

Функциональные характеристики экземпляра ПО «Arbitrage MOEX / Арбитраж MOEX»

Цели и задачи платформы

Платформа предназначена анализа сделок и котировок финансовых инструментов в формате L2 orderbook.

Прогноз может быть использован как для ручной, так и для автоматической торговли. ПО «Arbitrage MOEX / Арбитраж MOEX» настроено на анализ инструментов ПАО Московская Биржа.

Платформа позволяет решать задачи:

- прогноз цен скоррелированных финансовых инструментов на ближайшие 5 секунд
- расчет статистических параметров связей между скоррелированными инструментами
- прогноз ценовых уровней выгодных для выставления биржевых котировок
- расчет объемов транзакций оптимальных с точки зрения соотношения между потенциальной доходностью и риском
- данные расчётных ценовых котировок аккумулируются и впоследствии могут быть использованы для сравнения с данными реальной торговой сессии

Затрачиваемые ресурсы для работы

- сервер с Unix-дистрибутивом

Для компиляции требуется:

Процессор	Не менее 4 ядер, частота не менее 2GHz
Оперативная память	Не менее 4 ГБ
Дисковое пространство	Не менее 2 ГБ. Размер дискового пространства для запуска ПО зависит от размера обрабатываемых данных
Операционная система	Ubuntu 20.04

- для экспертной проверки организован удалённый доступ до сервера с тестовыми данными

Вводная информация

В качестве вводной информации ПО использует биржевую информацию (добавление, изменение и удаление заявок, сделки), обработанную в соответствии с заданным форматом. Для экспертной проверки на сервере организован доступ до биржевой информации за май 2023 года в заданном формате.

Выводная информация

В качестве выводной информации ПО возвращает текущее предсказание цены в зависимости от настроек предсказателя и переданных ранее данных. Версия ПО, сконфигурированная для экспертной проверки, предоставляет в табличном виде все значения ценовых предсказаний за указанный день.