

Artikel: Die tägliche Indexdispositionsliste

fortlaufende Backtesting-Auswertung seit 2011

Sebastian Schmidt ist externer Autor. Seine hier gezeigten Strategien sind ausschließlich virtuell.

Jegliche Nachahmungen in der Realität erfolgen auf eigenes Risiko und zudem zwingend nach Anlageberatung durch Ihre Bank

Auswertung für SDAX®



Indikation Nr.	Startdatum	Enddatum	Dauer Indikation in Handelstagen	Indikation	Ergebnis in Punkten	Ausstieggrund	kumulierte Punktgewinne und -verluste	Einstiegskurs (Open des Starttages)	Ausstiegskurs (Stop- bzw. Trailing Stop-Niveau)
1	03.01.2011	04.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	1	0	0
2	04.01.2011	05.01.2011	1	Long	4,73	Intraday-Trailing Stop	5,73	5.248,05	5.252,78
3	05.01.2011	06.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	5,73	0	0
4	06.01.2011	07.01.2011	1	Long	-11,72	Intraday-Trailing Stop	-5,99	5.236,96	5.225,24
5	07.01.2011	10.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	-5,99	0	0
6	10.01.2011	10.01.2011	1	Long	-52,06	Sofortverlust Stop	-58,05	5.206,00	5.153,94
7	11.01.2011	13.01.2011	2	Long	21,61	Intraday-Trailing Stop	-36,44	5.152,17	5.173,78
8	13.01.2011	14.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	-36,44	0,00	0,00
9	14.01.2011	20.01.2011	4	Long	11,63	Intraday-Trailing Stop	-24,82	5.174,91	5.186,54
10	20.01.2011	21.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	-24,82	0,00	0,00
11	21.01.2011	31.01.2011	6	Long	62,4	Intraday-Trailing Stop	37,58	5.111,79	5.174,19
12	31.01.2011	01.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	37,58	0,00	0,00
13	01.02.2011	10.02.2011	7	Long	130,53	Intraday-Trailing Stop	168,11	5.162,09	5.292,62
14	10.02.2011	11.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	168,11	0,00	0,00
15	11.02.2011	16.02.2011	3	Long	30,76	Intraday-Trailing Stop	198,87	5293,48	5324,24
16	16.02.2011	17.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	198,87	0,00	0,00
17	17.02.2011	21.02.2011	2	Long	-34,8	Intraday-Trailing Stop	164,07	5318,99	5284,19
18	21.02.2011	22.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	164,07	0,00	0,00
19	22.02.2011	22.02.2011	1	Long	-52,34	Sofortverlust Stop	111,73	5234,43	5182,09
20	23.02.2011	23.02.2011	1	Long	-52,03	Sofortverlust Stop	59,7	5.202,62	5.150,59
21	24.02.2011	24.02.2011	1	Long	-51,33	Sofortverlust Stop	8,38	5132,6	5081,27
22	25.02.2011	28.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	8,38	0,00	0,00
23	28.02.2011	02.03.2011	2	Long	66,67	Intraday-Trailing Stop	75,04	5189,37	5256,04
24	02.03.2011	03.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	75,04	0,00	0,00
25	03.03.2011	07.03.2011	2	Long	7,84	Intraday-Trailing Stop	82,88	5.224,99	5.232,83
26	07.03.2011	08.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	82,88	0,00	0,00
27	08.03.2011	09.03.2011	1	Long	-30,43	Intraday-Trailing Stop	52,45	5.259,96	5.229,53
28	09.03.2011	10.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	52,45	0,00	0,00
29	10.03.2011	11.03.2011	1	Long	-67,45	Intraday-Trailing Stop	-15	5.228,36	5.160,91
30	11.03.2011	14.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	-15	0,00	0,00
31	14.03.2011	14.03.2011	1	Long	-50,27	Sofortverlust Stop	-65,26	5.026,59	4.976,32
32	15.03.2011	17.03.2011	2	Out	0	Enter Long Signal	-65,26	0,00	0,00
33	17.03.2011	23.03.2011	4	Long	220,55	Intraday-Trailing Stop	155,29	4.833,05	5.053,60
34	23.03.2011	24.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	155,29	0,00	0,00
35	24.03.2011	11.04.2011	12	Long	174,69	Intraday-Trailing Stop	329,98	5.036,85	5.211,54
36	11.04.2011	12.04.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	329,98	0,00	0,00
37	12.04.2011	18.04.2011	4	Long	-16,59	Intraday-Trailing Stop	313,39	5.196,01	5.179,42
38	18.04.2011	19.04.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	313,39	0,00	0,00
39	19.04.2011	04.05.2011	9	Long	204,17	Intraday-Trailing Stop	517,56	5.128,71	5.332,88
40	04.05.2011	05.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	517,56	0	0
41	05.05.2011	06.05.2011	1	Long	-41,31	Intraday-Trailing Stop	476,25	5.356,58	5.315,27
42	06.05.2011	09.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	476,25	0	0
43	09.05.2011	12.05.2011	3	Long	47,12	Intraday-Trailing Stop	523,37	5.342,20	5.389,32
44	12.05.2011	13.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	523,37	0,00	0,00
45	13.05.2011	16.05.2011	1	Long	2,23	Intraday-Trailing Stop	525,6	5.433,65	5.435,88
46	16.05.2011	17.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	525,6	0	0
47	17.05.2011	23.05.2011	4	Long	10,11	Intraday-Trailing Stop	535,71	5.424,52	5.434,63
48	23.05.2011	24.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	535,71	0	0
49	24.05.2011	25.05.2011	1	Long	-13,15	Intraday-Trailing Stop	522,55	5.355,73	5.342,58
50	25.05.2011	26.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	522,55	0	0
51	26.05.2011	02.06.2011	5	Long	84,76	Intraday-Trailing Stop	607,31	5.364,24	5.449,00
52	02.06.2011	03.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	607,31	0,00	0,00

53	03.06.2011	06.06.2011	1	Long	-38,06	Intraday-Trailing Stop	569,25	5.437,61	5.399,55
54	06.06.2011	07.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	569,25	0	0
55	07.06.2011	08.06.2011	1	Long	-21,04	Intraday-Trailing Stop	548,21	5.402,68	5.381,64
56	08.06.2011	09.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	548,21	0	0
57	09.06.2011	10.06.2011	1	Long	9,68	Intraday-Trailing Stop	557,89	5.372,73	5.382,41
58	10.06.2011	13.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	557,89	0,00	0,00
59	13.06.2011	15.06.2011	2	Long	7,7	Intraday-Trailing Stop	565,59	5.376,73	5.384,43
60	15.06.2011	16.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	565,59	0	0
61	16.06.2011	16.06.2011	1	Long	-53,52	Sofortverlust Stop	512,07	5.351,93	5.298,41
62	17.06.2011	20.06.2011	1	Long	-33,43	Intraday-Trailing Stop	478,64	5309,07	5275,64
63	20.06.2011	21.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	478,64	0,00	0,00
64	21.06.2011	23.06.2011	2	Long	16,94	Intraday-Trailing Stop	495,59	5279,47	5296,41
65	23.06.2011	24.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	495,59	0,00	0,00
66	24.06.2011	27.06.2011	1	Long	-35,86	Intraday-Trailing Stop	459,73	5289,81	5253,95
67	27.06.2011	29.06.2011	2	Out	0	Enter Long Signal	459,73	0,00	0,00
68	29.06.2011	11.07.2011	8	Long	321,48	Intraday-Trailing Stop	781,21	5257,82	5579,3
69	11.07.2011	12.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	781,21	0,00	0,00
70	12.07.2011	12.07.2011	1	Long	-54,47	Sofortverlust Stop	726,74	5.446,64	5.392,17
71	13.07.2011	14.07.2011	1	Long	2,67	Intraday-Trailing Stop	729,41	5.452,04	5.454,71
72	14.07.2011	15.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	729,41	0	0
73	15.07.2011	18.07.2011	1	Long	-36,21	Intraday-Trailing Stop	693,2	5.396,95	5.360,74
74	18.07.2011	19.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	693,2	0	0
75	19.07.2011	21.07.2011	2	Long	36,45	Intraday-Trailing Stop	729,65	5.279,12	5.315,57
76	21.07.2011	22.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	729,65	0,00	0,00
77	22.07.2011	27.07.2011	3	Long	19,19	Intraday-Trailing Stop	748,84	5.386,91	5.406,10
78	27.07.2011	28.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	748,84	0	0
79	28.07.2011	28.07.2011	1	Long	-53,26	Sofortverlust Stop	695,58	5.325,58	5.272,32
80	29.07.2011	01.08.2011	1	Long	-27,98	Intraday-Trailing Stop	667,61	5283,13	5255,15
81	01.08.2011	10.08.2011	7	Out	0	Enter Long Signal	667,61	0,00	0,00
82	10.08.2011	10.08.2011	1	Long	-45,56	Sofortverlust Stop	622,05	4555,8	4510,24
83	11.08.2011	11.08.2011	1	Long	-44,48	Sofortverlust Stop	577,57	4.448,41	4.403,93
84	12.08.2011	12.08.2011	1	Long	-44,91	Sofortverlust Stop	532,66	4.490,65	4.445,74
85	15.08.2011	16.08.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	532,66	0,00	0,00
86	16.08.2011	17.08.2011	1	Short	83,91	Intraday-Trailing Stop	616,57	4653,3	4569,39
87	17.08.2011	18.08.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	616,57	0,00	0,00
88	18.08.2011	22.08.2011	2	Short	277,31	Intraday-Trailing Stop	893,88	4516,39	4239,08
89	22.08.2011	23.08.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	893,88	0,00	0,00
90	23.08.2011	23.08.2011	1	Short	-42,9	Sofortverlust Stop	850,98	4.290,27	4.333,17
91	24.08.2011	24.08.2011	1	Short	-42,94	Sofortverlust Stop	808,03	4.294,12	4.337,06
92	25.08.2011	29.08.2011	2	Short	42	Intraday-Trailing Stop	850,03	4.383,52	4.341,52
93	29.08.2011	30.08.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	850,03	0,00	0,00
94	30.08.2011	31.08.2011	1	Short	-44,84	Intraday-Trailing Stop	805,19	4.390,21	4.435,05
95	31.08.2011	02.09.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	805,19	0,00	0,00
96	02.09.2011	07.09.2011	3	Short	253,02	Intraday-Trailing Stop	1058,21	4.517,04	4.264,02
97	07.09.2011	08.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1058,21	0,00	0,00
98	08.09.2011	13.09.2011	3	Short	142,97	Intraday-Trailing Stop	1201,18	4.334,45	4.191,48
99	13.09.2011	14.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1201,18	0,00	0,00
100	14.09.2011	14.09.2011	1	Short	-41,62	Sofortverlust Stop	1159,57	4.161,59	4.203,21
101	15.09.2011	16.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1159,57	0,00	0,00
102	16.09.2011	16.09.2011	1	Short	-43,24	Sofortverlust Stop	1116,32	4.324,40	4.367,64
103	19.09.2011	20.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1116,32	0,00	0,00
104	20.09.2011	21.09.2011	1	Short	-30,3	Intraday-Trailing Stop	1086,02	4.352,01	4.382,31
105	21.09.2011	22.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1086,02	0,00	0,00
106	22.09.2011	26.09.2011	2	Short	147,55	Intraday-Trailing Stop	1233,57	4.331,89	4.184,34
107	26.09.2011	27.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1233,57	0,00	0,00
108	27.09.2011	27.09.2011	1	Short	-42,54	Sofortverlust Stop	1191,04	4.253,67	4.296,21
109	28.09.2011	29.09.2011	1	Short	-17,04	Intraday-Trailing Stop	1174	4.309,61	4.326,65
110	29.09.2011	30.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1174	0,00	0,00
111	30.09.2011	05.10.2011	3	Short	166,77	Intraday-Trailing Stop	1340,77	4.336,67	4.169,90
112	05.10.2011	06.10.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1340,77	0,00	0,00
113	06.10.2011	06.10.2011	1	Short	-41,92	Sofortverlust Stop	1298,85	4.192,40	4.234,32
114	07.10.2011	10.10.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1298,85	0,00	0,00
115	10.10.2011	10.10.2011	1	Short	-43,14	Sofortverlust Stop	1255,71	4.313,65	4.356,79
116	11.10.2011	12.10.2011	1	Short	-6,31	Intraday-Trailing Stop	1249,39	4.394,99	4.401,30
117	12.10.2011	14.10.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	1249,39	0,00	0,00
118	14.10.2011	14.10.2011	1	Short	-44,49	Sofortverlust Stop	1204,9	4.449,19	4.493,68
119	17.10.2011	18.10.2011	1	Short	24,48	Intraday-Trailing Stop	1229,38	4.489,85	4.465,37
120	18.10.2011	21.10.2011	3	Out	0	Enter Short Signal	1229,38	0,00	0,00
121	21.10.2011	21.10.2011	1	Short	-44,07	Sofortverlust Stop	1185,31	4.407,48	4.451,55
122	24.10.2011	24.10.2011	1	Short	-44,75	Sofortverlust Stop	1140,56	4.474,78	4.519,53
123	25.10.2011	02.11.2011	6	Out	0	Enter Short Signal	1140,56	0,00	0,00
124	02.11.2011	03.11.2011	1	Short	-16,94	Intraday-Trailing Stop	1123,62	4.480,34	4.497,28
125	03.11.2011	10.11.2011	5	Out	0	Enter Short Signal	1123,62	0,00	0,00
126	10.11.2011	11.11.2011	1	Short	2,36	Intraday-Trailing Stop	1125,98	4.451,51	4.449,15
127	11.11.2011	16.11.2011	3	Out	0	Enter Short Signal	1125,98	0,00	0,00
128	16.11.2011	22.11.2011	4	Short	191,64	Intraday-Trailing Stop	1317,62	4.502,16	4.310,52
129	22.11.2011	23.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1317,62	0,00	0,00
130	23.11.2011	24.11.2011	1	Short	16,65	Intraday-Trailing Stop	1334,27	4.223,94	4.207,29
131	24.11.2011	25.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1334,27	0,00	0,00
132	25.11.2011	28.11.2011	1	Short	-18,19	Intraday-Trailing Stop	1316,08	4.225,19	4.243,38
133	28.11.2011	29.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1316,08	0,00	0,00

134	29.11.2011	30.11.2011	1	Short	0,19	Intraday-Trailing Stop	1316,27	4.319,29	4.319,10
135	30.11.2011	02.12.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	1316,27	0,00	0,00
136	02.12.2011	05.12.2011	1	Short	-30,9	Intraday-Trailing Stop	1285,37	4.413,83	4.444,73
137	05.12.2011	07.12.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	1285,37	0,00	0,00
138	07.12.2011	08.12.2011	1	Short	12,74	Intraday-Trailing Stop	1298,11	4.454,86	4.442,12
139	08.12.2011	09.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1298,11	0,00	0,00
140	09.12.2011	15.12.2011	4	Short	78,31	Intraday-Trailing Stop	1376,42	4.340,55	4.262,24
141	15.12.2011	16.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1376,42	0,00	0,00
142	16.12.2011	20.12.2011	2	Short	8,85	Intraday-Trailing Stop	1385,27	4.267,42	4.258,57
143	20.12.2011	21.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1385,27	0,00	0,00
144	21.12.2011	21.12.2011	1	Short	-43,07	Sofortverlust Stop	1342,2	4.306,83	4.349,90
145	22.12.2011	23.12.2011	1	Short	-19	Intraday-Trailing Stop	1323,2	4.316,29	4.335,29
146	23.12.2011	27.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	1323,2	0,00	0,00
147	27.12.2011	29.12.2011	2	Short	-14,1	Intraday-Trailing Stop	1309,1	4.348,14	4.362,24
148	29.12.2011	10.01.2012	8	Out	0	Enter Short Signal	1309,1	0,00	0,00
149	10.01.2012	10.01.2012	1	Short	-44,09	Sofortverlust Stop	1265,01	4.408,88	4.452,97
150	11.01.2012	03.02.2012	17	Out	0	Systemtest-Ende	1265,01	0,00	0,00