

Принципиальные направления развития в рамках проекта QUIK

Данил Бабурин,
начальник отдела разработки ПО QUIK
ARQA Technologies

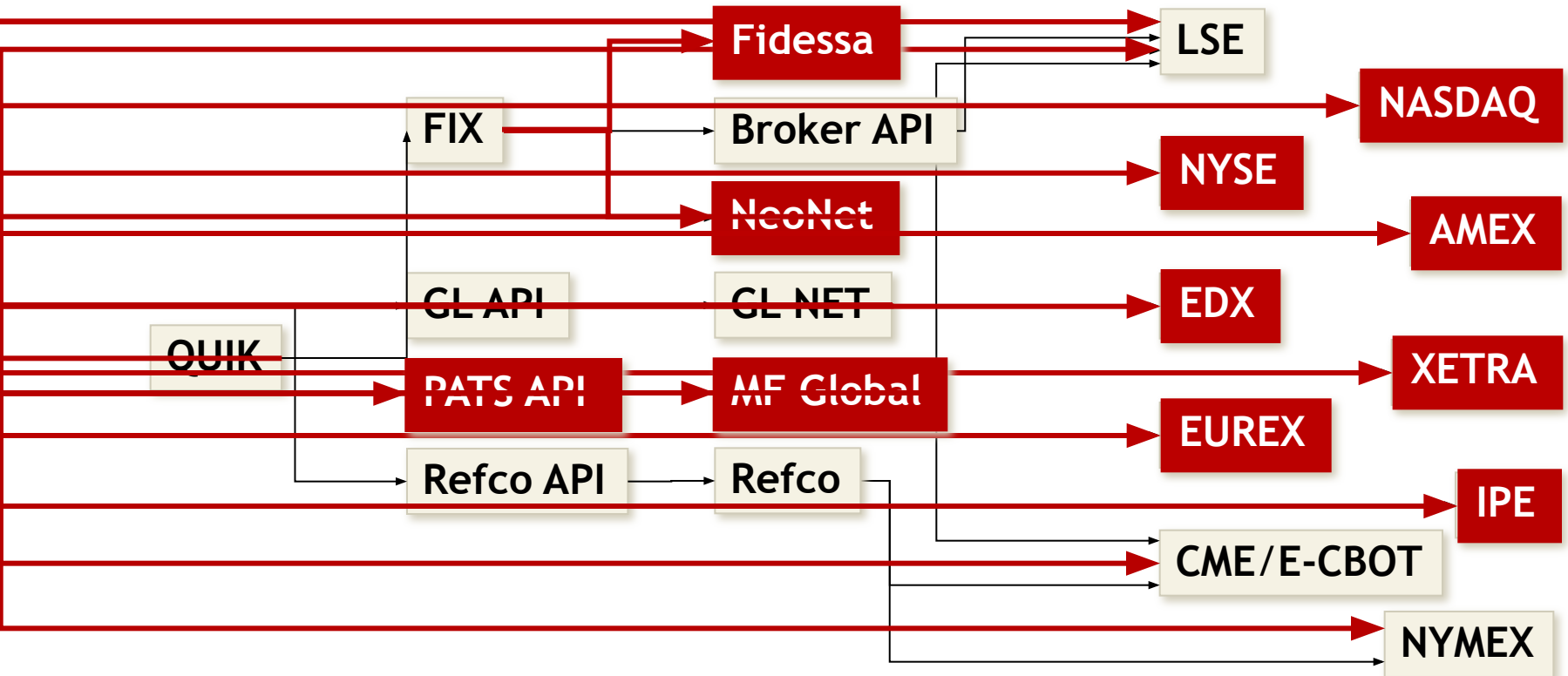


Программный интерфейс FIX

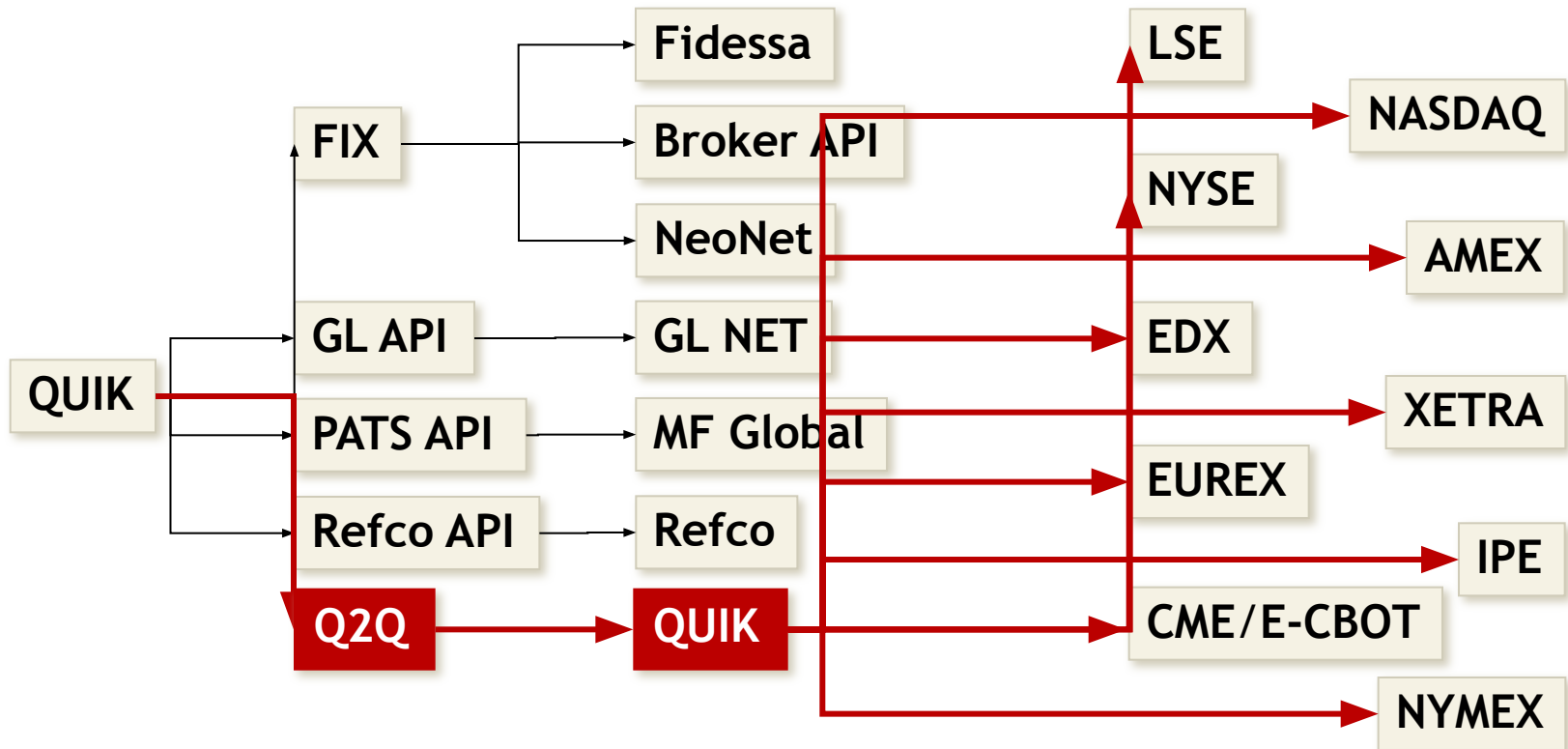
1. Поддержка версий протокола 4.0 и 4.2
2. Транспорт во фронт-офис
и бэк-офис брокера
3. Передача транзакций из OMS в QUIK
4. Подключение «торговых автоматов»
через FIX
5. DMA-проекты
6. Доступ к западным рынкам



Варианты доступа к зарубежным рынкам



Варианты доступа к зарубежным рынкам





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

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



Расчеты по операциям вида T+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





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

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



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



Модуль опционной аналитики

Панель параметров

Панель ввода стратегии

Окно графиков

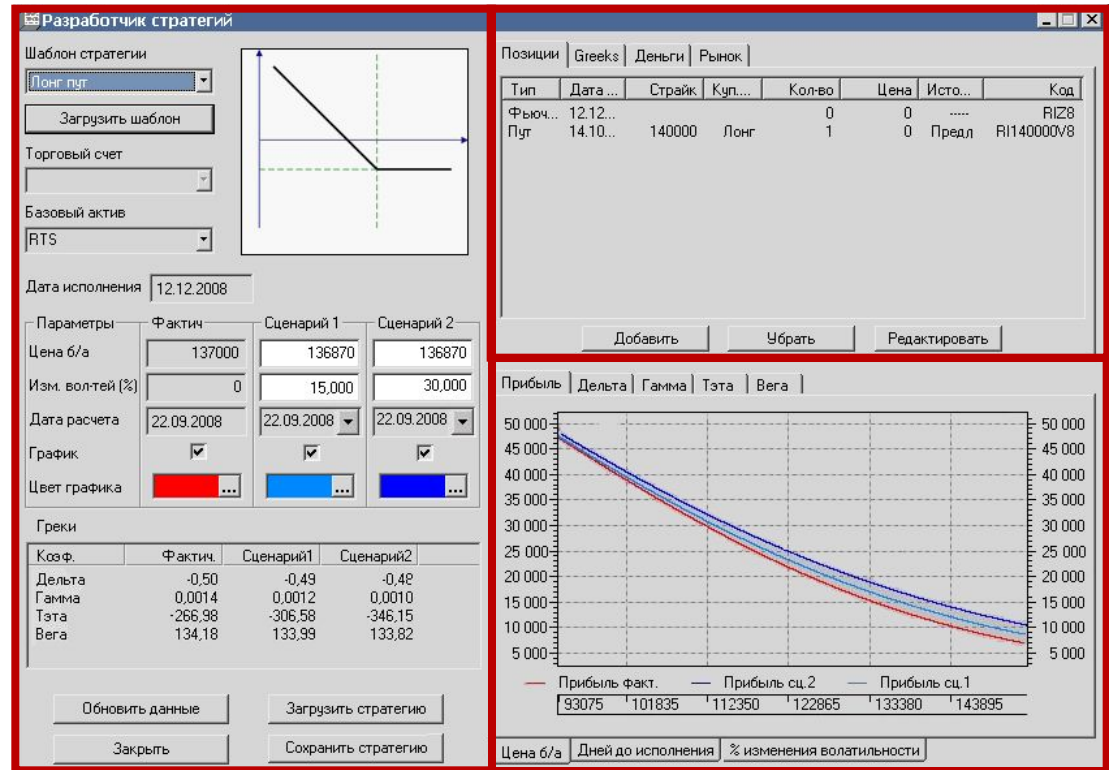
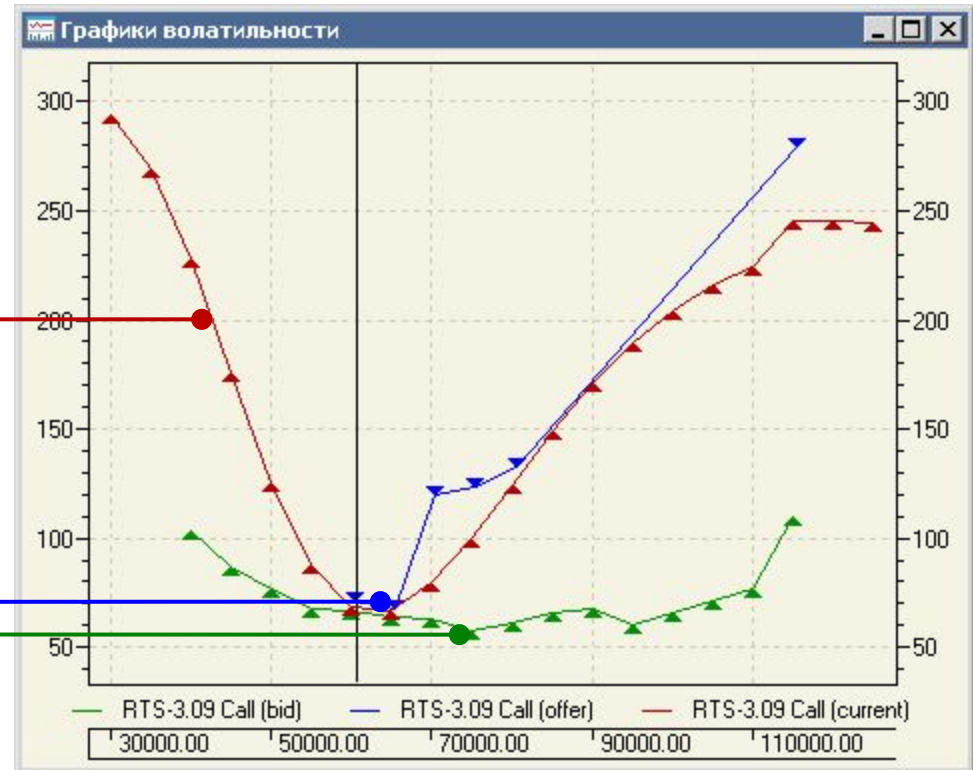


График волатильности

Теоретическая
волатильность

Волатильность
по котировкам
Bid и Offer





Модуль алгоритмической торговли

1. Айсберг (Iceberg)

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

3. TWAP (Time Weighted Average Price)

Равномерное распределение объема заявки в указанном промежутке времени по рыночной цене

2. Покупка/продажа волатильности (FORTS)

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

4. VWAP (Volume Weighted Average Price)

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



Принципиальные направления развития
в рамках проекта QUIK

ARQA Technologies

Отдел продаж:

sales@arqa.ru

(383) 219-1694

<http://www.arqa.ru>

