

«МДМ - мир акций»

Наименование стратегии: МДМ Мир акций

Тип стратегии: Стратегия относительного дохода.

Цель стратегии: Получить результат лучше индекса ММВБ

Предмет инвестирования: Российские акции.

Управление активами:

Для получения дохода в имущество фонда приобретаются акции.

Акции приобретаются в портфель фонда с учетом, как фундаментальных показателей, так и с учетом текущей динамики рынка акций. Для этого управляющий активами выбирает акции, которые имеют привлекательные фундаментальные показатели. Выбранные акции приобретаются в портфель, когда управляющий активами ожидает роста цен на рынке акций (восходящий тренд). В портфель приобретаются наиболее ликвидные акции.

Доля приобретенных акций может быть уменьшена или продана полностью, если управляющий активами ожидает снижение их цены (нисходящий тренд).

Наличие восходящего или нисходящего тренда определяется путём анализа уровней поддержки и сопротивления.

В соответствии с требованиями законодательства управляющий активами не может полностью продать все акции и находиться в деньгах.

Прирост стоимости имущества фонда за счет акций обеспечивается за счет прироста цены, приобретенных акций, а также за счет получаемых дивидендов.

Денежные средства: Если управляющий активами ожидает снижения рынка акций, часть активов фонда могут составлять денежные средства.

Управление рисками:

Рыночный риск. Управление рыночным риском осуществляется путем установки лимита на долю денежных средств в портфеле, (2) лимита на долю одного наименования акции в портфеле, (3) лимита на отклонение коэффициента Var портфеля фонда от коэффициента Var индекса ММВБ.

Риск ликвидности. Управление данным риском осуществляется путем установки лимита на долю неликвидных ценных бумаг в портфеле.

Риск: Высокий.

Ликвидность: Высокая

Рекомендуемый срок инвестирования: не менее 1 года.

Бенчмарк: ценовой индекс открытых фондов акций IF-EG (IF-E General).