**Raport 7/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**

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=5740 (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 = 2.1527

bestCalmar = 5.4935

la = 1739

bestMa = 2

bestparamAVolLength = 14

bestparamADuration = 12

bestparamABuffer = -0.00288

bestparamAVolThreshold = -1

bestparamASL = 0.00464



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S4a

Dla S4b:

sumReturn = 0.48704

bestCalmar = 4.6088

la = 954

bestMa = 16

bestparamBVolLength = 21

bestparamBDuration = 15

bestparamBBuffer = -0.00336

bestparamBVolThreshold = 89

bestparamBSL = 0.00304

Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S4b

Dla S4c:

sumReturn = 2.0711

bestCalmar = 7.3401

la = 2067

bestMa = 15

bestparamCVolLength = 9

bestparamCDuration = 12

bestparamCBuffer = 0.00368

bestparamCVolThreshold = 79

bestparamCSL = 0.00352



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S4c

Dla S4d:

sumReturn = 0.0497

bestCalmar = 0.74069

la = 2445

bestMa = 2

bestparamDVolLength = 30

bestparamDDuration = 9

bestparamDBuffer = -0.00016

bestparamDVolThreshold = 1

bestparamDSL = 0.00016



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S4d