

2021-11-08. Дополнительные примечания к проекту.

В связи с тем, что задача является достаточно сложной решено упростить некоторые ее части.

1. Переход к дневным данным. Для того, чтобы избавиться от большого количества данных предлагается преобразовать часовые данные в дневные и перейти к работе уже с дневными данными. Для преобразования нужно иметь в виду что агрегируются объем, количество трейдов, меняются значения high, low, open и т.д. Если у вас будет желание работать с часовыми данными - welcome. Там можно найти больше информации и изменения внутри дня также могут дать вам больше данных для анализа.
2. В контексте п.1 целевой показатель становится - доходность за следующие 24 часа по активу.
3. Небольшие пояснения по поводу агрегированных индексов. Было предложено 2 ее вариации. 1й - взвешенный по капитализации. Доходность всех активов r_i за определенный промежуток времени нужно нормировать согласно следующей формуле:

$$r_I = \sum_{i=1}^N r_i * cap_i / \sum_{i=1}^N cap_i.$$

Далее необходимо взять кумулятивное произведение доходности по времени и рассматривать этот ряд в качестве дополнительного инструмента. 2й - средневзвешенный:

$$r_I = \sum_{i=1}^N r_i / N$$

Необходим для того, чтобы избежать байеса за счет капитализации BTC, ETH (их доля капитализации от всех активов составляет 60-80%). Данный индикатор даст лучшее понимание как движется рынок в среднем и может говорить о том лучше ли перформят альткоины или нет в сравнении высококапитализированными активами.

Конечно, это были одни из примеров какие индексы вы можете составить и тут вы вправе самим какие индексы можно вводить какие нет.