

Alexanders Social-Trading-Experiment

Teil 2: Die „Mannschaften“ stehen fest...

...und haben die erste Runde bereits hinter sich. Nachdem Alexander Mantel im ersten Teil das System beschrieben hat, mit dem er Social Trading bei ayondo mit verschiedenen Follower-Konten testet, gibt es in diesem Teil einen Überblick über die Top-Trader-Mannschaften, die er ins Rennen geschickt hat und über die bisherige Performance.

» Portfolio 1

Das Portfolio 1 wurde nach folgenden Regeln aufgebaut: Fünf Trader mit der besten Performance in den vergangenen vier Wochen, deren bisheriger maximaler Drawdown unter elf Prozent lag. Dabei wurden nur Trader berücksichtigt, die selbst eigenes Geld einsetzen (Real-Money-Trader). Ein weiteres Auswahlkriterium war die Vorgabe, dass die Trader mindestens die Karrierestufe 3 erreicht haben müssen. Dem Besten der fünf Trader habe ich die Ordergröße 5x zugeteilt, dem Zweitbesten 4x und so weiter. Die Positionen des fünftbesten Top-Traders haben demzufolge nur mit einfacher Größe Einfluss auf mein Konto.

Portfolio 2

Portfolio 2 besteht ebenfalls aus den fünf Top-Tradern mit der besten Performance in den vergangenen vier Wochen, deren Drawdown bislang unter elf Prozent lag und die mindestens Karrierestufe 3 erreicht haben. Allerdings entfällt bei Portfolio 2 die Beschränkung auf

Real-Money-Trader. Es werden also auch Virtual-Money-Trader berücksichtigt, die nicht mit Echtgeld handeln. Wie auch beim ersten Portfolio gibt es eine Hebelwirkung indem dem Besten der fünf Top-Trader die Ordergröße 5x zugeteilt wird, dem Zweitbesten 4x und so weiter.

Portfolio 3 – „Die Offensiven“

Das dritte Portfolio ist extrem spekulativ und risikobereit ausgerichtet. Auch hier habe ich mir wieder die fünf Top-Trader mit der besten Performance in den vergangenen vier Wochen herausgesucht. Dabei gibt es aber weder eine Beschränkung auf Real-Money-Trader oder bestimmte Karrierestufen, noch spielt die Höhe des bisherigen Drawdowns eine Rolle – „alles erlaubt“ also. Zwei Einschränkungen gibt es jedoch: Es werden nur Trader berücksichtigt, die in den letzten sieben Tagen gehandelt haben. Es hat sich nämlich gezeigt, dass sehr risikobereite Trader häufig nach einem Drawdown ihre Aktivität einstellen. Die Aufnahme solcher inaktiver Trader ins

T1) Die Portfolios (Stand: 07.03.2015)

| Portfolio / Top-Trader | Ordergröße | effektiver Risikofaktor | bisherige Performance |
|------------------------|------------|-------------------------|-----------------------|
| Portfolio 1 | | | 2,27% |
| MrDACHS RM | 5x | 1 | |
| ADLTrader RM | 4x | 0,8 | |
| simplytrader RM | 3x | 0,6 | |
| resolution RM | 2x | 0,4 | |
| exxo-trades_com RM | 1x | 0,2 | |
| Portfolio 2 | | | 23,13% |
| Retour | 5x | 1 | |
| spread | 4x | 0,8 | |
| MrDACHS RM | 3x | 0,6 | |
| fundaments | 2x | 0,4 | |
| ADLTrader RM | 1x | 0,2 | |
| Portfolio 3 | | | -10,94% |
| Francan | 1x | 0,2 | |
| Aspira45 | 1x | 0,2 | |
| Alex12345 | 1x | 0,2 | |
| TradingH2o | 1x | 0,2 | |
| Pintere | 1x | 0,2 | |

Anmerkungen:

Jedes Portfolio ist mit 1000 Euro Startkapital ausgestattet. Start am 01.03.2015.
 RM=Real-Money-Trader (Dieser Top-Trader erzeugt die Signale mit einem Echtgeldkonto.)

Die Tabelle zeigt die drei Portfolios in der Startaufstellung vom 01.03.2015 und die bisherige Performance.

Quelle: www.ayondo.com

Portfolio würde keinen Sinn machen. Außerdem hat keiner der Trader im Portfolio 3 eine höhere Ordergröße als 1x zugeteilt bekommen.

Die Performance nach einer Woche

Die „Mannschaften“ von Portfolio 1 und 2 konnten die Woche mit Gewinnen abschließen. Besonders gut lief es für das Team von Portfolio 2. Es erzielte in nur einer Woche bereits eine Performance von mehr als 23 Prozent. Zu einem nicht unerheblichen Teil ist diese gute Performance dem Top-Trader „Retour“ zu verdanken, der bei

seinen Trades häufig von Bewegungen beim Währungspaar EUR/USD profitierte. Der Wochenverlierer war das sehr offensiv aufgestellte Team von Portfolio 3 mit einem Rückgang um fast elf Prozent.

Neues Spiel – neues Glück

Für die Performance in den kommenden Wochen werden wahrscheinlich zumindest teilweise andere Top-Trader verantwortlich sein, als die Trader in der jetzigen Startaufstellung. Da die Teams aus den besten Tradern der vergangenen vier Wochen bestehen sollen, reagiere ich jeweils sonntags, falls sich das Ranking verändert hat. In einem solchen Fall wird „ausgewechselt“. Welche Veränderungen es in den „Mannschaften“ gab, erfahren Sie in der nächsten Ausgabe.

Das Karrierestufenmodell als „Qualitätsfilter“

Schaut man sich die bisherige Entwicklung der drei Portfolios an, fällt auf, dass das Portfolio, bei dem die geringsten Anforderungen an die Top-Trader gestellt werden (Portfolio 3), bislang die schlechteste Performance brachte.

Nicht unbedingt die Real-Money-Trader-Eigenschaft sondern die höhere Karrierestufe scheint den entscheidenden Unterschied zu machen. Schaut man sich dieses ausgeklügelte System genauer an, (Bild 1) wird deutlich, woran das liegt. Mit jeder neuen Stufe steigen die Anforderungen an den Trader. Letztlich erreichen nur solche Trader den höchsten Level in der ayondo Karriere, denen es gelingt, alle Erfolgskriterien innerhalb der einzelnen Stufen erfolgreich zu erfüllen. Die höchste Stufe kann frühestens nach zwölf Monaten erreicht werden. Die zwei wichtigsten Parameter im ayondo Karrieremodell sind Drawdown und Performance, die den Trader zu diszipliniertem Handeln, Kontinuität und Nachhaltigkeit motivieren. Eine höhere Karrierestufe als Suchfilter kann also sicherstellen, dass die Top-Trader, denen man folgen möchte, ihre Performance nicht lediglich durch einzelne „Lucky Shots“ sondern durch eine bewährte Strategie erzielt haben. «

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

B1) Das Karrierestufenmodell von ayondo

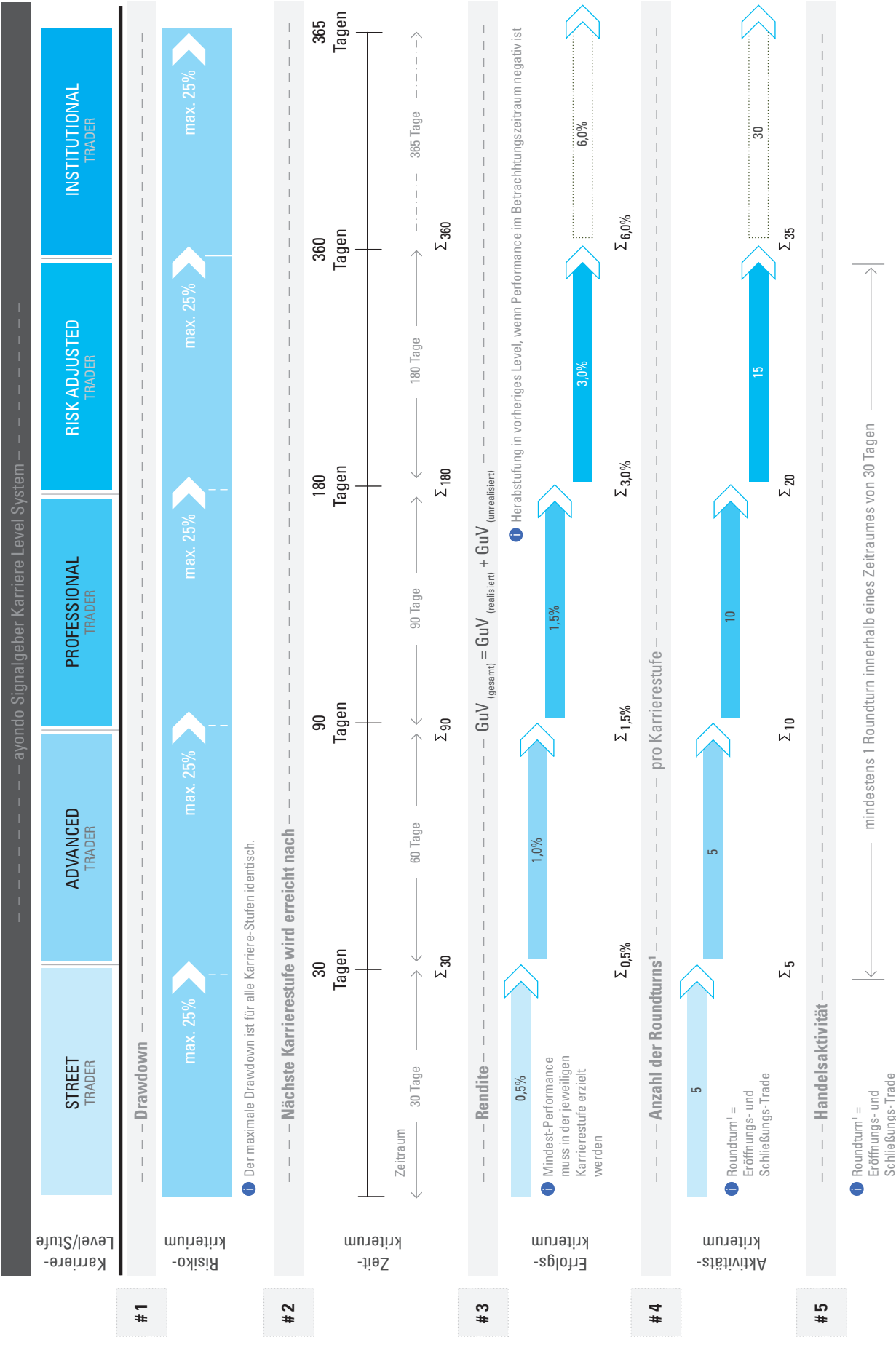


Bild 1 zeigt die Regelh, nach denen sich Top-Trader bei ayondo „hocharbeiten“ können.

Quelle: www.ayondo.com