Бот "Продвинутый Арбитраж" для фьючерсов FTX

Внешний вид торгового робота:

	двинутый арбитраж'	для фьючеро	сов и свопов	биржи FTX [1.	.0]											-		
Настройка подключения		Настройка то	рговой страте	гии														
Api Key: nKLFMQeSyw	OfDayU03u5pchUk	Пара 1	Пара 2	Только	Расхождение	Тейк-профит	Объем первой	Объем	Отклонение для	Отклонение объема	Отклонение цены	Количество	Макс. перекос	Реверсное	Коэф. усреднения	Сбросить	Закрыть	
Secret:				выход	для входа		сделки,%	докупки, «	докупки, %	разгрузки, %	разгрузки, %	докупок	%	в прибыли	в приоыли, %	спред	цепочку	
Sub: Spot		TRX-PE 🗸	TRX-06 ~		0.005	0.25	25	10	1	75	75	100	0		50	[Сброс]	[Закрыть]	
License: AA_TEST		~	~															
🔿 English 🔘 F	Russian																	
Подключиться	к бирже																	
Управление ботом																		
Торговое плечо	20 🌲																	
🗹 Записывать расхож	дения																	
Старт	Стоп																	
Снять все о	рдера																	
Статус			Лог							Открытые орд	tepa			Открыты	е позиции			
Параметр	Значение		14.06.2022 11	56:59: Цена по	оследней сделки	0.0609825 (sh	ort)		^	TRX-PERP - bu	у limit по цене (06083 объемо	м 10	TRX-0624	объемом -92	по цене 0,061	14520720720720	
Баланс, USD	49,7705		14.06.2022 11	:56:59: Текущи	ая средняя цена ий PnL по цепочк	e -0,21%				TRX-0624 - sell	limit по цене 0,0	0614425 объем	om 4	INAT EN	IF OU BEMOM TT	TTIO LIENE 0,00	14336736736736	
Статус соединения	Success		14.06.2022 11:56:59: Усреднение по TRX-PERP 14.06.2022 11:57:00: Включен режим реверсного объема, для позиции в профите							TRX-0624 - buy limit по цене 0,06037 объемом 5								
Ping на FTX, мс	27		14.06.2022 11:57:00: Козф. объема, для позиции в профите 50%. 14.06.2022 11:57:00: Такулний повение, токсовти сетии 101 (аналение 0.06083).															
Pel pueperso 1 */	-0,2068		14.06.2022 11	57:00: Котиро	вка 0,06100875 (значение разг	рузки 0,06129)										
гпс в ценочке 1, 4			4 4 00 0000 44				лаем на урове											
FILE LEIDAKE 1, 4			14.06.2022 11 14.06.2022 11	:57:00: Цена до	окупки 0,06083	э покупки - про		снь ниже										
			14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11	57:00: Цена до 57:00: Цена до 57:00: Цена пр	м уровне не обла окупки 0,06083 родажи 0,061902 ение по TRX-062	5 покупки - про 15 24		нь ниже										
THE B LIGHTAKE 1, 4			14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11	57:00: Цена до 57:00: Цена пр 57:00: Усредн 57:00: Включе	м уровне не обла окупки 0,06083 родажи 0,061902 ение по TRX-062 ен режим реверс	5 покупки - про 25 24 ного объема, д	џля позиции в	профите										
FILE UPIONKE 1, 4			14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11	57:00: На этой 57:00: Цена до 57:00: Усредн 57:00: Включе 57:00: Сделка 57:00: Коэф. о	м уровне не обла окупки 0,06083 родажи 0,061902 ение по TRX-062 ен режим реверса профите - прово объема, для пози	5 покупки - про 24 ного объема, д адим реверс об иции в профите	иля позиции в ъемов 50%	нь ниже профите										
TTIL B LEINARG T, 4			14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11	57:00: Ценадо 57:00: Ценадо 57:00: Усредн 57:00: Включе 57:00: Козф. о 57:00: Сделка 57:00: Сделка 57:00: Сделка	м уровне не обла окупки 0,06083 родажи 0,061902 нение по TRX-062 н режим реверса профите - прово объема, для пози профите - приме и профите - приме и профите - приме	5 покупки - про 24 ного объема, д одим реверс об ации в профите еняем коэф. 8 пи сетки 99 (а	ля позиции в ъемов 50% значение 0.060	профите ПРОФИТЕ										
гль э ценичке 1, 4			14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11 14.06.2022 11	57:00: Цена до 57:00: Цена по 57:00: Усредн 57:00: Корче 57:00: Козмоче 57:00: Козмоче 57:00: Сделка 57:00: Сделка 57:00: Сделка 57:00: Сделка	Фуровне не облисокупки 0.06083 родажи 0.061902 ение по TRX-062 н режим реверс профите - прово объема, для пози профите - прими ий уровень торго вка 0.06062375 (з покупки - про 24 ного объема, д дим реверс об щии в профите еняем козф. вли сетки 99 (з значение разг)	ля позиции в ъемов 50% вначение 0,060 рузки 0,06037	профите 083)										
тпы в ценочке 1, 4			14.06.2022 11 14.06.2022 11	137:00: На этой 157:00: Цена до 157:00: Усредн 157:00: Включе 157:00: Сделка 157:00: Сделка 157:00: Соф. 157:00: Текущи 157:00: Котиро 157:00: Котиро 157:00: Цена до	м уровне не обли окупки 0,06083 родажи 0,061902 ение по TRX-062 н режим реверс профите - прово объема, для пози профите - приме ий уровень торго вка 0,06062375 (и уровне не былк опродажи 0,0614	з пакупки - про 15 4 ного объема, д одим реверс об ции в профите еняем козф. вли сетки 99 (з значение разг) о покупки - про 1425	ля позиции в ъемов 50% значение 0,060 рузки 0,06037 даем на уровн	профите 083) не выше										
TTILE GENORGE I, 4			14.06.2022 11 14.06.2022 11	57:00: Цена др. 57:00: Цена рр. 57:00: Усредн 57:00: Включе 57:00: Сделка 57:00: Сделка 57:00: Сделка 57:00: Текуци 57:00: Котироl 57:00: Цена до 57:00: Цена по 57:00: Цена по	м уровне не обли окупки 0.06083 родажи 0.061902 ение по TRX-062 и профите - прово объема, для позу объема, для позу и уровень торго вка 0.06062375 (и уровень торго вка 0.06062375 (и уровень е было опродажи 0.0614 окупки 0.06037	5 покупки - про 5 24 ного объема, д дим реверс об щим в профите еняем козф. вли сетки 99 (с значение разг) 5 покупки - про 425	ля позиции в ъемов 50% яначение 0,060 рузки 0,06037 даем на уровн	профите 083)) не выше										
rni, si uenovite I, 4			$\begin{array}{c} 14.06.2022 \ 11\\ 14.06.202 \ 14.002\\ 14.06.202 \ 14.002\\ 14.06.202 $	57:00: Цена др. 57:00: Цена др. 57:00: Усредн 57:00: Колемс 57:00: Колемс 57:00: Козеф. о 57:00: Сделка 57:00: Текущи 57:00: Котироо 57:00: Цена до 57:00: Цена до 57:00: Цена до 57:00: Цена до 57:00: Цена до 57:00: Цена до	м уровне не обла родажи 0,061932 нение по TRX-062 профите - прово объема, для позя профите - прими 40 уровень торго вка 0,06062375 (0.0662375 му ровень е было опродажи 0,0614 окупки 0,06037 од завершен ==-	1 покупки - про 24 ного объема, д дим реверс об щии в профите елем козят, вли сетки 99 (з значение разгр зпакупки - про 425	для позиции в ъемов 50% иначение 0,060 рузки 0,06037 даем на уровн	профите 183)) не выше										

(в новых версиях, при добавлении функционала, внешний вид может немного измениться)

Торговая идея робота

Бот "Продвинутый Арбитраж" для фьючерсов FTX предназначен для торговли рыночно-нейтральных стратегий - арбитража и парного трейдинга. Основное преимущество бота — это система управления капиталом.

В этом боте используется наш авторский алгоритм диапазонного скальпинга для усреднения позиции. Основная его суть — это активное усреднение, которое включает в себе докупки и разгрузки. При этом, каждая сторона сделки усредняется автономно — это увеличивает эффективность усреднения. Эффективность состоит в том, что намного быстрее усредняется цена каждой стороны сделки, а также, нет существенной нагрузки на депозит за счет усреднения (по сравнению с обычным).

Как правильно подключиться

Для корректного подключения ключи создавать их на странице «Внешние ключи», для этого надо перейти на страницу «<u>Внешние ключи</u>», в списке выбрать "AlgoTradingCC" и создать ключи (обычные API ключи не подойдут).

Разрешение должно быть не под какой-то субсчет, а для всего счета – это надо для проверки привязки аккаунта к лицензии. Обязательно должна быть разрешена торговля. С ключами для чтения, бот не сможет торговать.

External Program API Keys			Guilling		
	ие интеграции требиют ETV API или		Algement (1.46)		
пекоторые внешние интеграции треоуют нт х дет ключи. т шата, взиг			GautEvalu	лидки для этой интеграции, а не вашего станд	
			Symphefication		
впешние юп			Regionitie		
ИМЯ	Время создания	Ключ АРІ	Charlage Transfing (South)	API Cekpet	Разрешения
1		angene	Galillia		Торговля 🥕
1	36395,0071,1619530		TigerToolk		Торговля 🥕
i			Bulline .	*****	Только для чтения 🧳
/		(AlgoTradingCC		Только для чтения 🛛 🧨
	_		CONTRACTOR .		
Создать ключ АРІ Создать ключ АРІ только для чтения			Hypeliter		
			Nummer (in particular)		

Блок «Настройки подключения»

API Key и Secret – это внешние ключи, для возможности автоматической торговли. Ключи шифруются, поэтому, бота можно запускать даже в небезопасных местах. Обязательно должно быть разрешение на торговлю.

Если вы планируете торговать на субсчете, в поле «Sub» внесите название субсчета. Если торгуете на основном – оставьте это поле пустым.

Кнопка «Подключиться» предназначена для подключения, проверки счета и ключей биржи. После успешного подключения, становятся доступными все другие блоки.

Блок «Управление ботом»

Этот блок предназначен для управления торговым процессом. Кнопка «Старт» предназначена для запуска робота. Кнопка «Стоп» - для остановки торговли.

«Отменить все ордера» - для отмены всех установленных ордеров (используется при перенастройке).

В поле «Плечо» устанавливаем максимальное торговое плечо для счета.

Если установить галку «Записывать спред» бот будет записывать расхождение. Спред записывается в файл .csv, чтобы можно было использовать его в разных платформах для анализа (например, Excel).

Блок «Логирование»

Это информационный блок, который выводит общую информацию, что делает робот в текущий момент с объяснениями и деталями.

Блок «Открытые позиции»

Этот блок показывает текущие открытые позиции. Здесь видна информация по средней цене, объему позиции и об инструменте, в котором открыта позиция.

Блок «Открытые ордера»

Этот блок показывает какие ордера выставлены роботом – по какому контракту, тип операции (покупка или продажа), вид ордера (стоп или лимит), цена и объём.

Блок «Статус»

Этот блок показывает размер депозита, качество связи – есть она или нет, а также пинг (скорость запросаответа с сервером). Также, выводится прибыль по каждой цепочке (в %).

Блок «Настройка торговой стратегии»

Этот блок предназначен непосредственно для настройки торговой стратегии.

В поле «<u>Пара1</u>» из выпадающего списка контрактов выбираем нужный инструмент для первой части рыночно-нейтральной позиции.

В поле «<u>Пара2</u>» из выпадающего списка контрактов выбираем нужный инструмент для второй части рыночно-нейтральной позиции.

Если установить поле «<u>Только выход</u>», то бот будет работать только в режиме закрытия позиции. Т.е., если будет открыта позиция, то бот будет торговать ее согласно настройкам, но после закрытия сделки, новую открывать не будет.

В поле «<u>Расхождения для входа, %</u>» указываем при каком расхождении между парами бот входит в позицию.

В поле «<u>Тейк-профит, %</u>» указываем при каком тейк-профите бот закроет рыночно-нейтральную позицию, в этом параметре суммируются все усредняемые сделки цепочки.

Следующее поле «<u>Объем первой сделки, %</u>» — это суммарный объем позиции в % от депозита. Т.е., если мы ставим вход на 50%, то открываем на 25% лонг, и на 25% шорт. Данные по размеру депозита берутся на момент открытия сделки и равны сумме обеспечения + нереализованный PNL на счете (показатель «общее обеспечение» на бирже).

Следующее поле «<u>Объем докупки, %</u>» — это объем, которым бот делает докупку методом диапазонного скальпинга. Это % от объема первой сделки одной торгуемой пары в цепочке.

В поле «<u>Отклонение для покупки, %</u>» указываем с каким шагом бот будет проводить докупки. Шаг рассчитывается от цены входа каждой пары в цепочке.

В поле «<u>Отклонение объема разгрузки, %</u>» указываем сколько % от объема сделки усреднения, будет разгружено на уровне разгрузки.

В поле «<u>Отклонение цены разгрузки, %</u>» указываем на каком расстоянии между усреднениями будет стоять разгрузочный ордер на часть размера докупки. Расчет в % от уровня докупки.

В поле «<u>Количество докупок</u>» указываем количество этих дополнительных ордеров. Если установить «0», то дополнительных ордеров не будет.

В поле «<u>Максимальный перекос объема, %</u>» устанавливается максимальная разница между объемом покупки и продажи. Т.е., если перекос пошел в сторону лонга по первой паре, то в ней будут ставится только

шорт сделки, а в другой паре – только лонг (для шорт обратно). И как только объем сбалансируется, бот вернется в обычный режим. Чтобы не устанавливать перекос, установите значение 0.

Если установить «<u>Реверсное усреднение прибыли</u>» то бот, когда сделка по одной из пар в цепочке зайдет в плюс, поменяет объемы покупки и продажи. Например, если в обычном режиме бот покупал 2 контракта и продавал 1, то при установленной галке, когда позиция в плюсе – бот установит на продажу 2 контракта, а покупать будет 1.

В поле «<u>Коэф. усреднения в прибыли</u>» пропорционально уменьшает объемы докупки и продажи, когда позиция в плюсе по одной из пар в цепочке. Т.е., если у нас стоят докупка 100 контрактов и продажа 40 контракта, при этом показатель стоит 40%. Тогда, при переходе позиции в плюс, бот будет ставить докупку 40 контракта (100 x 40%), и продажу 16 контрактов (40 x 40%). Чтобы отключить настройку, установите значение 100.

Кнопка «<u>Сбросить спред</u>» служит для сброса расчетного спреда (обнуление), для начала расчета с нуля. Сброс можно провести только когда нет открытых сделок.

Кнопка «Закрыть цепочку» служит для закрытия сделок для конкретной цепочки.

Для добавления строки – нажимаем на самую нижнюю пустую строку (бот должен быть остановлен).

Для удаления строки – нажимаем на строку, которую надо удалить, и нажимаем кнопку «Del» (бот должен быть остановлен).

Для того, чтобы получать новости по ботам и алготрейдингу, подпишитесь на канал по алготрейдингу>>>

Если у вас нет открытого счета, можете открыть счет FTX по нашей <u>партнерской ссылке</u>, и получить скидку 10% на комиссию навсегда.