

Анализ портфеля акций

Подготовила:
Загарских Юлия

Приобретаемые акции. 1.10.2018

Название	Цена акции	Кол-во	Сумма	Доля
Яндекс	2168	100	216800	0,04
Аэрофлот	106	1000	106000	0,43
Абрау-Дюрсо	150	626	93900	0,27
Газпром	162	500	81000	0,21
Лукойл	5022	100	502200	0,04

Краткое описание компаний

- **Яндекс** — российская транснациональная компания, зарегистрированная в Нидерландах и владеющая одноимённой системой поиска в Сети, интернет-порталами и службами в нескольких странах
- **Аэрофлот** - это одна из самых старых авиакомпаний мира и первая в России, которая за многолетнюю историю своего существования стала самой масштабной, современной и надёжной компанией в стране.
- **Абрау-Дюрсо** — российская компания, специализирующаяся на выпуске шампанского и игристого вина.
- **Газпром** — российская транснациональная энергетическая корпорация.
- **ЛУКОЙЛ** — российская нефтяная компания.

8.10.2018

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	2204,5	220450	1,68
Аэрофлот	104	104000	-1,89
Абрау-Дюрсо	145	90770	-3,33
Газпром	173,95	86975	7,38
Лукойл	5015	501500	-0,14

В целом, доходность акций обусловлена тенденциями рынка. Однако, акции Газпрома выросли больше остальных из-за благоприятного соотношения рублевых затрат и валютной выручки. Доходность портфеля: +0,74%

15.10.2018

На данной неделе мы видим, что акции всех компаний начинают падать. В целом, снижение доходности портфеля равно -3,36%, что является трендом рынка.

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	2133,5	213350	-1,59
Аэрофлот	100,6	100600	-5,09
Абрау-Дюрсо	140	87640	-6,67
Газпром	165,1	82550	1,91
Лукойл	4753	475300	-5,36

22.10.2018

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	1990	199000	-8,21
Аэрофлот	96,3	96300	-9,15
Абрау-Дюрсо	140	87640	-6,67
Газпром	162,3	81150	0,19
Лукойл	4725	472500	-5,91

На данной неделе видно сильное снижение стоимости акций компании Яндекс, что связано со слухами о покупке доли акций Сбербанком. Общая доходность портфеля: -5,95%

29.10.2018

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	1928,5	192850	-11,05
Аэрофлот	94	94000	-11,32
Абрау-Дюрсо	137	85762	-8,67
Газпром	153	76500	-5,56
Лукойл	4926,5	492650	-1,90

Видно сильное падение акций Аэрофлота, это связано с некоторыми факторами:

- финансовые результаты компании оказались хуже ожиданий инвесторов
- растет цена на авиакеросин на 20%.

Ожидается дальнейший упадок акций данной компании

5.11.2018

Акции Яндекса продолжают падать.

Аэрофлот пытается выровнять свою позицию на рынке.

Доходность портфеля: -2,5%, что почти в 2 раза меньше, чем 2 недели назад.

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	2019	201900	-6,87
Аэрофлот	103,8	103800	-2,07
Абрау-Дюрсо	142	88892	-5,33
Газпром	159	79500	-1,85
Лукойл	5192,5	519250	3,39

12.11.2018

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	1939	195839	-9,67
Аэрофлот	98	98098	-7,45
Абрау-Дюрсо	143	89661	-4,51
Газпром	154	77154	-4,75
Лукойл	5169	522069	3,96

На 6 неделе произошло очередное падение стоимости акций рассматриваемого портфеля, за исключением компании Лукойл, которая останется на таком же уровне.
Доходность портфеля: -4,5%

19.11.2018

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	1944	194400	-10,56
Аэрофлот	102,6	102600	-7,55
Абрау-Дюрсо	146	89518	-4,67
Газпром	155	77000	-4,94
Лукойл	4912	516900	2,93

Яндекс продолжает показывать самый плохой результат и тянуть общую статистику портфеля вниз. Доходность портфеля: -5%

26.11.2018

Все рассматриваемые ценные бумаги показывают падение. Даже Лукойл, который до этого показывал положительную динамику, показывается отрицательную доходность на рассматриваемой неделе.

Доходность портфеля:
-4,5%

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	1924	192400	-10,33
Аэрофлот	113,76	113760	-3,21
Абрау-Дюрсо	143	91396	-2,67
Газпром	151,79	77500	-4,32
Лукойл	4699,5	491200	-2,19

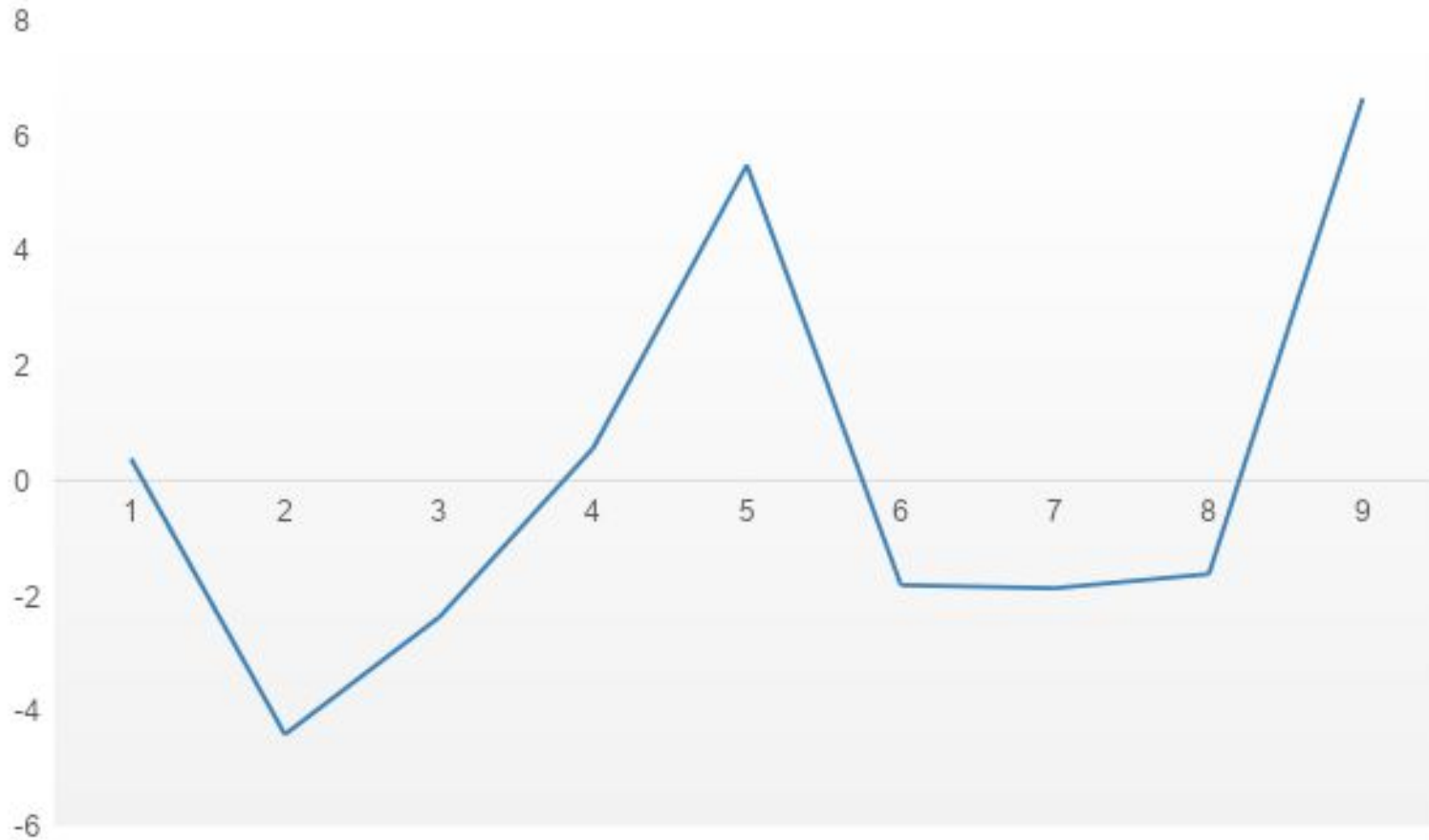
3.12.2018

Название	Цена акции	Сумма	Доходность
Яндекс	2019,5	201950	-11,25
Аэрофлот	115	115000	7,32
Абрау-Дюрсо	150	89518	-4,67
Газпром	166,6	75895	-6,30
Лукойл	5098,5	469950	-6,42

На последней неделе виден заметный рост акций компании Аэрофлот, и в целом, благодаря такому значительному росту, убыток портфеля казался меньше 4%.

Доходность портфеля:
-3,18%

Доходность портфеля



Анализ корреляции и ковариации

	Ковариация	Корреляция
Яндекс	0,2021	0,0121
Аэрофлот	-0,1624	-0,0126
Абрау-Дюрсо	5,5692	0,7581
Газпром	7,4722	0,9381
Лукойл	9,0249	0,9797

Вывод:

Положительное значение ковариации свидетельствует о том, что доходность ценной бумаги и портфеля изменяются в одном направлении.

Отрицательное значение ковариации говорит о том, что доходность ценной бумаги и доходность портфеля демонстрируют разнонаправленное движение.

Аэрофлот демонстрирует разнонаправленное движение с доходностью портфеля.

Доходной акций остальных компаний - однонаправленное движение

Спасибо за внимание!