

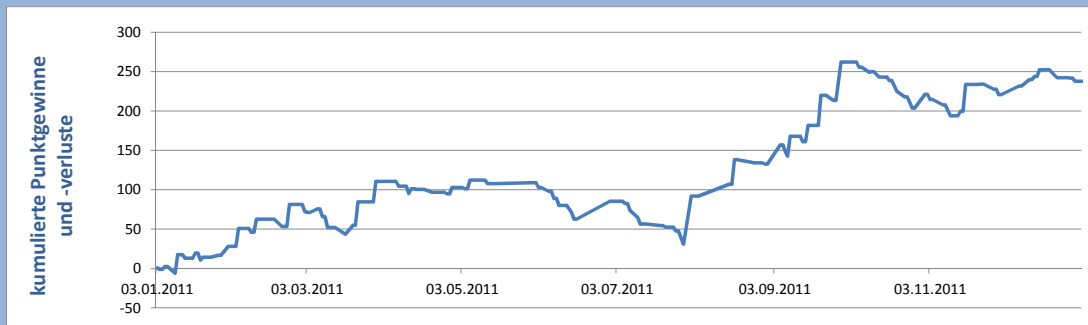
Artikel: Die tägliche Indexdispositionsliste

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 TecDAX®



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	-1,85	Intraday-Trailing Stop	-0,85	861,06	859,21
3	05.01.2011	06.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	-0,85	0	0
4	06.01.2011	07.01.2011	1	Long	3,64	Intraday-Trailing Stop	2,79	863,31	866,95
5	07.01.2011	10.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	2,79	0	0
6	10.01.2011	10.01.2011	1	Long	-8,69	Sofortverlust Stop	-5,9	869,00	860,31
7	11.01.2011	13.01.2011	2	Long	23,71	Intraday-Trailing Stop	17,81	858,63	882,34
8	13.01.2011	14.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	17,81	0,00	0,00
9	14.01.2011	17.01.2011	1	Long	-4,44	Intraday-Trailing Stop	13,37	879,98	875,54
10	17.01.2011	18.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	13,37	0,00	0,00
11	18.01.2011	19.01.2011	1	Long	6,39	Intraday-Trailing Stop	19,76	880,42	886,81
12	19.01.2011	20.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	19,76	0,00	0,00
13	20.01.2011	20.01.2011	1	Long	-8,79	Sofortverlust Stop	10,96	879,36	870,57
14	21.01.2011	24.01.2011	1	Long	3,34	Intraday-Trailing Stop	14,31	866,17	869,51
15	24.01.2011	27.01.2011	3	Out	0	Enter Long Signal	14,31	0	0
16	27.01.2011	28.01.2011	1	Long	2,45	Intraday-Trailing Stop	16,76	875,70	878,15
17	28.01.2011	31.01.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	16,76	0	0
18	31.01.2011	03.02.2011	3	Long	11,3	Intraday-Trailing Stop	28,06	863,69	874,99
19	03.02.2011	04.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	28,06	0	0
20	04.02.2011	08.02.2011	2	Long	22,77	Intraday-Trailing Stop	50,83	877,44	900,21
21	08.02.2011	09.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	50,83	0	0
22	09.02.2011	10.02.2011	1	Long	-4,66	Intraday-Trailing Stop	46,17	903,83	899,17
23	10.02.2011	11.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	46,17	0	0
24	11.02.2011	18.02.2011	5	Long	16,52	Intraday-Trailing Stop	62,69	894,60	911,12
25	18.02.2011	21.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	62,69	0,00	0,00
26	21.02.2011	21.02.2011	1	Long	-9,18	Sofortverlust Stop	53,51	917,79	908,61
27	22.02.2011	23.02.2011	1	Long	-0,06	Intraday-Trailing Stop	53,45	894,20	894,14
28	23.02.2011	24.02.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	53,45	0,00	0,00
29	24.02.2011	01.03.2011	3	Long	27,89	Intraday-Trailing Stop	81,33	873,54	901,43
30	01.03.2011	02.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	81,33	0,00	0,00
31	02.03.2011	02.03.2011	1	Long	-8,95	Sofortverlust Stop	72,39	894,50	885,55
32	03.03.2011	04.03.2011	1	Long	-1,22	Intraday-Trailing Stop	71,17	900,23	899,01
33	04.03.2011	07.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	71,17	0,00	0,00
34	07.03.2011	08.03.2011	1	Long	4,42	Intraday-Trailing Stop	75,59	893,23	897,65
35	08.03.2011	09.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	75,59	0,00	0,00
36	09.03.2011	10.03.2011	1	Long	-9,5	Intraday-Trailing Stop	66,09	900,71	891,21
37	10.03.2011	11.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	66,09	0,00	0,00
38	11.03.2011	14.03.2011	1	Long	-13,83	Intraday-Trailing Stop	52,26	873,96	860,13
39	14.03.2011	18.03.2011	4	Out	0	Enter Long Signal	52,26	0,00	0,00
40	18.03.2011	18.03.2011	1	Long	-8,78	Sofortverlust Stop	43,48	878,48	869,7
41	21.03.2011	22.03.2011	1	Long	11,38	Intraday-Trailing Stop	54,85	879,73	891,11
42	22.03.2011	23.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	54,85	0	0
43	23.03.2011	29.03.2011	4	Long	29,89	Intraday-Trailing Stop	84,75	886,01	915,90
44	29.03.2011	30.03.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	84,75	0,00	0,00
45	30.03.2011	07.04.2011	6	Long	25,83	Intraday-Trailing Stop	110,58	919,78	945,61
46	07.04.2011	08.04.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	110,58	0	0
47	08.04.2011	11.04.2011	1	Long	-6,07	Intraday-Trailing Stop	104,51	939,47	933,40
48	11.04.2011	12.04.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	104,51	0	0
49	12.04.2011	12.04.2011	1	Long	-9,26	Sofortverlust Stop	95,25	926,13	916,87
50	13.04.2011	14.04.2011	1	Long	6,13	Intraday-Trailing Stop	101,38	910,7	916,83
51	14.04.2011	15.04.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	101,38	0,00	0,00
52	15.04.2011	18.04.2011	1	Long	-1,07	Intraday-Trailing Stop	100,31	916,03	914,96

53	18.04.2011	21.04.2011	3	Out	0	Enter Long Signal	100,31	0,00	0,00
54	21.04.2011	26.04.2011	1	Long	-3,55	Intraday-Trailing Stop	96,76	921,37	917,82
55	26.04.2011	27.04.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	96,76	0,00	0,00
56	27.04.2011	28.04.2011	1	Long	-2,09	Intraday-Trailing Stop	94,66	921,98	919,89
57	28.04.2011	29.04.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	94,66	0,00	0,00
58	29.04.2011	03.05.2011	2	Long	8,21	Intraday-Trailing Stop	102,87	924,13	932,34
59	03.05.2011	04.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	102,87	0,00	0,00
60	04.05.2011	05.05.2011	1	Long	-1,57	Intraday-Trailing Stop	101,3	920,99	919,42
61	05.05.2011	06.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	101,3	0,00	0,00
62	06.05.2011	12.05.2011	4	Long	10,98	Intraday-Trailing Stop	112,28	914,59	925,57
63	12.05.2011	13.05.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	112,28	0,00	0,00
64	13.05.2011	16.05.2011	1	Long	-4,38	Intraday-Trailing Stop	107,9	927,71	923,33
65	16.05.2011	31.05.2011	11	Out	0	Enter Long Signal	107,9	0,00	0,00
66	31.05.2011	01.06.2011	1	Long	1,11	Intraday-Trailing Stop	109,01	914,02	915,13
67	01.06.2011	02.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	109,01	0,00	0,00
68	02.06.2011	03.06.2011	1	Long	-6,17	Intraday-Trailing Stop	102,84	908,15	901,98
69	03.06.2011	06.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	102,84	0,00	0,00
70	06.06.2011	07.06.2011	1	Long	-4,62	Intraday-Trailing Stop	98,22	901,52	896,90
71	07.06.2011	08.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	98,22	0,00	0,00
72	08.06.2011	08.06.2011	1	Long	-8,92	Sofortverlust Stop	89,29	892,48	883,56
73	09.06.2011	10.06.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	89,29	0,00	0,00
74	10.06.2011	10.06.2011	1	Long	-8,91	Sofortverlust Stop	80,39	890,5	881,59
75	13.06.2011	15.06.2011	2	Out	0	Enter Long Signal	80,39	0,00	0,00
76	15.06.2011	15.06.2011	1	Long	-8,92	Sofortverlust Stop	71,47	891,52	882,60
77	16.06.2011	16.06.2011	1	Long	-8,79	Sofortverlust Stop	62,68	879,12	870,33
78	17.06.2011	30.06.2011	9	Out	0	Enter Long Signal	62,68	0	0
79	30.06.2011	05.07.2011	3	Long	22,63	Intraday-Trailing Stop	85,31	883,59	906,22
80	05.07.2011	06.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	85,31	0	0
81	06.07.2011	07.07.2011	1	Long	-2,48	Intraday-Trailing Stop	82,84	901,29	898,81
82	07.07.2011	08.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	82,84	0	0
83	08.07.2011	08.07.2011	1	Long	-9,1	Sofortverlust Stop	73,74	909,86	900,76
84	11.07.2011	11.07.2011	1	Long	-8,94	Sofortverlust Stop	64,8	893,78	884,84
85	12.07.2011	12.07.2011	1	Long	-8,7	Sofortverlust Stop	56,1	869,99	861,29
86	13.07.2011	14.07.2011	1	Long	0,46	Intraday-Trailing Stop	56,56	869,51	869,97
87	14.07.2011	20.07.2011	4	Out	0	Enter Long Signal	56,56	0,00	0,00
88	20.07.2011	21.07.2011	1	Long	-1,76	Intraday-Trailing Stop	54,8	841,98	840,22
89	21.07.2011	22.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	54,8	0,00	0,00
90	22.07.2011	25.07.2011	1	Long	-2,2	Intraday-Trailing Stop	52,6	849,58	847,38
91	25.07.2011	26.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	52,6	0,00	0,00
92	26.07.2011	27.07.2011	1	Long	-4,92	Intraday-Trailing Stop	47,68	850,17	845,25
93	27.07.2011	28.07.2011	1	Out	0	Enter Long Signal	47,68	0,00	0,00
94	28.07.2011	28.07.2011	1	Long	-8,36	Sofortverlust Stop	39,33	835,52	827,16
95	29.07.2011	29.07.2011	1	Long	-8,22	Sofortverlust Stop	31,11	821,51	813,29
96	01.08.2011	04.08.2011	3	Short	60,73	Intraday-Trailing Stop	91,84	829,42	768,69
97	04.08.2011	16.08.2011	8	Out	0	Enter Short Signal	91,84	0,00	0,00
98	16.08.2011	17.08.2011	1	Short	15,04	Intraday-Trailing Stop	106,88	753,83	738,79
99	17.08.2011	18.08.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	106,88	0,00	0,00
100	18.08.2011	19.08.2011	1	Short	31,23	Intraday-Trailing Stop	138,11	716,1	684,87
101	19.08.2011	26.08.2011	5	Out	0	Enter Short Signal	138,11	0,00	0,00
102	26.08.2011	29.08.2011	1	Short	-3,76	Intraday-Trailing Stop	134,35	718,51	722,27
103	29.08.2011	30.08.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	134,35	0,00	0,00
104	30.08.2011	31.08.2011	1	Short	-1,68	Intraday-Trailing Stop	132,67	737,99	739,67
105	31.08.2011	05.09.2011	3	Out	0	Enter Short Signal	132,67	0,00	0,00
106	05.09.2011	06.09.2011	1	Short	24,17	Intraday-Trailing Stop	156,84	721,90	697,73
107	06.09.2011	07.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	156,84	0,00	0,00
108	07.09.2011	07.09.2011	1	Short	-7,03	Sofortverlust Stop	149,81	703,33	710,36
109	08.09.2011	08.09.2011	1	Short	-7,17	Sofortverlust Stop	142,63	717,30	724,47
110	09.09.2011	13.09.2011	2	Short	25,21	Intraday-Trailing Stop	167,84	718,00	692,79
111	13.09.2011	14.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	167,84	0,00	0,00
112	14.09.2011	14.09.2011	1	Short	-6,83	Sofortverlust Stop	161,01	683,15	689,98
113	15.09.2011	16.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	161,01	0,00	0,00
114	16.09.2011	20.09.2011	2	Short	20,78	Intraday-Trailing Stop	181,8	712,03	691,25
115	20.09.2011	21.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	181,8	0,00	0,00
116	21.09.2011	23.09.2011	2	Short	38,11	Intraday-Trailing Stop	219,91	695,45	657,34
117	23.09.2011	26.09.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	219,91	0,00	0,00
118	26.09.2011	26.09.2011	1	Short	-6,47	Sofortverlust Stop	213,43	647,28	653,75
119	27.09.2011	29.09.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	213,43	0,00	0,00
120	29.09.2011	05.10.2011	4	Short	48,59	Intraday-Trailing Stop	262,02	682,24	633,65
121	05.10.2011	06.10.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	262,02	0,00	0,00
122	06.10.2011	06.10.2011	1	Short	-6,45	Sofortverlust Stop	255,57	645,36	651,81
123	07.10.2011	10.10.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	255,57	0,00	0,00
124	10.10.2011	10.10.2011	1	Short	-6,63	Sofortverlust Stop	248,94	663,44	670,07
125	11.10.2011	12.10.2011	1	Short	0,87	Intraday-Trailing Stop	249,81	672,45	671,58
126	12.10.2011	14.10.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	249,81	0,00	0,00
127	14.10.2011	14.10.2011	1	Short	-6,8	Sofortverlust Stop	243,01	679,83	686,63
128	17.10.2011	18.10.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	243,01	0,00	0,00
129	18.10.2011	19.10.2011	1	Short	-4,58	Intraday-Trailing Stop	238,43	673,74	678,32
130	19.10.2011	20.10.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	238,43	0,00	0,00
131	20.10.2011	20.10.2011	1	Short	-6,83	Sofortverlust Stop	231,6	683,30	690,13
132	21.10.2011	21.10.2011	1	Short	-6,82	Sofortverlust Stop	224,77	682,45	689,27
133	24.10.2011	24.10.2011	1	Short	-6,94	Sofortverlust Stop	217,83	693,86	700,80

134	25.10.2011	26.10.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	217,83	0,00	0,00
135	26.10.2011	26.10.2011	1	Short	-6,99	Sofortverlust Stop	210,85	698,52	705,51
136	27.10.2011	27.10.2011	1	Short	-7,15	Sofortverlust Stop	203,7	714,58	721,73
137	28.10.2011	01.11.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	203,7	0,00	0,00
138	01.11.2011	02.11.2011	1	Short	17,58	Intraday-Trailing Stop	221,28	696,46	678,88
139	02.11.2011	03.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	221,28	0,00	0,00
140	03.11.2011	03.11.2011	1	Short	-6,75	Sofortverlust Stop	214,53	675,16	681,91
141	04.11.2011	08.11.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	214,53	0,00	0,00
142	08.11.2011	08.11.2011	1	Short	-6,89	Sofortverlust Stop	207,64	688,91	695,80
143	09.11.2011	10.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	207,64	0,00	0,00
144	10.11.2011	10.11.2011	1	Short	-6,85	Sofortverlust Stop	200,79	685,41	692,26
145	11.11.2011	11.11.2011	1	Short	-6,85	Sofortverlust Stop	193,94	684,72	691,57
146	14.11.2011	15.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	193,94	0,00	0,00
147	15.11.2011	16.11.2011	1	Short	5,42	Intraday-Trailing Stop	199,36	693,72	688,30
148	16.11.2011	17.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	199,36	0,00	0,00
149	17.11.2011	22.11.2011	3	Short	34,13	Intraday-Trailing Stop	233,49	685,45	651,32
150	22.11.2011	23.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	233,49	0,00	0,00
151	23.11.2011	24.11.2011	1	Short	0,78	Intraday-Trailing Stop	234,27	640,65	639,87
152	24.11.2011	28.11.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	234,27	0,00	0,00
153	28.11.2011	28.11.2011	1	Short	-6,6	Sofortverlust Stop	227,67	660,18	666,78
154	29.11.2011	30.11.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	227,67	0,00	0,00
155	30.11.2011	30.11.2011	1	Short	-6,81	Sofortverlust Stop	220,86	681,28	688,09
156	01.12.2011	08.12.2011	5	Out	0	Enter Short Signal	220,86	0,00	0,00
157	08.12.2011	09.12.2011	1	Short	10,59	Intraday-Trailing Stop	231,45	689,59	679,00
158	09.12.2011	12.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	231,45	0,00	0,00
159	12.12.2011	13.12.2011	1	Short	8,4	Intraday-Trailing Stop	239,85	678,66	670,26
160	13.12.2011	14.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	239,85	0,00	0,00
161	14.12.2011	15.12.2011	1	Short	3,79	Intraday-Trailing Stop	243,64	669,55	665,76
162	15.12.2011	16.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	243,64	0,00	0,00
163	16.12.2011	20.12.2011	2	Short	8,65	Intraday-Trailing Stop	252,29	669,31	660,66
164	20.12.2011	22.12.2011	2	Out	0	Enter Short Signal	252,29	0,00	0,00
165	22.12.2011	22.12.2011	1	Short	-6,69	Sofortverlust Stop	245,6	668,64	675,33
166	23.12.2011	27.12.2011	1	Short	-3,28	Intraday-Trailing Stop	242,32	677,72	681,00
167	27.12.2011	28.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	242,32	0,00	0,00
168	28.12.2011	29.12.2011	1	Short	-0,55	Intraday-Trailing Stop	241,77	677,18	677,73
169	29.12.2011	30.12.2011	1	Out	0	Enter Short Signal	241,77	0,00	0,00
170	30.12.2011	02.01.2012	1	Short	-4,15	Intraday-Trailing Stop	237,62	680,46	684,61
171	02.01.2012	03.02.2012	24	Out	0	Systemtest-Ende	237,62	0,00	0,00