

Inhalt

Vorwort	III
Über den Autor	IX
Abbildungsverzeichnis.....	X
Tabellenverzeichnis.....	XII
Listings.....	XIII
Formeln.....	XV
Symbole und Indizes	XVII
Abkürzungsverzeichnis.....	XX
1 Einführung.....	1
1.1 Rahmenbedingungen	1
1.2 Ziel, Methodik und Aufbau dieser Arbeit	3
1.3 Zeitliche Abgrenzung.....	6
2 Wissenschaftliche Grundlagen	7
2.1 Weighted Moving Average – gleitender Mittelwert.....	7
2.2 Positionen in einem Handel.....	8
2.3 Psychologische Faktoren	9
2.4 Backtest.....	10
2.4.1 In-Sample-Backtest	12
2.4.2 Out-Of-Sample Backtest.....	13
3 Neue Technologien.....	18
3.1 Chancen durch technologischen Wandel.....	18
3.2 Robotik im Anlagevermögen	21
4 Tradingsystem für die Versicherungsbranche	23
4.1 Vorbemerkungen	23
4.2 Anforderungen an das System	26
4.2.1 Herangehensweise	26
4.2.2 Ideen über den Finanzmarkt.....	27

4.2.3	Wahl der Anlagestrategie	35
4.2.4	Festlegen von Gewichtungen	38
4.2.5	Volatilitätsindizes	43
4.2.6	Tradingregeln.....	44
4.2.7	Skalierung des Systems	49
4.2.8	Quantifizierbare Vorhersagen.....	49
4.2.9	Kombination von Vorhersagen	54
4.2.10	Backtest	57
4.3	Systementwurf.....	61
4.3.1	Hauptkomponenten	61
4.3.2	Hilfskomponenten	63
4.4	Implementierung	65
4.4.1	Komponente Rule	66
4.4.2	Komponente BaseValue	69
4.4.3	Komponente SubSystem	71
4.4.4	Komponente DiversificationMultiplier	73
4.4.5	Komponente ValueDateTupel.....	75
4.4.6	Komponente Util	76
4.4.7	Komponente Validator	78
4.4.8	Komponente DataSource	78
4.5	Anwendung und Auswertung.....	79
5	Kritische Betrachtung.....	83
6	Fazit und Ausblick.....	90
	Literatur.....	93

Anhang	99
A1 Bedeutende Indizes	99
DAX 30.....	99
EURO STOXX 50	102
S&P 500.....	105
A2 Diagramme	108
Gesamtklassendiagramm	108
Gesamtklassendiagramm ohne Parameter und Methoden	109
Komponente Rule	110
Komponente VolatilityDifference.....	111
Komponente EWMAC.....	112
Komponente EWMA	113
Komponente BaseValue	114
Komponente SubSystem	115
Komponente DiversificationMultiplier	116
Komponente ValueDateTupel.....	117
Komponente Util	118
Komponente Validator	119
Komponente DataSource	120
Komponente CsvFormat.....	121
Komponente DateOrder.....	122
A3 Programmcode	123
pom.xml	123
Komponente Rule	126
Komponente VolatilityDifference.....	143
Komponente EWMAC.....	153
Komponente EWMA	158
Komponente BaseValue	164

Komponente SubSystem	173
Komponente DiversificationMultiplier.....	188
Komponente ValueDateTupel.....	195
Komponente Util	211
Komponente Validator	218
Komponente DataSource.....	226
Komponente CsvFormat.....	231
Komponente DateOrder.....	233
Komponente ExampleClient	234
A4 Testcode	242
Komponente RuleTest	242
Komponente VolatilityDifferenceTest.....	257
Komponente EWMACTest.....	267
Komponente EWMACTest	273
Komponente BaseValueTest	276
Komponente SubSystemTest	284
Komponente DiversificationMultiplierTest.....	298
Komponente ValueDateTupelTest.....	302
Komponente UtilTest	322
Komponente ValidatorTest	332
Komponente DataSourceTest.....	337