

Описание

В основе современной высокотехнологичной стратегии управления капиталом **Naphtha** лежит торговля недельными опционами на нефтяные фьючерсы WTI.

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

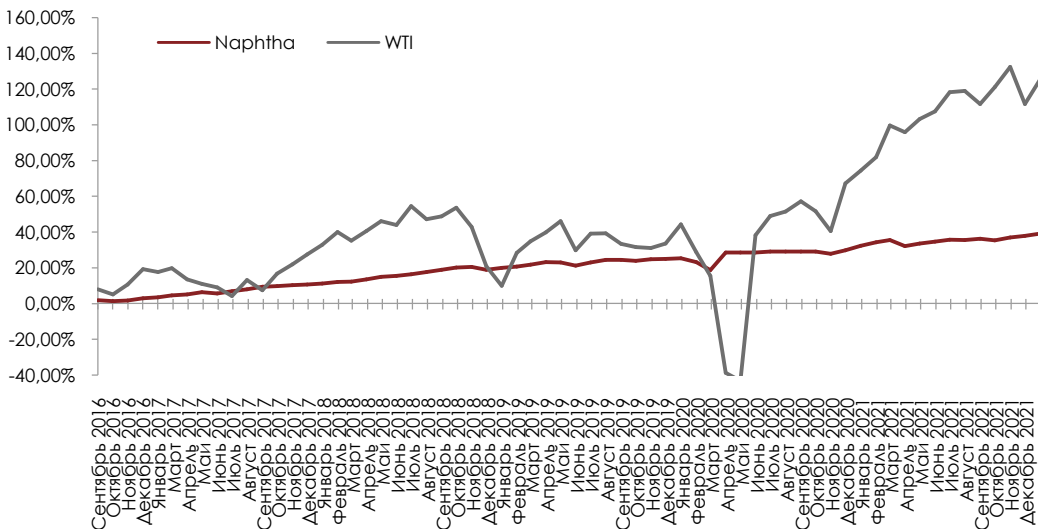
Terreus Capital AG

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
2016									1,85	-0,58	0,43	1,19	2,90	2,90
2017	0,59	1,11	0,53	1,27	-0,87	1,34	1,15	1,26	0,45	0,51	0,39	0,56	8,30	11,20
2018	0,81	0,29	1,15	1,52	0,44	0,88	1,33	1,27	1,15	0,37	-1,56	1,16	8,79	19,99
2019	0,71	1,08	1,33	-0,16	-1,74	1,71	1,44	0,11	-0,63	0,90	0,22	0,43	5,39	25,38
2020	-2,28	-4,47	9,82	-	-	0,70	-	-	-	-1,43	2,04	2,52	6,90	32,28
2021	1,92	1,37	-3,43	1,36	1,20	0,96	-0,23	0,81	-0,88	1,53	0,92	1,25	6,78	39,06

Инвестиционные показатели: Сентябрь 2016 – Декабрь 2021:



Параметры стратегии:

Дата запуска стратегии	Сентябрь, 2016	Доходность с сентября 2016 года	39,06%
Управляющий	Terreus Capital	Доходность за 2021 год	6,78%
Валюта	USD	Доходность за последний месяц	1,25%
Минимальный объем инвестиций	50 000 USD	Среднегодовая доходность	7,32%
Опыт инвестирования	Для квалифицированных инвесторов	Количество убыточных месяцев	12
Готовность к рискам	Высокая	Количество прибыльных месяцев	47
Вознаграждение	2% в год, 20% за успех	Коэффициент Шарпа	1,25
		Максимальная просадка	-6,75%

Статистические показатели:

Terreus Naphtha Strategy

Среднемес. доходность	0,61
Среднемес. волатильность	1,69
Среднегод. волатильность	5,87
Коэффициент Шарпа	1,25

Риск менеджмент:

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