

piątek, 3 listopada 2017

Zagraniczne Portfele Algoritmiczne

Portfel strategii USA

Wartość portfela

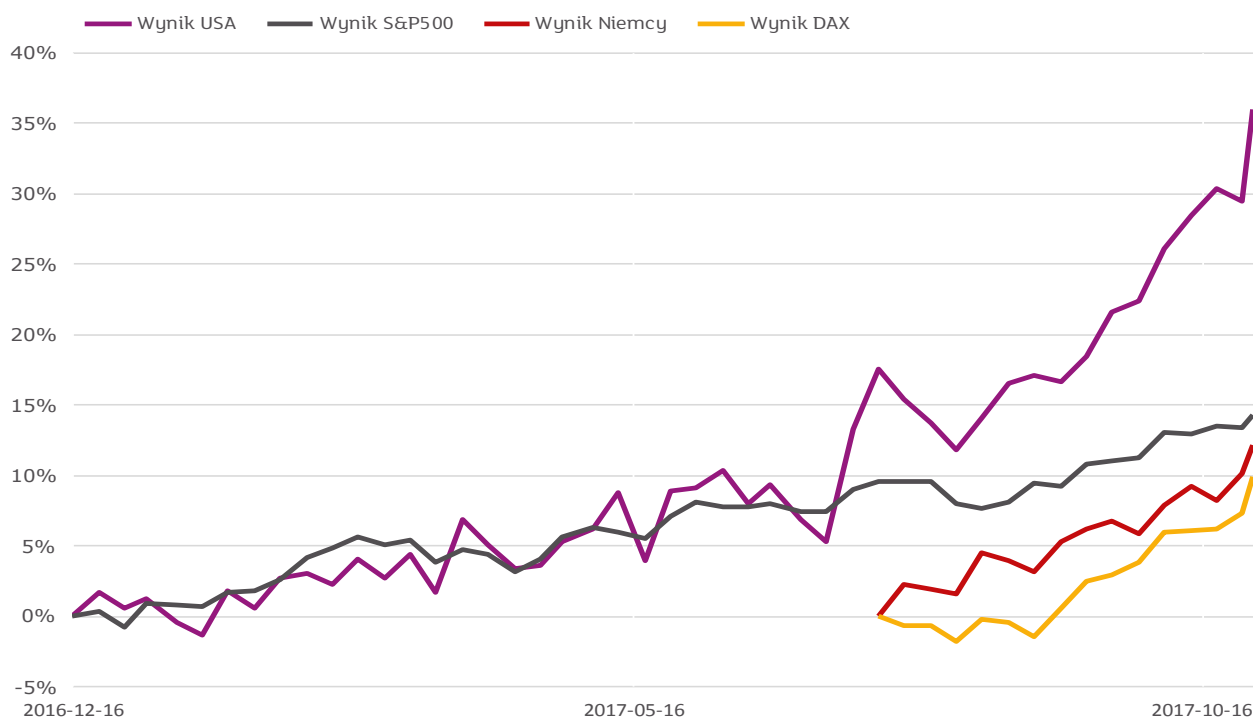
\$ 135 896,22
35,90%

Portfel strategii Niemcy

Wartość portfela

€ 112 088,41
12,09%

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(Niemcy).

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 USA

Portfel strategii USA

Wartość portfela

\$ 135 896,22
35,90%

Gotówka / Depozyt

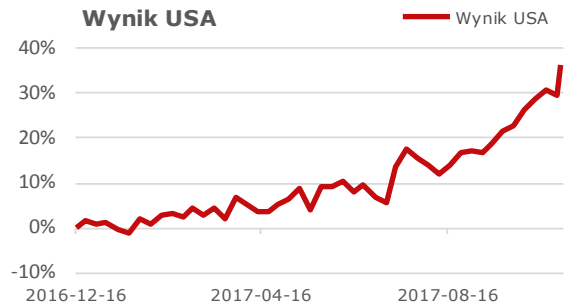
Wartość

\$ 83,49

Procent portfela

0,06%

Wynik USA



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	205,94	20388,06	15,00%	106,98%	0,42
2.	Micron Tech	2016-12-19	485	20,43	44,34	21504,9	15,82%	117,03%	0,00
3.	NRG Energy	2017-06-02	538	16,71	25,97	13971,86	10,28%	55,60%	0,03
4.	Lam Research	2017-06-02	57	157,15	206,82	11788,74	8,67%	32,18%	0,90
5.	Vertex Pharm	2017-07-14	79	131,77	144,90	11447,1	8,42%	9,96%	0,00
6.	First Solar	2017-09-08	211	47,35	57,87	12210,57	8,99%	22,22%	0,00
7.	Boeing Co	2017-09-08	42	235,75	262,63	11030,46	8,12%	12,00%	1,42
8.	INTUITIVE SU	2017-09-29	30	342,72	379,75	11392,5	8,38%	10,80%	0,00
9.	WYNN RESORTS	2017-10-13	75	141,29	150,05	11253,75	8,28%	6,20%	0,00
10.	DELPHI AUTOM	2017-10-13	109	98,57	99,31	10824,79	7,97%	0,75%	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

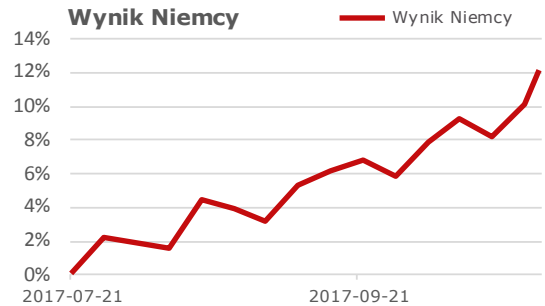
Wartość portfela

€ 112 088,41
12,09%

Gotówka / Depozyt

Wartość **€ 7,96**

Procent portfela **0,01%**



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	28,17	15211,8	13,57%	52,68%	0,00
2.	Commerzbank	2017-07-24	964	10,26	11,99	11558,36	10,31%	16,86%	0,00
3.	RWE AG	2017-07-24	570	17,34	22,00	12540	11,19%	26,87%	0,00
4.	Leoni AG	2017-07-24	202	48,92	57,88	11691,76	10,43%	18,32%	0,00
5.	Fraport AG	2017-08-08	123	84,74	81,69	10047,87	8,96%	-3,60%	0,00
6.	Stada Arznei	2017-08-21	120	82,26	82,79	9934,8	8,86%	1,52%	0,72
7.	E.ON SE	2017-09-01	1096	9,27	10,40	11398,4	10,17%	12,19%	0,00
8.	Kion Group A	2017-10-10	125	78,12	68,07	8508,75	7,59%	-12,86%	0,00
9.	Duerr AG	2017-10-23	85	112,18	117,61	9996,85	8,92%	4,84%	0,00
10.	DEUT PFANDBR	2017-10-30	873	12,34	12,82	11191,86	9,98%	3,89%	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



piątek, 3 listopada 2017

Portfele Algorytmiczne

Portfel strategii
Momentum
Zdywersyfikowana

Wartość portfela

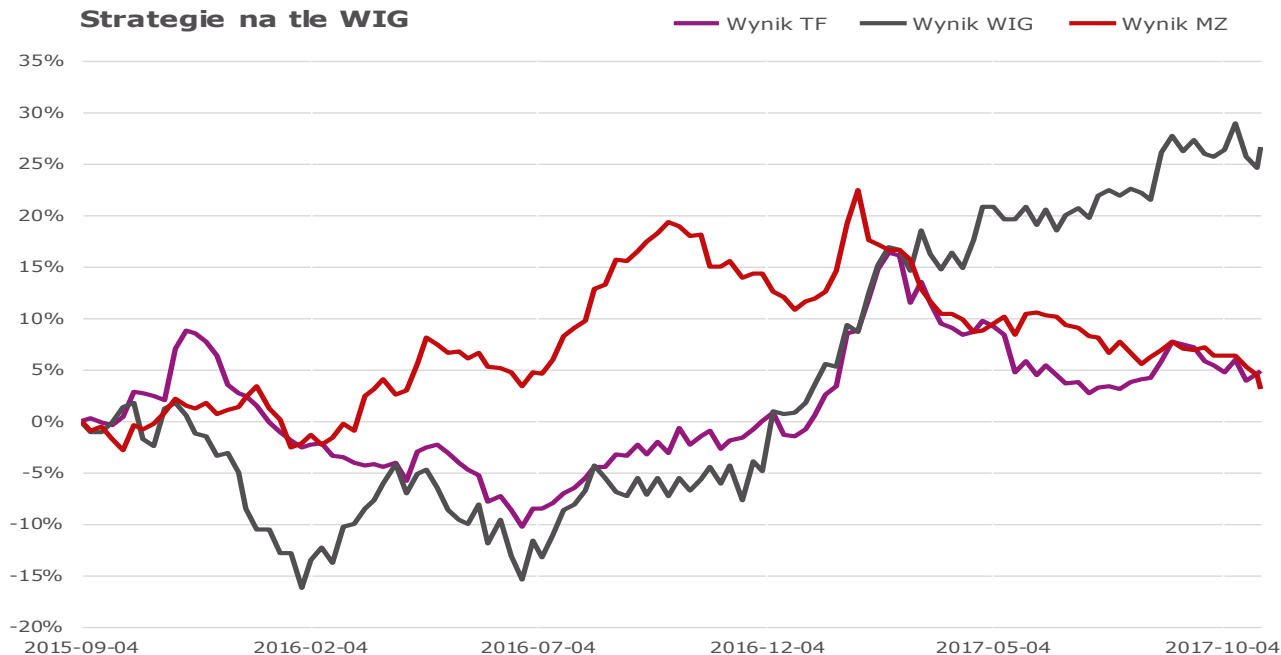
119 924,72 zł
19,92%

Portfel strategii
Trend Following

Wartość portfela

115 128,16 zł
15,13%

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.

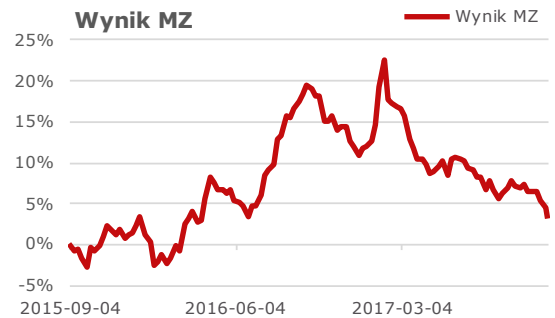
Kryteria doboru spółek są oparte na zasadach analizy technicznej - sygnały generowane są w sposób mechaniczny na podstawie określonego algorytmu. Zasadą jest dobór płynnych spółek spośród wchodzących do indeksu WIG, prowadzący portfel dopuszcza arbitralne decyzje dotyczące zaangażowania w daną spółkę.

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
119 924,72 zł
19,92%
Gotówka / Depozyt
Wartość **4 016,50 zł**
Procent portfela **3,35%**

Pozycje akcyjne

Lp.	Instrument	Data zakupu	Liczba	Kurs zakupu	Kurs bieżący	Aktualna wartość	Procent portfela	Rentowność	Dyw.
1.	CD Projekt	2017-11-02	100	121,45	120,30	12030	10,03%	-0,95%	
2.	JSW	2017-11-02	122	98,00	99,99	12198,78	10,17%	2,03%	
3.	Enea	2017-11-02	857	14,00	13,70	11740,9	9,79%	-2,14%	
4.	Energa	2017-11-02	949	12,65	12,52	11881,48	9,91%	-1,03%	
5.	Lpp	2017-11-02	1	8650,00	8475,00	8475	7,07%	-2,02%	
6.	Lotos	2017-11-02	181	66,25	66,60	12054,6	10,05%	0,53%	
7.	PKN Orlen	2017-11-02	93	128,50	129,20	12015,6	10,02%	0,54%	
8.	CCC	2017-11-02	44	275,05	266,30	11717,2	9,77%	-3,18%	
9.	PGE	2017-11-02	901	13,32	13,06	11767,06	9,81%	-1,95%	
10.	PZU	2017-11-02	257	46,70	46,80	12027,6	10,03%	0,21%	

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

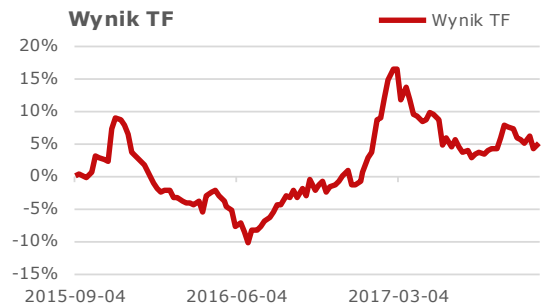
115 128,16 zł
15,13%

Gotówka / Depozyt

Wartość **68 871,36 zł**

Procent portfela **59,82%**

Wynik TF



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	8475,00	8475	7,36%	34,31%	0,00
3.	ENERGA	2017-07-20	225	11,09	12,52	2817	2,45%	12,89%	0,00
4.	JSW	2017-07-26	80	84,20	99,99	7999,2	6,95%	18,75%	0,00
5.	EUROCASH	2017-08-24	188	36,70	35,35	6645,8	5,77%	-3,68%	0,00
6.	EMPERIA	2017-08-30	74	93,50	88,05	6515,7	5,66%	-5,83%	0,00
7.	LOTOS	2017-09-12	120	59,00	66,60	7992	6,94%	12,88%	0,00

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.cegoelka@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 Gębał
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 jakkolwiek 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.