

Freunde der FDAX-TRADING-STRATEGIE

Hiermit fasse ich noch einmal die wichtigsten Elemente für den

Einstieg in die FDAX-TRADING-STRATEGIE zusammen.

Wobei als Risiko Management die Gewinnsicherung neu formuliert wurde.

Der Handelsansatz der FDAX-Strategie basiert in erster Linie auf Regression zum Mittelwert (Mean-Reversion). Für die Strategie wurde daher die Handelsspanne in volatilitätsabhängige Aktionszonen aufgeteilt. Aktionszonen dienen zur Orientierung für den Einstieg von Long- oder Short-Positionen. Sie basieren auf langjährigen Erfahrungswerten an denen sich innerhalb der Trading Range die meisten Korrekturen (Retracements) in Richtung Mittelkurs und darüber hinaus ausbilden.

Trade Management mit CFDs DE30 Cash.

Handelszeiten und Trading-Rahmen

Der Handelstag wird in 2 Aktionszeiten aufgeteilt und bietet somit auch Part Time Traders eine zeitlich geeignete Marktteilnahme und zwar von 8h bis 14:30h und dann von 14:30h bis 22h.

Positionsmanagement von 8-14:30h

1. Während dieser Handelszeit wird, sofern es sich anbietet, jeweils nur eine Position Long/Short an den ersten Aktionszonen eröffnet. Die ersten Aktionszonen Long und Short haben zurzeit jeweils einen Abstand von 40 Punkten zum Eröffnungskurs- oder Schlusskurs Vortag und werden je nach der VDAX-NEW Berechnung fortlaufend neu bewertet. Ein- und Ausstieg erfolgt mit Limit Order oder diskretionär. Gewinnziel sind daher 30- 40 Punkte für jede eröffnete Position von einem Kontrakt.

2. Die zweiten Aktionszonen Long/Short haben je einen Abstand von 40 Punkten zu den ersten Aktionszonen.

An der 2. Aktionszone Long/Short werden Positionen von zwei Kontrakten eröffnet. Das bedeutet zuweilen eine Verbilligung einer an den ersten Aktionszonen eröffneten Position die in den Verlust läuft. Wird von der zweiten Aktionszone aus ein Gewinnziel von 30-40 Punkten erreicht dann werden alle offenen 3 Kontrakte glatt gestellt. Das bedeutet in etwa Breakeven für den Einstieg an der ersten Aktionszone.

Insgesamt können bis 14:30h Positionen wie folgt eröffnet werden:

-ein Kontrakt an der ersten Zone Long

-ein Kontrakt an der ersten Zone Short

-zwei Kontrakte an der zweiten Zone Long

-zwei Kontrakte an der zweiten Zone Short

3. Sofern aus der ersten Aktionszeit noch eine Position offen ist wird in der zweiten Aktionszeit von 14:30-22h keine weitere Position an der gleichen Aktionszone eröffnet.

4. Sofern DAX-NEW Indikation unter 20 kann eine Long Position im Bereich Schlusskurs/Eröffnungskurs eröffnet werden wenn die DJIA FUT über Nacht im Verlust notierten und anfangen den Schlusskurs vom Vortag zu erreichen /überschreiten oder bereits hoch im Gewinn notieren. Die 1. Aktionszone Long wird dann zur 2. Aktionszone.

5. Wird an seltenen Tagen ohne das ein erkennbarer Trendtag vorliegt durch eine besonders negative Nachricht die erste Long Aktionszone, mit roten WRB (Wide Range Bars) durch gehandelt wird keine Position eröffnet und die zweite Aktionszone wird zur ersten Aktionszone . Es folgt eine weitere Zone die dann die zweite Zone ist. Einstiege nur nach Erforschung der Ursache und nach signifikanter grüner Umkehrkerze.

6. Positionseröffnungen in Übereinstimmung mit DJIA FUT siehe Text der FDAX-TRADING-STRATEGIE. Diese Abstimmung an den Zonen erfolgt jedoch nur bis 14:30 und danach nur für Reversals nach einer Rangeerweiterung!

Dieser Einstieg sollte zunächst gut beobachtet und geübt werden. Er wird statistisch nicht erfasst und gilt im Moment noch nicht für das Team Trading.

7. 80% Setup

In einem Umfeld kurzfristig sehr hoher Vola, wie z.B. nach Veröffentlichung wichtiger US-Wirtschaftsdaten, folgt einer langen 15- Minuten- Candlestick Kerze die praktisch ohne Docht oder mit einer Gap zur letzten Kerze schließt mit 80 prozentiger Wahrscheinlichkeit eine zweite in gleicher Richtung. Handel bevorzugt in Richtung Mean oder zu den 1. Aktionszonen aber keinesfalls über Hoch oder unter Tief der vorherigen Tagesrang hinaus. Dort werden nur Reversals gehandelt. Stop Loss in Mitte der langen Vorkerze.

Positionsmanagement von 14:30-22h

1. Nach 14:30h bzw. USA Börseneröffnung werden Positionen an den vorgenannten Aktionszonen eröffnet wenn der Kurs von oben oder unten die Zonen durch handelt. Das schließt auch eine 15M Kerze ein die zunächst über die Zonen hinaus gehandelt wurde und dann innerhalb der Zonen schließt. Der Handel über die Zonen hinaus mit anschließendem Schlusskurs innerhalb der Zonen sollte charttechnisch signifikant sein.

2. Wenn nach einer Rangeerweiterung zunächst die 2 Aktionszone durch gehandelt und somit eine Position von zwei Kontrakten eröffnet wurde dann wird zum gleichen Abstand eine 3. Aktionszone aktiviert. Einstieg jedoch mit vier Kontrakten und Time Stop wie oben erklärt. Wie gesagt, dies gilt nur für nachmittags. Alle nach 14:30h eröffneten Positionen werden spätestens bis 22h geschlossen.

Insgesamt können nach 14:30h Positionen wie folgt eröffnet werden:

- ein Kontrakt an der ersten Zone Long
- ein Kontrakt an der ersten Zone Short
- zwei Kontrakte an der zweiten Zone Long
- zwei Kontrakte an der zweiten Zone Short
- vier Kontrakte an der dritten Zone Short
- vier Kontrakte an der dritten Zone Long

Risiko Management / Absicherung von Gewinnen

Novizen der Strategie sollten grundsätzlich mit einem Tagesgewinn von 30-40 Punkten zufrieden sein und die weitere Kursentwicklung zunächst mit Demo weiter handeln.

Zeitstopp bis 14:30h

Alle Positionen werden nach Einstieg an der zweiten Aktionszone glatt gestellt wenn nach 3 weiteren 15 Minuten Kerzen keine davon mindestens 10 Punkte in Richtung Mean geschlossen wurde. Alle weiteren offenen Positionen die sich im Verlust befinden werden spätestens bis 14:30h geschlossen. Diese Situation ergibt sich meistens an Trendtagen.

Zeitstopp nach 14.30h

Wurde an der ersten Zone bei Kursrücklauf ein Kontrakt eröffnet und läuft dieser in den Verlust so wird an der 2. Aktionszone nach Kursrücklauf eine weitere Position von 2 Kontrakten eröffnet. Der Zeitstopp greift auch hier wie vor beschrieben.

Läuft nach Eröffnung einer Position an den ersten Zone diese in den Verlust und es kommt an der zweiten Zone zu keinem Kursrücklauf und in Konsequenz zu keinem weiteren Einstieg dann wird die Position mit Einstieg an der 1. Zone spätestens um 22h geschlossen.

Erfolgt nachmittags der Ersteinstieg an der 2. Zone und wird in Konsequenz eine dritte Aktionszone eröffnet so findet dort der Zeitstopp statt.

Gewinnsicherungsstopp

Neben den Zeitstopps kommt nach einem BEREITS erzielten Gewinn folgende Gewinnsicherungsregel zur Anwendung:

1. Punkt 2. des Positionsmanagement hat ein sehr starkes Gewinnpotenzial bedeutet aber bei ausgesprochenen Trendtagen eine erhöhte Gefahr. Wurde also während des Tages bereits ein Gewinn erzielt

und der DOW notiert an der 2. Aktionszone höher als Plus 80 für Short oder tiefer als Minus 80 für Long sollte auf einen Einstieg verzichtet werden.

1. Wird eine neue Position gemäß dem etablierten Trade Management eröffnet dann wird nach einem vorläufigen Buchgewinn von ca. 20 Punkten ein Stopp zum Einstandspreis gesetzt.
2. Wird eine neue Position gemäß dem etablierten Trade Management eröffnet und diese läuft in den Verlust dann wird ein Stop Loss von ca.20 Punkten zum Einstandspreis aktiviert.
3. Der Gewinnsicherungsstopp wird mit der Hälfte der jeweils gültigen Zonenabstände, zurzeit 20 Punkte, aktiviert.
4. Für Longpositionen sollte jeder nach Eröffnung einer Position innerhalb seiner Komfort-Zone ein Black Swan Stopp setzen.

Micro Trading

Innerhalb der Handelspanne und insbesondere zwischen den Zonen ist das Micro-Trading mit dem Zweck vieler und kleinerer Gewinnmitnahmen ein hervorragendes Instrument zur Gewinnmaximierung.

Anstatt 1 Kontrakt an der ersten und 2 Kontrakten an der zweiten werden diese um jeweils 1 Stück wie folgt erhöht und gemanagt:

Einstiege erfolgen jeweils ca. 10 Punkte über (Short) oder unter (Long) der aktuellen Aktionszonen. Es sollten, wenn der Kurs in Richtung Mittelkurs (Eröffnungs- oder Schlusskurs) tendiert, viele kleine Gewinne angestrebt werden. Wird eine Position mit Gewinn geschlossen und der Kurs kehrt an oder über des letzten Einstieg zurück wird ein neuer Kontrakt eröffnet. Es ist dabei durchaus möglich, dass sich dieses Procedere bis an die 2. Zone fortsetzt.

Läuft irgendein so eröffneter Kurs bis in die 2. Zone in den Verlust, dann wird dort jeweils nur noch 1 Kontrakt eröffnet aber wiederum ein weiterer ca.10 Punkte höher für Micro Trading.

Der Einstieg kann sehr effizient mit dem 3 Minuten Heikin Ashi Chart oder mit einer 5M Kerze gemanagt werden. Es ist daher gut möglich, dass ein Einstieg erst viel weiter als 10 Punkte von der nächsten Zone entfernt erfolgt.

Micro Trading zwischen den Zonen ist sehr individuell, wird im Forum statistisch nicht erfasst, jeder sollte für sich analoge Stopps anwenden.