

Komentář k roku 2012

Portfolio - ETF Forex - zakončilo rok 2012 opět ziskem, tentokrát +5,3%. Letos jsme již uzavřeli další dvě pozice na ziskových targetech. A sice short japonského jenu a Long eura, které se opět vrátilo k námi dlouhodobě uváděné F.V. úrovni 1,33+-. Aktuálně se Euro obchoduje výrazněji nad F.V (1,36+-) takže na platném rezistu a prodejním signálu lze spekulovat na opětovný test 1,33+-, tentokrát shora.

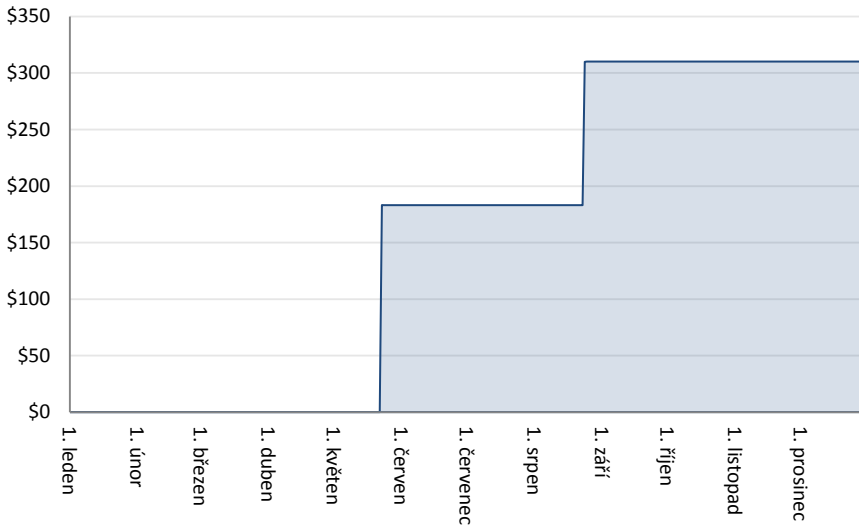
Otevřeny zůstávají pozice indické rupii, čínském yuanu, brazilském realu, švýcarském franku a kanadském dolaru. Všechny pozice obchodujeme přes nepákové měnové ETF akcie, obchodované na US trzích.

Obchodování měnových párů je díky ETF produktům oproštěno od největších a nejčastějších chyb, díky kterým drtivá většina klasických forexových obchodníků ztrácí = obchodování příliš velkých pozic vzhledem k obchodnímu účtu, přebobchodování, nediverzifikace, úzké a pouhou volatilitou odpalované Stoplossy apd...

Cílem zhodnocení tohoto portfolio pro rok 2013 je alespoň +10%, s nízkým drawdownem.

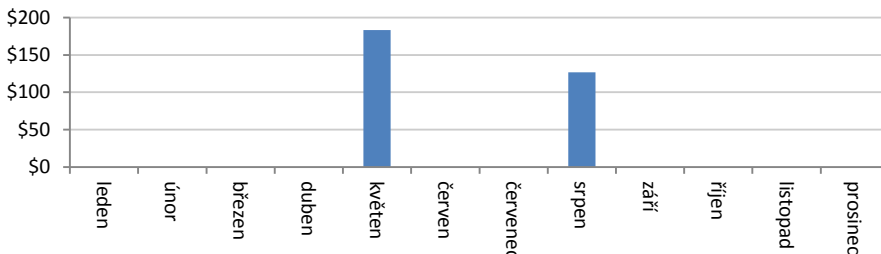
Graf zhodnocení portfolia za rok 2012

ETF forex - rok 2012
(bez poplatků, pouze uzavřené pozice)



Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2012
ETF forex	0	+1,8%	+1,3%	0	+2,2%	+5,3%



Zhodnocení portfolia 2012

včetně otevřených pozic

+5,3%

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 2012

Celkový zisk	\$310
Ziskové pozice	\$310
Ztrátové pozice	0
Počet obchodů	2
Počet ziskových obchodů	2
Počet ztrátových obchodů	0
Největší zisk	\$183
Největší ztráta	0
Největší kumulovaný zisk	\$183
Největší kumulovaná ztráta	0
Průměrný obchod	\$155
Průměr ziskových obchodů	\$155
Průměr ztrátových obchodů	-0
průměrný počet dní v pozici	16,5
Nejkratší počet dní v pozici	5
Nejdelší počet dní v pozici	28
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.