

STRATEGIE č. 7

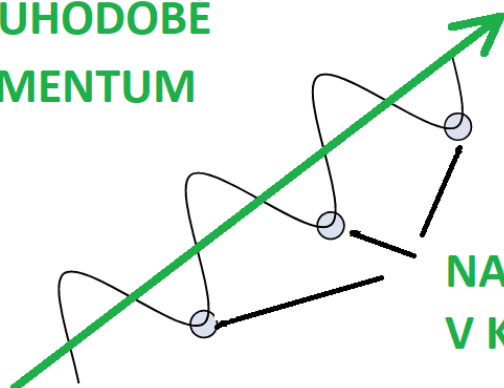
"MONDAY BUYER"

ALIAS "SPEKULACE NA NÁVRAT K PRŮMĚRNÉ CENĚ VE SMĚRU TRENDU"

(DLOUHODOBÉ MOMENTUM, NÁVRAT K PRŮMĚRNÉ CENĚ = MEAN REVERSION)

1) Strategie je založena na swingovém pohybu, tj. krátkodobé tendenci návratu k průměrné ceně, ve směru dlouhodobého momenta. V případě aktiv s dlouhodobým růstem (akcie) se využívají pouze růstové korekce.

**DLOUHODOBÉ
MOMENTUM**



**NAKUPOVÁNÍ
V KOREKCÍCH**

2) Strategie má několik podob, které se liší v komplexnosti výběru použitých **AKTIV** ze **SEZNAMU SP 500**

3) Vstupní signály vyhodnocujeme na základě **TÝDENNÍCH** grafů **VŽDY V PONDĚLÍ** (proto Monday Buyer)

4) Hledáme akcie ve **VÝRAZNĚJŠÍCH KOREKCÍCH** pomocí

a) indikátoru **RSI** (sledujeme poslední dvě svíčky)

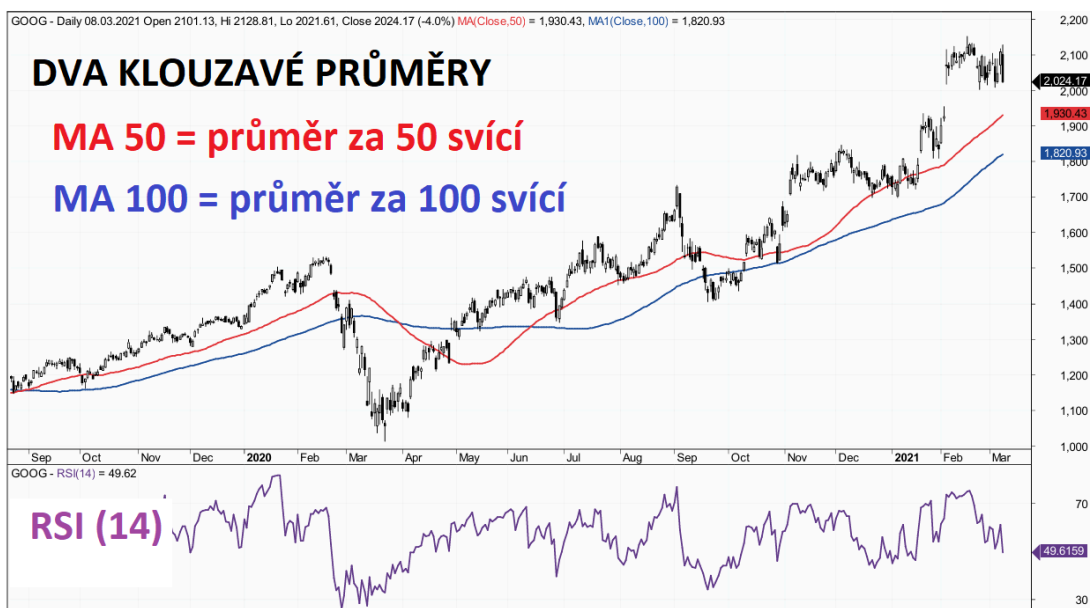
b) a krátkodobého klouzavého průměru **MA** (nastaven na periodě 10)

matematická podmínka může vypadat takto

a) trh se nachází v **ROSTOUCÍM TRENDU** (cena se nachází nad klouzavým průměrem)

b) cena se nachází v krátkodobém propadu (**RSI je MENŠÍ NEŽ 20**)

Příklad



RSI (Relative Strength Index = index relativní síly trhu) porovnává poslední uzavírací cenu trhu s cenový rozpětím v předem definovaném čase (např. posledních 10 svíček).

$$\text{RSI} = 100 - (100 / (1 + \text{RS}))$$

RS = součet kladných cenových změn za dané časové období resp. součet záporných cenových změn za dané časové období

Čím více se RSI blíží 0, tím je trh ve sledovaném období slabší neboli

RSI je menší než 30 = TRH JE PŘEPRODANÝ

Pokud se RSI blíží 100, uzavírá trh v blízkosti cenového maxima sledovaného období.

RSI je větší než 70 = TRH JE PŘEKOUPENÝ