

О фонде

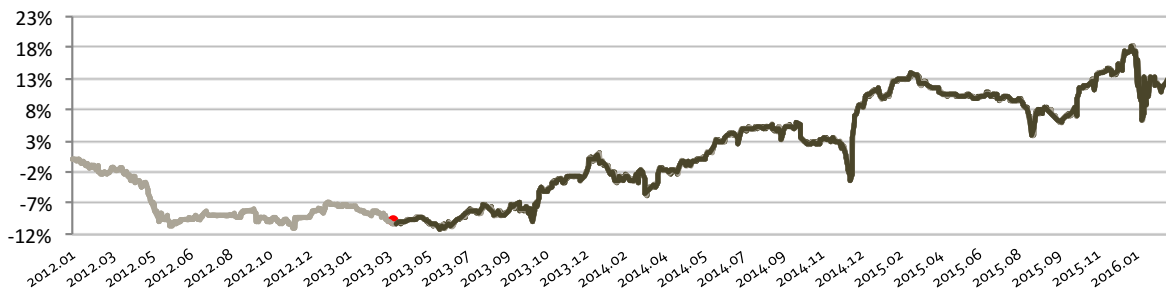
Фонд является альтернативой услуге по управлению портфелем, которая действует как уникальный фонд нескольких стратегий (англ. multi-strategy fund). Цель фонда – стремиться к приросту стоимости инвестиций, вне зависимости от мировой фазы роста экономики или цикла финансовых рынков. В управлении фондом используются методы как фундаментального, так и статистического, факторного и технического анализа. Некоторые стратегии основаны на статистических моделях и работают отчасти автоматизировано. Фонд одновременно может инвестировать несколько отдельных стратегий инвестирования.

Диверсификация денежных средств в различные стратегии инвестирования позволяет уменьшить волатильность фонда, а также зависимость от одной стратегии или одного класса имущества.

С целью контроля и ограничения волатильности фонда привлекается активное управление риском. Перераспределение денежных средств между стратегиями осуществляется путем оценки их исторических результатов, а это значит, что если определенная стратегия демонстрирует отрицательные результаты, часть средств может быть перенесена в другую стратегию с положительными результатами. Ограничиваются также как возможный убыток каждой стратегии инвестирования, так и возможный убыток инвестиции каждой отдельной инвестиции в финансовые инструменты, тем самым преследуется цель максимально сократить колебания фонда.

Средства фонда могут быть инвестированы в различные регионы и классы имущества: акции, долговые ценные бумаги и прочие финансовые инструменты с фиксированной доходностью, валюты, другие инвестиционные фонды, производные финансовые инструменты. Ограничения на инвестирование в отдельные регионы и имущественные классы не установлены, управляющие фондом могут инвестировать в каждый из регионов или классов имущества до 100 процентов средств фонда.

Результаты



Новый руководитель фонда с 8 апреля 2013

Историческая доходность

	Январь	Февраль	Март	Апрель	Май	Июнь	Июль	Август	Сентябрь	Октябрь	Ноябрь	Декабрь
2013	0,62%	-1,23%	-1,43%	0,37%	-1,12%	0,97%	1,13%	-0,27%	0,07%	3,76%	1,84%	2,87%
2014	-3,57%	1,23%	-0,02%	1,33%	1,45%	2,40%	2,22%	0,24%	-0,37%	-1,99%	-0,16%	5,99%
2015	1,00%	2,74%	-0,46%	-1,92%	0,02%	-0,05%	-0,76%	-1,28%	-1,89%	5,58%	2,14%	2,65%
2016	-3,38%	0,07%										

Экспозиция (нетто)

	Январь	Февраль	Март	Апрель	Май	Июнь	Июль	Август	Сентябрь	Октябрь	Ноябрь	Декабрь
2013	35%	59%	88%	51%	31%	45%	83%	49%	84%	46%	58%	38%
2014	49%	46%	78%	87%	17%	74%	11%	67%	6%	7%	15%	18%
2015	11%	8%	15%	21%	20%	18%	21%	32%	31%	13%	26%	9%
2016	25%	27%										

Классы активов

Акции	18,44%
Облигации	8,75%
Отрасли	-0,11%
Деривативы	0,00%
Депозиты	0,66%
Денежные средства**	72,26%
** Валютный риск может быть застрахован	100,00%

Доходность

1 год	0,43%
2 года	16,12%
3 года	24,11%
Средний годовой доход в 3 -летний период*	8,42%
Доходность фонда	13,43%
Доходность фонда*	26,47%
* Новый руководитель фонда с 8 апреля 2013	

Показатели

Прибыльные месяцы %	60,00%
Годовая волатильность*	10,57%
Коэффициент Шарпа*	2,20
Корреляция с MSCI World (EUR)*	0,44
Максимальное падение	-10,14%
* Новый руководитель фонда с 8 апреля 2013	

Риск и доходность, один месяц

	МП***	Результат
Novus Balanced Portfolio	-2,20%	0,07%
MSCI World (EUR)	-10,31%	-1,37%
MSCI Emerging Markets (EUR)	-8,38%	-0,69%
S&P 500 (EUR)	-8,69%	-1,34%
HFRX Global Hedge Fund Index (EUR)	-6,16%	-0,82%
*** Максимальное падение		

Фонд

Активы под управлением (EUR)	2 892 649
Управляющими учреждением	UAB "Novus Asset Management"
Руководитель фонда	Леонардас Диржис
Минимальная инвестируемая сумма (EUR)	10 000
Ликвидность	Ежедневно

Отказ от ответственности

ВСЕ ЗАЯВЛЕНИЯ О ПОЛУЧЕНИИ ПРИБЫЛИ ИЛИ ДОХОДА, А ТАКЖЕ ПРИМЕРЫ ПОЛУЧЕНИЯ ПРИБЫЛИ ИЛИ ДОХОДА, КОТОРЫЕ МОГУТ БЫТЬ РАЗМЕЩЕНЫ НА САЙТАХ НАШЕЙ КОМПАНИИ, ЯВЛЯЮТСЯ ТОЛЬКО ПРОГНОСТИЧЕСКОЙ ОЦЕНКОЙ ВОЗМОЖНОГО ЗАРАБОТКА И НЕ ГАРАНТИРУЮТ ЕГО ПОЛУЧЕНИЯ. СЧИТАЯ ПРЕДПОЛАГАЕМУЮ ПРИБЫЛЬ ГАРАНТИРОВАННОЙ, ВЫ ПРИНИМАЕТЕ НА СЕБЯ ТАКЖЕ РИСК ЕЕ НЕПОЛУЧЕНИЯ.

Основные термины

Максимальное падение - "Дродаун" - снижение капитала после максимальной достигнутой величины в результате торговой деятельности. Обычно выражается в процентах от максимума.

Годовая волатильность статистический финансовый показатель, характеризующий изменчивость цены. Является важнейшим финансовым показателем и понятием в управлении финансовыми рисками, где представляет собой меру риска использования финансового инструмента за заданный промежуток времени.

Коэффициент Шарпа - показатель эффективности инвестиционного портфеля (актива), который вычисляется как отношение средней премии за риск к среднему отклонению портфеля

Корреляция - статистическая взаимосвязь двух или более случайных величин (либо величин, которые можно с некоторой допустимой степенью точности считать таковыми). При этом изменения значений одной или нескольких из этих величин сопутствуют систематическому изменению