

Sådan vælger du dagens aktiekøbs-kandidat

En enkel, gennemarbejdet rutine for indikator.senzi.dk

Værktøjet har fire faner: Mine positioner, Screener, Backtest og Sweep. De løser to forskellige opgaver. Screeneren finder hvad der ser interessant ud i DAG; backtest og sweep fortæller om strategiens regler faktisk har en edge, og med hvilke indstillinger. Hemmeligheden bag et kvalificeret valg er at bruge dem i den rigtige rækkefølge - og at læse de rigtige kolonner.

I denne vejledning bruges UI'ets kolonnenavne (fx "Strategi", "Buy&Hold", "MaxDD") - ikke de tekniske feltnavne fra koden. Bagest finder du en kolonne-ordbog for hver fane.

Den mentale model: kalibrer sjældent, beslut dagligt

SWEEP kører du sjældent (fx en gang om måneden) for at finde robuste stop-indstillinger. MINE POSITIONER -> SCREENER -> BACKTEST kører du hver dag for at træffe selve beslutningen. En høj screener-score alene siger intet om edge - det er backtesten der kvalificerer signalet.

1 De fire værktøjer - hvad de hver især svarer på

Fane	Spørgsmålet den besvarer	Hvor tit
Mine positioner	Hvad ejer jeg, og skal noget sælges først?	Dagligt - først
Screener	Hvad udløser et købssignal i dag?	Dagligt
Backtest	Har reglerne en edge på lige netop denne aktie?	Dagligt (på kandidaterne)
Sweep	Hvilke stop-indstillinger er robuste?	Sjældent (fx 1x/måned)

2 Periodisk forarbejde: Sweep (kalibrering)

Kør Sweep som kalibrering - ikke som daglig rutine. Den tester alle kombinationer af Init, Trail og Slope over flere år og rangerer dem efter kolonnen Score, som er Afkast delt med MaxDD (afkast pr. enhed nedside-risiko).

- **Robust frem for spids:** Vælg en robust top-række - et område hvor flere naborækker også scorer højt - frem for den enlige række med højest råt Afkast.
- **Output:** Resultatet er dine Init / Trail / Slope. Dem bruger du i den daglige backtest, og de bestemmer hvor dine stop ligger.
- **Kadence:** Kør den igen når markedet skifter karakter (fx efter en meget volatil periode) - ikke dagligt.

Overfitting-fare: jo flere kombinationer du prøver, jo større er chancen for at en ser god ud ved et rent tilfælde. Derfor scorer sweepet på risikojusteret afkast (Afkast / MaxDD) og ikke på rå afkast alene.

3 Den daglige rutine - tre trin i fast rækkefølge

Trin 1 - Mine positioner (altid først)

Risiko før afkast. Indtast dine åbne handler og kig på kolonnerne Status, Trailing-stop, Gevinst og Nordnet trail %.

- Er Status "Stoppet ud", ville strategien allerede have solgt - på den viste dato/kurs. Sælg, og frigør kapital.
- Ellers: læg/justér din stop-loss i Nordnet på det viste Trailing-stop (absolut niveau), eller brug Nordnet trail % i Nordnets trailing stop.
- Du ved nu hvor meget kapital du reelt har at købe for - måske er dagens vigtigste handling at sælge, ikke at købe.

Trin 2 - Screener (find dagens kandidater)

Screeneren giver hver C25-aktie en Score fra 0 til 6 plus færdige niveauer: Entry, Initial-stop, Trailing-stop, Mål og Risiko%.

- **Filter:** Behold kun aktier med høj Score (start med 4 eller derover) i en optrend. Det er din bruttoliste.
- **Sizing:** Noter Entry, Initial-stop og Risiko%. Felterne over tabellen beregner Antal og Position ud fra dit depot og din risiko pr. handel.

Trin 3 - Backtest (kvalificer bruttolisten)

Dette trin adskiller et pænt udseende signal fra et med reel edge. Kør backtest på de tickere screeneren fandt, med de Init/Trail/Slope sweepet gav dig.

- **Edge:** Behold kun aktier hvor Strategi er klart positiv OG helst større end Buy&Hold (reglerne slår det at eje passivt).
- **Win%:** Win% må gerne være under 50% og stadig give overskud - trailing-stoppet gør vinderne større end taberne.
- **Robusthed:** MaxDD skal være til at leve med, og Handler skal være mange nok til at tallene betyder noget (få handler = støjtal).
- **Krydstjek:** Status "I marked" + Trailing-stop viser de aktier strategien selv er long i lige nu - et godt krydstjek mod dine egne positioner.

En aktie med høj Score i screeneren men negativ Strategi i backtesten er en fælde. Drop den - uanset hvor flot signalet ser ud i dag.

4 Beslutningen - dagens kandidat

Dagens kandidat er den aktie der opfylder ALLE tre:

- Udløser et frisk signal i Screeneren i dag (Score 4+ i en optrend).
- Har en solid Backtest med dine sweep-kalibrerede indstillinger (Strategi > 0 og helst > Buy&Hold, acceptabel MaxDD, nok Handler).
- Har en Risiko% der passer til din position-sizing (Antal / Position).

Kort sagt: Sweep (sjældent) -> Mine positioner -> Screener -> Backtest (dagligt). Sweep sætter spillereglerne, Mine positioner rydder bordet, Screener finder mulighederne, og

Backtest er kvalitetsfilteret.

5 Kolonne-ordbog - sådan læser du tabellerne

Opslag pr. fane. Venstre kolonne er præcis den overskrift du ser i UI'et.

Screener

Kolonne (UI)	Betydning
Score	Antal opfyldte swing-betingelser (0-6). Højere = stærkere sammenfald af trend, momentum og volatilitet.
RSI	RSI(14). Under 30 = oversolgt, over 70 = overkøbt, 40-65 = sund swing-zone.
Entry	Foreslået indgangskurs = aktuel lukkekurs.
Initial-stop	Det stramme stop på dag et = Entry - 2xATR. Risiko% og sizing baseres herpå.
Trailing-stop	Højeste_kurs - 3xATR (vist ved entry). Følger kursen OPAD, flyttes aldrig ned.
Mål	Entry + 2x risiko (2:1). Referenceniveau - i praksis exit'es via trailing-stoppet.
Risiko%	Afstand fra Entry til Initial-stop i %. Risiko PAA POSITIONEN - ikke på depotet.
Antal	Antal aktier så tabet ved stop = dit risikobudget (depot x risiko% pr. handel).
Position	Positionens størrelse i kr = Antal x Entry.

Backtest

Kolonne (UI)	Betydning
Handler	Antal gennemførte handler i perioden. Få handler = lille, mindre troværdig stikprøve.
Win%	Andel vindende handler. Må gerne være under 50% og stadig give overskud.
Afk/handel	Gennemsnitligt afkast pr. handel efter kurtage.
Strategi	Strategiens samlede afkast med renters rente over perioden. (= feltet total_ret)
Buy&Hold	Afkast ved bare at eje aktien hele perioden - referencepunktet at slå.
MaxDD	Max drawdown: største fald fra top til bund. Lavere = mindre smertefuldt forløb.
Status	"I marked" = strategien er long lige nu; "Ude" = ingen position.
Åbnet	Dato hvor strategien åbnede den aktuelle position (kun når Status er "I marked").
Trailing-stop	Det live stop-niveau lige nu, hvis strategien er long i aktien.

Sweep

Kolonne (UI)	Betydning
Init	Initial-stop i xATR fra entry. Lavere kapper tab hurtigere, men piskes oftere ud.
Trail	Trailing-stop i xATR fra højeste kurs. Højere rider trends længere.
Slope	Antal dage EMA50 skal være steget over. 0 = filter fra; 10-20 = mere selektiv.
Afkast	Gns. samlet afkast over de valgte aktier for denne kombination.
Win%	Gns. win-rate over aktierne.
MaxDD	Gns. max drawdown - strategiens nedside-risiko.
Handler	Samlet antal handler bag tallet. Flere = mere troværdigt.
Score	Risikojusteret: Afkast / MaxDD. Vælg en robust top-række, ikke en enlig spike.

Mine positioner

Kolonne (UI)	Betydning
Entry	Din entry-dato (nærmeste handelsdag) og entry-kurs.
Kurs	Seneste lukkekurs.
Højeste	Højeste lukkekurs siden din entry - trailing-stoppet beregnes herfra.
Gevinst	Gevinst/tab fra entry til nu (eller til exit hvis stoppet ud).
Trailing-stop	Dagens stop = Højeste - 3xATR, ratchet'et fra din entry. Sæt stop-loss her.
Nordnet trail %	% til Nordnets trailing stop = afstanden fra kurs til stop. NB: Nordnets % er fast, følger ikke ATR - gentjek jævnligt.
Status	"Åben" (følg trailing-stop) eller "Stoppet ud" (med dato/kurs).