

Independent Trading House

innowacyjność i doświadczenie



Independent Trading House to pierwsza w Polsce firma zajmująca się algorytmicznym podejściem do inwestycji. Nasze **Modele Strategii Algorytmicznych** to jedno z najnowocześniejszych rozwiązań inwestycyjnych dostępnych na rynku. Pozwalają na inwestowanie **w sposób obiektywny** i oparty o **rozwiązania informatyczne i statystyczne**.

Rozwiązania tego typu zdobyły w ostatnich latach uznanie wśród inwestorów, stając się wartościowym i **ważnym elementem zdywersyfikowanego portfela** inwestora.

W porównaniu do klasycznych inwestycji, fundusze algorytmiczne potrafią elastycznie **dostosowywać się do zmian**, co jest szczególnie ważne na dzisiejszym rynku.

Modele Strategii Algorytmicznych łączą w sobie wieloletnie doświadczenie i **konserwatywne podejście do ryzyka** z innowacyjnymi technologiami, dzięki czemu pozwalają na uzyskanie **atrakcyjnej stopy zwrotu** bez względu na cykle koniunkturalne czy uwarunkowania rynkowe.

Celem Independent Trading House jest dostarczanie Klientom **sprawdzonych, przetestowanych i obiektywnie przedstawionych systemów algorytmicznych** dedykowanych rynkowi Forex.

Independent Trading House zajmuje się **nadzorowaniem** ich działania, **opracowywaniem** i **wdrażaniem** procedur wsparcia technicznego przez współpracę z renomowanymi i licencjonowanymi podmiotami rynku finansowego.

Co wyróżnia inwestowanie z zastosowaniem Modeli Strategii Algorytmicznych od pozostałych rozwiązań oferowanych na rynku

Inwestowanie obiektywne za pomocą modeli algorytmicznych – decyzje inwestycyjne wynikają ze wskazań modeli opartych o profesjonalną analizę statystyczną, BIG DATA i procesy stochastyczne.

Powtarzalna stopa zwrotu – stabilne stopy zwrotu są osiągane dzięki zastosowaniu portfeli strategii algorytmicznych. Wysoki poziom rozdrobnienia transakcji i znaczne ograniczenie wykorzystania dźwigni finansowej sprawiają, że poszczególne transakcje nie mają decydującego wpływu na miesięczną stopę zwrotu. Takie działanie umożliwia ograniczenie ryzyka zarówno poszczególnych transakcji, jak i modeli w całości.

Eliminacja czynnika ludzkiego – całość procesu inwestycyjnego jest oparta wyłącznie o rozwiązania algorytmiczne dobierane według obiektywnych zasad. Zespół analityczny ITH zajmuje się nadzorowaniem zgodności ogólnego kierunku transakcji algorytmicznych z wydarzeniami fundamentalnymi o kardynalnym znaczeniu.

Konserwatywne podejście do ryzyka – głównym kryterium oceny wszystkich systemów jest poziom ryzyka. Dzięki temu oraz

zastosowaniu algorytmicznego systemu nadzoru możliwe jest skwantyfikowanie maksymalnego poziomu ryzyka. Wysoki poziom płynności rynku bazowego MSA umożliwia niemal natychmiastowe wycofanie środków z zajmowanych pozycji i realizację ewentualnej straty na ściśle określonym poziomie.

Oderwanie od cyklu hossy-bessa – MSA funkcjonują w sposób niezależny od cyklu hossy-bessa. W długim okresie działanie MSA wykazuje niską korelację (+/- 0,15) w stosunku do innych klas aktywów jak np. akcje, obligacje, commodities. Dzięki temu MSA mogą stanowić bardzo skuteczne uzupełnienie portfela inwestycyjnego i zmniejszenie jego ekspozycji na wysoko skorelowane grupy aktywów.

Wewnętrzna dywersyfikacja – każdy model (MSA) składa się z kilku - kilkunastu strategii składowych charakteryzujących się szeroką dywersyfikacją względem siebie oraz odmiennością strukturalną. Taka segmentacja przekłada się zgodnie z teorią portfelową na węższą stopę zwrotu osiąganą przy niższym ryzyku (wskaźniki efektywności).



Nowoczesny Inwestor ma do swojej dyspozycji szereg rozwiązań i bardzo zróżnicowane rynki. Daje to nieporównywalne do dostępnych wcześniej możliwości **dywersyfikowania portfela inwestycyjnego**, ale niesie ze sobą również wyzwania i zagrożenia. Rosnący poziom informatyzacji rynków wymaga od Inwestora **wciąż rosnących nakładów pracy, nauki i elastyczności**, by dostosować swoje metody inwestycyjne do **różnych instrumentów**.



Dzięki komplementarności rozwiązania **Independent Trading House**, Inwestor otrzymuje **gotowy element portfela inwestycyjnego**, co pozwala oszczędzić czas i nakłady pracy niezbędne do oponowania kolejnego instrumentu bazowego portfela. Pozwala to Inwestorowi skupić się na pozostałych rynkach stanowiących bazę portfela inwestycyjnego i w efekcie **zwiększyć skuteczność swoich decyzji inwestycyjnych**.

Korzyści płynące z inwestowania za pomocą Modeli Strategii Algorytmicznych

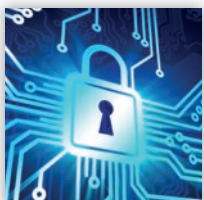
Inwestowanie z Modelami Strategii Algorytmicznych	Inwestowanie indywidualne
Brak konieczności poświęcania czasu	Potrzeba zainwestowania wolnego czasu
Opłata wstępna	Poniesiony wielokrotnie wyższy koszt szkoleń, opłaty otwarcia rachunku
Zespół doświadczonych analityków pracujących nad strategią inwestycyjną każdego z rozwiązań	Brak zdefiniowanej strategii inwestycyjnej
Ochrona kapitału w zdefiniowanych granicach	Brak ochrony kapitału
Konkurencyjne koszty transakcyjne dzięki płynności instytucjonalnej	Wysokie koszty transakcyjne
Inwestowanie przy użyciu premiowych źródeł informacyjnych oraz nowoczesnego oprogramowania	Brak opłacalności indywidualnego wykorzystania takich programów
Eliminacja czynnika ludzkiego	Wpływ czynnika ludzkiego/psychologicznego

Dlaczego MSA?



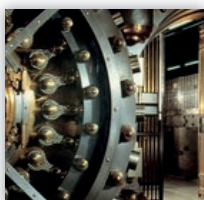
Ponadstandardowe stopy zwrotu

Modele Strategii Algorytmicznych pozwalają uzyskać ponadstandardową stopę zwrotu przy zachowaniu skwantyfikowanego ryzyka. Charakterystyka rynku bazowego MSA pozwala na niemal natychmiastowe wycofanie się z rynku w przypadku negatywnego rozwoju koszyka transakcji, dzięki czemu poziom potencjalnej straty jest ściśle określony.



Bezpieczeństwo

Wysoka wydajność działania MSA pozwala na uniknięcie stosowania procentu składanego, dzięki czemu z czasem kapitał bazowy MSA znajduje się pod pełną ochroną dzięki wcześniejszym zyskom. Statystyka wskazuje, że kwartał jest okresem wystarczającym, by wypracowany zysk przekroczył maksymalną potencjalną stratę modelu stając się pełnym zabezpieczeniem kapitału bazowego.



Zabezpieczenie depozytu

Independent Trading House oraz jego przedstawiciele **nigdy nie mają dostępu do środków swoich Klientów**. Działanie MSA jest realizowane za pośrednictwem **renomowanych brokerów** – FXSALT oraz LMAX. Środki naszych Klientów są przechowywane w **największych, ściśle regulowanych i nadzorowanych bankach** na rachunkach segregowanych.



Nieprzerwany dostęp do środków

Independent Trading House **nie ogranicza możliwości wypłaty środków** przez naszych Klientów. Umowa nie zawiera klauzul zabraniających wcześniejszej wypłaty, a sugerowany okres inwestycji jest tylko **statystyczną estymacją** opartą o wcześniejsze wieloletnie działanie MSA. Nasi Klienci nie ponoszą **żadnych opłat** z tytułu wypłaty oprócz kosztów bankowych naliczanych przez brokera lub banki.



Pełna informatyzacja procesu

Proces zawierania transakcji przez Modele Strategii Algorytmicznych jest **w pełni zautomatyzowany** i wolny od czynnika ludzkiego. Independent Trading House zajmuje się wyłącznie **obiektywnym testowaniem i wdrażaniem nowych rozwiązań** oraz nadzorowaniem **bieżącego działania** systemów informatycznych.



Zabezpieczenie zysków

Metodologia ograniczenia strat zakłada **wykorzystanie wcześniejszych zysków do zabezpieczenia kapitału** Inwestora w kolejnych okresach. Oznacza to, że z czasem, statystycznie **po upływie kwartału**, maksymalny poziom straty nie przekracza wcześniej wypracowanych zysków **skutecznie ograniczając ryzyko**.

ITH

INDEPENDENT TRADING HOUSE

Serdecznie dziękujemy za zainteresowanie **Modelami Strategii Algorytmicznych**. Współczesne rynki inwestycyjne wymagają świeżego spojrzenia, dynamiki w podejmowaniu decyzji oraz odpowiednich narzędzi. Nieprzerwanie rosnący **poziom informatyzacji** w procesie decyzyjnym wymaga coraz większej **wiedzy, narzędzi i nakładów pracy**, by efektywnie i skutecznie wykorzystać możliwości inwestycyjne poszczególnych rynków.

Doświadczenie **Independent Trading House** w tworzeniu, testowaniu i wdrażaniu algorytmicznych systemów inwestycyjnych sięga **początków regulacji rynku walutowego w 2008 roku**. W ciągu czterech lat stworzyliśmy **kilkadziesiąt** systemów transakcyjnych, przetestowaliśmy **kilka tysięcy** rozwiązań i stworzyliśmy szereg systemów informatycznych dla **odbiorców indywidualnych** oraz **domów maklerskich**.

Powodem stworzenia **Modeli Strategii Algorytmicznych** była chęć dostarczenia Inwestorom rozwiązania pozwalającego w sposób **bezobsługowy** korzystać z możliwości rynku walutowego.

Wcześniejsze rozwiązania wymagały **samodzielnego podejmowania decyzji** inwestycyjnych w oparciu o analizy lub sygnały inwestycyjne, utrzymania we własnym zakresie **infrastruktury informatycznej**.

Dzięki rozwiązaniom **Independent Trading House** dostęp do rynku walutowego jest **prostszy niż kiedykolwiek**. Pełne wsparcie ITH pozwala naszym Klientom w pełni wykorzystywać możliwości rynku walutowego bez ingerowania w proces na jakimkolwiek etapie.

Z wyrazami szacunku
Zespół Independent Trading House

ITH

INDEPENDENT TRADING HOUSE

Independent Trading House

al. Komisji Edukacji Narodowej 54/73, 02-797 Warszawa
tel.: +48 22 100 62 91, 100 62 92, fax: +48 22 448 59 08
e-mail: ith@ithfx.pl, skype: independenttradinghouse
www.ithfx.pl