

# WIP FINANCE

WORLDWIDE INVESTMENT PROJECT



## ISURFTRADE

La strategia è classificabile come sistema misto a bassa frequenza operativa, il sottostante e indicatore di segnali utilizzato è l'ETF (SPY) dell'indice US S&P 500 (benchmark di riferimento).

### KEY FEATURES

La generazione del segnale segue quelle che vengono tracciate come "onde" oscillatorie di breve/medio periodo. Il sistema è allineato al trend principale del mercato US di riferimento (Trend Follower), e in base ad esso esegue operazioni di Long o Short. In alcuni casi viene definito uno stato intermedio di "volatilità", che prevede differenti scelte nelle logiche di entrata ed uscita. Solo in queste fasi di mercato "limitate" il sistema si trasforma in un Trend Reversal.

La fase di chiusura del trade segue logiche diverse dall'entrata, ma in qualche modo riconducibili a indicatori che fungono da sensori sul livello di "tensione" del mercato. Il sistema è infatti in grado in modo automatico di elaborare i numerosi indicatori per identificare il momento mediamente più idoneo per massimizzarne il profitto (o minimizzarne la perdita se il trade è in negativo). A tal fine, vengono utilizzate logiche di analisi tecnica basate sul livello di volatilità intrinseca del mercato e un mix di soglie legate a situazioni di ipercomprato/ipervenduto identificabili con indicatori basati su medie mobili e oscillatori. Il modello è in grado di operare con modalità "a leva dinamica", selezionata fra un livello minimo e massimo parametrizzabili, a seconda del momento di mercato.

Uno dei casi in cui viene forzata l'uscita in perdita è il raggiungimento delle soglie impostate per lo Stop Loss. Anche se il sistema base non necessita di Stop Loss tecnico perché il modello sottostante si autoregola ed è in grado di riconoscere il momento ideale per minimizzare le perdite, viene richiesto spesso dagli operatori di mercato piuttosto che dagli investitori, di avere applicata di una soglia massima di gestione psicologica del Drawdown sul singolo trade. Anche per il Take Profit è stato implementato un algoritmo che permette di regolarlo in modo dinamico a seconda dei momenti di mercato e della tipologia di trend principale, andando in questo modo ad allungare o accorciare i trade.

### KEY FEATURES

#### SURFTRADE

|                                    |                         |
|------------------------------------|-------------------------|
| <b>Classe di rischio</b>           | Medio - Alto            |
| <b>Rendimento atteso</b>           | 17,00%                  |
| <b>Durata minima consigliata</b>   | 12 mesi                 |
| <b>Strumenti</b>                   | ETF "SPY"               |
| <b>Broker</b>                      | Interactive Brokers LLC |
| <b>Capitale consigliato</b>        | 25.000 €                |
| <b>Comm. Gestione Annuale</b>      | 2,00 %                  |
| <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