

Стратегия «Синергия»

Краткое описание



Краткое описание стратегии

Стратегия «Синергия*» представляет собой сплав двух стратегий. В качестве долгосрочной, «инвестиционной», составляющей здесь присутствует стратегия «Нефть – Золото – Валюта – Акции», а в качестве краткосрочной, «спекулятивной», – «Пилигрим»

«НЗВА», отслеживая динамику на нескольких практически не связанных между собой рынках (индекс РТС, золото, нефть и курс доллара США к рублю), отрабатывает более глобальные тренды продолжительностью от нескольких недель до нескольких месяцев. «Пилигрим», со свойственной ему чувствительностью, настроен на ловлю средне- и краткосрочных трендов в американской валюте протяженностью от нескольких дней до месяца.

Сплав стратегий «НЗВА» и «Пилигрим» позволяет создать эффективный инструмент для работы на финансовых рынках. Ведь стратегия «Синергия», так же, как и стратегии-доноры, во-первых, является мультирыночной, во-вторых, при возобновлении роста российского рынка акций будет участвовать в нем посредством покупки фьючерсных контрактов на индекс РТС, и наконец, в-третьих, хеджирует инвестиционный счет, не только защищая его от обесценивания рубля, но и позволяя получить дополнительный доход.

Кому адресована стратегия

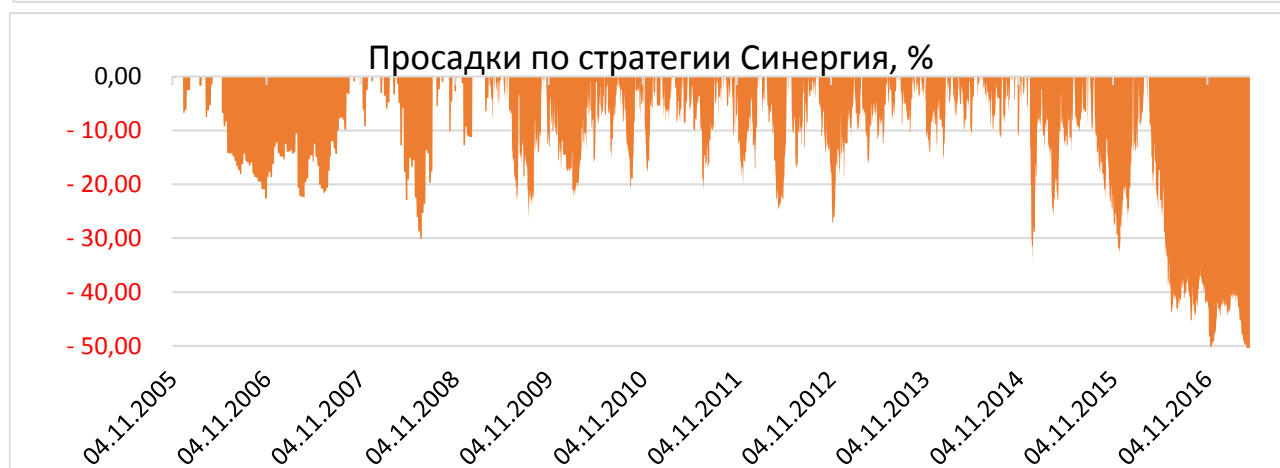
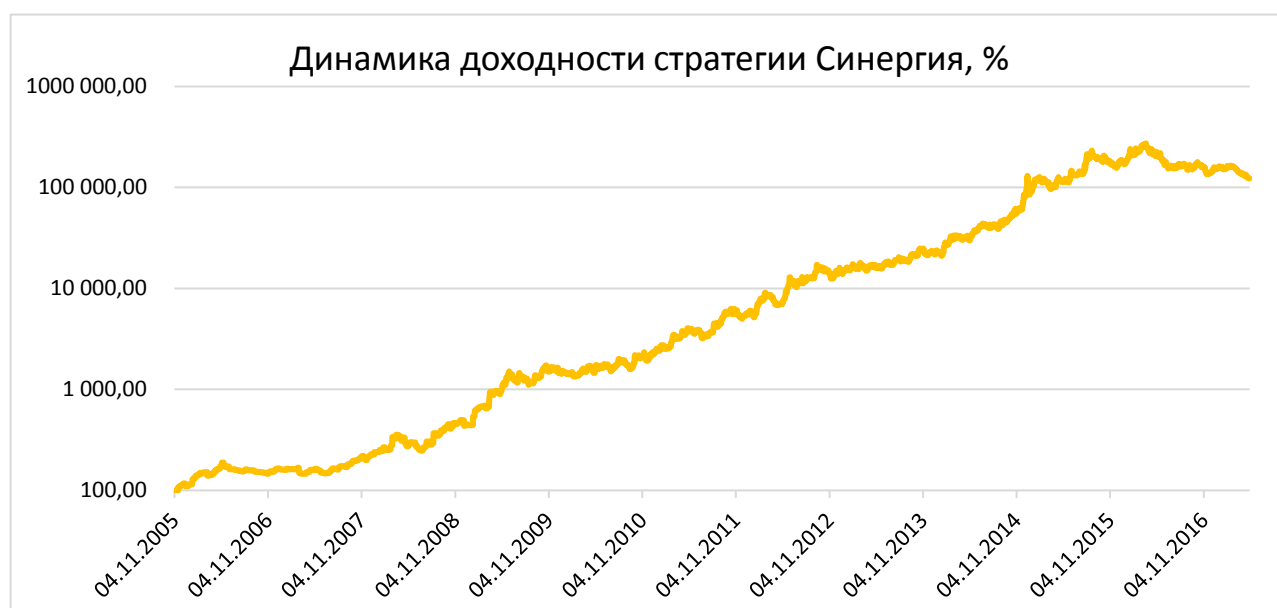
Данную стратегию можно порекомендовать активным инвесторам, толерантным к повышенным рискам, которые, удерживая относительно долгосрочные позиции, одновременно предпочитают совершать менее продолжительные спекулятивные операции.

* Синергия (от греч. *συνεργία* – сотрудничество; от греч. *σύν* – вместе, от греч. *ἔργον* – дело, (воз) действие) – суммирующий эффект взаимодействия двух или более факторов, характеризующийся тем, что их действие существенно превосходит эффект каждого отдельного компонента в виде их простой суммы.

Начальная дата: 04.11.05

Конечная дата: 01.11.17

	Стратегия	Индекс ММВБ
Среднегодовая доходность, %	81,4	7,4
Максимальная просадка, %	-62,3	-73,9



Помесячная доходность стратегии Синергия, %

	Янв	Фев	Мар	Апр	Май	Июн	Июл	Авг	Сен	Окт	Ноя	Дек	Итого
2017	0,0	2,8	-15,3	-10,4	-12,6	-1,9	2,5	13,1	2,5	1,8			-19,0
2016	18,6	11,0	6,6	-8,4	-17,9	-13,7	3,9	-9,8	10,3	-3,7	-12,8	13,2	-10,5
2015	37,1	-10,9	-9,3	11,7	4,3	12,6	31,8	17,1	-11,0	-5,0	-11,1	12,7	89,8
2014	23,5	8,2	4,6	-5,1	22,8	11,8	-2,4	7,3	9,7	14,0	29,9	30,5	304,4
2013	10,5	0,4	-9,8	13,4	-0,4	1,1	13,7	-4,1	16,2	10,8	-5,2	0,3	52,4
2012	16,9	27,3	-14,2	-8,2	77,8	-7,5	4,3	6,1	19,2	-6,5	3,9	1,5	150,7
2011	5,4	19,8	7,3	24,2	-7,0	-11,0	9,0	19,8	27,6	5,0	-8,2	11,4	149,4
2010	-2,8	-3,8	10,3	-3,9	12,6	0,8	7,0	2,0	-2,5	17,9	-0,6	16,2	62,7
2009	43,7	8,6	27,8	8,3	47,7	-15,4	3,0	-5,3	16,4	11,2	3,5	-5,6	233,3
2008	11,6	4,8	20,5	-18,9	9,6	-11,7	7,5	22,5	21,4	9,8	7,3	-11,2	85,3
2007	1,0	4,0	-13,2	9,9	-6,3	-0,8	8,0	7,5	9,2	12,4	0,7	11,7	49,2
2006	23,1	7,0	-5,2	14,8	4,9	-7,1	-1,7	-0,3	-2,6	-4,8	8,2	1,8	39,8
2005											11,4	2,9	14,7

Риски оценены по методике VAR. Согласно расчёту, годовой VAR с вероятностью 99% составляет -41,6%.

Максимальная продолжительность наблюдавшейся просадки составляет 589 дней.

Дополнительная информация

Консультации и поддержка	
В Москве	8-495-796-90-26
По России	8-800-200-44-00 (бесплатно)

Обучение от крупнейшего брокера России

Уровень «Начинающий» – это оптимальное сочетание теоретического курса основы биржевого дела и практических занятий с использованием данных реального рынка. [Подробнее...](#)

Уровень «Профессионал» – подходит для трейдеров, желающих расширить свой арсенал методов работы на фондовом рынке. [Подробнее...](#)

Поддержка профессиональных трейдеров

У Вас есть возможность видеть, что именно покупают профессиональные трейдеры компании «ФИНАМ». Для этого не необходимо стать клиентом компании. [Подробнее...](#)

Быстрое открытие брокерского счета

Открыть счет можно [дистанционно](#), не выходя из дома.

Преимущества работы с нами

- Сервис от [«Лучшего брокера Восточной Европы»](#);
- Открытие счета от [30 000 рублей](#);
- Более [315 000 клиентов](#), уже пользующихся услугами группы компаний «ФИНАМ»;
- Широкая [региональная сеть](#).

Настоящий материал и содержащиеся в нем сведения предназначены для клиентов АО «ФИНАМ», носят исключительно информативный характер и не могут рассматриваться ни как приглашение или побуждение сделать оферту, ни как просьба купить или продать ценные бумаги/другие финансовые инструменты, либо осуществить какую-либо иную инвестиционную деятельность. Представленная информация подготовлена на основе источников, которые, по мнению авторов данного аналитического обзора, являются надежными, но при этом отражает исключительно мнение авторов относительно анализируемых объектов. Несмотря на то, что настоящий обзор был составлен с максимально возможной тщательностью, ни его авторы, ни АО «ФИНАМ» не заявляют и не гарантируют ни прямо, ни косвенно его точность и полноту. Любая информация и любые суждения, приведенные в данном материале, являются суждением на момент публикации настоящего аналитического обзора и могут быть изменены без предупреждения. Ни АО «ФИНАМ», 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 АО «ФИНАМ» категорически запрещено.