

Общее:

Ссылка на информацию о всех доступных данных.

Если что, в паре BTC/USDT quote asset - это USDT, base asset - это BTC. Market Taker - тот, кто выставляет рыночный ордер.

Крипты: USDT, BTC - точно, а также варианты: ETH, BCH, LTC, BNB и другие, надо выбрать. Соответственно, всего пар C_n^2 . В идеале нам нужно, наверное, около четырех крипт.

Это не те данные, которые мы непосредственно будем записывать в нейросеть! Это те данные, которые мы получаем через api, а их обработка - это еще отдельная тема.

Для каждой пары:

- **<symbol>@aggTrade и <symbol>@trade:**

Эти потоки в реальном времени кидают информацию о сделках, тут нужно думать, какие фичи можно выделять. Пока могу накидать такие:

- *MinuteQuantity/SecondQuantity* - объемы продаж в base asset за соответствующую единицу времени.
- *MinuteVolume/SecondVolume* - объем продаж за соответствующую единицу времени в quote asset.
- *MinuteNumber/SecondNumber* - количество сделок за единицу времени.
- *SecondMinimumPrice/SecondMaximumPrice/SecondMeanPrice* - статистики цены за секунду.
- *LastPrice* - последняя цена.

А также можно добавить процент сделок, где покупателем выступал Market Taker, процент объема, а еще много чего еще. Дело в том, что мы получаем информацию обо всех сделках за единицу времени, а нам нужно их отобразить в фиксированный набор полей. Предложения принимаются.

- **<symbol>@kline_<interval>:**

<interval> - это 1m, 3m, 5m, 15m и так далее вплоть, наверное, до 12h. Поток возвращает разные метрики цены за соответствующий интервал. Для каждого интервала:

- *TradeNumber* - число сделок.

- *OpenPrice/ClosePrice/HighPrice/LowPrice* - статистики цены.
- *BaseVolume* - объем продаж в base asset.
- *QuoteVolume* - объем продаж в quote asset.
- *TakerBaseVolume/TakerQuoteVolume* - объем продаж среди сделок, когда покупателем выступает Market Taker.

- **<symbol>@ticker:**

Этот поток возвращает статистику по паре за последние 24 часа.

- *PriceChange/PriceChangePercent* - изменение цены.
- *WeightedAveragePrice* - средняя цена.
- *FirstPrice/LastPrice* - цена первой и последней сделок.
- *LastQuantity* - объем последней сделки.
- *BestBidPrice/BestAskPrice* - цены лучшего бида и аска.
- *BestBidQuantity/BestAskQuantity* - объемы лучшего бида и аска.
- *TradeNumber* - число сделок.

- **<symbol>@depth<levels>@100ms:**

Этот поток каждые 100ms кидает изменения ордербука. <levels> возьмем 10 или 20.

- *BidPrice<level>/BidQuantity<level>* - цена и объем ордера продажи, находящегося на определенном уровне ордербука.
- *AskPrice<level>/AskQuantity<level>* - цена и объем ордеров покупки.

Тут еще можно докинуть какие-нибудь изменения ордербука за последнюю секунду, например.

Как-то так.