

КИТ-Команда. Отчёт по рекомендациям

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

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



Комментарий

Волатильность на российском рынке увеличилась начиная с мая этого года. Несмотря на то, что сам характер движения стал менее ровным, по сравнению с динамикой зимы – весны текущего года, процент положительных сделок значительно увеличился. Кроме того, июльский рывок от минимумов года позволил максимально использовать капитал и сформировать портфель из большого числа бумаг на период роста.

В июле суммарная прибыль по модельному портфелю «КИТ Команда» составила 5,7% против 3,5% по индексу ММВБ.

Методика расчёта

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.)

Бумага	Дата рекомендации	Операция	Дата сделки	Цена открытия	Дата закрытия	Цена закрытия	Прибыль
GAZP	29.03.2012	покупка	12.04.2012	176	17.04.2012	173.8	-0.25%
SBERp	29.03.2012	продажа	13.04.2012	76	26.04.2012	70	1.58%
LKOH	02.04.2012	продажа	02.04.2012	1770	03.04.2012	1790	-0.23%
TATN	02.04.2012	покупка	03.04.2012	200	04.04.2012	196	-0.40%
MRKH	05.04.2012	покупка	05.04.2012	3.12	16.04.2012	3	-0.77%
GMKN	05.04.2012	продажа	05.04.2012	5300	04.05.2012	5000	1.13%
SBERp	06.04.2012	продажа	06.04.2012	77	26.04.2012	70	1.82%
SNGS	09.04.2012	покупка	09.04.2012	28	04.05.2012	27.44	-0.40%
TATN	11.04.2012	продажа	11.04.2012	186	15.05.2012	166	2.15%
HYDR	13.04.2012	покупка	13.04.2012	1.06	16.04.2012	1.05	-0.19%
SNGS	16.04.2012	покупка	16.04.2012	214	22.04.2012	212	-0.19%
SBER	16.04.2012	продажа	17.04.2012	93	18.04.2012	95.8	-0.60%
SNGS	23.04.2012	продажа	02.05.2012	213	04.05.2012	200	1.22%
TATN	25.04.2012	продажа	25.04.2013	194	06.05.2013	206	-0.15%
LKOH	26.04.2012	покупка	26.04.2012	1760	04.05.2012	1740	-0.23%
SBER	27.04.2012	продажа	02.05.2012	93.5	07.05.2012	89.9	0.77%
SNGS	10.05.2012	продажа	10.05.2012	27.6	15.05.2012	28.3	-0.51%

Бумага	Дата рекомендации	Операция	Дата сделки	Цена открытия	Дата закрытия	Цена закрытия	Прибыль
SBER	11.05.2012	продажа	12.05.2012	90.5	17.05.2012	82.75	1.71%
GMKN	11.05.2012	продажа	16.05.2012	5050	04.06.2012	4700	1.39%
LKOH	15.05.2012	продажа	15.05.2012	1680	18.05.2012	1570	1.31%
TATN	22.05.2012	продажа	25.05.2012	165	29.05.2012	168.3	-0.40%
GMKN	25.05.2012	покупка	15.06.2012	5150	27.06.2012	5400	0.97%
LKOH	28.05.2012	продажа	29.05.2012	1700	29.05.2012	1725	-0.29%
SNGS	28.05.2012	продажа	31.05.2012	205	01.06.2012	207	-0.20%
LKOH	04.06.2013	продажа	04.06.2013	1928	14.06.2013	1992	0.21%
TATN	08.06.2012	продажа	03.06.2012	178	15.06.2012	180	-0.22%
VTBR	14.06.2012	покупка	14.06.2012	0.056	25.06.2012	0.05512	-0.31%
SNGS	14.06.2012	покупка	15.06.2012	26.3	19.06.2012	27.7	1.06%
SNGS	19.06.2012	покупка	21.06.2012	205	05.07.2012	213	0.78%
SBERp	19.06.2012	покупка	02.07.2012	64.5	19.07.2012	68	1.09%
GMKN	19.06.2012	продажа	03.07.2012	5400	23.07.2012	5000	1.48%
SBER	21.06.2012	покупка	26.06.2012	83.5	03.07.2012	90	1.56%
TATN	21.06.2012	покупка	29.06.2012	177	04.07.2012	190	1.47%
GAZP	21.06.2012	продажа	05.07.2012	160	23.07.2012	150	1.25%
LKOH	03.07.2012	покупка	15.06.2012	1820	02.07.2012	1802	-0.20%
LKOH	03.07.2012	покупка	03.07.2012	1820	11.07.2012	1805	-0.16%
SNGS	03.07.2012	покупка	04.07.2012	28.35	06.07.2012	28.05	-0.21%
SBER	12.07.2012	покупка	17.07.2012	92	20.07.2012	91	-0.22%
SNGS	12.07.2012	продажа	17.07.2012	208	23.07.2012	195	1.25%
TATN	24.07.2012	продажа	24.07.2012	184	25.07.2012	187.67	-0.40%
GAZP	14.08.2012	покупка	17.08.2012	157.6	20.08.2012	154.448	-0.40%
GAZP	14.08.2012	покупка	17.08.2012	157.6	14.09.2012	168	1.32%
TATN	15.08.2012	продажа	31.08.2012	197	06.09.2012	201	0.41%
SBER	17.08.2012	покупка	23.08.2012	94	11.09.2012	94	0.00%
SBERp	25.09.2012	продажа	26.09.2012	68	26.09.2012	66	0.59%
GAZP	28.09.2012	продажа	12.10.2012	154	17.10.2012	157.08	-0.40%
GAZP	28.09.2012	продажа	19.10.2012	154	13.11.2012	141	1.69%
SBER	08.10.2012	продажа	08.10.2012	92.65	30.11.2012	89	0.79%
SNGS	09.10.2012	покупка	18.10.2012	214	23.10.2012	225	1.03%
SNGS	10.10.2012	продажа	12.10.2012	28.15	17.10.2012	28.713	-0.10%
SNGS	10.10.2012	продажа	23.10.2012	28.15	14.11.2012	25.5	0.47%
SNGS	10.10.2012	продажа	26.10.2012	27.45	06.11.2012	27.999	-0.20%
SNGS	10.10.2012	продажа	08.11.2012	27.45	14.11.2012	25.5	0.36%
SBERp	16.10.2012	покупка	17.10.2012	68.7	24.10.2012	67.326	-0.40%
SBERp	16.10.2012	продажа	01.11.2012	65.5	30.11.2012	67.1375	-0.50%
GMKN	08.11.2012	продажа	13.11.2012	4730	30.11.2012	4825	-0.40%
GMKN	04.12.2012	покупка	05.12.2012	4930	17.12.2012	5500	2.31%

Бумага	Дата рекомендации	Операция	Дата сделки	Цена открытия	Дата закрытия	Цена закрытия	Прибыль
GAZP	04.12.2012	покупка	21.12.2012	143.6	06.02.2013	140	-0.50%
VTBR	06.12.2012	покупка	12.12.2012	0.0532	23.01.2013	0.06	2.56%
SBERp	20.12.2012	покупка	08.01.2013	69.5	18.01.2013	74	1.29%
SNGS	22.01.2013	продажа	04.02.2013	259	13.02.2013	264.5	-0.42%
SBER	25.01.2013	покупка	28.01.2013	104	01.02.2013	110	1.15%
GMKN	29.01.2013	продажа	05.02.2013	5910	21.02.2013	5500	0.35%
SBER	25.02.2013	продажа	26.02.2013	104.8	04.04.2013	100.5	0.82%
URKA	11.03.2013	покупка	11.03.2013	235	15.04.2013	224	-0.23%
NVTK	12.03.2013	покупка	12.03.2013	312	23.04.2013	293	-0.18%
NLMK	12.03.2013	покупка	12.03.2013	58	15.03.2013	55.35	-0.14%
SNGSp	13.03.2013	покупка	13.03.2013	22.8	18.03.2013	21.6	-0.16%
SBERp	25.03.2013	покупка	26.03.2013	72	11.04.2013	74	0.28%
GAZP	01.04.2013	покупка	01.04.2013	134.5	02.04.2013	131.7	-0.10%
CHMF	01.04.2013	покупка	01.04.2013	279	02.04.2013	269.7	-0.17%
SNGS	01.04.2013	покупка	01.04.2013	238	03.04.2013	233.7	-0.09%
VTBR	01.04.2013	покупка	01.04.2013	0.0498	04.04.2013	0.0474	-0.14%
GAZP	03.04.2013	покупка	03.04.2013	131	10.04.2013	129	-0.31%
GAZP	08.04.2013	покупка	08.04.2013	130.6	10.04.2013	128.7	-0.22%
MTLR	08.04.2013	покупка	10.04.2013	138.8	12.04.2013	136.3	-0.18%
CHMF	09.04.2013	покупка	09.04.2013	263	15.04.2013	248	-0.57%
SNGS	15.04.2013	покупка	15.04.2013	221.6	17.04.2013	217	-0.21%
SBER	19.04.2013	продажа	06.05.2013	101.8	07.05.2013	104.2	-0.24%
GMKN	22.04.2013	продажа	25.04.2013	5100	26.04.2013	5210	-0.11%
GMKN	22.04.2013	продажа	25.04.2013	5150	26.04.2013	5210	-0.06%
LKOH	24.04.2013	продажа	24.04.2013	1948	22.05.2013	2068	-0.15%
RTKM	24.04.2013	покупка	26.04.2013	109.6	13.05.2013	114.5	0.11%
TATN	25.04.2013	продажа	25.04.2013	194	06.05.2013	206	-0.15%
SBERp	25.04.2013	продажа	25.04.2013	72	20.05.2013	76.6	-0.48%
SNGS	26.04.2013	покупка	26.04.2013	214	06.05.2013	220	0.08%
URKA	29.04.2013	покупка	29.04.2013	225	07.05.2013	235	0.22%
RTKM	29.04.2013	покупка	30.04.2013	115	13.05.2013	114.5	-0.01%
LKOH	06.05.2013	продажа	06.05.2013	2014	13.05.2013	2050	-0.11%
VTBR	06.05.2013	покупка	06.05.2013	0.0492	14.05.2013	0.047	-0.22%
SBERp	06.05.2013	продажа	07.05.2013	75	14.05.2013	76.6	-0.16%
SNGS	07.05.2013	покупка	07.05.2013	214	13.05.2013	220	0.20%
URKA	13.05.2013	покупка	21.05.2013	225	30.05.2013	228	0.07%
VTBR	14.05.2013	покупка	14.05.2013	0.046	17.05.2013	0.0437	-0.60%
SNGS	14.05.2013	покупка	14.05.2013	223	21.05.2013	218.3	-0.25%
MTSS	14.05.2013	покупка	14.05.2013	259	22.05.2013	270	0.42%
GAZP	14.05.2013	покупка	14.05.2013	125	23.05.2013	122.5	-0.20%

Бумага	Дата рекомендации	Операция	Дата сделки	Цена открытия	Дата закрытия	Цена закрытия	Прибыль
RTKM	14.05.2013	покупка	23.05.2013	109.6	29.05.2013	103	-0.30%
GMKN	16.05.2013	покупка	16.05.2013	4620	22.05.2013	4735	0.25%
CHMF	16.05.2013	покупка	16.05.2013	257.4	03.06.2013	273.3	0.86%
NLMK	17.05.2013	покупка	17.05.2013	45.74	21.05.2013	48	0.49%
MAGN	17.05.2013	покупка	17.05.2013	7080	04.06.2013	6770	-0.22%
SNGS	20.05.2013	покупка	20.05.2013	222	21.05.2013	218.3	-0.10%
LKOH	20.05.2013	покупка	20.05.2013	2025	21.05.2013	2013	-0.06%
GAZP	20.05.2013	покупка	20.05.2013	127.2	23.05.2013	121.59	-0.22%
VTBR	21.05.2013	покупка	21.05.2013	0.0468	22.05.2013	0.0483	0.32%
RTKM	22.05.2013	покупка	22.05.2013	114	23.05.2013	110.3	-0.32%
SBER	23.05.2013	покупка	23.05.2013	106	29.05.2013	101.7	-0.20%
SNGS	23.05.2013	покупка	23.05.2013	215.2	29.05.2013	209	-0.20%
VTBR	23.05.2013	покупка	23.05.2013	0.0478	29.05.2013	0.0457	-0.31%
GMKN	23.05.2013	покупка	23.05.2013	4620	30.05.2013	4700	0.17%
PZLT	23.05.2013	покупка	23.05.2013	984	03.06.2013	923	-0.19%
SBER	24.05.2013	покупка	24.05.2013	103	29.05.2013	101.7	-0.04%
SNGS	24.05.2013	покупка	24.05.2013	211	29.05.2013	209	-0.03%
GAZP	24.05.2013	покупка	24.05.2013	120	29.05.2013	129	0.60%
SBERp	29.05.2013	продажа	29.05.2013	76.5	03.06.2013	76.85	-0.06%
SNGS	30.05.2013	продажа	30.05.2013	216	30.05.2013	200	0.37%
SBERp	30.05.2013	продажа	30.05.2013	75.9	03.06.2013	72	0.44%
GMKN	03.06.2013	продажа	03.06.2013	4650	14.06.2013	4300	0.75%
sber	04.06.2013	продажа	14.06.2013	102	14.06.2013	92	1.08%
LKOH	04.06.2013	продажа	07.06.2013	1928	14.06.2013	1846	0.22%
HYDR	21.06.2013	покупка	21.06.2013	0.467	10.07.2013	0.5053	0.41%
FEES	21.06.2013	покупка	21.06.2013	0.1038	10.07.2013	0.1037	-0.01%
IRAO	21.06.2013	покупка	21.06.2013	0.012	25.06.2013	0.0129	0.37%
MRKH	21.06.2013	покупка	21.06.2013	1.055	28.06.2013	1.067027	0.05%
ROSN	21.06.2013	покупка	21.06.2013	221	27.06.2013	227.32	0.14%
VTBR	21.06.2013	покупка	21.06.2013	0.0476	27.06.2013	0.04780	0.06%
LKOH	21.06.2013	покупка	21.06.2013	1815	25.06.2013	1787	-0.31%
GMKN	21.06.2013	покупка	21.06.2013	4490	03.07.2013	4669.6	0.40%
RTKM	25.06.2013	покупка	25.06.2013	90.8	27.06.2013	86.7	-0.36%
TATN	25.06.2013	покупка	25.06.2013	188	01.07.2013	198.0016	0.27%
IRAO	25.06.2013	покупка	25.06.2013	0.0128	10.07.2013	0.0128	0.00%
SBERP	26.06.2013	покупка	26.06.2013	69.18	03.07.2013	70.300716	0.16%
GAZP	26.06.2013	покупка	26.06.2013	109.8	12.07.2013	121.63644	0.54%
CHMF	26.06.2013	покупка	26.06.2013	212	27.06.2013	204.7	-0.17%
TATN	26.06.2013	покупка	28.06.2013	192	18.06.2013	210	0.94%
SBER	26.06.2013	покупка	26.06.2013	91.4	28.06.2013	94	0.23%

Бумага	Дата рекомендации	Операция	Дата сделки	Цена открытия	Дата закрытия	Цена закрытия	Прибыль
ROSN	27.06.2013	покупка	27.06.2013	224.5	03.07.2013	225.78	0.04%
AFLT	27.06.2013	покупка	27.06.2013	56	25.07.2013	54.7	-0.33%
NVTK	28.06.2013	покупка	28.06.2013	348	10.07.2013	348.696	0.02%
VTBR	01.07.2013	покупка	01.07.2013	0.047	18.07.2013	0.0479	0.1%
LKOH	01.07.2013	покупка	01.07.2013	1898	10.07.2013	1905.0226	0.02%
RTKM	01.07.2013	покупка	01.07.2013	89.6	25.07.2013	116.3008	1.5%
MRKH	01.07.2013	покупка	01.07.2013	1.094	08.07.2013	1.0969538	0.0135%
CHMF	01.07.2013	покупка	01.07.2013	212.6	03.07.2013	217.29846	0.1768%
MTSS	04.07.2013	покупка	04.07.2013	258	19.07.2013	267.1848	0.1780%
GAZP	04.07.2013	покупка	04.07.2013	110	12.07.2013	121.858	1.2936%
CHMF	04.07.2013	покупка	04.07.2013	222	18.07.2013	236.0082	0.6310%
GMKN	05.07.2013	покупка	05.07.2013	4710	15.07.2013	4700	-0.0212%
ROSN	05.07.2013	покупка	05.07.2013	232	12.07.2013	248.3792	0.3530%
NLMK	05.07.2013	покупка	05.07.2013	45	25.07.2013	47.826	0.3140%
SNGS	05.07.2013	покупка	05.07.2013	25.5	18.03.2013	26.622	0.2200%
SNGSP	05.07.2013	покупка	05.07.2013	20.46	18.07.2013	21.321366	0.2105%
SBER	08.07.2013	покупка	08.07.2013	92.6	18.07.2013	98.32268	0.3090%
SBERP	08.07.2013	покупка	08.07.2013	70.25	19.07.2013	74.8303	0.3260%
GMKN	10.07.2013	покупка	10.07.2013	45.6	15.07.2013	46.69896	0.1446%
RTKMP	10.07.2013	покупка	10.07.2013	74.8	26.07.2013	78.30064	0.1872%
VTBR	10.07.2013	покупка	10.07.2013	0.0458	18.07.2013	0.0467	0.2352%
RASP	12.07.2013	покупка	12.07.2013	34.3	25.07.2013	32.3	-0.1749%
GMKN	16.07.2013	покупка	16.07.2013	4725	25.07.2013	4640	-0.1799%
ROSN	16.07.2013	покупка	16.07.2013	248	25.07.2013	241	-0.1694%
HYDR	18.07.2013	покупка	18.07.2013	0.57	25.07.2013	0.577581	0.0399%
FEES	18.07.2013	покупка	18.07.2013	0.124	25.07.2013	0.118	-0.1452%
IRAO	18.07.2013	покупка	18.07.2013	0.0137	26.07.2013	0.013	-0.1533%
LKOH	18.07.2013	покупка	18.07.2013	2005	31.07.2013	1970	-0.1746%
MRKH	18.07.2013	покупка	18.07.2013	1.244	26.07.2013	1.187	-0.1375%
GAZP	18.07.2013	покупка	18.07.2013	130	24.07.2013	127.5	-0.1923%
MSNG	18.07.2013	покупка	18.07.2013	1.166	29.07.2013	1.113	-0.1364%
SBER	22.07.2013	покупка	22.07.2013	99.1	24.07.2013	95.7	-0.1715%
GMKN	26.07.2013	покупка	26.07.2013	4620	31.07.2013	4470	-0.1948%

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

Дмитрий Остапенко
d.ostapenko@brokerkf.ru

Беляева Елена
e.belyaeva@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.