|  |  |
| --- | --- |
|   | 01.10.2018 |
| Инстурменты: | Цена | Кол-во | Ст-ть в сумме |
| [MTSS](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=MTSS) | 276 | 4000 | 1104000 |
| [RSTI](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=RSTI) | 0,8104 | 864000 | 700185,6 |
| [SBERP](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=SBERP) | 163,49 | 3365 | 550143,85 |
| MTLR | 105,45 | 8099 | 854000 |
| [TANL](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=TANL) | 57,2 | 8916 | 510000 |
| [TGKDP - привилег.акц](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=TGKDP) | 0,00345 | 2,9E+08 | 999990 |
| [MFON](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=MFON) | 573,9 | 1330 | 763000 |
| [RASP](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=RASP) | 120,46 | 6730 | 810000 |
| [MAGN](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=MAGN) | 52,62 | 11405 | 600000 |
| [IRKT](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=IRKT) | 70,05 | 13500 | 945675 |
| [LSNGP](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=LSNGP) | 93,6 | 11000 | 1029600 |
| [NMTP](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=NMTP) | 6,945 | 80000 | 555600 |
| [Депозитарные расписки - ENPL](https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=ENPL) | 312,5 | 2272 | 710000 |
| ИТОГО: | х | х | 10132194,45 |
| ММВБ |   |   | 2 465,03 |

В результате проделанной работы, можем наблюдать, что акции RASP имеет сред. Ожидаемую доходность 3,12%. Следующее место по % доходности, является MFON (1,89%), а потом уже SBERP (1,41%). Следовательно, остальные уровни доходности несоизмеримо малы или даже отрицательны. Представленный портфель ценных бумаг имеет ожидаемую среднюю доходность в размере (-5,14%), что в свою очередь показывает на отрицательный результат. Это говорит о том, что стоимость всего портфеля снизится на 675934,464. Если доходность в одном из рассмотренных случаев растет или падает, то доходность компании MTSS растет или падает быстрее в 0,78 ( коэф В), а если рассмотреть MFON то ее доходность растет и ли падает быстрее в -0,13 ( коэф В). При отрицательном показателе A можно сделать вывод о том, что управление портфелем не правильное и недостаточно эффективное. Таком образом можно сделать вывод, что портфель-ценных бумаг это достаточно рисковая вещь, за которой необходимо следить постоянно. Смысл формирования портфеля состоит в том, чтобы формировать его из таких ценных бумаг, которые со временем дадут прирост личного капитала. Поэтому не всегда стоит продавать весь портфель акций, а лишь его часть, т.к при частичной продаже можно получать постоянный доход в виде процентов или дивидендов или постепенной продаже бумаг. Исходя из моего анализа можно сделать заключение, что данный портфель принес убытки и акции были подобраны не корректно.