



АНАЛИЗ СДЕЛОК (ММВБ)

Руководство пользователя

Санкт-Петербург
2010 год

Содержание

1. Назначение утилиты.....	3
2. Структура и параметры утилиты.....	3
3. Структура архивного файла.....	5
4. Правила работы с утилитой.....	5
5. Удаление утилиты из Quik'a.....	9
6. Лицензионное соглашение.....	11
7. Контакты.....	14

1. Назначение утилиты

Назначение утилиты **Анализ сделок** или **TradeAnalysis** состоит в отслеживании различных параметров (прибыли, комиссии, объема, доходности и пр.) по уже открытым и закрытым сделкам за текущий день и за прошлые дни, а история по всем закрытым сделкам накапливается в специальном файле.

Таким образом, утилита будет незаменимым помощником в работе для любого трейдера или инвестора. С помощью нее можно оценивать эффективность торговли, анализировать свои ошибки, что очень полезно для совершенствования торговли.

2. Структура и параметры утилиты

Поговорим теперь более подробно о том, что же представляет из себя утилита. Вся полезная информация предоставляется трейдеру в виде таблицы.

№	Счет	Дата откр.	Бумага	Позиция	Цена откр. р.	Кол-во	Объем откр. р.	П/У о. р.	П/У о. %	Цена закр. р.	Объем закр. р.	Комиссия р.	П/У з. р.	П/У з. %	Доход год. %
1	87500	13.05.2010	АВТОВАЗАО	LONG	12,61	7	8 828,70	-150,98	-1,71			0,88			
2	87500	13.05.2010	КАМАЗ	LONG	66,19	5	330,95	-0,03	-0,01			0,03			
3	87500	07.05.2010	СБЕРБАНК	LONG	71,10	2	142,20	19,55	13,75			0,01			
4	87500	13.05.2010	ЛУКОЙЛ	SHORT	1 606,67	2	3 213,34	-13,06	-0,41			0,32			
5	87500	13.05.2010	СБЕРБАНК	LONG	80,64	3	241,92			80,79	242,37	0,05	0,40	0,17	0,17
6	87500	11.05.2010	СБЕРБАНК	LONG	74,50	4	298,00			80,82	323,28	0,06	25,22	8,46	1 544,36
7	87500	13.05.2010	ЛУКОЙЛ	SHORT	1 605,28	5	8 026,40			1 609,47	8 047,35	1,61	-22,56	-0,28	-0,28
8	87500	13.05.2010	ЛУКОЙЛ	LONG	1 609,47	3	4 828,41			1 606,67	4 820,01	0,96	-9,36	-0,19	-0,19
9	87500	07.05.2010	СБЕРБАНК	LONG	71,10	1	71,10			80,82	80,82	0,02	9,70	13,65	830,35
10															
11	ИТОГО						25 981,02	-144,52			13 513,83	3,94	3,40	4,36	474,89

В ней отображаются открытые на текущий момент сделки (4 строки в верхней части, не выделенные цветом). При этом указывается дата открытия той или иной сделки. Кроме того в таблице отражается информация о сделках, закрытых **сегодня**. Зеленым цветом выделяются прибыльные сделки, красным – убыточные. Также вся информация о закрытых сделках накапливается в файле истории.

Последней строчкой в таблице отображается строка «ИТОГО». В ней показываются суммарные (для объема открытия, П/У о. р., объема закрытия, комиссии, П/У з. р.) и средние (для П/У з. % и годовой доходности) значения некоторых показателей.

В момент первого запуска утилиты в таблице будет всего одна строка, однако по мере торговли будут появляться все новые и новые записи.

Важно иметь ввиду, что утилита учитывает только те сделки, которые заключались, когда она работала. Поэтому утилита должна быть запущена всегда, когда ведется торговля, иначе результаты ее работы не будут соответствовать реальному положению вещей.

Описание всех параметров, отображаемых утилитой, приведено в таблице ниже.

Название поля	Значение
Счет	Код клиента в торговой системе.
Дата откр.	Дата открытия позиции.
Бумага	Название торгуемой ценной бумаги.
Позиция	Характеризует, велась ли игра на повышение (LONG) или понижение (SHORT).
Цена откр. р.	Стоимость одной ценной бумаги (средневзвешенная).
Кол-во	Количество лотов в сделке.
Объем откр.	Сумма денег, затраченная (LONG) или вырученная (SHORT) от открытия позиции.
П/У о. р.	Показатель прибыльности данной позиции (в рублях): $\text{П/У откр. руб. (LONG)} = (\text{Цена р} - \text{Цена откр.}) * \text{Кол-во откр.} * \text{Лот} - \text{Комиссия.}$ $\text{П/У откр. руб. (SHORT)} = (\text{Цена откр.} - \text{Цена р}) * \text{Кол-во откр.} * \text{Лот} - \text{Комиссия.}$ Где Цена р - цена последней сделки на бирже по данной бумаге.
П/У о. %	То же, что и пред., но в процентах от объема: $\text{П/У откр. \% (LONG, SHORT)} = (\text{П/У откр. руб.} / \text{Объем откр.}) * 100.$
Цена закр. р.	Цена (средневзвешенная) одной ценной бумаги, по которой прошло закрытие позиции.
Объем закр. р.	Сумма денег, вырученная (LONG) или затраченная (SHORT) на закрытие позиции.
Комиссия р.	Величина комиссии от сделки в рублях (включает в себя, как биржевую, так и брокерскую комиссию).
П/У з. р.	Показатель прибыльности закрытой сделки в рублях: $\text{П/У закр. руб. (LONG)} = (\text{Объем закр.} - \text{Объем откр.}) - \text{Комиссия.}$ $\text{П/У закр. руб. (SHORT)} = (\text{Объем откр.} - \text{Объем закр.}) - \text{Комиссия.}$
П/У з. %	То же, что и пред., но в процентах от объема: $\text{П/У закр. \% (LONG, SHORT)} = (\text{П/У з. р.} / \text{Объем откр.}) * 100$
Дох-ть год. %	Доходность сделки в годовом масштабе: $\text{Дох. Год \%} = \text{П/У з. руб.} / \text{Объем о.} * [365 / (\text{дата з.} - \text{дата о.})] * 100,$ если дата открытия не равна дате закрытия и $(\text{П/У з. руб.} / \text{Объем о.}) * 100$ в противном случае.

3. Структура архивного файла

Как уже отмечалось выше, вся история совершенных сделок сохраняется в специальном файле. Он называется «Сделки.csv» и по умолчанию хранится в одной папке с самой утилитой. Посмотреть его содержимое можно при помощи Excel. Обзору структуры данного файла и посвящен настоящий раздел.

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N
1	СЧЕТ	ДАТА ОТКРЫТИЯ	ДАТА ЗАКРЫТИЯ	БУМАГА	ПОЗИЦИЯ	ЦЕНА ОТК	КОЛ-ВО	ОБЪЕМ О	ЦЕНА ЗАК	ОБЪЕМ ЗА	КОМИССИ	П/У З. (РУБ)	П/У З. %	ДОХОДНОСТЬ, ГОД. %
2														
3														
4	87500	13.05.2010	13.05.2010	СБЕРБАН	LONG	80,61	3	241,83	80,58	241,74	0,05	-0,14	-0,06	-0,06
5	87500	12.05.2010	13.05.2010	СБЕРБАН	LONG	79,5	3	238,5	80,58	241,74	0,05	3,19	1,34	488,5
6	87500	11.05.2010	13.05.2010	СБЕРБАН	LONG	74,16	2	148,32	80,58	161,16	0,03	12,81	8,64	1576,09
7														
8	87500	13.05.2010	13.05.2010	ЛУКОЙЛ	SHORT	1601,55	8	12812,4	1607,62	12861	2,57	-51,17	-0,4	-0,4
9	87500	13.05.2010	13.05.2010	АВТОВАЗ	LONG	12,61	2	2521	12,42	2484,8	0,5	-36,7	-1,46	-1,46
10	87500	11.05.2010	13.05.2010	СБЕРБАН	LONG	74,16	2	148,32	80,56	161,12	0,03	12,77	8,61	1571,17
11	87500	13.05.2010	13.05.2010	ЛУКОЙЛ	LONG	1607,62	2	3215,24	1605,45	3210,9	0,64	-4,98	-0,15	-0,15
12	87500	13.05.2010	13.05.2010	СБЕРБАН	SHORT	80,56	1	80,56	80,66	80,66	0,02	-0,12	-0,14	-0,14
13														
14														
15														
16	ОТКРЫТЫЕ СДЕЛКИ													
17	СЧЕТ	ДАТА ОТКРЫТИЯ	БУМАГА	ПОЗИЦИЯ	ЦЕНА ОТК	КОЛ-ВО	ОБЩ. КОЛ	ОБЪЕМ О	КОМИССИЯ (РУБ.)					
18	87500	13.05.2010	KMAZ	LONG	66,67	5	5	333,35	0,03334					
19	87500	13.05.2010	RU000A0D20P6	LONG	108,01	1	1	108,01	0,0108					
20	87500	13.05.2010	SBERO3	LONG	80,66	4	4	322,64	0,03226					

Типичный пример содержимого такого файла приведен на рисунке выше. В верхней части находится информация о закрытых сделках. Отмечены даты открытия и закрытия. Кроме того, сохранены все качественные показатели сделок.

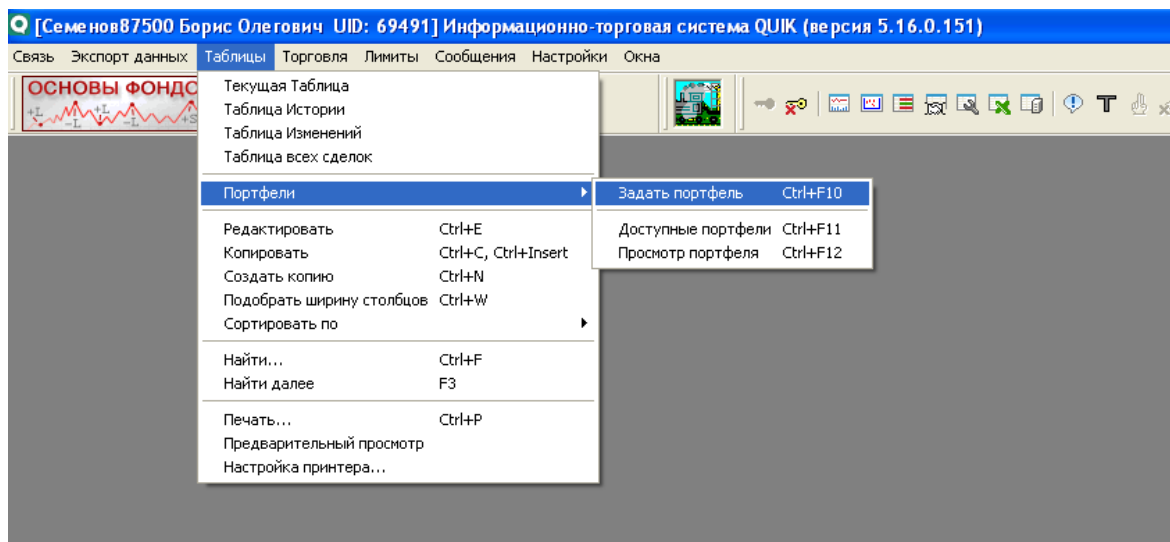
В нижней части приведена информация по открытым на текущий момент сделкам. Эта информация носит скорее служебный характер, т.к. нужна для корректного функционирования программы.

Важно: нельзя ничего исправлять и корректировать в файле с историей – это приведет к некорректной работе утилиты.

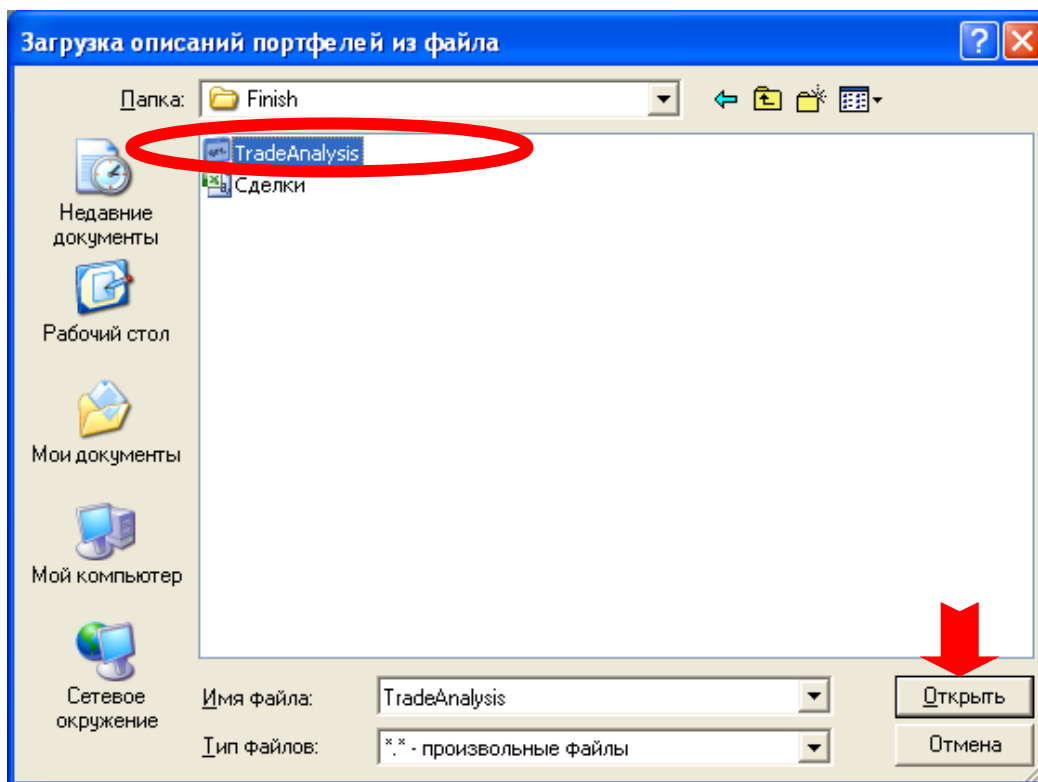
4. Правила работы с утилитой

Для запуска утилиты проделайте следующие действия:

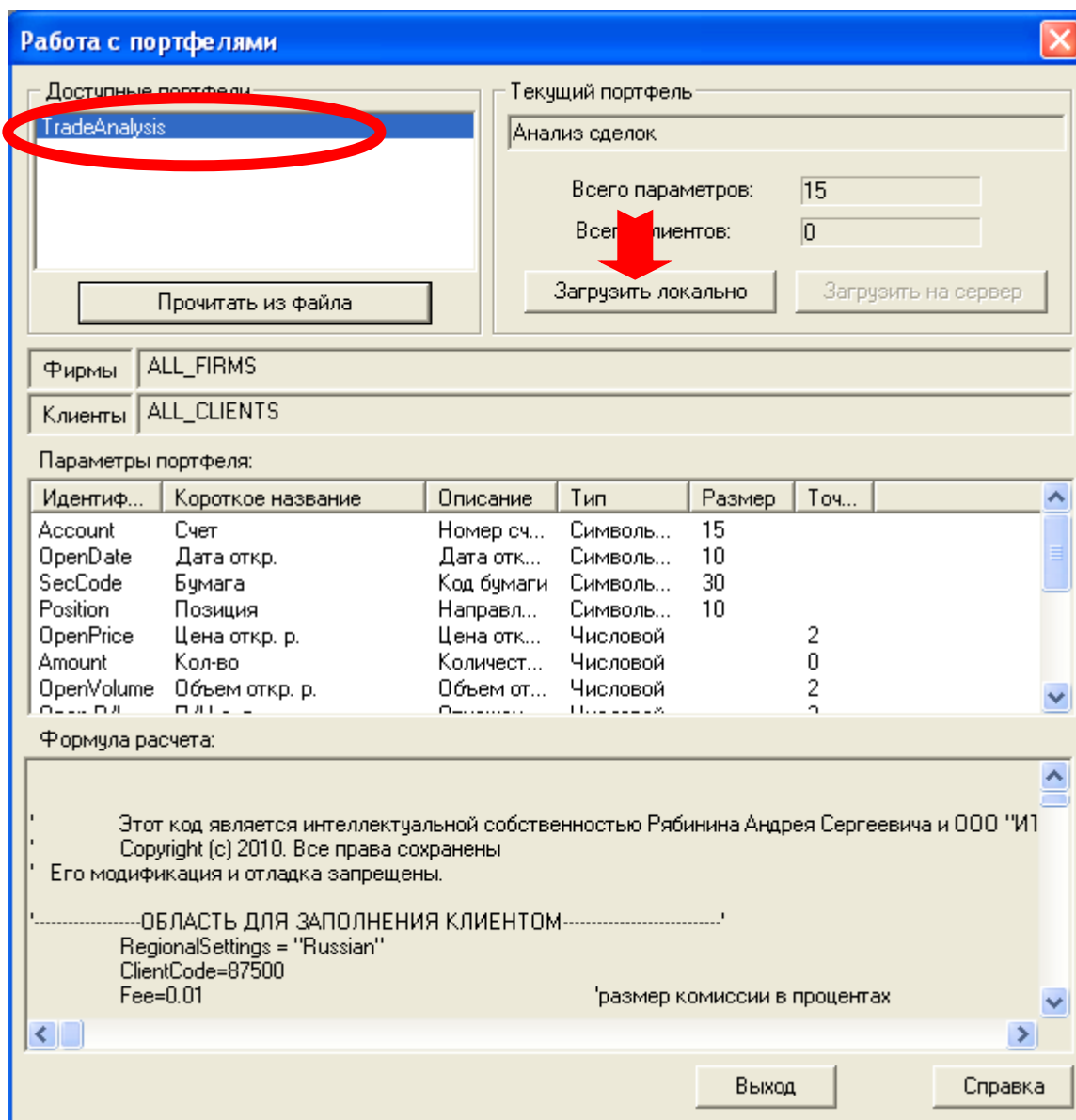
1. Запустите торговую программу Quik.
2. Выберите пункт меню Таблицы->Портфели->Задать портфель (или нажмите Ctrl+F10).



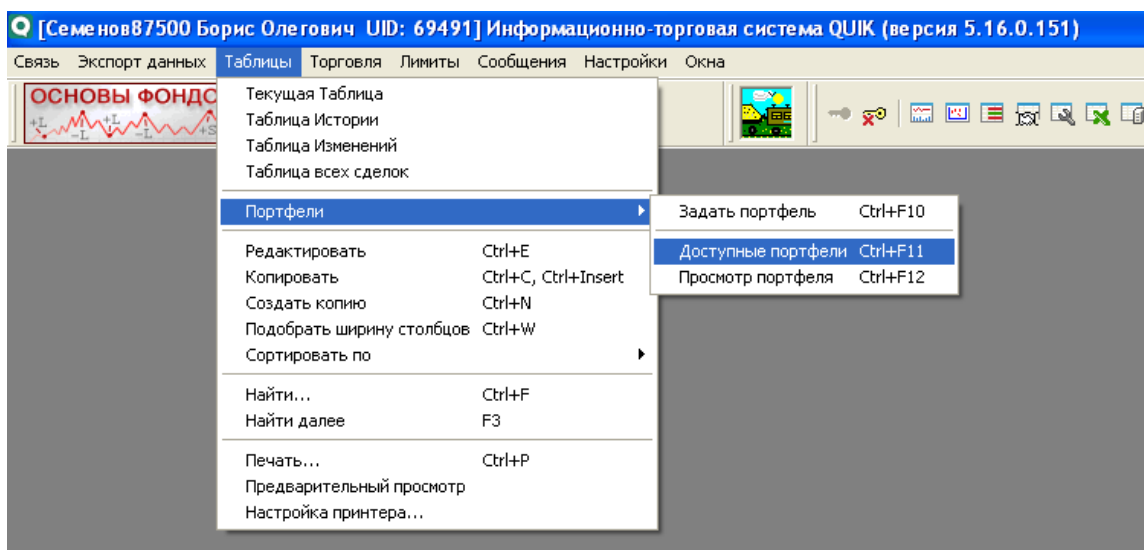
3. В появившемся окне найдите папку с Вашей утилитой, выберите ее и нажмите «Открыть».



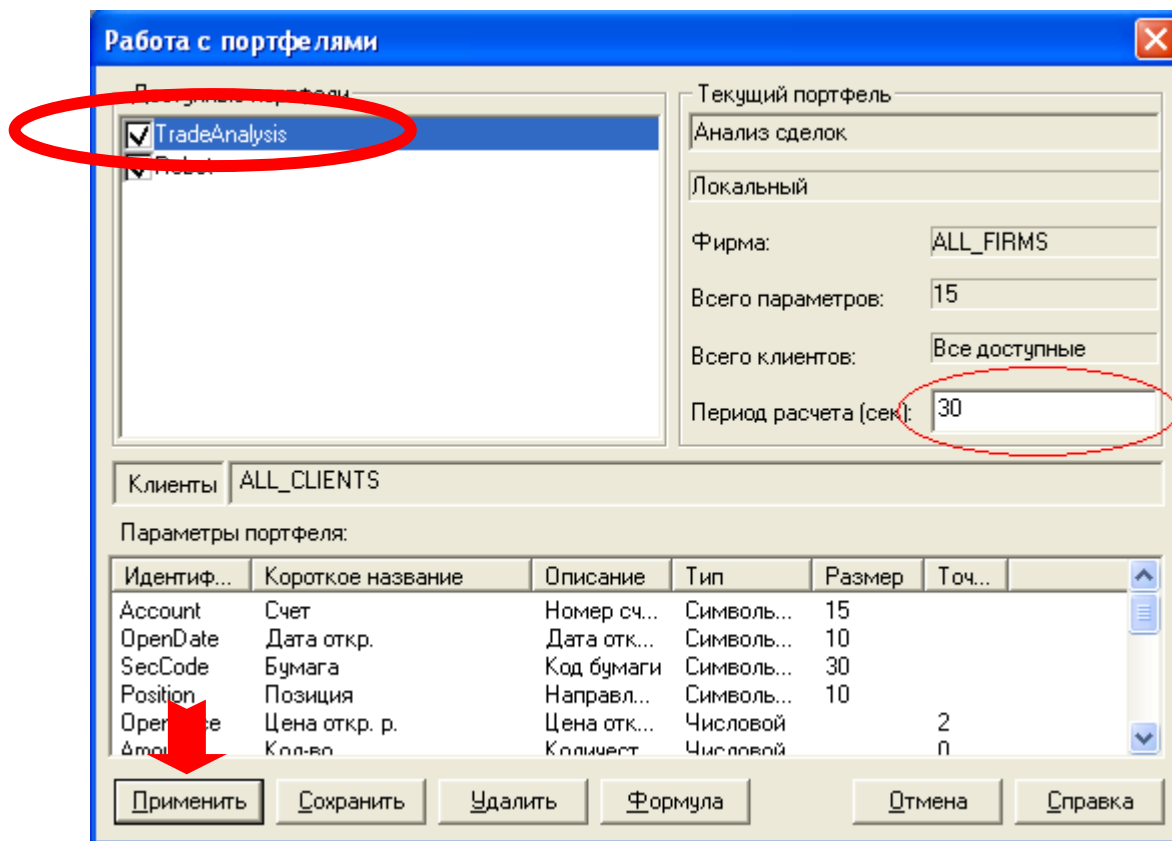
4. В появившемся окне нажмите кнопку «Загрузить локально», после чего закройте его (нажмите «Выход»).



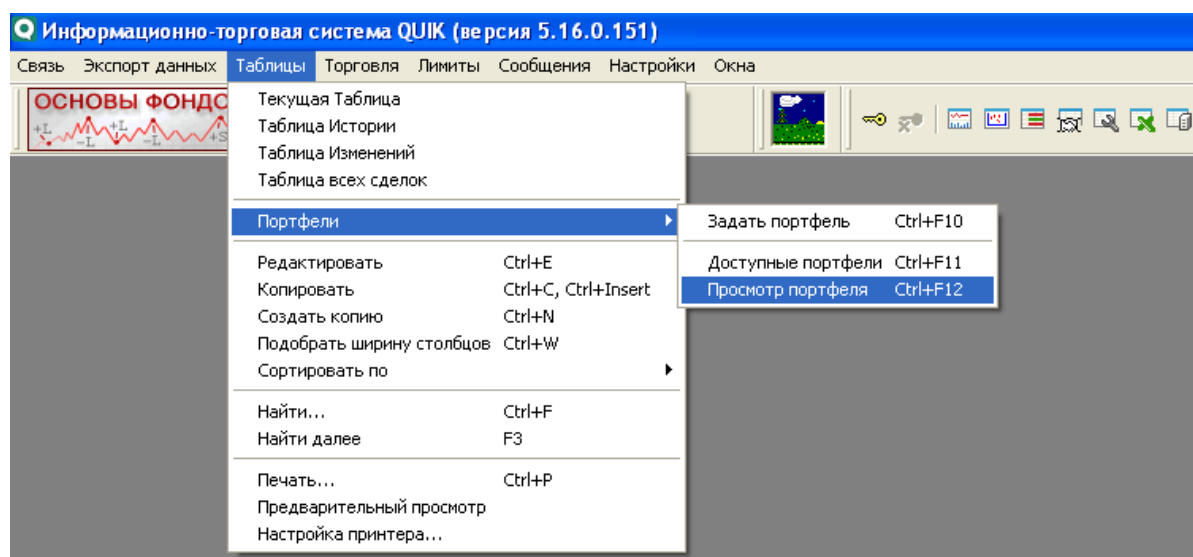
5. Далее выберите пункт меню Таблицы->Портфели->Доступные портфели (или нажмите Ctrl+F11).



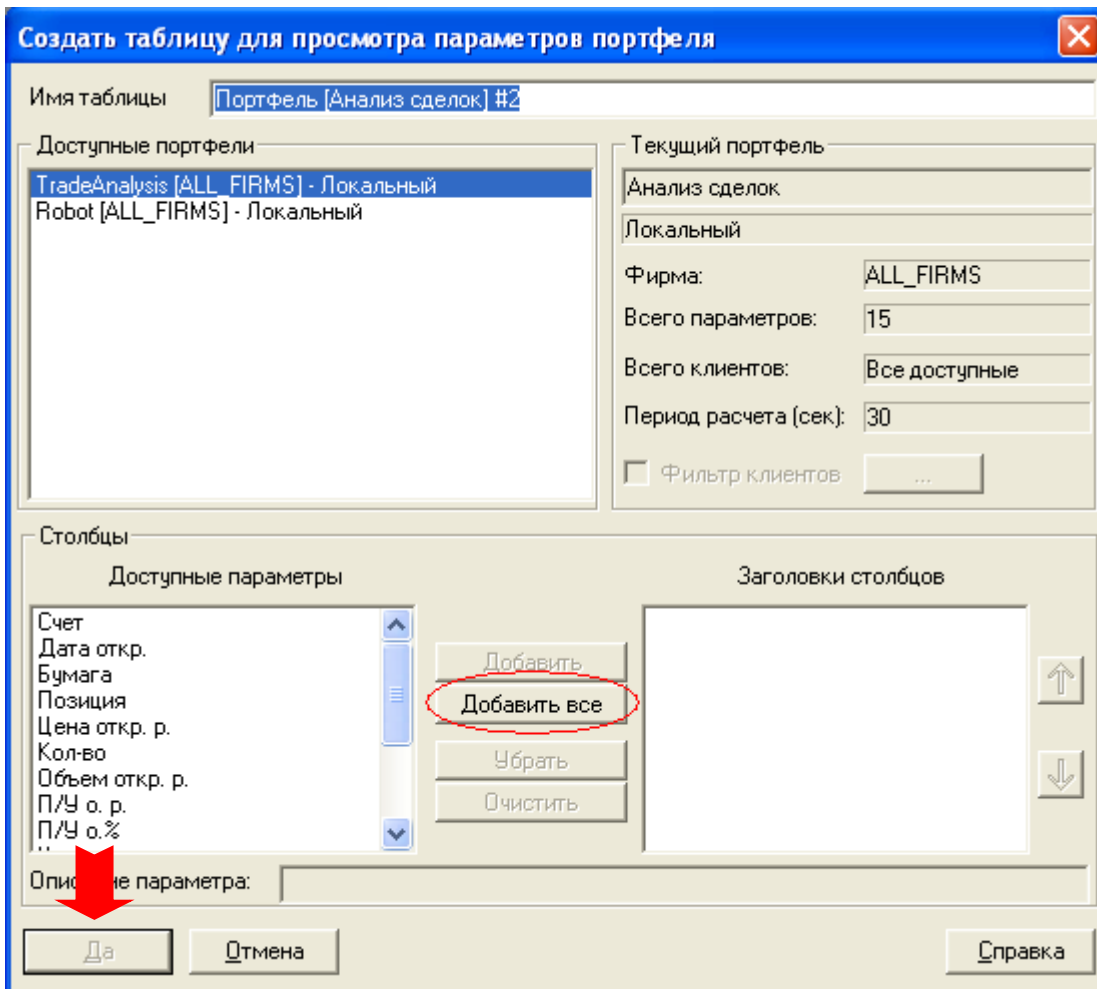
1. В появившемся окне выберите утилиту TradeAnalysis, задайте период расчета не меньше 20 сек. (желательно, 30 сек.) и нажмите кнопку «Применить».



2. После этого выберите пункт меню Таблицы->Портфели->Просмотр портфеля (или нажмите Ctrl+F12).



3. Выберите из списка доступных портфелей портфель TradeAnalysis, нажмите кнопку «Добавить все» (если вы не хотите, чтобы отображались все колонки, можете добавить лишь некоторые из возможных) и нажмите на кнопку «Да».



4. После проделанной работы у Вас на экране должна появиться таблица утилиты.

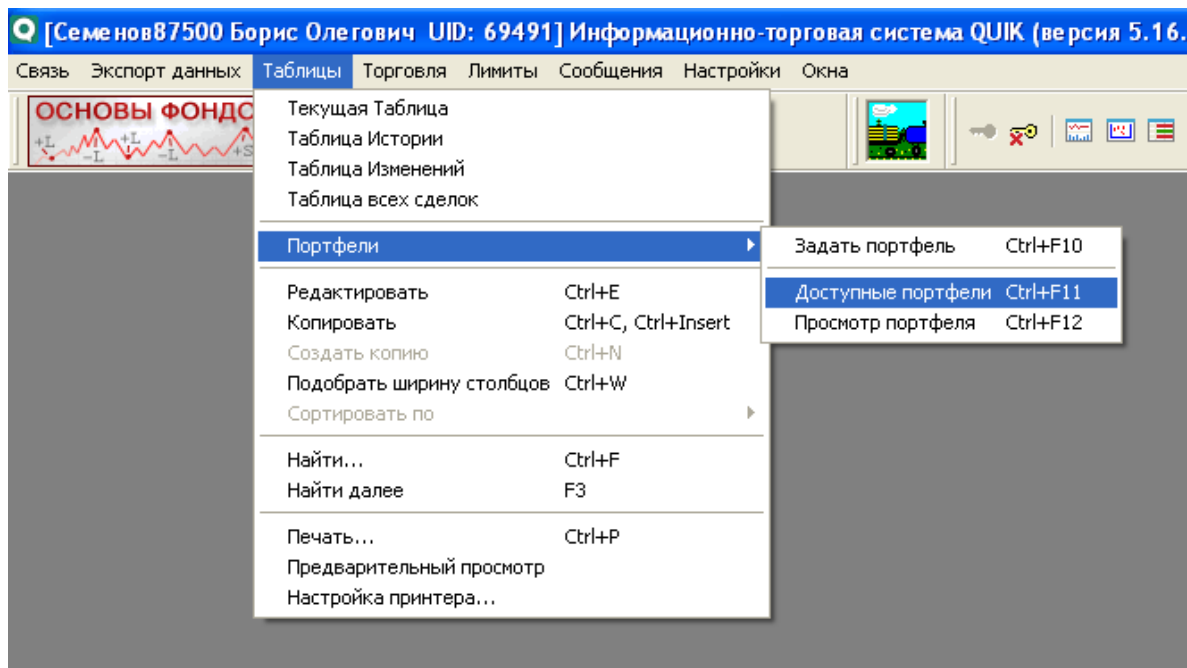
Важно: расчет параметров таблицы ведется в том числе на основе таблицы текущих значений параметров. Убедитесь, что необходимые для расчета параметров данные принимаются с сервера (не отключены фильтром в списке принимаемых параметров и бумага).

Важно: утилита рассчитана на работу только с одним клиентом, поэтому, если Вы попытаетесь запустить ее для клиента, «Код клиента» которого отличен от сообщенного при покупке утилиты, то она работать не будет.

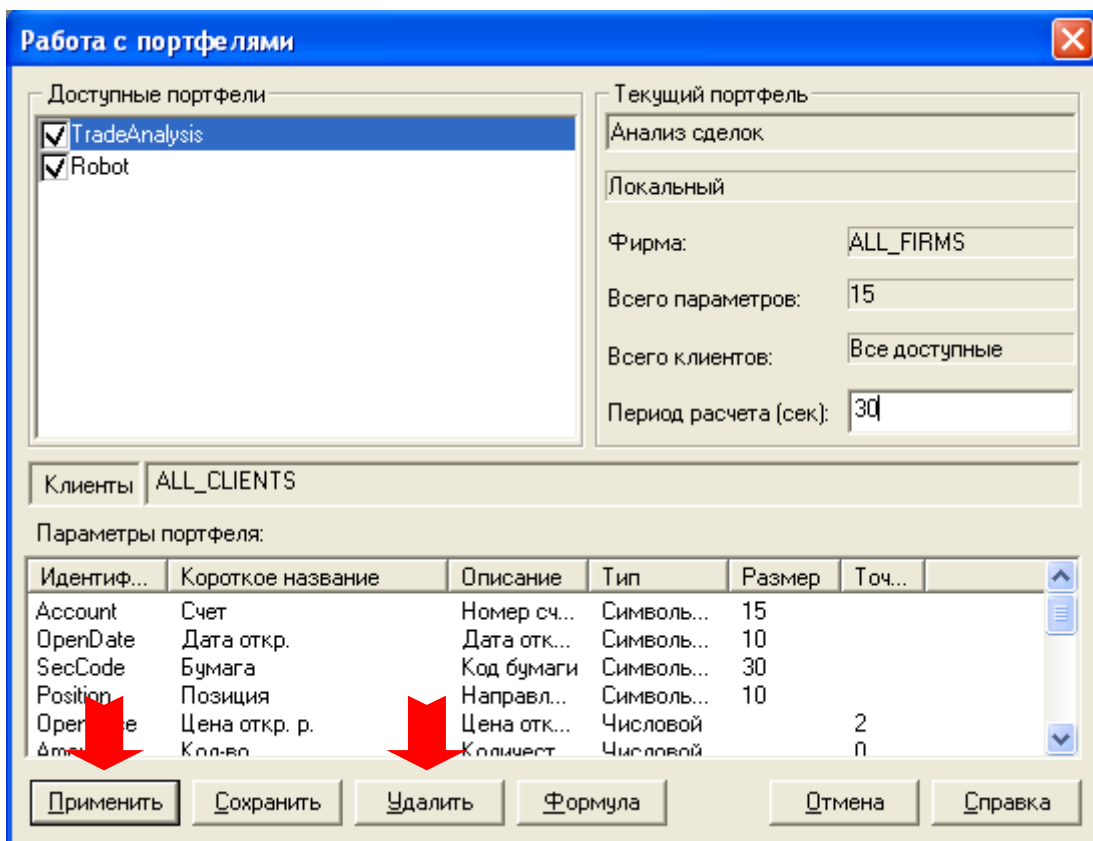
5. Удаление утилиты из Quik'a

В случае возникновения необходимости удаления утилиты из программы Quik, проделайте следующее:

1. Выберите пункт меню Таблицы->Портфели->Доступные портфели (или нажмите Ctrl+F11)



2. В появившемся окне выберите утилиту TradeAnalysis и нажмите кнопку «Удалить», затем «Применить».



3. Закройте таблицу утилиты нажатием на крестик в ее правом верхнем углу.

6. Лицензионное соглашение

На данное руководство пользователя распространяется действие приводимого ниже лицензионного соглашения.

Важно - ПРОЧИТЕ ВНИМАТЕЛЬНО!

Настоящее лицензионное соглашение (далее "соглашение") является юридическим документом, заключаемым между Вами (физическим или юридическим лицом) и компанией ООО «Инвестиционные торговые технологии» (далее «компания ИТТ»), являющейся производителем и исключительным правообладателем данного программного обеспечения (далее "программа" или "программное обеспечение"), относительно использования прилагаемого программного обеспечения, включающего в себя программное обеспечение, записанное на соответствующих носителях, любые печатные материалы и любую "встроенную" или "электронную" документацию, поставляемую компанией ИТТ. К программному обеспечению относятся также любые обновления и дополнения к программному обеспечению, исходно предоставленному компанией ИТТ.

Устанавливая, копируя, загружая, осуществляя доступ или иным образом используя указанную программу, материалы или документацию, Вы, тем самым, принимаете на себя условия настоящего соглашения.

Если Вы не согласны с условиями настоящего лицензионного соглашения, Вы не имеете права устанавливать или использовать данное программное обеспечение; верните его продавцу и получите обратно уплаченные деньги.

ЛИЦЕНЗИЯ НА ПРОГРАММУ

Программа защищена законами и международными соглашениями об авторских правах, а также другими законами и договорами, регулирующими отношения авторского права. Данная программа лицензируется, а не продается.

1. ЛИЦЕНЗИЯ.

Компания ИТТ предоставляет Вам следующие права при условии соблюдения Вами всех положений и условий настоящего соглашения:

* *Установка и использование.* Разрешается установить и использовать одну копию программного обеспечения на одном компьютере, в качестве которого может выступать рабочая станция, терминал или любое другое цифровое электронное устройство (далее "компьютер").

2. ПРОЧИЕ ПРАВА И ОГРАНИЧЕНИЯ.

* *Запрет на публикацию сведений, предоставляемых программой.* Запрещается публиковать на регулярной основе информацию на любых носителях, полученную при использовании программы без разрешения компании ИТТ.

** Запрет на вскрытие технологии, декомпиляцию и модификацию. Вам не разрешается изменять, декомпилировать, дезассемблировать, дешифровать и производить иные действия с объектным кодом программного обеспечения, имеющие целью получение информации о реализации алгоритмов, используемых в программном обеспечении, без письменного согласия на то компании ИТТ. Вы не имеете права каким-либо образом модифицировать механизм внутренней защиты программы за исключением случаев и только в той степени, когда такие действия явно разрешены действующим законодательством. Запрещается также любая модификация материалов, документации и исполняемых файлов программы без согласия компании ИТТ. Копирование и использование такого программного обеспечения, является незаконным и влечет ответственность в соответствии с законами государства, где такое копирование или использование имеют место.*

** Разделение программы. Программа лицензируется как единое изделие. Запрещается отделять от нее составляющие ее части для раздельного использования на нескольких компьютерах.*

** Временное пользование. Запрещается предоставлять программу во временное пользование.*

** Товарные знаки. Настоящее лицензионное соглашение не предоставляет Вам никаких прав в отношении каких-либо товарных знаков или названий, принадлежащих компании ИТТ.*

** Техническая поддержка. Компания ИТТ может оказывать услугу по технической поддержке программы (далее "техническая поддержка").*

** Конфиденциальность. Вы соглашаетесь с тем, что полученные от Вас в процессе регистрации данные, а также информация, сообщенная при обращении в Службу технической поддержки, могут быть использованы компанией ИТТ по ее усмотрению исключительно для внутренних нужд. Компания ИТТ гарантирует конфиденциальность полученной информации и ее недоступность третьим лицам, не являющимся сотрудниками компании ИТТ.*

** Расторжение соглашения. Без ущерба для каких-либо иных прав компания ИТТ вправе прекратить действие настоящего соглашения при несоблюдении Вами его положений и условий. В этом случае Вы обязаны уничтожить все имеющиеся у Вас копии программного продукта и его составных частей.*

3. ОБНОВЛЕНИЯ.

Чтобы воспользоваться программным продуктом, который является обновлением, необходимо иметь лицензию на данную программу.

4. АВТОРСКОЕ ПРАВО.

Все права собственности и авторские права на программу, содержание сопровождающих ее печатных материалов и любые копии программы принадлежат компании ИТТ и ее представителям. Все права собственности и авторские права на содержательную часть и в отношении ее, доступ к которой предоставляет программа, принадлежат владельцу авторских прав на данную содержательную часть и защищены законами и международными соглашениями об авторских правах. Настоящее соглашение не предоставляет Вам никаких прав на доступ к содержательной части. Все права, не предоставленные явно настоящим соглашением, сохраняются за компанией ИТТ.

5. ОТВЕТСТВЕННОСТЬ

Данная программа имеет информационное назначение и не является предложением проводить операции на рынке ценных бумаг. Информация, в ней содержащаяся, не может рассматриваться, как предложение о покупке или продаже ценных бумаг. Мы не утверждаем, что вся приводимая программой или документацией информация абсолютно точна.

Необходимо помнить, что любые инвестиции, предлагаемые в программе, могут быть связаны со значительными рисками и, следовательно, привести к убыткам.

Ни компания ИТТ, ни кто-либо из ее представителей или сотрудников не несет ответственности за возможный ущерб, нанесенный Вам в результате использования или невозможности использования данного программного обеспечения, а также в результате проведения операций с ценными бумагами, совершенных с использованием информации, содержащейся в программе. Любое лицо, юридическое или физическое, использующее данное программное обеспечение, понимает, что несет полную ответственность за возможные негативные последствия, вызванные несовместимостью или конфликтами программы с другими программными продуктами, установленными на компьютере этого лица.

Данное программное обеспечение не предназначено и не может быть использовано в информационных системах, работающих в опасных средах либо обслуживающих системы жизнеобеспечения, в которых сбой в работе программного обеспечения может создать угрозу жизни людей или повлечь большие материальные убытки. Принимая условия данного Договора, Вы соглашаетесь, что размер ответственности компании ИТТ за возможные последствия, вызванные использованием либо невозможностью использования программного обеспечения, ни при каких обстоятельствах не будет превышать суммы, заплаченной Вами при приобретении права на использование данного программного обеспечения.

7. Контакты

Информация об изменениях в различных версиях программы, а также список других полезных утилит доступны на официальном сайте в Internet <http://www.i-tt.ru/soft/qutils.html>

Форум пользователей программы: <http://www.i-tt.ru/forum/>

Служба технической поддержки: soft@i-tt.ru

Отдел продаж:

Тел.: 8-812-918 56 00

sales@i-tt.ru

Желаем приятной работы!

ООО "Инвестиционные Торговые Технологии".
Россия, Санкт-Петербург