

Grundlagen Kursaktualisierung

Ziel dieses Moduls

Kursdaten stellen bei der Aktienanalyse die wichtigste Grundlage dar, auf der finanzielle Entscheidungen gefällt werden die zu finanziellem Erfolg oder Misserfolg führen können. Daher ist es für jeden Anleger wichtig, genau zu wissen, welche Qualität die Datenbasis hat, die seinen Analysen zugrundeliegt und vor allem auch zu wissen, wo Schwächen liegen werden. Schwächen können systembedingt (zu wenig Daten) oder strukturell (schlechte Informationen) auftreten.

Shareholder verfolgt das Ziel die Datenbasis frei vom Nutzer auswählen zu lassen und möglichst viele unabhängige Datenquellen einzubinden. Diese können dabei sowohl kostenfrei (primär) aber auch kostenpflichtig sein. Dies ermöglicht es Kosten zu reduzieren und eigenen Präferenzen zu folgen.

Im Standard können unten aufgeführte Datenquellen in ShareHolder gewählt werden. Weitere Datenbasen können durch eigene Programmierung oder auf Anfrage eingebunden werden.

Datenquellen zur Kursaktualisierung

Freie Internetadressen

Eigenschaften: Kostenfrei, End-of-Day-Daten, teilweise Realtime, Praktisch alle Assets/Aktien weltweit

ShareHolder hat als Kernanspruch im Internet verfügbare Datenquellen kostenfrei und flexibel nutzen zu können. Es können daher sowohl CSV, JSON als auch HTML-Seiten automatisiert ausgelesen werden von beliebigen Internetquellen. Konfigurationen zum Auslesen existieren dabei z.B. für Yahoo, Ariva, Finanzen etc.

API-Datenprovider/-Portale

Eigenschaften: Kostenfrei bis kostenpflichtig je nach Anspruch, End-of-Day-Daten, teilweise Realtime, Praktisch alle Assets/Aktien weltweit, Abdeckung je nach Abomodell

Die Datenbereitstellung wurde in den letzten Jahren professionalisiert und es entstanden eine Reihe von nutzbaren Daten-Portalen, die über eine API entsprechende Daten abrufbar zur Verfügung stellen z.B. Alphavantage, Finnhub, Polygon.IO, Quandl etc. Diese sind eingebunden und können auch frei erweitert werden.

Shareholder EOD-Datenbank

Eigenschaften: Kostenlos abgedeckt mit einer Registrierung der Software, 4xtäglich aktualisiert, d.h. primär End-of-Daten, ausgesuchte Kern-Märkte (siehe Link unten)

Für systeminterne Strategien werden bereits intern Daten aggregiert und zusammengestellt. Dieser Datenpool wird daher kostenfrei allen registrierten Nutzern 4x täglich (ohne Gewähr und Bereitstellungspflicht) zur Verfügung gestellt.

Tai-Pan EOD

Eigenschaften: Abonnement über Lenz&Partnter, End-of-Day-Daten mit mind. 15min Verzögerung, Abdeckung je nach Abomodell

Lenz&Partner stellt neben dem eigenen Tai-Pan Produkt auch eine Möglichkeit zur Verfügung nur die Kursdatenbank zu nutzen. Diese ist daher in ShareHolder angebunden und kann per Klick abgerufen werden, um die EOD-Kursdaten abzurufen oder ganze Kataloge (Marktsegmente) zu synchronisieren.

Tai-Pan RT

Eigenschaften: Abonnement über Lenz&Partnter, End-of-Day-Daten in Realtime, Abdeckung je nach Abomodell

Lenz&Partner stellt neben Tai-Pan EOD auch Tai-Pan Realtime als eigenständiges Produkt zur Verfügung. Das Programm & die Daten sind speziell fürs Trading ausgerichtet. Diese können auch in ShareHolder per Klick abgerufen werden. Im Fokus stehen hier aber die EOD-Daten, da ShareHolder keine Intraday-Charts offiziell unterstützt.

XTB-Broker-Katalog und Kursaktualisierung

Eigenschaften: Kostenlos nach Registrierung bei <https://www.xtb.com/de>, EOD-Daten in Realtime, Abdeckung entsprechend XTB-Marktabdeckung (CFD, Indizes, Rohstoffe, Währungen, Aktien)

XTB ist ein professioneller CFD/Aktienbroker, die über eine API-Schnittstelle es auch erlaubt die Transaktionen als auch EOD-Kursdaten abzurufen. Eine entsprechende Synchronisation ist hierfür ebenfalls integriert.

Import aus CSV-Dateien

Eigenschaften: Kostenlos

Der manuelle CSV-Import für Einzeltitel oder ganze Marktsegmente ist eigentlich nur ein Spezialfall der Möglichkeit zum Auslesen von CSV/JSON/HTML-Inhalten von Internetportalen. Hierbei wird der Inhalt jedoch von lokalen Verzeichnissen oder Dateien ausgelesen.

Notfallplan Manuelle Eingabe

Es gibt für absolute Ausnahmefälle die Möglichkeiten Kursdaten manuell einzugeben oder zu korrigieren. Dies sollte aber die Ausnahme sein und hier eher die Datenquelle geändert werden.

Für Werte, die nur mit Schwierigkeiten oder überhaupt nicht aktualisiert werden können, gibt es die manuelle Kurseingabe vorgesehen. Durch Doppelklick auf den entsprechenden Titel an allen Stellen in SH24 (Depots, Watchlisten etc.) öffnet sich das Stammdatenblatt des Titels und kann editiert werden. Der Zeit-Stempel ab dem der neue Datensatz gilt wird bei einer Neueingabe und Speichern automatisch auf die aktuelle Uhrzeit und den Tag gesetzt den Sie eingeben. Wird nichts eingegeben wird das aktuelle Datum und die Uhrzeit der Eingabe automatisch beim Schließen des Menüs eingetragen .

Datenqualität

Datenupdate

Die Datenquellen können durch manuelle Auswahl manuell oder über eine automatischen Start kontinuierlich während der Programmnutzung upgedated werden.

Manuell erfolgt es über die Buttons in der Office-Ribbon-Bar:



Kursdatenbereinigung

Die Kursdatenbereinigung nimmt eine Verdichtung der Kursdatenmengen vor, d.h. bestehende Kursdaten werden nochmals sortiert und ungültige Einträge gelöscht. Der Vorgang sollte nur in Ausnahmefällen genutzt werden, da intern sichergestellt ist, dass die Daten konsistent sind. Die Funktion ist historisch entstanden und gilt mittlerweile als deprecated bzw. gehört zum Notfallprogramm.

Qualifizierte Datenzusammenführung

Als Ausbauvariante/Idee:

Siehe Für JQL- und Vorgangsschlüsselargumente für dieses Makro ist die Konfiguration mindestens einer Jira-Anwendungsverknüpfung erforderlich.

Probleme bei den Aktualisierungen

Internetkursaktualisierungen

Da immer wieder Probleme mit der Kursaktualisierung auftreten hier ein einfaches Vorgehensmodell, um den Fehler einzugrenzen:

Aktualisierungsfehler eines Titels

1. Hauptmenü . Kurse . Internetfilter . "Protokoll" oder "Fehlerprotokoll" aktivieren
2. Betroffenen Titel markieren (innerhalb Kursliste, Depot usw.) und eine Einzelaktualisierung mit Strg-F5 durchführen (oder Kontextmenü)
3. Angezeigte Protokoll prüfen hinsichtlich gebildeter URL/Adresse
4. Wurde die URL falsch gebildet, so sollten folgende Prüfungen durchgeführt werden:
 1. Wurde der Aktie das korrekte Marktsegment zugeordnet
 2. Hat das Marktsegment die korrekte Zuordnung zu einer Internetaktualisierungsadresse (Hauptmenü. Einstellungen. Märkte)

3. Sind die Werte für Symbol/ISIN/WKN für den Titel korrekt (Hier sind teilweise Sondervariablen zu setzen (Titelstammdaten.Button Variablen))
4. Wird der Titel überhaupt durch den Kursanbieter (Yahoo usw.) geführt / Ist ein Wechsel zu einer anderen Aktualisierungsadresse notwendig

Internetvariablen

Einer der häufigsten Fehler ist die falsche Zuordnung der Internet-Aktualisierungs-Variablen. Bei der Aktualisierung der Kursdaten für einen Titel können in der Aktualisierungsadresse nicht nur die WKN/ISIN/Symbolkennungen verwendet werden, sondern auch völlig freie Kennungen. Diese sind immer dann notwendig, wenn eine Kurslieferant für festgelegte Titel eigene Kennungen nutzt. Welche Kennung hier im Einzelfall zu nutzen ist, muss manuell über einen Abruf der entsprechenden Seite festgestellt werden. z.b. bei Yahoo bieten sich für Deutsche Titel:

<https://de.finance.yahoo.com/> und für weltweite Titel: <https://finance.yahoo.com/> an.

Die Eintragung erfolgt anschließend direkt im Variablen-Formular der Aktienstammdaten eines Titels:

The screenshot shows a software interface with a 'Variablen ...' dialog box. The dialog box contains a table with the following data:

Variable	Bezeichnung
Yahoo.Symbol.[isin]	^GDAXI
Yahoo.de.SA.[wkn]	N/A
Yahoo.de.SA.[isin]	N/A
Yahoo.de.SA.[yahoo.symbol]	N/A
Yahoo.com.SA.[yahoo.symbol]	N/A
Comdirect.Profil.ID	N/A
Comdirect.ID.[wkn]	N/A
Comdirect.SA.[comdirect.id]	N/A
Finanztreff.Symbol	N/A
onVista.IDINSTRUMENT.[isin]	N/A
onVista.IDNOTATION.[isin]	N/A
onVista.IDCURRENCYFROM	N/A
onVista.IDCURRENCYTO	N/A
onVista.zertifikate.IDOSI.[isin]	N/A
onVista.IDOSI.[isin]	N/A
Listenabfrage	N/A
ISYMBOL	N/A
ADIG.Fondsnr.[isin]	N/A

The background shows a 'Kennzahlen' table with the following data:

Bezeichnung	Wert
Unternehmensumsatz (Mio)	0,000
Aktienstückzahl (Mio)	0,0
Cashflow je Aktie	0,000
Buchwert je Aktie	0,000

There are also 'Markt' and 'Unternehmensdaten' sections visible in the background.

Revision #4

Created 2022-06-19 07:00:53 UTC by Jens Werschmoeller

Updated 2024-10-03 07:03:51 UTC by Jens Werschmoeller