

Quik Log Analyzer

Руководство пользователя

версия 1.0
18.10.2016

1. Установка

Программа совместима с операционной системой Windows начиная с версии Windows XP.

Важное предупреждение: я не торгую в шорт и с плечами, поэтому данные виды сделок могут отображаться в отчетах некорректно (у меня просто не на чем проверить)! Если у вас есть возможность прислать мне образцы выгрузок с такими сделками, я смогу проверить выдачу и доработать программу, если нужно.

Распакуйте архив с программой (qla-1.0.zip) в любую папку. Для простоты папку можно создать просто на рабочем столе. После распаковки в папке будут находиться два файла: qla.exe и qla.pdf (данное руководство). Qla.exe – исполняемый файл, а не программа установки. Инсталлировать ничего не надо.

2. Выгрузка данных из Quik

У меня Quik 7.2.2.3 для работы через Сбербанк, не исключено, что в других версиях что-то может отличаться, но я надеюсь, что нет. Запустите Quik, подключитесь к серверу. В меню «Расширения» выберите подменю «Отчеты», а в нем пункт «Отчет по всем сделкам клиента». Появится окошко. В нем выберите код клиента и задайте временной интервал. Обычно ваша задача заключается в том, чтобы выгрузить все сделки за все время торгов на бирже, но не все данные сохраняются вечно. Например, за 2009 уже ничего выгрузить нельзя. Для начала можно задать интервал от 01.01.2009 по сегодняшний день. Отправьте запрос.

После того, как отчет будет построен, на экране появится окно с таблицей сделок. В этом окне щелкните правой клавишей мыши, выберите пункт «Копировать всё в буфер обмена». Откройте папку с программой. Щелкните на пустом месте правой клавишей мыши, выберите «Новый файл», затем «Текстовый документ». Дайте новому документу имя, начинающееся на sdelki, например sdelki-2009-2016.txt. Это важно, программа ищет именно файлы с расширением txt с именем, начинающимся на sdelki. Откройте созданный файл, появится пустое окно в Блокноте. Нажмите Ctrl-V (вставить), появится список сделок в текстовом формате. Сохраните документ и закройте Блокнот.

В некоторых случаях выгрузка за большой период пропускает некоторые сделки. Почему, неизвестно; решением является выгрузка за меньший период. Например, мне пришлось сделать отдельно выгрузку за январь-февраль 2016. Выгрузку можно и нужно делать каждый раз в новый файл, но с именем, начинающимся на sdelki; например, я сделал дополнительную выгрузку в файл sdelki-2016-01-02.txt. Программа прочитает все файлы вида sdelki*.txt и

выбросит повторы, поэтому не нужно заботиться о том, что периоды в разных файлах перекрываются. Рекомендуется выгрузить каждый год в отдельный файл вида `sdelki-2013.txt`, `sdelki-2014.txt`, `sdelki-2015.txt` и т.п.

3. Построение отчета

После выгрузки дважды щелкните на файле `qla.exe`. Появится текстовое окно; пример содержания приведен ниже (некоторые цифры замаскированы):

```
reading sdelki-2010.txt...
reading sdelki-2011.txt...
reading sdelki-2013.txt...
reading sdelki-2014.txt...
reading sdelki-2015.txt...
reading sdelki-2016-01-02.txt...
reading sdelki-2016-01.txt...
reading sdelki-2016.txt...
reading sdelki-last.txt...
1771 transactions imported
1536 unique transactions
Spent:  *
Gained: *
Volume: *
Comms:  *
211 orders
success
```

В конце должна быть строка «success» (успех), в этом случае программа отработала корректно и отчеты построены. Если этой строки нет, при обработке возникла ошибка и следует внимательно прочитать содержимое текстового окна. Закройте окно.

В папке с программой появились новые файлы типа HTML, имена которых начинаются на `report`. Файл `report.html` содержит общий отчет за все время торгов, файлы вида `report-2015.html` – отчеты за каждый год. Открывайте файлы любым браузером и внимательно читайте.

После новых выгрузок из Quik запустите `qla.exe` заново. Удалять что-либо не нужно. В папке появляются также файлы `imported.txt`, `garbage.txt` и `orders.txt`. Это служебные файлы для отладки программы, их можно удалить.

4. Отчеты

Приведем для примера отчет по бумаге NYDR (РусГидро) за 2010 г. Основная часть таблицы должна быть понятна каждому торгующему на бирже. Приведены цены, объемы сделок, количество акций.

Акция NYDR

Дата и время	Цена	Количество	Покупка	Продажа	Прибыль
01.10.2010 18:43:08	1.5750	126700	199,552.50		
11.10.2010 15:16:52	1.5970	126700		202,339.89	2,787.39
17.11.2010 18:28:08	1.5560	22700	35,321.19		
22.11.2010 15:46:51	1.5790	22700		35,843.30	522.10

Баланс по бумагам: 0 шт., по деньгам: 2,481.46 руб., оборот 473,056.90 руб., комиссия 828.03 руб.

В целях компактности представления серии сделок по одной бумаге в одном направлении в течение одного дня объединяются в одну строку, даже если они прошли по разным ценам (цена в этом случае рассчитывается как суммарный объем, деленный на количество бумаг). Если за покупкой следует продажа того же количества бумаг, в графе «Прибыль» указывается разница между суммами покупки и продажи. При убытке число красное, при прибыли зеленое. В графах «Покупка», «Продажа», «Прибыль» комиссии не учитываются.

В конце таблицы по бумаге приводится общий баланс. Здесь баланс по деньгам учитывает комиссию. Необходимо убедиться, что баланс по бумагам равен 0. Если это не так, то следует найти причину. Возможны следующие варианты:

- в отчете за год не учитывается, что остаток по бумагам перешел со предыдущего года (остаток по бумагам отрицателен);
- в отчете за год не учитывается, что остаток по бумагам перешел на следующий год (остаток по бумагам положителен);
- бумага в настоящее время находится на балансе (остаток по бумагам положителен);
- некоторые сделки не были выгружены.

В последнем случае необходимо проверить последовательность сделок и дополнительно выгрузить те временные интервалы, в которых возможен пропуск сделок.

5. Контакты

Если у вас есть вопросы или предложения, можно написать на s.ayukov@gmail.com. Последнюю версию программы всегда можно найти на сайте <http://www.ayukov.com/qla/>