

ICEFX

ДАЙДЖЕСТ ЗА 2018 ГОД

Содержание

ГЛАВНЫЕ СОБЫТИЯ	3
Таймлайн событий	4
Акция «Легкий старт»	5
Завершился четвертый этап конкурсов Genesis и Genesis Prime	6
Новые торговые инструменты и контрагенты EXANTE и DIVISA UK	12
Региональный партнер	13
Компенсация комиссии за пополнение счета	14
ПОКАЗАТЕЛИ КОМПАНИИ	15
Клиентская активность	16
ИНВЕСТИЦИИ. ТОРГОВЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ	18
Топ 3 счета по доходности за 2018 год	19
Рейтинг А	20
Индексы	21
Миграция УС по рейтингам	22
Годовые итоги инвестиционной системы ICE FX	23
Причины	39
СМИ И ПУБЛИКАЦИИ	40
ИТОГИ 2018 ГОДА И ПЛАНЫ НА 2019 ГОД	42

Главные события

1

В течение года компания ICE FX сделала свои услуги и продукты максимально доступными.

На время действия акции «Легкий старт» отменены требования к минимальному депозиту.

В результате торговля с реальным выводом сделок на поставщиков ликвидности и инвестирование в профессиональные счета стали возможными для депозитов порядка 10 \$.

2

Основной сайт и Личный кабинет стали мультязычными, благодаря чему клиентская база теперь не ограничивается исключительно русскоязычными клиентами. Компания начала экспансию в англоязычных странах, а также странах Латинской Америки.

3

Вследствие добавления новых торговых контрагентов были существенно улучшены торговые и инвестиционные условия. Расширение списка контрагентов также повлияло на уменьшение спредов и улучшение исполнения торговых приказов. Добавлены новые классы активов, такие как CFD на фондовые индексы, сырьевые товары и криптовалюты.

Таймлайн событий



АКЦИЯ

«Легкий старт»

Только до 04.02.2019 Вы можете начать работу с ICE FX без ограничений по сумме депозита.
Торгуйте и инвестируйте пополнив депозит на любую сумму!

Самостоятельная торговля

Минимальный депозит:

Без ограничений

~~Минимум 100 USD~~

Инвестиции

Минимальный депозит:

Без ограничений

~~Минимум 500 USD~~

[ПЕРЕЙТИ НА СТРАНИЦУ АКЦИИ](#)

Завершился четвертый этап конкурсов Genesis и Genesis Prime.

Завершился четвертый этап конкурсов Genesis и Genesis Prime.

Каждый конкурс проводится на постоянной основе и длится 1 год. Конкурсы состоят из четырех этапов, проходя которые участник получает: капитал для торговли и инвестиции в свой счет; бонус на депозит; повышение рейтинга и так далее.



Больше 110 заявок



42 конкурсанта



Предоставлено
больше 80 000 USD

За все время конкурсов было получено больше 110 полноценных заявок. Учитывались только заявки с открытым мониторингом счета. К участию в конкурсах было допущено 42 соискателя. По результатам промежуточных этапов конкурсов было отчислено 24 конкурсанта.

Оба конкурса направлены на поиск эффективных торговых стратегий. Условия конкурсов основаны на необходимости соблюдения строгих требований к риск-менеджменту торговли. Все счета должны иметь ограничения максимальных потерь за неделю и максимальной просадки за этап. Превышение максимальной просадки и использование токсичных методов торговли («мартингейл», «усреднение» и т. д.) ведет к исключению из конкурса.

Строгие требования к ограничению риска компенсировались денежным фондом двух конкурсов. Компания ICE FX предоставила для торговли конкурсантов более 80 000 USD, из которых каждый участник получил не менее 1 000 USD на начало конкурса.

Лучшая доходность за этап *

Этап	Genesis		Genesis Prime	
	Управляемый счет	Доходность	Управляемый счет	Доходность
1	Overload	7,63 %	Proftrade	6,96 %
2	RS_D1	18,66 %	Proftrade	61,87 %
3	SUPREMACY	2,37 %	FW_PA5_GP	2,88 %
4	Klod	7,07 %	FW_PA5_GP	10,83 %

* – Означает, какой из счетов (любого этапа) показал лучшую доходность в течение одного из этапов (13-недельный период).

Для трех счетов были открыты мульти-копии, однако в рейтинги «В» и «А» не попал ни один счет, несмотря на имевшийся потенциал у некоторых трейдеров. Единственный конкурсант, который перешел на четвертый этап, - Icarus. К сожалению, он превысил максимальную просадку и был исключен из конкурса.

Список счетов, которые участвовали в последнем этапе конкурсов Genesis и Genesis Prime (GP), и их доходность:

Четвертый этап

Управляемый счет	Доходность за последний этап	Доходность за весь конкурс	Решение по итогу этапа
Icarus	-20,74 %	-8,84 %	Исключен из конкурса

Третий этап

Управляемый счет	Доходность за последний этап	Доходность за весь конкурс	Решение по итогу этапа
Proftrade (GP)	-4,31 %	66,71 %	Исключен из конкурса
RS_D1	1,97 %	24,97 %	Переведен на 4 этап
Trixet	-14,88 %	2,23 %	Исключен из конкурса
Alcapital	-7,87 %	2,01 %	Исключен из конкурса
AlexFX	-0,06 %	4,49 %	Повторное прохождение 3 этапа
Expansion	-2,06 %	2,80 %	Повторное прохождение 3 этапа
DesertSky	-2,17 %	2,42 %	Повторное прохождение 3 этапа

Второй этап

Управляемый счет	Доходность за последний этап	Доходность за весь конкурс	Решение по итогу этапа
Everest	6,52 %	7,4 %	Переведен на 3 этап
KANSAZ	1,98 %	2,49 %	Переведен на 3 этап
SUPREMACY	-11,93 %	-9,84 %	Исключен из конкурса

Первый этап

Управляемый счет	Доходность за последний этап	Доходность за весь конкурс	Решение по итогу этапа
Tradeprof	-8,22 %	-8,22 %	Исключен из конкурса
Lelouch	-13,06 %	-13,06 %	Исключен из конкурса
LockMaker (GP)	-11,48 %	-11,48 %	Исключен из конкурса
FW_PA5_GP (GP)	10,83 %	10,83 %	Переведен на 2 этап
Klod	7,07 %	7,07 %	Переведен на 2 этап
dayswingTR	-7,98 %	-7,98 %	Исключен из конкурса

Стоит отметить, что конкурсы Genesis и Genesis Prime проводятся поэтапно и участником можно стать в начале любого этапа. Подать заявку можно за 2 недели до начала этапа, а именно до 18 марта 2019 г.

Учитывая непостоянный характер спекулятивного рынка, конкурс не требует обязательного получения дохода по результату каждого периода.

В зависимости от торгового результата трейдер может быть переведен на следующий этап или отправлен на повторное прохождение неудачного для него этапа.

Строгость к торговле конкурсантов обусловлена дальнейшим управлением внушительными инвестиционными средствами. Поэтому ICE FX тщательно отбирает потенциально доходные системы, что, в свою очередь, отсеивает многих трейдеров, не соблюдающих системность торговли и контролируемый риск. Следовательно, трейдеры с качественными торговыми системами получают существенные средства в качестве капитала управляющего и инвестиционные средства от 50 000 USD, а также возможность войти в рейтинг «А» и попасть в состав Индекса.

Новые торговые инструменты и контрагенты EXANTE и DIVISA UK

ICE FX расширила линейку торговых инструментов, добавив новые классы активов: CFD на Индексы, CFD на сырьевые товары и CFD на криптовалюты. Клиенты теперь могут использовать 118 различных инструментов для торговли, которые условно разделены на 5 классов активов:



[Инструменты](#) [Торговые условия](#) [Маржинальные требования](#)

Подключены новые контрагенты

Количество внешних контрагентов, на которых производится вывод всех клиентских позиций, увеличилось до четырех.



КОНТРАГЕНТЫ ICE FX

Региональный партнер

Региональный партнер – это статус, который позволяет быть эксклюзивным представителем в своем регионе и получить массу других привилегий от ICE FX.

Чем больше стаж работы Регионального партнера с ICE FX, тем больше привилегий он получает:












1. привязку всех клиентов из региона;
2. возможность выбора клиентской программы;
3. статус Elite;
4. компенсацию до 30 % на рекламу и до 50 % на офис (после 12 и 24 месяцев успешного сотрудничества соответственно);
5. получение бонусного сертификата.

Подробная схема вознаграждения и требований представлена на странице [«Региональный партнер»](#).

Полная компенсация комиссии за пополнение счета

ICE FX компенсирует полную комиссию за пополнение счета любым способом до 19.01.2019. Пополнить свой счет можно следующими способами:

- банковским переводом;
- банковскими картами VISA/MasterCard;
- с помощью платежных систем Webmoney, ePayments, Skrill и NETELLER.

Способ пополнения	Издержки	Способ пополнения	Издержки
 Банковский перевод на счет Компании	0%	 ePayments	0%
  via  DIXIPAY	0%	 Skrill	0%
  via  Skrill	0%	 NETELLER	0%
		 WebMoney	0%

Компенсация действует как для новых, так и нынешних клиентов Компании вне зависимости от их активности и размера пополнения счета.

ПОПОЛНЕНИЕ И СНЯТИЕ СРЕДСТВ

Показатели Компании

КАПИТАЛИЗАЦИЯ	НАЧАЛО ГОДА	КОНЕЦ ГОДА	ИЗМЕНЕНИЕ
Суммарная	\$2 164 041	\$1 646 984	- \$517 057
Торговых счетов	\$15 844	\$44 623	+ \$28 779
Управляемых счетов	\$2 148 197	\$1 602 361	- \$545 836
в том числе средств управляющих	\$750 766	\$564 112	- \$186 654
в том числе средств инвесторов	\$1 397 431	\$1 038 250	- \$359 181

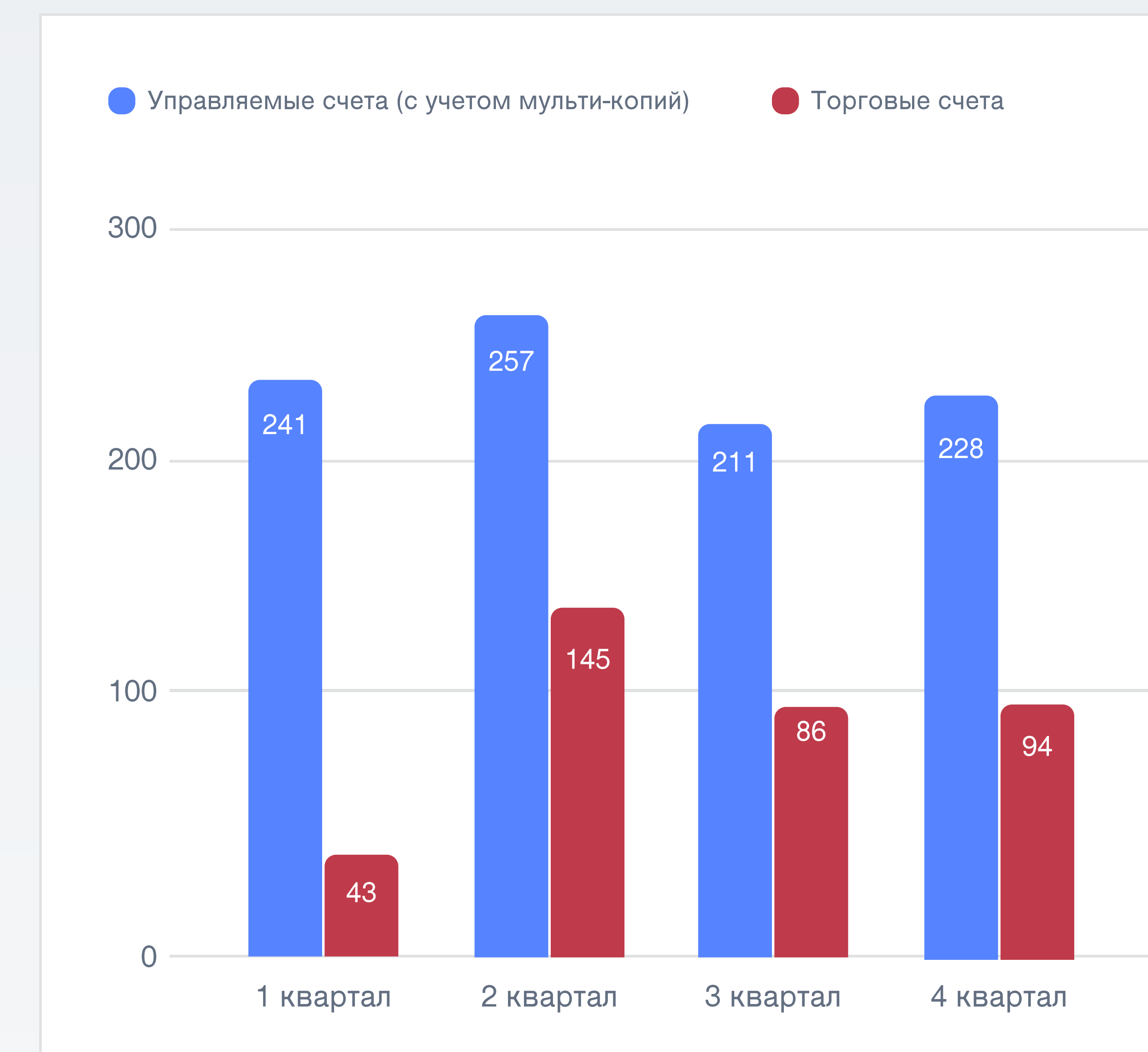
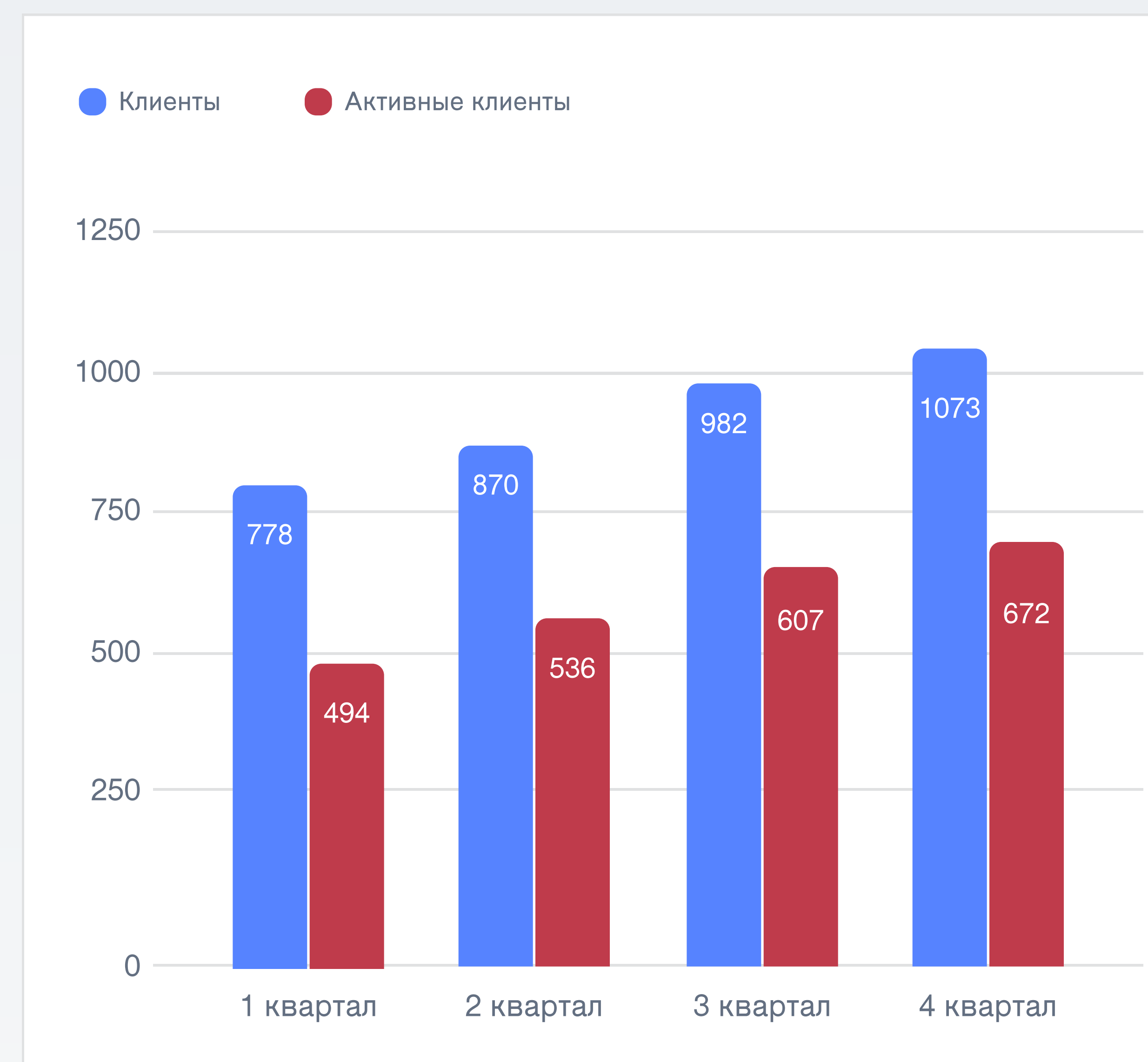
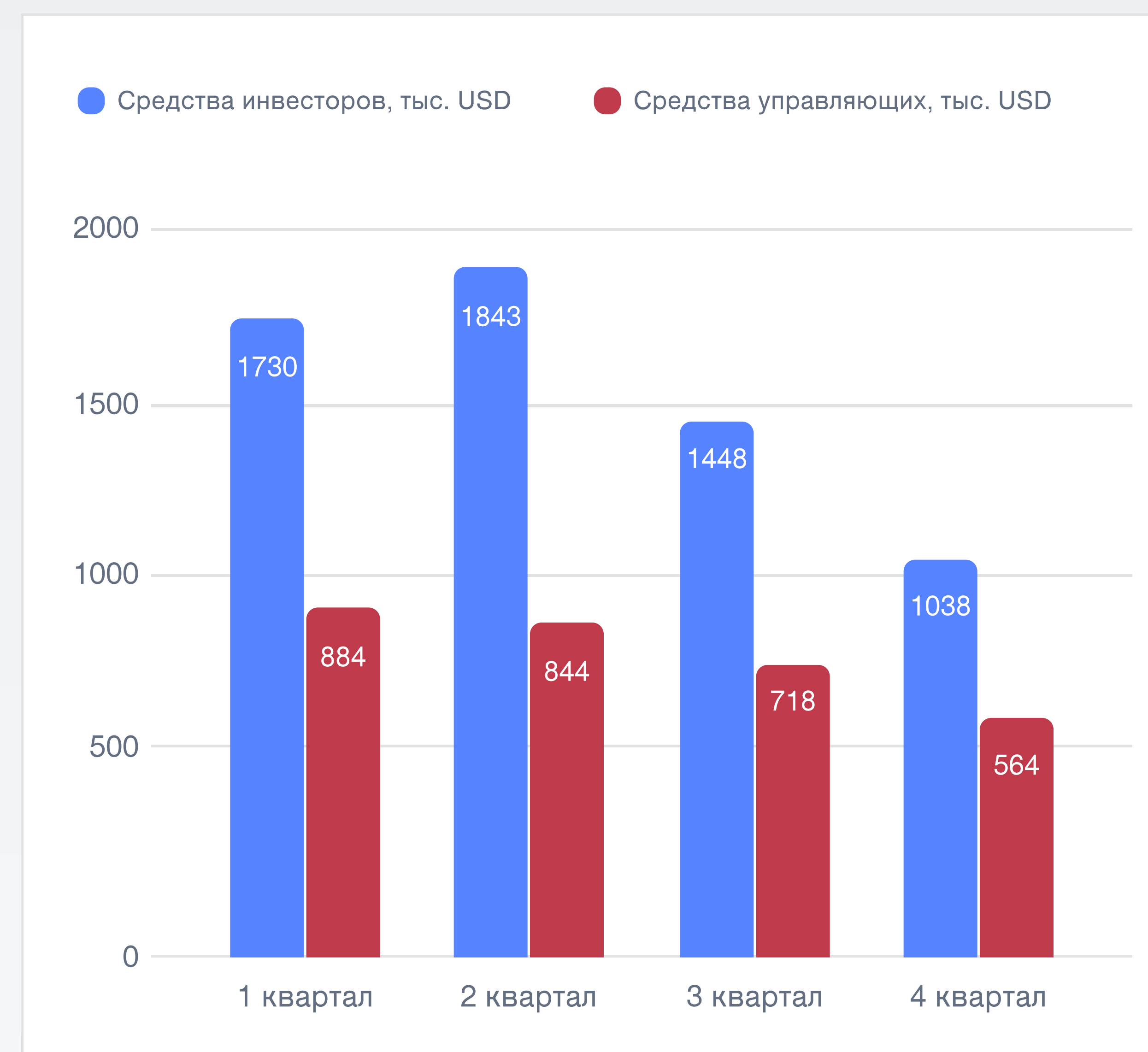
	НАЧАЛО ГОДА	КОНЕЦ ГОДА	ИЗМЕНЕНИЕ
Клиентов	635	1073	+ 438
в том числе активных	391	672	+ 281
Активных партнеров	25	61	+ 36
Торговых счетов	36	94	+ 58
Управляемых счетов	300	228	- 72
в том числе базовых	114	79	- 35
в том числе мульти-копий	180	149	- 31

Клиентская активность

	Январь	Февраль	Март	Апрель	Май	Июнь	Июль	Август	Сентябрь	Октябрь	Ноябрь	Декабрь
Клиенты	671	728	778	800	850	870	896	922	982	1004	1054	1073
Активные клиенты	427	463	494	511	529	536	577	592	607	629	655	672
Активные партнеры	29	30	25	27	28	30	30	30	52	54	56	61

Торговые и инвестиционные счета

	Январь	Февраль	Март	Апрель	Май	Июнь	Июль	Август	Сентябрь	Октябрь	Ноябрь	Декабрь
Торговые счета	36	42	43	49	100	145	144	70	86	87	128	94
Управляемые счета	302	294	241	225	237	257	259	229	211	245	249	228



Капитализация ICE FX включает в себя средства Компании, которая предоставляет их для управляющих из рейтинга «А», управляющих на стадии тестирования и конкурсантов Genesis и Genesis Prime. Ликвидация Индекса iSelect и нескольких счетов из рейтинга «А» в конце года, а также изменение объема средства в других Индексах, повлекли существенное снижение активного капитала.

Кроме этого, совокупный отрицательный результат инвестиционной системы за 2018 год, в отличие от результата 2017 года, повлек за собой снижение клиентской капитализации. Подобное следствие является нормой для компаний, предлагающих инвестиционные услуги с ограниченным риском для розничного сегмента. Подробный отчет о работе индексных управляющих, причинах отрицательного результата и перспективах на 2019 год отображен ниже в разделе «Инвестиции. Торговые результаты».

Инвестиции

Торговые результаты

Топ 3 счета по доходности за 2018 год

LuckyPound / Polar

68.04 %

Alfa

20.77 %

Celdic

10.56 %



Рейтинг А

Управляемый счет	Мультипликатор	Доходность						Максимальная просадка	a(prof/max(DD))	
		Год			Всего				Счет	Инвестор
		Счет	Инвестор		Счет	Инвестор				
LuckyPound / Polar	x1	11.01%	9.70%	10.13%	61.36%	47.59%	54.77%	11.27%	1.67	1.34
	x6	68.04%	58.96%	61.95%	857.12%	535.25%	690.95%	52.08%	2.41	1.82
Celdic	x1	10.56%	8.20%	8.96%	35.65%	27.26%	31.99%	18.09%	0.64	0.50
	x6	7.97%	2.06%	3.92%	74.38%	44.01%	59.50%	77.05%	0.29	0.18
Frame	x1	7.35%	6.65%	6.88%	66.42%	51.44%	59.61%	25.49%	0.79	0.63
	x6	-39.66%	-39.66%	-39.66%	188.72%	107.62%	150.18%	92.28%	0.50	0.33
Alfa	x1	6.21%	5.39%	5.66%	38.88%	30.47%	35.00%	15.98%	0.78	0.63
	x6	20.77%	18.08%	18.94%	172.70%	124.11%	150.92%	70.18%	0.62	0.48
Barracuda / Marcus	x1	-0.64%	-1.63%	-1.30%	49.85%	36.57%	43.95%	33.93%	0.91	0.68
	x6	-68.92%	-68.93%	-68.93%	97.53%	35.02%	69.54%	94.86%	0.60	0.23
MultiTrend	x1	-1.61%	-1.75%	-1.69%	2.55%	1.62%	2.10%	3.42%	0.50	0.32
	x6	-10.57%	-11.24%	-10.94%	13.53%	7.91%	10.80%	19.13%	0.47	0.28
SmartQuant	x1	-3.38%	-3.72%	-3.60%	-0.89%	-1.62%	-1.38%	10.18%	-0.06	-0.11
	x6	-28.54%	-29.81%	-29.36%	-18.62%	-21.68%	-20.68%	51.84%	-0.26	-0.30
Naragot	x1	-3.67%	-4.92%	-4.51%	-5.06%	-6.32%	-5.91%	17.67%	-0.36	-0.45
	x6	-39.33%	-43.10%	-41.87%	-44.06%	-47.61%	-46.48%	72.71%	-0.72	-0.77
ProfitLine	x1	-4.20%	-4.56%	-4.43%	26.25%	19.50%	23.13%	13.22%	-0.78	0.59
	x6	-35.79%	-36.53%	-36.27%	139.70%	86.97%	114.99%	62.28%	0.72	0.49
Mercurius	x1	-7.73%	-7.61%	-7.61%	16.10%	10.12%	13.71%	21.01%	0.35	0.23
	x6	-56.46%	-56.13%	-56.13%	-17.45%	-34.87%	-24.62%	85.66%	-0.10	-0.22
Solandr	x1	-11.99%	-11.99%	-11.99%	3.14%	1.86%	0.14%	16.16%	0.07	0.00
	x6	-59.83%	-59.83%	-59.83%	-21.31%	-30.23%	-25.21%	69.98%	-0.12	-0.17
Clever	x1	-15.79%	-15.84%	-15.82%	-13.43%	-13.49%	-13.47%	15.25%	-1.11	-1.12
	x6	-67.18%	-67.29%	-67.25%	-60.94%	-61.09%	-61.04%	65.23%	-1.08	-1.08
Asmodeux	x1	-21.01%	-21.82%	-21.56%	-2.25%	-5.21%	-3.69%	21.86%	-0.04	-0.09
	x6	-85.84%	-86.31%	-86.16%	-59.51%	-63.72%	-61.52%	83.27%	-0.33	-0.37

Индексы

Управляемый счет	Мультипликатор	Доходность						Максимальная просадка	a(prof/max(DD))	
		Месяц			Всего				Счет	Инвестор
		Счет	Инвестор		Счет	Инвестор				
iComposite	x1	-2.20%	-2.86%	-2.64%	13.69%	7.34%	10.63%	5.21%	0.91	0.50
	x6	-14.93%	-17.94%	-16.95%	87.02%	35.64%	60.51%	28.09%	0.91	0.42
iPro	x1	-7.07%	-7.38%	-7.28%	2.33%	-1.88%	0.31%	8.40%	0.10	-0.08
	x6	-36.97%	-38.12%	-37.74%	1.49%	-19.60%	-9.17%	42.42%	0.01	-0.18
iMain	x1	3.11%	2.07%	2.42%	26.06%	17.10%	21.71%	7.80%	1.12	0.76
	x6	10.87%	5.30%	7.14%	177.66%	88.86%	131.03%	40.82%	1.10	0.63
iMinor	x1	-23.28%	-24.07%	-23.82%	-18.00%	-20.37%	-19.43%	22.38%	-0.47	-0.53
	x6	-81.78%	-82.74%	-82.59%	-75.51%	-78.91%	-77.62%	80.05%	-0.68	-0.72

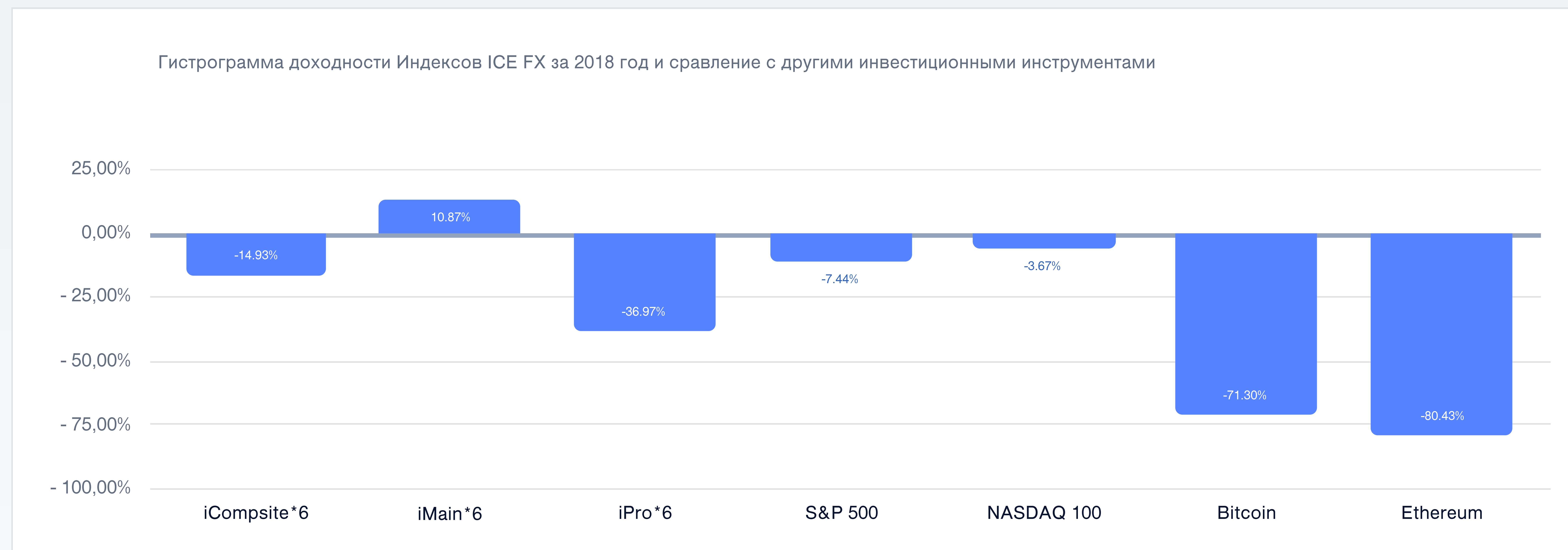
Миграция УС по рейтингам

Изменение рейтинга	Управляемый счет	Комментарий
A→Архив	LionTrader (10000640)	По решению риск-менеджера
C→Архив	LBowSoupKitchen (10000643)	Нарушение РМ
C→Архив	Tacitus (10000936)	Закрыт риск-менеджером
C→Архив	Orthodox (10001691)	Нарушение РМ
C→Архив	Senator (10001955)	Нарушение РМ
C→Архив	Predators (10002154)	Нарушение РМ
C→Архив	Onix (10002101)	Нарушение РМ
C→Архив	Kinetic (10002525)	Нарушение РМ
C→Архив	RedRock (10002441)	Нарушение РМ
C→Архив	Reflex (10002738)	Нарушение РМ
C→Архив	Hawksbill (10002685)	Нарушение РМ
C→Архив	Rafael (10001859)	Нарушение РМ
C→Архив	Cortez (10002231)	Нарушение РМ
C→Архив	Beta (10002347)	Нарушение РМ
C→Архив	Blake (10002679)	Нарушение РМ
C→Архив	Anaxis (10002682)	Нарушение РМ
C→Архив	Avernus (10002688)	Нарушение РМ
C→Архив	Endymion (10002700)	Нарушение РМ
C→B	Constar (10000684)	По условиям нахождения
C→B	Carbon (10001922)	По условиям нахождения
C→B	Incline (10002673)	По условиям нахождения
C→Архив	Premonit (10002694)	По условиям нахождения
C→Архив	Prosperity (10002273)	По условиям нахождения
C→Архив	Standard (10002147)	По условиям нахождения
C→Архив	GaltFX (10003487)	По условиям нахождения

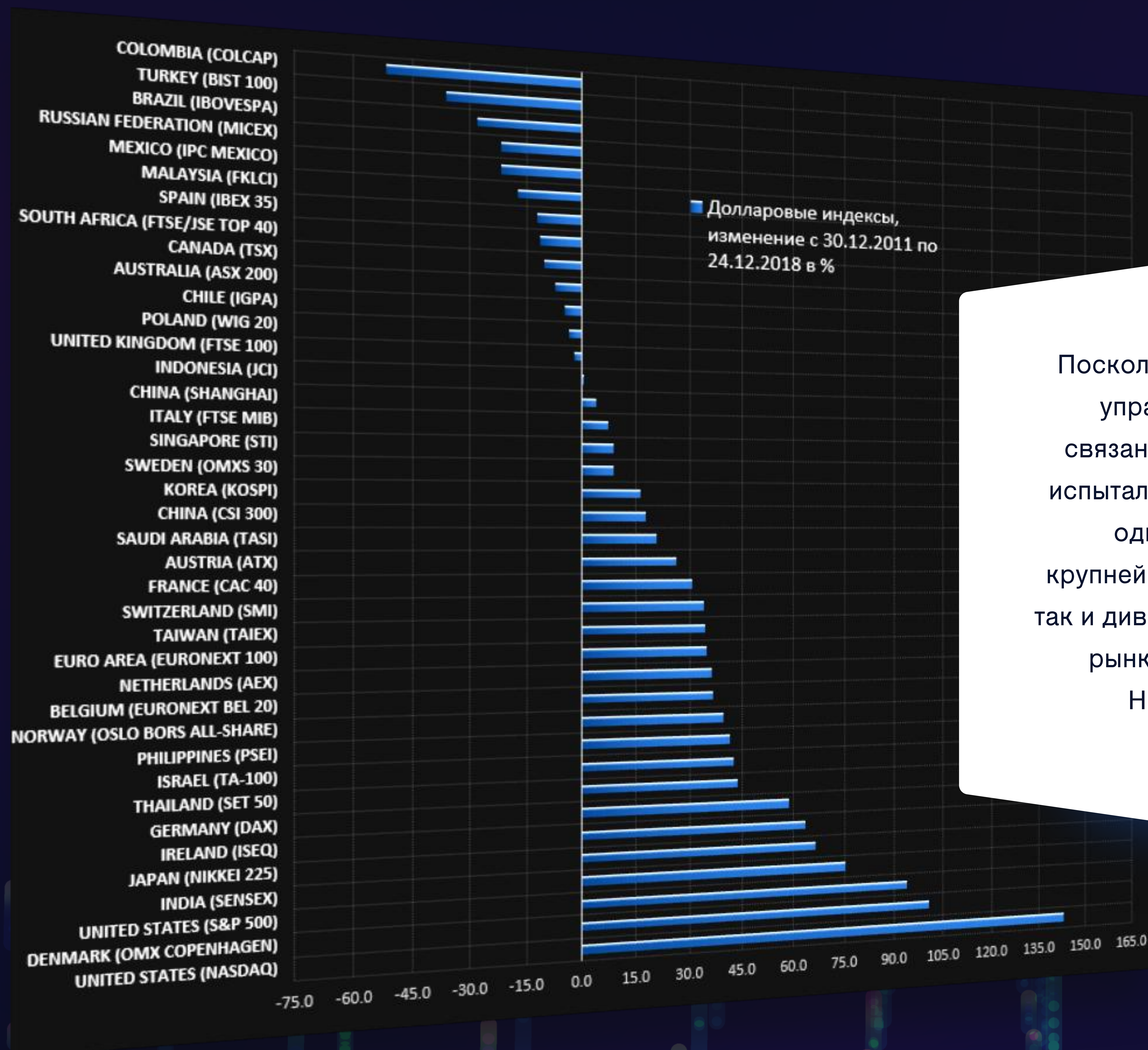
Изменение рейтинга	Управляемый счет	Комментарий
C→Архив	Apiga (10001783)	По условиям нахождения
C→Архив	Jaguar (10002507)	По условиям нахождения
C→Архив	TradeRaids (10002802)	По условиям нахождения
C→Архив	Vogelsberg (10001874)	По условиям нахождения
C→Архив	FireFox (10001045)	По условиям нахождения
C→Архив	SunnichPr (10004010)	По условиям нахождения
C→Архив	Omnitus (10002697)	По условиям нахождения
C→Архив	Artemisia (10000746)	По условиям нахождения
C→Архив	Trinity (10001710)	По условиям нахождения
C→Архив	Avalon (10001865)	По условиям нахождения
C→Архив	Takora (10003579)	По условиям нахождения
C→Архив	Vigal (10003702)	По условиям нахождения
C→Архив	Rexbrew (10004054)	По условиям нахождения
C→Архив	Julmaran (10004196)	По условиям нахождения
C→Архив	Stallion (10001830)	По условиям нахождения
C→Архив	Typhon (10002676)	По условиям нахождения
C→Архив	Ortus (10002741)	По условиям нахождения
C→Архив	Urban (10002580)	По условиям нахождения
C→Архив	Elysium (10000930)	По условиям нахождения
C→Архив	FX10 (10001051)	По условиям нахождения
C→Архив	Redwind (10003582)	По условиям нахождения
C→Архив	MooseProof (10002833)	По условиям нахождения
C→Архив	Phobos (10002863)	По условиям нахождения
C→Архив	Phoenix (10002714)	По условиям нахождения

Годовые итоги инвестиционной системы ICE FX

По итогам 2018 года Индексы ICE FX показали следующие результаты:



Прошедший год принес убытки инвесторам практически всех финансовых рынков: упали фондовые индексы всего мира (график результатов с начала года см. ниже); испытал сильное падение криптовалютный рынок (наиболее известные криптовалюты упали с начала года на 70–90 %); возникли сложности в торговле большинства масштабируемых торговых систем на Форексе.



Поскольку результаты большинства фондов и управляющих компаний в мире напрямую связаны с результатами фондовых индексов, испытали падение (при пересчете результата в одну базовую валюту – доллар США) как крупнейшие финансовые конгломераты в мире, так и диверсифицированные по отраслям и/или рынкам фонды (из иностранных – Berkshire Hathaway, из известных в странах СНГ – Арсагера, АФК Система).

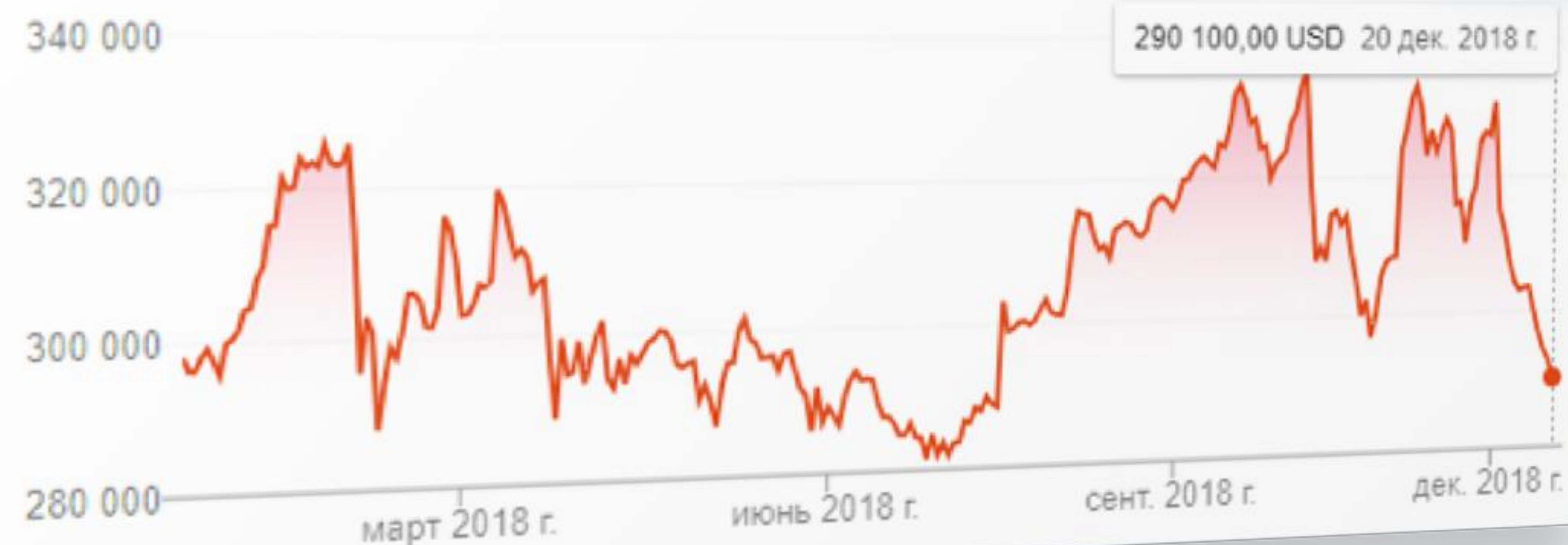
Источник –
<https://spydell.livejournal.com/>

Berkshire Hathaway Inc. Class A
NYSE: BRK.A

290 100,00 USD -2 940,00 (1,00 %) ↓

Закрыто: 20 дек., 16:30 GMT-5 · Отказ от обязательств
До открытия сессии 292 000,00 +1 900,00 (0,65 %)

1 день 5 дней 1 месяц 6 месяцев С1ЯН 1 год 5 лет

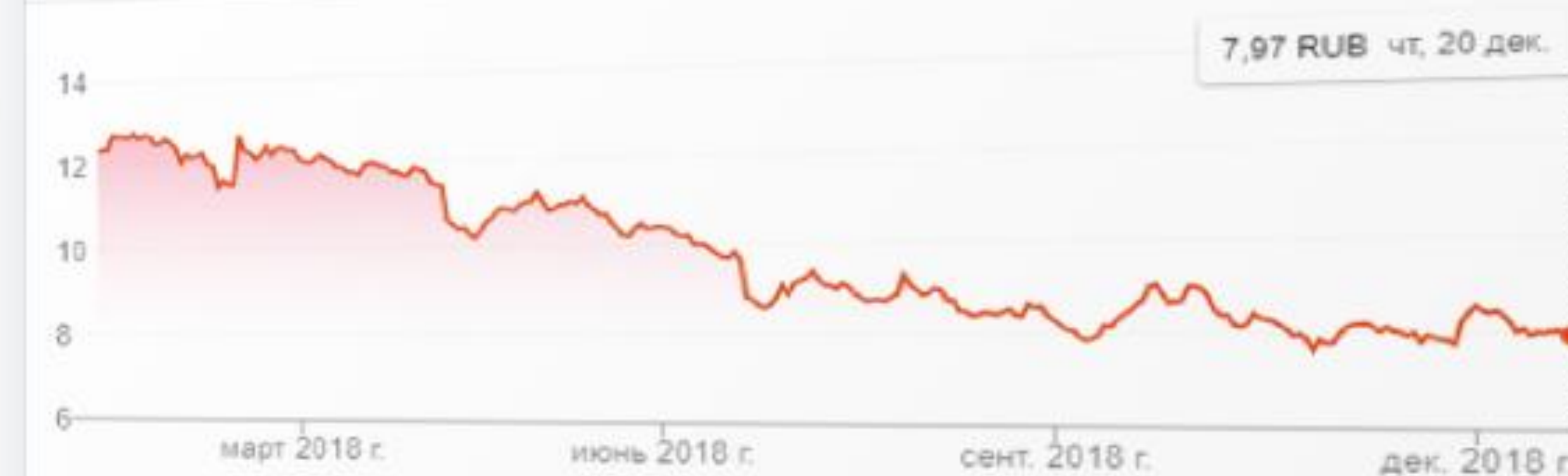


AFK Sistema PAO
MCX: AFKS

7,93 RUB -0,040 (0,50 %) ↓

21 дек., 16:12 GMT+3 · Отказ от обязательств

1 день 5 дней 1 месяц 6 месяцев С1ЯН 1 год 5 лет Макс.



Открытие	7,95	Див. доход	9,96 %
Максимум	7,99	Пред. закрытие	7,97
Минимум	7,89	52 нед. макс.	14,10
Рын. кап.	76,52 млрд	52 нед. мин.	7,60
Цена/приб.	-		

В целом для 2018 года характерна аномально отрицательная доходность для огромного спектра финансовых активов. По данным Deutsche Bank, 93 % активов принесли в 2018 году убыток и это максимальное значение данного показателя за всю историю наблюдений с 1901 года.

Аналитики Morgan Stanley сделали похожий вывод, показав, что ни один класс инвестиций в этом году не смог превзойти инфляцию. Подобного не было даже во времена финансового кризиса 2008–2010 гг.:

Exhibit 1: 2018: A historically bad year

Ranking	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018
1	REITS	MSCI EM	MSCI China	MSCI China	US 10yr	MSCI EM	REITS	US 10yr	MSCI China	Russell 2000	REITS	MSCI Japan	Commodities	MSCI China	US 2yr
2	MSCI	Commodities	REITS	MSCI EM	US 2yr	MSCI China	Russell 2000	Inflation Bonds	MSCI Europe	S&P 500	S&P 500	REITS	Russell 2000	MSCI EM	US HY
3	MSCI Europe	MSCI Japan	MSCI Europe	Commodities	US Agg. Bond	Global Hy	Commodities	EM\$Sov Credit	Global Hy	MSCI Japan	US 10yr	US 10yr	US HY	MSCI Europe	US Agg. Bond
4	Russell 2000	MSCI China	MSCI EM	MSCI Europe	EM Local Debt	US HY	MSCI EM	US IG	REITS	MSCI Europe	MSCI China	EM\$Sov Credit	Global Hy	MSCI Japan	US 10yr
5	MSCI Japan	EM\$Sov Credit	Russell 2000	Inflation Bonds	US IG	Commodities	MSCI Japan	US Agg. Bond	MSCI EM	US HY	US IG	S&P 500	S&P 500	S&P 500	REITS
6	Inflation Bonds	REITS	S&P 500	US 10yr	Inflation Bonds	MSCI Europe	US HY	REITS	EM\$Sov Credit	Global Hy	EM\$Sov Credit	US 2yr	MSCI EM	Russell 2000	US IG
7	Global Hy	MSCI Europe	Commodities	US 2yr	EM\$Sov Credit	EM\$Sov Credit	S&P 500	US HY	Russell 2000	MSCI China	US Agg. Bond	US Agg. Bond	EM\$Sov Credit	EM Local Debt	S&P 500
8	Commodities	S&P 500	Global Hy	US Agg. Bond	US HY	REITS	Global Hy	Global Hy	S&P 500	REITS	Russell 2000	US IG	REITS	Global Hy	Global Hy
9	EM\$Sov Credit	Russell 2000	US HY	EM\$Sov Credit	Global Hy	Russell 2000	EM Local Debt	S&P 500	US HY	US 2yr	Inflation Bonds	MSCI Europe	US IG	EM\$Sov Credit	Inflation Bonds
10	US HY	Global Hy	EM\$Sov Credit	S&P 500	Commodities	S&P 500	EM\$Sov Credit	US 2yr	EM Local Debt	US IG	US HY	Global Hy	EM Local Debt	REITS	EM\$Sov Credit
11	S&P 500	EM Local Debt	US Agg. Bond	US IG	MSCI Japan	US IG	US 10yr	EM Local Debt	US IG	US Agg. Bond	US 2yr	Russell 2000	Inflation Bonds	Inflation Bonds	EM Local Debt
12	US IG	US HY	MSCI Japan	EM Local Debt	Russell 2000	EM Local Debt	US IG	Russell 2000	Inflation Bonds	MSCI EM	Global Hy	US HY	MSCI Japan	Commodities	Commodities
13	US Agg. Bond	US Agg. Bond	US Agg. Bond	Global Hy	S&P 500	Inflation Bonds	US Agg. Bond	Commodities	MSCI Japan	Inflation Bonds	MSCI EM	Inflation Bonds	US Agg. Bond	US HY	Russell 2000
14	US 10yr	US 10yr	US IG	US HY	REITS	MSCI Japan	MSCI China	MSCI Europe	US Agg. Bond	EM Local Debt	EM Local Debt	MSCI China	MSCI China	US IG	MSCI Japan
15	EM Local Debt	US IG	US 2yr	Russell 2000	MSCI Europe	US Agg. Bond	MSCI Europe	MSCI Japan	US 10yr	US 10yr	MSCI Japan	EM Local Debt	US 2yr	US Agg. Bond	MSCI Europe
16	MSCI China	US 2yr	US 10yr	MSCI Japan	MSCI China	US 2yr	Inflation Bonds	MSCI EM	Commodities	EM\$Sov Credit	MSCI Europe	MSCI EM	US 10yr	US 10yr	MSCI EM
17	US 2yr	Inflation Bonds	EM Local Debt	REITS	MSCI EM	US 10yr	US 2yr	MSCI China	US 2yr	Commodities	Commodities	Commodities	MSCI Europe	US 2yr	MSCI China

Source: Bloomberg, Morgan Stanley Research; Not: We compute annual returns minus US headline inflation. Green means returns (in USD) beat inflation, and red means returns trailed inflation. 2018 data as of December 17, 2018.

К сожалению, негативные тренды прошедшего года затронули и состав управляющих рейтинга «А» (все они отбирались с учетом масштабируемости торговли на крупные суммы средств). Так, процент успешных управляющих ICE FX хоть и заметно выше 7 % положительных активов на мировых рынках в этом году, общий результат не находится в «положительной зоне». Рассмотрим всех по отдельности, начиная с состава индекса iPro.



[Polar / Lucky Pound](#)

Несмотря на необычно низкую торговую активность управляющего, вызванную, в свою очередь, низкой волатильностью на Форексе (см. ниже), ему удалось получить прибыль в этом году. Причина получения прибыли на фоне убытков схожих с ним управляющих кроется в жесткой фильтрации входов лишь после наиболее сильных движений на рынке. Грубо говоря, пока остальные входили и получали убытки на «вялом» рынке, управляющий счета Lucky Pound наблюдал за рынком со стороны. И правда говорят – «кто не работает, тот ест».



Solandr

Впервые за 5 лет торговли управляющий Solandr закрыл 2018 год с убытком на своих личных счетах:

	Янв	Фев	Мар	Апр	Май	Июн	Июл	Авг	Сен	Окт	Ноя	Дек	Год
2013									0.0%	0.0%	1.3%	10.6%	12.0%
2014	4.2%	6.9%	-1.3%	-4.9%	1.8%	-0.8%	-2.0%	3.1%	-1.0%	10.9%	7.8%	3.7%	31.2%
2015	-6.5%	1.7%	0.0%	14.1%	10.6%	-6.7%	1.0%	20.8%	6.9%	-2.2%	2.2%	0.9%	47.2%
2016	-0.2%	14.6%	-2.7%	0.0%	7.2%	0.0%	0.6%	2.3%	-1.4%	-3.3%	2.1%	6.5%	27.3%
2017	-1.2%	0.1%	4.3%	-2.6%	1.4%	1.6%	4.3%	0.3%	0.8%	0.9%	1.0%	0.1%	11.5%
2018	0.1%	-2.3%	-1.8%	0.2%	-2.2%	3.0%	-2.9%	3.4%	-1.8%	-5.0%	0.6%	0.0%	-8.6%

К сожалению, этот год стал особенно неудачным для всех трейдеров, торгующих пробой на EURUSD. Помимо Solandr убытки при торговле пробоев как в ICE FX, так и на других площадках получили и все остальные трейдеры, использующие этот принцип, – DIMTrade, Asmodeux, Naragot и другие.



[MultiTrend](#)

На фоне низкой волатильности управляющие решили воздержаться от торговли, что, по-видимому, оказалось правильным решением: пока «коллеги» получали убытки, команда MultiTrend находилась вне рынка. Тем не менее за год все равно получен небольшой убыток. Управляющие заявляют, что торговля возобновится с возвратом волатильности на рынок в следующем году.

Волатильность доходности

[Индекс iPro](#)

Clever

Не лучший год для управляющих. Кроме того, результаты в ICE FX подпортили некоторые технические проблемы: торговля управляющего предполагает очень малое среднее время удержания сделок, поэтому небольшие отличия, некритичные для других, здесь могут сильно повлиять на результат. Тем не менее все технические проблемы были решены и на своем основном счете управляющие закрыли год с небольшой, но прибылью. Стоит отметить, что с 2014 года ни один год не был закрыт с убытком, поэтому ожидаем прибыль и в будущем году.



Celdic

Торговая логика управляющего Celdic схожа с логикой управляющего Lucky Round: как правило, берутся лишь наиболее сильные трендовые движения на рынке, в остальное время торговля не ведется. Это может приводить к длительным периодам отсутствия движений на счете, однако в годы, скудные на трендовые движения, это приводит к отсутствию крупных убытков.



[ProfitLine](#)

Управляющий ProfitLine имеет оригинальную систему фильтрации, не завязанную на силу движения. Благодаря этому торговля ведется чаще и на трендовом рынке может быть взята большая прибыль. Результаты при этом не коррелируют с абсолютным большинством других трейдеров, что является однозначным показанием к присутствию трейдера в портфеле. Однако в прошедшем году данный подход привел к небольшому убытку.



Frame

Управляющий Frame – единственный из управляющих ICE FX, использующий принципиально иной источник данных для анализа ситуации на рынке (кроме котировок), – данные рыночного сентимента. 2018 год закрыт им с прибылью, что показывает, что в механике рынка не произошло фундаментальных сдвигов: «крупные игроки» по-прежнему являются выигрывающей стороной, а «мелкие спекулянты» – проигрывающей, стоящей в среднем против рынка. К тому же это единственный управляющий, имеющий непрерывную прибыльную торговую историю продолжительностью более 8 лет. К сожалению, он же – единственный управляющий рейтинга «А», использующий весьма агрессивный подход к риск-менеджменту, что уже вылилось в получении крупного убытка в начале 2018 года. Поэтому присутствие его в портфеле оправдано, но завышать долю его в портфеле не стоит.



[DIMTrade / SmartQuant](#)

Несмотря на использование большого числа разных торговых систем (на счете в ICE FX используется 7 различных торговых систем), большинство из них являются трендовыми (только такие системы способны дать масштабируемый результат, который не исчезнет с ростом суммы в управлении) и при этом ориентируются на торговлю как «крупных», так и «средних» трендов. Поскольку «крупных» и «средних» трендов в 2018 году было очень мало, это вылилось в убыточный результат по итогам года.

Индекс iMinor

Состав индекса iMinor в 2018 году получил отрицательный результат без каких-либо намеков на положительную тенденцию. Это вызвано как наличием в составе более «рискованных» торговых систем, получающих более крупные убытки на «неудобном» рынке, так и общей ситуацией отсутствия трендов.



Alfa

Единственный управляющий Индекса, показавший небольшой положительный результат в этом году. Несмотря на трендовую торговлю и торговлю как во время сильных трендовых движений, так и во время движений «средней» величины, манименеджмент используемой системы завязан на силу импульса (более сильные движения берутся большим плечом), поэтому на подобном «неудобном» для трендовых систем рынке управляющему удалось не потерять.



Asmodeux

Как уже было сказано выше, 2018 год стал очень тяжелым для пробойных систем на паре EURUSD, что вылилось в убытки и для управляющего Asmodeux. Несмотря на впечатляющий опыт торговли трейдера, стоящего за счетом Asmodeux, рынок не дал ни одного шанса на прибыль никому из подобных управляющих.

[Индекс iMinor](#)

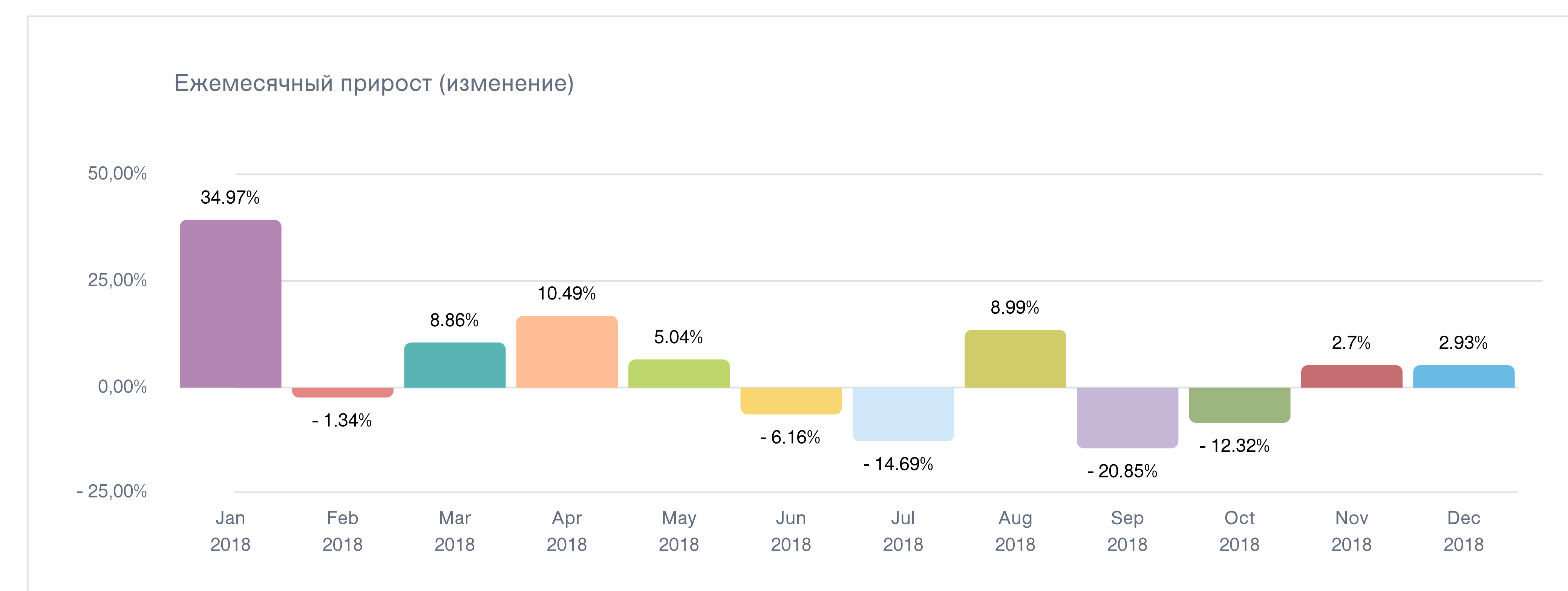
[Atractor](#)

Управляющий счета Atractor относится к классу трейдеров, торгующих тренды средней и большой величины на множестве валютных пар (как на мажорах, так и на кроссах). 2018 год был особенно тяжелым для всех подобных трейдеров. Если на мажорах (EURUSD, GBPUSD) некоторым трендовым трейдерам (Polar, Celdic, Alfa) еще удалось получить прибыль за счет фильтрации наиболее крупных движений, то на кроссах (EURAUD, GBPAUD) прибыль не получил ни один из них. Поскольку торговля Atractor сосредоточена в большей степени на кроссах и менее ликвидных мажорах, этот год стал для него отрицательным и худшим за всю историю реальной торговли.



[Naragot](#)

«Новичок» рейтинга «А», к сожалению, стартовал в ICE FX не с начала года и за 10 месяцев торговли получил убыток. Тем не менее на своих личных счетах управляющий получил по итогам года небольшую, но прибыль, обусловленную хорошим торговым результатом начала года.



Несмотря на полученный убыток при торговле пробоев на EURUSD, прибыль с торговли пробоев на парах GBPUSD и XAUUSD (золото/доллар) смогла покрыть полученный убыток и год завершился для управляющего в положительной зоне.

Причины

Финансовые рынки – это, в большинстве случаев, невероятно сложные системы, состоящие из миллионов участников с разными целями и ресурсами. Поэтому сказать что-либо с большой уверенностью зачастую вовсе невозможно и любое событие здесь для стороннего наблюдателя не более, чем игра вероятностей.

Тем не менее о чем-то судить все же можно. Во-первых, прошедший год оказался очень тяжелым для подавляющего большинства трендовых трейдеров. Это не проблема какого-то одного или небольшой группы из них. Мы можем говорить об этом с уверенностью, поскольку плохие результаты получили большинство подобных трейдеров – как на площадке ICE FX, так и за ее пределами. При этом большинство профессиональных трейдеров – одиночки, и поэтому даже при использовании схожих торговых идей они подходят к их отработке по-разному, но большинством из них получен убыток за год. Более того, поскольку отбор в Индексы и рейтинг «А» проводится по весьма жестким критериям, результат трейдеров Компании заметно превосходит результат широкой выборки профессиональных трендовых трейдеров на других площадках. Это заметно как по не очень удовлетворительным результатам «песочницы» управляющих (сосредоточенных в основном в рейтинге «С», а непрошедших трейдеров – в «архиве»), так и по результатам других подобных управляющих, о сотрудничестве с которыми задумывались портфельные и риск-менеджеры ICE FX.

Во-вторых, убытки обусловлены преимущественно отсутствием выраженных продолжений трендовых движений как на мажорах, так и на кроссах и как минимум частично являются следствием политики Европейского центрального банка (ЕЦБ). При этом в 2019 году заканчивается цикл понижения ставок ЕЦБ и ожидается окончание цикла повышения ставок Федеральной резервной системой США. Кроме того, в 2019 году прекращаются полномочия председателя ЕЦБ Марио Драги. При этом на финансовых рынках всего мира наблюдается выраженный спад: фондовые индексы всего мира (кроме одной страны – Саудовской Аравии, где происходит текущее сильное падение цены на нефть, но это, похоже, ненадолго) закрыли год в красной зоне. История показывает, что подобные события способны спровоцировать повышенную волатильность и тренды на парах-мажорах, поэтому логично ожидать выгодное трендовым управляющим повышение волатильности и формирование сильных трендов на парах-мажорах в 2019 году.

Аналитика годовой работы индексных счетов предоставлена Антоном Рыбиным

СМИ и публикации

ЯНВАРЬ

Итоги работы ICE FX в 2017 году и планы на 2018



Конкурс трейдеров Genesis



ФЕВРАЛЬ

Программа «Миграция»



МАРТ

Конкурс партнеров



АПРЕЛЬ

Преимущества инвестиций с ICE FX



МАЙ

Результаты аудита ICE AM



Интервью CEO ICE FX для ForexMagnates



СМИ и публикации

ИЮНЬ

Акция «Форсаж»



ОКТАБРЬ

Торговля CFD на криптовалюту с ICE FX



НОЯБРЬ

Партнерская программа ICE FX



ДЕКАБРЬ

Торговля с ICE FX



СЕНТЯБРЬ

Новые CFD на криптовалюты, сырье и фондовые индексы



Публикация на англоязычном ресурсе – Обзор Компании



Со всеми нашими публикациями Вы можете ознакомиться в разделе «[СМИ и публикации ежемесячных дайджестов](#)».



www.ice-fx.com

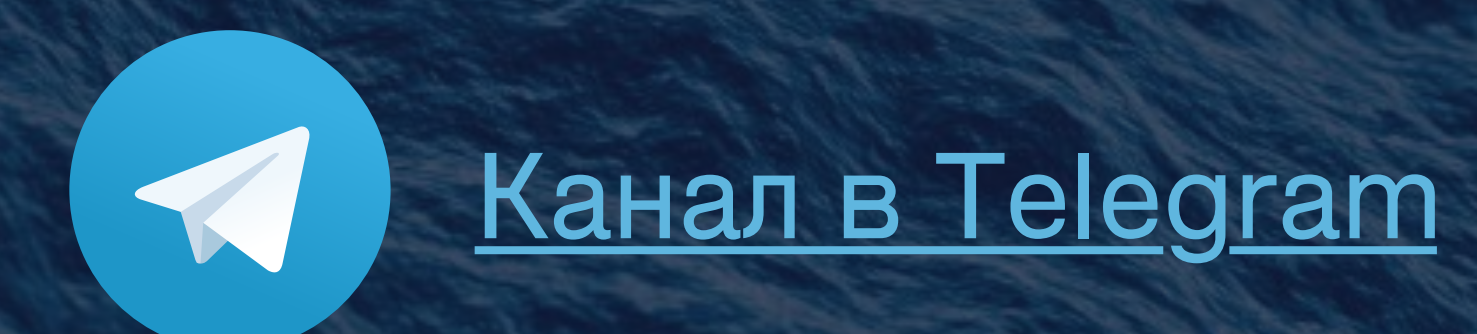
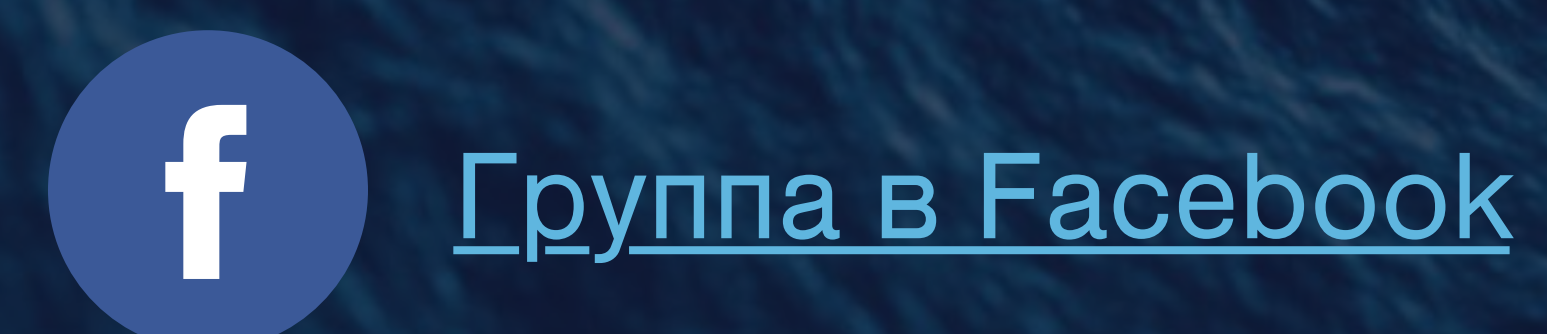
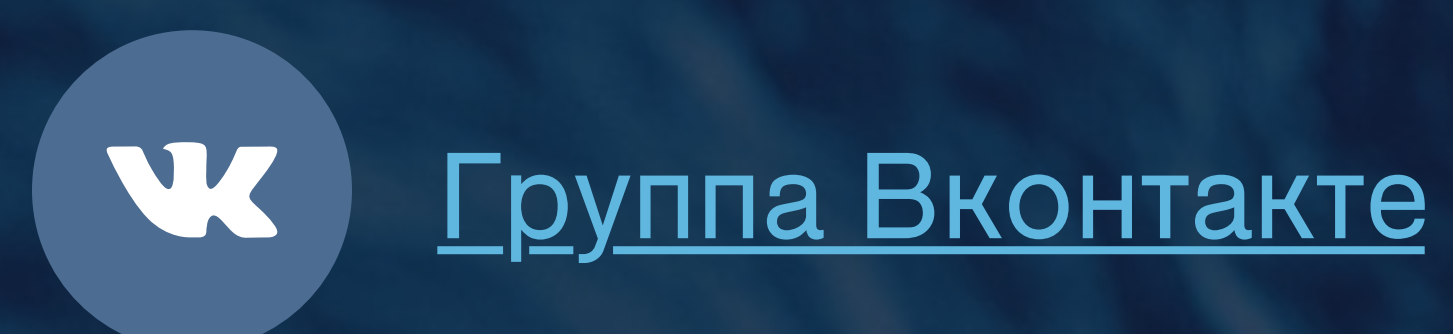
Итоги 2018 года

- новые торговые инструменты и поставщики ликвидности;
- запуск мультиязычного сайта и Личного кабинета;
- старт и проведение конкурсов трейдеров Genesis и Genesis Prime.

Планы на 2019 год

- запуск британской компании ICE UK;
- внедрение мультивалютных счетов;
- улучшение инвестиционного функционала.

Подробнее об этих и других нововведениях читайте в [статье CEO ICE FX](#).



ICEFX



2019

www.ice-fx.com

Почта для связи

support@ice-fx.com