

# Стратегия «Фьючерсный рост»

Краткое описание



**ФИНАМ**

# Стратегия «Фьючерсный рост»

## Ключевой аспект

Стратегия носит спекулятивный характер, торгуя одним из самых ликвидных из инструментов фондового рынка – фьючерсом на индекс РТС.

## Рекомендуемый порог инвестиций

500 000 руб.

## Целевая аудитория стратегии

Данная стратегия подойдет широкому кругу инвесторов, предпочитающих зарабатывать как на росте рынка акций, так и на его падении.

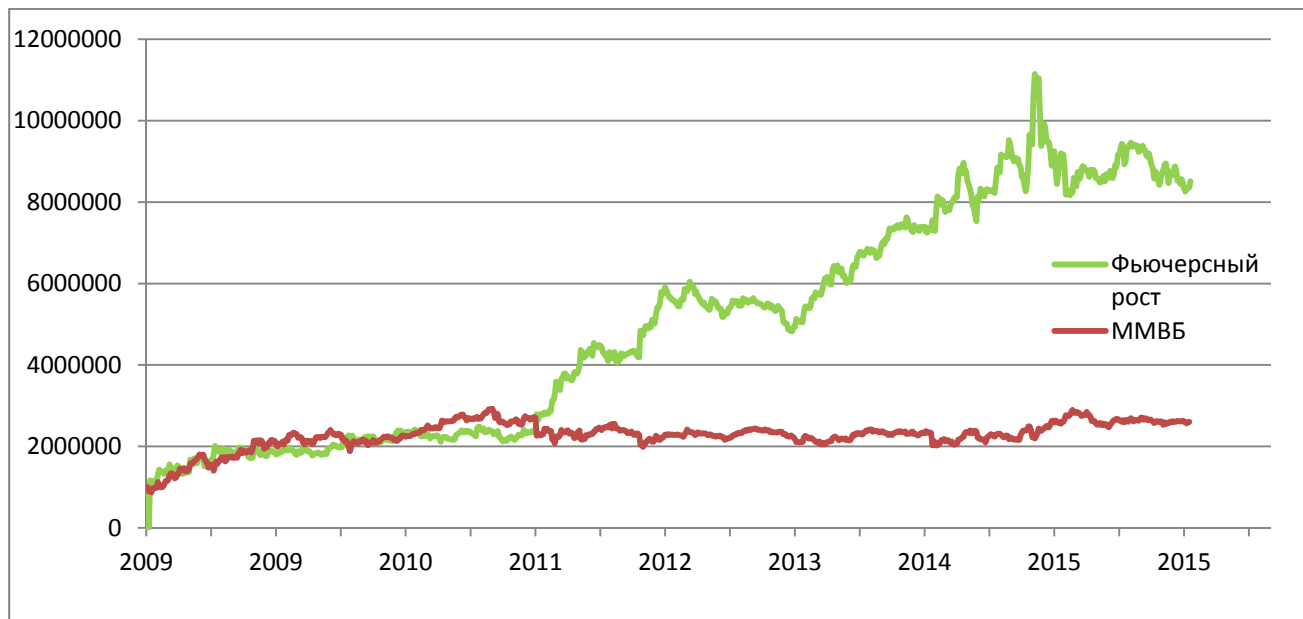
## Краткое описание

В стратегии используются три инструмента: индекс ММВБ, фьючерсный контракт на индекс РТС и фьючерсный контракт на доллар США. Сделки совершаются только с фьючерсом на индекс РТС; индекс ММВБ и фьючерсный контракт на доллар США используются для определения момента входа и выхода в позицию по стратегии.

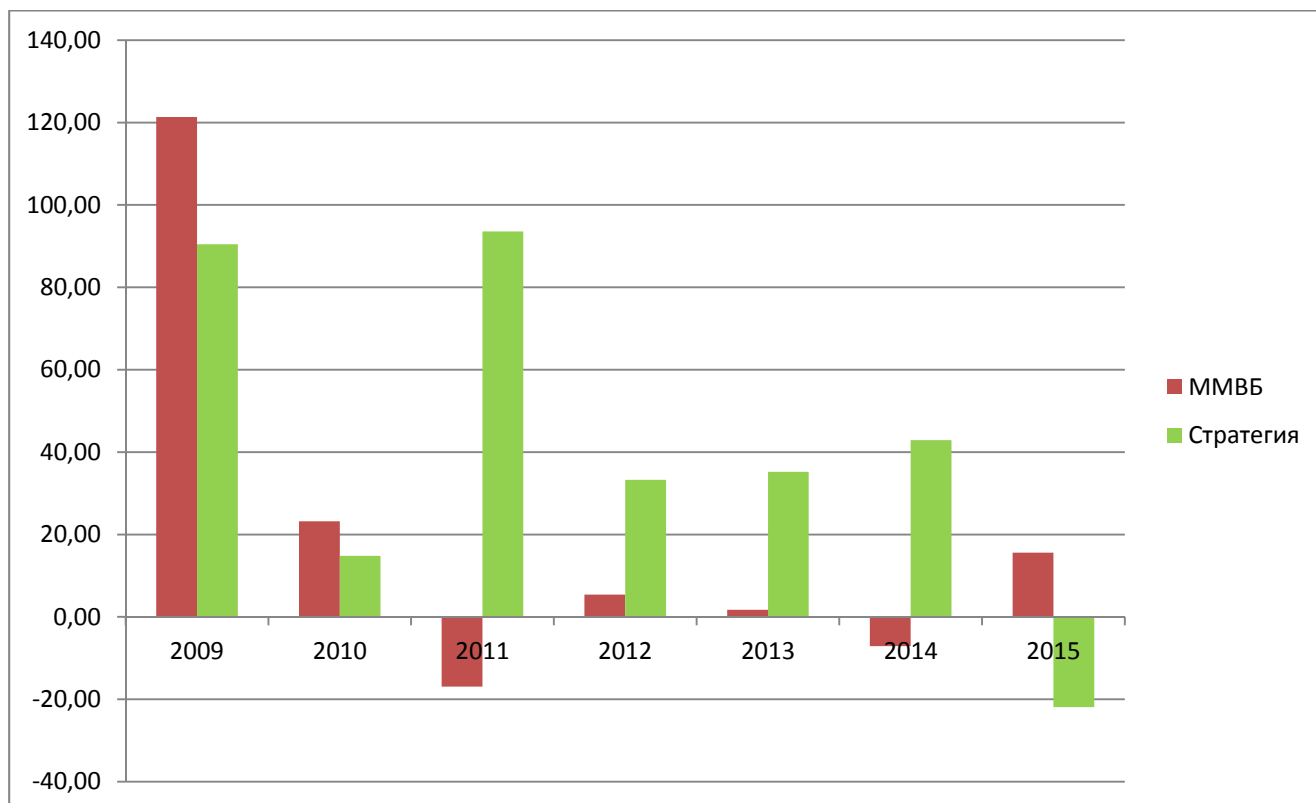
## Методика формирования портфеля

Портфель формируется из фьючерсного контракта на индекс РТС. Для входа в позицию отслеживается индекс ММВБ; как только мы определяем начавшийся тренд в индексе, дополнительно оцениваем ситуацию во фьючерсном контракте на доллар США, он является фильтром для совершения операций, поскольку цена контракта на фьючерс РТС зависит от стоимости доллара в том числе. Сделки носят среднесрочный характер и совершаются в случае расхождения и индекса, и валюты.

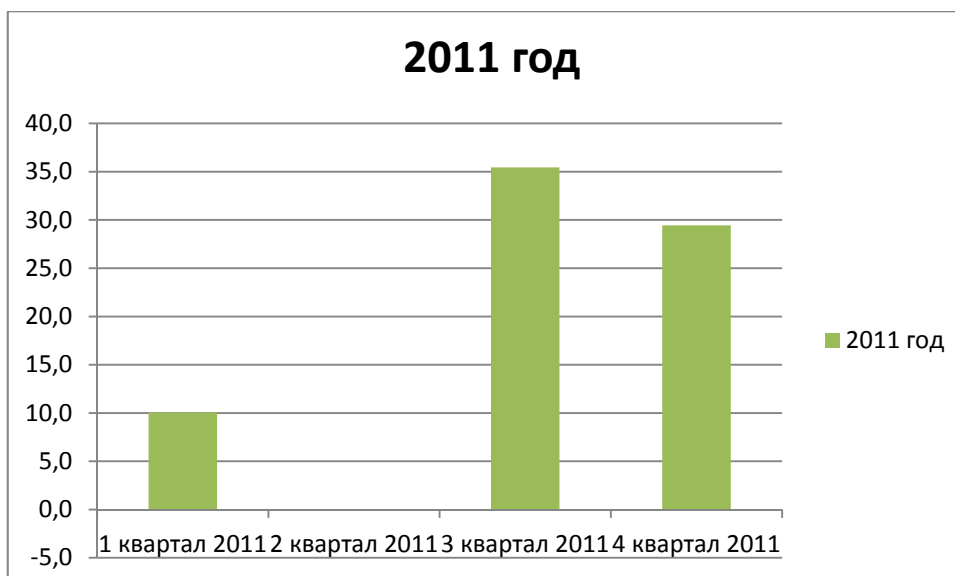
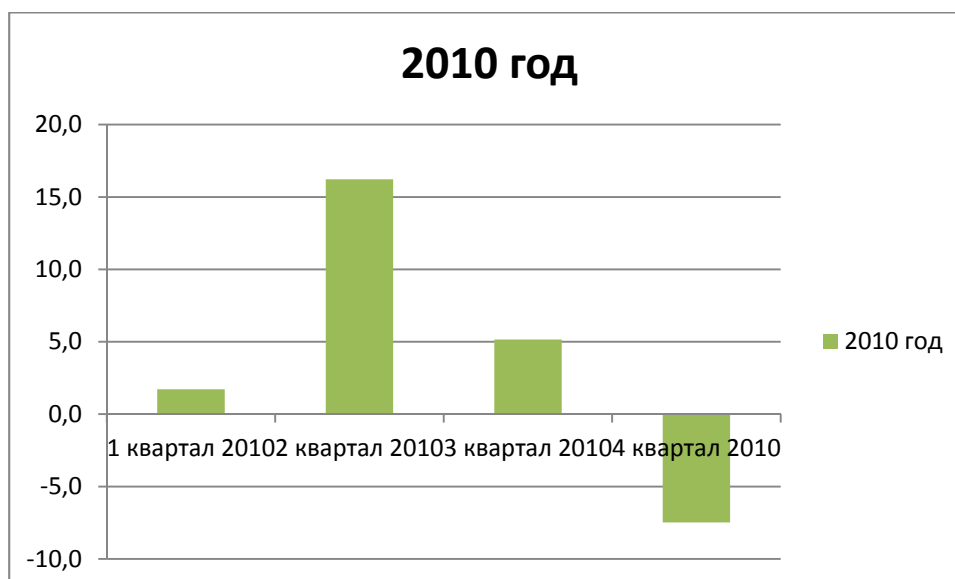
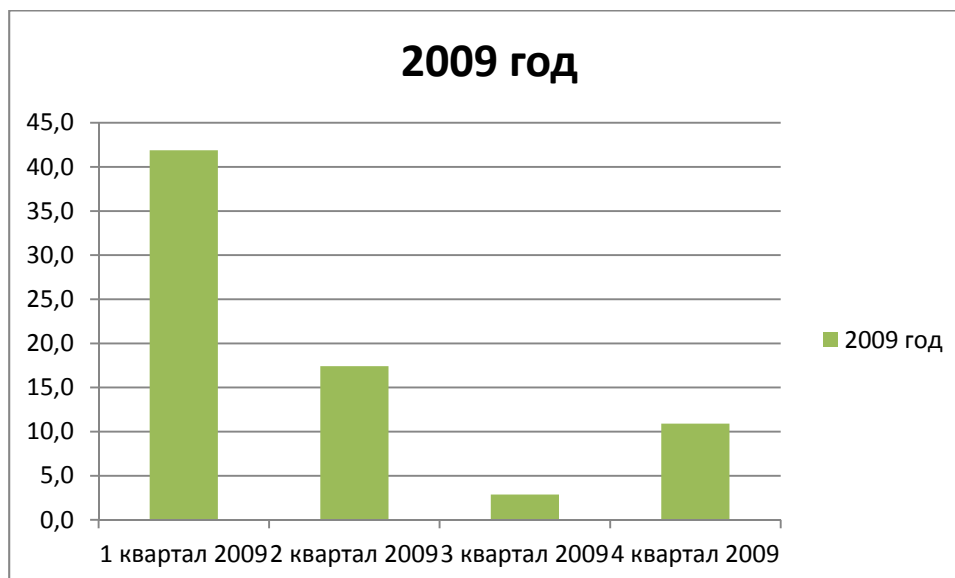
## График прироста по стратегии «Фьючерсный рост» в сравнении с индексом ММВБ, руб.:

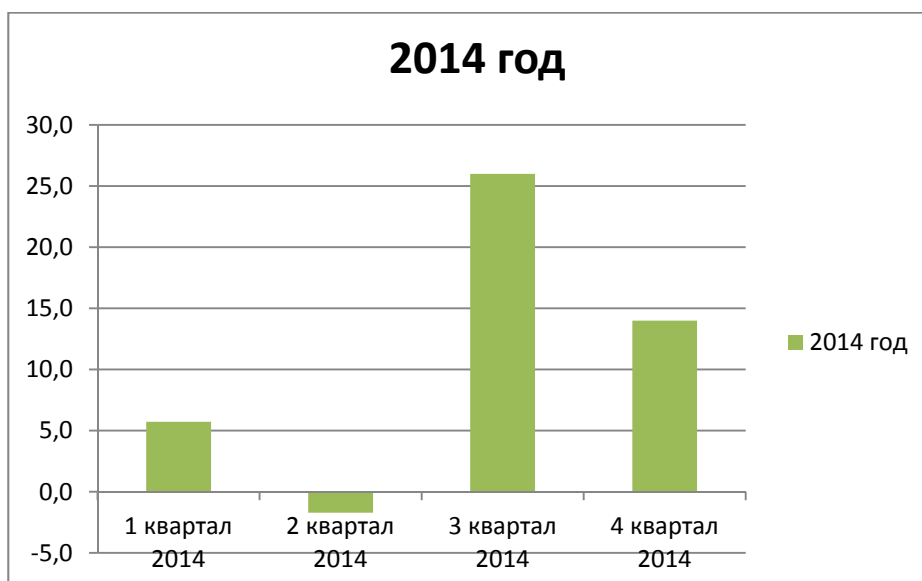
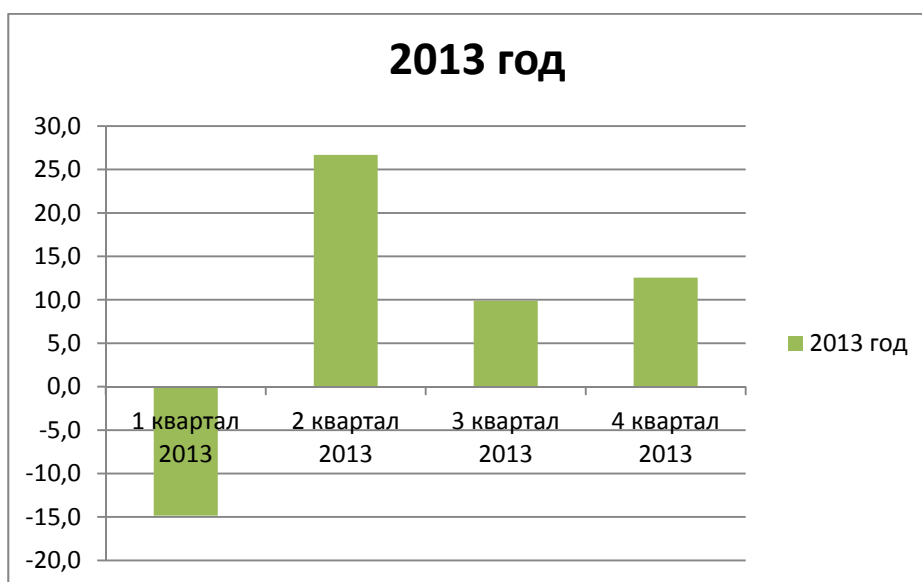
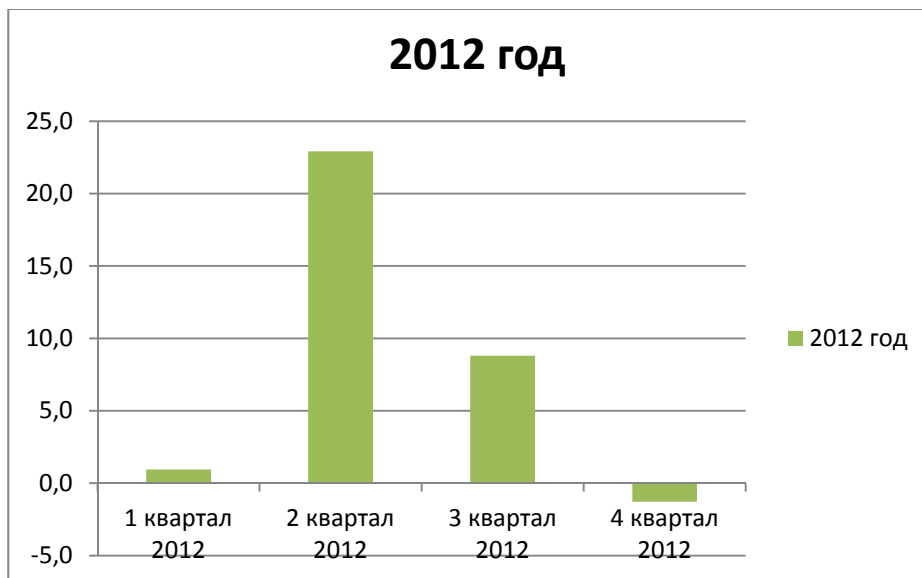


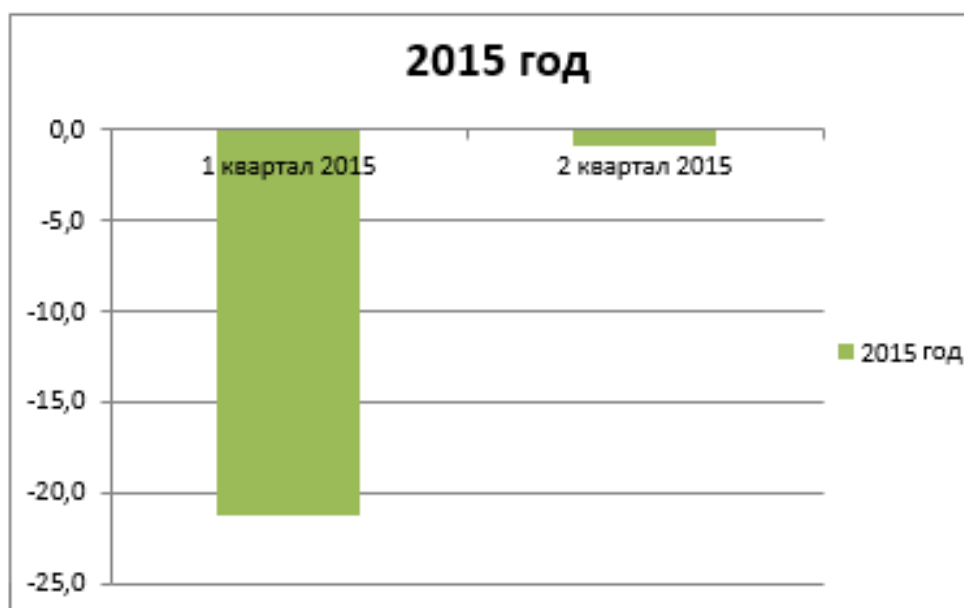
## Доходность по годам



## Поквартальные показатели стратегии «Фьючерсный рост» с 2009 г.:







### Статистические показатели стратегии «Фьючерсный рост»

Показатель	Стратегия	ММВБ
Период	6,5 лет	6,5 лет
Цена портфеля на начало периода	1000000	1000000
Цена портфеля на конец периода(сложный процент)	8512299	2603950
Доход за весь период	851,22%	260,39%
Среднегодовая доходность (сложный процент)	130,00%	40,0%
Максимальная просадка	25%	36%

Годовая динамика стратегии и ММВБ	Стратегия	ММВБ
2009	90,44	121,33
2010	14,80	23,21
2011	93,56	-16,94
2012	33,28	5,41
2013	35,21	1,73
2014	42,90	-7,10
2015	-21,90	15,59

Прибыль в пунктах за весь период	289665
% прибыльных сделок	42,25%
% убыточных сделок	57,75%
Максимальная просадка	25% 23.06.2015
Профит-фактор	1,38
Количество сделок за все время	748
Среднее количество сделок за квартал	28

<b>Доходность по кварталам к предыдущему кварталу</b>	<b>Доходность, %</b>
1 квартал 2009	41,9
2 квартал 2009	17,4
3 квартал 2009	2,9
4 квартал 2009	10,9
1 квартал 2010	1,7
2 квартал 2010	16,2
3 квартал 2010	5,2
4 квартал 2010	-7,5
1 квартал 2011	10,1
2 квартал 2011	0,0
3 квартал 2011	35,4
4 квартал 2011	29,4
1 квартал 2012	0,9
2 квартал 2012	22,9
3 квартал 2012	8,8
4 квартал 2012	-1,3
1 квартал 2013	-14,9
2 квартал 2013	26,7
3 квартал 2013	9,9
4 квартал 2013	12,6
1 квартал 2014	5,7
2 квартал 2014	-1,7
3 квартал 2014	26,0
4 квартал 2014	14,0
1 квартал 2015	-21,2
2 квартал 2015	-0,9



## **Контактная информация:**

### **Отдел инвестиционного консультирования**

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

8 (495) 796-93-88, доб. 4000.

E-mail: [\\_InvestmentConsulting@corp.finam.ru](mailto:_InvestmentConsulting@corp.finam.ru)

**Попробуйте заработать 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 иную 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 максимальной 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.

Брокерские и консультационные услуги оказывает АО «ФИНАМ». Доходность не гарантируется.

