

Влияние регулятора на курс криптовалют за счет новостей

Кудрин М.В. (Университет ИМТО)

Криптовалюты набирают популярность и привлекают денежные средства со всего мира. В средствах массовой информации подогревается интерес к торговле криптовалютами, в том числе с использованием заемных средств и деривативов. В связи с ростом количества ритейл трейдеров крупные игроки стали применять алгоритмы манипулирования стоимостью активов на криптовалютных биржах. В работе предложен вариант по определению направления изменения стоимости криптовалюты с помощью новостного анализа.

Введение. События февраля 2022 помогли многим жителям РФ осознать, что классические финансовые инструменты, такие как банковские депозиты и накопительные счета, не только не способны увеличить их сбережения, но и даже защитить их от инфляции, однако не лишили их доступа к их средствам, в отличие альтернативных финансовых инструментов в виде биржи. По данным Московской биржи, в 2021 году количество частных инвесторов превысило 13 млн человек. Активы частных инвесторов в один день заблокированы на неопределенный срок. В связи с этим интерес жителей РФ сместился на криптовалюты, доступ к которым не был заблокирован государством. Во всем мире наблюдается аналогичная тенденция, так как инвесторам наглядно показали существенный недостаток фондового рынка. Обилие материалов в средствах массовой информации подогревает интерес мирового сообщества к торговле криптовалютами, в том числе к торговле с кредитным плечом.

Основная часть. На протяжении 2022 года наблюдалась тенденция корреляции котировок криптовалют с показателями фондового рынка. В связи с появлением большого количества ритейл трейдеров крупным игрокам стал интересен криптовалютный рынок. Фонды стали заходить в торговлю криптовалютой и использовать те же алгоритмы, что и на фондовом рынке. В связи с этим движения криптовалют зачастую повторяют движения на фондовом рынке. Наиболее выраженной является корреляция биткоина с американскими индексами S&P500 и NASDAQ. Другие криптовалюты так же связаны с главной криптовалютой и фондовым рынком. Во время выхода экономических и макроэкономических данных, отчетов компаний и заседания ФРС на рынках наблюдается повышенная волатильность. При этом движение в случае нейтральной риторики происходит в диапазоне уровней поддержки и сопротивления. Причиной такого поведения являются как сами ритейл трейдеры, открывающие свои позиции во время или незадолго до выхода данных, так и крупные игроки, использующие сантимерт ботов для совершения сделок. Боты анализируют высказывания политиков, прогнозы по отчетам государств и компаний и открывают позиции, при этом и для криптовалютного, и для фондового рынков используется один и тот же алгоритм.

Выводы. В ходе работы были изучены методы, с помощью которых крупные игроки воздействуют на рынок криптовалют.

Ссылки

1. Агеев А. И. Криптовалюты, рынки и институты / А. И. Агеев, Е. Л. Логинов // Экономические стратегии. – 2018. – No 1. – С. 94–107.
2. Александров Д. Биткоин вне закона // БОСС: Бизнес. Организация. Стратегия. – 2017. – No 12. – С. 23–25.
3. Андриюшин С. А. Открытый банкинг, кредитная активность, регулирование и надзор // Банковское дело. – 2017. – No 6. – С. 26–34.
4. Баулин А. Блокчейн в эфире // Форбс / Forbes. – 2017. – No 11. – С. 126–127.
5. Бауэр В. П. Блокчейн как основа формирования дополненной реальности в цифровой экономике / В. П. Бауэр, С. Н. Сильвестров, П. Ю. Барышников // Информационное общество. – 2017. – No 3. – С. 30–40.
6. Вахранев А. В. Роль биткоинов в экономике и их производство // Бизнес в законе. – 2016. – No 6. – С. 224–226.
- 10
7. Ведута Е. Цифровая экономика приведет к экономической киберсистеме // Международная жизнь. – 2017. – No 10. – С. 87–102.
8. Вержбицкий А. Криптовалютная вольница // Форбс / Forbes. – 2017. – No 9. – С. 136–137.
9. Гайва Е. Блокчейн затормозил // Эксперт. – 2017. – No 15. – С. 46–47. Генкин А. С. Блокчейн и уникальные ценные объекты // Страховое дело. – 2017. – No 3. – С. 15–22.
10. Гецьман М. Развитие электронных сервисов глазами регистратора. Блокчейн как способ повышения достоверности электронного документа // Рынок ценных бумаг. – 2017. – No 2. – С. 47–49.
11. Гайва Е. Блокчейн затормозил // Эксперт. – 2017. – No 15. – С. 46–47.
12. Генкин А. С. Блокчейн и уникальные ценные объекты // Страховое дело. – 2017. – No 3. – С. 15–22.
13. Генкин А. С. Криптотехнологии и криминальные риски: есть ли повод для тревоги? // Страховое дело. – 2017. – No 5. – С. 47–55.
14. Герр Р. Виртуальные фантики // PC Magazine. – 2017. – No 10. – С. 30–31
15. Деньги // Большая российская энциклопедия: [в 35.] / гл.ред.Ю. С. Осипов. – М.: Большая российская энциклопедия, 2004 – 2017.
16. Долженков А. Одним движением руки // Эксперт. – 2017. – No 15. – С. 40–42.
17. Егорова М.В. Криптовалюты как новая реальность (обзор российской и мировой печати) //Международная экономика. – 2017. – No 11. – С. 34–41.
18. Карцхия А. Оцифрованное право: виртуальность в законе // Интеллектуальная собственность. Авторское право и смежные права.– 2018. – No 2. – С.5–20.
19. Кочергин Д. А. Место и роль виртуальных валют в современной платежной системе // Вестник СПбУ. Экономика. – 2017. – No 1. – С. 119–140. 20. Кузнецов В. А. О возможных сценариях законодательного регулирования цифровых валют в России / В. А. Кузнецов, Р. А. Прохоров, А. В. Пухов // Деньги и кредит. – 2017. – No 7. – С. 52–56.
21. Кузнецов И. В. Роль Bitcoin и других криптовалют в мировой экономике // Страховое право. – 2017. – No 3. – С. 56–60.
22. Лагутин И. Б. Правовое обеспечение блокчейн-технологий (вопросы теории и практики) / И. Б.
23. Майоров С. Криптовалюты как вид «частных денег» : читая Фридриха фон Хайека // Рынок ценных бумаг. – 2017. – No 5. – С. 32–37.
24. Недорезков В. В. Криптовалюты на базе технологии блокчейна: проблемы правового регулирования // Банковское право. – 2017. – No 4. – С.

45–49.

25. Новоселова Л. Блокчейн для голосования акционеров // Хозяйство и право. – 2017. – No 10. – С. 10–21.
26. Пази М. Цифровое золото. Откуда взялись деньги, которым не нужны банки и государства // Русский репортер. – 2017. – No 8. – С. 21.
27. Панишев А. Блокчейны: RAID для чистой правды // PC Magazine. – 2017. – No 5. – С. 58–70
28. Петров С. Ждать ли крипторубля // БОСС: Бизнес. Организация. Стратегия. – 2017. – No 10. – С. 16–17
29. Попов Е. В. Оценка готовности отраслей РФ к формированию цифровой экономики // Инновации. – 2017. – No 4. – С. 37–41.
30. Смирнов Ф. А. Трансформация мировой финансовой системы: блокчейн, «умные контракты» и внебиржевые деривативы // Аудитор. – 2017. – No 6. – С. 49–54.