



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

История										Средняя IV				Объем		Открытые контракты		Кoeffициент Call/Put	
Дата	Закр. пред. дня	Макс. цена	Мин. цена	Объем за сессию(шт)	Откр. поз.	Put IV	Call IV	Put(Forts) IV	Call(Forts) IV	Put Объем	Call Объем	Put открытые	Call	Объем коэфф.	Контракты	Контракты	Контракты		
1.2	144,200	147,500	142,135	63,591	22,832	22.7	17.4	48.3	48.3	1,543.8	0	2,9	0	199.2	0	1.66	309		
100	115,000	0	0	0	60	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		

Дата	Угол	Смещение	Дата	IV (р/с)	IV	Изменения	Процент	Теоретическая	Процент	Процент	Теоретическая	Процент	Процент	Теоретическая	Процент	Процент	IV Покупка/Продажа		
								цена (BS)			цена (BS)			цена (BS)			Покупка IV	Продажа IV	
0	69.4	10...	0.000006	0.9	0	0	100	30,955	0	225	115,000	2,060	2,325	1,397	2,090	0	54	56.2	
0	80.68	13...	0.000008	0.85	29	69	8.2	25,000	26,841	30,000	20,000	120,000	2,820	2,995	2,191	2,995	1.9	52.6	53.8
0	91.35	15...	0.000009	0.8	38	0	8.3	21,555	23,012	0	11,000	125,000	3,955	4,025	3,276	3,955	8.2	52	54.4
0	100...	18...	0.000011	0.74	39.4	70.1	0	10.3	17,990	19,503	23,800	130,000	5,275	5,375	4,675	5,100	9	57	57.7
0	107...	20...	0.000012	0.68	44.8	43	28.4	7.3	15,700	16,341	15,340	135,000	6,915	7,015	6,429	7,145	9	50.2	51.8
0	111...	22...	0.000013	0.61	38.9	39.5	39.3	18.5	11,550	13,524	11,690	140,000	8,825	8,925	8,536	8,980	9.9	49.2	49.6
0	111...	22...	0.000014	0.53	38.9	39.6	39.2	23.3	8,995	11,079	9,190	145,000	10,855	11,375	11,001	11,435	8.7	47.2	49.5
0	109...	22...	0.000...	0.47	39	40	39.6	27.5	6,960	8,978	7,180	150,000	13,770	0	13,800	14,130	8.3	47.8	0
0	104...	22...	0.000013	0.4	39.6	40.4	40	30.9	5,385	7,200	5,555	155,000	15,000	19,000	16,931	0	100	39.1	57

Позиция	Инструмент	Кол-во	Погашение	Страйк	Call/Put	Цена открытия	Тек. цена	Открытие позиции	Закр. позиции	Объем	Delta	Gamma	Theta	Vega	Ближай...	Тикер
STRADDLE	RTS-12.09...	1	14.12.2009	145,000	Put	11,580	10,855	20,700	19,945	11,580	10,855	0	0	0	0	RTS...
	RTS-12.09...	1	14.12.2009	145,000	Call	9,190	9,990	9,190	9,990	9,190	9,990	0	0	0	0	RTS...

Фьючерсы

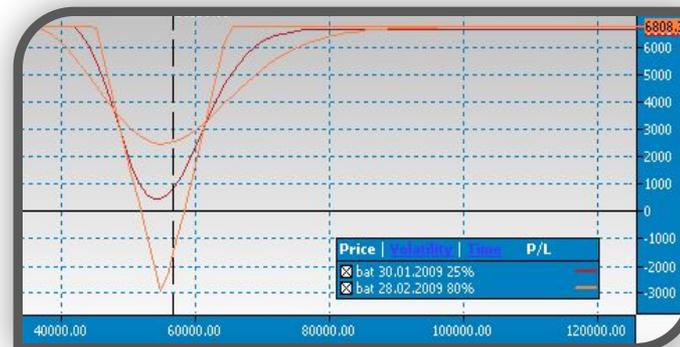
Опцион

Модельтор

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

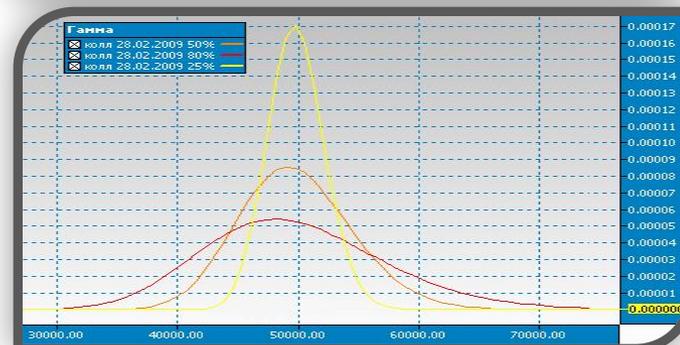
### График P/L

- доходность P/L
  - Цена
  - Дата
  - Волатильность



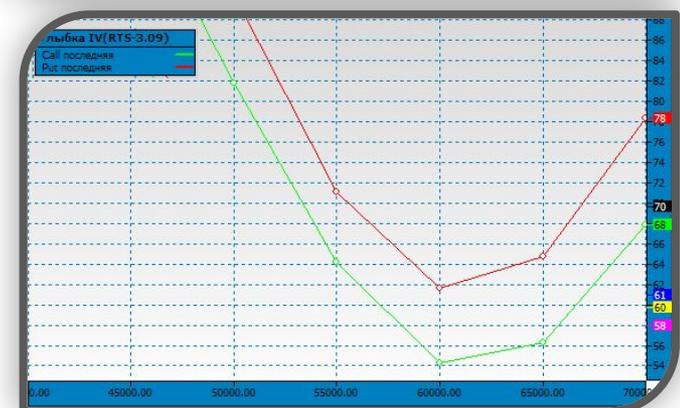
### Коэффициенты «греки»

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



### Улыбка волатильности

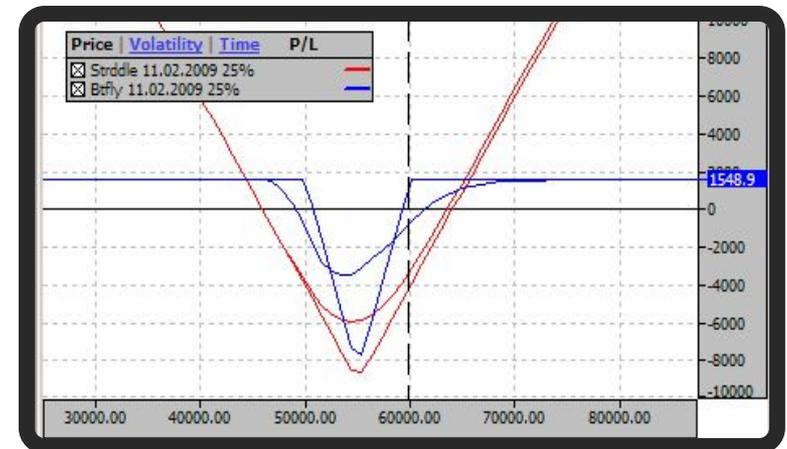
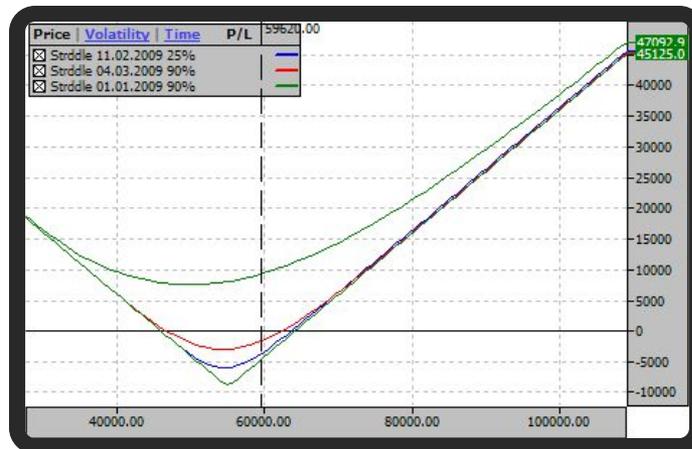
- модель **Volatility Skew**
- расчет по **Last, Ask, Bid**



### График Гарантийного обеспечения

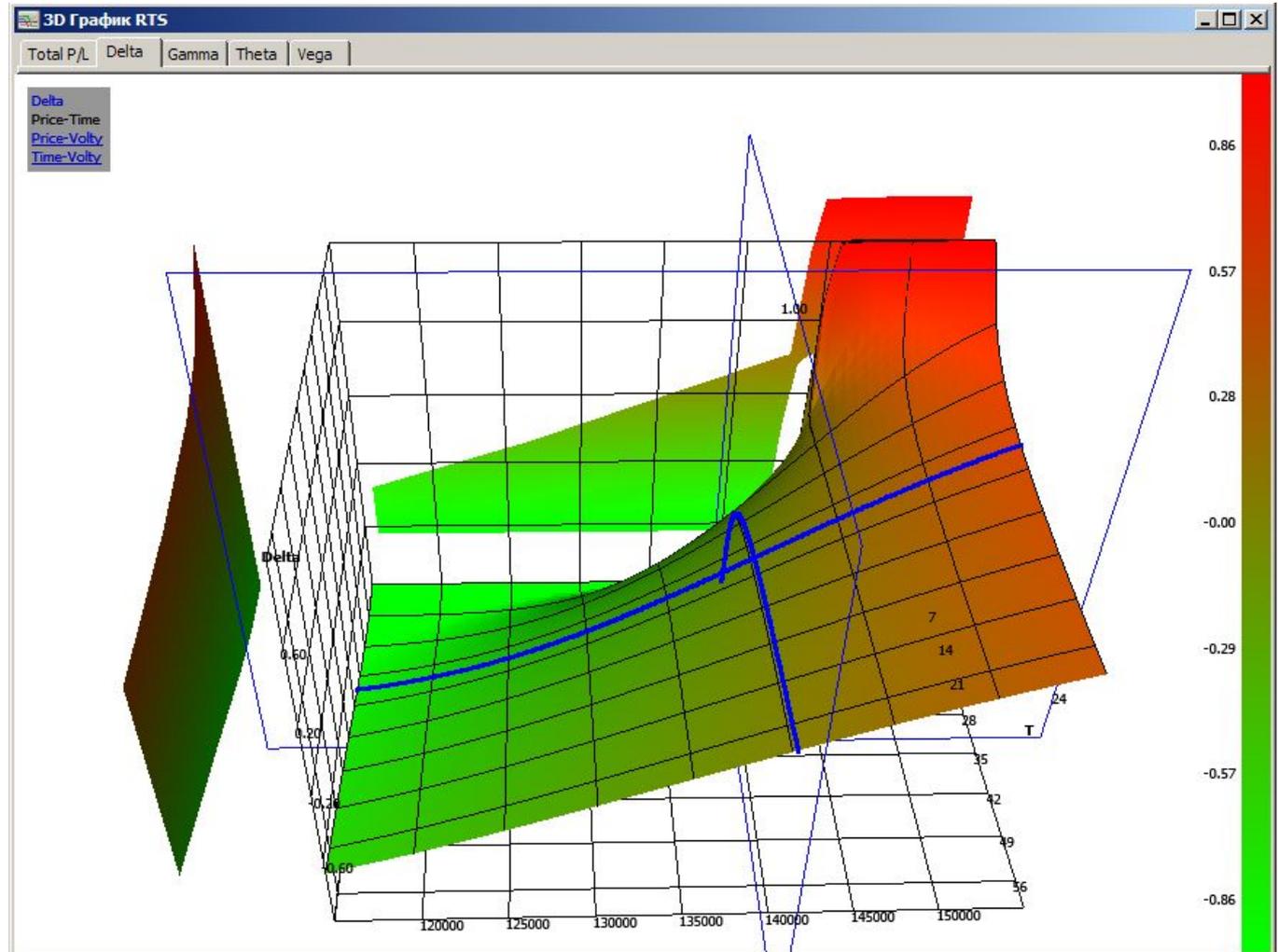
- В зависимости от цены базового актива

## 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 interface:

- Options Calculator (Опционный калькулятор):** Multiple instances showing input parameters like instrument, time, and payoff, along with calculated values for various Greeks and coefficients.
- Data Tables:** Tables listing instrument details, trade dates, and calculated values for different strategies and positions.
- P/L Charts:** Three distinct charts showing Profit/Loss (P/L) over time for different strategies, such as a straddle on 28.01.2009 with a 25% volatility.

## 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](mailto:service@mfd.ru)
- Телефон: 8 (495) 921 15 50