# Sprint 34

29 aug 2020 Tijdje niet aan pakket gewerkt. Beleggen, vooral het beleggen met opties heeft mij behoorlijk opgebroken. Ik sta nu op min 480 vanaf eerder dit jaar min 220. Dat is 260 euro verder in de min.

Ik wil eigenlijk zoveel mogelijk alleen nog ingaan op echt duidelijke signalen en de fouten die ik in het verleden heb gemaakt vermijden. Eigenlijk had ik bedacht tot december alleen nog “droog” te beleggen.

Ik weet dat ik enigszins gokverslaafd ben maar dat is beter dan dat ik hier helemaal mee stop omdat het de aandacht afleidt van mijn nare situatie. Het houdt mij geestelijk gezond om te blijven beleggen en ik hou mijn hersens erbij. Stop ik dan ga ik me daardoor ook nog eens heel akelig voelen en het houdt mij toch bezig via dit pakketje en via het beleggen zelf.  
 260 euro gedeeld door 6 maanden is veertig euro per maand. Dat is te overzien. Veel meer mag het ook niet worden mocht ik daaronder komen. Ik heb een nieuwe grens getrokken, min 600, dan stop ik definitief met beleggen voor dit jaar. Tot die tijd alleen nog veilige en kleine posities tot ik weer wat uit de min ben. Doel is toch nog steeds tot een beleggingsstrategie te komen die tot (veilige) winst leidt.

Laten we hopen dat ik in ieder geval een paar honderd euro winst kan maken en daarmee onder de de min 300 kom. Dat zou ik al een heel mooi resultaat vinden voor de komende maanden.

Beleggingsstrategie voor de komende maanden:

* alleen reageren op duidelijke signalen bij voorbeeld uitgezocht hebben dat die statistisch gezien tot winst leiden en tot een bescheiden risico
* alleen sterke fondsen kopen die ergens onderin hun bandbreedte zijn begonnen met klimmen, bijvoorbeeld ING. Niet te grote pakketten, niet meer dan een paar honderd euro. Voorzichtig met opties want ik kan daar geen stoploss op zetten. Van tevoren het risico op deze instrumenten berekenen:
* Met opties extra voorzichtig zijn
* van tevoren een uitgebreide optieberekening de stoploss grenzen bepalen
* liefst uitproberen in een droge run waarbij je de optie of optiecombinatie uitprobeert tezemen met een beleggingsstrategie
* calls en puts alleen voor aandelen die per stuk rond de 10 of 20 euro kosten
* calls alleen schrijven op basis van een gedeeltelijke positie in aandelen van bijvoorbeeld 50% en tezamen met een stoplimit kooporder van de overige 50% van de onderliggende aandelen
* alleen puts kopen in combinatie met een gedeeltelijke positie en een stoploss order voor diezelfde aandelen
* bij iedere positie die ik inneem op papier zetten:  
  van tevoren: wat de stoploss grenzen zijn en de strategie waarop ik bij – of verkoop op basis van signalen die nog gaan komen  
  tussentijdse transacties: motivatie voor de transactie
* Droog beleggen  
  Toch via de voorbeeldportefeuille gaan beleggen en daarin via een paar fondsen of instrumenten in beleggen die ik al dan niet in portefeuille heb. Dan kan ik namelijk wel allerlei risico’s nemen die ik anders niet zou nemen. Ook handig om bepaalde aandelen te volgen.

## Beleggen op basis van signalen: ideeën

* Ik wil graag – deels handmatig - kijken of ik een aantal dingen kan uitzoeken over het genereren van signalen op basis van indicatoren en steun- en weerstandslijnen.
* Een van de dingen die ik graag wil uitzoeken of beleggen via signalen van de instrumenten statistisch gezien tot winst of verlies leiden
* hoe groot dan de kans nog is dat ik iets verdien als ik iets te laat op een signaal reageer
* hoe groot de verwachte uitslag percentueel is van de koers zowel opwaarts als neerwaarts binnen zeg een week waarin het signaal is afgegaan
* Kijken hoe sterk of hoe zwak de koersontwikkeling is op een bepaald tijdstip ten opzichte van andere aandelen.

Ik zou handmatig kunnen kijken wat de betekenis is van deze signalen – liefst in combinatie met elkaar, door in de koershistorie van een bepaald aandeel te kijken en een en ander op papier kunnen zien te krijgen

Ad 1. en ad 2. Droge testruns en overzichten van signaalmomenten  
  
Ik zou een paar droge testruns kunnen doen of een en ander (deels) kunnen inbouwen in het pakketje om deze signaalmomenten te produceren bij een bepaald aandeel binnen een bepaalde periode: bijvoorbeeld een lijstje van MACD aan- en verkoopsignalen met daarbij de datum en het koersniveau. steunlijn.

Ad 1. Automatisch gegenereerde steun- en weerstandslijnen  
  
Dit staat al heel lang op mijn verlanglijstje: een manier om via een algoritme een steunlijn in te schieten en dan te bepalen of die al neerwaarts is gebroken de laatste tijd. Voorbeeld is dat ik zeg dat ik een drie-maands steunlijn wil hebben tot een week geleden en te kijken of die de laatste week is geschonden.   
Ik zou visueel kunnen vaststellen of je op die manier bruikbare steunlijnen krijgt. Mocht dat het geval zijn dan kan ik ook hier via het pakket signaaloverzichten van genereren bij een bepaald aandeel.

Ad 3.

De dingen die ik heb bedacht gaan wel tijd kosten. Ik wil er intussen zoveel mogelijk plezier van hebben. Ik heb gezien dat ik in de voorbeeldportefeuille van IEX geen stoplimit of stoploss orders kan inleggen alleen simpele limietorders. Daar heb ik dus niet zoveel aan. Wat ik wel zou kunnen doen is eens kijken hoe het zit met de optieprijzen en of die qua impliciete volatiliteit erg uiteen lopen. En mogelijk ook, hoe dat dan vervolgens komt. Ik wil áls ik weer met opties ga beleggen eigenlijk “droog” experimenteren met verschillende beleggingsstrategieën en verschillende instrumenten. Zo wil ik graag automatisch steunlijnen in kunnen schieten en kunnen bepalen of die al zijn geschonden (bijvoorbeeld door een oplopende steun heen gegaan). Daar zou ik een case van kunnen maken al was het alleen al op papier.

## Deze sprint

Onderhanden

|  |
| --- |
| * Spike: hoe via algoritme automatisch intekenen steun- en weerstandslijnen (horizontaal en vertikaal) van de afgelopen 3 maanden (instelbaar). |
| * Portefeuille kunnen opslaan – onderhanden, bezig uit te zoeken hoe dat zou kunnen. |

Backlog, op dit moment nog actueel

|  |
| --- |
| * Meerdere portefeuilles kunnen beheren |
| * Koersen inclusief laatste dag, ook als beurs nog open is. Deze tijdelijke koers moet dan later worden vervangen door de slotkoers van de dag bij het ophalen van koersinformatie |
| * Optiecalculator toevoegen |
| * Indicatorsignalen toevoegen plus methode om die via een knop te checken (bijvoorbeeld: heeft een bepaald fonds recentelijk een MACD koopsignaal getoond?) |
| * Toevoegen risico in huidige portefeuille aan de hand van berekende volatiliteit voor de respectievelijke aandelen in de portefeuille |
| * Opties aan portefeuille toevoegen |

Statistitieken verzamelen over de betekenis van signalen:

Gegeven een bepaald signaal bij een bepaald fonds. Bijvoorbeeld een macd verkoopsignaal. Wat is dan de verwachte percentuele opwaartste en neerwaartse koersbeweging binnen een dag en binnen een week? Vervolgens (gegeven een methode om automatisch een 3-maands steunlijn te tekenen onder de laatste koersen) dezelfde vraag bij het neerwaarts doorbreken van zo’n steun.

Recentelijk opgelost

|  |
| --- |
| * Gesodemieter libraries, workspaces Gesodemieter oplossen met overgang naar Mac en dan workspace telkens kapot, aparte manier om de workspace voor Mac resp Windows aan te vullen, complete kopie maken incl libraries op beide machines   Opgelost (voorlopig): uit git de .idea folder en het .iml bestand van beide machines verwijderd en de bijbehorende bestanden en folders ondergebracht in een macversion folder respectievelijk een windowsversion folder. In de .gitignore ervoor gezorgd dat .idea/ folder en niet wordt meegenomen. De .idea folder in de macversion en windowsversion folders hernoemd naar \_idea. Op die manier wordt wel een “oude”versie van de machinespecifieke bestanden bewaard. Dit moet per project, er zijn twee projecten: de koersenmodule en het beleggingspakket.  Verschil koersenmodule en beleggingspakket qua java versie  De koersenmodule maakt gebruik van java 8 omdat anders de libraries niet werken die de koersen op dit moment ophalen: bij het koersen ophalen moet namelijk gebruik gemaakt worden van javascript op de pagina’s omdat anders de koersen niet blijken te kloppen. Om die reden wordt van een bepaalde library die ik niet met java 11 aan de praat kon krijgen vanwege gezeur met modules. Het beleggingspakket maakt juist gebruik van open java jdk 11 (dwz niet van oracle want daar is vanaf java 11 van alles uit gesloopt). |

Recent toegevoegde functionaliteit

|  |
| --- |
| Volatiliteit tonen  Zodra je op een candle klikt wordt de volatiliteit berekend aan de hand van de laatste 250 beursdagen en onderin de grafiek afgedrukt. Deze volatiliteit blijkt goed overeen te komen met de waarde van de volatiliteitsindicator van IEX. Er blijkt ook een flink verschil te zijn tussen intrinsieke volatiliteit en deze berekende volatiliteit. Bij het beleggen kun je daar nog wel gebruik van maken om de winst te vergroten. |