

# Характеристика

## Стратегия Алгоритмическая «Валюта»

Стратегия 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.

**Цель** Получение доходности, значительно превышающей процентные ставки по депозитам при соответствующих рисках.

**Умеренный** уровень риска  
**10 млн. руб.** минимальная сумма

### Доходность стратегии

**Годовая\***  
**+ 34,47%**

**С начала года**  
**+9,35%**

**1 год**  
**+30,21%**

**Абсолютная\*\***  
**+63,11%**

**Коэффициент Шарпа\*\*\***  
**4,51**

\* указана среднегодовая доходность, рассчитанная по формуле сложного процента с 2020г.

\*\* с момента запуска стратегии 02.02.2020г.

\*\*\* ставка альтернативных вложений при расчете коэффициента равна нулю

**Вознаграждение**  
**0,17% от стоимости активов ежемесячно**  
**20% от чистой прибыли ежеквартально**

# Динамика доходности «Валюта»





# Стратегия основана на методике количественного инвестирования

Методы количественного инвестирования базируются на математике и статистике, исключая два важнейших фактора в трейдинге, зачастую негативно влияющие на итоговый результат: эмоции управляющего и направление движения рынка.



Разработчики таких стратегий, кванты, обрабатывают большие массивы исторических данных, на основе которых создаются математические модели поведения инструментов. Получившиеся модели “обкатывают” в условиях реальных торгов, оптимизируют и получившиеся продукты запускают в работу.

Услуги оказывает АО «Октан-Брокер». Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности, выдана ФКЦБ России 27.12.2000 г., №052-04219-100000, без ограничения срока действия, Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами №052-07240-001000, выдана ФКЦБ России 16.12.2003 г., без ограничения срока действия. Номер в Едином реестре инвестиционных советников: 26.

Стратегия «Алгоритмическая» доступна к подключению в рамках договора доверительного управления и/или автоследования на брокерском счете в рамках договора инвестиционного консультирования. Вознаграждение АО «Октан-Брокер» взимается в соответствии с Тарифами. Среднегодовая доходность по стратегии «Алгоритмическая» рассчитана исходя из результатов совершения операций на брокерском счете с максимальным уровнем риска с учетом реинвестирования полученной прибыли без учета вознаграждения АО «Октан-Брокер». Минимальная сумма инвестиций для подключения стратегии Алгоритмическая «Фьючерсы» 1000000 рублей. Минимальная сумма инвестиций для подключения стратегии Алгоритмическая «Акции» 400000 рублей. Для подключения к стратегии необходимо пройти инвестиционное профилирование. Уровень риска стратегии настраивается исходя из риск-профиля клиента. Для подключения к стратегии «Алгоритмическая» может потребоваться пройти тестирование на знание особенностей необеспеченных сделок и договоров РЕПО, сделок с производными финансовыми инструментами. Наименование программы автоследования и автоконсультирования: Программный комплекс алгоритмической торговли «Октан.Алготрейдинг».

#### Ограничение ответственности:

Настоящая информация представлена исключительно в ознакомительных целях. Настоящая информация, а также любые её комментарии, представленные АО «Октан-Брокер» или любым его сотрудником, не являются индивидуальной инвестиционной рекомендацией. Не является офертой или предложением заключить договор доверительного управления или иной договор об оказании инвестиционных или финансовых услуг. Приведенная доходность является справочной величиной и ее достижение не гарантируется в будущем. Доходность указана в процентах годовых. Инвестиции связаны с риском и могут привести к утрате капитала частично или полностью. Стоимость активов может как уменьшаться, так и увеличиваться в зависимости от ситуации на финансовых рынках. Иностранские акции и(или) валюта могут быть заблокированы на неопределенный срок в результате действий недружественных государств, государственных или наднациональных органов и образований, финансовых организаций. АО «Октан-Брокер» не несет ответственности за последствия принятия инвестиционных решений на основании данной информации.

Ознакомиться с условиями подключения стратегиям и получить иную информацию можно на сайте <https://octan.ru/>, по телефону: +7 (3812) 29-00-92, в офисе АО «Октан-Брокер» по адресу: Россия, гор. Омск, ул. Красный Путь, дом 109, офис 510.