

Инвестиционный портфель
“Оптимальный”
(Июнь 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 “Оптимальный” являлся рискованным. Имел высокий уровень потенциальной доходности, и сбалансированный риск для этой доходности.

Стратегия:

Стратегия предполагала вложения в стабильные дивидендные акции и растущего сектора экономики. В качестве противовеса используется продажа индекса SP500. Также в стратегии были использованы сырьевые товары на фоне наличия устойчивых трендов на данных рынках.

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 2022 – 2023 году ФРС США перешел к ужесточению монетарной политики на фоне резкого роста инфляции в стране. Регулятор стал повышать базовую ставку и довел ее до рекордного уровня 5 – 5,25% к началу июня 2023 года. Таким образом, рынок акций находился под давлением от ужесточения ДКП, испытывал проблемы с дальнейшим ростом. Также из-за роста инфляции в котировках золота наблюдался устойчивый растущий тренд. Цены на нефть из-за опасения рецессии мировой экономики снизились.

Показатели портфеля: Наибольший доход в период управления портфелем был получен в результате операций с тремя инструментами: GOLD - \$228,92, Amazon (AMZN) - \$142,44 и Adobe (ADBE) – \$102,94. Суммарно эти три актива принесли прибыль в \$474,3.

В период управления портфелем были получены дивиденды по акциям Apple (AAPL) в размере \$0,92, McDonalds (MCD) - \$12,16, Coca-Cola (KO) - \$3,68. Таким образом суммарный объем дивидендов составил \$16,76.

Таким образом **суммарная прибыль** составила **\$604,66** или **6,04%**.

Четыре сделки были закрыты с убытком: Tesla (TSLA) – (-\$29,62) , S&P 500 Index (US500) - (-\$229,95), Coca-Cola (KO) - (-\$22,72), нефть Brent (BRN) - (-\$162,28). На оплату комиссий и свопов было направлено \$116,39.

Суммарный убыток составил **\$444,57** или **4,44%** от первоначально вложенных средств.

Чистая прибыль за период управления портфелем составила **\$56,34**. **Общая прибыль портфеля** за весь период управления составила **0,56%**. За этот же период индекс широкого рынка S&P 500, который был взят за базу сравнения по портфелю, вырос на 7,2%.

Перечень всех сделок

Инструмент	Ордер	Объем	Цена сделки	Цена закрытия	Доход/убыток	Полученные дивиденды
amzn	buy	0,04	89,05	124,66	142,44	
adbe	buy	0,01	335,7	438,62	102,94	
tsla	buy	0,05	151,258	145,32	-29,62	
aapl	buy	0,04	142,41	192,86	81,8	0,92
mcd	buy	0,04	276,29	288,43	48,56	12,16
us500	sell	0,07	3956,8	4285,3	-229,95	
ko	buy	0,08	63,4	60,56	-22,72	3,68
gold	buy	0,02	1881,54	1996	228,92	
brn	buy	0,02	85,3	77,186	-162,28	
Ожидаемая прибыль		30%				
Риск		25%				
Накопленные комиссии и своп		-116,39				