

Geht man von einer vollständigen zyklischen Bewegung aus, sollte der RSI3M3 sogar das entgegengesetzte Extrem erreichen.

Test 1: Handelsregeln für ein einfaches Handelssystem:

Einstieg Long:

RSI3M3 kreuzt die 20er-Linie von unten nach oben.

Ausstieg aus der Long-Position:

RSI3M3 kreuzt die 50er-Linie Mittel-linie von unten nach oben.

Einstieg Short:

RSI3M3 kreuzt die 80er-Linie von oben nach unten.

Ausstieg aus der Short-Position:

RSI3M3 kreuzt die 50er-Linie (Mittel-linie) oben nach unten.

Auswertung für Tagesdaten mit dem DAX-Future vom 01.01.2000 bis 26.10.2023

Anzahl der Long- und Short-Trades: 265

Es wurde jeweils nur ein Kontrakt gekauft. Ein DAX-Punkt entspricht einem Wert von fünf Euro (Mini-DAX-Futures (FDXM)).

Trefferquote: 61,89 %

Payoff-Ratio: 0,71

Profitfaktor: 1,16

B1 Tages-Chart des Dax-Futures mit RSI-Variationen



Der untere Teil des Charts zeigt die Abwandlung des Standard-RSI. Die Periode 14 wird zum hektischen RSI(3) formiert, und ganz unten befindet sich der RSI3M3. Der RSI3M3 enthält eine hohe Reaktionsgeschwindigkeit und gleichzeitig ist seine hektische Struktur reduziert. Dadurch lassen sich die einzelnen Preiswellen deutlicher erkennen. Der Einfluss eines Trends wird durch die zyklischen Auf- und Abwärtsbewegungen relativiert.

Quelle: amibroker.com

Die schnelle Auswertung zeigt, dass in der Handelsidee ein Gewinnpotenzial steckt. Ein Profitfaktor von 1,16 ist jedoch nicht so verlockend, dass man die Handelsidee sofort in die Handelspraxis umsetzen sollte. Bei genauerer Betrachtung wird auch die Schwäche des Systems deutlich. Denn sobald ein Handelssignal gegen den Trend erfolgt und gleichzeitig eine niedrige Volatilität vorliegt,

Anzeige

MetaStock

MetaStock D/C (Daily Charts) wurde speziell für Trader entwickelt, die ihre Analysen nach Börsenschluss durchführen.

MetaStock wird standardmäßig mit 4 leistungsstarken Tools geliefert, mit denen Sie die Software an Ihre Bedürfnisse anpassen können:

- **Explorer** – Scannen Sie Wertpapiere, um diejenigen zu finden, die Ihre vordefinierten Kriterien erfüllen.
- **Expert Advisor** – Lassen Sie sich die Ergebnisse der Analyse in Ihrem Chart anzeigen.
- **Enhanced System Tester** – Erstellen, backtesten, vergleichen und perfektionieren Sie Ihre Strategie.
- **Indicator Builder** – Entwickeln Sie eigene Indikatoren, um Ihre Ideen zu verwirklichen.

Jetzt neu! Kursdatenlieferung von Lenz + Partner.



Exklusives Angebot für TRADERS' Leser!
www.lp-software.de/metastock

Lenz + Partner
part of infront