



SEASONALITY INSTITUTIONAL
-ADDON-

INHALTSVERZEICHNIS

	1
KURZBESCHREIBUNG SEASONALITY-PACKAGE	3
ANLEITUNG PACKAGE-INSTALLATION	4
1. SEASONALITY INSTITUTIONAL - INDIKATOR	5
2. SEASONALITY PREDICTION INSTITUTIONAL - INDIKATOR	8
3. INSTRUMENT STRENGTH INSTITUTIONAL - INDICATOR	9
4. INSTRUMENT DAY ANALYZER - INDICATOR	10
5. HOLD N DAYS - INDICATOR	12



KURZBESCHREIBUNG SEASONALITY-PACKAGE

WARNUNG!

Sehr geehrte Kunden, bevor Sie mit dem Seasonality Arbeitsplatz und den Indikatoren zu arbeiten beginnen, ersuchen wir Sie, diese Anleitung detailliert zu studieren, ehe Sie etwaige Einstellungen modifizieren.

Das Seasonality -AddOn ist ein fortschrittliches Tool, das viele Einstellungen und Parameter beinhaltet. Falsche Einstellungen die aus „Neugier“ getätigt wurden, können zu unerwünschtem Verhalten führen.

WICHTIG!

Sie können jegliche Änderungen in den Indikator-Einstellungen vornehmen, wir empfehlen aber ausdrücklich, nur die Parameter anzufassen, die Ihnen vertraut sind.

Die Saisonalität wird auf Grundlage der in Ihrem AgenaTrader verfügbaren Chart-Historie berechnet. Um eine aussagekräftige Berechnung zu erhalten, empfehlen wir, Daten für zumindest 10 Saisonen für das jeweilig betrachtete Instrument verfügbar zu haben. Auf End-of-Day Basis bedeutet das 10 Jahre an Charthistorie. Wird die Saisonalität auf Basis von geringeren Datenmengen berechnet, wird die Interpretationsfähigkeit deutlich gemindert und es können verfälschte Muster entstehen.

Achten Sie bei der Verwendung des SeasonalityPackages unbedingt auf ausreichend verfügbare Daten.

Viel Erfolg beim Handel mit dem Seasonality-Addon wünscht
Ihr AgenaTrader-Support Team



ANLEITUNG PACKAGE-INSTALLATION

- I. Nach dem Kauf bekommen Sie per Mail folgende Datei zugesendet:
 - SeasonalityInstitutionalPackage.atpack: diese Datei ist das eigentliche Package inklusiver aller darin enthaltenen Komponenten.

ACHTUNG! Wenn Sie den InternetExplorer oder MicrosoftEdge verwenden, wird die .atpack Datei vom Browser automatisch in eine Zip-Datei umbenannt. Nach dem Download müssen Sie daher die SeasonalityInstitutionalPackage.zip in SeasonalityInstitutionalPackage.atpack umbenennen!
- II. Speichern Sie die .atpack-Datei auf Ihrer Festplatte.
- III. Sie müssen nun die Lizenz für das Paket im AgenaTrader eintragen. Dafür klicken Sie auf das Symbol mit dem Fragezeichen, wählen Sie Über-> Aktivierungs-schlüssel eingeben, navigieren Sie zum „SeasonalityInstitutionalPackage“ und tragen Sie Ihren Aktivierungsschlüssel ein, den Sie per Mail erhalten haben. Klicken Sie auf „Aktivieren“. Wenn die Meldung erscheint, dass Ihre Lizenz erfolgreich aktiviert wurde, schließen Sie dieses Fenster.
- IV. Öffnen Sie Tools->Pakete->Paket importieren, lesen Sie den anschließenden Backup-Hinweis und sofern Sie bereits ein Backup durchgeführt haben, klicken Sie auf OK. Im nächsten Fenster navigieren Sie zum Speicherort der SeasonalityInstitutionalPackage.atpack Datei, klicken Sie auf diese und wählen Sie „Öffnen“. Bestätigen Sie die Agena-Neustart Aufforderung mit „OK“.
- V. Nach dem Neustart stellen Sie als ersten Schritt eine Verbindung zu Datenfeed her.
- VI. Sobald Sie eine Verbindung zu Ihrem Datenfeed hergestellt haben, wählen Sie Haupt -> Arbeitsplatz -> Seasonality, um den Seasonality - Workspace zu laden. Sobald alle Charts vollständig geladen sind, ist das SeasonalityInstitutionalPackage voll einsatzbereit.



1. SEASONALITY INSTITUTIONAL - INDIKATOR

Dieser Indikator ist das Herzstück der Saisonalitäts-Analyse, der aus der gesamten im Chart verfügbaren Historie, die Saisonalität berechnet. Mit dem SeasonalityInstitutional Indikator können Sie auf allen EndOfDay Zeiteinheiten (z.B. Tages-, Wochen-, oder Monatschart) jeweils auf den Zeitraum von einem Jahr berechnen lassen. Als eine Saison gilt also ein Jahr.

Zusätzlich ist mit dem SeasonalityInstitutional Indikator auch eine Anzeige von Intraday-Saisonalitäten möglich. Folgende Intraday-Zeiteinheiten sind verfügbar:

- 1 Minute (Saison = 1 Stunde oder 1 Tag, in den Settings einstellbar)
- 2 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 3 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 4 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 5 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 6 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 10 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 12 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 15 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 20 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 30 Minuten (Saison = 1 Tag)
- 1 Stunde (Saison = 1 Tag oder 1 Woche, in den Settings einstellbar)

Folgende Parameter sind beim SeasonalityInstitutional verfügbar:

- **PARAMETERS:**
 - **Calculation Option:** regelt, welche Daten zur Performanceberechnung und damit zur Saisonalitätsmuster-Kalkulation verwendet werden.
 - **CloseToClose:** Performancemessung vom Close der Vorperiode zum Close der aktuellen Periode
 - **IntraCandle:** Performancemessung vom Open eines Bars bis zu dessen Close
 - **BetweenCandles:** Performancemessung vom Close des vorigen Bars bis zum Open des aktuellen Bars
 - **CurrentTimeStart:**
 - **True:** Die Saisonalitätsberechnung startet genau vor einer Saison (Wert für eine Saison siehe in der Tabelle oben).
 - **False:** Die Saisonalitätsberechnung startet jeweils am 1.Jänner des Jahres, wenn EoD Charts betrachtet werden. Auf Intraday-Saisonalitäten hat diese Einstellung keinen Effekt.

- **Limit Lower / Limit Upper:**
 - Hier sind die Grenzwerte einstellbar, die für die Erkennung von Long/ShortRuns verwendet werden. Die Logik der SeasonalRuns wird gleich im nächsten Punkt „Output Mode“ – „LongRuns / ShortRuns“ beschrieben.

- **Output Mode:** regelt, welche Datenserie im Indikatorenpanel angezeigt werden soll
 - **CumulativePercentages:** dabei handelt es sich um die normale Anzeige des Saisonalitätsmusters, die auf Basis der vorhandenen Historie berechnet wird. Hier sei nochmals darauf hingewiesen, dass wir eine Historie von zumindest 2500 Preis-Kerzen für die Interpretation der Saisonalitätsmuster empfehlen. Das Saisonalitätsmuster startet bei 0 und gibt am dann die kummulierte Performance wieder, die aufgrund der letzten x Saisonen durchschnittlich zu erwarten ist.
 - **Percentages:** dieser Wert gibt die Wahrscheinlichkeit wider, mit der im jeweiligen Bar mit einem Anstieg zu rechnen ist. Die Werte schwanken zwischen 0 und 100%. Ein Extremwert von 100% bedeutet, dass der jeweilige Bar in jedem betrachteten Jahr angestiegen ist, 0% bedeutet dass der Wert in jedem Jahr gefallen ist (-> in 0% der Fälle angestiegen). Hierbei wird keine Aussage darüber getroffen, wie hoch dieser Anstieg ist, es handelt sich dabei um die Wahrscheinlichkeit, mit der bezogen auf die Saisonalität ein Anstieg am Zeitpunkt dieser Kerze zu rechnen ist.
 - **LongRuns:** bei einem SeasonalRun handelt es sich um Cluster mit saisonal besonders hoher Wahrscheinlichkeit eines Anstiegs/Abfalls während zumindest 5 Candles. Standardmäßig tritt ein Long-Run auf, wenn mind. 5 Bars einen Percentage – Wert von über 70 haben – also eine Wahrscheinlichkeit von 70% und höher, dass ein Anstieg während dieser Candles passiert. WICHTIG! Es darf jeweils ein Bar unter 70 liegen, wenn der direkt darauffolgende Bar wieder über 70 liegt – das entspricht immer noch einem LongRun. Den Wert von 70 können Sie unter „Limit Upper“ konfigurieren.
 - **ShortRuns:** die Logik ist genau vice versa zum LongRun. Ein ShortRun tritt also auf, wenn mind. 5 Bars einen Percentage-Wert von weniger als 30 aufweisen, die Ausnahme, dass jeweils ein Bar höher als 30 sein darf, wenn der nächste wieder unter 30 liegt, gilt auch hier. Den Wert von 30 können Sie unter „Limit Lower“ konfigurieren.
 - **MixedRuns:** es gibt Situationen, in denen der Percentage-Wert aufeinanderfolgender Bars stark schwankt, wodurch gleichzeitig Long- und Short-Runs auftreten können, da die Ausnahmeregel der SeasonalRuns besagt, dass jeweils ein Bar über/unter dem Limit liegen kann, wenn der darauffolgende Bar die Vorgabe wieder erfüllt. Um diese Situationen kennzeichnen zu können und auf die mögliche Unsicherheit bzw. Seitwärtsphase im Markt aufmerksam zu machen, werden die Candles, in denen ein Long- und ein Short-Run gleichzeitig auftreten, mit standardmäßig gelber Hintergrundfarbe gekennzeichnet.

- **Seasonperiod for 1 Hour:**
 - Hier können Sie einstellen, ob im 1-Stunden-Chart 1 Saison = 1 Tag oder 1 Saison = 1 Woche gelten soll.
- **Seasonperiod for 1 Minute:**
 - Hier können Sie einstellen, ob im 1-Minuten-Chart 1 Saison = 1 Stunde oder 1 Saison = 1 Tag gelten soll.
- **VISUAL:**
 - **Prediction Margin:**
 - **True:** rückt die Bars im Chart weiter nach links, damit die Zukunftsprojektion der Saisonalität besser sichtbar ist.
- **VISUAL PARAMETERS:**
 - **Down-color / Up-color / Mix-color:**
 - Regeln Sie hier die Hintergrundfarbe im Chart für ShortRuns (Down-color), LongRuns (Up-color) und MixedRuns (Mix-color).
 - **Future background color:**
 - Regeln Sie hier die Hintergrundfarbe für die Zukunftsprojektion im Indikatoren-Panel.
 - **Show future background:**
 - **True:** die Projektion in die Zukunft im Indikator-Panel wird mit einer Hintergrundfarbe versehen.
 - **Show future border line:**
 - **True:** es wird eine senkrechte Linie in der Farbe der „Future Background Color“ im Indikator-Panel angezeigt, die nochmals verdeutlichen soll, ab wo die Zukunftsprojektion beginnt (diese ist zusätzlich auch hellblau hinterlegt).
 - **Show lines:**
 - **True:** Zeigt die Grenzlinien im Indikatoren-Panel an – hat nur Effekt wenn „Output Mode“ = „Percentages“ gewählt ist.
 - **Show seasonal run:**
 - **True:** Im Chart werden die aufgespürten SeasonalRuns mit der unter „Down-color / Up-color / Mix-color“ gesetzten Farbe hinterlegt.

2. SEASONALITYPREDICTION INSTITUTIONAL - INDIKATOR

Der SeasonalityPredictionInstitutional beruht auf der Berechnung des SeasonalityInstitutional-Indikators. Anstatt die Saisonalität in einem eigenen Indikator-Panel anzuzeigen, wird hier die auf Basis der Saisonalität vorausgesagte Kursentwicklung direkt im Chart dargestellt. Somit kann auf einen Blick erkannt werden, wohin sich der Kurs beruhend auf statistischer Saisonalität hinbewegen wird. Auch hier ist darauf zu achten, dass Sie genügend Historie im Chat verfügbar haben, damit die Berechnung des saisonalen Musters statistisch signifikant ist und aussagekräftige Informationen bietet.

Folgende Parameter stehen bei der SeasonalityPredictionInstitutional zur Verfügung:

- **PARAMETERS:**
 - **Seasonperiod for 1 Hour:**
 - Hier können Sie einstellen, ob im 1-Stunden-Chart 1 Saison = 1 Tag oder 1 Saison = 1 Woche gelten soll.
 - **Seasonperiod for 1 Minute:**
 - Hier können Sie einstellen, ob im 1-Minuten-Chart 1 Saison = 1 Stunde oder 1 Saison = 1 Tag gelten soll.
 - **Seasons Lookback:**
 - Hier können Sie einstellen, wieviele Saisonen für die Berechnung der Saisonalen Muster verwendet werden sollen. Standardmäßig ist hier „0“ eingestellt, was bedeutet, dass die gesamte verfügbare Historie eines Charts zur Berechnung verwendet wird. Wenn Sie diesen Wert auf z.B. 5 setzen, werden nur die letzten 5 Saisonen zur Berechnung des Saisonalen Musters verwendet, auch wenn mehr Historie verfügbar wäre.
- **VISUAL:**
 - **Prediction Margin:**
 - **True:** rückt die Bars im Chart weiter nach links, damit die Zukunftsprojektion der Saisonalität besser sichtbar ist.
- **VISUAL PARAMETERS:**
 - **Color 1 / Color 2:**
 - Regeln Sie die Farben für den Farbverlauf („Use Gradient“ = „True“) -> es wird ein Verlauf von Color1 zu Color2 angezeigt.
 - **Use Gradient:**
 - **True:** die Zukunftsprojektionslinie wird nicht einfarbig sondern mit einem Farbverlauf dargestellt.
 - **False:** die Zukunftsprojektionslinie wird mit der „Color 1“ einfarbig dargestellt.

3. INSTRUMENTSTRENGTH INSTITUTIONAL - INDICATOR

Mit diesem Indikator können Sie sehr effektiv verschiedenste Märkte miteinander vergleichen. Für jedes Instrument, das Sie über die Parametereinstellungen hinzufügen, wird die Performance berechnet. Alle Instrumente starten bei einem Wert von 0, im Zeitablauf können Sie somit genau analysieren, wie unterschiedlich sich die Instrumente entwickelt haben. Es gibt keine Beschränkung bezüglich Asset-Klassen, Sie können alle beliebigen Instrumente miteinander vergleichen. Im Indikatorenfenster wird zusätzlich noch als Text angezeigt, wieviel Prozent Performance das jeweilige Symbol über die gesamte geladene Historie erwirtschaftet hat.

Zur Anzeige der Instrumente wird immer so viel Historie verwendet, wie für alle gewählten Instrumente verfügbar ist. Das Instrument mit der kürzesten verfügbaren Historie, bestimmt also die verwendete Anzahl an Bars, die für die Berechnung verwendet wird. Instrumente, für die mehr Historie verfügbar wäre, werden ebenfalls nur ab dem Zeitpunkt betrachtet, ab dem für alle Instrumente Historie verfügbar ist, um an diesem Zeitpunkt alle Werte auf 0 zu setzen und damit den Vergleich zu ermöglichen.

Folgende Parameter stehen bei der InstrumentStrengthStandard zur Verfügung:

- **PARAMETERS:**

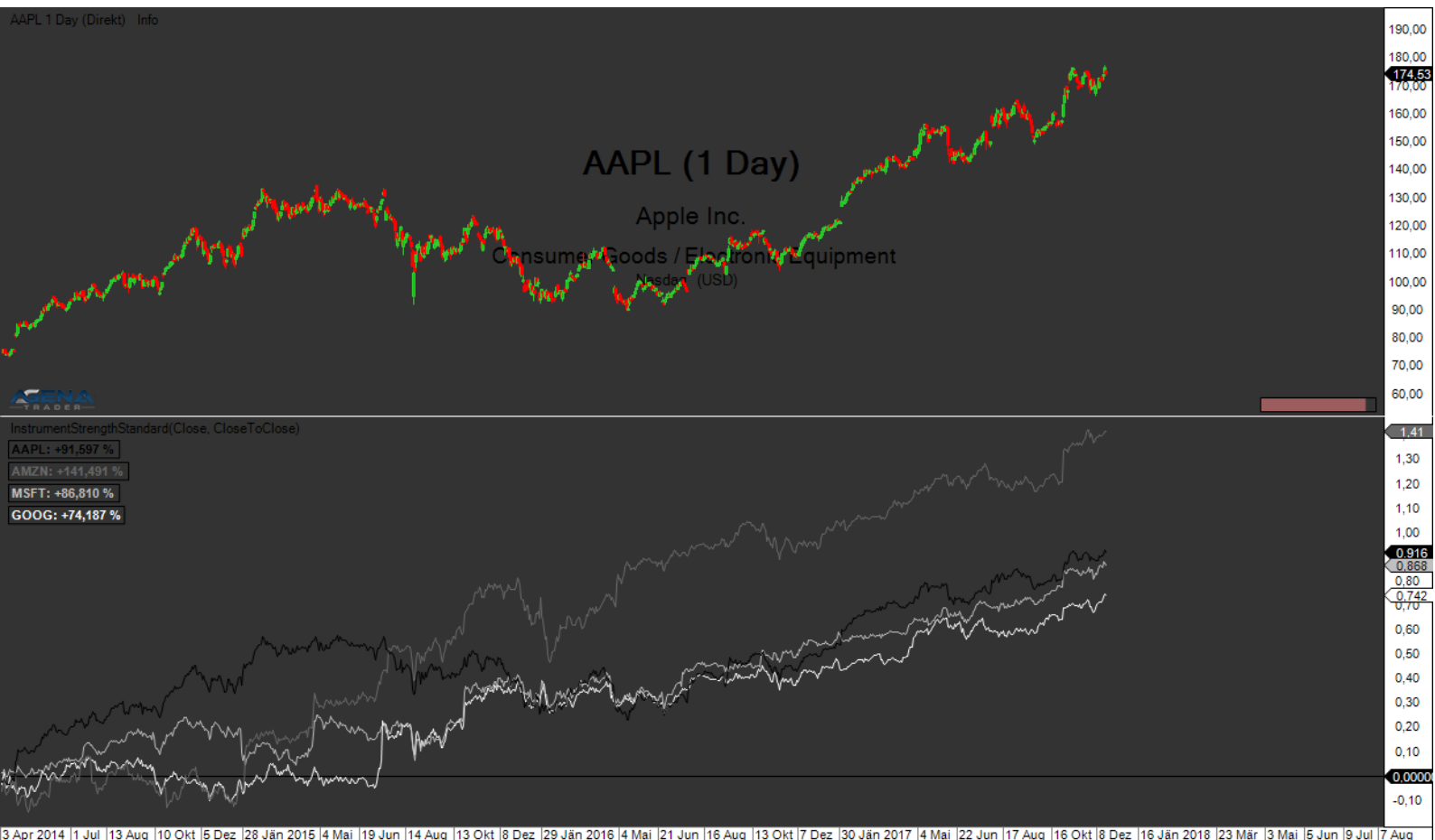
- **Calculation Option:** regelt, welche Daten zur Performanceberechnung und damit zur Saisonalitätsmuster-Kalkulation verwendet werden.
 - **CloseToClose:** Performancemessung vom Close der Vorperiode zum Close der aktuellen Periode
 - **IntraCandle:** Performancemessung vom Open eines Bars bis zu dessen Close
 - **BetweenCandles:** Performancemessung vom Close des vorigen Bars bis zum Open des aktuellen Bars

- **VISUAL:**

- **Linien:**
 - Regeln Sie die Linienfarbe jedes angezeigten Instruments.

- **INPUT INSTRUMENTS:**

- **Instrument 1-30:**
 - Sie können bis zu 30 Instrumente eingeben, die miteinander verglichen werden sollen. Sie können direkt das Symbol-Kürzel in die Zeile eintragen, oder über den kleinen Button am Ende jeder Zeile (erscheint wenn Sie in die Zeile klicken) den InstrumentEscort öffnen und damit das gewünschte Symbol auswählen.



4. INSTRUMENT DAY ANALYZER - INDICATOR

Mit diesem Tool können Sie auf äußerst effektive Weise feststellen, welcher der beste Handelstag der Woche für das aktuelle Instrument ist. Jeder Tag der Woche wird in die DayChange (DC) Session und die Overnight (ON) Session geteilt und die durchschnittliche Performance der jeweiligen Session über die gesamte Historie berechnet.

Jede Session beginnt mit einem Wert von 0, für die Montag DayChange Session wird dann nach jedem Montag die Performance vom Open bis zum Close berechnet und zum aktuellen Stand der Montag-DayChange Linie hinzugezählt. Der Verlauf der Montag DC - Linie zeigt also die Performance, die man erreicht hätte, wenn man jeden Montag zum Open gekauft hätte und zum Close verkauft hätte. Analog zu dieser Logik ist jede weitere Linie zu interpretieren.

Der InstrumentDayAnalyzer ist nur auf dem Tageschart verwendbar.

In der Tabelle auf der linken Seite des Indikators sind die Ergebnisse für jede Session nochmals grafisch aufbereitet.

Jede Spalte steht für eine einzelne Session (MO DC = Montag DayChange Session, MO ON = Montag Overnight Session, etc.)

In jeder Spalte finden Sie zwei Werte. Der obere Wert zeigt die durchschnittliche Bewegung, die an einem Montag während der DayChange Session zu erwarten ist, der untere Wert zeigt die dafür berechnete Wahrscheinlichkeit.

Als Beispiel: die MO DC Session von AAPL zeigt die Werte 0.16% und 54.6%. Das bedeutet dass AAPL in der Historie der letzten 2000 Bars (je nachdem wieviele Bars Sie im Chart geladen haben) an einem Montag vom Open zum Close eine Performance von 0.16% bei einer Wahrscheinlichkeit von 54.6% erreicht hat.



Folgende Parameter stehen für den InstrumentDayAnalyzer Indikator zur Verfügung:

- **INPUT PARAMETERS:**
 - **Show DayChange:** Show/Hide the DayChange Sessions
 - **Show larger legend:** „True“ uses
 - **Show Overnight:** Show/Hide the Overnight Sessions

5. HOLD N DAYS - INDICATOR

Dieser Indikator berechnet, welche Performance in den nächsten x – Tagen auf Basis der Saisonalität zu erwarten ist. Wieviele Tage in die Zukunft berechnet werden soll, können Sie in den Indikator-Settings frei wählen.

Wenn eine positive Performance erwartet wird, erscheint ein grüner Fächer, der die Bandbreite der zu erwartenden Bewegung anzeigt. Bei Abwärtsbewegungen ist der Fächer rot.

Neben dem Fächer finden Sie zwei Werte, der erste Wert ist die erwartete Performance über die nächsten x – Tage, die untere Zahl zeigt die Wahrscheinlichkeit, mit der diese Performance in den letzten x – Tagen auftreten wird.

Diese beiden Werte sind zusätzlich auch nochmals in den beiden Indikator-Fenster angezeigt, die geladen werden, wenn Sie den HoldNDays Indikator in Ihren Chart einfügen.

Der obere Linien-Indikator zeigt die zu erwartende Performance, der untere Graph zeigt die Wahrscheinlichkeit dieser Performance.

Die Werte werden wie erwähnt auf Basis der Saisonalität berechnet. Wenn Sie 30 Tage als Berechnungsgrundlage in den Einstellungen wählen, wird von der heutigen Kerze aus 30 Tage in die Zukunft gerechnet. Je nachdem, welche Performance in den letzten Jahren in dieser Zeitspanne erzielt werden konnte, werden die errechneten Werte ausgegeben.

Bitte achten Sie auch bei diesem Indikator unbedingt auf ausreichend Historie in Ihrem Chart, um eine aussagekräftige Analyse durchführen zu können.



Folgende Parameter stehen für den HoldNDays Indikator zur Verfügung:

- **INPUT PARAMETERS:**

- **Days:** Geben Sie hier an, auf wieviele Tage in die Zukunft die Performance berechnet werden soll. Sie müssen dieses Setting im Indikator HoldNDays sowie in der HnDProbability eingeben und anpassen, damit die Werte der Indikator-Panels die gleiche Berechnungsmethode verwenden.

Hinweis: Der Indikator HnDProbability steuert die Anzeige des zweiten Indikator-Panels, in dem die Wahrscheinlichkeitswerte ausgegeben werden. Dieser Indikator wird automatisch mit in den Chart eingefügt, wenn Sie HoldNDays einfügen. Einzeln ansteuerbar ist dieser aber erst, nachdem Sie das Indikatorfenster schließen und dann erneut öffnen, dann werden Sie den HnDProbability Indikator in der Liste der Indikatoren in Ihrem Chart sehen. Dieser Workflow ist aktuell noch nicht anders umzusetzen, wird aber mit einem Zukünftigen Update des Packages verbessert und vereinfacht werden.

- **Show Probability:** Sobald der HnDProbability-Indikator in der Indikator-Liste angezeigt wird, können Sie diesen prinzipiell wieder aus der Liste löschen, und ab dann dessen Anzeige über diesen Parameter steuern. Wenn Sie „True“ wählen, erscheint das zweite Panel mit der Wahrscheinlichkeitsanzeige, bei „False“ sehen Sie das zweite Indikator Panel nicht.

