

Auswertungsgrafiken - und Matrizen

Hauptreiter "Tradingmatrix"

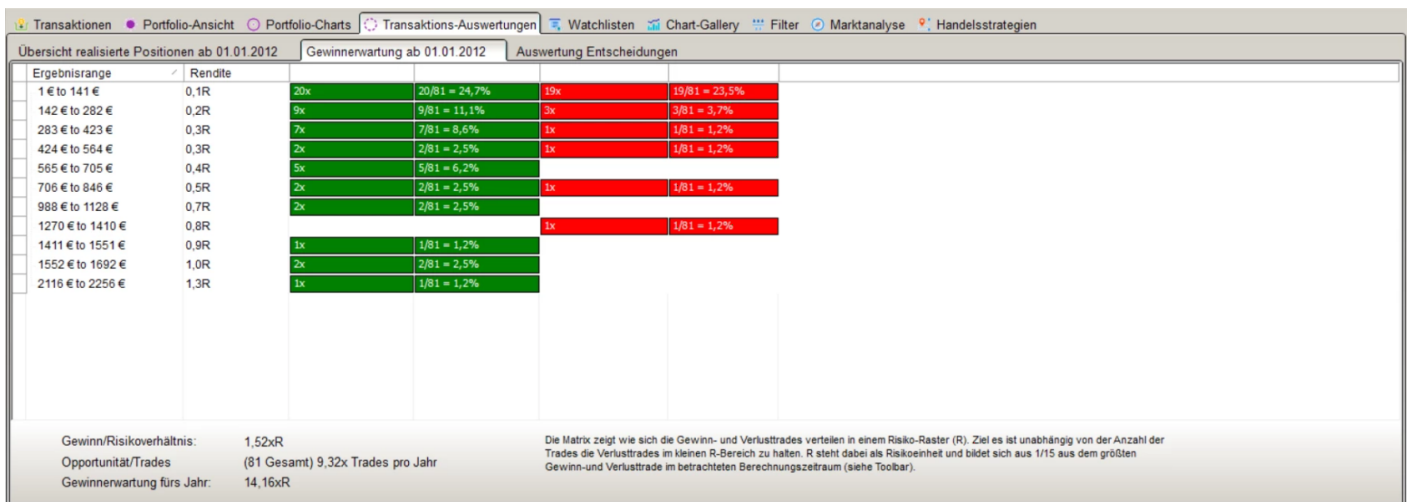
Übersicht realisierte Positionen

<div> Transaktionen Portfolio-Ansicht Portfolio-Charts Transaktions-Auswertungen Watchlisten Chart-Gallery Filter Marktanalyse Handelsstrategien </div>											
Übersicht realisierte Positionen ab 01.01.2012			Gewinnerwartung ab 01.01.2012			Auswertung Entscheidungen					
Bezeichnung	ISIN	Branche	Stk (Letzte)	Kaufkurs...	Verkaufs...	Letzte Aktion	AK	Zeit	GuV		
ABO Wind'H	DE0005760029	Versorger DE	-200	14,40	14,80	14.06.2019	27,40 €	2020	48,91 €	1,7%	
ADO Properties'X	LU1250154413	Immobilien SOAX	-76	39,84	42,66	04.01.2018	24,18 €	2020	172,28 €	5,7%	
Allianz'X	DE0008404005	Versicherung DAX	-10	170,45	199,85	12.11.2017	186,60 €	2020	180,05 €	4,1%	
Alphabet Inc. A'N	US02079K3059	Internetkommerz Nasdaq100	-4	1.153,42	1.496,37	09.08.2020	1.581,21 €	2020	3.106,97 €	30,8%	
Amazon.com Inc. 'N	US0231351067	Internetkommerz Nasdaq100	-2	1.101,27	1.120,66	07.11.2017	3.294,62 €	2020	21.053 €	1,1%	
Apple Inc. 'N	US0378331005	Computer-Hardware Nasdaq100	-20	101,30	110,53	22.05.2017	120,96 €	2020	52,25 €	2,7%	
ASML Holding N.V. 'A	NL0010273215	Elektrotechnologie EuroStoxx 50	-13	148,10	153,60	08.01.2018	304,80 €	2020	180,62 €	10,6%	
Audi'X	DE0006757008	Automobile CDAX	-2	737,58	734,00	04.01.2018	629,51 €	2020	12,32 €	-2,1%	
Axel Springer'X	DE0005501357	Verlag HDAX	-30	59,47	65,85	04.01.2018	55,00 €	2020	180,62 €	10,6%	
Berkshire Hathaway Inc. B'N	US0846707026	Holdings S-P100	-0,3060	160,65	154,55	14.04.2017	218,32 \$	2020	12,32 €	-2,1%	
Biogen Inc. 'N	US09062X1037	Biotechnologie Nasdaq100	-10	299,20	299,81	29.11.2019	276,00 \$	2020	12,32 €	-2,1%	
BMW'X	DE0005190003	Automobile DAX	-95	58,73	81,00	20.11.2016	61,38 €	2020	12,32 €	-2,1%	
BOERSE STUTTG. EUWAX-GOLD'S	DE000EWG0LD1		-12,5960	37,99	37,58	25.03.2017	52,68 €	2020	12,32 €	-2,1%	
CBK S&P500 3x Short ETN'S	DE000ETN0479		-3000	3,35	3,31	14.06.2019	2,39 €	2019	12,32 €	-2,1%	
COMS -MSCI WORL.T.U.ETF FX	LU0392494562	ZertIOS	-2,1360	46,80	47,59	07.04.2017	56,38 €	2020	12,32 €	-2,1%	
COMSTAGE-S+P 500 U.ETF FX	LU0488316133	ZertIOS	-0,2010	247,54	243,14	07.04.2017	329,24 €	2020	12,32 €	-2,1%	
CS -STX.EU 600 NR U.ETF FX	LU0378434582	ZertIOS	-1,3650	73,23	76,33	07.04.2017	73,87 €	2020	12,32 €	-2,1%	
Daimler'X	DE0007100000	Automobile DAX	-62	67,87	68,97	19.11.2017	74,50 €	2020	12,32 €	-2,1%	

Spalte	Erklärung
Bezeichnung	Name des Wertpapiers: Erscheint hier ein '-' so existiert in der Datenbasis kein Wertpapier, welches die in der Transaktion verwendeten WKN besitzt. Daher muß in der Datenbasis ein entsprechender Eintrag erzeugt werden. Hinter dem Namen können in Rotschrift +K (offene Kauforder) oder -V (offene Verkaufsorder) erscheinen. Dazu muß eine Transaktion in der Transaktionsliste vorhanden sein mit der Einstellung "Nur Auftrag".
Anz	Summe der jemals verkauften Stücke ohne Beachtung eines Abrechnungszeitraumes
Kaufkurs	Gewichteter Durchschnitts-Kaufkurs. Berücksichtigt werden in dieser Berechnung alle Käufe.

Spalte	Erklärung
Verkaufskurs	Gewichteter Durchschnitts-Verkaufskurs. Berücksichtigt werden in dieser Berechnung alle Verkäufe
Verschenkt	Wären die bereits verkauften Stücke bis heute gehalten worden und zum aktuellen Kurs verkauft, so würde sich der hier angegebene Gewinn oder Verlust ergeben. Die Berechnung erfolgt einfach über $Anz * (Kurs - \text{Gewichteter-Verkaufskurs})$
Wert	Aktuelle Kurs des Papiers
Gebühren	Summe der angefallenden Gebühren für alle Transaktionen die dieser Position zugeordnet werden können. Es werden damit sowohl Käufe wie auch Verkäufe berücksichtigt.
Steuern	Höhe des zu versteuernden Gewinns. Die Summe wird für alle Verkaufstransaktionen berechnet
Gewinn	Höhe des bis diesem Papier erzielten Gewinns (Kumulierte Gesamtsumme). Die Gewinnsumme ist dabei bereinigt um die Gesamtsumme der Gebühren.

Gewinnerwartungsmatrix



Hier finden Sie die Aufbereitung der bisherigen abgeschlossen Transaktionen in eine Gewinnmatrix, die genutzt wird zur Berechnung einer wahrscheinlichen Gewinnerwartung. Die Auswertung gehört zum Thema des Moneymanagements.

Dargestellt sind maximal 15 absolute Ergebnisbereiche, d.h. der größte Verlust/Gewinn wird zur Bildung einer angemessenen Risikoeinheit R genutzt. Im Minimum ist diese Größe 100€ groß. Diese Risikoeinheit unterteilt in einer Matrix nun alle Trades in die entsprechenden Bereiche. Im Ergebnis stehen sich die Gewinntrades und Verlusttrades mit Ihrer Häufigkeit und Wahrscheinlichkeit

gegenüber.

Hier am Beispiel ist eine Risikoeinheit 200€ groß. In der Range 1..200€ und damit für 1xR werden 10 Gewinntrades abgeschlossen und 16 Verlusttrades. In der größten gemachten Risikoeinheit 23R und damit zwischen 4401 und 4600€ wurde nur ein Trade abgeschlossen.

Die Matrix hilft einen Überblick über das eigene Handelssystem zu bekommen und Fragen wie:

- Häufigkeit von Verlusttrades/Gewinntrades
- Effizienz von Stopmechanismen
- Effizienz der Positionsgrößen
- Opportunität/Anzahl von Gewinntrades/Verlusttrades in welchem Bereich
- Balance zwischen Häufigkeit und Höhe von R in den einzelnen Trades
- und vor allem und letztlich die wahrscheinliche Gewinnerwartung pro Trade sowie pro Jahr zu ermitteln.

Die Gewinnerwartung pro Trade sagt dabei in diesem Beispiel mit 1.48R, dass bei jedem Trade zur Zeit im Schnitt für 1R

1.48xR als Gewinn erwartet werden kann. Warum diese Bezug zur Risikogröße? Mit jedem Trade wird ein definierbares (im Zweifel - aber selten praktisch - 100% der Einsatzgröße) Risiko eingegangen. Dieses tatsächlich umgesetzte Risiko (Verlust) drückt sich mit der Anzahl der Trades als Summe der Verlusttrades aus, die der Summe der Gewinntrades gegenübersteht. Symbolisch stehen so dem Risiko R der Gewinn G gegenüber. Mit 1.48 Gewinnerwartung steht so $1R = 1.48G$ gegenüber. Da R und G die gleiche Größeneinheit (hier 200€) besitzen kann die verkürzte Schreibweise 1.48R genutzt werden.

Handelssysteme arbeiten sehr unterschiedlich. Eine Pauschalaussage ist so für die Matrix nur schwer möglich. Eine Interpretation erfordert Kenntnisse vom System. Folgende Prüfungen können jedoch fast immer sinnvoll vorgenommen werden:

- Gewinntrades werden regelmäßig mit $>1R$ abgeschlossen (werde Gewinne tatsächlich effizient laufen gelassen)
- Verlusttrades gehören zum Trading, da nicht jede Position in die gewünschte Richtung laufen wird. Zu prüfen ist jedoch ob die Verlusttrades möglichst in der Mehrzahl $= 1R$ sind. Andernfalls wurden Stopkurse nicht gesetzt, nicht eingehalten oder beispielsweise auch die Tradeposition zu hoch gehalten (Positionsgröße zu hoch)
- Ein Idealbild wäre beinahe erreicht, wenn auf der Verlustseite lediglich mit 1xR Trades abgeschlossen werden. Die Gewinnseite werden über die am oberen Ende der Bandbreite liegenden mit 4R,5R usw. xR abgeschlossen. Höhere xR's sind hier natürlich wünschenswert.

Nach den Ausführungen sollte klar sein, dass Gewinnerwartungen immer über $>1R$ liegen sollten, da nur dann am Ende ein positiver Abschluß auf Ihrem Konto stattgefunden hat. Werte $\leq 1R$ sollten schleunigst zur Prüfung Ihrer Strategie führen. Die Matrix kann helfen hier grundsätzliche Schwächen Ihres Systemes zu finden.

Auswertung Entscheidungen bzw. Entscheidungsmatrix

Transaktionen Portfolio-Ansicht Portfolio-Charts Transaktions-Auswertungen Watchlisten Chart-Gallery Filter Marktanalyse Handelsstrategien							
Übersicht realisierte Positionen ab 01.01.2012 Gewinnerwartung ab 01.01.2012 Auswertung Entscheidungen							
Monat	Transaktion	Datum	Details	Einstiegsgrund	Einstiegsbewertung Zeit/Grund	Ausstiegsgrund	Ausstiegsbewertung Zeit/Grund
<div> <div>Monat</div> <div>Jahr</div> <div>Alles</div> </div>	1.122,03 €	V:27.01.2020 K:27.12.2019 (31,00) K:29.12.2018 (30,00) K:04.01.2018 (20,00)	Wirecard X	Undefiniert: Undefiniert: Fundamentalanalyse: Susan Levermann* Strategie	+ Fundamentalanalyse: Bestätigt	Gewinnssicherung: Sehr volatile Bewegung des Titels	- Stopkurs ist nur kurz Intraday berührt worden
	-126,00 €	V:27.01.2020 K:01.11.2019 (50,00)	Porsche Vz X	Fundamentalanalyse: Starke Marke, gute Gewinnaussichten	+ Fundamentalanalyse: Bestätigt	Gewinnssicherung: Gewinnsicherung bei extremen Märkten	+ Fundamentalanalyse: Bestätigt
	432,95 €	V:30.11.2019 K:01.08.2019 (5,00) K:01.07.2019 (5,00)	LUS - Wikifolio-Susan Levermann Strateg.	Sparplan: Ohne Nachdenken über Sparplan investiert Sparplan: Ohne Nachdenken über Sparplan investiert	+ Fundamentalanalyse: Bestätigt + Fundamentalanalyse: Bestätigt	Gewinnssicherung: Markt ist komplett überkauft, Hoffnung auf Jahresrendrallye erscheint mir etwas zu optimistisch	
	347,09 €	V:29.11.2019 K:01.04.2019 (10,00) K:01.03.2019 (10,00)	LUS - Wikifolio-Dynamische Relative Stär.	Sparplan: Weiterer Ausbau der Position Sparplan: Aufbau der 1. Position	+ Fundamentalanalyse: Bestätigt + Fundamentalanalyse: Bestätigt	Gewinnssicherung: Markt ist komplett überkauft, Hoffnung auf Jahresrendrallye erscheint mir etwas zu optimistisch	- Emotional: Unsinnige Gewinnmitnahme
	154,00 €	V:29.11.2019 K:01.11.2019 (60,00)	Gilead Sciences Inc. N	Undefiniert:		Gewinnssicherung: Markt ist komplett überkauft, Hoffnung auf Jahresrendrallye erscheint mir etwas zu optimistisch	
	18,72 €	V:29.11.2019	Biogen Inc. N	Undefiniert:		Gewinnssicherung: Markt ist komplett	
	Sie können mit der vorliegenden Liste auf den Zeitebenen (Monat, Jahr, Seit Depotbeginn) Auswertungen durchführen für die ausgeführten Transaktionen. Das besondere ist hier die Sortierbarkeit (Klick auf den Spaltenkopf) und die direkte Gegenüberstellung der erfassten Einstiegs- und Ausstiegsgründe zusammen mit einer Bewertungsschablone. Das System soll helfen Fehler transparent zu entdecken und das eigene System zu optimieren. Durch Doppelklick auf eine Position kann die zugehörige Transaktion (unter den Spalten Einstiegsgrund und Ausstiegsgrund) direkt verändert werden. Die Ansicht ist jederzeit über «F8» zu erreichen.						

Die Transaktionsauswertung erlaubt eine Auswertung der Einstiegs- und Ausstiegsgründe. Die Gründe werden in Kategorien (frei konfigurierbar) mit Freitext innerhalb der Transaktionsmasken eingegeben. Der Vergleich erfolgt dabei zweistufig.

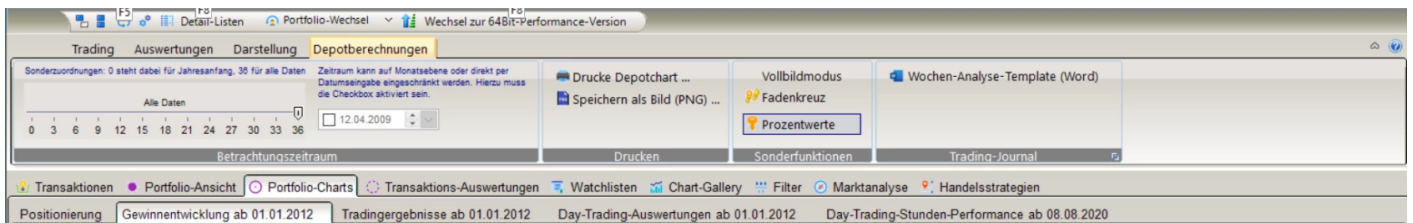
- Die erste Stufe sind die direkten Gründe für den Einstieg.
- Die zweite Stufe sind die Bewertungen der Gründe, die immer nur nachfolgend erfolgen kann mit zeitlichen Abstand.

Die reine Bewertung anhand des Tradeergebnisses erscheint in der Analyse zu oberflächlich. Für eine vollständige Analyse müssen für alle Trades (Kauf/Verkauf) entsprechende Gründe und Freitext-Notizen eingetragen werden. Ohne diese ist nur eine einfache Sortierfunktion nach Transaktionsergebnis und Datum möglich. Eine kritische Analyse des eignen Anlageverhaltens ist dann unmöglich.

Mögliche Aussagen

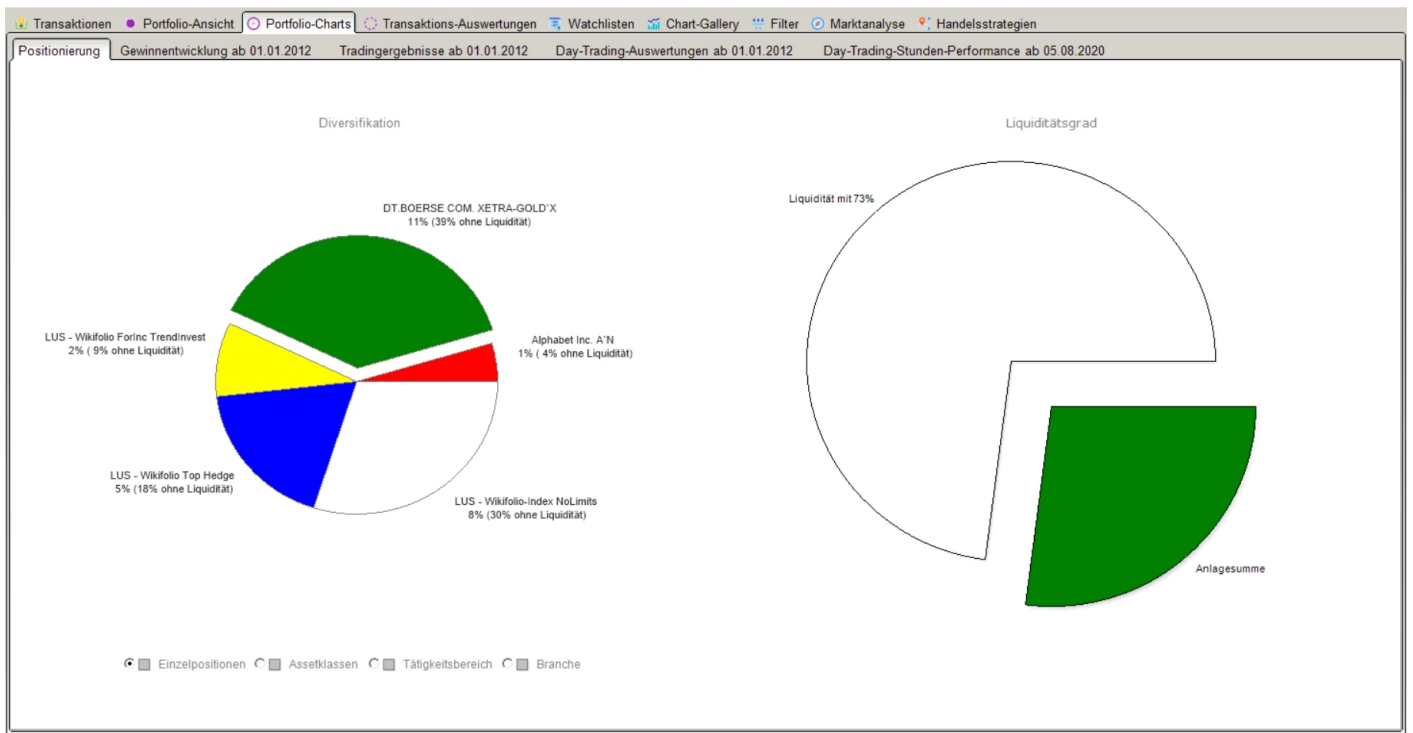
- Durch die Sortiermöglichkeit nach Tradeergebnis (Transaktion) sind auf den Zeitebenen Monat, Jahr, seit Depotstart die erfolgreichsten und verlustreichsten Trades sehr schnell in einer Übersicht zu erkennen. Durch Gegenüberstellung der Einstiegs- und Ausstiegsgründe ist eine nachträgliche Analyse des eigenen Anlageverhaltens und eventuelle Korrekturen möglich.
- Wird nur die Zeitebene (Monat) verwendet durch Auswahl des unteren Tabreiter "Monat", so können gezielt alle Monatstransaktionen nochmals kritisch geprüft werden.

Hauptreiter "Depotcharts"



Die Aktualisierung der Grafiken erfolgt im Hintergrund (Threadprozess) nach dem Laden eines Depots bzw. nach der Aktualisierung der Kursdaten. Die Grafiken werden beim Berichtsdruck 1:1 verwendet. Sollen im Bericht andere Zeiträume verwendet werden, so sind zuvor die Einstellungen der Grafiken zu ändern (3D Ansicht, Zeitraum usw.)

Positionierung



Die Positionierung hat als Hauptaufgabe, die Darstellung der Diversifikation und damit der Streuung des Depots aus verschiedenen Blickwinkeln darstellung. Rechts wird dabei der Liquiditätsgrad sehr prominent dargestellt und links diverse Auswertungen zur Diversifikation. Da die Erklärungen beinahe inhaltlich selbsterklärend sind, sollte noch erklärt werden, wie Anpassungen vorgenommen werden können:

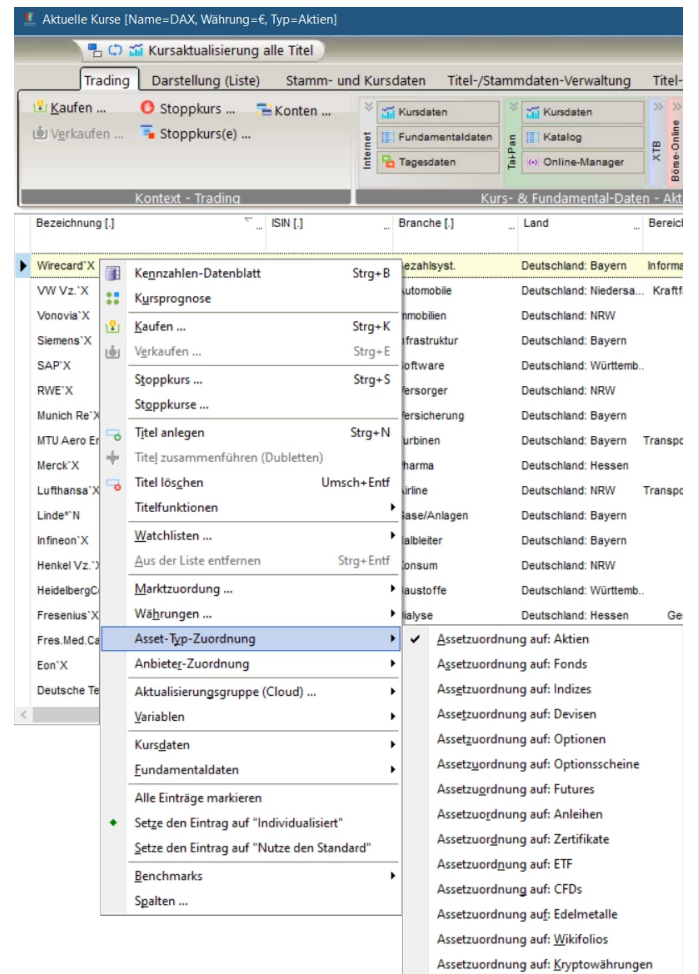
Darstellung nach ...	Anpassung durch
----------------------	-----------------

Einzelpositionen

Diese bestimmt sich allein durch das Anlagevolumen pro Einzelposition. Als Grafik-Markierung wird dabei der prozentuale Wert mit und ohne Liquidität angegeben. Die Visualisierung ist dabei natürlich ohne Liquidität einfach auf Basis der Verteilung des gesamten investierten Anlagevolumens.

Assetklassen

Die Zuordnung erfolgt über Einzel-Titel-Zuweisungen in den Detaillisten. Markieren Sie hierzu einzelne oder mehrere Titel (STRG+) und öffnen das Kontextmenü mit der rechten Maustaste. Sie können dann die Zuweisungen vornehmen.



Tätigkeitsbereich

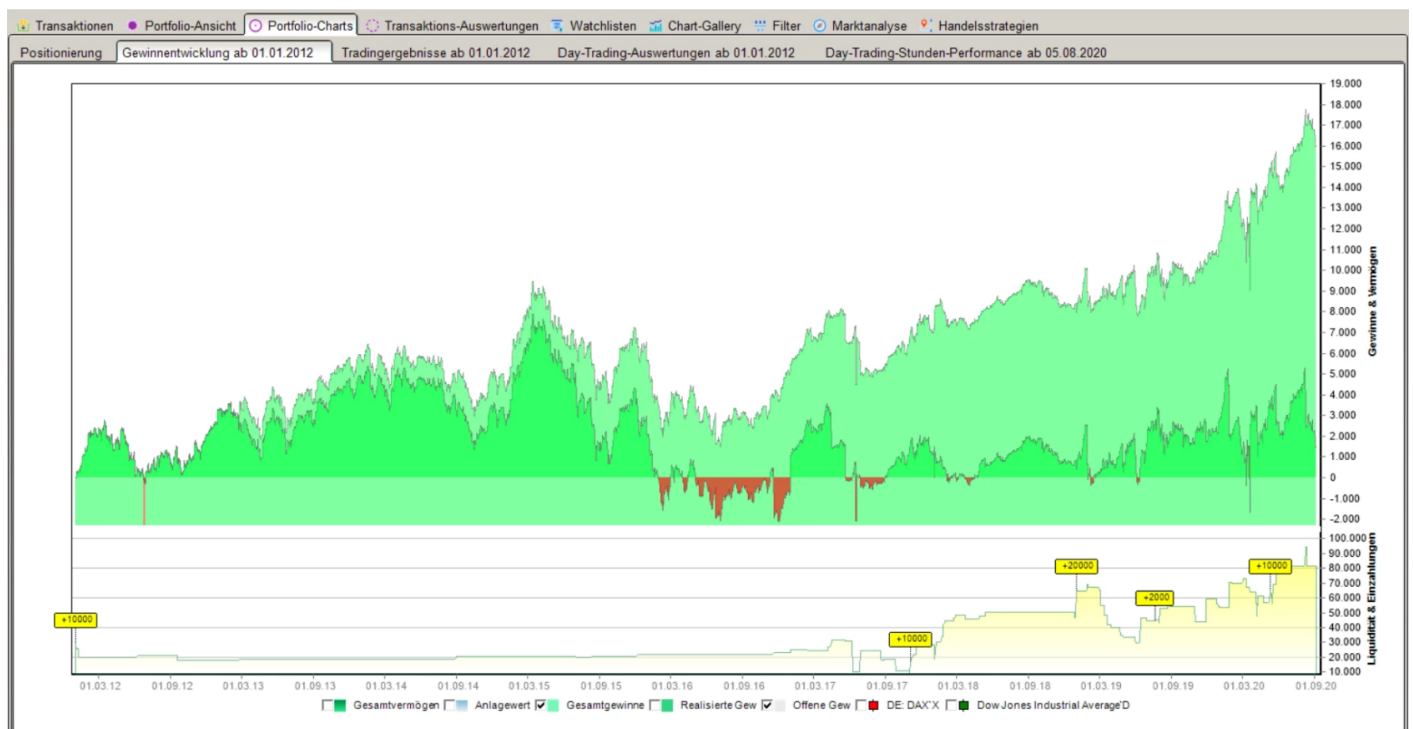
Sie können als Freitext-Feld dies in den Stammdaten eines Titels anpassen. Sie kommen hier durch Doppelklick auf den Titel in den Dialog. Die Daten werden durch diverse Stammdaten-Importe wie Tai-Pan oder Internet-Fundamentaldata-Portale aktualisiert.

Aktienstammdaten: VW Vz:X [ISIN=DE0007664039]	
Stammdaten	Unternehmensdaten
Kursdaten & Faktoren	Kursaktualisierung
Identifikationsdaten	
Bezeichnung	Wert
Name	VW Vz:X
Kurzname	Volkswagen VZ
VWD-Ticker-Symbol	VOW3
WKN (optional)	766403
ISIN	DE0007664039
Währung	€ (EUR)
Nachkommastellen	2
Tai-Pan-Identifikation	D66403
Land	Deutschland: Niedersachsen
Branche	Automobile
Tätigkeitsbereich	Kraftfahrzeugindustrie
Weblink	http://www.volkswagenag.com
IR-Weblink	http://www.volkswagenag.com
Hauptversammlungs-Ter...	30.09.2020
Ende Fiskaljahr	11.01.
Kurs-Update-Sperdatu...	
Letzter Quartalsberichts...	17.03.2020
Kommender Quartalsber...	29.04.2020
Fundamentaldata vom ...	27.08.2020
Bilanzierungsmethode	
Logo/Unternehmensbild-...	https://daten.comdirect.de/extern/logo_image.html?l...

Branche

Analog Tätigkeitsbereich wird ein eigenes Textfeld hierfür zur Pflege genutzt.

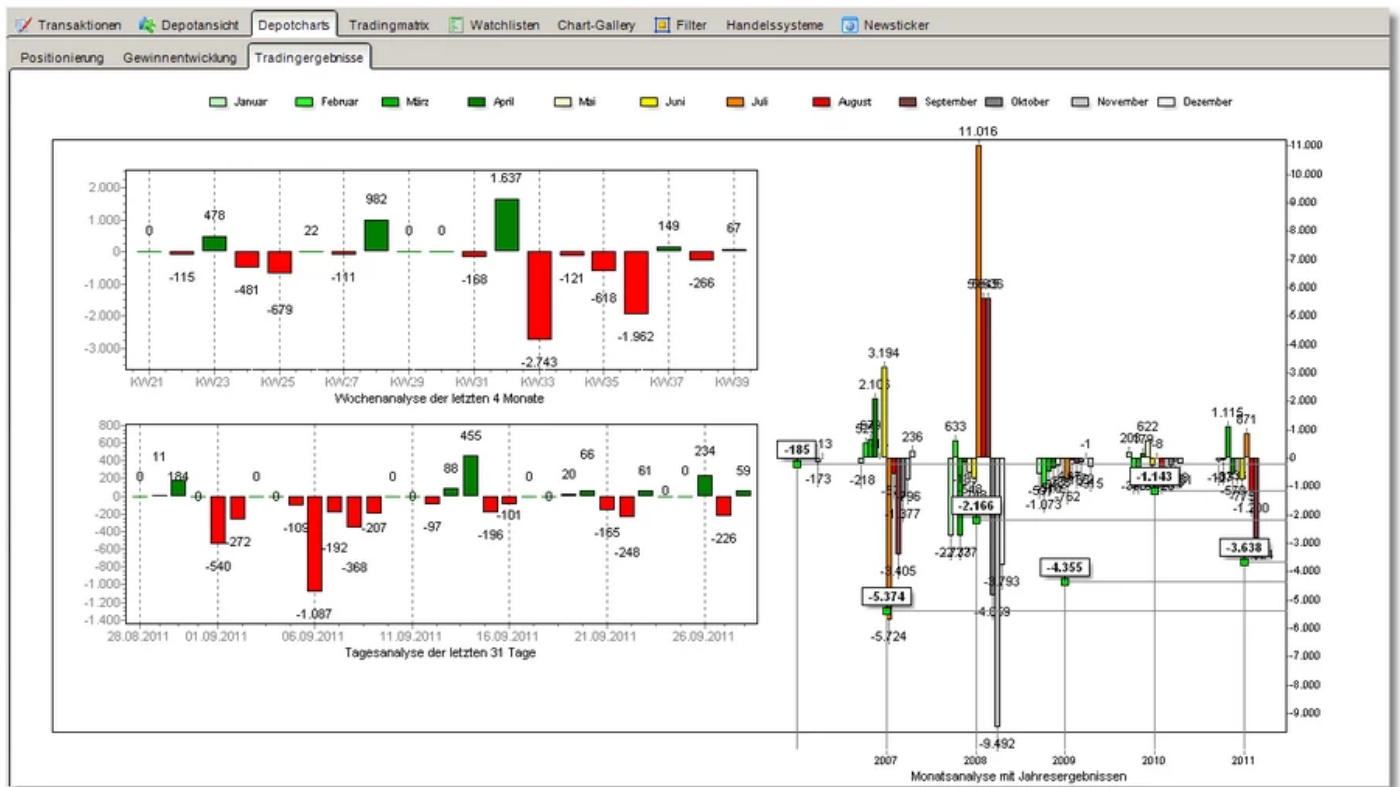
Gewinnentwicklung



Die Gewinnentwicklung berechnet rückwirkend bis zum festgelegten Stichtag die Entwicklung des Depots. Für die Berechnung sind korrekte historische Kursdaten für die Transaktionswerte zwingend. Dargestellt sind hierbei im Einzelnen:

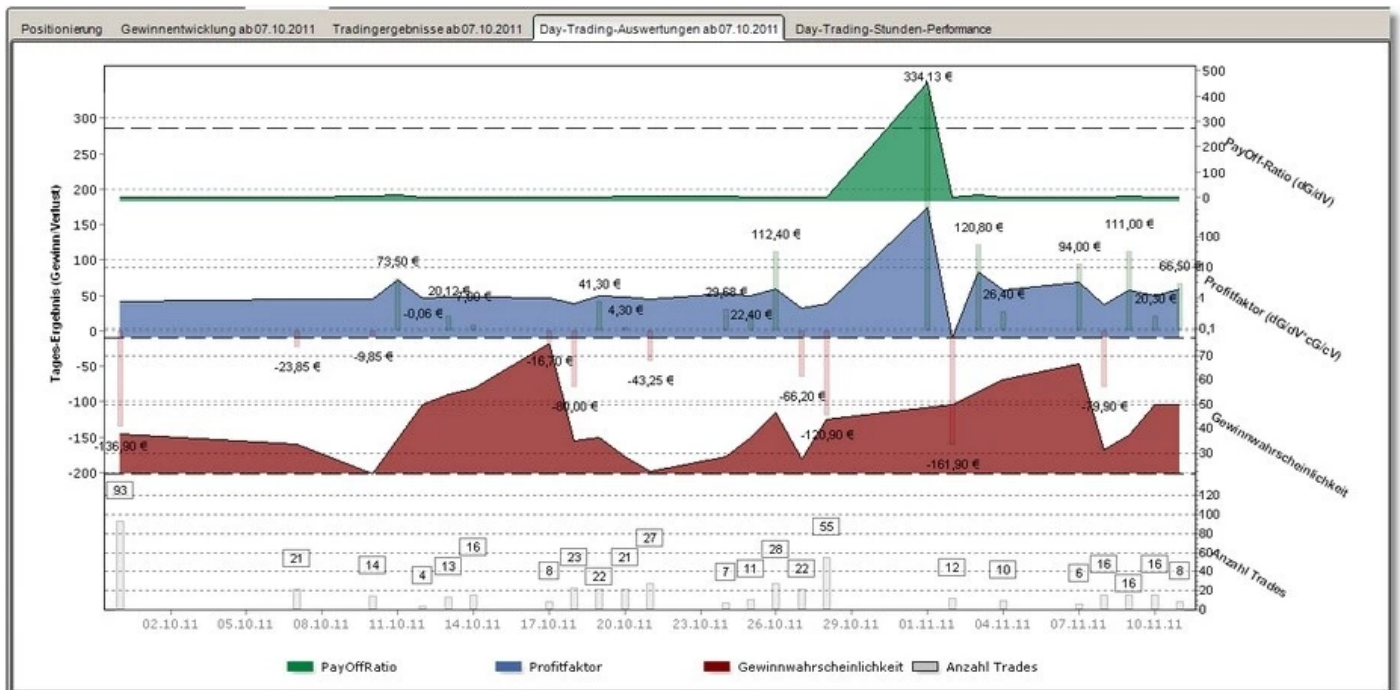
Chartlinie	Beschreibung
Offene Gewinne	Gewinne im aktuellen Depot
Realisierte Gewinne	Bereits realisierte im Depot verbuchte Gewinne
Ein-und Auszahlungen	Die Darstellung zeigt die gemachten Ein-und Auszahlungen im gewählten Zeitraum in einem nicht deaktivierbaren Bereich als Einzelchart (hier gelb) Ein Klick auf die Punkte auf der Ein-und Auszahlungslinie, erlaubt das direkte Springen zur betroffenen Transaktion. Diese kann anschließend direkt verändert werden.
Gesamtgewinne	Gesamtgewinn-Verlauf durch Summierung der realisierten und offenen Gewinne
Anlagewert	Im Depot befindlicher Kapitaleinsatz zum Stichtag.
Gesamtvermögen	Aktuelles investiertes Vermögen + Liquidität
1 und 2. Benchmarkwert	Die Vergleichswerte sind die in der Statusleiste genutzten Werte. Diese werden in den Kurslisten über das Kontextmenü "Statusleiste.Links", "Statusleiste.Rechts" festgelegt.

Tradingergebnisse



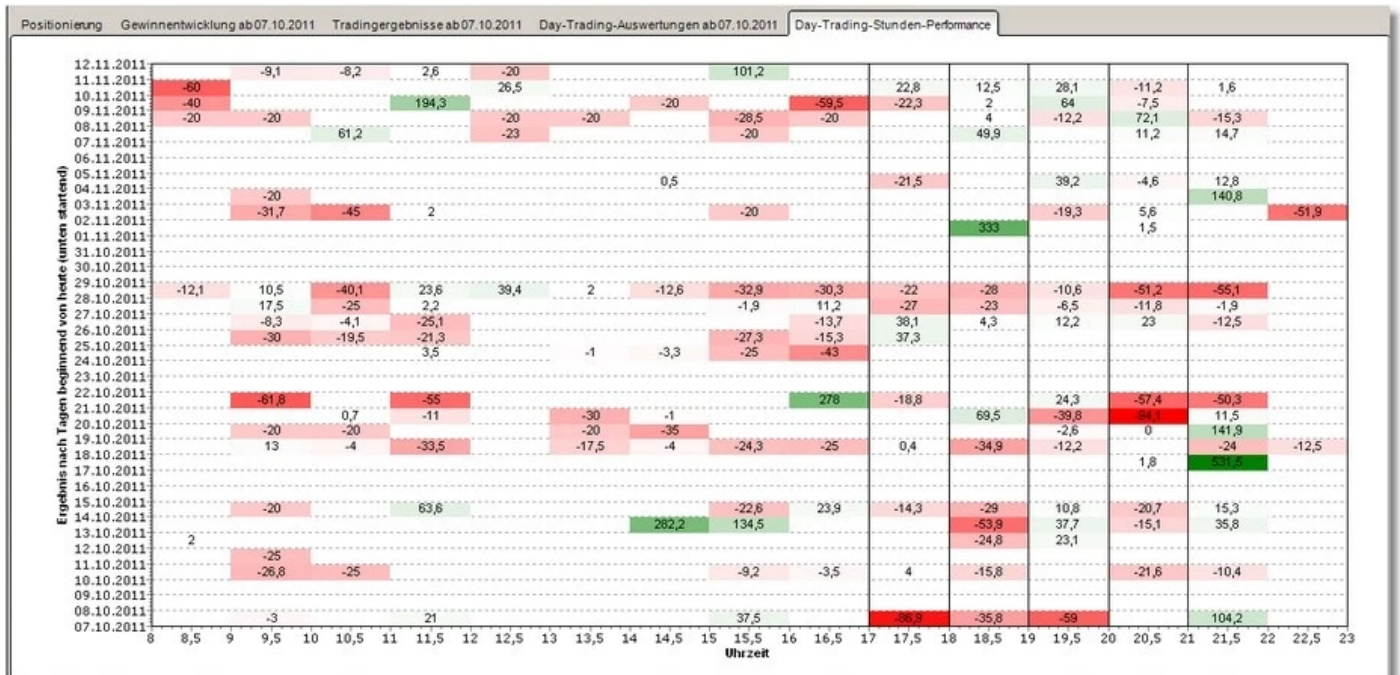
Die Tradingergebnisse zeigen auf einer Zeitachse mit monatlicher und wöchentlicher Einteilung realisierte Gewinne/Verluste. Gerade bei aktivem Trading zeigen die Wochencharts zusätzliche Vergleichswerte über die Zeitachse. Die Monatsansichten kummulieren diese Tradingergebnisse. Diese können beispielsweise genutzt werden, um einen Summenwert pro Monat in einem anderen System wie z.B. MS Money zu übernehmen. Die vollständige Übernahme aller Transaktionen in das zweite System und damit die Doppelpflege wird so vermieden. SHAREholder wird dann natürlich als führendes System betrachtet mit Detailaufstellungen.

Day-Trading



Hier werden wesentliche Kennzahlen für das eigene Trading zusammengeführt und einem historischen Verlauf gezeigt. Die Zeitachse richtet sich nach den Datums-Einschränkungen in der Ribbon-Bar unter "Depotcharts".

Day-Trading-Analyse nach Verkaufs-Zeitpunkt



Mit dieser Grafik werden die Verkaufszeitpunkte der vergangenen Tage analysiert. Dabei ist das Stundenraster auf der X-Achse und das Datum auf der Y-Achse. IN den Felder ist farblich kodiert das Trading-Ergebnis. Ziel ist es hierbei "unwirtschaftliche" Trading-Phasen herauszufinden und auf

dieser Basis weitere Analysen zu fahren. Hauptaugenmerk liegt dabei auf Phasen, die extrem volatil sind bzw. mit dem eigenen System weniger harmonieren und daher umgehend zu Verlusten führen (Ausstopp-Positionen). Es wird daher aktuell keine Analyse vom Kauf-Zeitpunkt vorgenommen, sondern nur vom Verkaufs-Zeitpunkt.

Revision #2

Created 18 June 2022 15:11:27 by Jens Werschmoeller

Updated 19 June 2022 06:39:01 by Jens Werschmoeller