

УДК 004.42

**МЕХАНИЗМ НЕПРЕРЫВНОЙ ПУБЛИКАЦИИ ДОСТОВЕРНЫХ ЦЕН
ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ В СИСТЕМЕ АЛГОРИТМИЧЕСКОЙ
ТОРГОВЛИ**

Глотов М.А. (НИУ ИТМО)

**Научный руководитель – д. физ.-мат. н., профессор Университета ИТМО Шполянский
Ю.А.
(ITIVITI)**

В данном докладе рассматривается разработка и реализация механизма для непрерывной публикации достоверных цен финансовых инструментов в системе алгоритмической торговли, у которого должна быть оптимальная архитектура с минимальными временными задержками, а также удобный и понятный для пользователя графический интерфейс.

Введение. В настоящий момент существующие механизмы непрерывной публикации достоверных цен финансовых инструментов имеют довольно сложную и неудобную архитектуру при их применении для большого количества финансовых инструментов. В частности проблема заключается в отсутствии автоматизации процесса настройки механизма для каждого отдельного инструмента.

Основная часть. В данной работе представлено решение, в основе которого заложен подход шаблонной настройки механизма таким образом, чтобы для инструментов, например, находящихся в одной группе, можно было настроить механизм непрерывной публикации достоверных цен задавая определенные параметры и условия для всех выбранных инструментов разом.

Выводы. Данный подход был успешно внедрен и протестирован в системе алгоритмической торговли Tbricks by ITIVITI. Результаты показали, что применение данного подхода позволяет сократить настройку тысячи инструментов до настройки всего нескольких десятков шаблонов.

Глотов М.А. (автор)

Подпись

Шполянский Ю.А. (научный руководитель)

Подпись