



Raport futures

wtorek, 3 sierpnia 2010

Rynek futures | analiza techniczna

Niniejsza publikacja jest publikacją handlową, prosimy o zapoznanie się z oświadczeniem umieszczonym na jej końcu.

Pozycja systemowa

Długa od 2514

Wynik aktualnej pozycji

Wynik teoretyczny w okresie od 1998.01.16 do 2010.07.30 ¹

Wynik od momentu rozpoczęcia publikacji tj. od 2010-07-05 ²

Potrzebny kapitał ¹

Max liczba strat z rzędu ¹

Max liczba zysków z rzędu ¹

Sygnal odwrócenia

2464

+400 PLN

24110 PLN

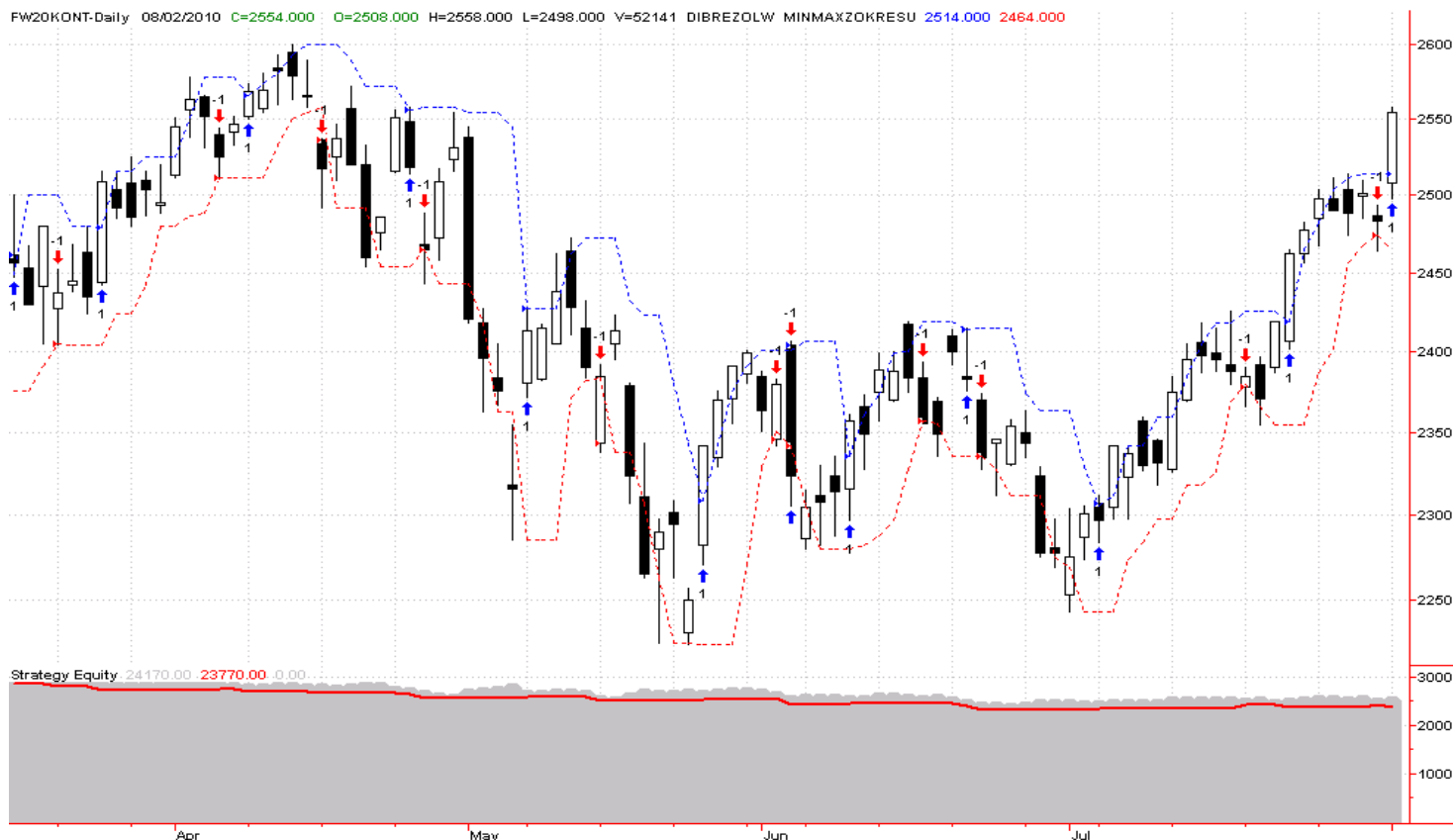
+730 PLN

10670 PLN

8

6

System generuje sygnały mechanicznie wg „metody żółwia”, zapoczątkowanej w 1984 roku przez grupę traderów skupionych wokół Richarda Dennisa i Williama Eckhardta. Sygnal kupna i sprzedaży powstaje, gdy notowania osiągną maksimum i minimum z ostatnich trzech sesji, odpowiednio. Okres trzy sesyjny został wybrany ze względu na satysfakcjonujące wyniki historyczne w przypadku kontraktów na WIG20 na GPW. Do stosowania metody najodpowiedniejsze są zlecenia z limitem aktywacji na w/w poziomach. Jest to system typu „stop and reverse”, czyli jednocześnie zamykający starą i otwierający nową pozycję przy tym samym poziomie. W kalkulacji wyników przyjmuje się wielkości kosztów- Prowizja 20 PLN (otwarcie i zamknięcie pozycji) i poślizg cenowy dla realizacji transakcji 10 PLN. Poziom depozytu wstępnego 2000 PLN. **System ma charakter wyłącznie edukacyjny i opiera się na notowaniach kontynuacyjnych FW20 w układzie dziennym.**



Rys. nr 1 FW20 - wykres dzienny

Biuro Aktywnej Sprzedaży

ul. Wspólna 47/49, 00-684 Warszawa

Zespół Prywatnego Maklera

Jarosław Banasiak (kierownik)

tel: (+48) 22 697 4870
email: jaroslaw.banasiak@dibre.com.pl

Joanna Gębal

tel: (+48) 22 697 4762
email: joanna.gebal@dibre.com.pl

Iwona Strzałkowska - Kominiak

tel: (+48) 22 697 4853
email: iwona.strzalkowska@dibre.com.pl

Marcin Bieguński

tel: (+48) 22 697 4984
email: marcin.bieguński@dibre.com.pl

Przemysław Miedziocha

tel: (+48) 22 697 4768
email: przemyslaw.miedziocha@dibre.com.pl

Mariusz Nowak

tel: (+48) 22 697 4848
email: mariusz.nowak@dibre.com.pl

Paweł Rudowski

tel: (+48) 22 697 4852
email: pawel.rudowski@dibre.com.pl

Tomasz Wojna

tel: (+48) 22 697 4809
email: tomasz.wojna@dibre.com.pl

Zespół Wsparcia Sprzedaży

Dominik Murlak (kierownik)

tel: (+48) 22 697 4703
email: dominik.murlak@dibre.com.pl

Daniel Cegielka (infoserwis)

tel: (+48) 22 697 4914
email: daniel.cegielka@dibre.com.pl

Dariusz Dadej (analiza techniczna)

tel: (+48) 17 850 3811
email: dariusz.dadej@dibre.com.pl

Piotr Neidek (analiza techniczna)

tel: (+48) 22 697 4766
email: piotr.neidek@dibre.com.pl

Paweł Szczepanik (sprzedaż i analiza techniczna)

tel: (+48) 22 697 4947
email: pawel.szczepanik@dibre.com.pl

Jacek Szczepański (dyrektor)

tel: (+48) 22 697 4826
fax: (+48) 22 697 4726/4923
email: jacek.szczepanski@dibre.com.pl

Informacja o ryzykach towarzyszących inwestowaniu w instrumenty pochodne: http://i.wp.pl/a/f/pdf/24719/pakiet_informacyjny_mifid.pdf

- ¹ przedstawione dane odnoszą się do symulacji wyników z przeszłości i wyniki te nie stanowią gwarancji ich osiągnięcia w przyszłości;
² przedstawione dane odnoszą się do przeszłości i wyniki te nie stanowią gwarancji ich osiągnięcia w przyszłości;

Niniejsza publikacja przygotowana przez Dom Inwestycyjny BRE Banku S.A. z siedzibą w Warszawie, przy ul. Wspólnej 47/49, 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. Informacje zawarte w niniejszej publikacji oparte są na danych uzyskanych ze źródeł, które Dom Inwestycyjny BRE Banku S.A., działając w dobrej wierze, uważa za wiarygodne. Dom Inwestycyjny BRE Banku S.A. nie gwarantuje jednak dokładności, kompletności ani trafności tych informacji. Dom Inwestycyjny BRE Banku 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 Inwestycyjny BRE Banku S.A.. Dom Inwestycyjny BRE Banku S.A. 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 Inwestycyjny BRE Banku S.A. udostępnia niniejszą publikację nieodpłatnie. Zabronione jest powielanie i rozpowszechnianie niniejszej publikacji bez pisemnej zgody Domu Inwestycyjnego BRE Banku S.A.