

Представяне на примерен портфейл "PORTFOLIO Obj-5"

За пасивни инвеститори с умерена търпимост към риска, структурираме опростен защитен портфейл (Obj-5) оптимизиран с професионален алгоритъм. Той е базиран на пазарно-неутрални long/short стратегии, допълнени с инструменти за борсово търгуване, следващи спот цената на златото. Целта му е да се избегнат внезапни загуби при силна волатилност, висок пазарен риск, слухове и стадни пазарни реакции. Представеният примерен портфейл „Obj-5“ съдържа: 42% инструменти, обвързани с цената на златото в EUR + 58% пазарно-неутрални инструменти, базирани на европейски акции. Валута: EUR.

For passive investors with moderate level of risk tolerance we have structured a simple protective portfolio (Obj-5) using an optimization algorithm. The portfolio is based on market-neutral long/short strategies, complemented by gold-backed exchange traded instruments, with the aim to avoid sudden losses, caused by volatility, market risk, rumors and herd behavior. The allocation of the presented portfolio "Obj-5" is: 42% instruments designed to track the spot gold price in EUR + 58% market neutral instruments, based on European securities. Currency: EUR.

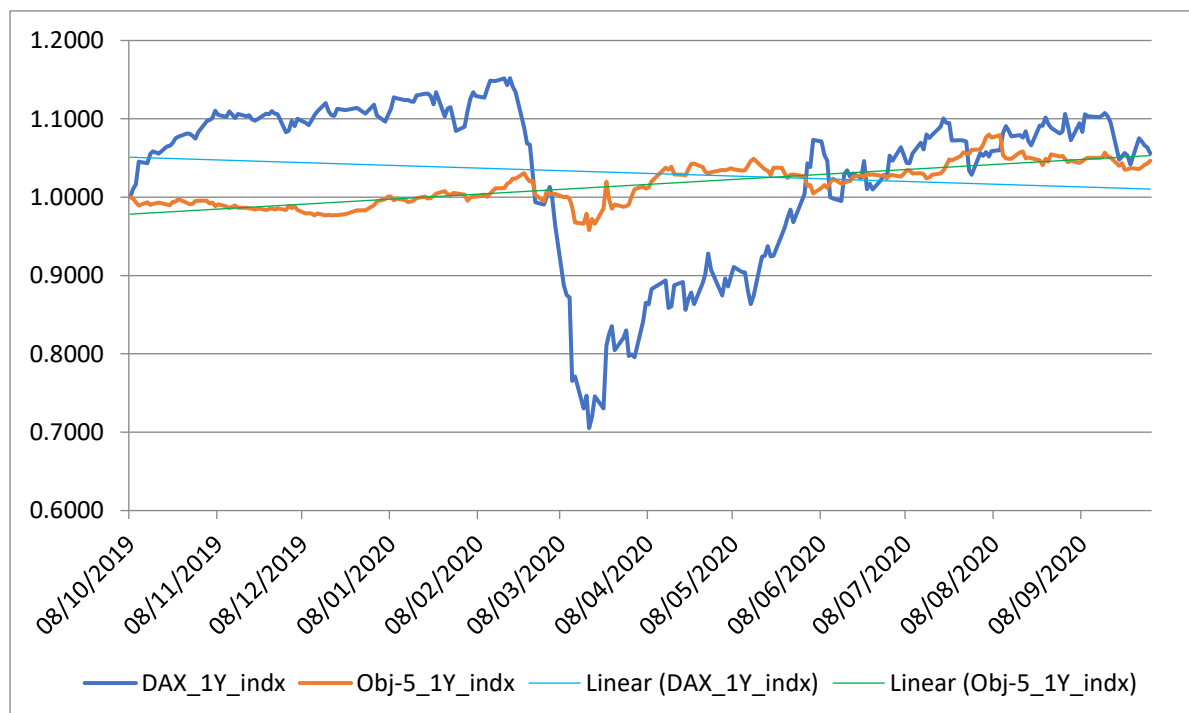
Данни / Data:

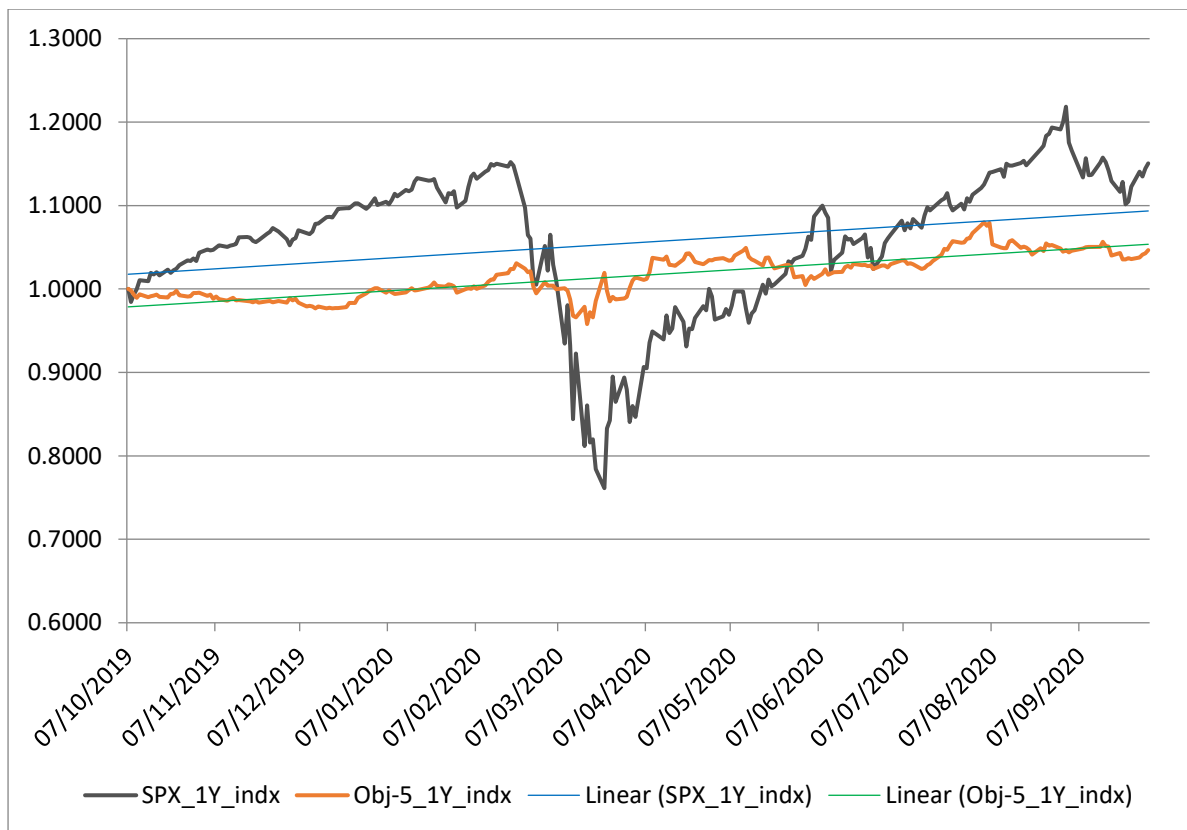
02.10.2020 13:00 EEST	PORTFOLIO Obj-5	SPX (S&P500)	DAX
RET 21 trading days:	+ 0.03%	- 5.59%	- 1.56%
RET 1Y:	+ 4.68%	+ 15.04%	+ 6.60%
STD (D) / 250 trading days:	0.5861%	2.1337%	2.0067%
STD (Y):	9.267%	33.736%	31.728%
A worst case daily loss with probability 0.4%:	≥ - 2.36%	≥ - 11.98%	≥ - 12.24%

Correlation (ret.): PORTFOLIO "Obj-5" vs DAX = 0.13474

Минимална възможна покупка / Min. piece: ≈ x EUR 1 000

Препоръчителен обем / Recommended volume: ≥ EUR 10 000





Такси и комисионни: според актуалната тарифа
<https://www.fibank.bg/web/files/documents/141/files/Tariff.pdf>

Commissions and fees: according to the currently effective tariff
https://www.fibank.bg/web/files/documents/203/files/Tariff_EN.pdf

♦ N.B.: Европейските регулации ни задължават да подчертаем, че предходните резултати не са гаранция за бъдещи резултати. Това представяне е предназначено само за информация. Данните и оценките в този доклад са ПРЕДНАЗНАЧЕНИ ЗА ИЗПОЛЗВАНЕ ОТ ПРОФЕСИОНАЛНИ ИНВЕСТИТОРИ и МОГАТ ДА БЪДАТ НЕРАЗБИРАЕМИ И НЕПОДХОДЯЩИ ЗА ИНВЕСТИТОРИТЕ НА ДРЕБНО, АКО ПОЛЗВАТ ТАЗИ ПУБЛИКАЦИЯ, ЗА ВЗЕМАНЕ НА ИНВЕСТИЦИОННИ РЕШЕНИЯ. ПРИ КАКВОТО И ДА Е СЪМНЕНИЕ, ТРЯБВА ДА СЕ КОНСУЛТИРАТЕ С ВАШИЯ ПРОФЕСИОНАЛЕН КОНСУЛТАНТ.

♦ N.B.: The EU-regulation requires us to point out that past results are no guarantee of future results. This report is for information purposes only. The data and estimations in this Report are INTENDED FOR USE BY PROFESSIONAL INVESTORS and WOULD BE RECKLESS AND INAPPROPRIATE FOR RETAIL INVESTORS TO USE THIS PUBLICATION WHEN MAKING AN INVESTMENT DECISION. IF IN DOUBT ALL OF YOU MUST CONTACT YOUR PROFESSIONAL ADVISER.

This paper should not be construed as providing investment advice. ((14) и (15) – CDR (EU) 2017/565)

Документът не може да бъде тълкуван като предоставяне на инвестиционен съвет. ((14) и (15) – ДР (ЕС) 2017/565)

КОНТАКТИ / CONTACTS:

- ✓ www.fibank.bg
- ✓ CLIENT SERVICES: (+ 359 2) 817 11 00; e-mail: invest@fibank.bg
- ✓ G. Hristov – Investment Adviser & Portfolio Manager: (+ 359 2) 800 2956; e-mail: georgi.hristov@fibank.bg