

# US AKCIE – spekulativní portfolio

## Komentář k roku 2011

Poprvé po 4 letech zveřejňování obchodních nastavení a řízení portfolia spekulativních tipů na US akcie se nám nepodařilo v uplynulém roku vygenerovat celkový zisk (= součet uzavřených pozic v r.2011 a otevřených pozic k 31.12.) za kalendářní rok (2011). Příčinou je extrémně volatilní vývoj na akciových trzích, který započal japonským zemětřesením, následovaný letní eskalací obav z šíření evropské dluhové krize. Nepravidelné střídání extra negativního sentimentu s krátkodobou pozitivní náladou nedovolilo části pečlivě vybraných Swing obchodů doputovat ke stanoveným Targetům. Právě nezvyklé kolísání sentimentu v loňském roce snižovalo hlavní výhodu naší metody = vysokou Winning %. Volatilita způsobila častější než obvyklé odpalování Stop loss pokynů. Negativní nálada akcelerovala trhy vždy rychleji, než při pozitivním sentimentu dokázaly trhy posilovat. I přes upravený money management a zařazení dlouhodobějších pozic do tohoto portfolia končí US akciová sekce se ztrátou 4,3%.

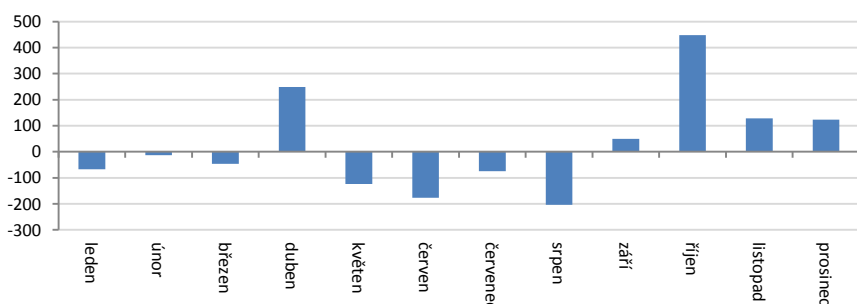
Po šňůře silně nadstandardních výsledků v uplynulých letech = zhodnocení +50% v roce 2008, +46% v roce 2009 a +39% v roce 2010 považujeme tento výsledek za určitou korekci k dlouhodobě průměrným očekávaným výsledkům této metody (30%+ p.a). Nicméně od uvedení této metody na našem webu Leveltrading zůstává celé portfolio US akcie v nadstandardním zisku +34,6%.

## Graf zhodnocení portfolia za rok 2011



## Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2011
US akcie	-1,3%	-0,5%	-2,3%	+7,0%	-7,2%	-4,3%



## Zhodnocení portfolia 2011

včetně otevřených pozic

# -4,3%

### Základní údaje

Kapitál	\$10.000
Trh	US akciové a ECN trhy
Frekvence	týdně 2-3 doporučení
Délka držení	1-14 dní
Portfoliomanager	Josef Lukáč

### Statistika za rok 2011

Celkový zisk	\$292
Ziskové pozice	\$3.179
Ztrátové pozice	-\$2.886
Počet obchodů	93
Počet ziskových obchodů	54
Počet ztrátových obchodů	39
Největší zisk	\$157
Největší ztráta	-\$189
Největší kumulovaný zisk	\$813
Největší kumulovaná ztráta	-\$620
Průměrný obchod	\$3,1
Průměr ziskových obchodů	\$59
Průměr ztrátových obchodů	-\$74
průměrný počet dní v pozici	21,3
Nejkratší počet dní v pozici	1
Nejdelší počet dní v pozici	31
Zisk-faktor (zisky/ztráty)	1,1
Procento úspěšnosti obchodu	58,1%

**LevelTrading.net**

profi(t) trading pro všechny

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

lukac@leveltrading.net

info@leveltrading.net

## US AKCIE – spekulativní portfolio

---

Obchodovaný trh	US akciové a ECN trhy
Obchodované tituly	Různé
Frekvence	Týdně průměrně 2 doporučení
Časové pásmo	Denní
Typ obchodů	Swing
Počáteční kapitál	\$10,000
Délka držení pozic	1-14 dní
Doporučení	Doporučujeme discount brokera (např. Interactive Brokers) s nízkými poplatky

Naše sofistikované obchodní modely každodenně několik hodin screenují akciové tituly na trzích v USA. Průběžně analyzujeme a následně vybíráme nejlepší tituly (s nejsilnějšími signály a zároveň splňující korektní obchodní parametry) k zobchodování. K výběru a správnému načasování používáme syntézu metod fundamentální, technické i sentiment analýzy. Nejzřetelnější kandidáty k obchodům uvádíme v příslušné sekci webu (US akcie).

V sekci US akcie naleznete všechny potřebné parametry k obchodu (obchodní nastavení): ticker, vstupní cenu, množství (odpovídající 10.000 USD účtu), target1 a target2 (doporučené výstupy), StopLoss (výstup pro případ, že cena půjde proti nám), TimeStop a poznámky.

Naše metoda dlouhodobě dosahuje více než 70 % vítězné pravděpodobnosti. Pouze loni byla Winning % cca 60%, což bylo způsobeno vysokou volatilitou trhů a nižší úspěšnost se ihned projevila i v horším než očekávaném výsledku za rok 2011.