

Функциональные характеристики экземпляра ПО «LOR / ЛОП»

Цели и задачи платформы

Платформа предназначена анализа сделок и котировок финансовых инструментов в формате L2 orderbook.

Прогноз может быть использован как для ручной, так и для автоматической торговли. ПО «LOR / ЛОП» анализирует биржевые данные фьючерсов и опционов на фьючерсы на срочном рынке ПАО «Московская Биржа» и предсказывает цены опционов в краткосрочной перспективе.

Платформа позволяет решать задачи:

- расчета цен опционов на основании модели Блэка-Шоулза и синтетических моделей оценки стоимости
- краткосрочного прогноза цен опционов CALL/PUT по всем страйкам
- анализа риска опционной позиции
- оценки стоимости опционной позиции
- расчета объема дельта-хэджа опционной позиции
- анализа параметров биржевых маркет-мейкерских программ

Затрачиваемые ресурсы для работы

- сервер с Unix-дистрибутивом

Для компиляции требуется:

Процессор

Не менее 4 ядер, частота не менее 2GHz

Оперативная память

Не менее 4 ГБ

Дисковое пространство

Не менее 2 ГБ.

Размер дискового пространства для запуска ПО зависит от размера обрабатываемых данных

Операционная система

Ubuntu 20.04

Вводная информация

В качестве вводной информации ПО использует биржевую информацию (добавление, изменение и удаление заявок, сделки), обработанную в соответствии с заданным форматом.

Выводная информация

В качестве выводной информации ПО возвращает расчёт профитности ценовых котировок опционной серии. Данные расчёты могут быть использованы как для отправки заявок вида «снять остаток», так и для выставления лимитных заявок на покупку/продажу опционов.