

Информация о предлагаемой услуге инвестиционного консультирования с использованием программы автоследования

1. Основные характеристики Программы и порядок её использования.

1.1. Описание Программы.

Назначением программы для ЭВМ «Программный комплекс алгоритмической торговли «Октан.Алготрейдинг» (далее – Программа) является автоматизированное, без непосредственного участия человека, формирование и предоставление индивидуальных инвестиционных рекомендаций (далее – ИИР), а также автоматизированное преобразование предоставленных ИИР в поручения брокеру на совершение сделок с ценными бумагами и (или) валютой и (или) на заключение договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, без непосредственного участия Клиента.

Функциональной особенностью Программы является наличие нескольких торговых роботов, осуществляющих автоматический анализ ценовой информации по спектру торговых инструментов.

Разработчиком Программы и инвестиционным советником, предоставляющим ИИР, сформированные Программой, является АО «Октан-Брокер» (далее – Компания).

1.2. Виды расходов, связанных с получением ИИР посредством Программы и порядке их расчета.

Расходы Клиента, связанные с получением ИИР посредством Программы, состоят из вознаграждения Компании за предоставление ИИР и вознаграждения за успех в размере, определённом в тарифном плане «Алготрейдинг», а также биржевой комиссии в размере, определённом организатором торговли. В случае предоставления ИИР по ценным бумагам также дополнительно оплачиваются услуги депозитария в размере, установленном тарифами депозитария. В случае если поручения на совершение сделок, преобразованные из предоставленных Компанией ИИР, направляются иному, чем АО «Октан-Брокер», брокеру, дополнительно оплачивается комиссия за совершение сделок иного брокера и иные комиссии в соответствии с тарифами такого брокера.

1.3. Правила синхронизации.

Синхронизация – это процедура сравнения открытых позиций по финансовым инструментам в портфеле Стратегии с открытыми позициями по финансовым инструментам в портфеле Клиента, формирование ИИР и их преобразование в поручение брокеру при отклонении состава портфеля Клиента от состава портфеля Стратегии.

Синхронизация проводится при подключении Клиента к Стратегии, вводе и выводе активов по счету Клиента, изменения инвестиционного профиля Клиента в течение одного рабочего дня с момента

наступления указанных событий.

При подключении Клиента к Стратегии, вводе активов по счёту Клиента, изменения инвестиционного профиля клиента на более рискованный в портфеле Клиента открываются новые позиции в процентном соотношении соответствующем объёму открытых позиций в портфеле Стратегии.

При выводе активов по счёту Клиента, изменения инвестиционного профиля Клиента на менее рискованный позиции в портфеле Клиента сокращаются или не наращиваются до момента приведения в процентном соотношении к объёму открытых позиций в портфеле Стратегии.

Процентное соотношение объёмов открытых позиций в портфеле Стратегии и портфеле Клиента после проведения синхронизации может незначительно отличаться вследствие проведения торгов финансовыми инструментами в лотах.

1.4. Сведения о минимально необходимых технических средствах, необходимых клиенту для получения ИИР посредством Программы.

Для получения ИИР посредством Программы Клиенту использовать технические средства не требуется. Программа не предоставляется Клиентам Компании для самостоятельного использования. Установка и настройка Программы производится на серверах Компании.

2. Сведения о Стратегиях, в соответствии с которыми осуществляется предоставление ИИР.

2.1 Название Стратегий.

- 2.1.1. Алгоритмическая.Фьючерсы.
- 2.1.2. Алгоритмическая.Акции.
- 2.1.3. Алгоритмическая.Валюта.

2.2. Описание Стратегий.

2.2.1. Стратегия «Алгоритмическая.Фьючерсы» реализована с помощью набора трендовых торговых роботов, основанных на различных идеях. Использование наиболее ликвидных фьючерсов на Срочном рынке Московской биржи позволяет сгладить кривую изменения капитала, диверсифицировать риски изменения рыночных закономерностей и оптимизировать издержки на осуществление сделок. Агрессивность Стратегии настраивается путём выбора размера торгового плеча.

ИИР предоставляются в отношении наиболее ликвидных фьючерсов на Срочном рынке Московской биржи.

Для получения ИИР в рамках Стратегии Клиенту необходимо пройти инвестиционное профилирование в Компании и открыть брокерский счёт.

2.2.2. Стратегия «Алгоритмическая.Акции» реализована с помощью набора трендовых торговых роботов, основанных на различных идеях. Использование наиболее ликвидных акций на Московской бирже позволяет сгладить кривую изменения капитала, диверсифицировать риски изменения рыночных закономерностей и оптимизировать издержки на осуществление сделок.

ИИР предоставляются в отношении наиболее ликвидных акций на Фондовом рынке Московской биржи.

Для получения ИИР в рамках Стратегии Клиенту необходимо пройти инвестиционное профилирование в Компании и открыть брокерский счёт.

2.2.3. Стратегия «Алгоритмическая.Валюта» реализована с помощью набора трендовых торговых алгоритмов, основанных на методах количественного анализа с использованием инструментов валютного и денежного рынков Московской Биржи. Ликвидная составляющая стратегии – спот валютная пара CNY/RUB, сглаживание кривой изменения капитала происходит за счет сделок с валютным свопом и РЕПО с центральным контрагентом.

ИИР предоставляются в отношении валютной пары CNY/RUB на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов Московской биржи.

Для получения ИИР в рамках Стратегии Клиенту необходимо пройти инвестиционное профилирование в Компании и открыть брокерский счёт.

2.3. Правила расчёта и периодичность публикации бенчмарков Стратегий.

В качестве бенчмарков Стратегий используется показатель доходности Стратегий, рассчитанный в процентах годовых, исходя из результатов совершения сделок у организатора торгов в портфеле Стратегий, с максимальным уровнем риска, с учетом реинвестирования полученной прибыли, без учета вознаграждения Компании.

Бенчмарки рассчитывается ежедневно и публикуется еженедельно на сайте Компании по адресу: <https://octan.ru/algo/>.

2.4. Правила расчёта и периодичность публикации точности следования по Стратегиям.

Точность следования по Стратегии показывает, насколько доходность Клиента приближена к доходности Стратегии.

Периодом расчёта и публикации точности следования является квартал.

Для расчёта показателя точности следования по Стратегии используется формула:

$T=100\%-|\Delta D|$, где ΔD рассчитывается по портфелям Клиентов, удовлетворяющим условию попадания в расчёт, как разность показателей доходности портфеля Клиента и Стратегии за период, взвешенная по сумме активов в портфеле Клиента.

Показатель доходности портфеля Клиента за период определяется с учетом вводов-выводов денежных средств и до удержания комиссий.

Для расчёта точности следования принимаются портфели Клиентов, одновременно отвечающие следующим требованиям:

- а) срок предоставления ИИР не менее одного квартала;
- б) валютой портфеля и гарантийным обеспечением являются рубли;
- в) Клиент не производил сделки в портфеле самостоятельно.

2.5. Перечень инвестиционных профилей Клиентов, в отношении которых осуществляется инвестиционное консультирование посредством Программы в рамках Стратегий.

ИИР по стратегиям «Алгоритмическая.Фьючерсы», «Алгоритмическая.Акции», «Алгоритмическая.Валюта» предоставляются Клиентам с инвестиционными профилями «Умеренный», «Агрессивный», «Сверхагрессивный».

2.6. Ограничения в отношении квалификации Клиентов, которые могут получать ИИР в рамках Стратегий.

Для получения ИИР в рамках Стратегии «Алгоритмическая.Фьючерсы» Клиенту-неквалифицированному инвестору может понадобиться пройти тестирование на знание особенностей сделок с финансовыми инструментами, используемыми в рамках Стратегии.

Для получения ИИР в рамках Стратегии «Алгоритмическая.Акции» Клиенту-неквалифицированному инвестору может понадобиться пройти тестирование на знание особенностей необеспеченных сделок и договоров РЕПО.

Для получения ИИР в рамках Стратегии «Алгоритмическая.Валюта» Клиенту-неквалифицированному инвестору может понадобиться пройти тестирование на знание особенностей необеспеченных сделок и договоров РЕПО.

2.7. Сведения о ёмкости Стратегий.

Максимально возможный суммарный объём портфелей Клиентов, подключённых к Стратегии «Алгоритмическая.Фьючерсы» (ёмкость Стратегии), ограничен 0,5% от среднедневного объема торгов на Срочном рынке Московской биржи.

Максимально возможный суммарный объём портфелей Клиентов, подключённых к Стратегии «Алгоритмическая.Акции» (ёмкость Стратегии), ограничен 0,5% от среднедневного объема торгов на Рынке акций и паёв Фондового рынка Московской биржи.

Максимально возможный суммарный объём портфелей Клиентов, подключённых к Стратегии «Алгоритмическая.Валюта» (ёмкость Стратегии), ограничен 0,5% от среднедневного объема торгов валютной парой CNY/RUB Валютном рынке и рынке драгоценных металлов Московской биржи.

2.8. Виды вознаграждения, уплачиваемого Компанией третьим лицам, в связи с оказанием услуг по инвестиционному консультированию посредством Программы.

Вознаграждение не выплачивается.

2.9. О возможности и порядке использования заемных средств.

В рамках стратегии «Алгоритмическая.Фьючерсы» заёмные средства не используются.

В рамках стратегий «Алгоритмическая.Акции» и «Алгоритмическая.Валюта» возможно использование заёмных средств.

Порядок использования заёмных средств определяется

Регламентом оказания брокерских услуг АО «Октан-Брокер».

2.10 Действующие ограничения, связанные с получением Клиентом ИИР посредством Программы.

В рамках стратегии «Алгоритмическая.Фьючерсы» минимальная сумма активов Клиента, в отношении которой предоставляются ИИР посредством Программы, составляет один миллион рублей.

В рамках стратегии «Алгоритмическая.Акции» минимальная сумма активов Клиента, в отношении которой предоставляются ИИР посредством Программы, составляет четыреста тысяч рублей.

В рамках стратегии «Алгоритмическая.Валюта» минимальная сумма активов Клиента, в отношении которой предоставляются ИИР посредством Программы, составляет десять миллионов рублей.

3. Порядок информирования Клиента в случаях прекращения использования и о временных перерывах в работе Программы.

Вероятность технических сбоев в работе Программы, способных привести к перерывам или прекращению работы Программы, существенно снижена за счет того, что формирование, предоставление и автоматизированное преобразование ИИР в поручение брокеру производятся на серверах Компании без использования оборудования Клиентов.

В случае прекращения использования или временном перерыве в работе Программы, в том числе результате технических сбоев, Компания извещает об этом Клиента посредством размещения соответствующего сообщения в личном кабинете Клиента на сайте Компании или направления такого сообщения Клиенту по электронной почте.

В случае недоступности Программы вследствие проведения технических работ Компания извещает об этом Клиента не позднее одного рабочего дня до момента начала технических работ.

Для совершения операций с финансовыми инструментами без использования программы автоследования, Клиент вправе самостоятельно совершить такие операции, подав соответствующее поручение брокеру.