

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 |
| Historische Vorstellung der New Technology Serie 2011/12 | 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

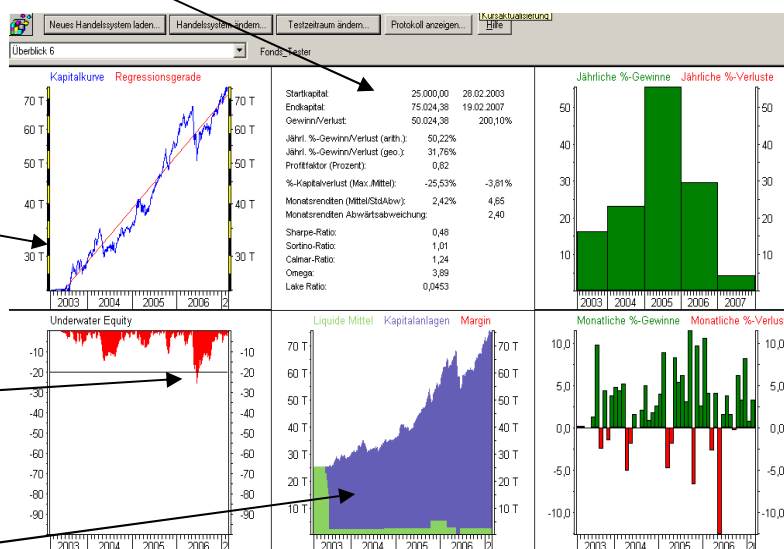
Auf den folgenden Seiten werden Sie immer wieder die unten stehenden Analysebilder aus dem Captimizer sehen, den sog. Simulator. Wir erläutern Ihnen jetzt in Kurzform, was Ihnen die Börsenstrategie an Ertrag eingebracht hat. Das **zentrale Quadrat** ist die **Kurz-Statistik** (siehe Erklärung):

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 GMAC 2013 und das World ETF Low Risk.

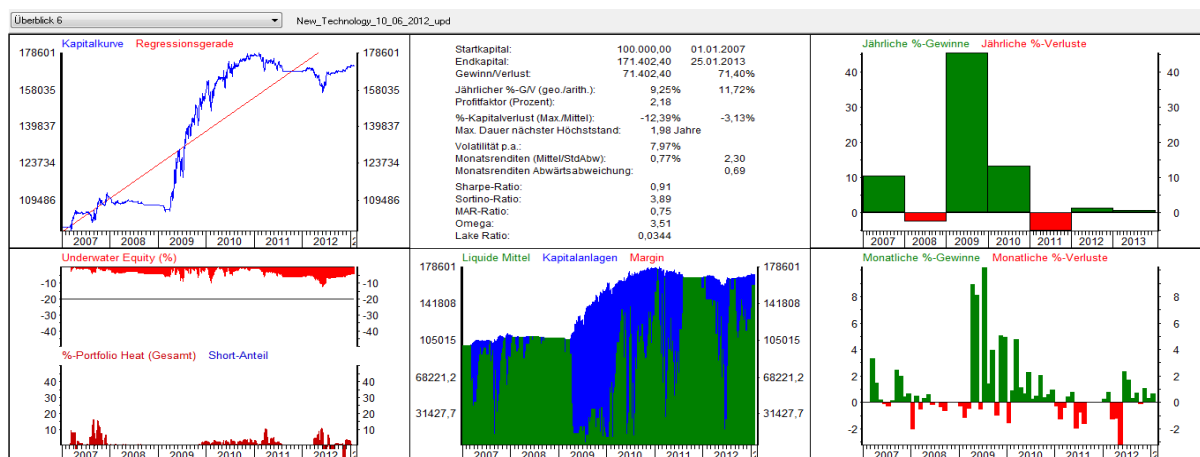
Welche Märkte handelt das neue Handelssystem Germany Master All Caps 2013?

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.

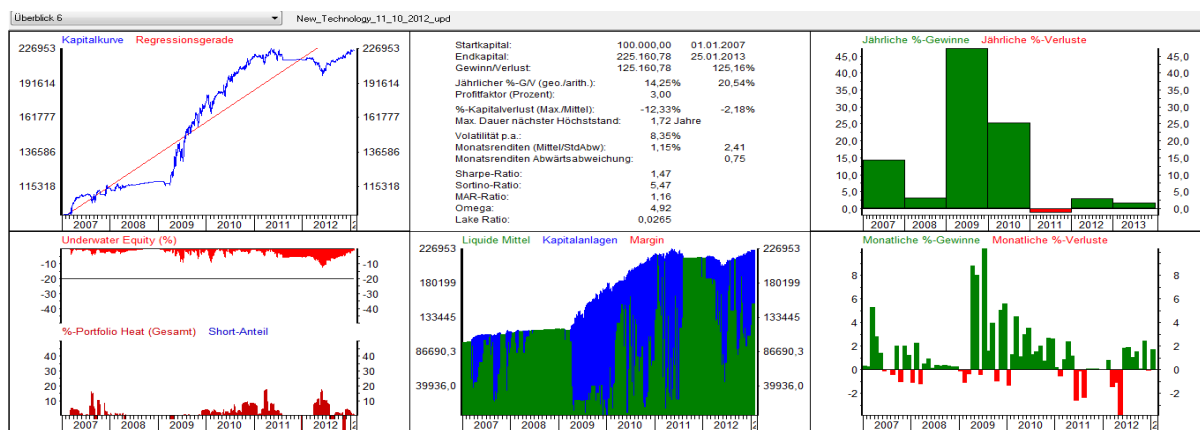
Unser neues „altes“ Motto: Kaufen und solange Halten, bis das Verkaufssignal kommt! Not-Stopps brauchen Sie nicht, weil die modernste Differenzialtechnologie das Verkaufssignal generiert.

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

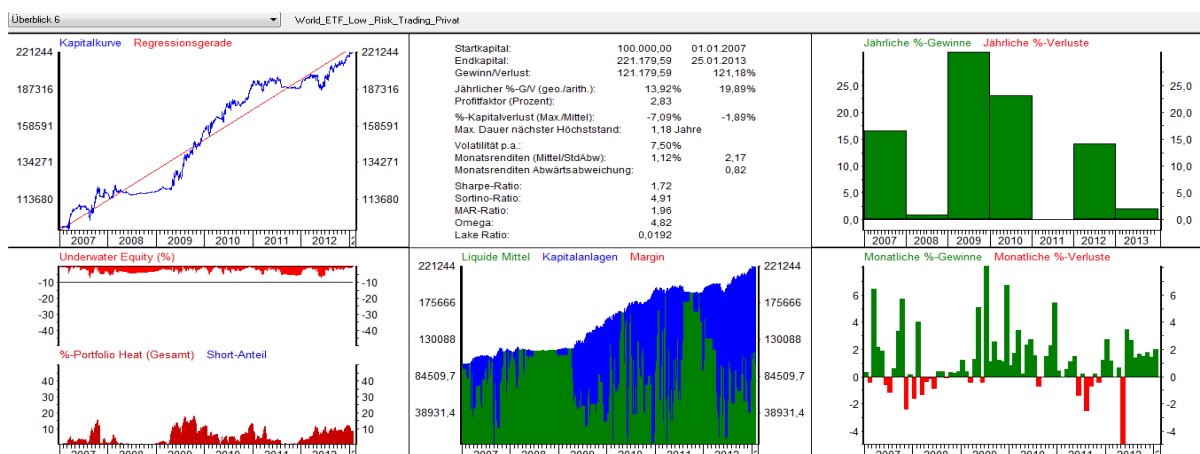
Historische Vorstellung der New Technology Serie 2011/12



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

Handelssystem verändern

Bezeichnung des Handelssystems: HS_Germany_Master_all_Cap_2013_F Autor des Handelssystems: Alle_Buchsysteme

Strategien des Handelssystems: Strategie deaktivieren
Germany_Master_all_Cap_2013_privat

Parameter für die Simulation des Handelssystems

Startkapital: 1000000,00
Währungs-ISO-Code: EUR
Startdatum: 01.07.2006

Zinsreihe für liquide Mittel: [Auswählen...] [Aus]
[EONIA Geldmarktzins (EU0009659945, Composite)]

Fester Zinssatz (%) für liquide Mittel: 0,00
Zinsabschlag (%) p.a.: 0,00
Zinstage: 360
Zinsauszahlung: Täglich
Zinsloser Anteil (%): 0,00

Zinssatz (%) für risikofreies Kapital: 1,50
Mindestrendite (%): 0,00
Max. zulässiger Kapitalverlust (%): 20,00
Max. zulässiger Investitionsgrad (%): 100,00

Neue Strategie hinzufügen Verändern Löschen
Strategie auswählen und hinzufügen... Strategie extern speichern

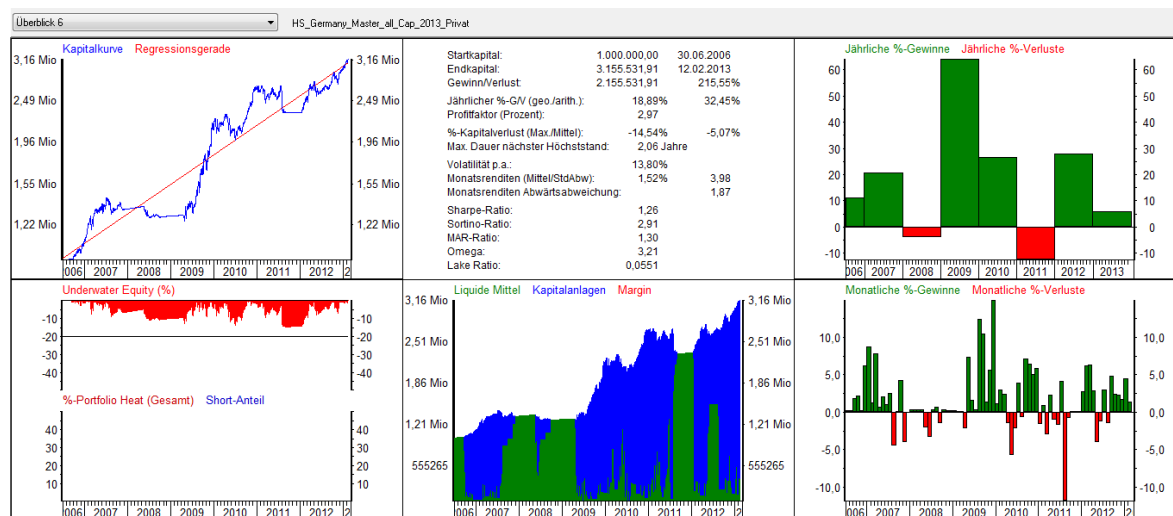
Beschreibung des Handelssystems

OK Abbruch Hilfe

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 | | | | | | | | | | | | |
| 2007 | 20,57 | 8,72 | 1,19 | 7,82 | 0,71 | 2,04 | 0,98 | 0,24 | 0,26 | 1,80 | 2,16 | 0,22 | 6,15 |
| 2008 | -3,92 | 0,35 | 0,32 | 0,35 | 0,33 | -2,06 | -3,38 | 0,37 | -4,56 | 0,04 | 4,26 | -4,01 | -0,05 |
| 2009 | 63,88 | 0,15 | 0,10 | 0,09 | -2,19 | 7,30 | 1,63 | 0,28 | 0,64 | -1,57 | 0,27 | 0,25 | 0,23 |
| 2010 | 26,57 | 1,12 | 2,96 | 2,37 | -1,48 | -5,81 | -2,22 | 3,88 | 12,41 | 10,40 | 1,40 | 5,61 | 14,88 |
| 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.

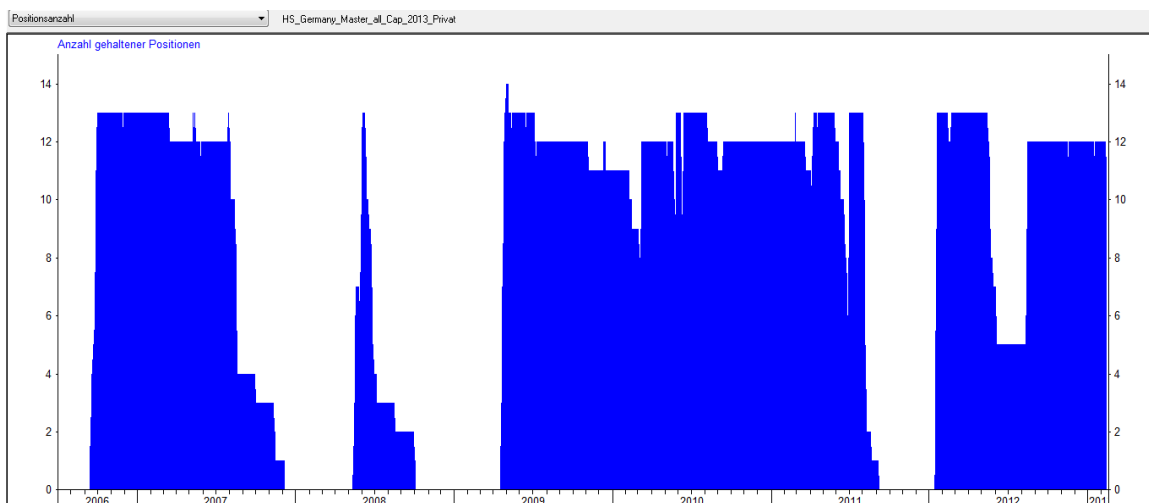
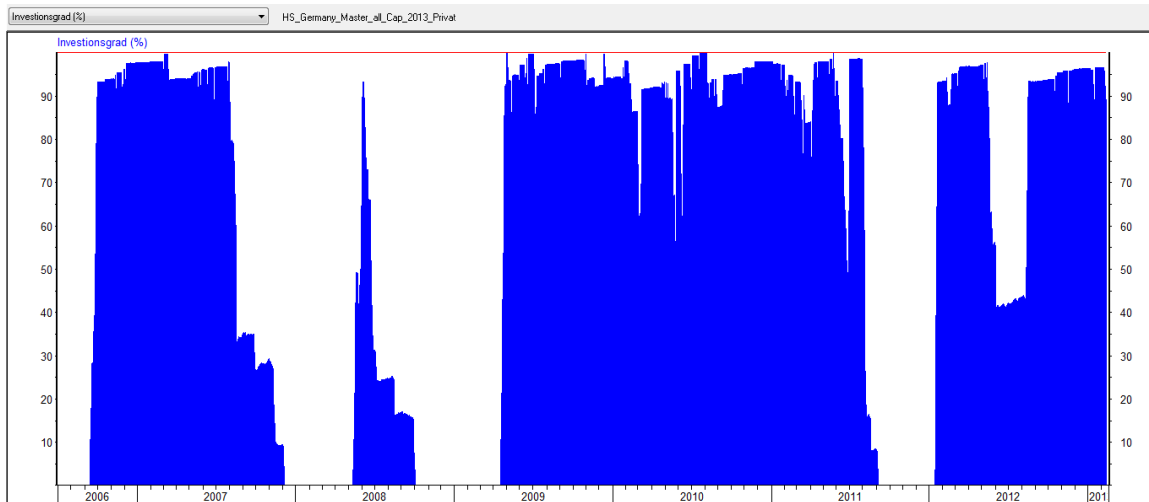
Deshalb muss man $197 + 11 = 208$ und $72 + 9 = 81$ rechnen, um die aktuelle reale Trefferquote zu erhalten: Also 81 geteilt durch $208 = 38,94\%$

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

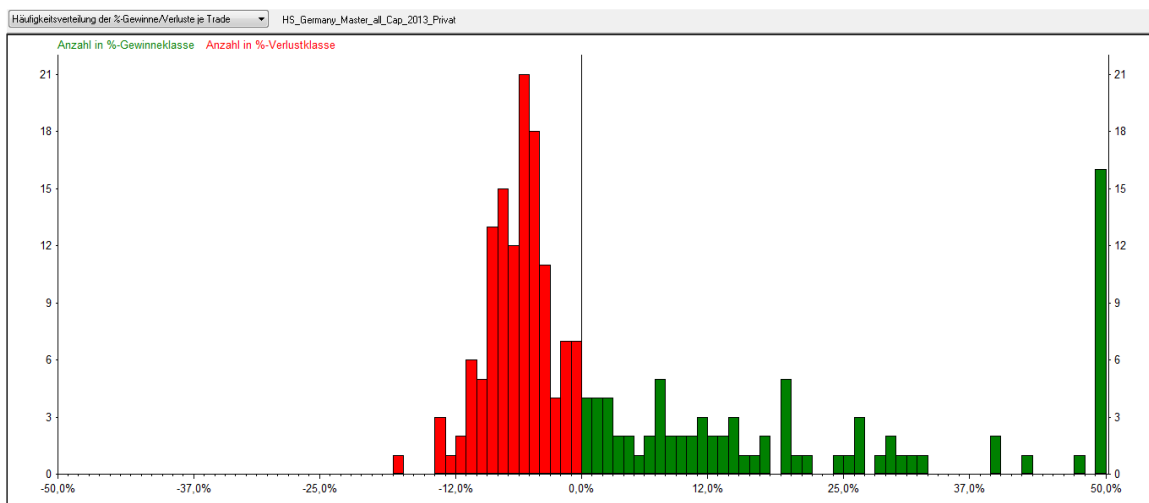
Setzen Sie bitte die wichtigen Kennzahlen in die Faustformeln von Kelly-Thorpe-Schwindt ein, und Sie werden sehen, dass es ein Top-System ist.

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:

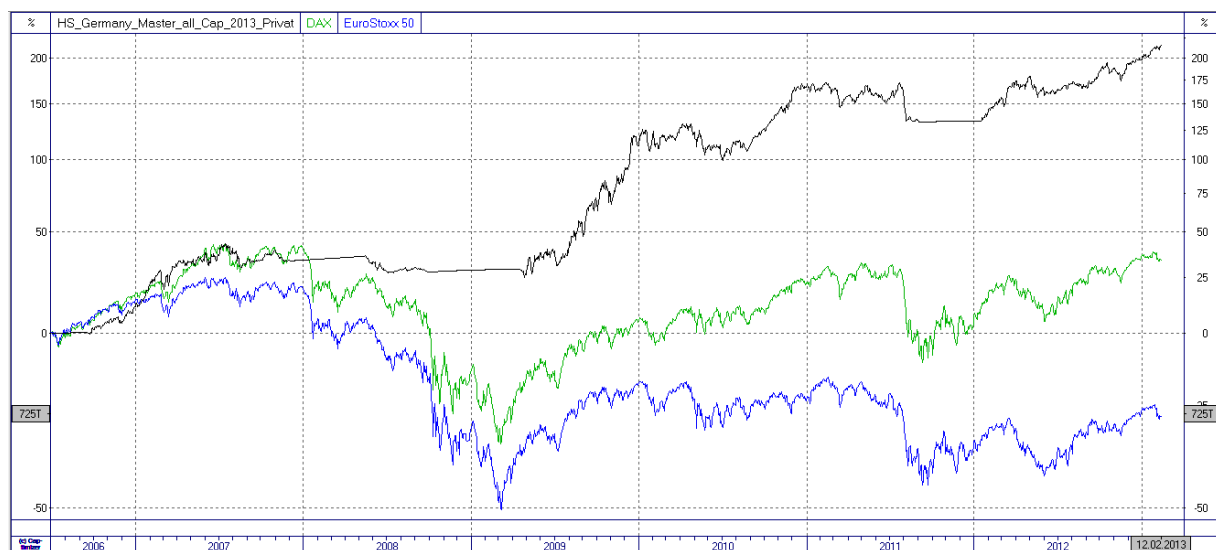


Wirkliche negative Singularitäten (-20 % und mehr) kommen nur sehr, sehr selten vor.

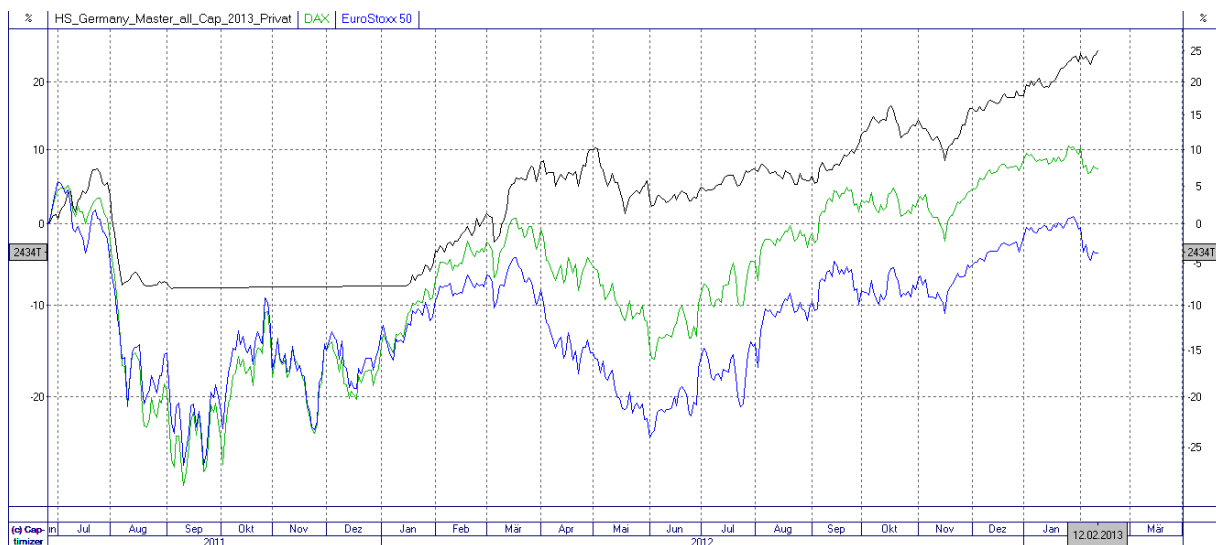
Offene Positionen:

| 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:



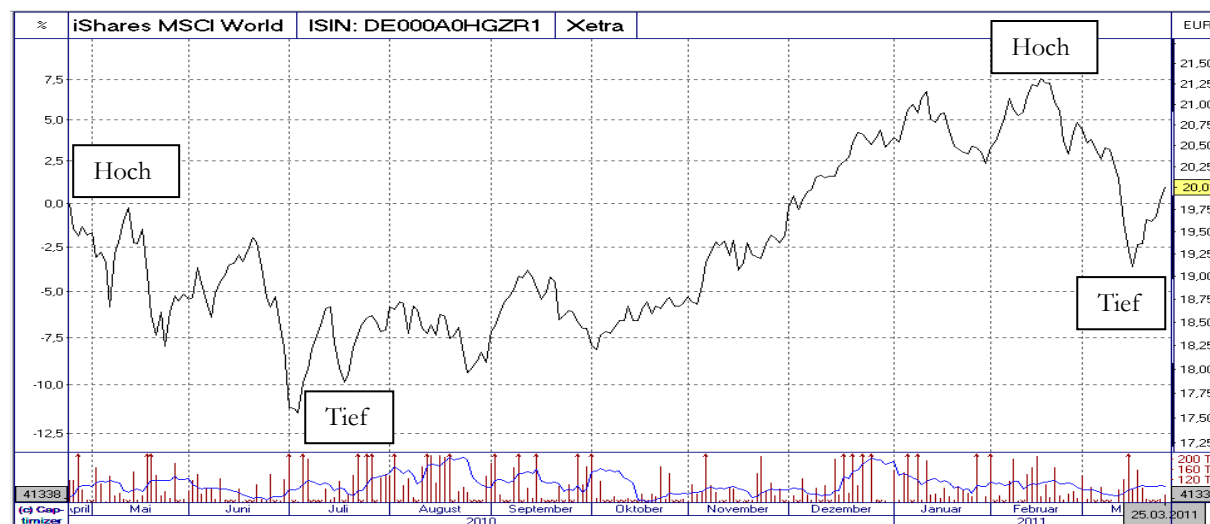
Leistungsvergleich mit DAX und EUROStoxx 50 – über die aktuelle Krise betrachtet:



Bemerkungen zum Benchmarking

Analyse eines mittelfristigen Trends der Weltaktienmärkte

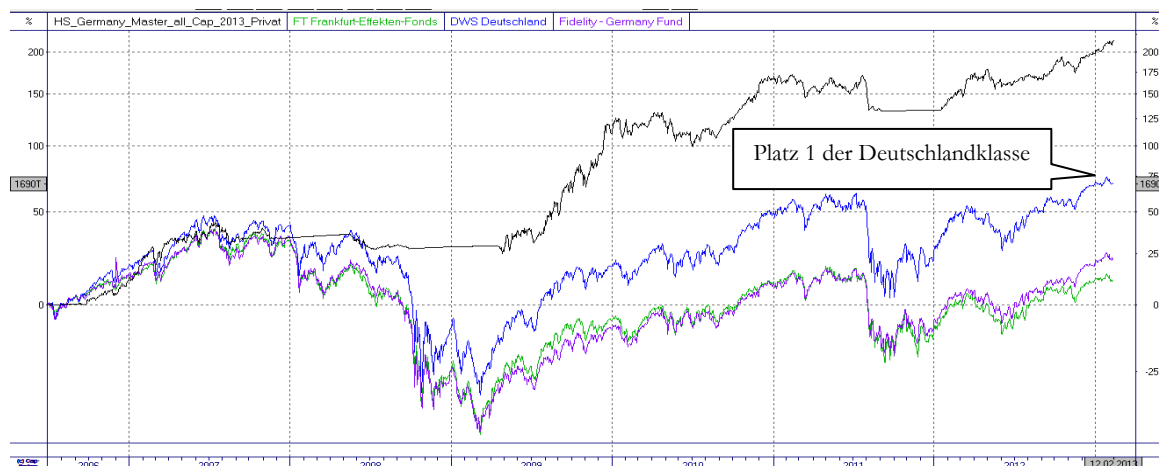
Sie sehen unten eine Auswertungsmethode für Fonds in Aktienmärkten, eine so genannte **Hoch-Tief-Hoch-Tief-Analyse**. Dazu verwenden wir einen Normpunkt im April 2010 = den Hochpunkt des **MSCI World in Euro** berechnet. Damit erhalten wir einen objektiven Leistungsmaßstab für den späteren Vergleich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



Warum ist das so?

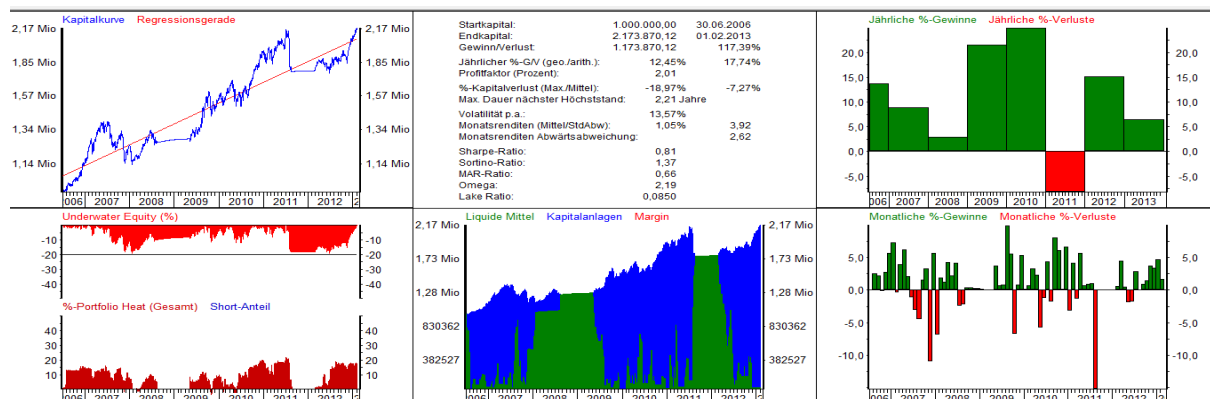
In der historischen Dow-Theorie unterscheidet man langfristige, mittelfristige und kurzfristige Trends. Wir sehen, dass Hoch im April 2010 liegt tiefer als das Hoch im Februar 2011. Das Tief im Juli 2010 liegt tiefer als das Tief im März 2011. Nach Charles Dow ist das ein mittelfristig steigender Sekundärtrend (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 erholungsstärkten Fonds der Deutschlandklasse:

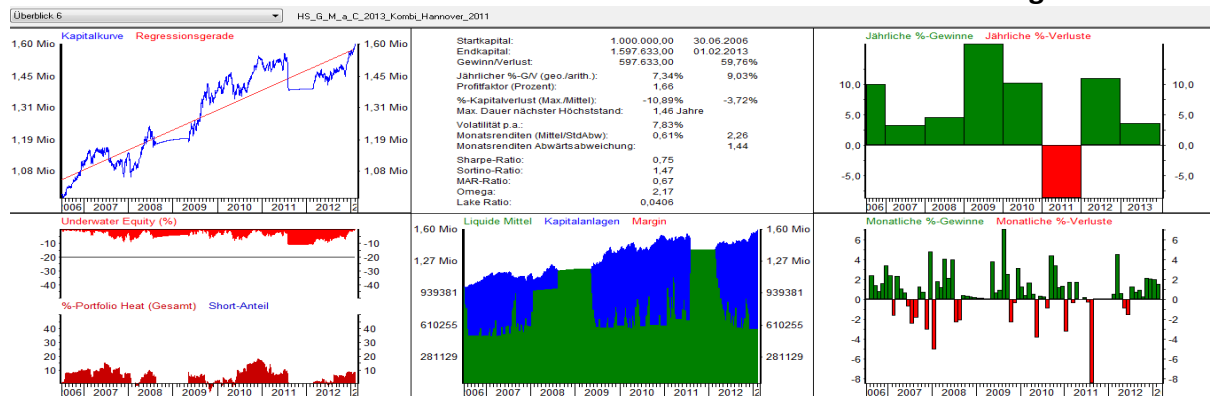


Anwendung in Kombinationshandelssystemen für Aktien Zunächst Vergleich HS GMAC mit HS Hannover

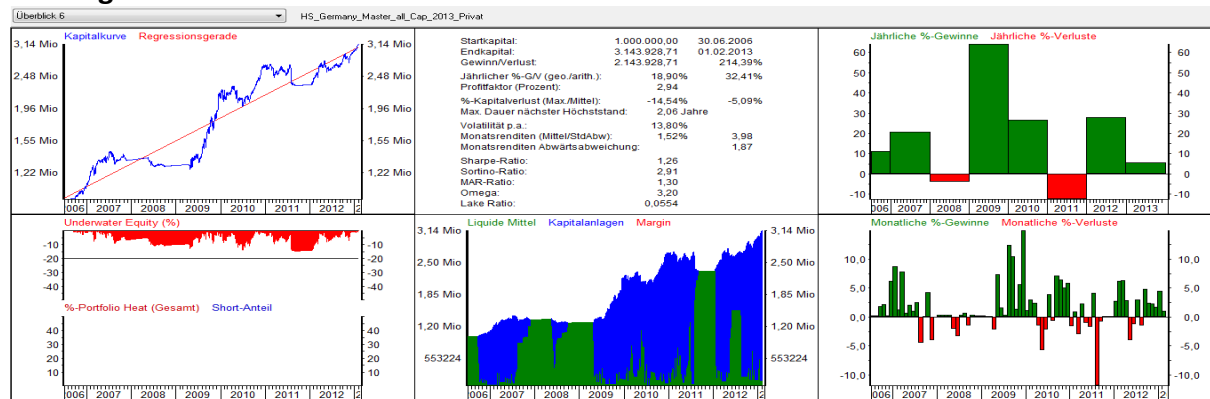
Ihr HS Hannover 2011 mit 14 Positionen voll investiert:



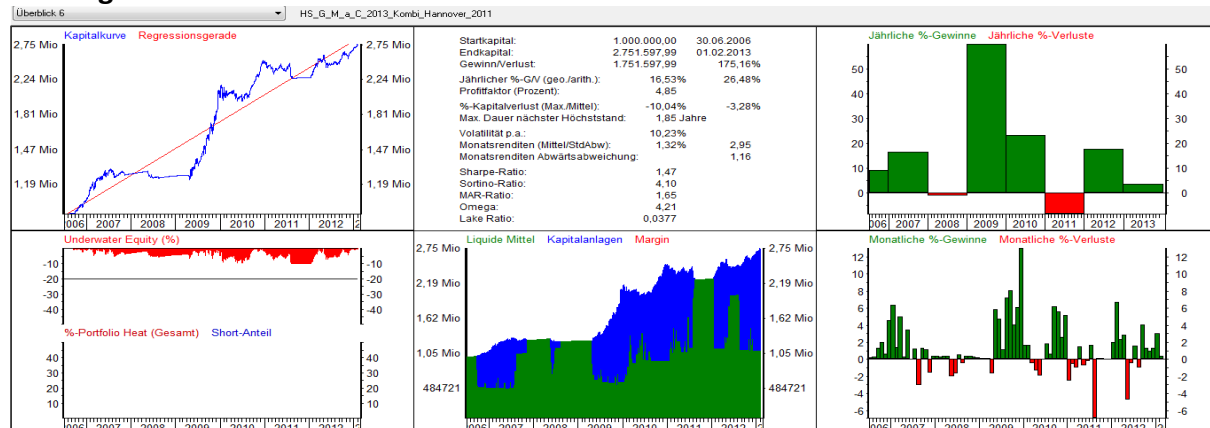
Ihr HS Hannover 2011 mit den 7 ersten Positionen 50 % Nominal-Investitionsgrad:



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

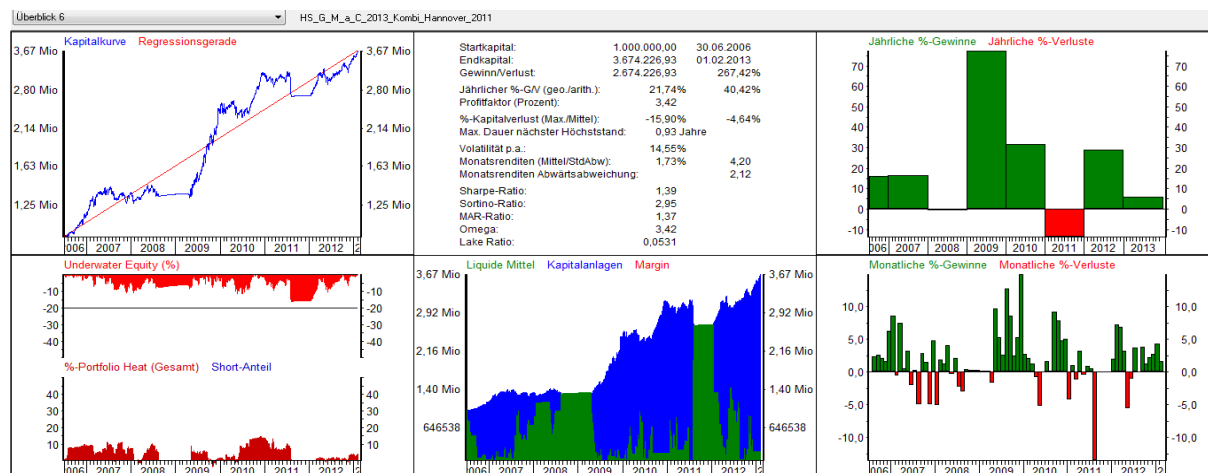


Im Vergleich das HS GMAC 2013 mit 7 Positionen 50 % investiert:

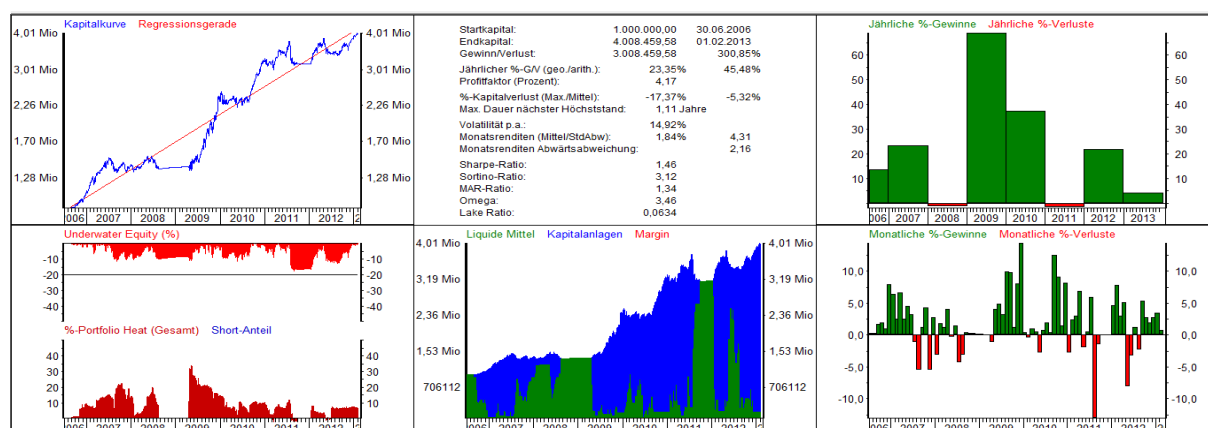


Kombination HS GMAC mit HS Hannover

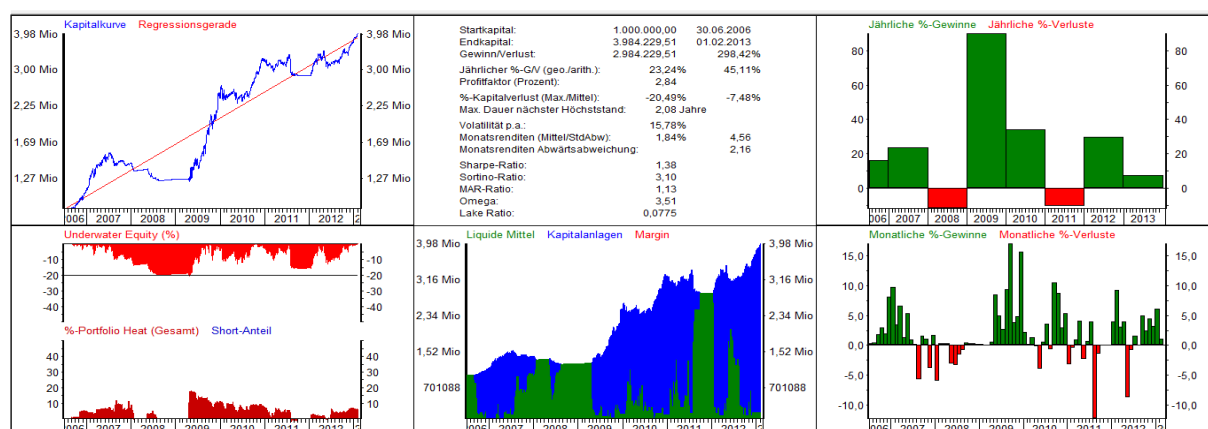
Nun kombiniere ich als erstes Ihr HS Hannover 2011 mit dem HS GMAC 2013 mit nominal 7 + 7 Positionen. Wir sehen als Ergebnis den wunderschönen Markowitz-Effekt gestreuter phasenverschobener Handelssysteme:



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.