Raport Futures Intraday

czwartek, 13 lutego 2025, 12:03

FW20M25	pkt	zm%	zm pkt
Kurs bieżący	2 582	0,62	16
Otwarcie	2 586	0,78	20
Maksimum	2 613	1,83	47
Minimum	2 580	0,55	14
Zm. dzienna	33	-17,5	-7
Baza	1	0,0	0
Wolumen	400	-45,1	-329
LOP	1 624	-0,7	-11

3 sesje	średnia	min	maks
Wolumen	502	355	729
LOP wsz.serie	66 167	64 788	67 611
Zmienność	38	31	44
5 sesji	**średnia**	**min**	**maks**
Wolumen	475	355	729
LOP wsz.serie	67 004	64 788	68 560
Zmienność	41	31	55
8 sesji	**średnia**	**min**	**maks**
Wolumen	438	199	729
LOP wsz.serie	66 938	64 788	68 560
Zmienność	39	28	55

Poziomy wsparcia	Poziomy oporu
2566	2604
2539	2622

Średnie			
SK-3	2 562	SK-15	2 457
SK-5	2 537	SK-20	2 432
SK-10	2 481	SK-45	2 348

Indeksy	pkt	zm%	zm pkt
WIG20	2 581	0,48	12
CAC40	8 139	1,20	97
DAX	22 442	1,33	294
FTSE100	8 744	-0,72	-63
BUX	88 218	0,19	168
S&PFuture	6 073	0,00	0

Źródło: Refinitiv

Techniczny poziom oporu: 2604

Techniczny poziom wsparcia: 2566

Komentarz FW20M2520 (wykres dzienny)

Po spektakularnym początku sesji, strona popytowa dostała zadyszki w rejonie oporu 2604-22. Przedpołudniowa część sesji buduje na wykresie dziennym coś na kształt spadającej gwiazdy. Takiego wyglądu świecy nie było w trakcie trwającego impulsu wzrostowego. Jeśli podaż zdoła utrzymać jej kształt również w drugiej części dnia, to może to zapowiadać jakąś formę korekty w kolejnych dniach.

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

czwartek, 13 lutego 2025, 12:03

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.