

Применение теории волн Эллиота к анализу динамики развития финансовых рынков

Выполнил:

Третьяков А.В., гр. 5304

Руководитель:

Середа А-В.И., ассистент

Актуальность работы

В работе затронута **проблема** прогнозирования развития финансовых рынков на основе исторических данных.

Актуальность работы продиктована ростом интереса частных инвесторов к финансовым рынкам.

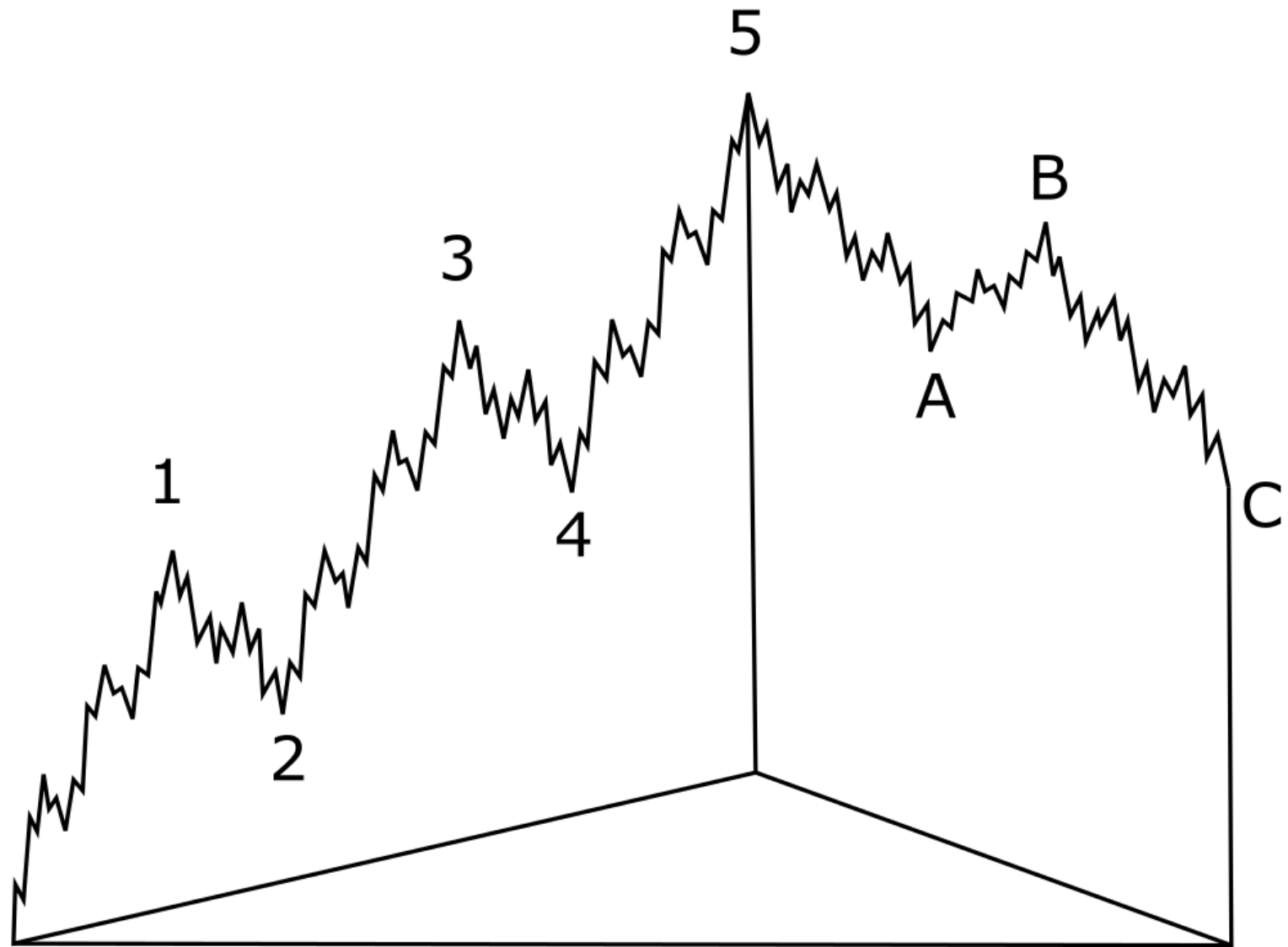
Цель и задачи

Цель: разработка программного модуля по автоматизации распознавания элементов теории волн Эллиота.

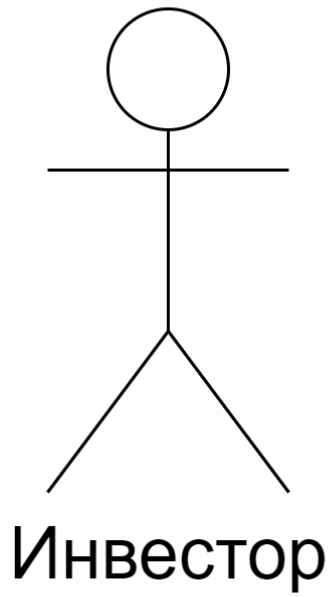
Задачи:

- Рассмотреть основы теории волн Эллиота
- Сформировать требования к модулю автоматизации
- Разработать модуль по автоматизации
- Применить решение на практике
- Сравнить с альтернативной стратегией торговли

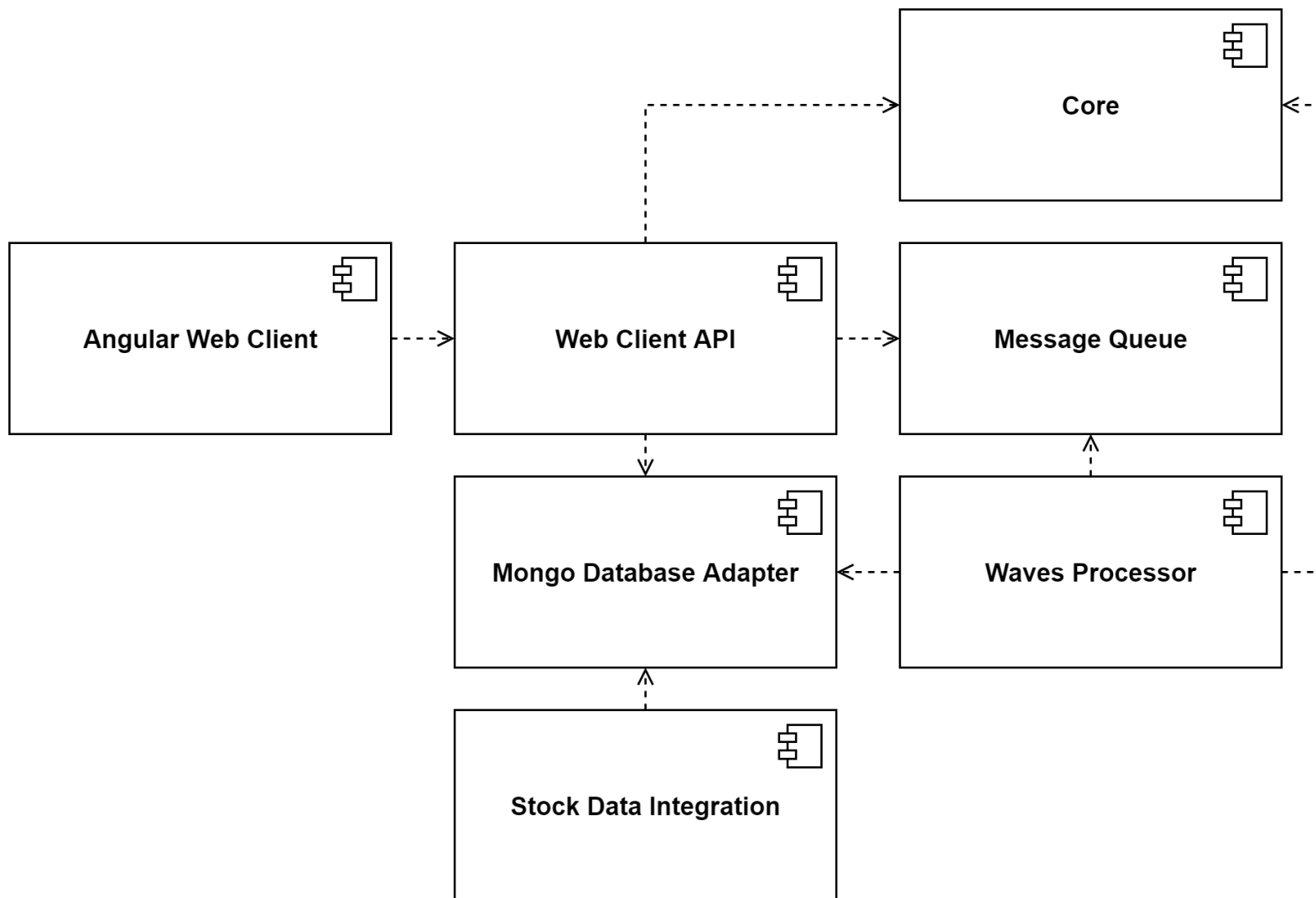
1. Теория волн Эллиота



2.



3. Реализация решения



All Stocks Bonds
Generate Waves

Ticker.

 CVX

 BBG000B9XRY4

Dec 11, 2018 → Jan 15, 2020

200m 1m 3m 6m YTD 1y ALL

• Series 1

OPEN: 103.62

HIGH: 106.94

LOW: 102.91

CLOSE: 104.21

Rank.	Name.
1	100
2	83.8
3	91.6
4	91.4
5	73.6
6	74.7
Wave.	Target. Risk.
U Impulse	136.97 110.42
U Impulse	132.38 115.7
D Impulse	118.7

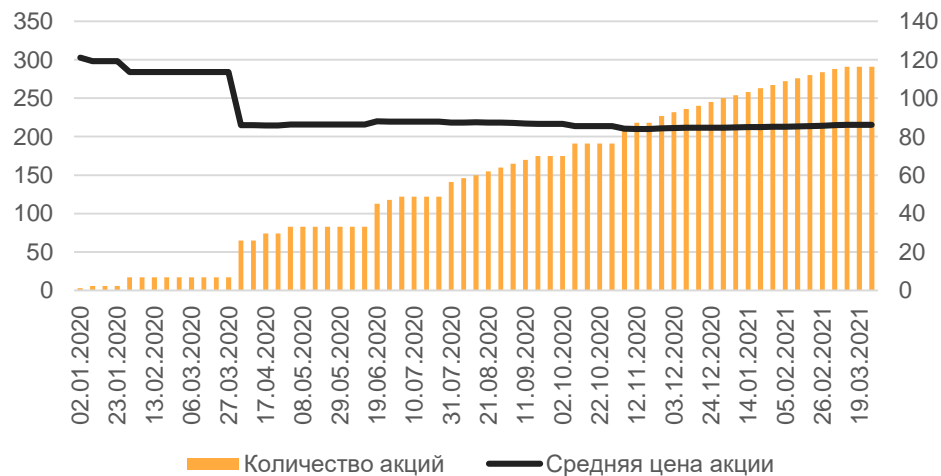
4. Применение решения на практике



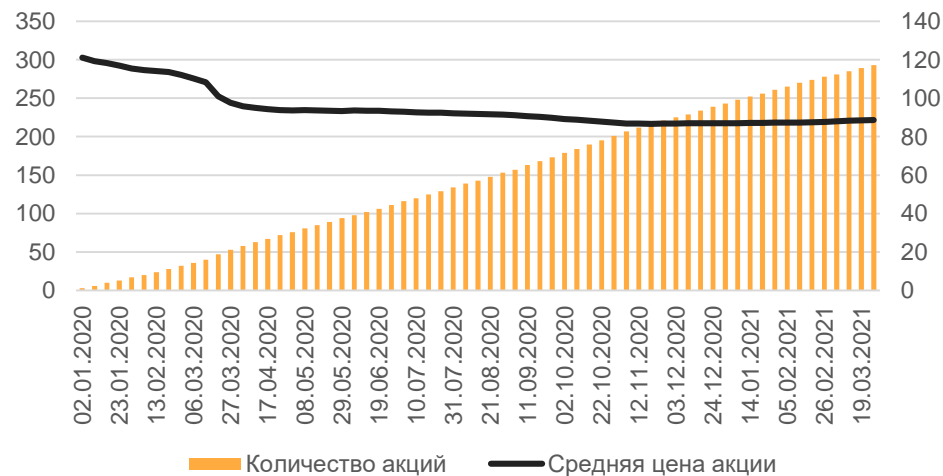
5. Сравнение с альтернативной стратегией торговли

Метод	Получено, у.е.	Потрачено, у.е.	Прибыль, у.е.
Теория волн Эллиота	31879.48	26400	5479.48
Buy & Hold	31192.84	26400	4792.84

Результаты торговли (Теория волн)



Результаты торговли (Buy & Hold)



Заключение

- В ходе работы рассмотрена теория волн Эллиота, отобраны основные элементы для автоматизации
- Реализовано приложение для автоматизации распознавания волн Эллиота
- Проведено сравнение решения с альтернативной стратегией торговли
- Последующая разработка может включать в себя ускорение процесса распознавания, повышение качества распознавания, а также проработку новых типов пользователей

Апробация

- GitHub: <https://github.com/backsapc/ew-predictor>

Применение теории волн Эллиота к анализу динамики развития финансовых рынков

Выполнил:

Третьяков А.В., гр. 5304

Руководитель:

Середа А-В.И., ассистент