

## ПАРАМЕТРЫ РИСК МЕНЕДЖМЕНТ

### 1 РИСК НА ДЕНЬ

Риск на день %:

Данный параметр устанавливается на 1 торговые сутки (они начинаются и заканчиваются во время ролловера). Данный параметр должен соответствовать вашей стратегии.

**Например:** риск на 1 день 3%, в таком случае, если Управляющий имеет свой капитал 1000 дол и 200 дол Инвестора, то потеря на депозит составит 3%. А именно капитал  $1200 \times 0,03 = 36$  дол.

### 2 РИСК НА ДНЕВНУЮ ПРИБЫЛЬ

При дневной доходности %

Риск на дневную прибыль %

от 0% и более от суммы депозита\*

max 100%

\* процент, который планируется заработать от суммы депозита. Например, доходность дневная может составить 150% от суммы депозита

Данный параметр учитывает, сколько Управляющий готов потерять заработанной прибыли. Планируемая прибыль может колебаться от 0 и более процентов от заработанной суммы депозита. Риск на прибыль устанавливается в интервале от 1% до 100%

**Например:** общий депозит Управляющего 10 000 долларов США, прибыль за день составила +10%, т.е. трейдер заработал 1000 долларов США, при установленных параметрах «При дневной доходности %» = 10% Управляющий имеет право потерять максимум тот размер от прибыли, который установлен в параметрах «Риск на дневную прибыль %», т.е. если данный параметр имеет значение 50%, то управляющий может потерять не более 500 долларов США от полученной за день прибыли – 1000 долларов США.

Так как дневная прибыль может быть разной, Управляющий может добавлять дополнительные параметры по уровню риска на дневную прибыль. Например, при зарплате 10% за день уровень риска на полученную прибыль Управляющий устанавливает 50%, а если прибыль составила 20%, то уровень риска на этот размер прибыли Управляющий может установить, к примеру, 40% и так далее, в зависимости от тактики торговли управляющего трейдера.

*РАССМОТРИМ СИТУАЦИЮ, ПРИ КОТОРОЙ МОЖНО  
ДОБАВИТЬ УСЛОВИЯ РИСКА НА ПРИБЫЛЬ*

Риск на дневную прибыль: **Добавить**

При дневной доходности %	Риск на дневную прибыль %
10%	50%
20%	40%
30%	25%

Можно устанавливать условия, при достижении которых, будет включаться риск на прибыль. В нашем примере установлено три условия риска, при разных уровнях доходности.

В первой ситуации, если прибыль от депозита в торговый день составила до 10%, например, 9%, то риск на прибыль не включается. В данной ситуации включен установленный Риск на день.

При наступлении дневной прибыли от 10% до 19,99% включается риск 50%. Например, если доход составил 15% (150 дол.) от суммы депозита 1000 дол., то при потере 75 дол. (50% от суммы прибыли 150 дол) торговля будет отключена.

При наступлении дневной прибыли от 20% до 29,99% риск на прибыль включается 40%

При наступлении доходности 30% включается риск 25% на прибыль и действует уже до конца дневного торгового дня.

**3** РИСК НА НЕДЕЛЮ

Риск на неделю %:

Параметр, который устанавливает риск на неделю. Неделя считается между понедельниками с учетом торгового дня (ролловера).

Просадка на неделю может быть от 0% до 100% (см. примечание)

#### 4 РИСК НА МЕСЯЦ

Риск на месяц %:

Месяц начинается каждого первого числа и заканчивается вначале следующего месяца с учетом торгового дня (ролlover).

(см. примечание)

#### 5 РИСК НА ИНВЕСТИЦИЮ

Минимальный риск на инвестицию для инвесторов % ⓘ:

Минимальный риск на инвестицию для Инвесторов, устанавливается Управляющим на инвестицию. Например, Управляющий может предложить для Инвестора риск 20%. Следовательно, при наступлении диапазона риска, например, 17% - 20% на сумму инвестиции, то открепление инвестиции может произойти до 20%

**Например,** Инвестиционная сумма 200 долларов, риск 17% - 20%. Открепление произойдет в сумме 34 долларов ( $200 \times 0,17 = 34$  дол) максимальный риск при этом 40 дол., т.е. нижняя граница 20%

#### *ДИАПАЗОН МИНИМАЛЬНОГО РИСКА НА ИНВЕСТИЦИЮ*

Диапазон минимального риска на инвестицию рассчитывается по формуле

$$R_u = 100 - \frac{100 - R_d}{100 - D} \times 100$$

**$R_u$**  – верхняя граница диапазона риска, который рассчитывается с учетом дневного риска, установленного Управляющим

**$R_d$**  – нижняя граница диапазона риска, который Управляющий и Инвестор устанавливают в поле «Минимальный риск на инвестицию для Инвесторов»

**$D$**  – дневной риск в процентах, который установил управляющий в риск менеджменте

**Пример.** Если Управляющий выбрал минимальный риск на инвестицию ( **$R_d$** ) 30%, а дневной риск ( **$D$** ) 7%, то получим верхнюю границу диапазона, при пересечении которой и произойдет открепление Инвестиции:

$$24.73 = 100 - \frac{100 - 30}{100 - 7} \times 100$$

Диапазон составляет 24,73 – 30, где 27,73% - верхняя граница диапазона

## 6 МАКСИМАЛЬНОЕ КОЛИЧЕСТВО УБЫТОЧНЫХ СДЕЛОК В ДЕНЬ ПОДРЯД

количество убыточных сделок подряд в день:

При совершении отрицательных сделок в одни торговые сутки подряд, торговля на счете будет закрыта.

**Например:** если Управляющий установил 3 убыточных сделки подряд в день, следовательно, при наступлении трех отрицательных сделок, открытие новых сделок будет недоступно.

## 7 МАКСИМАЛЬНОЕ КОЛИЧЕСТВО УБЫТОЧНЫХ СДЕЛОК В НЕДЕЛЮ ПОДРЯД

количество убыточных сделок подряд в неделю:

При совершении отрицательных сделок подряд в одну торговую неделю торговля на счете будет закрыта.

**Например:** если Управляющий установил 7 убыточных сделок подряд в неделю, следовательно, при наступлении семи отрицательных сделок, открытие новых сделок будет недоступно.

## 8 ЛОКИРОВАНИЕ

Локирование:  Да  Нет

Данная функция дает право торговать замком или отказаться от него.

Локирование (замок) – манипуляция на рынке, при которой открываются две встречные позиции (sell и buy) одинакового объема.

Параметр ДА – разрешает торговать на одном и том же инструменте позицией Sell и Buy одновременно.

Параметр НЕТ – разрешает открывать сделки на одном и том же инструменте позиции только в одну сторону или Sell или Buy.

Для Инвесторов это важная функция, так как торговлю замками часто используют непрофессиональные трейдера. Зачастую, данную функцию используют для увеличения доходности, но при этом депозит имеет огромную просадку. Этот параметр будет влиять на статус торговли трейдера, т.е. будет установлен параметр «Агрессивный»

## Торгуемые инструменты

 все

 Мажоры

 Кроссы

 Экзотические

 Индексы

 Commodities

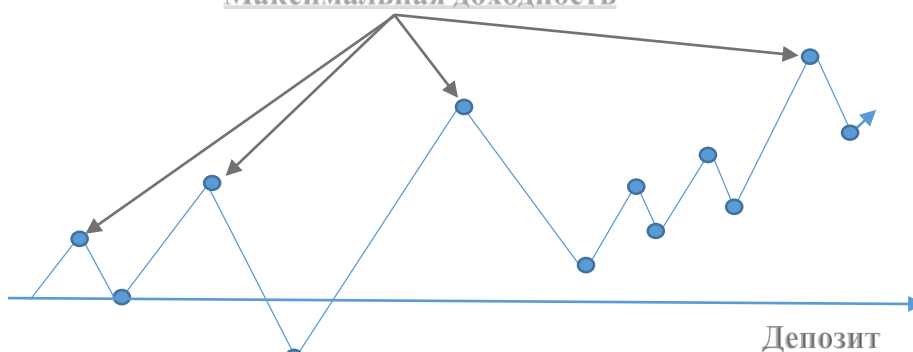
Данный параметр позволяет возможность выбрать торговые инструменты. Для этого, необходимо выбрать тот инструмент, которым Вы собираетесь торговать. В этом случае Вам для торговли будут доступны только те инструменты, которые Вы выбрали. На других инструментах торговля будет запрещена.

Можно выбрать определенные категории для торговли: Мажоры, Кроссы, Экзотические, Индексы или Commodities установив флажок.

Если в вашем арсенале могут быть любые инструменты, тогда нужно установить флажок «все». В данном случае, вам будут доступны все инструменты.

### ПРИМЕЧАНИЕ

#### Максимальная доходность



Риск на неделю и на месяц будет считаться каждый раз от максимальной точки достигнутой в этот период в момент дневного ролловера.

Таким образом, если риск на неделю составляет 15%, а с начала недели на момент дневного ролловера в среду, у нас была доходность за эту неделю 20%, то риск будет считаться уже от уровня доходности в 20% и при просадке депозита, счет закроет на уровне не 85% от депозита, который был вначале недели, а на уровне 102%. Считается следующим образом.

$$(100+20)-(120*0,15)=102$$

## РОЛЛОВЕР

Ролlover – технический параметр на ТИМА счете, при наступлении которого происходят:

- фиксирование результатов торговли.
- реинвестирование прибыли и зачисление ее на тело инвестиции.
- исполнение заявок на ввод/вывод инвестиции или прибыли с инвестиции.
- определение начала торговых суток, недели, месяца (торгового периода).

Параметр задается в часах и определяет сутки. Время устанавливается согласно времени терминала GMT+2.

**Например:** время ролловера установлено в четверг, в 20:00, следовательно, сутки начинаются в четверг, в 20:00 и заканчиваются в пятницу, в 20:00.

Торговый день, который начинается в пятницу в 20:00 будет заканчиваться в понедельник в 20:00.

Аналогично считается неделя, с понедельника 20:00 до понедельника 20:00 (суббота и воскресенье не учитываются в торговом периоде)

Месяц - первое число месяца, в 20:00 и конец первого числа, в 20:00

## ВАЖНО!!

При наступлении дневного (недельного, месячного) риска и дневного риска на прибыль, торговля будет закрыта. Разрешение будет открыто при наступлении следующего торгового дня (недели, месяца).

При наступлении риска на инвестицию, инвестиция отключается в момент установленного ролловера в ближайшие торговые сутки.

При установке риска на минимальную инвестицию Управляющим, Инвестор имеет право изменить данный параметр в большую сторону. Например, если Управляющий установил параметр 20%, а Инвестор 30%, то диапазон риска на инвестицию будет учитываться от 30% (по желанию Инвестора). Инвестор может согласиться с условиями Управляющего и установить себе те же 20%. Условие, которое выбрал Инвестор по данному риску, будет отображаться в личном кабинете Управляющего.