

CAPITALGUARD 2.0

Perché abbiamo CapitalGuard?

In qualità di broker europeo regolamentato, noi di Purple Trading teniamo alla sicurezza del capitale dei clienti. La funziona tecnica CapitalGuard, che è inclusa in tutte le strategie da noi offerte, ne è prova.

Si tratta di una soluzione essenziale per gli investitori per eliminare il rischio ed evitare perdite imprevedibili. Abbiamo sviluppato CapitalGuard con l'intenzione di offrire agli investitori una tecnologia capace di fare esattamente ciò.

Cos'è CapitalGuard 2.0?

Si tratta di una funzionalità tecnica che monitora lo sviluppo del patrimonio su un conto gestito specifico collegato ad una strategia. Se il drawdown massimo consentito di perdita è superato, CapitalGuard scollegherà il conto dalla strategia e chiuderà automaticamente tutte le posizioni di trading nel conto gestito, annullando anche gli ordini condizionati. Questo non fa altro che prevenire ulteriori perdite potenziali.

Quale è la differenza rispetto a CapitalGuard 1.0?

Rispetto all'esistente CapitalGuard 1.0, CapitalGuard 2.0 monitora il drawdown su un conto gestito specifico, non su un conto di riferimento per la strategia.

In pratica, questo significa che una volta attivato CapitalGuard 2.0, tutte le posizioni di trading verranno chiuse e tutti gli ordini condizionati verranno eliminati sul conto gestito specifico.

In altre parole, attivando CapitalGuard 2.0, si va a proteggere il capitale nei conti gestiti specifici preservando al contempo il trading degli altri clienti collegati alla stessa strategia che però non hanno raggiunto il livello di CapitalGuard 2.0 richiesto su tale strategia.

Come funziona CapitalGuard 2.0?

Sulla base del monitoraggio di operazioni, depositi e prelievi, CapitalGuard calcola il cosiddetto High Water Mark (HWM) per un conto gestito specifico.

L'HWM è il livello di patrimonio massimo raggiunto, che viene usato per monitorare il saldo più elevato del conto raggiunto per i conti del cliente. L'HWM viene ricalcolato con ogni transazione a saldo in modo tale che il drawdown sul conto prima della transazione e dopo la transazione rimangano invariati.

Esempio 1: Partiamo con un caso semplice

Un cliente ha un conto con 1 milione CZK. Questo è il saldo provvisorio più elevato sul conto, denominato HWM (high watermark). CapitalGuard è impostato al 20%.

Se questo conto perde 10.000 CZK a causa di un'operazione andata male, la perdita sarà dell'1%. Il saldo più elevato sul conto era di 1 milione CZK, quindi l'HWM sarà di 1 milione CZK. Tuttavia, se vi fosse un profitto aperto di 100.000 CZK e il patrimonio del conto passasse



a 1.1 milioni CZK, il nuovo HWM sarebbe di 1.1 milioni CZK. Non sembra così complesso, no? C'è un ma.

Esempio 2: Uno sguardo più vicino alle realtà

Abbiamo 1.1 milioni CZK sul conto del cliente dall'esempio precedente. Tuttavia, il cliente decide poi di depositare ancora 1 milione CZK. Dal momento che abbiamo consolidato il profitto aperto di 100.000 CZK e non ci sono altre posizioni di trading attive al momento, la situazione non è troppo complicata al momento. Il nuovo HWM è di 2.1 milioni CZK. Ma naturalmente la vita di un investitore può essere più complicata, quindi adattiamo il nostro esempio.

Attualmente abbiamo un saldo di 2.1 milioni CZK sul nostro conto, ma con la prossima operazione andiamo a perdere 200.000 CZK dal conto, per un nuovo saldo complessivo sul conto di 1.9 milioni CZK. L'HWM è ancora di 2.1 milioni CZK e il DD (Drawdown) è del 9.5% (perdita / HWM = 200.000 / 2.100.000).

Tuttavia, quale sarà l'HWM quando il cliente deposita 10 milioni CZK, che porteranno così il saldo del conto a 11.9 milioni CZK? La logica suggerirebbe che sommiamo semplicemente 1.9 milioni e 10 milioni, per un HWM di 11.9 milioni CZK. Ma è questo l'approccio più corretto?

Verifichiamo il DD. Non avevamo altre posizioni, il che significa che il DD non dovrebbe essere cambiato. In un conto con un saldo di 11.9 milioni CZK, abbiamo generato una perdita di 200.000 CZK, quindi il DD sarà dell'1.7% (perdita / HWM = 200.000 / 11.900.000). Questo comporta una riduzione del tasso complessivo di perdita a causa del nuovo deposito, il che non dovrebbe succedere perché il denaro dell'investitore sarebbe così esposto ad un rischio sempre maggiore. Per questo motivo dobbiamo ricalcolare l'HWM in modo tale che il DD rimanga al 9.5%.

Vediamo la cosa da una prospettiva diversa. Al momento, abbiamo 11.9 milioni sul conto del cliente e una perdita del 9.5%. Da una prospettiva puramente aritmetica, questo significa $100 - 9.5\% = 90.5\%$, quindi l'importo di 11.9 milioni CZK deve raggiungere il 90.5%. Ma qual è il 100% (HWM)? Calcolatrice alla mano si ottiene il valore di 13.149.171 CZK ($100\% / 90.5\% * 11.9$ milioni).

Qui si può vedere chiaramente che il nuovo HWM cambia con le operazioni a saldo sul conto gestito. Per questo motivo è molto difficile per un trader monitorare l'HWM corrente, proprio per il fatto dei costanti depositi e prelievi e il cambio del patrimonio che avviene sul conto del cliente. Tuttavia, non occorre andare in panico, in quanto Purple Trading ricalcola il valore dell'HWM corrente dopo ogni operazione a saldo.

Vuoi sapere qual è il drawdown corrente su un conto cliente gestito?

Come in precedenza, se un investitore ritiene che una strategia non è più ideale per sé, può decidere di ripensarci e scollegarsi dalla strategia.

Noi di Purple Trading comprendiamo che sono necessarie alcune informazioni per prendere una tale decisione. Pertanto, se la perdita nel conto gestito supera il 70% e/o 90% del valore di CapitalGuard indicato per ciascuna strategia nella PurpleZone, ti invieremo automaticamente una notifica all'indirizzo email registrato.



A fini illustrativi, diamo uno sguardo ai livelli soglia succitati come valori di drawdown. In questo esempio, il nostro capitale è di 10.000 CZK e CapitalGuard è impostato al -20% della strategia. La perdita massima può quindi essere 2000 CZK.

- Nel caso di un drawdown del 14%, il nostro capitale sarà di 8600 CZK, pari al 70% del valore di CapitalGuard. A questo punto riceverai la prima email di notifica.
- Nel caso di un drawdown del 18%, il nostro capitale sarà di 8200 CZK, pari al 90% del valore di CapitalGuard. A questo punto riceverai la seconda email di notifica.

Se vuoi sapere il valore del drawdown senza aspettare le notifiche succitate, contattaci e ti potremo fornire il valore corrente.

I CFD sono strumenti complessi, caratterizzati da un rischio elevato di perdere denaro rapidamente a causa della leva.

Il 76.6% dei conti degli investitori al dettaglio perde denaro quando negozia CFD con questo provider. Occorre considerare attentamente se ci si può permettere il rischio di perdere soldi.

Il trading di valute al margine comporta un livello elevato di rischio e potrebbe non essere adatto a tutti gli investitori.

L'alto grado di leva può operare sia a favore sia contro l'investitore. Prima di decidere di negoziare valute estere si dovrebbero valutare attentamente gli obiettivi di investimento, il livello di esperienza e l'appetito per il rischio. È possibile andare incontro alla perdita, totale o parziale, dell'investimento iniziale, per cui non si dovrebbe investire denaro che non si è disposti a perdere. Occorre essere consapevoli di tutti i rischi connessi con il trading di valute, rivolgendosi a un consulente finanziario indipendente in caso di dubbi.

Eventuali opinioni, notizie, studi, analisi, prezzi o altre informazioni contenute nel presente materiale sono fornite a titolo di commento di mercato e non costituiscono una consulenza agli investimenti. L.F. Investment Limited non si assume alcuna responsabilità per eventuali perdite o danni, incluse, senza limitazione alcuna, eventuali perdite di profitto, che possono derivare in maniera diretta o indiretta dall'uso di, o dall'affidamento su, tali informazioni.

Purple Trading è un marchio nazionale cipriota (n. 85981), un marchio nazionale del Regno Unito (n. UK00003696619) e un marchio dell'Unione europea (n. 018332329), detenuto e gestito da L.F. Investment Limited, 11, Louki Akrita, CY4044 Limassol, Cipro, una società di investimenti cipriota debitamente autorizzata e regolamentata in base alla licenza CySEC n. 271/15.

