

Стратегия «Импульс Капитал»



КУРС НА КАПИТАЛ



300 000 руб.

Минимальный размер
инвестиций

Стратегия «Импульс Капитал» ориентирована для размещения средств клиента во фьючерсные контракты российского фондового рынка: Фьючерсные контракты на:

- курс **доллар США - российский рубль**
- курс **евро - российский рубль**

Краткое описание и основные принципы

Решения о покупке или продаже принимаются на основе динамики валютных индексов. Сделки проводятся с фьючерсными контрактами **Si – доллар/рубль** и **Eu – евро/рубль**. Используются как длинные, так и короткие позиции, т.е. торговля ведётся как на рост данных контрактов, так и на их снижение, в случае оценки рынка как снижающегося.

1 Фьючерсный контракт = 1000 базовых единиц.

1 контракт Si = 1000\$

1 контракт Eu = 1000€

Курс \$ и € рассчитывается каждый день по курсу ЦБ РФ.

Для открытия и удержания открытой позиции, необходимо гарантийное обеспечение (залог), размер которого составляет примерно от **10%** до **20%** от стоимости фьючерсного контракта и зависит от волатильности рынка (скорости изменения цен за постоянный промежуток времени).

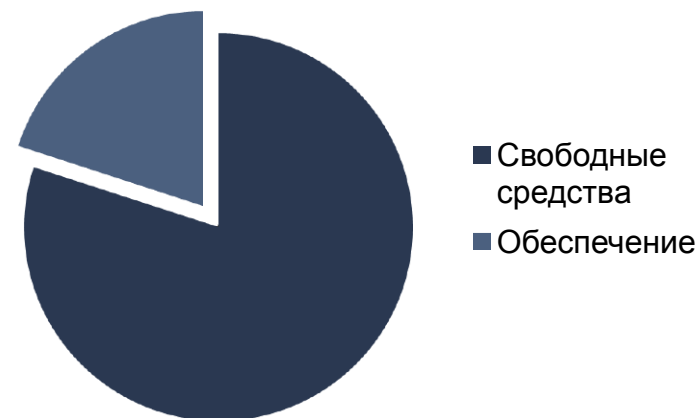
Длинная позиция –
покупка контракта с
целью продажи по более
высокой цене



Короткая позиция –
продажа контракта с
целью покупки его по
более низкой цене



Стоимость фьючерса



Риск-менеджмент

Жёсткий **контроль** за размером позиции ведёт механизированная система торговли (МТС, т.е. **робот**). При спокойном рынке позиция клиента может увеличиваться, когда на рынке повышенная волатильность и за тот же промежуток времени скорость изменения цены увеличивается в 2 и более раз, размер позиции клиента будет уменьшаться.

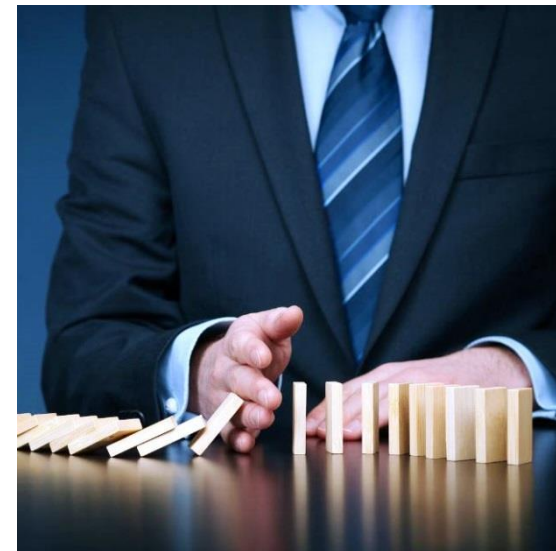
Также при движении рынка в сторону позиции, её размер может быть увеличен с целью получения дополнительной прибыли.

Всё это позволяет не только сохранить вложенный капитал, но **приумножить** и **защитить его от девальвации** при сниженных рисках.

Девальвация – понижение официального курса бумажных денег относительно других валют.

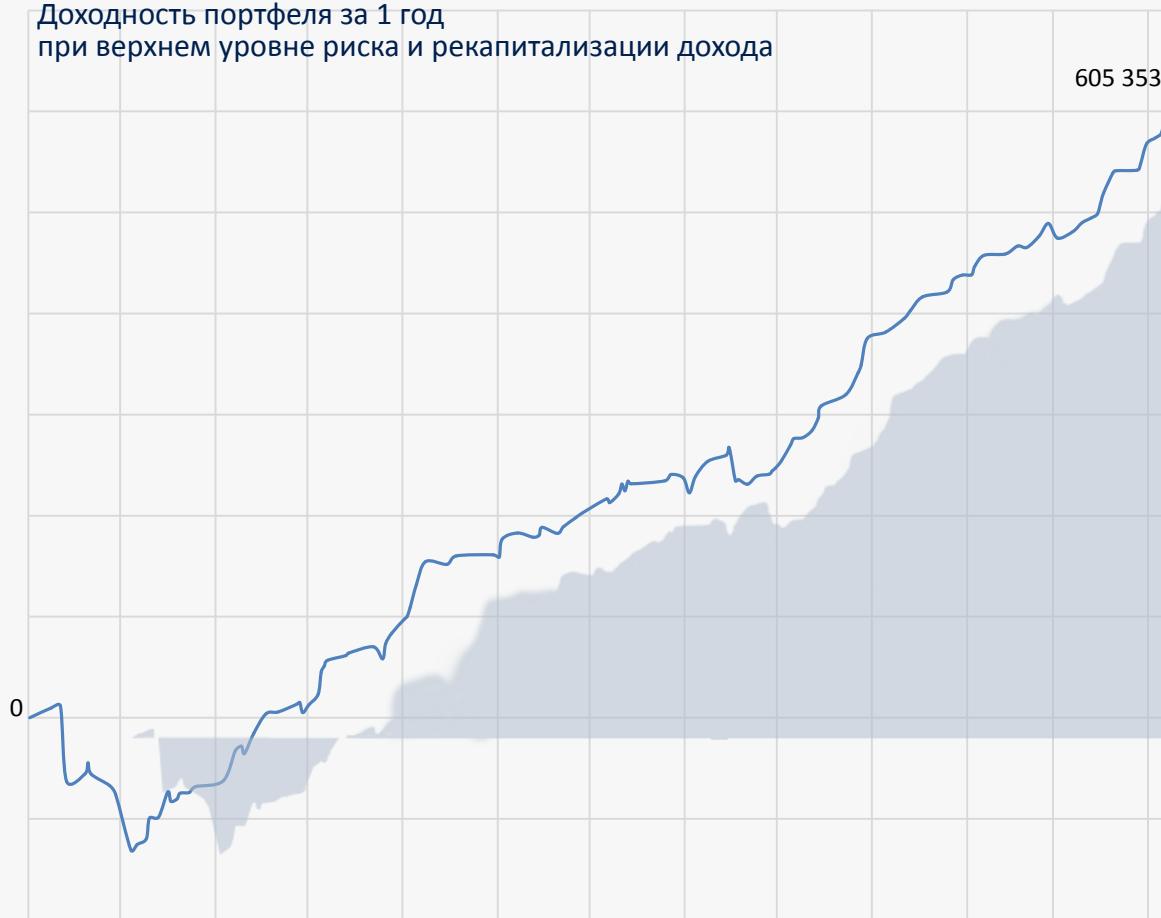
Лучшей защитой от падения курса национальных денежных знаков является покупка валют стран со стабильным курсом.

В случае роста рубля, для заработка используют продажу валюты в долг, с целью покупки её в дальнейшем по более низкой цене (короткая позиция).



Доходность стратегии «Импульс Капитал»

Доходность портфеля за 1 год
при верхнем уровне риска и рекапитализации дохода



Доходность указана из расчёта чистой прибыли для суммы вложений **1 млн. руб.**

Доходность отображает реальный торговый портфель компании за указанный промежуток времени.

Убытки и прибыль портфеля в разные промежутки времени могут варьироваться.

Идеальным входом в торговую стратегию считается время, в которое портфель находится в расчётном историческом минимуме.

**Анализируемый
промежуток времени:**

Апрель 2015 – Апрель 2016 гг.

Доходность стратегии 1

Доходность по месяцам

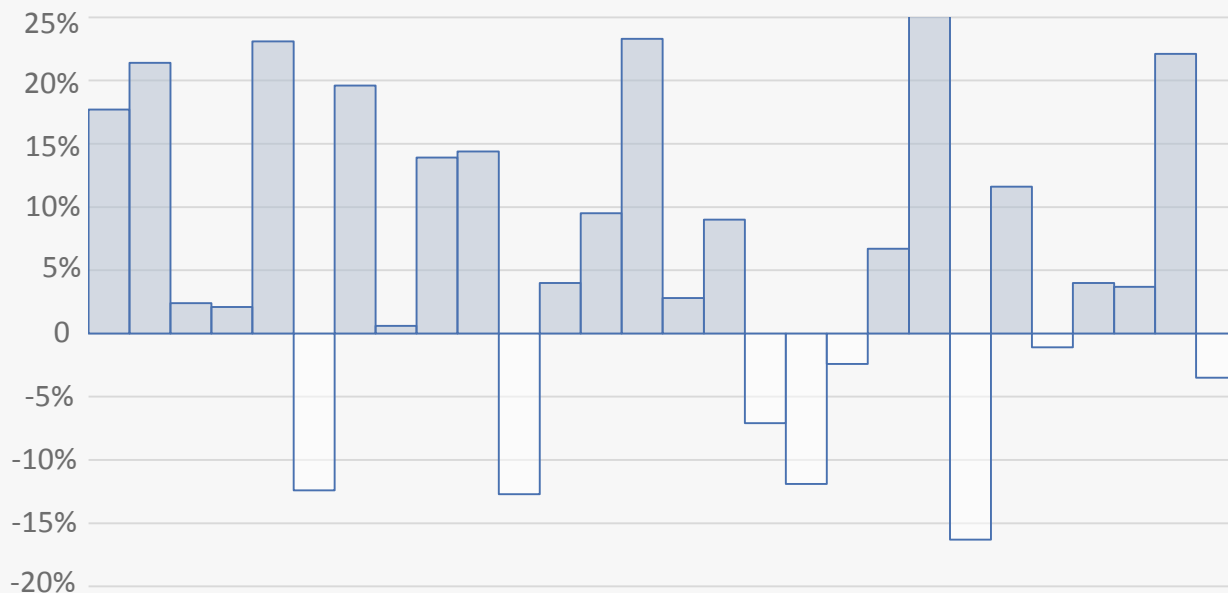


Диаграмма отражает доходность реального счёта клиента по месяцам с **ноября 2015 по июль 2017 гг.**

Абсолютно наглядно представлена информация о количестве торговых месяцев, которые принесли убыток или доход.

Каждый столбец показывает размер прибыли/убытка в процентах от размера счёта.

К сожалению, полностью от убыточных месяцев избавиться нельзя, а их череда может быть достаточно длительной. Связано это с особенностями торговли российского фондового рынка.

Но даже спустя несколько месяцев всегда приходят изменения, которые позволяют быстро отыграть убыток и заработать плановую годовую доходность.

Доходность стратегии «Импульс Капитал»

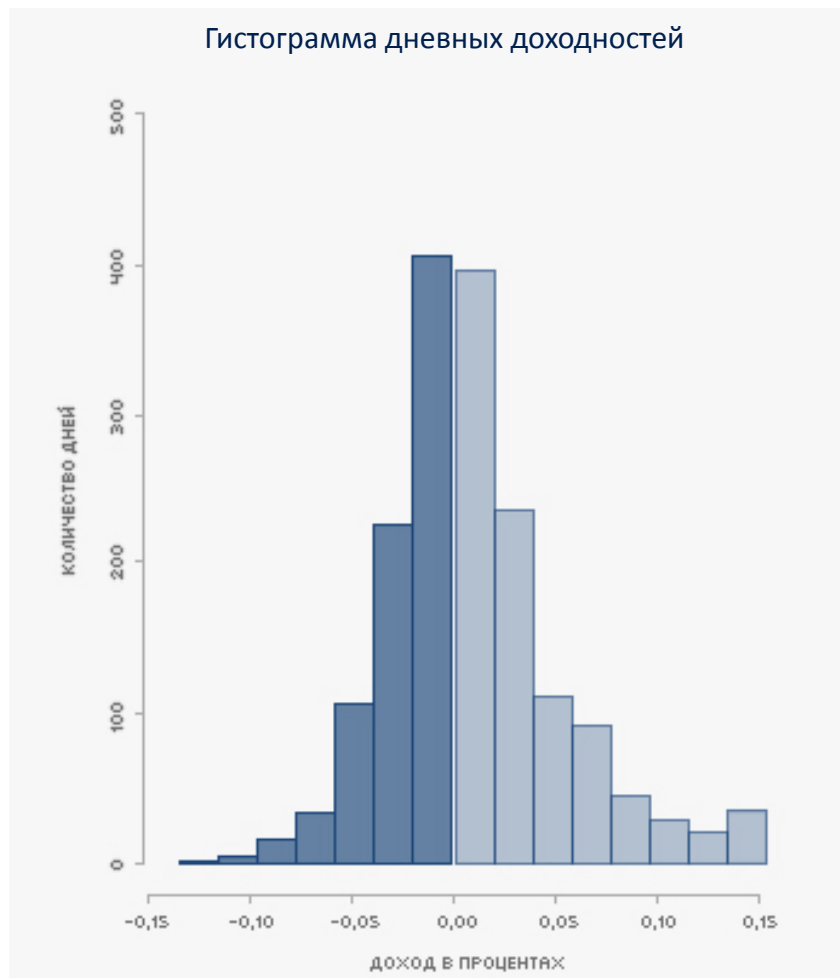


Диаграмма отражает доходность каждого торгового дня за последние **8 лет**.

Слева ось определяет количество торговых дней, а нижняя ось доходность в процентах, которую принёс каждый день.

В году примерно 240 торговых дней.

Значение 0,05 означает доход в 5%, цифры со знаком минус показывают убыток.

Около 80% всех сделок приносят колебания торгового счёта в пределах **±5%**.

Основную и наибольшую прибыль приносят сделки в **5%** случаев, поэтому важно не количество, а **качество**.

Всего несколько сделок в квартал приносят **более 80% годовой прибыли**.

Наши алгоритмы обновляются каждый квартал с целью соответствия текущей рыночной ситуации.

График доходности с учётом вывода прибыли

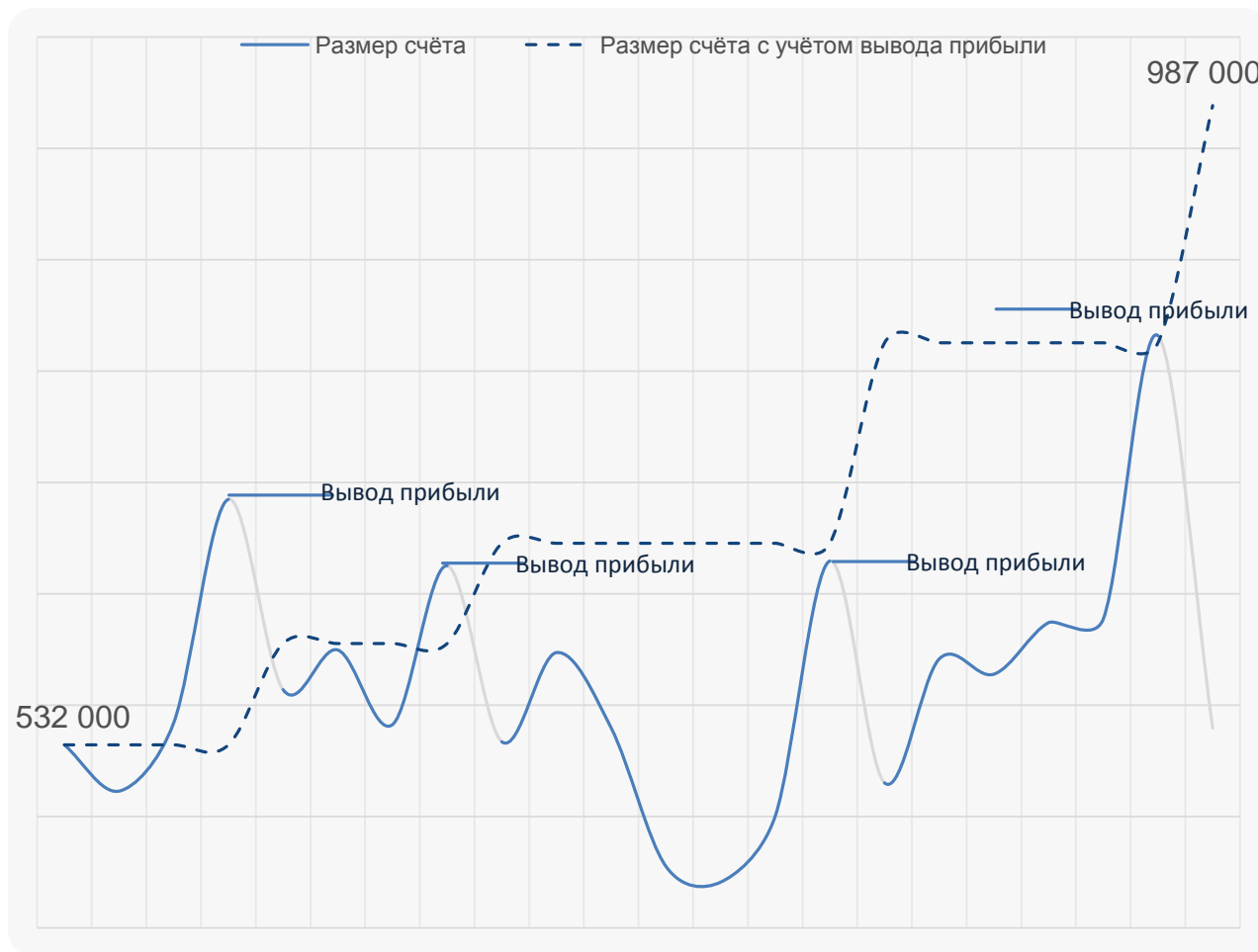


График доходности Стратегии «Импульс Капитал» на **реальном** торговом счёте клиента.

Первоначальный размер счёта:
532 000 руб.

Срок инвестирования:
ноябрь 2015 – август 2017 гг.

Прибыль системы:
455 000 руб.

Доходность системы за **21 мес.:**
74,4% с учётом уплаченного НДФЛ

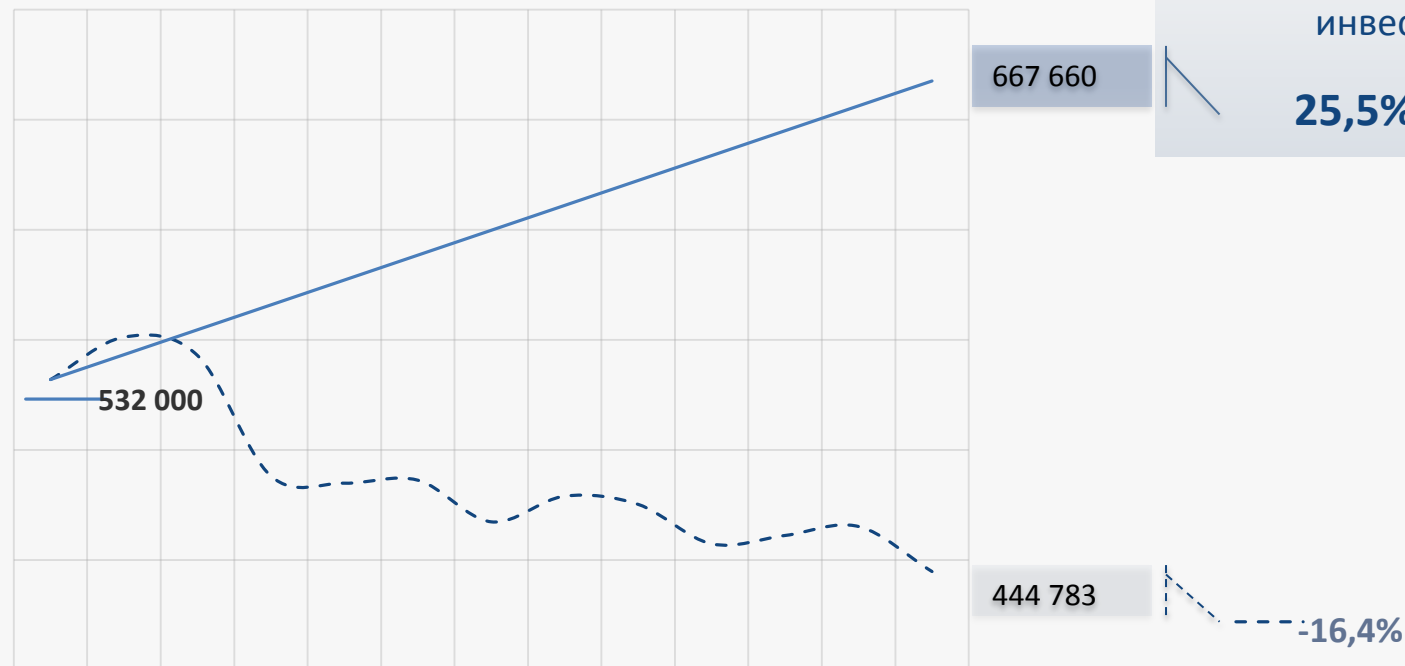
Доходность системы за 1 год:
42,5% годовых

Прибыль инвестора:
60% от чистой прибыли системы

25,5% годовых – чистая прибыль инвестора

График доходности с учётом вывода прибыли

График сравнения дохода от покупки валюты наличными и вложением в стратегию «Импульс Капитал». Рассматриваемый период: январь 2016 – январь 2017 гг.



Чистая прибыль инвестора:
25,5% годовых

- - - Доход от покупки наличной валюты

— Доход от вложения в стратегию

Контакты

ООО УК «Столичная Финансовая Корпорация»

Общество с ограниченной ответственностью Управляющая компания "Столичная Финансовая Корпорация" имеет **лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг** на осуществление деятельности по **управлению ценными бумагами** [№ 077-13354-001000](#) выдана Федеральной службой по финансовым рынкам 14.10.2010 (с 09.12.2013 «Банк России»), **без ограничения срока действия.**

Все заинтересованные лица могут до заключения договора доверительного управления ознакомиться с условиями управления активами, получить сведения и пообщаться с доверительным управляющим, осуществляющим управление, а также, иную информацию, которая должна быть предоставлена в соответствии с федеральным законом и иными нормативными актами РФ по указанному номеру телефона, адресу или адресу сайта.

Адрес: **г. Москва, ул. Большая Ордынка, д. 40, стр. 4 , БЦ Легион-1, под. 3**

Тел: **8 (495) 544-544-4**

Сайт: www.sfc-am.ru

E-mail: info@sfc-am.ru

Режим работы офиса:

Пн - Пт: **9:00 - 21:00**

Сб: **11:00 - 17:00**

Вс: **выходной**

Результаты деятельности управляющего по управлению ценными бумагами в прошлом не определяют доходы в будущем. Государство не гарантирует доходность инвестиций. Настоящий материал, содержащиеся в нём сведения носят исключительно информационный характер, не являются офертой и не могут рассматриваться как приглашение или побуждение сделать оферту, или как просьба купить или продать ценные бумаги/другие финансовые инструменты, либо осуществить какую-либо иную инвестиционную деятельность. Представленная в материале информация подготовлена на основе источников, которые, по мнению авторов, являются надёжными, но, при этом отражает исключительно мнение авторов относительно описываемых объектов и проведённые авторами исследования. Несмотря на то, что информация, приведённая в материале, отражена с максимально возможной тщательностью, ООО Управляющая компания «Столичная Финансовая Корпорация» не заявляет, и не гарантирует ни прямо, ни косвенно её точность и полноту. Любая информация и любые суждения, приведённые в данном материале, являются суждением на момент публикации настоящего материала и могут быть изменены без предупреждения. Ни ООО «Управляющая компания «Столичная Финансовая Корпорация», ни её сотрудники не несут ответственности за какие-либо потери, возникшие в результате использования настоящего материала или в какой-либо другой связи с ним.