Reguli privind crearea anumitor liste de instrumente (Watchlists) pe platformele xStation Desktop și xStation Mobile

- Modulul de sentiment media

Lista HOT (HOT List):

Lista HOT evidențiază instrumentele financiare care au înregistrat cele mai mari creșteri sau scăderi procentuale ale prețului într-o anumită perioadă selectată. Instrumentele sunt selectate în conformitate cu următoarele reguli:

a) sunt luate în considerare instrumentele disponibile în oferta aferentă contului respectiv, în funcție de clasa de active selectată;
b) pentru categoria „Creșteri", sunt selectate maximum 20 de instrumente care au înregistrat o variație pozitivă a prețului, ordonate descrescător în funcție de creșterea procentuală;
c) pentru categoria „Scăderi", sunt selectate maximum 20 de instrumente care au înregistrat o variație negativă a prețului, ordonate începând cu cea mai mare scădere procentuală;
d) variațiile de preț sunt comparate pentru perioada selectată: o zi, o săptămână, o lună sau trei luni.

Lista HOT reflectă evoluția istorică a prețurilor instrumentelor financiare, nu popularitatea acestora în rândul Clienților XTB. Performanțele anterioare nu garantează rezultate similare în viitor.

Sentimentul pieței (Market Sentiment):

Sentimentul pieței prezintă ponderea cumpărătorilor și a vânzătorilor pentru anumite instrumente de tip Contracte pentru Diferență (CFD), calculată pe baza pozițiilor deschise de Clienții XTB. Indicatorul și lista instrumentelor sunt determinate în conformitate cu următoarele reguli:

a) pentru fiecare Client și fiecare instrument financiar, se compară volumul total al pozițiilor long (de cumpărare) și al pozițiilor short (de vânzare);
b) un Client este încadrat în categoria cumpărătorilor dacă deține un volum pozitiv al pozițiilor long, mai mare sau egal cu volumul pozițiilor short, și în categoria vânzătorilor dacă deține un volum pozitiv al pozițiilor short, mai mare sau egal cu volumul pozițiilor long. În cazul în care volumele sunt egale și pozitive, Clientul este inclus în ambele categorii;
c) ponderea procentuală a cumpărătorilor și a vânzătorilor se calculează ca raport între numărul Clienților din categoria respectivă și suma numărului de Clienți din ambele categorii. Clienții care nu dețin poziții pe instrumentul respectiv nu sunt incluși în calcul;
d) instrumentele pentru care ponderea cumpărătorilor este de cel puțin 50% sunt incluse în categoria cumpărătorilor, iar celelalte instrumente sunt incluse în categoria vânzătorilor;
e) pentru fiecare categorie sunt selectate maximum 70 de instrumente disponibile în oferta aferentă contului, pentru care se înregistrează cel mai mare număr de Clienți care dețin poziții. Ulterior, se aplică filtrul corespunzător clasei de active selectate, iar rezultatele sunt ordonate descrescător în funcție de ponderea procentuală a cumpărătorilor, respectiv a vânzătorilor.

Sentimentul pieței reflectă pozițiile Clienților XTB incluși în calcul, nu situația pieței în ansamblu. Acesta nu reprezintă o prognoză privind evoluția viitoare a prețurilor.

Lista instrumentelor populare (Popular List):

Lista instrumentelor populare evidențiază instrumentele financiare care înregistrează cea mai mare popularitate în rândul Clienților XTB din cadrul unei anumite sucursale. Popularitatea este determinată pe baza numărului de ordine incluse în calcul, în conformitate cu următoarele reguli:

a) pentru fiecare clasă de active luată în considerare, sunt selectate cele trei instrumente pentru care s-a înregistrat cel mai mare număr de ordine;
b) în cazul acțiunilor străine cu deținere, sunt selectate cele trei instrumente cu cea mai mare popularitate, cu condiția ca acestea să fie incluse în datele analizate. Apartenența la o piață străină este determinată în funcție de diferența dintre piața indicată în simbolul instrumentului și țara aferentă sucursalei căreia îi este alocat Clientul;

XTB S.A. Varșovia Sucursala București S.A., Bulevardul Eroilor nr. 18, Sector 5, București, România, este înregistrată la Registrul Comerțului cu nr. J40/13245/2008, Cod Identificare Fiscală 24270192, Activitate Principală - Alte intermedieri financiare n.c.a. - 6499 Cod operator date personale 22438, Atestat C.N.V.M. 293/15.09.2008, Nr. înscriere în Reg. C.N.V.M. PJM01SFIM/400002

c) ETF-urile, ETN-urile și ETC-urile cu deținere formează o categorie comună. În cazul opțiunilor, ordinele sunt agregate în funcție de activul suport, iar în cazul criptomonedelor spot, în funcție de criptomoneda respectivă;
d) în cazul în care oferta include exclusiv acțiuni și ETF-uri, în locul selecției standard, sunt selectate maximum 10 dintre cele mai populare acțiuni și maximum 10 dintre cele mai populare ETF-uri;
e) listele sunt generate pentru zilele de luni până vineri. Ordinele din timpul weekendului nu sunt luate în considerare, iar în zilele de sâmbătă și duminică este afișată ultima listă generată în intervalul luni-vineri;
f) pentru o anumită sucursală și clasă de active, o zi este considerată insuficient de reprezentativă dacă nu a fost înregistrat niciun ordin, dacă numărul ordinelor a scăzut sub 50% din nivelul obișnuit sau dacă numărul instrumentelor a fost insuficient pentru generarea unei liste. Criteriul privind scăderea numărului de ordine se aplică exclusiv segmentelor pentru care nivelul obișnuit de activitate este de cel puțin 20 de ordine pe zi. În cazul selecției standard de câte trei instrumente, numărul minim necesar este reprezentat de cea mai mică dintre următoarele valori: trei instrumente sau numărul obișnuit de instrumente;
g) nivelurile obișnuite sunt determinate pe baza valorilor mediane calculate utilizând datele istorice aferente unei perioade de 21 de zile. În cazul unei zile insuficient de reprezentative, se utilizează lista aferentă celei mai recente zile din intervalul luni-vineri care îndeplinește criteriile stabilite, prin analizarea retroactivă a unei perioade de maximum 10 zile.

Modulul de sentiment media (Media Sentiment Module):

Modulul de sentiment media („Modulul”) prezintă opinii actuale cu privire la anumite societăți emitente de acțiuni tranzacționate public. Opiniile sunt colectate și agregate prin intermediul unui model de inteligență artificială, pe baza analizei conținutului disponibil public pe internet, precum articole sau rapoarte. Informațiile identificate cu ajutorul inteligenței artificiale sunt clasificate în funcție de caracterul pozitiv sau negativ al acestora, reflectând astfel sentimentul media într-o anumită perioadă.

Modulul este disponibil în aplicația mobilă XTB, direct în secțiunea aferentă instrumentului financiar respectiv, și prezintă un număr egal de informații cu caracter pozitiv și negativ. Pe lângă prezentarea sentimentului media, Modulul oferă Clienților posibilitatea de a consulta sursele informațiilor, permițând astfel verificarea informațiilor prezentate. Opiniile afișate în cadrul Modulului sunt actualizate periodic.

Modulul are exclusiv un scop informativ și auxiliar și nu constituie consultanță de investiții sau o recomandare de investiții în sensul legislației aplicabile.

XTB S.A. Varșovia Sucursala București S.A., Bulevardul Eroilor nr. 18, Sector 5, București, România, este înregistrată la Registrul Comerțului cu nr. J40/13245/2008, Cod Identificare Fiscală 24270192, Activitate Principală - Alte intermedieri financiare n.c.a. - 6499 Cod operator date personale 22438, Atestat C.N.V.M. 293/15.09.2008, Nr. înscriere în Reg. C.N.V.M. PJM01SFIM/400002