

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ОДЕСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ**

Кафедра кібернетики та інформаційних технологій

(найменування кафедри)

РЕФЕРАТ
кваліфікаційної роботи
на здобуття освітнього ступеня бакалавр

зі спеціальності 6.030502 «Економічна кібернетика»
(шифр та найменування спеціальності)

за освітньою програмою
«Економічна кібернетика»
(назва освітньої програми)

на тему: *"Аналіз програмних засобів та моделювання на ринку "Forex"*

Виконавець

Студентка 4 курсу , 4 гр.

Тодорова К.С.

(прізвище, ім'я, по батькові) /підпис/

Науковий керівник

К.е.н., доцент

(науковий ступінь, вчене звання)

Гострик О. М.

(прізвище, ім'я, по батькові) /підпис/

Одеса 2019

ЗАГАЛЬНА ХАРАКТЕРИСТИКА РОБОТИ

Актуальність теми. Висока дохідність і надійність - дві основні цілі вільних грошових коштів. При цьому кожна компанія ставить питання - як правильно використати вільні грошові кошти, тому що самі по собі вони не приносять дохід. Одним із способів інвестування грошових ресурсів є фінансовий ринок. Хоча він і недостатньо надійний, але приносить певний прибуток при правильній його оцінці.

Одним з найбільш популярних фінансових ринків, нині, є його підвид - валютний ринок FOREX, річний оборот якого налічує близько 93 трлн. доларів станом на 2018. Основна ідея роботи на цьому ринку полягає в купівлі/продажу валюти. Тому прогнозування курсів валют, з метою отримання прибутку є дуже актуальною проблемою.

Мета дослідження. Основною метою кваліфікаційної роботи на отримання ступеня бакалавра є розгляд питань прогнозування співвідношення курсів валютних пар. В роботі в якості прикладу використана валютна пара GBP | USD, вибір якої пов'язано з поточною ситуацією в Великобританії. В якості інструментів прогнозування використані можливості технічного аналізу сучасних торговельних терміналів.

У роботі проведено аналіз сучасних програмних засобів, які використовуються в трейдерській практиці для виконання фундаментального та технічного аналізу і доступні на будь-яких девайсах. ,

Завдання дослідження:

- знайомство з фінансовими ринками;
- огляд програмного забезпечення і оцінка його спроможності;
- знайомство з інструментами аналізу;
- моделювання ситуації на ринку на прикладі аналізу пари GBP | USD у режимі реального часу.

Об'єктом дослідження є процеси, що відбуваються на валютному ринку "FOREX".

Предметом дослідження програмні засоби, які використовуються для торгів на ринку "FOREX".

Методи дослідження - При підготовці даної роботи були застосовані наступні методи: аналізу і синтезу, індукції і дедукції порівнянь і аналогій, а також імітаційного моделювання. Також описані два основні способи аналізу ринку, а саме фундаментальний і технічний аналізи. При цьому перший з них використано для оцінки і аналізу фінансових і виробничих показників, що дає можливість оцінити економічну сторону ринку, а другий - дозволяє виконати прогнозування зміни цін в майбутньому на підставі зміни цін у минулому. Цей вид аналізу вивчає ринок з математичної сторони. Для аналізу торговельних платформ були застосовані: експертна оцінка та ABC і XYZ аналіз.

Інформаційна база дослідження досліджень послужили дані про курси валют за період з 08.05.2019 по 17.05.2019 і законодавчі акти, монографії і навчальні посібники, пов'язані з функціонуванням валютних ринків.

Структура та обсяг роботи. Кваліфікаційна робота складається зі вступу, трьох розділів, висновків і списку використаних джерел (найменувань). Загальний обсяг роботи становить 76 сторінок. Основний зміст викладено на 72 сторінках. Робота містить 8 таблиць і 13 рисунків. Список використаних джерел складає 35.

ОСНОВНИЙ ЗМІСТ РОБОТИ

У першому розділі розглянуті теоретичні засади фінансового ринку. Освітлені та вивчені найпопулярніші фондові біржі: американські - NYSE та NASDAQ; європейські - Лондонська фондова біржа (the London Stock Exchange), Франкфуртська фондова біржа (FWB); східні - Гонконгська фондова біржа (Hong Kong Stock Exchange) та Токійська фондова біржа (Tokyo stock exchange). Розкриті особливості функціонування валютного ринку, перелічені види угод та розкрита ситуація валютного ринку в Україні.

У другому розділі описані ряд торговельних платформ, надана відповідна характеристика. За допомогою метода експертної оцінки обрана найкраща, в якості якої визначено MT5. Можна сказати, що цієї думки дотримуються всі опитані експерти. В підтвердженні отриманих результатів було використано також ABC і XYZ аналіз, показали подібні результати. Також, слід відзначити таких фаворитів як: Rumus, Zulu Trade, Mirror Trader, ActTrader, Ninja Trader та cTrader. З іншого

боку, значущість критеріїв для кожного з експертів була встановлена різна, що свідчить, що вибір торговельної платформи – це також індивідуальний підхід.

У третьому розділі нами були розглянуті основні положення ведення торгів на ринку Forex. Детально були розглянуті можливості сучасної торговельної платформи MetaTrader 5. Особлива увага була приділена технології проведення угод і загальним правилам ризик менеджменту при торгівлі на валютному ринку. В якості прикладу було реалізовано угоду по торгівлі парою GBP|USD. Для проведення торгів було використано як фундаментальні, так і технічні індикатори, які дали можливість повно визначити поточний стан співвідношення активів і отримати прибуток.

Таким чином, підбиваючи підсумки вище викладеного можна сказати, що при організації торгівлі на валютному ринку доцільно використовувати не тільки фундаментальну складову інформації про стан розвитку економіки різних країн світу, а і технічні можливості сучасних торговельних терміналів, яким є MetaTrader 5.

ВИСНОВКИ

Проведене дослідження дозволяє зробити висновки, основними з яких є такі:

- процес розподілу і перерозподілу фінансових коштів між різними секторами економіки країн світу проводиться на фінансових ринках. Одним з видів таких ринків, який впливає на цей процес, є ринок Forex. Сьогодні цей ринок можна вважати одним з найефективніших і високоліквідних фінансових ринків. Про це свідчить висока волатильність його інструментів, що сприяє активній торгівлі;

- технічним і технологічним посередником між біржею і трейдером служить торговий термінал. На сьогодні цих програмних засобів нараховується дуже багато. Тому в роботі було проведено порівняльний аналіз існуючих торговельних платформ на основі експертного оцінювання фахівців з подальшою обробкою отриманих результатів за допомогою методів оцінки та вибору альтернатив. Для цього ними було використано ABC і XYZ аналіз. В якості експертів виступили провідні аналітики фірм Weltrade, ForexClub і World Forex.

Для проведення порівняльної оцінки нами були використані такі показники:

- Інтерфейс користувача
- Обробка даних
- Графічний аналіз
- Технічний аналіз
- Сигнали
- Наявність надання новин в реальному часі
- Мова програмування
- Можливість реалізації режиму автоматичної торгівлі
- Мобільність

В результаті проведених розрахунків нами була обрана найкраща платформа, яка відповідає не тільки потребам користувачів, а стандартам, яким повинні відповідати програмні засоби такого призначення. Таким програмним продуктом виявився сучасний термінал MetaTrader 5.

- прибуток на валютному ринку можна отримати тільки за рахунок укладання угод. Тому в роботі розглянуті основні види аналізу, а саме фундаментальний і технічний, які використані в подальшому для оцінки та прогнозування валютного ринку. Перший дозволяє оцінити поточну економічну ситуацію в світі завдяки новинам, а другий надає засоби, які дозволяють спрогнозувати поведінку ринку на основі графічного зображення;

- аналіз ситуації на ринку показав, що унікального індикатора на всі випадки життя немає, тому виникає необхідність використовувати всі ці засоби в комбінації. Тому в роботі проведена оцінка існуючих інструментів платформи MetaTrader 5, з метою подальшого її використання при проведенні торгів на валютному ринку.

В якості прикладу нами була обрана валютна пара GBP|USD. Вибір саме цього інструменту було зумовлено тим фактом, що сьогодні Великобританія ніяк не може визначитися з питанням щодо Євросоюзу. А цей факт істотно впливає на волатильність цього інструменту. В експерименті були використані такі індикатори, як Alligator, RSI, MACD, Moving Average і Fractal Adaptive, Moving Average і Лінії Фібоначчі.

Результати моделювання показали, що всі інструменти правдоподібно підтвердили стан ринкової тенденції, хоча кожен з них має певні позитивні і

негативні характеристики. Так реалізація угоди на DEMO рахунку при продажу по інструменту GBP / USD дозволила при лоті \$1 заробити \$3638 за термін з 8 -17 травня 2019 року.

Таким чином отримані результати дозволяють зробити висновок про те, що для більш зручної та більш прибуткової роботи на валютному ринку Forex доцільно використовувати сучасні торгові термінали, яким є MetaTrader 5. Ця платформа має досить багато вбудованих технічних інструментів, як індикаторів, так і радників(роботів), користуючись якими можна досягти бажаних результатів - отримати прибуток при торгівлі на фінансових і валютних ринках.

Підсумовуючи вищесказане слід відмітити такі положення:

- ринок Forex - один з найефективніших і високоліквідних фінансових ринків;
- при здійсненні торгівельних операцій на валютному ринку доцільно використовувати технологічну платформу MetaTrader 5, як має гнучкий інтерфейс і відповідає сучасним потребам користувачів в частині наявності робочих інструментів;
- для проведення комплексної оцінки стану валютного ринку необхідно використовувати такі основні види аналізу, як фундаментальний та технічний;
- в якості практичної реалізації запропонованих положень і на підставі моделювання ситуації на валютному ринку по оцінці стану та перспектив розвитку валютної пари GBP|USD, можна стверджувати про ефективність обраних нами засобів. Це підтверджується прибутком, який було отримано в результаті експерименту(\$3638 за тиждень торгів).