



**ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА
ПО ИНТЕЛЛЕКТУАЛЬНОЙ СОБСТВЕННОСТИ,
ПАТЕНТАМ И ТОВАРНЫМ ЗНАКАМ**

(12) ЗАЯВКА НА ИЗОБРЕТЕНИЕ

(21), (22) Заявка: **2003123788/09, 26.11.2002**

(43) Дата публикации заявки: **10.01.2005 Бюл. № 1**

(85) Дата перевода заявки РСТ на национальную фазу: **29.07.2003**

(86) Заявка РСТ:
RU 02/00509 (26.11.2002)

(87) Публикация РСТ:
WO 2004/049 (10.06.2004)

Адрес для переписки:
**107023, Москва, ул. Б.Семеновская 49, оф.404,
Центр "ИННОТЭК"**

(71) Заявитель(и):

Рогов Михаил Анатольевич (RU)

(72) Автор(ы):

Рогов Михаил Анатольевич (RU)

**(54) СПОСОБ ФОРМИРОВАНИЯ КОНТРАКТОВ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ ЧЕРЕЗ
КОМПЬЮТЕРНУЮ СИСТЕМУ**

Формула изобретения

1. Способ формирования контрактов управления рисками через компьютерную систему, включающий получение от пользователя сигналов, содержащих данные по определенному активу, данные по типу контракта, данные по цене исполнения ("страйк") на определенный актив, данные по текущей цене определенного актива ("спот"), минимальному значению изменения ("тику"), текущей процентной ставке без риска невыплаты, разбросу цены определенного актива за время его котировки и требуемому гарантийному взносу для определенного актива, задание с использованием алгоритма расчета стоимости дериватива, дериватива каждой переменной алгоритма расчета стоимости дериватива, в зависимости от принятых с соответствующим значением данных сигналов, переменной цены исполнения ("страйк") с значением текущей цены ("спот") на определенный актив по данным сигнала, после этого посредством алгоритма расчета стоимости дериватива задание переменной цены исполнения ("страйк") с значением цены исполнения по данным упомянутых сигналов, отличающийся тем, что в качестве сигналов, содержащих данные по определенному активу, получают сигналы, содержащие данные о мерах солнечной и геомагнитной активности или производных от них показателей, в качестве сигналов, содержащих данные по цене исполнения ("страйк") на определенный актив, получают сигналы, содержащие данные об уровне исполнения ("страйк") на меры солнечной и геомагнитной активности или производные от них показатели, в качестве сигналов, содержащих данные по текущей цене определенного актива ("спот"), получают сигналы, содержащие данные по текущему уровню ("спот") мер солнечной и геомагнитной активности или производных от них показателей, в качестве сигналов, содержащих данные по минимальному значению изменения ("тик"), получают сигналы, содержащие данные по минимальному значению изменения ("тик") мер солнечной и геомагнитной активности или

производных от них показателей, в качестве сигналов, содержащих данные по разбросу цены определенного актива за время его котировки, получают сигналы, содержащие данные по разбросу мер солнечной и геомагнитной активности или производных от них показателей, определяют разность между торговой ценой контракта и окончательной ценой закрытия, и посылают пользователю сигнал, содержащий данные об указанной разнице, подлежащей распределению, определяют разность между ценой исполнения "страйк" и текущей ценой "спот" определенного актива и посылают пользователю сигнал, содержащий данные об указанной разнице, подлежащей распределению.

2. Способ по п.1, отличающийся тем, что в составе получаемых от пользователя сигналов, получают сигнал, содержащий данные о типе контракта, об объеме контракта, дате начала контракта, дате (сроке) исполнения, о дополнительных условиях дериватива.

3. Способ по п.2, отличающийся тем, что в качестве получаемого от пользователя сигнала, содержащего данные о дополнительных условиях дериватива, получают сигнал, содержащий данные о валюте, географическом регионе, сторонах контракта.

4. Способ по п.1, отличающийся тем, что в качестве сигналов, содержащих данные о мерах солнечной и геомагнитной активности или производных от них показателях, получают сигналы, содержащие данные о среднемесячных числах солнечных пятен.

5. Способ по п.2, отличающийся тем, что в качестве сигналов, содержащих данные о типе контракта, получают сигналы, содержащие данные по типу контракта, выбранные из группы, включающей опцион на право продажи (опцион "пут") или опцион на право покупки (опцион "колл") или фьючерс или форвард или своп.

6. Способ по п.1, отличающийся тем, что в качестве сигналов, содержащих данные о мерах солнечной и геомагнитной активности или производных от них показателях, получают сигналы, содержащие данные о влиянии астрономических и геофизических мер.