

Инструкция по настройке и запуску опционных роботов

Для первичного ознакомления с опционными блоками в составе ТСЛаб 2.0 предлагаются скрипты для автоматической и ручной работы. В этом руководстве будут рассмотрены торговые роботы (скрипты **Buy Vola** и **Sell Vola** версии 75), поскольку именно они позволяют попробовать работу с этими интереснейшими инструментами даже начинающим опционщикам.

С целью безопасного освоения интерфейса этих роботов мы рекомендуем заказать у вашего брокера доступ к игровому контуру биржи с доступом по протоколу Плаза-2. В этом контуре достаточно хорошо представлен фьючерс на индекс РТС и его опционы. Другие тестовые и игровые контуры могут быть слишком неактивными и не позволят достаточно качественно поэкспериментировать с опционами.

Также в скриптах реализован режим виртуального исполнения заявок. В этом случае заявки агента не выводятся в рынок, а считаются исполненными незамедлительно.

Краткий обзор

Роботы продажи и покупки волатильности работают по следующему алгоритму:

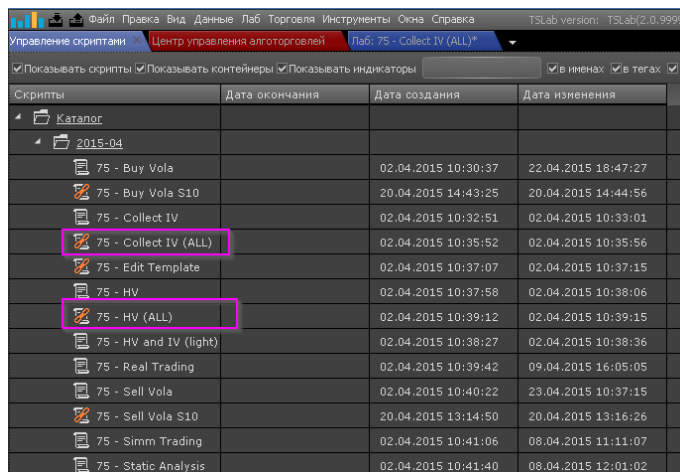
1. Делается оценка текущей исторической волатильности
2. Делается оценка текущей подразумеваемой волатильности на-деньгах
3. Определяется центральный страйк (ближайший к деньгам)
4. В случае, если историческая волатильность существенно (параметр агента **Entry Level %**) превосходит подразумеваемую, робот начинает котировать опционы в центральном страйке с целью их покупки.
5. В случае, если подразумеваемая волатильность существенно (параметр агента **Entry Level %**) превосходит историческую, робот начинает котировать опционы в центральном страйке с целью их продажи.
6. Позиция будет набираться до достижения максимального риска (параметр **Max Risk**).
7. Во время своей работы, агент постоянно выполняется дельта-хеджирование позиции. С этой целью алгоритм использует улыбку и алгоритмические приёмы **Алексея Каленковича**.
8. В случае, если Вы хотите сократить размер позиции, достаточно выставить параметр **Max Risk** равным 0. Тогда агент будет котировать набранные опционы с целью сокращения позиции вплоть до 0.

Для нормальной работы этих агентов, им необходимо подготовить данные (оценить волатильности). Этим занимаются вспомогательные агенты **Collect IV (ALL)** и **HV (ALL)**.

Инструкция по запуску агентов

Разберем последовательность шагов по запуску агента **Buy Vola** «с нуля». Подключение к провайдеру Финам.

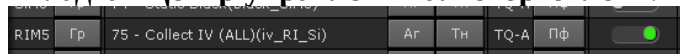
- 1 Необходимо сделать импорт в **ТСЛаб** Вкладка «**Управление скриптами**»:
скриптов **Collect IV (ALL)** и **HV (ALL)**.



- 2 На скрипте **Collect IV (ALL)** создаём агента. Инструменты **RIM5, SiM5, GZM5, SRM5** (в некоторых терминалах это **RTS-6.15, Si-6.15, GAZR-6.15, SBRF-6.15**). Рекомендую дать агенту имя «**iv_RI_Si**». Запускаем.

Голубые индикаторы – это оценка волатильности на-деньгах в соответствующих опционных сериях.

Вкладка «**Центр управления алготорговлей**»:



Нормальный внешний вид агента:



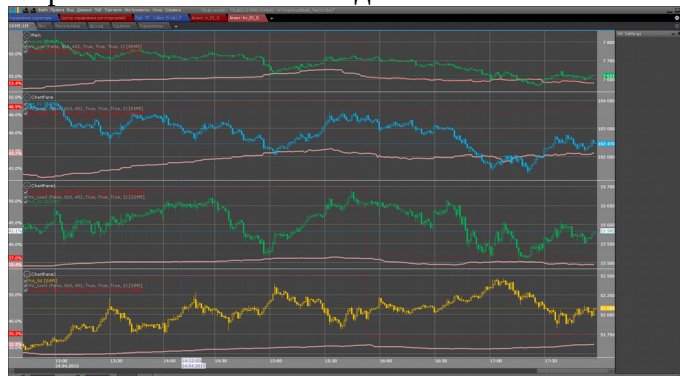
- 3 На скрипте **HV (ALL)** создаём агента. Инструменты те же. Рекомендую дать агенту имя «**hv_RI_Si**». Запускаем.

Розовые индикаторы – это оценки исторической волатильности соответствующих фьючерсов.

Вкладка «**Центр управления алготорговлей**»:



Нормальный внешний вид агента:



- 4 Необходимо сделать импорт в **ТСЛаб** Вкладка «**Управление скриптами**»:

скриптов **Buy Vola** и **Sell Vola**.

Скрипты	Дата окончания	Дата создания
Каталог		
2015-04		
75 - Buy Vola		02.04.2015 10:30:37
75 - Buy Vola S10		20.04.2015 14:43:25
75 - Collect IV		02.04.2015 10:32:51
75 - Collect IV (ALL)		02.04.2015 10:35:52
75 - Edit Template		02.04.2015 10:37:07
75 - HV		02.04.2015 10:37:58
75 - HV (ALL)		02.04.2015 10:39:12
75 - HV and IV (light)		02.04.2015 10:38:27
75 - Real Trading		02.04.2015 10:39:42
75 - Sell Vola		02.04.2015 10:40:22
75 - Sell Vola S10		20.04.2015 13:14:50

- На скрипте **Buy Vola** создаём агента. Инструмент **RIM5** (в некоторых терминалах это **RTS-6.15**). Рекомендую дать агенту имя «**bv_RIM5_Jun**». Запускаем.

«**bv**» значит **Buy Vola**
«**RIM5**» показывает базовый актив
«**Jun**» показывает что это июньская серия

Удобные соглашения по названиям агентов позволят Вам легко ориентироваться среди них, когда Вы будете торговать много базовых активов и много различных серий одновременно.

- Управление улыбкой и параметрами дельта-хеджера осуществляется в закладке «Smile».

Голубая линия – это биржевая улыбка.
Красная – рыночная улыбка (по методике Алексея Каленковича).
Белая – улыбка для дельта-хеджа.

Оранжевый пунктир – историческая волатильность.

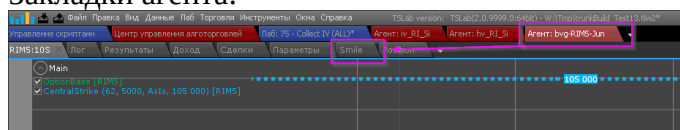
Вкладка «**Центр управления алготорговлей**»:



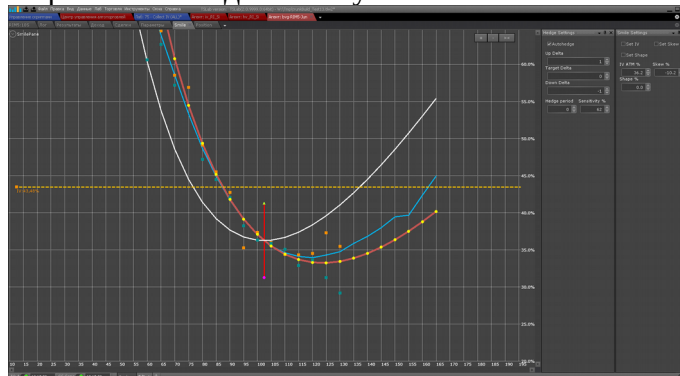
Нормальный внешний вид агента:



Закладки агента:



Нормальный вид панели улыбок:



- 7 Контроль за составом позиции осуществляется таблицей «**Position**». В ней показано количество колов и путов в разных страйках. Фьючерсы показываются в строке со страйком «0». В примере куплено 3 кола в страйке 100 000, 11 колов в страйке 105 000. Позиция захеджирована продажей 7 фьючерсов.

Position			
K	Qty Call	Qty Put	Total
0			-7
100 000	3		3
105 000	11		11

- 8 Визуальный анализ позиции выполняется на вкладке «**Position**».

Оранжевая линия показывает профиль позиции на дату экспирации (жаргонное название «кочерга»). Красная линия – текущий профиль позиции. Зеленый треугольник – маркер текущей цены базового актива (БА).

Закладки агента:



Нормальный вид панели позиций:

