

Zastosowanie metod mechanicznych analizy technicznej do optymalizacji transakcji na rynku walutowym

Zagadnienie przewidywania ruchów cen na rynkach finansowych jest niezwykle trudnym i złożonym procesem. Analiza techniczna jest, obok analizy fundamentalnej, najczęściej stosowanym narzędziem. W ramach tejże analizy techniki przewidywania zachowań rynku można podzielić na metody klasyczne (formacje, linie trendu, kanały itd.), uznaniowe (teoria Elliotta) i mechaniczne.

W pracy niniejszej zastosowano metody mechaniczne analizy technicznej do wyznaczania momentów zawierania transakcji na polskim rynku walutowym dla walut: euro, dolar amerykański, frank szwajcarski. Jako dane w obliczeniach wykorzystano kursy dzienne walut obcych podawane przez NBP w latach 2001–2008. Celem analizy był wybór metody i określenie jej parametrów, aby zysk z inwestycji w walutę osiągał wartość maksymalną. W trakcie optymalizacji sprawdzono średnie proste, średnie ważone oraz średnie wyrównane wykładniczo w dwóch metodach generacji sygnałów kupna i sprzedaży, tj. metodzie pojedynczej średniej i metodzie dwóch średnich. W obu metodach sprawdzono także zastosowanie filtrów mających na celu eliminację fałszywych sygnałów kupna i sprzedaży.

Uzyskane wyniki dla trzech analizowanych walut wskazywały metodę dwóch średnich prostych jako metodę optymalną.