**Raport 5/AB z badania rynku SILVER**

TEWI 07.05.2013

1. **Wykonawca:**

Aneta Bera

1. **Rynek:**

SILVER próbkowany co 1h.

Dane z bossa.pl. Ulokowane w m-pliku o nazwie SILVER.m zawierającym macierz o nazwie C o 2048 wierszach (okres 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=-5.3200

Calmar=-0.7928

la=986 (49.37%)

ma=27



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S1a

Dla S1b:

sumRb=10.37

Calmar=9.6916

lb=953(47,72%)

mb=10



Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S1b

Dla S1c:

sumRc=0.0200

Calmar=0.0031

lc=1041 (52.13%)

mc=10



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S1c

Dla S1d:

sumRd=5.1100

Calmar=1.8185

ld=1011 (50,63%)

md=27



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S1d