

Komentář k roku 2011

Naše na podzim nově předělané portfolio obchodující pouze signály na S&P500 indexu si udržuje nadále vysokou výkonnost, i když jsme výrazně snížili, právě kvůli vysoké Swing i intradenní volatilitě, páku při obchodování. Zcela jsme opustili e-mini futures na SP500 a obchodování nyní provádíme pouze s ETF akciemi SSO. Podrobnější popis na další straně pod grafy. Úprava tohoto obchodního portfolio umožnila úspěšné obchodování i ve vysoce volatilním období a přinesla výborné výsledky. Současně se snížila rizikovost a především citlivost portfolio na rychlé střídání pozitivního a negativního sentimentu na trzích. ETF akcie navíc umožňují dobře reagovat na aktuální situaci a druh obchodních signálů pružným nastavením money management parametrů což u e-mini futures bylo v podstatě vyloučeno.

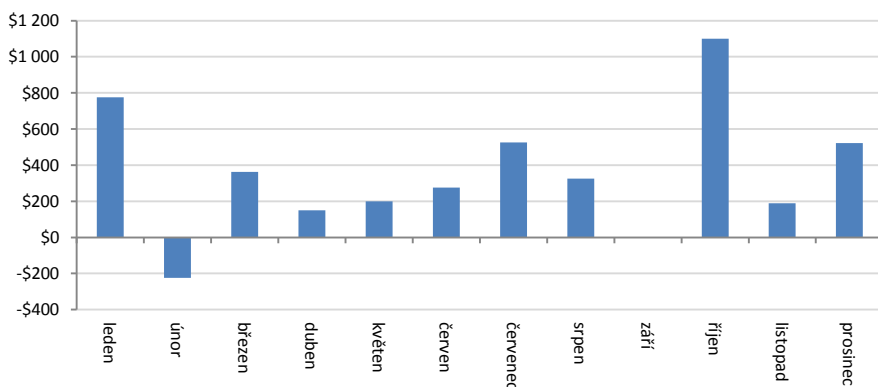
Graf zhodnocení portfolio za rok 2011

S&P500 - rok 2011
(bez poplatků, pouze uzavřené pozice)



Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2011
S&P500	+9,1%	+6,3%	+8,5%	+18,1%	0	+42,0%



Zhodnocení portfolio 2011

včetně otevřených pozic

+42,0%

Základní údaje

Kapitál	\$10.000
Trh	US akciové a ECN trhy
Frekvence	1-2 obchody týdně
Délka držení	Několik hodin až dní
Portfoliomanager	Josef Lukáč

Statistika za rok 2011

Celkový zisk	\$4.198
Ziskové pozice	\$6.165
Ztrátové pozice	-\$1.966
Počet obchodů	72
Počet ziskových obchodů	58
Počet ztrátových obchodů	14
Největší zisk	\$1.100
Největší ztráta	-\$304
Největší kumulovaný zisk	\$1.818
Největší kumulovaná ztráta	-\$304
Průměr z obchodů	\$58,3
Průměr ziskových obchodů	\$106
Průměr ztrátových obchodů	-\$140
Průměrný počet dní v pozici	1
Nejkratší čas v pozici	1
Nejdelší čas v pozici	8
Zisk-faktor (zisky / ztráty)	3,1
Procento úspěšnosti obchodů	80,60%

LevelTrading.net
profi(t) trading pro všechny

www.leveltrading.net

lukac@leveltrading.net

info@leveltrading.net

S&P500

Obchodované trhy	US akciové a ECN trhy
Obchodované tituly	Ultra S&P500 – ETF akcie SSO
Frekvence	Průměrně 1-2 obchody týdně
Časové pásmo	60 min. a denní
Typ obchodů	Swingtrading, Daytrading
Počáteční kapitál	\$10,000
Délka držení pozic	Od několika hodin po několik dnů
Doporučení	Realizovat všechny platné signály

Sekce S&P500 navazuje a rozšiřuje původní sekci ES Daytrading. Důvodem přechodu z rychlých přesně na bod naplánovaných intraday obchodů (Scalping) k Daytrading a hlavně Swing obchodům je vysoká tržní volatilita posledních měsíců, kdy intradenní Scalping metody s extrapřesným nastavováním obchodních úrovní, úzkými stoplossy i targety nemohou optimálně fungovat.

Správným řešením v těchto situacích je poskytnout obchodům více prostoru (širší Stop i Target a snížit páku). A přesně toto představuje nová sekce S&P500. Navíc se vlastní obchodování výrazně zjednoduší a klientům ušetří mnoho času tráveným sledováním intradenních volatilních grafů a čekáním na intraday signály.

V placené sekci naleznete naše kompletní obchodní nastavení pro daný obchodní den a to vždy před zahájením obchodování. Forma bude zcela stejná jako u dalších sekcí jako US akcie či ETF komodity.

Do obchodů budeme vstupovat pouze při splnění našich osvědčených obchodních signálů, které vycházejí z kombinace technické a sentiment analýzy. Obchodních signálů pro SPX index úspěšně obchodujeme několik (např. Momentum L/H, Magnet Level, Taylor technika a další), a proto předpokládáme provedení několika obchodů měsíčně.

Obchody budou prováděny výhradně s ETF akciemi SSO (Ultra SPX) a k obchodům bude využit plný či jen část účtu ve výši 10.000 USD.