

**Информация о предполагаемой услуге инвестиционного консультирования  
с использованием программы автоследования<sup>1</sup>**

**1. Основные характеристики программы автоследования и порядок ее использования.**

**1.1. Описание программы автоследования.**

Программа автоконсультирования/автоследования для ЭВМ «Хищник (версия 2.0.) (далее – Программа) – комплекс алгоритмической торговли, который автоматизированным способом без непосредственного участия человека формирует и представляет перечень индивидуальных инвестиционных рекомендаций (далее – ИИР), а также автоматизированным способом преобразует данные ИИР в одно или несколько поручений брокеру на совершение сделок с ценными бумагами и (или) на заключение договоров, являющихся производными финансовыми инструментами (далее – финансовые инструменты), предусмотренными такими ИИР, без непосредственного участия клиента.

Разработчиком и пользователем Программы является ООО ИК «Хамстер-Инвест» (далее – Инвестиционный советник). Программа не предоставляется Клиентам Инвестиционного советника для самостоятельного использования.

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

Расходы Клиента, связанные с получением ИИР посредством Программы, состоят из вознаграждения Инвестиционного советника за предоставление ИИР в соответствии с тарифным планом «Инвестиционное консультирование», комиссии брокера за совершение сделок, преобразованных из таких ИИР, комиссии вышестоящего брокера, а также биржевой комиссии в размере, определенном организатором торговли. В случае предоставления ИИР по ценным бумагам также дополнительно оплачиваются услуги депозитария в размере, установленном тарифами депозитария.

**1.3. Правила синхронизации.**

Синхронизация - процедура сравнения состава и объема открытых позиций финансовых инструментов в портфеле стратегии<sup>2</sup> с составом и объемом открытых позиций финансовых инструментов в портфеле Клиента.

Синхронизация осуществляется посредством формирования ИИР, направления ИИР и преобразования ИИР в поручение брокеру с целью приведения портфеля Клиента к портфелю

---

<sup>1</sup> Информация раскрывается в соответствии с требованиями внутреннего стандарта СРО НАУФОР «Требования к предоставлению услуг инвестиционного консультирования посредством программ автоследования»

<sup>2</sup> Стратегия – совокупность характеристик финансовых инструментов и условий, в соответствии с которыми предоставляются ИИР.

стратегии по составу и процентному соотношению объема открытых позиций финансовых инструментов.

Синхронизация проводится при подключении Клиента к стратегии, при вводе активов на счет Клиента или выводе/переводе активов со счета Клиента, изменения инвестиционного профиля Клиента, в течение 1 (одного) рабочего дня с момента наступления указанных событий.

При подключении Клиента к стратегии, вводе активов на счет Клиента, изменения инвестиционного профиля клиента на более рискованный, в портфеле Клиента открываются новые позиции, в процентном соотношении соответствующем объему открытых позиций в портфеле стратегии.

При выводе/переводе активов со счета Клиента, изменения инвестиционного профиля Клиента на менее рискованный, позиции в портфеле Клиента сокращаются до момента приведения в процентном соотношении к объему открытых позиций в портфеле стратегии.

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

#### **1.4. Правила предоставления ИИР в случае, если Инвестиционный советник при предоставлении ИИР по каждой стратегии используют коэффициент следования.**

Коэффициент следования не используется.

#### **1.5. Сведения о минимально необходимых технических средствах, необходимых Клиенту для получения ИИР посредством программы автоследования.**

Для получения ИИР посредством Программы технические средства Клиенту не требуются. Программа не предоставляется Клиентам Инвестиционного советника для самостоятельного использования. Установка и настройка Программы производится на сервере Инвестиционного советника.

## **2. Сведения о стратегиях, в соответствии с которыми осуществляется предоставление ИИР.**

### **2.1. Название стратегий:**

- 2.1.1. Консервативная
- 2.1.2. Рациональная
- 2.1.3. Агрессивная
- 2.1.4. Профессиональная

### **2.2. Описание стратегий:**

Все стратегии реализованы с использованием одного модельного портфеля, а их агрессивность настраивается с помощью жестко заданного мультипликатора *m*. Модельный портфель собирается с помощью набора из нескольких десятков торговых роботов, основанных на различных идеях, каждый из которых выдает целевую позицию по одному или нескольким активам. Все идеи содержат условия по типу «Если – То», методы искусственного интеллекта не применяются. В стратегиях используются ОФЗ, торгующиеся на основном (спот) рынке Московской биржи, наиболее ликвидные фьючерсы на Срочном рынке Московской биржи и наиболее ликвидные акций на Московской бирже.

Значение  $m$  находятся в диапазоне от 0,5 до 4,5 и равен:

- для стратегии «Консервативная» - 0,5;
- для стратегии «Рациональная» - 1,5;
- для стратегии «Агрессивная» - 2,5;
- для стратегии «Профессиональная» - 4,5.

### 2.3. Сведения о бенчмарке<sup>3</sup> стратегий (правила расчета и периодичность публикации показателей):

В качестве бенчмарка стратегий используется показатель доходности портфелей Клиентов, присоединенных к стратегии и удовлетворяющих условию попадания в расчет, рассчитанный в процентах годовых, исходя из результатов совершения сделок у организатора торгов, без учета вознаграждения за успех Инвестиционного советника (при наличии) и годового НДФЛ (при наличии).

Бенчмарк стратегий рассчитывается еженедельно и публикуется еженедельно на сайте Инвестиционного советника.

Формула расчета бенчмарка стратегий:

$V_n = \prod_{k=1}^n \Delta V_n\%$ , где  $\Delta V_n\%$  дневные приращения бенчмарка, рассчитанные как:

$$\Delta V_n\% = 1 + \frac{\sum \Delta \text{СЧА } i\text{-клиента, } n}{\sum \text{СЧА } i\text{-клиента, } n-1}$$

где:

$V$  - бенчмарк стратегии

$n$  - день расчета

$i$ -клиент – клиент, участвующий в расчете бенчмарка стратегии

СЧА – стоимость портфеля Клиента

$$\Delta \text{СЧА } i, n = \text{СЧА } i, n + \text{годовой НДФЛ (если есть)} + \text{комиссия за успех (если есть)} - \text{СЧА } i, n - 1$$

Для расчета приращений бенчмарка  $\Delta V_n\%$  стратегии в день  $n$  принимаются портфели Клиентов, одновременно отвечающие следующим требованиям:

- реинвестирование полученной прибыли и дивидендов, поступающих на специальный брокерский счет;
- отсутствие ввода/вывода/перевода денежных средств в течение последних 5 торговых дней с даты подачи поручения на ввод/вывод/перевод денежных средств.

### 2.4. Сведения о точности следования<sup>4</sup> (правила расчета и периодичность публикации показателей):

Для расчёта показателя точности следования по стратегиям используется формула:

$$V_n = \prod_{k=1}^n \Delta V_n\%$$

Точность следования равна  $\max |V_i / V_m - R_i / R_m|$

где:

$m \leq i \leq n$  по всем Клиентам, присоединенным к стратегии

<sup>3</sup> Показатель, который позволяет оценить доходность стратегии в прошлом.

<sup>4</sup> Показатель, который показывает, насколько доходность портфеля Клиента приближена к доходности Стратегии.

n – день расчета показателя

m – день начала периода расчета показателя

$R_n$  – относительная стоимость портфеля Клиента, которая вычисляется по формуле:  $R_n = \prod \Delta Rn\%$

где:

$\Delta Rn\% = \frac{сЧАi,n}{сЧАi,n-1}$ , если портфель Клиента удовлетворяет условию попадания в расчет бенчмарка стратегии

и

$\Delta Rn\% = \Delta Bn\%$ , если портфель Клиент не удовлетворяет условию попадания в расчет бенчмарка стратегии.

Периодом расчета и публикации точности следования является квартал.

Сведения о точности следования публикуется на сайте Инвестиционного советника.

## **2.5. Сведения о емкости<sup>5</sup> стратегий:**

Максимально возможный суммарный объем портфелей Клиентов (емкость стратегии), подключенных к стратегиям «Консервативная», «Рациональная», «Агрессивная» и «Профессиональная» равен 1 (Один) миллиард рублей по каждой стратегии.

Емкость стратегий может быть пересмотрена Инвестиционным советником в большую или меньшую сторону.

В случае достижения максимальной емкости стратегии, приостанавливается присоединение новых Клиентов к стратегии.

## **2.6. Перечень инвестиционных профилей Клиентов, в отношении которых Инвестиционный советник осуществляет инвестиционное консультирование посредством Программы в рамках Стратегий.**

В рамках стратегии «Консервативная» ИИР предоставляются Клиентам с инвестиционным профилем: Консервативный, Рациональный, Агрессивный, Профессиональный.

В рамках стратегии «Рациональная» ИИР предоставляются Клиентам с инвестиционным профилем: Рациональный, Агрессивный, Профессиональный.

В рамках стратегии «Агрессивная» ИИР предоставляются Клиентам с инвестиционным профилем: Агрессивный, Профессиональный.

В рамках стратегии «Профессиональная» ИИР предоставляются Клиентам только с инвестиционным профилем - Профессиональный.

## **2.7. Ограничения в отношении квалификации Клиентов, которые могут получать ИИИ в рамках Стратегии.**

Для получения ИИР в рамках стратегии «Консервативная» Клиенту-неквалифицированному инвестору необходимо пройти тестирование на знание особенностей сделок с финансовыми инструментами, используемыми в рамках стратегии, или иметь статус квалифицированного инвестора.

Для получения ИИР в рамках стратегий «Рациональная» и «Агрессивная» Клиенту-неквалифицированному инвестору необходимо пройти тестирование на знание особенностей

---

<sup>5</sup> Максимально возможный суммарный размер портфелей клиентов, получающих ИИР по каждой Стратегии.

сделок с финансовыми инструментами, используемыми в рамках стратегии, тестирование на знание особенностей необеспеченных сделок и договоров РЕПО, или иметь статус квалифицированного инвестора.

Для получения ИИР в рамках стратегии «Профессиональная» Клиенту необходимо иметь статус квалифицированного инвестора.

**3. Сведения о действующих ограничениях, связанных с получением Клиентом ИИР посредством Программы, включая сведения об ограничениях суммы активов Клиента, в отношении которой предоставляются ИИР посредством Программы в рамках каждой стратегии.**

3.1. Для получения ИИР посредством Программы в рамках стратегий Клиенту необходимо пройти инвестиционное профилирование или иметь статус квалифицированного инвестора, а также открыть брокерский счет в ООО ИК «Хамстер-Инвест» и счет депо в депозитарии вышестоящего брокера (ПАО «СПБ Банк»).

3.2. Минимальная сумма активов Клиента для предоставления ИИР посредством Программы в рамках всех стратегий составляет 1 (Один) миллион рублей. Рекомендуемая сумма активов Клиента для предоставления ИИР посредством Программы в рамках всех стратегий составляет 10 (Десять) миллионов рублей и более.

**4. Виды вознаграждения, уплачиваемого Инвестиционным советником третьим лицам, в связи с оказанием услуг по инвестиционному консультированию посредством Программы.**

Вознаграждение не выплачивается.

**5. О возможности и порядке расчета использования заемных средств (совершения необеспеченных сделок).**

В рамках стратегии «Консервативная» использование заемных средств (совершения необеспеченных сделок) невозможно.

В рамках стратегий «Рациональная», «Агрессивная», «Профессиональная» возможно совершение необеспеченных сделок.

Порядок совершения необеспеченных сделок определяется «Регламентом обслуживания на финансовых рынках ООО ИК «Хамстер-Инвест».

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

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

В случае прекращения использования или временном перерыве в работе Программы, в том числе в результате технических сбоев, Инвестиционный советник извещает об этом Клиента(-ов) посредством размещения соответствующего сообщения на сайте Инвестиционного советника в разделе «Новости» <http://hamster-invest.ru/about/novosti/> и/или в электронной системе «Личный кабинет Клиента».

В случае недоступности Программы вследствие проведения технических работ Инвестиционный советник извещает об этом Клиента (-ов) не позднее 1 (одного) рабочего дня до момента начала технических работ.

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