

Рекомендации

Рекомендуется предварительно изучить работу агентов в режиме виртуальных сделок и на игровом контуре биржи!

- Поклонникам ручной торговли для этого будет полезен скрипт **Simm Trading** – все сделки в обязательном порядке исполняются в режиме эмуляции. То есть заявки на рынок **не выводятся**.
- Поскольку скрипты предполагают длительное ведение позиций, автоматическое выполнение хеджирования и т. д., то нормальным режимом работы для них является **режим агента**.
- Настоятельно рекомендуется давать агентам осмысленные названия. Например, автор обычно называет агенты для сбора подразумеваемой волатильности «iv», «iv_RI» или «iv_RI_Si». Соответственно, за исторической волатильностью следят «hv», «hv_RI» или «hv_RI_Si». Торговые скрипты для покупки волатильности обычно называются «bv_RIM5_Jun» (такое название сразу раскрывает вид операции – **Buy Volatility**, базовый актив – **RIM5**, опционную серию – **июнь**).

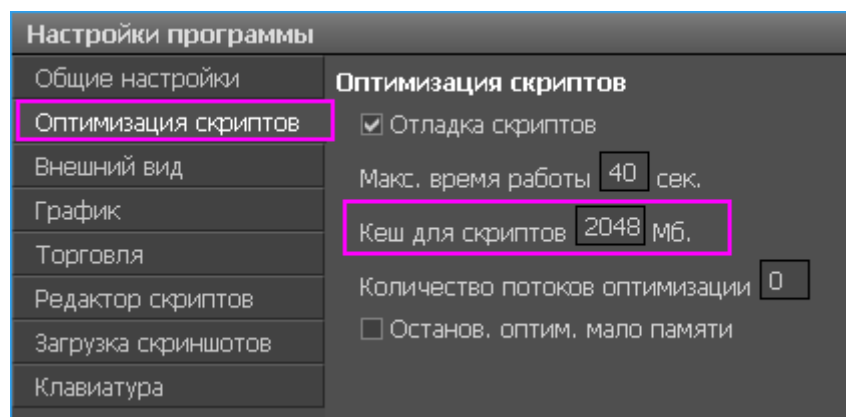
В противном случае при большом числе торгуемых базовых активов и торгуемых серий Пользователь может столкнуться с проблемой того, что будет трудно ориентироваться в большом количестве агентов.

- Игровой контур, как правило, предоставляется брокерами всем своим реальным клиентам бесплатно. Обладатели подключения по протоколу Плаза-2 получают дополнительный логин-пароль для своего роутера и могут легко подключиться к знакомой инфраструктуре. В игровом контуре достаточно прилично представлена главная серия опционов на индекс РТС.
- После запуска приложения с опционными агентами или после перезапуска агента рекомендуется проверить правильность всех настроек и адекватность его состояния. Лучше всего это сделать через интерфейс агента. В частности, должны присутствовать график Базового Актива (БА), на вкладке **Smile** должна быть отображена адекватная улыбка. Если агент уже набрал позицию – её профиль должен быть показан на вкладке **Position**.
- Для работы опционных агентов у вас **ВСЕГДА(!)** должны быть предварительно запущены агенты для сбора подразумеваемой и исторической волатильности в тех инструментах, с которыми Вы собираетесь работать.

Проще всего использовать для этого скрипты «**HV (ALL)**» и «**Collect IV (ALL)**».

- При торговле опционами мы рекомендуем **сразу** увеличить параметр программы «Файл» → «**Настройки программы**» → «**Оптимизация скриптов**» → «**Кеш для скриптов**» до 1000 МБ или, если Вам позволяет оперативная память, до 2000 МБ.

У себя при торговле через Транзак мы используем размер кеша 2048 Мбайт.



ВАЖНОЕ ОБЪЯВЛЕНИЕ ДЛЯ ОПЦИОНЩИКОВ

- Во время реальной торговли при использовании котировщика опционов (выставление задач котирования относительно рыночной улыбки) **настоятельно рекомендуем фиксировать уровень волатильности на деньгах и наклон улыбки**. Биржевая улыбка временами становится неадекватной, а самостоятельно менять эти параметры вслед за изменением рыночных заявок не слишком обременительно (примерно раз в неделю на спокойном рынке).
- Если Вы не можете (или не хотите) следить за этими параметрами в течение дня **обязательно замораживайте эти параметры хотя бы на время вечернего клиринга и на ночь**.

Предусмотрительно даже вообще отменять **все задачи котирования** на эти периоды. Потому что на быстром рынке после открытия торгов трудно ожидать исполнения по хорошим ценам.

- Если полностью положиться на биржевую улыбку и во время котирования послушно ходить вслед за ней, это может привести к исполнению по ОЧЕНЬ неадекватным ценам. Особенно утром на открытии торгов и после вечернего клиринга.**
- Если на бирже происходит какой-то сбой, остановка торгов, рассинхронизация времени или ещё какие-то чудеса, имеет смысл прервать котирование и подождать нормализации обстановки.

Известные проблемы

- При старте приложения в целом или даже агентов по отдельности несколько пересчетов опционным агентам может не хватать данных. Это выражается в сообщениях об ошибках в Главном Логге приложения. После перехода агентов в нормальный режим эти сообщения об ошибках должны исчезнуть.
- Иногда при старте приложения опционный агент может не увидеть свою позицию. В такой ситуации он неправильно считает свой текущий риск нулевым и выставляет заявку на донабор позиции. Если эта заявка исполнится, может быть куплен(продан) лишний опцион (сверх ограничения **MaxRisk**). Мы рекомендуем перед перезапуском приложения или агента выставлять агенту настройку **Block Trading**, которая защитит Вас от этой неприятности.
- Иногда при котировании опционов (с помощью задач котирования относительно улыбки) наблюдается эффект самопроизвольного снятия этих задач. Выражается это в том, что с графика улыбки пропадают отметки задач котирования, а все выставленные ранее лимитники отменяются.

В этом случае необходимо увеличить размер настройки «**Кеш для скриптов**» как было описано выше. Если при 2000 МБ поведение не нормализуется, то нужно увеличивать этот параметр дальше. Известен случай, когда при торговле через Плазу и котировании нескольких Досок Опционов Пользователю пришлось увеличить этот параметр до 4000 МБ.