

Приложение к маркетинговым материалам «Большая покупка»

Дата: 27.06.2018

Цель исследования: определение исторической доходности инвестиционного рублевого портфеля стратегии «Большая покупка» за период с 31.05.2017 по 31.05.2018. Первоначальные вложения равны 1000000 рублей, ежемесячное пополнение 50000 рублей.

1. Портфель – это индексы-бенчмарки фондов из стратегии «Большая покупка» с соответствующими весами.

Таблица 1. Состав портфеля (тикеры Bloomberg).

SOLTBHDR Index	BERUTRUU Index	BERUTRRH Index	NDDLGR Index	MUSAITNU Index	NDDLK Index	NDDUAS Index	NDDUJN Index	NDDUUS Index	NDEUCHF Index	GOLDLNAM Index	RTSI\$T Index
80%	0%	20%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%

2. Доходность портфеля в размере 6,60% рассчитана как годовая ставка внутренней доходности (IRR), при которой начальная сумма и сумма пополнений равняется стоимости портфеля в конце периода инвестирования 31.05.2018:

$$\text{Первоначальные вложения} * (1 + IRR)^{\frac{N}{12}} + \sum_{t=1}^{N-1} \text{Пополнение} * (1 + IRR)^{\frac{t}{12}} = \text{Стоимость портфеля на 31.05.2015}$$

$$1000000 * (1 + IRR)^1 + \sum_{t=1}^{11} 50000 * (1 + IRR)^{\frac{t}{12}} = 1633977,64$$

Из формулы выше получается, что историческая доходность портфеля равняется 6,60%.