

Инвестиционный портфель “Оптимальный”

Отчет о доходности
(Декабрь 2022)

Цель и преимущества портфеля “Оптимальный”

Цель:

Получение годовой доходности порядка 25% 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, с минимальным для этой доходности риском.

Стратегия:

Стратегия предполагает вложения в стабильные дивидендные акции, а также в качестве хеджирующего инструмента используется золото. В случае восстановления рынка, в портфель будут добавляться акции ИТ компаний для более ускоренного роста.

Основные параметры портфеля “Оптимальный”

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

Отчет о сделках и доходности портфеля

Основные события за отчетный период: В течение прошедшего года на финансовых рынках произошел слом тенденции. Ключевые индексы перестали расти и начала консолидироваться в широких диапазонах. Данная динамика обусловлена изменением кредитно-денежной политики в США. Ставку по федеральным фондам начали активно повышать в ответ на ускорение инфляции. В свою очередь, инфляция была вызвана сильным ростом цен на сырьевых рынках, а также стала последствием спасательных мер во время COVID-19, когда государства проводили программы QE.

Показатели портфеля: Наибольший доход в период управления портфелем был получен в результате операций с тремя инструментами: UPS - \$92,3 (49% всей прибыли), V - \$50,72 (27%) и KHC - \$10,25 (5,4%). Суммарно эти три актива принесли прибыль в \$153,27 или 91,5% всего дохода.

В период управления портфелем были получены дивиденды по акциям CME в размере \$10, V - \$1,8, UPS - \$7,6, KHC - \$4, KMB - \$11,6. Таким образом суммарный объем дивидендов составил \$35 или 18,6% полученной прибыли.

Таким образом **суммарная прибыль** составила **\$188,27** или **1,9%**.

Сделки, закрытые с убытком: KMB - (-\$82,2), CME - (-\$132,65), MMM - (-\$46,5), PG - (-\$55,25), BABA - (-\$123,6), GOLD - (-\$336,62), TNOTE - (-\$87,2). На оплату комиссий и свопов было направлено \$71,32.

Суммарный убыток составил **\$945,95** или **9,4%** от первоначально вложенных средств.

Чистый убыток за год управления портфелем составил **\$932,08**. **Общий убыток портфеля** за весь период управления составил **9,32%**. За этот же период индекс широкого рынка S&P 500, который был взят за базу сравнения по портфелю, снизился на 15,0%.

Перечень всех сделок

Инструмент	Ордер	Объем	Цена сделки	Цена закрытия	Доход/убыток	Полученные дивиденды
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
Ожидаемая прибыль		25%				
Риск		30%				
Накопленные комиссии и своп		-71,32				
Полученный убыток		-932,08				
Доходность портфеля		-9,32%				