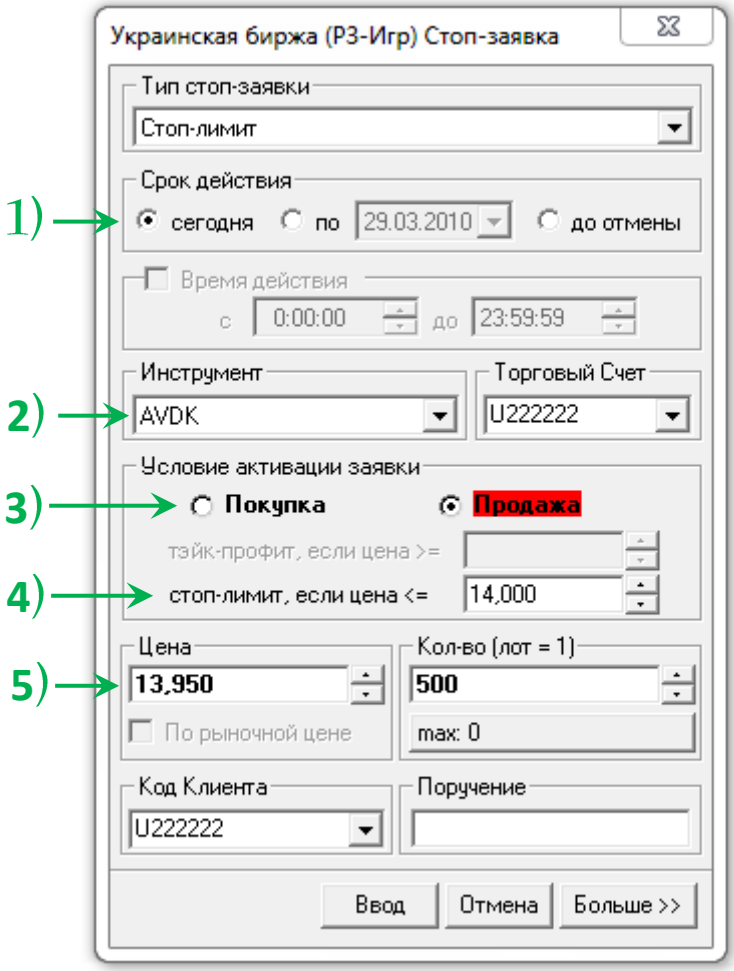
СТОП–ЗАЯВКИ.

Тип стоп-заявки: Стоп-Лимит

Описание: Самый простой тип условной заявки, в котором условием исполнения заявки является достижение ценой сделки заданного контрольного значения — стоп-цены. В результате исполнения заявки «стоп-лимит» в торговую систему передается лимитированная заявка с указанной в ней ценой.

Назначение: Данный тип условной заявки используется для ограничения убытков по открытой позиции.



Алгоритм выставления Стоп-лимита:

1) Устанавливаем срок действия заявки - до которого будет существовать Стоп-Лимит. (*в течение текущего дня* / до определённой даты / *без срока окончания*)

2) Бумага, по которой будет выставленная заявка.
3) Покупка или продажа
4) Условие уровня срабатывания стоп-лимита.
5) Цена и Количество ЦБ

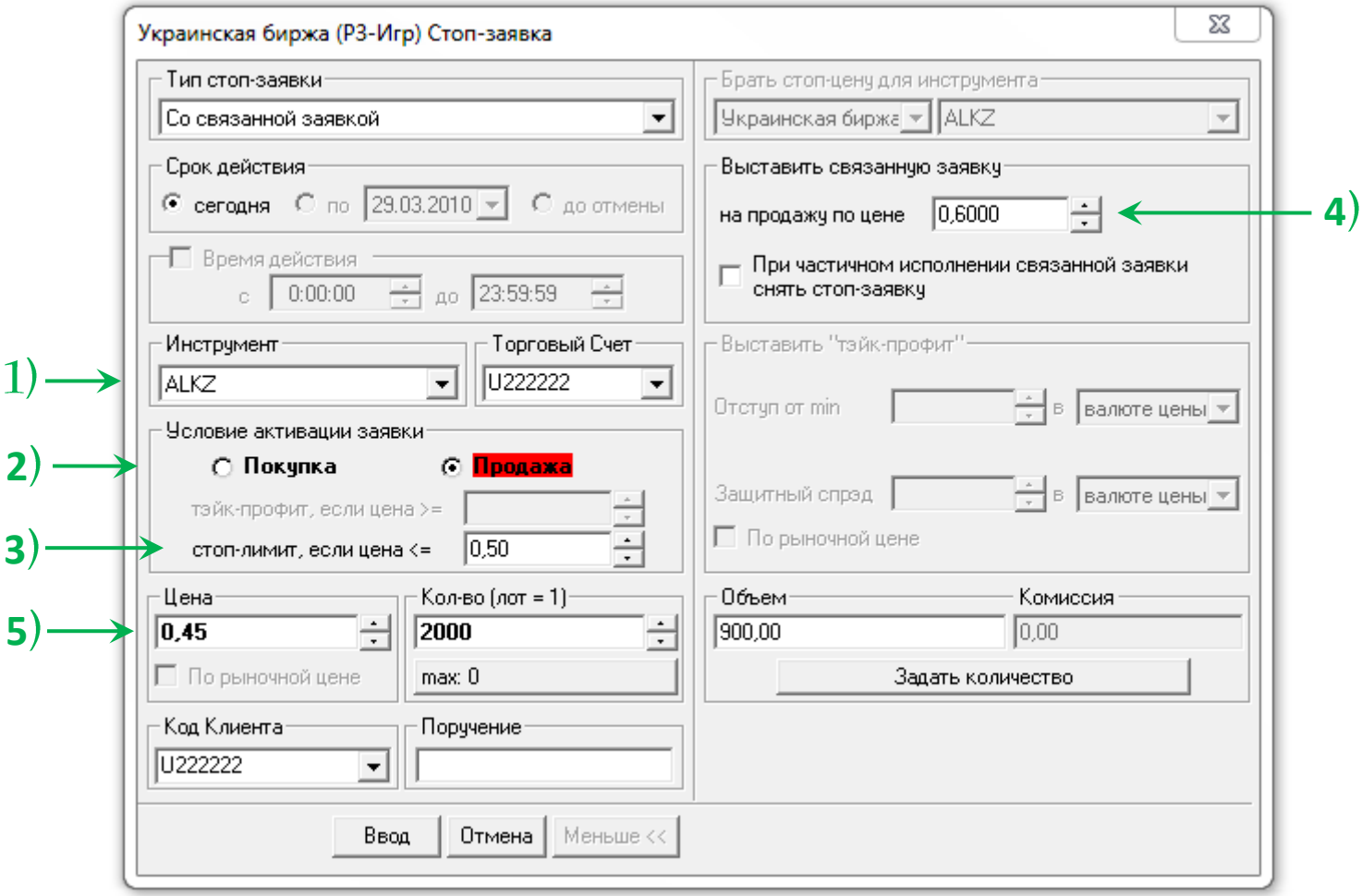
Тип стоп-заявки: Стоп-заявка «Со связанной заявкой»

Описание: комбинированная заявка, состоящая из стоп-лимита и обычной лимитированной заявки. Обычная заявка предназначена для планового закрытия позиции, а стоп-лимит — для ограничения возможных убытков от противоположного движения цены. Если одна из связанных заявок исполнится, то вторая автоматически снимается. Этот тип поручений также называют «О.С.О.» (one cancel other, «одна заявка отменяет другую»).

Преимуществом связанной заявки является то, что для исполнения связанной заявки средства блокируются в однократном размере, а при использовании двух отдельных заявок — в двойном.
Также исключается ситуация исполнения обеих заявок при сильном колебании цен.

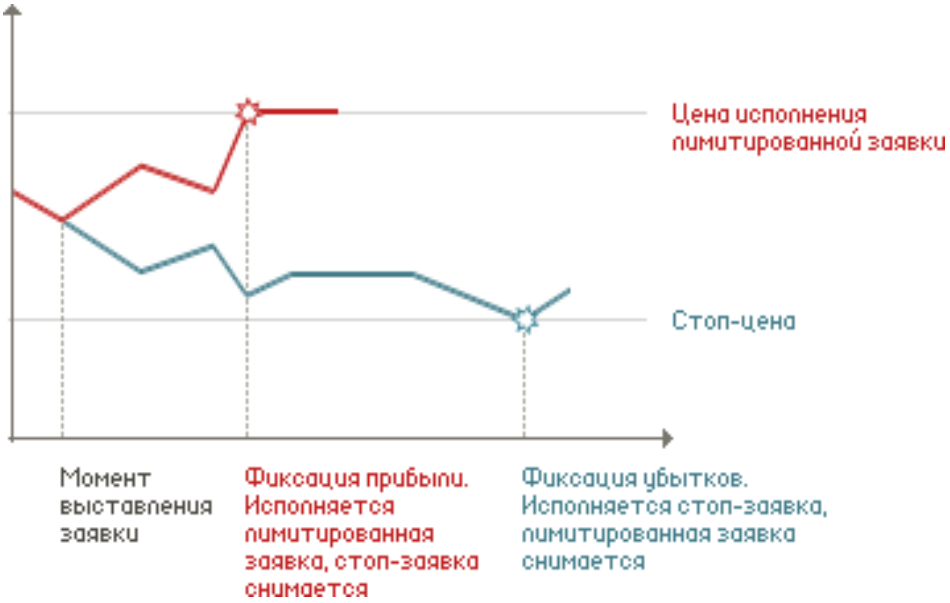
Примечание:

- Стоп-заявки «Со связанной заявкой» – действуют только в течении текущей торговой сессии.
- При исполнении стоп-заявки, связанная лимитированная заявка снимается полностью.
- При частичном исполнении связанной заявки стоп-заявка может либо (а) сниматься полностью, либо (б) уменьшаться на величину исполненной части связанной заявки, в зависимости от выбранных условий в заявке.



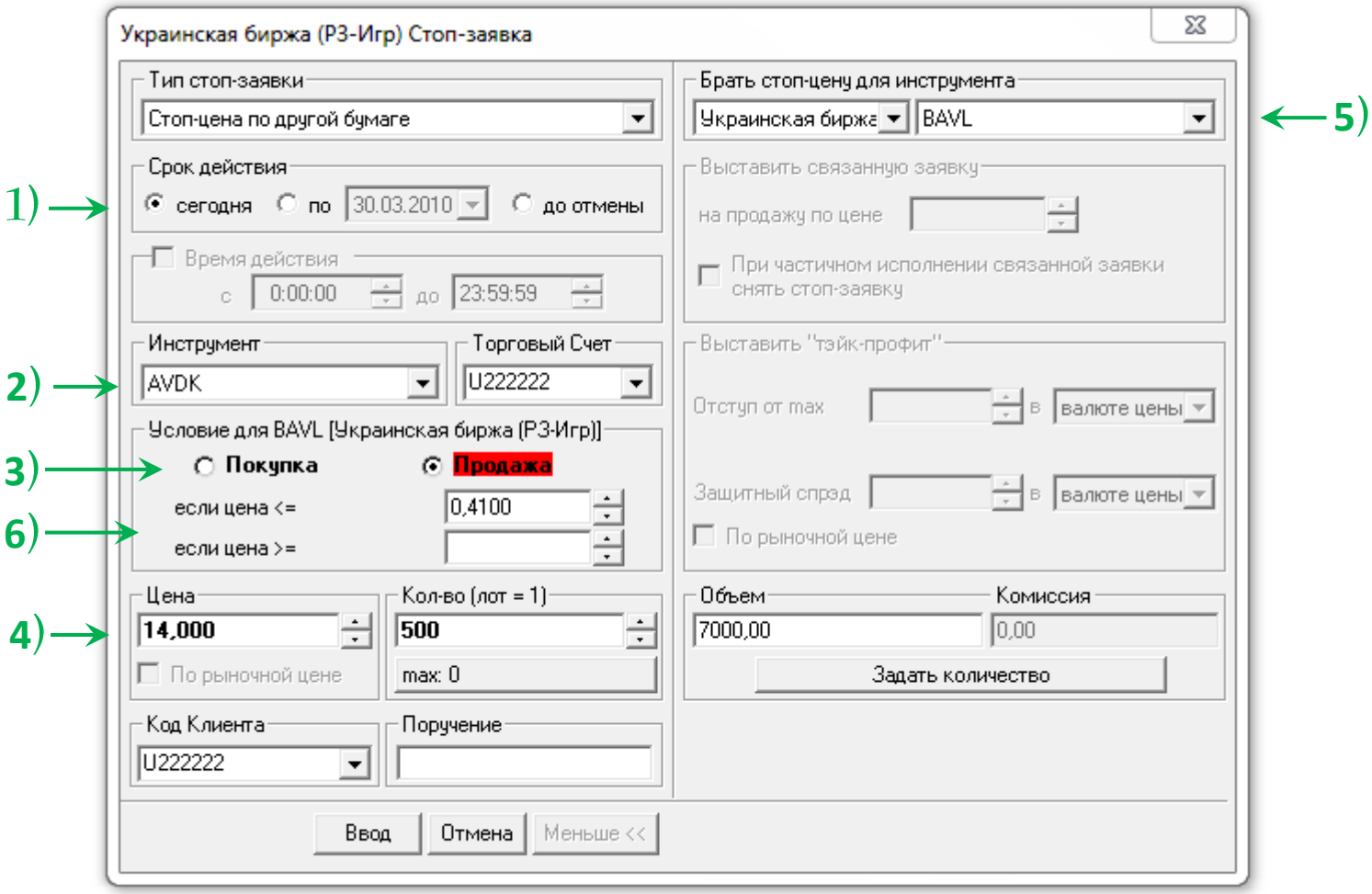
Алгоритм выставления Стоп-заявки:

1) Бумага, по которой будет выставляться заявка.
2) Выбор направления операции (Покупка или Продажа).
3) Условие уровня срабатывания стоп-заявки.
4) Цена выставляемой заявки.
5) Страховочная цена. (Если заявка не исполняется по цене, выставленной в п.4, и цена начинает «идти» в обратную сторону, то выставляется заявка по «Страховочной цене»)



Тип стоп-заявки: Стоп-цена по другой бумаге

Описание: Заявка, в которой условие проверяется по одному инструменту, а исполнение происходит по другому. Такая заявка позволяет использовать в качестве условия изменение цен по наиболее значимым бумагам, определяющим общее направление движения рынка, а при торговле срочными контрактами реагировать на изменение цен на базовый актив.



Алгоритм выставления Стоп-лимита:

1) Устанавливаем срок действия заявки - до которого будет существовать Стоп-Лимит.
   (*в течение текущего дня* / до определённой даты / *без срока окончания*)

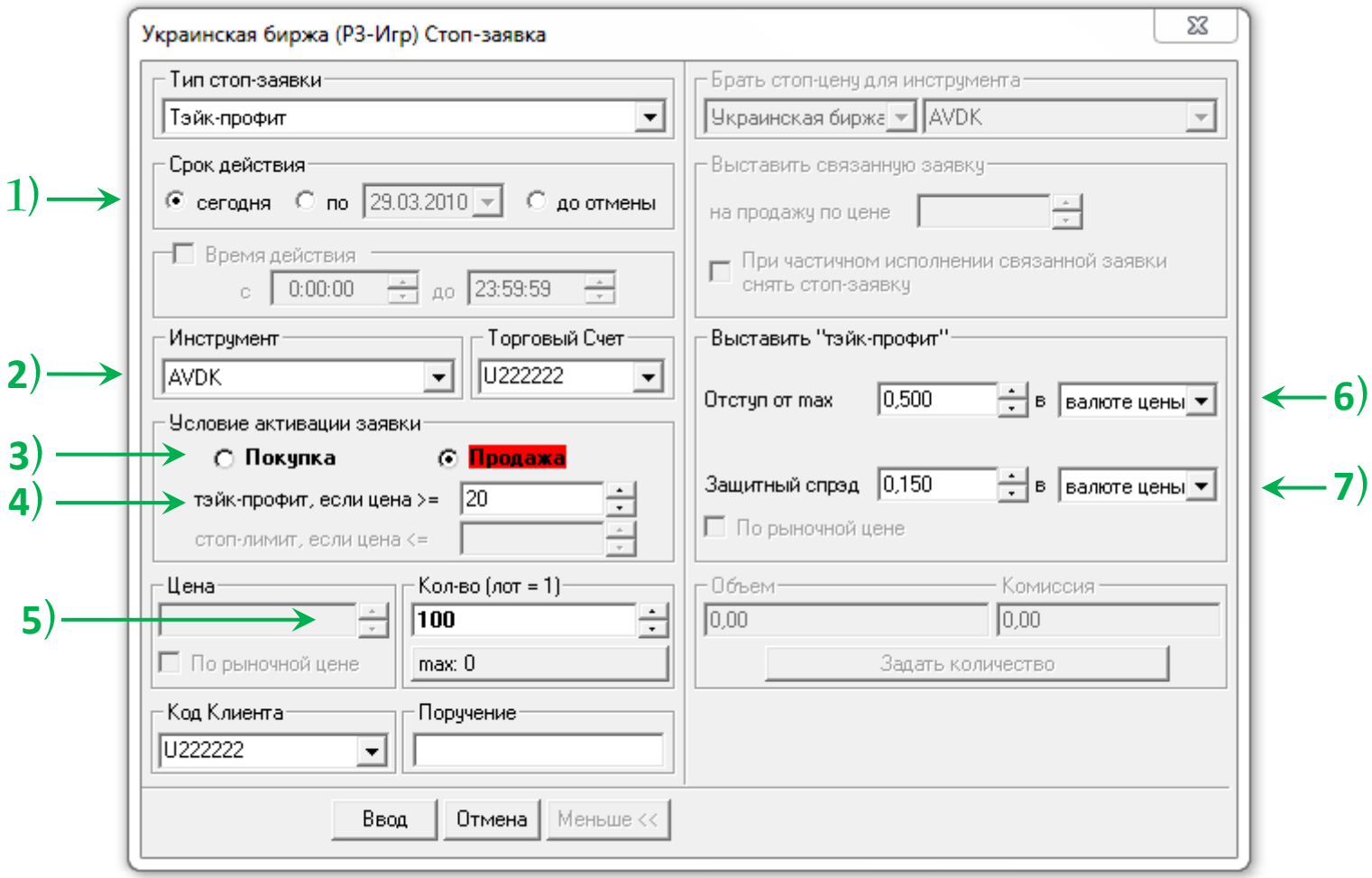
2) Бумага, по которой будет выставлена заявка.
3) Направление заявки
4) Цена и Количество выставляемой заявки по ЦБ.
5) Выбор «другой» бумаги, по которому будет проверяться условие срабатывания стоп-цены.
6) Условие слежения стоп-цены, после которого активируется выставляемая заявка.

Тип стоп-заявки: Тэйк-Профит

Описание: Это заявка с условием вида «исполнить при ухудшении цены на заданную величину от достигнутого максимума (на продажу) или минимума (на покупку)».

Заявка работает следующим образом (пример для заявки на продажу): после достижения ценой последней сделки условия стоп-цены начинается определение максимума цены последней сделки. Если цена последней сделки снижается от максимума на величину, превышающую установленный «отступ», то создается лимитированная заявка с ценой, меньше (для продажи) или больше (для покупки) цены последней сделки на величину «защитного спрэда». Величины «отступа» и «защитного спрэда» могут указываться как в значениях цены, так и в процентах.

Назначение: Закрытие позиции по инструменту с максимальной прибылью.



Алгоритм выставления Тэйк-профит:

1) Устанавливаем срок действия заявки - до которого будет существовать Стоп-Заявка.
   (*в течение текущего дня* / до определённой даты / *без срока окончания*)
2) Бумага, по которой будет выставленная заявка.
3) Покупка или продажа
4) Значение цены сделки, при достижении которой начинается проверка условий *тэйк-профита*. Начиная с этого момента будет проверяться условие максимума / минимума, и колебания цены на меньших уровнях не приведут к преждевременному исполнению условной заявки.
   (Для нашего примера – на этой точке тэйк-профит активируется и начинает проверять, будет расти цена дальше, или нет. При этом он проверяет, не стала ли цена последней сделки по бумаге ниже чем разница «локальный максимум цены» – «отступ от max»)
5) Количество ЦБ
6) «Отступ от max» - этот параметр указывает, насколько ниже/выше локального максимума цены может стать цена последней сделки.
7) «Защитный спрэд» — дополнительная разница цены между ценой исполнения тэйк-профита и ценой порождаемой им заявки. Поскольку условные заявки обычно ставятся на критических ценовых уровнях, то их достижение может вызвать стремительное движение цен. Для того, чтобы заявка гарантированно исполнилась, ее цена должна опережать движение цен, то есть быть на несколько пунктов меньше (для коротких позиций — больше) назначенной цены-условия.

Если разница «Локального максимума цены» и «Цены последней сделки» больше «Отступа от max», то Тейк-профит породит заявку на продажу по формуле =

«цена последней сделки» - «защитный спрэд»

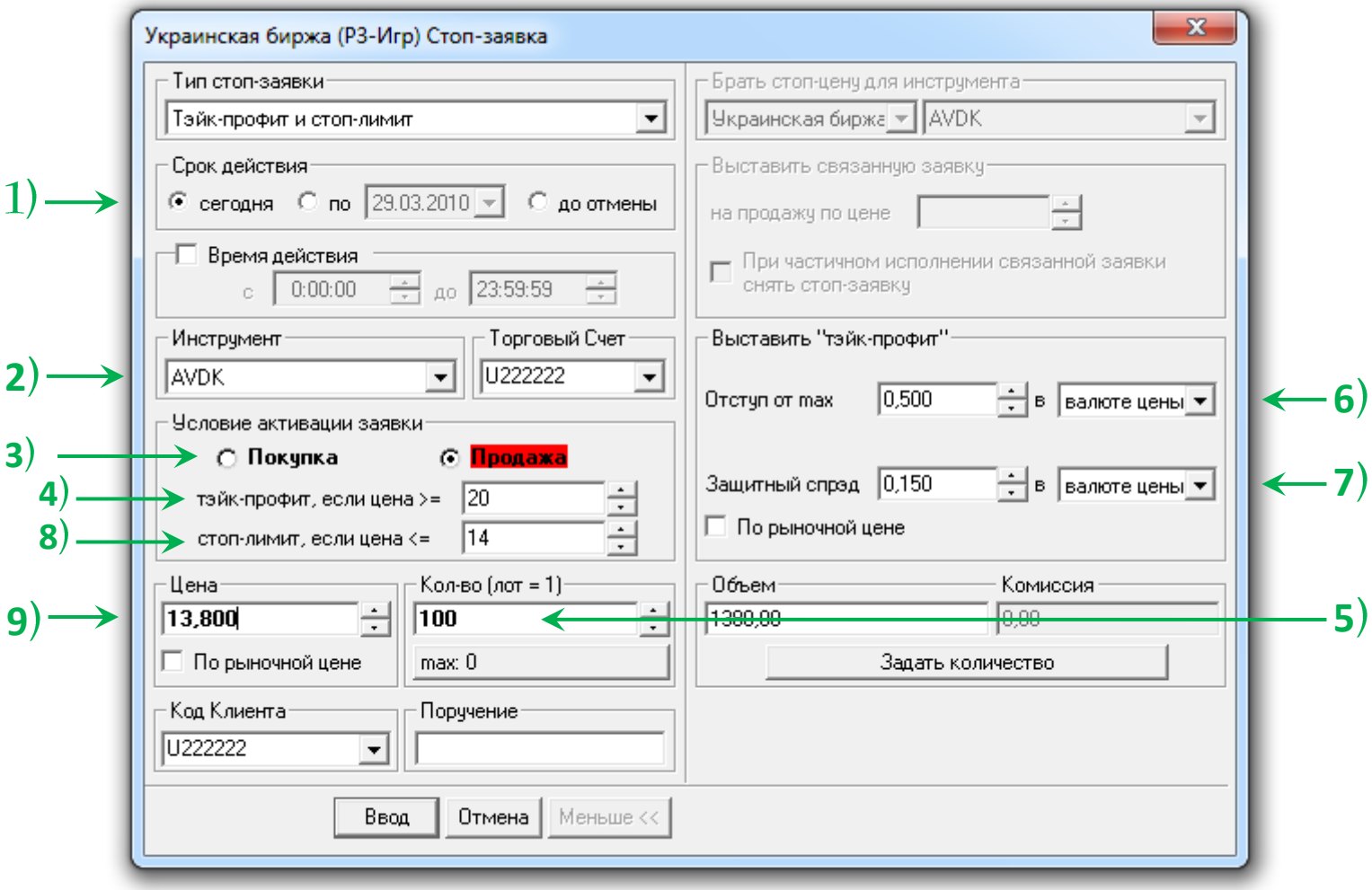
Тип стоп-заявки: Тэйк-Профит и стоп-лимит

Описание: Это заявка, имеющая два условия:

- *«тэйк-профит»,* если цена последней сделки после достигнутого максимума ухудшится на величину, превышающую установленный «отступ».
- *«стоп-лимит»,* если цена последней сделки ухудшится до указанного уровня.

В случае срабатывания одного из условий – прекращается проверка второго условия стоп-заявки. Одно из условий заявки можно не указывать. Если одновременно удовлетворены оба условия заявки, то заявка исполнится по условию «тэйк-профит».

Назначение: Фиксация максимальной прибыли с одновременным ограничением величины убытков.



Алгоритм выставления заявки «Тэйк-профит и стоп-лимит»:

1) Устанавливаем срок длительности - до которого будет существовать Стоп-Заявка.
   (*в течении текущего дня* / до определённой даты / *без срока окончания*)
2) Бумага, по которой будет выставленная заявка.
3) Покупка или продажа
4) Условие активации стоп-заявки.
   (Для нашего примера – на этой точке тэйк-профит активируется и начинает проверять, будет расти цена дальше, или нет. При этом он проверяет, не стала ли цена последней сделки по бумаге ниже чем разница «локальный максимум цены»-«отступ от max»)
5) Количество ЦБ
6) «Отступ от max» - этот параметр указывает, насколько ниже/выше локального максимума цены может стать цена последней сделки.
7) «Защитный спрэд» — насколько больше/меньше цены срабатывания тэйк-профита будет цена порожденной им лимитированной заявки на покупку/продажу.

Если разница «Локального максимума цены» и «Цены последней сделки» больше «Отступа от max», то Тейк-профит породит заявку по формуле =

«текущая цена последней сделки» - «защитный спрэд»

8) Если цена последней сделки ухудшится до указанного уровня, то вы ставится заявка по цене в п.9
9) Цена выставляемой заявки по срабатыванию условия стоп-лимита.