

Основные принципы арбитража

Границы применимости технического анализа

Рыночно-нейтральные стратегии

Арбитраж

Виды арбитража

Классический временной арбитраж

Географический (горизонтальный) арбитраж

Статистический арбитраж

Парный трейдинг

Парные опционы

Зачем нужна роботизация?

Зачем нужен скоринг?

Сервис "Арбитраж"

Скоринг

Выбор инструментов

Тайм-фрейм

Расширенные параметры скоринга

Соотношение плеч и типы арбитража

Соотношение плеч

Режим "Эконом"

Тип арбитража

Только разницы

Количество зон на весь диапазон 50

Фильтр инструментов для скоринга

Фьючерсы

Акции

Корзины

Задание весов для критерия скоринга

Скоринг арбитражных пар

Результаты скоринга пар

Описание показателей

Скоринг базовых инструментов

Анализ графика базиса

Для объемов

Для боковых

Отслеживать последние значения инструментов

Текущее значение показателей

Определение точки входа

Рекомендуемое значение

Географический (горизонтальный) арбитраж

Торговля волатильностью базиса, основанного на активе, размещенном на разных торговых площадках. Целесообразно использовать при большом объеме капитала.

Границы применимости технического анализа

Легче заработать, продавая торговые системы, чем используя торговые системы на рынке. Использование торговых систем становится более эффективным, если, вместо торговли отдельными активами, перейти на торговлю волатильностью базиса скоррелированных активов.

Для боковых

Выравнивание плеч по скользящей средней: позволяет торговать около средней линии (важно для торговли волатильностью базиса)

Для объемов

Выравнивание плеч по объему: например, при торговле по тренду

Задание весов для критерия скоринга

Выставлены рекомендуемые значения

Зачем нужен скоринг?

Скоринг - это автоматизированная процедура подбора и ранжирования пар активов для статистического арбитража. Потребность в этой, очень трудоемкой, процедуре объясняется ее важностью для получения требуемого уровня доходности при определенном риске и вложенном капитале.

Зачем нужна роботизация?

Необходимо быстро, без проскальзывания, войти в позицию двумя плечами одновременно.

Классический временной арбитраж

Торговля волатильностью базиса, основанного на акции и ее фьючерсе
Обобенности: 1. Минимальный риск (в день экспирации цена фьючерса = цене акции) 2. Низкий доход (крупные игроки не допускают большой волатильности базиса) Целесообразно использовать при большом объеме капитала Оценка доходности: 15-20 %

Описание показателей

Описание, пока, отсутствует

Определение точки входа

Рассмотрим поведение базиса на истории. Выберем период 1-2 года (15 мин. тайм-фрейм). 1. Определим текущее положение базиса по отношению к историческим максимумам и минимумам. 2. Определим перспективу движения базиса к середине диапазона на основе скоринга базовых инструментов данной пары 3. Вход в позицию после отскока базиса от границы диапазона на уровне второй скользящей средней (первая с тайм-фреймом = 1280 (месячная), вторая = 190)

Отслеживать последние значения инструментов

Можно включить отслеживание текущего значения базиса

Парные опционы

Довольно низкая ликвидность, рынок подвержен манипуляциям

Парный трейдинг

Парный трейдинг - торговля волатильностью базиса, основанного на двух разных активах

Скоринг базовых инструментов

Используем скоринг базовых инструментов для определения перспективы изменения их пары: на графиках активов определяем, находятся ли они на границах своих диапазонов и куда могут двигаться. Из этих движений отдельных активов, оцениваем возможное изменение их базиса. Если есть перспектива движения у базиса в сторону середины диапазона, определяем точку входа.

Статистический арбитраж

Торговля волатильностью базиса активов с высоким коэффициентом корреляции. При статистическом арбитраже принципиально важным является скоринг: выбор пары скоррелированных активов, отвечающих требованиям по необходимому капиталу, риску и доходности. Оценка доходности: 20-30 % (но может быть существенно выше, за счет эффективного скоринга и оптимизации стратегии)

Текущее значение показателей

Показывает гистограмму распределения базиса (можно оценить вероятность движения базиса за границу диапазона)

Только разницы

Наиболее безопасный тип арбитража, рекомендуемое значение

Фьючерсы

Рекомендуемое значение