

Методология расчета доходности портфелей робо-сервисов

FinEx Дата: 31.03.2021

Цель исследования: Определить текущую историческую аннуализированную доходность по сервисам ФинЭкс Плюс с момента запуска. Методология исследования:

- 1) Для расчета использовались активные портфели, открытые в сервисах ФинЭкс Плюс с момента запуска и по 01.12.2020 года.
- 2) Стоимости портфелей в USD были переведены в рубли на дату расчета.
- 3) Доходность портфелей в 18,5% (в годовых) рассчитывалась как средняя арифметическая аннуализированных доходностей каждого портфеля, рассчитанных по следующей формуле:

$$R_{annualized} = \frac{\text{Текущая стоимость портфеля}}{\sum \text{пополнений} + \text{первоначальное пополнение} - \text{снятия}} \cdot \frac{365}{N \text{ дней с первого пополнения}} - 1$$