

Распределение бумаг по группам на 5/07/19

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
Сургутнефтегаз(пр.)
Татнефть(об.)
Россети
ДВМП (X1)
Роснефть
Газпром
ОГК-2

Кол-во 15

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

Кол-во 15

Желтая

ЦМТ (X8)
Телеграф (X2)
Мостотрест
ТГК-2
Мечел (об.)
СОЛЛЕРС
Уралкалий
ТМК
РусГидро
Ютэйр
ВТБ
Ашинский МЗ(X6)
Магнит
МРСК Центр
МРСК Юга
(X9)
ЭнелРос

Кол-во 17

Зеленая

Кол-во 0

Всего 53
бумаг

Распределение бумаг по группам на 12/07/19

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
Сургутнефтегаз(пр.)
Татнефть(об.)
Россети
ДВМП (X1)
Роснефть
Газпром
ОГК-2

Кол-во 15

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)

Кол-во 17

Желтая

ЦМТ (X8)
Телеграф (X2)
Мостотрест
ТГК-2
Мечел (об.)
СОЛЛЕРС
Уралкалий
ТМК
РусГидро
Ютэйр
Магнит
МРСК Центр
МРСК Юга
(X9)

Кол-во 14

Зеленая

ЭнелРос

Кол-во 1

Всего 53
бумаг

Состояние портфеля 12/07/19

	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	11,79	+ 61,5%	45%	15%	1,35%	0,45%	3,25%	>600%
2	Ростелеком	71,11	79,7	+ 12,1%	210% + дивиденды ОГК-2 2017 + дивиденды 2018	72%	6,3%	2,1%	16,33%	>350%
3	Камаз (X3)	35,6	55,8	+ 56,7%	50%	17%	1,5%	0,5%	4,04%	
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	4,44	+ 15,3%	80%	27%	2,4%	0,8%	5,11%	
6	РОСИНТЕР (X7)	55,7	72,8	+ 30,6%	80%	27%	2,4%	0,8%	6,07%	
7	ОГК-2	0,361	0,5186	+ 43,7%	220% + дивиденды 2017	74%	6,6%	2,2%	17,5%	
8	ТМК	58,92	60,14	+ 2,1%	230%+часть дивидендов 2018	77%	6,9%	2,3%	12,33%	
9	ЦМТ(X8)	6,45	7,18	+11,3%	80%	27%	2,4%	0,8%	3,3%	
10	Ютэйр	7,47	6,92	- 7,4%	165%	55%	4,95%	1,65%	4,28%	
11	Русгидро	0,554	0,5718	+3,2%	200%	66%	6%	2%	9,59%	
12	Уркалий	85,05	87,8	+ 3,3%	75% +часть дивидендов 2018	25%	2,25%	0,75%	4,49%	
13	Магнит	3584	3831	+ 6,9%	95%	32%	2,85%	0,95%	5,29%	
14	ВТБ	0,03572	0,0429	+20,1%	95%	32%	2,85%	0,95%	4,57%	
15	Энелпрос	0,977	0,985	+ 0,8%	45%	16%	1,35%	0,45%	1,21%	
16	Соллерс	346,5	316	- 8,8%	35%	12%	1,25%	0,35%	0,85%	
17	X9			+1,9%	55%	19%	1,65%	0,55%	1,81%	
	Всего:				183%	61%	54,9%	18,3%		

Доходность портфеля

31,7%

рассчитываемая как отношение стоимости активов к размеру вложенных средств, выраженное в

Целевые уровни покупки на 12/07/19

Желтая таблица		
	Цена закр.	Спрос
ЦМТ ао [МБ ФР: Т+: Ак	7,06	7,10
Телеграф [МБ ФР: Т+: А	17,65	17,55
Мечел ао [МБ ФР: Т+: А	65,66	64,61
Мостотрест [МБ ФР: Т+	88,85	88,60
ТГК-2 [МБ ФР: Т+: Акци	0,002680	0,002660
СОЛЛЕРС [МБ ФР: Т+: .	318,5	316,0
ТМК ао [МБ ФР: Т+: Ак	60,28	59,94
РусГидро [МБ ФР: Т+: А	0,5665	0,5773
Уркалий-ао [МБ ФР: Т+	87,80	87,82
ЮТэйр ао [МБ ФР: Т+: А	6,85	6,97
Магнит ао [МБ ФР: Т+: .	3 860,0	3 842,5
МРСК Центр [МБ ФР: Т	0,2868	0,2850
МРСКЮга ао [МБ ФР: Т	0,06650	0,06600

ЦМТ < 7
Телеграф < 12
Мечел < 55
Мостотрест < 82
ТГК-2 < 0,002
Соллерс < 298
ТМК < 53
Русгидро < 0,5
Уркалий < 85
ЮТэйр < 6,6
Магнит < 3600
МРСК Центр < 0,26
МРСК Юга < 0,05

Зеленая таблица		
	Цена закр.	Спрос
ЭнелРос ао [МБ ФР: Т+	0,9905	0,9860

Энелрос < 0,977

