

Стратегия «Синергия Оптимум»



Финам

Стратегия «Синергия Оптимум»

Краткое описание стратегии

Стратегия «Синергия Оптимум» – более умеренный вариант популярной агрессивной стратегии «Синергия».

В основе торговой системы «Синергия Оптимум» лежит метод диверсификации портфеля при помощи инвестирования в самые ликвидные инструменты различных рынков Московской биржи. Благодаря такому подходу подписчики могут получать прибыль как от колебаний котировок рубля к доллару США и индекса РТС, так и от изменения стоимости нефти и золота.

Как и старшая «Синергия», стратегия «Синергия Оптимум» сочетает преимущества торговых систем «Нефть-золото-валюта-акции» («НЗВА») и «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 работу со средне- и краткосрочными трендами 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 Оптимум», 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, надежно хеджирует инвестиционный счет, не только защищая его от обесценивания рубля, но и позволяя получить дополнительный доход.

Отличительной особенностью стратегии «Синергия Оптимум» является возможность инвестирования части портфеля в инструменты с фиксированной доходностью – облигации федерального займа и облигации российских компаний. Вложение в облигации позволяет получать небольшой доход, когда рынки находятся в состоянии сильной волатильности и присутствует риск потери средств.

Кому адресована стратегия

Стратегия «Синергия Оптимум» – эффективное решение для клиентов, ориентированных на умеренные риски, которые рассчитывают получить относительно высокую потенциальную доходность при меньшей волатильности счета.

Начальная дата: 04.11.05

Конечная дата: 31.10.17

	Стратегия	Индекс ММВБ
Среднегодовая доходность, %	41,0	7,4
Максимальная просадка, %	-28,8	-73,9



Помесячная доходность стратегии Синергия Оптимум, %

	Янв	Фев	Мар	Апр	Май	Июн	Июл	Авг	Сен	Окт	Ноя	Дек	Итого
2017	0,5	2,3	-7,4	-4,8	-5,9	-0,7	1,7	7,8	1,7	1,3			-4,2
2016	8,9	5,7	3,3	-3,1	-7,6	-5,6	2,3	-3,6	4,8	-1,1	-4,3	7,8	6,0
2015	17,7	-4,0	-2,3	7,3	2,6	6,2	14,6	7,5	-4,5	-1,0	-4,6	6,2	52,3
2014	10,3	3,0	2,7	-4,2	10,9	5,7	-2,1	3,3	5,3	6,1	12,6	11,3	85,4
2013	5,4	0,9	-3,0	5,1	-0,5	0,0	6,6	-1,9	7,2	5,3	-2,4	0,7	25,1
2012	7,9	12,2	-5,9	-3,2	29,1	-2,3	3,7	3,5	8,7	-1,3	3,1	1,8	68,2
2011	3,0	8,6	3,8	10,6	-2,7	-4,1	4,3	8,0	11,0	2,8	-3,4	5,5	56,9
2010	-0,3	-0,5	6,1	-1,0	5,4	1,7	3,7	1,4	-0,3	7,7	0,1	6,9	34,7
2009	18,4	6,6	16,5	5,7	21,7	-6,2	3,2	-1,5	8,9	7,0	2,7	-1,1	113,8
2008	5,8	2,1	9,9	-8,0	5,0	-5,2	3,3	10,5	6,0	1,5	2,8	-3,4	32,5
2007	1,0	2,3	-5,9	5,1	-2,4	0,2	4,4	3,0	3,7	6,8	0,6	5,7	26,6
2006	11,7	3,7	-2,2	7,4	3,1	-3,3	-0,4	0,5	-0,8	-1,8	4,2	1,3	24,7
2005											5,8	2,0	7,9

Риски оценены по методике VAR. Согласно расчёту, годовой VAR с вероятностью 99% составляет -14,5%.

Максимальная продолжительность наблюдавшейся просадки составляет 588 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.