



IQ Security Fund
Algorithmic trading

ИНВЕСТИЦИОННАЯ ПРЕЗЕНТАЦИЯ

IQ Security Fund

Стратегия Basket 70

Алгоритмическое управление капиталом
на рынке цифровых активов

Составлено по данным за сентябрь 2026 · сформировано 01.10.2026

\$45 млн

капитал в управлении

200+

активных клиентов

2019

в реальной торговле на крипторынке

12+ лет

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 · СЕО · 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 70

Basket 70, капиталоемкая стратегия IQSF: активное следование тренду на **эффекте импульса**, усиленное **кластеризацией волатильности**, с компонентой **возврата к среднему** для повышения эффективности портфеля. Комбинация подходов повышает устойчивость в разных фазах рынка и позволяет извлекать доход из устойчивых направленных движений и 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								6,47	11,77	4,74	13,79	1,97	142,45
2020	6,02	1,73	1,31	8,88	-0,70	-4,48	25,20	-1,54	12,85	-2,42	-7,54	8,81	54,11
2021	7,64	21,21	-15,90	8,89	4,75	10,60	11,64	-1,34	33,46	8,96	6,10	0,29	135,95
2022	17,48	24,39	11,19	4,96	13,29	16,35	2,92	9,04	12,03	-1,26	0,70	1,47	185,14
2023	4,11	8,72	16,60	8,41	-4,24	10,90	-4,65	3,91	-4,86	11,67	6,00	13,65	92,68
2024	-7,26	20,13	6,26	-0,70	3,08	4,95	12,11	9,42	4,11	8,22	3,92	7,51	96,36
2025	8,27	6,27	1,52	-4,62	6,60	0,06	8,49	-5,98	5,02	2,30	1,67	-5,08	25,71
2026	11,40	-3,13	4,07	-1,59	-7,31	0,03	-10,86	4,69	1,96				-2,51

Отрицательные значения выделены синим. Колонка «Год»: результат календарного года, за 2019 аннуализированное значение (торговля с августа), за 2026 накопленный результат на 30.09.2026. Все показатели gross of fees, по верифицированным данным торговли.

ДИНАМИКА ПРОТИВ РЫНКА

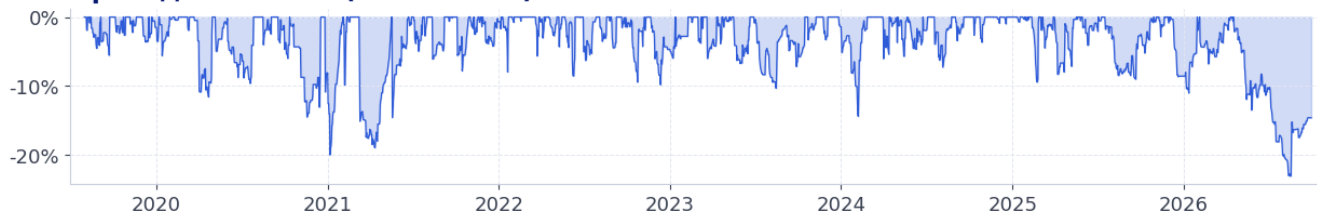
Basket 70 против BTC и ETH · август 2019, сентябрь 2026

дневные данные

Накопленная доходность



Просадка от пика (underwater)



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 расчетов аллокатора.

Ключевые метрики · 30.09.2026

ДОХОДНОСТЬ

Общий доход с августа 2019 **6 853,72%**Годовой доход (CAGR) **80,77%**Средний доход за месяц **5,37%**Месяцев закрыто в плюс **77%**Профит-фактор **1,69**Прибыльных лет **7 из 7**

ПРОСАДКИ

Максимальная просадка счёта **-23,08%**Максимальная за день **-14,58%**Средняя просадка счёта **-4,03%**Максимальный срок просадки **166 дней**Средняя длительность просадки **18 дней**Расчётная макс. допустимая **-30...-35%**

КОЭФФИЦИЕНТЫ

Годовая волатильность **27,37%**Коэффициент Шарпа **2,28**Коэффициент Сортино **6,93**Коэффициент Кальмара **3,50**Дневной VaR (95%) **-2,18%**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, сентябрь 2026), безрисковая ставка 0%; Шарп и Сортино считаются по месячным ($\times\sqrt{12}$), 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.

 $\times 1,8$

средний прибыльный месяц (8,4%) к среднему убыточному (-4,8%)

+0,95

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

41% · 77% · 83%

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

Basket 70 сочетает активное следование тренду на эффекте импульса и кластеризацию волатильности с компонентой возврата к среднему по высоколиквидным инструментам. Каждая сделка открывается с фиксированным риском. Убыточные позиции не усредняются, прибыльные могут наращиваться за счёт пирамидинга. Система эффективно работает как в лонг, так и в шорт, однако каждая сделка всегда 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 импульса, 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%
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 $\approx$ 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.