

# Ярослав Кабачков

Директор по стратегии ФГ «ФИНАМ»



# ФИНАМ

**3 893 млрд руб**

Обороты на фондовом  
рынке, за 2022 год

**29 497 млрд руб**

Обороты на срочном  
рынке, за 2022 год

**14 092 млрд руб**

Обороты на валютном  
рынке, за 2022 год



Представительства  
компании в **90 городах**  
по всему миру.  
Клиенты более чем  
в 70 странах.

**+7 (495) 796-93-88**



- Цифровая трансформация в управлении капиталом и активами охватывает широкий спектр услуг, выходящих далеко за рамки традиционного управления капиталом.

## ТРИ ОСНОВНЫЕ СИЛЫ, РАЗРУШАЮЩИЕ УПРАВЛЕНИЕ КАПИТАЛОМ

**Коммодилизация управления капиталом**

**Новые ожидания клиентов и сотрудников**

**Снижение затрат за счет цифровой трансформации**



Цифровые  
помощники



Мгновенный подбор  
наиболее эффективной  
стратегии



Advisors



Диагностика  
торговли



Аналитика



Автоследование



Контроль рисков клиента

Роботизированные консультации, благодаря современным интерфейсам и низким комиссиям, являются наиболее перспективным направлением. Благодаря автоматизации роботы получили более широкий доступ к инвестиционным стратегиям и советам, которые традиционно предназначались для состоятельных клиентов. Для брокерских компаний эти продукты сейчас являются экономически эффективным решением для управления большим количеством счетов клиентов. Это требует меньше накладных расходов благодаря автоматическому управлению портфелями, а для брокерских компаний, роботы могут служить новым каналом распространения проприетарных продуктов.

# Автоматизация бизнес процессов

1. Рассылка дайджестов
2. Проверки постов на форумах
3. Анализ недостающего контента
4. Система оценки покрытия клиентов продуктами
5. Автоматизация анализа лидов менеджеров

# Множество решений для любого инвестора дают большой потенциал входящего интереса

## Собственные решения



Торговые  
Сигналы  
Стратегии  
Подборки бумаг



## Партнерские решения



Развивающие  
Аналитика  
Обучение



Сервисные  
Торговый план  
Торговые системы  
Помощники



# Системы поиска решения позволяют быстро персонафицировать предложения

## Алгоритмические подборки

Опросник

Подбор по параметрам



## Подборки на основе ИИ

Рекомендательная система

Диагностика



## Торговые

Сигналы

Стратегии

Подборки бумаг



## Развивающие

Аналитика

Обучение



## Сервисные

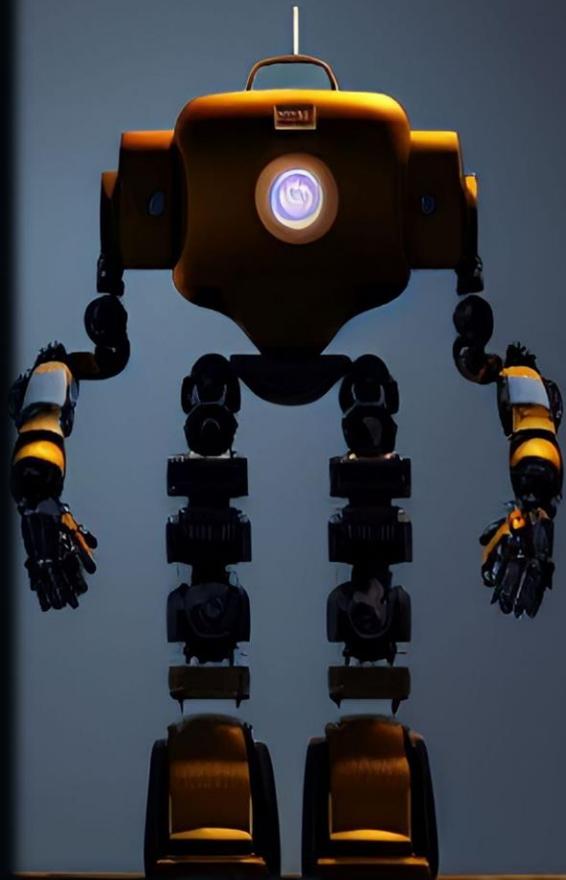
Торговый план

Торговые системы

Помощники



# Искусственный интеллект сегодня



Основное функциональное предназначение алгоритмов машинного обучения состоит в том, чтобы четко идентифицировать рабочие шаблоны и корреляции между огромными объемами информации, событий, операций и последовательностей. Сегодня машинное обучение успешно используется в автоматизации процессов, вопросах безопасности, оптимизации поддержки клиентов, кредитных предложениях, оптимизации портфеля, личных финансах и многих других секторах.

*Единственное уникальное качество ИИ заключается в том, что его можно использовать для изучения, наблюдения и анализа данных, собранных из различных каналов.*

*ИИ способен идентифицировать закономерности, которые человеческий глаз не может интерпретировать. Например, анализ шаблонов данных для любых мошеннических действий, связанных с онлайн-транзакциями, или сегментация потенциальных клиентов на основе их покупательского поведения.*

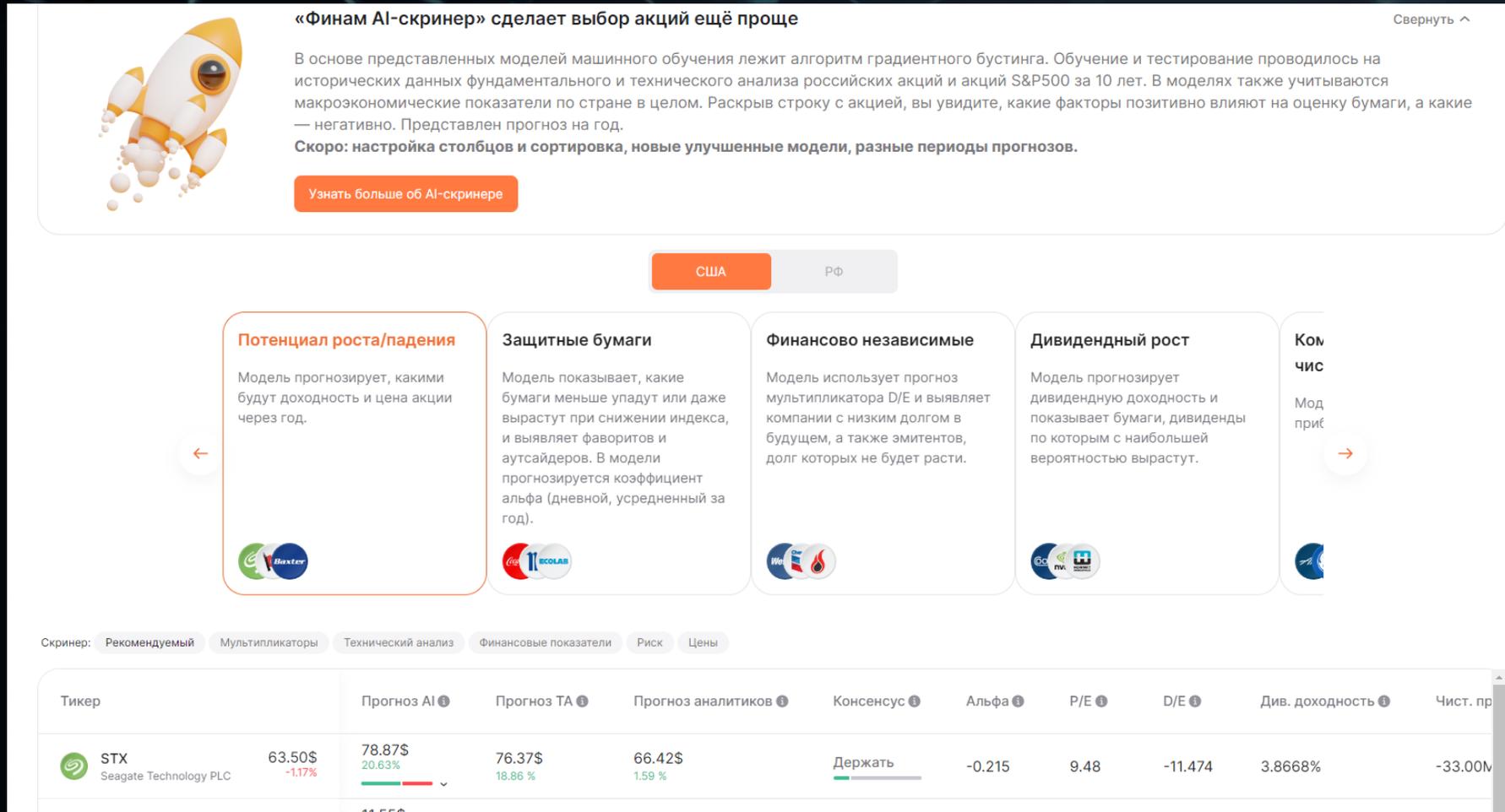


*Акцент сместился на улучшение качества обслуживания клиентов. ВРМ на основе ИИ помогает получить точное представление о поведении клиентов, и на основе этих данных можно определить будущие тенденции потребления.*

# Подбор бумаг и стратегий

«ИИ Скринер» — прототип инструмента для инвесторов на основе искусственного интеллекта.

Инструмент создан с использованием методов машинного обучения. «ИИ Скринер» анализирует множество данных, которые могут влиять на цены активов: фундаментальные показатели, индикаторы технического анализа, включая анализ трендов и паттернов поведения, консенсус-прогнозы аналитиков и другие источники. На их основе ИИ выявляет закономерности и составляет рейтинг активов с учетом веса, которые дают те или иные показатели.



**«Финам AI-скринер»** сделает выбор акций ещё проще Свернуть ^

В основе представленных моделей машинного обучения лежит алгоритм градиентного бустинга. Обучение и тестирование проводилось на исторических данных фундаментального и технического анализа российских акций и акций S&P500 за 10 лет. В моделях также учитываются макроэкономические показатели по стране в целом. Раскрыв строку с акцией, вы увидите, какие факторы позитивно влияют на оценку бумаги, а какие — негативно. Представлен прогноз на год.  
**Скоро: настройка столбцов и сортировка, новые улучшенные модели, разные периоды прогнозов.**

[Узнать больше об AI-скринере](#)

США РФ

**Потенциал роста/падения**  
Модель прогнозирует, какими будут доходность и цена акции через год.

**Защитные бумаги**  
Модель показывает, какие бумаги меньше упадут или даже вырастут при снижении индекса, и выявляет фаворитов и аутсайдеров. В модели прогнозируется коэффициент альфа (дневной, усредненный за год).

**Финансово независимые**  
Модель использует прогноз мультипликатора D/E и выявляет компании с низким долгом в будущем, а также эмитентов, долг которых не будет расти.

**Дивидендный рост**  
Модель прогнозирует дивидендную доходность и показывает бумаги, дивиденды по которым с наибольшей вероятностью вырастут.

**Комчис**  
Мод приф

Скринер: [Рекомендуемый](#) [Мультипликаторы](#) [Технический анализ](#) [Финансовые показатели](#) [Риск](#) [Цены](#)

Тикер	Прогноз AI	Прогноз ТА	Прогноз аналитиков	Консенсус	Альфа	P/E	D/E	Див. доходность	Чист. пр	
STX Seagate Technology PLC	63.50\$ -1.17%	78.87\$ 20.63%	76.37\$ 18.86 %	66.42\$ 1.59 %	Держать	-0.215	9.48	-11.474	3.8668%	-33.00M

**3 893 млрд руб**

Обороты на фондовом  
рынке, за 2022 год

**29 497 млрд руб**

Обороты на срочном  
рынке, за 2022 год

**14 092 млрд руб**

Обороты на валютном  
рынке, за 2022 год



Представительства  
компании в **90 городах**  
по всему миру.  
Клиенты более чем  
в 70 странах.

**+7 (495) 796-93-88**

