**Raport 13/AS z badania rynku CHFPLN**  TEWI 03.06.2013

1. **Wykonawca:**

Anton Smoliński

1. **Rynek:**

CHFPLN próbkowany co 1h.

Dane z bossafx.pl. Ulokowane w m-pliku o nazwie CHFPLN60.m zawierającym macierz o nazwie C o 5000 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.

Uzyskano nastepujące wyniki:

Dla S4a:

1stHalfSumReturn = -0.0253

2ndHalfSumReturn = -0.4677

bestCalmar = -0.4856

2ndHalfCalmar = -0.99553

la = 212

bestMa = 5

bestparamAVolLength = 3

bestparamADuration = 3

bestparamABuffer = -0.0025

bestparamAVolThreshold = -371

bestparamASL = 0.015



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S4a

Dla S4b:

1stHalfSumReturn = 0.5447

2ndHalfSumReturn = 0.4929

bestCalmar = 0.66884

2ndHalfCalmar = 0.70174

la = 828

bestMa = 6

bestparamBVolLength = 13

bestparamBDuration = 16

bestparamBBuffer = -0.0075

bestparamBVolThreshold = 65

bestparamBSL = 0.015



Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S4b

Dla S4c:

1stHalfSumReturn = 0.0766

2ndHalfSumReturn = 0.2226

bestCalmar = 0.15582

2ndHalfCalmar = 0.6092

la = 166

bestMa = 47

bestparamCVolLength = 3

bestparamCDuration = 10

bestparamCBuffer = 0.0325

bestparamCVolThreshold = 51

bestparamCSL = 0.015



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S4c

Dla S4d:

1stHalfSumReturn = 0.2732

2ndHalfSumReturn = 0.0967

bestCalmar = 2.0207

2ndHalfCalmar = 0.31978

la = 222

bestMa = 2

bestparamDVolLength = 36

bestparamDDuration = 12

bestparamDBuffer = 0.005

bestparamDVolThreshold = -57

bestparamDSL = 0.025



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S4d