Модельные портфели

Данный подход формирования портфелей предполагает приобретение акций российских компаний имеющих наиболее сильную финансовую основу и стабильность, а также перспективы дальнейшего развития, несмотря на революционные процессы, происходящие в мировой экономике. Мы учитывали большинство возможных рисков связанных с вложением в акции данных компаний и в связи с этим сформировали портфели, в состав которых входят акции российских эмитентов торгующихся на ММВБ и имеющих достаточный уровень ликвидности и возможности их приобретения. Первые два портфеля являются наиболее рискованными, а потому ориентированными на участников рынка имеющих возможность принимать на себя риски такого уровня и соответственно получать более высокий ожидаемый уровень дохода. Последние два портфеля ориентированы на участников имеющих более консервативную оценку риска, и соответственно готовых поступиться с уровнем ожидаемой доходности. Каждый из портфелей имеет инвестиционный период равный 1 календарному году, по окончанию которого будут подведены итоги, проведен анализ и сделаны выводы.

Портфель Boost

Название эмитента	Цена покупки 30.01.2009	Кол-во Лотов	Сумма (руб)	Цена закрытия 28.02.2009	Сумма	Изменение + /-	
Северсталь	90,64	1 103	99 976	130,60	144 052	44,09%	
МТС	111,37	898	100 010	123,37	110 786	10,77%	
Уралкалий	44,99	2 223	100 013	45,95	102 147	2,13%	
Акрон	356,50	280	99 820	494,00	138 320	38,57%	
ИТОГО			**399 819**		**495 305**	**23,88%**	
							17,30%
Индекс ММВБ			**624,9**		**666,05**	**6,59%**	

Портфель Flight

Название эмитента	Цена покупки 30.01.2009	Кол-во Лотов	Сумма (руб)	Цена закрытия 28.02.2009	Сумма	Изменение + /-	
Лукойл	1180,91	85	100 377	1151,31	97 861	-2,51%	
НЛМК	33,26	30	99 780	35,75	107 250	7,49%	
Новатэк	65,49	1527	100 003	81,60	124 603	24,60%	
Распадская	30,7	32	98 240	33,90	108 480	10,42%	
Роснефть	112,83	886	99 967	124,86	110 626	10,66%	
Газпромнефть	73,42	1362	99 998	78,35	106 713	6,71%	
ИТОГО			**598 366**		**655 533**	**9,55%**	
							2,97%
Индекс ММВБ			**624,90**		**666,05**	**6,59%**	

Портфель Glide

Название эмитента	Цена покупки 11.02.2009	Кол-во Лотов	Сумма (руб)	Цена закрытия 11.03.2009	Сумма	Изменение + /-	
Лукойл	1269,2	78	98 997,60	1282,97	100 072	1,08%	
ММК	8,34	119	99 246,00	7,94	94 522	-4,76%	
НЛМК	45,42	22	99 924,00	41,98	92 356	-7,57%	
Распадская	38,99	26	101 374,00	31,00	80 600	-20,49%	
Сбербанк а.о.	18,53	5400	100 062,00	17,21	92 934	-7,12%	
Сбербанк а.п.	9,30	10752	99 993,60	8,81	94 725	-5,27%	
Газпром	125,05	799	99 914,95	125,87	100 570	0,66%	
Газпромнефть	87,5	1142	99 925,00	83,58	95 448	-4,48%	
ИТОГО			**799 437**		**751 227**	**-6,03%**	
							-7,72%
Индекс ММВБ			**726,70**		**738,95**	**1,69%**	

Портфель Evolution							
Название эмитента	**Цена покупки 11.02.2009**	**Кол-во Лотов**	**Сумма (руб)**	**Цена закрытия 11.03.2009**	**Сумма**	**Изменение + /-**	
Северсталь	139,65	716	99 989,40	131,5	94 154	-5,84%	
ГМК Норильский Никель	2026,2	49	99 283,80	1725,64	84 556	-14,83%	
РусГидро	0,642	1557	99 959,40	0,641	99 804	-0,16%	
Мосэнерго	0,95	1052	99 940,00	0,879	92 471	-7,47%	
МТС	139	720	100 080,00	139,83	100 678	0,6%	
Новатэк	88,5	1129	99 916,50	73,49	82 970	-16,96%	
Полюс Золото	1264,5	79	99 895,50	1174,37	92 775	-7,13%	
Полиметалл	192	520	99 840,00	213,99	111 275	11,45%	
РБК	11,97	8354	99 997,38	8,83	73 766	-26,23%	
Роснефть	129,87	770	99 999,90	144,38	111 173	11,17%	
Сургутнефтегаз а.о.	20,81	48	99 888,00	24,83	119 189	19,32%	
Сургутнефтегаз а.п.	7,968	125,5	99 998,40	8,77	110 164	10,17%	
Татнефть а.о.	71,62	1396	99 981,52	83,84	117 041	17,06%	
Уралкалий	39,3	2544	99 979,20	63,5	161 544	61,58%	
Уралсвязьинформ а.о.	0,315	3174	99 981,00	0,307	97 442	-2,54%	
Акрон	465,51	214	99 619,14	556,88	119 172	19,63%	
ВТБ	0,0256	39062	99 998,72	0,0261	101 952	1,95%	
ФСК	0,106	9433	99 989,80	0,133	125 459	25,47%	
ИТОГО			**1 798 338**		**1 895 583**	**5,41%**	
							3,72%
Индекс ММВБ			**726,70**		**738,95**	**1,69%**	

Денис Шабанов
Заместитель начальника управления инвестиций АКБ «Инвестбанк» ОАО
Тел (495) 411-68-11 доб.27-38
shabanov@investbank.ru

Настоящий документ составлен исключительно в информационных целях и носит ознакомительный характер. Мнения, указанные в настоящем документе, не могут рассматриваться как предложение о проведении операций на рынке ценных бумаг, и в частности предложением об их покупке или продаже. Настоящий документ является собственностью АКБ «Инвестбанк» ОАО и не может быть воспроизведен полностью или частично в печатном и/или электронном виде, с него нельзя делать копии, выдержки из него не могут использоваться для каких-либо публикаций без предварительного письменного разрешения АКБ «Инвестбанк» ОАО. АКБ «Инвестбанк» ОАО не несет ответственности за несанкционированные действия третьих лиц, связанные с распространением настоящего документа или любой его части.