



# Анализ портфеля акций

Выполнила студентка 4 курса

Семилетова Алина

# Портфель акций (17 сентября 2018 год)

|                   | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого   |
|-------------------|-------------------|--------|---------|
| Роснефть          | 442,7             | 226    | 100055  |
| Норильский никель | 11520             | 17     | 200001  |
| Алроса            | 106,29            | 940    | 99945   |
| Сбербанк          | 190               | 2105   | 400036  |
| Лукойл            | 4,643             | 43068  | 199963  |
| Сумма             |                   |        | 1000000 |

# Информация о компаниях

- **Публичное акционерное общество «НК «Роснефть»** — российская нефтегазовая компания, контрольный пакет акций которой принадлежит государственному АО «Роснефтегаз». В 2013 году стала крупнейшей в мире компанией-производителем нефти. По данным журнала «Эксперт», в 2017 году занимала третье место среди российских компаний по объёмам выручки.
- **«Норильский никель»** – крупнейший в мире производитель никеля и палладия, один из крупнейших производителей платины и меди. Помимо этого, компания производит побочные металлы – кобальт, родий, серебро, золото, иридий, рутений, а также селен, теллур и серу.
- **«Алроса»** - российская группа алмазодобывающих компаний, занимающая лидирующую позицию в мире по объёму добычи алмазов (по состоянию на 2017 год). Корпорация занимается разведкой месторождений, добычей, обработкой и продажей алмазного сырья. Основная деятельность сосредоточена в Якутии, а также в Архангельской области и Африке. Алроса добывает 95 % всех алмазов России, доля компании в мировом объёме добычи алмазов составляет 27 %.
- **«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.
- **ПАО «ЛУКОЙЛ»** — российская нефтяная компания. Одна из крупнейших вертикально интегрированных нефтегазовых компаний в мире, на долю которой приходится более 2% мировой добычи нефти и около 1% доказанных запасов углеводородов.

| 24.09             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого      |
|-------------------|-------------------|--------|------------|
| Роснефть          | 449,4             | 226    | 101569,27  |
| Норильский никель | 12144             | 17     | 210834,39  |
| Алроса            | 106,96            | 940    | 100575,00  |
| Сбербанк          | 199,06            | 2105   | 419111,40  |
| Лукойл            | 4,798             | 43068  | 206638,48  |
| Сумма             |                   |        | 1038728,55 |

| 01.10             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого       |
|-------------------|-------------------|--------|-------------|
| Роснефть          | 499               | 226    | 112779,41   |
| Норильский никель | 11529             | 17     | 200157,2508 |
| Алроса            | 106,99            | 940    | 100603,2134 |
| Сбербанк          | 205,25            | 2105   | 432144,1526 |
| Лукойл            | 5,115             | 43068  | 220290,9207 |
| Сумма             |                   |        | 1065974,95  |

| 08.10             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого      |
|-------------------|-------------------|--------|------------|
| Роснефть          | 492,45            | 226    | 111299,04  |
| Норильский никель | 11399             | 17     | 197900,30  |
| Алроса            | 103,99            | 940    | 97782,30   |
| Сбербанк          | 193,6             | 2105   | 407615,63  |
| Лукойл            | 5,015             | 43068  | 215984,16  |
| Сумма             |                   |        | 1030581,42 |

| 15.10             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого      |
|-------------------|-------------------|--------|------------|
| Роснефть          | 469,25            | 226    | 106055,59  |
| Норильский никель | 11176             | 17     | 194028,75  |
| Алроса            | 97,44             | 940    | 91623,30   |
| Сбербанк          | 193,89            | 2105   | 408226,21  |
| Лукойл            | 4,837             | 43068  | 208318,12  |
| Сумма             |                   |        | 1008251,97 |

| 22.10             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого     |
|-------------------|-------------------|--------|-----------|
| Роснефть          | 473,65            | 226    | 107050,04 |
| Норильский никель | 11580             | 17     | 201042,67 |
| Алроса            | 96,6              | 940    | 90833,45  |
| Сбербанк          | 187,72            | 2105   | 395235,57 |
| Лукойл            | 4,725             | 43068  | 203494,55 |
| Сумма             |                   |        | 997656,27 |

| 29.10             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого     |
|-------------------|-------------------|--------|-----------|
| Роснефть          | 459,95            | 226    | 103953,69 |
| Норильский никель | 10770             | 17     | 186980,10 |
| Алроса            | 94,6              | 940    | 88952,84  |
| Сбербанк          | 186,3             | 2105   | 392245,83 |
| Лукойл            | 4,926             | 43068  | 212151,14 |
| Сумма             |                   |        | 984283,59 |

| 12.11             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого       |
|-------------------|-------------------|--------|-------------|
| Роснефть          | 464               | 226    | 104756,0255 |
| Норильский никель | 11608,000         | 17     | 197336      |
| Алроса            | 103               | 940    | 97001,84589 |
| Сбербанк          | 197               | 2105   | 414395,1869 |
| Лукойл            | 5,129             | 43068  | 220893,8675 |
| Сумма             |                   |        | 1034382,926 |

| 19.11             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого    |
|-------------------|-------------------|--------|----------|
| Роснефть          | 424               | 226    | 95851,2  |
| Норильский никель | 11746,000         | 17     | 199682   |
| Алроса            | 101               | 940    | 94510,04 |
| Сбербанк          | 198               | 2105   | 416858,6 |
| Лукойл            | 4,845             | 43068  | 208662,7 |
| Сумма             |                   |        | 1015564  |

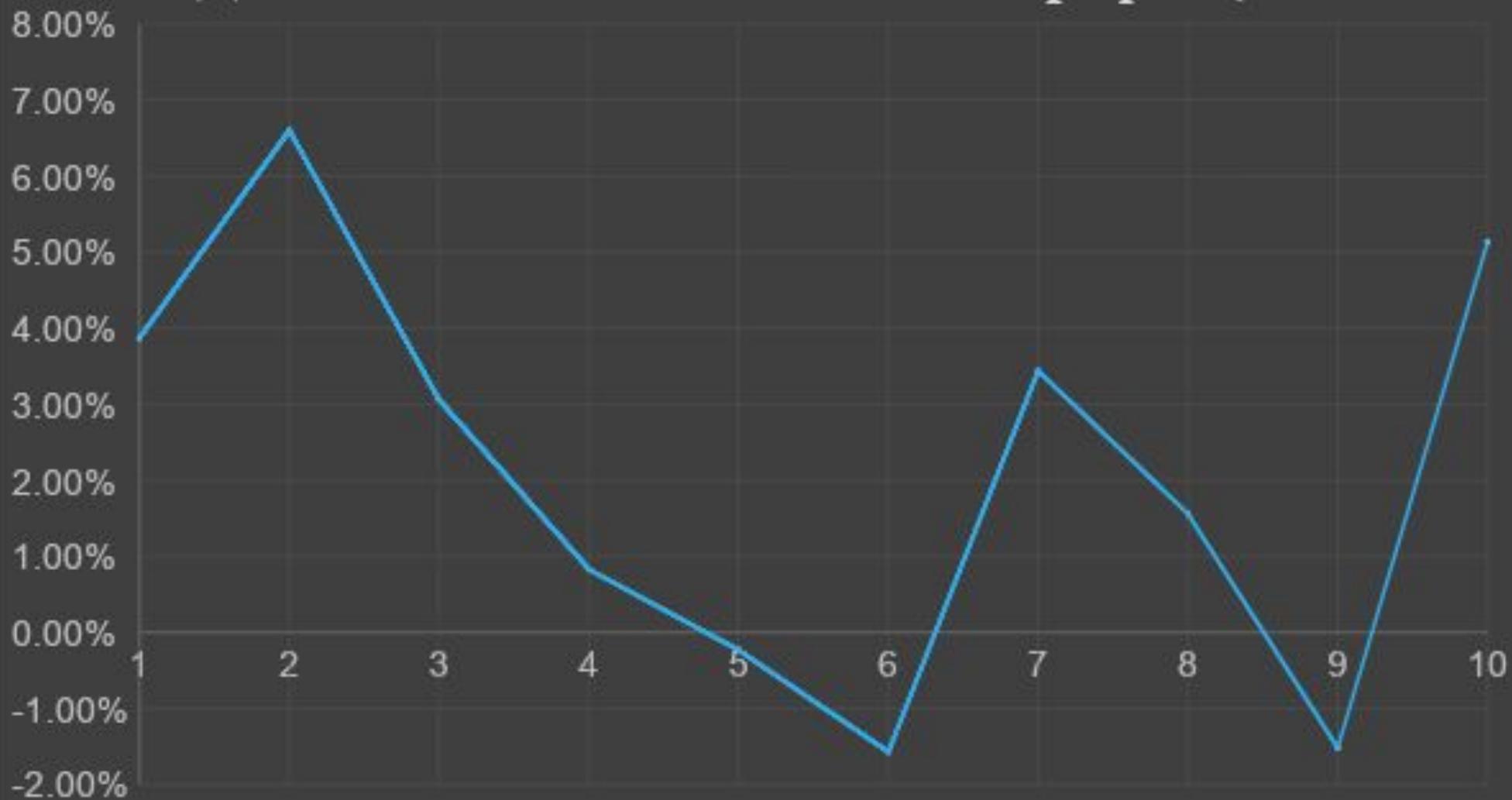
| 26.11             | Стоимость 1 акции | Кол-во | Итого    |
|-------------------|-------------------|--------|----------|
| Роснефть          | 407               | 226    | 91986,41 |
| Норильский никель | 11959,000         | 17     | 203303   |
| Алроса            | 99                | 940    | 93550,93 |
| Сбербанк          | 189               | 2105   | 396877,8 |
| Лукойл            | 4,623             | 43068  | 199101,6 |
| Сумма             |                   |        | 984819,8 |

# Портфель акций (3 декабря 2018 год)

|                   | Стоимость<br>1 акции | Кол-во | Итого    |
|-------------------|----------------------|--------|----------|
| Роснефть          | 434                  | 226    | 98088,71 |
| Норильский никель | 12817,000            | 17     | 217889   |
| Алроса            | 100                  | 940    | 94068,09 |
| Сбербанк          | 200                  | 2105   | 421722,2 |
| Лукойл            | 5,098                | 43068  | 219558,8 |
| Сумма             |                      |        | 1051327  |

| Дата       | Сумма портфеля | Доходность портфеля |
|------------|----------------|---------------------|
| 24.09.2018 | 1038728,55     | 3,87%               |
| 01.10.2018 | 1065974,95     | 6,60%               |
| 08.10.2018 | 1030581,42     | 3,06%               |
| 15.10.2018 | 1008251,97     | 0,83%               |
| 22.10.2018 | 997656,27      | -0,23%              |
| 29.10.2018 | 984283,59      | -1,57%              |
| 12.11.2018 | 1034382,926    | 3,44%               |
| 19.11.2018 | 1015564        | 1,56%               |
| 26.11.2018 | 984819,8       | -1,52%              |
| 03.12.2018 | 1051327        | 5,13%               |

## Доходность инвестиционного портфеля, %



| С портфелем | Ковариация | Корреляция |
|-------------|------------|------------|
| ROSN        | 1,095      | 0,093      |
| SBER        | 4,589      | 0,906      |
| GMKN        | 0,067      | 0,624      |
| ALRS        | 4,484      | 0,730      |
| LKOH        | 5,656      | 0,795      |

| С РТС |          |          |
|-------|----------|----------|
| ROSN  | -0,04643 | -0,2626  |
| SBER  | 0,045659 | 0,600163 |
| GMKN  | 0,000867 | 0,539287 |
| ALRS  | -0,00475 | -0,05149 |
| LKOH  | 0,046474 | 0,435112 |

| С ММВБ |          |          |
|--------|----------|----------|
| ROSN   | -0,02643 | -0,18321 |
| SBER   | 0,034986 | 0,563518 |
| GMKN   | 0,000767 | 0,584333 |
| ALRS   | 0,01199  | 0,159216 |
| LKOH   | 0,059926 | 0,687507 |

# Выводы

- За два месяца сумма инвестиционного портфеля повысилась на 5,13% (1051327 руб.). Значительное влияние на положительную динамику портфеля оказали такие компании как Алроса, Сбербанк, Норильский Никель и Лукойл. Итоговая сумма акций Роснефти на 3 декабря 2018 года по сравнению с 17 сентября 2018 года снизилась на 1966,29 руб.
- Отрицательное значение ковариации и корреляции с портфелем ни у одного эмитента не наблюдается, что говорит о слабой диверсификации портфеля, так как все акции изменяются в одном направлении с ним.
- Отрицательное значение с биржевыми индексами наблюдается у эмитента Роснефть, что свидетельствует о его разноправленности с индексами РТС и ММВБ.