

ABTRUST
ИНВЕСТИЦИОННОЕ ПАРТНЕРСТВО

**ТОРГОВЫЙ РОБОТ
INV-M.A.C
- ZERO**

INV-M.A.C-ZERO

КРАТКОЕ ОПИСАНИЕ: ТОРГОВЫЙ РОБОТ ИСПОЛЬЗУЕТ ТРЕНД СЛЕДЯЩУЮ СИСТЕМУ ИНДИКАТОРОВ С ЭЛЕМЕНТАМИ ВОЗВРАТА К СРЕДНЕМУ

ВХОДНЫЕ ПАРАМЕТРЫ:

- ✓ АКТИВНЫЙ ИНСТРУМЕНТ: **ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС РТС**
- ✓ ПЕРВОНАЧАЛЬНЫЙ КАПИТАЛ: **100 000 рублей**
- ✓ ПЕРИОД ОПТИМИЗАЦИИ: **16/01/2014 – 30/06/2016**
- ✓ ТАЙМ ФРЕЙМ: **1 ЧАС**
- ✓ КОЭФФИЦИЕНТ ВОВЛЕЧЕННОСТИ: **29%**

ДОХОДНОСТЬ
за период оптимизации в %

143

**ПОТЕНЦИАЛЬНАЯ
ДОХОДНОСТЬ**

в годовых %

до 65¹



CO (% в ГОД/МЕСЯЦ)

44/13

VAR⁹⁵ (ГОД/МЕСЯЦ в тыс. руб)

72/21

МАКСИМАЛЬНАЯ/ОТНОСИТЕЛЬНАЯ ПРОСАДКА (в тыс. руб./%)

30/18



¹Потенциальная доходность рассчитывается на основании теории вероятностей и математической статистики. В данном случае и далее, приводится цифра доходности верхней границы диапазона доходностей которые может показать робот за год торговли с вероятностью 80% (или в 8 случаях из 10). Полный же диапазон для конкретного случая: от 20% до 63% годовых. При этом, процент рассчитывается с учетом капитализации вложенного и заработанного капитала. То есть, если на вложенные 100 000, получена прибыль в 50 000 рублей (или 50%) годовых, то на следующий год она составит уже 75 000 (150 000 x 50%), таким образом по итогам двух лет прибыль будет 125 000 рублей или 125%.

ГРАФИКИ КАПИТАЛА

INV-M.A.C-ZERO



ГРАФИКИ КАПИТАЛА

INV-M.A.C-ZERO



INV-M.A.C-ZERO



²Модуль управления капиталом позволяет роботу самому принимать решение о количестве контрактов, которое он будет использовать для торговли. В отличие от простого робота, это позволяет уменьшать относительную просадку в случае торговли робота не в его пользу, а случае положительной динамики экспоненциально наращивать прибыль, что подтверждается графиком и экспоненциальной аппроксимацией. Эффект проявляется тем больше, тем дольше торгует робот.

INV-M.A.C-ZERO

КРАТКОЕ ОПИСАНИЕ: ТОРГОВЫЙ РОБОТ ИСПОЛЬЗУЕТ ТРЕНД СЛЕДЯЩУЮ СИСТЕМУ ИНДИКАТОРОВ С ЭЛЕМЕНТАМИ ВОЗВРАТА К СРЕДНЕМУ

ВХОДНЫЕ ПАРАМЕТРЫ:

- ✓ АКТИВНЫЙ ИНСТРУМЕНТ: **ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ПАО СБЕРБАНК**
- ✓ ПЕРВОНАЧАЛЬНЫЙ КАПИТАЛ: **100 000 рублей**
- ✓ ПЕРИОД ОПТИМИЗАЦИИ: **16/01/2014 – 30/06/2016**
- ✓ ТАЙМ ФРЕЙМ: **1 ЧАС**
- ✓ КОЭФФИЦИЕНТ ВОВЛЕЧЕННОСТИ: **36%**

ДОХОДНОСТЬ
за период оптимизации в %

202

**ПОТЕНЦИАЛЬНАЯ
ДОХОДНОСТЬ**

в годовых %

до 72



CO (% в ГОД/МЕСЯЦ)

39/11

VAR⁹⁵ (ГОД/МЕСЯЦ в тыс. руб)

65/19

МАКСИМАЛЬНАЯ/ОТНОСИТЕЛЬНАЯ ПРОСАДКА (в тыс. руб./%)

19/8



ГРАФИКИ КАПИТАЛА

INV-M.A.C-ZERO



ГРАФИКИ КАПИТАЛА

INV-M.A.C-ZERO



ГРАФИКИ КАПИТАЛА

INV-M.A.C-ZERO



INV-M.A.C-ZERO

КРАТКОЕ ОПИСАНИЕ: ТОРГОВЫЙ РОБОТ ИСПОЛЬЗУЕТ ТРЕНД СЛЕДЯЩУЮ СИСТЕМУ ИНДИКАТОРОВ С ЭЛЕМЕНТАМИ ВОЗВРАТА К СРЕДНЕМУ

ВХОДНЫЕ ПАРАМЕТРЫ:

- ✓ АКТИВНЫЙ ИНСТРУМЕНТ: **АКЦИИ ПАО СБЕРБАНК**
- ✓ ПЕРВОНАЧАЛЬНЫЙ КАПИТАЛ: **100 000 рублей**
- ✓ ПЕРИОД ОПТИМИЗАЦИИ: **16/01/2014 – 22/08/2016**
- ✓ ТАЙМ ФРЕЙМ: **1 ЧАС**
- ✓ КОЭФФИЦИЕНТ ВОВЛЕЧЕННОСТИ: **30%**

ДОХОДНОСТЬ
за период оптимизации в %

35

**ПОТЕНЦИАЛЬНАЯ
ДОХОДНОСТЬ**

в годовых %

до 49²



CO (% в ГОД/МЕСЯЦ)

2/7

VAR⁹⁵ (ГОД/МЕСЯЦ в тыс. руб)

11/3

МАКСИМАЛЬНАЯ/ОТНОСИТЕЛЬНАЯ ПРОСАДКА (в тыс. руб./%)

4/3



²В отличие от фьючерсов торговля акциями не кажется такой прибыльной на первый взгляд. В основном это связано с ГО обеспечением по фьючерсу, которое составляет порядка 10% от стоимости всего контракта, таким образом достигается аналог плеча 1 к 10. При торговле акциями, капитал реально в сделках расходуется на приобретение и продажу актива, и есть возможность использовать только тот капитал, который предоставляет брокер. Обычно это плечо 1:1. В тесте показан результат без плеча и по аналогии с тестами фьючерсного контракта коэффициент вовлеченности берется равный 30%. При таких коэффициентах риски совсем малы и составляют всего 3% от капитала за весь период тестирования если считать по максимальной просадки. При торговле акциями, можно смело наращивать коэффициент вовлеченности вплоть до 100%.

ГРАФИКИ КАПИТАЛА

INV-M.A.C-ZERO



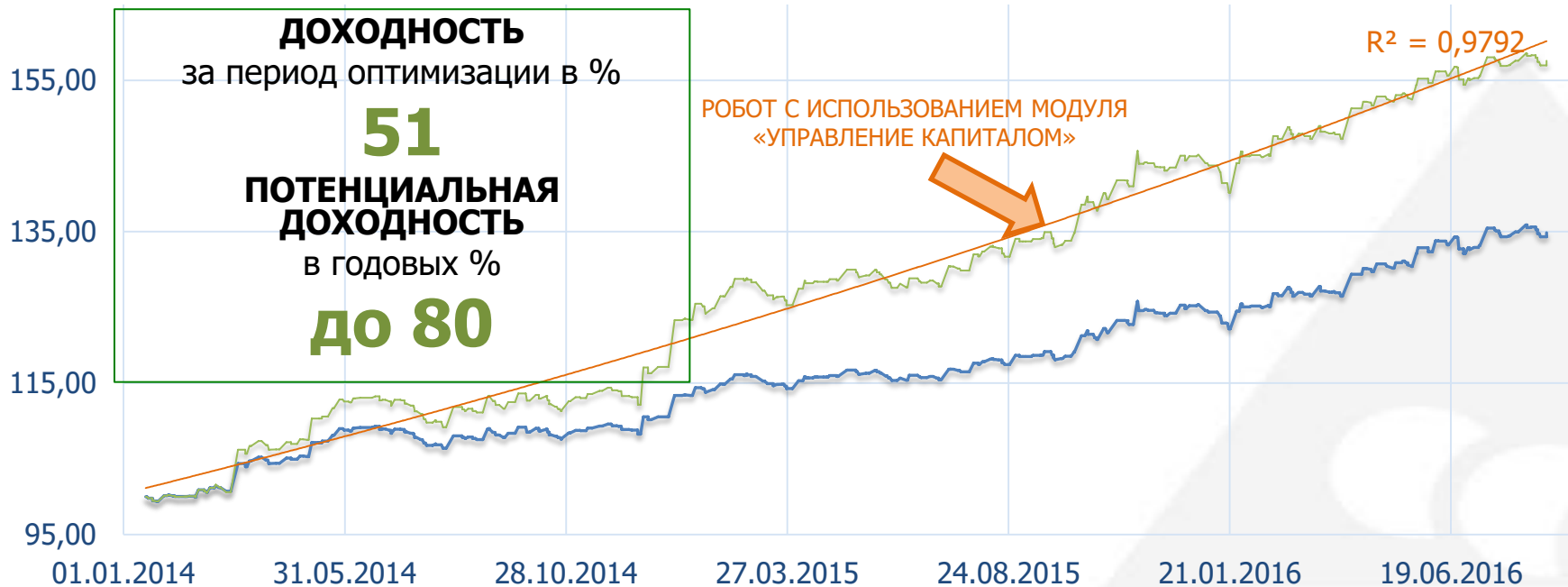
ГРАФИКИ КАПИТАЛА

INV-M.A.C-ZERO



ГРАФИКИ КАПИТАЛА

INV-M.A.C-ZERO



— Нормированный баланс INV-M.A.C-ZERO

— Нормированный баланс INV-M.A.C-ZERO с модулем MM

— Экспоненциальная (Нормированный баланс INV-M.A.C-ZERO с модулем MM)

ОСНОВНЫЕ ПОНЯТИЯ

ТОРГОВЫЙ РОБОТ (АЛГОРИТМ) – компьютерный код, программа обрабатывающая биржевую информацию, формирующая и передающая ордера от имени клиента

РИСК ПРОФИЛЬ ТОРГОВОГО РОБОТА – сводная информация, характеризующая торгового робота (алгоритм) по различным показателям

ПЕРВОНАЧАЛЬНЫЙ КАПИТАЛ – капитал на начальном этапе

ПЕРИОД ОПТИМИЗАЦИИ (ТЕСТИРОВАНИЯ) – период за который робот проходит (тестирование) оптимизацию параметров

ДОХОДНОСТЬ – доходность ТОРГОВОГО РОБОТА за оптимизируемый период, в % к первоначальному капиталу и в % годовых. В математической статистике рассчитывается от МАТЕМАТИЧЕСКОГО ОЖИДАНИЯ (МО). Для наших типов роботов, считается, что доходность каждого трейда никак не зависит от доходности предыдущего, или по другому что все доходности являются абсолютно независимыми величинами друг от друга.

СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ (СО) – статистический показатель, характеризующий разброс всех возможных доходностей вокруг МАТЕМАТИЧЕСКОГО ОЖИДАНИЯ. В финансовой математике это показатель называется РИСКОМ. Если считать, что все возможные показатели доходности имеют нормальное распределение (колоколообразное), то например 95% значение доходностей будут находится в интервале от $МО - 2 \times СО$ до $МО + 2 \times СО$. Финансовая математика трактует РИСК не только как риск потерь, но и как возможность заработать.

МАКСИМАЛЬНАЯ ПРОСАДКА – максимальная величина просадки допустимая для данного ТОРГОВОГО РОБОТА. Также служит основным ориентиром для остановки ТОРГОВОГО РОБОТА и принятия убытка. Реальный риск потерь, который показывал робот за время тестирования.

VAR⁹⁵ – сумма которая находится в зоне РИСКА в течение месяца (года), рассчитывается на основе МО и СО. Один из вариантов трактовки этого показателя такой - с вероятностью 95% максимальный убыток не превысит этого значения.

КОЭФФИЦИЕНТ ВОВЛЕЧЕННОСТИ – коэффициент использования денежных средств в работе робота, вычисляется как количество денежных средств необходимых роботу для торговли, к первоначальному депозиту (влияет на все виды РИСКА, который несет робот при торговле)

ТАЙМ ФРЕЙМ – временной интервал на котором робот принимает решение (записывается как 1 час, что означает не чаще одного раза в час)

КОНТАКТЫ

ИНВЕСТИЦИОННОГО ПАРТНЕРСТВА ABTRUST

Местонахождение:

127273, г. Москва, Нововладыкинский проезд, д.8, стр.3

Контактный телефон:

+7 (495) 972-02-42

Контактный e-mail:

incoming@ab-trust.ru

Адрес в сети Интернет:

www.ab-trust.ru

Контактное лицо:

Бачеров Алексей Викторович +7 (903) 963-55-51 avbacherov@ab-trust.ru