

О фонде

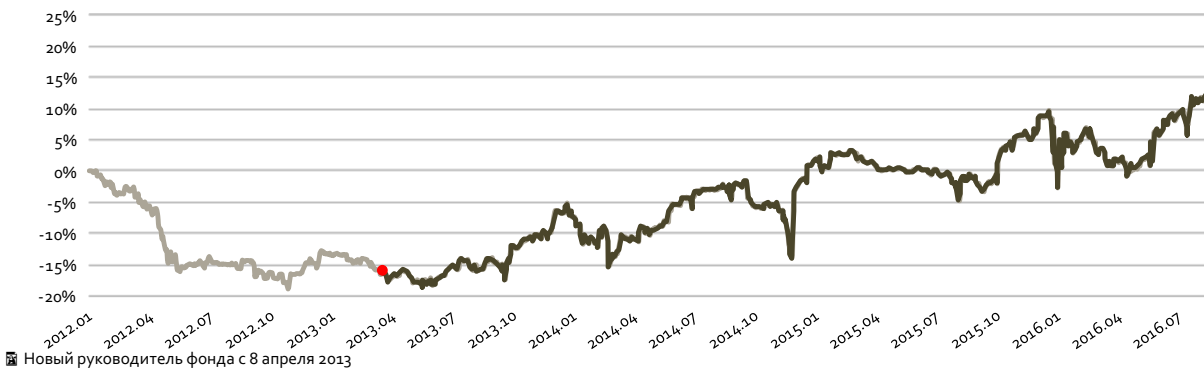
Фонд является альтернативой услуге по управлению портфелем, которая действует как уникальный фонд нескольких стратегий (англ. multi-strategy fund). Цель фонда – стремиться к приросту стоимости инвестиций, вне зависимости от мировой фазы роста экономики или цикла финансовых рынков. В управлении фондом 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



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%	-3,52%	-1,00%	0,97%	5,71%	1,28%	2,55%				

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%	13%	35%	33%	46%	84%	41%				

Классы активов

Акции	21,65%
Облигации	19,48%
Отрасли	0,00%
Деривативы	0,00%
Депозиты	0,00%
Денежные средства**	58,86%
** Валютный риск может быть застрахован	100,00%

Доходность

1 год	13,11%
2 года	15,33%
3 года	33,43%
Средний годовой доход в 3 -летний период*	9,07%
Доходность фонда	12,15%
Доходность фонда*	34,43%
* Новый руководитель фонда с 8 апреля 2013	

Показатели

Прибыльные месяцы %	58,54%
Годовая волатильность*	12,74%
Коэффициент Шарпа*	2,34
Корреляция с MSCI World (EUR)*	0,41
Максимальное падение	-12,48%
* Новый руководитель фонда с 8 апреля 2013	

Риск и доходность, один месяц

	МП***	Результат
Novus Balanced Portfolio	-3,22%	2,55%
MSCI World (EUR)	-1,69%	0,36%
MSCI Emerging Markets (EUR)	-2,22%	2,72%
S&P 500 (EUR)	-2,50%	-1,47%
HFRX Global Hedge Fund Index (EUR)	-0,44%	0,28%
*** Максимальное падение		

Фонд

Активы под управлением (EUR)	669 132
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