



Alexanders Social-Trading-Experiment

Teil 1: ayondo und ich

Bisher war ich lieber selbst derjenige, der beim Traden die Entscheidungen trifft. Nachdem ich mich für meine TRADERS´ Coverstory im Heft 11/2014 mit Social Trading beschäftigt habe, wollte ich nun einmal erleben wie es ist, „Follower“ eines anderen Traders zu sein.

» Ein „Selbstversuch“

Ich sage es ganz offen: Ich hatte große Zweifel, ob es wirklich etwas für mich ist, mein „Trading-Glück“ in die Hände eines anderen zu legen. Andererseits bin ich durchaus beeindruckt von der Performance und den Strategien mancher Top-Trader bei ayondo. Dass ayondos Plattform wirklich gut durchdacht und intuitiv zu bedienen ist, fiel

mir schon bei der Recherche für meine Coverstory auf – auch wenn die fehlende Möglichkeit, in TradeHub® Trailing-Stopsps zu setzen, für Punkteabzug sorgt. Ein Pluspunkt ist wiederum, dass ich dennoch selbst die Kontrolle behalten kann.

So habe ich mich dazu entschieden, mir drei Portfolios aus jeweils fünf Top-Tradern zu bauen. Eine Art Top-Trader-Mannschaft, bei der ich der Trainer bin. Bei ayondo kann pro Follower-Konto nur ein Portfolio ausgeführt werden. Deshalb war für meine drei Portfolios also die Eröffnung von drei Konten notwendig.

Vorüberlegungen

Meine Top-Trader sollten in den vergangenen vier Wochen eine gute Performance erreicht haben – also ein gutes Gespür für den Markt haben. Da jedes meiner Portfolios über 1000 Euro Startkapital verfügt, würden bei einfacher Ordergröße grundsätzlich 50 Euro meines Kapitals riskiert, wenn der Top-Trader mit einer Position fünf Prozent seines Kontos riskiert. Da ich mein Startkapital von 1000 Euro pro Portfolio jeweils auf fünf Top-Trader verteile, reduziert

B1) Verändern von Ordergröße und effektivem Risikofaktor

Ordergröße für MrDACHS einstellen

Alle Instrumente 5.0x
Effektiver Risiko-Faktor: 1.00

Wenn Sie diesem Top-Trader im proportionalen Verhältnis folgen möchten, wählen Sie bitte 1x. Wenn Ihr Top Trader dann z.B. 2% seines Kapitals bei einem Trade verliert, verlieren Sie ebenfalls ca. 2% Ihres Kapitals bei diesem Trade. Sollten Sie mehreren Tradern folgen, verteilt sich Ihr Risiko auf die Anzahl der Trader. Bei fünf Tradern im Portfolio folgen Sie jedem Trader mit 1/5.

Einstellung bestätigen Einzelwerte einstellen

Bild 1 zeigt Einstellungsmöglichkeiten beim Verhältnis, in welchem dem Top-Trader gefolgt wird.

Quelle: social.ayondo.com

sich der effektive Risikofaktor auf zehn Euro. Neben der Aufteilung des Kapitals auf mehrere Top-Trader kann über die ayondo Plattform jedem dieser Trader auch eine unterschiedliche „Ordergröße“ zugewiesen werden (Bild 1). Wenn ich also einem der fünf Trader eine zweifache Ordergröße zu-teile, würde sich das Follower-Verhältnis ändern, was bedeutet, dass sein Gewinn oder Verlust von fünf Prozent bei mir zu einer Veränderung in Höhe von 20 Euro führen würde. Diese Größe kann auch für verschiedene Asset-Klassen unterschiedlich festgelegt werden.

Zusätzlich bietet die Plattform die Möglichkeit, eine absolute Verlustgrenze für den Kontostand festzulegen, bei deren Erreichen das Following sofort beendet wird, wovon ich aber bewusst keinen Gebrauch mache. Bei meinen Portfolios steuere ich das Risiko über die Maßnahmen, die ich hier beschreibe, und über regelmäßige Anpassungen und Umschichtungen. Wichtig: Mein Following beginnt stets erst mit den nächsten zu eröffnenden Positionen des jeweiligen Traders – bereits offene Positionen werden nicht nachgeholt.

Die Portfolios

Die Portfolios 1 und 2 bestehen aus fünf Tradern mit der besten Performance in den vergangenen vier Wochen, deren bisheriger maximaler Drawdown unter elf Prozent lag. Für Portfolio 1 berücksichtige ich dabei nur Real-Money-Trader, während ich bei Portfolio 2 auch Top-Trader berücksichtige, die ihre Signale mit Demokonten erzeugen. Die Top-Trader zu finden, war über die Suchfunktion der ayondo Webseite in wenigen Minuten erledigt (Bild 2). Dem Besten der fünf Trader habe ich die Ordergröße 5x zugeteilt, dem Zweitbesten 4x und so weiter.

Das dritte Portfolio stellt das spekulativste meines Trios dar. Auch hier habe ich mir wieder die fünf Top-Trader mit der besten Performance in den letzten vier Wochen

B2) Top-Trader finden

The screenshot shows the 'Trader finden' search interface on the ayondo website. It includes a search bar for 'Trader Name...' and a 'Zeigen' button. Below the search bar are various filters and sliders: 'In diesem Markt...' (set to 'Alle Märkte'), 'In diesem Zeitraum...' (set to '1 Monat'), 'Karrierestatus...' (with a color-coded bar), 'Format...' (with a list icon), 'Kapital...' (with a magnifying glass icon), and 'Trader Name...' (with a search icon). There are also checkboxes for 'Performance', 'Max. Drawdown' (checked), 'Volatility', 'Sharpe Ratio', 'MAR Ratio', 'Gehandelt innerhalb der letzten' (set to 31 Tage), 'Anz. Follower', 'Anz. Trades', 'Ratio Win Trades', 'Ratio Win Months', and 'Profit/Trade'. A 'Real Money Trader zeigen' button is located in the top right corner. At the bottom, it says 'Anzahl gefundener Top-Trader: 31' and a disclaimer: '*Bitte beachten Sie, dass alle angezeigten Werte einmal pro Stunde aktualisiert werden.'

Bild 2 zeigt das Suchformular auf der ayondo Webseite, mit dem Top-Trader anhand verschiedener Kriterien gefunden werden können.

Quelle: social.ayondo.com

ausgesucht – diesmal aber ungeachtet dessen, ob sie Real-Money-Trader sind, welche Karrierestufe sie haben und wie der bisherige Drawdown aussieht. Keiner der Trader im Portfolio 3 hat eine höhere Ordergröße als 1x zugeteilt bekommen, was einem effektiven Risikofaktor von 0,2 entspricht. Auch wenn diese (Basis-)Einstellung grundsätzlich Proportionalität zwischen dem Signalgeber- und dem Follower-Konto gewährleisten soll, kann es durch Slippage zu Unterschieden bei der Orderausführung kommen.

Anpassungen und Umschichtungen

Anpassungen beziehungsweise Umschichtungen in den drei Portfolios werde ich – soweit notwendig – sonntags vornehmen. Notwendig wird dies, wenn sich das Ranking der Trader auf Monatsbasis verändert hat, ein Trader nicht mehr unter der Top 5 ist, oder er (bei Portfolio 1 und 2) einen Drawdown von elf Prozent oder mehr erlitten hat.

In der nächsten Ausgabe gibt es die Startaufstellung der Portfolios und erste Eindrücke der Performance. In späteren Ausgaben werde ich ähnliche Strategien auch bei anderen Social-Trading-Anbietern testen. «

Updates auch auf Guidants

Schon vor Erscheinen der nächsten TRADERS´ Ausgabe können Sie sich über die Entwicklung von Alexanders drei ayondo Konten auf seinem Guidants Experten-Desktop informieren: go.guidants.com/de#c/Alexander_Mantel



Alexander Mantel

Alexander Mantel beschäftigt sich seit seinem 17. Lebensjahr mit den Finanzmärkten. Dabei gilt sein Interesse hauptsächlich derivativen Produkten und neuen Entwicklungen der Finanzbranche. Für interessante Aufgaben ist er stets offen.

✉ finanzlabor@gmx.de