



# YIELDSHIELD

## ALPHA™

---

СТРАТЕГИЯ  
ОПЦИОННОГО ДОХОДА

# СОДЕРЖАНИЕ

01

Суть стратегии

02

Почему инвесторам  
это интересно

03

Как мы  
зарабатываем

04

Контроль  
риска

05

Условия  
для инвестора

06

Следующие шаги

МИССИЯ: ПРЕВРАЩАТЬ ВОЛАТИЛЬНОСТЬ АМЕРИКАНСКОГО РЫНКА  
В ПРЕДСКАЗУЕМЫЙ ДЕНЕЖНЫЙ ПОТОК ПРИ СТРОГОМ КОНТРОЛЕ РИСКА.



# СУТЬ СТРАТЕГИИ

Что делает YieldShield Alpha

## Продажа премий

по ликвидным опционам на 20+ ETF США (SPY, QQQ, GLD, и др.)

## Постоянный хедж

покупка защитных PUT на SPY и CALL на VIX — «страховка» от чёрных лебедей

## Капитал под контролем

≤ 60 % счёта задействовано в позициях, остальное — резерв

## Доход «подушка»

20 % счёта размещается в ETF YieldMax с дивидендной доходностью 6 % р.а.; доп. доход от covered call

## Ключевая идея

получать премию независимо от направления рынка, защищая капитал активным хеджем



# ПОЧЕМУ ИНВЕСТОРАМ ЭТО ИНТЕРЕСНО

Метрика	YieldShield Alpha	S&P 500 ETF (SPY)
Совокупная доходность (20 месяцев)	+67%	+13%
Годовая доходность (план)	42% ± 10%	~10%
Sharpe	1.65	-0.02
Sortino	2.47	-0.03
Макс. историческая просадка	-17.3%	-15.7%

- Превосходит рынок и по доходности, и по рискунаграде
- Быстрое восстановление: 39 дней из макс. просадки
- Прозрачно: счёт в Interactive Brokers, инвестор видит все операции в реальном времени



## КАК МЫ ЗАРАБАТЫВАЕМ

**54% – 18% + 6% ≈ 42% ГОДОВЫХ**

(премия – хедж + YieldMax = итоговая цель)

**54%**

В среднем  
6 сделок по продаже  
опционов  
каждые два месяца,  
~1.5 % каждая

**18%**

Хедж обходится  
~1,5 % счёта в месяц  
(безопасность  
> доход)



ETF YieldMax  
компенсируют  
до 1/3 расходов  
на хедж в виде  
дивидендов



# КОНТРОЛЬ РИСКА

Жёсткий лимит просадки  
30 %: при достижении – все  
позиции закрываются

Диверсификация  
по 5 секторным корзинам ETF

Мониторинг волатильности  
24/5: алгоритм снижает дельту  
при всплеске VIX

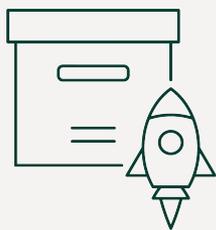


# УСЛОВИЯ ДЛЯ ИНВЕСТОРА

Параметр	Условие
Минимум для подключения	1 000 000 USD (счёт IBKR на имя инвестора)
Комиссия за управление	До 2 % годовых, оплачивается вперед
Success Fee	20 % от прибыли, только выше highwater mark
Доступ к средствам	Только у инвестора; мы получаем торговые права без вывода денег



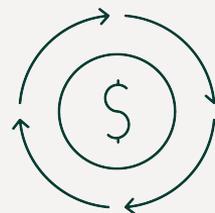
## СЛЕДУЮЩИЕ ШАГИ



Открыть/активировать счёт в Interactive Brokers



Выдать tradingrights стратегии YieldShield Alpha (только просмотр, без вывода)



Перевести капитал  $\geq 1\,000\,000$  USD



Получать ежемесячный отчёт + полный доступ онлайн 24/7



# КОНТАКТЫ ДЛЯ КОНСУЛЬТАЦИИ:

info@spuae.ae

ДОХОДНОСТЬ В ПРОШЛОМ НЕ ГАРАНТИРУЕТ ДОХОДНОСТЬ В БУДУЩЕМ. ИНВЕСТИЦИИ В ОПЦИОНЫ СВЯЗАНЫ С РИСКОМ ВОЗМОЖНОЙ ПОЛНОЙ ПОТЕРИ КАПИТАЛА.



Дисклеймер: Настоящая презентация подготовлена компанией Stability Partners FZCO, должным образом зарегистрированной и лицензированной Dubai Integrated Economic Zones Authority (DIEZA). Содержание данной презентации предоставляется исключительно в информационных и дискуссионных целях и не является, и не должно рассматриваться как, инвестиционная, финансовая, юридическая, налоговая или иная профессиональная рекомендация. Ничто в настоящей презентации не представляет собой предложение, оферту, приглашение, рекомендацию или побуждение к покупке, продаже, владению или совершению каких-либо операций с финансовыми инструментами, активами, продуктами или услугами. Если прямо не указано иное в отдельном письменном соглашении, Stability Partners FZCO не является и не действует в качестве регулируемого финансового института, управляющего активами, траста, брокера, дилера, кастодиана или лица, осуществляющего дискреционное управление инвестициями. Stability Partners FZCO не принимает, не хранит, не контролирует, не переводит и не управляет денежными средствами или активами клиентов ни при каких обстоятельствах. Все услуги предоставляются исключительно в формате недискреционного Advisory-сопровождения. Любая информация, мнения, оценки, прогнозы, сценарии, аналитические материалы или заявления прогнозного характера, содержащиеся в настоящей презентации, приведены исключительно в иллюстративных целях, могут быть изменены без предварительного уведомления и предоставляются без каких-либо заверений, гарантий или обязательств, явных или подразумеваемых, в отношении их точности, полноты, достоверности или достижимости. Инвестиционная деятельность связана с существенными рисками и подходит не всем инвесторам. Стоимость инвестиций может как увеличиваться, так и снижаться, и инвестор может потерять часть или весь вложенный капитал. Результаты в прошлом не являются показателем и не гарантируют будущих результатов. Не предоставляется никаких гарантий достижения каких-либо стратегий, прогнозов, сценариев или ожидаемых результатов. Stability Partners FZCO не оказывает налоговых, юридических, бухгалтерских или регуляторных консультаций. Получатели настоящей презентации самостоятельно несут ответственность за оценку целесообразности, преимуществ, рисков и последствий любых решений и настоятельно рекомендуются к получению независимых профессиональных консультаций с учётом своих индивидуальных обстоятельств до принятия любых инвестиционных или финансовых решений. Ничто в настоящей презентации не создаёт и не должно рассматриваться как создание каких-либо договорных обязательств, фидуциарных обязанностей, отношений доверия или иных обязательств любого рода. Все обсуждения носят необязывающий характер. Stability Partners FZCO оставляет за собой право по собственному усмотрению и без принятия каких-либо обязательств отказаться от предоставления консультаций, предложения или участия в любых сделках или услугах.