



МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

14.05.2016

21-я конференция трейдеров



Западные фонды играют ключевую роль на РФР

1. Строгое регулирование со стороны Администраторов и Регуляторов
2. Ребалансировка на основании индекса MSCI RUSSIA

- Акции на московской бирже
- АДР на Лондонской
- RSX



Ликвидность Что? Где? Когда?

адаптировано для IOS

Версия 7.52 19:09:25

СТРАНОВОЙ РИСК %:

-11.88

ММВБ ПО РЫНКУ GDR в Германии: 1,973.1
 ТЕКУЩЕЕ ЗНАЧЕНИЕ ММВБ: 1,904.5
 ТЕКУЩЕЕ ЗНАЧЕНИЕ Фьючерса РТС: 91,660.0

САЛДО ТОРГОВ, в млн., текущее 165.8
 САЛДО ТОРГОВ, в дневном масштабе 157.0
 САЛДО ТОРГОВ, к прошлому дню 14.3
 СПРАВЕДЛИВАЯ ЦЕНА ФЬЮЧЕРСА РТС 90,053.6
 Разница между справедливой и рыночной ценой **1,606.4**

Информационные технологии -1
 Нефтегазовый сектор -88
 Финансовый сектор -493
 Горнометаллургический сектор 97
 Телекоммуникации 71
 Потребительский сектор 663
 Электроэнергетика 1
 Транспортный сектор -85
INDEX ZEFINANCE 1354.932



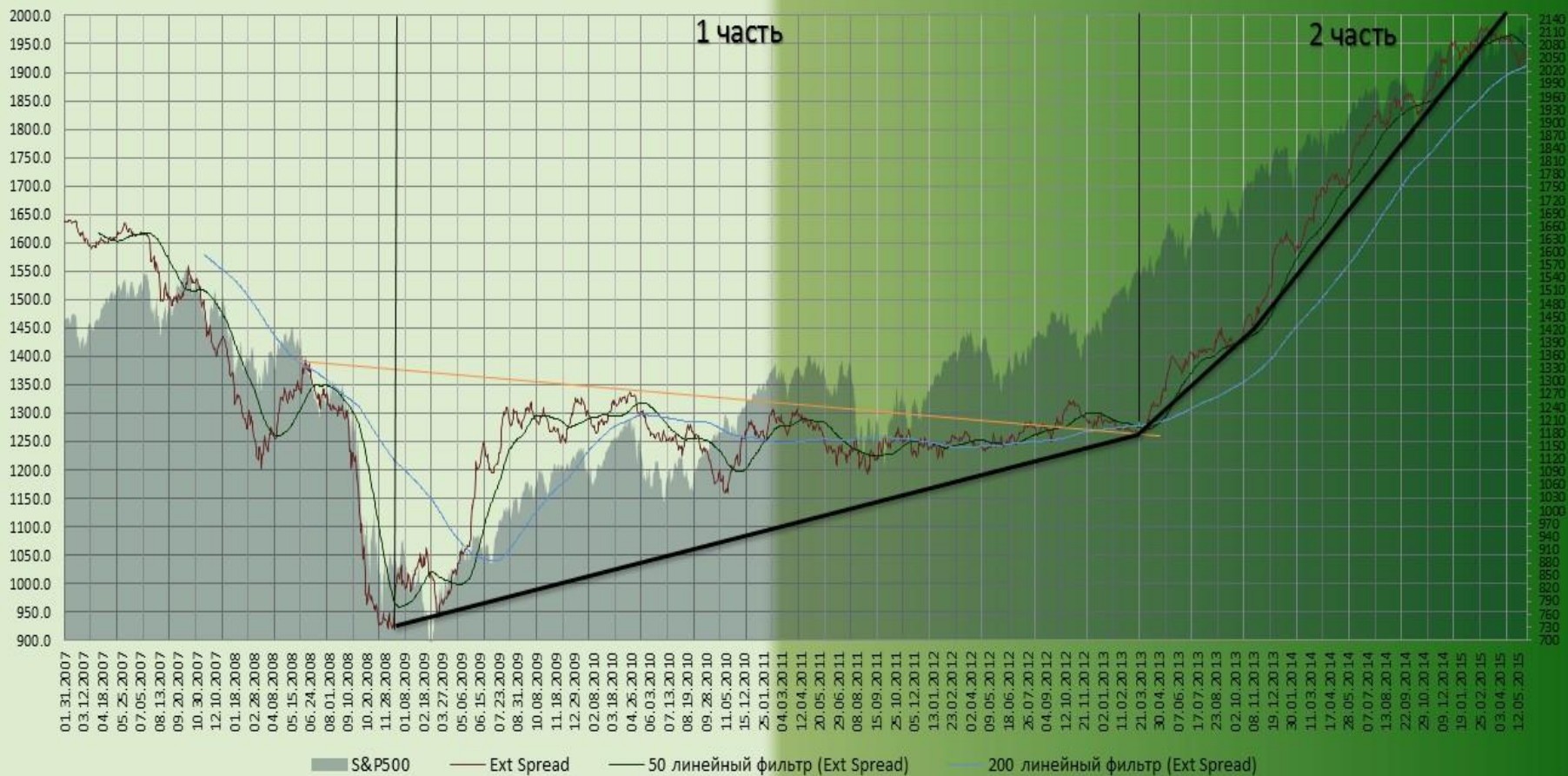
Бивалютная корзина: 69.55
 курс доллара США: 65.71 0.10%
 курс ЕВРО: 74.24

ОБОРОТ млн. руб.	Акция	% изменен ия	% изменен ия GDR	Сальдо притока в млн. Индексные фонды	GDR во Франкфурте на Майне	Поддержка по дивидендам 15 г.	Сальдо притока в Фонды "Активного" управления	Акция	ЦЕНА	Доля портфеля в %	Доля портфеля в %	Доля портфеля в %
276	АПРОСА	0.22		8	45.56		81	АПРОСА	73.24	1.44	1.48	1.8
276	АФК СИСТЕМА (G)	-0.03	0.06	-7	23.27	7.39	67	АФК СИСТЕМА	19.50	0.86	0.89	1.2
792	ВТБ	-0.03	0.06	-53	0.0664	0.005	221	ВТБ	0.0690	3.89	3.98	4.4
3,082	ГАЗПРОМ	0.09	0.06	-33	158.88	59.71	-8	ГАЗПРОМ	159.17	20.41	20.18	15.2
1,705	ГМК НорНикель	0.65	0.06	119	11136.35	7,264.2	-656	ГМК НорНикель	8,969	5.31	4.85	1.4
3,391	ЛУКОЙЛ	0.41	0.06	143	2635.6	1,773.0	173	ЛУКОЙЛ	2,685	14.59	14.64	13.8
2,100	МАГНИТ (G)	2.26	0.06	663	10869.1	2,881.1	272	МАГНИТ	9,034	6.28	6.75	12.6
90	МЕГАФОН (G)	1.22	0.06	39	741.68	714.11	87	МЕГАФОН	744.0	0.75	0.82	1.6
1,239	МОСКОВСКАЯ БИРЖА	-2.8		-209		41.86	66	МОСКОВСКАЯ БИРЖА	104.00	1.27	1.19	0.5
74	МОСЭНЕРГО	3.47	0.06	23	1.425	0.64	53	МОСЭНЕРГО	1.550	0.13	0.17	0.7
301	МТС (G)	0.41	0.06	33	299.20	258.56	-124	МТС	256.25	3.34	3.23	1.8
526	НОВАТЕК (G)	-0.18	0.06	-132	626.75	136.67	354	НОВАТЕК	619.20	6.13	6.25	6.6
1,413	РОСНЕФТЬ	1.21	0.06	213	319.24	82.49	-560	РОСНЕФТЬ	322.85	4.13	3.80	0.2
148	РОСТЕЛЕКОМ	0.22	0.06	0	92.93	33.24	106	РОСТЕЛЕКОМ	96.01	0.81	0.87	1.5
114	РУСГИДРО	-0.27	0.06	-22	0.635	0.22	-43	РУСГИДРО	0.673	0.83	0.78	0.1
7,616	СБЕРБАНК	-0.07	0.06	-224	127.70	7.39	2113	СБЕРБАНК	121.12	14.27	15.51	26.9
804	СЕВЕРСТАЛЬ	-0.14	0.06	-30	665.95	126.82	-584	СЕВЕРСТАЛЬ	689.00	1.53	1.09	10.7
761	СУРГУТНЕФТЕГАЗ	-0.58	0.06	-112	32.96	20.68	28	СУРГУТНЕФТЕГАЗ	33.38	2.60	2.54	1.3
2,066	СУРГУТНЕФТЕГАЗ ПРЕФ	-3.35	0.06	-580	40.91	41.86	-474	СУРГУТНЕФТЕГАЗ ПРЕФ.	40.98	2.95	2.29	17.4
455	ТАТНЕФТЬ	1.81	0.06	413	320.48	139.13	-176	ТАТНЕФТЬ	325.95	4.99	5.03	5.7
463	ТРАНСНЕФТЬ	-0.25		-85		13,051.0	306	ТРАНСНЕФТЬ	197,000	3.35	3.49	4.5
44	ЯНДЕКС (G)	-0.12	0.06	-1	1272.51	-	3	ЯНДЕКС	1,275.5	0.16	0.16	0.1
	ММВБ по % изменения GDR		0.07	166		838.82	1305	ПОРТФЕЛИ АКЦИЙ:	0.14	0.24	0.27	1.07

Сальдо % от трендового 0.06%
 Доход рынка ММВБ Доход портфеля Стратегия 100 Доход портфеля Стратегия 5/100 Портфельный профиль 30/100

Отток ликвидности позволяет заранее спрогнозировать снижение фондового рынка

Ext. Spread Zefinance.ru



SBERBANK, Д, MOEX

ОТКР 84.89 МАКС 85.19 МИН 82.20

ПРОДАЖА
121.07

0.00

ПОКУПКА
121.07

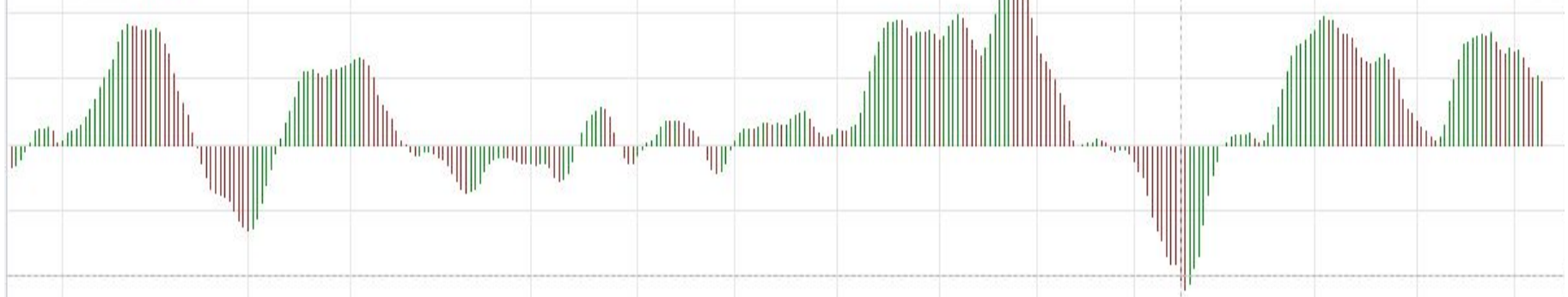
+

задержанные

Объем (20, false) 134.625M 76.701M



АО -10.3154



Фев Апр Май Июл Авг Сен Окт Ноя 2 2016-01-20 Мар Апр Май

Market Vectors Russia ETF – ключевой индикатор будущего движения рынка

В 12 из 11 случаев за последние 2 года позиции фондов точно определили будущее движение рынка



Как минимизировать риски

1. Хеджирование
2. Ребалансировка



Если вы можете в любой день потерять 100 % от счета, а хвалитесь доходностью в 50 % в месяц это бред

Инвестирование VS Спекуляции

1. Разные инструменты (Акции/Опционы)

2. Срок получения прибыли

Более подробно вебинар на московской бирже 27 и 29 октября
вебинар «Основы работы на финансовых рынках» в ШМБ

Цитата: Текущая бизнес-модель российских брокеров привела к тому, что у них только 80 000 активных счетов, а средняя жизнь такого счета составляет 9 месяцев, заявил вчера на конференции в Высшей школе экономики первый зампред ЦБ Сергей Швецов. То есть за девять месяцев человек полностью теряет свои накопления, объяснил регулятор, добавив, что для брокеров это не проблема: «Но так как у нас 140 млн населения, брокерам есть что перемалывать дальше. Они через инквизицию привлекают новых граждан».

Самый богатый человек в Вавилоне!

