

Консервативний інвестиційний портфель «Перші кроки»

Звіт про дохідність
(листопад 2022)

Мета та переваги портфеля «Перші кроки»

Мета:

Отримання орієнтовної річної прибутковості на рівні 40,5 % за максимально низькою волатильністю портфеля та максимальним просіданням 38 %.

Переваги:

- невелика сума вкладення;
- висока ліквідність активів, що входять у портфель;
- низький кредитний ризик активів, що входять у портфель;
- використання інструментів хеджування;
- професійне управління портфелем;
- просте слідування за портфелем.

Опис та стратегія портфеля «Перші кроки»

Опис:

Портфель «Перші кроки» є консервативним інвестиційним інструментом у лінійці портфелів компанії. Для оцінювання ефективності портфеля пропонується порівнювати його з індексом S&P 500. Розподіл коштів у різні акції дає змогу мінімізувати ризики портфеля і здобути прийнятний рівень доходу.

Стратегія:

Для досягнення поставленої мети в портфель включено два різновиди акцій. Акції великих стабільних компаній, які сплачують дивіденди, однак не мають значного зростання курсу акцій. А також акції компаній зростання, які мають значний потенціал для зростання. Саме акції зростання мають стати головним драйвером зростання портфеля.

Залежно від ринкової кон'юнктури частки активів у портфелі можуть змінюватися.

Основні параметри портфеля «Перші кроки»

- Валюта: долар США
- Оптимальна сума вкладення: \$10 000
- Очікувана дохідність: 40,5 %
- Ризик: утримання на рівні 38 %
- Мінімальний термін: 1 рік
- Ребалансування та заміщення активів за підсумками календарного місяця

Звіт та ребалансування портфеля

Основні події за звітний період: у 2022 році на фінансових ринках сталася зміна тенденції. Ключові індекси перестали зростати та почали активно знижуватися. Ця динаміка обумовлена зміною кредитно-грошової політики в США. Ставку за федеральними фондами почали активно підвищувати у відповідь на прискорення інфляції. Так само інфляція була спричинена сильним зростанням цін на сировинних ринках, а також стала наслідком рятувальних заходів під час COVID-19, коли держави проводили програми QE.

Показники портфеля: найбільший дохід у період управління портфелем було отримано в результаті операцій із трьома інструментами: GOLD — \$767,29 (33,4 % всього прибутку), AMD — \$432,4 (18,8 %) та CAT \$366,2 (15,9 %). Сумарно ці три активи принесли прибуток \$1565,89 або 71,1 % загального доходу.

У період управління портфелем були отримані дивіденди за акціями KMB у розмірі \$34,6, KO — \$8,4, MMM — \$35,66, CAT — \$4,8, AAPL-\$2,2 та CME — \$5. Отже, сумарний обсяг дивідендів склав \$90,6 або 3,9 % отриманого прибутку.

Дев'ять угод було закрито зі збитком: KMB — (-\$235,3), MMM — (-\$560,28), BABA — (-\$816,2), FB — (-\$164,12), CME — (-\$174,95), INTC — (-\$187,5), UPS — (-\$0,3), NG — (-\$62,2) та US500 — (-\$58,78). На оплату комісій та свопів було направлено \$230,14.

Сумарний збиток склав \$2264,63 або 22,6 % від початково вкладених коштів.

Отже, сумарний прибуток склав \$2293,01 або 22,93 %.

Чистий збиток за рік управління портфелем склав \$176,45. Загальний збиток портфеля за період управління склав 1,76 %. За такий же період індекс широкого ринку S&P 500, взятий за базу порівняння у портфелі, знизився на 13,7 %.

Перелік усіх угод

Інструмент	Ордер	Обсяг	Ціна угоди	Ціна закриття	Дохід/збиток	Отримані дивіденди
kmb	buy	0,1	132,83	109,37	-235,3	34,6
ko	buy	0,2	54,3	57,95	73	8,4
mmm	buy	0,14	165,11	125,09	-560,28	35,66
cat	buy	0,12	189,92	220,44	366,2	4,8
baba	buy	0,15	146,25	91,84	-816,2	
aapl	buy	0,1	143,53	152,69	91,6	2,2
amd	buy	0,1	105,82	149,06	432,4	
fb	buy	0,02	327,41	245,35	-164,12	
tsla	buy	0,1	793,61	1045,33	251,72	
cme	buy	0,05	207,41	172,42	-174,95	5
intc	buy	0,5	35,3	31,55	-187,5	
ups	buy	0,05	170,46	170,4	-0,3	
gold	buy	0,27	1932,69	1961,11	767,29	
ng	buy	0,01	7,671	6,999	-67,2	
us500	sell	0,11	3729,06	3782,5	-58,78	
brn	buy	0,03	91,68	98,03	190,54	
Tnote	sell	0,02	111,7	110,22	29,6	
Очікуваний прибуток		40,50%				
Ризик		38,00%				
Накопичені комісії та своп		-230,14				
Отриманий збиток		-176,45				
Дохідність портфеля		-1,76%				