

Инвестиционный портфель
“Оптимальный”
(Декабрь 2023)

Цель и преимущества портфеля “Оптимальный”

Цель:

Получение годовой доходности порядка 30% при умеренной волатильности портфеля.

Преимущества:

- небольшая сумма вложения
- высокая ликвидность активов, входящих в портфель
- низкий кредитный риск активов, входящих в портфель
- профессиональное управление портфелем
- простое следование за портфелем
- использование инструментов хеджирования

Описание и стратегия портфеля “Оптимальный”

Описание:

Портфель “Перспективный” является рискованным. Имеет высокий уровень потенциальной доходности, с минимальным для этой доходности риском.

Стратегия:

Стратегия предполагает вложения в сырьевые товары и акции из ИТ сектора, которые имеют наибольший потенциал роста.

Основные параметры портфеля “Оптимальный”

- Валюта: доллар США
- Оптимальная сумма вложения: 10 000\$
- Ожидаемая доходность: 30%
- Риск: удержание на уровне 25%
- Минимальный срок: 6 месяцев
- Ребалансировка и замещение: по итогам календарного месяца

Отчет и ребалансировка портфеля

Основные события за отчетный период: В 2023 году тренд на ужесточение монетарной политики сохранился вплоть до конца года. Регулятор пытался быстрыми темпами погасить инфляцию, чтобы не допустить укоренение ожидаемой инфляции. В течение года инфляция пошла на спад, на фоне чего ФРС США под конец года смягчил позицию по монетарной политике. В 2024 году ожидается уже первое снижение ставки с 5,25-5,5% до 5-5,25% на 0,25% в марте с вероятностью 65%.

Показатели портфеля: Наибольший доход в период управления портфелем был получен в результате операций с тремя инструментами: ADBE - \$470,85 (27,1%), CME - \$277,7 (16%) и TNOTE \$274,2 (15,8%). Суммарно эти три актива принесли прибыль в \$1022,65 или 58,9% всего дохода.

В период управления портфелем были получены дивиденды по акциям: AAPL- \$1,92, CME - \$22, EBAY - \$5, INTC - \$1,25. Таким образом суммарный объем дивидендов составил \$30,17.

Одна сделка была закрыта в убыток: EBAY – (-\$20,3). На оплату комиссий и свопов было направлено \$241,7.

Суммарный чистый доход составил **\$1507,72** или **15,07%** от первоначально вложенных средств. За аналогичный период индекс S&P 500 вырос на 11,2%.

Перечень всех сделок

Инструмент	Ордер	Объем	Цена сделки	Цена закрытия	Доход/убыток	Полученные дивиденды
brn	buy	0,04	76,089	82,817	269,12	
cme	buy	0,2	194,99	208,875	277,7	22
adbe	buy	0,15	435,81	467,20	470,85	
tsla	buy	0,15	232,5	246,86	215,4	
aapl	buy	0,06	179,59	196,08	98,98	1,92
ebay	buy	0,1	45,77	43,74	-20,3	5
gold	buy	0,04	2020,93	2038,73	71,19	
intc	buy	0,1	38,56	46,48	79,2	1,25
tnote	buy	0,06	107,82	112,39	274,2	
Ожидаемая прибыль		30%				
Риск		25%				
Накопленные комиссии и своп		-241,7				
Прибыль		1507,72				
Доходность		15,07%				