

Инвестиционный портфель «TeleTrade Высокодоходный»

Отчет о доходности
(Июнь 2021)

Цель и преимущества портфеля «TeleTrade Высокодоходный»

Цель:

Получение доходности в 61,9% в расчете на квартал с максимальной волатильностью портфеля, что значительно выше 4-5% по банковским депозитам

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 Высокодоходный»

Описание :

Портфель «TeleTrade Высокодоходный» сбалансирован с высоким риском для инвестиций с TeleTrade.

Бенчмарком для портфеля служит индекс S&P500. Несмотря на стратегию инвестиций с высоким риском портфель сбалансирован с точки зрения распределения активов из наиболее перспективных секторов мировой экономики.

Стратегия:

Стратегия портфеля предусматривает выбор активов на фондовом рынке с наибольшим потенциальным ростом и хеджированием при высокой вероятности коррекции.

В зависимости от рыночной конъюнктуры доли активов в портфеле могут меняться.

Основные параметры портфеля «TeleTrade Высокодоходный»

- Валюта: доллар США
- Оптимальная сумма вложения: 10 000\$
- Ожидаемая доходность: 61,9%
- Риск: удержание на уровне 39,1%
- Минимальный срок: 3 месяца
- Ребалансировка и замещение активов: по итогам календарного месяца

Отчет и ребалансировка портфеля

Основные события за отчетный период:

В США прошел сезон корпоративной отчетности за 1 квартал 2021 года, согласно данным аналитической компании Refinitiv, 85,4% компаний входящих в индекс широкого рынка S&P 500 превзошли консенсус-прогнозы аналитиков. Несмотря на это, с начала апреля, момента начала публикации корпоративной отчетности за 1 квартал 2021 года, индекс S&P 500 вырос лишь на 3%, при одновременном достижении рекордных значений продаж акции инсайдерами. Вместе с тем в США годовая инфляция достигла самого высокого уровня с октября 2008 года в 4,2%, что повышает вероятность более раннего сворачивания стимулирующей ДКП ФРС и глубокой коррекции американского фондового рынка.

Показатели портфеля:

Все пять бумаг портфеля были закрыты с прибылью, но раньше заявленных целевых ориентиров - акции банка Wells Fargo за период удержания выросли на 1,9%, что принесло 0,19% прибыли от счета или \$19, акции телекоммуникационного гиганта AT&T за период удержания выросли на 4,6%, что принесло 0,53% прибыли от счета или \$53,6, акции химической компании DuPont за период удержания прибавили 4,8%, что принесло 0,48% прибыли от счета или \$48,75, акции банка Citigroup за период удержания выросли на 2,6%, что принесло 0,26% прибыли от счета или \$25,9, и наконец акции автомобилестроительной компании Ford Motor за период удержания выросли на 0,8%, что принесло 0,11% прибыли от счета или \$11.

Суммарная прибыль составила **\$158,25** или **1,58%** от первоначально вложенных средств.

В период управления портфелем новых инструментов в портфель не добавлялось, напротив из-за выросших рисков коррекционного снижения американского фондового рынка, длинные позиции были ликвидированы раньше чем они достигли целевых ориентиров, при этом в портфеле была оставлена продажа фьючерса на индекс широкого рынка S&P 500 с расчетом на глубокую коррекцию, которая в прошедшем периоде так и не успела реализоваться.

Именно с операцией на продажу фьючерса на индекс S&P 500 связан весь отрицательный результат портфеля. Позиция на продажу не достигла защитного ордера, однако была ликвидирована по достижении даты завершения действия портфеля с убытком в \$2005,0 (20,05%).

На оплату комиссий и свопов было направлено \$150,99.

Таким образом **суммарный убыток** составил **\$2155,99** или **21,56%**.

Чистый убыток за три месяца управления портфелем составил **-\$1997,74**.

Общая доходность портфеля за весь период управления составила **-19,97%**.

Активы входящие в портфель

| Инструмент | Ордер | Объем | Цена сделки | Целевая цена | Цена закрытия | Доход/убыток | Полученные дивиденды |
|----------------------------|-------|-------|-------------|------------------|---------------|--------------|----------------------|
| WFC | buy | 0,25 | 37,80 | 54,00 | 38,56 | 19,0 | |
| C | buy | 0,14 | 71,51 | 95,00 | 73,36 | 25,90 | |
| T | buy | 0,4 | 29,18 | 46,00 | 30,52 | 53,60 | |
| DD | buy | 0,15 | 74,84 | 90,00 | 78,09 | 48,75 | |
| F | buy | 1,0 | 12,38 | 18,00 | 12,49 | 11,0 | |
| S&P500 | buy | 0,5 | 3805,00 | 3400,00 | 4200,00 | -2005,0 | |
| Ожидаемая прибыль | | | | 61,9% | | | |
| Риск | | | | 39,1% | | | |
| Свопы и комиссии | | | | -150,99\$ | | | |
| Полученная прибыль | | | | -1997,7\$ | | | |
| Доходность портфеля | | | | -19,97% | | | |