

Best of Both Worlds

Investeren en Traden

Langetermijnbeleggen



Hoe kan T.A. helpen?

Welke aanpak heeft gewerkt?

Enkele eenvoudige strategieën

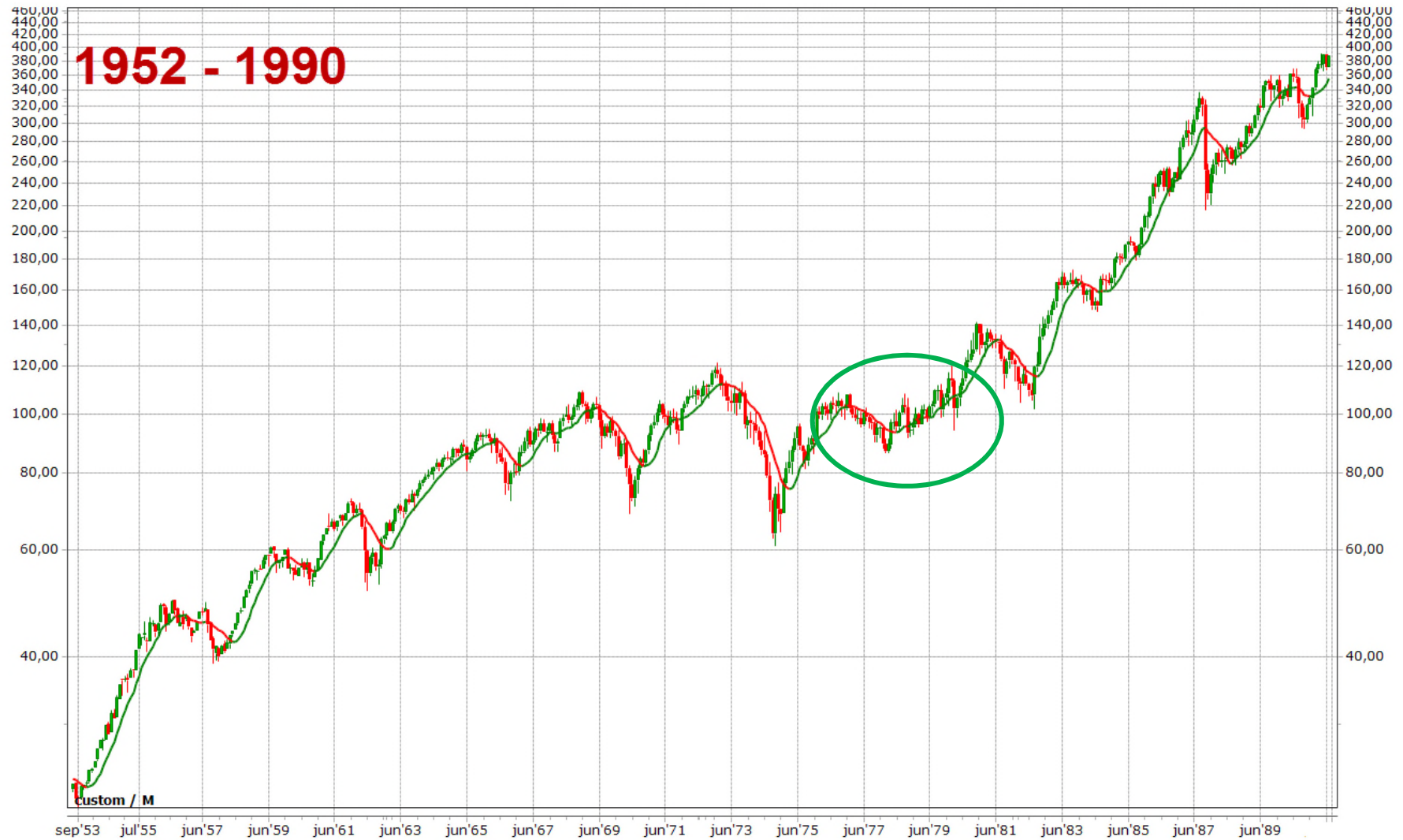
1. Mebane Faber



Faber zoekt o.m. naar:

- investeren zonder veel toezicht
- maandelijkse controle
- op indexen (S&P500) en ETF's
- de sleutel = 10 maanden SMA
 - slotkoers onder SMA 10 = exit
 - slotkoers boven SMA 10 = instap

_us S&p 500



_us S&p 500



De resultaten?

Returns 1900-2008	S&P500 B&H	S&P Timing
Jaarlijkse return (CAGR)	9.21%	10.45%
Max. drawdown	-83.66%	-45.00%
Beste jaar	+52,88%	+52.40%
Slechtste jaar	-43.86%	-26.87%

€ 1000 – 40 jaar	9.21%	10.45%
Eindresultaat	€ 33.923	€ 53.288

Faber: gebruik 5 etf's i.p.v. alleen SPY
spreiding over **complementaire assets**

SPY : grote bedrijven VS

EFA : niet Amerikaanse bedrijven

AGG: obligaties

IYR : vastgoed

DBC : grondstoffen

Resultaten combinatie van 5 ETF's + SMA-10 m.

Periode: 1973 – 2008:

11.27% gemiddelde jaarlijkse groei

Max. drawdown 9.53%

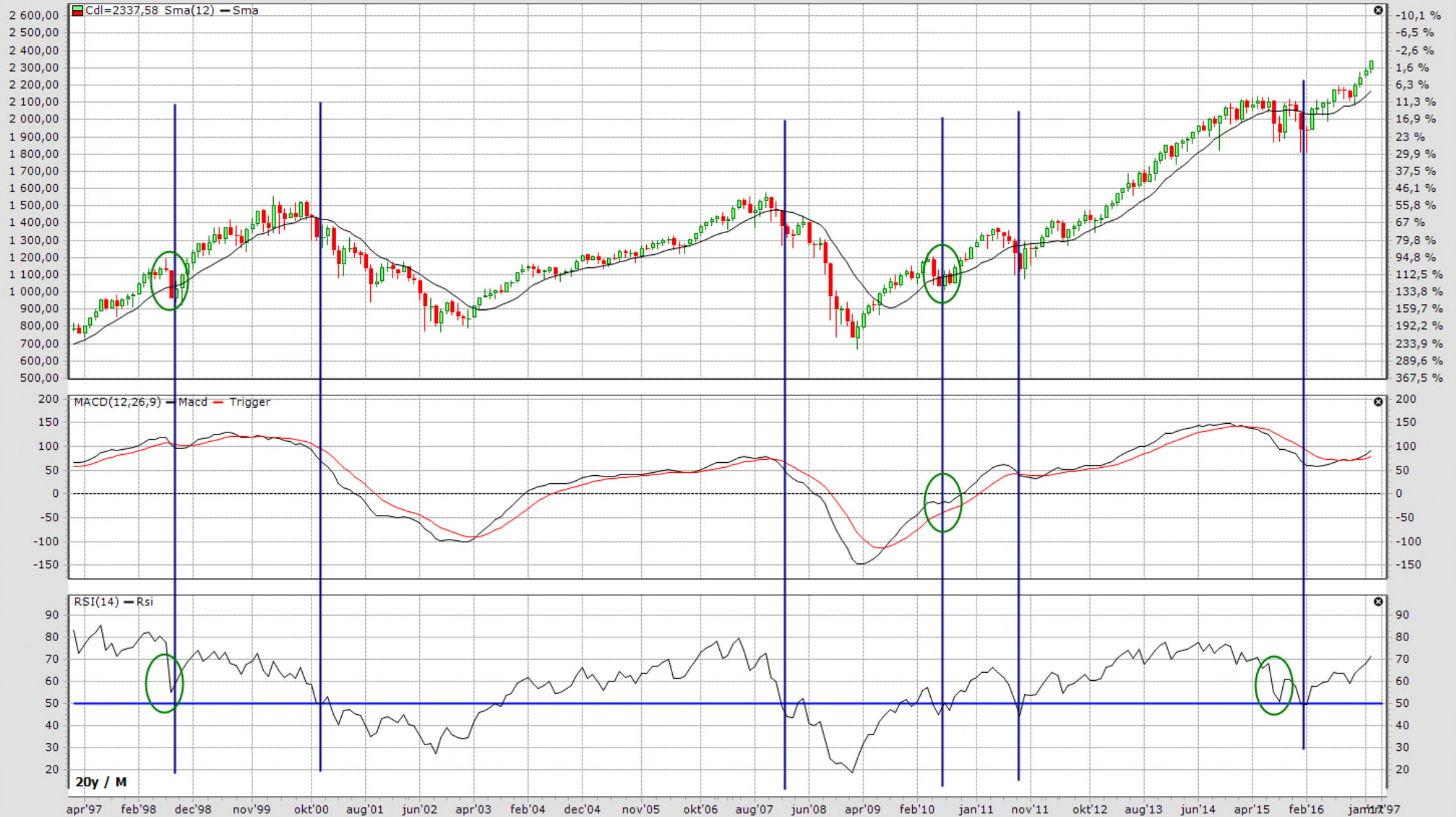
21 keer aankoop / verkoop

Slechts maandelijks opvolgen

Te veel onnodige uitstappunten met verlies.
Hoe beperken?

1. Slotkoers maand onder SMA 12 m.
2. SMA moet dalend zijn
3. Rode candle
4. MACD cross met signaallijn
5. $RSI \leq 50$

_us S&p 500 - I:SP500



In / Uit een ETF: hoe controleren?
Eén keer per maand:

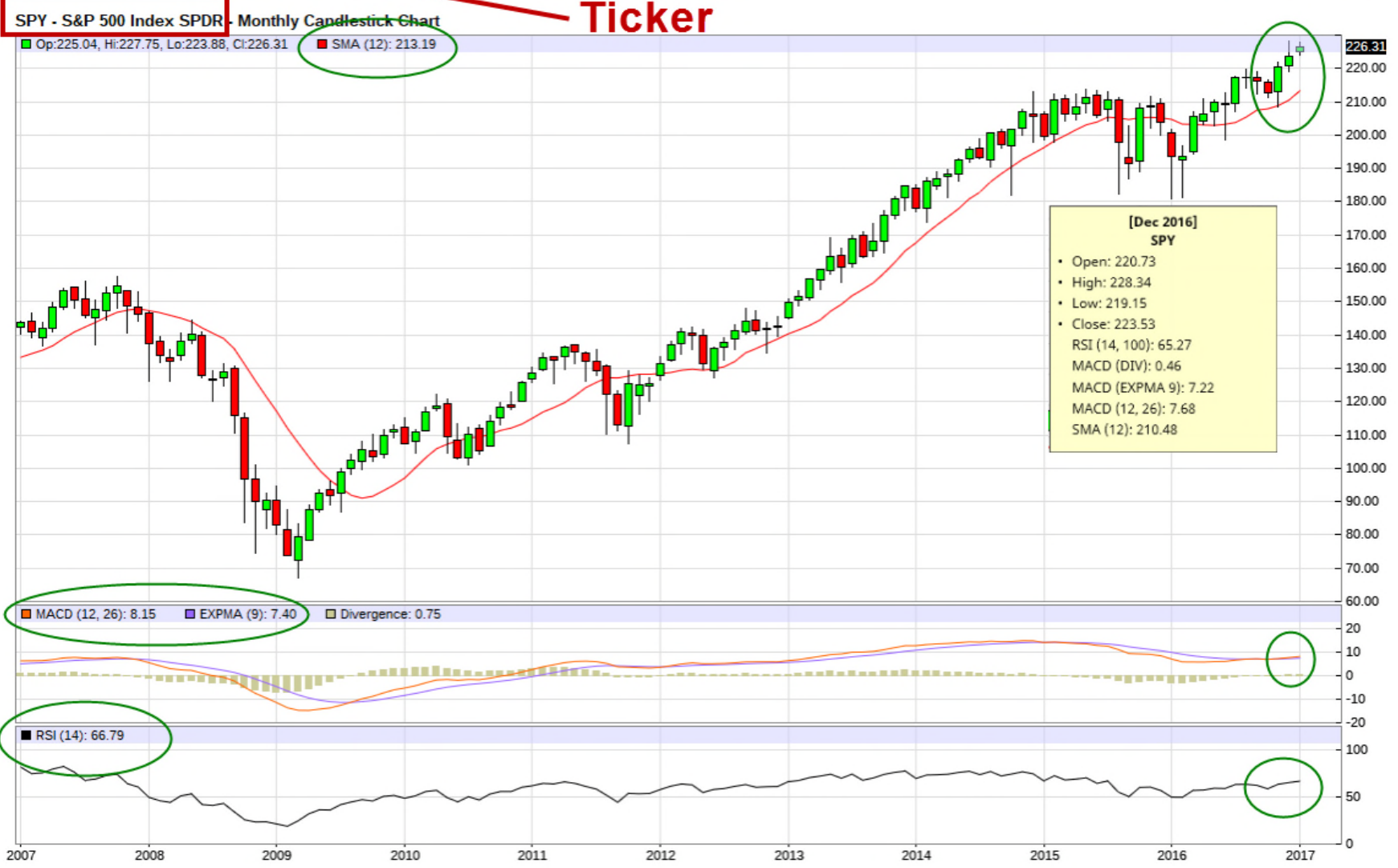
▶ bit.ly/2fP9nCU

Tickers invoeren voor de 4 andere etf

- TECHNICALS**
- Technical Analysis
- Trader's Cheat Sheet
- Barchart Opinion
- Trading Strategies
- Price History

- OPTIONS**
- Options Quotes
- Volatility & Greeks
- Covered Calls
- Naked Puts
- Option Spreads

- COMPANY**
- News
- Profile
- Constituents
- ETF Comparison



Ticker

Voordelen van deze aanpak:

- Eenvoudig
- Duidelijk
- Bewezen rendement
- Beperkte drawdowns
- Bedoeld voor de lange termijn



Bevat 15 strategieën

2. Extra: methode die voldoet aan de basisvereisten:

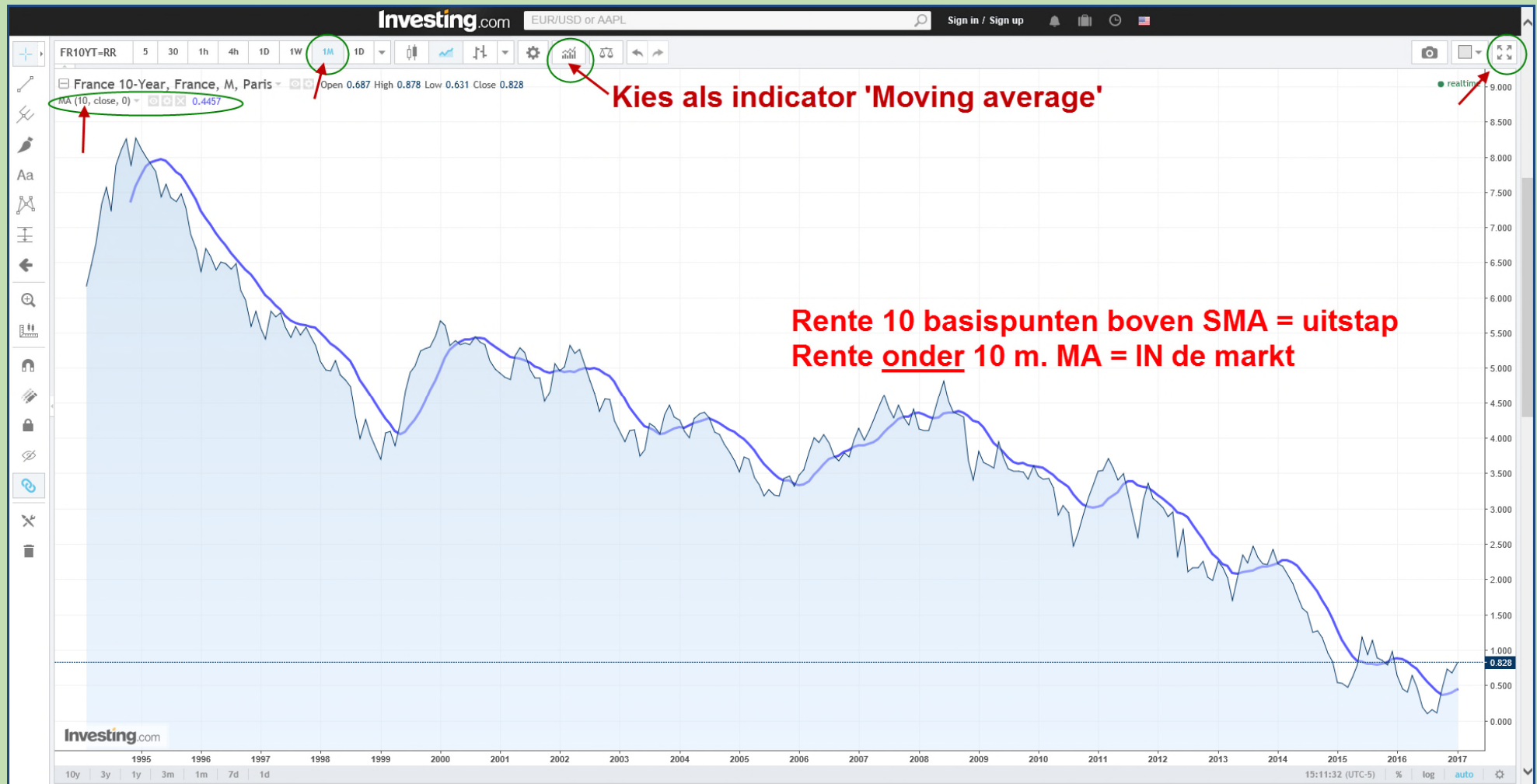
- eenvoudig
- weinig toezicht of controle
- bewezen rendement over 45 j.
- beperkte terugval

Wat is er nodig?

1. De Total Return Index (TRI) van de CAC40
2. Rente 10-jarige Franse overheidsobligaties

Waar vinden we die informatie?

► bit.ly/2jy7s7z



▶ bit.ly/2jzYru9



Total Return Performance als		
De indicatoren zijn:	% Winst/Jaar	% van de Tijd
Allebei positief	18.66%	49.5%
Gemengd	11.22%	37%
Allebei negatief	-18.46%	13.5%

Resultaat: € 1.000 wordt na 45 jaar € 2.206.457,-

Voorwaarde tot succes: **Discipline**

Gelijkaardige resultaten werden gevonden voor

- Msci Total Return U.K. : CAGR 15,79%**
- Msci Total Return Italië: CAGR 15,73%**

(in combinatie met 10-jarige overheidsobligatie)

Kortetermijnbeleggen

Trading



Trading

= max. enkele weken in de markt

Noodzakelijke en nuttige 'tools'

- filtersysteem
- voortschrijdende gemiddelden
- enkele simpele indicatoren
- stop loss
- timeframe: daggrafieken (+ evt. uurgrafieken)

- **Stap 1 – Sterke aandelen zoeken**

- haal de 5% sterkste aandelen uit een brede index (S&P500 / Stoxx600 / Russell2000 / Etf's ...)
- bepaal *de periode* waarover die aandelen de sterkste zijn: bv. vanaf de recentste correctie.

Waar/Hoe vind je die topaandelen?

→ via softwarepakket voor T.A. : Rel. Sterkte (**RS**)

→ gratis voor Amerikaanse/Canadese beurzen
- StockCharts toont de SCTR ('Scooters')
d.i. de *StockCharts Technical Rank*

Op de startpagina van StockCharts.com

Large-Cap SCTR

Symbol	SCTR	Change
VALE	99.9	+0.0
NVDA	99.7	+0.0
GLNCY	99.6	+0.0
MU	99.4	+0.0
URI	99.3	+0.2
ZION	99.1	+0.1
CFG	99.0	+0.3
BAC	98.8	+0.6
LNC	98.7	+1.1
WDC	98.5	+0.6

Last Updated: 2017-01-18 16:10ET

SharpChart ▼
PerfChart | CandleGlance

ETF SCTR

Symbol	SCTR	Change
XIVH	99.9	+0.0
RSXJ	99.8	+0.0
SLX	99.7	+0.1
COPX	99.6	+0.0
PICK	99.6	+0.1
KRE	99.5	+0.1
KBE	99.4	+0.2
XME	99.4	+0.7
KBWB	99.3	+0.0
IAI	99.2	+0.4

Last Updated: 2017-01-18 16:10ET

SharpChart ▼
PerfChart | CandleGlance

Toronto SCTR

Symbol	SCTR	Change
NDM.TO	99.9	+0.0
IVN.TO	99.8	+0.1
CGC.TO	99.7	-0.1
NVC.TO	99.6	+0.0
TKO.TO	99.5	+0.0
TCW.TO	99.3	-0.1
YGR.TO	99.2	-0.1
TMB.TO	99.1	+0.0
CMMC.TO	99.0	-0.2
FTP.TO	98.9	+0.1

Last Updated: 2017-01-18 16:10ET

SharpChart ▼
PerfChart | CandleGlance

Enkel aandelen met hoogste *relatieve sterkte* komen in aanmerking.

Theorie: de berekeningswijze

De elementen die de SCTR bepalen:

- LT: % boven/onder 200 ema (30%)
125-d. RoC (30%)
- MT: % boven/onder 50 ema (15%)
20-d. RoC (15%)
- KT: 14-d. RSI (5%)
3-d. slope van de PPO-histogram (5%)(% Price Oscil.)

Op Chartmill.com: ook Europese aandelen!

► <http://bit.ly/2lPtf7T>

ticker	Name	TA	Setup	Volume Increase	Relative Strength	Perf Today	Perf 1 Week	Perf 2 Week	Perf 1 Month	Perf 3 M
...PA	XILAM ANIMATION	10	2	1.84%	99.32	-6.12%	32.67%	37.9%	13.73%	104.72%
...IT.PA	SOITEC	10	6	-56.16%	98.86	2.21%	5.11%	13.5%	25.85%	103.3%
...A.PA	ERAMET	6	6	51.94%	97.96	-0.76%	3.69%	5.73%	-0.85%	17.14%
...SD.PA	INSIDE SECURE	9	2	32.29%	97.13	1.15%	7.88%	4.84%	11.59%	26.83%
...EME.PA	ATEME	10	5	-58.82%	96.62	-1.19%	0.6%	6.33%	18.64%	55.56%
...AS	ARCELORMITTAL	10	2	78.91%	96.53	-0.36%	16.7%	19.47%	14.22%	30.69%
...M.PA	STMICROELECTRONICS	10	6	6.87%	96.46	-0.31%	-3.14%	6.36%	21.16%	46.01%
...DI.AS	ORDINA	10	2	160.08%	95.73	-0.8%	10.29%	13.52%	11.39%	16.34%
...B.PA	RIBER	8	8	-74.18%	95.58	4.29%	5.26%	1.45%	35.92%	91.78%
...AR.BR	SMARTPHOTO GROUP	7	8	-11.08%	95.05	-0.42%	5.63%	2.39%	-8.54%	11.33%

Enkel aandelen met hoogste *relatieve sterkte* komen in aanmerking.

Ook voor ETF's vind je de relatieve sterkte hier:

► bit.ly/2jijRYL

5-day Intervals
 21-day Intervals
 Viewing Wednesday's Closing data.

Symbol	01/25	01/18	01/10	01/03	12/23	12/16	12/09	12/02	11/25	11/17	11/10	11/03	10/27
<u>XIV</u>	99.8	99.8	99.6	99.6	99.7	99.6	99.6	99.4	99.2	99.3	99.0	96.7	98.8
<u>SVXY</u>	99.7	99.7	99.5	99.6	99.6	99.6	99.5	99.3	99.1	99.2	98.9	96.5	98.7
<u>COPX</u>	99.4	98.8	99.0	98.3	97.8	98.7	99.3	99.5	99.5	98.9	99.4	96.9	95.2
<u>RSXJ</u>	99.1	99.1	99.2	99.0	99.1	99.4	98.9	99.6	99.3	99.6	99.6	99.2	99.0
<u>SLX</u>	98.8	98.9	98.9	98.8	98.9	99.3	99.8	99.9	99.9	99.7	99.6	98.2	98.2
<u>XME</u>	98.7	98.9	98.9	98.6	98.7	99.0	99.1	99.6	99.6	99.6	99.3	97.6	96.3
<u>PICK</u>	98.3	98.1	97.6	97.3	96.5	98.0	98.5	99.0	98.7	98.5	99.2	97.4	96.4
<u>KOL</u>	98.2	98.3	98.4	98.3	98.3	98.8	99.0	99.8	99.8	99.8	99.9	99.3	99.5
<u>URA</u>	98.0	92.7	93.3	53.3	36.9	44.3	37.4	8.0	8.4	7.6	5.3	3.5	4.2
<u>KRE</u>	97.7	97.7	98.2	98.1	98.3	98.2	97.9	98.3	97.6	97.9	97.3	89.3	90.6
<u>GBTC</u>	97.5	99.2	98.5	99.5	98.2	97.2	98.2	99.9	99.6	99.9	99.7	99.5	99.8
<u>PSCM</u>	97.4	97.6	98.0	97.5	98.0	98.4	98.6	98.9	98.7	98.8	98.4	93.5	93.9
<u>SILJ</u>	97.3	98.2	98.1	95.3	78.8	91.8	96.3	99.3	98.4	98.4	99.1	99.5	99.3
<u>KBWR</u>	97.2	96.7	97.4	97.9	98.0	97.8	97.0	98.0	97.5	97.7	96.6	85.0	86.4
<u>KBE</u>	97.1	97.2	97.6	97.8	98.1	97.7	97.6	97.8	97.0	97.5	96.4	86.2	87.8

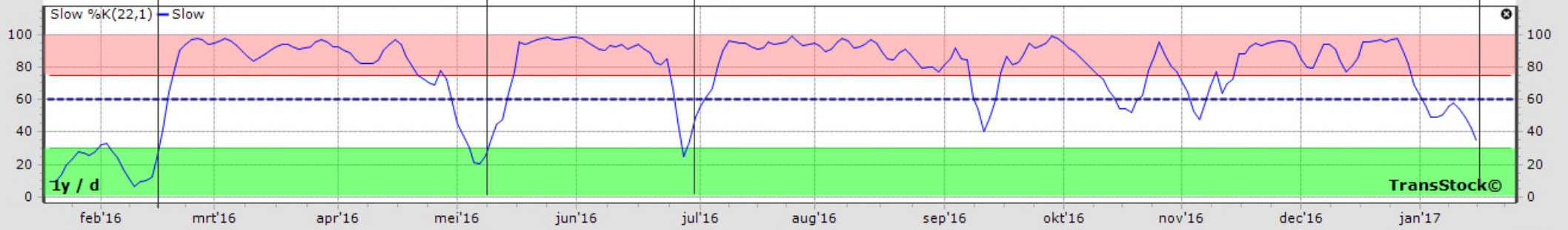
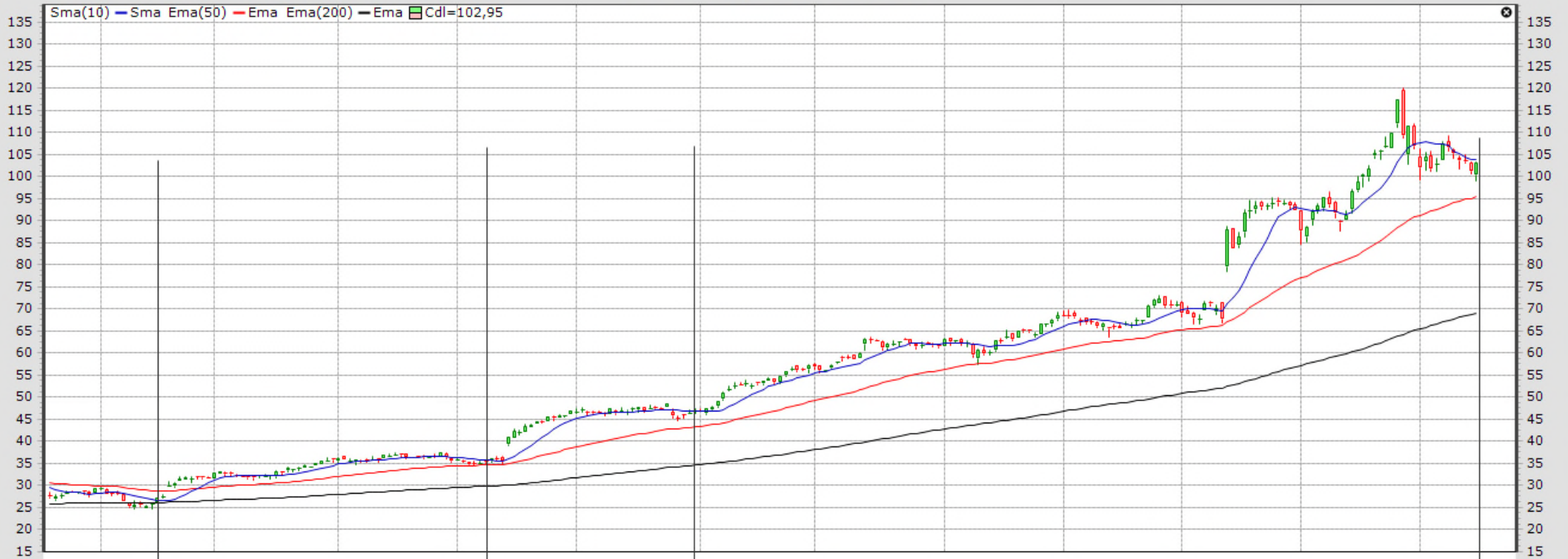
- Stap 1 – de sterkste aandelen
- **Stap 2 – De grafiek**

- Daggrafiek met 3 gemiddelden :
12 sma - **50** ema – 200 ema

- **1** indicator:
Slow Stochastics (2 grafieken)
instellingen 5/1 en 22/1

Oversold op 20, resp. 30
+ 50-lijn

Nvidia Corporation - NVDA



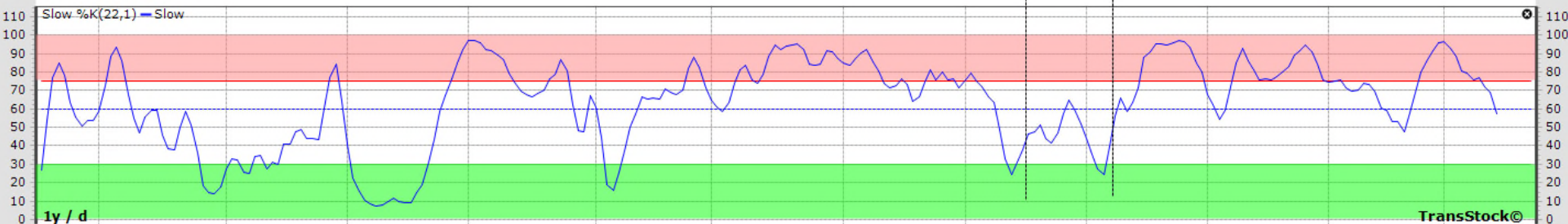
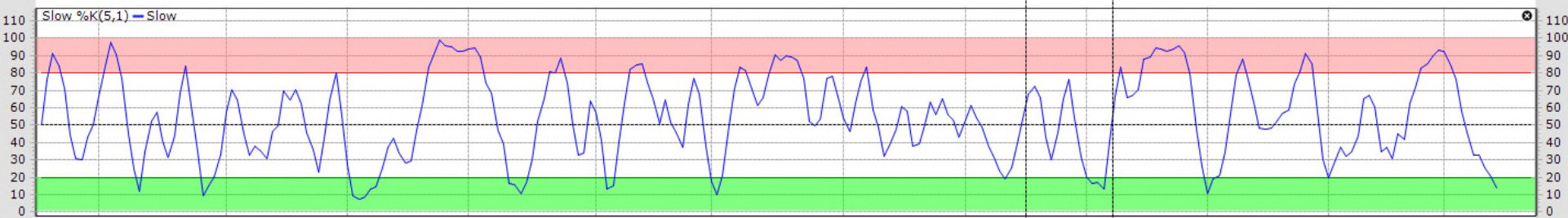
- Stap 1 – de sterkste aandelen
- Stap 2 – de grafiek
- **Stap 3 – De Instap**

Slow Stoch. (5/1) stijgt weer boven 50
Slow Stoch. (22/1) heeft oversold zone geraakt
+
koers bevindt zich boven 12-d. sma

Divergentie maakt het signaal krachtiger

Stop Loss onder de laatste bodem

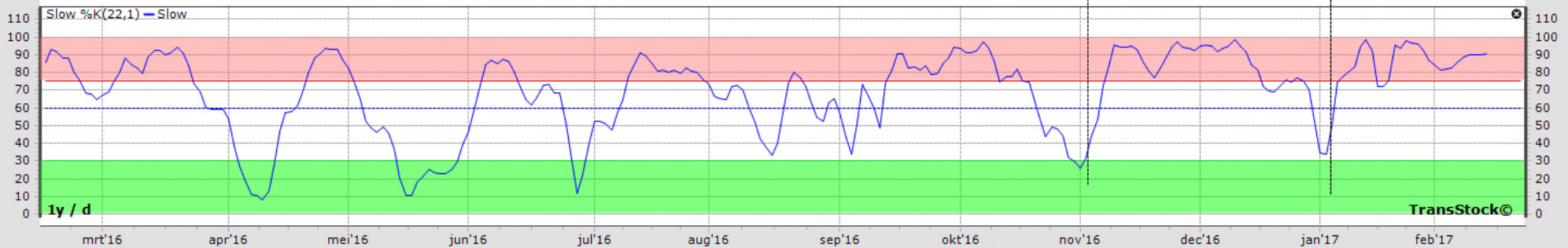
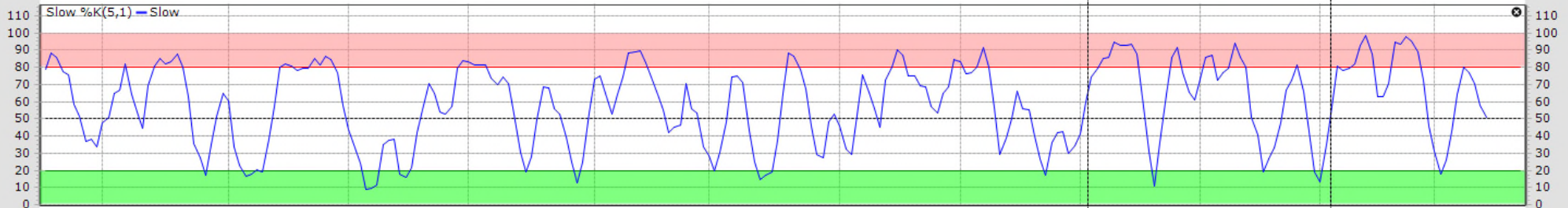
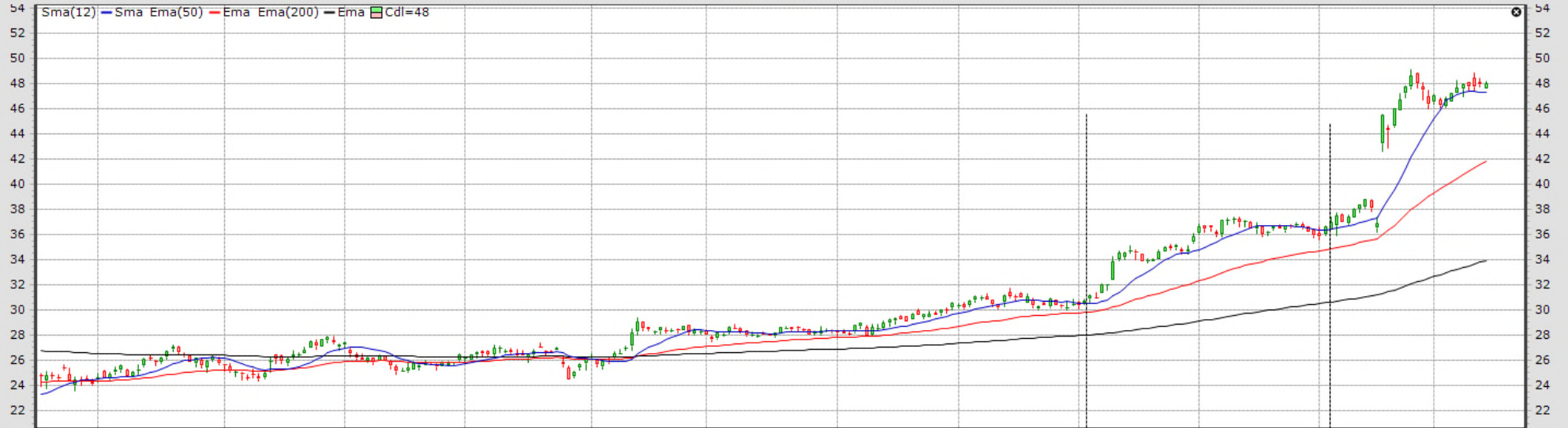
Micron Technology Inc - MU



1y / d

TransStock©

Csx Corporation - CSX



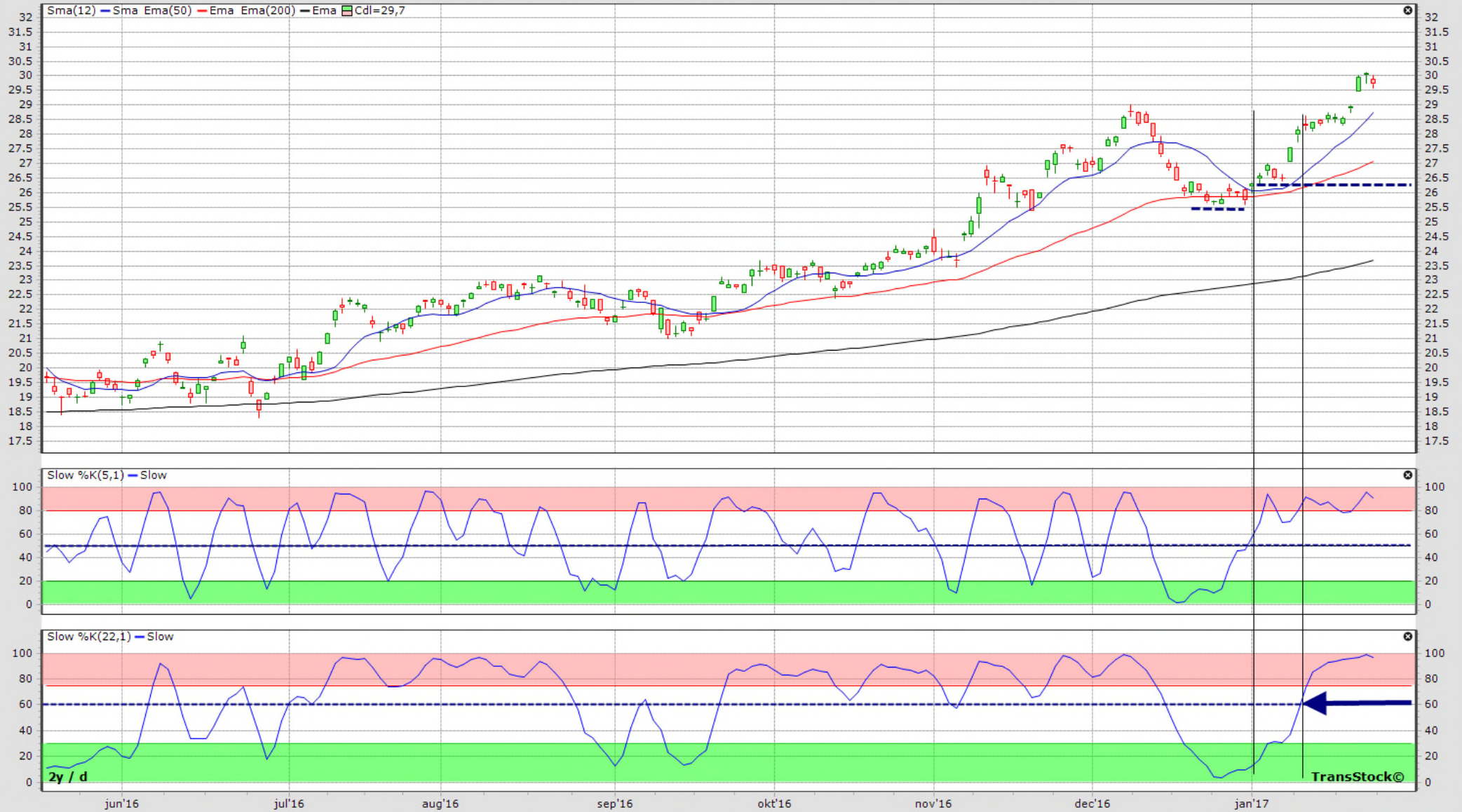
- Stap 1 – de sterkste aandelen
- Stap 2 – de grafiek
- Stap 3 – de instap

- **Stap 4 – De Opvolging**

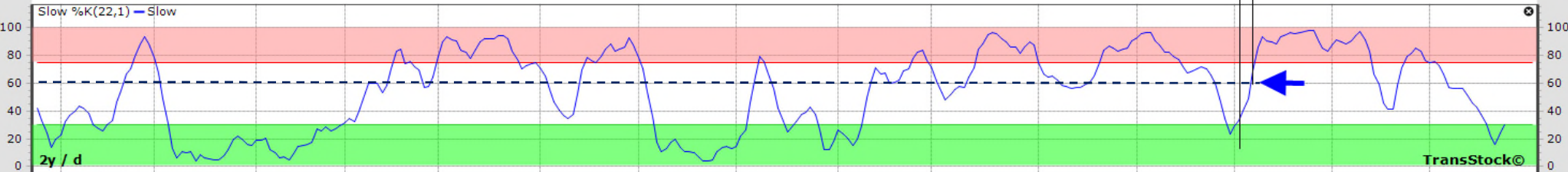
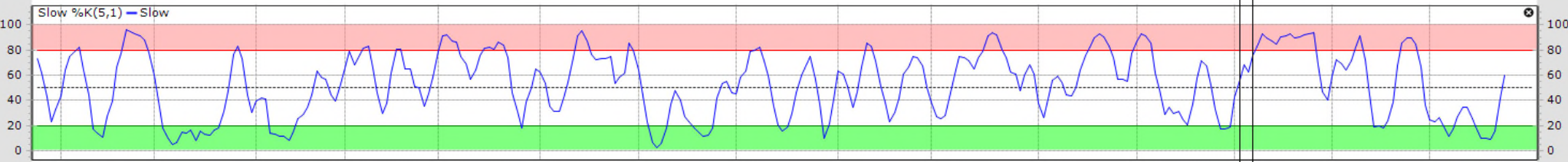
1. Plaats de Stop Loss bij aanvang
2. Verplaats SL naar break even zodra
Stoch. $22/1 > 60$

Gevolg: de trade wordt *risicoloos*

Ishares Msci Global Select Metals & Mining Producers Fund - PICK - Equity



Navistar International - NAV - INDUSTRIE



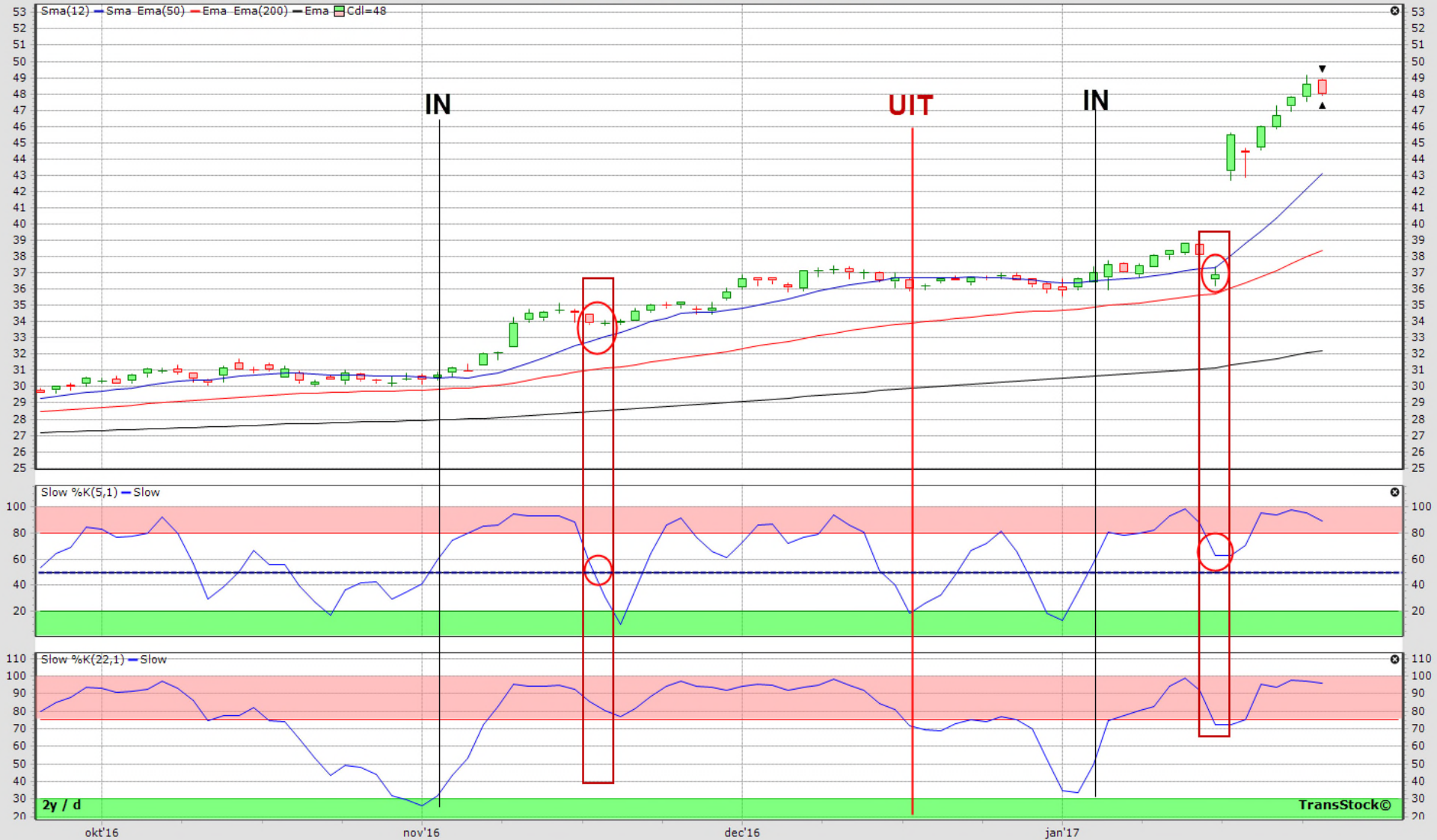
- Stap 1 – De sterkste aandelen
- Stap 2 – De grafiek
- Stap 3 – De instap
- Stap 4 – De opvolging

- **Stap 5 – De Uitstap**

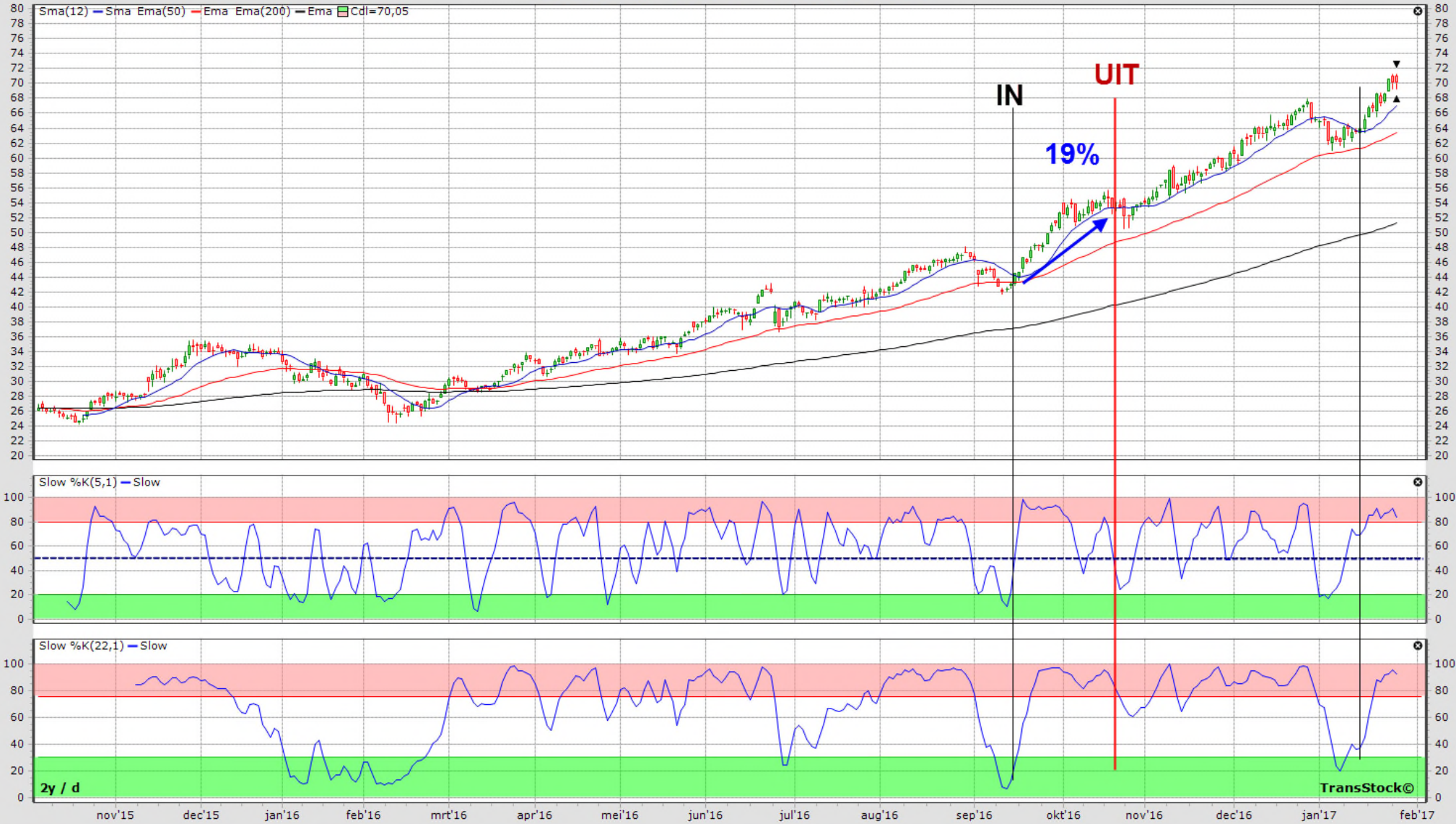
1. Uitgestopt door SL bij de start (klein -%) of op break even

2. Zodra de koers sluit onder 12-d. sma
+
Stoch. 5-1 < 50

Csx Corporation - CSX - INDUSTRIE



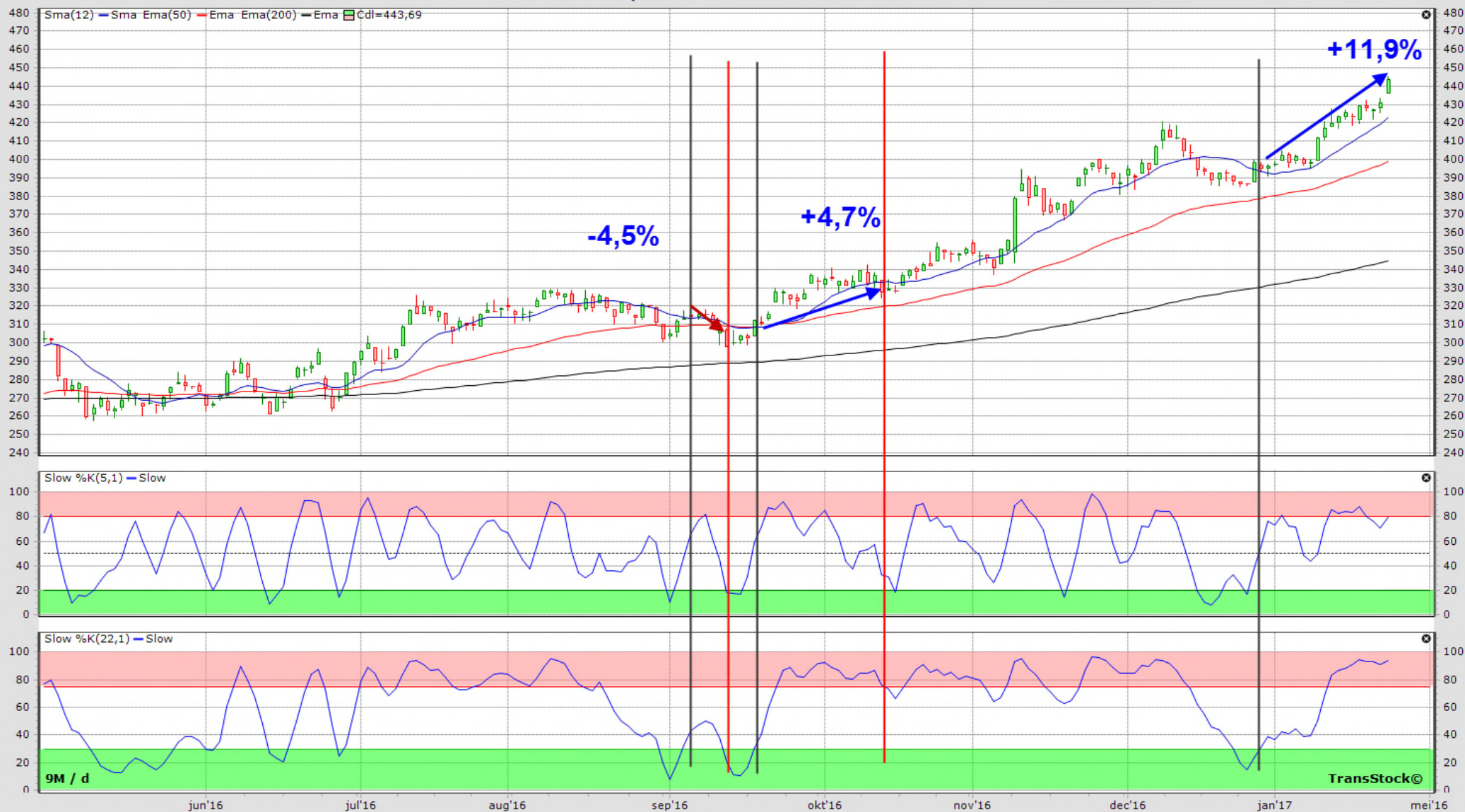
Covestro Ag - E:1COV - GRONDSTOFFEN



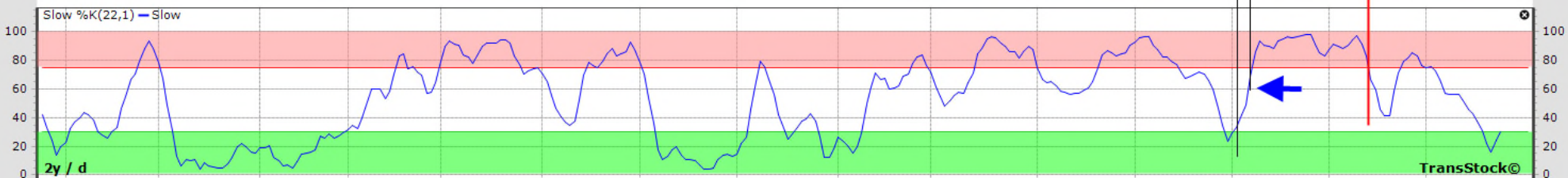
Weir Group Plc - E:WEIR - INDUSTRIE



Stoxx Europe 600 Basic Resources - I: SXPP



Navistar International - NAV - INDUSTRIE



Instappunten: ook nuttig voor LT-beleggers

Samen met andere TA-technieken toepasbaar

- weerstandlijn doorbroken
- specifieke indicatoren
- fibonacci retracements
- enz.

Samengevat:

- een methode voor traders
- dus: posities bewaken
- de kansen op verdere stijging zijn groot omwille van $RS > 95\%$
- voorzichtigheid: slechts 5% (tot 10%) per positie
- ook bruikbaar als instappunt voor LT-beleggers

VRAGEN?

LT-beleggen: @wilvoorspoels



Of

wilfried.voorspoels@gmail.com