

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра математического моделирования и анализа данных

Аннотация к дипломной работе

«Оптимальное инвестирование на основе критерия Келли»

Горобец Валерий Витальевич

Научный руководитель - кандидат физ.-мат. наук, доцент Сталевская С.Н.

Минск, 2018

Реферат

Дипломная работа, 55 с., 8 рисунка, 5 таблицы, 40 формул, 10 источников, 2 приложения.

ФОНДОВЫЙ РЫНОК, ТОРГОВАЯ СИСТЕМА, КРИТЕРИЙ КЕЛЛИ, ИНВЕСТИЦИОННАЯ СТРАТЕГИЯ, ТЕХНИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ, ПОТЕНЦИАЛЬНЫЙ РИСК И ДОХОД ОТ ИНВЕСТИЦИИ, ОПРЕДЕЛЕНИЕ ОПТИМАЛЬНОЙ ТОЧКИ ВХОДА, УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ ОТКРЫТОЙ ПОЗИЦИИ

Объект исследования - критерий Келли, предназначенный для поиска оптимальной величины инвестиции от текущего торгового счета.

Цель работы – исследовать использование трейдером инвестиционной стратегии, которая применяет критерий Келли.

Результатом является разработанная программа на языке Javascript с использованием фреймворка React, которая работает как торговый бот и предназначена для имитации поведения трейдера на фондовом рынке и тестировании различных стратегий технического анализа, а так же их анализ и подбор оптимальной стратегии для заданного актива.

Областью применения данного программного обеспечения является трейдер любого уровня, который желает в своей торговой стратегии использовать критерий Келли для защиты своего счета и желает на выбранном им активе подобрать наилучшую или протестировать ту или иную стратегию технического анализа для автоматизации торговли на фондовой бирже. Подобное решение способно оградить инвестора от невыгодных стратегий еще до начала торгов.

Abstract

Degree work, 55 p., 8 figures, 5 tables, 40 formulas, 10 sources, 2 applications.
STOCK MARKET, TRADING SYSTEM, KELLY CRITERION, INVESTMENT STRATEGY, TECHNICAL ANALYSIS, POTENTIAL RISK AND REVENUE FROM INVESTMENT, DETERMINATION OF THE OPTIMUM ENTRY POINT, RISK MANAGEMENT OF OPEN POSITION

Object of research – the Kelly criterion intended for finding the optimal value for an investment from a current trading account.

Purpose – explore the trader usage of an investment strategy that applies the Kelly criterion.

The result is the developed program that is written in Javascript language using React framework, which works as a trading bot and is intended for imitation of the trader's behavior in the stock market and testing various strategies of technical analysis, as well as their analysis and selection of the optimal for the given asset.

The scope of this software is a trader of any level who wants to use Kelly's criterion in his trading strategy to protect his account and wishes to select the best one on chosen asset or to test technical analysis strategy for automatic trading on the stock exchange. Such a solution can protect the investor from unprofitable strategies even before the trading starts.