



АНАЛИЗ ПОРТФЕЛЯ АКЦИЙ

Выполнила студентка
4 курса факультета управления
Мелентьева Юлия

ИНФОРМАЦИЯ О КОМПАНИЯХ

Газпром— российская (ранее советская) транснациональная энергетическая корпорация. На «Газпром» приходится 11 % мировой и 66 % российской добычи газа. Занимает семнадцатое место в списке крупнейших энергетических компаний по версии S&P Global Platts.

Алроса— российская группа алмазодобывающих компаний, занимающая лидирующую позицию в мире по объёму добычи алмазов . Корпорация занимается разведкой месторождений, добычей, обработкой и продажей алмазного сырья.

Лукойл— российская нефтяная компания. Основные виды деятельности компании — операции по разведке, добыче и переработке нефти и природного газа, реализации нефти и нефтепродуктов.

Сбербанк — крупнейший и старейший российский универсальный коммерческий банк, контролируется Центральным банком Российской Федерации, которому принадлежит более 52% акций. Предоставляет широкий спектр банковских услуг.

Роснефть— российская нефтегазовая компания. В 2013 году стала крупнейшей в мире компанией-производителем нефти

ПОРТФЕЛЬ АКЦИЙ (1 ОКТАБРЯ 2018 ГОДА)

01.окт	цена	кол-во	общая сумма
GAZP	161,89	1544	250000
ALRS	106,2	942	100000
LKOH	5016	60	300000
SBER	204,2	735	150000
ROSN	494,05	405	200000
			1000000

1 НЕДЕЛЯ (1-5 ОКТЯБРЯ)

05.окт	цена	общая сумма
GAZP	170,5	263296,1
ALRS	103,2	97175,14
LKOH	4987	298265,6
SBER	187,2	137512,2
ROSN	503	203623,1
		999872,1

Доходность портфеля
составляет -0,01%

2 НЕДЕЛЯ (8-12 ОКТЯБРЯ)

08.окт	цена	общая сумма
GAZP	171,81	265319
ALRS	104	97928,44
LKOH	4966	297009,6
SBER	191,85	140928
ROSN	479,45	194089,7
		995274,7

Доходность портфеля
составляет -0,47%

3 НЕДЕЛЯ (15-19 ОКТЯБРЯ)

15.окт	цена	общая сумма
GAZP	164	253258,4
ALRS	97,51	91817,33
LKOH	4747	283911,5
SBER	190,92	140244,9
ROSN	462,05	187045,8
		956277,9

Доходность портфеля
составляет -4,3%

4 НЕДЕЛЯ (22-26 ОКТЯБРЯ)

22.окт	цена	общая сумма
GAZP	155,7	240441
ALRS	96,6	90960,45
LKOH	4673,5	279515,6
SBER	180,7	132737,5
ROSN	465,3	188361,5
		932016,1

Доходность портфеля
составляет -6,8%

5 НЕДЕЛЯ (29-2 НОЯБРЯ)

29.окт	цена	общая сумма
GAZP	152,52	235530,3
ALRS	96,5	90866,29
LKOH	4872,5	291417,5
SBER	185,59	136329,6
ROSN	458,5	185608,7
		939752,4

Доходность портфеля
составляет -6%

6 НЕДЕЛЯ (5-9 НОЯБРЯ)

06.ноя	цена	общая сумма
GAZP	156	240904,3
ALRS	103,04	97024,48
LKOH	5055	302332,5
SBER	197,8	145298,7
ROSN	482,45	195304,1
		980864,2

Доходность портфеля
составляет -1,9%

7 НЕДЕЛЯ (12-16 НОЯБРЯ)

12.ноя	цена	общая сумма
GAZP	150,89	233013,2
ALRS	103,16	97137,48
LKOH	5129	306758,4
SBER	196,82	144578,8
ROSN	463,5	187632,8
		969120,7

Доходность портфеля
составляет -3%

8 НЕДЕЛЯ (19-23 НОЯБРЯ)

19.ноя	цена	общая сумма
GAZP	154,1	237970,2
ALRS	100,51	94642,18
LKOH	4845,5	289802,6
SBER	197,99	145438,3
ROSN	424,1	171683
		939536,4

Доходность портфеля
составляет -6%

9 НЕДЕЛЯ (26-30 НОЯБРЯ)

26.ноя	цена	общая сумма
GAZP	149,53	230913
ALRS	99,49	93681,73
LKOH	4623	276495,2
SBER	188,5	138467,2
ROSN	407	164760,7
		904317,8

Доходность портфеля
составляет -9,6%

10 НЕДЕЛЯ (3-7 ДЕКАБРЯ)

3 дек.	цена	общая сумма
GAZP	165,4	255420,3
ALRS	100,4	94538,61
LKOH	5098,5	304934,2
SBER	200,3	147135,2
ROSN	434	175690,7
		977719

Доходность портфеля
составляет -2,2%



ГРАФИК ДОХОДНОСТИ ПОРТФЕЛЯ

Анализ корреляции и ковариации ценной бумаги

	Ковариация	Корреляция
GAZP	3,008962422	0,82517347
ALRS	1,255293855	0,83790125
LKOH	1,29570002	0,821246
SBER	1,370454048	0,81983971
ROSN	1,35380762	0,81418358

Положительное значение всех рассчитанных коэффициентов ковариации говорит о том, что доходность всех ценных бумаг и портфеля изменялись однонаправленно

Отрицательных значений корреляции с биржевыми индексами не наблюдается, что говорит о том, что эмитенты изменяются в одном направлении с ними.

	РТС	
	Ковариация	Корреляция
GAZP	0,02	0,61
ALRS	0,02	0,60
LKOH	0,02	0,53
SBER	0,02	0,55
ROSN	0,02	0,55

	ММВБ	
	Ковариация	Корреляция
GAZP	0,02	0,68
ALRS	0,02	0,68
LKOH	0,02	0,59
SBER	0,02	0,59
ROSN	0,02	0,60

ВЫВОДЫ:

За 2 месяца наблюдений стоимость инвестиционного портфеля снизилась на 2,2% или на 22 281 рубль, что ниже рыночного снижения.

Несмотря на то, что стоимость портфеля практически не изменилась, в ноябре наблюдалось резкое снижение стоимости акций Лукойла, связанное с падением котировок практически всех нефтяных компаний. Однако в декабре в связи с новостью об ожидаемом росте добычи нефти компанией в 2019 году стоимость акций резко возросла и превысила своё первоначальное значение.

Стоимость акций Газпрома выросла на заявление о повышении дивидендов.



**СПАСИБО ЗА
ВНИМАНИЕ!**