РОСТ СБЕРЕЖЕНИЙ
простым языком о финансах

За пределами правила 4%

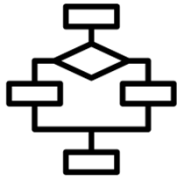
Снять много и не разориться

okama

База данных

- 110,000+ ценных бумаг
- 12 фондовых рынков мира
- внебиржевые инструменты
- валюты и криптовалюты
- спотовые цены
- макроэкономика

Библиотека на Python



- Доходность
- Риски
  (σ, VAR, CVAR и др.)
- Современная теория портфеля
- Скрининг по фундаментальным параметрам
- DCF
- Прогнозирование Монте-Карло
- Коэффициенты
  (CAPE10, Шарпа, Бета, Сортино и др.)

Интерфейсы

- Сайт okama.io
- MCP okama
- Jupyter Notebooks
- Коммерческие интерфейсы

База финансовых и экономических данных

rostsber.ru

Биржевые активы

- История цен закрытия: Московская биржа, NYSE, NASDAQ, LSE, XFRA (Frankfurt Stock Exchange), XAMS (Euronext Amsterdam) и др.
- Расчетная цена закрытия (Adjusted Close) с учетом реинвестиции дивидендов и сплитов
- История выплат дивидендов

Внебиржевые активы

- Взаимные фонды (США)
- Паевые инвестиционные фонды (взаимные фонды)
- Цены на недвижимость (Россия)

Валюты

- Курсы FX
- Курсы ЦБ России
- Криптовалюты

Индексы и бенчмарки

- Биржевые индексы
- Индекс доходности банковских вкладов (OKID.INDX - Россия)

Макроэкономические данные

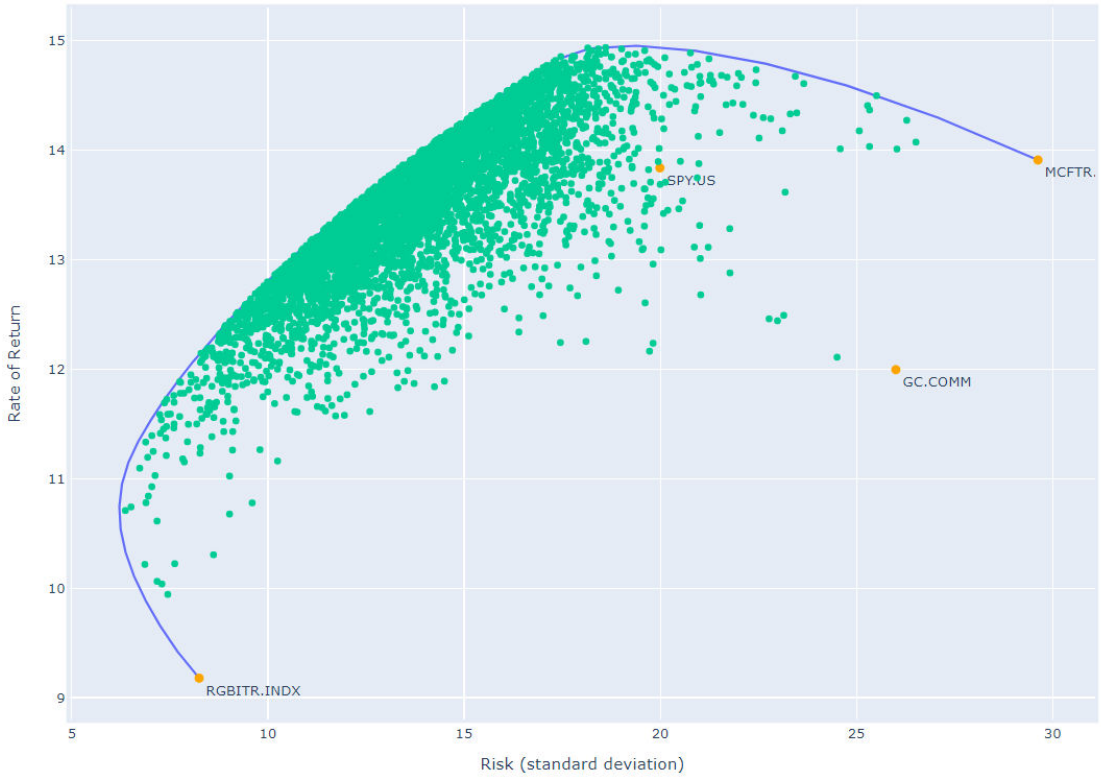
- Инфляция (Россия, ЕС, США, Великобритания, Китай, Израиль)
- Ставки ЦБ (Россия, ЕС, США, Великобритания, Китай, Израиль)
- Ставки банков TOP 10, лучшие ставки банков (Россия)
- Даты глобальных финансовых кризисов

110 000 тикеров

Проект okama

rostsber.ru

1. библиотека для Python
2. **okama.io** финансовые виджеты
3. **MCP okama** для LLM
4. API: бесплатная база финансовых данных
5. русскоязычный форум



Основные принципы:

- Некоммерческий проект
- Открытый код
- Участие всех заинтересованных

Аналоги и отличия

rostsber.ru

PORTFOLIO VISUALIZER

www.portfoliovisualizer.com

- Коммерческий проект
- Закрытый код
- Только активы США
- Базовая валюта – только USD

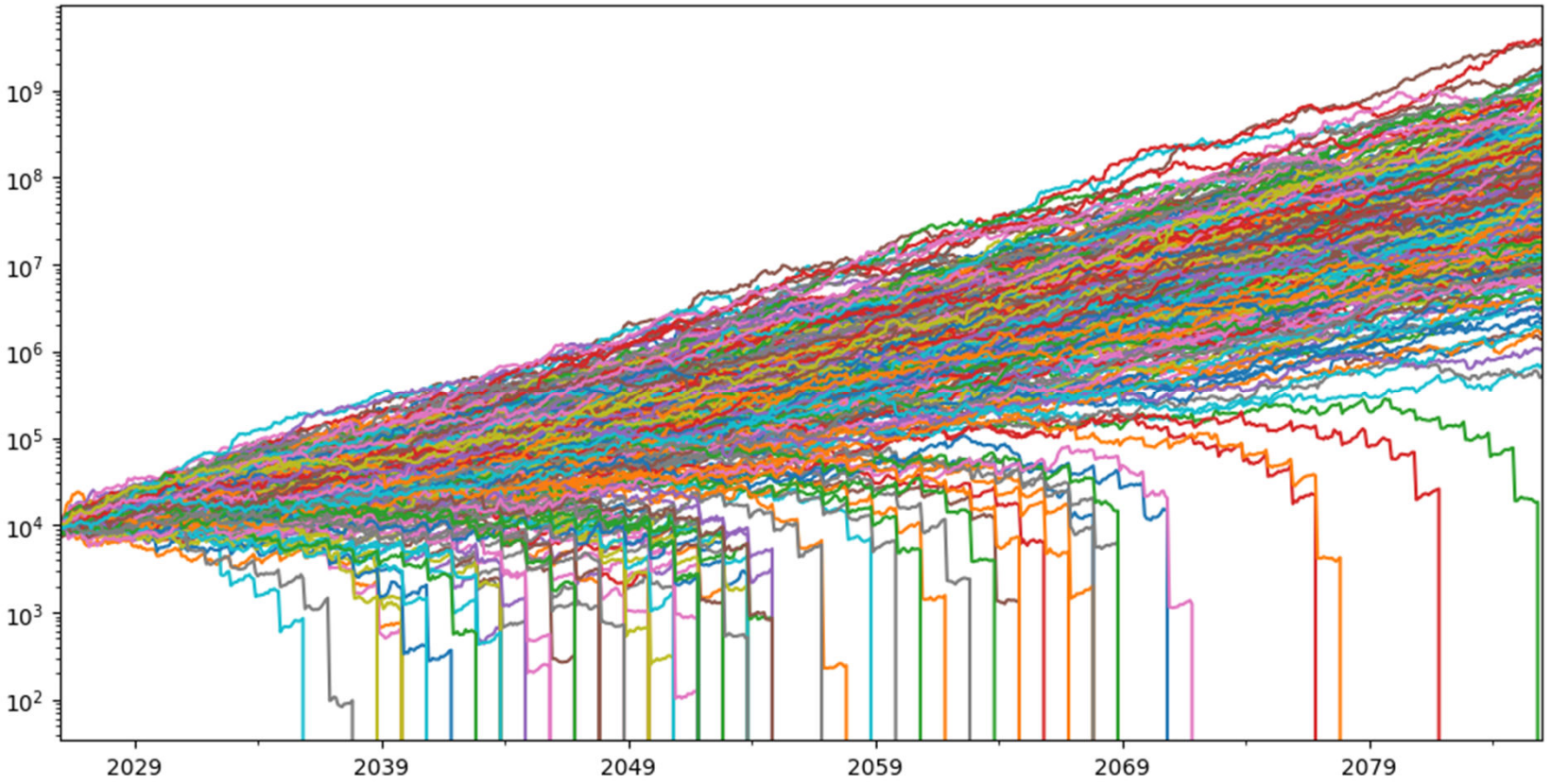
YCHARTS

ycharts.com

- Коммерческий проект
- Отличная финансовая графика
- Специализация – фундаментальный анализ

Делаем портфель пенсионера на okama.io

rostsber.ru



okama

Репозиторий библиотеки на GitHub:
https://github.com/mbk-dev/okama

MCP okama
https://github.com/mbk-dev/okama-mcp

How-to примеры применения okama на Jupyter Notebooks:
https://github.com/mbk-dev/okama/tree/master/examples

Документация okama:
https://okama.readthedocs.io/

Финансовые виджеты okama:
https://okama.io/

Русскоязычный форум проекта:
https://community.okama.io/

okama-mcp

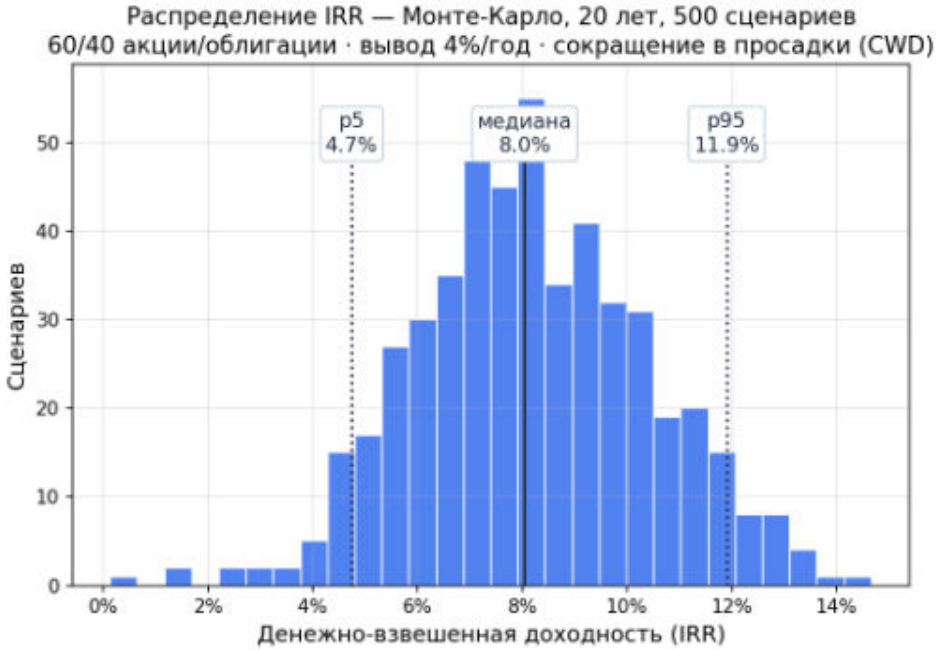
инвестиционная аналитика для ИИ-ассистентов — бесплатно и open source

Вы

Что будет с портфелем 60/40 при выводе 4% в год, если сокращать вывод в просадки? Покажи IRR.

ИИ-ассистент · via okama-mcp

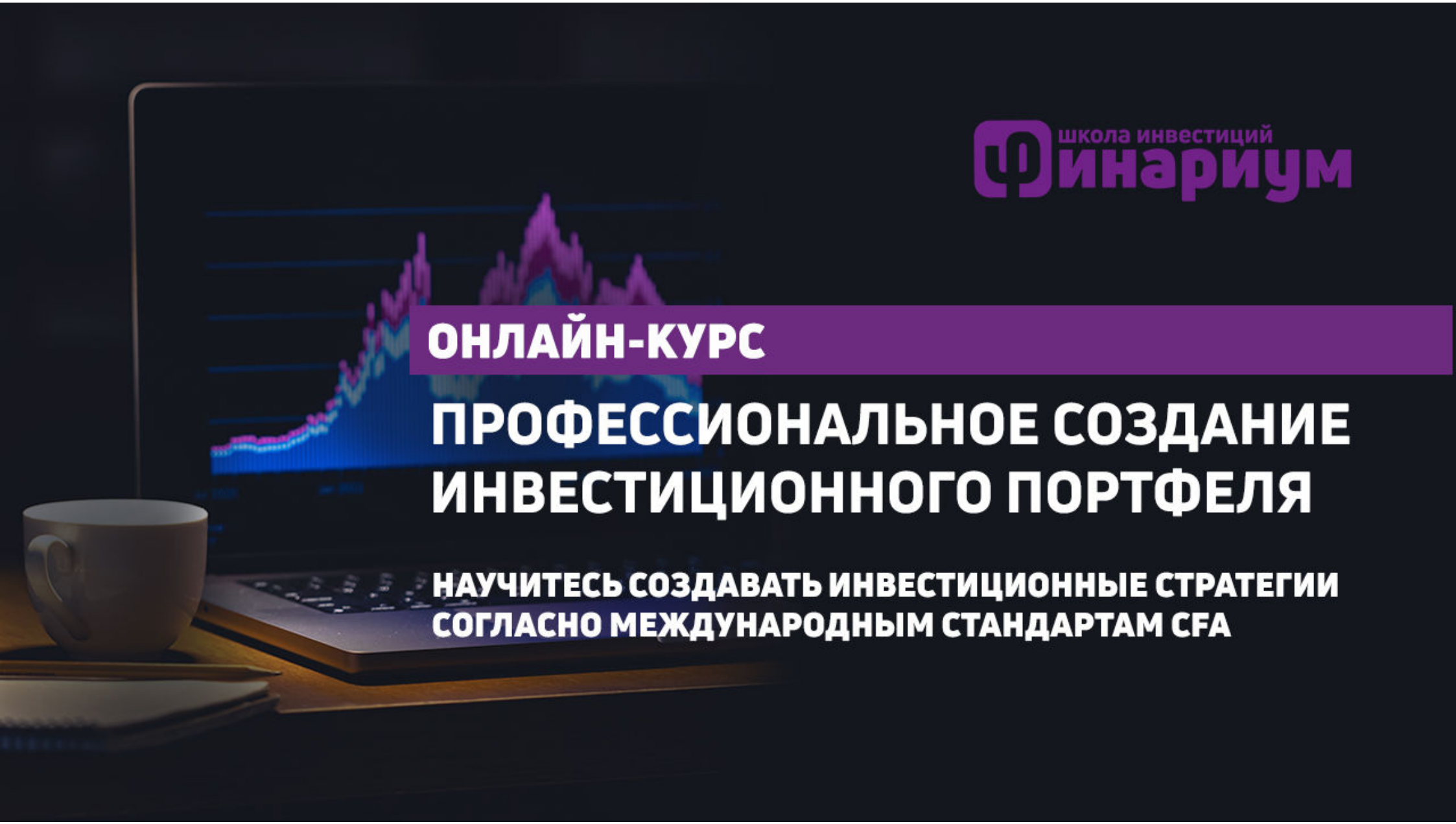
В 500 сценариях Монте-Карло медианная доходность с учётом изъятий — **8,0% годовых**; 90% исходов — между **4,7%** и **11,9%**. Сокращение вывода в просадки удерживает даже худшие сценарии в плюсе →




```
$ uvx okama-mcp stdio
```

25 инструментов · бэктесты · Монте-Карло · граница эффективности · графики

Работает с Claude Desktop, Claude Code, Cursor — любым MCP-клиентом


школа инвестиций
Финариум
ОНЛАЙН-КУРС
ПРОФЕССИОНАЛЬНОЕ СОЗДАНИЕ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ
НАУЧИТЕСЬ СОЗДАВАТЬ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ СТРАТЕГИИ СОГЛАСНО МЕЖДУНАРОДНЫМ СТАНДАРТАМ CFA

РОСТ СБЕРЕЖЕНИЙ
простым языком о финансах

Спасибо за внимание

Сергей Кикевич

sergey@rotsber.ru

@rostsber_news

okama.io

РОСТ СБЕРЕЖЕНИЙ
простым языком о финансах

Финариум