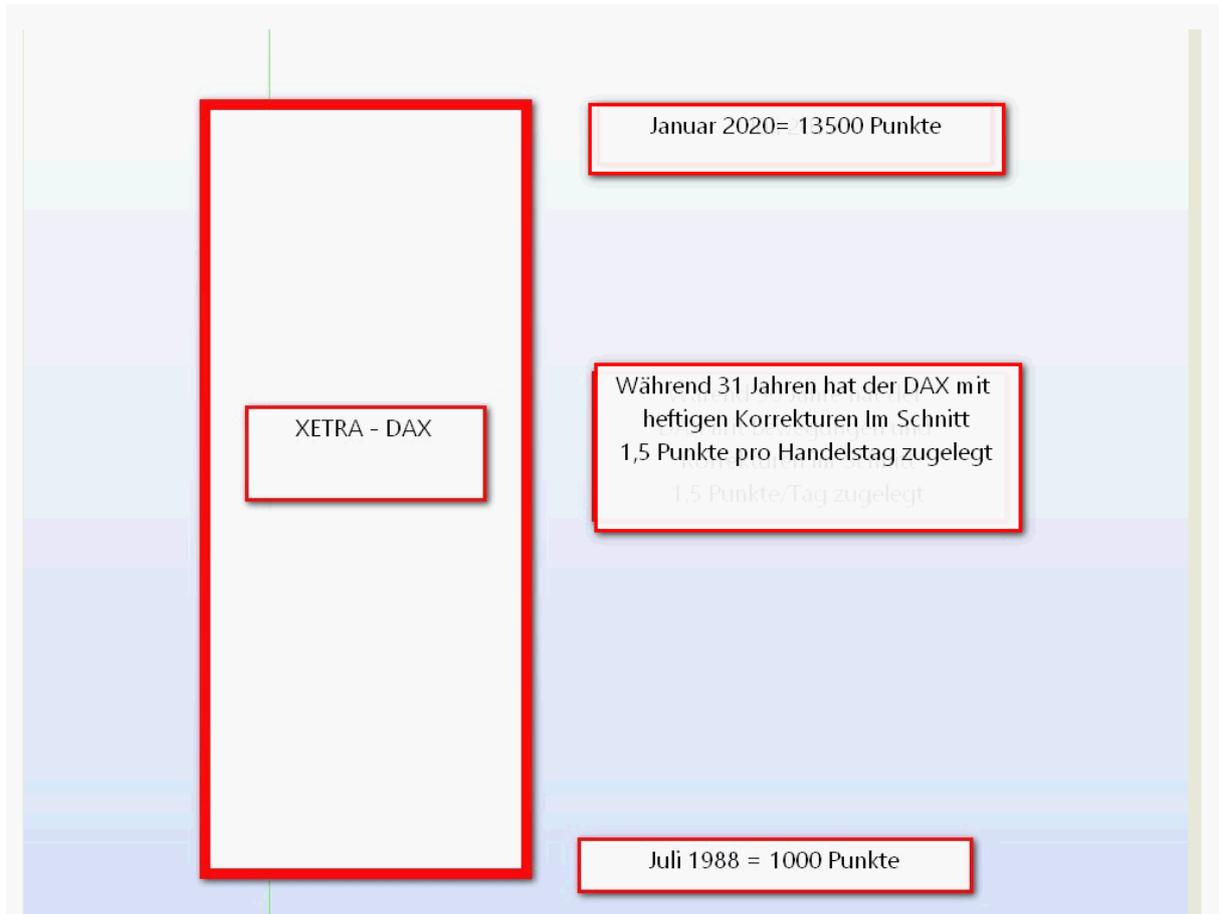


CFD(DAX) Endloskontrakte im Rhythmus der Konjunkturzyklen

Historische Kursbewegungen



Impulse und Korrekturen



Die tägliche Handelsspanne des DAX-Future (FDAX) bewegt sich im Durchschnitt um die 2 Prozent. In Wirklichkeit legt der Kurs innerhalb der Handelsspanne durch das Hin und Her oft deutlich weitere Strecken

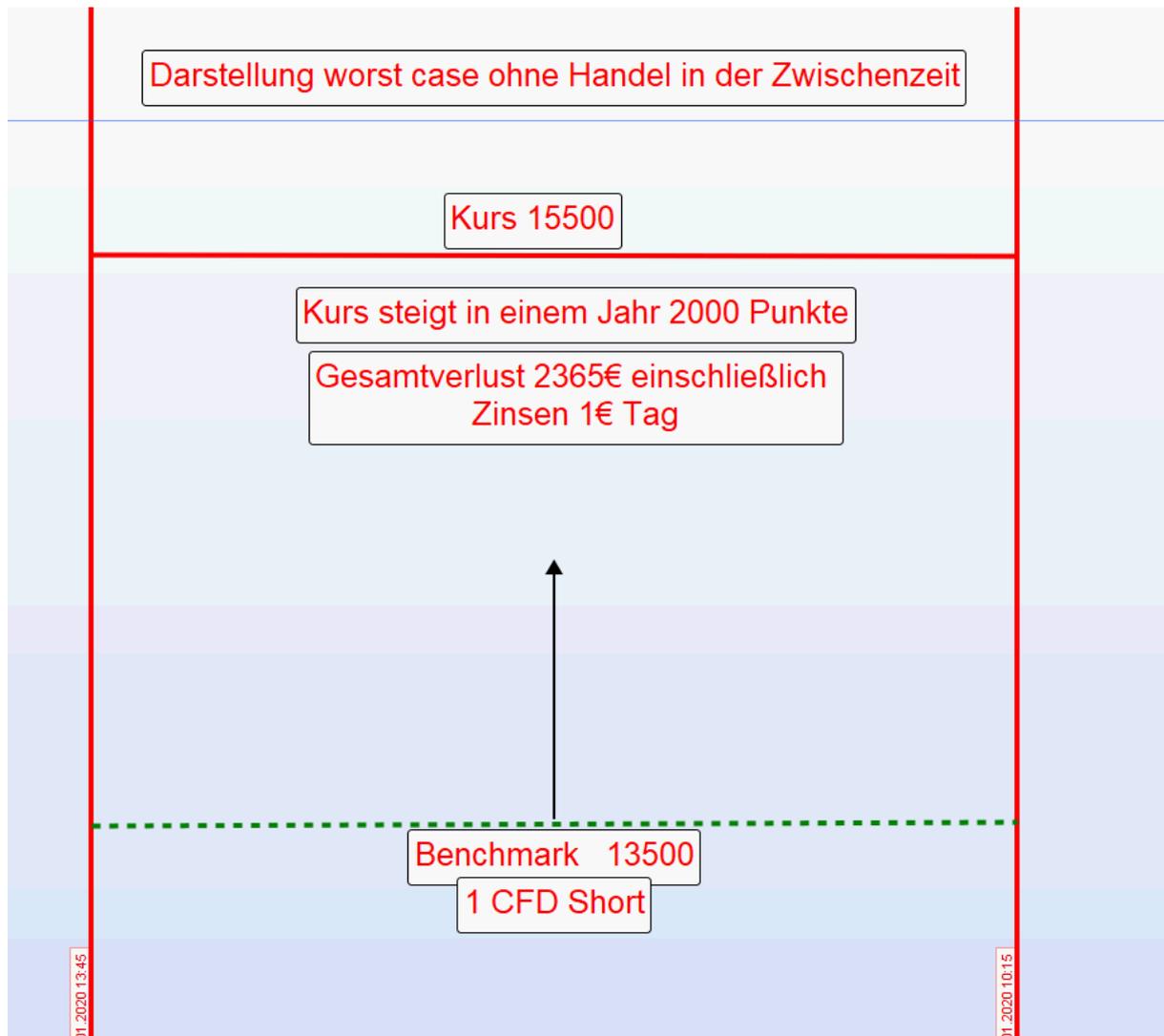
zurück. Statistische Untersuchungen ergeben, dass bis zu 90 Prozent aller Handelstage der Kurs über dem Vortagschlusskurs gehandelt wird und nur in 55 Prozent der Fälle höher schließt bzw. bis zu 90 Prozent aller Handelstage unter dem Vortagsschlusskurs gehandelt wird aber in weniger als der Hälfte der Fälle darunter schließt. Daraus können profitable Handelsansätze hergeleitet werden.

Der Handel

Worum geht es? Es geht um den Handel von fixen Langzeitpositionen Short/Long und gleichzeitigem Intraday-Handel gemäß der FDAX-TRADING-STRATEGIE.

Zurzeit notiert der Dax wieder am vor drei Jahren erreichten Allzeithoch und bietet eine gute Gelegenheit einen Endloskontrakt Short zu eröffnen.

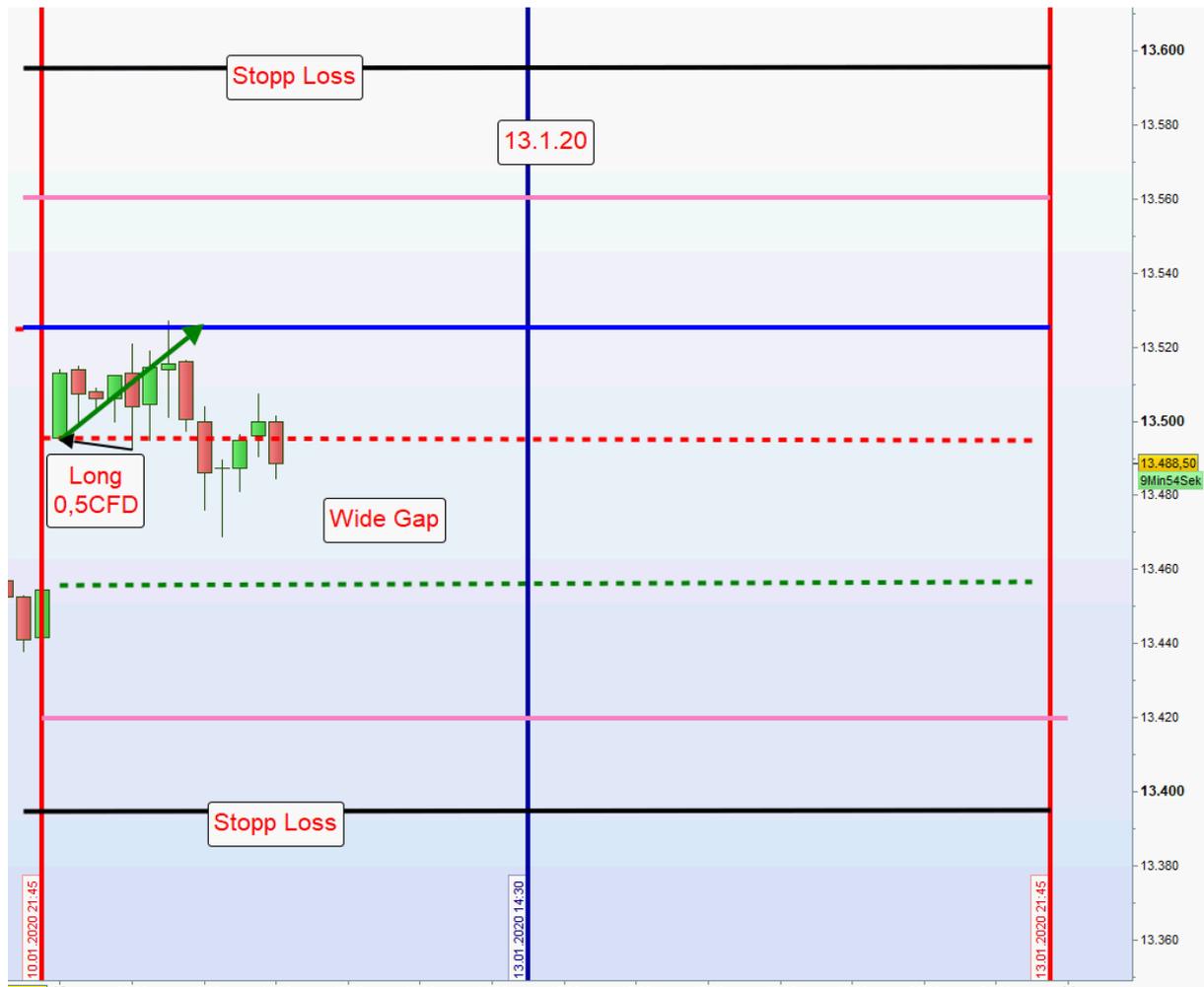
Im Folgenden wird die Handelsidee als Worst Case analysiert und nehmen an, dass der Kurs im Jahre 2020 von zurzeit 13500 (benchmark) um 2000 Punkte oder auch 15% auf 15500 steigt. Der theoretische Gesamtverlust wird im nächsten Chart dargestellt.



Demgemäß ist der durchschnittliche Verlust pro Handelstag gleich 2365€ geteilt durch 260 = 9,1€. Sofern Intraday mit zuzüglichen 0,5 CFD Long/Short Positionen ein durchschnittlicher Gewinn von 9,1€ erwirtschaftet wird, somit ein Breakeven für die Berichtszeit, gehören wir schon zu den 20% der Trader die angeblich keinen Verlust erleiden.

Abweichend vom Trade Management der FDAX-TRADING-STRATEGIE können auch, je nach Chartbild täglich, Long Positionen vom Eröffnungskurs aus in Richtung der Shortzonen eröffnet werden. Allerdings immer nur die Hälfte des Endloskontraktes Short. Fällt der Kurs nach der Eröffnung Long wird mit dem Übergewicht der Short Position ein Gewinn erzielt.

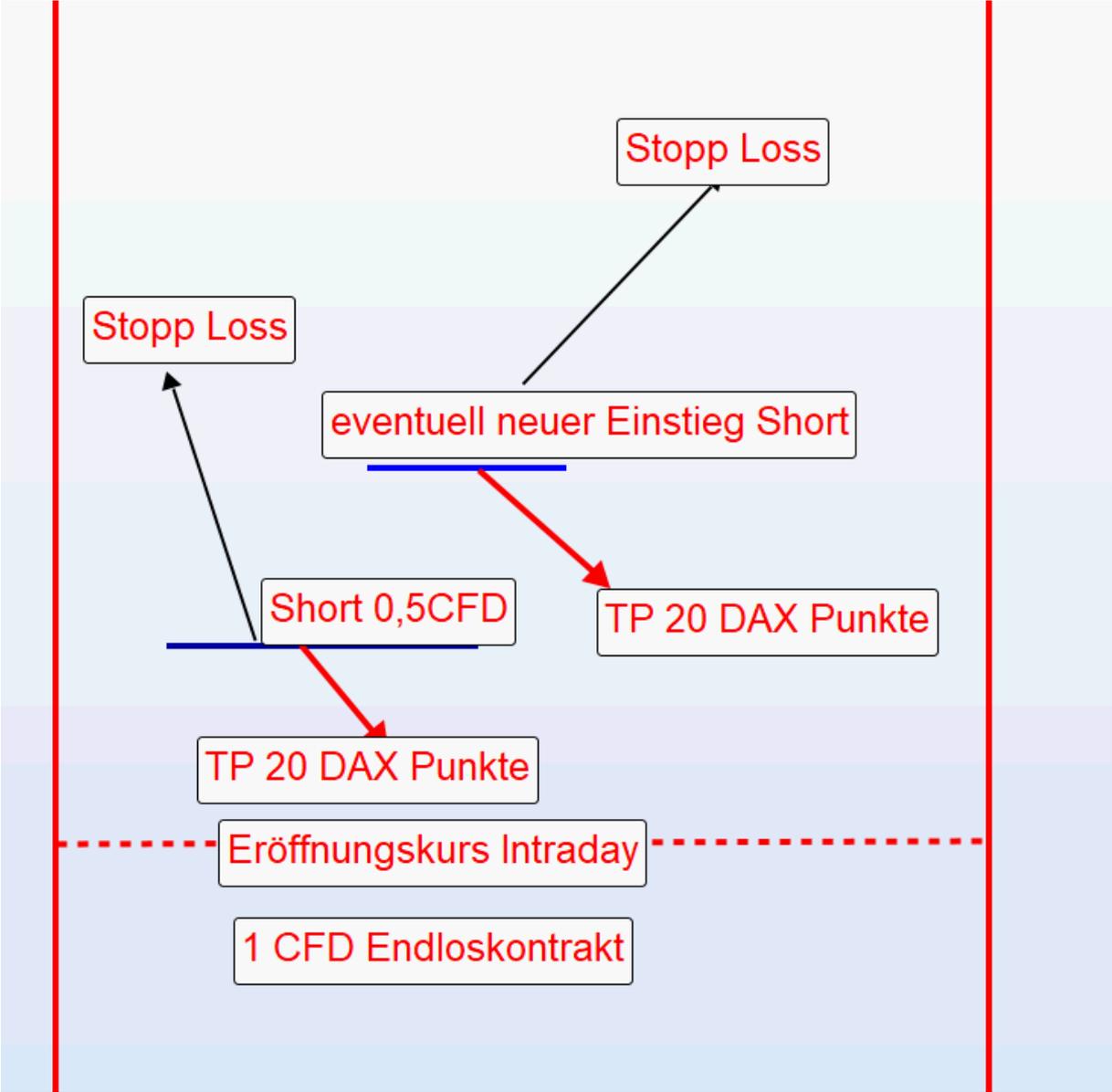
Beispiel Eröffnung einer Long Position 0,5 CFD in Richtung Erste Zone Short

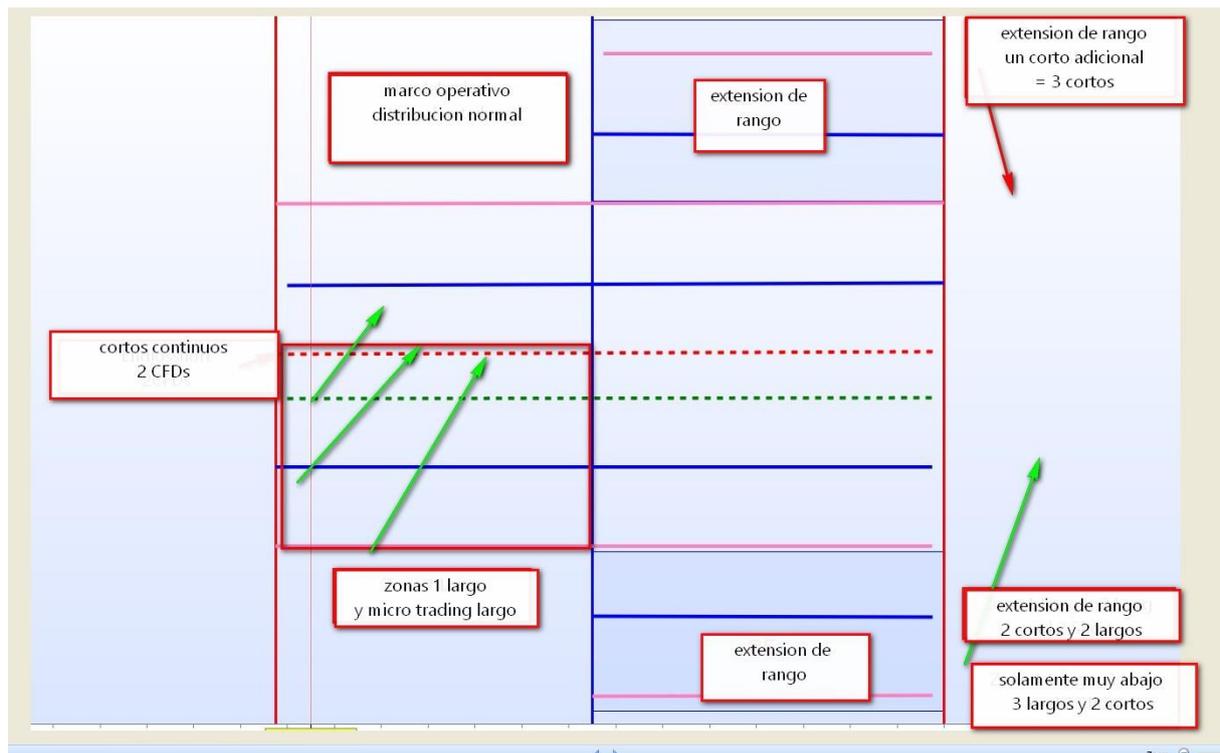


Die zusätzliche 0,5 CFD Shortposition, wird Intraday erstmalig über dem Eröffnungskurs an der ersten Zone Short oder, je nach Chartbild, darüber gehandelt und zwar mit einem TP von 20 DAX Punkten (10€ Gewinn) und Stopp Loss am Tageschart gemäß der FDAX-TRADING-STRATEGIE. Die Position wird wie Scalping

<https://www.investopedia.com/articles/trading/05/scalping.asp>

mit schneller Gewinnmitnahme (TP) gehandelt. Ist der Trade positiv wird NUR ÜBER der jeweilig letzten Positionseröffnung nochmalig Positionen mit dem gleichen Handelsmanagement eröffnet.





Ein durchschnittlicher Gewinn von 40 Punkten/Tag ist jedoch bei einer Handelsspanne von 80-120 Punkten mit Impulsen und Korrekturen an den Rändern der Range keine Hexerei.

Das Zahlenspiel dient nur zur Veranschaulichung. Natürlich könnte der Kurs über das Allzeithoch klettern, aber auch dann wieder unter 8000 fallen. Das liest sich abstrakt entspricht aber den bisherigen historischen Kursen und Wahrscheinlichkeiten.

Gemäß obiger Konstellation ist es jedoch durchaus möglich, dass die Gesamtposition durch weitere DAX-Kursverluste zunächst ein Gewinn erziele.

Der Handelansatz hat psychologische und markttechnische Vorteile. Durch die überwiegend fixe Shortposition ist der Trader immer im Markt. Bei möglichen Katastrophen, Black Swans und Flash Crashes stehen wir auf der richtigen Seite. Siehe Risiko Management

Die Longpositionen werden überwiegend nur an den Aktionszonen eröffnet was wiederum Intraday weniger zeitaufwendig ist.

Das Trademanagement wird nachvollziehbar in der einfachsten Form dargestellt. Interessierten Leser wird empfohlen vorher den Text der FDAX-TRADING-STRATEGIE zu lesen.

Nach dem die Eröffnung der Dauershortposition erfolgt ist kann der Intraday-Handel mit DE30 cash Long und zuweilen DE30 cash Short

beginnen. Eröffnete Positionen werden spätestens zum Schlusskurs glatt gestellt, so dass um 22h nur die Dauershortposition verbleibt.

Der Handel mit einer Longposition beschränkt sich überwiegend auf 1 Stück:

1. Einstieg mit Stop Buy nach 22h mit einem Abstand von 20 Punkten zum Schlusskurs. Wird die Longposition über Nacht eingestoppt dann wird diese so lang wie opportun gehalten um bereits mit dem „ Longkonto“ einen guten Gewinn zu erzielen. Zur Erinnerung: 40 Punkte entsprechen 50 Tage des historischen Gewinnes von 0,8 Punkte / Tag. Erfolgt eine Einstopfung und der Kurs fällt erheblich, dann wird doch mit der höheren Shortposition ein Anfangsgewinn erzielt.

2. Sofortiger Einstieg um 8h mit 2 Stück Long wenn nach den etablierten Kriterien ein Long Trendtag vorliegt. Wenn ein Trendtag vorliegt wurde zwangsläufig über Nacht bereits eine Longposition mit 1 Stück eingestoppt. Es sind dann 3 Stück Long im Markt.

Weiterhin kann sofort nach Eröffnung um 8h eine Position mit 3 Stück Long eröffnet werden wenn um 14:30h USA Arbeitsdaten veröffentlicht werden. Es werden kleinere Gewinnmitnahmen bis 14:30h von 30 Punkten bevorzugt. Ein Stück Long kann über 14:30h hinaus im Markt bleiben und sollte je nach Kursentwicklung gemanagt werden.

3. Einstieg wenn ein Minus-Doppelgap vorliegt.

4. Einstieg an den Aktionszonen Long wenn mit der Shortposition Intraday ein Gewinn erwirtschaftet wurde und kein Minus-Trendtag vorliegt, denn es gilt von einem Minus-Trendtag mit der Dauershortposition voll zu partizipieren

Die Position kann auf 2 Stück wie folgt erhöht werden: Einstieg an der 2. Aktionszone Long und auf 3 Stück nach einem Reversal bei einer Short-Rangeerweiterung.

Eine zusätzliche DE30 cash Shortposition kann nach einem Reversal bei einer Long-Rangeerweiterung eröffnet werden. Weiterhin bei einem Minus-Trendtag. Für diese zusätzlichen Shortpositionen werden kleinere Gewinnziele angestrebt.

Micro-Trading ist eine sehr lukrative Ergänzung. Wenn eine Longposition mit einem Gewinn von 40+ Punkten geschlossen wurde und es zu einem Kursrücklauf kommt wird eine neue Longposition unter dem ersten Einstiegskurs eröffnet.

Es versteht sich, dass nach Vorgehen gemäß 4. mit der Shortposition bereits ein hoher Tagesgewinn erzielt wurde und dieser mit den Longpositionen gesichert bzw. noch erhöht wird.

Longpositionen können natürlich auch in den Verlust laufen aber nur dann wenn mit den Dauershorts Intraday bereits ein Gewinn erzielt wurde oder wird.

Sofern Dauerlongpositionen zum Einsatz kommen erfolgt das Trademanagement invers. Wer sich an diese Vorgaben annähernd hält wird ein erfolgreicher Trader.

Risiko Management: Dieser Handelansatz verzichtet bei Dauershorts auf Verlustbegrenzung / Stop Losses. Für Dauerlongs wird für mögliche Black Swans ein Opportunitätstopp an den Kurs anpassend gesetzt und zwar Positionsdrehung mit erhöhter Stückzahl nach persönlicher Komfortzone. Für den zusätzlichen Intraday-Handel wird auf Stop Losses verzichtet weil bereits eine Gegenposition eröffnet wurde.

.Money Management: durch erhöhte Positionen bei steigenden Ergebnissen gemäß der Fixed Ratio Trading Methode. Weiterhin graduelle Erhöhung der Shortpositionen in Nähe des Allzeithochs und darüber.

Ich erwarte nicht, dass alle Leser den Ausführungen folgen können und zitiere eine der vielen Kommentare die mich nach Veröffentlichung der FDAX-TRADING-STRATEGIE bei der Vereinigung Technischer Analysten Deutschlands (VDTA) erreichten:

"Ich habe deine Veröffentlichung der Strategie im VTAD gelesen. Ich muss sagen, für mich persönlich ist deine Abhandlung mit das wertvollste was jemals über Börse geschrieben wurde. Die meisten Autoren versuchen irgendeine Strategie oder einen Indikator zu verkaufen oder zu erklären, ohne auf die Gesamtzusammenhänge der Börse einzugehen. Deine Abhandlung macht im Gegensatz genau das, wenn der Leser gewillt ist, dieses auch zu erkennen!

Ich auf jeden Fall hätte dir den Pokal überreicht. Es ist mir aber schon bewusst, dass ein „ revolutionärer“ Indikator mehr Aufmerksamkeit erzielt.

So ist der Mensch halt leider, es muss einfach sein und man sollte sich selber nicht allzu sehr mit arbeiten und denken abmühen müssen"