

Portfolio ROR. Time Weighted

Виджет **Portfolio ROR. Time Weighted** предназначен анализа портфелей ценных бумаг:

- 1. Rate Of Return,
- 2. Profit & Loss,
- 3. Динамики изменения RoR, P&L,
- 4. Отображение их структуры, денежных потоков и сделок.

YouTube

Виджет содержит 5 таблиц с данными, таблица **Portfolios** является основной.

- [Portfolio ROR. Portfolios](#)
- [Portfolio ROR. Securities](#)
- [Portfolio ROR. Dynamic](#)
- [Portfolio ROR. Cashflows](#)
- [Portfolio ROR. Deals](#)

Portfolios. ROR																	
Tradebook				Date 1		Date 2		Frequency									
Sec.Aggressive				31.03.2022		09.03.2023		Monthly									
Portfolio	ROR	P&L Total	P&L Coupon	BPV	YTM	CY	CY Mod	Dur	DurM	Cnvxty	Value End	Value Start	Cashflow				
Sec.Aggressive	0.041	10	2 306								32 328	26 832	-5 486				
Sec.Conservative	22.460	7 942	2 853	-12	8.491	6.987	8.718	2.796	2.679	10.229	44 117	39 194	3 019				
Sec.Aggressive...	17.114	5 013	2 760	-1	8.064	5.718	8.095	0.524	0.503	0.520	34 928	32 550	2 635				
Sec.Conservative...	26.089	9 071	2 984	-11	7.336	6.101	7.583	2.495	2.455	11.344	44 513	39 155	3 713				
		22 036	10 904	-24							155 886	137 731	3 880				

Securities																	
Dynamic				Cashflows		Deals											
Issue				ROR				P&L				Market				Date 2	
Instrument	ISIN	Maturity	Face/Val	Ccy	Portfolio	Market	Spread	Total	Coupon	YTM	CY	CY Mod	Dur	DurM	Cnvxty	BPV	Cpn Days
РЖД 1P-07R	RU000A0ZZ9R4	26.05.2033	1 000	RUB	53.222	24.291	28.931	1 102	202	1.0895	7.4315	7.5805	9.20	9.15	96.85	0	91
ГазпромКР3	RU000A101QM3	27.05.2025	1 000	RUB	25.290	25.290		1 493	430	9.0990	6.1261	9.3672	2.09	2.00	5.10	-2	100
ВЭБ 1P-21	RU000A101WF5	21.07.2023	1 000	RUB	19.152	19.152		1 261	433	7.7369	5.7808	7.7563	0.37	0.35	0.30	-0	48
Роснефть1P4	RU000A0IQK2	22.04.2027	1 000	RUB	18.730	18.730		1 112	571	0.2732	1.1605	1.1508	3.96	3.95	18.22	-3	133
Сбербанк-001P-SBER19	RU000A102CU4	17.11.2023	1 000	RUB	23.045	23.045		1 451	418	8.3919	5.6555	8.4347	0.68	0.65	0.75	-1	111
СФО ВТБ ПКБ-1-01-06	RU000A1032P1	01.12.2030	1 000	RUB	58.333	58.356	-0.023	2 375	528	9.4361	8.7062	9.8103	5.84	5.79	40.24	-4	8
МТС-001P-21	RU000A104W1	22.06.2026	1 000	RUB	0			277	403	9.0496	9.5162	9.0111	2.83	2.77	9.14	-2	73
								9 071	2 984							-11	

Portfolio ROR. Portfolios

Portfolios. ROR																	
Tradebook				Date 1		Date 2		Frequency									
Sec.Aggressive				31.03.2022		09.03.2023		Monthly									
Portfolio	ROR	P&L Total	P&L Coupon	BPV	YTM	CY	CY Mod	Dur	DurM	Cnvxty	Value End	Value Start	Cashflow				
Sec.Aggressive	0.041	10	2 306								32 328	26 832	-5 486				
Sec.Conservative	22.460	7 942	2 853	-12	8.491	6.987	8.718	2.796	2.679	10.229	44 117	39 194	3 019				
Sec.Aggressive...	17.114	5 013	2 760	-1	8.064	5.718	8.095	0.524	0.503	0.520	34 928	32 550	2 635				
Sec.Conservative...	26.089	9 071	2 984	-11	7.336	6.101	7.583	2.495	2.455	11.344	44 513	39 155	3 713				
		22 036	10 904	-24							155 886	137 731	3 880				

Состояние выбранных портфелей:

1. RoR Time Weighted
2. P&L, общий и купонный (дивидендный)
3. BPV, YTM/УТО, CY, CY Modified, Dur, Dur Modified, Convexity долговых инструментов
4. Рыночные стоимости портфелей на даты начала и окончания
5. Денежные потоки по портфелям

Portfolio ROR. Securities

Securities		Dynamic	Cashflows	Deals																
Issue					ROR			P&L		Market							Date 2			
Instrument	ISIN	Maturity	FaceVal	Ccy	Portfolio	Market	Spread	Total	Coupon	YTM	CY	CY Mod	Dur	DurM	Convty	BPV	Cpn Days	Market		
РЖД 1P-07R	RU000A0ZZ9R4	26.05.2033	1 000	RUB		53.222	24.291	28.931	1 102	202	1.0895	7.4315	7.5805	9.20	9.15	96.85	0	91	98.50000	
ГазпромКР3	RU000A101QM3	27.05.2025	1 000	RUB		25.290	25.290	1 493	430	9.0990	6.1261	9.3672	2.09	2.00	5.10	-2	100	93.29000		
ВЭБ 1P-21	RU000A101WF5	21.07.2023	1 000	RUB		19.152	19.152	1 261	433	7.7369	5.7808	7.7563	0.37	0.35	0.30	-0	48	99.28000		
Роснефть1P4	RU000A0JXQK2	22.04.2027	1 000	RUB		18.730	18.730	1 112	571	0.2732	1.1605	1.1508	3.96	3.95	18.22	-3	133	100.04000		
Сбербанк-001P-SBER19	RU000A102CU4	17.11.2023	1 000	RUB		23.045	23.045	1 451	418	8.3919	5.6555	8.4347	0.68	0.65	0.75	-1	111	98.11000		
СФО БТБ РКС-1-01-06	RU000A1032P1	01.12.2030	1 000	RUB		58.333	58.356	-0.023	2 375	528	9.4361	8.7062	9.8103	5.84	5.79	40.24	-4	8	92.13000	
МТС-001P-21	RU000A104W11	22.06.2026	1 000	RUB		0		277	403	9.0496	9.5162	9.0111	2.83	2.77	9.14	-2	73	101.69000		
								9 071	2 984							-11				

Состав выбранного портфеля:

1. Инструменты, позиции на даты начала и окончания отчета,
2. Доходности RoR Time Weighted позиций и рынка, расчет спреда между ними
3. Доходы по бумагам выбранного портфеля — общий и купонный (дивидендный)
4. BPV, YTM/УТО, CY, CY Modified, Dur, Dur Modified, Convexity долговых инструментов
5. Рыночные стоимости инструментов и их НКД на даты отчета
6. Денежные потоки в разрезе инструментов (сделки, выплаты эмитента, комиссии)

Portfolio ROR. Dynamic

Securities	Dynamic	Cashflows	Deals			
Step	ROR Step	ROR Cuml	P&L Step	P&L Cuml	Value	Value Chng %
29.04.2022	153.854	153.854	3 112	3 112	41 917	7.05
31.05.2022	-21.057	100.399	1 763	4 875	43 186	3.03
30.06.2022	-9.450	81.462	1 387	6 262	44 234	2.43
29.07.2022	-4.151	73.929	1 485	7 747	45 444	2.74
31.08.2022	-11.651	53.664	-155	7 592	44 676	-1.69
30.09.2022	-10.387	37.703	-939	6 653	43 521	-2.58
31.10.2022	0.431	38.297	1 313	7 966	44 486	2.22
30.11.2022	-3.319	33.706	147	8 113	44 136	-0.79
30.12.2022	-1.675	31.467	474	8 586	44 395	0.59
31.01.2023	-2.014	28.818	276	8 862	44 395	-0.00
28.02.2023	-1.908	26.360	46	8 908	44 393	-0.00
09.03.2023	-0.215	26.089	163	9 071	44 513	0.27

Изменения портфеля в течение срока отчета. Срок отчета разбивается на диапазоны дат с указанной периодичностью (Weekly, Monthly, Quarterly...)

Для каждого такого шага рассчитываются

1. RoR Cumulative — наращение доходности с начала отчета по дате шага
2. RoR шага — доходность портфеля в диапазоне дат шага
3. P&L Cumulative — наращение P&L с начала отчета по дате шага
4. P&L шага — измерение P&L портфеля в диапазоне дат шага
5. Market Value — изменение рыночной стоимости портфеля в течение дат отчета
6. Market Value Change — изменение стоимости портфеля в диапазоне дат шага, указанное в процентах

Portfolio ROR. Cashflows

Securities	ROR Dynamic	Cashflows							
Tradedate	Amount	Ccy	Price	Valuedate	Type	Info	Deal	Instrument	
01.03.2023	-820 000.00	USD	41.0000	01.03.2023	Чистая стоимость	Buy 10 @ 41	1 487 024	RUS-35	
01.03.2023	-21 958.33	USD	41.0000	01.03.2023	НКД	Buy 10 @ 41	1 487 024	RUS-35	
15.02.2023	-1 500 000.00	RUB	75.0000	16.02.2023	Чистая стоимость	Buy 2000 @ 75	1 481 693	ОФЗ 26224	
15.02.2023	-990 000.00	RUB	99.0000	16.02.2023	Чистая стоимость	Buy 1000 @ 99	1 481 690	ОФЗ 26224	
15.02.2023	-870 000.00	RUB	87.0000	16.02.2023	Чистая стоимость	Buy 1000 @ 87	1 481 692	ОФЗ 26224	
15.02.2023	-29 500.00	RUB	75.0000	16.02.2023	НКД	Buy 2000 @ 75	1 481 693	ОФЗ 26224	
15.02.2023	-14 750.00	RUB	99.0000	16.02.2023	НКД	Buy 1000 @ 99	1 481 690	ОФЗ 26224	
15.02.2023	-14 750.00	RUB	87.0000	16.02.2023	НКД	Buy 1000 @ 87	1 481 692	ОФЗ 26224	
15.02.2023	-9 300 000.00	RUB	93.0000	16.02.2023	Чистая стоимость	Buy 10000 @ 93	1 481 695	ОФЗ 26226	
15.02.2023	-980 000.00	RUB	98.0000	16.02.2023	Чистая стоимость	Buy 1000 @ 98	1 481 689	ОФЗ 26226	
15.02.2023	-276 600.00	RUB	93.0000	16.02.2023	НКД	Buy 10000 @ 93	1 481 695	ОФЗ 26226	
15.02.2023	-27 660.00	RUB	98.0000	16.02.2023	НКД	Buy 1000 @ 98	1 481 689	ОФЗ 26226	
15.02.2023	-138 238.36	RUB	98.7417	16.02.2023	Чистая стоимость	Buy 140 @ 98,741684	1 481 694	ОФЗ 26227	
15.02.2023	-823.20	RUB	98.7417	16.02.2023	НКД	Buy 140 @ 98,741684	1 481 694	ОФЗ 26227	

Отчет отображает все движения денежных средств по портфелю в течение срока отчета. Отображаются платежи по покупке и продаже бумаг, платежи эмитента и комиссии.

Portfolio ROR. Deals

Securities	Dynamic	Cashflows	Deals								
Tradedate	Instr 1	Product	Dir	Amount 1	Price	Instr 2	Amount 2	Coupon	Valuedate	Account	TradeClass
03.08.2022	MTC-001P-21	Bond	Buy	7	103.5000	RUB	-7 245	-68	03.08.2022	Sec.Conservative.Mod	T+ Облигации ПИР - безадрес.
03.08.2022	РЖД 1P-07R	Bond	Sell	-8	97.3900	RUB	7 791	88	03.08.2022	Sec.Conservative.Mod	T+ Облигации ПИР - безадрес.

Отчет отображает все сделки по выбранному портфелю, заключенные в течение срока отчета.

Отчет содержит поля, описывающие основные параметры сделок.

Теория

Внутренняя норма доходности, общепринятое сокращение — ... (ВНД) — это процентная ставка, при которой сумма дисконтированных денежных потоков (...) равна 0.

... рассчитывается на основании потока платежей, дисконтированного к дате расчета (дате первоначальной инвестиции).

Иначе говоря, для потока платежей ... внутренняя норма доходности ... рассчитывается из уравнения:

$$0 = \sum_{t=0}^n \frac{C_t}{(1+r)^t}$$

где:

- C_t — платёж через t лет ($t = 1, 2, \dots$) и
- $C_0 = I_0$ — начальная инвестиция

или

$$r = \frac{C_t}{C_0}$$

Внутренней доходностью для финансовых инструментов называют процентную ставку, при которой приведенная стоимость будущего потока платежей по данному финансовому инструменту совпадает с его рыночной ценой.

Определённая таким образом внутренняя доходность равна внутренней норме доходности инвестиции.

Управление

Управление осуществляется с помощью параметров, расположенных в панелях отчета.

Для управления используются параметры.

Price type	Тип цен <i>Переоценки</i> — Average, Bid, Offer, Close, Open, Low, High, Official, Last, Settle. По умолчанию не заполнено, переоценка — по типу цены, указанному в настройке инструмента.
Price source	Режим торгов площадки переоценки, по ценам которого будет произведена оценка позиций. Отображаются режимы торгов с продуктами, доступными для инструментов. По умолчанию не заполнено, переоценка — по цене режима, указанного в настройке инструмента.
Tradebooks	Список торговые счета пользователя для которых будет построен отчет
Report ccy	Валюта, в которой представлен отчет. К ней приводятся суммы отчета, рассчитанные в валютах, отличных от валюты отчета. По умолчанию поле не заполнено — используется национальная валюта, системный параметр.
Frequency	Периодичность, применяемая для определения дат совершения операции внутри диапазона дат — между Датой начала периода и Датой окончания периода . Список периодичности операций ограничен диапазоном дат отчета. В списке доступны только те периоды, операции по которым могут быть хотя бы один раз произведены до даты окончания отчета.
Date 1	Дата начала периода, за который строится отчёт. По умолчанию равна текущей дате.
Date 2	Дата окончания периода, за который строится отчёт. По умолчанию равна текущей дате.