

B2 Handelssystem RSI3M3 im Einsatz



Im Chart sind drei Handelssignale eingezeichnet. Das System zeigt seine hohe Effizienz in volatilen Seitwärtsmärkten. Im unteren Teil ist die Chaikin-Volatilität dargestellt. Die Nulllinie bildet hier eine Grenze. Werte über Null gelten als überdurchschnittlich volatil.

Quelle: amibroker.com

Trefferquote: 72,73 %

Payoff-Ratio: 0,55

Profitfaktor: 1,46

Auffällig ist der Rückgang der Payoff-Ratio. Hier wäre aufgrund des veränderten Exit-Signals eigentlich ein höherer Wert zu erwarten gewesen. Um eine endgültige Aussage treffen zu können, müsste man tiefer in die Analyse der Ergebnisse einsteigen und die Trades einzeln betrachten. Gute Handelsideen erzielen eine deutliche Effizienzsteigerung, wenn sie in den richtigen Märkten ausgewählt werden. Das hier vorgestellte System ist relativ einfach zu implementieren und könnte sehr gut für den diskretionären Trader eingesetzt werden. Ein Programmierer würde vermutlich deutlich mehr Handelsfilter einsetzen, um die klassische Schwächephase

kann die Bewegung des RSI3M3-Indikators nicht mehr in einem Zug das Indikatorziel (=50) erreichen. Deshalb lohnt es sich, die Handelsregeln zu modifizieren. Wir ergänzen die Handelsregeln mit einem einfachen Volatilitäts-Indikator von Marc Chaikin (CV) und verlängern den Ausstiegszeitpunkt.

CV = ROC(MA (High-Low, 10), 10)

Die Volatilitätsformel basiert auf dem Hoch und dem Tief eines Candlestick. Aus dieser Differenz wird ein Gleitender Durchschnitt gebildet mit MA(10). In einem weiteren Schritt muss der MA(10) dann in eine klassische Rate-of-Change (ROC) mit einer Periode von zehn eingebunden werden.

Test 2: Handelsregeln für ein einfaches Handelssystem:

Einstieg Long:

RSI3M3 kreuzt die 20er-Linie von unten nach oben und CV > 0.

Ausstieg aus der Long-Position:

RSI3M3 kreuzt die 60er-Linie von unten nach oben.

Einstieg Short:

RSI3M3 kreuzt die 80er-Linie von oben nach unten und CV > 0.

Ausstieg aus der Short-Position:

RSI3M3 kreuzt die 40er-Linie oben nach unten.

Die neue Auswertung mit den geänderten Handelsregeln bietet nun ein verbessertes Ergebnisbild.

se in Trendmärkten zu reduzieren. Wahrscheinlich würde die Verwendung eines Trendindicators, wie zum Beispiel ADX oder DMI, die Signalqualität weiter erhöhen. Dies ist jedoch nur eine Idee, und die Umsetzung wäre nicht zwingend notwendig. Generell ist es für das Systemverständnis immer besser, möglichst wenige Variablen zu verwenden. Ein komplexes System kann sehr gute Handelsergebnisse liefern, aber wenn diese ausbleiben, steht der Programmierer meist vor unlösbaren vielschichtigen Problemen.

Fazit

Wie bei den meisten Handelssystemen mit hoher Handelsfrequenz sind die Handelsergebnisse manchmal enttäuschend. Dies liegt an den weitgehend ungefilterten Signalen. Die Handelsidee muss nicht unbedingt schlecht sein. Wie die zweite Auswertung mit strengeren Regeln zeigt, bedarf es manchmal nur einer kleinen Änderung, um den Handel profitabel zu machen.

Die Anwendung des RSI3M3 empfiehlt sich vorzugsweise in volatilen Seitwärtsmärkten. In diesem Umfeld sind teilweise grandiose Handelsergebnisse möglich. In diesem Sinne muss der Trader vor dem Markteintritt eine Analyse durchführen. Die schlechtesten Ergebnisse werden in schwankungsarmen Trendmärkten erzielt. Das Handelssystem eignet sich für einen breiten Einsatz in praktisch jedem Zeitrahmen. Unterhalb von 5-Minuten-Candlesticks sollte man als privater Trader nicht gehen, da die Handelskosten eine hohe Bedeutung bekommen.