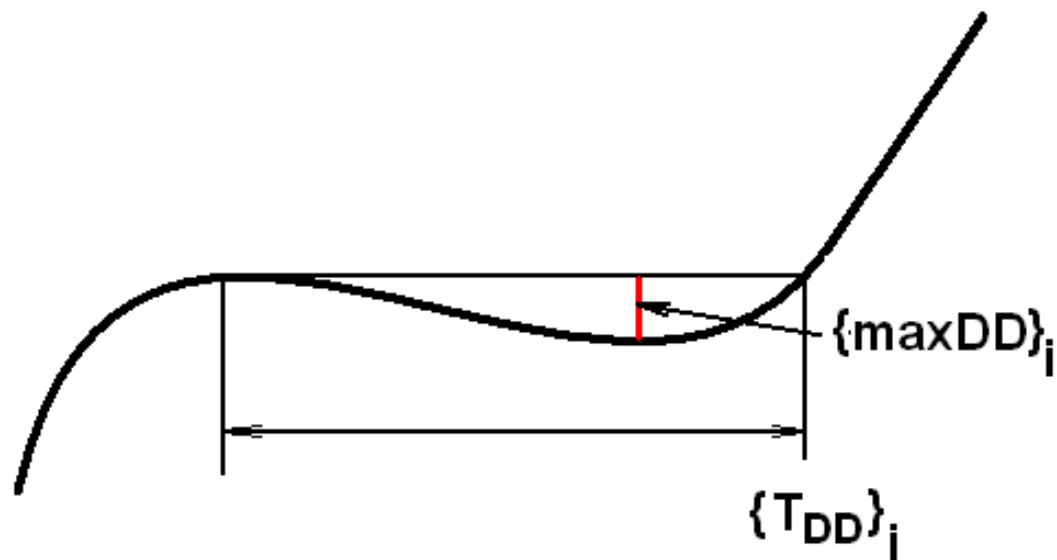


## УНИВЕР - Торговые Системы

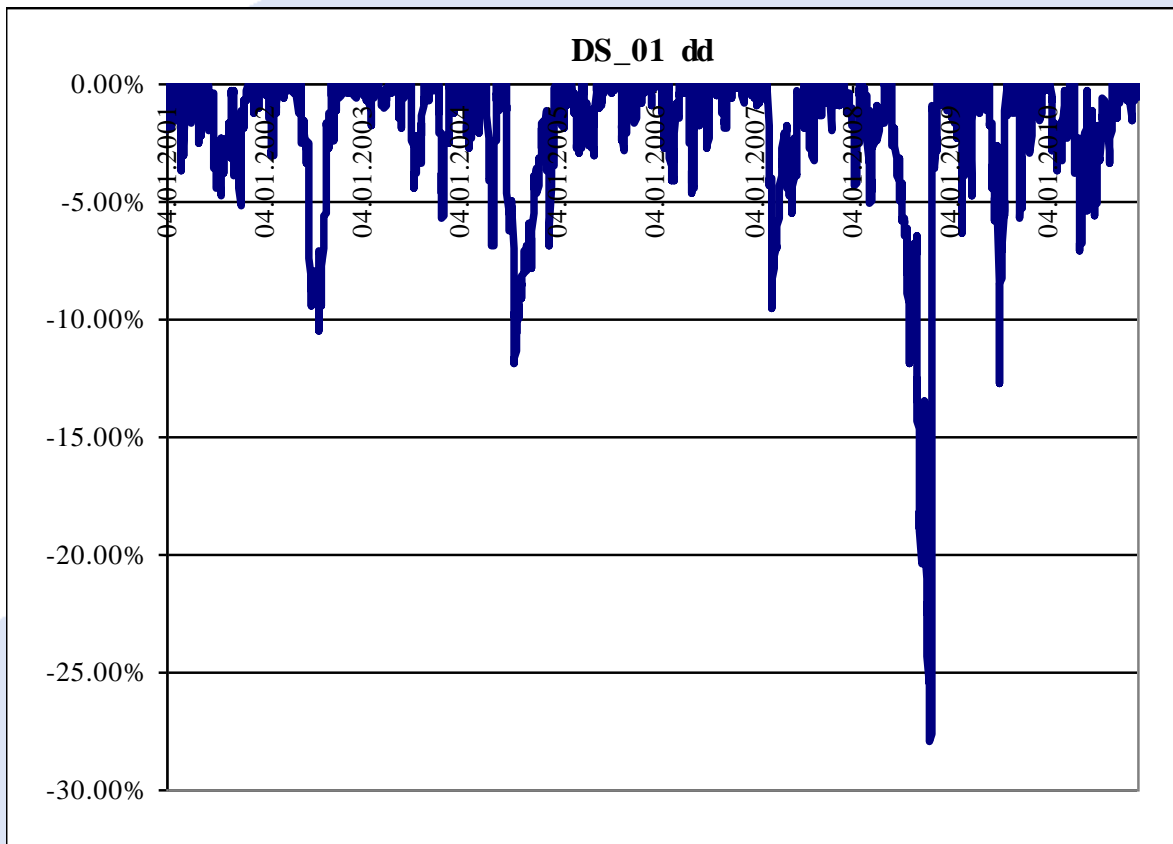
Особенности управления Риском при  
алгоритмическом трейдинге.  
Примеры, описание  
и история практического применения.



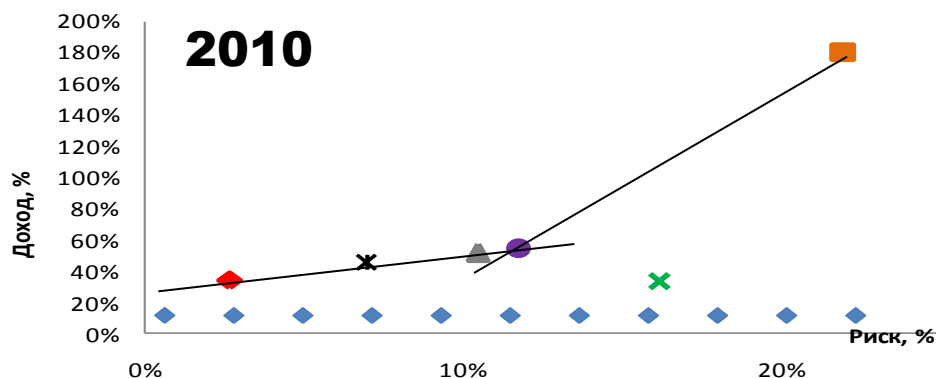
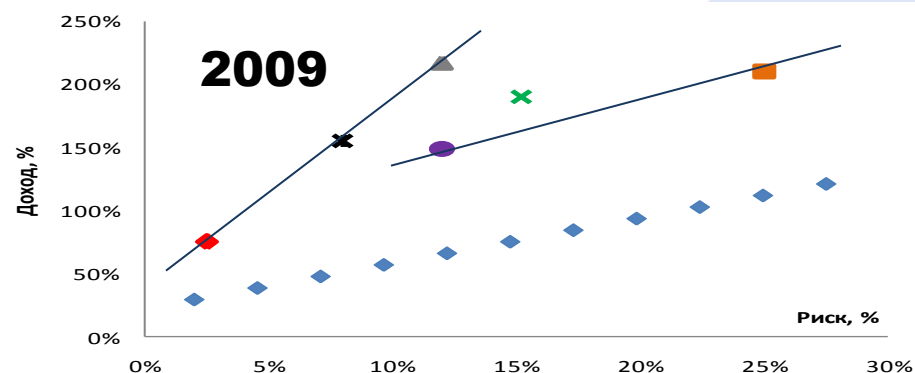
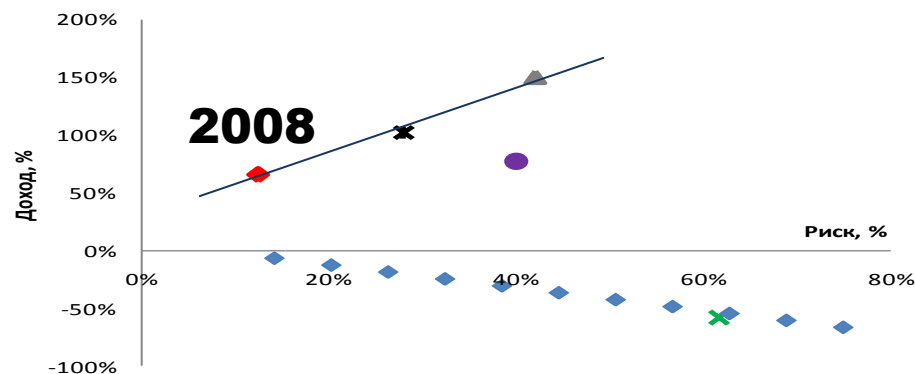
## Определение дродауна (drawdown)










# Риск профиль базовой торговой стратегии



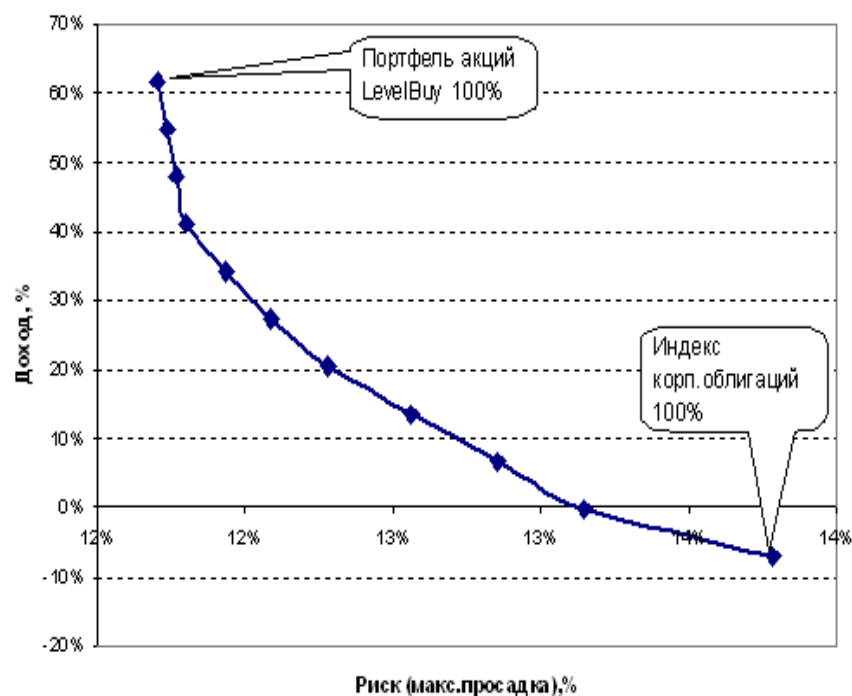
## Доходности/Риски портфелей



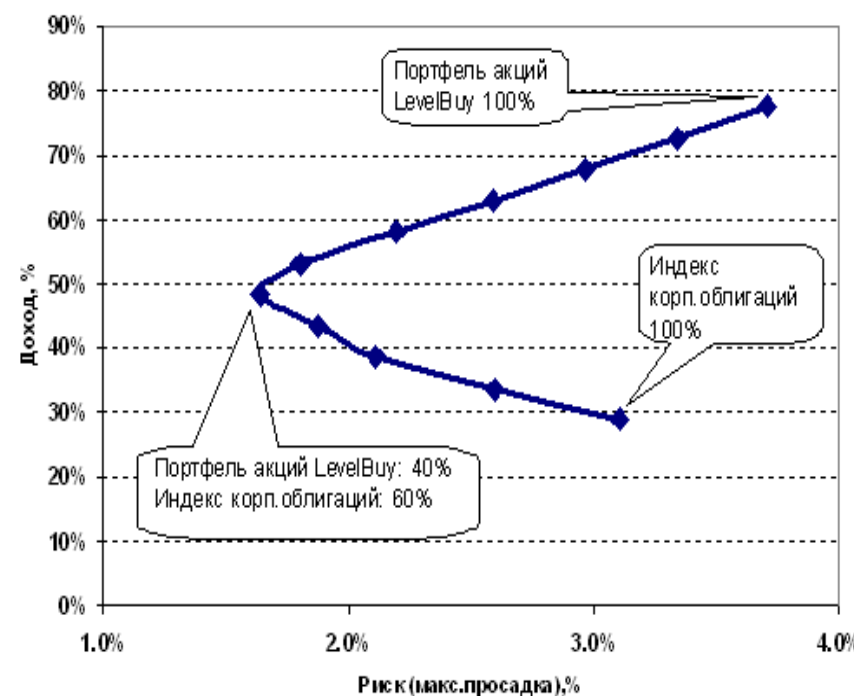
-  - Фьючерсы с плечом 1 к 6
-  - Фьючерсы с плечом 1 к 2
-  - Акции с плечом 1 к 2
-  - Акции с плечом 1 к 1
-  - Акции без плеча
-  - ПИФ УНИВЕР – Фонд акций
-  - Портфели из индекса акций ММВБ и индекса облигаций IFX-Cbonds в различных сочетаниях

# Добавление облигаций к портфелю

Варианты портфелей 2008



Варианты портфелей 2009



**УНИВЕР - Торговые Системы**

**Спасибо за внимание!**

