

基本信息

最小投资金额	100,000 USD
资产管理规模	11,800,000 USD
管理费	2%
业绩抽成	20%
高水位线条款	Yes
收益金额/百万美元	60,000
保证金权益	50%
法律架构	Managed Account
投资限制	Non US Only
投资风格	99% Systematic / 1% Discretionary / Short term / Market neutral / Technical, Fundamental, Volatility trading, Global macro, Multistrategy

公司信息

公司名称	IBTRADE LLC
公司资本金	IBTRADE LLC
联系电话	+82 2 6207 2072
网页	www.fxwirepro.com/cn
QQ	2178904894

月交易成绩

	一月	二月	三月	四月	五月	六月	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	年收益汇
2014	-1.38	-3.58	-1.62	0.44	3.56	1.58	0.47	0.43	6.39	9.70	11.57	-6.34	21.63
2015	4.33	11.71	13.17	1.59	16.79	2.91	3.63	-2.05	-0.03	4.21	2.23	10.21	91.87
2016	-0.74	11.02	21.30	5.91	0.81	1.50	-2.50	1.35	-3.83	0.18	-0.03	3.02	42.03
2017	-0.02	0.45	3.23	-1.37	-0.43								1.81

There is a substantial risk of loss in trading commodity futures, equities, options and off-exchange foreign currency products. Past performance is not indicative of future results.

主要交易策略

- FXMP-1 产品在各种市场条件下都奉行趋势交易原则，无论是在震荡行情还是非震荡行情或者是趋势行情。关于标的价格变动我们会综合使用各种技术指标，包括但不限于：MA（移动平均）、RSI、Stochastic 震荡、MACD、ADX、Fibonacci、Pivot Points、阻力/压力线、蜡烛图以及分时线和相关新闻影响等等。我们将会利用上述指标和技术方法来进行分析以获得可观的收益。
- FXMP-1 策略基于各货币之间的汇率波动进行。当有强烈的趋势来临时，将会在可以承受的最大杠杆处严格控制风险。产品遵循高抛低吸，逢低吸纳，逢高卖出的策略，获利后迅速抽身了结，在各个市场上都有不俗的表现。
- FXMP-1 主要集中于重要货币对以及G10国家的货币对。每次交易规模约为账户金额的10%~20%。比如开了10万美金的账户，那么每次交易规模大小约为1万美金至2万美金左右。合计成交额不会超过200万美金，风险敞口会根据投资者的风险偏好进行调整。

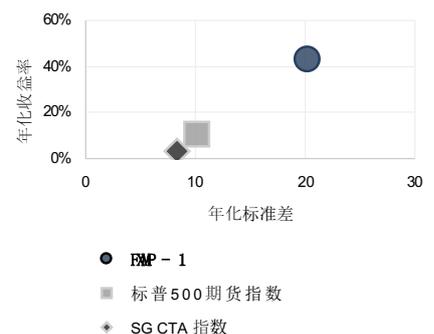
收益统计

上月回报率	-0.43%
年初至今回报	1.81%
3个月收益率	1.38%
12个月收益率	1.32%
36个月收益率	246.83%
总收益	237.49%
复合收益率	42.76%
正收益月份占比(%)	68.29%
平均正收益月份占比	5.49%
平均损失月数	-1.84

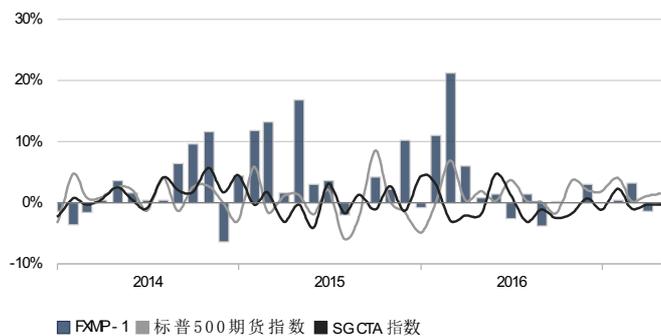
风险统计

夏普比率	1.88
索提诺比率	7.23
斯特林比率	3.55
Clamer 比率	8.10
偏度	1.25
峰度	1.51
最大回撤率	-6.45%
标准差(月)	5.82
跌势差	1.44
标普500相关系数	0.26

风险/回报图表



月收益率



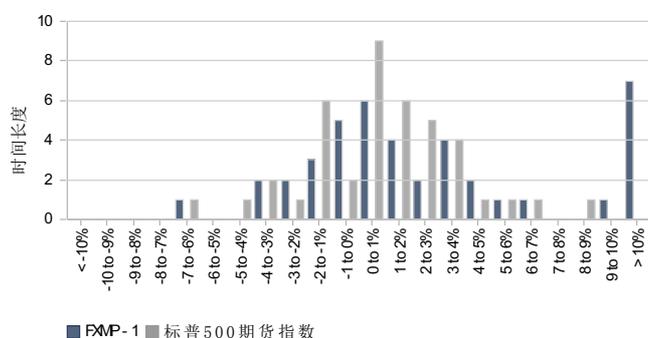
交易成绩 (VAMI)



主要基金管理人

IBTRADE LLC 是业内领先的金融研究公司，旗下的精品投资团队由多名获得业内认可和奖励的专业化投资管理人员组成。基于全球宏观市场的基本面和技术面的投资策略分析货币，关注主流市场和新兴市场的风险管理动态是所有策略的基石。

月收益分布



时间长度



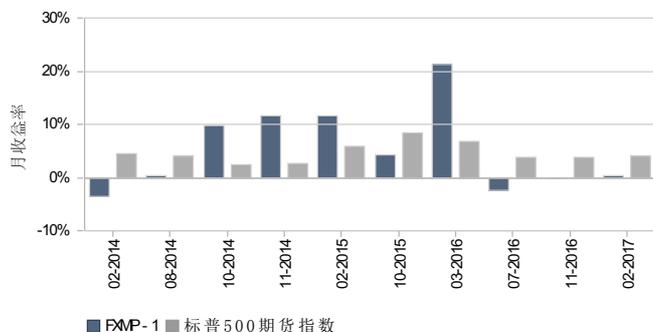
回撤报告

序号	回撤深度 (%)	回撤 (月)	反弹 (月)	开始时间	结束时间
1	-6.45	3	6	01/2014	09/2014
2	-6.34	1	2	12/2014	02/2015
3	-4.97	3	6	07/2016	03/2017
4	-2.08	2	1	08/2015	10/2015
5	-1.79	2	0	04/2017	05/2017

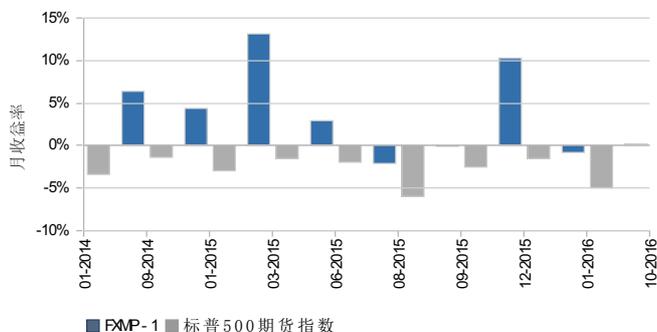
收益率报告

时间 (月)	最高值	最低值	均值	中位数	最新值	胜率 %
1 Month	21.30	-6.34	3.17	1.50	-0.43	68.29
3 Months	42.63	-6.45	10.75	5.69	1.38	84.62
6 Months	61.04	-3.40	24.87	23.89	4.89	86.11
1 Year	104.41	1.32	63.29	69.75	1.32	100.00
2 Years	251.64	77.30	176.12	171.49	77.30	100.00
3 Years	267.35	231.48	248.76	248.46	246.83	100.00
5 Years	-	-	-	-	-	-

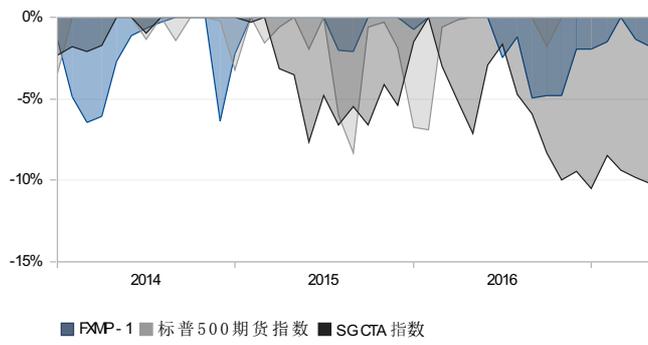
标普500期货指数



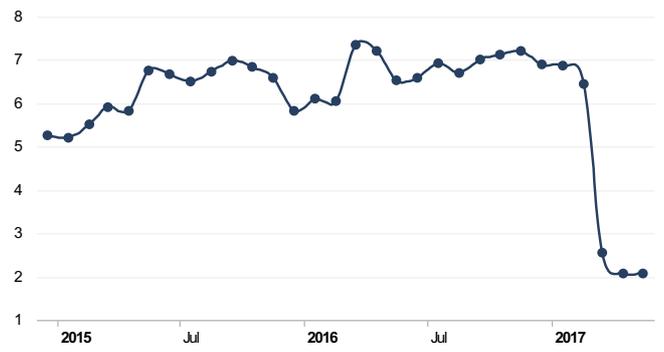
标普500期货指数



回撤率 (%)



波动率 (12月滚动)



时间窗口分析

	1月	3月	6月	1年	2年	3年
平均收益率	3.01	10.05	23.13	60.33	170.96	248.53
正收益率	68.29	84.62	86.11	100.00	100.00	100.00
平均正收益期间	5.49	13.38	29.18	63.29	176.12	248.76
平均负收益期间	-1.84	-3.74	-1.89	-	-	-
夏普比率	1.91	2.92	4.11	7.42	11.63	68.31
索提诺比率	7.23	20.94	99.16	0.00	0.00	0.00
标准差	5.75	12.74	20.95	29.55	52.47	12.62
跌势差	1.44	1.66	0.81	0.00	0.00	0.00

投资组合

