

Результаты доверительного управления

Инвестиционная группа «Сократ» предлагает вам ознакомиться с результатами департамента доверительного управления за семь месяцев 2016 г.

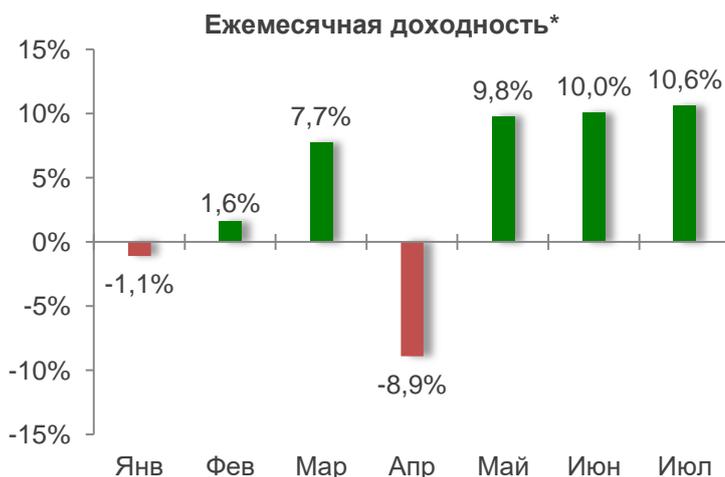
Опционная стратегия



* к активам на начало месяца, среднее по всем счетам

В июле 2016 г. по опционной стратегии была получена доходность на уровне 12,3% к активам на начало месяца (среднее по всем счетам). При этом за первые семь месяцев текущего года клиентские счета были увеличены на 55% (около **95% годовых**). Максимальный убыток составил чуть более 10% и был связан не с торговыми операциями, а с несвоевременным разъяснением биржи относительно экспирации фьючерсных контрактов по нефти на майские праздники.

Защита капитала от девальвации гривны



* к активам на начало месяца, среднее по всем счетам

Основным преимуществом данной стратегии является то, что финансовый результат считается в долларах США. Защита от девальвации гривны заключается в том, что часть активов направляется на хеджирование валютного риска, а часть на спекулятивные операции с деривативами. Учитывая текущую стабильность гривны, мы увеличили долю в спекулятивном портфеле, что позволило нам получить более высокую доходность в валюте. По итогам первых семи месяцев 2016 г. доходность по стратегии составила 31,7% к активам на начало года (**54% годовых в валюте**).

С детальным описанием всех продуктов доверительного управления можно ознакомиться по ссылке

[Продукты доверительного управления активами ИГ «Сократ»](#)

Инвестиционная группа «Сократ»

04070, г. Киев, ул. Почайнинская, 70, офис 5
Тел: +380 44 481-49-92, 481-49-91, 481-49-76

<http://www.sokrat.com.ua>

asset.management@sokrat.com.ua