

Описание десктоп торгового терминала АЕ

1. Доска инструментов Instrument desk
2. Стакан котировок Market depth
3. Доска опционов Option desk
4. Калькулятор опционов Option calculator
5. Конструктор опционных стратегий Option Chart
6. Редактор кривых волатильности Volatility editor
7. Графики кривых волатильности
8. Калькулятор спредов опционов
9. Монитор опционных стратегий
10. Создание и управление стратегиями исполнения
11. Стратегия исполнения Limit strategy
12. Стратегия исполнения Volatility limit strategy
13. Position group
14. Стратегия исполнения Connected order strategy (Робот связанных ордеров)
15. Range Hedger дельта хеджер с большими возможностями



Доска инструментов - Instrument desk

Доска инструментов — одно из основных окон программы, отображает различные финансовые инструменты, по умолчанию - фьючерсы АЕ

Instrument desk												▼	×
Ticker	Description	Class	Lot	Exp.Date	BidV	Bid	Ask	AskV	▲	Last	Last volume	LastTime	
BTC		Index	1							46 856	1	10:14:23	
ETH		Index	1							3 092	1	10:14:23	
BTCU21.AE	BTC U2021	Futures	1	24.09.2021	1	47 140	47 164	44		47 144	1	10:14:23	
ETHU21.AE	ETH U2021	Futures	1	24.09.2021	88	3 109	3 119	44		3 112	1	10:14:15	
BTC44000CU21	BTC 44000 Call U2021	Option	1	24.09.2021	100	6 214	6 414	100		6 423	25	10:06:54	
BTC50000CU21	BTC 50000 Call U2021	Option	1	24.09.2021	100	3 322	3 482	100		3 324	10	10:07:08	
ETH3200CU21	ETH 3200 Call U2021	Option	1	24.09.2021	100	300	310	100		309	100	10:10:18	
ETH2800PU21	ETH 2800 Put U2021	Option	1	24.09.2021	100	180	210	100		181	50	10:10:23	

Колонки данных окна: тикер, описание инструмента, класс, размер лота, цены бид и аск, цена последней сделки, объем последней сделки, время последней сделки, дневной объем, открытый интерес расчетная цена, изменение цены последней сделки от расчетной цены в % и др.

Нажав «правую кнопку» мыши на любом инструменте откроется контекстное меню:

Instrument desk											
Ticker	Exp.Date	▲	BidV	Bid	Ask	AskV	Last	Last volume	LastTime	Day volume	OI
BTC							46 136	1	12-19-18	2 616	
ETH							3 387				
ETHU21.AE	24.09.2021		44	3 400	3 406	1	3 405				0
BTCU21.AE	24.09.2021		44	46 383	46 423	44	46 403				34
BTC44000CU21	24.09.2021		100	4 177	4 377	100	4 207				2
BTC50000CU21	24.09.2021		100	1 498	1 658	100	1 554				0
ETH3200CU21	24.09.2021		100	362	372	100	372				0
ETH2800PU21	24.09.2021		100	42	72	100	68				0

- + Add instrument
- ✗ Delete instrument
- TE Set caption
- Show OHLC chart
- Show deal desk
- Show instrument properties
- Show market depth
- Show option calculator
- Show option desk
- Show option spread calculator
- Show option strategy monitor
- Show vertical option calculator
- Show volatility editor



Add instrument — добавить новый инструмент

Delete instrument — удалить инструмент

Set caption — установить название таблицы (удобно использовать когда открыто несколько окон)

Show OHLC chart — показать график истории цен инструмента

Show deal desk — открыть окно последних сделок по инструменту

Show instrument properties — показать параметры инструмента

Show market depth — открыть стакан котировок по инструменту

И вызвать модули для работы с производными инструментами на выбранный фьючерс (с автоматической загрузкой доступных опционов ближней серии экспирации)

Show option calculator — опционный калькулятор

Show option desk — доска опционов

Show option spread calculator — калькулятор спредов

Show option strategy monitor — монитор стратегий

Show vertical option calculator — вертикальный калькулятор

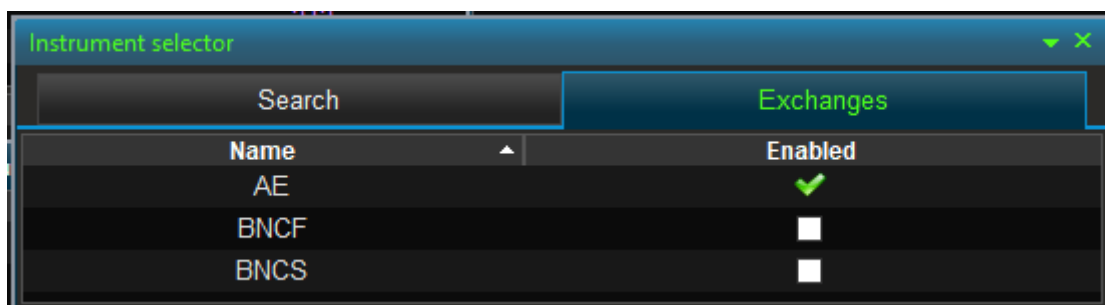
Двойной клик на выбранном инструменте вызывает стакан котировок.

В окне Instrument desk как и в любом другом окне можно скрыть ненужные колонки, для этого нужно правой кнопкой мыши нажать на название колонки и нажатием левой кнопкой мыши снять галки с названия тех колонок, которые нужно скрыть



Выбор инструментов - Instrument selector

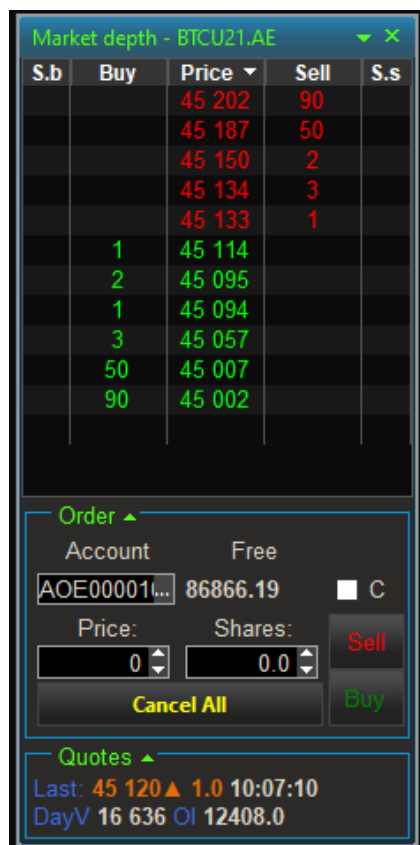
Окно Instrument selector предназначено для поиска торгового инструмента.



Вкладка Exchanges - доступные торговые площадки. Для доступа к торговым инструментам биржи Alternative Exchange, на вкладке Exchange ставится галочка напротив биржи AE.



Стакан котировок - Market depth



Стакан котировок открывается двойным кликом по интересующему финансовому инструменту, как из доски опционов и доски инструментов, так и из любого калькулятора или Option Chart. Интересующий инструмент можно просто перетащить в стакан и на него построятся рыночные котировки.

Окна стаканов котировок можно группировать точно также, как и все остальные окна программы и делать закладки.

По умолчанию стакан отсортирован по цене в порядке убывания, вверху цены продажи, внизу цены покупки, кликнув на колонку Price можно изменить сортировку — получим цены покупки наверху, цены продажи внизу.



Прямоугольным контуром выделяется цена, по которой была совершена последняя сделка LAST. В крайних колонках отображаются количество контрактов по своим ордерам по соответствующей цене.

Путем перетаскивания выделенной котировки из стакана в модуль исполнения Execution strategies, формируется стратегия исполнения по используемому инструменту в стакане, выделенной ценой Price и количеством по данной цене, причем при перетаскивании котировки на продажу (ask) формируется исполнение на покупку, при перетаскивании котировки на покупку (bid) формируется исполнение на продажу. Аналогично формируются позиции по инструментам при перетаскивании котировок из стакана в Option Chart. Также можно получить дополнительную информацию поставив галку на поле info.

Depth 2

Last — цена последней сделки

L.vol — объем в контрактах последней сделки

L.time — время последней сделки

D.vol — внутридневной оборот в контрактах

O.I. — открытый интерес в контрактах

Торговые счета - Account`s



Account's									
Number	Money	GM	GM%	Free	Free, %	Trans.	Al.tr.	Sh.p.	
AOE692162	5 694.04	564.34	10	5 129.7	90	14	✓	✓	

Positions				Aggregated positions			PosVolatility	Ref.GM
Ticker	Strike	Exp.Date	Type	Vol.	Last	Shares	OpenPrice	
AE				0		0.8042	62.17	
BTC				0	45 917	0.1	1	
BTC44000CU21	44 000	24.09.2021	Call	83.1	4 207	-50	4 207	
BTC48000CU21	48 000	24.09.2021	Call	81.6	2 393	101	2 393.28	
BTC48000PU21	48 000	24.09.2021	Put	81.6	3 707	1	2 077	
BTC50000CU21	50 000	24.09.2021	Call	81.4	1 554	-100	1 554.05	
ETH2800PU21	2 800	24.09.2021	Put	104.8	68	25	68	
ETH3200CU21	3 200	24.09.2021	Call	99.4	372	50	372	
USDT				0	1	1 102.369	1	

В окне Account`s отображается основная информация по торговому счету:

Number - номер счета

Money – лимит USDT по счету с учетом залогового обеспечения

GM – маржинальный требования (ГО) по открытым позициям и активным ордерам по счету

GM,% - значение маржинальных требований (ГО) в процентах от Money

Free – свободные денежные средства на счете

Free,% – свободные денежные средства на счете в процентах от Money

Trans. – количество транзакций по счету за текущую торговую сессию

Вкладка Positions

На вкладке Positions отображаются текущие позиции по торговому счету а также залоговое обеспечение в наличии: BTC и USDT (валюты по счету).

Данные: тикер инструмента, страйк опциона, дата экспирации инструмента, тип, IV опциона, цена последней сделки, количество контрактов, цена открытия.



Вкладка Aggregated positions

В окне Aggregated positions отображается общая позиция агрегированная по БА инструментам, со значениями ее греков.

При выборе БА инструмента, в нижнем окне отобразится список инструментов в общей позиции БА и PnL график по ней.

При совершении сделок и изменении позиций график PnL обновляется и отображать актуальную общую позицию по инструменту.



Окно Orders and Trades

В окне Orders and Trades во вкладке Active orders отображаются все активные ордера (заявки) по торговым инструментам. Нажатие на кнопку Cancel производит отмену ордера.

Вкладки окна:

Trades - таблица последних совершенных сделок

Old orders - таблица последних неактивных ордеров

Orders and trades												
Active orders												
Time	ID	Ticker	Bid	Last	Ask	Price	Sh.	Sh.r.	Comment	Status	Cancel	
14:23:26	9479737	ETH2800...	70	68	85	70	100	100	from MarketDe...	pending	Cancel	
14:23:52	9479848	BTC48000...	4 073	3 707	4 273	4 340	-50	-50	from MarketDe...	pending	Cancel	

Trades						
Time	ID	Ticker	Price	Shares	Comment	
12:17:51	6266208	AE	0	-0.01	commission for a trade 6266207	
12:17:51	6266207	ETH32...	372	50	from MarketDepth	
12:17:45	6266163	AE	0	-0.005	commission for a trade 6266162	
12:17:45	6266162	ETH28...	68	25	from MarketDepth	
12:17:01	6266088	AE	0	-0.02	commission for a trade 6266087	
12:17:01	6266087	BTC44...	4 207	-50	from MarketDepth	
10:33:12	6257968	AE	0	-0.0...	commission for a trade 6257967	
10:33:11	6257967	BTC50...	1 554	-99	from MarketDepth	
10:32:44	6257958	AE	0	-0.04	commission for a trade 6257957	
10:32:44	6257957	BTC48...	2 393	100	from MarketDepth	
10:32:00	6257928	AE	0	-0.0...	commission for a trade 6257927	
10:32:00	6257927	BTCU...	46 551	23	from MarketDepth	
10:32:00	6257923	AE	0	-0.0...	commission for a trade 6257922	
10:32:00	6257922	BTCU...	46 532	33	from MarketDepth	
10:31:59	6257918	AE	0	-0.0...	commission for a trade 6257917	
10:31:59	6257917	BTCU...	46 522	44	from MarketDepth	
10:10:34	6256628	AE	0	-0.0...	commission for a trade 6256627	
10:10:34	6256627	BTC50...	1 559	-1	from MarketDepth	
10:10:27	6256618	AE	0	-0.0...	commission for a trade 6256617	
10:10:27	6256617	BTC48...	2 421	1	from MarketDepth	

Old orders						
Time	ID	Ticker	Price	Shares	Status	Comment
12:17:51	9462754	ETH3200CU21	372	50	filled	from MarketDepth
12:17:45	9462653	ETH2800PU21	68	25	filled	from MarketDepth
12:17:01	9462604	BTC44000CU21	4 207	-50	filled	from MarketDepth
10:33:11	9455998	BTC50000CU21	1 554	-99	filled	from MarketDepth
10:32:44	9455993	BTC48000CU21	2 393	100	filled	from MarketDepth
10:31:59	9455951	BTCU21.AE	46 551	100	filled	from MarketDepth
10:10:34	9454978	BTC50000CU21	1 559	-1	filled	from MarketDepth
10:10:27	9454973	BTC48000CU21	2 421	1	filled	from MarketDepth
10:09:52	9454942	BTC50000CU21	1 671	-2	canceled	
10:09:52	9454941	BTC48000CU21	2 309	2	canceled	
10:09:35	9454938	BTC50000CU21	1 621	-2	canceled	
10:09:35	9454937	BTC48000CU21	2 359	2	canceled	
10:08:51	9454921	BTC50000CU21	1 621	-2	canceled	
10:08:51	9454920	BTC48000CU21	2 359	2	canceled	
07:53:03	9441429	BTCU21.AE	45 000	25	canceled	Buy 100 BTCU...
07:52:00	9441370	BTCU21.AE	45 000	25	canceled	Buy 100 BTCU...

Вкладка Trades

Во вкладке Trades отображены последние совершенные сделки по аккаунту и проведенные транзакции.

Orders and trades

Active orders		Trades		Old orders		 	
Trades							
Time	ID	Account	Ticker	Price	Shares	O.ID	Comment
14:32:48	6286145	AOE69...	AE	0	-0.02	0	commission for a trade 6286142
14:32:48	6286142	AOE69...	BTC48000PU21	4 340	-50	9479848	from MarketDepth
12:17:51	6266208	AOE69...	AE	0	-0.01	0	commission for a trade 6266207
12:17:51	6266207	AOE69...	ETH3200CU21	372	50	9462754	from MarketDepth
12:17:45	6266163	AOE69...	AE	0	-0.005	0	commission for a trade 6266162
12:17:45	6266162	AOE69...	ETH2800PU21	68	25	9462653	from MarketDepth
12:17:01	6266088	AOE69...	AE	0	-0.02	0	commission for a trade 6266087
12:17:01	6266087	AOE69...	BTC44000CU21	4 207	-50	9462604	from MarketDepth
10:33:12	6257968	AOE69...	AE	0	-0.0396	0	commission for a trade 6257967
10:33:11	6257967	AOE69...	BTC50000CU21	1 554	-99	9455998	from MarketDepth
10:32:44	6257958	AOE69...	AE	0	-0.04	0	commission for a trade 6257957
10:32:44	6257957	AOE69...	BTC48000CU21	2 393	100	9455993	from MarketDepth
10:32:00	6257928	AOE69...	AE	0	-0.0092	0	commission for a trade 6257927
10:32:00	6257927	AOE69...	BTCU21.AE	46 551	23	9455951	from MarketDepth
10:32:00	6257923	AOE69...	AE	0	-0.0132	0	commission for a trade 6257922
10:32:00	6257922	AOE69...	BTCU21.AE	46 532	33	9455951	from MarketDepth
10:31:59	6257918	AOE69...	AE	0	-0.0176	0	commission for a trade 6257917
10:31:59	6257917	AOE69...	BTCU21.AE	46 522	44	9455951	from MarketDepth
10:10:34	6256628	AOE69...	AE	0	-0.0004	0	commission for a trade 6256627
10:10:34	6256627	AOE69...	BTC50000CU21	1 559	-1	9454978	from MarketDepth
10:10:27	6256618	AOE69...	AE	0	-0.0004	0	commission for a trade 6256617
10:10:27	6256617	AOE69...	BTC48000CU21	2 421	1	9454973	from MarketDepth

Окно Deal desk

В окне Deal desk отображены последние сделки, которые были совершены на бирже по выбранному торговому инструменту. Данные: ID сделки, цена, количество контрактов, дата и время.

Deals BTCU21.AE				
Ticker: BTCU21.AE				
ID	Price	Shares	Time	
6292567	45 334	1	10.09.2021	14:59:47
6292562	45 344	1	10.09.2021	14:59:46
6292557	45 352	56	10.09.2021	14:59:45
6292552	45 349	44	10.09.2021	14:59:45
6292542	45 338	1	10.09.2021	14:59:43
6292537	45 332	1	10.09.2021	14:59:42
6292532	45 329	1	10.09.2021	14:59:41
6292527	45 309	1	10.09.2021	14:59:40
6292517	45 305	1	10.09.2021	14:59:39
6292507	45 295	1	10.09.2021	14:59:38
6292497	45 282	1	10.09.2021	14:59:37
6292487	45 292	1	10.09.2021	14:59:36
6292482	45 312	1	10.09.2021	14:59:35
6292477	45 332	1	10.09.2021	14:59:34
6292472	45 342	1	10.09.2021	14:59:34
6292467	45 352	1	10.09.2021	14:59:33
6292457	45 372	33	10.09.2021	14:59:32
6292452	45 392	67	10.09.2021	14:59:32

Доска опционов

Option desk - BTCU21.AE

Base instrument: BTCU21.AE ... Last: 47300.0 Type: Point Strikes: 2 Volumes

Exp.date: 27.08.2021										Exp.date: 24.09.2021								
Strike	Put	Vol.B	Bid	Ask	Vol.A	Last	Vol.L	Theor.	DayVol	Vol.B	Bid	Ask	Vol.A	Last	Vol.L	Theor.	DayVol	
	40000					848	1			100	1 694	1 794	100	1 834	1	1 751	1	
	42000	500	1	10	100	53	100	2	100	100	2 294	2 394	100	2 389	5	2 347	5	
	44000	100	10	25	100	104	50	33	50	50	3 045	3 130	100	3 145	10	3 082	10	
	46000	100	233	333	100	243	5	285	5	100	3 879	4 039	100	3 878	10	3 965	10	
48000		100	1 073	1 273	100	1 088	5	1 175	5	100	4 885	5 085	100	5 115	5	4 995	5	
	50000	100	2 663	2 863	100	2 853	2	2 784	7	100	6 058	6 258	100	6 053	5	6 169	5	
	52000	100	4 594	4 794	100	4 789	10	4 717	10	100	7 366	7 566	100	7 581	50	7 479	50	
Call		Vol.B	Bid	Ask	Vol.A	Last	Vol.L	Theor.	DayVol	Vol.B	Bid	Ask	Vol.A	Last	Vol.L	Theor.	DayVol	
	44000	100	3 245	3 405	100	3 306	10	3 322	10	100	6 298	6 498	100	6 423	25	6 371	25	
	46000	100	1 516	1 636	100	1 695	25	1 574	25	100	5 178	5 378	100	5 168	5	5 254	5	
48000		100	423	523	100	530	1	464	1	100	4 225	4 385	100	4 203	1	4 284	1	
	50000	100	30	88	100	119	1	73	1	100	3 389	3 549	100	3 324	10	3 458	10	
	52000	500	2	10	100	56	50	6	50	100	2 724	2 844	100	2 841	1	2 768	1	
	54000									100	2 131	2 291	100	2 119	25	2 199	25	
	56000									100	1 697	1 797	100	1 682	50	1 738	50	

Доска опционов отображает от одной до трёх серий опционов на один базовый инструмент. В доске опционов имеется два режима котировок: в пунктах (по умолчанию) и в волатильности (IV).

При вызове доски опционов через Instrument desk, доска опционов открывается сразу на выбранный базовый инструмент.

При открытии доски опционов через меню, для показа опционов необходимо выбрать базовый инструмент — фьючерс (Base instrument).

Если на выбранный базовый инструмент количество опционных серий больше 3-х, то в поле Exp.date появляется возможность выбора даты опционной серии.



Калькулятор опционов

Option calculator - BTCU21.AE, 26.08.2021															
Base instr.: BTCU21.AE		Last: 47 246	Exp. date: 24.09.2021		Strikes: 3		Calc. Date: 26.08.2021		Update by quote		Online		Refresh IV		
Put	Bid	Ask	Last	Volum	T.price	Strike	Volatility	IV	DayVolu	Delta	Gamma	Theta	Vega	Premium	OI
BTC36000PU21	874	974	993	1	929	36000	96.65	98.83	1	-0.13		-46.54	27.81	929	3 454
BTC38000PU21	1 231	1 331	1 339	1	1 289	38000	94.13	95.5	1	-0.17		-54.77	33.6	1 289	2
BTC40000PU21	1 694	1 794	1 834	1	1 760	40000	92.02	93.78	1	-0.22		-62.67	39.33	1 760	2 802
BTC42000PU21	2 316	2 416	2 389	5	2 358	42000	90.28	90.83	5	-0.28		-69.62	44.53	2 358	20
BTC44000PU21	3 045	3 130	3 145	10	3 096	44000	88.86	89.7	10	-0.34		-75	48.75	3 096	60
BTC46000PU21	3 913	4 073	3 878	10	3 981	46000	87.72	85.54	10	-0.41		-78.39	51.61	3 981	20
BTC48000PU21	4 928	5 128	5 115	5	5 015	48000	86.82	88.51	5	-0.48		-79.57	52.93	4 261	10
BTC50000PU21	6 099	6 299	6 053	5	6 192	50000	86.13	83.26	5	-0.54		-78.57	52.68	3 438	10
BTC52000PU21	7 407	7 607	7 581	50	7 504	52000	85.65	86.88	50	-0.61		-75.65	51.01	2 750	100
BTC54000PU21					8 938	54000	85.33	0		-0.67		-71.21	48.19	2 184	
Call	Bid	Ask	Last	Volum	T.price	Strike	Volatility	IV	DayVolu	Delta	Gamma	Theta	Vega	Premium	OI
BTC42000CU21	7 508	7 708	7 739	1	7 604	42000	90.28	93.67	1	0.72		-69.62	44.53	2 358	2
BTC44000CU21	6 257	6 457	6 423	25	6 342	44000	88.86	90.83	25	0.66		-75	48.75	3 096	492
BTC46000CU21	5 110	5 310	5 168	5	5 227	46000	87.72	86.83	5	0.59		-78.39	51.61	3 981	10
BTC48000CU21	4 193	4 353	4 203	1	4 261	48000	86.82	85.96	1	0.52		-79.57	52.93	4 261	140
BTC50000CU21	3 348	3 508	3 324	10	3 438	50000	86.13	84.17	10	0.46		-78.57	52.68	3 438	620
BTC52000CU21	2 693	2 813	2 841	1	2 750	52000	85.65	87.6	1	0.39		-75.65	51.01	2 750	1 098
BTC54000CU21	2 108	2 268	2 119	25	2 184	54000	85.33	84.13	25	0.33		-71.21	48.19	2 184	450
BTC56000CU21	1 676	1 776	1 682	50	1 725	56000	85.17	84.34	50	0.28		-65.7	44.55	1 725	1 220
BTC58000CU21	1 305	1 405	1 413	10	1 357	58000	85.15	86.66	10	0.23		-59.6	40.42	1 357	20
BTC60000CU21	1 010	1 110	1 126	10	1 066	60000	85.25	87.03	10	0.19		-53.29	36.1	1 066	400

При изменении цены базового инструмента (все параметры опционов будут сразу же пересчитаны, и калькулятор перейдёт в режим офлайн).

Чтобы изменить волатильность для расчета теоретической цены опциона, нужно ввести новое значение в колонке IV на выбранном страйке.

Нажатие кнопки «Online» вернет калькулятор в режим расчета онлайн.

Изменение расчета при заданной цене опциона происходит аналогично. Щелкните мышью в колонку «last» и введите свое значение цены опциона. Измененный параметр будет выделен красным цветом.

Также можно изменить дату расчетов (Calc. Date)

Заголовок окна содержит выбранный базовый инструмент, цену инструмента (last), дату экспирации, количество отображаемых страйков, дату расчета.

Update by quote – если включена данная кнопка, пересчёт будет происходить при любых изменениях цены базового актива.



Online – перевод калькулятора из режима офлайн в режим онлайн и обратно.

Refresh IV – данная кнопка вызывает пересчёт подразумеваемой волатильности.

Отображаемая информация:

Put/Call код инструмента

Put/Call — тикер опциона

Bid — спрос

Ask — предложение

Last — цена

Volume — объём последней сделки

T.Price — теоретическая цена

Strike — страйк

Volatility — волатильность, транслируемая биржей

IV — подразумеваемая волатильность

Delta, Gamma, Theta, Vega — греки

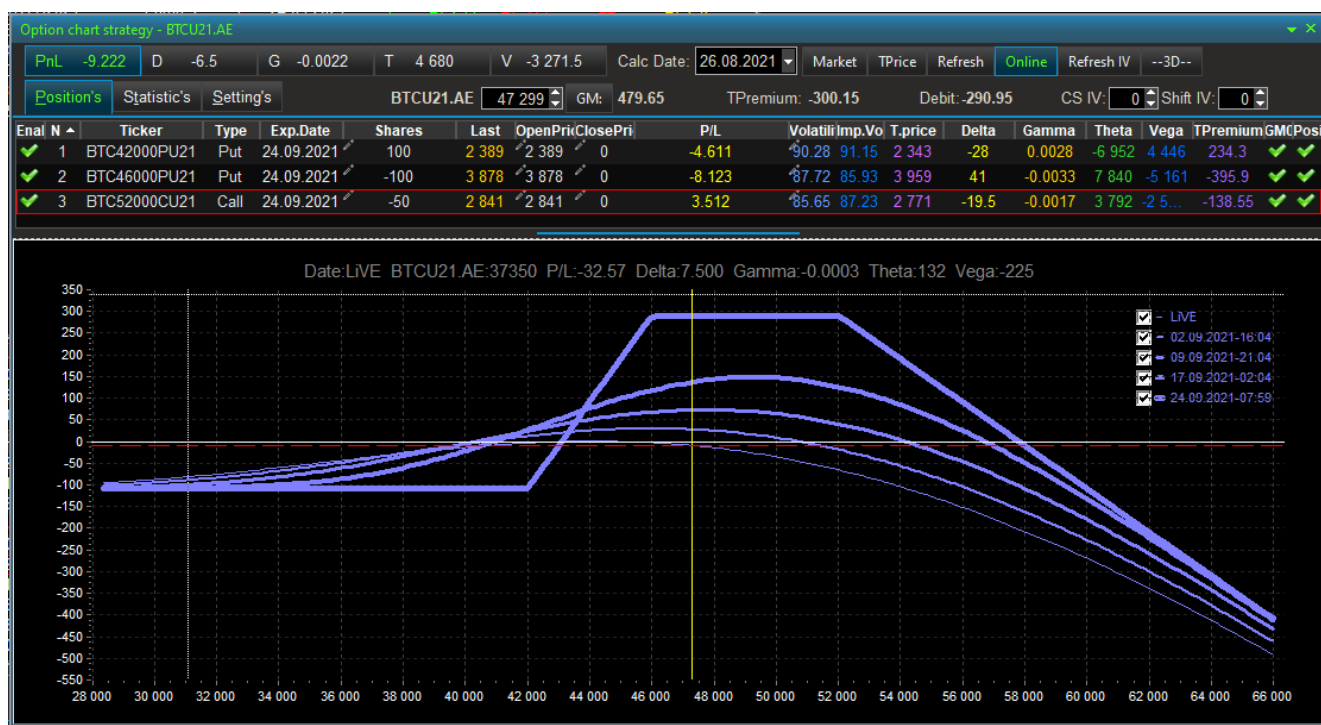
Premium — премия опциона

OI — открытый интерес



Конструктор опционных стратегий Option Chart

Option Chart — конструктор опционных стратегий, дает возможность создавать, анализировать, разрабатывать варианты управления опционной конструкцией.



Добавление опционов и фьючерсов в Option chart наиболее удобно делать путем перетаскивания (drag&drop) из доски опционов или калькулятора опционов, доски инструментов.

Выделив инструменты, можно сохранить созданную стратегию нажав правую кнопку мыши и выбрав всплывающем меню команду Export to file.

Основное меню:

Добавление контрактов — перетащите контракт из любого окна — доски опционов, калькуляторов и т. д.



Также открывается из монитора стратегий и калькулятора спредов с уже добавленными позициями.

P/L — Профиль стратегии профит/лосс

D/G/T/V — профиль греков

Calc Date — дата расчетов

Actual Price — установить значение цены по рынку

—3D— — 3D режим отображения

Refresh — обновить график

Online — индикатор режима расчета онлайн/офлайн

Refresh IV — обновить IV по ценам last

Закладка Positions

Сортировка возможна по любой колонке

Enabled — отображение контракта в стратегии

N — номер контракта по порядку

Ticker — тикер контракта

Type — тип контракта

Exp. Date — дата экспирации контракта

Shares — количество контрактов (значение изменяется пользователем)

Last — цена последней сделки

OpenPrice — цена открытия контракта (значение изменяется пользователем исходя из шага цены инструмента)



ClosePrice — цена закрытия контракта (значение изменяется пользователем исходя из шага цены инструмента)

P/L — значение профит/лосс контракта

Volatility — IV транслируемая биржей

Imp.Vol — IV расчетная по цене Last

T.price — теоретическая цена опциона

Delta, Gamma, Theta, Vega — греки

TPremium — временная стоимость опциона

Posi — расчет ГО при исполненной заявке — все контракты на счете трейдера

Отображение графика:

Легенда отображения профиля на дату

Двойной щелчок мыши на дате — убрать/показать профиль на дату

Щелчок на выбранной кривой высчитывает в верхней строке P/L и греков на выбранную дату. Этот профиль подсвечивается красным.



Закладка Statistics:



Статистика по стратегии:

Max profit/Max profit% — максимальный профит в цифрах/процентах

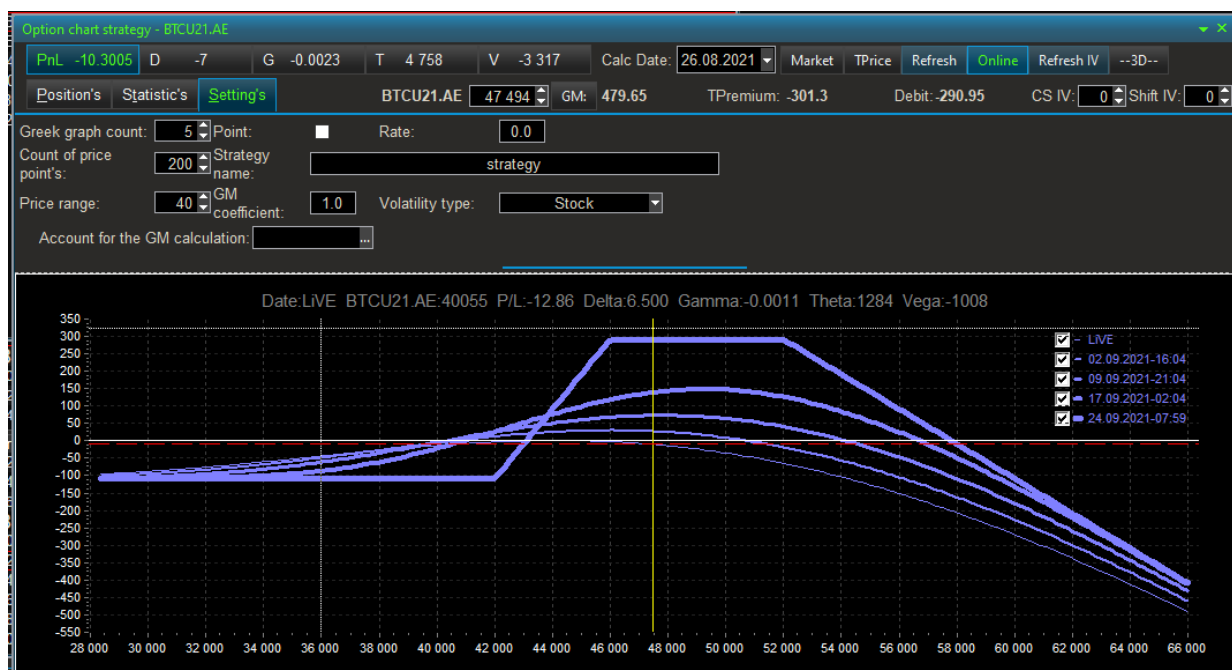
Max loss/Max loss % — максимальный убыток в цифрах/процентах

Gross PL % — максимальная прибыль от ГО

Gross P/L — точки безубыточности на дату экспирации



Закладка Settings:



Greek graph count — количество кривых P/L на графике

Count of price points — количество точек расчет для качества отображения графика

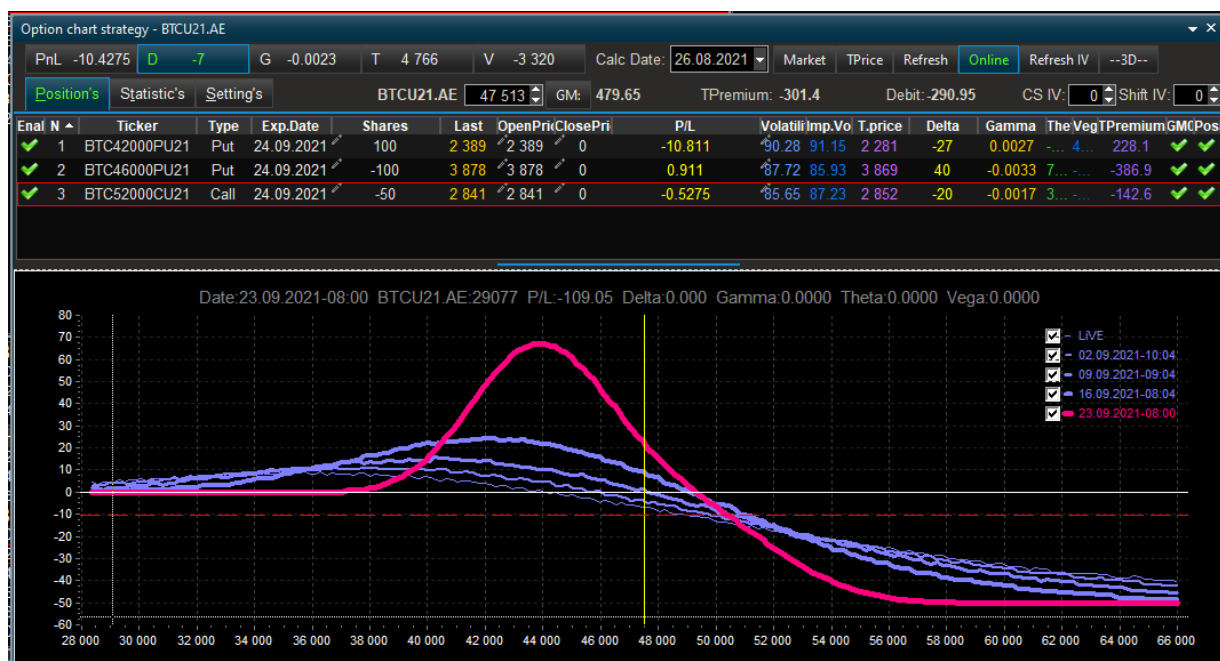
Price range — диапазон отображения страйков на графике

Point — отображение шкалы слева в значении пункты/рубли

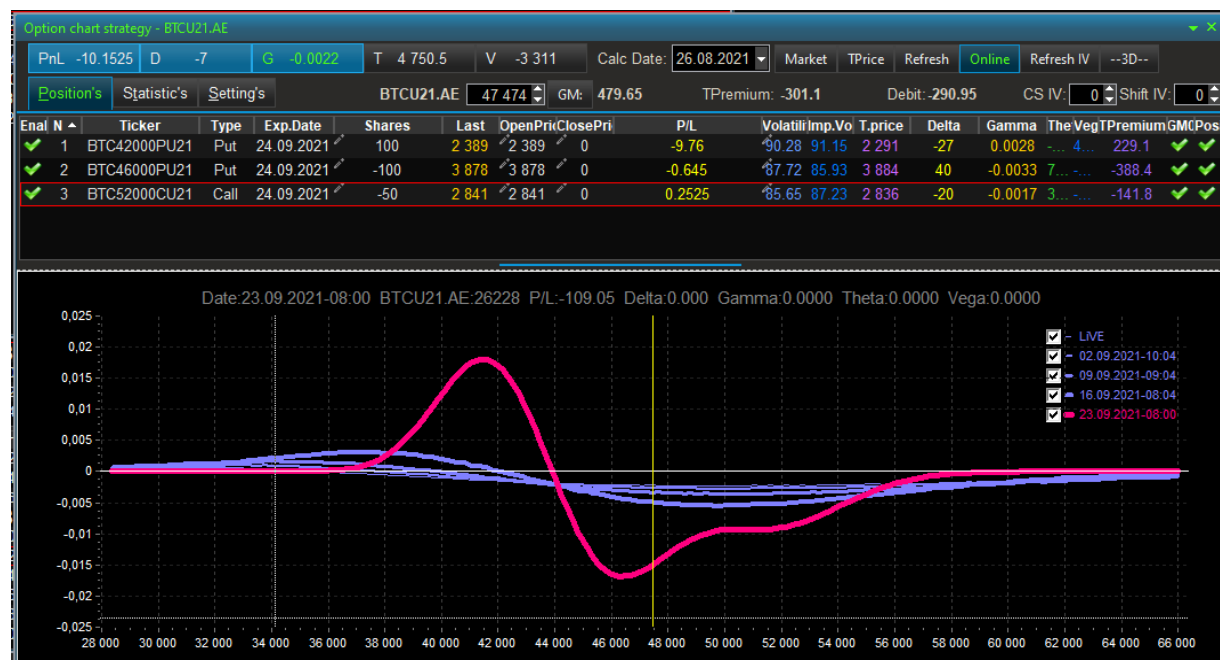
Strategy name — имя стратегии (может изменяться пользователем)



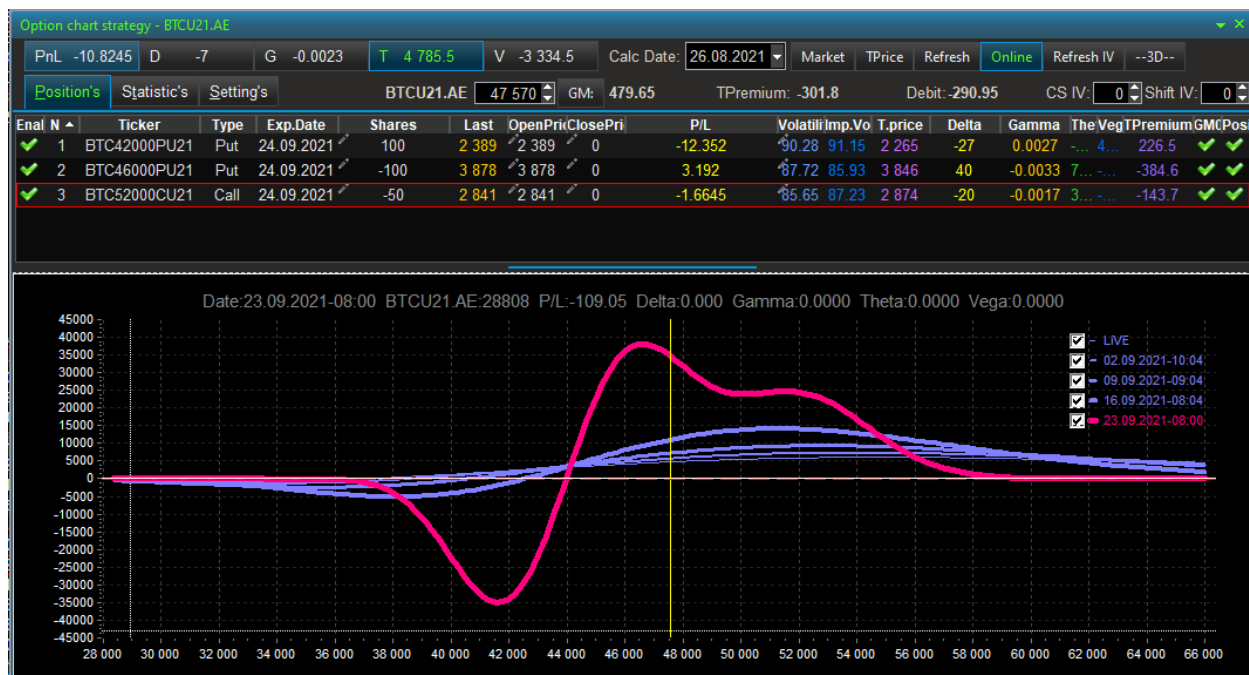
Закладка D (дельта) Отображение дельты



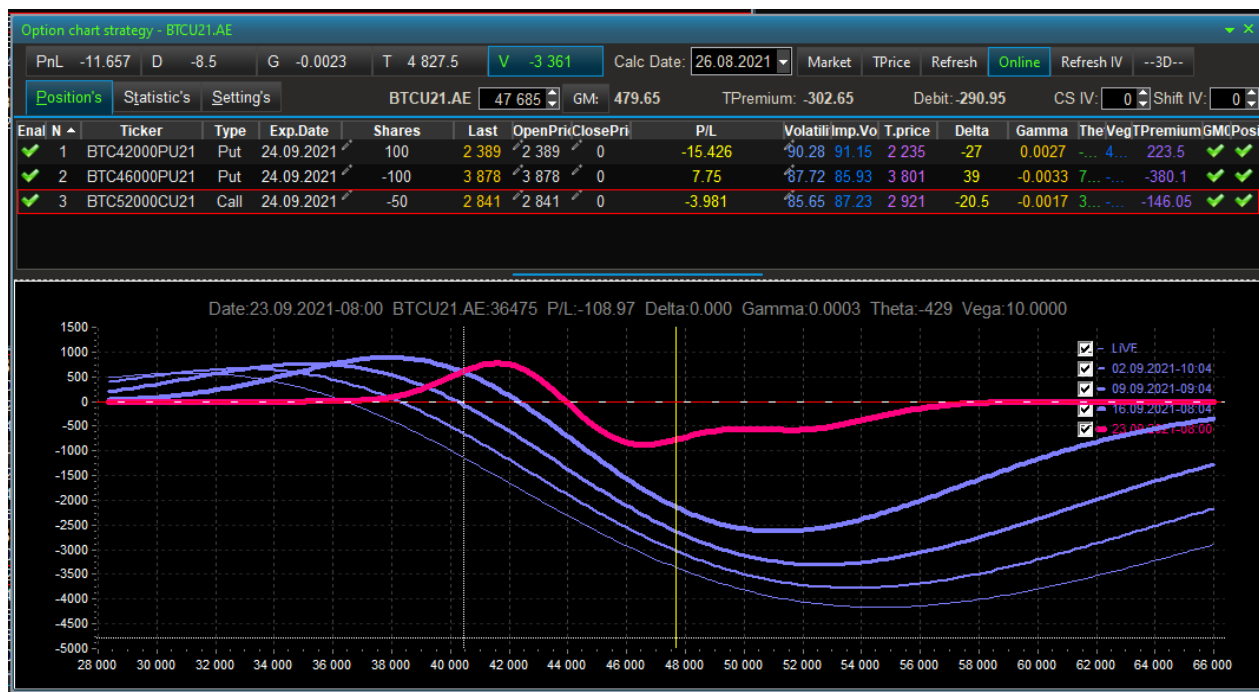
Закладка G (гамма) Отображение гаммы



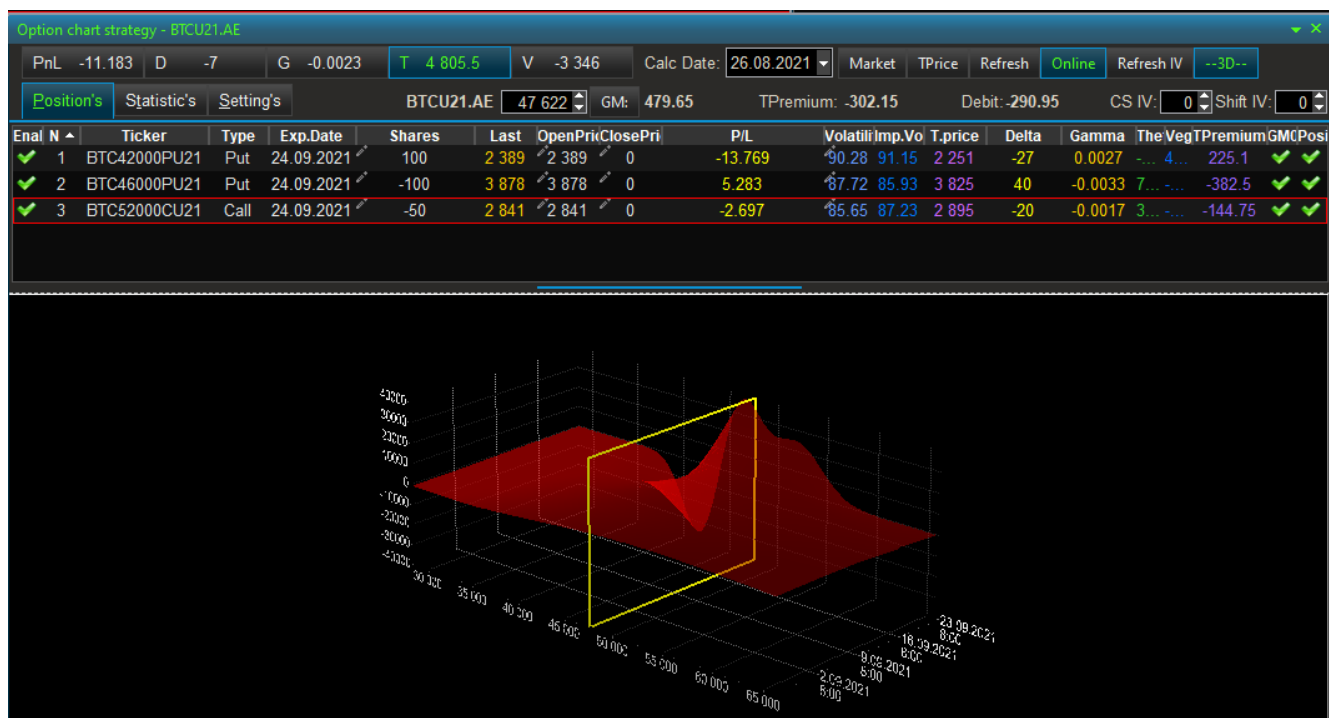
Закладка T (тэтта) Отображение тэтты



Закладка V (вега) Отображение веги



Закладка —3D— 3D режим



Редактор кривых волатильности Volatility editor



Strikes - количество отображаемых страйков в таблице от центрального.

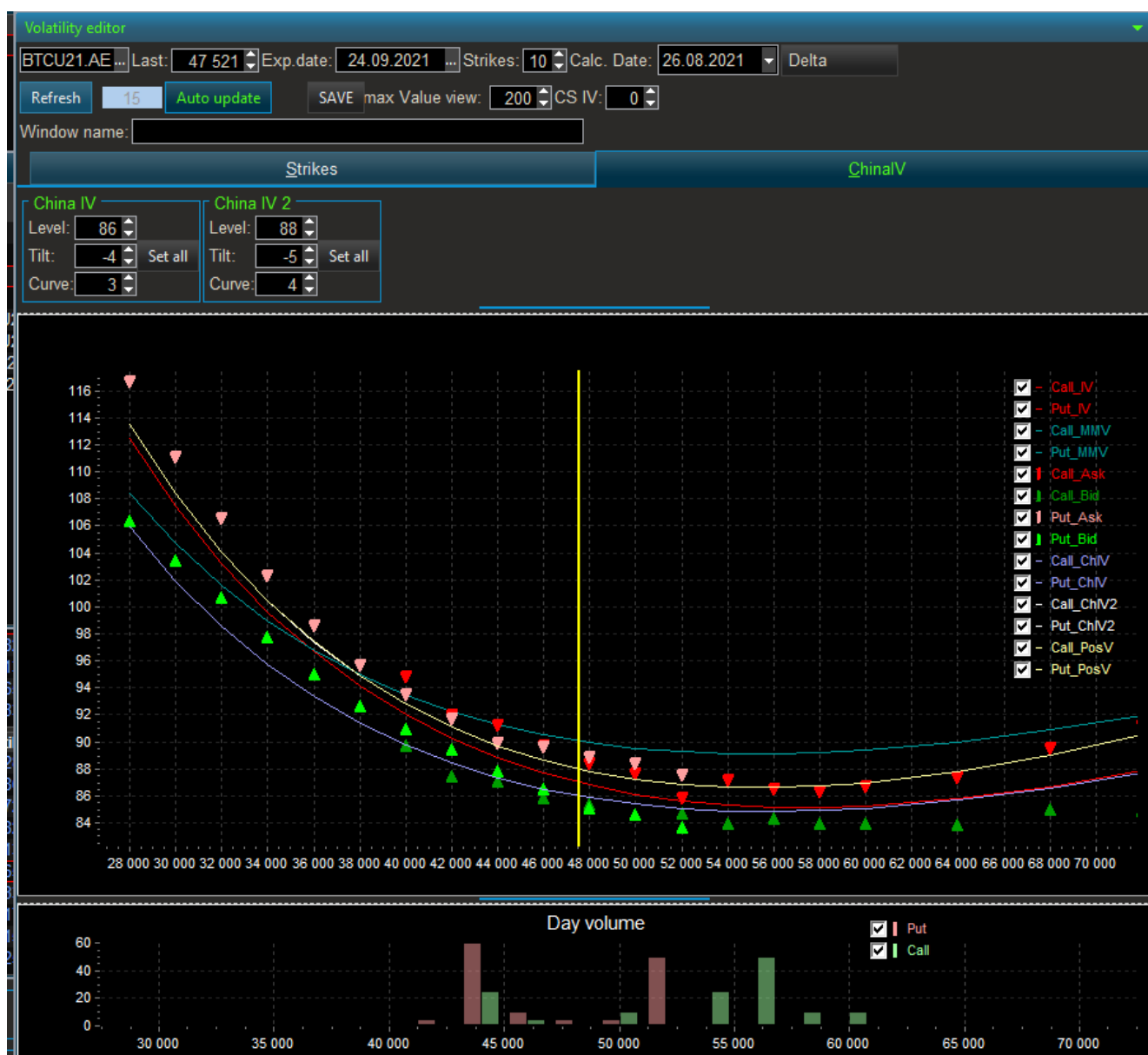
Кнопка Refresh - обновление данных, после внесения изменения для обновления отображения следует нажать Refresh



Кнопка Auto update - режим автоматического обновления данных, по умолчанию значение 15 секунд

Account - для сохранения значений волатильности на сервер выберите торговый счет и нажмите Save

Построение кривых волатильности



Level - задаем значение волатильности на центре кривой

Tilt - значение наклона кривой

Curve - значение крутозиса кривой

Кнопка Set all - придать значения модельной кривой соотв кривой MMVolatility или PosVolatility

Задав модель кривой China IV можем сохранить на сервере как кривую MMVolatility

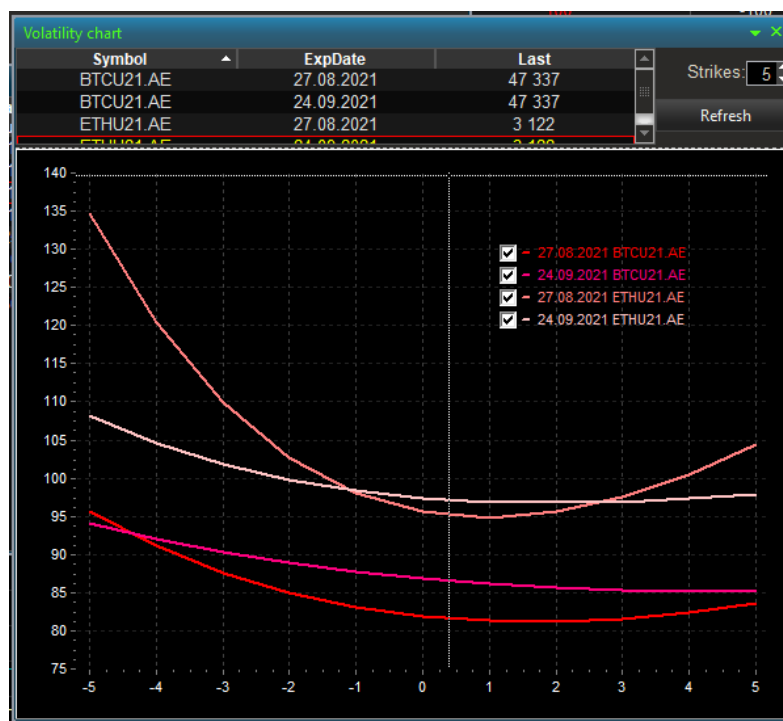
Задав модель кривой China IV2 можем сохранить на сервере как кривую PosVolatility

Обратите внимание! Вы задаете значения волатильности только отображаемым в таблице страйкам, для задания значений волатильности большему количеству страйков увеличьте параметр Strikes. Сохраненные значения страйков опционов относятся только к торговому счету, по которому вы произвели сохранение. Для каждой серии опционов требуется сохранять свои значения кривой волатильности.

Перед стартом дельта хеджера настроенного на расчет дельты по заданной кривой волатильности обязательно проверьте на вкладке Position заданные по опционам волатильности.



Графики кривых волатильности



При добавлении любого опциона методом перетаскивания (drag&drop) из доски опционов либо калькулятора опционов отобразится кривая волатильности опционной серии этого опциона.

Данный модуль программы предоставляет уникальную возможность сравнения кривых волатильности разных календарных серий для анализа календарных спредов, либо корзины волатильности опционных серий на сингл стоке с волатильностью индекса, как для выявления арбитражных возможностей, так и для эффективного хеджирования портфеля.

Количество отображаемых кривых волатильности не ограничено.

По оси X - 0 центральный страйк опционной серии, 1 2 3 ... - +1 +2 +3 ... страйка от центрального, -1 -2 -3 ... соотв -1 -2 -3 ... страйк от центрального

Кнопка Refresh - обновление данных

Strikes - количество отображаемых страйков от центрального



Калькулятор спредов опционов

Option spread calculator

Option spread calculator - BTCU21.AE, 26.08.2021

Base instr.: BTCU21.AE Last: 47 315 Exp. date: 24.09.2021 Strikes: 5 Calc. Date: 26.08.2021 Update by quote Online Shares: 1 -1

GM	Vega	Theta	Gamma	Delta	Market	Last	T.price	Strikes	T.price	Last	Market	Delta	Gamma	Theta	Vega	GM
0.359	5.79	-8.26	-0.04	456	346	357	36 000/38 000	1 643				0.04		8.26	-5.79	0.617
0.466	5.75	-7.96	-0.05	562	495	466	38 000/40 000	1 534				0.05		7.96	-5.75	0.724
0.586	5.23	-7.03	-0.06	706	555	593	40 000/42 000	1 407	1 951	1 589	0.06			7.03	-5.23	0.885
0.707	4.26	-5.48	-0.06	833	656	732	42 000/44 000	1 268	1 316	1 495	0.06			5.48	-4.26	0.964
0.819	2.93	-3.49	-0.07	989	833	880	44 000/46 000	1 120	1 255	1 305	0.07			3.49	-2.93	0.961
0.897	1.38	-1.28	-0.06	1 237	1 027		46 000/48 000	973	965	1 132	0.06			1.28	-1.38	0.895
0.932	-0.19	0.92	-0.07	1 372	938	1 172	48 000/50 000	828	879	1 001	0.07			-0.92	0.19	0.791
0.907	-1.62	2.84	-0.07	1 515	1 528	1 308	50 000/52 000	692	483	824	0.07			-2.84	1.62	0.676
0.825	-2.78	4.41	-0.06			1 429	52 000/54 000	571	722	674	0.06			-4.41	2.78	0.56
0.699	-3.61	5.48	-0.05			1 537	54 000/56 000	463	437	590	0.05			-5.48	3.61	0.458
0.55	-4.12	6.1	-0.05			1 629	56 000/58 000	371	269	473	0.05			-6.1	4.12	0.366
0.443	-4.32	6.33	-0.04			1 706	58 000/60 000	294	287	382	0.04			-6.33	4.32	0.291

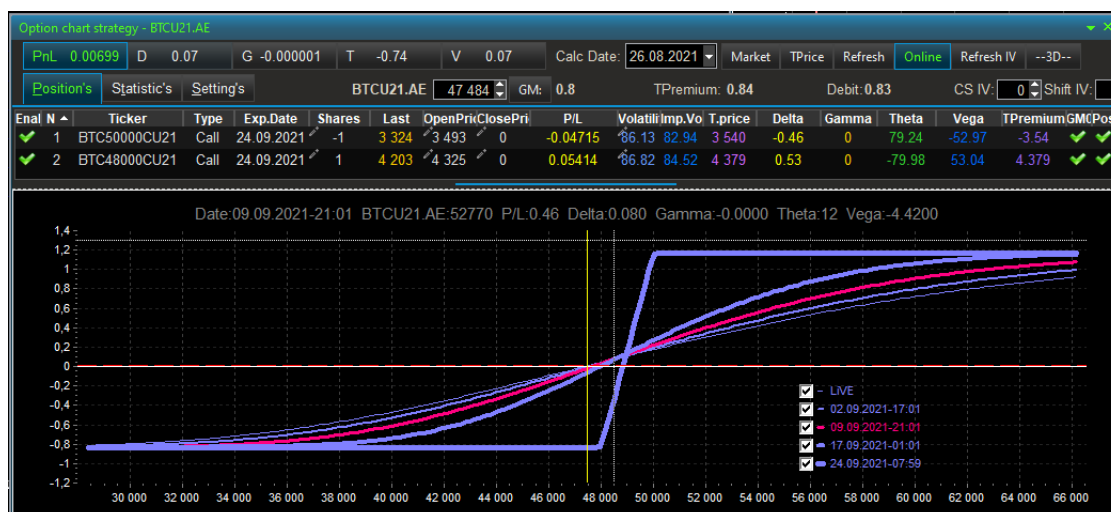
Калькулятор спредов.

Используется для выбора лучшего спреда из опционов, позволяет сравнить греки и маржинальные требования по разным грекам.

Количество купленных/проданных опционов в спреде задается в графе «Shares», позволяя задавать различные коэффициенты.

Слева в таблице спред строится на путах, справа на колах.

Двойной клик открывает выбранный спред в Option chart



Монитор опционных стратегий

Option strategy monitor.

Name	Comments	TPrice	Market	TPr-Mrkt	Delta	Gamma	Theta	Vega	GM	Premium	Profit	Loss	P/L	TShares	TSymbols
Bear Call Spread		-1 057	-543	-514	-0.08	0	-4.52	2.46	1.191	943	1	-1	1.12	2	2
Bear Put Spread		943	1 532	-589	-0.08	0	-4.52	2.46	1.191	943	1	-1	1.12	2	2
Bull Call Spread		880	641	239	0.08	0	0.98	-0.47	0.513	372	1	-1	1.27	2	2
Bull Put Spread		-1 120	-1 290	170	0.08	0	0.98	-0.47	0.513	372	1	-1	1.27	2	2
Call Back spread		2 409	824	1 585	0.4	0	-94.54	48.76	0.71	2 917		-4	0	3	2
Double Ratio Spread		-3 045	-1 602	-1 443	-0.12	-0.0001	161.5	-82.35	7.862	-3 045	5		0	6	4
Long Call Butterfly		177	502	-325	0	0	3.54	-1.99	0.183	-1 315	2		10.3	4	3
Long Condor		1 481	1 742	-261	0	0	-10.06	5.65	0.519	1 481	1	-1	0.35	4	4
Long Put Butterfly		177	558	-381	0	0	3.54	-1.99	0.183	-1 315	2		10.3	4	3
Long Straddle		7 830	6 939	891	0.12	0.0001	-185.16	95.64	3.386	7 322		-8	0	2	2
Long Strangle		6 007	5 086	921	0.12	0.0001	-181.62	93.65	3.187	6 007		-6	0	2	2
Put Back spread		1 775	2 769	-994	-0.28	0	-83.54	42.9	2.636	1 775		-4	0	3	2
Ratio Spread Call		-2 409	-424	-1 985	-0.4	0	94.54	-48.76	7.219	-2 917	4		0	3	2
Ratio Spread Put		-1 775	-2 169	394	0.28	0	83.54	-42.9	8.223	-1 775	4		0	3	2
Short Call Butterfly		-177	98	-275	0	0	-3.54	1.99	0.199	1 315		-2	0.1	4	3
Short Condor		-1 481	-1 102	-379	0	0	10.06	-5.65	0.54	-1 481	1	-1	2.85	4	4
Short Put Butterfly		-177	242	-419	0	0	-3.54	1.99	0.199	1 315		-2	0.1	4	3
Short Straddle		-7 830	-6 579	-1 251	-0.12	-0.0001	185.16	-95.64	8.646	-7 322	8		0	2	2
Short Strangle		-6 007	-4 766	-1 241	-0.12	-0.0001	181.62	-93.65	8.532	-6 007	6		0	2	2

Symbol	Exp.Date	IsPut	Shares	T.price	Bid	Ask	Last	Imp.Vol.	Volatility	Premium	Strike	Series	Shares
BTC48000PU21	24.09.2021	true	1	2 718	3 701	3 901	3 707	103.31	81.63	2 718	-1	0	1
BTC50000PU21	24.09.2021	true	-2	3 661	5 033	5 233	2 351	54.02	81.4	-7 322	0	0	-2
BTC52000PU21	24.09.2021	true	1	4 781	6 523	6 723	3 696	58.93	81.45	3 289	1	0	1

Инструмент анализа основных опционных стратегий на базовый фьючерс.

Использует базовый набор стандартных стратегий, с возможностью добавления новых.

Окно Instrument:

Ticker — базовый фьючерс

Exp. date — выбор опционной серии

Last — значение цены фьючерса с возможностью изменения

Calc. Date — дата расчета с возможностью изменения

Shares — выбор количества открываемой позиции



Окно Filters — задание рыночных условий или прогноза

Class — выбор класса стратегий («класс» редактируется или задается пользователем)

Time — выбор влияния времени

Market — прогноз рынка

Volatility — влияние волатильности

Окно Refresh — выбор скорости обновления расчета

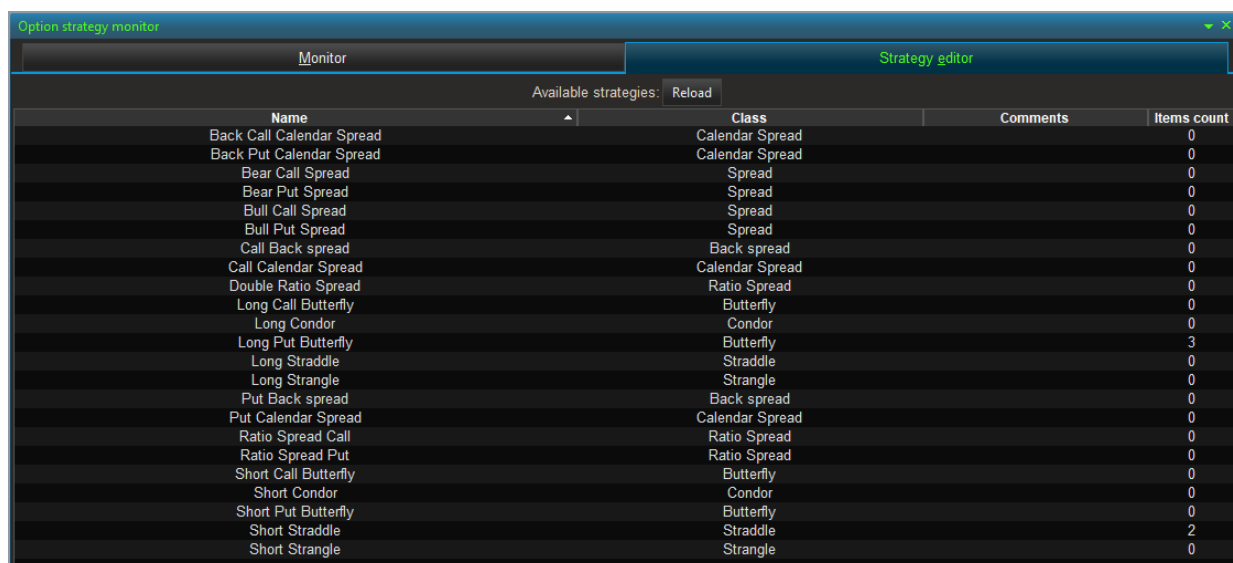
Треjder определяет прогноз рынка (бычий, медвежий, нейтральный), свой взгляд на изменение волатильности (растет, снижается), отношение к риску (ограничен, не ограничен) и времени, получает набор стратегий, подходящих под его требования, сравнивает стратегии по грекам, требуемому размеру ГО и возможности открытия стратегии в рынке. Любую выбранную стратегию можно подробно проанализировать в Option chart, кликнув на неё.

Открыв несколько окон Option Strategy monitor на разные инструменты, можно определить, на каком инструменте какая стратегия оптимальна в видении рынка трейдером.

В нижнем окне показаны опционы, входящие в эту стратегию.



Закладка Strategy editor



Name	Class	Comments	Items count
Back Call Calendar Spread	Calendar Spread		0
Back Put Calendar Spread	Calendar Spread		0
Bear Call Spread	Spread		0
Bear Put Spread	Spread		0
Bull Call Spread	Spread		0
Bull Put Spread	Spread		0
Call Back spread	Back spread		0
Call Calendar Spread	Calendar Spread		0
Double Ratio Spread	Ratio Spread		0
Long Call Butterfly	Butterfly		0
Long Condor	Condor		0
Long Put Butterfly	Butterfly		3
Long Straddle	Straddle		0
Long Strangle	Strangle		0
Put Back spread	Back spread		0
Put Calendar Spread	Calendar Spread		0
Ratio Spread Call	Ratio Spread		0
Ratio Spread Put	Ratio Spread		0
Short Call Butterfly	Butterfly		0
Short Condor	Condor		0
Short Put Butterfly	Butterfly		0
Short Straddle	Straddle		2
Short Strangle	Strangle		0

При клике правой кнопкой мыши на выбранную стратегию открывается всплывающее меню:

Add strategy — добавить новую

Delete strategy — удалить

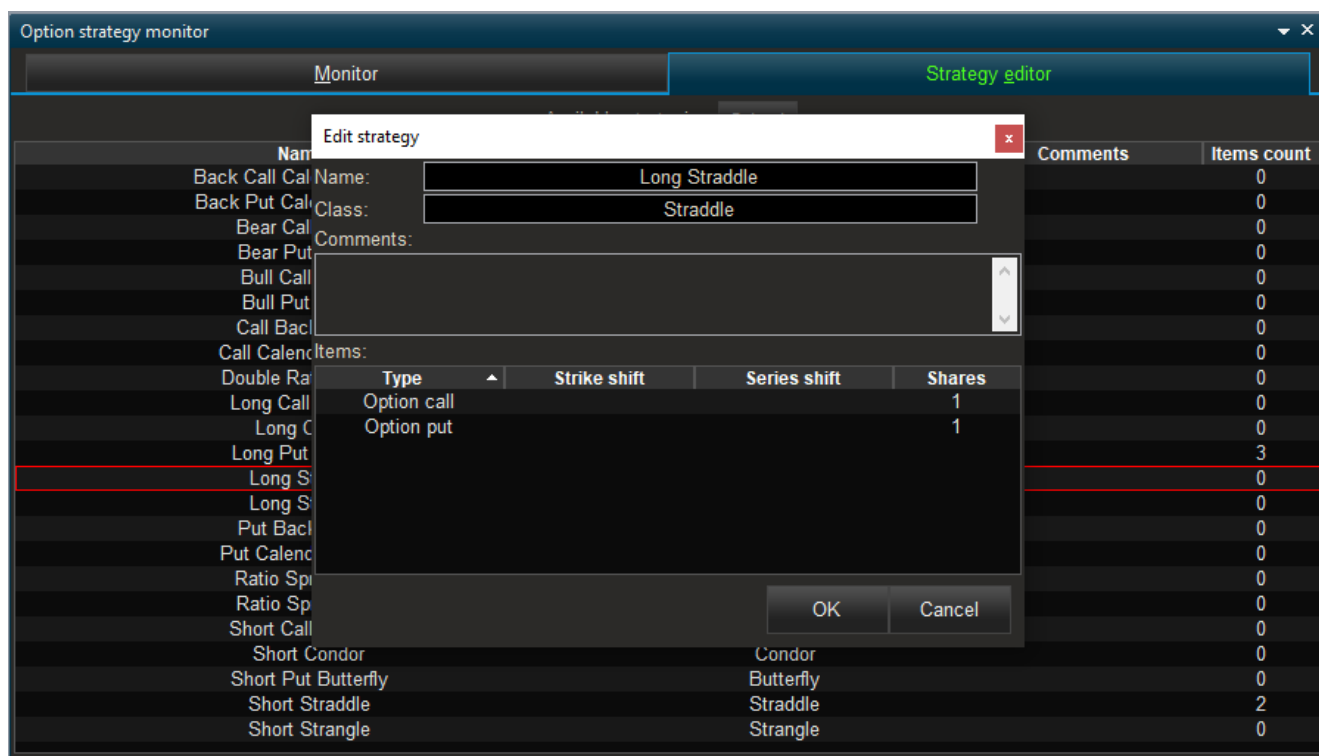
Edit strategy — отредактировать существующую

Export to file — сохранить стратегию в виде файла

Import from file — импортировать стратегию из файла



Добавление/редактирование стратегии.



Заполните поля «Name», «Class», «Comment». Лучше сразу придерживаться системы, т.к. в дальнейшем это позволит осуществлять сортировку по необходимым Вам признакам.

В поле «Items» необходимо добавить инструменты, из которых состоит стратегия: опционы, фьючерсы

Выбрав опцион, задайте:

Strike shift — сдвиг опциона относительно центрального страйка (значение не выбрано — опцион берется по центральному страйку)

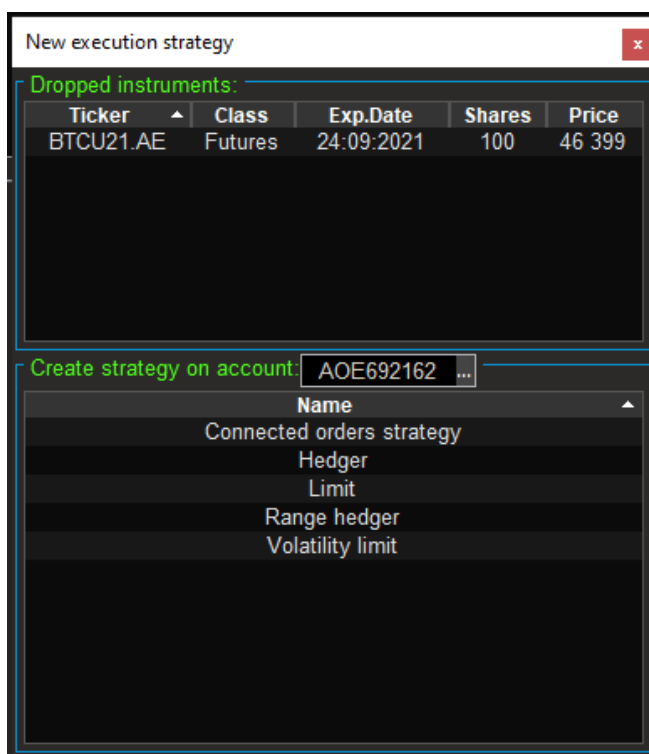
Series shift — сдвиг опциона по серии. Если значение не выбрано — берется текущая серия.

Shares — количество используемых опционов или фьючерсов.



Создание и управление стратегиями исполнения

Для создания любой стратегии исполнения достаточно выбрав один инструмент или несколько (удерживая нажатой кнопкой ctrl) перенести их в окно Execution strategy



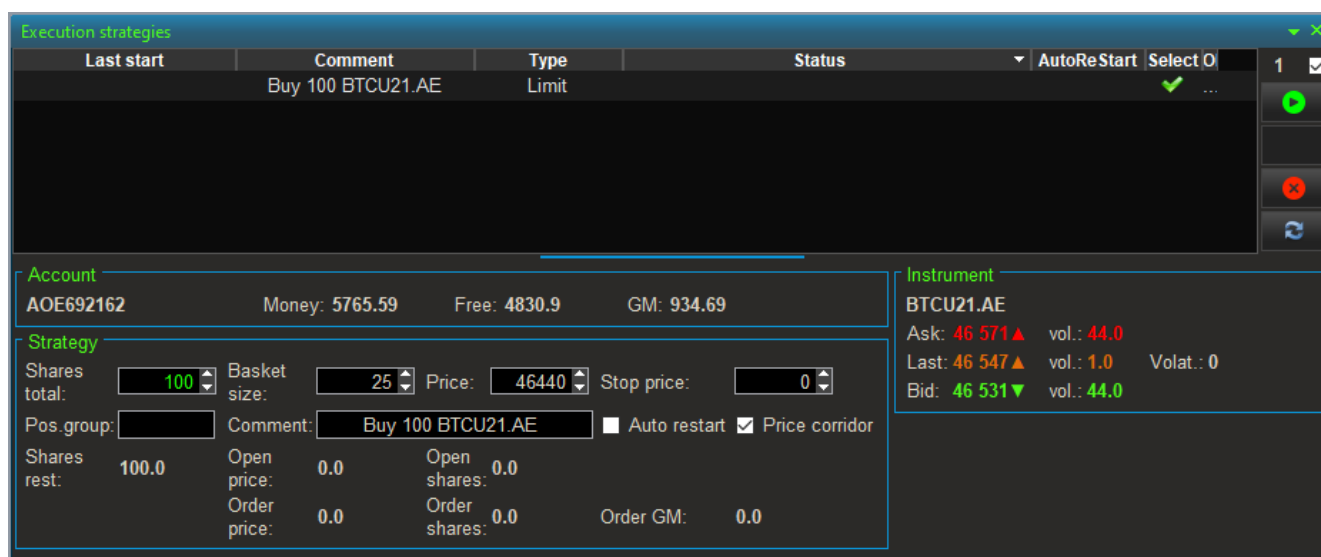
Выберите торговый счет для исполнения стратегии Create strategy on account и стратегию которую хотите создать - двойным кликом на стратегии из списка



Limit strategy

Limit strategy

Робот выставляет ордера (с кол-вом контрактов равное Basket size) по выбранному инструменту Instrument и по заданной цене Price до полного исполнения количества Shares total



Пример на скрине: задача купить 100 (Shares total) контрактов фьючерса BTCU21.AE по цене 46440 пунктов (Price), ордера будут выставляться по 25 контрактов (Basket size), до полного открытия позиции на 100 контрактов. Пока ордер на 25 контрактов полностью не исполнится - следующий ордер на 25 контрактов выставлен не будет.

Использование айсберг ордера позволяет скрыть общий объем открываемой позиции в стакане, тем самым не ухудшить цену открытия позиции.

Account – состояние торгового счета:

Money – текущий лимит денежных средств по счету

Free – свободные денежные средства по счету

GM – размер гарантийного обеспечения ГО по счету



Strategy – параметры исполнения стратегии:

Shares total – общее количество контрактов на исполнение, положительное значение означает покупку, отрицательное значение (знак «-») продажу

Basket size – количество контрактов одного ордера (айсберг ордер)

Price – цена ордера

Stop price — стоп условие. Робот будет выставлять ордера при выполнении условия по цене. Пример, зададим Stop price 46 500, робот выставит ордер на 25 контрактов по цене 46 440 если цена Last инструмента окажется ниже цены заданного условия Stop price 46 500

Shares rest – количество НЕ исполненных контрактов стратегии

Open price – средняя цена исполнения

Open shares – количество исполненных контрактов

Order GM – ГО ордера

Comment – комментарий стратегии, комментарий указывается у ордеров стратегии и сделок по ним

Instrument – рыночные данные инструмента:

Ask – лучшая цена на продажу и кол-во контрактов

Last – цена последней сделки и кол-во контрактов последней сделки

Bid – лучшая цена на покупку и кол-во контрактов

Volat – транслируемая биржей волатильность IV опциона (если инструмент - опцион)

При щелчке мыши в окно Price или Stop Price появится элемент выбора цены с текущими значениями Ask/Last/Bid



Для запуска стратегии нажмите кнопку Start, проверьте и подтвердите начало исполнения.

После нажатия кнопки Start стратегия исполнения отправляется на сервер исполнения в дата центре биржи и в соответствии с заданными параметрами осуществляет выставление ордеров автономно до момента полного исполнения либо остановки пользователем Stop.

Для изменения цены или других параметров робота нажмите кнопку Stop, после внесенных изменений для продолжения исполнения нажмите Start.

Галка Auto restart - автостарт стратегии после Stop стратегии по расписанию

Галка Price corridor - только для опционов, сервер блокирует выставление ордера по опциону: на покупку по цене более чем на 100% выше теор цены, на продажу по цене менее 50% теор цены опциона. Защита от покупок опционов по завышенным ценам и продаже по очень низким.

Volatility limit strategy

Volatility limit strategy

Робот выставляет ордера опциона по заданной волатильности. Задав величину минимального ордера Basket size, значение волатильности, в поле Price отобразится расчетная цена ордера по заданной волатильности. При отличии значения цены выставленного ордера от расчетной цены Price на величину чувствительности Sensibility (задается в минимальных шагах цены), будет автоматически снят старый ордер и выставлен новый ордер по цене Price.

Таким образом осуществляется котирование опционов по волатильности. Стратегий Volatility limit можно запустить неограниченное количество



Пример на скрине: задача купить 100 опционов колл по волатильности 80.00 ордерами по 10 контактов

Поле Instrument:

Volat - волатильность транслируемая биржей

TPrice - теор цена опциона. Расчет по Volat

IV - значение волатильности опциона по цене Bid Ask и Last

vol - кол-во контрактов по соотв котировке или цене последней сделки

Strategy - параметры работа:

Shares total — общее количество контрактов на исполнение, положительное значение означает покупку, отрицательное значение (знак «-») продажу



O.indent — смещение цены выставяемых ордеров от расчетной Price. Задается в минимальных шагах цены.

Basket size — количество контрактов в выставленном ордере

Pos. group — наименование аналитического счета учета позиции

Price IV — цена по волатильности

Sensibility — чувствительность перестановки ордеров измеряется в шагах цены. Если цена последней сделки изменится на заданную этим параметром величину, то стратегия исполнения переставит заявки.

Price — цена по которой будет выставлен ордер

Comment — комментарий стратегии, комментарий указывается у ордеров стратегии и сделок по ним

Volatility - вариант используемой волатильности:

Instrument — волатильность транслируемая биржей либо заданная вручную в Price IV

MarketMaker — заданная в Volatility editor кривая волатильности

Position — задаваемая в Volatility editor кривая волатильности

При щелчке мыши в окно Price или Stop Price появится элемент выбора цены с текущими значениями Ask/Last/Bid

Для запуска стратегии нажмите кнопку Start, проверьте и подтвердите начало исполнения.

После нажатия кнопки Start стратегия исполнения отправляется на сервер исполнения в дата центре биржи и в соответствии с заданными параметрами осуществляет выставление ордеров автономно до момента полного исполнения либо остановки пользователем Stop.

Для изменения цены или других параметров робота нажмите кнопку Stop, после внесенных изменений для продолжения исполнения нажмите Start.



Галка Auto restart - автостарт стратегии после Stop стратегии по расписанию

Галка Price corridor - только для опционов, сервер блокирует выставление ордера по опциону: на покупку по цене более чем на 100% выше теор цены, на продажу по цене менее 50% теор цены опциона. Защита от покупок опционов по завышенным ценам и продаже по очень низким.

Position group

Вы можете использовать метку Position group для выделения расчета дельты отдельных опционов от основной группы опционов

Пример, присваиваете основной позиции опционов группу Base с которой работает Range Hedger в котором указано в поле Group: Base, а опционам дельту которых не нужно учитывать при хеджировании присваиваете группу No base (можно присвоить в позициях).

Connected order strategy (Робот связанных ордеров)

Last start	Comment	Type	Status	AutoRe Start	Select O
10.09.2021 10:09:52		Connected ord...	Stopped	✓	...

AOE692162
Money: 5765.73
Free: 4831.99
GM: 933.74

Strategy
Lot count: 5
Basket size: 2
Sensibility: 2
Comment:

☒ Price corridor ☐ Auto restart

Target
Market : 8560.0 Exec.: 0.0
Theor.: 6975.215674 Total exec.: 0.0
Minim.: 0.0

Orders:

Ticker	Exp.Date	LimitEnte	Bid	Last	Ask	Tprice	Shares	O.shares	O.price	Possible price	Possible target	Status
BTC48000CU21	24.09.2021	✓	2 266	2 421	2 426	2 334	10			2 270	6 960	
BTC50000CU21	24.09.2021	✓	1 570	1 559	1 730	1 636	-10			1 726	6 960	

Пример на скрине: задача купить 50 вертикальных спредов BTC 48000/50000

Покупаем 5 лотов (Lot count) по 10 спредов (Shares 10 покупка 48000 и Shares -10 продажа 50000) по цене за лот 7000 пунктов, цена по рынку 8560 (Market Target)

Размер одного выставляемого ордера 2 контракта (Basket size)

При покупке (положительный таргет) нужно стремиться к меньшему значению таргета - купить конструкцию за меньшую цену и наоборот при продаже (отрицательный таргет) нужно стремиться к большему отрицательному значению - продать конструкцию по более высокой цене

Внимание! Определяйте значение Target исходя из справочных значений Minim Theor Market. Не перепутайте знак Target!

Задайте значение Basket size — минимальное количество контрактов ордера

Рекомендация: эффективное значение basket size зависит от объема открытия позиций по инструментам (Shares), т.е для Shares 10 эффективно использовать basket size 2, для 50 контрактов 5, для 1000 контрактов basket size 20 или 50. Зависит от ликвидности рынка и количества контрактов в стакане.

Задайте значение чувствительности Sensibility (в минимальных шагах цены), по умолчанию составляет 2. Определяет частоту выставления ордеров в зависимости от изменения бид и аск в стакане. Для уменьшения частоты выставления ордеров увеличьте значение Sensibility до 3, 4 или 5.

При выполнении заданного условия по Target (цели в пунктах) в колонке Possible Price отобразится значение цены выставляемого ордера по инструменту и в случае запущенной стратегии исполнения, будет произведено выставление ордера в торговую систему Биржи. При сделке по одному из выставленных ордеров произойдет автоматическое выставление маркет ордеров, по остальным инструментам комбинации, с учетом значения глубины пробоя маркет-ордера Indent.



В окне счета обозначается общая информация по счету:

Money – денежные средства на счете

Free – свободные денежные средства на счете

GM – общее ГО по счету

В окне Strategy задаются параметры исполнения:

Lotcount – общее количество лотов, робот не перейдет к исполнению следующего лота пока не будет полностью исполнен текущий лот

Basketsize – минимальное количество контрактов в ордере

Sensibility – чувствительность к изменению цены (измеряется в шагах цены)

Indent – глубина пробоя маркет ордера (измеряется в шагах цены)

Target – цель цены открытия. При щелчке мыши в этом окне отображаются значения Market/Theor/Minim. Можно ввести свое значения.

Comment – комментарий стратегии, комментарий указывается у ордеров стратегии и сделок по ним, рекомендуем использовать

В окне Target транслируется:

Market – цена открытия по рыночным ценам

Theor – теоретическая цена открытия

Minim – минимальная цена открытия

В окне Orders:

Ticker – тикер контракта

Type – тип контракта



Coeff. - множитель при расчете Target. Применяется для акций - цена за акцию, а торгуются лотами, нужно домножить.

LimitEnter - наличие галки означает что лимитные ордера по инструменту будут выставляться. Для снижения количества транзакций снимите галку с инструмента, где вероятность исполнения лимитного ордера низкая.

Shares – количество

BidV – объем спроса

Bid – цена спроса

Last – цена последней сделки

Ask – цена предложения

AskV – объем предложения

LastT – время последней сделки

Tprice – теоретическая цена

O.shares – количество исполненных ордеров

O.price – цена исполнения ордера

Possible price – возможная цена выставления ордера

Possible target – возможная цена исполнения всей стратегии

Для создания стратегии необходимо перенести нужные инструменты "мышкой" в окно Execution strategies по одному либо сразу все с нажатой клавишей Ctrl и выбрав стратегию Connected order strategy.

Для запуска стратегии нажмите кнопку Start, проверьте и подтвердите начало исполнения.

После нажатия кнопки Start стратегия исполнения отправляется на сервер исполнения в дата центре биржи и в соответствии с заданными параметрами



осуществляет выставление ордеров автономно до момента полного исполнения либо остановки пользователем Stop

Для изменения цены или других параметров работа нажмите кнопку Stop, после внесенных изменений для продолжения исполнения нажмите Start.

Галка Auto restart - автостарт стратегии после Stop стратегии по расписанию

Галка Price corridor - только для опционов, сервер блокирует выставление ордера по опциону: на покупку по цене более чем на 100% выше теор цены, на продажу по цене менее 50% теор цены опциона. Защита от покупок опционов по завышенным ценам и продаже по очень низким.

Hedging strategy

Range Hedger - дельта хеджер с большими возможностями

Range hedger — продвинутый робот Delta и Vega хеджирования, имеет расширенный функционал



Вкладка Setup:

Strategy — настраиваемые параметры стратегии:

Comment – комментарий стратегии, комментарий указывается у ордеров стратегии и сделок по ним, рекомендуем использовать

Type — выбор типа хеджирования

Use Volatility — выбор используемой кривой волатильности:

Instrument — для расчета Current дельты позиций использовать волатильность опционов, транслируемую биржей (по данной волатильности производится расчет теоретических цен опционов), по умолчанию.

MarketMaker — для расчета Current дельты позиций использовать волатильность опционов, заданную в редакторе волатильности (Volatility Editor) в графе MMVolatility.

Position — для расчета Current дельты позиций использовать использовать волатильность опционов, заданную в редакторе волатильности (Volatility Editor) в графе PosVolatility.

Levels

Min.Level — Max.Level — диапазон хеджируемой дельты позиции

Если Current дельты позиции выйдет за пределы диапазона, то будет выставлен хеджирующий ордер

Внимание! справедливо если задан Basket (минимальный размер контрактов хеджирующего ордера) равный 1. Если Basket задан большое количество контрактов, то ордера с требуемым количеством менее Basket выставляться не будут пока не потребуется выровнять дельту на величину Basket



Hold on level — если установить галку на этом параметре, то робот будет приводить уровень дельты к заданному параметру Level

Start Price — условие по цене при выполнении которого, робот будет выставлять хеджирующие ордера:

> — хедж ордер выставится, если цена last хеджирующего инструмента выше заданного уровня.

< — хедж ордер выставится, если цена last хеджирующего инструмента ниже заданного уровня.

Position

Max — максимальное количество контрактов. После того, как будет проторговано заданное количество контрактов стратегия исполнения остановится. Задается для ограничения количество сделок хеджирования

Traded — количество проторгованных стратегией контрактов.

Order type — по какой цене выставлять хеджирующий ордер:

Market — ордер по маркет цене (на покупку по лучшей цене предложения, на продажу по лучшей цене спроса)

Theor — по теоретической цене (только по опционам)

Spread — по середине спреда bid ask

Last — по цене последней совершенной сделки

Indent — параметр смещения цены хеджирующего ордера (в шагах цены!)

Пример. ордер на покупку по Market ask равен 46 900, если задать indent 20 при шаге цены на BTC пунктов ордер будет выставлен по цене 46 920 (пробой маркет цены на 20 пунктов) , если задать indent -20 то ордер выставится по цене 45 880

Current price — цена выставления хеджирующего ордера, для проверки



Timeout — таймаут (секунды). В случае неисполнения ордера, хеджер переставляет его. В данном случае, хеджер переставит ордер через 3 секунды.

Basket — минимальное количество контрактов хеджирующего ордера. (Внимание хеджирующий ордер с меньшим количеством контрактов чем Basket выставлен не будет!)

MaxBasket — максимальное количество контрактов, которые хеджер может продать (купить) в одном ордере, для приведения дельты к заданному диапазону.

Внимание! Перед запуском хеджера убедитесь на вкладке Positions в том что хеджируемая позиция верна и в верном значении Current level. Current shares - величина количества контрактов которое хеджер купит или продаст (-) после старта.

Для запуска стратегии нажмите кнопку Start, проверьте и подтвердите начало исполнения.

После нажатия кнопки Start стратегия исполнения отправляется на сервер исполнения в дата центре биржи и в соответствии с заданными параметрами осуществляет выставление ордеров автономно до момента полного исполнения либо остановки пользователем Stop.

Для изменения цены или других параметров робота нажмите кнопку Stop, после внесенных изменений для продолжения исполнения нажмите Start.

Галка Auto restart - автостарт стратегии после Stop стратегии по расписанию

Галка Price corridor - только для опционов, сервер блокирует выставление ордера по опциону: на покупку по цене более чем на 100% выше теор цены, на продажу по цене менее 50% теор цены опциона. Защита от покупок опционов по завышенным ценам и продаже по очень низким.



