

Indikatorengetriebenes algorithmisches trading (Bantleon)

Die dieser Bachelorthesis zugrunde liegende Aufgabenstellung ist es, einen Handelsalgorithmus zu entwickeln, welcher verschiedene Futures automatisch kauft bzw. verkauft. Diese Software wird in R, einer in der Finanzwelt verbreiteten Statistikprogrammiersprache, implementiert. Basierend auf dem sogenannten Direct-Filter-Approach (kurz DFA) werden verschiedene Handelsmodelle entwickelt und mittels Backtesting getestet. Dabei wollen wir nicht unbedingt täglich handeln, das heisst konkret, wir wollen kurzfristige, stochastische Fluktuationen herausfiltern. Somit wollen wir verhindern, zufälligen Preisschwankungen zu viel Beachtung zu schenken und uns auf die längerfristigen, systematischen Preisänderungen zu konzentrieren. Dies sollte dann zu einer langfristig guten Investitionsstrategie führen. Sämtliche Preisdaten der in dieser Arbeit verwendeten Futures wurden uns von der Bank Bantleon AG aus Zug zur Verfügung gestellt. In dieser Arbeit werden sowohl das Verhalten der entwickelten Handelsmodelle bezüglich einzelnen Futures als auch bezüglich eines ganzen Portfolios untersucht. Natürlich werden anschliessend ausführliche Performanceanalysen durchgeführt. Diese geben dann auch Auskunft über die Brauchbarkeit, Stärken und Schwächen der jeweiligen Handelsmodelle. Aus der dieser Bachelorarbeit vorangegangenen Projektarbeit „Indicator Driven Algorithmic Trading“ werden zusätzlich noch Moving-Average basierte Modelle in das schlussendliche Fazit miteinfließen. Schliesslich zeigt sich, dass die mathematisch komplexeren Modelle, auf die Handelsperformance bezogen, bei weitem nicht die besseren sind, aber durchaus ihre Vorzüge haben.



Diplomand
Michael Weber

Dozent
Marc Wildi

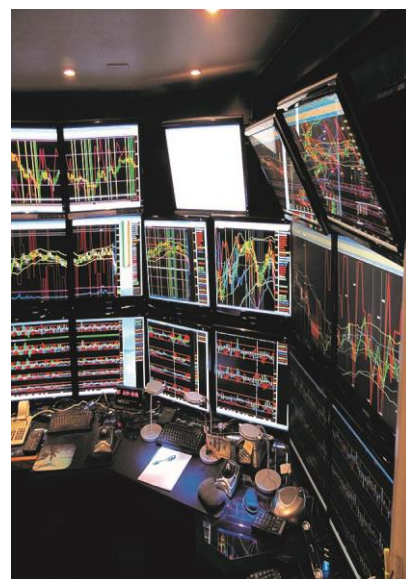


Bild klein 1.