CoT-Handelssystem für Gold

25.03.2013 | Dr. Jürgen Müller (EG für Gold und Silber)

Die Commitments of Traders Reporte stellen ein nützliches Werkzeug zur Evalierung kommender Trends dar.

Basierend auf diesen wöchentlichen Reporten kann für Gold ein Indikator wie folgt definiert werden:

CoT-Spread = ABS (Netto-Position Large Speculators) + ABS(Netto-Position Commercials)

wobei

• ABS(Netto-Position Large Speculators): Absoluter Wert der Nettoposition der großen Spekulaten
• ABS(Netto-Position Commercials): Absoluter Wert der Nettoposition der Commercials

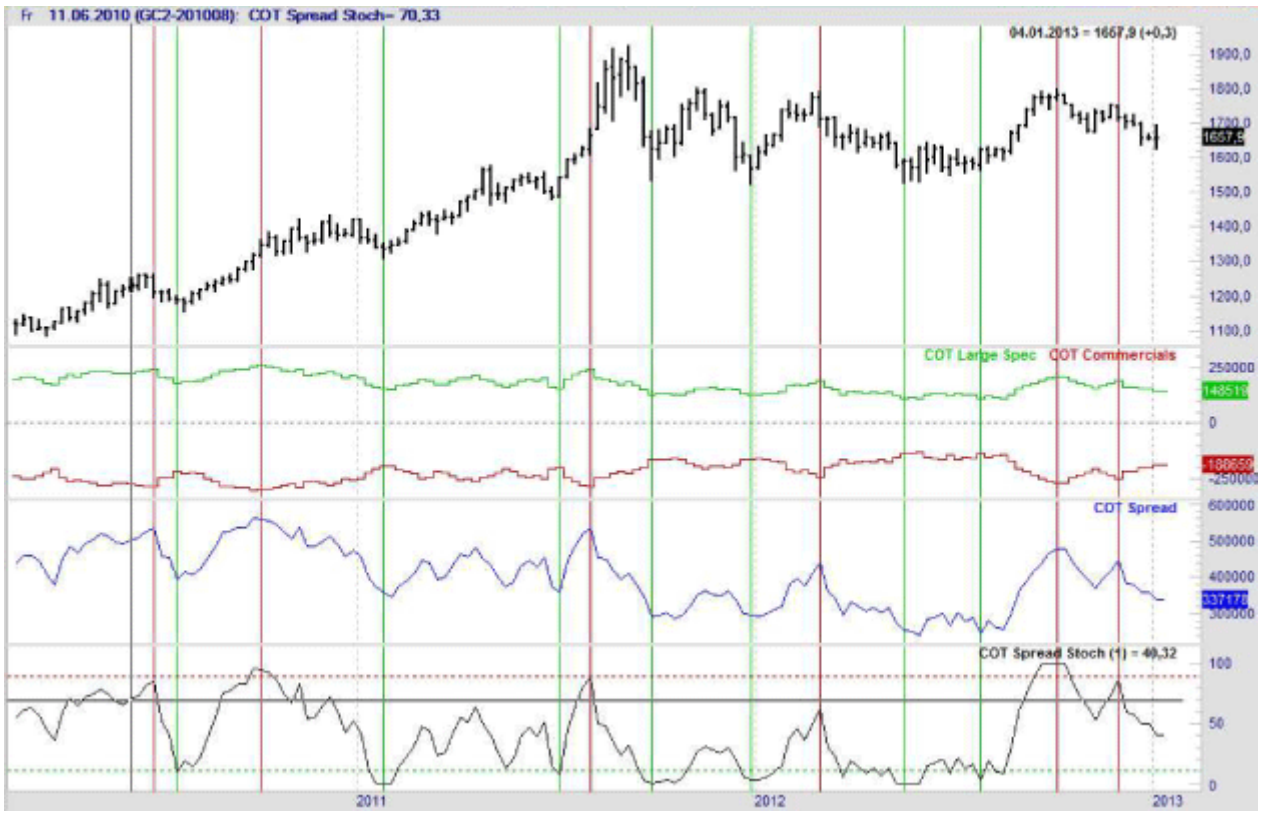
Dieser simple Indikator misst demnach lediglich den "Abstand" zwischen den Positionierungen dieser bei den Händlergruppen, siehe nachfolgende Graphik. Grundregel: Je kleiner der CoT-Spread ist, umso bullischer ist der Markt und vice versa.

In einem zweiten Schritt bilden wir aus diesem Indikator die Stochastik über die Zeitspanne eines Jahr es, um die kontinuierliche Änderung des absoluten Niveaus der CoT-Daten zu relativieren.

In Genesis' TradeNavigator lauten die verwendeten Formeln:

• COT Large Spec + ((COT Commercials) * -1)
• Stochastic Custom (COT Spread, lookback years * 52)

Auf wöchentlicher Basis ergibt sich für Gold der in Abb. 2 dargestellte Verlauf von Preis und stochast ischem Indikator.



Rein visuell ergeben sich durch diese simple Systematik sehr gute Einstiegspunkte. Im Backtest wird folgendes einfaches Handelssystem definiert:

• Long Entry: CoT Spread
• Long Exit: CoT Spread >= 90
• Short Entry: CoT Spread >= 90
• Short Exit: CoT Spread

Das System ist demnach immer im Markt. Von 1999 bis 2013 ergeben sich lediglich 29 Trades, von denen 23 Gewinner und 6 Verlierer sind. Der Profit-Faktor be trägt 6,43.

Trade Navigator
Genesis Financial Technologies - (800) 808-DATA - www.gfds.com

Summary - All Trades Report

Jan 5, 2013 18:03:20

Name:	New Strategy
Symbol:	GC2-057
Equity Filter:	OFF - All entries taken
Take Next Trade:	No Equity Filter Applied

Position selection All trades, From date 18.04.1999, To date 04.01.2013, Chart By Date, Ignore trades <= -999.999.999, Ignore trades >= 999.999.999, Ignore big wins 0, Ignore big losses 0, Profit is >= 0,00, Show cents No, Show Max Intra No

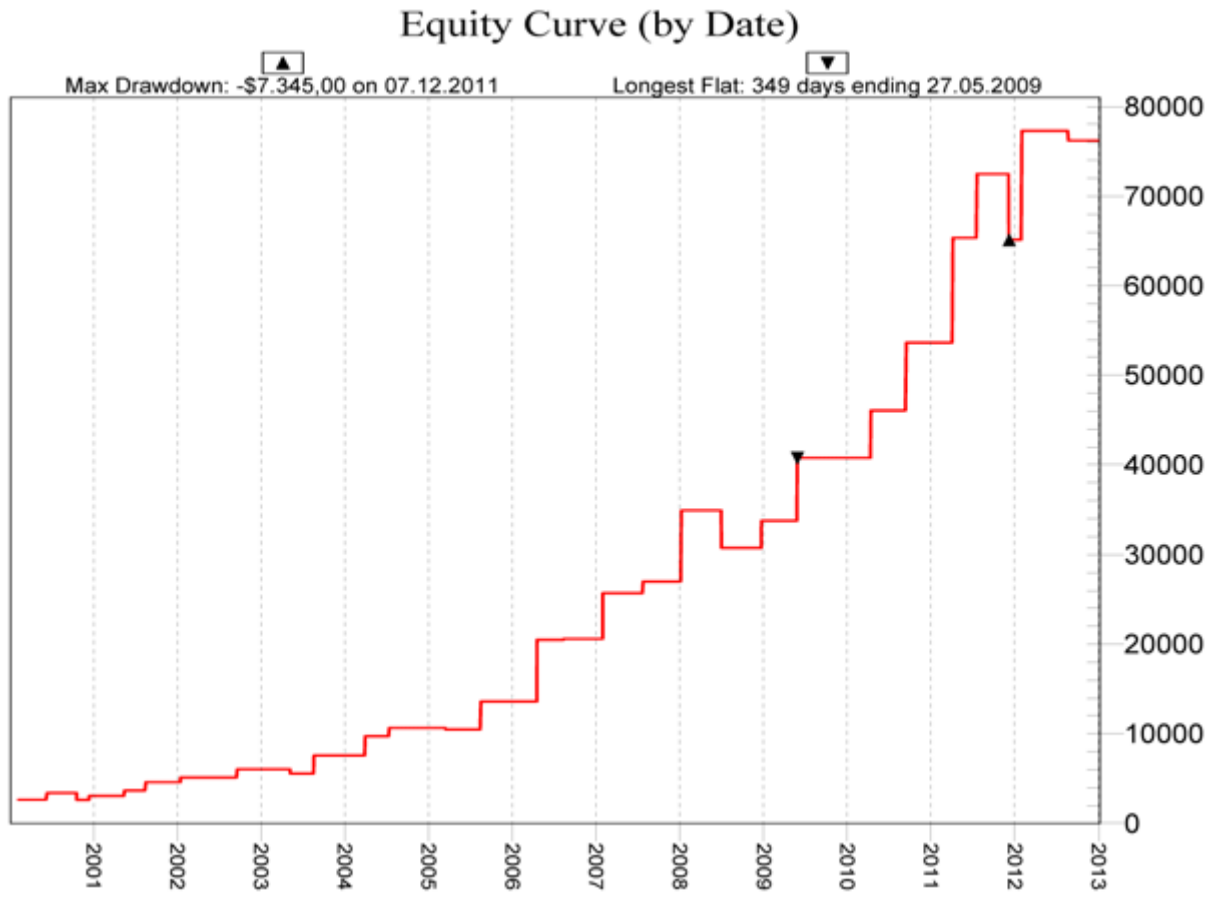
Overall

Total Net Profit:	$76.265	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**6,43**
Total Trades:	29	Winning Percentage:	79,3%
Average Trade:	$2.630	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	1,68
Max Closed-out Drawdown:	-$7.345	CPC Index (PF x Win% x PR):	8,56
Max Intraday Drawdown:	-$28.305	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	112,39%
Account Size Required:	$34.380	Return Pct:	**221,8%**
Open Equity:	-$6.045	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	66,98%
Percent in the Market:	16,1%	Optimal f:	0,75
Avg # of Bars in Trade:	53,14	Z-Score (W/L Predictability):	1,2
Avg # of Trades per Year:	2,1	Current Streak:	1 Losses

Monthly Profit Analysis

Average Monthly Profit:	$505	Monthly Sharpe Ratio:	0,21
Std Dev of Monthly Profits:	$2.132	Annualized Sharpe Ratio:	0,72
		Calmar Ratio:	0,21

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	23	Total Losers:	6
Gross Profit:	$90.305	Gross Loss:	-$14.040
Average Win:	$3.926	Average Loss:	-$2.340
Largest Win:	$12.165	Largest Loss:	-$7.345
Largest Drawdown in Win:	-$13.785	Largest Peak in Loss:	$4.565
Avg Drawdown in Win:	-$2.640	Avg Peak in Loss:	$1.423
Avg Run Up in Win:	$5.153	Avg Run Up in Loss:	$1.423
Avg Run Down in Win:	-$2.640	Avg Run Down in Loss:	-$10.117
Most Consec Wins:	6	Most Consec Losses:	1
Avg # of Consec Wins:	3,83	Avg # of Consec Losses:	1,00
Avg # of Bars in Wins:	50,04	Avg # of Bars in Losses:	65,00



© Dr. Jürgen Müller
www.goldsilber.org, www.technologiemetalle.org, www.werteinlagerung.de, www.cot-signale.de

GOLD & SILBER EINKAUFSGEMEINSCHAFT Technologie metalle EINKAUFSGEMEINSCHAFT

Dieser Artikel stammt von Rohstoff-Welt.de
Die URL für diesen Artikel lautet:
https://www.rohstoff-welt.de/news/42344--CoT-Handelssystem-fuer-Gold.html

Für den Inhalt des Beitrages ist allein der Autor verantwortlich bzw. die aufgeführte Quelle. Bild- oder Filmrechte liegen beim Autor/Quelle bzw. bei der vom ihm benannten Quelle. Bei Übersetzungen können Fehler nicht ausgeschlossen werden. Der vertretene Standpunkt eines Autors spiegelt generell nicht die Meinung des Webseiten-Betreibers wieder. Mittels der Veröffentlichung will dieser lediglich ein pluralistisches Meinungsbild darstellen. Direkte oder indirekte Aussagen in einem Beitrag stellen keinerlei Aufforderung zum Kauf-/Verkauf von Wertpapieren dar. Wir wehren uns gegen jede Form von Hass, Diskriminierung und Verletzung der Menschenwürde. Beachten Sie bitte auch unsere AGB/Disclaimer!

Die Reproduktion, Modifikation oder Verwendung der Inhalte ganz oder teilweise ohne schriftliche Genehmigung ist untersagt!
Alle Angaben ohne Gewähr! Copyright © by Rohstoff-Welt.de -1999-2025. Es gelten unsere AGB und Datenschutzrichtlinen.