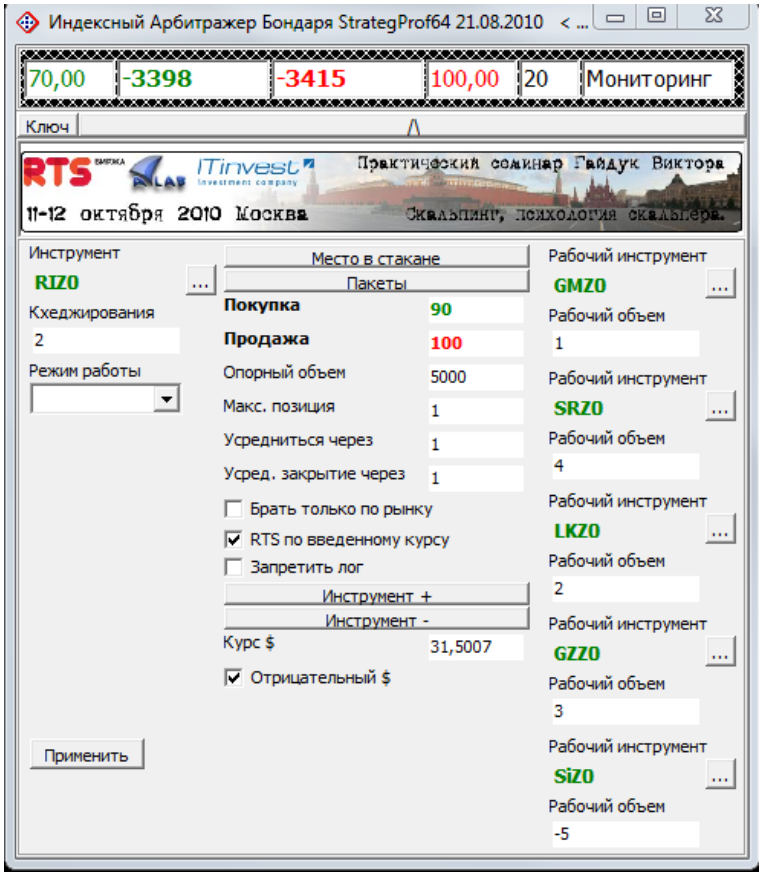


Руководство пользователя по Индексному Арбитражеру Бондаря

Индексный арбитраж – способ торговли, предполагающий открытие позиций в противоположных направлениях: с одной стороны фьючерс на индекс РТС, с другой (противоположной) - корзина фьючерсов на акции, входящих в расчет индекса РТС, или фьючерс «РТС Стандарт». При использовании фьючерса на доллар США полученная позиция максимально защищена.

Сделки проводятся автоматически по указанной трейдером раздвижке. По сути, Индексный Арбитражер Бондаря алгоритмизирует стратегию и при жестком соблюдении всех правил исключается большая часть рисков, связанных с неопределенностью цены инструмента в будущем (эти риски характерны для спекуляций). В худшем случае остается риск недополучения дохода.

Рисунок 1. Интерфейс Индексного Арбитражера Бондаря.



© 2010. Все права защищены. ООО "А-Лаб"

Для более удобной работы с Индексным Арбитражером введены графики, с помощью которых можно определить движение раздвижки торгуемой корзины, также на графике визуально отображаются уровни, на которых по указанию трейдера произойдут сделки.

Индексный Арбитражер Бондаря – это полуавтомат, поэтому стратегия сочетает в себе все преимущества роботорговли, а так же знания и опыт трейдера.

Начало работы

Для начала работы с Индексным Арбитражером необходимо скачать с блога www.dbondar.ru дистрибутив программы и дистрибутив терминала Алор-трейд, под который написан робот. (Важно установить терминал Алор-трейд именно с блога так, как при работе с более поздними версиями терминала могут возникать ошибки в работе Коррелятора).

Установка терминала Алор-трейд:

Скаченный с блога архив терминала нужно распаковать в папку, в которой будет установлен терминал. Запустить файл TEClient.exe. Создать ярлык терминала на рабочем столе.

Прописывание COM-объектов в реестре Windows

Для корректной работы Индексного Арбитражера необходимо прописать в реестре Windows COM-объекты (Component Object Model — Объектная Модель Компонентов)– интерфейс для использования механических торговых систем.

Прежде чем приступить, убедитесь, что в пути к папке с терминалом Alor-Trade, нет пробелов. Вместо пробелов использовать либо дефис (-), либо нижнее подчёркивание (_). Ниже приведены примеры корректного и некорректного пути к папке с терминалом:

Неверно: C:\Program Files\TEClientAPI_150_200_09\TEClient.exe (В данном варианте, имя папки «Program Files» содержится пробел.

Верно: C:\Алор_Трейд\TEClientAPI_150_200_09\TEClient.exe

Верно: D:\TEClientAPI_150_200_09\TEClient.exe

Шаг 1: Нажать по ярлыку терминала правой кнопкой мыши, выбрать раздел «свойства». Скопировать то, что находится в поле «объект» (путь к файлу «Teclient.exe»), (БЕЗ КАВЫЧЕК!). При этом сам терминал должен быть закрыт до окончания всей операции.

При ОС Windows XP, 2003

Шаг2: Нажать Пуск (Start), далее Выполнить (Run).

При ОС Windows Vista, 7

Шаг2: Нажать Пуск (Start), далее нажать «Все программы», затем «стандартные», запустить командную строку от имени Администратора (нажать по командной строке правой кнопкой мыши, затем «запуск от имени Администратора»)

Шаг3: Вставить в появившейся строке скопированный путь к файлу «Teclient.exe». Далее поставить пробел и следом /regserver.

Должно получится примерно следующее:

Путь_к_TEClient.exe /regserver

Пример: D:\TEClientAPI_150_200_09\TEClient.exe /regserver

Нажать Enter.

Установка Индексного Арбитражера

Скаченный с блога архив робота распаковать в папку, в которой будет установлен робот. Поскольку Индексный Арбитражер может работать с разными моделями арбитражных корзин.

© 2010. Все права защищены. ООО "А-Лаб"

Следует настраивать каждого Индексного Арбитражера в отдельной папке, это позволит отделить вспомогательные файлы робота с одной моделью арбитражной корзины, от вспомогательных файлов робота с другой моделью арбитражной корзины.

После размещения файла в соответствующей папке запустить файл StrategA64.exe. Создать ярлык Индексного Арбитражера выбранной арбитражной корзины на рабочем столе.

При первом запуске Индексного Арбитражера будет запрошен ключ на использование программы. Для того чтобы ввести ключ необходимо нажать на соответствующую кнопку «ключ» на лицевой панели робота.

В появившееся окошко внести ключ, полученный после оплаты по лицензионному соглашению. Нажать кнопку добавить.

Ключ

После добавления необходимо перезапустить робота! Для этого необходимо нажать красный крестик на лицевой панели робота. После этой процедуры в папке с роботом автоматически создадутся вспомогательные файлы, необходимые для работы робота.

Папка «Log1» будет использоваться для хранения ежедневных журналов работы робота. Данные файлы необходимы для предоставления программистам компании-разработчика ООО «А-Лаб» в случае возникновения ошибок в работе робота.

Файл «Key» содержит ключ, внесённый в робота. Для просмотра ключа можно открыть файл при помощи блокнота. Для этого необходимо нажать на файл «Key» правой кнопкой мыши, выбрать «открыть с помощью», выбрать «блокнот».

Файл «BotsDATA» отвечает за расположение робота на определённом месте рабочего стола. При запуске Коррелятора Бондаря робот будет запущен в том месте, где он был закрыт в последний раз. Если при запуске робота на рабочем столе не появляется робот, то следует удалить файл «BotsDATA» и запустить робота заново. При этом робот откроется в верхнем левом углу рабочего стола.

Файл «Bot1» используется для хранения пользовательских настроек робота.

Настойка Индексного Арбитражера

В разделе «инструмент» (находится слева) указывается ценная, бумага, которая будет хеджироваться фьючерсом на доллар.

В поле «Слот №» необходимо указать номер слота в терминале Алор-трейд, на котором настроен брокерский счёт.

В поле «Счёт №» указать брокерский счёт.

В поле «Инструмент» выбрать обозначение (тиккер) ведущего инструмента.

В поле «Предел таймера» указать величину максимального значения задержки соединения, при котором возможна работа робота. При превышении заданной величины робот не будет выставлять заявки на совершение сделок.

В поле «Рабочий объём» указать количество контрактов этого инструмента в корзине.

После внесения настроек по инструменту нажать «Ок» и «Применить» на лицевой панели робота.

В разделе «Рабочий инструмент» (находится справа) указывается ценная бумага, которая будет выставляться на рынок лимитированной заявкой. Покупка\продажа арбитражной корзины будет начинаться именно с этой бумаги. (если стоит галочка в функции "Брать только по рынку" сделка будет проходить заявкой "по рынку")

В поле «Слот №» необходимо указать номер слота в терминале Алор-Трейд, на котором расположен брокерский счёт.

В поле «Счёт №» указать брокерский счёт.

В поле «Инструмент» выбрать обозначение (тиккер) торгуемого инструмента.

© 2010. Все права защищены. ООО "А-Лаб"

В поле «Рабочий объём» указать количество контрактов, которым робот будет осуществлять хеджирование.

После внесения настроек по торгуемому инструменту нажать «Ок» и «Применить» на лицевой панели робота.

Нажмите кнопку "Инструмент +", тем самым добавить необходимое количество инструментов.

После добавления инструментов нажать «Ок» и «Применить» на лицевой панели робота.

Произвести перезапуск робота. Для этого необходимо нажать крестик в правом верхнем углу робота и запустить заново с помощью ярлыка.

Произведите настройку добавленных инструментов по вышеописанным правилам.

Последним инструментом должен быть контракт на доллар. Внимание, при выставлении количества контрактов на доллар значение выставляется в минусовом значении. Пример: -4 или -9.

Для удаления лишних инструментов используйте кнопку "Инструмент -". Инструменты будут удаляться снизу вверх.

Режим работы

При работе с Индексным арбитражером Бондаря используются следующие режимы работы:

«Монитор» - режим в котором робот мониторит рынок, выводя данные, но сделок не совершает;

«Арбитр стандарт» - режим работы робота, при котором робот открывает позиции только "продавая раздвижку", открытые ранее позиции закрываются по указанной раздвижке;

«Двухсторонний режим» - режим работы робота, при котором робот открывает позиции как от продажи, так и от покупки.

«Закрытие дня» - режим, при котором по указанной раздвижке закрываются все открытые позиции и не открываются новые позиции (в одной заявке будет выставлен весь открытый ранее объём);

«Закрытие дня с усреднением» - режим, при котором по указанной раздвижке закрываются все открытые позиции долями, равными рабочему объёму. Новые позиции не открываются.

После выбора любого из режимов работы необходимо нажать «Применить» на лицевой панели робота. Также возможен переход в режимы работы при помощи горячих клавиш, указанных в скобках.

Лицевые настройки.

Покупка\Продажа — спрэд, наличие которого на рынке является сигналом к совершению сделки.

Опорный объём — среднее количество контрактов в стакане, по которым выводится раздвижка.

Максимальная позиция — максимальное количество контрактов для торговли.

Усреднение через — после открытия позиции арбитражёр добавит к цене открытия указанное количество пунктов.

Усреднить закрытие через — после каждой сделки на закрытие позиции, робот будет добавлять указанное количество пунктов, что позволит закрывать каждые следующий контракт лучше предыдущего.

Брать только по рынку — все сделки будут проходить по рыночной цене.

RTS по введенному курсу - при включенной функции робот считает раздвижку с учётом курса доллара.

Запретить лог — запрещает записывать все действия во внутренний файл (внимание: при ошибке, выявить её причину невозможно)

Курс $ — вводится актуальный курс доллара.

Отрицательный $ — включать при использовании в корзине фьючерса на доллар.

© 2010. Все права защищены. ООО "А-Лаб"

Место в стакане

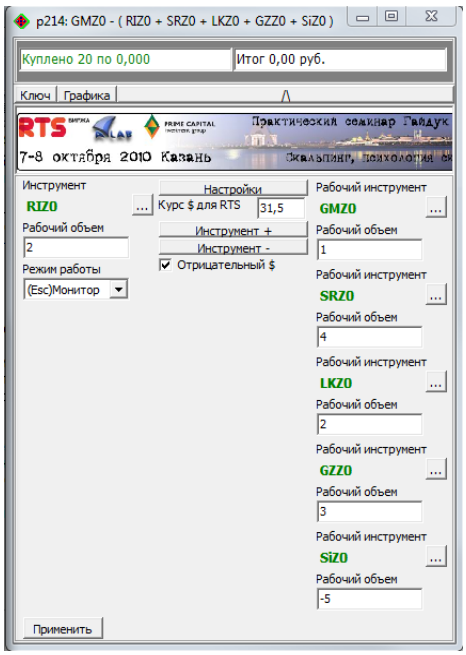
«Место в стакане» - текущее место цены в стакане относительно лучшей цены предложения;
«Объём впереди» - количество лотов (заявок) перед выставленной заявкой.
«Стоять в закрытии» -
«Чувствительность к изменению опоры» -
Пакеты.

Усреднение пакетами позволяет продавать\покупать не один рабочий объем, а набирать указанный пакет контрактов.
«Объём пакета» - количество контрактов, который робот должен набрать на уровне покупки\продажи.
«Хотелка» - доход в пунктах раздвижки, который робот должен брать с 1 контракта.
«Перемещать задание» - позволяет самостоятельно передвигать продажу\покупку при переходе цены в новый «канал».

Финрез.

Финрез – это робот, умеющий высчитывать разницу цен (раздвижку) между инструментами (группой инструментов), отображать размер и объем открытой позиции, а так же финансовый результат в течение торгового дня. Для легкости восприятия раздвижка отображается в графическом виде.

Рисунок 2. Интерфейс программы Финансовый результат.



Настройка «Финреза» производится по такому же принципу как «Индексный Арбитражёр».

© 2010. Все права защищены. ООО "А-Лаб"

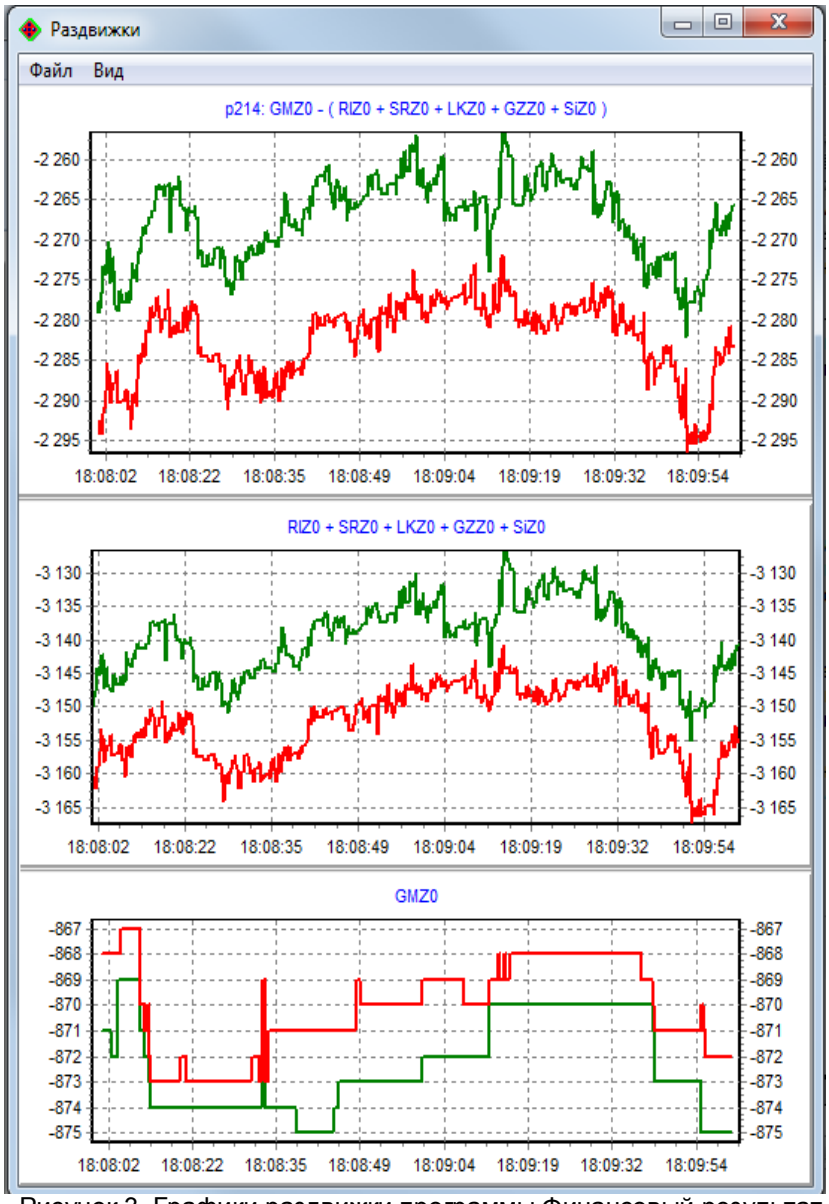


Рисунок 3. Графики раздвижки программы Финансовый результат.

Желаем вам успехов и надеемся, что прочтенный материал, послужит опорой для создания вами, Уважаемые клиенты, прочного фундамента на пути к профессиональной торговле и начала вашей трейдерской карьеры!

С уважением,

Коллектив Авторской Лаборатории

Биржевого Трейдинга (ООО «А-Лаб»)

© 2010. Все права защищены. ООО "А-Лаб"