Арбитражная стратегия торговли

NEO/USD/BTC

Оглавление

[Определения и необходимые вводные 3](#_Toc505088230)

[Условие входа-выхода 4](#_Toc505088231)

[Условие масштабирования 5](#_Toc505088232)

[Значения параметров стратегии 6](#_Toc505088233)

[Пример логов по результатам одной сделки 6](#_Toc505088234)

[Дополнительные параметры 7](#_Toc505088235)

# Определения и необходимые вводные

– цена по валютной паре NEO/USD на бирже BITFINEX в момент времени

– цена по валютной паре NEO/BTC на бирже BITFINEX в момент времени

– цена по валютной паре BTC/USD на бирже BITFINEX в момент времени

– расчетная цена NEO/BTC в USD на бирже BITFINEX в момент времени :

– спред (отношение) стоимости NEO/USD и NEO/BTC/USD в момент времени :

– верхняя граница входа в сделку (условие)

– верхняя граница выхода из сделки (условие)

– нижняя граница входа в сделку (условие)

– нижняя граница выхода их сделки (условие)

– размер спреда в момент последнего входа в сделку или масштабирования

– доступный торговый баланс

– доля торгового баланса для входа в сделку, %

– доля торгового баланса для увеличения позиции в сделке, %

– параметр увеличения позиции в сделке, %

# Условие входа-выхода

Условие входа в сделку 1:

Открываем короткую позицию USD/NEO и длинную позицию NEO/BTC.

Размер позиции в обоих случаях одинаковый в долларовом эквиваленте и равняется.

Только если в случае с парой USD/NEO никаких дополнительных операций делать не надо, то для пары NEO/BTC необходимо высчитать размер позиции в биткоинах.

Запоминаем размер спреда на момент открытия сделки:

Условие выхода из сделки 1:

Закрываем короткую позицию USD/NEO и длинную позицию NEO/BTC.

Размер позиции закрытия равняется размеру позиции открытия по каждой паре плюс размеры масштабирования, в случае если была процедура масштабирования.

Условие входа в сделку 2:

Открываем длинную позицию USD/NEO и короткую позицию NEO/BTC.

Размер позиции рассчитывается так же, как и в условии входа в сделку 1, описанном выше.

Запоминаем размер спреда на момент открытия сделки:

Условие выхода из сделки 2:

Закрываем длинную позицию USD/NEO и короткую позицию NEO/BTC.

# Условие масштабирования

В случае если стратегия открыла сделку по условию, а спред продолжает увеличиваться, необходимо увеличивать позицию для увеличения заработка.

Условие масштабирования для сделки 1:

И запоминаем размер спреда на момент масштабирования:

Размер позиции в обоих случаях одинаковый в долларовом эквиваленте и равняется.

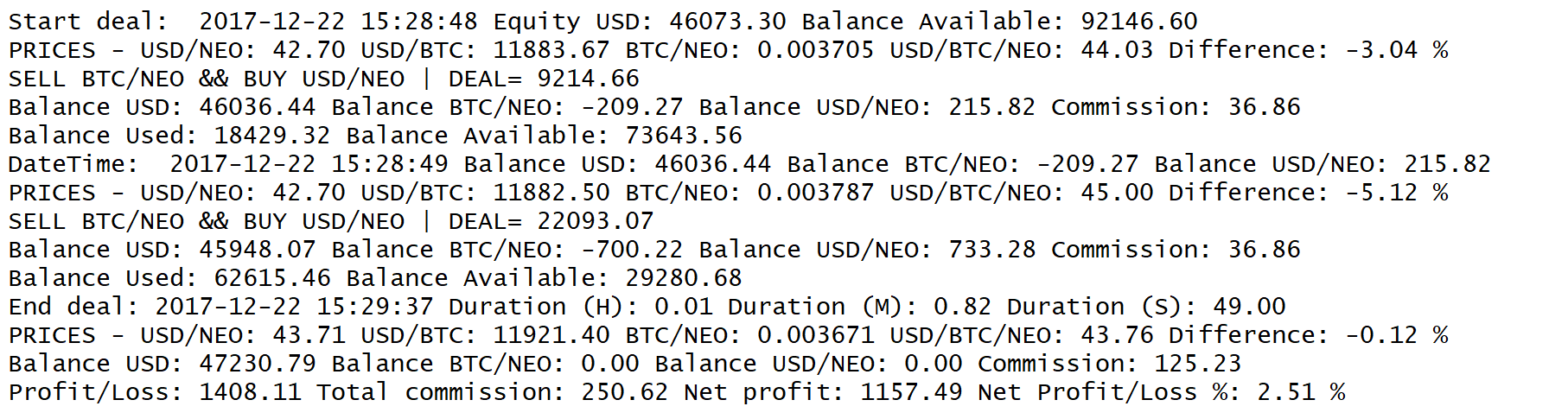
Только если в случае с парой USD/NEO никаких дополнительных операций делать не надо, то для пары NEO/BTC необходимо высчитать размер позиции в биткоинах.

Условие масштабирования для сделки 2:

И запоминаем размер спреда на момент масштабирования:

# Значения параметров стратегии

# Пример логов по результатам одной сделки



Расшифровка логов:

1. 2017-12-22 15:28:48 спред достиг значения -3.04, что является условием входа в сделку 2. Balance\_available в этот момент равен 92146.60$, а размер позиции 9214.66$. Открываем короткую позицию по NEO/BTC и длинную по NEO/USD. Balance\_available уменьшился на значение balance\_used.
2. 2017-12-22 15:28:49 спред увеличился и достиг значение -5.12, что является дополнительным условием масштабирования. Увеличиваем позицию по обеим парам на сумму 22093.07.
3. 2017-12-22 15:29:37 спред уменьшился до -0.12, что стало условием выхода из сделки. Полностью закрываем обе открытые позиции и считаем Profit/Loss.

# Дополнительные параметры

Минимальный размер ордера NEO/USD = 0.2

Минимальный размер ордера NEO/BTC = 0.2