

Клуб инвесторов

Инвестиционные
идеи

И торговые стратегии



Финам

Накопительные стратегии, результат за год 11,5% годовых.



Облигации Министерства Финансов = 9-10% годовых: 24018, 24019, 29006, 29007, 29008, 29011.

Корпоративные облигации = 8-12% годовых (после НДФЛ) =
Полипласт Б03, Каркаде Б02, Мечел13.

Рекомендуемые суммы = от 300 000 на эмитента.

**ИРО облигаций в мае
(идет сбор заявок):**

- 1.Срок = 1 год
- 2.Выплата купонов = 1 раз в месяц
- 3.Ставка 14% годовых
- 4.Минимальная сумма
3 млн. рублей.



По бюджетному правилу
При нефти = 55\$, доллар должен стоять 56 рублей

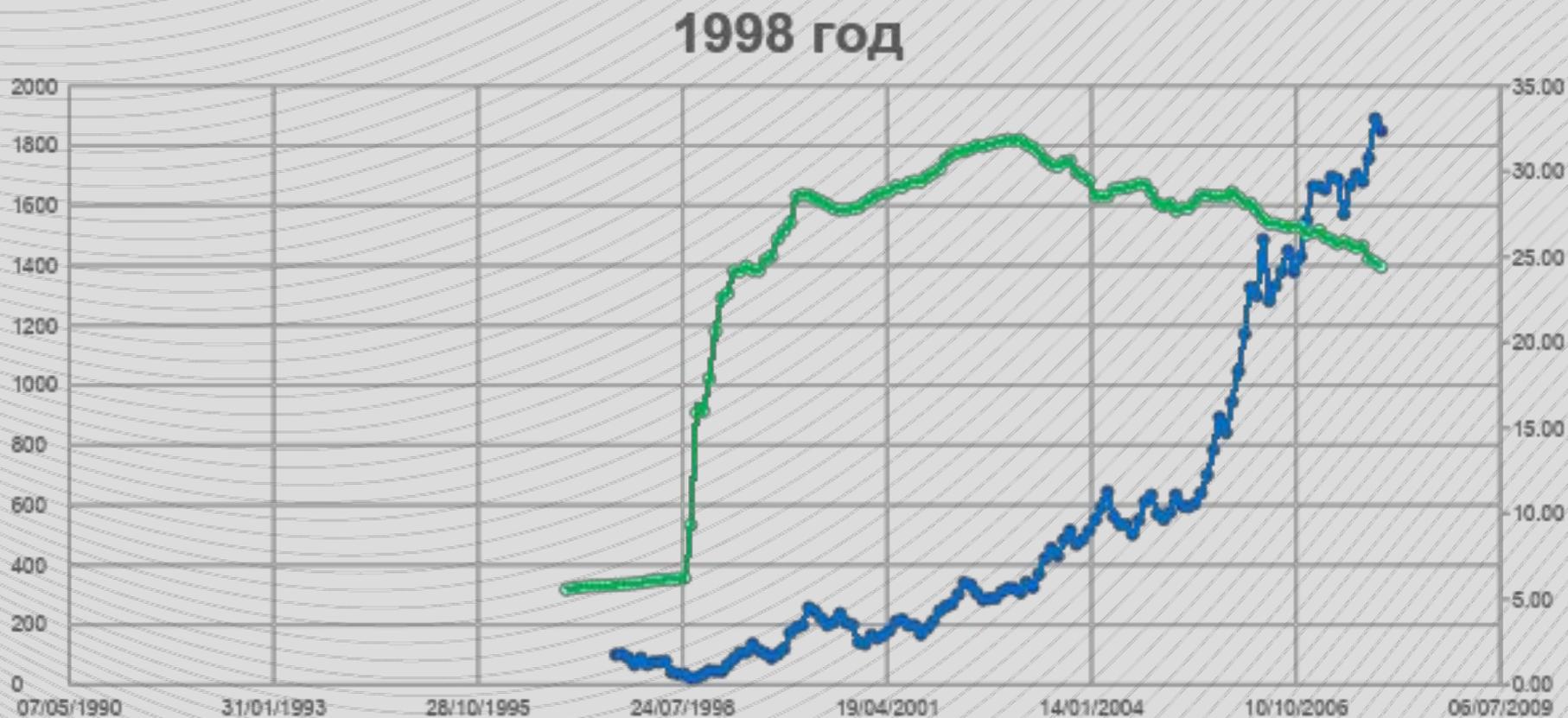
USDRUB_TOM 60,7800 60,9000 60,7025 60,7500 1,0 млрд.

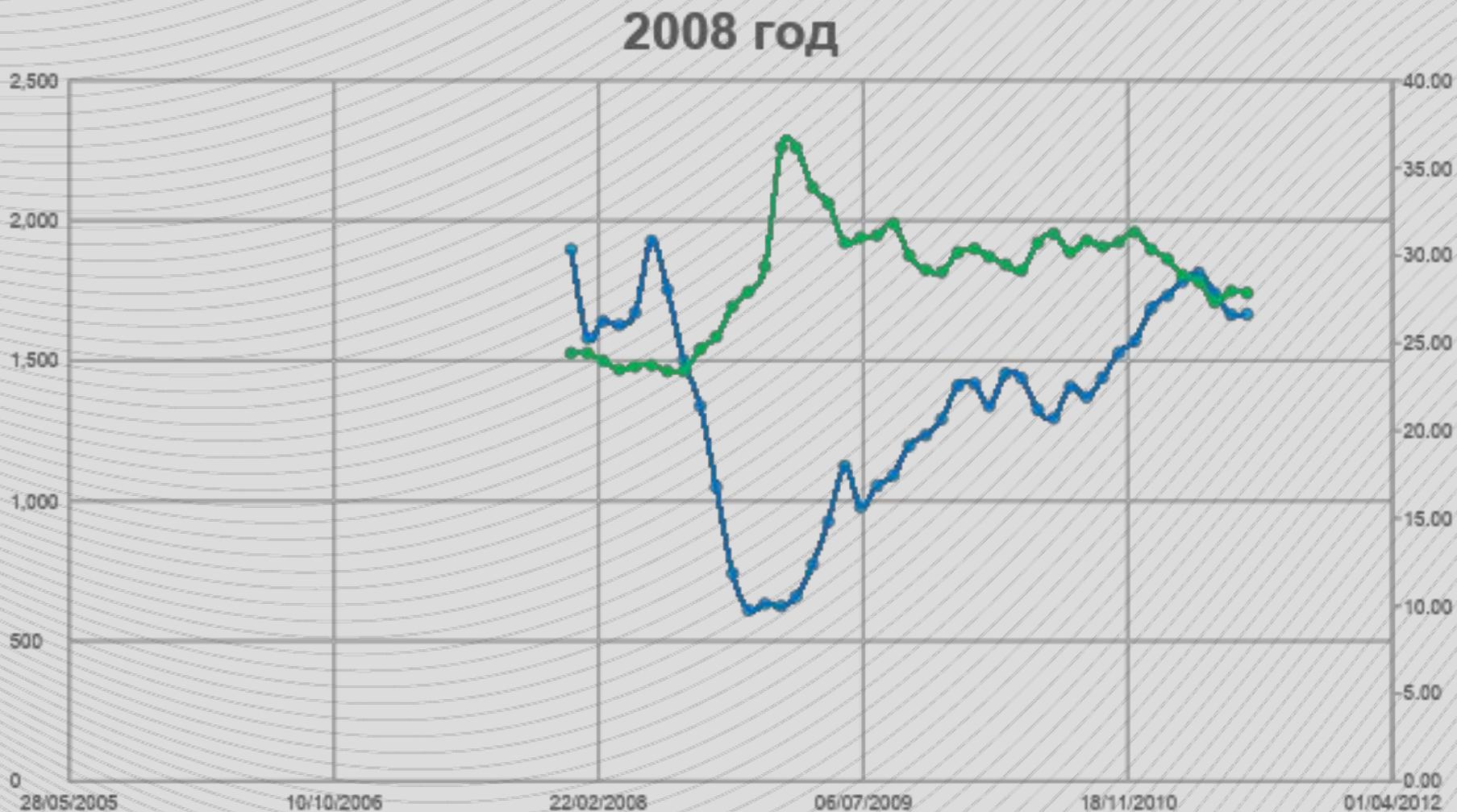
EMA (9) 62,2

EMA (27) 63,3









- Доходности компаний, цены ресурсов
 - Ставки в стране
- Приток/отток капитала
 - Геополитика

Никель и алюминий – 2016-2017

Товары ▾

Алюминий ▾ ☆

Где самый выгодный тариф?

Найти

Товары ▾

Никель ▾

Выберите рынок ▾

7Д

1М

6М

1Г

5Л

MAX



Ставка с 16 декабря 2014 года = 17% годовых

Ставка с марта 2017 = 9,75% годовых

Ожидаем снижения ставки до 8% годовых

Ставки по депозитам снизятся до 4-6% годовых, в ноябре 2016 приток вкладов населения = 0;

Дивиденды (июнь-июль):

1.Алроса = 9 рублей (год), цена = 96;

2.Лукойл = 120 рублей (квартал), цена = 2800;

3.Газпром = 10-20 рублей, цена = 135 рублей.

Дивиденды:

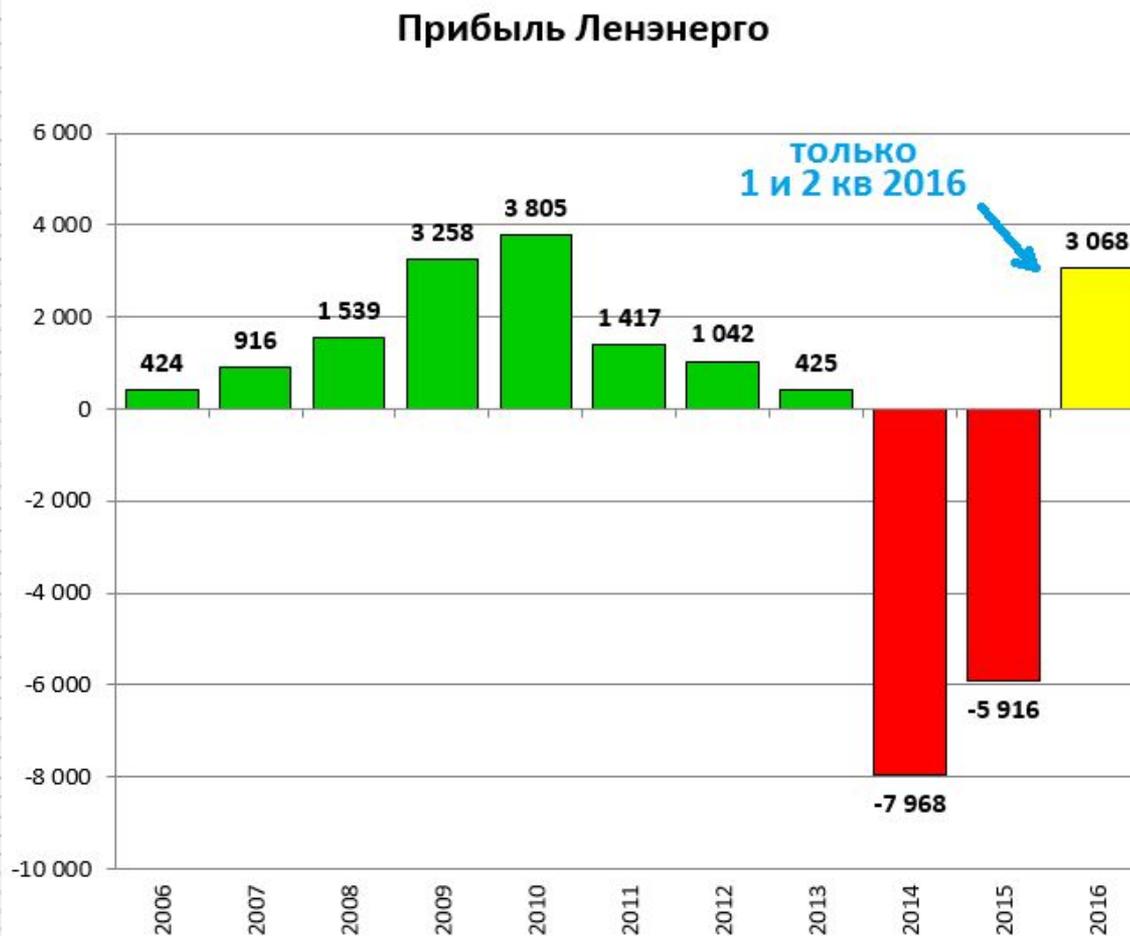
		Дивиденд	Дивиденд
Газпром	СД май, отчет в конце апреля	10-20 рублей	8%-15%
ФСК	СД май	2,7 копейки	14%
Башнефть ап	СД май	146-164 рублей	12%-13%

(!) Важен момент объявления, новость

Россети, Аэрофлот, ВТБ, Сбербанк

Цель +5÷10%





10% прибыли идет на **дивиденды** по префам



Прибыль в 2016 = **0,7 трлн руб.**,
 Прибыль 4 кв = «0» :

25% МСФО: 7,4 рубля на акцию

35% МСФО: 10,3 рубля на акцию

50% МСФО: 14,8 рубля на акцию

Прибыль в 2016 = **0,5 трлн руб.**,
 Убыток в 4 кв = -200 млрд руб:

25% МСФО: 5,3 рубля на акцию

35% МСФО: 7,4 рубля на акцию

50% МСФО: 10,6 рубля на акцию

Башнефть.

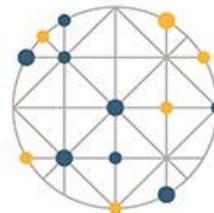
Рустэм Хамитов: «Дивиденды Башнефти ждем в таком же объеме, как и по 2015 году, без изменений».



- 1) «в таком же объеме» – 164 руб/акция
- 2) 50% от МСФО – 146 руб/акция



MSCI



\$14,6 млрд

+НЛМК

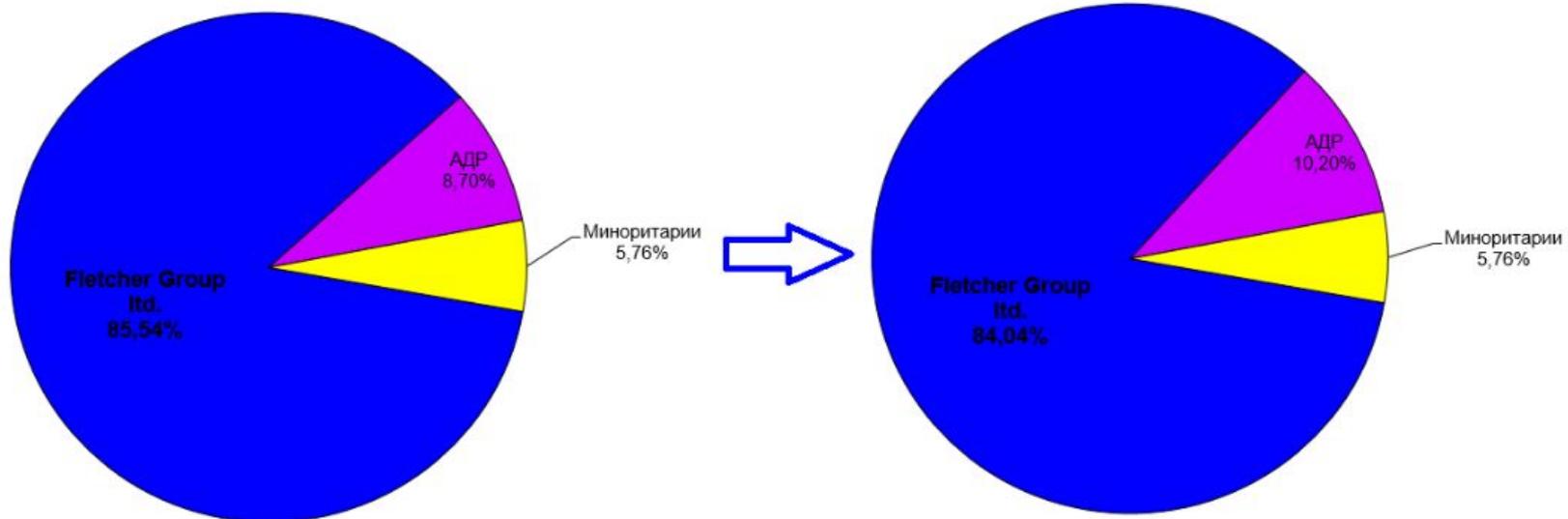
-Ростелеком ао

Цель: +10%

8 декабря 2016:

Лисин продает 1,5%

Структура акционеров ОАО "НЛМК"

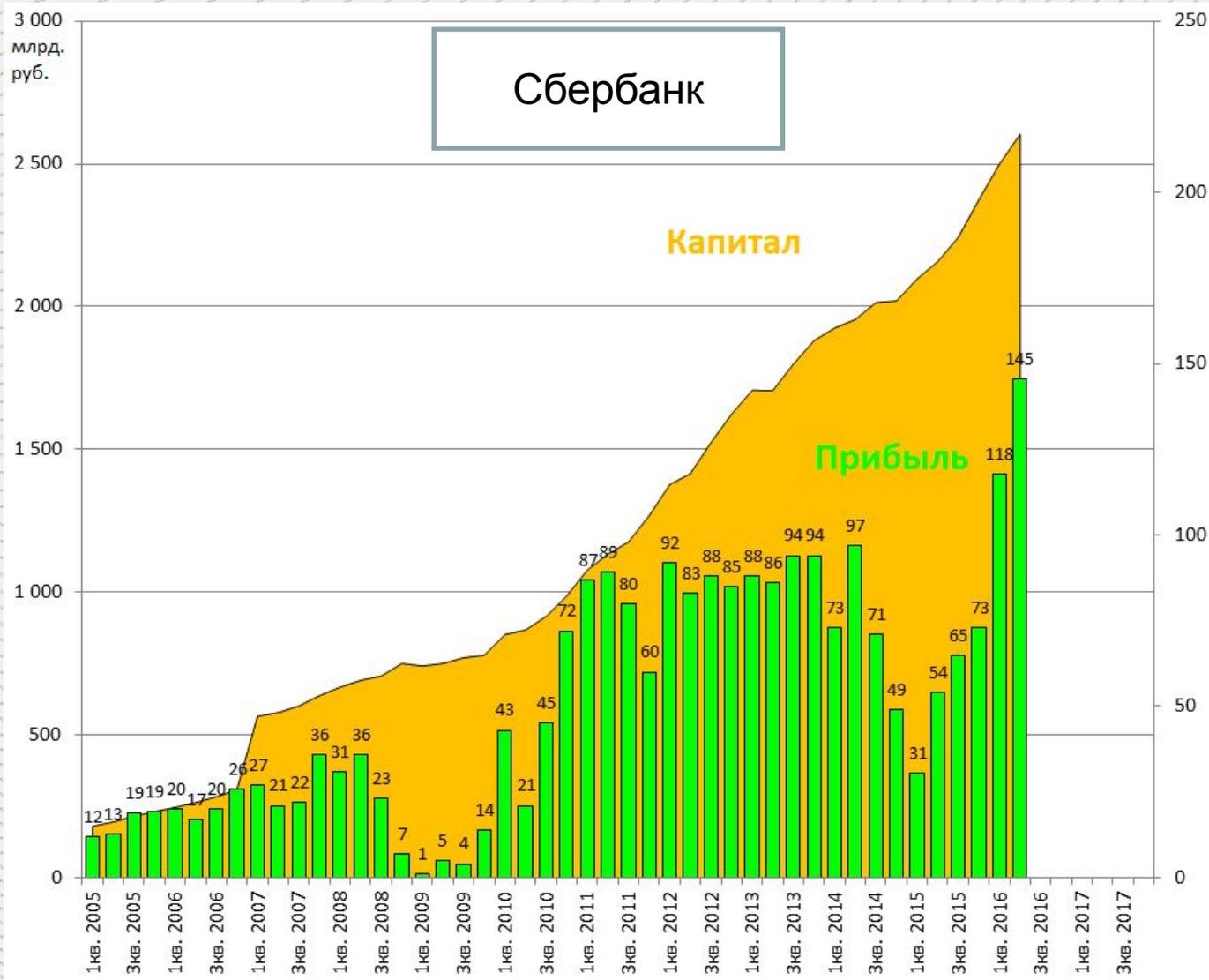


MSCI Code	Security Name	Price	Currency	Shares FIF Adjusted	Weight%
1896804	SBERBANK RUSSIA COM(RUB)	162.50000	RUB	10,793,474,000	18.90
1884205	GAZPROM (RUB)	127.79000	RUB	10,653,080,805	14.67
1874804	LUKOIL HOLDING(RUB)	2913.00000	RUB	425,281,628	13.35
3241302	NOVATEK GDR	123.30000	USD	91,089,180	6.77
6071002	MAGNIT GDR	36.50000	USD	307,324,404	6.76
2491705	NORILSK NICKEL MMC(RUB)	8687.00000	RUB	55,385,917	5.18
2056003	TATNEFT COMMON (RUB)	331.05000	RUB	1,416,149,150	5.05
3481902	ROSNEFT (RUB)	321.35000	RUB	1,165,799,560	4.04
3692203	VTB BANK(RUB)	0.06529	RUB	5,184,216,534,935	3.65
2788702	TRANSNEFT PREF (RUB)	195800.00000	RUB	1,554,875	3.28
2375301	MOBILE TELESYS ADR	10.66000	USD	499,595,394	3.21
6994201	ALROSA (RUB)	93.00000	RUB	2,577,737,970	2.58
1885703	SURGUTNEFTEGAZ PREF(RUB)	29.43000	RUB	6,931,798,412	2.20
1885706	SURGUTNEFTEGAZ COMN(RUB)	27.03500	RUB	7,145,198,941	2.08
2517402	SEVERSTAL (RUB)	782.30000	RUB	209,429,665	1.77
7143701	MOSCOW EXCHANGE (RUB)	112.36000	RUB	1,367,181,896	1.66
6187102	NLMK INTER RAO UES(RUB)	3.97600	RUB	31,320,000,000	1.37% 1.34
6086401	RUSHYDRO (RUB)	0.90500	RUB	115,876,639,467	1.13
3058501	AFK SISTEMA GDR	8.40000	USD	168,875,000	0.85
6971101	+ PHOSAGRO GDR	14.15000	USD	97,134,714	0.83
1885503	- <u>ROSTELECOM COMMON (RUB)</u>	74.18000	RUB	901,220,234	0.72

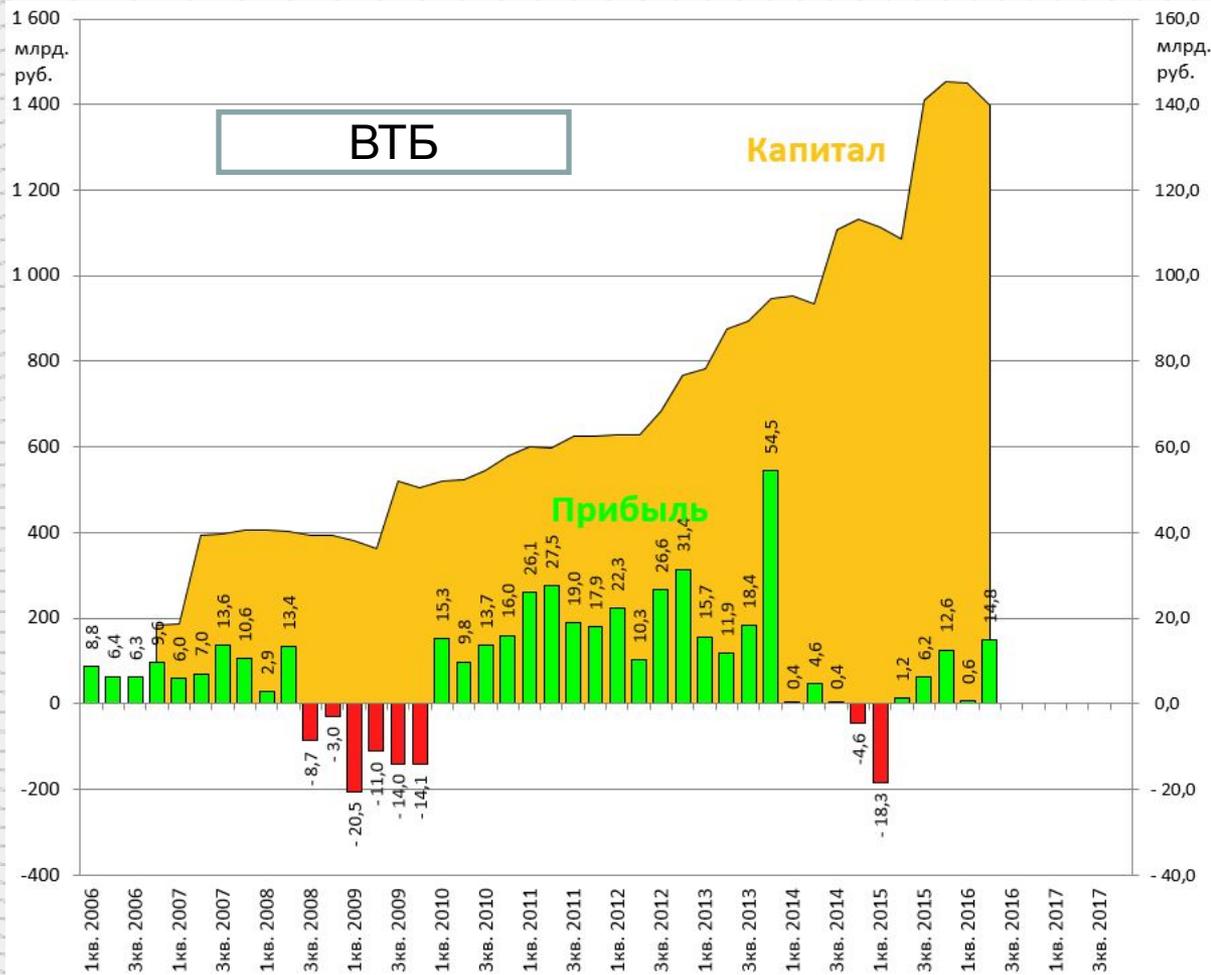
+\$200 млн
(+11 млрд
рублей)

-\$100 млн
(-5,5 млрд
рублей)

Примеры идей: Сбербанк vs ВТБ

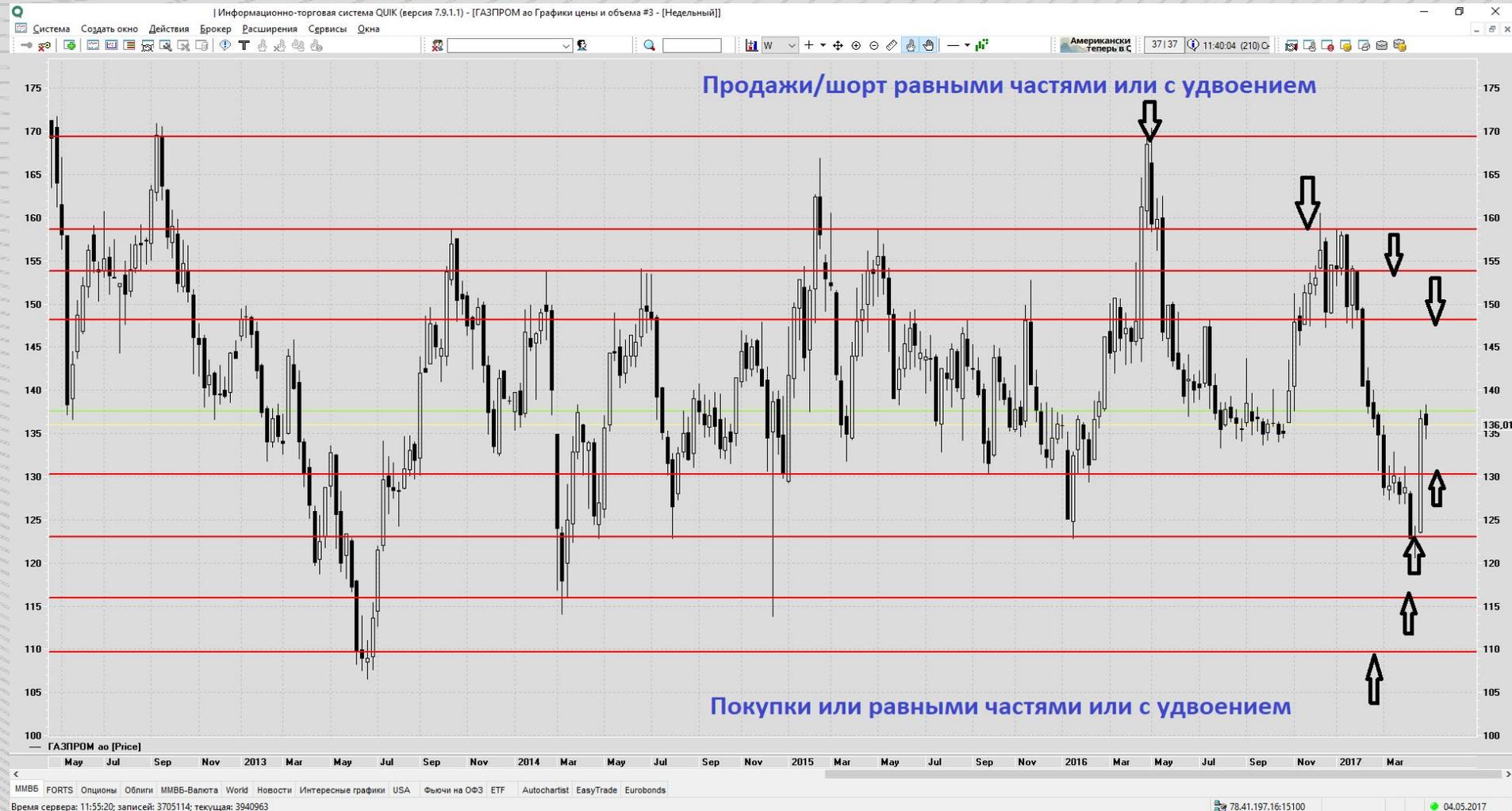


Примеры идей: Сбербанк vs ВТБ



Банки - точка роста. ВТБ оживает

- Торгуем ГЭП (отдельный файл)
- Торговля в боковике (Газпром)
- Торговля в боковике (Сбербанк)
- Торговля на RSI + Volume



Только в программе Транзак:

1. Строим индикатор Keltner Channel с параметрами:

- От 15 до 30 ЕМА и АTR (по умолчанию 20)
- Коэф. = от 2 до 3,5. Чем больше параметр, тем меньше сделок и длиннее трейд.
- Графики акций от 15 минут до 1 часа.

Keltner Channel параметры

Параметры | Оформление | Дополнительно

Тип цены

close med typical
 high low open

Скользящая средняя

Тип: EMA Период: 27

Отклонение

Период ATR: 27 Коэф.: 3

Ось: Правая
 Левая
 Без привязки

Сбербанк

OK Отмена Справка

2. Смотрим на выход акций из канала вниз или вверх. На закрытии свечи входим в сделку.
3. Торгуем возврат к средней. Если видим тренд (последовательные максимумы/минимумы с пробоем канала) – торгуем трендовые стратегии.
4. Если акция последовательно выходит выше канала, то ищем противоположный сигнал.
5. Входим сделку со стопом и тэйком: тэйк = средняя канала, стоп = $\frac{1}{2}$ от тэйка.

Вход в шорт 164,2, тэйк = 162,4, стоп = 165.
Вышли в течение 2 часов по тэйку.

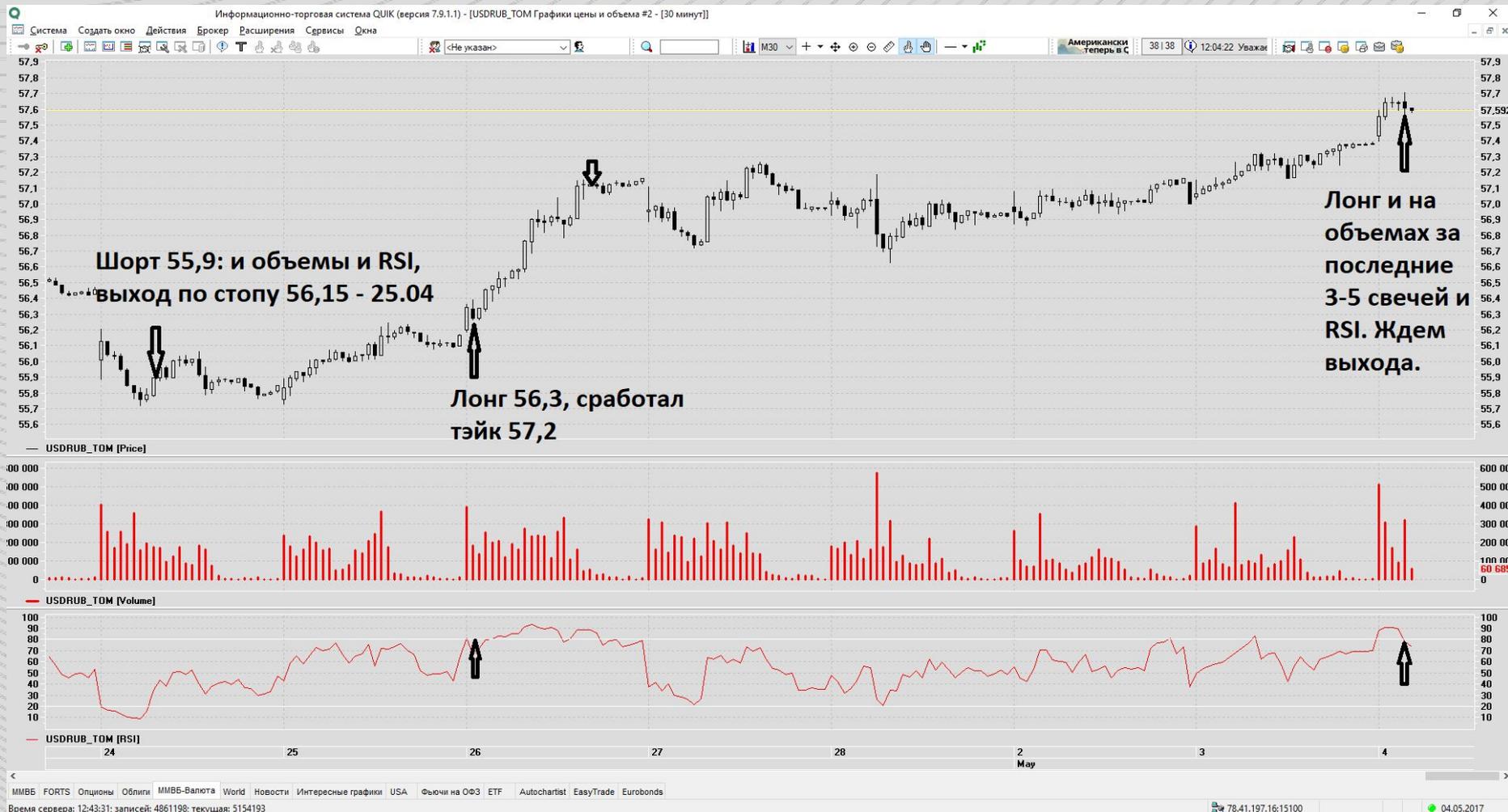


Только доллар США = USDRUB_TOM
(фьючерсы не работают)

1. Timeframe = 30 минут.
2. RSI = 7
3. Volume – смотрим отклонение от среднего значения

Входы и выходы:

1. ЛОНГ = RSI вышел из перекупленности (пересек значение 80 вниз);
2. ШОРТ = RSI вышел из перепроданности (пересек значение 20 вверх);
3. Стоп = 0,4%, тэйк = 1,5%.



RSI + Volume

У робота сделок больше



Доходность с 01.07.2014 года = 59 руб. с 1 доллара

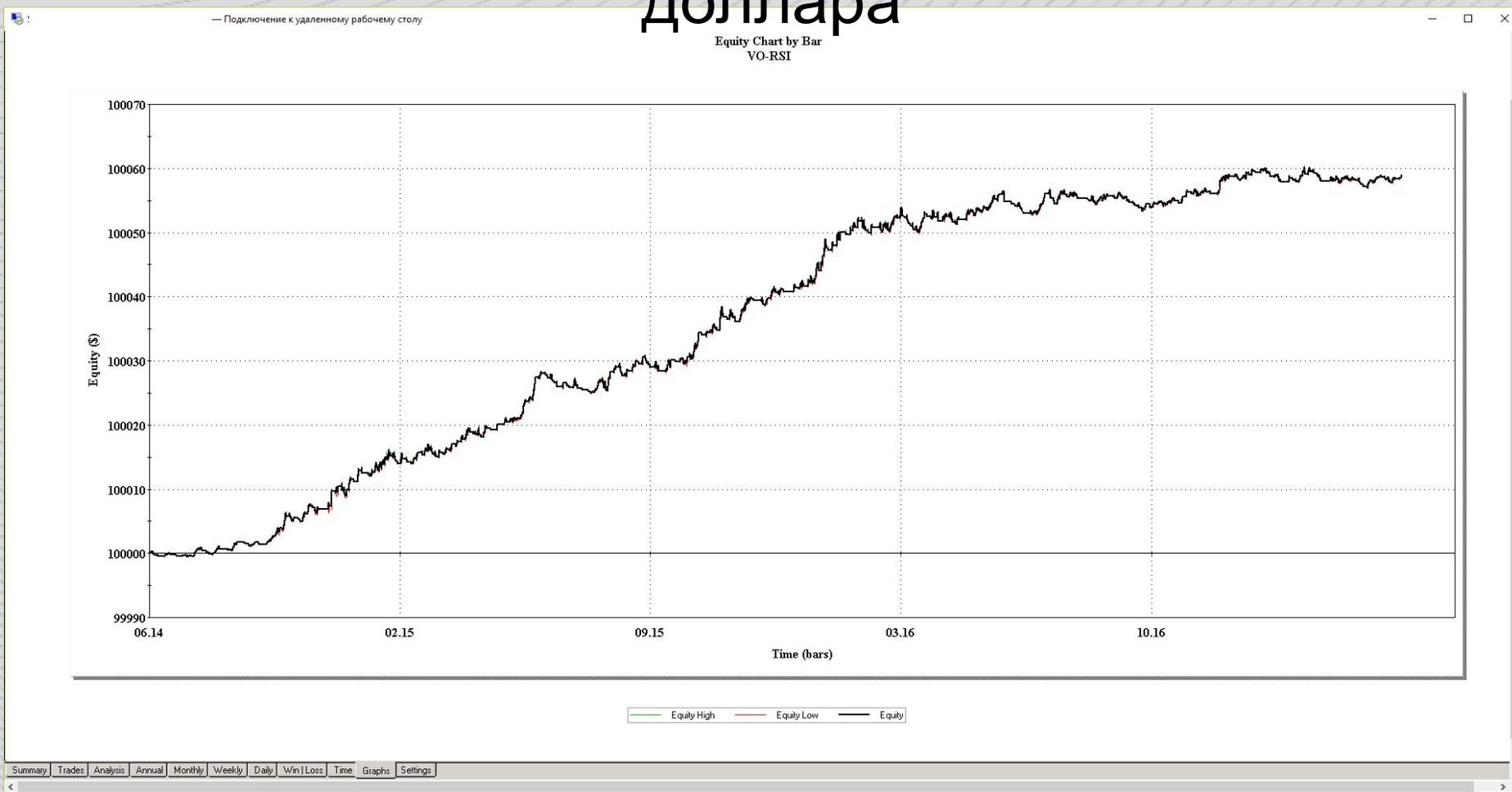


Схема №1: облигации + налоговый вычет = 23%

Облигации
= 10%

Возврат
налога 13%

ИТОГО: 23%
в первый
год

Схема №2: стратегии или недооцененные акции = полное освобождение от налогов через 3 года.

Покупка
недооцененных
акций > 100%

Или
подключение
агрессивных
стратегий > 50%

ИТОГО: не
платим налоги
через 3 года!

+7 (3952) 28-08-58
Г. Иркутск, ул. Ленина, д. 6, 1-й этаж

www.finam.ru
www.finambank.ru

Спасибо за внимание!