IQ Security Fund
Algorithmic trading

ИНВЕСТИЦИОННАЯ ПРЕЗЕНТАЦИЯ

IQ Security Fund

Стратегия Basket 50

Алгоритмическое управление капиталом на рынке цифровых активов

Составлено по данным за октябрь 2026 · сформировано 01.11.2026

$45 млн	200+	2019	12+ лет
капитал в управлении	активных клиентов	в реальной торговле на крипторынке	развития торговой системы

СТРУКТУРА

IQ Security Fund работает через два юридических лица: **IQ Security, osoba rizikového kapitálu, s.r.o.** (Чехия), зарегистрирована в реестре **Чешского национального банка (ČNB)** согласно §15 Закона № 240/2013 Coll. (ZISIF) для управления фондом; и **IQ Security Fund Inc.** (Панама), контрактное лицо для мандатов индивидуального управления счетами (SMA). Полные корпоративные и регистрационные данные предоставляются квалифицированным инвесторам по запросу.

ВАЖНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Настоящий документ подготовлен IQ Security Fund исключительно в информационных целях и предназначен только для профессиональных и институциональных инвесторов. Документ не является публичной офертой, индивидуальной инвестиционной рекомендацией, предложением или приглашением приобрести какие-либо финансовые инструменты или услуги и не предназначен для розничного распространения. Получая настоящий документ, вы подтверждаете статус профессионального или институционального инвестора и согласие с изложенными ограничениями.

Прошлые результаты инвестиционной деятельности не определяют и не гарантируют доходность в будущем. Алгоритмические стратегии на рынке цифровых активов сопряжены с высокими рыночными рисками, включая высокую волатильность, риск ликвидности, технологические и регуляторные риски; стоимость активов может как расти, так и снижаться, вплоть до потери существенной части или всей суммы инвестиций. Стратегия подходит только инвесторам, способным принять такие риски.

Показатели доходности в настоящем документе указаны gross of fees и рассчитаны на основе верифицированных исторических данных торговли; результат инвестора после вычета комиссий будет ниже. Данные рассчитаны по дневным рядам PnL торговых счетов и рыночным данным бирж; методология предоставляется по запросу. Отдельные заявления могут носить прогнозный характер; фактические результаты могут существенно отличаться. Информация актуальна на дату титульного листа и может быть изменена без уведомления.

Решение об инвестировании принимается инвестором самостоятельно с учётом его финансового положения, целей и допустимого уровня риска; рекомендуется независимая финансовая, юридическая и налоговая консультация. Документ конфиденциален, не подлежит воспроизведению или передаче третьим лицам без предварительного письменного согласия IQ Security Fund и не предназначен для распространения в юрисдикциях, где такое распространение противоречит законодательству.

О компании IQ Security Fund

IQ Security Fund, компания по управлению активами с собственными алгоритмическими стратегиями на рынке цифровых активов. Стратегии исполняются по API на отдельных управляемых счетах (SMA): **капитал никогда не покидает счёт инвестора**. Принцип, который мы не нарушаем: **сначала контроль риска, затем доходность.** Решения принимает система по формализованным правилам.

С КЕМ МЫ РАБОТАЕМ

Мы работаем исключительно с **профессиональными фондами, семейными офисами и квалифицированными инвесторами**. Среди наших клиентов: хедж-фонды и проп-трейдинговые компании индустрии алгоритмической торговли. Капитал всегда остаётся на счёте клиента; ключевая информация и подтверждение результатов раскрываются на этапе due diligence.

Биржи исполнения: Binance · Bitget · Bybit · Kraken · KuCoin · BingX · OKX · и другие

ОСНОВАТЕЛИ



Илья Жучков

ОСНОВАТЕЛЬ · CEO · ОАЭ

Более 13 лет опыта в инвестициях, трейдинге и управлении активами. Основатель IQ Security Fund: определяет стратегическое направление, инвестиционную политику и стандарты управления рисками. Совместно с квант-разработчиком занимается разработкой, тестированием и поиском новых стратегий.



Сергей Долгов

СООСНОВАТЕЛЬ · ПАРТНЁР · ОАЭ

Более 7 лет опыта в алгоритмическом трейдинге, инвестициях и управлении активами. Отвечает за развитие бизнеса: привлечение институциональных клиентов (хедж-фонды, семейные офисы) по всему миру, партнёрства и переговоры. Активно вовлечён в разработку и отбор торговых стратегий.

ПОДХОД

01 Система, а не прогноз
Решения принимает алгоритм по формализованным правилам, без ручного вмешательства.

02 Риск важнее доходности
Фиксированный риск и стоп-лосс в каждой сделке. Приоритет: сохранение капитала.

03 Полная прозрачность
Отчётность и метрики подтверждаются данными биржи на этапе due diligence.

04 Зрелое преимущество
Моментум и возврат к среднему, хорошо изученные рыночные явления. Мы опираемся только на закономерности, подтверждённые временем и работающие на разных рынках.

ИСТОРИЯ КОМПАНИИ

2012
Ядро торговой системы создано и запущено на фондовом рынке.

2019
Перенос систем на криптовалютный рынок, старт непрерывной live-торговли.

2023
Открытие стратегий для внешнего капитала, первые институциональные мандаты.

2026
$45 млн в управлении, 200+ клиентов, портфель из нескольких стратегий-корзин.

Стратегия Basket 50

Basket 50, флагманская капиталоёмкая стратегия IQSF: корзина из нескольких систем, основанных на **эффекте моментума** и **возврате к среднему значению**. Комбинация двух разных подходов повышает эффективность портфеля и позволяет получать доход в различные фазы рынка. Стратегия ориентирована на извлечение выгоды из краткосрочных движений и исторически особенно сильна в периоды частых локальных коррекций.

Эффективность стратегий IQSF подтверждается стабильной работой на длительном периоде, в течение различных рыночных циклов: бычьего, медвежьего и фаз бокового движения. Корреляция дневных доходностей с BTC за всю историю составляет -0,02: результат определяется работой системы, а не направлением рынка.

РЕЗУЛЬТАТЫ 2019-2026, % ЗА МЕСЯЦ

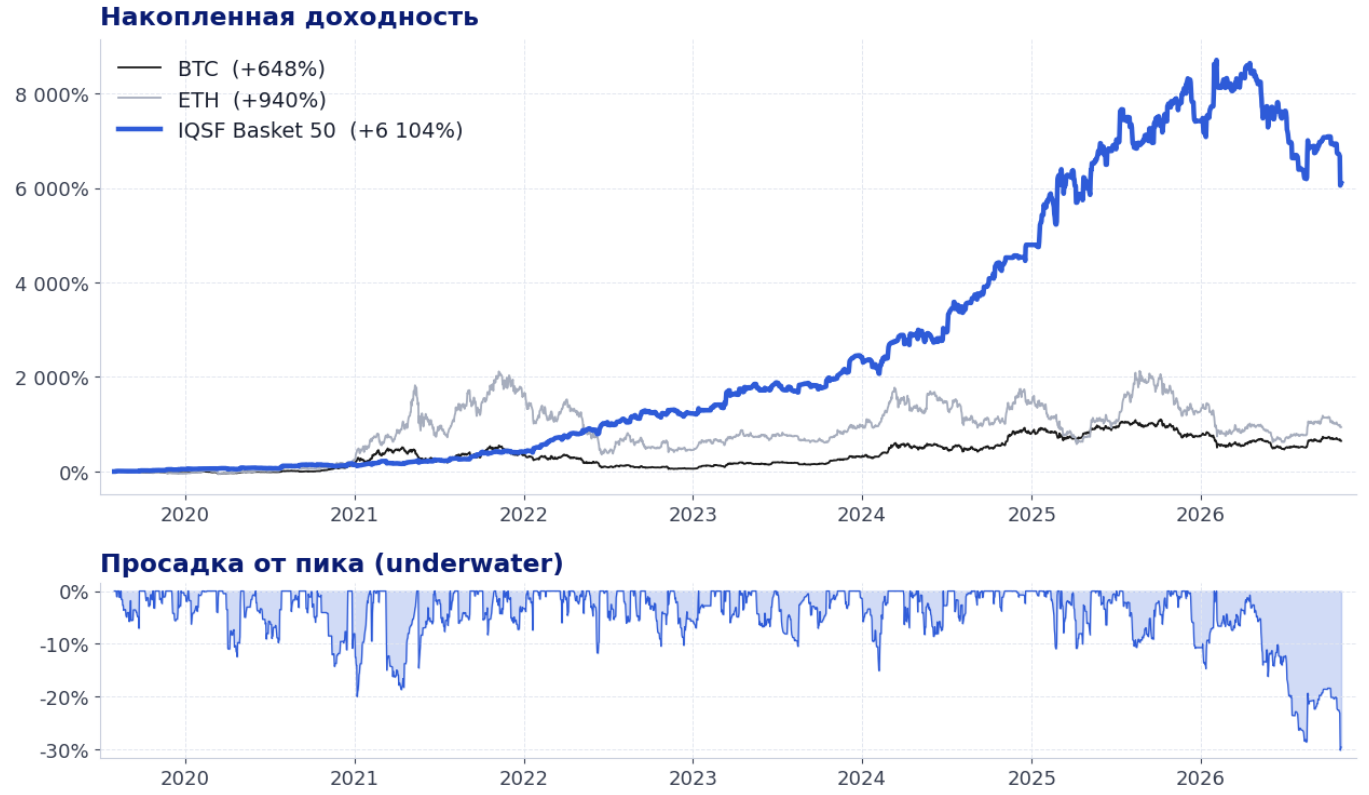
Год	ЯНВ	ФЕВ	МАРТ	АПР	МАЙ	ИЮНЬ	ИЮЛЬ	АВГ	СЕНТ	ОКТ	НОЯБ	ДЕК	Год
2019								7,49	13,37	4,03	14,68	3,42	**166,19**
2020	6,04	2,07	-0,02	11,02	-0,57	-4,58	28,37	-1,32	13,80	-3,16	-7,54	12,69	**65,80**
2021	7,90	18,36	-15,05	11,02	4,85	9,05	7,70	-2,19	31,51	11,06	0,19	-1,86	**108,33**
2022	18,41	24,45	11,50	4,77	10,31	16,02	3,95	5,25	8,36	-1,91	-0,69	0,57	**155,87**
2023	5,07	8,32	15,17	7,27	-2,72	8,28	-4,73	4,56	-5,46	11,47	6,16	14,87	**89,61**
2024	-7,82	20,32	5,93	-1,93	-0,42	5,36	14,61	10,02	6,03	9,68	4,22	5,15	**94,25**
2025	17,17	10,47	2,16	-5,84	12,58	1,41	9,10	-6,22	6,60	3,90	2,70	-7,18	**53,54**
2026	13,69	-3,46	2,85	-0,31	-8,30	-0,54	-15,90	7,60	2,69	-13,46			**-17,45**

Отрицательные значения выделены синим. Колонка «Год»: результат календарного года, за 2019 аннуализированное значение (торговля с августа), за 2026 накопленный результат на 31.10.2026. Все показатели gross of fees, по верифицированным данным торговли.

ДИНАМИКА ПРОТИВ РЫНКА

Basket 50 против BTC и ETH · август 2019, октябрь 2026

дневные данные



Показатели рассчитаны по данным реальной торговли с аккаунта Binance. На других биржах результаты могут отличаться в зависимости от ликвидности, комиссий и условий исполнения. Дневной ряд PnL предоставляется по запросу для собственных расчётов аллокатора.

Ключевые метрики · 31.10.2026

ДОХОДНОСТЬ

Общий доход с августа 2019	6 104,12%
Годовой доход (CAGR)	76,71%
Средний доход за месяц	5,22%
Месяцев закрыто в плюс	70%
Профит-фактор	1,58
Прибыльных лет	7 из 7

ПРОСАДКИ

Максимальная просадка счёта	-30,13%
Максимальная за день	-14,58%
Средняя просадка счёта	-4,72%
Максимальный срок просадки	269 дней
Средняя длительность просадки	19 дней
Расчётная макс. допустимая	-30...-35%

КОЭФФИЦИЕНТЫ

Годовая волатильность	30,12%
Коэффициент Кальмара	2,55
Коэффициент Сортино	5,57
Коэффициент Шарпа	2,06
Дневной VaR (95%)	-2,43%
Корреляция с BTC	-0,02

Расчётная макс. допустимая просадка (-30...-35%), ориентир с запасом на основе исторических данных и стресс-моделирования сценариев, не наблюдавшихся на рынке. Это не гарантия и не жёсткий лимит: фактические просадки могут обновляться, что является нормальной частью работы стратегии.

Расчёт по дневным доходностям за весь период live-торговли (август 2019, октябрь 2026), безрисковая ставка 0%; Шарп и Сортино считаются по месячным (×√12), в методологии панели IQSF.

АСИММЕТРИЯ ДОХОДНОСТИ

В плюс закрывается лишь 41% торговых дней, и результат создаёт положительное математическое ожидание: убыток каждой сделки ограничен фиксированным риском, а прибыльные движения кратно крупнее. Волатильность это рабочая среда стратегии, и с ростом горизонта асимметрия проявляется всё устойчивее.

×2,0
средний прибыльный месяц (+9,5%) к среднему убыточному (-4,7%)

+1,21
коэффициент асимметрии (skew) дневных доходностей, перевес крупных движений в плюс

41% · 70% · 80%
день, месяц, квартал: чем длиннее горизонт, тем чаще период закрыт в плюс: горизонт работает на инвестора

7 из 7
все закрытые календарные годы (2019-2025) в плюсе

ТОРГОВАЯ ЛОГИКА

Стратегия ориентирована на торговлю локальных трендов, всплесков волатильности и возврата к среднему по высоколиквидным инструментам. Каждая сделка открывается с фиксированным риском; убыточные позиции не усредняются, прибыльные могут наращиваться пирамидингом. Система работает и в лонг, и в шорт, но каждая сделка открывается только в одну сторону.

Сильные движения рынка для стратегии не страшны: чаще всего именно на них возникает основной доход. Отсутствие сделок в периоды экстремальной волатильности преднамеренно: большие стоп-лоссы делают вход невыгодным. Учитывая редкость устойчивых трендов, алгоритмы IQSF выбирают осторожность; подход основан на историческом анализе и сохранении капитала.

ТЕХНОЛОГИИ

Торговое преимущество
Это не HFT, машинное обучение не используется. Преимущество большинства систем основано на эффекте моментума, который хорошо изучен и используется многими ведущими фондами. Все решения принимает алгоритм по формализованным правилам, без ручного вмешательства и субъективных прогнозов.

Модуль исполнения
Вход в рынок идёт рыночными ордерами. При открытии позиций большого объёма используется высокоскоростной алгоритм TWAP: заявки дробятся во времени, чтобы минимизировать проскальзывание и влияние на цену. Каждая сделка проходит внутри одной биржи, без кросс-биржевого арбитража; стратегия может разворачиваться на разных площадках.

Данные и бэк-тестирование
Каждый компонент системы многократно протестирован на разных рынках: FOREX, сырьевые товары и криптовалюты, более десяти лет данных. Система оптимизируется на данных Binance BTC/USDT, но остаётся прибыльной на других биржах и парах. Моделирование методом Монте-Карло используется как вспомогательный инструмент.

Риски, параметры и условия

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

01 Надёжность системы

Основные компоненты неизменны более 12 лет; регулярное тестирование и моделирование в любых стрессовых условиях. Реальная торговля на крипторынке с 2019 года, более 6 лет.

02 Фиксированный риск

Каждая сделка открывается с фиксированным риском; стоп-лоссы и тейк-профиты учитывают текущую волатильность. Ручные вмешательства не применяются.

03 Биржевые риски

Риск на капитал, а не только на депозит; надёжная API-интеграция и собственный софт; круглосуточный мониторинг систем автоматикой и сотрудниками компании.

04 Гибкость по биржам

Стратегия торгуется внутри одной биржи и не является кросс-биржевым арбитражем. При этом её можно развернуть на разных биржах, что снижает зависимость от одной площадки.

ПАРАМЕТРЫ СТРАТЕГИИ

Торговые активы	**BTC и ETH, бессрочные фьючерсы**
Удержание позиции	**До 3 дней**
Стоп-лоссы (фиксированный риск)	**Используются**
Автоматизация	**Полная**
Сделок в месяц	**0-40**
Ёмкость стратегии	**$200 млн**
Капитал в управлении (все стратегии)	**$45 млн**
Представленные результаты	**Gross of fees**

УСЛОВИЯ ИНВЕСТИРОВАНИЯ

Минимальная аллокация	**$300,000**
Рекомендуемый горизонт	**От 3 лет**
Комиссия за управление	**0%**
Плата за подключение	**Отсутствует**
Комиссия за результат	**25-30% · High-Water Mark**
Выплата комиссии	**Ежеквартально**
Блокировка средств	**Отсутствует, вывод в любой момент**
Форма инвестирования	**Управляемый субаккаунт (SMA)**
Размещение капитала	**Счёт инвестора на бирже**
Обеспечение	**USDT / BTC / ETH**

НАША СТРАТЕГИЯ НЕ

- не использует машинное обучение и не прогнозирует рынок
- не усредняет убыточные позиции
- не относится к HFT
- не использует кросс-биржевой арбитраж
- не допускает ручных вмешательств
- не ставит на направление рынка (корреляция с BTC ≈ 0)

ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ГОРИЗОНТ

От 3 лет

Рекомендуемый горизонт инвестирования. Рынок проходит через разные циклы: рост, просадки, восстановление. Преимущество стратегии проявляется на полном цикле, а не в отдельные недели или месяцы. Инвесторы входят в разные моменты, поэтому на коротком отрезке личный результат во многом зависит от точки входа, а не от самой системы. С ростом горизонта эта разница сглаживается.

DUE DILIGENCE И ДАЛЬНЕЙШИЕ ШАГИ

01

Знакомство

Звонок с командой IQSF; стандартный DDQ, дневные ряды PnL и отчётность по запросу.

02

Due diligence

Раскрытие ключевой информации: методология, отчётность, подтверждение трек-рекорда данными биржи.

03

Мандат

Параметры SMA: размер аллокации, риск-профиль, обеспечение, порядок отчётности.

04

Подключение

Субаккаунт на бирже инвестора, подключение по API, старт торговли. Отключение в любой момент.