

## EDGE STONE Investment Boutique предлагает новый продукт:

### Стратегия управления капиталом W-SURF VIX

Настоящий инвестиционный продукт - это стратегия управления капиталом на фондовом рынке США. В стратегии используются импульсные и трендовые системы, которые осуществляют торговые операции с фьючерсами на основные индексы фондового рынка США и некоторыми торгуемыми на бирже фондами (ETF). Торговые системы используют различную логику для анализа рыночной ситуации, благодаря чему достигается высокая устойчивость стратегии в целом и низкий риск инвестиций.

Объединение двух независимых подходов позволяет получить качественную стратегию управления капиталом с основными показателями выше, чем у каждой системы в отдельности. Среди таких преимуществ:

- **Высокая устойчивость** – предлагаемый продукт составляют системы с различной логикой принятия решения, и работающие с разными инструментами фондового рынка.
- **Низкий риск инвестиций** – различные торговые подходы компенсируют друг другу неэффективные периоды торговли без потери общей доходности.
- **Высокая доходность** – для амбициозных инвесторов ожидаемая доходность стратегии может достигать 80% за год, при этом риск инвестиций не превысит 20% капитала.

#### Основные параметры стратегии:

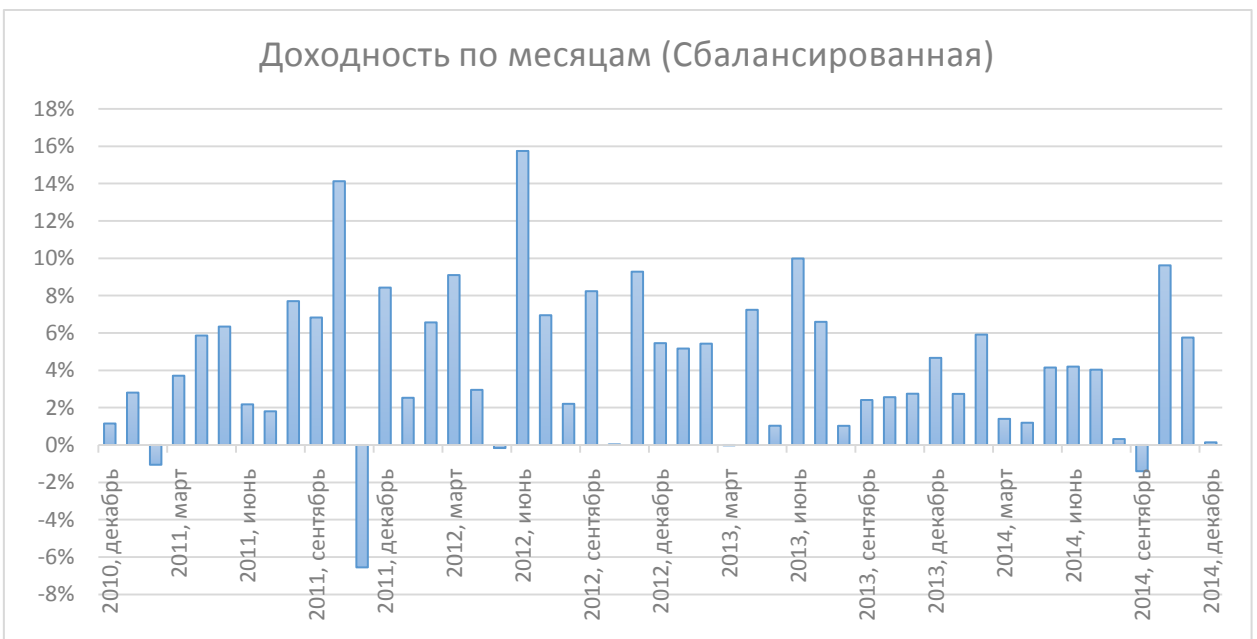
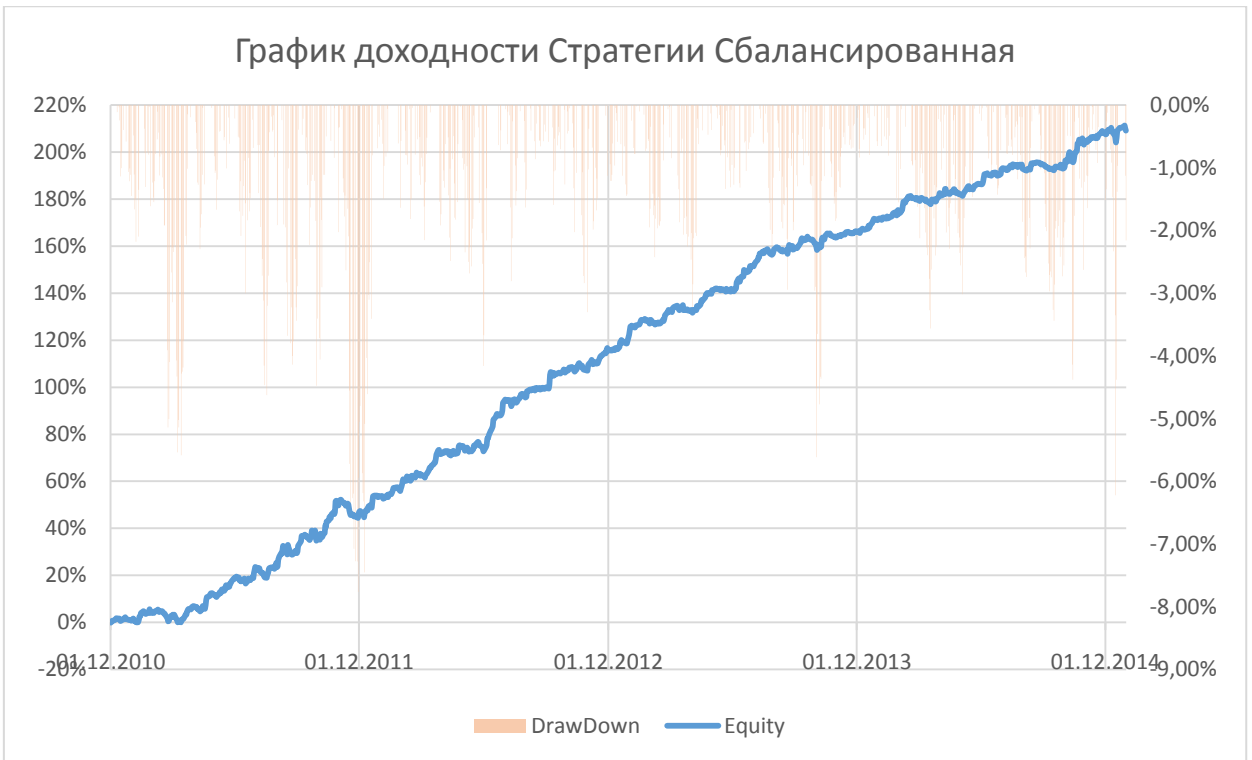
Минимальный размер счета	\$120 000
Минимальный период инвестирования	1 квартал

Стратегия / риск:	Ожидаемая доходность (% годовых)	Просадка максимальный уровень
Консервативная	<b>20%</b>	7,5%
Сбалансированная	<b>40%</b>	15%
Агрессивная	<b>80%</b>	30%

#### Результаты работы сбалансированной стратегии следующие:

Среднегодовая доходность стратегии	50%
Максимальное понижение капитала	8%



Максимальный доход за месяц – 15,75%

Максимальное понижение капитала за месяц – 6,56%

Средняя доходность за месяц – 4,27%



### **Коротко о применяемых торговых подходах:**

**Импульсные системы,** входящие в состав стратегии, торгуют фьючерсами на индексы S&P, Dow Jones и Nasdaq – это переворотные системы, работающие в часовом временном интервале. Т.е. по каждой из них всегда есть позиции во фьючерсах, а анализ рыночной ситуации происходит один раз в час. Под ценовым импульсом понимается краткосрочное направленное движение цены, которое в соответствии с нашей статистической моделью с большей вероятностью продолжится, чем развернется. Системы по-разному оценивают рыночные импульсы и их влияние на предстоящие изменение цен. Поэтому сигналы торговых систем часто разнесены во времени, а иногда имеют противоположное направление, что говорит о неопределенной динамике рынка. Таким образом, объединение систем позволяет извлекать прибыль из сильных рыночных движений, а в период неопределенности удерживать минимальную позицию, для сокращения потерь.

**Трендовые системы,** входящие в состав стратегии, торгуют краткосрочными ETF на волатильность (интенсивность движения рынка), которые строятся на основе фьючерсов на волатильность индекса S&P. Для определения господствующего движения, системы анализируют различные временные интервалы и, в силу особенностей построения этих инструментов, удерживают позиции только в случае снижения ETF. Системы удачно дополняют друг друга благодаря различной оценке начала и завершения тренда, которая, в свою очередь, учитывают текущую рыночную волатильность.

### **Для того чтобы начать инвестировать, необходимо:**

- 1.** С помощью нашей компании открыть свой личный индивидуальный брокерский счет в американской брокерской компании **Interactive Brokers**.
- 2.** Заключить с нашей компанией «Договор аренды и консультационного обслуживания программного комплекса W-SURF».
- 3.** Зачислить денежные средства на свой брокерский счет в Interactive Brokers.

Мы готовы ответить на любые интересующие Вас вопросы, и по Вашему запросу вышлем развернутое описание применяемых торговых стратегии и условий работы.

### **Контактная информация:**

**Нуждов Михаил**  
+7 927 286 6734  
[num@edgestone.ru](mailto:num@edgestone.ru)

**Морусенцев Алексей**  
+7 927 289 9679  
[moralex@edgestone.ru](mailto:moralex@edgestone.ru)

**EDGE STONE Investment Boutique**

13-15 Gregory Afxentiou, I.D.E. Ioannou Building, office 207, Mesa Yeitonia, 4003 Lemesos, Cyprus  
г.Москва, Пресненская наб. д.6, стр. 2, этаж 16, Башня «Империя», ММДЦ «Москва-Сити»  
г.Пенза ул. Московская 56, офис 223.

**+7 495 995-80-30**  
[www.EdgeStone.ru](http://www.EdgeStone.ru)