MECH LAB RESEARCH

QUANTITATIVE FORSCHUNG · WHITE PAPER · JULI 2026

GER40 Regime Adaptive EA

Zwei unabhängige Simulationsstudien zu einem regimeadaptiven, ausschließlich Long handelnden Handelssystem für den GER40 (DAX 40) Index: eine zweieinhalbjährige statistische Validierung sowie eine sechsmonatige Verifikation im MetaTrader 5 Strategy Tester.

Über dieses White Paper. Dieses Dokument beschreibt, was der GER40 Regime Adaptive EA leistet, welchen Tests das System unterzogen wurde und welche Ergebnisse diese Tests erbracht haben. Es richtet sich sowohl an eigenständig handelnde Trader als auch an professionelle Kapitalallokatoren. Bewusst wird der proprietäre Aufbau des Modells nicht offengelegt: die konkreten Indikatoren, Referenzzeiträume und Schwellenwerte bleiben geistiges Eigentum von Mech Lab Research.

Grundlage aller Zahlen. Jede in diesem Dokument genannte Zahl ist das Ergebnis einer historischen Simulation: Studie I basiert auf exportierten Preis und Signaldaten, Studie II wurde im MetaTrader 5 Strategy Tester auf Tickdaten mit 100 Prozent Qualität durchgeführt. Keine Zahl in diesem Dokument stammt aus realem Live Handel, und simulierte Ergebnisse sind kein Hinweis auf zukünftige Resultate.

Erstellt von Purvang Gandhi, Gründer von Mech Lab Research · Instrument: GER40 (DAX 40) Index CFD · Zeitrahmen: H1 · Richtung: ausschließlich Long · Plattform: MetaTrader 5

Dieser Expert Advisor wurde von Mech Lab Research entwickelt und veröffentlicht, einem Unternehmen mit Fokus auf die innere Marktstruktur (market internals). MTS Institute und The Regime Report sind Schwesterunternehmen desselben Gründers.

INHALT

Zusammenfassung 3

Das System: was es leistet 4

Studie I. Zweieinhalbjährige statistische Validierung 5

Studie I. Robustheitstests 6

Studie II. Sechsmonatige Verifikation in MetaTrader 5 7

Studie II. Analyse der Handelsqualität 8

Praktischer Einsatz: was zu erwarten ist 9

Wie beide Studien gemeinsam zu lesen sind 10

Eignung und Risikohinweise 11

Wichtige Hinweise

Simulierte Ergebnisse. Sämtliche Performancezahlen in diesem Dokument stammen aus historischer Simulation. Es handelt sich nicht um reale Handelsergebnisse, und sie dürfen nicht als solche verstanden werden. Simulierte Ergebnisse weisen inhärente Einschränkungen auf: sie werden im Wissen um bereits bekannte historische Kursverläufe erstellt, und keine Simulation kann die tatsächliche Ausführung, Liquidität oder die psychologischen Bedingungen des Live Handels vollständig abbilden.

Vertraulichkeit der Methodik. Dieses Dokument beschreibt das Verhalten und die Tests des Systems, nicht dessen internen Aufbau. Die Auswahl der Indikatoren, die Referenzzeiträume und die Schwellenwerte sind Eigentum des Unternehmens und werden weder hier noch auf der Produktseite offengelegt.

Vorgesehener Einsatzzweck. Der EA ist für eigenständig geführte Handelskonten konzipiert. Die meisten Proprietary Trading Unternehmen (Prop Firms) untersagen den Einsatz von Expert Advisors Dritter auf ihren Evaluierungs und finanzierten Konten; dieses Produkt wird daher nicht für einen solchen Einsatz angeboten oder beworben. Der Käufer ist selbst dafür verantwortlich, die Regeln jeder Plattform einzuhalten, auf der er das Produkt einsetzt.

ZUSAMMENFASSUNG

Der GER40 Regime Adaptive EA ist ein vollständig mechanisches, ausschließlich Long handelndes System für den GER40 Index auf dem Stundenchart. Sein prägendes Merkmal ist ein proprietäres Zwei Zustands Regimemodell: das System klassifiziert sein eigenes Handelsumfeld fortlaufend als günstig oder ungünstig, handelt ausschließlich im günstigen Zustand und bleibt die übrige Zeit vollständig positionslos am Markt fern.

Diesem Dokument liegen zwei unabhängige Studien zugrunde. Studie I ist eine statistische Validierung über zweieinhalb Jahre Stundendaten (Januar 2024 bis Juli 2026), gemessen auf Signalebene in Indexpunkten und geprüft mittels Monte Carlo Verfahren, Zeitsegmentierung sowie Transaktionskosten Stresstests. Studie II ist ein sechsmonatiger Test des fertigen Expert Advisors im MetaTrader 5 Strategy Tester (Januar bis Juli 2026) auf Tickdaten mit 100 Prozent Qualität und simuliertem Slippage, auf einem Konto mit 50.000 US Dollar.

+38,4%	1,48	3,95	14,1%
NETTOERGEBNIS STUDIE II, SECHS MONATE, SIMULIERT	PROFIT FACTOR, STUDIE II	SHARPE RATIO, STUDIE II	MAXIMALER EQUITY DRAWDOWN

Was die beiden Studien belegen

- **Der Vorteil ist selektiv, nicht dauerhaft.** In Studie I war die regimeadaptive Konfiguration nur 15,5 Prozent aller Stunden am Markt, behielt dabei jedoch 94 Prozent des Gewinns des ungefilterten Systems und reduzierte den maximalen Drawdown um rund 28 Prozent.
- **Das Ergebnis ist kein Zufall der Handelsreihenfolge.** Bei 10.000 zufälligen Neuanordnungen derselben Trades lag der tatsächliche historische Drawdown der Konfiguration auf der ungünstigen Seite ihrer eigenen Verteilung. Das Risikoprofil ist nicht das Produkt einer glücklichen Abfolge.
- **Der Vorteil hat jedes Kalendersegment überstanden.** Alle fünf Halbjahresfenster der Studie I waren sowohl für das Basissystem als auch für die regimeadaptive Konfiguration unabhängig voneinander profitabel.
- **Der fertige EA reproduziert dieses Verhalten auf der Plattform.** Die 121 Trades der Studie II zeigen dieselbe Signatur: eine moderate Trefferquote (30,6 Prozent), getragen von einem durchschnittlichen Gewinn, der 3,4 mal so groß ist wie der durchschnittliche Verlust.

Die folgenden Abschnitte stellen jede Studie vollständig dar und erläutern anschließend, wie beide gemeinsam zu lesen sind.

Was das System leistet

Der EA beruht auf einer einfachen Arbeitsteilung zwischen zwei Ebenen. Dieses Design spiegelt den Auftrag von Mech Lab Research als auf die innere Marktstruktur spezialisiertes Unternehmen wider: anstatt externe Faktoren zu prognostizieren, untersucht das System den inneren Zustand des Marktes und seiner eigenen Performance und handelt nur, wenn dieser innere Zustand günstig ist.

Ebene eins: Einstiegsmodul

Ein statistisches Preismodell identifiziert die Momente, in denen sich der GER40 gemessen an seinem jüngsten Verhalten bis zu einem Extrem ausgedehnt hat, und positioniert sich auf eine Rückkehr hin, stets und ausschließlich von der Long Seite. Positionen werden mechanisch beim Kerzenschluss eröffnet und geschlossen; ein diskretionärer Eingriff findet zu keinem Zeitpunkt statt.

Ebene zwei: Regimemodell

Über dem Einstiegsmodul arbeitet die Komponente, die dem Produkt seinen Namen gibt. Das System überwacht den statistischen Zustand seiner eigenen Performance und ordnet das Umfeld einem von zwei Regimen zu. Im günstigen Regime werden Signale ausgeführt. Im ungünstigen Regime wird keine neue Position eröffnet, unabhängig davon, was das Einstiegsmodul anzeigt. Die praktische Konsequenz ist in jeder Grafik dieses Dokuments sichtbar: ausgedehnte Ruhephasen, in denen das System bewusst nichts unternimmt, wechseln sich mit konzentrierten Aktivitätsphasen ab.

Was dieses Design bringt und was es kostet

- **Es bringt Drawdown Kontrolle.** Rund 85 Prozent der Zeit außerhalb des Marktes zu verbringen bedeutet rund 85 Prozent weniger Exposure gegenüber ungünstigen Ereignissen. Genau daher rührt die Verbesserung des Drawdowns und der risikoadjustierten Kennzahlen in Studie I.
- **Es kostet Geduld.** Wochen ohne Handelsaktivität sind ein bewusst gestaltetes Merkmal, keine Störung. Ein Käufer, der tägliche Aktivität erwartet, wird dieses System als frustrierend empfinden; ein Käufer, der Systeme nach risikoadjustierter Rendite beurteilt, wird feststellen, dass die ruhigen Phasen genau den Kern des Produkts ausmachen.
- **Es akzeptiert eine niedrige Trefferquote.** Etwa zwei von drei Trades schließen mit Verlust. Die Ökonomie funktioniert, weil Gewinntrades im Durchschnitt drei bis vier mal so groß sind wie Verlusttrades. Dies wird hier klar benannt, weil es der häufigste Grund ist, aus dem unvorbereitete Käufer Systeme dieser Art wieder aufgeben.

> **Was nicht offengelegt wird.** Die verwendeten Indikatoren, ihre Referenzzeiträume, die Regimeschwellen und die genauen Umschaltbedingungen sind Eigentum des Unternehmens. Dieses Dokument belegt, dass das System unter strengen Tests funktioniert; es liefert keine Anleitung, es nachzubauen.

Zweieinhalb Jahre, 15.174 Stundenkerzen

Studie I misst das System auf Signalebene, in Indexpunkten, über den Zeitraum vom 2. Januar 2024 bis 3. Juli 2026. Verglichen werden zwei Konfigurationen: das Basis Einstiegsmodul, das jedes Signal übernimmt, und die regimeadaptive Konfiguration, bei der das Zwei Zustands Modell die Teilnahme steuert.



Kumuliertes Ergebnis in Indexpunkten: Basissystem im Vergleich zur regimeadaptiven Konfiguration, Januar 2024 bis Juli 2026. Simuliert, vor Kosten.

KENNZAHL	BASISSYSTEM (KONTROLLGRUPPE)	REGIMEADAPTIV (PRODUKT)
Nettoergebnis (Punkte)	7.572,5	7.120,1
Maximaler Drawdown (Punkte)	1.838,4	1.322,3
Sharpe Ratio (annualisiert)	**1,17**	**1,67**
Calmar Ratio	**1,65**	**2,15**
Profit Factor (je Trade)	1,19	1,65
Trefferquote	32,5%	35,5%
Chance Risiko Verhältnis je Trade	2,46 : 1	2,98 : 1
Trades / Handelsfenster	1.339	417
Zeit im Markt	49,4%	15,5%

Ergebnisse auf Signalebene in Indexpunkten, vor Spread, Kommission und Slippage (Kosten Stresstest auf der nächsten Seite).

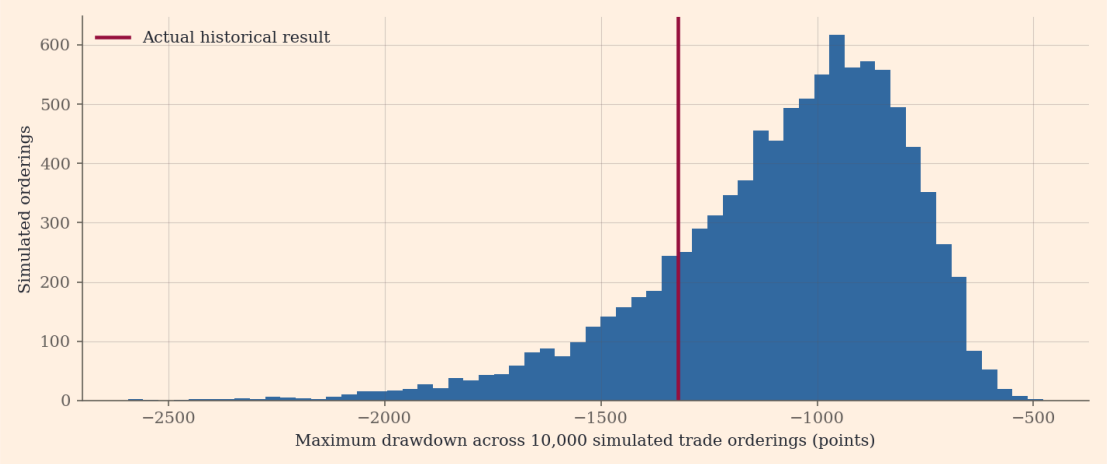
Das Regimemodell verzichtet auf sechs Prozent des Gesamtgewinns und erhält im Gegenzug eine Reduktion des maximalen Drawdowns um 28 Prozent sowie eine deutliche Verbesserung sämtlicher risikoadjustierter Kennzahlen, während es 84,5 Prozent der Zeit außerhalb des Marktes bleibt.

> **Warum das Basissystem gezeigt wird.** Das Basissystem erfüllt in diesem Dokument genau eine Funktion: es ist die experimentelle Kontrollgruppe, die den Beitrag der Regimeebene isoliert. Ohne sie wäre «regimeadaptiv» eine nicht überprüfbare Behauptung. Das Basissystem ist nicht Teil des Produkts: der EA implementiert ausschließlich die regimeadaptive Konfiguration, und die Regimeebene kann nicht deaktiviert werden.

Das Ergebnis aus drei Richtungen geprüft

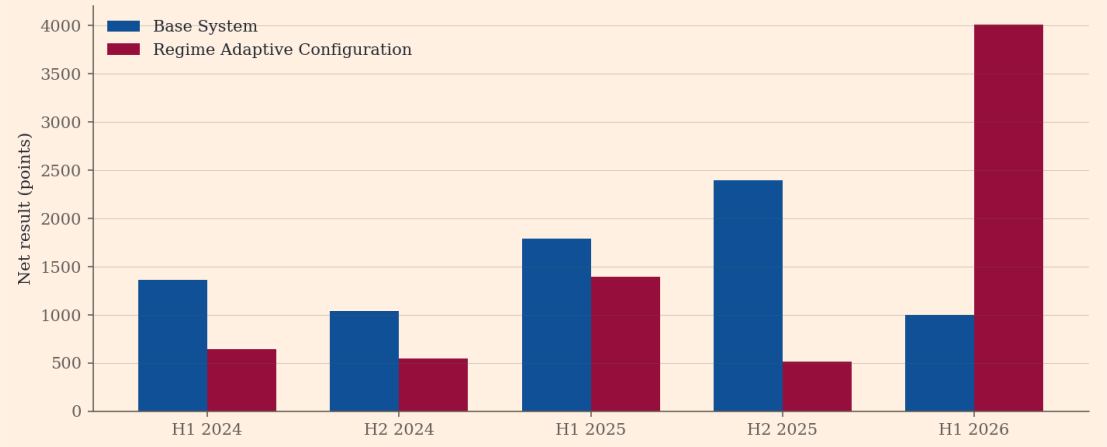
1. Monte Carlo Simulation zur Handelsreihenfolge

Die tatsächlichen historischen Trades wurden in 10.000 zufällige Reihenfolgen neu angeordnet, um zu prüfen, wie stark der berichtete Drawdown von der glücklichen oder unglücklichen Abfolge abhängt, in der die Trades zufällig stattfanden. Nur 17,7 Prozent der Neuanordnungen ergaben einen schlechteren Drawdown als das tatsächliche Ergebnis. Der historische Drawdown der Konfiguration liegt auf der ungünstigen Seite ihrer eigenen Verteilung, und ihr von der Reihenfolge unabhängiger Median Drawdown (1.023 Punkte) ist deutlich besser als der berichtete Wert.



Verteilung des maximalen Drawdowns über 10.000 zufällige Neuanordnungen derselben Trades, regimeadaptive Konfiguration.

2. Konsistenz über Zeitsegmente



Nettoergebnis je Halbjahresfenster. Jedes Fenster war für beide Konfigurationen unabhängig voneinander profitabel.

3. Transaktionskosten Stresstest

Bei einer Neuberechnung der Handelshistorie mit einer festen Kostenpauschale je Round Trip: unter der Annahme von 3 Punkten je Round Trip behält die regimeadaptive Konfiguration 82 Prozent ihres Bruttoergebnisses (5.869 von 7.120 Punkten), da sie 417 statt 1.339 Trades ausführt. Die niedrige Handelsfrequenz ist selbst bereits ein Schutz gegen Kosten.

Der fertige EA, auf der Plattform

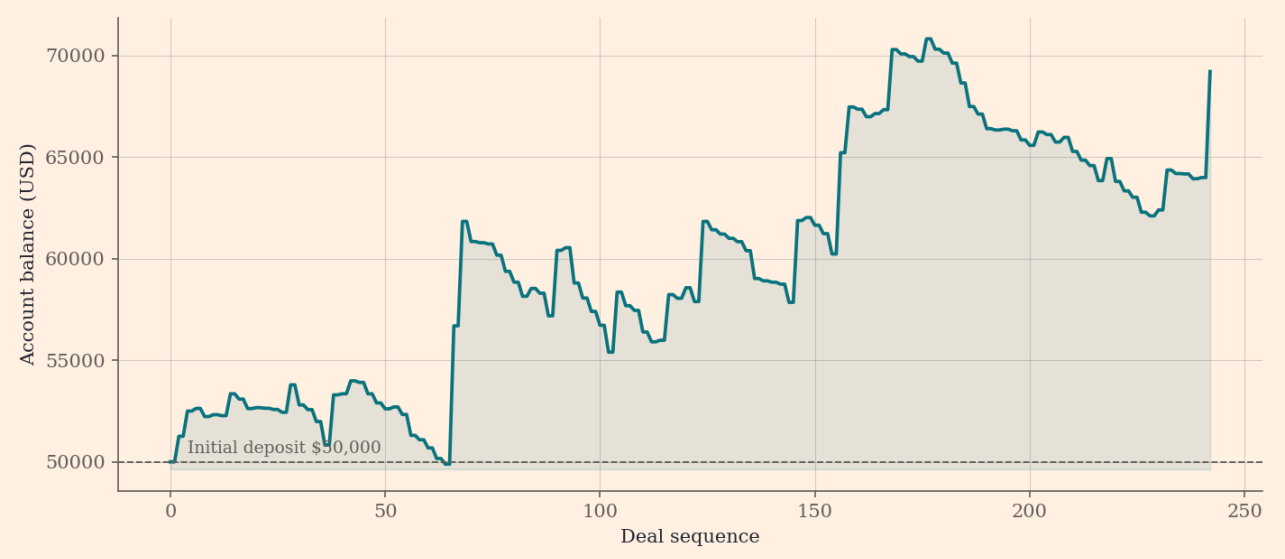
Studie II testet den kompilierten Expert Advisor selbst, nicht die Signal Logik im Abstrakten, im MetaTrader 5 Strategy Tester, vom 1. Januar bis 9. Juli 2026 auf GER40 H1. Der Test verwendete Tickdaten mit 100 Prozent Qualität (13,2 Millionen Ticks), simuliertes Slippage, eine Anfangseinzahlung von 50.000 US Dollar, einen Hebel von 1:100 sowie eine feste Positionsgröße. Der vollständige, unveränderte Strategy Tester Bericht liegt der Produktseite bei.

$19.217
NETTOGEWINN, SIMULIERT

121
TRADES, ALLE LONG

3,36 : 1
DURCHSCHNITTSGEWINN ZU DURCHSCHNITTSVERLUST

12,3%
MAXIMALER BALANCE DRAWDOWN



Kontostand je Abschluss, MetaTrader 5 Strategy Tester, Anfangseinzahlung 50.000 US Dollar, 1. Januar bis 9. Juli 2026. Simuliert.

KENNZAHL	WERT	KENNZAHL	WERT
Nettogewinn	$19.217,31	Profit Factor	1,48
Rendite auf Einzahlung	+38,4%	Sharpe Ratio	3,95
Trades gesamt	121	Recovery Factor	1,90
Trefferquote	30,58%	Expected Payoff	$158,82
Durchschnittlicher Gewinntrade	$1.601,11	Balance Drawdown (max.)	12,31%
Durchschnittlicher Verlusttrade	−$476,47	Equity Drawdown (max.)	14,05%
Größter Gewinntrade	$6.805,77	Datenqualität	100%
Größter Verlusttrade	−$1.739,83	Durchschnittliche Haltedauer	6h 05m

MetaTrader 5 Strategy Tester, FOREX.com Global Demo Server, Build 5836. Simulierte Ergebnisse, kein Live Handel.

Was die Handelshistorie unter der Oberfläche zeigt

Die Ökonomie einer Trefferquote von 30 Prozent

84 der 121 Trades schlossen mit Verlust. Dennoch war das System deutlich profitabel, weil die 37 Gewinntrades im Durchschnitt 1.601 US Dollar einbrachten gegenüber einem durchschnittlichen Verlust von 476 US Dollar, ein Verhältnis von 3,36 zu 1. Zu einem Zeitpunkt traten zehn aufeinanderfolgende Verluste auf, die 3.983 US Dollar kosteten, gegenüber einer maximalen Serie aufeinanderfolgender Gewinne von 11.947 US Dollar. Ein Käufer muss auf Verlustserien dieser Länge vorbereitet sein: dies ist eine strukturelle Eigenschaft des Designs, kein Mangel.

Gewinn folgt der Gelegenheit, nicht dem Glück

Die Korrelation zwischen dem Gewinn jedes Trades und seiner maximalen günstigen Kursbewegung, dem besten während der offenen Position erreichten Preis, betrug 0,89. Einfach ausgedrückt: wenn Trades Geld einbrachten, dann weil sich der Kurs tatsächlich zugunsten des Systems bewegte und dieses die Bewegung erfasste, nicht wegen einiger glücklicher Ausstiege. Profitable Trades konzentrierten sich zudem auf längere Haltedauern: Verlusttrades wurden durch die Systemlogik innerhalb von Stunden beendet, während die größten Gewinner ein bis zwei Tage offen blieben.

Die ruhigen Monate sind sichtbar und beabsichtigt

Die monatliche Verteilung der Einstiege zeigt intensive Aktivität im Januar, März und Juni sowie nahezu vollständige Inaktivität im Februar und Juli. Genau dies leistet das Zwei Zustands Modell auf der Plattform, exakt wie von Studie I vorhergesagt: konzentrierte Teilnahme in günstigen Regimen und disziplinierte Abwesenheit in der übrigen Zeit. Ein Live Einsatz dieses EA wird dasselbe Muster zeigen, und die richtige Interpretation zweier ruhiger Wochen lautet, dass das Modell funktioniert, nicht dass es zum Stillstand gekommen ist.

> **Zum Vergleich der Zahlen beider Studien.** Studie I wird auf Signalebene in Indexpunkten gemessen, vor Kosten, über einen Zeitraum von 30 Monaten. Studie II wird in US Dollar gemessen, bezogen auf eine bestimmte Konto und Positionsgröße, nach simuliertem Slippage, über sechs Monate. Die Zahlen lassen sich daher nicht unmittelbar addieren oder in ihrer Größenordnung vergleichen; der nächste Abschnitt erläutert, wie sich beide gegenseitig bestätigen.

Was zu erwarten ist: Monat für Monat und Serie für Serie

Die schlechteste Phase, in Zahlen

Ein Käufer sollte sein Konto anhand der historisch schlechtesten Phase dimensionieren und sich darauf vorbereiten, nicht anhand des Durchschnitts. Aus der Aufzeichnung von Studie II:

SERIESTATISTIK	WERT
Maximale Anzahl aufeinanderfolgender Verlusttrades	**10 Trades (−$3.982,54)**
Maximaler aufeinanderfolgender Verlust nach Betrag	−$5.142,05 (5 Trades)
Maximaler aufeinanderfolgender Gewinn nach Betrag	+$11.946,77 (2 Trades)
Durchschnittliche Gewinn / Verlustserien	2 / 4

MetaTrader 5 Strategy Tester Aufzeichnung, simuliert. Verlustserien dieser Länge sind eine strukturelle Eigenschaft eines Designs mit niedriger Trefferquote und hoher Auszahlung.

Monat für Monat

MONAT (2026)	JAN	FEB	MÄR	APR	MAI	JUN	JUL*
Nettoergebnis ($)	−109	+6.806	+1.195	−37	+9.616	−5.069	+6.816
Geschlossene Trades	32	1	28	11	7	36	6

*Juli ist ein unvollständiger Monat (bis 9. Juli). Simuliert. Bemerkenswert ist der Februar: das Regimemodell erlaubte im gesamten Monat nur einen einzigen Trade, und dieser war der größte Gewinner der gesamten Aufzeichnung. Der Juni war der Monat der Verlustserie. Gewinn tritt konstruktionsbedingt episodisch auf und verteilt sich nicht gleichmäßig über den Kalender.

Fragen zum Einsatz, klar beantwortet

- **Wird Martingale, Grid oder Averaging eingesetzt?** Nein. Immer nur eine Position, feste Größe, ausschließlich Long. Keinerlei Recovery Mechanismen.
- **Welcher Broker?** Jeder MetaTrader 5 Broker, der ein CFD auf den Index GER40 / DAX 40 anbietet. Studie II wurde auf Basis der Kursstellung von FOREX.com Global durchgeführt; Spreads und Kontraktspezifikationen unterscheiden sich je nach Broker und sollten vor dem Einsatz geprüft werden.
- **Kontogröße?** Studie II verwendete 50.000 US Dollar mit fester Positionsgröße. Kleinere Konten sollten die Positionsgröße proportional skalieren, damit der historische Drawdown und eine Marge darüber hinaus stets komfortabel tragbar bleiben.
- **Wird ein VPS benötigt?** Empfohlen, wie für jeden EA, der rund um die Uhr beim Kerzenschluss online sein muss, wobei der Stundenchart das System deutlich weniger latenzempfindlich macht als Intraday Scalping Produkte.
- **Ist ein Eingreifen erforderlich?** Nein. Das System ist so konzipiert, dass es in Ruhe gelassen wird, gerade auch während seiner Ruhephasen.

Wie beide Studien gemeinsam zu lesen sind

Die beiden Studien wurden mit unterschiedlichen Werkzeugen, in unterschiedlicher Auflösung und über unterschiedliche Zeithorizonte durchgeführt, und genau darin liegt ihr Wert: jede deckt den blinden Fleck der anderen ab.

	STUDIE I	STUDIE II
Was getestet wird	Das Signalsystem, auf Signalebene	Der kompilierte EA, auf der Plattform
Zeithorizont	30 Monate (Jan 2024 Jul 2026)	6,3 Monate (Jan Jul 2026)
Einheit	Indexpunkte, vor Kosten	US Dollar, mit simuliertem Slippage
Stärke	Langer Zeithorizont; Robustheit gegenüber Monte Carlo, Segmenten und Kosten	Realitätsnähe der Ausführung; 100% Tickqualität; auf der Plattform überprüfbar
Einschränkung	Keine Modellierung der Ausführung	Kürzeres Zeitfenster; eine einzelne Marktphase

Die beiden Studien sind sich ergänzende Belege, keine Wiederholungen.

Drei Bestätigungspunkte

- **Dieselbe Handelssignatur.** Studie I sagte eine Trefferquote von etwa einem Drittel voraus, bei Gewinnern, die etwa drei mal so groß sind wie Verlierer; Studie II ergab 30,6 Prozent und 3,36 zu 1. Der Charakter des Systems hat den Weg vom Forschungscode zum kompilierten Plattformprodukt überstanden.
- **Dasselbe Regimeverhalten.** Die 15,5 Prozent Zeit im Markt aus Studie I tauchen in Studie II als ganze Monate geplanter Inaktivität wieder auf, sichtbar in den eigenen Einstiegsverteilungsgrafiken der Plattform.
- **Dieselbe Größenordnung des Drawdowns.** Der Drawdown von 12 bis 14 Prozent in Studie II bei der gewählten Positionsgröße steht im Einklang mit dem, was der Punkte basierte Drawdown aus Studie I bei vergleichbarem Exposure nahelegt, einschließlich des Monte Carlo Befunds, dass der historische Wert eher konservativ ist.

Was beide Studien nicht liefern, ist eine Live Handelshistorie. Die Position von Mech Lab Research hierzu ist klar formuliert: Simulation, so rigoros sie auch sein mag, ist ein Beleg für die Qualität des Designs, keine Garantie für zukünftige Performance, und Käufer sollten sie entsprechend gewichten.

Für wen dieses Produkt geeignet ist

- Eigenständig handelnde Trader, die ihre eigenen MetaTrader 5 Konten führen, Systeme nach risikoadjustierter Rendite beurteilen und mit einem Profil aus niedriger Trefferquote und hoher Auszahlung gut zurechtkommen.
- Systematisch handelnde Trader, die eine GER40 Komponente suchen, deren bewusst niedrige Zeit im Markt (rund 15 Prozent der Stunden) sie zu einem Kandidaten für die Kombination mit nicht korrelierten Strategien macht.

Für wen dieses Produkt nicht geeignet ist

- Trader, die tägliche Aktivität oder eine hohe Trefferquote erwarten. Zwei von drei Trades enden mit Verlust; es können ganze Wochen ohne jede offene Position vergehen.
- Nutzer von Evaluierungs oder finanzierten Konten bei Proprietary Trading Unternehmen. Die meisten Unternehmen untersagen Expert Advisors Dritter und werten identische Handelsströme über mehrere Kunden hinweg als Regelverstoß. Dieses Produkt wird für einen solchen Einsatz nicht angeboten, und ein Einsatz dort verstößt mit hoher Wahrscheinlichkeit gegen die Bedingungen des jeweiligen Unternehmens.

Risikohinweise

- Sämtliche Ergebnisse in diesem Dokument sind simuliert. Simulierte Ergebnisse werden im Wissen um bereits bekannte historische Kursverläufe erstellt und stellen keinen realen Handel dar. Es wird keine Zusicherung gegeben, dass ein Konto ähnliche Ergebnisse wie die dargestellten erzielen wird.
- Der Handel mit gehebelten Index CFDs birgt ein hohes Verlustrisiko, einschließlich des Totalverlusts des eingesetzten Kapitals. Hebel verstärkt sowohl Gewinne als auch Verluste.
- Die gezeigten Simulationen umfassen Drawdowns von 12 bis 14 Prozent sowie zehn aufeinanderfolgende Verlusttrades. Der Live Einsatz sollte so dimensioniert werden, dass ein Ergebnis, das wesentlich schlechter ausfällt als die historische Aufzeichnung, weiterhin tragbar bleibt.
- Die Zahlen aus Studie I verstehen sich, sofern nicht anders angegeben, vor Transaktionskosten; reale Ergebnisse werden durch Spread, Kommission, Swap und Slippage gemindert.
- Dieses Dokument ist ausschließlich bildender und beschreibender Natur. Es stellt keine Anlageberatung, keine Empfehlung und kein Angebot zur Vermögensverwaltung dar. Käufer sollten die Eignung anhand ihrer eigenen Umstände beurteilen und bei Bedarf unabhängigen Rat einholen.

Über den Herausgeber. Dieser Expert Advisor wird von **Mech Lab Research** erstellt, einem Unternehmen mit Fokus auf die innere Marktstruktur (market internals): die systematische Untersuchung des Verhaltenszustands eines Marktes und einer Strategie selbst, wovon das Regimemodell dieses Produkts ein unmittelbarer Ausdruck ist. Unter demselben Gründer sind zwei Schwesterunternehmen tätig. **MTS Institute** bietet professionelle Ausbildung für Marktintermediäre an, darunter Broker Dealer, Odd Lot Market Maker und Analysten, gemeinsam mit deren Kunden und Teams. **The Regime Report** ist eine globale Publikation zur Kapitalallokation mit Fokus auf externe Marktfaktoren, gerichtet an Investoren, Portfolioinhaber und Derivate Strategen. Das Rahmenwerk des Gründers ist zudem als bei Amazon veröffentlichte Bücher und als strukturierter Kurs bei Udemy verfügbar. Der vollständige, unveränderte MetaTrader 5 Strategy Tester Bericht, auf dem Studie II beruht, ist zusammen mit der Produktseite verfügbar. © 2026 Mech Lab Research. Alle Rechte vorbehalten.