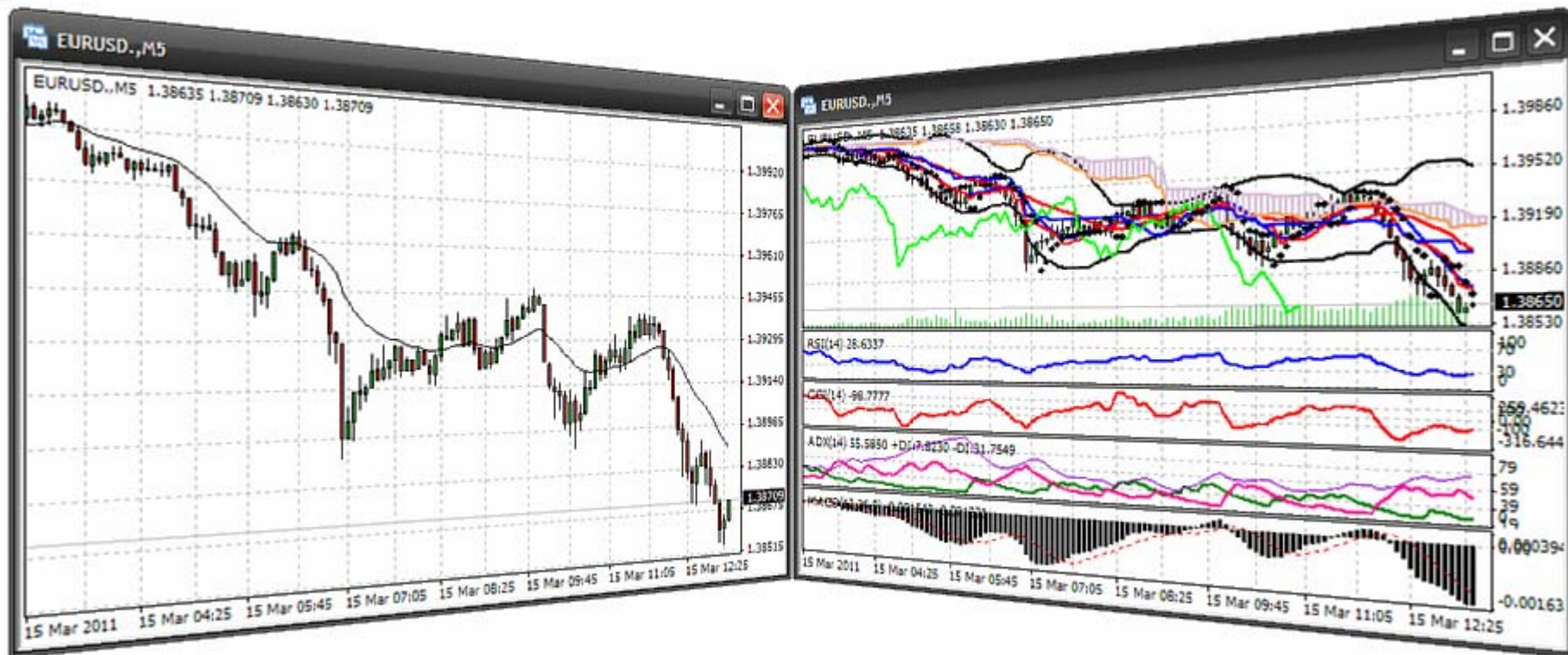


# **OBCHODNÍ SYSTÉMY NA FOREXU**

**Odborný seminář pro veřejnost – Praha, 16.3.2011**

**Tomáš Vobořil a Jan Šírek, Colosseum, a.s.**

# PROČ TO DĚLAT JEDNODUŠE, KDYŽ..



*..TO JDE SLOŽITĚ?*

# PROGRAM SEMINÁŘE

*Dnes máme na programu:*

- **Úvod** do obchodních systémů
- Jak se **staví systém** na Forex
- Jaké **parametry** systému **sledujeme** a dosahujeme
- Představení **konkrétního** obchodního systému na Forex
- Bohaté **příklady, zkušenosti** a **ukázky** obchodů
- ***Rádi odpovíme na všechny vaše dotazy***

# ÚVOD DO OBCHODNÍCH SYSTÉMŮ

*Tak trochu jiný úvod, než jste vždycky slyšeli.*

**Obchodní systém nejsou  
omalovánky pro děti, ani složitý  
koncept jaderné elektrárny.**

**Obchodní systém je čistý a jasný  
soubor pravidel, podle kterých  
obchodujeme.**

# ÚVOD DO OBCHODNÍCH SYSTÉMŮ

*Obchodní systém (přístup) je důležitá součást obchodníka. Je to soubor všech pravidel, proč, jak, kdy a kde zadávat obchodní pokyny a pozice.*

- **Nutný základ** pro obchodníka
- Základní myšlenka
- Technické nástroje
- Stanovení přesných pravidel
- Money a Risk management
- Testování na historických datech
- Sepsání pravidel

# ÚVOD DO OBCHODNÍCH SYSTÉMŮ

**Bez obchodního systému to  
nepůjde.**

**Bez obchodního systému se  
stáváme oběťmi plného  
spektra emocí.**

**Psychický a finanční kolaps  
je pak pouze přirozeným  
koncem.**

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

*Obchodování na trzích je komplexní záležitost. Je to nápad, technika, hlava a čas. **Základní myšlenka**, nápad, je přitom úplně prvním krokem, který určí váš další směr.*

- Kde vezmeme tuto základní myšlenku?
- Knihy, Internet, Mentor, **Já**
- Obchodních přístupů je nekonečně mnoho. **Já jsem jeden.**
- Co si vyberu?
- **Studium grafů**, Studium grafů, Studium, Grafy, Studium G...

# **JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX**



**Cenový graf je nejlepší učitel tradingu.**

**Většina ostatních věcí je jenom ztráta času.**



# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

*Technických nástrojů existuje celá řada. Obvykle ke stavbě OS stačí jeden nebo několik technických nástrojů. Čím jednodušší si to uděláte v tomto kroku, tím jednodušší bude celá vaše kariéra tradera.*

- Ze **zkušeností** doporučujeme cestu tímto směrem:
- Základní cenové technické úrovně (**S/R**) a **formace**
- Analýza svícových grafů
- Mezi Indikátory to primitivní a pochopitelné (**EMA**, MACD)

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX



**Nikdy nezapomeňme, že  
chceme obchodovat co nejdéle,  
možná celý život.**

**Chceme se celý život obtěžovat  
se složitostmi?**

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

*Zkušený obchodník si dobře uvědomuje nevyzpytatelnost trhů. Uvědomuje si také nestálost svého myšlení a chování. Stanovení přesných pravidel je tak důležitá věc, kterou je třeba důsledně dodržovat.*

- Pohyb trhu je nekonečný, neohraničený a **chaotický**
- Trh tvoří trend pouze **30 %** času a ne každý trend je čistý
- Chování většiny obchodníků je **emotivní** a iracionální
- Na trhu vydělává pouze **5 – 10 %** obchodníků
- Závěr: Trh je chaos; **Potřebujeme pravidla**, jak ho zvládat
- Položení pravidel = vznik strategie

# **JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX**



**Trh jde vždycky tam, kde leží  
více pokynů.**

**Trh nikdy nejde tím směrem, v  
něžž usilovně doufáme.**

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

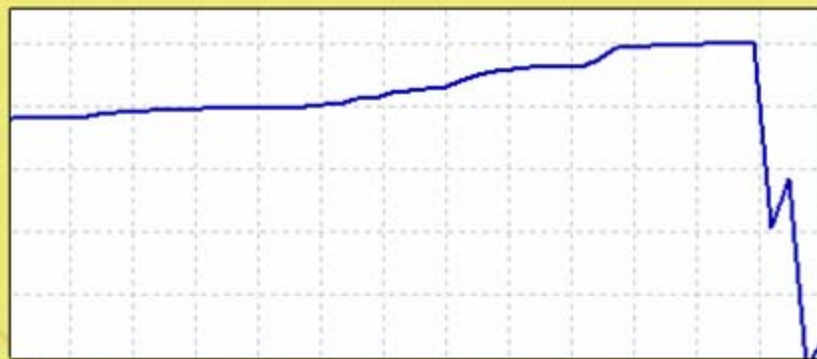
*Trading je hra pravděpodobností. Je to zábavná hra pro toho, kdo chápe nejzákladnější pravidla – omezovat ztráty a nechat profity běžet. Je to velice frustrující hra pro toho, kdo tato pravidla nechápe nebo nechce pochopit.*

- Zakomponovat **Stop Loss, vždy a všude!**
- **V každém obchodě!** omezit ztrátu a nechat profit běžet
- Ztráty jsou nevyhnutelné, stejně jako **zisky jsou nevyhnutelné**
- Výstup **na nule** je lepší než ztráta
- **Malý zisk** je lepší než ztráta
- **Žádný obchod** je lepší než ztráta

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX



**Pokud nepoužíváme Stop Loss,  
naše budoucnost má jasný směr.**



# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

*Testování na historických datech je krokem, který je třeba bezpodmínečně udělat. Už jste si někdy koupili auto, aniž byste se s ním předtím pořádně projeli a vyzkoušeli? Už jste někdy obchodovali systémem, aniž byste ho předtím pořádně otestovali?*

- Pravidla máme – následuje **manuální test** vybrané strategie
- Nejdelší a **nejvíce náročný** krok
- **Volba trhu** dle strategie
- Konkrétní **vstupy** a **výstupy**
- Test je původcem vzniku nových nápadů a **vylepšení**
- Několikanásobné **opakování testu** je běžné (časožrout)

# ***JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX***

**Testování má smysl.**

**Pokud dostatečně netestujeme,  
děláme jenom zbytečné  
nesmysly.**



# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

*Backtest je zpětné testování vybraného trhu na historických datech. Procházíme trh ve vybraných časech úsečku po úsečce a průběžně si zapisujeme výsledky. Ty jsou potom záznamem, který v nás probudí **důvěru v systém** – bez níž je trading jenom skokem jepice do propasti.*

- Doporučujeme používat data, se kterými chceme následně obchodovat (tj. chci obchodovat **FX** u **Colossea** = použiji CMT4)
- Doporučený vzorek dat je min. **50 obchodů** v řadě (intraday)
- Pozitivní test na jiném trhu zvyšuje robustnost
- Ideální software je tabulkový procesor (MS Excel, **Google Spreadsheet**)

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

*Co musí **backtest** obsahovat? Především všechna základní data, která potom použijeme ke zhodnocení našeho systému ze všech požadovaných stran.*

- **Datum** obchodního dne
- **Čas vstupu** do obchodní pozice
- Metoda vstupu
- **Čas výstupu** z obchodní pozice
- Metoda výstupu
- Počítání se **spready**
- Celkový **zisk/ztráta** za daný den

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

## *Další rozšiřující součásti backtestu.*

- **Úspěšnost systému:**
  - úspěšnost systému v procentech, tzn. kolik obchodů z 50 je ziskových
- **RRR (Risk-Reward-Ratio):**
  - Poměr rizika k zisku, neboli je-li průměrný ztrátový obchod 150 USD a průměrný ziskový obchod 300 USD, RRR máme 1 : 2
- **Drawdown:**
  - Nejvyšší ztráta v obchodech v řadě za sebou, kterou obchodní systém zaznamená

# **JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX**



**Pokud riskujeme 1000 USD a  
přitom se spokojíme se 100 USD..**

**..potom nejlepší co můžeme  
udělat je honem rychle si  
odinstalovat platformu.**

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

*Další rozšiřující součásti backtestu.*

- **Screenshoty** z obchodování (obchodních seancí), **zakreslení vstupů a výstupů**
- Na Screenshoty doporučujeme snímač obrazovky a grafický editor **Snagit!**

# JAK SE STAVÍ SYSTÉM NA FX

*Posledním krokem před reálnými trhy je kompletní **sepsání pravidel**. Pokud jste někdy letěli letadlem a bezpečně jste se odlepili od země a bezpečně přistáli, bylo to z jediného důvodu – piloti na nic nezapomněli, mají kontrolní soupisky. **Chcete v trzích létat bezpečněji?***

- Důležitý a **Velmi** opomíjený krok
- Kompletní krátká dokumentace obchodního plánu
- **Nástroj zpětné kontroly:**
- Nedodržení -> chyby -> poučení -> zpětná kontrola -> pokrok

# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

*Strategie **SDIV** je intradenní obchodní strategie založená na spolupráci cenového grafu a indikátoru.*

- **Jednoduchá a přesná pravidla**
- **Robustnost** (Ize uplatnit prakticky na všech likvidních trzích a různých časových rámcích)
- **Vysoký potenciál**
- **Nízké riziko**
- Obchodování ve správném čase
- Pouze několik hodin

# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

## Strategie SDIV (Skryté DIVERgence): vstupy a výstupy:

- Trh: **EURO** (Euro FX (futures) nebo EUR/USD (fx)) – lze i jiné trhy
- Časový rámec: **1 minuta** (lze zvolit jiný dle množství času a velikosti rizika)
- Cenový graf : nejlépe **Candlestick (svícový)**
- Indikátor vstupu: **Skrytá divergence mezi cenou a indikátorem (RSI 14)**
- Indikátor výstupu: **Korekce (vlny) v trhu (Posouvaný SL)**



# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

*Nutný základ: pochopení RSI divergencí.*

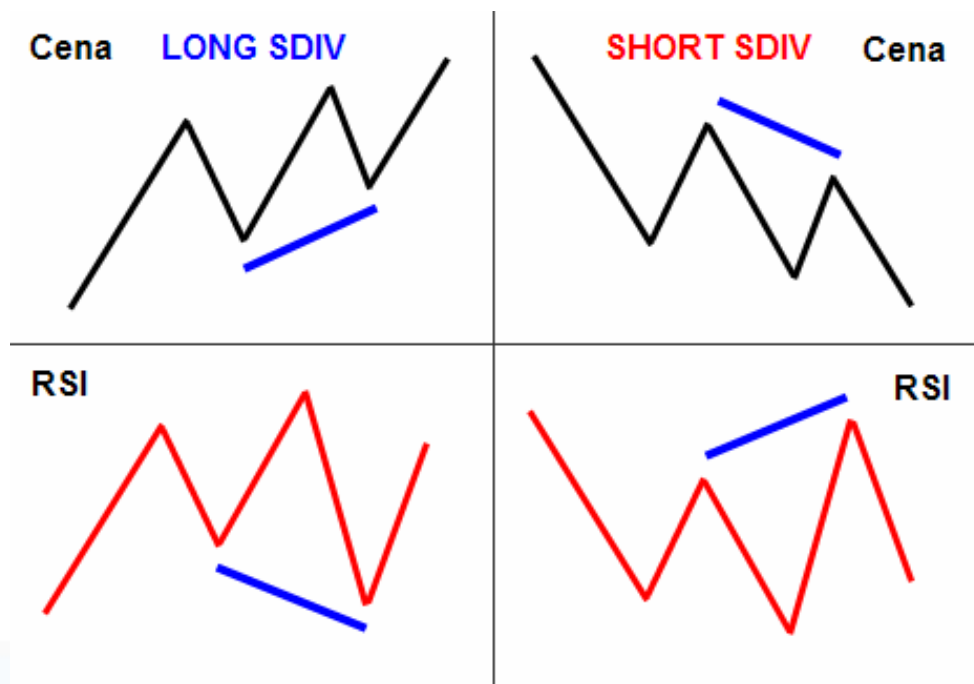
- Cena (M1) a indikátor RSI (14) na grafu



# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

*Nutný základ: pochopení RSI divergencí.*

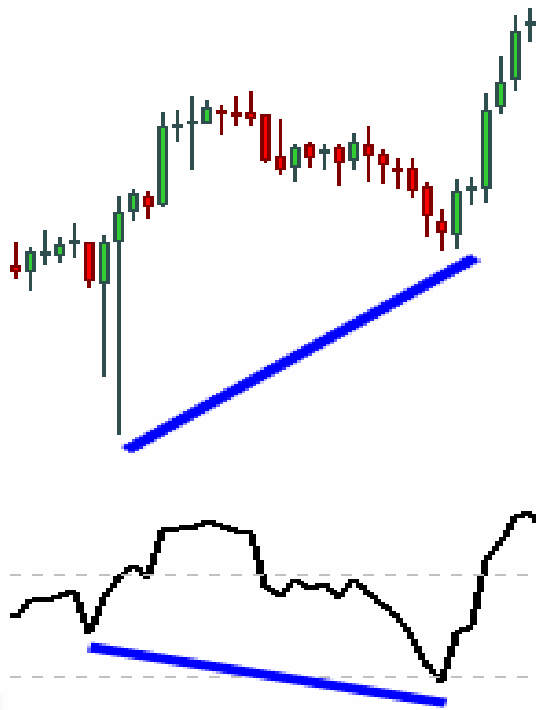
- **Skrytá divergence**, trendový patern, nesoulad mezi vrcholy / dny cenového grafu a indikátoru **RSI** (MACD, CCI, Stochastic..)



# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

*Nutný základ: pochopení RSI divergencí.*

- SDIV Long



- SDIV Short



# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

*Strategie SDIV má přesná pravidla vstupu a výstupu:*

- Obchodování na 1 trhu - **EUR/USD 1 min. (svíce)**
- Obchodování pouze v obchodní seanci **od 14:00 do 17:00 SEČ**
- Vstup do pozice vždy pouze na základě 1 paternu – **skrytá divergence (SDIV)**
- Po SDIV **nutné uzavření svíčky nad high/pod low svíce předchozí**
- **Stop loss (SL) vždy 1 pip nad poslední high** či pod poslední **low**
- V případě **pohybu o 10 pipů** ve směru obchodu vždy **posun SL na vstupní hodnotu**
- **Výstup nepřetržitě posouváním SL 1 pip nad poslední high** či pod poslední **low**

# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

*Strategie SDIV splňuje přísná pravidla risk managementu:*

- **Obchodování s trendem** = vyšší pravděpodobnost úspěchu
- **Omezit ztrátu a nechat profit běžet** – základní SL 1 pip nad poslední high/pod poslední low a následné posouvání
- **Ztráty jsou nevyhnutelné** – nutný vždy základní SL
- **Výstup na nule je lepší než ztráta** – v případě pohybu o 10 pipů ve směru obchodu vždy posun SL na vstupní hodnotu
- **Malý zisk je lepší než ztráta** – vystoupit nejlépe vždy podle plánu

# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

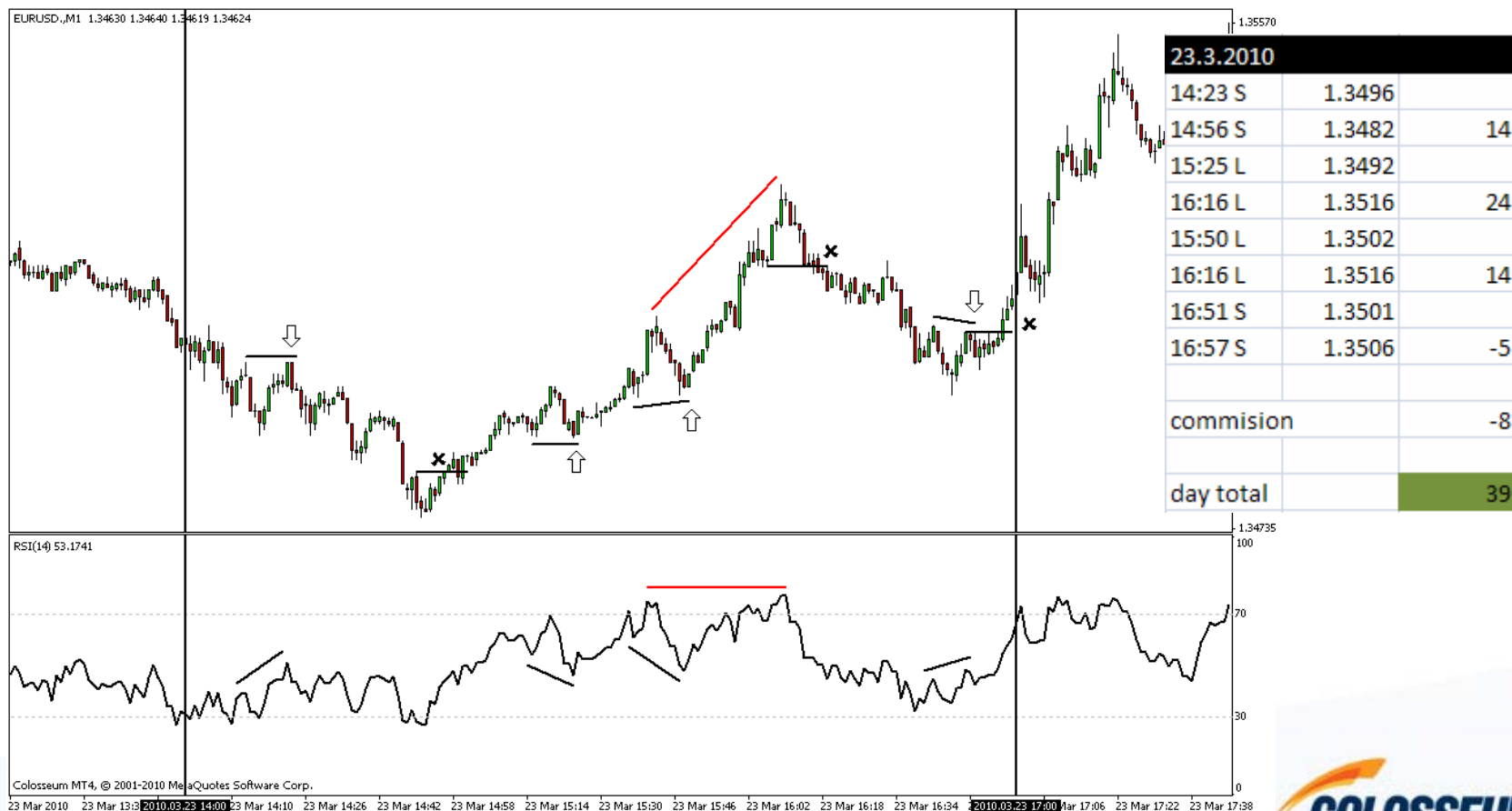
Výsledky backtestu za měsíc březen 2010.

SDIV System, EUR/USD, 14:00 - 17:00, 1min.

2.3.2010			3.3.2010			4.3.2010		
14:21 L	1.3543		15:12 S	1.3639		no trade		
15:05 L	1.3559	16	15:17 S	1.3639	0			
14:51 L	1.3564		15:36 L	1.3662		commision		0
15:05 L	1.3559	-5	15:39 L	1.3649	-13			
15:22 L	1.3552		16:52 S	1.365		day total		0
15:58 L	1.3581	29	17:19 S	1.3644	6			
commision		-6	commision		-6			
day total		34	day total		-13			
9.3.2010			10.3.2010			11.3.2010		
16:24 L	1.3557		14:44 S	1.3616		15:10 L	1.3656	
17:30 L	1.3577	20	15:13 S	1.3607	9	15:40 L	1.3674	18
16:48 L	1.3573		15:21 S	1.3607		15:14 L	1.3657	
17:30 L	1.3577	4	15:49 S	1.3602	5	15:40 L	1.3674	17
16:56 L	1.3576		16:12 L	1.3609		15:29 L	1.3665	
17:30 L	1.3577	1	16:34 L	1.362	11	15:40 L	1.3674	9
commision		-6	16:44 L	1.362		15:35 L	1.3674	
day total		19	16:56 L	1.362	0	15:40 L	1.3674	0
			17:00 L	1.3616		commision		-8
			18:25 L	1.3665	49	day total		36
			commision		-10			
			day total		64			

# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

Jsou dny, kdy trh nabídne **trend** a **profity**.



# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

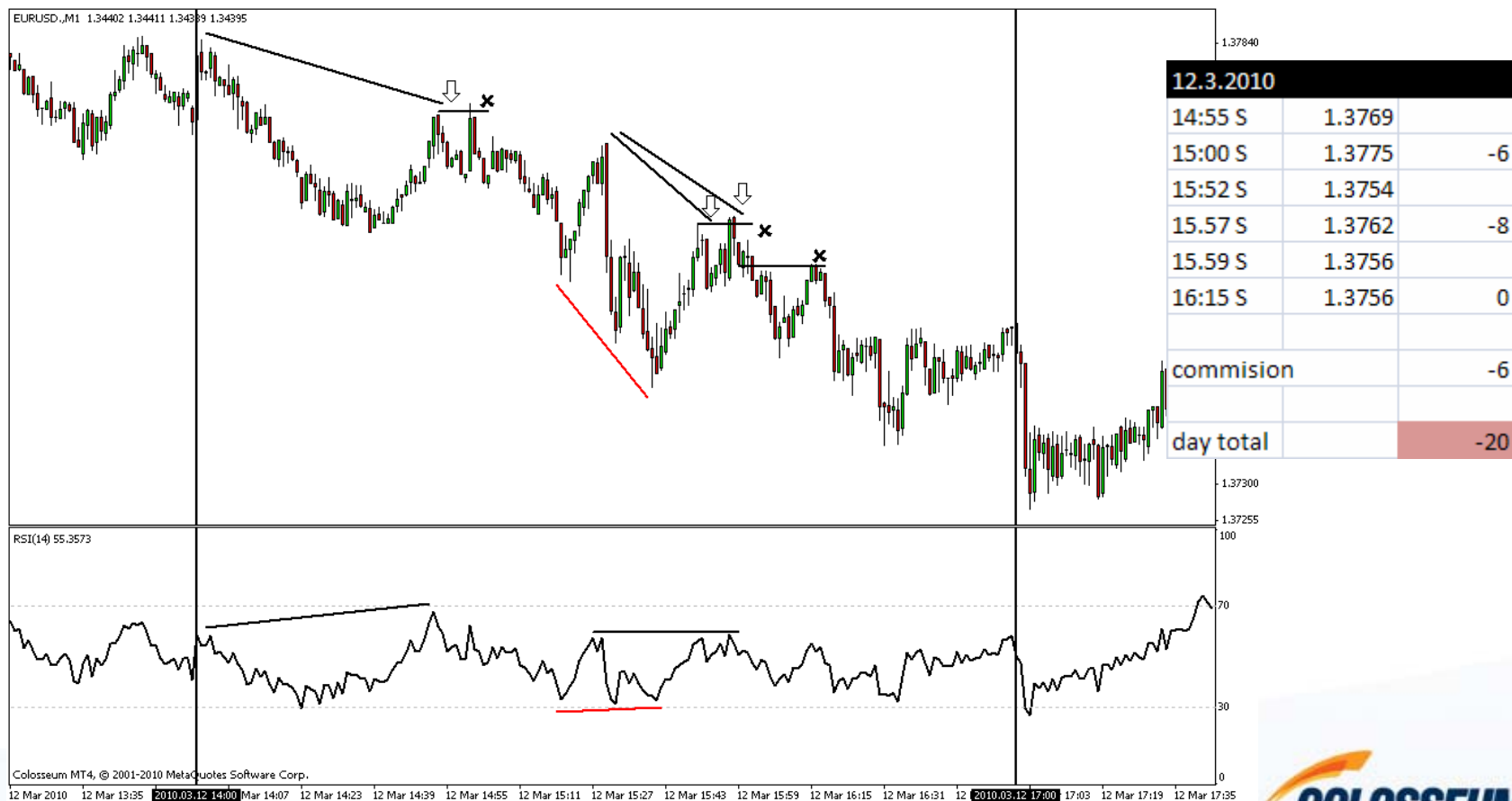
*Jsou dny, kdy trh „jde do strany“ a nenabídne žádný signál.*





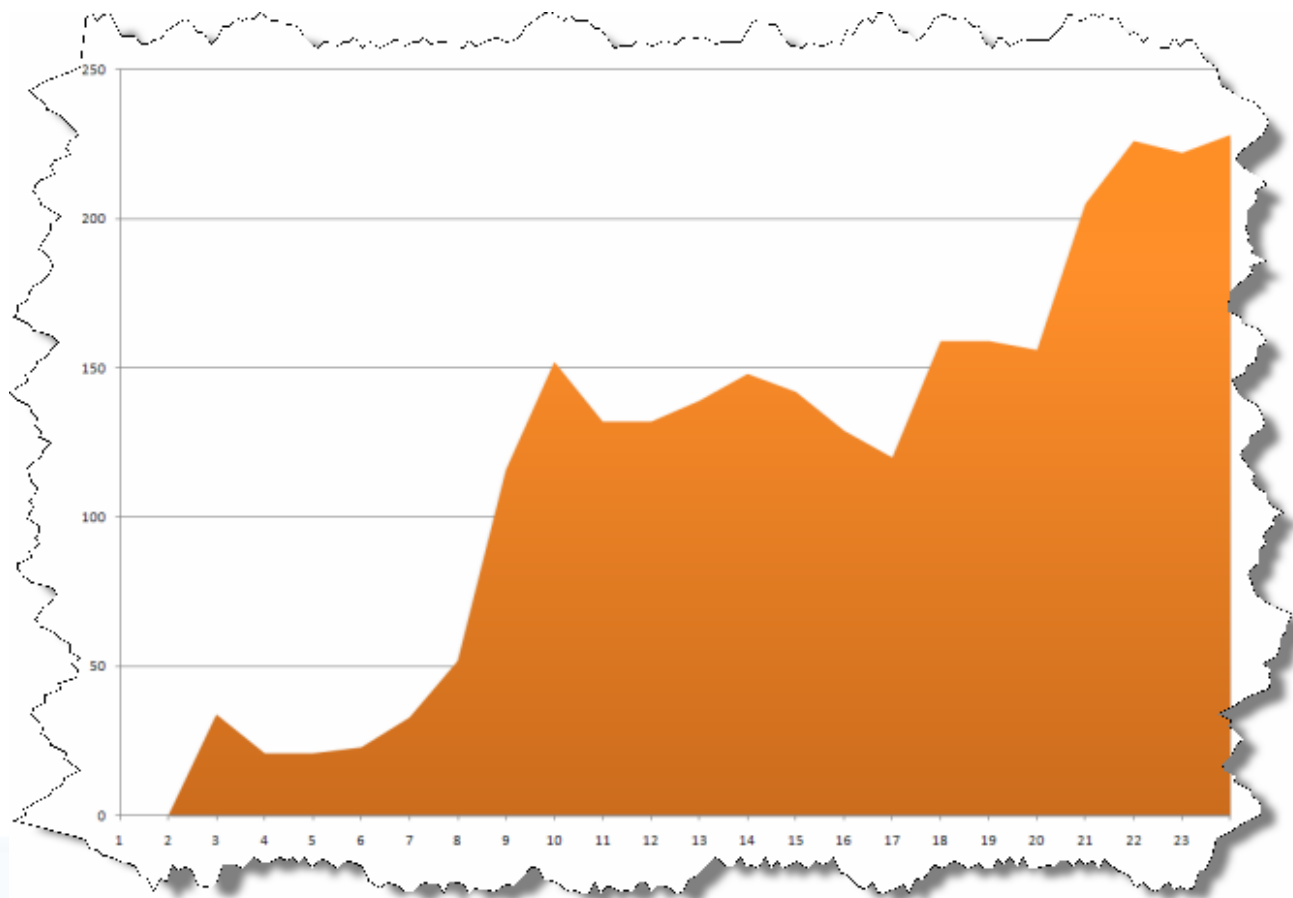
# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

*Jsou dny, kdy trh bude jenom nositelem drobných ztrát.*



# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

## Vývoj účtu.



# OBCHODNÍ SYSTÉM SDIV

*Co můžeme na strategii sledovat a hodnotit.*

- Ziskové obchody – **34**
- Ztrátové obchody – **13**
- Neutrální obchody – **11** (celkem obchodů **58**)
- Ziskové dny – **12**
- Ztrátové dny – **7** (**4** dny bez obchodu)
- Průměrný zisk – **12,2** pips
- Průměrná ztráta – **5,5** pips
- Průměrné RRR (ztráta/zisk) -  $1 : 2,2 =$  cca **1 : 2**
- Procentuální úspěšnost – **78 %**
- Maximální propad – **14** pips

# PLATFORMA COLOSSEUM MetaTrader 4

Colosseum **MetaTrader 4 (MT4)** je špičková platforma pro obchodování na forexu.

- **Vynikající živé grafy**
- **Kompletní nástroje** technické analýzy
- **Široké spektrum** indikátorů
- Skripty **usnadňující** rutinní práci
- **Automatické** obchodní **strategie**
- **Český** jazyk

# PLATFORMA COLOSSEUM MetaTrader 4



# PLATFORMA COLOSSEUM MetaTrader 4

10023742: Colosseum MetaTrader 4 - Demoučet - [EURUSD.,Daily]

Soubor Pohled Vložit Grafy Nástroje Okno Nápověda

Nový pokyn Zapnout strategie

M1 M5 M15 M30 H1 H4 D1 W1 MN

**Pokyn**

EURUSD.

Buy Stop

Sell Limit

ASK

Spread

Buy Limit

Sell Stop

1.39745

1.39733

1.39720

1.39715

1.39707

1.39697

1.39682

1.39669

1.39657

1.39644

1.39632

Symbol: EURUSD., Euro vs US Dollar

Objem: 1.00

Zastavení ztrát: 0.00000 Realizovat zisk: 0.00000

Komentář:

Typ: Čekající pokyn

Čekající pokyn

Typ: Buy Limit EURUSD. 1.00

za cenu: Buy Limit

Sell Limit

Buy Stop

Sell Stop

Platnost do: 10/21/2010 09:47

Podat pokyn

Otevírací cenu lze nastavit do úrovně, která se od tržní ceny liší o minimálně 0 bodů.

Zůstatek: 50 000.00 Majetek: 50 000.00 Dostupná marže: 50 000.00 0.00

Obchod Historie ůtů Alarmy Poštovní schránka Strategie Deník

Pro pomoc, stiskněte F1 Default 2010.08.03 00:00 O: 1.31780 H: 1.32620 L: 1.31470 C: 1.32280 V: 11009 8058/4 kb

# COLOSSEUM, a.s. - FOREX

## FOREX u společnosti Colosseum, a.s.

- Platforma **Colosseum MetaTrader 4**
- **Špičkové** spready: EURUSD 1,9, USDJPY 2,3
- Desetinná kotace – ještě **přesnější ceny**
- **Automatická exekuce**, non-dealing desk
- Finanční páka **100 : 1**
- Účty od **2 000 USD**



# COLOSSEUM, a.s. - FOREX

## Spready



Měnový pár	Obvyklý spread	Od	Do
EUR/USD	1,9	1,3	2,3
USD/JPY	2,3	1,7	2,6
GBP/USD	2,9	1,8	3,9
USD/CHF	2,5	1,8	3,6
AUD/USD	2,5	1,8	3,0
USD/CAD	3,3	2,4	5,0
NZD/USD	4,2	2,9	5,3
EUR/JPY	3,3	2,5	3,8
GBP/JPY	6,4	5,2	7,1
EUR/GBP	3,3	2,6	4,1
EUR/CHF	3,5	2,5	5,0
GBP/CHF	6,6	4,7	9,2

Měnový pár	Obvyklý spread	Od	Do
EUR/AUD	5,7	4,0	7,3
EUR/CAD	6,7	5,2	10,0
EUR/NZD	8,8	5,4	12,3
CHF/JPY	4,8	3,8	6,0
AUD/JPY	5,5	4,6	6,1
CAD/JPY	5,0	3,6	6,5
AUD/CAD	8,4	6,1	10,3
NZD/JPY	6,2	4,9	7,1
AUD/NZD	8,9	6,1	11,6
AUD/CHF	7,3	6,2	8,3
USD/CZK	x	x	x



# NAŠE INTERNETOVÉ STRÁNKY

WWW.COLOSSEUM.CZ

www.colosseum.cz

WWW.EMAX.CZ

© 2008 - 2009 Colosseum, a.s. Všechna práva jsou vyhrazena. Home | Sitemap | Napište nám | O nás | Kariéra | Press | Rizika | Realizace | Aboncy



# VAŠE DOTAZY



# **DĚKUJEME VÁM ZA POZORNOST**

**Tomáš Vobořil, [voboril@colosseum.cz](mailto:voboril@colosseum.cz) - Jan Šírek, [sirek@colosseum.cz](mailto:sirek@colosseum.cz)**

**Colosseum, a.s., Londýnská 59, 120 00 Praha 2**

**Tel.: +420 2460 888 88, Fax: +420 2460 888 89, [info@colosseum.cz](mailto:info@colosseum.cz)**

# UPOZORNĚNÍ

TATO ZPRÁVA JE POUZE INFORMATIVNÍ A NENÍ MYŠLENA JAKO NÁVRH NEBO NABÍDKA KE KOUPI ČI PRODEJI JAKÉKOLIV KOMODITY, FUTURES KONTRAKTU NEBO OPCE. FAKTA A INFORMACE ZDE OBSAŽENÉ JSOU ZÍSKÁNY ZE ZDROJŮ, KTERÉ COLOSSEUM, A.S. („SPOLEČNOST“) POVAŽUJE ZA VĚROHODNÉ, S TÍM, ŽE ZA PŘESNOST A SPOLEHLIVOST INFORMACÍ OBSAŽENÝCH V TĚCHTO ZDROJÍCH ODPOVÍDÁ JEJICH ZDROJ. SPOLEČNOST NEODPOVÍDÁ ZA TYPOGRAFICKÉ CHYBY V TĚTO ZPRÁVĚ. VEŠKERÉ NÁZORY A ODHADY V TĚTO ZPRÁVĚ VYJADŘUJÍ NÁZOR SPOLEČNOSTI K DATU TĚTO ZPRÁVY A VYHRAZUJE SI PRÁVO NA JEJICH ZMĚNU BEZ PŘEDCHOZÍHO UPOZORNĚNÍ.

SPOLEČNOST, JEJÍ POBOČKY, PŘEDSTAVITELÉ A/NEBO ZAMĚSTNANCI MOHOU, ALE NEMUSÍ KDYKOLIV DRŽET KRÁTKÉ A/NEBO DLOUHÉ POZICE V JAKÉKOLIV KOMODITĚ, FUTURES KONTRAKTU, OPCÍ NEBO JINÉM INVESTIČNÍM INSTRUMENTU ZMIŇOVANÉM V TĚTO ZPRÁVĚ. PŘÍKAZY UVEDENÉ V TOMTO DOKUMENTU MOHOU BÝT POUZE ILUSTRATIVNÍ A SPOLEČNOST JE MŮŽE, ALE NEMUSÍ PROVÁDĚT NA TRHU. VEŠKERÉ NÁZORY V TĚTO ZPRÁVĚ JSOU NÁZORY ANALYTICKÉHO ODDĚLENÍ SPOLEČNOSTI. OSTATNÍ POSKYTOVATELÉ INVESTIČNÍCH SLUŽEB NEBO JINÉ PUBLIKACE MOHOU VYJADŘOVAT ROZDÍLNÝ NEBO PROTICHŮDNÝ NÁZOR. NÁZORY V TĚTO ZPRÁVĚ MOHOU BÝT ZALOŽENY NA RŮZNÝCH ANALYTICKÝCH METODÁCH NEBO DISCIPLÍNÁCH. NAPŘÍKLAD FUNDAMENTÁLNÍ A TECHNICKÁ ANALÝZA OBVYKLE POUŽÍVAJÍ RŮZNÉ METODY A ODLIŠNÉ ČASOVÉ OBDOBÍ, PROTO MOHOU ČINIT RŮZNÉ ZÁVĚRY OHLEDNĚ VÝVOJE STEJNÉ KOMODITY NEBO TERMÍNOVÉHO KONTRAKTU.

INVESTIČNÍ STRATEGIE POPISOVANÉ V TĚTO ZPRÁVĚ JSOU RISKANTNÍ A NEJSOU VHODNÉ PRO KAŽDÉHO INVESTORA. POKUD PLNĚ NEPOROZUMÍTE PODMÍNKÁM A RIZIKŮM POPISOVANÝCH OBCHODŮ, VČETNĚ ROZSAHU POTENCIÁLNÍHO RIZIKA ZTRÁTY, KTERÉ MŮŽE DOSÁHNOUT A V URČITÝCH PŘÍPADECH I PŘESÁHNOUT HODNOTU INVESTICE, MĚLI BYSTE SE TAKOVÝCH OBCHODŮ ZDRŽET.

VÍCE INFORMACÍ ZÍSKÁTE NA [WWW.COLOSSEUM.CZ](http://WWW.COLOSSEUM.CZ).

© 2011 COLOSSEUM, A.S. VŠECHNA PRÁVA VYHRAZENA. JAKÉKOLIV NEAUTORIZOVANÉ POUŽITÍ, DUPLIKACE NEBO ŠÍŘENÍ TOHOTO MATERIÁLU JE ZAKÁZANO.