Изменение формулы расчета кривой волатильности.

27 февраля одновременно с плановым обновлением ТКС SPECTRA до версии 5.3 изменяется формула расчета кривой волатильности. Кривая волатильности представляет собой функцию:

$$\sigma(x) = f(x, s, a, b, c, d, e) = a + b * \left(1 - \exp(-cy^2)\right) + \frac{d * arctg(e * y)}{e}$$, где:

- *s, a, b, c, d, e* - параметры, подлежащие настройке
- $x = \frac{1}{\sqrt{T}} * \ln(\frac{Strike}{F})$ горизонтальная координата кривой, являющаяся по сути пересчитанным страйком, так как T (время до экспирации) и F (текущая котировка фьючерса-базового актива) фиксированы;
- $y = x - s$

Изменяется расчет параметра y:

- $y = x - s * \frac{1}{\sqrt{T}}$