Alfa-portfolio: první vrstva (filtr) pro mining sniperů

Strategie z alfa-modelů (neuronové sítě), statistiky, portfolio pro maximální Return/DD, řízení equity a simulace účtu 5 000 USD. Stav k 26. 11. 2026, data 25. 5. - 25. 11. 2026, M30. Všechny částky jsou simulace z historických obchodů, nikoli záruka.

Role tohoto portfolia: jde teprve o první vrstvu (filtr). Určuje, které alfa-modely a v jakém režimu mají smysl. Nad ním se v Golden Hydra budou těžit sniper strategie, jejichž cílem je ziskovost podstatně vyšší než u této základny. Čísla v tomto dokumentu proto popisují základ před sniper vrstvou, ne konečný výsledek.

Hlavní čísla

- Základ: 165 unikátních strategií s kompletním seznamem obchodů (38 je po korekci nákladů kladných ve všech třech segmentech). Statické portfolio z 13 málo korelovaných strategií (průměrná korelace 0,04) má Return/DD Training 23,7, Test 14,4 a na nevídané Validation jen 3,6 (zisk 71 R, pokles 19,4 R).
- Řízení equity (nová vrstva): dynamický výběr strategií (každé 2 týdny jen z minulých dat) a řízení rizika podle drawdownu zvedá Return/DD na nevídané Validation z 3,6 na 17,8 (zisk 72 R při poklesu 4,0 R místo 19,4 R). Parametry byly voleny jen na Test; 47 z 48 zkoušených nastavení řízení drawdownu překonalo dynamický výběr bez řízení i na Validation.
- 5 000 $ na nevídané Validation při riziku 0,5 / 1 / 2 % na obchod: statické portfolio 7 076 $ / 9 900 $ / 18 718 $ (max. pokles 9 / 18 / 32 %), řízené portfolio 7 145 $ / 10 164 $ / 20 287 $ (max. pokles 2,0 / 3,9 / 7,8 %).
- Neuronové řízení velikosti pozic (trénink backpropagation) nepřineslo mimo vzorek žádné zlepšení, proto není součástí řízené varianty. Výsledky jsou v kapitole 4.
- Ještě bez statistik: 326 nových alfa-modelů s uloženými vahami. Obchodní seznamy teprve vzniknou při backtestu v NT8 (40 modelů je zkompilovaných). Řízení z kapitoly 4 se na ně přepočítá.

Poplatky

Simulace počítají se základním nákladem 3 USD RT na 100 000 jednotek. U brokera máme vyjednáno 1 USD RT, takže zbývá rezerva 2 USD RT na slippage. Tabulka citlivosti v kapitole 5 ukazuje, co by se stalo při vyšším nákladu.

Důležitá omezení

- Strategie nemají stop-loss, proto je „riziko na obchod“ definováno jako 99. percentil ztráty obchodu v Training (R). Skutečná ztráta jednotlivého obchodu může být větší.
- Původní simulace u JPY párů počítala náklad 3 JPY místo 3 USD na 100 000 jednotek (cca 150x méně). Zde je náklad všude 3 USD, přepočtený na zlomek nominálu. Bez opravy by JPY strategie (148 ze 165) vypadaly mnohem lépe.
- Cenová data JPY párů (a dalších) mají díru 11. 11. 23:00 - 25. 11. 00:00. Obchody otevřené před ní se držely přes celou díru (až 314 hodin), 138 takových obchodů je z analýzy vyloučeno. Validation u JPY párů tak reálně pokrývá 19. 10. - 11. 11. a poslední den.
- Statické portfolio má někdy otevřeno 13 obchodů současně, takže při riziku 2 % může být v riziku přes 20 % účtu.
- Validation má jen 5 týdnů a obsahuje jeden korelovaný šok (23. - 27. 10., všech 13 strategií ztratilo -19 R). Výsledky je nutné ověřit v NT8 a na brokerovi.

1. Co máme a co ještě ne

Zdroj	Počet	Stav
Strategie s kompletním seznamem obchodů	165 unikátních (167 exportů)	Statistiky, portfolio a simulace v tomto dokumentu
Párové složení těchto strategií	AUDJPY 66, EURNZD 2, EURUSD 11, GBPCAD 1, GBPNZD 14, NZDCAD 1, NZDJPY 82, NZDUSD 1	
Natrénované alfa-modely s uloženými vahami	326 jedinečných	Z nové flotily; bez obchodních seznamů
z toho zkompilováno pro NT8	40 modelů (48 signálových feedů)	Backtest v NT8 zatím nespuštěn
Starší alfa-modely (167 strategií výše)	0 vah doložených	Váhy zanikly při restartech, nelze nad nimi těžit

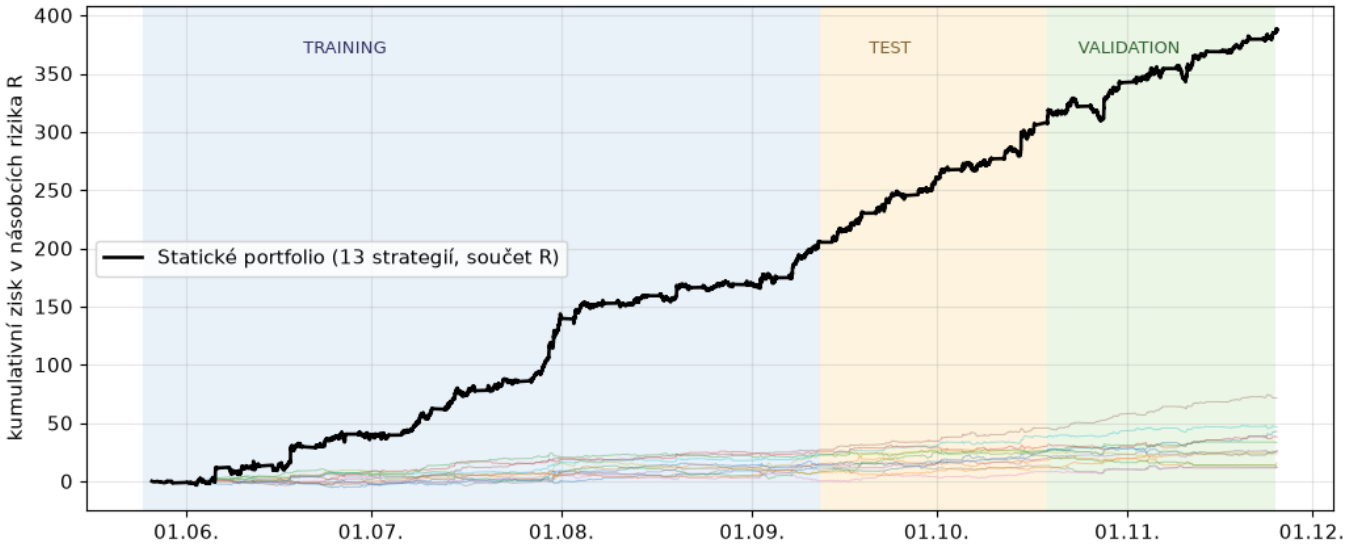
Jedinečné alfa-modely s vahou podle páru / horizontu predikce (celkem 326)

Pár / horizont predikce	Alfa-modelů s vahou
EURUSD	100
EURUSD_H30	81
GBPCAD_H10	29
NZDJPY_H10	28
EURUSD_H10	22
GBPNZD_H30	18
AUDJPY_H30	11
GBPNZD_H10	9
GBPCAD_H1	7
EURNZD_H30	7
NZDJPY_H30	4
NZDCAD_H30	4
NZDCAD_H10	3
AUDUSD	2
NZDJPY_H1	1

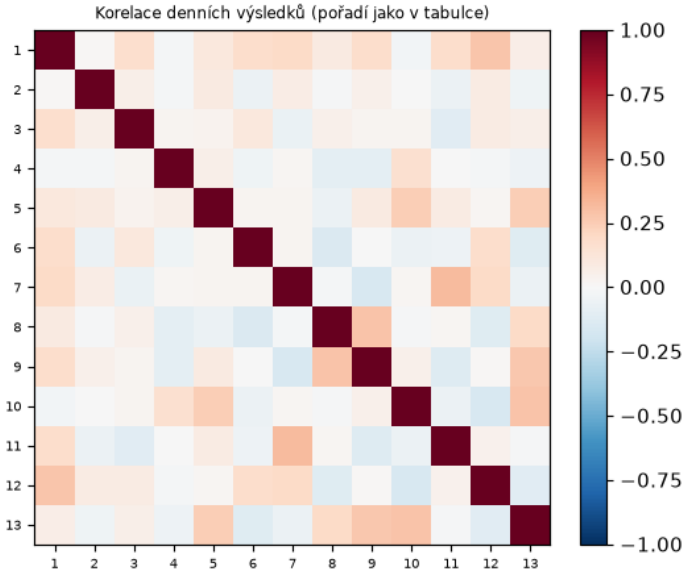
Alfa-modely jsou neuronové sítě (3 skryté vrstvy po 64 uzlech) trénované metodou backpropagation (Adam, 130 epoch) na predikci pohybu ceny; horizont predikce je 1, 3, 10 nebo 30 barů.

2. Statické portfolio pro maximální Return/DD

Postup: ze 165 strategií vstoupilo do výběru 62 kandidátů, kladných v Training i Test. Hladový výběr přidával po jedné strategii, která nejvíc zvedla Return/DD společné křivky (součet R v čase) na Training+Test, s limitem korelace denních výsledků 0,75. Validation (19. 10. - 25. 11.) se k výběru nepoužila. Return/DD = celkový zisk v R / maximální pokles v R.



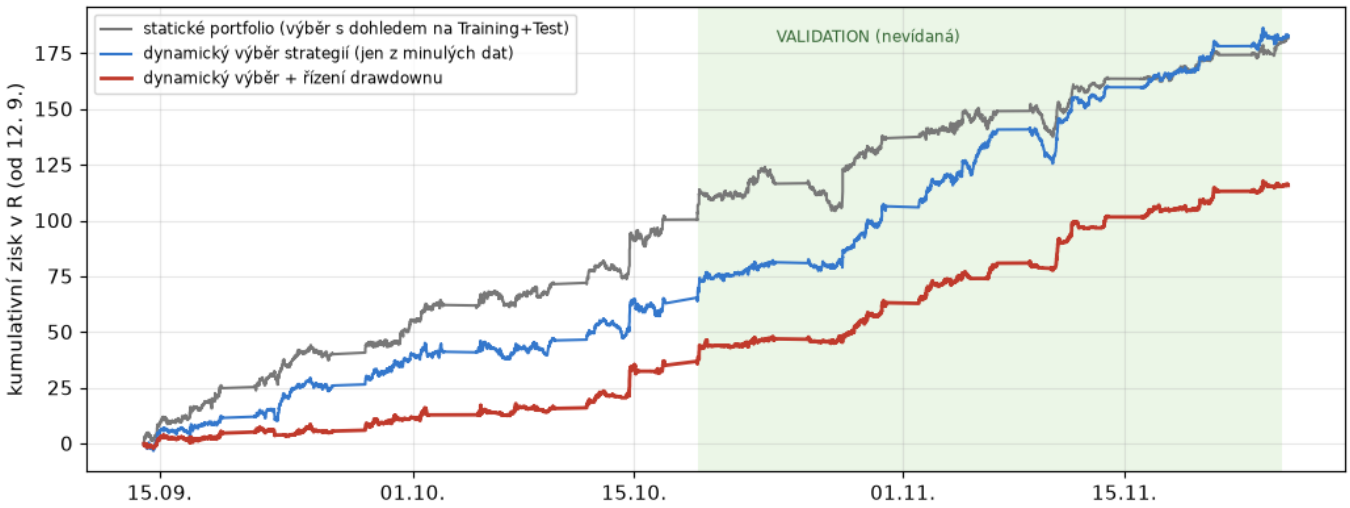
#	Strategie (server/projekt/pořadí_člen)	Pár	Obchodů	Výhry %	PF	R/DD Train	R/DD Test	R/DD Valid.	Zisk R Valid.
1	62533429/9x_EURUSD/S0002_M444	EURUSD	1 206	53	1,36	6,9	5,7	1,9	7,7
2	62533528/NZDCAD/S0001_M185	NZDCAD	1 119	52	1,25	4,7	0,8	3,0	6,7
3	62533350/run/S0002_M240	EURUSD	1 236	56	1,59	6,0	4,8	8,2	26,9
4	62533503/GBPNZD/S0001_M123	GBPNZD	1 027	50	1,19	1,7	1,0	4,6	12,3
5	62533492/EURNZD/S0002_M332	EURNZD	1 196	50	1,16	3,3	4,1	-0,2	-1,6
6	62527889/run/S0001_M368	EURUSD	1 169	54	1,36	1,8	3,1	4,7	16,0
7	62531393/run/S0001_M60	EURUSD	1 212	54	1,27	6,8	1,0	1,5	6,8
8	62531393/AUDJPY/S0043_M307	AUDJPY	1 170	48	1,08	0,7	1,9	-1,0	-9,5
9	62533378/NZDJPY/S0076_M476	NZDJPY	1 121	52	1,16	3,1	0,7	0,0	0,2
10	62533378/NZDJPY/S0046_M224	NZDJPY	1 040	52	1,12	0,1	2,7	1,3	3,5
11	62531393/AUDJPY/S0030_M233	AUDJPY	1 091	52	1,11	2,3	0,5	-0,4	-3,0
12	62531393/run/S0002_M99	EURUSD	1 155	53	1,23	3,5	1,8	1,0	5,0
13	62533378/NZDJPY/S0051_M275	NZDJPY	1 095	51	1,09	1,8	0,5	-0,1	-0,6
	PORTFOLIO		**14 837**	**52**	**1,22**	**23,7**	**14,4**	**3,6**	**70,6**



3. Řízení equity portfolia i jednotlivých strategií

Cíl: zvýšit Return/DD i na nevídané Validation. Všechny úpravy jsou kauzální, rozhodnutí o velikosti rizika a o zapnutí strategie vzniká jen z informací dostupných v okamžiku vstupu. Parametry se volí jen na Training a Test, Validation se neladí.

- Úroveň jednotlivých strategií, dynamický výběr: každé 2 týdny (od 27. 7.) se ze všech 165 strategií znovu vybere 13 nejlepších podle Return/DD z celé dosavadní historie, s limitem korelace 0,75. Strategie, které přestaly fungovat, vypadnou, nové se přidají. Do výběru vstupují jen obchody uzavřené před rebalancí.
- Úroveň portfolia, řízení drawdownu: riziko se násobí faktorem max(0; 1 - DD / 3 R), kde DD je pokles reálné řízené equity od maxima posledních 150 uzavřených obchodů. Při poklesu o 3 R se obchodování zastaví a po zotavení (nebo po odeznění starého maxima) se obnoví. Parametry (150; 3 R; podlaha 0,0) vybrány na Test.

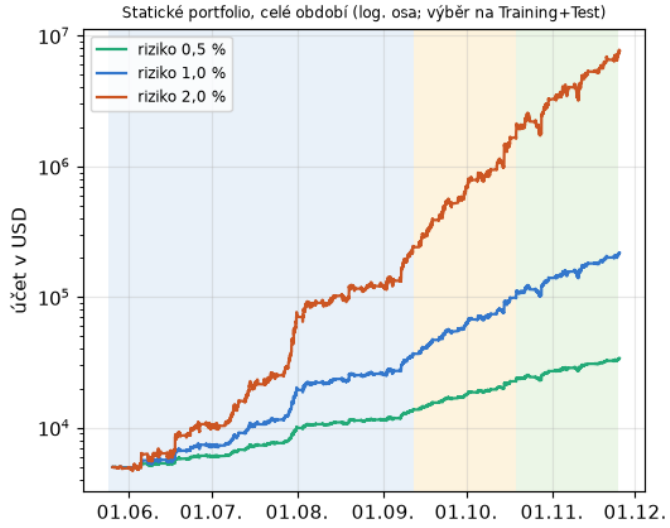


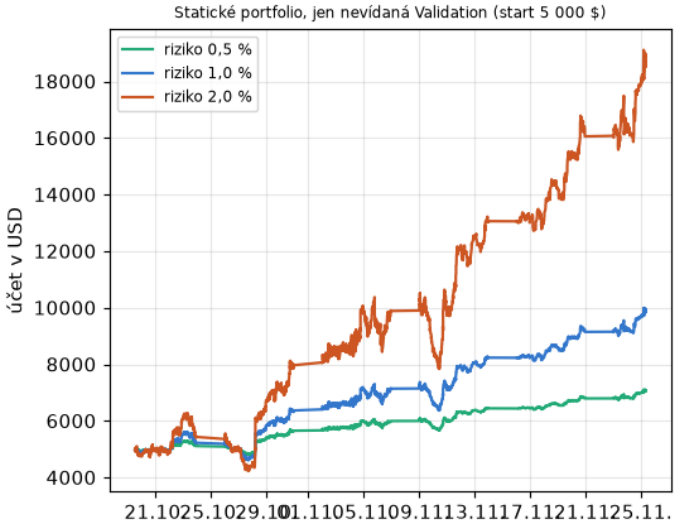
Varianta	Test R/DD	Validation R/DD	Validation zisk R	Validation max. pokles R
Statické portfolio (výběr s dohledem na Training+Test)	14,4	3,6	71	19,4
Dynamický výběr, 5 strategií	10,0	7,8	56	7,1
Dynamický výběr, 8 strategií	7,8	7,8	72	9,2
Dynamický výběr, 13 strategií	8,3	6,7	108	16,1
Dynamický výběr 5 + řízení drawdownu	10,3	8,8	51	5,8
Dynamický výběr 8 + řízení drawdownu	8,2	9,0	62	6,8
Dynamický výběr 13 + řízení drawdownu (hlavní varianta)	10,6	17,8	72	4,0

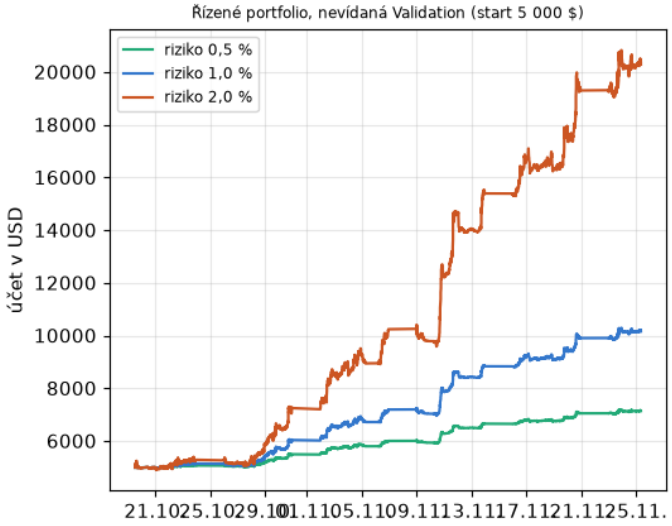
Hlavní varianta je 13 strategií (stejná velikost jako statické portfolio, zvoleno předem). Varianty s 5 a 8 strategiemi jsou uvedeny kvůli úplnosti a vycházejí o něco hůř. Zlepšení je konzistentní, ale zkouší se jen 5 týdnů a jeden korelovaný šok. Skutečná robustnost se ověří na delší historii a na nových alfa-modelech v NT8.

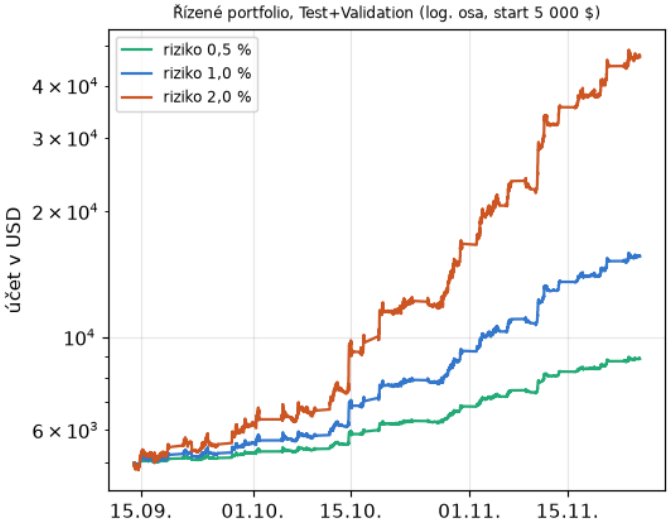
4. Ukázka: 5 000 $ při riziku 0,5 % / 1 % / 2 % na obchod

Každý obchod riskuje zadané procento aktuálního účtu (složené úročení). Velikost pozice = riziko / R strategie, kde R je 99. percentil ztráty obchodu v Training. Obchody se řadí podle času uzavření. U řízeného portfolia se riziko navíc násobí faktorem z kapitoly 3.









Riziko na obchod	Statické: celé období	Statické: Validation (nevídaná)	Max. pokles	Řízené: Validation (nevídaná)	Max. pokles	Řízené: Test+Validation
0,5 %	33 829 $	7 076 $	9,2 %	7 145 $	2,0 %	8 875 $
1,0 %	216 987 $	9 900 $	17,7 %	10 164 $	3,9 %	15 600 $
2,0 %	7 613 616 $	18 718 $	32,5 %	20 287 $	7,8 %	46 818 $

Jak to číst: sloupec „Statické: celé období“ obsahuje Training a Test, na nichž bylo portfolio vybráno, a je proto nadhodnocený. Údaje „Validation“ jsou z nevídaného období 19. 10. - 25. 11. (5 týdnů). U řízeného portfolia jsou Test a Validation mimo vzorek výběru strategií, parametry řízení byly voleny na Test.

5. Poplatky, slippage a citlivost na náklady

U brokera máme vyjednáno 1 USD RT na 100 000 jednotek, zatímco simulace počítají se základem 3 USD RT. Zbývá tedy rezerva 2 USD RT na slippage. Tabulka ukazuje statické portfolio při různých nákladech (Return/DD v R).

Náklad na obchod (100 000 jednotek)	Training	Test	Validation	Zisk R Validation
1 USD RT (vyjednáno u brokera)	32,7	18,5	5,3	90,0
3 USD RT (základ použitý v simulacích)	23,7	14,4	3,6	70,6
6 USD RT (základ + 3 USD slippage)	6,8	8,0	1,8	41,5
9 USD RT	0,2	3,2	0,5	12,4
15 USD RT	-1,0	-0,5	-0,7	-45,8

Při skutečně vyjednaném 1 USD RT jsou výsledky lepší než v simulacích výše a i při 6 USD RT (základ + 3 USD slippage) zůstává portfolio na Validation kladné. Strategie jsou ale citlivé na vysoké náklady (od ~9 USD RT zisk mizí), proto je třeba sledovat skutečný slippage na účtu.

6. Neuronové řízení (backpropagation): co se zkoušelo a nefungovalo

Zkoušeli jsme dvě řídicí sítě (MLP 32-16, ensemble 5 modelů, trénink backpropagation algoritmem Adam, walk-forward: model A trénovaný na Training hodnotí Test, model B trénovaný na Training+Test hodnotí Validation):

- NN filtr obchodů (předpověď výsledku obchodu před vstupem). In-sample zvedá Return/DD z 23,7 na 110,2, na Test z 14,5 na 16,7, na Validation ale 3,7 na 2,4. Korelace předpovědi s výsledkem: Training 0,39, Test 0,09, Validation -0,00.
- NN řízení velikosti pozice po strategiích (předpověď průměrného výsledku příštích 10 obchodů ze stavu strategie, portfolia a volatility trhu). Korelace Training 0,39, Test 0,07, Validation -0,04. Return/DD na Validation při rostoucí agresivitě k: k=0.25: 2,7; k=0.50: 2,3; k=1.00: 1,8; k=1.50: 1,5 (základ 3,6).

Závěr: na šesti měsících dat a těchto vstupech sítě mimo vzorek nepředpovídají kvalitu obchodů ani režim strategie, proto nejsou součástí řízené varianty. Vyšší přínos očekáváme až od delší historie a od sniper vrstvy nad ověřenými alfa-modely.

Příloha A: všech 165 strategií se statistikami (korigované náklady, v násobcích R)

Return/DD = zisk v R / max. pokles v R v daném segmentu. „ano“ = kladný zisk ve všech třech segmentech. Řazeno podle Return/DD na Validation.

#	Strategie	Pár	Obch.	Výhry %	PF	Zisk R Train	Zisk R Test	Zisk R Val.	R/DD Train	R/DD Test	R/DD Val.	Vše +
1	62533503/run/S0001_M74	EURUSD	1 216	53	1,25	11	1	20	2,7	0,2	8,5	ano
2	62533350/run/S0002_M240	EURUSD	1 236	56	1,59	27	18	27	6,0	4,8	8,2	ano
3	62533429/9x_EURUSD/S0001_M191	EURUSD	1 251	52	1,29	21	-1	12	7,6	-0,3	6,0	
4	62533378/NZDJPY/S0057_M319	NZDJPY	1 140	53	1,22	18	-1	12	1,9	-0,2	5,7	
5	62533378/NZDJPY/S0068_M422	NZDJPY	1 135	49	1,05	-6	1	10	-0,7	0,2	5,6	
6	62527889/run/S0001_M368	EURUSD	1 169	54	1,36	13	14	16	1,8	3,1	4,7	ano
7	62533503/GBPNZD/S0001_M123	GBPNZD	1 027	50	1,19	8	4	12	1,7	1,0	4,6	ano
8	62533378/NZDJPY/S0054_M302	NZDJPY	1 129	51	1,09	-1	5	7	-0,1	1,2	3,8	
9	62533378/NZDJPY/S0060_M329	NZDJPY	1 082	50	1,07	2	0	9	0,1	0,1	3,2	ano
10	62533528/NZDCAD/S0001_M185	NZDCAD	1 119	52	1,25	24	3	7	4,7	0,8	3,0	ano
11	62533378/NZDJPY/S0081_M491	NZDJPY	1 059	50	1,01	-2	-4	6	-0,2	-0,9	3,0	
12	62531393/AUDJPY/S0063_M477	AUDJPY	1 162	54	1,18	22	-5	7	2,3	-0,4	2,9	
13	62531393/AUDJPY/S0020_M125	AUDJPY	1 121	51	1,14	9	0	8	1,7	0,1	2,9	ano
14	62533318/9x_EURUSD/S0001_M84	EURUSD	1 231	54	1,29	17	5	8	3,2	1,9	2,8	ano
15	62528108/run/S0001_M118	EURUSD	1 263	56	1,33	16	9	10	3,9	1,9	2,8	ano
16	62533378/NZDJPY/S0022_M110	NZDJPY	1 102	51	1,13	13	-1	8	1,8	-0,2	2,8	
17	62533378/NZDJPY/S0024_M112	NZDJPY	1 134	52	1,02	-4	1	6	-0,4	0,1	2,7	
18	62533378/NZDJPY/S0072_M445	NZDJPY	1 172	49	1,06	-1	4	6	-0,0	0,5	2,5	
19	62527889/run/S0002_M489	EURUSD	1 154	52	1,23	15	0	7	3,5	0,1	2,5	ano
20	62533378/NZDJPY/S0031_M150	NZDJPY	1 124	51	1,02	-2	-1	6	-0,2	-0,2	2,4	
21	62531393/AUDJPY/S0048_M332	AUDJPY	1 075	49	1,05	10	-11	8	0,7	-0,9	2,4	
22	62533378/NZDJPY/S0065_M408	NZDJPY	1 123	50	1,01	-6	3	5	-0,4	0,7	2,1	
23	62533378/NZDJPY/S0049_M256	NZDJPY	1 118	52	1,07	2	-2	7	0,2	-0,3	2,0	
24	62533378/NZDJPY/S0037_M177	NZDJPY	1 062	51	1,00	0	-6	5	0,0	-1,0	2,0	
25	62533378/NZDJPY/S0062_M345	NZDJPY	1 127	52	1,15	15	3	6	1,1	0,6	2,0	ano
26	62533429/9x_EURUSD/S0002_M444	EURUSD	1 206	53	1,36	23	16	8	6,9	5,7	1,9	ano
27	62533378/NZDJPY/S0047_M229	NZDJPY	1 142	51	1,02	-1	-1	4	-0,1	-0,4	1,9	
28	62533378/NZDJPY/S0040_M207	NZDJPY	1 077	50	1,06	4	-5	10	0,4	-0,5	1,9	
29	62531393/AUDJPY/S0055_M391	AUDJPY	1 084	48	1,02	-2	-1	6	-0,2	-0,1	1,8	
30	62531393/AUDJPY/S0032_M250	AUDJPY	1 045	48	1,03	8	-8	5	0,9	-1,0	1,7	
31	62531393/AUDJPY/S0037_M290	AUDJPY	1 125	49	0,96	-2	-7	4	-0,3	-1,0	1,7	
32	62533378/NZDJPY/S0044_M217	NZDJPY	1 113	49	1,00	-1	-5	5	-0,1	-0,5	1,5	
33	62531393/run/S0001_M60	EURUSD	1 212	54	1,27	26	6	7	6,8	1,0	1,5	ano
34	62531393/AUDJPY/S0066_M491	AUDJPY	1 123	50	1,08	5	1	6	0,4	0,2	1,5	ano
35	62533539/9x_EURUSD/S0001_M398	NZDUSD	1 162	53	1,20	14	5	7	3,2	1,5	1,4	ano
36	62533378/NZDJPY/S0082_M499	NZDJPY	1 118	52	1,02	-4	1	5	-0,4	0,2	1,3	
37	62533378/NZDJPY/S0046_M224	NZDJPY	1 040	52	1,12	0	8	3	0,1	2,7	1,3	ano
38	62533378/NZDJPY/S0042_M215	NZDJPY	1 122	50	1,09	4	6	5	0,4	1,7	1,3	ano
39	62531393/AUDJPY/S0005_M36	AUDJPY	1 084	48	1,01	-1	-2	5	-0,1	-0,3	1,3	
40	62531393/AUDJPY/S0015_M104	AUDJPY	1 107	51	1,08	2	3	5	0,2	0,7	1,3	ano
41	62533378/NZDJPY/S0064_M405	NZDJPY	1 081	51	1,10	8	-1	5	1,4	-0,3	1,3	
42	62531393/AUDJPY/S0028_M216	AUDJPY	1 116	50	1,04	4	-5	5	0,6	-0,4	1,2	
43	62531393/AUDJPY/S0003_M21	AUDJPY	1 092	49	1,05	-2	3	7	-0,1	0,4	1,2	
44	62533378/NZDJPY/S0007_M47	NZDJPY	1 074	49	0,97	-1	-6	4	-0,2	-0,7	1,2	
45	62533378/NZDJPY/S0056_M317	NZDJPY	1 091	51	1,12	9	4	3	1,0	1,3	1,2	ano
46	62533378/NZDJPY/S0020_M104	NZDJPY	1 062	52	1,11	8	3	2	1,0	0,9	1,2	ano
47	62533378/NZDJPY/S0033_M155	NZDJPY	1 125	52	1,07	9	-4	5	1,6	-0,5	1,2	
48	62533378/NZDJPY/S0079_M486	NZDJPY	1 083	50	1,14	5	9	5	0,4	3,0	1,2	ano
49	62533378/NZDJPY/S0041_M208	NZDJPY	1 162	52	1,15	10	9	3	1,0	2,7	1,2	ano
50	62533378/NZDJPY/S0069_M431	NZDJPY	1 079	52	1,08	4	4	4	0,3	1,1	1,1	ano
51	62531393/AUDJPY/S0002_M16	AUDJPY	1 177	48	0,99	5	-10	3	0,5	-0,8	1,0	
52	62533492/EURNZD/S0001_M168	EURNZD	1 260	53	1,21	21	9	7	2,6	2,7	1,0	ano
53	62531393/AUDJPY/S0040_M295	AUDJPY	1 096	51	1,09	11	-4	4	1,6	-0,5	1,0	
54	62533378/NZDJPY/S0002_M17	NZDJPY	1 076	50	1,05	-2	2	5	-0,2	0,7	1,0	
55	62531393/run/S0002_M99	EURUSD	1 155	53	1,23	15	7	5	3,5	1,8	1,0	ano
56	62533378/NZDJPY/S0005_M42	NZDJPY	1 091	51	1,05	-0	4	5	-0,0	1,1	0,9	
57	62531393/AUDJPY/S0010_M86	AUDJPY	1 078	49	1,08	3	3	4	0,3	0,7	0,9	ano
58	62531393/AUDJPY/S0062_M466	AUDJPY	1 094	47	0,97	-2	-5	3	-0,2	-0,7	0,9	
59	62533378/NZDJPY/S0052_M279	NZDJPY	1 121	50	1,03	-6	8	2	-0,4	2,6	0,8	
60	62531393/AUDJPY/S0046_M323	AUDJPY	1 102	47	1,05	2	1	3	0,2	0,2	0,8	ano
61	62531393/AUDJPY/S0027_M212	AUDJPY	1 077	51	1,01	-3	1	3	-0,3	0,1	0,8	
62	62531393/AUDJPY/S0054_M386	AUDJPY	1 059	49	1,04	4	-2	3	0,4	-0,4	0,7	

#	Strategie	Pár	Obch.	Výhry %	PF	Zisk R Train	Zisk R Test	Zisk R Val.	R/DD Train	R/DD Test	R/DD Val.	Vše +
63	62533378/NZDJPY/S0034_M166	NZDJPY	1 007	50	1,03	3	-2	3	0,7	-0,3	0,7	
64	62531393/AUDJPY/S0022_M134	AUDJPY	1 058	51	1,00	0	-3	3	0,0	-0,4	0,7	
65	62533318/GBPCAD/S0001_M364	GBPCAD	1 156	51	1,22	11	16	2	1,6	8,3	0,7	ano
66	62533378/NZDJPY/S0075_M475	NZDJPY	1 089	52	1,06	2	1	3	0,3	0,4	0,6	ano
67	62531393/AUDJPY/S0012_M94	AUDJPY	1 095	50	1,05	5	-1	2	0,5	-0,2	0,6	
68	62533378/NZDJPY/S0026_M120	NZDJPY	1 113	50	1,04	6	-4	4	0,5	-0,8	0,6	
69	62533378/NZDJPY/S0027_M125	NZDJPY	1 130	47	1,02	2	-2	2	0,2	-0,3	0,5	
70	62533378/NZDJPY/S0015_M83	NZDJPY	1 063	52	1,07	10	-2	2	1,1	-0,3	0,5	
71	62531393/AUDJPY/S0006_M40	AUDJPY	1 062	51	1,02	4	-3	1	0,4	-0,3	0,5	
72	62533378/NZDJPY/S0074_M471	NZDJPY	1 113	50	1,00	1	-3	1	0,1	-0,5	0,5	
73	62533378/NZDJPY/S0043_M216	NZDJPY	1 047	50	1,01	-1	1	2	-0,1	0,1	0,5	
74	62531393/AUDJPY/S0008_M57	AUDJPY	1 074	49	1,04	10	-7	2	1,1	-0,6	0,4	
75	62531393/AUDJPY/S0044_M312	AUDJPY	1 118	49	1,07	6	2	2	0,4	0,3	0,4	ano
76	62533378/NZDJPY/S0011_M67	NZDJPY	1 114	51	1,01	-2	3	1	-0,3	1,0	0,3	
77	62533378/NZDJPY/S0053_M290	NZDJPY	1 146	51	1,01	-3	3	1	-0,3	0,9	0,3	
78	62533378/NZDJPY/S0010_M53	NZDJPY	1 072	48	0,99	2	-5	2	0,2	-0,8	0,3	
79	62531393/AUDJPY/S0036_M288	AUDJPY	1 127	48	1,05	7	-1	2	0,5	-0,1	0,3	
80	62533378/NZDJPY/S0025_M117	NZDJPY	1 175	49	1,08	-0	10	1	-0,0	3,6	0,3	
81	62533378/NZDJPY/S0014_M80	NZDJPY	1 179	52	1,09	7	4	1	1,2	1,4	0,3	ano
82	62531393/AUDJPY/S0009_M60	AUDJPY	1 085	48	1,02	3	-1	1	0,2	-0,2	0,3	
83	62533378/NZDJPY/S0077_M478	NZDJPY	1 047	51	0,98	-4	0	1	-0,4	0,0	0,3	
84	62533378/NZDJPY/S0050_M274	NZDJPY	1 155	53	1,15	17	6	1	2,5	1,3	0,3	ano
85	62531393/AUDJPY/S0057_M418	AUDJPY	1 123	49	0,98	-6	2	1	-0,4	0,5	0,2	
86	62533378/NZDJPY/S0080_M489	NZDJPY	1 117	50	0,98	3	-7	1	0,2	-0,8	0,2	
87	62533378/NZDJPY/S0006_M43	NZDJPY	1 121	48	1,03	14	-10	1	1,2	-0,9	0,2	
88	62533378/NZDJPY/S0038_M185	NZDJPY	1 049	50	1,00	-4	2	1	-0,3	0,6	0,2	
89	62533350/run/S0003_M61	EURUSD	1 153	51	1,06	13	-6	1	3,1	-0,4	0,2	
90	62533378/NZDJPY/S0066_M412	NZDJPY	1 109	51	1,11	11	3	1	1,1	0,8	0,2	ano
91	62531393/AUDJPY/S0033_M256	AUDJPY	1 102	47	0,99	1	-4	1	0,1	-0,6	0,2	
92	62531393/AUDJPY/S0018_M118	AUDJPY	1 103	48	1,03	5	-2	1	0,4	-0,2	0,2	
93	62533378/NZDJPY/S0013_M72	NZDJPY	1 102	52	1,11	16	0	1	3,6	0,0	0,2	ano
94	62533378/NZDJPY/S0019_M100	NZDJPY	1 056	50	1,09	8	1	1	1,1	0,2	0,2	ano
95	62531393/AUDJPY/S0052_M366	AUDJPY	1 085	47	0,97	3	-9	1	0,2	-0,8	0,2	
96	62533378/NZDJPY/S0012_M70	NZDJPY	1 094	50	1,01	1	0	1	0,0	0,0	0,1	ano
97	62533378/NZDJPY/S0067_M418	NZDJPY	1 139	50	1,01	0	2	1	0,0	0,4	0,1	ano
98	62531393/AUDJPY/S0045_M317	AUDJPY	1 113	48	1,01	6	-5	0	0,6	-0,6	0,1	
99	62533378/NZDJPY/S0021_M109	NZDJPY	1 099	51	1,03	8	-5	0	0,9	-0,6	0,1	
100	62533378/NZDJPY/S0030_M143	NZDJPY	1 117	51	0,98	-4	0	0	-0,2	0,1	0,1	
101	62533378/NZDJPY/S0003_M20	NZDJPY	1 134	50	1,00	-2	1	0	-0,1	0,1	0,1	
102	62531393/AUDJPY/S0011_M92	AUDJPY	1 119	50	0,95	-5	-3	0	-0,4	-0,5	0,1	
103	62531393/AUDJPY/S0061_M464	AUDJPY	1 109	47	0,97	-6	0	0	-0,5	0,0	0,1	
104	62531393/AUDJPY/S0039_M294	AUDJPY	1 062	51	1,00	1	-1	0	0,1	-0,1	0,0	
105	62533378/NZDJPY/S0076_M476	NZDJPY	1 121	52	1,16	22	3	0	3,1	0,7	0,0	ano
106	62531393/AUDJPY/S0035_M282	AUDJPY	1 132	52	0,96	-2	-3	0	-0,2	-0,5	0,0	
107	62531393/AUDJPY/S0038_M291	AUDJPY	1 097	47	1,00	-1	-0	0	-0,1	-0,0	0,0	
108	62531393/AUDJPY/S0019_M120	AUDJPY	1 115	49	0,99	4	-5	-0	0,2	-0,7	-0,0	
109	62531393/AUDJPY/S0031_M234	AUDJPY	1 117	50	0,94	4	-13	-0	0,7	-0,8	-0,0	
110	62533378/NZDJPY/S0073_M464	NZDJPY	1 037	50	0,98	-5	3	-0	-0,5	0,8	-0,1	
111	62533378/NZDJPY/S0063_M381	NZDJPY	1 133	50	1,03	3	1	-0	0,3	0,4	-0,1	
112	62533378/NZDJPY/S0051_M275	NZDJPY	1 095	51	1,09	10	3	-1	1,8	0,5	-0,1	
113	62531393/AUDJPY/S0004_M22	AUDJPY	1 075	49	1,01	5	-3	-0	0,3	-0,4	-0,1	
114	62531393/AUDJPY/S0013_M97	AUDJPY	1 163	47	0,98	-1	-1	-0	-0,1	-0,2	-0,1	
115	62531393/AUDJPY/S0050_M363	AUDJPY	1 076	51	1,02	4	1	-1	0,4	0,1	-0,1	
116	62533378/NZDJPY/S0035_M172	NZDJPY	1 043	51	1,08	10	2	-1	1,3	0,3	-0,2	
117	62531393/AUDJPY/S0060_M447	AUDJPY	1 119	49	1,02	5	-1	-1	1,1	-0,2	-0,2	
118	62533378/NZDJPY/S0016_M84	NZDJPY	1 073	50	1,03	2	3	-1	0,2	0,5	-0,2	
119	62533492/EURNZD/S0002_M332	EURNZD	1 196	50	1,16	15	13	-2	3,3	4,1	-0,2	
120	62531393/AUDJPY/S0007_M45	AUDJPY	1 105	49	1,00	0	1	-1	0,0	0,1	-0,3	
121	62533378/NZDJPY/S0059_M324	NZDJPY	1 086	53	1,02	2	2	-2	0,3	0,5	-0,3	
122	62533378/NZDJPY/S0029_M136	NZDJPY	1 122	48	1,00	11	-9	-2	1,3	-0,9	-0,3	
123	62533378/NZDJPY/S0008_M49	NZDJPY	1 097	50	0,97	1	-4	-2	0,1	-0,5	-0,3	
124	62531393/AUDJPY/S0017_M117	AUDJPY	1 128	47	1,01	4	-1	-2	0,3	-0,1	-0,3	
125	62531393/AUDJPY/S0001_M6	AUDJPY	1 129	49	0,95	-8	4	-2	-0,7	0,9	-0,4	
126	62533378/NZDJPY/S0061_M335	NZDJPY	1 147	50	1,07	11	3	-2	0,7	0,6	-0,4	
127	62533378/NZDJPY/S0045_M218	NZDJPY	1 083	50	1,04	2	5	-2	0,3	1,6	-0,4	
128	62531393/AUDJPY/S0030_M233	AUDJPY	1 091	52	1,11	15	4	-3	2,3	0,5	-0,4	

#	Strategie	Pár	Obch.	Výhry %	PF	Zisk R Train	Zisk R Test	Zisk R Val.	R/DD Train	R/DD Test	R/DD Val.	Vše +
129	62531393/AUDJPY/S0023_M136	AUDJPY	1 014	47	0,95	-5	0	-3	-0,4	0,0	-0,4	
130	62531393/AUDJPY/S0049_M333	AUDJPY	1 106	49	1,01	2	2	-2	0,1	0,4	-0,4	
131	62533378/NZDJPY/S0028_M131	NZDJPY	1 070	51	1,01	7	-3	-3	0,4	-0,5	-0,5	
132	62531393/AUDJPY/S0016_M110	AUDJPY	1 120	48	0,93	-0	-11	-3	-0,0	-0,8	-0,5	
133	62533378/NZDJPY/S0078_M479	NZDJPY	1 107	49	0,97	8	-8	-5	0,9	-0,8	-0,5	
134	62531393/AUDJPY/S0041_M303	AUDJPY	1 119	47	0,98	-2	1	-3	-0,2	0,2	-0,5	
135	62533378/NZDJPY/S0039_M190	NZDJPY	1 072	50	1,03	7	2	-5	0,5	0,3	-0,5	
136	62533378/NZDJPY/S0018_M97	NZDJPY	1 073	51	0,98	1	0	-3	0,2	0,1	-0,5	
137	62533378/NZDJPY/S0009_M52	NZDJPY	1 088	49	0,99	0	1	-2	0,0	0,2	-0,6	
138	62533378/NZDJPY/S0017_M85	NZDJPY	1 073	48	1,01	7	-1	-4	0,6	-0,1	-0,6	
139	62531393/AUDJPY/S0026_M189	AUDJPY	1 170	49	0,97	-2	3	-6	-0,1	0,6	-0,6	
140	62531393/AUDJPY/S0064_M478	AUDJPY	1 100	47	0,98	3	-2	-4	0,2	-0,3	-0,6	
141	62533378/NZDJPY/S0055_M304	NZDJPY	1 101	50	1,04	12	-2	-4	1,8	-0,4	-0,6	
142	62533378/NZDJPY/S0023_M111	NZDJPY	992	51	1,09	11	6	-5	1,5	1,8	-0,6	
143	62531393/AUDJPY/S0058_M423	AUDJPY	1 070	49	0,97	3	-1	-6	0,4	-0,1	-0,6	
144	62531393/AUDJPY/S0053_M381	AUDJPY	1 106	50	1,05	5	8	-6	0,5	1,8	-0,6	
145	62533378/NZDJPY/S0048_M239	NZDJPY	1 078	49	1,02	3	5	-5	0,2	0,9	-0,7	
146	62533378/NZDJPY/S0036_M176	NZDJPY	1 122	50	1,03	7	2	-4	0,6	0,4	-0,7	
147	62533378/NZDJPY/S0058_M323	NZDJPY	1 063	52	1,05	10	1	-4	1,1	0,1	-0,8	
148	62531393/AUDJPY/S0024_M171	AUDJPY	1 122	48	0,95	-3	1	-6	-0,3	0,3	-0,8	
149	62531393/AUDJPY/S0029_M230	AUDJPY	1 120	52	1,03	-1	9	-4	-0,1	2,5	-0,8	
150	62531393/AUDJPY/S0065_M479	AUDJPY	1 149	48	0,95	4	-5	-7	0,3	-0,7	-0,8	
151	62533378/NZDJPY/S0071_M443	NZDJPY	1 133	50	0,96	13	-11	-8	1,0	-0,8	-0,8	
152	62531393/AUDJPY/S0059_M446	AUDJPY	1 048	46	1,01	3	2	-4	0,3	0,3	-0,8	
153	62533378/NZDJPY/S0001_M7	NZDJPY	1 026	52	1,02	7	4	-9	0,9	0,8	-0,8	
154	62533378/NZDJPY/S0032_M152	NZDJPY	1 104	49	1,00	12	-6	-6	0,9	-0,8	-0,8	
155	62531393/AUDJPY/S0034_M274	AUDJPY	1 059	48	0,96	4	-2	-7	0,5	-0,3	-0,9	
156	62531393/AUDJPY/S0056_M417	AUDJPY	1 094	48	0,98	5	2	-10	0,5	0,4	-0,9	
157	62533378/NZDJPY/S0070_M436	NZDJPY	1 122	48	0,96	-7	4	-5	-0,4	0,8	-0,9	
158	62533378/NZDJPY/S0004_M23	NZDJPY	1 124	50	1,03	10	-1	-5	0,9	-0,1	-0,9	
159	62531393/AUDJPY/S0025_M187	AUDJPY	1 135	47	0,94	-7	3	-6	-0,5	0,7	-0,9	
160	62531393/AUDJPY/S0014_M99	AUDJPY	1 147	47	0,95	-1	3	-10	-0,0	0,3	-1,0	
161	62531393/AUDJPY/S0042_M306	AUDJPY	1 042	51	1,04	13	-1	-8	2,5	-0,1	-1,0	
162	62531393/AUDJPY/S0043_M307	AUDJPY	1 170	48	1,08	8	13	-10	0,7	1,9	-1,0	
163	62531393/AUDJPY/S0047_M331	AUDJPY	1 076	47	0,96	2	-0	-8	0,1	-0,1	-1,0	
164	62531393/AUDJPY/S0051_M364	AUDJPY	1 040	49	0,99	8	-3	-7	1,4	-0,7	-1,0	
165	62531393/AUDJPY/S0021_M129	AUDJPY	1 104	48	0,97	10	-11	-4	1,1	-0,9	-1,0	