



Экономические циклы S&P 500

Стратегия «Экономические циклы S&P 500». Индекс SPECFR6P

ИНВЕСТИЦИОННОЕ СТРАХОВАНИЕ ЖИЗНИ



Инвестиционная идея:

Стратегия-хамелеон: состав акций автоматически ротируется в зависимости от текущих экономических условий. Индикатор экономической ситуации – показания индекса Chicago Fed National Activity Index (CFNAI). В зависимости от того, в какой фазе находится экономика США — рост, снижение, спад, восстановление — выбирается оптимальная тактика инвестирования, которая обеспечивает инвестиционный доход. Фиксация и выплата дохода происходит в конце действия программы. Защищенная сумма инвестиций составляет 100% от суммы взноса. Срок программы 4 года

Ротация акций происходит по следующему принципу:



Рост экономики

Стратегия Momentum – на этом этапе экономического цикла, портфель стратегии состоит из 100 компаний, которые за последние 12 месяцев опережают рынок (например Mastercard Inc A, NIKE Inc B, Pfizer Inc, Starbucks Corp, Under Armour Inc A и т.д.)



Переход к постепенному снижению экономики

Стратегия Vuuback – на данном этапе Ваш доход обеспечивают 30 компаний, которые в период роста смогли накопить существенные денежные ресурсы обеспечивают своим акциям положительные значения (например, Apple Inc., Booking Holdings Inc, Estee Lauder Cos. A)



Экономический спад

Стратегия Low Volatility High Dividend – на период экономического спада, в портфель входят акции 50 наиболее стабильных компаний, не подверженных колебаниям рынка (например, Ford Motor Co, Kellogg Co, Philip Morris International, Western Union Co и т.д.)



Переход от спада к восстановлению

Стратегия Value – в период восстановления экономики, портфель составляют 114 компаний с наилучшими показателями балансовой стоимости, доходов и отношения продаж к цене акции (например, Coty Inc., Whirlpool Corp, Xerox Corp, Phillips 66, General Motors Company и т.д.)



Формула расчета доходности:

