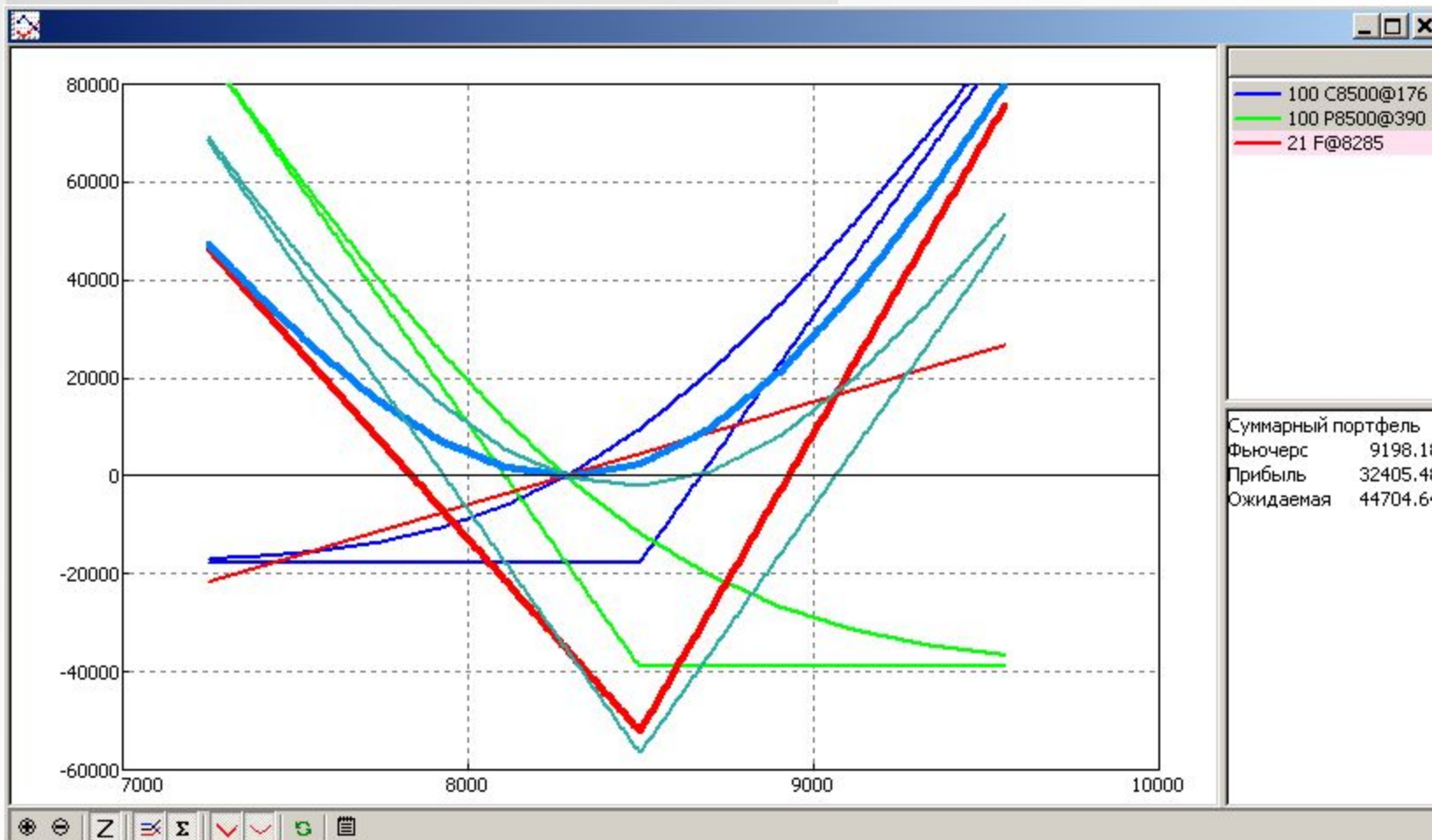


Опционный аналитик FORTS



- Проведение в режиме реального времени анализа сложных позиций, состоящих их фьючерсов и опционов.
- Построение графиков сложных позиций
- Дружественный интерфейс

Оptionный аналитик FORTS. Возможности

option - Option1

Файл Правка Импорт Окно Справка

Option1

Дата расчетов	Дата исполнения	Инструмент	Тип опциона	Страйк	Кол-во	Цена сделки	Название	Цена фьючерса	Ставка %	Премия	σ, %	Дней до исполнения	Δ	Γ	ϕ	Vega
25.05.2004	15.06.2004	Фьючерс			20	8285,00	ESM4	8285,00	15,00							
25.05.2004	09.06.2004	Опцион	Put	8000,00	200	197,00	ES0008000R4	8285,00	15,00	197,00	50,32	14	-0,34	0,0004	-14,99	5,93
25.05.2004	09.06.2004	Опцион	Call	8500,00	100	170,00	ES0008500F4	8285,00	15,00	170,00	40,40	14	0,39	0,0006	-12,55	6,18
25.05.2004	09.06.2004	Опцион	Put	8500,00	100	420,00	ES0008500R4	8285,00	15,00	420,00	46,33	14	-0,59	0,0005	-14,56	6,26
25.05.2004	09.06.2004	Опцион	Put	9000,00	-100	911,00	ES0009000R4	8285,00	15,00	911,00	70,52	14	-0,70	0,0003	-19,81	5,59
25.05.2004	09.06.2004	Опцион	Put	9500,00	150	1222,60	ES0009500R4	8285,00	15,00	1222,60	40,00	14	-0,96	0,0001	-3,01	1,50
25.05.2004	09.06.2004	Опцион	Put	0000,00	50	1715,00	ES0010000R4	8285,00	15,00	1715,00	40,00	14	-1,00	1,00004	-0,79	0,40
25.05.2004	09.06.2004	Опцион	Put	0500,00	100	2215,00	ES0010500R4	8285,00	15,00	2215,00	35,00	14	-1,00	0,00002	-0,03	0,02

Σ -59000,00 Π 0,00 Δ -0,6528 Γ 0,1094 ϕ -2710,907 v 1243,9171

Выборочный портфель
Фьючерс 9556.72
Прибыль 46671.72
Ожидаемая 52271.45

Суммарный портфель
Фьючерс 8523.44
Прибыль 4043.75
Ожидаемая 1605.62

Готово NUM

Пуск Входящие ... Торги фью... Microsoft E... C:\Docume... Microsoft P... Опционны... option - O... EN 16:21

Оptionный аналитик FORTS. Импорт

- Данные импортируются из **Excel**
- Обновление данных в режиме **On-line**
- Одновременное использование импорта в Опционный аналитик FORTS и экспорта данных из таблицы «**Текущие финансовые инструменты**» любой системы интернет-трейдинга (Алор-трейд, Квик, Нет-Инвестор и т. д.)

Оptionный аналитик FORTS. Импорт

ЭКСПОРТ:

таблица
«Финансовые
инструменты»
- Excel

1	Код бумаги 1	Бумага	Код бумаги	Погашение	Спрос	Кол. спр
2	ESM4	Фьючерсный контракт	EERU-6.04	15.06.2004	8285	
26	ES0007000U4	Амер. Put.7000 Фьюч.к	EERU094PA	10.09.2004	100	
27	ES0007500F4	Амер. Call.7500 Фьюч.к	EERU064CA	09.06.2004	791	
28	ES0007500I4	Амер. Call.7500 Фьюч.к	EERU094CA	10.09.2004	0	
29	ES0007500R4	Амер. Put.7500 Фьюч.к	EERU064PA	09.06.2004	31	
30	ES0007500U4	Амер. Put.7500 Фьюч.к	EERU094PA	10.09.2004	50	
31	ES0008000F4	Амер. Call.8000 Фьюч.к	EERU064CA	09.06.2004	456	
32	ES0008000I4	Амер. Call.8000 Фьюч.к	EERU094CA	10.09.2004	100	
33	ES0008000R4	Амер. Put.8000 Фьюч.к	EERU064PA	09.06.2004	155	
34	ES0008000U4	Амер. Put.8000 Фьюч.к	EERU094PA	10.09.2004	60	
35	ES0008500F4	Амер. Call.8500 Фьюч.к	EERU064CA	09.06.2004	170	
36	ES0008500I4	Амер. Call.8500 Фьюч.к	EERU094CA	10.09.2004	0	

ИМПОРТ:

Excel –
Оptionный
аналитик

Текущая таблица параметров

	Спрос	Общ. спр	Предл.	Общ. предл	Откр.	Макс. цена	Мин. цена	Ср. взв. це	Цена послед.	Колво по
Энерг	5.507	8.799	5.530	19.983	5.620	5.640	5.500	5.535	5.530	20
КОЙЛ	810.800	194.371	811.000	71.902	805.000	812.730	802.180	807.040	811.000	100
Энерг	2.300	200.595	2.300	183.883	2.291	2.303	2.280	2.291	2.300	5
ЭЭС	8.727	572.458	8.730	364.260	8.701	8.749	8.673	8.711	8.726	200
тел.а	65.250	1.417.341	65.260	1.395.097	65.000	65.270	64.770	65.030	65.250	5.481
рбанк	9.889.000	2.105	9.889.000	4.376	9.816.000	9.979.000	9.885.000	9.914.020	9.889.000	20
нэт.З	35.620	4.665	35.770	7.632	35.500	35.890	35.450	35.694	35.770	20
DC-ао	355.200	260.262	355.400	539.102	355.000	358.490	353.100	354.910	355.400	1
ЭВЕХ	53.6500		53.7000		53.2100	54.0000	53.2100	53.6786	53.7000	3.300
IRG	8.70000		9.00000		8.73500	8.73500	8.73500	8.73500	8.73500	5.700
KNG	1.980.0000		2.020.0000		0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	2.010.0000	100
JHG	807.4000		849.0000		809.5000	809.5000	809.5000	809.5000	809.5000	61
NGG	0.00000		0.00000		0.00000	0.00000	0.00000	0.00000	2.3000	59.500
MG	65.0000		65.4000		65.3500	65.3500	65.3500	65.3500	65.3500	761
ERG	0.00000		10.000.0000		0.00000	0.00000	0.00000	0.00000	9.910.00000	37
3SG	18.40000		18.50000		0.00000	0.00000	0.00000	0.00000	18.70000	3.000
ODG	350.0000		370.0000		0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	355.0000	80

option - 1.ops

Дата расчетов	Дата исполнения	Инструмент	Тип опциона	Страйк	Кол-во	Цена сделки	Назва
25.05.2004	15.06.2004	Фьючерс			20	8285,00	
25.05							00 ES0008
25.05							00 ES0008
25.05							00 ES0008
25.05							00 ES0009
25.05					60		ES0009
25.05							00 ES0010
25.05							00 ES0010

Подключение к данным Excel

Страница Excel: [Export.xls]Sheet1

Инструменты: A - 1

Цена инструмента: I - 9

Дата исполнения: D - 4

Обновлять открытые страницы:

Оptionный аналитик FORTS. Вычисления

Премия – вычисляемая премия для текущей цены фьючерса при заданной волатильности (если вычисляется подразумеваемая волатильность, то премия является заданной величиной),

σ , % - заданная волатильность в % годовых для вычисления опционной премии при текущей цене фьючерса (или вычисляемая подразумеваемая волатильность при заданной премии)

Дней до исполнения – рассчитанное количество дней до окончания обращения фьючерса или опциона с учётом выходных и праздничных дней,

Δ - рассчитанное значение коэффициента чувствительности
ДЕЛЬТА

Γ - рассчитанное значение коэффициента чувствительности **ГАММА**

θ - рассчитанное значение коэффициента чувствительности **ТЭТА**

Vega - рассчитанное значение коэффициента чувствительности
ВЕГА

Оptionный аналитик FORTS. Вычисления

option - [1.ops]

Файл Правка Импорт Окно Справка

Инструмент	Тип опциона	Страйк	Кол-во	Название	Цена фьючерса	Премия	σ , %	Δ	Γ	θ	Vega
Фьючерс			20	ESM4	8285,00			1,00			
Опцион	Put	8000,00	200	ES0008000R4	8285,00	197,00	50,32	-0,34	0,0004	-14,99	5,93
Опцион	Call	8500,00	100	ES0008500F4	8285,00	170,00	40,40	0,39	0,0006	-12,55	6,18
Опцион	Put	8500,00	100	ES0008500R4	8285,00	420,00	46,33	-0,59	0,0005	-14,56	6,26
Опцион	Put	9000,00	-100	ES0009000R4	8285,00	911,00	70,52	-0,70	0,0003	-19,81	5,59
Опцион	Put	9500,00	150	ES0009500R4	8285,00	1222,60	40,00	-0,96	0,0001	-3,01	1,50
Опцион	Put	10000,00	50	ES0010000R4	8285,00	1715,00	40,00	-1,00	0,00004	-0,79	0,40
Опцион	Put	10500,00	100	ES0010500R4	8285,00	2215,00	35,00	-1,00	0,000002	-0,03	0,02

Σ 91100.00 Π -0.00 Δ 70.1241 Γ -0.0301 θ 1980.7041 v -559.1714

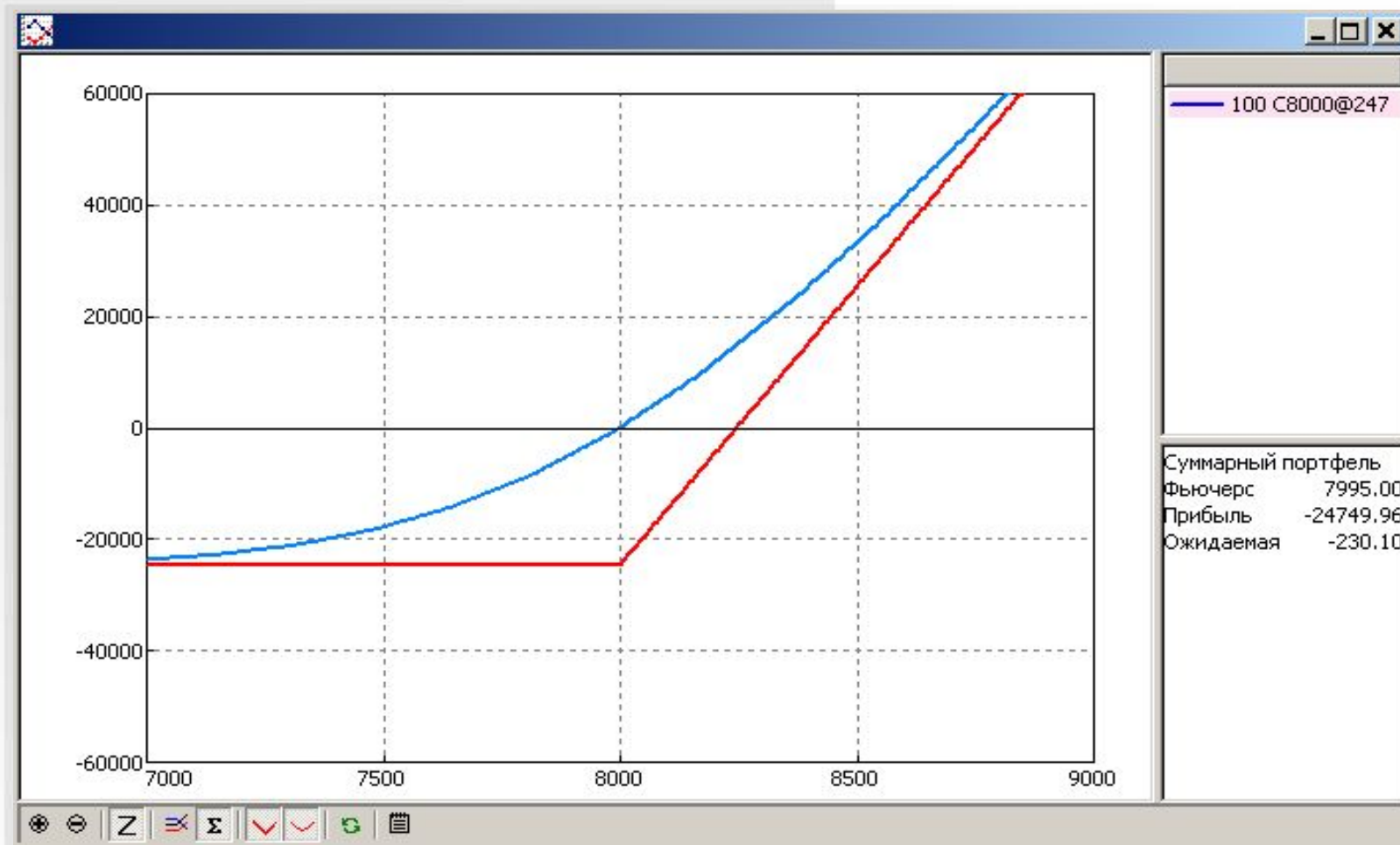
Готово NUM

Futures & Options in
RТС

www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru

- Графическое изображение портфеля, состоящего из одной или нескольких позиций.
- Изменение состава анализируемой позиции
- Сравнительный анализ нескольких позиций

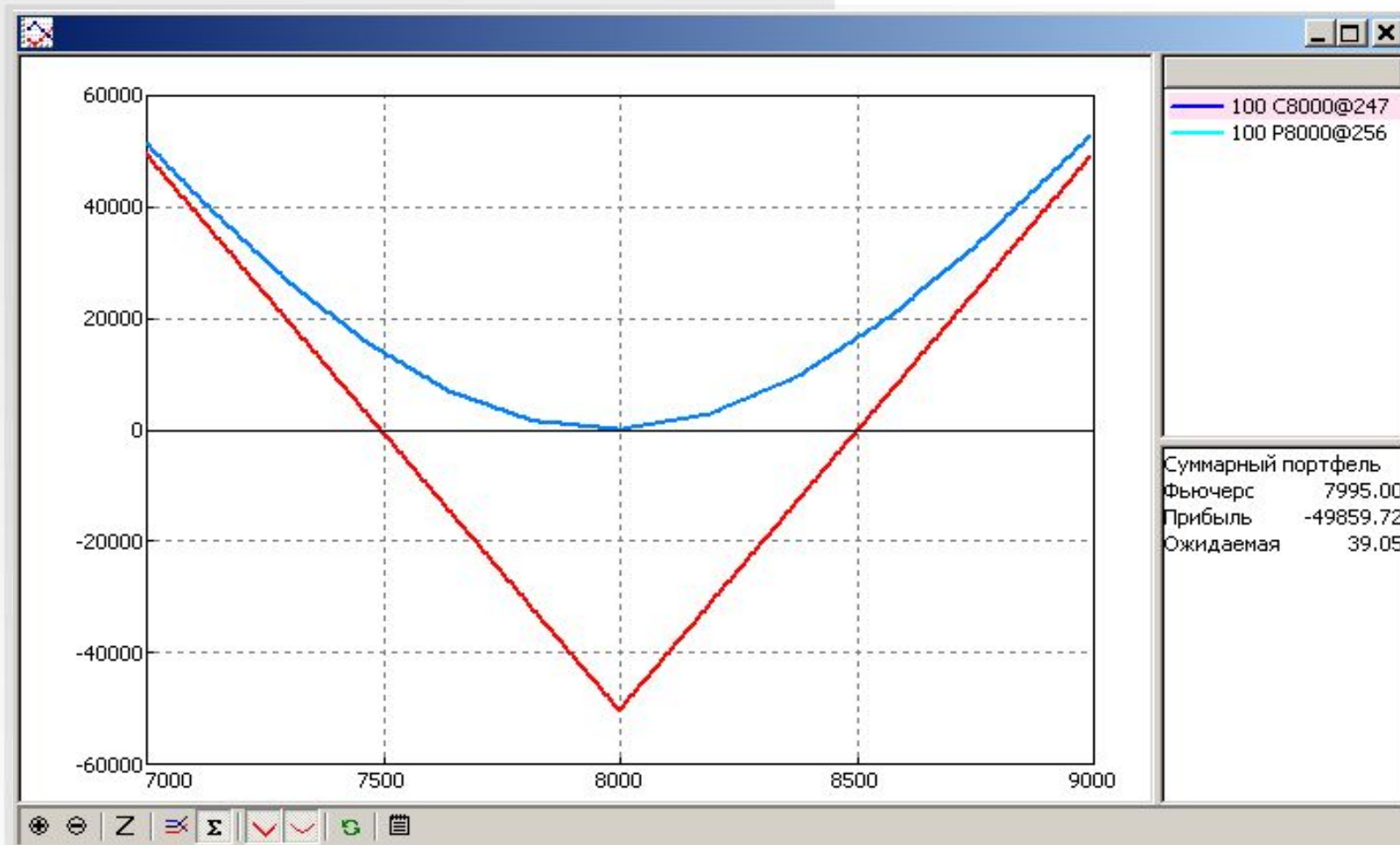
Оptionный аналитик FORTS. Графика



Futures & Options in
RТС

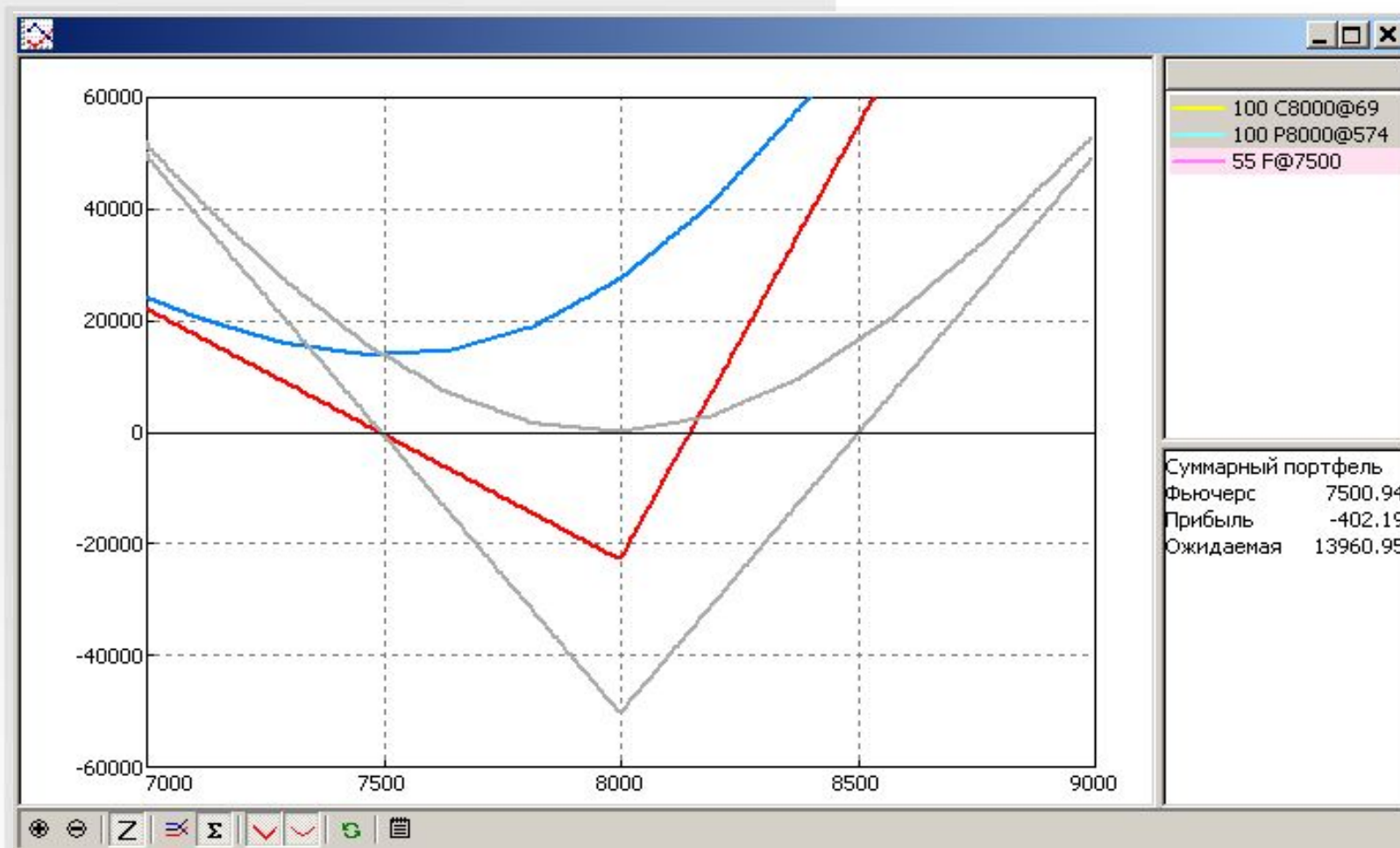
www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru

Оptionный аналитик FORTS. Графика



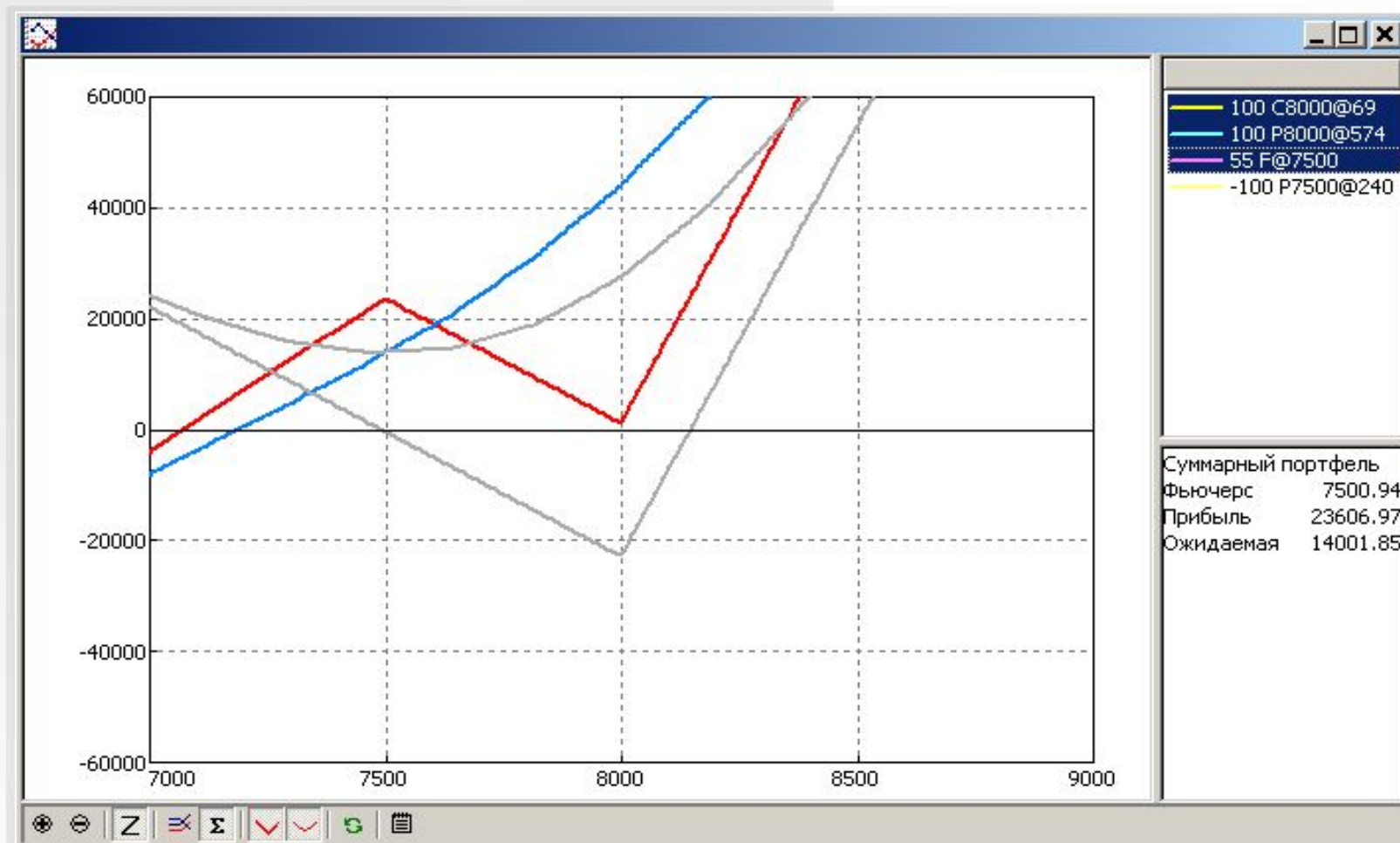
Futures & Options in
RТС

Оptionный аналитик FORTS. Графика



Futures & Options in
RТС

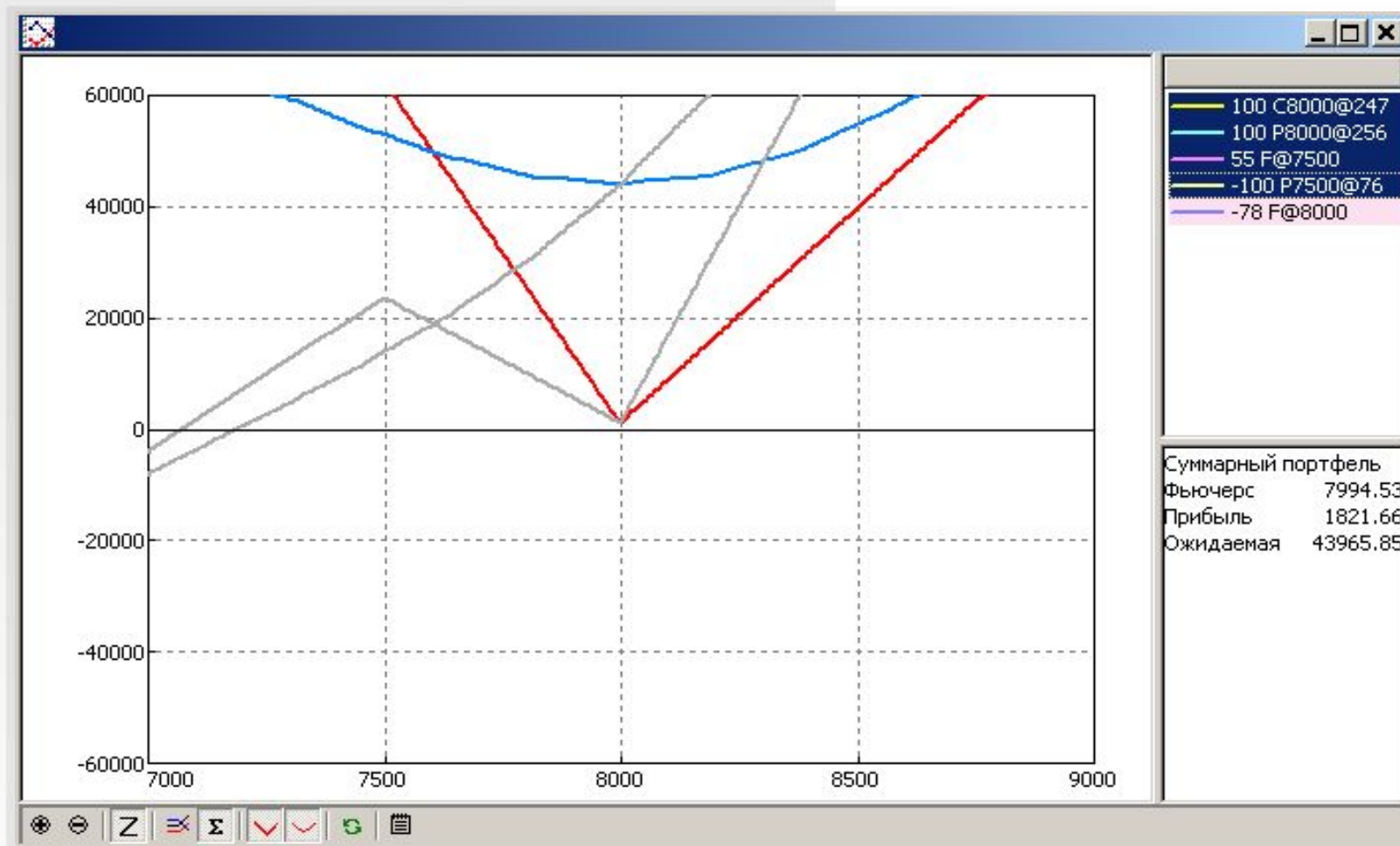
Оptionный аналитик FORTS. Графика



Futures & Options in
RТС

www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru

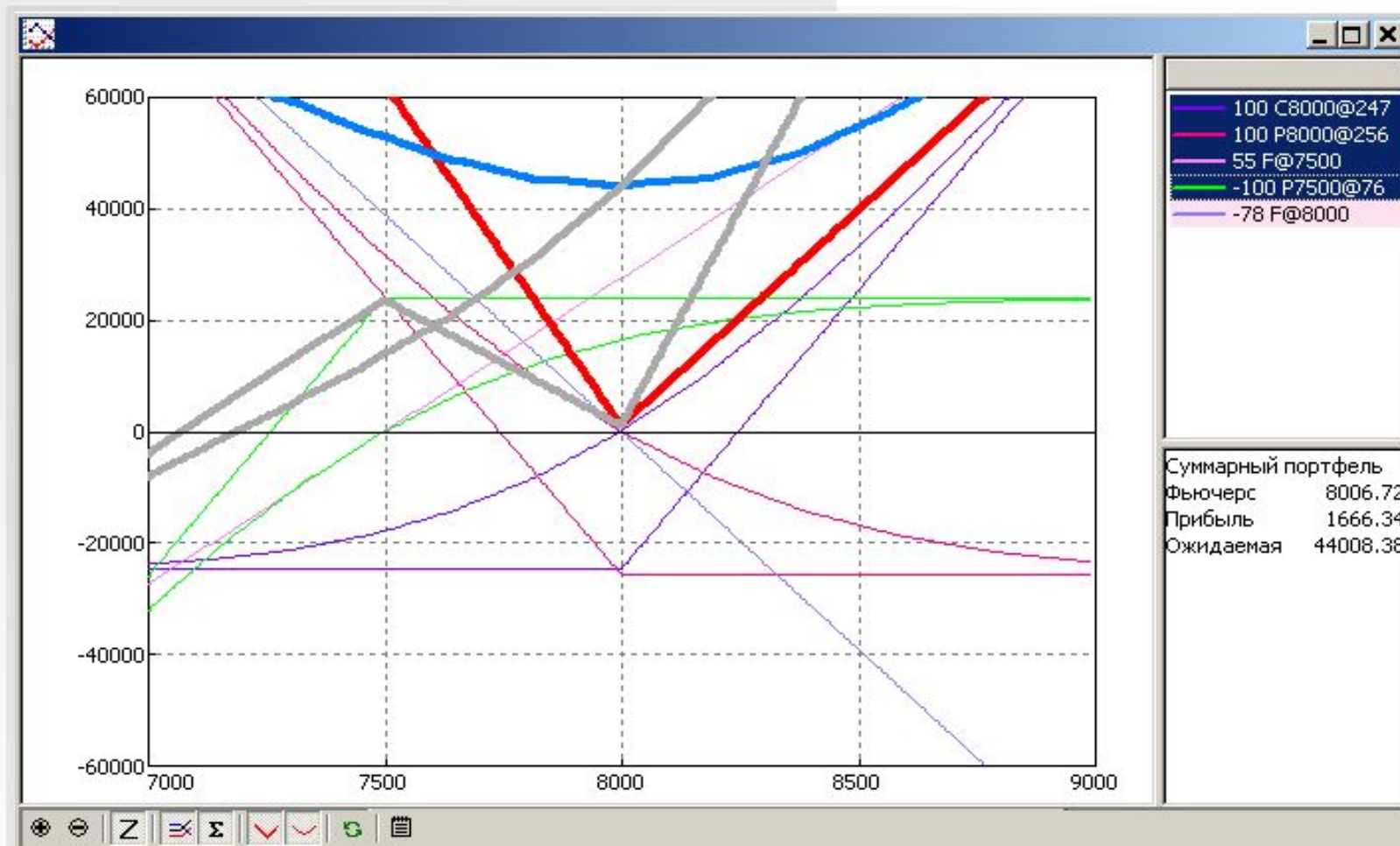
Оptionный аналитик FORTS. Графика



Futures & Options in
RТС

www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru

Оptionный аналитик FORTS. Графика



Futures & Options in
RТС

www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru
www.rts.ru



Управление срочного рынка РТС

- тел. (095) 705-9031
- e-mail: forts@rts.ru
- <http://www.rts.ru>, www.forts.ru