



Модуль Автоследования

Руководство для Клиента

Версия 2.1

The logo for quik, featuring the word "quik" in a white, lowercase, sans-serif font inside a green circle.

quik

Содержание

1. Общие положения.....	2
2. Основные функции программы.....	3
2.1 Таблица «Стратегии»	3
2.2 Таблица «Состав стратегии»	5
2.3 Таблица «Подписчики стратегии»	7
2.4 Таблица «Рекомендации»	8
2.5 Таблица «Состав рекомендации».....	10
2.6 Таблица «Результат исполнения рекомендации»	11
2.7 Параметры подключения	12
2.8 Параметры заявок	13
3. Преобразование долей инструментов в портфеле Управляющего и корректировка позиций Клиента.....	16

Ваши пожелания и комментарии к данному Руководству
направляйте по электронной почте на адрес: quiksupport@arqatech.com



1. Общие положения

Модуль Автоследования (далее «Модуль») сигналам Управляющих, в том числе использующих торговых роботов, предназначен для автоматического исполнения рекомендаций (торговых сигналов) Управляющего при подключении Клиента к выбранной стратегии (портфелю финансовых инструментов).

В системе предусмотрено два типа пользователей:

- **Управляющий** – отправляет торговые сигналы по стратегии (портфелю финансовых инструментов) в зависимости от условий на рынке.
- **Клиент** с помощью Рабочего места QUIK подписывается на стратегию, указав при этом выделенный на стратегию объем денежных средств в поддерживаемой Модулем валюте. Возможна подписка на несколько стратегий. Стратегии для Клиента не должны содержать пересекающийся набор инструментов.

Клиент может настроить правила исполнения торговых сигналов в настройках подписки (подробнее см. п. [2.8](#)):

- с ценой, указанной в сигнале Управляющего *;
- с отступом от рекомендованной Управляющим цены *;
- с проскальзыванием от рекомендованной Управляющим цены *;
- с исполнением по рынку.

(*) Для данных правил исполнения рекомендаций можно настроить дополнительные правила:

- с перевыставлением заявок;
- исполнение по цене последней сделки;
- исполнение айсберг-заявками;
- переворот позиции одной заявкой;
- с заданным тайм-аутом и, в случае неисполнения заявки за указанное время, выставить рыночную заявку.

Модуль отслеживает поступающие от Управляющего торговые сигналы и текущие позиции Клиентов, подписавшихся на стратегию. Для каждого подписавшегося Клиента формируется список транзакций на выставление/снятие заявок согласно заданным Клиентом правилам исполнения торговых сигналов. Сформированный список конечных транзакций передается Модулем на терминал Клиента с заполненными параметрами. Далее эти заявки выставляются от лица Клиента через сервер QUIK на соответствующие торговые площадки.

Модуль может быть настроен для работы в режиме исполнения рекомендаций без участия Клиента.

Модуль синхронизирует позиции Клиента и Управляющего по каждой стратегии при подписке на стратегию, возобновлении подписки и при восстановлении соединения с сервером QUIK.

Если в настройках Рабочего места QUIK включен признак «Запрашивать подтверждение» (пункт меню Система / Настройки / Основные..., раздел «Торговля» / «Заявки»), то Модуль запрашивает подтверждение пользователя перед синхронизацией.

2. Основные функции программы

2.1 Таблица «Стратегии»

меню Расширение / Автоследование / Стратегии...

2.1.1 Назначение таблицы

Таблица предназначена для отображения стратегий, доступных для подписки.

2.1.2 Формат таблицы

Каждой стратегии в таблице соответствует отдельная строка.



	Код стратегии	Название стратегии	Количество инст	Доход с начала	Доход с нач. Информаци	Доход с начала	Среднегодот	Просадка, %	
1	St1	1-Стратегия №1 (ФР)	3	0,00	0,00		33,11	33,12	33,13
2	St3	1-Стратегия №3 (ФР+СР)	1	0,00	0,00	[BLE][16] Cи	31,11	32,12	33,13
3	St4	1-Стратегия №4 (СР+СМЕ)	2	0,00	0,00		41,11	42,12	43,13
4	St5	1-Стратегия №5 (CURR)	2	0,00	0,00		51,11	52,12	53,13
5	St6	1-Стратегия №6 (на весь портф)	3	0,00	0,00		61,11	62,12	63,13
6	St8	1-Стратегия №8	2	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00

Значения параметров в столбцах таблицы:

Параметр	Назначение
Код стратегии	Код стратегии
Название стратегии	Полное наименование стратегии
Количество инструментов	Количество инструментов в стратегии
Статус	Статус подписки. Возможные значения: _ «Подключена»;

— «Приостановлена»	
Объем	Объем денежных средств, выделенных на стратегию
Фирма	Фирма клиента
Счёт депо	Торговый счет клиента
Код клиента	Код клиента
Валюта	Код валюты
Доход с начала месяца, %	Доходность по стратегии с начала месяца, в процентах
Доход с начала года, %	Доходность по стратегии с начала года, в процентах
Информация	Информация о причине приостановки подписки. Поле заполняется только для подписок со статусом «Приостановлена»
Доходность с начала стратегии, %	Доходность по стратегии с начала подписки на нее, в процентах
Среднегодовая доходность, %	Среднегодовая доходность по стратегии, в процентах
Просадка, %	Убыток по стратегии, в процентах
Доходность за прошлый месяц, %	Доходность по стратегии за прошедший месяц, в процентах
Доходность за год, %	Доходность по стратегии за прошедший год, в процентах
Доходность за полгода, %	Доходность по стратегии за прошедшие полгода, в процентах
Доходность за месяц, %	Средняя доходность по стратегии за месяц, в процентах
Доходность за неделю, %	Средняя доходность по стратегии за неделю, в процентах
URL стратегии	Ссылка на страницу с описанием стратегии на сайте брокера

2.1.3 Настройка таблицы

Окно редактирования таблицы содержит следующие настройки:

1. «Имя таблицы» – позволяет ввести наименование таблицы, отличное от принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.1.4 Доступные функции

- Данные из таблицы доступны для копирования в буфер обмена, вывода через DDE сервер, экспорта через ODBC.
- Двойное нажатие левой кнопкой мыши – открыть таблицу «Состав стратегии <Наименование стратегии>» для стратегии, на которой стоит курсор. Подробнее см. п. [2.2](#).

Полный список управляющих клавиш для всех типов таблиц приведен в Руководстве пользователя QUIK Приложение к Разделу 2 «Основные принципы работы с программой».

Функции, доступные из контекстного меню таблицы:

- «Подключить стратегию» – открыть окно подписки на стратегию. Подробнее см. п. [2.7](#).
- «Отключить стратегию» – отписаться от стратегии.
- «Возобновить подписку» – возобновить подписку на ранее оформленную стратегию. Используется при необходимости возобновления подписки, которой в результате некорректной синхронизации позиций Клиента и Управляющего был присвоен статус «Приостановлена».
- «Изменить параметры подписки» – изменить настройки исполнения торговых сигналов. Подробнее см. п. [2.8](#).
- «Тип режима оповещений для мобильных клиентов» – выбор режима оповещений для мобильных клиентов. Возможные значения:
 - «Нет оповещений» (по умолчанию) – оповещения не используются;
 - «По подписке» – оповещение по изменению статуса подписки (возобновлена/приостановлена/снята);
 - «По сигналам» – оповещение по внешним сигналам Управляющего на выполнение рекомендации для активной подписки;
 - «По всем типам оповещений» – оповещения по всем типам (по сигналам и подписке).
- «Подписчики» – открыть таблицу «Подписчики стратегии <Наименование стратегии>» для стратегии, на которой стоит курсор. Подробнее см. п. [2.3](#).
- «Состав стратегии» – открыть таблицу «Состав стратегии <Наименование стратегии>» для стратегии, на которой стоит курсор. Подробнее см. п. [2.2](#).

2.2 Таблица «Состав стратегии»

2.2.1 Назначение таблицы

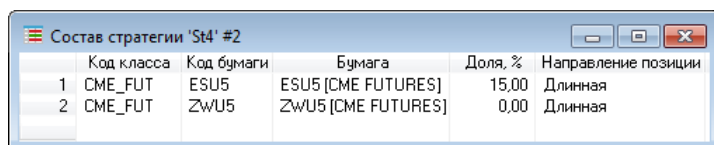
Таблица «Состав стратегии <Наименование стратегии>» предназначена для отображения инструментов, включенных в стратегию.

Таблица может быть вызвана следующими способами:

- Двойным нажатием левой кнопкой мыши в таблице «Стратегии» по стратегии, на которой стоит курсор.
- Из контекстного меню таблицы «Стратегии» выбором функции «Состав стратегии» для стратегии, на которой стоит курсор.

2.2.2 Формат таблицы

Каждому инструменту в таблице соответствует отдельная строка.



	Код класса	Код бумаги	Бумага	Доля, %	Направление позиции
1	CME_FUT	ESU5	ESU5 [CME FUTURES]	15,00	Длинная
2	CME_FUT	ZWU5	ZWU5 [CME FUTURES]	0,00	Длинная

Значения параметров в столбцах таблицы:

Параметр	Назначение
Код класса	Код класса инструмента
Код бумаги	Код инструмента
Бумага	Наименование инструмента
Доля, %	Доля инструмента в стратегии, в процентах
Направление позиции	Направление позиции. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none">– «Длинная»;– «Короткая»

2.2.3 Настройка таблицы

Окно редактирования таблицы содержит следующие настройки:

1. «Имя таблицы» – позволяет ввести наименование таблицы, отличное от принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.2.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для копирования в буфер обмена, вывода через DDE сервер, экспорта через ODBC.

Полный список управляющих клавиш для всех типов таблиц приведен в Руководстве пользователя QUIK Приложение к Разделу 2 «Основные принципы работы с программой».

2.3 Таблица «Подписчики стратегии»

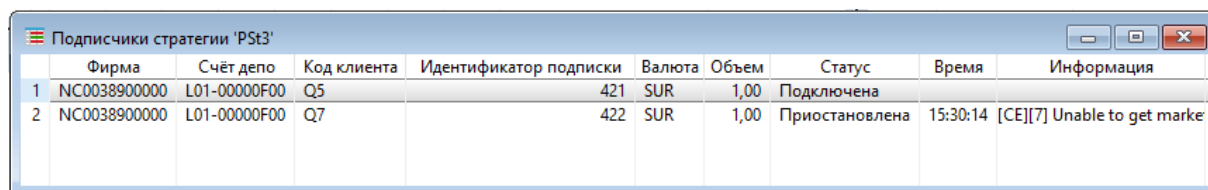
2.3.1 Назначение таблицы

Таблица «Подписчики стратегии <Наименование стратегии>» предназначена для отображения списка Клиентов, подписанных на данную стратегию.

Таблица вызывается из контекстного меню таблицы «Стратегии» выбором функции «Подписчики» для стратегии, на которой стоит курсор.

2.3.2 Формат таблицы

Каждому коду клиента в таблице соответствует отдельная строка.



	Фирма	Счёт депо	Код клиента	Идентификатор подписки	Валюта	Объем	Статус	Время	Информация
1	NC0038900000	L01-00000F00	Q5	421	SUR	1,00	Подключена		
2	NC0038900000	L01-00000F00	Q7	422	SUR	1,00	Приостановлена	15:30:14	[CE][7] Unable to get marke

Значения параметров в столбцах таблицы:

Параметр	Назначение
Фирма	Фирма клиента, подписанного на стратегию
Счет депо	Счет депо клиента, подписанного на стратегию
Код клиента	Код клиента, подписанного на стратегию
Идентификатор подписки	Идентификатор подписки на стратегию
Валюта	Код валюты
Объем	Объем денежных средств, выделенных на стратегию
Статус	Статус подписки. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none">«Подключена»;«Приостановлена»
Время	Время приостановки подписки. Поле заполняется только для подписок со статусом «Приостановлена»
Информация	Причина приостановки подписки. Поле заполняется только для подписок со статусом «Приостановлена»

2.3.3 Настройка таблицы

Окно редактирования таблицы содержит следующие настройки:

1. «Имя таблицы» – позволяет ввести наименование таблицы, отличное от принятого по умолчанию.
3. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.3.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для копирования в буфер обмена, вывода через DDE сервер, экспорта через ODBC.

Полный список управляющих клавиш для всех типов таблиц приведен в Руководстве пользователя QUIK Приложение к Разделу 2 «Основные принципы работы с программой».

Функции, доступные из контекстного меню таблицы:

- «Подключить стратегию» – открыть окно подписки на стратегию. Подробнее см. п. [2.7](#).
- «Отключить стратегию» – отписаться от стратегии.
- «Возобновить подписку» – возобновить подписку на ранее оформленную стратегию. Используется при необходимости возобновления подписки, которой в результате некорректной синхронизации позиций Клиента и Управляющего был присвоен статус «Приостановлена».
- «Изменить параметры подписки» – изменить настройки исполнения торговых сигналов. Подробнее см. п. [2.8](#).

2.4 Таблица «Рекомендации»

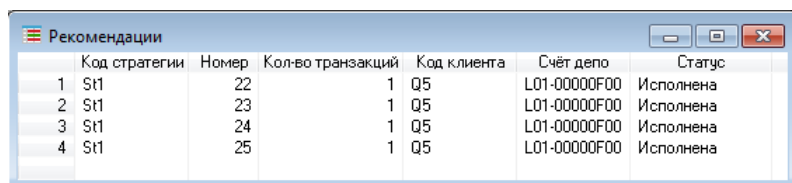
меню **Расширение / Автоследование / Рекомендации...**

2.4.1 Назначение таблицы

Таблица предназначена для отображения рекомендаций, полученных Клиентом.

2.4.2 Формат таблицы

Каждой рекомендации в таблице соответствует отдельная строка.



	Код стратегии	Номер	Кол-во транзакций	Код клиента	Счёт депо	Статус
1	St1	22	1	Q5	L01-00000F00	Исполнена
2	St1	23	1	Q5	L01-00000F00	Исполнена
3	St1	24	1	Q5	L01-00000F00	Исполнена
4	St1	25	1	Q5	L01-00000F00	Исполнена

Значения параметров в столбцах таблицы:

Параметр	Назначение
Код стратегии	Код стратегии
Номер	Номер рекомендации
Кол-во транзакций	Количество транзакций в рекомендации
Код клиента	Код клиента, подписанного на стратегию
Счёт депо	Счет депо клиента, подписанного на стратегию
Статус	Статус рекомендации. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none">– «Получена»;– «Исполнена»;– «Активна»;– «Снята»

2.4.3 Настройка таблицы

Окно редактирования таблицы содержит следующие настройки:

1. «Имя таблицы» – позволяет ввести наименование таблицы, отличное от принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.4.4 Доступные функции

- Данные таблицы доступны для копирования в Буфер обмена Windows и экспорта через DDE-сервер.
- Двойное нажатие левой кнопкой мыши – открыть таблицу «Состав рекомендации <Номер рекомендации>» для рекомендации, на которой стоит курсор. Подробнее см. п. [2.5](#).

Полный список управляющих клавиш для всех типов таблиц приведен в Руководстве пользователя QUIK Приложение к Разделу 2 «Основные принципы работы с программой».

Функции, доступные из контекстного меню на таблице:

- «Состав рекомендации» – открыть таблицу «Состав рекомендации <Номер рекомендации>» для рекомендации, на которой стоит курсор. Подробнее см. п. [2.5](#).
- «Результат исполнения рекомендации» – открыть таблицу «Результат исполнения рекомендации <Номер рекомендации>» для рекомендации, на которой стоит курсор. Подробнее см. п. [2.6](#).

2.5 Таблица «Состав рекомендации»

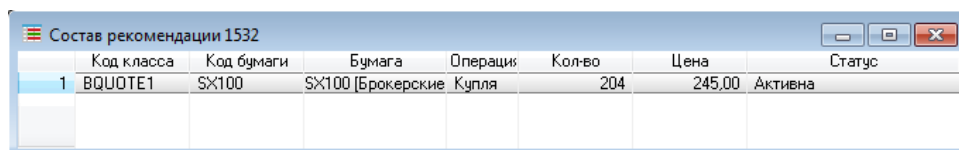
2.5.1 Назначение таблицы

Таблица «Состав рекомендации <Номер рекомендации>» предназначена для отображения параметров рекомендации, полученной Клиентом.

Таблица может быть вызвана следующими способами:

- Двойным нажатием левой кнопкой мыши в таблице «Рекомендации» по рекомендации, на которой стоит курсор.
- Из контекстного меню таблицы «Рекомендации» выбором функции «Состав рекомендации» для рекомендации, на которой стоит курсор.

2.5.2 Формат таблицы



	Код класса	Код бумаги	Бумага	Операции	Кол-во	Цена	Статус
1	BQUOTE1	SX100	SX100 Брокерские	Купля	204	245.00	Активна

Значения параметров в столбцах таблицы:

Параметр	Назначение
Код класса	Код класса инструмента
Код бумаги	Код инструмента
Бумага	Наименование инструмента
Операция	Направление операции – «Покупка» или «Продажа»
Тип	Тип выставленной заявки. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none">– «Л» – лимитированная;– «М» – рыночная
Кол-во	Количество лотов в заявке
Цена	Цена в заявке
Статус	Статус рекомендации. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none">– «Исполнена»;– «Активна»;– «Снята»;– «<Причина отклонения заявки торговой системой или сервером QUIK>»

2.5.3 Настройка таблицы

Окно редактирования таблицы содержит следующие настройки:

1. «Имя таблицы» – позволяет ввести наименование таблицы, отличное от принятого по умолчанию.
2. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.5.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для копирования в буфер обмена, вывода через DDE сервер, экспорта через ODBC.

Полный список управляющих клавиш для всех типов таблиц приведен в Руководстве пользователя QUIK Приложение к Разделу 2 «Основные принципы работы с программой».

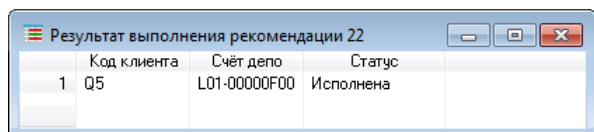
2.6 Таблица «Результат исполнения рекомендации»

2.6.1 Назначение таблицы

Таблица «Результат исполнения рекомендации <Номер рекомендации>» предназначена для отображения результатов исполнения данной рекомендации в разрезе кодов клиентов.

Таблица вызывается из контекстного меню таблицы «Рекомендации» выбором функции «Результат исполнения рекомендации» для рекомендации, на которой стоит курсор.

2.6.2 Формат таблицы



Результат выполнения рекомендации 22			
	Код клиента	Счёт депо	Статус
1	Q5	L01-00000F00	Исполнена

Значения параметров в столбцах таблицы:

Параметр	Назначение
Код клиента	Код клиента, подписанного на стратегию данной рекомендации
Торговый счет	Торговый счет клиента
Результат	Результат выполнения рекомендации. Возможные значения: <ul style="list-style-type: none">– «Получена»;– «Исполнена»;– «Активна»;

2.6.3 Настройка таблицы

Окно редактирования таблицы содержит следующие настройки:

1. «Имя таблицы» – позволяет ввести наименование таблицы, отличное от принятого по умолчанию.
3. «Набор параметров» – выбор отображаемых параметров и настройка их очередности.

2.6.4 Доступные функции

Данные из таблицы доступны для копирования в буфер обмена, вывода через DDE сервер, экспорта через ODBC.

Полный список управляющих клавиш для всех типов таблиц приведен в Руководстве пользователя QUIK Приложение к Разделу 2 «Основные принципы работы с программой».

2.7 Параметры подключения

Окно с параметрами подключения к стратегии вызывается выбором пункта контекстного меню «Подключить стратегию» таблицы «Стратегии».

Параметры подключения

Фирма: NC0038900000

Счет депо: A01-00000F00

Код клиента: Q5

Валюта: SUR

Объем: 100000.00

☐ Закрыть позиции

☒ Держать подписку активной

Да Отмена

Окно содержит следующие параметры:

1. «Фирма» – фирма клиента.
2. «Счет депо» – торговый счет клиента.
3. «Код клиента» – код клиента. Для клиентов без ЕДП при подписке на стратегию, в состав которой входят только инструменты Срочного рынка, в поле указывается торговый счет клиента.
4. «Валюта» – код валюты цены и объема заявки.
5. «Объем» – объем денежных средств, выделенных на стратегию.

6. «Закрыть позиции» – признак формирования рыночных заявок по закрытию позиций (по инструментам не входящим в стратегию) перед подпиской на стратегию. Если выполнение условия по закрытию позиций невозможно (по причине отсутствия рынка или приостановке торгов по рынкам, не входящим в стратегии), то созданная подписка не синхронизируется и переводится в статус «Приостановлена». Функция доступна только для типа стратегии с подпиской на объем по всей стоимости портфеля.
7. «Держать подписку активной» – включив признак подписка держится в активном состоянии (не переводится в приостановленное состояние). Если при начальной синхронизации возникла ошибка, то статус подписки остается активным, и начальная синхронизация возобновляется при каждой поступившей рекомендации.

Для подключения к стратегии нажмите кнопку «Да».

2.8 Параметры заявок

Правила исполнения торговых сигналов настраиваются пользователем в окне «Параметры заявок».

Окно вызывается при выборе пункта контекстного меню «Изменить параметры подписки» таблиц «Стратегии» или «Подписчики стратегии».

Если на одну стратегию пользователь подписан несколькими кодами клиентов, то пункт «Изменить параметры подписки» доступен только из таблицы «Подписчики стратегии».

Параметры заявок

☐ Лимитированные по предложенной цене
 ☐ Лимитированные с заданным проскальзыванием
 ☒ Лимитированные с заданным отступом
 ☐ Исполнение по рынку

	Код класса	Код бумаги	Отступ (покупка), %	Отступ (продажа), %
1	SPBFUT	LKOH-9.15	0,00	0,00
2	SPBFUT	Si-9.15	0,00	0,00

☐ Исполнение по цене последней сделки
 ☒ Переворот позиции одной заявкой

☐ Исполнение айсберг-заявками
 ☐ Таймаут на лимитированные заявки

Видимое количество
 Секунд

☐ Перевыставлять заявки

Количество перевыставлений
 Таймаут между перевыставлениями

Окно содержит следующие параметры:

1. «Лимитированные по предложенной цене» – исполнение торгового сигнала лимитированной заявкой с ценой, указанной в сигнале Управляющего. Параметр выбран по умолчанию.
2. «Лимитированные с заданным отступом» – исполнение торгового сигнала лимитированной заявкой с отступом от рекомендованной Управляющим цены.

- Если выбран параметр «Лимитированные с заданным отступом», таблица содержит следующие параметры:

Параметр	Назначение
Код класса	Код класса инструмента
Код бумаги	Код инструмента
Отступ (покупка), %	Отступ при покупке, в процентах
Отступ (продажа), %	Отступ при продаже, в процентах

Для заявок на покупку цена рассчитывается по следующей формуле:

Цена = MAX[ROUND{«цена рекомендации» – «цена рекомендации» * «величина отступа для данной бумаги»}, округлить до точности цены в торговой системе], нижний лимит]

Для заявок на продажу цена рассчитывается по следующей формуле:

Цена = MIN[ROUND{«цена рекомендации» + «цена рекомендации» * «величина отступа для данной бумаги»}, округлить до точности цены в торговой системе], верхний лимит]

Где,

- нижний лимит – «pricemin» (минимальная цена);
- верхний лимит – «pricemax» (максимальная цена).

3. «Лимитированные с заданным проскальзыванием» – исполнение торгового сигнала лимитированной заявкой с проскальзыванием от рекомендованной Управляющим цены.

- Если выбран параметр «Лимитированные с заданным проскальзыванием», таблица содержит следующие параметры:

Параметр	Назначение
Код класса	Код класса инструмента
Код бумаги	Код инструмента

Проскальзывание (покупка), %	Проскальзывание при покупке, в процентах
Проскальзывание (продажа), %	Проскальзывание при продаже, в процентах

Для заявок на покупку цена рассчитывается по следующей формуле:

Цена = MIN[ROUND{(цена рекомендации + цена рекомендации * величину проскальзывания для данной бумаги), округлить до точности цены в торговой системе}, верхний лимит]

Для заявок на продажу цена рассчитывается по следующей формуле:

Цена = MAX[ROUND{(«цена рекомендации» – «цена рекомендации» * «величина проскальзывания для данной бумаги»), округлить до точности цены в торговой системе}, нижний лимит]

Где,

- _ нижний лимит – «pricemin» (минимальная цена);
- _ верхний лимит – «pricemax» (максимальная цена).

4. «Исполнение по рынку» – исполнение торгового сигнала рыночной заявкой.
5. «Исполнение по цене последней сделки» – исполнение по цене последней сделки по рынку, с учетом указанных правил (отступ, проскальзывание).
6. «Переворот позиции одной заявкой» – переворот позиций одной заявкой для рекомендаций типа «Закреть длинную, открыть короткую позицию» / «Закреть короткую, открыть длинную позицию». При отключенном признаке переворот позиции выполняется двумя заявками (первая заявка закрывает открытую позицию по рыночной цене, вторая открывает новую позицию по цене рекомендации, с учетом правил исполнения). Параметр выбран по умолчанию.
7. «Исполнение айсберг-заявками (Видимое количество)» – исполнение айсберг-заявками с обязательным указанием видимого количества (в лотах).
8. «Таймаут на лимитированные заявки (секунд)» – таймаут на исполнение лимитированной заявки, в секундах. В случае неисполнения заявки за указанное время, выставляется рыночная заявка. Количество в рыночной заявке равно неисполненному количеству лимитированной заявки.
9. «Перевыставлять заявки (Количество перевыставлений)» – количество перевыставлений заявок. Применяется для исполнения лимитированных заявок с заданным отступом или проскальзыванием. Обязательно заполняется поле «Количество перевыставлений» и «Таймаут между перевыставлениями» (см. ниже). При достижении таймаута заявка перевыставляется на неисполненный остаток каждый раз с ухудшением цены на заданный отступ / проскальзывание. Если по окончании заданного количества перевыставлений остается неисполненный остаток, то он выставляется по рыночной цене.
10. «Таймаут между перевыставлениями» – таймаут между перевыставлениями заявок, в секундах.

Для сохранения изменений нажмите кнопку «Да».

3. Преобразование долей инструментов в портфеле Управляющего и корректировка позиций Клиента

Тип рекомендации	Текущее направление позиции по инструменту	Текущий размер доли инструмента (%)	Скорректированное направление позиции и размер доли инструмента (%) в портфеле Управляющего	Корректировка позиций Клиента
Открыть длинную позицию	Короткая	0	Длинная, размер доли из рекомендации	Открыть длинную позицию в количестве Qty *
		Ненулевое значение	Длинная, размер доли из рекомендации	Закрыть короткую позицию по цене рекомендации. Открываем длинную позицию в количестве Qty *
	Длинная	0	Длинная, размер доли из рекомендации	Открыть длинную позицию в количестве Qty *
		Ненулевое значение	Длинная, текущий размер доли + размер доли из рекомендации	Открыть длинную позицию в количестве Qty *
Открыть короткую позицию	Длинная	0	Короткая, размер доли из рекомендации	Открыть короткую позицию в количестве Qty *
		Ненулевое значение	Короткая, размер доли из рекомендации	Закрыть длинную позицию по цене рекомендации. Открыть короткую позицию в количестве Qty *
	Короткая	0	Короткая, размер доли из рекомендации	Открыть короткую позицию в количестве Qty *
		Ненулевое значение	Короткая, текущий размер доли + размер доли из рекомендации	Открыть короткую позицию в количестве Qty *

Тип рекомендации	Скорректированное направление			
	Текущее направление позиции по инструменту (%)	Текущий размер доли инструмента (%)	позиции и размер доли инструмента в портфеле Управляющего	Корректировка позиций Клиента
Закрыть длинную позицию	Короткая	0	Длинная, 0	Корректировка не производится
		Ненулевое значение	Длинная, 0	Корректировка не производится
	Длинная	0	Длинная, 0	Корректировка не производится
		Ненулевое значение	Длинная, текущий размер доли – размер доли из рекомендации. Если в результате вычитания получено отрицательное значение, то значение размера доли устанавливается равным 0	Закрыть длинную позицию на количество, полученное с учетом доли в рекомендации «Закрыть длинную позицию». Если количество, полученное из оценки покупательной способности клиента, меньше, чем количество, полученное с учетом доли в рекомендации «Закрыть длинную позицию», то закрывается длинная позиция только в количестве Qty *
Закрыть короткую позицию	Длинная	0	Короткая, 0	Корректировка не производится
		Ненулевое значение	Короткая, 0	Корректировка не производится
	Короткая	0	Короткая, 0	Корректировка не производится
		Ненулевое значение	Короткая, текущий размер доли – размер доли из рекомендации. Если в результате вычитания получено	Закрыть короткую позицию на количество, полученное с учетом доли в рекомендации «Закрыть короткую позицию». Если количество, полученное

Тип рекомендации	Текущее направление позиции по инструменту (%)	Текущий размер доли инструмента (%)	Скорректированное направление позиции и размер доли инструмента в портфеле Управляющего	Корректировка позиций Клиента
	отрицательное значение, из оценки покупательной способности клиента, меньше, то значение размера доли устанавливается равным 0			чем количество, полученное с учетом доли в рекомендации «Закреть короткую позицию», то закрывается короткая позиция только в количестве Qty *
Закреть длинную, открыть короткую позицию	Длинная	0	Короткая, размер доли из рекомендации	Открыть короткую позицию в количестве Qty *
		Ненулевое значение	Короткая, размер доли из рекомендации	Закреть всю открытую длинную позицию клиента. Открыть короткую позицию на то же количество (осуществляется переворот позиций). В случае, если покупательной способности клиента недостаточно для образования позиции, то открывается короткая позиция в доступном для клиента количестве
	Короткая	0	Короткая, размер доли из рекомендации	Открыть короткую позицию в количестве Qty *
		Ненулевое значение	Короткая, размер доли из рекомендации	Открыть короткую позицию в количестве Qty *
Закреть короткую, открыть длинную позицию	Короткая	0	Длинная, размер доли из рекомендации	Открыть длинную позицию в количестве Qty *
		Ненулевое значение	Длинная, размер доли из рекомендации	Закреть всю открытую короткую позицию клиента.

Тип рекомендации	Скорректированное направление			Корректировка позиций Клиента
	Текущее направление позиции по инструменту (%)	Текущий размер доли инструмента (%)	позиции и размер доли инструмента в портфеле Управляющего	
				Открыть длинную позицию на то же количество (осуществляется переворот позиции). В случае, если покупательной способности клиента недостаточно для образования позиции, то открывается длинная позиция в доступном для клиента количестве
	Длинная	0	Длинная, размер доли из рекомендации	Открыть длинную позицию в количестве Qty *
		Ненулевое значение	Длинная, размер доли из рекомендации	Открыть длинную позицию в количестве Qty *

** – Qty – количество, рассчитываемое с учетом скорректированной по полученной рекомендации доли инструмента и объема денежных средств, указанного в настройках подписки на стратегию.