Парадоксальные движения бумаг США в начале торгов 1 августа

Сегодня в начале торгов трейдеры всего мира стали свидетелями парадоксального поведения таких акций, как PFE, T, BAC, S и т.д.

По этим акциям одновременно ставились заявки по рынку на покупку и продажу с разницей в 1 цент.

Согласно сообщениям брокеров ошибка была вызвана тем, что алгоритмы банка Goldman Sachs «сломались» из-за ошибки в даркпулах брокера Knight Kapital.

Согласно сообщениям брокеров **работа даркпулов Knight Capital была нарушена**, из-за чего некоторое время наблюдалась **задержка в обработке полученных от участников рынка заявок**.

UPD: на рынке пошли слухи, что, возможно, у самих Knight Capital был алгоритм, который должен был выполнить некие действия за 5 дней, но по ошибки выполнил за 5 мин.

UPD2: из-за этой ошибки у Knight Capital сегодня **за первый час** торгов по некоторым бумагам **был проторгован просто фантастический объем**:
GOV — **1973%** среднедневного объема, **PL** - **1063%**, **MTZ** - **747%**, **EXG**- **672%**, **N** - **578%**, **B** - **518%** (остальные бумаги из этого списка в комментариях Анатолия Радченко ниже).

UPD 3: ***Возможно, ошибки в алгоритмах работы даркпулов Knight Capital связаны с тем, что сегодня вступили в силу новые правила на биржах NYSE и Nasdaq, согласно которым простые трейдеры могут выставлять заявки по акциям с интервалом в одну тысячною доллара.***

Побробнее о новом правиле тут:
traderupdates.nyse.com/2012/07/nyse_and_nyse_mkt_retail_liqui_1.html

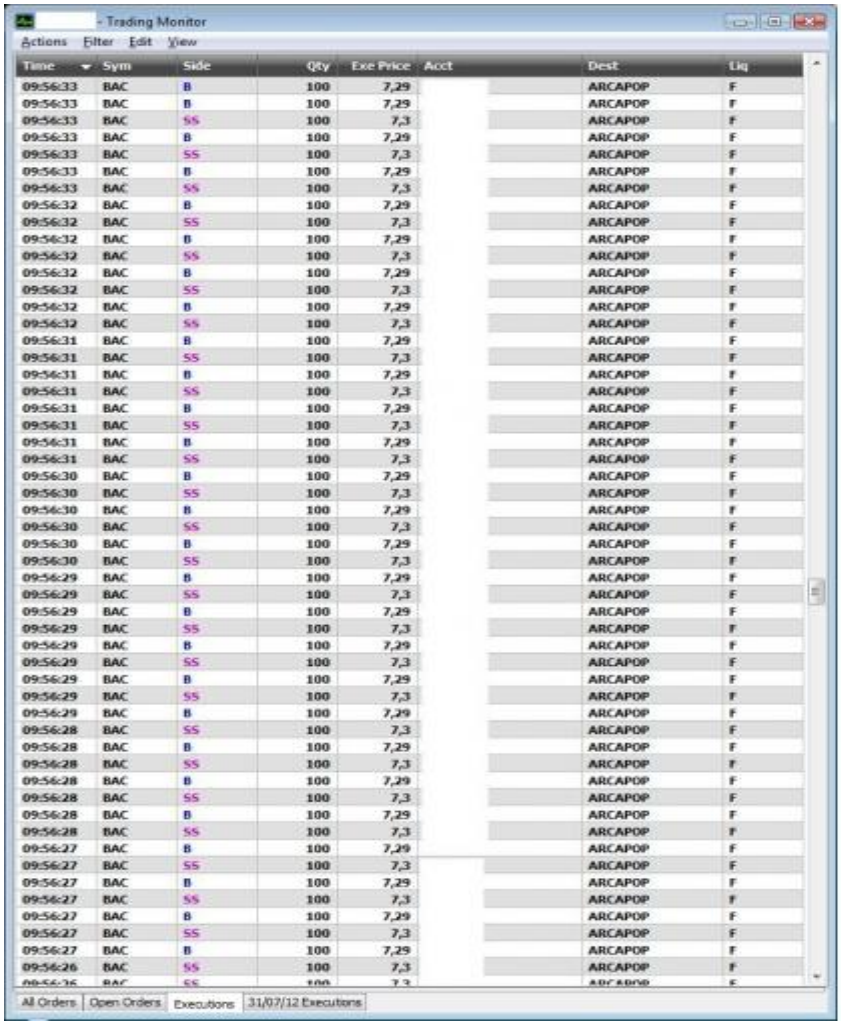
Вот как это выглядело на акциях компании AT&T:



Такая же ситуация наблюдалась и по акциям Pfeizer (PFE):



Самые шустрые успели на этом заработать — вот пример сделок одного из наших трейдеров на акциях Bank of America (BAC):



Time	Sym	Side	Qty	Exe Price	Acct	Dest	Liq
09:56:33	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:33	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:33	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:33	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:33	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:33	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:33	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:32	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:32	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:32	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:32	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:32	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:32	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:32	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:32	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:31	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:31	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:31	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:31	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:31	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:31	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:31	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:31	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:30	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:30	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:30	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:30	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:30	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:30	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:29	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:28	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:28	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:28	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:28	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:28	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:28	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:28	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:27	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:27	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:27	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:27	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:27	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:27	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F
09:56:27	BAC	B	100	7,29		ARCAPOP	F
09:56:26	BAC	SS	100	7,3		ARCAPOP	F

Будьте осторожны!