

Managed futures: направленная, систематическая стратегия управления капиталом

USD

О стратегии

Инвестиционная цель:

Получение прибыли независимо от направления движения фондового рынка.

Целевая USD доходность: >20%

Максимальный риск: <10%
(peak-to-trough drawdown)

Ключевые преимущества:

Высокая результативность
Инвестиционный процесс, имеющий edge.

Прибыльность на падающих рынках
Короткие позиции и диверсификация.

Систематическое исполнение
Основанное на правилах, точное исполнение стратегии. Без человеческого фактора.

Надежный риск-менеджмент
Система контроля рисков. Защита позиций с 1 секунды существования.

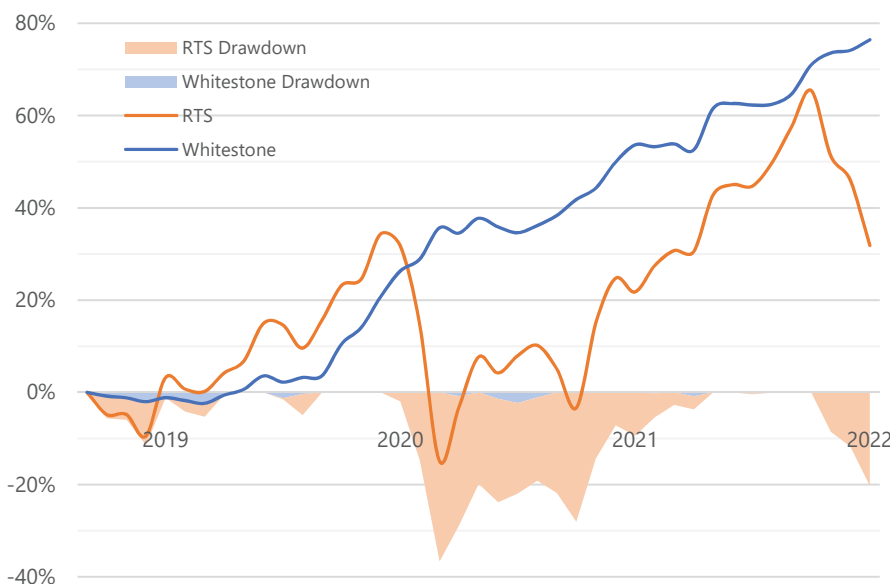
Дополнительные преимущества:

Компенсация убытков
Если они превысили выбранный уровень. Пропорционально размеру success fee.

Юридическая защищенность
Управляемые счета. Капитал остается на счете клиента у надежного брокера.

Прозрачность и контроль
24/7 онлайн контроль и доступ к отчетам.

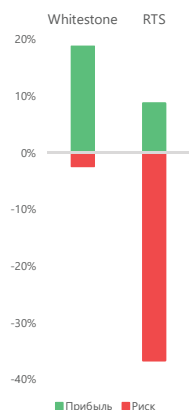
Совпадение интересов
Менеджмент компании размещает свой капитал тут.



Год / Месяц	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	Итого
2018										-0,80%	-0,37%	-0,83%	-1,99%
2019	0,86%	-0,62%	-0,63%	1,82%	1,28%	2,96%	-1,36%	1,01%	0,39%	7,02%	3,62%	6,86%	23,22%
2020	4,60%	2,16%	5,59%	-0,93%	2,66%	-1,56%	-1,04%	1,29%	1,81%	2,85%	2,09%	4,61%	24,14%
2021	2,49%	-0,25%	0,40%	-0,86%	6,02%	0,68%	-0,22%	0,12%	1,47%	4,20%	1,74%	0,38%	16,19%
2022	1,33%												1,33%
Итого													76,49%

Источник: Blackpoint Capital. Кривая капитала и доходность приведены gross (до уплаты налогов и комиссий за управление).

Параметры	Whitestone	RTS
Прибыль/убыток:	76,5%	31,9%
Среднегодовая прибыль/убыток:	18,8%	8,7%
Максимальная просадка (риск):	-2,4%	-36,6%
Фактор восстановления (Gain-To-Pain Ratio):	7,91	0,24
Кoeffициент Шарпа:	4,30	0,61
Корреляция с RTS:	-0,03	
Профит фактор:	1,95	



Disclaimer. Данный отчет не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, и финансовые инструменты либо операции, упомянутые в данном отчете, могут не соответствовать Вашему инвестиционному профилю. Прошлая доходность не гарантирует будущую доходность. Инвестиционная деятельность сопряжена с риском и может приводить к убыткам.

О стратегии

WHITESTONE использует стратегию **следования тренду**. Прибыль извлекается из восходящих и нисходящих изменений цен в акциях, облигациях, валютных и товарных инструментах.

Диверсификация по различным инструментам позволяет чаще находить тенденции и получать лучшие результаты.

Главная цель – средне- и долгосрочные ценовые тенденции. При этом WHITESTONE не предсказывает их, а идентифицирует и участвует в них по мере развития.

Фундамент WHITESTONE – **контроль рисков**. **Три аспекта:** разумное принятие рисков; умение на деле укладываться в максимальный риск; защита от критических рисков.

WHITESTONE использует на 100% **систематический подход**. Все этапы инвестиционного процесса основаны на точно исполняемых правилах.

Исполнение происходит с помощью автоматизированных компьютерных моделей, под контролем человека.

WHITESTONE использует количественные методы, статистику и теорию вероятности.

Характеристика	Описание
Тип продукта	Managed account (Управляемый счет)
Тип стратегии	Managed futures, absolute return
Источник прибыли	Направленные движения рынков, следование за трендом
Направления позиций	Лонг / Шорт / Флет
Диверсификация	Инвестирование в несколько классов активов
Контроль рисков	На уровне портфеля, позиции и объема допустимых потерь
Корреляция	Низкая историческая корреляция с акциями и облигациями
Процесс	Систематический, основанный на правилах

О компании

Blackpoint Capital, LLC ("Blackpoint Capital") – инвестиционно-консалтинговая компания, специализирующаяся на управлении капиталом.

Инвестиционная философия основана на академических исследованиях и количественных методах.



Marat Timirgalin
Managing partner & CIO
15+ yrs in Finance, M.Sc. IT



Ruslan Gabbasov
Chief Technology Officer
19+ yrs in IT, M.Sc. IT

Важная информация

Данный документ не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, и финансовые инструменты либо операции, упомянутые в данном документе, могут не соответствовать Вашему инвестиционному профилю.

Только для профессиональных инвесторов, не для распространения среди розничных инвесторов.

Информация, содержащаяся в настоящем документе, не является и не должна толковаться как реклама, приглашение, оферта, предложение или рекомендация участвовать в какой-либо инвестиционной стратегии или предпринимать какие-либо другие действия, в том числе покупать или продавать какой-либо продукт или ценную бумагу или предлагать какие-либо банковские или финансовые услуги Blackpoint Capital, LLC.

Этот документ был подготовлен без учета целей, финансового положения или потребностей какого-либо лица. Получатели не должны истолковывать содержание этого документа как финансовый, инвестиционный или иной совет. На него не следует полагаться при принятии каких-либо инвестиционных решений.

Будущие результаты предсказать невозможно. Настоящий документ содержит мнения, выводы, оценки и другие прогнозные заявления, которые по своей природе подвержены различным рискам и неопределенностям. Фактические события или результаты могут существенно отличаться, положительно или отрицательно, от тех, которые отражены или предполагаются в таких прогнозных заявлениях. Приведенная здесь информация о прошлых результатах работы, будь то фактическая или смоделированная, не является показателем будущих результатов.