

Инвестиционная стратегия

«Золотое сечение»

www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 2107
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

Концепция стратегии

Выдающийся математик Фибоначчи, открыв в XIII в. числовую последовательность, названную впоследствии его именем, можно сказать, «поверил алгеброй гармонию». Соотношение чисел Фибоначчи, как и знаменитая пропорция «золотое сечение», описывает универсальный закон природы, отражающий порядок устройства нашего мира. Применение принципа золотого сечения — меньшая часть относится к большей, как большая ко всему целому — мы видим буквально повсюду:



СПИРАЛЬ ДНК



ПЧЕЛИНЫЕ СОТЫ



ПИРАМИДА В ГИЗЕ



МУЗЫКАЛЬНЫЕ ПРОИЗВЕДЕНИЯ



КРИСТАЛЛИЧЕСКИЕ ОБРАЗОВАНИЯ

Финансовые рынки точно так же подчиняются законам природы, и потому в трейдинге так популярно применение уровней Фибоначчи, то есть торговля с применением последовательности чисел Фибоначчи.

Стратегия «Золотое сечение» использует те же математические законы, по которым устроен наш мир, и изящные решения, подсказанные самой природой.

www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 2107
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

Методика формирования портфеля

Рыночные индексы практически каждый день меняют свое движение. Человеку по своей природе сложно столь же часто перестраивать собственное видение рынка — инвестор психологически привыкает к текущим ценам и любое их изменение в ту или иную сторону **изначально воспринимает как переоценку или недооценку актива**. Люди с большой неохотой фиксируют убытки, зато при получении малейшей прибыли стремятся закрыть позицию, тем самым недополучая значительную часть прибыли.

КАК ИЗБЕЖАТЬ ЭТИХ ОШИБОК? ОБРАТИТЬСЯ ЗА ПОМОЩЬЮ К ЦАРИЦЕ НАУК — МАТЕМАТИКЕ

Среди тысяч биржевых методов на протяжении десятилетий самым эффективным, простым и точным остается торговля с помощью уровней Фибоначчи — «межевых линий», разделяющих «ареалы» обитания «быков» и «медведей».

2 x 2

ЛЕГКОСТЬ И ПРОСТОТА ПРИМЕНЕНИЯ МЕТОДА



ЭФФЕКТИВНЫЙ СПОСОБ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ТРЕНДА



ПОМОЩНИК В ОПРЕДЕЛЕНИИ ВОЗМОЖНЫХ ЦЕЛЕВЫХ ЦЕН



НАДЕЖНЫЙ СПОСОБ ИДЕНТИФИКАЦИИ «РАЗВОРОТОВ»

www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 2107
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

Методика формирования портфеля



Торговая стратегия «Золотое сечение» внимательно отслеживает все уровни сопротивления и поддержки.



Наличие специальных фильтров не дает системе совершить фальстарт и отсекает убыточные сделки.



Когда загорается «зеленый свет», стратегия в ту же секунду подает заявку на биржу. «Золотое сечение» торгует на среднесрочных тенденциях продолжительностью от нескольких часов до нескольких дней. В год стратегия может совершить до 60 сделок по одной акции.



Стратегия торгует только «голубыми фишками», самыми ликвидными акциями российского рынка, что минимизирует возможные потери от «проскальзываний».



Для получения максимального результата с каждого движения в торговой системе используются только те акции, амплитуда колебания цен которых значительно выше по сравнению со среднерыночными показателями. Ими оказались акции гигантов российской экономики – Газпрома, Сбербанка и Банка ВТБ.

www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 2107
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

финам

Риск-менеджмент



Уникальная особенность алгоритма — расчет приказов Take profit по уровням Фибоначчи от предыдущих сильных движений.



Предусмотрена возможность эффективной торговли не только для периодов роста, но и в случае продолжительного снижения.

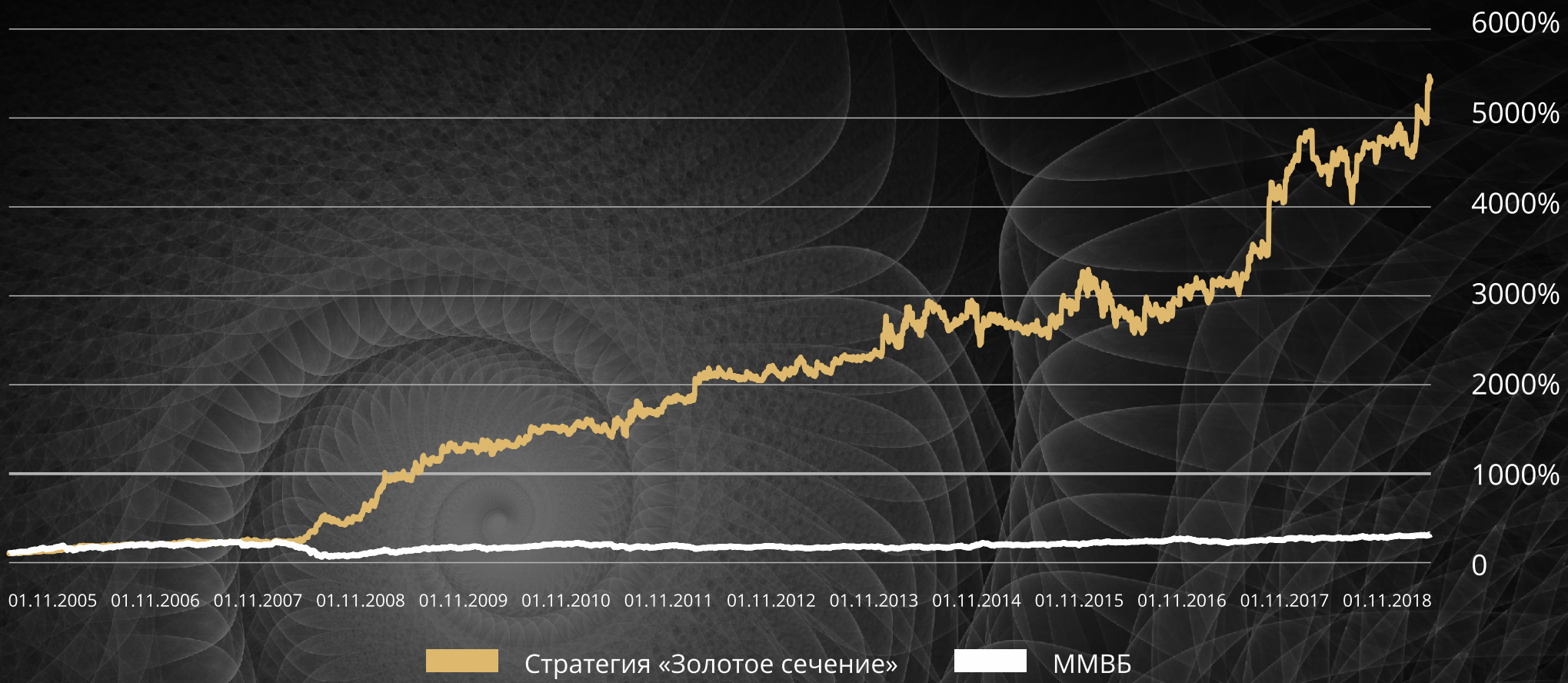


Адаптивный алгоритм для любого состояния российского рынка, в том числе кризисного.

www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 2107
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

Динамика доходности стратегии «Золотое сечение»



www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 2107
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

Статистические показатели стратегии «Золотое сечение»

5322,13%

ДОХОД ЗА ВЕСЬ ПЕРИОД

34%

СРЕДНЕГОДОВАЯ ДОХОДНОСТЬ

(СЛОЖНЫЙ ПРОЦЕНТ)

	Стратегия	Индекс ММВБ
Период управления	165 мес.	165 мес.
Цена портфеля на начало периода	1 000 000 руб.	1 000 000 руб.
Цена портфеля на конец периода	54 221 264 руб.	3 118 020 руб.
Доход за весь период	5322,13%	211,80%
Среднегодовая доходность (сложный процент)	34%	9%
Максимальное снижение	-21,60%	-73,93%
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)	1,08	0,20



www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 2107
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

финам

Отдел инвестиционного консультирования

+7 495 796 93 88, доб. 4000
e-mail: _InvestmentConsulting@corp.finam.ru
www.finam.ru



Финам