

Regelwerk der FDAX-TRADING-STRATEGIE

<https://www.vtad.de/node/1446> ist ein kompletter und robuster Handels- und Businessplan.

In Anlehnung an diese Strategie wurde ein mechanischer Handelsansatz mit festen Bezugspunkten von Positionseröffnungen, Gewinnmitnahmen und Stop losses erstellt.

Es handelt sich um keinen EA sondern um einen zeitlich weniger intensiven Handel jedoch mit dem Nachteil, dass die Korrelation DJIA und FDAX, Veröffentlichungen von wichtigen Nachrichten und sich daher Anbahnung von Trendtagen unberücksichtigt bleiben. Trotzdem hat dieser Handelsansatz in der Vergangenheit hervorragende Ergebnisse erzielt.

Trade Management

Der Handelsansatz basiert in erster Linie auf Regression zum Mittelwert (Mean-Reversion). Für die Strategie wird daher die Intraday-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 oder German30 Cash. Aktionszonen werden je nach der VDAX-NEW Berechnung fortlaufend neu bewertet. Die Einteilung der Aktionszonen erfolgt über oder unter dem Close Vortag um 22h und Open um 8h.

Bei einer Indikation unter 20 werden die Aktionszonen wie folgt eingeteilt und zwar:

Beidseitig 30 Punkte erste Zone und 35 Punkte zweite Zone

Bei einer Indikation von 20-25 = 45 Punkte beidseitig.

Bei einer Indikation von 25-30 = 50 Punkte beidseitig.

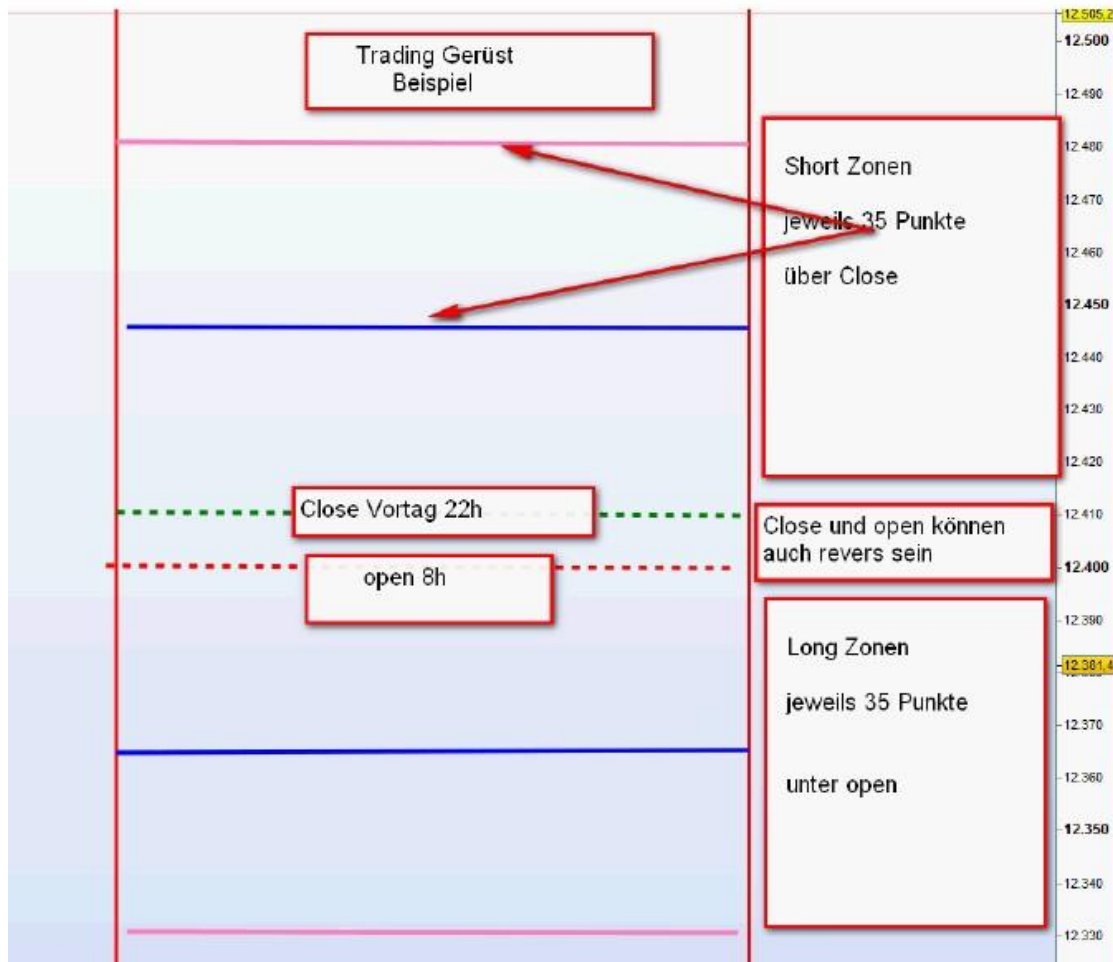
Bei einer Indikation von 30-35 = 60 Punkte beidseitig

Bei einer Indikation über 40 auch 60 Punkte beidseitig aber es wird auf den Einstieg an der ersten Long-Zone Verzichtet.

Kenner der Strategie werden feststellen, dass Zonen erweitert wurden. Grund: DAX Notierung zurzeit über 13000 und früher 6-8000. Da bei dieser Notierung noch keine Erfahrungswerte über 20 vorliegen, können Zonen noch angepasst werden.



Beispiel Trading Gerüst



Regelwerk des mechanischen Handelsansatzes

Basisregel

Positionseröffnung 1CFD (oder mehrfach) an den ersten Zonen Short/Long

Glattstellung mit Gewinn sofern Eröffnungskurs (Open) oder Schlusskurs (Close) erreicht wird.

Wird erste Eröffnungsposition mit Verlust in die zweite Zone gehandelt, erfolgt dort eine Positionsverdopplung (2CFDs oder mehrfach)

Sind um 22h noch Positionen offen, so werden diese entweder mit Gewinn/Verlust glattgestellt.

Verlustregel mit Glattstellung.

Es gibt zwei Verlustregel:

- 1. Zeitstopp wird wie folgt mit Glattstellung unter/über der zweiten Aktionszone ausgeführt: Bei Einstieg Long oder Short zählt diese 15M Kerze als erste Kerze. Wenn dann bei drei weiteren Kerzen (dann die vierte) bei Schließung dieser Kerze ein Verlust von mehr als 20 Punkten vorherrscht, wird die Gesamtposition geschlossen. Der Handel wird für den Tag erst dann wieder aufgenommen, wenn nach 14.30h eine Range-Erweiterung stattfindet (Siehe weiter unten: Range-Erweiterung)**

Eingefügte Charts zeigen wie an der 20 Punkte Marke Glattstellung bzw. keine erfolgte.

Handelstag 28.12.17



keine Glattstellung an der 20 Punkte Marke



2. Not-Stopp

Der Not-Stopp tritt dann in Kraft, wenn nach Positionseröffnungen an der ersten und dann zweiten Zone der Kurs zügig 35 Punkte unter/über der zweiten Zone notiert. Kommt dies vor, dann wird der Handel für den Tag eingestellt. In der Regel handelt es sich um einen Trend Tag.

Gegenrichtung umkehren.



Handel nach Range-Erweiterung

Nur wenige Handelstage haben bis 14:30h ihre Handelsspanne ausgeschöpft. In Anlehnung an das Market-Profile wird die Handelsspanne bis 14:30h als Value Area eingezeichnet. Hoch und Tief dieser Range sind dann Eröffnungskurse ab 14:30. Von diesen wiederum werden die

dann aktuellen Zonen gehandelt. Die Range-Erweiterung wird nicht gehandelt, wenn vormittags ein Not-Stopp griff oder wenn noch Positionen offen sind.



Gewinnsicherung/Verlustminderung 3 Regeln

1. Wurden an der ersten und zweiten Zone, Short oder Long, Positionen eröffnet und nur die Positionen aus der zweiten Zone mit Gewinn glattgestellt, dann werden nach einem Reversal bis zur zweiten Zone dort keine neuen Positionen eröffnet. Die Positionen aus der ersten Zonen laufen entweder in den Gewinn oder sie werden mit Verlust an der

20 Punkte Marke oder um 22h glattgestellt. Ausnahme, wenn Doppel Gap vorliegt.





2. Wurden auf einer Seite des Charts bereits die Positionen aus erster und zweiter Zone mit Gewinn abgewickelt, dann werden auf dieser Seite keine neuen Positionen eröffnet.

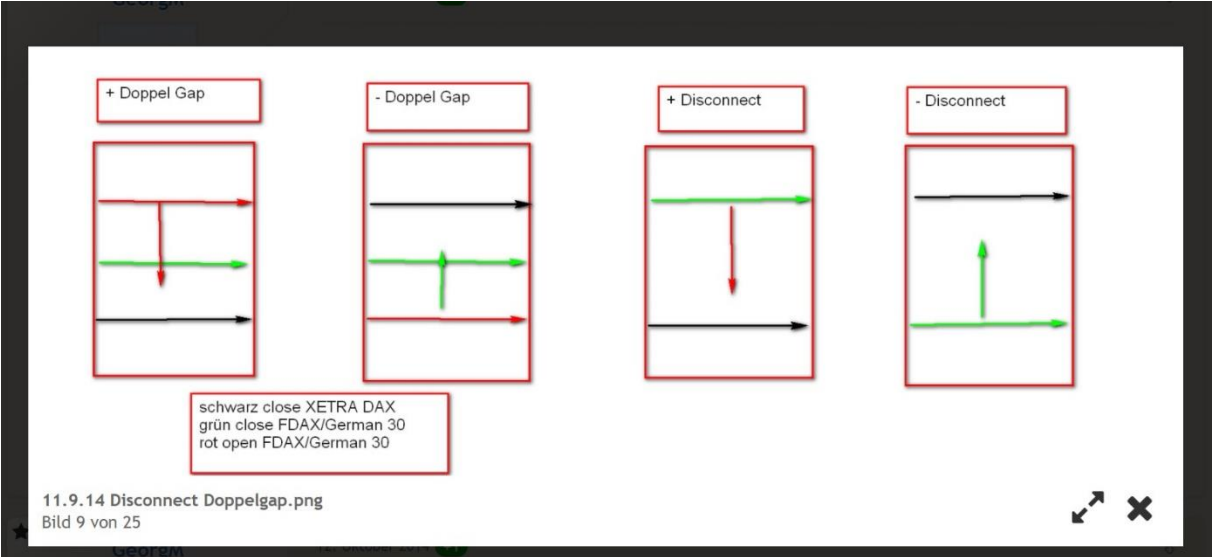
3. Wurden bis 20h bereits Gewinne erwirtschaftet, dann werden nach einer Range Erweiterung keine neuen Positionen eröffnet.



Doppel Gap

Eine Doppel Gap liegt vor, wenn der FDAX/DE30 um 22:00h +/- 20 Punkte über/unter dem Close XETRA-DAX um 17:30h schließt und nach Eröffnung am Folgetag um 8h mit einer Gap von +/- 50 Punkte in gleicher Richtung eröffnet. Insgesamt mindestens +/- 70 Punkte. Der Einstieg Long/ Short erfolgt sofort nach Eröffnung und das Gewinnziel ist der Schlusskurs des FDAX um 22h. Der Einstiegskurs entspricht somit der ersten Zone und wenn die Position in

in den Verlust tendiert, dann wird aus der ersten Zone die zweite Zone. Hier beginnen dann auch die Verlust Stopps. Wird das Kursziel erreicht, dann wird nacheinem Retracement zum Eröffnungskurs keine neue Position Eröffnet und der Handel wird mit den aktuellen Zonen Und Range-Erweiterung fortgesetzt.





Handelszeiten

An Feiertagen in den USA oder Länderbedingt halben Feiertagen in D beziehungsweise zwischen Weihnachten und Dreikönigen kommt es meistens zu einem niedrigen Handelsvolumen. Der Handel sollte dann ruhen.