

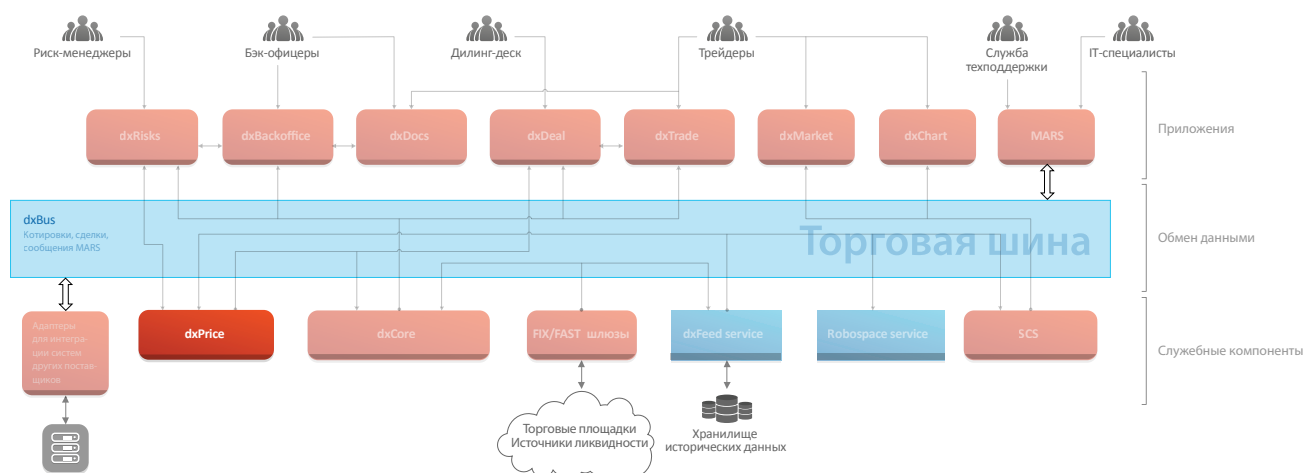


ЭКСПЕРТ СИСТЕМА

Автоматизация брокерской, биржевой и финансовой деятельности

dxPrice

Опционным рынкам часто не хватает ликвидности в определенных страйк-ценах, поэтому вопрос об определении рыночной цены или приемлемой цены покупки здесь часто бывает очень актуальным. Уникальная технология dxPrice позволяет выявлять лучшую цену опционного контракта в любом доступном потоке рыночных данных.





ЭКСПЕРТ СИСТЕМА

Автоматизация брокерской, биржевой и финансовой деятельности

Технология dxPrice может быть использована в различных приложениях, решающих, например, такие задачи, как увеличение пропускной способности каналов рыночных данных, закрытие торгового дня, маркет-мейкинг.

Цены выбираются из целого потока ставок, заявок и предложений доступных для опционной серии. В результате цены для всей серии становятся равными, безарбитражными, при этом, они отражают реальную рыночную ситуацию. Также важной особенностью является универсальность этого алгоритма, благодаря чему эта технология может применяться для всех типов инструментов.

Основные характеристики

- Ровные цены и кривые волатильности;
- Безарбитражные цены для всей опционной серии;
- Лучшие предложения по цене из доступных на рынке;
- Эффективная работа как на рынках с низкой, так и с высокой ликвидностью, а также в случае падения рынка;
- Может использоваться в режиме реального времени.

