

FDAX-TRADING-STRATEGIE

Vom CFD zum FDAX Daytrading Händler

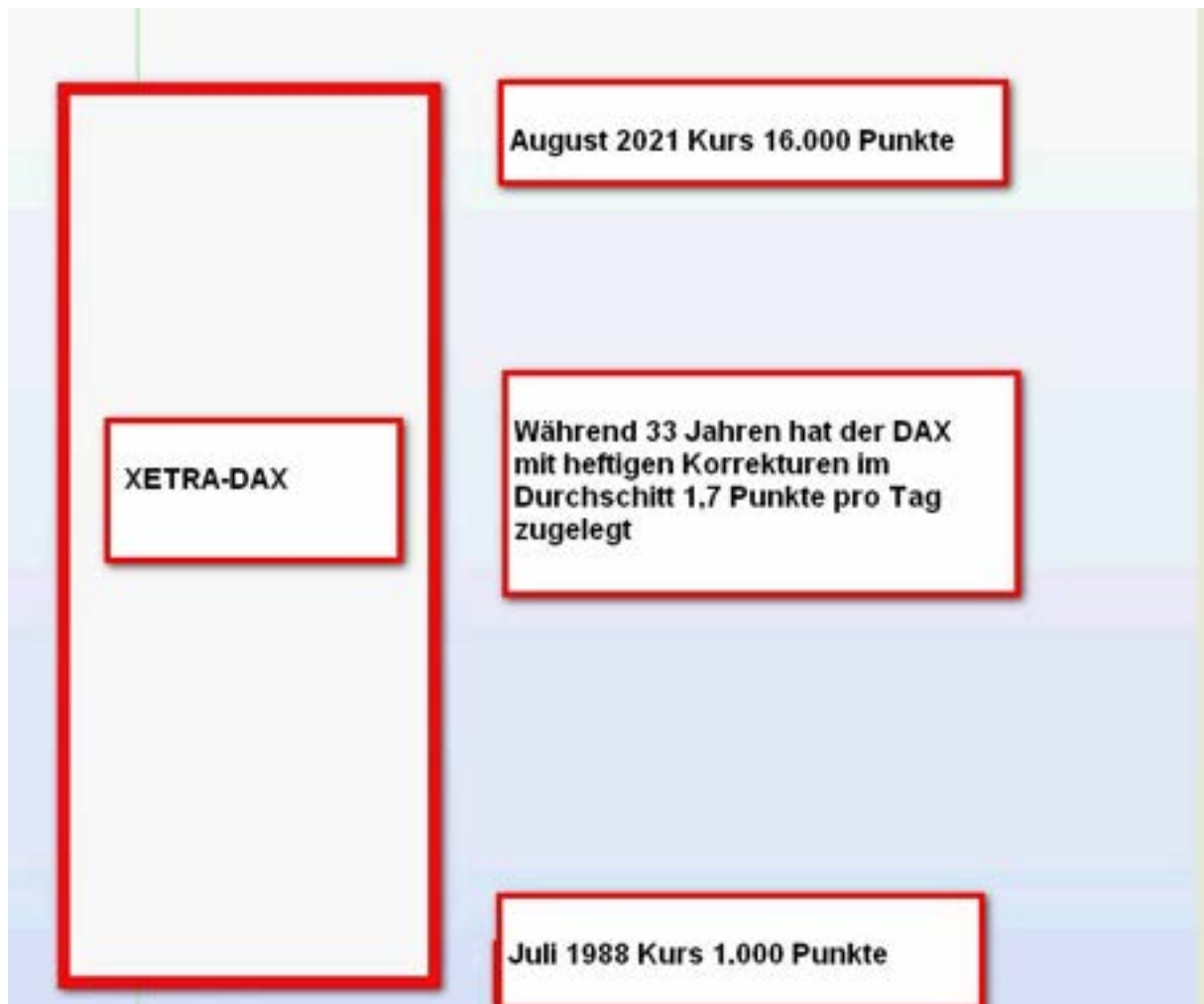
Aktualisiert

Trading

Man gebe mir die Gelassenheit um die Dinge zu akzeptieren, die ich nicht ändern kann; den Mut, die Dinge zu ändern, die ich ändern kann; und die Weisheit, den Unterschied zu erkennen.

Das folgende ganzheitliche Trading Plan deckt alle Bewegungen innerhalb der täglichen Trading Range/Handelsspanne ab. Zuweilen entscheidet der Common Sense oder bei Unsicherheit erfolgt kein Handel.

Bei strikter Einhaltung der Handlungsanweisungen kann auf Sicht ein hoher Gewinn erzielt werden. Ein Handelssystem ist nur ein Teil eines Business Plan. Die Umsetzung verlangt daher viel mehr als nur das Regelwerk



Historische Kursbewegungen

DAX-Jahreschart. Nach jedem Allzeithoch von 1000 + Punkten erfolgt eine große Korrektur.



Korrekturen dieser Art finden in jedem Zeitrahmen statt.



Die tägliche Handelsspanne des DAX-Future (FDAX) beträgt im Durchschnitt rund zwei Prozent. In Wirklichkeit legt der Kurs aufgrund des kurzfristigen Hin und Her aber oft deutlich weitere Strecken zurück. Genau davon profitiert die hier vorgestellte Mean-Reversion-Strategie. Statistische Untersuchungen des Autors zeigen, dass an bis zu 90 Prozent aller Handelstage der

Kurs über den Vortagschlusskurs ansteigt, aber nur in 55 Prozent der Fälle tatsächlich darüber schließt. Umgekehrt fällt der Kurs an rund 90 Prozent aller Handelstage unter den Vortagsschlusskurs, aber schließt in weniger als der Hälfte der Fälle auch darunter. Daraus leitet sich der in diesem Artikel vorgestellte Handelsansatz ab, der bereits im Jahr 2011 vom VTAD als Forschungsarbeit vorgestellt wurde.

<https://www.vtad.de/fa/marktvorteil-mit-einem-innovativen-konzept-der-technischen-analyse/>

Natürlich haben nur Handelsstrategien mit positivem Erwartungswert überhaupt eine Chance, im realen Einsatz tatsächlich Gewinne zu erwirtschaften. Zur Überprüfung der Nachhaltigkeit des Handelsansatzes wurde von 2010 bis 2013 ein simpler Vorwärtstest mit einem Höchsteinsatz von sechs DAX-CFDs vorgenommen. Das Ergebnis:

Während der Berichtszeit wurde das Anfangskapital von 2000 Euro ohne Positionserhöhungen auf 8931 Euro hochgehandelt. Es kam allerdings zu Drawdowns von beispielsweise 1400 Punkten während des Flash Crashes.

In den Folgejahren wurde der einfache Handelsansatz kontinuierlich zu einem kompletten und robusten Handels- und Businessplan mit erheblichem Gewinnpotenzial ausgebaut.

Im Wesentlichen basiert die kurzfristige Handelsstrategie auf Mean Reversion aber auch Trendtage werden gehandelt.

Handelszeiten

Der Handelstag beginnt um 8:00h bis 22:00h und wird unterteilt in Vormittag von 8:00h bis 14:30 und Nachmittag von 14:45 bis 22:00h. Die Handelsansätze sind unterschiedlich und daher können Part Time Trader davon profitieren.

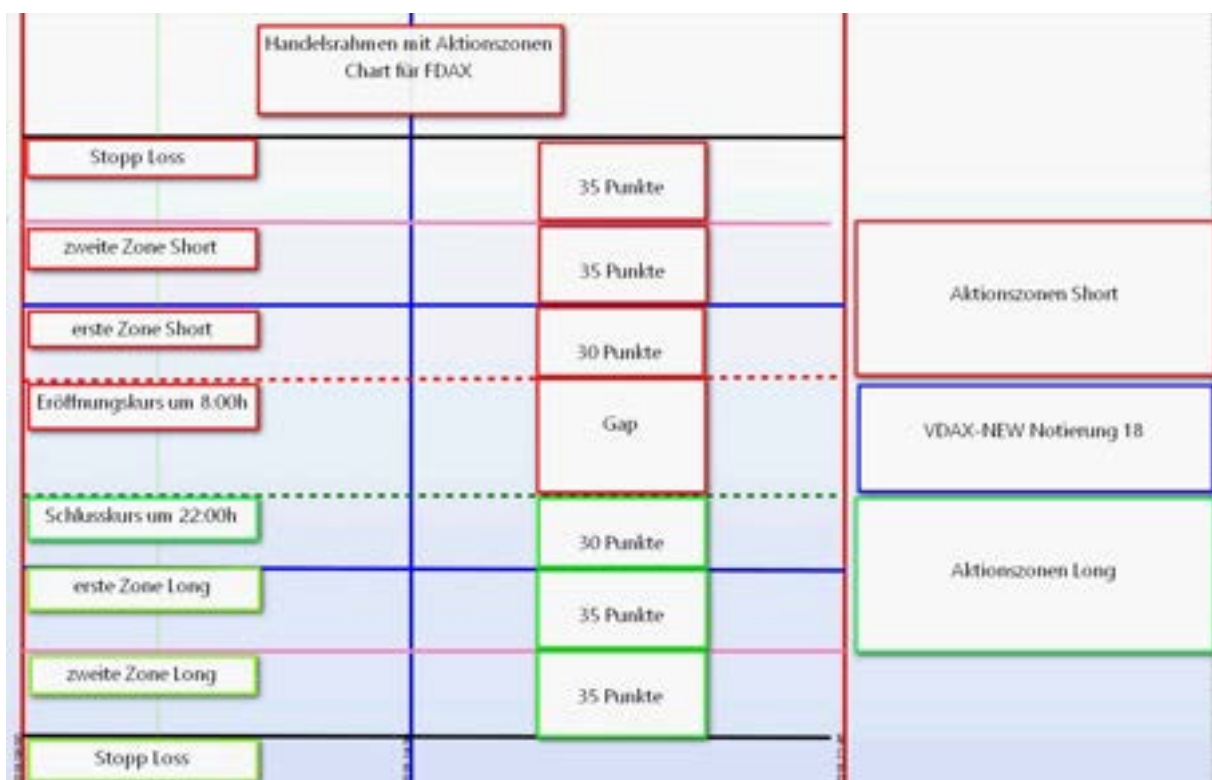
Handel am Vormittag

Aktionszonen

Es wird täglich ein Trading-Rahmen mit volatilitätsabhängigen Aktionszonen erstellt. Die Zonen basieren auf langjährigen

Erfahrungswerten an denen sich innerhalb der Trading Range die meisten Korrekturen (Retracements) in Richtung Mittelkurs und darüber hinaus ausbilden. Diese dienen für die Eröffnung von Long-oder Shortpositionen. Das Prinzip ist also, niedrig zu kaufen und hoch zu verkaufen bzw. hoch zu verkaufen um niedrig zu kaufen. Nach der ersten FDAX-Kursnotierung um 8:00h MEZ stehen 5 Schlüsseldaten zur Verfügung:

1. Schlusskurs XETRA-DAX um 17:35h Vortag (nach Auktion)
2. Schlusskurs FDAX um 22:00h Vortag
3. FDAX Eröffnungskurs als Referenzkurs für den Handelstag
4. Kurs VDAX-NEW und VIX zur Bestimmung der zu erwartenden Intraday Handelsspanne.
5. DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE FUTURES (DJIA FUT)



Handelsrahmen bei einem VDAX-NEW Kurs unter 20

Aufgrund der erhöhten DAX Notierung seit dem früheren Allzeithoch von 8.000 Punkten wurden die Abstände der Zonen etwas erhöht. Siehe unten.

Mit dieser Darstellung wird eine Normalverteilung der morgendlichen Handelsspanne bis 14:30h abgedeckt. Nachmittags kommt es oft zu einer Range Erweiterung. Siehe Handel am Nachmittag. Eröffnungs- und Schlusskurs kommen in gleicher Häufigkeit auch invers sein.

Die DJIA FUT sind der wichtigste Indikator für den FDAX-Handel. Sie können daher beim Handel nicht ignoriert werden. Insbesondere werden die Notierungslücken um 8:00h (gaps) und der Handel am Nachmittag von den DJIA FUT weitestgehend bestimmt. Es wird daher immer wieder auf die DJIA FUT Bezug genommen.

Je nach Volatilität erweitert oder verengt sich die tägliche Handelsspanne. Es erfolgt eine flexible Anpassung der Zoneneinteilung je nach Stand VDAX VDAX-NEW.

<https://de.investing.com/indices/vdax>

<https://www.investopedia.com/terms/c/candlestick.asp>

Wenn Kurs unter 20, dann 40 Punkte für erste und zweite Zone
Wenn Kurs zwischen 20-25, dann 50 Punkte beidseitig.
Wenn Kurs zwischen 25-30, dann 55 Punkte beidseitig.
Wenn Kurs zwischen 30-35, dann auch 65 Punkte für Short
und die erste Zone Long wird erweitert auf 130 Punkte

Weiterhin ist aufgrund der erhöhten Notierungen von DAX und DOW zu beobachten, dass bei einer Notierung diese Indizes von minus 0,5% + morgens um 8:00h mit stark fallenden Kursen zu rechnen ist. Liegt diese Notierung vor
<https://de.investing.com/indices/indices-cfds>
dann erfolgt ein Einstieg Long erst an der zweiten Zone bzw. darunter. Falls Unsicherheit besteht, wird auf den Handel verzichtet.

Wenn VDAX-NEW über 35 notiert kein Handel



Trade Management

Mit Trade-Management bezeichnet man jegliche Aktionen die ein Trader aktiv unternimmt um eine Position zu eröffnen, Gewinne zu realisieren und das Risiko zu minimieren.

Positionseröffnung:

Eine Position wird eröffnet, wenn der Kurs die erste Zonenlinie (Short oder Long) erreicht. Wird die erste Eröffnungsposition mit Verlust in die zweite Zone gehandelt, erfolgt dort eine einmalige Positionsverdopplung. Hier sei angemerkt, dass die Verbilligung an der zweiten Zone

wesentlich zum Erfolg beiträgt.

.

Gewinnmitnahme:

Die Gewinnmitnahme erfolgt, sofern die Position aus der ersten Zone den Eröffnungs- oder Schlusskurs des Vortages erreicht. Ebenso erfolgt die Glattstellung mit Gewinn, sofern eine Position aus der zweiten Zone wieder die erste Zonenlinie erreicht.

Für händische Ausführungen bitte den Absatz

Handelstechnik/Orderausführungen

beachten. Somit können die Gewinnmitnahmen auch größer/kleiner als die Zonenbreite sein.

Neue Positionseröffnungen mit Gewinnsicherung

- Wurden Gewinne aus den ersten/zweiten Zonen oder eventuell beiden Zonen realisiert so können neue Positionen eröffnet werden. Zur Gewinnsicherung bzw. Verlustminderung unterliegen neue Positionseröffnungen einem weitergehenden einfachen Regelwerk.

- Wurden an der ersten und zweiten Zone, Short oder Long, Positionen eröffnet und nur die Positionen aus der zweiten Zone mit Gewinn glattgestellt, dann wird nach einem Retracement (Rückkehrbewegung) bis zur zweiten Zone dort nur dann eine neue Position eröffnet, wenn der VDAX-NEW unter 17 notiert.

- Wurden vormittags bereits Gewinne erzielt bzw. eine Position aus der ersten Zone noch offen ist, dann erfolgt in der Zeit von 13:00h bis 14:45h keine weitere Positionseröffnung.

- Wurden auf einer Seite des Charts, oben oder unten, Positionen aus erster und zweiter Zone erfolgreich abgewickelt,

und der



Kurs dreht in Folge auf die andere Seite des Charts dann werden dort zur Gewinnsicherung nur noch die Hälfte der üblichen Kontrakte gehandelt. Siehe folgender Chart.



Risiko Management

Feste Stopps

Gleichzeitig müssen in der Strategie natürlich auch mögliche Verluste begrenzt werden. Eine Glattstellung mit Verlust erfolgt, wenn eine noch offene Position an die vorher festgelegte Verlustzone läuft. Diese befindet sich 35 Punkte über oder unter den zweiten Zonen. Sind um 22 Uhr noch Positionen offen, so werden diese entweder mit Gewinn oder Verlust glattgestellt.

Zeitstopps/ Time Stopps (TS)

Wurden vormittags Positionen eröffnet und notieren diese kurz vor 14.30h noch im Verlust, dann erfolgt ein Zeitstopp und die

Positionen werden glatt gestellt. Zeitstopp für alle noch offene Positionen am Tagesende um 22:00h.

Seitwärts Konsolidierung auf Zeit (SK)

Eine Konsolidierung auf Zeit ist eine Seitwärtsbewegung und findet gewöhnlich am Tagestief-hoch mit sich abwechselnden 15M Kerzen über einen Zeitraum von 60-90 Minuten statt. Danach ist davon auszugehen, dass sich der Tagestrend in gleicher Richtung fortsetzt und eine noch offene Position wird glatt gestellt.

Stopp zur Gewinnsicherung (GS)

Dieser Stopp kommt nur dann zur Anwendung wenn bereits Gewinne erzielt wurden. Der GS Stopp wird immer dann eingesetzt, wenn nach Eröffnung einer neuen Position erkennbar ist, dass die Kursentwicklung der DOW FUT stark in die andere Richtung tendiert.

Zeitfaktor (ZF)

Nach Eröffnung einer Position an einer Zone ist der Zeitfaktor in Verbindung mit Chartlesung für die Erfüllung des TP, Mitnahme von Teilgewinnen oder auch Ausstieg mit Breakeven aus der Position von höchster Wichtigkeit. Nur der diskretionäre Händler mit Übersicht und Erfahrung kann das Management der offenen Position richtig steuern.

Eine Position die bereits 40 bzw 45 Punkte in einer Zone von 50 Punkten im Gewinn notiert lassen wie NIE in den Verlust laufen insbesondere wenn nach Eröffnung uns ausreichend Zeit zur Verfügung steht.



Ab 13:00h bis 14:45h werden keine neuen Positionen eröffnet.
 Grund: abnehmendes Handelsvolumen über die Mittagszeit und
 Zurückhaltung vor Veröffentlichungen der US
 Wirtschaftsnachrichten um 14:30h.





Notierungslücken/ Gaps

Gaps sind Bewegungen durch die ein gewisser Kursbereich übersprungen wird in dem keine Kursnotierung oder Handel stattfindet. Gaps, außer einer Doppel Gap und Wide Gap, werden nicht gehandelt.

Doppel Gap

Ein solches liegt vor, wenn der FDAX zum Beispiel um 22:00 Uhr um 10-20 Punkte über oder unter dem Schlusskurs/Auktion des Xetra-DAX notiert und am Folgetag mit einem weiteren Gap in gleicher Richtung eröffnet (um beispielweise zusätzliche 60 Punkte). Insgesamt muss die Lücke mindestens 70 Punkte betragen um als Doppel-Gap zu gelten.

Trade Management Doppel Gap Short



Kein Doppel Gap Handel wenn VDAX-NEW über 30 notiert.

Aus dem Chart ist ersichtlich, dass der Eröffnungskurs unter dem XETRA-DAX und FDAX Schlusskurs notiert. Nach Eröffnung um 8:00h wird eine Position Long mit dem Gewinnziel DAX Schlusskurs der Gap eröffnet

Wide Gap

Wide Gaps sind Notierungslücken die nicht die Anforderungen einer Doppel Gap erfüllen jedoch eine Differenz von Close und Open von +/- 40 Punkten ausmachen. Gehandelt wird diese ab dem Vortageschlusskurs, dann erste Aktionszone, mit dem Gewinnziel Eröffnungskurs um 8h. Zeitstopp kurz vor 14:30h wenn Position im Verlust. Es ist ein Revers Gap Close Handelsansatz. Notiert de VDAX-NEW über 20 wird der Handel der Wide Gap erst nach einer Mindestlücke von 70 Punkten in Erwägung gezogen. Kein Wide Gap Handel wenn VDAX-NEW über 30 notiert. Wurde bis 13:00h der Schlusskurs nicht angehandelt, dann erfolgt nur noch der Handel einer noch offen Position oder der Handel am Nachmittag und zwar ab 14:45h.

Grundsätzlich kann der Eröffnungskurs um 8:00h unter oder über dem Schlusskurs vom Vortag um 22:00h notieren. Auf der Seite Eröffnungskurs gibt es zwei Zonen plus Stopp Loss und auf der Seite Schlusskurs nach dem Einstieg 1 Zone plus Stopp Loss.

Es erfolgt daher auch der Zonenhandel über oder unter dem Eröffnungskurs.



Sofern der VDAX-NEW über 30 notiert und beide Gaps, Doppel Gap und Wide Gap, nicht als solche gehandelt werden erfolgt die Aufteilung der Zonen unter und über dem Eröffnungskurs. Der Schlusskurs wird also nicht berücksichtigt.

FDAX Gaps werden in der Regel von den DJIA FUT und aktuell wichtigen Nachrichten hergeleitet.

Insbesondere bei hoher VDAX-NEW Notierung und kommt es sehr häufig zu einer Fortsetzung der Initialrichtung.

Zonenhandel wenn um 8:00h die DJIA FUT über 0,50% notieren. Insbesondere auch dann, wenn es sich um ein Reversal vom Vortag handelt.

Die Gewinnmitnahme kann auch gestückelt erfolgen und zwar 50% nach 30+ Punkten und 50% am DAX Schlusskurs.



Wird nach Eröffnung eine Position zur Gapschließung eröffnet und es kommt zu einem Retracement (Rückkehrbewegung) wird die erste Zone zur zweiten Zone.

Wurde die Position abgewickelt, erfolgt der normale Zonenhandel.

Für beide Gap Ansätze liegt der Stopp Loss auch 35 Punkte unter/über der zweiten Zone

Monster Gap mit einer Kurslücke von über 300 Punkten.

Treten diese auf, dann wird an diesem Tag erst am Nachmittag gehandelt. Grund: nach einem Monster-Gap können nach Eröffnung um 8:00h die ersten Kerzen sehr weit sein und somit eröffnete Positionen schnell ausgestoppt werden. Notiert der VDAX über 20 und die DOW FUTURES (DJIA FUT) über 2% im Gewinn/ Verlust erfolgt auch nachmittags kein Handel.



Aufgrund der höheren DAX Notierung wurde die Monster Gap von 200 auf 300 Punkte erweitert.

Die Feststellung für Wide – und Monster Gaps errechnen sich aus der Differenz zwischen Schlusskurs um 22:00h und Eröffnungskurs um 8:00h

Nachrichtenabhängige Positionseröffnungen

Im Vorfeld wichtiger Veröffentlichungen wie US-Arbeitsmarktbericht und FED/EZB Zinsentscheidungen kommt es in einem bullischen Umfeld regelmäßig zu Kursgewinnen. Der US Arbeitsmarktbericht wird am ersten Freitag des Monats um 14:30h MEZ veröffentlicht. Das Federal Open Market

Committee trifft sich regulär acht Mal in einem Kalenderjahr. Es wird nach Eröffnung um 8:00h eine Long Position eröffnet sofern die DOW FUTURES (DJIA FUT) nicht im Verlust notieren.

Nach der Veröffentlichung der Daten kommt es gewöhnlich zu weiten Kursausschlägen. Nur sehr erfahrene Trader sollten dann noch aktiv werden denn es kommt darauf an ob die Daten bedeutend über oder unter den Erwartungen liegen. Es muss dann zwingend im Tandem mit den DJIA FUT gehandelt werden.

Trade Management: Beispiel für 20:00 USD Zinsentscheidung der FED

Nach Gewinn von 30-50 Punkten je nach Zonenbreite erfolgt eine Gewinnmitnahme (TP) von 50% der Kontrakte. Weitere 50% werden kurz vor 20:00h glatt gestellt. Bei einem Kursrücksetzer wird die Anfangsposition um 50% aufgestockt und bei Gewinn werden wiederum 50% glatt gestellt-----

Korrigiert der Kurs in die zweite Zone wird eine Position Long verdoppelt und der TP erfolgt für diese Position nach 35 Punkten Gewinn.

Charttechnisch erfolgt für diesen Tag keine Unterteilung in Vor- und Nachmittag. Positionseröffnungen können, wie aus folgenden Chart ersichtlich, erfolgen:



Trade Management: US Arbeitsmarktbericht

Grundsätzlich werden bis 14:30h Long Positionen gehandelt.
Der Einstieg unterliegt strengen Kriterien:

Sofortiger Einstieg Long um 8:00h wenn DOW Futures und FDAX positiv notieren oder auch steigender Kurs über dem Close vom DAX (XETRA) um 17:30h Vortag.

Sind diese Voraussetzungen nicht gegeben, dann zuerst Eröffnung der Börse um 9:00h und Long Umkehrkerze abwarten. Dieser Einstieg ist dann die erste Zone Long.

Teilgewinne (TP) zum Beispiel mit 30-50 Punkten, je nach Volatilität, können auch realisiert werden. Bei Rücksetzer kann Aufstockung erfolgen. An zweiter Zone Long Verdopplung der Position.



Trade Management: Beispiel für EZB Sitzung

Handel wie am US Arbeitsmarkt Daten jedoch Gewinnmitnahme
50% kurz vor 13:45h

TRENDTAGE LONG/SHORT

Trendfolge: Positionseröffnung in Abstimmung mit DJIA FUTURES (DJIA FUT)

Notieren um 8:00h die DOW FUT (DJIA FUT) mit 1 % im plus/minus erwägen wir den Einstieg Long/Short wenn ein Katalysator in Gestalt sehr positiver/negativer Nachrichten über Nacht vorliegt.

Sehr selten bilden sich Trend Tage ohne Korrekturen innerhalb des laufenden Tages aus. Die Gewinnmitnahme aber auch Verlustbegrenzung durch Zeitstopps unterliegt dem Common Sense und der individuellen zeitlichen Anpassung. Nachstehend Verschiedene Handelstage und deren Managements.





Trend-Tag Long





Trend-Tag Short

Position Management bei hoher VDAX-NEW Notierung



REVERSAL TRENDTAG

Nach einem Trendtag, Short/Long, erfolgt öfters eine Gegenbewegung am Folgetag. Typisches Chartmerkmal ist eine Doppel Gap über Nacht und direkte Gegenbewegung um 8:00h



Erfolgt nach heftigen Korrektur ein Reversal am gleichen Tag so ist am Folgetag mit einer Fortsetzung dieser Bewegung zu rechnen. Dies trifft auch umgekehrt nach Reversal vom Tageshoch zu. Siehe auch Late Break out/down.

Long/Short in Richtung der Zonen

Handel in Richtung der Zonen Long/Short.

Eine Kursbewegung in Richtung der Zonen ist jeden Tag gegeben.

Unter gewissen charttechnischen Voraussetzungen, Kurs für Short sollte nicht im Plus notieren und für Long nicht im Minus. kann in Richtung der Zonen gehandelt werden. Der Einstieg wird von der vollen Kerze beginnend um 7:45h bestimmt. Diese sollte mindestens die Hälfte der tagesgültigen Zonenbreite ausmachen. Dazu gehört dann noch eine Stopp Sell/Stopp Buy Order von 20 Punkten unter/über dem Ersteinstieg. Wird diese ausgelöst entsteht zunächst ein Verlust von 20 Punkten + Spread. Glatt gestellt wird die Position im Gewinn im Laufe des Tages üblicherweise an den zweiten Zonen vormittags oder an den zweiten Zonen der Setups am Nachmittag. Dann wird dort eine neue Position nicht mehr verdoppelt.

Trifft dies alles nicht ein, dann werden beide Positionen, Gewinn und Verlust, kurz vor 22h glatt gestellt.



US Federal Holidays

In einem bullischen Umfeld steigen die Kurse gewöhnlich nach einem US Federal Feiertag und Long Positionen werden bevorzugt.

Für 2021 sind die US Feiertage wie folgt:

- Monday, January 18 – Martin Luther King, Jr. ...
- Monday, February 15 – President's Day.
- Monday, May 31 – Memorial Day.
- Sunday, July 4 – Independence Day.
- Monday, July 5 – Independence Day (observed)
- Monday, September 6 – Labour Day.

FDAX-TRADING-STRATEGIE

Handel am Nachmittag

Viele Handelstage haben bis 14:30 Uhr, wenn die US -Vorbörse beginnt, ihre Handelsspanne nicht ausgeschöpft. Zu diesem Zeitpunkt zeichnen wir zunächst die Handelsspanne bis 14:30h als Value-Zone ein. Ausgehend davon wird gehandelt, wenn einer der fünf (5) nachfolgenden Setups zur Positionseröffnung vorliegt:

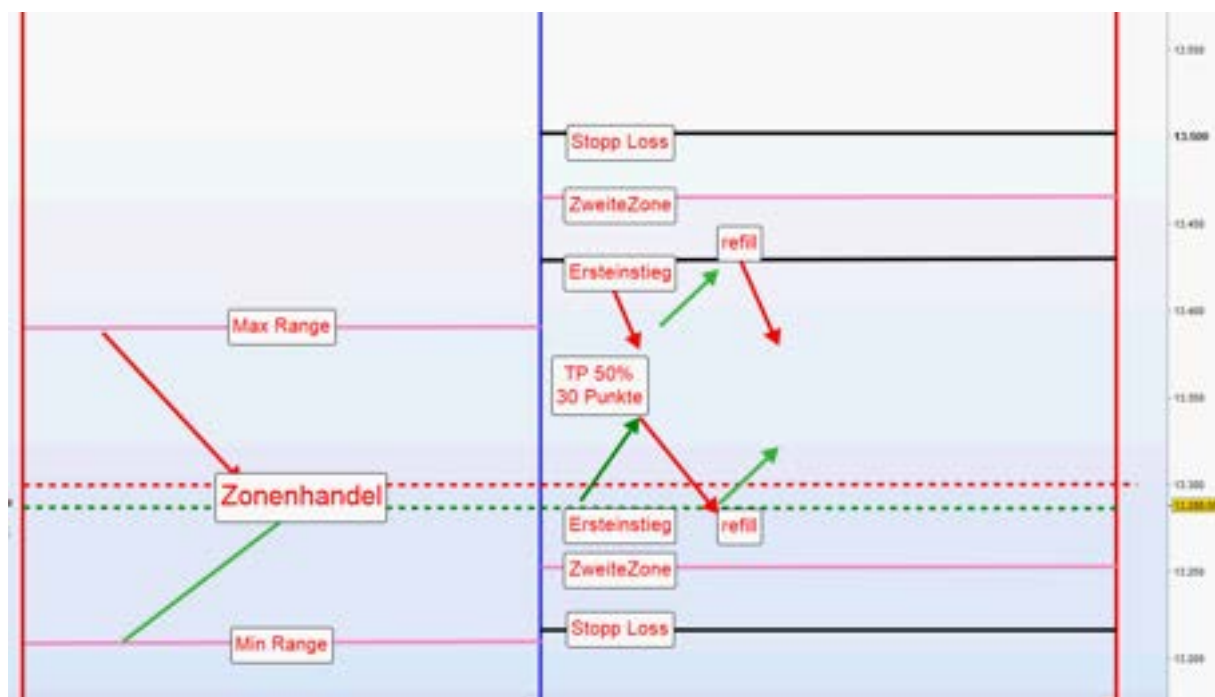
- 1.Range Erweiterung. Short und Long.
- 2.Handel zum Mittelkurs, wenn Kurs die morgens definierte Stopp Loss Linie durchhandelt. Short und Long
- 3.Kurs kreuzt von unten Linie Schlusskurs Vortrag. Nur Long
- 4.Handel in Richtung Eröffnungskurs. Short und Long
5. Early und Late Reversals eingeleitet durch die DJIA FUT. Short und Long

Eine Positionseröffnung ist immer, analog zum Vormittag, die erste Zone. Es folgt eine zweite Zone mit Verdopplung der Position und der Stopp Loss. Das Trade Management ist daher zum Vormittag unverändert. Es können für Positionen der Setups 2 bis 5 auch 50% Teilgewinne erzielt und bei einem Rücksetzer zum Ersteinstieg wieder aufgefüllt werden(refill)

Alternativ ist es auch möglich, insbesondere wenn während des Tages schon Gewinne erwirtschaftet wurden, nach 30+ Punkten ein Teilgewinn von 50%(TP 50%) sicher zu stellen. Kommt es

danach zu einem Rücksetzer, dann wird die Position glatt gestellt. Fällt oder steigt der Kurs weiter, so kann in der nächsten Zone erneut eine Position eröffnet werden.

Beispiel:



Dieser Handel hat eine sehr hohe Erfolgsquote weil sich der Handel, außer Setup 3, immer in der Nähe vom max. und min. der täglichen Trading Range vollzieht. Unfair Value!

Die Handelsfrequenz steigt mit zunehmender VDAX Volatilität.

Kein Handel am Nachmittag wenn zum Zeitpunkt einer möglichen Positionseröffnung die DOW FUTURES (DJIA FUT) über 1% im Gewinn oder im Verlust notieren. Notiert der VDAX über 20 kein Handel wenn die DOW Futures über/unter 2% notieren. Ausgenommen Early und Late Reversals Setup 5.

Voraussetzung für den Handel am Nachmittag sind folgende minimum Intraday Handelsspannen:

100 Punkte für VDAX Notierung bis 17.

125 Punkte für VDAX Notierung zwischen 17 und 30.

150 Punkte für VDAX Notierung über 30

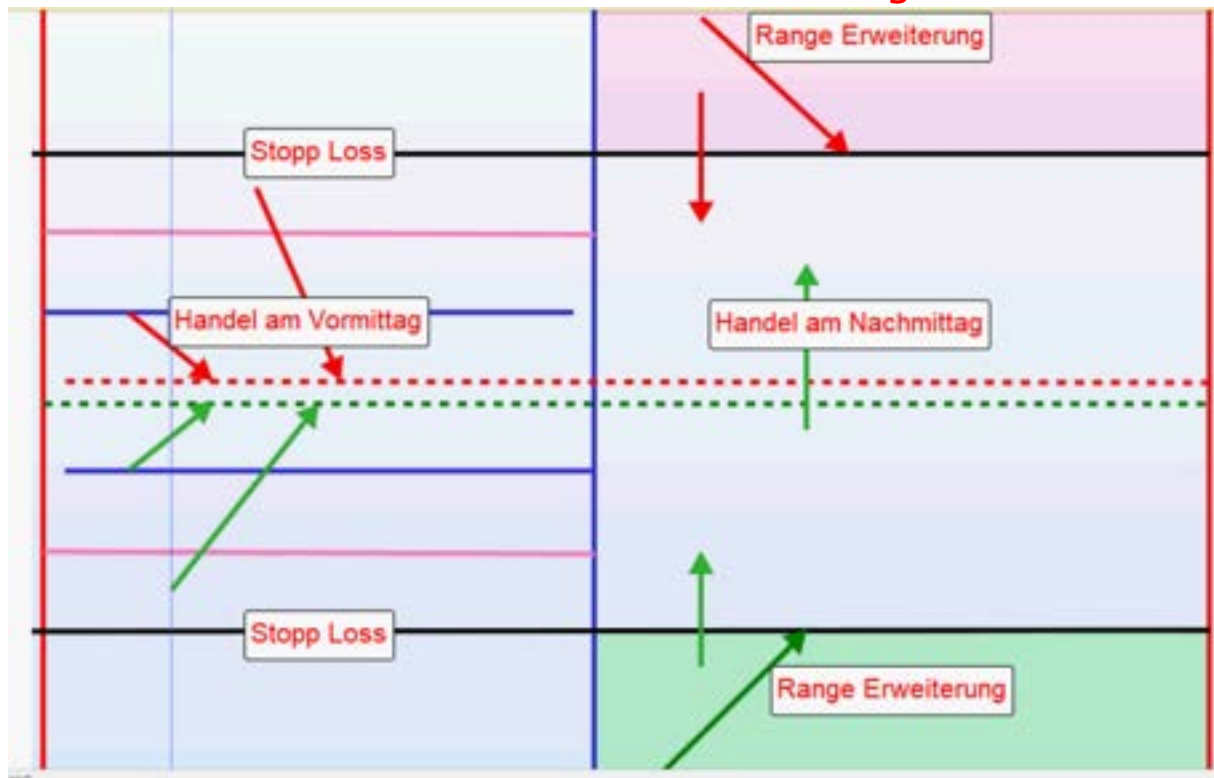
Ausgenommen Setup 3

Offene Positionen vom Vormittag, insbesondere aus den zweiten Zonen, sollten a priori abgewickelt werden.

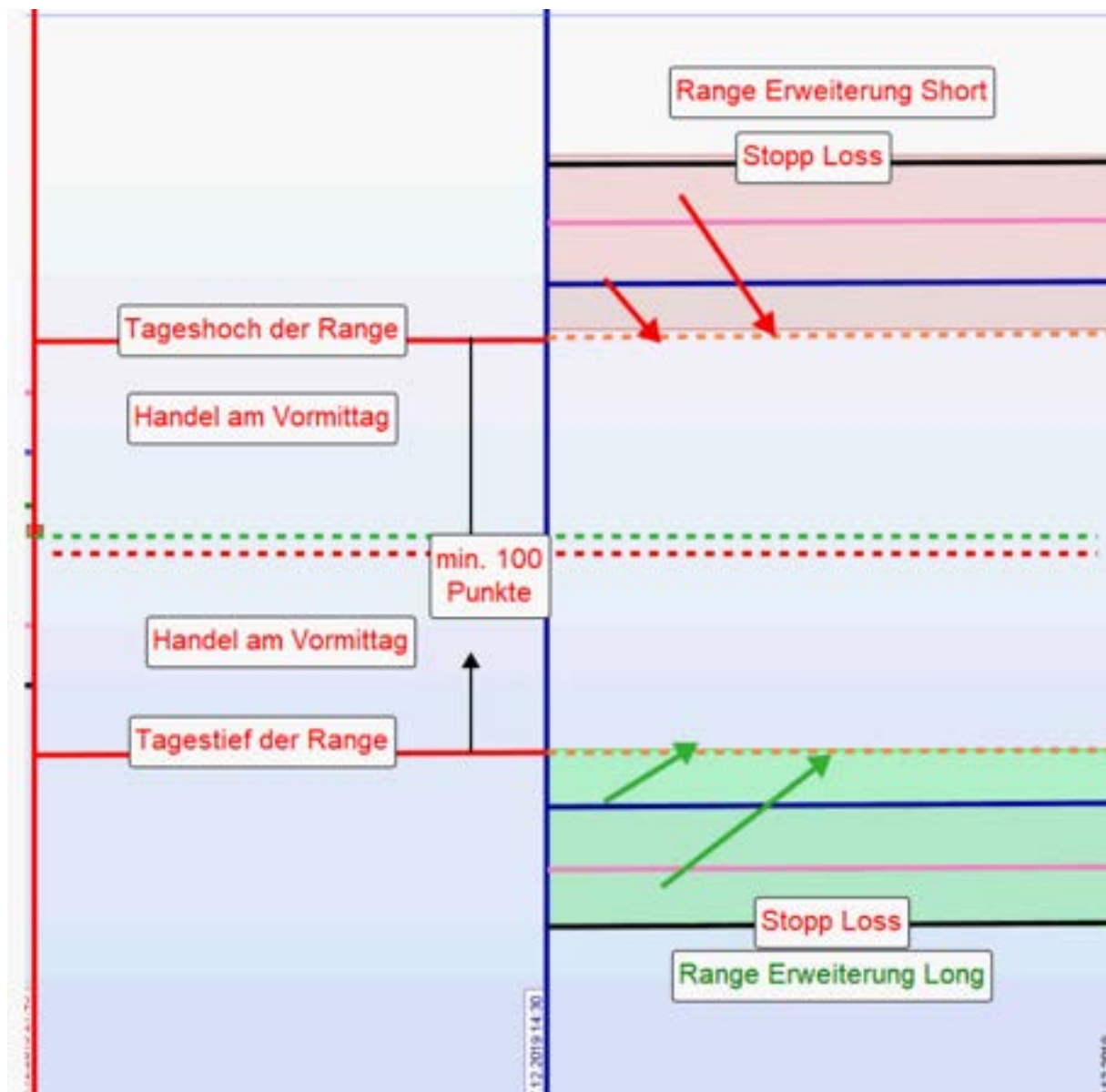
Sofern morgens beide Positionen aus der ersten und zweiten Zone mit hohem Verlust ausgestoppt wurden so wird auf dieser Seite des Charts nachmittags nur dann gehandelt, wenn nach dem Ausstoppen der Kurs wieder in die zweite Zone gehandelt wurde. Der Grund für diese Sicherheitsmaßnahme ist, dass sehr oft nach dem Ausstoppen der Kurs die initiale Richtung fortsetzt und dann ein Trend-Tag vorliegen kann. Ausgenommen Early und Late Reversals Setup 5.



Übersicht Handel am Vor-und Nachmittag



Setup 1.Range Erweiterung



Setup 2. Handel zum Mittelkurs, wenn Kurs die morgens definierte Stopp Loss Linie durchhandelt. Short und Long





Nach einem plötzlichen Kursrutsch folgt meistens ein Setup 2



Setup 3. Kurs kreuzt von unten Linie Schlusskurs Vortag oder wird mit Stop Buy Order ausgeführt. Nur Long.



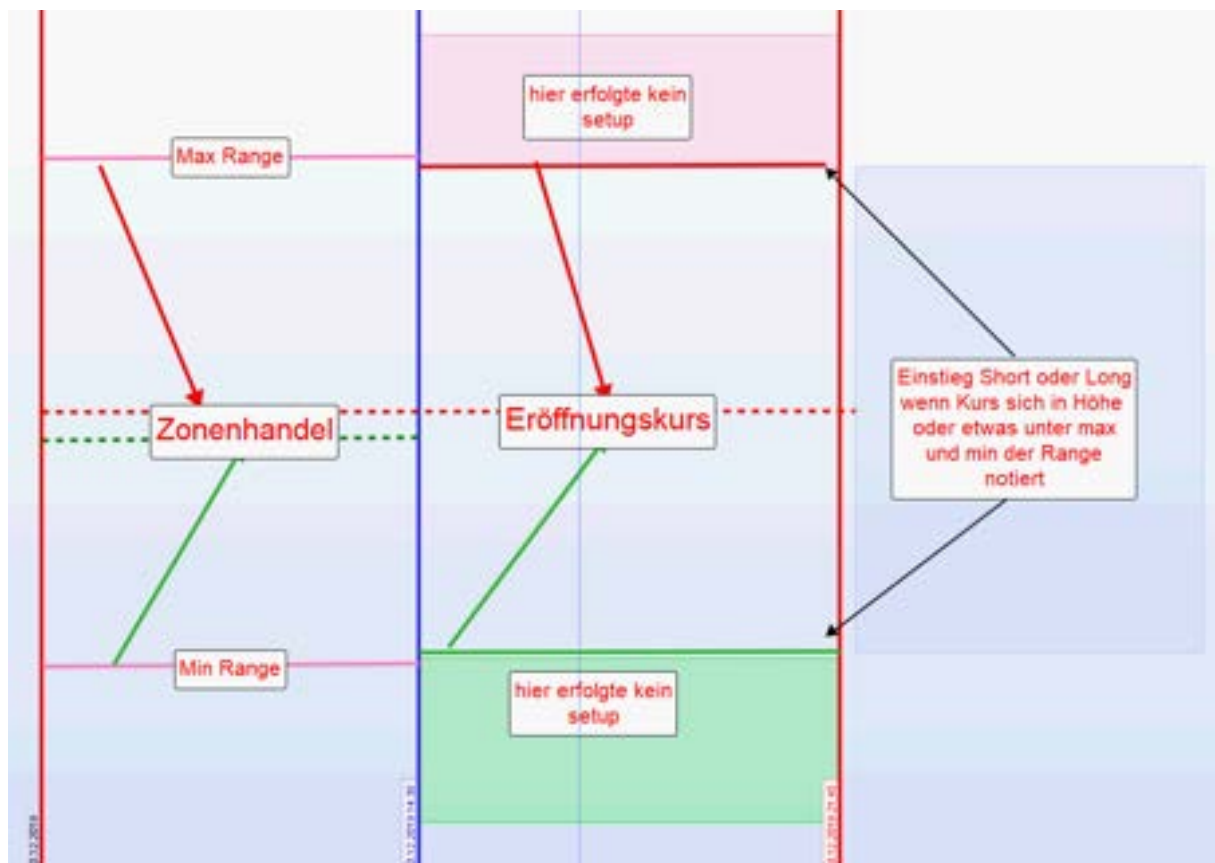




Ausnahme: Wenn Eröffnung- und Schlusskurs im wesentlichen unverändert sind und Trading Range vormittags sehr eng war.

Setup 4. Handel in Richtung Mittelkurs. Short und Long

Während alle vorigen Setups für Positionseröffnungen präzise Vorgaben haben, findet dieser Handel in Nähe von Tageshoch/-tief in Richtung Mittelkurs statt. Tageshoch-tief kann auch auf einer Seite des Charts an der ersten oder zweiten Zone sein. Der Kurs kann auch in die Zone der Range Erweiterung gehandelt worden sein ohne in dieser zu schließen.







Mehrfach Setups

Zuweilen ergibt sich nachmittags die Möglichkeit mehrere Setups in Folge zu handeln

Wurde nachmittags ein Setup erfolgreich abgewickelt, dann sollte der nächste Einstieg nur auf der anderen Chartseite sein. Siehe Chart. Die vermeidet Over Trading.



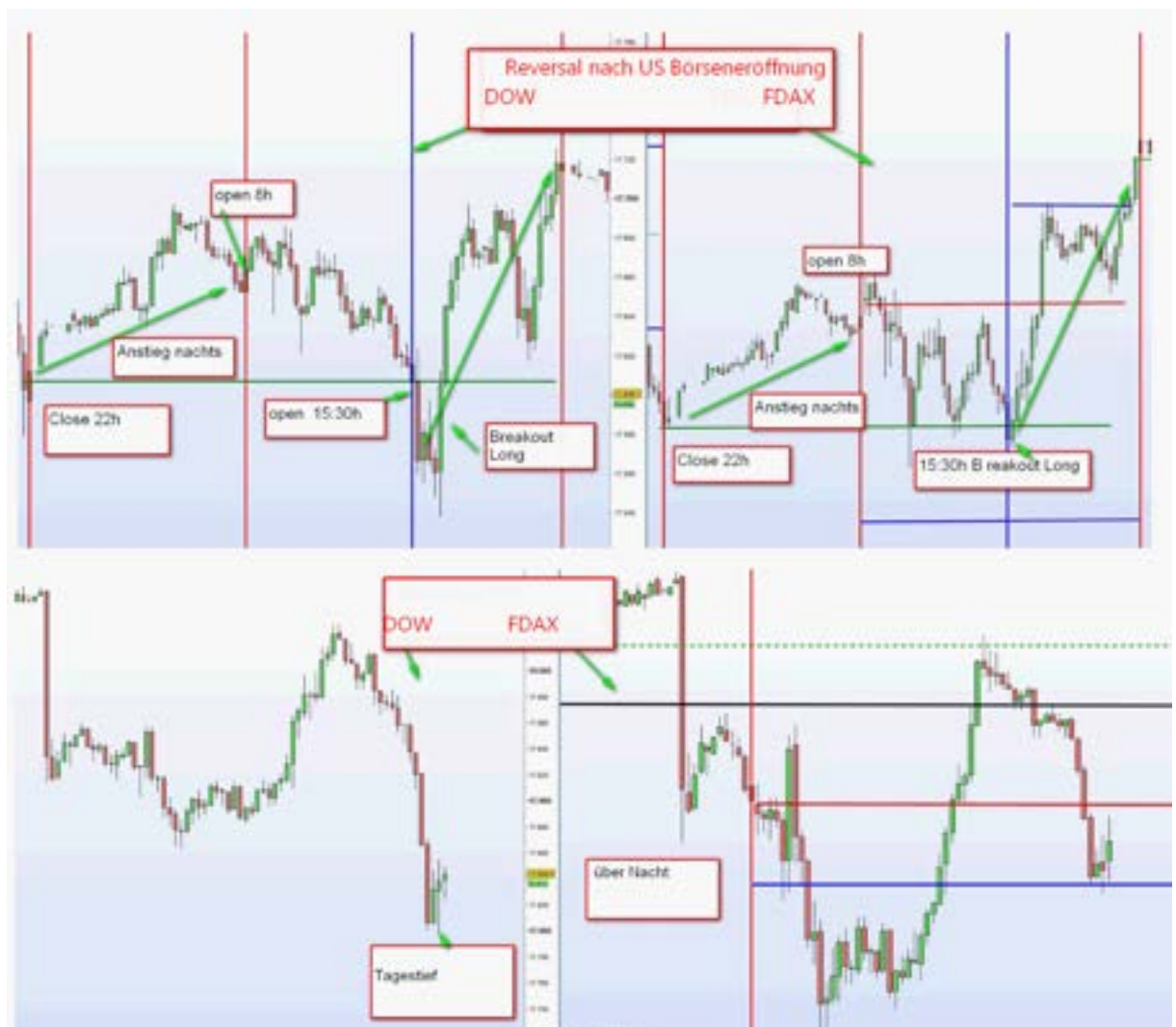
5. Reversals (Umkehrungen) eingeleitet durch die DJIA FUT. Short und Long

Es kommt nach 14:30h bzw. nach 15:30h gelegentlich zu einem Trend Tag mit Schlusskurs am Hoch oder Tief der Trading Range aber auch zu den Early und Late Reversals mit partieller oder kompletter Umkehr der Range. Geübte Trader können mit diesen Reversals, da an keine Zonen gebunden, hohe Gewinne erzielen.

Neunzig Prozent der Reversals erfolgen wenn:

1. die DOW FUTURES (DJIA FUT) vor der Eröffnung der US Börse sehr hoch im Verlust/Gewinn notieren und es dann zu einer sofortigen Gegenbewegung (Early reversals) kommt oder auch
2. nach 20:00h durch Intraday Gewinnmitnahmen (Late Reversals.)

Gewöhnlich drehen dann alle drei US Major Indices (Nasdaq, S&P 500, DOW).





Auswertung Handel am Nachmittag für das Jahr 2019 ergab:

An 265 Handelstagen wurden nachmittags 116 Mal eine Order ausgeführt. Insgesamt also 105 Gewinntage, 5 Verlusttage und 6 Breakeven.

Setup 1. Gewinne an 27 Handelstagen/ Verluste 1/ Breakeven 3

Setup 2. Gewinne an 12 Handelstagen/ Verluste 0/ Breakeven 1

Setup 3. Gewinne an 25 Handelstagen/ Verluste 1/ Breakeven 1

Setup 4. Gewinne an 41 Handelstagen/ Verluste 3/ Breakeven 1

Als Fazit dieser Auswertung darf festgestellt werden, dass Part Timer hier eine Chance haben erfolgreich zu partizipieren.

Voraussetzung solide Kenntnisse des gesamten Regelwerks und für nachmittags auch insbesondere die Korrelation DOW FUT und FDAX.

Handel am Nachmittag mit 5 Setups

1. Range Erweiterung. Short und Long.

2. Handel zum Mittelkurs, wenn Kurs die morgens definierte Stopp Loss Linie durchhandelt. Short und Long

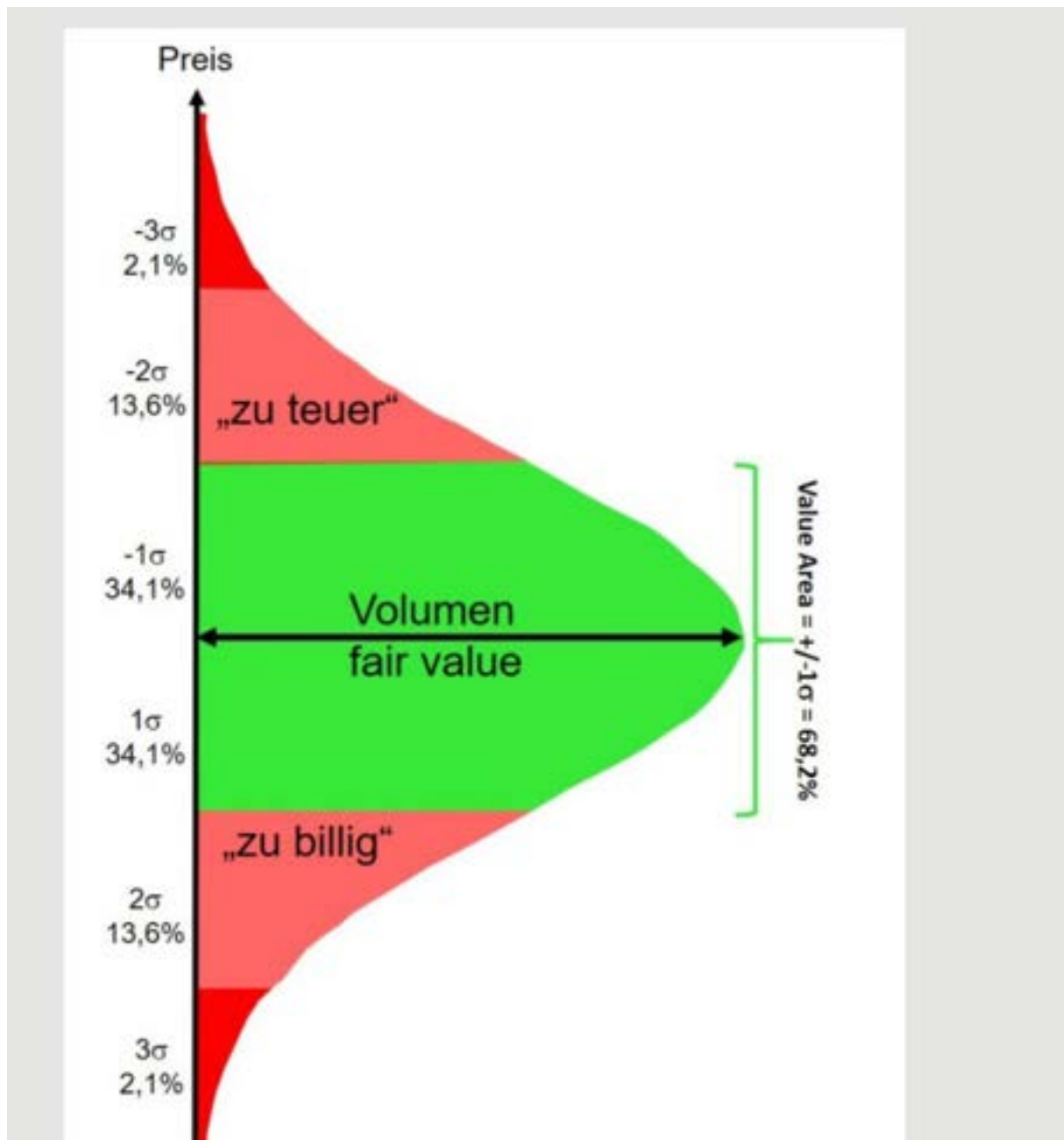
3. Kurs kreuzt entweder von unten den Schlusskurs vom Vortag oder wird analog zu den morgendlichen Positionseröffnungen mit Alarm und Stopp Buy Order ausgeführt. Voraussetzung: Close Vortag befindet sich in der Nähe vom Tagestief des aktuellen Charts. Nur Long

4. Handel vom Hoch/Tief Richtung Mittelkurs . Short und Long

5. Early und Late Reversals/Umkehr eingeleitet durch die DJIA FUT. Short und Long

Warum so erfolgreich? Einstiege, außer Setup 3, finden alle an den Extremen der Intraday Trading Range

oder Unfair Value mit einem hohen Potenzial zur Umkehr statt.



Wann und wo entstehen Verluste und wie können diese verhindert oder verringert werden

Ein signifikantes Merkmal für typische Verlust-Trades ist, dass eine oder beide Zonen mit hohem Volumen schnell und deutlich durchgehandelt werden. Verluste durch Stopp Loss haben zu 80% gemeinsam, dass der Eröffnungskurs um 8:00h nicht oder nur geringfügig darunter oder darüber gehandelt wird. Wichtiger Augenmerk liegt auf der Entwicklung von DJIA FUT

über Nacht und der Eröffnung XETRA-DAX um 9:00h. Trotz aller Sorgfalt kann man Verluste nicht gänzlich verhindern jedoch wesentlich verringern und zwar durch: Durch Anpassung der Aktionszonen.



Nachdem festgestellt wurde, dass keine Kerze unter/über dem Open um 8:00 schloss und der Kurs durch die erste Zone durchgehandelt wurde, dann warten wir zum Einstieg erst eine 5M Umkehrkerze ab.

Impuls und Korrektur betrachtet mit 15M Kerze

Handel jedoch nach 5M Umkehrkerze





Weiterhin



Beide Zonen Long wurden vormittags sichtbar durchgehandelt. Durch eine Zonenanpassung wäre kein Verlust sondern ein Gewinn angefallen.

Regel:

Wird eine Position an der ersten Zone eröffnet und danach festgestellt, dass die erste Zone durchgehandelt wurde und zwischen der ersten und zweiten keinerlei Korrektur erkennbar ist, dann erfolgt ein erneuter Einstieg erst nach einer Umkehrkerze. Sofern diese Umkehrkerze mehr als 10 Punkte unter der normalen zweiten Zone schließt, wird nur noch die Hälfte der Kontrakte eröffnet und der Stopp Loss neu definiert.

Wide Range Bar WRB

Eine WRB ist eine Candlestick Volumen-Kerze 2-3 Mal länger als die üblichen Kerzen.

Sofern diese in Nähe Tageshoch - tief vorkommen ist mit einer Folgekerze in gleicher Richtung zu rechnen.

Also: Kein Einstieg nach der ersten WRB Kerze sofern sich diese an der ersten Zone - wo normalerweise ein Einstieg in die Gegenrichtung zum Mean erfolgt - ausbildet





Auch durch spätere Positionseröffnung

Notiert der Kurs entweder positiv oder negativ und eine heftige Gegenbewegung erreicht mit 3-4 15M Kerzen die erste gegenüber liegende Zone so eröffnen wir dort keine Position. Kein Einstieg ohne Umkehrkerze. Besondere Aufmerksamkeit kommt der 9:00h Kerze, Eröffnung DAX, zu.



Zonen bei hoher Volatilität 60 Punkte. Für den Einstieg wird ein Alarm mit Abstand von 10 Punkten gesetzt. Weiterhin wird eine händisch vorbereitete Limit Order mit 15 Punkten Abstand zur Zonenlinie bereit gehalten. Wird der Alarm ausgelöst wird die Limit Order abgesetzt. Aus dem 1 Minuten Chart ist ersichtlich das kein Rücksetzer erfolgte und die Order erst weiter oben ausgeführt wurde. Danach werden die Zonen angepasst.

Vorsicht wenn nach der ersten 15M Kerze bis 9:00h eine Seitwärtsbewegung folgt. Entweder auf Einstieg an der zweiten Zone verzichten oder signifikante Umkehrkerze abwarten.



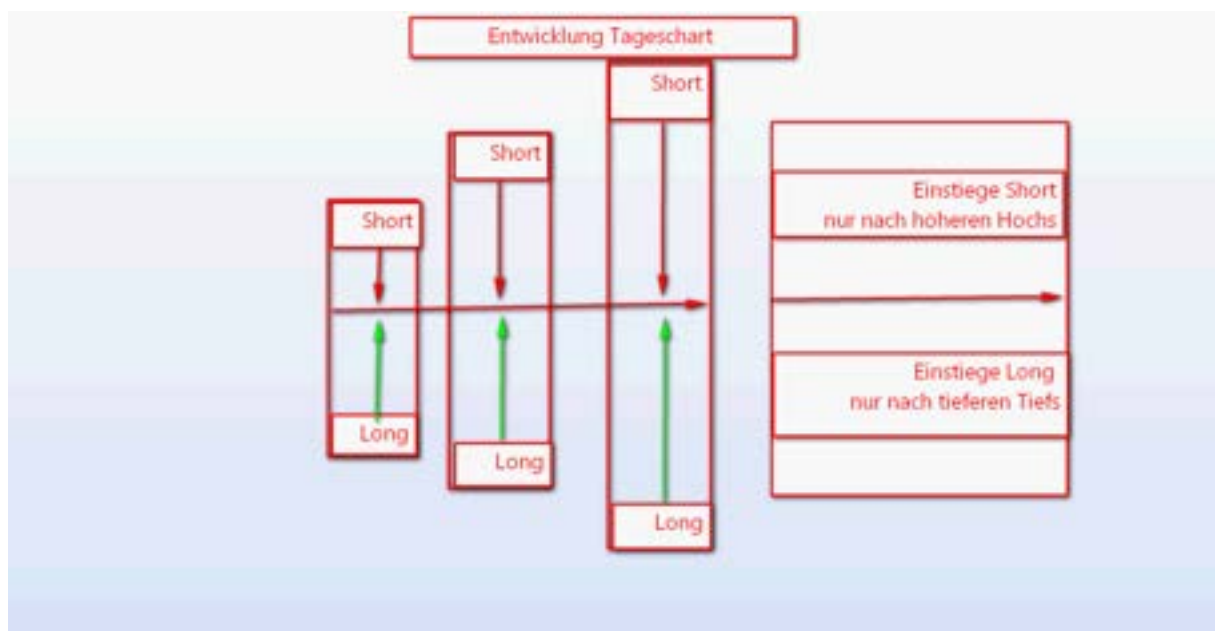
Anpassung Stopp Loss

Die Wahrscheinlichkeit einer Verlustkürzung oder sogar Gewinnerzielung ist sehr hoch.





Die wichtigste Regel im Day-Trading



Ausgenommen an Trendtagen, FED, EZB und US Arbeitsmarktdaten jeden 1. Freitag im Monat

Handelstechnik/Orderausführungen

Praktische Ratschläge für den Handel bis 13:00h

Der Eröffnungskurs um 8:00h wird von dem Geschehen über Nacht bestimmt und alle Ereignisse und Resultate der asiatischen Börsen sind in den DJIA FUT enthalten.

Der Börsennachrichtensender CNBC, auch in D zu empfangen, veröffentlicht in der Vorbörse 7:30h bis 8:00h den sogenannten Over Night Indikator. Auch gibt de.investing.com/indices/indices-cfds einen guten Überblick.

Ein systematischer Handelsansatz mit diskretionären Elementen verlangt Präsenz in der Nähe des Bildschirms. Es gehört zu den guten Ritualen nach Erstellung des Handelsrahmens 5 Punkte vor den Zonen einen Alarm zu setzen und bereits vorher die Order mit Gewinnziel und Stopp Loss aufzugeben.

Beispiele:

Markt	Größe	Level	Aktuell	Stop	Limit	Orderart
● Deutschland ...	-1	12546	12531.0▲	70	30	Limit
● Deutschland ...	-2	12581	12531.0▲	35	35	Limit
● Deutschland ...	+1	12453	12533.0▲	70	30	Limit
● Deutschland ...	+2	12418	12533.0▲	35	35	Limit

Viele Kurse durchschneiden mit Momentum die Linien. Andererseits kommt es zu einer punktgenauen Berührung der Zonen mit sofortigem Rücksetzer zum Mean. Außerdem gibt es „near misses“ von 1-3 Punkten ohne Orderausführungen.

Ein geübter Trader kann nach dem Alarm bereits eine Buy Stop <.



Near Misses



Dies kann nach einem Chart je nach Kursverlauf und gemäß dem Beispiel-Ausführungschart im Regelwerk bedeuten, dass die Orderausführung in der Tat 10 Punkte über der Zonenlinie für Long oder unter der Zonenlinie für Short stattfinden kann. Aber auch bei einer weiteren Anpassung, wenn der Kurs die Zonenlinie mit Momentum durchkreuzt, viel später zu einem besseren Kurs ausgeführt wird.

Das gleiche Prinzip kann auch für die Gewinnmitnahme erfolgen. Über Zeit passen sich die Gewinne der Zonenbreite an. Also es gibt Trades mit weniger und auch mit mehr Gewinn.

Neueinstieg hier Wiedereinstieg

Wurde das Ziel (heute 50 Punkte) nicht vollständig erreicht und fand eine partielle Gewinnmitnahme statt, dann muss ein Neueinstieg besser sein. Heute tiefer für Long.

Der Kurs Neueinstieg wird dann zur ersten Zone.

Charttechnisch kann dann auch der Neueinstieg beim vorherigen Tief erfolgen und zwar mit Alarm u s w



Money und Risiko -Management

Das Verlust-Management findet auf zwei Ebenen statt.

1. Intraday durch festgelegten Verlust Stopp 35 Punkte unter und über der zweiten Aktionszone. Weiterhin durch drei Aktionstopps, siehe Risiko Management, und durch

Einschränkungen zum Beispiel keine neue Eröffnung von Positionen zwischen 13:00h und 14:45h.

2. Im übergeordneten Zeitrahmen Gewinnabsicherung durch das Money Management. Positionserhöhungen erfolgen nach einer positiven Kapitalkurve in Etappen. Positionskürzung nach einem Rücksetzer. Sobald der Verlust die Hälfte der letzten Erhöhungsebene erreicht wird die Positionsgröße um zwei Stufen zurückversetzt

Durch das Intraday Regelwerk mit Positionseröffnungen, Gewinnmitnahmen und Verlustbegrenzung ist ein Rahmen gesteckt. Der positive Erwartungswert oder Profitfaktor kann von einem interessierten Betrachter mittels eines händischen Backtest gründlich und exakt ermittelt werden.

Kein Handel:

Zwischen Weihnachten und Heilige Drei Könige Freitags nach Close XETRA-DAX um 17:30h. Auch an dem Tag vor einem Feiertag.

Zusammenfassung

Die vorgestellte Strategie hat ein sehr hohes Ertragspotenzial und ist bei genauer Kenntnis des Regelwerks und nach einer Einarbeitungszeit von passionierten und erfahrenen Trader recht einfach ohne Hektik umzusetzen. Sie hat diskretionäre Elemente und daher ist eine Präsenz in der Nähe der Trading Plattform unerlässlich.

