

Beurssignalen Algoritmes

Beurssignalen is ruim 20 jaar actief in de financiële markten en ontwikkelt algoritmes die in verschillende financiële producten handelen. Van aandelen tot opties en futures.

Wij ontwikkelen algoritmes die koop- en verkoopsignalen genereren in verschillende markten. In deze gids vertellen we u meer over de verschillende soorten algoritmes en hoeveel kapitaal u nodig heeft om deze algoritmes goed te volgen. Tot slot geven we u ook een globaal inzicht welke strategie onze algoritmes toepassen en daaraan gerelateerd stoplosses.

Inhoud:

1. Vier categorieën systemen
2. Hoeveel kapitaal nodig?
3. Toegepaste strategie

1. Vier categorieën systemen

Onze algoritmes handelen in verschillende financiële producten. Deze kunnen we als volgt onderverdelen:

- Aandelen
- Opties en Turbo's
- Mini futures
- Futures

Aandelen

Het aandelen algoritme heeft het laagste risico, omdat het systeem zonder hefboom handelt. Dat komt er op neer dat de beweeglijkheid van uw vermogen het laagste zal zijn. Wie een zo klein mogelijk risico wil lopen, kiest voor het aandelen algoritme. De potentiële winst is lager, maar dus ook het risico.

Momenteel volgt ons aandelen algoritme Amerikaanse, Belgische en Nederlandse aandelen. Van de aandelen die het systeem volgt, zal het automatisch een positie innemen wanneer een kans daar is. Het systeem zal tot een maximum van 5 open posities gaan op hetzelfde moment. Elke positie zal voor zo'n €1.000 of \$1.200 aan aandelen kopen.

De risk/reward van ons aandelen signaal is 2:1. Het systeem werkt dus met een target die altijd minimaal 2 keer zo hoog is dan de stop loss.

Opties

Ons opties algoritme heeft een gemiddeld risico. Dit komt door de hefboom, die nog relatief laag ligt (in vergelijking tot de futures), maar wel zeker van belang is. U zult dus sneller een relatief grote winst pakken, maar de kans op een relatief groot verlies is aanwezig. Ons opties algoritme maakt gebruik van een trailing stop loss. Bij eventuele grote bewegingen buiten de reguliere beurstijden bestaat de kans dat de koers door de trailing stop loss schiet.

- [Hier vindt u meer uitleg over opties](#)

Het opties algoritme kan zowel van opgaande als neergaande koersen profiteren. Er worden calls en puts gekocht. Het systeem schrijft dus nooit opties. Je kunt de optiesignalen dus niet omgekeerd handelen volgens de "Follow Inverse" methode.

Het opties algoritme is op dit moment alleen actief op de AEX Index. U kunt het Call Opties en Put Opties signaal gelijktijdig volgen met het startkapitaal dat op Copydealing wordt gecommuniceerd. Er zal namelijk **NOOIT** gelijktijdig een call optie en een put optie worden gekocht.

Mini futures en futures

De laatste twee categorieën systemen zijn mini futures en futures. Deze producten lijken erg veel op elkaar, zoals de naam doet vermoeden. Ze kenmerken zich door het hoogste risico omdat er met een hoge hefboom wordt gehandeld.

- [Hier vindt u meer uitleg over \(mini\) futures](#)

In totaal hebben we 4 mini future en 5 future systemen. Hieronder volgt een overzicht van deze systemen met daarbij steeds de tickercode, hefboom (waarde per punt) en de onderliggende waarde van de future.

Mini futures

Systeem	Ticker	Waarde per punt/pip	Volgt
Euro-Dollar mini future	E7	\$6,25 per pip*	euro/dollar koers
Japane Yen-Dollar mini future	J7	\$6,25 per pip**	yen/dollar koers
BOBL future	FGBM	€1.000 per punt	BOBL Index (5-jarige Duitse staatsobligatie)
Dax mini future	FDXM	€5 per punt	Dax Index (Duitse beurs)

*vierde cijfer achter de komma, **zesde cijfer achter de komma

Futures

Systeem	Ticker	Waarde per punt	Volgt
AEX future	FTI	€200 per punt	AEX Index
Dow future	YM	\$5 per punt	Dow Jones Industrial Average
CAC future	FCE	€10 per punt	CAC 40 Index
Eurostoxx	FESX	€10 per punt	Euro Stoxx 50
Bund future	FGBL	€1.000 per punt	Bund Index (10-jarige Duitse staatsobligatie)

Voor de handel in de futures is een veel groter kapitaal vereist dan bijvoorbeeld de opties. Bij de mini futures is dit kapitaal uiteraard meestal lager dan bij de futures. Door deze grootte en de hoge hefboom is het bij futures enorm belangrijk om u altijd aan de gestelde kapitaalvereisten te houden! (Zie het volgende hoofdstuk voor deze kapitalen.)

Voor de grootte en de hefboom van een (mini) future volgt hieronder een voorbeeld:

We nemen het Euro-Dollar systeem. De totale waarde van dit contract is 6,25 dollar keer iedere pip. Bij een koers van 1,1200 komt dit neer op 70.000 dollar (6,25 dollar x 11.200). Van de broker hoeft u alleen duizend tot soms enkele duizenden dollars (of euro's) aan te houden. Hierdoor handelt u met een hefboom.

Stel het systeem zit long en de koers stijgt van 1,1200 naar 1,1210. Een stijging van 0,089% in de euro/dollar koers. Het contract stijgt alleen met 62,50 dollar. Op een kapitaal van 2.500 euro is dat een stijging van 2,23%. De koersbeweging wordt dus 25 keer versterkt!

2. Hoeveel kapitaal nodig?

Het is héél belangrijk dat u te allen tijde voldoende kapitaal aanhoudt in relatie tot de geactiveerde systemen.

Het kapitaal waarmee u handelt bepaalt of u in staat bent om een algoritme (of algoritmes) te volgen. Indien u te weinig kapitaal aanhoudt, is de broker niet in staat om een signaal uit te voeren, waardoor u winst mis kan lopen.

Het kan nog erger, als u aan het einde van de dag te weinig kapitaal op uw rekening heeft staan om de posities open te houden, zal de broker posities voor u sluiten (margin call). Vaak sluiten ze de posities die op dat moment het slechtste rendement hebben als eerste. In dat geval sluit u dus mogelijk met een verlies, terwijl het algoritme er uiteindelijk met een winst vandoor gaat.

Om meerdere systemen gelijktijdig te volgen moet u altijd de startkapitalen van de betreffende systemen bij elkaar op te tellen die in Copydealing staan aangegeven.

Zet u meerdere (mini) future signalen gelijktijdig aan? Dan kunt u 75% van de op Copydealing gecommuniceerde startkapitalen nemen. Er kan in dat geval gebruik worden gemaakt van elkaars buffer. **LET OP: dit geldt niet voor Aandelen en Opties.**

Check altijd de kapitalen in Copydealing. Deze zijn altijd up-to-date. Kapitalen in deze gids zijn dat niet altijd. Zo veranderen brokers soms de kapitaalvereisten als gevolg van veranderingen in de markt, zoals corona in 2020. Indien u twijfelt, mag u ons altijd een mail sturen op info@beurssignalen.com.

Aandelen

We hebben één aandelensysteem. Om deze te volgen heeft u 5.000 euro aan vrij kapitaal nodig.

Ieder signaal dat dit systeem genereert heeft ongeveer een positiegrootte van 1.000 euro en kan tot een maximum van vijf posities innemen.

Opties

Wie het optiesysteem wil volgen, heeft een kapitaal van 2.500 euro nodig. Hiermee kunnen de Puts en Calls tegelijkertijd worden gevolgd, u bent echter niet verplicht om ze tegelijk te volgen.

Iedere optietrade heeft ongeveer een positiegrootte van tussen de 500 en 1.000 euro.

Mini futures en futures

We hebben vier mini future systemen die in verschillende markten actief zijn:

1. De Euro-Dollar mini future vergt 5.000 euro aan kapitaal.
2. De Japanse Yen-Dollar mini future vergt 5.000 euro aan kapitaal.
3. De BOBL future vergt 5.000 euro aan kapitaal.
4. De Dax mini future vergt 15.000 euro aan kapitaal.

Voor de vijf future systemen gelden de volgende kapitalen per systeem:

1. De AEX future vergt 20.000 euro aan kapitaal.
2. De Dow future vergt 20.000 dollar aan kapitaal.
3. De CAC future vergt 15.000 euro aan kapitaal.
4. De Bund future vergt 10.000 euro aan kapitaal.

5. De Eurostoxx future vergt 10.000 euro aan kapitaal.

LET OP!: Dit zijn de bedragen die wij aanraden per systemen in een normale marktsituatie.

Hierbij zijn drie punten belangrijk:

1. U heeft met deze bedragen altijd een voldoende veiligheidsmarge om ook na een reeks verliesgevend trades mee te doen. Het BOBL systeem heeft bijvoorbeeld minimaal 1.500 euro aan vrij kapitaal (margin) nodig van de broker om een positie te openen. Met 5.000 euro heeft u dus een aanzienlijke buffer. Indien u een BOBL positie heeft en de margin in uw rekening minder dan 1.500 euro bedraagt, krijgt u een margin call van de broker. De broker zal dan de positie automatisch voor u verkopen. Het dient als een soort ingebouwde stop loss van de broker. Na zo'n margin call kan het systeem geen positie voor u openen.
2. De markt is veranderlijk. Als gevolg van deze verandering, staat de margin die u nodig heeft niet vast. Na de corona crash is de markt bijvoorbeeld veel beweeglijker geworden en is het risico toegenomen. Om zich tegen dit hogere risico (lees: hogere volatiliteit) in te dekken heeft de broker destijds besloten de margins te verhogen. Als gevolg hiervan zijn wij gedwongen de aangeraden kapitalen te verhogen of verlagen als de situatie hierom vraagt. Het aangeraden kapitaal per systeem wordt altijd in Copydealing geüpdatet.
3. Als u meerder systemen wilt volgen, is het van belang altijd de som van kapitaal voor de verschillende systemen aan te houden. Dus wilt u de AEX Opties en de BOBL future volgen? Dan raden wij 7.500 euro kapitaal aan. Tenzij u dus 2 of meer (mini) future systemen gelijktijdig volgt, dan kunt u dus 75% van de startkapitalen nemen die op Copydealing worden gecommuniceerd.

3. Toegepaste strategie

De strategie die de algoritmes toepassen is simpel: verliezen snel afsnijden en winsten de vrije loop laten. Vaak zie je juist dat beleggers het tegenovergestelde doen als gevolg van emoties.

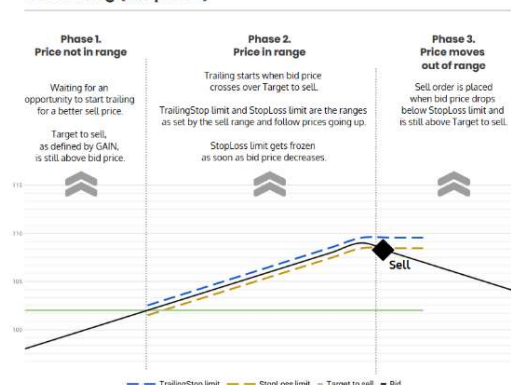
Ons algoritme is gebaseerd op het handelsprincipe 'the trend is your friend, until the end when it bends'. Het algoritme surft dus mee in de richting van de markt. Stijgt de prijs van een onderliggend product, dan zal het algoritme dus een longpositie aangaan en net zolang meesurfen totdat de trend wordt verbroken.

De trend wordt altijd verbroken door een prijsdaling in een stijgende trend of een prijsstijging bij een dalende trend. Dan zal de (trailing) stop loss worden geraakt en geeft het algoritme een sluit signaal. Deze de trailing stop loss beweegt dus mee met de trend in de markt.

Hiernaast ziet u een versimpeld voorbeeldje van de trailing stop loss.

De trailing stop loss staat relatief kort ingesteld. Dat betekent dat het maximale verlies altijd klein is tegenover de potentiële winst. Dit betekent concreet dat onze winstratio ongeveer 50/50 is. Gemiddeld genomen zullen op langere termijn de winsten ongeveer twee keer zo groot zijn als de verliezen. Echter, het kan dus voorkomen dat we op korte termijn soms een flinke draai om onze oren krijgen. Stel u daarop in, zodat u niet

Sell trailing (simplified)



in paniek raakt als dit voorkomt. Begin daarom rustig met één systeem om te wennen aan het idee dat een computer voor u handelt op de beurs.

Hoe hoog is de stop loss?

Ieder systeem hanteert standaard een stop loss. Deze beperkt het verlies per trade en is afhankelijk van verschillende parameters in de markt. Dit betekent dat de precieze hoogte zal verschillen per keer.

Toch kan het in enkele gevallen voorkomen dat de stop loss wordt doorbroken. Niet door falen van het systeem, maar door sluiting van de markt. Futuresmarkten hebben als kenmerk veel langere openingstijden te hebben dan reguliere markten, maar dat betekent niet dat ze 24 uur per dag en 7 dagen per week open zijn.

Op een bepaald moment sluit de markt dus, waarna er niet gehandeld kan worden. In de tijd dat er niet gehandeld kan worden, kunnen er wel gebeurtenissen plaatsvinden die markten doen bewegen. Dit leidt dan tot 'gaps' in de grafiek, oftewel gaten waarop een systeem onmogelijk kan anticiperen. Hieronder ziet u een voorbeeldje van gaps.



VOORBEELD: we zitten long in een markt met de AEX op 600 punten en de markt sluit. Na sluitingstijd worden er bijvoorbeeld aanslagen gepleegd op raffinaderijen van Shell waardoor de AEX index een flinke dreun krijgt van 8 punten, terwijl onze stoploss op bijvoorbeeld 3 punten staat. Doordat het incident tijdens sluitingstijd plaatsvindt, zal de AEX openen op 592 punten, flink onder de stop loss, en zal het systeem een groter verlies dan de stop loss moeten incasseren.