

Правила конкурса

1. Общие положения

- 1.1. Конкурс «Алгоритмус-2012» проводится с целью популяризации алгоритмической торговли и ознакомления аудитории с системой 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 «ММВБ-РТС», сайта 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 открыта с момента анонсирования конкурса и продлится вплоть до 18 июля 2012 г.
- 2.2. Период проведения конкурса устанавливается с 10:00 25 июня 2012 г. по 18:45 17 августа 2012 г. (по московскому времени).
- 2.3. Подведение итогов конкурса планируется завершить к 25 августа 2012 г., выдача призов победителям будет производиться в начале сентября 2012 г.
- 2.4. Для участия в конкурсе необходимо осуществить ряд мероприятий:
 - 1) Зарегистрироваться в конкурсе на сайте mfd.ru (можно использовать существующий аккаунт пользователя mfd.ru);
 - 2) Добавить торговые стратегии;
 - 3) Настроить механизм транслирования торговых сигналов в систему EasyMANi;
 - 4) В течение периода конкурса передавать торговые сигналы в систему.
- 2.5. Допускается передача торговых сигналов по инструментам российского спот и срочного рынка:
 - 1) Секция корпоративных ценных бумаг ММВБ КЦБ
 - ОАО «Северсталь», ао;
 - ОАО «Газпром», ао;
 - ОАО «ГМК «Норильский никель», ао;
 - ОАО «ЛУКОЙл», ао;
 - ОАО «НК Роснефть», ао;
 - ОАО «Сбербанк», ао;
 - ОАО «Сбербанк», ап;
 - ОАО «Сургутнефтегаз», ао;
 - ОАО «Уралкалий», ао;
 - ОАО «Банк ВТБ», ао.
 - 2) Секция срочных инструментов FORTS
 - Фьючерсный контракт на Индекс РТС (RTS-9.12);
 - Фьючерсный контракт на Индекс ММВБ (MIX-9.12);
 - Фьючерсный контракт на курс доллар США - российский рубль (Si-9.12);
 - Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Сбербанк России" (SBRF-9.12);
 - Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Газпром" (GAZR-9.12).
- 2.6. Торговые сигналы принимаются в период торговых сессий:
 - 1) Секция корпоративных ценных бумаг – с 10:00 до 18:45 по московскому времени;
 - 2) Секция срочных инструментов FORTS – с 10:00 до 23:50 по московскому времени (основная и вечерняя сессии).

3. Термины, определения и формулы

3.1. При расчете показателей конкурса используются следующие термины и формулы:

1. Стратегия – последовательность торговых сигналов на совершение сделок, передаваемых участником конкурса, по отдельной торговой площадке (КЦБ, FORTS). Одна стратегия может включать в себя сигналы по одному или нескольким инструментам, но только в рамках одной площадки.
2. 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 $Q_i < 0$;
3. 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.
4. Текущая стоимость портфеля – сумма условных денежных средств и текущей стоимости ценных бумаг.

Для площадки ММВБ-КЦБ 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 (площадка FORTS) 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);

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

$$E_t = \left(\frac{C_t}{C_0} - 1 \right) \times 100\% \times \frac{365}{t}, \text{ где:}$$

C_t – стоимость в момент t ;

C_0 – стартовый капитал;

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

6. Просадка портфеля – снижение стоимости портфеля в момент t относительно максимума стоимости за предыдущие периоды:

$$PR_t = MAX_0^t(C) - C_t;$$

7. Максимальная просадка портфеля – максимальная величина просадки портфеля за период от 0 до t :

$$MaxPR = MAX_0^t(PR_i)$$

8. Величина маржевого покрытия – отношение стоимости портфеля к размеру собственных средств (сумме денежных средств, если эта сумма больше нуля, и сумме стоимостей длинных позиций по ценным бумагам), выраженное в процентах:

$$MC_t = \frac{C_t}{MAX(M;0) + \sum_0^n MAX(Q_i;0) \times P_i} \times 100\%, \text{ где:}$$

C_t – стоимость портфеля;

M – остаток денежных средств;

Q_i – количество ценных бумаг i в портфеле;

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

9. Размер гарантийного обеспечения – сумма денежных средств, заблокированных для обеспечения фьючерсных контрактов:

$$ГО = \sum_0^n Q_i \times ГО_i, \text{ где:}$$

Q_i – количество контрактов по открытой позиции i ;

$ГО_i$ – размер гарантийного обеспечения, установленный биржей для контракта i ;

10. 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 спот-рынку (ММВБ КЦБ) рассчитывается по формуле:

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

Q – объем сделки (количество ценных бумаг);

P – цена совершения сделки (покупки или продажи);

Размер комиссионного вознаграждения по фьючерсам (FORTS) рассчитывается по формуле:

$$Comiss_{futures} = Q \times RC \times 2, \text{ где:}$$

Q – объем сделки (количество контрактов);

RC – размер сбора за регистрацию сделки, установленного биржей для отдельного инструмента:

- Фьючерсный контракт на Индекс РТС (RTS-9.12) – 2 руб.;
- Фьючерсный контракт на Индекс ММВБ (MIX-9.12) – 3 руб.;
- Фьючерсный контракт на курс доллар США - российский рубль (Si-9.12) – 50 коп.;
- Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Сбербанк России" (SBRF-9.12) – 50 коп.;
- Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Газпром" (GAZR-9.12) – 1 руб.

4. Номинации и порядок определения рейтинга участников

- 4.1. Соревнование между участниками проводится в трех отдельных категориях: «Рынок спот», «Рынок фьючерсов» и «Демо-счета».
- 4.2. В категорию «Рынок спот» принимаются стратегии, оперирующие средствами на реальных счетах с инструментами рынка корпоративных ценных бумаг (ММВБ КЦБ).

- 4.3. В категорию «Рынок фьючерсов» принимаются стратегии, оперирующие средствами на реальных счетах с инструментами рынка фьючерсов (FORTS).
- 4.4. В категорию «Демо-счета» принимаются стратегии, оперирующие на демонстрационных счетах игровых серверов биржи ММВБ-РТС.
- 4.5. Участник при регистрации стратегии указывает, осуществляется ли торговля на реальном или на демонстрационном счете.
- 4.6. Для подтверждения того, что стратегия оперирует реальным счетом, организатор вправе запросить у биржи ММВБ-РТС подтверждение, что сигналы, отправленные по стратегиям, соответствуют реальным сделкам (по цене и объему). В случае если такое подтверждение не поступает, стратегия участника переводится в категорию «Демо-счета».
- 4.7. В конкурсе предусмотрено три основных номинации:
 1. Максимальная доходность по рынку спот;
 2. Максимальная доходность по срочному рынку;
 3. Стабильный доход.
- 4.8. Приз в номинации «Максимальная доходность по рынку спот» присваивается участнику, который по результатам конкурса продемонстрировал наибольшую доходность среди стратегий в рамках категории «Рынок спот».
- 4.9. Приз в номинации «Максимальная доходность по срочному рынку» присваивается участнику, который по результатам конкурса продемонстрировал наибольшую доходность среди стратегий в рамках категории «Рынок фьючерсов».
- 4.10. Для определения победителя в номинации «Стабильный доход» отбираются 30% наиболее доходных стратегий из категорий «Рынок спот» и «Рынок фьючерсов», показавших положительную доходность. По каждой из отобранных стратегий определяется максимальная просадка за период конкурса. Участник, максимальная просадка по стратегии которого оказалась наименьшей, признается победителем.
- 4.11. Победители в трех основных номинациях отбираются только среди стратегий, чье количество трейдов за период участия в конкурсе, не менее 10.
- 4.12. Для участников категории «Демо-счет» предусмотрены поощрительные призы, которые вручаются трем участникам, чьи стратегии продемонстрировали максимальную доходность по итогам конкурса.
- 4.13. В процессе конкурса могут учреждаться дополнительные номинации, которые объявляются и описываются отдельно.
- 4.14. Рейтинг участников 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 рейтинге следующего дня, рассчитываемого в 14:00.
- 4.15. Последний расчет рейтинга осуществляется 17 августа в 19:00.
- 4.16. По каждой стратегии при расчете рейтинга участников рассчитываются показатели: доходность, просадка, маржевое покрытие (для КЦБ), гарантийное обеспечение (для FORTS).
- 4.17. Рейтинг стратегий определяется по доходности отдельно по трем категориям стратегий: «Рынок спот», «Рынок фьючерсов», «Демо-счета».
- 4.18. 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.
- 4.19. Размер стартового капитала условного портфеля, находящегося в управлении стратегии, указывается участником при регистрации стратегии. Участникам, осуществляющим торговлю на демонстрационных счетах, устанавливается единый стартовый капитал в сумме 100 тысяч

рублей. 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. В его состав входят: представители организатора конкурса ООО «МФД-ИнфоЦентр», представители биржи ОАО «ММВБ-РТС», представители algorithmus.ru.
- 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 финальному рейтингу участников, рассчитанному в 19:00 17 августа 2012 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 22 августа. В апелляционном заявлении должно быть указано: автор заявления (фамилия, имя, отчество), регистрация на конкурсе (логин или email), контактная информация (телефон, email), суть возражений участника.
- 5.5. По каждому апелляционному заявлению жюри выносит мотивированное определение: принимать ли во внимание это заявление при определении победителей.
- 5.6. 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 жюри оглашается 25 августа на сайте mfd.ru. В случае необходимости проведения дополнительных оценок срок рассмотрения итогов конкурса может быть продлен.
- 5.7. Дата вручения призов победителям определяется организатором по окончании конкурса. Если призер не может явиться лично на вручение приза, приз может быть передан его представителю или отправлен по почте.

6. Условия маржевой торговли и гарантийное покрытие

- 6.1. Стратегии, работающие на спот рынке (ММВБ КЦБ), могут использовать плечо 2, т.е. разрешены «короткие» сделки (шорт) и открытие «длинных» позиций (лонг) под заем ценных бумаг, находящихся в портфеле. Расчет маржевого покрытия и лимита заемных средств осуществляется в соответствии с «Правилами осуществления брокерской деятельности при совершении на рынке ценных бумаг сделок с использованием денежных средств и/или ценных бумаг, переданных брокером в заем клиенту (маржинальных сделок)», утвержденных приказом_Федеральной службы по финансовым рынкам от 7 марта 2006 г. N 06-24/пз-н.
- 6.2. Размер маржевого покрытия не может снижаться менее чем 25%. В случае если уровень покрытия снижается менее 25%, стратегия снимается с конкурса.

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.