



Κατασκευή & Διαχείριση Χαρτοφυλακίου

Μάθημα: Διαχείριση Επενδύσεων
Καθηγητής : Δράκος Αναστάσιος
Επιμέλεια: Ζιάκας Αναστάσιος

ΔΕΔΟΜΕΝΑ ΕΡΓΑΣΙΑΣ

ΤΙ ΘΑ ΔΟΥΜΕ?

Περίοδος παρακολούθησης και
διαχείρισης: 18/7/2018-14/8/2018

Αρχικό Κεφάλαιο : 100.000 ευρώ.

Επιλογή στρατηγικής & κριτηρίων.

Επιλογή μετοχών.

Διαχείριση.

ΕΠΙΛΟΓΗ ΣΤΡΑΤΗΓΙΚΗΣ

Αμυντικό χαρτοφυλάκιο

ΑΠΟ ΠΟΥ ΠΡΟΕΡΧΟΝΤΑΙ ΟΙ
ΜΕΤΟΧΕΣ ΜΑΣ?

- 1) LARGE CAP
- 2) MID CAP

ΣΥΝΟΛΟ: 15 ΜΕΤΟΧΕΣ

ΜΕΤΟΧΕΣ

| | | |
|--------------|--------------|---------------|
| ΓΡΙΒ | ΜΥΤΙΑ | ΟΛΘ |
| ΤΙΚΤ | ΙΚΤΙΝ | ΚΛΜ |
| ΜΠΕΛΑ | ΣΑΡ | ΟΛΥΜΠ |
| ΟΠΑΠ | ΠΛΑΙΣ | ΟΤΕ |
| ΕΕΕ | ΥΓΕΙΑ | ΑΝΕΜΟΣ |

ΚΡΙΤΗΡΙΟ ΕΠΙΛΟΓΗΣ :
ΣΥΣΧΕΤΙΣΗ < 0,5

SCORING ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ

| ΜΕΤΟΧΕΣ | ΚΡΙΤΗΡΙΑ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ ΜΕΤΟΧΩΝ | | | | | | ΣΥΝΟΛΟ | SCORE |
|---------|------------------------------|------|------------|-----------------|-----------------|---------------|--------|-------|
| | ΚΕΦΑΛΑΙΟΠΟΙΗΣΗ | ΒΗΤΑ | ΡΕΥΣΤΟΤΗΤΑ | ΤΥΠΙΚΗ ΑΠΟΚΛΙΣΗ | ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΗ ΔΟΜΗ | CURRENT RATIO | | |
| | 25% | 10% | 25% | 10% | 15% | 15% | 100% | |
| ΓΡΙΒ | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1 | 0,4 | |
| ΜΥΤΙΛ | 1 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0,7 | 4 |
| ΟΛΘ | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1 | 0,4 | |
| ΤΙΚΤ | 1 | 1 | 1 | 1 | 0 | 1 | 0,85 | 2 |
| ΙΚΤΙΝ | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,1 | |
| ΚΛΜ | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,1 | |
| ΜΠΕΛΑ | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| ΣΑΡ | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0,25 | |
| ΟΛΥΜΠ | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,1 | |
| ΟΠΑΠ | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0,85 | 3 |
| ΠΛΑΙΣ | 0 | 1 | 0 | 1 | 1 | 1 | 0,5 | 6 |
| ΟΤΕ | 1 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0,7 | 5 |
| ΕΕΕ | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,35 | |
| ΥΓΕΙΑ | 0 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,35 | |
| ΑΝΕΜΟΣ | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,1 | |
| | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |

ΣΥΣΤΑΣΗ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ

| Α/Α | ΜΕΤΟΧΗ | ΣΤΑΘΜΙΣΗ | ΠΟΣΟ |
|-----|---------|----------|--------|
| 1 | ΜΠΕΛΑ | 16% | 16000 |
| 2 | ΤΙΚΤ | 16% | 16000 |
| 3 | ΟΠΑΠ | 12% | 12000 |
| 4 | ΜΥΤΙΛ | 16% | 16000 |
| 5 | ΟΤΕ | 10% | 10000 |
| 6 | ΠΛΑΙΣ | 10% | 10000 |
| | ΜΕΤΡΗΤΑ | 20% | 20000 |
| | ΣΥΝΟΛΟ | 100% | 100000 |

ΑΛΛΑΓΕΣ ΣΤΟ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ

| 1η ΑΛΛΑΓΗ | | | |
|----------------------------------|-----------|----------------|-----------|
| Νέα Σύσταση | | Ημερομηνία | 23/7/2018 |
| Ημέρες από έναρξη | | | 6 |
| ΣΥΝΝΑΛΑΓΕΣ | | | |
| Πώληση | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Μετοχή | 0 | | |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο από διαθεσίμων από πώληση | | | 0 € |
| Τόκοι από Μετρητα | | | 0 € |
| Διαθέσιμα με μετρητα | | | 20.000 € |
| Αγορά | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΣΑΡ | 7,1 | 1.408 | 10.000 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο | | | 10.000 € |

| 3η ΑΛΛΑΓΗ | | | |
|----------------------------------|-----------|----------------|----------|
| Νέα Σύσταση | | Ημερομηνία | 2/8/2018 |
| Ημέρες από έναρξη | | | 16 |
| ΣΥΝΝΑΛΑΓΕΣ | | | |
| Πώληση | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΤΙΚΤ | 20,75 | 774 | 16.061 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο από διαθεσίμων από πώληση | | | 16.061 € |
| Τόκοι από Μετρητα | | | 18 € |
| Διαθέσιμα με μετρητα | | | 26.365 € |
| Αγορά | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΟΛΘ | 24,5 | 653 | 16.000 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |

| 2η ΑΛΛΑΓΗ | | | |
|----------------------------------|-----------|----------------|----------|
| Νέα Σύσταση | | Ημερομηνία | 1/8/2018 |
| Ημέρες από έναρξη | | | 15 |
| ΣΥΝΝΑΛΑΓΕΣ | | | |
| Πώληση | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΟΤΕ | 11,15 | 921 | 10.269 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο από διαθεσίμων από πώληση | | | 10.269 € |
| Τόκοι από Μετρητα | | | 17 € |
| Διαθέσιμα με μετρητα | | | 20.286 € |
| Αγορά | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΓΡΙΒ | 8,55 | 1.169 | 10.000 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο | | | 10.000 € |

| 4η ΑΛΛΑΓΗ | | | |
|----------------------------------|-----------|----------------|----------|
| Νέα Σύσταση | | Ημερομηνία | 3/8/2018 |
| Ημέρες από έναρξη | | | 17 |
| ΣΥΝΝΑΛΑΓΕΣ | | | |
| Πώληση | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΜΥΤΙΛ | 8,7 | 1.856 | 16.147 € |
| ΟΛΘ | 24,9 | 653 | 16.260 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο από διαθεσίμων από πώληση | | | 32.407 € |
| Τόκοι από Μετρητα | | | 20 € |
| Διαθέσιμα με μετρητα | | | 32.427 € |
| Αγορά | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο | | | |

ΑΛΛΑΓΕΣ ΣΤΟ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ

| 5η ΑΛΛΑΓΗ | | | |
|----------------------------------|-----------|----------------|----------|
| | | | |
| Νέα Σύσταση | | Ημερομηνία | 3/8/2018 |
| Ημέρες από έναρξη | | | 17 |
| ΣΥΝΝΑΛΑΓΕΣ | | | |
| <u>Πώληση</u> | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΜΠΕΛΑ | 14,06 | 1.147 | 16.127 € |
| | | | |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο από διαθεσίμων από πώληση | | | 16.127 € |
| Τόκοι από Μετρητα | | | 81 € |
| Διαθέσιμα με μετρητα | | | 16.208 € |
| <u>Αγορά</u> | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| | | | |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο | | | |

| 6η ΑΛΛΑΓΗ | | | |
|----------------------------------|-----------|----------------|----------|
| | | | |
| Νέα Σύσταση | | Ημερομηνία | 6/8/2018 |
| Ημέρες από έναρξη | | | 20 |
| ΣΥΝΝΑΛΑΓΕΣ | | | |
| <u>Πώληση</u> | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΣΑΡ | 7,18 | 1.408 | 10.109 € |
| | | | |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο από διαθεσίμων από πώληση | | | 10.109 € |
| Τόκοι από Μετρητα | | | 131 € |
| Διαθέσιμα με μετρητα | | | 10.241 € |
| <u>Αγορά</u> | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΕΕΕ | 30,8 | 1.883 | 58.000 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο | | | |

| 7η ΑΛΛΑΓΗ | | | |
|----------------------------------|-----------|----------------|----------|
| | | | |
| Νέα Σύσταση | | Ημερομηνία | 7/8/2018 |
| Ημέρες από έναρξη | | | 21 |
| ΣΥΝΝΑΛΑΓΕΣ | | | |
| <u>Πώληση</u> | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΕΕΕ | 31 | 1.883 | 58.373 € |
| ΓΡΙΒ | 8,63 | 1.169 | 10.088 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο από διαθεσίμων από πώληση | | | 68.461 € |
| Τόκοι από Μετρητα | | | 26 € |
| Διαθέσιμα με μετρητα | | | 79.727 € |
| <u>Αγορά</u> | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΟΛΥΜΠ | 1,95 | 10.256 | 20.000 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο | | | |

| 8η ΑΛΛΑΓΗ | | | |
|----------------------------------|-----------|----------------|----------|
| | | | |
| Νέα Σύσταση | | Ημερομηνία | 7/8/2018 |
| Ημέρες από έναρξη | | | 21 |
| ΣΥΝΝΑΛΑΓΕΣ | | | |
| <u>Πώληση</u> | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| ΟΛΥΜΠ | 1,96 | 10.256 | 20.102 € |
| | | | 0 € |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο από διαθεσίμων από πώληση | | | 20.102 € |
| Τόκοι από Μετρητα | | | 139 € |
| Διαθέσιμα με μετρητα | | | 20.242 € |
| <u>Αγορά</u> | τιμή Μτχ. | αριθμ. Μετοχών | ποσό |
| | | | |
| Μετοχή | 0 | 0 | 0 € |
| Σύνολο | | | |

ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

ΑΡΧΙΚΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ : 100.000

ΤΕΛΙΚΟ ΚΕΦΑΛΑΙΟ : 101.969

ΑΠΟΔΟΣΗ: 1,969%