

Marktüberwachung, Volatilitätsprognose und algorithmischer Handel

Marktüberwachung, Volatilitätsprognose und algorithmischer Handel

Marktüberwachung

- Gemäß der Marktmissbrauchsverordnung (“Market Abuse Regulation” – MAR) müssen “Persons Professionally Arranging or Executing Transactions” (PPAETs) potentielle Verstöße gegen die MAR (Insider Handel, Marktmanipulation oder Marktmissbrauch) überwachen. Die Überwachung muss durch Maßnahmen, Systeme und Verfahren erfolgen, die in Bezug auf die Art und die Größe des Handelsbetriebs angemessen und verhältnismäßig sind.

Volatilitätsprognose

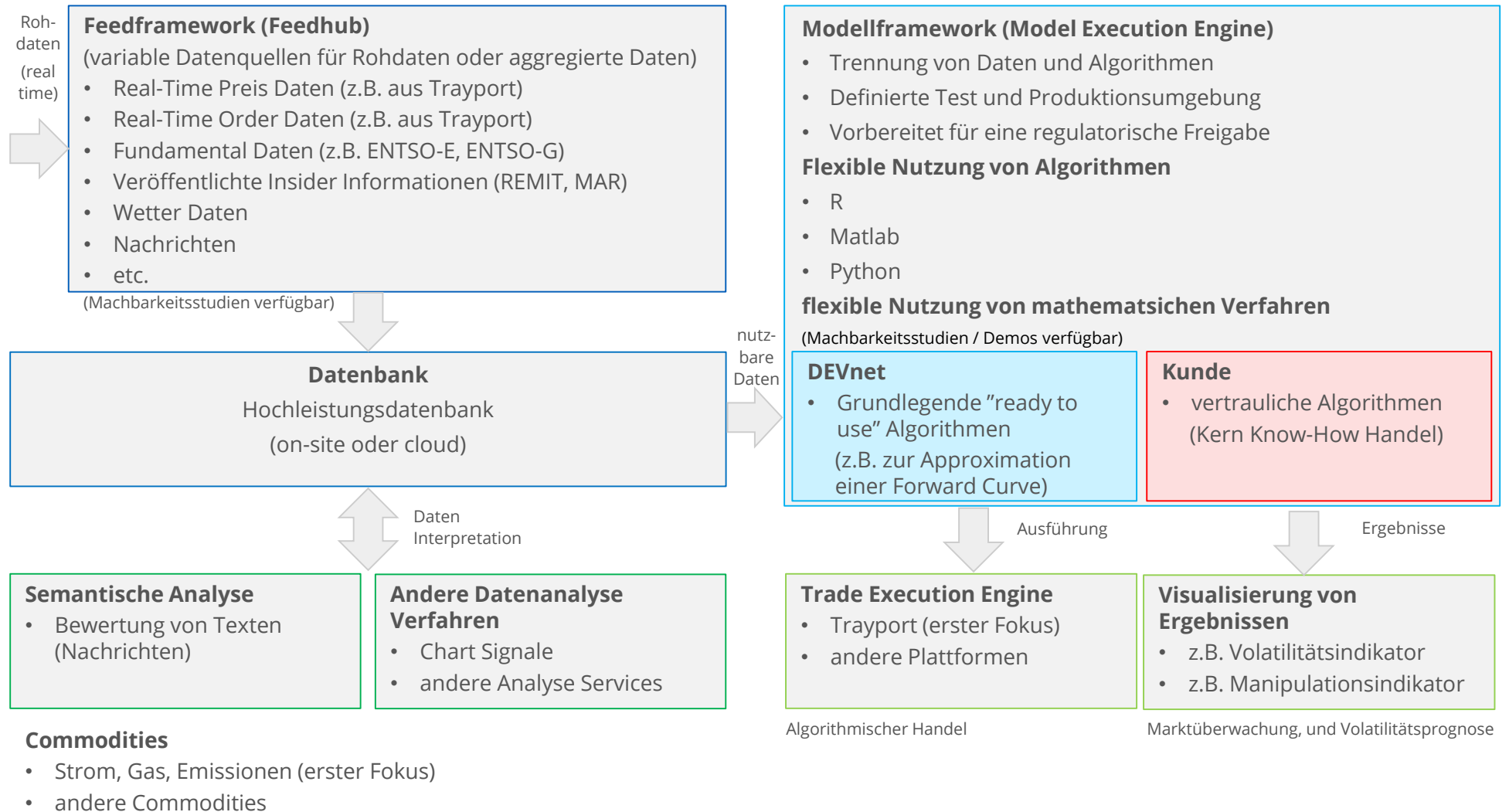
- Angebote im Energiemarkt haben oft längere Bindefristen. Kurzfristige Volatilitätsprognosen können das Risiko, dass Angebote in Zeiten höherer Volatilität aus dem Geld oder aus dem Markt sind reduzieren.

Algorithmischer Handel

- Algorithmischer Handel im Energiebereich (Strom, Gas und Emissionen) nimmt zu. Die Zahl der über API angebundenen automatisierten Handelsapplikationen an der EPEX Spot hat in den letzten zwei Jahren signifikant zugenommen und sich alleine in den letzten sechs Monaten verdoppelt.

Die analytischen und mathematischen Ansätze sind in allen Bereichen sehr ähnlich. Grundkomponenten können für verschiedene Zwecke eingesetzt werden.

DEVnet Werkzeuge und Vision zu Marktüberwachung, Volatilitätsprognose und algorithmischem Handel



Marktüberwachung, Volatilitätsprognose und algorithmischer Handel

DEVnet Erfahrung

- Erfahrung in der Dekodierung von Orderbuchdaten auf EUREX / XETRA (Aktien, ETFs, Derivate) und Trayport (Energie)
- Stream Analytics Erfahrung
- Starkes kdb+ Team
- Erfahrung in der Architektur großer Systeme
- Mathematische, quantitative Erfahrung / Know-How (z.B. Dr. in Stochastik und Dr. in Statistik)
- Fähigkeit große Datenmengen zu handhaben

Möglichkeiten für technische Lösungen

- Cloud Solution (Stream analytics (Microsoft Azure) oder Google Cloud platform) oder on-premise Lösung
- Kombination von hdb (historical database) und rdb (realtime database)
- Massgeschneidete Lösungen oder Nutzung verfügbarer Bibliotheken auf Basis von C / C++, Python, oder Java



Ihre Ansprechpartner

Dr. Florian Reithinger
Principal Consultant

Mobile: +49 171 9781834
E-mail: f.reithinger@devnet.de



Markus Weber
Principal Consultant

Mobile: +49 171 2032844
E-mail: m.weber@devnet.de