

Анализ портфеля акций

ПРЕЗЕНТАЦИЯ ПОДГОТОВЛЕНА СТУДЕНТОМ ГРУППЫ М-1515

ХМЕЛЕВСКИМ АНДРЕЕМ

Приобретаемые акции на момент 1 октября 2018 года

Название	Цена акции (01.10.2018)	Кол-во акций	Денежные средства	Доля в портфеле
Лукойл	5016	159	800000	0,4
Яндекс	2134	187	400000	0,2
Сургутнефтегаз	27,8	7194	200000	0,1
Сбербанк	204,2	979	200000	0,1
Алроса	106,2	3766	400000	0,2
Всего			2000000	X

Описание компаний, акции которых были приобретены

- ▶ ПАО «ЛУКОЙЛ» - российская нефтяная компания. До 2007 г. являлась крупнейшей по объёму добычи нефтяной компании в России.
- ▶ «Яндекс» - российская транснациональная компания, зарегистрированная в Нидерландах и владеющая одноимённой системой поиска в Сети, интернет-порталами и службами в нескольких странах. Наиболее заметное положение занимает на рынках России, Турции, Белоруссии и Казахстана.
- ▶ ПАО «Сургутнефтегаз» - одна из крупнейших российских нефтяных и газодобывающих компаний.
- ▶ ПАО «Сбербанк» - российский финансовый конгломерат, крупнейший транснациональный и универсальный банк России, Центральной и Восточной Европы. Контролируется Центральным банком Российской Федерации, которому принадлежит 50% уставного капитала плюс одна голосующая акция.
- ▶ ПАО «Алроса» - российская группа алмазодобывающих компаний, занимающая ведущие позиции в мире по объёму добычи алмазов. Корпорация занимается разведкой месторождений, добычей, обработкой и продажей алмазного сырья. Основная деятельность сосредоточена в Якутии, а также в Архангельской области и Африке.

Неделя 1 (8 октября)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	4966	792025,5183
Яндекс	2170,5	406841,612
Сургутнефтегаз	27,47	197625,8993
Сбербанк	191,85	187904,0157
Алроса	104	391713,7476
Всего		1976110,793

- На этой неделе все акции следовали рыночному тренду;
- Доходность портфеля за первую неделю составила -1,19%.

Неделя 2 (15 октября)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	4753	758054,2265
Яндекс	2131,5	399531,3964
Сургутнефтегаз	26,97	194028,777
Сбербанк	191,38	187443,6827
Алроса	97,4	366854,9906
Всего		1905913,073

- На этой неделе все акции следовали рыночному тренду
- Доходность инвестиционного портфеля составила -4,7%

Неделя 3 (22 октября)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	4673,5	745374,8006
Яндекс	1755	328959,7001
Сургутнефтегаз	27,03	194460,4317
Сбербанк	180,7	176983,3497
Алроса	96,6	363841,8079
Всего		1809620,09

- На этой неделе все акции, кроме акций Яндекса, следовали рыночному тренду;
- Акции Яндекса за одну неделю потеряли 17,66% стоимости на фоне слухов о поглощении Газпромом;
- Доходность инвестиционного портфеля составила -9,52%

Неделя 4 (29 октября)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	4914	783732,0574
Яндекс	1862,5	349109,6532
Сургутнефтегаз	26,43	190143,8849
Сбербанк	185,14	181332,0274
Алроса	95,77	360715,6309
Всего		1865033,254

- Акции Яндекса частично компенсировали спад, который произошел на прошлой неделе;
- Доходность инвестиционного портфеля составила -6,75%

Неделя 5 (5 ноября)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	5055	806220,0957
Яндекс	2002	375257,732
Сургутнефтегаз	27	194244,6043
Сбербанк	197,8	193731,6357
Алроса	98,52	371073,4463
Всего		1940527,514

- Данная неделя характеризовалась ростом биржевых индексов РТС и ММВБ, а также всех ценных бумаг, входящих в инвестиционный портфель (доходность портфеля возросла с -6,75% до -2,97%, но до сих пор является отрицательной)

Неделя 6 (12 ноября)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	5129	818022,3285
Яндекс	1886	353514,5267
Сургутнефтегаз	26,94	193812,9496
Сбербанк	196,82	192771,7924
Алроса	103,16	388549,9058
Всего		1946671,503

- На 6 неделе произошло снижение биржевых индексов, при этом также произошло снижение большинства акций в инвестиционном портфеле, за исключением Лукойла и Алросы, которые продолжили инертный рост с прошлой недели
- Доходность изменилась с -2,97% до -2,67%

Неделя 7 (19 ноября)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	4846	772886,7624
Яндекс	1924,5	360731,0216
Сургутнефтегаз	27,14	195251,7986
Сбербанк	198	193927,522
Алроса	100,51	378568,7382
Всего		1901365,843

- На данной неделе продолжился спад биржевых индексов, а также большинства акций в инвестиционном портфеле (Яндекс рос против рынка, однако до сих пор остался самой убыточной ценной бумагой в портфеле)
- Доходность портфеля относительно периода покупки составила -4,93%

Неделя 8 (26 ноября)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	4607	734768,74
Яндекс	1878,5	352108,716
Сургутнефтегаз	26,71	192158,2734
Сбербанк	191,7	187757,1009
Алроса	100,5	378531,0734
Всего		1845323,904

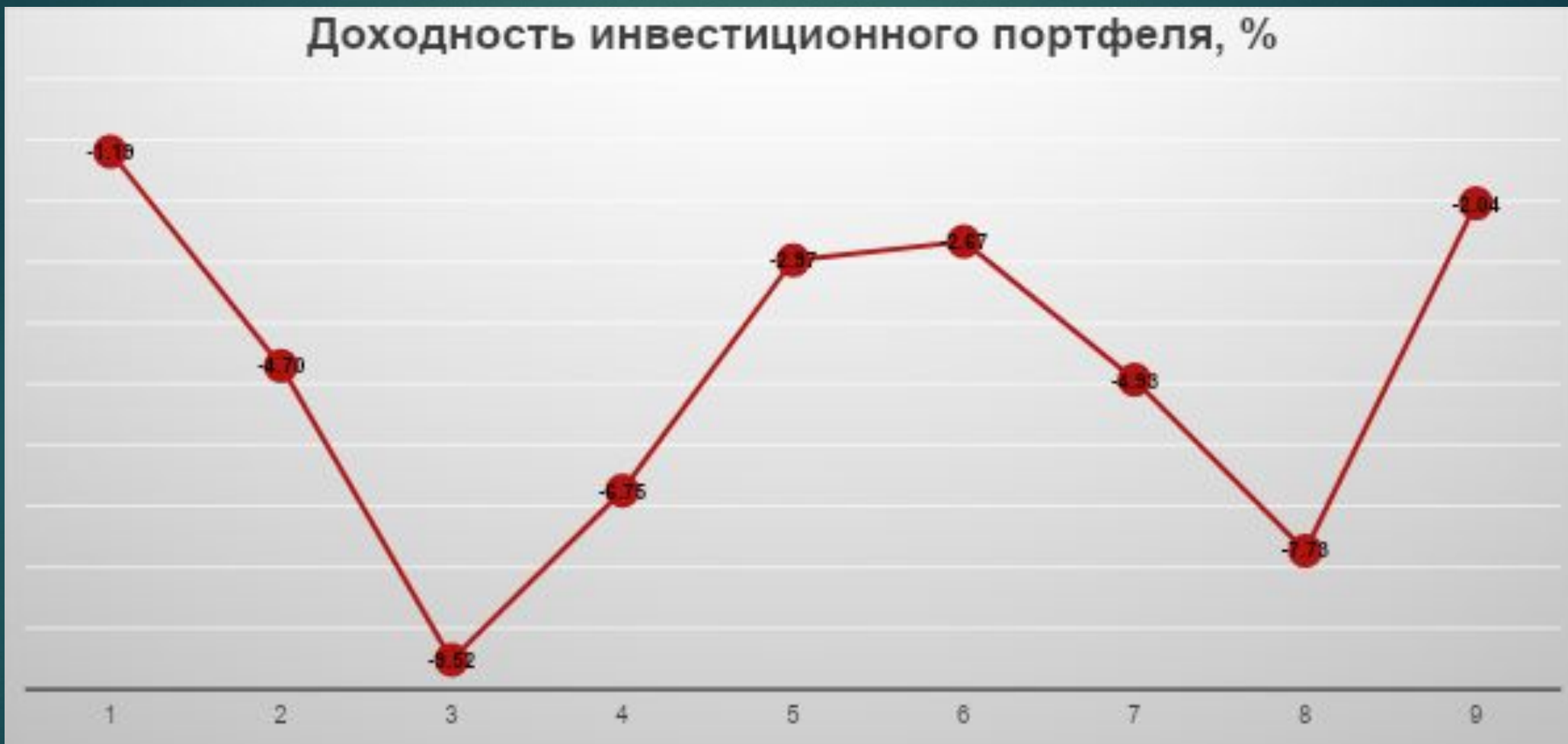
- На предпоследней неделе все ценные бумаги, входящие в инвестиционный портфель, продолжили свое падение в едином тренде с биржевыми индексами
- Доходность портфеля составила -7,73%

Неделя 9 (3 декабря)

Компания	Цена акций	Стоимость портфеля
Лукойл	5098,5	813157,8947
Яндекс	1989	372820,9934
Сургутнефтегаз	27,83	200215,8273
Сбербанк	200,3	196180,2155
Алроса	100,04	376798,4934
Всего		1959173,424

- На последней неделе произошел разворот тренда, при котором рассматриваемые биржевые индексы и все ценные бумаги, входящие в инвестиционный портфель, показали значительный рост
- Доходность портфеля на конец рассматриваемого периода остановилась на отметке -2,04%

График доходности портфеля



Анализ корреляции и ковариации ценной бумаги и инвестиционного портфеля в целом, а также инвестиционного портфеля в целом и биржевых ИНДЕКСОВ

Компания	Ковариация	Корреляция
YNDX	22,336	0,747
LKOH	18,295	0,897
SNGS	4,685	0,585
SBER	13,351	0,802
ALRS	5,240	0,433

	Ковариация	Корреляция
PTC	10,05	0,73
ММВБ	11,98	0,91

Вывод: положительная и достаточно близкая к единице корреляция готовит о слабой диверсификации данного инвестиционного портфеля, что приводит к выводу о том, что необходимо изменить структуру и состав акций в портфеле. Однако полученные данные нельзя назвать в полной степени объективными, так как в рассматриваемом периоде наблюдался спад всех крупных мировых фондовых рынков, что привело к падению акций большинства компаний мира.

Спасибо за внимание!