

## Komentář k roku 2012

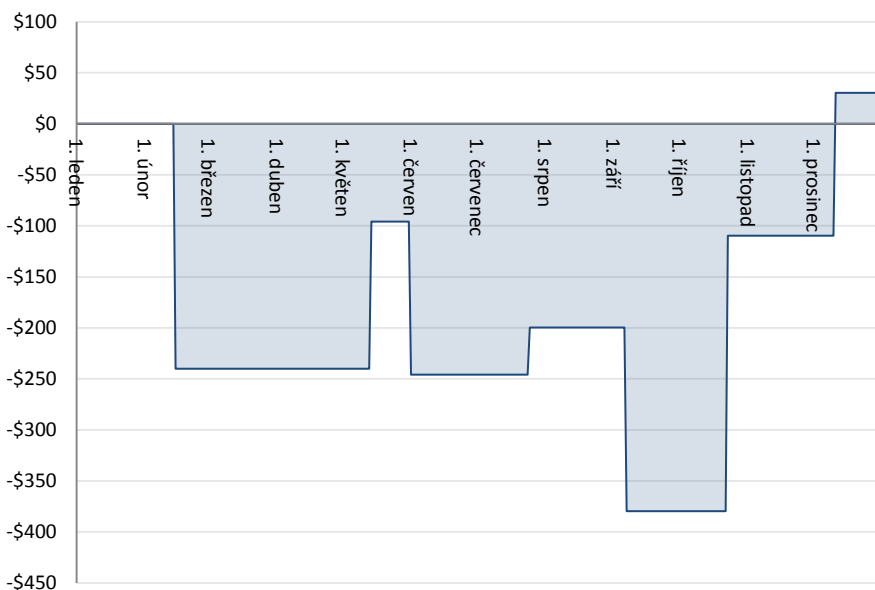
Výsledek portfolia S&P500 za rok 2012 je pro nás také zklamáním. Naše obchodní metoda pro index S&P500 je založena na několika dlouhodobě osvědčených obchodních signálech jako jsou konfluence nejdůležitějších technických ukazatelů, S/R + extrémny na sentiment indikátorech, Magnet Level, Momentum L/H a Taylor T.

Daleko více než technika však v loňském roce akciové indexy ovlivňovaly prohlášení a činy politiků a centrálních bank. To se bohužel projevilo v poklesu úspěšnosti, ale i četnosti platných obchodních signálů v obchodování naší S&P500 sekce.

Výsledek +0,3 % považujeme za neúspěch obzvláště při úspěšných analýzách a odhadech směřování trhů (týdenní Zpravodaje) a připravujeme nyní akčnější styl obchodování tohoto portfolia. Dle síly signálu budeme ještě více manévrovat s určením velikosti pozice a také zvážíme těsnější Targety a Stoplosy. Toto by mělo přinést více obchodů se zachováním pozitivní Winning% i celkové Expectancy.

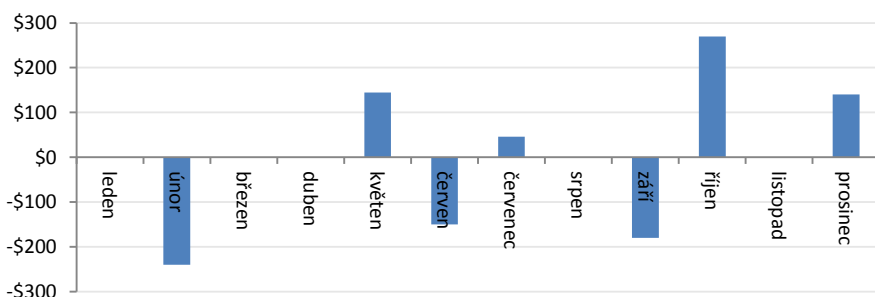
## Graf zhodnocení portfolia za rok 2012

**S&P500 - rok 2012**  
(bez poplatků, pouze uzavřené pozice)



## Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2012
S&P500	-2,4%	-0,1%	-1,3%	+4,8%	0	+0,3%



## Zhodnocení portfolia 2012

včetně otevřených pozic

# +0,3%

### 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 2012

Celkový zisk	\$30
Ziskové pozice	\$600
Ztrátové pozice	-\$570
Počet obchodů	7
Počet ziskových obchodů	4
Počet ztrátových obchodů	3
Největší zisk	\$270
Největší ztráta	-\$240
Největší kumulovaný zisk	\$270
Největší kumulovaná ztráta	-\$240
Průměr z obchodů	\$4,3
Průměr ziskových obchodů	\$150
Průměr ztrátových obchodů	-\$190
Průměrný počet dní v pozici	
Nejkratší čas v pozici	1
Nejdelší čas v pozici	8
Zisk-faktor (zisky / ztráty)	1,1
Procento úspěšnosti obchodů	57,1%

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

[www.leveltrading.net](http://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 využít plný či jen část účtu ve výši 10.000 USD.