

3. Береза А. М. Інформаційні системи і технології в економіці: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. /А.М.Березна.— К.: КНЕУ, 2002. — 80 с.

УДК 336

О. А. Божко

Науковий керівник к.пед.н., доц. Кареліна О.В.

Тернопільський національний технічний університет ім. І. Пулюя

ВИЗНАЧЕННЯ ОПТИМАЛЬНОЇ СТРАТЕГІЇ ТОРГІВЛІ НА ВАЛЮТНОМУ РИНКУ FOREX

О. А. Bozhko

DEFINITION OF THE OPTIMAL TRADING STRATEGIES IN THE FOREIGN EXCHANGE MARKET FOREX

Сьогодні неможливо представити професійного учасника фінансового ринку, який не використовував би прогнозування в тому або іншому вигляді. Проте якість прогнозу за наявними методами в прикладних задачах вимагає подальшого покращення. Навіть за наявності великої кількості готових програмних пакетів для прогнозу курсу, їх жорсткі структурні обмеження не дозволяють отримати достовірні прогнози у мінливих обставинах сьогоdnішнього ринку [1].

Таким чином, є актуальною розробка ефективних стратегій торгівлі на міжбанківському валютному ринку Forex, який вважається одним із найбільш непрогнозованих фінансових ринків [2].

Нами була розроблена одна з таких стратегій торгівлі на основі математичних індикаторів і показана її робота за 1 цільовий тиждень. А також проаналізована її ефективність за даний часовий період.

В основі цієї системи є слідування за напрямком основного тренду, визначити який допомагають трендові індикатори, короткочасні, корекційні тенденції, їх потенціал.

В розробленій торговій системі використовуються такі індикатори: Bollinger Bands, Moving Average, ZigZagStairs. Додаткові надбудови, що використовуються для аналізу та прийняття рішення: канал лінійної регресії, сітка Фібоначчі, горизонтальні лінії підтримки/супротиву.

Кожен індикатор сам по собі не дає достатньої інформації для прийняття рішення про купівлю чи продаж валюти. Він може навіть призвести до збитковості через суб'єктивність сприйняття його «сигналів». Тому, використовуючи комплекс індикаторів, ми, так би мовити, заздалегідь відфільтруємо потенційно неприбуткові угоди. І беремо лише ті, на яких ймовірність отримати прибуток вища.

Аналіз по цій торговій системі за день виглядає наступним чином.

21.05.13

Сьогодні канал направлений вгору, але чіткого ствердження що ріст продовжиться я не маю (рисунок 1). Оскільки основний тренд у нас, як і раніше, ведмежий, сьогодні очікую імпульсний рух вниз і оновлення локальних мінімумів. Також сформувався горизонтальний рівень супротиву, що також може послугувати підтвердженням нашого рішення продавати. Альтернативний сценарій – пробиття рівня супротиву 1.5269 і рух до рівня локальних максимумів 1.5326. Але, як на мене, він менш ймовірний.

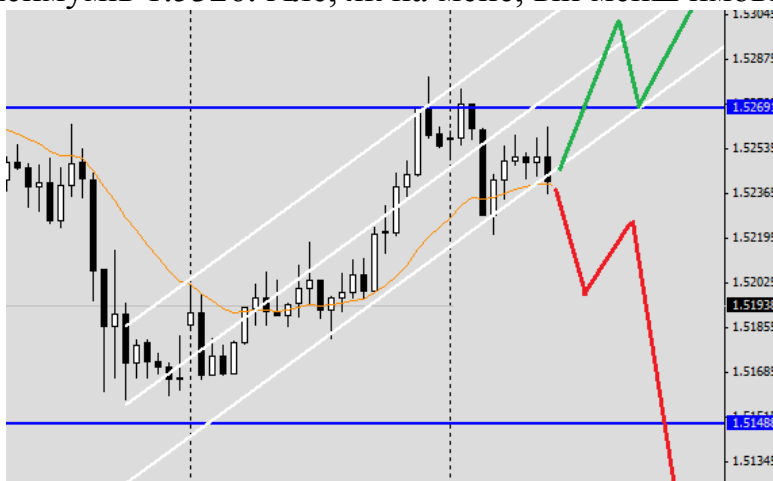


Рисунок 1. Прогноз-аналіз на 21.05.2013р.

Очікуємо підтвердження нашого рішення від ВВ на М30. Отримавши його – входимо на продаж (рисунок 2).

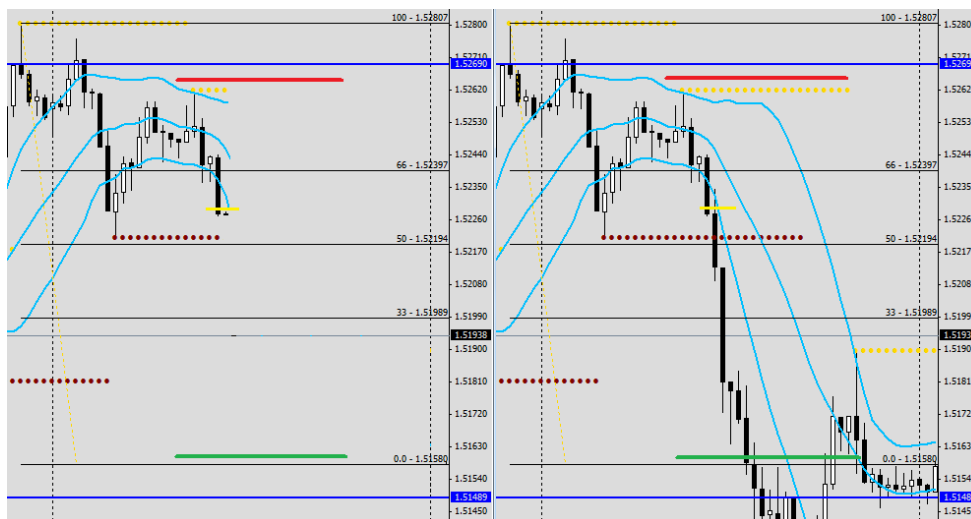


Рисунок 2. Момент входу і результат.

З урахуванням консервативного ризик-менеджменту [3] прибутковість за цей тиждень склала 8,2% початкового депозиту. Якщо взяти з урахуванням за

місяць то ці дані становлять близько 15-20% початкового депозиту. Дане значення доволі велике, що, у свою чергу, дає нам підстави вважати розроблену торгову систему достатньою для застосування в умовах реального ринку

Література:

1. Иванов Ю. "Форекс. Учебное пособие" – Москва: Омега-Л, 2005. – 230с.
2. Максимов В. «Основы успеха валютных спекуляций» - Москва, 2003. – 320с.
3. Найт Ф. «Риск, неопределенность и прибыль» - Москва, 2003. – 360 с.

УДК 658.5.012.1: 330.88

Н.М. Волоснікова

Національний технічний університет „Харківський політехнічний університет”

**ОРГАНІЗАЦІЯ ВЗАЄМОДІЇ НЕФОРМАЛІЗОВАНИХ
ІНФОРМАЦІЙНИХ ПОТОКІВ ІНТЕГРОВАНОЇ ЛОГІСТИЗАЦІЇ
ПРОЦЕСІВ НА ПІДПРИЄМСТВАХ**

N.Volosnikova

**ORGANIZATIONS COOPERATE INFORMAL INFORMATION FLOWS
INTEGRATED LOGISTICS PROCESSES IN THE ORGANIZATIONS**

При побудові моделі інтегрованої логістизації процесів на підприємствах необхідно враховувати процеси, пов'язані зі збором, обробкою та використанням інформації. У відповідності з теорією розробленої Ст. Біром [1] модель життєздатної системи це модель організаційної структури будь якої автономної системи, за умови, що вона володіє певними характеристиками. Під економічне поняття «життєздатна система» може потрапити будь-яка система, здатна підтримувати своє окреме існування в певному інституційному середовищі. Однією з основних характеристик життєздатних систем полягає в тому, що вони можуть адаптуватися до мінливих умов інституційного середовища.

З точки зору кібернетичної теорії організацій інтегровані логістизаційні процеси на підприємствах, що входять в модель життєздатної системи слід розглядати як рекурсивні – одні життєздатні системи інтегрованої логістизації процесів на підприємствах містять в собі інші життєздатні системи інтегрованої логістизації процесів на підприємствах, які можна моделювати за допомогою кібернетичних описів, ідентичних як вищестоящим, так і нижчестоящим за рівнем системи в ієрархії.