

# Анализ портфеля акций

Выполнила студентка группы М-1515  
Факультета Управления  
Базилева Софья



## Информация о компаниях

- Публичное акционерное общество «Распадская» (RASP) - российская угольная компания.
  - ПАО «НПО Наука» (NAUK) - российское промышленное предприятие, занимающееся разработкой и производством систем кондиционирования воздуха, систем автоматического регулирования давления летательных аппаратов, систем жизнеобеспечения космических аппаратов и входящих в них агрегатов.
  - ПАО «Уралкалий» (URKA) - российская компания, крупнейший в мире производитель калийных удобрений.
  - «Магнит» (MGNT) – российская компания розничной торговли и одноимённая сеть продовольственных магазинов
- «Мобильные ТелеСистемы» (MTSS) - российская телекоммуникационная компания, оказывающая услуги в России и странах СНГ под торговой маркой «МТС»

Портфель на момент покупки( 1 октября)			
Эмитенты	Стоимость 1 акции	Кол-во	Итого
RASP	117,32	2835	332.602
NAUK	423	793	335.439
URKA	83,75	980	82.075
MGNT	3825	30	114.750
MTSS	274,7	492	135.152
Сумма			1.000.019

01.ОКТ	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	117,32	2835	332602,2
NAUK	423	793	335439
URKA	83,75	980	82075
MGNT	3825	30	114750
MTSS	274,7	492	135152,4
			1000019

08.ОКТ	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	123,11	2835	349016,9
NAUK	429	793	340197
URKA	81	980	79380
MGNT	3771	30	113130
MTSS	269,9	492	132790,8
			1014515

15 ОКТ	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	124,35	2835	352532,3
NAUK	414	793	328302
URKA	83,75	980	82075
MGNT	3560	30	106800
MTSS	269,65	492	132667,8
			1002377

22 ОКТ	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	120	2835	340200
NAUK	380	793	301340
URKA	85,5	980	83790
MGNT	3487	30	104610
MTSS	264,6	492	130183,2
			960123,2

29 ОКТ	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	119,65	2835	339207,8
NAUK	360	793	285480
URKA	84	980	82320
MGNT	3541	30	106230
MTSS	258,9	492	127378,8
			940616,6

12.НОЯ	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	119,85	2835	339774,75
NAUK	358	793	283894
URKA	82,22	980	80575,6
MGNT	3656	30	109680
MTSS	265,95	492	130847,4
			944771,75

19.НОЯ	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	141	2835	399735
NAUK	349	793	276757
URKA	84,6	980	82908
MGNT	3500	30	105000
MTSS	266,3	492	131019,6
			995419,6

26 ноя	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	125,5	2835	355792,5
NAUK	344	793	272792
URKA	85	980	83300
MGNT	3490	30	104700
MTSS	247,5	492	121770
			938354,5

3 дек	СТОИМОСТЬ	КОЛ-ВО	Сумма
RASP	126,86	2835	359648,1
NAUK	330	793	261690
URKA	85,36	980	83652,8
MGNT	3500	30	105000
MTSS	248,7	492	122360,4
			932351,3

Дата	Сумма портфеля	Доходность портфеля
01.10.2018	1000018,6	
08.10.2018	1014514,65	1,450
15.10.2018	1002377,05	0,236
29.10.2018	940616,55	-5,940
12.11.2018	944771,75	-5,525
19.11.2018	995419,6	-0,460
26.11.2018	938354,5	-6,166
03.12.2018	932351,3	-6,767



## График изменения суммы портфеля



Дата	РТС	Изменение индекса	ММВБ	Изменение индекса
01.10.2018	1191,28		2472,22	
08.10.2018	1158,25	-2,77	2454,28	-0,73
15.10.2018	1146,72	-3,74	2389,05	-3,36
29.10.2018	1112,61	-6,60	2317,06	-6,28
12.11.2018	1114,75	-6,42	2393,81	-3,17
19.11.2018	1135,71	-4,66	2373,78	-3,98
26.11.2018	1084,17	-8,99	2308,5	-6,62
03.12.2018	1154,18	-3,11	2441,19	-1,26



	С ПОРТФЕЛЕМ	
	Ковариация	Корреляция
RASP	6,322337935	0,337281314
NAUK	21,69475957	0,809137614
URKA	-2,911907139	-0,510951444
MGNT	4,026151108	0,487989997
MTSS	8,517059954	0,808880015

	С РТС	
	Ковариация	Корреляция
RASP	2,284276613	0,191446524
NAUK	8,110001331	0,475195906
URKA	-1,036268363	-0,285666008
MGNT	1,972754271	0,375645385
MTSS	3,093303881	0,461531347

	С ММББ	
	Ковариация	Корреляция
RASP	0,415951260	0,0348977
NAUK	6,559297880	0,38473765
URKA	-1,631589522	-0,450249047
MGNT	2,969183294	0,565975513
MTSS	2,355589063	0,351830686



## Выводы:

1. По итогам двух месяцев наблюдений сумма портфеля снизилась на 6,7% или на 67 677,3 тысячи рублей. Прирост стоимости акций наблюдается только у двух эмитентов: ПАО «Распадская» и ПАО «Уралкалий».

2. Так как акции только одного эмитента (Уралкалий) имеют отрицательное значение ковариации и корреляции с портфелем, то портфель нельзя назвать дифференцированным, большая часть акций изменяется вместе с общим значением портфеля.

3. В сравнении с биржевыми индексами отрицательное значение наблюдается также только у ПАО «Уралкалий», на основании чего можно сделать вывод о независимости акций этого эмитента от рыночных тенденций.

4. Причинами такого поведения акций Уралкалия можно назвать будущий запуск двух проектов: открытие Усть-Яйвинских и Половодовских участков в 2020 году. На текущий момент проекты реализованы на 40%.



## Выводы:

5. Достаточно высокие темпы роста стоимости акций ПАО «Распадская» (8,13% на момент завершения наблюдения, наивысшая доходность за все время наблюдения -20,1%) можно объяснить введением в начале сентября в эксплуатацию лавы 4-10-31 с промышленными запасами 3,5 млн. тонн угля.