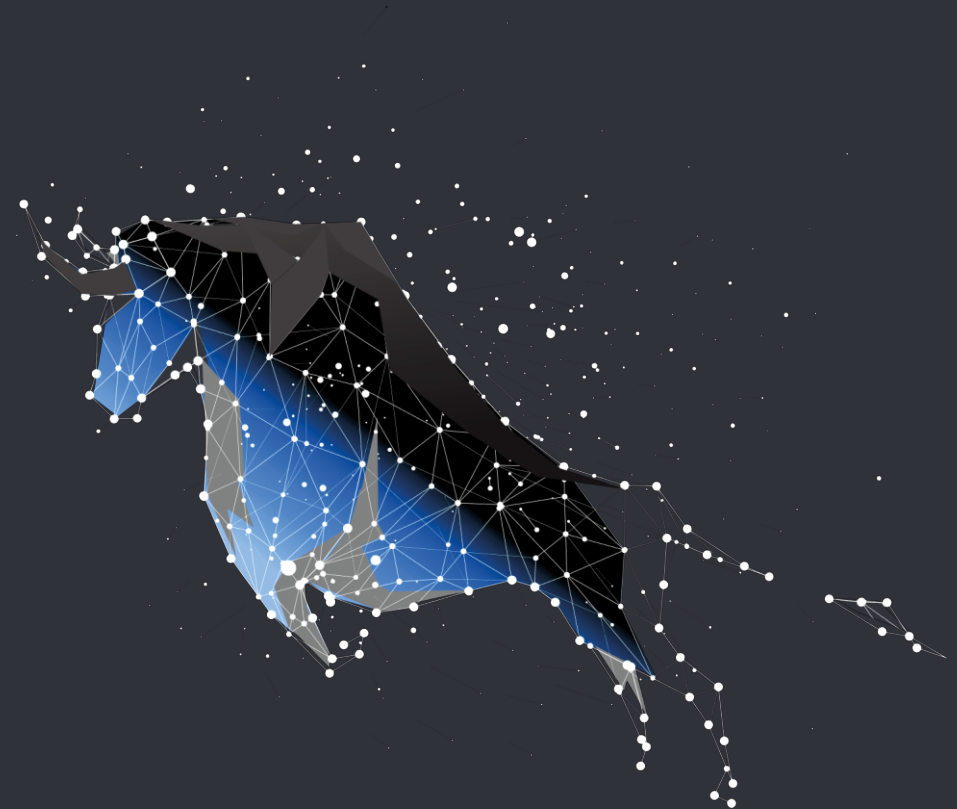


Разумный Алгоритм – результат, который не спит



Сложности, с которыми сталкиваются инвесторы

- ▶ отсутствие времени
- ▶ эмоциональное принятие решений
- ▶ слишком много данных
- ▶ много шума скрывает суть



Результат?

Упущенные возможности и низкая доходность.



Затраты времени на анализ при имеющихся проблемах

50
лет

Потребуется профессиональному аналитику для оценки всех публичных компаний мира

3
часа

Займет анализ одной компании по мультипликаторам, динамике последних лет, основным финансовым показателям и прогнозам

Стратегия Alpha Synergy



Alpha Synergy — это не просто скрининг, это полноценная система принятия решений, основанная на данных.



Как это работает? 3 шага

умные сигналы

экспертная проверка

ваш выбор

Алгоритмический отбор

- ▶ Alpha Synergy сканирует рынок и рассчитывает баллы по 50+ метрикам
- ▶ Оценивает прибыльность, импульс, стоимость и макрофакторы

Проверка аналитиками

- ▶ Команда экспертов анализирует сигналы и исключает слабые идеи
- ▶ Приоритет — логика, актуальность и наличие триггера

Проверка вами

- ▶ Вы решаете, какие идеи добавить в свой портфель
- ▶ Без давления. Полный контроль. Прозрачные условия.



Алгоритмический подход

Как работает наш алгоритм сканирования рынка

- ▶ Алгоритм структурирует и сопоставляет все данные, чтобы выявить скрытые рыночные сигналы и аномалии.
- ▶ Анализируем не только «что происходит», но и «почему» и «что будет дальше».



Мы ежедневно обрабатываем поведение более чем **3000** компаний по **50+** финансовым и нефинансовым метрикам, включая:



Динамику выручки и чистой прибыли



Поведенческие паттерны в разных отраслях



Поведение инсайдеров и buyback активности



Отчёты, дивидендную политику, новости, аналитику



Маржинальность, долговую нагрузку, эффективность



Влияние макроэкономических факторов

Что делает Alpha Synergy с этими данными?

После сбора данных Alpha Synergy:



01 Присваивает рейтинг каждой компании по внутренней модели (value, momentum, stability, macro-fit)

02 Ищет закономерности между метриками и будущей доходностью

03 Отсеивает шум и нестабильные сигналы

04 Формирует список высоковероятных кандидатов для инвестирования с оценкой риска и потенциала роста

05 Передаёт идеи аналитикам и клиенту

Показатели, выявляющие недооцененность, риски и потенциал компаний:



Ключевые фундаментальные показатели, определяющие эффективность и перспективу роста компаний



Отраслевая особенность и перспектива



Качественные факторы



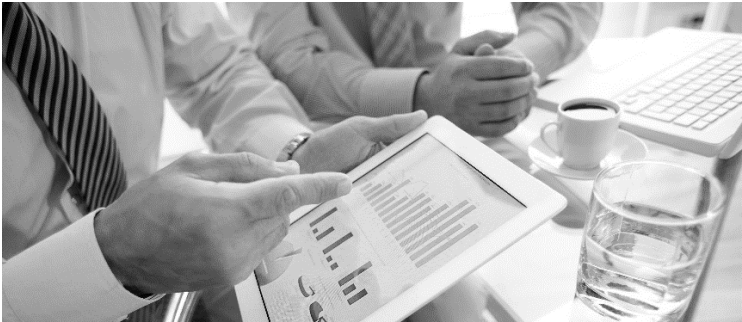
Динамика показателей за последние 5 лет



Геополитический и новостной фон

Наши рекомендации по стратегии Alpha Synergy

Стратегия Alpha Synergy:
Май 2024 – Апрель 2025



Стратегия, основанная на фактах,
проверках и управляемом риске.

Компания	Дата сигнала	Цена входа	Целевая цена	Стоп-лосс	Дата выхода	Цена выхода	Доходность	Риск
DOCU	08.10.2024	\$62.78	\$74.30	\$55.80	12.11.2024	79.77	+27,06%	Средний
TSLA	05.11.2024	\$251.10	\$325.00	\$223.20	11.11.2024	346.00	+37,79%	Высокий
GELYY	06.12.2024	\$37.28	\$42.00	\$32.75	09.02.2025	\$44.96	+20.60%	Средний
LUMN	07.02.2025	\$5.07	\$6.36	\$4.30	24.03.2025	\$4.30	-15.19%	Высокий
CRWD	14.02.2025	\$453.77	\$495.00	\$425.17	21.02.2025	\$425.17	-6.30%	Средний

Результаты стратегии Alpha Synergy



01 **Общая доходность** (Total Return) — сколько процентов стратегия заработала за тестируемый период (12 месяцев).

▶ **48,15%**

02 **Доля прибыльных сделок %** (Win Rate) — отношение количества прибыльных сделок к общему числу сделок.

▶ **68,29%**

41 прибыльная / 28 убыточных

03 **Среднее соотношение прибыли к убытку** (Risk-Reward Ratio) — средняя доходность прибыльных сделок против средней убытков убыточных.

▶ **+13,44%**

средняя прибыль

-9,29%

средний убыток

04 **Риски стратегии** (Strategy Risks) — максимальная серия убытков без перерыва, стресс-фактор для капитала и психики.

▶ **НИЖЕ СРЕДНЕГО**

7 сделок подряд, -9.05% от локального пика

Важно:



Основная часть просадки пришлась на период повышенной волатильности в феврале 2025 года, вызванной неожиданными экономическими указами Дональда Трампа.

За тот же период индекс S&P 500 снизился на -12,8%, что сопоставимо или существенно выше просадки стратегии.

Кто использует алгоритмические исследования в инвестициях



Мы стоим в одном ряду с лидерами индустрии, адаптируя лучшие практики алгоритмического анализа под нужды инвесторов СНГ.

BlackRock

Управляет активами на триллионы долларов с помощью платформы Aladdin — одной из самых мощных систем алгоритмического анализа рисков в мире.

CITADEL

Ведущий игрок на рынке алгоритмической торговли с глобальной инфраструктурой и собственными дата-научными решениями.

Renaissance

Один из самых прибыльных хедж-фондов в истории, основанный на математических моделях и автоматизированной торговле.

TWO SIGMA

Использует машинное обучение и статистические модели для генерации инвестиционных идей и минимизации риска.

BRIDGEWATER

Использует системный подход к анализу макроэкономических данных и алгоритмическую стратегию управления портфелем.

PARTNER FINANCE PROSPERITY IN PARTNERSHIP

Мы — первые в Казахстане, кто использует автоматизированную инвестиционную аналитику и стратегии, основанные на глубоком алгоритмическом анализе.