

Komentář k roku 2012

Celý rok 2012 byl velmi volatilní, což se projevilo i ve frekvenci našeho obchodování. Celkově jsme provedli pouze 50 obchodů. To je oproti klidnějším rokům málo. Zisk (pozice uzavřené v tomto roce) činil \$1.745, což je v procentním vyjádření 17.5%. I když mým cílem je zhodnocovat účet v průměru o 30% ročně, tak jsem s výsledkem spokojen. Trh prostě nebyl příliš nakloněn mé strategii.

Největším problémem mého portfolia je stále držení akcií s tickerem GNK, které nejví ztrácejí. Tuto pozici tento rok ještě podržím, ale pokud nedojde k zlepšení, tak ji budeme muset uzavřít.

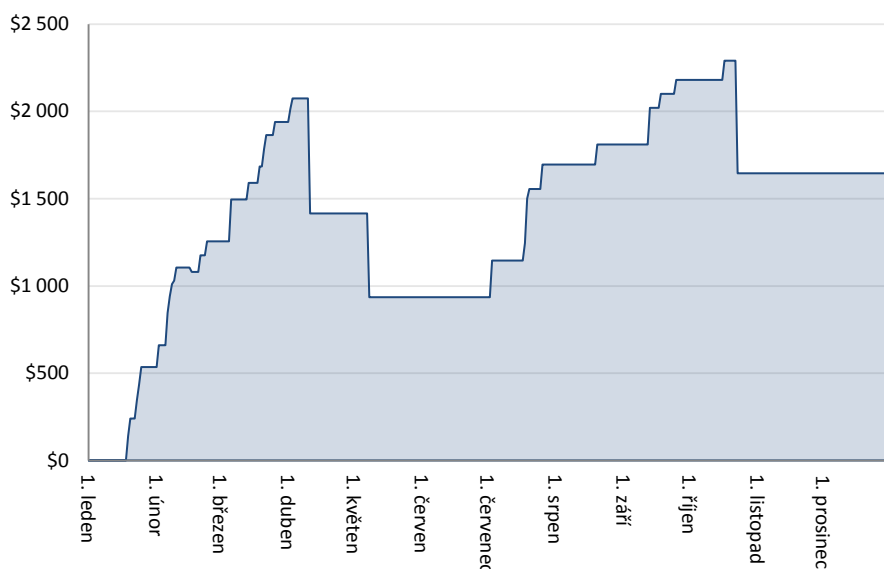
Co je pro mne komfortní, je procento ziskových obchodů. To je na úrovni 80% (většina obchodů je ziskových). Objeví se ovšem pár ztrát, které jsou vyšší, a proto systém vždy zažije období propadu.

Dlouhodobě je tato strategie zisková a to je velmi důležité. Osobně jsem obchodně již takto nastaven a výkyvy v ekvinní křivce, které se objevují, beru jako součást tohoto systému.

Věřím, že i v nadcházejícím roce se mi povede dosáhnout zhodnocení alespoň stejné jako v roce 2012.

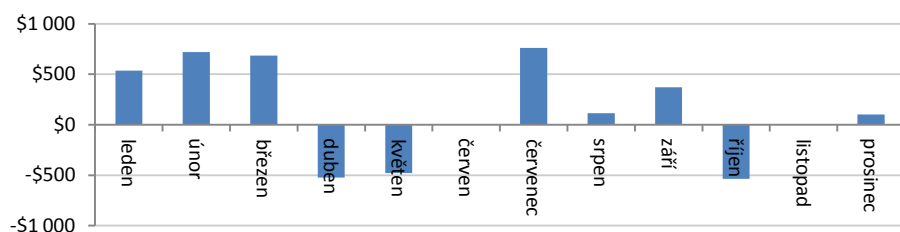
Graf zhodnocení portfolia za rok 2012

Opce - rok 2012
(bez poplatků, pouze uzavřené pozice)



Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2012
OPCE	+19,4%	-10,0%	+12,5%	-4,4%	-6,9%	+10,6%



Zhodnocení portfolia 2012

včetně otevřených pozic

+10,6%

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 2012

Celkový zisk	\$1.745
Ziskové pozice	\$1.585
Ztrátové pozice	-\$1.840
Počet obchodů	50
Počet ziskových obchodů	40
Počet ztrátových obchodů	10
Největší zisk	\$155
Největší ztráta	-\$480
Největší kumulovaný zisk	\$1.355
Největší kumulovaná ztráta	-\$940
Průměrný obchod	\$34,9
Průměr ziskových obchodů	\$90
Průměr ztrátových obchodů	-\$184
průměrný počet dní v pozici	18,3
Nejkratší počet dní v pozici	3
Nejdelší počet dní v pozici	31
Zisk-faktor (zisky/ztráty)	1,9
Procento úspěšnosti obchodu	80,0%

LevelTrading.net
profi(t) trading pro všechny

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 spread 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

siroky@leveltrading.net

info@leveltrading.net