



INDEX ONE LEG ARBITRAGE

RESEARCH

2024

ООО «ВАН ТЕХНОЛОГИИ»

Общие сведения.

В данном документе представлен обзор программного продукта, с названием «Index One Leg Arbitrage» («Индексный одноногий арбитраж»). Курс рассчитан для начинающих программистов и людей без знания программирования.

В состав продукта входят:

- 1) Программное обеспечение в виде скрипта для терминала OsEngine.
- 2) Блок-схемы работы скрипта.
- 3) Видео для самообучения тому, как работает скрипт, что означают его настройки.

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

1. Персональный компьютер на основе линейки процессоров Intel, не ниже 10го поколения.
2. Размер оперативной памяти на компьютере не менее 16 гигабайт.
3. Свободное место на жёстком диске в размере не менее 50 гигабайт.
4. Операционная система Windows не ниже десятой версии, установленная как основная операционная система на персональном компьютере.
5. Интернет браузер Гугл-Хром, установленный на Windows.
6. Текстовый редактор Microsoft Word.
7. Подключение к сети интернет.
8. Программа Diagramm Designer.

Программа (скрипт), доступные в продукте:

- 1) VolatilityMathBathArbitrage.cs

Модуль 1. Теория.

1. Загрузка OsEngine с ГитХаб и подгрузка исторических данных для дальнейшего тестирования.
2. Переменные, которые нужно понимать для исследований в области арбитражей. Волатильность, корреляция, коинтеграция.
3. Источники данных: BotTabScreener, BotTabIndex. Их визуал.
4. Взвешивание индекса. Академические варианты. Знакомство с формулами взвешивания индексов и их настройки в интерфейсах OsEngine.

Модуль 2. Стратегия.

1. История модификации алгоритма нашей командой.
2. Алгоритм распределения бумаг по торговым модулям.
3. Алгоритм распределения торгуемых объёмов по бумагам.
4. Алгоритм снятия сигналов для бумаг внутри модулей. И алгоритмы закрытия позиций.
5. Алгоритм делистинга снятых с торгов бумаг.
6. Итоговая логика работы робота. Тестирование.

Модуль 3. Реальная торговля.

1. Вводные, которые нужно знать про OsEngine и его функционирование в реальных торгах.
2. Трагедии алготрейдеров. Как не впасть в FOMO, нарушение рисков и торговлю не робастными стратегиями.
3. Варианты запуска робота.
4. Запуск робота с нуля в продакшен из материалов данного курса.