



Event Drive

ЛОВИМ МОМЕНТ

ЛОВИМ МОМЕНТ

На чём работает стратегия?

Идея

Основа стратегии – спекуляция акциями компаний США, на которые ожидаются существенные изменения в цене в следствии недооцененности или переоцененности компаний, а также событийных факторов: поглощения, выкупы, отчеты, банкротства.



Подробно о факторах

Теория

Поглощение – обретение одной компанией контроля над другой. Мы проводим оценку компании-поглотителя и либо шортим либо покупаем акции компании-мишени.

Выкупы – это обратный выкуп собственных акций компанией эмитентом у акционеров. Такие действия показывают уверенность руководства компании в перспективах своего развития. Это положительно сказывается на котировках, заставляя их подрасти.

Отчеты – все котируемые компании в США 4 раза в год обязаны обнародовать свой финансовый отчет, где отражается полная картина текущих дел компании. Если отчет хороший, то акции взлетают, плохой – падают.

Банкротства – процедура разорения, отказа предприятия платить по своим долгам из-за отсутствия средств. При такой ситуации котировки акций становятся ничтожны.



Методология торговли

Торговля

Отбор компаний осуществляется на основе ключевых финансовых показателей, недооцененности компании или факторов в ближайшие 60 дней.

Оценка производится как недооцененных, так и переоценённых компаний. Таким образом в портфеле есть компании купленные и проданные (шорт позиции).

Подход, в котором есть купленные и проданные компании имеет низкую корреляцию к фондовым индексам. Низкая корреляция к фондовому индексу SP500 (Бетта ниже 1) позволяет инвесторам использовать данный портфель для диверсификации стратегий нацеленных на покупку акций в среднесрочный или долгосрочный портфель.



Как работает робот

РИСКИ

Расчетный уровень риска на компанию в портфеле ниже 3,5%.

За всеми позициями следит робот. Робот отслеживает он-лайн изменение стоимости портфеля.

Если снижение портфеля достигнет максимально возможного уровня, он ликвидирует позиции, останавливая дальнейшее возможное снижение портфеля в стоимости.



Как сравнить виды хеджа?

Показатели



СЧЕТ

Средства на Вашем личном счету в Interactive Brokers. Управляющий размещает торговые ордера. Внесение и изъятие средств доступно только клиенту.



ДОХОДНОСТЬ

Ожидаемая доходность: 45% годовых, исходя из статистики и back test при максимальной Drawdown 3,5% со сделки.



КОМИССИЯ

Комиссия 25% уплачивается только с Вашей прибыли. Комиссия может быть ниже и зависит от объема средств в стратегии.



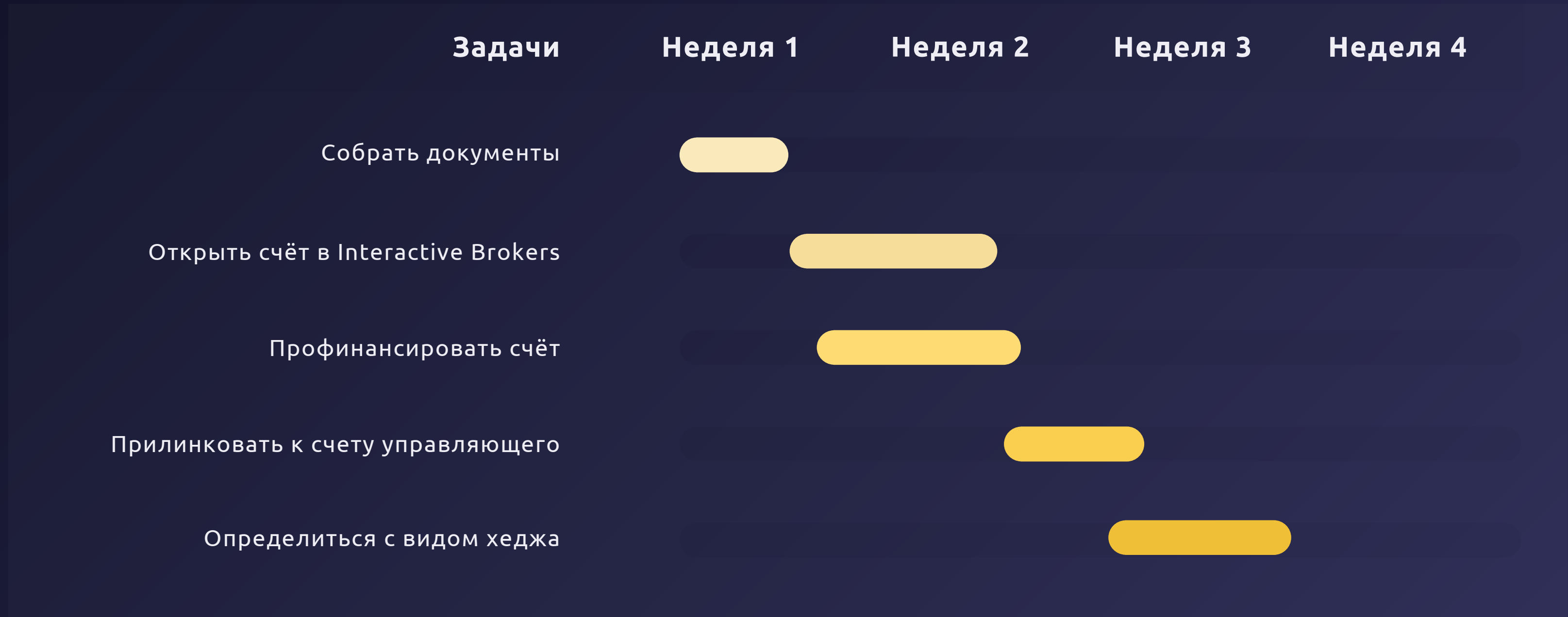
МИНИМАЛЬНАЯ СУММА

Ваш присоединяемый счет в interactive Brokers к стратегии Event Drive должен иметь не менее 50 000\$.



Процесс инвестиций

Таймлайн



Наша команда

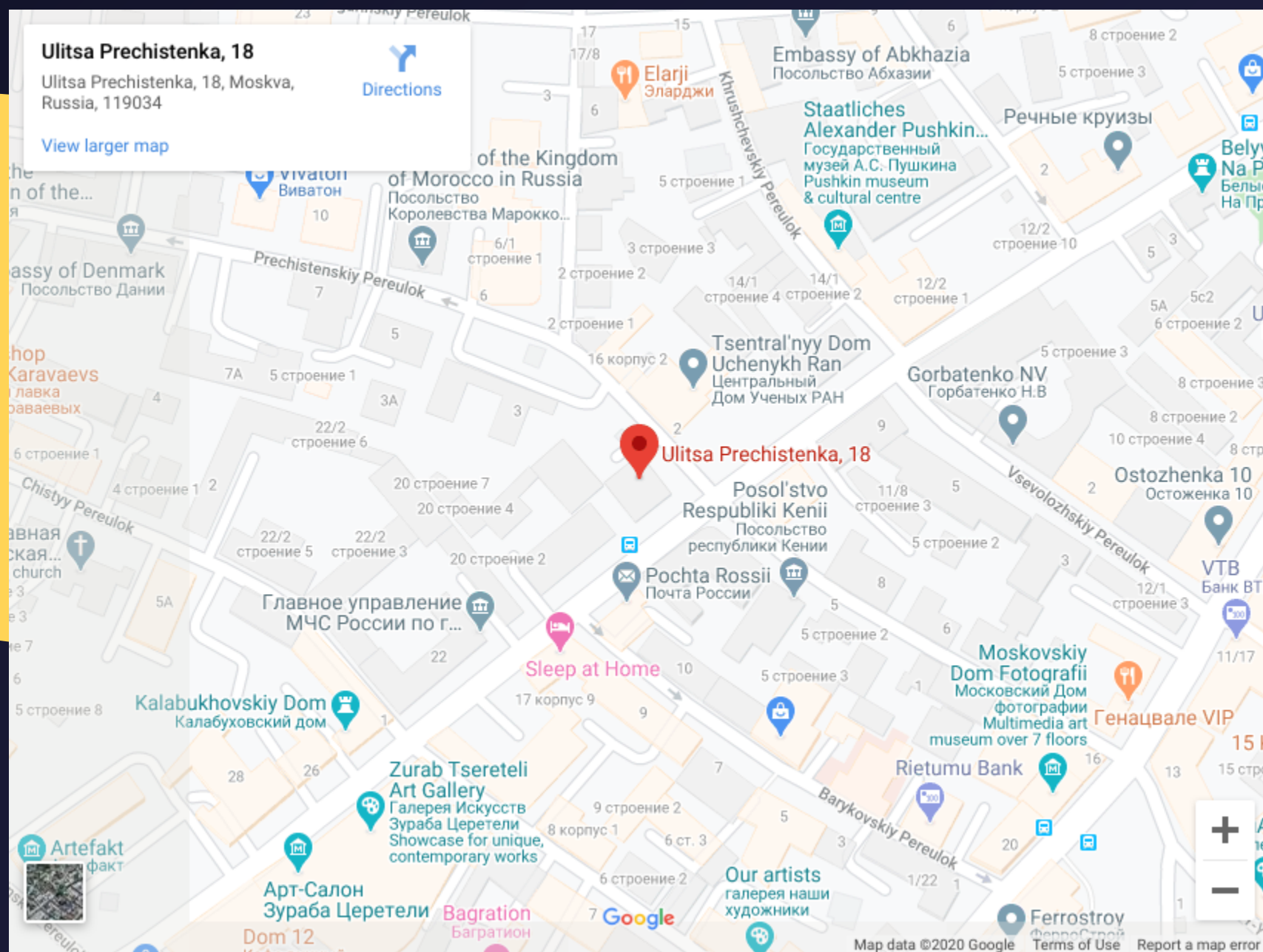


СЕРГЕЙ СМИТ
Управляющий портфелем



АНАСТАСИЯ ВИЛКОВА
Compliance Officer

Контакты



АДРЕС

Россия, Москва, ул. Пречистинка, д.18

ТЕЛЕФОН

+7 (499) 777 99 00

EMAIL

info@smit.com

[Открыть счёт](#)