

Popis jednotlivých položek v reportu Testeru strategií

Testování sloupcových grafů (Bars in test)

Označuje hloubku historických dat, na základě kterých bylo modelování založeno.

Značky namodelovány (Ticks modelled)

Určuje velikost modelové řady. Každý záznam řady představuje stav svíčky (OHLCV – Open, High, Low, Close, Volume) v daném okamžiku. Stav svíček se mohou lišit v závislosti na použitém období (TimeFrame), modelovací metodě a přítomnosti historických dat nižších období.

Modelování kvality (Modelling quality)

Kvalita modelu se vypočítává dle následujícího výrazu:

$$MQ = ((0.25 * (StartGen - StartBar) + 0.5 * (StartGenM1 - StartGen) + 0.9 * (HistoryTotal - StartGenM1)) / (HistoryTotal - StartBar)) * 100$$

Kde platí, že:

- HistoryTotal = celkový počet svíček v historii
- StartBar = číslo svíčky, na které bylo zahájeno testování
- StartGen = číslo svíčky nejnižšího časového období, na které bylo zahájeno testování
- StartGenM1 = číslo svíčky minutového období, na které bylo zahájeno testování

Počáteční depozit (Initial deposit)

Počáteční vklad.

Celkový čistý zisk (Total net profit)

Vyjadřuje rozdíl mezi hrubým ziskem a hrubou ztrátou.

Hrubý zisk (Gross profit)

Souhrn všech ziskových transakcí.

Hrubá ztráta (Gross loss)

Souhrn všech ztrátových transakcí.

Ziskový faktor (Profit factor)

Zobrazuje poměr mezi hrubým ziskem a hrubou ztrátou.

Předpokládaný zisk (Expected payoff)

Vypočítává se dle vzorce:

$$EP = (ProfitTrades / TotalTrades) * (GrossProfit / ProfitTrades) - (LossTrades / TotalTrades) * (GrossLoss / LossTrades)$$

Kde platí, že:

- TotalTrades = celkový počet obchodů
- ProfitTrades = počet ziskových obchodů
- LossTrades = počet ztrátových obchodů
- GrossProfit = souhrn ziskových obchodů

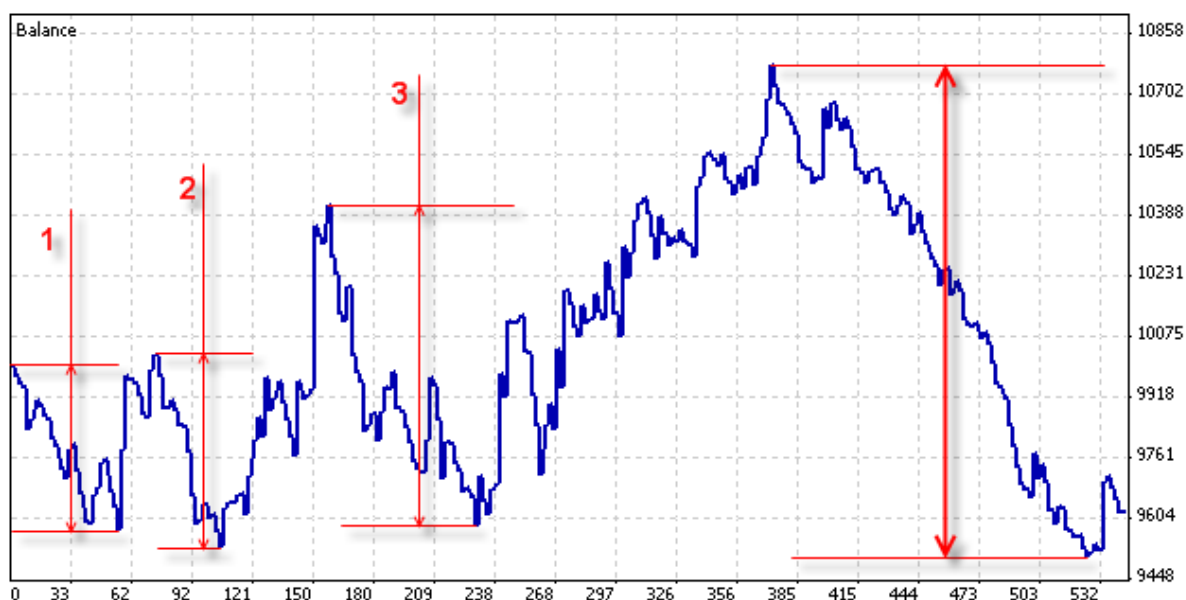
- GrossLoss = souhrn ztrátových obchodů

Absolutní pokles (Absolute drawdown)

Jedná se o rozdíl mezi počátečním vkladem a nejmenší hodnotou zůstatku během testování

Maximální pokles (Maximal drawdown)

Jedná se o největší rozdíl mezi nejvyšším zůstatkem a následujícím nejnižším zůstatkem (viz. Obrázek)



Ostatní položky jsou již jen matematické vyjádření vztahů jednotlivých položek.

Transakce celkem (Total trades)

Celkový počet uskutečněných obchodů během testování

Krátké pozice (Short positions (won %))

Celkový počet krátkých pozic a procentuální vyjádření ziskových pozic.

Dlouhé pozice (Long positions (won %))

Celkový počet dlouhých pozic a procentuální vyjádření ziskových pozic.

Ziskové obchody (Profit trades (% of total))

Celkový počet ziskových obchodů a procentuální vyjádření vůči celkovému počtu obchodů.

Ztrátové obchody (Loss trades (% of total))

Celkový počet ztrátových obchodů a procentuální vyjádření vůči celkovému počtu obchodů.

Největší ziskový obchod (Largest profit trade)

Hodnota nejvyššího ziskového obchodu.

Největší ztrátový obchod (Largest loss trade)

Hodnota nejvyššího ztrátového obchodu.

Průměrný ziskový obchod (Average profit trade)

Průměrná velikost ziskového obchodu.

Průměrný ztrátový obchod (Average loss trade)

Průměrná velikost ztrátového obchodu.

Maximální návazné výhry (Maximum consecutive wins)

Maximální počet po sobě jdoucích ziskových obchodů.

Maximální návazné prohry (Maximum consecutive losses)

Maximální počet po sobě jdoucích ztrátových obchodů.

Maximální návazní zisk (Maximal consecutive profit)

Nejvyšší zisk v sérii po sobě jdoucích ziskových obchodů a počet těchto obchodů v sérii.

Maximální návazná ztráta (Maximal consecutive loss)

Nejvyšší ztráta v sérii po sobě jdoucích ztrátových obchodů a počet těchto obchodů v sérii.

Průměrné návazné výhry (Average consecutive wins)

Průměrný počet po sobě jdoucích ziskových obchodů.

Průměrné návazné prohry (Average consecutive losses)

Průměrný počet po sobě jdoucích ztrátových obchodů.

Barvy použité v grafu modelování kvality

Bars in test	4190	Ticks modelled	13539097	Modelling quality	46.78%
Initial deposit	10000.00				
Total net profit	458.20	Gross profit	9629.55	Gross loss	9171.35
Profit factor	1.05	Expected payoff	4.36		
Absolute drawdown	791.50	Maximal drawdown (%)	2436.10 (19.4%)		
Total trades	105	Short positions (won %)	105 (42.86%)	Long positions (won %)	0 (0.00%)
		Profit trades (% of total)	45 (42.86%)	Loss trades (% of total)	60 (57.14%)
		Largest profit trade	955.15	loss trade	-497.30
		Average profit trade	213.99	loss trade	-152.86
		Maximum consecutive wins (profit in money)	5 (376.75)	consecutive losses (loss in money)	7 (-661.75)
		Maximal consecutive profit (count of wins)	1158.00 (3)	consecutive loss (count of losses)	89.15 (6)
		Average consecutive wins	2	consecutive losses	0.9

Lime – světle zelená (7)

Modelování na minutovém období

Deeper green – tmavě zelená (3,4,5,6)

Modelování na vyšším období M5 až H4

Pink color – růžová (2)

Poměrové modelování bez dat na nižším období

Gray color - šedá (1)

Modelování limitováno datem