

Джеффри Оуэн Кац, Донна Л. МакКормик

Энциклопедия торговых стратегий/Пер. с англ. — М.: Альпина Паблишер,
2002. — 400 с.

ОГЛАВЛЕНИЕ

Предисловие.....	9
Введение.....	11
Что такое полностью механическая торговая система?.....	12
Какие входы и выходы считать оптимальными?.....	13
Научный подход к разработке систем.....	15
Материалы и методы, необходимые для научного подхода.....	16
Часть I. Рабочие инструменты.....	19
Введение.....	19
Глава 1. Данные.....	21
Виды данных.....	21
Временные масштабы данных.....	23
Качество данных.....	25
Поставщики и источники данных.....	29
Глава 2. Симуляторы.....	32
Виды симуляторов.....	32
Программирование симулятора.....	32
Выходные данные симулятора.....	34
* Эффективность симулятора.....	41
Надежность симуляторов.....	45
Выбор правильного симулятора.....	45
Симуляторы, использованные в этой книге.....	46
Глава 3. Оптимизаторы и оптимизация.....	47
Что делают оптимизаторы.....	47
Как используются оптимизаторы.....	48
Виды оптимизаторов.....	49
Как потерпеть неудачу при оптимизации.....	59
Как достичь успеха при оптимизации.....	62
Альтернативы традиционной оптимизации.....	65
Инструменты и информация для оптимизации.....	66
Какой оптимизатор подходит вам?.....	68
Глава 4. Статистика.....	69
Зачем нужен статистический анализ при оценке торговых систем?.....	70
Выборка.....	71
Оптимизация и подгонка под исторические данные.....	72
Размер выборки и репрезентативность.....	75
Статистическая оценка системы.....	75
Другие статистические методы и их использование.....	84
Заключение.....	87
Часть II. Исследование входов в рынок.....	89
Введение.....	89
Что является хорошим входом?.....	89

Приказы, используемые во входах.....	90
Методы входа, рассмотренные в этой книге.....	92
Стандартизованные выходы.....	96
Стандартизация долларовой волатильности.....	97
Портфель и платформа для стандартного тестирования.....	101
Глава 5. Модели, основанные на пробоях.....	103
Виды пробоев.....	ЮЗ
Характеристики пробоев.....	104
Тестирование моделей, основанных на пробое.....	106
Входы на пробое канала.....	106
Пробои максимального максимума/минимального минимума.....	114
Входы на пробое волатильности.....	118
Вариации системы пробоя волатильности.....	122
Анализ и обобщения.....	126
Заключение.....	129
Что мы узнали?.....	130
Глава 6. Модели, основанные на скользящих средних.....	131
Что такое скользящее среднее?.....	131
Зачем нужны скользящие средние.....	131
Проблема запаздывания.....	132
Виды скользящих средних.....	133
Виды моделей с входом, основанным на скользящем среднем.....	135
Характеристики входов, основанных на скользящих средних.....	136
Приказы, используемые для осуществления входов.....	137
Методология тестирования.....	137
Тесты моделей, следующих за трендом.....	142
Тесты противотрендовых моделей.....	148
Заключение.....	154
Что мы узнали?.....	155
Глава 7. Входы на основе осцилляторов.....	157
Что такое осциллятор?.....	157
Виды осцилляторов.....	157
Получение сигналов входа при помощи осцилляторов.....	160
Характеристики входов на основе осцилляторов.....	163
Методика тестирования.....	163
Результаты тестов.....	168
Тестирование моделей, основанных на понятии перекупленности/перепроданности.....	168
Тесты моделей, основанных на расхождении.....	172
Суммарный анализ.....	175
Заключение.....	177
Что мы узнали?.....	177
Глава 8. Сезонность.....	178
Что такое сезонность?.....	178
Формирование сезонных входов.....	180

Характеристики сезонных входов.....	182
Виды приказов, используемых для осуществления сезонных входов. . .	183
Методология тестирования.....	183
Результаты тестов.....	191
Заключение.....	203
Что мы узнали?.....	204
Глава 9. Лунные и солнечные ритмы.....	205
Безумие или закономерность?.....	205
Лунные циклы и торговля.....	207
Сигналы входа на основе лунного цикла.....	207
Методология тестирования лунных моделей.....	209
Обзор результатов.....	222
Заклучение.....	222
Солнечная активность и торговля.....	223
Входы, основанные на солнечной активности.....	223
Результаты тестирования солнечных моделей.....	224
Заклучение.....	227
Что мы узнали?.....	227
Глава 10. Входы на основе циклов.....	229
Обнаружение циклов с использованием МЕЗА.....	229
Обнаружение циклов при помощи групп фильтров.....	230
Фильтры Баттеруорта.....	232
Волновые фильтры.....	233
Получение циклических торговых сигналов входа с использованием групп фильтров.....	239
Характеристики циклических входов.....	239
Методология тестирования.....	240
Результаты тестирования.....	245
Заклучение.....	250
Что мы узнали?.....	251
Глава 11. Нейронные сети.....	252
Что такое нейронные сети?.....	252
Нейронные сети в торговле.....	255
Прогнозирование с помощью нейронных сетей.....	255
Входы на основе нейронной сети.....	256
Модель на обращенном во времени Медленном %K.....	257
Модели на основе точки разворота.....	265
Результаты торговли для всех моделей.....	269
Обзор результатов.....	276
Заклучение.....	281
Что мы узнали?.....	281
Глава 12. Генетические алгоритмы.....	283
Что такое генетические алгоритмы?.....	283
Развитие моделей входа, основанных на правилах.....	284
Эволюционный поиск модели входа.....	285

Методология тестирования.....	288
Результаты тестов.....	294
Заключение.....	305
Что мы узнали?.....	305
Часть III. Исследование выходов.....	307
Введение.....	307
Важность стратегии выхода.....	307
Цели хорошей стратегии выхода.....	308
Виды выходов, используемых в стратегии выхода.....	309
Принципиальные моменты при выходе из рынка.....	315
Тестирование стратегий выхода.....	318
Стандартные входы для тестирования выходов.....	318
Глава 13. Стандартная стратегия выхода.....	321
Что такое стандартная стратегия выхода?.....	321
Характеристики стандартного выхода.....	321
Цель тестирования ССВ.....	322
Тесты исходной ССВ.....	323
Тестирование модифицированной ССВ.....	329
Результаты тестирования.....	333
Заключение.....	336
Что мы узнали?.....	336
Глава 14. Улучшения стандартной системы выхода.....	337
Назначение тестов.....	337
Тестирование модели с фиксированной защитной остановкой и целевой прибылью.....	339
Тестирование динамических защитных остановок.....	344
Тестирование целевой прибыли.....	353
Тестирование расширенного ограничения времени удержания позиции.....	356
Сравнение результатов наилучшей стратегии выхода на различных рынках.....	358
Заключение.....	358
Что мы узнали?.....	360
Глава 15. Сочетание выходов с искусственным интеллектом.....	361
Методология тестирования нейронного компонента стратегии выходов.....	362
Результаты тестирования нейронного выхода.....	365
Методология тестирования генетического компонента выходов.....	367
Заключение.....	376
Что мы узнали?.....	376
Заключение.....	377
Ссылки и рекомендуемая литература.....	389