

piątek, 22 września 2017

Portfele Algorytmiczne

Portfel strategii
Momentum
Zdywersyfikowana

Wartość portfela

124 596,79 zł

24,60%

Portfel strategii
Trend Following

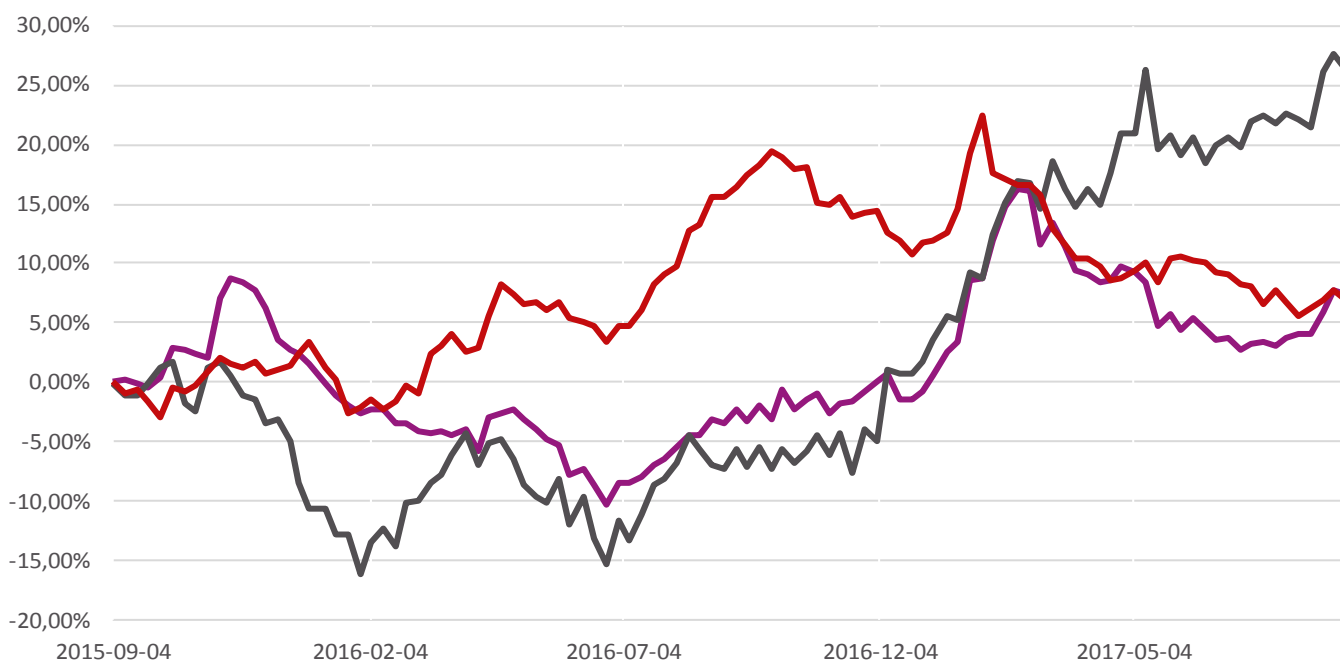
Wartość portfela

116 185,80 zł

16,19%

Strategie na tle WIG

Wynik TF Wynik WIG Wynik MZ



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.



Dom Maklerski

Szczegóły strategii Momentum Zdywersyfikowany

Portfel strategii
Momentum
Zdywersyfikowana

Wartość portfela

124 596,79 zł

24,60%

Gotówka / Depozyt

Wartość

57 817,74 zł

Procent portfela

46,40%



Pozycje akcyjne

Lp.	Instrument	Data zakupu	Liczba	Kurs zakupu	Kurs bieżący	Aktualna wartość	Procent portfela	Rentowność	Dyw.
1.	CEZ	2017-02-09	79	70,40	71,00	5609	4,50%	8,39%	5,31
2.	VISTULA	2017-02-14	1633	3,34	3,63	5927,79	4,76%	8,68%	
3.	GTC	2017-04-24	557	9,15	9,62	5358,34	4,30%	5,14%	
4.	GPW	2017-04-24	110	46,00	45,17	4968,7	3,99%	-1,80%	
5.	ATAL	2017-05-25	139	38,30	43,90	6102,1	4,90%	14,62%	
6.	ROBYG	2017-06-01	1490	3,39	3,23	4812,7	3,86%	-4,72%	
7.	PCC ROKITA	2017-06-12	54	91,48	90,40	4881,6	3,45%	-1,18%	
8.	PKP	2017-08-07	77	64,00	62,30	4797,1	3,39%	-2,66%	
9.	FORTUNA	2017-08-14	201	24,30	22,78	4578,78	3,23%	-6,26%	
10.	IDEA BANK	2017-08-25	189	26,30	26,00	4914	3,47%	-1,14%	
11.	IMPEXMETAL	2017-08-25	1117	4,45	4,43	4948,31	3,49%	-0,45%	
12.	11BIT	2017-08-30	25	197,05	187,50	4687,5	3,31%	-4,85%	
13.	FAMUR	2017-09-05	823	6,04	6,31	5193,13	3,67%	4,47%	

Pozycje Opcyjne

Instrument	Data zakupu	Liczba	Kurs zakupu	Kurs bieżący	Zysk/strata na pozycji
------------	-------------	--------	-------------	--------------	------------------------

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. Strategia zakłada stosowanie opcji w celu zabezpieczenia portfela przed systemowym ryzykiem załamania na rynkach kapitałowych przy jednoczesnym wykluczaniu najbardziej popularnych, szeroko pokrywanych spółek (głównie z WIG20). Osoby zainteresowane otrzymywaniem sygnałów przed sesją, zachęcamy do kontaktu na adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl lub pod numerem telefonu +48 22 697 48 48

Szczegóły strategii Trend Following

Portfel strategii
Trend Following

Wartość portfela

116 185,80 zł
16,19%

Gotówka / Depozyt

Wartość

47 264,06 zł

Procent portfela

40,68%


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	6,73	5882,02	5,06%	19,05%	0,20
2.	LPP	2017-05-24	1	6310,00	8870,00	8870	7,63%	40,57%	0,00
3.	PZU	2017-06-01	139	44,25	47,00	6533	5,62%	6,21%	
4.	ENERGA	2017-07-20	225	11,09	13,19	2967,75	2,55%	18,94%	
5.	TAURON	2017-07-24	653	3,85	3,83	2500,99	2,15%	-0,52%	
6.	JSW	2017-07-26	80	84,20	97,48	7798,4	6,71%	15,77%	
7.	ORANGE	2017-07-31	1220	5,54	5,32	6490,4	5,59%	-3,97%	
8.	EUROCASH	2017-08-24	188	36,70	37,33	7018,04	6,04%	1,72%	
9.	EMPERIA	2017-08-30	74	93,50	92,81	6867,94	5,91%	-0,74%	
10.	ENEA	2017-09-11	480	14,70	14,63	7022,4	6,04%	-0,48%	
11.	LOTOS	2017-09-12	120	59,00	58,09	6970,8	6,00%	-1,54%	

Strategia Trend Following to skoncentrowany (do 15 spółek) portfel najbardziej płynnych polskich spółek wchodzących do indeksu WIG. Celem portfela jest zajmowanie pozycji w spółkach o ugruntowanym trendzie (dołączanie do trwającego trendu). Strategia zakłada stosunkowo szybką realizację straty. Pozycje zajmowane są w sposób stopniowy, co zmniejsza potencjalną stratę w przypadku niekorzystnej koniunktury. Osoby zainteresowane otrzymywaniem sygnałów przed sesją, zachęcamy do kontaktu na adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl lub pod numerem telefonu +48 22 697 48 48

piątek, 22 września 2017

Zagraniczne Portfele Algorytmiczne

Portfel strategii
USA

Wartość portfela

\$ 121 519,75

21,52%

Portfel strategii
Niemcy

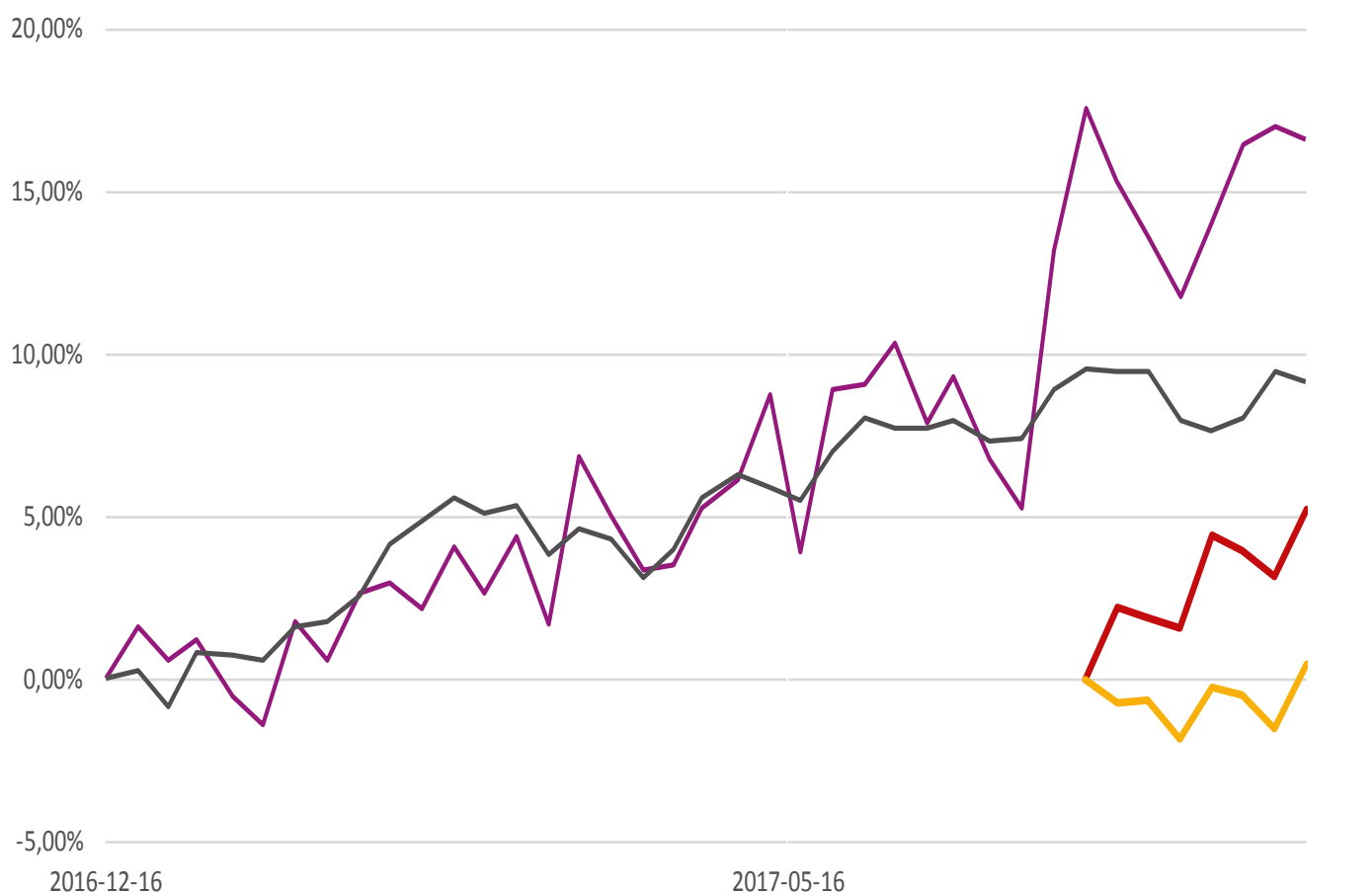
Wartość portfela

€ 106 712,42

6,71%

Strategie na tle S&P500 i DAX

Wynik USA Wynik S&P500 Wynik Niemcy Wynik DAX



Szczegóły strategii USA

Portfel strategii
USA

Wartość portfela

\$ 121 519,75
21,52%

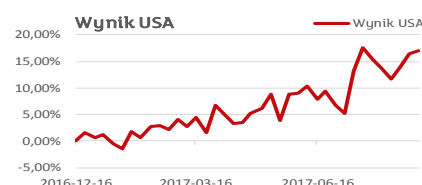
Gotówka / Depozyt

Wartość

\$ 798,48

Procent portfela

0,66%



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	180,76	17895,24	14,73%	81,58%	0,28
2.	Micron Tech	2016-12-19	485	20,43	35,91	17416,35	14,33%	75,77%	
3.	NRG Energy	2017-06-02	538	16,71	24,19	13014,22	10,71%	44,94%	
4.	Lam Research	2017-06-02	57	157,15	172,28	9819,96	8,08%	9,91%	
5.	Vertex Pharm	2017-07-14	79	131,77	152,06	12012,74	9,89%	15,40%	0,45
6.	H&R Block In	2017-08-28	320	30,47	26,21	8387,2	6,90%	-13,98%	
7.	Progressive	2017-09-04	227	46,52	47,68	10823,36	8,91%	2,49%	
8.	First Solar	2017-09-08	211	47,35	48,76	10288,36	8,47%	2,98%	
9.	Boeing Co	2017-09-08	42	235,75	256,04	10753,68	8,85%	8,61%	
10.	FMX Corp	2017-09-08	114	87,33	90,44	10310,16	8,48%	3,56%	

Strategia USA, to skoncentrowany portfel skupiający się na walorach wchodzących w skład S&P500 oraz Nasdaq100 ze stałą liczbą 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

Szczegóły strategii Niemcy

Portfel strategii
Niemcy

Wartość portfela

€ 106 712,42
6,71%

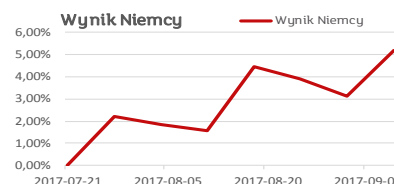
Gotówka / Depozyt

Wartość

€ 76,18

Procent portfela

0,07%



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	23,00	12420	11,64%	24,66%	0,00
2.	Commerzbank	2017-07-24	964	10,26	11,21	10806,44	10,13%	9,26%	0,00
3.	RWE AG	2017-07-24	570	17,34	20,23	11531,1	10,81%	16,67%	0,00
4.	Duerr AG	2017-07-24	95	104,32	106,15	10084,25	9,45%	1,75%	0,00
5.	Leoni AG	2017-07-24	202	48,92	55,50	11211	10,51%	13,45%	0,00
6.	Aurubis AG	2017-07-24	143	70,13	72,48	10364,64	9,71%	3,35%	0,00
7.	Osram Licht	2017-07-31	146	69,60	69,57	10157,22	9,52%	-0,04%	0,00
8.	Fraport AG	2017-08-08	123	84,74	80,48	9899,04	9,28%	-5,03%	0,00
9.	Stada Arznei	2017-08-21	120	82,26	80,93	9711,6	9,10%	-0,74%	0,72
10.	Stroeer SE	2017-09-04	193	52,07	54,15	10450,95	9,79%	3,99%	0,00

Strategia Niemcy, to skoncentrowany portfel skupiający się na walorach wchodzących w skład indeksów DAX i mDAX ze stałą liczbą 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

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
wicedyrektor
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.cegelka@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
marcin.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 jakiegokolwiek 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.