**Raport 4/AB z badania rynku FUS500**

TEWI 07.05.2013

1. **Wykonawca:**

Aneta Bera

1. **Rynek:**

FUS500 próbkowany co 1h.

Dane z bossa.pl. Ulokowane w m-pliku o nazwie FUS500.m zawierającym macierz o nazwie C o 2048 wierszach (okres nieco ponad 3 miesięcy) 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=50 i kończąc na świecy kon=2047.

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=174.55

Calmar=9.1340

la=1223 (61.2%)

ma=19



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S1a

Dla S1b:

sumRb= -70.7000

Calmar=-0.9158

lb=1360 (68,1%)

mb=48



Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S1b

Dla S1c:

sumRc=149.2

Calmar=3.8397

lc=638 (31.95%)

mc=48



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S1c

Dla S1d:

sumRd=-45.40

Calmar=-0.7999

ld=775 (38.81%)

md=19



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S1d