

Tysk matematiker knækker finansmarkederne



Mahan Tahvildari – tysk matematiker og trader. Over 200 mennesker kopierer hans handler på eToro.

Allerede som barn var han foran de andre, når det drejede sig om matematik og geometri. Jo mere abstrakt og kompliceret matematikken blev, jo mere skilte hans sig ud, og i dag er han som 27-årig ved at afslutte sin anden kandidatgrad i matematik ved Oxford-universitet i England.

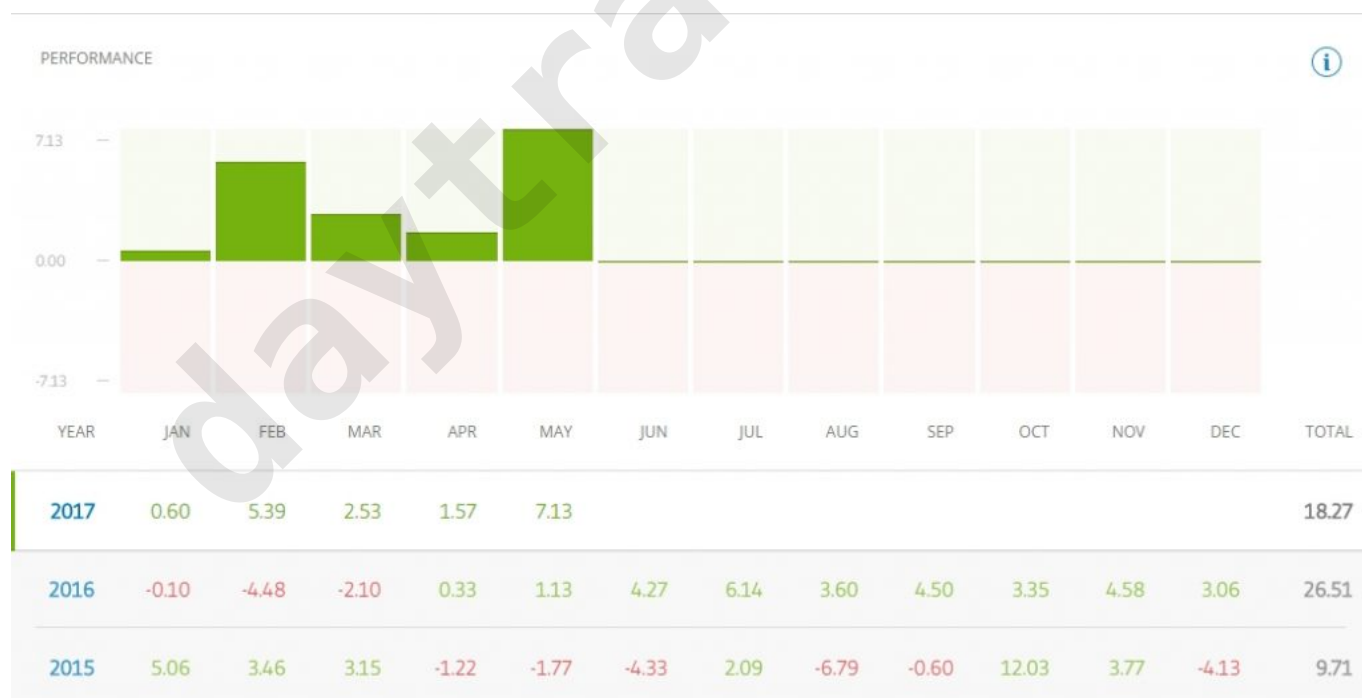
Den tyske matematiker Mahan Tahvildari har talent for algebra, ligninger og sandsynlighedsregning, og han har igennem de seneste år overført sin viden til som trader at handle det tyske DAX-indeks, hvor han med en gevinststrate på hele 99,3% vindende handler stikker ud i mængden af de hundredetusindvis af aktive tradere, som handler live **på handelsplatformen eToro.**

Næsten 3000 mennesker følger Mahan Tahvildari, og i dag

fungerer han som copy trader, hvilket vil sige, at man kan kopiere alle hans handler. Det gør over 200 mennesker på nuværende tidspunkt. Tahvildari har i de seneste 13 måneder ikke haft en eneste tabende måned, og det skyldes blandt andet, at han med stor disciplin og begrænset risiko trader det tyske DAX-indeks. I juni måned vil han i et gratis webinar fortælle om sine strategier og om at være copy trader i **copy trading-forløb** under daytrader.dk, men vi har bedt Tahvildari om allerede nu at give os et lille indblik i, hvordan han har kunnet skabe et så stabilt afkast i DAX-indekset, som er et marked, hvor rigtigt mange daytradere kommer galt afsted.

Se live-webinar med Mahan Tahvildari via vores copytrading-forløb. Tilmeld dig her.

Herunder kan du se Mahan Tahvildaris afkast i procent per måned (klik evt. for at forstørre):

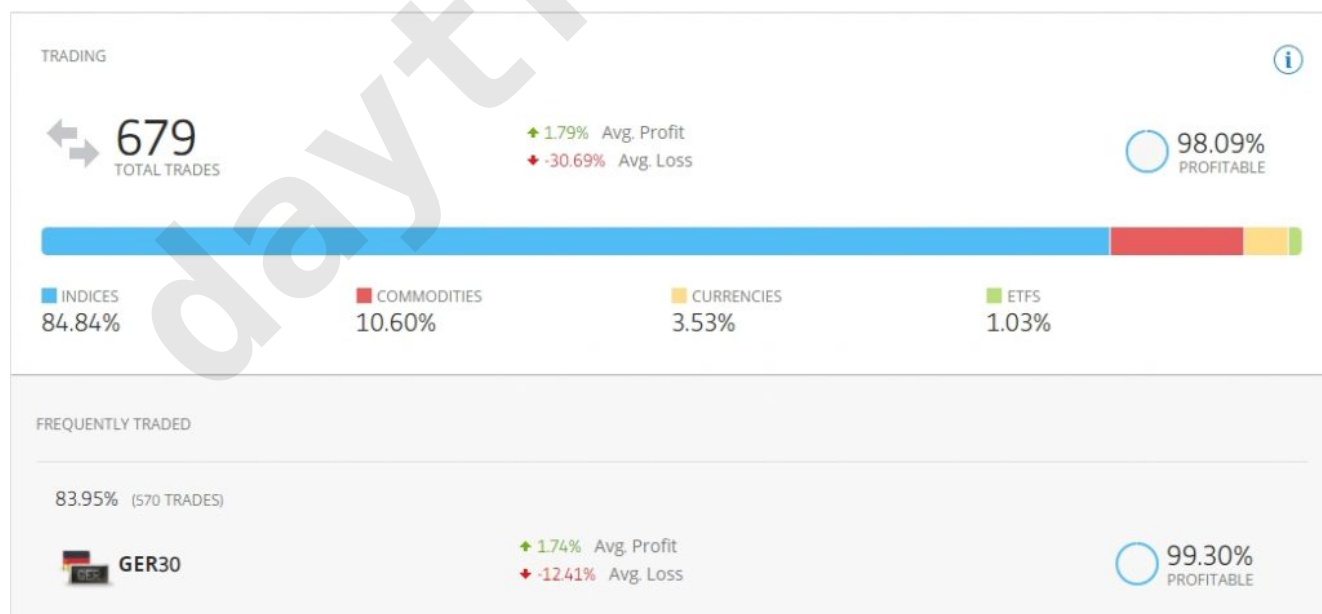


Daytrader.dk spurgte den tyske matematiker, hvordan det er lykkedes ham over tid at skabe så stabile, gode resultater.

Fortæl os først lidt om din baggrund, og hvordan du kom ind i trading.

Jeg er en 27-årig matematiker, der arbejder som senior-konsulent med financial risk management i den internationale banksektor. Samtidig med det studerer jeg finansiell matematik på Oxford-universitetet, og jeg opnår min anden kandidatgrad næste år.

Jeg blev fascineret af investering og trading i løbet af mit første år på universitet, da jeg var på udkig efter, hvordan jeg kunne benytte finansielle modeller til at tjene en formue! Efter at have tradet stort set alle typer af finansielle instrumenter med dårlige resultater blev det klart for mig, at det var en meget mere udfordrende vej at gå, end jeg først havde forventet. Derfor begyndte jeg at læse bøger om investering og trading, deltog i seminarer og trading-konferencer. Jeg meldte mig også ind i en trading-klub og øvede mig med adskillige trading-strategier. Jo længere jeg er kommet i mine matematiske studier, jo mere har jeg fået en forståelse af de værktøjer, man kan benytte til trading. I kombination med de erfaringer, som jeg har opnået, er jeg blevet mere effektiv og profitabel.



Mahan Tahvildari har en god track-record, som er dokumenteret på eToro. I det tyske DAX-indeks har hele 99,3% af hans handler været profitable.

Hvorfor blev du fascineret af matematikken?

Tilbage i folkeskolen, da matematikken blev mere abstrakt gennem algebraiske ligninger, geometri og funktioner, begyndte jeg at klare mig bedre end de andre elever. Jeg blev endnu bedre i gymnasiet inden for områder som lineær algebra, analyse og sandsynlighedsregning, og jeg vidste allerede her, at det skulle være mit hovedfag på universitetet. Jeg kan godt lide at løse komplekse, logiske problemer og benytte matematiske modeller til at løse problemer i den virkelige verden. I matematikken skal man bevise hver en antagelse, som man har. Denne præcise og tidløse videnskab har altid været meget fascinerende for mig.

Få et tip, når vi ser en god børshandel i aktier og valutaVia Messenger-app

Kan du beskrive din strategi for os?

Jeg har udviklet en kvantitativ model for min DAX-trading-strategi. Det er baseret på den ofte benyttede stokastiske differentialligning $dS_t = S_t (\mu dt + \sigma dW_t)$, også kendt som geometriske brownske bevægelser, som inden for stokastisk kalkulus er et basis-værktøj til at prisfastsætte finansielle instrumenter. Variablen S_t står for det finansielle aktiv (f.eks. DAX), prisen på et givent tidspunkt er t , og parameteren μ kaldes "drift", mens σ er volatiliteten (standardafvigelsen), og W_t er den brownske bevægelse (efter den matematiske model Wienerprocessen).

"Drift"-parameteren μdt kan fortolkes som den langsigtede trend på DAX-indekset, og den probabilistiske volatilitets-parameter σdW_t er markedsusikkerheden. Jeg bruger prisdata fra markedet til at estimere modellens parametre og kalibrere dem afhængigt af tidsintervallet. Ud over dette så er **Bollinger bands** (som vist på figuren herunder), en god indikator for at fastsætte entry og exits, da "drift"-parameteren μ kan estimeres via det glidende gennemsnit og

standardafvigelsen ud fra båndenes afgrænsning.



De klassiske Bollinger-bands vist på det tyske DAX-indeks på en dagsgraf.

Du har en imponerende 99,3% gevinstrate på dine handler i DAX. Når du en sjælden gang taber en handel, så er tabene en del større end gevinsterne. Det virker derfor som om, at du bruger store stop-losses – er det korrekt fortolket, og kan du fortælle os, hvordan du får det til at fungere?

Min gevinstrate er tæt på 100% i DAX, og det har givet mig ca. 50% i afkast over de seneste 12 måneder. Over 200 mennesker kopierer min trades, og jeg administrerer over 100.000 dollars med min DAX-strategi via kontoen "Algebraiker" på **eToro**. Jeg benytter større stops for mine positioner, fordi mean reversion, volatilitet, anti-cyklisk trading og risk management er nøgleelementer i mine strategier. Det sker en sjælden gang imellem, at mine handler rammer deres stop, og det er en del af helheden, som man ikke kan komme uden om. Når volatiliteten er høj, så forebygger store stops de tabende handler, da et pullback i sidste ende kan gøre handlen profitabel.

Det ser ud til, at du trader med en meget lav risiko, og det giver et stabilt og sikkert afkast. Har du nogensinde været fristet til at geare din positioner fem gange mere for at

flerdoble gevinsten?

Når man ser tilbage, kan man godt få den tanke, at et meget højere afkast ville have været muligt. Men trading handler også om overlevelse i markedet, og hvis jeg havde brugt højere gearing – afhængig af markedsvolatiliteten – så ville flere positioner have endt i tab, hvilket ville have skadet det overordnede afkast. At bruge høj gearing i kombination med store stops kan være helt ødelæggende. Når man ser tilbage, udgør de historiske priser kun et enkelt scenarie ud af mange mulige, og derfor er det vigtigt at have en risk management-tilgang, som også beskytter kapitalen mod værre scenarier.

Se live-webinar med Mahan Tahvildari via vores copytrading-forløb. Tilmeld dig her.

Tidligere har du tradet andre instrumenter såsom guld og EURUSD. Brugte du de samme strategier på disse produkter, eller havde du en anden strategi her?

Jeg handlede guld og EURUSD for at "hedge" nogle af mine DAX-positioner, da disse to instrumenter i nogle tidsintervaller er negativt korreleret, hvilket reducerer den samlede risiko i porteføljen, når volatiliteten er høj. Jeg benyttede mig i den forbindelse af optimal investeringsteori for ufuldstændige markeder. Siden dengang har jeg formået at forfine min model, sådan at jeg minimerer risikoen, og i den forbindelse har jeg droppet trades, som kun havde en hedging-funktion (afdækning af risiko, red.)

Hvad er dine ambitioner som trader?

Jeg er drevet af hele tiden at forbedre mine evner som matematiker og trader, samtidig med at jeg har nogle finansielle mål. Ud over det så er det meget interessant at mødes personligt med andre tradere og dele ideer og erfaringer.

Har du et godt råd til tradere, som har handlet i et stykke

tid, men som endnu ikke er blevet konsistent profitable?

Tænk ikke for meget på de kortsigtede gevinster, du kan få. Lav om på den måde, du tænker på, så du fokuserer på at beholde dine penge, og udvikl din egen strategi med en bæredygtig risk management-strategi. Risk management sørger for, at du kan fortsætte med at trade, selv når markedet går imod dig. Lad være med at ændre parametrene på din strategi for ofte – ellers bliver det svært at måle ordentligt på effekten. Sørg for hele tiden at forøge din viden ved at studere bøger, tage på seminarer, eksperimentere med nye ideer og kommunikere med andre tradere. Hvis du har lyst til at følge min strategi og få et fornuftigt afkast, så kan du skrive dig op på eToro og kopiere mine handler.

Mahan Tahvildari er en del af daytrader.dk's copytrading-forløb, hvor han afholder et webinar om sine trading-strategier. Du kan deltage i forløbet ved at tilmelde dig vores copytrading-forløb ved at **klikke på dette link**.

Prøv vores gratis handelssignaler i aktier og valuta - LIVE Via Messenger-app
--

Disclaimer:

eToro er en platform med flere aktiv-klasser, der tilbyder både investering i aktier og handel med CFD'er.

Bemærk venligst, at CFD'er er komplekse instrumenter og har en høj risiko for hurtigt at tabe penge på grund af gearing. 51% af detailinvestorkonti taber penge, når de handler med CFD'er med denne udbyder. Du bør overveje, om du forstår, hvordan CFD'er fungerer, og om du har råd til at tage den høje risiko for at miste dine penge.

Tidligere resultater er ikke en indikation af fremtidige

resultater. Den præsenterede handelshistorik er mindre end 5 hele år og er muligvis ikke tilstrækkelig som grundlag for investeringsbeslutning. Copy Trading er ikke ensbetydende med investeringsrådgivning. Værdien af ☐dine investeringer kan gå op eller ned. Din kapital er i fare.

eToro USA LLC tilbyder ikke CFD'er og giver ingen repræsentationer og påtager sig intet ansvar med hensyn til nøjagtigheden eller fuldstændigheden af ☐indholdet af denne publikation, som er udarbejdet af vores partner ved at bruge offentligt tilgængelige ikke-entitetsspecifikke oplysninger om eToro.

yes

Headline Copy trading

Disclaimer Headline Til orientering:

Disclaimer Text {{procent}} af private mister penge ved at handle CFD hos denne udbyder. Du bør overveje, om du forstår, hvordan CFD'er fungerer, og om du har råd til at risikere at miste dine penge. Hos daytrader.dk skaber vi gratis indhold og læringsforløb for jer brugere. Det kan vi blandt andet gøre, fordi vi indgår samarbejde med brokerne, der betaler for omtale på siden.

Disclaimer remove close dialogbox 1

Disclaimer set loss procent company etoro

Disclaimer place in top 1