

Стратегия «Все Преимущества»

Краткое описание



ФИНАМ

Стратегия «Все Преимущества»

Стратегия «Все Преимущества» является сочетанием фундаментального анализа и вероятностно-статистических математических методов управления портфельными инвестициями. Причем, что наиболее актуально, существенную долю в портфеле данной стратегии составляют акции второго эшелона, которые в некоторых случаях, на наш взгляд, имеют более высокий потенциал роста, чем сегмент «голубых фишек».

Минимальный порог инвестиций: 500 000 руб.

Краткое описание

Стратегия «Все Преимущества» является уникальным сочетанием практически всех подходов управления портфельными инвестициями, включая самые передовые идеи финансового инжиниринга последних лет.

Отбор бумаг в портфель осуществляется на основе фундаментального анализа. Существенное влияние на структуру портфеля оказывает как текущая, так и прогнозируемая макроэкономическая ситуация.

Важным аспектом данной стратегии является использование системы управления рисками, а также применение эффективных методов теории вероятности и статистики при определении оптимального времени открытия позиций. Здесь используется алгоритм оценки волатильности и других показателей риска всего портфеля, а также динамический анализ этих индикаторов. Причем торговля осуществляется не отдельными бумагами, а оптимальным, с точки зрения фундаментального анализа, портфелем в целом.

Сочетание фундаментального анализа в совокупности с системой контроля за рисками и теорией оптимального управления позволяет реализовать уникальную среднесрочную стратегию для торговли на ММВБ. В ней дополнительно реализуется еще одно важное преимущество – возможность работы с малыми капиталами в перспективном сегменте акций второго эшелона.

Методика формирования портфеля

Торговля в данной стратегии осуществляется не отдельными бумагами, а диверсифицированным портфелем, который составляется из акций российских компаний (как голубых фишек, так и менее ликвидных акций второго эшелона), отбираемых на основе фундаментального анализа. Инструментарий фундаментального анализа предполагает использование передовых методик сравнительной оценки и оценки на основе прогнозирования будущих финансовых показателей анализируемых компаний.

Мониторинг портфеля

В рамках системы контроля за рисками мониторинг портфеля осуществляется на ежедневной основе. Пересмотр структуры портфеля осуществляется еженедельно.

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 указанному ниже адресу и/или телефону:

Адрес: Россия, г. Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2, комн. 29.
Телефон: 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: du-light@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.