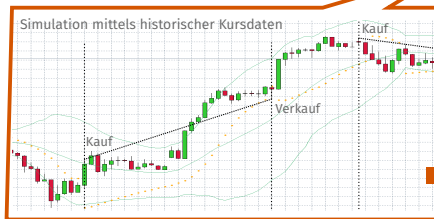


# HISTORISCHE KURS DATEN AM FINANZMARKT

Entwicklungsstadien automatisierter Anlagestrategien:



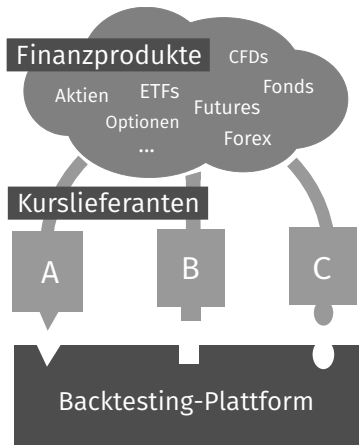
== Evaluierung einer Strategie  
über einen historischen  
Kursdatensatz

➔ Realistische Einschätzung  
über Rendite und Risiko

Historische Kursdaten sind unverzichtbar und deren Qualität und Vollständigkeit maßgeblich für das Testen von Handelsstrategien.

# AGGREGATION UND AUFBEREITUNG VON KURS DATEN

Problem:



Steigende Zahl an Finanzprodukten,  
Märkten und Kurslieferanten

→ Keine einzige Quelle für alle Kursdaten

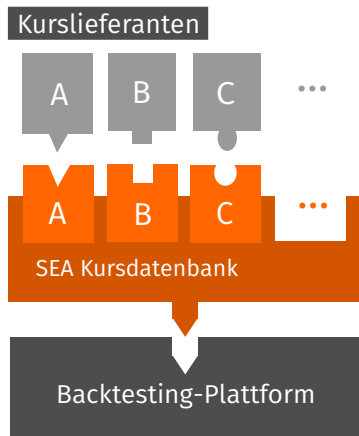
→ Diverse Formate und Protokolle

→ Schwankende Qualität und  
Vollständigkeit

→ Nebenaufgaben werden teilweise nicht  
richtig berücksichtigt  
(handelsfreie Tage, Kursplits, ...)

# AGGREGATION UND AUFBEREITUNG VON KURS DATEN

Lösung:



## Automatisierte Kursdatenaufbereitung

- Import über verschiedene Kurslieferanten mittels angepasster Module
- Identifizierung fehlerhafter Kurse durch redundante Imports
- Interpolation fehlender Daten mit Hilfe eines Trading-Kalenders
- Ein einzelnes performantes Interface für die Backtesting-Plattform

- Software wird produktiv bei der Optimierung von Handelsstrategien eingesetzt
- Adapter für Kursdaten-Import über InteractiveBrokers, MetaTrader, Comdirect und Ariva
- Weiterentwicklung durch zwei Programmierer
- Finanzierung durch private Investoren

**Software-Enhanced Analytics GmbH**

in Gründungsphase

**Ansprechpartner: Vasco Grossmann**

**vgr@informatik.uni-kiel.de**