

Komentář k roku 2011

ETF Forex portfolio beze zbytku splnilo naše očekávání a v uplynulém roce přineslo nám i našim klientům více než 10%-ní zisk. Drtivá většina obchodních pozic byla zaměřena na námi očekávané posílení podhodnoceného amerického dolaru k ostatním měnám, k čemuž nakonec došlo a mohli jsme tak postupně uzavírat zajímavé zisky. Nadále očekáváme cca 10%-ní zhodnocování tohoto pozičního forexového portfolia, obchodovaného pouze s minimální pákou (poměr vlastního a kapitálu a marginu 1:1).

Aktuálně máme v portfoliu 4 otevřené pozice, 2 na Long a 2 na Short. Obchody jsou otevřeny na švýcarském franku, japonském jenu, indické rupii a čínském yuanu. Toto portfolio je pro klienty jiných sekcí zcela ZDARMA !

Dovolujeme si tvrdit, že pro 90-95% retailových FOREX obchodníků by bylo ziskovější, kdyby začalo obchodovat právě ETF měnové instrumenty a třeba i dle našich signálů...

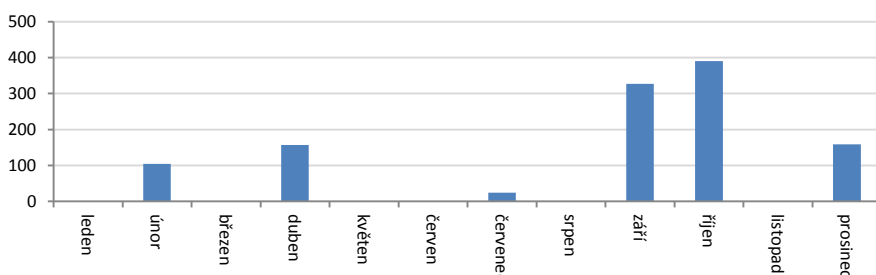
Graf zhodnocení portfolia za rok 2011

ETF forex - rok 2011
(bez poplatků, uzavřené pozice)



Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2011
ETF forex	+1,0%	+1,6%	+3,5%	+5,5%	-0,7%	+10,9%



Zhodnocení portfolia 2011

včetně otevřených pozic

+10,9%

Základní údaje

Kapitál	\$10.000
Trh	US akciové a ECN trhy
Frekvence	2 obchody měsíčně
Délka držení	Několik dní
Portfoliomanager	Josef Lukáč

Statistika za rok 2011

Celkový zisk	\$1.161
Ziskové pozice	\$1.161
Ztrátové pozice	0
Počet obchodů	9
Počet ziskových obchodů	9
Počet ztrátových obchodů	0
Největší zisk	\$235
Největší ztráta	0
Největší kumulovaný zisk	\$1.161
Největší kumulovaná ztráta	0
Průměrný obchod	\$129
Průměr ziskových obchodů	\$129
Průměr ztrátových obchodů	-0
průměrný počet dní v pozici	16,4
Nejkratší počet dní v pozici	1
Nejdelší počet dní v pozici	30
Zisk-faktor (zisky/ztráty)	--
Procento úspěšnosti obchodu	100%

LevelTrading.net
profi(t) trading pro všechny

www.leveltrading.net

lukac@leveltrading.net

info@leveltrading.net

ETF FOREX

Obchodované trhy	US akciové a ECN trhy
Obchodované tituly	Měnové ETF akcie
Frekvence	Průměrně 2 obchody měsíčně
Časové pásmo	Denní a týdenní
Typ obchodů	Swing a poziční obchodování
Počáteční kapitál	\$10,000+\$10.000 margin
Délka držení pozic	Několik dní či týdnů
Doporučení	Disciplína, trpělivost a řízení peněz (moneymanagement)

Měnové ETF akcie výrazně zjednodušují akciovým investorům a obchodníkům participaci na důležitých měnových pohybech. I přes některá omezení (ve srovnání s Forex trhem), však přinášejí měnové ETF akcie spoustu výhod:

- ✓ obchodování je zcela stejné, jako se standardními akciemi
- ✓ významná výhoda možnosti volby velikosti obchodní pozice
- ✓ možnost částečného nabírání či vystupování z pozic
- ✓ možnost využít marginu brokera.

Forex sice disponuje takovými možnostmi, jako obchodování 24 hodin denně, 7 dní v týdnu, automatické využití výrazné páky, free grafické platformy a data apd. Tyto zdánlivé a mnohými marketéry zdůrazňované „výhody Forexu“ však vedou u drtivé většiny obchodníků pouze k velkým ztrátám a rozčarování.

Správnou cestou k úspěchu v obchodování je jednoznačně pečlivé analyzování a vybírání pouze nejlepších příležitostí, nejsilnějších obchodních signálů a obchodování těch opravdu významných měnových pohybů (nikoliv intradenních několikapipsových šumů), což přináší daleko lepší výsledky všem kategoriím obchodníků (začínající, pokročilí).

Měnové ETF akcie kopírují měnové páry tak, že hodnota ETF akcie je 100násobek forexového kurzu (hodnoty sledované měny k dolaru). V případě Eura, kdy je kurz aktuálně 1,36 stojí jedna ETF akcie na Euro (FXE) 136 USD.

Na důležitých měnových párech sledujeme a vyhodnocujeme jejich vývoj a závislost na fundamentech, akciových, dluhopisových i komoditních trzích i vzájemnou korelaci párů. K obchodům vybíráme signály s velkou pravděpodobností úspěchu, kombinujeme jak poziční obchody, tak i Swing obchody. Současně přitom vyhodnocujeme i vzájemnou korelaci/ nekorelaci připravovaných a otevřených pozic v ETF forex portfoliu.

Vybrané ETF akcie k obchodům zveřejňujeme sekci ETF forex (Free sekce) s platným obchodním nastavením. Upozorňujeme, že jde o absolutně unikátní a bezkonkurenční službu v ČR !!

Velikost každé obchodní pozice činí 20% 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, ovšem zároveň počítáme s možností sáhnout si do povoleného marginu od brokera ve výši dalších 10.000 USD. Tuto možnost ovšem budeme využívat pouze výjimečně, při extra dobrých příležitostech a zároveň více než pěti otevřených ETF forex pozicích.

Aktuální ceny titulů v tabulkách (přehledech) jsou v průběhu dne nepravidelně aktualizovány, nelze v žádném případě, i vzhledem ke zpoždění volných dat, zaručit plnou průběžnou aktuálnost dat. Proto aktuální ceny v přehledech je nutno považovat pouze za orientační.