



 NetInvestor

для срочного рынка

- **Опционы: аналитика и торговля опционами**
 - Доска опционов: цены, «греки», IV
 - Фьючерсы: параметры серий опционов
 - Моделирование, анализ и торговля
 - Анализ профиля риска
 - Трехмерная поверхность профиля риска
 - Риски Гарантийного обеспечения

Менеджер опционов

- **Просмотр информации на рынке**
- **Анализ опционных стратегий**
 - **Спреды**
 - **Хеджирование**
 - **Арбитраж**
 - **Спекуляция волатильностью**
- **Моделирование портфелей**
- **Сравнение доходности и риска**
- **Торговые операции на рынке**

Доска опционов

Менеджер опционов RTS																			
Theta	Vega	Gamma	Delta	IV (BS)	IV		% изменения	Последняя	теоретическая цена (BS)	Продажа	Покупка	Страйк	Покупка	Продажа	теоретическая цена (BS)	Последняя	% изменения	IV Покупки/Продажи	
					Продажа	Покупка												Покупка IV	Продажа IV
RTS-12.09 (Дней до экспирации 60) Маркируемый																			
68.09	97....	0.000005	0.9	0	0	0	100	0	31,851	0	225	115,000	1,945	2,100	1,301	2,100	0.4	54	55.3
79.37	12....	0.000007	0.86	44.2	64.1	0	0	27,255	27,695	30,000	25,000	120,000	2,655	2,850	2,055	2,755	9.8	52.4	53.9
90.22	15....	0.000009	0.81	30.5	0	0	8.3	21,555	23,815	0	11,000	125,000	3,740	3,880	3,085	3,750	12.9	52	52.9
99.68	18....	0.000011	0.75	34.6	61.3	0	10.3	17,990	20,247	22,800	12,010	130,000	4,995	5,060	4,428	5,110	12.8	50.9	51.3
106....	20....	0.000012	0.69	43.1	41.6	21.4	5.3	16,050	17,020	15,755	12,100	135,000	6,575	6,600	6,112	6,585	15	50.1	50.2
111.4	22....	0.000013	0.62	38.1	38.3	37.9	15.3	12,000	14,148	12,060	11,970	140,000	8,400	8,460	8,150	8,460	15.1	49	49.3
112....	22....	0.000014	0.55	38.1	38.2	38	19.9	9,390	11,631	9,410	9,360	145,000	10,850	10,865	10,543	10,860	13.3	49.2	49.2
111....	23....	0.000014	0.48	38.8	38.9	38.8	23.7	7,330	9,460	7,385	7,330	150,000	13,830	13,890	13,283	13,860	10	50.2	50.5
106....	22....	0.000013	0.41	39.8	39.8	39.3	26	5,770	7,615	5,790	5,700	155,000	15,000	19,000	16,348	0	100	41.9	59.4
RTS-12.09 (Дней до экспирации 60) С уплатой премии																			
68.09	97....	0.000005	0.9	0	0	0	100	0	31,851	0	0	115,000	0	0	1,301	0	100	0	0
79.37	12....	0.000007	0.86	0	0	0	100	0	27,695	0	0	120,000	0	0	2,055	0	100	0	0
90.22	15....	0.000009	0.81	0	0	0	100	0	23,815	0	0	125,000	0	0	3,085	0	100	0	0
99.68	18....	0.000011	0.75	0	0	0	100	0	20,247	0	0	130,000	0	0	4,428	0	100	0	0
106....	20....	0.000012	0.69	0	0	0	100	0	17,020	0	0	135,000	0	0	6,112	0	100	0	0
111.4	22....	0.000013	0.62	0	0	0	100	0	14,148	0	0	140,000	0	0	8,150	0	100	0	0
112....	22....	0.000014	0.55	0	0	0	100	0	11,631	0	0	145,000	0	0	10,543	0	100	0	0
111....	23....	0.000014	0.48	0	0	0	100	0	9,460	0	0	150,000	0	0	13,283	0	100	0	0
106....	22....	0.000013	0.41	0	0	0	100	0	7,615	0	0	155,000	0	0	16,348	0	100	0	0

- Котировочные данные
- Теоретическая цена
- Греки: дельта, гамма, вега, тетта
- Подразумеваемая волатильность

Фьючерсы и агрегированная информация

Менеджер опционов RTS															
Дата	Закрытие пред. дня	Макс.цена	Мин.цена	Объем за сессию(шт)	Откр.поз.	Средняя IV				Объем		Открытые контракты		Коэффициент Call/Put	
						Put IV	Call IV	Put(Forts) IV	Call(Forts) IV	Put Объем	Call Объем	Put открытые	Call	Объем.коэффи...	Контракты...
-0.2	144,200	147,500	142,720	53,300	22,178	22.8	16.7	48.4	48.4	984.8	1,881.4	3,011.6	4,927.7	1.910419	1.636229
-100	115,000	0	0	0	60	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

Сери	Theta	Vega	Gamma	Delta	IV (BS)	IV		% изменения	Последняя	Теоретическая цена (BS)	Продажа	Покупка	Страйк	Покупка	Продажа	Теоретическая цена (BS)	Последняя	% изменения	IV Покупки/Продажи	
						Продажа	Покупка												Покупка IV	Продажа IV
40	67.63	96...	0.000005	0.9	0	0	0	100	0	32,169	0	22	115,000	1,945	2,195	1,263	2,100	0.4	54.4	56.7
40	78.91	12...	0.000007	0.86	41.3	62.1	0	0	27,255	27,999	30,000	25,000	120,000	2,655	2,845	2,009	2,755	9.8	52.9	54.2
40	89.81	15...	0.000009	0.81	26.9	0	0	8.3	21,555	24,101	0	11,000	125,000	3,740	3,825	3,021	3,750	12.9	52.4	52.9
40	99.38	18...	0.000011	0.76	32.8	60	0	10.3	17,990	20,513	22,800	12,010	130,000	4,990	5,050	4,344	5,110	12.8	51.4	51.8
40	106....	20...	0.000012	0.69	41.9	40	19.2	5.3	16,050	17,264	15,695	12,100	135,000	6,480	6,540	6,005	6,480	16.3	50.2	50.5
40	111....	22...	0.000013	0.62	37.9	38.4	37.8	14	12,180	14,367	12,300	12,150	140,000	8,300	8,340	8,019	8,310	16.6	49.1	49.3
0	113....	23...	0.000014	0.56	38	38	37.8	17.9	9,630	11,890	9,630	9,560	145,000	10,665	10,740	10,338	10,680	14.7	49.3	49.6
0	111....	23...	0.000014	0.48	39	39	38.6	21.1	7,575	9,631	7,575	7,480	150,000	13,560	13,710	13,103	13,590	11.8	49.9	50.5
0	107....	22...	0.000013	0.42	39.2	39.2	39.1	25	5,850	7,811	5,855	5,830	155,000	15,000	19,000	16,146	0	100	42.9	60.3

- Волатильность IV PUT и CALL по серии
- Объемы PUT и CALL
- Открытый интерес (OI)
- Коэффициент CALL/PUT: объемы и OI

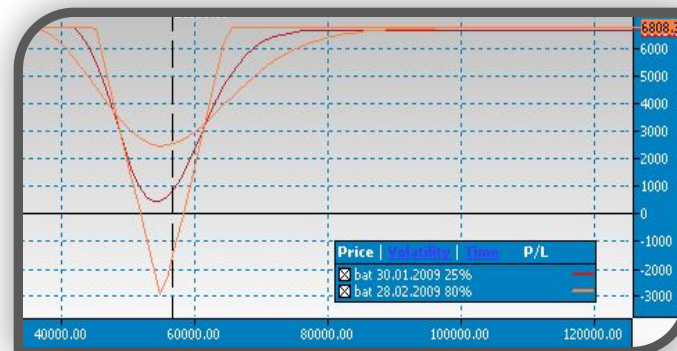
Анализ. Торговля. Моделирование

The screenshot displays a complex financial table with multiple columns. The top section shows summary statistics for 'RTS-12.09' futures, including 'Макс.цена' (Max Price), 'Мин.цена' (Min Price), 'Объем за сессию(шт)' (Volume for session), and 'Средняя IV' (Average IV). The main table lists individual positions with columns for 'Цена' (Price), 'IV', 'Delta', 'Gamma', 'Theta', 'Vega', and 'Gamma'. The bottom table provides a summary of 'STRADDLE' positions, including 'Кол-во' (Quantity), 'Погашение' (Maturity), 'Страйк' (Strike), and 'Call/Put' type.

- Оценка греков, прибыли в табличной форме
- Покупка и продажа позиций по рыночной цене
- Покупка и продажа позиций по указанным ценам
- Просмотр размера гарантийного обеспечения

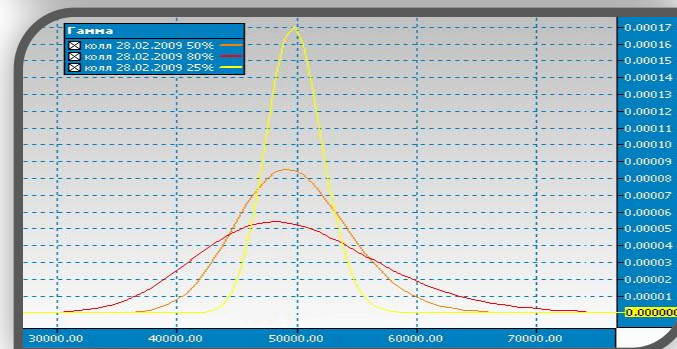
График P/L

- доходность P/L
 - Цена
 - Дата
 - Волатильность



Коэффициенты «греки»

- **Delta, Gamma, Theta, Vega**
- для разных стратегий и параметров модели



Улыбка волатильности

- модель **Volatility Skew**
- расчет по **Last, Ask, Bid**

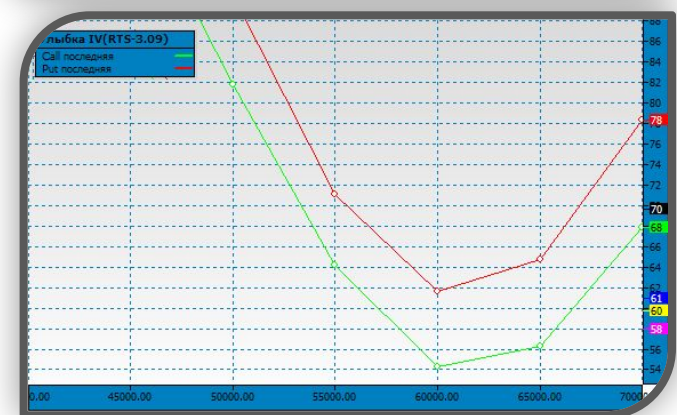
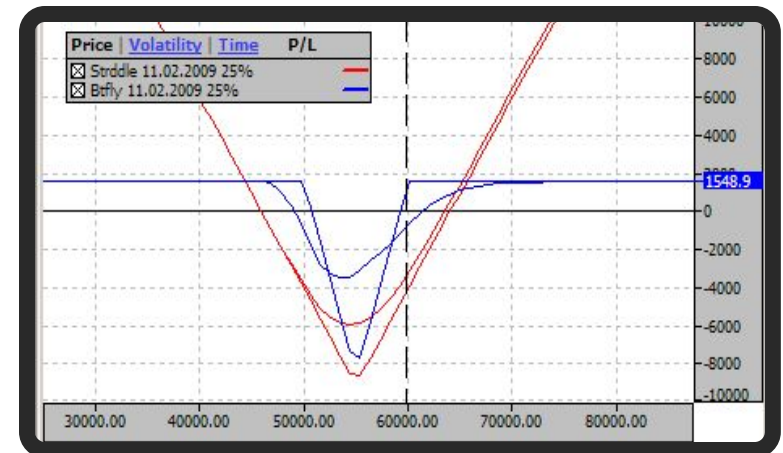
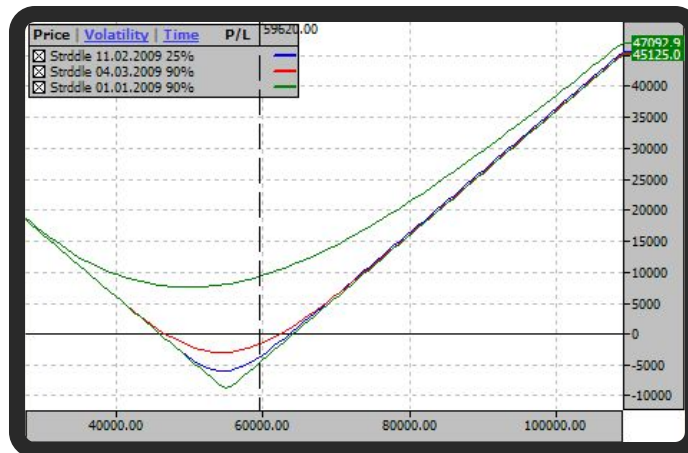


График Гарантийного обеспечения

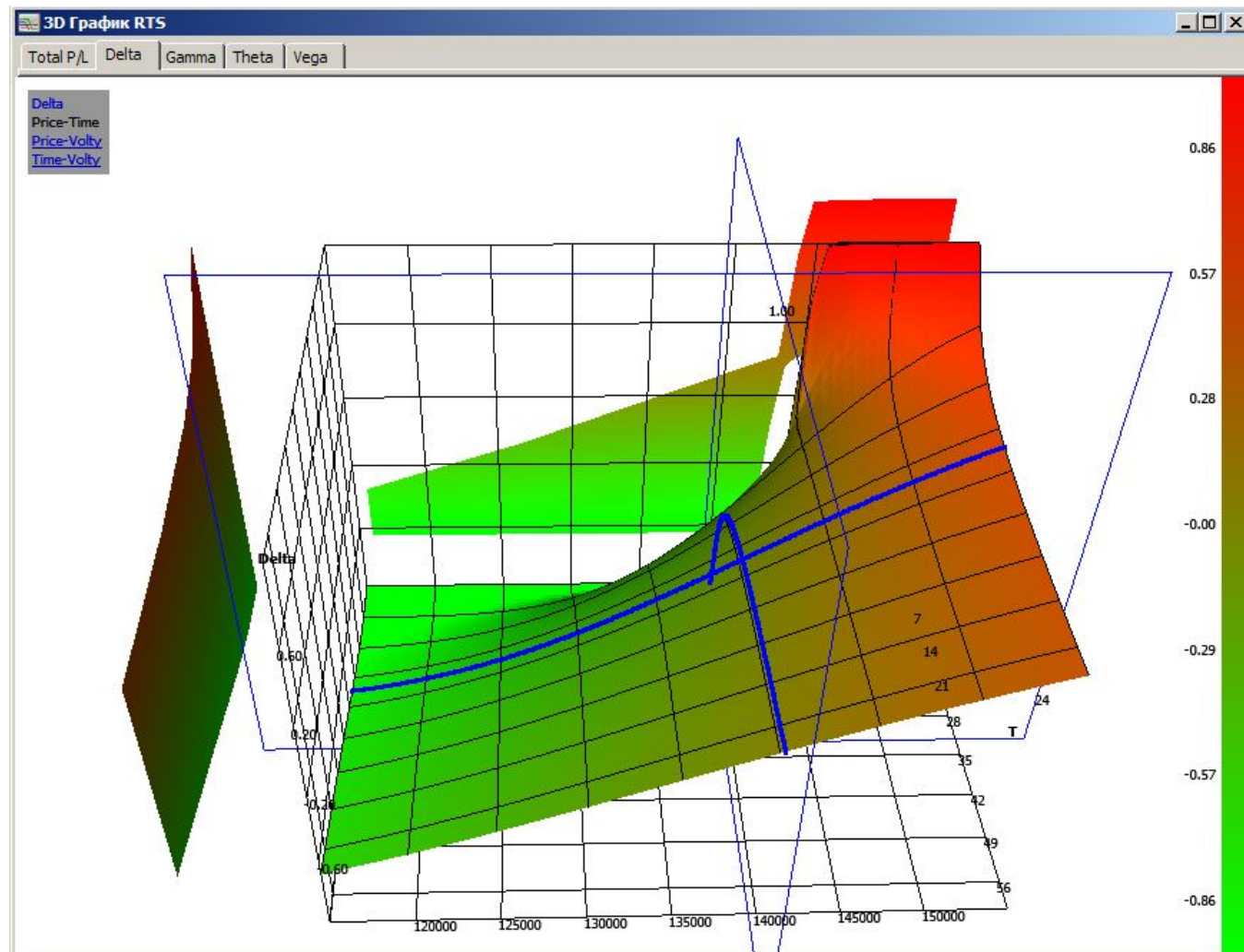
- В зависимости от цены базового актива

Сравнение эффективности и уровня риска стратегий:



- Одна стратегия при различных уровнях волатильности и датах до экспирации
- Несколько спредов для с одной и разной датой экспирации

Поверхность доходности



Настройки и шаблоны

The image displays several overlapping windows from the NetInvestor software, illustrating its advanced features for options trading analysis.

- Options Calculator (Опционный калькулятор):** Multiple instances of this window are shown, displaying detailed data for various instruments (e.g., RTS-6.09, RTS-3.09). The windows include columns for instrument name, time, last price, open interest, and closing price. They also feature a grid for calculating Greeks (Delta, Gamma, Vega, Theta) and other metrics for different positions.
- Charting Tools:** Three distinct charts are visible:
 - A **P/L (Profit/Loss) chart** showing a V-shaped curve for a straddle strategy on 28.01.2009 with a 25% volatility. The x-axis represents price (40,000.00 to 100,000.00) and the y-axis represents P/L (-15,000 to 41,375.00).
 - A **Volatility chart** showing a similar V-shaped curve, highlighting the relationship between price and volatility.
 - A **Price chart** showing a linear upward trend, likely representing the underlying asset's price over time.
- Data Tables:** Several tables are visible, including:
 - A table with columns: Instrument, Time, Last Price, Open Interest, Closing Price.
 - A table with columns: IV (Implied Volatility), IV (BS), IV (Prokash/Plouze), IV (Prokash/Plouze), IV (Prokash/Plouze), IV (Prokash/Plouze), IV (Prokash/Plouze), IV (Prokash/Plouze), IV (Prokash/Plouze).
 - A table with columns: Call/Put, Strike, Max profit, Delta, Gamma, Theta, Vega, and Break-even expiration.
 - A table with columns: Instrument, Volume, Strike, Call/Put, Price opened, Last Price, Delta, Gamma, Theta, Vega.

Преимущества

Отсутствие связи с внешними системами

Отсутствуют экспорты/импорты, передача данных, обработка БД

Данные актуальны и достоверны без задержек

Заложенные в модели и расчеты котировки поступают онлайн

Невозможны операторские ошибки

Данные не могут быть потеряны или искажены

Оптимальная компоновка

«Традиционная» доска опционов позволяет охватить одним взглядом обстановку на рынке

Доступно и понятно трейдеру

Независимо от опыта работы на срочном рынке пользователь сможет моделировать, изучать и сравнивать опционные стратегии



Автор: Константин Ивайловский

- Служба поддержки: service@mfd.ru
- Телефон: 8 (495) 921 15 50