

**FINANČNÍ EFEKTIVITA STRATEGIE č. 1**  
**"KRÁTKODOBÝ TRENDOVÝ OBCHOD V TRENDOVÉM KANÁLU"**  
**ALIAS "KOLIK MŮŽE BURZA NADĚLIT PENĚZ"**  
(VZOROVÝ VÝPOČET NA ZÁKLADĚ BACK TESTINGU)

1) Stanov VARIANTU Strategie č. 1

a) varianta A = vstup do pozice na DRUHÉM přiblížení k TL

b) varianta B = vstup do pozice na TŘETÍM přiblížení k TL

2) Rekapituluj parametry Strategie

a) vstup do obchodu po přiblížení k TL na vzdálenost 10% šířky trendového kanálu

b) PT nastaven na 40% šířky trendového kanálu

c) minimální požadovaný PT pro otevření obchodu = 5 EUR

d) SL nastaven na 10% šířky trendového kanálu od TL

3) Převezmi parametry Obchodního plánu

a) riskovat max 1% zůstatku obchodního účtu

4) Popiš vyhodnocované období a vyhodnocované obchody

a) vyhodnocované aktivum

b) délka vyhodnocovaného období

c) počet ziskových obchodů vs. počet ztrátových obchodů (WinRate)

c) velikost zisku (inkaso příjmů) vs. velikost ztrát (náklady na obchodování)

d) čistý zisk bez započtení nákladů na otevření pozic (com) a držení přes noc (swap)

Příklad

1) verze strategie "A" (nástup do první pozice na druhém dotyku s TL)

2) vyhodnocované aktivum EUR / USD

3) vyhodnocované období od 5.12. do 28.2.2025

4) započítané obchody = 5 ziskových obchodů, 1 ztrátový (pro účely výpočtu)

5 šířka kanálu = 180 pips tj. 180 EUR / 1 lot

6) ztráta na uměle započítaném ztrátovém obchodu (otevřeno 10% před TL, zavřeno 10% za TL)

maximální přípustná ztráta =  $0,2 \times 180 = 36$  EUR / 1 lot

obchod (1 lot)	1	2	3	4	5	6
zisk EUR	71	95	70	85	80	0
ztráta EUR	0	0	0	0	0	36

zisk **401 EUR / 1 lot**

počet ziskových obchodů **5**

ztráta **36 EUR / 1 lot**

počet ztrátových obchodů **1**

balance **365 EUR / 1 lot**

WinRate (úspěšnost odhadu) **86%**

## 7) Přepočet ziskovosti pro účet o velikosti 2000 EUR

a) maximální přípustné riziko (1%) =  $0,01 \times 2000 = 20$  EUR

b) maximální velikost obchodu  $20 / 36 \times 1 \text{ lot} = 0,55$  lotu

c) kalkulovaný zisk  $0,55 \times 365 = 200$  EUR (přepočteno na velikost obchodu 0,55 lotu)



Reference

Money management

<https://finex.cz/rubrika/forex/forex-money-management/>

Testování obchodní strategie

[https://www.robomarkets.cz/blog/investing/strategies/jak-testovat-obchodni-strategii/#Co\\_je\\_Obchodni\\_strategie](https://www.robomarkets.cz/blog/investing/strategies/jak-testovat-obchodni-strategii/#Co_je_Obchodni_strategie)