

DerBoersenMathematiker.de



DerBoersenMathematiker.de

**Dipl.-Math.
Rainer Schwindt**

Premium-Handelssystem

**Germany Master All Caps
Professional 2013**

+

Turbo-Tool 2013

+

Research-Tool 2013

Handelssystem für alle 160 Aktien aus DAX, MDAX, TecDAX und SDAX

Handbuch zum Handelssystem

Unternehmensberatung Schwindt

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

Germany Master All Caps Professional 2013

Alle Rechte, einschließlich derjenigen des auszugsweisen Abdrucks sowie der photo-mechanischen 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
 E-Mail: Schwindt@DerBoersenMathematiker.de

Inhaltsverzeichnis

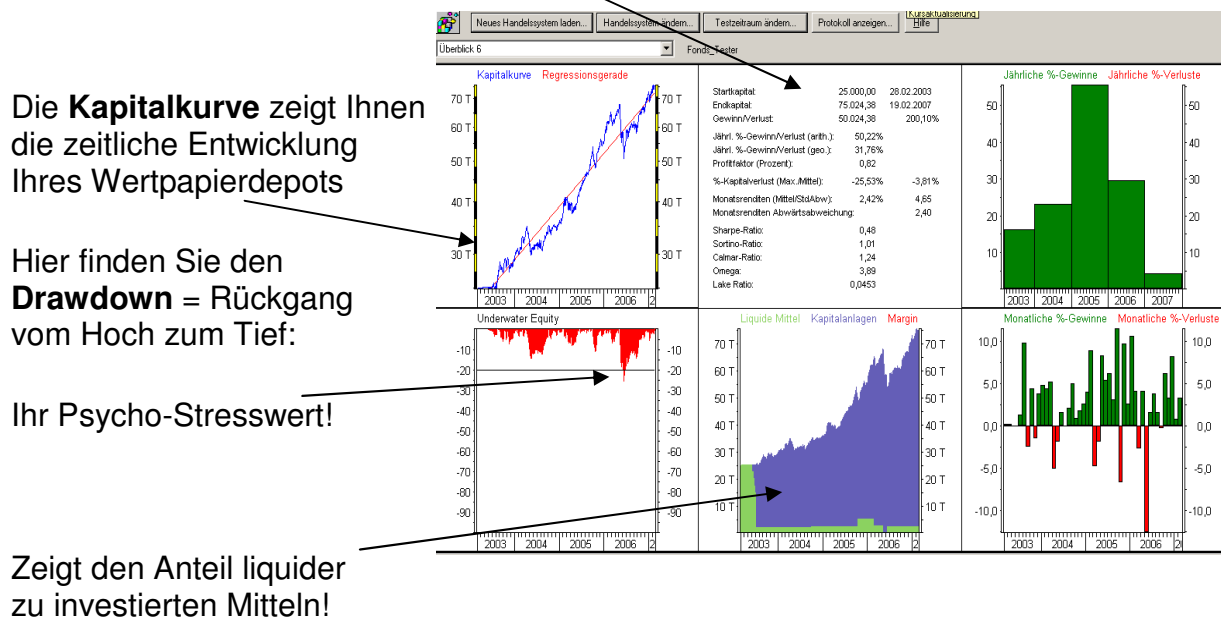
Legende	3
Handelssystem-Innovationen 2013	4
Welche Datenabos für Captimizer benötigen Sie mindestens?	5
Historische Betrachtung	6
Entwicklung von der New Technology ETF-Serie 2011/12 zum World ETF LR	7
Vorstellung Handelssystem Germany Master All Caps 2013 Privat	8
Bemerkungen zum Benchmarking	12
Welche Strategiefelder sind beim HS GMAC belegt?	14
Typische Trades des HS GMAC	15
Anwendung in Kombinationshandelssystemen für Aktien	17
Kombination HS GMAC mit HS Hannover	19
Kombination HS GMAC mit HS Frankfurt	20
Technischer Anhang	21

Wohin speichert man die gelieferte Software?

23

Legende

Auf den folgenden Seiten werden Sie immer wieder die unten stehenden Analysebilder aus dem Captimizer sehen, den sog. Simulator. Wir erläutern Ihnen jetzt in Kurzform, was Ihnen die Börsenstrategie an Ertrag eingebracht hat. Das **zentrale Quadrat** ist die **Kurz-Statistik** (siehe Erklärung):



Die **Kapitalkurve** zeigt Ihnen die zeitliche Entwicklung Ihres Wertpapierdepots

Hier finden Sie den **Drawdown** = Rückgang vom Hoch zum Tief:

Ihr Psycho-Stresswert!

Zeigt den Anteil liquider zu investierten Mitteln!

In den **Säulendiagrammen** (jeweils in der Grafik rechts außen) finden Sie eine Analyse der periodischen Gewinne und Verluste (monatlich/jährlich).

Kurz-Statistik:

Objektive unkritische Parameter sind: **Startdatum und Enddatum**;
Endkapital - Startkapital = Gewinn oder Verlust in € oder in % (für den gesamten Zeitraum)!

Jährlicher % Gewinn/Verlust (arith): = %Gesamt / Jahre

Wichtiger und aussagekräftiger: Die Geometrische Rendite!

Der jährliche **Gewinn/Verlust (geo.)** wird benutzt, um verschiedene Investments **objektiv** bezüglich **Erträgen** vergleichen zu können. **Zinseszinsseffekt!**
 Das Beispiel oben würde einem Sparbuch mit einem **Zins** von **31,76 %** pro Jahr entsprechen.

Kapitalverlust_Max = Ihr Maximalstress

Kapitalverlust_Mittel = Ihr Dauerstress bezüglich regelmäßigen Kapitalrückgangs von einem regelmäßigen Hoch zum Tief. Es ist eine Art mittlere Pendelbewegung im Trend.

Alle anderen Parameter bedürfen einer sehr intensiven Erklärung, welche die Unternehmensberatung Schwindt individuell jedem Kunden als Coaching anbietet!

Handelssystem-Innovationen 2013

Seit gut 6 Jahren vertreibe ich nun schon meine Handelssysteme für Aktien und Fonds/ETFs. Wie Sie wissen, arbeite ich seit der Finanzkrise 2008 als Krisenmanager für abgestürzte Fonds (insgesamt 16)– die z.B. an extremen Drawdowns und/oder an extremen Mittelabflüssen leiden. Die Leser meiner Marktanalysen wissen, dass das Krisenmanagement für solche Fonds die schwierigste Arbeit in der Fondsindustrie darstellt (extreme Fixkosten, extreme Transaktionskosten etc.), und trotzdem arbeite ich besser als die meisten Fondsmanager der Volumen-Marktführer der gleichen Fondsklasse – siehe Bericht auf meiner Homepage.

Als positiver Nutzen aus meiner Arbeit entstanden neue innovative Handelssysteme im Jahr 2009 wie das Handelssystem Berlin. Begleitend zu meinen vier Dachfondsmandaten von 2010 -2012 entstand bis Frühjahr 2012 etwas ganz außergewöhnliches in der Risiko-Rendite-Relation - das neue Handelssystem:

Germany Master All Caps 2013

Sie können alle 160 Aktien des DAX + MDAX + SDAX + TecDAX handeln.

Die Besonderheit ist, dass ich hier die Methoden des risikoarmen Index-Managements auf Einzelaktien übertragen konnte. Wie Sie wissen, ist eine Aktie extrem volatil als ein Index oder Fonds. Das macht es nicht leicht, das Risiko zu senken, und trotzdem eine hohe Rendite zu erwirtschaften.

Dank meiner Lösungen für die extreme Herausforderung mit dem **IAM ALMARO Aktiv** hatte ich systematisch live am Markt über 3 Jahre die Möglichkeit, innovative Schritte zu testen – ohne das übliche Backtesten – und das in der bisher schwierigsten Marktlage der Neuzeit. Heraus kam das Aktienhandelssystem GMAC 2013 und das World ETF Low Risk.

Welche Märkte handelt das neue Handelssystem Germany Master All Caps 2013?

Sie dürfen alle 160 Aktien des DAX + MDAX + SDAX + TecDAX in die Suchliste der Strategie aufnehmen. Ja, Sie lesen richtig, ich erlaube sogar die TecDAX-Werte. Vor denen warnte ich in der Vergangenheit - wegen der deutlich höheren Volatilität gegen über Standardwerten. Sie kennen meine Methode zur Fundamentalauswahl – vergessen Sie es – denn diese ist nicht mehr nötig, dank modernster Investmentmathematik. IQ-Buy und IQ-Sell können Sie, wenn Sie die Arbeitszeit an der Börse zur Verfügung haben, wie immer anwenden. Jedoch zeigen Ihnen die Risikokennzahlen, dass Sie keinen Max-Drawdown erleiden würden, der solche Zusatzarbeit für Privatanleger rechtfertigt.

Unser neues „altes“ Motto: Kaufen und solange Halten, bis das Verkaufssignal kommt! Not-Stopps brauchen Sie nicht, weil die modernste Differenzialtechnologie das Verkaufssignal generiert.


Und modernste Differenzial-Filtertechnologie hält Sie aus allen „Schweingereien“ der Märkte heraus – das lesen Sie aus der Kapitalkurve der Übersicht 6 des Captimizer.

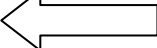
Historische Betrachtung

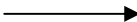
Der Einsatz der ETF-Handelssysteme der New Technology Serie in den verschiedenen Trendphasen wird im Folgenden kurz vorgestellt. Diese Betrachtungen und Lösungen sind in das HS GMAC 2013 eingeflossen.

Trendarten und Strategiebausteine:

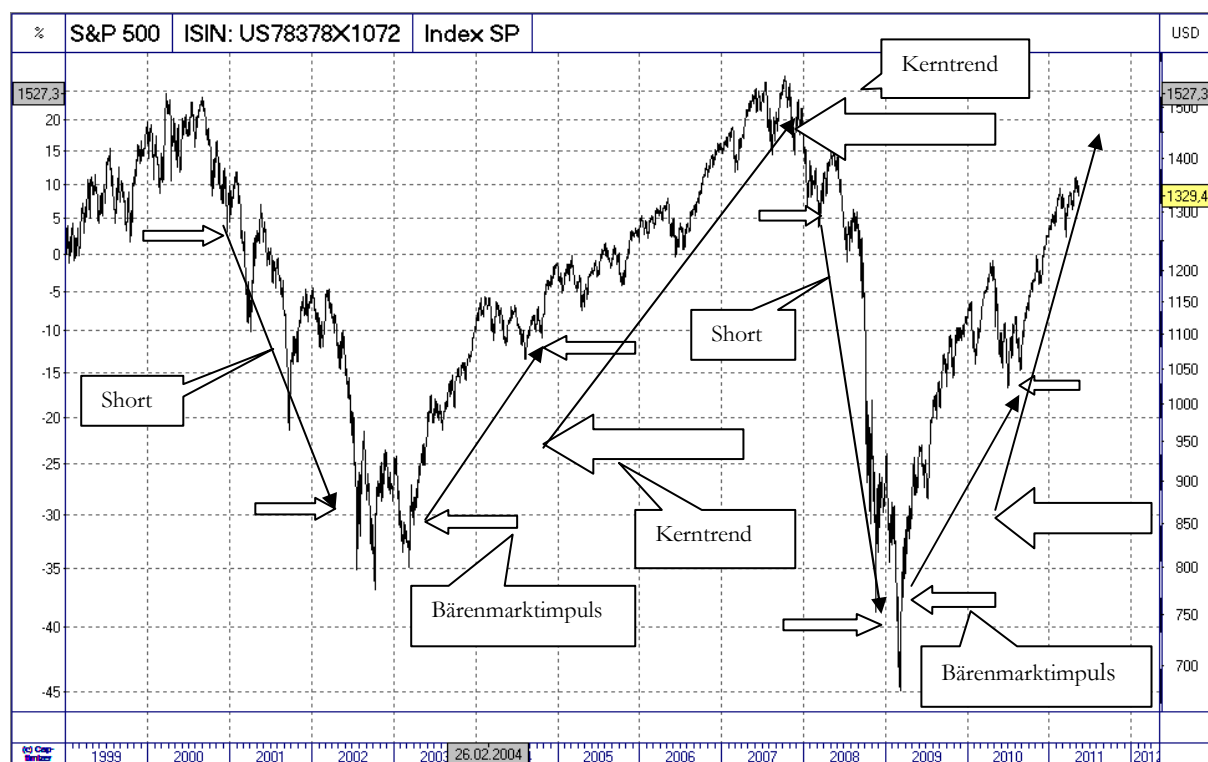
Short (kleine Pfeile von links nach rechts) 

Bärenmarktimpuls (kleine Pfeile von rechts nach links) 

Kerntrend (breite Pfeile von rechts nach links) 

Trendrichtung (lange schmale Pfeile) 

Stand des Charts: 17.5.2011



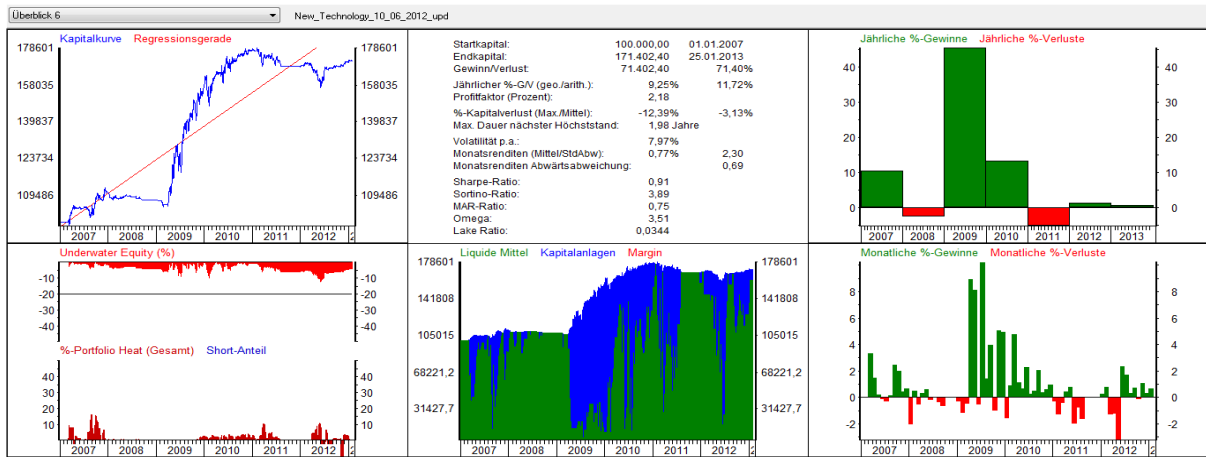
Der große Nutzen für den Kunden:

Die Strategien „Bärenmarktimpuls“, „Kerntrend“ und „Short“ wurden von mir überlagert und in ein einziges Handelssystem überführt - mit dem Namen „New Technology“, was die Basis für Fonds wie den IAM ALMARO Aktiv und seinen Vorgänger im Jahr 2010 war. D.h. Sie arbeiten tatsächlich lediglich mit 1 Handelssystem und nicht mit mehreren.

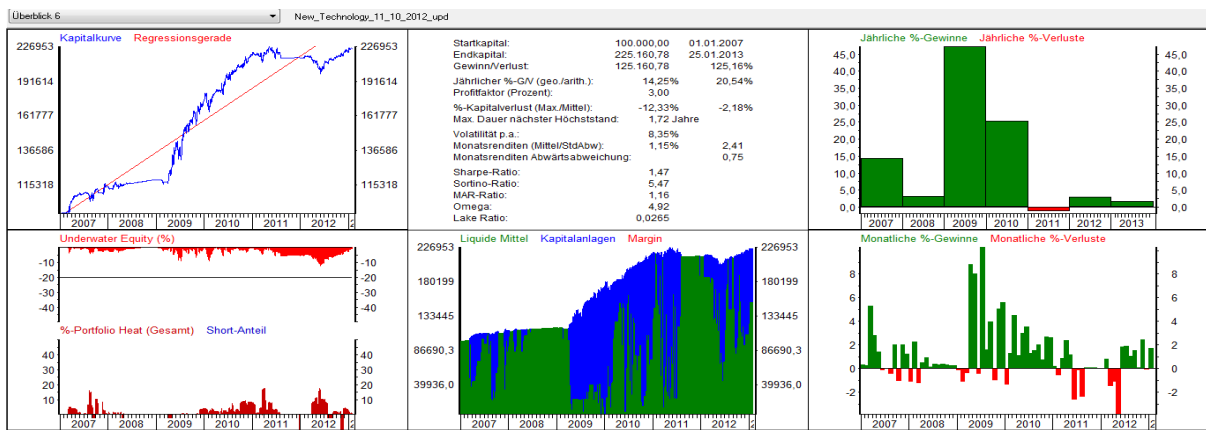
Ein weiterer Vorteil für Sie:

Der Gesamtgewinn wird gesteigert gegenüber dem besten Einzelsystem!

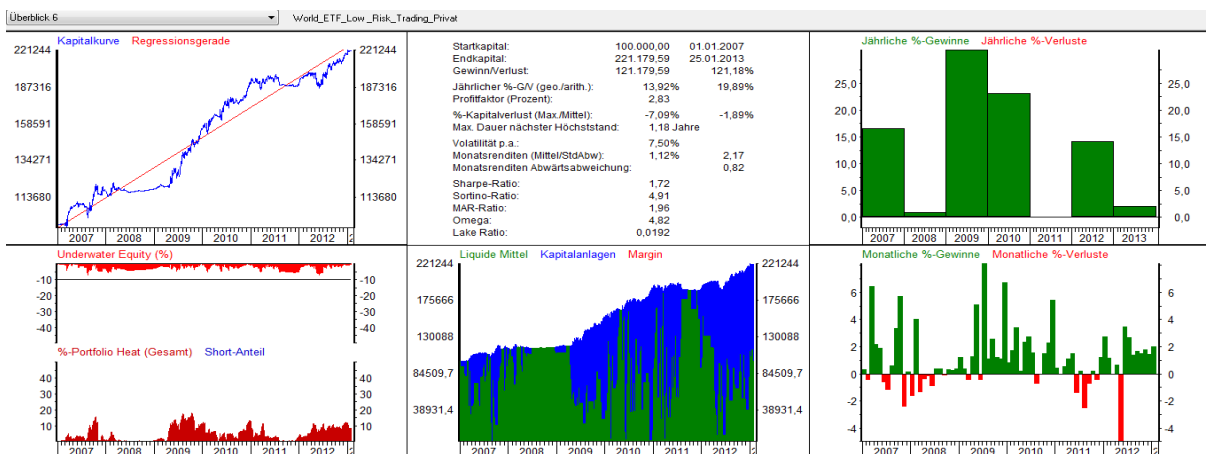
Entwicklung von der New Technology ETF-Serie 2011/12 zum World ETF LR



Das daraus entwickelte NT-Update im folgenden Bild beruht nicht auf Verbesserung der Formeln, sondern resultiert einzig und allein aus einer Verbesserung des Money-Managements (im Gegensatz zu Bild oben), wie ich es in meinen Seminaren von November 2012 - Januar 2013 zeigte. In Multistrategiesystemen stellt das Money-Management immer das wesentliche Instrument zum Erfolg dar.

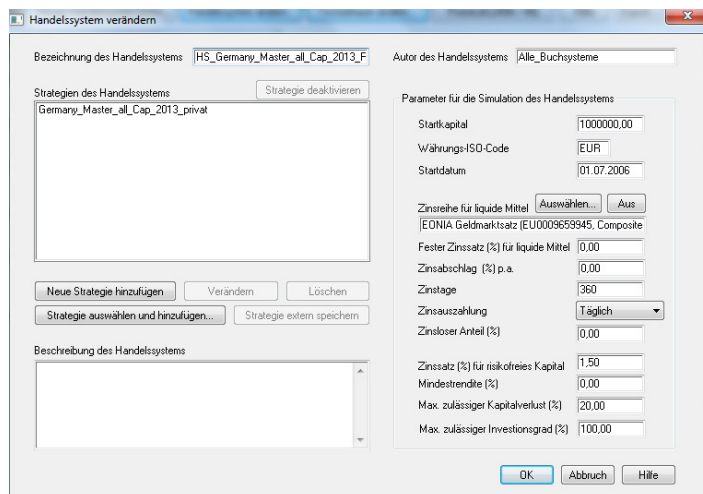


Die technologische Weiterentwicklung von NT lautet World ETF Low Risk Trading Privat:



Kann man nun die Erkenntnisse aus den Fonds auf Einzelaktien übertragen? Die Antwort ist Ja, u.a. die Frühindikation und ein verbesserter Captimizer 8.52 ergaben GMAC 2013 Privat.

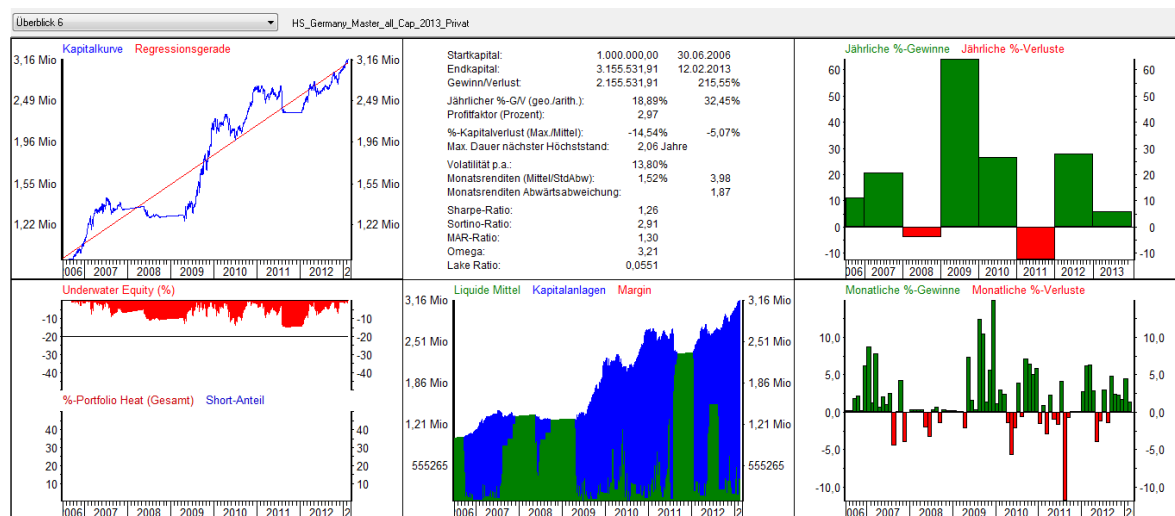
Vorstellung Handelssystem Germany Master All Caps Professional 2013



Die Transaktionskosten pro Trade werden sehr hoch angesetzt:
0,25 % variabel und 10 EUR Mindestgebühr – kein Kappen der Gebühren.

Leistungsdaten:

Nominal 14 Positionen aus DAX, MDAX, SDAX, TecDAX (160 Aktien alles aus Xetra).
Schwankung real: 12 – 14 Positionen bei quasi vollem Investitionsgrad.



Renditematrix des Handelssystems:

Renditematrix		HS_Germany_Master_all_Cap_2013_Privat											
Jahresrenditen (%)		Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2006	11,19							0,24	0,26	1,80	2,16	0,22	6,15
2007	20,57	8,72	1,19	7,82	0,71	2,04	0,98	2,57	-4,56	0,04	4,26	-4,01	-0,05
2008	-3,92	0,35	0,32	0,35	0,33	-2,06	-3,38	0,37	0,64	-1,57	0,27	0,25	0,23
2009	63,88	0,15	0,10	0,09	-2,19	7,30	1,63	0,28	12,41	10,40	1,40	5,61	14,88
2010	26,57	1,12	2,96	2,37	-1,48	-5,81	-2,22	3,88	-0,73	7,14	6,46	5,07	5,90
2011	-12,74	-1,65	0,86	-3,06	2,31	-1,04	-1,71	4,16	-11,93	-0,80	0,08	0,07	0,05
2012	27,84	2,69	6,17	6,34	2,87	-4,02	-1,30	2,93	-1,58	4,84	2,38	2,33	1,68
2013	5,87	4,46	1,35										
Mittelwert	17,41	2,26	1,85	2,32	0,43	-0,60	-1,00	2,06	-0,78	3,12	2,43	1,36	4,12

Statistische Kennzahlen:

Transaktions-Kennzahlen		HS_Germany_Master_all_Cap_2013_Privat	
	Gesamt	Long	
Nettogewinn:	1.439.816,70	1.439.816,70	
Nicht realisierte G/V.:	628.903,07	628.903,07	
Anzahl offene Positionen:	11 ←	11	
Profitfaktor:	2,44	2,44	
Profitfaktor (Prozent):	2,97	2,97	
Summe der Gewinne:	2.440.922,51	2.440.922,51	
Summe der Verluste:	-1.001.105,82	-1.001.105,82	
Durchschnittliches Ergebnis:	7.308,71	7.308,71	
durch. Gewinn / durch. Verlust	4,23 ←	4,23	
Durchschnittlicher Gewinn:	33.901,70	33.901,70	
Größter Gewinn:	425.440,10	425.440,10	
Durchschnittlicher Verlust:	-8.008,85	-8.008,85	
Größter Verlust:	-25.772,44	-25.772,44	
Durchschnittliches %-Ergebnis:	7,58% ←	7,58%	
durch. %-Gewinn / durch. %-Verlust	5,16	5,16	
Durchschnittlicher %-Gewinn:	31,27%	31,27%	
Größter %-Gewinn:	466,17%	466,17%	
Durchschnittlicher %-Verlust:	-6,07%	-6,07%	
Größter %-Verlust:	-17,61%	-17,61%	
Trefferquote:	36,55%	36,55%	
Anzahl:	197 ←	197	
Anzahl im Gewinn:	72	72	
Anzahl im Verlust:	125	125	
Max. Anzahl Gewinner in Folge:	5	5	
Max. Anzahl Verlierer in Folge:	12	12	
Durchschnittliche Dauer (Tage):	63	63	
Durch. Dauer bei Gewinnern (Tage):	131	131	

Es gibt ca. 9 unverlierbare offene Trades und 2 gefährliche Trades.

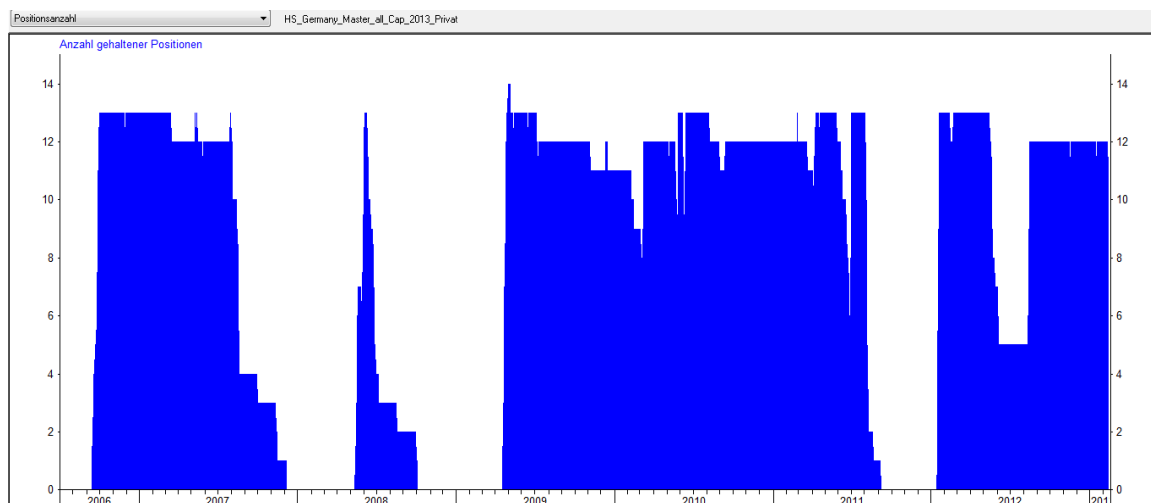
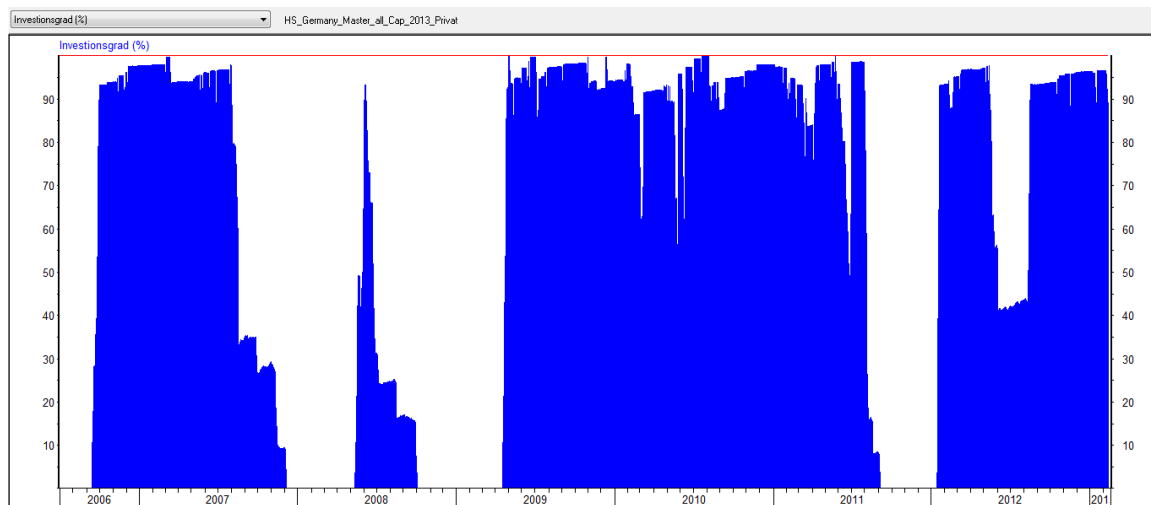
Deshalb muss man $197 + 11 = 208$ und $72 + 9 = 81$ rechnen, um die aktuelle reale Trefferquote zu erhalten: Also 81 geteilt durch $208 = 38,94\%$

Die Gewinn-/Verlustquotienten betragen mindestens $4,23$ und der Erwartungswert beträgt $7,58\%$. Das ist mehr als genug fürs „Geld drucken“.

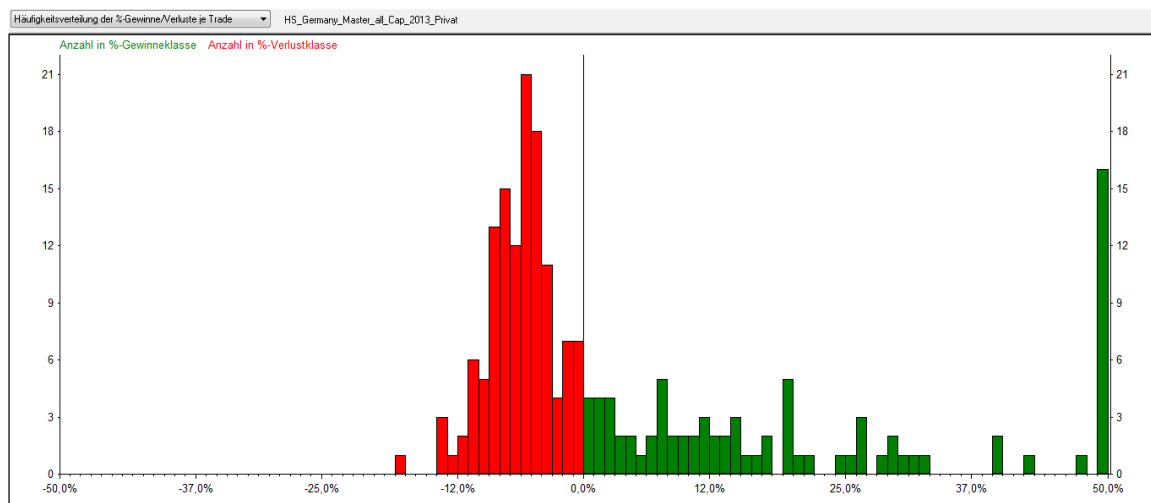
Setzen Sie bitte die wichtigen Kennzahlen in die Faustformeln von Kelly-Thorpe-Schwindt ein, und Sie werden sehen, dass es ein Top-System ist.

Auch langfristige Reaktionssysteme reagieren schnell wenn es nötig ist:

Sie sehen an der Steilheit der blauen Flanken wie rasch auf- und abgebaut wird.



Sie sehen hier: Gewinne laufen lassen und Verluste begrenzen:

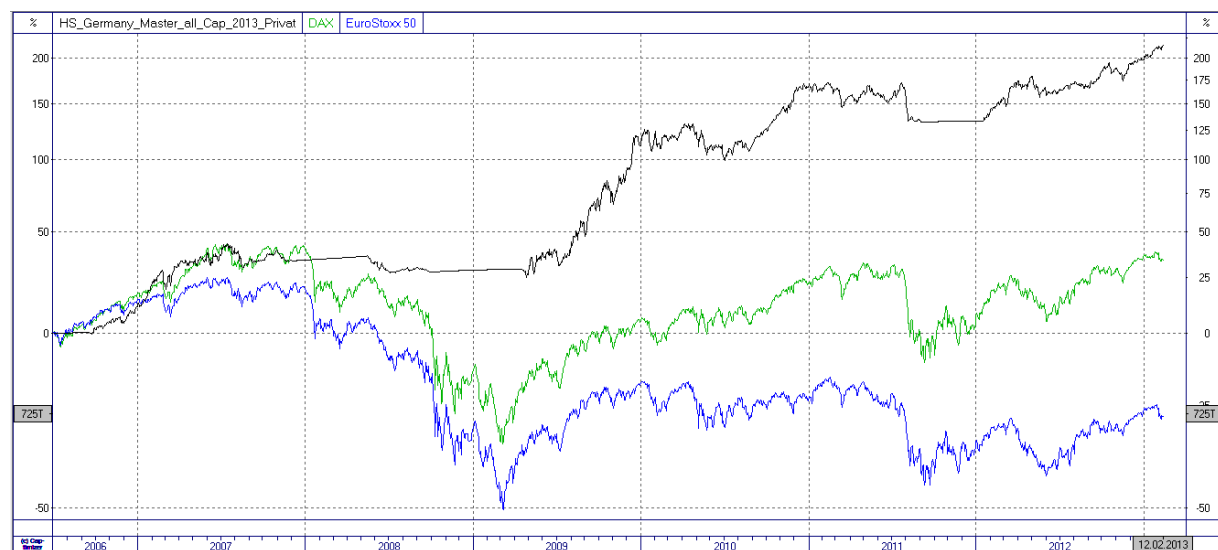


Wirkliche negative Singularitäten (-20 % und mehr) kommen nur sehr, sehr selten vor.

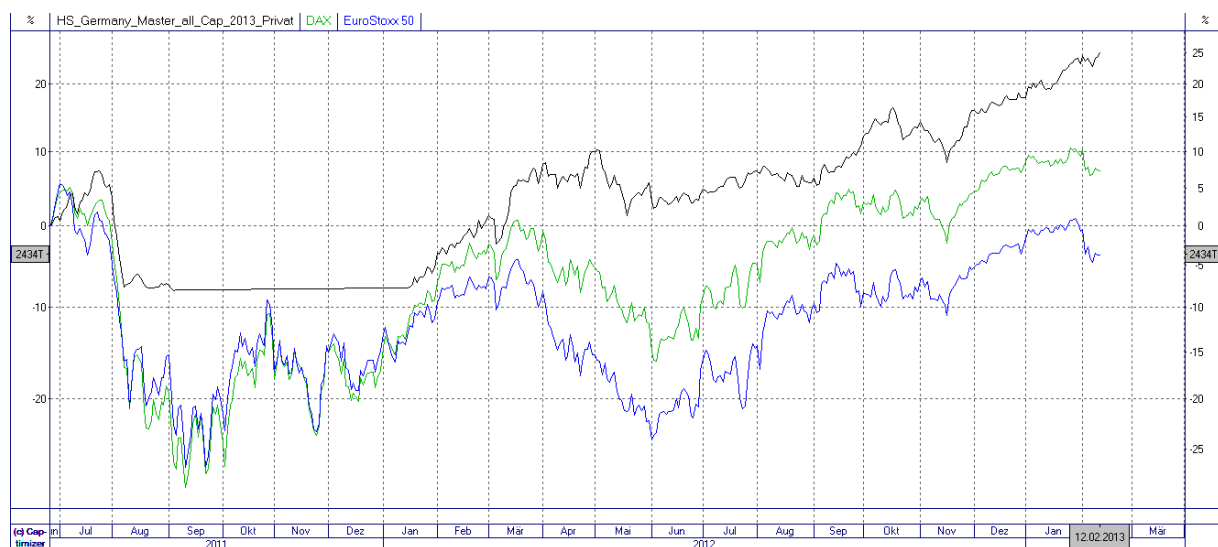
Offene Positionen:

Offene Positionen										
HS_Germany_Master_all_Cap_2013_Privat										
Einstiegsdatum	Stückzahl	Einstiegsbetrag	Ausstiegsbetrag	Gewinn/Verlust	%-Gewinn/Verlust	Transaktionskosten	Strategie	Handelsrichtung	Analysiertes Wertpapier	Umsetzungsar
18.01.2012	1067	166.852,13	290.224,00	122.954,74	73,69	417,13	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	KWS Saat AG O.N.	Direkt
18.01.2012	4769	165.353,15	398.354,57	232.588,03	140,66	413,38	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	SARTORIUS AG VZO O.N.	Direkt
15.08.2012	4698	189.552,56	240.114,78	50.088,34	26,42	473,88	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	BiotestAG VZ O.N.	Direkt
23.10.2012	35265	199.423,58	308.568,75	108.646,62	54,48	498,56	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	C.A.T. Oil AG	Direkt
06.11.2012	5614	202.623,30	229.331,90	26.202,05	12,93	506,56	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	Amadeus Fire AG	Direkt
20.11.2012	2073	196.955,73	212.586,15	15.138,03	7,69	492,39	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	Allianz SE	Direkt
20.11.2012	3360	197.887,20	218.232,00	19.850,08	10,03	494,72	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	Beiersdorf	Direkt
30.11.2012	4814	209.685,81	228.665,00	18.454,98	8,80	524,21	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	Deutsche Boerse	Direkt
17.01.2013	27325	217.438,69	225.431,25	7.448,97	3,43	543,60	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	TUI AG NA	Direkt
17.01.2013	15138	213.710,72	242.964,90	28.719,91	13,44	534,28	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	CENTROTEC Sustainable O.N	Direkt
08.02.2013	6656	222.543,36	221.911,04	-1.188,68	-0,53	556,36	Ger_mas13_all_c_pv	LONG	Cewe Color Holding O.N.	Direkt

Leistungsvergleich mit DAX und EUROStoxx 50 – ganz langfristig:



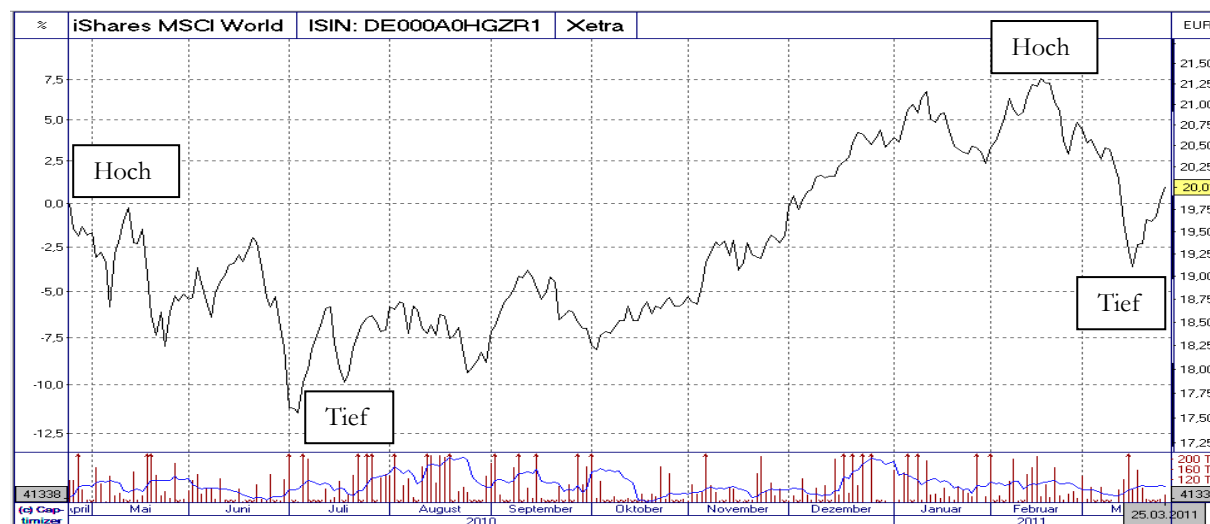
Leistungsvergleich mit DAX und EUROStoxx 50 – über die aktuelle Krise betrachtet:



Bemerkungen zum Benchmarking

Analyse eines mittelfristigen Trends der Weltaktienmärkte

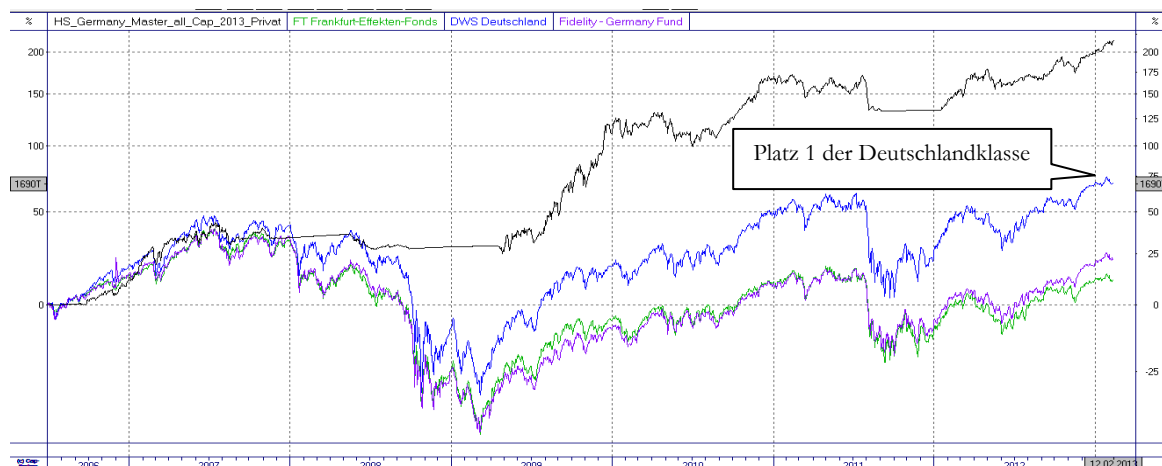
Sie sehen unten eine Auswertungsmethode für Fonds in Aktienmärkten, eine so genannte **Hoch-Tief-Hoch-Tief-Analyse**. Dazu verwenden wir einen Normpunkt im April 2010 = den Hochpunkt des **MSCI World in Euro** berechnet. Damit erhalten wir einen objektiven Leistungsmaßstab für den späteren Vergleich von Finanzinstrumenten (Wertpapiere mit Sondervermögensstatus):



Warum ist das so?

In der historischen Dow-Theorie unterscheidet man langfristige, mittelfristige und kurzfristige Trends. Wir sehen, dass Hoch im April 2010 liegt tiefer als das Hoch im Februar 2011. Das Tief im Juli 2010 liegt tiefer als das Tief im März 2011. Nach Charles Dow ist das ein mittelfristig steigender Sekundärtrend (siehe Bild oben). Aber finanzmathematisch liegt das Tief im März 2011 tiefer als das Hoch im April 2010. Daraus folgt, dass das Buy and Hold Ergebnis mit ca. **minus 3,2 %** ausfällt. Deshalb kann man mit o.g. Bewertungsmethode objektiv die Leistungen von z.B. Fonds vergleichen, unter Einbeziehung historischer Risiken wie Max-Drawdown etc.

Vergleich mit 3 von 5 erholungstärksten Fonds der Deutschlandklasse:



Cleverere Handelssysteme streuen nicht nur zur Risikokontrolle, sondern als Reaktionssysteme verhindern sie so, dauerhaft auf das falsche Pferd zu setzen, weil sie falsche Pferde nach hinreichender Zeit erkennen können.

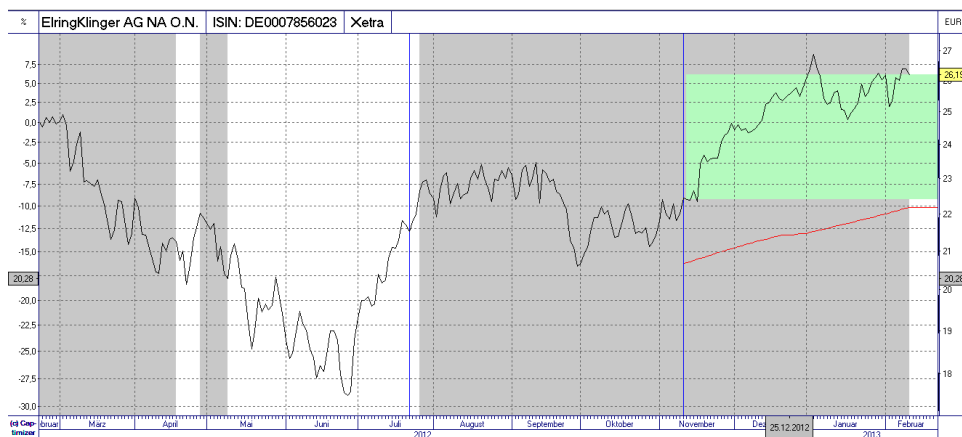
Aber fälschlicherweise unterstellt man technischen Handelssystemen, die Zukunft voraussagen zu wollen.

Und eben das tun sie gerade nicht, sondern wenden wie bereits beschrieben ganz einfach Mathematik an. Und es wird nichts anderes als bekanntes Know-how verschiedener Wissenschaften kombiniert.

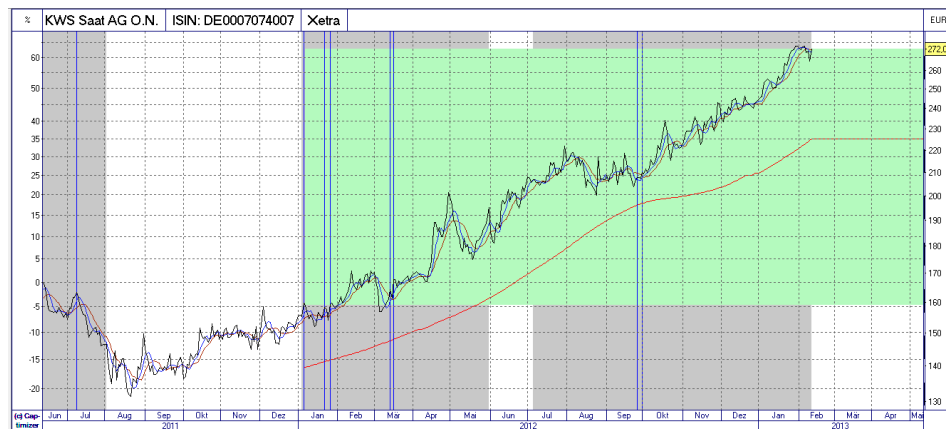
In einem meiner Fachbücher zeige ich ganz einfach und klar, dass man den Verlauf des Börsenkurses mit den Verlaufseigenschaften der Temperatur einer Klimaanlage vergleichen kann.

Meine Handelssysteme verhindern zukünftige falsche Verhaltensweisen von Anlegern.

Typischer Trade HS Hannover:

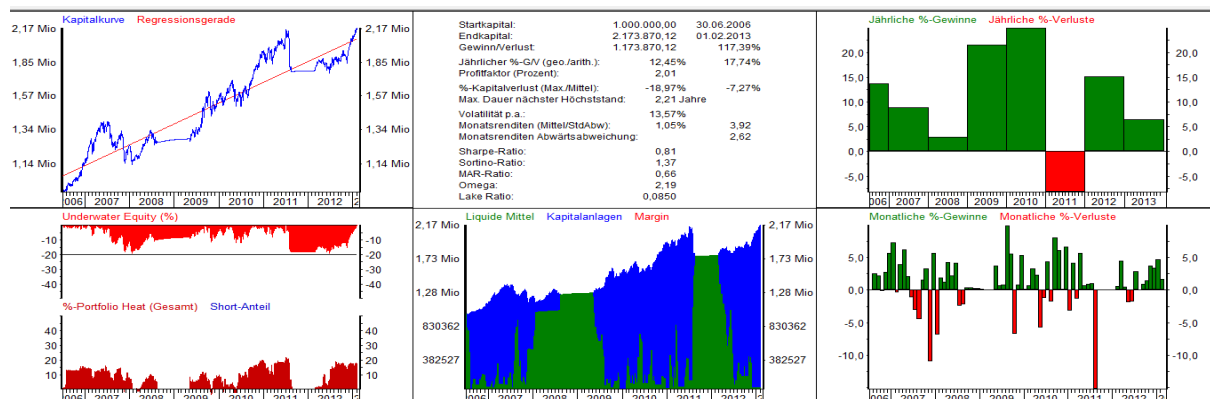


Typischer Trade HS Frankfurt:

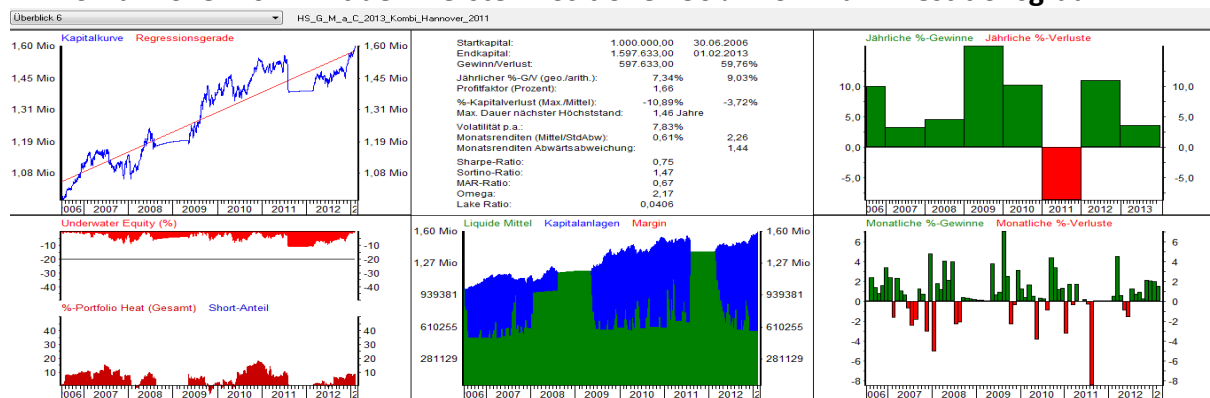


Anwendung in Kombinationshandelssystemen für Aktien Zunächst Vergleich HS GMAC mit HS Hannover

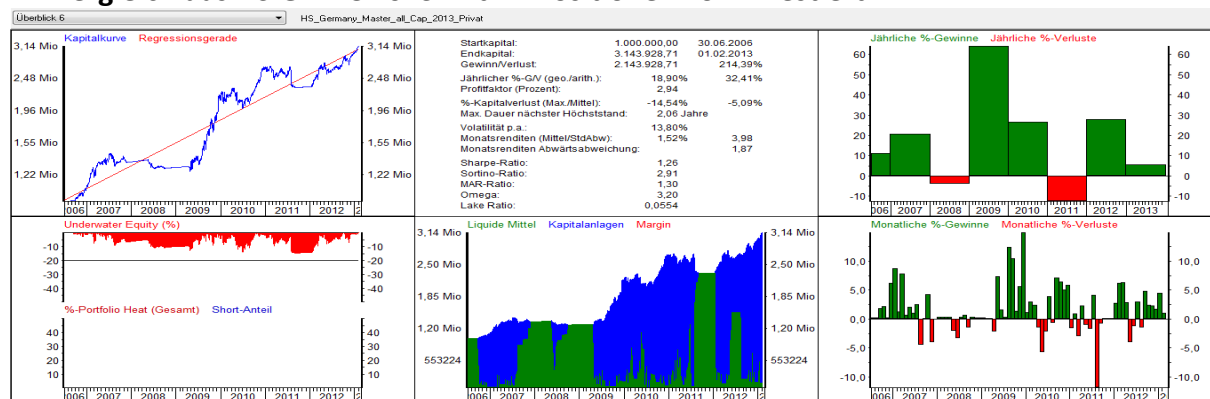
Ihr HS Hannover 2011 mit 14 Positionen voll investiert:



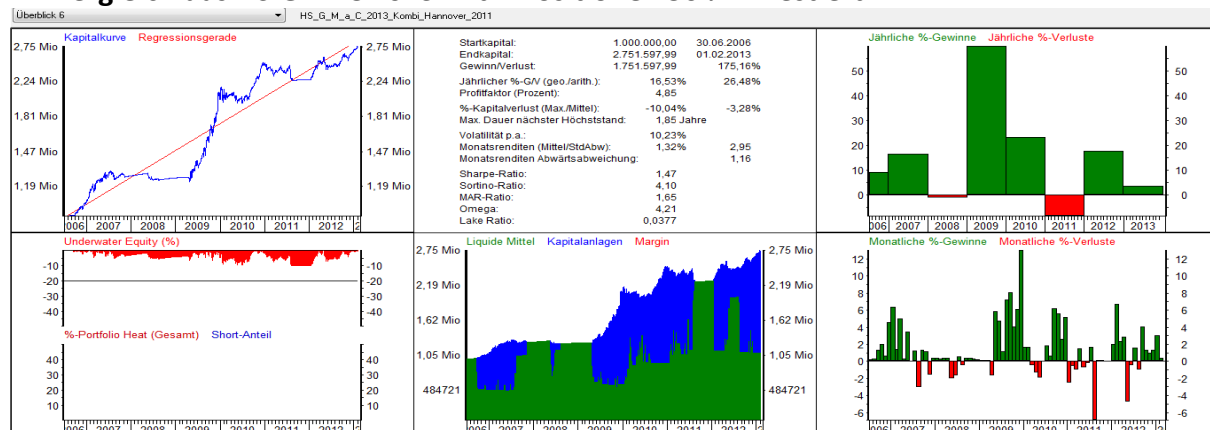
Ihr HS Hannover 2011 mit den 7 ersten Positionen 50 % Nominal-Investitionsgrad:



Im Vergleich das HS GMAC 2013 mit 14 Positionen voll investiert:

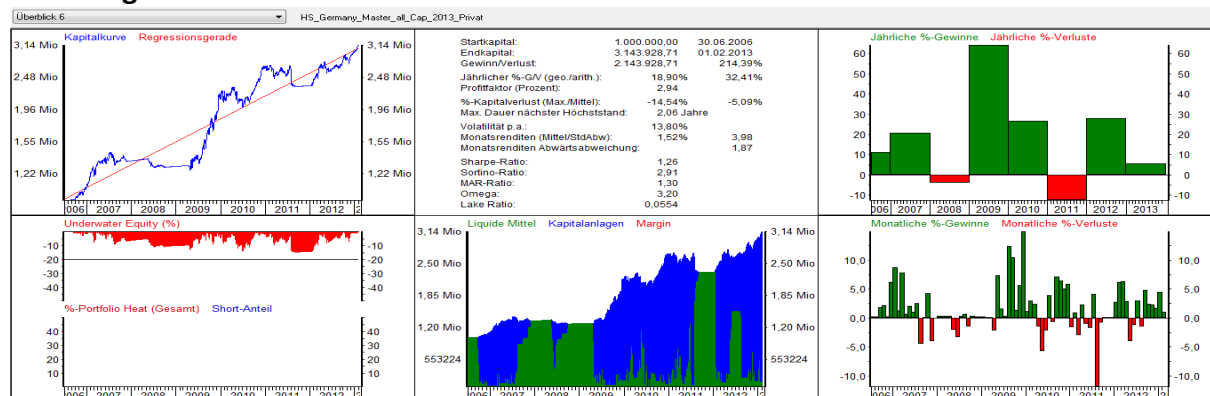


Im Vergleich das HS GMAC 2013 mit 7 Positionen 50 % investiert:

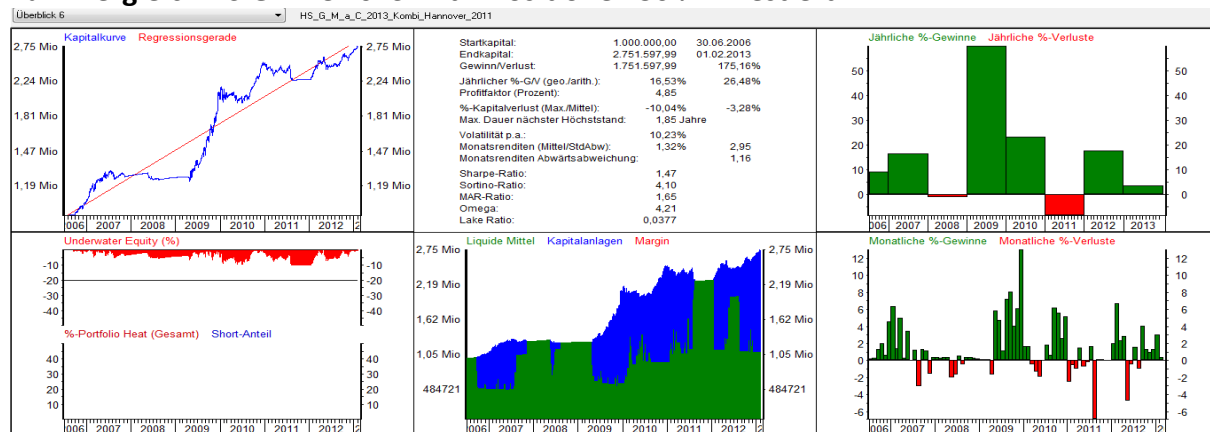


Anwendung in Kombinationshandelssystemen für Aktien Zunächst Vergleich HS GMAC mit HS Frankfurt

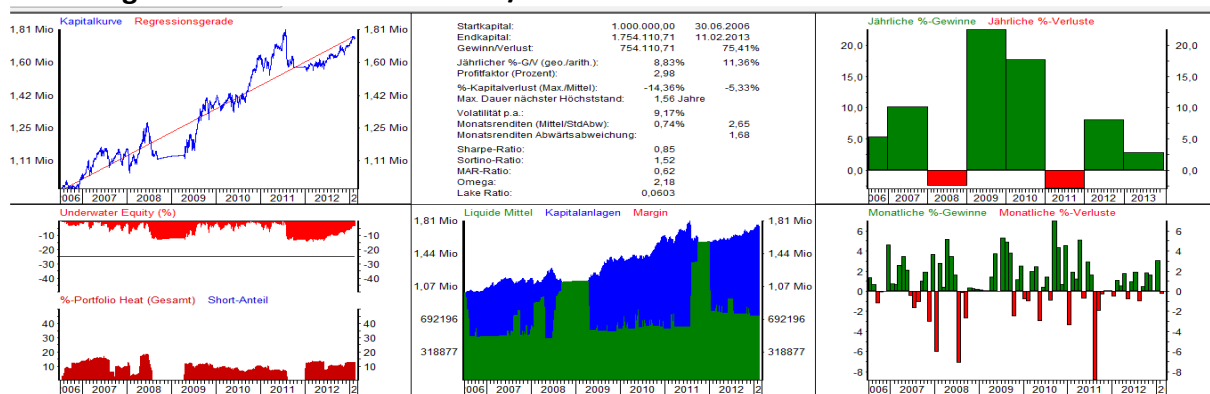
Zum Vergleich HS GMAC 2013 mit 14 Positionen voll investiert:



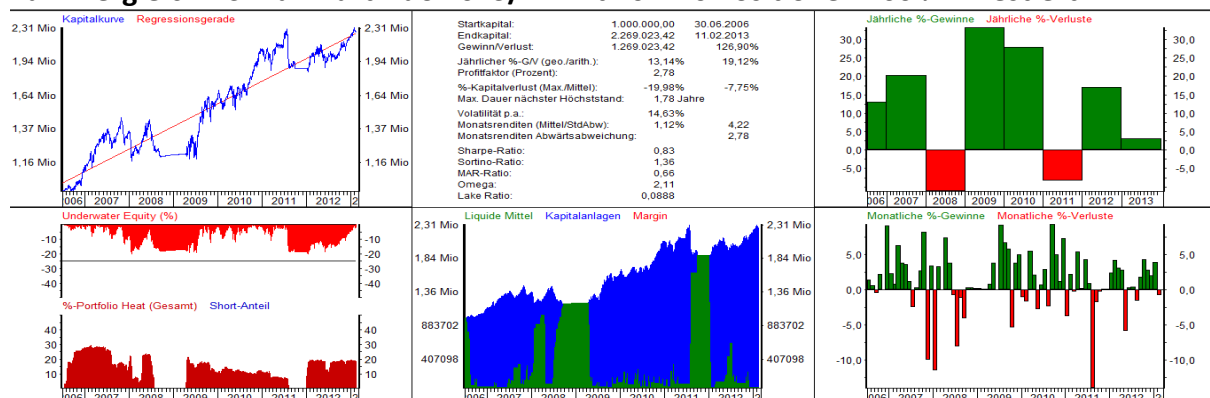
Zum Vergleich HS GMAC 2013 mit 7 Positionen 50 % investiert:



Zum Vergleich HS Frankfurt Duo 2013/12 mit 5 + 5 Positionen 50 % investiert:

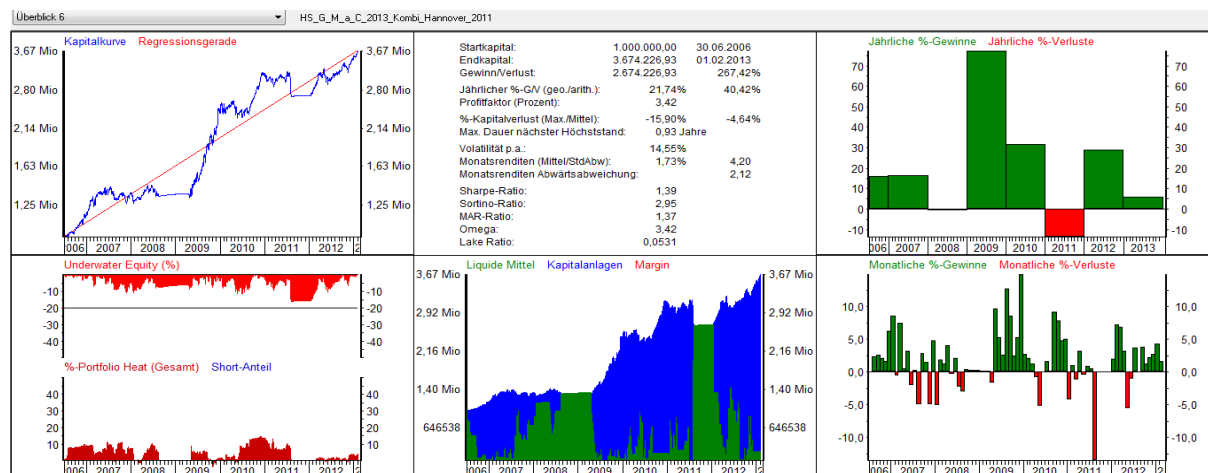


Zum Vergleich HS Frankfurt Duo 2013/12 mit 10 + 10 Positionen 100 % investiert:

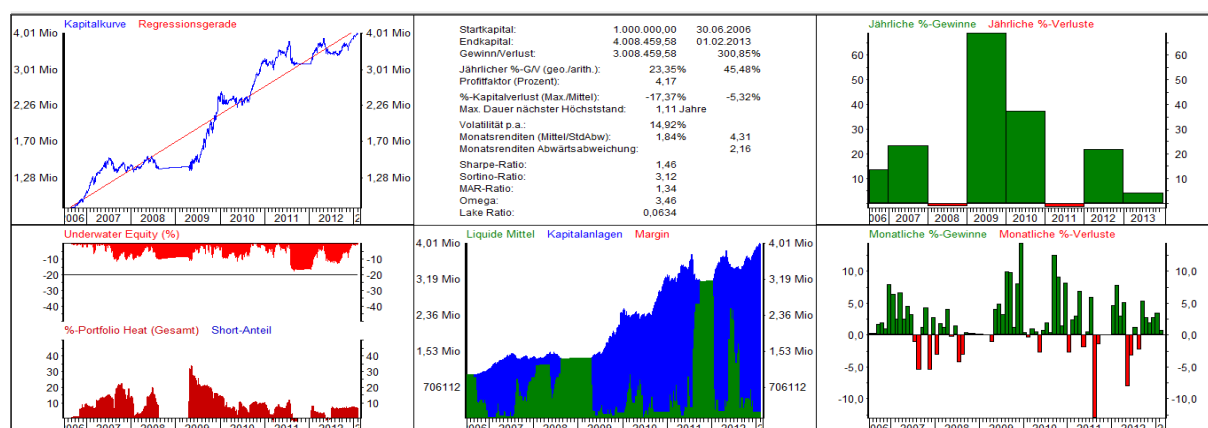


Kombination HS GMAC mit HS Hannover

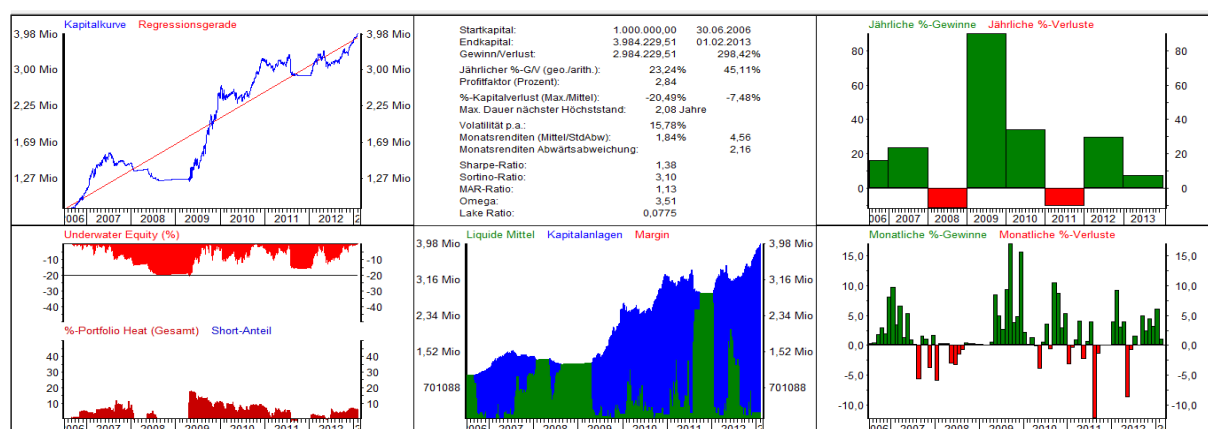
Nun kombiniere ich als erstes Ihr HS Hannover 2011 mit dem HS GMAC 2013 mit nominal 7 + 7 Positionen. Wir sehen als Ergebnis den wunderschönen Markowitz-Effekt gestreuter phasenverschobener Handelssysteme:



GMAC kombiniert mit Hannover Fundamental 2013:



GMAC kombiniert mit Hannover Standard 2013:



Anmerkung: Das Standard-System Hannover 2011 oder 2013 mit 130 Aktien ist auf jeden Fall pflegeleichter als das Fundamental-HS Hannover mit 63 Aktien.

Die Kombinationshandelssysteme: GMAC – Frankfurt:

GMAC:

Strategie ändern

Allgemeines | Wertpapiere/Umsetzung | Einstieg | Logikausstieg | Sicherheitsausstieg | Kurszielausstieg | Zeitzielausstieg | Positionen

Legen Sie bitte fest, auf welche Art die Positionsgröße bestimmt werden soll. Dabei können Sie die Höhe des einzusetzenden Kapitals direkt angeben oder auch indirekt über die Angabe eines prozentualen Risikos berechnen lassen.

Art der Positionsgrößenmittlung
 Prozentualer Anteil vom aktuellen Gesamtkapital
 7,50 % vom aktuellen Gesamtkapital

Hebel neutralisieren

Minimale Positionsgröße
 Es ist kein Mindestbetrag vorgegeben.

Maximale Anzahl an gleichzeitig gehaltenen Positionen dieser Strategie: 8
 Maximale Anzahl an gleichzeitig gehaltenen Positionen für ein Wertpapier: 1

Ok Abbruch Hilfe

Frankfurt:

Strategie ändern

Allgemeines | Wertpapiere/Umsetzung | Einstieg | Logikausstieg | Sicherheitsausstieg | Kurszielausstieg | Zeitzielausstieg | Positionen

Legen Sie bitte fest, auf welche Art die Positionsgröße bestimmt werden soll. Dabei können Sie die Höhe des einzusetzenden Kapitals direkt angeben oder auch indirekt über die Angabe eines prozentualen Risikos berechnen lassen.

Art der Positionsgrößenmittlung
 Prozentualer Anteil vom aktuellen Gesamtkapital
 4,98 % vom aktuellen Gesamtkapital

Hebel neutralisieren

Minimale Positionsgröße
 Es ist kein Mindestbetrag vorgegeben.

Maximale Anzahl an gleichzeitig gehaltenen Positionen dieser Strategie: 4
 Maximale Anzahl an gleichzeitig gehaltenen Positionen für ein Wertpapier: 1

Ok Abbruch Hilfe

Sie sahen an den unterschiedlichen Handelssystemkombinationen, wie entscheidend das Money-Management ist.

Nur Gangster versprechen Ihnen den Börsenerfolg ohne arbeiten zu müssen.

There is no free lunch!