

# Анализ рынка российских акций

Бикеев Кирилл, 212 группа

00

# Цели и задачи



# Цели

Основная гипотеза

**Спрос рождает предложение**

Цель

**Проверить, действительно ли крупные игроки оказывают сильное влияние на формирование цены актива**

# Задачи

- › Поиск данных
- › Выбор инструмента для анализа
- › Проверить как сделки курпных игроков отражаются на цене
- › Выяснить какая доходность будет если опираться на эти данные
- › Сделать выводы

01

# **Поиск данных и выбор инструментов**

# Самый эффективный источник данных

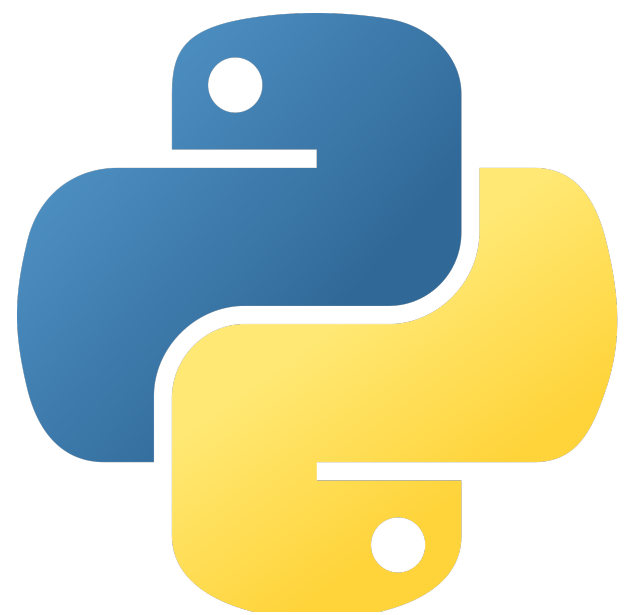
**Московская биржа** — крупнейший российский биржевой холдинг, является организатором торгов акциями, облигациями, производными инструментами, валютой, инструментами денежного рынка, углеродными единицами<sup>[2]</sup>, драгоценными металлами

Для анализа будет использован датасет Netflow2 (Агрегированный нетто-объем)



**МОСКОВСКАЯ  
БИРЖА**

# Инструменты



**Python** — высокоуровневый язык программирования общего назначения с динамической строгой типизацией и автоматическим управлением памятью, ориентированный на повышение производительности разработчика, читаемости кода и его качества



Jupyter — интерактивный блокнот, первоначально являвшийся веб-реализацией и развитием IPython, ставший самостоятельным проектом, ориентированным на работу со множеством сред выполнения



Блокнот Colab — это бесплатная интерактивная облачная среда для работы с кодом на языке Python от Google в браузере. Принцип у нее такой же, как у остальных онлайн-офисов компании: она позволяет одновременно с коллегами работать с данными. Рассказываем, в чем преимущества Colab для написания кода в каких сферах он может быть полезен разработчикам и не только.

02

**Приступим к анализу**



# Весь процесс предоставлен в ноутбукe



[https://colab.research.google.com/drive/  
1WsDivNgbxQXL1w\\_yTAqqvJp3tHBsUF99?usp=sharing](https://colab.research.google.com/drive/1WsDivNgbxQXL1w_yTAqqvJp3tHBsUF99?usp=sharing)

03

**Выводы**

# Выводы и список использованной информации

Крупные игроки оказывают сильное влияние на цену актива это можно заметить при анализе показателей  $rv$  и цены, более того можно построить торговую модель основанную на этих показателях. Таким образом удалось подтвердить гипотезу выдвинутую в начале доклада

Ссылка на датасет: <https://fs.moex.com/f/11743/netflow2-get-data-ru.html>

**Спасибо**