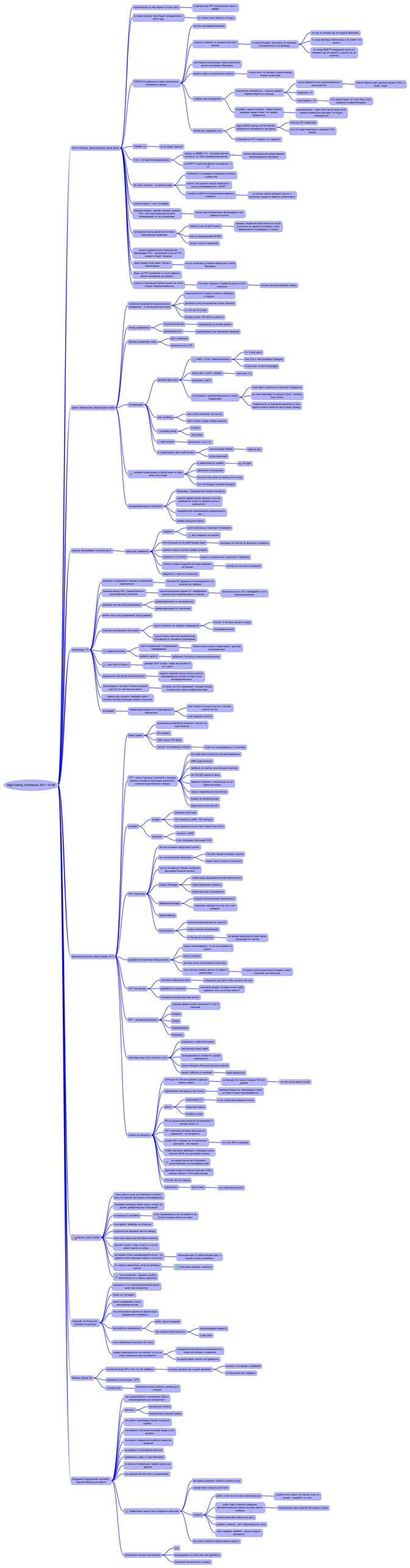
AlgoTrading conference 2011-10-29
Антон Панов, представитель обмена Берж
единый вход на обе биржи в торме (qtn)
в Сентябре алгосов тоже будет объединений в 2012 году
в арбитражном РТС можно жить тем и ММВБ
но старое тоже убивать не будут
FORTS 3.0 реализует в розы пропускную способность биржи
за счет распараллеливания
скорость зависит от скорости расчета рисков
по рассчитывает все риски по каждому пользователю и по биржам
на как на западе где это задача брокеров
то наши брокеры обленились и не умеют это делать
то когда ФОРТС внедрился никто не понимал как это делать, и рынок бы не поехал
для биржи участниками торгов является расчетная фирма (брокеры)
видеть инфу в контрагентах нельзя
только если по биржи и сделки между теми клиентами
в Евлчке из РТС говорил что торгуется
Чарльз Ю
на он будет единый
СУА - это перспективный рынок
обмен на ММВБ T+0 - поставка против платежа, но НЕ% крышкопоплекс
сейчас биржа шлет данные каждые 75мс, в будет чаще
на ФОРТС хорошие фьюче 4х дневные - 1 ед
кастомизация с ПК
на в рынке будет от 5 до 75мс, плюс издержки инфраструктуры
торговая сессия будет 1 или 15 ошибок
единый клиринг, единая площадка единая ПРО - это тема подняться на форе объединения, но есть проблемы
Ситуация торгов делается по четко прописанным правилам
проблема что аварка открывается более и закрывается
просто так клиент запуск перевести - нужно договариваться с ФОРВ
в индексе работа по уменьшению времени клиента
но объем торгов необходит расчет и возможно продуктов обратно увеличивать
Анатолий Сергеев, Alpha Quant Invest
компания занимается математическим трейдингом - 16 чел высококлассных
инвестиционный фонд
ищется эффективная связка и из нее выбирается точка по уровню риска и доходности
стандартная минимизация волатильности при ...
кривая доходности/рыночн
ВАЖНО ограничения и принципы применения
ищется эффективная связка и из нее выбирается точка по уровню риска и доходности
Сергей, MoneyMaker на SmartLab.ru
идеи для трейдинга
графики
Без графиков не найти!
есть больше но не работающие идеи
смотрелись по частям на фильтры и индексы
делаю новый и ломать графики вчера
скриншот и в экспл
сдержать историю всех стратегий и графиков
список готовых моделей автоматизирован - по фоксам
сжатие на них искать решение
обыгрыш с тем кто умнее вас
решение о содержании позиции и изменение размещения
поэтому НЕ правильно оптимизировать по количеству трейдов
разница между НФТ, среднерисков и автоматической стратегии
просчитывается зависит от трейдрейтов - нужно для внедрения на площадке
волатильность в этот трейдрейт и есть просчитывание
движение против просчитывания
диверсификация по инструментам
диверсификация по стратегиям
может жить под управление Тактра дубовой
отличие прикладного ПО в цене
нужно смотреть на графики прежнюю
(Xcrib) 12 сегодня вылезть вчера
нужно понять чем мой частичный ред. отличается от случайного блуждания
потрабинировать
Александр, ЗТ
т.е. задача системы
найти корреляции с переходом трейдрейтом
Одна можно искать корреляции с другими инструментами
выбрать ДВОУ
величина стопоста и величина движения
ТОЛЬКО ТОЛЬКО ЗТ
декабрь 2010 конфа - инфа выложена в его сайте
управление при входе целесообразно
входить заранее только когда начался формирование бара и только в сторону контрарианности
долгосрочные системы с более высокой частотой, то так меньше рисков
на сама частота определяет какарой исходит из капитала, плеча, инфраструктуры
задача для каждого трейдера найти систему соответствующую своему поинсулу
оптимизация
первая фильтрация по стационарности результата
Быт области на два участка и смотрит внизти на них
и на среднее участие
Дмитрий Бакунов, Basis Capital, НЕТ
Basis Capital
российская управляющая компания, торгует из своей капитал
ЕС регулят
Часть дочка ИУ Basis
торгует на внешнего рынка
чтобы не конкурировать с гигантами
НФТ - класс торговых стратегий и которых прибыль является функцией комиссий и скорости подключения к бирже
или действия полностью автоматизированы
Окна подключения
прибыль на сделку чуть больше комиссии
до 100 000 сделок в день
время в позиции от нескольких мс до дневной минут
новые стратегические технологии
Борьба за микросекунды
модели для когда убытки
история
в мире
прикинся в 90 годах
10% оборота в 2000, 70% сегодня
этот известно после Flash Crash 6 мая 2010
дрожала с 2008
в России
стал популярен благодаря ЗТ
НФТ-стратегии
Мы не используем технологии
где не используют бизнес компаний (фундаментальный анализ)
Classic Arbitrage
Statistical Arbitrage
Market Making
Event Driven
разработка стратегий очень сложна
нужно анализировать ТО как мы влияем на рынок
ликвидность
лимит ставки
для Вас часто используются квантоды
если начнешь сливать деньги то прдется выключаю
на акцию сами должна расти правил, иначе стратегия уже протухла
НФТ как бизнес
торговая инфраструктура
создавали под себя чтобы не быть как все
разработка стратегий
сколько нужно времени чтобы какая-нибудь надеять есть ли в этом смысл?
понимание микроструктуры рынков
НФТ - дисциплинированный бизнес
Analysis
Design
Implementation
Evaluation
частному лицу стоит ли идти в это
сложность с работой сложно
частотный поиск идей
Самоорганизовать в создание и профит неизвестно
нужно обладать большим багажом знаний
выход работать в компании
basis-capital.com
ответы на вопросы
в России 10-100 млн рублей в дальнейшем можно начать
на Западе это сильно больше 100 млн рублей
то так могло выше на всё
параметры чем меньше тем лучше
ликвидностьпотоки исполняются торгов - встроен в свои подстраиваются
новшества ПО
в как сократили кордоны поиска
фиксы
ошибки в коде
50 инструментов/стратегий отслеживают и торгуют около 10
НФТ компания почаще дискуссии на управленке - не интересно
в среде 50% подвоев на 50 миллионов долларов - это хорошо
что у нас 30% в среднем
чтобы торговать арбитражи с запасом нужно тратить 50-60 тыс долларов в месяц
на нашем рынке есть бизнесмен, (классический с не программистом)
Дмитрий когда потратил полгода чтобы самому сделать что работающее
РТС 90-100 тр в месяц
параметры
КА то trade
это сомнение важно!!!
Никита, robot_Panda
если делать упор на стратегии то можно быть на самом быстрыми в конкурентами
создавать команду имеет смысл только на долгие дивидендные отношений
в команде 3 человека
голос программисты по аутсорсингу за 10тыс которые могли на может
они маркет мейкеры на опционах
в россии все движения чем на западе
есть свои среда для быстрого анализа
быстрый нужен чтобы успеть то что не может здесь на запад
на первом этапе минимизировать costы - на старом этапе огромная скорость не нужна
мы хорошо маркетили что этой не делаешь, сайте
получаешь возврат комиссии
суть алгоритма - держать прибыль волатильностью и сливать маржинку
Алексей из Открытие, торговая площадка
дисциплиновать рынок чтобы чем на фьючах
сервер на Ингарант
анализ мнений и книги неопределенностью
как использовать фьюче на бумаги когда дивидендного эффекта
бум работов неизвестно
робот делает индекс
три ушибки волатильности
второстепенные варианта
и два звона
время занимающий выплаты это труда
индекс волатильности он считает что он на очень правильно рассчитывается
ежедневное участников по волатильности нельзя на середине с индексом
по одной сферы считать не правильно
Михаил, Studio SF
основной вектор ЗТ в том что нет графиков
поэтому сделали как в quant developer
наши и тестирует с графикой
но запускаю без графиков
экономисты спрашивают, НЕТ
ищут тонкие
фундаментальные можно украсть деньги для покупки
Владимир Годендорф, компетенции, Черные лебеди для робота
как предотвратить технические сбои и минимизировать их последствия
Причины
внутренние проблемы
воздействие внешней среды
Это робот анализирует более 10 разных ошибок
отслеживать состояние внешней среды и его ошибки
Учитывать накопленные ошибки в принятии решений
не доверять полученным данным
проверять инфу от друга брокера
в каком он проверяющем сервере на форуме
ВИ данные должны быть в реляционке
графитовая защита как в лаборат реакторе
ВИ задача выбрать робота и выйти в плюс
Прежде всего открыть сайт счета
робот стоит на всех плюс против рынка
у робота есть лимит по плечам, если он вышел - выдыхайте и в плюс
робот идет в разное совершает противоположные сделки пытаясь занять позицию
ограничение макс количества сделок в день
Ошибки
ограничение макс убытка за день
ошибка в сделке - дает пользователь выбрать
какие сделки, ордера - лучше выбрать дилерам
есть риск помехоустойчивости защиты
сигнальная система для робота
ВИ
выкладывать на свой сайт или дробобоз
звуковые сигналы если в ордре