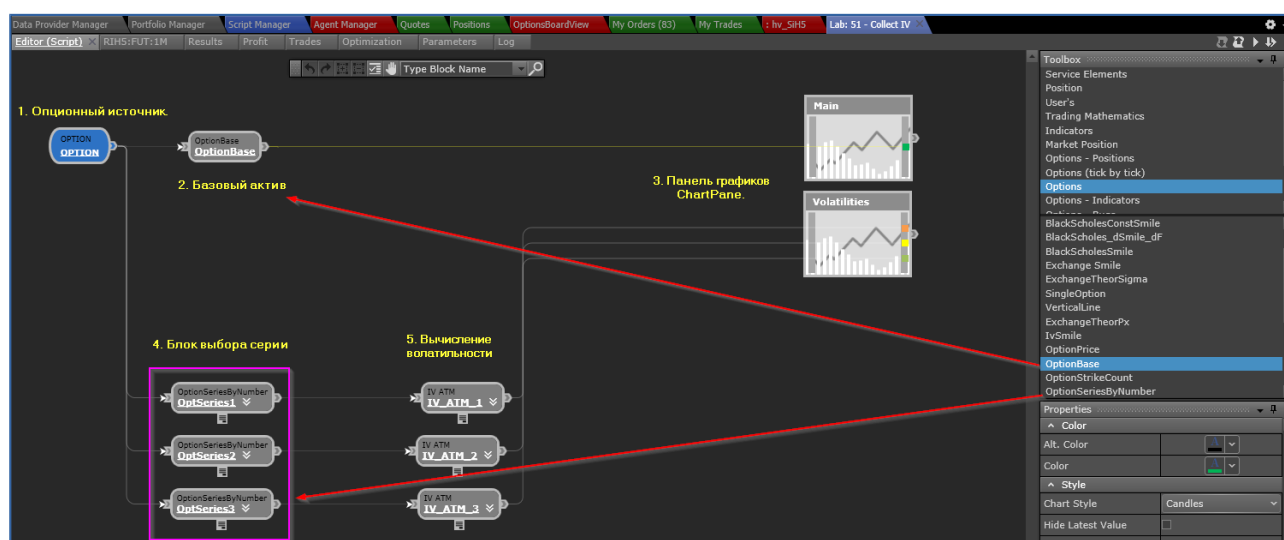


Скрипт Collect IV

Специализированный скрипт **Collect IV** в режиме агента может быть назначен на различные опционные источники. При этом будет выполняться сбор волатильности на деньгах в трех сериях опционов для данного Базового Актива (БА). Индикатор сохраняет свои значения в глобальном кеше и впоследствии эти данные могут использоваться независимо. В том числе в скриптах, которые не имеют опционного источника.



Для реализации алгоритма использованы блоки:

1. **Опционный источник.** Предоставляет доступ к БА и всем его опционам. При работе с ним через API на вход вашего блока будет подан интерфейс **IOption**. В нём содержится вся информация с котировками, позициями, волатильностью и т. п.
2. **Базовый актив (OptionBase).** Блок из категории Options. Извлекает из опционного источника БА и позволяет далее работать с ним обычным способом как с обычным блоком **Source (Instrument)**. В данном скрипте блок используется для отображения баров БА на обычном линейном графике «цена-время» (панель **Main**).
3. **Панель рисования обычных графиков ChartPane.** Сюда выводятся значения волатильности от индикаторов IV_ATM в виде линейного графика. Линии имеют тип «**Line without zeroes**» («**Линия без нулей**») чтобы пропущенные точки не исказили визуальное восприятие информации.
4. **Блок выбора серии OptionSeriesByNumber.** Извлекает из опционного источника целиком серию (опционы с одинаковой датой истечения). При работе с ним через API на вход вашего блока будет подан интерфейс **IOptionSeries**. В нём содержится вся информация с котировками, позициями, волатильностью и т. п. Но все опционы имеют одинаковое время жизни.

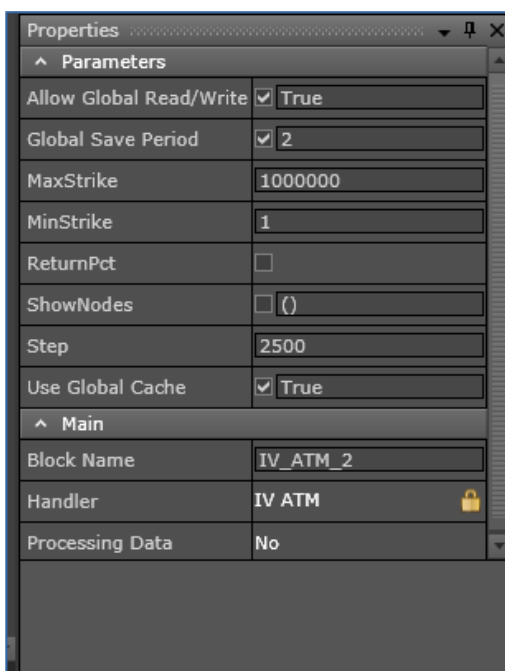
Настраиваемые параметры:

ExpirationMode – выбор различных алгоритмов отбора серии. В скрипте стоит режим **ExpiryByNumber**. При этом блок возвращает серию в соответствии с её порядковым номером (нумерация с 1). В данном режиме для этого используется второй настраиваемый параметр **Number**.

Также возможны режимы **First Expiry** (ближайшая ещё живая серия), **Last Expiry** (последняя ещё живая серия), **Fixed Expiry** (жестко задана дата экспирации; **в данный момент не реализовано**).

5. **Блок получения величины «Волатильность на деньгах» (IV ATM).** На вход подаётся опционная серия.

Алгоритм работы: ФОРТС транслирует свою теоретическую улыбку. Блок строит по ней интерполирующий сплайн и вычисляет значение волатильности при текущей цене БА. Эта величина и считается значением данного индикатора.



Параметры настройки блока (снабжены описанием, которое становится видно в нижней части панели после клика на то или иное свойство).

Allow global read/write – разрешает индикатору писать свои значения в глобальный кеш для сохранения между сессиями и повторного использования другими агентами. Для одной серии должен быть только один блок с возможностью записи.

Global Save Period – частота записи в кеш.

MinStrike/MaxStrike – диапазон рабочих страйков. Если на краях улыбка становится неадекватной, есть возможность вырезать её середину отдельно (необходимо предоставить хотя бы 5-7 страйков).

ReturnPct – пересчитывать волатильность в проценты. Мы выкладываем кеш в обычных безразмерных единицах, поэтому если Вы эту настройку меняете, то наши кешы лучше не использовать.

ShowNodes – показывать маркеры узлов на улыбке. Не используется.

Step – шаг страйков. Не используется.

Use Global Cache – использовать ли глобальный кеш или достаточно локального (вычисленные значения будут доступны только внутри его собственного агента).