

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.



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.

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

УНИКАЛЬНОСТЬ СТРАТЕГИИ



*Защищает
капитал в случае
кризиса*



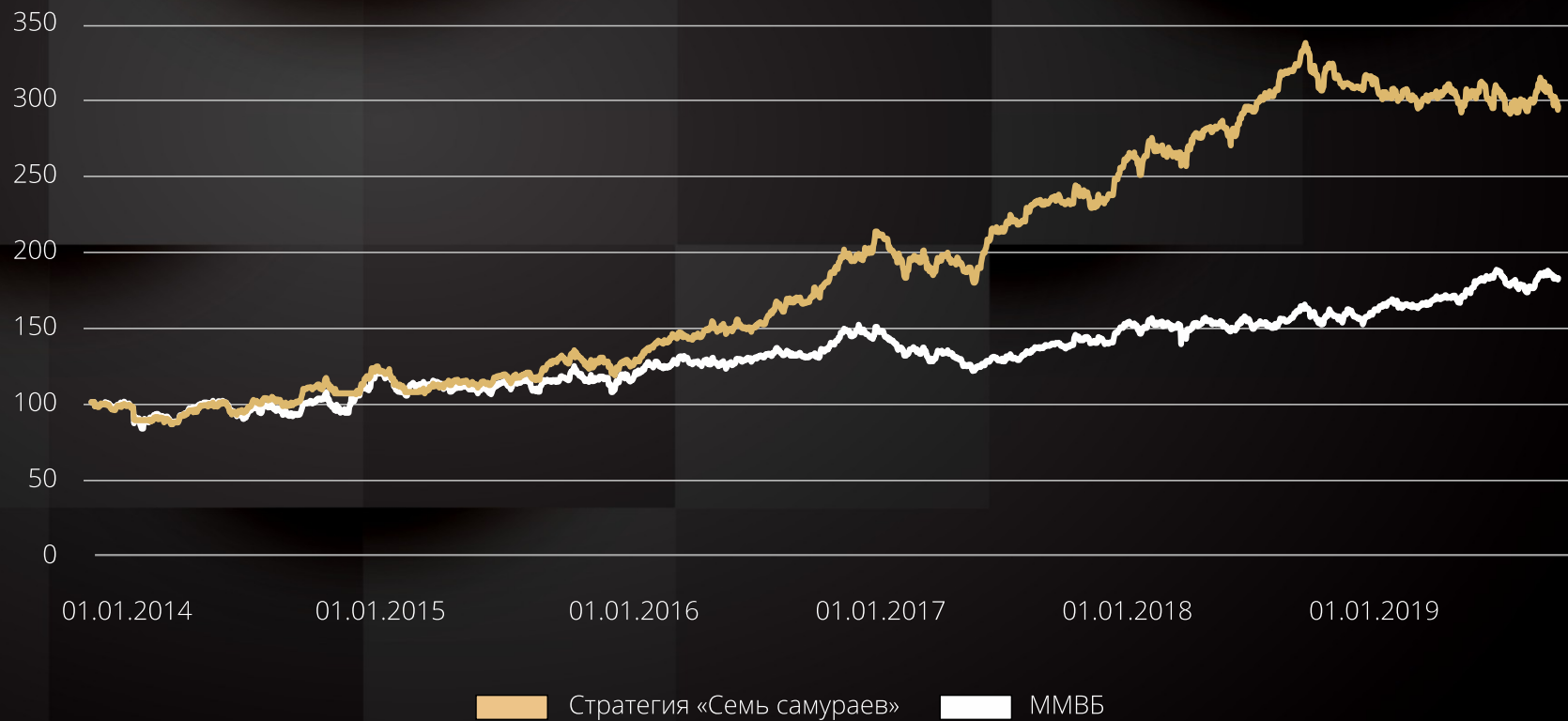
*Слабо зависит от общей
динамики рынка, новостного
фона и слабопредсказуемых
событий*



*Выбирает только лучшие
среднесрочные идеи
на российском рынке*

ПОКАЗАТЕЛИ ДОХОДНОСТИ

ДИНАМИКА ДОХОДНОСТИ СТРАТЕГИИ «7 САМУРАЕВ»



СТАТИСТИЧЕСКИЕ ПОКАЗАТЕЛИ СТРАТЕГИИ «СЕМЬ САМУРАЕВ»

Доход за весь период

Среднегодовая доходность
(сложный процент)

ПОКАЗАТЕЛЬ	СТРАТЕГИЯ	Индекс ММВБ
Период		
Цена портфеля на начало периода		
Цена портфеля на конец периода		
Доход за весь период		
Среднегодовая доходность		
Максимально снижение		
Эффективность управления (коэффициент Шарпа)		

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



ВЫСОКИЙ РЕЙТИНГ
НАДЕЖНОСТИ RAEX RUА



С 1994 ГОДА НА РЫНКЕ



БОЛЕЕ 235 000
КЛИЕНТОВ



БОЛЕЕ 90 ОФИСОВ
ПО ВСЕЙ СТРАНЕ



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



Лауреат премии
«Финансовый Олимп — 2017»
в двух категориях



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



Гран-при премии
«Финансовая элита России — 2018»



Гран-при премии
«Финансовая элита России — 2017»



«Лучший брокер Восточной Европы»
по версии IAIR Awards 2014

...и еще более 50 наград!

КОНТАКТЫ