

В этом выпуске:

Новые возможности системы



Модуль доверительного управления поддерживает рынок FORTS.

Новые возможности системы



Новая версия NI Admin - инструмента управления счетами клиента для брокера и риск-менеджера.

В разработке: Новая версия NI Client



В новую версию (Build) войдут как уже анонсированные новинки, так и некоторые реализованные пожелания пользователей.

В разработке: Трансляция ожидаемой волатильности по опционам FORTS.



Значения ожидаемой волатильности «Implied volatility» будут доступны в NI Client.

Дополнительное программное обеспечение.



Библиотека стыковки внешних приложений с сервером NetInvestor.

В помощь пользователю: А знаете ли вы?



Как открыть таблицу ВСЕХ сделок?



- Вопросы и ответы по системе.
- Глас аналитика — избранное из ленты аналитических материалов сайта www.mfd.ru

Новые возможности: Модуль доверительного управления поддерживает рынок FORTS.

Модуль ДУ («Доверительное управление») предназначен для работы управляющего активами. Он обеспечивает возможность объединения клиентских счетов в группы, относящиеся к той или иной торговой стратегии. При выставлении от имени группы торговой заявки, модуль ДУ сформирует отдельные заявки с одинаковыми условиями по каждому клиентскому счету.

При этом одни и те же счета клиентов могут быть отнесены в разные группы для совершения сделок по различным стратегиям.

Использование данного модуля значительно упрощает синхрон-

ное наблюдение за состоянием активов в портфелях клиентов, меняющимся в зависимости от результатов выбранных для них стратегий.

Модуль ДУ позволяет также по результату

анализа ситуации оперативно реструктурировать состав портфеля, устанавливать ограничения на долю

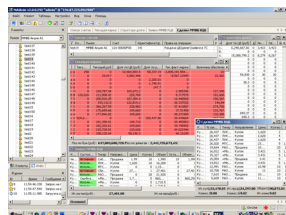
активов в портфелях группы клиентов (отдельного клиента).

Сейчас модуль ДУ можно использовать и на рынке FORTS.

Документация по работе модуля и полнофункциональная демо-версия модуля доступны на сайте www.NetInvestor.ru в разделе «Дополнительное программное обеспечение».

Приобретение модуля ДУ возможно любым лицом и не требует специальных действий от обслуживающего его брокера. Главное, чтобы брокер использовал NetInvestor.

Новые возможности: Новая версия NI Admin.



Новая версия NI Admin является самостоятельным приложением, что является перспективным шагом для дальнейшего развития его функциональных возможностей. Кроме этого, новая версия стала еще экономичнее в использовании компьютерных ресурсов.

Для использования модуля необходимо обновить серверную часть системы, а получить новую версию можно в службе технической поддержки.

Новая клиентская часть NetInvestor проходит финальную часть доработки и тестирования. Всех желающих приглашаем принять в этом участие, а новые функции NI Client подробно будут описаны в следующем выпуске «Вестника». В новую версию (build) NI Client войдут уже анонсированные новинки и некоторые реализованные пожелания пользователей. Для получения beta-версии необходимо обратиться в службу технической поддержки.

Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте www.NetInvestor.ru.

В разработке: Трансляция ожидаемой волатильности по опционам FORTS.

$$\text{Volatility}_i = \sqrt{\frac{\sum_{k=1}^{N+1} \left(\ln \left(\frac{P_{k+1}^i}{P_k^i} \right) - \mu_i \right)^2}{N}}$$

$$\mu_i = \frac{\sum_{k=1}^{N+1} \ln \left(\frac{P_{k+1}^i}{P_k^i} \right)}{N}$$

P_k^i - ставка переоценки для i-го инструмента за k-ый день
(цена - для акций, значение доходности - для облигаций)
N - количество точек, взятое для расчёта.

Ожидаемая волатильность (Implied volatility) - прогноз в отношении степени неустойчивости рыночной цены в будущем. Прогнозная неустойчивость цен составляется по ежедневным котировкам опционов и вычисляется на основе модели Блэка - Шоулза.

Значение Implied volatility рассчитывается организатором торгов ОАО «Фондовой биржей РТС» по торгуемым на FORTS опционам. Случайные сделки при расчете отсекаются фильтром Калмана. Разработчиками системы NetInvestor реализуется возможность трансляции значений волатильности на терминалы NI Client. Использование этого индикатора в трейдинге позволит опционным игрокам реализовывать различные стратегии.

Одна из опционных стратегий была представлена в первом выпуске Вестника инвестиционной финансовой группой «Партнер». Все предыдущие выпуски размещены на сайте www.NetInvestor.ru

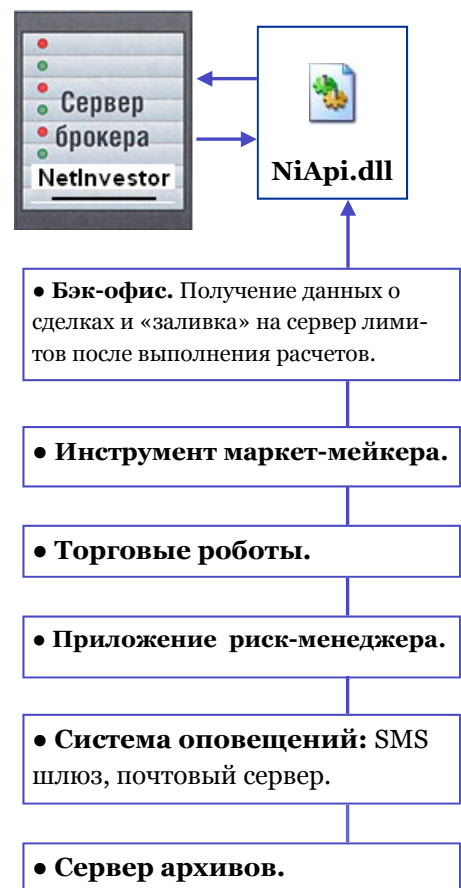
Дополнительное программное обеспечение: Библиотека стыковки внешних приложений с сервером NetInvestor.

Идеология архитектуры системы NetInvestor предусматривает открытость для сторонних разработчиков. Она заключается в том, что создателями системы описана структура баз данных серверной части и разработана библиотека (DLL) для стыковки с внешними приложениями. DLL фактически является интерфейсом доступа к системе (API), с помощью которой можно программировать любые необходимые пользователю функции.

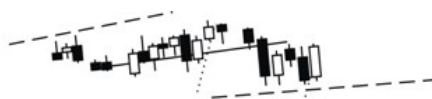
Некоторые компании успешно используют эти возможности системы и создают собственные программы для бэк-офиса, мидл-офиса или выполнения функций маркет-мейкеров. В последнем случае брокерская компания фактически само-

стоятельно разрабатывает клиентскую часть системы NetInvestor, с требуемыми функциями — выставление / снятие заявок по заданным алгоритмам и финансовым инструментам. В качестве «собственной» разработки можно использовать и готовый продукт, главное, что бы он имел описанный протокол обмена с внешними приложениями.

Модуль NiApi.dll и документацию к нему можно получить и использовать совершенно бесплатно. В разделе «Дополнительное программное обеспечение» Интернет-сайта NetInvestor.ru содержится все необходимое для этого.



Скачать последнюю версию NetInvestor, получить ответ на вопрос о работе с программой и внести предложение об улучшении системы можно на сайте www.NetInvestor.ru.



В помощь пользователю. А знаете ли вы?

Модуль ДУ. Вы можете выставлять заявки за группы клиентов одним щелчком мыши, воспользовавшись модулем доверительного управления. Заявка, выставляемая за группу, автоматически выставляется за каждого из ее членов. При этом объем заявки может быть рассчитан системой для каждого клиента в соответствии с заданными условиями – например, купить инструмент на все доступные средства, или на все собственные средства, или такое количество, чтобы инструмент составлял 50 процентов портфеля и т.п.

Модуль ДУ. В модуле доверительного управления можно ввести в таблицу «Сводный портфель» начальный уровень активов клиента (меню «Сводный портфель»-«Дополнительные столбцы»). Если затем привязать к этому полю условие нарушения структуры (меню «Сводный портфель» - «Условия нарушения структуры»), система обеспечит контроль за так называемым «уровнем просадки» управляемых активов.

Автоматизация торговли. Простой способ автоматического выставления заявок – использовать текстовый файл или протокол обмена DDE. Для этого включите поиск новых заявок в меню «Файлы» - «Настройки» - «Импорт». Формат текстового файла и DDE-обмена описан в полном руководстве пользователя NetInvestor Client в главе «Настройка DDE обмена и автоматический ввод заявок», которое находится на сайте www.NetInvestor.ru в разделе «Документация».

Более совершенный способ создания «роботов» - использовать NiApi.DLL (стр. 2) или готовые системы под MetaStock и Omega TradeStation (подробнее это описано в июньском выпуске «Вестника»).



Вопросы и ответы.

Q. Как получить таблицу со ВСЕМИ сделками на торгах?

A. Для этого необходимо кликнуть правой кнопкой мыши в любом месте таблицы последних сделок и выбрать в контекстном меню «История по всем за». После этого необходимо выбрать период «60 минут», «3 часа» или «за 1 день» и откроется таблица со сделками.

С этой таблицей можно работать как с любой другой в NI Client: накладывать фильтры на список финансовых инструментов, задавать необходимый набор полей и сортировать.

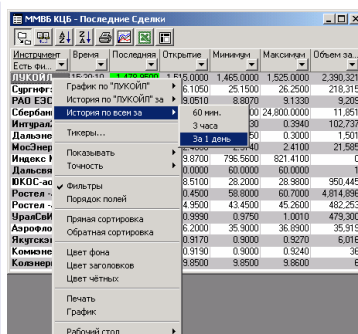
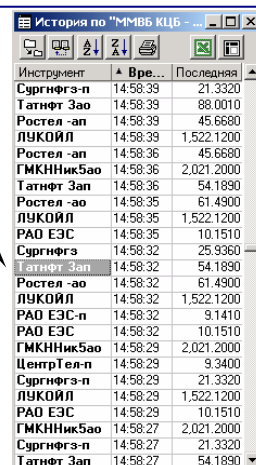


Таблица последних сделок.

Таблица всех сделок позволит заметить начавшуюся активность по малоликвидным инструментам.

Полученная таблица ВСЕХ сделок.




Глас аналитика www.mfd.ru

Избранное из ленты «Настроение рынка» сайта www.mfd.ru

Наконец-то на рынке прошла фиксация прибыли. Даже если коррекция продлится неделю или больше, о ней все будут говорить с удовольствием.

В условиях большого количества свободных денег в стране и при недостатке ликвидных инструментов для их покупки, ведущие российские бумаги будут и дальше дорожать. Тут, как говорится - бабло побеждает зло.

Обычно бывает, что людям не нужно, чтоб было правильно, а нужно, чтоб было хорошо. ● Судя по проходящим сегодня на бирже оборотам, наливочная страда может продолжиться до конца дня. ● Индекс РТС день закончит скорей всего чуть пониже вчерашнего, но руку, или даже палец, на отсечение мы в подтверждение этой мысли не предложим. Откусят по локоть.

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

Предложения к разработчикам системы просьба присылать на develop@mfd.ru, замечания о работе программного обеспечения на 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.

