

DerBoersenMathematiker.de



DerBoersenMathematiker.de

**Dipl.-Math.
Rainer Schwindt**

Handelssystem Germany-MAC-Frankfurt-2013 Das Kombinations-Handelssystem des Börsenmathematikers

Entwickelt für Captimizer 9.X

[Information zu allen Versionen](#)

Unternehmensberatung Schwindt

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

Handelssystem-Germany-MAC-Frankfurt 2013

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.

Geben Sie einfach: **Handelssystem Mathematiker** bei Google ein.

Dann finden Sie noch mehr Informationen zu Handelssystemen.

Handelssystem-Germany-MAC-Frankfurt-2013

Was sind die Unterschiede zur quasi kompatiblen Version C 8.52?

Die Formeln der Handelssysteme sind absolut identisch zu den bewährten Systemen 2006.

Im Captimizer 9 ist neu:

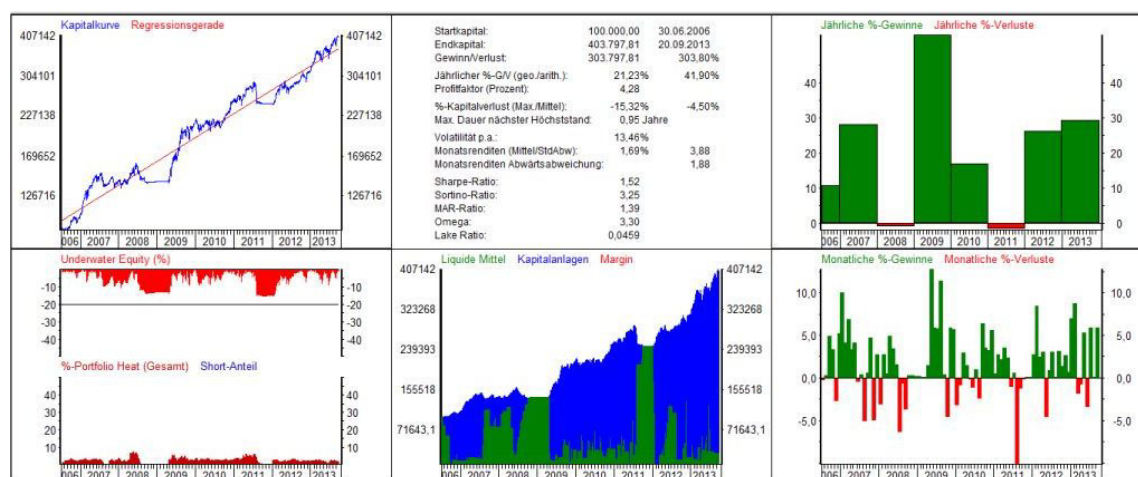
Längere fehlerfreie Zeitreihen aller Aktien im DAX, MDAX, TecDAX, SDAX. Dadurch erhalten wir mehr marktgerechte Signale.

Meine mathematischen Handelssysteme haben den Auftrag: „Folge dem Markt aber nicht negativ“. Das ist ein großer Unterschied im Vergleich zur gewöhnlichen Trendfolge. Differenzial-Technologie der Mess- und Regelungstechnik.

Außerdem werden im neuen Captimizer die Positionsgrößen und die Gebühren für Transaktionen sachgerechter umgesetzt – es bleibt weniger totes Kapital über.

Durch diese Gründe werden die Signale mit einem noch besser vom BörsenMathematiker abgestimmtes Money-Management überführt.

Neue „Schalter“ im Captimizer verhindern negative Verhaltensweisen, die noch in der Version C 8.52 vorhanden waren.



Am jetzt ab Version C9.04 richtigen Portfolio Heat sehen Sie, wie gering schon immer das Einstiegsrisiko aller Handelssysteme des BörsenMathematikers war.

Der neue Benchmarking Standard des BörsenMathematikers im Internet

Finanzmathematisch machen Backtests die Jahrzehnte zurückreichen keinen Sinn, weil so nicht die Leistungsfähigkeit des gezeigten Handelssystems bewiesen wird, sondern der Zinseszineffekt über große Zeiträume. Nur ein einziges überragendes Ergebnis in der fernen Vergangenheit reicht aus, um enorme Unterschiede in der arithmetischen Gesamtrendite zu suggerieren. Genauso schädlich für Rückwärtsanalysen sind falsche soziologische Annahmen wie Gebühren über Jahrzehnte mit den heutigen Sätzen rückwärts zu extrapolieren oder noch schlimmer, konstante Festzinsen z.B. 3 % p.a. + EONIA über Jahrzehnte für die Performance eines Handelssystems in Anrechnung zu bringen.

Natürlich macht es auch keinen Sinn, ETFs rückwärts zu extrapolieren, die vor dem Jahr 2006 noch gar nicht existierten. Ein DAX-INDEX ist nicht mathematisch gleich dem DAX-ETF wenn man 10 Jahre zurückgeht.

Seriöse, faire mathematische Handelssysteme sind immer stetig abhängig von den Eingangsdaten.

Es wäre finanzmathematisch vermessen (unsinnig), in einem nichtlinearen Börsenpreissystem von einer Gleichheit zu sprechen die mathematisch nicht existiert. Wir erzielen bei Vergleichen INDEX zu ETF Ähnlichkeiten in der Performance, aber niemals Gleichheit, weil die Zufallsketten bei den Ziehungen einen anderen Weg durch das Börsenlabyrinth gehen.

Das bedeutet für die Handelssysteme nicht, dass der Börsenmathematiker keine Backtests an Kursreihen über Jahrzehnte hinweg durchgeführt hat, sondern der Börsenmathematiker nutzt diese Tests nur, um Stabilitätsuntersuchungen vorzunehmen, aber nicht zu Werbezwecken. Es werden also zukünftig für Performance-Untersuchungen ein ca. 5-Jahres-Standard verwendet, in dem mindestens 2 Bärenmärkte enthalten sind.

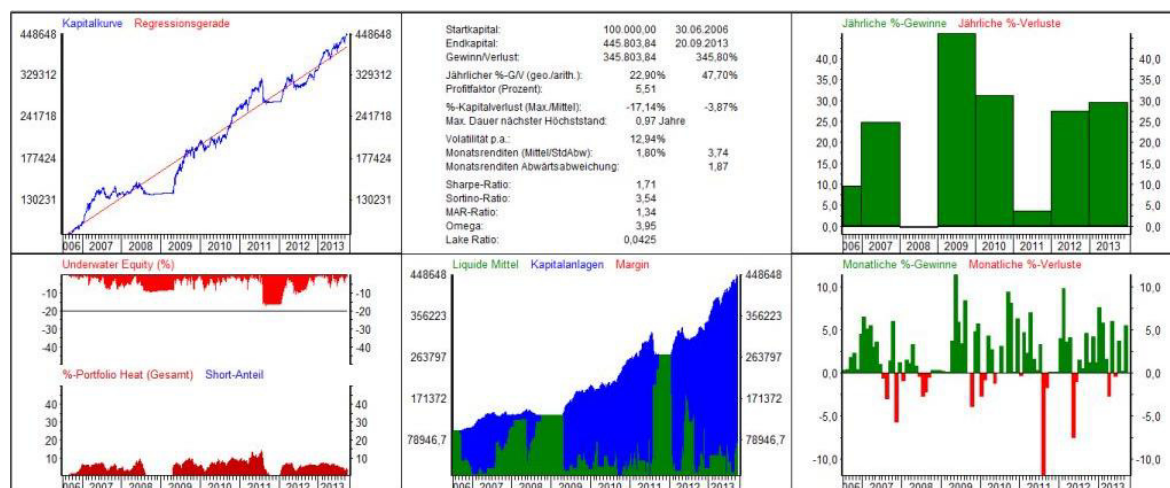
Sobald ein abgeschlossener Bärenmarkt (neues primäres Tief) entstanden ist, rückt der Performancetest in der heute unbekanntem Zukunft einen Bärenmarkt auf. Dieses Vorgehen ist für den Anleger wesentlich sinnvoller als der einfache gleitende 5-Jahrestest, der in Zeitschriften zu finden ist. Denn diese finanzmathematisch sehr zweifelhafte Methode belohnt alle paar Jahre die größten Versager-Fonds, weil der große Maximum-Drawdown als vermögensverwalterische schlechte Leistung, diese Manager auch noch belohnt. Durch das entstandene maximale Anlagerisiko entwickelt sich ein hohes Momentum, weil der Markt zufällig stark hochläuft. Aber der Manager hat nichts mit jenem Momentum zu tun, denn er hat nicht als Magier der Märkte diese persönlich hochgehext - wird aber gerne so verkauft.

Die Korrekturen von März bis Anfang Juni ergaben deutliche Erhöhungen der arithmetischen Gesamtrendite.

Ende Juni 2013 hatte es noch eine wesentliche Änderung der Xetra-Datenbank für Deutsche Aktien gegeben, die die Arithmetische Gesamtrendite durch Effekte vor 2008 stark beeinflusste. Diese senkten die Rendite wieder etwas – liegt aber immer noch deutlich über den Werten des Captimizer 8.52.

Mit der Version 9.06 der Daten-DVD ist wohl das Ende der Verbesserungen für Deutsche Aktien erreicht.

Handelssystem Germany-MAC-Frankfurt



Kombinations-Handelssysteme-Kennzahlen:

Kennzahlen von Handelssystem-Kombinationen für Pro

Performance - Privatanleger Stichtag = 20.9.2013	GMAC-Hannover Deutschland	Multi Asset Long only	GMAC-Frankfurt Deutschland	Multi Asset Turbo	DAX-Index Buy and Hold
Startkapital 1.7.2006 in €	1.000.000 €	500.000 €	1.000.000 €	500.000 €	1.000.000 €
Endkapital €	4.458.030 €	2.306.400 €	4.037.970 €	2.856.511 €	1.359.000 €
Gewinn €	3.458.030 €	1.806.400 €	3.037.970 €	2.356.511 €	359.000 €
Gewinn %	345,80%	361,29%	303,79%	471,30%	35,90%
Offene Positionen	10	9	13	9	1
Anlagedauer Jahre	5,24	5,24	5,24	5,24	5,24
Maximale Positionszahl	13	13 + 6	15	14 + 6	1
Tradezahl	155	193	156	228	1
Trefferquote	52,9%	57,5%	46,8%	55,7%	
Gewinn-/Verlustverhältnis	4,37	3,37	4,37	3,42	
Profitfaktor	5,51	5,26	3,84	4,3	
Drawdown % Maximum	17,14%	15,07%	15,32%	10,23%	44,29%
Mittel-Drawdown	3,87%	3,49%	4,50%	2,75%	11,70%
Geo.-Rendite %	22,90%	23,49%	21,23%	27,17%	6,03
Arith.-Rendite %	47,70%	49,86%	41,90%	65,01%	6,85
Rendite 2012	27,40%	32,89%	26,05%	32,88%	28,89
Rendite 2013 YTD	29,59%	23,06%	29,14%	26,46%	13,9

Captimizer Handelssystem Kennzahlen:

Handelssysteme Kennzahlen Privat

Performance-Privat Stichtag = 20.9.2013	GMAC 2013	Hannover 2013	Frankfurt 2013	World ETF LR	Fonds Universal	DAX-Index Buy and Hold
Startkapital 1.7.2008 in €	100.000 €	100.000 €	100.000 €	100.000 €	100.000 €	100.000 €
Endkapital €	277.990 €	315.975 €	282.986 €	192.472 €	178.915 €	135.900 €
Gewinn €	177.990 €	215.975 €	182.986 €	92.472 €	78.915 €	35.900 €
Gewinn %	177,99%	215,98%	182,98%	92,47%	78,91%	35,90%
Offene Positionen	12	8	30	7	13	
Anlagedauer Jahre	5,24	5,24	5,24	5,24	5,24	5,24
Maximale Positionszahl	12	13	19 x 2	12	13	1
Tradezahl	146	85	158	210	72	1
Trefferquote	40,4%	58,8%	56,3%	51,9%	54,2%	
Gewinn-/Verlustverhältnis	4,25	4,05	3,92	2,43	3,91	
Profitfaktor	2,88	5,79	5,05	2,91	4,63	
Drawdown % Maximum	15,46%	18,92%	18,51%	9,11%	16,99%	44,29%
Mittel-Drawdown	4,16%	3,97%	4,68%	1,88%	4,63%	11,70%
Geo.-Rendite %	21,53%	25,97%	21,95%	12,08%	11,74%	6,03
Arith.-Rendite %	33,95%	44,92%	34,91%	16,10%	15,04%	6,85
Rendite 2012	19,97%	20,15%	17,35%	11,21%	13,61%	28,89
Rendite 2013 YTD	12,52%	13,90%	12,15%	6,29%	9,26%	13,9

Beispiel zur Handelssystem-Analyse:

Captimizer Pro V.9.04 - [Simulator - HS_GMAC_Kombi_Frankfurt_2013_C9]

Auswahl Handelssystem Depot Verwaltung Fenster Hilfe

Neues Handelssystem laden... Handelssystem ändern... Testzeitraum ändern... Protokoll ()

Transaktions-Kennzahlen HS_GMAC_Kombi_Frankfurt_2013_C9

	Gesamt	Long
Nettogewinn:	2.091.855,83	2.091.855,83
Nicht realisierte G/V.:	844.197,67	844.197,67
Anzahl offene Positionen:	12	12
Profitfaktor:	4,08	4,08
Profitfaktor (Prozent):	4,42	4,42
Summe der Gewinne:	2.770.358,15	2.770.358,15
Summe der Verluste:	-678.502,31	-678.502,31
Durchschnittliches Ergebnis:	14.039,30	14.039,30
durch. Gewinn / durch. Verlust	4,37	4,37
Durchschnittlicher Gewinn:	38.477,20	38.477,20
Größter Gewinn:	543.217,42	543.217,42
Durchschnittlicher Verlust:	-8.811,72	-8.811,72
Größter Verlust:	-40.043,17	-40.043,17
Durchschnittliches %-Ergebnis:	12,61%	12,61%
durch. %-Gewinn / durch. %-Verlust	4,72	4,72
Durchschnittlicher %-Gewinn:	33,74%	33,74%
Größter %-Gewinn:	469,05%	469,05%
Durchschnittlicher %-Verlust:	-7,14%	-7,14%
Größter %-Verlust:	-19,53%	-19,53%
Trefferquote:	48,32%	48,32%
Anzahl:	149	149
Anzahl im Gewinn:	72	72
Anzahl im Verlust:	77	77
Max. Anzahl Gewinner in Folge:	9	9
Max. Anzahl Verlierer in Folge:	13	13
Durchschnittliche Dauer (Tage):	107	107
Durch. Dauer bei Gewinnern (Tage):	171	171
Durch. Dauer bei Verlierern (Tage):	46	46

Wir sehen 12 offene Trades:

8 Trades davon werden auf jeden Fall mit Gewinn abgeschlossen.

3 Trades könnten bei einem Börsen-Crash mit Verlust abschließen.

1 Trade kann bei einem Börsen-Crash entweder mit Gewinn oder Verlust abschließen.

Nach der Portfolio Heat Methode erhalten wir aktuell eine Gesamttrefferquote von ca. 50 %.

Wichtiger ist der Gewinnfaktor = 4,37!

Vergleich mit dem DAX (P) und dem besten Deutschlandfonds im gleichen Zeitraum:

