

Анализ портфеля акций

Выполнил:

Иванов Владислав М-1515

Информация компаниях

ПАО «Интер РАО» — российская энергетическая компания, управляющая активами в России, а также в странах Европы и СНГ. В сферу деятельности Интер РАО входит производство и сбыт электрической и тепловой энергии, международный энергетический трейдинг, инжиниринг, проектирование и строительство энергообъектов.

«Яндекс» — российская транснациональная компания, зарегистрированная в Нидерландах и владеющая одноимённой системой поиска в Сети, интернет-порталами и службами в нескольких странах. Наиболее заметное положение занимает на рынках России, Турции, Белоруссии и Казахстана.

«Норникель» — российская горно-металлургическая компания. В настоящее время «Норникель» объединяет группу предприятий, возглавляемую Публичным акционерным обществом «Горно-металлургическая компания «Норильский никель».

«Корпорация „Иркут“» — российская авиастроительная корпорация. Штаб-квартира расположена в Москве. Полное наименование — Публичное акционерное общество «Научно-производственная корпорация „Иркут“».

Дальневосточная энергетическая компания - энергетическая сбытовая компания, осуществляющая деятельность по продаже электрической энергии потребителям на территории Приморского края, Хабаровского края, Амурской области и Еврейской АО.

СТОИМОСТЬ НА МОМЕНТ ПОКУПКИ

Портфель на момент покупки (1 октября)			
Эмитент	Стоимость 1 акции	Количество	Итого
IRAO	4,04	35 488	143 371,52
YNDX	2 134	92	196 328
GMKN	11 307	13	146 991
IRKT	74,25	3 500	259 875
DVEC	1,49	170 090	253 434,1
Итого			999 999,62

01.окт			
IRAO	4,04	35159	142042,36
YNDX	2134	92	196328
GMKN	11307	12	135684
IRKT	74,25	3500	259875
DVEC	1,49	170089	253432,61
			987361,97

08.окт			
IRAO	3,97	35159	139581,23
YNDX	2170,5	92	199686
GMKN	11321	12	135852
IRKT	62,25	3500	217875
DVEC	1,53	170089	260236,17
			953230,4

15.окт			
IRAO	3,86	35159	135713,74
YNDX	2178	92	200376
GMKN	11088	12	133056
IRKT	61,1	3500	213850
DVEC	1,57	170089	267039,73
			950035,47

22.окт			
IRAO	3,87	35159	136065,33
YNDX	1755	92	161460
GMKN	85,5	12	1026
IRKT	59,85	3500	209475
DVEC	1,61	170089	273843,29
			781869,62

29.окт			
IRAO	3,83	35159	134658,97
YNDX	1859,5	92	171074
GMKN	10679	12	128148
IRKT	57	3500	199500
DVEC	1,61	170089	273843,29
			907224,26

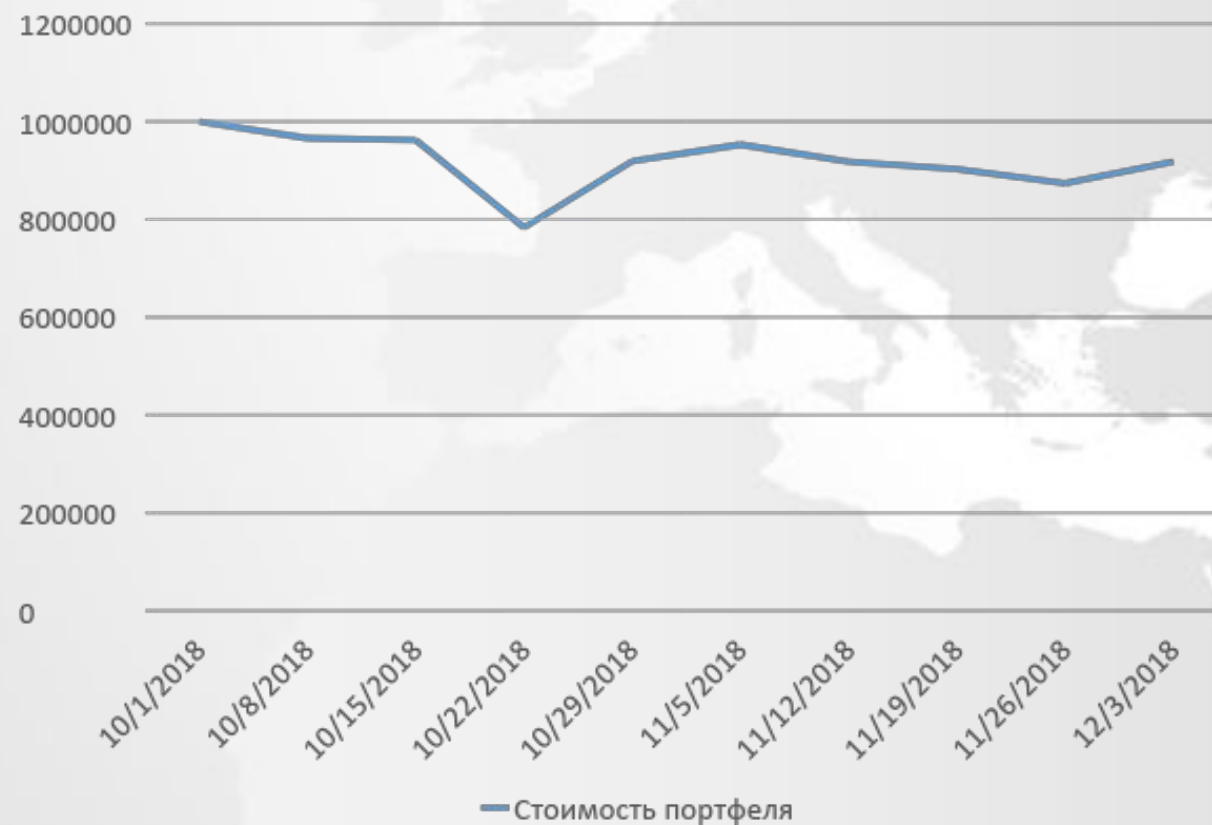
05.ноя			
IRAO	3,94	35159	138526,46
YNDX	1995	92	183540
GMKN	11517,5	12	138210
IRKT	60,59	3500	212065
DVEC	1,575	170089	267890,18
			940231,64

12.ноя			
IRAO	3,95	35159	138878,05
YNDX	1886	92	173512
GMKN	11608	12	139296
IRKT	55,66	3500	194810
DVEC	1,52	170089	258535,28
			905031,33

26.ноя			
IRAO	3,9	35159	137120,1
YNDX	1920	92	176640
GMKN	11959	12	143508
IRKT	47,68	3500	166880
DVEC	1,39	170089	236423,71
			860571,81

03.дек			
IRAO	4,09	35159	143800,31
YNDX	1989	92	182988
GMKN	12817	12	153804
IRKT	50,88	3500	178080
DVEC	1,44	170089	244928,16
			903600,47

Изменение стоимости портфеля



Дата	РТС	Изменение индекса	ММВБ	Изменение индекса
01.10.18	1191,28		2472,22	
08.10.18	1158,25	-2,77	2454,28	-0,73
15.10.18	1146,72	-3,74	2389,05	-3,36
29.10.18	1112,61	-6,6	2317,06	-6,28
12.11.18	1114,75	-6,42	2393,81	-3,17
19.11.18	1135,71	-4,66	2373,78	-3,98
26.11.18	1084,17	-8,99	2308,5	-6,62
03.12.18	1154,18	-3,11	2441,19	-1,26

	С ПОРТФЕЛЕМ	
	Ковариация	Корреляция
IRAO	1,074867698	0,351418859
YNDX	2,129299936	0,250727704
GMKN	1,72030276	0,30635265
IRKT	-1,918557735	-0,194302085
DVEC	-1,84805442	-0,30012397

	С РТС	
	Ковариация	Корреляция
IRAO	-0,000146043	-0,004039496
YNDX	0,006209927	0,061862601
GMKN	0,01190582	0,179371006
IRKT	-0,013602086	-0,116542489
DVEC	-0,011467797	-0,157558598

Выводы

По итогам 2 месяцев наблюдений стоимость портфеля снизилась на 8,2% или 82 235,48 рублей. Прирост стоимости акций наблюдается у ПАО «Интер РАО ЕЭС» и ПАО «Норильский никель»

У 2 компаний (ПАО «Иркут» и ПАО «ДЭК») корреляция и ковариация стоимостей акций и портфеля, значит портфель слабо дифференцирован и большая часть акций изменяется вместе с общим значением портфеля

В сравнении с биржевыми индексами отрицательное значение наблюдается у ПАО «Интер РАО ЕЭС», ПАО «Иркут» и ПАО «ДЭК». Это значит, что их стоимость изменяется независимо от рыночных тенденций

Рост стоимости акций ПАО «Норильский никель» имеет потенциалом наличия крупных заказов, связанных с планами по строительству аккумуляторного завода в Германии.

Рост стоимости акций ПАО «Интер РАО ЕЭС» можно объяснить поступательным развитием электроэнергетической компании.

Падение стоимости акций «Яндекса» возможно связано с сообщениями о законопроекте по доле иностранцев.