



Образовательный курс
ТРЕЙДИНГ И УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ

Wolfline Capital LLC, 2018

1.1 Особенности курса

1. **Индивидуальный подход:** целью и конечной задачей курса является разработка индивидуальных торговых стратегий и стратегий управления риском каждого слушателя;
2. **Удобный формат и постоянная обратная связь:** возможность постоянного участия в закрытом чате с практикующими трейдерами и ведущими экспертами нашей компании;
3. **Аналитический функционал платформы FINAZZI:** для фундаментального анализа инструментов инвестирования мы используем функционал разработанной нами платформы FINAZZI;
4. **Практическая ориентированность:** основу материала составляют примеры реальной торговли успешных трейдеров, что не имеет аналогов среди обучающих программ;
5. Возможность войти в команду трейдеров реального дэска: в случае демонстрации положительных результатов мы можем предложить слушателям возможность войти в команду трейдеров существующего или создаваемого трейдинг дэска/фонда.

Целевая Аудитория:

- ✓ Начинающие трейдеры и те, кто хочет научиться зарабатывать на финансовых рынках.
- ✓ Трейдеры, которые имеют опыт работы на финансовых рынках, но хотят улучшить свои навыки и научиться строить инвестиционные стратегии подобные тем, что используют инвестиционные фонды.

Ключевые направления курса:

- ✓ Разработка индивидуальной торговой стратегии.
- ✓ Проработка детального риск-менеджмента, подходящего индивидуально конкретному трейдеру и конкретной системе.
- ✓ Изучение нестандартных методик управления капиталом.
- ✓ Грамотное и разумное распределение не используемых в торговле средств для получения дополнительного дохода при помощи инструментов финансового рынка.



1.2 Основы торговых стратегий хедж-фондов

1. **Фундаментальные предпосылки работы на финансовых рынках:** статистические закономерности и основные принципы успешной работы. Понятие тренда, трендовые и разворотные паттерны;
2. **Ключевые принципы построения трендовых и контртрендовых торговых стратегий:** основы поведения «умных денег» и использование этих знаний в торговле; виды трендов и способы торговли на трендовом рынке, стратегии торговли в канале; контртрендовая торговля и стратегии;
3. **Трейдинг как собственный бизнес:** построение бизнес-процессов в индивидуальном трейдинге. Подход к трейдингу, как к бизнесу;
4. **Профессиональные подходы к оценке и управлению риском в трейдинге:** Risk-management, VaR, RWA, CAPM и способы их использования в частном и корпоративном трейдинге;
5. **Типы управления капиталом,** тестирование на тип биологической обратной связи;
6. **Практика:** Работа с функционалом FINAZZI.

Основные навыки, которые получит слушатель:

- ✓ Клиент узнает, почему на рынках вообще возможно зарабатывать, в чем отличие в подходах к трейдингу у профессионалов и трейдеров, теряющих капитал. Как войти в 5% зарабатывающих трейдеров.
- ✓ Клиент узнает секреты работы на рынках профессионального трейдера и поймет, что значит подход к трейдингу, как к бизнесу.
- ✓ Клиент поймет, как применять корпоративные методы управления риском, используемые в хедж-фондах и trading desks. Вместе с Вами мы разберем, как не терять деньги на трейдинговых операциях.
- ✓ Клиент получит свой doskonaльный профиль трейдера, что позволит ему максимально комфортно, не борясь с самим собой и не подгоняя свою психологию под чужие правила, зарабатывать на финансовых рынках, делая это с удовольствием.



1.3 Разработка собственной торговой стратегии

1. **«Цикл гибели» и «цикл успеха», формирование авторского подхода к разработке торговой стратегии:** практическая сессия разработки и корректировки индивидуальных торговых стратегий;
2. **Основы фундаментального анализа и использование его в разработке торговой стратегии:** подходы к анализу финансовых рынков; стратегии, которые используют профессионалы (global macro, анализ ликвидности, математический анализ) и их детальный разбор. Выбор методов и инструментов анализа для торговли;
3. **Торговля рыночными неэффективностями:** основы торговли спредами, торговля гэпами, торговля неэффективностями в стоимости на рынке деривативов и базисного актива, торговля базисом;
4. **Практика:** Поиск, разбор и оптимизация инвестиционных идей, сформированных на базе выбранных методов анализа.

Основные навыки, которые получит слушатель:

- ✓ Клиент поймет, как, научившись зарабатывать один раз, делать это постоянно и с каждым разом увеличивая свой доход все больше и больше.
- ✓ Клиент поймет, как не попасться на типичные ловушки в трейдинге и как самому научиться ставить сети для максимизации прибыли.
- ✓ Клиент познакомится с тем, какие механизмы в действительности используются самыми успешными профессионалами рынка.
- ✓ Поиск, разбор и оптимизация инвестиционных идей, сформированных на базе выбранных методов анализа.



1.4 Основы формирования инвестиционного портфеля

1. **Ключевые методики формирования портфеля:** LQA и MVA методики формирования инвестиционного портфеля, оценка весовых коэффициентов, ICAPM и CAPM методики;
2. **Ключевые механизмы пересмотра состава портфеля:** реинвестирование средств и докупы, пересмотр весовых коэффициентов инструментов внутри портфеля, эффективный портфель и теория Марковица;
3. **Основы хеджирования:** использование инструментов рынка опционов и фьючерсов для хеджирования рисков портфеля, контрарианские стратегии для хеджирования рисков портфеля.

Основные навыки, которые получит слушатель:

- ✓ Клиент получит ключевые навыки формирования инвестиционного портфеля и познает как аналогичные задачи решают инвестиционные банки и другие профессиональные участники рынка.
- ✓ Клиент узнает как и в каких случаях следует пересматривать состав своего инвестиционного портфеля.
- ✓ Клиент познакомится с основными методиками хеджирования рисков инвестиционного портфеля, используемыми инвестиционными банками и другими профессиональными участниками рынка.



1.5 Основы формирования торговой отчетности

1. **Основы торговой отчетности:** необходимость ведения отчетности; виды торговых документов трейдера и их функции (калькуляция, база данных и текущие показатели);
2. **Предварительный контроль за сделками:** коэффициенты предварительного контроля и их важность; непрерывная оптимизация торгового подхода и выбранной торговой стратегии;
3. **Текущий контроль за сделками:** коэффициенты текущего контроля. Работа с коэффициентами на практике и программирование собственного торгового журнала;
4. **Практика:** Разбор и оптимизация полученных результатов в ходе досконального тестирования. Построение скатерограммы сделок, z-коэффициент и корреляционные модели.
5. **Практика:** Формирование конечной торговой системы с учетом управления рисками и капиталом. Поиск оптимального портфеля торговых подходов.

Основные навыки, которые получит слушатель:

- ✓ Клиент получит профессиональные методы учета своих позиций и поймет, как сделать работу с отчетностью максимально эффективной и комфортной.
- ✓ Клиенту станут доступны разработки и механизмы, позволяющие еще до начала торговли понять слабые и сильные стороны системы.
- ✓ Клиент поймет, как проводить настройку своих работающих торговых систем в режиме реального времени так, чтобы они генерировали постоянный доход. Также узнает о ведущем ПО в этой сфере.



Информация о лекторе Курса

1. *Практикующий трейдер, с опытом работы более 5 лет;*
2. *Автор множества статей и двух монографий на темы трейдинга и корпоративных финансов;*
3. *Разработчик платформы VI-анализа "FINAZZI";*
4. *Принимал участие и руководил целым рядом проектов на рынке слияний и поглощений, IPO и ICO;*
5. *Профессиональный портфельный управляющий;*
6. *Входит в состав экспертного совета Международного Союза экономистов и МЭС БРИКС;*
7. *Активный лектор.*



КАЛМЫКОВ ВИКТОР ВЛАДИМИРОВИЧ

- *Кандидат экономических наук*
- *Директор департамента по работе с кредитными рисками ООО «Волфлайн капитал»*



Contacts.

Russia, Moscow
Business center "Smolenskiy Passage"
(Smolenskaya ploschad, building 3), floor 6

info@wolflinecapital.com
wolflinecapital.com

+7 (499) 350-2555

