

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

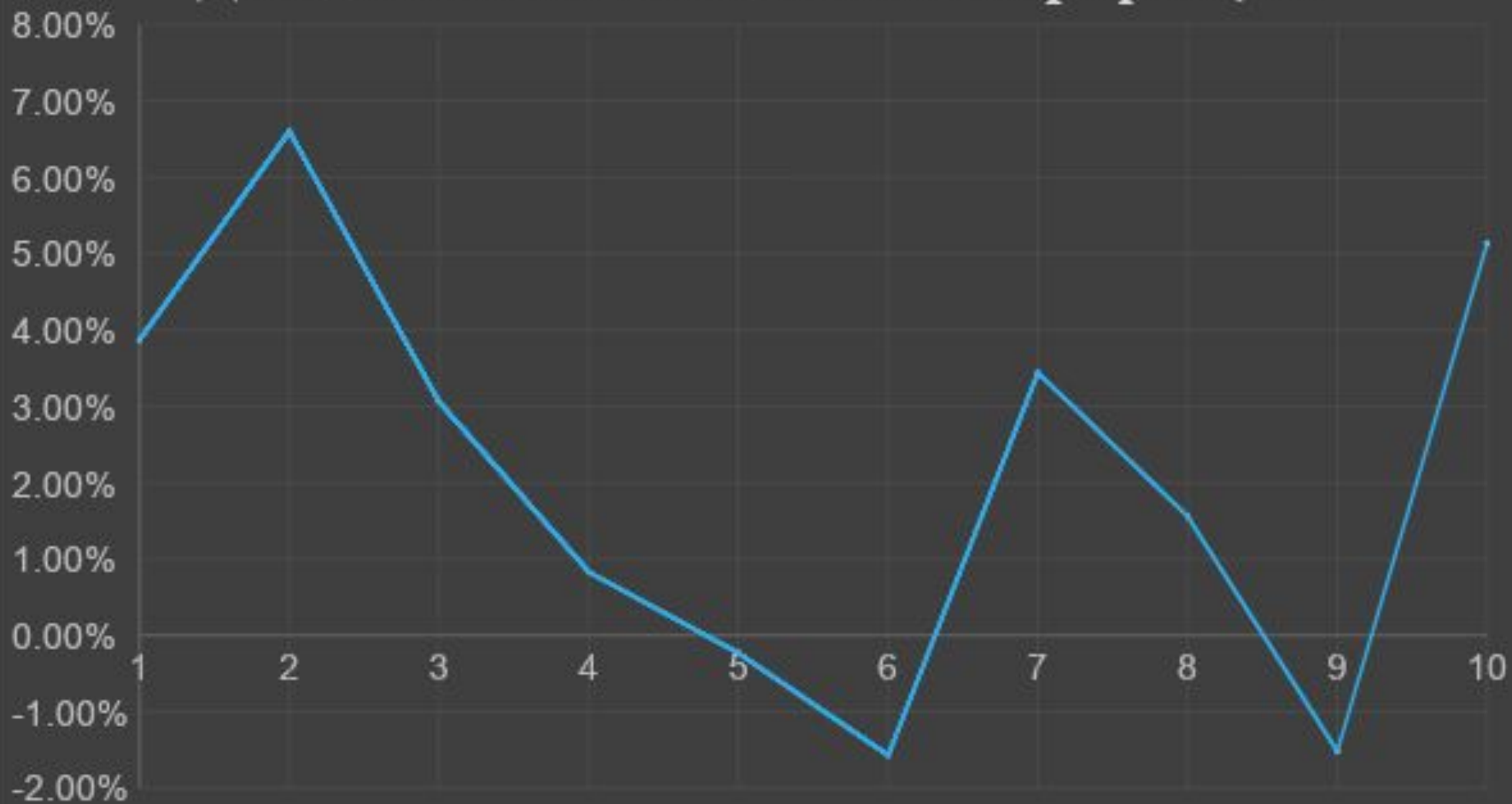
26.11	Стоимость 1 акции	Кол-во	Итого
Роснефть	407	226	91986,41
Норильский никель	11959,000	17	203303
Алроса	99	940	93550,93
Сбербанк	189	2105	396877,8
Лукойл	4,623	43068	199101,6
Сумма			984819,8

Портфель акций (3 декабря 2018 год)

	Стоимость 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.