



СОКРАТ[↑]

**Торговая система
«Персональный брокеридж»**

Торговая система «Персональный брокеридж»

Торговая система «Персональный брокеридж» – это новая услуга инвестиционной группы «Сократ» для частных инвесторов на основе активного портфельного инвестирования.



- Новая услуга предназначена, прежде всего для тех клиентов, у которых нет свободного времени либо которые пока не готовы самостоятельно осуществлять покупку/продажу ценных бумаг на фондовом рынке
- Данная услуга будет также интересна инвесторам, которые торгуют самостоятельно и хотели бы диверсифицировать свои инвестиционные портфели по стратегиям торговли

Механизм инвестирования

Системный подход



- Решение об открытии или закрытии позиции принимается на основе сигналов механической торговой системы (МТС), которая была разработана, протестирована и успешно реализована специалистами инвестиционной группы «Сократ»
- Наличие жестко определенных правил открытия и закрытия позиций полностью устраняет психологическую составляющую управления активами, что позволяет получать устойчивые результаты торговли с контролируемым риском

Механизм инвестирования

Портфельное инвестирование



- Объектами инвестирования являются только ликвидные ценные бумаги украинских эмитентов, а также инструменты срочного рынка
- С целью диверсификации в портфель входят ценные бумаги, представляющие разные секторы экономики и имеющие слабую корреляцию друг с другом, что значительно снижает риски инвестора
- Наличие в портфеле инструментов срочного рынка позволяет сгладить кривую доходности и обогнать динамику индекса UX на падающем рынке

Механизм инвестирования

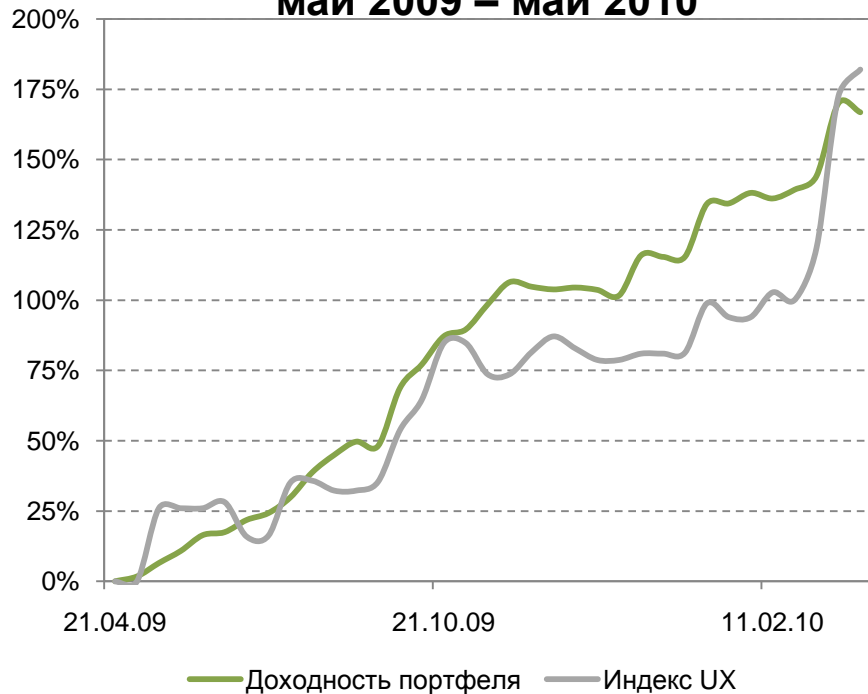
Риск-менеджмент



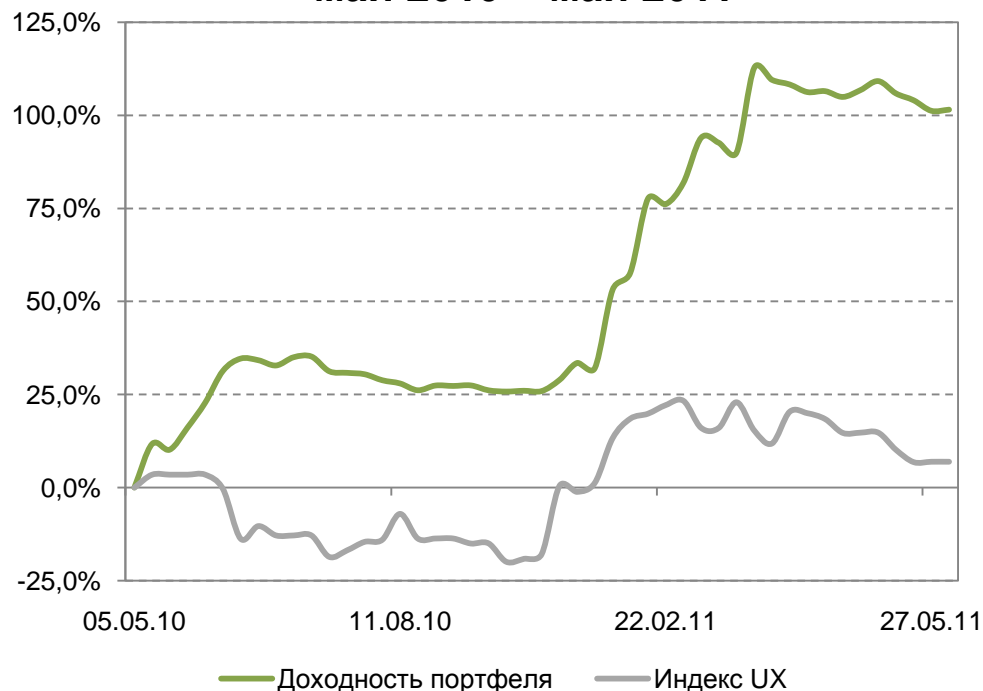
- Обязательным условием контроля над рисками является выставление защитных ордеров (стоп-лоссов)
- В зависимости от степени риска инструмента, позиции открываются таким объемом, чтобы вероятный убыток по отдельному финансовому инструменту не превысил 2-3% от общей суммы инвестиционного портфеля
- Главная цель риск-менеджмента – не допустить просадку портфеля более чем на 15% для консервативной и 25% для агрессивной стратегии торговли

Результаты тестирования МТС, применяемой для услуги Торговая система «Персональный брокеридж»

Доходность за период май 2009 – май 2010



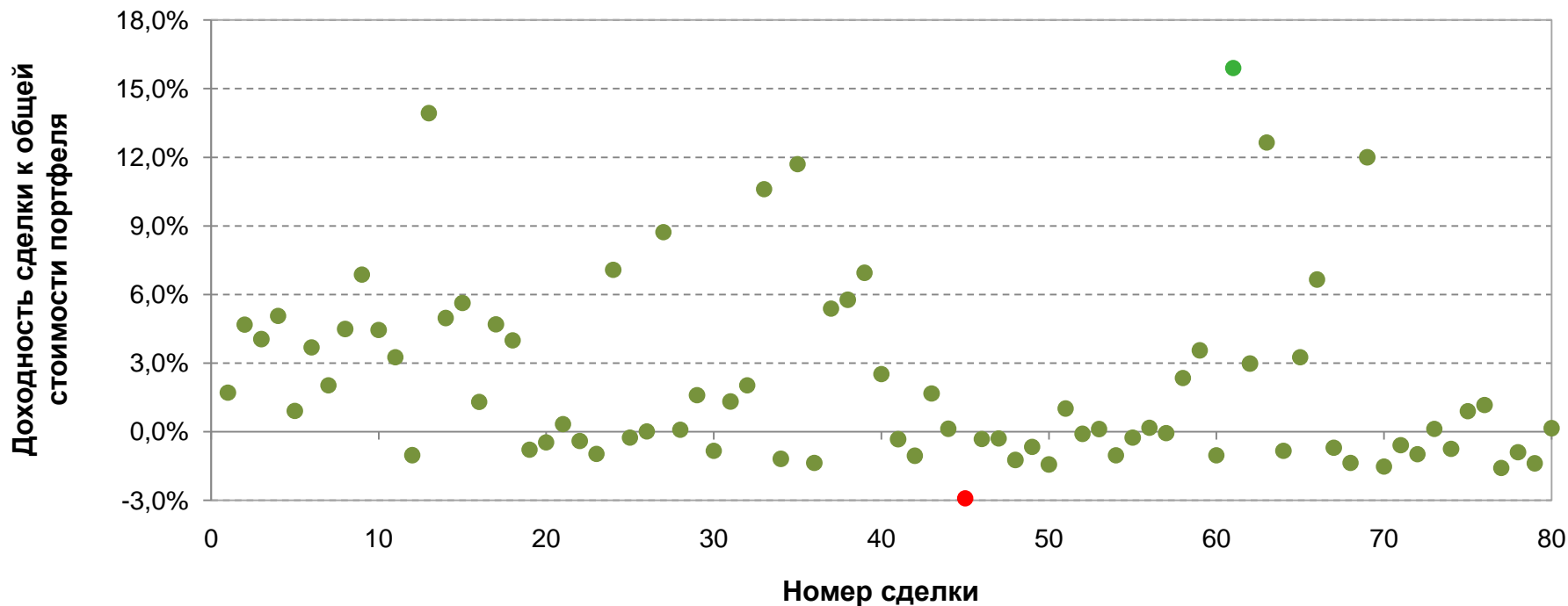
Доходность за период май 2010 – май 2011



- За период май 2009 – май 2010 торговая система показала доходность 167%*.
- Наличие в портфеле инструментов срочного рынка, позволило торговой системе обогнать динамику индекса UH в периоды падения рынка (май 2010 – май 2011 гг., когда доходность торговой системы составила 100%*, при этом индекс UH вырос лишь на 7%)

* Результаты, полученные на исторических данных, не являются гарантией получения такого же уровня доходности в будущем

Результаты сделок МТС (май 2009 – май 2011)



- количество сделок – 80 шт. (купил/продал), что является репрезентативным показателем надежности;
- прибыльных сделок 60%, убыточных 40%;
- максимально прибыльная сделка составила 15,9%, максимально убыточная -2,9%;
- максимальная просадка кривой доходности -7% длительностью 3,5 месяца;
- убыточные сделки ограничены уровнем 1,5-2% за счет ограничения убытков стоп-лоссами;
- максимально прибыльные сделки не ограничены в величине.

Условия

- торговец имеет право совершать исключительно сделки купли-продажи, но не выводить денежные средства со счета инвестора;
- минимальная сумма инвестиций: от 20 000 грн., оптимальная 50 000-90 000 грн. без учета инвестиционного дохода;
- срок инвестирования: не менее 1 года;
- выбор стратегии управления активами в зависимости от риска;
- комиссия 0,05% за каждую торговую сделку на спотовом рынке и 1 грн. за контракт на срочном рынке.

Досрочное снятие активов:

- предупреждение за 3 рабочих дня;
- вывод только денежных средств;
- продажа ЦБ по рыночной стоимости;
- комиссия от суммы выводимых активов – 1% + вознаграждение торговца от инвестиционного дохода в зависимости от выбранной стратегии инвестирования;
- вывод активов возможен через полгода без комиссии за досрочное снятие активов.

Риски

Каждый инвестор должен осознавать, что любой инвестиционный процесс сопряжен с определенными рисками. Именно этот фактор определяет доходность инвестиционных вложений, причем имеется прямая зависимость возможного риска (потери части капитала) и предполагаемой конечной суммы прибыли. Инвестор, выбирающий малорисковые стратегии управления капиталом, имеет меньшую вероятность получения высоких доходов, чем тот, который выбрал стратегию с более высоким уровнем риска.

В предлагаемой нами услуге клиент может сам выбрать стратегию торговли в зависимости от своих предпочтений к риску:

- **консервативная:** риск до 15%*, потенциальная прибыль до 40%.
- **агрессивная:** риск до 25%*, потенциальная прибыль до 70%.

* Потенциальные риски не учитывают форс мажорные обстоятельства

Вознаграждение торговца

Консервативная стратегия торговли

При доходности до 40% годовых – вознаграждение торговца составит 20% от инвестиционного дохода за вычетом всех операционных расходов (комиссия брокеру, блокировка/разблокировка денежных средств).

При доходности свыше 40% годовых – вознаграждение торговца составит:

- 20% от суммы полученного дохода до 40%;
- 50% от суммы полученного дохода свыше 40%;

Максимальная просадка счета 15%.

Агрессивная стратегия торговли

При доходности до 70% годовых – вознаграждение торговца составит 20% от инвестиционного дохода за вычетом всех операционных расходов (комиссия брокеру, блокировка/разблокировка денежных средств).

При доходности свыше 70% годовых – вознаграждение торговца составит:

- 20% от суммы полученного дохода до 70%;
- 50% от суммы полученного дохода свыше 70%;

Максимальная просадка счета 25%.

Контакты

Светлана Опрощенко

Директор

Департамента интернет-трейдинга

oproshchenko@sokrat.com.ua

+38 (044) 498-49-18

Алексей Беляев

Заместитель директора

Департамента интернет-трейдинга

belyaev@sokrat.com.ua

+38 (044) 498-49-32

Татьяна Зимина

Специалист по работе с клиентами

Департамента интернет-трейдинга

zimina@sokrat.com.ua

+38 (044) 498-49-32

Денис Королев

Администратор

Департамента интернет-трейдинга

korolyov@sokrat.com.ua

+38 (044) 498-49-23

Егор Бельковец

Администратор

Департамента интернет-трейдинга

belkovets@sokrat.com.ua

+38 (044) 498-49-35

Инвестиционная группа «Сократ»

Бизнес-центр «Ильинский»

ул. Ильинская, 8, 5 этаж, подъезд 11,
Киев, 04070, Украина

Телефон/факс: +380 44 207 01 00

+380 44 207 01 01

+380 44 498 49 10