

СТРАТЕГИЯ

USA Islamic Market

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

Финам

Стратегия USA Islamic Markets ориентирована на мусульман, соблюдающих религиозные каноны. В состав стратегии входят перспективные акции на американском рынке, прошедшие скрининг на соответствие нормам ислама по стандартным методологиям, общепринятым в международной практике.



Для составления стратегии используются акции, идентифицированные как Shariah-compliant (соответствующие шариату)[1] ведущими разработчиками глобальных фондовых индексов на основании скрининга по методологиям, общепринятым в международной практике (MSCI, Thomson Reuters).



Торговля в рамках портфеля стратегии USA Islamic Market ведется **без использования кредитного плеча и шорт-позиций** (коротких позиций).



Пересмотр активов, входящих в состав стратегии, на предмет соответствия исламу производится раз в месяц.

[1] *Это позволило нам не привлекать исламских ученых непосредственно к разработке стратегии. При этом разработчики с максимально возможной тщательностью удостоверились в том, что включенные в стратегию акции указываются как дозволенные с точки зрения ислама по вышеназванным методологиям. Мы не берем на себя ответственность за то, что та или иная акция может выйти из числа соответствующих исламу раньше, чем об этом станет известно составителям стратегии.*

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

Финам

ФОРМИРОВАНИЕ ПОРТФЕЛЯ

Для формирования портфеля используется инновационный подход к построению стратегии, основанный на симбиозе:

1. Фундаментального анализа для первоначального отбора активов для стратегии.
2. Идей нобелевского лауреата Марковица для построения эффективного портфеля.
3. Теории построения инвестиционных портфелей всемирно признанных экспертов Шарпа и Сортино.
4. Технического анализа для фиксации сверхприбыли и закрытия позиции по стоп-лоссу.
5. Моментум-эффекта как ценовой аномалии фондового рынка.

ПРОЦЕСС ФОРМИРОВАНИЯ ПОРТФЕЛЯ:

Из 100 самых ликвидных акций, соответствующих шариату, отбираются 5–10 эмитентов. → Бумаги отбираются при помощи двух алгоритмов. Акции, подходящие под условия одного алгоритма, приобретаются на 10% от счета, акции, подходящие под условия двух алгоритмов, приобретаются на 20% от счета. → Состав портфеля пересматривается раз в 2–3 месяца.

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

Финам

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

РАЗМЕР ПОЗИЦИИ

зависит от волатильности и направленности рынка.

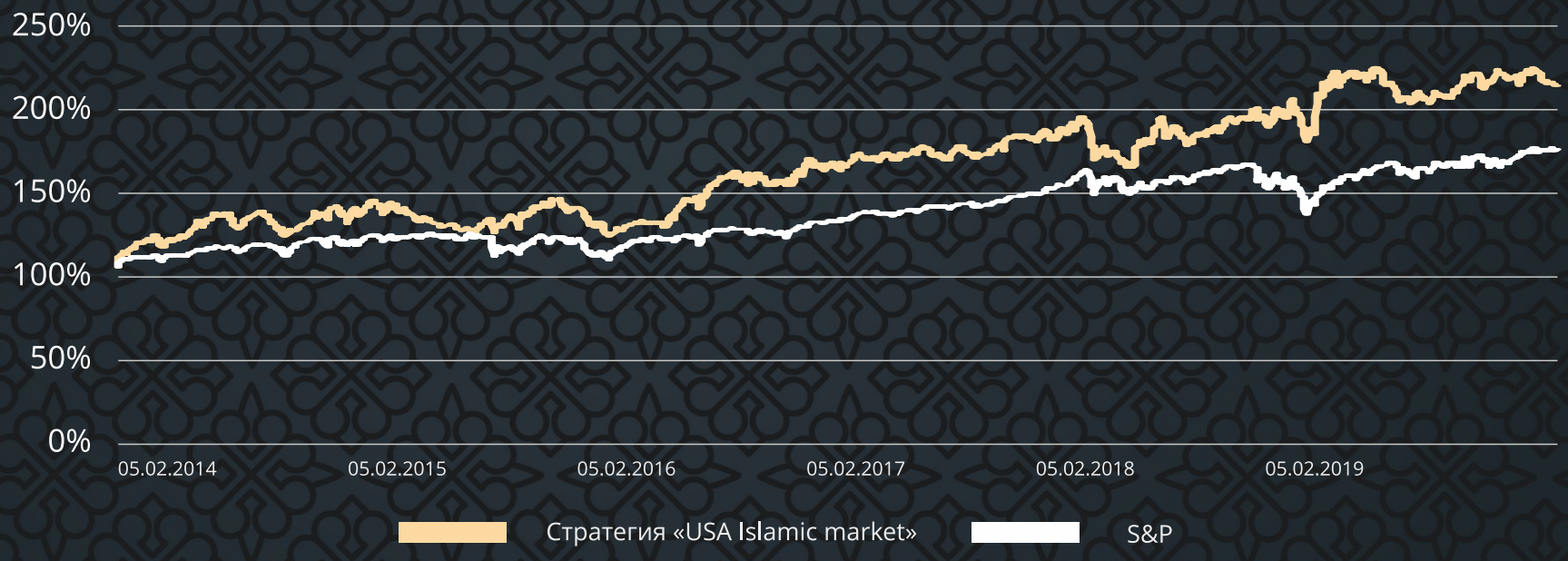
РИСК НА СДЕЛКУ В ОТДЕЛЬНОЙ АКЦИИ

не более 3% от портфеля.

СТРАТЕГИЯ НИКОГДА НЕ ИСПОЛЬЗУЕТ

торговые операции на заемные средства, что существенно снижает риски высокой просадки по счету.

ДИНАМИКА ДОХОДНОСТИ СТРАТЕГИИ USA ISLAMIC MARKET, ₽



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

Финам

СТАТИСТИЧЕСКИЕ ПОКАЗАТЕЛИ СТРАТЕГИИ USA ISLAMIC MARKET, ₽

123,67%

Доход за весь период

15%

Среднегодовая доходность (сложный процент)

ПОКАЗАТЕЛЬ	СТРАТЕГИЯ	S&P
Период управления	69 мес.	69 мес.
Цена портфеля на начало периода	1 000 000 руб.	1 000 000 руб.
Цена портфеля на конец периода	2 236 682 руб.	1 688 227 руб.
Доход за весь период	123,67%	68,82%
Среднегодовая доходность (сложный процент)	15%	10%
Максимальное снижение	-16,98%	-19,79%
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)	0,72	0,45

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

Финам

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

РАЗМЕР ПОЗИЦИИ

зависит от волатильности и направленности рынка.

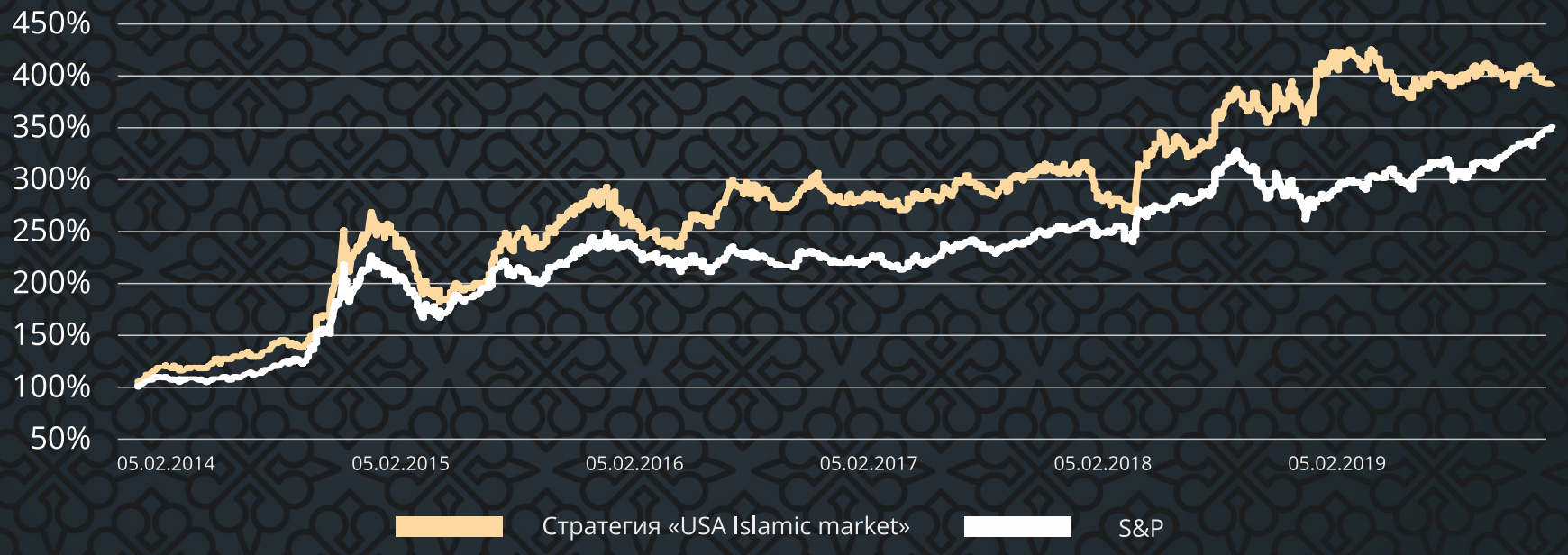
РИСК НА СДЕЛКУ В ОТДЕЛЬНОЙ АКЦИИ

не более 3% от портфеля.

СТРАТЕГИЯ НИКОГДА НЕ ИСПОЛЬЗУЕТ

торговые операции на заемные средства, что существенно снижает риски высокой просадки по счету.

ДИНАМИКА ДОХОДНОСТИ СТРАТЕГИИ USA ISLAMIC MARKET, $



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

Финам

СТАТИСТИЧЕСКИЕ ПОКАЗАТЕЛИ СТРАТЕГИИ USA ISLAMIC MARKET, $

312,94%

Доход за весь период

28%

Среднегодовая доходность (сложный процент)

ПОКАЗАТЕЛЬ	СТРАТЕГИЯ	S&P
Период управления	69 мес.	69 мес.
Цена портфеля на начало периода	1 000 000 $	1 000 000 $
Цена портфеля на конец периода	4 129 355 $	3 140 489 $
Доход за весь период	312,94%	214,05%
Среднегодовая доходность (сложный процент)	28%	22%
Максимальное снижение	-33,08%	-26,91%
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)	1,13	0,98

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

Финам

КОНТАКТЫ

Отдел инвестиционного консультирования

Тел.: +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