumR(kon);

Wskaźnik Calmara oznaczający stosunek powyższego zysku dla największego obsunięcia na krzywej zysku skumulowanego - Calmar;

Liczbę otwieranych pozycji la, lb, … (procent spośród wszystkich testowanych świec)

Poszukiwano optymalnej wartości parametru m (liczby świec dla ustalenia średniej), dla której uzyskiwane były najlepsze wartości zysku. Parametry te odpowiednio oznaczono – ma, mb, …

Uzyskano:

Dla S1a:

sumRa=-4.3890

Calmar=-0.4242

la=2433 (49.15%)

ma=2



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S1a

Dla S1b:

sumRb=20.8030

Calmar=5.1659

lb=2329 (47,05%)

mb=37



Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S1b

Dla S1c:

sumRc=1.5620

Calmar=0.1800

lc=2622 (52.97%)

mc=37



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S1c

Dla S1d:

sumRd=14.5150

Calmar=2.7532

ld=2511 (50,37%)

md=2



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S1d