



Инструкция по работе с условными (стоп-) заявками



Содержание

1. Общая информация о документе	3
2. Общая информация об условных заявках в QUIK	4
3. Порядок работы условных заявок в системе QUIK	5
4. Уведомление о рисках	7
5. Условная заявка «Стоп-лимит»	7
6. Условная заявка «Тейк-профит»	13
7. Условная заявка «Стоп-цена по другому инструменту»	19
8. Условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит»	22
9. Условная заявка «Связанная стоп-заявка»	31
10. Условная заявка «Стоп-заявка по исполнению»	36
11. Алгоритмическая стоп-заявка	37
12. FAQ	42

Ваши вопросы, пожелания и комментарии к данной Инструкции направляйте по электронной почте на адрес: quiksupport@arqatech.com.



1. Общая информация о документе

Данный документ содержит подробную информацию об условных (стоп-) заявках в системе QUIK и ответы на наиболее важные и частые вопросы клиентов, касающиеся стоп-заявок в системе QUIK.

Краткий обзор содержания разделов инструкции:

- В разделах 2 и 3 содержится информация о том, как связаны стоп-заявки в системе QUIK с позициями клиента, биржевыми сделками и заявками (лимитированными и рыночными). В этих разделах описано, как просмотреть текущее состояние стоп-заявок, заявок и сделок по ним и проверить, было ли выполнено указанное условие.
- В разделе 4 содержится общая информация о возможных рисках, связанных с использованием стоп-заявок в системе QUIK.

Если ранее вы не работали со стоп-заявками в системе QUIK, рекомендуется в первую очередь ознакомиться с разделами 2, 3 и 4 данной инструкции.

- Разделы с 5 по 11 содержат следующую информацию:
 - алгоритмы работы стоп-заявок;
 - описание параметров и их влияния на работу стоп-заявок;
 - примеры с числовыми значениями;
 - графики, демонстрирующие работу каждого условия.
- В разделе 12 содержатся подробные ответы на наиболее важные и часто задаваемые вопросы трейдеров, связанные с использованием стоп-заявок в системе QUIK. Данный раздел рекомендуется к ознакомлению в случае, если у вас возник определённый вопрос относительно функционала стоп-заявок.

Если вам необходима практика по работе со стоп-заявками без использования средств вашего основного счёта, вы можете запросить доступ к учебному серверу QUIK у вашего брокера (если он предоставляет такую услугу) или получить доступ к нашему учебному серверу QUIK Junior. Для этого зарегистрируйтесь на сайте по ссылке: <https://arqatech.com/ru/support/demo/>

Инструкцию по подключению к учебному серверу вы получите в информационном письме с темой «Регистрация демо-доступа QUIK», которое придет на адрес электронной почты, указанный при регистрации.

Если после ознакомления с данным документом у вас остались вопросы по работе со стоп-заявками в системе QUIK, свяжитесь с нами по электронной почте quiksupport@arqatech.com.



2. Общая информация об условных заявках в QUIK

Условные (стоп-) заявки в системе QUIK – функционал системы QUIK, позволяющий автоматически выставить биржевую заявку в торговую систему биржи при выполнении указанных ценовых условий.

Исполнение условной заявки – отправка в торговую систему биржи поручения на выставление биржевой заявки при выполнении указанных ценовых условий.

Биржевая заявка – заявка на покупку или продажу, зарегистрированная в торговой системе биржи. Именно по биржевым заявкам происходит заключение сделок в торговой системе биржи с последующим открытием, изменением или закрытием позиции по счёту. Биржевые заявки бывают лимитированными и рыночными.

Лимитированная заявка – биржевая заявка, цена которой явным образом указывается трейдером при выставлении. Сделки по таким заявкам не могут исполниться по цене хуже указанной, однако в соответствии с правилами торгов – по таким заявкам могут быть заключены сделки по цене лучше указанной, при наличии соответствующего встречного предложения в торговой системе биржи.

Рыночная заявка – биржевая заявка, исполнение которой происходит по текущим рыночным ценам в соответствии с действующими правилами торгов на бирже. Для таких заявок нельзя указать цену явным образом.

Исполнение биржевой заявки – это заключение сделки в торговой системе биржи по этой заявке и соответствующее изменение позиций по счёту. Исполнение биржевой заявки может быть частичным или полным.

Прямое назначение условных заявок:

- фиксация прибыли;
- минимизация убытков;
- закрытие позиций по выгодным, с точки зрения трейдера, ценам.

Также условные заявки могут использоваться для открытия позиции при наступлении определённых условий для реализации соответствующей стратегии (например, открытие позиции при пробое уровня сопротивления или поддержки и др.).

**Функционал стоп-заявок может быть ограничен брокером для конкретного счёта в соответствии с заключённым договором о брокерском обслуживании между трейдером и брокером или может быть предоставлен в качестве отдельной услуги.
Для получения доступа к функционалу стоп-заявок необходимо обратиться к действующему брокеру.**

В системе QUIK предусмотрен функционал автоматического переноса неисполненных активных стоп-заявок на следующую торговую сессию. Таким образом стоп-заявка в QUIK может быть



активна:

- до конца текущей торговой сессии;
- до указанной даты;
- до отмены.

Возможность переносить стоп-заявки между торговыми сессиями, а также максимальный срок действия стоп-заявки следует уточнять у брокера, с которым заключен соответствующий договор.

В отличие от лимитированных заявок, цены стоп-заявок, в большинстве случаев, имеют более широкие границы допустимых цен (в зависимости от установленных диапазонов на бирже и на сервере брокера).

3. Порядок работы условных заявок в системе QUIK

Торговля с использованием условных (стоп-) заявок начинается с регистрации условной заявки и отслеживания изменения цены:

- если заданное условие выполнено – условная заявка исполняется и выставляет биржевую заявку («порождаемая заявка»);
- если выставленная биржевая заявка исполняется – заключается сделка и происходит изменение позиции.

В системе QUIK предусмотрена проверка достаточности средств для сделок, которые могут быть заключены в результате исполнения стоп-заявки. У разных брокеров проверка достаточности средств может осуществляться по-разному, например:

- Вариант 1:

- резервирование средств осуществляется в момент регистрации стоп-заявки;
- в момент исполнения стоп-заявки (если она исполняется в день регистрации) повторная проверка достаточности средств не выполняется;
- резервирование средств под стоп-заявки, перенесенные с предыдущих торговых сессий, не осуществляется;
- при исполнении таких стоп-заявки происходит повторная проверка достаточности средств.

- Вариант 2:

- резервирование средств осуществляется в момент регистрации стоп-заявки;
- в момент исполнения стоп-заявки повторная проверка достаточности средств не выполняется для (актуально как для стоп-заявок, зарегистрированных сегодня, так и для стоп-заявок, перенесенных с предыдущих торговых сессий).



В таких случаях, если при регистрации стоп-заявки средств достаточно, условная заявка выставляется, а средства блокируются для исполнения «порождаемой заявки», в последствие – сделки.

Если средств недостаточно, условная заявка отклоняется с соответствующим сообщением об ошибке.

• Вариант 3:

- Проверка покупательной способности и резервирование средств осуществляется не в момент регистрации стоп-заявки, а в момент исполнения стоп-заявки.

В таком случае, если при исполнении стоп-заявки на счете клиента недостаточно средств, «порождаемая заявка» отклоняется с соответствующим сообщением об ошибке.

Чтобы узнать, как именно выполняется проверка достаточности средств у вашего действующего брокера необходимо направить ему соответствующий запрос.

Сервер QUIK проверяет выполнение условий для активных стоп-заявок по текущей цене инструмента, которая рассчитывается сервером QUIK на основании цены последней сделки потока обезличенных сделок. Обезличенные сделки передаются биржей отдельно от данных по текущим торговым параметрам и отдельно от котировок в стакане.

При необходимости ознакомиться с изменениями цены по инструменту, рекомендуется ориентироваться на цены сделок в таблице обезличенных сделок или на график цены и объёма.

В случае возникновения затруднений при работе со стоп-заявками или иной спорной ситуации по результатам работы условных заявок в системе QUIK, рекомендуется ознакомиться с разделом 12 данного документа. Если не удалось найти ответ на вопрос или решение проблемы – необходимо обратиться с соответствующим запросом к вашему брокеру.

Для отслеживания позиций и управления активными, исполненными и снятыми условными заявками доступны следующие инструменты терминалов QUIK:

1. Таблицы и окна Рабочего места QUIK:

- таблица стоп-заявок (подробнее см. п. 3.7, раздел 3 Руководства пользователя QUIK);
- график цены и объёма – управление стоп-заявками возможно по уровням ценовых условий (подробнее см. п. 4.2, раздел 4 Руководства пользователя QUIK).

2. Мобильные приложения QUIK Android X и iQUIK X:

- вкладка «Стоп-заявки» на экране «Заявки» (подробнее см. Руководства пользователя QUIK Android X и iQUIK X или п. 3.6-3.7, раздел 3 Руководства пользователя QUIK);
- на графиках по уровням цены (подробнее см. п. 4.2, раздел 4 Руководства пользователя QUIK).

3. Браузерный терминал webQUIK:

- таблица «Стоп-заявки» (подробнее см. «Руководство пользователя webQUIK» или п. 3.7, раздел 3 Руководства пользователя QUIK);



- на графиках по уровням цены (подробнее см. «Руководство пользователя webQUIK» или п. 4.2, раздел 4 Руководства пользователя QUIK).

Документация по клиентским терминалам доступна для скачивания с нашего сайта в разделе Техническая поддержка / Файловый архив: <https://arqatech.com/ru/support/files/>

- «Руководство пользователя QUIK»;
- «Руководство пользователя QUIK Android X»;
- «Руководство пользователя QUIK Android X планшет»;
- «Руководство пользователя iQUIK X»;
- «Руководство пользователя iQUIK X iPad»;
- «Руководство пользователя webQUIK».

4. Уведомление о рисках

Контроль условий и исполнение стоп-заявки осуществляется сервером системы QUIK, находящимся вне торговой системы биржи. В связи с этим вероятно ситуация, когда при наступлении условий стоп-заявки ее исполнение невозможно по техническим причинам. Например, в случае сбоя в канале связи либо в шлюзе между сервером QUIK и торговой системой биржи. Использование стоп-заявки может создавать дополнительные риски, так как происходит изменение рыночной позиции пользователя без его непосредственного участия.

В связи с этим брокерам рекомендуется заключать с клиентами – пользователями системы QUIK дополнительное соглашение, уведомляющее о рисках и возлагающее на пользователя всю ответственность за последствия исполнения стоп-заявки или ее неисполнения по каким-либо причинам.

В случае истечения срока действующих доверенностей, или блокировки прав доступа пользователя к системе, их дальнейшее хранение и исполнение зависит от настроек сервера QUIK у брокера. Для получения дополнительной информации по этому вопросу, вам необходимо обратиться с соответствующим запросом к вашему брокеру.

5. Условная заявка «Стоп-лимит»

Основным назначением условной заявки «Стоп-лимит» является минимизация убытков в случае ухудшения цены до определённого уровня. Данный тип условия подходит для открытия позиции в случае, если цена преодолевает уровень сопротивления или поддержки (см. [примеры](#)).

Ключевые параметры условной заявки «Стоп-лимит»:

- **Цена стоп-лимит** – уровень цены, до которого должна ухудшиться текущая цена для исполнения условной заявки «Стоп-лимит» и выставления биржевой заявки по **цене исполнения**.
 - Для заявок на продажу ухудшением цены является её падение, в этом случае проверяется, не стала ли текущая цена меньше или равна ($< =$) указанной **цене стоп-лимит**.



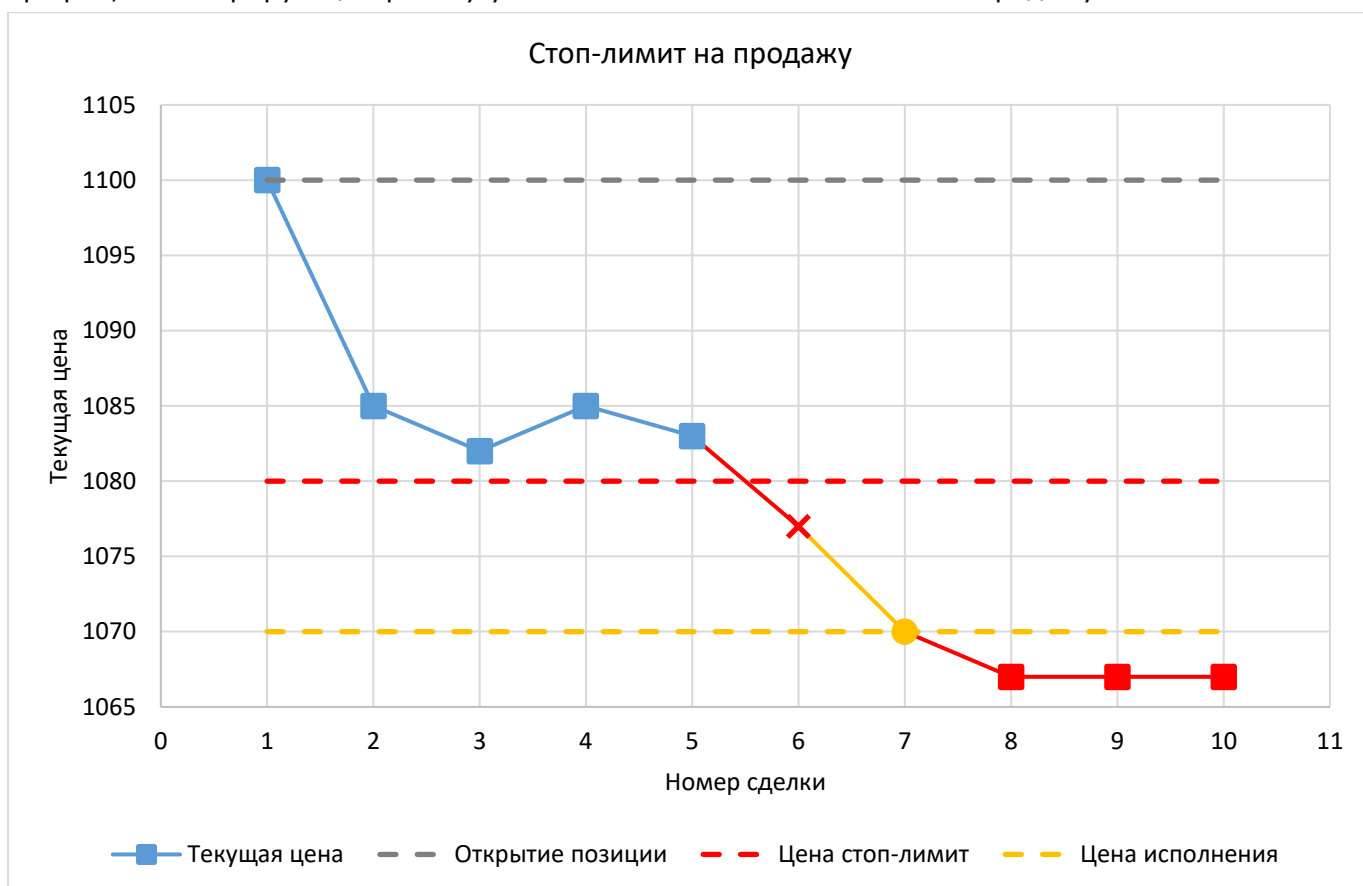
- Для заявок на покупку ухудшением цены является её рост, в этом случае проверяется, не стала ли текущая цена больше или равна ($> =$) указанной **цене стоп-лимит**.
- **Цена исполнения** – цена биржевой лимитированной заявки, которая будет выставлена при достижении уровня цены **стоп-лимит**. **Цена исполнения** может быть указана равной, больше или меньше **цены стоп-лимит** не зависимо от направления стоп-заявки.

Пример 1: «Стоп-лимит» на продажу для закрытия позиции

Была открыта длинная позиция по 1100 с целью закрытия позиции (продажи) по большей цене. Существует риск, что цена не вырастет, а наоборот существенно упадёт, в таком случае данная позиция принесёт убытки. Чтобы предусмотреть эту ситуацию и оперативно закрыть позицию, минимизировав убытки, выставляется условная заявка «Стоп-лимит» на продажу со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит \leq 1080; цена исполнения = 1070.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Стоп-лимит» на продажу:



- В момент 1 – открыта позиция по 1100 и выставлена условная заявка «Стоп-лимит» на закрытие позиций для минимизации убытков;
- В моменты 2-5 – цена не достигала уровня **цены стоп-лимит** (1080);
- В момент 6 – цена достигла или преодолела уровень **цены стоп-лимит** (1080), условная заявка «Стоп-лимит» исполнена и биржевая лимитированная заявка по **цене исполнения** (1070) выставлена в систему;



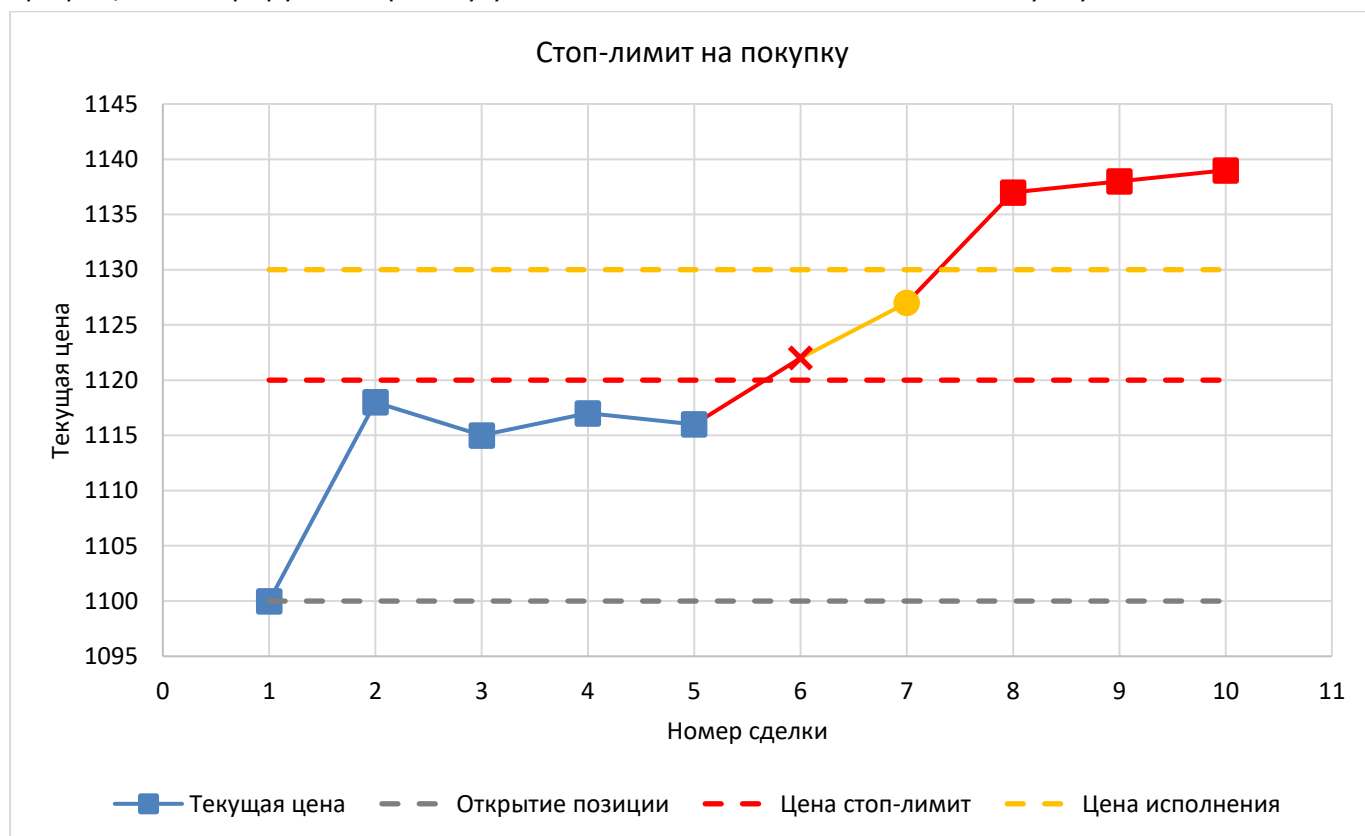
- В момент 7 – удалось заключить сделку по цене не ниже **цены исполнения** (1070), закрыть позицию и ограничить / зафиксировать убыток за счёт того, что цена заявки опережала рынок (была ниже рыночной), и в системе были встречные котировки по лучшей цене;
- В моменты 8-10 – цена продолжает ухудшаться, но позиция уже закрыта и убытки не увеличиваются.

Пример 2: «Стоп-лимит» на покупку для закрытия позиции

Была открыта короткая позиция по 1100 с целью закрытия позиции (покупки) по меньшей цене. Существует риск, что цена не упадёт, а наоборот, существенно вырастет, в таком случае короткая позиция принесёт убытки. Чтобы предусмотреть эту ситуацию и оперативно закрыть позицию, минимизировав убытки, выставляется условная заявка «Стоп-лимит» на покупку со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит \geq 1120; цена исполнения = 1130.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Стоп-лимит» на покупку:



- В момент 1 – открыта позиция по 1100 и выставлена условная заявка «Стоп-лимит»;
- В моменты 2-5 – цена не достигала уровня **цены стоп-лимит** (1120);
- В момент 6 – цена достигла или преодолела уровень **цены стоп-лимит** (1120), условная заявка «Стоп-лимит» исполнена и биржевая лимитированная заявка по **цене исполнения** (1130) выставлена в систему;
- В момент 7 – удалось заключить сделку по цене не ниже **цены исполнения** (1130), закрыть позицию и ограничить / зафиксировать убыток за счёт того, что цена заявки опережала рынок (была выше рыночной), и в системе были встречные котировки по лучшей цене;



- В моменты 8-10 – цена продолжает ухудшаться, но позиция уже закрыта и убытки не увеличиваются.

Пример 3: «Стоп-лимит» на продажу для открытия позиции при преодолении уровня поддержки

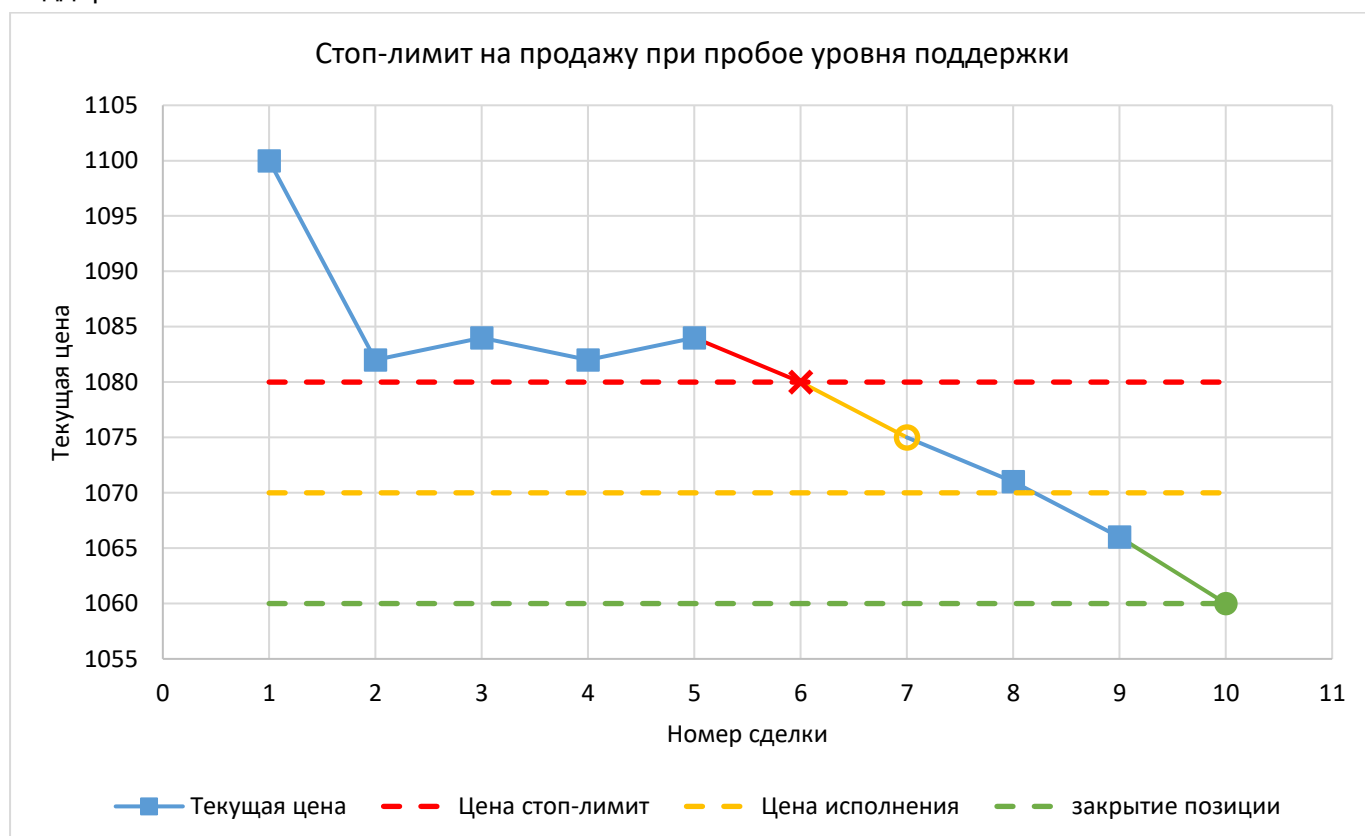
Планируется открыть короткую позицию (продать) в случае, если цена преодолеет уровень поддержки и опустится ниже него. Предполагается, что в этом случае цена продолжит падать, и если открыть позицию при пробое уровня поддержки, то, когда цена упадёт ещё ниже, можно закрыть позицию, откупив бумаги по более низкой цене, и получить прибыль из разницы. В данном примере для закрытия короткой позиции будет использоваться лимитированная заявка, но допускается также использование рыночной заявки или стоп-заявки с другим условием.

Выставляется условная заявка «Стоп-лимит» на продажу со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит \leq 1080; цена исполнения = 1070.

Цена стоп-лимит выбрана исходя из предположения, что именно таким будет уровень поддержки.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Стоп-лимит» на продажу при пробое уровня поддержки:



- В момент 1 – выставлена условная заявка «Стоп-лимит» на продажу для открытия короткой позиции в случае пробоя уровня поддержки 1080;
- В моменты 2-5 – цена приближается к области уровня поддержки, но не преодолевает его;



- В момент 6 – цена достигла или преодолела уровень **цены стоп-лимит** (1080), произошёл пробой уровня поддержки, условная заявка «Стоп-лимит» исполнена и биржевая лимитированная заявка по **цене исполнения** (1070) выставлена в систему;
- В момент 7 – удалось заключить сделку по цене не ниже **цены исполнения** (1070), открыв короткую позицию на пробое, за счёт того, что цена заявки опережала рынок (была ниже рыночной), и в системе были встречные котировки по лучшей цене;

В этот же момент можно выставить, лимитированную заявку на покупку по более низкой цене, например – по цене 1060.

- В моменты 8-9 – цена продолжает падать;
- В момент 10 – цена падает до уровня 1060, в торговой системе появляется предложение по цене не хуже (не выше 1060), поэтому удаётся заключить сделку на покупку по цене 1060 и закрыть короткую позицию.

Таким образом, сначала была выполнена продажа и открытие короткой позиции на пробое уровня поддержки, а затем, за счёт дальнейшего падения рынка, была выполнена покупка по более низкой цене, которая закрыла короткую позицию и принесла прибыль в виде разницы между ценой продажи и ценой покупки.

Пример 4: «Стоп-лимит» на покупку для открытия позиции при преодолении уровня сопротивления

Планируется открыть длинную позицию (купить) в случае, если цена преодолеет уровень сопротивления и поднимется выше него. Предполагается, что в этом случае цена продолжит расти, и если открыть позицию при пробое уровня сопротивления, то, когда цена поднимется ещё выше, можно закрыть позицию, продав бумаги по более высокой цене, и получить прибыль из разницы. В данном примере для закрытия длинной позиции будет использоваться лимитированная заявка, но допускается также использование рыночной заявки или стоп-заявки с другим условием.

Выставляется условная заявка «Стоп-лимит» на покупку со следующими параметрами:

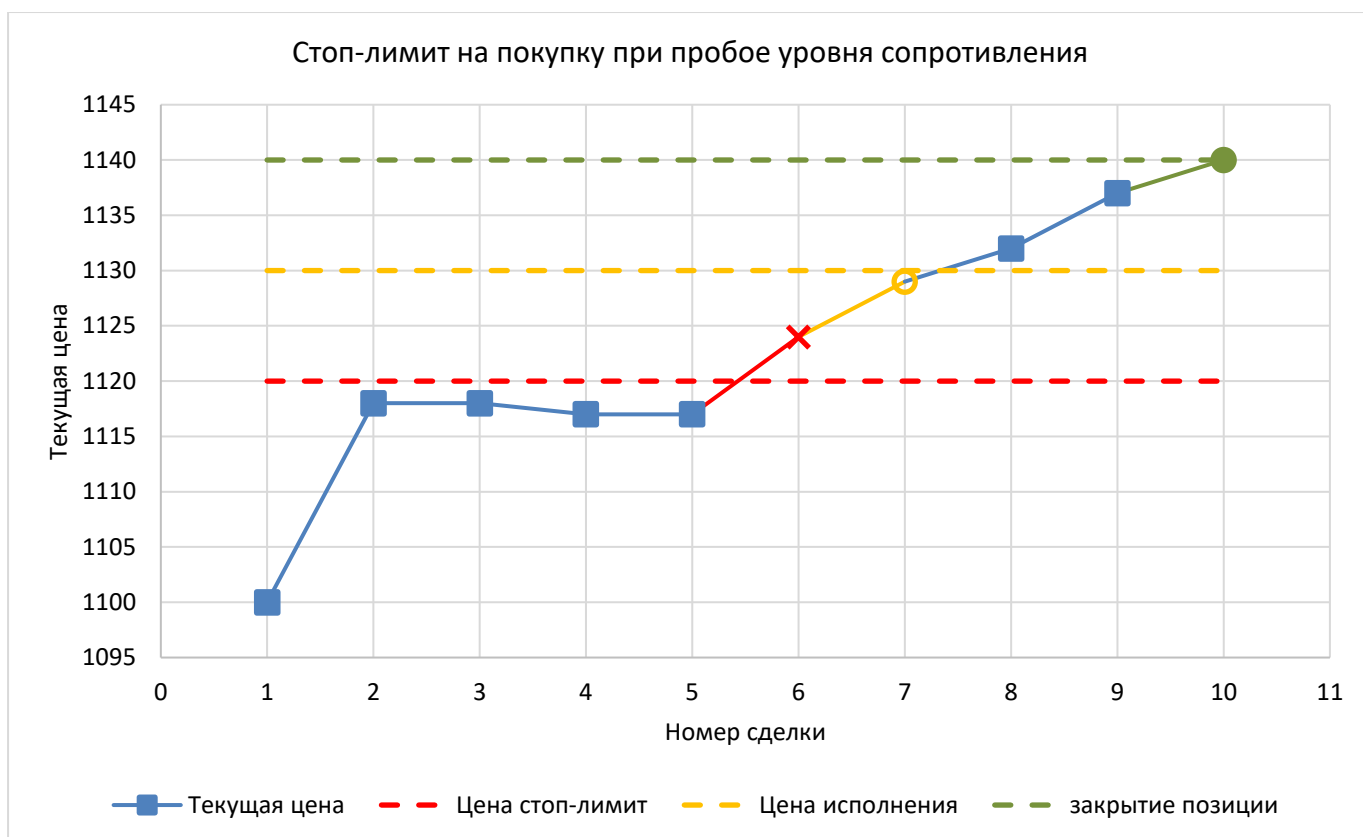
Цена стоп-лимит \geq 1120; цена исполнения = 1130.

Цена стоп-лимит выбрана исходя из предположения, что именно таким будет уровень сопротивления.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Стоп-лимит» на покупку при пробое уровня сопротивления:



Стоп-лимит на покупку при пробое уровня сопротивления



- В момент 1 – выставлена условная заявка «Стоп-лимит» на покупку для открытия короткой позиции в случае пробоя уровня сопротивления 1120;
- В моменты 2-5 – цена приближается к области уровня сопротивления, но не преодолевает его;
- В момент 6 – цена достигла или преодолела уровень **цены стоп-лимит** (1120), произошёл пробой уровня сопротивления, условная заявка «Стоп-лимит» исполнена и биржевая лимитированная заявка по **цене исполнения** (1130) выставлена в систему;
- В момент 7 – удалось заключить сделку по цене не выше **цены исполнения** (1130), открыв длинную позицию на пробое, за счёт того, что цена заявки опережала рынок (была ниже рыночной), и в системе были встречные котировки по лучшей цене.

В этот же момент можно выставить, лимитированную заявку на продажу по более высокой цене, например – по цене 1140.

- В моменты 8-9 – цена продолжает расти;
- В момент 10 – цена повышается до уровня 1140, в торговой системе появляется спрос по цене не хуже (не ниже 1140), поэтому удаётся заключить сделку на продажу по цене 1140 и закрыть длинную позицию.

Таким образом, сначала была выполнена покупка и открытие длинной позиции на пробое уровня сопротивления, а затем, за счёт дальнейшего роста рынка была выполнена продажа по более высокой цене, которая закрыла длинную позицию и принесла прибыль в виде разницы между ценой продажи и ценой покупки.



Примеры заполнения формы ввода условной заявки «Стоп-лимит» в Рабочем месте QUIK

Условная заявка «Стоп-лимит» на продажу акций Сбербанк со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит \leq 281,00;

Цена исполнения = 280,95.

Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка

Тип стоп-заявки
Стоп-лимит

Срок действия
 сегодня по 10.03.2021 до отмены

Время действия
с 0:00:00 до 23:59:59

Инструмент
Сбербанк

Торговый Счет
NL0011100043

Условие активации заявки
Покупка Продажа

тейк-профит, если цена \geq

стоп-лимит, если цена \leq 281,00

Цена
280,95

Кол-во (лот 10)
1

По рыночной цене

max: 513

Код Клиента
1868

Поручение

Ввод Отмена Больше >>

Условная заявка «Стоп-лимит» на покупку акций Сбербанк со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит \geq 282,00;

цена исполнения = 282,05.

Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка

Тип стоп-заявки
Стоп-лимит

Срок действия
 сегодня по 10.03.2021 до отмены

Время действия
с 0:00:00 до 23:59:59

Инструмент
Сбербанк

Торговый Счет
NL0011100043

Условие активации заявки
Покупка Продажа

тейк-профит, если цена \leq

стоп-лимит, если цена \geq 282,00

Цена
282,05

Кол-во (лот 10)
1

По рыночной цене

max: 499

Код Клиента
1868

Поручение

Ввод Отмена Больше >>

6. Условная заявка «Тейк-профит»

Основным назначением условной заявки «Тейк-профит» является накопление прибыли в случае улучшения цены до определённого уровня, отслеживание дальнейшего улучшения цены и фиксации накопленной прибыли в случае ухудшения цены.

Ключевые параметры условной заявки «Тейк-профит»:

- **Цена тейк-профит** – уровень, которого должна достигнуть текущая цена, чтобы условная заявка «Тейк-профит» начала отслеживание изменения текущей цены для формирования накопленной прибыли и её дальнейшей фиксации.
 - Для заявок на продажу улучшением цены считается её повышение, в этом случае проверяется, не стала ли текущая цена больше или равна ($> =$) **цене тейк-профит**.
 - Для заявок на покупку улучшением цены считается её падение, в этом случае проверяется, не стала ли текущая цена меньше или равна ($< =$) **цене тейк-профит**.



В процессе отслеживания изменения цены условная заявка «Тейк-профит» запоминает лучшую цену за время отслеживания, это называется – «фиксация локального экстремума цены». Для заявок на покупку фиксируется наименьшая цена, а для заявок на продажу – наибольшая. Дальнейшие расчёты выполняются относительно последнего зафиксированного локального экстремума, а именно последней зафиксированной наилучшей цены.

В качестве первой лучшей цены используется цена, которая равна или лучше **цены тейк-профит**, такая цена обеспечивает дальнейшее отслеживание изменений.

- **Отступ** – величина, на которую текущая цена должна ухудшиться относительно самой лучшей цены, чтобы условная заявка «Тейк-профит» исполнилась и выставила биржевую заявку.

В случае, если в торговой системе заключается сделка по цене хуже последней наилучшей цены на величину большую, либо равную **отступу**, значит «произошёл пробой отступа».

Цена такой заявки называется – «цена пробоя».

- условие продолжения расчёта цены:
 - для заявок на продажу: **Текущая_цена \geq лучшая_цена – отступ;**
 - для заявок на покупку: **Текущая_цена \leq лучшая_цена + отступ;**
- условие пробоя **отступа** и исполнения условной заявки:
 - для заявок на продажу: **Текущая_цена $<$ лучшая_цена – отступ;**
 - для заявок на покупку: **Текущая_цена $>$ лучшая_цена + отступ;**

Величина отступа может быть указана в виде абсолютного отклонения в цене или в виде процента от наилучшей цены. Допускается указание нулевого отступа, в таком случае любое ухудшение цены приведёт к исполнению условной заявки «Тейк-профит» и выставлению биржевой лимитированной заявки.

- **Защитный спред** – величина, на которую цена лимитированной биржевой заявки должна отличаться от «цены пробоя». **Защитный спред** используется для того, чтобы обеспечить оперативное исполнение биржевой лимитированной заявки при ухудшении цены и зафиксировать накопленную прибыль. **Защитный спред** участвует в формировании цены лимитированной заявки, которая будет выставлена в случае, если текущая цена окажется хуже последней лучшей цены на величину большую либо равную **отступу**.

- Для заявок на продажу:
 - **Цена исполнения = цена_пробоя – защитный_спред;**
- Для заявок на покупку в качестве **цены исполнения** берётся наименьшая из двух цен:
 - **Цена 1 = цена_пробоя + защитный_спред;**
 - **Цена 2 = цена_тейк-профит + отступ + защитный_спред.**

Величина защитного спреда может быть указана в виде абсолютного отклонения в цене или в виде процента от «цены пробоя». Допускается использование нулевого и отрицательного спреда.

Логику работы условной заявки «Тейк-профит» демонстрирует следующая последовательность:

1. Проверяется, достигла ли цена уровня цены тейк-профит.



2. Если цена достигла уровня **цены тейк-профит**, то начинается отслеживание изменения цены.
3. Если цена стала лучше, то она запоминается и дальнейший расчет происходит от этой наилучшей цены, фиксируется локальный экстремум.
4. Если цена стала хуже лучшей цены, то проверяется, не стала ли цена хуже на величину отступа.
5. Если цена ухудшилась на величину отступа или больше, выставляется лимитированная заявка по цене с учётом **защитного спреда**.
6. Если цена не стала хуже отступа, продолжается отслеживание цены.

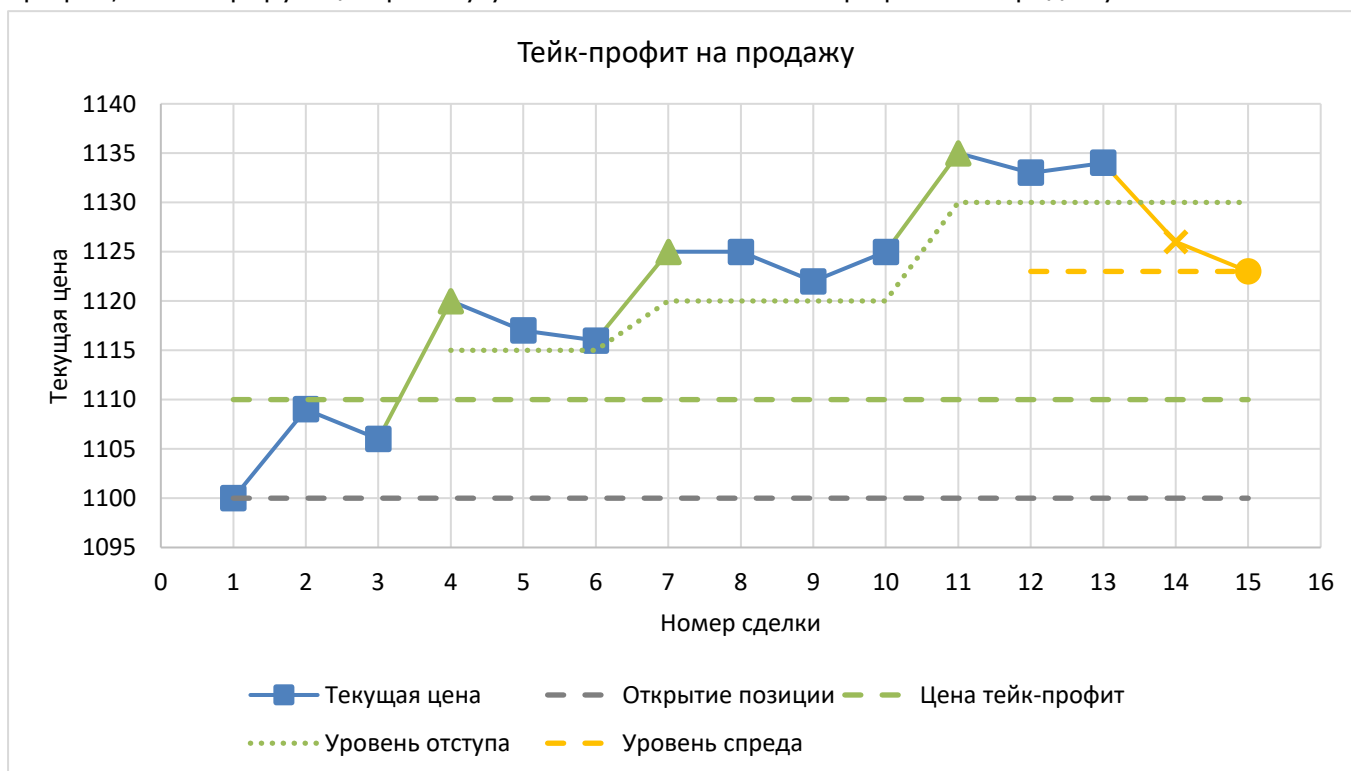
Отслеживание изменения цены (шаги 3-6) выполняется до тех пор, пока текущая цена не окажется хуже последней зафиксированной наилучшей цены на величину большую, либо равную отступу (шаг 5).

Пример 1: «Тейк-профит» на продажу

Открыта длинная позиция по цене 1100. Предположим, что если цена улучшится (поднимется) до 1110, то позиция принесёт прибыль, достаточную для закрытия позиции. При этом цена может продолжить улучшаться (расти), и позицию можно закрыть по более выгодной цене. Чтобы зафиксировать возможную прибыль, выставляется условная заявка «Тейк-профит» на продажу со следующими параметрами:

Цена тейк-профит ≥ 1110 ; отступ = 5, спред = 2.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Тейк-профит» на продажу:



- В момент 1 – открыта позиция по 1100 и выставлена условная заявка «Тейк-профит» на продажу;
- В моменты 2-3 – цена не достигала уровня **цены тейк-профит** (1110);
- В момент 4 – цена достигает уровня **цены тейк-профит** (1110) или преодолевает его, условная заявка «Тейк-профит» начинает отслеживание изменения цены:
 - фиксируется лучшая цена (локальный максимум) – 1120;
 - рассчитывается уровень отступа:
Лучшая_цена - отступ = 1120 - 5 = 1115.
- В моменты 5-6 – цена не становится лучше (выше) чем **лучшая цена** (1120), и не достигает **уровня отступа** (1115);
- В момент 7 – цена равна 1125, это значение выше, чем последняя **лучшая цена** (1120), оно фиксируется и **уровень отступа** пересчитывается от него:
 - **Лучшая_цена - отступ = 1125 - 5 = 1120;**
- В моменты 8-9 – цена не становится лучше (выше), чем **лучшая цена** (1125), и не достигает **уровня отступа** (1120);
- В момент 11 – цена становится 1135, это значение выше, чем последняя **лучшая цена** (1125), оно фиксируется и **уровень отступа** пересчитывается от него:
 - **Лучшая_цена - отступ = 1135 - 5 = 1130;**
- В момент 14 – цена ухудшается и достигает **уровня отступа** («пробивает отступ»). Выставляется лимитированная заявка на продажу, где:
 - **Цена исполнения = цена_пробоя – защитный_спред.**

Цена исполнения – соответствует уровню спреда на графике.

Условная заявка «Тейк-профит» считается исполненной и более не отслеживает изменение цены. Объем зафиксированной прибыли можно оценить как разницу между уровнем **цены тейк-профит** и ценой открытия позиции. Накопленную прибыль, полученную в результате работы условной заявки **тейк-профит**, можно оценить по разности **уровня спреда**, по цене которого выставляется лимитированная заявка, и по **цене тейк-профит**.

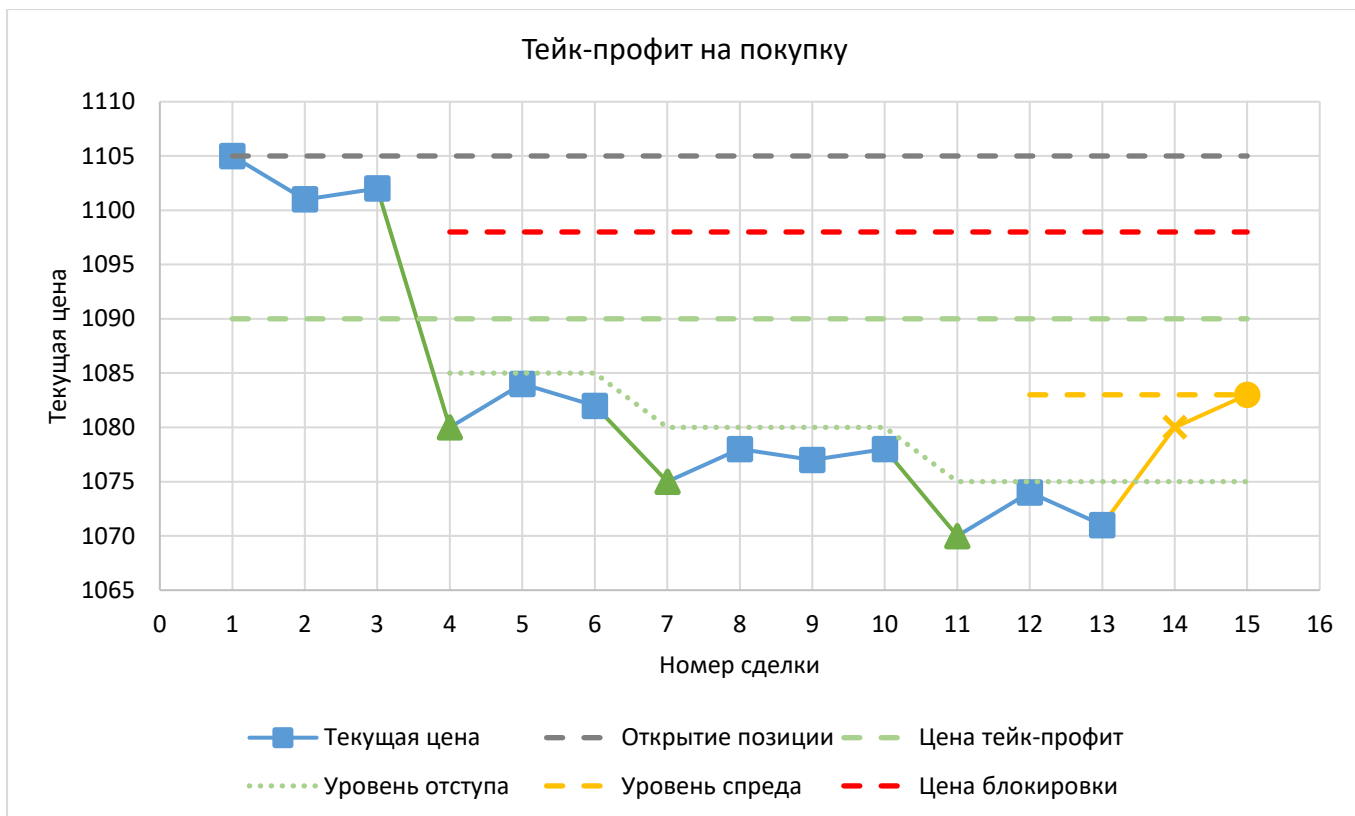
Пример 2: «Тейк-профит» на покупку

Открыта короткая позиция по цене 1105. Предположим, что если цена улучшится (упадёт) до 1090, то позиция принесёт прибыль, достаточную для закрытия позиции. При этом цена может продолжить улучшаться (падать), и позицию можно закрыть по более выгодной цене. Чтобы зафиксировать возможную прибыль, выставляется условная заявка «Тейк-профит» со следующими параметрами:

Цена тейк-профит \geq 1090; отступ = 5, спред = 3.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Тейк-профит» на покупку:





- В момент 1 – открыта позиция по 1105 и выставлена условная заявка «Тейк-профит» на покупку;
- В моменты 2-3 – цена не достигала уровня **цены тейк-профит** (1090);
- В момент 4 – цена достигает уровня **цены тейк-профит** (1090) или преодолевает его, условная заявка «Тейк-профит» начинает отслеживание изменения цены:
 - фиксируется лучшая цена (локальный минимум) – 1080;
 - рассчитывается уровень отступа:

$$\text{Лучшая_цена} + \text{отступ} = 1080 + 5 = 1085.$$
- В моменты 5-6 – цена не становится лучше (ниже) чем лучшая цена (1080), и не достигает **уровня отступа** (1085);
- В момент 7 – цена становится 1075, это значение ниже, чем последняя **лучшая цена** (1080), оно фиксируется и **уровень отступа** пересчитывается от него:
 - $$\text{Лучшая_цена} + \text{отступ} = 1075 + 5 = 1080;$$
- В моменты 8-9 цена не становится лучше (ниже), чем **лучшая цена** (1075), и не достигает **уровня отступа** (1080);
- В момент 11 – цена становится 1070, это значение ниже, чем последняя **лучшая цена** (1075), оно фиксируется и **уровень отступа** пересчитывается от него:
 - $$\text{Лучшая_цена} + \text{отступ} = 1070 + 5 = 1075.$$
- В момент 14 – цена ухудшается и достигает **уровня отступа** («пробивает отступ»). Выставляется лимитированная заявка на продажу, **цена исполнения** считается как наименьшая из двух цен:
 - $$\text{Цена 1} = \text{цена_пробоя} + \text{защитный_спред};$$
 - $$\text{Цена 2} = \text{цена_тейк-профит} + \text{отступ} + \text{защитный_спред}.$$



Цена 1 соответствует уровню спреда на графике.

Цена 2 соответствует «уровню блокировки» на графике.

Условная заявка «Тейк-профит» считается исполненной и более не отслеживает изменение цены. Объем фиксированной прибыли можно оценить как разницу между уровнем **цены тейк-профит** и ценой открытия позиции. Накопленную прибыль, полученную в результате работы условной заявки **тейк-профит**, можно оценить по разности **уровня спреда**, по цене которого выставляется лимитированная заявка и по **цене тейк-профит**.

Примеры заполнения формы ввода условной заявки «Тейк-профит» в Рабочем месте QUIK

Условная заявка «Тейк-профит» на покупку акций Сбербанк со следующими параметрами:
Цена тейк-профит $\leq 280,00$; отступ = 0,1; защитный спред = 0,05.

Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка

Тип стоп-заявки: Тейк-профит

Срок действия: сегодня по 10.03.2021 до отмены

Время действия: с 0:00:00 до 23:59:59

Инструмент: Сбербанк Торговый Счет: NL0011100043

Условие активации заявки: Покупка Продажа
тейк-профит, если цена \leq 280
стоп-лимит, если цена \geq

Цена: По рыночной цене Кол-во (лот 10): 1 max: 511

Код Клиента: 1868 Поручение:

Брать стоп-цену для инструмента: Акции 1-го уровня (э) Сбербанк

Выставить связанную заявку: на покупку по цене

При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку

Выставить "тейк-профит": Отступ от min: 0,1 в валюте цены Защитный спред: 0,05 в валюте цены По рыночной цене

Объем и комиссия: 0,00 0,00

Задать количество

Ввод Отмена Меньше <<

Условная заявка «Тейк-профит» на продажу акций Сбербанк со следующими параметрами:
Цена тейк-профит $\geq 282,00$; отступ = 0,1; защитный спред = 0,05.



Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка

Тип стоп-заявки
Тейк-профит

Срок действия
 сегодня по 10.03.2021 до отмены

Время действия
с 0:00:00 до 23:59:59

Инструмент: Сбербанк Торговый Счет: NL0011100043

Условие активации заявки

 тейк-профит, если цена >= 282
 стоп-лимит, если цена <=

Цена: По рыночной цене Кол-во (лот 10): 1 max: 515

Код Клиента: 1868 Поручение:

Брать стоп-цену для инструмента
Акции 1-го уровня (э) Сбербанк

Выставить связанную заявку
 на продажу по цене
 При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку

Выставить "тейк-профит"
 Отступ от max: 0,1 в валюте цены
 Защитный спред: 0,05 в валюте цены
 По рыночной цене

Объем и комиссия: 0,00 0,00

7. Условная заявка «Стоп-цена по другому инструменту»

Основным назначением условной заявки «Стоп-цена по другому инструменту» является выставление лимитированной заявки по **целевому инструменту** в том случае, если цена **инструмента условия** достигнет уровня **стоп-цены**.

Ключевые параметры условной заявки «Стоп-цена по другому инструменту»:

- **Инструмент условия** – инструмент, цена которого проверяется на предмет достижения уровня стоп-цены.
- **Стоп-цена** – уровень цены, которого должна достигнуть цена **инструмента условия** для выставления лимитированной заявки по **целевому инструменту** по **цене исполнения**.
- **Цена исполнения** – цена лимитированной заявки по **целевому инструменту**. **Цена исполнения** может быть указана равной, больше или меньше **цены стоп-лимит** независимо от направления стоп-заявки.
- **Целевой инструмент** – инструмент, по которому выставляется лимитированная заявка по **цене исполнения**.

Проверка выполнения условия, а именно достижение ценой инструмента условия уровня стоп-цены, выполняется аналогично условной заявке «Стоп-лимит».

Особенности параметров условной заявки «Стоп-цена по другому инструменту»:



1. При указании **стоп-цены** независимо от направления заявки (на покупку или на продажу) можно выбрать то, каким образом цена **инструмента условия** должна измениться относительно этой **стоп-цены** для выполнения условия: цена должна подняться и оказаться больше либо равна (\geq) **стоп-цене**, или цена должна упасть и оказаться меньше либо равна (\leq) **стоп-цене**.

Обратным примером, где такой возможности нет является условная заявка «Стоп-лимит», где изменение цены относительно стоп-цены для выполнения условия определяется исключительно направлением заявки.

2. В качестве **инструмента условия** может быть выбран тот же инструмент, что указан в качестве **целевого инструмента**. Таким образом можно отслеживать изменение цены и выполнять выставление лимитированной заявки по одному и тому же инструменту.

Применение условной заявки «Стоп-цена по другому инструменту» позволяет:

- Реализовать торговую стратегию по **целевому инструменту** в зависимости от того, как проходят торги по **инструменту условия** (при наличии зависимости между этими инструментами).
- Фиксировать прибыль в случае, если цена улучшается до указанного уровня. Для этого необходимо в качестве **целевого инструмента** и **инструмента условия** указать один и тот же инструмент:
 - для заявки на продажу указать **стоп-цену** с условием «больше или равно» (\geq);
 - для заявки на покупку указать **стоп-цену** с условием «меньше или равно» (\leq).
- Ограничить убыток в случае, если цена ухудшается до указанного уровня, для этого необходимо в качестве **целевого инструмента** и **инструмента условия** указать один и тот же инструмент:

- для заявки на продажу указать **стоп-цену** с условием «больше или равно» (\leq);
- для заявки на покупку указать **стоп-цену** с условием «меньше или равно» (\geq).

В таком случае стоп-заявка будет работать как условная заявка «Стоп-лимит».

- Открыть позицию, при достижении цены определенного уровня, для этого необходимо в качестве **целевого инструмента** и **инструмента условия** указать один и тот же инструмент и:
 - если ожидается рост рынка до определённого уровня, указать **стоп-цену** с условием «больше или равно» (\geq):
 - для заявки на покупку, если ожидается, что рынок после достижения указанного уровня продолжит расти;
 - для заявки на продажу, если ожидается, что рынок после достижения указанного уровня развернется и начнет падать.
 - если ожидается падение рынка до определённого уровня, указать **стоп-цену** с условием «больше или равно» (\leq):
 - для заявки на продажу, если ожидается, что рынок после достижения указанного уровня продолжит падать;
 - для заявки на покупку, если ожидается, что рынок после достижения указанного уровня развернется и начнет расти.



Примеры заполнения формы ввода условной заявки «Стоп-цена по другому инструменту» в Рабочем месте QUIK:

Условная заявка «Стоп-цена по другому инструменту» на покупку акций Сбербанк-п со следующими параметрами:

Инструмент условия – Сбербанк; целевой инструмент – Сбербанк-п; стоп-цена ≤ 282 ; цена исполнения = 281.

Если цена акций Сбербанка упадет до уровня стоп-цены (282) или ниже, будет выставлена лимитированная заявка на покупку акций Сбербанк-п по цене исполнения (281).

The screenshot shows a window titled "Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка". The form is divided into several sections:

- Тип стоп-заявки:** "Стоп-цена по другому инструменту".
- Срок действия:** "сегодня" selected, with a date field set to "10.03.2021".
- Время действия:** "с 0:00:00 до 23:59:59".
- Инструмент:** "Сбербанк-п".
- Торговый Счет:** "NL0011100043".
- Условие для Сбербанк [Акции 1-го уровня (эмулятор)]:** "Покупка" selected. "если цена \leq " is set to "282".
- Цена:** "281".
- Кол-во (лот 10):** "1".
- Объем и комиссия:** "2 810,00" and "2,09".
- Брать стоп-цену для инструмента:** "Акции 1-го уровня (э)" and "Сбербанк".
- Выставить связанную заявку:** "При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку" checked.
- Выставить "тейк-профит":** "Отступ от min" and "Защитный спред" fields.
- Buttons:** "Ввод", "Отмена", "Меньше <<".

Условная заявка «Стоп-цена по другому инструменту» на продажу акций Сбербанк со следующими параметрами:

Инструмент условия – Сбербанк; целевой инструмент – Сбербанк; стоп-цена $>= 284$; цена исполнения = 285.

Если цена акций Сбербанка поднимется до уровня стоп-цены (284) или выше, будет выставлена лимитированная заявка на продажу акций Сбербанк по цене исполнения (285).



8. Условная заявка «Тейк–профит и стоп–лимит»

Условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» предназначена для отслеживания улучшения и ухудшения цены, выставление биржевой заявки (в зависимости от улучшения/ухудшения) по одному из условий: «Тейк-профит», для фиксации прибыли в случае, если цена улучшается или по условию «Стоп-лимит» для минимизации убытков, если цена ухудшается.

Ключевые параметры условной заявки «Тейк–профит и стоп–лимит» совпадают с параметрами условных заявок «[Стоп–лимит](#)» и «[Тейк–профит](#)».

Параметры вводятся на одной форме ввода отдельно друг от друга. Есть возможность, указать параметры только для одного из условий. В таком случае условная заявка будет проверять только то условие, параметры которого указаны.

Если указаны параметры обоих условий, то условная заявка «Тейк–профит и стоп–лимит» работает следующим образом:

- При улучшении цены до уровня **цены тейк-профит**:
 - заявка начинает отслеживать дальнейшее изменение цены в соответствии с алгоритмом «Тейк-профит», проверка условия «Стоп-лимит» прекращается;
 - если во время расчёта цены по условию «Тейк-профит» цена ухудшится до уровня **цены стоп-лимит**, заявка не будет исполнена по условию «Стоп-лимит».
- При ухудшении цены до уровня **цены стоп-лимит**:



- условная заявка исполняется и выставляет биржевую заявку по условию «Стоп-лимит»;
- проверка условия «Тейк-профит» прекращается.

Для данного условных заявок «Тейк-профит и стоп-лимит» можно указать тип биржевой заявки (рыночная или лимитированная), которая будет выставлена в случае исполнения условной заявки по тому, или иному условию.

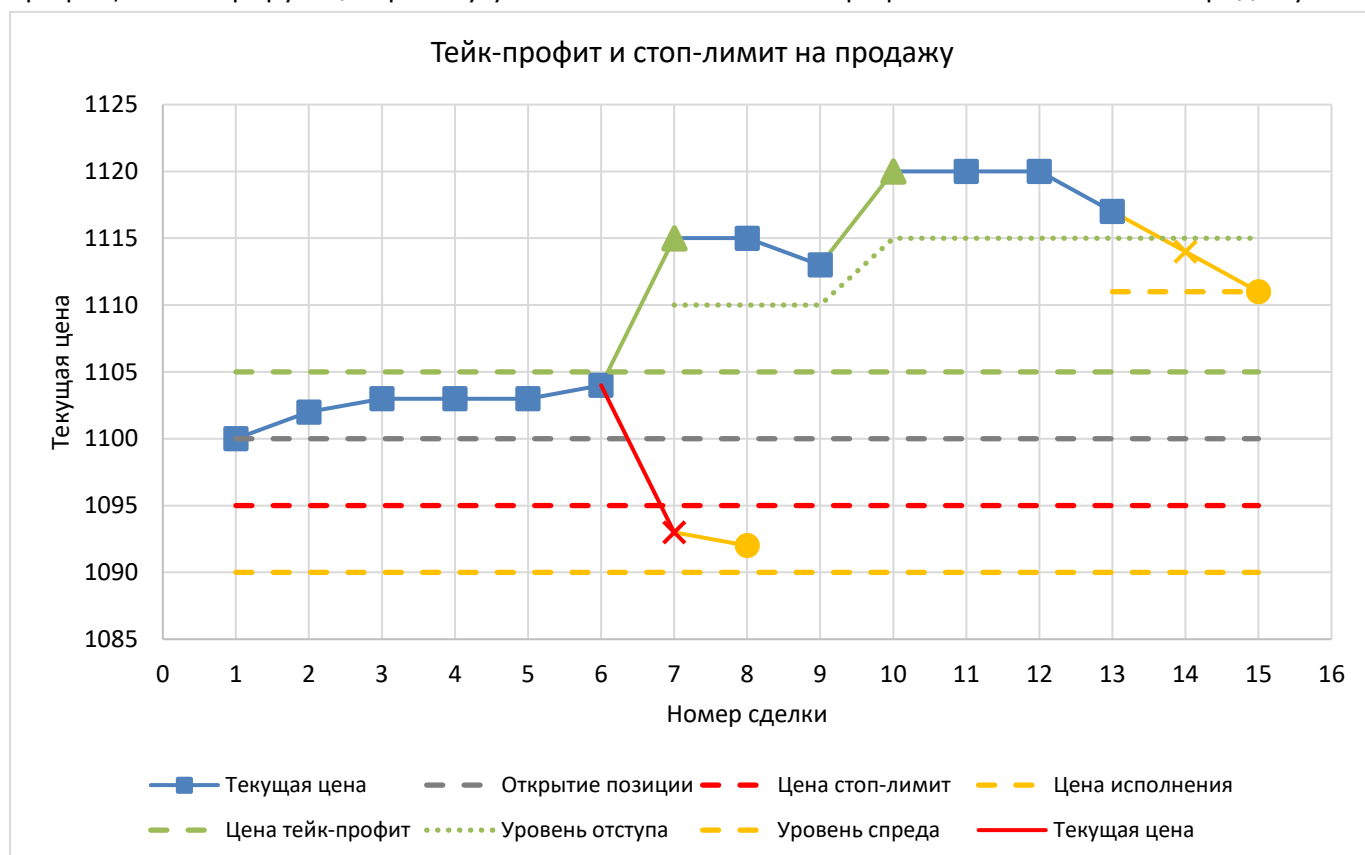
Пример 1: «Тейк-профит и стоп-лимит» на продажу

Открыта длинная позиция по цене 1100 для дальнейшего закрытия (продажи) по более выгодной цене. Существует вероятность, что цена будет улучшаться (расти) до неопределённого уровня, либо цена может начать ухудшаться (падать). В случае, если цена начнёт улучшаться, необходимо начать отслеживание изменение цены, чтобы увеличить и зафиксировать прибыль на развороте цены. В случае, если цена начнёт ухудшаться, необходимо закрыть позицию, минимизировав убытки.

Для решения этих задач выставляется условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит ≤ 1095 ; цена исполнения = 1090; цена тейк-профит ≥ 1105 ; отступ = 5; спред = 3.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Тейк-профит и стоп лимит» на продажу:



- В момент 1 – открыта позиция по 1100 и выставлена условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» на закрытие;



- В моменты 2-6 – цена не ухудшается до указанного уровня **цены стоп-лимит** (1095) и не улучшается до уровня **цены тейк-профит** (1105);
- В момент 6 – два возможных сценария:
 - сценарий «А» – цена ухудшается до уровня **цены стоп-лимит** (1095):
 - условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» исполняется по условию **стоп-лимит**;
 - выставляется биржевая лимитированная заявка по **цене исполнения** (1090);
 - проверка условия **Тейк-профит** прекращается.
 - сценарий «Б» – цена улучшается до уровня **цены тейк-профит** (1105):
 - условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» продолжает отслеживать изменение цены в соответствии с алгоритмом работы условия **Тейк-профит**;
 - проверка условия **Стоп-лимит** прекращается.

Пример 2: «Тейк-профит и стоп-лимит» на покупку

Открыта короткая позиция по цене 1100 для дальнейшего закрытия (покупки) по более выгодной цене. Существует вероятность, что цена будет улучшаться (падать) до неопределённого уровня, либо цена может начать ухудшаться (расти). В случае, если цена начнёт улучшаться, необходимо начать отслеживание изменение цены, чтобы увеличить и зафиксировать прибыль на развороте цены. В случае, если цена начнёт ухудшаться, необходимо закрыть позицию, минимизировав убытки.

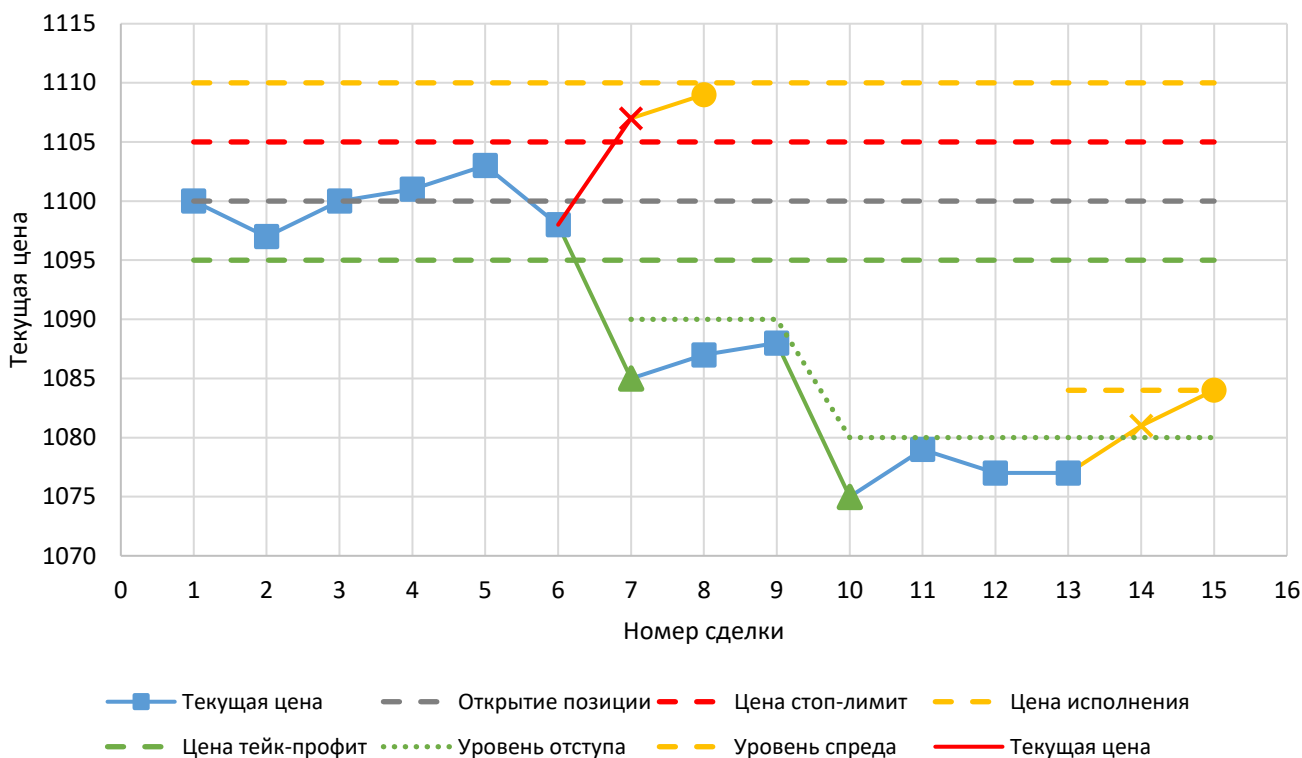
Для решения этих задач выставляется условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит ≥ 1105 ; цена исполнения = 1115; цена тейк-профит ≤ 1095 ; отступ = 5; спред = 3.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Тейк-профит и стоп лимит» на покупку:



Тейк-профит и стоп-лимит на покупку



- В момент 1 – открыта позиция по 1100 и выставлена условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» на закрытие;
- В моменты 2-6 – цена не ухудшается до указанного уровня **цены стоп-лимит** (1105) и не улучшается до уровня **цены тейк-профит** (1095);
- В момент 6 – два возможных сценария:
 - сценарий «А» – цена ухудшается до уровня **цены стоп-лимит** (1105):
 - условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» исполняется по условию **Стоп-лимит**;
 - выставляется биржевая лимитированная заявка по **цене исполнения** (1100);
 - проверка условия **Тейк-профит** прекращается.
 - сценарий «Б» – цена улучшается до уровня **цены тейк-профит** (1095):
 - условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» продолжает отслеживать изменение цены в соответствии с алгоритмом работы условия **Тейк-профит**;
 - проверка условия **Стоп-лимит** прекращается.

Примеры заполнения формы ввода условной заявки «Тейк-профит и стоп-лимит» в Рабочем месте QUIK:

Условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» на покупку акций Сбербанка проверяет оба условия: **Стоп-лимит** и **Тейк-профит** при следующих параметрах:

Цена стоп-лимит ≥ 282 и цена тейк-профит ≤ 280 .

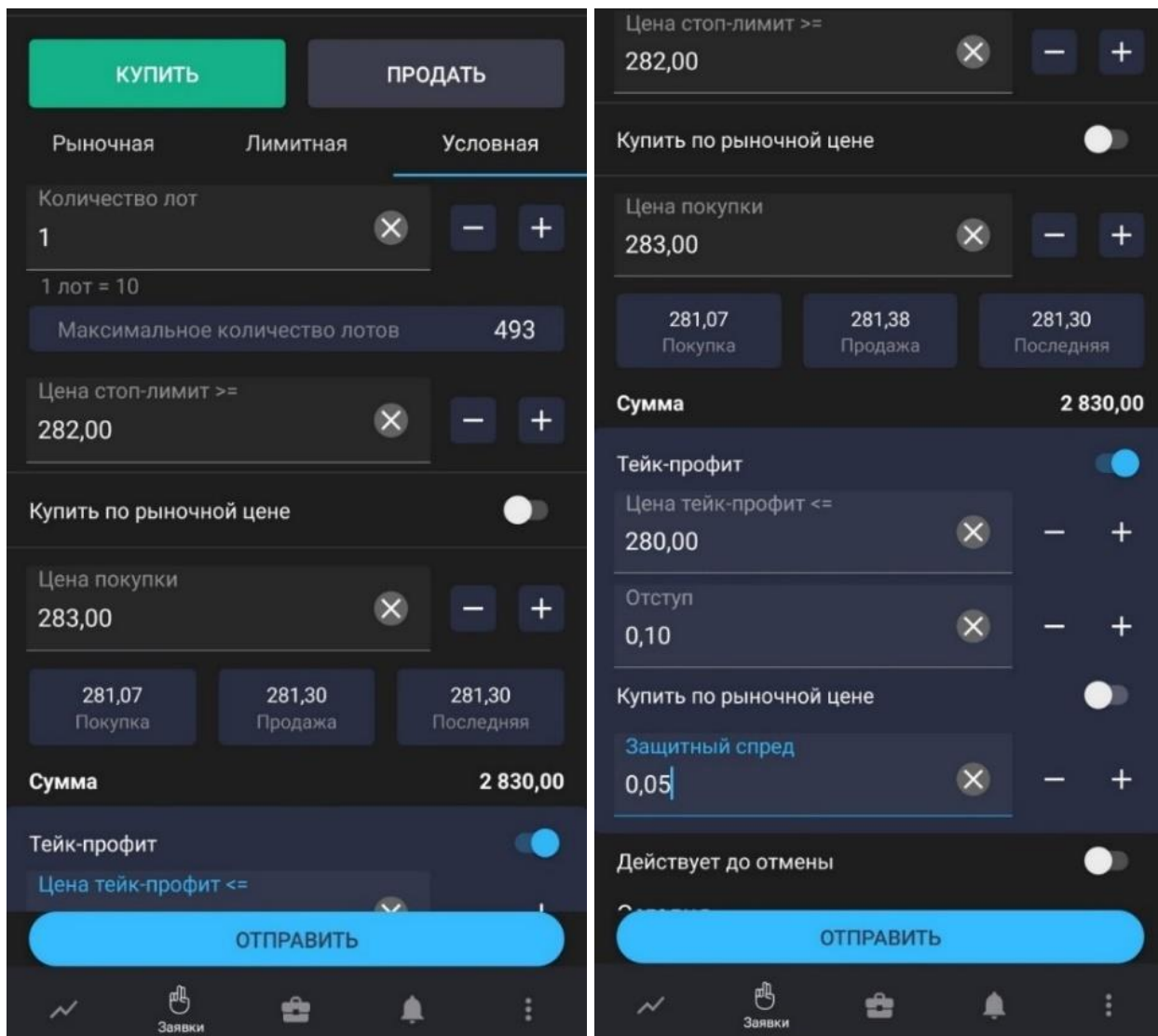
В случае исполнения по одному из них будет выставлена лимитированная заявка либо по **цене**



исполнения = 283, если цена достигнет уровня цены **стоп-лимит** раньше, чем уровня **цены тейк-профит**. Иначе начнётся расчёт цены по условию **Тейк-профит**, в случае исполнения будет выставлена лимитированная заявка с ценой, учитывающей величину **защитного спреда**.

Пример заполнения формы ввода аналогичной условной заявки «Тейк-профит и стоп-лимит» в мобильном приложении QUIK Android X (аналогичным образом заявка вводится в мобильном приложении iQUIK X и в webQUIK):





Условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» на продажу акций Сбербанка проверяет оба условия: **Стоп-лимит** и **Тейк-профит** при следующих параметрах:

Цена стоп-лимит ≤ 281 и цена тейк-профит ≥ 282 .

В случае достижения ценой уровня **цены стоп-лимит**, будет выставлена рыночная заявка на продажу. В случае достижения **цены тейк-профит**, начнётся расчёт цены в соответствии с алгоритмом работы условия **Тейк-профит**, и в случае «пробоя отступа» будет выставлена рыночная заявка на продажу без учёта **защитного спреда**.



Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка

Тип стоп-заявки
Тейк-профит и стоп-лимит

Срок действия
 Сегодня по 10.03.2021 до отмены

Время действия
с 0:00:00 до 23:59:59

Инструмент: Сбербанк Торговый Счет: NL0011100043

Условие активации заявки

 тейк-профит, если цена >= 282
 стоп-лимит, если цена <= 281

Цена: 0 Кол-во (лот 10): 1
 По рыночной цене max: 516

Код Клиента: 1868 Поручение:

Брать стоп-цену для инструмента: Акции 1-го уровня (э) Сбербанк

Выставить связанную заявку
 на продажу по цене
 При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку

Выставить "тейк-профит"
 Отступ от max: 0,1 в валюте цены
 Защитный спред в валюте цены
 По рыночной цене

Объем и комиссия: 0,00 2,09

Пример заполнения формы ввода аналогичной условной заявки «Тейк-профит и стоп-лимит» в мобильном приложении QUIK Android X (аналогичным образом заявка вводится в мобильном приложении iQUIK X и в webQUIK):

КУПИТЬ ПРОДАТЬ

Рыночная Лимитная Условная

Количество лот 1

1 лот = 10
Максимальное количество лотов 511

Цена стоп-лимит <= 281,00

Продать по рыночной цене

281,07 Покупка 281,40 Продажа 281,40 Последняя

Тейк-профит
 Цена тейк-профит >= 282,00
 Отступ 0,10

Продать по рыночной цене

Заявки

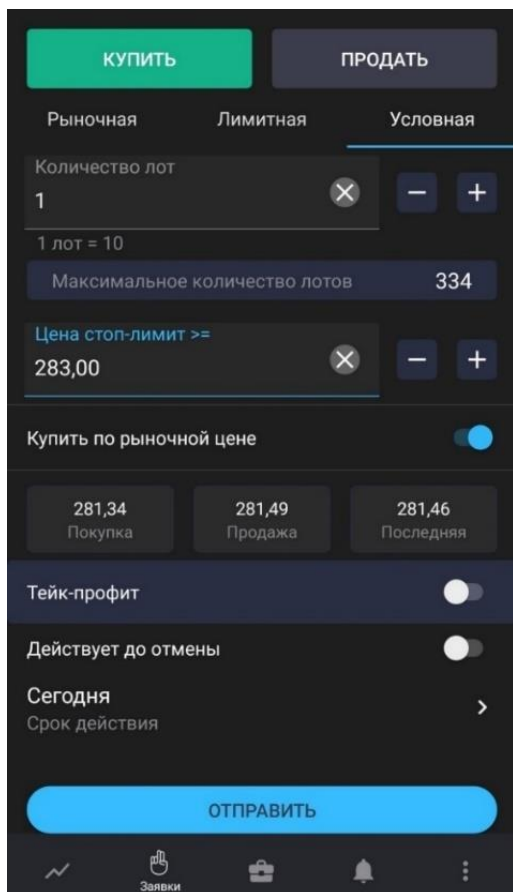


Условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» на покупку акций Сбербанка проверяет только условие **Стоп-лимит**, но в отличие от обычной условной заявки «Стоп-лимит» при достижении ценой уровня **цены стоп-лимит**, вместо лимитированной заявки по **цене исполнения** выставляется рыночная заявка.

Для обычной условной заявки «Стоп-лимит» такой возможности нет.

Пример заполнения формы ввода аналогичной условной заявки «Тейк-профит и стоп-лимит» в мобильном приложении QUIK Android X (аналогичным образом заявка вводится в мобильном приложении iQUIK X и в webQUIK):





Условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» на продажу акций Сбербанка проверяет только условие **Тейк-профит**, но в отличии от обычной условной заявки «Тейк-профит» в случае «пробоя отступа» вместо лимитированной заявки с ценой, учитывающей **защитный спред**, выставляется рыночная заявка.

Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка

Тип стоп-заявки: Тейк-профит и стоп-лимит

Срок действия: сегодня по 10.03.2021 до отмены

Время действия: с 0:00:00 до 23:59:59

Инструмент: Сбербанк Торговый Счет: NL0011100043

Условие активации заявки: Покупка Продажа

тейк-профит, если цена >= 283

стоп-лимит, если цена <=

Цена: По рыночной цене Кол-во (лот 10): 1 max: 515

Код Клиента: 1868 Поручение:

Брать стоп-цену для инструмента: Акции 1-го уровня (э) Сбербанк

Выставить связанную заявку: на продажу по цене

При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку

Выставить "тейк-профит": Отступ от max: 0,1 в валюте цены

Защитный спред: в валюте цены

По рыночной цене

Объем и комиссия: 0,00 0,00

Задать количество

Ввод Отмена Меньше <<



Пример заполнения формы ввода аналогичной условной заявки «Тейк-профит и стоп-лимит» в мобильном приложении QUIK Android X (аналогичным образом заявка вводится в мобильном приложении iQUIK X и в webQUIK):

Купить Продать

Рыночная Лимитная Условная

Количество лот 1

1 лот = 10

Максимальное количество лотов 514

Цена стоп-лимит <=

Продать по рыночной цене

281,31 Покупка 281,40 Продажа 281,40 Последняя

Тейк-профит

Цена тейк-профит >= 283,00

Отступ 0,10

Продать по рыночной цене

Действует до отмены

ОТПРАВИТЬ

9. Условная заявка «Связанная стоп-заявка»

Условная заявка «Связанная стоп-заявка» предназначена для планового заключения сделки по желаемой цене в случае, если в торговой системе появится соответствующее предложение или спрос. В случае ухудшения цены для минимизации убытков заключается сделка по условию **Стоп-лимит**.

Условная заявка «Связанная стоп-заявка» выставляет в систему одновременно две заявки: условную заявку «Стоп-лимит» и лимитированную **связанную заявку**, при этом средства под исполнение блокируются в единичном объёме, а не индивидуально для каждой заявки. В случае, если одна из двух заявок исполняется, вторая заявка снимается автоматически.

Возможны ситуации, когда встречное предложение обеспечивает не полное, а частичное исполнение **связанной заявки**. Для таких случаев в системе QUIK предусмотрена опция «При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку». Если опция включена, при частичном исполнении **связанной заявки** стоп-заявка снимается. Если опция отключена, при частичном исполнении **связанной заявки** количество стоп-заявки уменьшается



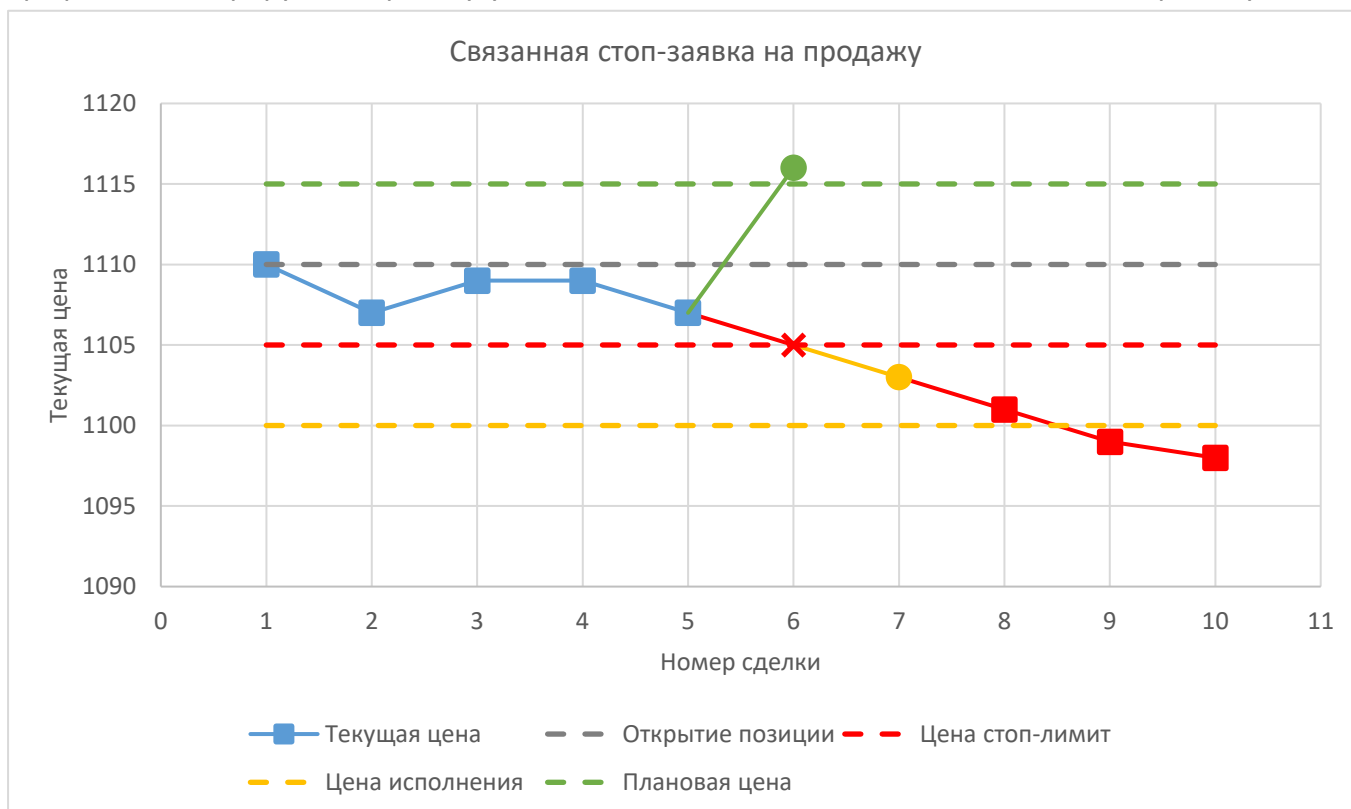
до величины неисполненного остатка **связанной заявки**.

Пример 1: «Связанная стоп-заявка» на продажу

Открыта длинная позиция по цене 1110, которую следует закрыть, но на данный момент неизвестно, будет ли цена ухудшаться (падать) или улучшаться (расти). Чтобы предусмотреть оба варианта и закрыть позицию по плановой цене, зафиксировав прибыль при улучшении цены, или напротив, чтобы минимизировать убытки при её ухудшении – выставляется «Связанная стоп-заявка» на продажу со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит ≤ 1105 ; цена исполнения = 1100; цена связанной заявки = 1115.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Связанная стоп-заявка» на продажу:



- В момент 1 – открыта позиция и выставлена условная заявка «Связанная стоп-заявка»;
- В моменты 2-5 – цена не ухудшается до уровня **цены стоп-лимит** (1105), встречное предложение по цене не хуже **цены связанной заявки** (1115) отсутствует;
- В момент 6 – два возможных сценария:
 - сценарий «А» – цена ухудшается и достигает уровня **цены стоп-лимит** (1105):
 - условная заявка «Стоп-лимит» исполняется;
 - выставляется лимитированная заявка по **цене исполнения** (1100);
 - **связанная заявка** по цене 1115 автоматически снимается.
 - сценарий «Б» – в системе появляется встречное предложение по цене не хуже цены **связанной заявки** (1115):
 - происходит заключение сделки (сделок) по **связанной заявке**;



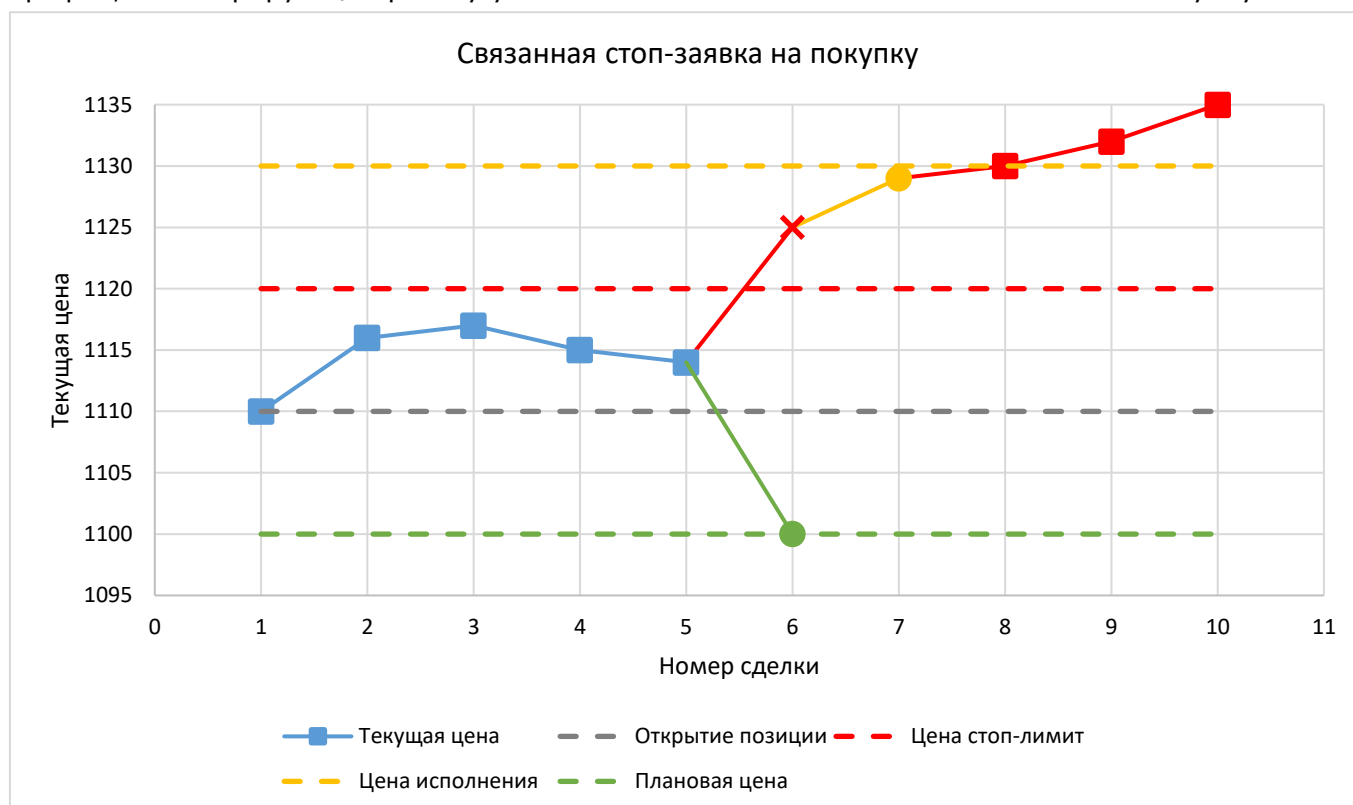
- если **связанная заявка** исполнена частично, и опция «При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку» отключена, то условная заявка «Стоп-лимит» и лимитированная **связанная заявка** остаются активными до полного исполнения **связанной заявки** или исполнения условной заявки «Стоп-лимит»;
- условная заявка «Стоп-лимит» снимается если:
 - **связанная заявка** полностью исполнена;
 - **связанная заявка** исполнена частично, но опция «При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку» была включена.

Пример 2: «Связанная стоп-заявка» на покупку

Открыта короткая позиция по цене 1110, которую следует закрыть, но на данный момент неизвестно, будет ли цена ухудшаться (расти) или улучшаться (падать). Чтобы предусмотреть оба варианта и закрыть позицию по плановой цене, зафиксировав прибыль при улучшении цены, или напротив, чтобы минимизировать убытки при её ухудшении – выставляется «Связанная стоп-заявка» на покупку со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит \geq 1120; цена исполнения = 1130; цена связанной заявки = 1100.

График, иллюстрирующий работу условной заявки «Связанная стоп-заявка» на покупку:



- В момент 1 – открыта позиция и выставлена условная заявка «Связанная стоп-заявка»;
- В моменты 2-5 – цена не ухудшается до уровня **цены стоп-лимит** (1120), встречное предложение по цене не хуже **цены связанной заявки** (1100) отсутствует;



- В момент 6 – два возможных сценария:
 - сценарий «А» – цена ухудшается и достигает уровня **цены стоп-лимит** (1120):
 - условная заявка «Стоп-лимит» исполняется;
 - выставляется лимитированная заявка по **цене исполнения** (1130);
 - **связанная заявка** по цене 1100 автоматически снимается.
 - сценарий «Б» – в системе появляется встречное предложение по цене не хуже цены **связанной заявки** (1100):
 - происходит заключение сделки (сделок) по **связанной заявке**;
 - если **связанная заявка** исполнена частично, и опция «При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку» отключена, то условная заявка «Стоп-лимит» и лимитированная **связанная заявка** остаются активными до полного исполнения **связанной заявки** или исполнения условной заявки «Стоп-лимит»;
 - условная заявка «Стоп-лимит» снимается если:
 - **связанная заявка** полностью исполнена;
 - **связанная заявка** исполнена частично, но опция «При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку» была включена.

Примеры заполнения формы ввода условной заявки «Связанная стоп-заявка» в Рабочем месте QUIK:

Условная заявка «Связанная стоп-заявка» на покупку акций Сбербанк со следующими параметрами:

Цена стоп-лимит \geq 282; цена исполнения = 283; цена связанной заявки = 281.



Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка

Тип стоп-заявки
Со связ. заявкой

Срок действия
 сегодня по 10.03.2021 до отмены

Время действия
с 0:00:00 до 23:59:59

Инструмент: Сбербанк Торговый Счет: NL0011100043

Условие активации заявки

 тейк-профит, если цена <=
 стоп-лимит, если цена >= 282

Цена: 283 Кол-во (лот 10): 1
 По рыночной цене max: 491

Код Клиента: 1868 Поручение:

Брать стоп-цену для инструмента: Акции 1-го уровня (э) Сбербанк

Выставить связанную заявку
 на покупку по цене 281
 При частичном исполнении связанной заявки снять стоп-заявку

Выставить "тейк-профит"
 Отступ от min: в валюте цены
 Защитный спред: в валюте цены
 По рыночной цене

Объем и комиссия: 2 830,00 2,10

Пример заполнения формы ввода аналогичной условной заявки «Связанная стоп-заявка» в мобильном приложении QUIK Android X (аналогичным образом заявка вводится в мобильном приложении iQUIK X и в webQUIK):

КУПИТЬ ПРОДАТЬ

Рыночная Лимитная Условная

Количество лот 1
 1 лот = 10
 Максимальное количество лотов 511

Цена покупки 281,00

281,28 Покупка 281,38 Продажа 281,38 Последняя

Сумма 2 810,00

Связанная стоп-заявка

Цена стоп-лимит >= 282,00
 Цена исполнения 283

Заявки



10. Условная заявка «Стоп-заявка по исполнению»

Условная заявка «Стоп-заявка по исполнению» отслеживает исполнение выбранной активной биржевой лимитированной заявки (**базовой заявки**). Когда **базовая заявка** исполняется, условная заявка начинает проверять выполнение указанного условия: **Стоп-лимит, Тейк-профит**, или **Тейк-профит и стоп-лимит**.

Срок действия данной ограничен сроком действия отслеживаемой лимитированной заявки в рамках текущей торговой сессии.

Направление условной заявки «Стоп-заявка по исполнению» всегда обратно направлению **базовой заявки**: если **базовая заявка** на покупку, то условная заявка будет на продажу; если **базовая заявка** на продажу, то условная заявка будет на покупку.

Условные заявки «Стоп-заявка по исполнению» можно использовать для закрытия позиции, когда **базовая заявка** открыла эту позицию, либо для открытия позиции, когда **базовая заявка** закрывает позицию.

По одной базовой заявке можно выставить несколько условных заявок «Стоп-заявок по исполнению».

Ключевые параметры условной заявки «Стоп-заявка по исполнению»: **условие заявки** и **номер базовой заявки**. Остальные параметры определяются выбранным **условием заявки**.

При вводе условной заявки «Стоп-заявка по исполнению» можно указать параметры активации, которые позволят учитывать полное и частичное исполнение **базовой заявки**:

1. «Частичное исполнение заявки учитывается» – признак того, что условная заявка «Стоп-заявка по исполнению» активируется при частичном исполнении **базовой заявки**. Если опция отключена, то условная заявка «Стоп-заявка по исполнению» активируется только при полном исполнении **базовой заявки**.
2. «Брать исполненный объем заявки в качестве количества выставляемой стоп-заявки» – признак того, что в качестве количества инструментов в условной заявке «Стоп-заявка по исполнению» принимается исполненный объем **базовой заявки**. Если опция отключена, то объем заявки указывается явно параметром **количество**.

Если обе опции включены, то при частичном исполнении **базовой заявки** происходит активация условной заявки «Стоп-заявка по исполнению» с указанием количества инструментов, равным объему исполненной части **базовой заявки**. При дальнейшем исполнении **базовой заявки** происходит увеличение объема условной заявки «Стоп-заявка по исполнению». При этом в зависимости от движения цен на рынке, возможно наступление условий исполнения условной заявки «Стоп-заявка по исполнению» для активированного объема, а затем снова может происходить увеличение активированного объема в результате следующего частичного исполнения **базовой заявки**.



Примеры заполнения формы ввода условной заявки «Стоп–заявка по исполнению» в Рабочем месте QUIK:

Активная лимитированная заявка на открытие длинной позиции по акциям Сбербанк по цене 280. Когда она исполнится, должна быть выставлена условная заявка «Тейк-профит и стоп-лимит» со следующими параметрами:

**Цена тейк-профит \geq 281; цена стоп-лимит \leq 279; цена исполнения = 278;
отступ = 0,1; защитный спред = 0,05.**

Акции 1-го уровня (эмулятор) Стоп-заявка

Тип стоп-заявки
Тейк-профит и стоп-лимит по заявке

Срок действия
 сегодня по 10.03.2021 до отмены

Параметры активации стоп-заявки
 Частичное исполнение заявки учитывается
 Брать исполненный объем в качестве количества выставляемой стоп-заявки

Условие активации заявки
ПРОДАВАТЬ
тейк-профит, если цена \geq 281
стоп-лимит, если цена \leq 279,00

Цена 278,00 Кол-во (лот 10)
 По рыночной цене max: 0

Параметры "тейк-профит"
Отступ 0,1 в валюте цены
Спред 0,05 в валюте цены
 По рыночной цене

Параметры базовой заявки:
Номер 5741026441
Класс Акции 1-го уровня (:
Инструмент Сбербанк
Торговый Счет NL0011100043
Операция Купля
Цена 280,00
Количество 1
Баланс 1
Код клиента
Поручение

Объем и комиссия
0,00
Задать количество

Ввод Отмена

11. Алгоритмическая стоп–заявка

Назначением алгоритмической стоп–заявки является автоматическое отслеживание наличия открытой позиции и изменений цены (при наличии открытой позиции) для выставления биржевой заявки на весь объем позиции, чтобы закрыть её с фиксацией прибыли, если цена улучшилась до заданного уровня, или с минимизацией убытков, если цена ухудшилась.

Особенностью алгоритмической стоп–заявки является то, что в отличие других условных заявок в системе QUIK, при выставлении алгоритмической стоп–заявки по позиции по какому-либо инструменту, после закрытия позиции и ее повторного открытия, нет необходимости снова выставлять алгоритмическую стоп-заявку, так как она автоматически активируется по открытию позиции и продолжит следить за изменением цены. Если позиция закроется, отслеживание изменения цены прекратится.



Алгоритмическая стоп-заявка – функционал Модуля Алгоритмической Торговли, который не является безусловным функционалом Рабочего места QUIK. Уточнять условия доступа к Модулю и его функционалу необходимо у действующего брокера. Документация с описанием возможностей Модуля доступна по ссылке: [Модуль алгоритмической торговли Light](#).

Ключевые параметры алгоритмической стоп-заявки:

- **Позиция** – позиция по данному инструменту:
 - положительное значение – **длинная позиция**;
 - отрицательное значение – **короткая позиция**;
 - ноль – позиция закрыта.
- **Цена позиции** – средневзвешенная цена позиции по инструменту.
- **Тейк–профит** – отклонение биржевой цены от **цены позиции** для закрытия позиции с фиксацией прибыли. Может быть задано как абсолютное значение цены или в процентах.
- **Стоп–лимит** – отклонение биржевой цены от **цены позиции** для закрытия позиции с минимизацией убытков. Может быть задано как абсолютное значение цены или в процентах.
- **Коридор** – коридор цен, формируемый ценами **тейк–профит** и **стоп–лимит** относительно **цены позиции**; отражает диапазон цен, в пределах которого не происходит закрытия позиции ни по одному из условий, имеет **верхнюю** и **нижнюю границы**. Допустимо использование как обоих условий, так и одного из них.
- **Спред** – величина, устанавливающая «опережающее» отклонение цены выставленной лимитированной заявки в случае пробоя какой-либо границы ценового коридора. Отклонение может быть задано как абсолютное значение цены или в процентах. Допустимо выставление рыночной заявки, в этом случае **спред** не указывается.

Порядок работы алгоритмической стоп–заявки:

1. Трейдер выставляет алгоритмическую стоп–заявку с условиями **Стоп–лимит** и/или **Тейк–профит**. Позиции у трейдера может ещё не быть и заявка, хоть и выставлена, не будет отслеживать цену, пока позиция не будет открыта.
2. Как только трейдер открывает позицию, выставленная алгоритмическая стоп–заявка рассчитывает цену открытия позиции клиента, и устанавливает границы **коридора цен**: одна граница отвечает за срабатывание условия **Тейк–профит**, другая отвечает за срабатывание условия **Стоп–лимит**, положение уровней определяется ценой открытия позиции и указанными отклонениями цен условий: **Стоп–лимит** и **Тейк–профит**. Пока цена находится в пределах коридора, алгоритмическая стоп–заявка не срабатывает и не выставляет биржевую заявку на закрытие позиции.
3. Как только цена выходит за пределы коридора, алгоритмическая стоп–заявка выставляет биржевую заявку, для закрытия позиции клиента. Цена такой заявки, если она не рыночная, определяется из цены границы коридора и указанного спреда.
4. После выставления такой биржевой заявки и закрытия позиции, алгоритмическая стоп–заявка продолжает отслеживание позиции, и если она снова откроется, алгоритмическая



стоп–заявка автоматически повторно начнёт расчет цены для дальнейшего закрытия позиции при выходе цены за пределы коридора.

5. В зависимости от позиции трейдера алгоритмическая стоп–заявка сама определяет направление, в котором необходимо подать биржевую заявку для закрытия позиции, и положение границ коридора для того или иного условия.

Таблица направления заявки:

Позиция	Направление заявки	Условие	
		Тейк-профит	Стоп-лимит
Длинная	Продажа	Верхняя граница	Нижняя граница
Короткая	Покупка	Нижняя граница	Верхняя граница

Расчёт границ коридора и цены лимитированной заявки для отклонений, заданных в абсолютных величинах или в процентах, происходит по следующим формулам:

В зависимости от вида позиции (длинная/короткая) уровень той или иной границы коридора использует отклонение для соответствующего условия, а цена выставленной лимитированной стоп–заявки определяется только положением границы коридора и указанным спредом.

- При наличии длинной позиции:

Верхняя граница = Цена позиции + Тейк-профит = Цена позиции * (1 + Тейк-профит%/100)

Нижняя граница = Цена позиции - Стоп-лимит = Цена позиции * (1 - Стоп-лимит%/100)

- При наличии короткой позиции:

Верхняя граница = Цена позиции + Стоп-лимит = Цена позиции * (1 + Стоп-лимит%/100)

Нижняя граница = Цена позиции - Тейк-профит = Цена позиции * (1 - Тейк-профит%/100)

- Расчёт цены лимитированной заявки на продажу:

Тейк-профит: Цена = Верхняя граница + Спред = Верхняя граница * (1 - Спред%/100)

Стоп-лимит: Цена = Нижняя граница - Спред = Нижняя граница * (1 - Спред%/100)

- Расчёт цены лимитированной заявки на покупку:

Тейк-профит: Цена = Нижняя граница - Спред = Нижняя граница * (1 + Спред%/100)

Стоп-лимит: Цена = Верхняя граница + Спред = Верхняя граница * (1 + Спред%/100)

Пример 1: Алгоритмическая стоп-заявка по длинной позиции

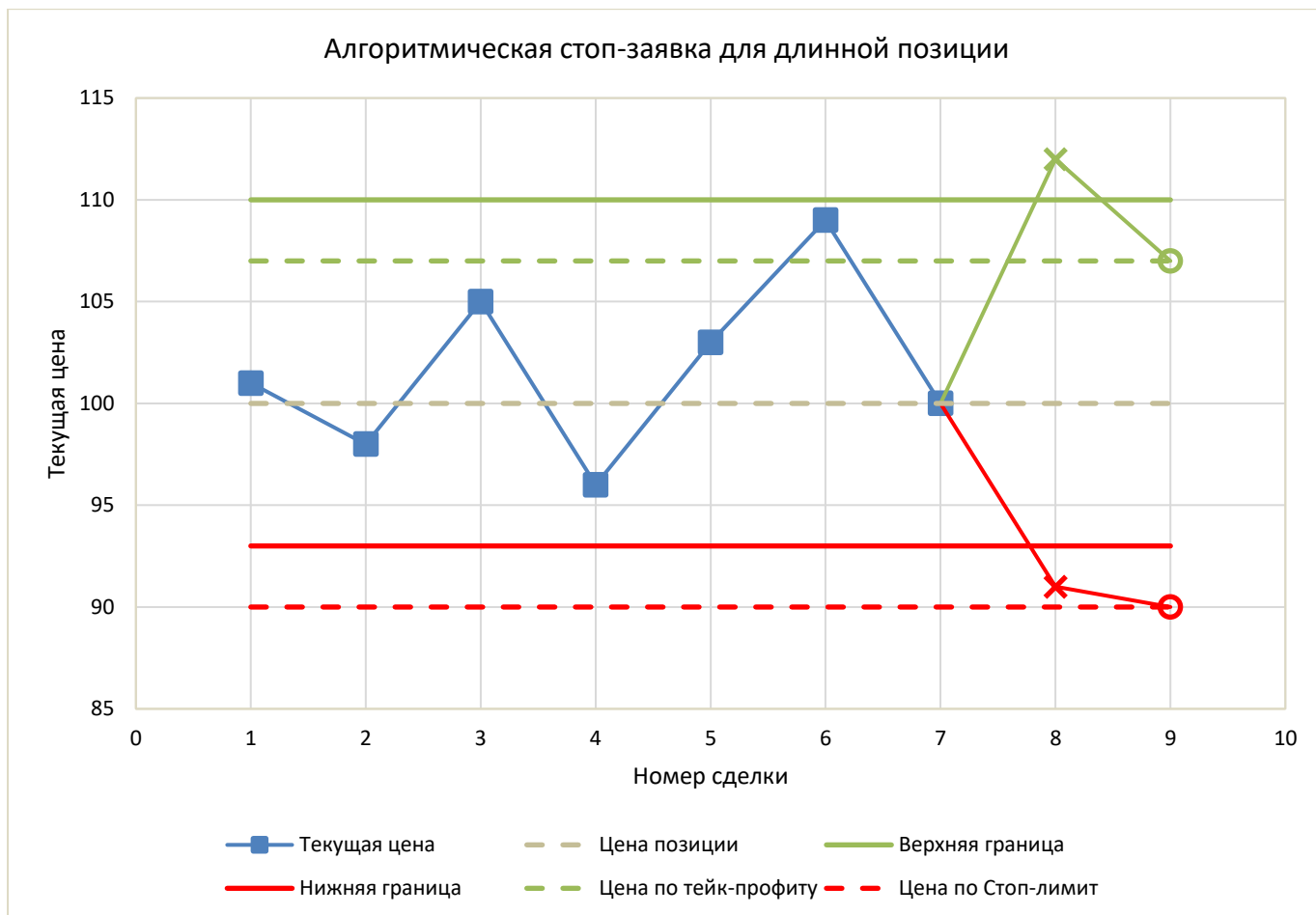
Открыта длинная позиция, для закрытия которой необходимо продать актив, алгоритмическая стоп–заявка работает на продажу. В этом случае, условие **Тейк–профит** указывает положение верхней границы коридора, а условие **Стоп-лимит** указывает положение нижней границы коридора. Позиция: длинная, цена позиции: 100 (цена открытия).

Выставляется алгоритмическая стоп–заявка со следующими параметрами:

Тейк-профит = 10; Стоп-лимит = 7; спред = 3.



График, иллюстрирующий работу алгоритмической стоп-заявки для длинной позиции:



Если цена достигнет одного из двух условий, будет выставлена лимитированная заявка на продажу, цена которой заведомо определена трейдером с точностью до цены открытия позиции, ведь именно от неё отсчитываются граница коридора, а от них – спред, который определяет цену заявки.

Пример 2: Алгоритмическая стоп-заявка по короткой позиции

Открыта короткая позиция, для закрытия которой необходимо купить актив, алгоритмическая стоп-заявка работает на покупку. В этом случае, условие **Тейк-профит** указывает положение нижней границы коридора, а условие **Стоп-лимит** указывает положение верхней границы. Позиция: короткая, цена позиции: 100 (цена открытия).

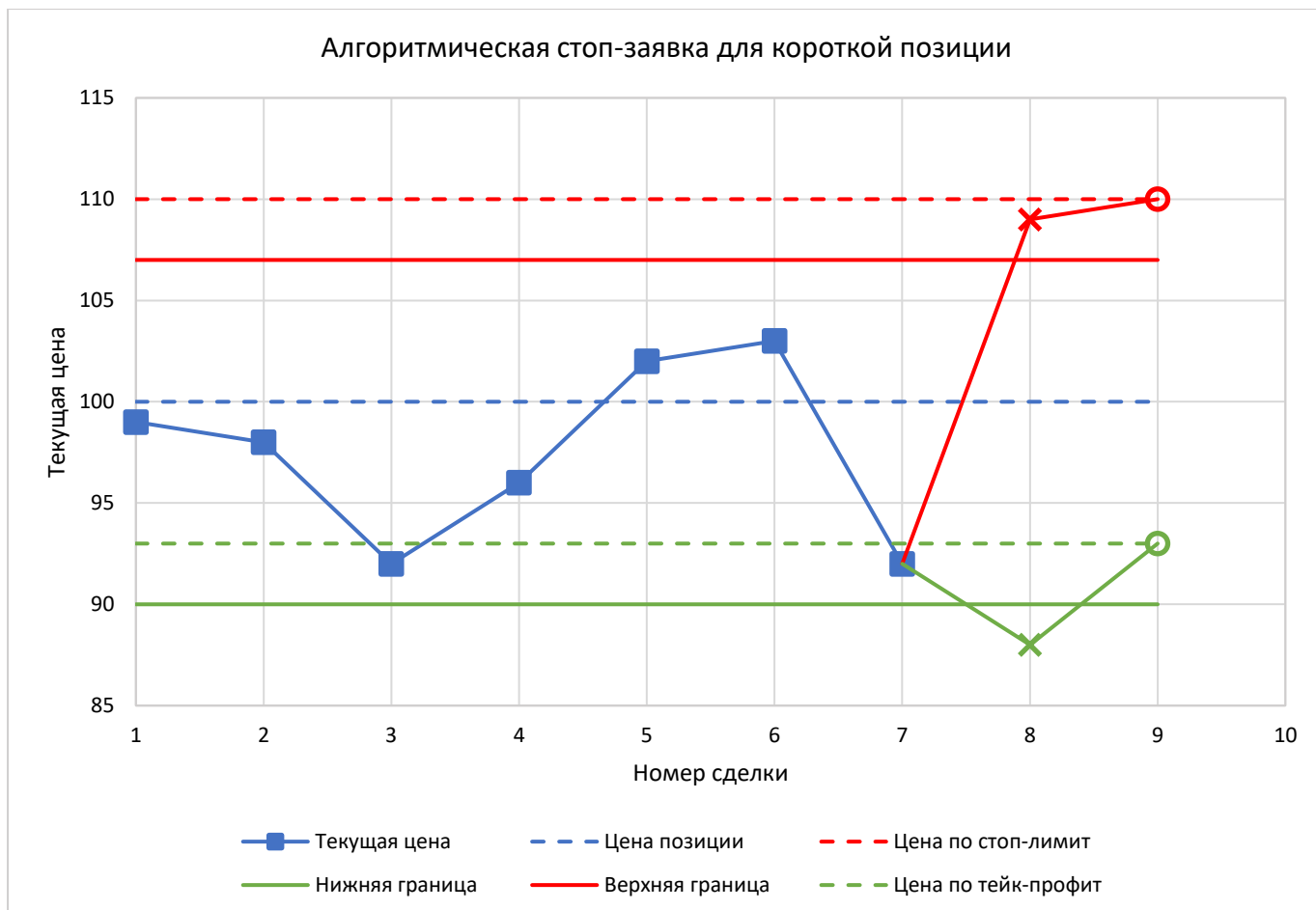
Выставляется алгоритмическая стоп-заявка со следующими параметрами:

Тейк-профит = 10; Стоп-лимит = 7; спред = 3.

График, иллюстрирующий работу алгоритмической стоп-заявки для короткой позиции.



Алгоритмическая стоп-заявка для короткой позиции



Если цена достигнет одного из двух условий, будет выставлена лимитированная заявка на продажу, цена которой заведомо определена трейдером с точностью до цены открытия позиции, ведь именно от неё отсчитываются граница коридора, а от них – спред, который определяет цену заявки.

Примеры заполнения формы ввода алгоритмической стоп-заявки в Рабочем месте QUIK:

Окно ввода алгоритмической заявки можно открыть пунктом контекстного меню из Таблицы алгоритмических заявок.

Алгоритмическая стоп-заявка по акции Сбербанк со следующими параметрами:

Тейк-профит = 10; стоп-лимит = 7; спред = 3.

Параметры заданы в абсолютном денежном выражении.



Алго: Стоп-заявка Ввод заявки

Класс: **Акции 1-го уровня (эмулятор)**

Инструмент: **Сбербанк**

Срок действия: **До отмены**

Дата: **10.03.2021**

Время: **17:47:51**

Организация: _____

Торговый Счет: **NL0011100043**

Рабочий интервал
Начало: **14:30:00** Окончание: **3:55:00**

Тейк-профит: **10** Тип тейк-профита: **Деньги**

Стоп-лимит: **7** Тип стоп-лимита: **Деньги** Снимать клиентские заявки

Спред: **3** Тип спреда: **Деньги** По рыночной цене

Код Клиента: **1868** Комментарий: _____

Оповещать об исполнении связанных заявок

Да **Отмена**

12.FAQ

1. «Почему после выставления стоп-заявки позиция не закрылась / позиция не открылась / позиция не изменилась?»

Ответ:

Позиции в системе QUIK меняются только по сделкам, заключённым в торговой системе биржи. Стоп-заявка в системе QUIK не является сделкой, поэтому при выставлении стоп-заявки позиции не изменяются до тех пор, пока данная стоп-заявка не будет исполнена, и по порожденной биржевой заявке не будет заключена сделка (подробнее см. в п. [2](#) и [3](#)).

2. «Как проверить, исполнилась ли выставленная стоп-заявка?»

Ответ:

Проверить, была ли исполнена стоп-заявка можно в таблице стоп-заявок по полю «Состояние». Если стоп-заявка была исполнена, то в поле «Состояние» будет указано «Исполнена». Также при исполнении стоп-заявки в поле «Номер заявки» будет указан номер порожденной биржевой заявки, если она будет успешно зарегистрирована в торговой системе, иначе если стоп-заявка исполнится, а порожденная биржевая заявка будет отклонена, в поле «Результат» будет указана причина отклонения заявки.

3. «Как исполнилась стоп-заявка?»

Ответ:



В случае, если стоп-заявка исполняется и подаёт поручение на выставление биржевой заявки, которая успешно регистрируется в торговой системе биржи, то в таблице стоп-заявок в поле «Номер заявки» указывается номер порожденной биржевой заявки. Эта биржевая заявка также появляется в таблице заявок, где можно подробно ознакомиться с ее параметрами. Также в таблице заявок есть поле «Стоп-заявка», в котором указан номер стоп-заявки, по исполнению которой была выставлена эта биржевая заявка.

Дальнейшее заключение сделок по порожденной заявке можно отслеживать по таблице сделок, где для каждой сделки в поле «Заявка» указывается номер вашей заявки, по которой была заключена сделка.

4. «Почему в таблице «Стоп-заявки» состояние указано как «Исполнена», но биржевая заявка не выставилась?»

Ответ:

Состояние «Исполнена» означает, что было выполнено указанное ценовое условие и стоп-заявка направила в торговую систему поручение на выставление биржевой заявки. Если порожденная биржевая заявка была успешно зарегистрирована в торговой системе, то в таблице стоп-заявок в поле «Результат» будет указано «Выставлена заявка в ТС», а в поле «Номер заявки» будет указан номер выставленной биржевой заявки, и сама заявка отобразится в таблице заявок.

При этом может возникнуть ситуация, когда условие стоп-заявки было выполнено, стоп-заявка исполнилась и направила поручение на выставление биржевой заявки в торговую систему биржи, но сама биржевая заявка была отвергнута торговой системой по какой-либо причине. В таком случае состояние стоп-заявки всё равно будет «Исполнена», но при этом в таблице стоп-заявок поле «Номер заявки» заполнено не будет и в таблице заявок новая заявка не появится, так как биржевая заявка выставлена не была. Причины отклонения порождаемой биржевой заявки указываются в таблице «Стоп-заявки» в поле «Результат».

5. «В таблице стоп-заявок в поле «Результат» мало информации о причине отклонения стоп-заявки.»

Ответ:

В этом случае, для получения более подробных комментариев о причинах отклонения необходимо обратиться к брокеру с соответствующим запросом, указав при обращении номер стоп-заявки.

6. «Почему в таблице стоп-заявок видно не все стоп-заявки?»

Ответ:

Некоторые стоп-заявки могут не отображаться в таблице из-за настроек фильтров таблицы, и/или из-за активных пользовательских фильтров по столбцам.

Проверить настройки фильтров таблицы можно в окне редактирования таблицы стоп-заявок, доступном из пункта меню Действия / Редактировать таблицу, или по комбинации горячих клавиш (по умолчанию CTRL+E). Для отображения всех доступных стоп-заявок



следует отключить все имеющиеся фильтры, а также убедиться, что в списке классов выбраны все торговые классы.

Подробное описание настроек таблицы «Стоп-заявки» содержится в п. 3.7.3 Раздел 3 «Просмотр информации» Руководства пользователя QUIK.

Проверить наличие пользовательских фильтров в таблице можно по значку воронки в левом верхнем углу таблицы. Если значок цветной, значит в таблице включены пользовательские фильтры, которые могут скрывать часть данных, в таком случае необходимо отключить фильтры (значок воронки станет серым) и проверить наличие интересующих вас стоп-заявок в таблице.

Подробное описание работы с пользовательскими фильтрами содержится в п. 2.8.8 Раздел 2 «Основные принципы работы» Руководства пользователя QUIK.

Также можно создать таблицу стоп-заявок заново, при создании таблицы фильтры по умолчанию отключены.

Если после отключения всех фильтров интересующие вас стоп-заявки не появились в таблице, значит они либо были исполнены, либо сняты в одной из предыдущих торговых сессий. В таком случае, чтобы уточнить статус стоп-заявок, необходимо обратиться к действующему брокеру.

В случае отклонения стоп-заявок сервером QUIK, они не будут отображаться в таблице стоп-заявок. Проверить, были ли среди ваших стоп-заявок те, которые отклонил сервер QUIK, можно по таблице сообщений. За более подробными комментариями о причинах отклонения стоп-заявок необходимо обратиться к действующему брокеру.

7. «Как выставить стоп-заявку в QUIK?»

Ответ:

В программе Рабочее место QUIK есть несколько способов выставить условную заявку. Подробное описание ввода стоп-заявки содержится в п. 5.6.4 Раздел 5 «Торговые операции клиента» Руководства пользователя QUIK.

В мобильных терминалах QUIK X и в браузерной версии webQUIK для ввода условной заявки необходимо выбрать «Условная» на экране ввода заявки.

8. «Почему нельзя ввести стоп-заявку – кнопка серая или неактивная? Почему не могу ввести стоп-заявку?»

Ответ:

Возможность вводить стоп-заявки устанавливается действующим брокером на основании договора о брокерском обслуживании, брокер может как предоставлять, так и ограничить возможность использования стоп-заявки. Для получения возможности использования стоп-заявок необходимо обратиться к действующему брокеру.

9. «Как узнать состояние стоп-заявки»

Ответ:



Выставленные стоп-заявки отображаются в таблице стоп-заявок. Состояние стоп-заявки указано в поле «Состояние», возможные значения:

- «Активна» – стоп-заявка проверяет выполнение указанного условия;
- «Исполнена» – указанное условие было выполнено, стоп-заявка направила поручение на выставление биржевой заявки, дальнейшая проверка условия не выполняется;
- «Снята» – стоп-заявка была снята, поручения на выставление биржевой заявки отправлено не было, дальнейшая проверка условия не выполняется.

10.«Почему стоп-заявка не исполняется, хотя цены котировок в стакане отвечают условию?»

Ответ:

Проверка выполнения условий стоп-заявок выполняется сервером QUIK на основании цен всех обезличенных сделок в торговой системе, а не на основании цен в стакане котировок. В стакане котировок отображаются цены и объёмы активных биржевых заявок, по ним проверка выполнения условия не осуществляется.

Проверить выполнение условия можно ценам на графике цены и объёма, либо в таблице обезличенных сделок. Если стоп-заявка не исполнена, значит цен, отвечающих условию, ещё не было.

11.«Почему стоп-заявка не исполнилась сразу же, когда в таблице текущих торгов были цены, отвечающие условию?»

Ответ:

Проверка выполнения условий стоп-заявок выполняется сервером QUIK на основании цен всех обезличенных сделок в торговой системе, а не на основании данных в таблице текущих торгов.

Проверить выполнение условия можно по ценам на графике цены и объёма, либо в таблице обезличенных сделок. Если стоп-заявка не исполнена, значит цен, отвечающих условию, ещё не было.

Несмотря на то, что расчёты параметров таблицы текущих торгов выполняются биржей на основании обезличенных сделок, обновления параметров самой сделки передаются биржей отдельно друг от друга, из-за этого изменения в таблице текущих торгов могут происходить не синхронно с обезличенными сделками.

12.«Почему стоп-заявка исполнилась по другой цене?»

Ответ:

Вероятно, это обусловлено не вполне верным пониманием того, как работает условие данной стоп-заявки.

Следует по таблице стоп-заявок уточнить условие стоп-заявки и её параметры, сопоставив их с алгоритмом работы данного условия (см. п. 5-10).



Если же результат работы стоп-заявки по-прежнему под сомнением, необходимо по параметру «Сделка условия» в таблице стоп-заявок найти обезличенную сделку в таблице обезличенных сделок, убедиться, что с учётом условия стоп-заявки и указанных параметров, а также цены обезличенной сделки, ожидаемый результат работы заявки был верным. Если это так, необходимо обратиться к брокеру, сообщить ему номер стоп-заявки и инициировать разбор данной ситуации.

13. «Как выставить стоп-заявку, которая будет работать также, как в другой торговой системе?»

Ответ:

Необходимо ознакомиться со списком доступных условий для стоп-заявок в системе QUIK и выбрать из них то, которое подойдёт под решение вашей задачи – см. п. 5-11. Других условий для стоп-заявок в системе QUIK не предусмотрено.

При необходимости обеспечить нужный алгоритм работы условных заявок, вы можете создать собственные «стоп-заявки», которые будут работать в соответствии с заданным вами алгоритмом. Это возможно путём написания LUA-скриптов с использованием функций QLUA. Вы также можете найти уже готовые решения на LUA.

При этом следует иметь в виду, что при использовании LUA-скриптов, все расчёты, проверка выполнения условия и отправка заявок будут выполняться только в том случае, если ваш терминал запущен, подключен к серверу и соответствующий LUA-скрипт работает.

14. «Когда имеющий функционал стоп-заявок будет улучшен, изменён или расширен?»

Ответ:

В обозримой перспективе в системе QUIK не запланировано значимого изменения функционала стоп-заявок. В первую очередь потому, что основную часть задач, связанных с выставлением биржевых заявок при определённых условиях, уже сейчас можно решить с использованием LUA-скриптов и функций QLUA.

При необходимости обеспечить нужный алгоритм работы условных заявок, вы можете создать собственные «стоп-заявки», которые будут работать в соответствии с заданным вами алгоритмом. Это возможно путём написания LUA-скриптов с использованием функций QLUA. Вы также можете найти уже готовые решения на LUA.

При этом следует иметь в виду, что при использовании LUA-скриптов, все расчёты, проверка выполнения условия и отправка заявок будут выполняться только в том случае, если ваш терминал запущен, подключен к серверу и соответствующий LUA-скрипт работает.

15. «Как работает тейк-профит, если указать отрицательный отступ?»

Ответ:

При отрицательном отступе условие тейк-профит будет действовать так, как это следует из алгоритма и формул в п. 6.



После того, как цена улучшится до указанного уровня цены тейк–профит и начнётся расчёт цен, тейк–профит будет следить за улучшением цены до тех пор, пока цена будет улучшаться относительно последней лучшей цены на величину равную отступу по модулю, либо больше. Иначе тейк–профит исполнится и выставит биржевую заявку.

- Для заявок на продажу условие продолжения расчёта цены:
Текущая_цена \geq лучшая_цена - (-|отступ|) = лучшая_цена + |отступ|
Условие исполнения тейк–профита на продажу:
Текущая_цена $<$ лучшая_цена + |отступ|
- Для заявок на покупку условие продолжения расчёта цены:
Текущая_цена \leq лучшая_цена + (-|отступ|) = лучшая_цена - |отступ|
Условие исполнения тейк–профита на покупку:
Текущая_цена $>$ лучшая_цена - |отступ|

16. «Как работает тейк–профит, если указать нулевой отступ?»

Ответ:

При нулевом отступе условие тейк–профит будет действовать так, как это следует из алгоритма и формул в п. 6.

После того, как цена улучшится до указанного уровня цены тейк–профит и начнётся расчёт цен, тейк–профит будет следить за улучшением цены до тех пор, пока цена улучшается или остается без изменений. Любое ухудшение цены приводит к пробую отступа, исполнению тейк–профита и выставлению биржевой заявки.

17. «Как работает тейк–профит, если указать отрицательный спред?»

Ответ:

При отрицательном спреде условие тейк–профит будет действовать так, как это следует из алгоритма и формул в п. 6.

В случае пробоя отступа и исполнения тейк–профита будет выставлена биржевая заявка, цена которой будет посчитана следующим образом:

- Для заявок на продажу:
Цена_заявки = цена_пробоя - (-|спред|) = цена_пробоя + |спред|
- Для заявок на покупку:
Цена_заявки = цена_пробоя + (-|спред|) = цена_пробоя - |спред|

18. «Как работает тейк–профит, если указать нулевой спред?»

Ответ:

При нулевом спреде условие тейк–профит будет действовать так, как это следует из алгоритма и формул в п. 6.

В случае пробоя отступа и исполнения тейк–профита будет выставлена биржевая заявка, цена которой будет равна цене, пробившей отступ – цене пробоя.



19. «Как правильно использовать стоп–заявки и как выбирать вводимые параметры?»

Ответ:

Мы не даём прямых рекомендаций к действию или консультаций по торговым стратегиям, так как не можем решить за вас, как правильно использовать то или иное условие, какие значения необходимо вводить в той или иной ситуации.

Фактическую необходимость использования тех или иных стоп–заявок в системе QUIK вы определяете самостоятельно, исходя из вашего понимания условий рынка, и/или на основании рекомендаций более опытных коллег. Вместе с тем, вы принимаете или отказываетесь от риска и ответственности за возможные убытки, которые могут иметь место в случае неверного представления о том, как работают стоп–заявки в системе QUIK, либо в случае развития рынка в нежелательном направлении.

20. «Я выставил заявку «стоп–лимит», что будет, если цена окажется ещё хуже, чем цена стоп-лимит и цена исполнения?»

Ответ:

В этом случае условная заявка стоп–лимит исполнится и выставит лимитированную заявку. Эта лимитированная заявка окажется вне рынка, так как текущая цена хуже цены заявки. Из-за этого сделок по заявке не будет до тех пор, пока не появится предложение или спрос по цене не хуже цены исполнения. При этом может быть так, что такого предложения не появится и заявка останется активной до тех пор, пока она не будет снята торговой системой или трейдером. Позиция при этом не изменится, так как не будет сделок.

