

Fallstudie: Software i-matrix

## Minimale Anlagerisiken durch Kybernetik

Die Kybernetik, das heisst die Wissenschaft der Kommunikation und Kontrolle von lebenden Organismen und Maschinen, wird auch als die Kunst des Steuerns bezeichnet. Sie gilt als Schlüssel zur Analyse komplexer Systeme und kommt deshalb auch in der Finanzanalyse zum Einsatz. Unter anderem ermöglicht es die Kybernetik, nichtlineare Dynamiken zu berechnen und dadurch Aufschaukelungen und Dämpfungen in komplexen Systemen zu veranschaulichen.

### Versteckte Muster (er)kennen

Die Software i-matrix ist auf die Berechnung von Kursbewegungen spezialisiert und kann dadurch sowohl Privatanlegern als auch Profis wertvolle Trading-Signale liefern. Anstatt wie andere Systeme auf einzelne Zahlenreihen zurückzugreifen, berechnet die Software die Wechselwirkungen aus einer Vielzahl von Faktoren. Erstmals werden dabei die versteckten Muster der Wellenbewegungen in den Finanzmärkten systematisch sichtbar gemacht. Ziel ist dabei klar, Phasen der Instabilität zu vermeiden, Anlagen gezielt während robuster Phasen zu tätigen und

Kybernetik ist die wissenschaftliche Forschungsrichtung, die vergleichende Betrachtungen über Gesetzmässigkeiten im Ablauf von Vorgängen anstellt.

dadurch das Anlagerisiko deutlich zu reduzieren. Die Software i-matrix nutzt hierbei Rechenverfahren aus der Raketentechnik und der Überlagerung von Wellen.

### Track-Record lässt aufhorchen

Die Indikatoren von i-matrix sind seit der Einführung im Jahr 2005 immer weiter perfektioniert worden, zuletzt mit einer kybernetischen Korrelationsanalyse. Ge-

Selbstständig anlegen? Für viele Bankkunden ein Traum, der ausserhalb ihrer Reichweite scheint: zu komplex das Anlageuniversum, zu hoch die Risiken. Welche Möglichkeiten stehen Anlegern offen, die ihre Risiken besser einschätzen wollen? Eine neuartige Software zur Berechnung von Kursbewegungen, welche die Kybernetik und AlgorithmenRechenverfahren der Raketentechnik nutzt, verspricht Hoffnung.

Alexandra Kohl

mäss Dr.-Ing. Artur P. Schmidt, der die Software von Grund auf entwickelt hat, liegt die Trefferquote der Indikatoren von i-matrix heute bei 95 Prozent. Der Aufschwung ab März 2009 wurde vom System präzise angezeigt: Das generierte Kaufsignal ermöglichte bis zum November 2009 vor allem durch die Fokussierung auf Finanztitel einen Gewinnzuwachs von durchschnittlich 75 Prozent. Eine (hypothetische) Rückrechnung für den Börsencrash von 2002/03 hat ergeben, dass mit



## Interview

## «Unser Ansatz ist meines Erachtens revolutionär»

**Warum sind Sie überzeugt, dass Kybernetik die richtige Antwort ist?**

Dr.-Ing. Artur P. Schmidt: Jedes Modell, das die Nichtlinearität der Welt ausblendet, ist im Grunde genommen nur Kaffeesatzleseerei. Im Gegensatz zur Charttechnik und der klassischen «Technischen Analyse» kann die Kybernetik die voraussichtliche Entwicklung an den Märkten zuverlässig berechnen, weil sie eine Vielzahl sich ständig verändernder ökonomischer Grössen wie Inflation, Zinspolitik, Geldpolitik, Konjunkturzyklen, Volatilitäten usw. berücksichtigt.

**Was ist das Problem bei der klassischen Analyse?**

Die gesamte klassische Analyse basiert auf linearen Berechnungsmodellen, die von ihrem Ansatz her gar nicht in der Lage sind, Komplexität tatsächlich zu berechnen. Eine solide Börsensoftware aber muss die aktuellen Zusammenhänge, die sich täglich ändern können, verstehen. Deshalb kann nur

eine Börsensoftware, die Instabilitäten ausdrücklich in ihren Berechnungen berücksichtigt, die Wirklichkeit richtig abbilden und somit versteckte Muster sichtbar machen.

**Warum bezeichnen Sie i-matrix als revolutionär?**

i-matrix ist revolutionär, weil die Berechnungsgrundlagen auf der Kybernetik beruhen. Das heisst, sie berechnet und koppelt in jedem Augenblick Daten aus der Vergangenheit, Gegenwart und Zukunft in nicht-linearer Weise und ist damit der klassischen «Technischen Analyse» weit überlegen. Ich spreche gerne davon, dass i-matrix den zum Teil völlig überbewerteten Markt für Anlageberatungen von hinten aufrollen wird. Unser Ansatz ist meines Erachtens revolutionär. Dieser Anspruch kann mit konkreten Zahlen belegt werden: die Performance von i-matrix liegt derzeit rund 55 Prozent über dem Marktdurchschnitt. Ich bin deshalb überzeugt: Für Anleger, die sich eine besse-


re Kontrolle und Performance wünschen, gibt diese Basisinnovation der Finanzmarktanalyse Sicherheit und schützt das Vermögen.

**Welche unternehmerischen Ziele verfolgen Sie?**

Zunächst werden wir die Tradercockpit GmbH in eine AG umwandeln. Ziel ist es, eine Beteiligungsholding wie Berkshire Hathaway von Warren Buffet aufzubauen. Ausserdem wollen wir in den nächsten zwei bis drei Jahren das Unternehmen mittels eines IPO an die Börse bringen. Hierzu suchen wir noch strategische Investoren und werden in verschiedenen Tranchen etwa 25 Prozent des Unternehmens als Venture Capital sowie durch einen Börsengang zur Zeichnung anbieten. Mehr ist nicht nötig, da unsere einzigartigen Trading-Signale uns ein hohes Eigenwachstum ermöglichen.

diesem System selbst in Abschwungphasen jährliche Gewinne von bis zu 50 Prozent hätten erzielt werden können. Je hö-

her die Volatilität in den Märkten ist, desto mehr Gewinne können mit dem Trading-System von Artur P. Schmidt erzielt werden.

formance von über 600 Prozent erzielt werden konnte, dient Anlegern als Einführung in das Indikatorensystem. Nach einer Einführungsphase von etwa zwei bis drei Monaten können Anleger gemäss den jeweiligen Pivotpunkten (Umkehrpunkten) auch selbstständig in den Märkten traden. Das Pivotpunkte-System signalisiert durch den Farbwechsel von Rot auf Grün bzw. Grün auf Rot, ob eine Anlage – und zwar gleichgültig aus welchem Segment – robust ist oder nicht. Auch während des Börsencrashes von 2008 konnte das Musterdepot zulegen. 

**Welche Anlagekriterien sind zentral?**

Anleger sollten mindestens neun verschiedene Anlagen tätigen, um ihre Risiken zu minimieren. Zudem sollte das Kapital zeitlich gestaffelt eingesetzt werden. Hierzu berechnet i-matrix sogenannte Pivotpunkte (Umkehrpunkte) – zu diesen Zeitpunkten ist der Ein- bzw. Ausstieg besonders günstig. Generell sollte die Anlagestrategie folgenden Empfehlung berücksichtigen:

- 2/3 des Kapitals in ETF (Exchange Traded Funds) oder Mini Futures in Indizes mit maximalem Hebel 4 investieren.
- Nur etwa 1/3 in Aktien (wobei Blue Chips jeweils mit 1/9 und Small Caps jeweils mit 1/18 des Depotwerts gewichtet werden sollten).

**Phasen optimal nutzen**

Der Indikator wird neben dem Rückkopplungsprinzip mit dem Wellenprinzip berechnet und erzeugt daher markante Umkehrpunkte (Pivotpunkte). Diese stellen jeweils das Stop-Loss eines Investments sowohl bei steigenden als auch bei fallenden Kursen dar. Herkömmliche Training-Stops oder Stop-Loss-Limiten werden damit überflüssig. Wer konsequent nach den Pivotpunkten tradet, kann sowohl grosse Auf- als auch Abschwungphasen mit den geeigneten Instrumenten (Long ETF/Short ETF, Mini Futures Long/Short) optimal nutzen.

**Zuverlässige Hinweise**

Das Muster-Portfolio von i-matrix, mit dem seit Auflegung 2005 mittlerweile eine Per-

**Kontakt**

**Dr.-Ing. Artur P. Schmidt**  
Gründer



Tradercockpit GmbH  
Bahnhofstrasse 21, 6304 Zug  
Tel. 078 748 24 07  
artur.schmidt@tradercockpit.ch  
www.tradercockpit.ch