**Raport 8/AS z badania rynku CHFPLN**  TEWI 26.05.2013

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 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 = 0.22742

bestCalmar = 2.3179

la = 337

bestMa = 4

bestparamAVolLength = 12

bestparamADuration = 5

bestparamABuffer = -0.00144

bestparamAVolThreshold = -9

bestparamASL = 0.00224



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S4a

Dla S4b:

sumReturn = 1.576

bestCalmar = 5.3655

la = 464

bestMa = 13

bestparamBVolLength = 18

bestparamBDuration = 13

bestparamBBuffer = -0.0064

bestparamBVolThreshold = 65

bestparamBSL = 0.01536



Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S4b

Dla S4c:

sumReturn = 1.238

bestCalmar = 5.582

la = 1051

bestMa = 49

bestparamCVolLength = 3

bestparamCDuration = 7

bestparamCBuffer = 0.00432

bestparamCVolThreshold = 95

bestparamCSL = 0.0056



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S4c

Dla S4d:

sumReturn = 1.8881

bestCalmar = 6.149

la = 795

bestMa = 2

bestparamDVolLength = 40

bestparamDDuration = 12

bestparamDBuffer = -0.00016

bestparamDVolThreshold = -23

bestparamDSL = 0.00832



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S4d