

Стратегия Глобал Хедж Фонд

Мультикласс и Мультистратегия



ФИНАМ

***На сегодняшний день немногие
управляющие могут похвастаться
стабильными и высокими
результатами. Почему?***

- 1. Человеческий фактор.*
- 2. Все решения завязаны на одном человеке, который может быть неправ.*
- 3. Наличие одной стратегии.*
- 4. Недостаток опыта.*



Что мы предлагаем:

- Высокопрофессиональное управление. Общий стаж команды управления на глобальных рынках – свыше 50 лет, включая рынки России, Америки, Европы, работу с акциями, фьючерсами, опционами.
- Диверсификация по управляющим, стратегиям, рынкам, активам.
- Жесткий контроль рисков на всех уровнях, включая управление рисками по рынкам, портфелям, позициям, стратегиям и распределение рисков по управляющим активами.
- Отсутствие корреляции, так как каждый трейдер торгует на разных инструментах, биржах и тайм-фреймах.

На данный момент торговля осуществляется на российских и американских биржах, что позволяет минимизировать валютные риски. Ведется торговля акциями, фьючерсами и опционами.

Данная стратегия включает в себя несколько подстратегий, которые торгуются абсолютно независимо друг от друга. Принцип данной стратегии основан на полной диверсификации активов, рынков, стратегий, временных горизонтов, фаз рынка и, главное, управляющих. Каждый управляющий торгует по своим алгоритмам, своими инструментами и на своих тайм-фреймах и не коррелирует с другими управляющими внутри фонда. Статистически мультистратегические и мультиклассовые фонды показывают более стабильные и высокие результаты.

Деньги мигрируют внутри фонда между стратегиями и управляющими, где стратегия или управляющий, которые показывают более высокие результаты, получают больше денежных средств.

Преимущество данной стратегии – контроль за рисками на всех уровнях при ликвидности активов.



Российский рынок

Торгуемые активы – акции, фьючерсы.

Используется графический, технический и фундаментальный анализ (свинги, паттерны, новости).

Торговля состоит из 2 частей:

1. пробойные стратегии по уникальному алгоритму, не имеющие аналогов в индустрии;
2. наше ноу-хау – алгоритмическая торговля с помощью системы управления торговыми роботами. В распоряжении управляющих имеется более 100 различных роботов, каждый из которых отлично зарекомендовал себя на различных фазах рынка и тайм-фреймах. В зависимости от состояния рынка подбирается пул роботов, наиболее эффективных в данный момент.

Краткое описание

Стратегия рассчитана на достижение максимального устойчивого прироста доходности портфеля на разных фазах рынка. В стратегии сбалансированно используются торговые системы, построенные на основе статистического и графического анализа, отслеживающие сильные движения акций после преодоления ключевых уровней поддержки и сопротивления, а также трендовые алгоритмы на основе технического анализа; используется также корреляционный анализ инструментов.

Методика формирования портфеля

Инвестирование осуществляется в наиболее ликвидные акции.

Проводится постоянный анализ основных тенденций рынка. На основании проведенного анализа активы распределяются по трендовым, пробойным, дельта-хеджевым торговым системам с учетом наименьшего риска и в зависимости от фазы рынка.

Мониторинг портфеля

Пересмотр структуры портфеля осуществляется ежедневно в зависимости от сигналов по системе. Одновременно с этим проводится мониторинг рисков в зависимости от новостного фона по всем рынкам.



Американский рынок

Торгуемые активы – акции, фьючерсы.

Инвестируя средства в ценные бумаги, важно понимать, что недостаточно просто определить момент покупки или продажи актива, точно так же как недостаточно один раз определить оптимальный состав портфеля. Данная стратегия подразумевает комплексное управление активами, в рамках которого осуществляется отбор и пересмотр эффективного портфеля, осуществляется процедура risk & money-management и поиск оптимальных точек для открытия позиций. Отбор наилучших активов и грамотное распределение их в портфеле позволяют обыгрывать рынок как во время трендовых движений, так и во время консолидаций.

Краткое описание

Стратегия позволяет выйти на крупнейшую фондовую площадку мира – американский фондовый рынок. В настоящее время ситуация на мировых рынках нестабильна – волнения в странах арабского мира, землетрясение в Японии, текущая ситуация в Европе, снижение рейтинга США. В связи с этим в стратегии применяются инновационные подходы, которые позволяют качественно маневрировать капиталом и наилучшим образом отрабатывать безграничные возможности американского фондового рынка. Работая над эффективной и прибыльной стратегией на фондовом рынке, мы постарались сделать так, чтобы она была максимально гибкой под напором экономической нестабильности и приносила плоды, не полагаясь только на хорошую погоду на фондовых рынках.

Методика формирования портфеля

На американских фондовых биржах (NYSE, Nasdaq, AMEX) торгуется порядка 7000 бумаг. Огромная ликвидность и разнообразие бумаг и индустрий, представляющих различные сектора мировой экономики, позволяют создать гибкий портфель с широкой диверсификацией, показывающий положительную динамику даже в условиях нестабильной ситуации на рынке.

Постоянное присутствие на рынке позволяет своевременно оценивать рыночную ситуацию и вовремя реагировать на происходящие процессы. Своевременно инвестировав средства в наиболее сильные акции, можно получить высокий уровень доходности, сохраняя при этом риск на приемлемом уровне, не превышающем систематический.

Мониторинг портфеля

- Постоянное присутствие на фондовой площадке, колоссальный опыт работы управляющих в различных фазах рынка.
- Состав портфеля пересчитывается ежемесячно, еженедельно и ежедневно с целью обеспечения наибольшей доходности и уменьшения риска путем увеличения диверсификации активов.
- В стратегии реализованы три точки захода в течение дня: утренняя, дневная и вечерняя сессии, что позволяет контролировать риски.
- Управление активами основано на статистической выборке — именно поэтому полное отрабатывание всех возможных рыночных ситуаций дает статистический перевес в данной стратегии.



Команда

Александр Герчик. Опыт управления активами с 1996 года, с 1999 года – ни одного убыточного месяца.

Богдан Згерский. Опыт управления активами с 1999 года. Сумма активов под управлением – более \$100 млн. Фонд «Ингосстрах акции» под управлением Богдана Згерского по соотношению риск/доходность получил в 2011 году максимально возможную оценку за качество управления от рейтингового агентства «Эксперт РА». Ранее ПИФ «Интерфин Телеком» под его управлением поднялся в рейтинге НЛУ с 384 на 1 место по итогам первого полугодия 2009 года.

Николай Сударкин. Треjder, программист, опыт управления активами с 2000 года. Специализация – российский рынок. Управление активами компании и собственным капиталом.

Дмитрий Дехтяренко. Треjder. Опыт управления активами с 2005 года. Специализация – американский рынок. Управление активами компании и собственным капиталом.

Денис Зарицкий. Треjder. Опыт управления активами с 2006 года. Специализация – американский рынок. Управление активами компании и собственным капиталом.

Максим Романов. Треjder. Опыт управления активами с 2008 года. Специализация – американский и российский рынок. Управление активами компании и собственным капиталом.

