

DerBoersenMathematiker.de



DerBoersenMathematiker.de

**Dipl.-Math.
Rainer Schwindt**

Handelssystem Deutschland Schnellübersicht 2015 und ETF World + Fonds Börsenmathematikers

Designed für Captimizer 9.X

Information zur Version Basic und Pro

Unternehmensberatung Schwindt

Copyright © 2006 - 2014 Unternehmensberatung Rainer Schwindt "Der BörsenMathematiker"

Unter dem Titel:

Handelssystem Deutschland Schnellübersicht

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

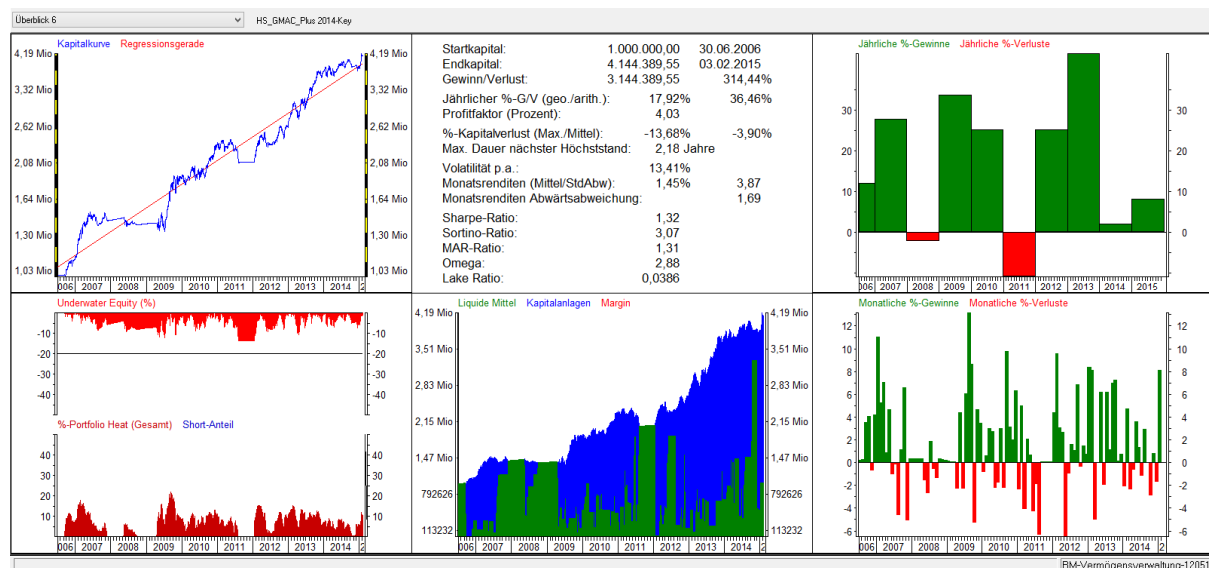
Handelssystem Schnellübersicht: Deutschland, World ETF und Fonds Welt

Handelssystem Plus 2015 - Captimizer Kennzahlen:

Performance-Privat Stichtag = 2.2.2015	GMAC 2015 Plus	Hannover 2015Plus	Frankfurt 2015 Plus	World ETF LR Plus	Fonds Universal	DAX-Index Buy and Hold
Startkapital 1.7.2006 in €	1.000.000 €	1.000.000 €	1.000.000 €	1.000.000 €	1.000.000 €	1.000.000 €
Endkapital €	4.144.389 €	5.198.926 €	4.177.144 €	2.486.421 €	2.622.949 €	1.885.237 €
Gewinn €	3.144.389 €	4.198.926 €	3.177.144 €	1.486.421 €	1.622.949 €	885.237 €
Gewinn %	314,44%	419,89%	317,71%	148,64%	162,29%	88,52%
Offene Positionen	5	6	15	6	8	
Anlagedauer Jahre	8,62	8,62	8,62	8,62	8,62	8,62
Maximale Positionszahl	7	7	8 x 2	12	8	1
Tradezahl	127	84	134	319	114	1
Trefferquote	43,3%	52,4%	54,5%	50,2%	57,5%	
Gewinn-/Verlustverhältnis	4,72	5,31	3,63	2,3	3,2	
Profitfaktor	3,6	5,85	4,34	2,32	4,33	
Drawdown % Maximum	13,68%	17,10%	22,82%	8,37%	19,96%	54,57%
Mittel-Drawdown	3,90%	5,04%	6,66%	1,57%	6,31%	14,96%
Geo.-Rendite %	17,92%	21,07%	18,03%	11,14%	11,83%	7,62
Arith.-Rendite %	36,46%	48,69%	36,84%	17,24%	18,82%	10,25
Rendite 2013	43,81%	29,45%	23,48%	7,67%	19,82%	25,38
Rendite 2014	2,12%	13,73%	3,08%	4,43%	10,20%	2,64
Rendite 2015 YTD	8,14%	8,50%	9,42%	7,97%	5,99%	9,48

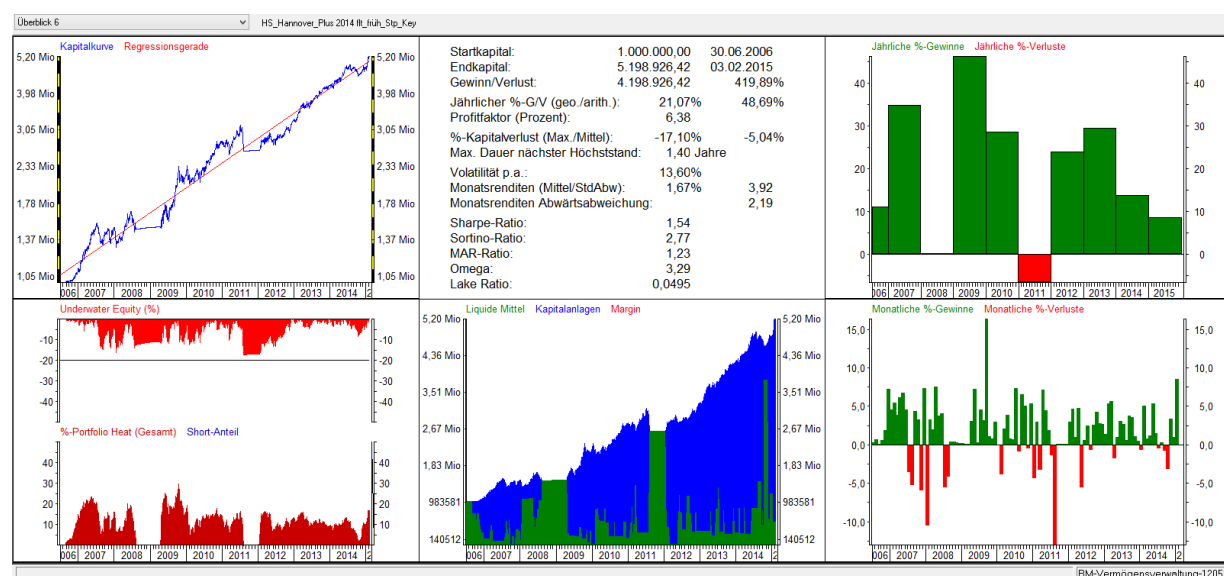
Handelssystem GMAC

160 Aktien aus DAX, MDAX, SDAX, TecDAX.



Handelssystem Hannover:

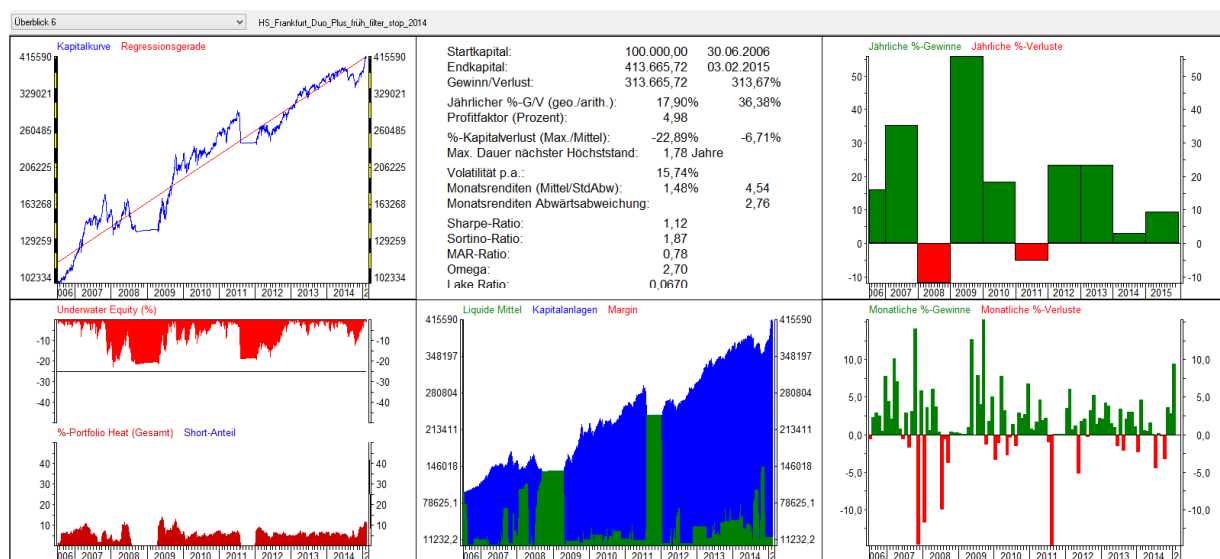
65 fundamental gute Aktien aus DAX, MDAX, SDAX.



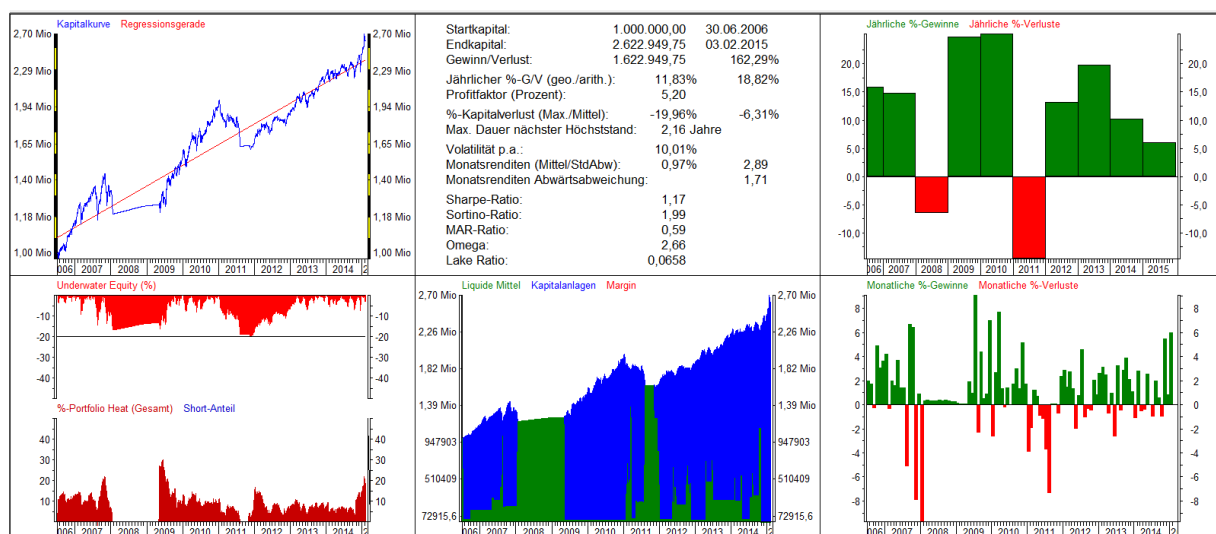
Transaktions-Kennzahlen HS_Hannover_Plus 2014 flt_früh_Stp_Key

	Gesamt	Long
Nettogewinn:	3.238.353,01	3.238.353,01
Nicht realisierte G/V.:	891.994,29	891.994,29
Anzahl offene Positionen:	6	6
Profittfaktor:	5,85	5,85
Profittfaktor (Prozent):	6,38	6,38
Summe der Gewinne:	3.906.567,53	3.906.567,53
Summe der Verluste:	-668.214,52	-668.214,52
Durchschnittliches Ergebnis:	38.551,82	38.551,82
durch. Gewinn / durch. Verlust	5,31	5,31
Durchschnittlicher Gewinn:	88.785,63	88.785,63
Größter Gewinn:	623.360,94	623.360,94
Durchschnittlicher Verlust:	-16.705,36	-16.705,36
Größter Verlust:	-55.015,60	-55.015,60
Durchschnittliches %-Ergebnis:	14,01%	14,01%
durch. %-Gewinn / durch. %-Verlust	5,80	5,80
Durchschnittlicher %-Gewinn:	31,70%	31,70%
Größter %-Gewinn:	163,30%	163,30%
Durchschnittlicher %-Verlust:	-5,46%	-5,46%
Größter %-Verlust:	-14,30%	-14,30%
Trefferquote:	52,38%	52,38%
Anzahl:	84	84
Anzahl im Gewinn:	44	44
Anzahl im Verlust:	40	40
Max. Anzahl Gewinner in Folge:	6	6
Max. Anzahl Verlierer in Folge:	8	8
Durchschnittliche Dauer (Tage):	112	112
Durch. Dauer bei Gewinnern (Tage):	190	190
Durch. Dauer bei Verlierern (Tage):	27	27
Maximale Dauer bei Gewinnern:	689	689
Maximale Dauer bei Verlierern:	113	113
Nicht ausgeführt (Liquiditätsmangel):	0	0
Nicht ausgeführt (Mindestpositionsgröße):	0	0

Handelssystem Frankfurt: 65 fundamental gute Aktien aus DAX, MDAX, SDAX.

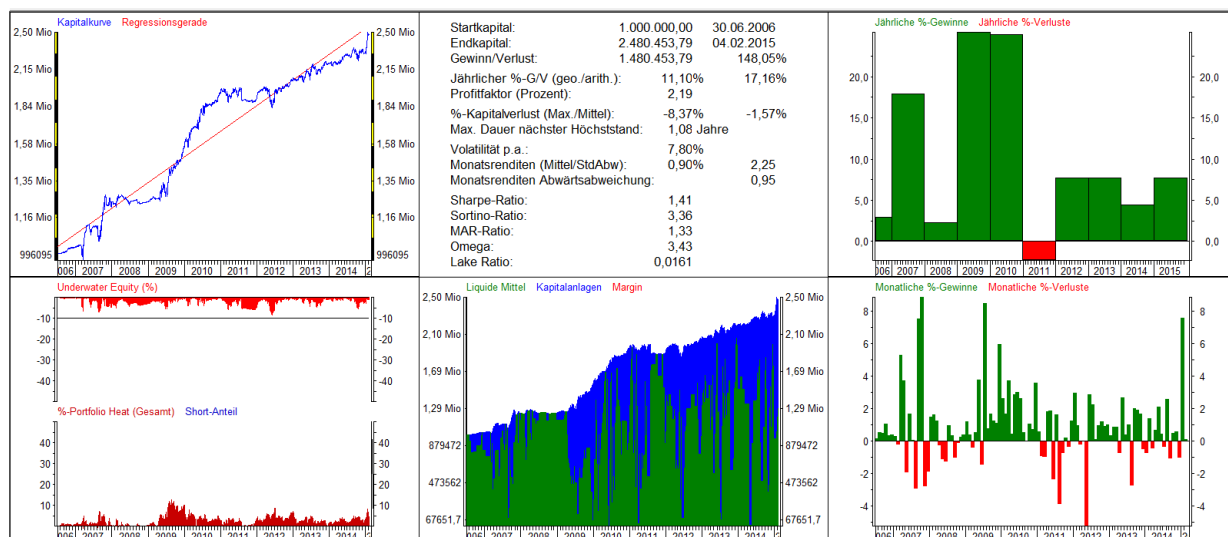


Handelssystem Fonds Plus 2015 – 266 Fonds aus der Welt Fondliste:



Handelssystem World ETF LR Plus 2015:

Kombination von 4 mathematischen Strategien mit einer Setzliste, die sich aus ca. 50 – 60 Welt-ETFs zusammensetzt.



Wie kann man aus den Kennzahlen der Einzelhandelssysteme prädiktive Abschätzungen der Renditeerwartung für ein beliebiges Kombinations-Handelssystem berechnen?

1. Sie legen fest wieviel %-Gesamtkapital jeweils auf Handelssystem: Hannover, GMAC, Frankfurt (CH), Fonds Universal und Short-DAX verteilt wird.

GMAC = 22 %, Hannover = 18 %, Frankfurt (CH) = 10 %, Fonds = 25 %, Short = 8 %, Renten und Geldmarkt = 15 %, Floating-Reserve = 3 %

Aus der Tabelle auf Seite 3 dieses PDF erhalten Sie die folgenden Werte:

Sie nehmen die arithmetische Gesamtrendite aus dem Zeitraum 1.7.2006 bis 2.2.2015 und den Maximum Drawdown.

Handelssystem	arithmetische Rendite %	Maximum Drawdown %
Hannover	419 %	17,1 %
GMAC	314 %	13,7 %
Frankfurt (CH)	317 %	22,8 %
Fonds	162 %	20,0 %

18 % Gesamtkapital entsprechen 0,18 Gewicht im Kombinations - Handelssystem:

Für Hannover $0,18 \times 337 \% = 75,42 \%$ Gewinnanteil

Für Hannover $0,18 \times 17,1 \% = 3,08 \%$ Max-Drawdown-Anteil

Das macht man für alle HS genauso. Danach bildet man die Summe aller Gewinnanteile und die Summe aller Max-Drawdown-Anteile.

So erhält man die wichtige Abschätzung dafür, was die Kombination ergeben sollte. Das ganze kann man in eine Excel-Tabelle bringen und kann dann mit den Gewichten spielen.

Zu Lieferumfang meiner Multi-Asset-Systeme gehört eine Excel-Tabelle die alles finanzmathematisch präziser umsetzt und Risiko-Kennzahlen enthält und natürlich nicht nur die %-Gesamtkapital / %-Max-Drawdown variiert sondern auch die Positionszahl der Einzelsysteme untersuchen kann.

So ergibt sich, dass ein Kombinations-Handelssystem mehr erzielt als die Summe der Teilsysteme.

Regel:

Um Rendite zu optimieren, muss man die besten Systeme übergewichten, und wenn Risikominderung wichtiger ist werden die defensiven Komponenten übergewichtet.

Das Optimum für Sie ergibt sich aus der ausgewogenen Balance beider Faktoren.

Beispiel:

2er-Kombi Hannover (45 %) + GMAC (55 %).