

IC-R2000 (opční strategie - iron condor na index Russell 2000)

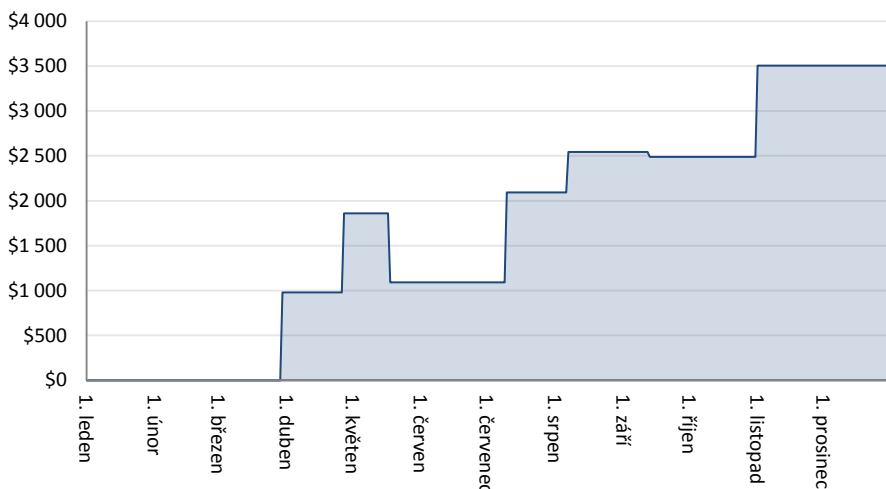
Komentář k roku 2012

Tuto strategii jsme začali obchodovat v březnu roku 2012. Do konce roku strategie připsala \$3.506, což představuje 35%. Tato strategie je sestavena tak, aby průměrný roční zisk byl 20%. Tento cíl byl tedy splněn nadprůměrně. Této strategii příliš nesvědčí trendující trhy a ty nebyly v roce 2012 nijak velké. Proto bylo zhodnocení lepší, než se čekalo.

Systém IC-R2000 se snažím neustále zlepšovat tak, aby byl zaručen co největší komfort při otevření pozice. Špatnou zprávou však je, že v novém roce trhy během několika dnů prudce posílily a nebylo možné pozici rychle upravit. Došlo tak k velké ztrátě, kterou se budu snažit v roce 2013 smazat a přidat další zisk. I na tom jsem zapracoval a věřím, že tato situace se již nebude opakovat.

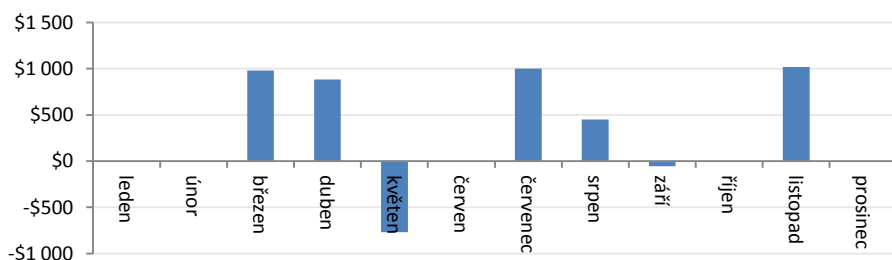
Graf zhodnocení portfolia za rok 2012

IC-R2000 - rok 2012
(bez poplatků, pouze uzavřené pozice)



Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2012
IC-R2000	+9,8%	+1,1%	+14,0%	+10,2%	-27,1%	+8,0%



Zhodnocení portfolia 2012

včetně otevřených pozic

+8,0%

Základní údaje

Kapitál	\$10.000
Trh	US opční trhy
Frekvence	1 obchod měsíčně
Délka držení	1 měsíc
Portfoliomanager	Jan Široký

Statistika za rok 2012

Celkový zisk	\$3.506
Ziskové pozice	\$6.220
Ztrátové pozice	-\$2.714
Počet obchodů	11
Počet ziskových obchodů	7
Počet ztrátových obchodů	4
Největší zisk	\$1.751
Největší ztráta	-\$1.300
Největší kumulovaný zisk	\$2.140
Největší kumulovaná ztráta	-\$1.460
Průměrný obchod	\$118,7
Průměr ziskových obchodů	\$889
Průměr ztrátových obchodů	-\$679
průměrný počet dní v pozici	16,0
Nejkratší počet dní v pozici	2
Nejdelší počet dní v pozici	28
Zisk-faktor (zisky/ztráty)	2,3
Procento úspěšnosti obchodu	63,6%

LevelTrading.net
profi(t) trading pro všechny

www.leveltrading.net

siroky@leveltrading.net

info@leveltrading.net

IC-R2000 (opční strategie - iron condor na index Russell 2000)

Obchodované trhy	US opční trhy
Opce	Iron Condor, Long call, Long put
Frekvence	1 obchodměsíčně
Časové pásmo	Měsíční
Typ obchodů	Poziční
Počáteční kapitál	\$10.000
Délka držení pozic	1 měsíc
Doporučení	Doporučujeme brokera s nízkými poplatky

Tento systém vychází z obchodování opční strategie Iron Condor, při které spekulujeme na to, že podkladové aktivum (v našem případě index Russell2000) zůstane v určitém cenovém rozpětí během stanovené doby.

Iron Condor je tvořen dvěma spready:

Call kreditní spread: prodej call opce OTM a nákup vzdálenější call opce o jeden a více strike cen jako pojištění.

Put kreditní spread: prodej put opce OTM a nákup vzdálenější put opce o jeden a více strike cen jako pojištění.

Za vytvořenou strategii obdržíme kredit, který se snažíme uhájit.

Strategie se otevírá 30-35 dní do expirace, což je optimální doba k vůli časovému rozpadu opcí.