

Was Sie wissen müssen - die wichtigsten Fakten zu SYSTEM22 DSE

Grundsätzliches:

SYSTEM22 DSE wurde von mir als spekulative Ergänzung zum regulären SYSTEM22 Handelssystem entwickelt, kann aber auch alleine eingesetzt werden. Es unterscheidet sich von SYSTEM22 in folgenden, grundlegenden Punkten:

- SYSTEM22 DSE arbeitet auf Tages- und nicht auf Wochenbasis.
- SYSTEM22 DSE ist kein breit diversifiziertes Depot, sondern umfasst nur Trading in den fünf Basiswerten Dax, S&P 500, Euro/US-Dollar, Gold und Bund Future.
- Es findet, anders als bei SYSTEM22, kein Money-Management statt. D.h., dass erzielte Gewinne immer wieder reinvestiert werden und grundsätzlich das gesamte, zur Verfügung stehende Kapital eingesetzt wird.

Kurz: SYSTEM22 DSE vollzieht im Gegensatz zu SYSTEM22 kein mittelfristiges Investment, sondern ist Spekulation und birgt somit zwar höhere Gewinnchancen, aber eben auch höhere Risiken.

Entstehung und Struktur:

Handelssysteme, die auf Tagesbasis arbeiten, haben gegenüber denen, welche die mittelfristig ausgerichtete Wochensicht verwenden, Vorteile ... aber auch nicht unwesentliche Nachteile. Hauptproblem dabei sind die in den vergangenen Jahren häufiger gewordenen Phasen mit immens hohen Schwankungen und sehr plötzlichen Richtungswechseln. Die vermeintlich schnellere Reaktion eines Systems auf Tagesbasis entwickelt sich da oft zu einem Bumerang, weil man in deutlich mehr Bullen- oder Bärenfallen tappt. Für ein breites, diversifiziertes Depot über alle Assetklassen hinweg, wie es SYSTEM22 darstellt, sind Signale auf Tagesbasis daher nicht geeignet ... zumal dieses kurzfristige Trading bei einigen Bereichen, insbesondere einigen Rohstoffen und US-Aktien, nur sehr mäßige Erfolge zeigt. Das liegt daran, dass dort oft von einem Tag zum anderen bereits bei der Handelseröffnung immense Kurssprünge auftreten, die sich auf Tagesbasis negativ auswirken, weil sie nie vorhersehbar sind ... in der Wochensicht aber weniger ins Gewicht fallen. Darüber hinaus ist es natürlich nicht jedermanns Sache, ggf. täglich reagieren zu müssen. **Aber:**

Diese zunehmenden Schwankungen der Börsen haben mich in 2010 bewogen, immer mal wieder zu testen, ob einzelne Elemente nicht doch gute Ergebnisse auf Tagesbasis bringen können. Und in der Tat ist dem so. Aus den „funktionierenden“ Sektoren habe ich diejenigen fünf Basiswerte ausgesucht, die nicht nur bei den Anlegern auf das breiteste Interesse stoßen, sondern darüber hinaus immer eine ausreichende Auswahl an Derivaten aufweisen: Dax, S&P 500, Euro/US-Dollar, Gold und Bund Future. Diese Elemente bilden zusammen das SYSTEM22 DSE.

Das Handelssystem für alle fünf Bereiche arbeitet zwar nach dem selben Grundprinzip, die Parameter in den Formeln sind aber an die jeweiligen Basiswerte angepasst. Was nötig ist, da sich ihre Schwankungsintensität deutlich unterscheidet. Dabei habe ich aber *nicht* versucht, Parameter zu finden, die auf kurze Sicht die beste Performance bringen, denn das Kursverhalten ändert sich natürlich immer wieder. Was heute optimal scheint, ist morgen in der Regel genau die falsche Einstellung. Daher habe ich jeweils diejenigen Parameter gewählt, die über zwei Jahre hinweg die besten Ergebnisse zeitigten, denn in einer solch langen Phase erleben die Börsen in aller Regel alle Formen der Kursbewegung. Wobei Sie, wenn Sie sich den Performance-Chart in der täglichen Ausgabe ansehen, feststellen: In Seitwärtstrends können auch Systeme auf Tagesbasis keine Wunder vollbringen. Mit Derivaten zu agieren und in einer solchen, monatelangen Phase zumindest insgesamt wenig Verlust zu machen, ist da schon aller Ehren wert. Nichtsdestotrotz überprüfe ich diese Parameter regelmäßig, um sie neuen Gegebenheiten anpassen zu können, denn es kommt immer wieder zu gravierenden Veränderungen im Kursverhalten einzelner Bereiche.

Ich habe das SYSTEM22 DSE Mitte November 2010 fertig gestellt und zu diesem Zeitpunkt auch offiziell veröffentlicht. Die Performance-Berechnung begann ab dem jeweils ersten Signal in 2010 und wurde dementsprechend zurückgerechnet. Wer mich kennt, weiß indes, dass ich dabei auf Heller und Pfennig genau gerechnet und die Parameter selbstredend nicht verändert habe. Diese Performance sowie die abgebildeten Trades sind also durchaus authentisch. Dennoch muss klar sein, dass das nicht bedeutet, dass sich die Performance auch zwingend so fortsetzen *muss*. Über zwei Jahre hinweg berechnete Parameter sind dafür zwar eine gute Voraussetzung ... aber keine Garantie!

Beachten Sie bitte auch eines: Sie sehen in den Tabellen, welche die bisherigen Trades auflisten, dass die Zahl der Verlusttrades trotz der hohen Gewinn-Performance recht hoch ist. Warum? Weil auch Handelssysteme nun mal nicht hellsehen können. Die Gewinne rühren nicht daher, dass SYSTEM22 DSE heute schon weiß, wo die Kurse morgen stehen, sondern daher, dass es konsequent Gewinne laufen lässt, Verluste aber, auch über die zusätzliche Sicherung von Stop-Loss-Verkaufsorders, immer im Rahmen hält.

Vorgehensweise

SYSTEM22 DSE besteht aus börsentäglichen Updates, die die aktuellen Charts der fünf Basiswerte, deren Tradingtabellen und die momentane Gesamtperformance enthalten. Darüber hinaus sehen Sie hier auf einen Blick, ob am folgenden Morgen irgendwo Handlungsbedarf besteht oder nicht.

Ich arbeite hier mit k.o.-Zertifikaten, da diese die faireste Kursstellung aufweisen und immer in beliebiger Menge kauf- oder verkaufbar sind. Käufe und Verkäufe rechne ich dabei für die Tradingperformance immer am Morgen nach der Empfehlung im Update zum ersten Kurs an der Börse Stuttgart ab (09:00 Uhr). Dabei gelten folgende Grundsätze:



- Ich wähle Zertifikate, die einen Hebel zwischen 5 und 7 aufweisen, bei Gold sind sie meist sogar niedriger. Höhere Hebel bergen zu hohes Risiko, weil es auch immer wieder Phasen mit mehreren Verlusttrades nacheinander geben wird, die bei höheren Hebeln eine zu starke Schwächung des Basiskapitals bedeuten würden. Zusammen mit den Stop-Loss-Levels der Positionen bieten moderate Hebel die Sicherheit, in einem Trade nur im ungünstigen Fall (und somit selten) einen Verlust über 20% zu erleiden.

- Grundsätzlich werden die Positionen verkauft, wenn ein Ausstiegssignal oder ein Signal in die Gegenrichtung angezeigt wird. Hierzu der folgende Beispielchart: Ein Long-Signal ist ein grünes Dreieck, ein Short-Signal ein rotes Dreieck, ein neutrales Signal (keine Position) wird durch ein „-“ Zeichen dargestellt. Ausnahmen sind Verkäufe, die schon vorher durch einen Stop-Loss-Verkauf vollzogen wurden.

- Um extreme Bewegungen innerhalb eines Tages abzusichern, hat jede Position immer zusätzlich eine Stop-

Loss-Verkaufsorder, die Sie auch sofort nach dem Kauf der Position eingeben und regelmäßig aktualisieren sollten. Achten Sie bitte darauf, diese Stop-Loss-Orders mit der längsten von Ihrem Broker angebotenen Laufzeit einzugeben und regelmäßig entsprechend der Angaben in den täglichen Updates zu aktualisieren.

Grundsätzlich entscheidet zwar das System-Signal über Ein- und Ausstieg. Aber die Positionen werden immer von einem Stop-Loss begleitet, um zu verhindern, dass die Kurse innerhalb eines Handelstages zu weit durch die Signalzone rutschen oder aber unnötig viel von zwischenzeitlich erzielten Gewinnen abgegeben werden müssen. Ich prüfe das Niveau des Stop-Loss täglich und gebe Änderungen im täglichen Update umgehend durch. Der Stop-Loss wird immer so gewählt, dass keine Verluste, die nennenswert über 20% liegen, auftreten. Wird ein Signal neutralisiert oder gedreht, bevor der Stop-Loss greift, gilt immer das Signal, denn der Stop-Loss stellt, wie gesagt, nur die zusätzliche Sicherungsleine dar.

- Erzielte Gewinne werden immer reinvestiert. Dabei bleiben die fünf Bereiche vom Kapital her immer getrennt. Es macht keinen Sinn, einem gerade schlecht laufenden Bereich noch gute Gewinne aus einem anderen hinterher zu werfen, daher bleiben die „Töpfe“ immer unter sich. Ich behalte mir aber vor, auch eine kleinere Summe einzusetzen, wenn mir die eine oder andere Situation nicht geheuer ist. D.h. es werden durchaus auch Teilkäufe vorgenommen. Ansonsten wird es nur dann einen nennenswerten Kassenbestand geben, wenn einzelne Bereiche neutral sind, d.h. kein Signal aufweisen.

Die Gesamtperformance, berechnet ab dem 1.1.2010 und im Update auf Seite 3 unten, basiert auf einem Startkapital von 8.000 Euro und einer Verteilung von zum Start jeweils 2.000 Euro auf die Bereiche Dax, S&P 500, Euro/USD und Gold. Die fünfte Position Bund Future kam später hinzu und wurde durch je 500 Euro finanziert, die ich dafür den anderen vier Bereichen abgezogen hatte. **Wichtig:**

Wie man mit SYSTEM22 DSE umgehen sollte:

Es wäre ratsam, nur in NEUE Signale einzusteigen und nicht in solche, die bereits eine Zeitlang laufen.

Ich berechne die Performance aller Bereiche zusammen, weil ich der Ansicht bin, dass es besser ist, alle Sektoren zu handeln, anstatt sich nur einen oder zwei auszusuchen. Die Gesamtheit macht das echte Ergebnis ... und auf je mehr „Füße“ man sich stellt, desto besser werden Schwankungen in einem einzelnen Bereich ausgeglichen.

Sie können aber natürlich auch nur einzelne Bereiche handeln, das ist Ihnen (natürlich!) ebenso freigestellt wie die Wahl der Höhe des Startkapitals. Im Grunde können sie auch mit 1.000 Euro und nur dem Dax anfangen ... oder aber 5.000 Euro oder mehr pro Bereich als Basis wählen. Darüber hinaus können Sie sich genauso eigene Zertifikate herausuchen, die einen höheren oder niedrigeren Hebel aufweisen, falls Ihnen meine Vorschläge zu wenig oder zu sehr spekulativ sind. Das ist immer und jederzeit Ihre Entscheidung. **Aber!**

Bitte bedenken Sie, dass es sich hier nicht um ein Investieren, sondern um ein Spekulieren handelt! Ich habe die Startbeträge vor allem deswegen recht moderat gewählt, um eine klare Abtrennung zum SYSTEM22 Basis-system zu schaffen. Dort, mit breiter Diversifizierung und vorsichtigem Money-Management, kann man m.E. durchaus ein Viertel bis ein Drittel seines Gesamtvermögens einsetzen. Hier aber, wo immer voll investiert wird, das Kapital nur auf vier Füße verteilt ist und die Hebel der Zertifikate höher sind, sollte man wirklich nur Geld einsetzen, das nicht ausgerechnet Teil der Altersvorsorge ist oder in Kürze gebraucht wird. Bitte beachten Sie das unbedingt! Und nun:

Viel Vergnügen und Erfolg mit SYSTEM22 DSE!

Mit besten Grüßen
Ronald Gehrt