

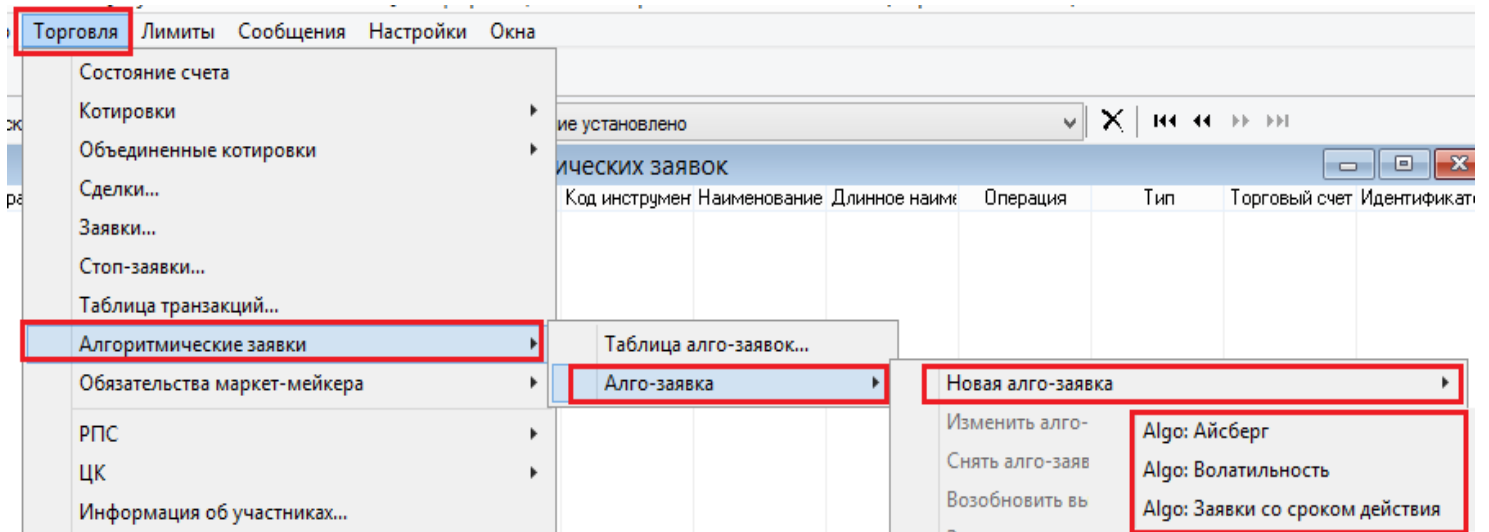
## Уважаемый клиент!

В терминале QUIK с текущего времени Вам подключен новый функционал «Алгоритмические заявки QUIK».

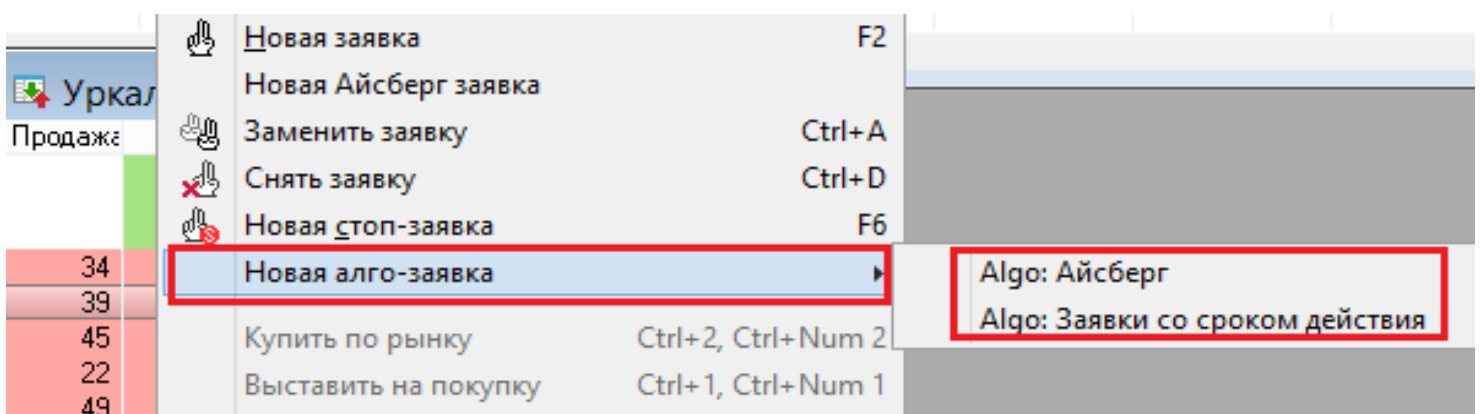
В текущий момент доступны следующие виды алгоритмических заявок:

Тип Алго-заявок	Доступно для Фондового рынка	Доступно для Срочного рынка
Айсберг-заявки	да	да
Волатильность	нет	да (для опционов)
Со сроком действия	да	нет

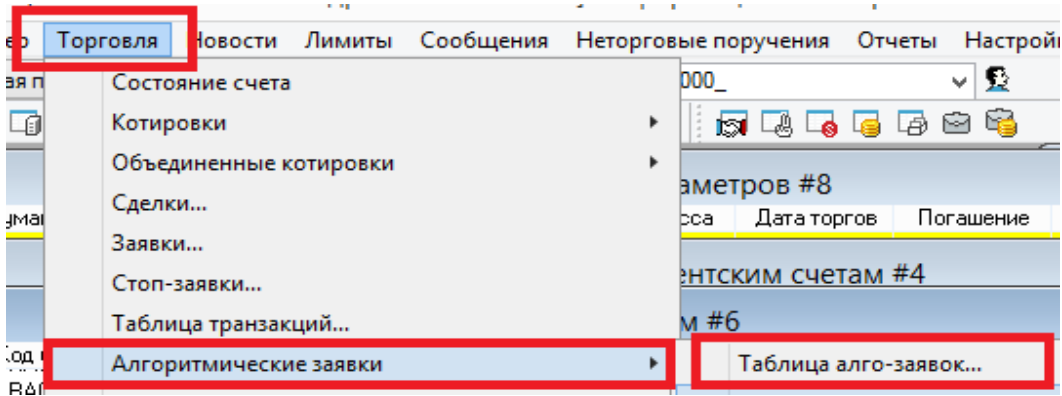
Алгоритмические заявки доступны из меню Торговля\Алгоритмические заявки\Алго-заявки\Новая заявка\



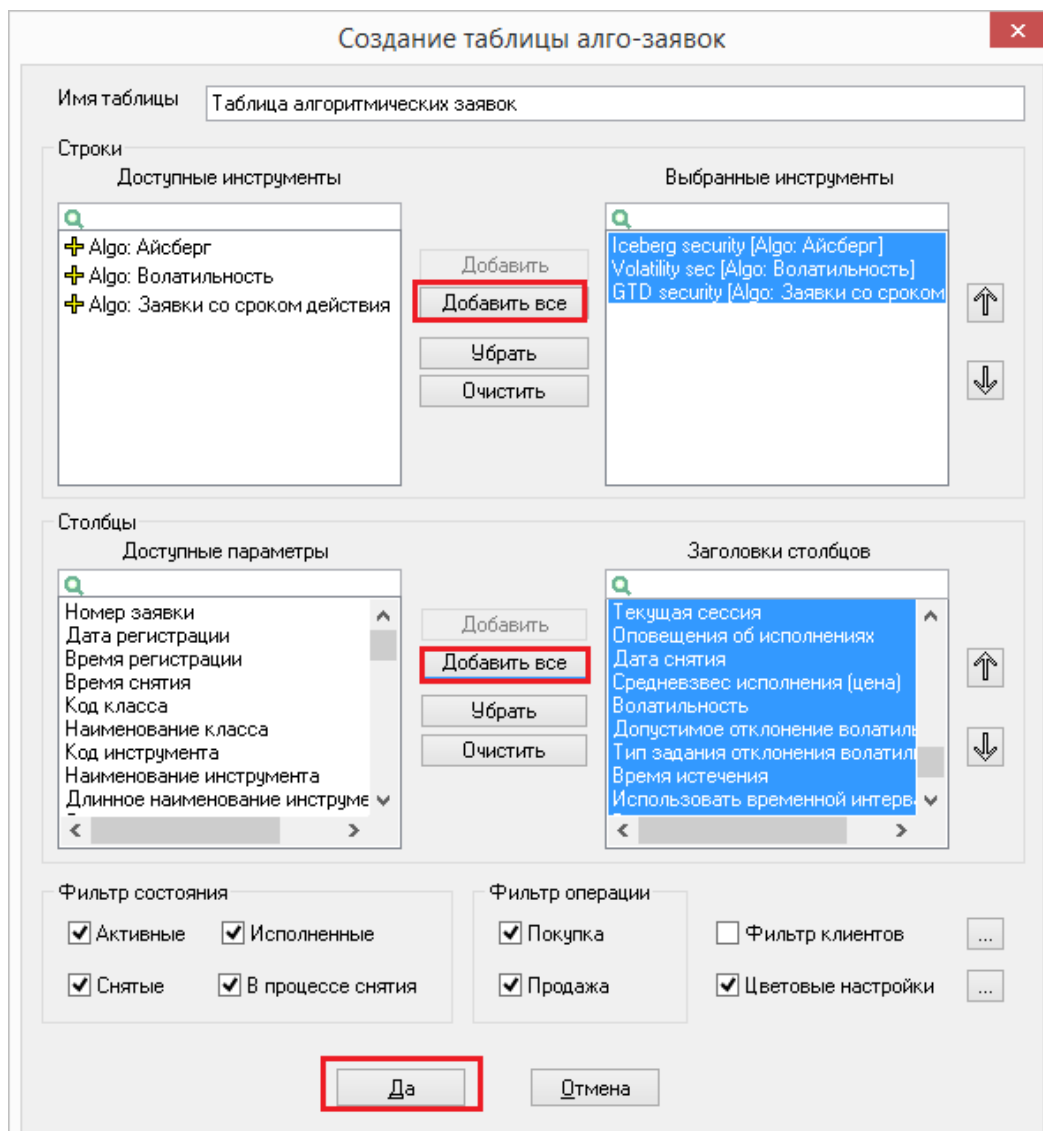
Кроме того, некоторые типы алго-заявок Вы можете выставить через окно котировок «стакан».



При выставлении новой Алгоритмической заявки Вы можете посмотреть ее в таблице Алго-заявок. В меню Торговля\Алгоритмические заявки\Таблица алго-заявок\



В открывшемся окне необходимо нажать «Добавить все» далее «Да»



Откроется таблица (см. ниже), в которой Вы сможете увидеть Вашу Алго-заявку:

Номер заявки	Дата регистра	Время регистр	Дата снятия	Время снятия	Код класса	Наименовани	Код инс	Наименовани	Длинное наи	Операция	Тип	Торговый счет	Идентиф

**Обратите внимание!** Снятие заявок доступно через таблицу «Алгоритмических заявок», при снятии алгоритмической заявки снимается так же порожденная ей «обычная» заявка, но при снятии порожденной заявки алгоритмическая заявка не снимается, при этом алгоритмическая заявка вновь выставляет порожденную заявку.

Номер заявки	Дата регистра	Время регистр	Время снятия	Код класса	Наименование	Код инструмен	Наименование	Длинное наимк	Операция	Тип	То
1	06.11.2014	15:45:21	15:45:22	SPBFUT	FORTS: Фьючей	СНХ4	СНМФ-11 14	СНМФ-11 14	Покупка	Лимитированн	SP

Новая алго-заявка

Изменить алго-заявку Ctrl+A

Снять алго-заявку Ctrl+D

### Краткий механизм выставления Алгоритмических заявок:

Алгоритмическая заявка типа «Айсберг»:

Основным отличием данной заявки от биржевой заявки типа «Айсберг», является возможность выставления ее со сроком действия, а также выставление данного типа на Срочном рынке.

#### Algo: Айсберг Ввод алго-заявки

Класс  
FORTS: Опционы

Инструмент  
GM062500BL4

Покупка     Продажа

Срок действия  
В течение сессии

Видимое Кол-во

Код Клиента

Организация  
SPBFUT (SPBFL)

Торговый Счет  
SPBFUT00000

Агрессивность  
Нормальный ре

Дата  
05.11.2014

Условие снятия  
 до отмены  
порожд. заявки

Кол-во (лот 1)  
  
max: 0

Цена  
  
 Рыночная

Комментарий

Оповещать об исполнении связанных заявок

## Параметры, указываемые в заявке:

1. «Класс» – выбор класса, которому принадлежит торгуемый инструмент.
2. «Организация» – идентификатор фирмы – участника торгов, от имени которой регистрируется заявка.
3. «Инструмент» – выбор инструмента из списка ценных бумаг данного класса.
4. «Торговый счет» – торговый счет для совершения операции.
5. «Покупка / продажа» – направление операции.
6. «Агрессивность» – выбор способа расчета количества бумаг в порождаемых заявках:
  - ◆ «Нормальный режим» – на каждой итерации выставляется заявка с объемом, указанным в поле «Видимое количество».
  - ◆ «Анализ ТТП» – на каждой итерации выставляется заявка с количеством, которое можно сразу исполнить по цене алго-заявки. Например, если цена спроса  $\leq$  цене алго-заявки, то выставляется заявка с количеством, равным спросу, иначе – «Видимому количеству».
  - ◆ «Анализ стакана» – на каждой итерации анализируется содержимое Таблицы котировок, и выставляется заявка с количеством, равным сумме спроса(предложения) до строчки с ценой алго-заявки. Данный вариант не доступен, если указано исполнение заявки по рыночной цене.
7. «Тип исполнения» – выбор срока действия алго-заявки:
  - ◆ «Сессия» – алго-заявка должна быть исполнена в текущую торговую сессию,
  - ◆ «До даты» – алго-заявка должна быть исполнена до указанной даты включительно,
  - ◆ «До отмены» – срок исполнения не ограничен.
8. «Дата» – Дата действия. Поле доступно, если указан «Тип исполнения» – «До даты».
9. «Срок действия», флажок «до отмены порожденной заявки» – признак снятия алгоритмической заявки при отмене порожденной им заявки.
10. «Видимое кол-во» – количество бумаг в каждой заявке, выставляемой в торговую систему, выраженное в лотах (величина DisplayedQty).
11. «Кол-во (лот = ...)» – суммарное количество бумаг в данной алгоритмической заявке, выраженное в лотах. В скобках указано количество бумаг в одном лоте.
12. «Цена» – цена за единицу инструмента. При установке флажка в поле «Рыночная», операции будут проводиться по рыночной цене.
13. «Код клиента» – идентификатор клиента в системе QUIK.
14. «Комментарий» – текстовый комментарий к заявке.
15. «Оповещать об исполнении связанных заявок» – отправлять оповещение при исполнении связанных заявок.

### Алгоритмическая заявка типа “Волатильность”:

Алгоритм подразумевает возможность покупки/продажи опционов по заданной волатильности.

При выставлении заявки задается желаемое значение волатильности и максимальное допустимое отклонение волатильности в процентах или пунктах волатильности. Далее для данного значения волатильности рассчитывается цена опциона с использованием модели Блэка-Шоулза, и по рассчитанной цене выставляется заявка в торговую систему. После каждого изменения параметров, участвующих в расчете цены по волатильности, вычисляется максимально и минимально допустимая цена опциона, исходя из допустимого отклонения, и при отклонении цены выставленной заявки за пределы полученного диапазона, неисполненное количество перевыставляется с новой ценой.

При наступлении промежуточного клиринга все активные заявки по волатильности автоматически приостанавливаются. Если в это время выставляется новая связанная заявка, то происходит проверка статуса клиринга (параметр «clstate») по инструменту. Если статус – «Идет пр.», исполнение алго-заявки приостанавливается. При снятии активной заявки по волатильности формируется диагностика: «Невозможно снять алго-заявку N... Идет пром. клиринг».

После завершения пром. клиринга, алго-заявка продолжает функционирование.

#### Algo: Волатильность Ввод алго-заявки ✕

Класс FORTS: Опционы	Инструмент GM062500BL4
Организация SPBFUT [SPBFUT]	Торговый Счет SPBFUT00000
<input checked="" type="radio"/> Покупка <input type="radio"/> Продажа	
Кол-во (лот 1) <input type="text"/>	Волатильность <input type="text"/>
Тип отклонения волатильности Абс. изменение	Допустимое отклонение <input type="text"/>
Цена опциона (мин., текущая, макс.) <input type="text"/> <input type="text"/> <input type="text"/>	
Код Клиента <input type="text"/>	Комментарий <input type="text"/>
<input type="checkbox"/> Оповещать об исполнении связанных заявок	
<input type="button" value="Да"/>	<input type="button" value="Отмена"/>

### Параметры, указываемые в заявке:

1. «Класс» – выбор класса, которому принадлежит торгуемый инструмент.
2. «Инструмент» – выбор инструмента из списка контрактов данного класса.
3. «Организация» – идентификатор фирмы-участника торгов, от имени которой регистрируется заявка.
4. «Торговый счет» – торговый счет для совершения операции.
5. «Покупка»/«продажа» – направление операции.
6. «Кол-во» – количество контрактов, выраженное в лотах. В скобках указано количество бумаг в одном лоте.
7. «Волатильность» – выбор допустимого значения волатильности ( величина  $\sigma$ ).
8. «Тип отклонения волатильности» – тип задания допустимого отклонения волатильности:
  - ◆ «% от волатильности» – в процентах от значения волатильности;
  - ◆ «Абс. изменение» – в пунктах волатильности.
9. «Допустимое отклонение» – допустимое отклонение значения волатильности.
10. «Цена опциона (мин., текущая, макс.)» – справочные поля, отображающие значения цен опциона, соответствующих введенным значениям волатильности и допустимого отклонения. Минимальная цена опциона (левая ячейка) соответствует значению волатильности с допустимым отклонением вниз, текущая цена (средняя ячейка) – заданному значению волатильности, максимальная цена (правая ячейка) – значению волатильности с допустимым отклонением вверх. Значения в этих полях пересчитываются при изменении введенных значений волатильности и допустимого отклонения, а также при изменении цены последней сделки для базового актива опциона.

Для отображения цен опционов в данных полях необходимо, чтобы:

  - ◆ В настройках программы (пункт меню Настройки/Основные, раздел «Торговля» / «Заявки» / «Алгоритмические заявки» был включен флажок «Рассчитывать цену в форме подачи заявки по указанной волатильности»,
  - ◆ Для всех фьючерсов, являющихся базовыми активами опционов, настроено получение параметра «Цена последней сделки». Если в настройках программы (пункт меню Настройки/Основные раздел «Программа» / «Получение данных») выбран способ «Исходя из настроек открытых пользователем таблиц», то получение параметра будет настроено автоматически. Если выбран другой способ, то нужно открыть пункт меню Связь/Списки, выбрать класс «Фьючерсы ФОРТС» и убедиться, что в фильтре получаемых параметров присутствует «Цена последней сделки». Получение этого параметра отключать нельзя, иначе расчет цен опциона будет некорректным.
11. «Код Клиента» – идентификатор клиента в системе QUIK.
12. «Комментарий» – текстовый комментарий к заявке.
13. «Оповещать об исполнении связанных заявок» – отправлять оповещение при исполнении связанных заявок.

## Алгоритмическая заявка со сроком действия

**Обратите внимание!** В данный момент не доступна для рынка ФОРТС.

Алгоритм заявки со сроком действия (GTD-заявки) подразумевает имитацию биржевой заявки со сроком действия: «До даты», «До отмены» и «До времени».

При регистрации GTD-заявки, на биржу сразу выставляется связанная заявка с параметрами:

- ◆ срок действия – «Сессия»,
- ◆ тип – «Лимитированная».

Остальные параметры связанной заявки соответствуют параметрам алго-заявки, введенной пользователем.

При снятии GTD-заявки связанная заявка снимается. При снятии связанной заявки снимается GTD-заявка. В начале следующего дня GTD-заявка, с не истекшим сроком действия, выставляет на биржу связанную заявку.

GTD-заявки «До времени» при наступлении указанного в алго-заявке времени снимают связанную заявку и изменяют статус на «Снята».

Algo: Заявки со сроком действия Ввод алго-зая... ✕

Класс	Организация
NY_AMEX	ATON [MC00314]
Инструмент	Торговый Счет
LCI	L01+00000F00

Покупка     Продажа

Срок действия	Дата	Время
До отмены	05.11.2014	12:43:54

Рабочий интервал

Начало:	10:30:00	Окончание:	23:55:00
---------	----------	------------	----------

Цена	Кол-во (лот 1)	max: 0

Код Клиента	Комментарий

Оповещать об исполнении связанных заявок

## Параметры, указываемые в заявке:

1. «Класс» – выбор класса, которому принадлежит торгуемый инструмент.
  2. «Организация» – идентификатор фирмы-участника торгов, от имени которой регистрируется заявка.
  3. «Инструмент» – выбор инструмента из списка ценных бумаг данного класса.
  4. «Торговый счет» – торговый счет для совершения операции.
  5. «Покупка / продажа» – направление операции.
  6. «Срок действия» – период времени, в течение которого заявка должна быть исполнена. Может принимать одно из значений:
    - ◆ «До времени»,
    - ◆ «До даты»,
    - ◆ «До отмены».
  7. «Дата» \* – дата, до которой должна быть исполнена алго-заявка (включительно). Поле доступно, если указан «Срок действия» – «До времени», «До даты».
  8. «Время» – время окончания исполнения алго-заявки. Поле доступно, если указан «Срок действия» – «До времени». При включенной настройке «Показывать дату и время торговых данных с учетом локальной временной зоны» (подробнее см. Руководство пользователя QUIK, п. 2.18.1) значения параметров «Дата» и «Время окончания» указываются с учетом временной зоны компьютера, на котором запущен терминал QUIK
  9. «Рабочий интервал» – период времени, в течение которого биржевая заявка должна быть активна:
    - ◆ «Начало» – время выставления биржевой заявки; Значения по умолчанию времени выставления и снятия биржевых заявок по определенному биржевому классу определяется временем проведения торговой сессии.
    - ◆ «Окончание» – время снятия биржевой заявки. Значения по умолчанию времени выставления и снятия биржевых заявок по определенному биржевому классу определяется временем проведения торговой сессии.
- При установленном признаке заявка каждый день в течение своего срока действия выставляется на бирже во время, указанное в параметре «Начало», и снимается во время, указанное в параметре «Окончание».
10. «Цена» – цена за единицу инструмента.
  11. «Кол-во (лот ...)» – суммарное количество бумаг в данной алгоритмической заявке, выраженное в лотах. В скобках указано количество бумаг в одном лоте.
  12. «Код клиента» – идентификатор клиента в системе QUIK.
  13. «Комментарий» – текстовый комментарий к заявке.
  14. «Оповещать об исполнении связанных заявок» – отправлять оповещение при исполнении связанных заявок



# Спасибо за внимание!

## **Техподдержка:**

Тел.: +7 (495) 745-55-85

ICQ: 191161882

[helpdesk@aton.ru](mailto:helpdesk@aton.ru)

## **Горячая линия для частных Клиентов:**

Тел.: +7 (495) 777-66-77

Тел.: +7 (800) 333-66-77 (звонок по России бесплатный)