

DerBoersenMathematiker.de



DerBoersenMathematiker.de

**Dipl.-Math.
Rainer Schwindt**

BM-Money-Saver 2014 Das neue Handelssystem des Börsenmathematikers

Designed für Captimizer 9.X

Information zur Version Basic und Pro

Unternehmensberatung Schwindt

Copyright © 2006 - 2013 Unternehmensberatung Rainer Schwindt "Der BörsenMathematiker"
Unter dem Titel:

BM-Money-Saver 2014

Alle Rechte, einschließlich derjenigen des auszugsweisen Abdrucks sowie der fotomechanischen Wiedergabe, vorbehalten.

Dieses Buch will keine spezifischen Anlageempfehlungen geben und enthält lediglich allgemeine Hinweise. Autor, Herausgeber und die zitierten Quellen haften nicht für etwaige Verluste, die auf Grund der Umsetzung ihrer Gedanken und Ideen entstehen.

Kontaktanschrift:

Unternehmensberatung Rainer Schwindt
Karlsruher Straße 16/3
D-68766 Hockenheim
Tel.: +49 (0)6205 / 18 94 35

Homepage: www.DerBoersenMathematiker.de
Homepage für institutionelle Klienten: www.Mathematik-Consult.de
E-Mail: Schwindt@DerBoersenMathematiker.de

Die Suchmaschinen im Netz haben ein langes und langsames Gedächtnis. Man kann diese Information nicht immer löschen. Deshalb haben wir ein Abfang PDF erstellt, das alle Kontaktdaten für Sie bereitstellt, falls Sie fragen zu historischen Web-Infos haben.

Alternativ finden Sie über die Suchmaschine **Google** mit dem Parameter:

filetype: pdf

und dann fügen Sie nur die zwei Schlüsselworte

Börsenmathematiker Schwindt an.

Als Drittes Wort ist Band1 , Band2 ...

oder

Handelssysteme

Finden Sie noch mehr Informationen.

Vorbemerkungen

Die Datenabos für BM-Money-Saver-2014 Handelssysteme

Für den Captimizer 9 können Sie zwei unterschiedlichen Daten-Abos für Fonds (Top500 und Top5000) bestellen. Das macht es für uns notwendig zwei unterschiedliche Datenmodelle für unsere BM-Money-Saver-Handelssysteme anzubieten:

Für das Daten-Abo (Pro) Top 5000 gilt (Extra-Abo zur Vergrößerung der Fondsdatenbank):

Für die Klasse dynamische mit höheren Volatilitätsrisiken stellen wir eine Datenbank mit aktuell 352 von uns zertifizierten Fonds der Klassen: Aktien, Rohstoffe und Immobilien zu Verfügung.

Für das Daten-Abo (Basis) Top 500 im Basis-Abo von logical line enthalten gilt: Für die Klasse dynamische Fonds mit höheren Volatilitätsrisiken stellen wir eine Datenbank mit aktuell 222 von uns zertifizierten Fonds der Klassen: Aktien, Rohstoffe und Immobilien zu Verfügung.

Zu den beiden gerade beschriebenen Datenmodellen der Abos stellen wir wieder eine spezielle zertifizierte Datenbank mit Fonds der Klasse konservativ ~ nennen wir diese einmal vereinfacht Renten-Fonds.

Beim Basis-Abo sind ca. 20 konservative Fonds enthalten und beim Pro-Model sind ca. 24 Fonds enthalten – die Zahl kann sich jederzeit vergrößern!

Die Datenbank ist so konstruiert, das jederzeit damit ein voll regulierter Publikumsfonds gemanagt werden kann, also die Anlagerichtlinien jederzeit eingehalten werden können.

Bei Schrumpfung des Fondsuniversums durch Schließung oder Verschmelzung von Fonds machen wir rechtzeitig Vorschläge zur Ergänzung unserer Datenbank.

Als modernes Kombinationshandelssystem auf Basis des Captimizer 9, besteht unser BM-Money-Saver-2014 aus 2 Grundvarianten:

1. BM-Money-Saver-2014 Pro (Abo 5000)
2. BM-MoneySaver-2014-Basic (Abo 500)

Jedes dieser 2 Grundvarianten enthält Zwei Strategie-Module:

Konservativ-Strategie (~ Renten)

Dynamik-Strategie (Aktien, Rohstoffe, Immobilien)

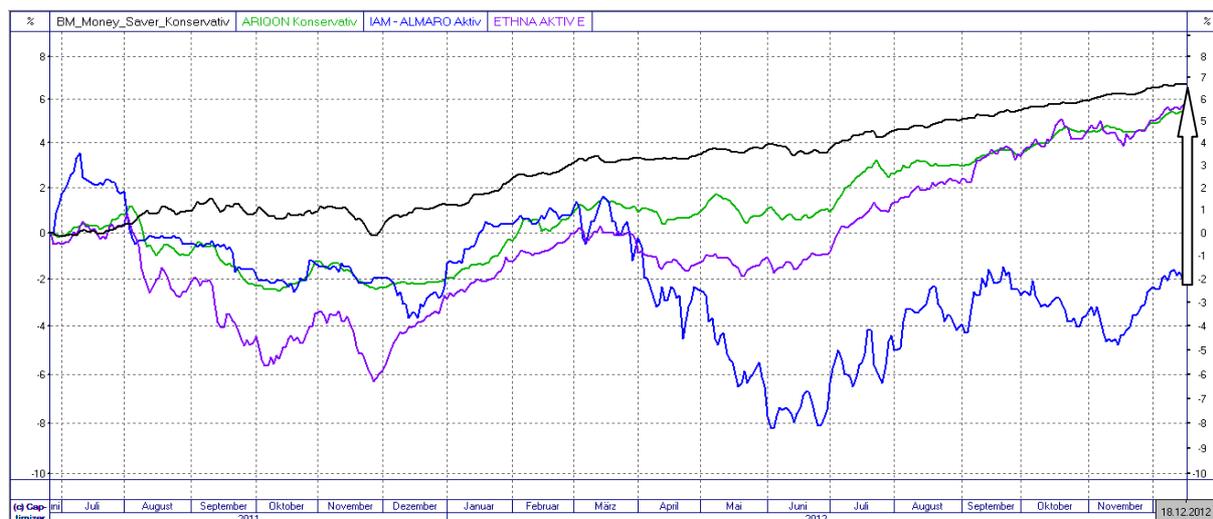
Es sind die bewährten Handelssysteme Universal Fonds 2013 und das weniger bekannte Money-Saver 2008, was durch den neuen Captimizer 9 jetzt quasi vollautomatisiert werden kann, was bis C 8.52 nicht einfach umsetzbar war.

Dank der zuverlässigeren und berechenbareren Geldverteilungsmethode des neuen Captimizer, können wir eine dynamische Allokation der Gelder auf:

Renten = X %, Aktien etc. = Y % und Cash = Z % durchführen.

Wir können Wahlfrei z.B.: Renten = 30 % + Aktien = 70 % oder umgekehrt investieren. Sie wählen, was Sie als Grundrisiko für sich als Akzeptabel halten Auf der folgenden Seite sehen Sie die bewährte Qualität des Systems.

Das Handelssystem BM-Money-Saver-Konservativ (Im Folgenden kurz Konservativ genannt.)



Tradejournal der Klasse Geldmarkt

Zusammenfassung meiner Managementleistung mit IAM ALMARO AKTIV anhand der Trades im Handel von Geldmarktfonds und Geldmarkt-ETFs.

Von mir wurden 32 von 52 Trades mit Gewinn abgeschlossen. Meine Trefferquote liegt bei 61,5 %. Diese ist verbrieft durch die nachweisbaren Fonds-Orders des IAM ALMARO AKTIV. Die Höhe der Verluste bewegt sich in der Regel immer deutlich unterhalb der Größenordnung der Transaktionskosten.

Die Geldmarktfonds dienen im Wesentlichen der taktischen Bargeldsicherung, um Investitionsreserven zu sichern. Oder aber es wurden bei sehr kurzen Anlagezeiten fast immer Anteilsrücknahmen durch außerplanmäßige Verkäufe von Geldmarktinstrumenten abgewickelt.

Sie sehen, obwohl es das primäre Ziel des Fonds ist Gewinne im Aktienmarkt zu erwirtschaften, ist das Handelssystem Konservativ auch in der Lage, nominale leichte Gewinne im Geldmarkt zu erzeugen – also Gelderhaltung zu betreiben. Das ist entscheidend bei den Wechseln von Anlageklasse zu Anlageklasse: Aktienmarkt <- -> Geldmarkt.

Tradejournal der Klasse Anleihen etc.

In dieser Anlageklasse hat das Handelssystem 33 Trades abgewickelt, mit 9 Verlierern - 4 davon entstanden durch die Übernahme des IAM Smart Momentum am 27. und 28.6.2011. Was trotzdem einer Trefferquote von 72,7 % entspricht. Diese ist verbrieft durch die nachweisbaren Fonds-Orders des IAM ALMARO AKTIV.

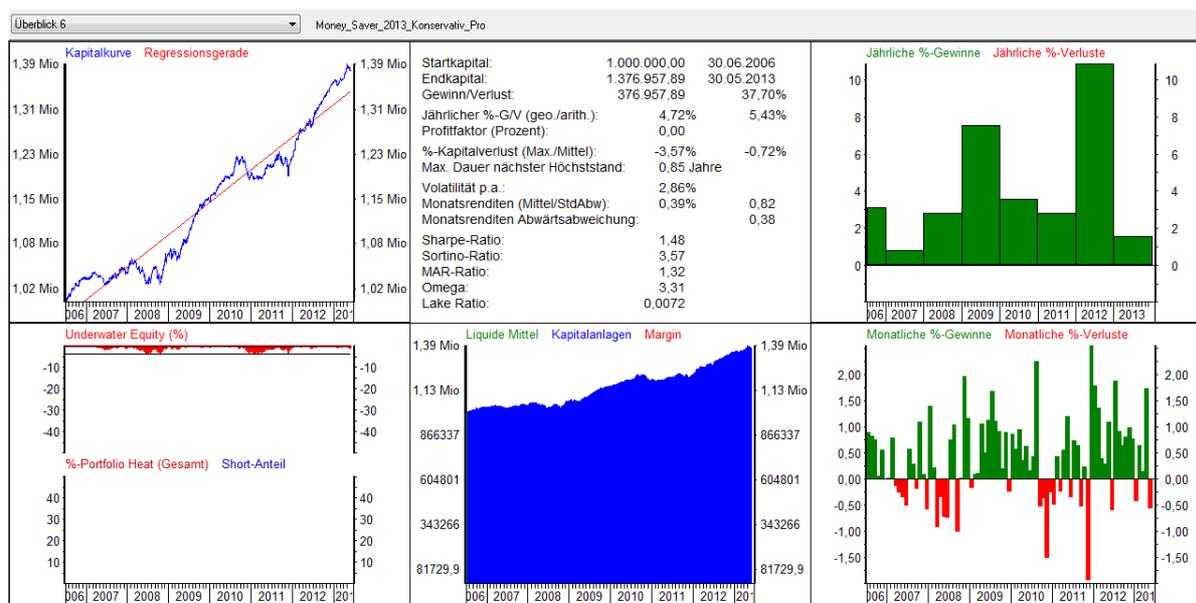
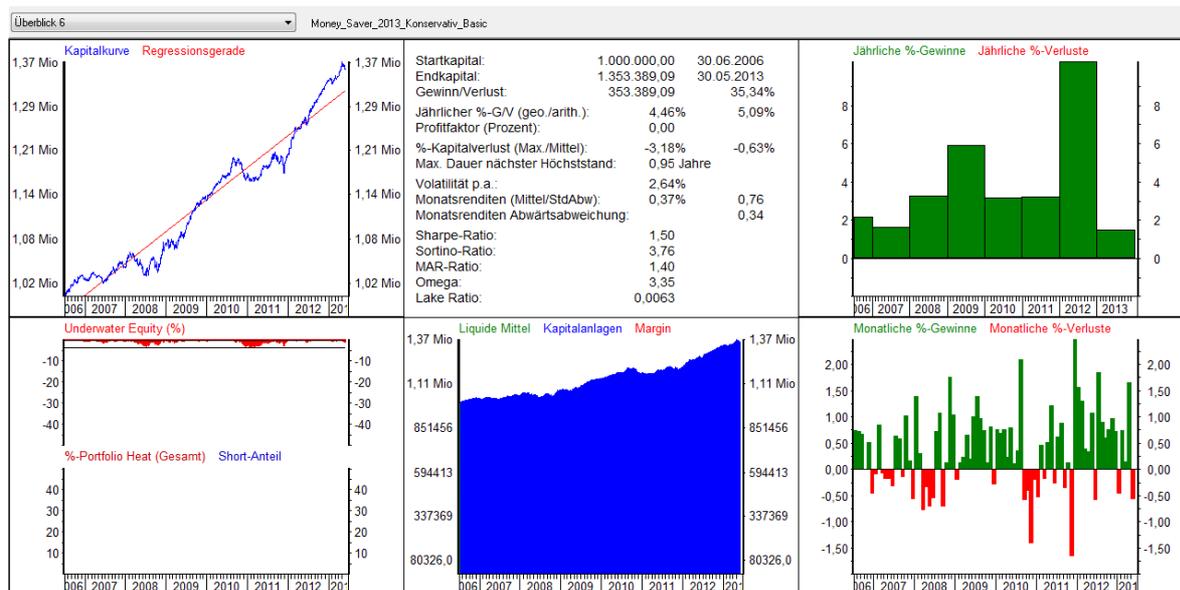
Es war das primäre Ziel des IAM ALMARO AKTIV-Initiators Gewinne in Aktienmärkten zu erwirtschaften. Nur deshalb ist der Anteil des Handelsmoduls Konservativ sehr stark untergewichtet betrieben worden. Das ist erkenn- und belegbar durch den Anteil an der PTR des Fonds mit nur ca. 10 % im Durchschnitt. Also muss man den Ertrag des konservativen Moduls um den Faktor 8 hochskalieren, um die Leistung als reinen Konservativen Fonds zu berechnen, was bei 10 Mio. EUR Anlagevolumen zu einem Nettoertrag von ca. 7 % in der im Chart angegebenen Laufzeit geführt hätte - dies war aber nicht der Auftrag des Kunden.

Die ungünstigen Rahmenbedingungen (All In ca. 15 % Kosten) des IAM ALMARO Aktiv ergaben beim Handel seinen Summentrack.

Der Pfeil zeigt die gesamte Korrektur der Nachteile über die Laufzeit meines Mandats. Das Handelssystem Konservativ wurde 2008 für den Einsatz (Mandat) bei einem Schweizer Vermögensverwalter während der Lehman/Hypo-Real-Krise entwickelt – dafür benötigte ich einen Zeitrahmen von Mitte August bis Mitte September.

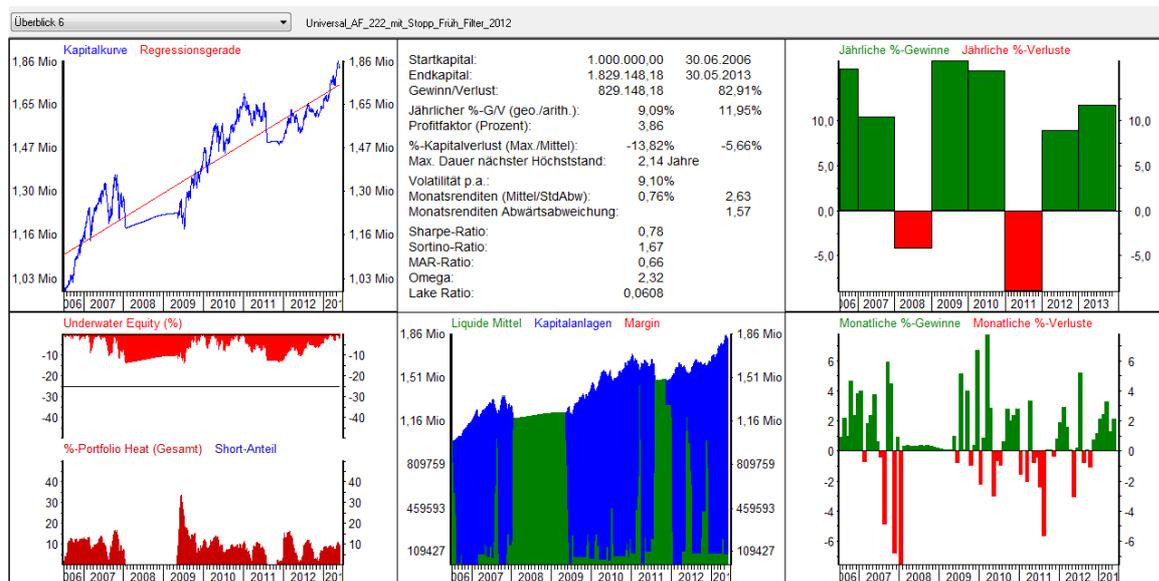
Einzelbeschreibung der BörsenMathematiker Handelssysteme „Konservativ“

Renten:

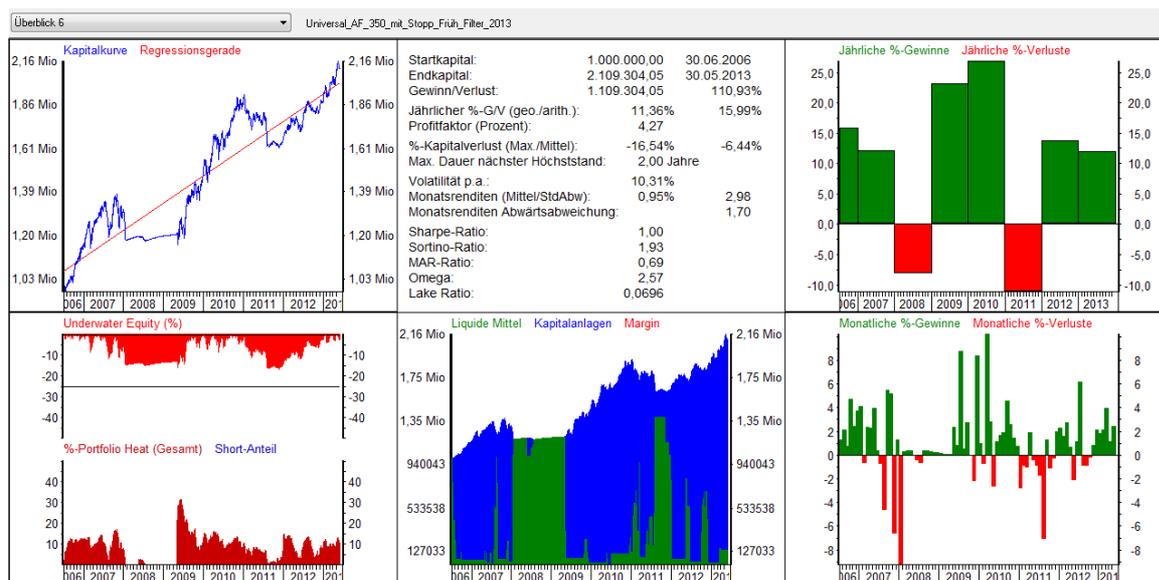


Einzelbeschreibung der BörsenMathematiker Handelssysteme „Dynamik“

„Kleines Daten-Abo“:



„Großes Daten-Abo“:



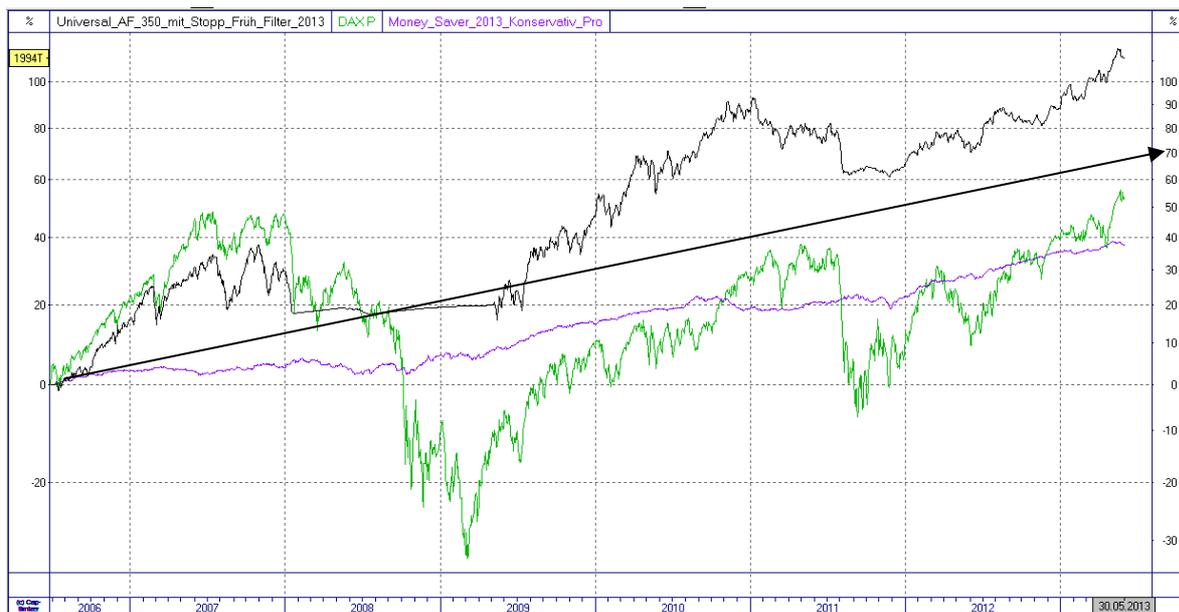
Den Dynamik und den Konservativ Strategiebaustein kann man jetzt in Kombination einsetzen. Für Kunden mit viel Verlust-Aversion:

80 % Renten + 20 Aktien oder 75 % Renten + 20 % Aktien + 5 % Cash.

So wird der MAX-Drawdown gesteuert.

BM-Money-Saver 2014

Der Erfolg des BM-Money-Saver-2014 liegt zwischen der lila und schwarzen Kurve im Mittel:



Man erhält bei gesenktem Risiko auf lange Sicht eine Outperformance des DAX – als Orientierung dient der Pfeil. Das Kapital schwankt weniger als Schwarz aber es schwankt mehr als lila – das ist die mathematische Regel, die hier gilt.