

## Стратегия «Защита Каро- Канн»

**Ключевой аспект:** включение в портфель акций российских компаний на основе математических методов анализа спроса и предложения на рынке. Использует строгий риск-менеджмент целью которого является снижение вероятности неблагоприятного результата даже в кризисные периоды.

**Минимальный порог инвестиций:** 1 000 000 рублей

## На кого ориентирована стратегия

Данная стратегия подойдет инвесторам, которые предпочитают минимальные риски и сбалансированный подход к инвестициям.

## Краткое описание

Стратегия базируется на математических методах анализа поведения акций на рынке. В стратегии реализуется основной принцип торговли на рынке «Давай прибыли течь, режь убытки сразу». Если позиция, включенная в портфель, не приносит прибыли, она исключается в кратчайшие сроки, в то время как растущие позиции удерживаются максимально возможное время.

## Методика формирования портфеля

Выбор ценных бумаг для инвестиций в рамках стратегии «Защита Каро-Канн» осуществляется среди ста акций с наибольшим объемом сделок на ММВБ. Основная задача стратегии – выделить акции, в которых наблюдается устойчивый спрос даже в кризисное время.

Ежедневно проводится математический анализ котировок акций на наличие сигналов к совершению сделок по данной стратегии. Формирование сигналов происходит на основе оценки поведения акции. К примеру, одним из основных критериев является установление акцией новых максимумов. Изначально в портфель покупаются активы только на часть средств, в случае, если стоимость активов продолжает расти, то происходит докупка. Данная методика позволяет избежать ошибок в самом начале инвестирования и использовать накопленную прибыль в качестве «подушки безопасности». Выход из позиции осуществляется единовременно.

## Мониторинг портфеля

Мониторинг портфеля происходит ежедневно, пересмотр структуры портфеля осуществляется в среднем 3-4 раза в месяц.

## Контакты

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](mailto:dudoc@corp.finam.ru)

Адрес страницы в сети Интернет: [www.fdu.ru](http://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.