



AVTRUST
ИНВЕСТИЦИОННОЕ ПАРТНЕРСТВО

ТОРГОВЫЙ РОБОТ M.A.C - RS



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 является МАТЕМАТИЧЕСКИМ ОЖИДАНИЕМ (МО), если считать, 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)

СРАВНЕНИЕ ТОРГОВЫХ РОБОТОВ

ТОРГОВЫЕ РОБОТЫ могут весьма сильно отличаться по характеру торговли. Показатели которые необходимо учитывать **ИНВЕСТОРУ**, должны включать в себя:

- **ПРИБЫЛЬНОСТЬ**

за тестируемый период базовый показатель, если робот не зарабатывает, или зарабатывает мало, его легко отбраковать

- **РИСК**

выражается **МАКСИМАЛЬНОЙ ПРОСАДКОЙ**, **СТАНДАРТНЫМ ОТКЛОНЕНИЕМ** и **VAR**. Помогают оценить потенциальные потери, подобрать робота с учетом индивидуальных особенностей **ИНВЕСТОРА**, отслеживать работу робота

- **ХАРАКТЕР**

функция капитала отражает торговую стратегию. Робот может зарабатывать большую часть прибыли на каком-то благоприятном портрете рынка, а в других случаях терять, именно профиль функции капитала позволяет оценить это обстоятельство, и помогает **ИНВЕСТОРУ** быть готовым к периодам роста и падения

- **ЭФФЕКТИВНОСТЬ**

Любой робот имеет свой риск-профиль, и его сравнение с другими позволяет подобрать наиболее подходящего робота для **ИНВЕСТОРА**, кроме того любой робот сравнивается с самой простой стратегией на рынке **BUY AND HOLD** – купи и держи – это дает простой инструмент для экспресс анализа



ПРИМЕР ПРОФИЛЯ ФУНКЦИИ КАПИТАЛА ТОРГОВОГО РОБОТА В СРАВНЕНИЕ СО СТРАТЕГИЕЙ V&N

ТОРГОВЫЙ РОБОТ **M.A.C - RS**

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

ВХОДНЫЕ ПАРАМЕТРЫ:

- ✓ АКТИВНЫЙ ИНСТРУМЕНТ: **ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС RTS**
- ✓ ПЕРВОНАЧАЛЬНЫЙ КАПИТАЛ: **100 000 рублей**
- ✓ ПЕРИОД ОПТИМИЗАЦИИ: **16/01/2014 – 17/03/2016**
- ✓ ТАЙМ ФРЕЙМ: **30 МИН**
- ✓ КОЭФФИЦИЕНТ ВОВЛЕЧЕННОСТИ: **29%**

ДОХОДНОСТЬ
(% ГОДОВЫХ)

35

ПРЕВЫШЕНИЕ НАД V&N
(% ГОДОВЫХ)

71



CO (% В ГОД/МЕСЯЦ)

23/7

VAR⁹⁵ (ГОД/МЕСЯЦ В ТЫС. РУБ)

38/11

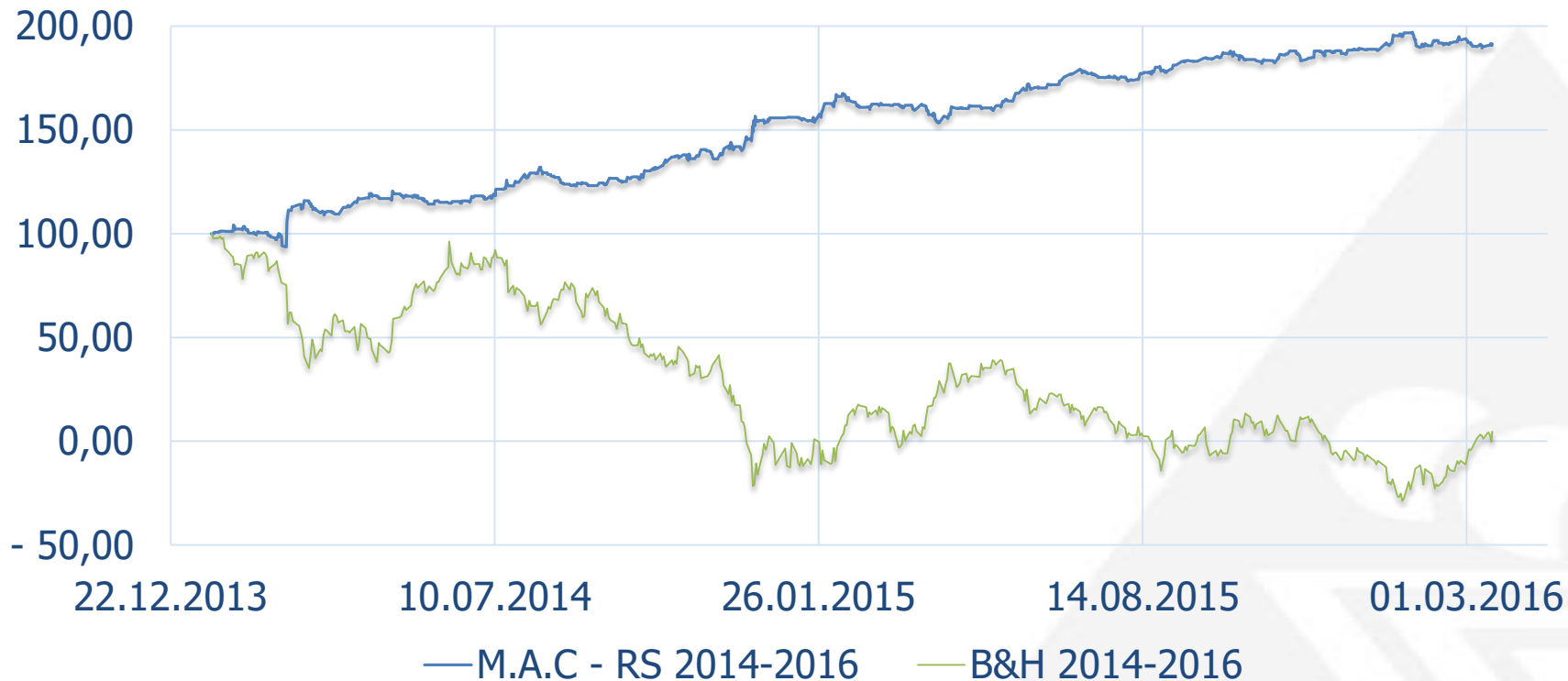
МАКСИМАЛЬНАЯ ПРОСАДКА (В ТЫС. РУБ./%)

15/15



ГРАФИКИ КАПИТАЛА

M.A.C - RS



M.A.C - RS

ПАРАМЕТРЫ СТРАТЕГИИ

Коэффициент вовлеченности

	В&Н	M.A.C - RS
Коэффициент вовлеченности	29%	29%

ПАРАМЕТРЫ ПРИБЫЛЬНОСТИ СТРАТЕГИИ ЗА ПЕРИОД

Период тестирования, в календарных днях

Период тестирования, в календарных днях	791	791
---	-----	-----

Прибыльность стратегии за период

Прибыльность стратегии за период	-95%	91%
----------------------------------	------	-----

Отношение чистой прибыли / общей прибыли

Отношение чистой прибыли / общей прибыли	- 1/10	3/10
--	--------	------

ПАРАМЕТРЫ РИСКОВАННОСТИ СТРАТЕГИИ ЗА ПЕРИОД

СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ за период тестирования

СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ за период тестирования	100%	34%
---	------	-----

VAR 95% в тыс. рублей за период тестирования

VAR 95% в тыс. рублей за период тестирования	100	56
--	-----	----

ДОХОДНОСТЬ/СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ СТРАТЕГИИ

ДОХОДНОСТЬ/СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ СТРАТЕГИИ	2/10	2 7/10
---	------	--------

Максимальная просадка за период тестирования, тыс. рублей

Максимальная просадка за период тестирования, тыс. рублей	100	15
---	-----	----

Максимальная просадка, в % к первоначальному депозиту

Максимальная просадка, в % к первоначальному депозиту	100%	15%
---	------	-----

Соотношение прибыльных трейдов к убыточным по числу

Соотношение прибыльных трейдов к убыточным по числу	9/10	6/10
---	------	------

Отношение суммы среднего прибыльного трейда к среднему убыточному

Отношение суммы среднего прибыльного трейда к среднему убыточному	1	2 3/10
---	---	--------

Соотношение прибыли к риску на один трейд

Соотношение прибыли к риску на один трейд	9/10	1 4/10
---	------	--------

ПАРАМЕТРЫ СТРАТЕГИИ В ПЕРЕСЧЕТЕ НА 1 ГОД

ПРИБЫЛЬНОСТЬ в год, сложный процент

ПРИБЫЛЬНОСТЬ в год, сложный процент	-36%	35%
-------------------------------------	------	-----

СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ за 1 год, в процентах

СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ за 1 год, в процентах	100%	23%
--	------	-----

VAR 95% в год, тыс. рублей

VAR 95% в год, тыс. рублей	100	38
----------------------------	-----	----

ПАРАМЕТРЫ СТРАТЕГИИ В ПЕРЕСЧЕТЕ НА 1 МЕСЯЦ

СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ за 1 месяц, в процентах

СТАНДАРТНОЕ ОТКЛОНЕНИЕ за 1 месяц, в процентах	100%	7%
--	------	----

VAR 95% в месяц, тыс. рублей

VAR 95% в месяц, тыс. рублей	100	11
------------------------------	-----	----

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