

Распределение бумаг по группам на 2/08/19

Красная

Новатэк
Распадская
ГМК НорНикель –
Лукойл
Татнефть(пр.)
Полюс Золото

Кол-во 6

Оранжевая

М.Видео
ММК
СевСталь
Сбербанк (об.)
Сбербанк(пр.)
НЛМК
Акрон
ИнтерРао
Татнефть(об.)
Россети
ДВМП (X1)
Роснефть
Газпром
ОГК-2

Кол-во 14

Серая

МТС –
ФСК –
Сургутнефтегаз(об) –
Не рекомендованы для
долгосрочной торговли

ТПлюс(X5)
Транснефть
ТГК-1
+Мосэнерго
НМТП
КАМАЗ
Иркутскэнерго
КМЗ
РОСИНТЕР (X7)
Ростелеком(об.)
Аэрофлот
Система
ВТБ
Ашинский МЗ(X6)
Сургутнефтегаз(пр.)
Уралкалий

Кол-во 19

Желтая

ЦМТ (X8)
Телеграф (X2)
Мостотрест
ТГК-2
Мечел (об.)
СОЛЛЕРС
ТМК !
РусГидро
Ютэйр
Магнит
МРСК Центр
МРСК Юга

Кол-во 12

Зеленая

ЭнелРос
(X9)

Кол-во 2

Всего 53
бумаг

Распределение бумаг по группам на 9/08/19

Красная

Новатэк
Распадская
ГМК НорНикель –
Лукойл
Татнефть(пр.)
Полюс Золото

Кол-во 6

Оранжевая

М.Видео
ММК
СевСталь
Сбербанк (об.)
Сбербанк(пр.)
НЛМК
ИнтерРао
Татнефть(об.)
Россети
Роснефть
Газпром

Кол-во 11

Серая

МТС –
ФСК –
Сургутнефтегаз(об) –
Не рекомендованы для
долгосрочной торговли

ТПлюс(X5)
Транснефть
ТГК-1
+Мосэнерго
НМТП
КАМАЗ
Иркутскэнерго
КМЗ
РОСИНТЕР (X7)
Ростелеком(об.)
Аэрофлот
Система
ВТБ
Ашинский МЗ(X6)
Сургутнефтегаз(пр.)
ДВМП (X1)
ОГК-2

Кол-во 20

Желтая

ЦМТ (X8)
Телеграф (X2)
Мостотрест
ТГК-2
Мечел (об.)
СОЛЛЕРС
ТМК !
РусГидро
Ютэйр
МРСК Центр
МРСК Юга

Кол-во 11

Зеленая

ЭнелРос
(X9)
Магнит

Кол-во 3

Всего 51
бумаг

Состояние портфеля 9/08/19

	Название бумаги	Цена приобретения	Текущая цена	% изменения текущей цены к цене приобретения	% вложенного капитала от запланированного для данного инструмента		% вложенного капитала от всего размера средств используемых на рынке акций		% актива в стоимости портфеля	Целевой уровень доходности
					В масштабах средств 2013 г.	В масштабах средств 2017 г.	В масштабах средств 2013 г.	В масштабах средств 2017г.		
1	Система	7,30	11,84	+62,2%	45%	15%	1,35%	0,45%	3,29%	>600%
2	Ростелеком	71,11	81,7	+ 14,9%	210% + дивиденды ОГК-2 2017 + дивиденды 2018	72% <i>с учетом дивидендов</i> 97%	6,3%	2,1%	16,77%	>350%
3	Камаз (X3)	35,6	54,1	+ 51,9%	50%	17%	1,5%	0,5%	3,88%	
4	ТПлюс(X5)	0,51	0,7	+ 37,3%	75%	25%	2,25%	0,75%	Не учитывается в стоимости биржевого портфеля	
5	Ашинский МЗ (X6)	3,85	4,42	+ 14,8%	80%	27%	2,4%	0,8%	5,11%	
6	РОСИНТЕР (X7)	55,7	69	+ 23,9%	80%	27%	2,4%	0,8%	5,77%	
7	ОГК-2	0,361	0,473	+ 31%	220% + дивиденды 2017	74% <i>с учетом дивидендов</i> 83%	6,6%	2,2%	16,25%	
8	ТМК	58,1	56,12	-3,4%	230%+часть дивидендов 2018-19	77% <i>с учетом дивидендов</i> 96%	6,9%	2,3%	13,7%	
9	ЦМТ(X8)	6,45	7,48	+16%	80%	27%	2,4%	0,8%	3,46%	
10	Ютэйр	7,32	6,71	- 8,7%	180%	61%	5,3%	1,8%	4,71%	
11	Русгидро	0,554	0,55	- 0,7%	200%	66%	6%	2%	9,14%	
12	Магнит	3584	3572	- 0,3%	95%	32%	2,85%	0,95%	4,95%	
13	ВТБ	0,03572	0,0407	+14%	95%	32%	2,85%	0,95%	4,27%	
14	Энелрос	0,954	0,92	- 3,3%	125%	42%	4,15%	1,25%	5,75%	
15	Соллерс	346,5	309	- 10,8%	35%	12%	1,25%	0,35%	0,79%	
16	X9			-3,1%	55%	19%	1,65%	0,55%	2,24%	
	Всего:				190%	62,35%	57%	19%		
Доходность портфеля				22%	рассчитываемая как отношение стоимости активов к размеру вложенных средств, выраженное в процентах					

Целевые уровни покупки на 9/08/19

Желтая таблица		
	Цена закр.	Спрос
ЦМТ ао [МБ ФР: Т+: Акц]	7,52	7,40
Телеграф [МБ ФР: Т+: А]	19,25	19,05
Мечел ао [МБ ФР: Т+: А]	62,23	62,02
Мостотрест [МБ ФР: Т+	89,30	88,80
ТГК-2 [МБ ФР: Т+: Акц]	0,002390	0,002350
СОЛЛЕРС [МБ ФР: Т+: .	310,0	308,0
ТМК ао [МБ ФР: Т+: Акц]	56,20	56,04
РусГидро [МБ ФР: Т+: А]	0,5520	0,5481
ЮТэйр ао [МБ ФР: Т+: А]	6,72	6,64
МРСК Центр [МБ ФР: Т	0,2694	0,2690
МРСКЮга ао [МБ ФР: Т	0,06170	0,06100

ЦМТ < 7
Телеграф < 12
Мечел < 55
Мостотрест < 82
ТГК-2 < 0,002
Соллерс < 298
ТМК < 53
Русгидро < 0,5
ЮТэйр < 6,6
МРСК Центр < 0,26
МРСК Юга < 0,05

Зеленая таблица		
	Цена закр.	Спрос
Магнит ао [МБ ФР: Т+: А]	3 582,5	3 557,0
ЭнелРос ао [МБ ФР: Т+	0,9210	0,9175

Магнит < 3400
ЭнелРос < 0,915

