

DerBoersenMathematiker.de



DerBoersenMathematiker.de

**Dipl.-Math.
Rainer Schwindt**

Premium-Handelssystem

World ETF Low Risk Professional

+

Turbo-Tools + Research-Tools

**ETF-Handelssystem für liquide ETFs aller Art an den Börsen
Frankfurt, Paris und Mailand**

Eine Weiterentwicklung der Handelssysteme New York 2007 und New Technology 2011/12

Handbuch zum Handelssystem

Unternehmensberatung Schwindt

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

Premium-Handelssystem World ETF Low Risk Professional

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

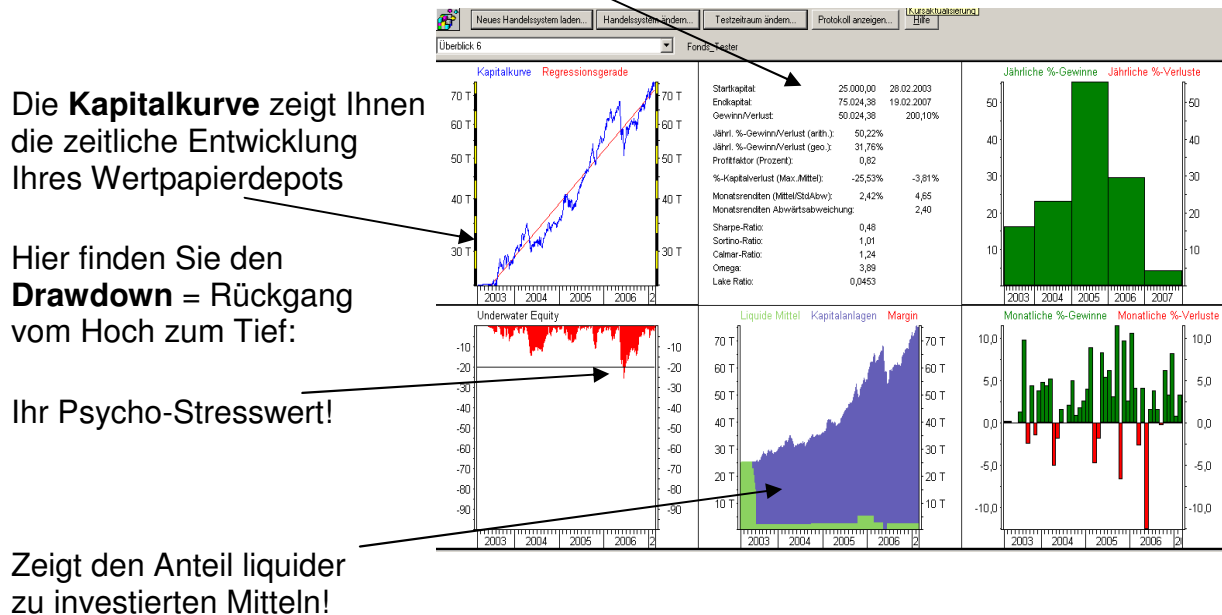
Homepage: www.DerBoersenMathematiker.de
 E-Mail: Schwindt@DerBoersenMathematiker.de

Inhaltsverzeichnis

Legende	3
Welche Datenabos für Captimizer benötigen Sie mindestens?	4
Historische Betrachtung	5
Historische Vorstellung der New Technology Serie 2011/12	6
So sahen die im NT-System verwendeten Strategien aus	7
Vom HS New Technology zum World ETF Low Risk 2013	8
Vorstellung Handelssystem World ETF Low Risk für Privatanleger	9
Typische Trades der 4 Strategien	12
Bemerkungen zum Benchmarking	16
Technischer Anhang	18
Beispiel für verwendbare ETFs	19
Wohin speichert man die gelieferte Software?	20

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):



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 **Ertrag** 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!

Welche Datenabos für Captimizer benötigen Sie mindestens?

Das neue Abo Datenservice-Basis enthält alles, was Sie benötigen. Indizes, ETFs, Währungen und sonstiges.

Es könnten auch ausgewählte Hebelpapiere in meinen Systemen verwendet werden. Ich selbst zeige Ihnen ausschließlich ungehebelte Systeme. Wie Sie sehen, kommt es ohne Hebeltricks zu exorbitanten Renditen. Und das mit ganz langweiligen Papieren. Das liegt wie Paracelsus schon sagte, einzig an der Dosis, die man einsetzt. Was viele nicht glauben wollen: Häufig erzeugt weniger Einsatz mehr Rendite. Das liegt an der Nichtlinearität des Börsenkursraumes wie es Mathematiker formulieren!

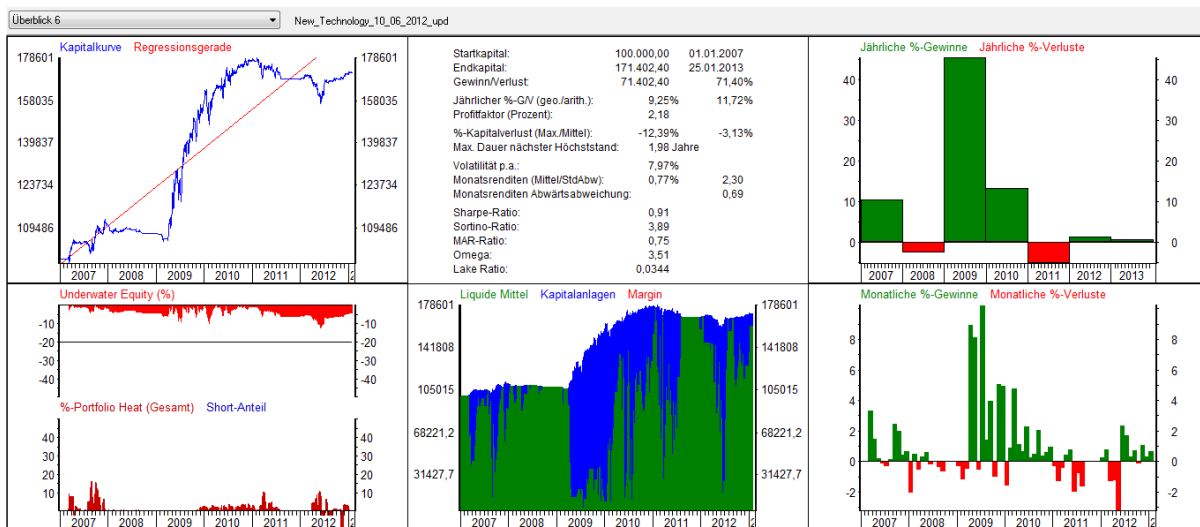
Bei der klassischen Trendfolge wird der Kern der Bewegung eines primären Trends ausgeschöpft. Weicht man davon ab und versucht die Spitzen des Marktes besser abzuschöpfen, verschlechtert man im Allgemeinen die Performance gegenüber dem unveränderten System, das die Kerntrends handelt!

Handelssystementwickler die solches versuchen, scheitern immer wieder an psychologischen Fallen und verletzen das Gesetz Gewinne laufen zu lassen und Verluste zu begrenzen.

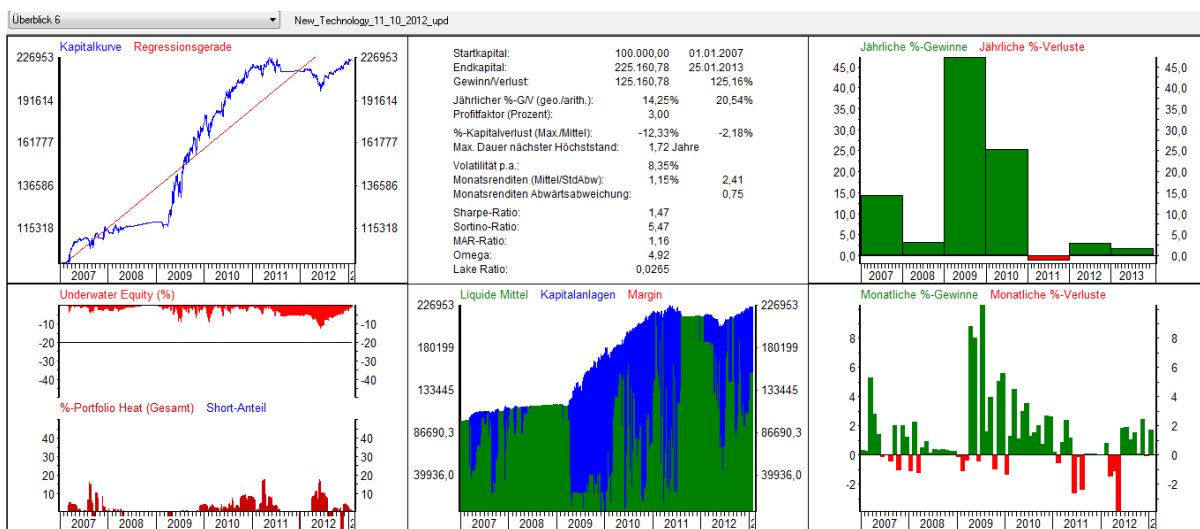
Die unsägliche Mär vom reinen Zufall an der Börse widerlegt man durch Folgendes: Man unterscheidet zwischen einem reinen Zufallssignal und einem zufällig gestörten Signal. Ein zufällig gestörtes Mess-Signal bekommt man in den Griff. Das macht die Heizung im Keller Ihres Hauses auch. Die Ölheizung weiß z. B. nicht, wann die Kälte aus Russland kommt, aber Sie schafft es, dass Sie nicht frieren – es sei denn, Sie haben vergessen, Öl zu bestellen.

Ein Handelssystem vom BörsenMathematiker bestellt rechtzeitig „das Öl der Börse“. Es denkt an alle Nebenbedingungen.

Historische Vorstellung der New Technology Serie 2011/12



Dieses NT-Update im Bild unten beruht nicht auf Verbesserung der Formeln, sondern resultiert einzig und allein aus einer Verbesserung des Money-Managements, wie ich es in meinen Seminaren von November 2012 - Januar 2013 zeigte. In Multistراتيجияsystemen ist das Money-Management das wesentliche Instrument zum Erfolg.



Vorstellung Handelssystem World ETF Low Risk Professional

Handelssystem verändern

Bezeichnung des Handelssystems: Autor des Handelssystems:

Strategien des Handelssystems:

Low_Risk_Strategy_3_2013
Low_Risk_Strategy_1_2013
Low_Risk_Strategy_4_2013
Low_Risk_Strategy_7_2013

Beschreibung des Handelssystems

Parameter für die Simulation des Handelssystems

Startkapital:

Währungs-ISO-Code:

Startdatum:

Zinsreihe für liquide Mittel:

EONIA Geldmarktsatz (EU0009659945, Composite)

Fester Zinssatz (%) für liquide Mittel:

Zinsabschlag (%) p.a.:

Zinstage:

Zinsauszahlung:

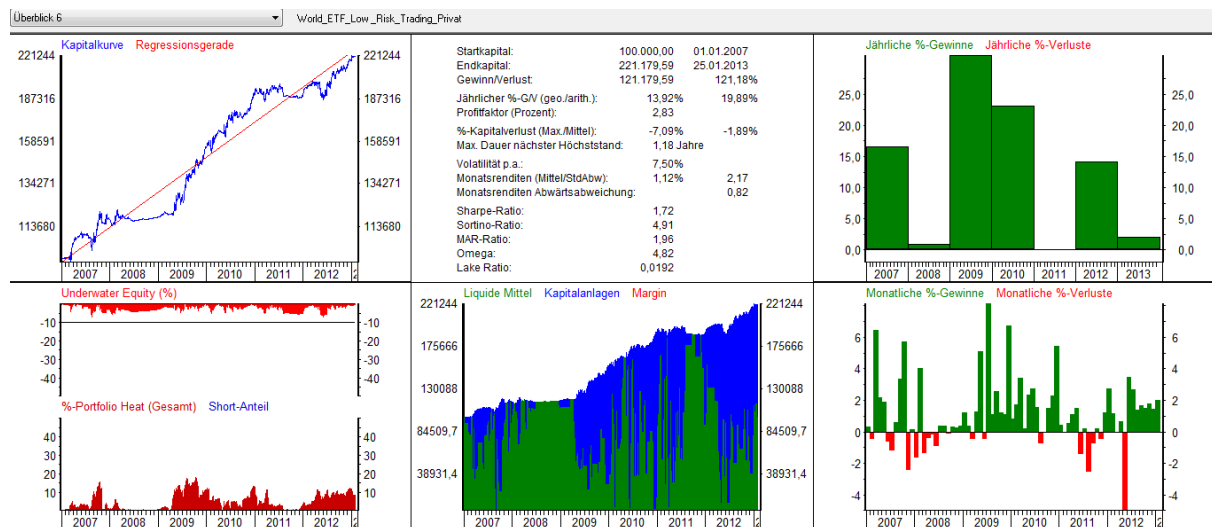
Zinsloser Anteil (%):

Zinssatz (%) für risikofreies Kapital:

Mindestrendite (%):

Max. zulässiger Kapitalverlust (%):

Max. zulässiger Investitionsgrad (%):



Renditematrix des Handelssystems:

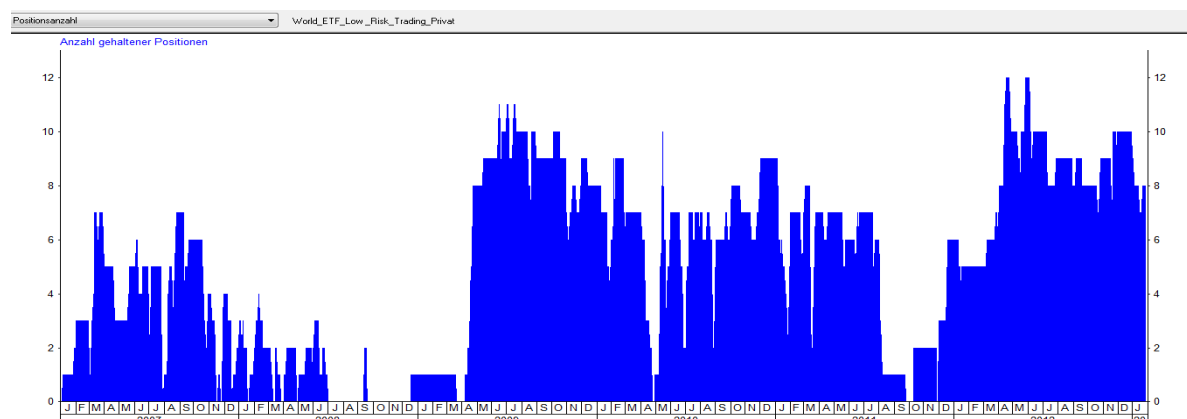
Renditematrix World_ETF_Low_Risk_Trading_Privat

Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)												
	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2007	16,64	0,34	-0,47	6,46	2,15	1,91	-0,64	-1,20	0,62	3,33	5,71	-2,44	0,13
2008	0,96	-1,65	4,04	-1,35	-0,40	-0,20	-0,90	0,36	0,35	-0,12	0,33	0,25	0,36
2009	31,16	1,24	0,39	-0,46	1,25	5,10	-0,49	8,11	1,09	2,56	1,20	1,12	6,74
2010	23,18	0,81	1,74	3,40	0,19	2,34	2,74	1,54	-0,75	-0,01	1,50	2,27	5,42
2011	-0,13	0,41	-0,06	0,55	1,13	1,49	-1,42	0,23	-2,54	-0,77	0,20	-0,45	1,19
2012	14,12	2,74	1,18	0,00	0,67	-5,00	3,49	2,68	1,39	1,67	1,52	1,76	1,44
2013	2,00	2,00											
Mittelwert	12,56	0,84	1,14	1,43	0,83	0,94	0,46	1,95	0,03	1,11	1,74	0,42	2,55

Statistische Kennzahlen:

Transaktions-Kennzahlen		World ETF Low Risk Trading Privat	
Nettogewinn:	102.367,62	102.367,62	
Nicht realisierte G/V.:	10.166,55	10.166,55	
Anzahl offene Positionen:	8	8	
Profitfaktor:	2,95	2,95	
Profitfaktor (Prozent):	2,83	2,83	
Summe der Gewinne:	154.937,54	154.937,54	
Summe der Verluste:	-52.569,92	-52.569,92	
Durchschnittliches Ergebnis:	433,76	433,76	
durch. Gewinn / durch. Verlust	2,90	2,90	
Durchschnittlicher Gewinn:	1.302,00	1.302,00	
Größter Gewinn:	8.858,24	8.858,24	
Durchschnittlicher Verlust:	-449,32	-449,32	
Größter Verlust:	-2.550,79	-2.550,79	
Durchschnittliches %-Ergebnis:	2,75%	2,75%	
durch. %-Gewinn / durch. %-Verlust	2,78	2,78	
Durchschnittlicher %-Gewinn:	8,43%	8,43%	
Größter %-Gewinn:	43,88%	43,88%	
Durchschnittlicher %-Verlust:	-3,03%	-3,03%	
Größter %-Verlust:	-11,96%	-11,96%	
Trefferquote:	50,42%	50,42%	
Anzahl:	236	236	
Anzahl im Gewinn:	119	119	
Anzahl im Verlust:	117	117	
Max. Anzahl Gewinner in Folge:	9	9	
Max. Anzahl Verlierer in Folge:	17	17	
Durchschnittliche Dauer (Tage):	29	29	
Durch. Dauer bei Gewinnern (Tage):	44	44	
Durch. Dauer bei Verlierern (Tage):	13	13	

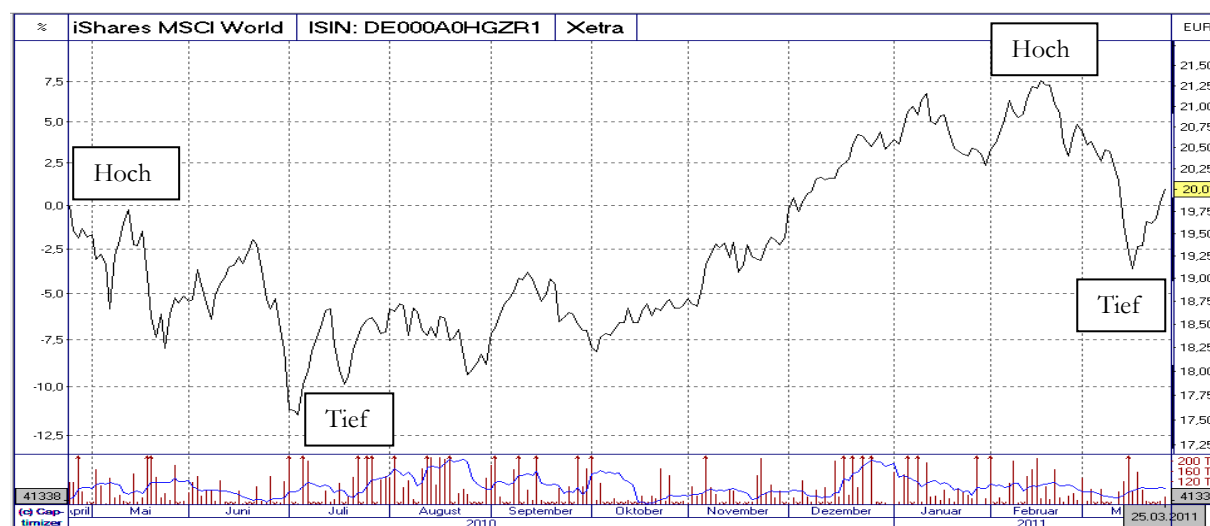
Die Trefferquote ist über 50 %, die Gewinn-/Verlustquotienten betragen 2,9 und der Erwartungswert beträgt 2,75 %. Das ist mehr als genug fürs „Geld drucken“.



Bemerkungen zum Benchmarking

Analyse eines mittelfristigen Trends der Weltaktienmärkte

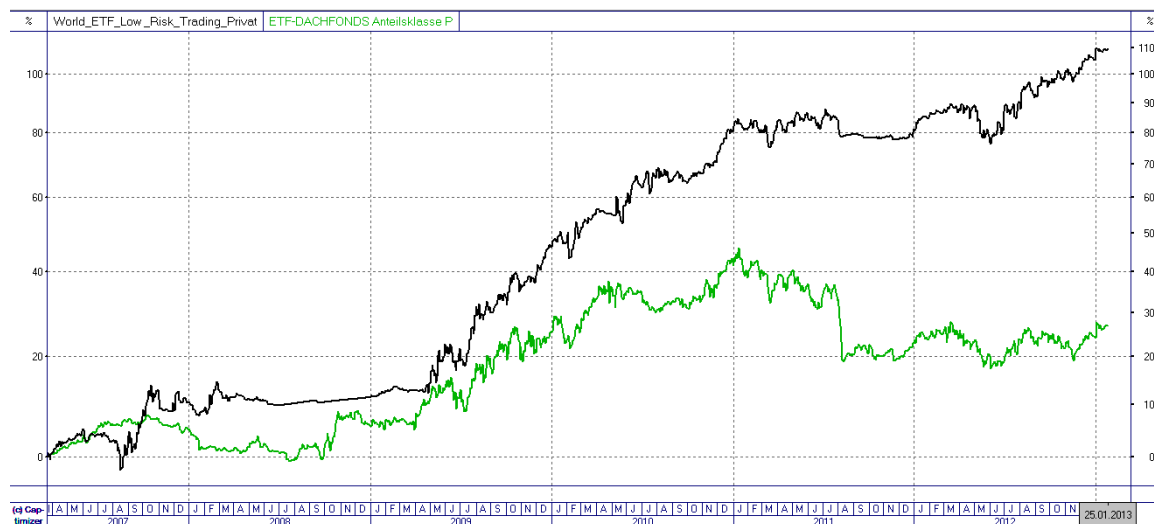
Sie sehen unten eine Auswertungsmethode für Fonds in Aktienmärkten, eine so genannte **Hoch-Tief-Hoch-Tief-Analyse**. Dazu verwenden wir einen Normpunkt im April 2010 = den Hochpunkt des **MSCI World in Euro** berechnet. Damit erhalten wir einen objektiven Leistungsmaßstab für den späteren Vergleich 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 dem ältesten ETF-Dachfonds:



Beispiel für verwendbare ETFs:

Zu analysierendes Wertpapier	Umsetzung	
DE0005933931	iShares DAX® (DE)	Direkt
DE0006289390	iShares DJ Industrial Average (DE)	Direkt
DE000A0D8Q07	iShares EURO STOXX (DE)	Direkt
DE0005933956	iShares EURO STOXX 50 (DE)	Direkt
DE0006289408	ISHARES FTSE 100 (DE)	Direkt
DE000A0HG2Q2	iShares FTSE/EPRA European Property Inde	Direkt
DE0005933923	ISHARES MDAX (DE)	Direkt
DE000A0HG2M1	iShares MSCI Brazil	Direkt
DE000A0HG2V3	iShares MSCI Eastern Europe	Direkt
DE000A0HG2L3	iShares MSCI Korea	Direkt
DE000A0NA0K7	iShares MSCI Latin America	Direkt
DE000A0HG2K5	iShares MSCI Taiwan	Direkt
DE000A0LGQN1	iShares MSCI Turkey	Direkt
DE000A0HG2R1	iShares MSCI World	Direkt
DE000A0F5UJ5	iShares NASDAQ-100® (DE) (E××T)	Direkt
DE000A0H08D2	iShares Nikkei 225® (DE) (E××7)	Direkt
DE0002643889	iShares S&P 500	Direkt
DE0005933964	iShares SMI (DE) (E×11)	Direkt
DE0005933949	iShares STOXX Europe 50 (DE)	Direkt
DE0002635307	iShares STOXX Europe 600 (DE)	Direkt
DE0005933972	iShares TecDAX® (DE) (E×S2)	Direkt
FR0010408799	Lyxor ETF Brazil Ibovespa	Direkt

Hinzufügen... Verändern... Löschen Alle löschen Wertpapierliste hinzufügen... Laden... Speichern

Transaktionskosten für alle Einträge der Liste ändern.....

Zu analysierendes Wertpapier	Umsetzung	
LU0392496690	ComStage ETF ATX	Direkt
LU0392496427	ComStage ETF SMI	Direkt
LU0322250985	db x-trackers CAC 40 ETF	Direkt
LU0274211480	db x-trackers DAX ETF	Direkt
LU0292106167	db x-trackers DBLCl - OY Balanced ETF	Direkt
LU0292097234	db x-trackers FTSE 100 ETF	Direkt
LU0292107645	db x-trackers MSCI Emerging Markets TRN	Direkt
LU0292100046	db x-trackers MSCI Korea TRN Index ETF	Direkt
LU0322252502	db x-trackers MSCI Russia Capped Index E	Direkt
LU0292109187	db x-trackers MSCI Taiwan TRN Index ETF	Direkt
LU0274208692	db x-trackers MSCI World TRN Index ETF	Direkt
LU0322248658	db x-trackers Russell 2000 ETF	Direkt
LU0328474803	db x-trackers S&P /ASX 200 ETF	Direkt
LU0292109690	db x-trackers S&P CNX NIFTY ETF	Direkt
LU0274221281	db x-trackers SMI ETF	Direkt
LU0328475792	db x-trackers STOXX 600 ETF	Direkt
DE000A0KRJZ9	ETF5 Gold	Direkt
DE000A0D8Q23	iShares ATX (DE)	Direkt
DE0005933931	iShares DAX® (DE)	Direkt
DE0006289390	iShares DJ Industrial Average (DE)	Direkt
DE000A0D8Q07	iShares EURO STOXX (DE)	Direkt
DE0005933956	iShares EURO STOXX 50 (DE)	Direkt

Hinzufügen... Verändern... Löschen Alle löschen Wertpapierliste hinzufügen... Laden... Speichern

Transaktionskosten für alle Einträge der Liste ändern.....

Zu analysierendes Wertpapier	Umsetzung	
DE000A0F5UJ5	iShares NASDAQ-100® (DE) (E××T)	Direkt
DE000A0H08D2	iShares Nikkei 225® (DE) (E××7)	Direkt
DE0002643889	iShares S&P 500	Direkt
DE0005933964	iShares SMI (DE) (E×11)	Direkt
DE0005933949	iShares STOXX Europe 50 (DE)	Direkt
DE0002635307	iShares STOXX Europe 600 (DE)	Direkt
DE0005933972	iShares TecDAX® (DE) (E×S2)	Direkt
FR0010408799	Lyxor ETF Brazil Ibovespa	Direkt
FR0010204081	Lyxor ETF China Enterprise	Direkt
FR0007056841	Lyxor ETF DJ Industrial Average	Direkt
FR0010204073	Lyxor ETF Eastern Europe	Direkt
FR0010361675	Lyxor ETF Hong Kong (HSI)	Direkt
FR0010429068	Lyxor ETF MSCI Emerging Markets	Direkt
FR0010361683	Lyxor ETF MSCI India	Direkt
FR0010361691	Lyxor ETF MSCI Korea	Direkt
FR0010397554	Lyxor ETF MSCI Malaysia	Direkt
FR0010444786	Lyxor ETF MSCI Taiwan	Direkt
FR0007063177	Lyxor ETF Nasdaq-100	Direkt
FR0010636464	Lyxor ETF Pan Africa	Direkt
FR0010326140	Lyxor ETF Russia (DJ Rusindex Titans 10)	Direkt
FR0010464446	Lyxor ETF South Africa (FTSE JSE Top 40)	Direkt
FR0010326256	Lyxor ETF Turkey (DJ Turkey Titans 20)	Direkt

Hinzufügen... Verändern... Löschen Alle löschen Wertpapierliste hinzufügen... Laden... Speichern

Transaktionskosten für alle Einträge der Liste ändern.....

Wichtig:

Es können noch mehr ETFs verwendet werden.

Mindestzeitreihenlänge = Start ab 2009 oder früher.