

Техническое задание (разработка)

Контекст

В переписке участники проекта «Проект Елена Мельникова» обсуждают результаты market stress-теста, представленного в виде аналитического отчета ANGT Market Research. Отчет содержит данные по поведению участников рынка, оборотам, финансовой модели комиссий пула и сценарию масштабирования. Цель — создать прозрачную fee-модель для роста пула и использовать отчет как материал для загрузки в Knowledge Base/RAG.

Задачи

1. Разработать прозрачную fee-модель пула на основе предоставленных данных.

- На основе анализа текущих метрик (ликвидность, объемы, комиссии) и сценария масштабирования (\$100k ликвидности, 500 активных холдеров, ~1.9x swap volume) создать модель, отражающую динамику комиссионного потока и доходности на TVL.

- **Просил:** Fin Tech.

2. Классифицировать поведенческие типы участников пула.

- На основе описанных в отчете классов (high-turnover scalper, dip buyer/recovery trader, active LP rebalancer и др.) создать систему классификации, основанную на поведении, а не на предположениях о владельцах кошельков.

- **Просил:** Fin Tech.

3. Интегрировать отчет в Knowledge Base/RAG.

- Подготовить отчет в формате, подходящем для загрузки в Knowledge Base/RAG.

- **Просил:** Fin Tech.

4. Провести анализ внешнего объема и комиссий.

- Уточнить долю внешнего объема и комиссионного потока, исходя из гипотезы 60-70% внешнего volume/fee flow.

- **Просил:** Fin Tech.

5. Построить экономическую модель для каждого поведенческого класса.

- На основе case-стадий (high-turnover scalper, dip buyer, active LP rebalancer) создать модели, отражающие их влияние на пул (обороты, комиссии, PnL).

- **Просил:** Fin Tech.

Приоритеты

- **Высокий приоритет:** Разработка fee-модели пула и интеграция отчета в Knowledge Base/RAG.

- **Средний приоритет:** Классификация поведенческих типов и построение экономических моделей.

- **Низкий приоритет:** Анализ внешнего объема и комиссий (требуется дополнительных данных).

Открытые вопросы

1. Какие метрики и форматы требуются для загрузки отчета в Knowledge Base/RAG?

- Необходимо уточнить требования к структуре и формату отчета.

2. Как получить данные о LP NFT/range/feeGrowth для полного расчета PnL активных LP?

- В отчете указано, что данные о LP-позициях недоступны. Требуется уточнение, как их получить или заменить.

3. Как определить долю внешнего объема и комиссионного потока?

- Гипотеза 60-70% внешнего volume/fee flow требует подтверждения. Нужно уточнить методику атрибуции транзакций.

4. Как классифицировать "кандидат-классы" (momentum trader, passive holder и др.)?

- В отчете указано, что эти классы требуют дополнительных наблюдений. Нужно уточнить критерии включения в классификацию.

5. Какие дополнительные данные требуются для анализа "repeat stress participants"?

- Для отслеживания повторных участников между недельными тестами необходимы данные за несколько периодов.