

Стратегия «ММВБ 10»

Краткое описание



Финам

Ключевой аспект

Портфель построен на основе технического анализа с использованием инновационной методики отбора лидеров из наиболее сильных эмитентов, входящих в индекс «ММВБ 10» (индекс «голубых фишек»).

Минимальный порог инвестиций

500 000 рублей.

Целевая аудитория стратегии

Данная стратегия подойдет инвесторам, которые склонны к использованию традиционных инструментов и предпочитают сбалансированные инвестиции.

Краткое описание

Стратегия базируется на сбалансированном сочетании систематизированного технического и фундаментального анализа. Данный подход применяется для отбора наиболее сильных эмитентов, акции которых входят в индекс «ММВБ 10». Таким образом, формируется портфель, задача которого — с наибольшей эффективностью использовать возможности сильных «голубых фишек». На рынке всегда есть эмитент, который выделяется на фоне остальных. Стратегия подразумевает выявление такого лидера и наращивание его доли в портфеле, что позволяет получить максимальную отдачу от инвестиций.

Методика формирования портфеля

Инвестирование в рамках стратегии «ММВБ 10» предполагает покупку акций, входящих в данный индекс. Путем инновационного анализа «голубых фишек» мы меняем доли бумаг относительно их веса в индексе и направляем основную часть инвестиций в лидера рынка.

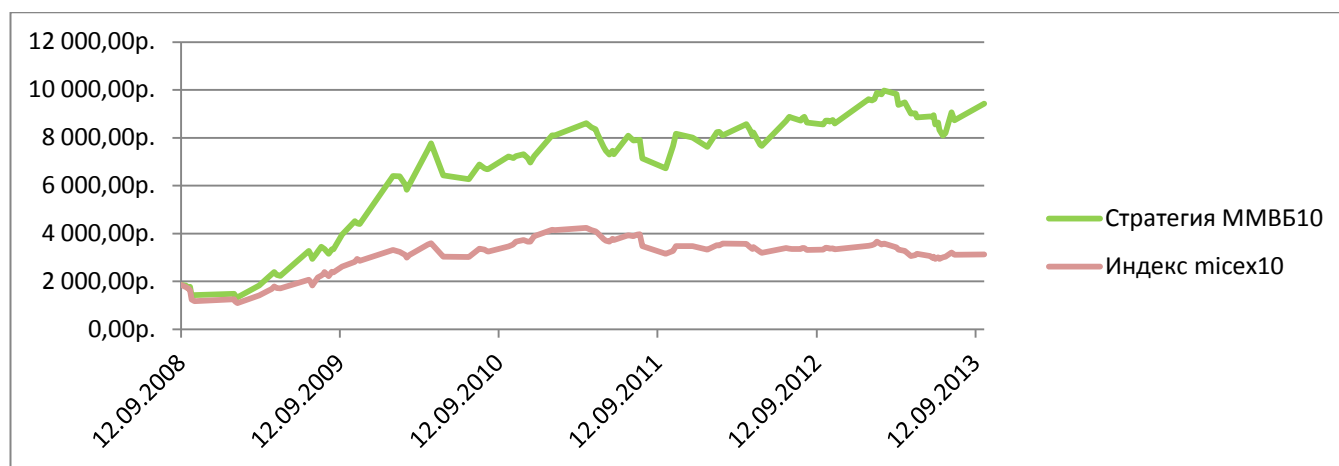
Ежедневно производится анализ котировок акций на основе инновационного метода изучения интереса инвесторов к группе лидеров российского рынка, входящих в индекс «ММВБ 10». При поступлении от системы сигнала к покупке в портфеле пересматривается набор акций и объемы инвестирования в разных эмитентов. Лидер получает порядка 50 % инвестиций, остальные средства распределяются между оставшимися акциями в равных пропорциях. Продажа бумаги происходит при поступлении сигнала об изменении структуры индекса.

Мониторинг портфеля

Пересмотр структуры портфеля осуществляется ежеквартально, в зависимости от изменения структуры индекса «ММВБ 10». Пересмотр объемов вложений в акции отслеживается ежедневно, в зависимости от изменения уровня интереса инвесторов к той или иной акции система дает сигнал к смене лидера и пересмотру объема инвестиций. Одновременно проводится мониторинг новостного фона по компаниям, акции которых включены в портфель.

Стратегия «ММВБ 10»

Динамика доходности стратегии «ММВБ 10» в сравнении с индексом mісех10:

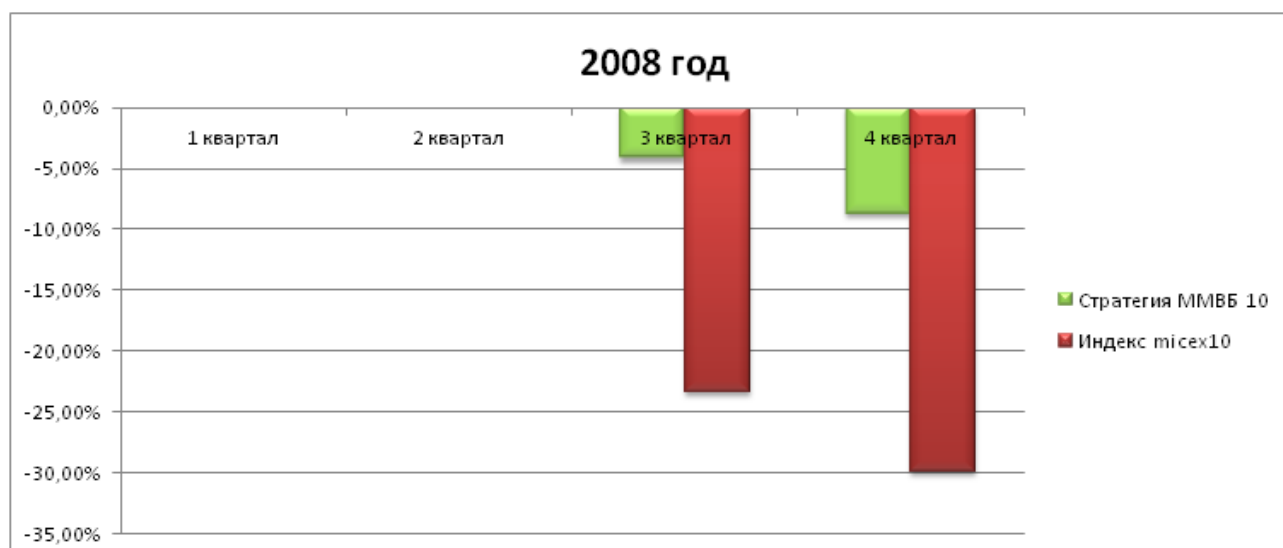


Поквартальные показатели стратегии с 2008 г. Сравнение стратегии «ММВБ 10» с индексом mісех10:

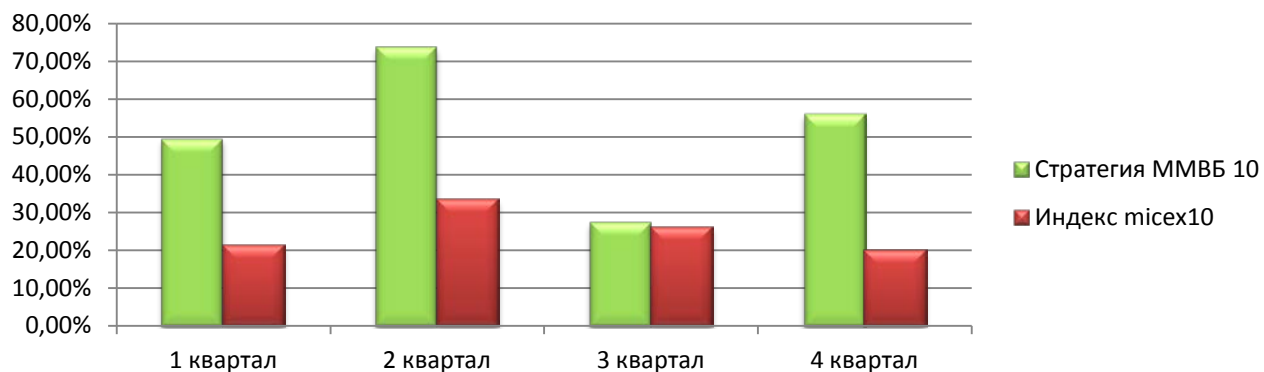
Доход за весь период	357,94%
Средний годовой доход	59,66%
Максимальная просадка	-12,94%

	Стратегия ММВБ 10		Индекс mісех10	
	2008 год	Итого	2008 год	Итого
1 квартал				
2 квартал				
3 квартал	-4,23%	-4,23%	-23,40%	-23,40%
4 квартал	-8,71%	-12,94%	-29,96%	-53,36%
	2009 год	Итого	2009 год	Итого
1 квартал	49,48%	49,48%	21,40%	21,40%
2 квартал	73,69%	123,17%	33,47%	54,87%
3 квартал	27,57%	150,74%	26,29%	81,16%
4 квартал	55,96%	206,70%	20,00%	101,16%

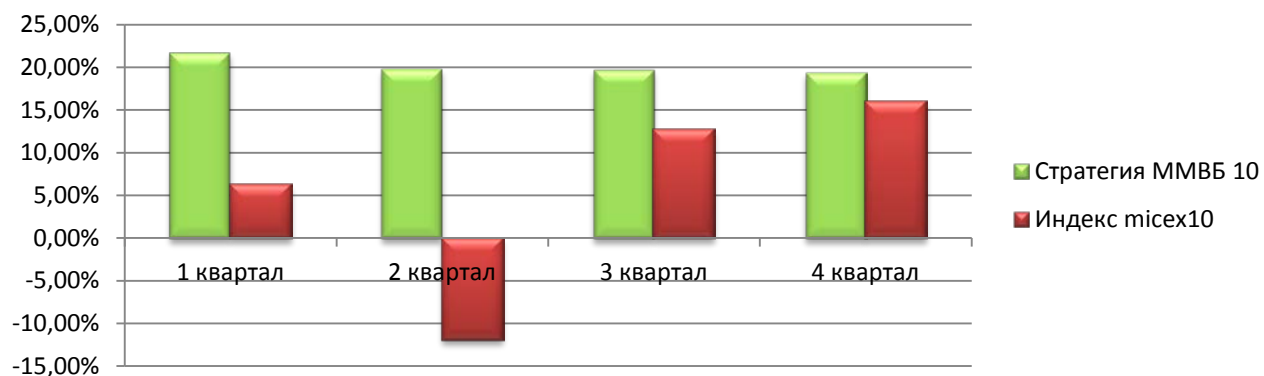
		2010 год	Итого	2010 год	Итого
1 квартал		21,72%	21,72%	6,32%	6,32%
2 квартал		19,80%	41,52%	-11,91%	-5,59%
3 квартал		19,71%	61,23%	12,70%	7,11%
4 квартал		19,36%	80,59%	16,00%	23,11%
		2011 год	Итого	2011 год	Итого
1 квартал		11,83%	11,83%	5,86%	5,86%
2 квартал		-3,06%	8,77%	-7,58%	-1,72%
3 квартал		-6,51%	2,26%	-18,10%	-19,82%
4 квартал		24,90%	27,16%	3,41%	-16,41%
		2012 год	Итого	2012 год	Итого
1 квартал		17,26%	17,26%	7,84%	7,84%
2 квартал		8,54%	25,80%	-6,44%	1,40%
3 квартал		7,28%	33,08%	2,52%	3,92%
4 квартал		14,42%	47,50%	1,39%	5,31%
		2013 год	Итого	2013 год	Итого
1 квартал		-1,16%	-1,16%	-4,58%	-4,58%
2 квартал		-6,12%	-7,28%	-8,18%	-12,76%
3 квартал		16,21%	8,93%	4,07%	-8,69%
4 квартал					



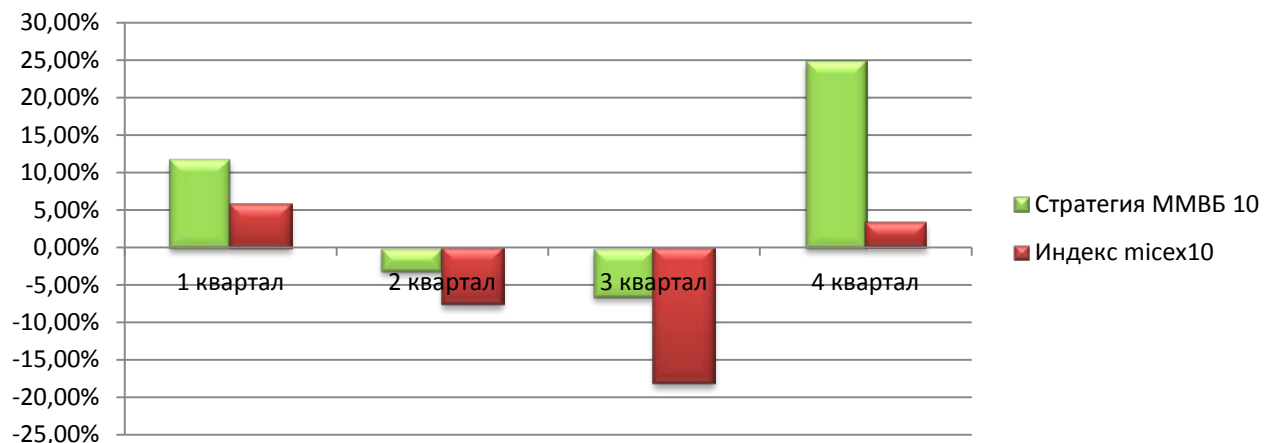
2009 год



2010 год



2011 год



2012 год



2013 год



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

Заработайте на инвестиционной идее!

[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 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.