

## В этом выпуске:

### Новые возможности системы



NetInvestor и системы технического анализа — экспорт данных и создание систем автотрейдинга.

### Новые программные продукты.



• NetInvestor для наладонных компьютеров Pocket PC  
• DIXI+ Server для трансляции биржевых данных по локальной сети.

### В разработке: Стоп—лосс по позиции.



При выставлении такого стоп—лосса не указывается количество лотов для сделки. Система будет следить за состоянием портфеля самостоятельно.

### Как заработать: Стратегии от FORTS.



Появление новых инструментов в FORTS—одномесечных опционов, - расширяет возможности участников рынка.

### В помощь пользователю: Тонкие настройки NetInvestor.



NetInvestor имеет множество настроек, которые позволяют гибко управлять как внешним видом, так и функциональными возможностями.



• Вопросы и ответы по системе.  
• Глас аналитика— избранное из ленты аналитических материалов сайта [www.mfd.ru](http://www.mfd.ru)

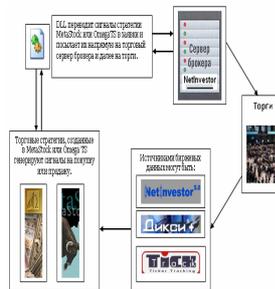
## Новые возможности системы.

### Автотрейдинг с MetaStock и Omega

МФД-ИнфоЦентр разработана система автотрейдинга («торговый робот»), на базе популярнейшего MetaStock'a, которая позволяет программировать торговые стратегии и совершать сделки в соответствии с генерируемыми сигналами в автоматическом режиме.

Используя встроенные в MetaStock индикаторы и примеры торговых систем, достаточно легко разработать собственную стратегию, — для этого не нужно владеть серьезными навыками программирования.

Обмен данными между торговым сервером NetInvestor и MetaStock происходит без использования файлов. Это самый быстрый и надежный способ передачи данных, и ра-



Работа системы автотрейдинга.

нее именно он был реализован для создания робота Omega Trade Station — NetInvestor.

Для этого создана библиотека DLL, являющейся ядром разработки, которая позволяет осуществлять **двухсторонний** обмен данными сервера брокера и робота, — робот всегда будет знать текущее состояние портфеля.

Для получения пробной или полнофункциональной версии DLL необходимо обратиться по телефону (095) 252—1550 в отдел продаж.

Подробнее на стр.2

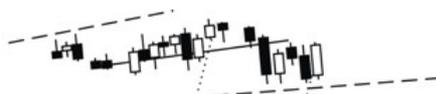
### Экспорт данных в системы технического анализа.

• Разработчиками добавлена возможность экспорта цен покупки и продажи, а не только последней сделки, что важно для работы с низколиквидными инструментами.

• При обрыве связи или перезапуске машины пропущенные данные восстанавливаются системой полностью *без разрывов*.  
• С помощью дополнительной утилиты,

доступной на сайте [NetInvestor.ru](http://NetInvestor.ru), решена проблема с программным сбоем MetaStock 8.0 при импорте в него он-лайн данных из любых систем Интернет - трейдинга.

Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте [www.NetInvestor.ru](http://www.NetInvestor.ru).



## Новые возможности.

## Автотрейдинг с MetaStock и Omega.



Поток биржевых данных поступает в систему технического анализа, которая генерирует торговые сигналы и отправляет их DLL. Далее DLL посылает заявку на сервер NetInvestor брокера, который выставляет ее на торги. Выставленные заявки и совершенные сделки трейдер может увидеть в клиентской части NetInvestor или в системе технического анализа (стратегии).

Важно то, что с помощью DLL может быть выполнен запрос на сервер брокера и получено состояние портфеля, которое будет передано в систему анализа.

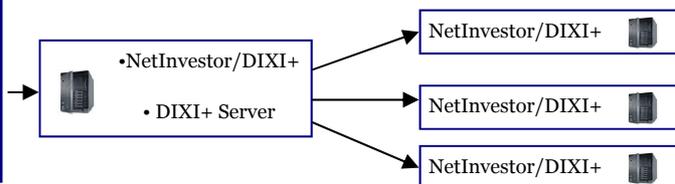
Реализация DLL под MetaStock и NetInvestor не имеет аналогов среди конкурирующих систем.

## Новые программные продукты.



МФД-ИнфоЦентр разработана версия NetInvestor для наладочных компьютеров Pocket PC. Pocket-версия программы обладает всем базовым набором функций, необходимых для оперативного принятия решения и проведения операций на рынке и предоставляет трейдеру высокую степень мобильности.

Отдельный программный продукт Dixi+ Server позволяет подключить группу компьютеров по локальной сети к одному источнику биржевых данных - системам Dixi+ или NetInvestor. Он может быть установлен на любой компьютер вместе с клиентской частью NetInvestor или Dixi+. Это позволит снизить нагрузку на канал доступа в Интернет, торговый сервер, экономить трафик и может быть использовано в дилинговых залах.



## В разработке.

## Стоп-лосс по позиции.



МФД-ИнфоЦентр разрабатывает новый вид стоп-приказа: «стоп-лосс по позиции».

Если, допустим, имеется длинная позиция по некоторой бумаге, то в систему возможно выставить стоп-лосс, указав только цену— система автоматически определит направле-

ние и объем сделки. В случае, если позиция по данной бумаге изменится, - например трейдер «руками» продаст часть бумаг, то при достижении рынком ценовых условий стоп-лосса, система закроет позицию по этой бумаге продав оставшееся количество лотов.

Этот стоп может оставаться активным (по

желанию трейдера) и после закрытия позиции, что обеспечивает контроль позиции при последующем ее открытии без повторного выставления стоп-приказа с такими же новыми условиями.

Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте [www.NetInvestor.ru](http://www.NetInvestor.ru).



## Success Story. Как заработать на срочном рынке.

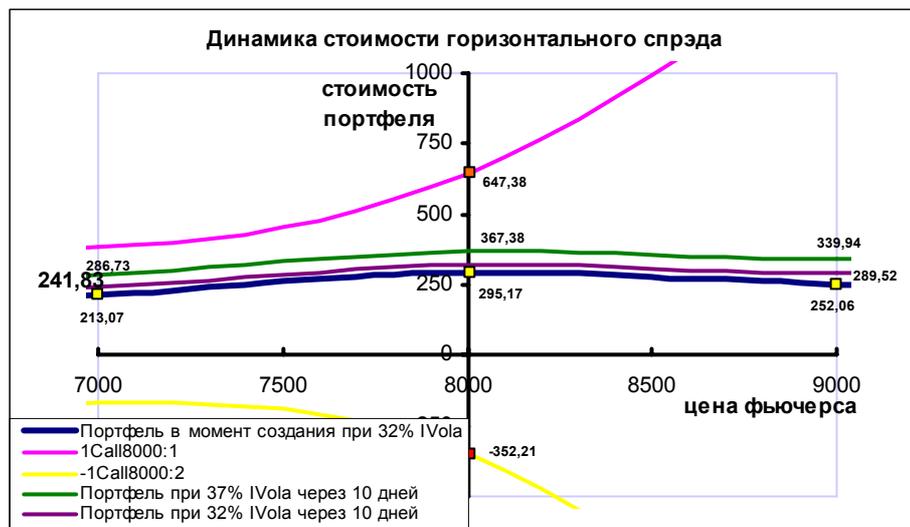
Наиболее распространенные комбинации ближних и дальних опционов подразделяются на горизонтальные и диагональные спреды:

**горизонтальный спред** – состоит, как правило, из опционов одного типа и одного страйка, но с разными датами истечения;

**диагональный спред** – состоит из опционов одного типа, но с разными страйками и датами истечения.

Горизонтальные, и диагональные спреды также подразделяются по их направленности на «медвежьи», «бычьи» и нейтральные.

Уникальность спредов, основанных на опционах с разными датами истечения, состоит в том, что с их помощью *трейдер может зарабатывать даже в том случае, если движение цен на рынке базового актива уменьшает стоимость его позиции.*



### Вариант использования горизонтального спреда

Примером стратегии, нацеленной на игру на разнице подразумеваемой волатильности (*Implied Volatility, IV*) опционов и волатильности базового актива, является продажа «короткого» опциона call со страйком 8000 (срок до истечения – 30 дней) и покупка одного дальнего опциона с таким же страйком (срок до истечения – 90 дней). При подразумеваемой волатильности в 32% стоимость «короткого» опциона будет составлять 352,21 руб., дальнего – 647,38 руб. Соответственно, стоимость такого горизонтального спреда в момент создания равна 295,17 руб. (см. гра-

фик). Окончательный результат по такой позиции зависит от соотношения подразумеваемой волатильности по «ближнему» и «дальнему» опционам. При этом, максимальный выигрыш трейдер получит, если через 10 дней подразумеваемая волатильность на рынке увеличится на 5 процентных пунктов – с 32 до 37% при сохранении цены фьючерса на том же уровне. В этом случае игрок зарабатывает **24,5%**. Если при росте волатильности произойдет также увеличение цены фьючерса на 12,5%, то прибыль от такого горизонтального спреда будет уже меньше – **15%**. А при падении стоимости фьючерса на 12,5%, даже в случае изменения подразумеваемой волатильности,

участник рынка зафиксирует относительно умеренный убыток в 2,9%. Использование подобной стратегии позволит достичь максимальной прибыли, когда игрок предполагает, что в ближайшем будущем подразумеваемая волатильность на рынке увеличится или снизится без существенного изменения волатильности базового актива.

Такая ситуация может сложиться, к примеру, когда на рынке ожидается какое-либо значимое событие и опционные игроки, предвидя будущие колебания рынка базового актива, активно «покупают» волатильность.

### Стратегия представлена:



### «Короткие» опционы – новые

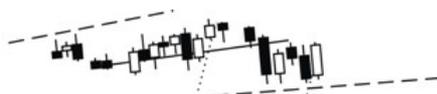
#### возможности:

**Для продавцов** – возможность получить более высокую прибыль за один и тот же период за счет последовательной продажи нескольких «коротких» опционов вместо одного «длинного»

**Для покупателей** – возможность получить более высокую прибыль при краткосрочных и среднесрочных операциях, поскольку стоимость «коротких» опционов меньше стоимости «длинных» опционов с аналогичными страйками

**Для проведения арбитражных операций** – наличие нескольких опционов с разными сроками действия, базовым активом для которых является один и тот же фьючерс, позволяет совершать дополнительный арбитраж синтетических позиций – «синтетику» на отдельных «ближних» опционах, на «ближних» опционах и фьючерсе, на «ближних» и «дальних» опционах.

Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте [www.NetInvestor.ru](http://www.NetInvestor.ru).

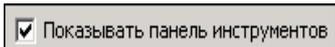


## В помощь пользователю. Тонкие настройки.

Для того, чтобы на графиках цен по умолчанию присутствовала панель инструментов,



необходимо отметить пункт «Показывать панель инструментов», используя меню «Файлы» - «Настройки» - «Графики общие»

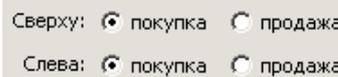


Настройки программы вызываются с помощью меню «Файл» - «Настройки». Вкладка «КВП» позволяет управлять внешним видом «стакана» заявок:

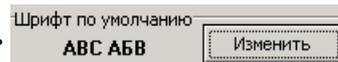
• При включении этой опции изменения в «стакане» заявок будут выделяться цветом, что очень удобно для активных трейдеров.



• Этими настройками можно управлять видом «стакана» в соответствии с индивидуальными предпочтениями.



• Тип и размер шрифта в «стакане» заявок может быть настроен трейдером индивидуально «под себя».



## Вопросы и ответы.

**Q. Как изменить тип графика на «Японские свечи»?**

**A.** Щелкните правой кнопкой мыши в окне графика и выберите в контекстном меню опцию «Панель инструментов». В появившемся выпадающем меню смените периодичность графика на любой, отличный от «тикового».

**Q. Почему при нажатии кнопки «Оценить портфель по рынку» не по всем инструментам в портфеле рассчитывается рыночная рублевая оценка?**

**A.** Щелкните правой кнопкой мыши в окне «Последние котировки» и выберите пункт «Тикеры». Убедитесь, что список выбранных тикеров соответствует составу инструментов в портфеле.

**Q. Как получить таблицу Всех сделок, прошедших на бирже?**

**A.** Щелкните правой кнопкой мыши в окне «Последние сделки» и выберите пункт меню «История по всем».

**Q. После соединения и авторизации появляется ошибка «Ошибка потока данных». Почему?**

**A.** Возможно Вы подключаетесь в режиме «Использовать открытые соединения» в то время, когда сервер брокера ожидает подключения с использованием «Системы безопасности» (проверьте меню «Файлы»-«Настройки»- «NetInvestor»).



## Глас аналитика.

### Избранное из ленты «Настроение рынка» сайта [www.mfd.ru](http://www.mfd.ru)

Рынок напоминает пешехода, который никак не может решить, успеет ли он перейти дорогу, пока горит зеленый свет, и не уверенно топчется на месте.

Чиркнули в темноте спичкой, убедились, что все на месте, и снова погрузились в темноту, пока иностранные оценщики не прольют свет на стоимость «Газпрома».

Плохие новости все знают. А хорошая заключается в том, что большинство аналитиков стали негативно смотреть на рынок. Это значит, что локальное дно совсем рядом.

Для осуществления Ацкока (отскока—прим. ред.) надо обладать либо железными ... здоровьем, либо большим объемом ликвидности. Ни того ни другого не видно.

Служба технической поддержки NetInvestor всегда с Вами в режиме online по телефонам 252-1550 добавочный 620 / 675 / 603 / 590, электронной почте [service@mfd.ru](mailto:service@mfd.ru) и ICQ 107293639 / 303669872 / 324608540 / 70871304

Предложения к разработчикам системы просьба присылать на [develop@mfd.ru](mailto:develop@mfd.ru), замечания о работе программного обеспечения на [alarm@mfd.ru](mailto:alarm@mfd.ru)

Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте [www.NetInvestor.ru](http://www.NetInvestor.ru).

