

FB Opportunity Fund

FB Opportunity Fund – это активно управляемый фонд с высоким уровнем риска, ориентирован на получение максимальной доходности и использует сложные торговые стратегии, которые часто включают использование плеча, короткие продажи и производные финансовые инструменты. Фонд инвестирует не менее 80% своих активов в деривативные инструменты на фондовом рынке США. Основными торговыми инструментами являются опционы на ведущие индексы фондового рынка США — S&P 500, Russell 2000. Цель фонда — долгосрочный рост стоимости активов при непрерывном управлении рисками.

Почему FB Opportunity Fund?

1. Фонд за счет применения особых инвестиционных стратегий способен получать прибыль как на растущем, так и на падающем рынке и в периоды рыночной стагнации.
2. Фонд является ликвидным инструментом, поскольку инвестор имеет возможность выйти из фонда раз в месяц.
3. Фонд относится к категории фондов с низким уровнем расходов (отсутствуют платы за вход, выход из фонда, плата за управление).
4. Фонд использует стратегии хедж-фонда. Стратегия, используемая с начала основания фонда (7.03.2016), показала общую доходность 61%.

Доходность фонда

С начала текущего года	12.841%
1 месяц	2.081%
1 год	18.150%
С момента основания фонда	60.785%
Средняя месячная доходность	1.510%

2018 ▲ 14.461%

2017 ▲ 16.141%

2016 ▲ 17.876%

Ключевая информация

Дата основания	5 ноября 2015
Дата начала работы	7 марта 2016
Страна регистрации	Эстония
ISIN	EE3500110236
Базовая валюта	EUR
AUM	EUR 4,235,010
Мин. сумма инвестиции	EUR 100,000
Стоимость пая	EUR 1,000
Отчётный период NAV ¹	Ежемесячно
Риск	Высокий

Стоимость пая

Дата	30.09.2019
NAV пая	EUR 1486.5480
Покупка пая	EUR 1486.5480
Продажа пая	EUR 1486.5480
Коэффициент Шарпа ²	4.23
Волатильность фонда ³	1.05

Платежи

Плата за управление	—
Плата за вход	—
Плата за выход	—
Плата за результативность: 30% от роста Чистой стоимости пая, превышающего ее максимальный исторический уровень на конец месяца	

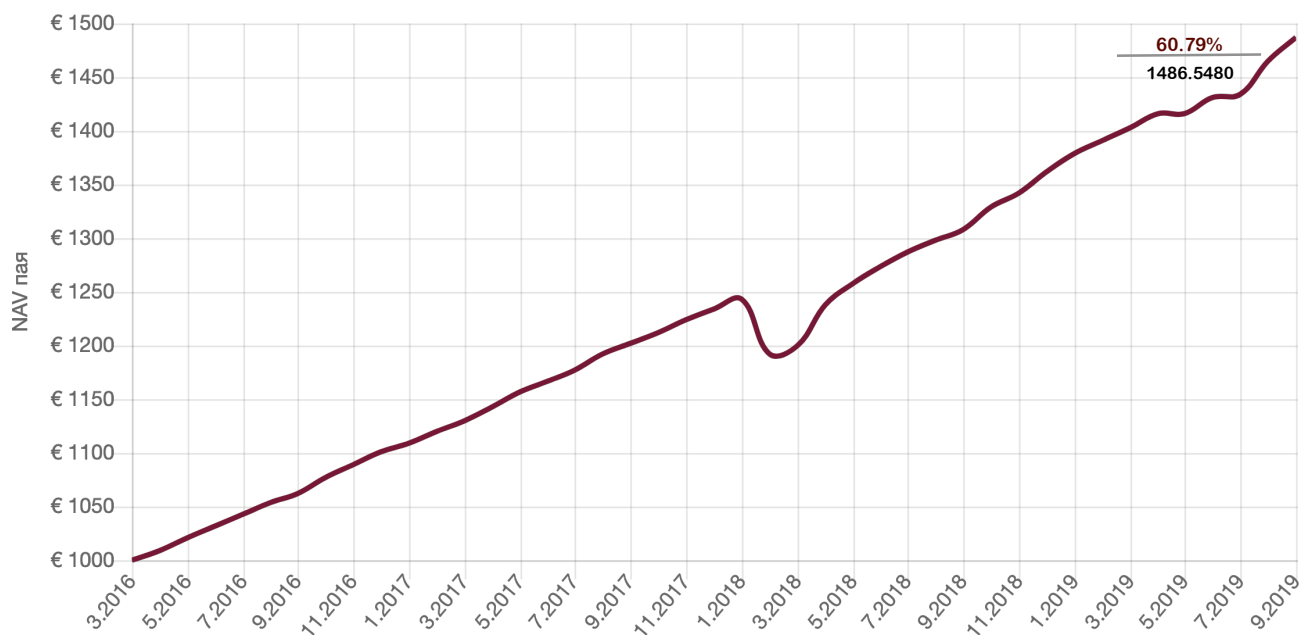
Ежемесячные показатели FB Opportunity Fund

Год	Янв	Фев	Мар	Апр	Май	Июн	Июл	Авг	Сен	Окт	Ноя	Дек	Годовая Дох-сть
2019	1.765%	1.255%	1.213%	1.264%	0.006%	1.533%	0.248%	3.031%	2.081%				12.841%
2018	1.120%	-4.280%	0.655%	3.054%	2.070%	1.698%	1.503%	1.274%	1.093%	2.215%	1.443%	2.088%	14.461%
2017	1.006%	1.451%	1.241%	1.624%	1.757%	1.207%	1.213%	1.748%	1.201%	1.228%	1.332%	1.146%	16.141%
2016			0.001%	1.270%	1.668%	1.596%	1.431%	1.474%	1.105%	1.966%	1.564%	1.613%	17.876%

Предупреждение

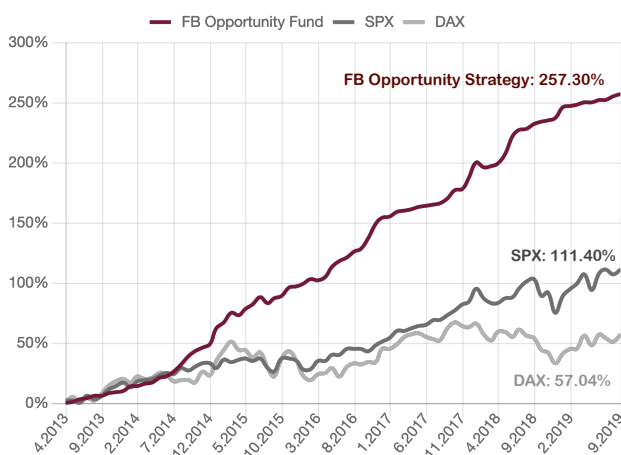
Ни доходность фонда за предыдущие периоды, ни история его деятельности до настоящего момента не означают обещания и не служат индикатором доходности фонда на следующие периоды или выполнения целей его деятельности. Вышеописанное достижение целей фонда не гарантируется.

Показатели деятельности FB Opportunity Fund



Стратегия FB Opportunity

Поскольку фонд зарегистрирован в ноябре 2015 года, а фактически начал свою работу только в марте 2016 года, то история фонда пока только создаётся. В основе работы фонда лежит стратегия, которая уже апробирована на реальном фондовом рынке начиная с 2013 г.



Анализ рисков

	DAX	SPX	FB Opportunity Strategy
Cumulative return:	57.04%	111.40%	257.30%
Max Drawdown:	20.19%	13.52%	5.62%
Peak-To-Valley:	Oct 17 — Dec 18	Sep 18 — Dec 18	Jul 15 — Aug 15
Recovery:	Ongoing	4 months	2 Months
Sharpe ³ Ratio:	0.41	0.91	2,09
Sortino ⁴ Ratio:	0.06	0.62	2.29
Standard Deviation:	4.37%	3.26%	2.68%
Downside Deviation:	3.03%	2.27%	1.76%
Mean Return:	0.68%	1,03%	1.92%
Positive Periods:	41 (53,25%)	56 (72,73%)	72 (93,51%)
Negative Periods:	36 (46,75%)	21 (27,27%)	5 (6,49%)

¹ NAV (Чистая стоимость активов) – цена инвестиционного фонда в расчете на пай. Стоимость пая рассчитывается путем деления общей стоимости всех ценных бумаг в портфеле фонда (за вычетом всех обязательств), на количество паёв фонда в обращении.

² Коэффициент Шарпа используется для определения того, насколько хорошо доходность актива компенсирует принимаемый инвестором риск. При сравнении двух активов с одинаковым ожидаемым доходом, вложение в актив с более высоким коэффициентом Шарпа будет менее рискованным.

³ Волатильность Фонда означает, на сколько далеко кривая доходности фонда отходит от средней доходности в течение определенного периода времени, включая движение только вниз. Фонд, чья кривая доходности более стабильна, является менее рискованным, а фонд чья кривая доходности более волатильна – более рискованным.

⁴ Коэффициент Сортино — показатель, позволяющий оценить доходность и риск инвестиционного инструмента, портфеля или стратегии; рассчитывается аналогично коэффициенту Шарпа, однако вместо волатильности портфеля используется так называемая «волатильность вниз».