

# 多角套利优化算法参考

- guhghhaa

May '18
- 国际外汇市场无风险套汇路径的优化搜索- MBA智库文档

全球外汇套利的识别指标及可能的最优套汇路径

A robust non-linear multivariate Kalman filter for arbitrage identification in high frequency data (1996)

- May '18
- bilibilihuangyifan

在考虑不同挂单顺序为不同路径的情况下，n角的计算量是n!😂如果你做30个，那肯定是要优化的，不然要算到天荒地老了。