



# Raport futures

czwartek, 26 sierpnia 2010

## Rynek futures | analiza techniczna

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

### Pozycja systemowa

**Krótką od 2451**

**Wynik aktualnej pozycji**

**Wynik teoretyczny w okresie od 1998.01.16 do 2010.08.06 <sup>1</sup>**

**Wynik od momentu rozpoczęcia publikacji tj. od 2010-07-05 <sup>2</sup>**

**Potrzebny kapitał <sup>1</sup>**

**Max liczba strat z rzędu <sup>1</sup>**

**Max liczba zysków z rzędu <sup>1</sup>**

### Sygnal odwrócenia

**2483**

**+390 PLN**

**23920 PLN**

**+840 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.**



Created with AmiBroker - advanced charting and technical analysis software. <http://www.amibroker.com>

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](http://i.wp.pl/a/f/pdf/24719/pakiet_informacyjny_mifid.pdf)

<sup>1</sup> przedstawione dane odnoszą się do symulacji wyników z przeszłości i wyniki te nie stanowią gwarancji ich osiągnięcia w przyszłości;

<sup>2</sup> 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.