



АНАЛИЗ ПОРТФЕЛЯ АКЦИЙ

Проект подготовила Толкачева Ксения
Студентка группы М-1515



	Направленность	Стоимость 1 акции	Кол-во	Итого
ФСК ЕЭС	Электроэнергетика	0,1646	60753 4	100000
X5 RETAIL GROUP	Мультиформатная компания	1455	138	200000
Яндекс	Транснациональная компания	2174,5	92	200000
ММК	Металлургический комбинат	34,04	7345	250000
М.Видео	Розничная сеть техники	407,9	613	250000
Сумма				1000000

Информация о компаниях

- ФСК ЕЭС-российская энергетическая компания, основным видом деятельности которой является передача электроэнергии по Единой национальной электрической сети России. В этом виде деятельности компания является субъектом естественной монополии.
- X5 RETAIL GROUP-одна из ведущих российских мультиформатных продуктовых розничных компаний. Управляет магазинами нескольких торговых сетей: магазинами «у дома» под брендом «Пятёрочка», супермаркетами «Перекрёсток», гипермаркетами «Карусель» и магазинами «шаговой доступности» под брендом «Перекрёсток Экспресс».
- 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.
- ММК-российский металлургический комбинат в городе Магнитогорске Челябинской области. Один из крупнейших металлургических комбинатов СНГ и России.
- М.Видео-российская торговая сеть по продаже бытовой техники и электроники. По данным за 2016 год занимала первое место в России как по продажам на рынке бытовой техники и электроники, так и по доле занимаемых торговых площадей. Штаб-квартира расположена в Москве

Первая неделя (1 окт.-8 окт. 2018)

	1 окт.
ФСК ЕЭС	100000
X5 RETAIL GROUP	200000
Яндекс	200000
ММК	250000
М.Видео	250000
Сумма	1000000

	8 окт.
ФСК ЕЭС	91130,1
X5 RETAIL GROUP	190164
Яндекс	296420
ММК	351825,5
М.Видео	249437,8
Сумма	951022,6

*Доходность портфеля = (Стоимость ценных бумаг на момент расчета –
Стоимость ценных бумаг на момент покупки) / Стоимость ценных бумаг на
момент покупки*

1 неделя = (951022,6 - 1000000) / 1000000 = -0,049 =

-4,9%

Вторая неделя (15 октября)

	15 окт.
ФСК ЕЭС	91130,1
X5 RETAIL GROUP	190164
Яндекс	196420
ММК	351825,5
М.Видео	239437,8
Сумма	931022,6

- Доходность портфеля на 2 неделе *равна -0,7%*

Третья неделя (22 октября)

	22 окт.
ФСК ЕЭС	90130,1
X5 RETAIL GROUP	170164
Яндекс	166420
ММК	340825,5
М.Видео	236437,8
Сумма	857022,6

- Доходность портфеля на 3 неделе *равна* **-0,79%**

Четвертая неделя (29 октября)

	29 окт.
ФСК ЕЭС	85054,76
X5 RETAIL GROUP	175260
Яндекс	171304
ММК	368719
М.Видео	233491,7
Сумма	828215,74

- Доходность портфеля на 4 неделе *равна -0,3%*

Пятая неделя (5 ноября)

	5 ноября
ФСК ЕЭС	91130,1
X5 RETAIL GROUP	222732
Яндекс	183540
ММК	348887,5
М.Видео	249491
Сумма	560650,88

- Доходность портфеля на 5 неделе *равна* **-32,4%**

Шестая неделя (12 ноября)

	12 ноября
ФСК ЕЭС	78979,42
X5 RETAIL GROUP	144210
Яндекс	192740
ММК	341542,5
М.Видео	274011
Сумма	624948,56

- Доходность портфеля на 6 неделе *равна* **11,7%**

Седьмая неделя (19 ноября)

	19 ноября
ФСК ЕЭС	66828,74
X5 RETAIL GROUP	138690
Яндекс	191820
ММК	326852,5
М.Видео	258686
Сумма	673554,24

- Доходность портфеля на 7 неделе *равна 7%*

Восьмая неделя (26 ноября)

	26 ноября
ФСК ЕЭС	60753,4
X5 RETAIL GROUP	138000
Яндекс	189980
ММК	312162,5
М.Видео	252556
Сумма	702979,58

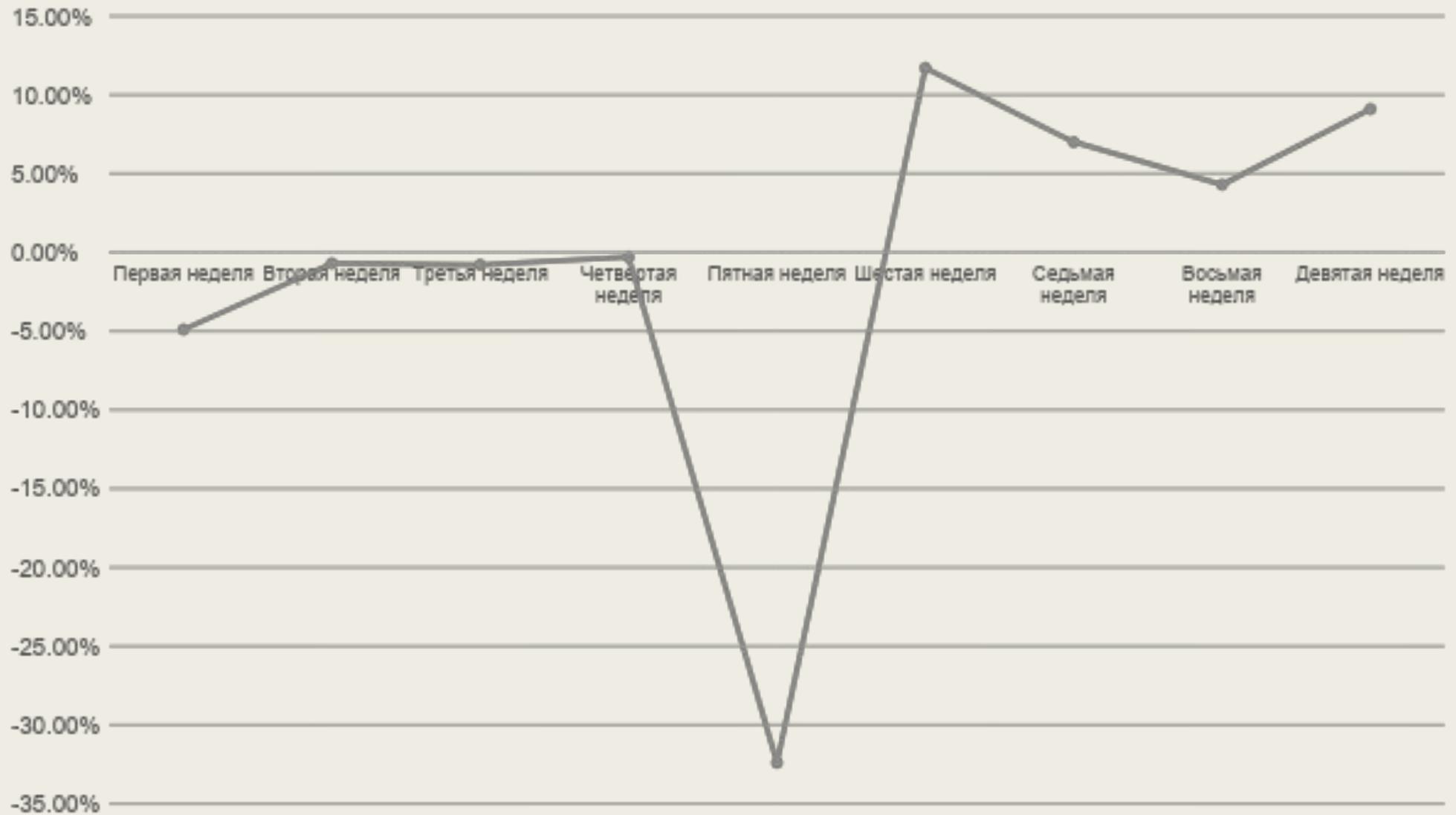
- Доходность портфеля на 8 неделе *равна* **4,3%**

Девятая неделя (3 декабря)

	3 декабря
ФСК ЕЭС	18226,02
X5 RETAIL GROUP	137862
Яндекс	184460
ММК	290127,5
М.Видео	238457
Сумма	787298,96

- Доходность портфеля на 9 неделе *равна* **9,1%**

Доходность портфеля



Корреляция и ковариация

	С ПОРТФЕЛЕМ	
	Ковариация	Корреляция
FSK YeES	-2,732934349	-0,25881606
X5 Retail Group NV	4,791131492	0,243883903
Yandex	5,16248546	0,186643165
MAGN	4,119575088	0,107155946
MVID	0,760435825	0,131978135

	С РТС	
	Ковариация	Корреляция
FSK YeES	-0,004854913	-0,109213787
X5 Retail Group NV	0,020413885	0,246833862
Yandex	0,006491506	0,055748445
MAGN	0,032087257	0,19825789
MVID	-0,000179063	-0,007382069

	С ММВБ	
	Ковариация	Корреляция
FSK YeES	-0,004682020	-0,12022387
X5 Retail Group NV	0,023027342	0,317822241
Yandex	0,00388684	0,038101788
MAGN	0,009794503	0,069078305
MVID	0,001850439	0,087078259

Так как акции только одного эмитента (ФСК ЕЭС) имеют отрицательное значение ковариации и корреляции с портфелем, то портфель нельзя назвать дифференцированным, большая часть акций изменяется вместе с общим значением портфеля. Если сравнивать с биржевыми индексами, то отрицательное значение наблюдается у ФСК ЕЭС, М. Видео (в сравнении с индексом РТС) и только у ФСК ЕЭС (в сравнении с индексом ММВБ). Но значения являются приближенными к 0 по модулю, поэтому не стоит брать это как фактор влияющий на диверсификацию портфеля.

Вывод:

- Портфель состоит из компаний разных направленностей, чтобы охватить тенденции разных рынков и проследить за его изменениями.
- По прошествии срока наблюдения за акциями, из вложенного 1000000 осталось 787298 рублей. Портфель потерял 212702 рублей. За весь наблюдаемый период портфель перенес резкое уменьшение объема из-за падения акций компании Яндекс. В целом портфель следовал тенденциям рынка.

Спасибо за внимание!