

Анализ портфеля акций

ВЫПОЛНИЛА СТУДЕНТКА

ГРУППЫ М-1515

ЮШИНА АНАСТАСИЯ

Портфель акций (1 октября 2018 г.)

	Стоимость 1 акции	Кол-во	Итого
TRCN	4450	77	342650
GCHE	1170	254	297180
KROT	341	573	195393
ABRD	148	333	49284
BELU	622	158	98276
Итого			982783

Информация о компаниях

- **ПАО «ТрансКонтейнер»** – российский интермодальный контейнерный оператор, оперирующий крупнейшим в России парком контейнеров и фитинговых платформ, на всей сети железных дорог. У Общества есть уникальный опыт эффективного управления парком на более чем 300 000 маршрутов в России и за рубежом, а также реализации комплексных транспортно-логистических решений «от двери до двери» позволяющих доставить контейнерный груз в любой пункт назначения.
- **ПАО Группа «Черкизово»** – крупнейший в России производитель мясной продукции, ориентированный на потребителя. Группа занимает первое место по мясопереработке и совокупному производству мяса птицы, а также второе место – по производству свинины.
- **ПАО «Красный Октябрь»** — московская кондитерская фабрика, производит карамель, конфеты, шоколад и ирис. Одно из старейших предприятий в кондитерской отрасли России. С 2000 года входит в состав «Объединенные кондитеры».
- **ПАО «Абрау-Дюрсо»** — российская компания, специализируется на производстве шампанского и игристого вина. Расположена в поселке Абрау-Дюрсо Краснодарского края. «Абрау-Дюрсо» выпускает игристые вина классическим и преимущественно ускоренным методами.
- **ПАО BELUGA GROUP** — крупнейшая алкогольная компания в России. Лидер по производству водки и ликеро-водочных изделий на этом рынке, а также один из главных импортеров крепкого алкоголя в стране.

1 неделя (1-5 октября 2018 г.)

5 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4500	346500
GCHE	1125	285750
KROT	340	194820
ABRD	148	49284
BELU	602	95116
Итого		971470

Доходность портфеля составила -1,15%., наблюдается снижение стоимости портфеля на 11 313 руб. Наибольшее влияние оказало снижение стоимости акции GCHE на 3,85%.

2 неделя (8-12 октября 2018 г.)

12 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4485	345345
GCHE	1080	274320
KROT	341	195393
ABRD	141	46953
BELU	610	96380
Итого		958391

Доходность портфеля составила -2,48%.
Снижение стоимости портфеля на 24392 руб.
В большей степени за счет снижения стоимости акций GCHE на -7,69%.

3 неделя (15-19 октября 2018 г.)

19 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4530	348810
GCHE	1080	274320
KROT	308	176484
ABRD	141	46953
BELU	626	98908
Итого		945475

Доходность портфеля составила -3,8%.
Снижение стоимости портфеля на 37308 руб.
В больше степени за счет снижения стоимости акций KROT на -9,67%.

4 неделя (22-26 октября 2018 г.)

19 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4400	338800
GCHE	1070	271780
KROT	310	177630
ABRD	137	45621
BELU	598	94484
Итого		928315

Доходность портфеля составила -5,54%. Снижение стоимости портфеля на 54468 руб. В большей степени за счет снижения акций KROT на -9,1%. Наблюдается снижение стоимости всех акций.

5 неделя (22 октября-2 ноября 2018 г.)

19 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4450	342650
GCHE	1076	273304
KROT	309	177057
ABRD	134	44622
BELU	600	94800
Итого		932433

Доходность портфеля составила -5,12%.
Снижение стоимости портфеля на 50350 руб.
В больше степени за счет снижения стоимости акций ABRD на -9,46%.

6 неделя (6-9 ноября 2018 г.)

19 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4440	341880
GCHE	1084	275336
KROT	311	178203
ABRD	141	46953
BELU	598	94484
Итого		936856

Доходность портфеля составила -4,67%.
Снижение стоимости портфеля на 45927 руб.
В больше степени за счет снижения стоимости акций KROT на -8,8%.

7 неделя (12-16 ноября 2018 г.)

19 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4400	338800
GCHE	1116	283464
KROT	315	180495
ABRD	141	46953
BELU	600	94800
Итого		944512

Доходность портфеля составила -3,89%.
Снижение стоимости портфеля на 38271 руб.
В больше степени за счет снижения стоимости акций KROT на -7,62%.

8 неделя (19-23 ноября 2018 г.)

19 октября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4300	331100
GCHE	1092	277368
KROT	313	179349
ABRD	143	47619
BELU	556	87848
Итого		923284

Доходность портфеля составила -6,05%.
Снижение стоимости портфеля на 59499 руб.
В больше степени за счет снижения стоимости акций BELU на -10,6%.

9 неделя (26-30 ноября 2018 г.)

30 ноября	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4480	344960
GCHE	1092	277368
KROT	343,5	196825,5
ABRD	146	48618
BELU	460	72680
Итого		940451,5

Доходность портфеля составила -4,31%.
Снижение стоимости портфеля на 42331,5 руб.
В больше степени за счет снижения стоимости акций BELU на -26%.

10 неделя (3 декабря 2018 г.)

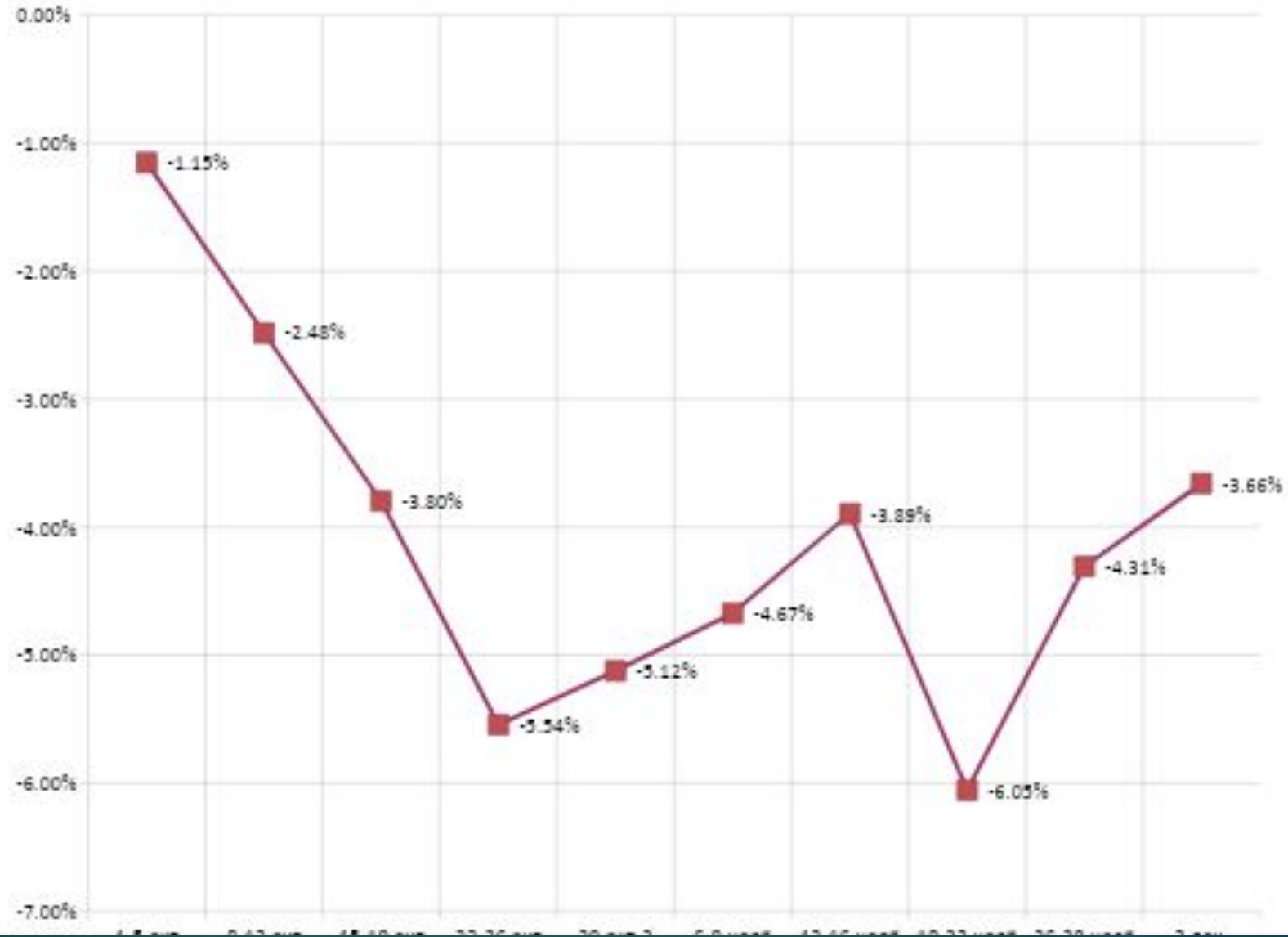
3 декабря	Цена акции	Стоимость портфеля
TRCN	4530	348810
GCHE	1092	277368
KROT	354	202842
ABRD	145	48285
BELU	440	69520
Итого		946825

Доходность портфеля составила -3,66%.
Снижение стоимости портфеля на 35958 руб.
В больше степени за счет снижения стоимости акций BELU на -29,3%.

Изменение доходности портфеля по неделям

Доходность портфеля	
1-5 окт	-1,15%
8-12 окт	-2,48%
15-19 окт	-3,80%
22-26 окт	-5,54%
29 окт-2 нояб	-5,12%
6-9 нояб	-4,67%
12-16 нояб	-3,89%
19-23 нояб	-6,05%
26-30 нояб	-4,31%
3 дек.	-3,66%

Доходность портфеля



С портфелем	Ковариация	Коррелляция
TRCN	0,296919344	0,192566256
GCHE	0,272486656	0,140448395
KROT	0,535431112	0,145137139
ABRD	0,107685032	0,051002594
BELU	-1,217507523	-0,198777145
С РТС		
TRCN	0,122257339	0,045516498
GCHE	0,113998999	0,033730656
KROT	0,232611714	0,036195847
ABRD	-0,17151858	-0,046633746
BELU	-2,493304397	-0,233680409
С ММВБ		
TRCN	-0,377450098	-0,112465766
GCHE	0,178140404	0,042184517
KROT	-2,530035676	-0,315079907
ABRD	-0,701357845	-0,152614462
BELU	4,264815211	0,319899914

ВЫВОДЫ

- ▶ 1. За два месяца наблюдений сумма инвестиционного портфеля снизилась на 3,66% или на 35958 руб. На протяжении всего периода наблюдалось снижение стоимости акций практически всех эмитентов, что может быть обусловлено спадом биржевых индексов.
- ▶ Отрицательное значение ковариации и корреляции с портфелем наблюдается только у эмитента BELU, что говорит о слабой диверсификации портфеля, так как все остальные акции изменяются в одном направлении с ним.
- ▶ Отрицательное значение ковариации и корреляции с биржевыми индексами наблюдается у большинства эмитентов (ABRD, BELU, KROT), что говорит об их независимости и разнонаправленности с индексами РТС и ММВБ.
- ▶ Данная тенденция может быть связана со значительным расширением ассортимента и производства, хорошим урожайным годом (ABRD и BELU), а также поддержкой государства, направленной на модернизацию заводов и производственных мощностей (KROT).

Спасибо за внимание!

