# Распределение бумаг по группам на 2/08/19

| Красная | Оранжевая | Серая | Желтая | Зеленая |
|---|---|---|---|---|
| Новатэк | М.Видео | МТС – | ЦМТ (Х8) | ЭнелРос (Х9) |
| Распадская | ММК | ФСК – | Телеграф (Х2) | |
| ГМК НорНикель – | СевСталь | Сургутнефтегаз(об) – | Мостотрест | |
| Лукойл | Сбербанк (об.) | Не рекомендованы для долгосрочной торговли | ТГК-2 | |
| Татнефть(пр.) | Сбербанк(пр.) | | Мечел (об.) | |
| Полюс Золото | НЛМК | ТПлюс(Х5) | СОЛЛЕРС | |
| | Акрон | Транснефть | ТМК ! | |
| | ИнтерРао | ТГК-1 | РусГидро | |
| | Татнефть(об.) | +Мосэнерго | Ютэйр | |
| | Россети | НМТП | Магнит | |
| | ДВМП (Х1) | КАМАЗ | МРСК Центр | |
| | Роснефть | Иркутскэнерго | МРСК Юга | |
| | Газпром | КМЗ | | |
| | ОГК-2 | РОСИНТЕР (Х7) | | |
| | | Ростелеком(об.) | | |
| | | Аэрофлот | | |
| | | Система | | |
| | | ВТБ | | |
| | | Ашинский МЗ(Х6) | | |
| | | Сургутнефтегаз(пр.) | | |
| | | Уралкалий | | |
| Кол-во 6 | Кол-во 14 | Кол-во 19 | Кол-во 12 | Кол-во 2 |

Всего 53 бумаг

# Распределение бумаг по группам на 9/08/19

| Красная | Оранжевая | Серая | Желтая | Зеленая |
|---|---|---|---|---|
| Новатэк | М.Видео | МТС – | ЦМТ (Х8) | ЭнелРос |
| Распадская | ММК | ФСК – | Телеграф (Х2) | (Х9) |
| ГМК НорНикель – | СевСталь | Сургутнефтегаз(об) – | Мостотрест | Магнит |
| Лукойл | Сбербанк (об.) | Не рекомендованы для долгосрочной торговли | ТГК-2 | |
| Татнефть(пр.) | Сбербанк(пр.) | | Мечел (об.) | |
| Полюс Золото | НЛМК | ТПлюс(Х5) | СОЛЛЕРС | |
| | ИнтерРао | Транснефть | ТМК ! | |
| | Татнефть(об.) | ТГК-1 | РусГидро | |
| | Россети | +Мосэнерго | Ютэйр | |
| | Роснефть | НМТП | МРСК Центр | |
| | Газпром | КАМАЗ | МРСК Юга | |
| | | Иркутскэнерго | | |
| | | КМЗ | | |
| | | РОСИНТЕР (Х7) | | |
| | | Ростелеком(об.) | | |
| | | Аэрофлот | | |
| | | Система | | |
| | | ВТБ | | |
| | | Ашинский МЗ(Х6) | | |
| | | Сургутнефтегаз(пр.) | | |
| | | ДВМП (Х1) | | |
| | | ОГК-2 | | |
| Кол-во 6 | Кол-во 11 | Кол-во 20 | Кол-во 11 | Кол-во 3 |

Всего 51 бумаг

# Состояние портфеля 9/08/19

| | Название бумаги | Цена приобретения | Текущая цена | % изменения текущей цены к цене приобретения | % вложенного капитала от запланированного для данного инструмента | | % вложенного капитала от всего размера средств используемых на рынке акций | | % актива в стоимости портфеля | Целевой уровень доходности |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | В масштабах средств 2013 г. | В масштабах средств 2017 г. | В масштабах средств 2013 г. | В масштабах средств 2017г. | | |
| 1 | Система | 7,30 | 11,84 | +62,2% | 45% | 15% | 1,35% | 0,45% | 3,29% | >600% |
| 2 | Ростелеком | 71,11 | 81,7 | + 14,9% | 210% + дивиденды ОГК-2 2017 + дивиденды 2018 | 72% *с учетом дивидендов* 97% | 6,3% | 2,1% | 16,77% | >350% |
| 3 | Камаз (Х3) | 35,6 | 54,1 | + 51,9% | 50% | 17% | 1,5% | 0,5% | 3,88% | |
| 4 | ТПлюс(Х5) | 0,51 | 0,7 | + 37,3% | 75% | 25% | 2,25% | 0,75% | Не учитывается в стоимости биржевого портфеля | |
| 5 | Ашинский МЗ (Х6) | 3,85 | 4,42 | + 14,8% | 80% | 27% | 2,4% | 0,8% | 5,11% | |
| 6 | РОСИНТЕР (Х7) | 55,7 | 69 | + 23,9% | 80% | 27% | 2,4% | 0,8% | 5,77% | |
| 7 | ОГК-2 | 0,361 | 0,473 | + 31% | 220% + дивиденды 2017 | 74% *с учетом дивидендов* 83% | 6,6% | 2,2% | 16,25% | |
| 8 | ТМК | 58,1 | 56,12 | -3,4% | 230%+часть дивидендов 2018-19 | 77% *с учетом дивидендов 96%* | 6,9% | 2,3% | 13,7% | |
| 9 | ЦМТ(Х8) | 6,45 | 7,48 | +16% | 80% | 27% | 2,4% | 0,8% | 3,46% | |
| 10 | Ютэйр | 7,32 | 6,71 | - 8,7% | 180% | 61% | 5,3% | 1,8% | 4,71% | |
| 11 | Русгидро | 0,554 | 0,55 | - 0,7% | 200% | 66% | 6% | 2% | 9,14% | |
| 12 | Магнит | 3584 | 3572 | - 0,3% | 95% | 32% | 2,85% | 0,95% | 4,95% | |
| 13 | ВТБ | 0,03572 | 0,0407 | +14% | 95% | 32% | 2,85% | 0,95% | 4,27% | |
| 14 | Энелрос | 0,954 | 0,92 | - 3,3% | 125% | 42% | 4,15% | 1,25% | 5,75% | |
| 15 | Соллерс | 346,5 | 309 | - 10,8% | 35% | 12% | 1,25% | 0,35% | 0,79% | |
| 16 | Х9 | | | -3,1% | 55% | 19% | 1,65% | 0,55% | 2,24% | |
| | Всего: | | | | 190% | 62,35% | 57% | 19% | | |
| Доходность портфеля | | | | 22% | рассчитываемая как отношение стоимости активов к размеру вложенных средств, выраженное в процентах | | | | | |

# Целевые уровни покупки на 9/08/19

Желтая таблица

| | Цена закр. | Спрос | |
|---|---|---|---|
| ЦМТ ао [МБ ФР: Т+: Ак | 7,52 | 7,40 | ЦМТ< 7 |
| Телеграф [МБ ФР: Т+: А | 19,25 | 19,05 | Телеграф < 12 |
| Мечел ао [МБ ФР: Т+: А | 62,23 | 62,02 | Мечел < 55 |
| Мостотрест [МБ ФР: Т+ | 89,30 | 88,80 | Мостотрест < 82 |
| ТГК-2 [МБ ФР: Т+: Акци | 0,002390 | 0,002350 | ТГК-2 < 0,002 |
| СОЛЛЕРС [МБ ФР: Т+: | 310,0 | 308,0 | Соллерс < 298 |
| ТМК ао [МБ ФР: Т+: Аки | 56,20 | 56,04 | ТМК < 53 |
| РусГидро [МБ ФР: Т+: А | 0,5520 | 0,5481 | Русгидро < 0,5 |
| ЮТэйр ао [МБ ФР: Т+: А | 6,72 | 6,64 | ЮТэйр < 6,6 |
| МРСК Центр [МБ ФР: Т | 0,2694 | 0,2690 | МРСК Центр < 0,26 |
| МРСКЮга ао [МБ ФР: Т | 0,06170 | 0,06100 | МРСК Юга < 0,05 |

Зеленая таблица

| | Цена закр | Спрос | |
|---|---|---|---|
| Магнит ао [МБ ФР: Т+: А | 3 582,5 | 3 557,0 | Магнит < 3400 |
| ЭнелРос ао [МБ ФР: Т+: | 0,9210 | 0,9175 | ЭнелРос < 0,915 |