

Инвестиционный портфель «TeleTrade Перспективный»

Отчет о доходности
(Декабрь 2020 г)

Цель и преимущества портфеля «TeleTrade Высокодоходный»

Первоначальная цель:

Получение доходности в 35,4% в расчете на шесть месяцев с минимальной 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 Перспективный» сбалансирован с умеренным риском для инвестиций с TeleTrade.

Бенчмарком для портфеля является индекс S&P500. Портфель сбалансирован с умеренным уровнем риска.

Стратегия:

Стратегия построения портфеля базируется на экономической ситуации в США. Большинство инвестиционных банков оценивают восстановление американской экономики умеренными темпами после фактической заморозки на период эпидемии. Основной акцент сделан на рост широкого рынка акций.

Первоначальная стратегия со ставкой на восстановление мирового нефтегазового сектора за время действия портфеля (с июня по ноябрь 2020 года) себя не оправдала.

Основные параметры портфеля «TeleTrade Высокодоходный»

- Валюта: доллар США
- Оптимальная сумма вложения: 10 000\$
- Ожидаемая доходность: 35,4%
- Риск: удержание на уровне 23%
- Минимальный срок: 6 месяца
- Ребалансировка и замещение активов: по итогам календарного месяца

Отчет и ребалансировка портфеля

Основные события за отчетный период:

В течение шести месяцев действия портфеля финансовые рынки показали высокую волатильность, связанную с возможными рисками возникновения второй волны коронавируса COVID-19, а также растущим напряжением во взаимоотношениях США и Китая. Акциям нефтяных компаний потребовалось значительно большее время для восстановления, поэтому ставка на рост бумаг данного сектора себя не оправдала.

Показатели портфеля: Часть акций портфеля – ExxonMobil (XOM), British Petroleum (BP) и Royal Dutch Shell (RDSb) – получили stop-loss, сделки по ним были закрыты. Небольшой убыток был зафиксирован и по одной из сделок с индексом S&P 500. Общий убыток по данным позициям составил \$1464,2.

Суммарный убыток составил **\$1476,7** или **14,77%** от первоначально вложенных средств.

Доход в период управления портфелем был получен в результате операций с четырьмя инструментами: Палладий (XPDUSD) - \$938,68, Goldman Sachs (GS) - \$12,8, S&P 500 (US500) – \$1224,85 и Apple (AAPL) – \$315,57. В период управления портфелем были получены дивиденды по акциям ExxonMobil (XOM) в размере \$26,1, British Petroleum (BP) - \$24,8 и по акциям Royal Dutch Shell (RDSb) - \$39,04.

Общий объем дохода, полученный за период управления портфелем достиг **\$2581,84**. **Чистый доход** за шесть месяцев управления портфелем составил **\$1063,74**.

Общая доходность портфеля за весь период управления (с июня по ноябрь 2020 г) составила **10,63%**. За этот же период индекс широкого рынка S&P 500, который был взят за базу сравнения по портфелю, вырос на 19,18%.

Активы входящие в портфель

Инструмент	Ордер	Объем	Цена сделки*	Целевая цена	Цена закрытия*	Доход/убыток	Полученные дивиденды
XPDUSD	buy	0,19	1942,47	2244	2071,78	939,39	
GS	sell	0,1	201,28	100	200	12,8	-12,5
XOM	buy	0,61	46,27	59	39,47	-415,08	26,1
RDSb	buy	1,21	31,03	50	26,88	-501,68	39,04
BP	buy	0,7	23,97	40	17,59	-522,84	24,8
AAPL	buy	0,03	319,24	424,39	424,39	315,57	
US500	buy	0,8	3390,06	3600	3540,09	1224,35	
Ожидаемая прибыль					35,4%		
Риск					23%		
Полученная прибыль**						1063,74	
Доходность портфеля**					10,63%		

* Указаны средневзвешенные цены

** С учетом дивидендов