

# US AKCIE – spekulativní portfolio

## Komentář k roku 2012

Naše portfolio US akcie zakončilo rok 2012 s pro nás nepotěšitelným výsledkem = ztrátou 5,6% (uzavřené pozice v roce 2012 + otevřené zisky a ztráty k 31.12.2012). Uzavřené obchody přinesly zisk 12,1%, ovšem některé střednědobější pozice bohužel nakonec stáhly výsledek do minusu, přestože jsme u nich čekali a nadále i očekáváme výraznější posílení v dalším období.

V roce 2012 (ale v podstatě již od poloviny 2011) došlo, díky zásahům a vyjádřením centrálních bank a politiků k potlačení významnosti fundamentů i techniky (na čemž je naše obchodní metoda postavena). Prudké a rychlé obraty tržního sentimentu často v průběhu jednoho dvou dnů, nevyhovovaly naší Swing obchodní metodě. Také jsme dostávali daleko menší počet platných obchodních signálů. Proto jsme přistoupili k zařazování více fundamentálnějších a i rizikovějších střednědobých pozic do portfolia.

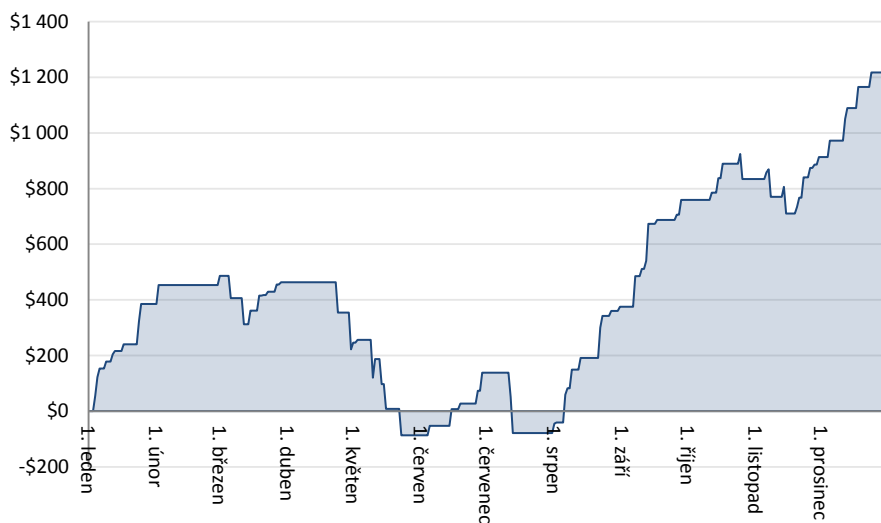
Pokles volatility a schopnost udržení započatých tržních Swing trendů (alespoň na několik dní) v posledních týdnech roku již opět ukázaly výhody naší obchodní metody. Výsledkem je dlouhá šňůra ziskových obchodů z posledních cca 3 měsíců a dosažení Targetu i na několika střednědobějších pozicích jako NOKIA či TC.

Po 2 hubených letech letos očekáváme návrat k dlouhodobým výsledkům této metody = 20-30 % p.a.

## Graf zhodnocení portfolia za rok 2012

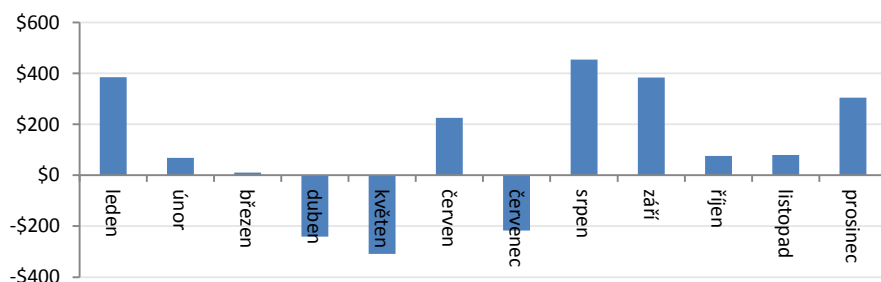
### US akcie - rok 2012

(bez poplatků, pouze uzavřené pozice)



## Výkonnost (%)

Portfolio	Q1	Q2	Q3	Q4	Otevřené	Rok 2012
US akcie	+4,6%	-3,3%	+6,2%	+4,6%	-17,8%	-5,7%



## Zhodnocení portfolia 2012

včetně otevřených pozic

# -5,7%

### 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 2012

Celkový zisk	\$1.165
Ziskové pozice	\$2.526
Ztrátové pozice	-\$1.362
Počet obchodů	52
Počet ziskových obchodů	38
Počet ztrátových obchodů	14
Největší zisk	\$172
Největší ztráta	-\$136
Největší kumulovaný zisk	\$973
Největší kumulovaná ztráta	-\$350
Průměrný obchod	\$22,4
Průměr ziskových obchodů	\$66
Průměr ztrátových obchodů	-\$97
průměrný počet dní v pozici	21,7
Nejkratší počet dní v pozici	1
Nejdélejší počet dní v pozici	31
Zisk-faktor (zisky/ztráty)	1,9
Procento úspěšnosti obchodu	73,1%

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

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

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