

«Сократ»

Бизнес-центр «Ильинский»,
5 этаж, подъезд 11, ул. Ильинская, 8,
Киев, 04070, Украина
Телефон/факс: +38 (044) 207-01-00, 207-01-01
<http://www.sokrat.com.ua> it@sokrat.com.ua

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ УСЛУГИ ТОРГОВАЯ СИСТЕМА «ПЕРСОНАЛЬНЫЙ БРОКЕРИДЖ»

С момента запуска услуги «Персональный брокеридж» (июль 2011-март 2012 гг.) доходность портфеля, который управляется с помощью механической торговой системы (МТС) достигла +4,8% по консервативной стратегии торговли и +5,8% - по агрессивной.

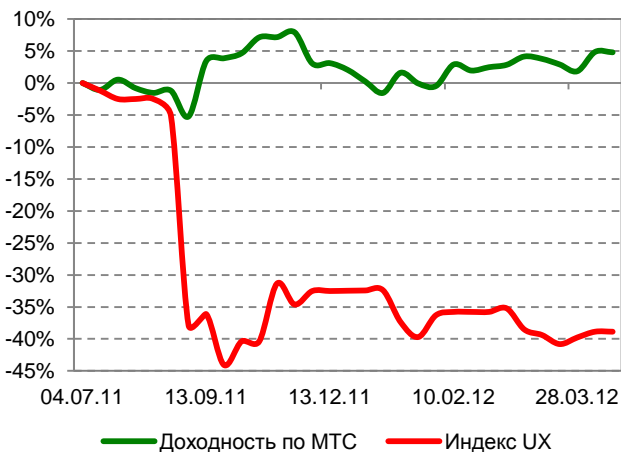
Несмотря на общее снижение рынка на 40% и динамику индекса UX в отсутствии тренда (в широком диапазоне) в течении последних пяти месяцев, МТС смогла продемонстрировать положительный результат благодаря жесткой системе управления рисками, а также возможностью открывать короткие продажи по фьючерсу на индекс UX.

Результаты торговли по услуге Торговая система «Персональный брокеридж» за период с 04.07.2011 по 31.03.2012

Показатель*	Стратегия торговли	
	Консервативная	Агрессивная
Доходность	4,8%	5,8%
Максимальное падение кривой доходности	8,8%	11,2%
Количество сделок (открытие/закрытие позиции)	30	
Прибыльные сделки	53%	
Убыточные сделки	47%	
за период 04.07.2011-31.03.2012 индекс UX снизился на 38%		

* с учетом закрытия текущих позиций по ценам закрытия на 31.03.2012

Доходность по консервативной стратегии



Доходность по агрессивной стратегии

