

# Інвестиційний портфель «Оптимальний»

Звіт про прибутковість  
(Грудень 2022)

# Мета та переваги портфеля «Оптимальний»

## **Мета:**

Отримання річної прибутковості приблизно 25 % за помірної волатильності портфеля.

## **Переваги:**

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

# Опис та стратегія портфеля «Оптимальний»

## **Опис:**

Портфель «Оптимальний» був ризикованим. Мав високий рівень потенційної прибутковості з мінімальним для цієї прибутковості ризиком.

## **Стратегія:**

Стратегія передбачає вкладення в стабільні дивідендні акції, а в якості інструмента, що хеджує, використовується золото. У разі відновлення ринку до портфеля додаватимуться акції ІТ-компаній для прискореного зростання.

## Основні параметри портфеля «Оптимальний»

- Валюта: долар США
- Оптимальна сума вкладення: 10 000 \$
- Очікувана дохідність: 25 %
- Ризик: утримання на рівні 30 %
- Мінімальний термін: 6 місяців
- Ребалансування та заміщення: за підсумками календарного місяця

# Звіт про угоди та прибутковість портфеля

**Основні події за звітний період:** упродовж минулого року на фінансових ринках відбувся злам тенденції. Ключові індекси перестали зростати й почала консолідуватися в широких діапазонах. Ця динаміка зумовлена 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: UPS — \$92,3 (49 % всього прибутку), V — \$50,72 (27 %) та KHC — \$10,25 (5,4 %). Сумарно ці три активи принесли прибуток \$153,27 або 91,5 % всього доходу.

У період управління портфелем були отримані дивіденди за акціями CME у розмірі \$10, V — \$1,8, UPS — \$7,6, KHC — \$4, KMB — \$11,6. Сумарний обсяг дивідендів склав \$35 або 18,6 % отриманого прибутку.

Отже, сумарний прибуток склав **\$188,27** або **1,9 %**.

Угоди, закриті зі збитками: KMB — (-\$82,2), CME — (-\$132,65), MMM — (-\$46,5), PG — (-\$55,25), BABA — (-\$123,6), GOLD — (-\$336,62), TNOTE — (-\$87,2). На оплату комісій та свопів було направлено \$71,32.

Сумарний збиток склав **\$945,95** або **9,4 %** від початково вкладених коштів.

**Чистий збиток** за рік управління портфелем становив **\$932,08**. **Загальний збиток портфеля** за період управління склав **9,32 %**. За цей же період індекс широкого ринку S&P 500, взятий за базу порівняння в портфелі, знизився на 15,0 %.

# Перелік усіх угод

Інструмент	Ордер	Обсяг	Ціна угоди	Ціна закриття	Дохід/збиток	Отримані дивіденди
KHC	buy	0,05	37,52	39,57	10,25	4
KMB	buy	0,05	132,36	115,92	-82,2	11,6
CME	buy	0,05	198,02	171,49	-132,65	10
MMM	buy	0,05	148,05	138,75	-46,5	
PG	buy	0,05	148,07	137,02	-55,25	
BABA	buy	0,05	96,63	71,91	-123,6	
GOLD	buy	0,02	1842,26	1673,95	-336,62	
SP500	sell	0,08	3728,08	4048,5	-256,33	
TNOTE	sell	0,02	110,2	114,56	-87,2	
UPS	buy	0,05	170,46	188,92	92,3	7,6
V	buy	0,04	203,36	216,04	50,72	1,8
<b>Очікуваний прибуток</b>		<b>25%</b>				
<b>Ризик</b>		<b>30%</b>				
<b>Накопичені комісії та своп</b>		<b>-71,32</b>				
<b>Отриманий збиток</b>		<b>-932,08</b>				
<b>Дохідність портфеля</b>		<b>-9,32%</b>				