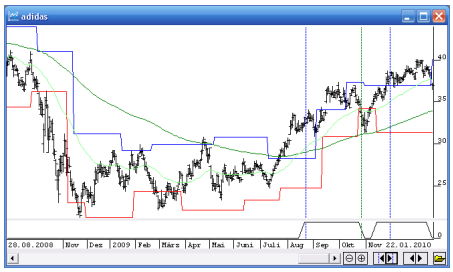
Warnung

Ich übernehme keinerlei Haftung für das Funktionieren dieses Beispiels in der Praxis. Hier soll nur gezeigt werden, wie mit Eusdoni ein Handelssystem entwickelt werden kann.

Swing-Chart-Trendfolger auf Wochenbasis

Nachbau des Handelssystems aus dem Buch „Trading Strategien (nicht nur) für Extrem Situationen“ von Philipp Kahler.



Kurzer gleitender Durchschnitt (ShortMA)

Langer gleitender Durchschnitt (LongMA)

LastSwingHigh (LowWeek (), HighWeek ())

LastSwingLow (LowWeek (), HighWeek ())

Das Handelssystem wird weitgehend so aufgebaut wie es Herr Kahler vorschlägt.Es ist fast mit dem Swing-Handelssystem identisch. Lediglich die Swing-Punkte werden auf Wochenbasis berechnet.

Wertpapiere

Es wird mit den Wertpapieren des DAX getestet. Hier werden die Wertpapiere aus einer

Tai-Pan Kursdatenbank verwendet. Wenn Sie einen andere Kursdatenbank verwenden, müssen Sie alle Wertpapiere löschen und Ihre Wertpapiere einfügen.

Trenderkennung

Die Bedingungen für einen Aufwärtstrend lauten:

- Der kurze EMA muss größer als der lange EMA sein.
- Der Tiefstkurs der Woche muss über dem kurzen EMA liegen.
- Der kurze EMA muss größer als der kurze EMA vor zehn Tagen sein.

Dabei gilt folgendes:

Die EMA's werden aus den Weighted-Close der Woche berechnet. Hierfür wurde ein neuer Indikator benötigt.

```
function TypicalPriceWeek () : indicator;
begin
  TypicalPriceWeek := (CloseWeek () + HighWeek () + LowWeek ()) / 3.0;
end;
```

Die Periodenlänge des kurzen EMA ist ein viertel der Periodenlänge des langen EMA (50 Tage, 200 Tage).

Einstieg mit der Swing-Technik

In den Trendphasen wird die Swing-Technik nach Long-Einstiegen suchen.

Wird das letzte Swing-Hoch der Woche überschritten, wird eingestiegen. Das Stopp wird auf das jeweils letzte Swing-Tief der Woche gelegt und eventuell nachgezogen.

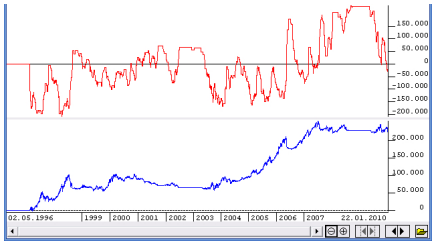
Ausstieg über Stopps

Unterschreitet das Tief des Tages den Stopp, wird ausgestiegen. Der Stopp wird auf das jeweils letzte Swing-Tief der Woche nachgezogen.

Implementierung

Es werden dieselben Indikatoren, wie im Swing-Handelssystem verwendet. Als Parameter der Indikatoren werden jetzt aber die Indikatoren auf Wochenbasis (LowWeek () und HighWeek ()) verwendet.

Ergebnisse



Kontostand

Gewinn
Gewinn: 225.361,10 Konto Max./Min: 230.171,14/-209.297,22 Gewinn Max./Min: 256.073,67/-3.137,09 Trans.: 939 Gewinn/Trans.: 240,00
Ausstiege: 457 Gewinntrades: 43 % Durchschn. Gewinn: 20,86 % Durchschn. Verlust: 7,10 %

Die Ergebnisse sind viel besser als beim Swing-Handelssystem auf Tagesbasis. Weniger Transaktionen, höhere Gewinntraderate, der durchschnittliche Verlust ist zwar etwa doppelt so hoch wie beim Swing-Handelssystem auf Tagesbasis aber dafür ist der durchschnittliche Gewinn mehr als dreimal so hoch. Herr Kahler hat wohl recht, wenn er behauptet, dass Swing-Trading, in den Aktienmärkten, nicht auf Tagesbasis betrieben werden sollte.

Download des Beispiels

Swing_Chart_Trendfolger_Wochenbasis.tsy Dateigröße 65 KB

Weitere Verbesserungsvorschläge

- Short-Selling
- Anpassen der Positionsgröße so wie es Herr Kahler in seinem Buch vorschlägt.

Siehe auch

Swing-Charting ,
Swing-Indikator ,
Swing-Low Signal ,
Swing-High Signal ,
Swing-Handelssystem ,
Swing-Constant-Risc Handelssystem