

В. Г. ПАВЛЮКЕВИЧ, Н. В. МАРКОВСКАЯ

(г. Гродно, Гродненский государственный университет имени Я. Купалы) Науч. рук. **Н.В. Марковская**,
канд. физ.-мат. наук, доц.

РАЗРАБОТКА МЕХАНИЧЕСКИХ ТОРГОВЫХ СИСТЕМ ДЛЯ РАБОТЫ НА ФИНАНСОВОМ РЫНКЕ FOREX

Механические торговые системы (МТС, советники) – это системы, предназначенные для автоматизации процесса совершения сделок купли и продажи на рынке Forex. Все механические торговые системы строятся на основе заранее заложенного в них алгоритма, то есть определенного набора торговых правил. Данные системы создаются на основе языка MQL 4 или MQL 5. Советники нужны трейдерам, которые за годы практической торговли вывели свою приносящую прибыль ручную торговую систему и теперь хотят ее автоматизировать. МТС должна быть четкой и простой, строиться на определенном наборе торговых правил, которые не должны противоречить друг другу.

Рекомендуется создавать механическую торговую систему после того, как уже существует ручная рабочая торговая система. В данном случае можно увидеть насколько её автоматизация повлияет на результаты торговли. Если она будет приносить прибыль, то есть смысл использовать ее в дальнейшей работе. Однако новичкам следует знать, что пока у них нет эффективной собственной системы, то не стоит пытаться её автоматизировать, а тем более покупать сторонние механические торговые системы. Построение эффективной МТС возможно, но только по правилам, которые вам понятны, потому что в дальнейшем надо будет совершенствовать и подстраивать свою МТС к текущим реалиям рынка, так как он постоянно меняется.

У механических торговых систем много как преимуществ, так и недостатков. МТС торгуют исключительно по техническому анализу и абсолютно не используют фундаментальный. Это будет немного затруднительно для трейдеров, которые привыкли использовать оба анализа в работе.

Основное отличие фундаментального анализа от технического заключается в том, что фундаментальный основывается на следующем положении: цены валют на рынке Forex являются отражением спроса и предложения, которые в свою очередь зависят от фундаментальных факторов экономики.

Последователи же технического анализа утверждают, что причину в изменениях валютных курсов вообще не стоит искать, достаточно анализировать сами цены. Предполагается, что невозможно найти причину изменения цен, до того, как рынок сам уже успеет включить её в цену. Технический анализ в большинстве случаев занимается более короткими интервалами времени: от минутных до недельных. На этих интервалах (таймфреймах) фундаментальный анализ, за исключением одной его разновидности (торговли на новостях) практически бесполезен, поскольку сами фундаментальные данные обычно выходят раз в неделю, месяц, квартал.

Однако если целью анализа является прогнозирование среднесрочных и долгосрочных прогнозов на валютном рынке Forex, то здесь уже становится необходимо проводить исследования, касающиеся внутренних, глубинных причин изменения валютных курсов. Только такой тип анализа даст возможность оценить перспективы динамики спроса и предложения на валюты. Кроме того, такой подход даст инвестору возможность не рассматривать краткосрочные колебания – рыночный шум.

Существуют следующие методы технического анализа на финансовом рынке: Acceleration / Deceleration Oscillator (Осциллятор Ускорения / Замедления) измеряет ускорение или замедление цены; Accumulation / Distribution (Накопления /

Распределения) связывает объём торгов и изменение цены; Alligator (Аллигатор) предназначен для выявления зарождающегося тренда; Bollinger Bands (Полосы Боллинджера) можно определить как индикатор форекс, схожий с конвертами скользящих средних, но основанный на текущей волатильности рынка; Commodity Channel Index (Индекс Товарного Канала) измеряет изменение цены по сравнению с её статистическим средним значением; Momentum (Момент (Импульс)) измеряет на сколько изменилась цена за данный промежуток времени; Moving Average (Скользящее Среднее) показывает среднее значение цены инструмента за некоторый период времени; Parabolic SAR (Параболическая Система) разработан для анализа трендовых рынков; Relative Strength Index (Индекс Относительной Силы) следующий за ценой осциллятор, который колеблется в диапазоне от 0 до 100 и др. [1].

При разработке механической торговой системы стоит рассмотреть следующее:

1 Ориентации системы торговли. Есть 3 существенных типа систем, которые могут быть рекомендованы для торговли: следующие за трендом: в этом случае нам нужна система, чтобы различать, движется ли рынок вверх, вниз или в сторону; прорыв уровней сопротивления или поддержки: системы, которые следуют по направлению прорыва после смены тренда или после бокового тренда; коридор цен: система, созданная специально, чтобы получить прибыль в течение периодов, когда рынок находится в каком-либо диапазоне цены.

2 Технологии фильтрации. Самые простые фильтры принимают меры для исключения сигнала к торговле, если тренд или некоторые другие факторы недостаточно благоприятны.

3 Позиции входа в рынок. Правилами должны быть недвусмысленные математические сигналы, не оставляющие простора для фантазии людей.

4 Первоначальное управление риском. Оно может осуществляться за счёт фиксированного количества наличных денег или такого средства, как фиксированный процент исходного капитала, реакции на изменчивость и т. д.

5 Защитные стоп-сигналы. Сигналы, при которых сделка автоматически закрывается по указанной трейдером цене.

6 Позиции выхода из рынка. Когда сработал один или больше стоп-сигналов, достигнута особая цель или сменился ведущий тренд [2].

Список используемой литературы

1. Математика в трейдинге [Электронный ресурс]. – 2015. – URL: <http://articles.mql4.com> (дата обращения: 15.01.2015).
2. Технический анализ на валютном рынке [Электронный ресурс]. – 2015. – URL: <http://fx-insta.ru>. (дата обращения: 17.01.2015).