Raport Futures Intraday

poniedziałek, 10 lutego 2025, 11:49

FW20M25	pkt	zm%	zm pkt
Kurs bieżący	2 503	0,56	14
Otwarcie	2 491	0,08	2
Maksimum	2 505	0,64	16
Minimum	2 488	-0,04	-1
Zm. dzienna	17	-51,4	-18
Baza	3	0,0	0
Wolumen	126	-74,8	-374
LOP	1 503	1,6	24

3 sesje	średnia	min	maks
Wolumen	418	372	500
LOP wsz.serie	68 011	67 516	68 560
Zmienność	46	35	55
5 sesji	**średnia**	**min**	**maks**
Wolumen	400	199	546
LOP wsz.serie	67 401	65 816	68 560
Zmienność	40	28	55
8 sesji	**średnia**	**min**	**maks**
Wolumen	348	161	546
LOP wsz.serie	67 163	65 816	68 560
Zmienność	34	17	55

Poziomy wsparcia	Poziomy oporu
2460	2548
2378	2604

Średnie			
SK-3	2 485	SK-15	2 418
SK-5	2 454	SK-20	2 390
SK-10	2 439	SK-45	2 330

Indeksy	pkt	zm%	zm pkt
WIG20	2 500	0,47	12
CAC40	7 982	0,11	9
DAX	21 811	0,11	24
FTSE100	8 739	0,44	39
BUX	87 112	0,46	395
S&PFuture	6 075	0,43	26

Źródło: Refinitiv

Techniczny poziom oporu: 2548

Techniczny poziom wsparcia: 2460

Komentarz FW20M2520 (wykres dzienny)

Początek nowego tygodnia to kontynuacja dobrych nastrojów z poprzednich sesji. Strona kupująca narusza kolejny opór na 2495, którego przełamanie otwierałoby drogę w rejonu 2548. Z kolei pierwszym istotnym wsparciem wydaje się pułap 2460, jako maksimum z końca stycznia.

Objaśnienia, szczegółowe informacje prawne, jak i wyłączenia odpowiedzialności znajdują się na ostatniej stronie raportu.
Zlecenia telefoniczne: Klienci BM Alior Banku (z telefonów komórkowych i stacjonarnych) 19 503 (z sieci Play: 12 19 503), z zagranicy +48 12 19 503, +48 12 370 74 00, opłaty za połączenie z infolinią: z telefonów stacjonarnych – w kraju opłata jak za połączenie lokalne, z telefonów komórkowych i zagranicy – opłata zgodna z cennikiem operatora danej sieci komórkowej, Internet: www.bm.aliorbank.pl

Raport Futures Intraday

poniedziałek, 10 lutego 2025, 11:49

Biuro Maklerskie Alior Bank S.A.

ul. Łopuszańska 38D
02-232 Warszawa

Zespół Analiz i Doradztwa Biura Maklerskiego Alior Bank S.A.

Zbigniew Obara	Menedżer ds. Analiz, Makler Papierów Wartościowych	Zbigniew.Obara@alior.pl
Marcin Brendota	Menedżer ds. Analiz i Doradztwa Inwestycyjnego	Marcin.Brendota@alior.pl
Arkadiusz Banaś	Specjalista ds. Analiz	Arkadiusz.Banas@alior.pl
Tomasz Kolarz	Ekspert ds. Data Science	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, XIV 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.