

Регламент для клиентов LTD "MULTIPRULIN TRADING GROUP"

Оглавление

	Стр.
Цель регламента для клиентов компании.....	2
Цели компании	2
Финансовые инструменты (активы)	2
Обзор стратегии.....	2
Риск-менеджмент	3
Лимитирующие факторы стратегии	3
Измерение эффективности	3

Цель регламента для клиентов компании

Данный документ создан для того, чтобы пояснить цели компании и природу отношений с клиентами. В документе подробно описаны следующие аспекты:

- Цель компании
- Торговая стратегия
- Ожидаемый возврат
- Риски
- Лимитирующие факторы стратегии
- Измерение эффективности

Данный документ подлежит пересмотру управляющими компанией LTD "MULTIPRULIN TRADING GROUP" (далее Multiprulin) каждый месяц и может быть изменен в соответствии с изменяющимися тенденциями фондового рынка.

Цели компании

Главная цель компании - это генерация позитивных возвратов превышающих средний возврат индустрии, имеющий минимальную корреляцию с рынком. Multiprulin достигает данные цели, управляя финансовыми инструментами с помощью собственного торгового алгоритма. Типичный возврат компании составляет от 2% до 5% в месяц (данная проекция выведена на основе прошлых торговых данных и не может гарантировать статичность будущих возвратов). Компания взимает комиссию с клиентов за управление активами, которая основана на степени эффективности управления средствами клиентов.

Финансовые инструменты (активы)

Multiprulin проводит торговые операции с акциями публичных компаний зарегистрированных в США и ETF (Фонд торгуемый на бирже). Данные типы активов являются оптимальными для компании с точки зрения их соотношения риск / возврат.

Обзор стратегии

Multiprulin проводит свои торговые операции в соответствии с разработанным алгоритмом. Данный алгоритм может быть описан как "Следующий за рынком long/short портфель".

Первым этапом в работе алгоритма является измерение рыночных объемов и сентиментального баланса рынка, что позволяет определить последующее направление движения рынка с 95% точностью.

Вторым этапом работы заключается поиск активов, которые имеют самую высокую вероятность изменения цены в определенном направлении. Так как

стратегия подразумевает long/short трейдинг алгоритм позволяет получать прибыль при возрастающем и падающем рынке. Следовательно, long/short элемент стратегии понижает корреляцию с рынком, что приводит к минимизации рисков.

Риск-менеджмент

Подход Multiprulin к торговле подразумевает краткосрочные, высокочастотные позиции (overnight) в акциях с наибольшей вероятностью прибыли, которые закрываются в течении первых 30 минут торговой сессии. Данный подход позволяет минимизировать риски связанные с релизом экономических данных способных изменить sentiment рынка, следовательно и вероятность прибыли от активных позиций.

Лимитирующие факторы стратегии

Не смотря на отсутствие корреляции возвратов стратегии с рынком, существует корреляция с волатильностью рынка. Таким образом, главным лимитирующим фактором стратегии является отсутствие волатильности на рынке или же отсутствие направленного движения. Как правило, периоды с минимальной волатильностью характеризуются минимальным количеством позиций. Данные действия предпринимаются с целью сохранения капитала.

Измерение эффективности

Измерение эффективности работы компании производится ежемесячно относительно рыночного индекса S&P500. Характеристики измерения эффективности представлены ниже:

- Возврат стратегии относительно возврата рынка (за период)
- Среднее отклонение возвратов (за период)
- Полуотклонение негативных возвратов (за период)
- Соотношение Шарпа (за период)
- Соотношение Сортино (за период)

Приведенные выше характеристики должны использоваться комбинированно, с целью комплексного понимания эффективности работы компании.

Для ознакомления со статистикой работы компании, пожалуйста, перейдите по ссылке (и указать ссылку на страницу статистики)

Если хотите узнать больше – свяжитесь с нами (ссылка на страницу контактов)