

Стратегия «Большое дерево»

Ключевой аспект: включение в портфель акций российских компаний на основе критериев фундаментального и технического анализа с использованием новой методики управления рисками, которая нацелена на минимизацию возможных потерь.

Минимальный порог инвестиций: 1 000 000 рублей.

На кого ориентирована стратегия

Данная стратегия подойдёт инвесторам, не склонным к высоким рискам, предпочитающим сбалансированные инвестиции.

Краткое описание

Стратегия базируется на сбалансированном сочетании систематизированного технического и фундаментального анализа. На основе совокупности этих критериев производится отбор акций для включения в портфель. Строгий Риск-менеджмент направлен на снижение вероятности неблагоприятного результата и минимизацию возможных потерь, что крайне важно в инвестировании. Применение данного подхода нацелено на формирование портфеля с соотношением доходности и риска для умеренно консервативной группы инвесторов.

Методика формирования портфеля

Инвестирование в рамках стратегии «Большое дерево» осуществляется как в «голубые фишки», такие как ценные бумаги ОАО «Газпром», ОАО «Сбербанк России», ОАО «ГМК «Норильский никель», так и в менее ликвидные акции второго эшелона российского фондового рынка.

На ежедневной основе производится анализ графиков котировок акций на наличие сигналов к совершению сделок по данной стратегии. Формирование сигналов происходит на основе нескольких технических индикаторов, ключевым из которых является оптимизированный *Ценовой канал (Price channel)*. Принцип построения данного индикатора состоит в том, что определяется максимальная и минимальная цена за выбранный период времени. Кроме того, используется индикатор *Средний истинный диапазон (Average True Range - ATR)*, он представляет собой показатель волатильности рынка в период, заданный программной системой, которую использует управляющий. При поступлении от системы сигнала на покупку, приобретение бумаги может осуществляться до момента достижения предельной цены покупки, после достижения которой, сделка не совершается из-за изменения соотношения доходности и риска. Продажа бумаги происходит при поступлении от системы сигнала на выход из позиции, либо при достижении цены, изначально определённой при первоначальных расчетах в качестве страховки от падения, в моменте.

Мониторинг портфеля

Пересмотр структуры портфеля осуществляется ежедневно, в зависимости от сигналов по программной системы. Одновременно производится мониторинг новостного фона по компаниям, акции которых включены в портфель.

ООО «Управляющая компания «Финам Менеджмент».

Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами №077-11748-001000 от 11.11.2008, выдана ФСФР России, без ограничения срока действия.

Все заинтересованные лица могут до заключения соответствующего договора ознакомиться с условиями управления активами, получить сведения о лице, осуществляющем управление активами, и иную информацию, которая должна быть предоставлена в соответствии с федеральным законом и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации по указанным ниже адресу и/или телефону.

Адрес: Россия, г. Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2, комн. 29.

Тел.: 8-800-200-44-00 (бесплатно по России),

+7 (495) 796-90-26 (многоканальный),

факс: +7 (495) 796-93-89.

Почтовый адрес: Россия, 127006, г. Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2, комн. 29.

Режим работы офиса: понедельник – пятница: 10:00 - 21:00, суббота: 10:00 – 16:00, воскресенье: выходной

Адрес электронной почты: dudoc@corp.finam.ru

Адрес страницы в сети Интернет: www.fdu.ru

Результаты деятельности управляющего по управлению ценными бумагами в прошлом не определяют доходы учредителя управления в будущем. Государство не гарантирует доходность инвестиций.

Настоящий материал и содержащиеся в нем сведения носят исключительно информативный характер, не являются офертой и не могут рассматриваться как приглашение или побуждение сделать оферту или как просьба купить или продать ценные бумаги/другие финансовые инструменты, либо осуществить какую-либо иную инвестиционную деятельность.

Представленная в материале информация подготовлена на основе источников, которые, по мнению авторов, являются надежными, но, при этом отражает исключительно мнение авторов относительно описываемых объектов и проведенные авторами исследования. Несмотря на то, что информация, приведенная в материале, отражена с максимально возможной тщательностью, ООО «Управляющая компания «Финам Менеджмент» не заявляет и не гарантирует ни прямо, ни косвенно ее точность и полноту. Любая информация и любые суждения, приведенные в данном материале, являются суждением на момент публикации настоящего материала и могут быть изменены без предупреждения.

Ни ООО «Управляющая компания «Финам Менеджмент», ни его сотрудники не несут ответственности за какие-либо потери, возникшие в результате использования настоящего материала либо в какой-либо другой связи с ним.

Копирование, воспроизводство и/или распространение настоящего материала, частично или полностью, без

письменного разрешения ООО «Управляющая компания «Финам Менеджмент» категорически запрещено.