**Raport 12/AS z badania rynku EURPLN**  TEWI 24.05.2013

1. **Wykonawca:**

Anton Smoliński

1. **Rynek:**

EURPLN próbkowany co 1h.

Dane z bossafx.pl. Ulokowane w m-pliku o nazwie EURPLN60.m zawierającym macierz o nazwie C o 5740 wierszach i 5 kolumnach: świeca OHLC i wolumen. Dane za okres – 9.07.2012 - 07.05.2013

1. **Wyniki testów**

Badania Cross-walidacji. Na dwóch połówkach badanego rynku.

Dla S4a:

1stHalfSumReturn = 0.504

2ndHalfSumReturn = -0.2508

bestCalmar = 0.75381

2ndHalfCalmar = -0.28617

la = 816

bestMa = 4

bestparamAVolLength = 14

bestparamADuration = 12

bestparamABuffer = -0.0025

bestparamAVolThreshold = -1

bestparamASL = 0.015



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S4a

Dla S4b:

1stHalfSumReturn = 0.9638

2ndHalfSumReturn = -0.8376

bestCalmar = 1.3266

2ndHalfCalmar = -0.5717

la = 599

bestMa = 25

bestparamBVolLength = 13

bestparamBDuration = 25

bestparamBBuffer = -0.0075

bestparamBVolThreshold = 10

bestparamBSL = 0.015

Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S4b

Dla S4c:

1stHalfSumReturn = -0.4697

2ndHalfSumReturn = 0.4154

bestCalmar = -0.41956

2ndHalfCalmar = 0.38142

la = 1072

bestMa = 14

bestparamCVolLength = 9

bestparamCDuration = 15

bestparamCBuffer = 0.005

bestparamCVolThreshold = 75

bestparamCSL = 0.015



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S4c

Dla S4d:

1stHalfSumReturn = 0.1953

2ndHalfSumReturn = -0.0556

bestCalmar = 7.2333

2ndHalfCalmar = -0.64501

la = 26

bestMa = 3

bestparamDVolLength = 26

bestparamDDuration = 7

bestparamDBuffer = 0.015

bestparamDVolThreshold = -8

bestparamDSL = 0.015



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S4d