Принципиальные направления
развития в рамках проекта QUIK

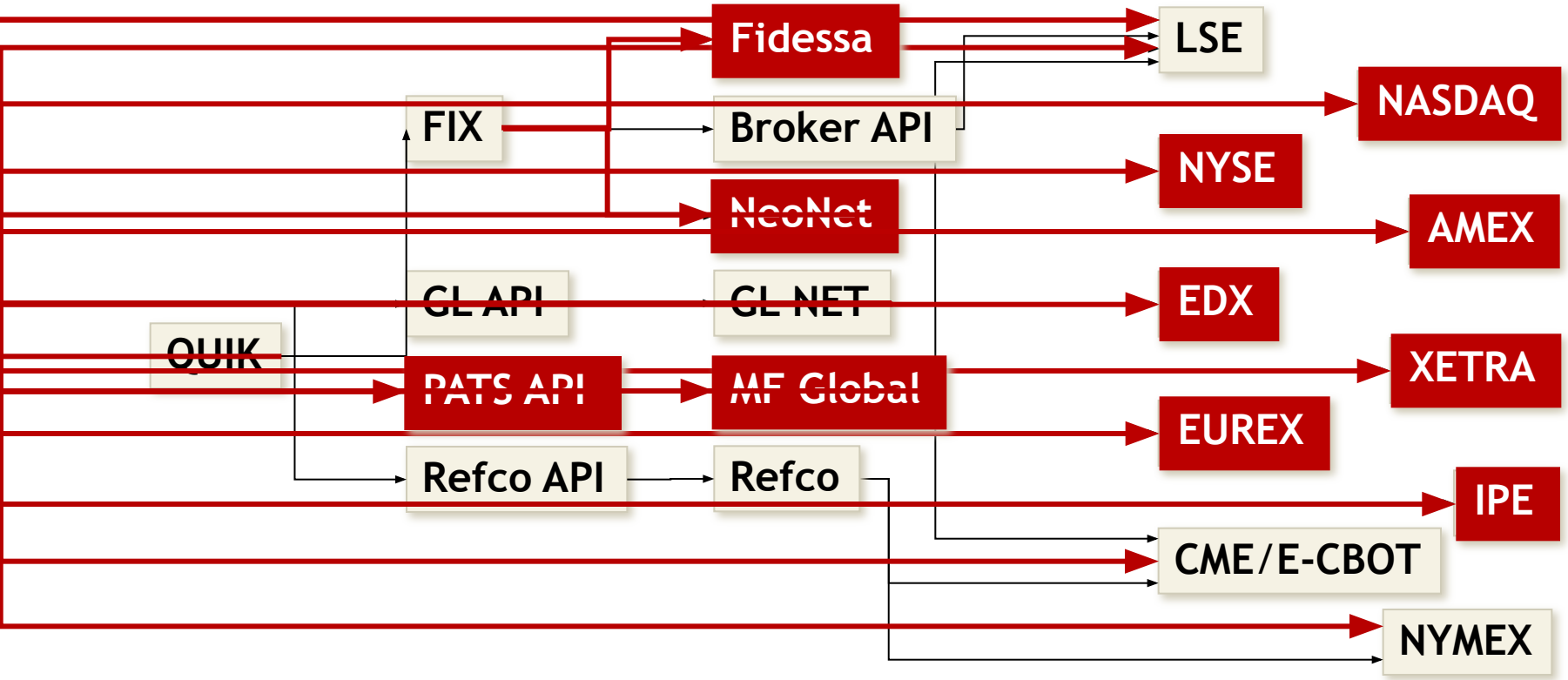
Данил Бабурин,
начальник отдела разработки ПО QUIK
ARQA Technologies

Программный интерфейс FIX

1. Поддержка версий протокола 4.0 и 4.2
2. Транспорт во фронт-офис
   и бэк-офис брокера
3. Передача транзакций из OMS в QUIK
4. Подключение «торговых автоматов»
   через FIX
5. DMA-проекты
6. Доступ к западным рынкам

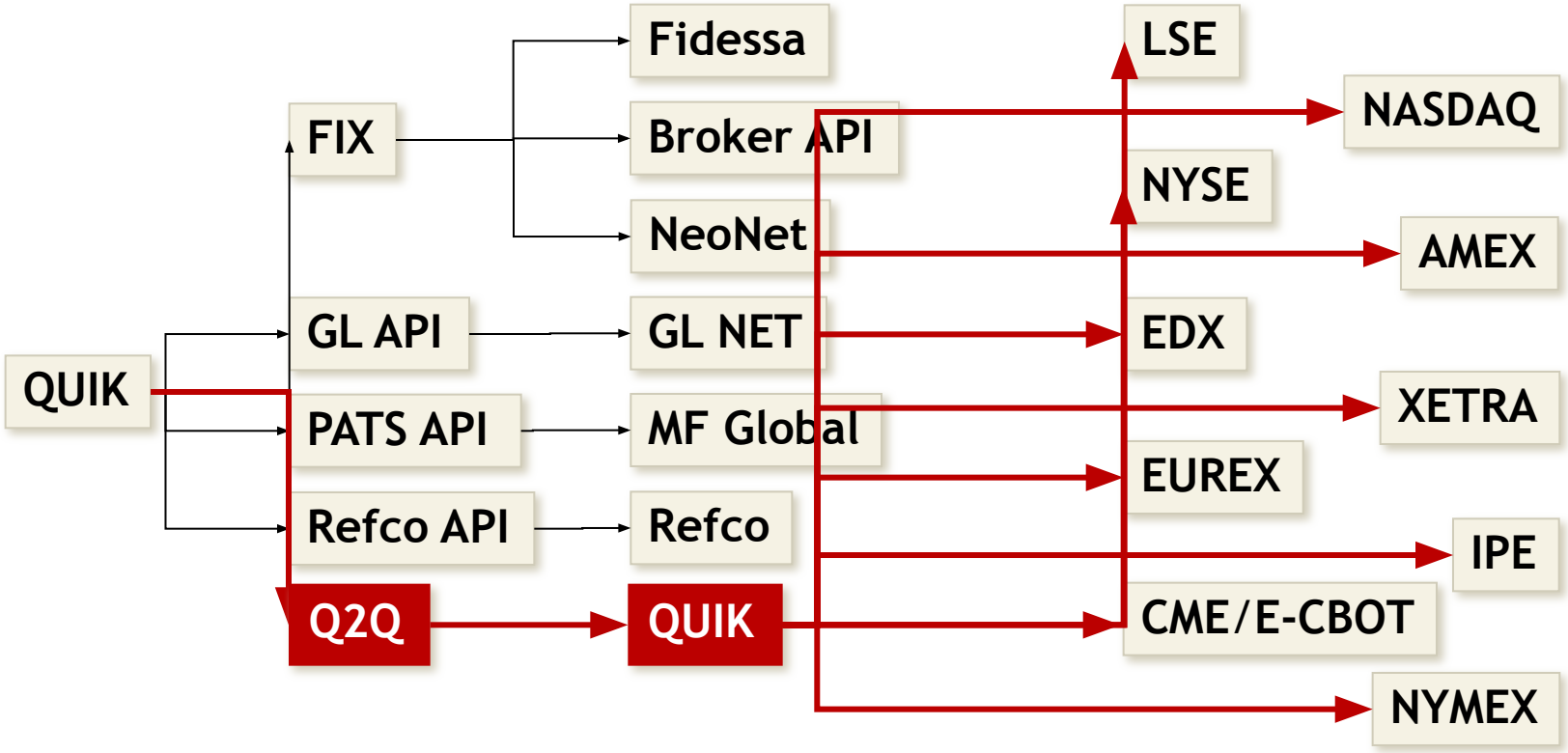
© ARQA Technologies, 2009

Варианты доступа к зарубежным рынкам



© ARQA Technologies, 2009

Варианты доступа к зарубежным рынкам



© ARQA Technologies, 2009

Контроль специальных ограничений

1. Ограничение на максимальный объем заявки, выставляемой клиентом

   ПРИМЕР: Для российских ADR на LSE можно ограничить подачу заявок на объем не более 50 000 долларов

2. Глобальный лимит, контролирующий общую задолженность

   ПРИМЕР: Лимитирование суммарного оборота клиента за день по определенному рынку

© ARQA Technologies, 2009

Схемы расчета комиссии

1. Комиссия за поручение:

   Комиссия за каждое поручение, которое привело к образованию сделки (сделок)

2. max (процент, фикс)

   Комиссия за сделку в виде процента, но не более фиксированной суммы

3. max (за штуку, фикс)

   Комиссия в зависимости от количества контрактов в заявке, без учета цены, но не более фиксированной суммы

© ARQA Technologies, 2009

Расчеты по операциям вида Т+3

1. «Классы вывода средств»

   Списание активов по факту сделки, зачисление по факту расчетов

2. «Ресурсы в наличии» и «ресурсы в пути»

   Дополнительный контроль покупательной способности с учетом неисполненных обязательств

© ARQA Technologies, 2009

Мультивалютная позиция

1. Разные валюты – разные позиции

   Везде своя покупательная способность

2. Сервис ведения различных валютных позиций с общей покупательской способностью

   При использовании Модуля неторговых поручений – возможность операций конвертации

3. Единая позиция для учета всех операций клиента

   Онлайн-конвертация

4. Совместное использование п.2 и п.3

© ARQA Technologies, 2009

Единая денежная и бумажная позиция

1. Единая бумажная позиция:
   - Арбитраж между площадками,
   - Арбитраж с внебиржевым рынком
2. Единая денежная позиция:
   - Для западных и российских площадок,
   - Для спот- и срочного рынка

© ARQA Technologies, 2009

Портфельное гарантийное обеспечение

Назначение Модуля расчета ПГО:

1. Настроить алгоритм контроля рисков для конечных клиентов по правилам, независимым от правил контроля рисков на конкретной бирже
2. Предоставить клиентам сервис единой денежной позиции между спот- и срочным рынками
3. Получить возможность предоставления полноценного клиентского сервиса на западных срочных площадках

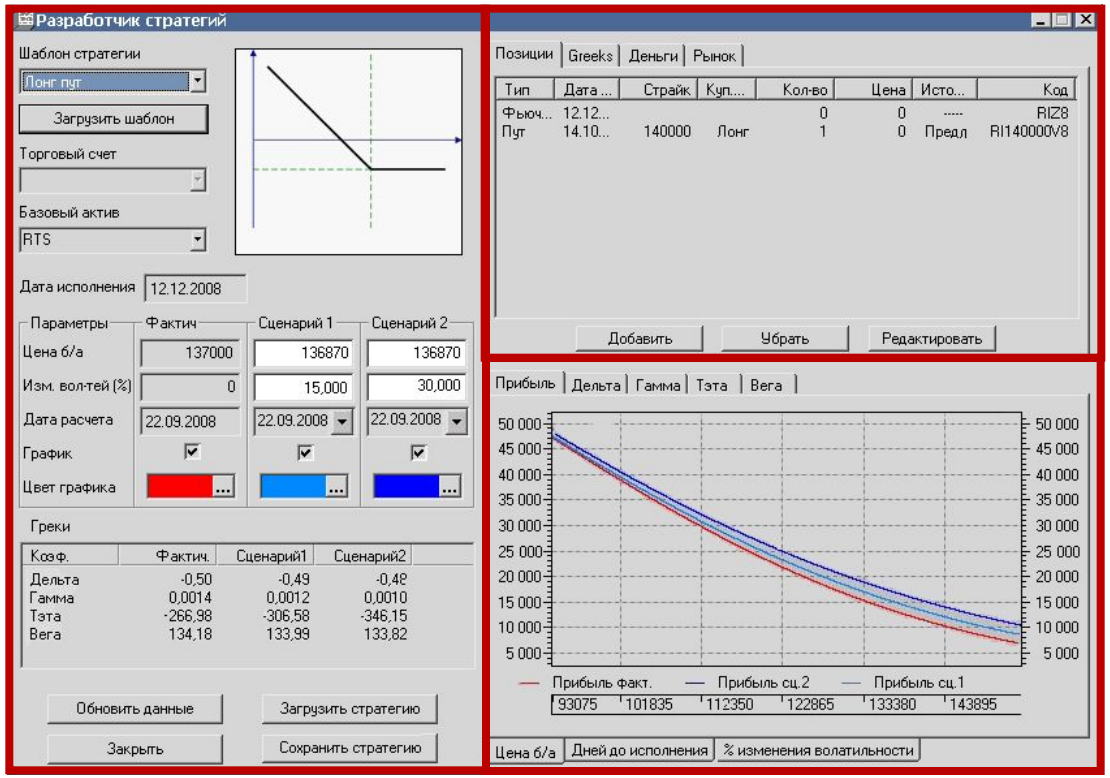
© ARQA Technologies, 2009

Модуль опционной аналитики

Панель параметров

Панель ввода стратегии

Окно графиков

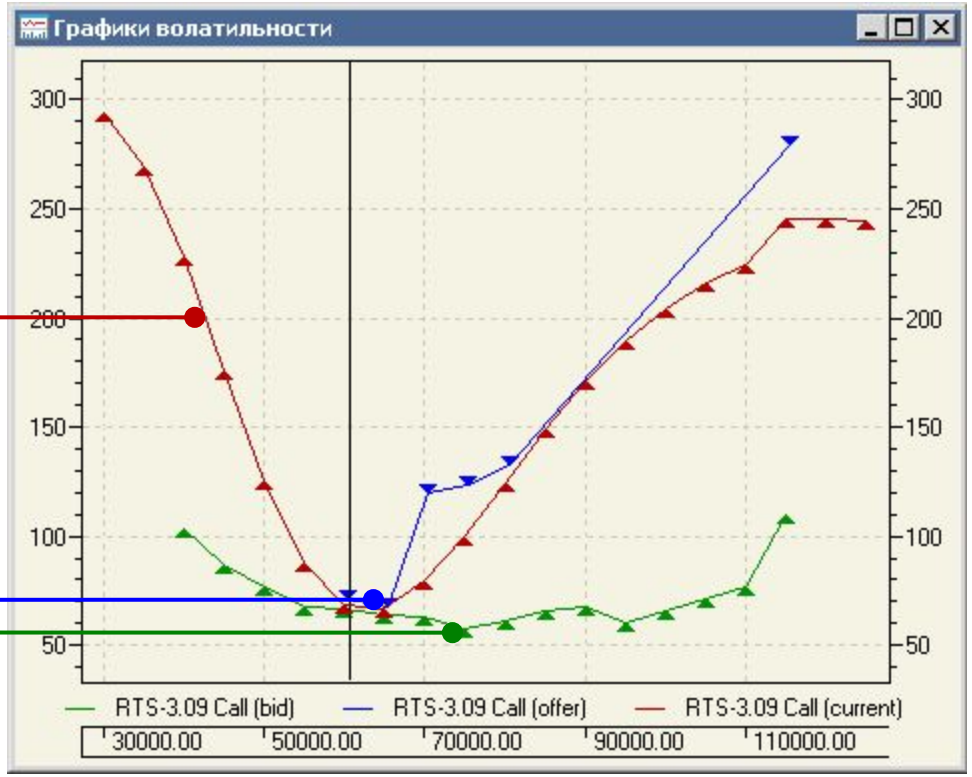


© ARQA Technologies, 2009

График волатильности

Теоретическая волатильность

Волатильность по котировкам Bid и Offer



© ARQA Technologies, 2009

Модуль алгоритмической торговли

1. **Айсберг (Iceberg)**

   Заявка со скрытым количеством, при исполнении – повторение заявки, и так далее до исчерпания заданного объема

2. **Покупка/продажа волатильности (FORTS)**

   Заявки по опционам с указанием волатильности и допустимого отклонения в %. Расчет цены заявок по волатильности

3. **TWAP (Time Weighted Average Price)**

   Равномерное распределение объема заявки в указанном промежутке времени по рыночной цене

4. **VWAP (Volume Weighted Average Price)**

   Средневзвешенная цена покупки/продажи пакета – не хуже средневзвешенной цены по рынку

© ARQA Technologies, 2009

ARQA Technologies

Отдел продаж:

sales@arqa.ru

(383) 219-1694

http://www.arqa.ru

© ARQA Technologies, 2009