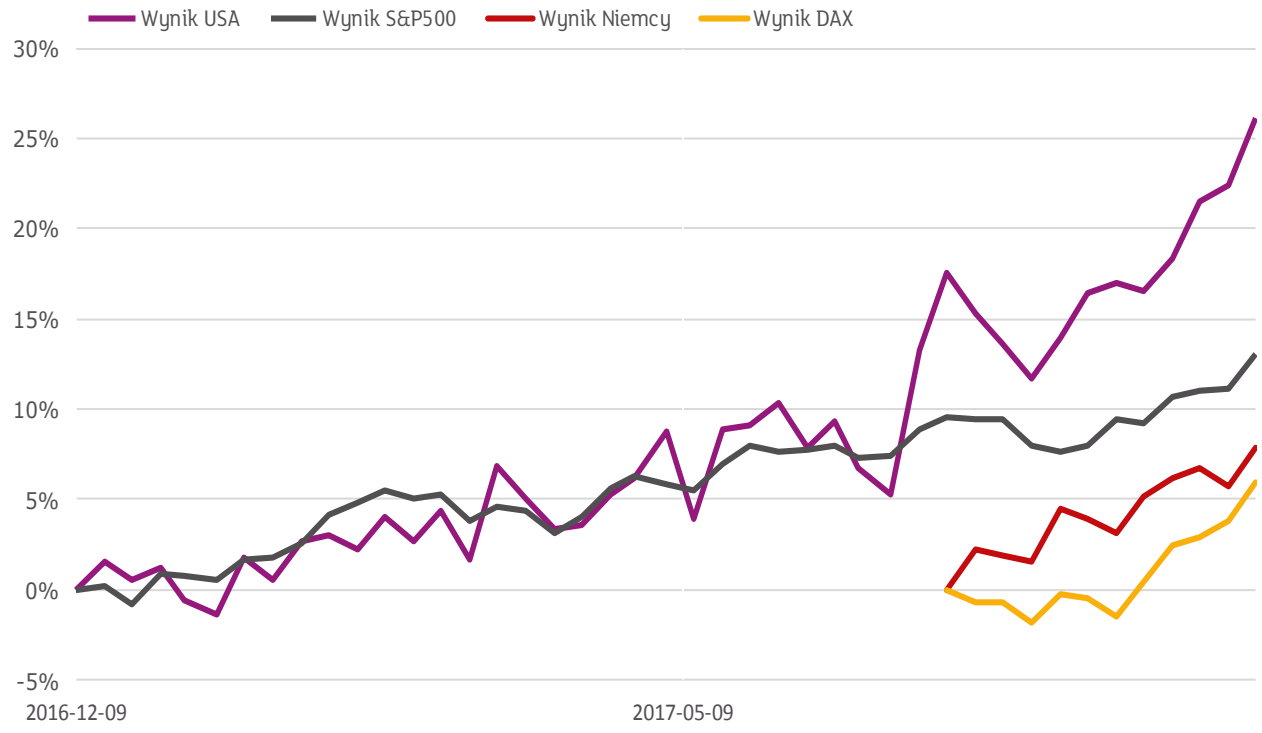
mBank Dom Maklerski

wtorek, 10 października 2017

Zagraniczne Portfele Algorytmiczne

Portfel strategii USA	**Wartość portfela**	**$127 222,09** **27,22%**
Portfel strategii Niemcy	**Wartość portfela**	**€ 106 987,93** **6,99%**

Strategie na tle S&P500 i DAX



Wyjściowa kwota obu portfeli to 100 000 jednostek waluty bazowej. Portfel strategii **USA** prowadzony jest od 19 grudnia 2016 r. a strategii **Niemcy** od dnia 24 lipca 2016 r. Transakcje zawierane są wirtualnie po cenach otwarcia danego dnia przy uwzględnieniu standardowej prowizji internetowej. Dywidendy są wypłacane po dniu ich przyznania, po odliczeniu 19% podatku.

Kryteria doboru spółek oparte są na zasadach analizy technicznej - sygnały generowane są w sposób mechaniczny na podstawie określonego algorytmu. Zasadą jest dobór płynnych spółek spośród elementów wchodzących w skład indeksu S&P500(USA) oraz DAX i mDAX(Niemicy).

Niniejsza publikacja jest publikacją handlową, prosimy o zapoznanie się z oświadczeniem umieszczonym na jej końcu. Inwestowanie na rynku kapitałowym wiąże się z ryzykiem inwestycyjnym szczegółowo opisanym w pakiecie MIFID zamieszczonym na stronie Domu Maklerskiego mBanku:
http://www.mdm.pl/ui-pub/site/oferta_indywidualna/rachunek_maklerski/regulaminy_i_regulacje.

mBank Dom Maklerski

Szczegóły strategii USA

Portfel strategii USA

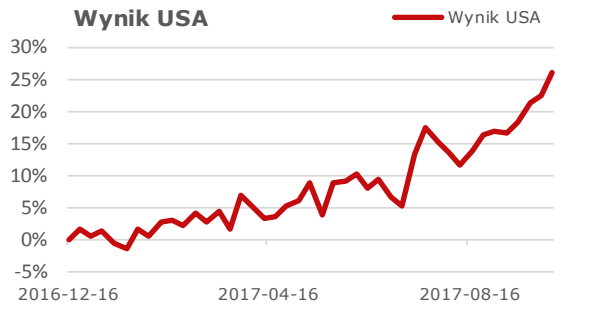
Wartość portfela **$ 127 222,09**

27,22%

Gotówka / Depozyt

Wartość **$ 62,76**

Procent portfela **0,05%**



Pozycje akcyjne

Lp.	Instrument	Data zakupu	Liczba	Kurs zakupu	Kurs bieżący	Aktualna wartość	Procent portfela	Rentowność	Dyw.
1.	**NVIDIA Corp**	2016-12-19	99	99,70	185,39	18353,61	14,43%	86,37%	0,42
2.	**Micron Tech**	2016-12-19	485	20,43	40,96	19865,6	15,61%	100,49%	0,00
3.	**NRG Energy**	2017-06-02	538	16,71	25,74	13848,12	10,88%	54,22%	0,03
4.	**Lam Research**	2017-06-02	57	157,15	184,66	10525,62	8,27%	18,08%	0,90
5.	**Vertex Pharm**	2017-07-14	79	131,77	155,55	12288,45	9,66%	18,05%	0,00
6.	**First Solar**	2017-09-08	211	47,35	46,91	9898,01	7,78%	-0,93%	0,00
7.	**Boening Co**	2017-09-08	42	235,75	258,39	10852,38	8,53%	9,60%	0,00
8.	**FMC Corp**	2017-09-08	114	87,33	90,76	10346,64	8,13%	4,12%	0,17
9.	**AUTODESK INC**	2017-09-29	90	111,25	117,14	10542,6	8,29%	5,29%	0,00
10.	**INTUITIVE SU**	2017-09-29	30	342,72	354,61	10638,3	8,36%	3,47%	0,00

Strategia USA, to skoncentrowany portfel skupiający się na walorach wchodzących w skład S&P500 oraz Nasdaq100 ze stałą liczbę elementów wynoszącą 10. Wyjątkiem są sytuacje, gdy wskaźniki zawarte w algorytmie wskazują większe prawdopodobieństwo spadków. W takim przypadku, Strategia USA zakłada zamianę akcji na ETF oparte o amerykański dług oraz ETF na metale szlachetne. Osoby zainteresowane otrzymywaniem sygnałów przed sesją, zachęcamy do kontaktu na adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl lub pod numerem telefonu +48 22 697 48 48

mBank Dom Maklerski

Szczegóły strategii Niemcy

Portfel strategii Niemcy

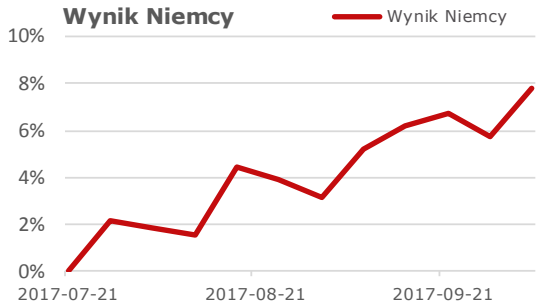
Wartość portfela **€ 106 987,93**

6,99%

Gotówka / Depozyt

Wartość **€ 43,67**

Procent portfela **0,04%**



Pozycje akcyjne

Lp.	Instrument	Data zakupu	Liczba	Kurs zakupu	Kurs bieżący	Aktualna wartość	Procent portfela	Rentowność	Dyw.
1.	**Lufthansa**	2017-07-24	540	18,45	23,98	12949,2	12,10%	29,97%	0,00
2.	**Commerzbank**	2017-07-24	964	10,26	11,58	11163,12	10,43%	12,87%	0,00
3.	**RWE AG**	2017-07-24	570	17,34	19,89	11337,3	10,60%	14,71%	0,00
4.	**Leoni AG**	2017-07-24	202	48,92	56,37	11386,74	10,64%	15,23%	0,00
5.	**Osram Licht**	2017-07-31	146	69,60	63,00	9198	8,60%	-9,48%	0,00
6.	**Fraport AG**	2017-08-08	123	84,74	79,86	9822,78	9,18%	-5,76%	0,00
7.	**Stada Arznei**	2017-08-21	120	82,26	82,27	9872,4	9,23%	0,89%	0,72
8.	**E.ON SE**	2017-09-01	1096	9,27	9,65	10576,4	9,89%	4,10%	0,00
9.	**HELLA KGAA H**	2017-10-02	214	49,63	50,88	10888,32	10,18%	2,52%	0,00
10.	**Kion Group A**	2017-10-10	125	78,12	78,00	9750	9,11%	-0,15%	0,00

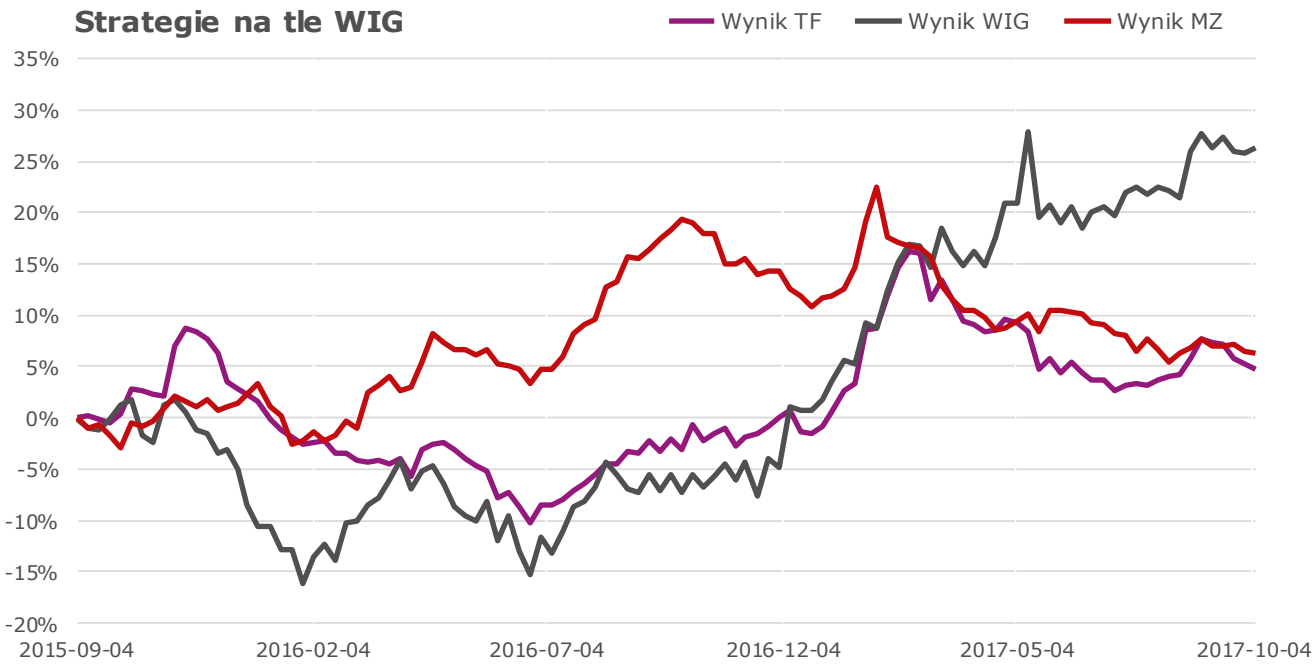
Strategia Niemcy, to skoncentrowany portfel skupiający się na walorach wchodzących w skład indeksów DAX i mDAX ze stałą liczbę elementów wynoszącą 10. Wyjątkiem są sytuacje, gdy wskaźniki zawarte w algorytmie wskazują większe prawdopodobieństwo spadków. W takim przypadku, Strategia Niemcy zakłada zamianę akcji na ETF oparte o Europejski dług oraz ETF na metale szlachetne. Osoby zainteresowane otrzymywaniem sygnałów przed sesją, zachęcamy do kontaktu na adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl lub pod numerem telefonu +48 22 697 48 48

mBank Dom Maklerski

wtorek, 10 października 2017

Portfele Algorytmiczne

Portfel strategii Momentum Zdywersyfikowana	**Wartość portfela**	**123 770,58 zł**
		23,77%
Portfel strategii Trend Following	**Wartość portfela**	**115 868,89 zł**
		15,87%



Wyjściowa kwota obu portfeli to 100 000 zł, portfel strategii **Momentum Zdywersyfikowana** jest prowadzony od 22 kwietnia 2013 r. a strategii **Trend Following** od dnia 16 czerwca 2015 r. Transakcje są zawierane wirtualnie po cenach otwarcia danego dnia (przy jej braku do godz. 12 00 po cenach odniesienia ustalanych przez GPW SA), przy uwzględnieniu standardowej prowizji internetowej. Dywidendy są wypłacane po dniu ich przyznania, po odliczeniu 19% podatku.

Kryteria doboru spółek są oparte na zasadach analizy technicznej - sygnały generowane są w sposób mechaniczny na podstawie określonego algorytmu. Zasadą jest dobór płynnych spółek spośród wchodzących do indeksu WIG, prowadzący portfel dopuszcza arbitralne decyzje dotyczące zaangażowania w daną spółkę.

Niniejsza publikacja jest publikacją handlową, prosimy o zapoznanie się z oświadczeniem umieszczonym na jej końcu. Inwestowanie na rynku kapitałowym wiąże się z ryzykiem inwestycyjnym szczegółowo opisanym w pakiecie MIFID zamieszczonym na stronie Domu Maklerskiego mBanku:
http://www.mdm.pl/ui-pub/site/oferta_indywidualna/rachunek_maklerski/regulaminy_i_regulacje.

mBank Dom Maklerski

Szczegóły strategii Momentum Zdywersyfikowany

Portfel strategii Momentum Zdywersyfikowana

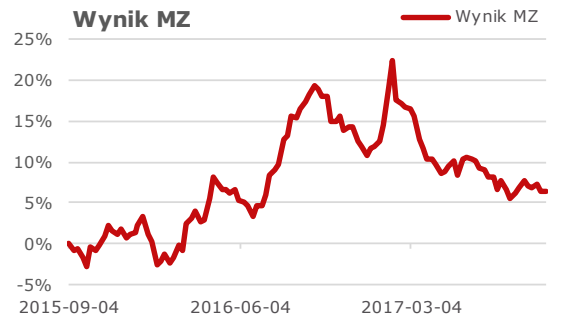
Wartość portfela **123 770,58 zł**

23,77%

Gotówka / Depozyt

Wartość **79 563,52 zł**

Procent portfela **64,28%**



Pozycje akcyjne

Lp.	Instrument	Data zakupu	Liczba	Kurs zakupu	Kurs bieżący	Aktualna wartość	Procent portfela	Rentowność	Dyw.
1.	**GTC**	2017-04-24	557	9,15	9,63	5363,91	4,33%	5,25%	
2.	**GPW**	2017-04-24	110	46,00	45,00	4950	4,00%	-2,17%	
3.	**PCC ROKITA**	2017-06-12	54	91,48	94,50	5103	4,12%	3,30%	
4.	**PKP**	2017-08-07	77	64,00	58,79	4526,83	3,66%	-8,14%	
5.	**IDEA BANK**	2017-08-25	189	26,30	24,98	4721,22	3,81%	-5,02%	
6.	**IMPEXMETAL**	2017-08-25	1117	4,45	4,44	4959,48	4,01%	-0,22%	
7.	**11BIT**	2017-08-30	25	197,05	189,95	4748,75	3,84%	-3,60%	
8.	**FAMUR**	2017-09-05	823	6,04	6,14	5053,22	4,08%	1,66%	
9.	**AMICA**	2017-10-04	29	167,50	164,85	4780,65	3,86%	-1,58%	

Strategia Momentum Zdywersyfikowana jest oparta o szeroko (do 24 spółek) zdywersyfikowany portfel polskich spółek wchodzących do indeksu WIG. Celem portfela jest zajmowanie pozycji w spółkach rozpoczynających trend wzrostowy oraz szybka realizacja zysków przy pozytywnym scenariuszu. Osoby zainteresowane otrzymywaniem sygnałów przed sesją, zachęcamy do kontaktu na adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl lub pod numerem telefonu +48 22 697 48 48

mBank Dom Maklerski

Szczegóły strategii Trend Following

Portfel strategii Trend Following

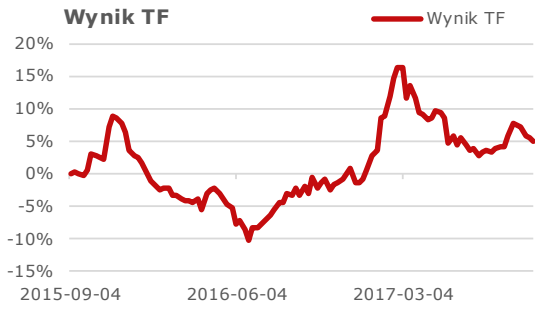
Wartość portfela **115 868,89 zł**

15,87%

Gotówka / Depozyt

Wartość **68 871,36 zł**

Procent portfela **59,44%**



Pozycje akcyjne

Lp.	Instrument	Data zakupu	Liczba	Kurs zakupu	Kurs bieżący	Aktualna wartość	Procent portfela	Rentowność	Dyw.
1.	**PGNIG**	2016-12-20	874	5,82	6,87	6004,38	5,18%	21,46%	0,20
2.	**LPP**	2017-05-24	1	6310,00	8379,95	8379,95	7,23%	32,80%	0,00
3.	**ENERGA**	2017-07-20	225	11,09	12,48	2808	2,42%	12,53%	0,00
4.	**JSW**	2017-07-26	80	84,20	100,20	8016	6,92%	19,00%	0,00
5.	**EUROCASH**	2017-08-24	188	36,70	38,00	7144	6,17%	3,54%	0,00
6.	**EMPERIA**	2017-08-30	74	93,50	89,60	6630,4	5,72%	-4,17%	0,00
7.	**LOTOS**	2017-09-12	120	59,00	66,79	8014,8	6,92%	13,20%	0,00

mBank Dom Maklerski

Kontakt

Biuro Aktywnej Sprzedaży
ul. Wspólna 47/49, 00-684 Warszawa

Kamil Szymański, CFA
dyrektor
tel. +48 22 697 4706
fax. +48 22 697 4726/4923
kamil.szymanski@mbank.pl

Jarosław Banasiak
tel. +48 22 697 4870
fax. +48 22 697 4726/4923
jaroslaw.banasiak@mbank.pl

Zespół Wsparcia Sprzedaży

Daniel Cegiełka
infoserwis
tel. +48 22 697 4914
daniel.cegielka@mbank.pl

Piotr Neidek
analiza techniczna
tel. +48 22 697 4766
piotr.neldek@mbank.pl

Remigiusz Lemke
analiza techniczna
tel. +48 22 697 4848
remigiusz.lemke@mbank.pl

Zespół Prywatnego Maklera

Joanna Gębal
tel. +48 22 697 4 7 62
joanna.gebal @mbank.pl

Marcin Bieguński
tel. +48 22 697 49 84
marcln.biegunski@mbank.pl

Przemysław Miedziocha, CFA
tel. +48 22 697 47 68
przemyslaw.miedziocha@mbank.pl

Paweł Rudowski
tel. +48 22 697 4852
pawel.rudowski@mbank.pl

Rafał Włóka
tel. +48 22 697 48 09
rafal.wloka@mbank.pl

Niniejsza publikacja przygotowana przez Dom Maklerski mBanku jest publikacją handlową, została przygotowana wyłącznie w celach informacyjnych, nie stanowi rekomendacji w rozumieniu przepisów „Rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 19 października 2005 r. w sprawie informacji stanowiących rekomendacje dotyczące instrumentów finansowych lub ich emitentów lub wystawców (Dz. U. nr 206 z 2005 r.), nie stanowi porady inwestycyjnej, nie stanowi oferty zbycia lub nabycia wymienionych w niej instrumentów finansowych, nie stanowi podstawy do zawarcia jakiejkolwiek umowy lub powstania jakiegokolwiek zobowiązania. mBank S.A. z siedzibą w Warszawie (00-950), przy ul. Senatorskiej 18 prowadzi działalność maklerską w ramach wyodrębnionej jednostki organizacyjnej – Biura Maklerskiego posługującego się nazwą Dom Maklerski mBanku. Informacje zawarte w niniejszej publikacji oparte są na danych uzyskanych ze źródeł, które Dom Maklerski mBanku działając w dobrej wierze, uważa za wiarygodne. Dom Maklerski mBanku nie gwarantuje jednak dokładności, kompletności ani trafności tych informacji. mBank S.A., jego organy zarządcze, organy nadzorcze, ani pracownicy nie ponoszą odpowiedzialności za wszelkie skutki finansowe i niefinansowe powstałe w wyniku wykorzystania niniejszej publikacji lub zawartych w niej informacji. Wszelkie opinie, prognozy, kalkulacje i szacunki zawarte w niniejszej publikacji stanowią jedynie wyraz subiektywnej oceny autora na moment jej wydania i mogą być zmieniane bez uprzedzenia. Opinie wyrażone w niniejszej publikacji nie pozostają w jakiejkolwiek zależności od rekomendacji przygotowywanych przez Dom Maklerski. Portfel jest wirtualny a jego skład jest wynikiem pracy analityków technicznych i bazuje na ich osobistej wiedzy, doświadczeniu i informacji ogólnie dostępnych. Dom Maklerski mBanku nie jest zobowiązany do aktualizowania ani modyfikowania niniejszej publikacji, ani do informowania jej odbiorców w przypadku, gdy jakakolwiek poruszona w niej kwestia lub zawarta w niej opinia, prognoza, kalkulacja lub szacunek ulegnie zmianie lub stanie się nieaktualne. Dom Maklerski mBanku udostępnia niniejszą publikację nieodpłatnie. Zabronione jest powielanie i rozpowszechnianie niniejszej publikacji bez pisemnej zgody mBanku S.A.