

FUN AND PROFIT TRADING PLAN

INHALTSVERZEICHNIS

CHECKLISTE:

- Börsenkalender
- Trading Logbuch
- Trading Tagebuch
- Tagesablauf
- Untersuchung von Candlesticks auf Tagesbasis
- Nachrichtenscanner – Aktien
- Sell on Good News System

SYSTEMAUSWERTUNG:

- Systemauswertung 10-100 Trades
- Rolle des Computers / PC Ausstattung
- Auswertung eines Handelssystems

STOPTOOLS:

- Anfangsstopp
- Ausgleichsstopp
- Trailingsstopp
- Zeitstopp

CHARTDARSTELLUNG:

- Chartdarstellung

ORDERPLATZIERUNG:

- Orderplatzierung beim 1-5 Tage Trading

POSITIONSGRÖßBESTIMMUNG

- Formel für 1-5 Tage Trading

GEWINNMITNAHME

- Jahressicht
- Tradingsicht

FUN AND PROFIT TRADING:

- Fun and Profit Trading

FUN AND PROFIT HEDGING:

- Fun and Profit Hedging

FUN AND PROFIT INVESTMENT:

- Fun and Profit Investment

FUN AND PROFIT INVEST-SYSTEME

- siehe Inhaltsverzeichnis

FUN AND PROFIT KONZEPTE

- siehe Inhaltsverzeichnis

HANDELSYSTEME AUF CHARTBASIS

- 1) V – Formation
- 2) 3-5 Balken in Serie
- 3) Dach / Boden System
- 4) Narrow Range Bar
- 5) Topping / Bottom Shadows
- 6) Starke Kerzen / Mega Kerzen
- 7) Smash Day Muster
- 8) Hidden Smash Day
- 9) Ampel System
- 10) 10 Tage / 3 Tage Ausbruchsystem
- 11) Kerzenanalyse 5 X 5 / 4 X 4
- 12) Umkehrsystem

AUSSTIEGSSIGNAL:

- Short 2 Cover / Long 2 Cover
- Rote Ampel
- Rasierter Kopf
- Tripple Bar Breakout
- Trendlinie Exit
- Trendkanal Breakout
- Trendkanal Kursziel

SPREADING SYSTEM

- Professional Spreading
- Intermarket Spreads Wochenbasis
- Inter Branchen Spreading
- Morning / Night Attack Spreading

TRENDFILTER:

- Close – Close Trendfilter
- 20 – Tage Durchschnitt
- Wochenhoch / Wochentief
- 200 – Tage Durchschnitt

VOLATILITÄTFILTER:

- Volatilitätsfilter 0,5 % - 2,5 %

VOLUMENFILTER:

- Volumenspitzen / Volumen-Explosion

TIMES AND SALES FILTER:

- Times and Sales Scanner

ZYKLIK FILTER:

- Trendzyklisch
- Antizyklisch
- Statistische Filter

GLEITENDER DURCHSCHNITT

- Golden Cross / Dead Cross Woche
- Zyklisch Wochenbasis
- Antizyklisch Wochenbasis

TERMINGESCHÄFTE

- Akkumulation Optionsscheine
- DAX Spreading Wochenbasis
- V-DAX Filter

AKTIENAUSWAHL

- Gewinner/Verlierer/Remis Woche

SICHERHEIT

- Verlustbremse
- Optionsscheine Anfangsstopp
- Overnight Regeln

FIBONACCI RETRACEMENT

- Akkumulation Wochenbasis
- Fibonacci - 50 % Wochenbasis

PYRAMIDE

- Pyramide R-Vielfache
- 3er Fibonacci Pyramide

TRIPPLE BAR DURCHSCHNITT

- Trendfolge –Filter / System
- Limit – Trading
- Volatilität - Spreading

INDEX FILTER

- Marktbreite
- American Setup

VOLATILITÄTS SYSTEM:

- Schwankungsbreite 50 %
- 3er L – Formation Wochenbasis
- 2er L- Formation Wochenbasis
- 1er Inside – Day Woche
- Remis System

KURSLÜCKEN SYSTEME

- Pattern Gap
- Uuups Gap - Intraday
- Gap % Trap - Intraday
- Boomer & Buster – Intraday

SPEED FILTER:

- Tempo System

STEIGUNGSGERADE:

- Steigungsgerade Limit Kauf/Verkauf
- Steigungsgerade Wochenschlusskurs
- Steigungsgerade 18 Tage Durchschnitt
- Steigungswinkel Filter

BÖRSENKALENDER

Der **Börsenkalender** soll folgende Termine anzeigen:

- Verfallstage von Optionen
- Berichtssaison / Unternehmensberichte
- Feiertage USA/BRD/ASIEN
- FED Zinssitzungen
- Ölmarktberichte
- Monatliche Konjunkturdaten(Arbeitslosenzahlen, Häusermarkt, Konsumenten etc.)

Sender N-TV:

Detaillierter Tages und Wochenüberblick von Marktnachrichten
Videotextseite 436 / 437

Internet Seite:

<http://www.comdirect.de/inf/news/kalender.html>

Finanznachrichten Seiten:

<http://www.finanznachrichten.de/nachrichten-aktien>

<http://www.finanzen.net>

<http://www.aktiencheck.de/>

<http://de.reuters.com/article/companiesNews/idDEBEE69E0G420101015>

<http://www.vem-aktienbank.de/index.php?id=243>

<http://www.google.de/trends>

TRADING LOGBUCH à LA CAPTAIN KIRK

Ich kann mir ein Diktiergerät für das Trading besorgen, da dies während des Tradingprozesses effektiver ist, seine Gedanken und Emotionen festzuhalten. Am Ende des Tradingtages kann das aufgenommene „Protokoll“ aufgeschrieben werden, da der Inhalt auf Tonband gespeichert wurde. Der Einsatz eines Diktiergerätes verlangt nicht so viel Disziplin wie es ein schriftliches Protokoll benötigt. Außerdem sind die Gedanken und Fakten schneller ausgesprochen als aufgeschrieben. Genau wie es Captain Kirk auf der Enterprise macht.

TRADINGTAGEBUCH

Das **Tradingtagebuch** enthält:

- die verwendete Strategie
- die begangenen Fehler bei der Ausführung der Strategie
- Psychologischer Gemütszustand
- Auswirkung von Psychologie auf den Trade
- Ergebnis

Idee: Man kann den Puls und Blutdruck beim Trading messen, wenn die Werte sich von dem Ruhezustand entfernen, ist das ein Indikator, das die Position zu groß für das Depot ist. Die emotionale Notlage spiegelt sich in dem Verhalten des Körpers wieder. Erfolgreiches Trading findet am Ruhepuls statt, da dies auch auf eine emotionale Ruhe schließen lässt.

TAGESABLAUF

SELEKTION / ZEITLICHE PLANUNG / RISIKOKONTROLLE

Vorbereitung am Abend 18:00 Uhr Europa / 22:00 Uhr USA

Durchführung von Software – Scans

Mechanische Setups:

- Auswahl der zehn „besten“ Aktien für Käufe und Leerverkäufe
- Maximal 5 LONG Positionen / Maximal 5 SHORT Positionen
- Analyse des Tagescharts

Orderplatzierung nach Börsenschluss für 2-5 Tage Swinger Trades

Vorbereitung am Morgen 8:00 – 9:00 Uhr

1 Stunde Frühstück zwischen 8: 00 Uhr – 9 :00 Uhr CET

Check Aktien, die mit mind. 2 % Kurslücke eröffnen;

Check S&P Future (Psychomarken, Tendenz im Tagesvergleich)

Größte Gewinner / Verlierer nach Branchen einteilen; Größter Umsatz
Aktiencheck nach Psychomarken (20,30,40,50...100, 150, 200)

Finden und Interpretieren von Nachrichten

- NTV
- Internet
- Etc.

Mittagspause des Tradingtages 12:00 – 14:00 Uhr

2 Stunden Mittagessen + Siesta zwischen 12:00 Uhr – 14:00 Uhr CET

30 Minuten zum Essen (kleine Portion) / 30 Minuten zum Schlafen (kein langer Schlaf)

Vorbereitung für Tradingtag USA 14:00 – 16:00 Uhr

2 Stunden Vorbereitung für 16: 00 Uhr Positionierung: USA Vorbörse / Eröffnung

Check Aktien, die mit mind. 2 % Kurslücke eröffnen;

Check S&P Future (Psychomarken, Tendenz im Tagesvergleich) / Nachrichtencheck

Größte Gewinner / Verlierer nach Branchen einteilen; Größter Umsatz
Aktiencheck nach Psychomarken (20,30,40,50...100, 150, 200)

Nachbereitung des Tradingtages 18:00 Uhr Europa / 22:00 Uhr USA

Täglicher Rückblick

- Investitionsgrad (0-200 %), Intraday + Overnight
- Schriftliche Aufzeichnungen: Tradingjournal, Tradingtagebuch
- Berechnung von realisierten Gewinn und Verlust
- Berechnung von Buchgewinn oder Buchverlust
- Berechnung der Gewinnerwartung

UNTERSUCHUNG CANDLESTICK AUF TAGESBASIS

Trendbestimmung 3 Monatschart:

- Steigt die Aktie?
- Fällt die Aktie?
- Kursspanne Hoch-Tief in den 10 Tagen?

Suche nach Widerstands- und Unterstützungszonen

- Gibt es Widerstände oder Unterstützungen bei ganzen Zahlen?
- Hoch und Tief des Vortages

Technische Aspekte

- Steigt der 20- Tagedurchschnitt? Vergleich mit dem Stand vor 3 Monaten
- Steigt der 200 – Tagedurchschnitt? Vergleich mit dem Stand vor 1 Jahr

- Befindet sich der Schlusskurs über 20 – Tagedurchschnitt?
- Befindet sich der Wochen Schlusskurs über 200 – Tagedurchschnitt?

Wie verhält sich der breite Markt?

- Dow Jones Industrial Average
- Gewinner / Verlierer Verhältnis im Index

Wie verhält sich der Intermarketspread auf Wochenbasis? DJIA : Einzelwert?

- Relativ Stärker
- Relativ Schwächer
- Etwa gleich

Anstiegswinkel / Abstiegswinkel berechnen?

- Graduell(30 Grad oder weniger)
- Moderat(zwischen 30 und 60 Grad)
- Steil(über 60 Grad)
- Extrem steil(über 75 Grad)

Steigungswinkel:

Taschenrechner: SHIFT - Taste / tan – Taste / m = Steigung

$$\alpha = \arctan(m). \quad / \quad m = 0,4$$

Im obigen Beispiel errechnet man:

$$\alpha = \arctan(0,4) \approx 21,8^\circ.$$

NACHRICHTEN SCAN - AKTIEN

Die letzten 10 Analysten Kommentare:

- Buy
- Hold
- Sell

Gewinnerwartung der Analysten:

- Erfüllte Gewinnerwartung
- Enttäuschende Gewinnerwartung
- Übertroffene Gewinnerwartung

Bilanzergebnis der letzten 4 Quartale:

- Positiv
- Negativ
- Dividende
- Verschuldungsgrad (Eigenkapital im Verhältnis zum Fremdkapital)
- Veröffentlichungsdatum der Bilanzergebnisse:

Gewinnwachstum der letzten 4 Quartale:

- Kein Gewinnwachstum
- Gewinnsteigerung in % zum vorherigen Quartal

Kapitalmaßnahmen:

- Aktiensplit
- Reversal Split
- Kapitalerhöhung
- Unternehmensanleihen

Unternehmensnachrichten:

- Negative Nachrichten (zu Produkten und Dienstleistungen)
- Positive Nachrichten (zu Produkten oder Dienstleistungen)

Branchenüberblick:

- Positive Nachrichten (zu Produkten oder Dienstleistungen)
- Negative Nachrichten (zu Produkten oder Dienstleistungen)

Veränderung im Management:

- Vorstandswechsel in den letzten 10 Jahren
- Letzter Vorstandswechsel

Übernahmephantasie:

- Übernahmegerüchte
- Übernahmeangebote
- Übernahmekandidat

Gerichtsverfahren:

- Kläger oder Beschuldigter
- Gerichtstermine

SELL ON GOOD NEWS SYSTEM

Setup:

News Check www.finanznachrichten.de / www.aktiencheck.de /
<http://de.reuters.com/article/companiesNews> / www.finanzen.net /
<http://www.comdirect.de/inf/news/kalender.html> nach Unternehmensnachrichten.

Wichtige Nachrichten: Unternehmenszahlen
Bilanztermine / Gewinnwarnung / Gewinnmeldung / Gerichtsverhandlung

Bilanztermine:

Um eine Position einzugehen muss ich mich mind. 1 Woche vor dem Bilanztermin über das Datum informiert haben. Keine spontanen Entscheidungen.

Einstieg: Verkauf am Tagestief (SHORT)

Es wird nach dem letzten Schlusskurs vor der Nachricht ein Stopp Loss auf das letzte Tagestief gesetzt.

Ad- Hoc Meldungen:

Wenn Ad- Hoch Meldungen gehandelt werden, muss die Position spätestens 30 Minuten nach der Meldung platziert sein. Ansonsten kommt man zu spät.
Der Stopp Loss Auftrag wird auf den gestrigen Tagesschlusskurs gesetzt.

Negative Kurslücken:

Wenn Aktien mit einer negativen Kurslücke auf eine Nachricht reagieren, dann wird SHORT in Trendrichtung gehandelt. 30 Minuten nach Eröffnung wird ein Stopp Loss auf das bisherige Intraday Tagestief gesetzt.

Positive Kurslücken:

Wenn Aktien mit einer positiven Kurslücke innerhalb der gestrigen Kursspanne auf eine Nachricht reagieren, dann wird ein Stopp Loss auf den gestrigen Schlusskurs gesetzt.
Wenn Aktien mit einer positiven Kurslücke oberhalb der gestrigen Kursspanne eröffnen, dann wird ein Stopp Loss auf den gestrigen Höchstkurs gesetzt.

Stops:

Anfangsstopp wird mit 1 Punkt Abstand zum Einstiegskurs gesetzt
Ausgleichsstopp wird nach 1 Tag benutzt, falls der Kurs im Plus ist

Trailingstopp wird nach der zweiten Gewinnkerze unter das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gesetzt und bei weiteren Gewinnkerzen nachgezogen

Zeitstopp wird benutzt, wenn kein Stopp nach 5 Sitzungen erreicht wird.

Zeitraumen: 1 Woche

Positionsgröße:

1 R = 1 % des Kontovolumens → 500 Stück

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert.

PC / SOFTWARE AUSSTATTUNG

Hardware: 1.000 MHz-Prozessor / 10 GB Festplatte / 128 RAM / 17 Zoll Monitor / DSL

Software: Tradestation.com / Metastock.com / Sino MX-Pro / MS-Office

Chart-Tools:

- Anzeige von Kerzencharts / Punkcharts über verschiedene Zeiträume
- Datenbankverwaltung (Aktualisierung und Speicherung von Kursdaten)
- Anzeige verschiedener Indikatoren
- Anzeige von Daten in tabellarischer Form
- Eintragen von Linien in den Chart
- Testen anhand von historischer Daten
- Überwachung des Systems in Echtzeit

Daten: Unabhängig davon, wie schnell Ihr Computer rechnet oder wie robust Ihr Handelssystem ist – ohne gute Daten wird aus dem Trading nichts. Daten sind der Treibstoff Ihres Systems. Grundsätzlich gibt es zwei Varianten: Echtzeit und Historisch.

Wie gewohnt muss man für hohe Geschwindigkeit und kurze Wartezeiten tiefer in die Tasche greifen. Tagesende Daten reichen aus, um ein System gewinn bringend traden zu können. In vielen Fällen kann die Anzeige von Echtzeitdaten zu einer Informationsflut kommen.

Manche Trader mit Echtzeitdaten führen einen guten und logischen Trade durch, aber sie steigen aus der Position zu schnell wieder aus, weil sich der Kurs schwankend gegen sie richtet. Letztendlich wäre die ursprüngliche Kaufentscheidung richtig gewesen. Der Trader mit Tagesende Daten hätte von der Gegenbewegung nichts mitbekommen und die Position gehalten.

Die Suche nach guten Daten kann so schwierig sein wie Suche nach einem guten Handelssystem. Zwei Trader, die am selben Markt mit demselben System handeln können völlig verschiedene Ergebnisse erzielen. Wie ist das möglich, wenn die Daten doch von ein und derselben Börse kommen?

Die Börsen ziehen zur Ermittlung des höchsten und tiefsten Kurses an einem Tag den höchsten Brief und tiefsten Geldkurs heran, auch wenn zu diesen Preisen kein Handel stattgefunden hat. Das liegt daran, dass eine Stopp-Order durch einen Bid oder Ask auf dem Stopp-Preis ausgelöst und eine Limit-Order ausgeführt wird, sobald ein Bid oder ein Ask zum Limit angezeigt wird.

Diese widersprüchlichen Anforderungen verschiedener Trader führen zum Ergebnis, dass manche Datenlieferanten die Bids und Asks in die Datenmenge einschließen und andere ausschließlich die durchgeführten Trades(Times and Sales) anzeigen. Manchmal übermittelt ein Datenanbieter die Daten auf die eine Art und am nächsten Tag wieder auf die andere.

FUN AND PROFIT PC: wird ausschließlich für Firmengeschäfte benutzt. Es dürfen keine weiteren Programme installiert werden. Das Research findet auf separaten PC statt. Der Firmen PC dient nur als Automat für die Ordereingabe.

ROLLE DES COMPUTERS SYSTEMTRADING

1. Die wichtigste Aufgabe des Computers beim Systemtrading ist eine mechanische Kontrollinstanz zu schaffen. Dies bezieht sich vor allem auf Einstiegsregeln, Ausstiegsregeln, Handelszeiten, Stopp Management und auf die Positionsgröße. Dieser Aspekt ist hilfreich bei der Risikokontrolle. Wenn der Trade nicht den Tradingregeln entspricht, kann eine Computersoftware den Einstieg verhindern bzw. alarmieren.
2. Der Computer ist bei der Analyse der Handelssignale effektiver und kann die attraktivsten Signal herausfiltern, wenn die Kriterien klar genug definiert sind.
3. Die Online Ordererteilung ist im Vergleich zum telefonischen Auftrag günstiger.
4. Eine Computer Software kann Trailing Stopps effektiver managen.
5. Der Broker ist Online im Gegensatz zum Telefon Broker rund um die Uhr erreichbar und Orders können autonom platziert werden.
6. Es können verknüpfte Orders wie If-Done Aufträge platziert werden.
7. Die Computersoftware darf aber nicht der Hauptbestandteil meiner Handelsaktivität sein.
 - Die Computersoftware kann falsche Signale generieren, wenn die Kursdaten des Computers nicht mit der Realität übereinstimmen.
 - Die Computersoftware kann falsch programmiert worden sein und deshalb falsche Signale generieren.
 - Die Computersoftware kann manipuliert bzw. gehackt werden.
 - Stromausfall, Internetausfall, Hardwareprobleme, Softwareprobleme, Serverprobleme, Providerprobleme, Diebstahl können dazu führen, dass ich keinen Zugang mehr zum Markt und meinen Positionen habe.
 - Ich kann mich psychologisch gesehen von der Software trennen und die Signale und Risikokontrolle ignorieren
 - Wenn man keinen PC zur Verfügung hat, kann man keine Trades durchführen und seine offenen Positionen managen
 - Das Betriebssystem der meisten PCs ist sehr unzuverlässig
8. Der Computer kann nicht für mich denken. Er wird das wiedergeben, was man ihm „beigebracht“ hat. Wenn ich das System auf dem Papier nicht verstehe, dann wird eine Computersoftware den desolaten Tradingprozess nur automatisieren und nicht verbessern.
9. Computer kann bei Systemauswertung helfen.

GRUNDPRINZIPIEN DES SYSTEMTRADINGS

- 1) Die Trading Systeme steigen immer mit dem Markttrend ein. Es gibt keine Ausnahmen. Bei steigenden Kursen wird mit Stopp Buy eingestiegen. Bei fallenden Kursen wird mit Stopp Loss eingestiegen. Keine Marktprognose.
- 2) Die Akkumulation findet per Limitkauf unter dem aktuellen Marktpreis statt. Die Akkumulation per Limitverkauf findet über dem aktuellen Marktpreis statt. Die Technik handelt antizyklisch. Hier darf 1 Einstieg nicht mehr als 20 % der Gesamtsumme betragen, die für diesen Einstieg vorgesehen ist. Es darf keine Position vergrößert werden, die nicht mindestens den Break Even erreicht hat.
- 3) Das maximal Risiko für jeden Trade wird auf 1 Prozent des gesamten Anlagekapitals beschränkt. Jeder Einstieg erhält einen Anfangsstopp beim Broker.
- 4) Das Handelsgeschäft wird durch Diversifikation von verschiedenen Handelssystemen flexibel gestaltet. Hierbei gilt, dass ein System, das 2 Verluste hintereinander zu verzeichnet, für den jeweiligen Zeitrahmen eine Sperre erhält. Bei Daytrading kriegt es 1 Tag Sperre, bei Wochentradning bekommt es 1 Woche Ruhe. Dies führt dazu, dass nur die aktuellen Gewinnersysteme arbeiten und die Verlierer eine Auszeit erhalten.
- 5) Des Weiteren wird ein weites Spektrum an Aktien beobachtet, welches dazu führt, dass es jederzeit LONG und SHORT Einstiege gibt. Die Verlustbremse gilt auch für die Einzelwerte, wenn in einem Wert 2 Verluste nacheinander auftreten, dann wird dieser Wert entsprechend dem Handelssystem, in Bezug auf seinen Zeitrahmen, gesperrt.
- 6) Schwankungen der Märkte im Verhältnis zueinander werden registriert, um die relativ stärkeren und relativ schwächeren Werte herauszufiltern. Intermarketspreads.
- 7) Für den Ausstieg werden Trailing Stopps und Zeitstopps verwendet. Manche Systeme können auch mit einem Gewinnziel von 2 R gehandelt werden, dies bezieht sich dann aber auf höchstens 50 % des Aktienbestands. Dies muss aber explizit vor dem Trade festgelegt werden.
- 8) Jedes System enthält Filter für psychologische Faktoren (ganze, glatte Zahlen) und volumentechnische Faktoren (Most Volume Prices) und Open Interest (Orderbuch)
- 9) Jedes System erhält das Positionsdrehungssystem, welches eine ausgestoppten Order nicht nur liquidiert, sondern die gleiche Stückzahl der Gegenseite einnimmt. Jeder Wert, darf nur einmal gedreht werden, da hier die Verlustbremse greift. Die Niveaus für die Anfangsstopps sind die ursprünglichen Einstiegsorders.
- 10) Die Zeitrahmen dürfen für den eingegangenen Trade niemals geändert werden. Deshalb muss der Zeitstopp im Vorhinein festlegen, wie lange die Position gehalten wird.
- 11) Wenn Slippage auftritt, dann wird der Anfangsstopp zu meinen Gunsten um diesen Betrag nachgezogen.

AUSWERTUNG EINES HANDELSYSTEMS

- **Maximaler Rückgang:** Der Abstand zwischen dem höchsten Kapitalstand und dem niedrigsten Kapitalstand. Der größte Verlust des Systems vor einer Erholung
- **Längste gewinnlose Zeit:** Die längste Zeit in dem das System keinen Gewinn erzielen konnte. Kann gleich zu Beginn vorkommen oder nach einer Reihe von erfolgreichen Trades
- **Durchschnittliche Rückgang:** Den maximalen Rückgang gibt es nur einmal, aber der durchschnittliche Rückgang berücksichtigt alle Rückgänge des Jahres
- **Gewinn-Verlust Verhältnis:** Diese Kennzahl vergleicht die Beträge der erzielten Gewinne mit den erlittenen Verlusten.
- **Durchschnittlicher Trade:** Der erzielte Gewinn oder Verlust, der bei jedem Trade zu erwarten ist. Wieder eine Kennzahl, die wichtiger ist als der prozentuale Gewinneranteil.
- **Gewinn unter Berücksichtigung von Ausreißern:** Bei jedem Handelssystem kann es zu einigen Gewinnen und/oder Verlusten kommen. Die Chancen, dass sich diese Sonderfälle wiederholen, sind äußerst gering.
- **Höchstanzahl aufeinanderfolgender Verluste:** Die Anzahl aller Verluste, die nacheinander aufgetreten sind. Diese Kennzahl gibt dem Trader eine Ahnung, wie lange er unter Umständen auf einen Gewinner Trade warten muss.
- **Nettogewinn bei Long und Short Positionen:** In den meisten Fällen wird ein robustes Handelssystem die Gewinne zu ungefähr gleichen Teilen mit Long und mit Short Positionen erzielen. Dies hängt aber mit der Marktverfassung zusammen.
- **Prozentanteil positiver Monate:** Ein System, das nur in einem Monat pro Jahr profitabel ist, ist wenig wünschenswert. Ein gutes System sollte in mindestens 6 Monaten pro Jahr Gewinne erzielen.
- **Chartdarstellung des Marktwertes:** Ein Bild sagt mehr als 1000 Worte. Ein Chart der Kapitalentwicklung zeigt Informationen schnell und übersichtlich. Der Rückgang, die längste gewinnlose Zeit, die Volatilität der Kapitalentwicklung und das Kapitalwachstum lassen sich in einem Chart leichter interpretieren.

Computer Hardware: 1000 MHz Prozessor, 10 GB Festplatte, 128 MB RAM, 2-5 Monitore für verschieden Masken, DSL Internetanschluss.

Feldversuch / Praxis - Test:

Wenn System nach 10 Trades kein Geld verdient hat, dann wird es für einen Monat ausgemustert. Wenn nach 10 Trades das System profitabel ist, dann werden 100 Trades angestrebt. Der Systemtest erfolgt mit einem Risiko von $1 R = 1\%$ des Kontovolumens, damit auch der Worst-Case von Verlustserien mich nicht zu weit zurück wirft.

Der maximale Drawdown beträgt 10% des Kontovolumens.

Dann wird das System für mindestens 1 Monat abgeschaltet.

Das gleiche gilt, wenn eine Serie von 10 Verlusttrades in Folge auftritt.

CHARTDARSTELLUNG

- 1) **Skalierung**. Nur glatte/ganze Zahlen
- 2) **Punktchart** auf Schlusskursbasis
- 3) **Kerzenchart** zur Bestimmung der Highs/Lows (Schlusskurs)
- 4) **Volumenchart** als Stäbe oder als Punktchart
- 5) **Spreadchart**: Schlusskursspread als Punktchart
- 6) **Psychomarken**: Psychologische Marken im Chart als Linie ziehen
- 7) **Oszillator**: Geschwindigkeitsveränderung wird in der Mitte mit einer Nulllinie dargestellt. Negativer Bereich steht für eine Verlangsamung. Positiver Bereich steht für eine Beschleunigung. Die Nulllinie bedeutet, dass die Kursgeschwindigkeit stagniert.
- 8) **Volumengewichteter Durchschnitt** als gleitender Durchschnitt
- 9) **Simple Moving Average**: 20 – Tagedurchschnitt / 200 –Tagedurchschnitt
- 10) **Zeitrahmen**: 3 Monatschart / 1 Jahreschart

POSITIONSGRÖßENBESTIMMUNG 2-5 TAGE TRADING

Definition:

Um die Positionsgröße bei Aktien zu bestimmen wird folgende Formel verwendet.

$$\frac{1 \% \text{ des aktuellen Kontovolumens}}{\text{Punktabstand des Anfangsstopps}} \\ = \text{Stückzahl}$$

Beispiel:

500 € entsprechen bei 50.000 € auf Konto 1%

Der Anfangsstopp ist 1 € vom Einstiegskurs entfernt

→ $500 \text{ €} : 1 \text{ €} = 500 \text{ Stücke}$

Das Anfangsrisiko entspricht somit 500 € oder 1 % des Konto falls der Stopp ausgelöst wird.

Durch die Positionsdrehung bei der Auslösung des Stopps wird wiederum eine Position mit dem Risiko 1 R = 500 € oder 1 % des Kontovolumens eingegangen. Somit entsteht ein Gesamtrisiko für den Einstieg von 2 % auf das Kontovolumens, falls beide Positionen mit 1R ausgestoppt werden.

Erklärung:

Diese Positionsgrößenbestimmung lässt zu, dass auch 10 Verluste in Folge auftreten können, wobei während der Drawdownphase der Betrag von 1 R absolut gesehen sinkt. In einer Gewinnphase steigt der Eurobetrag von 1 R.

Bei Aktien lässt sich die Stückzahl leicht an den Kontorahmen anpassen.

Der Größenbestimmung Ihrer Position sollten Sie mehr Aufmerksamkeit widmen als allen anderen Systemkomponenten zusammengenommen.

ORDERPLATZIERUNG 2-5 DAYS TRADING

Setup: 2-5 Tage Trading / Umkehrsystem

Uhrzeit: StoppMarket Order nach Börsenschluss:

Einstieg:

LONG: Stopp Buy 500 Stück am Tageshoch

SHORT: Stopp Loss 500 Stück am Tagestief

Die Einstiegsorder wird an eine If-Done Order gekoppelt.

Wenn ein Stopp Buy ausgeführt wird, dann wird gleichzeitig per If-Done ein Stopp Loss über 1000 Stück am Tagestief platziert.

Wenn ein Stopp Loss ausgeführt wird, dann wird gleichzeitig per If-Done ein Stopp Buy über 1000 Stück am Tageshoch platziert.

Die If-Done Order verdoppelt dann die Stückzahl am Tagestief(hoch), um ggf. die Position zu drehen, fall der Markt es verlangt.

Umkehrsystem If-Done Order:

Stopp Buy 500 Stück am Tageshoch → If-Done Stopp Loss 1000 Stück am Tagestief

Stopp Loss 500 Stück am Tagestief → If-Done Stopp Buy 1000 Stück am Tageshoch

Die gedrehte Position erhält nur einen Deckungsauftrag. Nur 1 Mal drehen!

500 Stück „gedrehte“ Position am Tagestief → If-Done Stopp Buy 500 Stück Tageshoch

500 Stück „gedrehte“ Position am Tageshoch → If-Done Stopp Loss 500 Stück Tagestief

Wenn beide Einstiege ausgestoppt wurden, dann wird der Wert für 1 Woche gesperrt.

Pyramide:

(System X) Einstieg für die 1. Position beträgt 500 Stück (100%),

wenn Position 1 R erreicht werden 250 Stück (50 %) dazu gekauft,

wenn Position 2 R erreicht, dann werden 125 Stück (25 %) dazu gekauft.

Bewertung:

Die Einstiegsniveaus werden nach Freitagsschluss bestimmt, um die emotionalen und spontanen Entscheidungen zu reduzieren. Wenn der Einstieg, dann am Montag stattfindet, kann die Position 5 Tage bis zum nächsten Wochenende geschlossen werden.

STOPP TOOLS

1. **Anfangsstopp:** Sicherheitsstopp
2. **Trailingsstopp Methode:** Die Stufen zum Gewinn
3. **Time Stopp Methode:** Zeit ist Geld
4. **Rote Ampel Methode:** Anzeichen von Schwäche -> Reduzierung

Verwendung: Alle Stopps müssen bei jedem Trade verwendet werden, ansonsten ist mein Tradingstil unseriös und das Konto wird eher früher als später von mir ausgelöscht.

- 1) Der **Anfangsstopp** wird sofort beim Einstieg in den Trade beim Broker platziert und bleibt über die komplette Dauer des Trades aktiv. Bei Aktien beträgt der Abstand zum Einstiegskurs mindestens 1 % und maximal 5 %, abhängig von der Hoch-Tief Spanne der Signalkerze.
Positionsgröße:
1% des Kontovolumens : Punktabstand zum Anfangskurs = Stückzahl
Der Anfangsstopp deckt 100 % der offenen Position.
- 2) Der **Trailingsstopp** wird nach der ersten Gewinnkerze verwendet. Der Anfangsstopp wird vom Ausgangspunkt, um die Punktzahl meines Buchgewinns, zu meinen Gunsten verschoben. Bei jeder weiteren Gewinnkerze wird der Stopp um den Buchgewinn nachgezogen.
Bei einer negativen Kerze bleibt der Trailingstopp unverändert.
Der Trailingstopp deckt 33 % der Anfangsposition
- 3) Der **Time Stopp** wird verwendet, wenn nach 3 Sitzungen(inklusive Einstiegkerze) kein vorheriger Stopp erreicht wurde. Der Time Stopp liquidiert einen Teil der Position spätestens nach 3 Sitzungen(Kerzen), um die Kapitalbindung zu lösen und den Cashflow zu garantieren. **Time Stopp Wochenende:** Das Wochenende (Samstag, Sonntag) wird zum Zeitstopp addiert. Wenn eine Position während dem Wochenende das Zeitlimit überschreiten würde, dann wird zum Freitagsschlusskurs liquidiert.
Der Time Stopp deckt 33 % der Anfangsposition
- 4) Der **Rote Ampel Stopp** wird verwendet, wenn ein Schlusskurs sich gegen meine offenen Position wendet und somit einen Tagesverlust hervorruft.
Der Rote Ampel Stopp deckt 33 % der Anfangsposition
- 5) Wenn **Slippage** durch eine Kurslücke oder eine schlechte Ausführung vorkommt, dann wird der Stopp um den Betrag der Slippage zu meinen Gunsten verschoben.

33er EXIT

Anfangsstopp: 100 % der Position wird gedeckt

Ausstiegstechnik: Jeder separate Ausstieg deckt 33% (ein Drittel) der Position

33% Rote Ampel → Schlusskurs wendet sich gegen meine Position

33 % Zeitstopp → Greift nach der dritten Kerze (Einstiegskerze + 2 Sitzungen)

33 % Trailingstopp → Der Anfangsstopp wird vom Ausgangspunkt um die Punktzahl meines Buchgewinns zu meinen Gunsten verschoben.

Erklärung:

Anfangsstopp: Wenn der Trade schlecht verläuft, dann wird die Position komplett liquidiert.

Rote Ampel Stopp: Wenn der Trade eher schwach beginnt, dann wird die Position reduziert. Die restliche Position wird durch den Anfangsstopp geschützt. Die Rote Ampel greift bei den ersten Schwächenzeichen.

Der **Zeitstopp** ist der wesentliche Bestandteil der zeitlichen Planung, denn er deckt einen Teil der Position, unabhängig vom Marktverhalten. Dies sichert die Liquidität und stärkt das Bewusstsein für die zeitliche Beschränkung des Trades.

Der **Trailingstopp** sichert den bereits erreichten „Buchgewinn“. Der Trailingstopp hält die Position solange der Markt in Trade-Richtung tendiert. Er sichert die Position gegen unerwartet starke Gegenbewegungen des Marktes. Er untersteht keiner zeitlichen Begrenzung, sondern zielt darauf ab einen „langfristigen“ Trend zu erwischen. Bei einer deutlichen Marktkorrektur gegen meine Position wird die Position reduziert.

Wenn der Trade optimal für mich verläuft, dann halte ich 100 % der Position für 3 Sitzungen, dann greift der **Zeitstopp**. Danach halte ich 66 % der Position, um den Trend zu folgen.

Sobald der Trend nachlässt, decke ich 33 % der Position (**Rote Ampel**).

Wenn der Trend umkehrt, dann decke ich den Rest (**Trailingstopp**).

Wenn durch die ersten beiden Ausstiege ein Gewinn erzielt wurde, kann der **Trailingstopp** versuchen einen langfristigen Trend zu folgen, ohne Verlustrisiken zu erzeugen, während die Liquidität des Tradingkapitals gewährleistet ist.

Wenn ein Trailingstopp nachgezogen wird, dann muss unbedingt dieser **Anteil beim Anfangsstopp reduziert** werden. Dies gilt auch für den Zeitstopp und die Rote Ampel. Sobald eine Ausstiegstechnik verwendet wird, dann muss unbedingt dieser Anteil am Anfangsstopp reduziert werden. Ansonsten droht die Gefahr, dass bei einer Gegenbewegung des Marktes die Position ungewollt „gedreht“ wird.

Fazit:

Der Vorteil beim Verwenden von mehreren Ausstiegstechniken ist, dass die Position flexibler glatt gestellt wird. Man ist nicht zu 100 % abhängig von einer einzigen Ausstiegstechnik. Es bewirkt, dass der Händler bei einem positiven Verlauf des Geschäfts seine ganze Ware nicht auf einmal auf den Markt wirft.

Dies hat den Effekt, dass Gewinne zwar teilweise mitgenommen werden, aber durch die restliche Stückzahl die „**Gewinne laufen gelassen**“ werden.

Die Ware wird lediglich bei einer sehr schlechten Marktsituation komplett auf den Markt geschmissen, da dies als eine Art Notbremse wirkt.

Die „**Verluste werden begrenzt**“ und der Händler kann wieder auf volle Liquidität zurückgreifen.

GEWINNMITNAHMESYSTEM JAHRESSICHT / GEHEBELTE POSITION

Buchgewinn: (Dauer in Kerzen bis Position liquidiert ist)

1% - 10 % → Verkauf 10 % Bestand (10 Kerzen)
 10% - 20 % → Verkauf 20 % Bestand (5 Kerzen)
 20 % - 50 % → Verkauf 33 % Bestand (3 Kerzen)
 50 % - 100 % → Verkauf 40 % Bestand (2,5 Kerzen)
 100 % - X → Verkauf 50 % Bestand (2 Kerzen)

entspricht in R-Vielfachen

0-1 R → Verkauf 10 % Bestand (10 Kerzen)
 1R – 2 R → Verkauf 20 % Bestand (5 Kerzen)
 2R – 3 R → Verkauf 33 % Bestand(3 Kerzen)
 3R – 5R → Verkauf 40 % Bestand (2,5 Kerzen)
 5R + X → Verkauf 50 % Bestand (2 Kerzen)

Bewertung: Jeder Schlusskurs ab der ersten Gewinnerkerze

Paketgröße : 1000 Aktien als Anfangsbestand (2% des Kontovolumens)

Vorteil: Risikoabbau; Cashflow; Höchstpunktmitnahme; sichert größeren Gewinn mehr als kleineren; BreakEven geht auf Einstiegskurs; Restbestand kann als Hedge oder Spread verwendet werden.

GEWINNMITNAHME MODELL

Gewinn %	Verlust zum Retracement %
1	1
5	4,76
10	9,09
20	16,66
30	23,07
40	28,57
50	33,3
60	37,5
70	41,17
80	44,44
90	47,36
100	50
200	66,6
300	75
400	80
1000	90,9
10000	99

Interpretation:

Eine Gewinnmitnahme lohnt sich ab 20 % Buchgewinn, da das Verhältnis von Performance und Retracement anfängt eklatant voneinander abzuweichen.

TRADING GEWINNZIELSYSTEM: 2 R GEWINN

Gewinner	Verlierer	Resultat
10	0	+20
9	1	+17
8	2	+14
7	3	+11
6	4	+8
5	5	+5
4	6	+2
3	7	-1
2	8	-4
1	9	-7
0	10	-10

Gewinnverhältnis: Wenn Gewinnziel 2 R beträgt, dann wird System bei einem Verhältnis von 4 / 6 profitabel.

Zeitstopp: Der Zeitstopp wird verwendet, wenn Kurs nach 3 Sitzungen (Kerzen) auf den jeweiligen Zeitrahmen weder den Anfangsstopp noch das Gewinnziel erreicht hat.

GEWINNMITNAHME MIT AUSGLEICHSSTOPP

Setup: Anfangsstopp beträgt 1 R; Ausgleichsstopp wird verwendet, wenn Position 1 R Buchgewinn aufweist; 2 R Gewinnziel

Gewinner	Remis	Verlierer	Resultat
0	5	5	-5
1	5	4	-2
2	5	3	1
3	5	2	4
4	5	1	7
5	5	0	10

Interpretation: Das Remis (Ausgleichsstopp) verringert unter Umständen den maximalen Drawdown und die längste Verlustserie.

Das Remis verringert aber auch die Chancen auf einen 2 R Gewinn und kann sich gleichermaßen auch negativ auf die Rendite auswirken.

Der Ausgleichsstopp erzeugt mehr Trades und somit höhere zeitliche, psychische und finanzielle Kosten.

Zeitstopp: Wenn nach 3 Kerzen kein Stopp und kein Gewinnziel gegriffen hat, dann Liquidation.

FUN AND PROFIT TRADING

Bewertung: XETRA Freitagsschluss Analyse von Wochenkerzen

Chartansicht: 3 Monatschart(Punkt/Kerze) mit 20 – Tage Durchschnitt

Aktienauswahl: DAX / MDAX / TECDAX / SDAX

Nominalfilter: Eine Aktie muss mind. 20,00 € pro Stück kosten.

Permanent Filter: *Einstieg:* Filter müssen 50 % + X zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Chartsignale → *Spezialfilter:*

- 1) Dach / Boden System → *Volumen-Spitzen Filter*
- 2) V- Formation → *Speed Filter*
- 3) 3-5 Balken Street → *Zyklik Filter*
- 4) Smash Day → *Volumen-Explosion Filter*
- 5) Hidden Smash Day → *Volumen-Explosion Filter*
- 6) Ampelsystem → *Steigungswinkel Filter*
- 7) 5 x 5 / 4 x 4 Kerzenanalyse → *Steigungswinkel Filter*
- 8) Narrow Range Bar
- 9) Topping / Bottom Tails
- 10) Starke Kerzen / Mega Kerzen
- 11) 10 Tage / 3 Tage Ausbruch System

Frequenz: Jedes Chartsignal darf nur 1 LONG und 1 SHORT Signal pro Tag generieren.
Wenn ein System mehrere Einzelwerte für einen Tag liefert, dann wird per Los entschieden.

Einzelwerte:

Aus 160 Aktien werden täglich maximal 5 verschiedene LONG Signale wahrgenommen.
Aus 160 Aktien werden täglich maximal 5 verschiedene SHORT Signale wahrgenommen.

Long Power:

Das Fremdkapital darf das Eigenkapital bei den kumulierten LONG Positionen nicht überschreiten. Der Maximale LONG Hebel entspricht 2.

Short Power:

Das Fremdkapital darf das Eigenkapital bei den kumulierten SHORT Positionen nicht überschreiten. Der Maximale SHORT Hebel entspricht 2.

Vertrag:

- Die Geschäftsführer müssen sich vertraglich verpflichten für den Eigenhandel nur 2-5 Tage Trading mit maximal 500 Aktien pro Position zu praktizieren.
- Das Fremdkapital darf das Eigenkapital in eine Trendrichtung nicht überschreiten.
- Es wird kein Intraday Trading betrieben.

Strafe: Bei Verletzung dieser Grundregeln wird der Geschäftsführer für 6 Monate suspendiert

FUN AND PROFIT HEDGING

Bewertung: Täglich ab 18:00 – 24:00 Uhr nach XETRA Schluss

Chartansicht: 1 Jahreschart(1 Kerze = 1 Woche) mit 20 – Tage Durchschnitt

Aktienauswahl: Bestandaktien aus DAX / MDAX / TECDAX / SDAX

Bestandsfilter: Die gehandelte Stückzahl muss zu 100 % im Depot vorhanden sein

Signale: Beim Hedging werden nur SHORT Signal gehandelt.

Trendfilter: Close – Close Wochenbasis

Einstieg: Per Stopp Loss Order am aktuellen Tagestief nach Börsenschluss

Chartsignale:

- Dach / Boden System
- Sommet System
- 3-5 Balken Street
- Smash Day
- Hidden Smash Day
- Narrow Range Bar
- Topping / Bottom Tails
- Ampelsystem
- Starke Kerzen
- 10 Tage / 3 Tage Ausbruch System
- 5 x 5 / 4 x 4 Kerzenanalyse

Frequenz: Jedes Chartsignal darf nur 1 SHORT Signal pro Tag generieren.

Einzelwerte: Alle Bestandswerte werden täglich nach SHORT Einstiegen gescannt.

Short Power:

Das Fremdkapital darf das Eigenkapital bei den kumulierten SHORT Positionen nicht überschreiten. Der Maximale SHORT Hebel entspricht 2 → 100 % gedeckt

Vertrag:

- Die Geschäftsführer müssen sich vertraglich verpflichten für das Hedging maximal die Stückzahl der Bestandsaktie zu 100 % zu übernehmen.
- Das Fremdkapital darf das Eigenkapital in eine Trendrichtung nicht überschreiten.
- Es wird kein Intraday Trading betrieben.

Strafe:

Bei Verletzung dieser Grundregeln wird der Geschäftsführer für 6 Monate suspendiert

FUN AND PROFIT INVESTMENT

Bewertung: Monatlich am 1. Handelstag des Monats

Chartansicht: 5 Jahreschart mit 200 Tage Durchschnitt.

Aktienauswahl: DAX / MDAX / TECDAX / SDAX

Trendfilter:

Wenn XETRA - Monatsschlusskurs über dem 200 – Tage Durchschnitt liegt, werden nur LONG Signale gehandelt.

Wenn XETRA – Monatsschlusskurs unter dem 200 – Tage Durchschnitt liegt, werden nur SHORT Signale gehandelt.

Frequenz: Jedes Chartsignal darf nur 1 LONG und 1 SHORT Signal pro Monat generieren.

Aktienselektion LONG:

Die 4 besten TOP PERFORMER aus den Indizes werden verglichen

Ein TOP PERFORMER muss mind. 10 % Rendite auf Monatssicht aufweisen, um für eine Position in Frage zu kommen.

Aktienselektion SHORT:

Die 4 besten LOW PERFORMER aus den Indizes werden verglichen

Ein LOW PERFORMER muss mind. -10 % Rendite auf Monatssicht aufweisen, um für eine Position in Frage zu kommen.

Akkumulation:

1 LONG Tranche beträgt 10 % der Gesamtsumme.

1 SHORT Tranche beträgt 10 % der Gesamtsumme.

Vertrag:

- Die Geschäftsführer müssen sich vertraglich verpflichten für das Investment maximal 10 % der Gesamtsumme in eine Trendrichtung pro Monat zu investieren.
- Die Akkumulation findet über den Zeitraum von 1 Jahr statt.

Strafe:

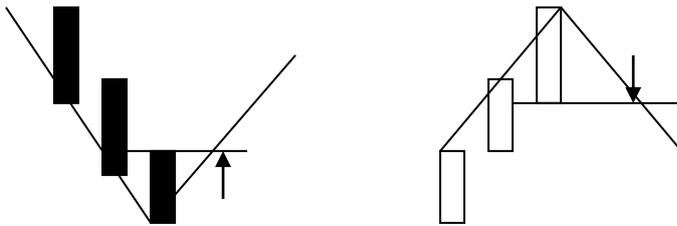
Bei Verletzung dieser Grundregeln wird der Geschäftsführer für 6 Monate suspendiert.

FUN AND PROFIT CHARTMUSTER

3 – 5 BALKEN STREET

Setup:

Scanne Aktien, die mindestens 3 Tage am Stück gefallen bzw. gestiegen sind. Nach dem 3. Balken wird über das Hoch (Tief) der Kerze ein Stopp Buy bzw. Stopp Loss gesetzt.



Einstieg: Kauf am Tageshoch (LONG) / Verkauf am Tagestief (SHORT)

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

TrailingStopp wird nach der zweiten und folgenden Gewinnkerzen auf das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gesetzt

Zeitstopp nach 3 Sitzungen wird aktiv, wenn nach 5 Sitzungen kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert

Zeitraahmen: Tageschart / Wochenchart

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Anti Zyklik Filter Tagesbasis

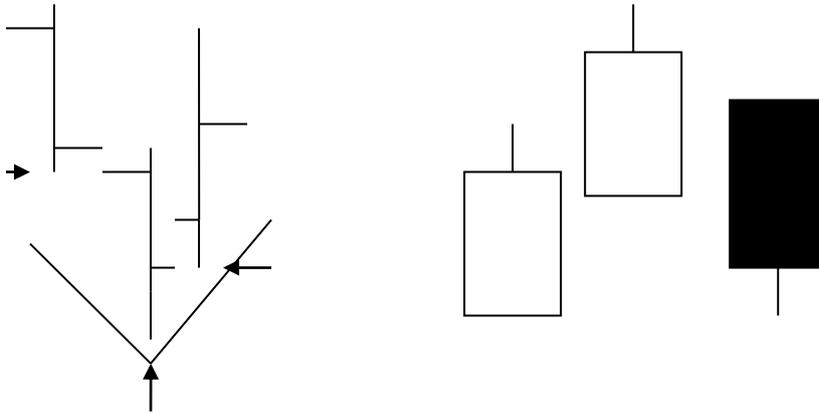
Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

DACH / BODEN SYSTEM

Setup: Tageschart / Wochenchart



Sobald ein Kurstief (sprich das untere Ende eines Balkens) auftritt und die Tiefs von den Balken rechts und links davon jeweils preislich höher liegen als die des mittleren Balkens, repräsentiert der mittlere Balken und Zwischentief.

Bei einem Zwischenhoch gilt die umgekehrte Formel.

Kursverläufe gehen immer von Zwischenhoch zum Zwischentief

Einstieg:

SHORT, bei einem „DACH“ (Zwischenhoch)

LONG, bei einem „BODEN“ (Zwischentief)

Der Einstieg erfolgt Market, sobald mind. 3 Kerzen die Formation bilden.

Stops:

Der Anfangsstopp wird auf den Höchstkurs des DACHS oder Bodens gesetzt.

Der Anfangsstopp enthält die doppelte Stückzahl, um die Position zu drehen.

Der Zeitstopp beträgt 5 Kerzen nach der Eröffnung der Position.

Der Trailing Stopp wird genau um die Punktzahl des Buchgewinns nach jeder Gewinnkerze nachgezogen.

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Volumen-Spitzen Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

V- FORMATION

Setup:

Man braucht 2 tendierende Punkte nacheinander (2 Rote/Grüne).

Der Körper der 2. Kerze sollte kleiner sein als die vorherige.

Wenn der Kurs in 3. Sitzung wieder das Niveau des 1. Punktes erreicht, dann handelt er sich um ein Zwischenhoch(tief).

Chartansicht: Punktchart

Zeitraumen: Tagesbasis / Wochenbasis

Einstieg:

Per Stopp Loss/Stopp Buy auf dem Niveau des 1. Punktes

Frequenz: 1 Signal → 1 Trade

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

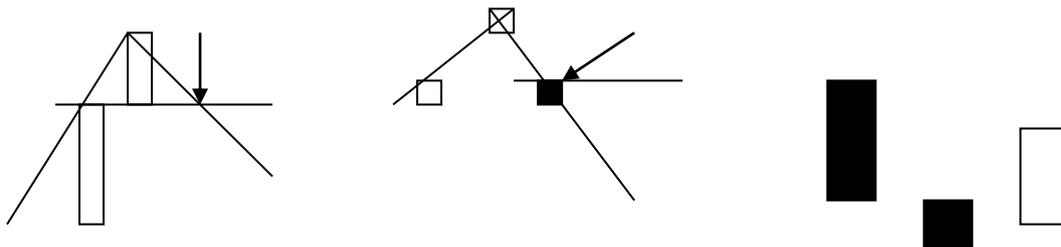
Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Ausgleichsstopp wird nach der ersten Gewinnkerze verwendet

Trailingstopp wird nach der zweiten Sitzung unter das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gezogen.

Zeitstopp wird verwendet, wenn Trade nach 5 Kerzen keinen Stopp auslöst.

Anfangsrisiko: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl



Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Speed Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

NARROW RANGE BAR

Setup: Als Narrow Range Bar (NRB) wird ein Balken definiert, der einen geringeren Abstand zwischen Hoch und Tief hat als der vorherige Balken.

Erscheint ein NRB, so heißt das, dass eine dramatische Abnahme der Vola eingetreten ist. Zum Beispiel wenn XYZ am Montag ein Hoch von 22 € und ein Tief von 20 € hat, wäre die Tagesspanne insgesamt 2 € ($22 - 20 = 2$).

Wenn am nächsten Tag zwischen 21,50 € und 21 € gehandelt wird (0,50 €), wäre das ein NRB.



Einstieg: Kauf am Tageshoch (LONG) / Verkauf am Tagestief (SHORT)

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief
Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp: Nach jeder Tageskerze wird der Stopp um den Betrag des Buchgewinns nachgezogen.

Zeitstopp 5 Kerzen, wenn kein Stopp erreicht wurde.

Gewinnziel: Für die Hälfte der Position wird ein Limit Gewinnziel von 2 R in Bezug auf den Anfangsstopp gesetzt.

Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

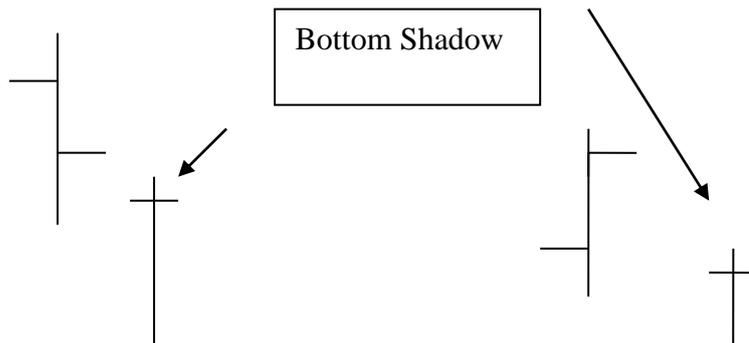
BOTTOM SHADOWS

Setup:

Ein BOTTOM SHADOW, der nach unten zeigt, entsteht aus dem Fallen einer Aktie unter das Tief der vorherigen Kerze und einer plötzlichen Umkehr nach oben.

Der Fallen unter das Tief der vorherigen Kerze besteht nur aus einem Schatten.

Der Schlusskurs befindet sich über dem Tief der vorherigen Kerze



Einstieg: Kauf bei Tageshoch (LONG) / Verkauf bei Tagestief (SHORT)

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp nach 5 Kerzen, wenn kein Stopp ausgelöst wird.

Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Gewinnziel: 2 R Limitgewinnziel für die Hälfte der Position

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

TOPPING SHADOWS

Setup:

Ein TOPPING SHADOW, der nach oben zeigt entsteht aus einer ursprünglichen Aufwärtsbewegung, die ein höheres Hoch als die vorherige Kerze hat und einer plötzlichen Abwärtsbewegung weicht.

Der Anstieg über das Hoch besteht nur aus einem Schatten.
Der Schlusskurs befindet sich unter dem Hoch der vorherigen Kerze.

Einstieg:

Kauf bei Tageshoch (LONG) / Verkauf bei Tagedstief (SHORT)



Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stopps:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief
Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp nach 5 Kerzen, wenn kein Stopp ausgelöst wird.

Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Gewinnziel: 2 R Limitgewinnziel für die Hälfte der Position

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

STARKE KERZEN

Setup:

Einstieg LONG, falls der Schlusskurs über 75 % der Schwankungsbreite für den Tag liegt und die vorherige Kerze einen kleineren roten Körper hat

Einstieg SHORT, falls der Schlusskurs über 75 % der Schwankungsbreite für den Tag liegt und die vorherige Kerze einen kleineren grünen Körper hat

Einstieg: Kauf am Tageshoch (LONG) / Verkauf am Tagestief (SHORT)

Stopps:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

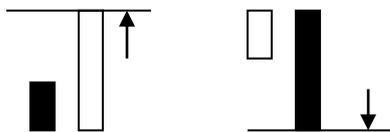
Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Ausgleichsstopp wird nach der ersten Gewinnerkerze benutzt.

Trailingsstopp wird nach der zweiten Gewinnerkerze auf das Tief der jeweiligen Kerze gesetzt. Nach jeder weiteren Kerze wird der Trailingsstopp auf das jeweilige Tief nachgezogen

TimeStopp wird verwendet, wenn nach 5 Kerzen kein Stopp gegriffen hat

Zeitraumen: 1 Woche, 1 Tag



Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

MEGA KERZEN

Setup:

Einstieg LONG, falls das Tief einer steigenden Einstiegskerze maximal 25 % innerhalb der vorherigen Kursspanne liegt.

Einstieg SHORT, falls das Hoch einer fallenden Einstiegskerze maximal 25 % innerhalb der vorherigen Kursspanne liegt.

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarket-Spreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Einstieg: Kauf am Tageshoch (LONG) / Verkauf am Tagestief (SHORT)

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

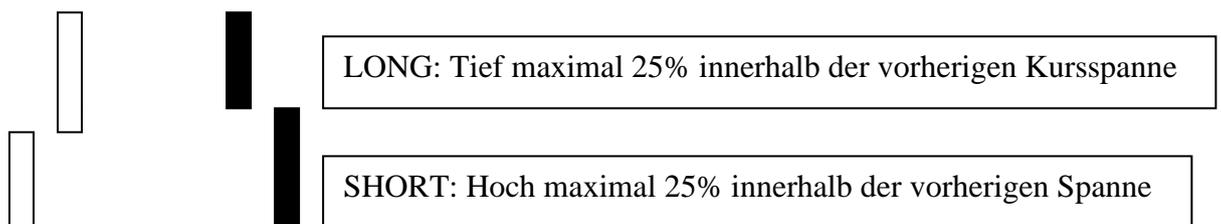
Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Ausgleichsstopp wird nach der ersten Gewinnerkerze benutzt.

Trailingsstopp wird nach der zweiten Gewinnerkerze auf das Tief der jeweiligen Kerze gesetzt. Nach jeder weiteren Kerze wird der Trailingsstopp auf das jeweilige Tief nachgezogen

TimeStopp wird verwendet, wenn nach 5 Kerzen kein Stopp gegriffen hat

Zeitraumen: 1 Woche, 1 Tag



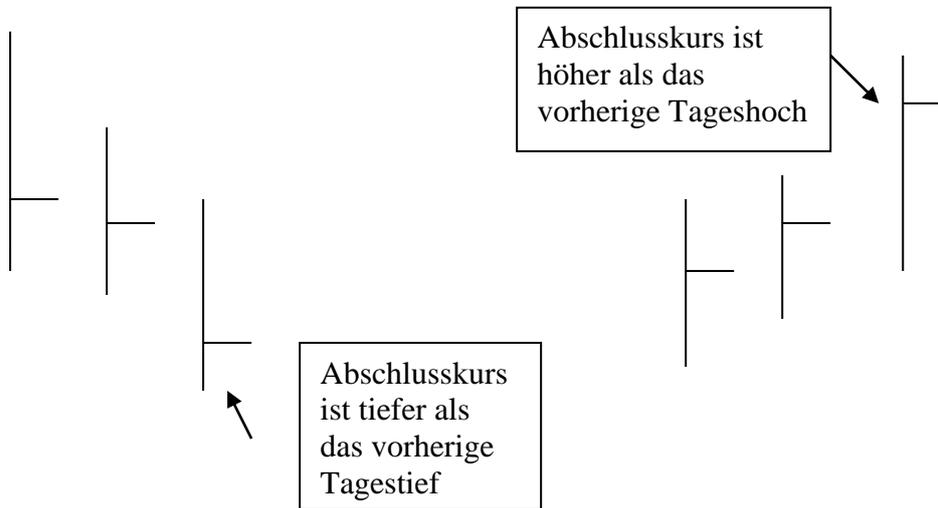
Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

SMASH DAY MUSTER

Setup:

Ein Smash Day Kaufsignal entsteht, wenn der Schlusskurs oberhalb des vorherigen Tageshochs liegt. Ein Smash Day Verkaufssignal entsteht, wenn der Schlusskurs unterhalb des vorherigen Tagestiefs liegt.



Einstieg:

Wenn bereits am nächsten Handelstag ein höheres Hoch als der Smash Day auftritt, dann handelt es sich um ein sehr starkes Kaufsignal. Wenn jedoch kein höheres Hoch folgt, sondern das Tagestief erreicht wird, so entsteht ein Verkaufssignal.

Stopp Buy LONG Signal am Tageshoch / Stopp Loss SHORT Signal am Tagestief

.Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Volumen-Explosion Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse:

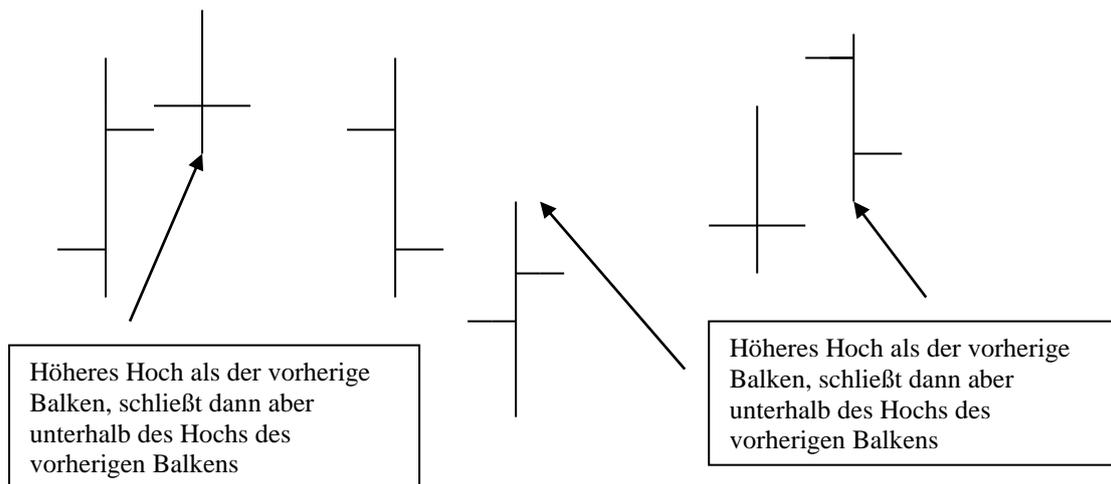
Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

HIDDEN SMASH DAY MUSTER

Setup:

Ein Balken bildet ein höheres Hoch als der vorherige Balken, schließt dann aber unterhalb des Hochs des vorherigen Balkens.

Ein Balken bildet ein tieferes Tief als der vorherige Balken und schließt dann oberhalb des vorherigen Balkens.



Einstieg: Tagesbasis / Wochenbasis

Stopp Buy LONG Signal am Balkenhoch / Stopp Loss SHORT Signal am Balkentief

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Volumen-Explosion Filter Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition)

10 TAGE AUSBRUCH SYSTEM

Setup:

Die Kurspanne der letzten 10 Tage wird eingegrenzt, wenn Kurs die Volatilitätsgrenzen nach oben nach unten berührt, dann wird eingestiegen.

Bewertung:

1 Handelstag des jeweiligen Monats

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Steigungswinkel 10 Tage Hoch – 10 Tage Tief

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Einstieg:

10 Tage Höchstkurs → Stopp Buy Long Einstieg

10 Tage Tiefstkurs → Stopp Loss Short Einstieg

Die Einstiegsorders werden jeweils mit einem If-Done Auftrag über die eingegangene Stückzahl ausgestattet, um ggf. die Position zu drehen und im Worst-Case zu liquidieren.

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle 10 Tagestief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle 10 Tageshoch.

Trailingsstopp wird täglich um den Buchgewinn nachgezogen.

Zeitstopp beträgt 5 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).



3 TAGE AUSBRUCH SYSTEM

Setup:

Die Kurspanne der letzten 3 Tage wird eingegrenzt, wenn Kurs die Volatilitätsgrenzen nach oben nach unten berührt, dann wird eingestiegen.

Bewertung:

Letzter Handelstag der Woche.

Einstieg Montag – 1. Handelstag der Woche

Einstieg:

3 Tage Höchstkurs → Stopp Buy Long Einstieg

3 Tage Tiefstkurs → Stopp Loss Short Einstieg

Die Einstiegsorders werden jeweils mit einem If-Done Auftrag über die eingegangene Stückzahl ausgestattet, um ggf. die Position zu drehen und im Worst-Case zu liquidieren.

Permanent Filter: $50\% + X$ müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Steigungswinkel 3 Tage Hoch – 3 Tage Tief

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle 3 Tagestief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle 3 Tageshoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 3 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

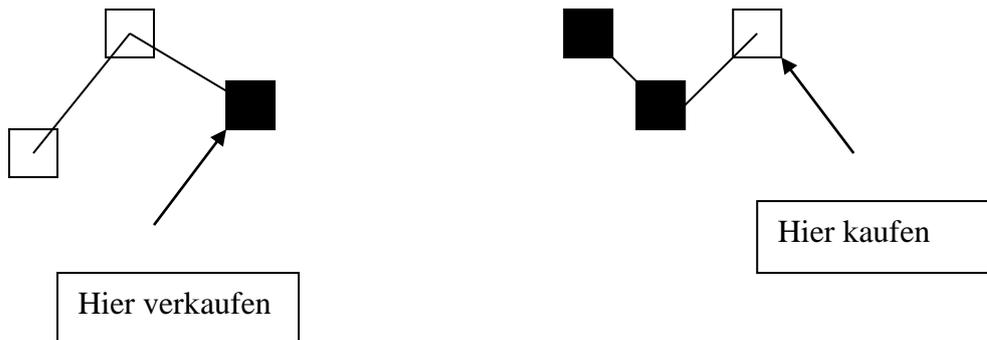
Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

AMPEL SYSTEM

Setup: Vergleiche aktuellen Schlusskurs mit dem vorherigen Schlusskurs

Wenn Punktfarbe von Rot (fallend) auf Grün (steigend) wechselt, dann LONG Einstieg.
Wenn Punktfarbe von Grün (steigend) auf Rot (fallend) wechselt, dann SHORT Einstieg.



Einstieg: Kauf am Tageshoch (LONG) / Verkauf am Tagestief (SHORT)

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Ampelstopp: Wenn Punktfarbe sich gegen meine Trendrichtung wendet.

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Steigungswinkel Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Positionsdrehung:

Der Anfangsstopp und der Ampelstopp drehen die Position.

Positionsgröße:

1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

Zeitraumen: Tageschart / Wochenchart

KERZENANALYSE 5 X 5 WOCHENBASIS

Check: Freitagsschlusskurs

Setup:

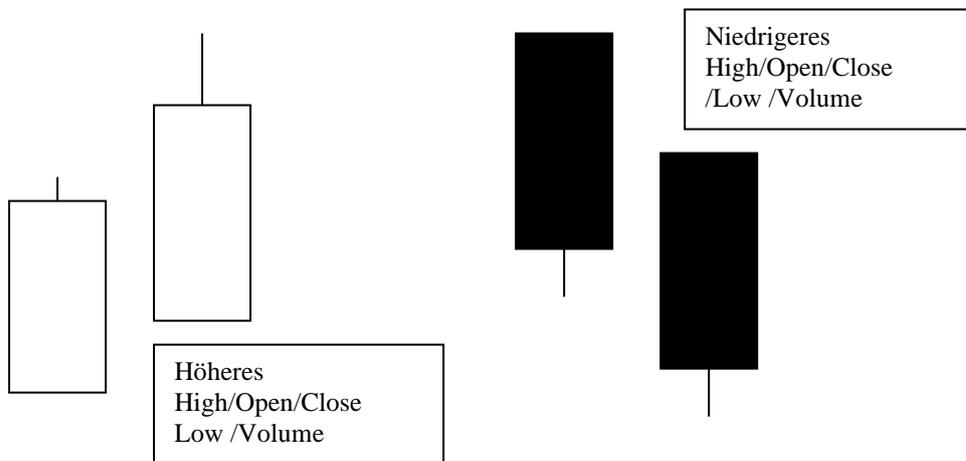
Analysiere die Wochenkerze einer Aktie auf High / Open/ Close / Low / Volumen.
5 x Grüne / Rote Kursdaten im Vergleich zur Vorwoche liefern ein Handelssignal.

LONG:

Eine Aktie hat im Vergleich zur Vorwoche ein höheres High / Open/ Close / Low / Volumen

SHORT:

Eine Aktie hat im Vergleich zur Vorwoche ein niedrigeres High/Open/Close /Low /Volumen



Einstieg:

LONG: Hoch der Freitagskerze

SHORT: Tief der Freitagskerze

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Steigungswinkel Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position das aktuelle Freitagstief

Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen das aktuelle Freitagshoch

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 3 Wochenkerzen

Positionsgröße:

1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

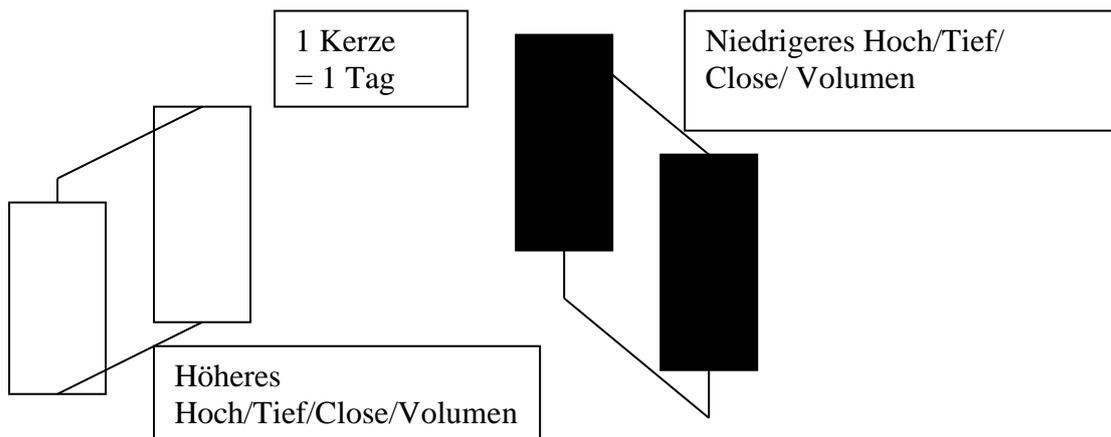
KERZENANALYSE 4 X 4 TAGESBASIS

Check: Täglicher Schlusskurs Montag – Donnerstag

Setup: Analysiere die Tageskerze einer Aktie auf Hoch/Tief/Close/Volumen
4 x Grüne / Rote Kursdaten im Vergleich zum Vortag liefern ein Handelssignal.

LONG: Eine Aktie hat im Vergleich zur letzten Kerze ein höheres Hoch/Tief/Close/Volumen

SHORT: Eine Aktie hat im Vergleich zur letzten Kerze ein niedrigeres Hoch/Tief/Close/Vol.



Einstieg:

LONG: Hoch der Tageskerze

SHORT: Tief der Tageskerze

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Tagesbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Tagesbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Tagesbasis
- Steigungswinkel Tagesbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position das aktuelle Tagestief

Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen das aktuelle Tageshoch

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Tageskerzen

Positionsgröße:

1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse:

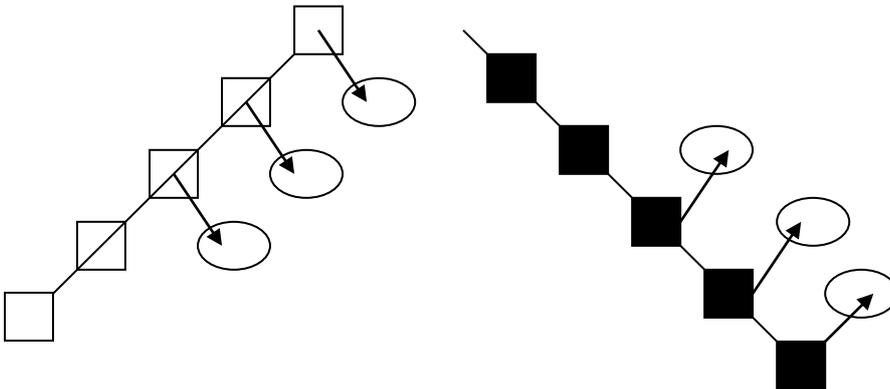
Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

3 – 5 SCHLUSSKURS STRASSE / V - FORMATION

Setup:

Scanne Aktien, die mindestens 3 Schlusskurse am Stück gefallen bzw. gestiegen sind.
Wenn der Kurs in der 4. Sitzung wieder das Niveau des 2. Punktes erreicht, dann handelt es sich um ein Zwischenhoch(tief).

Bei längeren Serien wird der vorherige Schlusskurs als Referenzpunkt genommen



Einstieg:

LONG: Stopp Buy auf dem Niveau des vorherigen negativen Schlusskurses

SHORT: Stopp Loss auf dem Niveau des vorherigen positiven Schlusskurses

Permanent Filter: 50 % + X müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Tagesbasis/Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Tagesbasis/Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Tagesbasis/Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 0,5 % - 2,5 % Tagesbasis

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp 5 Kerzen, wenn kein Stopp erreicht wurde.

Gewinnziel: Für die Hälfte der Position wird ein Limit Gewinnziel von 2 R in Bezug auf den Anfangsstopp gesetzt.

Positionsgröße: 1 % des Kontovolumens : Punktabstand des Anfangsstopp = Stückzahl

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

UMKEHR SYSTEM

Setup: Verknüpfte If-Done Order.

Wenn die Stopp Buy Order ausgelöst wird, dann wird automatisch ein Stopp Loss Auftrag für die doppelte Stückzahl auf den Anfangsstopp gelegt. Damit wird die Stückzahl gedreht für den Fall, das der Kurs sich in die konträre Richtung bewegt gedreht.

Wenn die Stopp Loss Order ausgelöst wird, dann wird automatisch ein Stopp Buy Auftrag für die doppelte Stückzahl auf den Anfangsstopp gelegt. Damit wird die Stückzahl für den Fall, das der Kurs sich in die konträre Richtung bewegt gedreht.

Die Position darf nur einmal gedreht werden, die Stopp Niveaus bleiben identisch
Die gedrehte Position erhält nur einen Liquidationsauftrag für die eingegangene Stückzahl.
Diese Liquidation Order kann auch per If-Done platziert werden.

Anfangsstopp:

Der vorherige Einstiegskurs

Trailingsstopp: Stopp wird nach jeder folgenden Kerze auf der Tief (Hoch) des Körpers der jeweiligen Kerze gezogen, bis die Position gedreht wird.

Zeitpunkt: System funktioniert am besten in Zeiten hoher Volatilität.

Eigenschaft: In einem Seitwärtsmarkt werden viele unprofitable Trades eingegangen, d.h. am besten eignet sich ein tendierender Markt. Niedrige Transaktionskosten sind ebenfalls notwendig.

Vorteil Handelssysteme allgemein:

Die Positionsdrehung kann bei jedem anderem Handelssystem verwendet werden, indem der Anfangsstopp die doppelte Stückzahl erhält.

Dies führt dazu, dass der Trade „gedreht“ wird und ich somit die richtige Position einnehme.

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

FUN AND PROFIT AUSSTIEGSSIGNALE

AUSSTIEGSSIGNAL SHORT TO COVER / LONG TO COVER

Zeitraumen: Tagesbasis / Wochenbasis

Durchschnitte: 18 Tage Durchschnitt auf Tagesbasis / Wochenbasis

Setup: Trendfilter + Chartmuster

Short to Cover:

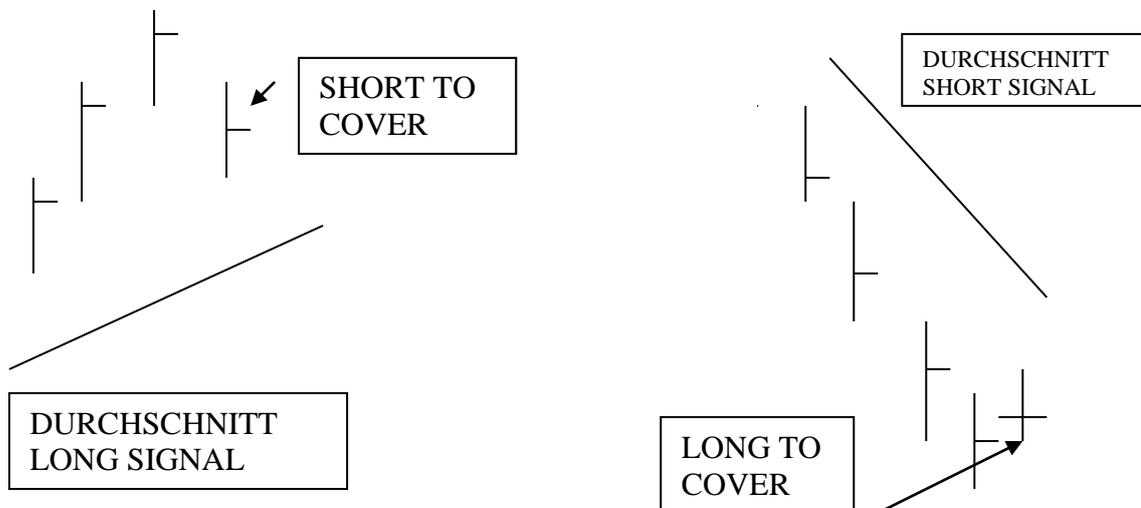
Wenn ein SHORT Signal über dem gleitenden Durchschnitt (Trendfilter) auftritt, dann ist das ein Ausstiegssignal (Short to Cover).

Long to Cover:

Wenn ein LONG Signal unter dem gleitenden Durchschnitt (Trendfilter) auftritt, dann ist das ein Ausstiegssignal (Long to Cover).

Ausstiegssignal:

Dieses Szenario bietet nur ein Ausstiegssignal zum decken (covern) einer offenen Position, aber für ein Einstiegssignal müssen gleitender Durchschnitt (Trendfilter) und Chartmuster die gleiche Richtung anzeigen.



AUSSTIEGSSIGNAL ROTE AMPEL

Zeitraumen: Tagesbasis

Setup: Trendfilter + Chartmuster

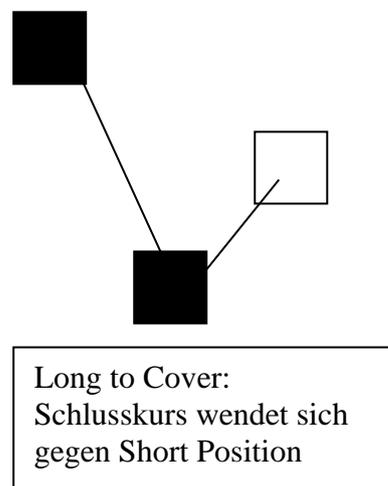
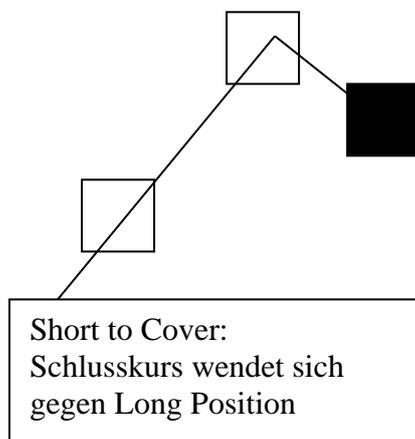
Charting: Punktchart

Long to Cover / Short to Cover:

Wenn Punktfarbe (17:45 XETRA - Schlusskursbasis) sich gegen die Trendrichtung meiner offenen Position wendet, dann wird der Rote Ampel Stopp aktiviert.

Ausstiegssignal:

Dieses Szenario bietet ein Ausstiegssignal zum decken (covern) einer offenen Position.



Ausführung:

Market Order Parkettbörse nach Feststellung des 17: 45 Uhr XETRA Schlusskurs

AUSSTIEGSSIGNAL / GEWINNMITNAHME RASIERTER KOPF

Zeitraumen: Tagessicht / Wochenbasis

Setup: Schlusskurs bei 90 % oder – 90 % der heutigen Kursspanne

Kerzen ohne oberen Schatten → Shaven Head

Kerzen ohne unteren Schatten → Shaven Bottom

Short to Cover:

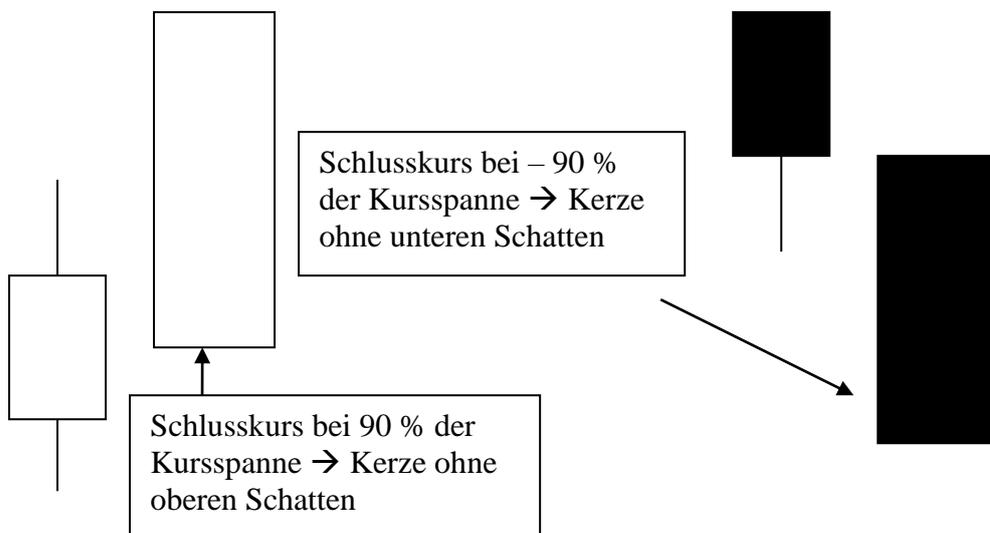
Wenn ein Shaven Head nach einer kleineren Kerze auftritt, dann wird 50% der Position gedeckt.

Long to Cover:

Wenn ein Shaven Bottom nach einer kleineren Kerze auftritt, dann wird 50 % der Position gedeckt.

Ausstiegssignal:

Dieses Szenario bietet nur ein Ausstiegssignal zur Gewinnmitnahme von 50 % der Position. Gewinnmitnahme an guten Tagen. Der Rest der Position wird per Zeitstopp oder Trailingsstopp gedeckt.



Idee:

Die Märkte bilden Tiefpunkte aus, indem die Schlusskurse nahe am Tageshoch liegen.

Die Märkte bilden Hochpunkte aus, indem die Schlusskurse nahe am Tageshoch liegen.

Nach einer großen Kursspanne ist es wahrscheinlich, dass die Volatilität kleiner wird.

AUSSTIEGSSIGNAL TRENDLINIE EXIT

Setup:

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein höheres Tief als die vorherige Kerze haben.

Bilde eine Steigungsgerade der beiden steigenden Tiefs.

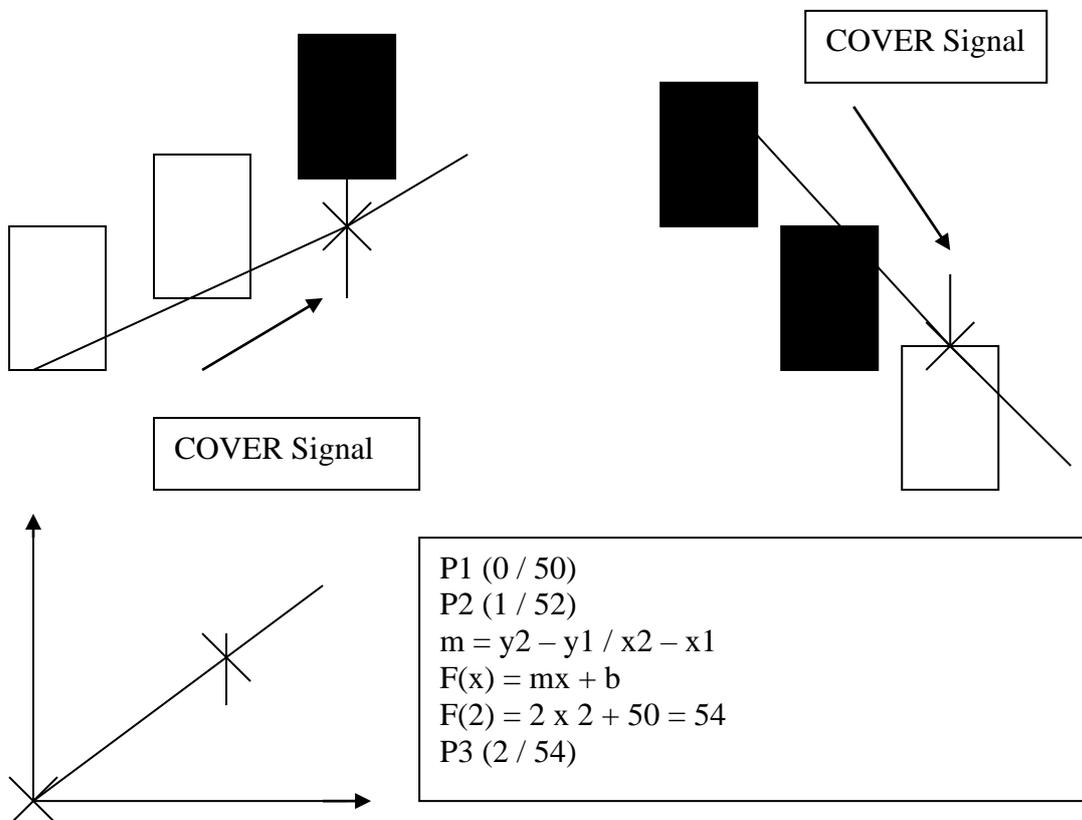
Berechne den nächsten Punkt. per Formel: $f(x) = mx + b$

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein tieferes Hoch als die vorherige Kerze haben.

Bilde eine negative Steigungsgerade der bei beiden fallenden Hoch.

Berechne den nächsten Punkt per Formel: $f(x) = mx + b$

Steigungswinkel: Taschenrechner: SHIFT - Taste / tan - Taste / m = Steigung



Short to Cover:

Wenn das folgende Tief die Steigungsgerade nach unten schneidet, dann zum Freitagsschlusskurs SHORT to COVER

Long to Cover:

Wenn das folgende Tief die negative Steigungsgerade nach oben schneidet, dann zum Freitagsschlusskurs LONG to COVER

Ausstiegssignal:

Dieses Szenario bietet ein Ausstiegssignal zum decken (covern) der Position.

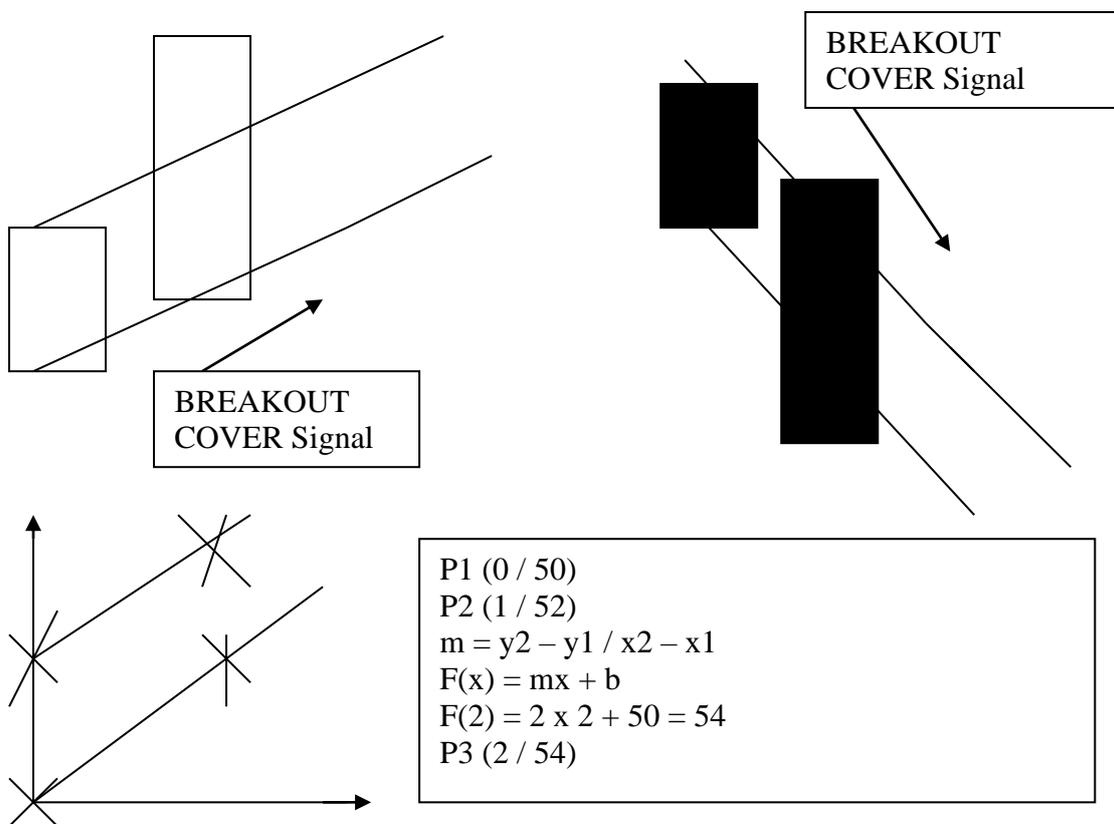
GEWINNMITNAHME TRENDKANAL BREAKOUT

Setup:

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein höheres Tief als die vorherige Kerze haben.
 Bilde eine Steigungsgerade der beiden steigenden Tief(Hoch)punkte.
 Berechne den nächsten Punkt. per Formel: $f(x) = mx + b$

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein tieferes Tief als die vorherige Kerze haben.
 Bilde eine negative Steigungsgerade der bei beiden fallenden Tief(Hoch)punkte.
 Berechne den nächsten Punkt per Formel: $f(x) = mx + b$

Steigungswinkel: Taschenrechner: SHIFT - Taste / tan - Taste / m = Steigung



Gewinnmitnahme Short to Cover:

Wenn ein Freitagsschlusskurs über dem Hoch des Trendkanals schließt, dann zum Freitagsschlusskurs 50 % des Bestands SHORT to COVER

Gewinnmitnahme Long to Cover:

Wenn ein Freitagsschlusskurs unter dem Tief des Trendkanals schließt, dann zum Freitagsschlusskurs 50 % des Bestands LONG to COVER

Ausstiegssignal:

Dieses Szenario bietet ein Signal zur Gewinnmitnahme bei starken Bewegungen.

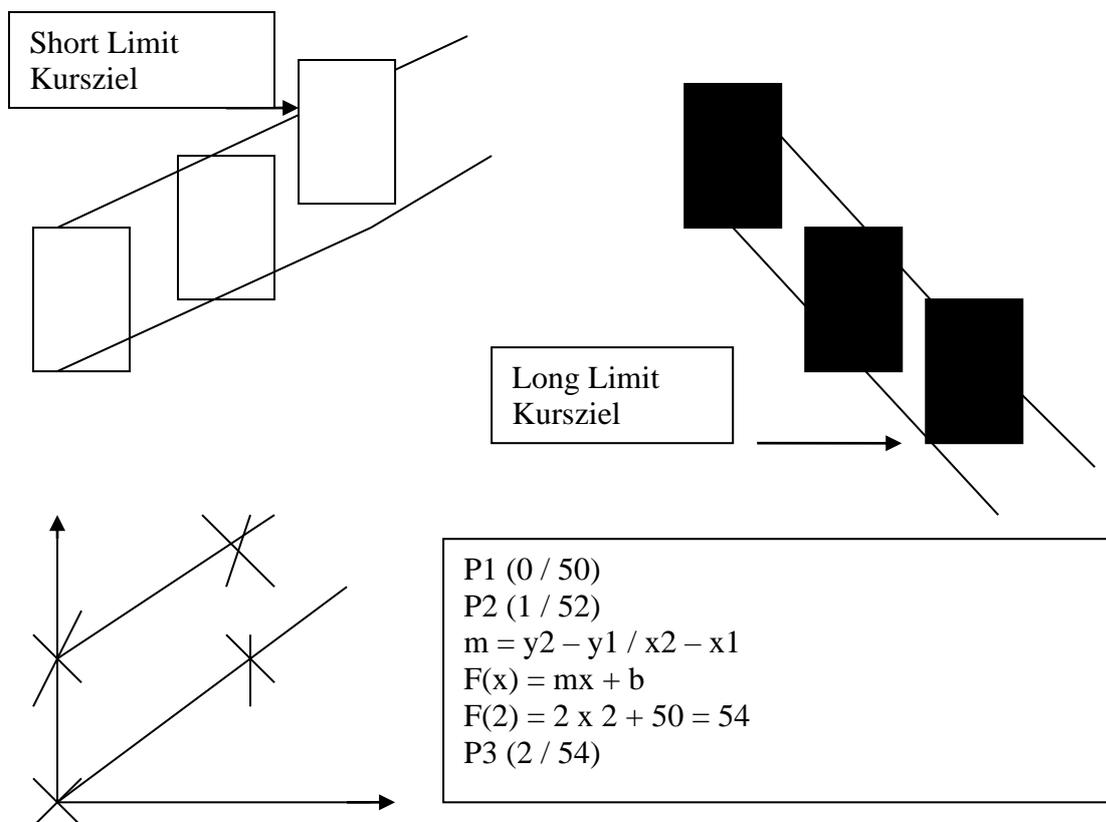
GEWINNMITNAHME KURSZIEL TRENDKANAL

Setup:

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein höheres Tief als die vorherige Kerze haben.
Bilde eine Steigungsgerade der beiden steigenden Tief(Hoch)punkte.
Berechne den nächsten Punkt. per Formel: $f(x) = mx + b$

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein tieferes Tief als die vorherige Kerze haben.
Bilde eine negative Steigungsgerade der bei beiden fallenden Tief(Hoch)punkte.
Berechne den nächsten Punkt per Formel: $f(x) = mx + b$

Steigungswinkel: Taschenrechner: SHIFT - Taste / tan - Taste / m = Steigung



Kursziel Short to Cover:

Kursziel für eine Long-Position ist die obere Begrenzung des Trendkanals
Beim Erreichen von Kursziel werden 50 % des Bestands liquidiert.

Kursziel Long to Cover:

Kursziel für eine Short-Position ist die untere Begrenzung des Trendkanals.
Beim Erreichen von Kursziel werden 50 % des Bestands liquidiert.

Ausstiegssignal:

Dieses Szenario bietet ein Signal für Kursziele bei starken Bewegungen.

AUSSTIEGSSIGNAL / GEWINNMITNAHME TRIPLE BAR BREAKOUT

Setup: Tagestrading / Wochentradning

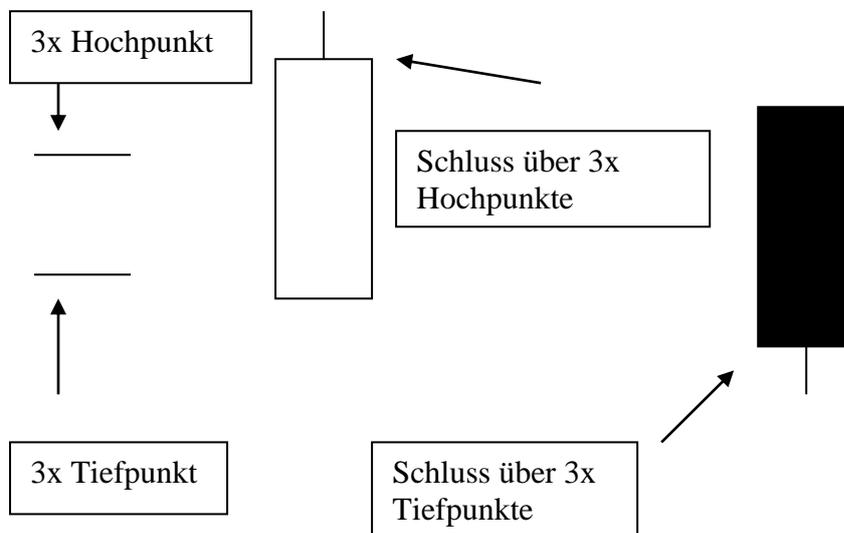
- Es wird ein gleitender Durchschnitt der letzten 3 Hochpunkte berechnet.
- Es wird ein gleitender Durchschnitt der letzten 3 Tiefpunkte berechnet.

Diese beiden Linien stellen zusammen eine Art Bollinger Band dar.

Einstieg:

Wenn der Kurs über der oberen Linie schließt, dann SHORT Einstieg nächste Eröffnungskurs

Wenn der Kurs unter der unteren Linie schließt, dann LONG Einstieg nächste Eröffnungskurs



Setup:

Schlusskurs **über** Tripple Bar Hochpunkt

Schlusskurs **unter** Tripple Bar Tiefpunkt

Short to Cover:

Wenn ein Long Tripple Bar Breakout stattfindet, dann wird 50 % der Position gedeckt.

Long to Cover:

Wenn ein Short Tripple Bar Breakout stattfindet, dann wird 50 % der Position gedeckt.

Ausstiegssignal:

Dieses Szenario bietet nur ein Ausstiegssignal zur Gewinnmitnahme von 50 % der Position.

Gewinnmitnahme an guten Tagen. Der Rest der Position wird per Zeitstopp oder

Trailingsstopp gedeckt.

FUN AND PROFIT TRADING FILTER

INTRMARKETSPREAD WOCHENTRADING

Berechnung:

$$\frac{\text{Kurs des Hauptmarktes}}{\text{Kurs des Einzelwertes}} \\ = \text{Intermarketspread}$$

Interpretation:

Vergleich des Spreads von einem Freitagsschlusskurs zum nächsten Freitagsschlusskurs zeigt relative Stärke oder Schwäche einer Aktie an

Regel: LONG Signal

Wenn der Spread sich verkleinert, dann ist die Aktie relativ stärker.
Der Sekundärmarkt muss eine Wochenperformance von mind. 0,3 % haben.

Regel. SHORT Signal

Wenn der Spread größer wird, dann ist die Aktie relativ schwächer.
Der Sekundärmarkt muss eine Wochenperformance von mind. -0,3 % haben.

Anwendung:

DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE : Einzelwert

Der DJIA 30 wird als Hauptmarkt (Benchmark) verwendet.

Einstieg:

Wenn eine Aktie die beiden Regeln erfüllt, dann erfolgt Einstieg.
Wenn ein Markt die beiden Regeln erfüllt, dann erfolgt Einstieg.

SHORT: Stopp Loss am Freitagstief / **LONG:** Stopp Buy am Freitagshoch

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief
Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 3 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

500 Aktien bei 1 Punkt Abstand. 1R= 1% des Kontovolumens

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

Zeitraumen: 1 Woche

TRENDFILTER CLOSE – CLOSE TAGESBASIS / WOCHENBASIS

Zeitraumen: Tagesbasis / Wochenbasis

Check: Täglich nach Tagesschlusskurs / Freitagsschlusskurs

Setup:

Auf einem Tageschart Chart muss der aktuelle Schlusskurs **über** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein **LONG** Signal handeln zu können.

Wenn ein **SHORT** Signal auftritt, während sich der heutige Schlusskurs **über** dem gestrigen Schlusskurs befindet, dann wird dies nur als Ausstiegssignal für offene **LONG** Positionen gehandelt, aber es werden keine **SHORT** Bestände aufgebaut.

Auf einem Tageschart Chart muss der aktuelle Schlusskurs **unter** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein **SHORT** Signal handeln zu können.

Wenn ein **LONG** Signal auftritt, während sich der heutige Schlusskurs **unter** dem gestrigen Schlusskurs befindet, dann wird dies nur als Ausstiegssignal für offene **LONG** Positionen gehandelt, aber es werden keine **SHORT** Bestände aufgebaut

Wenn der heutige Schlusskurs im Vergleich zum vorherigen Schlusskurs **unverändert** ist (- 0,3 % bis 0,3 %), dann deutet dass auf eine **BOX** hin. Wenn eine **BOX** auftritt können beide Seiten platziert werden. **LONG** am Tageshoch / **SHORT** am Tagesstief.

Idee: Trendfolge. Der Trend ist dein Freund.

Der Trendfilter verhindert, dass in einem tendenziell steigenden Markt **SHORT** Positionen eingegangen werden. Das gleiche gilt für **LONG** Positionen in einem fallenden Markt.

Chartsignale:

- Dach / Boden System
- Sommet System
- 3-5 Balken Street
- Smash Day
- Hidden Smash Day
- Narrow Range Bar
- Topping / Bottom Tails
- Ampelsystem
- Starke Kerzen
- 10 Tage / 3 Tage Ausbruch
- 5 x 5 / 4 x4 Kerzenanalyse

Aktienauswahl: DAX / MDAX > 20,00 €

Aktienselektion:

Stärkste Aktie auf Tagesbasis **LONG**

Stärkste Aktie auf Tagesbasis **SHORT**

Stückzahl: 500 Aktien pro Trade

TRENDFILTER WOCHENBASIS

Setup:

Auf einem 1 Jahreschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein **LONG** Signal handeln zu können.

Wenn ein **SHORT** Signal auftritt, während sich der Markt **über** dem 20 Tage Durchschnitt befindet, dann wird dies nur als Ausstiegssignal für offene **LONG** Positionen gehandelt, aber es werden keine **SHORT** Bestände aufgebaut.

Auf einem 1 Jahreschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein **SHORT** Signal handeln zu können.

Wenn ein **LONG** Signal auftritt, während sich der Markt **unter** dem 20 Tage Durchschnitt befindet, dann wird dies nur als Ausstiegssignal für offene **SHORT** Positionen gehandelt, aber es werden keine **LONG** Bestände aufgebaut

Idee: Trendfolge.

Der Trendfilter verhindert, dass in einem tendenziell steigenden Markt **SHORT** Positionen eingegangen werden. Das gleiche gilt für **LONG** Positionen in einem fallenden Markt.

Chartsignale:

- Dach / Boden System
- V - Formation
- 3-5 Balken Street
- Smash Day
- Hidden Smash Day
- Narrow Range Bar
- Topping / Bottom Tails
- Ampelsystem
- Starke Kerzen
- 10 Tage Ausbruch System
- Kerzenanalyse 5 X 5 / 4 X 4

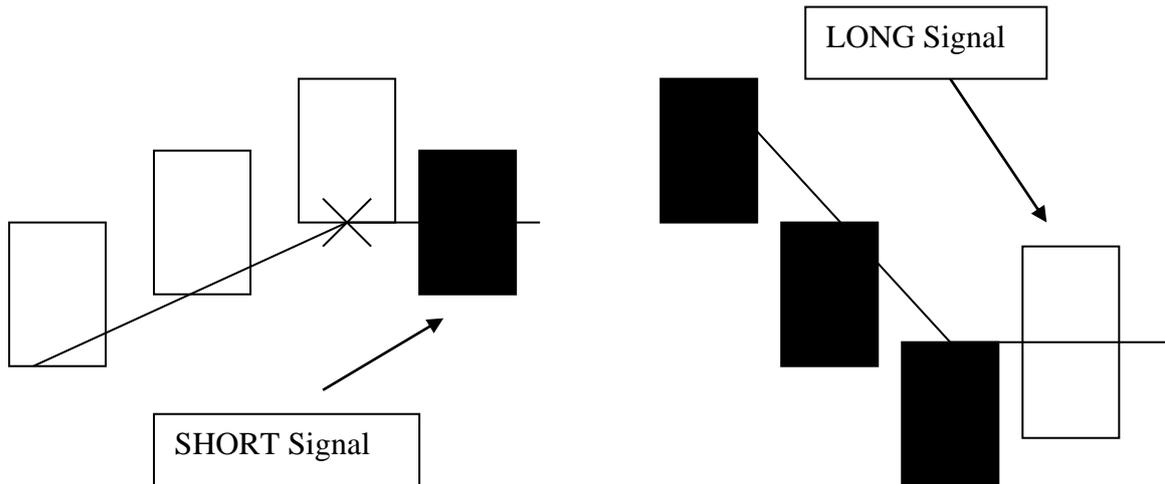
Aktienauswahl: DAX / MDAX / TECDAX / SDAX > 20,00 €

WOCHENHOCH / WOCHENTIEF TRENDLINIE

Setup:

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein höheres Tief als die Vortageskerze haben.
Sobald die Aktie einen Schlusskurs unter dem letztem Tief aufweist, dann SHORT Signal.

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein tieferes Tief als die Vortageskerze haben.
Sobald die Aktie einen Schlusskurs über dem letzten Hoch aufweist, dann LONG Signal.



Trendfilter:

Auf einem Intraday- Chart muss der aktuelle XETRA – Kurs **über** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem Intraday- Chart muss der aktuelle XETRA – Kurs **unter** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können

Einstieg:

Stopp Buy LONG Signal am Wochenhoch / Stopp Loss SHORT Signal am Wochentief

Die Einstiegsorders werden jeweils mit einem If-Done Auftrag über 1000 Aktien ausgestattet, um ggf. die Position zu drehen und im Worst-Case zu liquidieren.

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 3 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

500 Aktien bei 1 Punkt Abstand. 1R= 1% des Kontovolumens

INVESTMENT - TRENDFILTER 200 TAGE DURCHSCHNITT

Chartrahmen: 200 Tage Durchschnitt auf 5 Jahrescharts

Setup:

Der 200 Tage Durchschnitt muss im Vergleich zum Vorjahr gestiegen sein.
Wenn die Position zum 1. Januar eingegangen wird, dann muss der 200 Tage Durchschnittspreis des Vorjahres unter dem aktuellen Preis liegen.

Das gleiche gilt, für jeden beliebigen Monatsanfang im Jahr (1 April 2010 – 1. April 2009) wird der aktuelle Durchschnitt mit dem genau vor 1 Jahr verglichen.

Der SMA 200 Check kann für alle Aktien am 1. Handelstages des Monats verwendet werden.

Einstieg:

aktueller SMA 200 – Vorjahres SMA 200 = entweder positiv oder negativ

Wenn das Ergebnis positiv ist, dann gilt es als LONG Signal.

Wenn das Ergebnis negativ ist, dann gilt es als SHORT Signal.

Aktienakkumulation:

Am **1. Handelstag** von jedem Monat (zu Tradingzeiten 10:00 / 16:00 / 21:00 Uhr CET)

$10.000 \text{ €} \times 12 \text{ Monate} = 120.000 \text{ € per anno}$

$1/12 \times 12 \text{ Monate} = 100 \% \text{ per anno}$

Jede 10.000 € Tranche darf maximal auf 1 Einzelwert verteilt werden (Konzentration).

Eine Position, die einen Buchverlust aufweist darf nicht vergrößert werden (kein Verbilligen).

Der Einsatz für eine Position darf von Monat zu Monat höchstens verdoppelt werden, wenn die Aktie einen Buchgewinn von mind. 10 % aufweist und weiterhin einen steigenden 200 Tage Durchschnitt im Vergleich zum Vorjahr aufweist.

Stops:

Anfangsstopp ist 10 % vom Einstiegskurs für jede Tranche → **Einstiegskurs – 10 %**

Jeder neue Einstieg erhält seinen eigenen Anfangsstopp.

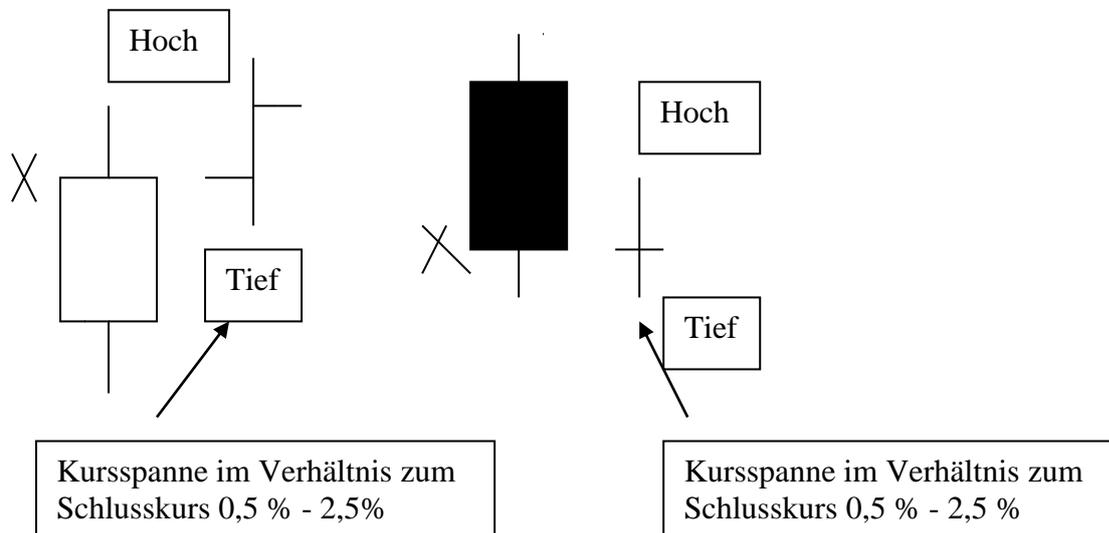
Monatscheck: Wenn eine Aktie auf Monatsbasis (Check 1. Handelstag des Monats) sich unter dem aktuellen 200 SMA befindet, dann wird die Position liquidiert.

Am Ende des Jahres erfolgt Gewinnmitnahme per Gewinnmitnahme Modell: Jahressicht
Aktien siehe Investmentplan.

Idee: Der gleitende Durchschnittspreis repräsentiert einen geglätteten Kursverlauf. Dadurch ist Trenderfassung bei einem steigenden Durchschnittspreis eindeutiger. Vor allem verhindert dieser Ansatz den Einstieg in einen fallenden Markt.

VOLATILITÄTS FILTER AKTIEN / TAGESTRADING

Setup: Die Kursspanne (Hoch – Tief) der Einstiegskerze muss im Vergleich zum Vortagesschlusskurs zwischen 0,5 Prozent und 2,5 Prozent liegen.



Idee: Wenn die Kursspanne größer ist, dann ist Anfangsstopp zu weit vom Markt entfernt. Ein Gewinnziel von 2 R ist realistisch. Einstieg bei relativ kleiner Volatilität.

Nominalwert:

Bei einer 100,00 € Aktie eine Kursspanne zwischen 0,50 – 2,50 €

Bei einer 50,00 € Aktie eine Kursspanne zwischen 0,25 – 1,25 €.

Bei einer 20,00 € Aktie eine Kursspanne zwischen 0,10 – 0,50 €

VOLATILITÄTS FILTER AKTIEN / WOCHENTRADING

Setup: Die Kursspanne (Hoch – Tief) der Einstiegskerze muss im Vergleich zum Vortagesschlusskurs zwischen 1 Prozent und 5 Prozent liegen.

Idee: Wenn die Kursspanne größer ist, dann ist Anfangsstopp zu weit vom Markt entfernt. Ein Gewinnziel von 2 R ist realistisch. Einstieg bei relativ kleiner Volatilität.

Nominalwert:

Bei einer 100,00 € Aktie eine Kursspanne zwischen 1,00 – 5,00 €

Bei einer 50,00 € Aktie eine Kursspanne zwischen 0,50 – 2,50 €.

Bei einer 20,00 € Aktie eine Kursspanne zwischen 0,20 – 1,00 €

VOLUMEN-SPITZEN

Einstiegssetup: Eine Volumenspitze tritt dann auf, wenn ein Volumenstab, rechts und links von sich 2 kleinere Volumenstäbe hat.

Idee: Das spricht für einen Anstieg des Volumens und der darauffolgenden Abschwächung des Volumens. Ein hohes Volumen steht dafür, dass viele Papiere den Besitzer wechseln. Meisten von starken Händen zu den schwachen Händen.

Zeitraumen: Tageschart

Kombination: Eine Volumenspitze kann als Filter für andere Einstiegssetups fungieren. Vor allem bei der Dach/Boden Formation ist eine Volumenspitze eine weitere Bestätigung einer bevorstehenden Kurswende.

Stops: Es werden die Stops des kombinierten Handelssystems verwendet, die auf den Kursdaten(Chartdaten) basieren.

Positionsgröße: 500 Aktien → 1 R entspricht 1 % des Kontovolumens.

Orderplatzierung: Nach dem Tagesschlusskurs

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

VOLUMEN-EXPLOSION

Einstiegssetup: Ein Volumenausbruch tritt dann auf, wenn ein Volumenstab im Vergleich zum vorherigen Volumenstab mindestens 50 % größer ausfällt.

Idee: Das spricht für einen Anstieg des Volumens. Ein hohes Volumen steht dafür, dass viele Papiere den Besitzer wechseln. Meisten von starken Händen zu den schwachen Händen.

Zeitraumen: Tageschart / Wochenchart

Kombination: Ein Volumenausbruch kann als Filter für andere Einstiegssetups fungieren. Vor allem bei Momentum Strategien wie Smash Day / Mega Kerzen / Starke Kerzen

Stops: Es werden die Stops des kombinierten Handelssystems verwendet, die auf den Kursdaten(Chartdaten) basieren.

Positionsgröße: 500 Aktien → 1 R entspricht 1 % des Kontovolumens.

Orderplatzierung: Nach dem Tagesschlusskurs

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

TIMES AND SALES SCAN - TAGESSICHT

Setup:

Scanne den Tagesverlauf vom fortlaufenden Handel einer Aktie und identifiziere das Kursniveau an dem die meisten Stücke gehandelt wurden.

Einstieg:

Wenn Schlusskurs **unter** diesem Niveau liegt, dann liegt ein SHORT Signal vor.

Wenn Schlusskurs **über** diesem Niveau liegt, dann liegt ein LONG Signal vor.

Trendfilter:

Dieser „Volumengewichteter Durchschnitt“ können im Chart als eine Art Simple Moving Average dargestellt werden.

Bewertung:

Ausgenommen von der Bewertung sind der Eröffnungskurs und der Schlusskurs, da hier generell die meisten Stücke gehandelt werden. Der Verlauf des fortlaufenden Handels zeigt aber die wahre Verfassung des Marktes.

TIMES AND SALES SCAN - INTRADAY

Setup:

Scanne jede Stunde des fortlaufenden Handels nach dem Kurs, der das größte Volumen aufweist. Wenn der aktuelle Kurs über dem Niveau des größten Handels liegt, dann LONG. Wenn der aktuelle Kurs unter dem Niveau des größten Handel liegt, dann SHORT.

Nach der 2. Stunde wird ein Durchschnittspreis der beiden größten Volumen pro Stunde gebildet. Es wird zu diesem Durchschnitt, jede Stunde ein weiteres Kursniveau mit dem größten Handel für die nächste Stunde hinzugefügt.

Dieser Durchschnittspreis kann als volumengewichteter Durchschnittspreis verwendet werden.

Trendfilter

Der volumengewichtete Durchschnittspreis kann als gleitender Durchschnitt im Chart verwendet werden.

Einstieg:

Das Schneiden des Kurses von oben nach unten SHORT (unten nach oben LONG) des volumengewichteten SMA kann wie bei normalen Durchschnitten als Einstiegstechnik dienen.

Bewertung

Ausgenommen von der Bewertung sind der Eröffnungskurs und der Schlusskurs, da hier generell die meisten Stücke gehandelt werden. Der Verlauf des fortlaufenden Handels zeigt aber die wahre Verfassung des Marktes.

TREND + ZYKLIK

Setup:

1 Woche in 5 Tageschartkerzen unterteilen und Verhältnis auflisten.

Grün	Rot
3	2
4	1
2	3
0	4

Einstieg: Wenn Farbe der Wochenkerze mit dem Tagesverhältnis übereinstimmt, dann wird Position in Trendrichtung eröffnet.

Verhältnis:

50 % + X → Mindestens 3 / 2 für eine Seite.

Stopps:

Anfangsstopp wird mit 1 Punkt Abstand zum Einstiegskurs gesetzt

Ausgleichsstopp wird nach 1 Woche benutzt, falls der Kurs im Plus ist

Trailingstopp wird nach der zweiten Gewinnkerze unter das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gesetzt und bei weiteren Gewinnkerzen nachgezogen

Zeitstopp wird benutzt, wenn kein Stopp nach 5 Sitzungen erreicht wird.

Zeitraumen: 1 Woche wird in 5 Tage unterteilt.

Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können

Positionsgröße:

500 Aktien → 1 R = 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

ÜBERKAUFTE / ÜBERVERKAUFTE ANTIZYKLIK

Setup:

1 Woche in 5 Tageschartkerzen unterteilen und Verhältnis auflisten.

Tagesverhältnis mind. 80 % für eine Seite.

Grüne Kerze bringt 1 Punkt für Grün/

Rote Kerze bringt 1 Punkt für Rot/

Doji bringt 0 Punkte/

Grün	Rot
5	0
4	1
0	5
1	4

Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Einstieg: Wenn das Tagesverhältnis der Wochenkerze mindestens 80 % zu einer Seite tendiert, dann wird Position in Gegenrichtung eröffnet.

LONG: Hoch der Freitagskerze

SHORT: Tief der Freitagskerze

Stopps:

Anfangsstopp wird mit 1 Punkt Abstand zum Einstiegskurs gesetzt

Ausgleichsstopp wird nach 1 Woche benutzt, falls der Kurs im Plus ist

Trailingstopp wird nach der zweiten Gewinnkerze unter das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gesetzt und bei weiteren Gewinnkerzen nachgezogen

Zeitstopp wird benutzt, wenn kein Stopp nach 5 Sitzungen erreicht wird.

Zeitraumen: 1 Woche

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

TEMPO SYSTEM

Chartansicht: Punktchart

Zeitraumen: Wochenbasis / Tagesbasis

Tempo:

$$\frac{\text{Heutiger(aktueller) Punktabstand} - \text{Gestriger(vorheriger) Punktabstand}}{\text{Zeit(2 Sitzungen)}}$$

Wenn Ergebnis im positiven Bereich liegt, dann nimmt Tempo zu

Wenn Ergebnis gleich 0 (Null) ist, dann bleibt das Tempo gleich.

Wenn Ergebnis negativ ist, dann bremst der Markt.

Setup:

Einstieg in Trendrichtung, wenn Tempo im positiven Bereich liegt.

Einstieg gegen Trendrichtung, wenn Tempo im negativen Bereich liegt.

Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Einstieg:

LONG aktuelles Kerzenhoch

SHORT aktuelles Kerzentief

Stops:

Anfangsstopp wird mit 1 Punkt Abstand vom Einstieg beim Broker gesetzt

Ausgleichsstopp wird nach der ersten Gewinnkerze benutzt

Trailingstopp wird nach der zweiten Gewinnkerze unter das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gezogen. Dieses Spiel wird nach jeder weiteren Kerze wiederholt. Der TrailingStopp wird nur zu meinen Gunsten verschoben

Zeitstopp: Wenn nach 5 Kerzen kein Stopp gegriffen hat, wird Position nach 5 Sitzungen liquidiert.

Chart: Geschwindigkeitscharts als Oszillator mit Nulllinie in der Mitte

Charting: Das System ist mit der Bewertung immer unmittelbar am aktuellen Marktgeschehen und vernachlässigt historische Daten. Der Vorteil liegt darin, dass wenige, aber dafür relevante Informationen verwendet werden.

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens

INDEX - FILTER MARKTBREITE / PERFORMANCE

Marktbreite Setup: Wochenbasis

Scanne die gesamte Marktbreite nach Gewinner/Verlierer/Remis.

Für den deutschen Markt kann die gesamte DAX Familie bewertet werden, für den amerikanischen Markt können der S&P 500, DJIA, NASDAQ Composite oder die Aktien, die an der NYSE gehandelt werden, als Marktbreite dienen.

Scanne einen Index auf Gewinner/Verlierer Verhältnis (Tabelle)

Wenn Gewinner Seite mehr Aktien hat(mind. 51%) dann LONG Signal

Wenn Verlierer Seite mehr Aktien hat(mind. 51%) dann SHORT Signal

Unverändert bedeuten Null Punkte

Bei Unentschieden gemischter Markt → BOX

Indexfilter Wochenbasis:

Wenn der Index Filter ein LONG Signal liefert, dann werden nur LONG Signale bei Aktien wahrgenommen.

Wenn der Index Filter ein SHORT Signal liefert, dann werden nur SHORT Signal bei Aktien wahrgenommen.

American Setup: Tagesbasis

Wenn ein amerikanischer Index (DJIA) auf Tages-Schlusskursbasis mind. 0,3 % Rendite aufweist, dann werden nur LONG Positionen getradet.

Wenn ein amerikanischer Index (DJIA) auf Tagesschlusskursbasis mind. -0,3 % Rendite aufweist, dann werden nur SHORT Positionen getradet.

Wenn ein amerikanischer Index(DJIA) auf Tageschlusskursbasis unverändert ist, dann werden für diesen Tag keine Positionen getradet.

Indexfilter Tagesbasis:

Uhrzeit: 22:30 Uhr nach USA Tagesschlusskurs

LONG + SHORT Kandidaten am Deutschen Markt werden auf den Indexfilter gescannt.

Wenn der Indexfilter ein LONG Signal liefert, dann werden für den nächsten Tag nur LONG Signale wahrgenommen.

Wenn ein Indexfilter ein SHORT Signal liefert, dann werden für den nächsten Tag nur SHORT Signale wahrgenommen

STEIGUNGSWINKEL FILTER

Zeitraumen: Tagesbasis / Wochenbasis

Setup: Scanne Aktien die einen Steigungswinkel von mindestens 45 Grad haben.
Scanne Aktien die einen negativen Steigungswinkel von mindestens - 45 Grad haben

Berechnung:

Vergleich den aktuellen Schlusskurs mit dem vorherigen Schlusskurs

P1 (0 / 50)

P2 (1 / 52)

Steigung

$$m = \frac{y_2 - y_1}{x_2 - x_1}$$

Funktionsgerade

$$f(x) = mx + b$$

$$f(2) = 2 \times 2 + 50 = 54$$

P3 (2 / 54)

Steigungswinkel

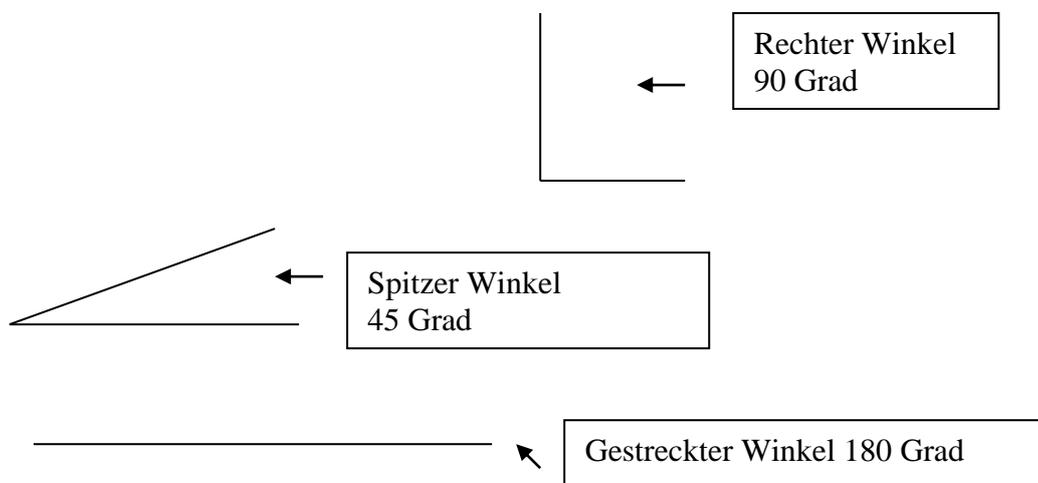
$$\alpha = \arctan(m)$$

$$m = 2$$

$$\alpha = 63 \text{ Grad}$$

Taschenrechner: SHIFT - Taste / tan - Taste / m = Steigung

Minimale Steigung: m = 1,00 Steigungswinkel = 45 Grad



Idee: Dieser Filter bietet Chancen, wenn der Markt in eine Richtung explodiert.

TERMINGESCHÄFTE V-DAX FILTER WOCHENBASIS

Setup I:

Kauf von Optionsscheinen Call / Put wird durch den V-DAX gefiltert.

Optionsscheinfiler:

Einstieg nur, wenn V-DAX Freitagsschlusskurs **unter** 18 Tage Durchschnitt liegt.

Idee Optionsscheinkäufer:

Einstieg bei ruhigen und euphorischen Markt. Kein Einstieg an panischen Tagen.
Anstieg der Volatilität bietet zusätzlich Gewinnchancen.

Setup II:

Verkauf von Optionen Call / Put wird durch den V-DAX gefiltert.

Stillhalter Filter:

Einstieg als Stillhalter, wenn V-DAX Freitagsschlusskurs **über** 18 Tage Durchschnitt liegt.

Idee Stillhalter:

Verkauf von Optionen an panischen Tagen.
Abfall der Volatilität bietet zusätzlich Gewinnchancen.

Setup III:

Kauf von DAX- Aktien wird durch den V-DAX gefiltert.

Aktien Filter:

Kauf von DAX – Aktien, wenn V-DAX auf Wochenschlusskurs **über** 18 Tage Linie schließt

Idee: Kauf von Aktien bei Panik

FUN AND PROFIT TRADING STYLEZ

PROFESSIONEL SPREADING TAGESSICHT / WOCHENSICHT

Setup: Körper der Kerze

Schlusskurs – Eröffnungskurs = negative oder positive Bewegung

Check: Börsenschluss

Aktiensauswahl: DAX / MDAX / TECDAX / SDAX

Signal:

Aktie mit größter positiver Bewegung in Prozent **LONG**

Aktie mit größter negativer Bewegung in Prozent **SHORT**

Einstieg:

Stopp Buy LONG Signal am Balkenhoch / Stopp Loss SHORT Signal am Balkentief

Die Einstiegsorders werden jeweils mit einem If-Done Auftrag über 1000 Aktien ausgestattet, um ggf. die Position zu drehen und im Worst-Case zu liquidieren.

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

500 Aktien bei 1 Punkt Abstand. 1R= 1% des Kontovolumens

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können

Positionsgröße:

1 R = 1 % des Kontovolumens / 2 x 500 Stück = 1000 Stück oder 50.000 €

INTER-BRANCHEN SPREAD

Berechnung:

$$\frac{\text{Kurs des Branchenführers}}{\text{Kurs des Konkurrenten}} \\ = \text{Inter Branchen Spread}$$

Interpretation:

Vergleich des Spreads von einem zum nächsten Zeitraum(Kerze) zeigt relative Stärke oder Schwäche eines Konkurrenz Aktie an

Regel:

Wenn der Spread sich verkleinert, dann ist der Konkurrent relativ stärker;
Wenn der Spread größer wird, dann ist der Konkurrent relativ schwächer

Anwendung:

Branchenführer einer Branche mit Konkurrenten derselben Branche vergleichen.

Einstieg: Gleichzeitiger Einstieg

Im stärkeren Markt LONG ; im schwächeren Markt SHORT

Stopps:

Anfangsstopp wird aktiviert, wenn sich der Spread 1000 € gegen mich wendet

Trailingstopp wird aktiviert, wenn das Spreadverhältnis sich gegen mich wendet

Zeitstopp wird nach 3 Sitzungen aktiviert, wenn kein anderer Stopp gepackt hat

Ausstieg:

Der Spread MUSS komplett liquidiert werden (beide Seiten)

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens je Seite

Zeitraumen: 1 Woche

Branchen:

Banken: Deutsche Bank / Commerzbank

Chemie: BASF / Kali und Salz

Auto: Daimler / BMW oder Daimler / VW

Technologie: SAP / Infineon

Staat: Dt. Telekom / Dt. POST

Versorger: EON / RWE

MORNING / NIGHT ATTACK SPREADING

Check: 10:00 / Börsenschluss

Setup:

Checke die Differenz zwischen dem Kurs nach der 1. Handelsstunde und dem Schlusskurs.

aktueller Schlusskurs – Kurs um 10:00 Uhr
= negative oder positive Bewegung

Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Einstieg:

Aktie mit größter positiver Bewegung zum Schlusskurs **LONG**
Aktie mit größter negativer Bewegung zum Schlusskurs **SHORT**

Positionsgröße:

1 R = 1 % des Kontovolumens / 500 Stück oder 50.000 € je Seite

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

TRIPPLE BAR DURCHSCHNITT TRENDFOLGE FILTER / SYSTEM

Setup: Wochenbasis

- Es wird ein gleitender Durchschnitt der letzten 3 Hochpunkte berechnet.
- Es wird ein gleitender Durchschnitt der letzten 3 Tiefpunkte berechnet.

Diese beiden Linien stellen zusammen eine Art Bollinger Band dar.

Einstieg:

Wenn der Durchschnitt der letzten 3 Hochpunkte und der letzten 3 Tiefpunkte im Vergleich zum Vortag fällt steigt, dann LONG Einstieg per Stopp Buy am Freitagshoch

Wenn der Durchschnitt der letzten 3 Hochpunkte und der letzten 3 Tiefpunkte im Vergleich zum Vortag fällt, dann SHORT Einstieg per Stopp Buy am Freitagstief

Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist der Durchschnitt der letzten 3 Tiefsturse
Anfangsstopp SHORT Position ist der Durchschnitt der letzten 3 Höchsturse.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 3 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße: 1R= 1% des Kontovolumens

Durchschnitt der letzten 3 Höchsturse – Durchschnitt der letzten 3 Tiefsturse
1 % des Kontovolumens

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

TRIPPLE BAR DURCHSCHNITT LIMIT - TRADING

Setup: Wochenbasis

- Es wird ein gleitender Durchschnitt der letzten 3 Hochpunkte berechnet.
- Es wird ein gleitender Durchschnitt der letzten 3 Tiefpunkte berechnet.

Diese beiden Linien stellen zusammen eine Art Bollinger Band dar.

Einstieg:

Wenn der Kurs die obere Linie berührt, dann SHORT Einstieg per Limitverkauf

Wenn der Kurs die untere Linie berührt, dann LONG Einstieg per Limitkauf.

Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist der 50 % Abstand zu Durchschnitt der letzten 3 Tiefstkurse

Anfangsstopp SHORT Position ist der 50 % Abstand zu Durchschnitt der letzten 3 Höchstkurse

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 3 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

1R= 1% des Kontovolumens

Durchschnitt der letzten 3 Höchstkurse – Durchschnitt der letzten 3 Tiefstkurse
1 % des Kontovolumens

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

TRIPLE BAR VOLATILITÄTS - SPREADING

Setup: Analysiere den Abstand(Differenz) zwischen Tripple Bar Hoch und Tripple Bar Tief.

Idee: Wenn der Abstand zwischen dem Durchschnitts Hoch und dem Durchschnitts Tief relativ zum vorherigen Abstand kleiner wird, dann bedeutet das eine abnehmende Vola.

Wenn der Abstand zwischen dem Durchschnitts Hoch und dem Durchschnitts Tief im Vergleich zum vorherigen Abstand größer wird, dann bedeutet das eine ansteigende Vola.

Einstieg:

Der Einstieg bei abnehmender (kleinerer) Vola ist bei LONG / SHORT vorzuziehen.

Steigende Vola:

Der Einstieg bei ansteigender Vola ist von Hektik/Panik geprägt.

Triple Bar Stopps:

Anfangsstopp LONG Position ist der Durchschnitt der letzten 3 Tiefstkurse
Anfangsstopp SHORT Position ist der Durchschnitt der letzten 3 Höchstkurse.

Idee: Wenn der Abstand zwischen Hoch und Tief kleiner wird, dann ist auch der Anfangsstopp näher am Markt, somit entsteht ein besseres Chance – Risiko Verhältnis.

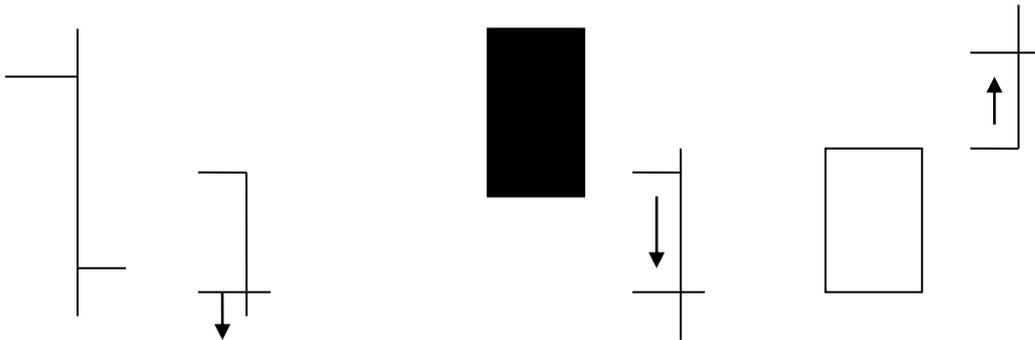
SCHWANKUNGSBREITE 50 % WOCHENBASIS

Setup: Eröffnungskurs Montag

Schwankungsbreite der vorherigen Woche (Hoch-Tief) ermitteln.
Nehmen Sie nun 50 % der Schwankungsbreite (Wochenkerze) und klammern Sie den heutigen Eröffnungskurs um diesen Betrag ein. 5 Minuten nach Eröffnung.

Einstieg:

Der obere Wert ist Kaufsignal (LONG) / Der untere Wert (SHORT)



Permanent Filter: $50\% + X$ müssen zu einer Seite tendieren

- Intermarketspreads DJIA : Basiswert Wochenbasis
- 20 – Tage Durchschnitt Wochenbasis
- Tripple Bar Trendfolge Filter Wochenbasis
- Steigungswinkel Wochenbasis

Volatilitäts-Filter: 1 % - 5 % Wochenbasis

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief
Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach der 1. Gewinnkerze verwendet, sprich um den Buchgewinn nachgezogen.

Zeitstopp wird nach 5 Sitzungen aktiviert

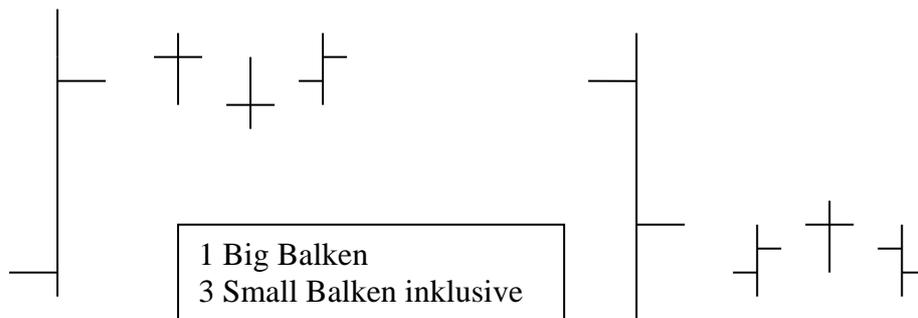
Positionsgröße: $1R = 1\%$ des Kontovolumens

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

3er L – FORMATION WOCHENBASIS

Setup: Die L-Formation besteht aus 1 großen positiven Balken und 3 relativ kleineren Balken, die sich alle innerhalb der Kursspanne des großen Balkens befinden.

Die Minus L-Formation besteht aus 1 großen negativen Balken und 3 relativ kleineren Balken, die sich alle innerhalb der Kursspanne des großen Balkens befinden.



Trendfilter:

Auf einem Intraday- Chart muss der aktuelle XETRA – Kurs **über** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem Intraday- Chart muss der aktuelle XETRA – Kurs **unter** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können

Einstieg:

LONG: Stopp Buy am aktuellen Tageshoch

SHORT: Stopp Loss am aktuellen Tagestief

Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position das vorherige Tagestief

Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen das vorherige Tageshoch

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Tageskerzen

Positionsgröße:

1R= 1% des Kontovolumens

Abstand zum Kerzenhoch(tief) / 1 % des Kontovolumens

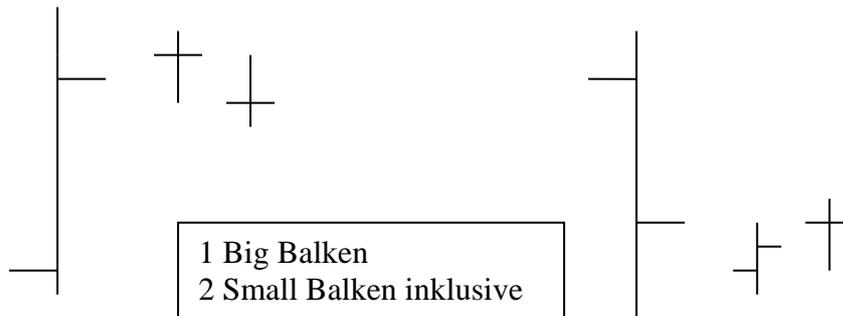
Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

Idee: Starke Abnahme der Volatilität / Dreiecksformation

KLEINE 2er L – FORMATION WOCHENBASIS

Setup: Die L-Formation besteht aus 1 großen positiven Balken und 2 relativ kleineren Balken, die sich alle innerhalb der Kursspanne des großen Balkens befinden.

Die Minus L-Formation besteht aus 1 großen negativen Balken und 2 relativ kleineren Balken, die sich alle innerhalb der Kursspanne des großen Balkens befinden.



Trendfilter:

Auf einem Intraday- Chart muss der aktuelle XETRA – Kurs **über** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem Intraday- Chart muss der aktuelle XETRA – Kurs **unter** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können

Einstieg:

LONG: Stopp Buy am aktuellen Tageshoch

SHORT: Stopp Loss am aktuellen Tagestief

Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position das vorherige Tagestief

Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen das vorherige Tageshoch

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Tageskerzen

Positionsgröße:

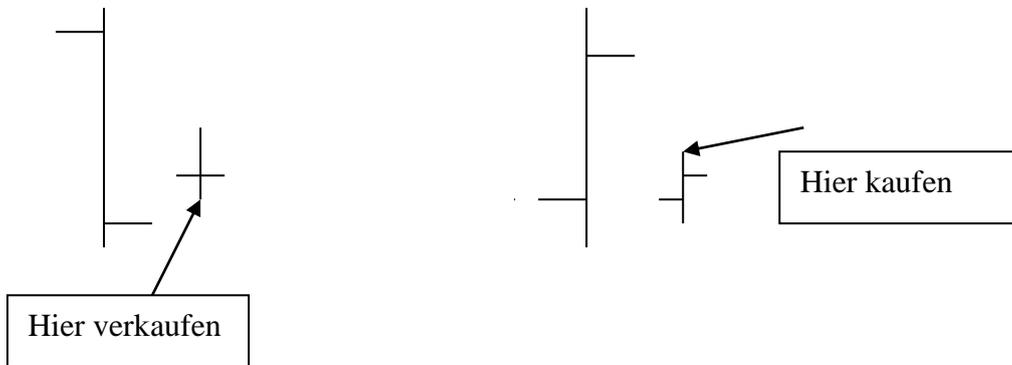
1R= 1% des Kontovolumens

Abstand zum Kerzenhoch(tief) / 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

INSIDE WOCHE MUSTER WOCHENBASIS

Setup: Eine Inside Woche tritt auf, wenn sich ein Balken komplett in der Kursspanne des vorherigen Balkens befindet.



Trendfilter:

Auf einem Intraday- Chart muss der aktuelle XETRA – Kurs **über** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem Intraday- Chart muss der aktuelle XETRA – Kurs **unter** dem gestrigen Schlusskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können

Einstieg: Wochenbasis

Stopp Buy LONG Signal am Balkenhoch / Stopp Loss SHORT Signal am Balkentief

Die Einstiegsorders werden jeweils mit einem If-Done Auftrag über 1000 Aktien ausgestattet, um ggf. die Position zu drehen und im Worst-Case zu liquidieren.

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle Kerzentief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle Kerzenhoch.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnerkerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Kerzen, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

1000 Aktien bei 1 Punkt Abstand. 1R= 1% des Kontovolumens

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

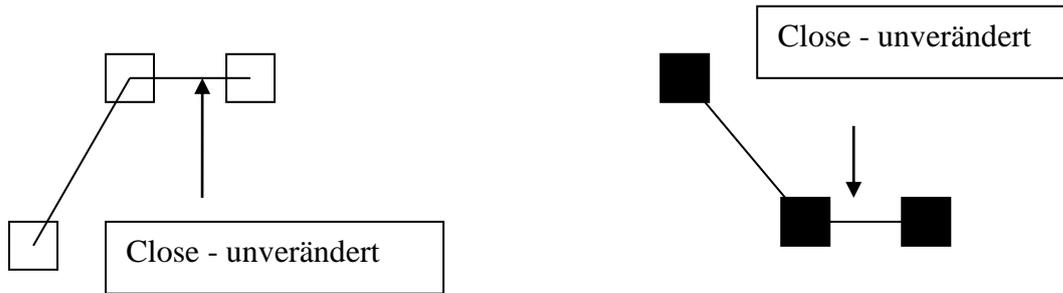
Idee: Starke Abnahme der Vola

REMIS SYSTEM TAGESBASIS

Chartansicht: Punktchart

Setup:

Scanne Aktien, die vom vorherigen Schlusskurs bis zum aktuellen Schlusskurs eine unveränderte Rendite aufweisen. (Veränderung: - 0,3 % bis 0,3 %)



Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Einstieg:

LONG: Stopp Buy am aktuellen Tageshoch
SHORT: Stopp Loss am aktuellen Tagestief

Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position das vorherige Tagestief
Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen das vorherige Tageshoch

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 3 Tageskerzen

Positionsgröße:

1R= 1% des Kontovolumens
Abstand zum Kerzenhoch(tief) / 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

FIBONACCI AKKUMULATION WOCHENBASIS

Basiswerte: Limit Einstieg Aktien

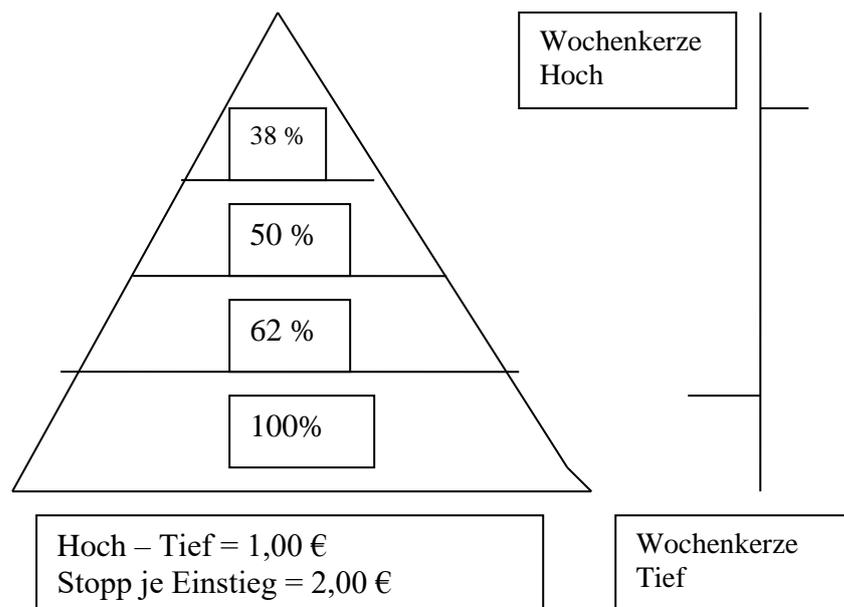
Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Setup:

1. Tranche = 62 % von Hoch - Tief → 10 % der Gesamtsumme (100 Stück)
2. Tranche = 50 % von Hoch - Tief → 20 % der Gesamtsumme (200 Stück)
3. Tranche = 38 % von Hoch - Tief → 30 % der Gesamtsumme (300 Stück)
4. Tranche = 0 % von Hoch - Tief → 40 % der Gesamtsumme (400 Stück)



Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position die doppelte Volatilität der Bewertungskerze
 Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen die doppelte Volatilität der Bewertungskerze

Jeder Einstieg erhält Stopp der 200 % der Vola der Bewertungskerze entfernt ist.

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Tageskerzen

Positionsgröße: 1R= 1% des Kontovolumens

Doppelte Volatilität Bewertungskerze / 1 % des Kontovolumens

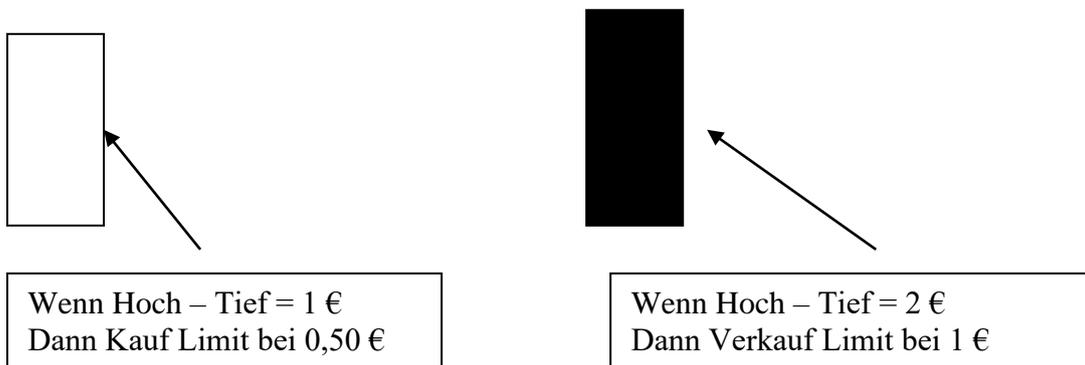
FIBONACCI RETRACEMENT - 50 % WOCHENBASIS

Setup: Scanne den Abstand zwischen Hoch – Tief auf Wochenbasis

Einstieg:

LONG: Limit Kauf bei 50 % Niveau zwischen Hoch – Tief

SHORT: Limit Verkauf bei 50 % Niveau zwischen Hoch – Tief



Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position das vorherige Tagestief

Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen das vorherige Tageshoch

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Tageskerzen

Positionsgröße:

1R= 1% des Kontovolumens

Abstand zum Kerzenhoch(tief) / 1 % des Kontovolumens

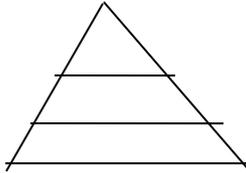
Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

PYRAMIDE R-VIELFACHE

Setup:

Gipfelsystem (System X) Einstieg für die 1. Position (100%),
wenn Position 1 R erreicht wird 50 % dazu gekauft,
wenn Position 2 R erreicht, dann werden 25 %



3. 25%
2. 50%
1. 100%

Prinzip:

Fremdkapital darf niemals Eigenkapital überschreiten;
Solange Position verdient gibt der Broker Kredit

Stopps:

Anfangsstopp gilt für jede Tranche 1 Punkt Abstand zum Einstieg

Ausgleichsstopp wird verwendet, sobald eine Tranche auf Tagesbasis im Plus ist

Trailingstop wird für jede Tranche benutzt, die 2 Kerzen im Plus ist (Hoch/Tief)

Zeitstopp wird nach 5 Gewinnerkerzen je Tranche verwendet

Positionsgröße:

1 R = 1 % des Kontovolumens

1 R = 500 Stück ; 0,5 R = 250 Stück ; 0,25 R = 125 Stück

Hebel:

MAXIMALER Hebel beträgt 2,00

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

3er FIBONACCI PYRAMIDE WOCHENBASIS

Basiswerte: Aktien

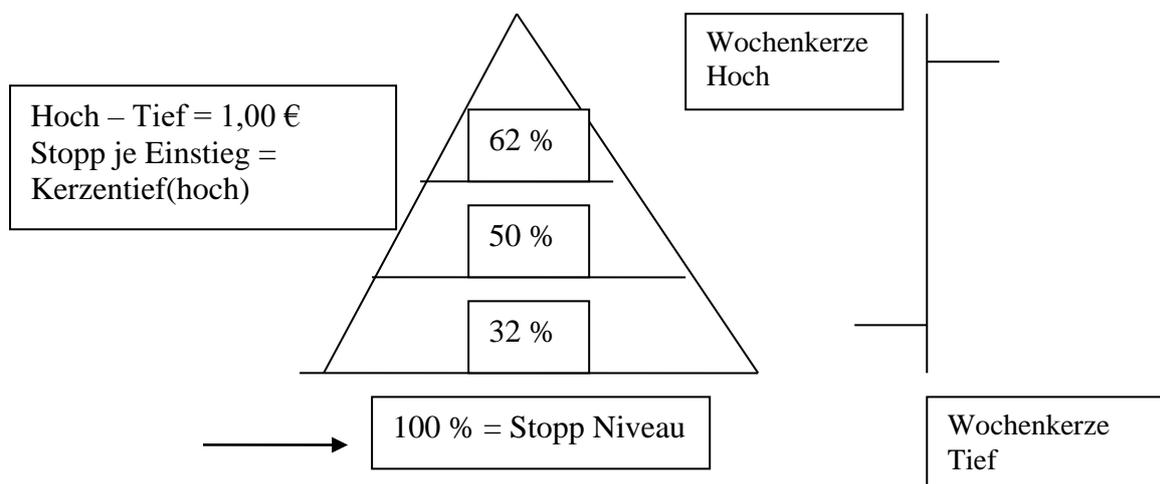
Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Setup: 3er Pyramide

1. Tranche = 62 % von Hoch - Tief → 20 % der Gesamtsumme (200 Stück)
2. Tranche = 50 % von Hoch - Tief → 30 % der Gesamtsumme (300 Stück)
3. Tranche = 38 % von Hoch - Tief → 50 % der Gesamtsumme (500 Stück)



Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position das vorherige Wochentief

Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen das vorherige Wochenhoch

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Tageskerzen

Positionsgröße:

1R= 1% des Kontovolumens

Abstand zum Kerzenhoch(tief) / 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

Idee: Die kleinste Position hat den höchsten Einstiegskurs und die größte Position hat den günstigsten Einstiegskurs. Dadurch wird der durchschnittliche Einstiegskurs auf das günstigste Niveau gezogen.

FUN AND PROFIT

KURSLÜCKEN

PATTERN GAP TAGESBASIS

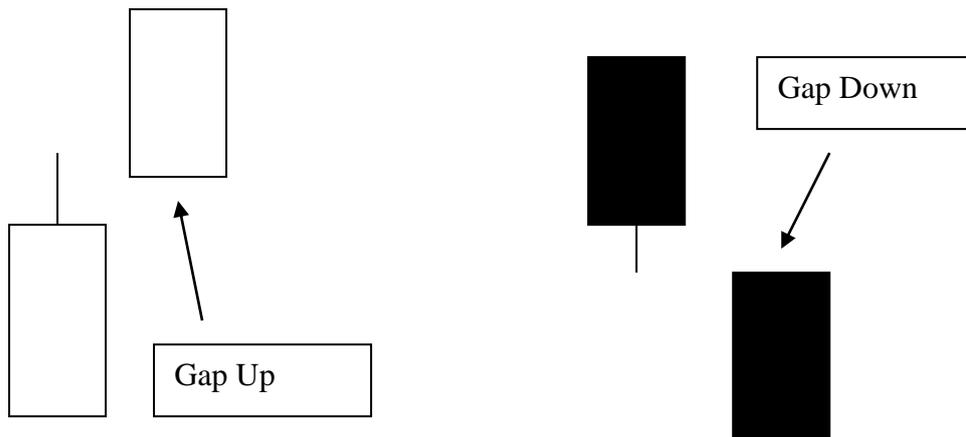
Setup:

Ein positives Pattern Gap tritt auf, wenn das Tief des aktuellen Balkens über dem Schlusskurs des vorherigen Balkens liegt.

Der aktuelle Schlusskurs liegt über dem aktuellen Eröffnungskurs.

Ein negatives Pattern Gap tritt auf, wenn das Hoch des aktuellen Balkens unter dem Schlusskurs des vorherigen Balkens liegt.

Der aktuelle Schlusskurs liegt unter dem aktuellen Eröffnungskurs.



Trendfilter:

Auf einer 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einer 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Einstieg:

LONG: Stopp Buy am aktuellen Tageshoch

SHORT: Stopp Loss am aktuellen Tagerstief

Stops:

Anfangsstopp ist bei LONG Position das vorherige Tagerstief

Anfangsstopp ist bei SHORT Positionen das vorherige Tageshoch

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp beträgt 5 Tageskerzen

Positionsgröße:

1R= 1% des Kontovolumens

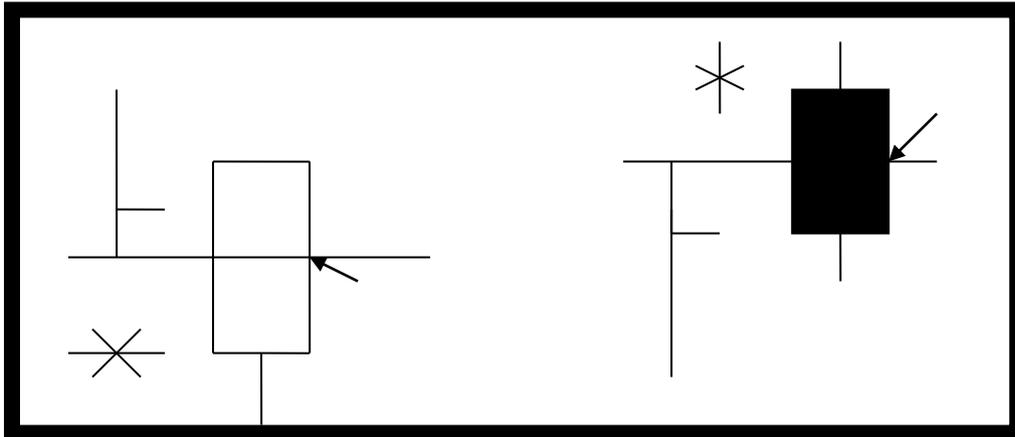
Abstand zum Kerzenhoch(tief) / 1 % des Kontovolumens

UUUPS CHARTMUSTER AKTIEN

Setup:

Wir suchen einen Eröffnungskurs, der unter (über) dem Tiefstkurs (Höchstkurs) der Vortages liegt. Das ist eine besondere Kurslücke, da sich nicht innerhalb der gestrigen Spanne liegt. (auch Pennystocks)

Entry: Er erfolgt, sobald nach der Kurslücke das alte Tagerstief (Tageshoch) erreicht wird.



Anfangsstopp: Tagerstief(Tageshoch) minimal 1 Punkt

Gewinnmitnahme: 50 % des Kontovolumens nach der 1. Gewinnkerze

Stops:

Ausgleichsstopp: Nach der 1 Gewinnkerze auf Tagesbasis

Trailingsstopp: Tief(Hoch) vom Körper der vorherigen Kerze

Zeitstopp beträgt 5 Tageskerzen

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens - 1000 Stück

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

GAP & TRAP

Setup:

Scanne Aktien, die mit einer negativen oder positiven Kurslücke eröffnen, die mindestens 2 % zum Schlusskurs vom Vortag betragen muss.

Das Gap findet innerhalb der vorherigen Kursspanne statt.

Einstieg:

Nach der Eröffnung wird bei einer positiven Kurslücke ein Stopp Loss Auftrag auf den Schlusskurs des Vortages gesetzt.

Nach der Eröffnung wird bei einer negativen Kurslücke ein Stopp Buy Order auf den Schlusskurs des Vortages gesetzt

Stops:

Anfangsstopp wird mit 1 Punkt Abstand zum Einstieg platziert

Ausgleichsstopp wird nach der ersten Gewinnerkerze verwendet

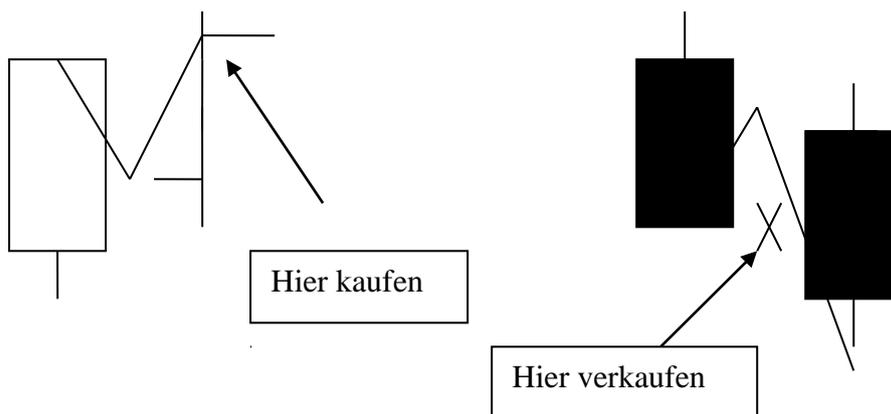
Trailingsstop wird nach der zweiten Gewinnerkerze verwendet, auf das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze → Prior Bar Stopp

Zeitstopp wird nach 5 Kerzen verwendet, wenn kein anderer Stopp greift.

Paketgröße: 1000 Aktien → 1 R = 1 % des Kontovolumens

Zeitraumen: Tageschart

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).



BOOMER

Boomer sind Aktien, die seit Ende der regulären Handelszeit des letzten Börsentages um mind. 10 % oder mehr zugelegt haben. Solche Aktien sind in der Regel infolge „guter Nachrichten“ gestiegen und der Markt zeigt in der Regel eine Überreaktion.

BUSTER

Buster sind Aktien, die seit Ende der regulären Handelszeit des letzten Börsentages um mind. -10 % oder mehr gesunken sind. Solche Aktien sind in der Regel infolge „schlechter Nachrichten“ gefallen und der Markt zeigt eine Überreaktion.

Einstieg:

Boomer kauft man am besten nach der ersten Kurssteigerung 30 Min nach der Eröffnung

Buster verkauft man am besten nach dem ersten Kursverfall 30 Minuten nach der Eröffnung.

Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Stopps:

Anfangsstopp: Tagestief beim Boomer / Tageshoch beim Buster

Trailingsstopp: Auf 30 Minuten Basis - Stopp wird um die Punktzahl des Buchgewinns nachgezogen.

Zeitstopp ist der Tagesschluss

Positionsgröße: 1% des Kontovolumens entspricht 1 R

Paketgröße: 1000 Aktien

Orderplatzierung: 30 Minuten nach Handelbeginn

Zeitraumen: Einstieg auf Tagesbasis / Trailingsstopp Intraday auf 30 Minuten Basis

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

FUN AND PROFIT

MOVING AVERAGE

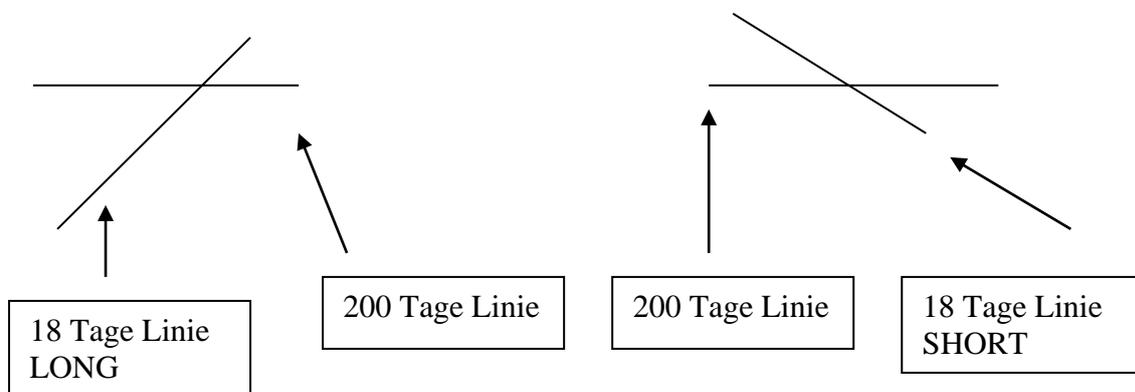
GLEITENDER DURCHSCHNITT GOLDEN CROSS / DEAD CROSS WOCHENBASIS

Setup: Scanne am Wochenschlusskurs gleichzeitig einen kurzfristigen gleitenden Durchschnitt und einen langfristigen gleitenden Durchschnitt.
Zur Berechnung der Durchschnitte werden nur Wochenschlusskurse verwendet

Einstieg:

LONG: Wenn der kurzfristige 18- Tage Durchschnitt den langfristigen 200 Tage Durchschnitt **von unten nach oben** schneidet.

SHORT: Wenn der kurzfristige 18 - Tage Durchschnitt den langfristigen 200 Tage Durchschnitt **von oben nach unten** schneidet.



Stops:

Der Anfangsstopp wird 10 % vom Einstiegskurs gesetzt

Der Trailingsstopp wird um die Punktzahl einer positiven Kerze zu meinen Gunsten nachgezogen.

Der Zeitstopp wird nach 5 Kerzen nach der Eröffnung der Pos. aktiviert.

Positionsgröße:

Auf den 10 % Anfangsstopp wird 1 R = 1 % Kontorisiko gesetzt.

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

GLEITENDER DURCHSCHNITT ANTIZYKLISCH

Setup:

200 Tage Linie Minus 20 % Kauflimit
200 Tage Linie Plus 20 % Verkaufslimit

Durchschnitt wird auf Schlusskursbasis berechnet, wenn Schlusskurs eine Volatilitätsgrenze erreicht, dann wird Position per Akkumulation eingegangen

Stopp: 10 % vom Einstiegskurs entfernt

Akkumulieren:

20 % der Gesamtposition. Einstieg über 5 Tageskerzen, falls Position auf Tagesbasis Buchgewinn erzielt hat; keine Verlustposition darf vergrößert werden.

Gewinnziel: 200 Tage Linie

Zeitstopp: 1 Monat

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens / 1000 Stück Aktien

Märkte: Aktien, Indizes

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

GLEITENDER DURCHSCHNITT ZYKLISCH

Setup:

Wenn Kurs den 20 Tage Durchschnitt schneidet, dann wird per StoppBuy(Loss) der Trend gekauft

Einstieg:

Der Durchschnitt wird auf Schlusskursbasis berechnet.

Wenn der Kurs sich unter dem Durchschnitt befindet, dann wird ein LONG Stopp Buy auf diesen Kurs gesetzt.

Wenn der Kurs sich über dem Durchschnitt befindet, dann wird ein SHORT Stopp Loss auf diesen Kurs gesetzt.

Stops:

Der Anfangsstopp wird 10 % vom Einstiegskurs gesetzt

Der Trailingsstopp wird um die Punktzahl einer positiven Kerze zu meinen Gunsten nachgezogen.

Der Zeitstopp wird nach 5 Kerzen nach der Eröffnung der Pos. aktiviert.

Positionsgröße:

Auf den 10 % Anfangsstopp wird $1 R = 1 \% \text{ Kontorisiko}$ gesetzt.

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

GLEITENDER DURCHSCHNITT LIMITKAUF

Setup:

Ein gleitender Durchschnitt, der im Vergleich zum Zeitpunkt der letzten Messung 10 % gestiegen bzw. gefallen ist.

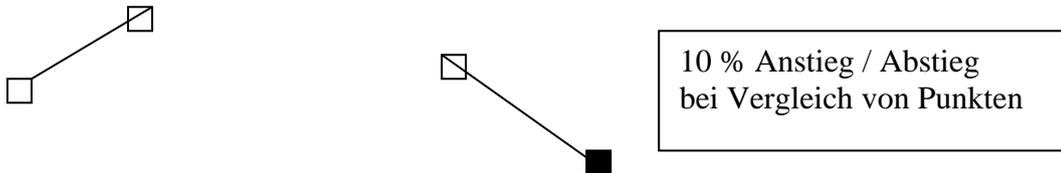
Zum Beispiel wenn der Preis des 20-Tage Durchschnitts heute im Vergleich zu dem Preis desselben gleitenden Durchschnitts vor 1 Monat gestiegen ist, dann wird ein Limitkaufauftrag auf den heutigen 20 Durchschnitt gesetzt.

20 Tagedurchschnitt vor 20 Tagen: 10,00 €

20 Tagedurchschnitt heute: 11,00 €

200 Tagedurchschnitt vor 200 Tagen 50,00 €

200 Tagedurchschnitt heute: 45,00 €



Einstieg.

- 1) Limitkauf 11,00 €
- 2) Limitverkauf 45,0 €

Stopps:

Anfangsstopp ist 10 % von der Ausführung gesetzt, somit der vorherige Punkt.

Trailingsstopp wird nach jeder Gewinnkerze auf Tagesbasis verwendet

Zeitstopp ist der doppelte Zeitrahmen des verwendeten Durchschnitts.

Positionsgröße: 1 R entspricht 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

STEIGUNGSGERADE 18 TAGE DURCHSCHNITT

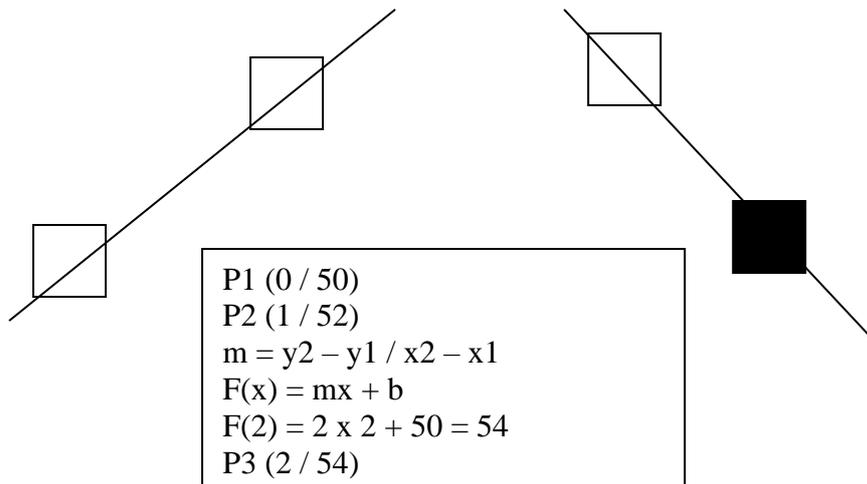
Setup:

Berechne die Steigungsgerade zwischen dem 18 Tage Durchschnitt vor 1 Woche.

Vergleiche den 18 Tage Durchschnittspunkt von heute.

Berechne den nächsten Punkt. per Formel: $f(x) = mx + b$

Berechne den Steigungswinkel der Steigungsgerade: SHIFT - Taste / tan - Taste / m



Chartdarstellung: Durchschnittskurs als Punktchart darstellen.

Einstieg:

LONG – Wenn der Steigungswinkel im Vergleich vor 1 Woche mind. 45 % beträgt.

SHORT – Wenn der negative Steigungswinkel im Vergleich vor 1 Woche mind. 45 % beträgt.

LONG: Stopp Buy - Hoch der Freitagskerze

SHORT: Stopp Loss - Tief der Freitagskerze

Stops:

Anfangsstopp wird mit 1 Punkt Abstand zum Einstiegskurs gesetzt

Ausgleichsstopp wird nach 1 Woche benutzt, falls der Kurs im Plus ist

Trailingstopp wird nach der zweiten Gewinnkerze unter das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gesetzt und bei weiteren Gewinnkerzen nachgezogen

Zeitstopp wird benutzt, wenn kein Stopp nach 5 Sitzungen erreicht wird.

Zeitraumen: 1 Woche

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens

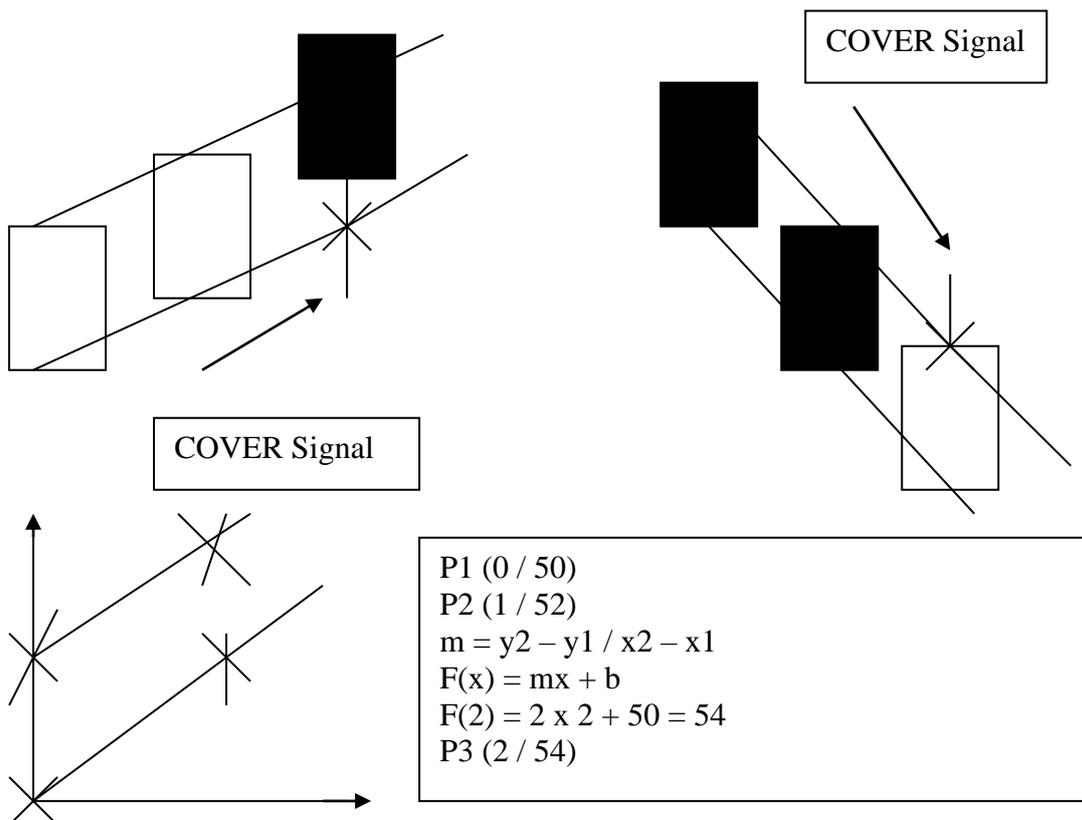
Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraum gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

STEIGUNGSGERADE TRENDKANAL LIMITKAUF

Setup:

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein höheres Tief als die vorherige Kerze haben.
 Bilde eine Steigungsgerade der beiden steigenden Tief(Hoch)punkte.
 Berechne den nächsten Punkt. per Formel: $f(x) = mx + b$

Eine Aktie muss 2 Wochenkerzen jeweils ein tieferes Tief als die vorherige Kerze haben.
 Bilde eine negative Steigungsgerade der bei beiden fallenden Tief(Hoch)punkte.
 Berechne den nächsten Punkt per Formel: $f(x) = mx + b$



Einstieg:

LONG: Limit Kauf bei prognostizierten Tiefs des Trendkanals.

SHORT: Limit Verkauf bei prognostizierten Hoch des Trendkanals

Stops:

Anfangsstopp ist 50 % der Kursspanne des Trendkanals vom Einstiegskurs entfernt.

Trailingsstopp wird nach jeder Tageskerze um den Buchgewinn nachgezogen

Zeitstopp ist der Freitagsschlusskurs

Positionsgröße:

1R= 1% des Kontovolumens

Abstand zum Kerzenhoch(tief) / 1 % des Kontovolumens

Trendfilter: Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Wochenschlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

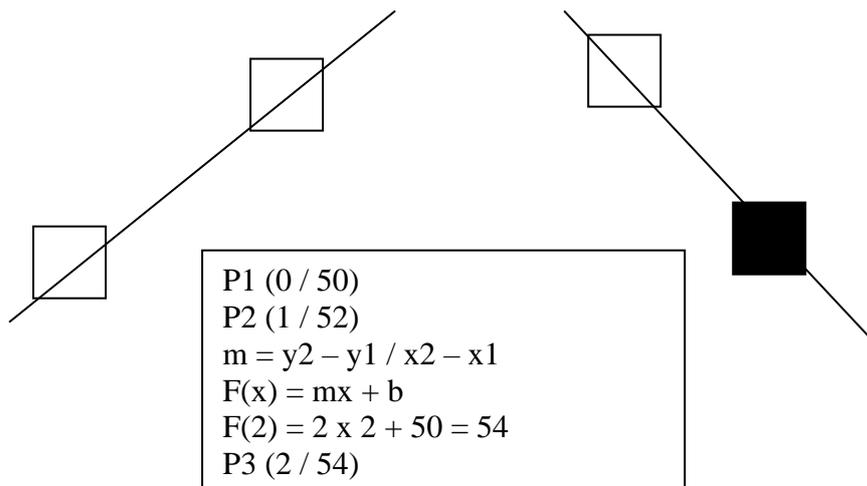
STEIGUNGSGERADE WOCHENSCHLUSSKURS

Setup:

Berechne die Steigungsgerade zwischen dem heutigen / vorherigen Freitagsschlusskurs.
Vergleiche den aktuellen Wochenschlusskurs mit dem Schlusskurs der Vorwoche.

Berechne den nächsten Punkt. per Formel: $f(x) = mx + b$

Berechne den Steigungswinkel der Steigungsgerade: SHIFT - Taste / tan - Taste / m



Chartdarstellung: Wochenschlusskurs als Punktchart darstellen.

Einstieg: mindestens $m = 1,00$

LONG – Wenn der Steigungswinkel im Vergleich vor 1 Woche mind. 45 % beträgt.

SHORT – Wenn der negative Steigungswinkel im Vergleich vor 1 Woche mind. 45 % beträgt.

LONG: Stopp Buy - Hoch der Freitagskerze

SHORT: Stopp Loss - Tief der Freitagskerze

Stops:

Anfangsstopp wird 5 % Abstand zum Einstiegskurs gesetzt

Ausgleichsstopp wird nach 1 Woche benutzt, falls der Kurs im Plus ist

Trailingstopp wird nach der zweiten Gewinnkerze unter das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gesetzt und bei weiteren Gewinnkerzen nachgezogen

Zeitstopp wird benutzt, wenn kein Stopp nach 5 Sitzungen erreicht wird.

Zeitraumen: 1 Woche

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitraumen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

TERMINGESCHÄFTE AKKUMULATION OPTIONSSCHEINE MONATSBASIS

Einstiegssetup: Je nach Präferenz: Kleinere Volatilität nach einem Kursanstieg

Märkte: Die Optionsscheine auf große Indizes: DAX

V-DAX Filter:

Einstieg nur, wenn V-DAX Freitagsschlusskurs unter 18 Tage Durchschnitt liegt.

Basispreis:

Call 2% - 5 % aus dem Geld / Put 2% - 5% aus dem Geld

Der Abstand zum Kassakurs muss beim Put und Call identisch sein.

Laufzeit: Die Optionsscheine müssen mindestens 4 Monate Laufzeit besitzen

Zeitraumen: Der Zeitstopp ist das Monatsende des folgenden Monats.

Anfangsstopp: -50 % vom Einstiegskurs

Ausstieg: Per Zeitlimit 1 Monat

Optionsscheinwert:

Die Optionsscheine müssen mind. 0,80 € kosten, da bei kleineren Zahlen der Spread von Geld/Brief prozentual zu groß ist.

Akkumulation:

Am Ende des Monats, sprich der letzten Handelstages des Monats

Freitagsschluss wird am Ende des Monats 1. Tranche von 5 investiert → 20%

Jeden weiteren Freitag wird eine Tranche vom „gewinnenden“ Optionsschein gekauft.

Strategie: Die Verlustposition wird nicht vergrößert.

Positionsgröße: Bei der ersten Tranche wird in den Call und Put der gleiche Eurobetrag investiert → z.B. 1000 € CALL/PUT

Der Spread darf maximal 2 % des Kontovolumens betragen (PUT/CALL Gesamtsumme)

Danach beträgt jede weitere Tranche 1% des Kontovolumens bei der Vergrößerung der „gewinnbringenden“ Position

Bewertung: Die Bewertung der Optionsscheine findet am Freitagsschluss nach jeder Woche statt.

TERMINGESCHÄFTE OPTIONSSCHEINE DAX SPREADING

Setup: Wochenbasis

Gleichzeitiger Kauf von DAX Call / DAX Put zum Freitagsschlusskurs XETRA.

V-DAX Filter:

Einstieg nur, wenn V-DAX Freitagsschlusskurs unter 18 Tage Durchschnitt liegt.

Einstieg bei kleiner Volatilität ist am besten.

Basispreis:

Call 2% - 5 % aus dem Geld / Put 2% - 5% aus dem Geld

Der Abstand zum Kassakurs muss beim Put und Call identisch sein.

Laufzeit: Die Optionsscheine müssen mindestens 4 Monate Laufzeit besitzen

Zeitraumen: Der Zeitstopp ist das Monatsende des folgenden Monats.

Anfangsstopp: -50 % vom Einstiegskurs

Ausstieg: Per Gewinnmitnahme liquidieren.

Die Rendite wird von Schlusskurs zu Schlusskurs berechnet.

Basiswert auf Tagessicht:

0,1 % - 0,5 % → 10 % des Bestands

0,5 % - 1 % → 20 % des Bestands

1,01% - 1,5 % → 30 % des Bestands

1,51 % - 2 % → 40 % des Bestands

2,00 % - X % → 50 % des Bestands

Optionsscheinwert: Die Optionsscheine müssen mind. 0,80 € kosten, da bei kleineren Zahlen der Spread von Geld/Brief prozentual zu groß ist.

Strategie: Die Verlustposition wird nicht vergrößert.

Positionsgröße: Bei der ersten Tranche wird in den Call und Put der gleiche Eurobetrag investiert → z.B. 1000 € CALL/PUT

Der Spread darf maximal 5 % des Kontovolumens betragen (PUT/CALL Gesamtsumme)

Bewertung zur Gewinnmitnahme:

Die Bewertung der Optionsscheine findet nach XETRA Schluss 17:45 statt.

**AKTIENAUSWAHL WOCHENBASIS
GEWINNER / FREITAG
17:35 EUROPA / 22:00 USA**

Setup:

Scann einen Index nach Aktien die auf Wochenbasis 5 % Performance auf Wochenbasis im Vergleich zum letzten Freitag aufweisen. Das sind die Aktien, die eine sogenannte „Outperformance“ von 3 % zum Vergleichsindex aufweisen.

Gewinner- Auswahl:

Diese Aktien können für 2-5 Tage (**Wochentrading**) ausgewählt werden, d.h. am Freitag nach Börsenschluss wird:

Stopp Buy Auftrag auf das aktuelle Tageshoch vom Freitag gesetzt.
Stopp Loss Auftrag auf das aktuelle Tagestief vom Freitag gesetzt.

**AKTIENAUSWAHL WOCHENBASIS
VERLIERER / FREITAG
17:35 EUROPA / 22:00 USA**

Setup:

Scann einen Index nach Aktien die auf Wochenbasis -5 % Performance auf Wochenbasis im Vergleich zum letzten Freitag aufweisen. Das sind die Aktien, die eine sogenannte „Underperformance“ von -3 % zum Vergleichsindex aufweisen.

Verlierer-Auswahl:

Diese Aktien können für 2-5 Tage (**Wochentrading**) ausgewählt werden, d.h. am Freitag nach Börsenschluss wird:

Stopp Buy Auftrag auf das aktuelle Tageshoch vom Freitag gesetzt.
Stopp Loss Auftrag auf das aktuelle Tagestief vom Freitag gesetzt.

**AKTIENAUSWAHL AUF WOCHENBASIS
REMIS / JEDEN FREITAG
17:35 UHR EUROPA / 22:00 UHR USA**

Setup:

Scann nach Aktie die auf Wochenbasis 0,3% bis -0,3% Performance auf Wochenbasis im Vergleich zum letzten Freitag aufweisen. Das sind die Aktien, die ein sogenanntes „REMIS“ beim Indexscan aufweisen.

Remis-Auswahl:

Diese Aktien können für 2-5 Tage (**Wochentrading**) ausgewählt werden, d.h. am Freitag nach Börsenschluss wird:

Stopp Buy Auftrag auf das aktuelle Tageshoch vom Freitag gesetzt.
Stopp Loss Auftrag auf das aktuelle Tagestief vom Freitag gesetzt.

DIE VERLUSTBREMSE

Wenn 2 Verluste nacheinander in einer Aktie bei 2-5 Tage Trading (Wochentradning) auftreten, d.h. die ursprüngliche Position und die darauf folgende gedrehte Position werden in Folge mit Verlust ausgestoppt, dann ist diese Aktie 1 Woche lang für neue Einstiege gesperrt.

Wenn 2 Verluste nacheinander in einer Aktie für Intraday oder Daytrading auftreten, d.h. wenn die ursprüngliche Position und die gedrehte Position in Folge mit Verlust ausgestoppt werden, dann ist diese Aktie für den aktuellen und den darauf folgenden Tag gesperrt.

Dasselbe gilt für das verwendete Handelssystem.

Selbst, wenn in diesem Zeitraum ein Handelssignal auftreten sollte, darf es aufgrund der Sperrung nicht eingegangen werden.

Dies kann durch eine Computer Software kontrolliert bzw. überwacht werden.

Die Verlustbremse schränkt die Tradingaktivität ein, wenn das System beginnt eine Verlustserie aufzuweisen. Dies hilft auf dabei, die Verluste einzuschränken.

Bei der Verlustbremse tritt auch der Effekt der zeitlichen Streuung auf.

OPTIONSSCHEINE ANFANGSSTOPP

Wenn die anfängliche Spread Position Call/Put eingegangen wird, dann wird die Verlustgrenze für den verlierenden Schein bei -50% gesetzt.

Wenn der Optionsschein auf Schlusskursbasis den -50 % Anfangsstopp erreicht, dann wird er zum Handelsschluss per Market Order liquidiert.

Das stellt sicher, das für den nächsten Einstieg, wenigstens die Hälfte vorhanden bleibt.

Das Gewinnziel bei Optionsscheinen ist 100 %, somit entsteht eine Chance / Risiko von 2:1.

Dieser Stopp führt auch, dazu die Gewinne des Scheins „im Geld“ zu optimieren, da dieser sich vervielfachen kann.

Falls ein Schein 50 % verliert ist es besser, einen frischen Optionsschein mit anderem Basispreis, der näher am Geld liegt zu kaufen.

Mit dieser Regel, wird ein **Totalverlust** eines Optionsscheins ausgeschlossen, was einen wesentlichen Teil der ausgegeben Scheine betrifft. Die meisten Optionsscheine verfallen wertlos, deshalb ist es meine Pflicht, zumindest **50 % des eingesetzten Kapitals zu erhalten.**

Um den Schein, der „ins Geld“ läuft brauche ich mir zunächst keine Sorgen zu machen. Die Gewinne kümmern sich selbst um sich.

Anfangsstopp → -50 % vom Einstiegskurs vom OPTIONSSCHEIN

Fairer Terminpreis = Kassamarktpreis + Finanzierungskosten – Erträge

Strukturierte Produkte = Basiswert + Derivat(Option) = Strukturiertes Produkt

Zertifikate sind rechtlich gesehen Anleihen.

OVERNIGHT REGELN MARGIN KONTO AKTIENMARKT

- Es darf keine Position über Nacht gehalten werden, die einen Buchverlust auf Schlusskursbasis des jeweiligen Marktes aufweist. Cover nachbörslich.
- Es darf höchstens ein Investitionsgrad von 200 % an LONG Positionen über Nacht gehalten werden, wenn ein Buchgewinn vorhanden ist.
- Es darf höchstens ein Investitionsgrad von 200 % an SHORT Positionen über Nacht gehalten werden, wenn ein Buchgewinn vorhanden ist.
- Es dürfen maximal 5 verschiedene Einzeltitel LONG über Nacht gehalten werden
- Es dürfen maximal 5 verschiedene Einzeltitel SHORT über Nacht gehalten werden

WÄHRUNGSRISIKO US – AKTIEN

Szenario I:

Wenn EUR/USD Spot steigt, dann fällt der Europreis für US-Aktien

Szenario II:

Wenn EUR/USD Spot fällt, dann steigt der Europreis für US-Aktien

Prinzip:

Wenn USD relativ stärker als EUR ist, dann steigt der Europreis für US-Aktien

Wenn USD relativ schwächer als EUR ist, dann fällt der Europreis für US-Akten

Einstieg:

Der Einstieg in US-Aktien ist günstiger, nach einem Anstieg des EUR/USD Spot.

Ausstieg:

Der Ausstieg aus US-Aktien ist günstiger, nach einem Abfall des EUR/USD Spot.

STATISTISCHER FILTER

S&P 500 1982-1998

	Hoch - Tief	Schlusskurs- Eröffnungskurs
Montag	4.22	+.631
Dienstag	4,30	+.130
Mittwoch	4.29	+.221
Donnerstag	4.19	-.044
Freitag	4.45	-.1164

US-STAAATSANLEIHEN 1988 - 1998

	Hoch-Tief	Schlusskurs- Eröffnungskurs
Montag	.708	-.001
Dienstag	.781	.064
Mittwoch	.767	.010
Donnerstag	.823	-.017
Freitag	1.05	.022

Beste Handelstag im Drei-Tages Zyklus

Kauf zum Eröffnungskurs Verkauf zum Tagesschluss nach 3 Tagen

Wert	Tag	% Anstieg	Durch. Profit
Staatsanleihen	Dienstag	52%	86\$
S&P 500	Montag	57 %	212

Statistisch gesehen ist es im **S&P 500** am günstigsten am **Montag** zum **Eröffnungskurs** eine **LONG** Position aufzubauen und **3 Tage** lang zu halten.

Folglich ist die beste Zeit für **SHORT** Leerverkäufe die **Eröffnung** am **Donnerstag** und eine Haltedauer bis zum **Montags Eröffnungskurs**.

Staatsanleihen bringen die meiste Rendite, wenn man **dienstags** zur **Eröffnung** eine **LONG** Position eingeht.

Die **Wochentage** können als **Filter** für diese Märkte dienen.

FEIERTAGE

DAX 1959-1992

1 Tag vor Weihnachten bis 1 Tag nach Weihnachten

Durchschnittliche Rendite: 1,3 %

1 Tag vor Weihnachten

Durchschnittliche Rendite 0,4 %

1 Tag vor Ostern

Durchschnittliche Rendite: 0,6 %

TAGE DES MONATS

Die Tagesspanne zwischen dem **28. des Monats bis zum 8. des Folgemonats** ist durchgehend **positiv**.

Die Tagesspanne zwischen dem **8. des Monats bis zum 28. des Monats** enthält 13 negative Tage, deren **Verlust wesentlich größer** ist, als die Kursveränderungen der positiven Tage.

MONATE

Die Monate von **November bis Mai** sind durchschnittlich durchgehend **positiv**

Die Monate von **Mai bis November** sind **gemischt**, wobei **September und Oktober** die **negativste Entwicklung** aufweisen.

FUN AND PROFIT INVESTMENT PLAN

INHALTVERZEICHNIS FUN AND PROFIT INVEST

ZEITLICHE STREUUNG MINIMIERT DAS BÖRSENRISIKO

INVESTMENTSYSTEME:

- 1) Drawdown - Modell
- 2) Psycho- System
- 3) Rentensystem
- 4) Aktienselektion LONG
- 5) Aktienselektion SHORT
- 6) Dogs of the Dow Dividende
- 7) Low Five of the Dow Dividende
- 8) Anlagensicherung / Hedging
- 9) Indikatorenmodell
- 10) Sentimentindikator
- 11) Blue Chips Long-Term
- 12) China Long-Term
- 13) Nasdaq Composite Banken
- 14) 200 Tage Filter Aktien
- 15) Bonitätsindikator
- 16) US Invest / American Style
- 17) Akkumulation Pyramide Monatsbasis
- 18) 3 Monate Ausbruch System
- 19) 200 Tage Durchschnitt Steigungsgerade
- 20) Modell Portfolio

DRAWDOWN MODELL: 1 JAHR LONGTERM

Drawdown %	Gewinn zur Erholung %
5	5,3
10	11,1
15	17,6
20	25
25	33
30	42,9
40	66,7
50	100
60	150
75	300
90	900
99	9999
100	<i>Unmöglich</i>

Drawdown Stopp:

Bei Aktienakkumulation wird der Stopp bei maximal 10 % unter den Einstiegkurs gesetzt. Ansonsten lohnt es sich nicht weiter runter zu gehen.

Es lohnt sich vielmehr zu einem späteren Zeitpunkt bei einem niedrigeren Kurs einzusteigen, um den exponentiellen Anstieg der Performance nach einem Kursverfall.

GEWINNMITNAHME MODELL: 1 JAHRESSICHT

Gewinn %	Verlust zum Retracement %
1	1
5	4,76
10	9,09
20	16,66
30	23,07
40	28,57
50	33,3
60	37,5
70	41,17
80	44,44
90	47,36
100	50
200	66,6
300	75
400	80
1000	90,9
10000	99

Interpretation:

Eine Gewinnmitnahme lohnt sich ab 20 % Buchgewinn, da das Verhältnis von Performance und Retracement anfängt eklatant voneinander abzuweichen.

PSYCHO SYSTEM INVESTMENT STYLE

Setup:

Kauf-Verkaufslimits auf ganze Zahlen bei Aktien (beim Broker) setzen (1,10,20,30,40,50,60,70,80,90,100,150,200,300,400,500,1000), wenn Kurs das erste Mal psychologische Marke erreicht, dann ist Retracement wahrscheinlich;

Akkumulieren:

Die 1. Position beträgt 20 % des angestrebten Gesamtvolumens.

Jeder weitere Kauf beträgt 20 % des Gesamtvolumens, wobei in 5 Tranchen gekauft wird -> 5 x 200 Stück = 1000 Stück

An einem Tag darf nur eine Tranche akkumuliert werden, d.h. dass der Zeitrahmen nicht gewechselt werden darf.

Es darf keine weitere Position aufgebaut werden, solange Position keinen Buchgewinn erreicht hat -> keine Verlustposition vergrößern.

Stopps:

Anfangsstopp wird bei 200 Aktien 5 Punkte entfernt sein.

TimeStopp wird verwendet, wenn die Aktien nach 5 Kerzen(1Woche) keinen Buchgewinn erreicht haben.

Ausgleichsstopp auf den Durchschnittskurs wird verwendet, wenn die Aktien nach 5 Kerzen(1Woche) im Plus stehen.

Trailingstop wird nach 10 Tagen verwendet, wenn kein Stopp vorher gegriffen hat.

Der Trailingsstopp wird auf das Tief der zweiten 5 Tageskerzen gesetzt (Tief der 2. Wochenkerze) und dementsprechend alle 5 Kerzen nachgezogen

Gewinnziel:

Nächste Psychologische Marke löst Gewinnmitnahme per Tabelle aus

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition)

FUN AND PROFIT RENTENSYSTEM

Zeitraumen: Aktienakkumulation auf Monatsbasis

Einstiegsuhrzeit:

Am 1. Handelstag von jedem Monat (zu Tradingzeiten 10:00 / 16:00 / 21:00 Uhr CET)

Tranchen:

10.000 € x 12 Monate = 120.000 € per anno

1/12 x 12 Monate = 100 % per anno

Konzentration:

Jede 10.000 € Tranche darf maximal auf 1 Einzelwert verteilt werden (Konzentration).

Verbilligen:

Eine Position, die einen Buchverlust aufweist darf nicht vergrößert werden (kein Verbilligen).

Pyramiding:

Der Einsatz für eine Position darf von Monat zu Monat höchstens verdoppelt werden, wenn die Aktie einen Buchgewinn von mind. 10 % aufweist und weiterhin TOP PERFORMER in seinem Index ist.

Stopps:

Anfangsstopp ist 10 % vom Einstiegskurs für jede Tranche → Einstiegskurs – 10 %.

Jeder neue Einstieg erhält seinen eigenen Anfangsstopp → Einstiegskurs – 10 %.

Gewinnmitnahme:

Am Ende des Jahres erfolgt Gewinnmitnahme per Gewinnmitnahme Modell:
Jahressicht Aktien siehe Investmentplan.

AKTIENSELEKTION LONG

Zeitraumen: 1 Monatsbasis (1. Handelstag des Monats)

TOP PERFORMER Nr. 1 Deutscher Markt

Aktienselektion: DAX / MDAX / TECDAX / SDAX → Die 4 besten TPs aus den Indizes werden verglichen

Setup: Ein TOP PERFORMER muss mind. 10 % Rendite auf Monatssicht aufweisen, um für eine Position in Frage zu kommen.

Trendfilter: Der XETRA – Monatsschlusskurs muss über dem 200 Tage Durchschnitt liegen.

Aus den 4 besten TPs in den Indizes wird der stärkste TOP PERFORMER akkumuliert.

Stopp: Anfangsstopp ist 10 % (exklusive Kosten) vom Einstiegskurs entfernt.

Die Zugehörigkeit der Aktien in einem Index garantiert eine gewisse Liquidität / Qualität / Value / Free Float. → regulierter Markt

AKTIENSELEKTION SHORT

Zeitraumen: 1 Monatsbasis (1. Handelstag des Monats)

LOW PERFORMER Nr. 1 Deutscher Markt

Aktienselektion: DAX / MDAX / TECDAX / SDAX → Die 4 besten LPs aus den Indizes werden verglichen

Setup. Ein LOW PERFORMER muss mind. -10 % Rendite auf Monatssicht aufweisen, um für eine Position in Frage zu kommen.

Trendfilter Der XETRA – Monatsschlusskurs muss unter dem 200 Tage Durchschnitt liegen.

Aus den 4 besten LPs in den Indizes wird der schwächste LOW PERFORMER leerverkauft.

Anfangsstopp ist 10 % (exklusive Kosten) von Einstiegskurs entfernt.

ANLAGENSICHERUNG HEDGING

Für jeden Euro der LONG investiert wird, muss ein Euro SHORT in einem ähnlichen Markt (1 € relativ starke Aktie LONG / 1 € relativ schwache Aktie SHORT).

DIVIDENSTRATEGIE DOGS OF THE DOW

Setup:

Nach dieser Strategie werden einmal jährlich, zum Beispiel am 1. Januar, die 5 Aktien aus dem Dow Jones mit der höchsten Dividendenrendite in Prozent gekauft und ein Jahr lang gehalten. Der Kaufzeitpunkt selbst ist dabei gar nicht so entscheidend. Sie können auch in einem anderen Monat einsteigen. Wichtig ist nur, dass Sie die Aktien 1 Jahr lang im Depot lassen.

Nach diesen 12 Monaten werden diese 5 Werte dann aktuellen dividendenstärksten Aktien ausgetauscht. Natürlich können hier auch wieder Aktien aus dem Vorjahr dabei sein. Eben je nachdem, wie sich die Kurse und Dividenden der einzelnen Aktien entwickeln.

DIVIDENDENSTRATEGIE LOW FIVE DOW

Setup:

Nach dieser Strategie werden einmal jährlich, zum Beispiel am 1. Januar, die 5 Aktien aus dem Dow Jones mit der höchsten Dividendenrendite in Prozent und dem nominal niedrigsten Aktienkurs gekauft und ein Jahr lang gehalten. Der Kaufzeitpunkt selbst ist dabei gar nicht so entscheidend. Sie können auch in einem anderen Monat einsteigen. Wichtig ist nur, dass Sie die Aktien 1 Jahr lang im Depot lassen.

Nach diesen 12 Monaten werden diese 5 Werte dann aktuellen dividendenstärksten und nominal billigsten Aktien ausgetauscht. Natürlich können hier auch wieder Aktien aus dem Vorjahr dabei sein. Eben je nachdem, wie sich die Kurse und Dividenden der einzelnen Aktien entwickeln.

Schritte:

- (1) Suche die Aktien mit der höchsten Dividendenrendite in Prozent und dem nominal niedrigsten Aktienkurs aus einem Zielindex(DAX, DOW, MDAX etc.) heraus.
- (2) Kaufen Sie diese 5 Aktien und investieren Sie in jede den gleichen Betrag. Streuen Sie die Einstiege. 1 Woche = 1 Tranche.
- (3) Halten Sie die 5 Aktien dann mind. 12 Monate im Depot.

DAS INDIKATORMODELL

Aus 4 Börsenindikatoren lässt sich ein Gesamtindikator für den DAX zusammenstellen. Der Gesamtindikator berücksichtigt den Diskontsatz, die Inflationsrate, den Dollarkurs und die jeweilige Saison im Jahr.

Berechnung:

Wenn die letzte Diskontsatzänderung der EZB eine Senkung war, wird dies als 1 Punkt gewertet, war die letzte Änderung eine Erhöhung, bekommt der Indikator eine 0 gut geschrieben.

Für die Inflationsrate gilt: Lag sie vor einem Jahr höher, gibt es einen 1 Punkt, lag sie tiefer gibt es 0 Punkte

Der Dollar wird umgekehrt gewertet: Ein stärkerer Dollarkurs im Vergleich zum Euro als zählt 1 Punkt, ein niedrigerer 0 Punkte.

Zuletzt wird ein saisonaler Indikator aufgenommen. Die Zeit vom 1. November bis zum 30. April zählt 1 Punkt, die Zeit vom 1. April bis zum 31. Oktober kriegt 0 Punkte.

Einstiegssignal:

Steigt die Gesamtsumme der 4 Indikatoren auf 3 oder 4, ist dies ein Kaufsignal, fällt sie auf 1 oder 0 ist dies ein Verkaufssignal.

Die 2 ist als Ergebnis neutral. Gab es vor der neutralen 2 ein Kaufsignal, bleibt dieses erhalten. Gab es vorher ein Verkaufssignal, bleibt dieses ebenfalls in Kraft.

Wenn ein Investor wissen will, ob er Standardaktien kaufen soll, fragt er:

- 1. Liegt der Dollar im Vergleich zum Euro höher als vor einer Jahr?**
- 2. Liegt die Inflationsrate niedriger als vor einem Jahr?**
- 3. War die letzte Diskontsatzänderung eine Senkung?**
- 4. Liegt das Datum zwischen 1. November – 30. April?**

Dieses Indikatorenmodell ist kein vollständiger Handelsansatz, da er die Entwicklung der Einzelwerte nicht berücksichtigt. Das Indikatorenmodell kann jedoch als Filter für langfristige Systeme dienen, da dieses Modell keine Chartdaten, sondern unabhängige Daten berücksichtigt. Der Gesamtmarkt kann auf seine Verfassung überprüft werden.

SENTIMENTINDIKATOR

Die Stimmung am Börsenmarkt kann am objektivsten durch die Anzahl der Neuemissionen von Aktien (IPO) pro Monat / Jahr ermitteln. Je bullischer der Markt, desto mehr Neuemissionen werden emittiert. Ein Bärenmarkt ist durch eine geringe Anzahl von IPO gekennzeichnet.

Ein historischer Vergleich mit ehemaligen Bullenjahren und Bärenjahren kann einen Anhaltspunkt geben. Darüber hinaus kann die Anzahl der IPO mit dem Vorjahr verglichen werden und ein Anstieg oder einen Abfall anzeigen.

Auch die Zahl der Kapitalerhöhungen kann verglichen werden. Eine Kapitalerhöhung hat durchaus den Effekt, dass „neue Aktien“ geboren werden. Die Kapitalerhöhungen können auf Jahres- und auf Monatsbasis verglichen werden.

LONGTERMN SYSTEM

BLUE CHIPS

1 -10 JAHRE

Setup:

Aktienakkumulation, wenn Leitindizes wie Dow Jones Industrial Average; DAX, STOXX 50, innerhalb eines Jahres mindestens 50 % verloren haben.

Der Bewertungszeitraum bezieht sich von 1. Januar des vorherigen Jahres bis zum 1. Januar des aktuellen Jahres.

Einstieg:

Die Gesamtsumme wird in 5 Tranchen unterteilt, wobei Kauflimits an der unteren Begrenzung der Kursspanne auf Wochenbasis gesetzt werden.

Das entspricht 1 Schwung nach unten entspricht 1 Einstieg.

5 Abschwünge bedeuten den kompletten Einstieg.

Anmerkung:

Bear Market wechselt nicht sofort in einen Bull Market, sondern der Kurs wird erst seitlich tendieren, um dann die Tendenz nach oben wieder aufzunehmen.

Bull Market wechselt nicht sofort in einen Bärenmarkt, sondern es findet ein seitliches Topping Out statt, das bis zu 3 Monate dauern kann statt

Anfangsstopp:

Für jede Tranche wird ein Stopp Loss Auftrag 15 % unter dem Einstiegskurs platziert.

Gewinnmitnahme:

Jährliche Gewinnmitnahme (Buchgewinn = prozentualer Verkauf vom Bestand; bei über 50 % Buchgewinn wird der Verkauf vom Bestand bei der Hälfte (50 % der Aktienbestands) gecappt (gedeckelt).

Thesaurierung:

Dividenden und realisierte Gewinne werden reinvestiert, wenn der Markt ein weiteres Mal 50 % korrigiert.

CHINA LONGTERM

1- 10 JAHRE

Setup:

CHINA Werte, die in Frankfurt gehandelt werden in gleichen Anteilen als Indexportfolio zusammenstellen.

Auswahl:

10 Volumenstärksten Aktien auf Jahresbasis in Frankfurt, werden zu gleichen Teilen über 10 Wochen akkumuliert.

Einstieg:

Montags um 10:00 Uhr Ortzeit in Frankfurt

Replacement:

Aktie fällt aus dem Indexdepot, wenn sie nicht mehr zu den 10 Umsatzstärksten Aktien auf Jahressicht gehört. Diese Aktie wird durch die aufrückende Aktie ersetzt.

Aktie fällt auch aus dem Depot, wenn eine Underperformance zum Index von 20 % festgestellt wird. Wenn dies geschieht wird die Aktie liquidiert und sie wird nur durch eine neue Aktie ersetzt, wenn der neue Kandidat eine Outperformance von mindestens 20% zum Gesamtindex vorweisen kann und zu den 10 Umsatzstärksten gehört.

Gewinnmitnahme:

Wenn sich Index verdoppelt, dann werden alle Aktienpositionen halbiert (Stichtag 1 Jahressicht, z.B. 1 Januar).

Realisierter als Rücklage:

Der realisierte Gewinn des Index wird als Rücklage verzinst, um zu reinvestieren, wenn Index sich halbiert (Stichtag 1 Jahressicht).

Idee:

Hohe Volatilität, starkes Wachstum, alternative zum Westmarkt, Währungsspekulation

NASDAQ COMPOSITE BANKEN 1-10 JAHRE

Setup:

NASDAQ COMPOSITE Bankenwerte, die auf 5 Jahressicht mindesten 90 % an Wert verloren haben.

Auswahl:

Davon werden die 10 Umsatzstärksten auf Jahresbasis ausgewählt. Diese 10 Umsatzstärksten Bankaktien werden in gleichen Teilen über 10 Wochen akkumuliert.

Einstieg:

Montag 16:00 Uhr Mitteleuropäische Zeit / Kauf in USA 30 Min nach Handelsbeginn.

Replacement:

Aktie fällt aus dem Index, wenn sie nicht mehr zu den 10 Umsatzstärksten Werten auf Jahressicht gehört.

Aktie fällt aus dem Index, wenn sie eine Underperformance von 50 % zum Index hat.

Gewinnmitnahme:

Wenn sich Index verdoppelt werden alle Aktienpositionen halbiert.

Gewinn als Rücklage: Der realisierte Gewinn des Index wird als Rücklage verzinst, um zu reinvestieren, wenn sich der Index halbiert (Stichtag 1 Jahr; z.B. 1 Januar).

Idee:

Der prozentuale Wertverlust bietet ein tolles Chance-Risiko Verhältnis, wenn die Bankwerte sich wieder erholen, um auf das Niveau vor der „Finanzkrise“ zu gelangen.

Der Spekulant kauft das, was kein anderer mehr haben will → niedriger Preis, kleine Margin

BONITÄTSINDIKATOR

Setup:

Dieser Indikator vergleicht die Rendite öffentlicher Anleihen, bei denen der Staat, die Länder oder die Kommunen die Schuldner sind, mit der Rendite von Industriefirmen (DJIA, EUROSTOXX) aufgelegt werden.

Einstieg:

Wenn der Rendite Spread zwischen Industriefirmen (Hauptmarkt) und Staatsanleihen (Sekundärmarkt) kleiner wird, dann deutet das auf einen größeren Optimismus im Markt hin. Dies kann **bullish** für den Aktienmarkt gesehen werden.

Wenn der Rendite Spread zwischen Industriefirmen (Hauptmarkt) und Staatsanleihen (Sekundärmarkt) größer wird, dann deutet das auf eine Skepsis hinsichtlich der Bonität der Unternehmen ihre Anleihen und Zinsen zu bedienen.

Dies kann **bearish** für den Aktienmarkt gesehen werden.

Erklärung:

Die Rendite bei Industriefirmen ist in der Regel größer als bei Staatsanleihen, da hier größere Unsicherheit gegenüber der Zahlungsfähigkeit der Unternehmen herrscht.

BUCHWERT INDIKATOR

Setup: Check Buchwert je Aktie gemessen an der Bilanzsumme.

Einstieg: Wenn Marktkapitalisierung (aktueller Börsenkurs) unter den Buchwert je Aktie gemessen an der Bilanzsumme fällt.

Akkumulieren:

Die 1. Position beträgt 20 % des angestrebten Gesamtvolumens.

Jeder weitere Kauf beträgt 20 % des Gesamtvolumens, wobei in 5 Tranchen gekauft wird
-> 5 x 200 Stück = 1000 Stück

In einer Woche darf nur eine Tranche akkumuliert werden, d.h. dass der Zeitrahmen nicht gewechselt werden darf.

Es darf keine weitere Position aufgebaut werden, solange Position keinen Buchgewinn erreicht hat -> keine Verlustposition vergrößern.

Stopps:

Der Anfangsstopp wird 10 % vom Einstiegskurs gesetzt

Der Trailingsstopp wird um die Punktzahl einer positiven Kerze zu meinen Gunsten nachgezogen.

Der Zeitstopp wird nach 5 Kerzen nach der Eröffnung der Pos. aktiviert.

Positionsgröße:

Auf den 10 % Anfangsstopp wird 1 R = 1 % Kontorisiko gesetzt.

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

AMERICAN INVESTMENT INDEX FILTER

Zeitraumen: Wochenbasis

American Investment:

Wenn Dow Jones Industrial Average auf Wochenschlusskurs Basis mind. – 2 % Rendite oder - 200 Punkte aufweist, dann werden Aktien für den Investment Bestand akkumuliert.

Positive Wochenrendite:

Wenn der Dow Jones Industrial Average auf Wochenschlusskurs Basis eine positive Rendite aufweist, werden keine Aktien akkumuliert. → Keine Rallyes kaufen.

Einstieg: USA / GERMANY Montags

Beginn der Akkumulation um 16:00 Uhr bzw. 30 Minuten nach Handelsbeginn in USA.

Frequenz: 1 Woche = 1 Einstieg

Positionsgröße: 1 Tranche = 20 des angestrebten Gesamtvolumens.

AKKUMULATIONS PYRAMIDE AKTIEN MONATSBASIS

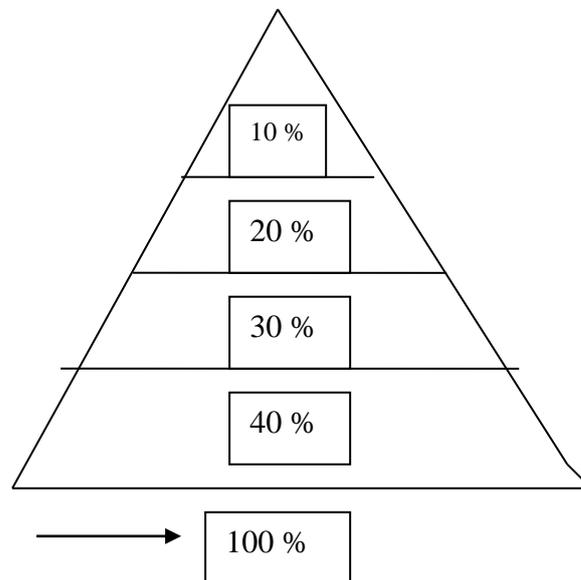
Trendfilter:

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **über** dem 20 Tage Tagesdurchschnittskurs liegen, um ein LONG Signal handeln zu können.

Auf einem 3 Monatschart muss der XETRA – Schlusskurs **unter** dem 20 Tage Durchschnittskurs liegen, um ein SHORT Signal handeln zu können.

Setup:

1. Tranche = aktueller Kurs – 10 % → 10 % der Gesamtsumme
2. Tranche = aktueller Kurs – 25 % → 20 % der Gesamtsumme
3. Tranche = aktueller Kurs – 50 % → 30 % der Gesamtsumme
4. Tranche = aktueller Kurs – 75 % → 40 % der Gesamtsumme



Idee: Die kleinste Position hat den höchsten Einstiegskurs und die größte Position hat den günstigsten Einstiegskurs. Dadurch wird der durchschnittliche Einstiegskurs auf das günstigste Niveau gezogen.

3 MONATE AUSBRUCH SYSTEM

Setup:

Die Kurspanne der letzten 3 Monate wird eingegrenzt, wenn Kurs über bzw. unter den Volatilitätsgrenzen schließt, dann wird eingestiegen.

Bewertung:

1 Handelstag des jeweiligen Monats

Einstieg:

3 Monate Höchstkurs → Stopp Buy Long Einstieg

3 Monate Tiefstkurs → Stopp Loss Short Einstieg

Die Einstiegsorders werden jeweils mit einem If-Done Auftrag über die eingegangene Stückzahl ausgestattet, um ggf. die Position zu drehen und im Worst-Case zu liquidieren.

Stops:

Anfangsstopp LONG Position ist das aktuelle 3 Monate Tief

Anfangsstopp SHORT Position ist das aktuelle 3 Monate Tief.

Trailingsstopp wird nach jedem Monat auf das aktuelle 3 Monatstief(hoch) nachgezogen.

Zeitstopp beträgt 1 Jahr, wenn kein Stopp gegriffen hat, dann wird liquidiert.

Positionsgröße:

1R= 1% des Kontovolumens → 1 % des Kontovolumens / 3 Monatshoch – 3 Monatstief

Verlustbremse:

Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).



STEIGUNGSGERADE 2 PUNKTE FORM 200 TAGE DURCHSCHNITT

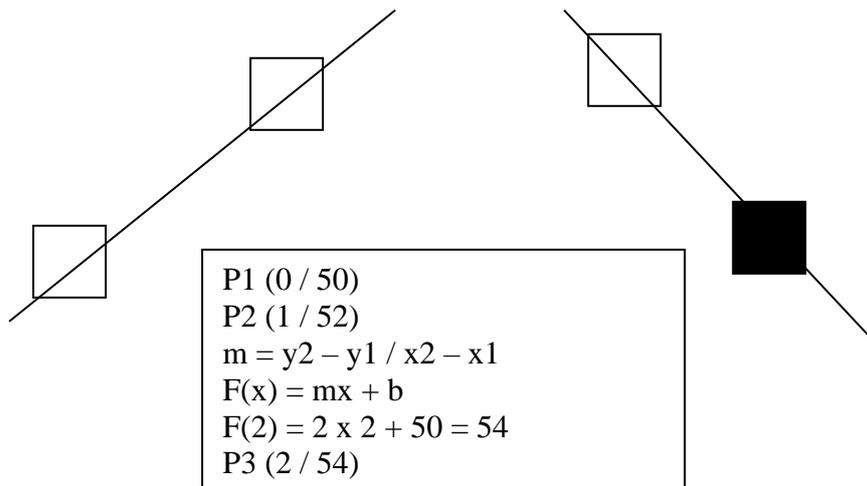
Setup:

Berechne die Steigungsgerade zwischen dem 200 Tage Durchschnitt vor 1 Monat.

Vergleiche den 200 Tage Durchschnittspunkt von heute.

Berechne den nächsten Punkt. per Formel: $f(x) = mx + b$

Berechne den Steigungswinkel der Steigungsgerade: SHIFT - Taste / tan – Taste / m



Chartdarstellung: Durchschnittskurs als Punktchart darstellen.

Einstieg:

LONG – Wenn der Steigungswinkel im Vergleich vor 1 Monat mind. 45 % beträgt.

SHORT – Wenn der negative Steigungswinkel im Vergleich vor 1 Monat mind. 45 % beträgt.

LONG: Stopp Buy - Hoch der Freitagskerze

SHORT: Stopp Loss - Tief der Freitagskerze

Stops:

Anfangsstopp wird 5 % Abstand zum Einstiegskurs gesetzt

Ausgleichsstopp wird nach 1 Woche benutzt, falls der Kurs im Plus ist

Trailingstopp wird nach der zweiten Gewinnkerze unter das Tief(Hoch) der jeweiligen Kerze gesetzt und bei weiteren Gewinnkerzen nachgezogen

Zeitstopp wird benutzt, wenn kein Stopp nach 5 Sitzungen erreicht wird.

Zeitrahmen: 1 Woche

Positionsgröße: 1 R = 1 % des Kontovolumens

Verlustbremse: Nach 2 Verlusten in Folge wird das System für den angewendeten Zeitrahmen gesperrt. Die gleiche Sperre gilt auch für den gehandelten Basiswert. (siehe Verlustbremse Definition).

. MODELL - PORTFOLIO

Modellportfolio Aggressiv:

Kasse: 10 %

- Euro/Dollar Bargeld 8 %
- Physisches Gold 2 %

Aktienquote LONG: 80 %

- Maximal 8 Einzelwerte je 10 %
- Minimal 2 Einzelwerte je 40 %

Optionen + Derivate 10 %

- Maximal 1 % pro Derivat
- Maximal 10 Derivate je 1 %
gleichzeitig

Modellportfolio Ausgewogen:

Kasse: 25 %

- Euro/Dollar Bargeld 15 %
- Physisches Gold 10 %

Aktienquote LONG: 50 %

- Maximal 5 Einzelwerte je 10 %
- Minimal 2 Einzelwerte je 25 %

Optionen + Derivate 10 %

- Maximal 1 % pro Derivat
- Maximal 10 Derivate je 1 %
gleichzeitig

Festverzinsliche Anlagen 15 %

- 15 % Anlage auf 1 Jahr verzinst

Modellportfolio: Konservativ

Kasse: 50%

- Euro/Dollar Bargeld 40 %
- Physisches Gold 10 %

Aktienquote LONG 20 %

- Maximal 2 Einzelwerte je 10 %
- Minimal 1 Einzelwert je 20 %

Festverzinsliche Anlagen 30 %

- 30 % Anlage auf 1 Jahr verzinst.

Modellportfolio Hedging Aggressiv:

Kasse: 10 %

- Euro/Dollar Bargeld 8 %
- Physisches Gold 2 %

Aktienquote: LONG 40 % / SHORT 40 %

- Maximal 8 Einzelwerte je 10 %
- Minimal 2 Einzelwerte je 40 %
- 1 € LONG → 1 € SHORT in einer
relativ schwächeren Aktie

Optionen + Derivate 10 %

- Maximal 1 % pro Derivat
- Maximal 10 Derivate je 1%
gleichzeitig

Modellportfolio Hedging Ausgewogen

Kasse: 30%

- Euro/Dollar Bargeld 20 %
- Physisches Gold 10 %

Aktienquote: LONG 30 % / SHORT 30 %

- Maximal 6 Einzelwerte je 10 %
- Minimal 2 Einzelwerte je 30 %
- 1 € LONG → 1 € SHORT in einer
relativ schwächeren Aktie

Optionen + Derivate 10 %

- Maximal 1 % pro Derivat
- Maximal 10 Derivate je 1%
gleichzeitig

Modellportfolio Hedging Konservativ

Kasse: 30 %

- Euro/ Dollar 20 %
- Physisches Gold 10 %

Aktienquote: LONG 20 % / SHORT 20%

- Maximal 2 Einzelwerte je 10 %
- Minimal 1 Einzelwert je 20 %
- 1 € LONG → 1 € SHORT in einer
relativ schwachen Aktie

Festverzinsliche Anlage: 30 %

- 30 % Anlage auf 1 Jahr verzinst

FUN AND PROFIT KONZEPTE

FUN AND PROFIT KONZEPTE

CHECKLISTEN:

- 25 Fehler beim Trading
- 12 Stufen Methode
- Allgemeine Regeln
- Handelsregeln
- Technische Analyse Regeln
- Regeln zum Positionsaustritt
- Aspekte / Bestandteile eines Handelssystems
- Checkliste Peak Performance

ERKLÄRUNGEN:

1. 5 Fehler beim Handel mit Optionen
2. Hartes Dach / Harter Boden
3. Money Management Low Margin Konten
4. Der natürliche Zyklus der Kursspannenveränderung
5. Tails Thesen
6. Volumenspitzen
7. Die Stadien der Kursbewegung
8. Akkumulation – Die letzte Marktberingung
9. Distribution – Der Höhepunkt der Verkäufe
10. Trend - Definition
11. D I S C I P L I N E
12. Steigungsgerade / Steigungswinkel / Trendkanal
13. Ausstiegsmöglichkeiten
14. Interview Zielformulierung
15. Dividenden Allgemein
16. Optionsscheine Kennzahlen
17. Korrelation Beta Faktor
18. Steigungswinkel berechnen
19. Aktion und Reaktion
20. Zeitrahmen
21. Rendite / Sicherheit / Liquidität – Dreiecksverhältnis
22. Sektoren und Branchen
23. Texas Hold'em Poker System

REGELN DER BÖRSE:

1. FWB PRÄSENZHANDEL
2. BÖRSE DÜSSELDORF
3. XETRA

25 FEHLER BEIM TRADING

- 1) Sie haben versäumt sich selbst und Ihre Mission zu definieren
- 2) Sie haben versäumt, sich auf der Basis Ihrer Mission und Ihrer Selbstdefinition Ziele zu setzen
- 3) Kein spezifisches Set von Tradingregeln entwickelt, die zu Ihrer Mission und Ihren Zielen passen
- 4) Keine Regeln getestet oder simuliert
- 5) Keine alltäglichen Aufgaben erledigt. Diese Aufgaben sind: Selbstanalyse, mentale Beschäftigung mit dem vergangenen Handelstag und möglichen Probleme, die tägliche Aufzeichnung des Tradings und die Beurteilung dieser Aufzeichnungen
- 6) Einstieg, ohne zu wissen, wo Ihr Kapitalschutz ist. Damit verbunden ist, sich nicht an Ihre definierten Stopps zu halten
- 7) Zu frühe Gewinnmitnahme
- 8) Sie beobachten Ihr Trading nicht genau und lassen sich ablenken. Man darf bei Trading nicht müde oder erschöpft sein
- 9) Man achtet darauf, was anderer tun und folgt dem Markt
- 10) Sie lassen sich von der Spannung mitreißen, laufen Trades nach, Handeln zu hoch und vergessen Ihre Tradingregeln
- 11) Ihre Position ist zu groß oder zu klein
- 12) Sie lassen zu, dass Ihr Leben derart aus dem Gleichgewicht gerät, dass Ihr Trading dadurch sabotiert wird.
- 13) Sie traden in Zeiten wichtiger Veränderungen in Ihre Leben
- 14) Sie werden zu optimistisch und denken, Sie könnten den Markt voraussagen
- 15) Sie lassen zu, dass Emotionen Sie an gutem Trading und an der Befolgung Ihrer Regeln hindern
- 16) Sie bleiben in einer stagnierenden Positionen engagiert oder traden, wenn der Markt sich nicht bewegt und keine Chancen bietet
- 17) Sie kennen das ECN, mit dem Sie traden, oder die von Ihnen benutzte Software nicht gut genug
- 18) Sie halten einen IntradayTrade über Nacht (Margin Call)
- 19) Sie traden nachbörslich, in den ersten 15 Minuten oder in der Zeit zwischen 12:30 und 15:30 Uhr
- 20) Sie sammeln zu viele Infos und werden überwältigt
- 21) Ihr Trading richtet sich nach Gerüchten, die Sie in Chatrooms oder in den Finanzmedien aufgeschnappt haben.
- 22) Sie „verbilligen“ eine Verlustposition
- 23) Sie vermischen 2 Tradingstile auf demselben Konto, ohne ehe Sie nur bei einem davon Kompetenz erreicht zu haben
- 24) Verschiede Eingabefehler
- 25) Sie haben keinen Plan, wenn etwas schief geht

ASPEKTE PROFESSIONELLES TRADING

1. Persönlich

- Spirituell
- Moralisch
- Emotional
- Physisch
- Organisatorisch (Zeitmanagement und Aufzeichnungen)

2. Geschäftsplan für den Traderfolg formulieren

3. Trading

- Schriftlicher Tradingplan
- Tägliche Tradingdisziplin
- Checkliste für jeden Tradingtag
- Tradingaufzeichnungen
- Tradingtagebuch

4. Ergebnisorientierte Zielgebiete

- Monatliche Profitabilität
- Renditen des Investments
- Maximaler Drawdown
- Maximale Zahl von Verlustmonaten pro Jahr

„Entwerfen Sie einen Plan, um den Sie selbst Goldman Sachs beneiden könnte.“

„Die Tradingperformance ist Ihre Performance. Sie reflektiert Ihr Training und ihre Kondition ebenso gut, als wären Sie ein trainierter Athlet, der an den Olympischen Spielen teilnimmt. Wer gut trainiert hat und einen guten Coach besitzt, wird auch gut abschneiden. Wer sich schlecht vorbereitet hat und wenig über sich weiß, wird schlechtes Ergebnis erzielen.“

12 STUFEN METHODE

- Listen Sie Überzeugungen über die Märkte und Trading auf
- Sammeln Sie Marktinformationen
- Bestimmen Sie ihre Ziele
- Legen Sie einen Zeitrahmen und Ihren Tradingstil fest
- Finden Sie die besten historischen Muster innerhalb Ihres Zeitrahmens heraus und finden Sie heraus, was sie gemeinsam haben
- Verstehen Sie die Konzepte hinter den historischen Mustern und bestimmen Sie, wie Sie sie möglicherweise in Echtzeit bestimmen können
- Legen Sie Ihre Stopps und Transaktionskosten fest
- Entwickeln Sie ein Schema des Glatstellens Ihrer Trades zum Zweck der Gewinnmitnahmen und bestimmen Sie ihre Gewinnerwartung
- Suchen Sie nach R-Multiple-Trades
- Erhöhen Sie Ihre Gewinne durch angemessene Positionsgrößenbestimmung
- Suchen Sie ständig nach Möglichkeiten, Ihre Ergebnisse zu verbessern
- Stellen Sie Pläne für ein Worst-Case Szenario auf und gehen Sie Ihren Plan noch einmal vor jedem Trade durch

ALLGEMEINE REGELN

1. Untersuchen Sie, ob Sie wirklich traden wollen

Bevor Sie ein erfolgreicher Trader sind, müssen Sie enorm viel lernen und Sie setzen sich großen finanziellen Risiken aus. Sie müssen in Ihre Ausbildung Geld und Zeit investieren. Es ist durchaus möglich, dass Sie in ihren Anfangszeiten zusätzlich kontinuierlich Geld verlieren. Bevor Sie sich der Herausforderung Börse stellen, fragen Sie sich, ob Sie das auch wollen.

2. Seien Sie kein Perfektionist

Den perfekten Trade gibt es nicht. Verlieren ist Teil des Spiels und kommt konstant vor. Sehen Sie jeden Trade als einen von 10.000 auf einem langen Weg zum Erfolg an. Dadurch verliert ein einzelner Verlust – Trade an Bedeutung und Sie können Ihren Blick fürs Ganze schärfen. Sie werden an der Börse verlieren, die Frage ist nur, was unterm Strich steht.

3. Seien Sie ein Perfektionist

Steht diese Regel nicht mit Regel 2 in Konflikt? Ganz und gar nicht! Führen Sie jeden Trade perfekt durch. Halten Sie sich mit eiserner Disziplin Ihre Regeln und halten Sie mit regelrecht religiöser Konsequenz Ihre Stopp Kurse ein.

4. Haben Sie keine Angst vor Verlusten

Nichts wird Verluste mehr anziehen als die Angst davor. Beherrschen Sie Ihre Psychologie. Nehmen Sie das eine oder andere Psychologie – Börsenbuch in die Hand.

5. Seien Sie illoyal

Um Ihre Flexibilität zu bewahren, müssen Sie Ihren Positionen gegenüber immer illoyal sein. Verlieben Sie sich nicht in ihre großen Gewinner – sonst schmelzen sie dahin. Sie müssen in der Lage sein, Ihre Meinung schnell zu ändern und sich dementsprechend zu positionieren.

6. Bleiben Sie bodenständig

In starken Gewinnphasen kommt gerne das Super – Ich herausgesprungen – machen Sie ein paar Tage Pause, wenn Ihr Depot exorbitant angewachsen ist.

7. Machen Sie Pausen nach Verlustphasen

Noch viel wichtiger ist, nach Verlustphasen ein paar Tage Pause zu machen. Wenn Ihr Depot um 20 % geschrumpft ist, gönnen Sie sich eine Auszeit. Sie sind zu diesem Zeitpunkt nicht in Einklang mit den Märkten.

8. Werden Sie kein Fachidiot

Es gibt noch andere schöne Dinge auf der Welt außer Börse.

9. Das Spiel der Spiele:

Käufer vs. Verkäufer. Ihr Tradingplan muss aus diesen drei Teilen bestehen: Einstieg, Stopp, Ausstieg

HANDELSREGELN

1. Rekapitulieren Sie Ihre Charts konstant / Führen Sie ein Handelsjournal

Analysieren Sie täglich mehrere Charts und verfolgen Sie die Kursentwicklung nach ihrer Analyse weiter – selbst wenn Sie nicht investiert sind. Übung macht den Meister.

Archivieren Sie jeden Trade inklusive Chart, den Sie eingegangen sind.

Notieren Sie gewonnene Erkenntnisse, Gründe für den Einstieg, Stopp Niveau und Kursziel. Wenn die Position geschlossen wurde, evaluieren Sie Ihr Verhalten. Was können Sie beim nächsten Trade besser machen? Wo lagen die Fehler? Notieren Sie Nettogewinne und Nettoverlust. So sehen Sie, welche Trades dazu tendieren, in den Verlust zu laufen. Dadurch können Sie diese eliminieren.

2. Führen Sie ein Journal über Chart – Formationen

Katalogisieren Sie Ihre Erfahrungen und Bemerkungen über bekannte oder von Ihnen entdeckte Chart – Formationen.

3. Entwickeln Sie einen Handelsplan

Dies ist eine der wichtigsten und schwierigsten Regeln. Verfassen Sie Regeln für sich, unter welchen Umständen Sie wann Positionen schließen und öffnen. Erarbeiten Sie Stopp Loss Techniken und definieren Sie, wann welche Technik zum Einsatz kommt. Stellen Sie sich vor, Sie seien bei einem Hedge Fonds angestellt und Ihr Chef bittet Sie um einen schriftlichen Bericht Ihres Handelsstils.

4. Gewinnpositionen tendieren dazu, von Beginn an Gewinne zu verzeichnen.

Das ist ein allgemeines Phänomen, das Sie in der strikten Begrenzung von Verlusten unterstützt.

5. Handeln Sie immer nach Ihrer eigenen Meinung

Wenn Sie Short im DAX sind und die ganze Welt schreit, dass morgen der DAX durch die Decke geht, dann bleiben Sie investiert. Ändern Sie Ihre Positionen niemals aufgrund der Aussage eines anderen Marktteilnehmers – nicht einmal, wenn es Alan Greenspan ist. Ausnahme: Es ändert sich das technische Bild aufgrund der Aussage einer Position.

7. Kaufen Sie niemals eine Verlustposition nach

Manche Marktteilnehmer meinen, man könne seinen Einstand „verbilligen“, wenn man eine Verlustposition aufstockt. Sie verbilligen Ihre Position auf diese Weise nicht, sondern verteuern sie, da Sie den potentiellen Verlust vergrößern.

8. Bleiben Sie am Ball

Informieren Sie sich stets ausführlich. Lesen Sie Fachmagazine und Sachbücher, gehen Sie in Internetforen und besuchen sie Messen und Seminare. Dadurch bleiben sie stets über neue Techniken und Handelsansätze auf dem Laufenden. Stillstand ist Rückschritt. Rückschritt ist Verlust.

9. Ignorieren Sie die Massenmeinung über die künftige Kursentwicklung

Es kann Ihnen egal sein, was Zeitungen, Fernsehen und Nachbarn über die Börse sagen. Niemand anders außer Ihnen entscheidet, wie Sie sich positionieren. Wenn Sie erkennen, dass die Masse wie Sie positioniert ist, müssen Sie die Position nicht unbedingt schließen! Lassen Sie sich nur nicht von der gerade vorherrschenden Meinung beeinflussen und konzentrieren Sie sich auf die Charts.

TECHNISCHE ANALYSE

5. Legen Sie die Haltedauer vor dem Einstieg fest

Bevor sie eine Position eröffnen, sollten sie unbedingt die geplante Haltedauer festlegen. Vermischen Sie also auf keinen Fall die Zeithorizonte. Wenn Sie eine Position aufgrund eines 5 Minuten Chart eingegangen sind und Sie halten diese Position nach 4 Wochen noch immer, so haben sie eindeutig keinen legitimen Grund diese Position zu halten

6. Arbeiten Sie nicht nur auf einer Zeitebene

Konzentrieren Sie sich nicht ausschließlich auf den Wochenchart oder den 5 Minuten Chart. Nicht jeder Markt kann auf jeder Zeitebene getradet werden. Viele Day Trader begehen den Fehler, ausschließlich kurzfristige Positionen zu eröffnen. Diese verursachen hohe Gebühren und fahren nur kleine Gewinne ein. Aber man braucht auch die großen Swings, um profitabel zu sein. Umgekehrt wird der gleiche Fehler gemacht: Viele Großinvestoren und auch Fonds konzentrieren sich einzig und alleine auf langfristige Bewegungen. Doch tritt eine Seitwärtsphase oder ein Bärenmarkt auftritt, wären sie besser mit kleinen, aber feinen Gewinnen gefahren!

7. Planen Sie jeden Trade

Jeder Trade sollte geplant werden. Steigen Sie niemals impulsiv oder aufgrund eines Tipps in einen Trade ein. Tipps sind hilfreich, aber nur, wenn Sie noch eigene Nachforschungen und Analysen anstellen.

8. Warten Sie immer auf eine Bestätigung

Wenn Sie eine Position aufgrund eines technischen Signals eröffnen, sollte dies stets nur mit einer entsprechenden Bestätigung erfolgen. Handeln Sie niemals blind und folgen Sie niemals nur einen einzigen Indikator.

9. Legen Sie den Stopp- Loss vor Positionseröffnung fest.

Wie viel Sie maximal riskieren wollen, muss vor der Positionseröffnung bereits feststehen. Eröffnen Sie niemals einen Trade ohne ein Stopp Niveau. Ein einziger Fehler in dieser Sparte kann ihre ganzen Gewinne (und mehr) vernichten.

REGELN ZUM POSITIONSAUSSTIEG

1. Wenn Chart Formationen und oder andere Signale einen künftigen Trend gegen ihre Position anzeigen, ergreifen Sie Gegenmaßnahmen.

Wenn Sie sich in einem Trade befinden und es erste Anzeichen gibt, dass der Markt drehen könnte, müssen sie handeln. Das Beste ist, seinen Stopp Loss enger zu ziehen und dadurch das Verlustrisiko zu minimieren. Schließen Sie allerdings nicht blindlings jede Position, sonst kommen Sie nie in die Gewinnzone.

2. Wenn Ihr Stopp erreicht wird, dann steigen Sie aus

Sollten die Kurse Ihren Stopp Loss erreichen, steigen Sie unverzüglich aus. Das ist der Sinn eines Stopp Loss. Trainieren Sie Ihre Disziplin und bewahren Sie Ihr Vermögen.

3. Wenn die Position von Beginn an gegen Sie läuft, schließen Sie den Trade

Wenn die Position vom ersten Tag an herbe Verluste einfährt, schließen Sie die Position. Es ist unwahrscheinlich, dass das Setup, wegen dem Sie den Trade eingegangen sind, noch Gültigkeit besitzt. Steigen sie notfalls später zu einem „besseren“ Kurs erneut in die Position ein.

4. Wenn Sie nicht da sind, schließen Sie die Position

Wenn Sie verreisen oder sich nicht um Ihre Position kümmern können/wollen, schließen Sie Ihre Trades, bevor Sie längere Zeit abwesend sind. Es könnte unter Umständen ein teurer Urlaub werden.

5. Seien Sie immer wachsam

Werden Sie offenen Positionen niemals nachlässig. Verfolgen Sie sowohl Verlust- als auch Gewinnpositionen konstant, um den Marktverhältnissen entsprechend agieren zu können. Sie sollten zu jeden Zeitpunkt wissen, wann Sie die Position schließen werden und welchen Buchgewinn bzw. Buchverlust diese Position zurzeit aufweist.

6. Eröffnen Sie, nachdem Sie ausgestoppt worden sind, nicht sofort eine Position

Hüten Sie sich davor, kurz nachdem Sie aus dem Markt geschüttelt worden sind, wieder eine Position zu eröffnen. Dies kommt einem Nichtbeachten des Stopps gleich, da Sie wieder in derselben Verlustposition stecken.

7. Nehmen Sie niemals schnelle, kleine Gewinne mit

Die Maxime lautet: „Verluste begrenzen, Gewinne maximieren“. Hüten Sie sich davor, Gewinnpositionen frühzeitig abzustoßen. Nehmen Sie niemals Gewinne innerhalb der ersten drei bis sechs Candles mit.

8. Verwenden Sie dynamische Stopp Loss Niveaus

Passen Sie Ihren Stopp Loss der Kursentwicklung an. Ziehen Sie nach Kursgewinnen in einer Long – Position den Stopp Loss nach oben an. Minimieren Sie Ihr Risiko und sichern Sie Ihre Gewinne!

9. Vergrößern Sie niemals Ihr Risiko

Bewegen Sie Ihren Stopp Loss nur dann, wenn Sie Ihr Risiko dezimieren. Vergrößern Sie niemals ihr anfängliches Verlustpotential.

10. Schließen Sie niemals eine Gewinn - Position ohne ein Ausstiegssignal

Stellen Sie Gewinnpositionen erst nach einem konkreten Ausstiegssignal glatt.

BESTANDTEILE EINES HANDELSYSTEMS

- 1) Ein Set von Setup-Bedingungen für Screening Ihrer Aktien
- 2) Einstiegsregeln für die Aktien auf Ihrer Beobachtungsliste
- 3) ein Szenario für den schlechtesten denkbaren Fall, mit dem man einen Verlust von 1 R definieren kann
- 4) Regeln für die Gewinnmitnahme
- 5) Regeln für Positionsgrößenbestimmung
- 6) Regeln zum Wiedereinstieg

Alle Fehler sind im Grunde genommen psychologischer Natur. Und daher können alle Fehler in vier Kategorien unterteilen:

1. Fehler bei der Ausführung
2. Fehler beim Einstieg und beim Setup
3. Fehler beim Ausstieg
4. Fehler bei den Positionsgrößen

Um Fehler beim Trading zu korrigieren, müssen Sie regelmäßig drei Dinge tun:

- 1) Ihre Trades aufzeichnen
- 2) auf Basis dieser Trades jeden Abend auf Ihren Tradingtag zurückblicken
- 3) sich diese Dinge täglich ins Gedächtnis rufen, bevor sie traden

Die simpelste Lösung wäre ein Excel-Spreadsheet. Dieses Spreadsheet enthält neun Spalten, wobei jede Zeile einen einzelnen Trade repräsentiert:

1. Datum und Uhrzeit
2. Aktiensymbol
3. Einstiegskurs
4. Ursprüngliches Risiko (Stopp)
5. Anzahl der Aktien
6. Gesamtrisiko des Trades (R)
7. Gesamtgewinn oder –Verlust, inklusive Gebühren
8. Ihr R-Vielfaches
9. Haltezeit

CHECKLISTE PEAK PERFORMANCE

- 1) Widme ich mich vorbehaltlos dem Trading? Verpflichte ich mich, zu tun, was erforderlich ist, auch wenn das einen Vollzeitjob bedeutet, um die notwendigen Arbeiten erledigen zu können.
- 2) Bin ich bereit, Zeit zur Selbstanalyse aufzuwenden, weil ich weiß, dass ich selbst der wichtigste Faktor meines Tradings bin?
- 3) Bin ich bereit, für die Selbstanalyse ebenso viel Zeit aufzuwenden wie für die Marktanalyse
- 4) Bin ich bereit, Verluste zu erleiden (kleine Beträge) und zwar bei mehr als 50 Prozent der Fälle, weil ich weiß, dass Profitabilität von der Gewinnerwartung abhängt und nicht davon, Recht zu behalten?
- 5) Bin ich bereit, den Versuch aufzugeben, die Märkte zu kontrollieren und mich stattdessen darauf zu konzentrieren, meine Ausstiegstechniken zu kontrollieren?
- 6) Bin ich bereit, meine Emotionen aufzuzeichnen und damit anzuerkennen, dass sie von mir kommen und nicht vom Markt oder einer externen Situation?
- 7) Bin ich dazu bereit, meine emotionalen Muster zu finden und an Ihnen zu arbeiten?
- 8) Bin ich bereit herauszufinden, wer ich bin und was ich will, bevor ich an meinem Tradingsystem arbeite?
- 9) Bin ich bereit ein Handelssystem zu konzipieren, das perfekt zu meiner Persönlichkeit passt.
- 10) Bin ich bereit, zu mir passende Zielvorstellungen zu konzipieren, bevor ich mit dem Trading beginne?
- 11) Bin ich bereit, einen Algorithmus zur Positionsgrößenbestimmung zu entwickeln, um diese Ziele zu erreichen?
- 12) Bin ich bereit mein System zu simulieren, um herauszufinden, was ich bei wechselnden Marktbedingungen zu erwarten kann?
- 13) Bin ich bereits, Regeln zu entwickeln, die mein Verhalten bestimmen?
- 14) Bin ich bereit ein Tradingtagebuch zu führen?
- 15) Bin ich bereit jeden Tag auf meine Trades zurückzublicken, um bestimmen zu können, welche Fehler ich gemacht habe?
- 16) Bin ich bereit regelmäßig mental zu überprüfen, welche Fehler ich gemacht habe, wie ich Fehler korrigieren und die Dinge, die ich ohnehin schon gut mache, noch verbessern kann?

FUN AND PROFIT ERKLÄRUNGEN

5 FEHLER BEIM HANDEL MIT OPTIONEN(SCHEINEN)

FEHLER	Warum Verluste entstehen	Wie man Verluste vermeidet
Sich ausschließlich auf das Markttiming verlassen	Man ignoriert die implizite Vola; das kann dazu führen, dass man beim Optionskauf zu viel bezahlt	Sorgfältig analysieren, welche Optionen, eine historisch niedrige Vola besitzen
Nur kurzfristige Optionen kaufen, die einen geringen Zeitwert haben	Der Zeitwertverlust in den letzten 3 Monaten ist extrem und verursacht Verluste	Optionen wählen, die mindestens noch 3 Monate laufen.
Nur weit-aus-dem-Geld liegende Optionen kaufen. Das sind Optionen, die weiter als 5 % aus dem Geld liegen.	Man ignoriert die Wahrscheinlichkeit, das führt zum Kauf von Optionen mit geringer Gewinnwahrscheinlichkeit und großen Spread	Vor dem Einstieg, die Wahrscheinlichkeit, mit einem Option ins Geld zu kommen, beachten
Zu komplexe Strategien anwenden / Zu einseitige Strategien verwenden/	Führt dazu, die Übersicht und das Risiko aus den Augen zu verlieren	Ziele festlegen und dafür sorgen, dass die Position diese Ziele erreicht, ohne mehr Risiko einzugehen, als man tragen kann.
Ein zu weitmaschiges Netz auswerfen / hohe Diversifikation	Zu viel Zeitverlust bei der Suche unter illiquiden Optionen, großer Spread, keine gute Selektion.	Sich auf Basiswerte mit aktiv gehandelten Optionen konzentrieren

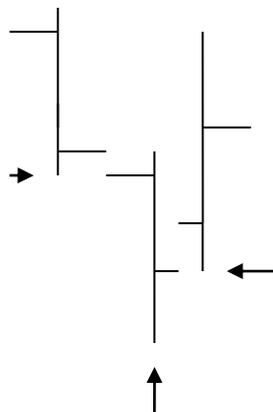
MARKTSTRUKTUR

Ich kann ein Markttief mit einer einfachen Formel identifizieren:

Sobald ein Kurstief (sprich das untere Ende eines Balkens) auftritt und die Tiefs von den Balken rechts und links davon jeweils preislich höher liegen als die des mittleren Balkens, repräsentiert der mittlere Balken und Zwischentief.

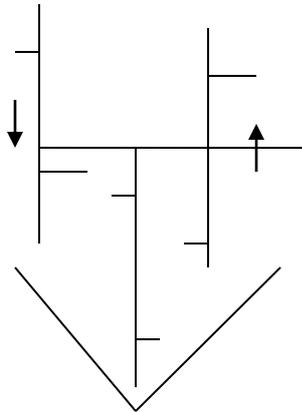
Bei einem Zwischenhoch gilt die umgekehrte Formel.

Kursverläufe gehen immer von Zwischenhoch zum Zwischentief



HARTER BODEN DEFINITION

100 Ticks /10 Min / Tageschart



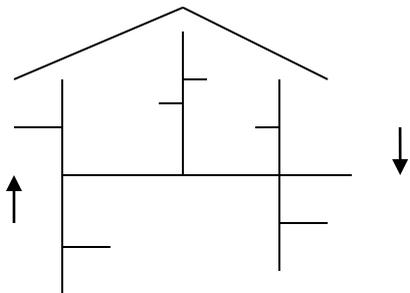
Definition:

1. Der mittlere Balken muss eine tieferes Tief als die beiden benachbarten Balken rechts und links.
2. Die beiden benachbarten Balken rechts und links müssen beide ein höheres Hoch haben als das Hoch des mittleren Balkens.

Wenn beide Bedingungen erfüllt sind, dann handelt es sich um einen „HARTEN BODEN“ → Umkehrsignal/Einstiegssignal

HARTES DACH DEFINITION

100 Ticks /10 Minuten / Tageschart



Definition:

1. Der mittlere Balken muss ein höheres Hoch haben als beide benachbarten Balken rechts und links.
2. Die beiden benachbarten Balken rechts und links müssen beide eine tieferes Tief haben als das Tief des mittleren Balkens.

Wenn beide Bedingungen erfüllt sind, dann handelt es sich um ein „HARTES DACH“ → Umkehrsignal/ Einstiegssignal

MONEY MANAGEMENT – LOW MARGIN KONTO

Definition:

Low Margin Konten sind Konten, die einen größeren Hebel als 5 anbieten.

Das Börsenjahr wird in 4 Quartale, ausgehend vom 1. Januar des Jahres an, unterteilt. Ein Quartal entspricht 3 Monaten. Danach wird eine Summe festgelegt, die man bereit ist in einem Jahr zu **VERLIEREN**. Dieser Betrag sollte **maximal 20 %** des Gesamtvermögens betragen. Bei einem Vermögen von 100.000 € entspricht das einem Risiko von $1R = 20.000€$

Dieser 20 % Anteil des Vermögens wird in 4 Tranchen auf das Tradingkonto überwiesen. Jeweils zum **1. Januar / 1. April / 1. Juli / 1. Oktober** des Jahres werden 5 % des Vermögens auf das Tradingkonto überwiesen.

Bei einem kleineren Prozentsatz des Vermögens z.B. 10 % wird diese Summe durch 4 geteilt und am entsprechenden Datum überwiesen.

Dieser Ansatz verhindert, dass man am Anfang der Tradingaktivität voll investiert ist. Darüber hinaus besteht die Möglichkeit während des Jahres wieder zurückzukommen, falls das Konto einen Verlust bzw. **Totalverlust** erlitten hat. Es entsteht der Effekt der **zeitlichen Streuung** und der psychologische Druck ist nicht so stark, wenn Geld in Reserve gehalten wird.

Nach 4 Quartalen findet eine Abrechnung statt, wenn mehr Geld auf dem Konto ist, als bei der 1. Tranche überwiesen wurde, dann wird überschüssiges Kapital abgezogen. Wenn kein Kapital mehr vorhanden ist, dann muss eine Berechnung des aktuellen Vermögens vollzogen und ein neuer Euroanteil, gemessen am Gesamtvermögen, errechnet werden.

Jedes neue Jahr startet mit der kleinsten Tranche. Im Laufe des Börsenjahres wird das Tradingkapital vergrößert.

NATÜRLICHER ZYKLUS EINER KURSBEWEGUNG

Der Zyklus wiederholt sich jahrein, jahraus. Kleine Kursspannen werden von großen Kursspannen abgelöst – und diese wiederum von kleinen Kursspannen. Das funktioniert wie ein Uhrwerk – es ist der Schlüssel für erfolgreichen Handel.

Was nämlich die Aufmerksamkeit der Öffentlichkeit und der Amateure auf die Börse zieht, sind starke Kursbewegungen. Die Öffentlichkeit und die Amateure glauben, dass die Intensität der Kursveränderung weiterhin so stark ausfallen wird. Meistens irren sie mit dieser Annahme.

Es ist das typische Verlierer-Spielchen, in einen Markt einzusteigen, der für die letzten Tage „heiß“ war – dieser wird, nachdem die Öffentlichkeit auf diesen aufmerksam wurde, wahrscheinlich in eine Konsolidierungsphase bzw. eine Seitwärtsphase eintreten.

Wir halten nach Märkten Ausschau, die in der Vergangenheit hoch volatil waren und deren Kursspannen dafür bekannt sind besonders groß zu sein. Allerdings müssen diese Märkte in letzter Zeit kleine Kursspannen produziert haben, weil wir wissen, es wird bald eine große Kursspanne auftreten - und das in naher Zukunft.

Wir werden vor jeder großen Kursspanne mit sich verkleinernden Kursspannen vom Markt „gewarnt.“

Kleine Kursspannen zeugen große Kursspannen

Große Kursspannen zeugen kleinen Kursspannen.

- Wenn Sie eine Long-Position halten und die Kurs unter den Eröffnungskurs purzeln, obwohl sie einen Balken erwarten, der saftige Gewinne einführt: stellen Sie glatt
- Wenn Sie eine Short-Position halten und die Kurse sich weit über dem Eröffnungskurs festigen können, obwohl Sie einen Balken mit saftigen Verlusten erwarten, dann stellen Sie glatt.
- Versuchen Sie niemals, große Kursrücksetzer unterhalb des Eröffnungskurses zu kaufen in der Erwartung, dass der Schlusskurs über dem Eröffnungskurs liegt.

Je kürzer Ihr Anlagehorizont, desto weniger Geld werden Sie verdienen, denn Gewinne brauchen Zeit um zu wachsen. Erfolgreiche Bauern pflanzen auch nicht an, nur um Minuten später die Erde wieder aufzubuddeln, um nachzusehen, wie sich die Ernte entwickelt. Sie geben der Pflanze Zeit zu wachsen. Wir Trader können viel von diesem Prozess des natürlichen Wachstums lernen. Erfolg an den Börsen folgt demselben Prinzip: Gut Ding braucht Weile. Immer wenn ich versucht hab herumzuhüpfen habe ich Geld verloren.

Um langfristig profitabel zu traden, kommt es nicht darauf an, wie aktiv sie traden, dass heißt in welchen Intervallen die Positionen eröffnen und wieder schließen, sondern ob sie wirklich nur die besten Gelegenheit beim Schopf packen.

TOPPING TAIL THESEN

- Eine Kehrtwende ist nach einem Tail in der Regel etwas betonter
- Tails zeigen, wo Glattstellungen auftraten
- Ein Topping Tail deckt auf, wo professionelle Verkäufer Aktien an die Allgemeinheit abstoßen
- Ein Bottoming Tail deckt auf, wo professionelle Käufer billig einsammeln
- Ein Bottoming Tail ist am bemerkenswertesten, wenn er nach einigen sinkenden Balken auftritt
- Wenn ein Bottoming Tail nach einigen sinkenden Balken auftritt, wartet der Master Trader darauf, dass die Aktie wieder steigt.
- Ein Topping Tail ist am bemerkenswertesten, wenn er nach einigen steigenden Balken auftritt
- Wenn ein Topping Tail nach einigen Balken auftritt, wartet der Master Trader, bis die Aktie wieder fällt

Der Master Trader versucht, über dem Hoch eines Bottoming Tails nach einigen sinkenden Balken zu kaufen

Der Master Trader versucht, unter dem Tief eines Topping Tails nach einigen steigenden Balken zu kaufen

VOLUMENSPITZEN

Das Volumen in seiner nützlichsten Form teilt uns mit, wann einer Aktie der Kauf- oder Verkaufstreibstoff ausgeht. **Volumenspitzen nach einem starken Anstieg oder Abfall zeigen an, dass eine baldige Kurswende bevorsteht.** Die wichtigste Aussage in dieser Regel: „nach einem starken Anstieg oder Abfall“.

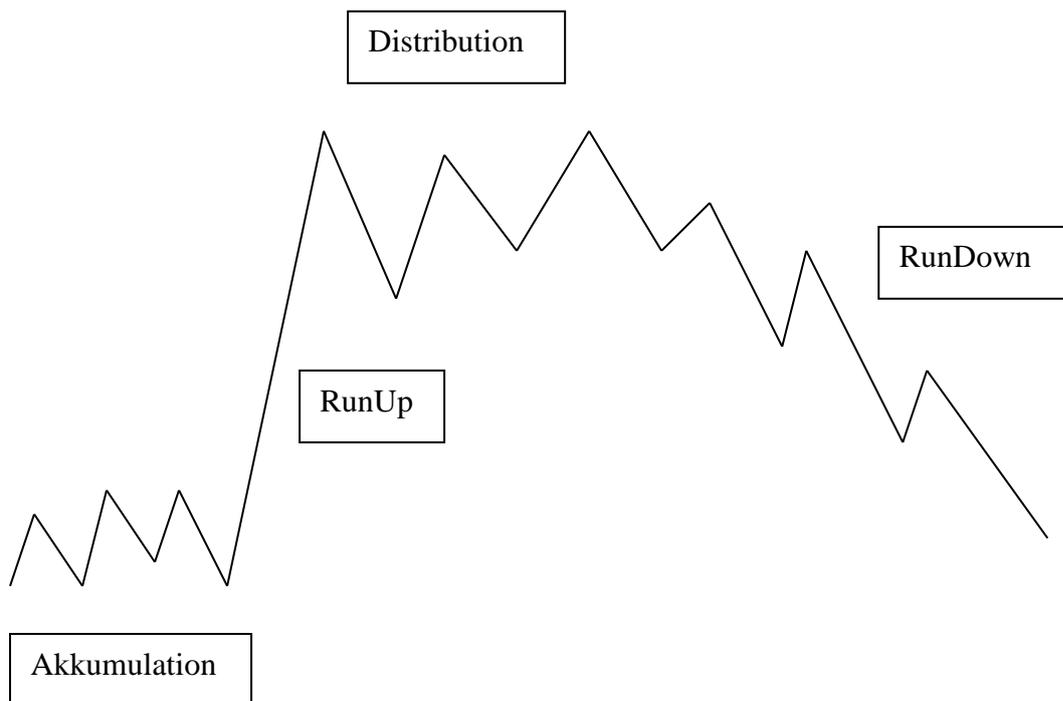
DIE STADIEN DER KURSBEWEGUNG

Alle spekulativen Märkte durchlaufen die folgenden Stadien der Kursbewegung:

- Akkumulation(Anhäufung von Stücken) – Das Tief des Marktes
- Anstieg oder Ausbruch
- Distribution(Verteilung von Stücken) – Das Hoch des Marktes
- Abfall oder Einbruch

Der Chart enthält viele Informationen: Übersteigt die Nachfrage das Angebot, dann steigt der Kurs, bis ein Gleichgewicht hergestellt ist. Der Chart ist auch ein Abbild von Angst und Gier.

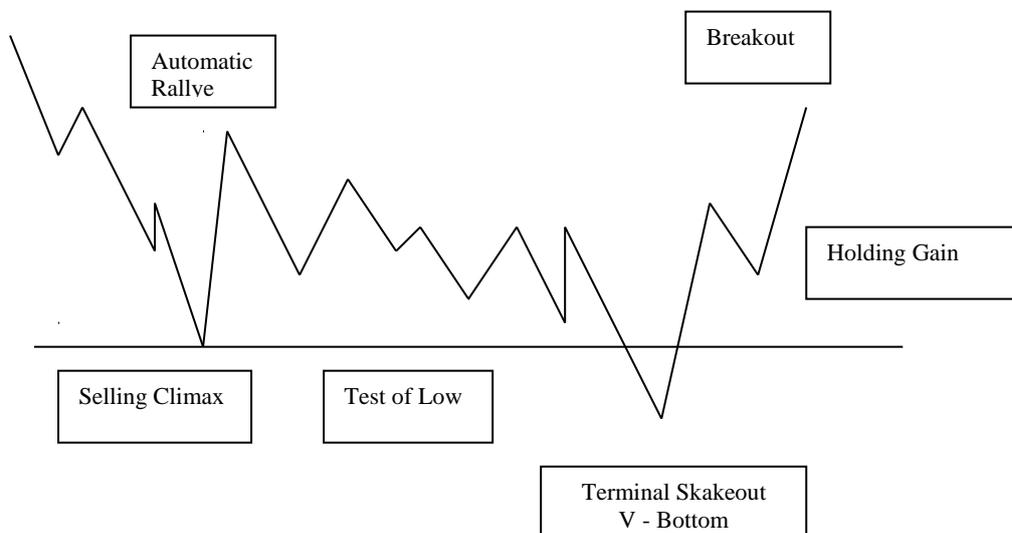
- Gier: „Hätte ich nur mehr davon gekauft, da hätte ich Millionen verdienen können.“
- Angst: „Wenn der Kurs weiter so einbricht, dann verliere ich noch alles.“



AKKUMULATION – DIE LETZTE MARKTBEREINIGUNG

Die Akkumulation beginnt oft mit einem Selling Climax. Eine Verkaufsspitze ist durch mehrere negative Balken mit großen Spannen gekennzeichnet, wobei der letzte Balken die größte Spanne bei stark steigendem Volumen zeigt. Darauf folgt ein scharfer Kursanstieg, der den letzten Run Down korrigiert. Diese scharfe Rallye ist eine Voraussetzung für den Anfang einer Akkumulationsphase. Im Anschluss an diese Rallye testet der Markt das Tief mehrmals. Ein potentieller Einstiegspunkt für einen Kauf ist der dritte oder vierte Einbruch bzw. Test des ursprünglichen Selling Climax.

Wenn der Kurs nach längerer Zeit und mehreren Versuchen ein tieferes Tief bildet, dann ist es wahrscheinlich, dass es sich um eine letzte Marktbereinigung handelt, die dann den Run Up einleitet. Wenn beim ersten oder zweiten testen des Tiefs ein tieferes Tief gebildet wird, dann deutet das auf eine Fortsetzung des Abwärtstrends hin.



Am Ende der Akkumulation kann es zu einer letzten Marktbereinigung kommen. Diese zeigt sich als plötzlicher Einbruch des Kurses unter den gesamten Akkumulationsbereich bei gesteigerten Volumen. Darauf folgt ein ebenso schneller Anstieg, der den ganzen Verlust wieder wettmacht. Dann kommt oft ein relativ kleiner Kursverfall, der sich schnell umkehrt und mit großen Volumen und starkem Schub wieder ansteigt.

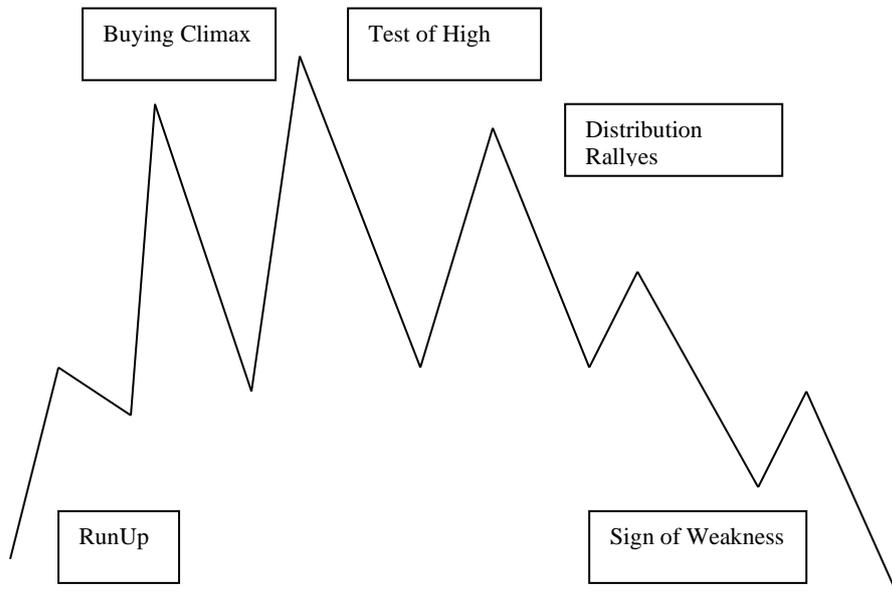
Die letzte Marktbereinigung stellt den Tradern eine Falle, die bei Erreichen eines neuen Tiefs glattstellen oder shorten. Diese Kursbewegung bildet ein V – Bottom.

Zusammenfassung:

1. Der erste Anstieg nach einem Selling Climax (Verkaufsspitze) hält nicht lange an.
2. Wenn Sie in der frühen Anfangsphase der Akkumulation kaufen, dann sind kleine Renditen bis zur Beendigung der Akkumulation wahrscheinlich
3. Die besten Gewinnchancen bieten sich, wenn Sie nach dem 3. oder 4. Test des Tiefs gegen Ende der Akkumulationsphase kaufen
4. Die größten Gewinne werden während des Run Up und dem Run Down gemacht.

DISTRIBUTION – DER HÖHEPUNKT DER KÄUFE

Die Distribution beginnt normalerweise mit einer Kaufspitze. Eine Kaufspitze wird durch mehrere positive Balken mit relativ großen Spannen gekennzeichnet, wobei der letzte Balken die größte Spanne bei stark steigenden Volumen zeigt. Auf die Kursspitze folgt ein scharfer Kurseinbruch, der den letzten Sprung des Run Up korrigiert. Auf diesen rapiden Kurseinbruch folgt ein Antesten des vorherigen höchsten Kurses. Diese Bewegung kann entweder früh wieder nach unten drehen oder auch zu einem neuen, etwas höheren Hoch führen.



Jetzt geht der Markt in eine Phase über, in der sich Angebot und Nachfrage mehr oder weniger die Waage halten. Nach einem scharfen Kurseinbruch wird es zu mehreren Kursanstiegen mit darauf folgenden Reaktionen kommen.

Zusammenfassung

1. Während der Distribution reagiert der Markt auf einen Kursverfall mit scharfen mehrtätigen Rallyes
2. Wenn Sie in der frühen Anfangsphase der Distribution verkaufen, dann sind kleine Renditen bis zu Beendigung der Distributionsphase wahrscheinlich
3. Die besten Gewinnchancen bieten sich beim 3. oder 4. Test des Buying Climax. Dies geschieht gegen Ende der Distributionsphase.
4. Die größten Renditen werden während des Run Up und Run Down gemacht.

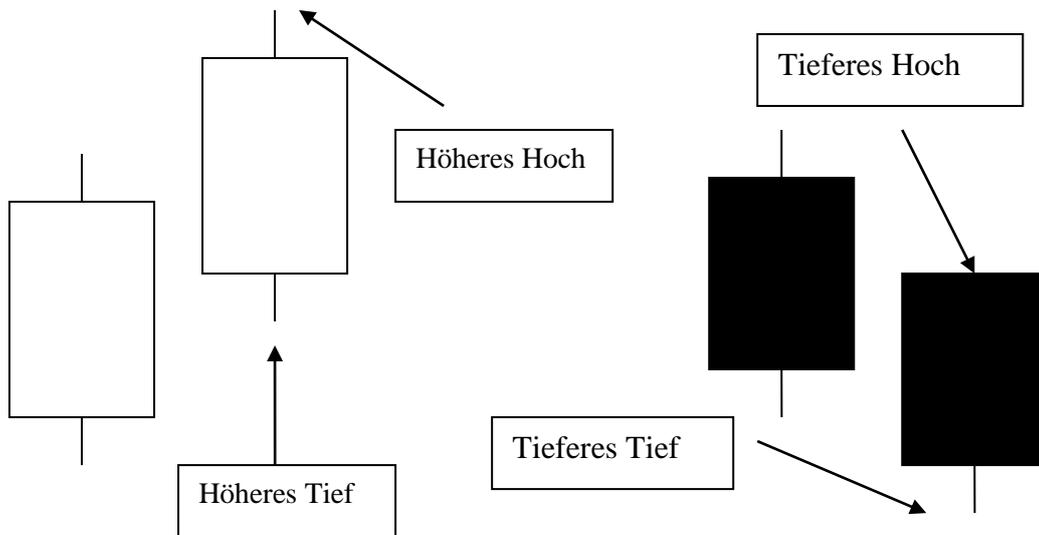
TREND – DEFINITION

Trend Definition:

Um einen Trend zu bestätigen braucht man die letzten 2 Kerzen.

Wenn die zweite Kerze ein höheres Hoch und ein höheres Tief hat als die vorherige Kerze, dann beschreiben diese beiden Kerzen einen Aufwärtstrend.

Wenn die zweite Kerze ein tieferes Hoch und ein tieferes Tief hat als die vorherige Kerze, dann beschreiben diese beiden Kerzen einen Abwärtstrend.

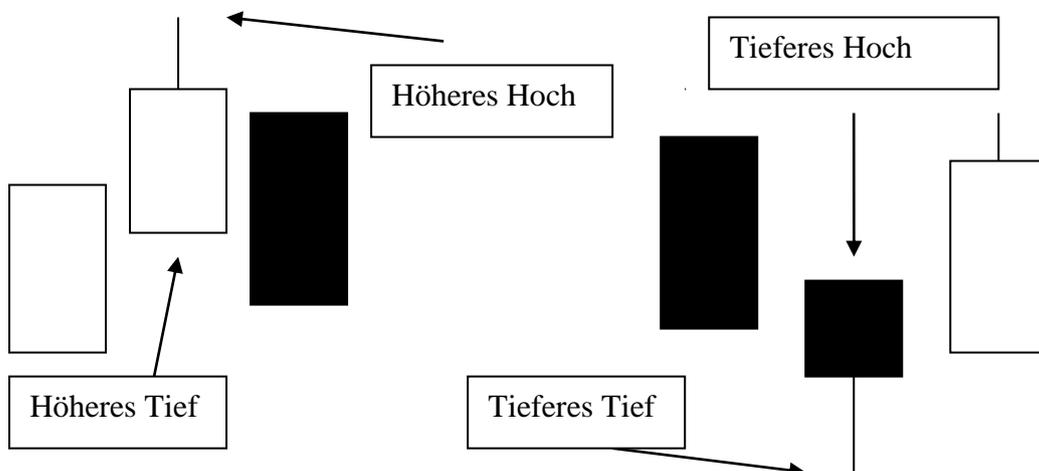


Trend Wechsel:

Um einen Trendwechsel zu bestätigen braucht man die letzten 3 Kerzen.

Wenn die zweite Kerze ein höheres Hoch und ein höheres Tief als die erste und die dritte Kerze hat, dann beschreiben diese drei Kerzen einen Trendwechsel.

Wenn die zweite Kerze ein tieferes Hoch und ein tieferes Tief als die erste und die dritte Kerze hat, dann beschreiben diese drei Kerzen einen Trendwechsel.



SOLLTE MAN EIN HANDELSYSTEM KAUFEN?

Sieht die hypothetische Überprüfung der historischen Daten von 10 Jahre gut aus?

Sie werden sich wundern, wie oft Systeme angeboten werden, die nur über kurze Zeiträume getestet wurden. Die Rechtfertigung hierfür ist, dass die Märkte sich verändert hätten und die Daten von vor 10 Jahren nicht relevant seien. Oft zeigen Anbieter die Ergebnisse der jüngsten Vergangenheit, vor allem bei Märkten, die einen starken Trend aufweisen.

Sieht die hypothetische Überprüfung anhand historischer Daten realistisch aus?

Blieben Sie realistisch! Wenn es übertrieben erfolgreiche Systeme gäbe, dann hätten wir schon längst keine Börsen mehr. Es kann eine Optimierung vorliegen.

Wenn es sich um ein System für mehrere Märkte handelt, sind die Parameter dieselben?

Verschiedene Parameter für verschiedene Märkte können auf eine Überoptimierung hinweisen. Die Parameter für verschiedene Märkte sollten ähnlich sein.

Gibt es glaubwürdige Erfolgsaufzeichnungen für die letzten 18 Monate?

Der realisierte Erfolg sollte mindesten halb so groß sein wie beim Test der historischen Daten.

Erscheint das System logisch konstruiert und nicht übermäßig komplex?

Systeme sollten möglichst einfach sein und auf Kursveränderungen basieren. Sehr komplexe Systeme sind in der Praxis schwer oder gar nicht anwendbar.

Scheint der Anbieter eher ein Techniker oder ein Verkäufer zu sein?

Nachdem Sie mit dem Anbieter Kontakt aufgenommen haben, ruft er Sie ständig an und drängt Sie zum Kauf? Betont er andauernd die überragenden Gewinne seines Systems, oder lässt er seine tatsächlichen Erfolgsaufzeichnungen für sich sprechen?

Wurde das System von einem Dritten überprüft?

Die Überprüfung durch dritte kann eine objektive Beurteilung abgeben. Jedoch ist es auch eine Praxis gewisse „Scheinkunden“ als Beweis der Gewinne anzuführen. Hier ist große Vorsicht geboten. Am Ende müssen Sie sich auf sich Ihr eigenes Urteil verlassen.

TRADING AUSBILDUNG

1. Handelt der Lehrer jeden Tag?

Wenn die Antwort „nein“ lautet, gehen Sie wieder oder hängen Sie den Hörer wieder auf. Dafür gibt es keine Entschuldigung. Würden Sie für Flugstunden bezahlen, wenn der Lehrer gar nicht selbst fliegt. Wenn die Antwort „ja“ lautet, finden Sie heraus, ob es sich um einen erfolgreichen Trader handelt. Würden Sie Flugstunden bei einem nehmen, der bei jedem Flugversuch abstürzt?

2. Ist die von der Firma angebotene Ausbildung ungewöhnlich billig?

Stellen Sie fest, warum sie so „unbezahlbares“ Wissen so billig anbieten. Tatsache ist, dass wenn Sie eine Harvard Ausbildung wollen, müssen Sie auch eine Harvard Ausbildung bezahlen. Sie erinnern sich, dass es keinen Ferrari für den Preis eines Fords gibt, egal wer der Autohändler ist oder für wie menschlich er sich hält.

3. Können Sie nach dem Seminar noch ein oder zwei Tag bleibe, um dem Lehrer beim Handel zuzusehen?

Wir denken, dass das Trading Seminar nichts wert war, wenn Sie der Lehrer nicht zusehen lässt, wenn er in Aktion ist. Wer handeln und unterrichten kann, sollte nicht dagegen haben, wenn Sie ihm beim Handel zusehen. Wenn nicht, dann schreiben Sie die Firma ab.

4. Werden in dem Seminar echte Trading-Techniken gelehrt, oder wird Ihnen nur beigebracht, wie Sie eine bestimmte Trading-Software benutzen?

Eine gute Trading-Technik wird immer wirksam sein, egal welche Trading-Software Sie benutzen. So eine Ausbildung ist am wertvollsten. Wenn wir von einer Trading-Ausbildung sprechen, dann sprechen wir nicht von einem Software-Trading. Wenn wir von einer Trading-Ausbildung sprechen wir von dem zeitlosen Wissen, das angewandt werden kann, egal ob der Trader seine Aufträge übers Telefon oder ein superschnelles ECN aufgibt. Das Hilfsmittel, das Sie zum Handel einsetzen, ist zwar wichtig, aber nicht das eigentlich Thema. Ein superschnelles Software-System in der Hand eines nicht ausgebildeten Traders ist nur ein schnellerer Weg in seinen Untergang. Schnelle Ausführung ist ein Vorteil, wenn Sie wissen was Sie tun. Ansonsten bringt es schneller die Defizite des Traders hervor.

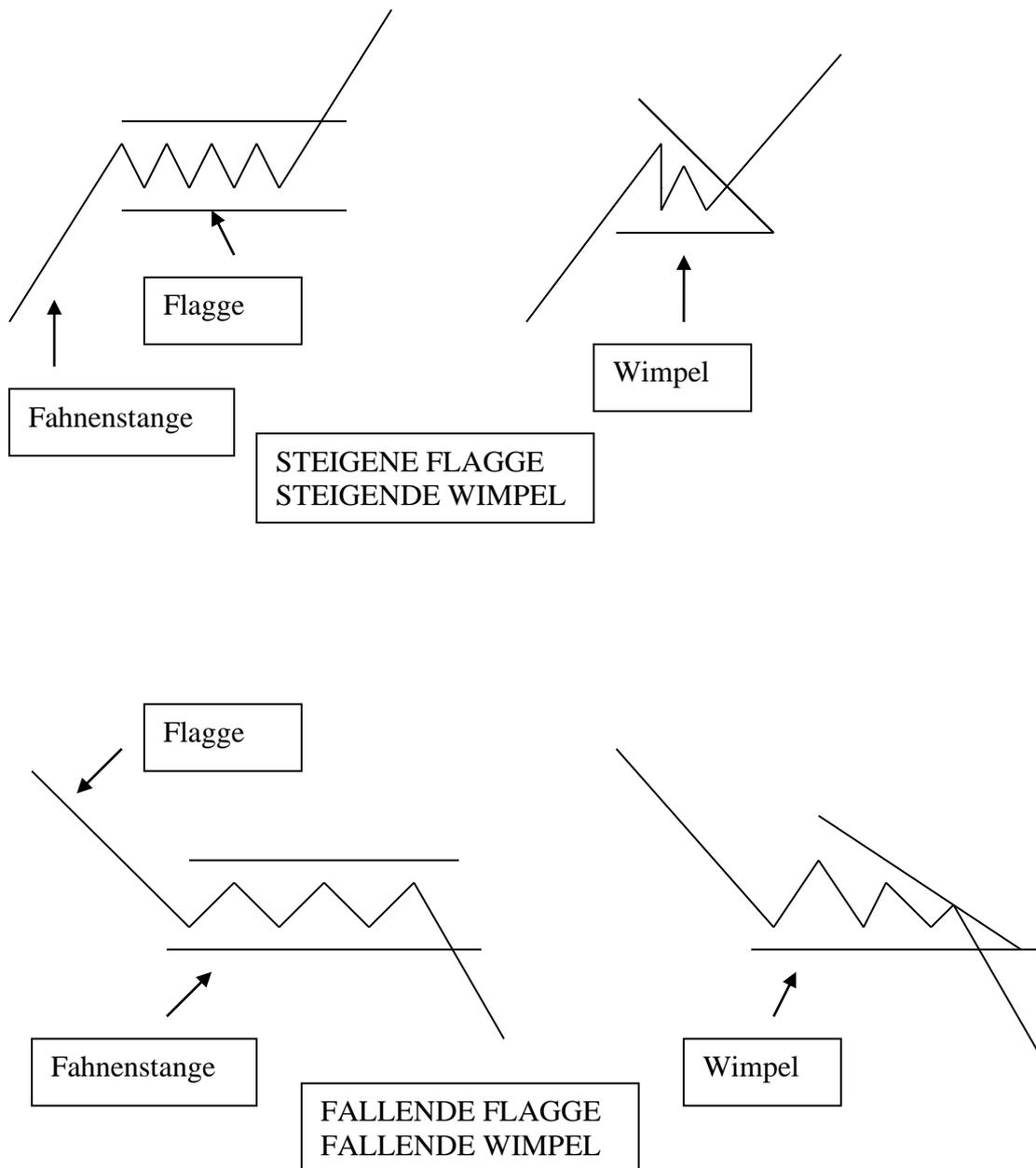
5. Können Sie mit dem Lehrer in Verbindung bleiben?

Das ist sehr wichtig, weil die immer breiter werdende Kluft zwischen dem Augenblick und Ihrem Ausbildungsseminar anfangs oft schwindenden Selbstvertrauen begleitet wird. Eine Firma, die Nachfolgeseminare gratis oder zum nominalen Preis anbietet, ist verantwortungsvoll und legt Wert darauf, dass Ihre Studenten Fortschritte machen.

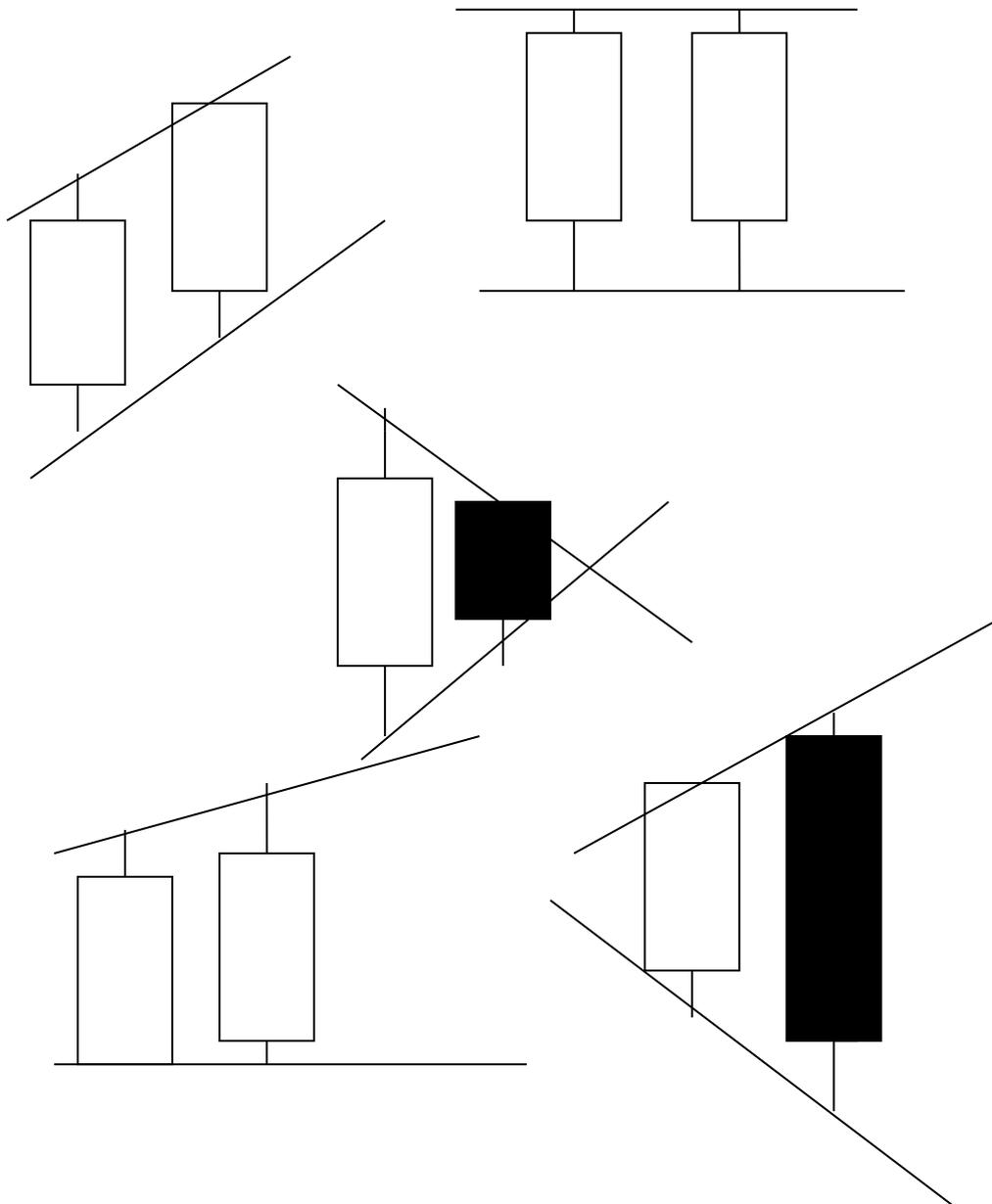
FLAGGEN UND WIMPEL

Flaggen und Wimpel bestehen aus drei Segmenten

1. Einen klar definierten, steilen Kursbewegung
2. Einer Korrektur dieser Bewegung
3. Einer Wiederaufnahme der ursprünglichen Bewegung



TRENDKANAL KONZEPTE



Trendkanalsorten:

Höheres Hoch / Höheres Tief – Trend Day
Tieferes Tief / Tieferes Tief – Trend Day

Höheres Hoch / Tieferes Tief – Outside Day
Tieferes Hoch / Höheres Tief – Inside Day

Gleiches Hoch / Gleiches Tief – Box Day

Höheres Hoch / Gleiches Tief – ½ Trend Day
Tieferes Tief / Gleiches Hoch – ½ Trend Day

AUSSTIEGSMÖGLICHKEITEN

Umkehr:

Dieser Ausstieg erfolgt, wenn ein System festgestellt hat, dass der Kurs in die andere Richtung als ursprünglich festgestellt geht. Das System schließt dann die offene Position und korrigiert sich selbst, indem es eine neue Position in die entgegengesetzte Richtung eröffnet. Dieser Umstieg kann profitabel enden oder auch nicht. Das Problem dabei sind die Fehlsignale, die auftauchen, wenn das System dem Kurs nachläuft. Das System eröffnet eine neue Position und der Kurs ändert die Richtung, also kehrt das System die Position um und korrigiert den Fehler, aber gleich wieder dreht der Kurs wieder und verläuft in die ursprüngliche Richtung. Systeme, die auf einem solchen Umkehrstopp basieren, sind permanent im Markt und warten auf langfristig anhaltende Trends. Es gibt keine Stopp Loss Grenzen oder Kursziele. Der Kurs bestimmt Ein- und Ausstiege.

Schützender Stopp:

Das System hat sich geirrt und schließt die Position mit einem geringen Verlust. Dieser Stopp bedeutet immer einen Verlust. Das Problem der schützenden Stopps liegt im frühzeitigen Ausstieg aus einem Trade. Es kommt vor, dass ein Trade durch einen weiter entfernten und nominal größeren Stopp den Drawdown aussitzen kann, um dann schließlich doch noch profitabel zu werden. Nichtsdestotrotz ist der schützende Stopp dazu da den Trader vor der Insolvenz zu bewahren. Deshalb ist die Ausführung des Stopps keine Katastrophe, sondern ein notwendiges Werkzeug um geschäftsfähig zu bleiben.

Kursziel:

Das System hat eine im Voraus festgelegte Gewinnzone erreicht und die Wahrscheinlichkeit, dass der Gewinn weiter ansteigt, ist gering. Dieser Ausstieg schließt die Position im Gewinn, deshalb ist er so beliebt. Es ist aber leider so, dass die meisten profitablen Systeme Ihren Profit aus einigen wenigen großen Gewinnpositionen erwirtschaften. Sozusagen sind es die statistischen Ausreißer, die an der Börse das große Geld bringen. Wenn man mit einem festen Kursziel arbeitet, dann hat man keine Chance die Ausreißer zu erwischen.

DISCIPLINE

D – Don't forget old support and resistance levels (Vergessen Sie nie die alten Unterstützungs- und Widerstandsniveaus). Alte Unterstützungen werden zum Widerstand und umgekehrt.

I – If...then system (Wenn... dann System). Wenn der Markt Ihre Erwartungen erfüllt, dann halten Sie ihre Position – andernfalls aussteigen.

S – Stopps immer benutzen

C – Consider options. (Alle Ihnen zur Verfügung stehenden Möglichkeiten in Betracht zu ziehen)

I – Intraday technicals are important even if you are not a day or a swing trader. (Intraday Signale sind wichtig, selbst wenn sie kein Day oder Swing Trader sind).

P – Pace trades to market environment. (Trades sollten der Marktumgebung entsprechen). Ändern Sie Ihren Börsenstil je nach Marktsituation.

L – Locals, never forget them. Vergessen Sie nie die Lokaltrader

I – Indicator, the more the better. Indikatoren – je mehr desto besser

N – Never trade in the belief the market is wrong. (Handeln Sie an der Börse nie in dem Glauben, der Markt sei im Unrecht.)

E – Examine the market's reaction to news. (Beobachten Sie die Marktreaktion auf Nachrichten).

THEORIEN

Portfolio:

Der Schwächste fliegt – der Stärkste siegt

Die Gewinnerpositionen werden gehalten – die Verliererpositionen werden liquidiert.

Zufall:

Wenn mehrere Einzelwerte das gleiche Handelssignal und die gleiche Trendrichtung anzeigen, dann wird 1 Einzelwert per Los aus einem Topf gezogen → Auslosung Fußball

Wenn mehrere Einzelwerte ein Investment Signal liefern dann wird 1 Einzelwert per Los aus einem Topf gezogen → Auslosung Fußball

Es kann auch ein Zufalls - Trade ausgelost werden. Dazu wird aus allen Aktien in einem Index nur 1 Aktie als Basiswert ausgelost. Dann muss noch die Trendrichtung Long/Short ausgelost werden. → Auslosung Fußball

PERSÖNLICHKEITS CHECKLISTE

1. Denk immer an das Gebet

- Der Herr wird mir helfen, wenn ich ihn darum bitte.
- Ohne den Herrn kann ich nichts erreichen, mit ihm kann ich alles erreichen

2. Selbsterkenntnis

- Bin ich ein Glücksspieler?
- Setze ich mein Geld gerne im großen Stil aufs Spiel?
- Denke ich billig?
- Bedeuten mir Kurs oder Qualität mehr?
- Hasse ich sogar kleine Verluste?
- Ist der Kick genauso wichtig wie das Gewinnen?
- Bin ich geduldig?
- Wo liegt meine Hemmschwelle für Risiko?

3. Erkenne den Feind

- Wer sitzt am anderen Ende meines Trades?
- Übersehen Sie sich nie selbst, wenn Sie einen Schuldigen suchen

4. Besorge dir eine Ausbildung und zwar schnell

- Suchen Sie eine Qualitätsfirma, die ein Trainingsprogramm für Trader anbietet
- Lesen Sie die Tradingbücher, auf die es wirklich ankommt

5. Schütze dein wertvollstes Gut

- Beim Einstieg muss gleichzeitig ein Anfangsstopp beim Broker gesetzt werden

6. Einfachheit

- Würden Ihre Tradingtaktiken einen intelligenten 12 jährigen ernsthaft verwirren?
- Sind für Ihr Trading mathematische Berechnungen notwendig?
- Benötigen Sie einen Taschenrechner beim Trading?
- Benötigen Sie mehr als 3 Computerprogramme für die Ausführung ihres Trades
- Benötigen Sie mehr als 5 Minuten, um ihre Tradingstrategien aufzuschreiben

7. Lerne aus deinen Verlusten

- Führen Sie ein Tradingtagebuch?
- Führen Sie ein Tradingjournal?

8. Konzentriere dich nicht hauptsächlich auf niedrig bewertete Aktien

- Ein 2 € Anstieg, in einem Tag, ist für eine 60€ Aktie fast ein normales Ereignis. Ein 2€ Anstieg bei einer 10€ Aktie ist so selten, dass es wahrscheinlich am nächsten Tag in der Zeitung steht,

9. Keine Streuung

- Streuung schließt weder Verluste aus, noch erhöht sie die Chancen auf Gewinn. Sie bietet eventuell ein dickeres Kissen, wenn ein Trader falsch liegt, gleichzeitig vermindert es auch den Gewinn, wenn der Trader richtig liegt.

10. Erkenne, dass keine Action manchmal die beste Aktion ist

- Mangel an Geduld
- Unwissenheit, wann Nichtstun die beste Aktion ist.
- Wie viele Kauf- oder Verkaufsentscheidungen basieren auf einem festgelegten Plan und wie viele erfolgen, weil Sie nervös, gelangweilt oder von etwas anderem abgelenkt waren?

11. Erkenne, wann es Zeit ist, sich dankbar zu verabschieden

- Sie haben zweimal hintereinander verloren
- Die Börse wird laut S&P Future außerordentlich negativ
- Sie fühlen sich aus dem Gleichgewicht, unsicher, verwirrt, desorientiert und wissen nicht warum
- Ihr festgelegter Tradingplan bricht aufgrund eines plötzlichen Börsenereignisses zusammen
- Sie fühlen sich krank
- Ihr Gemütszustand ist erschöpft
- Sie beschäftigen sich gerade mit einem persönlichen Problem

12. Suchen Sie keine Entschuldigungen – sie haben noch nie etwas gebracht

- Sie müssen tief im Herzen wissen, dass das Endergebnis nur bei ihnen liegt.

MISSION DEFINITION

- Was sind Ihre Leitsätze? (Welche Grundsätze sind für Sie so wichtig, dass Sie sie nicht ändern oder aufgeben wollen?)
- Was sind Ihre Werte? (Werte sind Vorlieben, die Ihnen wichtig sind, die Sie aber auch ändern könnten.)
- Liste Sie die einflussreichsten Personen in Ihrem Leben auf. Was bewundern Sie an ihnen?
- Beschreiben Sie Ihr eigenen Stärken und Talente
- Welche Herausforderungen und Hindernisse gibt es in Ihrem Leben?
- Wie stark sind Ihre Beziehungen zu den Menschen, die Ihnen am nächsten stehen? Welchen Einfluss haben diese Personen derzeit auf Ihre Mission? Welchen Einfluss könnten sie in Zukunft haben?
- Versetzen Sie sich in die Zukunft. Wie wird Ihr Leben in einem, in drei und in fünf Jahren aussehen?
- Was will ich mich mit meiner Zeit anfangen?
- Worauf werde ich mein Talent verwenden?
- Welchen Grundsätzen werde ich folgen?
- Welches Erbe will ich einmal hinterlassen?
- Wie viel Zeit kann ich pro Tag, Woche oder Monat dem Trading widmen?
- Habe ich die nötige zusätzliche Zeit zur Vorbereitung auf jeden Tag?
- Kann ich jeden Tag 30 bis 60 Minuten erübrigen, bevor die Märkte eröffnen?
- Wie viel Risikokapital habe ich zur Verfügung?
- Wie viel Geld muss ich jeden Monat verdienen?
- Welcher Teil muss davon vom Trading kommen?
- Habe ich noch andere Finanzquellen, auf die ich bauen kann, während ich lerne profitabel zu traden?
- Wie groß sind meine Fähigkeiten am Computer?
- Bin ich diszipliniert?
- Weiß ich viel über die Märkte?
- Gibt es in meinem Leben, viele **INTERVIEW: ZIELFORMULIERUNG**
- Ihre Motivation, das Ziel zu erreichen (was erregt Sie so bei dem Gedanken es erreicht zu haben?)
- Was müssen Sie lernen oder herausfinden, um es zu erreichen?
- Die Hindernisse auf dem Weg zum Ziel. Welche persönlichen Themen oder Überzeugungen könnten Ihren Fortschritt behindern? Welche extremen Faktoren wie Menschen, Ereignisse oder andere Dinge könnten das tun?
- Was brauchen Sie, um das Ziel zu erreichen – Zeit, andere Leute, Ausrüstung, Kapital etc.
- Sie haben Ihre Mission schriftlich festgehalten
- Sie haben Selbsterforschung betrieben

- Und Sie haben eine Liste ihrer Überzeugungen angefertigt, vor allem derjenigen, die mit den Märkten und mit Trading zu tun haben.
- Wenn ich nur noch 6 Monate zu leben hätte, würde ich dann irgendwelche Punkte von der Liste streichen oder hinzufügen?
- Wenn ich ein Ziel aus dieser Liste aussuchen müsste und wüsste, dass ich es ganz bestimmt erreichen werde, für welches würde ich mich entscheiden?
- Was leistet Ihr Geschäft für Ihre umfassende persönliche Mission?
- Was ist der Hauptzweck, das wichtigste Ziel des Geschäfts?
- Gehört das Geldverdienen zu den wichtigsten Zielen?
- Was sind die wichtigsten Werte, die das Geschäft abdeckt, wenn es erst einmal läuft?
- Ihre persönliche Geschichte und Ihre Erfahrung beim Trading
- Eine kurze Zusammenfassung Ihrer Tradingstrategie

INTERVIEW: ZEIT?

- Wie viel Zeit kann ich pro Tag, Woche oder Monat dem Trading widmen?
- Habe ich die nötige zusätzliche Zeit zur Vorbereitung auf jeden Tag?
- Kann ich jeden Tag 30 bis 60 Minuten erübrigen, bevor die Märkte eröffnen?

INTERVIEW: GELD?

- Wie viel Risikokapital habe ich?
- Wie viel Geld muss ich jeden Monat verdienen?
- Welcher Teil davon muss vom Trading kommen?
- Habe ich noch andere Finanzquellen, auf die ich bauen kann, während ich lerne, profitabel zu traden?

INTERVIEW: TALENT?

- Wie groß sind meine Fähigkeiten am Computer?
- Bin ich diszipliniert?
- Weiß ich viel über die Märkte?
- Gibt es in meinem Leben viele äußere Faktoren, die mein Trading negativ beeinflussen könnten?
- Worin besteht der „Vorteil“ meines Tradingstils, oder worin könnte er bestehen?

INTERVIEW: SELBSTEINSCHÄTZUNG

Wie viel Zeit kann ich pro Tag dem Trading widmen?

Mit wie vielen Ablenkungen kannst du rechnen, während du tradest?

Was denkst du, wie viel Zeit musst du in die Entwicklung deines Trading Systems, in deine persönliche psychologische Arbeit und in die Ausarbeitung deines Business Plans für deine Trading Geschäft stecken?

Wie gut kennst du dich mit Computern aus? Was musst du noch lernen, bevor du dieses Unterfangen angeht?

Was weißt du über Statistiken?

Wie würdest du deine Marktkenntnisse einschätzen? [Hierzu zählen unter anderem Kenntnisse von Trading-Mechanismen, was die Märkte bewegt, wie man Aufträge effektiv und kostengünstig durchführt, welche Indikatoren man benutzen könnte usw.]

Wo liegen psychologisch gesehen, deine Stärken und Schwächen, insbesondere in Hinblick auf die Entwicklung von Trading Systemen?

Wie sieht es mit deinen Stärken und Schwächen bezüglich persönlicher Disziplin aus?

Neigst du zu Zwängen(verhedderst du dich leicht vor Aufregung, wenn du tradest), leidest du unter persönlichen Konflikten (gab es in deiner Vergangenheit Konflikte im familiären Umfeld, in der Arbeit oder in vergangenen Trading Erfahrungen), oder gibt es irgendwelche emotionalen Probleme, die sich immer wieder bemerkbar machen, wie beispielsweise Angst oder Ärger?

Was musst du – ausgehend von deiner persönlichen Bestandsaufnahme - leisten, leisten oder lösen, bevor du mit dem Trading beginnst? Und wie wirst du dies tun?

INTERVIEW: *EIGENE ZIELE*

Worin hast du als Trader Vorteile? Welches spezielle Konzept, das dir einen Vorteil verschafft, verfolgst du beim Trading?

Wie viel Geld hast du persönlich? Wie viel von diesem Geld könntest du verlieren? Die meisten Fonds werden beispielsweise bei -50 % geschlossen. Wie sieht es bei dir aus? Wie viel Risiko kannst du bei einem bestimmten Trade eingehen?

Wie viel Geld musst du jedes Jahr machen? Brauchst du dieses Geld zum Leben?

Was ist, wenn du nicht genug Geld machst, um davon zu leben? Kann es sein, dass du sogar mehr verdienst, als du zum Leben brauchst, sodass dein Trading Kapital wachsen kann? Verkraftest du es, wenn du regelmäßig Geld von deinem Trading Kapital entnimmst, um deine Rechnungen zu bezahlen?

Gehst du die Sache realistisch an, oder erwartest du wie der beste Trader der Welt zu traden? Nehmen wir zum Beispiel an, du hast ein sehr gutes System, das in 50% der Fälle richtig liegt und Gewinne abwirft, die doppelt so groß sind wie die Verluste. Dennoch könnte es auch in diesem System vorkommen, das du 10 Verluste in Folge verzeichnest. Dein System funktioniert immer noch wie erwartet, aber du könntest leicht 10 Verluste in Folge haben. Würdest du damit klar kommen?

Hast du die Zeit und die Nerven kurzfristig zu traden?

Wie viele soziale Kontakte brauchst du? Wie viel Zeit brauchst du für soziale Kontakte?

Kannst du Tag für Tag selbstständig arbeiten? Brauchst du andere Menschen um dich herum? Inwieweit beeinflussen dich diese anderen Menschen?

Kannst du kurz sagen, welchen Prozentsatz deines Trading Kapitals du jedes Jahr voraussichtlich verdienst? Welches Risiko bist du bereit einzugehen, um das zu erreichen?

Was ist der größte Drawdown zwischen Spitzen- und Tiefstwert, den du hinnehmen würdest?

Wie wirst du wissen, dass dein Plan funktioniert und wie wirst du wissen, wann er nicht funktioniert? Was erwartest du von deinem System in unterschiedlichen Märkten: bei Trends, Konsolidierungen, hohe Volatilität?

INTERVIEW: *TRADING MANAGER*

Welche Art von Kunden möchtest du? Privatkunden? Ein paar gute Freunde? Verschiedenen Terminverwalter? Anspruchsvolle Trader? Institutionelle Kunden?

Wie sind deine Kunden? Welche Ziele haben sie? Welchen Service bietest du ihnen? Versuchen sie beispielsweise, ihre Anlagen ganz speziell zu streuen, indem sie ihr Geld bei dir anlegen?

Da du mit dem Geld deiner Kunden tradest, wie viel Risiko können sie vertragen? Wann wäre es wahrscheinlich, dass sie ihr Geld zurückziehen?

Wie viele Gewinne können sie verkraften, bevor sie zu überschwänglich werden?

Welchen Gebühren erhebst du? Wie viel entnimmst du dem Kundenkonto jedes Quartal oder jeden Monat? Welche Erträge musst du erzielen, damit du einen Kunden zufrieden stellst, der diese Gebühr aufbringen muss?

Welches Tradingvolumen hast du? Wie willst du es erreichen? Was hast du vor, sobald du es erreichst? Inwieweit verändert dies dein Trading?

Was ist das Schlimmste, was in Bezug auf deine Kundenbeziehungen passieren kann? Wie kannst du dich darauf vorbereiten, dass es gar nicht so weit kommt? Wie gehst du mit Kundenproblemen oder Problemkunden um?

Wie gehst du damit um, wenn eine große Menge neuen Kapitals eingeschossen wird oder es zu einer großen Entnahme von Kapital kommt?

INTERVIEW: *TRADING IDEEN*

Welche Art von Märkten willst du traden? Ist es angebracht, sich zu spezialisieren? Willst du nur liquide Märkte traden, oder interessieren dich auch illiquide Märkte?

Willst du erst einige Bedingungen aufstellen, bevor du in den Markt einsteigst? Falls ja, um welche Bedingungen handelt es sich?

Was denkst du über den Einstieg in die Märkte? Für wie wichtig hältst du Einstiegspunkte?

Welchen Anfangsstopp stellst du dir angesichts deiner Ziele für Ertrag und Drawdown vor? Wirst du in der Lage sein, wieder in den Markt einzusteigen, so dass du keine Marktbewegung verpasst?

Wie hast du vor deine Gewinne mitzunehmen? Trailingsstopp? Technische Stopps? Kursziele?

Wie verhältst du dich in Bezug auf Position Sizing?

Die größte Position hat das größte Risiko

Einer der schlimmsten Fehler, zu denen Trader neigen, ist es, mit einer großen Position zu beginnen, sagen wir mit einem Risiko von 1 R, und dieses Risiko allmählich zu reduzieren, wenn der Aktienkurs steigt. Sie beginnen zum Beispiel mit 1000 Aktien von QCOM und nehmen bei 500 Aktien einen schnellen Gewinn mit, weil Sie den Stopp hoch genug nachziehen, um sicherzustellen, dass Sie keinen Verlust erleiden. Dann verkaufen Sie vielleicht noch 250 Aktien mit einem Gewinn von 2 R und behalten die restlichen 250, mit denen Sie maximalen Gewinn anstreben. Was stimmt nicht? Das Problem bei dieser Strategie ist folgendes: Sie halten die größte Position, 1000 Aktien, zu dem Zeitpunkt, wenn das Risiko eines 1-R-Verlusts am höchsten ist.

Das Missverständnis des Glücksspielers

Wenn Sie ein 60-Prozent-System haben, dann liegt die Gewinnwahrscheinlichkeit jedes Trades bei 60 Prozent. Diese Wahrscheinlichkeit ändert sich auch durch eine Verlustserie nicht. Es sind noch immer 60 Prozent. Die Annahme, die Wahrscheinlichkeit eines Gewinnes steige nach einer Serie von Verlusten, kann zu Ihrem finanziellen Ruin führen – und bei vielen Tradern tut sie das auch.

- Die beste Strategie zur Positionsbestimmung besteht darin, einen kleinen Prozentsatz (ein Prozent oder weniger) des Gesamtkapitals pro Trade riskieren. Zu diesem Zweck müssen Sie berechnen, wie hoch dieser Prozentsatz Ihres Depots in Währungseinheiten ist, und diesen Betrag dann durch R dividieren, um Ihre Positionsgröße zu bestimmen.
- Ihre Positionen sollten dann am größten sein, wenn sich der Trade zu Ihren Gunsten entwickelt.
- Watchlist von ausgewählten Aktien anlegen

DIVIDENDEN ALLGEMEIN

Bardividende: Diese Form der Dividende ist in Deutschland am häufigsten. Sie wird normalerweise abhängig vom Gewinn des Unternehmens gezahlt: Die Ausschüttungsquote, also der Teil des Gewinns, der in Form einer Dividende an die Aktionäre fließt, sollte dabei meiste konstant bleiben. Die Bardividende wird dann abzüglich anfallender Steuern an die Aktionäre ausgeschüttet und auf deren Konten überwiesen. In Deutschland wird die Dividende normalerweise nur einmal im Jahr – meist am Tag nach der Hauptversammlung – ausgezahlt. In anderen Ländern gibt es die Zahlung auch zweimal pro Jahr, in den USA sind Quartalsdividenden weit verbreitet.

Für sie ist wichtig: Um Dividenden zu kassieren, müssen Sie als Anleger die Aktie normalerweise am Tag der Hauptversammlung zu Börsenschluss im Depot haben. Nur so bekommen Sie die Ausschüttung. Am nächsten Tag notiert die Aktie dann nämlich „ex-Dividende“, also ohne Dividendenanspruch. Entsprechend notiert die Aktie am Ex-Tag zur Eröffnung meist um die Dividende niedriger.

Dividendenbonus und Sonderdividende:

Hier bekommen die Aktionäre einen Bonus, beispielsweise wenn ein Unternehmen über hohe liquide Mittel, also Cash verfügt. Ein Bonus wird allerdings nur selten gezahlt. Denn gewöhnen sich die Anleger an hohe Bonuszahlungen, zählen sie diese zur normalen Dividende hinzu und erwarten sie entsprechend Jahr für Jahr. Ist dann die überschüssige Liquidität einmal verbraucht und fällt der Bonus flach, dann empfinden dass die Anleger als echte Dividendenkürzung: Sie steigen aus, verkaufen die Aktien, der Kurs fällt.

Stockdividende:

Gratisaktien/Berechtigungsaktien: Offene Rücklagen werden in Grundkapital umgewandelt. Die Aktionäre erhalten dann in einem bestimmten Bezugsverhältnis für jede alte Aktie Berechtigungsaktien. Das hat einen großen Vorteil: Durch die Gratisaktien wird der Preis der Aktie optisch niedriger.

Aktienrückkäufe:

Immer mehr Firmen beteiligen ihre Aktionäre nicht über die Zahlung einer Dividende am Gewinn, sondern über Aktienrückkäufe. Das bringt zwar keine Überweisung aufs Konto, dafür aber normalerweise Kursgewinne.

OPTIONSSCHEINE KENNZAHLEN

Die Kennzahl Rho:

Der beschriebene Zinseinflussfaktor auf den Optionsscheinpreis wird mit der Kennzahl Rho angegeben. Das Rho gibt die Veränderung des Optionsscheinpreises bei einer Änderung des Zinsniveaus an. Das Rho eines Call-Optionsscheins ist stets positiv, weil der Wert eines Call mit steigendem Zinsniveau ebenfalls zunimmt. Bei einem Put-Optionsschein hingegen ist das Rho immer negativ, weil ein Put mit steigenden Zinsen an Wert verliert.

Die Kennzahl Theta:

Das Theta drückt aus, um welchen Betrag der theoretische Wert des Optionsscheins bei Konstanz aller weiteren Bewertungsparameter sinkt, wenn die Restlaufzeit des Optionsscheins um eine Einheit, zum Beispiel 1 Tag oder 1 Woche zurückgeht. Theta erlaubt somit eine Aussage über den Zeitwertverfalls des Optionsscheins. Bei nur noch sehr kurz laufenden Optionsscheinen sollte der Anleger den Zeitwertverfall genau beobachten, wobei dessen Intensität von der Moneyness des Optionsscheins abhängig und insbesondere bei am Geld notierenden Optionsscheinen in den letzten bei Monaten stark ausgeprägt ist.

Die Kennzahl Moneyness:

Die Moneyness drückt das Verhältnis von aktuellem Kurs des Basiswertes zum Basispreis aus und quantifiziert somit die Werthaltigkeit eines Optionsscheins. Ebenso wie bei der Parität und der innere Wert misst auch die Moneyness, wie weit ein Optionsschein im Geld, am Geld bzw. aus dem Geld ist. Die Moneyness eines Optionsscheins ist größer als 1, wenn der aktuelle Kurs des Basiswertes über (Call) bzw. unter (Put) dem Basispreis liegt. Der Optionsschein befindet sich somit im Geld. Am Geld ist ein Optionsschein, wenn der aktuelle Kurs des Basiswertes gleich dem Basispreis ist. In diesem Fall ist die Moneyness gleich 1. Der Optionsschein hat eine Moneyness kleiner als 1, wenn der aktuelle Kurs des Basiswertes unter (Call) bzw. über (Put) dem Basispreis liegt. Der Optionsschein ist aus dem Geld.

Die Kennzahl Delta

Sensitivitätskennzahl, die angibt, welchen Einfluss der Preis des Basiswertes auf den Wert der Option hat. Das Delta ist mathematisch die erste Ableitung des Optionspreises nach dem Preis des Basiswertes. So bedeutet ein Delta von 0,5 dass eine Veränderung des Basiswertes um 1 Euro (in linearer Näherung) eine Veränderung des Optionspreises von 50 Cent hervorruft. Das Delta ist insbesondere im Zusammenhang mit dem sog. Delta-Hedging wichtig.

Die Kennzahl Gamma: Gamma einer Option gibt an, wie stark sich deren *Delta* (in linearer Näherung) ändert, wenn sich der Kurs des Basiswerts um eine Einheit ändert und alle anderen Größen sich nicht verändern. Mathematisch ist das Gamma die zweite Ableitung des Optionspreises nach dem Preis des Basiswertes. Für den Inhaber der Option (also sowohl für Long Call als auch für Long Put) gilt immer, dass $\text{Gamma} \geq 0$ ist. Die Kennzahl findet auch bei Absicherungsstrategien in Form des Gamma-Hedging Berücksichtigung.

Die Kennzahl Vega

Das **Vega** (manchmal auch **Lambda** oder **Kappa**, da Vega kein Buchstabe des griechischen Alphabets ist) einer Option gibt an, wie stark sich der Wert der Option ändert, wenn sich die Volatilität des Basiswerts um einen Prozentpunkt ändert und alle anderen Größen konstant bleiben.

Die Kennzahl Hebel:

Der **Hebel** wird errechnet, indem man den aktuellen Kurs des Basiswerts durch den aktuellen Preis der Option dividiert. Bezieht sich die Option auf ein Vielfaches oder einen Bruchteil des Basiswerts, muss dieser Faktor in der Rechnung entsprechend berücksichtigt werden. Man spricht hierbei vom Bezugsverhältnis.

$$\text{Hebel} = \frac{\text{aktueller Aktienkurs}}{\text{aktueller Optionspreis}} \cdot \text{Ratio}$$

Die Kennzahl Omega

Man erhält durch Multiplikation des Deltas mit dem aktuellen Hebel eine neue Hebelgröße, die sich in den Kurstabellen meist unter der Bezeichnung **Omega** oder „Hebel effektiv“ findet. Eine Option mit einem aktuellen Hebel von 10 und einem Delta von 50% hat also „nur“ ein Omega von 5, der Schein steigt also etwa um 5%, wenn die Basis um 1% steigt. Auch hier ist jedoch wieder zu beachten, dass sowohl das Delta und das Omega und die meisten anderen Kennzahlen sich ständig ändern. Trotzdem bietet das Omega ein relativ gutes Bild von den Chancen der entsprechenden Option.

Die Kennzahl Aufgeld:

Das Aufgeld gibt bei einem Call-Optionsschein an, um wie viel teurer der Erwerb des Basiswerts durch Kauf und sofortige Ausübung des Optionsrechts zum Betrachtungszeitpunkt gegenüber dem direkten Erwerb des Basiswertes ist. Bei einem Put-Optionsschein gibt das Aufgeld an, um wie viel teurer der Verkauf des Basiswerts durch Kauf und sofortiger Ausübung des Optionsrechts zum Betrachtungszeitpunkt gegenüber dem Verkauf des Basiswerts ist. In der Regel wird zur besseren Einschätzung des Optionsscheins das Aufgeld bezogen auf ein Laufzeitjahr (jährliches Aufgeld) ausgewiesen. Ist der Optionsschein „in the money“, so drückt das Aufgeld den Zeitwert des Optionsscheins in Prozent des aktuellen Kurses des Basiswerts aus.

Die Kennzahl Break-even-Punkt

Der Break-even-Punkt eines Optionsscheins lässt sich an einem bestimmten Kurs des Basiswerts festmachen: Diesen Kurs muss der Basiswert erreichen, um eine Ausübung des Optionsscheins gemessen am Emissionskurs ohne Verlust zu ermöglichen.

Future Basis: Die Basis ist die Differenz zwischen dem Future-Preis und dem Kassapreis des Basiswerts. Sie kann positiv oder negativ sein. Am Fälligkeitstag sind Kassapreis und Future-Preis identisch; die Basis ist null.

Carry Basis: Die Differenz zwischen dem theoretischem Future-Preis und dem Kassapreis des Basiswerts wird theoretische Basis, „Carry-Basis“, genannt.

Future-Preis = Kassapreis + Finanzierungskosten - Erträge

KORRELATION BETA FAKTOR

Einfach ausgedrückt ist er ein Gradmesser, der angibt, wie stark die Aktie im Vergleich zum Markt schwankt. Bei einem Wert von 1,0 schwankt die Aktie so stark wie der Durchschnitt. Liegt der Wert unter 1,0 deutet dies auf weniger Schwankung hin, bei einem Wert von über

1,0 schwankt die Aktie stärker als der Durchschnitt. Ein negatives Beta bedeutet, dass sich die Rendite des Vermögensgegenstandes gegenläufig zum Gesamtmarkt entwickelt.

Der Betafaktor eines Wertpapiers i gegenüber einem effizienten Marktportfolio M wird definiert als

d.h. als der Quotient aus der statistischen Kovarianz der Renditeerwartungen des Wertpapiers i mit den Renditeerwartungen des Markt-Portfolios M zu der Varianz des Markt-Portfolios M oder - was das gleiche ist - als Produkt aus dem Korrelationskoeffizienten des Wertpapiers i zu dem Markt-Portefeuille M mit dem Verhältnis von Standardabweichung des Wertpapiers i zur Standardabweichung des Markt-Portefeuilles M .

Das Beta eines Marktportefeuilles ist damit definitionsgemäß 1.

Das β sagt aus, welche Änderung die erwartete Rendite eines individuellen Wertpapiers bzw. Wertpapier-Portfolios bei einer Änderung der Rendite des Markt-Portfolios um einen Prozentpunkt erfährt und zeigt damit einen linearen Zusammenhang zwischen der erwarteten Rendite einer risikobehafteten Investition und der erwarteten Rendite des Markt-Portfolios auf.

Mit dem Betafaktor lassen sich drei Gruppen von Wertpapieren bilden:

1. $\beta > 1$ bedeutet: das Wertpapier bewegt sich in größeren Schwankungen als der Gesamtmarkt
2. $\beta = 1$ bedeutet: das Wertpapier bewegt sich gleich dem Gesamtmarkt
3. $\beta < 1$ bedeutet: das Wertpapier bewegt sich weniger stark als der Gesamtmarkt.

Übertriebene Rechnung

Entscheidend für die Aufnahme eines Wertpapiers in das Portfolio ist sein Beitrag zum Risiko des Gesamtportfolios. Ist das Beta sowie die Standardabweichungen des Wertpapiers (WP) und des Portfolios (PF) bekannt, so lässt sich damit die Korrelation berechnen.

$$\beta_{WP} = \frac{\rho_{EP}\sigma_{WP}}{\sigma_{PF}} \Leftrightarrow \rho_{EP} = \frac{\beta_{WP}\sigma_{PF}}{\sigma_{WP}}$$

Diese wird für die Berechnung der Varianz des erweiterten Portfolios (EP) benötigt.

$$\sigma_{EP}^2 = \sigma_1^2 x_1^2 + \sigma_2^2 x_2^2 + 2x_1 x_2 \sigma_1 \sigma_2 \rho$$

STEIGUNGSWINKEL BERECHNEN

Für größere Steigungswinkel dagegen, oder wenn ihre Größe exakt bestimmt werden soll, benötigt man die Umkehrfunktion des Tangens, das heißt die Arcustangens-Funktion:

$$\alpha = \arctan(m). \quad / m = 0,4$$

Im obigen Beispiel errechnet man:

$$\alpha = \arctan(0,4) \approx 21,8^\circ.$$

Taschenrechner: SHIFT - Taste / tan – Taste / m = Steigung

Bei negativen Steigungen ist hier zu beachten, dass –aufgrund der Punktsymmetrie der Arcustangens-Funktion– dann auch die Steigungswinkel α negativ werden.

Bei der Angabe in Prozent (%) ist zu beachten, dass Steigung und Steigungswinkel nicht proportional zueinander sind, es also auch nicht möglich ist, Steigungen und Steigungswinkel mit einem einfachen Dreisatz ineinander umzurechnen. So entspricht beispielsweise der Steigung 1 (= 100 %) ein Steigungswinkel von 45° , der Steigung 2 (= 200 %) dagegen nur noch ein Winkel von rund $63,4^\circ$, und für einen Steigungswinkel von 90° schließlich müsste die Steigung ins Unendliche wachsen.

Beispiel Steigungswinkel:

Bei einem fallenden Markt wird einfach nur ein negatives Vorzeichen eingefügt.

m = 0,1	Steigungswinkel = 5,7 Grad
m = 0,5	Steigungswinkel = 26,6 Grad
m = 1,00	Steigungswinkel = 45 Grad
m = 2,00	Steigungswinkel = 64,4 Grad
m = 10,00	Steigungswinkel = 84,3 Grad
m = 100,00	Steigungswinkel = 89,4 Grad
m = 1000,00	Steigungswinkel = 89,94 Grad

AKTION UND REAKTION

Jeder Aktion des Kurses entspricht eine Reaktion, sowohl im zeitlichen als auch im räumlichen Sinne. Die Reaktionen sind aber nicht unbedingt identisch. Unter Umständen entsprechen sie der Aktion zeitlich, aber nicht räumlich, oder umgekehrt. Darin liegt eine Methodik des Tradens verborgen und auch die Möglichkeit, ein Ungleichgewicht des Marktes festzustellen.

Beispiel:

Die **Aktion** besteht aus einem Kursanstieg um 10 Punkte in 5 Tagen.

Die entsprechende **Reaktion** wäre ein Verlust von 10 Punkten in 5 Tagen.

Wenn nun aber der Kurs in 5 Tagen nur um 5 Punkte nachgibt, dann hatte die Reaktion einfach zu wenig Zeit. Die nächste Aktion wird wahrscheinlich ein Anstieg um 5 oder 10 Punkte in den nächsten 5 Tagen sein, um die vorherige Aktion und Reaktion auszugleichen.

Korrektur

Der Kauf während einer Korrektur nach einem Zeichen der Stärke erlaubt es Ihnen auf einen fahrenden Zug aufzuspringen und dabei das Risiko gering zu halten, ausgestoppt zu werden. Beim Kauf in einer Korrektur während einer kurzfristigen Schwäche sollte ein Stopp von einer durchschnittlichen Spanne verwendet werden. Kaufen Sie bei Stärke ist, dann ist ein größerer Stopp erforderlich.

Die meisten Schübe korrigieren um ungefähr 50 %. Sie kaufen bei einer kurzfristigen Schwäche in Erwartung eines Umkehrpunktes. Ein Trade wird sicherer, wenn sie Ihre Position während einer Korrektur und nicht während des Ausbruchs eröffnen. Sie werden zwar einige große Kursbewegungen verpassen, aber Sie können Ihre Stopps mit geringerem Abstand platzieren.

Güterzugtheorie

Sobald ein Zug auf eine bestimmte Geschwindigkeit beschleunigt hat, ist es unmöglich, ihn abrupt zum Stehen zu kriegen. Sicherlich habe ich die Möglichkeit, die Notbremse zu betätigen. Trotzdem wird es eine bestimmte Zeit dauern, bis die Antriebskraft derart verringert wird, dass der Zug quietschend zum Stehen kommt. → Trendverhalten

Die Nachteile:

- Sie werden einige große Kursbewegungen verpassen, wenn sie auf die Korrektur warten, um ihre Position zu eröffnen.
- Sie wissen nicht, auf welchem Kursniveau während der Korrektur Sie Ihre Position eröffnen sollen
- Die Korrektur könnte sich als Trendwende herausstellen und so zu Verlusten führen.

ZEITRAHMEN

Die Verwendung mehrerer Zeiträume stellte sich als grundlegender Fortschritt in der Technischen Analyse heraus, der die Ergebnisse beim Trading stark verbessern kann. Heute beobachten viele Trader mehr als nur einen Zeiträume während der Marktanalyse. Aber nur wenige haben diese Idee zu einer umfassenden, effizienten Trading – Methode weiterentwickelt, die analytische Raffinesse mit praktikablen Regeln und Prinzipien vereint.

Manche Markttechniker haben mit verschiedenen Zeitrahmen experimentiert, andere nicht. Betrachten wir diese Konzept etwas genauer.

Was bedeutet der Begriff Zeitrahmen eigentlich?

Ein Zeitrahmen ist eine regelmäßige Auswahl von Kursen in einer zeitlichen Abfolge, angefangen von einzelnen Ticks und Minuten bis hin zu Jahren, aber natürlich gibt es nach oben keine Begrenzung.

Einen bestimmten Zeitrahmen zu wählen ist keine Hexerei. Alle Zeitrahmen sind eigentlich frei wählbar aus Gewohnheit anstatt auf Grund von wissenschaftlichen Erkenntnissen festgelegt. Theoretisch besteht zwischen einen Wochenchart und einen 9 Tage Chart kein wirklicher Unterschied, ebenso wenig wie der Tageschart dem 16 Stunden Chart überlegen ist.

Wie viele Zeitrahmen sollte ein Trader beobachten? Wenn drei Zeitrahmen besser sind als einer, sind dann nicht zwölf Zeitrahmen viel Mal besser?

Theoretisch gibt es unzählige Zeitrahmen, angefangen vom Tickchart bis hin zur Unendlichkeit. Natürlich können wir niemals alle beobachten. Und glücklicherweise müssen wir das auch nicht.

Vergessen Sie nicht, dass zwei Zeitrahmen, die sehr nahe beieinander liegen, auch fast identische Resultate zeigen. Obwohl ein Trader vielleicht nicht genau weiß, welcher Zeitrahmen genau der richtige ist, so wird er doch erkennen, dass sich die Informationen zweier sehr eng beieinander liegender Zeitrahmen fast genau gleichen und somit für diese Zwecke nur von geringem Wert sind.

Die Fünffach – Regel hilft bei der Feststellung der gewählten Zeitrahmen für diese Art der Analyse. Diese Regel besagt, dass der nächstgelegene Zeitrahmen ungefähr fünf Mal länger sein soll als der fokussierte Zeitrahmen. Der zweite längere Zeitrahmen soll wiederum fünf Mal länger sein als der erste Zeitrahmen und so fort. Dementsprechend soll der kürzere Zeitrahmen sein als der fokussierte Zeitrahmen und so weiter.

Brauchbare Zeitrahmen:

10 Minuten / 1 Stunde / 1 Tag / 1 Woche / 1 Monat / 1 Quartal / 1 Jahr / 5 Jahre

DREIECKS VERHÄLTNIS LIQUIDITÄT – RENDITE – SICHERHEIT

Es gibt einige wenige ökonomische Grundmechanismen, die Anleger kennen und beherrschen sollten, weil sie unmittelbar Einfluss auf ihre Finanzen haben. Prinzipiell lassen sich Anlageprodukte nach 3 Faktoren beurteilen:

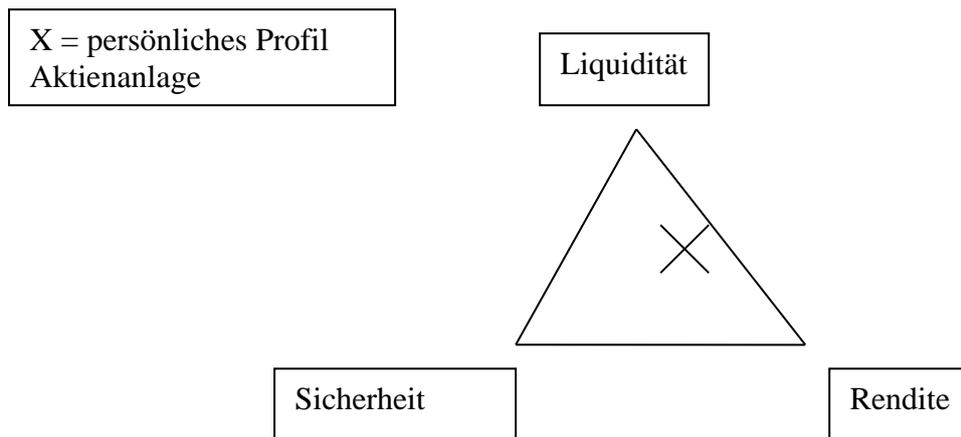
Liquidität – Rendite – Sicherheit

Abhängigkeit der Faktoren untereinander:

Höhere Rendite → geringere Liquidität → geringere Sicherheit

Höhere Liquidität → geringere Rendite → geringere Sicherheit

Höhere Sicherheit → geringere Rendite → geringere Liquidität



Die Geldtypen:

- **Souveräne**

haben eine positive Einstellung zum Geld und sind bestrebt, ihren hohen Lebensstandard und ihre finanzielle Unabhängigkeit zu wahren. Charakteristisch ist ihr hohes Maß an Eigenverantwortung und ihre Bereitschaft, kalkulierbare Risiken einzugehen. Sie verfügen über einen hohen Sachverstand in Geldangelegenheiten und sind in ihrem persönlichen Umfeld als Ratgeber gefragt. Ihre persönliche materielle Zukunft schätzen sie vergleichsweise optimistisch ein.

- **Ambitionierte**

Suchen das Gesprächsthema im Bekanntenkreis. Geld zu haben gibt ihnen das Gefühl von Freiheit und Unabhängigkeit, es ist Voraussetzung für Lebensqualität. Ambitionierte haben Spaß an Finanzthemen, informieren sich regelmäßig über Börsenkurse und sehen es als reizvolle Herausforderung in Geldangelegenheiten fit zu sein. Charakteristisch ist ihr hohes Maß an Autonomie und Eigenverantwortung sowie ihre Bereitschaft, Risiken einzugehen. Ambitionierte sehen ihrer persönlichen Zukunft sehr optimistisch entgegen.

SEKTOREN UND BRANCHEN

Wichtige Marktsektoren:

- Grundstoffe
- Zyklische Konsumgüter
- Energie

- Finanzdienstleister
- Gesundheitswesen
- Industrie / Gewerbe
- Technologie
- Telekommunikationswesen
- Versorger

Jeder dieser Sektoren kann aus 12 oder mehr Branchen bestehen.

Zum Technologiesektor gehören Branchen wie das Computerwesen, Internet, Bürogeräte und Halbleiterelektronik. Zu Finanzdienstleistern zählen zum Beispiel Banken, Versicherungen und Wertpapier-Handelshäuser.

Wichtige Branchen:

- Automobile
- Banken
- Biotechnologie
- Chemie
- Einzelhandel
- Energie
- Essen & Trinken
- Freizeit
- Gesundheit
- Halbleiter
- Hardware
- Immobilien
- Industrie
- Internet
- IT-Services
- Kommunikation
- Öl / Gas Branche
- Software
- Versicherungen

Gesamtmarkt Portfolio:

Ein marktbreites Portfolio besteht aus 5 – 15 Branchen.

Eine Diversifikation innerhalb einer Branche ist aufgrund der hohen Korrelation bei den Titeln derselben Branche nicht empfehlenswert, wenn man eine ausgleichende Gesamtmarktrendite anstrebt.

**POKER
TEXAS HOLD'EM SYSTEM**

Setup: 2 Bilder / Poket Pair

ASS + KÖNIG	KÖNIG + DAME	DAME + BUBE	ASS + ASS
ASS + DAME	KÖNIG + BUBE		
ASS + BUBE			

Kombinationen: 7 Kombination von 169 möglichen → 4 %

Wahrscheinlichkeit: Auf 100 Hände wird jede 25. Hand gespielt. → 4 Hände

Setzlimit: Limit Poker

Maximaler Einsatz: 0,10 € pro Runde / 1 R = 0,50 € → 5 x 0,10 Cent → 5 % pro Runde

Cash: 10,00 € → 1 R = 5 %

Hold'em: Wenn Setup eintrifft, dann wird die Hand bis zum Schluss gespielt

Fold'em: Jede andere Kombination wird sofort gefolded.

Wenn Blinds bezahlt werden müssen, dann wird zur nächsten Gelegenheit gefolded. No Pay.

Tische: 10 verschiedene Tische je 10,00 \$ → 100 \$ benötigt.

Spieler:

Minimum 3 weitere Spieler

Maximal 7 weitere Spieler.

Handlimit: Maximal 100 Hände an einem Tag

Zeitlimit: Maximal 1 Stunde Poker am Tag

Gewinnziel: 20 % Rendite → 2,00 € → Poker wird beendet

Verlustbremse: -10 % Rendite → -1,00 € → Poker wird beendet

FWB PRÄSENZHANDEL

Grundsätze für die Börsenpreisfeststellung

- Die Feststellung eines Börsenpreises erfolgt auf der Basis der Marktlage
- Die Marktlage am Referenzmarkt muss berücksichtigt werden

- Meistausführungsprinzip: Es ist derjenige Preis festzustellen, zu dem der größte Umsatz bei minimalem Überhang der dem Skontroführer vorliegenden Orders innerhalb der zuletzt veröffentlichten Taxe stattfindet.
- Preiskontinuität: Können mehrere Börsenpreise festgestellt werden, so ist der Preis festzustellen, welcher möglichst nahe zum zuletzt festgestellten Börsenpreis liegt (unter der Berücksichtigung der Tendenz)
- Gleichbehandlungsgrundsatz: Alle Order, die zum Zeitpunkt der Preisfeststellungen vorliegen, werden gleich behandelt

Parketthandel / Skontroführer

Die Vermittlung der dem Skontroführer erteilten Orders hat grundsätzlich Vorrang vor einem Selbsteintritt. Zur Vermeidung von Teilausführungen kann vom Vermittlungsvorrang abgewichen und ein Meistausführungsprinzip abweichender Börsenpreis festgestellt werden, wenn

- Der Gegenwert der potentiellen Teilausführung wirtschaftlich wenig sinnvoll ist, d.h. die Teilausführung einer Order 3.000 € oder in von der Geschäftsführung bestimmten Wertpapieren 10.000 € unterschreiten würde oder
- Der Gegenwert der potentiellen Teilausführung weniger als 10 % des Volumens der Order darstellt
- Ein Abstand zum nächsten ausführbaren Limit von mindestens 20 % der Taxenbreite, welche bei Eingang der Order gültig war, eingehalten wird

Teilausführungen mit einem Gegenwert von unter 500 € pro Order, dürfen nur im Benehmen mit der Handelsüberwachungsstelle vorgenommen werden.

Eigen- und Aufgabegeschäft

Eigen- und Aufgabegeschäft des Skontroführers in den ihm zugewiesenen Papieren dürfen nicht tendenzverstärkend wirken

- Eigengeschäft: Der Makler oder Skontroführer wird über seine Depotbank zum Kontrahenten
- Ausgabegeschäft: Makler muss die Benennung des fehlenden Kontrahenten innerhalb bestimmter Fristen vornehmen

Möglichkeit des Maklers, sich bei der Vermittlung die Benennung des Kontrahenten auf der Kauf- oder Verkaufsseite zu einem späteren Zeitpunkt vorzubehalten.

- Benennung des Verkäufers, bis zum Schluss der nächsten Börsenversammlung
- Benennung des Käufers, spätestens am zweiten Börsentag nach dem Abschlussstag vor Börsenschluss

ERMITTLUNG DES ERSTEN BÖRSENPREISES

- Taxe soll möglichst mit einführenden Kredit- und Finanzinstitut (Konsortialführer) abgestimmt werden, soweit dieses zum Ausgleich eines eventuell vorhandenen Überhanges bereit ist.
- Annahmeschluss frühestens 15 Minuten nach Ausruf der Eingabe der ersten Taxe

- Sofern das einführende Institut nicht zum vollständigen Marktausgleich bereit ist, darf der Skontrofführer diesem keine weiteren Informationen aus dem Orderbuch mitteilen.

Mindestanforderungen an die Stellung von Taxen und Ausführung in Aktien

- Einstellung einer Taxe mit Volumen vor Handelsbeginn um 9:00 Uhr (Frühe Taxe)
- Anteil der Handelszeit des Präsenzhandels eines Handelstages, für die eine Taxe eingestellt ist (Taxen-Präsenz)
- Einhaltung vorgegebener maximaler Spreads (Taxen-Breite)
- Einhaltung vorgegebener Mindestvolumina
- Einhaltung einer maximalen Ausführungszeit
- Ausführung von Order innerhalb der Taxen (Ausführungsqualität)
- Anteil von Teilausführungen

Aktien werden nach Anzahl der order pro Tag und Preisniveau in Liquiditätsklassen eingeteilt, unterschiedliche Parameter je Liquiditätsklasse

Börsenplatz Düsseldorf

- Verbindliche Quotes: Skontrofführer muss alle von ihm betreuten liquiden Wertpapiere aktuelle Quotes zu veröffentlichen. Der akute Quote gilt für das angezeigte Volumen als handelbares Angebot
- Liquiditätssicherung und Vollaussführung: Skontrofführer ist verpflichtet, Kundenausfrage bis zu den im festgelegten Regelwerk Quality Trading festgelegten Garantievolumen bzw. bis zu dem mit den Quotes angezeigten Volumen oder Stückzahlen voll auszuführen
- Leistungsangebot im maklergeschützten Handel ist nahezu vollständig im Regelwerk Quality Trading und damit verbindlich vorgeschrieben
- XETRA-Garantie für DAX (bis 17:30 ohne Spread bis 100.000 €) MDAX, SDAX, TECDAX; bei inländischen und ausländischen Aktien aktuelle Marktlage an den übrigen deutschen Börsen als Referenz, bei geöffneten ausländischen Heimatmarkt zusätzlich die dortige Preispanne unter Berücksichtigung eines vom Skontrofführer definierten Ab- bzw. Aufschlag

XETRA

Designated Sponsor

- Überbrückt temporäre Ungleichgewichte zwischen Angebot und Nachfrage
- Stellt auf Anfragen Geld-Brief-Spannen (Quotes)

- Kein Monopolist, Rolle für alle Teilnehmer offen
- Keine wesentlichen Informationsvorteile gegenüber anderen Marktteilnehmern
- Leistungsabhängige Reduktion der Börsentgelte

Aufgaben und Pflichten des Designated Sponsors

- Mindestquotierungsvolumen & maximaler Spread abhängig von der Liquidität der jeweiligen Aktie
- Mindestquotierungsdauer im fortlaufenden Handel, mind. 50 % der effektiven Handelszeit (Monat)
- Teilnahmeverpflichtung in Auktionen und Volatilitätsunterbrechungen
- Eingabe eines Quotes kurz nach Beginn der Aufrufphase
- Haltes des Quotes bis zur Preisermittlung
- Änderung des Quotes (Volumen und Limit) möglich

Handelsformen

Fortlaufender Handel:

- Nur Round-Lot-Orders
- Offenes, anonymes Orderbuch mit kumulierten Stückzahlen/Anzahl der Orders pro Limit
- Laufende Preisermittlung
- Orderausführung nach Preis-/Zeitpriorität
- Schutzmechanismen: Volatilitätsunterbrechung / Erweiterte Volatilitätsunterbrechung

Handelsformen

Auktion:

- Handel aller Ordergrößen (Odd-Lot und Round-Lot Orders)
- Festgelegte Struktur: Aufrufphase mit zufälligen Ende / Preisermittlung
- Teilweise geschlossenes, anonymes Orderbuch
- Ermittlung der Auktionspreises nach dem Meistausführungsprinzip
- Schutzmechanismen: Market-Order Unterbrechung/ VolaUnterbrechung/Erweiterte Volatilitätsunterbrechung

HANDELSPHASEN

Vorhandelsphase/Nachhandelsphase:

- Orderbuch geschlossen
- Eingabe/Ändern/Löschen von Orders
- Bearbeitung von Trade Confirmations (nur Nachhandelsphase)

Auktionen:

- Teilweise geschlossenes Orderbuch (indikativer Preis und best bid/ask bzw. Volumensangaben)
- Alle Order (Odd Lots und/oder Round Lots) außer Orders mit entsprechender Handelsbeschränkung
- Market Order Unterbrechung und Volatilitätsunterbrechungen

Fortlaufender Handel:

- Offenes Orderbuch
- Round Lot außer Orders mit entsprechenden Handelsbeschränkungen
- Volatilitätsunterbrechungen

PREISBILDUNG

Grundsatz:

- Nur vorhandene Limite und der Referenzpreis können als Börsenpreis ermittelt werden. (Ausnahme Midpoint im Marktmodell XXL).

Auktion:

- Meistausführungsprinzip: Ermittlung des Auktionspreises entsprechend dem Limit mit dem Limit mit dem höchstens ausführbaren Ordervolumen im Orderbuch
- Bei nicht eindeutiger Orderbuchsituation, wird der Überhang oder der Referenzpreis herangezogen
- Befinden sich nur Market Order im Orderbuch, erfolgt die Ausführung zum Referenzpreis.

Fortlaufender Handel:

- Kernregel: Ausführung nach Preis/Zeit Priorität
- Market Orders, die sich ausführbar gegenüberstehen (nicht ausgeführte Market Order im Orderbuch), werden zum Referenzpreis ausgeführt.

TICK SIZE

Minimale Preisveränderung (Tick Size)

- Für Preislimite bis 0,25 € generell 0,001 € (0,1 Cent)
- Für Preislimite oberhalb 0,25 € beträgt die Tick Size 0,01 (1 Cent)

Für folgende Aktien ist die **Tick Size auf 0,005 €** (0,5 Cent) festgesetzt
(vielleicht nicht mehr ganz aktuell)

- Dt. Telekom DTE
- Infineon IFX
- BMA AG BWM
- Commerzbank CBK
- Daimler DAI
- Deutsche Bank DBK
- Dt. Lufthansa LHA
- Dt. Post DPW
- SAP AG SAP
- TUI AG TUI1

PREISBILDUNG FORTLAUFENDER HANDEL

Bereits im Orderbuch befindlich Orders horizontal
Neu eingehende Order vertikal

	Market Order	Limit Order	Market und Limit Order
Kauf Market Order	Referenzpreis	Niedrigstes Verkaufslimit	Referenzpreis oder Verkaufslimit (Minimum)
Verkauf Market Order	Referenzpreis	Höchstes Kauflimit	Referenzpreis oder Kauflimit (Maximum)
Kauf Limit Order	Referenzpreis oder Kauflimit (Minimum)	Niedrigstes Verkaufslimit	Referenzpreis oder Limite (Minimum)
Verkauf Limit Order	Referenzpreis oder Verkaufslimit (Maximum)	Höchstes Kauflimit	Referenzpreis oder Limite (Maximum)

WERTPAPIERLEIHE – DEFINITION

- Überlassung von Wertpapieren kurzfristig und gegen Entgelt für eine bestimmte Zeit
- Uneingeschränkter Eigentumsübergang und Entleiher
- Anspruch des Verleihers auf Rückübertragung von Wertpapieren gleicher Art und Güte

- Sachdarlehen in Wertpapieren gemäß §§ 607 – 609 Bürgerliches Gesetzbuch

DER FINANZMARKT

Börsenhandel:

Organisierter Markt mit feststehenden Regeln:

- Kontrahierungszwang
- Aufsichtsorgane
- Valuta T+2
- Preisbildungsregeln
- Preistransparenz

Außerbörslicher Handel (OTC):

Nicht lokalisierter Markt ohne feste Handelszeiten, auf dem per Bildschirm oder Telefon gehandelt wird (OTC – Over the Counter)

- Individuelle Vertragsausgestaltung

VOLUMENTIEF !

Volumentief analysieren → vergleiche mit Volumenspitzen

Call / Put Verhältnis (Spread) als Chart darstellen → Beschleunigungsprinzip (Tempo System)

