

Rýnir

Arnór Barkarson	Ragnar Lárus Sigurðsson	Þórður Arnarsson	Gunnar Sveinsson
Reykjavík University	Reykjavík University	Reykjavík University	Reykjavík University
Reykjavík, Iceland	Reykjavík, Iceland	Reykjavík, Iceland	Reykjavík, Iceland
arnorbarkar@ru.is	ragnarls08@ru.is	thordura08@ru.is	gunnarsve06@ru.is



1 Summary

2 Introduction

3 Body

3.1 Bollinger bands

Bollinger bönd eru upprunalega þróuð sem greiningartól á þróun verðbréfavorða. Síðan þá hefur þessari aðferð verið beitt á ýmis vandamál með misgóðum niðurstöðum.

Bollinger bönd samanstanda af

- Miðband, N-lotu einfalt hlaupandi meðaltal (HM).
- Efra band, N-lotu staðalfrávik margfaldað með K, fyrir ofan miðbandið ($HM + K\sigma$).
- Neðra band, N-lotu staðalfrávik margfaldað með K, fyrir neðan miðbandið ($HM - K\sigma$).

Bollinger böndin nýtast því vel til þess að greina hvar í tímalínu óeðlileg hækkun eða lækkun á sér stað.

...

Útfærslan okkar byggist á því að keyra ítranir af Bollinger böndum á tímalínu með mismunandi gluggastærð, þar sem gluggastærðin er að hluta til ákvörðuð af stærð tímalínunnar. Hverri ítrun er síðan gefið ákveðið vægi miðað við gluggastærð hennar, væginu er hagað þannig að 100% vægi skiptist niður á ítranirnar.

...

4 Conclusion

5 Abstract