

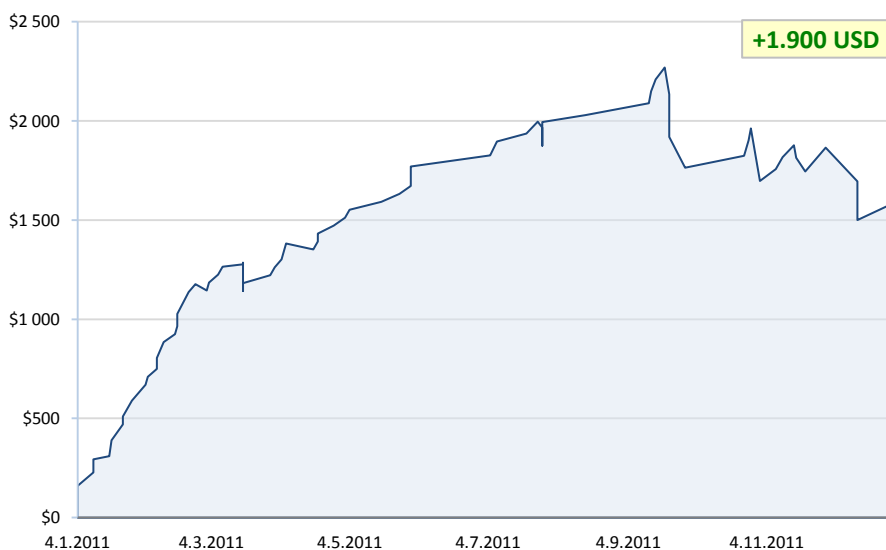
## Komentář k roku 2011

Máme za sebou další obchodní rok a opční portfolio opět uzavřelo v zelených číslech. Celý rok byl velmi volatilní, což nás nutilo být spíše mimo trh, protože je pro nás prvořadá ochrana kapitálu. I proto zisk \$1900 z uzavřených pozic hodnotíme velmi pozitivně. Jelikož ale stále v portfoliu máme nakoupeny akcie GNK, je zisk daleko menší: \$600. Tyto akcie však i nadále budeme držet dál, a pokud nedojde do konce roku ke zlepšení situace, budeme je uzavírat.

Následující rok dle mého názoru bude i nadále více volatilní, ale očekávám v průběhu roku cca 3-4 měsíční růst indexů. V tomto období se budeme snažit vydělat co nejvíce peněz. Pokud ale bude situace napjatá a nejistá, nebudeme otevírat příliš mnoho obchodů, protože cílem opčního portfolia je hlavně ochrana kapitálu a dlouhodobá kladná výnosnost.

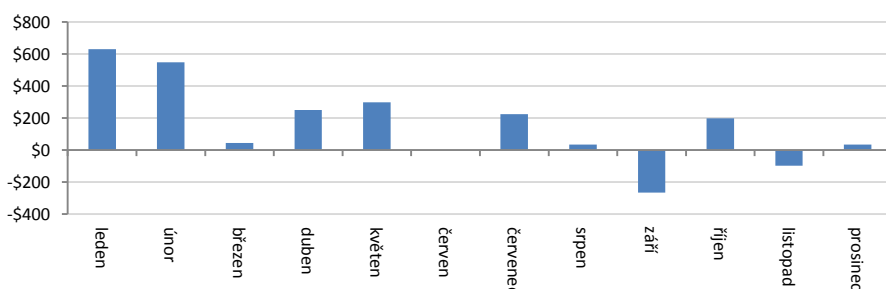
## Graf zhodnocení portfolia za rok 2011

opce - rok 2011  
(bez poplatků, pouze uzavřené pozice)



## Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2011
OPCE	+12,2%	+5,5%	-0,1%	+1,4%	-13,0%	+6,0%



## Zhodnocení portfolia 2011

včetně otevřených pozic

# +6,0%

### Základní údaje

Kapitál	\$10.000
Trh	US opční trhy
Frekvence	1-2 obchody týdně
Délka držení	1-3 týdny
Portfoliomanager	Jan Široký

### Statistika za rok 2011

Celkový zisk	\$1.900
Ziskové pozice	\$3.493
Ztrátové pozice	-\$1.593
Počet obchodů	80
Počet ziskových obchodů	65
Počet ztrátových obchodů	15
Největší zisk	\$150
Největší ztráta	-\$265
Největší kumulovaný zisk	\$1.177
Největší kumulovaná ztráta	-\$505
Průměrný obchod	\$23,8
Průměr ziskových obchodů	\$54
Průměr ztrátových obchodů	-\$106
průměrný počet dní v pozici	11,2
Nejkratší počet dní v pozici	1
Nejdelší počet dní v pozici	31
Zisk-faktor (zisky/ztráty)	2,2
Procento úspěšnosti obchodu	81,3%

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

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

siroky@leveltrading.net

info@leveltrading.net

# OPCE

---

Obchodované trhy	US opční trhy
Opce	Long call, Long put, Call debet spread, Put debet spread, Call credit spread, Put credit spread, Put writing
Frekvence	Záleží na vstupních signálech - cca 1-2 obchody týdně. Vstupní signály jsou známy do 16:00.
Časové pásmo	Denní
Typ obchodů	Swing
Počáteční kapitál	\$10.000
Délka držení pozic	1-3 týdny
Doporučení	Doporučujeme brokera s nízkými poplatky

Každý den, v průběhu obchodování, analyzujeme všechny dostupné opce na americké akcie. Základem našeho systému je neustálý monitoring objednávek "velkých hráčů" na trhu. Je jasné, že tito mají více cenotvorných informací než malí obchodníci. Náš algoritmus rozpozná tyto obchody a umožní nám se jich zúčastnit.

Na našich stránkách prezentujeme vstupní a výstupní hodnoty z našeho systému a to v reálném čase. K obchodování využíváme strategií - Long call, Long put, Call debet spread či, Put debet sprej a Put writing. Riziko je nastaveno maximálně na 5% hodnoty účtu na jednu transakci.

Sekce - Opce - prezentuje naše portfolio, které Vám doporučujeme denně sledovat. Jelikož obchody přicházejí v rámci obchodních hodin, máme nastaveno automatické refreshování stránek po 1 minutě. Tímto sou zaručeny okamžité aktualizace a klient má ihned přehled o tom, co se v dané době děje s portfoliem.

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

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

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

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