

DerBoersenMathematiker.de



DerBoersenMathematiker.de

**Dipl.-Math.
Rainer Schwindt**

BM-USA-Handelssysteme 2015

Neue Handelssysteme des Börsenmathematikers

Entwickelt für Captimizer 9.X

Mit Spezialkapitel zum IQ-Buy und IQ-Sell

[Information zu allen Versionen](#)

Unternehmensberatung Schwindt

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

BM-USA-Handelssysteme 2015

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 neuen USA-Handelssysteme des Börsenmathematikers

HS USA Sprint 2015
 HS USA Medium 2015
 HS USA Marathon 2015

Inhalt

	Seite
BM USA Handelssysteme 2015	3
Besonderheiten beim Handel mit Wertpapieren in einer Fremdwährung	8
Besonderheiten des IQ-Buy und IQ-Sell bei Fremdwährungen	10
Interessante Anmerkung	11
Technischer Anhang	12

BM USA-Handelssysteme 2015

Schon lange bekannt sind die Handelssysteme Deutschland: Hannover, Frankfurt und GMAC, die in Aktien auf DAX, MDAX, TecDAX, SDAX investieren.

Später folgten die 3 namensähnlichen Handelssysteme vom Typ Schweiz.

Immer mehr Kunden stellten Anfragen an mich, ob nicht etwas Ähnliches für den USA-Aktienmarkt zu bekommen sei.

Die Verbesserungen im Captimizer seit 2013 ergaben nun die Möglichkeit, etwas Gleichwertiges für den US-Markt zu entwickeln. Bisher hatten wichtige Indikatoren sehr versteckte Fehler enthalten, die ein sicheres Arbeiten für US-Aktien verhinderten.

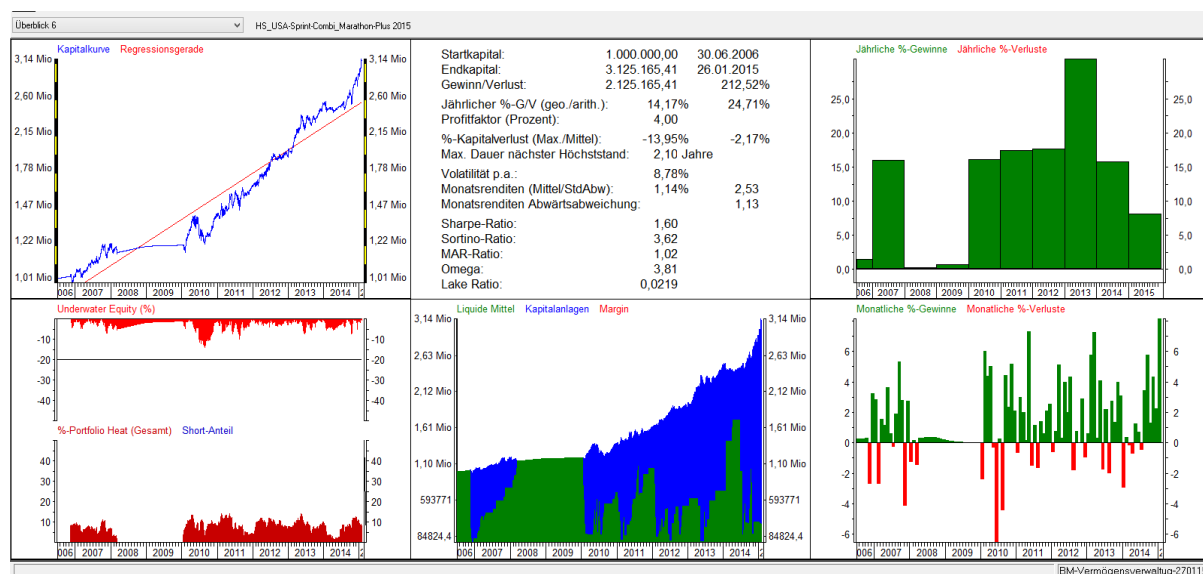
Da die US-Märkte etwas anders ticken als z.B. Deutschland und die Schweiz war zwar eine Ideen-Basis vorhanden, aber wenn man den Entwicklungsweg Deutschland – Schweiz in einfacher Weise verfolgte, ergaben sich trotz individueller USA-Filterung in manchen Börsenzeiten ein für den Börsenmathematiker nicht akzeptabler Maximum Drawdown von manchmal 33 %.

Also musste eine durchschlagendere Idee her. Das ist nun gelungen.

Alle drei neuen Basishandelssysteme für US-Aktien arbeiten mit den fehlerfreien größten 130 US-Aktien. Dabei wurde ein so geringer Max-Drawdown für Aktiensysteme erzielt, der selbst mich überraschte.

Sehen Sie selbst:

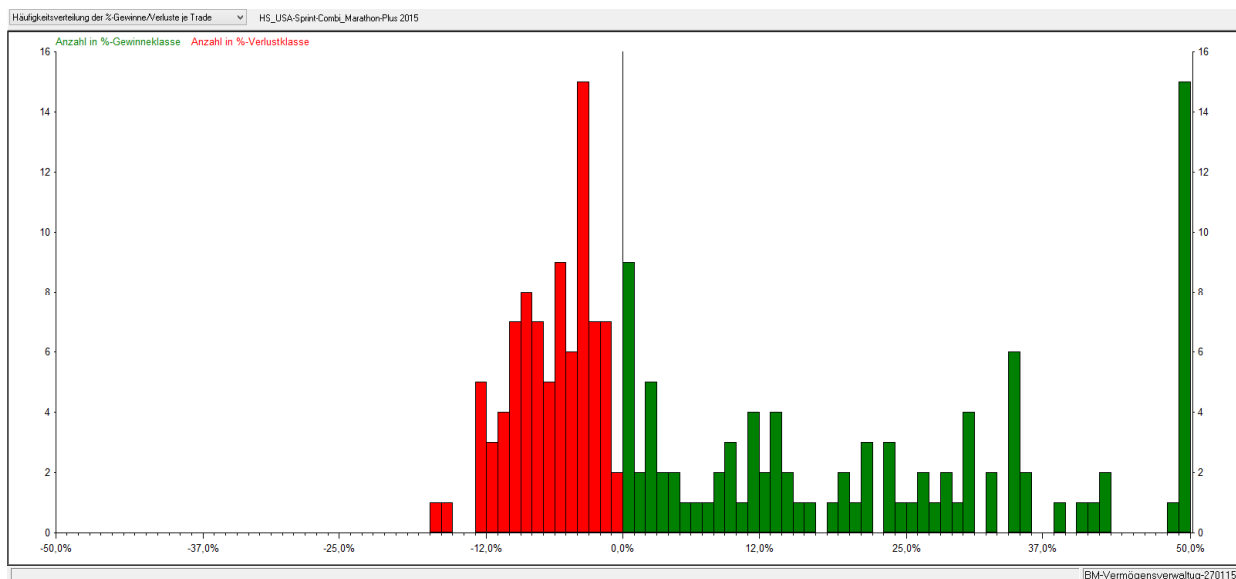
Kombinations-Handelssystem US Sprint + Marathon 2015



Renditematrix HS_USA-Sprint-Combi_Marathon-Plus 2015

Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)												
	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2006	1,51						0,24	0,26	0,24	0,29	-2,70	3,25	
2007	16,04	2,85	-2,70	1,57	1,13	3,63	0,61	-0,31	1,88	5,31	2,79	-4,13	2,72
2008	0,26	-1,28	0,17	-1,50	0,33	0,33	0,34	0,36	0,35	0,38	0,33	0,25	0,23
2009	0,72	0,15	0,10	0,09	0,07	0,06	0,06	0,03	0,03	0,03	0,03	0,03	0,03
2010	16,14	-2,42	6,00	4,37	5,02	-0,34	-6,56	0,25	-4,44	4,44	2,37	5,19	2,10
2011	17,39	-0,66	2,98	2,00	0,18	7,33	-1,54	1,16	-1,67	1,42	0,61	2,11	2,54
2012	17,69	-0,63	0,74	5,11	0,33	4,00	2,00	4,33	-1,81	0,74	-0,03	2,89	-0,99
2013	30,79	0,59	5,76	7,24	0,33	4,09	-1,76	2,21	-2,04	2,74	1,35	3,96	3,10
2014	15,79	-2,98	0,38	-0,18	-0,75	1,23	0,71	-0,46	3,45	5,78	1,31	4,33	2,22
2015	8,12	8,12											
Mittelwert	12,45	0,41	1,68	2,34	0,83	2,54	-0,77	0,87	-0,44	2,34	1,01	1,33	1,69

Verteilung der Trades



Offene Trades zur aktuellen Marktlage

Einstiegsdatum	Stückzahl	Einstiegsbetrag	Ausstiegsbetrag	Gewinn/Verlust	%-Gewinn/Verlust	Transaktionskosten	Strategie	Handelsrichtung	Analysiertes Wertpapier	Umsetzungsart
15.06.2012	3176	88.754,53	209.897,33	120.965,30	136,29	177,51	US-Mar-PL-15	LONG	Fiserv Inc. DL-.01	Direkt
08.05.2013	2064	122.952,17	252.382,92	129.184,85	105,07	245,90	Us-Spr-PL-15	LONG	Sigma-Aldrich Corp. DL 1	Direkt
20.06.2014	1822	120.204,00	159.919,23	39.474,82	32,84	240,41	US-Mar-PL-15	LONG	Pepsico Inc	Direkt
23.06.2014	2035	120.826,25	201.997,82	80.929,91	66,98	241,65	US-Mar-PL-15	LONG	Unitedhealth Group Incorporated	Direkt
11.08.2014	6491	120.306,07	161.466,80	40.920,11	34,01	240,61	US-Mar-PL-15	LONG	Cisco Systems Inc	Direkt
05.09.2014	1315	127.577,24	167.135,05	39.302,65	30,81	255,15	US-Mar-PL-15	LONG	Costco Wholesale DL., 10	Direkt
06.10.2014	3218	145.527,10	201.368,27	55.550,11	38,17	291,05	Us-Spr-PL-15	LONG	Dollar Tree Inc	Direkt
15.10.2014	992	136.174,83	172.638,35	36.191,17	26,58	272,35	Us-Spr-PL-15	LONG	Lockheed Martin Corp	Direkt
16.10.2014	2326	120.655,89	154.404,70	33.507,49	27,77	241,31	US-Mar-PL-15	LONG	C.H. Rob. Worldwide NEW	Direkt
17.10.2014	1757	122.622,10	166.199,32	43.331,98	35,34	245,24	US-Mar-PL-15	LONG	Home Depot Inc.	Direkt
20.10.2014	1286	137.980,96	171.215,05	32.958,12	23,89	275,96	Us-Spr-PL-15	LONG	Berkshire Hathaway Class B	Direkt
20.10.2014	1182	124.767,95	167.912,64	42.895,05	34,38	249,54	US-Mar-PL-15	LONG	Amgen	Direkt
20.10.2014	1129	137.390,54	177.382,73	39.717,41	28,91	274,78	Us-Spr-PL-15	LONG	Fedex Corporation	Direkt
21.10.2014	1595	127.476,89	160.436,23	32.704,38	25,66	254,95	US-Mar-PL-15	LONG	Apple Inc.	Direkt
07.01.2015	3125	161.143,13	174.593,12	13.127,70	8,15	322,29	Us-Spr-PL-15	LONG	Merck Co. DL-.01	Direkt
21.01.2015	4522	165.435,46	169.192,94	3.426,61	2,07	330,87	Us-Spr-PL-15	LONG	Broadcom	Direkt

Source: |BM-Vermögensverwaltung-270115

Kombinations-Handelssystem US Sprint + Marathon 2015

Statistische Kennzahlen

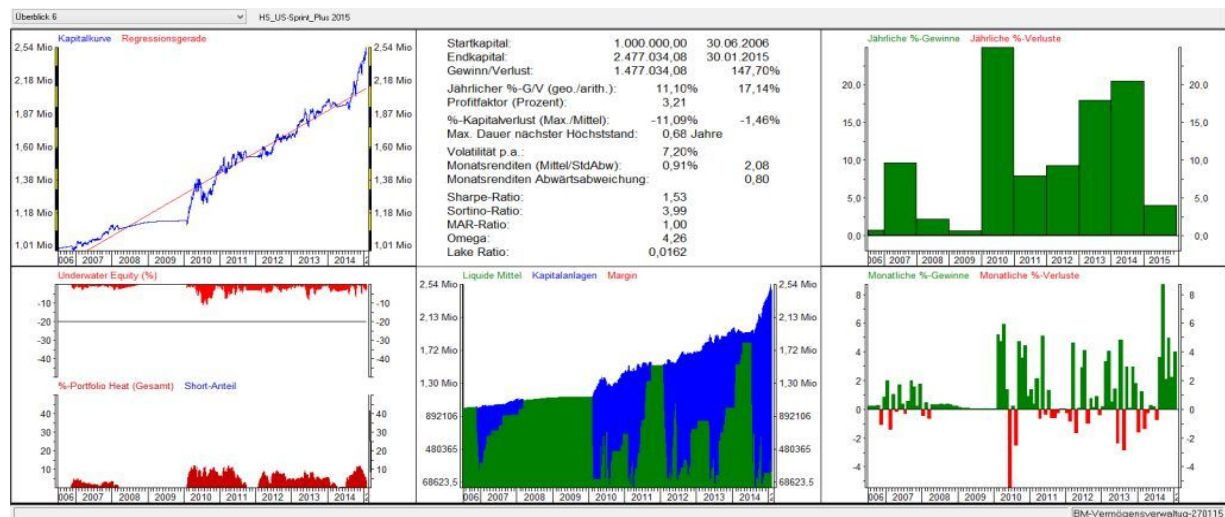
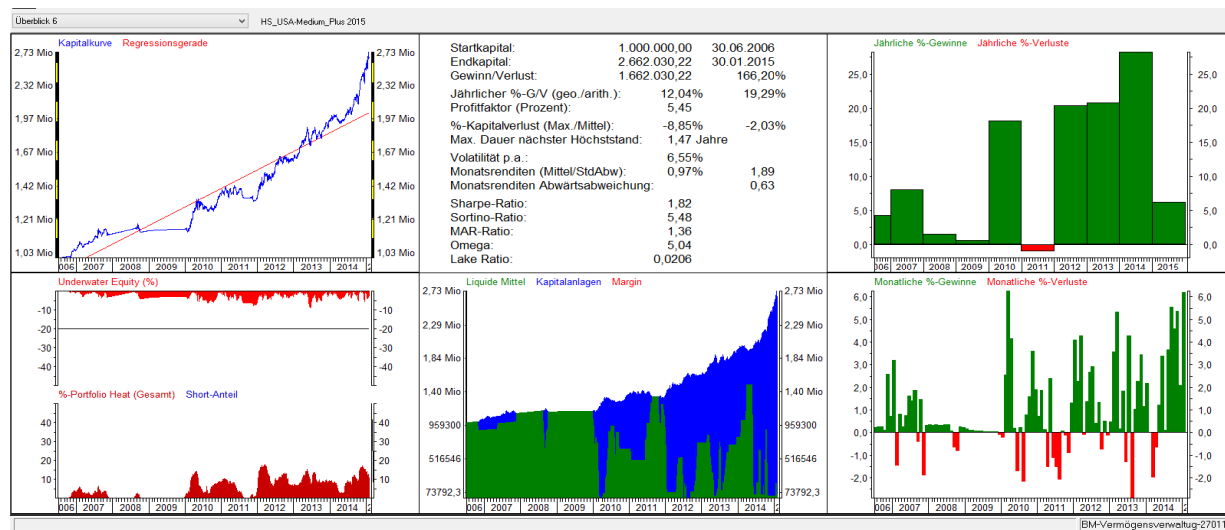
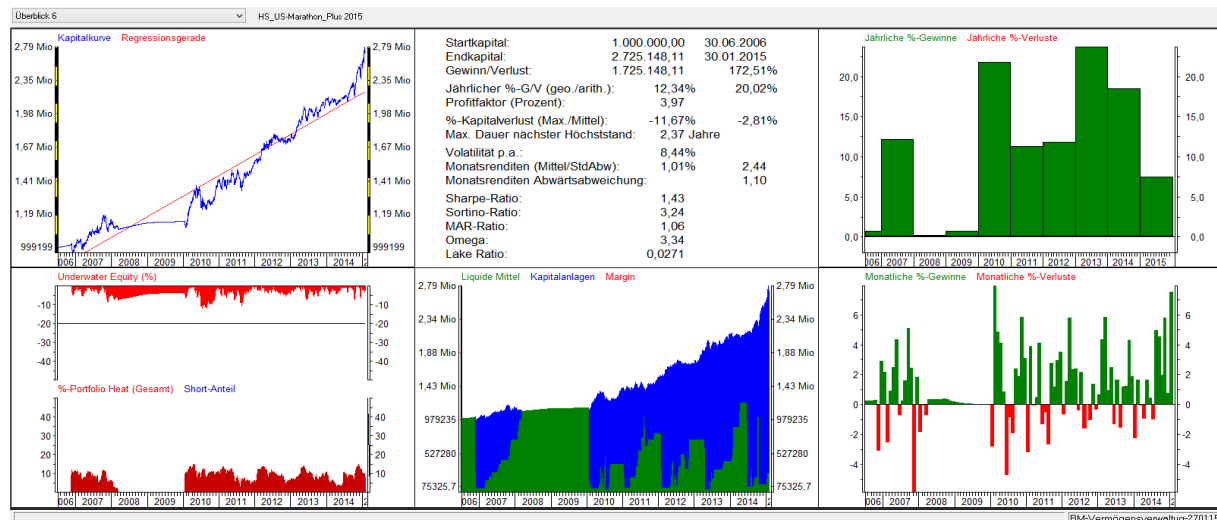
Transaktions-Kennzahlen	HS_USA-Sprint+Combi_MarathonPlus 2015		
	Gesamt	Long	Short
Nettogewinn:	1.249.824,53	1.249.824,53	0,00
Nicht realisierte G.V.:	784.187,58	784.187,58	0,00
Anzahl offene Positionen:	16	16	0
Profitfaktor:	3,84	3,84	0,00
Profitfaktor (Prozent):	4,00	4,00	0,00
Summe der Gewinne:	1.690.004,14	1.690.004,14	0,00
Summe der Verluste:	-440.179,61	-440.179,61	0,00
Durchschnittliches Ergebnis:	7.483,98	7.483,98	0,00
durch. Gewinn / durch. Verlust	4,18	4,18	0,00
Durchschnittlicher Gewinn:	21.125,05	21.125,05	0,00
Größter Gewinn:	115.931,80	115.931,80	0,00
Durchschnittlicher Verlust:	-5.059,54	-5.059,54	0,00
Größter Verlust:	-17.967,62	-17.967,62	0,00
Durchschnittliches %-Ergebnis:	9,89%	9,89%	0,00%
durch. %-Gewinn / durch. %-Verlust	4,35	4,35	0,00
Durchschnittlicher %-Gewinn:	27,53%	27,53%	0,00%
Größter %-Gewinn:	156,17%	156,17%	0,00%
Durchschnittlicher %-Verlust:	-6,33%	-6,33%	0,00%
Größter %-Verlust:	-16,34%	-16,34%	0,00%
Trefferquote:	47,90%	47,90%	0,00%
Anzahl:	167	167	0
Anzahl im Gewinn:	80	80	0
Anzahl im Verlust:	87	87	0
Max. Anzahl Gewinner in Folge:	11	11	0
Max. Anzahl Verlierer in Folge:	12	12	0
Durchschnittliche Dauer (Tage):	107	107	0
Durch. Dauer bei Gewinnern (Tage):	176	176	0
Durch. Dauer bei Verlierern (Tage):	44	44	0
Maximale Dauer bei Gewinnern:	691	691	0
Maximale Dauer bei Verlierern:	313	313	0
Nicht ausgeführt (Liquiditätsmangel):	0	0	0
Nicht ausgeführt (Mindestpositionsgröße):	0	0	0

BM-Vermögensverwaltung-270115

Die echte Trefferquote liegt bei ca. 50 %, weil in den 16 oben offenen Trades die überwiegende Mehrheit einen Gewinner liefern wird.

Handelssystem Kennzahlen der USA-Handelssysteme einzeln betrachtet

Methode hier: Minimaler Max-Drawdown mit optimaler Rendite. Die alternative wäre dazu Maximale Rendite bei leicht erhöhtem Drawdown. Wir verwenden dabei nur unterschiedliches Money-Management. Es wird niemals Fitting an Charts vorgenommen.



Schnellübersicht aller Kennzahlen:

Performance - Privatanleger Stichtag = 30.1.2015	USA-Sprint US-Aktien	USA-Medium US-Aktien	USA-Marathon US-Aktien	Kombination USA-Sprint+Marathon	DOW-Index Buy and Hold
Startkapital 1.7.2006 in €	1.000.000 €	1.000.000 €	1.000.000 €	1.000.000 €	1.000.000 €
Endkapital €	2.477.034 €	2.662.030 €	2.725.148 €	3.076.945 €	1.866.972 €
Gewinn €	1.477.034 €	1.662.030 €	1.725.148 €	2.076.945 €	866.972 €
Gewinn %	147,70%	166,20%	172,51%	207,70%	86,70%
Offene Positionen	15	16	14	16	1
Anlagedauer Jahre	8,62	8,62	8,62	8,62	8,62
Maximale Positionsanzahl	18	18	18	10+9	1
Tradezahl	186	120	100	167	1
Trefferquote	43,0%	45,8%	57,0%	47,9%	
Gewinn-/Verlustverhältnis	4,04	6,13	2,91	4,18	
Profitfaktor	3,05	5,19	3,97	3,85	
Drawdown % Maximum	11,09%	8,85%	11,67%	13,93%	48,83%
Mittel-Drawdown	1,46%	2,03%	2,81%	2,16%	12,45%
Geo.-Rendite %	11,10%	12,04%	12,34%	13,93%	7,52
Arith.-Rendite %	17,14%	19,29%	20,02%	24,11%	10,06
Rendite 2014	20,45%	28,18%	18,42%	15,77%	25,08
Rendite 2015 YTD	4,00%	6,21%	7,52%	6,51%	2,5

Anmerkung:

Der Captimizer berechnet die Trefferquote nur für die geschlossenen Trades. Rechnet man die offenen Trades dazu, die nicht mehr unter Break-Even schließen werden, dann liegt die Trefferquote über 50 % bei 3 von 4 Handelssystemen. Das 4. Handelssystem (Sprint) liegt knapp unter 50 %.

Jedoch entscheidend ist das Gewinn/Verlustverhältnis kombiniert mit der Trefferquote.