

Alexanders Social-Trading-Experiment

Teil 3: Das Finale

In den vergangenen Wochen hat Alexander Mantel mit drei ayondo Konten verschiedene Top-Trader-Mannschaften ins Rennen geschickt, um zu erfahren, welche Möglichkeiten ihm die ayondo Plattform als Follower bietet. In diesem Teil gibt er einen Überblick zur Performance und analysiert das Ergebnis der jeweiligen Mannschaft.

B1) Loss Protection festlegen

Loss Protection Einstellungen

Der Auslösebetrag muss mindestens 5% unter deinem aktuellen Kontostand liegen.

Aktueller Kontowert 1.231,31 EUR

Aktueller Auslösebetrag 0,00 EUR

Auslösebetrag (EUR)

Hinweis: Der eingegebene Betrag stellt nur den von Ihnen gewählten Schwellwert dar, zu dem alle Positionen geschlossen werden. Durch Marktbewegungen kann deshalb das tatsächliche Vermögen nach ausgeführter Loss Protection unter dem von Ihnen gewählten Betrag liegen

Speichern

Bild 1 zeigt, wie Sie als Follower bei ayondo einen Betrag festlegen können, nach dessen Erreichen Sie keine weiteren Verluste tolerieren.

Quelle: www.ayondo.com

» Klarer Platz 1

Das Team aus Portfolio 2 ist der eindeutige Gewinner. Mit einer Performance von fast 24 Prozent konnte es sich klar von den anderen Mannschaften abgrenzen. Aufgrund dieser starken Performance bot es sich an, die bisherigen Gewinne zumindest teilweise abzusichern. Möglich ist dies mit der Loss-Protection-Funktion der ayondo Plattform (Bild 1). Ich habe die Loss Protection auf 1050 Euro eingestellt. Dies entsprach einem Abstand von ungefähr 15 Prozent zum derzeitigen Portfoliowert. Bei einer schlechten Performance würde bei diesem Betrag die automatische Ausführung beendet und das Portfolio wäre immer noch mit fünf Prozent im Gewinn. Ich verwende die Loss Protection hier also als eine Art Trailing-Stopp.

Guter Platz 2

Das Team aus Portfolio 1 hat während der Laufzeit meines Experiments eine Performance von fast drei Prozent hingelegt und belegt damit den zweiten Platz. Bedenkt

man, dass diese Performance in nur vier Wochen erzielt wurde, ist auch dies eine durchaus gute Leistung.

Schlechter Platz 3

Nicht aufgegangen ist die Strategie von Portfolio 3, unter Inkaufnahme hoher Risiken schnelle Gewinne einzufahren. Die Chance, hohe Erträge zu erzielen, war etwa gleich gewichtet mit der möglicher Verluste. Die Erwartungshaltung war hier sehr hoch, jedoch war bereits mit den Auswahlkriterien das Risiko definiert. Auch nach mehreren Umschichtungen blieb die Performance negativ (minus 25 Prozent).

Umschichtungen

Da die Teams aus den besten Tradern der vergangenen vier Wochen bestehen sollten, schaute ich jeweils sonntags, ob sich das Ranking verändert hat. In einem solchen Fall wurde „ausgewechselt“. Besonders oft war das bei Portfolio 3 nötig. Dies lag daran, dass die Performance von Top-Tradern in den unteren Karrierestufen häufig sehr volatil war. Auf Rekordgewinne folgen nicht selten Kursverluste, die unter Umständen die bisher erzielte Performance des Systems in Mitleidenschaft ziehen. Ein Umstand, der – wie oben beschrieben – auch der Performance des offensiven Portfolios 3 Schaden zugefügt hat. Relativ stabil hingegen war die Zusammensetzung von Portfolio 1 und 2. Hier waren oft lediglich Änderungen der Ordergröße notwendig, weil sich das Ranking innerhalb der Top 5 verändert hatte. Die Top-Trader blieben aber oft über lange Zeit in der Mannschaft. Die Zusammensetzung der Portfolios zum Schlussstand zeigt Ihnen die Tabelle.

Analyse und Bewertung

Nachdem der Wettbewerb gelaufen ist, muss ich mir als Trainer meiner Top-Trader-Mannschaften natürlich auch einige Gedanken zum Ergebnis machen. Die konservativ ausgerichteten Portfolios konnten mit einer ordentlichen Rendite überzeugen. Bei der Auswahl der Top-Trader wurden hier nur solche berücksichtigt, deren bisheriger Drawdown kleiner als elf Prozent war und die innerhalb des ayondo Karrierestufenmodells mindestens Stufe 3 erreicht haben. Bei der spekulativen Variante wurden Verlustrisiken bewusst in Kauf genommen. Deshalb galten diese Einschränkungen dort nicht. Auch der Verzicht auf eine Hebelwirkung durch überproportionale Ordergrößen, wie sie bei Portfolio 1 und 2 Anwendung fanden, konnte Portfolio 3 nicht vor Verlusten bewahren. Die Performance der beiden Gewinner-Portfolios zeigt jedoch, dass der Grundgedanke, auf Trader mit einer guten 4-Wochen-Performance zu setzen, nicht falsch ist. Auch die Aufteilung des Kapitals

T1) Die Portfolios (Stand: 28.03.2015)

Portfolio / Top-Trader	Ordergröße	effektiver Risikofaktor	bisherige Performance
Portfolio 1			2,76%
MrDACHS RM	5x	1,0	
simplytrader RM	4x	0,8	
resolution RM	3x	0,6	
ADLTrader RM	2x	0,4	
exxo-trades_com RM	1x	0,2	
Portfolio 2			23,61%
MrDachs RM	5x	1,0	
exodusTRADING	4x	0,8	
Horseman2014	3x	0,6	
syscout	2x	0,4	
fundaments	1x	0,2	
Portfolio 3			-24,86%
WBTHGeldanlage	1x	0,2	
FX30000	1x	0,2	
Tava10	1x	0,2	
Black4Kamine30	1x	0,2	
Francan	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.)

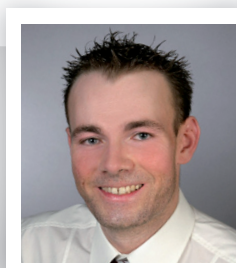
Die Tabelle zeigt die drei Portfolios nach der Umschichtung am 22.03.2015 und die bisherige Performance.

Quelle: www.ayondo.com

auf mehrere Top-Trader zur Diversifizierung und die Anwendung (moderater) Hebel durch leicht überproportionale Ordergrößen scheinen grundsätzlich sinnvoll zu sein.

So geht es weiter

In der kommenden Ausgabe heißt es „Lessons Learned“ – Alexander erzählt welche „Dos & Don'ts“ er bei seinem Experiment gelernt hat und gibt Tipps, wie Sie als Follower bei ayondo Ihren Erfolg verbessern können. «



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.

✉ traders@alexandermantel.com