

Pricer / Настройка вычислений

В процессе работы Option Workshop производит различные вычисления: расчёт теоретических цен и коэффициентов чувствительности, параметров позиций. В зависимости от мощности компьютера выполняемые действия программы могут занимать разный процент ресурса CPU.

Для того чтобы регулировать частоту, с которой программа делает перерасчёт, в настройки вынесен параметр Pricer interval (рис. 1[1]). Данный параметр задаёт время в миллисекундах, на протяжении которого программа накапливает все изменения на рынке. По окончании периода происходит перерасчёт всех параметров по последним актуальным ценам.

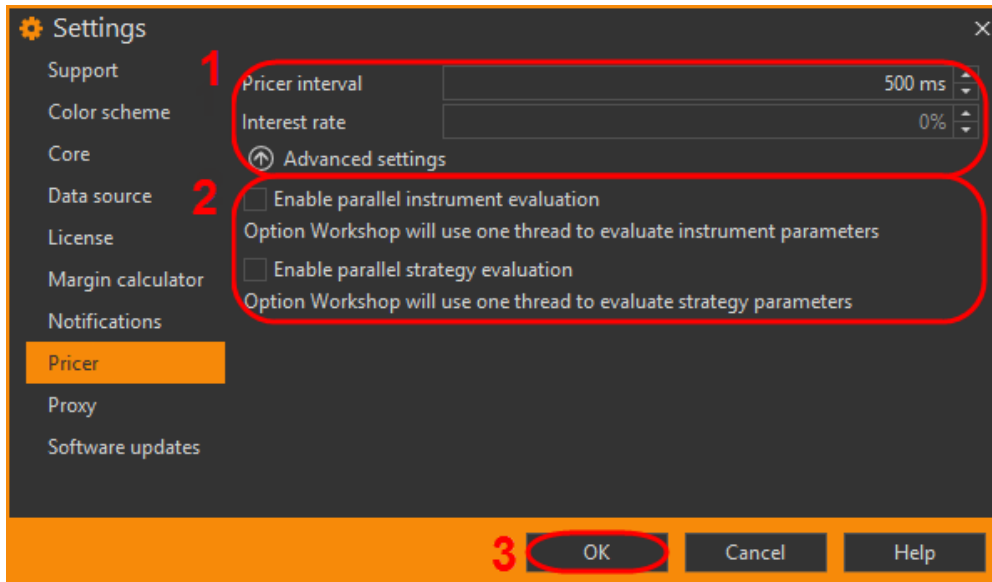


Рисунок 1 – вкладка Pricer

Параметр Interest rate – безрисковая процентная ставка. Значение этого параметра влияет на вычисления модели ценообразования (см. раздел [Настройка моделей ценообразования](#)). Данный параметр задаётся в процентах.

По умолчанию в OW используется один поток для расчета параметров инструментов и один – для стратегий. Для ускорения вычислений оба вида расчетов можно выполнять в несколько параллельных потоков, активировав переключатели (рис. 1[2]):

- включить параллельное вычисление параметров инструментов;
- включить параллельное вычисление параметров стратегий.

После установки параметров нажмите кнопку ОК для применения настроек (рис. 1[3]).