

DerBoersenMathematiker.de



DerBoersenMathematiker.de

**Dipl.-Math.
Rainer Schwindt**

Premium-Handelssysteme

Frankfurt 2013

Früh mit Stopp

Handbuch zum Handelssystem

Unternehmensberatung Schwindt

Copyright © 2006 - 2013 Unternehmensberatung Rainer Schwindt "Der BörsenMathematiker"

Unter dem Titel:

Premium-Handelssystem Frankfurt 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
68766 Hockenheim

Homepage: www.DerBoersenMathematiker.de
E-Mail: RainerSchwindt@aol.com

Inhaltsverzeichnis

Legende	3
Die Handelssysteme Frankfurt	4
Systemkennzahlen Frankfurt	5
Charts mit Systemvisualisierung	10
Spezielles Risiko- und Money-Management	13
Voreinstellung der Positionsgröße	13
Kapitalkurvenvergleich	15
Was ist der Drawdown?	17
Technischer Anhang:	
Fundamentalanalyse kinderleicht gemacht	21
Wohin speichert man die gelieferte Software?	22
Hilfe zur Vermögensverwaltung	29
Updates für Fondshandelssysteme 2011/12	32

Legende

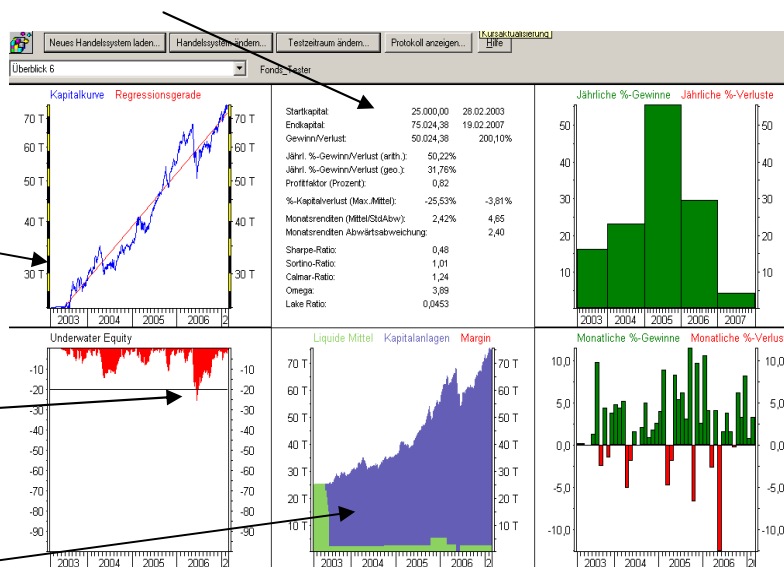
Auf den folgenden Seiten werden Sie immer wieder die unten stehenden Analysebilder aus dem Captimizer sehen, den sog. Simulator. Wir erläutern Ihnen jetzt in Kurzform, was die Börsenstrategie Ihnen an Ertrag eingebracht hat. Das **zentrale Quadrat** ist die **Kurz-Statistik** (siehe Erklärung):

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!**

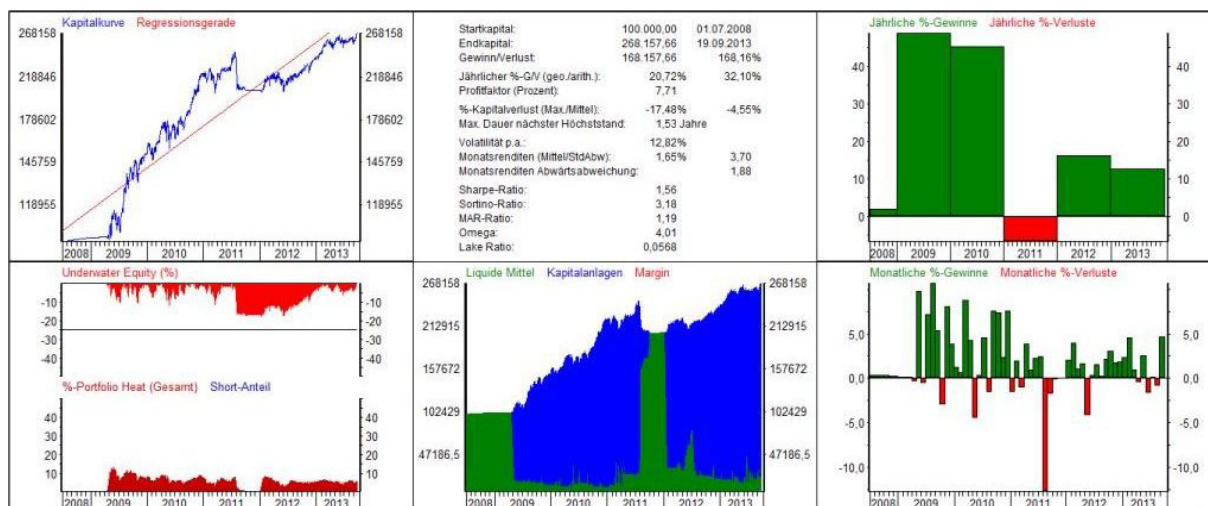
Der jährliche **Gewinn/Verlust (geo.)** wird benutzt, um verschiedene Investments **objektiv** bezüglich **Ertrag** vergleichen zu können. **Zinseszinsseffekt!**
 Das Beispiel oben würde einem Sparbuch mit einem **Zins** von **31,76 %** pro Jahr entsprechen.

Kapitalverlust_Max = Ihr Maximalstress

Kapitalverlust_Mittel = Ihr Dauerstress bezüglich regelmäßigem Kapitalrückgang von einem regelmäßigen Hoch zum Tief. Es ist eine Art mittlere Pendelbewegung im Trend.

Alle anderen Parameter bedürfen einer sehr extensiven Erklärung, welche die Unternehmensberatung Schwindt individuell jedem Kunden anbietet!

Aktuelle Handelssystem-Frankfurt-Kennzahlen:



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	
Profittfaktor	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	
Profittfaktor	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