

Marktanalyse

Ziel

Das Analysetool erlaubt den Aufbau von visuellen Entscheidungsbäumen für eine Markteinschätzung. Es wird dabei bewusst vermieden eine Kauf/Verkaufsentscheidung dabei zu realisieren, sondern vielmehr die Möglichkeit der visuellen Markteinschätzung auf verschiedenen Zeitebenen, mit unterschiedlichen Gewichtungen und Beschriftungen zu unterstützen. Es werden dabei mehrere aufbaubare Modelle unterstützt, die parallel existieren können.

Es ist nicht das Ziel eine Kauf/Verkaufsentscheidung auf Basis einer "Formel" zu berechnen, sondern strukturiert wesentliche Markt-Einflussfaktoren für sich persönlich aufzuarbeiten und sich selbst ein Marktbild unabhängig von anderen zu bilden. Die Art der Zusammensetzung und die Herleitung ist völlig frei in Benutzerhand und folgt immer einer Baum-Struktur. Die Größenverhältnisse & Anordnung ist dabei frei bestimmbar. Jedes Kriterium kann dabei die Status "Positiv", "Negativ" und "Neutral" einnehmen. Die Begründungen für eine Markteinschätzung, können dabei unter Beschreibung erfasst werden.

(Glühbirne) Die Idee hierzu ist mir gekommen nach dem Start eines persönlichen Trading-Tagebuchs, womit ich systematisch relevante Themen aufgearbeitet habe. Bislang fehlte mir hierzu jedoch das Tooling, um hierbei visuelle Strukturen zu nutzen. Es stellte sich so aber sehr schnell heraus, dass ein reiner Indikatoren-Ansatz für mich alleine nicht ausreichend war. Vielleicht kann ich Ihnen mit diesem Werkzeug ebenfalls helfen.

Grundstruktur

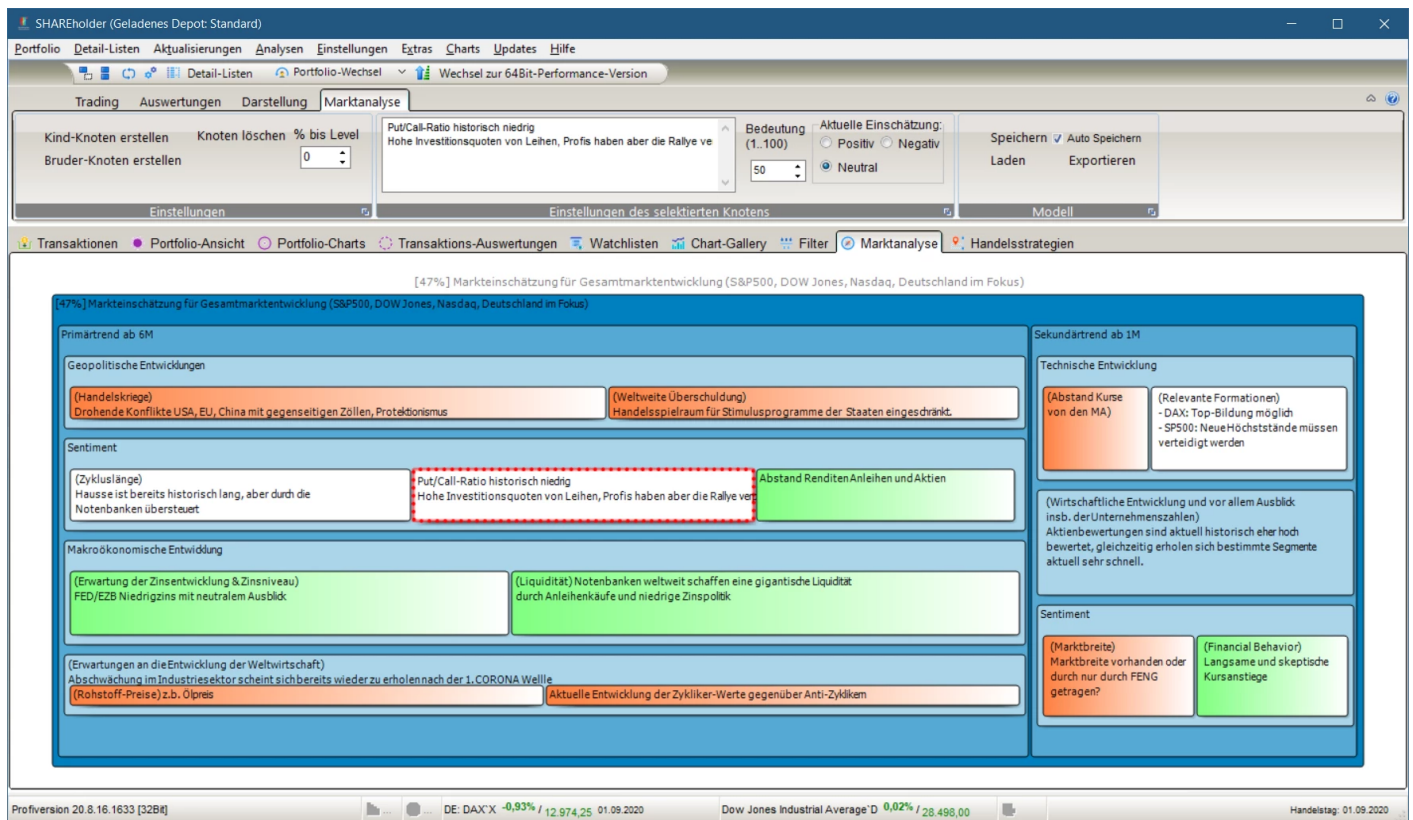
Von mir vorgeschlagene Grundstruktur (wie auf der Abbildung zu sehen):

- Bestimmende Faktoren und Status für den Primärtrend (6M),
- Sekundärtrend (1M) und
- Tagesanalyse (1d)

bilden die Grundstruktur. Unterhalb dieser Hauptebenen erfolgt eine weitere Unterscheidung von kursbestimmenden Faktoren.

Jedes kursbildende Merkmal kann mit eigener Beschriftung, Einschätzung (positiv, negativ, neutral) und Größenverhältnis gesetzt werden. Um ein Element zu ändern, muss es mit der Maus (einfacher

Mausklick) selektiert werden. Es wird hierbei mit einer rot gestrichelten Linie markiert und kann dann editiert werden über die Toolbar (Beschreibung, Bedeutung, Einschätzung). Der Beschreibungstext kann hierbei mehrzeilig sein und entsprechend mit dem "Pfeil" aufgeklappt werden. Es erscheint ein entsprechendes Mehrzeilen-Eingabefeld (Memo). Die Einstellungen hierfür werden über die Toolbar gesetzt und müssen mit "Übernehmen" abgeschlossen werden. Es kann dabei festgelegt werden, ob in diesem Moment gleichzeitig das Model gespeichert werden soll über die zugehörige Checkbox "Auto Speichern".



Das hier gezeigte Beispiel verwendet Zeitebenen "Primärtrend" / "Sekundärtrend" etc. Dies muss nicht so sein und ist nur ein möglicher Ansatzpunkt. Sie können hierbei eigene Strukturen und Herleitungen nutzen. Knoten können hierzu gelöscht, als Kind-Knoten (unterhalb des aktuell gewählten) oder als Bruder-Knoten (neben dem aktuell ausgewählten) erzeugt werden.

Die Marktanalyse-Karte verwendet aufgrund des Levels eine automatische Farbgebung beginnend von hellblau zu weiß. Die Farbgebung wird dabei justiert zwischen 1 Level und niedrigsten Knoten-Level. Wird somit beispielsweise unterhalb von MACD ein weiterer Knoten erstellt, verschiebt sich die Farbskala. Jeder Knoten (auch die übergeordneten) können hierbei eine individuelle Status-Farbe ("Einschätzung") haben. Negativ wird damit als Orange, Positiv mit Grün belegt. Eine "Neutrale" Einschätzung führt zu der Verwendung des normalen Farbwertes innerhalb des Levels des Knoten d.h. damit ein hellblau...weiß Farb(verlaufs)wertes.

Die "Landkarte" ist zum aktuellen Zeitpunkt bewusst vollständig manuell und soll die eigene "Tagesanalyse" und "Markteinschätzung" strukturieren und unterstützen.

Long-Wahrscheinlichkeits-Berechnung

Es gibt für alle Einträge bis Level 3 eine Wahrscheinlichkeitsberechnung in [... %] Darstellung vor den Beschreibungstexten. Hierbei werden die Bedeutungswerte im Verhältnis zu der Summe der Einträge auf gleicher Ebene gezogen. Hierbei werden "neutrale" Einträge in der Betrachtung ignoriert. Positive entsprechend führen zu einem positiven Beitrag und negative bleiben unberücksichtigt für die Long - Wahrscheinlichkeitsberechnung.

Beim Trivialfall von 2 Einträgen, bei dem

- 1 Positiv und 1 negativ bewertet wird ergibt dies damit 50% LONG
- 1 Positiv und 1 neutral bewertet ergibt damit 100% LONG, da neutrale Einträge ignoriert werden

Die Berechnung erfolgt nach unten selbstverständlich vollständig und rekursiv. Nur die Anzeige der %-Werte ist begrenzt aus optischen Gründen unter den gegebenen Zielstellungen.

Besonderheiten

- Es können über die Speichern/Laden Funktion unterschiedliche Modelle aufgebaut werden. Im Standard wird jedoch immer aus dem Datenverzeichnis die "Marktanalyse.TEE" Datei gezogen. Dies ist damit das Standardmodell, was bei Systemstart geladen wird. Werden Änderungen vorgenommen, so wird diese Datei entsprechend gespeichert.

Revision #1

Created 20 June 2022 10:45:04 by Jens Werschmoeller

Updated 20 June 2022 10:45:20 by Jens Werschmoeller