

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 дату шага
- 2. RoR шага — доходность портфеля в диапазоне дат шага
- 3. P&L Cumulative — наращение P&L с начала отчета по дату 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

Отчет содержит поля:

Step	Дата шага
P&L Step	Доход портфеля, рассчитанный с даты предыдущего шага периодичности расчета. С даты по дату
P&L Cuml	Кумулятивный доход портфеля, рассчитанный с даты начала отчета по дату шага периодичности расчета: С даты по дату шага
Value	Величина рыночной стоимости на дату шага

Value Chng %	Величина изменения рыночной стоимости портфеля с даты предыдущего шага периодичности расчета, рассчитанная в процентах. С даты по дату Равно $\frac{V_{\text{портфеля}}(t) - V_{\text{портфеля}}(t_{\text{пред}})}{V_{\text{портфеля}}(t_{\text{пред}})} \times 100\%$
ROR Step	Доходность портфеля, рассчитанная с даты предыдущего шага периодичности расчета. С даты по дату
ROR Cuml	Кумулятивная доходность портфеля, рассчитанная с даты начала отчета по дату шага периодичности расчета: С даты по дату шага