

An aerial photograph of a city skyline at sunset. The sky is a mix of orange, yellow, and blue. In the foreground, several tall, modern skyscrapers are visible, some with glass facades reflecting the light. The city extends into the distance, with a river or canal visible on the left side. A large red graphic element is overlaid on the right side of the image, containing the title and date.

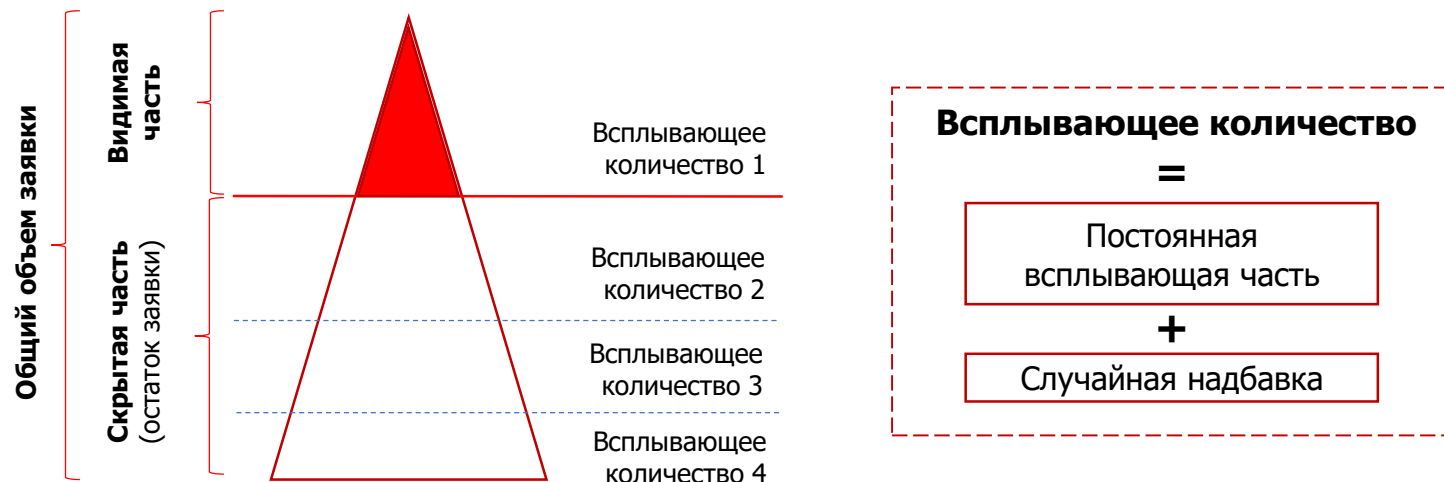
ЗАЯВКА ТИПА «АЙСБЕРГ»

27 ЯНВАРЯ 2023

ОПИСАНИЕ, ЦЕЛИ СОЗДАНИЯ

Айсберг-заявка – безадресная лимитированная заявка, в которой указывается общее количество контрактов и их «видимое количество».

- ✓ Айсберг-заявка позволяет скрыть от рынка (в стакане) определенную часть своего объема, для того чтобы **минимизировать влияние на рыночную цену** крупных относительно рынка заявок.
- ✓ При подачи Айсберг-заявки Клиент задаёт общий объем заявки и объем **постоянной всплывающей** части. Когда видимая часть полностью исполняется в рынке, «всплывает» следующая часть. Она попадает в конец очереди того же ценового уровня.
- ✓ **Гарантийное обеспечение** блокируется под полный объем заявки.



ПАРАМЕТРЫ АЙСБЕРГ-ЗАЯВКИ

В параметрах заявки Клиент дополнительно указывает:

Подтип заявки	Айсберг
Общий объем заявки <i>FullAmount</i>	Общее количество контрактов
Объем постоянной всплывающей части или процент от общего объема заявки <i>DiscloseConstAmount</i> или <i>DiscloseConstAmount%</i>	Значение видимой части. Не меньше минимально допустимого в зависимости от базового актива (<i>MinAmount</i>) и не больше общего объема заявки. $DiscloseConstAmount = Round(FullAmount * DiscloseConstAmount\%/100, 0)$ $MinAmount \leq DiscloseConstAmount \leq FullAmount$
Амплитуда отклонения в процентах для случайной надбавки <i>VarianceAmount</i> или <i>VarianceAmount%</i>	Значение надбавки для всплывающей части – случайная величина с равномерным распределением из диапазона: $VarianceAmount = Round(DiscloseConstAmount * VarianceAmount\%/100, 0)$ $DiscloseRandomAmount = [-VarianceAmount; VarianceAmount]$ $0 \leq VarianceAmount\% \leq VarianceLimit\%$, где <i>VarianceLimit%</i> заданный параметр. По умолчанию VarianceAmount% = 0% , т. е. случайная надбавка отсутствует.

АЛГОРИТМ ИСПОЛНЕНИЯ АЙСБЕРГ-ЗАЯВКИ

Айсберг-заявка исполняется в несколько этапов, пока остаток заявки («скрытая» часть) больше всплывающей части:



Видимое количество на i -м шаге – меньше из:

- Суммы постоянной всплывающей части (задается при подаче Айсберг-заявки) и случайной надбавки (определяется независимо на каждом шаге, по умолчанию = 0);
- «Остатка» Айсберг-заявки после $(i - 1)$ этапов исполнения Айсберг-заявки.

$DiscloseAmount_i = \text{Min} (DiscloseConstAmount + DiscloseRandomAmount_i; \text{«остаток»}),$

где «остаток» = $FullAmount - \sum_{m=1}^{i-1} DiscloseAmount_m,$

причем для $i = 1: \sum_{m=1}^{i-1} DiscloseAmount_m = 0, \text{«Остаток»} = FullAmount$

ОТОБРАЖЕНИЕ ОБЪЁМА

В шлюзе

Новые поля
(видны только
в своих сделках)

Поле	Описание
public_amount	Объем видимой части в операции
public_amount_rest	Неисполненный объем видимой части
private_amount	Объем айсберга в операции
private_amount_rest	Неисполненный общий объем айсберга

В терминале

private_amount_rest public_amount_rest public_amount_rest private_amount_rest

Свои покупки: скрытые	Свои покупки	Покупка: количество	Цена	Продажа: количество	Свои продажи	Свои продажи: скрытые
			118 490	182		
			118 480	58		
			118 470	77		
			118 460	50		
			118 450	43		
			118 440	66		
			118 430	164	100	900
			118 420	47		
		4	118 410			
		123	118 400			
		105	118 390			
		59	118 380			
		149	118 370			
		60	118 360			
		67	118 350			
		78	118 340			

ИДЕНТИФИКАТОРЫ ЗАЯВКИ

Новые поля

	public_order_id	public_amount	public_amount_rest	Public_action	price	dir	private_order_id	private_amount	private_amount_rest	private_action	client_code	comment
1. Подача заявки айсберг	100	50	50	1	312	1	100	400	400	1	OD01123	iceberg
	101	10	10	1	312	1	10	10	10	1	PJ99888	
	102	80	80	1	310	2	250	80	80	1	FS01020	
2. Матчинг 1-й видимой части	100	50	0	2	312	1	100	50	350	2	OD01123	iceberg
	102	50	30	2	310	2	103	50	30	2	FS01020	
	101	1	0	2	312	1	101	1	0	2	PJ99888	
	102	1	29	2	310	2	103	1	29	2	FS01020	
3. Всплытие 2-й видимой части	103	50	50	1	312	1	100	50	350	3	OD01123	iceberg
4. Матчинг 2-й видимой части	103	29	21	2	312	1	100	29	321	2	OD01123	iceberg
	102	29	0	2	310	2	103	29	0	2	FS01020	
5. Снятие заявки айсберг	103	21	0	0	312	1	100	321	0	0	OD01123	iceberg

ТРАНЗАКЦИИ CANCEL И MOVE ДЛЯ ЗАЯВКИ АЙСБЕРГ

Cancel - удаление	по public_order_id	снимается весь айсберг (видимая и скрытая части)	Ошибка, если видимая часть исполнилась (даже если весь айсберг не исполнился)
	по private_order_id	снимается весь айсберг (видимая и скрытая части)	Ошибка, если весь айсберг исполнился
Move - изменение (только по цене)	по public_order_id	Изменяется весь айсберг (видимая и скрытая части)	Ошибка, если видимая часть исполнилась (даже если весь айсберг не исполнился)
	по private_order_id	Изменяется весь айсберг (видимая и скрытая части)	Ошибка, если весь айсберг исполнился

МИНИМАЛЬНЫЙ ОБЪЁМ ВСПЛЫВАЮЩЕЙ ЧАСТИ

- Айсберг-заявка доступна по всем инструментам и для всех Клиентов.
- Сбор по Айсберг-заявкам считается посделочно с учетом скальперской скидки, как обычная заявка.
- Биржей устанавливается минимальный объем всплывающей части Айсберг-заявки.

Базовый актив	Тип инструмента	Минимальный объем всплывающей части (в контрактах)
Si	F	500
RTS	F	150
BR	F	300
SBRF	F	250
ED	F	400
Eu	F	200
GAZR	F	250
GOLD	F	200
*	*	100

*Если базовый актив и/или тип инструмента не указаны в таблице, то применяется значение **

ИНТЕРФЕЙС В ТОРГОВОМ ТЕРМИНАЛЕ (ДЕМО-ВЕРСИЯ)

Order type section with 'iceberg' selected. A red box highlights the 'Qty' button in the 'Disclose' field.

Справа актуальный вид интерфейса

При нажатии на кнопку напротив Disclose надпись на ней меняется с «Qty» на «%». И соответственно поле Disclose воспринимается как проценты от «Quantity» (или FullAmount).

Order type section with 'айсберг' selected. The 'Disclose' field shows '1,00%'.

ОТЧЕТЫ

- В отчеты fordlog, oordlog добавляются поля <private_amount>, <private_amount_rest> и <private_id_ord>, а также соответствующий бит в поле <xstatus>. Новые поля заполняются только для Айсберг-заявок.
- В отчеты errlog добавляется поле <private_amount>, а также соответствующий бит в поле <xstatus>. Заполняется только для Айсберг-заявок.