

Роботы на бирже

В Москве прошла конференция «Роботы в биржевой торговле», организованная агентством DERIVATIVE EXPERT при поддержке НАУФОР

На конференции выступили ведущие эксперты в области алгоритмической торговли и создания торговых роботов. Ежегодное мероприятие привлекло широкий круг участников, среди которых ведущие разработчики алгоритмических торговых систем; специалисты-интеграторы из IT-подразделений инвестиционных компаний и банков, а также начинающие «роботехники».

Информационные технологии на фондовом рынке приобретают все большее значение. Это демонстрируют не только различные данные о бурном росте алгоритмической торговли, но и такие мероприятия, как конференция «Роботы в биржевой торговле», прошедшая при платиновом спонсорстве РТС. Один из участников конференции отметил качественное изменение состава участников по сравнению с прошлогодним мероприятием: «Уровень знаний/опыта/наработок меня шокировал. Такое впечатление, что наработки для Plaza II есть, как минимум, у каждого четвертого из присутствующих, и, наверное половина разработчиков топ-100 роботов на текущем ЛЧИ (конкурс РТС «Лучший частный инвестор», — прим. ред.) были там».

Сергей Замолоцких, директор департамента инфраструктурных проектов РТС (фото сверху),

выступил с обзором того, что было сделано биржей за последнее время.

В докладе **Виталия Курбаковского**, директора по операциям на открытом рынке ЗАО «Математика финансов», было наглядно продемонстрировано, как классическая модель оценки опционов Блэка-Шоулза модифицирована для более адекватного отражения рынков, и на основе этой идеи спроектирован робот в программе Excel, который три года подряд эффективно работал на рынке.

Роман Гагарский, генеральный директор ООО «Когнитивные Финансовые Технологии», за пять минут показал, как с помощью специальных кнопок в «Live Trade Professional» можно написать робота, имея налицо три сущности — открытие, закрытие и манименеджмент.

Три докладчика рассмотрели различные аспекты изменения ситуации на отечественном рынке

алгоритмической торговли в связи с выходом на него крупных зарубежных компаний.

Георгий Заря, senior sales executive Otkritie Securities Limited (фото внизу), указал на ряд особенностей работы западных компаний, среди которых диверсификация стратегий и рынков, мощное и современное оборудование, готовность работать на сравнительно небольших доходностях.

Ярослав Миронов, менеджер по развитию бизнеса Orc Software, продемонстрировал забавный слайд-фильм про двух мышат: «Сложность против скорости, борьба алгосистем на американском рынке». Один из персонажей — Джон из американского инвестиционного банка с кучей долларов, а второй — Вася, частный трейдер из России. Аналогичные рыночные идеи приходят в их головы одновременно, 1 января. Но дальнейшая реализация впоследствии приносит нашему Васе прибыль в 9,5 тыс. долларов, в то время как инвестиционный банк Джона терпит убытки на 410 тыс. долларов. Вывод: любому Васе вполне по силам бодаться с крупняком.

Дмитрий Бондарь, директор ООО «А-Лаб», объяснил, почему один и тот же робот, попав в руки разных людей-трейдеров, показывает совершенно разные результаты. Он не согласился с Ярославом Мироновым, отметив, что Васе осталось недолго бодаться с крупняком, поэтому свою нишу он видит в разработке полуавтоматов для дискретных трейдеров. □

