

КИТ-Команда. Отчёт по рекомендациям

Динамика портфеля с 1 сентября 2012 г. по 31 августа 2013 г.

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



Комментарий

В августе 2013 года волатильность на российском фондовом рынке заметно снизилась. Фактически рынок находился в боковике, в рамках того разброса цен, который был установлен в июле. Общая динамика соответствовала направлению движения развивающихся рынков и риски оттока средств с emerging markets преобладали. В связи с этим, рост цен на нефть практически не оказал позитивного влияния даже на нефтяные «фишки». В сентябре мы ждём активизации участников торгов и завершения летнего затишья.

В августе суммарная прибыль по модельному портфелю «КИТ Команда» составила -0,8% против -0,95% по индексу ММВБ.

Сводные характеристики сигналов за год

Сделки	Количество сделок	Средняя прибыль по сделке	Средняя доходность* сделки	Макс / мин доходность* сделки	Макс / мин прибыль на сделку
Прибыльные	71	0.47%	4.96%	29.80%	2.56%
Убыточные	74	-0.21%	-3.07%	-6.20%	-0.60%
Все сделки	145	0.12%	0.93%		

*доходность = прибыль по сделке / объём сделки

Методика расчёта прибыли

Расчёты прибыли (убытков) по сделкам составлены на основе рекомендаций по покупке и продаже акций. Рекомендации опубликованы в записках «Технический анализ» и «Торговые рекомендации» (в рамках услуги «КИТ-Команда») Отдела анализа и консультаций, размещённых на сайте компании www.brokerkf.ru, личном кабинете клиента «КИТ Финанс», ООО <http://lk.brokerkf.ru/team> 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. Расчёт прибыли (убытков) проводился только по закрытым позициям. Открытые на дату составления отчёта позиции в отчёте не отражены.

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.)

История сделок

Бумага	Операция	Объём	Цена открытия	Дата открытия	Цена закрытия	Дата закрытия	Прибыль
GAZP	покупка	20%	157.6	17.08.2012	168	14.09.2012	6.60%
TATN	продажа	20%	197	31.08.2012	201	06.09.2012	-1.99%
SBER	покупка	20%	94	23.08.2012	94	11.09.2012	0.00%
SBERP	продажа	20%	68	26.09.2012	66	26.09.2012	3.03%
GAZP	продажа	20%	154	12.10.2012	157.08	17.10.2012	-1.96%
GAZP	продажа	20%	154	19.10.2012	141	13.11.2012	9.22%
SBER	продажа	20%	92.65	08.10.2012	89	30.11.2012	4.10%
ROSN	покупка	20%	214	18.10.2012	225	23.10.2012	5.14%
SNGS	продажа	10%	28.15	12.10.2012	28.713	17.10.2012	-1.96%
SNGS	продажа	10%	28.15	23.10.2012	25.5	14.11.2012	10.39%
SNGS	продажа	20%	27.45	26.10.2012	27.999	06.11.2012	-1.96%
SNGS	продажа	10%	27.45	08.11.2012	25.5	14.11.2012	7.65%
SBERP	покупка	20%	68.7	17.10.2012	67.326	24.10.2012	-2.00%
SBERP	продажа	20%	65.5	01.11.2012	67.1375	30.11.2012	-2.44%
GMKN	продажа	20%	4730	13.11.2012	4825	30.11.2012	-1.97%
GMKN	покупка	20%	4930	05.12.2012	5500	17.12.2012	11.56%
GAZP	покупка	20%	143.6	21.12.2012	140	06.02.2013	-2.51%
VTBR	покупка	20%	0.0532	12.12.2012	0.06	23.01.2013	12.78%
SBERP	покупка	20%	69.5	08.01.2013	74	18.01.2013	6.47%
ROSN	продажа	20%	259	04.02.2013	264.5	13.02.2013	-2.08%
SBER	покупка	20%	104	28.01.2013	110	01.02.2013	5.77%
GMKN	продажа	5%	5910	05.02.2013	5500	21.02.2013	7.45%
SBER	продажа	20%	104.8	26.02.2013	100.5	04.04.2013	4.28%
URKA	покупка	5%	235	11.03.2013	224	15.04.2013	-4.68%
NLMK	покупка	3%	58	12.03.2013	55.35	15.03.2013	-4.57%
SBERP	покупка	10%	72	26.03.2013	74	11.04.2013	2.78%
GAZP	покупка	5.0%	134.5	01.04.2013	131.7	02.04.2013	-2.08%
CHMF	покупка	5.0%	279	01.04.2013	269.7	02.04.2013	-3.33%
ROSN	покупка	5.0%	238	01.04.2013	233.7	03.04.2013	-1.81%
VTBR	покупка	3.0%	0.0498	01.04.2013	0.0474	04.04.2013	-4.82%
GAZP	покупка	20.0%	131	03.04.2013	129	10.04.2013	-1.53%
GAZP	покупка	15.0%	130.6	08.04.2013	128.7	10.04.2013	-1.45%
MTLR	покупка	10.0%	138.8	10.04.2013	136.3	12.04.2013	-1.80%
CHMF	покупка	10.0%	263	09.04.2013	248	15.04.2013	-5.70%
ROSN	покупка	10.0%	221.6	15.04.2013	217	17.04.2013	-2.08%
SBER	продажа	10%	101.8	06.05.2013	104.2	07.05.2013	-2.30%
GMKN	продажа	5.0%	5100	25.04.2013	5210	26.04.2013	-2.11%

Бумага	Операция	Объём	Цена открытия	Дата открытия	Цена закрытия	Дата закрытия	Прибыль
GMKN	продажа	5.0%	5150	25.04.2013	5210	26.04.2013	-1.15%
LKOH	продажа	2.5%	1948	24.04.2013	2068	22.05.2013	-5.80%
RTKM	покупка	2.5%	109.6	26.04.2013	114.5	13.05.2013	4.47%
TATN	продажа	2.5%	194	25.04.2013	206	06.05.2013	-5.83%
TATN	продажа	3%	194	25.04.2013	206	06.05.2013	-5.83%
SBERP	продажа	7.5%	72	25.04.2013	76.6	20.05.2013	-6.01%
ROSN	покупка	3%	214	26.04.2013	220	06.05.2013	2.80%
URKA	покупка	5%	225	29.04.2013	235	07.05.2013	4.44%
RTKM	покупка	3%	115	30.04.2013	114.5	13.05.2013	-0.43%
LKOH	продажа	6%	2014	06.05.2013	2050	13.05.2013	-1.76%
VTBR	покупка	5%	0.0492	06.05.2013	0.047	14.05.2013	-4.47%
SBERP	продажа	8%	75	07.05.2013	76.6	14.05.2013	-2.09%
ROSN	покупка	7%	214	07.05.2013	220	13.05.2013	2.80%
URKA	покупка	5%	225	21.05.2013	228	30.05.2013	1.33%
VTBR	покупка	12%	0.046	14.05.2013	0.0437	17.05.2013	-5.00%
ROSN	покупка	12%	223	14.05.2013	218.3	21.05.2013	-2.11%
MTSS	покупка	10%	259	14.05.2013	270	22.05.2013	4.25%
GAZP	покупка	10%	125	14.05.2013	122.5	23.05.2013	-2.00%
RTKM	покупка	5%	109.6	23.05.2013	103	29.05.2013	-6.02%
GMKN	покупка	10%	4620	16.05.2013	4735	22.05.2013	2.49%
CHMF	покупка	14%	257.4	16.05.2013	273.3	03.06.2013	6.18%
NLMK	покупка	10%	45.74	17.05.2013	48	21.05.2013	4.94%
MAGN	покупка	5%	7080	17.05.2013	6770	04.06.2013	-4.38%
ROSN	покупка	6%	222	20.05.2013	218.3	21.05.2013	-1.67%
LKOH	покупка	10%	2025	20.05.2013	2013	21.05.2013	-0.59%
GAZP	покупка	5%	127.2	20.05.2013	121.59	23.05.2013	-4.41%
VTBR	покупка	10%	0.0468	21.05.2013	0.0483	22.05.2013	3.21%
RTKM	покупка	10%	114	22.05.2013	110.3	23.05.2013	-3.25%
SBER	покупка	5%	106	23.05.2013	101.7	29.05.2013	-4.06%
ROSN	покупка	7%	215.2	23.05.2013	209	29.05.2013	-2.88%
VTBR	покупка	7%	0.0478	23.05.2013	0.0457	29.05.2013	-4.39%
GMKN	покупка	10%	4620	23.05.2013	4700	30.05.2013	1.73%
PZLT	покупка	3%	984	23.05.2013	923	03.06.2013	-6.20%
PIKK	покупка	2%	64	23.05.2013	68	21.08.2013	6.25%
SBER	покупка	3%	103	24.05.2013	101.7	29.05.2013	-1.26%
ROSN	покупка	3%	211	24.05.2013	209	29.05.2013	-0.95%
GAZP	покупка	8%	120	24.05.2013	129	29.05.2013	7.50%
SBERP	продажа	13%	76.5	29.05.2013	76.85	03.06.2013	-0.46%
ROSN	продажа	5%	216	30.05.2013	200	30.05.2013	8.00%
SBERP	продажа	9%	75.9	30.05.2013	72	03.06.2013	5.42%

Бумага	Операция	Объём	Цена открытия	Дата открытия	Цена закрытия	Дата закрытия	Прибыль
GMKN	продажа	10%	4650	03.06.2013	4300	14.06.2013	8.14%
LKOH	продажа	5%	1928	04.06.2013	1992	14.06.2013	-3.21%
SBER	продажа	10%	102	14.06.2013	92	14.06.2013	10.87%
LKOH	продажа	5%	1928	07.06.2013	1846	14.06.2013	4.44%
HYDR	покупка	5%	0.467	21.06.2013	0.5053	10.07.2013	8.21%
FEES	покупка	5%	0.1038	21.06.2013	0.1037	10.07.2013	-0.12%
IRAO	покупка	5%	0.012	21.06.2013	0.0129	25.06.2013	7.50%
MRKH	покупка	5%	1.055	21.06.2013	1.067027	28.06.2013	1.14%
ROSN	покупка	5%	221	21.06.2013	227.32	27.06.2013	2.86%
VTBR	покупка	15%	0.0476	21.06.2013	0.04780	27.06.2013	0.42%
LKOH	покупка	20%	1815	21.06.2013	1787	25.06.2013	-1.54%
GMKN	покупка	10%	4490	21.06.2013	4669.6	03.07.2013	4.00%
RTKM	покупка	8%	90.8	25.06.2013	86.7	27.06.2013	-4.52%
TATN	покупка	5%	188	25.06.2013	198.0016	01.07.2013	5.32%
IRAO	покупка	5%	0.0128	25.06.2013	0.0128	10.07.2013	0.00%
SBERP	покупка	10%	69.18	26.06.2013	70.300716	03.07.2013	1.62%
GAZP	покупка	5%	109.8	26.06.2013	121.63644	12.07.2013	10.78%
CHMF	покупка	5%	212	26.06.2013	204.7	27.06.2013	-3.44%
TATN	покупка	10%	192	28.06.2013	210	18.06.2013	9.38%
SBER	покупка	8%	91.4	26.06.2013	94	28.06.2013	2.84%
ROSN	покупка	7%	224.5	27.06.2013	225.78	03.07.2013	0.57%
AFLT	покупка	14%	56	27.06.2013	54.7	25.07.2013	-2.32%
NVTK	покупка	8%	348	28.06.2013	348.696	10.07.2013	0.20%
VTBR	покупка	5%	0.047	01.07.2013	0.0479	18.07.2013	1.96%
LKOH	покупка	5%	1898	01.07.2013	1905.0226	10.07.2013	0.37%
RTKM	покупка	5%	89.6	01.07.2013	116.3008	25.07.2013	29.80%
MRKH	покупка	5%	1.094	01.07.2013	1.0969538	08.07.2013	0.27%
CHMF	покупка	8%	212.6	01.07.2013	217.29846	03.07.2013	2.21%
MTSS	покупка	5%	258	04.07.2013	267.1848	19.07.2013	3.56%
GAZP	покупка	12%	110	04.07.2013	121.858	12.07.2013	10.78%
CHMF	покупка	10%	222	04.07.2013	236.0082	18.07.2013	6.31%
GMKN	покупка	10%	4710	05.07.2013	4700	15.07.2013	-0.21%
ROSN	покупка	5%	232	05.07.2013	248.3792	12.07.2013	7.06%
NLMK	покупка	5%	45	05.07.2013	47.826	25.07.2013	6.28%
SNGS	покупка	5%	25.5	05.07.2013	26.622	18.03.2013	4.40%
SNGSP	покупка	5%	20.46	05.07.2013	21.321366	18.07.2013	4.21%
SBER	покупка	5%	92.6	08.07.2013	98.32268	18.07.2013	6.18%
SBERP	покупка	5%	70.25	08.07.2013	74.8303	19.07.2013	6.52%
GMKN	покупка	6%	45.6	10.07.2013	46.69896	15.07.2013	2.41%
RTKMP	покупка	4%	74.8	10.07.2013	78.30064	26.07.2013	4.68%

Бумага	Операция	Объём	Цена открытия	Дата открытия	Цена закрытия	Дата закрытия	Прибыль
VTBR	покупка	12%	0.0458	10.07.2013	0.0467	18.07.2013	1.96%
RASP	покупка	3%	34.3	12.07.2013	32.3	25.07.2013	-5.83%
GMKN	покупка	10%	4725	16.07.2013	4640	25.07.2013	-1.80%
ROSN	покупка	6%	248	16.07.2013	241	25.07.2013	-2.82%
HYDR	покупка	3%	0.57	18.07.2013	0.577581	25.07.2013	1.33%
FEES	покупка	3%	0.124	18.07.2013	0.118	25.07.2013	-4.84%
IRAO	покупка	3%	0.0137	18.07.2013	0.013	26.07.2013	-5.11%
LKOH	покупка	10%	2005	18.07.2013	1970	31.07.2013	-1.75%
MRKH	покупка	3%	1.244	18.07.2013	1.187	26.07.2013	-4.58%
GAZP	покупка	10%	130	18.07.2013	127.5	24.07.2013	-1.92%
MSNG	покупка	3%	1.166	18.07.2013	1.113	29.07.2013	-4.55%
SBER	покупка	5%	99.1	22.07.2013	95.7	24.07.2013	-3.43%
NVTK	покупка	5%	356	22.07.2013	344	06.08.2013	-3.37%
SBERP	покупка	5%	75.15	22.07.2013	72.7	07.08.2013	-3.26%
GAZP	покупка	8%	128.7	26.07.2013	125.3	07.08.2013	-2.64%
GMKN	покупка	6%	4620	26.07.2013	4470	31.07.2013	-3.25%
SBER	покупка	6%	95.4	26.07.2013	95.4	06.08.2013	0.00%
ROSN	покупка	8%	238.6	05.08.2013	233.5	07.08.2013	-2.14%
RTKM	покупка	5%	114.6	05.08.2013	109.5	07.08.2013	-4.45%
LKOH	покупка	10%	1962	05.08.2013	1933	06.08.2013	-1.48%
TATN	продажа	4%	205.5	06.08.2013	204	09.08.2013	0.74%
GAZP	покупка	5%	126.5	09.08.2013	131	16.08.2013	3.56%
SBER	покупка	10%	94.6	09.08.2013	95.8	16.08.2013	1.27%
HYDR	покупка	5%	0.57	09.08.2013	0.58	16.08.2013	1.75%
LKOH	покупка	5%	1910	09.08.2013	1974	15.08.2013	3.35%
SBERP	покупка	10%	73	26.08.2013	72	26.08.2013	-1.37%
SBERP	покупка	10%	73.5	26.08.2013	72	26.08.2013	-2.04%
LKOH	покупка	5%	1970	29.08.2013	1930	30.08.2013	-2.03%

Контакты:

Санкт-Петербург: 8 (812) 457 19 19, ул. Марата, 69-71, Бизнес-центр «Ренессанс Плаза»
Москва: 8 (495) 981 06 06, Пречистенская наб., 17, Бизнес-центр «Баркли Плаза»

www.brokerkf.ru , www.kfe.ee

КИТ Команда

Архипов Андрей
a.arhipov@brokerkf.ru

Ялыгин Александр
a.yalygin@brokerkf.ru

Служба клиентской поддержки

clients@brokerkf.ru

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.