

Московский Физико-Технический Институт
Факультет Аэрофизики и Космических Исследований
Кафедра Логистические Системы и Технологии

КУЗЬМИНА Антонина Ильинична

**Математическое моделирование конвейера принятия
торговых решений трейдером фондовой биржи**

ДИПЛОМНАЯ РАБОТА

Научный руководитель:

Москва, 2016

Содержание

Введение	4
Раздел 1. Постановка задач	5
1.1. Необходимые термины	5
1.2. Этапы конвейера принятия решений трейдером фон- довой биржи	7
1.3. Постановка задач	8
1.3.1. Задача поиска известного паттерна в истории котировок	8
1.3.2. Задача кластеризации в пространстве фраг- ментов историй торгов	8
1.3.3. Задача построения эффективной торговой стра- тегии	8
Раздел 2. Теоретическое введение	8
2.1. Алгоритм динамического искажения времени	8
2.1.1. Базовый алгоритм динамического искажения времени	8
2.1.2. Алгоритм derivative dynamic time warping . . .	8
2.1.3. Метрики расстояния	8
2.2. Алгоритмы кластеризации	9
2.2.1. Примеры задач кластеризации	9
2.2.2. Эвристические графовые алгоритмы класте- ризации	9
2.2.3. Статистические алгоритмы кластеризации . .	9

2.2.4. Алгоритмы иерархической кластеризации . . .	9
2.2.5. Самоорганизующиеся карты Кохонена	9
Раздел 3. Численные эксперименты	9
3.1. Поиск паттерна в истории котировок	9
3.2. Кластеризация фрагментов историй котировок	9
3.3. Построение полностью автоматизированной торговой стратегии	9
Заключение	9
Список литературы	9

Введение

Объектом исследования в данной работе является конвейер принятия решений трейдером фондовой биржи.

Основной целью данной работы является разработка математической модели конвейера принятия решений трейдером фондовой биржи, а также ее практическая реализация и проверка на реальных данных как всей моделирующей программы в целом, так и ее отдельных частей.

Работа состоит из введения, трех глав, заключения и списка литературы.

В первом разделе приведены экономические термины, необходимые для понимания работы, описаны этапы конвейера принятия решений трейдером фондовой биржи, а также приведена формальная постановка задач, рассматривающихся в работе.

Второй раздел представляет собой теоретическое введение к описанию экспериментов, проведенных в рамках данной работы. В нем описаны алгоритмы, примененные при написании программы: алгоритм динамического искажения времени (а также его модификация, алгоритм derivative dynamic time warping, и используемые метрики расстояния в пространстве историй котировок) и алгоритмы кластеризации (эвристические, статистические и иерархические методы кластеризации, а также самоорганизующиеся карты Кохонена). Приведены основные теоремы, связанные с гарантиями сходимости используемых методов.

В третьем разделе описываются результаты, полученные в ходе практической реализации алгоритмов и тестирования их на реальных исторических данных.

Раздел 1. Постановка задач

1.1. Необходимые термины

Ниже приведены определения финансовых терминов, использующиеся в работе.

Актив — некоторая сущность, которая может быть куплена или продана в любой момент времени по цене, соответствующей этому моменту времени. Цены покупки и продажи актива в один и тот же момент времени не обязаны совпадать.

Тик — сделка купли-продажи, произошедшая на бирже. Характеризуется моментом времени, ценой и объемом. Объем сделки - количество элементарных единиц актива, которые были проданы продавцом и куплены покупателем.

Свеча — элемент данных, представляющий собой консолидированную информацию об изменении цены актива в некоторый промежуток времени. Как правило, свеча включает в себя 4 величины: цену открытия интервала (цена первого тика из временного интервала), цену закрытия (цена последнего тика из временного интервала), а также максимальную и минимальную цены тиков из рассматриваемого временного интервала. Нередко также в состав свечи включают общий объем всех сделок, произошедших в течение рассматриваемого промежутка времени, однако в данной работе эта величина не используется.

Торговая система — алгоритм, совершающий сделки на бирже по определенным математическим правилам. Может иметь параметры, влияющие на поведение системы.

Сделка покупки актива — сделка по покупке-продаже актива, в которой рассматриваемая торговая система выступает в качестве покупателя.

Сделка продажи актива — сделка по покупке-продаже актива, в которой рассматриваемая торговая система выступает в качестве продавца.

Закрытая сделка — пара сделок с совпадающими объемами, состоящая из сделки по покупке актива и сделки по продаже актива.

Ряд данных — последовательность данных о цене актива за определенный промежуток времени. Как правило, включает в себя информацию обо всех свечах этого актива за данный промежуток времени.

Прибыль закрытой сделки — разность цен сделок продажи и покупки этой закрытой сделки, умноженная на объем этих сделок.

Прибыль торговой системы за некоторый интервал времени. Обозначим n общее число закрытых сделок торговой системы за рассматриваемый период. Обозначим p_i , $i = 1, \dots, n$ прибыль i -ой закрытой сделки. Тогда прибылью торговой системы называется величина $profit = \sum_{i=1}^n p_i$.

Просадка торговой системы за некоторый интервал времени. Обозначим n общее число закрытых сделок торговой системы за рассматриваемый период. Обозначим p_i , $i = 1, \dots, n$ прибыль i -ой закрытой сделки. Тогда просадкой торговой системы называется величина

$$drawdown = \max_{i=1, \dots, n} \left(\max_{k=1, \dots, i} \sum_{j=1}^k p_j - \sum_{j=1}^i p_j \right)$$

Функционал качества торговой системы — некоторая функция, характеризующая качество торговой системы. Как правило, для ее вычисления используется последовательность закрытых сделок торговой си-

стемы. Типичные примеры функционала качества — *profit* и *profit/drawdown*.

1.2. Этапы конвейера принятия решений трейдером фондовой биржи

В данной работе рассматривается трейдер фондовой биржи, принимающий торговые решения на основе фигур технического анализа. Конвейер принятия решений в этом случае включает в себя следующие этапы:

1. Поиск закономерностей фондового рынка
 - (a) Выделение типичных фигур технического анализа
 - (b) Определение информативности каждой фигуры технического анализа
2. Создание торговой стратегии
 - (a) Поиск фигур технического анализа в биржевых данных в режиме реального времени
 - (b) Принятие торгового решения и совершение сделки
 - (c) Оптимизация торговой стратегии
 - (d) Запуск автоматической торговой системы

В данной работе рассматриваются все этапы этого конвейера, однако основное внимание уделяется трем задачам: задаче поиска известного паттерна в истории котировок, задаче кластеризации в пространстве

фрагментов историй котировок и задаче автоматизированного построения эффективной торговой стратегии.

1.3. Постановка задач

1.3.1. Задача поиска известного паттерна в истории котировок

1.3.2. Задача кластеризации в пространстве фрагментов историй торгов

1.3.3. Задача построения эффективной торговой стратегии

Раздел 2. Теоретическое введение

2.1. Алгоритм динамического искажения времени

2.1.1. Базовый алгоритм динамического искажения времени

2.1.2. Алгоритм derivative dynamic time warping

2.1.3. Метрики расстояния

2.2. Алгоритмы кластеризации

2.2.1. Примеры задач кластеризации

2.2.2. Эвристические графовые алгоритмы кластеризации

2.2.3. Статистические алгоритмы кластеризации

2.2.4. Алгоритмы иерархической кластеризации

2.2.5. Самоорганизующиеся карты Кохонена

Раздел 3. Численные эксперименты

3.1. Поиск паттерна в истории котировок

3.2. Кластеризация фрагментов историй котировок

3.3. Построение полностью автоматизированной торговой стратегии

Заключение

Список литературы