

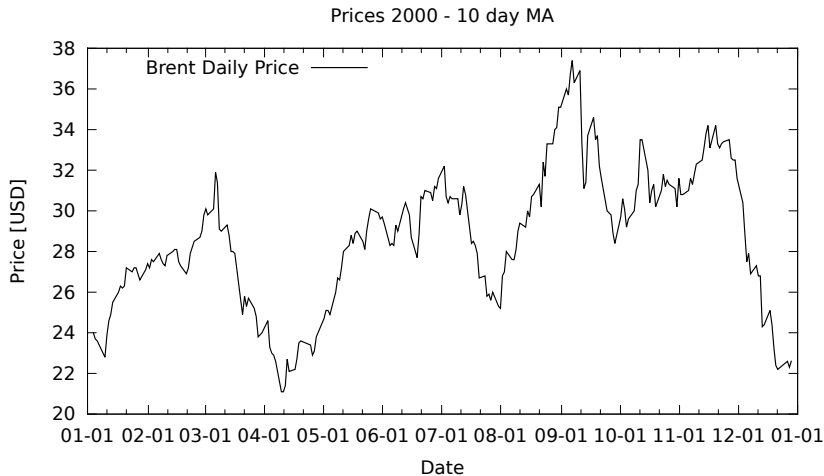
Klouzavé průměry – moving averages

- indikátor technické analýzy
- jednoduchá heuristika
- používané pro zachycení změny trendu ve vývoji ceny podkladového aktiva (ropa brent)

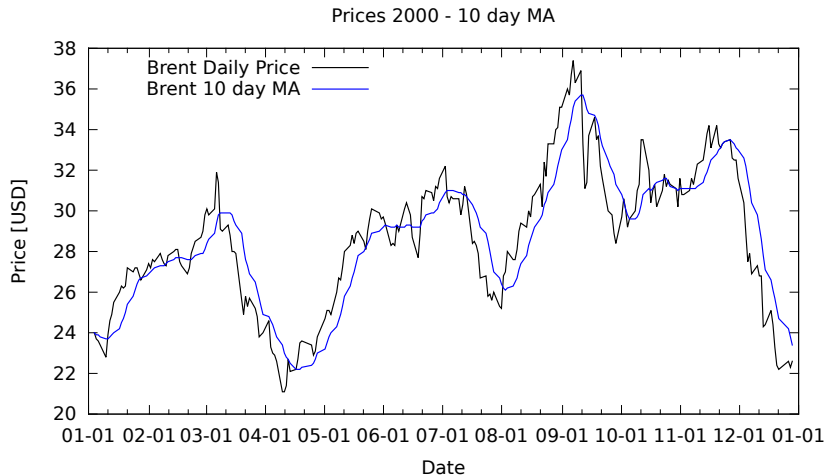
Strategie

- krátce po změně trendu zaujmu pozici
- změnu identifikuje protnutí cenové křivky s křivkou klouzavého průměru
- pozici opustím jakmile dojde k obrácení trendu

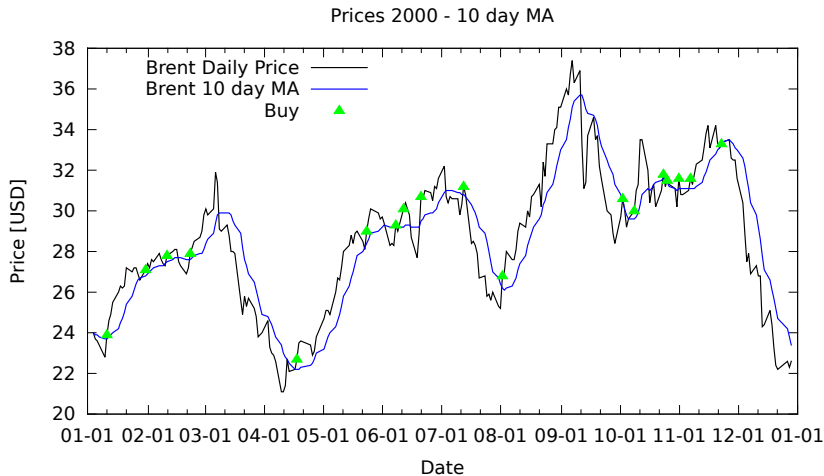
Příklad



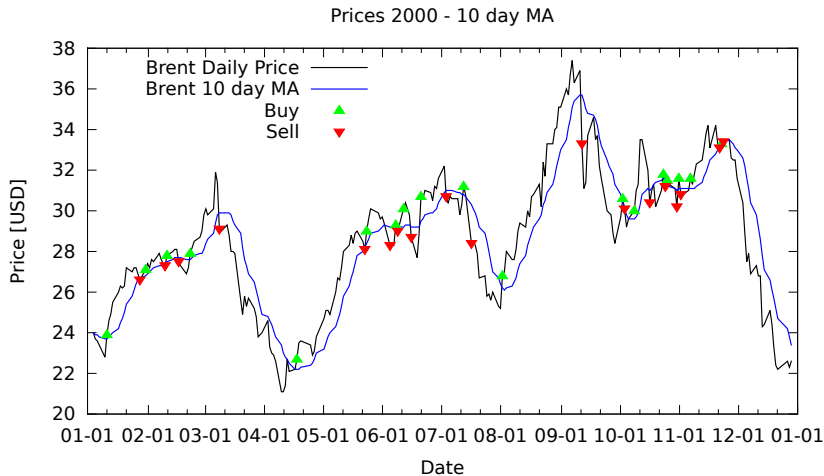
Příklad



Příklad



Příklad



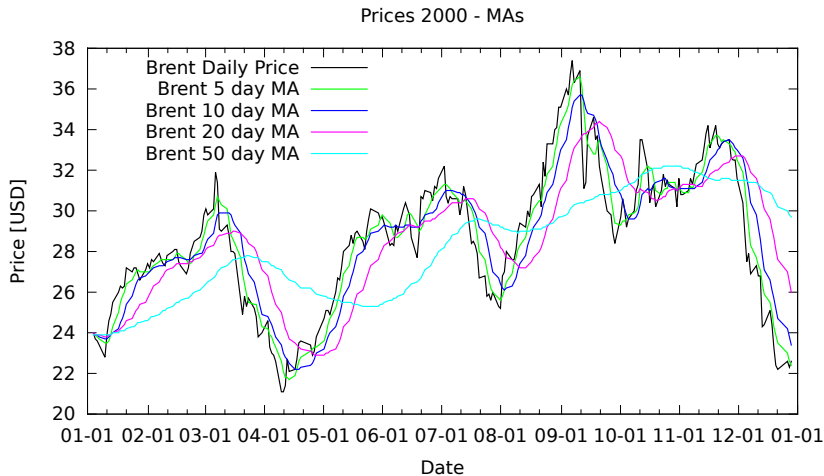
Zhodnocení po započtení poplatku 0.03% činí 78%.

Proč nejsme všichni bohatí?

Úskalí

- MA generují velký počet chybných bodů
- je třeba efektivně zamítnat nesprávné body
- pro různá období se hodí různé průměry
- vydělává na trendu a ztrácí na volatilitě
- jde o věc měřítka
- delší období "bez trendu"

Různé průměry



Ropa Brent

- denní spotové ceny

- k nalezení zde:

www.eia.gov/dnav/pet/hist/LeafHandler.ashx?n=PET&s=RB RTE&f=D

- denní obchodování

- kupuji i prodávám za zítřejší cenu
- možnost dospecifikace jako dpolňková heuristika

- samostatná podúloha – výstup z pozice

- volba množin – návrh:

- trénovací 2009–2010
- testovací 2011