

Инструкция к программе
Риск-менеджер

Руководство пользователя
2015

Оглавление

Введение 3
Краткое описание возможностей программы 4
Установка, настройка и подключение 5
- Установка Риск-менеджера 6
- Регистрация лицензии или демо версии 10
- Настройка торгового терминала QUIK 11
  - Загрузка настроек 13
  - Настройка внешних транзакций 16
  - Настройка торговых счетов 18
- Запуск 19
- Подключение 21

Модули 23
- Риск-менеджер 24
  - Подключение 27
  - Настройки 29
    - Основные 30
    - Лимиты 33
    - Сделки 35
    - Время 36
    - Комиссии 37

Контакты 38

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Введение

Для кого предназначен данный продукт:
для тех, кто только начинает свою торговлю на фондовом рынке и им сложно контролировать как свою прибыль, так и свои убытки;
- для трейдеров, которые хотели бы, чтоб их риски были всегда под контролем;
- для трейдеров кому трудно контролировать свои эмоции;
- для инвесторов предоставившие свои счета в управление трейдеру. Со стороны инвестора можно установить лимиты трейдеру на торговую сессию, чтоб он не потерял больше оговоренной суммы;
- для дилинговых залов;

для начальников или управляющих командой трейдеров. С помощью программы определить лимиты возможных потерь, на каждого из трейдеров и не беспокоиться, что в момент вашего отсутствия трейдер превысит установленные лимиты.

Программа поддерживает работу, как с раздельными, так и с едиными брокерскими счетами (ЕБС). Может работать сразу с несколькими терминалами Quik, открытых у одного или у разных брокеров.

На данный момент Риск-менеджер доступен только для пользователей торгового терминала QUIK.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Краткое описание возможностей программы

Риск менеджер - личный контролер, который в автоматическом режиме отслеживает риски, по заданными трейдером параметрам.

Возможности:

Работа с неограниченным количеством торговых терминалов Quik (по умолчанию 10 квиков) и счетов, субсчетов;

- Индивидуальные настройки параметров для каждого счета или субсчета;

Установка на компьютер трейдера или на выделенный сервер. Возможность поставить программу на выделенный сервер программы разработчика и сделать настройки, что доступ к программу возможен только раз в неделю или с утра до начала торгов;

- Контроль торговли (если лимит превышен, то риск менеджер закрывает вновь открываемые позиции и снимает активные заявки или стоп-заявки);

Выставление обычного лимита торговую сессию день или треллинг-профит, который расчеты ведет от максимально значения вашего счета за торговую сессию, или треллинг-профит сделка - ведет расчет от максимального значения вашего счета, фиксируя данные по счету, только в момент совершения сделки;

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Установка, настройка и подключение

Видео инструкция

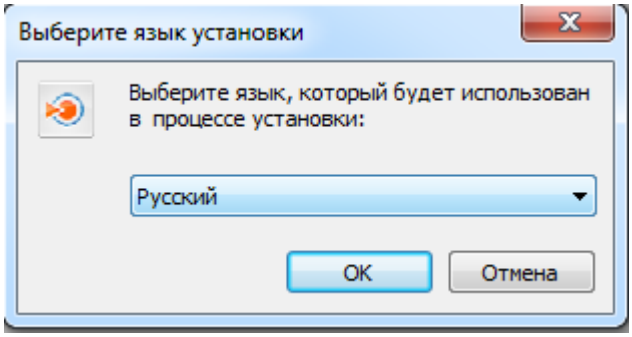
Для работы Риск-менеджера необходимо предварительно установить на компьютер Microsoft .NET Framework 4.0 Client Profile, если он не установлен.

Скачиваем и запускаем файл PM.exe. (Скачать PM.exe)

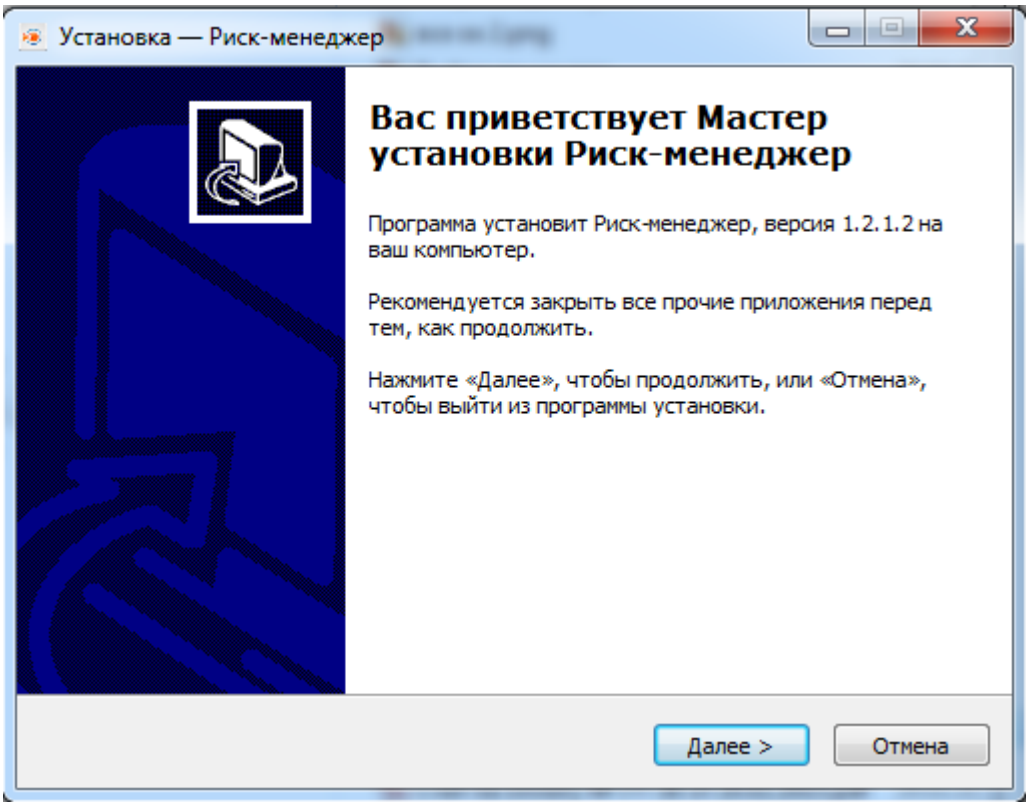
Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Установка Риск-менеджера

Выбираем русский язык и нажимает "ОК".

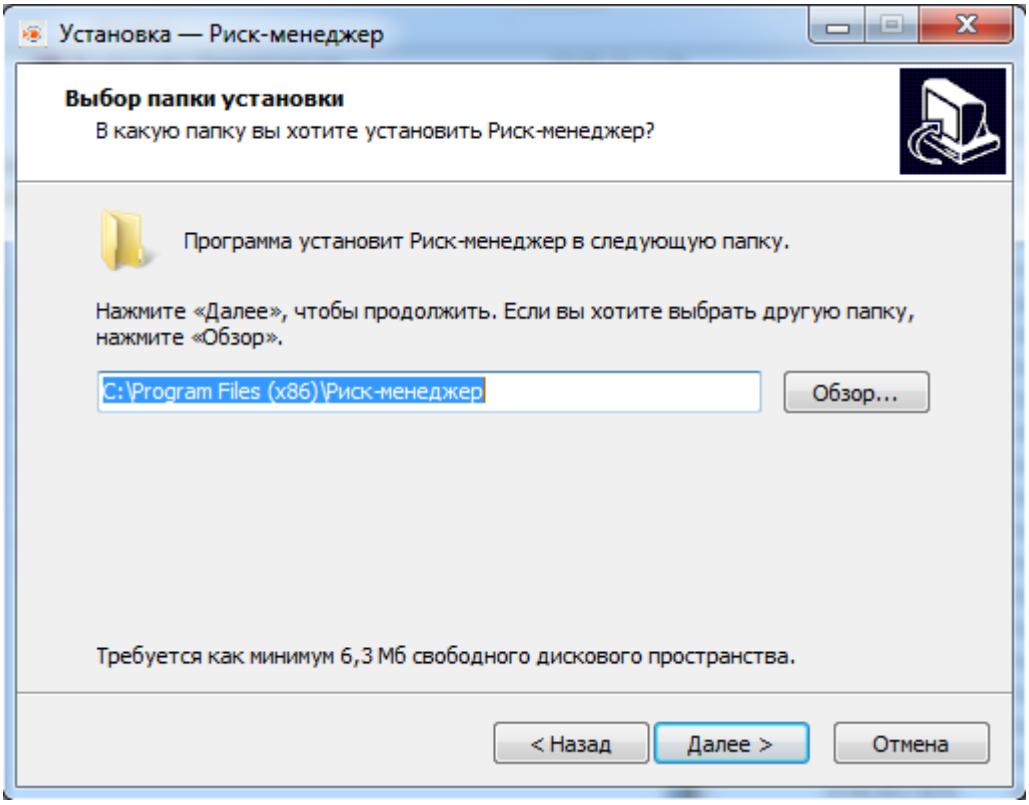


Нажимаем "Далее"

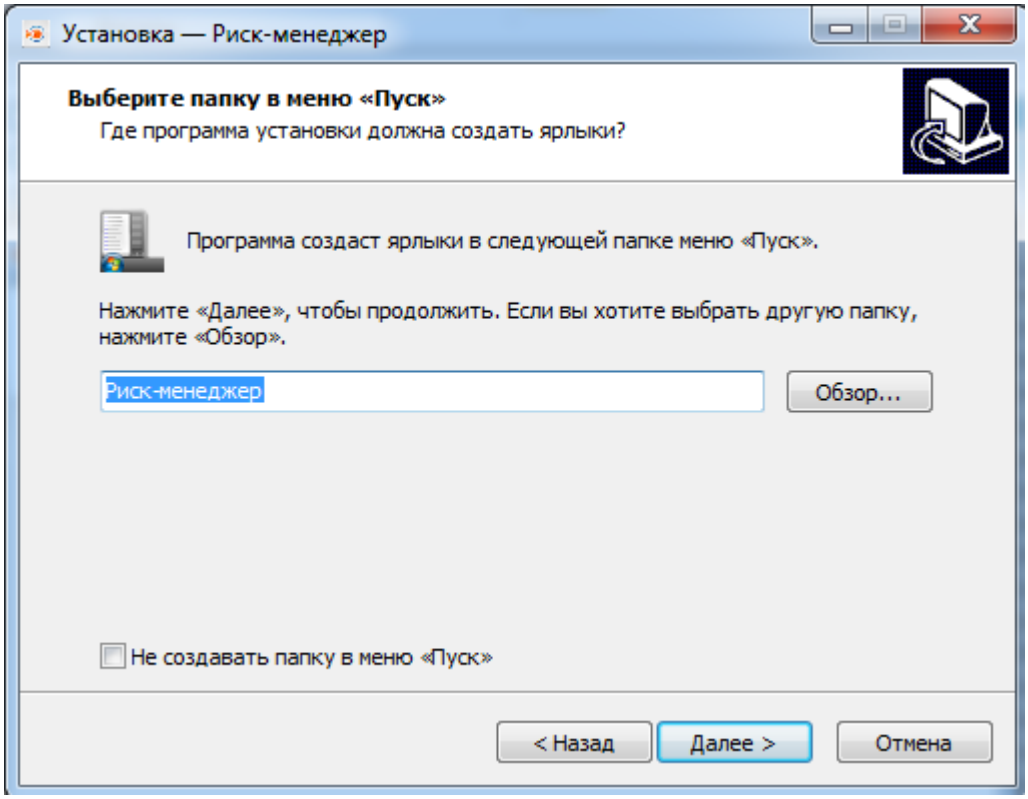


Выберите место, куда будет произведена установка, нажимаем "Далее"

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

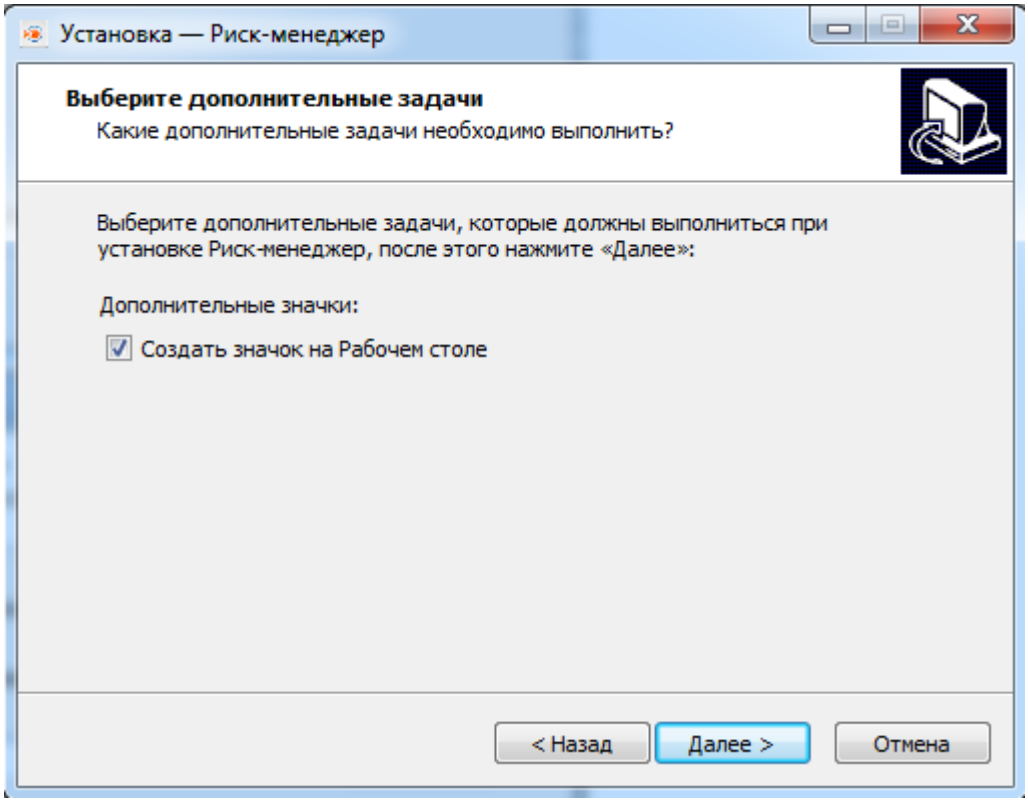


Выбираем название папки для меню Пуск, где будут созданы ярлыки для программы и нажимаем "Далее"

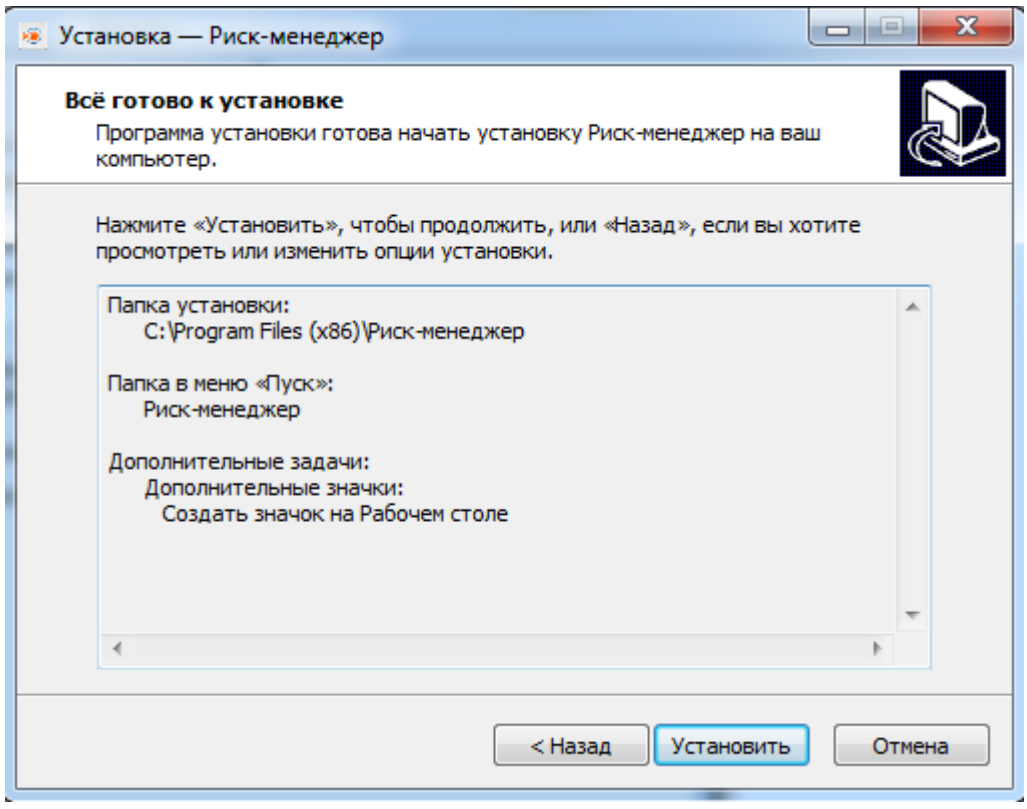


Если вы хотите видеть ярлык для запуска программы на рабочем столе, поставьте галочку и нажмите кнопку "Далее".

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

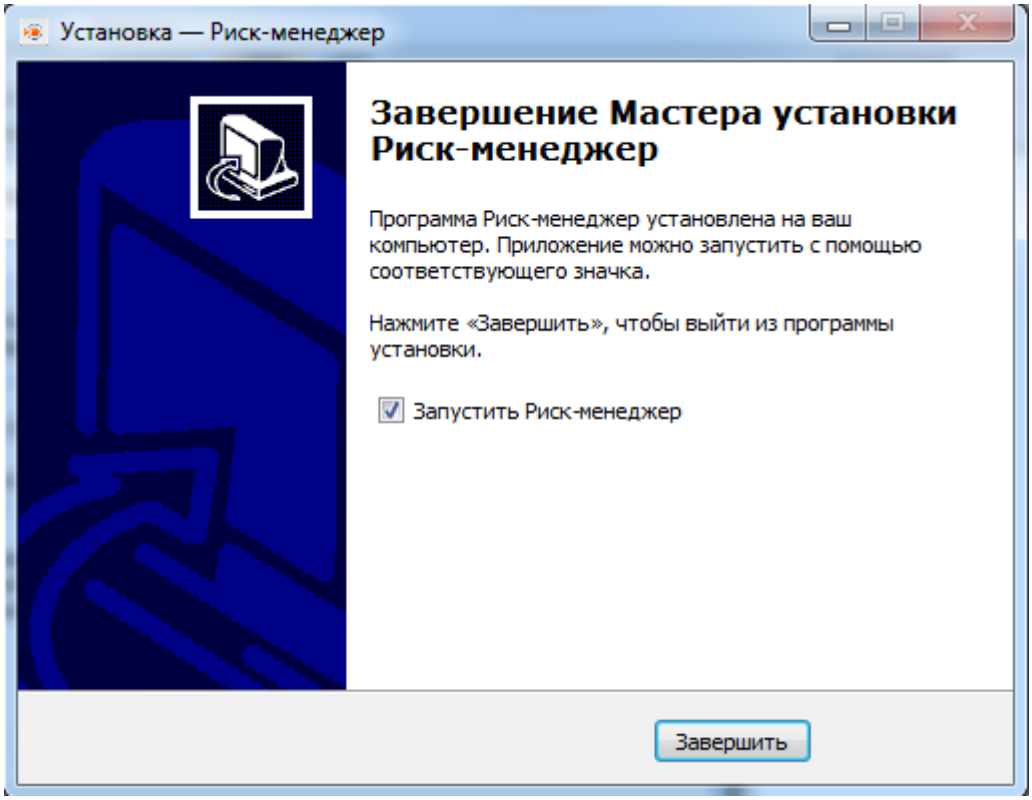


Нажимаем установить и программа устанавливается на ваш компьютер



Нажимаем кнопку "Завершить"

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

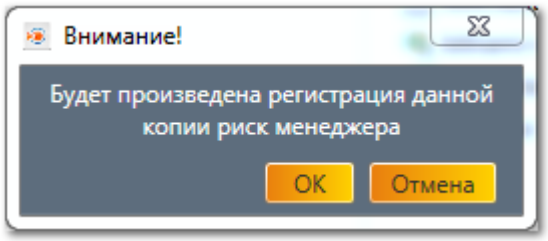


Установка Риск-менеджера завершена

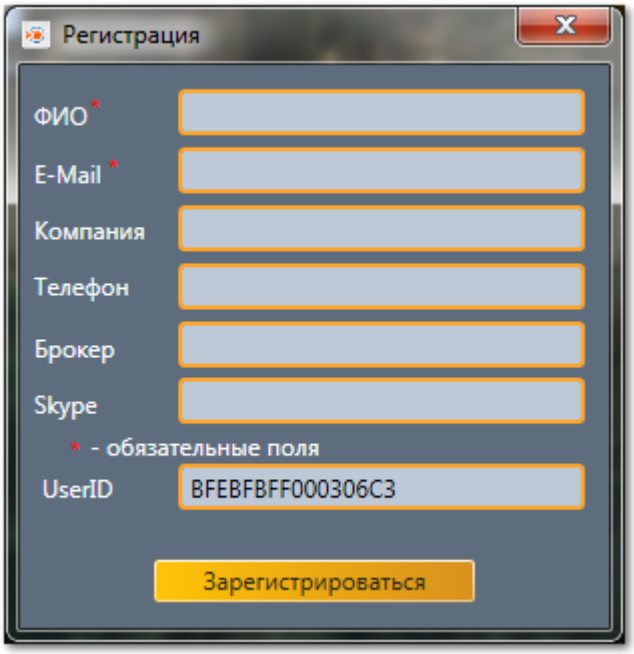
Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Регистрация лицензии или демо версии

Если вход в программу осуществляется первый раз, то после запуска вам будет предложено пройти регистрацию:



Регистрацию можно будет пройти позже, если сейчас не стоит задача опробовать программу в "боевом" режиме. Без регистрации можно ознакомиться с функционалом программы, но работать и закрывать позиции будет осуществятся после регистрации вашей версии программы.



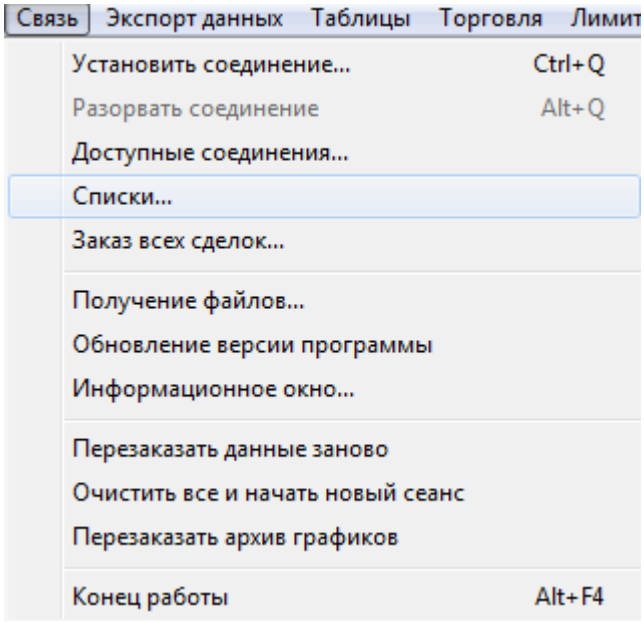
Заполняете форму и нажимаете зарегистрироваться. Если не получиться отправить информации о регистрации, то будет предложена отправка на почту support@rbkm.ru. Необходимо отправить UserID и имя для регистрации версии.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Настройка торгового терминала QUIK

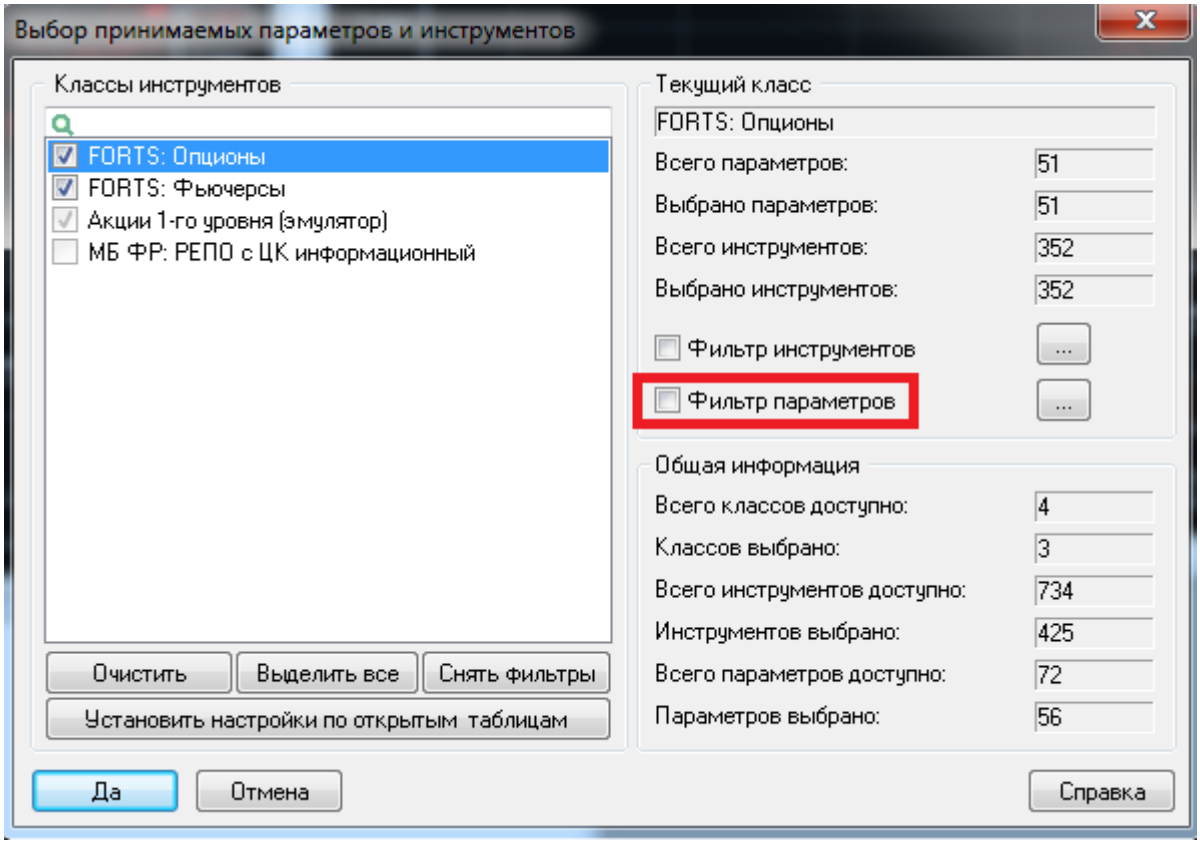
Запустите торговый терминал Quik.
Введите логин и пароль для подключения к серверу.
Настройка рабочего стола Quik

В программе Quik зайдите в пункт меню Связь/Списки



выберите классы, по которым будете торговать и в правой части окна уберите галочки напротив фильтра параметров.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

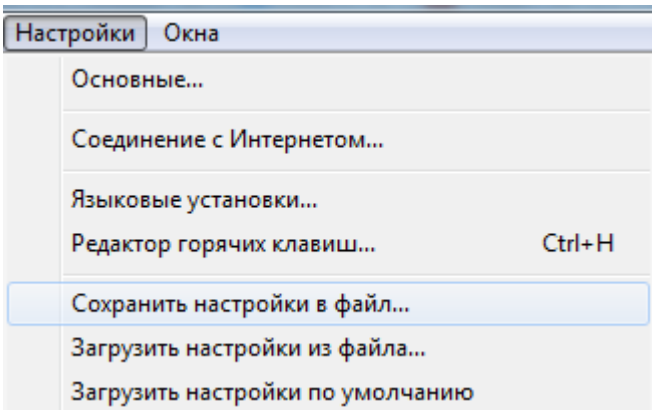


После выполнения всех вышеперечисленных операций нажимаем «Да». Если у Вас в настройках было получение данных по открытым таблицам, то QUIK запросит подтверждение, отвечаем «Да».

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Загрузка настроек

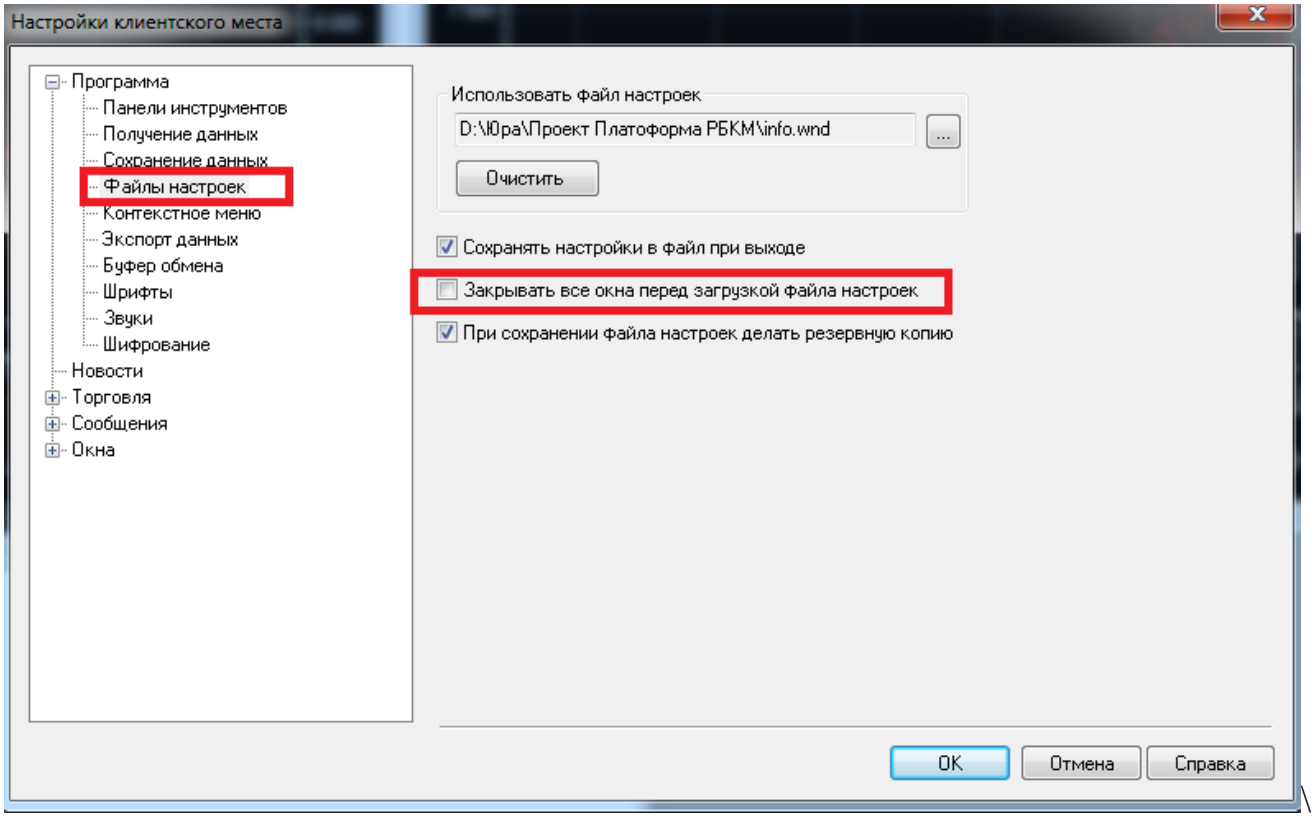
Внимание!!! Перед выполнением данного пункта сохраните настройки вашего рабочего стола QUIK. Для этого перейдите в верхнее меню «Настройки» – «Сохраните настройки в файл» после чего выберите директорию сохранения и имя для файла настроек и нажмите сохранить.



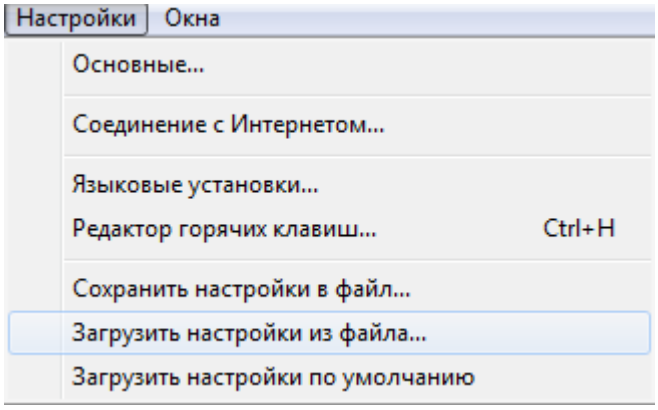
Загрузите настройки рабочего стола QUIK, необходимые для работы программы. Шаблон можно скачать с сайта настройки для Quik (настройки подойдут для QUIK 6.16 и выше, для более ранних версий QUIK настройки можно получить отправив письмо на почту support@rbkm.ru).

Во избежание потери настроек вашего рабочего стола убедитесь, что отключена настройка закрытия окон, перед загрузкой нового файла настроек. Заходим в меню "Настройки/Основные/Программы/Файл Настроек" и убираем галочку напротив пункта "Закрывать все окна перед загрузкой файла настроек" и нажимаем "ОК".

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены



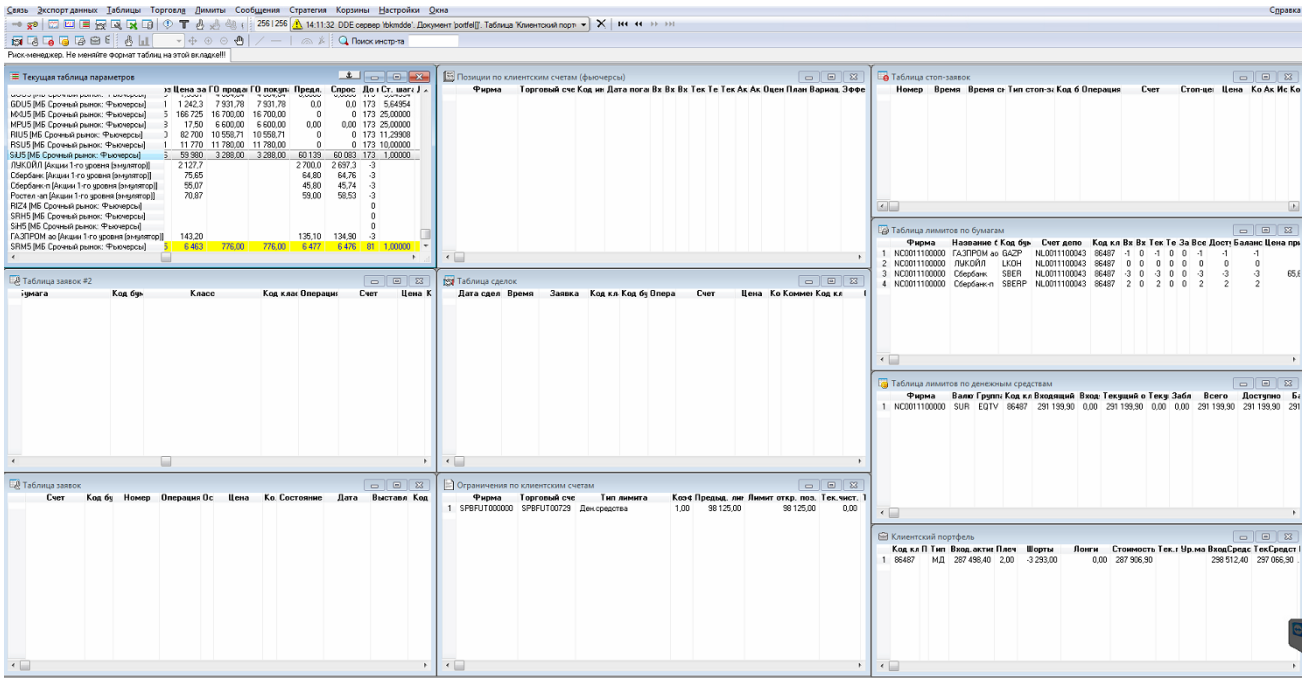
В QUIK заходим в меню «Настройки» выбираем пункт «Загрузить настройки из файла», файл настроек, если еще не скачан, то его можно скачать Настройки QUIK, выбираем наш шаблон и нажимаем Загрузить.



Если вы все сделали правильно в QUIK появится новая вкладка под названием «Риск менеджер…..». **Не изменяйте таблицы** в этой вкладке иначе, риск менеджер работать не будет. **Единственное, что вы можете делать в этой вкладке – это добавлять необходимые инструменты в таблицу текущих параметров**.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

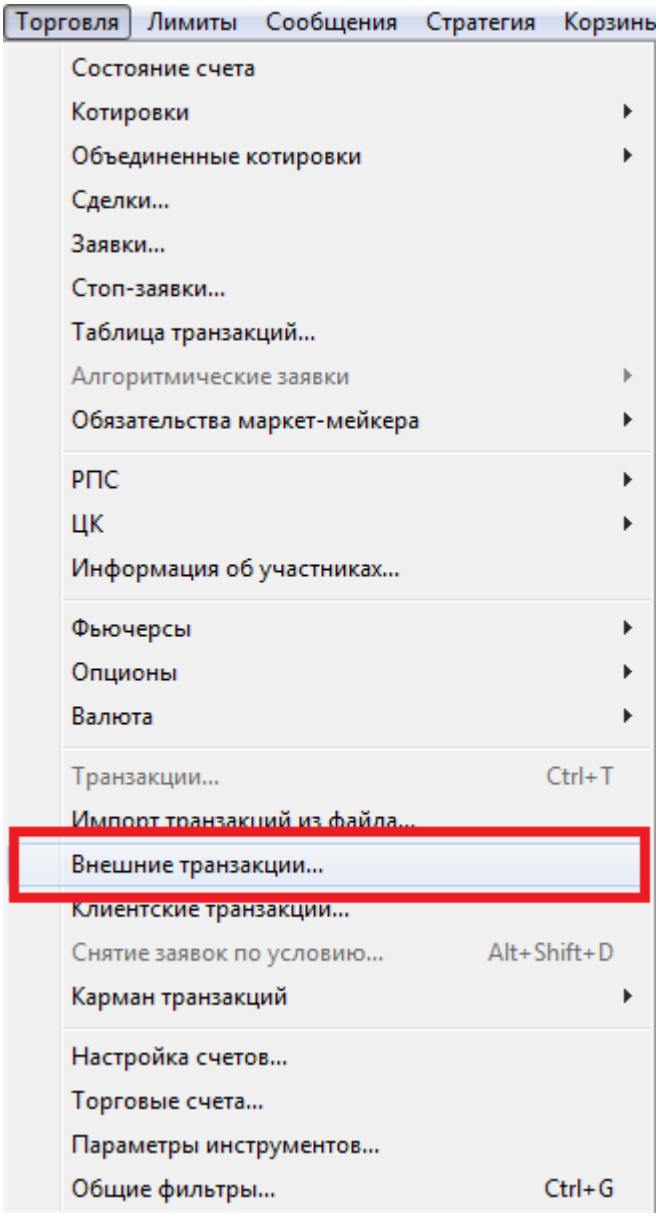
Риск-менеджер: Инструкция



Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

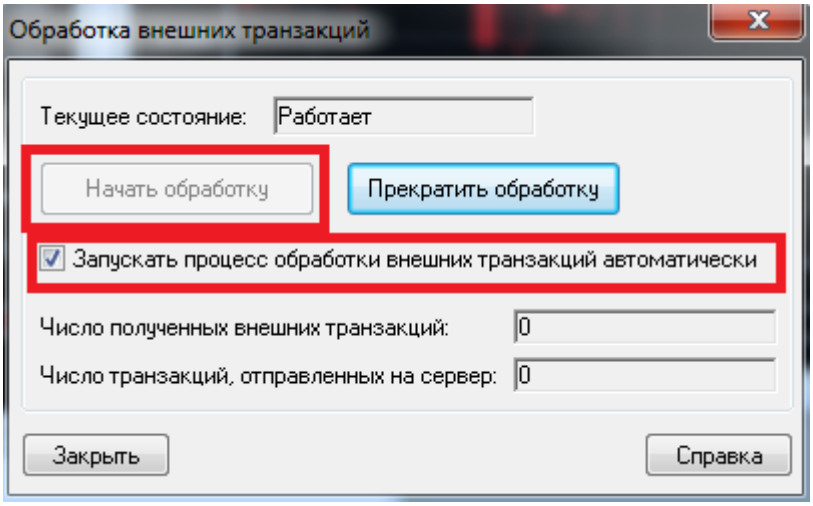
Настройка внешних транзакций

В торговом терминале QUIK зайдите в пункт меню "Торговля"/ "Внешние транзакции"



и установите галочку "Запускать процесс обработки внешних транзакций автоматически", после этого нажмите кнопку "Начать обработку"

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

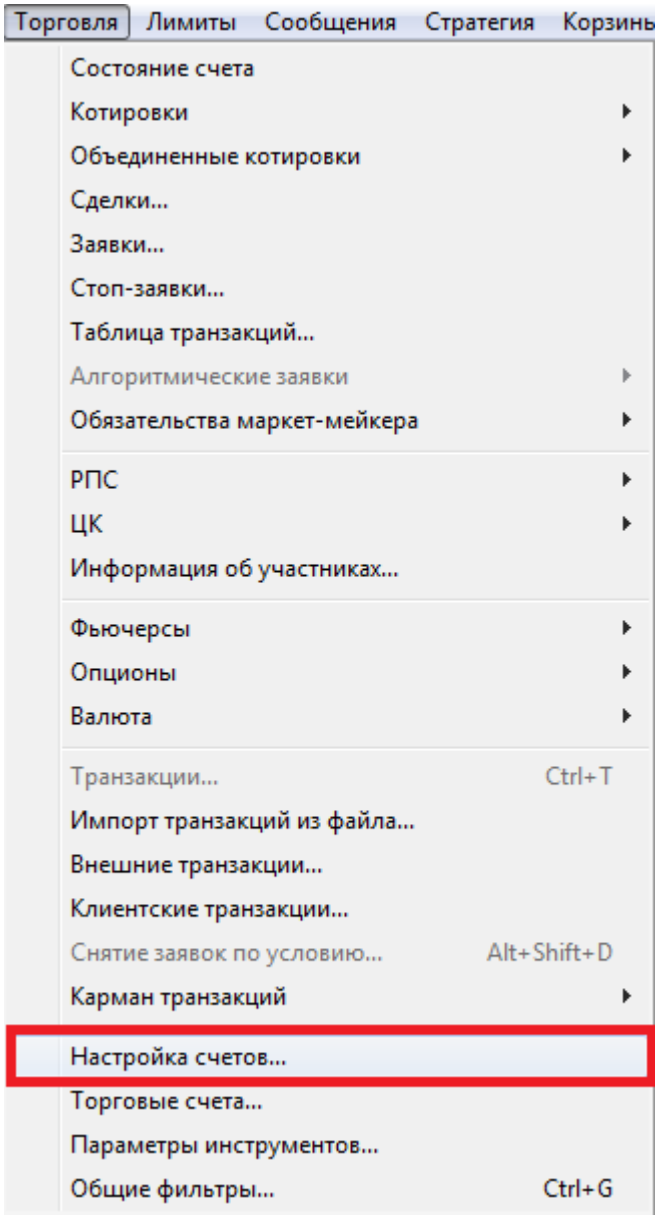


После выполнения всех операций закройте QUIK и вновь зайдите в него.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Настройка торговых счетов

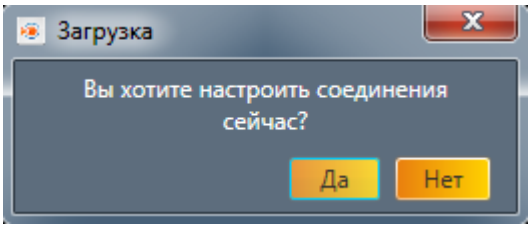
В торговом терминале QUIK зайдите в пункт меню "Торговля" / "Настройка счетов" и добавьте необходимые для работы торговые счета.



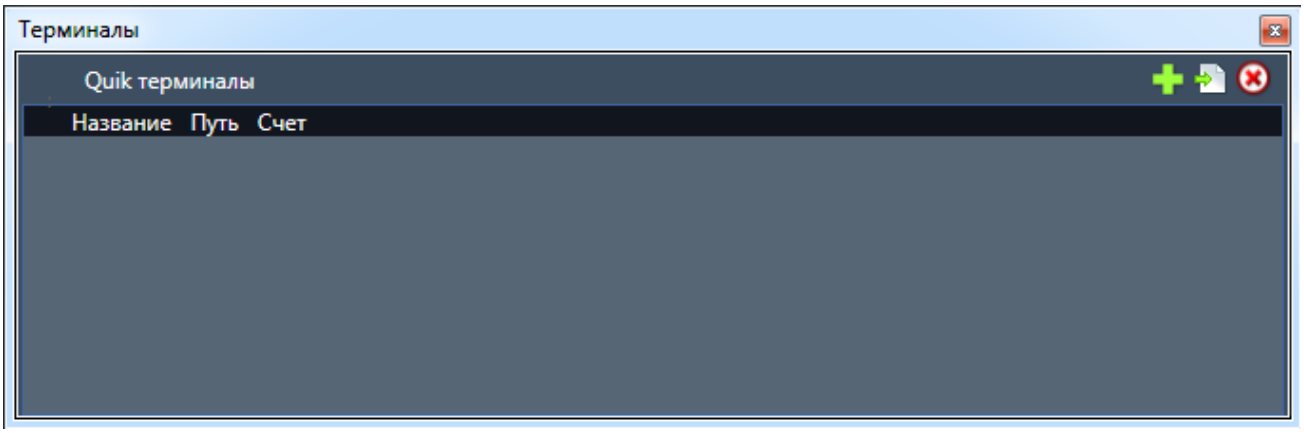
Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Запуск

!!! Запуск Риск-менеджера и QUIK должны осуществляться под одинаковыми правами, т.е. либо оба приложения запускаются под правами администратора или под правами пользователя. Рекомендуем запускать оба приложения под правами пользователя.



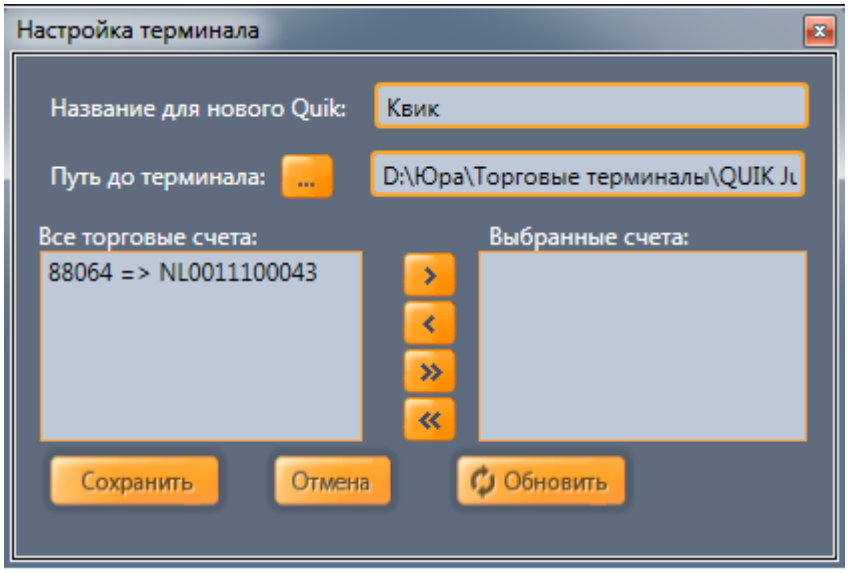
После это перед вами откроется окно добавления и настройки терминалов QUIK.



	Добавление нового соединения с терминалом QUIK
	Копирование выделенного соединения с терминалом QUIK
	Удаления соединения с терминалом QUIK

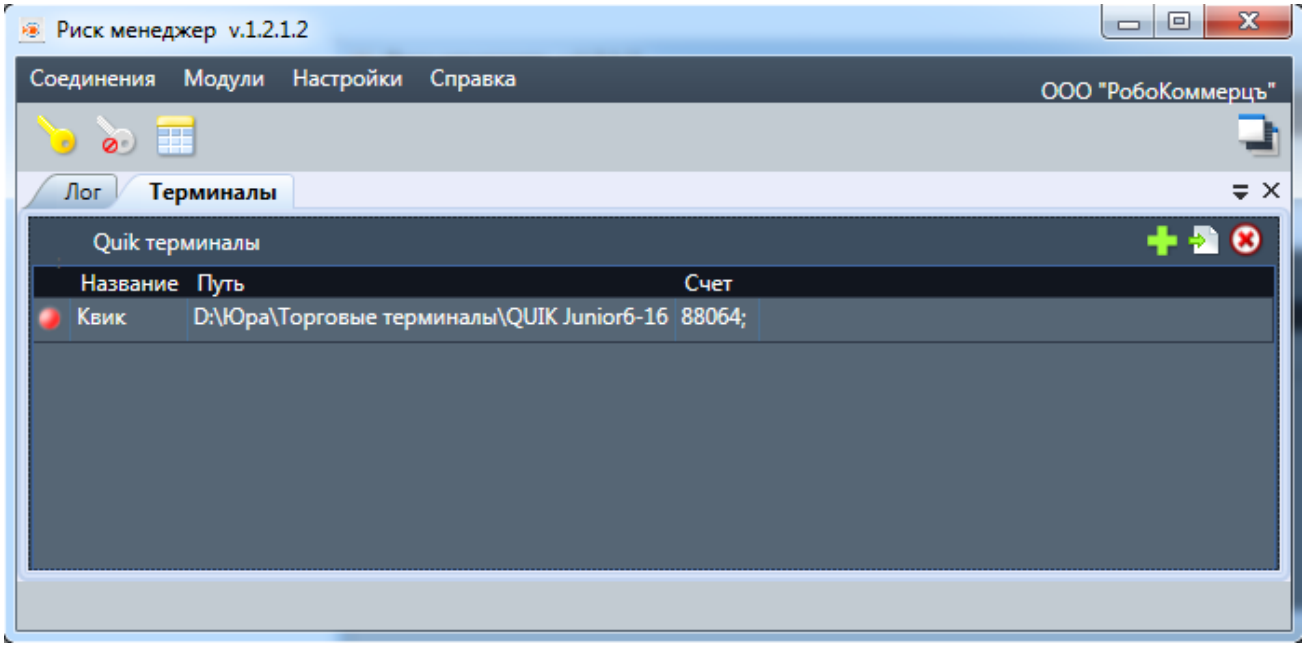
После нажатия на кнопку  Появится следующее окно. Слева будут все доступные счета. Прописываем название данного подключения. Указываем путь до файла info.exe через кнопку  . И из левой части переносим счета относящиеся к данному квику в правую часть. Нажимаем кнопку сохранить.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены



Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Подключение

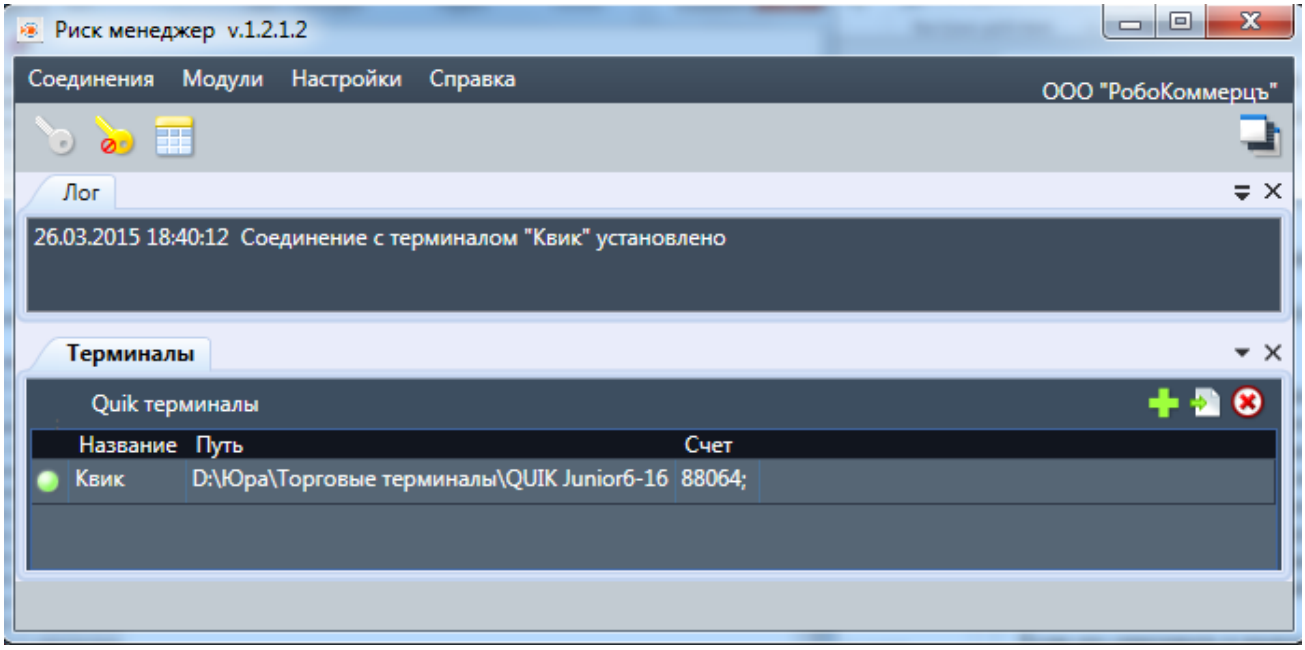


Назначение кнопок:

	Установить соединения с терминалами QUIK.
	Разорвать соединения с терминалами QUIK.
	Закрепление поверх всех окон
	Обновить данные.
	Индикатор подключения

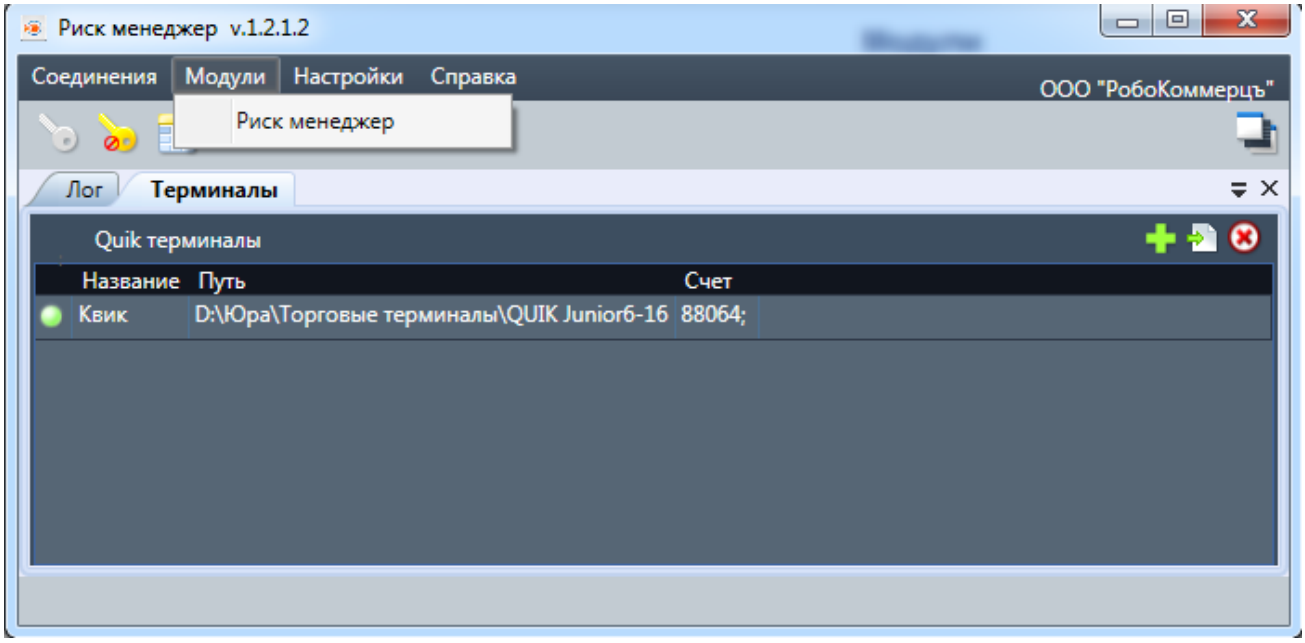
Следующим шагом будет установление соединения. Нажимаем на кнопку  или заходим через меню Соединения/Установить соединение. Если все настроено правильно, копия программы зарегистрирована и QUIK включен, то индикатор подключения изменит свое состояние с красного  на зеленый . И появится соответствующая запись в логе об успешном соединении.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены



Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Модули



Доступные модули:

1. Риск менеджер

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Риск-менеджер

Возможности Риск-менеджера:

№	Характеристика	Описание	Реализация
1	Отслеживание и блокировка при достижении установленного убытка	Автоматический расчет прибыли/убытка и в случае необходимости блокировка торговли. По умолчанию сделано закрытие вновь открываемых позиций и снятие заявок/стоп-заявок при попытке трейдера продолжить торговлю.	Реализовано
2	Тип расчета потерь	Расчет лимита потерь в денежном выражении или процентах от счета	Реализовано
3	Тип расчета лимита	Обычный - расчет ведется от начальной сумму на счете в начале сессии Трейлинг профит - Расчет убытка ведется от максимального значения по счету за текущий торговый день Трейлинг профит + сделка - Расчет максимального значения счета учитывается только при совершении сделки и от полученной величины ведется расчет убытков	Реализовано
4	Режим расчета	Для ММВБ только убыток за день, для FORTS можно учитывать только вариационную маржу, убыток за день или вариационную маржу и накопленный доход.	Реализовано
5	Прекращение торговли по достижении прибыли	После достижении по счету указанной трейдером величины Риск-менеджер закроет все позиции и снимет все заявки и стоп-заявки. При попытке трейдером продолжить торговлю, будет автоматически закрывать открываемые позиции и снимать заявки и стоп-заявки.	Реализовано
6	Защита прибыли	После достижения планируемой прибыли на счете, уменьшение прибыли возможно только до указанной величины.	Реализовано
7	Защита прибыли при сделке	Фиксация нового значения по прибыли ведется только в момент совершения сделки. После достижения планируемой прибыли на счете, уменьшение прибыли возможно только до указанной величины.	Реализовано
8	Просадка по счету за период времени	Возможность установить максимальное снижение счета до указанной величины.	Реализовано

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

		После достижения данной величины, все вновь открываемые позиции будут закрывать Риск-менеджером автоматически, а стоп-заявки и заявки будут сниматься. Данный запрет будет до тех пор, пока не изменят условия в настройках	
10	Ручная блокировка	В случае необходимости можно заблокировать возможность трейдера вести торговлю. Все вновь открываемые позиции будут закрывать Риск-менеджером автоматически, а стоп-заявки и заявки будут сниматься	Реализовано
Лимиты			
11	Торговля только по выбранным инструментам	Возможность установить ограничения по торгуемым инструментам. Если трейдер совершает операцию по не разрешенному инструменту, то в данном случае возможно уведомление или автоматическое закрытие позиции.	Реализовано
12	Торговля только в лонг/шорт или лонг и шорт	Разрешить торговлю только на покупку, продаже или покупку и продажу. Например. если трейдер совершает операцию, в шорт, а ему по этому инструменту запрещен шорт, то в данном случае возможно уведомление или автоматическое закрытие позиции.	Реализовано
13	Максимальное количество лотов	При превышении лимитов для покупки или продажи инструмента, по которому установлены лимиты, возможно уведомление или автоматическое закрытие той части позиции, на которую превышен лимит.	Реализовано
Сделки			
14	Лимит по сделкам	Максимальное количество трейдов, которое может совершить трейдер за торговый день	Планируется
15	Серия убыточных сделок	После превышения данного параметра, трейдеру будет запрещена торговля указанный интервал времени	Планируется
16	Убыток за интервал, мин	Если за указанный промежуток времени, убыток составил больше указанного значения, то торговля приостанавливается на заданный период времени	Планируется
17	Убыточных сделок за период	Если за указанный промежуток времени, количество убыточных сделок составило	Планируется

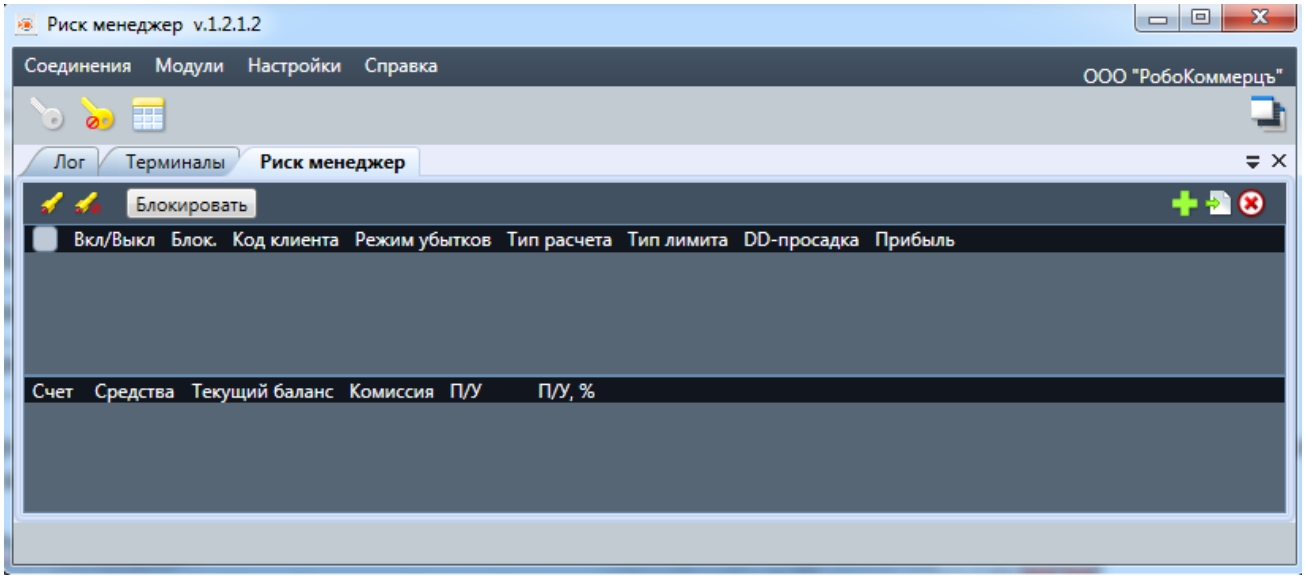
Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

		больше указанного значения, то торговля приостанавливается на заданный период времени	
18	Пауза после закрытии позиции с убытком	Если позиция была закрыта с убытком, то открытие новых позиций по заданному инструменту будет возможно только через заданный интервал времени.	Планируется
Время			
19	Время торговли	Для каждого трейдера возможно установить свое время торговли.	Планируется
20	Закрытие позиций в конце сессии или перед клирингами	За определенный период времени до конца сессии позиции трейдера будут закрыты, если данная опция включена.	Планируется
Комиссии			
21	Учет комиссии брокера	Учет в просадке комиссии брокера	Планируется

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Подключение

Очень Важно!!! Для Блокировки счета необходимо учесть, что если трейдер будет торговать инструмента не транслируемыми из вашего QUIK в Риск-менеджер, то программа не сможет закрыть позиции трейдера по данному инструменту, т.к. нет информации о параметрах данного инструмента. Во избежании этого необходимо добавить все или возможные инструменты, которыми будет торговать трейдер в таблицу текущих параметров в QUIK'e , передающую информацию по ДДЕ в Риск-менеджер

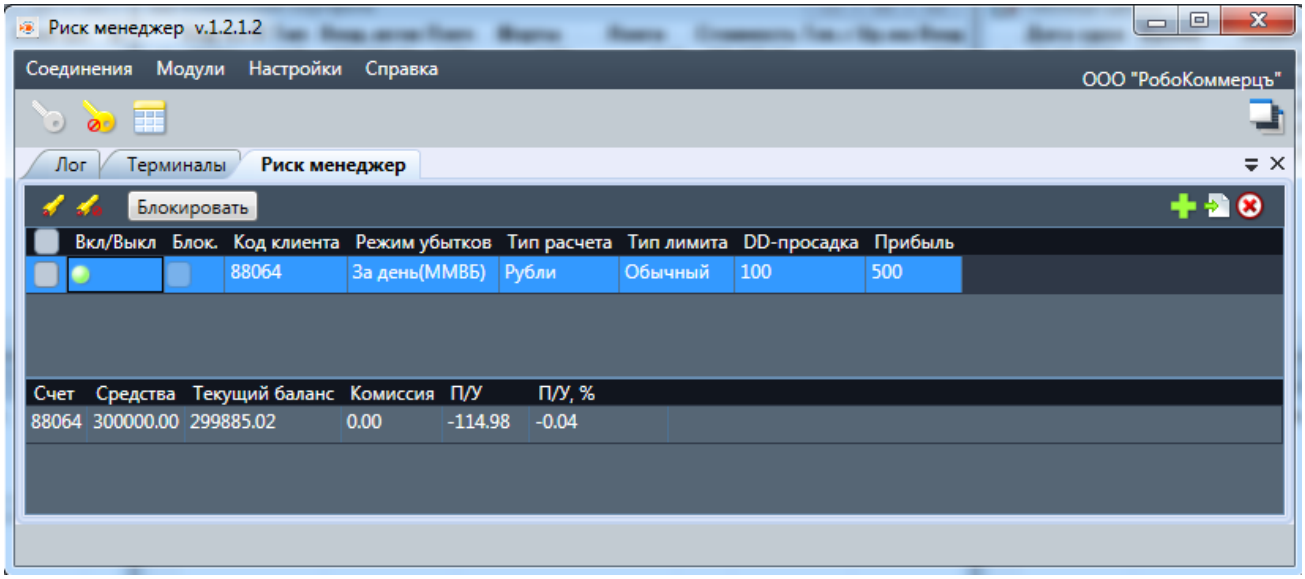


	Используется для массового запуска отмеченных ☑ экземпляров Риск-менеджера
	Используется для массовой остановки отмеченных ☑ экземпляров Риск-менеджера
	Добавление нового риск-менеджера
	Копирование выделенного риск-менеджера
	Удаления выделенного риск-менеджера

Кнопка "Блокировать" позволяет Риск-менеджеру (человеку) в ручном режиме запретить торговлю трейдеру, т.е. все вновь открываемые позиции будут закрываться, а заявки и стоп-заявки сниматься.

После запуска Риск-менеджера по счета

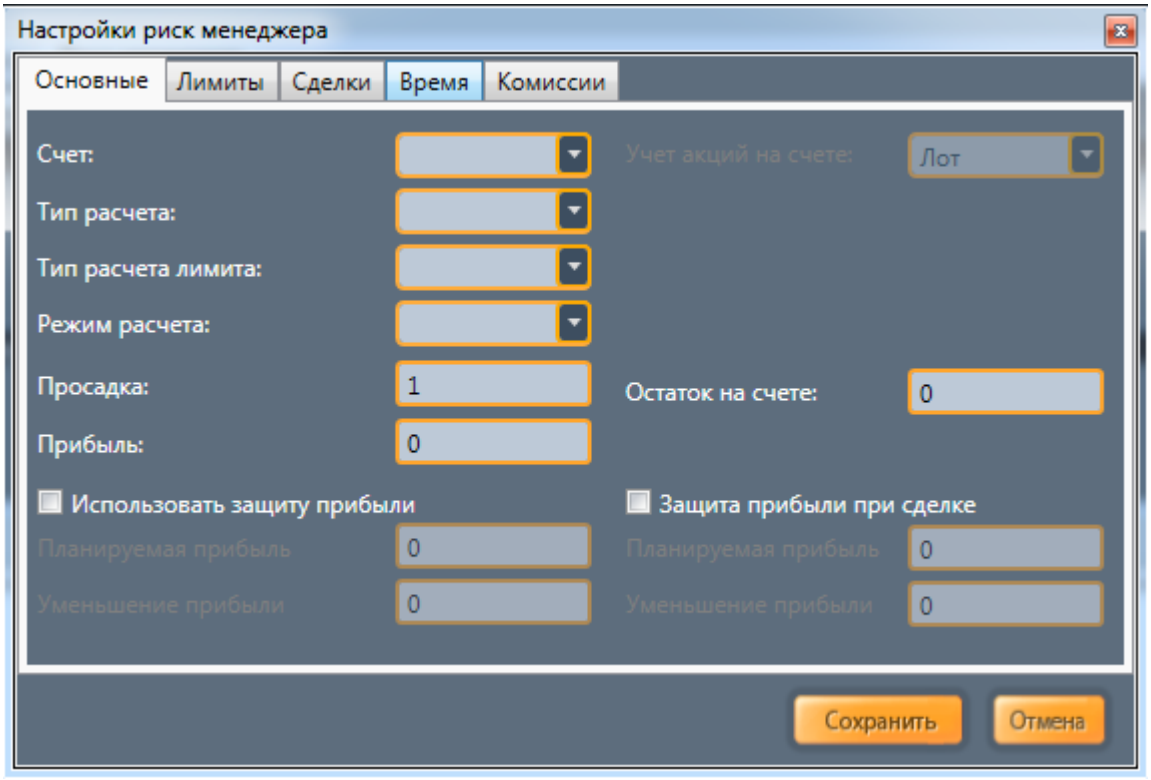
Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены



В нижней части экрана показываются расчеты по счетам:
Счет - текущий счет, по которому работает Риск-менеджер;
Средства - входящие лимиты на начало сессии;
Текущий баланс - текущие средства, с учетом комиссии брокера, если включена данная опция;
Комиссия - расчет комиссии брокера, если включен блок комиссии в Риск-менеджере;
Полная - прибыль/убыток в абсолютной величине;
П/У % - прибыль/убыток в относительно величине.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

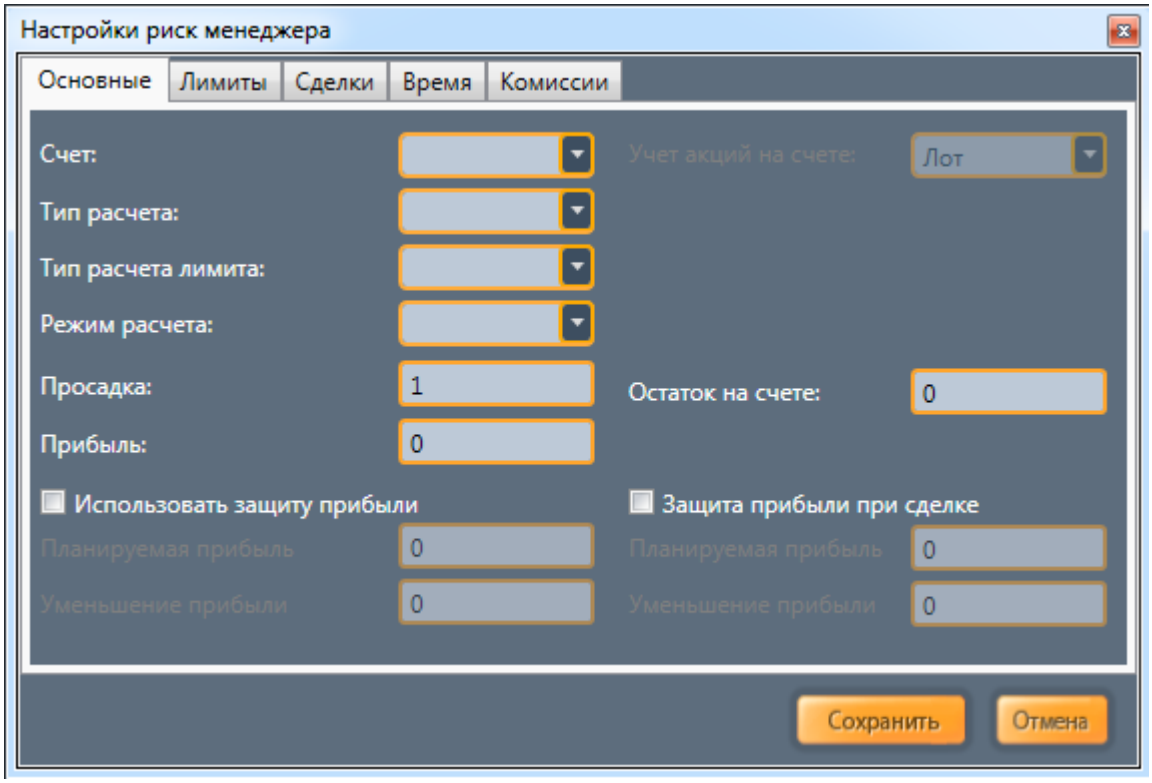
Настройки



Основные - устанавливаются основные параметры риск-менеджера;
Лимиты - устанавливаются лимиты по торгуемым инструментам и торгуемые инструменты;
Сделки - устанавливаются лимиты по сделкам и все что связано с ними;
Время - устанавливается время торговли трейдера;
Комиссии - устанавливается комиссии по счету.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Основные



Счет - счет, по которому будет осуществляться риск-менеджмент;
Тип расчета - проценты или рубли. Данная опция влияет на просадку и прибыль. Т.е. Если стоят проценты, а просадка 2, то просадка будет равна начальный депозит *2%;
Тип расчета лимита - Обычный, трейлинг профит и трейлинг профит + сделка.

Базовые параметры для всех примеров: Начальный депозит 10000 рублей, Просадка 50, Прибыль 100.

Обычный - Сначала трейдер заработал 100 рублей, его счет стал равен 10100 П/У (прибыль/убыток) =+100, потом две убыточные сделки по 75 рублей П/У=-50, . И как только по его счету П/УБ=-50, то происходит блокировка торговли по счету (закрываются все позиции и снимаются все активные стоп-заявки и заявки по данному счету), т.е. все вновь открываемые трейдером позиции будут закрываться, а заявки и стоп-заявки снимаются.

Трейлинг профит - Сначала трейдер заработал 100 рублей, его счет стал равен 10100 П/У (прибыль/убыток) =+100, расчет убытка в данном случае ведется от максимального значения по счету, т.е. если в процессе торговли у трейдера был П/У +90, то счет его был 10090 и если произошла просадка на 50 рублей, т.е. счет стал 10040, то риск-менеджер заблокирует торговлю (закрываются все позиции и снимаются все активные стоп-заявки и заявки по данному счету), т.е. все вновь открываемые трейдером позиции будут закрываться, а заявки и стоп-заявки снимаются.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Трейлинг профит + сделка - Сначала трейдер заработал 100 рублей, его счет стал равен 10100 П/У (прибыль/убыток) =+100, расчет убытка в данном случае ведется от максимального значения по счету, но перерасчет данной величины происходит в момент совершения сделки, т.е. блокировки не будет как в предыдущем случае, если в процессе торговли у трейдера был П/У +90, то счет его был 10090 и произошла просадка на 50 рублей, счет стал 10040. В этом случае как только сделка закрылась происходит перерасчет максимального значения по счету он будет равен 10100, и как только от этой величины будет снижение на 50 рублей, то риск-менеджер заблокирует торговлю (закрываются все позиции и снимаются все активные стоп-заявки и заявки по данному счету), т.е. все вновь открываемые трейдером позиции будут закрываться, а заявки и стоп-заявки снимаются.

Режим расчета - ВМ - вариационная маржа (только для FORTS), ВМ+НД - вариационная маржа + накопленный доход (только для FORTS), За день (только для ММВБ);
Просадка - величина просадки, либо в абсолютных величинах (рубли) либо в относительных (%)осле достижении данной величины по счету, дальнейшая торговля блокируется;
Прибыль - величина прибыли, либо в абсолютных величинах (рубли) либо в относительных (%) после достижении данной величины по счету, дальнейшая торговля блокируется;

Использовать защиту прибыли:

Планируемая прибыль - величина, по достижению которой включается опция защиты прибыли;
Уменьшение прибыли - величина, до которой может опуститься прибыль после достижения планируемого значения;
Пример: Начальный депозит 10000 рублей, Защита прибыли включена, Планируемая прибыль 200, защита прибыли 150

Сначала трейдер заработал 100 рублей, его счет стал равен 10100 П/У (прибыль/убыток) =+100, потом убыток в 50 рублей ПУ=+50, потом заработал +150 П/У= +200. Как только П/У достигает планируемой прибыли, то включается опция защиты прибыли. При снижении прибыли до заданного значения "Уменьшение прибыли" равное 150, произойдет блокировка торговли;

Защита прибыли при сделке:

Планируемая прибыль - величина, по достижению которой включается опция защиты прибыли при сделке;
Уменьшение прибыли - величина, до которой может опуститься прибыль после достижения планируемого значения при сделке;
Пример: Начальный депозит 10000 рублей, Защита прибыли включена, Планируемая прибыль 200, защита прибыли 150

Сначала трейдер заработал 100 рублей, его счет стал равен 10100 П/У (прибыль/убыток) =+100, потом убыток в 50 рублей ПУ=+50, потом заработал +200. Как только

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

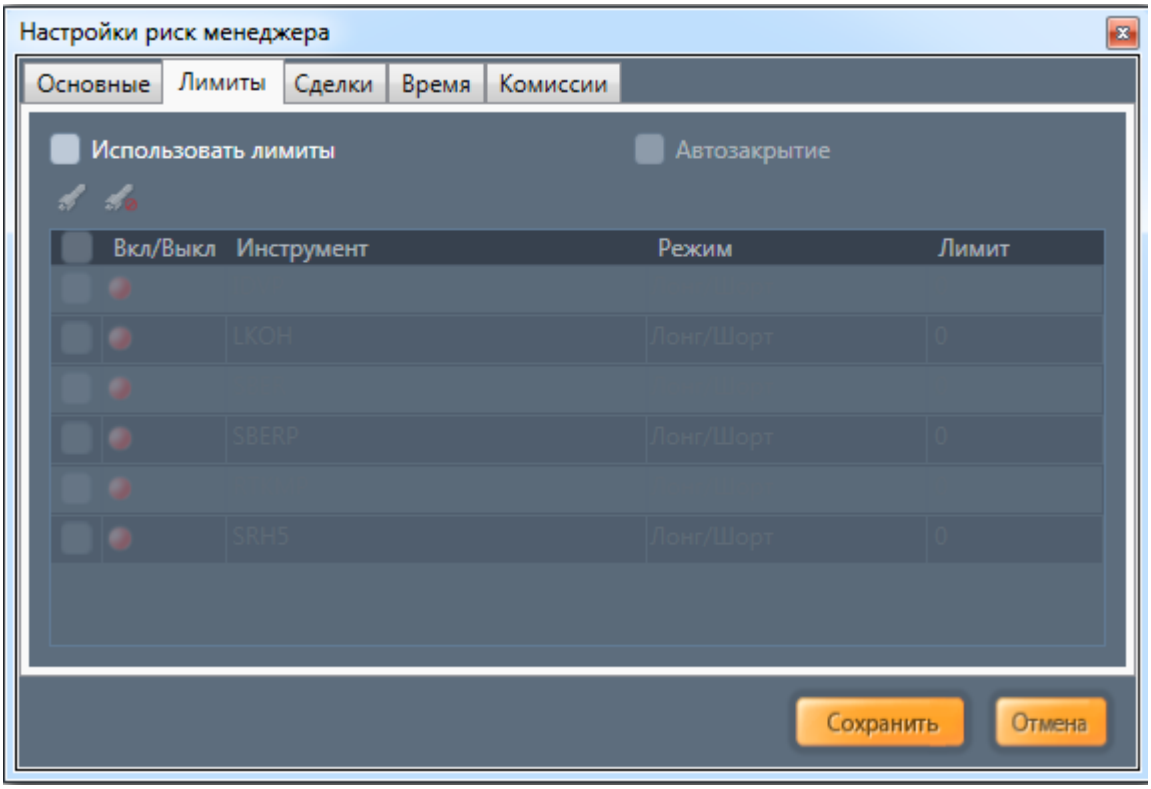
будет совершена сделка, то будет произведен перерасчет П/У и он будет равен=+250 и только после этого включается опция защиты прибыли при сделке. При снижении прибыли до заданного значения "Уменьшение прибыли" равное 150, произойдет блокировка торговли;

Учет акций на счете - необходимо указать как учитываются акции у вас на счете для корректного закрытия позиций по ММВБ при блокировке счета. В лимитах по бумагах можно посмотреть в чем ведется у вашего брокера учет, в акциях или лотах;

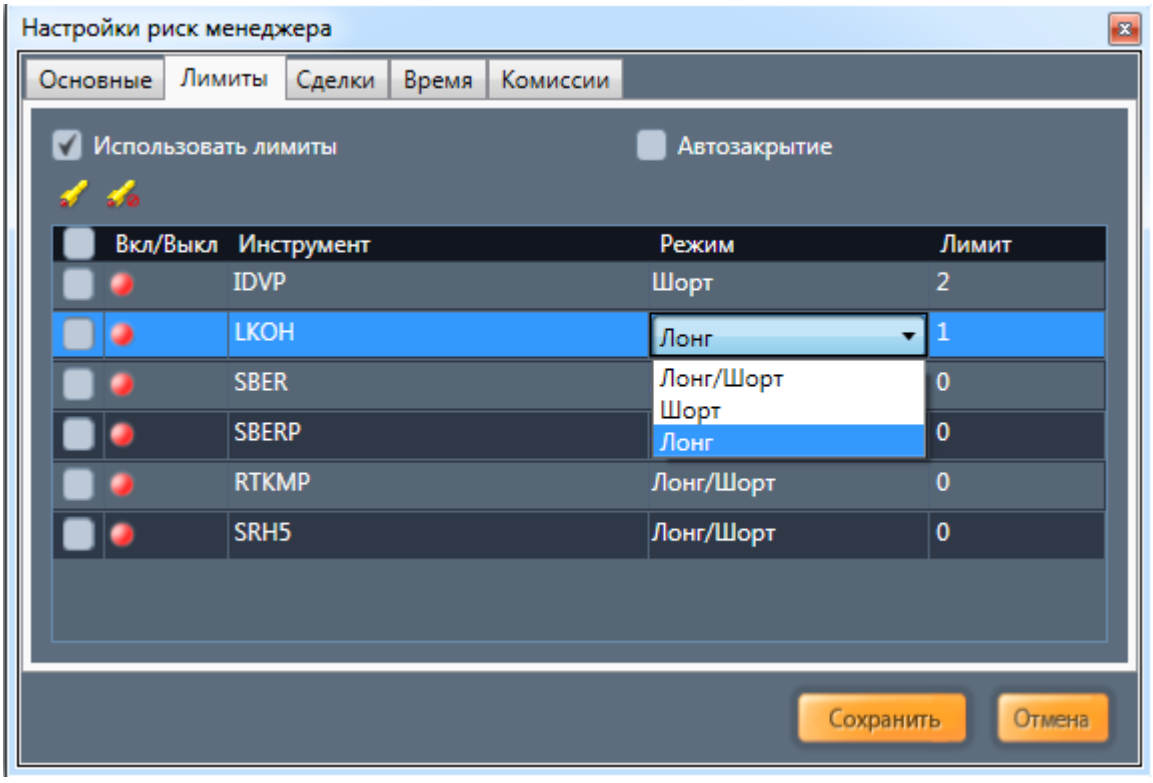
Остаток на счете - сумма ниже, которой не позволено опускаться по счету. Блокировка торговли будет до тех пор, пока данное значение не будет уменьшено или не увеличена сумма на счете.

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Лимиты



Для активации данной опции необходимо поставить галочку использовать лимиты



После активации у вас будут отражены все инструменты, которые находятся у вас в таблице текущих параметров для настроек Риск-менеджера. Если трейдер совершить

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

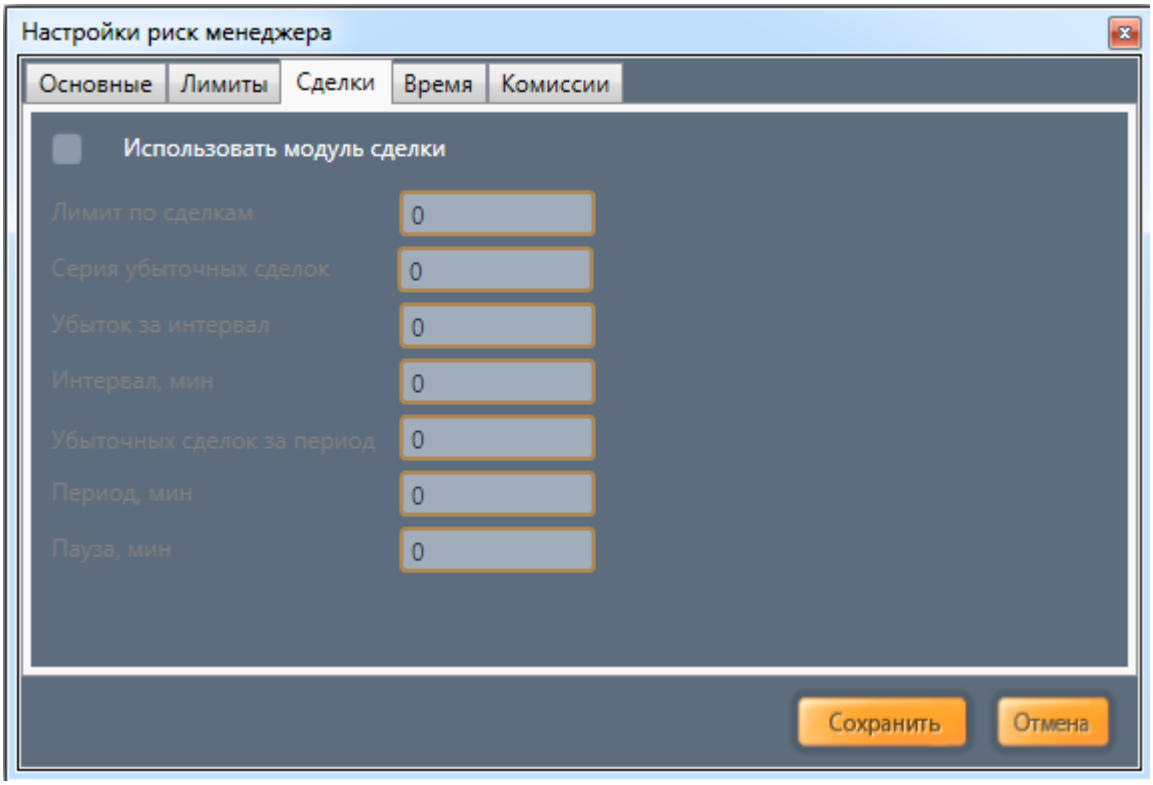
операцию не указанную в этом списке (соответственно ее нет и вашем QUIK, в таблице текущих параметров), то программа сможет только вывести сообщение о данной операции трейдера, а закрыть не сможет, т.к. нет у Риск-менеджера информация о параметрах данного инструмента. Для решения данной задачи, нужно добавить в таблицу текущих параметров, данный инструмент.

Автозакрытие - если трейдером будут нарушены правила лимитов по инструментам или направлению торговли, то данная опция позволяет автоматически закрывать позицию "нарушавшую" условия, иначе будет просто уведомление.

Для редактирования режима и лимитов необходимо нажать два раза на строке в соответствующей колонки, тогда появиться возможность изменить условия.

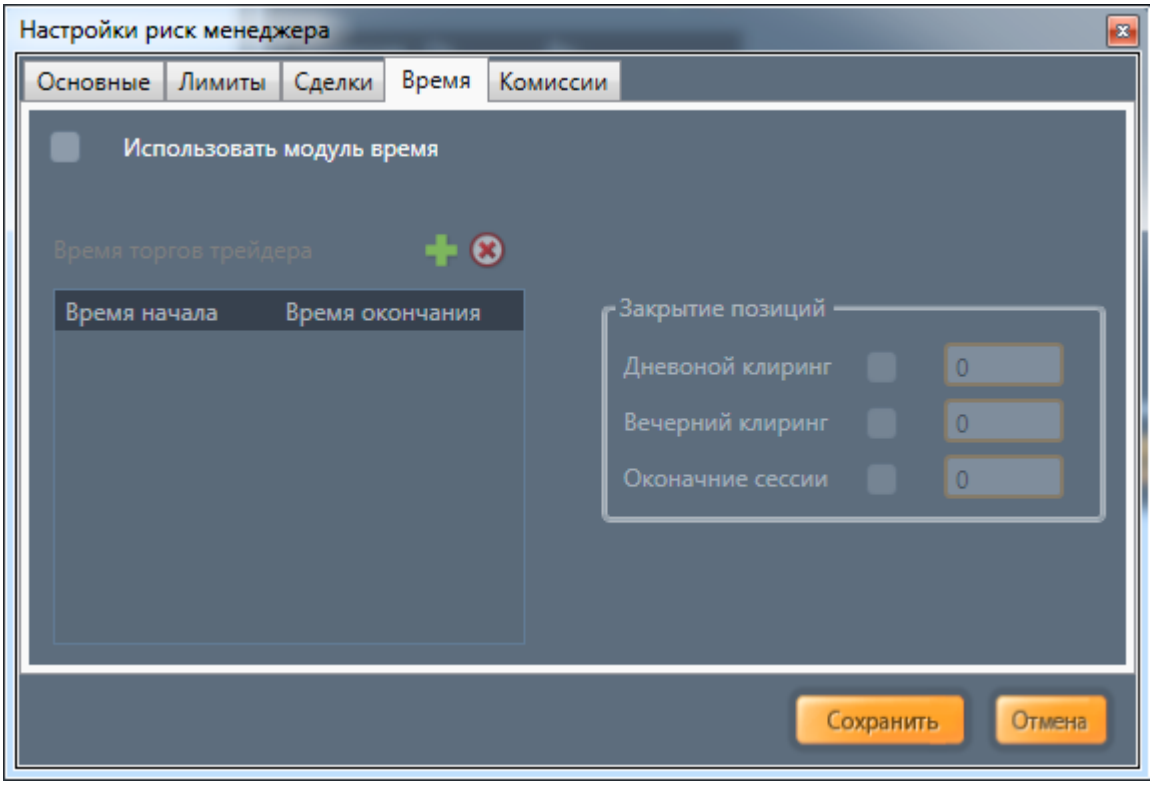
Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Сделки



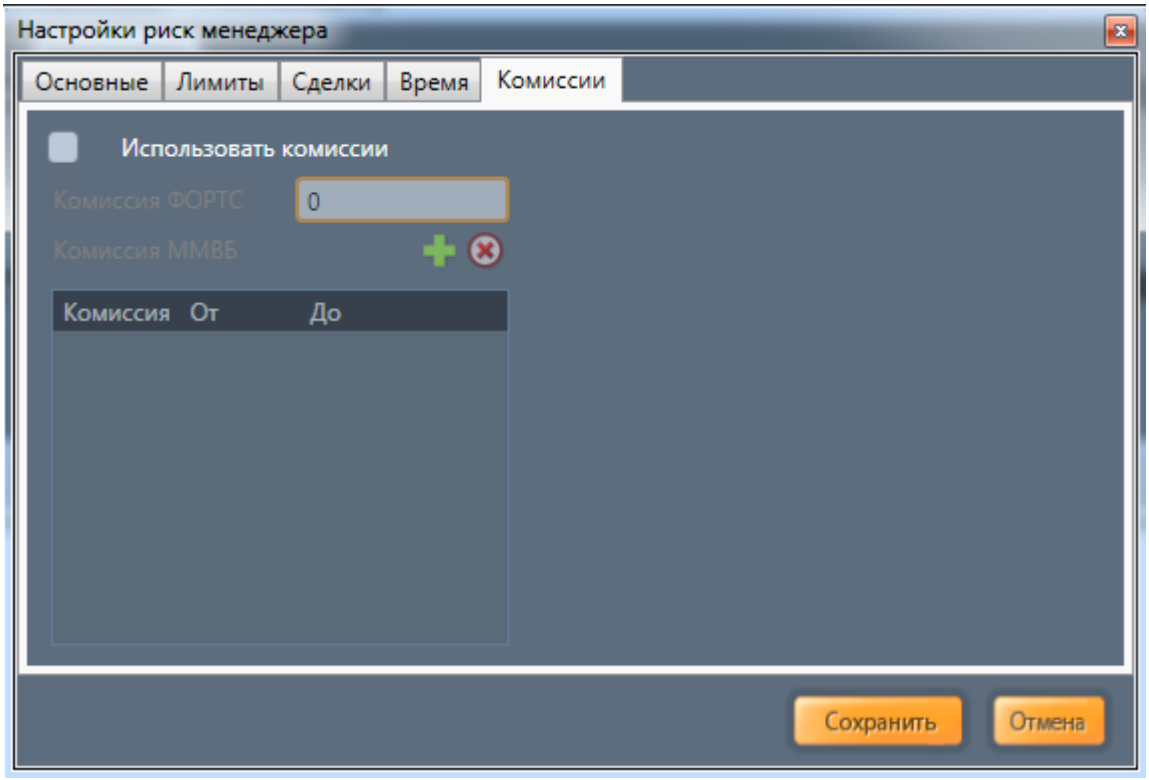
Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Время



Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Комиссии



Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены

Контакты

Информация об изменениях в различных версиях программы, а также список других полезных утилит доступны на официальном сайте в Internet http://www.rbkm.ru

Мы будем рады получить любые Ваши пожелания и комментарии.
Служба технической поддержки:
Тел. (343) 237-26-91
support@rbkm.ru
Отдел продаж:
Тел.: (343) 237-26-91
ifno@rbkm.ru

Желаем приятной работы!
ООО «РобоКоммерц».

Copyright © 2015 ООО "РобоКоммерц". Все права защищены