

Инвестиционный портфель
“Оптимальный”
(Июль 2024)

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” 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 2024 году тренд на сохранение повышенной базовой процентной ставки сохранился. Регулятор продолжил бороться с повышенной потребительской инфляцией. На этом фоне в течение года инфляция пошла на спад, на фоне чего ФРС США смягчил риторику в отношении ДКП. В 2024 году ожидается первое снижение ставки с 5,25-5,5% до 5-5,25% на 0,25% в сентябре с вероятностью 70%. Рынок акций на этом фоне рос, однако в основном за счет компаний самой крупной капитализации.

Показатели портфеля: Наибольший доход в период управления портфелем был получен в результате операций с тремя инструментами: MSFT - \$391,5 (34,0%), AAPL - \$283,44 (24,6%) и GOOG \$144,33 (12,5%). Суммарно эти три актива принесли прибыль в \$819,27 или 71,1% всего дохода.

В период управления портфелем были получены дивиденды по акциям: AAPL- \$2,94, CME - \$9,2, EBAY - \$5,4, MSFT - \$7,5, GOOG - \$0,6. Таким образом суммарный объем дивидендов составил \$25,64.

Четыре сделки были закрыты в убыток: ADBE – (-\$270,84), CME – (-\$109,16), TNOTE – (-\$92,4), PFE – (-\$5,2). На оплату комиссий и свопов было направлено \$251,6.

Суммарный доход составил **\$443,69** или **4,44%** от первоначально вложенных средств.

Перечень всех сделок

Инструмент	Ордер	Объем	Цена сделки	Цена закрытия	Доход/убыток	Полученные дивиденды
goog	buy	0,03	144,28	192,39	144,33	0,6
pfe	buy	0,05	29,26	28,22	-5,2	
amd	buy	0,03	182,09	182,23	0,42	
cme	buy	0,04	221,4	194,11	-109,16	9,2
adbe	buy	0,03	591,97	501,69	-270,84	
ebay	buy	0,1	41,75	52,97	112,2	5,4
aapl	buy	0,06	184,60	231,84	283,44	2,94
msft	buy	0,05	385,53	463,83	391,5	7,5
tnote	buy	0,06	111,99	110,45	-92,4	
IR					220,92	
				Итого	675,21	25,64