

Описание

В основе современной высокотехнологичной стратегии управления капиталом **Lucrum Plus** лежит торговля недельными опционами на американский индекс SnP500

Преимущества:

- Превосходные результаты при контролируемых рисках
- Нейтральность к рынку
- Способность развиваться и адаптироваться к рынку
- Высокая ликвидность базового актива

Стратегия постоянно совершенствуется и подстраивается под изменяющиеся рыночные условия.

Стратегия основана на 20-летнем опыте управляющих опционным портфелем и подразумевает тщательный контроль потенциальных рисков

Используются элементы машинного обучения и мультифакторные модели

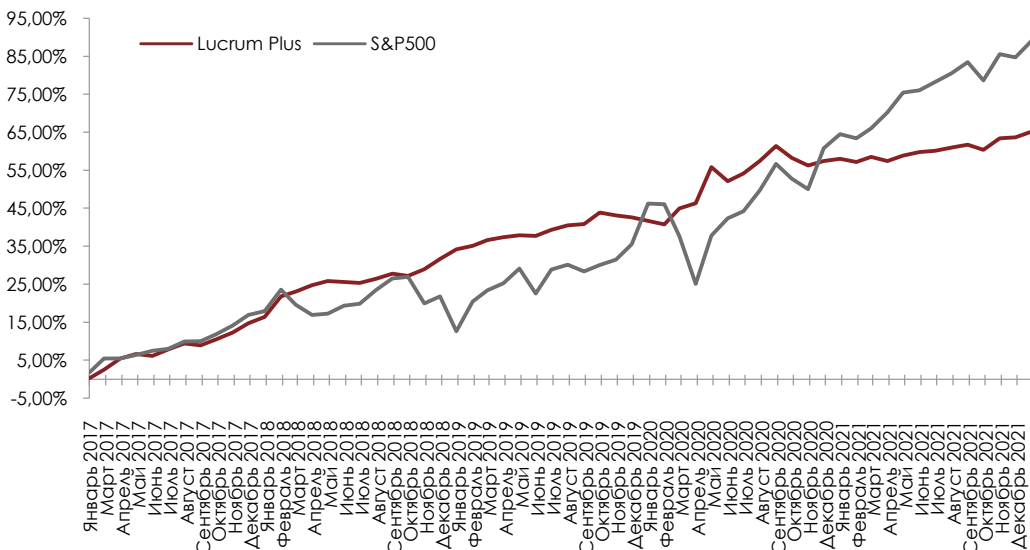
Terreus Capital AG

Москва,
Площадь борьбы, д. 15,
Тел.: +7 495 727-63 60
Info@terreuscapital.ru

Показатели доходности стратегии по месяцам, %:

	Янв.	Фев.	Март	Апр.	Май	Июнь	Июль	Авг.	Сен.	Окт.	Ноя.	Дек.	Год	Сумма
2017	0,29	2,29	2,91	1,16	-0,50	1,75	1,60	-0,55	1,61	1,73	2,49	1,64	16,42	16,42
2018	5,44	1,20	1,70	1,14	-0,26	-0,24	1,10	1,28	-0,56	1,74	2,75	2,49	17,78	34,20
2019	0,95	1,45	0,78	0,50	-0,19	1,67	1,12	1,42	2,00	-0,80	-0,50	-0,89	7,51	41,71
2020	-1,00	4,21	9,32	1,56	-3,74	2,02	3,30	3,97	-3,07	-2,09	1,17	0,60	16,25	57,96
2021	-0,81	1,37	-1,12	1,41	0,94	0,36	0,81	0,76	-1,34	3,01	0,28	1,51	7,18	65,14

Инвестиционные показатели: Январь 2017 – Декабрь 2021:



Параметры стратегии:

Дата запуска стратегии	Январь, 2017	Доходность с января 2017 года	65,14%
Управляющий	Terreus Capital	Доходность за 2021 год	7,18%
Валюта	USD	Доходность за последний месяц	1,51%
Минимальный объем инвестиций	50 000 USD	Среднегодовая доходность	13,03%
Опыт инвестирования	Для квалифицированных инвесторов	Количество убыточных месяцев	16
Готовность к рискам	Высокая	Количество прибыльных месяцев	44
Вознаграждение	2% в год, 20% за успех	Коэффициент Шарпа	1,92
		Максимальная просадка	-5,16%

Статистические показатели:

Terreus Lucrum Plus Strategy	
Среднемес. доходность	1,09
Среднемес. волатильность	1,96
Среднегод. волатильность	6,77
Коэффициент Шарпа	1,92

Риск менеджмент:

Все торговые позиции в обязательном порядке хеджируются для ограничения максимально допустимой просадки, что обеспечивает гладкую кривую роста инвестированного капитала

* Начало торговли на реальном счете

** Alpha (%) – оценка доходности стратегии независимой от доходности рынка (SnP500)

** Correlation – корреляция стратегии к индексу S&P500

** Beta – отражает изменчивость доходности стратегии по отношению к доходности среднерыночного портфеля (S&P500)