



**FAKULTA
INFORMAČNÍCH
TECHNOLGIÍ
ČVUT V PRAZE**

ZADÁNÍ BAKALÁŘSKÉ PRÁCE

Název: Arbitrážní příležitosti kryptoměn
Student: Čeněk Žid
Vedoucí: Mgr. Jan Starý, Ph.D.
Studijní program: Informatika
Studijní obor: Znalostní inženýrství
Katedra: Katedra aplikované matematiky
Platnost zadání: Do konce letního semestru 2020/21

Pokyny pro vypracování

- 1) Zjistěte, do jaké míry jsou dostupná historická data z kryptoměnových burz.
- 2) Implementujte sběr dat na úrovni order book jednotlivých měnových párů a ukládejte tato data v nějakém vhodném formátu.
- 3) Najděte a analyzujte v těchto datech arbitrážní příležitosti.
- 4) Spočítejte základní statistiky výskytu, obchodovatelnosti a výnosnosti arbitrážních trojúhelníků.
- 5) Implementaci proveďte v jazyce Python s využitím dostupných modulů.
- 6) Aplikaci řádně otestujte a zdokumentujte.

Seznam odborné literatury

Dodá vedoucí práce.

Ing. Karel Klouda, Ph.D.
vedoucí katedry

doc. RNDr. Ing. Marcel Jiřina, Ph.D.
děkan

V Praze dne 5. února 2020