www.ProValue.club

Сообщество PROVALUE.CLUB

АЛЬМАНАХ

По Вэлью Инвестированию
И Умной Спекуляции

№ 23

Январь 2016г.

Раскрытые сделки

Сделок: 6
Риск/прибыль: 1 к 10 и выше
Максимальный риск в сделке: 0.3% - 0.6%
Доходность консервативная: +52% годовых
Доходность спекулятивная: +78% годовых

- **ТОП10 инвестиционных Идей на 2016**
- **Пут Стратегии на SPY**
- **Использование балансовой стоимости**

Содержание

ДОСТУПНЫЕ МАТЕРИАЛЫ PROVALUE _____ 4

ПРИГЛАШАЕМ ИНВЕСТОРОВ, ТРЕЙДЕРОВ, АВТОРОВ СТАТЕЙ И АНАЛИТИКОВ В СООБЩЕСТВО PROVALUE! _____ 5

ЗАКРЫТЫЕ И ОТКРЫТЫЕ НАМИ СДЕЛКИ _____ 7

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ ФОНДА PROVALUE _____ 9

ИНСТРУМЕНТЫ PROVALUE ANALYTICS _____ 10

ОБУЧЕНИЕ В АКАДЕМИИ PROVALUE _____ 11

Изучаем Вэлью Инвестирование и продвинутые Опционные Стратегии.

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Различие Вэлью Инвестирования и Умной Спекуляции

Сегодня огромное количество людей пытаются предсказать поведение рынка. Строят графики, проводят технический анализ, изучают новости. Они играют на бирже. При этом, не имея ни явного преимущества перед другими игроками, ни даже положительного математического ожидания успеха.

Особенно это относится к игрокам на рынке Форекс. Мы, в Академии ProValue, не занимаемся игрой на рынке. Мы занимаемся и обучаем подходам «Вэлью Инвестирования» и «Умной Спекуляции».

Вэлью инвестирование (Value Investing) предполагает два подхода:

1) покупку акций компаний ниже номинальной или даже ликвидационной стоимости, когда рынок закладывает в цену самый худший сценарий, который редко реализуется на практике. Покупка на таких уровнях цен настолько безопасна, что даже в случае банкротства компании, остается достаточно средств, чтобы вернуть первоначальные инвестиции.
2) Покупка по приемлемой цене самых лучших с финансовой точки зрения компаний с устойчивым конкурентным преимуществом, имеющих стабильные показатели роста прибылей в течение последних 10 лет. Такие компании любит Уоррен Баффет.

По сути, инвестор покупает бизнес, а точнее долю в прибылях компании и спит спокойно.

При этом консервативный доход составляет около 20% годовых. Однако, покупая во время кризисов, на плохих новостях, при использовании Анти-Вэлью стратегий, доходность увеличивается до 50% годовых и более.

С другой стороны, на рынке часто появляются сделки с соотношение риск/прибыль 1 к 20 и более. При этом даже не важно, в какую сторону пойдет рынок. При любом его движении мы зарабатываем.

Такие сделки не являются Инвестиционными, но в эти моменты у нас есть преимущество перед рынком, в виде математического ожидания, превышающего два, три и более раз. Подобные сделки мы называем **Умной Спекуляцией**. Они позволяют зарабатывать в 85%-95% случаев. А в кризисы, могут удвоить весь портфель, рискуя в одной сделке 0.1%.

К таким сделкам относится продажа переоцененных опционов на фьючерсы и покупка недооцененных долгосрочных опционов на качественные акции, товарные фьючерсы, металлы, валюты и ETF.

Для понятности, в описании сделок мы будем использовать портфель в 10 000$. Прибыль или убыток так же будет указываться исходя из данной величины портфеля.

Для более крупного портфеля процент прибыли будет таким же, каким мы его указываем.

Данный Альманах раскрывает Вам примеры наших сделок!

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Доступные материалы ProValue

В этом разделе мы собираем некоторые публикации, рекомендации и обучающие материалы, публикуемые в Сообществе ProValue, которые помогут вам более глубоко разобраться в фундаментальном анализе компаний, функционировании рынков, формировании долгосрочных прибыльных стратегий по управлению капиталом.

- Новые правила учета лизинга могут увеличить обязательства компаний на $2 трлн.
- Топ-10 инвестиционных идей на 2016 год
- Лучшие акции с дивидендами в энергетическом секторе на 2016 год
- Проблемы использования инвесторами бухгалтерской балансовой стоимости
- Арбитражная Стратегия на ETF (UNG) Природный Газ
- Price/Economic book value. Расчет экономической балансовой стоимости
- Исследуем вероятность черного лебедя на SPY
- Как "на коленке" посчитать Эффективность Работы Менеджмента Компании?
- Отличная Компания в Нефтеперерабатывающем Секторе в Которую Вложился Баффет
- Почему Надо Ставить на Лидера в Отрасли? Phillips 66 и Конкуренты
- Консервативная Опционная Стратегия на Phillips 66 (PSX)
- #Conference: Пут Стратегии на SPY

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Приглашаем Инвесторов, Трейдеров, Авторов статей и Аналитиков в Сообщество ProValue!

Сообщество ProValue объединяет Вэлью Инвесторов и практиков опционных стратегий в единое целое, позволяя сообща исследовать торговые и инвестиционные стратегии.

Сегодня мы приглашаем практиков инвестирования к обсуждению исследования по трофейным компаниям, стратегиям Черных Лебедей, индексным и VIX стратегиям работы с волатильностью. Для наших участников доступны не только обширная wiki и видеотека, но и продвинутые инструменты анализа акций.

Value означает ценность, значение, смысл! ProValue — это методы, исследующие фундаментальные ценности, преимущества и смысл в инвестировании.

Мы не используем технический анализ, предсказания поведения рынка, прогнозы «экспертов». Мы выявляем неэффективности рынка, исследуем истинную стоимость активов, находим сделки, дающие **преимущество перед другими участниками рынка**.

Присоединяйтесь к обсуждениям и вступайте в Сообщество!

Становитесь участником нашего сообщества. Выкладывайте свои полезные материалы по инвестированию, мысли по торговым стратегиям, *best practice* которые у вас выработались. Участвуйте в наших исследованиях и применяйте полученные знания на практике. Вступайте в закрытые разделы и получайте торговые рекомендации наши и наших участников.

Для участников Сообщества ProValue

Всем участникам в открытом доступе предоставляются обширные материалы по нашим стратегиям работы на различных рынках (газа, кофе, металлов, акций, индексов и т.п.), наши сделки, которые мы открываем на своих счетах и счетах клиентов, а так же много информации, позволяющей понять логику поиска сделок с соотношением риск-прибыль 1 к 10 и выше.

Данные материалы доступны всем желающим, кто готов постигать Вэлью подход не только в анализе акций, но и опционов, фьючерсов на различных рынках.

Ниже перечислены некоторые из доступных материалов:

- ЭкспрессКурс «Инвестирование в Акции»
- Более 18 видеоуроков по Вэлью Инвестированию и Умной Спекуляции
- Инвестиционный Альманах

Обучение в Академии ProValue — это обширная практика Вэлью Инвестирования и продвинутых Опционных Стратегий. Объединение подходов фундаментального вэлью анализа акций и рынков с преимуществами опционных стратегий, позволяют уверенно инвестировать на любом типе рынков.

Кроме учебных и практических материалов, мы предоставляем рабочие инструменты.

ProValue Analytics — это не имеющие аналогов в мире Инструменты, для Экспресс Анализа Акций, Компаний и Опционов.

Поскольку рынки постоянно меняются, появляются новые возможности, вырисовываются новые торговые стратегии, то нам нужны аналитики, трейдеры, инвесторы, которые готовы участвовать в наших исследованиях, делиться наработками, использовать результаты в своей торговле. Нам нужны авторы статей, которые не просто желают рассказать свои мысли, идеи другим участникам нашего Сообщества, но и получать обратную связь, критику, пояснения относительно слабых сторон ваших стратегий.

Приветствуем всех, кто разделяет наши ценности Вэлью подхода в Сообществе ProValue! Участвуйте в наших внутренних мероприятиях, делитесь своим опытом, используйте наши наработки в свой практике.

Желающие участвовать, могут регистрироваться тут в сообществе, или писать нам на ask@provalue.ru для индивидуального общения. Так же не забывайте про Skype-консультации, которые доступны всем.

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Закрытые и открытые нами сделки

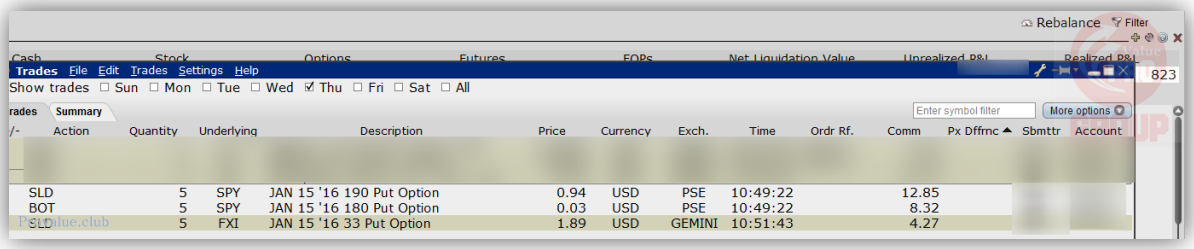
1. Медвежьи Стратегии на Американский SPY и Китайский FXI

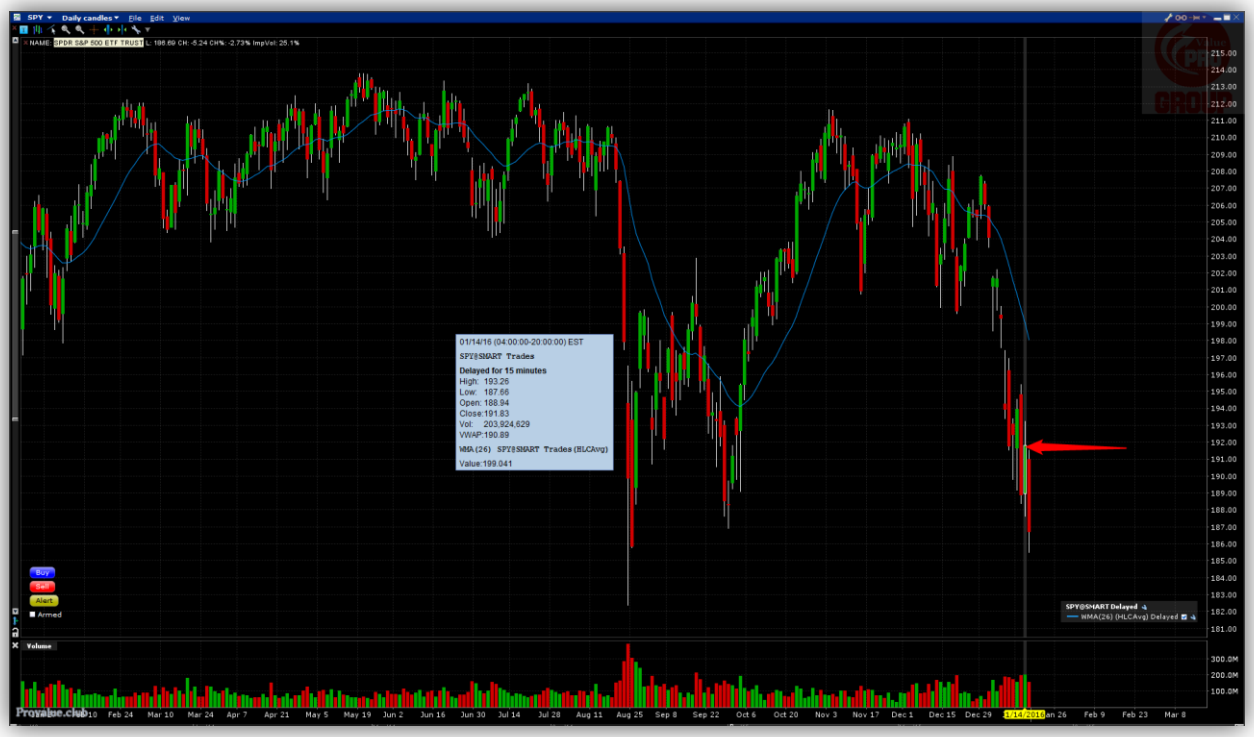
14 января закрыты две стратегии на оба ETF поскольку рынок наметил резкий разворот вверх за 2 дня до экспирации. Мы решили не рисковать, поскольку вероятность падения резко уменьшилась и прибыль стала быстро испаряться.

Бывший 33/30 January FXI Put spread, преобразованный в голый 33 пут.
И 190/180 SPY January Put spread.

Конечно, рынок на следующий день развернулся вниз, но мы ведь не предсказываем, а используем математику, теорию вероятности и здравый смысл. Часть позиции была оставлена и модернизирована на извлечение максимальной прибыли при значительном падении на следующий день в пятницу.

Доходность +8% к портфелю



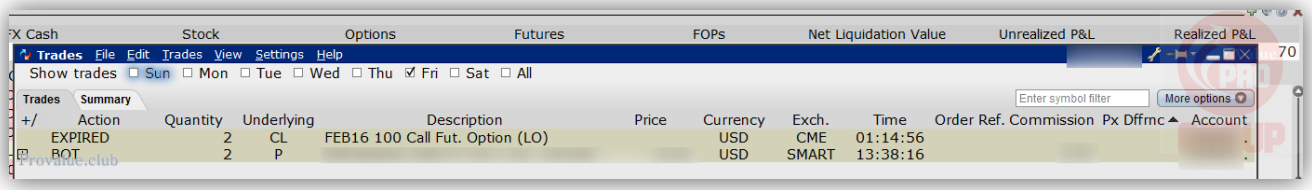


Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

2. Pandora Media Inc (P)

15 января удачно закрыта сделка по медийной анти-вэлью компании Pandora (P). Как показал ProValue Analytics, эта компания оказалась с плохим фундаменталом и это же показал наш опционный сканер: повышенную волатильность и открытый интерес по путям. Мы рекомендовали эту сделку в закрытом сообществе ProValue.club и сегодня закрыли.

Доходность +0.7% к портфелю



Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Результаты работы Фонда ProValue

Не понимаете язык Альманаха, вы можете пройти обучение в Академии ProValue онлайн.

Имея $5000-10000 счет, новички, не прошедшие обучение, умудряются потерять более $3000, в первые месяцы! Пройдя обучение в академии, вы больше не будете совершать глупых ошибок и научитесь на ошибках других и, наконец, начнете зарабатывать на бирже.

Убыточные и нейтральные сделки

Потери по убыточным сделкам составили -2,3%, включая стратегии черного лебедя по газу, хлопку, сахару и соевому маслу.

Итоги Январь 2016г.

Итого Потерь: -2.3%*
Итого Прибыль: +8.7%*
Итого Чистая Прибыль: +6.5%*

Консервативный: Для консервативного портфеля в *$15 000* доходность **+52%**
Спекулятивный: Для агрессивного портфеля в *$10 000* доходность составит **+78%**

* сумма указана исходя из портфеля в $10 000. Сделки открывались на большем портфеле, что дает пропорциональный результат.

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Инструменты ProValue Analytics

ProValue Analytics — Не имеющие аналогов в мире Инструменты для Экспресс Анализа Акций, Компаний и Опционных комбинаций.

- Инструмент по быстрому и максимально эффективному анализу **количественных показателей компании** за последние 20 лет.
- 50+ сравнительных графиков, которые позволяют быстро и наглядно выявлять преимущества и недостатки компаний.
- #1 Инструмент «Сравнение компании с конкурентами»;
- Готовые сеты для выявления **красных/зеленых флагов** компании.
- Отработанные на многолетней практике методы Вэлью анализа.
- **Опционные сканеры**, а так же сканеры Уоррена Баффета, Джоуэла Гринблатта, Питера Линча, Грэхема и Анти-Вэлью.

http://Analytics.ProValue.Club

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Обучение в Академии ProValue

Вэлью Инвестирование

Вы научитесь:

- Правильно выбирать акции с точки зрения бизнеса;
- Покупать надежные компании с конкурентным преимуществом по приемлемой цене, и потенциалом для многолетнего роста;
- Находить компании с потенциалом 10-ти кратного роста;
- Находить компании, торгующиеся ниже ликвидационной стоимости на плохих новостях;
- Мыслить так же как Уоррен Баффет и Питер Линч.

http://Value.ProValue.club

Продвинутые Опционные Стратегии

Вы научитесь:

- Открывать сделки с соотношением риск/прибыль 1 к 10 и выше;
- Находить и использовать конкурентное преимущество перед рынком;
- Зарабатывать при любом движении рынка;
- Не использовать стоп-лоссы, и никогда не жалеть, что рынок пошел туда, куда вы думали, но уже без Вас.

http://Options.ProValue.club

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Премиум Подписка ProValue

- Еженедельные **«Клубные Занятия»**;
- Регулярные инвестиционные и торговые рекомендации;
- Инструменты Инвестора **ProValue Analytics**;
- **Список акций**, отобранных по принципу инвестирования Уоррена Баффета и Чарли Мангера. Джоуэла Гринблатта и Питера Линча;
- **Опционные стратегии** на акции, на товарные рынки, фьючерсы и индексы;
- Участие в конференциях и мозговом штурме инвест идей;
- Обучение, ответы на вопросы, **решение инвестиционных задач**;

http://provalue.club/index/premium

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.

Хотите еще?

Мы надеемся, что Вам понравилась представленная информация!

Если вы хотите получать полезные материалы регулярно БЕСПЛАТНО, и всегда быть в курсе актуальных инвестиционных возможностей, то подписывайтесь на АЛЬМАНАХ:

www.Almanac.ProValue.ru

Инвестиционное Сообщество PROVALUE.CLUB

Ведущий аналитик
Андрей Макарский

Организаторы
Василий Дейнега
Андрей Макарский
Команда ProValue Group
ProValue Team

Контакты
email: ask@provalue.ru
site: www.ProValue.ru

Прошлые достижения не гарантия будущих прибылей. Все торговые операции имеют Риск потери средств.
Стоит использовать в сделках только свободный капитал.