

## Regelwerk für "Wahrscheinlichkeiten der FDAX-Intraday-Kursentwicklung"

Die FDAX-TRADING-STRATEGIE ( FDTs ) basiert, ausser an manifesten Trendtagen, auf Trading By Mean Reversion.

Der Handelsansatz " "Wahrscheinlichkeiten der FDAX-Intraday-Kursentwicklung" ist ein By-Product der FDTs, denn es wurde untersucht wie man von den zwingenden Kursbewegungen hin zu den Aktionszonen, an denen die Umkehr gehandelt wird, profitieren könnte.

Seit dem 3. Januar 2011 dokumentiere ich nach dem Zufallsprinzip aber mit einem nachvollziehbaren Regelwerk Resultate (Mikroebene) die bisher und auch in Zukunft auf ( Makroebene) laufend Gewinne produzieren. Die Untersuchungen erstrecken sich auf einen viel längeren Betrachtungszeitraum konnten doch erst mit dem Handel über Nacht und neuer Finanzmarktinstrumente praktisch umgesetzt werden.

Es ging zunächst einmal darum die Bewegungen innerhalb der ersten Aktionszonen zu untersuchen und zu sehen ob man daraus Kapital schlagen konnte. Das positive Ergebnis übersteigt alle Erwartungen. Das Regelwerk greift bei einer Vola von 17 - 50. Mit der Gewissheit, dass bis jetzt nur ganz wenige Verlusttage anfielen kann sich der Marktteilnehmer entspannt zurücklehnen und die Entfaltung der Kursdynamik fast wie ein Unbeteiligter analysieren. Dabei fallen wertvolle Erkenntnisse für die FDTs an.

Trade Management mit CFDs DE30 Future und DE30 Cash.

Grundregel:

Handelstäglich wird mit der Zeitachse jeweils nur eine Position Long/Short oder Short/Long innerhalb der ersten Aktionszonen der FDAX-Trading-Strategie eröffnet. Die erste Aktionszone hat einen Abstand von 30 Punkten zum Eröffnungskurs um 8h oder Schlusskurs 22h Vortag. Einstieg mit Stop Buy oder Stop Sell 20 Punkte über/unter dem Schlusskurs des jeweiligen Finanzmarktinstrumentes um 22h. Gewinnziel für Stop Buy Order ist die erste Aktionszone Short und für Stop Sell die erste Aktionszone Long. Nach Erreichung der ersten Aktionszone wird die Position gedreht und das Gewinnziel ist jeweils Eröffnungskurs des Tages oder Schlusskurs vom Vortag gemäß der Zoneneinteilung der FDAX-Trading-Strategie. Eine eventuelle Verlustposition wird zum Schlusskurs glatt gestellt. Ergebnisse für Longpositionen werden oben im Chart und für Shortpositionen unten im Chart fortschreibend festgehalten. Entwicklung der Longposition wird innerhalb des Charts mit grüner und der Shortposition mit roter Trendlinie dargestellt.

Legende: Grüne Trendlinie Close Vortag 22h, rote Trendlinie Open um 8h und blaue Trendlinien die Aktionszonen Short/Long mit einem jeweiligen

Abstand von 30 Punkten zu Close oder Open.

Im Einklang mit der vorherrschenden Volatilität wird der oben erwähnte Abstand der Aktionszonen wie folgt angepasst:

VDAX-NEW Indikation von 15 - 20 = 30 Punkte beidseitig

VDAX-NEW Indikation von 21 - 30 = 40 Punkte auf der Long- und 35 Punkte auf der Shortseite

VDAX-NEW Indikation über 31 = 50 Punkte auf der long- und 40 Punkte auf der Shortseite

Obwohl mit der Grundregel und einem Stop Loss von 100 Punkten für die Longposition nachhaltig Gewinne erzielt wurden hat ein zusätzliches Regelwerk - das peut a peut entwickelt wurde - die Performance gesteigert. Die hohe Vola ab dem 5 August 2011 ist eine echte Herausforderung und dieser wurde mit der Regel 5.2 begegnet.

Die nachstehende Fassung des Regelwerks ist verbindlich und wird auch nicht nach Belieben geändert. Es ist zu berücksichtigen dass eine neue Gliederung mit kleinen Änderungen die Regelangabe in den vergangenen Charts teilweise obsolet macht und zwei Ergebnisse negativ beeinflusst. Insgesamt wird das bisherige Gesamtergebnis bei Anwendung der jetzigen Regeln eher verbessert was wiederum gut für die Zukunft ist.

1. Ist eine Übernachtposition durch eine große Eröffnungslücke 50 Punkte + im Gewinn, dann wird für den Tag keine konträre Position an der ersten Aktionszone Long oder Short eröffnet.

2. Ist eine Erstposition, Long oder Short, bei niedriger VDAX-NEW Indikation ( unter 22 ) mit 25 Punkten nach Börseneröffnung um 8h im Gewinn wird diese Position mit Gewinnstopp auf 20 Punkte abgesichert. Sofern glatt gestellt, ohne dass eine Aktionszone erreicht wurde, wird bei Erfüllung trotzdem eine konträre Position gemäß dem Regelwerk eröffnet. Der durchschnittliche langfristige Mittelkurs des VDAX liegt bei 22.

Liegt morgens nach den Kriterien der FDX-Trading-Strategie ein Trendtag vor dann wird Regel 2 wie folgt modifiziert:

2.1. Kein Gewinnmitnahmestopp. Bei Erreichung einer ersten Aktionszone mit Gewinn wird die Position glatt gestellt. Es wird in Folge an der ersten Aktionszone keine konträre Position zu der bereits glatt gestellten eröffnet.

3. Die Positionen werden mit einem Stop Loss abgesichert wenn für den Tag ein Verlust von 100 Punkten erreicht wurde. Dabei wird der angefallene Gewinn für die konträre Position angerechnet. Beispiel: Shortposition erzielt einen Gewinn von 30 Punkten dann kann die Longposition bis höchstens 130 Punkte in den Verlust laufen.

4. Wurde eine Position bereits mit Gewinn glattgestellt und die dann oder bereits vorher eröffnete Position läuft von diesem Glattstellungspunkt vorübergehend über 30 Punkte in den Verlust, dann wird diese bei einem Rücklauf in Breakeven bzw. wenn insgesamt für den Tag ein Gewinn erzielt wurde glatt gestellt.

5. Der Handelsansatz ist derart konzipiert, dass das Anfangsrisiko nicht über 40 Punkte liegen sollte. Ein Anfangsverlust von 40 Punkten tritt in der Regel dann ein, wenn beide Positionen, Long und Short, über Nacht oder später eröffnet wurden ohne dass eine dieser Positionen mit Gewinn vorher glatt gestellt wurde.

5.1 Werden über Nacht oder im Laufe des Tages 2 Positionen , Long und Short, eröffnet ohne dass bis 15:30h eine Aktionszone punktgenau angehandelt wurde dann wird eine der beiden Positionen erst dann glatt gestellt, wenn nach US Börseneröffnung eine Rangeerweiterung der Handelsspanne über die ersten Aktionszonen festgestellt wird und es in Folge zu einem Kursrücklauf über die Aktionszonen in Richtung Mittelkurs kommt.

Kommt es zu keiner Ausführung, dann wird die Gesamtposition kurz vor 22h mit 40 Punkten Verlust geschlossen.

5.2 Kommt es bei einer sehr hohen VDAX-NEW Indikation über 30 zu einer zweifachen Einstoppung über Nacht dann bieten sich folgende Möglichkeiten an:

- Bis mittags Glattstellung der Verlustposition an einer der ersten Aktionszonen. Gewinnposition bis zu einem Verlustausgleich in Richtung 2. Aktionszone laufen lassen.
- Nachmittags beginnend um 15:30h wenn ein Kursrücklauf über die 2. Aktionszone in Richtung Mean stattfindet.

Auch hier Glattstellung wenn ein Verlustausgleich erzielt wurde.

Diese Regel trifft auch für den Fall zu wenn bei einer Vola von Plus 30 über Nacht nur eine Position eröffnet wurde, diese nach 8h in den Verlust läuft und dabei eine konträre Position eröffnet wird.

Sofern diese Aktionen keinen Erfolg haben dann erfolgt eine Glattstellung der noch im Rennen befindlichen Position entweder zum Schlusskurs oder wenn für den Tag ein Gesamtverlust von 100 Punkten anfällt.

6.3 Kommt es in ganz seltenen Fällen, meistens über das Wochenende, bei Einstoppung einer Position zu einem Slippage dann wird die konträre Position nach Möglichkeit mit einer Stop Order an den 40 Punkte Abstand

herangeführt. Einer der beiden Positionen wird dann glatt gestellt wenn die ganz normalen Aktionszonen erreicht werden.

6. Common Sense . Der gesunde Menschenverstand gebietet, dass bei besonderen Umständen - persönlicher oder externer Art - Verluste begrenzt und Gewinne kapitalisiert werden.

Die einzelnen Regel werden nach und nach mit Charts erklärt.