



QUIK. Инструменты для торговли на срочном рынке Украинской биржи

Виталий Скоробогатов

Руководитель отдела технической поддержки QUIK, ARQA Technologies

arqa.ru

Стандартные возможности QUIK

- Блок скальперских операций в стакане
- Функционал работы с условными заявками
- Комбинированный stop-limit и take-profit
- Stop-limit с условием по другому инструменту
- Функционал объединенного стакана котировок
- Автоматизация торговли

Информация о позициях клиентов

- Ограничения срочного рынка
- Общая вариационная маржа
- Открытые позиции и маржа по клиенту

Риск-менеджмент

- Учет и контроль рисков
- Установка ограничений по клиентским счетам
- Различные способы pre-trade контроля:
 - по алгоритмам Украинской биржи
 - с использованием ПГО QUIK
 - единая денежная позиция QUIK
 - для украинских, российских и западных площадок
 - для спот- и срочного рынка



CoLibri FM



Опционы

- Доска опционов
- Расчет греков по модели Блека-Шолеса

	Тип	Волатильн	Банковская %	Премия	Страйк	Расч. цена	Дельта(%)	Гамма(%)	Тэта(руб)	Po(руб)	Вега(руб)
LK0008500I5	CALL	15	8	2 849,75	8 500	11 224	0,99	0,0000	0,58	-4,96	0,00
LK0008500U5	PUT	15	8	0,00	8 500	11 224	-0,00	0,0000	-0,00	0,00	0,00
LK0009000I5	CALL	15	8	2 357,16	9 000	11 224	0,98	0,0000	0,47	-4,04	0,06
LK0009000U5	PUT	15	8	0,02	9 000	11 224	-0,00	0,0000	-0,01	0,01	0,06
LK0009500I5	CALL	15	8	1 865,03	9 500	11 224	0,98	0,0000	0,28	-3,03	0,68
LK0009500U5	PUT	15	8	0,49	9 500	11 224	-0,00	0,0000	-0,09	0,10	0,68
LK0010000I5	CALL	15	8	1 377,51	10 000	11 224	0,95	0,0001	-0,25	-1,46	3,83
LK0010000U5	PUT	15	8	5,57	10 000	11 224	-0,04	0,0001	-0,51	0,76	3,83
LK0010500I5	CALL	15	8	913,87	10 500	11 224	0,84	0,0003	-1,44	1,79	11,11
LK0010500U5	PUT	15	8	34,54	10 500	11 224	-0,15	0,0003	-1,59	3,09	11,11
LK0011000I5	CALL	15	8	518,99	11 000	11 224	0,62	0,0005	-2,86	7,34	18,07
LK0011000U5	PUT	15	8	132,26	11 000	11 224	-0,37	0,0005	-2,90	7,72	18,07
LK0011500I5	CALL	15	8	241,34	11 500	11 224	0,35	0,0005	-1,10	-7,32	17,76
LK0011500U5	PUT	15	8	347,21	11 500	11 224	-0,63	0,0005	-1,03	-7,86	17,76
LK0012000I5	CALL	15	8	89,25	12 000	11 224	0,15	0,0003	0,87	2,13	11,22
LK0012000U5	PUT	15	8	1 117,02	12 000	11 224	-0,87	0,0003	-0,87	-11,22	11,22
LK0012500U5	PUT	15	8	0	12 500	11 224	0	0	0	0	0
LK0013000I5	CALL	15	8	0	13 000	11 224	0	0	0	0	0
LK0013000U5	PUT	15	8	0	13 000	11 224	0	0	0	0	0

Цена	Объем
10	216
11	250
100	500
200	126
211	50
212	250
230	250
235	50
260	999
262	250
300	250
528	4
530	100

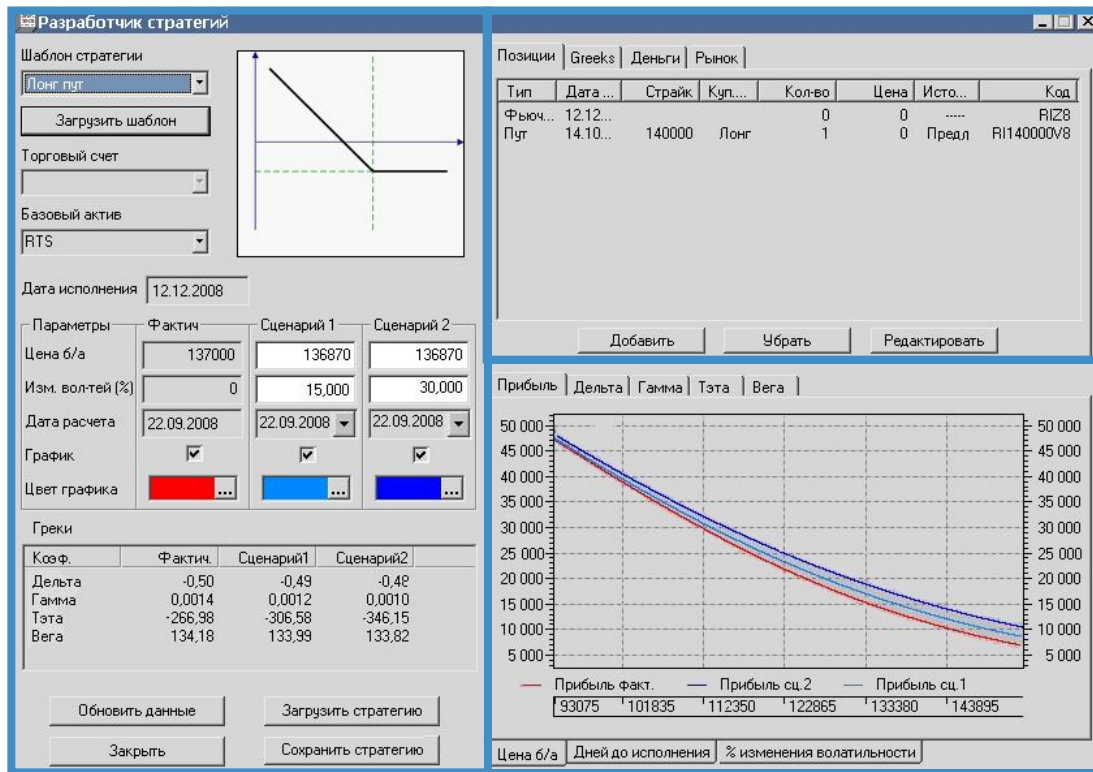
PUT Опцион	PUT Спрос	PUT Пред.	PUT Расч.прем	Страйк	CALL Расч.прем	CALL Спрос	CALL Пред.	CALL Опцион
LK0008500U5	0	0	0,00	8 500	2 849,75	0	0	LK0008500I5
LK0009000U5	0	0	0,02	9 000	2 357,16	0	0	LK0009000I5
LK0009500U5	11	30	0,49	9 500	1 865,03	1 251	0	LK0009500I5
LK0010000U5	36	49	5,57	10 000	1 377,51	1 210	1 266	LK0010000I5
LK0010500U5	91	100	34,54	10 500	913,87	765	810	LK0010500I5
LK0011000U5	235	260	132,26	11 000	518,99	434	470	LK0011000I5
LK0011500U5	456	536	347,21	11 500	241,34	200	240	LK0011500I5
LK0012000U5	824	904	687,73	12 000	89,25	60	105	LK0012000I5
LK0012500U5	0	0	1 117,02	12 500	25,94	0	0	LK0012500I5
LK0013000U5	0	0	1 589,62	13 000	5,94	0	0	LK0013000I5

Модуль опционной аналитики

Панель параметров

Панель ввода стратегии

Окно графиков



Trust Manager

[[Петров Петр Петрович UID:98] Trust Manager (версия 1.4.0.178) - [5] [X]

Связь | Справочники | Заявки | Таблицы | Сервис | Окна

Текущая таблица параметров №1

	Спрос	Кол. спр	Общ. спр	Предл.	Кол. пред	Общ. пред	Макс. цена	Мин. цена	Цена после	Кол-во	Ср. взв. це	Оборот	Общ. кол-в	Цена	Объем
ИркЭнерго	7,000	29,700	269,100	7,064	12,300	270,100	7,076	6,860	7,000	200	7,000	8,137,949	1,162,500	7,725	8
ЛУКОЙЛ	1,327,500	388	3,963	1,340,000	500	7,592	1,333,230	1,276,649	1,327,500	18	1,325,584	1,761,407,938	1,328,770	7,867	2924
МосЭнерго	2,354	100	180,100	2,362	6,900	220,800	2,365	2,347	2,354	100	2,354	2,130,727	905,100	8,039	1
РАД ЭЭС	9,115	17,800	508,000	9,120	11,700	970,300	9,167	9,100	9,120	20,400	9,137	1,195,323,349	130,826,400	8,054	4
Ростел -ao	65,850	12,835	44,149	65,860	4	24,625	65,100	65,200	65,850	14	65,763	556,739,709	8,465,860	8,232	1
Сбербанк	24,889,000	64	158	24,900,000								299,400,292	12,130	8,243	6

Ограничения на группы

Имя груп	Группа инст	Тип огра	Лимит	Текущий	Ограничени
Group_1	BlueChips	не менее	50	100.00	Портфель
Group_2	BlueChips	не менее	30	100.00	<Stocks

Группы инструментов

Код	Описание	Содержимое
<Money>	Денежные акт...	
<Stocks>	Все акции	
<Bonds>	Все облигации	
BlueChips	Голубые фишки	IRGZ [EQBR], LKOH ...
Futures	Фьючерсы FO...	SPBFUT

Позиция на срочном рынке по группе Group_5

Код актива	Наимен...	Позиция ...	Тек. позиция	Те
EERU-9.05	ESU5	-5	-5	

Текущая таблица параметров №2

	Класс	Спрос	Предл.	Кол. спрос	Кол. предл	Макс. цена	Мин. цена	Цена после	% измен.закр.
ESU5	Фьючерсы FORTS	9,136	9,139	53	1	9,143	9,135	9,135	-0.06
ESZ5	Фьючерсы FORTS	9,225	9,260	50	200	0	0	0	0.00
GMU5	Фьючерсы FORTS	20,204	20,293	9	1	20,281	20,260	20,260	0.29
GMZ5	Фьючерсы FORTS	0	21,059	0	14	0	0	0	0.00

Заккрытие позиции на срочном рынке

Класс инструментов: Фьючерсы FORTS | Инструмент: ESU5

Цена: 9139

Лучший спрос: 9136

Лучшее предложение: 9139

Последняя цена: 9135

Тип позиций: длинные короткие

Величина позиции: все позиции позиции за сегодня доля всех позиций произвольное количество позиций (округл. вниз) произвольное количество позиций (сохр. кол-ва)

Количество: 5 | Группа: Group_5

Да | Отмена

ESU5 [...]

Цена	Объем
8935	3
9000	5
9130	350
9131	5
9135	32
9136	53
9139	1
9140	25
9141	1
9142	62
9144	5
9145	6
9147	2
9148	300
9158	30
9160	250

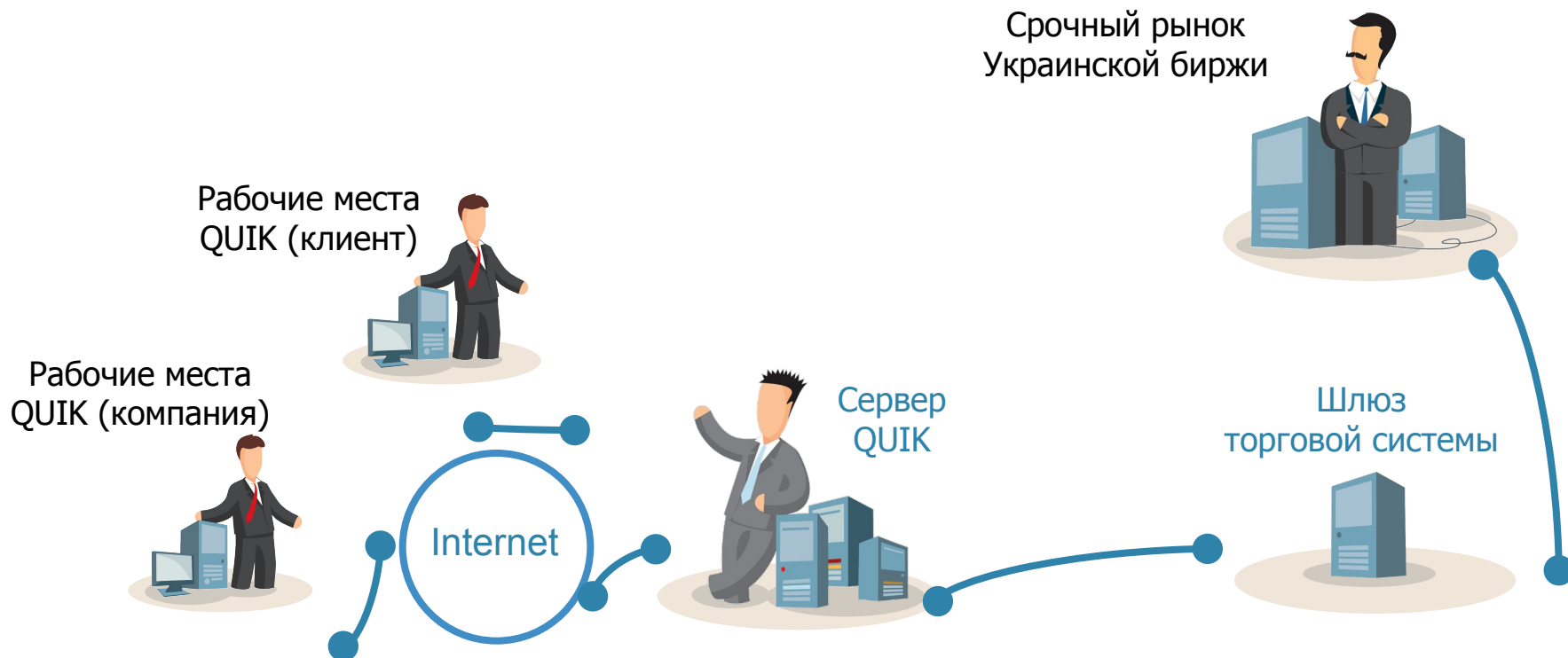
ESZ5 [...]

Цена	Объем
9209	100
9225	50
9260	200
9275	50

Общая | Позиции | Котировки | Сообщения

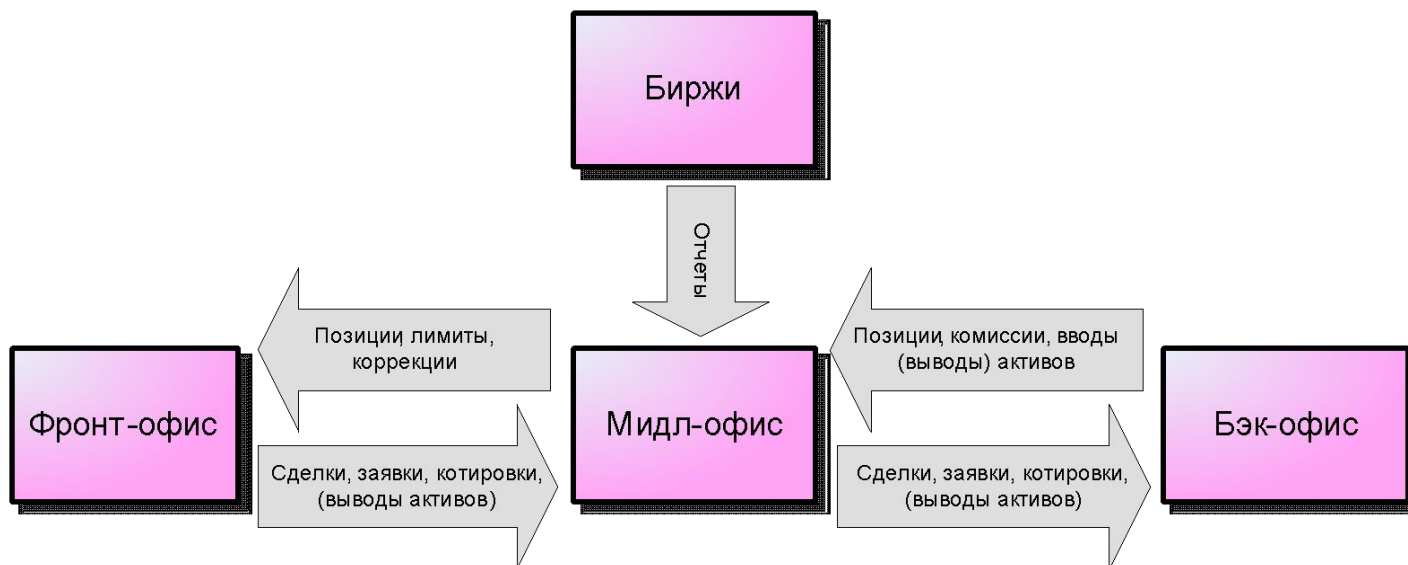
Дата: 26.08.05 | Соединение установлено

Тестовый контур



Бэк-офис брокера QORT

- поддержка украинского законодательства
- интеграция с QUIK
- обработка операций онлайн
- автоматическая регистрация пользователей QUIK



Контакты

Отдел продаж и маркетинга
sales@arqa.ru

+7 (383) 219-1619

