

Použití technik UI v algoritmickém obchodování

Jan Škoda

Matematicko-fyzikální fakulta Univerzity Karlovy v Praze

10. března 2014



Náplň přednášky

- Motivace – burzy
- Principy burzy a její pravidla
- Challenge: představení
- Algoritmická ZOO & hodnocení
- State of the art
- Co se z UI používá nebo naopak nefunguje
- Challenge: čeho chci dosáhnout
- Nástroje
- Co jsem neřekl a co neudělám
- Směr & nápady
- Diskuze ...
- Pokud zbyde čas: smysl burzy a obchodování

Úvod do burzy

Motivace

- \$\$\$
- Zvědavost
- Agent, který umí postupně nakupovat a prodávat se ziskem
- Hodnocení:
 - Procentuelní roční výnos na historických datech
 - Minimální tzv. "dropdown"
- Stačí to?

Základní termíny

- Symboly, graf, ticky, spread, lot, index
- Pokyny: buy/long, sell/short
- Pomocné atributy: stop-loss, take-profit
- Zisk a riziko
- Indikátor

Mé cíle

- Seznámení s algoritmickým obchodováním
- State of the art
- Analýza zajímavých strategií, možná zlepšení
- Vývoj vlastní strategie
- Rozdělení práce

State of the art

Algoritmická ZOO

- MACD
- Turtle Trader
- Neuronová síť
- HFT
- ...
- Akademický výzkum?

Nástroje

- Metatrader & MQL 4,5
- Možnost napojit vlastní kód v libovolném jazyce
- Backtesting, forwardtesting, optimalizace, trénování
- Knihovny pro MQL
- Zdroje: fóra, recenze, akademické články, komunita

Plán a diskuze

Co jsem neřekl a co neudělám

- Síťová latence, zpoždění pokynu
- Backtesting: tick data
- Forwardtesting
- Fundamentální analýza
- ...?

Směr & nápady

- Sběr a analýza dalších zajímavých strategií
- Remake strategie Turtle Trader

Děkuji za pozornost.
Dotazy? Diskuze?



[MQL4/5 Community](#)



[pipcop.com fóra](#)



...