КИТФинанс
Брокерская компания

Технический анализ

Отчёт по рекомендациям за период с 1 апреля по 15 октября

В таблице указана прибыль по сделкам модельного портфеля. Рекомендации составлялись на основе технического анализа «голубых фишек» за период с 1 апреля по 15 октября 2012 года.

Эмитент	Тикер	Накопленная прибыль
Газпром	GAZP	10%
ГМК Норильский никель	GMKN	25%
Русгидро	HYDR	-1%
Лукойл	LKOH	1%
Холдинг МРСК	MRKH	-4%
Роснефть	ROSN	14%
Сбербанк (ао)	SBER	16%
Сбербанк (ап)	SBERP	19%
Сургутнефтегаз	SNGS	0%
Татнефть	TATN	13%
ВТБ	VTBR	-2%
Индекс ММВБ*		-5%
Банковский депозит *		5,3%

* - информационно, прирост за тот же период

Методика расчёта

Расчёты прибыли (убытков) по сделкам составлены на основе рекомендаций по покупке и продаже акций. Рекомендации опубликованы в записках «Технический анализ» Отдела анализа и консультаций, размещённых на сайте компании www.brokerkf.ru и других СМИ.

При расчёте результата по сделкам во внимание принимались только рекомендации с чётко обозначенными ценами покупки и продажи бумаг (без учёта общих ожиданий по движению цены). Прогнозы, по которым сделка не могла быть совершена (цена не дошла до точки входа, первоначальные рекомендации были изменены и т.д.) в расчётах не учитывались.

Если стоп-лосс был обозначен как «короткий» без определения конкретных цен, то цена закрытия позиции с убытком рассчитывалась по наименьшей из величин: или -2% от точки входа, или 33% от величины ожидаемой прибыли.

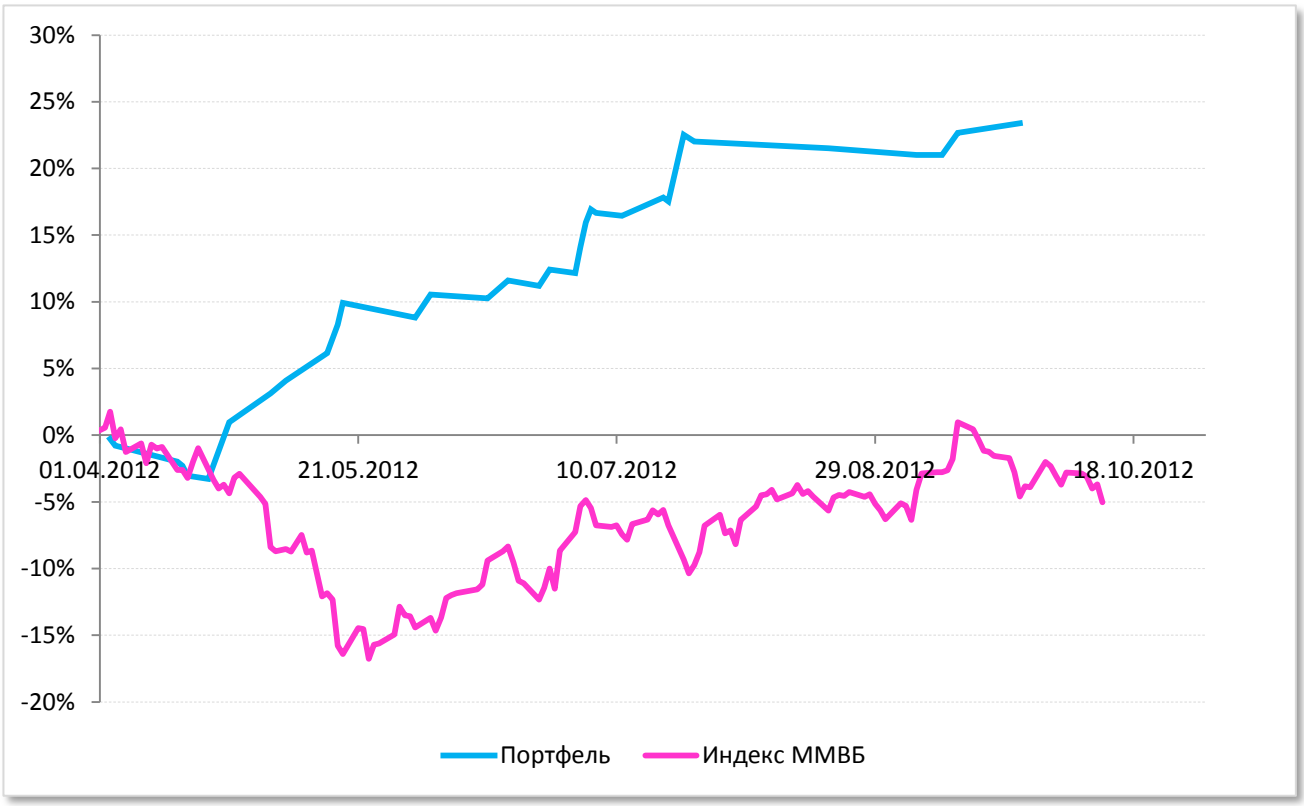
При наличии нескольких сценариев развития событий, в расчёте использовался наиболее пессимистический.

Результаты указаны без учёта транзакционных издержек (комиссии, проскальзывание и т.д.)

КИТФинанс
Брокерская компания

Динамика портфеля

На рисунке ниже представлена динамика процентного прироста стоимости портфеля* за отчётный период в сравнении с доходностью индекса ММВБ.



* - В рассматриваемом периоде максимальное число инструментов, по которым удерживались позиции, было равно 4. Таким образом, доходность, каждого инструмента в портфеле рассчитывалась по формуле *r(i) * 0.25*, где *r(i)* – доходность *i*- ого инструмента.

Бумага	Дата рекомендации	Операция	Дата сделки	Цена открытия	Дата закрытия	Цена закрытия	Результат, %
LKOH	02.04.2012	продажа	02.04.2012	1770	03.04.2012	1790	-1.1%
TATN	02.04.2012	покупка	03.04.2012	200	04.04.2012	196	-2.0%
MRKH	05.04.2012	покупка	05.04.2012	3.12	16.04.2012	3	-3.8%
GMKN	05.04.2012	продажа	05.04.2012	5300	04.05.2012	5000	5.7%
SBERP	06.04.2012	продажа	06.04.2012	77	26.04.2012	70	9.1%
SNGS	09.04.2012	покупка	09.04.2012	28	04.05.2012	27.44	-2.0%
TATN	11.04.2012	продажа	11.04.2012	186	15.05.2012	166	10.8%
GAZP	29.03.2012	покупка	12.04.2012	176	17.01.2012	173.8	-1.2%
HYDR	13.04.2012	покупка	13.04.2012	1.06	16.04.2012	1.05	-0.9%
SBERP	29.03.2012	продажа	13.04.2012	76	26.04.2012	70	7.9%

КИТФинанс
Брокерская компания

Бумага	Дата рекомендации	Операция	Дата сделки	Цена открытия	Дата закрытия	Цена закрытия	Результат, %
ROSN	16.04.2012	покупка	16.04.2012	214	22.04.1906	212	-0.9%
SBER	16.04.2012	продажа	17.04.2012	93	18.04.2012	95.8	-3.0%
LKOH	26.04.2012	покупка	26.04.2012	1760	04.05.2012	1740	-1.1%
ROSN	23.04.2012	продажа	02.05.2012	213	04.05.2012	200	6.1%
SBER	27.04.2012	продажа	02.05.2012	93.5	07.05.2012	89.9	3.9%
SNGS	10.05.2012	продажа	10.05.2012	27.6	15.05.2012	28.3	-2.5%
SBER	11.05.2012	продажа	12.05.2012	90.5	17.05.2012	82.75	8.6%
LKOH	15.05.2012	продажа	15.05.2012	1680	18.05.2012	1570	6.5%
GMKN	11.05.2012	продажа	16.05.2012	5050	04.06.2012	4700	6.9%
TATN	22.05.2012	продажа	25.05.2012	165	29.05.2012	168.3	-2.0%
LKOH	28.05.2012	продажа	29.05.2012	1700	29.05.2012	1725	-1.5%
ROSN	28.05.2012	продажа	31.05.2012	205	01.06.2012	207	-1.0%
TATN	03.06.2012	продажа	08.06.2012	178	15.06.2012	180	-1.1%
VTBR	14.06.2012	покупка	14.06.2012	0.056	25.06.2012	0.05512	-1.6%
SNGS	14.06.2012	покупка	15.06.2012	26.3	19.06.2012	27.7	5.3%
GMKN	25.05.2012	покупка	15.06.2012	5150	27.06.2012	5400	4.9%
LKOH	03.06.2012	покупка	15.06.2012	1820	02.07.2012	1802	-1.0%
ROSN	19.06.2012	покупка	21.06.2012	205	05.07.2012	213	3.9%
SBER	21.06.2012	покупка	26.06.2012	83.5	03.07.2012	90	7.8%
TATN	21.06.2012	покупка	29.06.2012	177	04.07.2012	190	7.3%
SBERP	19.06.2012	покупка	02.07.2012	64.5	19.07.2012	68	5.4%
LKOH	03.07.2012	покупка	03.07.2012	1820	11.07.2012	1805	-0.8%
GMKN	19.06.2012	продажа	03.07.2012	5400	23.07.2012	5000	7.4%
SNGS	03.07.2012	покупка	04.07.2012	28.35	06.07.2012	28.05	-1.1%
GAZP	21.06.2012	продажа	05.07.2012	160	23.07.2012	150	6.3%
SBER	12.07.2012	покупка	17.07.2012	92	20.07.2012	91	-1.1%
ROSN	12.07.2012	продажа	17.07.2012	208	23.07.2012	195	6.3%
TATN	24.07.2012	продажа	24.07.2012	184	25.07.2012	187.67	-2.0%
GAZP	14.08.2012	покупка	17.08.2012	157.6	20.08.2012	154.448	-2.0%
GAZP	14.08.2012	покупка	17.08.2012	157.6	14.09.2012	154.448	6.6%
TATN	15.08.2012	продажа	31.08.2012	197	06.09.2012	201	2.0%
SBER	17.08.2012	покупка	23.08.2012	94	11.09.2012	94	0.0%
SBERP	25.09.2012	продажа	26.09.2012	68	26.09.2012	68.5	-2.9%

КИТФинанс
Брокерская компания

Отдел рыночного анализа и консультаций

Дмитрий Шагардин
d.shagardin@brokerkf.ru

Василий Евдокиенко
v.evdokienko@brokerkf.ru

Андрей Архипов
Arh.andr@gmail.com

Татьяна Атаманова
t.atamanova@brokerkf.ru

Служба клиентской поддержки

Единый номер для БЕСПЛАТНЫХ звонков из любой точки России: 8 (800) 700 00 55
Санкт-Петербург:
Тел.: +7 (812) 457 19 19

Москва:
Тел.:+ 7 (495) 981 06 06

E-mail: clients@brokerkf.ru

Форум: http://forum.brokerkf.ru

Youtube: www.youtube.com/brokerkf

Facebook: http://www.facebook.com/BrokerKITFinance

Техническая поддержка

Тел. + 7 (812) 332 32 96
E-mail: support@brokerkf.ru

Время работы: с 9.00 до 24.00

Наши адреса

Санкт-Петербург
ул. Марата, д. 69-71
Бизнес-центр «Ренессанс Плаза»

Москва
Пречистенская набережная, дом 17,
Бизнес-центр «Баркли Плаза»

Настоящий обзор подготовлен исключительно в информационных целях. Ни полностью, ни в какой-либо части не представляет собой предложение по покупке, продаже или совершению каких-либо сделок или инвестиций в отношении указанных в настоящем обзоре ценных бумаг и не является рекомендацией по принятию каких-либо инвестиционных решений.

Информация, использованная при подготовке настоящего обзора, получена из предположительно достоверных источников, однако проверка использованных данных не проводилась и КИТ Финанс (ООО) не дает никаких гарантий корректности содержащейся в настоящем обзоре информации.

КИТ Финанс (ООО) не обязан обновлять или каким-либо образом актуализировать настоящий обзор, однако КИТ Финанс (ООО) имеет право по своему усмотрению, без какого-либо уведомления изменять и/или дополнять настоящий обзор и содержащиеся в нем рекомендации. Настоящий обзор не может быть воспроизведен, опубликован или распространен ни полностью, ни в какой-либо части, на него нельзя делать ссылки или проводить из него цитаты без предварительного письменного разрешения КИТ Финанс (ООО).

КИТ Финанс (ООО) не несет ответственности за любые неблагоприятные последствия, в том числе убытки, причиненные в результате использования информации, содержащейся в настоящем обзоре, или в результате инвестиционных решений принятых на основании данной информации.

КИТ Финанс (ООО) Лиц. ФСФР России на осуществление брокерской деятельности № 078-06525-100000 от 14.10.2003