

Торговая система «Персональный брокеридж» – год успешной работы

Год назад, 04.07.2011, инвестиционная группа «Сократ» запустила новую услугу для своих клиентов – Торговая система «Персональный брокеридж». Данная услуга предполагает активное портфельное инвестирование на основе сигналов механической торговой системы (МТС), которая была разработана и успешно реализована специалистами инвестиционной группы «Сократ».

Минимальная сумма инвестирования составляет 20 000 грн., а срок инвестирования - 1 год. Объектами инвестирования выступают только ликвидные ценные бумаги украинских эмитентов, а также инструменты срочного рынка. Обязательным условием контроля над рисками является выставление защитных ордеров (стоп-лоссов).

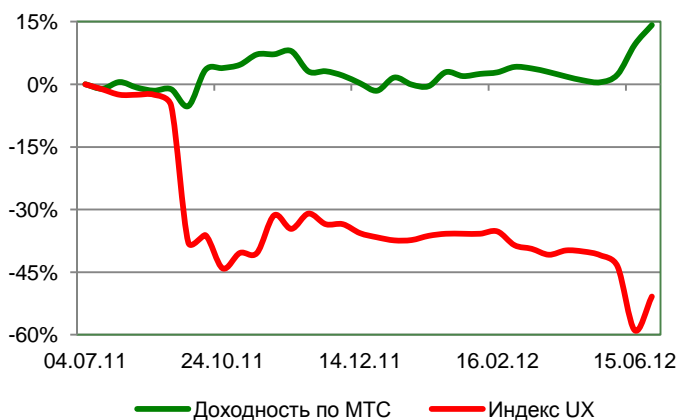
По итогам года услуга Торговая система «Персональный брокеридж» продемонстрировала доходность на уровне 14,2% по консервативной стратегии торговли и 21,6% по агрессивной. Благодаря жесткой системе управления рисками максимальная просадка доходности не превысила 8,8% и 11,2% соответственно.

«В условиях, общего снижения рынка за последний год более чем на 50%, полученная доходность МТС на уровне 15-20% – это отличный результат. Учитывая, что та часть активов, которая использовалась на спотовом рынке, не была задействована в «коротких» продажах, МТС не смогла реализовать весь свой потенциал, поэтому в дальнейшем мы планируем внести некоторые коррективы в работу МТС с целью максимизации прибыли», – отметил директор департамента интернет-трейдинга инвестиционной группы «Сократ» Алексей Беляев.

Сравнительная характеристика стратегий торговли по услуге «Персональный брокеридж» за период 04.07.2011-03.07.2012

Показатель	Стратегия торговли	
	Консервативная	Агрессивная
Доходность	14,2%	21,6%
Максимальное падение кривой доходности	8,8%	11,2%
Вознаграждение/риск	1,6	1,9
Количество сделок (открытие/закрытие позиции)	33	
Прибыльные сделки	55%	
Убыточные сделки	45%	
за период 04.07.2011-03.07.2012 индекс UX снизился на 50%		

Доходность по консервативной стратегии



Доходность по агрессивной стратегии

