

Распределение бумаг по группам на 21/06/19

Красная

Новатэк
Распадская
ГМК НорНикель –
Лукойл
Татнефть(пр.)
Полюс Золото

Кол-во 6

Оранжевая

М.Видео
ММК
СевСталь
Сбербанк (об.)
Сбербанк(пр.)
НЛМК
Акрон
ИнтерРао
Сургутнефтегаз(пр.)
Татнефть(об.)
Россети
ДВМП (X1)
Роснефть
Газпром
ОГК-2

Кол-во 15

Серая

МТС –
ФСК –
Сургутнефтегаз(об) –
Не рекомендованы для
долгосрочной торговли

ТПлюс(X5)
Транснефть
ТГК-1
+Мосэнерго
НМТП
КАМАЗ
Иркутскэнерго
КМЗ
РОСИНТЕР (X7)
ЭнелРос
Ростелеком(об.)

Кол-во 14

Желтая

ЦМТ (X8)
Телеграф (X2)
Мостотрест
ТГК-2
Аэрофлот
Мечел (об.)
Система
СОЛЛЕРС
Уралкалий
ТМК
РусГидро
Ютэйр
ВТБ
Ашинский МЗ(X6)
Магнит

Кол-во 15

Зеленая

(X9)

Кол-во 1

Всего 51
бумаг

Распределение бумаг по группам на 28/06/19

Красная

Новатэк
Распадская
ГМК НорНикель –
Лукойл
Татнефть(пр.)
Полюс Золото

Кол-во 6

Оранжевая

М.Видео
ММК
СевСталь
Сбербанк (об.)
Сбербанк(пр.)
НЛМК
Акрон
ИнтерРао
Сургутнефтегаз(пр.)
Татнефть(об.)
Россети
ДВМП (X1)
Роснефть
Газпром
ОГК-2

Кол-во 15

Серая

МТС –
ФСК –
Сургутнефтегаз(об) –
Не рекомендованы для
долгосрочной торговли

Т Плюс(X5)
Транснефть
ТГК-1
+Мосэнерго
НМТП
КАМАЗ
Иркутскэнерго
КМЗ
РОСИНТЕР (X7)
ЭнелРос
Ростелеком(об.)
Аэрофлот

Кол-во 15

Желтая

ЦМТ (X8)
Телеграф (X2)
Мостотрест
ТГК-2

Мечел (об.)
Система
СОЛЛЕРС
Уралкалий
ТМК
РусГидро
Ютэйр
ВТБ
Ашинский МЗ(X6)
Магнит
МРСК Центр
МРСК Юга

Кол-во 16

Зеленая

(X9)

Кол-во 1

Всего 53
бумаг

Состояние портфеля 28/06/19

	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	9,94	+ 36,2%	45%	15%	1,35%	0,45%	2,71%	>600%
2	Ростелеком	71,11	80,8	+ 13,6%	210% + дивиденды ОГК-2 2017 + дивиденды 2018	72%	6,3%	2,1%	16,38%	>350%
3	Камаз (X3)	35,6	61	+ 71,3%	50%	17%	1,5%	0,5%	4,3%	
4	ТПлюс(X5)	0,51	0,7	+ 37,3%	75%	25%	2,25%	0,75%	Не учитывается в стоимости биржевого портфеля	
5	Ашинский МЗ (X6)	3,85	4,19	+ 8,8%	80%	27%	2,4%	0,8%	4,9%	
6	РОСИНТЕР (X7)	55,7	70,4	+ 26,4%	80%	27%	2,4%	0,8%	5,86 %	
7	ОГК-2	0,361	0,548	+ 51,8%	220% + дивиденды 2017	74%	6,6%	2,2%	18,7%	
8	ТМК	58,92	60,18	+ 2,1%	230%+часть дивидендов 2018	77%	6,9%	2,3%	12,23%	
9	ЦМТ(X8)	6,45	7,1	+10%	80%	27%	2,4%	0,8%	3,21%	
10	Ютэйр	7,47	6,89	- 7,7%	165%	55%	4,95%	1,65%	3,98%	
11	Русгидро	0,554	0,6077	+9,7%	200%	66%	6%	2%	9,97%	
12	Уркалий	85,05	87,86	+ 3,3%	75% +часть дивидендов 2018	25%	2,25%	0,75%	4,44%	
13	Магнит	3584	3773	+ 5,3%	95%	32%	2,85%	0,95%	5,12%	
14	ВТБ	0,03572	0,04018	+12,5%	95%	32%	2,85%	0,95%	4,12%	
15	Энелрос	0,977	1,144	+ 17,1%	45%	16%	1,35%	0,45%	1,21%	
16	Соллерс	346,5	314	- 9,9%	35%	12%	1,25%	0,35%	0,97%	
17	X9			+0,2%	55%	19%	1,65%	0,55%	1,95%	
	Всего:				183%	61%	54,9%	18,3%		

Доходность портфеля

33,8%

рассчитываемая как отношение стоимости активов к размеру вложенных средств, выраженное в

Целевые уровни покупки на 28/06/19

Желтая таблица	Цена закр.	Спрос
ЦМТ ао [МБ ФР: Т+: Акц	7,10	7,04
Телеграф [МБ ФР: Т+: А	16,95	16,80
Мечел ао [МБ ФР: Т+: А	67,01	67,10
Аэрофлот [МБ ФР: Т+: А	102,32	101,46
Мостотрест [МБ ФР: Т+	91,10	90,75
ТГК-2 [МБ ФР: Т+: Акци	0,002520	0,002505
СОЛЛЕРС [МБ ФР: Т+: .	318,5	316,5
ТМК ао [МБ ФР: Т+: Акц	60,14	60,12
РусГидро [МБ ФР: Т+: А	0,6034	0,6074
Уркалий-ао [МБ ФР: Т+	87,92	87,84
Система ао [МБ ФР: Т+	9,740	9,917
Ашинский МЗ [МБ ФР: Т	4,105	4,380
ВТБ ао [МБ ФР: Т+: Акц	0,040130	0,040100
ЮТэйр ао [МБ ФР: Т+: А	6,85	6,82
Магнит ао [МБ ФР: Т+: .	3 791,0	3 754,0
МРСК Центр [МБ ФР: Т	0,2942	0,2964
МРСК Юга ао [МБ ФР: Т	0,06820	0,06800

ЦМТ < 7
Телеграф < 12
Мечел < 55
Аэрофлот < 75
Мостотрест < 82
ТГК-2 < 0,002
Соллерс < 298
ТМК < 53
Русгидро < 0,5
Уркалий < 85
Система < 8,5
Ашинский МЗ < 3,6
ВТБ < 0,038
ЮТэйр < 6,6
Магнит < 3600
МРСК Центр < 0,26
МРСК Юга < 0,05

