

## Правила конкурса

### 1. Общие положения

- 1.1. Конкурс «Алгоритмус-2016» проводится с целью популяризации алгоритмической торговли. Технической платформой для проведения конкурса является система автоследования торговым сигналам EasyMANi.
- 1.2. Организатором конкурса выступает ООО «МФД-ИнфоЦентр», разработчик системы EasyMANi.
- 1.3. Конкурс проводится при участии и поддержке биржи ОАО «Московская Биржа», сайта [algoritmus.ru](http://algoritmus.ru), а также ряда брокерских и инвестиционных компаний.
- 1.4. Целью проведения конкурса является выявление торговых стратегий, наиболее полно отвечающих критериям, установленным по номинациям.

### 2. Период проведения конкурса и порядок регистрации

- 2.1. Регистрация на конкурс начинается 14 марта 2016 г. и продлится до 13 мая 2016 г. включительно.
- 2.2. Период проведения конкурса устанавливается с 10:00 21 марта 2016 г. по 18:45 10 июня 2016 г. по московскому времени.
- 2.3. Итоги конкурса будут опубликованы 17 июня 2016 г.
- 2.4. Для того, чтобы принять участие в конкурсе необходимо:
  - 1) Зарегистрироваться на странице <http://mfd.ru/2016>;
  - 2) Добавить торговые стратегии;
  - 3) Настроить трансляцию торговых сигналов в систему EasyMANi;
- 2.5. К конкурсу также допускаются стратегии, трансляция которых осуществлялась до начала конкурса. Предыдущий доход стратегии учитываться не будет. Таким образом, все участники конкурса будут в одинаковых условиях.
- 2.6. Список финансовых инструментов, обращающихся на бирже, которые могут использоваться в конкурсных стратегиях:
  - 1) Сектор основного рынка Московской Биржи
    - ОАО «Газпром», ао;
    - ОАО «Газпром нефть», ао;
    - ОАО «ГМК «Норильский никель», ао;
    - ОАО «Интер РАО ЕЭС», ао;
    - ОАО «ЛУКОЙл», ао;
    - ПАО «Магнит», ао;
    - ОАО «НК Роснефть», ао;
    - ОАО «Российские сети», ао;
    - ОАО «НЛМК», ао;
    - ОАО «РусГидро», ао;
    - ОАО «Сбербанк», ао;
    - ОАО «Сбербанк», ап;
    - ОАО «Северсталь», ао;
    - ОАО «Сургутнефтегаз», ао;
    - ОАО «Татнефть», ао;
    - ОАО «АК Транснефть», ап;
    - ОАО «Уралкалий», ао;
    - ОАО «ФСК ЕЭС», ао;

- ОАО «Банк ВТБ», ао.

## 2) Сектор фьючерсов срочного рынка

- Фьючерсный контракт на Индекс РТС (RTS-6.16);
- Фьючерсный контракт на Индекс ММВБ (MIX-6.16);
- Фьючерсный контракт на курс доллар США - российский рубль (Si-6.16);
- Фьючерсный контракт на курс евро-российский рубль (Eu-6.16);
- Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Сбербанк России" (SBRF-6.16);
- Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Газпром" (GAZR-6.16);
- Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "НК "ЛУКОЙЛ" (LKOH-6.16);
- Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО Банк ВТБ (VTBR-6.16);
- Фьючерсный контракт на курс евро-доллар США (ED-6.16);
- Фьючерсный контракт на золото (GOLD-6.16).
- Фьючерсный контракт на нефть Brent (BR-4.16, BR-5.16, BR-6.16, BR-7.16).

### 2.7. Торговые сигналы учитываются в период торговых сессий:

- 1) Сектор основного рынка Московской Биржи – с 10:00 до 18:40 по московскому времени;
- 2) Сектор срочного рынка – с 10:00 до 23:50 по московскому времени (основная и вечерняя сессии).

## 3. Термины, определения и формулы

### 3.1. При расчете результатов участника конкурса используются следующие термины и формулы:

- I. Стратегия – последовательность торговых сигналов на совершение сделок, передаваемых участником конкурса, по отдельной торговой площадке (основной рынок, срочный рынок). Одна стратегия может включать в себя сигналы по одному или нескольким инструментам, но только в рамках одной площадки.
- II. Открытая позиция по ценным бумагам  $Q_i$  – количество ценных бумаг в портфеле. Различают два вида позиции: «длинная» (лонг) – если в результате покупки ценных бумаг  $Q_i > 0$ , и «короткая» (шорт) – если в результате продажи  $Q_i < 0$ ;
- III. Трейд – последовательность сделок по одному инструменту в разном направлении (покупка и продажа), у которых суммарный объем покупки равен суммарному объему продажи. По завершении трейда количество бумаг (контрактов) по этому инструменту в портфеле равно нулю.
- IV. Текущая стоимость портфеля – сумма условных денежных средств и текущей стоимости ценных бумаг.

Для сектора основной рынок определяется по формуле:

$$C_t = M + \sum_i^n Q_i \times P_i, \text{ где:}$$

$M$  – остаток денежных средств;

$Q_i$  – количество ценных бумаг  $i$  в портфеле;

$P_i$  – рыночная цена ценной бумаги  $i$  (цена последней сделки);

Для фьючерсов определяется по формуле:

$$C_t = M + \sum_i^n QL_i \times (P_i - OP_i) \times IP_i + \sum_j^m QS_j \times (OP_j - P_j) \times IP_j, \text{ где:}$$

$M$  – остаток денежных средств;

$QL_i$  – количество открытых контрактов по «длинной» (лонг) позиции  $i$ ;

$OP_i$  – цена открытия (покупки) в пунктах «длинной» позиции  $i$ ;

$P_i$  – текущая цена (в пунктах) по инструменту по позиции  $i$ ;

$IP_i$  – цена одного пункта контракта в рублях (по данным биржи);  
 $QS_j$  – количество открытых контрактов по «короткой» (шорт) позиции  $j$ ;  
 $OP_j$  – цена открытия (продажи) в пунктах по «короткой» позиции  $j$ ;  
 $P_j$  – текущая цена в пунктах по инструменту по позиции  $j$ ;  
 $IP_j$  – цена одного пункта контракта в рублях (по данным биржи);

- V. Доходность – отношение стоимости условного портфеля в момент  $t$  к размеру стартового капитала минус единица, выраженное в процентах:

$$E_t = \left( \frac{C_t}{C_0} - 1 \right) \times 100\%, \text{ где:}$$

$C_t$  – стоимость в момент  $t$ ;

$C_0$  – стартовый капитал;

$t$  – количество дней, прошедших с момента регистрации стратегии в конкурсе до текущего дня;

- VI. Просадка портфеля – снижение стоимости портфеля в момент  $t$  относительно максимума стоимости за предыдущие периоды:

$$PR_t = \text{MAX}_0^t(C) - C_t;$$

- VII. Максимальная просадка портфеля – максимальная величина просадки портфеля за период от 0 до  $t$ :

$$\text{MaxPR} = \text{MAX}_0^t(PR_i)$$

- VIII. Размер гарантийного обеспечения – сумма денежных средств, заблокированных для обеспечения фьючерсных контрактов и опционов:

$$\Gamma O = \sum_0^n Q_i \times \Gamma O_i, \text{ где:}$$

$Q_i$  – количество контрактов по открытой позиции  $i$ ;

$\Gamma O_i$  – размер гарантийного обеспечения, установленный биржей для контракта  $i$

- IX. Комиссия по сделке – размер обязательных платежей, взимаемых организаторами торгов (биржей, брокером) при осуществлении каждой сделки. Размер комиссионного вознаграждения устанавливается для всех участников конкурса в одинаковом размере. Комиссия влияет на размер условных денежных средств, остающихся у участника после совершения сделки.

Размер комиссионного вознаграждения по основному рынку биржи (акции) рассчитывается по формуле:

$$\text{Comiss}_{spot} = Q \times P \times \frac{0,04}{100}, \text{ где:}$$

$Q$  – объем сделки (количество ценных бумаг);

$P$  – цена совершения сделки (покупки или продажи);

Размер комиссионного вознаграждения по фьючерсам и опционам рассчитывается по формуле:

$$\text{Comiss}_{futures} = Q \times RC, \text{ где:}$$

$Q$  – объем сделки (количество контрактов);

РС – размер сбора за регистрацию сделки с одним контрактом, составляющий 1 руб.

#### **4. Номинации и порядок определения рейтинга участников**

- 4.1. Соревнование между участниками проводится в двух отдельных категориях: «Рынок акций», «Рынок фьючерсов».
- 4.2. В категории «Рынок акций» участвуют стратегии, использующие акции, торгующиеся на основном рынке Московской биржи.
- 4.3. В категории «Рынок фьючерсов» участвуют стратегии, использующие фьючерсные контракты срочного рынка Московской Биржи.
- 4.4. Участник при регистрации стратегии указывает категорию стратегии.
- 4.5. Для подтверждения того, что стратегия оперирует реальным счетом, организатор вправе запросить у Московской Биржи подтверждение, что сигналы, отправленные по стратегиям, соответствуют реальным сделкам (по цене и объему). В случае, если такое подтверждение не поступает, стратегия участника дисквалифицируется.
- 4.6. В конкурсе предусмотрены две основные номинации:
  1. «Акции»;
  2. «Фьючерсы»;
- 4.7. Приз в номинации «Акции» присваивается участнику, который по результатам конкурса продемонстрировал наибольшую доходность среди стратегий в рамках категории «Рынок акций».
- 4.8. Приз в номинации «Фьючерсы» присваивается участнику, который по результатам конкурса продемонстрировал наибольшую доходность среди стратегий в рамках категории «Рынок фьючерсов».
- 4.9. Для определения победителей отбираются только стратегии, по которым в ходе конкурса было совершено не менее 10 трейдов в номинациях «Акции», «Фьючерсы». В номинации доля времени в позиции должна быть не менее 30 календарных дней.
- 4.10. В процессе конкурса могут учреждаться дополнительные номинации, которые объявляются и описываются отдельно.
- 4.11. Рейтинг участников в турнирной таблице определяется два раза в день в течение периода конкурса: в 14:00 и 19:00 по московскому времени. Сигналы, полученные после 19:00 (во время вечерней сессии), учитываются в результатах следующего дня, рассчитываемых в 14:00.
- 4.12. Последний расчет рейтинга участников осуществляется 16 июня в 19:00.
- 4.13. Для расчета показателей по каждой стратегии участника ведется условный портфель, составленный на основании торговых сигналов. Текущая стоимость инструментов (открытых позиций) в конкретный момент времени оценивается по текущей рыночной цене (цене последней сделки) по инструменту.
- 4.14. Операции в номинации «Фьючерсы» совершаются участником с одного собственного брокерского счета согласно технологиям Московской биржи.
- 4.15. Размер стартового капитала условного портфеля, находящегося в управлении стратегии, указывается участником при регистрации стратегии. Изменение размера стартового капитала условного портфеля в течение конкурса не допускается.

#### **5. Конкурсное жюри, определение победителей**

- 5.1. Для подведения итогов конкурса и определения победителей формируется независимое конкурсное жюри.

- 5.2. Задачей жюри является оценка итогов конкурса, рассмотрение апелляционных заявлений участников и утверждение списка победителей.
- 5.3. Победители в каждой из основных номинаций определяются по состоянию счетов участников на 19:00 10 июня 2016 г.
- 5.4. В случае, если участники конкурса не согласны с итоговым рейтингом, они могут обратиться в конкурсное жюри с апелляционным заявлением. Прием апелляционных заявлений проводится до 15 июня 2016. В заявлении на апелляцию указываются: фамилия, имя и отчество автора, логин или email регистрации, контактная информация телефон или email для связи, суть возражений участника. Заявление направляется по адресу электронной почты [easyMANi@mfd.ru](mailto:easyMANi@mfd.ru).
- 5.5. Список победителей по каждой номинации утверждается конкурсным жюри с учетом показателей рейтинга, апелляционных заявлений участников, а также других фактов, которые могут повлиять на результаты конкурса. Решение будет опубликовано 17 июня 2016 года на сайте MFD.RU. В случае необходимости проведения дополнительных оценок срок рассмотрения итогов конкурса может быть продлен.
- 5.6. Процедура награждения победителей будет определена в ходе конкурса. Соответствующая информация будет раскрыта на сайте MFD.RU.

## **6. Условия маржинальной торговли и требования к гарантийному обеспечению**

- 6.1. Стратегии, работающие на основном рынке (акций), могут использовать заемные средства в размере 100%. В стратегиях разрешены «короткие» позиции (шорт) и открытие «длинных» позиций (лонг) под залог ценных бумаг, находящихся в портфеле.

## **7. Форс-мажорные обстоятельства**

- 7.1. Организатор конкурса не несет ответственности за обстоятельства, возникшие не по его вине, в том числе: технические перебои, изменение законодательства, прочие события, могущие повлиять на порядок проведения конкурса и его итоги.
- 7.2. Вместе с тем организатор выражает стремление минимизировать негативное воздействие от подобных событий на конкурс и приложить все усилия для объективного подведения итогов и выявления победителей.