СТРАТЕГИЯ
«СЕМЬ САМУРАЕВ»

Наверняка все помнят ставшую классикой историческую сагу Акиры Куросавы «Семь самураев» (1954). Сюжет данной картины вошел в золотой фонд кинематографии и был неоднократно воссоздан в ремейках. Вдохновленные образами героев Куросавы, мы постарались создать торговую стратегию, объединяющую акции. Подобно тому, как у каждого из семи самураев уникальный характер и собственный путь, у каждой из акций свое предназначение и уникальные характеристики. Прежде чем попасть в диверсифицированный портфель, каждая акция проходит многоуровневый кропотливый отбор, чтобы принести максимальную пользу стратегии.



www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 4000
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

ОТБОР АКТИВОВ В ПОРТФЕЛЬ

ЛИКВИДНОСТЬ

Только акции из индекса Московской биржи

ДИВЕРСИФИКАЦИЯ

В портфель включаются акции из различных секторов российской экономики

ПОТЕНЦИАЛ РОСТА

Только лучшие акции приобретаются в портфель. Аутсайдеры формируют в портфеле позиции с короткой продажей

НЕЙТРАЛЬНОСТЬ

Динамика портфеля практически не зависит от динамики российского рынка

Наш многолетний опыт в совокупности с детальным анализом показывает, что часто акции, наиболее удовлетворяющие требованию по ликвидности, включаются в фондовые индексы, такие, например, как индекс ММВБ. Поэтому для первоначального отбора бумаг в портфель мы используем именно акции, вошедшие в индекс ММВБ.

Диверсификация осуществляется на основе статистических оценок коэффициентов корреляции акций. Таким образом, только семь акций, отобранных способом, указанным выше, подобно семи самураям противостоят опасностям, турбулентности финансовых рынков и кризисам.

---

www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 4000
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Стратегия включает в себя «оборону» в виде системы контроля за рисками, использующую как стандартные, так и уникальные инновационные подходы современного портфельного управления.

РАЗМЕР ПОЗИЦИИ

Зависит от волатильности рынка. Чем ниже волатильность, тем ближе расположен стоп-лосс

ФИЛЬТР ПО НАЛИЧИЮ ТРЕНДА

Если у фундаментально дешевой акции отсутствует растущий тренд, то такой инструмент не включается в портфель

РЕБАЛАНСИРОВКА ПОРТФЕЛЯ

Пересмотр структуры портфеля осуществляется ежемесячно

Система контроля за рисками построена на том, что в результате исторического статистического тестирования определяется такой критический уровень снижения, который может свидетельствовать о наступлении:

- Негативного тренда на рынке
- Кризисных явлений на фондовых площадках
- Глобальной нестабильности

---

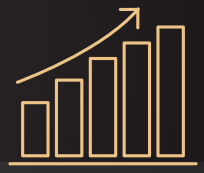
www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 4000
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

УНИКАЛЬНОСТЬ СТРАТЕГИИ



Защищает капитал в случае кризиса



Слабо зависит от общей динамики рынка, новостного фона и слабопредсказуемых событий



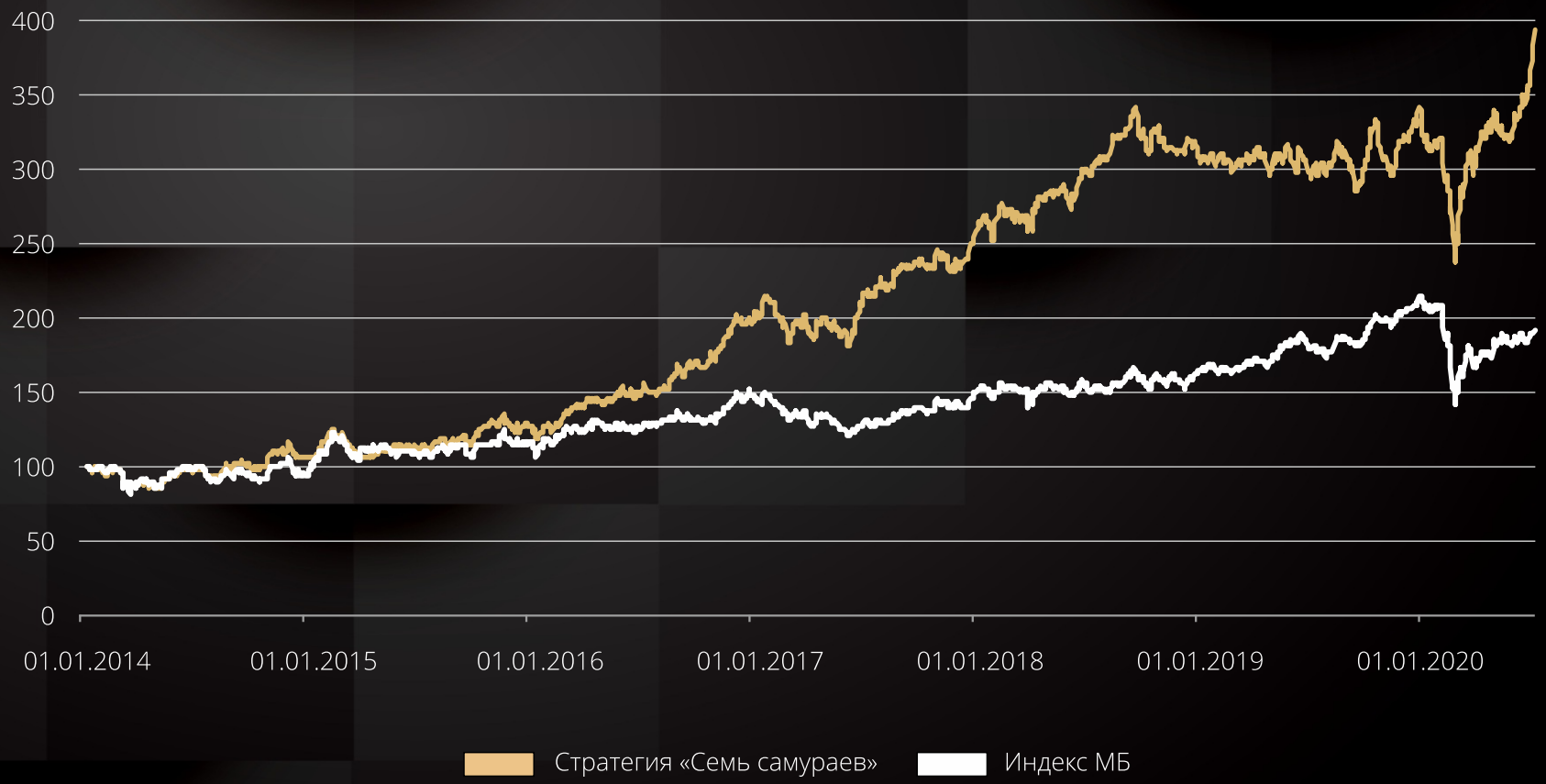
Выбирает только лучшие среднесрочные идеи на российском рынке

www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 4000
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

ПОКАЗАТЕЛИ ДОХОДНОСТИ

ДИНАМИКА ДОХОДНОСТИ СТРАТЕГИИ «7 САМУРАЕВ»



www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 4000
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

СТАТИСТИЧЕСКИЕ ПОКАЗАТЕЛИ СТРАТЕГИИ «СЕМЬ САМУРАЕВ»

293%

Доход за весь период

23%

Среднегодовая доходность (сложный процент)

ПОКАЗАТЕЛЬ	СТРАТЕГИЯ	Индекс МБ
Период	80 мес.	80 мес.
Цена портфеля на начало периода	1 000 000 руб.	1 000 000 руб.
Цена портфеля на конец периода	3 930 000 руб.	1 912 908 руб.
Доход за весь период	293%	91,29%
Среднегодовая доходность	23%	10%
Максимально снижение	-30,30%	-34,39%
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)	0,87	0,37

www.finam.ru | +7 495 796 93 88, доб. 4000
Москва, пер. Настасьинский, д. 7, стр. 2

Финам

«ФИНАМ» — глобальный брокер и национальный лидер в сфере инвестиционных услуг



ВЫСОКИЙ РЕЙТИНГ НАДЕЖНОСТИ RAEX RUA



С 1994 ГОДА НА РЫНКЕ



БОЛЕЕ 260 000 КЛИЕНТОВ



БОЛЕЕ 90 ОФИСОВ ПО ВСЕЙ СТРАНЕ

Гран-при премии «Финансовая элита России» (2018–2019)

Лучшая брокерская компания для розничных инвесторов в рамках премии «Элита фондового рынка — 2018»

«Лучший брокер» по версии журнала Financial One (2015–2016)

Лучшая брокерская компания в секции срочного рынка в рамках премии «Элита фондового рынка — 2019»

Гран-при премии «Финансовая элита России — 2017»

«Лучший брокер Восточной Европы» по версии IAIR Awards 2014

...и еще более 50 наград!

финам

КОНТАКТЫ

Отдел инвестиционного консультирования

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

Информация, представленная в данном материале, не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией. Она составлена без учета вашего инвестиционного профиля, а упомянутые финансовые инструменты либо операции могут не соответствовать ожидаемой вами доходности, горизонту инвестирования, а также допустимому для вас риску убытков. АО «ФИНАМ», УК «Финам Менеджмент», АО «Банк ФИНАМ» не несут ответственности за возможные убытки в случае совершения операций либо инвестирования в финансовые инструменты, упомянутые в данном материале, и не рекомендуют использовать его в качестве единственного источника информации при принятии инвестиционного решения.

Финам