

Friday Gold Rush



Die Idee:

Die Strategie ist denkbar einfach. Ich kaufe am Donnerstagabend Gold und lasse die Position 24 Stunden laufen. Am Freitagabend verkaufe ich meine Gold Longs wieder. Alternativ kann man die Position auch erst am Montagmorgen auflösen. Die Ergebnisse sehen ähnlich aus. Es ist kein Stop Loss und kein Take Profit vorgesehen.

Warum es funktioniert:

Gold erfüllt zwei Funktionen. Auf der einen Seite wird Gold als Rohstoff zur Weiterverarbeitung in der Schmuckindustrie genutzt. Gold verarbeitende Firmen werden damit vorzugsweise am Freitag Gold einkaufen um den Transport kostengünstig über das Wochenende organisieren. Damit können Sie ihre Produktionsstätten über die Woche voll auslasten und sparen sich Zuschläge für Wochenendarbeit. Auf der anderen Seite dient Gold für viele Investoren als „Save Heaven“ und damit als Versicherung gegen Crashes und eventuelle unkalkulierbare Risiken über das Wochenende. Diese Investoren wollen sich vorzugsweise in der Zeit absichern wo die Börse geschlossen ist und eventuelle Kurslücken zu erwarten sind. Sie kaufen ebenfalls am Freitag Gold als Versicherung und verkaufen es am Montag wieder. Diese beiden Argumente helfen dabei, dass Gold am Freitag überproportional zum Rest der Woche steigt. Ein Long Investment in Gold ist dementsprechend statistisch vorteilhaft.

Gut:

- Sehr einfaches System welches leicht umzusetzen ist
- Strategie arbeitet stabil
- Sehr hohe Liquidität in den jeweiligen Futures
- Geringe Transaktionskosten
- Nur ein Trade die Woche
- Seit 2000 sehr gute Performance
- Nur geringe Drawdowns

- Konnte auch im Gold Bärenmarkt ab 2012 deutliche Gewinne erzielen

Schlecht:

- Kein SL
- Negative Carry
- Von 1990 bis 2000 gute relative Performance aber absolut nichts gewonnen

Interessant:

- Verbesserung der Strategie durch individuelles Timing möglich
- Die Strategie funktioniert in vielen Rohstoffmärkten sehr verlässlich
- Funktioniert am besten in Phasen großer Unsicherheit an der Börse
- Verschiedene Zeitintervalle am Freitag machen die Strategie noch profitabler
- Strategie könnte mit dem Verkauf von Put Optionen noch weiter optimiert werden