

Futures Direction (введение/описание)

Стратегия "Futures Direction" представляет собой инновационный подход к торговле на базе фьючерсных рынков основных американских индексов. Основанная на принципах "Smart Money", она объединяет анализ движения крупных игроков рынка с применением специального алгоритма, основанного на фундаментальных и макроэкономических показателях. Это позволяет идентифицировать направление движения рынка с высокой точностью и осуществлять торговлю в соответствии с прогнозами.

Стратегия "Futures Direction" базируется на концепции "Smart Money", которая предполагает анализ действий крупных игроков на рынке для выявления возможностей для успешной торговли в соответствии с инвестиционной политикой. Стратегия активно отслеживает действия банков, фондов и маркет-мейкеров, поскольку влияние институционалов на рынок может быть значительным. Используя данные о перемещении больших объемов капитала, стратегия определяет точки входа и выхода из позиций с целью максимизации потенциальной прибыли.

Для дополнительного повышения эффективности стратегии, интегрированы фундаментальные факторы и макроэкономические модели в анализ данных. Стратегия включает в себя анализ данных по экономическим показателям, таким как рост ВВП, уровень безработицы, инфляция и другие, чтобы определить общее направление движения рынка и потенциальные возможности для торговли.

Futures Direction (Цель стратегии)

Наша стратегия "Futures Direction" направлена на обеспечение высокой прибыльности и стабильного роста капитала на фондовом рынке, основываясь на направлениях, выявленных на фьючерсных рынках, но торгуя на рынке ценных бумаг. Средняя доходность S&P500 за последние 15 лет составляет 14% годовых, главная цель стратегии - превзойти этот индекс. Стратегия стремится к достижению выше средней доходности, обеспечивая клиентам возможность увеличивать свои инвестиции в долгосрочной перспективе.

Наша стратегия "Futures Direction" предусматривает как длинные, так и короткие позиции, что позволяет нам генерировать прибыль как в периоды роста, так и в периоды стагнации рынка. Мы активно ищем возможности для получения дохода в любых рыночных условиях, что обеспечивает стабильность и надежность инвестирования для наших клиентов. Наша цель - не только превзойти рыночные показатели, но и обеспечить максимальную прибыльность и успех на финансовых рынках, создавая оптимальные условия для роста и процветания инвестиционного портфеля наших клиентов.

Futures Direction (Риски)

Стратегия придает большое значение управлению рисками и сохранности капитала клиентов. Алгоритм включает в себя строгий контроль рисков в виде стоп-лосса и применение различных методов защиты от потенциальных убытков, что позволяет минимизировать финансовые риски и обеспечить стабильность инвестиционного портфеля. Максимальная волатильность стратегии составляет 15%.

Futures Direction (аллокация активов)

"Futures Direction" основана на дифференцированной ассет-аллокации, которая обеспечивает оптимальное соотношение риска и доходности для наших клиентов. Основными компонентами ассет-аллокации являются:

Акции: Выделяется значительная доля портфеля на инвестиции в акции на основе фондового рынка, куда в основном входят голубые фишки. Это позволяет использовать потенциал роста компаний и рыночных индексов для достижения высокой прибыльности.

ETF: Активно используются ETF (биржевые фонды) для торговли на фондовых рынках. ETF предоставляют доступ к широкому спектру активов, включая акции, облигации, сырьевые товары и другие, что позволяет эффективно диверсифицировать портфель и управлять рисками.

Облигации: Для диверсификации портфеля и снижения общего уровня риска также используются облигации. Это помогает обеспечить стабильность и сохранность капитала в условиях волатильности на финансовых рынках.

Наша стратегия предусматривает активное управление ассет-аллокацией с целью максимизации потенциальной прибыли при минимальном уровне риска. Мы стремимся к созданию хорошо сбалансированного портфеля, который обеспечивает высокую доходность и устойчивость в различных рыночных условиях.

Futures Direction (Преимущества стратегии)

Разносторонний подход: Стратегия "Futures Direction" не ограничивается только долгосрочными позициями на фондовом рынке, но также включает в себя возможность открытия коротких позиций. Это позволяет эффективно адаптироваться к различным циклам экономики и использовать возможности как в периоды роста, так и в периоды стагнации рынка.

Высокая эффективность: Благодаря алгоритму подбора идей и идентификации направления рынка, эффективность прибыльных сделок составляет более 70%. Это свидетельствует о высокой успешности стратегии и ее способности генерировать прибыльные сделки на финансовых рынках.

Глобальная диверсификация: Стратегия также рассматривает возможность инвестиций глобально, что позволяет инвестировать в более чем 50 экономик мира и более 100 разнообразных сегментов. Это обеспечивает дополнительные возможности для диверсификации портфеля и увеличения потенциальной прибыльности.

Аллокация активов: Стратегия включает в себя инвестиции в облигации/акции/ETF, что помогает снизить общий уровень риска портфеля и избежать потерь в периоды высокой волатильности на рынке. К примеру, облигации обеспечивают стабильный доход и защиту капитала, что делает стратегию более устойчивой к колебаниям рынка.

Эффективный риск-менеджмент: Преимущество стратегии заключается в ее эффективном риск-менеджменте. Максимальная просадка стратегии составляет всего 15%, при этом достигается значительная годовая прибыль в размере 38.51%. Это подтверждает способность стратегии эффективно управлять рисками и обеспечивать стабильность в различных рыночных условиях.

В целом, стратегия "Futures Direction" предлагает высокую прибыльность, эффективный риск-менеджмент и широкие возможности для диверсификации инвестиционного портфеля, что делает ее привлекательным выбором для инвесторов, стремящихся достичь успешных результатов на финансовых рынках.

Доходность стратегии по итогам 2023 года составила 38,51%.

Стратегия продемонстрировала достаточно уверенные результаты относительно S&P500, превывис доходность основного индекса на 14,5%. Количество закрытых в позитивной зоне сделок составляет порядка 76,5%. В рамках стратегии закрытые позиции принесли прибыль в размере 52%, при убытке текущих позиций в размере 13,5%.

Основное давление на доходность стратегии оказывал фактор долгосрочных казначейских облигаций, где на текущий момент сосредоточено порядка 50% позиций. Вышеприведенные позиции приобретались во втором квартале 2023 года, после чего портфель вошел в фазу высокой волатильности в течение второго и третьего квартала. Данная позиция продолжает нести определенный убыток для стратегии. Несмотря на давление со стороны ФРС, с момента покупки позиций, регулятор произвел повышение ставок единой, а инфляция снизилась до отметки в 3,1%.

Ожидания по стратегии в 2024 году.

Несмотря на ожидания рынка, касательно снижения инфляции и снижения процентных ставок, американская и в частности, глобальная экономика испытает последствия высоких ставок. Исторически, снижение ставок является вынужденной мерой для поддержания экономики и может нести удручающий характер. Таким образом, исходя из фундаментальных факторов, потенциал основных американских индексов может быть достаточно ограниченным и находиться на отметке в 5000-5100 пунктов по S&P500 в первом полугодии 2024.

Вторая половина 2024 года может указать на начало рецессии в главной мировой экономике.

Вероятность негативного сценария для экономики достаточно высока, при условии продолжения количественного изъятия со стороны ФРС. Более того, давление высоких ставок окажет негативное влияние на потребительскую способность США. При условии снижения капитала домохозяйств США и истощения накоплений, вероятность рецессии представляется достаточно высоко вероятным фактором.

