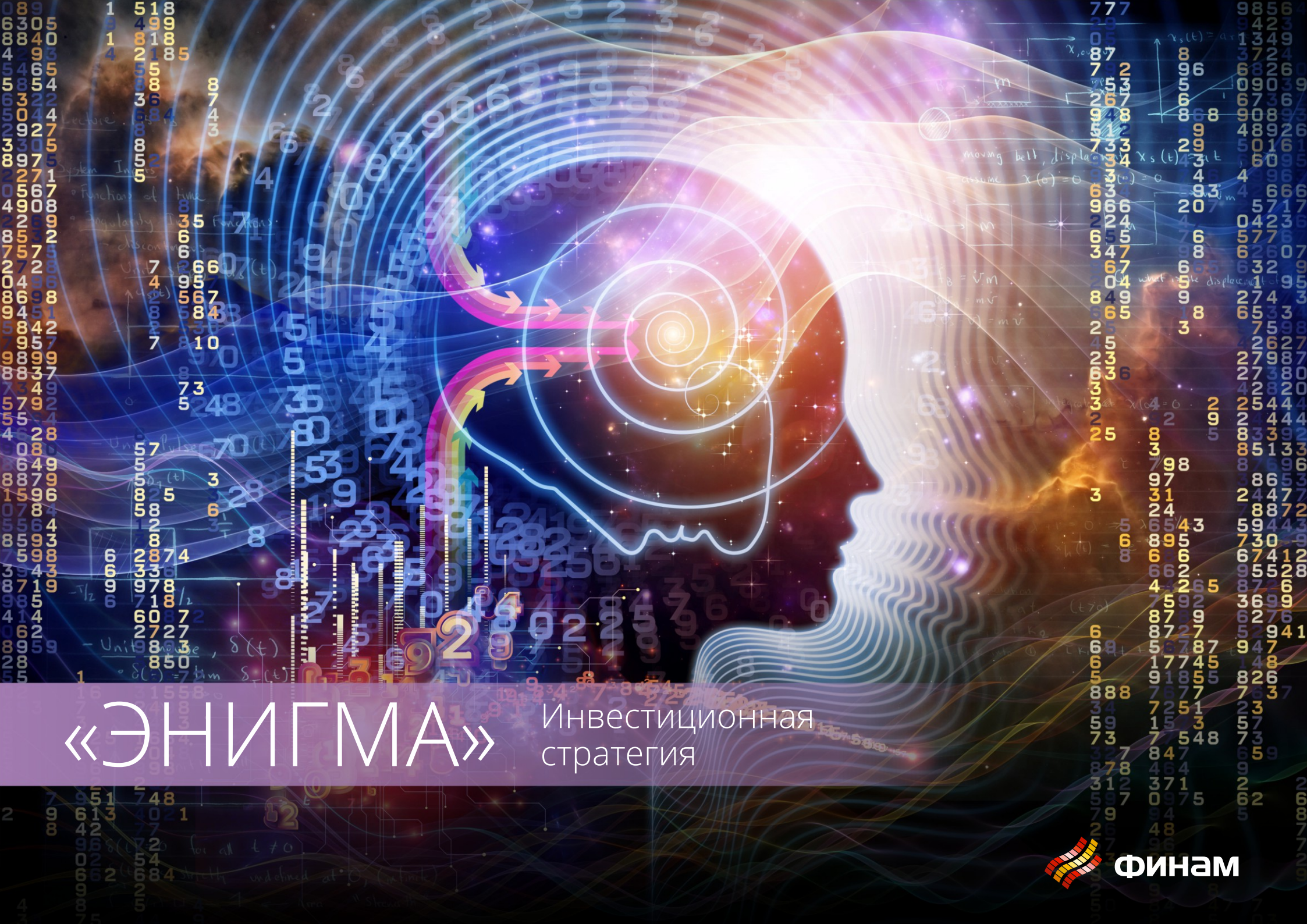




«ЭНИГМА»

Инвестиционная
стратегия

Концепция стратегии «Энигма»

Американский рынок акций предоставляет инвесторам поистине безграничные возможности для отработки совершенно разнообразных идей, методов и подходов к трейдингу.

Он обладает уникальными характеристиками:



Самая высокая
ликвидность рынка



Более 500 публичных
компаний
с капитализацией
выше 5 млрд долл



Представляет
все отрасли
мировой экономики



Динамика широкого
рынка S&P500 не
зависит от цен
на сырье или
какой-либо
отдельной отрасли



финам

Методика формирования портфеля

Мы решили применить инновационный подход к построению стратегии, основанный на симбиозе:



Фундаментального анализа для первоначального отбора активов для стратегии



Идей нобелевского лауреата Марковица для построения эффективного портфеля



Теории построения инвестиционных портфелей всемирно признанных экспертов Шарпа и Сортино



Технического анализа для фиксации сверхприбыли и закрытия позиции по стоп лоссу



Моментум-эффекта, как ценовой аномалии фондового рынка



Хеджирования портфеля непокрытыми продажами в слабых активах



Размещения временно свободных средств в краткосрочных долговых активах



финам

Методика формирования портфеля

В данной стратегии применяются самые передовые компьютерные технологии с использованием автоматизированной системой принятия решения по формированию портфеля и дальнейшему его контролю



Для сглаживания просадок в периоды коррекций стратегия открывает позиции шорт



Во времена долгосрочных нисходящих трендов стратегия может полностью закрыть инвестиционный портфель. Свободные средства временно размещаются в краткосрочные долговые активы



В случае значительного роста отдельных акций, предусмотрена фиксация полученной прибыли



финам

Отбор активов в портфель

1

Индекс детально препарируется. В фокусе остаются только компании — лидеры по капитализации с ценой акций, позволяющей собрать эффективный портфель с минимальной суммой.

2

На следующем этапе фокус-лист акций изучается на предмет их свойств по исторической доходности и волатильности по методике нобелевских лауреатов Шарпа и Сортино.

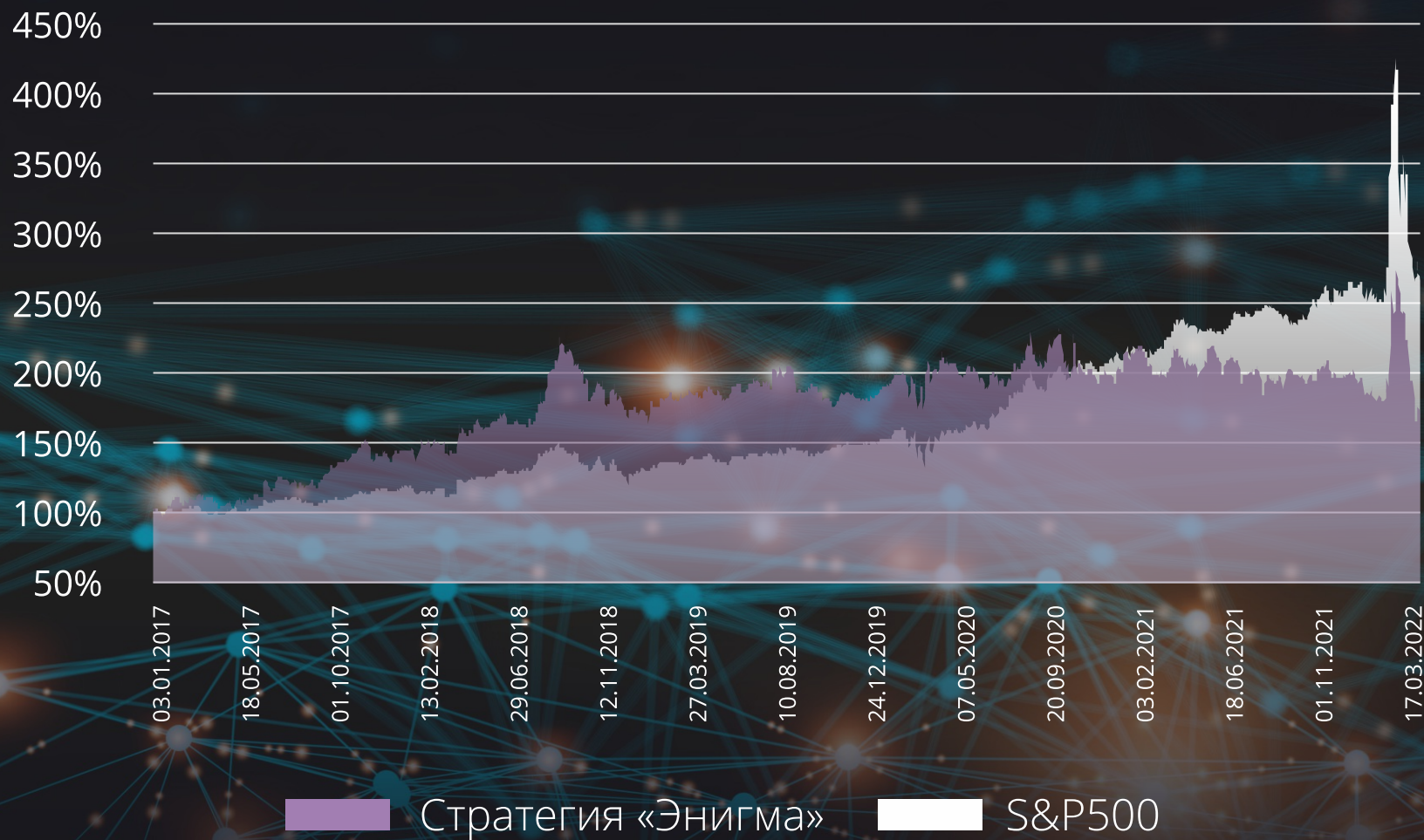
3

Далее в зависимости от общей ситуации на рынке и выполнения ряда условий в каждой конкретной акции стратегия формирует размеры позиций активов, входящих в инвестиционный портфель.

4

Наиболее слабые активы хеджируют портфель непокрытой продажей

Динамика доходности стратегии «Энигма», ₽



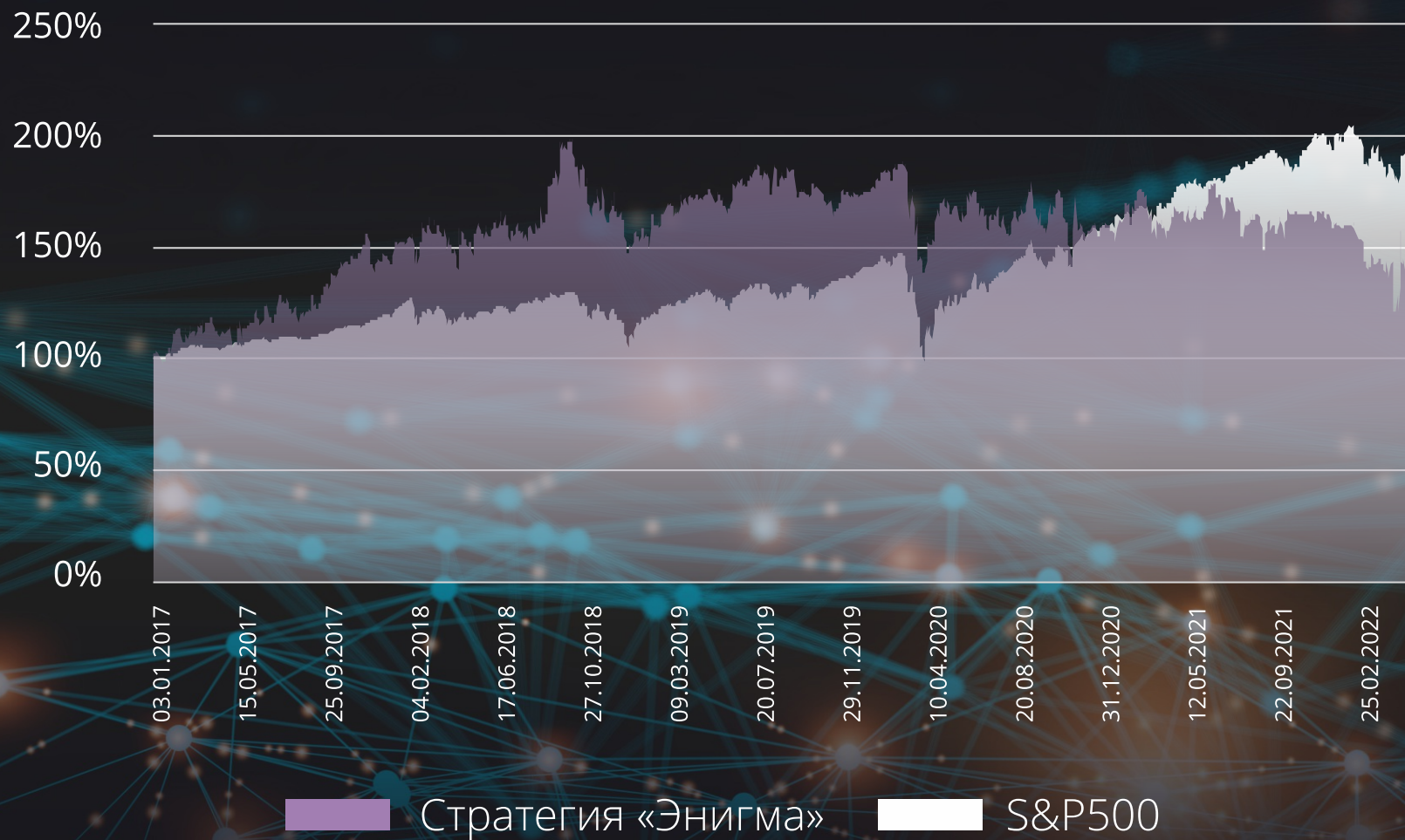
Статистические показатели стратегии «Энигма», ₽

Доход за весь период

Среднегодовая доходность
(сложный процент)

ПОКАЗАТЕЛЬ	СТРАТЕГИЯ	S&P500
Период управления		
Цена портфеля на начало периода		
Цена портфеля на конец периода		
Доход за весь период		
Среднегодовая доходность (сложный процент)		
Максимальное снижение		
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)		

Динамика доходности стратегии «Энигма», \$



Статистические показатели стратегии «Энигма», \$

Доход за весь период

Среднегодовая доходность
(сложный процент)

ПОКАЗАТЕЛЬ	СТРАТЕГИЯ	S&P500
Период управления		
Цена портфеля на начало периода		
Цена портфеля на конец периода		
Доход за весь период		
Среднегодовая доходность (сложный процент)		
Максимальное снижение		
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)		

«ФИНАМ» — глобальный брокер и национальный лидер в сфере инвестиционных услуг



С 1994 ГОДА
НА РЫНКЕ



БОЛЕЕ 340 000
КЛИЕНТОВ



БОЛЕЕ 90 ОФИСОВ
ПО ВСЕЙ СТРАНЕ



«Премия Invest Idei Awards — 2021»
за самую точную аналитику
2021



«Лучшее аналитическое
покрытие иностранных акций»
по версии Московской биржи
2021



«Инвестиционный советник года»,
премия «Элита фондового рынка»
2020



Лауреат премии
«Эффективное образование» —
Учебный центр «ФИНАМ»
2020



«Компания срочного рынка»,
премия «Элита фондового рынка»
2020



Лауреат премии «Развитие
регионов. Лучшее для России»
2020

...и еще более 50 наград!

Информация, представленная в данном материале, не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией. Она составлена без учета вашего инвестиционного профиля, а упомянутые финансовые инструменты либо операции могут не соответствовать ожидаемой вами доходности, горизонту инвестирования, а также допустимому для вас риску убытков. АО «ФИНАМ», УК «Финам Менеджмент», АО «Банк ФИНАМ» не несут ответственности за возможные убытки в случае совершения операций либо инвестирования в финансовые инструменты, упомянутые в данном материале, и не рекомендуют использовать его в качестве единственного источника информации при принятии инвестиционного решения.

