

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 87 с., 22 рис., 6 табл., 2 дод., 15 джерел.

АЛГОРИТМІЧНА ТОРГІВЛЯ, СТАТИСТИЧНИЙ АРБІТРАЖ,
АНАЛІЗ ЧАСОВИХ РЯДІВ, КОІНТЕГРАЦІЯ, СТАЦІОНАРНІСТЬ

Об'єкт дослідження – фінансові часові ряди цінних паперів.

Предмет дослідження – алгоритмічні торгові стратегії на основі явища повернення до середнього значення.

Мета роботи – проаналізувати предмет дослідження, реалізувати деякі трейдингові стратегії, провести тестування стратегій та порівняти оцінки.

Методи дослідження – методи дослідження стаціонарності: експонента Харста, доповнений тест Дікі-Фуллера; методи знаходження коінтеграції: коінтеграційний доповнений тест Дікі-Фуллера, тест Йохансена.

Актуальність – трейдингові моделі що базуються на статистичному арбітражі застосовуються для торгівлі цінними паперами на фондовому ринку як банками, так і хедж-фондами. Найпоширенішими серед них є стратегії повернення до середнього значення пари цінних паперів.

Результати роботи – було створено та протестовано на історичних даних декілька стратегій статистичного арбітражу. Виявлено, що стратегії повернення до середнього значення є прибутковими, та мають досить малі ризики.

Шляхи подальшого розвитку предмету дослідження – залучення більшої кількості цінних паперів до стратегій статистичного арбітражу, застосування стратегій для торгівлі іншими фінансовими інструментами.