

АЛГОРИТМИЧЕСКИЙ ПОРТФЕЛЬ

Сумма инвестиций:	от \$30 000	Целевая доходность, \$:	40 - 70%	Минимальный срок инвестирования:	1 год
Ликвидность:	15 дней	Stop loss:	50%	Вознаграждение управляющего:	30% Комиссия за успех

ИНВЕСТИЦИОННАЯ АКТУАЛЬНОСТЬ

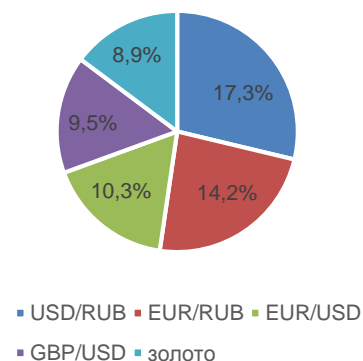
Данная стратегия основана на использовании торговых роботов. Прибыль для инвестора генерирует набор алгоритмов, ориентированных на наиболее ликвидные валютные пары: EUR/USD, GBP/USD, EUR/GBP, USD/JPY, сырье: золото, серебро, нефть BRENT, а также рублевые пары: USD/RUB и EUR/RUB. Робот – программа, которая автоматически выполняет торговые операции по заданному алгоритму, основанному на определенной рыночной закономерности. Популярность алгоритмической торговли в мире постоянно растет благодаря ее высокой эффективности, достигаемой за счет точности и скорости исполнения операций и дающей в ряде стратегий решающее конкурентное преимущество. В последние годы более 80% торговых операций на развитых рынках осуществляются посредством алгоритмов.

Более 75% портфеля распределяется на низко рискованные нейтральные к рынку стратегии: арбитраж и парный трейдинг, которые позволяют стабильно зарабатывать, исключая рыночные риски и создавая постоянную доходность. Остальная часть средств используется в качестве обеспечения для высокодоходных статистических стратегий. Часть из них позволяет получать прибыль, например, за счет высокой волатильности на рынках, связанной с низкой стоимостью нефти. Тем не менее из-за своей значительной волатильности портфель не имеет задачи обеспечивать ежемесячный стабильный доход, на этом фоне результаты стратегии следует оценивать на ежеквартальной основе.

Алгоритмический подход к построению торговых систем открывает множество возможностей для быстрого нахождения, оптимизации и точного исполнения стратегий и позволяет эффективно извлекать прибыль из складывающихся рыночных ситуаций.

Инструменты, используемые в стратегии
USD/RUB
EUR/RUB
EUR/USD
GBP/USD
Золото
Серебро
Нефть Brent

Структура портфеля в I полугодии 2015 года



РИСК - МЕНЕДЖМЕНТ

Критерии риск - менеджмента	
Лимиты	валюты – 70-80%, сырье – 20-30%.
Валюты стран/регионов	США, Россия, Великобритания, еврозона, Япония.

ОБЯЗАТЕЛЬНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Общество с ограниченной ответственностью «Кьюби Финанс». Лицензия на осуществление брокерской деятельности № 077-12805-100000, Лицензия на осуществление дилерской деятельности № 077-12816-010000, Лицензия по управлению ценными бумагами № 077-12828-001000 выдана Федеральной службой по финансовым рынкам в 2009 году без ограничения срока действия.

Портфельное управление сопряжено с финансовым риском. Показатели доходности инвестиций в прошлом не могут служить ориентиром оценки результативности инвестиций в будущем. Стоимость инвестиций может как увеличиваться, так и уменьшаться, и клиенты могут в конечном итоге не получить первоначально инвестированную сумму. Изменения курса обмена иностранной валюты могут также вызвать уменьшение или увеличение стоимости инвестиций.

ООО «Кьюби Финанс» рекомендует клиентам не использовать данный материал в качестве единственного источника информации при принятии инвестиционного решения. Инвестиционное решение должно быть основано на исчерпывающей информации. Перед принятием решений об инвестировании в портфельное управление необходимо проконсультироваться с финансовым советником.