

poniedziałek, 5 lutego 2018

Zagraniczne Portfele Algoritmiczne

Portfel strategii USA

Wartość portfela

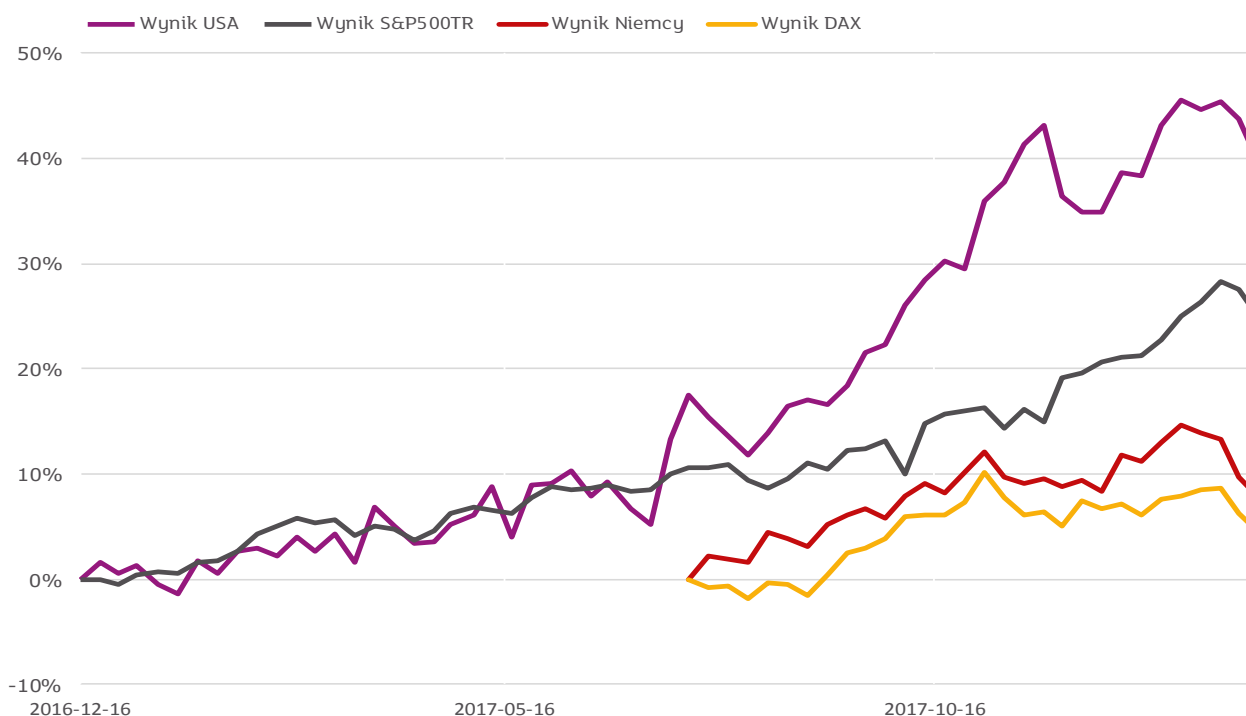
\$ 139 490,75
39,49%

Portfel strategii Niemcy

Wartość portfela

€ 107 756,87
7,76%

Strategie na tle S&P500TR 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 metodach ilościowych - 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

\$ 139 490,75
39,49%

Gotówka / Depozyt

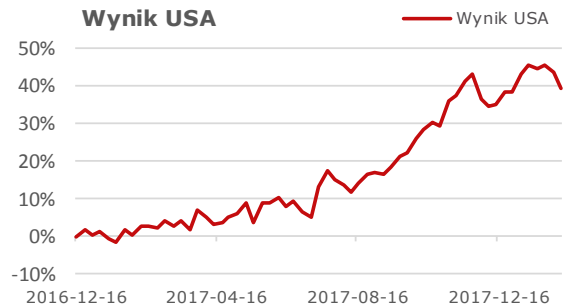
Wartość

\$1 817,36

Procent portfela

1,30%

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	233,52	23118,48	16,57%	134,79%	0,57
2.	Micron Tech	2016-12-19	485	20,43	40,82	19797,7	14,19%	99,80%	0,00
3.	First Solar	2017-09-08	211	47,35	66,44	14018,84	10,05%	40,32%	0,00
4.	Boeing Co	2017-09-08	42	235,75	348,91	14654,22	10,51%	48,60%	1,42
5.	Urban Outfit	2017-12-29	323	35,26	32,63	10539,49	7,56%	-7,46%	0,00
6.	Michael Kors	2017-12-29	179	63,70	65,27	11683,33	8,38%	2,46%	0,00
7.	Alcoa Inc	2017-12-29	211	54,00	49,09	10357,99	7,43%	-9,09%	0,00
8.	Kohls Corp	2018-01-19	180	66,62	63,47	11424,6	8,19%	-4,73%	0,00
9.	DR Horton In	2018-01-19	235	51,21	46,37	10896,95	7,81%	-9,45%	0,00
10.	Caterpillar	2018-01-26	71	168,81	157,49	11181,79	8,02%	-6,71%	0,00

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 pod adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl



Szczegóły strategii Niemcy

Portfel strategii
Niemcy

Wartość portfela

€ 107 756,87
7,76%

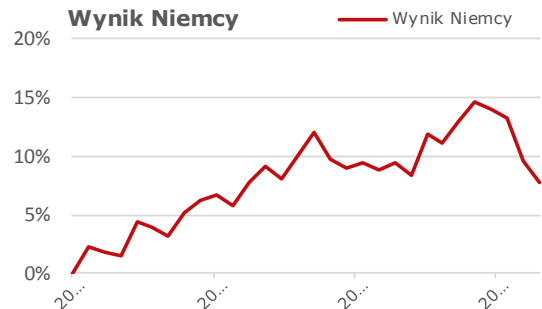
Gotówka / Depozyt

Wartość

€ 50,99

Procent portfela

0,05%



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	28,08	15163,2	14,07%	52,20%	0,00
2.	Commerzbank	2017-07-24	964	10,26	13,11	12638,04	11,73%	27,78%	0,00
3.	Leoni AG	2017-07-24	202	48,92	59,38	11994,76	11,13%	21,38%	0,00
4.	Stada Arznei	2017-08-21	120	82,26	86,66	10399,2	9,65%	6,22%	0,72
5.	E.ON SE	2017-09-01	1096	9,27	8,23	9020,08	8,37%	-11,22%	0,00
6.	Infineon Tec	2017-11-27	416	24,59	22,40	9318,4	8,65%	-8,91%	0,00
7.	Rheinmetall	2017-12-11	90	105,30	112,20	10098	9,37%	6,55%	0,00
8.	Wacker Chemi	2017-12-11	66	145,21	154,30	10183,8	9,45%	6,26%	0,00
9.	Salzgitter A	2018-01-15	201	51,28	46,75	9396,75	8,72%	-8,83%	0,00
10.	Deut Post-RG	2018-01-15	255	40,36	37,23	9493,65	8,81%	-7,76%	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 pod adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl

poniedziałek, 5 lutego 2018

Portfele Algorytmiczne

Portfel strategii
Momentum
Zdywersyfikowana

Wartość portfela

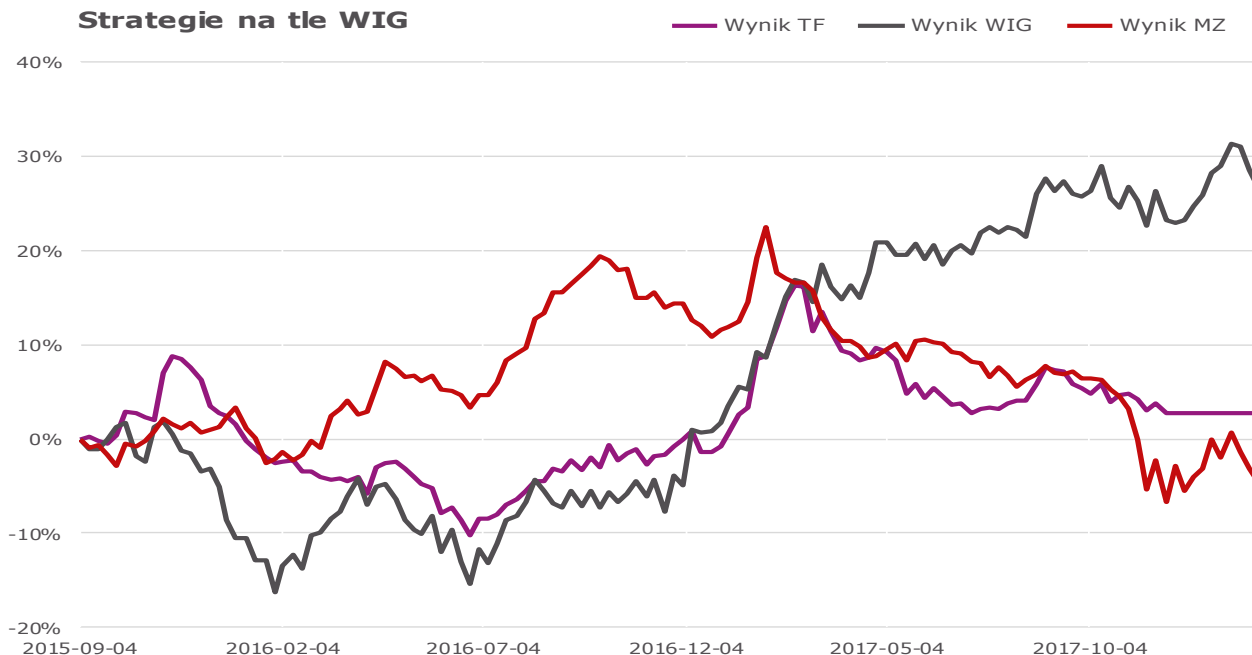
110 843,11 zł
10,84%

Portfel strategii
Trend Following

Wartość portfela

112 813,90 zł
12,81%

Strategie na tle WIG



Wyjściowa kwota obu portfeli to 100 000 zł, portfel strategii **Momentum** 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 oparte są na metodach ilościowych - 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

110 843,11 zł
10,84%

Gotówka / Depozyt

Wartość

31,09 zł

Procent portfela

0,03%



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	111,00	11100	10,01%	-8,60%	
2.	JSW	2017-11-02	122	98,00	99,20	12102,4	10,92%	1,22%	
3.	Energa	2017-11-02	949	12,65	11,91	11302,59	10,20%	-5,85%	
4.	Lpp	2017-11-02	1	8650,00	9825,00	9825	8,86%	13,58%	
5.	CCC	2017-11-02	44	275,05	278,00	12232	11,04%	1,07%	
6.	PZU	2017-11-02	257	46,70	43,00	11051	9,97%	-7,92%	
7.	Orange	2017-11-20	2000	5,82	5,81	11620	10,48%	-0,17%	
8.	Millennium	2018-01-17	1160	9,34	9,27	10753,2	9,70%	-0,75%	
9.	PKO BP	2018-01-17	233	46,10	44,51	10370,83	9,36%	-3,45%	
10.	BZ WBK	2018-01-17	25	430,00	418,20	10455	9,43%	-2,74%	

Strategia Momentum, to skoncentrowany portfel skupiający się na walorach wchodzących w skład indeksu WIG20 i mWIG ze stałą liczbą elementów wynoszącą 10. Wyjątkiem są sytuacje, gdy wskaźniki zawarte w algorytmie wskazują większe prawdopodobieństwo spadków. W takim przypadku, Strategia Momentum zakłada zamianę akcji na obligacje lub pozostanie poza rynkiem. Osoby zainteresowane otrzymywaniem sygnałów przed sesją, zachęcamy do kontaktu pod adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl



Szczegóły strategii Trend Following

Portfel strategii
Trend Following

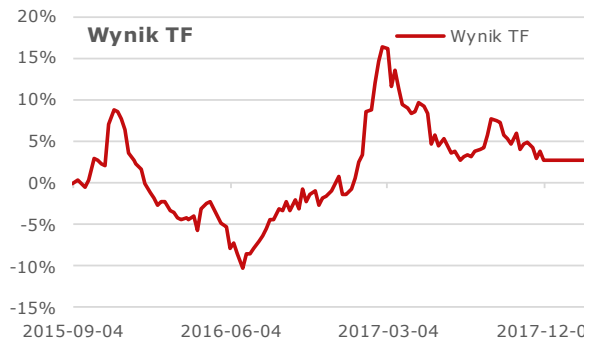
Wartość portfela

112 813,90 zł
12,81%

Gotówka / Depozyt

Wartość **105 517,50 zł**

Procent portfela **93,53%**



Pozycje akcyjne

Lp.	Instrument	Data zakupu	Liczba	Kurs zakupu	Kurs bieżący	Aktualna wartość	Procent portfela	Rentowność	Dyw.
1.	Emperia	2017-08-30	74	93,50	98,60	7296,4	6,47%	5,45%	0,00

Portfel Trend Following jest prowadzony od dnia 16 czerwca 2015 r. Kwota początkowa to 100 000 zł. 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. Osoby zainteresowane otrzymywaniem sygnałów przed sesją, zachęcamy do kontaktu pod adres Remigiusz.Lemke@mbank.pl

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 47 62
joanna.gebal@mbank.pl

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

Dawid Szröder
tel. +48 22 697 48 45
dawid.szroder@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 jakiegokolwiek 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.