

Hanseatic Technical Trading Analysts e.V.

Einladung

Der HTTA lädt in Zusammenarbeit mit dem HBK Mitglieder und Gäste zu folgender Veranstaltung ein:

Monte Carlo Simulation und Positionsgrößenbestimmung -

Ziele und Wahrscheinlichkeiten,
Vergleich von Handelssystemen,
Van Tharp's Trading Game

Referenten: Lars Zilch und Dr. Alexander Schwarz

- Termin:** Samstag, den 18. März 2017 von 10:00 - 16:30 Uhr,
Einlass ab 9.30, Mittagspause 12:30 - 14:00
- Ort:** Universität Hamburg, Edmund-Siemers-Allee 1,
Hörsaal ESA AS-Saal - Senatssitzungssaal
2. Stock (Zugang über Fahrstuhl oder Treppe neben Hörsaal H)

Wir freuen uns über zahlreiches Erscheinen und aktive Beteiligung.

Gäste sind bei unseren Veranstaltungen herzlich willkommen.

Ein erster Besuch bei uns ist kostenfrei.

Für jede weitere Teilnahme verlangen wir eine Kostenbeteiligung von 25,- Euro.

Wir bitten Gäste, sich per eMail anzumelden.



Lars Zilch

Jahrgang 1966

Ausbildung: Diplom im Fachbereich Angewandte Informatik und Mathematik an der FH Fulda.

Seit 1992 beschäftigt bei großem Softwarehaus in Nürnberg.

Börsenerfahrung:

- Das Interesse an den Märkten wurde während des Booms am Neuen Markt 1999/2000 geweckt. Damals erste Gehversuche mit Optionen.
- Programmierung von Handelssystemen und Indikatoren in *Wealth Lab Developer*.
- Im Jahr 2004 erster Kontakt zu Dr. Alexander Schwarz über Fachartikel im Trader`s Magazin.
 - In den Jahren danach einige Artikel gemeinsam im Trader`s veröffentlicht.
 - Seitdem an verschiedenen „Forschungsprojekten“ gemeinsam gearbeitet.
- Nebenberuflich, unregelmäßig an der Börse tätig. Vorwiegend mit CFDs.
- Hauptinteresse:
 - Alles! Lernt leidenschaftlich und tauscht gerne Wissen aus.
 - Studierte zahlreiche Bücher und Kurse, um dann in teils ungewollten und oft kostspieligen Selbstversuchen herauszufinden, wie man es nicht machen sollte, um als Trader konstant erfolgreich zu sein.
 - Lieblings-Börsen-Weisheiten / aus eigener Erfahrung
 - *Trading ist ein Beruf* (kein Hobby)
 - *If you trade without a plan you better plan to fail.*
 - Im Nebeneffekt entstand eine Wissenslandkarte und Erfahrungen im Bereich Informationsaufbereitung und Werkzeugentwicklung.
 - 2016 für mehrere Monate die Gelegenheit gehabt, sich intensiv mit den Themen *Positionsgrößenbestimmung* und *Monte Carlo Simulation* zu befassen. In der Zeit entstanden Werkzeuge, mit denen das Wissen aus verschiedenen Quellen zum Thema besser nachvollzogen werden kann.



Dr. Alexander Schwarz

Jahrgang 1959

Ausbildung:

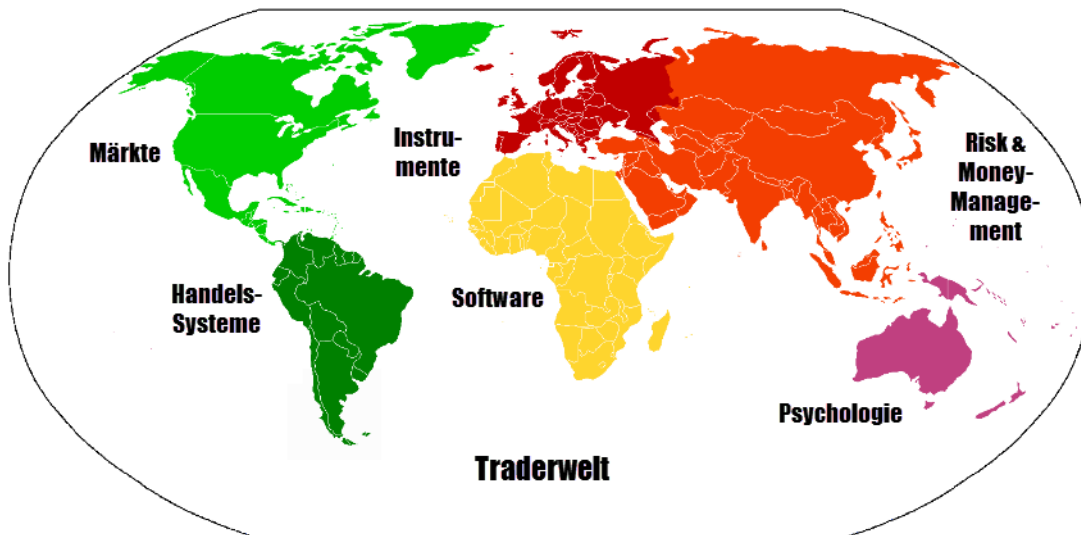
Diplom im Fach Geologie, Promotion im Fach Mineralogie mit einer Arbeit über Tiefseebohrungen vor der Küste Japans (Marianengraben).

Börsenerfahrung:

- Rund zwanzig Jahre Handelserfahrung, bevorzugt im Derivatebereich.
- Von 1999 bis 2005 Entwicklung und Umsetzung Indikatorbasierter Handelssysteme.
- Beratungstätigkeit für institutionelle und private Kunden im Bereich Managed Futures.
- Von 2004 bis 2009 Trading Coach, unter anderem zusammen mit dem Mentaltrainer Rainer Hatz. Während dieser Zeit entstand eine Reihe von Fachartikeln in der Zeitschrift Trader's, u.a. auch zusammen mit Lars Zilch.
- Von 2010 bis 2016 Mitarbeit bei der Mecam AG www.mecam.ch Dort mitverantwortlich für das Risk-Management eines globalen Investmentfonds.
- Seit rund zehn Jahren bevorzugte Beschäftigung mit strukturellen Eigenschaften von Märkten. Neben Elliott-Wellen und Kursmustern steht dabei die Erforschung von Zeitstrukturen besonders im Vordergrund.

Monte Carlo Simulation und Positionsgrößenbestimmung

Vom Tag an, an dem uns *Trading* begegnet, bilden wir unsere ganz persönlichen Landkarten aus. In dieser Metapher könnte eine *Trader-Weltkarte* zum Beispiel so aussehen.



Man erkennt welche „Länder“ neben einander liegen und auf welchem „Kontinent“ sie zu finden sind. Beim Vergrößern werden immer mehr Einzelheiten sichtbar, welche „Flüsse“ (Themen) sich durch mehrere „Länder“ ziehen, usw.

So unterschiedlich das mit Kenntnissen in Geographie ist, so unterschiedlich sind auch unsere persönlichen Trading-Landkarten ausgebildet. Einige Länder kennt man aus persönlicher Erfahrung, einige aus Büchern. Von manchen hat man schon gehört, kann aber nicht sagen wo sie genau liegen und andere sind uns noch völlig fremd.

Manche Trading-Coaches behaupten ja seit jeher, dass sich die meisten Trading-Interessierten von den "falschen" Themen angezogen fühlen und dabei die vernachlässigen, ignorieren oder gar nicht erst kennen, die eigentlich für Erfolg beim Trading ausschlaggebend sind. Wir halten uns demnach (zu lange) in den falschen Regionen der Welt auf.

Position Sizing (PS) und **Monte Carlo Simulation (MC)** gehört normalerweise für die meisten Trading-Interessierten nicht zu den „*Most sexiest Places on Earth*“. Und das obwohl diese laut einiger Autoren doch **so** enorm bedeutsam sind und zur Reiseroute eines jeden Traders gehören sollten.

Van Tharp, Paul King, Larry Sanders, **Howard Bandy**, Adam Grimes und Volker Butzlaff sind nur Einige, die sich mit Money Management, *Position Sizing* (PS) und *Monte Carlo Simulation* (MC) in ihren Büchern befasst oder Software dafür entwickelt haben. Ihre Werke werden und wurden auch gekauft, und dennoch gehören diese „Länder“ nicht zu den Hauptreisezielen der Branche, sondern gelten eher als Geheimtipp für Exoten.

Haftungsausschluss: Für die Vortragsinhalte auf HTTA-Veranstaltungen sind die jeweiligen Referenten verantwortlich. Der HTTA übernimmt hier keine Haftung.

HTTA e.V., Ansprechpartner Manfred Schweng, eMail: mschweng@gmx.net

*Was steckt also genau dahinter? Ist der Mangel an Aufmerksamkeit berechtigt? Ist alles so schwer zu verstehen oder wird es nur ‚schlecht‘ vermittelt? Braucht man ausgesprochene Fähigkeiten in **Statistik** und teure **Software**, oder reichen auch Grundkenntnisse und **Excel** aus?*

*Worin liegt diese vielbeschworene Bedeutung von PS + MC und ist sie nachvollziehbar? Was hat „**Vertrauen**“ damit zu tun? Was kann man damit über mein Handelssystem erfahren was ich noch nicht weiß? Sagt es mir auch etwas über Kapitalbedarf?*

*Kann man wirklich durch **Spielen** etwas über diese Themen lernen? Was kann eine einzelne Kennzahl (**SQN**[™]) über ein Tradingsystem ausdrücken? Sind Ziel und Ziel (Goal/ Objective) dasselbe? Warum ist **Backtesting** notwendig, aber nicht ausreichend?*

Und ist Position Sizing vielleicht doch sexy und Simulation ganz easy?

Die Veranstaltung wird auf der einen Seite ein Reisebericht sein: Es sollen Erfahrungen und Erkenntnisse einiger Monate in kompakter Weise vermittelt werden (quasi *In 80 Minuten um die Welt*). Kernaussagen und Methoden genannter Autoren werden dargestellt und wo möglich miteinander verglichen (Einordnung auf der Landkarte).

Wir wollen aber auch ganz praktisch einige Thesen der „Gurus“ überprüfen und viele der oben gestellten Fragen an Beispielen nachgehen. Dabei kommen Werkzeuge (Software) zum Einsatz die eigens dazu entwickelt wurden, das Verständnis und die Erlernbarkeit zu erhöhen. Zumindest hat es dem Autor und Trader-Freunden dabei geholfen 😊

Diese Reise ist noch nicht beendet und wer reiselustig ist schlieÙe sich gerne an.

Bitte unbedingt die eigene Landkarte mitbringen!