



Анализ сделок внутри дня (ММВБ, FORTS)

Руководство пользователя

Санкт-Петербург
2009 год

Содержание

Что делает	3
Скриншот	3
Как использовать – краткая инструкция	3
Как использовать – более подробно	4
1. Загрузка программы	4
2. Настройка параметров программы	6
3. Создание таблицы	8
4. Поля, доступные в таблице	9
5. Функции, доступные в таблице	9
6. Как удалить утилиту из QUIK’а	10
Лицензионное соглашение	11
Контакты	13

Что делает

Считает прибыль/убыток по Вашим открытым и закрытым сделкам за текущий день (ММББ, FORTS). Учет сделок происходит по 10 показателям, отдельно по каждой бумаге, с учетом брокерских комиссионных. С ее помощью можно выявлять лучшие и худшие сделки, оценивать доходность операций и контролировать риски. Автоматически записывает все данные в Excel-файл.

Скриншот:

	Бумага	Дата	Поза	Рын. Цена	Ср.цена о	Кол.о	Объем о	П/У о р.	П/У о %	П/У о total %	Кол.з	Объем з	П/У з р.	П/У з %	П/У з total %	Комисс.р.	П/У о+з.р.	П/У о+з.р./total %
1	ГАЗПРОМ АО	5/4/2009	SHORT	155.0000	151.6250	12.100	1.834.662.00	-40.838.00	-2.23	-0.80	0	0.00	0.00	0.00	0.00	-1.100.79	-41.938.79	-0.8209
2	СУРГНФГЗ-П	5/4/2009	---	10.7550	10.8363	0	0.00	0.00	0.00	0.00	1,148	2.476,712.00	11,738.40	0.95	0.23	-1.486.03	10.252.37	0.2007
3																		
4	ИТОГО	5/4/2009					1,834,662.00	-40,838.00	-2.23	-0.80		2,476,712.00	11,738.40	0.95	0.23	-2,586.82	-31,686.42	-0.6202

Рис. 1. Таблица, которую утилита создает в QUIK'е

Как использовать – краткая инструкция:

1. Нажатием клавиш «Ctrl»+«F10» открывается окно, в котором выбираем требуемый файл на диске (TradeResults.qpl) и нажимаем кнопку «Открыть».
2. Нажимаем кнопку «Загрузить локально». В окне сообщений появляется уведомление о прочтении файла. Нажимаем кнопку «Выход».
3. Следующий этап пропускаем, потому что загруженные локально описания таблиц автоматически отмечаются доступными для создания таблиц.
4. Нажатием клавиш «Ctrl»+«F12» открывается окно создания таблицы. Формируем список «Заголовки столбцов» выбором параметров из числа доступных.
5. Нажатием кнопки «Да» создается таблица, в строках которой перечислены итоги сделок в течение сегодняшнего торгового дня, со следующими параметрами в столбцах (см. Табл.2):

	Значение
Бумага	Краткое название бумаги
Дата	Дата
Поза	LONG - текущая поза лонг (иными словами – сегодня мы купили больше лотов, чем продали), SHORT - текущая поза шорт, ---- - все позиции закрыты встречными сделками
Кол.о	Количество открытых позиций (лотов)
Объем о	Объем открытых позиций (рублей)
П/У о р.	Прибыль / убыток по открытым позициям (в рублях)
П/У о %	Прибыль / убыток по открытым позициям (в % к объему)
П/У о total %	Прибыль / убыток по открытым позициям (в % к полной стоимости активов)
Ср.цена з	Средняя цена закрытых позиций
Кол.з	Количество закрытых позиций (лотов)
Объем з *	Объем в рублях закрытых позиций
П/У з р.	Прибыль / убыток по закрытым позициям (в рублях)
П/У з %	Прибыль / убыток закрытых позиций (в % к объему закрытых/2)
П/У з total %	Прибыль / убыток закрытых позиций (в % к полной стоимости активов)
Оборот, р.	Суммарный оборот торговли

Значение

Комисс р.	Комиссионное вознаграждение брокеру и бирже (в рублях)
П/У о+з-к р.	Полная прибыль по открытым + закрытым позициям - комиссионное вознаграждение (в рублях)
П/У о+з-к/total %	Полная прибыль по открытым + закрытым позициям - комиссионное вознаграждение (в % к полной стоимости активов)

Табл. 1. Описание параметров в столбцах таблицы

* - Объем з показывает торговый оборот в рублях.

П/У о р., П/У о % считаются с момента открытия позиции и до ее закрытия, как только сделка закрывается, эти цифры обнуляются.

П/У з р., П/У з % появляются в таблице только после полного или частичного закрытия позиции.

П/У о+з-к р., П/У о+з-к/total % появляются в таблице только после полного или частичного закрытия позиции.

В ячейках таблицы появятся данные, пересчитываемые с заданной регулярностью.

Если данные в таблице отсутствуют, то, скорее всего, в коде программы указаны недоступные коды клиентов.

При необходимости можно изменить периодичность расчета или сократить список кодов клиентов с помощью фильтра, выбрав пункт контекстного меню «Параметры портфеля» или нажав «Ctrl»+«F11».

Как использовать – более подробно:

1. Загрузка программы

Этот этап добавляет описания собственных таблиц в список доступных типов. Если предполагается работа с описаниями таблиц на сервере, его можно пропустить.

Загрузка кода программы выполняется выбором пункта меню программы **Таблицы/Портфели/Задать портфель**, или нажатие клавиш «Ctrl»+«F10» (см. Рис. 3).

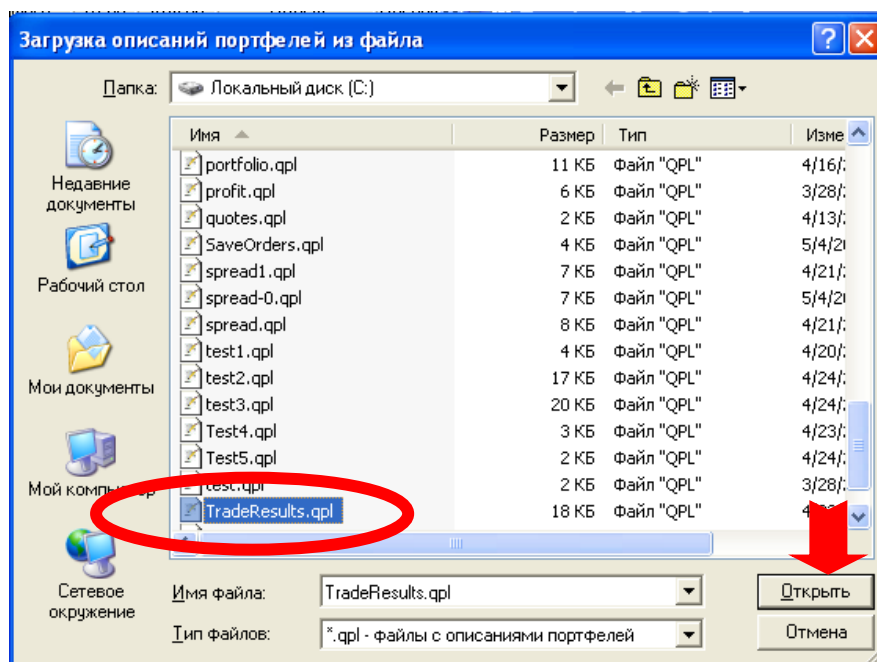


Рис. 3. Меню QUIK после нажатия клавиш «Ctrl»+«F10».

1. Выберите файл, загружаемый с диска. Файлы имеют стандартные расширения «.QPL». Название таблицы появится в списке «Доступные портфели».
2. При чтении файла осуществляется проверка правильности программы. Если программа содержит ошибки, система уведомит об этом в «Окне сообщений». В сообщении указывается имя файла и номер строки, в которой обнаружена ошибка.
3. Если файл прочитан успешно, то в полях отобразятся соответствующие параметры:

Поле	Назначение
Текущий портфель	Название таблицы
Всего параметров	Число параметров (столбцов), описанных в структуре таблицы
Всего клиентов	Количество доступных кодов клиентов, из числа перечисленных в структуре таблицы. В новой версии языка параметр не актуален.
Фирмы	Перечень идентификаторов фирмы в торговой системе (значения, соответствующие полю «Дилер» в Таблице заявок или Таблице сделок)
Клиенты	Перечень идентификаторов клиентов для отображения в таблице
Параметры портфеля	Перечень описанных параметров и расширенные сведения по ним
Формула расчета	Исходный код программы на языке QPILE

4. Для загрузки прочитанной из файла таблицы нажмите кнопку «Загрузить локально».
5. Кнопка «Загрузить на сервер» позволяет загрузить программу на сервер, которая станет доступна всем его пользователям. Право загрузки программ на сервер назначается администратором системы QUIK (см. Рис. 4).

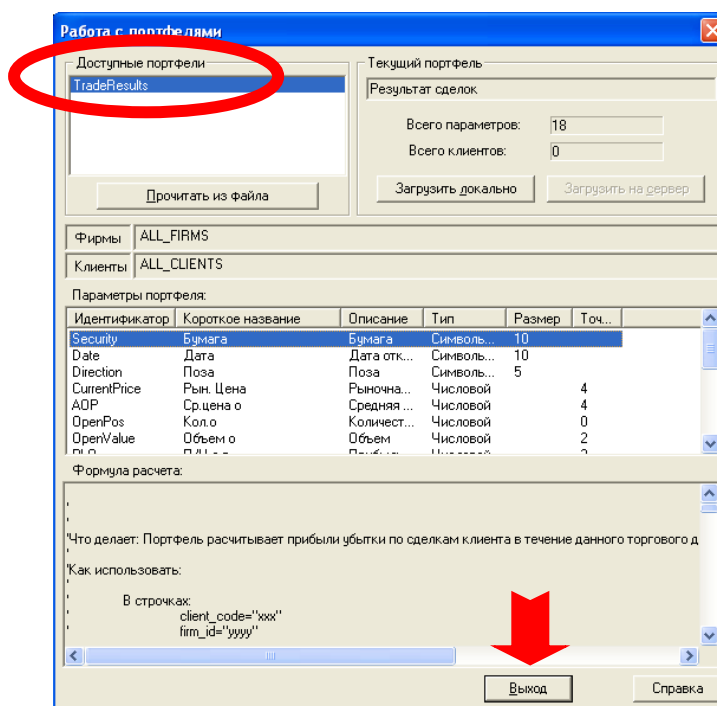


Рис. 4. Меню QUIK после нажатия клавиш «Ctrl»+«F10».

6. При локальной загрузке код выполняется на текущем рабочем месте и просмотр таблицы на его основе доступен тоже только на этом месте.

2. Настройка параметров программы

Этот этап определяет список обрабатываемых программ и определяет периодичность вычислений. Если программы были загружены локально, то они автоматически помечаются выбранными.

Выбор доступных программ с описаниями типов таблиц выполняется выбором пункта меню программы **Таблицы/Портфели/Доступные портфели**, или нажатием клавиш «Ctrl»+«F11».

1. В списке «Доступные портфели» приведены все программы, доступные пользователю для создания таблиц, как загруженные локально, так и серверные. Выберите программу из числа доступных, установив на ней флажок. В полях диалога отобразятся параметры, относящиеся к структуре программируемой таблицы.
2. Установите период расчета значений таблицы. Для исполнения программ с большим количеством вычислений период расчета значений рекомендуется устанавливать не менее 5-10 секунд.
3. Нажмите кнопку «Сохранить» для сохранения настроек.
4. Нажатие кнопки «Удалить» приводит к удалению из списка выбранной строки. Серверные типы таблиц удалить нельзя.
5. Нажатием кнопки «Формула» открывается окно с исходным кодом программы и описанием таблицы (справочно).
6. Чтобы закрыть окно с сохранением настроек, нажмите кнопку «Применить». Нажатие кнопки «Отмена» закрывает окно без сохранения изменений (см. Рис. 5).

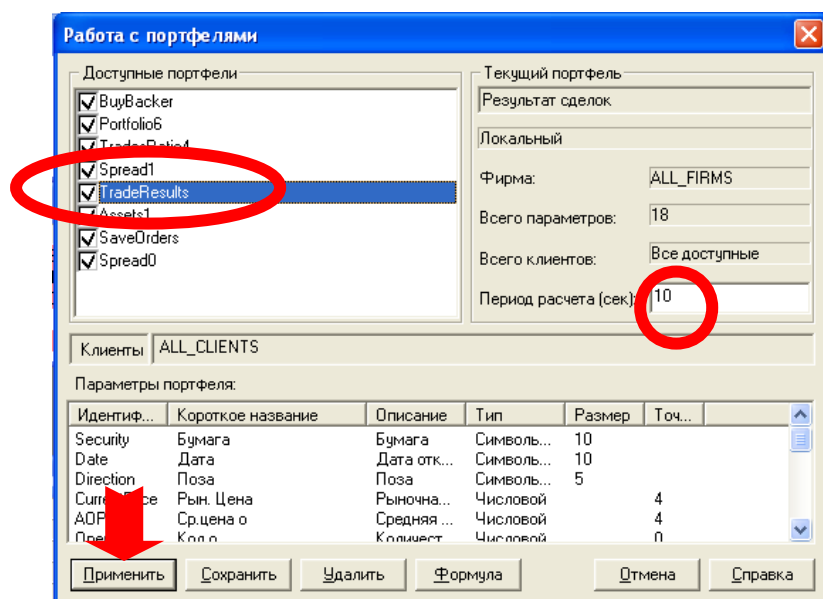


Рис. 5. Меню QUIK после нажатия клавиш «Ctrl»+«F11».

- * ПРИМЕЧАНИЕ: Список загруженных утилит в окне **Доступные портфели** у Вас может отличаться от показанного на рисунке.

Применение настроек к существующим таблицам:

- Как отключить пересчет значений в таблице?
 1. Выберите пункт контекстного меню «Приостановить расчет» либо нажмите «Ctrl»+«F11» и снимите флажок с требуемого типа таблицы. При этом в таблице будут отображены последние вычисленные значения.
 2. Если по одной программе было сформировано несколько таблиц, то расчет приостановится во всех этих таблицах.
 3. Для отключения пересчета во всех таблицах нужно нажать «Ctrl»+«F11» и снять все флажки.
- Как изменить период расчета в существующей таблице?

Выберите пункт контекстного меню «Параметры портфеля» или нажмите «Ctrl»+«F11», затем измените значение параметра «Период расчета (сек)» и нажмите кнопку «Применить».

3. Создание таблицы

Этот этап формирует таблицу на основании программы. На базе одной программы можно создать несколько таблиц для удобства их расположения на экране.

Создание программируемой таблицы выполняется выбором пункта меню программы **Таблицы/Портфели/Просмотр портфеля**, или нажатием клавиш «Ctrl»+«F12».

1. Выберите программу в списке «Доступные портфели». В полях раздела «Текущий портфель» отобразятся данные по структуре таблицы.

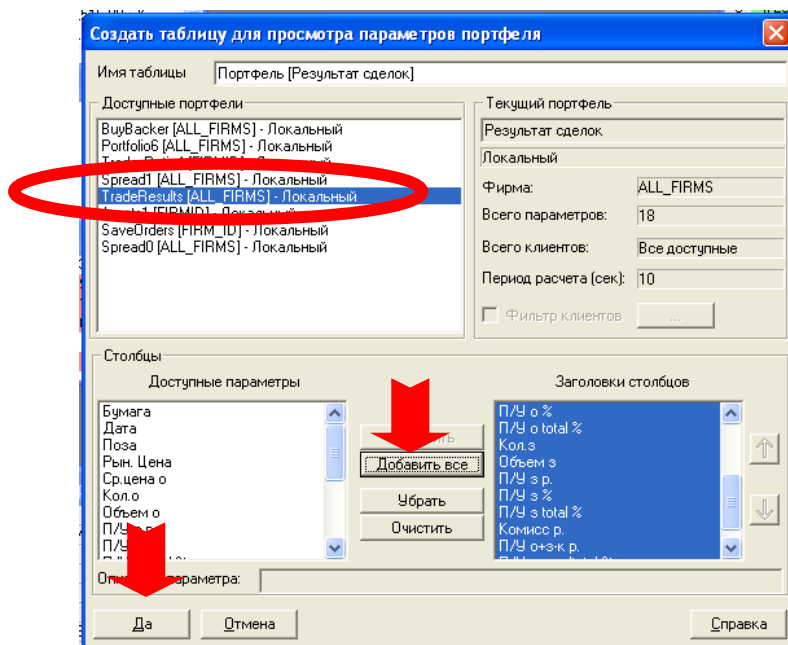



Рис. 6. Меню QUIK после нажатия клавиш «Ctrl»+«F12».

2. Если необходимо, ограничьте количество отображаемых строк в таблице с помощью фильтра «Фильтр клиентов» (см. Рис. 6).
 3. Сформируйте список столбцов таблицы из числа доступных параметров и последовательность их отображения в таблице. В поле «Описание параметра» справочно приводится расширенное описание выделенного параметра.
 4. Нажатием кнопки «Да» создается таблица.
- * ПРИМЕЧАНИЕ: Полученная таблица имеет такие же функции управления, как и другие таблицы системы QUIK. Например, для редактирования таблицы можно нажать кнопку  на панели инструментов, или клавиши «Ctrl»+«E».
 - * РЕКОМЕНДАЦИИ: 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 бумаг).
 - * ПРИМЕЧАНИЕ: Список загруженных утилит в окне **Доступные портфели** у Вас может отличаться от показанного на рисунке.

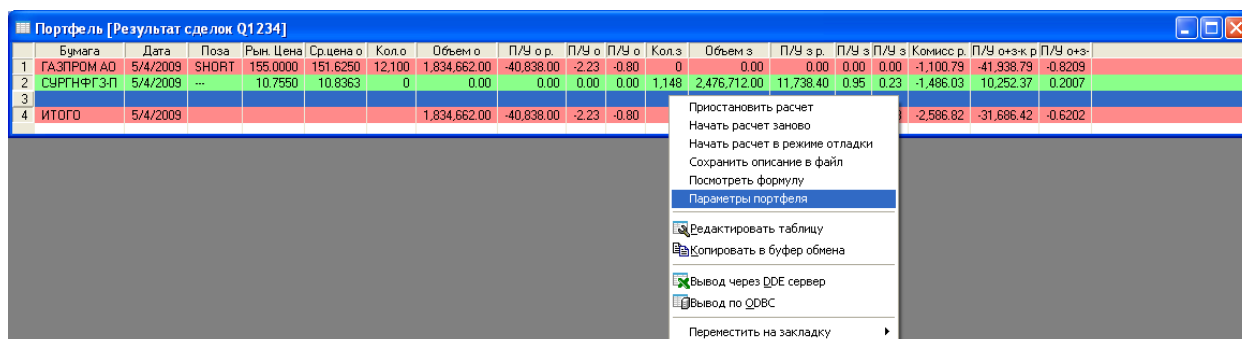
4. Поля, доступные в таблице

После всех проделанных действий у Вас должна появиться таблица следующего вида (если у Вас в течение данного торгового дня еще не было сделок, то строк с наименованием конкретных акций – первых двух в данном примере - видно не будет). Значение ее полей мы уже обсуждали в разделе Ошибка: источник перекрестной ссылки не найден (см. Рис.1 и табл. 2)

5. Функции, доступные в таблице

Данные таблицы доступны для копирования, экспорта в Excel, экспорта через ODBC.

Функции, доступные из контекстного меню таблицы (наведите курсор на таблицу и нажмите правую кнопку мышки) (см. Рис. 7):



Бумага	Дата	Поза	Рын. Цена	Срцена о	Коло	Объем о	П/У о р	П/У о	П/У о	Колз	Объем з	П/У з р	П/У з	П/У з	Комисс р	П/У о+з р	П/У о+з	
1	ГАЗПРОМ АО	5/4/2009	SHORT	155.0000	151.6250	12.100	1.834.662.00	-40.838.00	-2.23	-0.80	0	0.00	0.00	0.00	0.00	-1.100.79	-41.938.79	-0.8209
2	СУРГНФГЗП	5/4/2009	---	10.7550	10.8363	0	0.00	0.00	0.00	0.00	1.148	2.476.712.00	11.738.40	0.95	0.23	-1.486.03	10.252.37	0.2007
3																		
4	ИТОГО	5/4/2009					1.834.662.00	-40.838.00	-2.23	-0.80						-2.586.82	-31.686.42	-0.6202

Рис. 7. Меню работы с таблицей, созданной утилитой

- «Приостановить расчет» – остановить вычисление параметров таблицы (при этом в таблице отображаются последние вычисленные данные),
- «Начать расчет заново» – сбросить все значения и начать расчет заново,
- «Начать расчет в режиме отладки» – сбрасывает все значения, запускает окно отладки и начинает расчет заново,
- «Сохранить описание в файл» – сохранить в текстовый файл программу, описывающую данную таблицу,
- «Посмотреть формулу» – показать в окне код программы данной таблицы,
- «Параметры портфеля» – открыть окно с параметрами программы, в том числе период расчета в секундах.

6. Как удалить утилиту из QUIK'a

Если Вы захотите по тем или иным причинам удалить уже установленную утилиту из QUIK'a, сделайте следующее:

1. Находясь в QUIK'e, зайдите в список обрабатываемых программ (пункт меню **Таблицы**→**Портфели**→**Доступные портфели**, или клавиши «Ctrl»+«F11»).
2. В окне «Доступные портфели» выберите ту утилиту, которую Вы хотите удалить (Динамика счета (ММВБ) – в данном примере).
3. Нажмите кнопку «Удалить». А затем – «Применить».
4. Удалите таблицу, созданную утилитой, из окна QUIK'a стандартным способом – нажав на крестик в правом-верхнем углу таблицы (см. Рис. 8).
- 5.

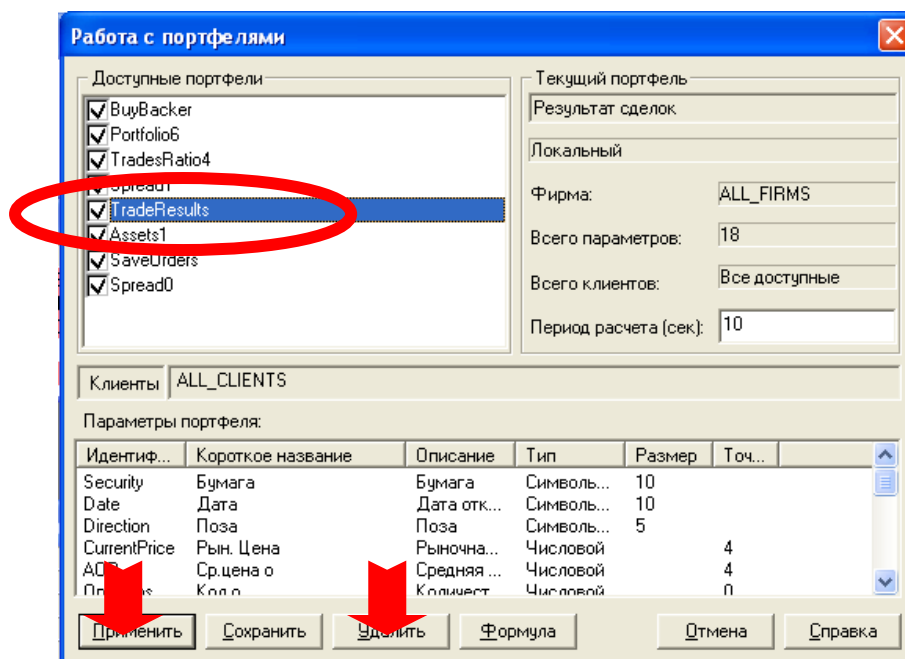


Рис. 8. Меню работа с портфелями (удаление утилиты из QUIK)

Лицензионное соглашение

На данное руководство пользователя распространяется действие приводимого ниже лицензионного соглашения.

ВАЖНО - ПРОЧТИТЕ 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 отдельного 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 в услуге 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.

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>

В разделе «[Форум](#)» можно ознакомиться с ответами на распространенные вопросы пользователей, а также задать свой вопрос разработчикам или аналитикам компании ИТТ.

Мы будем рады получить любые Ваши пожелания и комментарии.

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