

Механизм сохранения капитала (алгоритм CPPI): инвестиции в акции и облигации с высокой ожидаемой доходностью и минимальным риском потери вложенных средств

+ 30.83%*

с начала 2010 года
с учетом реинвестирования

+ 8.40%*

за январь-апрель 2012 года

+ 5.91%*

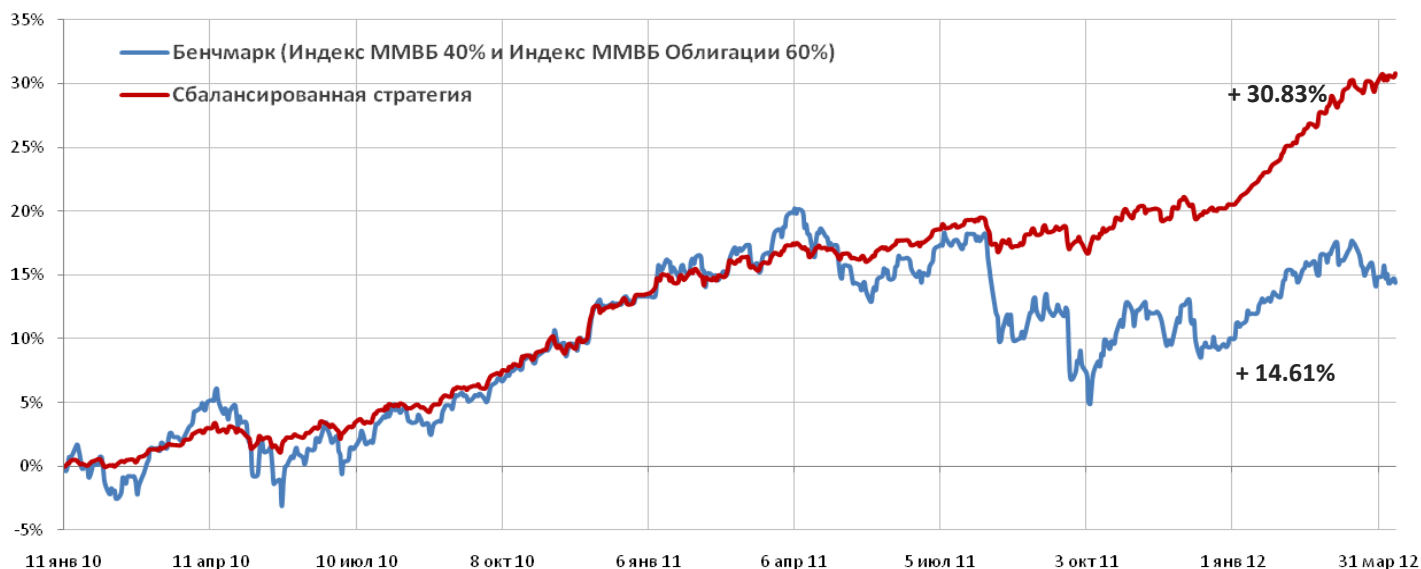
за 2011 год

+ 13.01%*

за 2010 год

+ 2.00%*

в кризисном 2008 году



В основе управления лежит алгоритм страхования портфеля пропорциями (CPPI), минимизирующий риск потери первоначальной суммы инвестиций. Стратегия предполагает размещение от 30% до 60% активов в облигации с приемлемым соотношением надежность/доходность. В основном эти инструменты приобретаются до погашения, поэтому рыночный риск по ним отсутствует. Оставшаяся часть портфеля формируется из наиболее перспективных акций.

Управление осуществляется путем поддержания постоянной пропорции между акциями и облигациями относительно минимального уровня доходности. Соотношение активов в портфеле в каждый момент времени таково, что его текущая общая стоимость, рассчитанная к концу срока инвестирования, составляет не менее 100% от первоначально инвестированных средств.

Инвестиционная цель

Сохранение и умеренный прирост капитала. Получение доходности, превосходящей уровень инфляции в 1.5-2 раза

Ожидаемая доходность и риск

Ожидаемая доходность: 13-16% годовых. Риск связан с получением доходности ниже инфляции. Максимальный риск – нулевая доходность при сильном падении рынка акций.

Бенчмарк:

40% ММВБ
и 60% ММВБ Облигации

Базовая валюта:

Рубль

Срок инвестиций:

от 1 года

Минимальная сумма инвестиций 1 млн. руб.

Комиссия за управление 1%

Комиссия за успех 15%

(812) 635-68-65

Санкт-Петербург, наб. канала
Грибоедова, д. 6/2, лит. А

WWW.DOHOD.RU

* Информация, содержащаяся в настоящем документе, в том числе данные об ожидаемой доходности стратегии и уровне риска, не является гарантией получения дохода и/или обещанием доходности вложений. Приведенная доходность является результатом моделирования правил управления на исторических данных и не гарантирует получение каких-либо результатов в будущем. Услуга предоставляется ООО «УК «ДОХОДЪ». Лицензия ФСФР России № 178-09678-001000 от 14.11.06.