



OS ENGINE INDEX

ООО «ВАН ТЕХНОЛОГИИ»

Общие сведения.

В данном документе представлен обзор программного продукта, с названием «Os Engine Index Arbitrage». Курс рассчитан для начинающих программистов.

В состав продукта входят:

- 1) Программное обеспечение в виде скриптов для терминала OsEngine.
- 2) Видео для самообучения о том, как делать предоставленных роботов.

Что потребуется для прохождения курса (минимальные требования к оборудованию и техническим средствам для запуска программ):

- Знание основ программирования (C#).
- Умеете работать в Visual Studio.
- Знакомы с OsEngine: можете самостоятельно скачать проект с GitHub, скачать исторические данные, умеете работать с позициями, свечами, индикаторами.
- Персональный компьютер на основе линейки процессоров Intel, не ниже 10го поколения.
- Размер оперативной памяти на компьютере не менее 16 гигабайт.
- Свободное место на жёстком диске в размере не менее 50 гигабайт.
- Операционная система Windows не ниже десятой версии, установленная как основная операционная система на персональном компьютере.
- Интернет браузер Гугл-Хром, установленный на Windows.
- Текстовый редактор Microsoft Word.
- Подключение к сети интернет.

Программы, доступные в продукте:

- 1) MultiExchangePairArbitrageOnTheIndexModern.cs
- 2) MultiOneLegArbitrageInTrendModern.cs
- 3) MultiOneLegArbitrageMeanReversionModern.cs
- 4) TrendPackageOnIndex.cs
- 5) IndexArbitrageClassicModern.cs

Теория.

1. Индексы. Знакомство. Как их строить, как налаживать автоматическое взвешивание.
2. Переменные. Корреляция, Коинтеграция, Волатильность. Стадии волатильности инструментов и индексов.
3. Данные. Правильная упаковка данных для тестирования различных типов арбитражей.

Практика.

1. Обзор источника «BotTabIndex» и архитектуры слоя создания стратегий на индексе. Обзор кода всех бесплатных роботов для индексного арбитража, которые есть в проекте.
2. Скрипт. Одноногий индексный арбитраж на схождение к среднему. Теория, обзор кода, тесты. Из коробки > 0.3% на сделку. Крипта.
3. Скрипт. Одноногий индексный арбитраж в тренд. Теория, обзор кода, тесты.
4. Скрипт. Торговля пакетом ускоряющихся бумаг с широкого рынка при сигналах с индекса. Теория, обзор кода, тесты. Из коробки > 1.1 % на сделку. MOEX SPOT.

5. Скрипт. Мультибиржевой парный трейдинг от индекса для Market Making бирж криптовалют. Теория, обзор кода, тесты. Скрипт сделан в многопоточном ключе, одновременно поддерживает до 10 различных бирж, доп визуализация – Таблица Бид/Аск с разных бирж, позиция и профит.

6. Скрипт. Классический индексный арбитраж, торговля двумя пакетами инструментов друг против друга по коинтеграции и корреляции. + многопоточное исполнение для боевой торговли и вход/выход Айсбергами. Теория, обзор кода, тесты.