

## **Niekooperacyjne systemy transakcyjne dla rynku Forex**

**dr Przemysław Juszcuk**

**Instytut Badań Systemowych Polskiej Akademii Nauk**

**Zakład Wspomagania Decyzji w Warunkach Ryzyka**

**Streszczenie:** Obecnie obserwuje się stale rosnący wzrost znaczenia systemów transakcyjnych dla dynamicznych rynków, takich jak rynek forex. Jest to związane z dużą liczbą instrumentów dostępnych dla inwestorów. W szczególności popularność zyskują transakcyjne systemy regułowe, w których reguły bazują na wskaźnikach analizy technicznej. Ze względu jednak na jednokryteriove oceny zestawów wskaźników rynkowych dostarczane przez aktualnie używane systemy transakcyjne, użytkownik systemu otrzymuje jedną, najlepszą (z punktu widzenia pojedynczego kryterium) rekomendację.

Na seminarium przedstawiona zostanie autorska koncepcja rozszerzenia transakcyjnych systemów regułowych bazująca na podejściu wielokryterialnym pozwalającym uzyskać pewną pulę rozwiązań dla decydenta znajdujących się na froncie Pareto. Proces podejmowania decyzji wspomagany będzie przez mechanizmy znane z teorii gier niekooperacyjnych, ze szczególnym uwzględnieniem równowagi Nasha.