

«УТВЕРЖДЕНО»
Общим собранием участников
ООО ИК «Хамстер-Инвест»
(Протокол № 2025/03/17 от «17» марта 2025г.)

**Информация об услуге инвестиционного консультирования
с использованием программы автоконсультирования и автоследования¹**
(редакция вступает в силу с «01» апреля 2025 года)

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

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

1.1. Описание программы автоконсультирования и автоследования.

Программа автоконсультирования и автоследования «Хищник», версия 3.0. (далее по тексту – ПО «Хищник», версия 3.0) – 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 ПО «Хищник», версия 3.0 является ООО ИК «Хамстер-Инвест» (далее - Инвестиционный советник). ПО «Хищник», версия 3.0 не предоставляется клиентам Инвестиционного советника для самостоятельного использования.

1.2. Виды расходов, связанных с получением ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0, и порядок их расчета.

Расходы клиента, связанные с получением ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0, состоят из вознаграждения Инвестиционного советника за предоставление ИИР в соответствии с тарифным планом согласно соответствующей стратегии², 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 дополнительно оплачиваются услуги депозитария в размере, установленном тарифами депозитария.

С действующими тарифами можно ознакомиться в приложении [№ 5 «Тарифы ООО ИК «Хамстер-Инвест» к «Регламенту обслуживания на финансовых рынках ООО ИК «Хамстер-Инвест»](#).

1.3. Правила синхронизации.

Синхронизация - процедура сравнения состава и объема открытых позиций финансовых инструментов в портфеле стратегии 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 стратегии по составу и процентному соотношению объема открытых позиций финансовых инструментов.

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

Процедура синхронизации состоит из двух частей: синхронизация теоретического мультипликатора (рассчитанного как отношение стоимости портфеля клиента к стоимости активов стратегии) и синхронизация состава и объема позиций согласно ИИР с открытыми позициями клиента.

1.3.1 Синхронизация теоретического мультипликатора 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.

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

В случае, если по итогу основной сессии мультипликатор для портфеля отличается от теоретического мультипликатора (рассчитанного как отношение стоимости портфеля клиента к стоимости активов стратегии) более чем на 5%, синхронизация теоретического мультипликатора проводится на следующий торговый день в течение основной торговой сессии.

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/перевode 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.

1.3.2. Синхронизация состава и объема позиций согласно ИИР с открытыми позициями клиента осуществляется только в отношении активов, по которым выдаются ИИР. Проверка на необходимость данной синхронизации происходит ежедневно до начала торгов, в случае необходимости синхронизация производится в течение торгового дня в основную торговую сессию.

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 ПО «Хищник», версия 3.0.

ПО «Хищник», версия 3.0 не предоставляется клиентам Инвестиционного советника для самостоятельного использования. Установка и настройка ПО «Хищник», версия 3.0 производится на стороне Инвестиционного советника.

1.6. Условия и порядок преобразования предоставленной ИИР в поручение брокеру на совершение сделки с ценной бумагой и (или) заключение договора, являющегося производным финансовым инструментом, предусмотренных указанной ИИР.

ПО «Хищник», версия 3.0 преобразует предоставленные ИИР в одно или несколько поручений брокеру на совершение сделки с ценной бумагой и (или) заключение договора, являющегося производным финансовым инструментом, предусмотренных такой ИИР, передающихся в торговую программу «Quik», без непосредственного участия клиента.

Поручения, преобразованные ПО «Хищник», версия 3.0 из ИИР, автоматически исполняются ООО ИК «Хамстер-Инвест» как брокером в ходе организованных торгов на ПАО «Московская биржа», посредством выставления биржевых заявок. Заявкиставляются в случайном порядке; при выставлении заявки учитывается тип инструмента. Преобразование ИИР в поручения брокеру может происходить с использованием механизма определения оптимального объема заявки, в результате чего требуемый объем позиции может набираться несколькими поручениями.

2. Сведения о стратегиях, в соответствии с которыми осуществляется предоставление ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0.

2.1. Название стратегий:

2.1.1. Консервативная

2.1.2. Рациональная

2.2. Описание стратегий:

2.2.1 Стратегия «Консервативная»

Стратегия нацелена на консервативное инвестирование в низкорискованные облигации федерального займа (ОФЗ) без использования заемных средств. Допускается вложения в акции, входящие в индекс ПАО «Московская биржа», в размере до 30% от объема активов.

В стратегии «Консервативная» используются:

- Инструменты фондового рынка (исключительно ОФЗ и акции), сделки с которыми заключаются на организованных торгах, проводимых ПАО «Московская биржа»;
- Использование заемных средств не предусмотрено; маржинальные (необеспеченные) сделки не совершаются;
- Параметры ИИР в рамках указанной стратегии соответствуют инвестиционному профилю «Консервативный» (пункт 3.15.1. Соглашения об инвестиционном консультировании, являющегося приложением № 20 к Регламенту обслуживания на финансовых рынках ООО ИК «Хамстер-Инвест»).

2.2.2 Стратегия «Рациональная»

Стратегия нацелена на получение доходности, существенно превышающей процентные ставки по депозитам при соответствующих рисках. В стратегии активно используются инструменты срочного рынка (фьючерсы) на фондовые, валютные и товарные активы, длинные и короткие позиции по акциям российских эмитентов, а также длинные позиции по ОФЗ. Идея стратегии состоит в том, что на рынке всегда есть один или несколько активов, на которых можно зарабатывать, сочетание нескольких активов в рамках одной стратегии позволяет снизить общий риск при неизменном математическом ожидании. Стратегия реализована на основе нескольких десятков 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 стратегии «Рациональная» используются:

- Инструменты фондового рынка (ОФЗ; акции эмитентов, зарегистрированных в РФ (в том числе акции международных публичных компаний - МКПАО); БПИФы), сделки с которыми заключаются на организованных торгах, проводимых ПАО «Московская биржа»;
- Инструменты срочного рынка (фьючерсы), сделки с которыми заключаются на организованных торгах, проводимых ПАО «Московская биржа»;
- Допускаются маржинальные (необеспеченные) сделки в рамках стандартного уровня риска клиента³. Стратегия использует как длинные, так и короткие позиции.
- Параметры ИИР в рамках указанной стратегии соответствуют инвестиционному профилю «Рациональный» (пункт 3.15.3. Соглашения об инвестиционном консультировании, являющегося приложением № 20 к Регламенту обслуживания на финансовых рынках ООО ИК «Хамстер-Инвест»).

2.3. Сведения о бенчмарке⁴ 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:

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

³ Клиент со стандартным уровнем риска (КСУР) в соответствии с Указанием Банка России № 6681-У.

⁴ Показатель, который позволяет оценить доходность стратегии в прошлом.

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

где:

B - бенчмарк стратегии

n – день расчета

i-клиент – клиент, участвующий в расчете бенчмарка стратегии

CЧА – стоимость портфеля клиента

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

Для расчета приращений бенчмарка $\Delta Bn\%$ 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 следования⁵ (правила расчета и периодичность публикации показателей):

Для расчёта показателя точности следования по стратегиям используется формула:

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

Точность следования равна $\max |B_i / B_m - R_i / R_m|$

где:

$m \leq i \leq n$ по всем клиентам, присоединенным к 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:

$\Delta Rn\% = \frac{CЧА\ i, n}{CЧА\ i, n-1}$, 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.

Значение точности следования рассчитывается в %, с точностью до одного знака после запятой.

2.5. Сведения о емкости⁶ стратегий:

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

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

⁵ Показатель, который показывает, насколько доходность портфеля клиента приближена к доходности Стратегии.

⁶ Максимально возможный суммарный размер портфелей клиентов, получающих ИИР по каждой Стратегии.

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 ПО «Хищник», версия 3.0 в рамках Стратегий.

В рамках стратегии «Консервативная» ИИР могут предоставляться клиентам с инвестиционным профилем: Консервативный, Умеренно-консервативный, Рациональный, Агрессивный, Профессиональный.

В рамках стратегии «Рациональная» ИИР могут предоставляться клиентам с инвестиционным профилем: Рациональный, Агрессивный, Профессиональный.

2.7. Ограничения в отношении квалификации клиентов, которые могут получать ИИР в рамках Стратегии.

2.7.1. Для получения ИИР в рамках стратегии «Консервативная» ограничения в отношении квалификации клиентов отсутствуют.

2.7.2. Для получения ИИР в рамках стратегий «Рациональная» клиенту-неквалифицированному инвестору необходимо пройти тестирование на знание особенностей сделок с финансовыми инструментами, используемыми в рамках стратегии, тестирование на знание особенностей необеспеченных сделок и договоров РЕПО, или получить статус квалифицированного инвестора.

3. Сведения о действующих ограничениях, связанных с получением клиентом ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0, включая сведения об ограничениях суммы активов клиента, в отношении которой предоставляются ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0 в рамках каждой стратегии.

3.1. Для получения ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0, клиенту необходимо заключить договор брокерского обслуживания с ООО ИК «Хамстер-Инвест» и депозитарный договор с депозитарием вышестоящего брокера (ПАО «СПБ Банк»).

3.2. Для получения ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0, в рамках стратегии «Рациональная» необходимо:

- а) клиенту – неквалифицированному инвестору пройти тестирование на знание особенностей сделок с финансовыми инструментами, используемыми в рамках стратегии, тестирование на знание особенностей необеспеченных сделок и договоров РЕПО, или получить статус квалифицированного инвестора;
- б) клиент должен иметь одну из следующих категорий риска в соответствии с Указанием Банка России № 6681-У:
 - клиент со стандартным уровнем риска (КСУР);
 - клиент с повышенным уровнем риска (КПУР);
 - клиент с особым уровнем риска.

3.3. Минимальная сумма активов клиента для предоставления ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0, в рамках всех стратегий составляет 1 (Один) миллион рублей. Рекомендуемая сумма активов клиента для предоставления ИИР посредством ПО «Хищник», версия 3.0, в рамках всех стратегий составляет 12 (Двенадцать) миллионов рублей и более.

4. Виды вознаграждения, уплачиваемого Инвестиционным советником третьим лицам, в связи с оказанием услуг по инвестиционному консультированию посредством ПО «Хищник», версия 3.0.

Вознаграждение не выплачивается, договоры с третьими лицами отсутствуют

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

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

В рамках стратегий «Рациональная» 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 ПО «Хищник», версия 3.0.

Вероятность технических сбоев в работе ПО «Хищник», версия 3.0, способных привести к перерывам или прекращению работы ПО «Хищник», версия 3.0, снижена за счет того, что формирование, предоставление и автоматизированное преобразование ИИР в поручение брокеру производятся на сервере Инвестиционного советника без использования оборудования клиентов.

Информация о технических сбоях или проведении технических работ в ПО «Хищник», версия 3.0, раскрывается на сайте Инвестиционного советника в разделе «Новости» <http://hamster-invest.ru/about/novosti/> и/или в электронной системе «Личный кабинет клиента».