

Правила конкурса

1. Общие положения

- 1.1. Конкурс «Алгоритмус-2013» 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 «Московская Биржа», 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 начинается 25 марта 2013 г. и продлится до 15 мая 2013 г. включительно.
- 2.2. Период проведения конкурса устанавливается с 10:00 15 апреля 2013 г. по 18:45 14 июня 2013 г. (по московскому времени).
- 2.3. Итоги конкурса будут опубликованы 24 июня 2013 г.
- 2.4. Для того, чтобы принять участие в конкурсе необходимо:
 - 1) Зарегистрироваться на странице <http://mfd.ru/2013>;
 - 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, которые могут использоваться в конкурсных стратегиях:
 - 1) Сектор основного рынка Московской Биржи
 - ОАО «ФСК ЕЭС», 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) Сектор срочного рынка FORTS
 - Фьючерсный контракт на Индекс РТС (RTS-6.13);
 - Фьючерсный контракт на Индекс ММВБ (MIХ-6.13);
 - Фьючерсный контракт на курс доллар США - российский рубль (Si-6.13);
 - Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Сбербанк России" (SBRF-6.13);
 - Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Газпром" (GAZR-6.13).
 - Фьючерсный контракт на золото (GOLD-6.13)
- 2.7. Торговые сигналы учитываются в период торговых сессий:
 - 1) Сектор основного рынка Московской Биржи – с 10:00 до 18:45 по московскому времени;
 - 2) Сектор срочного рынка 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:

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

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 «Симпатия инвесторов».
- 4.2. В категории «Рынок спот» участвуют стратегии, использующие инструменты основного рынка Московской биржи.

- 4.3. В категории «Рынок фьючерсов» участвуют стратегии, использующие инструменты срочного рынка FORTS Московской Биржи.
- 4.4. Номинация «Симпатия инвесторов» выявляет самого популярного управляющего с наибольшим количеством подписчиков.
- 4.5. Участник при регистрации стратегии указывает категорию стратегии.
- 4.6. 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.
- 4.7. В конкурсе предусмотрено три основных номинации:
 1. Максимальная доходность по рынку спот;
 2. Максимальная доходность по срочному рынку;
 3. Симпатия инвесторов.
- 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 «Симпатия инвесторов» отбирается стратегия с наибольшим количеством подписчиков, которые совершили в ходе конкурса более десяти сделок. Участник, набравший наибольшее количество таких подписчиков, признается победителем.
- 4.11. Для определения победителей отбираются только стратегии, по которым в ходе конкурса было совершено не менее 10 трейдов.
- 4.12. В процессе конкурса могут учреждаться дополнительные номинации, которые объявляются и описываются отдельно.
- 4.13. 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.
- 4.14. Последний расчет рейтинга осуществляется 14 июня в 19:00.
- 4.15. 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.
- 4.16. 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 14 июня 2013 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 21 июня. В заявлении на апелляцию указываются: фамилия, имя и отчество автора, логин или email регистрации, контактная информация телефон или email для связи, суть возражений участника.
- 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 24 июня 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 спот рынке, 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. Расчет обязательств, лимитов и 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 маржинального обязательства не может составлять менее чем 25%. В случае, если уровень покрытия окажется 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.