

ALMAGLOBAL

El objetivo de este proyecto es dar los primeros pasos en la construcción de un bot que busque oportunidades de arbitraje de tasa de interés. Para ello es necesario que se conecte a la plataforma remarkets de rofex: <https://remarkets.primary.ventures/> utilizando websocket (por ej. usando el paquete pyRofex) y obtenga además los precios spot de acciones para las cuales hay futuros en remarkets. Luego, con las tasas implícitas calculadas busque oportunidades de arbitraje de tasa de interés.

1. Crear una cuenta de test en remarkets desde su site: <https://remarkets.primary.ventures/>
2. El paquete pyRofex (<https://github.com/matbarofex/pyRofex>) permite obtener el book de los diferentes instrumentos en remarkets en tiempo real. Por ejemplo, del próximo futuro de GGAL. Utilizando el bid y ask junto con el precio del spot (usar por ejemplo el paquete yfinance (<https://pypi.org/project/yfinance/>), o datos simulados) es posible calcular la tasa tomadora y colocadora implícitas en el precio del futuro GGAL vs la acción GGAL o entre el precio del futuro de dólar y el spot.
3. Calcular las tasas implícitas para los futuros galicia, pamp, ypf, y al menos un plazo de futuro de dólar.
4. Printear en la consola las tasas implícitas tomadoras y colocadoras cada vez que haya una modificación en los precios, luego indique si hubiera las oportunidades de arbitraje.
5. (*Opcional*) En el caso de que existan oportunidades, enviar las órdenes de futuros en remarkets (que es la pata que podemos mandar en el ambiente simulado de remarkets) y escribir en la consola la información relevante del trade (precio de ejecución del futuro y spot, y el profit que debería generar el trade).
6. (*Opcional*) Para la función que evalúa la tasa implícita, escribir un test unitario.
7. Comentar el código y documentar en un README su funcionamiento y subirlo a un repositorio en github.
8. (*Opcional*) Liste las aproximaciones y suposiciones hechas durante el proceso junto con sus pros y contras.