

Стратегия «Двойной удар»

Краткое описание



ФИНАМ

Стратегия «Двойной Удар»

Философия стратегии:

В данной стратегии совмещены два классических подхода: фундаментальный анализ, в основе которого лежит экономическая теория и технический анализ, базирующийся на математическом аппарате.

Ключевой аспект стратегии:

Комбинация фундаментального и технического анализа позволяет с одной стороны отбирать недооцененные акции и создавать интересные инвестиционные идеи¹, с другой стороны четко определять уровни стоп-приказов², являющихся частью комплекса алгоритмов управления рисками в рамках стратегии.

Минимальная сумма инвестиций³: 500.000 рублей.

На кого ориентирована стратегия:

Данная стратегия подойдет инвесторам, склонным к риску, и вложениям в акции «второго эшелона»⁴.

Краткое описание стратегии:

Для того чтобы оценить потенциал роста ценной бумаги используются многочисленные инструменты и мультипликаторы⁵ (например, чистая прибыль компании к ее рыночной стоимости), позволяющие определить оптимальную для покупки стоимость акции. Акции развивающихся компаний и с наибольшей недооцененностью попадают в инвестиционный портфель⁶. Расчет долей активов в инвестиционном портфеле и уровень стоп-приказов определяются на основе классической портфельной теории Г. Марковица.

Методика формирования портфеля:

Портфель состоит из двух инвестиционных составляющих:

1. Первая часть средств инвестируется в «голубые фишки»⁷, то есть наиболее ликвидные акции. Для данных позиций происходит ежедневная переоценка ситуации и уровня стопа, то есть осуществляется активное управление.
2. Оставшаяся часть портфеля отводится для покупки активов под долгосрочные инвестиционные идеи.

¹ Инвестиционная идея – замысел по осуществлению инвестиций в тот или иной объект в наибольшей степени способствующих возможности практической реализации задач инвестирования.

² Стоп-приказ (stop order) - этот приказ исполняется по рынку, когда сделки проходят по цене, по которой был отдан ордер. По этому ордеру может быть осуществлен вход и выход на рынок. Выходы обычно называют стоп-лосс (stop-loss) - это стоп-приказ, ограничивающий убытки, и тэйк-профит (take-profit) – стоп-приказ, фиксирующий прибыль. При отдаче такого приказа на покупку (buy-stop), цена должна быть выше текущей рыночной цены, на продажу (sell-stop) - ниже.

³ Минимальная сумма инвестиций – минимальный размер суммы денежных средств, необходимых для формирования портфеля клиента по стратегии.

⁴ К акциям "второго эшелона" принято относить широкий спектр ценных бумаг, эмитенты которых не входят в число компаний первой величины на фондовом рынке.

⁵ Финансовые мультипликаторы - финансовые коэффициенты, на основе которых происходит оценка компаний (эмитентов).

⁶ Портфель – совокупность ценных бумаг и/или денежных средств, включая иностранную валюту, предназначенных для инвестирования в ценные бумаги, в том числе полученными управляющим в процессе деятельности по управлению ценными бумагами, принадлежащих клиенту физическому или юридическому лицу, выступающих как целостный объект доверительного управления.

⁷ Голубые фишки - акции или ценные бумаги наиболее крупных, ликвидных и надёжных компаний со стабильными показателями получаемых доходов и выплачиваемых дивидендов.

Мониторинг состояния портфеля:

Для первой части портфеля отбираются так называемые компании эмитенты ценных бумаг, чей бизнес постоянно расширяется. Пересмотр данной части портфеля происходит раз в 3 месяца. Активы под долгосрочные инвестиционные идеи приобретаются по мере поступления новостей о той или иной компании - эмитенте.

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 требованиями действующего законодательства Российской Федерации, в том числе нормативно правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг, по указанным ниже адресу и 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 или 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. Любые данные, информация, идеи и суждения, приведенные в данном материале, являются данными, информацией, идеями и суждениями 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.