Export z OBD dne 10.01.2011

Pořadové číslo: 1/2

Literární forma:	D_Článek ve sborníku
Titul (v originále):	Automatizované obchodní systémy - optimalizace interakce s prostředím trhu při obchodování s komoditami
Rok publikace:	2010
Autor:	Tučník Petr Mgr. (KP-2410, KA-95453, MP-100)
Název zdroje:	Kognice a umělý život X
Místo publikace:	Opava
ISSN-ISBN:	978-80-7248-589-5
Vydavatel:	Slezská univerzita
Místo konání:	Ostravice
Vydání:	2010
Strany:	381-384
Abstrakt orig.:	Automatizované obchodní systémy slouží k podpoře rozhodování při obchodních rozhodnutích nebo autonomnímu (samostatnému) obchodování. Kritickou fází obchodování je identifikace obchodních příležitostí a správné načasování vstupu a výstupu z trhu. K tomuto účelu jsou využívány indikátory technické analýzy. Příspěvek se zabývá problematikou optimalizace využití vybraných signálů technické analýzy v automatizovaných obchodních systémech v různých typech tržního prostředí, lišícího se volatilitou (kukuřice, ropa). Práce bude zaměřená na prostředí komoditních trhů, ale výsledky jsou do velké míry aplikovatelné i v jiných typech tržního prostředí, např. u akciových trhů apod.
Abstrakt čes.:	Automatizované obchodní systémy slouží k podpoře rozhodování při obchodních rozhodnutích nebo autonomnímu (samostatnému) obchodování. Kritickou fází obchodování je identifikace obchodních příležitostí a správné načasování vstupu a výstupu z trhu. K tomuto účelu jsou využívány indikátory technické analýzy. Příspěvek se zabývá problematikou optimalizace využití vybraných signálů technické analýzy v automatizovaných obchodních systémech v různých typech tržního prostředí, lišícího se volatilitou (kukuřice, ropa). Práce bude zaměřená na prostředí komoditních trhů, ale výsledky jsou do velké míry aplikovatelné i v jiných typech tržního prostředí, např. u akciových trhů apod.
Abstrakt angl.:	Automated trading systems are used for decision support in business decisions or autonomous (user-independent) trading. The identification of business opportunities and timing of entry and exit to/from market is essential phase of trading. Indicators of technical analysis are used for this purpose. This paper is focused on area of optimization of selected technical analysis signal application in automated trading systems in

	different types of market environment, differentiated mainly by volatility (corn, oil). The work is focused on commodity markets, but results are applicable in other types of market environment as well, e.g. stock market trading, etc.
Rozsah:	4
Balení:	brožovaný
Typ dokumentu:	IN
CODN:	CST
Médium:	papír, dat. soubor
Uložení:	kancelář
Hlavní klíč:	automatizované obchodní systémy, technická analýza, komodity
Vedlejší klíč:	automated trading systems, technical analysis, commodities
Jazyk:	cze
Titul česky:	Automatizované obchodní systémy - optimalizace interakce s prostředím trhu při obchodování s komoditami
Titul anglicky:	Automated Trading Systems - Optimization of Interaction with Market Environment in Commodity Trading
Datum konání:	20100531
Projekt:	GA402/09/0662

Pořadové číslo: 2/2

Literární forma:	D_Článek ve sborníku
Titul (v originále):	Optimization of Automated Trading System`s Interaction with Market Environment
Rok publikace:	2010
Autor:	Tučník Petr Mgr. (KP-2410, KA-95453, MP-100)
Název zdroje:	Perspectives in business informatics research : 9th international conference, BIR 2010
Místo publikace:	Heidelberg
ISSN-ISBN:	978-3-642-16100-1
Vydavatel:	Springer
Místo konání:	Rostock, Německo
Strany:	55-61
Abstrakt orig.:	This paper is focused on the automated trading systems (ATS) design and optimization. In a preparation phase before use, an optimization of interaction of such systems with its intended market environment should be done. The technical analysis indicators are most frequently used in ATS. Optimization is done by testing of different settings of MACD indicator and optimal settings depend heavily on market parameters. The intended use of the ATS is to perform its activity independently to some extend (depending on user`s preferences). The main aim is to enhance automated trading system performance, in order to improve its usefulness and acceptability for the user. Paper will be focused on futures markets only (Chicago and New York), but results are applicable to other areas of trading as well.
Abstrakt čes.:	Příspěvek je zaměřen na návrh a optimalizaci automatizovaných obchodních systémů (AOS). Před použitím by v rámci přípravné fáze měla být prováděna optimalizace takových systémů vždy před použitím v zamýšleném tržním prostředí. Indikátory technické analýzy jsou nejčastěji používaným nástrojem v AOS. Optimalizace je prováděna testováním rozdílných nastavení MACD indikátoru, přičemž optimální nastavení silně závisí na parametrech trhu. Zamýšlené použití AOS je do jisté míry autonomní (v závislosti na preferencích uživatele). Hlavním cílem je zvýšit efektivitu AOS a dosáhnout tak vyšší užitečnosti a přijatelnosti pro uživatele. Příspěvek se zaměřuje pouze na obchodování s termínovanými kontrakty (Chicago a New York), ale výsledky jsou aplikovatelné také do jiných oblastí obchodování.
Abstrakt angl.:	This paper is focused on the automated trading systems (ATS) design and optimization. In a preparation phase before use, an optimization of interaction of such systems with its intended market environment should be done. The technical analysis indicators are most frequently used in ATS. Optimization is done by testing of different settings of MACD indicator and optimal settings depend heavily on market parameters. The

	intended use of the ATS is to perform its activity independently to some extend (depending on user`s preferences). The main aim is to enhance automated trading system performance, in order to improve its usefulness and acceptability for the user. Paper will be focused on futures markets only (Chicago and New York), but results are applicable to other areas of trading as well.
Rozsah:	6
Typ dokumentu:	IN
CODN:	WRD
Médium:	papír, dat. soubor
Uložení:	kancelář
Hlavní klíč:	automatizovaný obchodní systém, komodity, futures, trading
Vedlejší klíč:	automated trading system, commodities, futures, trading
Jazyk:	eng
Titul česky:	Optimalizace interakce automatizovaného obchodního systému s tržním prostředím
Titul anglicky:	Optimization of Automated Trading System`s Interaction with Market Environment
Datum konání:	20100929
Projekt:	GA402/09/0662