Модельный Портфель Депозит+

Модельные портфели Искра Индекс сохраняют актуальность в течение 1 месяца. Пожалуйста, не забывайте своевременно актуализировать свои реальные портфели в соответствии с модельными

Валюта портфеля	USD
Минимальный горизонт инвестирования	3 - 3.5 года
Ожидаемая среднегодовая доходность	4.7%
Ожидаемый среднегодовой риск	2.6%
Тип портфеля по уровню риска	Консервативный
Интервал 90% вероятности для годовой доходности	[0.4% 9.0%]
Интервал 90% вероятности для доходности за 5 лет	[13.9% 33.1%]

Тикер ETF	Базовый индекс ETF	Доля в портфеле
SHY	UST 1-3 Barclays Capital U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index Гособлигации США	19.1%
IGOV	FTSE World Government Bond Index Developed Markets Capped Select Index Ex-US Гособлгации развитых рынков кроме США	74.7%
EMB	J.P. Morgan EMBI Broad Diversified Core Index Государственные облигации развивающихся рынков	0.0%
HYG	Markit iBoxx USD Liquid High Yield Index Высокорискованные облигации США	0.0%
IVV	S&P500 Index Акции США	2.5%
IEFA	MSCI EAFE Index Акции развитых рынков кроме США и Канады	0.0%
IEMG	MSCI Emerging Markets Investable Market IndexMSCI EM IMI Акции развивающихся рынков	0.0%
REET	FTSE EPRA Nareit Global Real Estate Index Акции компаний недвижимости	0.0%
GSG	S&P GSCI Commodities Index Сырьвые товары	3.7%
IPRV	S&P Listed Private Equity Index Акции компаний рынка частного капитала	0.0%

Для формирования нового портфеля необходимо определить сумму вложений в каждый ETF: она равна указанной в таблице доле от объёма (стоимости) всего портфеля. Затем приходящиеся на каждый ETF суммы можно либо ввести в торговом приложении Вашего брокера, которое автоматически рассчитает целое количество акций, либо сделать заявку по телефону.

Для поддержания оптимальной структуры портфеля один раз в месяц необходимо проводить ребалансировку портфеля. При проведении ребалансировки сначала необходимо определить разницу между текущей стоимостью, приходящейся на каждый ETF в Вашем портфеле, и его стоимостью исходя из новой доли согласно обновлённому отчёту о портфеле Депозит+. После этого необходимо продать акции тех ETF, чья доля стала избыточной, и докупить акции ETF с долей ниже целевой. Ребалансировку следует проводить при отклонении новых долей от текущих не менее чем на 20 базисных пунктов (0.2%).