

Electronic and Algorithmic Trading

Код: FIN-016

Длительность: 6 ч.

Описание:

В рамках курса рассматриваются вопросы, связанные с современной электронной и алгоритмической торговлей на организованных финансовых рынках.

Предоставить слушателям информацию о том:

- как происходит электронная торговля на современных организованных биржах?
- что такое прямой доступ на рынок?
- как участники подключаются к биржам?
- какие виды рыночных данных рассылаются участникам?
- как происходит исполнение приходящих ордеров биржей?
- какие бывают типы ордеров и их отличия?
- что такое алгоритмическая торговля?
- какие основные виды торговых алгоритмов используются участниками?
- как происходит разработка новых торговых алгоритмов.

Цели:

Предоставить слушателям информацию о том:

- как происходит электронная торговля на современных организованных биржах?
- что такое прямой доступ на рынок?
- как участники подключаются к биржам?
- какие виды рыночных данных рассылаются участникам?
- как происходит исполнение приходящих ордеров биржей?
- какие бывают типы ордеров и их отличия?
- что такое алгоритмическая торговля?
- какие основные виды торговых алгоритмов используются участниками?
- как происходит разработка новых торговых алгоритмов.

Разбираемые темы:

- Современное состояние электронной и алгоритмической торговли, вызванное эволюцией рынков и технологий.
- Экстремальные события на современных рынках, такие как flash crash и дефолт брокера Knight Capital.
- Что такое высокочастотная торговля и большая дискуссия о пользе или ее

вреде, а также регуляторные инициативы.

- Виды рыночных данных, рассылаемые биржами участникам.
- Торговые платформы бирж.
- Как участники подсоединяются к биржам.
- Как биржи исполняют приходящие ордера.
- Основные виды ордеров и разница между ними.
- Что такое алгоритмическая торговля и какие основные виды алгоритмов используются участниками.
- Проверки, которые используются перед отправкой ордера на биржу.
- Обработка сделок, совершенных на бирже.
- Анализ качества совершенных сделок.
- Управление рисками при алгоритмической торговле.
- Процесс разработки торговых алгоритмов.

Целевая аудитория:

Бизнес-аналитики, разработчики, тестировщики, работающие в проектах инвестиционного банкинга.