

Лесенка заявок

Лесенка заявок (FOS) используется для автоматического выставления заявок на фьючерсы и опционы.

Принцип работы лесенки заявок заключается в создании сетки заявок на покупку и продажу. При исполнении заявки одного типа выставляется соседняя заявка такого же типа. Данный алгоритм позволяет зарабатывать на колебаниях цены в заданном диапазоне.

Форма создания FOS открывается нажатием кнопки



на тулбаре (рис. 1).

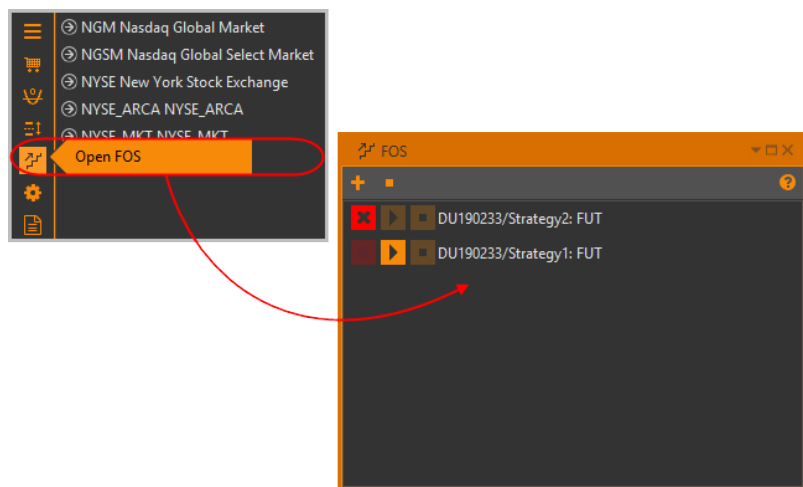


Рисунок 1 – переход к Менеджеру FOS

Содержание страницы:

- Основные операции
 - Создание
 - Запуск
 - Остановка
 - Удаление
- Параметры настройки

При нажатии правой кнопки мыши на название лесенки откроется список команд (рис. 2).

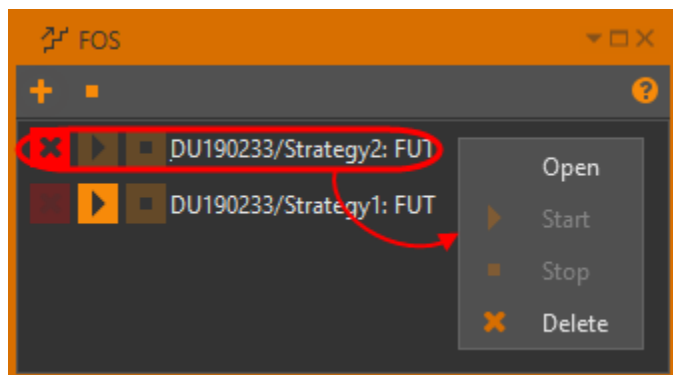


Рисунок 2 – список команд

При открытии списка пользователю могут быть недоступны некоторые команды. Для их активации необходимо дважды нажать на название лесенки или выбрать команду Open (рис. 2). После чего откроется окно настройки выбранной лесенки (рис. 3).

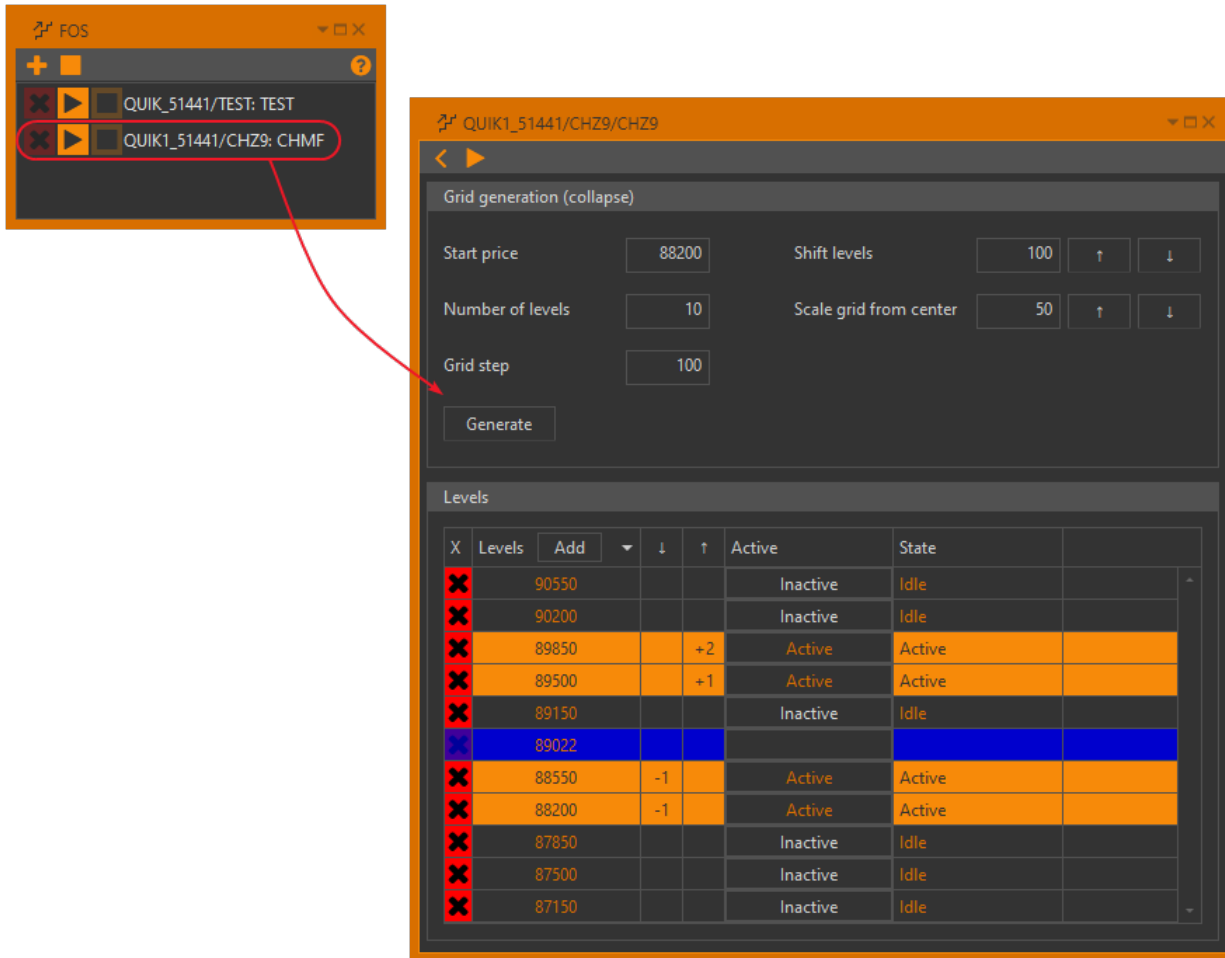


Рисунок 3 – активация

В открывшемся окне отображаются параметры настройки выбранного FOS, текущие открытые заявки в сетке Levels. После активации лесенку заявок можно запускать, задавать параметры, останавливать.

Основные операции

Создание

Для создания лесенки заявок следует:

1. нажать кнопку



в форме создания FOS (рис. 4).

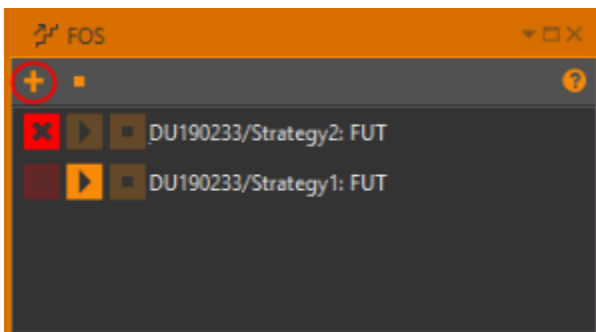


Рисунок 4 – переход к списку FOS

2. В открывшейся форме указать:

- название лесенки,
- счёт,
- инструмент,
- стратегию, в которую будут попадать совершенные по заявкам сделки (рис. 5).
Нажать ОК.

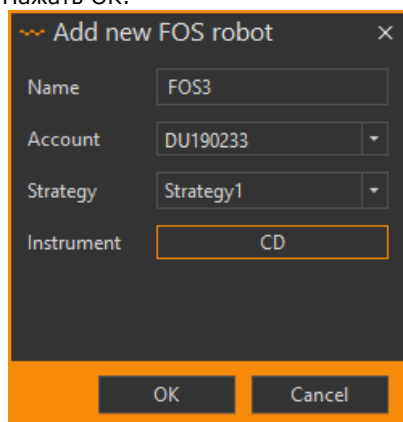


Рисунок 5 – создание

К торговому счету и базовому активу может быть прикреплено любое количество лесенок заявок.
К одной стратегии может быть привязан только один FOS.
Лесенку заявок нельзя привязать к стратегии **actual**.

После создания лесенка заявок отобразится в форме FOS (рис. 6).

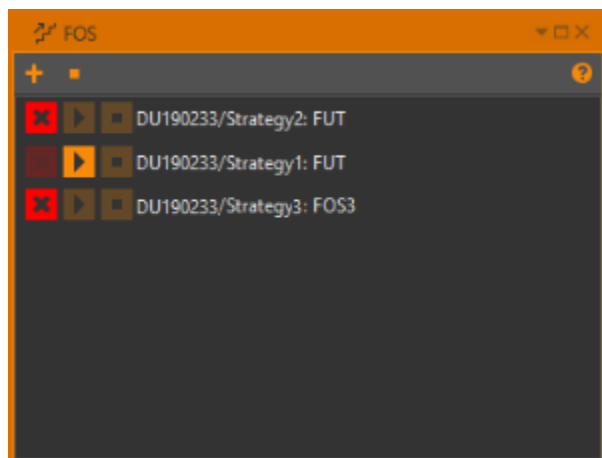


Рисунок 6 – создание нового робота

Запуск

Для запуска необходимо:

1. нажать дважды на название лесенки в списке формы FOS (рис. 7);

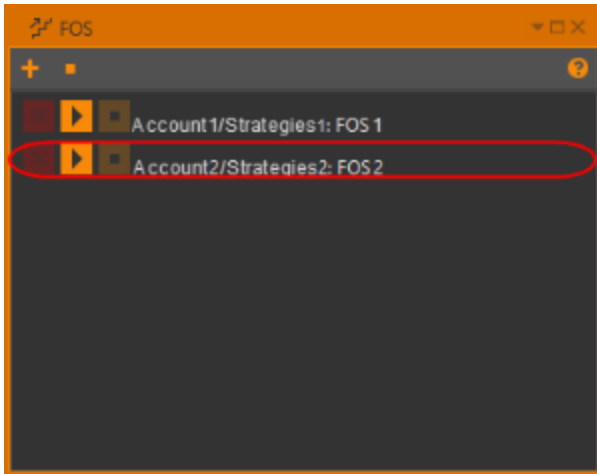


Рисунок 7 – выбор работа

2. нажать кнопку



в форме FOS или в окне настройки (рис. 8).

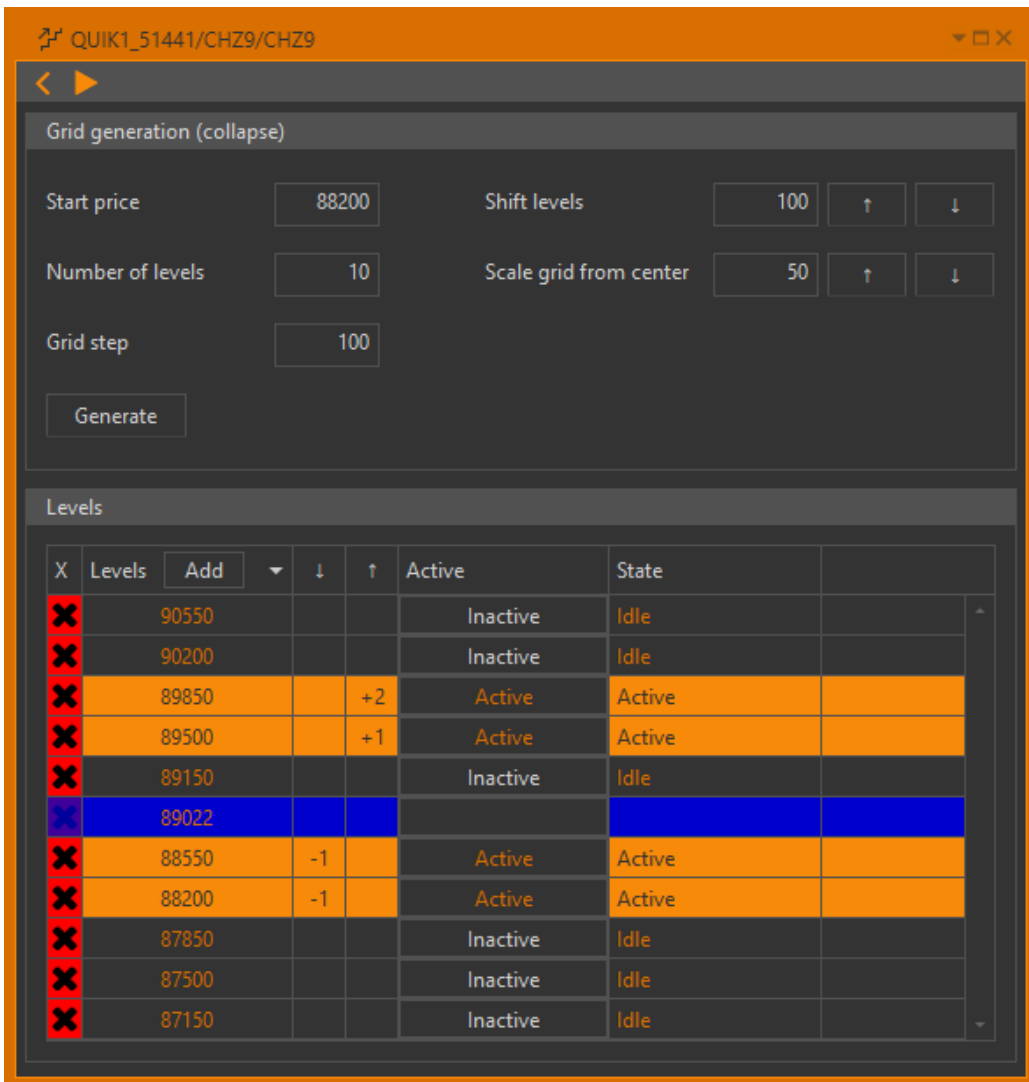


Рисунок 8 – форма управления лесенкой заявок

После запуска при наличии встречной заявки с такой же или лучшей ценой совершится сделка. После совершения

сделки по заявке ее уровень в сетке Levels становится Inactive. Соседняя по уровню в сетке заявка становится Active. Все сделки попадают в указанную при создании FOS стратегию.

Остановка

Для остановки лесенки следует нажать кнопку



в форме FOS или в окне настройки. Для остановки одновременно всех лесенок нужно нажать кнопку



в верхней части формы FOS.

Удаление

Для удаления следует нажать кнопку



Параметры настройки

Заявки выставляются с учетом параметров вкладки Grid generation (collapse) в окне настройки (рис. 9):

- Start price – начальная цена генерации сетки (нижняя цена сделки);
- Number of levels – количество уровней (узлов) в сетке;
- Grid step – шаг узлов сетки, частота изменения цены;
- Shift levels – сдвиг уровней в сетке на N позиций;
- Scale grid from center – сдвиг шага на N позиций, масштабирование сетки - сдвиг узлов сетки к центру или расширение.

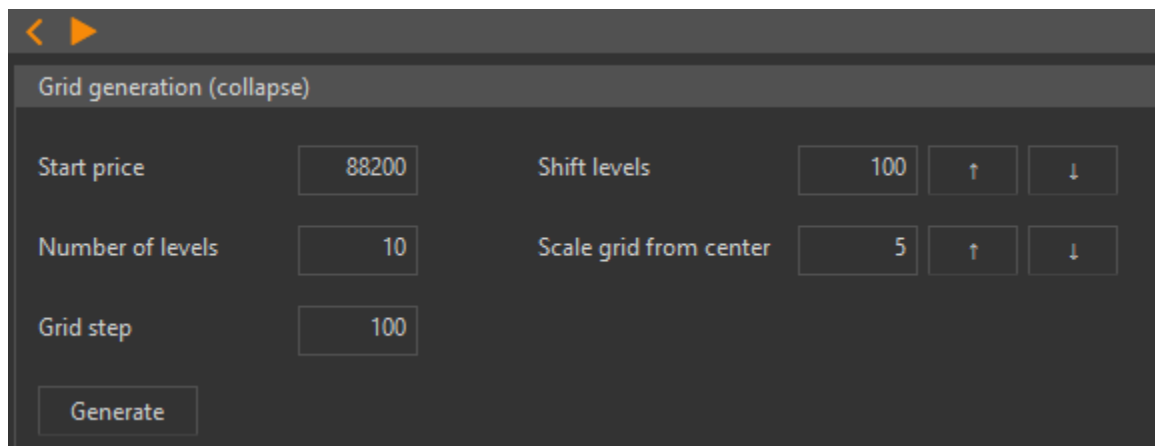


Рисунок 9 – параметры настройки

При необходимости вкладку Grid generation (collapse) можно свернуть, кликнув на вкладку, после чего вкладка свернется, название изменится на Grid generation (expand).

При вводе параметров формируется сетка заявок (рис. 10).

X	Levels	Add	▼	↓	↑	Active	State
✘	90550					Inactive	Idle
✘	90200					Inactive	Idle
✘	89850			+2		Active	Active
✘	89500			+1		Active	Active
✘	89150					Inactive	Idle
✘	89022						
✘	88550			-1		Active	Active
✘	88200			-1		Active	Active
✘	87850					Inactive	Idle
✘	87500					Inactive	Idle
✘	87150					Inactive	Idle

Рисунок 10 – табличное отображение заявок

Настройка сетки Levels представлена в таблице 1.

Таблица 1 - Параметры сетки Levels

Поле	Описание	Настройка
X	Удаление уровней из сетки заявок	Для удаления уровня из сетки необходимо кликнуть на .
Levels, кнопка Add	Цена заявки на определенном уровне в сетке, добавление нового уровня	По клику на Add добавляется новый узел (уровень заявки) по принципу: минимальная цена сделки – 1. Синим цветом выделен уровень с ценой базового актива (рыночная цена).
	Пересечение уровня сверху вниз	Описание операции для уровня: <ul style="list-style-type: none"> Вводим «1» – по умолчанию «+1» – покупка. Вводим «-1» – продажа. Вводить можно любое количество контрактов, например: 1, 2, 3 и т.п. Для одного уровня не обязательно заполнять оба направления пересечения заявки. Для ввода одной операции сразу для всех уровней необходимо нажать Ctrl+Enter.
	Пересечение уровня снизу вверх	Описание операции для уровня: <ul style="list-style-type: none"> Вводим «1» – по умолчанию «+1» – покупка Вводим «-1» – продажа Вводить можно любое количество контрактов, например: 1, 2, 3 и т.п. Для одного уровня не обязательно заполнять оба направления пересечения заявки. Для ввода одной операции сразу для всех уровней необходимо нажать Ctrl+Enter.
Active	Работа уровня	Для активации уровня необходимо кликнуть на кнопку: <ul style="list-style-type: none"> Inactive – получает данные, операции не совершаются. Active – совершаются операции.

State	Статус уровня	Статус уровня меняется автоматически в зависимости от работы уровня: <ul style="list-style-type: none">• Idle – простаивающий (уровень).• Active – активный (уровень).• Stopping – остановочный (уровень).
-------	---------------	--

При исполнении заявки на одном уровне выставляется соседняя заявка с соседней ценой на соседнем уровне.

При достижении крайних узлов сетки текущая позиция по фьючерсу (по рыночной цене) закрывается. FOS остановится. Все совершенные сделки попадут в соответствующую стратегию.

Обзорный вебинар по новой версии робота FOS (лесенка заявок).