



SYMPHONY RESEARCH 2024

ООО «ВАН ТЕХНОЛОГИИ»

1. Общие сведения

В данном документе представлен обзор программного продукта, с названием «Symphony».

В состав продукта входят:

- 1) Программное обеспечение в виде скрипта для терминала OsEngine.
- 2) 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.

Программа (скрипт), доступная в продукте:

- 1) Symphony.cs

Модуль 1. Теория.

- 1) Загрузка OsEngine с ГитХаб и подгрузка исторических данных для дальнейшего тестирования.
- 2) Переменные, которые нужно понимать для исследований. Волатильность, корреляция.
- 3) Источники данных: BotTabScreener, BotTabIndex. Их визуал.
- 4) Взвешивание индекса. Академические варианты. Знакомство с формулами взвешивания индексов и их настройки в интерфейсах OsEngine.
- 5) Различные подходы к распределению бумаг по стадиям волатильности.

Модуль 2. Стратегия.

- 1) История модификации алгоритма нашей командой.
- 2) Тестер и настройка лотности бумаг. Подключение скриптов к OsEngine.
- 3) Алгоритм распределения бумаг по стадиям волатильности.
- 4) Алгоритм распределения торгуемых объёмов по бумагам.
- 5) Алгоритм делистинга снятых с торгов бумаг.
- 6) Типы ордеров в алгоритме.
- 7) Стандартные фильтры.
- 8) Импульсная ветка логики.
- 9) Пробойная ветка логики.
- 10) Третья ветка логики.
- 11) Тесты за 10 лет истории.

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) Запуск робота с нуля в продакшен из материалов данного курса.