

Raport Futures Intraday

piątek, 18 września 2020, 12:08 FW20



FW20U20	pkt	zm%	zm pkt
Kurs bieżący	1 740	-0,23	-4
Otwarcie	1 749	0,29	5
Maksimum	1 750	0,34	6
Minimum	1 738	-0,34	-6
Zm. dzienna	12	-67,6	-25
Baza	0	-	0
Wolumen	2 223	-87,5	-15 585
LOP	8 226	-16,3	-1 600

3 sesje	średnia	min	maks
Wolumen	49 905	36 703	73 005
LOP	39 257	37 945	41 783
Zmienność	30	23	37

5 sesji	średnia	min	maks
Wolumen	37 700	14 873	73 005
LOP	38 394	35 832	41 783
Zmienność	28	18	37

8 sesji	średnia	min	maks
Wolumen	32 695	14 873	73 005
LOP	37 054	34 692	41 783
Zmienność	36	12	68

Poziomy wsparcia	Poziomy oporu
1 701	1 794
1 687	1 810

Średnie			
SK-3	1 741	SK-15	1 763
SK-5	1 747	SK-20	1 781
SK-10	1 754	SK-45	1 805

Indeksy	pkt	zm%	zm pkt
WIG20	1 739	-0,36	-6
CAC40	5 037	-0,04	-2
DAX	13 252	0,34	44
FTSE100	6 055	0,08	5
BUX	33 738	-0,44	-148
SP500F	3 362	0,00	0

Źródło: Thomson Reuters



Techniczny poziom oporu: 1794

Techniczny poziom wsparcia: 1701

Komentarz FW20Z2020

Wczorajsza kontra popytu nie ma dziś kontynuacji, a notowania FW20 lekko cofają się. Odpowiada to neutralnym nastrojom na kontraktach na indeksy DAX oraz S&P500. Krajowe dane o sierpniowej produkcji przemysłowej okazały się gorsze od oczekiwań (odczyt 1,5 vs konsensus 2,8% r/r). Dziś wygasa wrześniowa seria kontraktów, jednak z uwagi na pozostałą niewielką liczbę pozycji, ostatnia godzina handlu nie powinna być nerwowa. /tk/

Raport Futures Intraday

piątek, 18 września 2020, 12:08 FW20



Biuro Maklerskie Alior Bank SA

ul. Łopuszańska 38D
02-232 Warszawa

Zespół Analiz i Doradztwa Biura Maklerskiego Alior Bank SA:

Zbigniew Obara	Menedżer Zespołu Analiz, Makler Papierów Wartościowych	12 682 64 79	Zbigniew.Obara@alior.pl
Marcin Brendota	Ekspert ds. analiz, Doradca Inwestycyjny	22 555 22 90	Marcin.Brendota@alior.pl
Adam Dudon	Ekspert ds. analiz, Doradca Inwestycyjny	12 340 17 70	Adam.Dudon@alior.pl
Tomasz Kolarz	Ekspert ds. Data Science	12 682 64 24	Tomasz.Kolarz@alior.pl

Powyższy materiał został przygotowany przez Biuro Maklerskie Alior Bank SA. Właścicielem niniejszego opracowania jest Alior Bank Spółka Akcyjna z siedzibą w Warszawie, ul. Łopuszańska 38D, 02-232 Warszawa, Sąd Rejonowy dla m.st. Warszawy w Warszawie, XIII Wydział Gospodarczy, KRS: 0000305178, REGON: 141387142, NIP: 1070010731, kapitał zakładowy: 1 305 539 910 PLN (opłacony w całości). Powielanie bądź publikowanie niniejszego opracowania lub jego części bez pisemnej zgody Biura Maklerskiego Alior Bank S.A. jest zabronione.

Biuro Maklerskie nie gwarantuje realizacji założonego celu inwestycyjnego ani uzyskania określonego wyniku inwestycyjnego. Prezentowane wyniki inwestycyjne nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych wyników w przyszłości, są wynikiem inwestycyjnym osiągniętym w konkretnym okresie historycznym.

W szczególności Biuro Maklerskie zwraca uwagę, iż na cenę instrumentów finansowych ma wpływ wiele różnych czynników, które są lub mogą być niezależne od aktywów tworzących portfel instrumentów bazowych lub emitentów instrumentów bazowych i wyników ich działalności. Do czynników tych można zaliczyć m. in. zmieniające się warunki ekonomiczne, prawne, polityczne i podatkowe, których niejednokrotnie nie można przewidzieć lub które mogą być trudne do przewidzenia.

Niniejsze opracowanie jest wyrazem wiedzy oraz poglądów autorów i nie powinno być inaczej interpretowane. W szczególności informacje zawarte w niniejszym dokumencie nie stanowią rekomendacji w rozumieniu Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) NR 596/2014 z dnia 16 kwietnia 2014 r. w sprawie nadużyć na rynku (rozporządzenie w sprawie nadużyć na rynku) oraz uchylające dyrektywę 2003/6/WE Parlamentu Europejskiego i Rady i dyrektywy Komisji 2003/124/WE, 2003/125/WE i 2004/72/WE, ani usługi doradztwa inwestycyjnego. Usługa doradztwa inwestycyjnego jest świadczona na podstawie odrębnej umowy o doradztwo inwestycyjne.

Niniejszy raport wyraża wiedzę oraz poglądy autorów według stanu na dzień sporządzenia. Opracowanie zostało sporządzone z rzetelnością i starannością przy zachowaniu zasad metodologicznej poprawności, na podstawie ogólnodostępnych informacji, uznanych przez Biuro Maklerskie za wiarygodne.

Wykresy przygotowano za pomocą programu AMIBROKER. Dane do wykresów dostarcza firma STATICA i Thomson Reuters. Źródłem pozostałych danych są PAP, prasa finansowa i internetowe serwisy finansowo-ekonomiczne.

UWAGA !!!

Inwestycja w kontrakty terminowe wiąże się z koniecznością wniesienia depozytów zabezpieczających stanowiących jedynie ułamkową część wielkości całego zobowiązania wynikającego ze standardu tego typu instrumentu finansowego (tzw. dźwignia finansowa). Powoduje to zwielokrotnienie ryzyka inwestycyjnego w przypadku gwałtownych i znaczących zmian kursu instrumentu pochodnego.

Należy zwrócić uwagę na fakt, że rynek terminowy charakteryzuje się w horyzoncie krótkoterminowym większą zmiennością niż rynek kasowy, co dodatkowo zwiększa ryzyko inwestycyjne.

W związku z powyższym inwestycja w instrumenty pochodne takie jak kontrakty terminowe na indeks WIG 20 wiąże się z możliwością utraty nie tylko wszystkich środków zaangażowanych w transakcję (utrata 100% kapitału), ale też z ewentualnym powstaniem dodatkowych zobowiązań i kosztów, co w sumie może wiązać się ze stratą przekraczającą wartość zainwestowanych środków w transakcję na rynku terminowym. Negatywny efekt zmian kursów kontraktów terminowych na indeks WIG 20, może spowodować straty przekraczające wartość zainwestowanych środków już w trakcie jednej sesji giełdowej.