

## Definitionen:

Vormittag	08:00 bis 14 :00 Uhr
Nachmittag	bei News ab 14:30 Uhr, sonst ab 15:30 Uhr bis 18:00 Uhr
FDAX-SK	FDAX- <b>Schlusskurs</b> vom Vortag um 22:00 Uhr
FDAX-EK	FDAX- <b>Eröffnungskurs</b> von Heute um 08:00 Uhr
FDAX-X	FDAX zum <b>XETRA</b> -Schluss
FDAX-NL	FDAX- <b>Notierungslücke</b>
FDAX-MIN	<b>Minimaler</b> FDAX-Kurs vormittags
FDAX-MAX	<b>Maximaler</b> FDAX-Kurs vormittags
AZ-1	<b>Aktionszone</b> 1
AZ-2	<b>Aktionszone</b> 2
DJIA-SK	DJIA Future <b>Schlusskurs</b> vom Vortag um 22:15 Uhr
DJIA-EK	DJIA- Future <b>Eröffnungskurs</b> von Heute um 08:00 Uhr
DJIA-AK	DJIA Future <b>aktueller Kurs</b>
DJIA-ANL	DJIA Future <b>aktuelle Notierungslücke</b>
Nikkei-EK	Nikkei <b>Eröffnungskurs</b>
Nikkei-SK	Nikkei <b>Schlusskurs</b>

## Berechnung der Aktionszonen um 08:00 Uhr:

$$\text{FDAX-NL} = \text{FDAX-EK} - \text{FDAX-SK}$$

Wenn  $|\text{FDAX-NL}| \leq 10$ :

$$\text{AZ-1-Short} = \text{FDAX-EK} + (35 \text{ bis } 45)$$

$$\text{AZ-1-Long} = \text{FDAX-EK} - (35 \text{ bis } 45)$$

$$\text{AZ-2-Short} = \text{FDAX-EK} + (60 \text{ bis } 70)$$

$$\text{AZ-2-Long} = \text{FDAX-EK} - (60 \text{ bis } 70)$$

Wenn  $\text{FDAX-NL} < -10$ :

$$\text{AZ-1-Long} = \text{FDAX-EK} - (30 \text{ bis } 40)$$

$$\text{AZ-2-Long} = \text{FDAX-EK} - (60 \text{ bis } 70)$$

$$\text{AZ-1-Short} = \text{FDAX-SK} + (30 \text{ bis } 40)$$

$$\text{AZ-2-Short} = \text{FDAX-SK} + (60 \text{ bis } 70)$$

Wenn  $\text{FDAX-NL} > 10$ :

$$\text{AZ-1-Long} = \text{FDAX-SK} - (30 \text{ bis } 40)$$

$$\text{AZ-2-Long} = \text{FDAX-SK} - (60 \text{ bis } 70)$$

$$\text{AZ-1-Short} = \text{FDAX-EK} + (30 \text{ bis } 40)$$

$$\text{AZ-2-Short} = \text{FDAX-EK} + (60 \text{ bis } 70)$$

## Sonstige Berechnungen um 08:00 Uhr:

$$\text{DJIA-ANL} = \text{DJIA-AK} - \text{DJIA-SK}$$

Trendtag, wenn:  $((\text{Nikkei-SK} - \text{Nikkei-EK}) > 100 \text{ und } (\text{DJIA-SK} - \text{DJIA-EK}) > 40)$

oder

$((\text{Nikkei-SK} - \text{Nikkei-EK}) < -100 \text{ und } (\text{DJIA-SK} - \text{DJIA-EK}) < -40)$

Anmerkung: 100/-100 sind angenommene Werte, die noch verifiziert werden müssen!

Doppelgap, wenn:  $((\text{FDAX-SK} - \text{FDAX-X}) > 20 \text{ und } (\text{FDAX-SK} - \text{FDAX-EK}) > 20)$

oder

$((\text{FDAX-SK} - \text{FDAX-X}) < -20 \text{ und } (\text{FDAX-SK} - \text{FDAX-EK}) < -20)$

## Strategien:

### **Mean Reversion-Strategie Aktionszone 1 (MRS-A1V):**

Vormittags, wenn kein Trendtag:

Wenn  $0 \leq |DJIA-ANL| \leq 30$

Einstieg sofort

Wenn  $30 < |DJIA-ANL| \leq 50$

Einstieg nach Umkehrkerze beim DJIA

Kursziel: FDAX-EK

### **Mean Reversion-Strategie Aktionszone 2 (MRS-A2V):**

Vormittags, wenn kein Trendtag:

Wenn  $0 \leq |DJIA-ANL| \leq 40$

Einstieg sofort

Wenn  $40 < |DJIA-ANL|$

Einstieg nach Umkehrkerze beim DJIA

Kursziel: FDAX-EK

### **Mean Reversion Strategie Nachmittag (MRS-N):**

Nachmittags, wenn kein Trendtag:

Wenn  $FDAX > FDAX-Max$

Einstieg nach Umkehrkerze beim DJIA

Wenn  $FDAX < FDAX-Min$

Einstieg nach Umkehrkerze beim DJIA

Wenn Rückläufer zu den AZ

Einstieg nach Umkehrkerze beim DJIA

Kursziel: FDAX-EK

### **Trendfolge Strategie Vormittag (TRDFS-V):**

Wenn Trendtag:

Einstieg

um 08:00 Uhr oder

um 08:30 Uhr, wenn Vorkerzen-15 größer/kleiner FDAX-EK oder

kurz vor XETRA-Dax Eröffnung um 09:00 Uhr

Kursziel: 22:00 Uhr

### **Trendfolge Strategie Nachmittag (TRDFS-N):**

Wenn Trendtag:

Einstieg

kurz vor US Eröffnung um 15:30 Uhr

Kursziel: 22:00 Uhr

### **Doppelgap Strategie (DGS):**

Wenn Doppelgap und kein Trendtag:

Wenn  $0 \leq |DJIA-ANL| \leq 30$

Einstieg sofort

Wenn  $30 < |DJIA-ANL|$

Einstieg nach Umkehrkerze beim DJIA

Kursziel: Gap-Schließung