

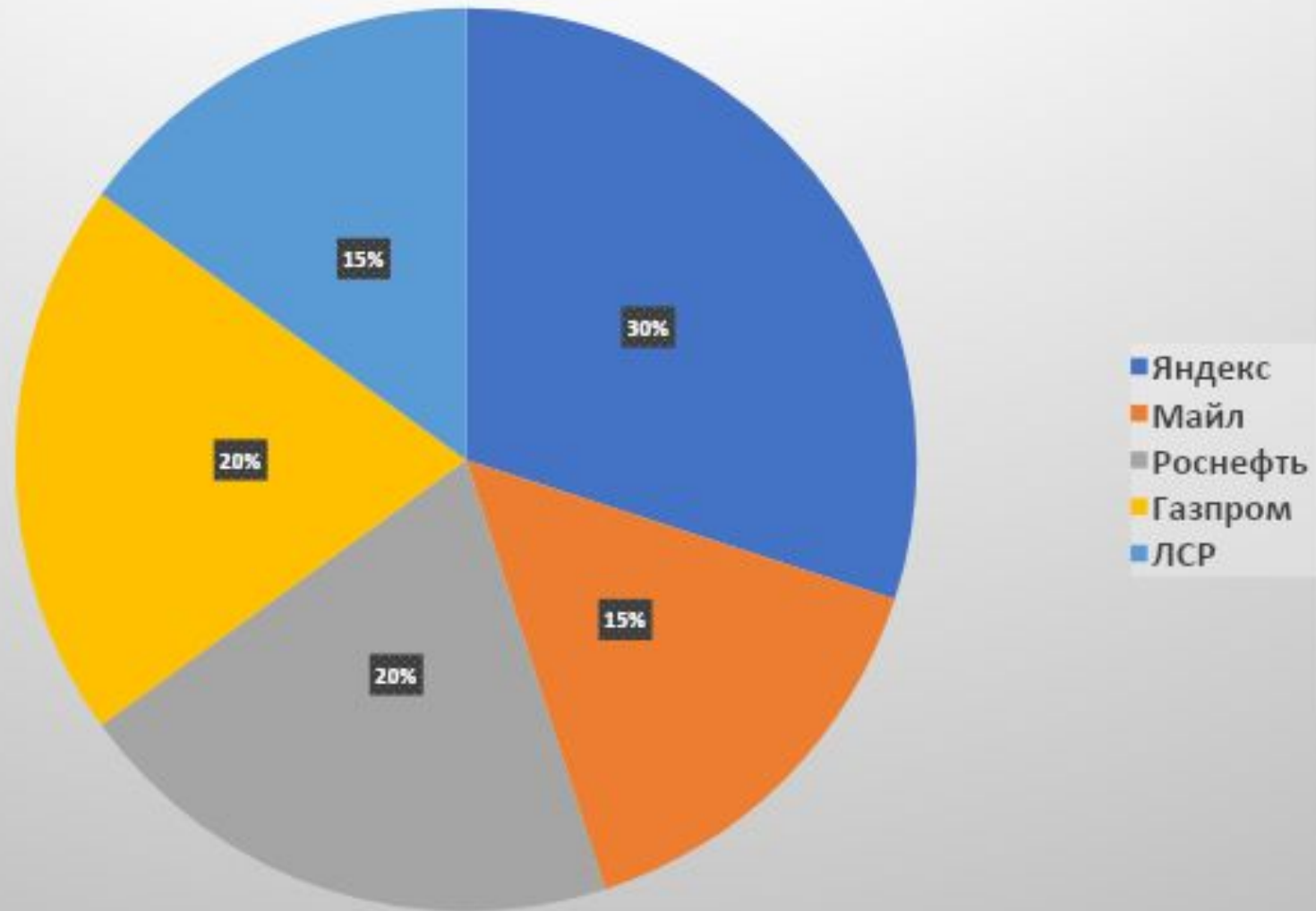
Инвестиционный портфель

М-1515

Люлин Алексей



Портфель акций



Доходность по неделям

Доходность										
Акции		08.окт	15.окт	22.окт	29.окт	05.ноя	12.ноя	19.ноя	26.ноя	03.дек
	Яндекс	1,71%	0,35%	-19,42%	4,79%	8,86%	-5,79%	2,04%	-2,16%	5,63%
	Майл	3,14%	-4,84%	6,08%	-2,72%	4,97%	-4,80%	-0,78%	-2,82%	1,65%
	Роснефть	4,80%	-3,63%	0,70%	-1,68%	5,45%	-3,93%	-8,50%	-4,88%	7,59%
	Газпром	6,13%	-4,55%	-5,06%	-1,68%	1,90%	-3,28%	2,13%	-3,34%	11,04%
	ЛСР	0,37%	-0,45%	-2,61%	-2,53%	-1,02%	0,48%	0,79%	-0,72%	3,92%
Средняя		3,23%	-2,36%	-6,28%	-0,29%	4,62%	-3,85%	-0,83%	-2,82%	6,19%

Доходность нарастающим итогом

Акции	08.ОКТ	15.ОКТ	22.ОКТ	29.ОКТ	05.НОЯ	12.НОЯ	19.НОЯ	26.НОЯ	03.ДЕК
Яндекс	2%	2%	-18%	-14%	-6%	-12%	-10%	-11,8%	-6,8%
Майл	3%	-2%	4%	1%	6%	1%	0%	-2,4%	-0,8%
Роснефт ь	5%	1%	2%	0%	5%	1%	-7%	-11,8%	-5,1%
Газпром	6%	1%	-4%	-5%	-4%	-7%	-5%	-8,0%	2,2%
ЛСР	0%	0%	-3%	-5%	-6%	-6%	-5%	-5,6%	-1,9%

Итоги

- За данный период инвестиционный портфель уменьшился на 3,04% и составил 969 638,62 рубля
- Наибольшее влияние на портфель оказали акции Яндекса. Цена на данную акцию упала на 6,8%
- Наиболее выгодными в портфеле оказались акции Газпрома, за текущий период их цена возросла на 2,2%

Корреляция

	Яндекс	Майл ру групп	Роснефть	Газпром	ЛСР
Яндекс	1				
Майл ру групп	-0,1697274	1			
Роснефть	0,30593279	0,725993334	1		
Газпром	0,77617951	0,040576429	0,412143184	1	
ЛСР	0,71502034	-0,196918113	0,284804437	0,874839561	1

По данным корреляционной таблицы мы видим, что есть большая зависимость между акциями Газпрома и ЛСР Групп. Так же схоже поведение акций Яндекса и Газпрома, Яндекса и ЛСР Групп и Роснефти и Майл ру Групп

Ковариация

Акции	0,0025
Яндекс	0,0005
Майл	0,0014
Роснефть	0,0018
Газпром	0,0004
ЛСР	0,0015

Значение ковариации для всех акции портфеля довольно таки низкое – это означает, что зависимости между доходностью определенной акции и доходностью портфеля в целом практически нет

Вывод

За время наблюдения за данными акциями можно сделать следующие выводы:

- Портфель акций нуждается в структурном изменении:
 - Акции Майл ру групп, несмотря на отрицательный итог за текущий период, по-моему мнению, являются перспективными
 - Вложение в ЛСР Групп было рискованным и неоправданным
- Необходимо оперативное управление пакетом акций – есть сильная зависимость от состояния рынка в целом, который в последнее время весьма нестабилен