

Інвестиційний портфель
“Оптимальний”
(Грудень 2023)

Ціль та переваги портфеля “Оптимальний”

Ціль:

Отримання річної прибутковості близько 30% за помірної волатильності портфеля.

Переваги:

- невелика сума вкладень
- висока ліквідність активів, що входять до портфеля
- низький кредитний ризик активів, що входять до портфеля
- професійне управління портфелем
- просте слідкування за портфелем
- використання інструментів хеджування

Опис та стратегія портфеля “Оптимальний”

Опис:

Портфель "Оптимальний" є ризикованим. Має високий рівень потенційної прибутковості з мінімальним для цієї прибутковості ризиком.

Стратегія:

Стратегія передбачає вкладення в сировинні товари та акції ІТ сектору, які мають найбільший потенціал зростання.

Основні параметри портфеля “Оптимальний”

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

Звіт та ребалансування портфеля

Основні події за звітний період: у 2023 році тренд на жорсткість монетарної політики зберігся аж до кінця року. Регулятор намагався швидкими темпами погасити інфляцію, щоб не допустити вкорінення очікуваної інфляції. Протягом року інфляція пішла на спад, на тлі чого ФРС США під кінець року пом'якшив позицію щодо монетарної політики. У 2024 році очікується вже перше зниження ставки з 5,25-5,5% до 5-5,25% на 0,25% у березні з ймовірністю 65%.

Показники портфеля: Найбільший дохід у період управління портфелем було отримано в результаті операцій з трьома інструментами: ADBE - \$470,85 (27,1%), CME - \$277,7 (16%) та TNOTE \$274,2 (15,8%). Сумарно ці три активи принесли прибуток \$1022,65 або 58,9% всього доходу.

У період управління портфелем були отримані дивіденди за акціями: AAPL-\$1,92, CME – \$22, EBAY – \$5, INTC – \$1,25. Таким чином, сумарний обсяг дивідендів склав \$30,17.

Одна угода була закрита на збиток: EBAY – (-\$20,3). На оплату комісій та свопів було направлено \$241,7.

Сумарний чистий дохід становив **\$1507,72** чи **15,07%** від спочатку вкладених коштів. За аналогічний період індекс S&P 500 зріс на 11,2%.

Перелік всіх угод

Інструмент	Ордер	Обсяг	Ціна угоди	Ціна закриття	Дохід/збиток	Отримані дивіденди
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	
Очікуваний прибуток		30%				
Ризик		25%				
Накопичені комісії та своп		-241,7				
Прибуток		1507,72				
Дохідність		15,07%				