

Стратегия «Валютная»

Краткое описание



ФИНАМ

Стратегия «Валютная»

Ключевой аспект

Стратегия «Валютная» базируется на операциях с фьючерсным контрактом на валютную пару доллар США/российский рубль на срочном рынке Московской биржи.

Рекомендуемый порог инвестиций

500 000 руб.

Целевая аудитория стратегии

Данная стратегия подойдет инвесторам, предпочитающим использовать в своей инвестиционной деятельности все преимущества торговли фьючерсным контрактом на курс самой популярной мировой валюты – доллара США – по отношению к российскому рублю.

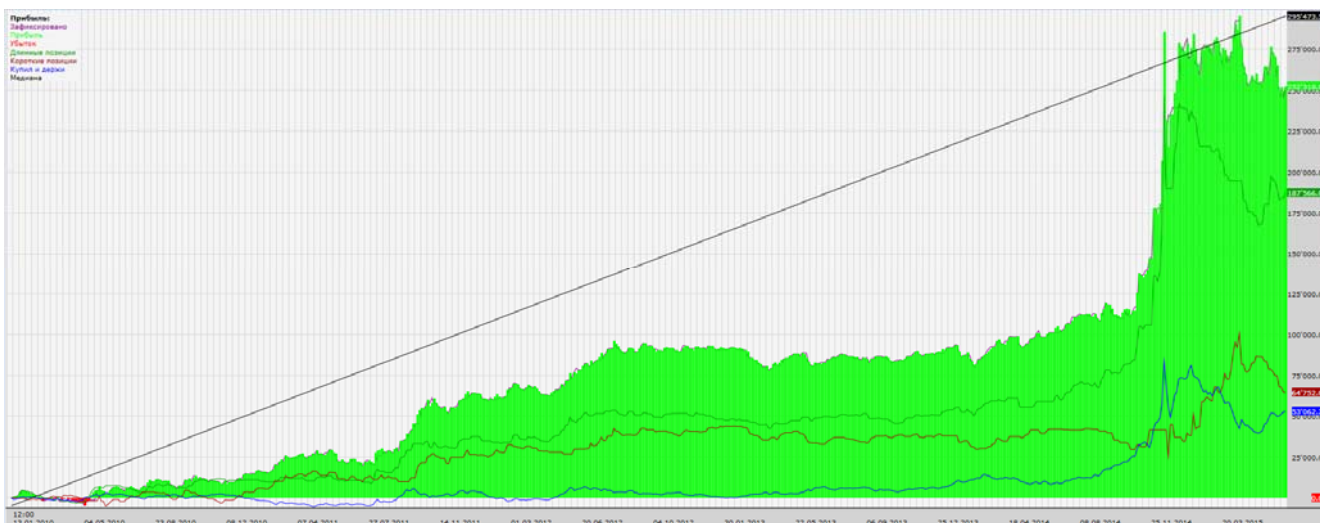
Краткое описание

Стратегия «Валютная» разработана специалистами АО «ФИНАМ» и построена на выявлении трендовых движений на валютной паре доллар США/российский рубль с помощью авторских технико-математических методов, а также с помощью отслеживания направленных движений котировок нефти.

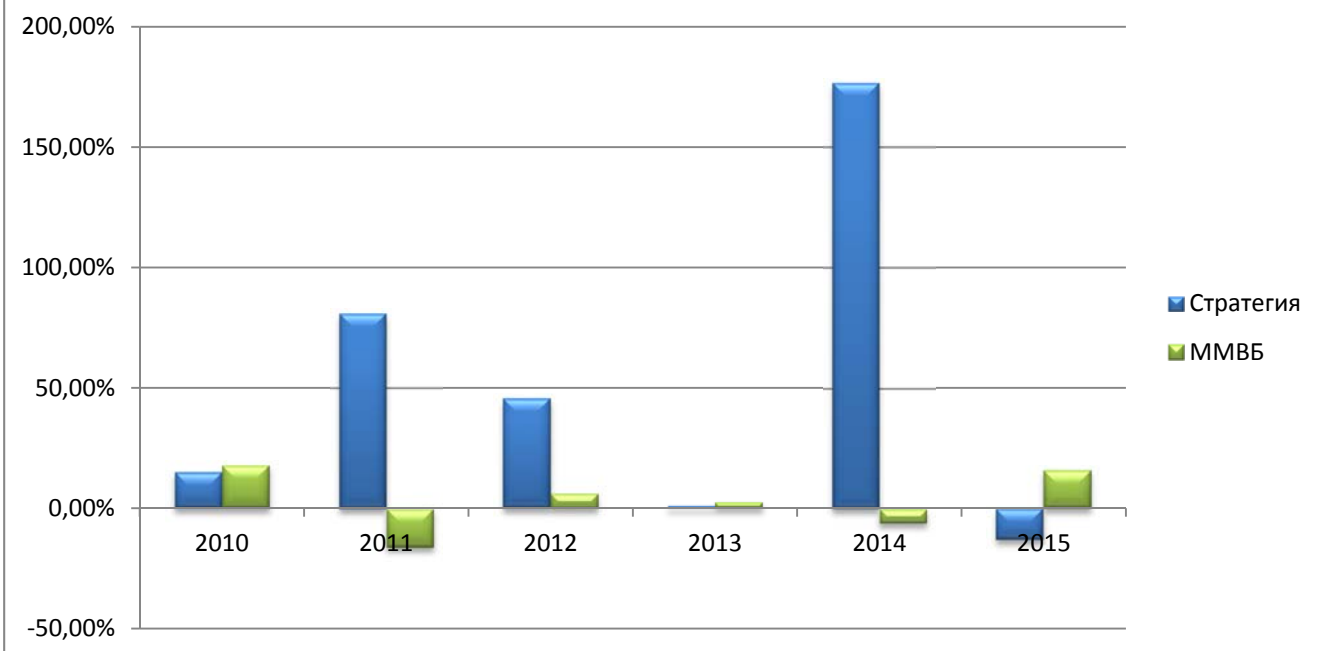
Методика формирования портфеля

Инвестирование в рамках стратегии «Валютная» предполагает покупку/продажу фьючерсного контракта на валютную пару доллар США/российский рубль. Отбор и включение фьючерсного контракта в портфель происходит на основании технического индикатора, который своевременно позволяет распознать зарождающийся тренд.

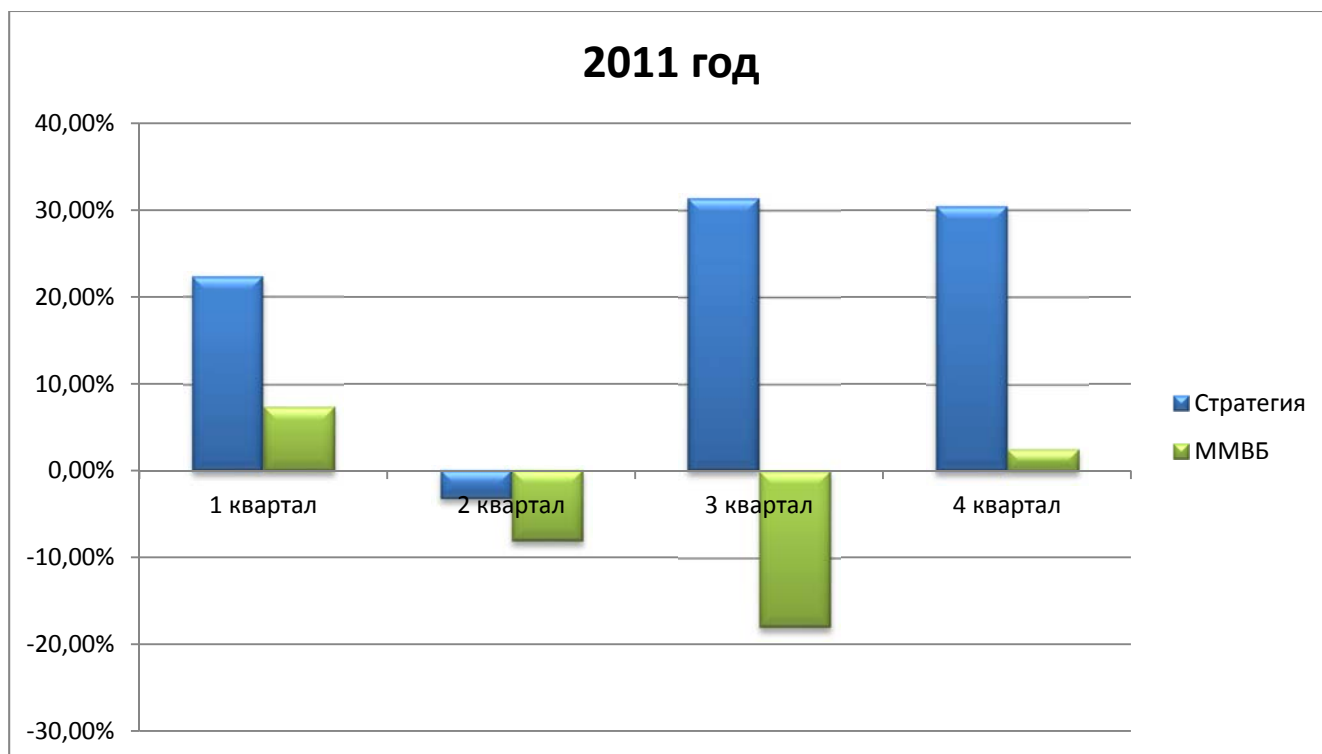
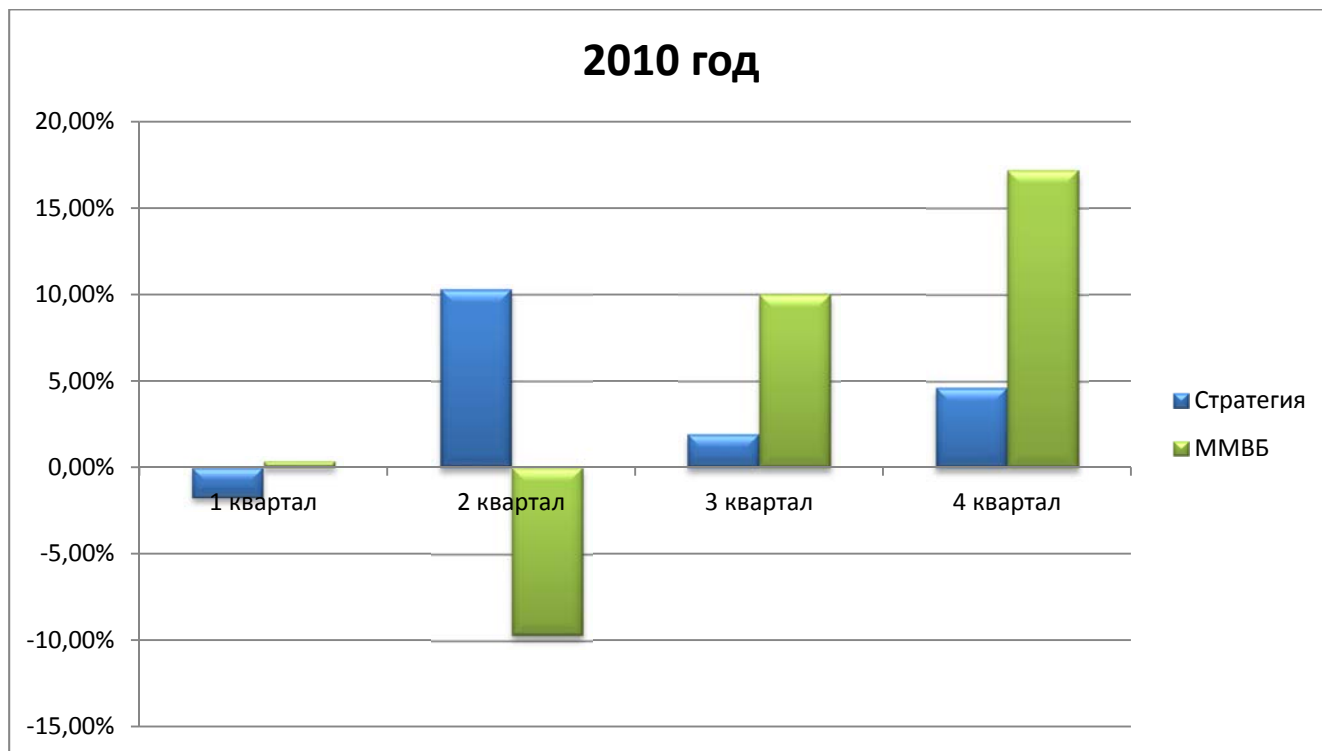
График прироста¹ по стратегии в сравнении с индексом ММВБ



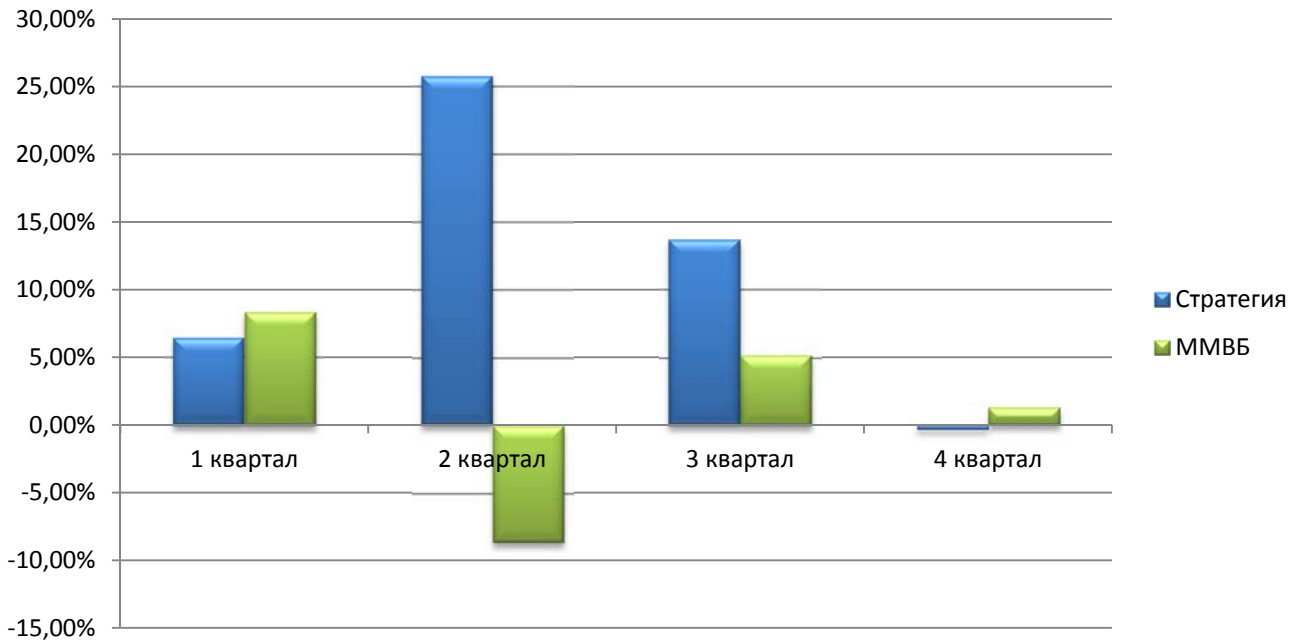
Прирост по годам:



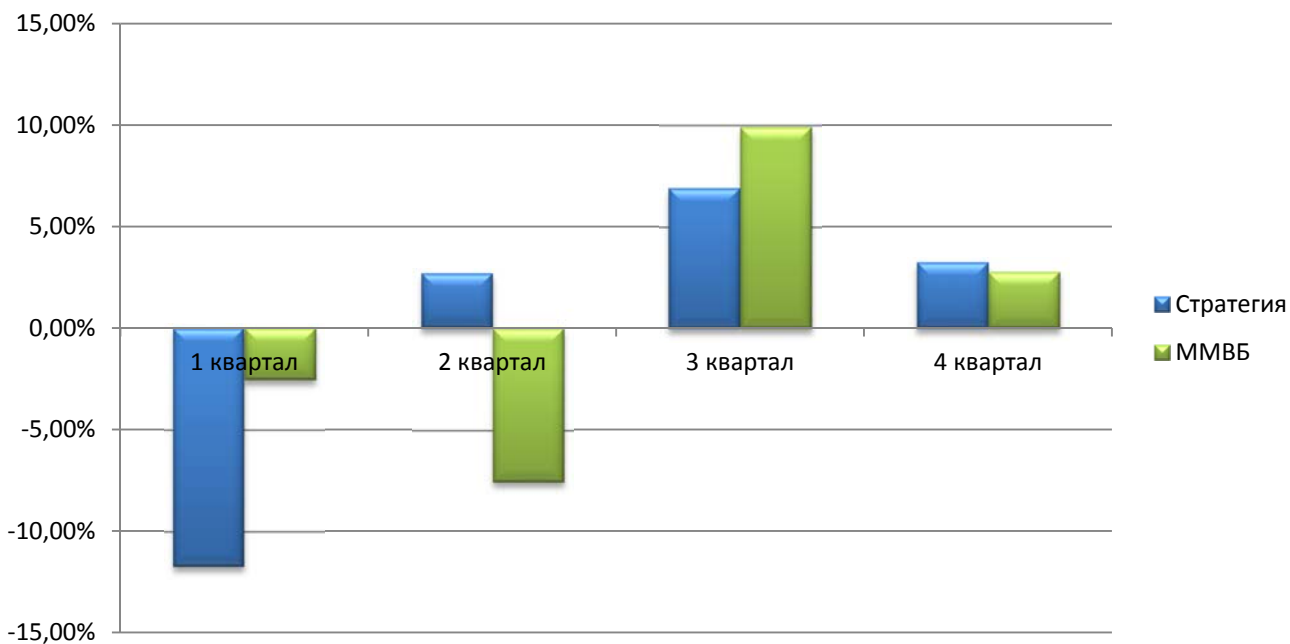
Годовые показатели стратегии «Валютная» с 2010 г.



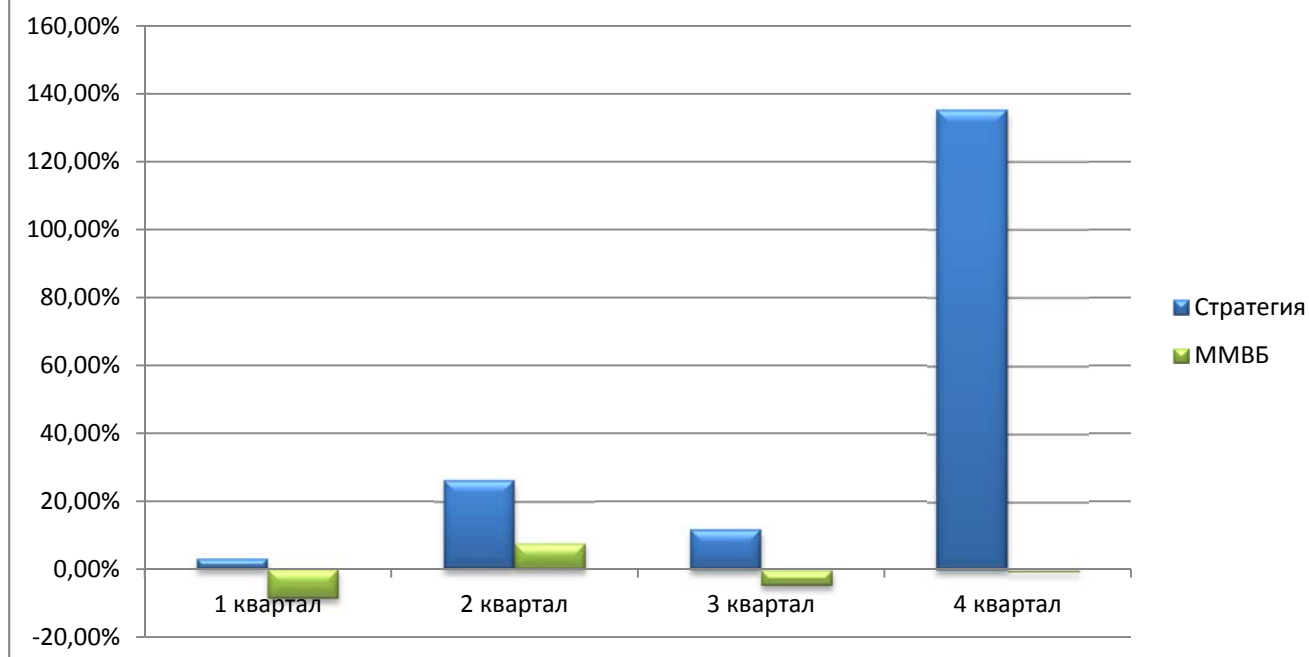
2012 год



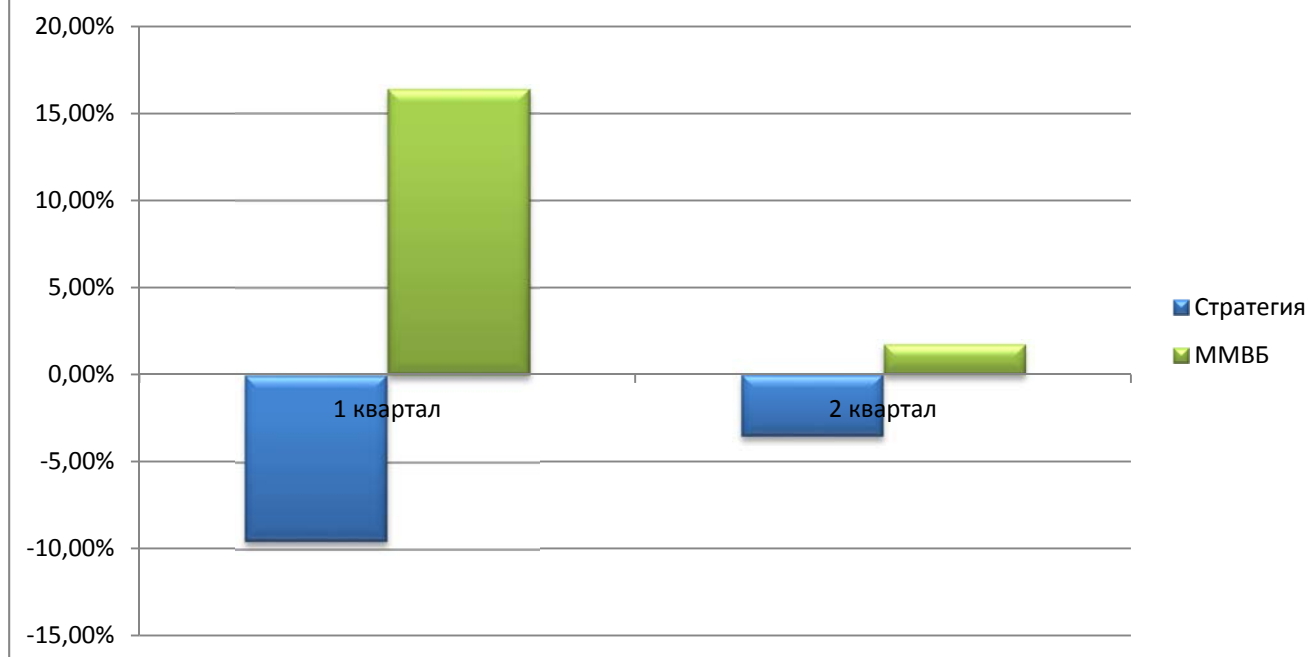
2013 год



2014 год



2015 год



Статистические показатели стратегии «Валютная»:

Показатель	Стратегия	ММВБ
Период управления	5,5 лет	5,5 лет
Цена портфеля на начало,	500 000 руб.	500 000 руб.
Цена портфеля на конец периода (сложный процент) ³	1 829 240 руб.	604 825 руб.
Доход ² за весь период	265,85%	20,97%
Среднегодовая доходность ² (сложность процент)	48,34%	3,81%
Максимальная просадка	-22,01%	-36,65%

Годовая динамика доходности² стратегии и индекса ММВБ

Период	Стратегия	ММВБ
2010 год	15,14%	16,83%
2011 год	80,90%	-16,94%
2012 год	45,55%	5,41%
2013 год	-8,90%	1,73%
2014 год	176,62%	-7,2%
2015 год	-12,75%	15,59%

Прирост стоимости портфеля³ по кварталам по отношению к предыдущему кварталу

Период	Результат, в %:
1 квартал 2010 года	-1,73%
2 квартал 2010 года	10,30%
3 квартал 2010 года	1,94%
4 квартал 2010 года	4,63%
1 квартал 2011 года	22,31%
2 квартал 2011 года	-3,25%
3 квартал 2011 года	31,39%
4 квартал 2011 года	30,45%
1 квартал 2012 года	6,43%
2 квартал 2012 года	25,76%

3 квартал 2012 года	13,67%
4 квартал 2012 года	-0,31%
1 квартал 2013 года	-11,74%
2 квартал 2013 года	2,71%
3 квартал 2013 года	6,91%
4 квартал 2013 года	3,22%
1 квартал 2014 года	3,06%
2 квартал 2014 года	26,37%
3 квартал 2014 года	11,78%
4 квартал 2014 года	135,41
1 квартал 2015 года	-9,57%
2 квартал 2015 года	-3,52%

¹ Указан прирост модельного портфеля специалистов АО «ФИНАМ» за период с 01.01.2010 по 30.06.2015.

² В данном материале термины «доход», «доходность» означают результат полученный специалистами АО «ФИНАМ» по модельному портфелю за соответствующий интервал времени.

³ Результат полученный специалистами АО «ФИНАМ» по модельному портфелю за соответствующий интервал времени.

АО «ФИНАМ» предоставляет рекомендации по совершению сделок на срочном рынке, следование которым осуществляет клиент самостоятельно либо представитель клиента, действующий на основании доверенности. АО «ФИНАМ» не гарантирует получение дохода в случае следования данным рекомендациям. Результат на конкретном счете может зависеть от суммы, тарифного плана и конкретной рыночной ситуации в момент совершения сделки.

Брокерские и консультационные услуги оказывает АО «ФИНАМ».

Контактная информация:

Отдел инвестиционного консультирования

Рабочий телефон: 8-800-200-44-00 (бесплатно по России),

8 (495) 796-93-88, доб. 40-00.

E-mail: _InvestmentConsulting@corp.finam.ru

Заработайте на инвестиционной стратегии!

[Откройте счет](#) прямо сейчас!

Настоящий материал и содержащиеся в нем сведения предназначены для клиентов АО «ФИНАМ», носят исключительно информативный характер и не могут рассматриваться ни как приглашение или побуждение сделать оферту, ни как просьба купить или продать ценные бумаги/другие финансовые инструменты либо осуществить какую-либо инвестиционную деятельность. Представленная информация подготовлена на основе источников, которые, по мнению авторов данного аналитического обзора, являются надежными, но при этом отражает исключительно мнение авторов относительно анализируемых объектов. Несмотря на то что настоящий обзор был составлен с максимально возможной тщательностью, ни его авторы, ни АО «ФИНАМ» не заявляют и не гарантируют ни прямо ни косвенно его точность и полноту. Любая информация и любые суждения, приведенные в данном материале, являются суждением на момент публикации настоящего аналитического обзора и могут быть изменены без предупреждения. Ни АО «ФИНАМ», ни его сотрудники не несут ответственности за какие-либо потери, возникшие в результате использования настоящего материала либо в какой-либо другой связи с ним. Копирование, воспроизводство и/или распространение настоящего материала, частично или полностью, без письменного разрешения АО «ФИНАМ» категорически запрещено.