

ВЫБОР ИНВЕСТИЦИОННОЙ СТРАТЕГИИ



Что такое стратегия?



Для чего нужна стратегия?



Достигнуть
Цели

- Сохранить
- Накопить
- Приумножить



Контролировать
риск



Экономить
время



Краткосрочные

(до 1 года)

Вложения в ликвидные инструменты с фиксированной доходностью

- Депозит
- Облигации

Среднесрочные

(от 1 до 5 лет)

Требуют активного управления и финансовой экспертизы
Рекомендуется диверсификация минимум по двум валютам
Активное управление на рынке акций

₽

\$

Долгосрочные

(5 – 10 лет)

Вложение в экономики развитых и развивающихся стран

Индексные инвестиции

₽

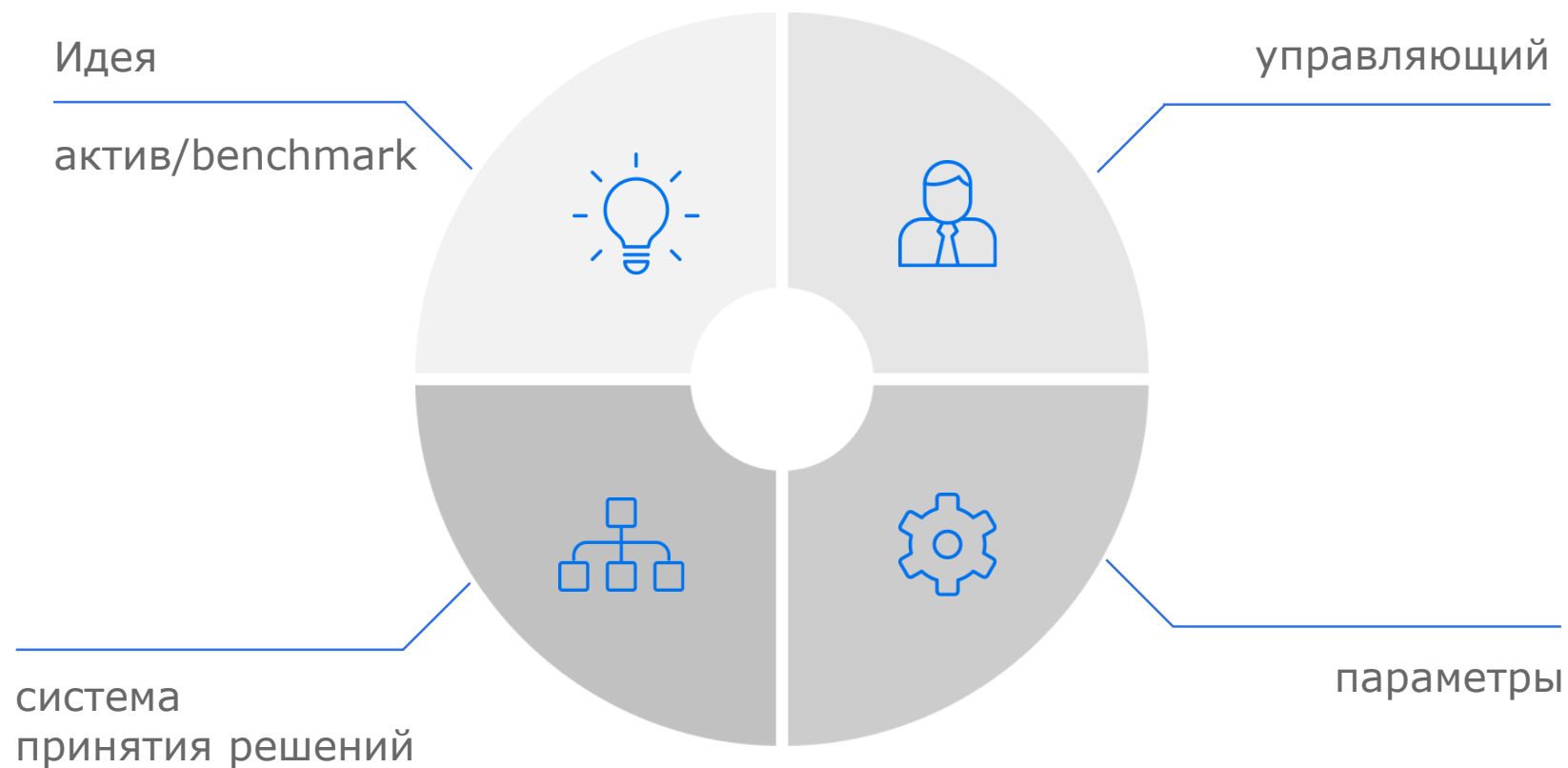
\$

€

£

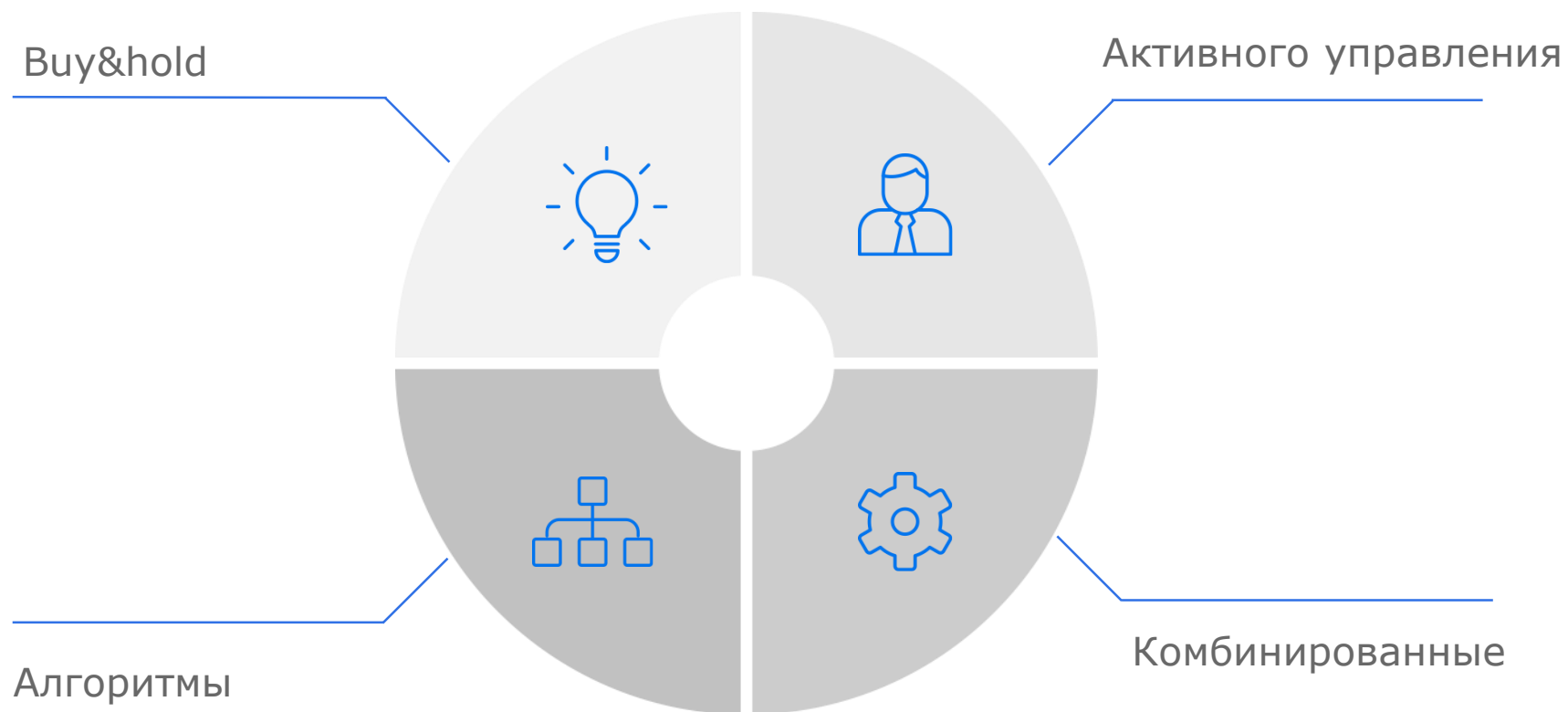


Из чего состоит стратегия?





Какие бывают стратегии

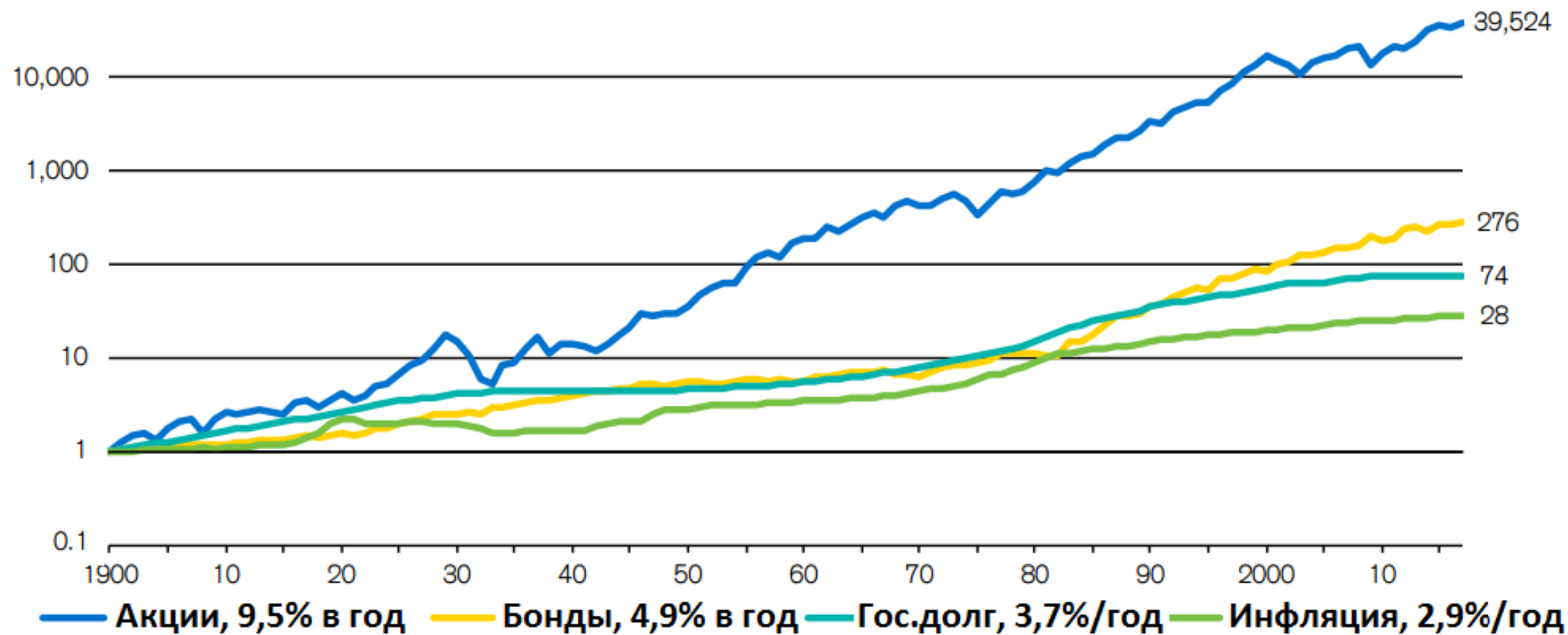


Определите:

- Цель
- Валюту
- Класс актива
- Инвестиционный профиль
- Срок
- Свое участие в инвестировании
- Доходность/риск



Накопленная доходность различных классов активов. 1900 - 2016 (США)



₽

- ОФЗ 4.5-6%
- Корп. облигации 7-10%
- Акции ММВБ 10-20%

\$

- US Treasures 1.5%
- Корп. облигации 2-4%
- Акции S&P500 7-15%

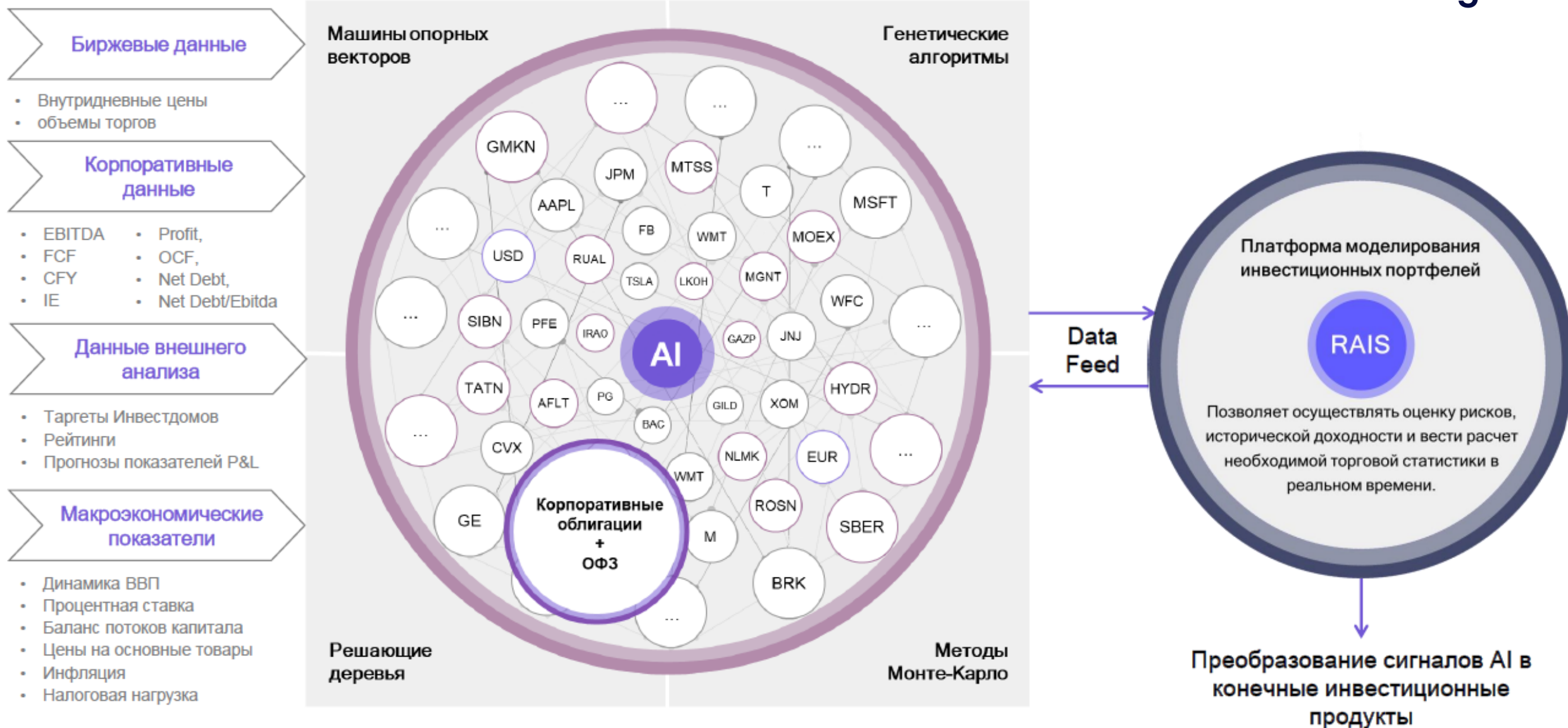


На что еще обратить внимание

- Методология оценки риска VAR 95%/99%
- Историческая доходность (симуляция или данные реальных торгов)
- Отношение средней прибыльной к средней убыточной сделке >1,5
- Емкость стратегии

Риск профиль	Риск $Var_{год}(95\%)$
Консервативный	0%-1%
Умеренно-Консервативный	1%-5%
Рациональный	5%-15%
Умеренно-Агрессивный	15%-25%
Агрессивный	25%-35%
Сверх-Агрессивный	35%-60%

Принцип работы Искусственного Интеллекта



Решение финансовой задачи

*Ни один из методов ИИ (машинного обучения) на сегодняшний день **не способен полностью решить** финансовую задачу в виду ее исключительной сложности и комплексности*

Наилучший результат показывают **комбинированные системы**, сочетающие в себе n -ое количество методов, настроенных в связке **непротиворечивости**. Наша система Ai Blackbox использует ансамбли аналитических моделей.

Принятие решений выполняется на основе частичной непротиворечивости: модели голосуют за принятие того или иного решения (buy/sell/hold); в результате **сильные и согласованные решения принимаются**



НОВОСТНЫЕ ЗАГОЛОВКИ - ХУДШИЙ СОВЕТЧИК В ПРИНЯТИИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ РЕШЕНИЙ, ОСОБЕННО КОГДА РЫНКИ ВОЛАТИЛЬНЫ.



Юрий Скоркин

БКС Брокер

info@fintarget.ru

