

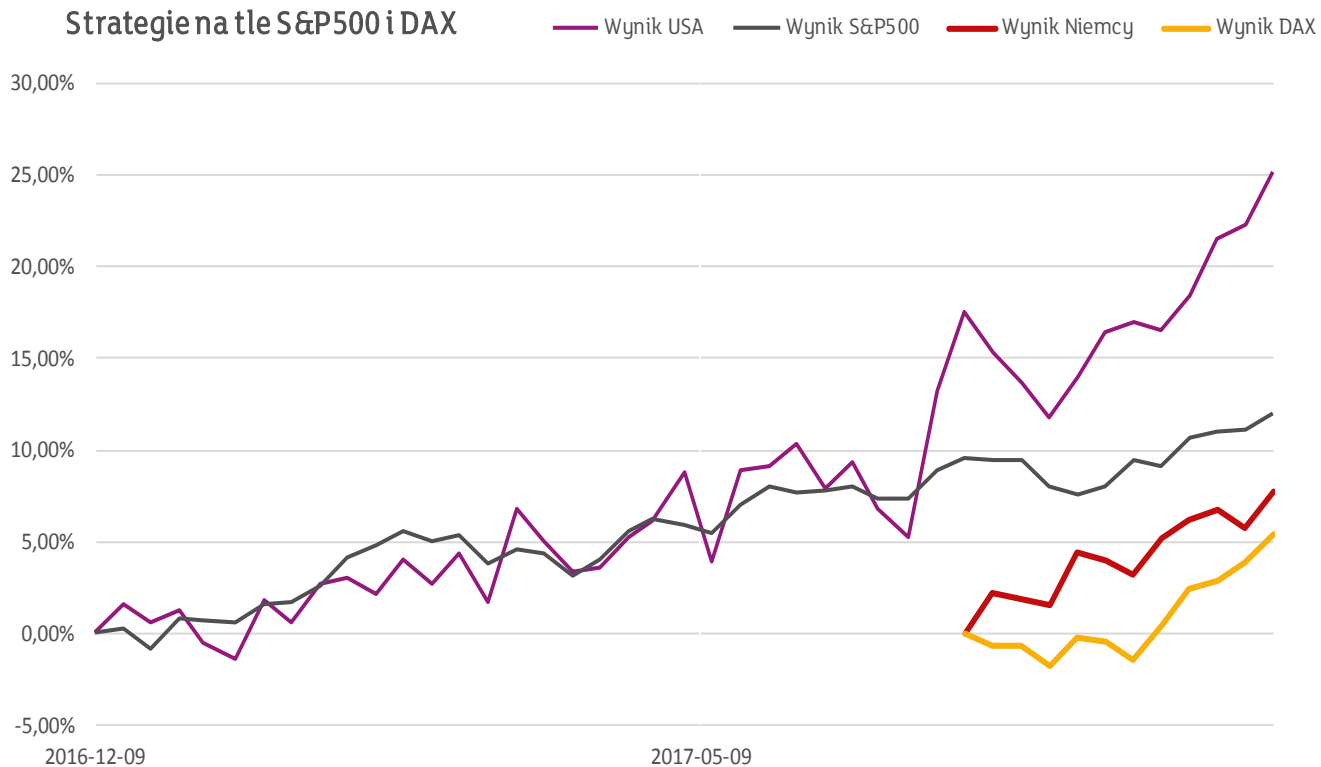
czwartek, 5 października 2017

Zagraniczne Portfele Algoritmiczne

Portfel strategii USA	Wartość portfela	\$ 125 893,29
		25,89%

Portfel strategii Niemcy	Wartość portfela	€ 107 554,88
		7,55%

Strategie na tle S&P500 i DAX



Szczegóły strategii USA

Portfel strategii USA

Wartość portfela

\$ 125 893,29
25,89%

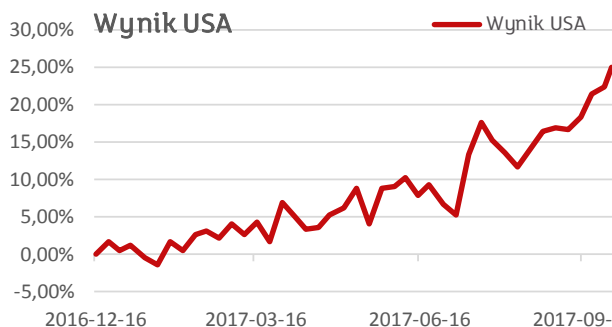
Gotówka / Depozyt

Wartość

\$ 62,86

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	180,87	17906,13	14,22%	81,84%	0,42
2.	Micron Tech	2016-12-19	485	20,43	39,56	19186,6	15,24%	93,64%	0,00
3.	NRG Energy	2017-06-02	538	16,71	25,77	13864,26	11,01%	54,40%	0,03
4.	Lam Research	2017-06-02	57	157,15	185,02	10546,14	8,38%	18,31%	0,90
5.	Vertex Pharm	2017-07-14	79	131,77	152,51	12048,29	9,57%	15,74%	0,00
6.	First Solar	2017-09-08	211	47,35	47,65	10054,15	7,99%	0,63%	0,00
7.	Boeing Co	2017-09-08	42	235,75	255,76	10741,92	8,53%	8,49%	0,00
8.	FMC Corp	2017-09-08	114	87,33	90,96	10369,44	8,24%	4,35%	0,17
9.	AUTODESK INC	2017-09-29	90	111,25	114,05	10264,5	8,15%	2,52%	0,00
10.	INTUITIVE SU	2017-09-29	10	1028,15	1084,90	10849	8,62%	5,52%	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

Szczegóły strategii Niemcy

Portfel strategii
Niemcy

Wartość portfela

€ 107 554,88
7,55%

Gotówka / Depozyt

Wartość

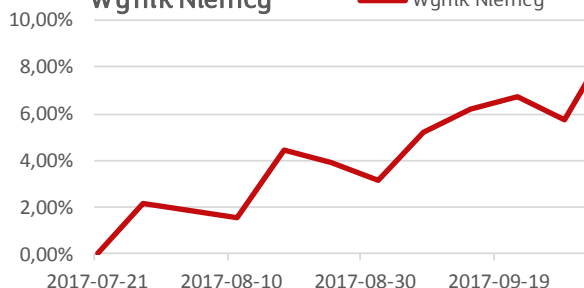
€ 14,57

Procent portfela

0,01%

Wynik Niemcy

— Wynik Niemcy



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	24,55	13257	12,33%	33,06%	0,00
2.	Commerzbank	2017-07-24	964	10,26	11,35	10941,4	10,17%	10,62%	0,00
3.	RWE AG	2017-07-24	570	17,34	19,25	10972,5	10,20%	11,01%	0,00
4.	Leoni AG	2017-07-24	202	48,92	58,55	11827,1	11,00%	19,69%	0,00
5.	Aurubis AG	2017-07-24	143	70,13	68,75	9831,25	9,14%	-1,97%	0,00
6.	Osram Licht	2017-07-31	146	69,60	65,35	9541,1	8,87%	-6,11%	0,00
7.	Fraport AG	2017-08-08	123	84,74	80,32	9879,36	9,19%	-5,22%	0,00
8.	Stada Arznei	2017-08-21	120	82,26	83,04	9964,8	9,26%	1,82%	0,72
9.	E.ON SE	2017-09-01	1096	9,27	9,41	10313,36	9,59%	1,51%	0,00
10.	HELLA KGAA H	2017-10-02	214	49,63	51,46	11012,44	10,24%	3,69%	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

czwartek, 5 października 2017

Portfele Algorytmiczne

Portfel strategii
Momentum
Zdywersyfikowana

Wartość portfela

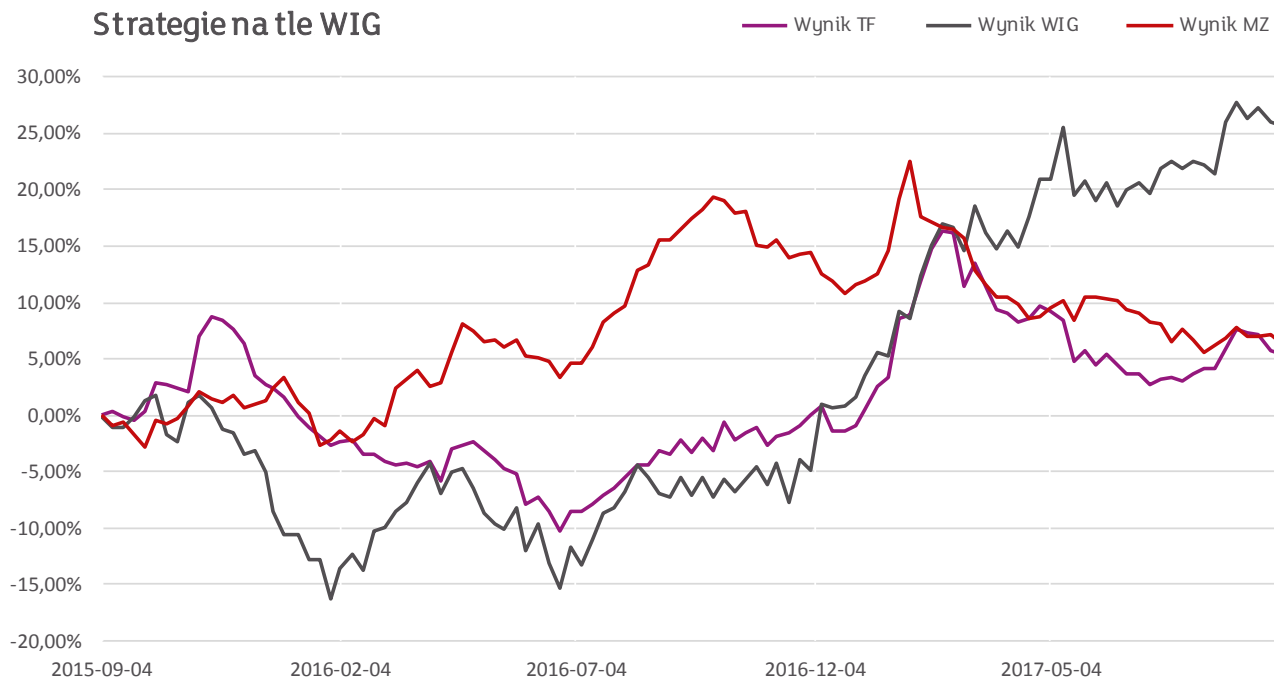
123 486,58 zł
23,49%

Portfel strategii
Trend Following

Wartość portfela

115 163,82 zł
15,16%

Strategie na tle WIG



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.

Szczegóły strategii Momentum Zdywersyfikowany

Portfel strategii
Momentum
Zdywersyfikowana

Wartość portfela

123 486,58 zł
23,49%

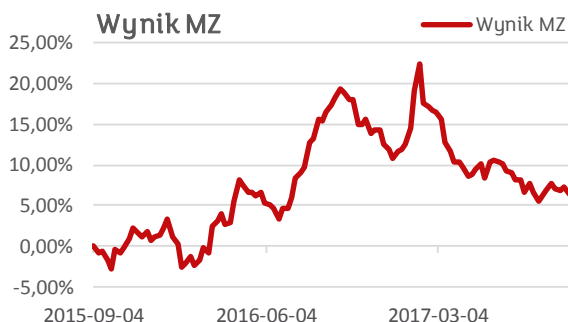
Gotówka / Depozyt

Wartość

79 563,52 zł

Procent portfela

64,43%



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	9,27	5163,39	4,18%	1,31%	
2.	GPW	2017-04-24	110	46,00	44,60	4906	3,97%	-3,04%	
3.	PCC ROKITA	2017-06-12	54	91,48	96,50	5211	4,22%	5,49%	
4.	PKP	2017-08-07	77	64,00	56,80	4373,6	3,54%	-11,25%	
5.	IDEA BANK	2017-08-25	189	26,30	25,10	4743,9	3,84%	-4,56%	
6.	IMPEXMETAL	2017-08-25	1117	4,45	4,44	4959,48	4,02%	-0,22%	
7.	11BIT	2017-08-30	25	197,05	190,40	4760	3,85%	-3,37%	
8.	FAMUR	2017-09-05	823	6,04	6,03	4962,69	4,02%	-0,17%	
9.	AMICA	2017-10-04	29	167,50	167,00	4843	3,92%	-0,30%	

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

Szczegóły strategii Trend Following

Portfel strategii
Trend Following

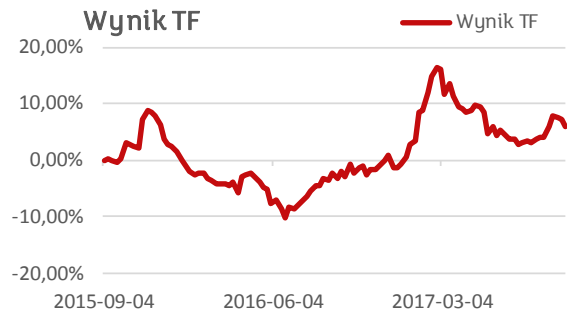
Wartość portfela

115 163,82 zł
15,16%

Gotówka / Depozyt

Wartość **68 871,36 zł**

Procent portfela **59,80%**



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	6,65	5812,1	5,05%	17,68%	0,20
2.	LPP	2017-05-24	1	6310,00	8449,00	8449	7,34%	33,90%	0,00
3.	ENERGA	2017-07-20	225	11,09	12,38	2785,5	2,42%	11,63%	0,00
4.	JSW	2017-07-26	80	84,20	94,55	7564	6,57%	12,29%	0,00
5.	EUROCASH	2017-08-24	188	36,70	38,75	7285	6,33%	5,59%	0,00
6.	EMPERIA	2017-08-30	74	93,50	92,39	6836,86	5,94%	-1,19%	0,00
7.	LOTOS	2017-09-12	120	59,00	63,00	7560	6,56%	6,78%	0,00



Dom Maklerski

