



UNITED TRADERS

UT PROP SCALPING

Система обучения профессиональных трейдеров

Лекция #3



UNITED TRADERS

Электронный трейдинг

Long и Short сделки

Ордера

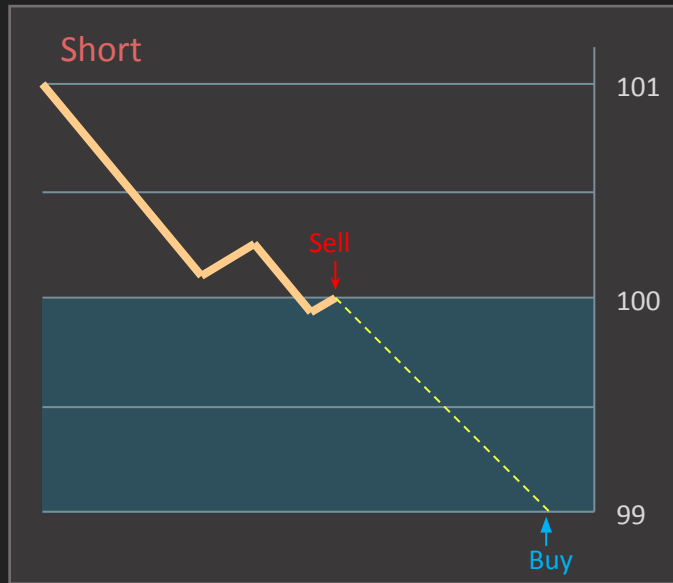
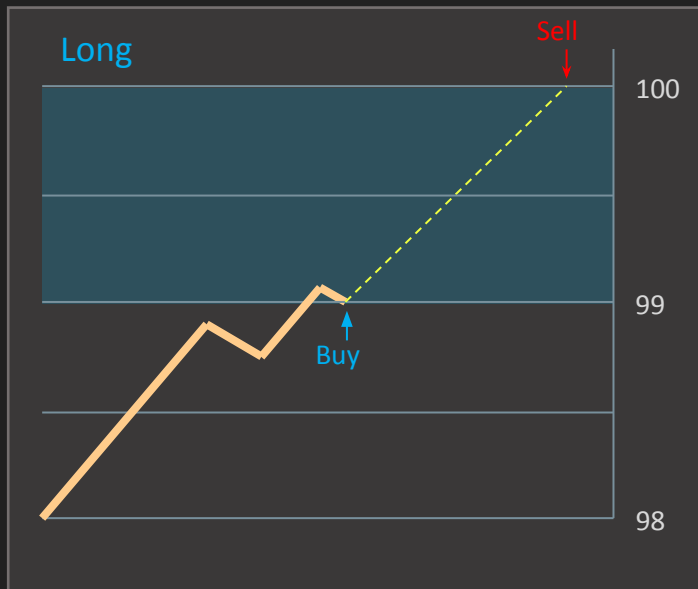
Добавление и удаление ликвидности

Введение в Level II и Time & Sales



UNITED TRADERS

Long и Short сделки



(Цена продажи - Цена покупки) x Объем = Прибыль/Убыток

Long
(Цена выхода - Цена входа) x Объем = Прибыль/Убыток

Short
(Цена входа - Цена выхода) x Объем = Прибыль/Убыток

$$(100 - 99) \times 1 = +1 \$$$

Level II (Стакан) и Time&Sales



UNITED TRADERS

Заявки на покупку

Заявки на продажу

Лента принтов

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	7.00	15			
4.00	8	8.00	7			
3.00	10	9.00	10			
2.00	9	10.00	11			
1.00	6	11.00	8			

Price – цена заявки

Size – количество акций



UNITED TRADERS

Ордера

Market - требование немедленно исполнить приказ по любой возможной цене и в полном объеме. **Недопустим для скальпера.**

Limit - просьба исполнить приказ по указанной цене (или лучше), по возможности в полном объеме. **Идеален для скальпера.**

Stop*** - ордер (Limit или Market), отправляющийся на биржу в случае достижения ценой актива указанного в приказе значения. **Практически никогда не используется в профессиональном скальпинге.**



UNITED TRADERS

Ордера / Market

Market - требование немедленно исполнить приказ по любой возможной цене и в полном объеме. **Недопустим для скальпера.**

Buy Market 1000 Shares

Buy Market (от 0.00 до ∞) 1000 Shares

Sell Market 1000 Shares

Sell Market (от 0.00 до ∞) 1000 Shares

Ордера / Market



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 10 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки



UNITED TRADERS

Ордера / Market

Покупатели

Buy 5.00 10 sh
Buy 4.00 10 sh
Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh
Sell 7.00 25 sh
Sell 8.00 15 sh



Time & Sales		
#	Price	Size

Позиции		
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки

Ордера / Market

Покупатели

Buy 5.00 10 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 22 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки
Long	15	6.00

Ордера / Market



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 10 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 22 sh

Market Sell 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки
Long	15	6.00

Ордера / Market



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 4.00 5 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 22 sh

Time & Sales

#	Price	Size
3	4.00	5
2	5.00	10
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	30	--	-19.95

Цена покупки: 6.00
Ср. цена продажи:
 $(5.00 * 10 + 4.00 * 5) / 15 = 4.67$

Результат:
 $(4.67 - 6.00) * 15 = -19.95$



UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Limit - просьба исполнить приказ по указанной цене (или лучше), по возможности в полном объеме. **Идеален для скальпера.**

Buy Limit 99.00 1000 Shares **Buy Limit** (99.00 и ↓) (от 0 до 1000) Shares

Sell Limit 99.00 1000 Shares **Sell Limit** (99.00 и ↑) (от 0 до 1000) Shares

Ордера / Limit



UNITED TRADERS

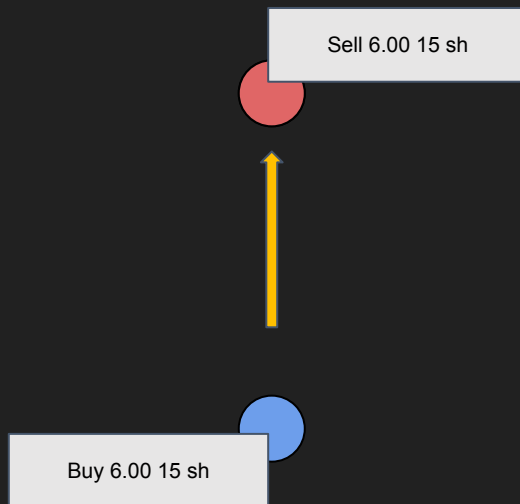
Sell 6.00 15 sh

Time & Sales		
#	Price	Size

Ордера / Limit

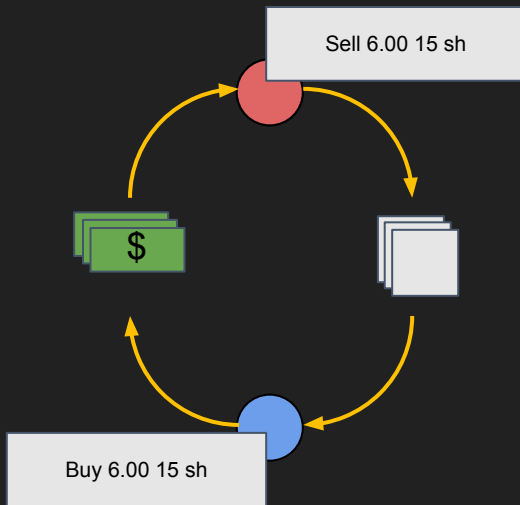


UNITED TRADERS



Time & Sales		
#	Price	Size

Ордера / Limit

[illegible]

Ордера / Limit



UNITED TRADERS



Time & Sales		
#	Price	Size
1	6.00	15

Ордера / Limit



UNITED TRADERS

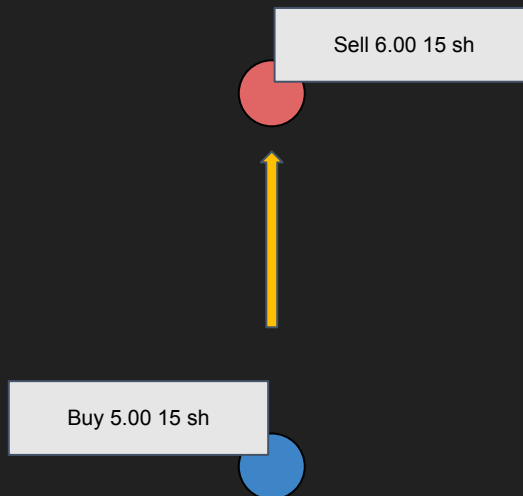
Sell 6.00 15 sh

Time & Sales		
#	Price	Size

Ордера / Limit



UNITED TRADERS



Time & Sales		
#	Price	Size



Buy 5.00 15 sh

Time & Sales		
#	Price	Size

Ордера / Limit



UNITED TRADERS

Buy 5.00 15 sh



Sell 6.00 15 sh



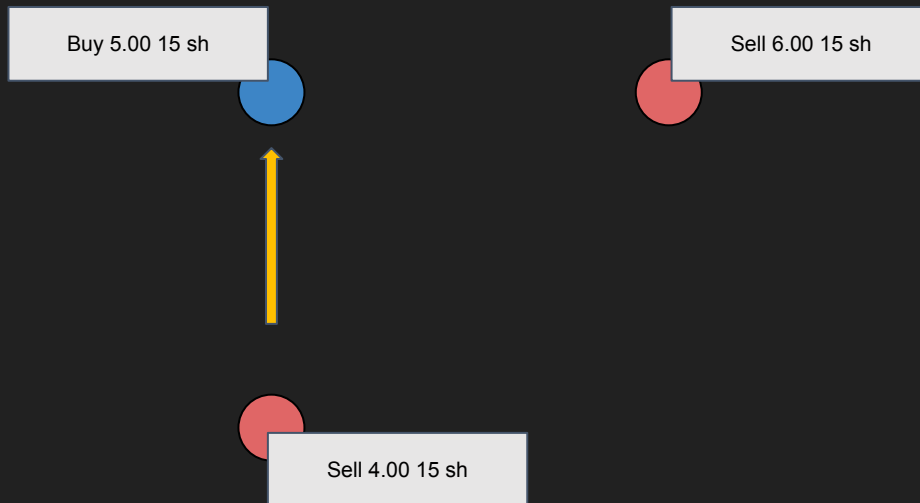
Time & Sales

#	Price	Size

Ордера / Limit

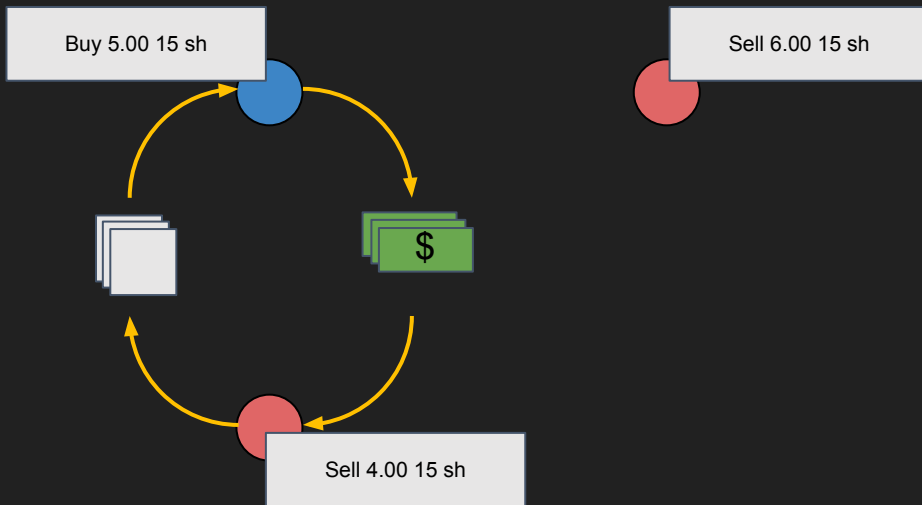


UNITED TRADERS



Time & Sales		
#	Price	Size

Ордера / Limit

[illegible]

Ордера / Limit



UNITED TRADERS



Sell 6.00 15 sh



Time & Sales		
#	Price	Size
1	5.00	15

Ордера / **Limit** / Порядок исполнения заявок



UNITED TRADERS

1

Buy 3.00 5 sh

Покупатели

Buy 3.00 5 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh



UNITED TRADERS

Ордера / **Limit** / Порядок исполнения заявок

1

Buy 3.00 5 sh

2

Buy 4.00 10 sh

Покупатели

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 5 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh




Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh



UNITED TRADERS

Ордера / **Limit** / Порядок исполнения заявок








1	Buy 3.00 5 sh	
2	Buy 4.00 10 sh	
3	Buy 5.00 5 sh	

Покупатели		Продавцы	
Buy 5.00 5 sh			Sell 6.00 15 sh
Buy 4.00 10 sh			Sell 7.00 25 sh
Buy 3.00 5 sh			Sell 8.00 15 sh






UNITED TRADERS



Ордера / Limit / Порядок исполнения заявок

1	Buy 3.00 5 sh	
2	Buy 4.00 10 sh	
3	Buy 5.00 5 sh	
4	Buy 3.00 6 sh	
5	Buy 3.00 4 sh	
6	Buy 5.00 2 sh	
7	Buy 5.00 8 sh	

Покупатели

Buy 5.00 15 sh	
Buy 4.00 10 sh	
Buy 3.00 15 sh	

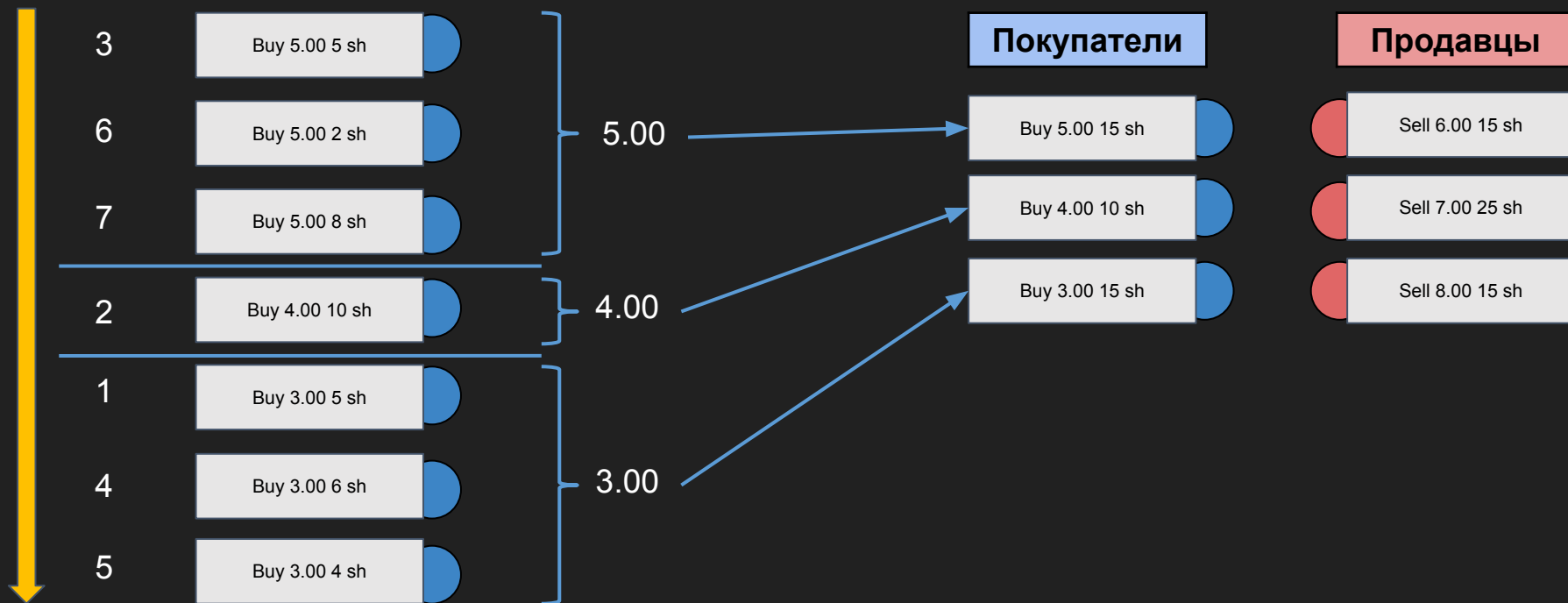
Продавцы

Sell 6.00 15 sh	
Sell 7.00 25 sh	
Sell 8.00 15 sh	



UNITED TRADERS

Ордера / Limit / Порядок исполнения заявок



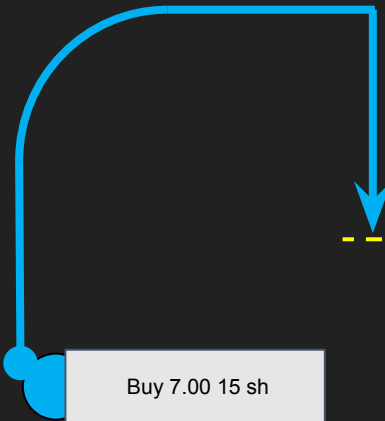


UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 5.00 15 sh
Buy 4.00 10 sh
Buy 3.00 25 sh



Продавцы

Sell 6.00 15 sh
Sell 7.00 25 sh
Sell 8.00 15 sh

Time & Sales		
#	Price	Size

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	-15.00

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Цена покупки: 6.00

Цена продажи: 5.00

Результат: $(5.00 - 6.00) * 15 = -15$



UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 5.00 15 sh
Buy 4.00 10 sh
Buy 3.00 25 sh



Buy 6.00 5 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh
Sell 8.00 15 sh
Sell 9.00 22 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	-15.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 6.00 5 sh

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 22 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	0.00

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Цена покупки: 6.00

Цена продажи: 6.00

Результат: $(6.00 - 6.00) * 15 = 0.00$



UNITED TRADERS

Ордера / Limit



Time & Sales		
#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 6.00 5 sh

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 7.00 15 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 22 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	0.00

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	15	7.00

Ордера / Limit



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 6.00 5 sh

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Продавцы

Sell 7.00 40 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 22 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	0.00

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	15	7.00

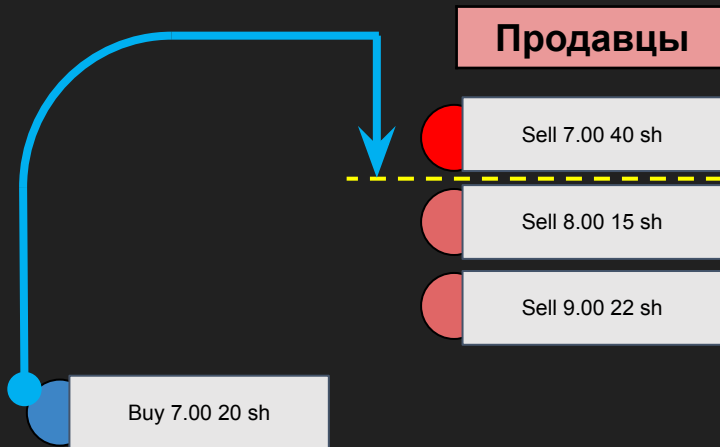


UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 6.00 5 sh
Buy 5.00 15 sh
Buy 4.00 10 sh



Time & Sales		
#	Price	Size
1	6.00	15

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	15	7.00



UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 6.00 5 sh

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Продавцы

Sell 7.00 20 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 22 sh

Time & Sales

#	Price	Size
2	7.00	20
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	0.00

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	15	7.00



UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 6.00 5 sh
Buy 5.00 15 sh
Buy 4.00 10 sh



Продавцы

Sell 7.00 20 sh
Sell 8.00 15 sh
Sell 9.00 22 sh

Time & Sales		
#	Price	Size
2	7.00	20
1	6.00	15

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	15	7.00



UNITED TRADERS

Ордера / Limit

Покупатели

Buy 6.00 5 sh

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Продавцы

Sell 8.00 10 sh

Sell 9.00 22 sh

Sell 10.00 12 sh

Time & Sales

#	Price	Size
4	8.00	5
3	7.00	20
2	7.00	20
1	6.00	15

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	30	--	15

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Цена покупки: 6.00

Цена продажи: 7.00

Результат: $(7.00 - 6.00) * 15 = 15$



UNITED TRADERS

Ордера

Market - требование немедленно исполнить приказ по любой возможной цене и в полном объеме. **Недопустим для скальпера.**

Limit - просьба исполнить приказ по указанной цене (или лучше), по возможности в полном объеме. **Идеален для скальпера.**

Stop*** - ордер (Limit или Market), отправляющийся на биржу в случае достижения ценой актива указанного в приказе значения. **Практически никогда не используется в профессиональном скальпинге.**

Добавление и удаление ликвидности



UNITED TRADERS

Добавление ликвидности

Level II				Time & Sales			Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size	BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size				Price	Size	Price	Size			
5.00	10	7.00	15				5.00	15▲+5	7.00	15			
4.00	8	8.00	7				4.00	8	8.00	7			
3.00	10	9.00	10				3.00	10	9.00	10			
2.00	9	10.00	11				2.00	9	10.00	11			
1.00	6	11.00	8				1.00	6	11.00	8			
Позиции						Позиции							
Сторона сделки			Цена сделки			Сторона сделки			Цена сделки				
Ордера						Ордера							
Сторона ордера			Цена ордера			Сторона ордера			Цена ордера				
						Buy			5.00				

Добавление и удаление ликвидности



UNITED TRADERS

Удаление ликвидности

Level II				Time & Sales			Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size	BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size				Price	Size	Price	Size			
5.00	10	7.00	15				5.00	5 ▼ ⁻⁵	7.00	15	1	5.00	5
4.00	8	8.00	7				4.00	8	8.00	7			
3.00	10	9.00	10				3.00	10	9.00	10			
2.00	9	10.00	11				2.00	9	10.00	11			
1.00	6	11.00	8				1.00	6	11.00	8			
Позиции						Позиции							
Сторона сделки			Цена сделки			Сторона сделки			Цена сделки				
						Short			5.00				
Ордера						Ордера							
Сторона ордера			Цена ордера			Сторона ордера			Цена ордера				

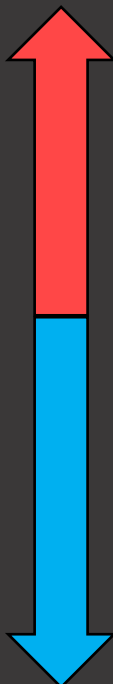
Добавление и удаление ликвидности



UNITED TRADERS

Buy

A S K	11.00	8
	10.00	11
	9.00	10
	8.00	7
	7.00	15
	6.00	0
	5.00	10
	4.00	8
	3.00	10
	2.00	9
	1.00	6



Удаление ликвидности

Best ASK

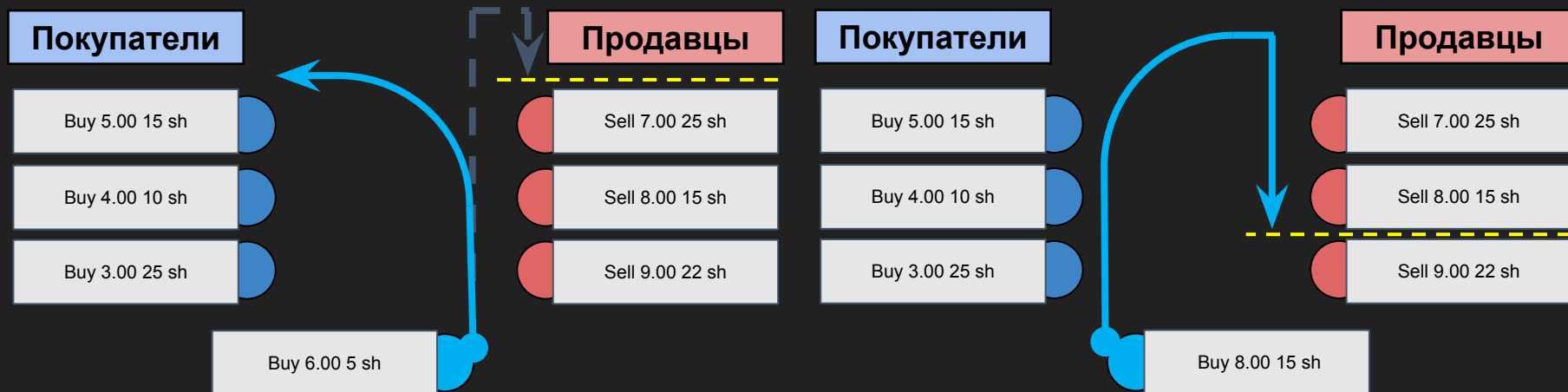
Добавление ликвидности

Level II			
BID		ASK	
Price	Size	Price	Size
5.00	10	7.00	15
4.00	8	8.00	7
3.00	10	9.00	10
2.00	9	10.00	11
1.00	6	11.00	8

Добавление и удаление ликвидности



UNITED TRADERS



Добавление и удаление ликвидности



UNITED TRADERS

Sell

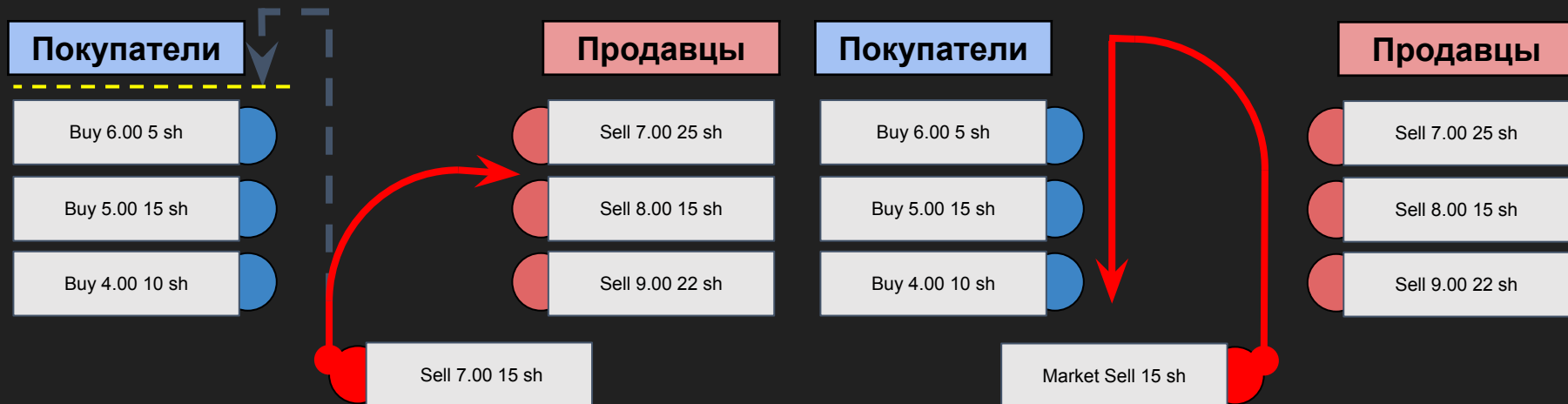
	11.00	8		Добавление ликвидности	
	10.00	11			
	9.00	10			
	8.00	7			
	7.00	15			
	6.00	0			
	5.00	10			
	4.00	8			
	3.00	10			
	2.00	9			
B I D	1.00	6		Удаление ликвидности	
	Best BID				

Level II			
BID		ASK	
Price	Size	Price	Size
5.00	10	7.00	15
4.00	8	8.00	7
3.00	10	9.00	10
2.00	9	10.00	11
1.00	6	11.00	8

Добавление и удаление ликвидности



UNITED TRADERS



Добавление и удаление ликвидности



UNITED TRADERS

	Добавление ликвидности	Удаление ликвидности
Все участники	+ заявка в стакане	- заявка в стакане принт в ленте принтов
Треjder	открытый ордер	изменение в окне позиций
Контрагент (вторая сторона)	--	исполнение ордера изменение в окне позиций

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

-5

Sell 6.00 10 sh

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	5

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

-5

Sell 6.00 10 sh

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	5

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 20 sh

Time & Sales

#	Price	Size
2	6.00	10
1	6.00	5

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

-20

Sell 7.00 5 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 20 sh

Time & Sales

#	Price	Size
3	7.00	20
2	6.00	10
1	6.00	5

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 10 sh

-5

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 7.00 5 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 20 sh

Time & Sales

#	Price	Size
4	5.00	5
3	7.00	20
2	6.00	10
1	6.00	5

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 5.00 10 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

+15

Sell 6.00 15 sh

Sell 7.00 5 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
4	5.00	5
3	7.00	20
2	6.00	10
1	6.00	5

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Buy 2.00 30 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh

Sell 7.00 5 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
5	5.00	10
4	5.00	5
3	7.00	20
2	6.00	10
1	6.00	5

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 4.00 5 sh

-5

Buy 3.00 25 sh

Buy 2.00 30 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh

Sell 7.00 5 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
6	4.00	5
5	5.00	10
4	5.00	5
3	7.00	20
2	6.00	10

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 3.00 25 sh

Buy 2.00 30 sh

Buy 1.00 60 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh

Sell 7.00 5 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
7	4.00	5
6	4.00	5
5	5.00	10
4	5.00	5
3	7.00	20

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 3.00 25 sh

Buy 2.00 30 sh

Buy 1.00 60 sh

Продавцы

Sell 4.00 10 sh

Sell 5.00 15 sh

Sell 6.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
7	4.00	5
6	4.00	5
5	5.00	10
4	5.00	5
3	7.00	20

Time & Sales



UNITED TRADERS

Покупатели

Buy 3.00 25 sh

Buy 2.00 30 sh

Buy 1.00 60 sh

Продавцы

-5

Sell 4.00 5 sh

Sell 5.00 15 sh

Sell 6.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size
8	4.00	5
7	4.00	5
6	4.00	5
5	5.00	10
4	5.00	5



UNITED TRADERS

Level II

Time & Sales

BID

ASK

Price

Size

Price

Size

#

Price

Size

5.00

10

6.00

15

4.00

8

7.00

7

3.00

10

8.00

10

2.00

9

9.00

11

1.00

6

10.00

8

Пример №1

Задача: купить 5 акций по цене 6.00

Сторона сделки

Объем сделки

Цена сделки

Результат

Стоимость

Ордера

Сторона ордера

Объем ордера

Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	15			
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
BUY 5 Shares
Limit Order 6.00



Мы решили купить 5 акций по цене 6.00.

Позиции				
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат	Стоимость

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	10 ▼ ⁻⁵	1	6.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
BUY 5 Shares
Limit Order 6.00
Rem. Liquidity



Отправили ордер: BUY 5 Shares Limit Order Rem Liquidity.
 В ленте проходит принт о покупке 5 акций по цене 6.00.
 Size по цене 6.00 стал 10.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	5	6.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	10	1	6.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
BUY 5 Shares
Limit Order 6.00
Rem. Liquidity



Мы получаем позицию (5 акций по цене 6.00).
Результат позиции в данный момент времени составляет
-5.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	5	6.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Level II				Time & Sales		
BID		ASK				
Price	Size	Price	Size	#	Price	Size
5.00	10	6.00	10	1	6.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Выход №1

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат	Стоимость
Long	5	6.00	-5.00	

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	10	1	6.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Выход из позиции
Отправка ордера
Sell 5 Shares
Limit Order 6.00



Мы решили продать 5 акций по цене 6.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	5	6.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	15 ▲ +5	1	6.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Выход из позиции
Отправка ордера
Sell 5 Shares
Limit Order 6.00
Add Liquidity



Отправили ордер: Sell 5 Shares Limit Order 6.00 Add Liquidity.
 Встали в уровень 5 акциями по цене 6.00.
 Size по цене 6.00 стал 15.
 У нас появился ордер на продажу 5 акций по цене 6.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	5	6.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	5	6.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	0 ▼ ⁻¹⁵	2	6.00	15
4.00	8	7.00	7	1	6.00	5
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Выход из позиции
Отправка ордера
Sell 5 Shares
Limit Order 6.00
Add Liquidity



Кто-то решил купить 15 акций по цене 6.00.
В ленте проходит принт о покупке 15 акций по цене 6.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	10 ▲ ⁺⁵	0.00	0.00 ▲ ⁺⁵

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	7.00 ▲ ⁺¹	7	2	6.00	15
4.00	8	8.00	10	1	6.00	5
3.00	10	9.00	11			
2.00	9	10.00	8			
1.00	6	11.00	15			

Выход из позиции
Отправка ордера
Sell 5 Shares
Limit Order 6.00
Add Liquidity



У нас покупают 5 акций по цене 6.00.
Котировка становится BID 5.00 и ASK 7.00.
Спред стал 2.00.
Мы закрыли сделку (Flat) с результатом 0.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	10 ▲ ⁺⁵	0.00	0.00 ▲ ⁺⁵

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Level II				Time & Sales		
BID		ASK				
Price	Size	Price	Size	#	Price	Size
5.00	10	6.00	10	1	6.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Или

Выход №2

Оформление заявки			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена заявки	Результат
Long	5	6.00	-5.00
Ордера			
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера	



UNITED TRADERS

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	10	1	6.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Кто-то решил купить 10 акций по цене 6.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	5	6.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	7.00 ▲⁺¹	7	2	6.00	10
4.00	8	8.00	10	1	6.00	5
3.00	10	9.00	11			
2.00	9	10.00	8			
1.00	6	11.00	15			

В ленте проходит принт о покупке 10 акций по цене 6.00 – уровень разобрали.
Котировка становится BID 5.00 и ASK 7.00.
Спред стал 2.00.
Пока наш результат -5.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	5	6.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
6.00▲ ⁺¹	10	7.00	7	2	6.00	10
5.00	10	8.00	10	1	6.00	5
4.00	8	9.00	11			
3.00	10	10.00	8			
2.00	9	11.00	15			

Сразу поставили новый BID 6.00
Котировка становится BID 6.00 и ASK 7.00.
И наш результат стал 0.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	5	6.00	0.00▲ ⁺⁵

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
6.00	10	7.00	12 ▲ +5	2	6.00	10
5.00	10	8.00	10	1	6.00	5
4.00	8	9.00	11			
3.00	10	10.00	8			
2.00	9	11.00	15			

Выход из позиции
Отправка ордера
Sell 5 Shares
Limit Order 7.00
Add Liquidity



Мы продаём 5 акций по цене 7.00.
 Отправили заявку: Sell 5 Shares Limit Order 7.00 Add Liquidity.
 Встали в уровень 5 акциями по цене 7.00.
 Size по цене 7.00 стал 12.
 У нас появился ордер на продажу 5 акций по цене 7.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	5	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	5	7.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
6.00	10	7.00	2 ▼ ⁻¹⁰	3	7.00	10
5.00	10	8.00	10	2	6.00	10
4.00	8	9.00	11	1	6.00	5
3.00	10	10.00	8			
2.00	9	11.00	15			

Выход из позиции



UNITED TRADERS

Кто-то решил купить 10 акций по цене 7.00.
 В ленте проходит принт о покупке 10 акций по цене 7.00.
 Size по цене 7.00 стал 2.
 У нас покупают 3 акции по цене 7.00 и результат сделки становится 3.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	8 ▲ ⁺³	6.00	3.00 ▲ ⁺³

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	2 ▼ ⁻³	7.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00 ▼ ⁻¹	10	6.00 ▼ ⁻¹	5	4	6.00	10
4.00	8	7.00	2	3	7.00	10
3.00	10	8.00	10	2	6.00	10
2.00	9	9.00	11	1	6.00	5
1.00	6	10.00	8			

Выход из позиции



UNITED TRADERS

Вдруг, кто-то решил продать 10 акций по цене 6.00. В ленте проходит принт о продаже 10 акций по цене 6.00 – уровень “выносят”.
Котировка становится BID 5.00 и ASK 6.00.
Результат позиции становится 1.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	8	6.00	1.00 ▼ ⁻²

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	2	7.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00 ▼ ⁻¹	10	6.00 ▼ ⁻¹	5	4	6.00	10
4.00	8	7.00	2	3	7.00	10
3.00	10	8.00	10	2	6.00	10
2.00	9	9.00	11	1	6.00	5
1.00	6	10.00	8			

Выход из позиции



UNITED TRADERS

Вдруг, кто-то решил продать 10 акций по цене 6.00. В ленте проходит принт о продаже 10 акций по цене 6.00 – уровень “выносят”.
Котировка становится BID 5.00 и ASK 6.00.
Результат позиции становится 1.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	8	6.00	1.00 ▼ ⁻²

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	2	7.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	5	4	6.00	10
4.00	8	8.00 ▲ ⁺¹	10	3	7.00	10
3.00	10	9.00	11	2	6.00	10
2.00	9	10.00	8	1	6.00	5
1.00	6	11.00	18			

Выход из позиции



Отменили ордер о продаже 2 акций по цене 7.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	8	6.00	1.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	8 ▼ ⁻²	6.00	5	5	5.00	2
4.00	8	8.00	10	4	6.00	10
3.00	10	9.00	11	3	7.00	10
2.00	9	10.00	8	2	6.00	10
1.00	6	11.00	18	1	6.00	5

Выход из позиции
Отправка ордера
Sell 2 Shares
Limit Order 5.00



Мы продаём оставшиеся акции (2) по цене 5.00, чтобы не понести убытки.
 Мы закрыли сделку с результатом 1.00.
 Купил 5 акций по 6.00
 Продали 3 акции по 7.00 и 2 акции по 5.00
 Ср. цена выхода 6.2

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	10 ▲ ⁺²	0.00	1.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Level II

Time & Sales

BID

ASK

Price

Size

Price

Size

#

Price

Size

5.00

10

6.00

15

4.00

8

7.00

7

3.00

10

8.00

10

2.00

9

9.00

1

1.00

6

10.00

8

Пример №2

Short/Sell

Сторона сделки

Объем сделки

Цена сделки

Результат

Ордера

Сторона ордера

Объем ордера

Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	15			
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
Short 5 Shares
Limit Order 5.00



Мы продаём 5 акций по цене 5.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	5 ▼ ⁻⁵	6.00	15	1	5.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
Short 5 Shares
Limit Order 5.00
Rem. Liquidity



Отправили ордер: SHORT 5 Shares Limit Order Rem Liquidity.
 В ленте проходит принт о продаже 5 акций по цене 5.00.
 Size по цене 5.00 стал 5.
 Мы получаем позицию (5 акций по цене 5.00).
 Результат позиции пока что составляет: -5.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	5	5.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	5	6.00	15	1	5.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Выход из позиции
Отправка ордера
Buy 5 Shares
Limit Order 3.00



Мы решили выйти (“откупить обратно”) 5 акций по цене 3.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	5	5.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	5	6.00	15	1	5.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	15 ▲+5	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Выход из позиции
Отправка ордера
Buy 5 Shares
Limit Order 3.00
Add. Liquidity



Для этого мы отправили заявку: Buy 5 Shares Limit Order 3.00 Add. Liquidity. Встали в уровень 5 акциями по цене 3.00.

Size по цене 3.00 стал 15.

У нас появился ордер на покупку 5 акций по цене 3.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	5	5.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Buy	5	3.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	5	6.00	15	1	5.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	15	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Выход из позиции
Отправка ордера
Buy 5 Shares
Limit Order 3.00
Add. Liquidity



Кто-то решил продать 30 акций:

- 5 акций по цене 5.00
- 8 акций по цене 4.00
- 15 акций по цене 3.00
- 2 акции по 2.00

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	5	5.00	-5.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Buy	5	3.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
2.00 ▼ ⁻³	7 ▼ ⁻²	6.00	15	5	2.00	2
1.00	6	7.00	7	4	3.00	15
		8.00	10	3	4.00	8
		9.00	11	2	5.00	5
		10.00	8	1	5.00	5

Выход из позиции

Отправка ордера

Buy 5 Shares

Limit Order 3.00

Add. Liquidity



UNITED TRADERS

В ленте проходят принты о продаже 30 акций.
 Котировка становится BID 2.00 и ASK 6.00 (спред 4.00)
 Size по цене 2.00 стал 7.
 Нам продают 5 акций по цене 3.00.
 Мы закрыли сделку с результатом 10.00.
 И мы - молодцы)

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	10 ▲ ⁺⁵	0.00	10.00 ▲ ⁺¹⁵

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Level II

Time & Sales

BID

ASK

Price

Size

Price

Size

#

Price

Size

5.00

10

6.00

15

4.00

8

7.00

7

3.00

10

8.00

10

2.00

9

9.00

1

1.00

6

10.00

8

Пример №4

Market Order

Сторона сделки

Объем сделки

Сторона сделки

Объем сделки

Ордера

Сторона ордера

Объем ордера

Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	15			
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	5 ▼ ⁻⁵	6.00	15	1	5.00	5
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
Short 30 Shares Market Order



В ленте проходит принт о продаже 5 акций по цене 5.00. Size по цене 5.00 стал 5.
Мы продаём 30 акций. Но мы пока еще не учились в United Traders, потому не умеем правильно отправлять ордер(Шлём ордер “по рынку”, не разбираясь в ситуации.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
2.00 ▼ ⁻³	2 ▼ ⁻⁷	6.00	15	5	2.00	7
1.00	6	7.00	7	4	3.00	10
		8.00	10	3	4.00	8
		9.00	11	2	5.00	5
		10.00	8	1	5.00	5

Вход в позицию
Отправка ордера
Short 30 Shares Market Order



Отправляем приказ о продаже 30 акций.
В ленте проходят принт о продаже 30 акций:

- 5 акций по цене 5.00
- 8 акций по цене 4.00
- 10 акций по цене 3.00
- 7 акции по 2.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	30	3.37	-79.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
2.00 ^{▼-3}	2 ^{▼-7}	6.00	15	5	2.00	7
1.00	6	7.00	7	4	3.00	10
		8.00	10	3	4.00	8
		9.00	11	2	5.00	5
		10.00	8	1	5.00	5

Вход в позицию
Отправка ордера
Short 30 Shares Market Order



Котировка становится BID 2.00 и ASK 6.00 (спред 4.00)
 Size по цене 2.00 стал 7.
 Мы получаем позицию (30 акций по средней цене 3.37).

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	30	3.37	-79.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
2.00 ^{▼-3}	2 ^{▼-7}	6.00	15	5	2.00	7
1.00	6	7.00	7	4	3.00	10
		8.00	10	3	4.00	8
		9.00	11	2	5.00	5
		10.00	8	1	5.00	5

Как считать среднюю цену цену позиции?



UNITED TRADERS

$$2 \times 7 = 14$$

$$3 \times 10 = 30$$

$$4 \times 8 = 32$$

$$5 \times 5 = 25$$

Сумма: 101

Ср. цена входа: $101/30 = 3.37$

Результат позиции на данный момент (unrealized): -79.00.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	30	3.37	-79.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00▲ ⁺³	5▲ ⁺⁵	6.00	13▼ ⁻²	6	6.00	2
4.00	2▲ ⁺²	7.00	7	5	2.00	2
3.00	10▲ ⁺¹⁰	8.00	10	4	3.00	15
2.00	2	9.00	11	3	4.00	8
1.00	6	10.00	8	2	5.00	5

Кто-то (это могут быть несколько независимых трейдеров) решает купить 22 акции:

- 10 акций по цене 3.00
- 2 акции по цене 4.00
- 5 акций по цене 5.00
- 2 акции по цене 6.00.

В ленте проходит принт о покупке 2 акций по цене 6.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	30	3.37	-79.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	5	6.00	13	6	6.00	2
4.00	2	7.00	7	5	2.00	2
3.00	10	8.00	10	4	3.00	15
2.00	2	9.00	11	3	4.00	8
1.00	6	10.00	8	2	5.00	5

Выход из позиции

Отправка ордера

Buy 30 Shares

Market Order



UNITED TRADERS

Котировка становится BID 5.00 и ASK 6.00 (спред 1.00).
Size по цене 6.00 стал 13.

Мы, “молодые и неопытные”, покупаем 30 акций, чтобы
выйти из позиции. Но мы снова делаем это неумеючи -
“по рынку”.

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	30	3.37	-79.00

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	5	9.00▲ ⁺³	11	9	8.00	10
4.00	2	10.00	8	8	7.00	7
3.00	10	11.00	15	7	6.00	13
2.00	2	12.00	15	6	6.00	2
1.00	6	13.00	15	5	2.00	2

Выход из позиции

Отправка ордера

Buy 30 Shares
Market Order



UNITED TRADERS

Отправляем приказ на покупку 30 акций. "По рынку".
В ленте проходят принты:

- 13 акций по 6.00
- 7 акций по 7.00
- 10 акций по 8.00

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	60▲ ⁺³⁰	0.00▼ ⁻²⁷	-105.9

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	5	9.00	11	9	8.00	10
4.00	2	10.00	8	8	7.00	7
3.00	10	11.00	15	7	6.00	13
2.00	2	12.00	15	6	6.00	2
1.00	6	13.00	15	5	2.00	2

Выход из позиции

Отправка ордера

Buy 30 Shares
Market Order



UNITED TRADERS

Котировка становится BID 5.00 и ASK 9.00 (спред 4.00). Мы купили 30 акций по **средней цене 6.90** и закрыли сделку с результатом -105.90. Это печально. Ведь элементарное понимание принципов работы с ордерами избавило бы нас от такого минуса.

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	60	0.00	-105.9

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



UNITED TRADERS

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	15			
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Пример №5

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	15			
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
Sell 20 Shares
Limit Order 5.00



Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
4.00	8	5.00	10	1	5.00	10
3.00	10	6.00	15			
2.00	9	7.00	7			
1.00	6	8.00	10			
		9.00	11			

Вход в позицию
Отправка ордера
Sell 20 Shares
Limit Order 5.00



Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	10	5.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	10	5.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
4.00	8	6.00	15	1	5.00	10
3.00	10	7.00	7			
2.00	9	8.00	10			
1.00	6	9.00	11			
		10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
Cancel Sell 10 Shares
Limit Order 5.00



Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	10	5.00	-10.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	15	1	5.00	10
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера
Buy 10 Shares
Limit Order 5.00



Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Short	10	5.00	-10.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Buy	10	5.00

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
4.00	8	6.00	15	2	5.00	10
3.00	10	7.00	7	1	5.00	10
2.00	9	8.00	10			
1.00	6	9.00	11			
		10.00	8			

Вход в позицию
Отправка ордера



Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	20	0.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Домашнее задание



UNITED TRADERS

1. Long и Short сделки. Добавление и удаление ликвидности

2. Примеры

Коммиссионные сборы состоят из

- ☐ Brokerage fee + ECN + Clear + NSCC + SEC + NSDQ + NYSE
- ☐ Brokerage fee + ECN
- ☐ ECN

Какие ECN платят за добавление ликвидности

- ☐ NYSE, ARCA, NASDAQ, NASDAQ PX, EDGX, BATS
- ☐ NASDAQ BX, EDGA, BYX

Какие ECN платят за удаление ликвидности

- ☐ NYSE, ARCA, NASDAQ, NASDAQ PX, EDGX, BATS
- ☐ NASDAQ BX, EDGA, BYX

Какой индекс у рыночного центра ARCA в Level II (станок)

- ☐ ARCA
- ☐ PACX
- ☐ PA

Какой индекс у рыночного центра EDGA в Time Sales (TS)

- ☐ EDGA
- ☐ DA
- ☐ GA

Результат без учета комиссии

Выберите одно или несколько верных утверждений

- ☐ Gross
- ☐ Net
- ☐ PnL
- ☐ Fee (Комиссия)

Пример 3 (Шаг 1)

Исходные данные

Level II				Time & Sales		Позиции			
BID		ASK		#	Size	Сторона сделки	Объем сделки	Исполнение	Результат
Price	Size	Price	Size						
5.00	10	6.00	15						
4.00	8	7.00	7						
3.00	10	8.00	10						
2.00	9	9.00	11						
1.00	6	10.00	8						

Обзор			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	

Если я отправлю ордер Sell/Short Limit 5.00 5 Shares, то

- ☐ Добавлю ликвидность
- ☐ Уволю ликвидность

Time&Sales

Time & Sales			Time & Sales		
#	Price	Size	#	Price	Size
1	5.00	5	1	5.00	5

- ☐ Пройдет красный принт
- ☐ Пройдет синий принт

Time & Sales		
#	Price	Size

- ☐ Без изменений



Направление сделки

- ☐ Long
- ☐ Buy
- ☐ Sell/Short
- ☐ Short

Результат

- ☐ +1.00 \$
- ☐ -1.00 \$
- ☐ 0.00 \$

Если я отправлю ордер Buy Limit 6.00 5 Shares, то

Level II				Time & Sales		
BID		ASK		#	Price	Size
Price	Size	Price	Size			
5.00	10	6.00	15			
4.00	8	7.00	7			
3.00	10	8.00	10			
2.00	9	9.00	11			
1.00	6	10.00	8			

- ☐ Добавлю ликвидность
- ☐ Уволю ликвидность

Домашнее задание



UNITED TRADERS

НАЗАД

ОТПРАВИТЬ

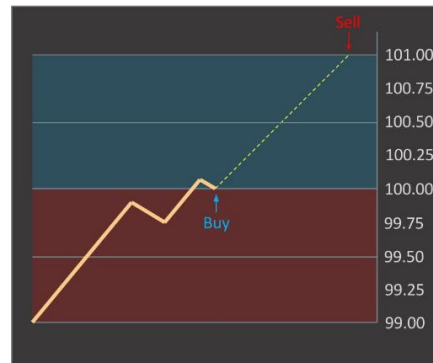
Страница 9 из 9

Long и Short сделки. Добавление и удаление ликвидности

Ответ записан.

[Посмотреть результат](#)

[Отправить ещё один ответ](#)



✓ Направление сделки

- ☒ ☐ ☐ ☐

✗ Результат

- ☐ ☐ ☐

Правильный ответ

- ☒ ☐

Покупатели

Buy 5.00 10 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 22 sh

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	-15.00

Time & Sales

#	Price	Size
1	6.00	15



UNITED TRADERS

Продавцы

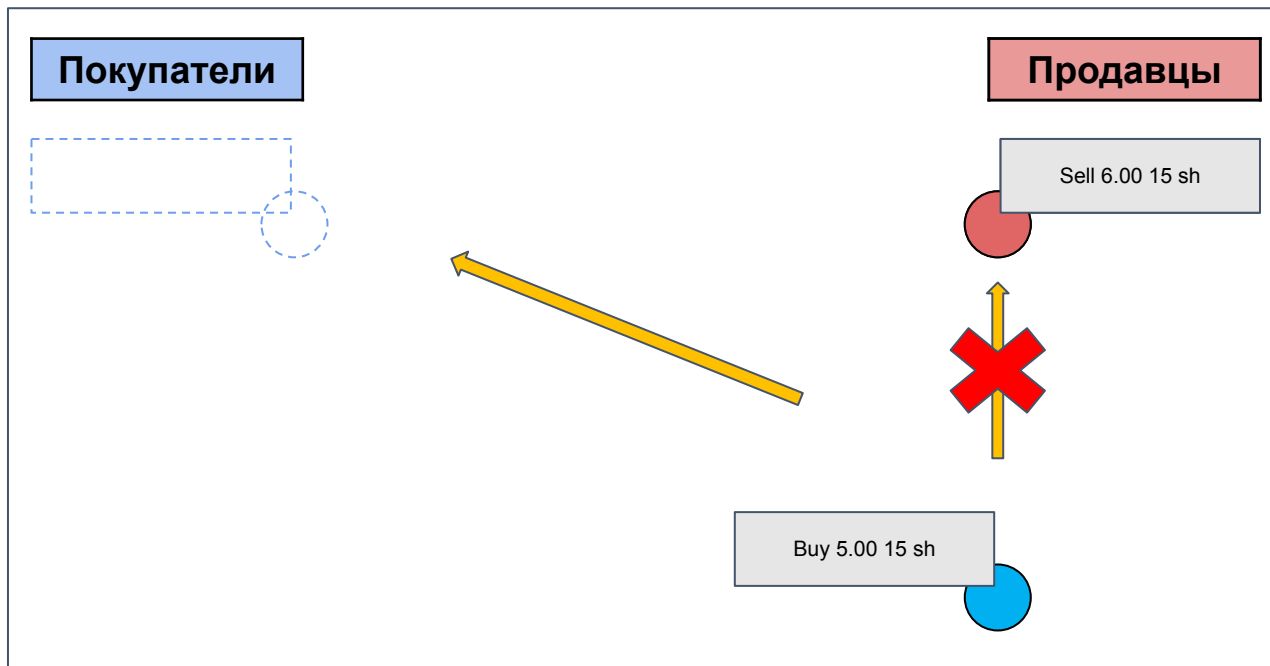
Sell 6.00 15 sh

Time & Sales

#	Price	Size



UNITED TRADERS



Time & Sales		
#	Price	Size



Limit

Покупатели

Buy 5.00 15 sh



Продавцы

Sell 6.00 15 sh



Time & Sales

#	Price	Size

Позиции

Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

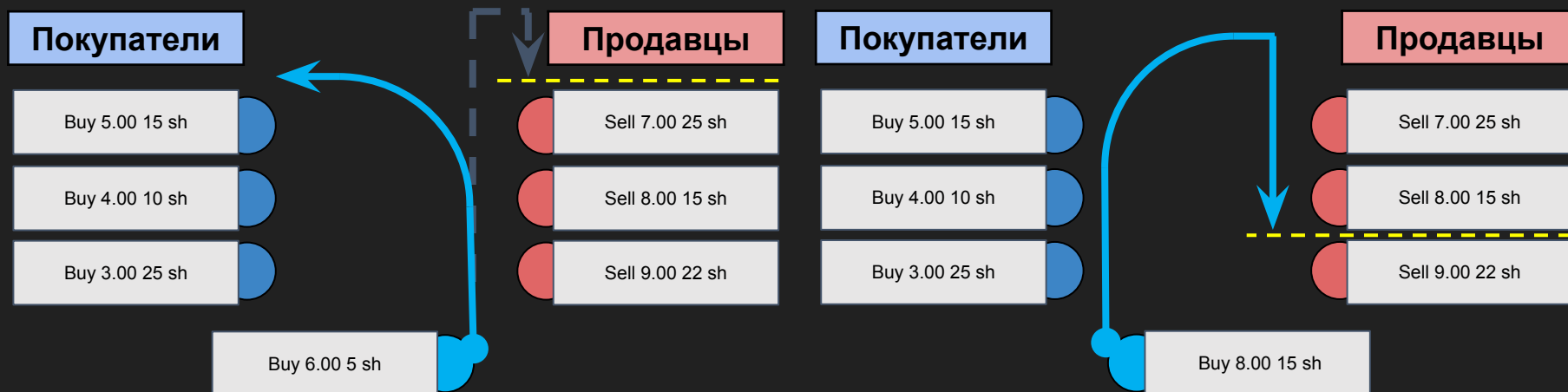
Ордера

Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Buy	5.00	15

Добавление и удаление ликвидности

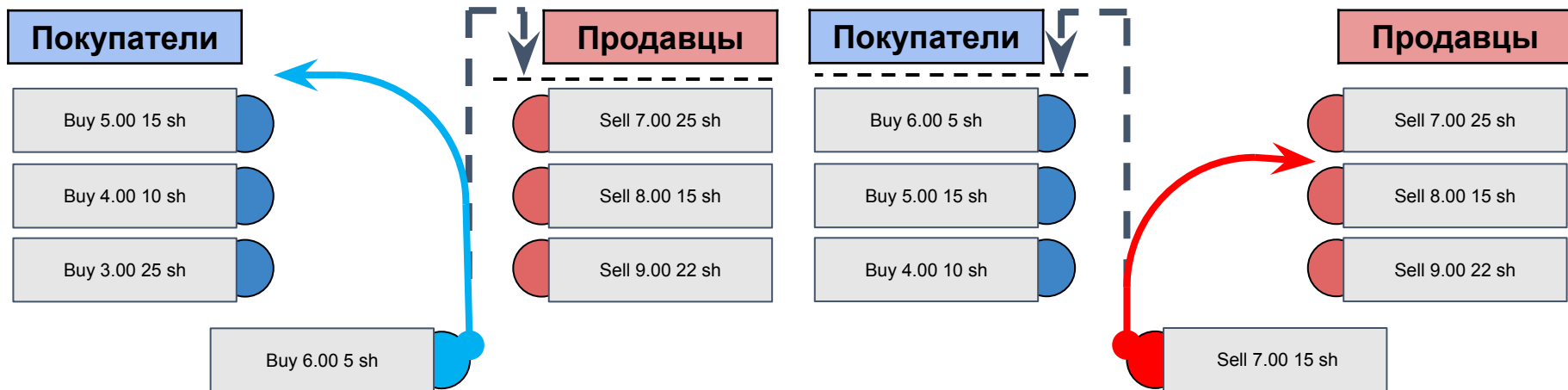


UNITED TRADERS





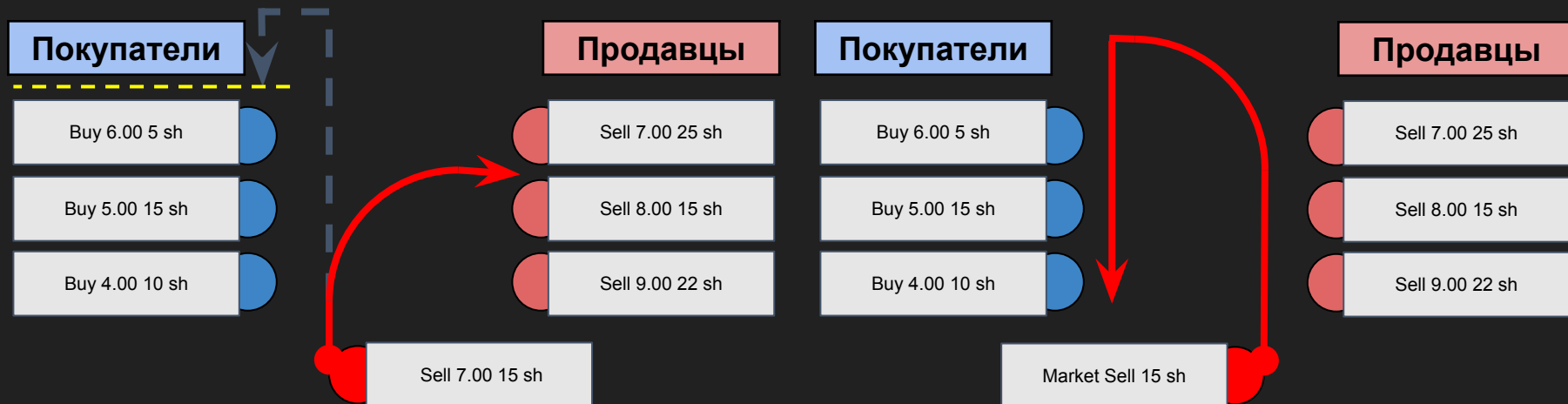
UNITED TRADERS



Добавление и удаление ликвидности

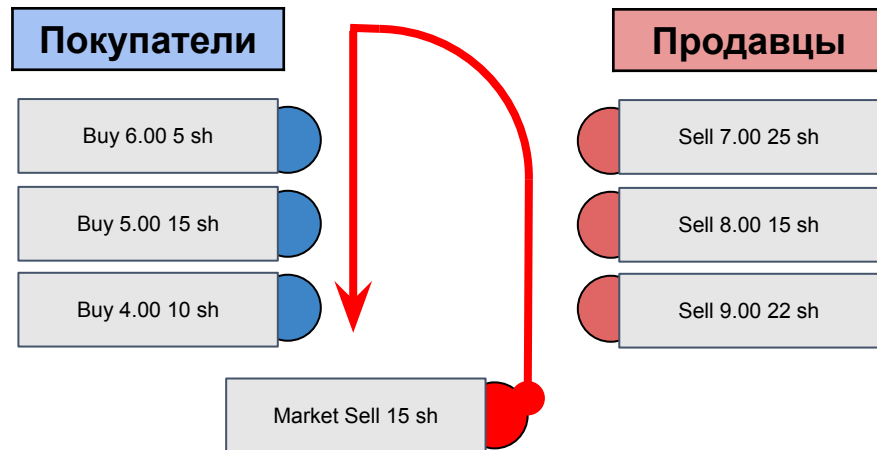
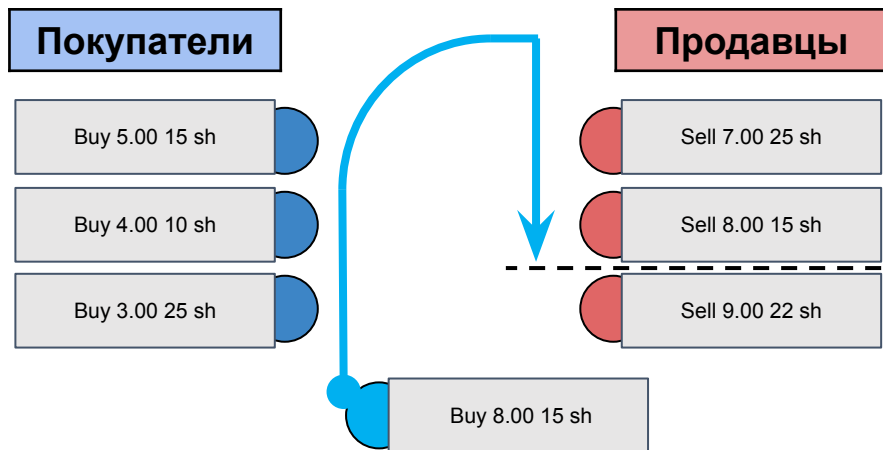


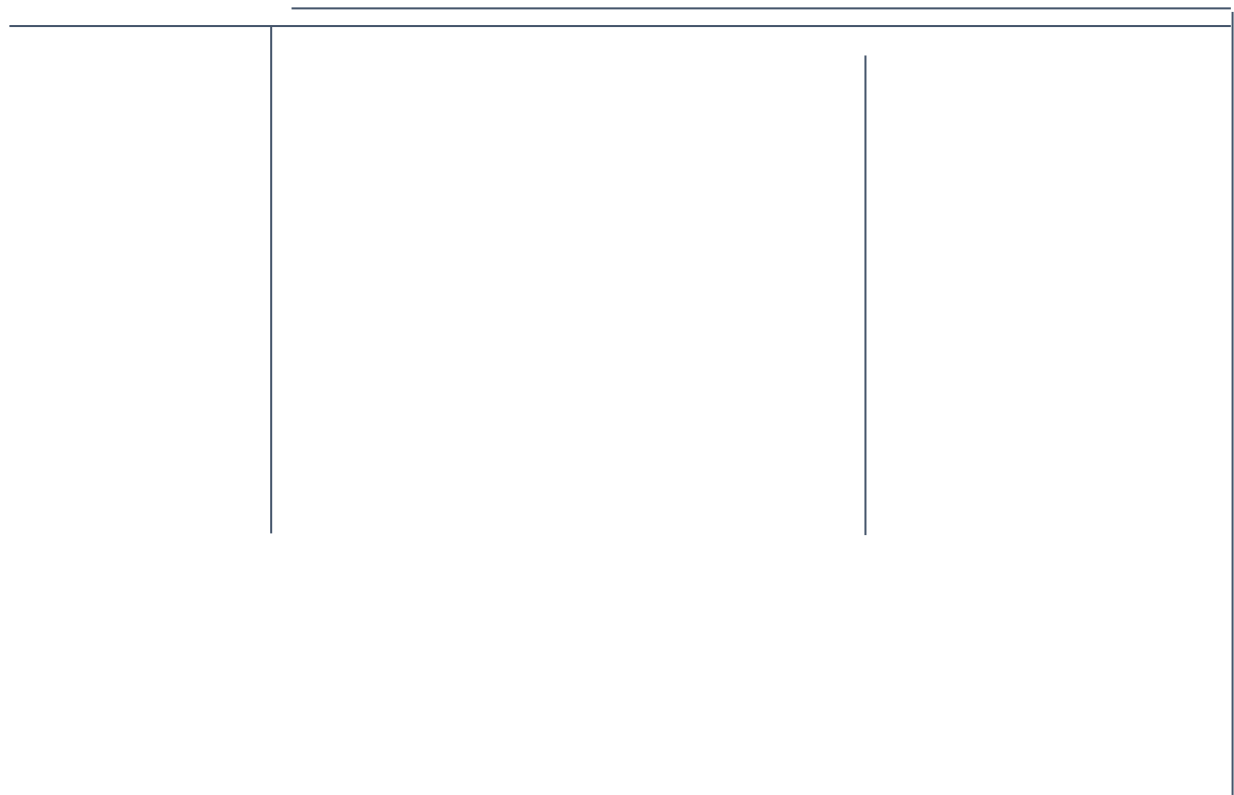
UNITED TRADERS





UNITED TRADERS





Покупатели

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Buy 3.00 25 sh

Продавцы

Sell 6.00 15 sh

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Time & Sales		
#	Price	Size

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

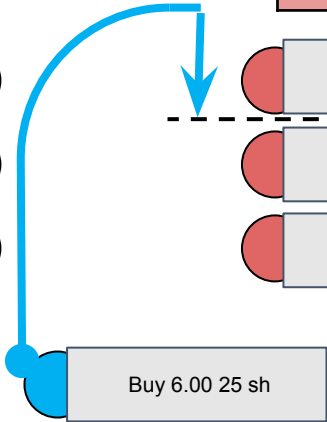
Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Покупатели

Buy 5.00 15 sh	
Buy 4.00 10 sh	
Buy 3.00 25 sh	

Продавцы

Sell 6.00 15 sh	
Sell 7.00 25 sh	
Sell 8.00 15 sh	



Time & Sales		
#	Price	Size




Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Покупатели

Buy 6.00 10 sh	
Buy 5.00 15 sh	
Buy 4.00 10 sh	

Продавцы

Sell 7.00 25 sh	
Sell 8.00 15 sh	
Sell 9.00 30 sh	

Time & Sales		
#	Price	Size
1	6.00	15




Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	15	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Buy	10	6.00

Покупатели

Buy 6.00 5 sh	
Buy 5.00 15 sh	
Buy 4.00 10 sh	

Продавцы

Sell 7.00 25 sh	
Sell 8.00 15 sh	
Sell 9.00 30 sh	

Time & Sales		
#	Price	Size
2	6.00	5
1	6.00	15

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	20	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Buy	5	6.00

Покупатели

Buy 6.00 15 sh

Buy 5.00 15 sh

Buy 4.00 10 sh

Продавцы

Sell 7.00 25 sh

Sell 8.00 15 sh

Sell 9.00 30 sh

Time & Sales		
#	Price	Size
2	6.00	5
1	6.00	15




Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	20	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Buy	5	6.00

Покупатели

Buy 6.00 10 sh	
Buy 5.00 15 sh	
Buy 4.00 10 sh	

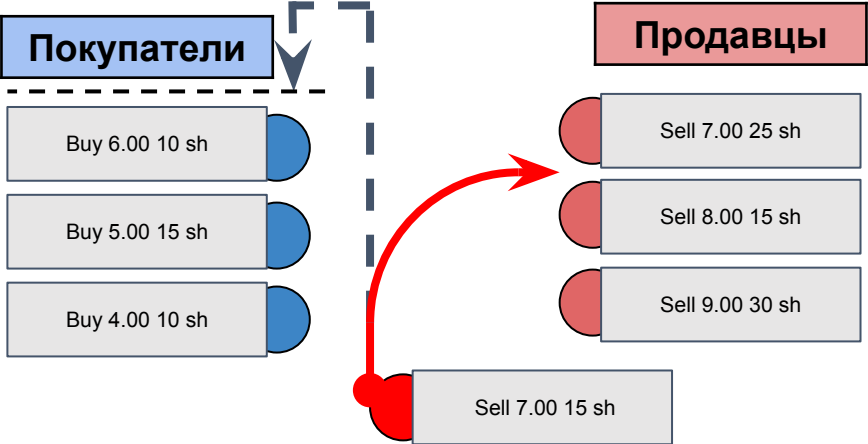
Продавцы

Sell 7.00 25 sh	
Sell 8.00 15 sh	
Sell 9.00 30 sh	

Time & Sales		
#	Price	Size
2	6.00	5
1	6.00	15

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	20	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера



Time & Sales		
#	Price	Size
2	6.00	5
1	6.00	15



Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	20	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера

Покупатели

Buy 6.00 10 sh	
Buy 5.00 15 sh	
Buy 4.00 10 sh	

Продавцы

Sell 7.00 45 sh	
Sell 8.00 15 sh	
Sell 9.00 30 sh	

Time & Sales		
#	Price	Size
2	6.00	5
1	6.00	15



Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	20	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	20	7.00

Покупатели

Buy 6.00 10 sh	
Buy 5.00 15 sh	
Buy 4.00 10 sh	

Продавцы

Sell 7.00 25 sh	
Sell 8.00 15 sh	
Sell 9.00 30 sh	

Time & Sales		
#	Price	Size
3	7.00	20
2	6.00	5
1	6.00	15

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Long	20	6.00	0.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера
Sell	20	7.00

Покупатели

Buy 6.00 10 sh	
Buy 5.00 15 sh	
Buy 4.00 10 sh	

Продавцы

Sell 8.00 15 sh	
Sell 9.00 30 sh	
Sell 10.00 20 sh	

Time & Sales		
#	Price	Size
4	7.00	25
3	7.00	20
2	6.00	5
1	6.00	15

Позиции			
Сторона сделки	Объем сделки	Цена сделки	Результат
Flat	40	--	20.00

Ордера		
Сторона ордера	Объем ордера	Цена ордера