

## Komentář k roku 2012

Kromě několika kompletně uzavřených obchodů je naše poziční ETF komoditní portfolio aktuálně naplněno dřívějšími akumulovanými pozicemi ve vybraných komoditách a nadále tedy čekáme na jejich postupné „uzrávání“.

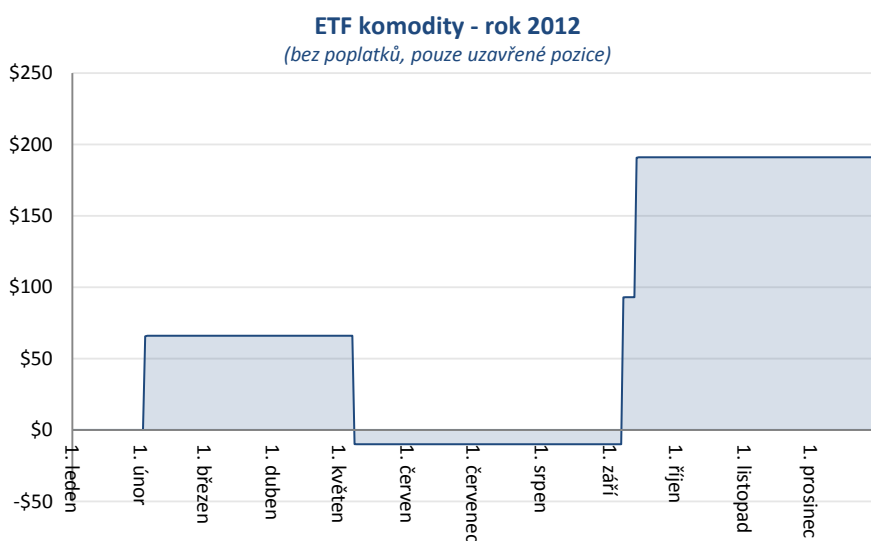
Máme diverzifikováno v různých oblastech jako v agrokomoditách, energy komoditách, atraktivních globálních indexech (Čína, Japonsko, Vietnam), uranových i zlatostříbrných producentech. Dále máme vsazeno i na pokles US bondů či růst ceny stříbra.

I když se dlouhou dobu portfolio nacházelo v průběžné ztrátě, způsobené negativní situací v globální ekonomice, postupně se naše pozice dostávají a v dalším období budou dostávat z průběžné ztráty do zisku.

Celkově portfolio končí ještě rok 2012 v malé ztrátě (-0,3%), i když jsme tento rok již očekávali opět ziskový výsledek.

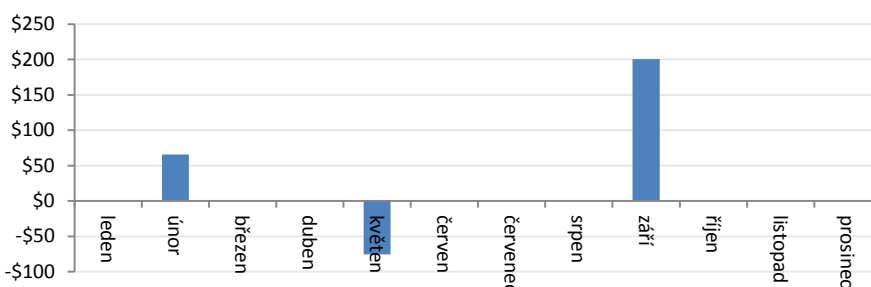
V tomto roce očekáváme růst jak akciových tak komoditních trhů, což by mělo naše komoditní portfolio již opět přivést k zajímavým ziskům.

## Graf zhodnocení portfolia za rok 2012



## Výkonnost (%)

| Portfolio    | Q1    | Q2    | Q3    | Q4 | Otevřené | Rok 2012 |
|--------------|-------|-------|-------|----|----------|----------|
| ETF komodity | +0,7% | -0,8% | +2,0% | 0  | -2,2%    | -0,3%    |



## Zhodnocení portfolia 2012

včetně otevřených pozic

# -0,3%

### Základní údaje

|                  |                       |
|------------------|-----------------------|
| Kapitál          | \$10.000              |
| Trh              | US akciové a ECN trhy |
| Frekvence        | 3 obchody měsíčně     |
| Délka držení     | Několik dní           |
| Portfoliomanager | Josef Lukáč           |

### Statistika za rok 2012

|                              |        |
|------------------------------|--------|
| Celkový zisk                 | \$191  |
| Ziskové pozice               | \$266  |
| Ztrátové pozice              | -\$76  |
| Počet obchodů                | 4      |
| Počet ziskových obchodů      | 3      |
| Počet ztrátových obchodů     | 1      |
| Největší zisk                | \$103  |
| Největší ztráta              | -\$76  |
| Největší kumulovaný zisk     | \$103  |
| Největší kumulovaná ztráta   | -\$76  |
| Průměrný obchod              | \$47,7 |
| Průměr ziskových obchodů     | \$89   |
| Průměr ztrátových obchodů    | -\$76  |
| průměrný počet dní v pozici  | 19,5   |
| Nejkratší počet dní v pozici | 9      |
| Nejdelší počet dní v pozici  | 30     |
| Zisk-faktor (zisky/ztráty)   | 3,5    |
| Procento úspěšnosti obchodu  | 75,0%  |

**LevelTrading.net**  
profi(t) trading pro všechny

[www.leveltrading.net](http://www.leveltrading.net)

[lukac@leveltrading.net](mailto:lukac@leveltrading.net)

[info@leveltrading.net](mailto: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.

Vybrané komodity postupně nakupujeme do diverzifikovaného pozičního komoditního portfolia a vystupujeme až na předem plánovaných targetech. Pokud obchodní signál zabere hned, ihned uzamkneme Swing zisk. Nicméně pozice v portfoliu časově neomezujeme, jako u US akciového portfolia. Pozice mohou v portfoliu zrát i delší dobu, obzvláště pokud nám není právě nakloněn akciový a komoditní sentiment.