

# WIP FINANCE

WORLDWIDE INVESTMENT PROJECT



## ALGO

La linea di gestione Wip Algo utilizza l'analisi statistico-quantitativa al fine di individuare e sfruttare positivamente le inefficienze che si presentano sui mercati finanziari. Attraverso questo tipo di analisi è infatti possibile verificare la solidità di ogni singola strategia, individuarne il rapporto rischio rendimento storico e stimarne il comportamento futuro. L'esecuzione delle operazioni è ottimizzata attraverso l'impiego di trading systems sempre attivi sui mercati e che operano con un approccio "multimarket" e "multistrategy", e danno vita a più di 20 strategie.

### KEY FEATURES

Il portafoglio si compone principalmente di futures, forex, volatility derivatives, e opzioni, aventi per sottostante:

- I principali indici azionari americani ed europei quotati sui mercati regolamentati.
- I principali indici obbligazionari americani ed europei quotati sui mercati regolamentati.
- I principali cross valutari.
- L'indice Vix e i suoi derivati.

La diversificazione è ottenuta attraverso l'impiego di strategie che rispondono a logiche di trading basate su volatilità breakout, mean reverting e trend following ed applicate a sottostanti con caratteristiche differenti tra loro, nonché ad orizzonti temporali che vanno da poche ore fino alla settimana. L'utilizzo ponderato e proporzionale di questi elementi consente di creare un mix ottimale, in grado di offrire rendimenti decorrelati dall'andamento dei mercati finanziari.

Il rischio totale del portafoglio viene controllato attraverso l'adozione di rigidi criteri di uscita dalla posizione e attraverso l'utilizzo di regole di money management predefinite.

### KEY FEATURES

#### ALGO

<b>Classe di rischio</b>	Alto
<b>Rendimento atteso</b>	20,00%
<b>Durata minima consigliata</b>	12 mesi
<b>Strumenti</b>	F&O su Indici azionari e obbligazionari, Forex, F&O sul Vix
<b>Broker</b>	Interactive Brokers LLC
<b>Capitale consigliato</b>	100.000 €
<b>Comm. Gestione Annuale</b>	20 %
<b>Comm. sulla Performance Fee</b>	20,00 % *
<b>Liquidabilità</b>	Giornaliera
<b>Sottoscrizione</b>	Quindicinale

#### AVVERTENZE LEGALI:

Sebbene le informazioni presenti in questo documento provengano da fonti attendibili, WIP Finance SA non ne garantisce l'accuratezza. Il presente documento è per uso privato di WIP Finance SA e non può essere né riprodotto né divulgato (nel suo intero o in parte) a nessuna persona senza permesso scritto. Nessuno può fare previsioni sicure sull'andamento dei mercati o garantire il successo degli investimenti. In nessun caso i risultati ottenuti in passato garantiscono quelli futuri né possono prevederli. Per quanto riguarda quindi le performance dei portafogli consigliati non vi è alcuna garanzia di uguali risultati per il futuro. Il modo in cui il presente documento viene distribuito potrebbe violare le leggi di alcuni paesi. Coloro che ne vengono in possesso devono informarsi sulla normativa vigente ed osservare le eventuali restrizioni. Il presente documento non costituisce un'offerta di vendita, né un invito a comprare un prodotto di investimento, non deve essere quindi considerato una sollecitazione al pubblico risparmio. Gli investimenti menzionati nel presente documento potrebbero non essere adatti a chiunque, è quindi consigliabile seguire sempre il consiglio di un professionista. I clienti dovrebbero ottenere una consulenza legale e fiscale adatta alle loro particolari possibilità.

\* Le Performance Fees saranno calcolate su base trimestrale e verrà applicato il "High Water Marking" per compensare i periodi (trimestri) in perdita. Sarà inoltre applicato un "look-back period" di tre periodi (trimestri). La perdita in qualsiasi periodo sarà aggiunta alle perdite accumulate del "look-back period". Il guadagno in qualsiasi periodo andrà a ridurre le eventuali perdite accumulate nei tre periodi precedenti. Non sarà perciò possibile accreditare alcuna Performance Fee fin tanto che esisteranno delle perdite accumulate



WIP Finance SA

via Calprino 18, 6900 Paradiso, Svizzera  
+41 91 985 2750 - info@wipfinance.com  
www.wipfinance.com