

# Анализ доходности портфеля акций

Выполнила: Егорова Юлия  
Группа М15-15

# Приобретаемые акции на 01.10.2018

Название	Цена акций , руб. 01.20.2018	Кол-во, шт.	Денежные средства, руб.	Доля в портфеле, %
ГАЗПРОМ	161,89	1554	251 577,06	25
СБЕРБАНК	204,2	1226	250 349,2	25
М.ВИДЕО	406,5	487	197 965,5	20
АЭРОФЛОТ	106,2	1887	200 399,4	20
МТС	274,7	363	99 716,1	10
Всего			1 000 007,26	X

# Информация об эмитентах



«Сбербанк» — российский финансовый конгломерат, крупнейший транснациональный и универсальный банк России, Центральной и Восточной Европы. Контролируется Центральным банком Российской Федерации, которому принадлежит 50% уставного капитала плюс одна голосующая акция. Предоставляет широкий спектр банковских услуг.



ПАО «Газпро́м» — российская транснациональная энергетическая корпорация. Государство контролирует более 50 % акций. На «Газпром» приходится 11 % мировой и 66 % российской добычи газа. Занимает семнадцатое место в списке крупнейших энергетических компаний по версии S&P Global Platts.

# Информация об эмитентах

The logo for M.Video, featuring the text "М.видео" in a red, stylized, cursive font on a white background.

М.Видео — российская торговая сеть по продаже бытовой техники и электроники. По данным за 2012 год занимала первое место в России как по продажам на рынке бытовой техники и электроники, так и по доле занимаемых торговых площадей.

The logo for MTC, consisting of a red square with a white circle inside, followed by the letters "МТС" in a bold, red, sans-serif font on a white background.

МТС — российская телекоммуникационная компания, оказывающая услуги в России и странах СНГ

The logo for Aeroflot, featuring the word "АЭРОФЛОТ" in blue, uppercase letters, with a stylized red, white, and blue wing graphic to the right. Below it, the text "Российские авиалинии" is written in a smaller, blue font.

Аэрофлот является бесспорным лидером гражданской авиации России, фактическим национальным перевозчиком. Аэрофлот в 1989 году первым из российских авиакомпаний вступил в Международную ассоциацию воздушного транспорта (IATA). Аэрофлот базируется в аэропорту Шереметьево.

# Неделя 1 (8 октября)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	171.81	1 554	266 993
SBER	191.85	1 226	235 208
MVID	401.80	487	195 677
AFLT	102.65	1 887	193 701
MTSS	269.90	363	97 974
Всего			989 552

Доходность портфеля составила -1.05%. Снижение стоимости портфеля относительно 01 октября на 10 455 руб. Снижение произошло в большей степени из-за снижения стоимости акций SBER и AFLT.

# Неделя 2 (15 октября)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	164.00	1 554	254 856
SBER	190.92	1 226	234 068
MVID	394.60	487	192 170
AFLT	100.15	1 887	188 983
MTSS	269.65	363	97 883
Всего			967 960

Доходность портфеля составила -3.2%. Снижение стоимости портфеля относительно 01 октября на 32 047 руб. Продолжилось снижение стоимости акций SBER и AFLT, у которых наблюдается нисходящий тренд. В то время как GAZP продолжил расти.

# Неделя 3 (22 октября)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	155.70	1 554	241 958
SBER	180.70	1 226	221 538
MVID	390.10	487	189 979
AFLT	92.40	1 887	174 359
MTSS	264.60	363	96 050
Всего			923 883

Доходность портфеля составила -7.61%. Снижение стоимости портфеля относительно 01 октября на 76 124 руб. Сильное снижение у акций AFLT в 13%. Кроме того, падение продолжили акции SBER. Также упали в цене акции GAZP (-4%) и MVID (-4%).

# Неделя 4 (29 октября)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	152.52	1 554	237 016
SBER	185.59	1 226	227 533
MVID	399.70	487	194 654
AFLT	94.05	1 887	177 472
MTSS	258.90	363	93 981
Всего			930 656

Доходность портфеля составила -6.94%. Снижение стоимости портфеля относительно 01 октября на 69 351 руб. Снижение произошло в большей степени из-за продолжительного снижения стоимости акций SBER (-9%) и AFLT (-11.5%). Нисходящий тренд по акциям MVID начал разворачиваться.



# Неделя 5 (5 ноября)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	153.71	1 554	238 865
SBER	192.60	1 226	236 128
MVID	407.00	487	198 209
AFLT	101.78	1 887	192 059
MTSS	262.20	363	95 179
Всего			960 439

Доходность портфеля составила -3.96%. Снижение стоимости портфеля относительно 01 октября на 39 568 руб. Акции MVID показывают рост в цене (+0.12%), в то время как стоимость акций AFLT, SBER и MTSS показывают относительное снижение в темпах падения стоимости.

# Неделя 6 (12 ноября)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	150.89	1 554	234 483
SBER	196.82	1 226	241 301
MVID	397.80	487	193 729
AFLT	96.90	1 887	182 850
MTSS	265.95	363	96 540
Всего			948 903

Доходность портфеля составила -5.11%. Снижение стоимости портфеля относительно 01 октября на 51 104 руб. Ранее показывающие рост акции MVID упали в цене на 2%. Также сохранился тренд на снижение стоимости акций GAZP, SBER, AFLT и MTSS.

# Неделя 7 (19 ноября)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	154.10	1 554	239 471
SBER	197.99	1 226	242 736
MVID	401.10	487	195 336
AFLT	98.72	1 887	186 285
MTSS	266.30	363	96 667
Всего			960 494

Доходность портфеля составила -3.95%. Снижение стоимости портфеля относительно 01 октября на 39 513 руб. На данной неделе произошел небольшой прирост в стоимости всех акций (по сравнению с предыдущей неделей), однако относительно 01 октября по всем акциям наблюдается достаточно сильное снижение.

# Неделя 8 (26 ноября)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	149.53	1 554	232 370
SBER	188.50	1 226	231 101
MVID	399.50	487	194 557
AFLT	110.90	1 887	209 268
MTSS	247.50	363	89 843
Всего			957 138

Доходность портфеля составила -4.29%. Снижение стоимости портфеля относительно 01 октября на 42 869 руб. Несмотря на сильную просадку в стоимости акций GAZP (-7.6%), SBER (-7.7%) и MTSS (-9.9%), акции AFLT показывают рост в 4% впервые за рассматриваемый период.

# Неделя 9 (3 декабря)

Название	Цена акции	Кол-во	Стоимость портфеля
GAZP	165.40	1 554	257 032
SBER	200.30	1 226	245 568
MVID	406.60	487	198 014
AFLT	111.84	1 887	211 042
MTSS	248.70	363	90 278
Всего			1 001 934

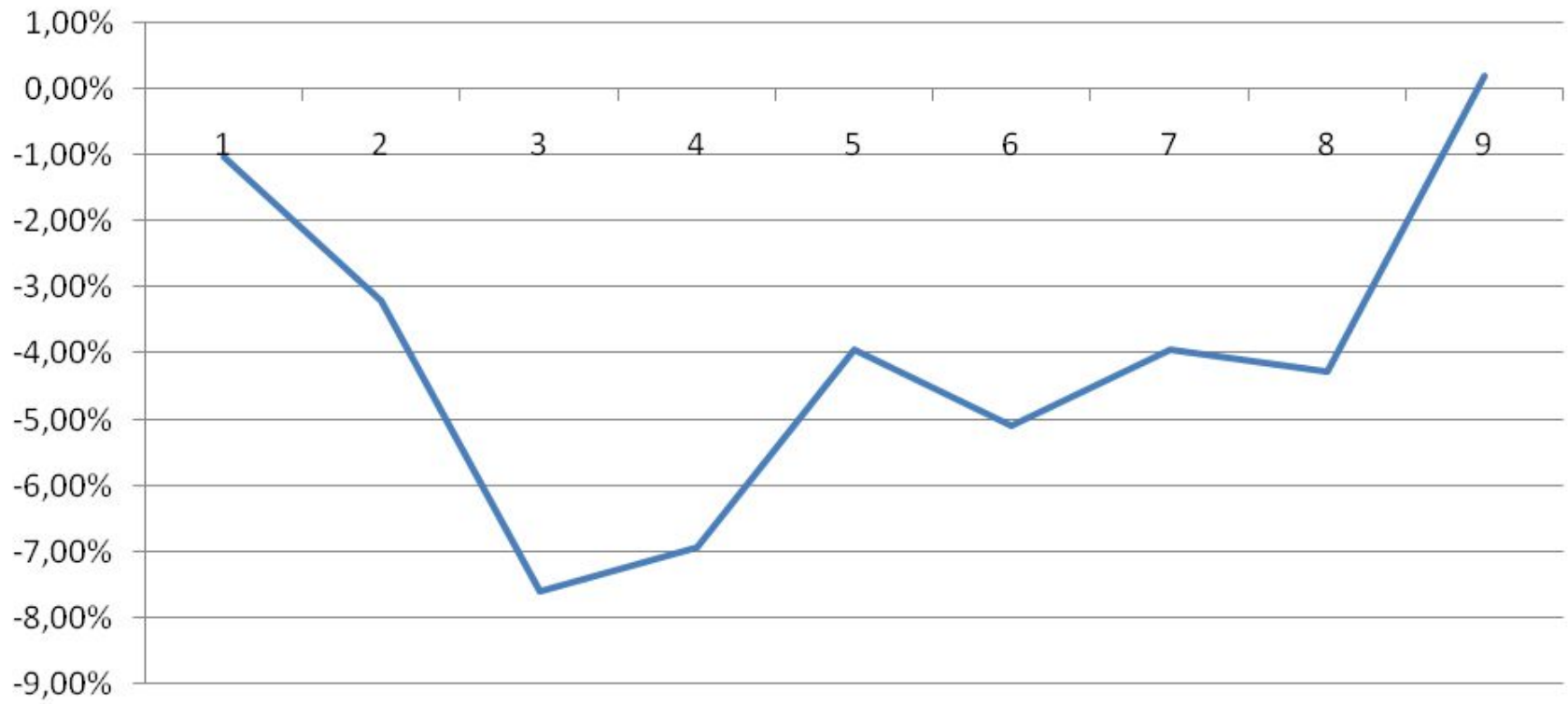
Доходность портфеля составила +0.19%. Увеличение стоимости портфеля относительно 01 октября на 1 927 руб. Акции AFLT продолжили расти. Помимо них акции GAZP продемонстрировали рост относительно 01 октября в 2.2%. За тот же анализируемый период не произошло существенных изменений в стоимости акций MVID (+0.02%), в то время как снизились MTSS (-9.46%) и SBER (-1.9%)

# Изменение доходности портфеля

Неделя	Доходность портфеля
1-5 окт	-1,05%
8-12 окт	-3,20%
15-19 окт	-7,61%
22-26 окт	-6,94%
29 окт-2 ноябр	-3,96%
5 ноябр-9 ноябр	-5,11%
12 ноябр-16 ноябр	-3,95%
19 ноябр - 23 ноябр	-4,29%
26 ноябр - 30 ноябр	0,19%

# Изменение доходности портфеля

## Доходность портфеля



# Анализ корреляции и ковариации

	С ПОРТФЕЛЕМ	
	Ковариация	Корреляция
<b>GAZP</b>	0,467273	0,039761
<b>SBER</b>	1,893156	0,202405
<b>MVID</b>	4,144594	0,498886
<b>AFLT</b>	5,537942	0,859648
<b>MTSS</b>	6,469031	0,856466



# Анализ корреляции и ковариации

	С ММВБ	
	Ковариация	Корреляция
<b>GAZP</b>	0,024214314	0,188599
<b>SBER</b>	0,035014269	0,339896
<b>MVID</b>	0,062002271	0,678249
<b>AFLT</b>	0,077480441	0,840257
<b>MTSS</b>	0,091319768	0,839618

# Анализ корреляции и ковариации

	С РТС	
	Ковариация	Корреляция
<b>GAZP</b>	0,02890068	0,214778
<b>SBER</b>	-0,055688841	-0,84557
<b>MVID</b>	0,022369909	0,480575
<b>AFLT</b>	0,004758206	0,117942
<b>MTSS</b>	0,022896873	0,486783

# Вывод по анализу корреляции и ковариации

---

- 1. Корреляция положительна (искл: SBER при сравнении с биржевым индексом РТС), колеблется в диапазоне 0,1-0,8. Портфель можно назвать средне диверсифицированным.
- 2. Следует отметить, что полученные данные при анализе могут быть не совсем объективны, поскольку в рассматриваемом периоде наблюдалось падение стоимости акций многих крупных мировых компаний.

# Вывод

---

- За рассматриваемый период сумма инвестиционного портфеля возросла на 1927 руб. (+0,19%).
- Наибольший рост продемонстрировали акции AFLT (+5,31%) и акции GAZP (+2,17%). В то время как акции MTSS и SBER упали в стоимости на -9,46% и 1,91% соответственно. Акции MVID практически не изменились в стоимости

---

**Спасибо за внимание!**