**Raport 2/AB z badania rynku GBPCHF**

TEWI 07.05.2013

1. **Wykonawca:**

Aneta Bera

1. **Rynek:**

GBPCHF próbkowany co 1h.

Dane z bossa.pl. Ulokowane w m-pliku o nazwie GBPCHF.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= -0.0880

Calmar= -0.3980

la= 2899 (58.57%)

ma=2



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S1a

Dla S1b:

sumRb=0.3720

Calmar=1.8398

lb=2638 (53,29%)

mb=19



Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S1b

Dla S1c:

sumRc=0.4825

Calmar=4.1957

lc=2313 (48.25%)

mc=19



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S1c

Dla S1d:

sumRd=-0.1652

Calmar=-0.6737

ld=2010 (40,61%)

md=2



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S1d