

АНАЛИЗ ПОРТФЕЛЯ АКЦИЙ

ВЫПОЛНИЛА СТУДЕНКА

Группы М-1515

ШИШМАРЕВА СВЕЛАНА

ПОРТФЕЛЬ АКЦИЙ (1 ОКТЯБРЯ 2018 Г.)

	Стоимость 1 акции, руб.	Кол-во	Итого
ALRS	106,63	400	42 652
GMKN	11 307	70	791 490
SBER	204,2	378	77 187,6
YNDX	2134	18	38 412
URKA	83,75	601	50 333,75
Итого			1 000 075

ИНФОРМАЦИЯ О КОМПАНИЯХ

- **ПАО АК «АЛРОСА» (ALRS)** - российская группа алмазодобывающих компаний, занимающая лидирующую позицию в мире по объёму добычи алмазов (по состоянию на 2017 год)
- **ПАО "ГМК "Норильский никель» (GMKN)** - российская горно-металлургическая компания, крупнейший в мире производитель палладия, один из крупнейших производителей никеля, платины и меди
- **ПАО «Сбербанк» (SBER)** - российский финансовый конгломерат, крупнейший транснациональный и универсальный банк России, Центральной и Восточной Европы.
- **ПАО «Яндекс» (YNDX)** – российская транснациональная компания, зарегистрированная в Нидерландах и владеющая одноимённой системой поиска в Сети, интернет-порталами и службами в нескольких странах.
- **ПАО «Уралкалий» (URKA)** - российская компания, крупнейший в мире производитель калийных удобрений.

1 НЕДЕЛЯ (1-5 ОКТЯБРЯ 2018 Г.)

5 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	103,2	41600
GMKN	11 292	792470
SBER	187,2	72519,3
YNDX	2143	39069
URKA	81,6	48681
Итого		994339,3

Доходность портфеля составила – -1,001249062
Наблюдается снижение портфеля на 9 977,8 руб.

2 НЕДЕЛЯ (8-12 ОКТЯБРЯ 2018 Г.)

12 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	97	38800
GMKN	11 170	781900
SBER	191,85	72519,3
YNDX	2140	38520
URKA	86,45	51956,45
Итого		983695,75

Доходность портфеля составила – 0,42476406
Наблюдается снижение портфеля на 16379,25 руб.

3 НЕДЕЛЯ (15-19 ОКТЯБРЯ 2018 Г.)

19 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	99,28	39712
GMKN	11378	796460
SBER	183,8	69476,4
YNDX	1790	32220
URKA	85,25	51235,25
Итого		989103,65

Доходность портфеля составила – -1,054707312
Наблюдается снижение портфеля на 10975,35 руб.

4 НЕДЕЛЯ (22-26 ОКТЯБРЯ 2018 Г.)

26 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	94,6	37840
GMKN	10650	745500
SBER	181	68418
YNDX	1761,5	31707
URKA	84	50484
Итого		933949

Доходность портфеля составила – -2,35793171
Наблюдается снижение портфеля на 66126 руб.

5 НЕДЕЛЯ (22 ОКТЯБРЯ – 2 НОЯБРЯ 2018 Г.)

2 ноября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	101,6	40640
GMKN	11470	802900
SBER	192,6	72802,8
YNDX	1995	35910
URKA	262,2	157582,2
Итого		1109835

Доходность портфеля составила $-1,712508589$
Наблюдается увеличение портфеля на 109 760 руб.

6 НЕДЕЛЯ (6-9 НОЯБРЯ 2018 Г.)

9 ноября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	103,99	41596
GMKN	11689	818230
SBER	195,75	73993,5
YNDX	1921,5	34587
URKA	82,28	49450,28
Итого		1017856,78

Доходность портфеля составила – 0,445090666
Наблюдается увеличение портфеля на 17781,78 руб.

7 НЕДЕЛЯ (12-16 НОЯБРЯ 2018 Г.)

16 ноября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	99,9	39960
GMKN	11714	819980
SBER	199,26	75320,3
YNDX	1916	34488
URKA	84,2	50604,2
Итого		1020352

Доходность портфеля составила – -0,064571245
Наблюдается увеличение портфеля на 20277,48 руб.

8 НЕДЕЛЯ (19-23 НОЯБРЯ 2018 Г.)

23 ноября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	101,8	40720
GMKN	11954	836780
SBER	197,3	74579,4
YNDX	1898,5	34173
URKA	84,9	51024,9
Итого		1037277

Доходность портфеля составила – 0,442465862
Наблюдается увеличение портфеля на 37202,3 руб.

9 НЕДЕЛЯ (26-30 НОЯБРЯ 2018 Г.)

30 ноября	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	99,63	39852
GMKN	12738	891660
SBER	194	73332
YNDX	1965	35370
URKA	84	50484
Итого		1090698

Доходность портфеля составила – 0,062641328
Наблюдается увеличение портфеля на 90623 руб.

10 НЕДЕЛЯ (3 ДЕКАБРЯ 2018 Г.)

3 декабря	Цена акции	Стоимость портфеля
ALRS	100,04	40016
GMKN	12817	897190
SBER	200,3	75713,4
YNDX	1989	35802
URKA	85,36	51301,4
Итого		1100023

Доходность портфеля составила – 0,854935097
Наблюдается увеличение портфеля на 99 948 руб.



ГРАФИК ИЗМЕНЕНИЯ СУММЫ ПОРТФЕЛЯ

Доходность портфеля

1-5 окт	-1%
8-12 окт	-0,42%
15-19 окт	-1,05%
22-26 окт	-2,36%
29 окт-2 нояб	1,71%
6-9 нояб	-0,44%
12-16 нояб	-0,06%
19-23 нояб	0,44%
26-30 нояб	0,06%
3 дек.	0,86%

	С ММВБ	
	Ковариация	Корреляция
ALRS	0,227774332	0,046546448
GMKN	-1,902085067	-0,222566824
SBER	0,085682727	0,01636429
YNDX	0,442792269	0,034334442
URKA	-0,266212679	-0,080211445

	С ПОРТФЕЛЕМ	
	Ковариация	Корреляция
ALRS	0,605177522	0,206121908
GMKN	1,742700868	0,339870088
SBER	1,002235543	0,319031291
YNDX	1,542452774	0,199343209
URKA	0,26233401	0,131741258

	С РТС	
	Ковариация	Корреляция
ALRS	-0,12376707	-0,031602393
GMKN	1,29140927	0,188811086
SBER	1,351141315	0,322431711
YNDX	0,640043794	0,062011574
URKA	0,499111937	0,187905139

ВЫВОДЫ:

- По итогам двух месяцев наблюдений сумма портфеля увеличилась на 10% или на 99947,76 рублей. Прирост стоимости акций наблюдается только у двух эмитентов – **GMKN** и **URKA**, однако за счет того, что 79% акций было у **GMKN**, то стоимость портфеля увеличилась.
- Акции всех эмитентов имеют положительное значение ковариации и корреляции с портфелем, а это значит, что портфель нельзя назвать дифференцированным.
- В сравнении с биржевыми индексами отрицательное значение наблюдается у **ПАО «Уралкалий»**, **ПАО "ГМК "Норильский никель»** и **ПАО АК «АЛРОСА»**, на основании чего можно сделать вывод о независимости акций этих эмитентов от рыночных тенденций.
- Таким образом, снижение стоимости акций **ПАО АК «АЛРОСА»** связана с аварией на руднике "Мир" в Якутии, аналитики **ПАО «Сбербанк»** объясняют снижение котировок акций нервозностью рынка. Прошел слух о поглощении **ПАО «Яндекс»** Сбербанком, поэтому акции **YNDX** претерпели снижение. Из-за роста цен на палладий у **ПАО "ГМК "Норильский никель» (GMKN)** увеличилась цена на акции, еще одним положительным звеном портфеля стал **ПАО «Уралкалий»** благодаря будущему запуску двух проектов : открытие **Усть-Яйвинских** и **Половодовских** участков в **2020** году (на текущий момент эти проекты реализованы на 40%).

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!