



Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

Рыночно-нейтральные стратегии

При поддержке



Давид Серебренников



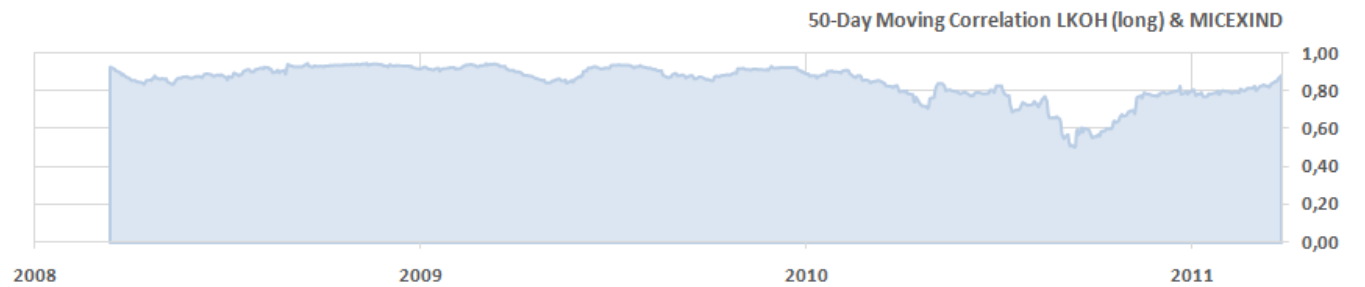
Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке





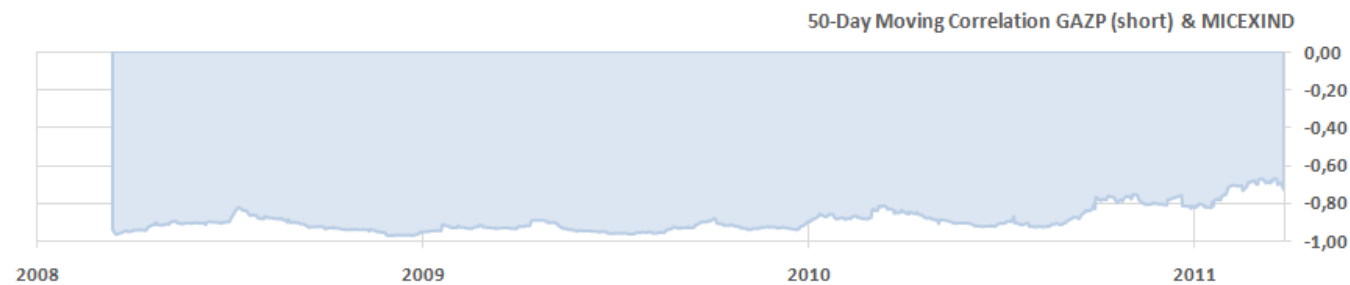
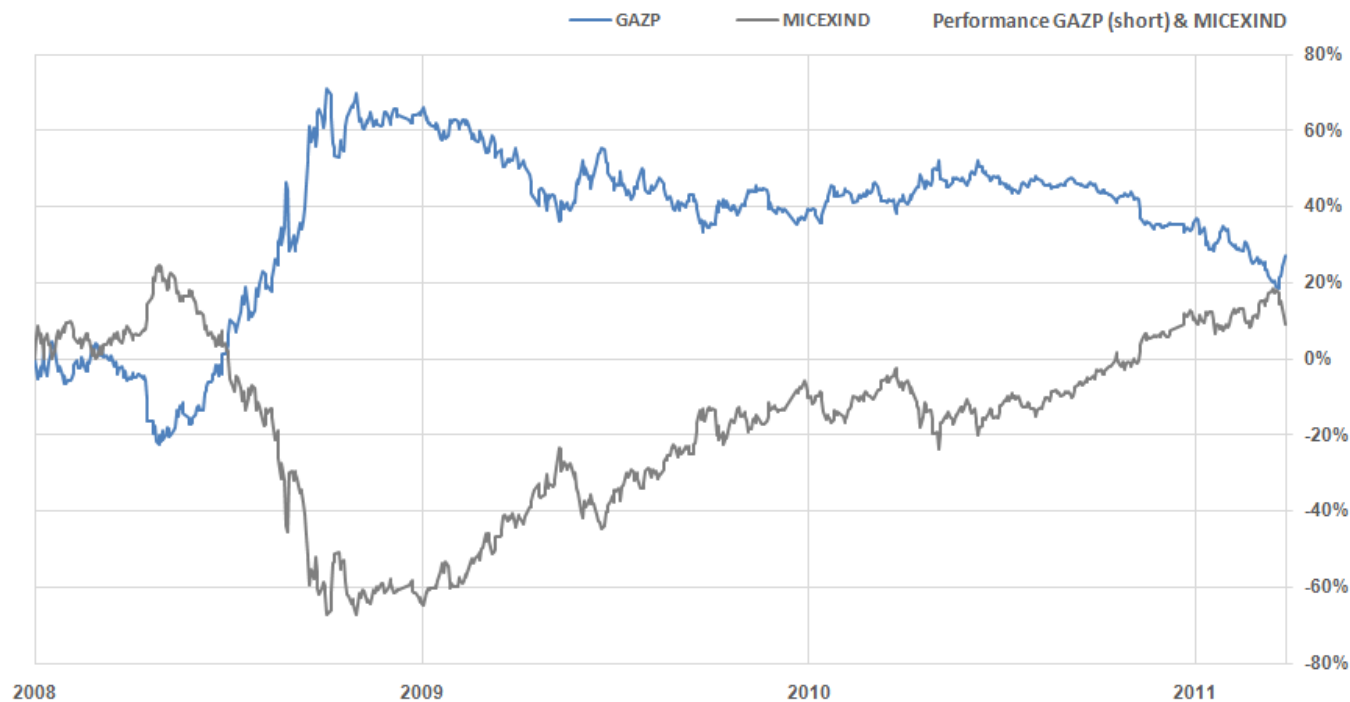
Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке





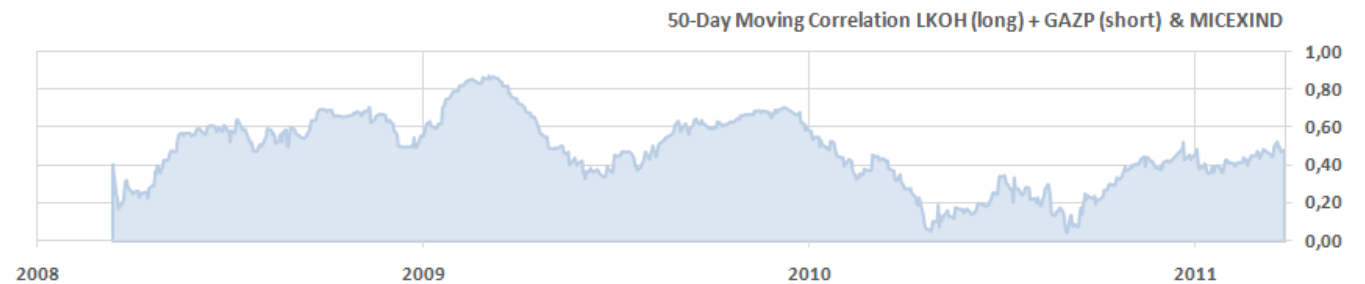
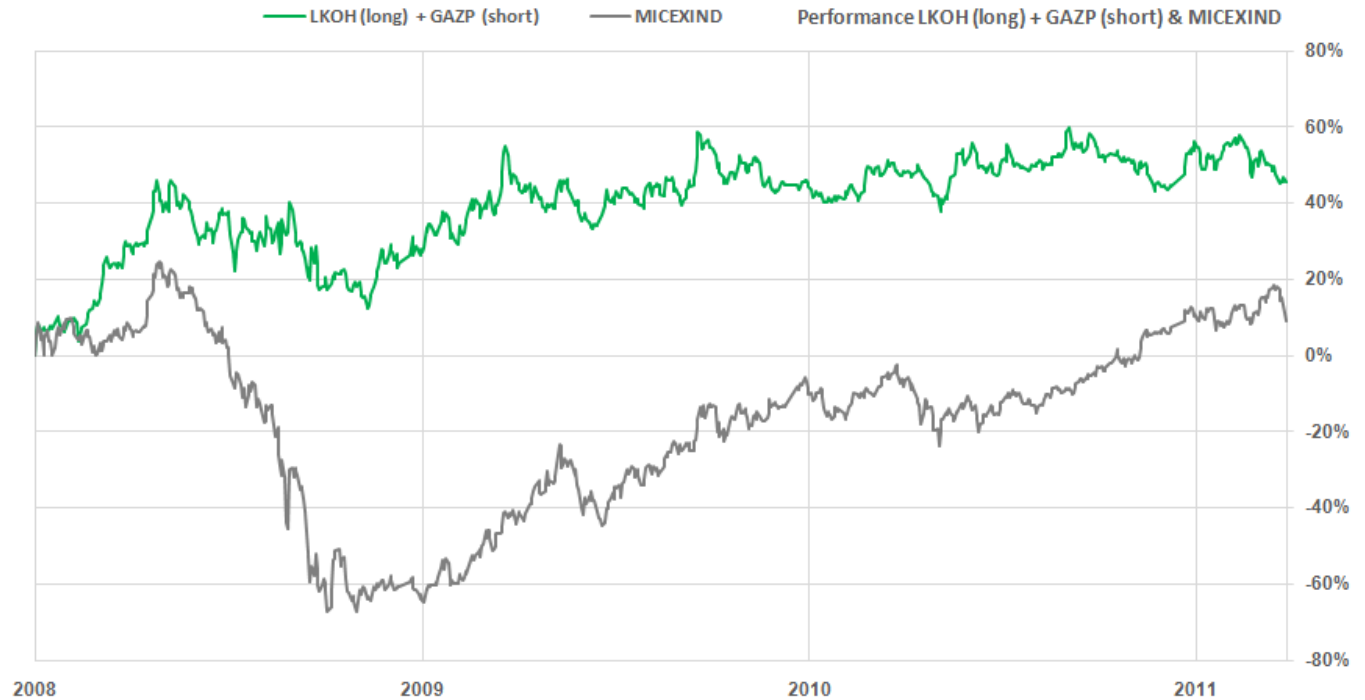
Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке





Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке





Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- **Фундаментальный подход**
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

$$EPS = \frac{\text{Income} - \text{Dividend}}{\text{Stocks}}$$

$$BV = \frac{\text{Equity}}{\text{Stocks}}$$

Рыночные мультипликаторы

$$P/E = \frac{\text{Price}}{\text{EPS}}$$

$$P/BV = \frac{\text{Price}}{\text{BV}}$$

$$P/S = \frac{\text{Mcap}}{\text{Sales}}$$

При поддержке



Коэффициенты рентабельности

$$ROS = \frac{\text{Income}}{\text{Sales}}$$

$$ROA = \frac{\text{Income}}{\text{Assets}}$$

$$ROE = \frac{\text{Income}}{\text{Equity}}$$



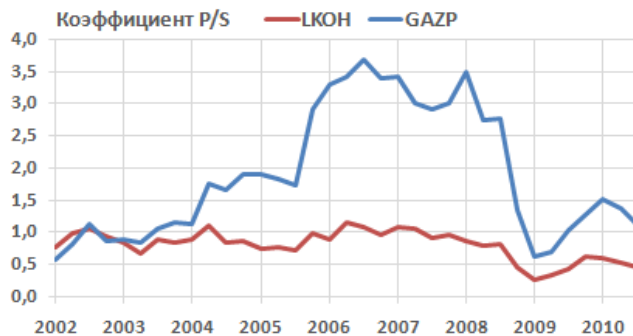
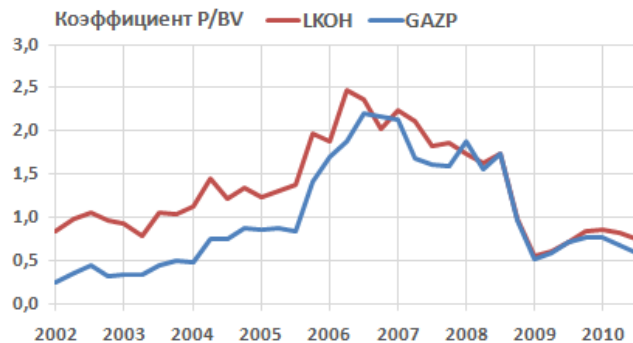
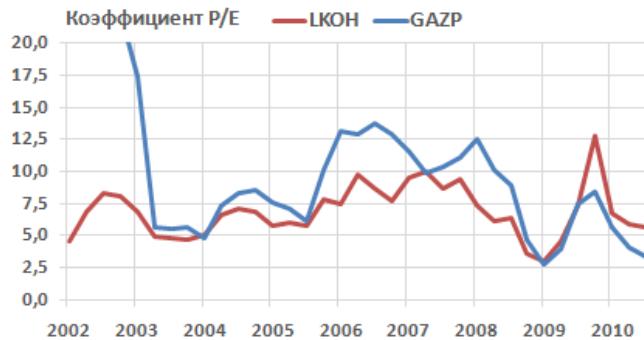
Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- **Фундаментальный подход**
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке





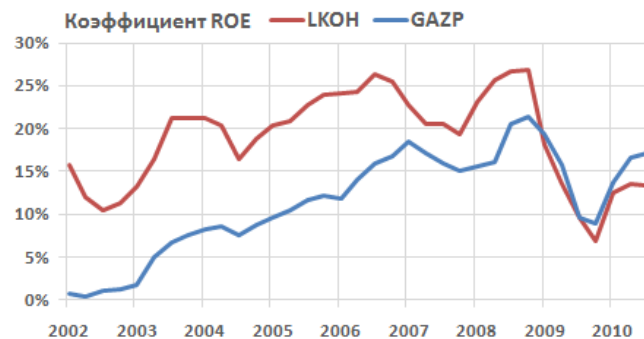
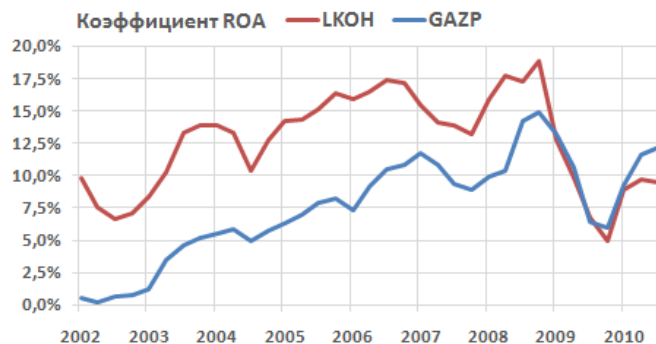
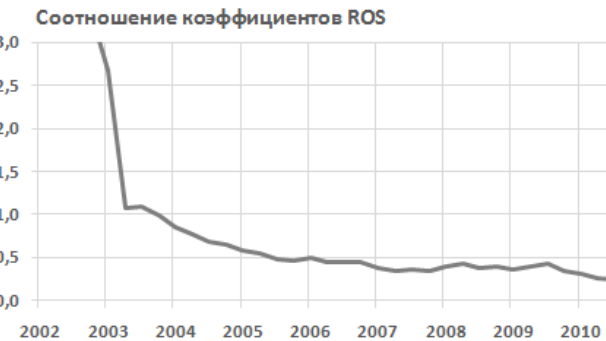
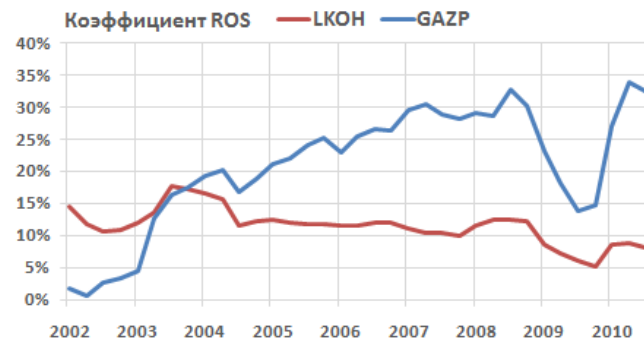
Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- **Фундаментальный подход**
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке





Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- **Статистический подход**
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

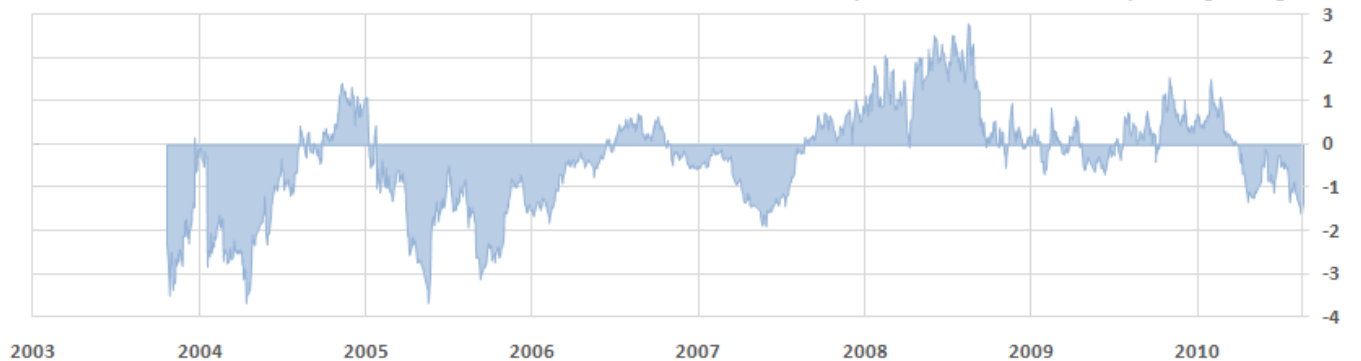
При поддержке



Spread LKOH/GAZP & 200-Day Moving Average



Absolute Spread Deviation from 200-Day Moving Average





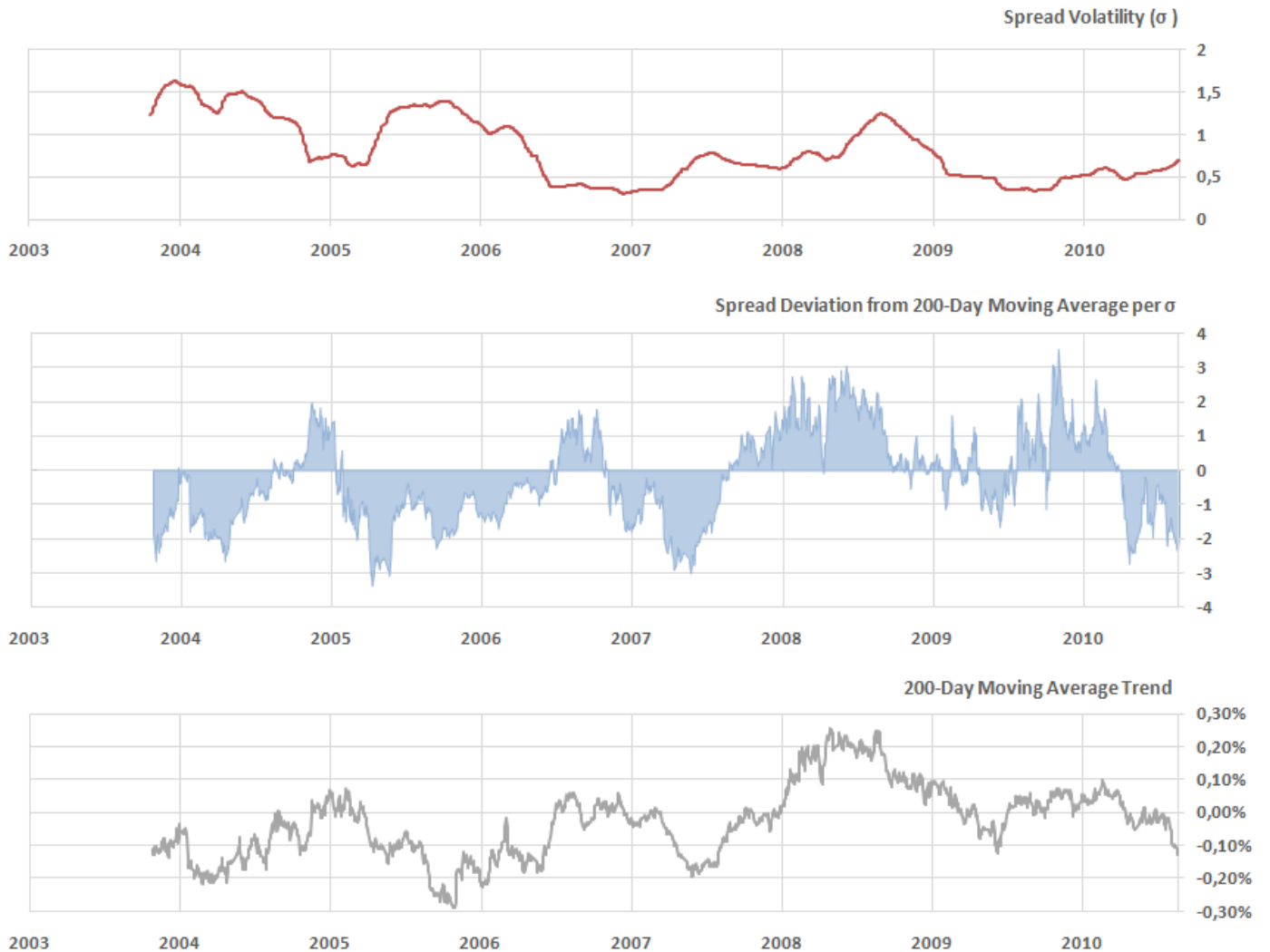
Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- **Статистический подход**
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке





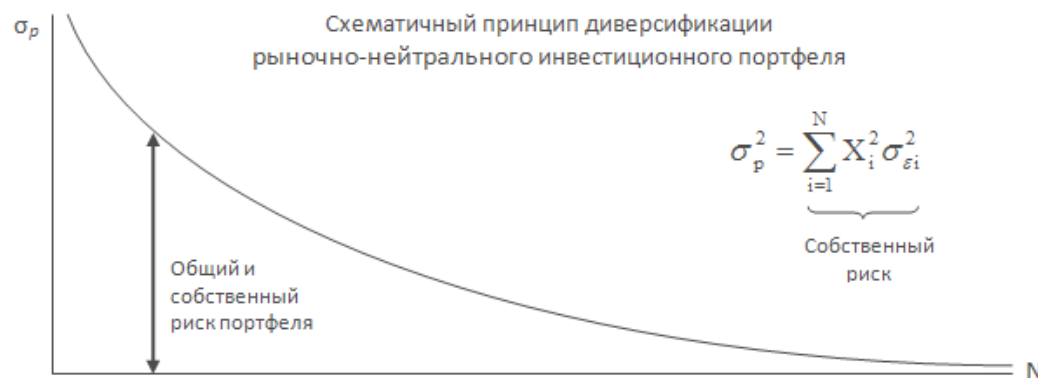
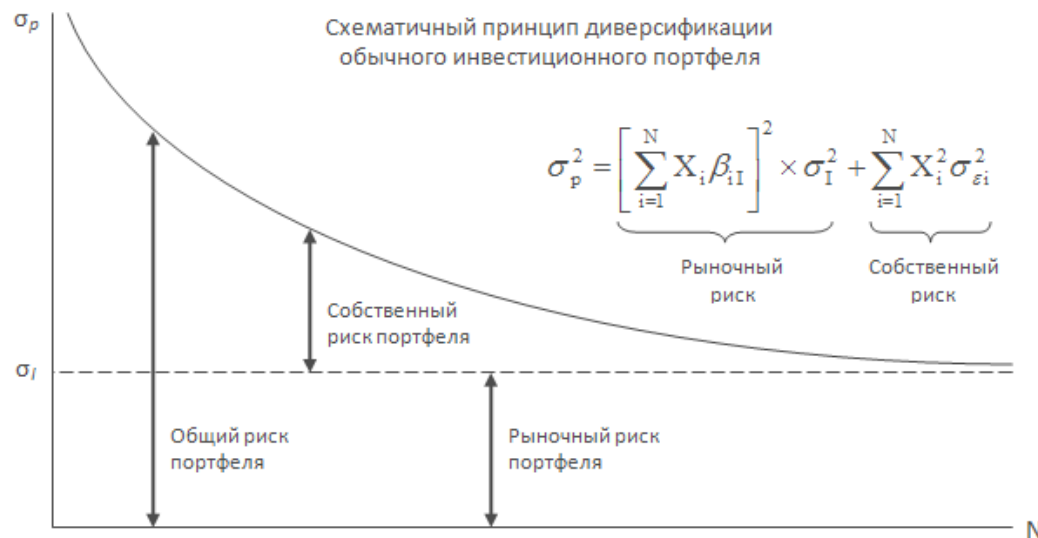
Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- Статистический подход
- Диверсификация

Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке





Рыночно-нейтральные стратегии

- Введение
- Фундаментальный подход
- Статистический подход
- Диверсификация

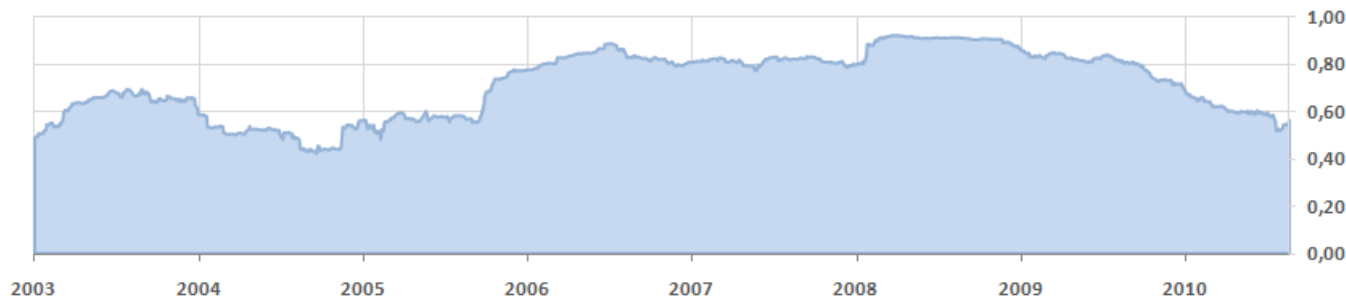
Арбитраж

Торговля волатильностью

При поддержке



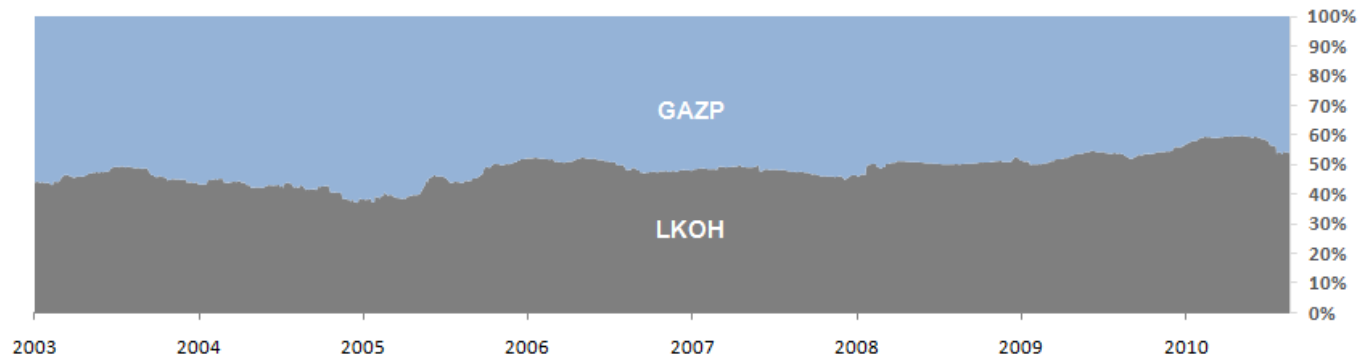
Correlation LKOH & GAZP



Beta LKOH Beta GAZP



Portfolio structure





О компании

Стратегии

Результаты

Сервисы

Аналитика

Общая информация

Команда

Документы

Новости

Контакты

Благодарю за внимание!

Давид Серебренников
Управляющий партнер
Rossmix Fund Management

Skype: david.serebrennikov
E-mail: ds@rossmix.ru

www.rossmix.ru
y-dav.livejournal.com

При поддержке

