Инвестиционная стратегия

«Золотое сечение США»

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

Финам

Концепция стратегии



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 США» 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

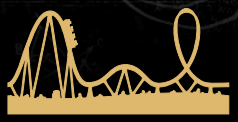
ЛЕГКОСТЬ И ПРОСТОТА ПРИМЕНЕНИЯ МЕТОДА



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 США» 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 США» торгует на среднесрочных тенденциях продолжительностью от нескольких часов до нескольких дней.



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.

Для улучшения диверсификации инвестиций каждый квартал отбираются самые ликвидные акции из всех отраслей экономики в той пропорции, в которой эти отрасли представлены в индексе S&P.

Information Technology	*20%*
Communication Services	*15%*
Consumer Discretionary	*10%*
Energy	*10%*
Financials	*10%*
Health Care	*10%*
Consumer Staples	*25%*
Industrials	
Materials	
Real Estate	
Utilities	

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.

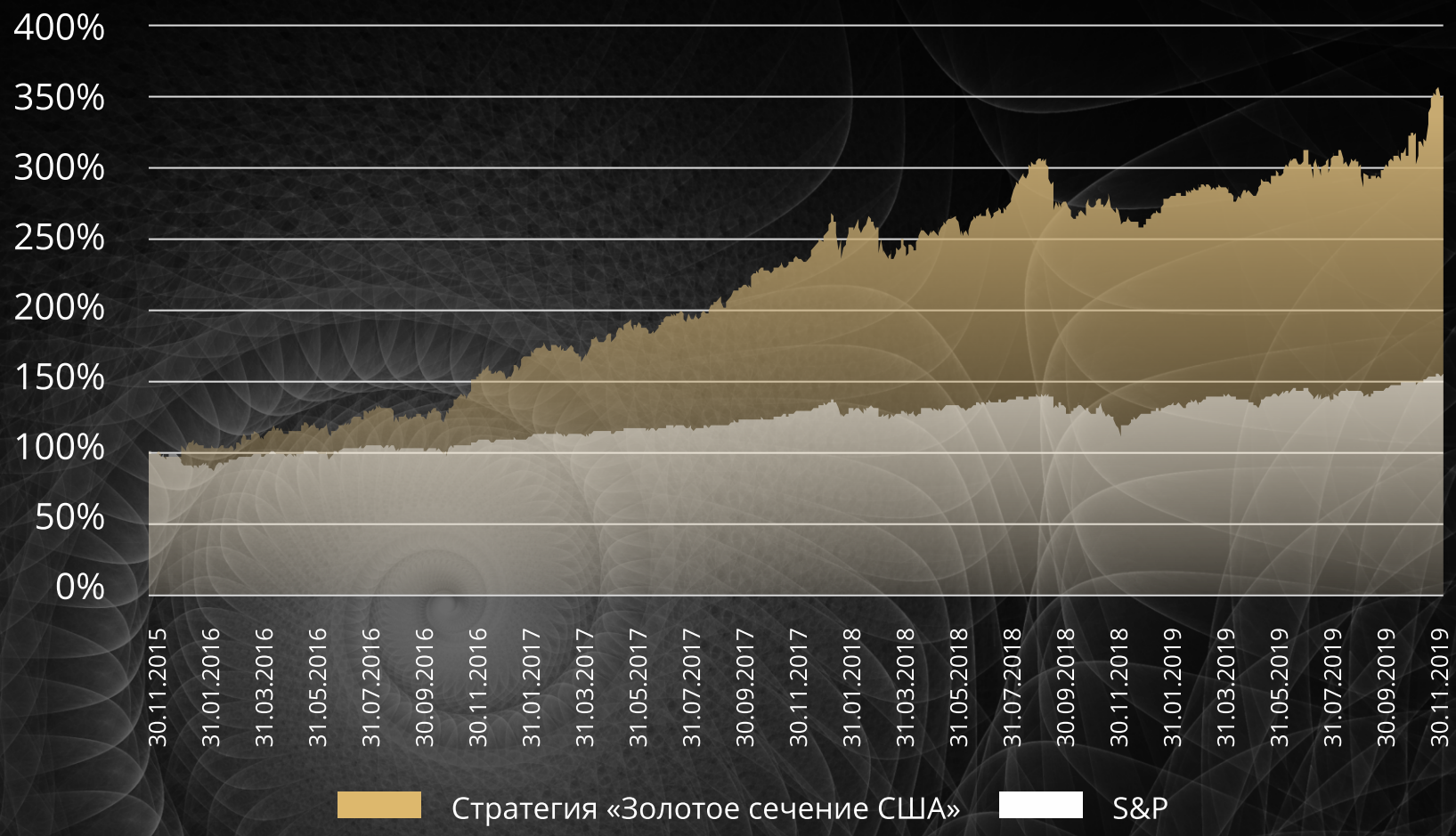


Адаптивный алгоритм для любого состояния российского рынка, в том числе кризисного.

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

Финам

Динамика доходности стратегии «Золотое сечение США», $



Финам

Динамика доходности стратегии «Золотое сечение США», $

250,64%

ДОХОД ЗА ВЕСЬ ПЕРИОД

35%

СРЕДНЕГОДОВАЯ ДОХОДНОСТЬ
(СЛОЖНЫЙ ПРОЦЕНТ)

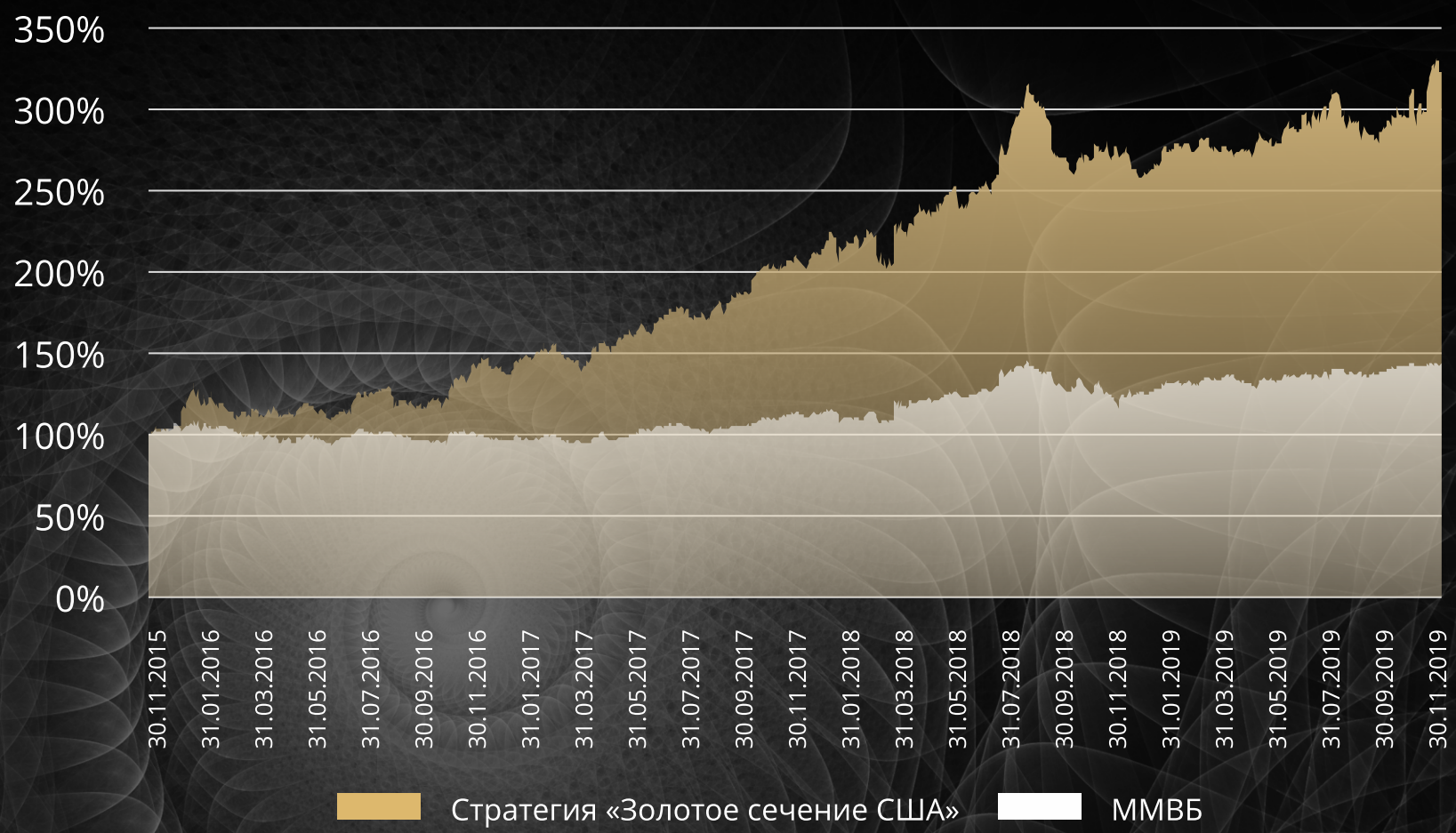
	Стратегия	S&P
Период управления	50 мес.	50 мес.
Цена портфеля на начало периода	1 000 000 $	1 000 000 $
Цена портфеля на конец периода	3 506 443 $	1 556 427 $
Доход за весь период	250,64%	55,64%
Среднегодовая доходность (сложный процент)	35%	11%
Максимальное снижение	-15,94%	-20,62%
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)	1,74	0,76



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

финам

Динамика доходности стратегии «Золотое сечение США», ₽



Финам

Динамика доходности стратегии «Золотое сечение США», ₽

223,75%

ДОХОД ЗА ВЕСЬ ПЕРИОД

33%

СРЕДНЕГОДОВАЯ ДОХОДНОСТЬ
(СЛОЖНЫЙ ПРОЦЕНТ)

	Стратегия	Индекс ММВБ
Период управления	50 мес.	50 мес.
Цена портфеля на начало периода	1 000 000 руб.	1 000 000 руб.
Цена портфеля на конец периода	3 237 492 руб.	1 437 015 руб.
Доход за весь период	223,75%	43,70%
Среднегодовая доходность (сложный процент)	33%	9%
Максимальное снижение	-18,58%	-20,66%
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)	1,48	0,59



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

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