

БЕЛОРУССКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
Факультет информационных технологий и робототехники
Кафедра «Программное обеспечение информационных систем
и технологий»

ДОПУЩЕН К ЗАЩИТЕ
Заведующий кафедрой

_____ Ю.В. Полозков
(подпись) (инициалы и фамилия)

« ____ » _____ 2019 г.

РАСЧЕТНО-ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА
ДИПЛОМНОГО ПРОЕКТА

«Программное средство для алгоритмической маржинальной торговли на
валютной бирже»

Специальность 1-40 01 01 «Программное обеспечение информационных технологий»
Специализация 1-40 01 01 05 «Управление качеством и тестирование программного
обеспечения»

Обучающийся
группы 10701115
(номер)


(подпись, дата)

Е.Н. Котковец

Руководитель


(подпись, дата)

Е.В. Тернов

Консультанты:

по компьютерному проектированию


(подпись, дата)

Е.В. Тернов

по разделу «Охрана труда»


(подпись, дата)

А.М. Лазаренков

по разделу «Экономика»


(подпись, дата)

И.В. Насонова

Ответственный за нормоконтроль


(подпись, дата)

Н.С. Домаренко

Объем проекта:

расчетно-пояснительная записка – 71 страниц;

графическая часть – 10 листов;

магнитные (цифровые) носители – 1 единиц.

Минск 2019

РЕФЕРАТ

МЕХАНИЧЕСКАЯ ТОРГОВАЯ СИСТЕМА, ТРЕЙДИНГ, РИСК, БИРЖА, ПРИБЫЛЬ, ПРОГРАММИРОВАНИЕ НА MQL5

Объектом исследования является механическая торговая система.

Цель проекта – изучение возможности применения программного трейдинга на валютном рынке и выработка рекомендаций по созданию и использованию эффективной механической торговой системы.

В процессе работы (проектирования) выполнены следующие исследования (разработки): рассмотрена сущность программного трейдинга, в частности даны определения МТС ведущих специалистов фондовых рынков и определены достоинства и недостатки системного трейдинга, а также концепции, лежащие в основе механических торговых систем; спроектирована механическая торговая система, в рамках которой приведена методика формулирования торговой идеи, изучены возможности оптимизации параметров и порядок тестирования МТС. Рассмотрены показатели, по которым оценивается эффективность работы стратегии и методы управления риском при использовании МТС; проведено тестирование разработанной механической торговой системы, результаты которого исследовались на предмет ее дальнейшего использования на рынке акций.

Элементами научной новизны (практической значимости) полученных результатов являются:

- возможность совершать сделки купли/продажи валюты на валютном рынке;
- приемлемый риск сделок.

Разработанная МТС может использоваться в качестве самостоятельного инструмента принятия решений на рынке валюты, также может служить основой для создания более эффективной механической торговой системы, показывающей лучшие результаты.

Студент-дипломник подтверждает, что приведенный в дипломном проекте расчетно-аналитический материал объективно отражает состояние исследуемого процесса (разрабатываемого объекта), все заимствованные из литературных и других источников теоретические и методологические положения и концепции сопровождаются ссылками на их авторов.

Дипломный проект: 71 страницу, 21 рисунок, 13 таблиц, 23 источника, 2 приложения.

СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННОЙ ЛИТЕРАТУРЫ

- 1 Вильямс Л. Долгосрочные секреты краткосрочной торговли. - М.: Аналитика. 2001. - 312 с.
- 2 Демарк Т. Технический анализ – новая наука. - М.: Диаграмма, 1999. - 288 с.
- 3 Кац Дж., МакКормик Д. Энциклопедия торговых стратегий/ Перевод с англ. - М.: Альпина, 2002. – 400 с.
- 4 Лебо Ч. Компьютерный анализ фьючерсных рынков: Перевод с англ. - М.: Альпина, 2000. - 304 с.
- 5 Лефевр Э. Воспоминания биржевого спекулянта. - М.: Олимп- Бизнес, 2004.- 544 с.
- 6 Миркин Я.М. Ценные бумаги и финансовый рынок: Профессиональный курс в Финансовой Академии при Правительстве РФ. - М.: Перспектива, 1995. – 536 с.
- 7 Мэрфи Дж. Технический анализ фьючерсных рынков: теория и практика. - М.: Сокол, 1996. - 592 с.
- 8 Пардо Р. «Разработка, тестирование и оптимизация торговых систем для биржевого трейдера»./ Перевод с англ. - М. Минакс, 2002. - 224 с.
- 9 Швагер Дж. Технический анализ. Полный курс. - М.: Альпина, 2001. - 768 с.
- 10 Covell, Michael, Trend following: how great traders make millions in up or down markets, 2004. - 11 с.
- 11 Elder, Alexander, Trading for a living: psychology, trading tactics, money management, 1992. - 66 с.
- 12 Kaufman, Perry, Trading systems and methods- 3 edition – 505 с.
- 13 Williams, Bill, New trading dimensions: how to profit from chaos in stocks, bonds, and commodities, 35 с.
- 14 Wilder, J. Welles, New concepts in technical trading systems, 1978. 143 с.
- 15 Chuck LeBeau , Chuck LeBeau’s System Traders Club BULLETIN, Vol.1, №3, June, 1998
- 16 Оверченко М., Бочкарева Т. Заработать на чужих ошибках 2005. – 19 с.
- 17 Боровин А. Изучаем RSI// Валютный спекулянт, №10, 2000
- 18 Дерри Т. Торговые системы//Валютный спекулянт, № 1 (15), 2001
- 19 Копыркин К. Индикатор тренда на основе динамического ценового канала// Современный трейдинг, №4, 2001
- 20 Сафин Изучаем стохастический осциллятор// Валютный спекулянт, №11, 2000
- 21 Материалы конференции «Вопросы системной торговли» - 2003 г. Доклад Храмцова А. Режим доступа: <http://support.tsresearchgroup.com/>, дата доступа: 25.05.2019.
- 22 Вершина Г.А. Охрана труда: учебник / Г.А. Вершина, А. М. Лазаренков. – Минск: ИВЦ Минфина, 2017. – 512 с.
- 23 Миркин Я.М. Ценные бумаги и финансовый рынок: Профессиональный курс в Финансовой Академии при Правительстве РФ. - М.: Перспектива, 1995. – 536 с.
Лазаренков А.М., Фасевич Ю.Н. / Электронное издание: Пожарная безопасность. Учебное пособие по дисциплине «Охрана труда». – Минск: Регистрационный номер БНТУ/МТФ 35-16.2019. Зарегистрировано 06.03.2019. – 14, 5 усл.эл.л.