

Алгоритмические заявки, они же ALGO-заявки.

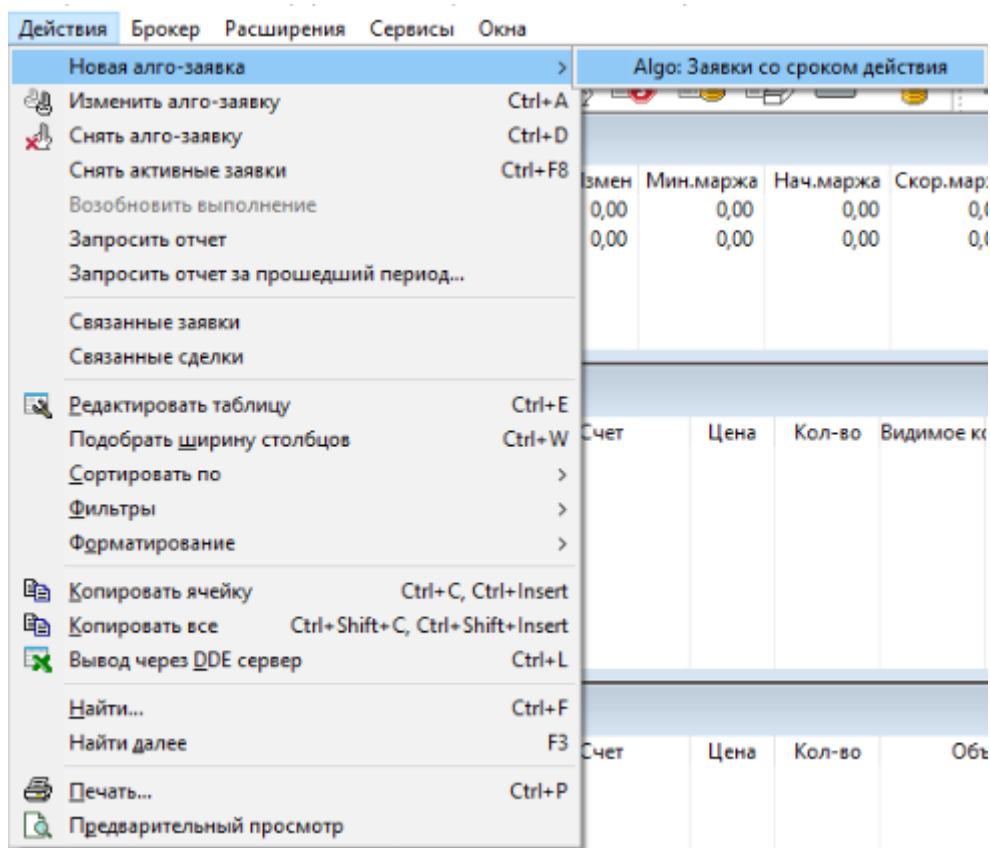
Что такое алго-заявка?

Алгоритмические заявки (алго-заявки) представляют собой поручения особого вида, условия исполнения которых заданы заранее специальным алгоритмом. При наступлении событий, заложенных в алгоритме, выставляется или снимается биржевая заявка с указанными условиями.

Существует несколько типов алгоритмических заявок. На текущий момент предоставляется только алго-заявка типа «GTD».

Заявка со сроком действия (GTD) — это имитация биржевой заявки с определенным сроком действия: «До даты», «До отмены» и «До времени». Используя данный тип алго-заявки, можно указать «срок жизни», до которого будет действовать обычная биржевая заявка.

Заявку можно поставить через меню транзакций, из стакана, либо через «действия» или из таблицы алго-заявок.



Вот как выглядит окно ввода алго-заявки

Algo: Заявки со сроком действия Ввод заявки

Класс: FORTS: Фьючерсы
 Организация: SPBFUT589000 [SPI]

Инструмент: ALH1
 Торговый Счет: SPBFUT

Покупка | Продажа

Срок действия: До даты
 Дата: 05.03.2021
 Время: 10:12:10

Рабочий интервал
 Начало: 15:30:00 | Окончание: 16:55:00

Цена: 8920
 Кол-во (лот 100): 1
 Код расчетов: []

Рыночная
 max: 0

Партнер: SPBFUT589000 [SPBFUT589000]

Код Клиента: SPBFUT
 Комментарий: []

Оповещать об исполнении связанных заявок

Да | Отмена

Какие ключевые параметры отличают этот тип заявки от обычной рыночной/лимитированной

- 1) Срок действия. Возможно указать:
 - До даты
 - До отмены
 - До времени
- 2) Дата и время. Поле «Время» активно в случае выставления заявки со сроком действия «До времени»
- 3) Рабочий интервал

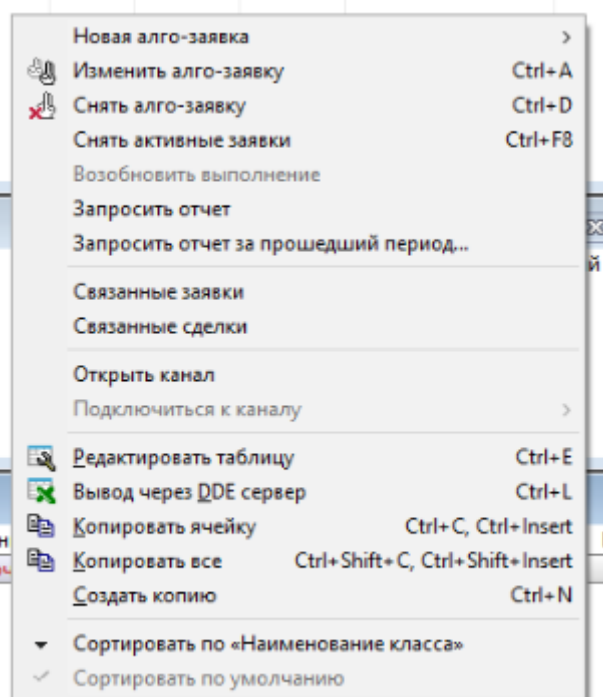
Рассмотрим более подробно механику работы алго-заявок

Как выглядит выставленная заявка?

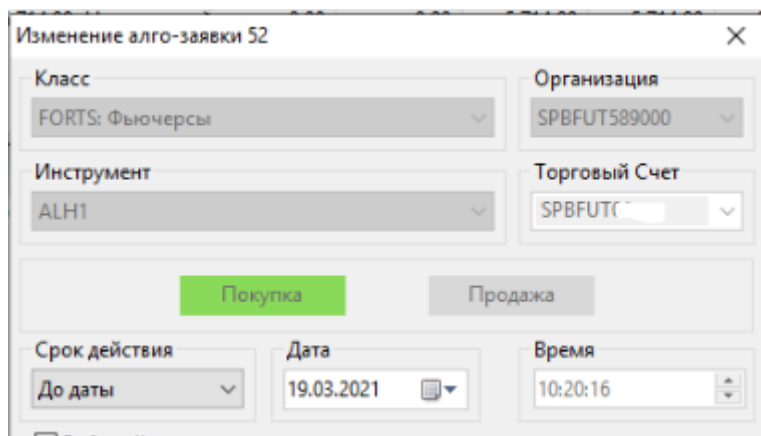
Номер заявки	Дата регистра	Время регистра	Дата снятия	Время снятия	Наименование	Инструмент	Инструмент сс	Операция	Тип	Количество	Остаток	Цена	Объем	Статус	Код клиента	Срок действия	Дата истечения	Время истечен	Время старта	Время окончания	Комментарий
52	24.02.2021	10:13:46			FORTS: Фьюче	ALRS-3.21	ALH1	Покупка	Лимитирован	1	1	8 920	8 920,00	Активна	SPBFUT	До даты	05.03.2021	0:00:00	15:30:00	16:55:00	

Обратите внимание, в таблице есть поля «Срок действия», «дата истечения», «время истечения», «время старта» и «время окончания»

Возможные действия с заявкой включают в себя как возможность редактирования, так и возможность загрузки отчета по алго-заявке, также возможно открыть таблицу связанных заявок, где будут не все заявки, а только выставленные/снятые/измененные заявки в результате действия алго-заявки



В случае выбора срока действия «до даты», алгоритм будет работать следующим образом. Например, сегодня 24.02. Срок действия заявки указан до 19.03. В таком случае, по окончании торговой сессии, если заявка не была исполнена, она снимается, и автоматически будет выставлена на следующий рабочий день, и так до окончания действия заявки, либо до факта ее полного исполнения



В случае выбора срока действия «До времени», можно указать дату, до какого времени будет действовать заявка. Поле «Дата» также остается активным. Если указана только дата, до 00:00 19.03 заявка снимется. Если указать «До времени», и например указать время 15:00, то в таком случае, заявка перестанет быть активно в 15:00 19.03.

Класс: FORTS: Фьючерсы
 Организация: SPBFUT589000
 Инструмент: ALH1
 Торговый Счет: SPBFUT

Покупка | Продажа

Срок действия: До времени
 Дата: 17.03.2021
 Время: 14:25:16

Также можно указать «Рабочий интервал». Это будет означать, что заявка будет активной только в указанное время. На примере скриншота ниже, заявка будет действовать до 17.03 14:25, причем активна она будет только во время дневной сессии, т.е. с 10:30 до 18:02. В 18:02:30, если заявка не исполнилась, она будет снята, и выставлена на следующий день после 10:30:02

Класс: FORTS: Фьючерсы
 Организация: SPBFUT589000
 Инструмент: ALH1
 Торговый Счет: SPBF

Покупка | Продажа

Срок действия: До времени
 Дата: 17.03.2021
 Время: 14:25:16

Рабочий интервал
 Начало: 10:30:02 | Окончание: 18:02:30

Цена: 8920
 Кол-во (лот 100): 1
 Код расчетов:
 Рыночная
 max: 0

Партнер

Вся информация о свойствах заявки есть в таблице алго-заявок. Открыть таблицу алго-заявок можно через меню «Создать окно». Если в списке нет данной таблицы, ее можно добавить вручную из раздела «Прочее». Также, можно воспользоваться быстрой клавишей F7, и выбрать таблицу алго-заявок.

Изменение алго-заявки 55

Класс: FORTS: Фьючерсы
 Организация: SPBFUT589000
 Инструмент: ALH1
 Торговый Счет: SPBFUTC

Покупка / Продажа

Срок действия: До отмены
 Дата: 24.02.2021
 Время: 11:08:08

Рабочий интервал
 Начало: 19:00:00
 Окончание: 23:50:00

Цена: 8920
 Кол-во (лот 100): 1
 Код расчетов: max 0

Партнер: _____

Код Клиента: SPBFUT
 Комментарий: _____

Оповещать об исполнении связанных заявок

Да / Отмена

Срок расчѐт	Входящий остаток	Текущий остаток	Заблокировано	Всего	Доступно
T0	5 714,99	5 714,99	0,00	5 714,99	5 714,99
T2	5 714,99	5 714,99	0,00	5 714,99	5 714,99
T0	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
T2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Цена	Объем	Статус	Код клиента	Срок действия	Дата истечения	Время истечения	Время старта	Время окончания
8 920	8 920,00	Снята	SPBFUT	До даты	05.03.2021	0:00:00		
8 920	8 920,00	Снята	SPBFUT	До даты	29.04.2021	0:00:00		
10 400	10 400,00	Снята	SPBFUT	До даты	29.04.2021	0:00:00		
8 920	8 920,00	Активна	SPBFUT	До отмены			19:00:00	23:50:00

При активации алгоритма, выставляется обычная заявка. Информация о ней есть в таблице обычных заявок

№	Жанр	Выставлен	Период	Инструмент	Операция	Счет	Цена	Кол-во	Видимое кол-во	Остаток	Объем	Комментарий	Состояние	UID	UID сначало
1		13:03:12		Нормаль:ALH1 [FORTS: Фьючерсы]	Купля	SPBFUT	8 920	1		1	8 920,00	SPBFUT	Активна	191 645	

По алго-заявке можно загрузить отчет, он будет включать в себя информацию обо всем, связанном с указанной заявкой. Информация хранится только внутри дня. В одном из следующих обновлений терминала информация будет транслироваться за весь срок жизни алго-заявки

Инструмент	ALH1 [SPBFUT]
Оповещения об исполнении	Нет
Срок действия	До даты [28.04.2021]
Код клиента	SPBFUT
Тип	Лимитированная
Цена	8920
Количество	1
Использовать временной интервал	Да
Время старта	13:20:00
Время окончания	13:21:00
Статус	Активна
Остаток	1
Исполненное количество	0

История изменений

Время	Цена	Количество	Срок действия	Использовать временной интервал	Время старта	Время окончания
24.02.2021 13:16:37	8920	1	До даты [28.04.2021]	Нет		
24.02.2021 13:22:00	8920	1	До даты [28.04.2021]	Да	13:20:00	16:00:00

Транзакции

Время	ID	Номер заявки	Статус	Тип	Операция	Цена	Количество	Класс	Инструмент	Торговый счет	Сообщение
24.02.2021 13:03:12	14	2006661888091393221	Успешно обработана торговой системой	новая	Покупка	8920	1	SPBFUT	ALH1	SPBFUT	Заявка 2006661888091393221 успешно зарегистрирована.
24.02.2021 13:16:37	15	2006661888091393221	Успешно обработана торговой системой	снятие				SPBFUT	ALH1	SPBFUT	Заявка 2006661888091393221 снята. Неисполненный остаток: 1.
24.02.2021 13:20:00	16	2006661888091394784	Успешно обработана торговой системой	новая	Покупка	8920	1	SPBFUT	ALH1	SPBFUT	Заявка 2006661888091394784 успешно зарегистрирована.
24.02.2021 13:22:00	17	2006661888091394784	Успешно обработана торговой системой	снятие				SPBFUT	ALH1	SPBFUT	Заявка 2006661888091394784 снята. Неисполненный остаток: 1.

Связанные заявки

Номер заявки	Статус	Операция	Цена	Количество	Объем	Остаток	Время	Класс	Инструмент	Время снятия	Торговый счет
2006661888091393221	Снята	Покупка	8920	1	8920,00	1	24.02.2021 13:03:12	SPBFUT	ALH1	24.02.2021 13:16:37	SPBFUT
2006661888091394784	Снята	Покупка	8920	1	8920,00	1	24.02.2021 13:20:00	SPBFUT	ALH1	24.02.2021 13:22:00	SPBFUT

Связанные сделки

Номер заявки	Номер сделки	Цена	Количество	Объем	Операция	Время	Класс	Инструмент	Торговый счет
--------------	--------------	------	------------	-------	----------	-------	-------	------------	---------------

Важные моменты

- 1) UID выставившего и снявшего обычную заявку будет 191645. Это UID модуля алго-заявок
- 2) Проверка лимитов происходит только при активации алго-заявки. Например, если заявка выставлена в 10:05, с рабочим интервалом с 11:00, и сейчас средств на счете не хватает, то отмена заявки по этой причине будет только после 11:00.
- 3) На текущий момент доступно выставление заявок по российским акциям и облигациям, по валюте и фьючерсам.
- 4) Выставление алго-заявок, в отличие от стоп-заявок, возможно только в торговое время! До начала торговли, выставить заявку нельзя, даже если активны сервера Quika
- 5) При частичном исполнении заявки, в следующую активацию алгозаявка выставит обычную заявку на не исполненный остаток.