

Инвестиционный портфель «TeleTrade Консервативный»

Отчет о доходности
(май 2022)

Цель и преимущества портфеля «TeleTrade Консервативный»

Цель:

Получение ориентировочной годовой доходности на уровне 31,9% при максимально низкой 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

Описание и стратегия портфеля «TeleTrade Консервативный»

Описание:

Портфель консервативный от TeleTrade является консервативным инвестиционным инструментом в линейке портфелей от компании TeleTrade. Бенчмарком для портфеля является индекс S&P500. Распределение средств между несколькими классами активов позволяет минимизировать риски портфеля и получить приемлемый уровень дохода.

Стратегия:

Усиление инфляции, прежде всего в США, и мире может стать долгосрочным трендом. На этом фоне ФРС США начнет проводить жесткую кредитно-денежную политику, то есть начнет повышать ставки. Данные действия могут привести к росту стоимости фондирования для компаний, а также к замедлению роста уровня жизни населения. Учитывая данную тенденцию, портфель формировался из акций компаний стоимости, которые могут стать бенефициарами ускорения инфляции.

Основные параметры портфеля «TeleTrade Консервативный»

- Валюта: доллар США
- Оптимальная сумма вложения: 10 000\$
- Ожидаемая доходность: 31,9%
- Риск: удержание на уровне 27%
- Минимальный срок: 1 года
- Ребалансировка и замещение активов: по итогам календарного месяца

Отчет и ребалансировка портфеля

Основные события за отчетный период: В течение прошедшего года на финансовых рынках произошел слом тенденции. Ключевые индексы перестали расти и начали 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: PG - \$116,7 (19,5% всей прибыли), AA - \$232,5 (39%) и KO – \$94 (15,7%). Суммарно эти три актива принесли прибыль в \$443,2 или 74,2% всего дохода.

В период управления портфелем были получены дивиденды по акциям PG в размере \$17,4, KO - \$25,2, AIG - \$19,2, VZ - \$57,24, AAPL - \$0,44 и NVDA - \$0,12. Таким образом суммарный объем дивидендов составил \$119,6 или 20% полученной прибыли.

Десять сделок было закрыты с убытком: VZ – (-\$93,9) , BA - (-\$568,1), TSLA - (-\$283,26) , MSFT - (-\$917,7), AMZN – (-\$436,02), US500 – (-\$34,48 , AAPL – (-\$15,5) , NVDA – (-\$104,64) , AMD – (-\$82,81) и GOLD - (-\$1214,35). На оплату комиссий и свопов было направлено \$214,25.

Суммарный убыток составил **\$4166,46** или **41,66%** от первоначально вложенных средств.

Суммарная прибыль составила **\$611,56** или **6,1%**.

В период управления портфелем в него были добавлено несколько новых активов: TSLA, MSFT, AMZN, US500, AAPL, NVDA, AMD, GOLD. Также менялись некоторые параметры сделок, такие как Stop Loss и Take Profit.

Чистый убыток за год управления портфелем составил **\$3554,9**. **Общий убыток портфеля** за весь период управления составила **35,54%**. За этот же период индекс широкого рынка S&P 500, который был взят за базу сравнения по портфелю, снизился на 0,5%.

Перечень всех сделок

Инструмент	Ордер	Объем	Цена сделки	Целевая цена	Цена закрытия	Доход/убыток	Полученные дивиденды
PG	buy	0,1	136,31	170	147,98	116,7	17,4
KO	buy	0,2	56,14	70	60,84	94	25,2
AA	buy	0,3	36,93	60	44,68	232,5	
AIG	buy	0,3	52,44	80	53,57	33,9	19,2
VZ	buy	0,3	57,07	70	53,94	-93,9	57,24
BA	buy	0,1	253,66	350	196,85	-568,1	
TSLA	buy	0,12	1081,44	1450	1057,84	-283,26	
MSFT	buy	0,3	330,4	390	299,81	-917,7	
AMZN	buy	0,03	3443,08	3900	3297,74	-436,02	
US500	buy	0,02	4563,9	4900	4391,5	-34,48	
AAPL	buy	0,02	174,8	200	167,05	-15,5	0,44
NVDA	buy	0,03	248,69	350	213,81	-104,64	0,12
AMD	buy	0,03	122,43	170	94,82	-82,81	
XAUUSD	buy	0,16	1989,39	2300	1913,5	-1214,35	
Ожидаемая прибыль		31,90%					
Риск		36,60%					
Накопленные комиссии и своп		-214,25					
Полученный убыток		-3554,9					
Доходность портфеля		-35,54%					