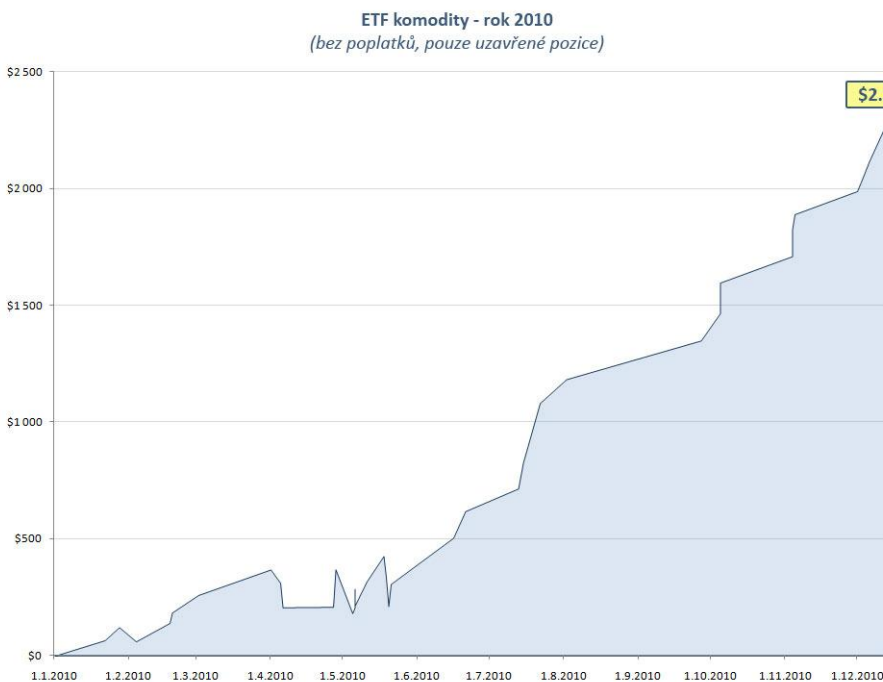


Komentář k roku 2010

ETF komoditní portfolio vykázalo za 2010 rok velmi pěkné **18%-ní** zhodnocení, když v roce 2009 byl výsledkem našeho obchodování nádherný zisk **+40%**. Pro zajímavé zhodnocení vlastního kapitálu na světových komoditních trzích obchodník nemusí nutně investovat do vražedných futures kontraktů či opcí na komoditní futures. Díky velkému množství likvidních ETF akcií mohou obchodníci, bez velkého rizika, participovat na zajímavých pohybech komodit, globálních indexů i měnových párů. Logické a jasné obchodní signály, s jasným money managementem a risk managementem, prostě přinášejí výsledky. Co by za 18%-ní zhodnocení dala většina obchodníků, trápící se s obchodováním futures kontraktů, futures opcí, komoditních spreadů apd..

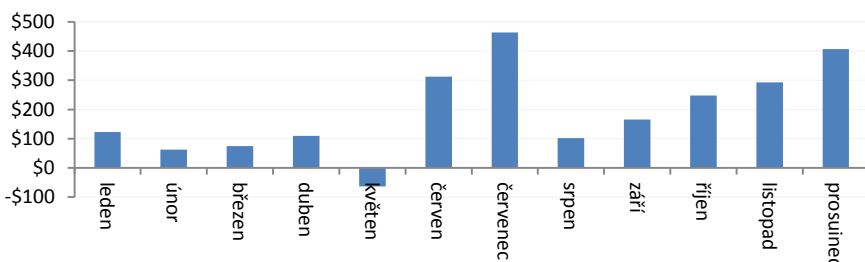
Navíc nás vyhledávání příležitostí a řízení portfolia stálo a stojí opravdu jen minimum času. Signály na komoditách buď prostě jsou nebo nejsou. A když jsou, tak se zobchodují. A pokud se zobchodují správné signály se správnou diverzifikací, pak se můžeme chlubit našimi dlouhodobě výbornými výsledky.

Graf zhodnocení portfolia za rok 2010



Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2010
ETF komodity	+2,6%	+3,6%	+7,3%	+9,5%	-5,0%	+18,0%



Zhodnocení portfolia 2010

+18,0%

Základní údaje

Kapitál	\$10.000
Trh	US akciové a ECN trhy
Frekvence	1 obchod týdně
Délka držení	Několik dní
Portfoliomanager	Josef Lukáč

Statistika za rok 2010

Celkový zisk	\$2.299
Ziskové pozice	\$2.996
Ztrátové pozice	-\$697
Počet obchodů	37
Počet ziskových obchodů	30
Počet ztrátových obchodů	7
Největší zisk	\$256
Největší ztráta	-\$187
Největší kumulovaný zisk	\$308
Největší kumulovaná ztráta	-\$216
Průměrný obchod	\$62,1
Průměr ziskových obchodů	\$100
Průměr ztrátových obchodů	-\$100
průměrný počet dní v pozici	13,9
Nejkratší počet dní v pozici	1
Nejdelší počet dní v pozici	31
Zisk-faktor (zisky/ztráty)	4,3
Procento úspěšnosti obchodu	81,1%

LevelTrading.net
profi(t) trading pro všechny

www.leveltrading.net

lukac@leveltrading.net

info@leveltrading.net

ETF KOMODITY

Obchodované trhy	US akciové a ECN trhy
Obchodované tituly	Komoditní ETF akcie (včetně Ultra Short a Double Long ETF akcií)
Frekvence	průměrně 3 obchody měsíčně
Časové pásmo	60 min a denní
Typ obchodů	Swing a poziční obchodování
Počáteční kapitál	\$10,000
Délka držení pozic	Od několika hodin po několik dní či týdnů
Doporučení	Disciplína, trpělivost a řízení peněz (moneymanagement)

Podobně jako US akcie, i komoditní ETF akcie (akcie sledující vývoj komodit, indexů i měn) denně screenujeme, porovnáváme se základními fundamenty, COT reporty a následně vybíráme nejvhodnější kandidáty k zobchodování. Vybrané kandidáty, před otevřením trhu, zveřejňujeme v placené sekci s platným obchodním nastavením (tedy tím, jak obchod budeme realizovat my).

Velikost každé obchodní pozice činí 10% z vyčleněného obchodního kapitálu pro tuto metodu. Pro výpočet zhodnocení a počtů kusů akcií do obchodu jsme zvolili velikost vyčleněného obchodního kapitálu 10.000 USD.

Sledování a obchodování ETF/ETN

Double long	Double short	Popis
SSO	SDS	S&P500
DGP	DZZ	Zlato
XLF-only Long	SKF	Finanční sektor
TLT-only Long	TBT	Lehman - dluhopisový fond

Mezinárodní ETF

EWA	Austrálie
EWC	Kanada
EWJ	Japonsko
EEM	Rozvojové trhy
EWY	Jižní Korea
FXI	Čína
PIN	Indie
EWZ	Brazílie
EWT	Taiwan
ILF	Latinská amerika
RSX	Rusko

Další komodity

UNG	Plyn
SLV	Stříbro
DBA	Zemědělství
RJA	Rogers Agrokomodity
RJN	Rogers Energy
GDX	Těžaři zlata
GDXJ	Junior těžaři zlata
GLD	Zlato
USO	Ropa