

Всего было рассмотрено 55 тикеров со второго листа файла эмитенты КОТИРОВКИ.xlsx.

Исследовались недельные цены закрытия, временной интервал, в рамках которого были данные по всем компаниям начинался 04.12.2011 и заканчивался 24.05.2015 - всего 181 неделя.

Оказалось, что у трех компаний с тикерами "PHOR.RX.Equity", "IRA0.RX.Equity", "UNAC.RX.Equity" отсутствуют некоторые значения цен закрытия в указанном диапазоне, поэтому в дальнейшем исследовалось 52 компании. Для них формировался вектор разностей доходностей размерности 74.

Всего было рассмотрено $12 \times 12 \times 9 \times 4 = 5184$ модели. Варьировались такие параметры, как время отбора (от 1 до 12 месяцев), время ожидания (от 0 до 8 недель), время инвестирования (от 1 до 12 месяцев), процент от общего количества в группе победителей и проигравших (50%, 30%, 20%, 10%)

Для проверки значимости лучшей модели использовалась процедура Bootstrap Reality Check с некоторыми параметрами.

Лучшей по средней доходности (0.05937230% в месяц) оказалась стратегия с параметрами 11 месяцев на отбор, 2 недели на ожидание, 1 месяц на инвестирование,

Портфели победителей и проигравших составляли 10% от общего количества компаний (5 победителей и 5 проигравших)

Bootstrap p-value = 0.030, т.е. данная стратегия показала значимый результат на 5% уровне значимости.

В принципе наблюдался эффект увеличения средней доходности при уменьшении количества компаний в группах победителей и проигравших.

Топ 20 по средней доходности стратегий

	mean	t	p-value	hist_per	moment_per	invest_per	percent
4993	0.05937230	4.262263	5.963273e-05	44	2	4	0.1
5005	0.05730663	4.185605	7.836618e-05	44	3	4	0.1
4970	0.05611414	5.478534	5.807367e-07	44	0	8	0.1
4983	0.05606710	7.444641	1.548113e-10	44	1	12	0.1
5007	0.05580334	8.000341	1.406120e-11	44	3	12	0.1
4995	0.05579356	7.724331	4.635847e-11	44	2	12	0.1
4982	0.05578903	5.623398	3.243900e-07	44	1	8	0.1
5019	0.05520070	8.081216	9.909851e-12	44	4	12	0.1
4959	0.05511223	7.729637	4.530820e-11	40	8	12	0.1
4981	0.05509804	3.784259	3.134328e-04	44	1	4	0.1
4971	0.05505143	7.104844	6.655487e-10	44	0	12	0.1
4994	0.05478330	5.732997	2.080796e-07	44	2	8	0.1
5017	0.05472229	3.967245	1.681830e-04	44	4	4	0.1
5079	0.05451946	7.433274	1.625731e-10	48	0	12	0.1
4947	0.05439868	7.694909	5.263701e-11	40	7	12	0.1
5006	0.05408209	5.739845	2.023669e-07	44	3	8	0.1
4912	0.05380128	9.046464	1.523226e-13	40	4	16	0.1
4935	0.05372410	7.485068	1.300826e-10	40	6	12	0.1
4911	0.05365056	7.530907	1.067746e-10	40	4	12	0.1
4542	0.05351457	11.221988	0.000000e+00	28	0	24	0.1