**Raport 10/AS z badania rynku FDE30**  TEWI 27.05.2013

1. **Wykonawca:**

Anton Smoliński

1. **Rynek:**

FDE30 próbkowany co 1h.

Dane z bossafx.pl. Ulokowane w m-pliku o nazwie FDE3060.m zawierającym macierz o nazwie C o 2050 wierszach i 5 kolumnach: świeca OHLC i wolumen. Dane za okres – 7.01.2013 - 07.05.2013

1. **Wyniki testów**

Sprawdzono dla danych jak wyżej cztery skrypty S4a, S4b, S4c, S4d. Wszystkie cztery skrypty testowano dla tego przedziału czasowego rozpoczynając od świecy pocz=ma i kończąc na świecy kon=2050 (size(C)).

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; Dodatkowo policzono współczynnik SharpeRatio, którego zastosowanie pozwala określić stabilność zachowania strategii. Dla obydwu współczynników większa wartość oznacza lepszą strategię.

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 nastepujące wyniki:

Dla S4a:

sumReturn = 500.3544

bestCalmar = 5990.8333

la = 155

bestMa = 12

bestparamAVolLength = 5

bestparamADuration = 17

bestparamABuffer = -0.00016

bestparamAVolThreshold = -199

bestparamASL = 0.00096



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S4a

Dla S4b:

sumReturn = 1063.6786

bestCalmar = 7194.7955

la = 339

bestMa = 2

bestparamBVolLength = 21

bestparamBDuration = 31

bestparamBBuffer = -0.00016

bestparamBVolThreshold = 16

bestparamBSL = 0.00096



Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S4b

Dla S4c:

sumReturn = 670.143

bestCalmar = 4915.9554

la = 906

bestMa = 2

bestparamCVolLength = 4

bestparamCDuration = 5

bestparamCBuffer = -0.00016

bestparamCVolThreshold = -14

bestparamCSL = 0.00096



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S4c

Dla S4d:

sumReturn = 1575.244

bestCalmar = 5095.898

la = 795

bestMa = 37

bestparamDVolLength = 22

bestparamDDuration = 31

bestparamDBuffer = -0.00016

bestparamDVolThreshold = -48

bestparamDSL = 0.00096



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S4d