

Торговый робот, разработанный с использованием индикатора волн Эллиота

*Козячая М. А., магистрант ГрГУ им. Я. Купалы,
науч. рук. Марковская Н. В.,
канд. физ.-мат. наук, доц.*

В истории человечества результаты промышленных революций всегда принимались как благо. Именно они привели к созданию принципиально новых продуктов. Торговые роботы — новый продукт информационных технологий, способный изменить биржевую индустрию. Сфера информационных технологий — это компьютеры, программное обеспечение, телекоммуникации и Интернет. Ценность Интернета определяется его возможностями сбора, анализа и передачи информации. Интернет уже сейчас приводит к радикальным изменениям в экономике за счет своей эффективности. Информационные технологии позволяют увеличить эффективность производства за счет реорганизации производственного процесса, а также влияя на производительность экономики в целом.

Эпохи промышленных революций всегда сопровождались созданием новых продуктов. Биржевая индустрия, как информационно насыщенное пространство, является прекрасным объектом для создания торговых роботов. Торговый биржевой робот — это не только продукт новой экономики, но и объект инноваций. Сегодня существует большое количество видов свободного заработка при помощи торгового биржевого робота. Самыми проверенным способом инвестирования можно назвать торговлю на Форексе. Вся необходимая информация поступает от мировых агентств одновременно всем участникам рынка [1]. Поэтому появляется определенное время для принятия решения. Основываясь на полученной информации, миллионы людей по всему миру принимают то или иное решение. На Форексе основными валютами можно назвать: японскую йену, английский фунт, евро, доллар США, швейцарский франк.

Торги на международном финансовом рынке Форекс, как и любая важная финансовая деятельность, не могут покоряться только настроению трейдера. Он должен ориентироваться в своем выборе на определенные принципы, гарантирующие успешность сделки. В общем, эти принципы называются торговой стратегией. Трейдеры индивидуально подбирают подходящие им методы работы на Форекс. Реализовывать стратегию можно как самостоятельно, так и при помощи автоматической торговой системы.

Торговых стратегий Форекс имеет огромное множество. Хороша та стратегия, которая приносит доход своему трейдеру. Следовательно, основой любой торговой стратегии являются индикаторы. Индикаторы — это дополнительные графики, представляющие вспомогательные функции, рассчитанные на основе графика цены и являющиеся частью технического анализа.

Ранее был реализован пользовательский индикатор «Третья волна Эллиота» с использованием встроенного в торговую платформу MetaTrader4 индикатора **Bollinger Bands**. Пользовательский индикатор предназначен для графического представления третьей волны Эллиота, а также для анализа динамики цен финансовых инструментов, что в свою очередь позволяет определить количество торговых операций и их тип (Sell или Buy). Более подробное описание данного индикатора можно найти в статье «Реализация пользовательского индикатора для трехволновой теории Эллиота» [2].

Представим алгоритм пользовательского индикатора, основанного на волновой теории Эллиота, с применением скользящих средних. Стратегия скользящих средних предполагает усреднение колебаний валют, которые изучаются по историческому периоду, что помогает проследить направление движения. Именно поэтому данный индикатор подходит для определения волн Эллиота. К недостаткам такой стратегии относится запаздывание по отношению к курсу значения. Важность сигнала зависит от длительности периода усреднения, но чем длительнее период, тем больше запаздывание. Для того чтобы компенсировать запаздывание, возьмем разность между 5-периодной и 35-периодной скользящей средней. На графике данный индикатор будет располагаться под ценовым в виде гистограммы.

Основное правило определения волн Эллиота построено на пересечениях индикатора нулевой линией. Когда индикатор поднимается существенно выше нулевой линии, а затем опускается, то фиксируем точку 1 (волна 1). Затем ждем момента, когда индикатор снова поднимется значительно выше нулевой линии. Тогда фиксируем точку 2 (волна 2) и так далее. Признаком окончания волн Эллиота будет являться расхождение между 3 и 5 волной графика цены и индикатора. Это признак разворота в противоположную сторону и начала нового тренда. Именно с этого момента начинается новый отсчет волн Эллиота.

Волновой анализ на сегодняшний день наиболее гибкий, мощный и перспективный инструмент, который позволяет на всех временных отрезках прогнозировать тенденции, которые приводят к определенным изменениям на финансовых графиках.

Литература

1. Технический анализ // Технические индикаторы [Электронный ресурс]. — 2011. — Режим доступа: <http://ta.mql4.com/ru/indicators/>. — Дата доступа: 29.09.2011.
2. Козячая, М. А. Реализация пользовательского индикатора для трехволновой теории Эллиота: в 4 т. / М. А. Козячая // Молодежь и наука: реальность и будущее: Материалы IV Международной научно-практической конференции. — Т. 4 / редкол.: О. А. Мазур, Т. Н. Рябченко, А. А. Шаохин. — Невинномысск: Невинномысский институт экономики, управления и права, 2011. — С.433–436.