

КЕРУВАННЯ КАПІТАЛОМ В ІНТЕРНЕТ-ТРЕЙДІНГУ

Форманюк П. П.

Науковий керівник – доц., к.т.н. Кабачій В. В.

Аналіз проблеми. Процес торгівлі умовно можна розподілити на дві відносно незалежні частини. Перш називається торговою стратегією, виконує роль аналізу поточної ситуації на ринку, прийняття рішення про вхід в нього, його типу (купити \ продати) та моменту закриття позиції. Розмір коштів задіяних по кожному контракту визначатиметься другою частиною котру називають системою управління капіталом. В даній доповіді наводься результати аналізу деяких стратегій ММ (Money management).

Постановка задачі. Вивчення результатів роботи існуючих систем управління капіталом у поєднанні з різнотипними троговими стратегіями.

Результати досліджень. Було розглянуто три різнотипні трогові стратегії що працювали на рахунку розміром 25 000\$. З погляду ММ результати їх роботи відрізняються за такими параметрами: прибуток, втрати, відношення прибутку до маржі, відношення прибутку до втрат, відсотка виграшів, ймовірності банкрутства.

Для прикладу типова трогова стратегія, що виграє в більшості випадків і використовує осцилятори для входу, при відсутності управління капіталом дає 5315\$ з 20% використання капіталу. При використанні методики ризику фіксованою сумою (750\$) система покращує свою прибутковість на 50% при збільшенні ризику на 10%, відношення прибутку до максимального збитку 1.24. При використанні підходу фіксованого відсотка від початкової суми вкладень (4%) трогова система не покращує своїх показників а відношення прибутку до максимально можливих втрат складає 0.94, що робить трогову систему збитковою.

Аналізуючи отримані результати приходимо висновку що існує не один спосіб вплинути на результати роботи трогової системи з використання методів управління капіталом, результати цього впливу не завжди задовільні, мало того інколи краще взагалі відмовитись від управління капіталом, однак існують і такі які можуть значно покращити характеристики трогової системи.

В майбутньому планується формалізувати основні методики управління капіталом та закодувати їх на мові MQL4 у вигляді фрагментів експертів котрі можна було б додавати до існуючих трогових стратегій тим самим тестуючи їх спільну результативність.