

Portfolio ROR. Portfolios

Portfolios. ROR													
Tradebook													
Sec.Aggressive x Sec.Conservative x Sec.Aggressive.Mod x Sec.Conservative.Mod x													
Date 1 31.03.2022 Date 2 09.03.2023 Frequency 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

Отчет содержит поля

ROR	Внутренняя норма доходности портфеля, рассчитанная для всех платежей по нему. В расчет включаются платежи открытия и закрытия позиции на даты начала и окончания отчета $ROR = \frac{1}{P_0} \left(\sum_{t=1}^T \frac{P_t}{(1+ROR)^t} + \frac{P_T}{(1+ROR)^T} \right) - 1$ где: P_t — платёж через t лет ($t=1, \dots, T$) и P_0 — начальная инвестиция
Cashflow	Сумма внешних платежей портфеля за период отчета. Сумма платежей приводится к Валюте отчета с использованием FX курсов Площадки переоценки .
P&L Coupon	Сумма реализованного и нереализованного дохода по купонам / дивидендам
P&L Total	Полный доход по всем инструментам портфеля в <i>Валюте отчета</i> .
YTM	Доходность к погашению портфеля. Рассчитывается как средневзвешенная YTM всех инструментов портфеля, взвешенная по сумме вложения.
CY	Средневзвешенная текущая доходность инструментов портфеля, взвешенная по рыночной стоимости инструментов на дату окончания отчета.
CY Mod	Средневзвешенная модифицированная текущая доходность инструментов портфеля, взвешенная по рыночной стоимости инструментов на дату окончания отчета.
Dur Mod	Модифицированная дюрация портфеля. Рассчитывается как средневзвешенная модифицированная дюрация всех инструментов портфеля, взвешенная по рыночной стоимости всех инструментов на дату окончания отчета.
Dur	Дюрация портфеля. Рассчитывается как средневзвешенная дюрация всех инструментов портфеля, взвешенная по рыночной стоимости всех инструментов на дату окончания отчета.
Value Start	Рыночная стоимость портфеля на дату начала отчета, рассчитанная по ценам Площадки переоценки, включая НКД (для долговых инструментов). $V_{start} = \sum_{i=1}^N P_i(t_0) \cdot CF_i(t_0, t_1) \cdot e^{-R(t_0, t_1)}$ Для расчета используются данные на конец дня, предшествующего дате начала отчета.
Value End	Рыночная стоимость портфеля на дату окончания отчета, рассчитанная по ценам Площадки переоценки, включая НКД (для долговых инструментов). $V_{end} = \sum_{i=1}^N P_i(t_1) \cdot CF_i(t_1, t_2) \cdot e^{-R(t_1, t_2)}$

Portfolio	Название портфеля (торгового счета) Отображение счета может зависеть от параметра отчета <i>Раздельно по счетам</i> — если параметр (флаг) присутствует в отчете и не включен, значение поля пустое.
BPV	Изменение стоимости инструментов портфеля при изменении доходности на один базисный пункт вверх.