



## Research Algorithmic Group

100% partner-owned private investment management firm

BVI | Russia

г.Тюмень, ул. 50лет Октября 8Б

post@ragve.ru

**Владельцам частных капиталов и семейных офисов мы предлагаем инвестиционные решения на базе алгоритмического фонда**

### Календарная доходность:

	янв	фев	мар	апр	май	июн	июл	авг	сен	окт	ноя	дек	Год
2008	-9.5	-0.8	20.1	3.8	23.1	0.6	-9.2	-9.4	40.5	-3.5	23.6	3.1	82.4
2009	0.2	0.0	17.0	25.4	20.3	-11.8	1.4	8.0	-1.9	11.3	18.8	-1.9	86.9
2010	-2.7	-1.9	1.4	6.8	7.2	-5.0	11.2	-4.8	-7.1	8.1	-2.1	6.1	17.4
2011	2.0	3.1	3.6	-1.2	2.4	3.1	4.9	-2.1	5.8	-3.4	6.1	-2.2	22.2
2012	2.8	2.1	-2.4	5.4	-3.4	2.2	-4.2	6.9	-7.6	6.1	5.5	2.1	15.5
2013	4.2	-1.7	-4.4	13.5	9.7	5.8	7.3	8.4	9.9	-5.2	6.8	8.7	62.9
2014	1.6	1.5	0.8	2.5	4.0	0.3	1.8	0.8	2.0	0.3	-3.2	5.2	17.6
2015	12.3	-7.5	8.9	12.5	-6.5	4.4	6.0	-6.2	8.5	17.2	6.8	6.7	63.1
2016	8.8	12.5	6.0	4.0	-0.8	20.5	3.5	-1.3	-0.2	1.9	4.4	5.4	64.8
2017	-0.6	0.7	9.9	1.5	-1.6	-3.0	2.6	-0.3	2.2	-0.3	3.5	2.7	17.2
2018	7.0	5.4	4.8	2.3	4.1	3.4	3.7	3.9	3.4	3.6	4.0	6.0	51.5
2019	3.5	3.6	1.5	2.7	3.0	4.9	2.2	4.4	3.3	5.5	-0.4	4.7	38.9
2020	6.4	12.1	17.4	6.5	5.7	11.6	1.9	5.6	6.6	1.0	9.8	10.3	95.1
2021	4.5	3.0	2.9	4.1	1.5	3.5	3.5	2.1	1.4	4.1	13.2	3.0	46.6
2022	9.9	7.7	4.7	2.0	2.9	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	27.1

### Исторические просадки

	пик	впадина	восстановление	глубина в %	длина	падение	восстановление
1	2008-07-01	2008-08-01	2008-09-01	-0.1774	3	2	1
2	2009-06-01	2009-06-01	2009-10-01	-0.1180	5	1	4
3	2010-08-01	2010-09-01	2011-01-01	-0.1153	6	2	4
4	2008-01-01	2008-02-01	2008-03-01	-0.1022	3	2	1
5	2012-09-01	2012-09-01	2012-11-01	-0.0764	3	1	2
6	2015-02-01	2015-02-01	2015-03-01	-0.0750	2	1	1
7	2015-05-01	2015-05-01	2015-07-01	-0.0650	3	1	2
8	2009-12-01	2010-02-01	2010-04-01	-0.0634	5	3	2
9	2015-08-01	2015-08-01	2015-09-01	-0.0620	2	1	1
10	2013-02-01	2013-03-01	2013-04-01	-0.0605	3	2	1

Наши стратегии реализованы в наиболее ликвидном формате - индивидуально управляемых счетах (separated managed accounts, SMA) в ведущих российских банках.

### **Характеристика:**

Стратегии направлены на решение одной из двух задач: повышении доходности инвестиционного портфеля при заданном уровне риска или уменьшении волатильности портфеля при сохранении целевой доходности.

Стратегии предполагают инвестирование в инструменты фондового и срочного рынка, обращающиеся на Московской бирже, и номинированные в рублях.

### **Принципы управления:**

Портфель не имеет предпочтений для «длинной» или «короткой» стороны: большая часть алгоритмов может торговать симметрично.

### **Методология:**

Портфель состоит из широкого множества некоррелированных и, преимущественно, краткосрочных алгоритмов, торгующих на разных инструментах. Основная часть алгоритмов портфеля может быть классифицирована как краткосрочные и среднесрочные паттерновые системы.

### **Описание:**

Средняя историческая доходность - от 25% годовых. Допустимый риск портфеля - 15%.

Инвестиционный горизонт - 1 год.

Инвестиционный профиль: Сбалансированный.

### **Условия:**

Минимальная сумма для инвестиций – 5 млн. рублей

Отчетный период – календарный квартал.

### **Вознаграждение:** High

Watermark - Да

Плата за успех - 20 %

В целях безопасности наши сервера расположены в Москве, в ЦОД DataSpace – объекте премиум класса, с сертификатами TIER III. Такое размещение позволяет минимизировать технологические риски и убытки, связанные с отключением электричества, интернета, поломкой компьютерного оборудования, неустойчивой работы терминалов и бирж.

Услуги прямого подключения (DMA) в рамках ultra low-latency решений к бирже оплачивает инвестор.

Юридически оформляется договор услуг, со всеми приложениями.

### **Для начала работы инвестору необходимо:**

1. Определить для себя критический уровень риска или долю капитала, которую инвестор готов потерять. Рекомендуемое значение от 10 до 15% от первоначального капитала.
2. Открыть брокерский счет с доступом ко всем возможным площадкам, в любом банке/инвестиционной компании. Оплатить доступ к DMA.
3. Пополнить брокерский счет денежными средствами.
4. Подписать договор управления и передать техническую информацию.
5. Получать отчеты.