

Endloskontrakte FDAX Long/Short im Rhythmus der Konjunkturzyklen

Kursentwicklung und Ableitung einer Strategie

Diese Handels-Strategie kann auch für alle Mayor Indexes angewendet werden.

Dieser attraktive Handelsansatz wurde vom Autor 2011 als Teil einer Arbeit in der Schlussbetrachtung vorgestellt.

<https://www.vtad.de/fa/marktvorteil-mit-einem-innovativen-konzept-der-technischen-analyse/>

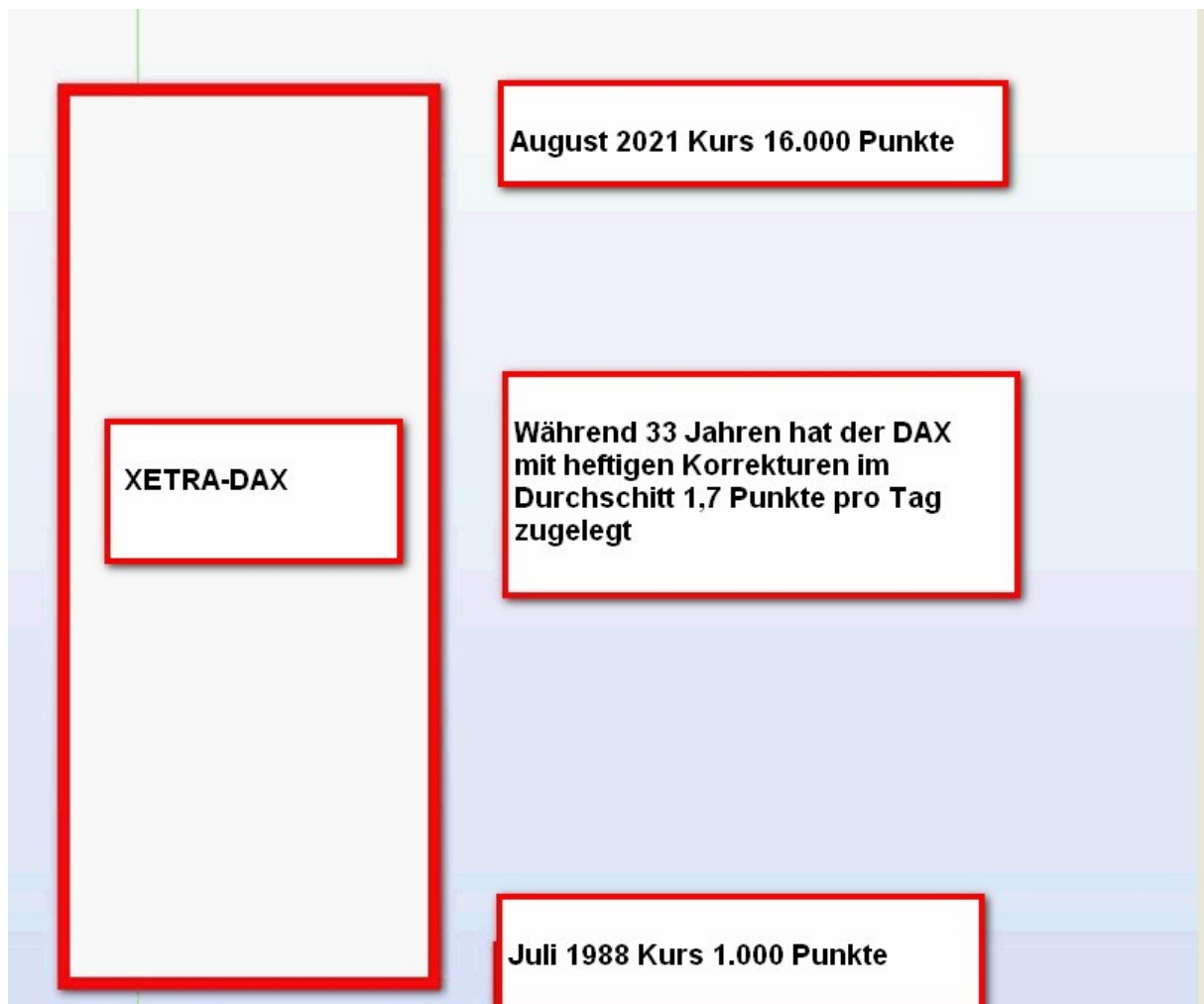
Er ist für aktive Day Trader geeignet und bei Beobachtung des Regelwerks kann auf Sicht kein Verlust entstehen jedoch hohe Gewinne erwirtschaftet werden. Der Intraday Handel orientiert sich an der FDAX-TRADING-STRATEGIE deren Auszüge schon zwei Mal in TRADERS ´ veröffentlicht wurden. Diese kann vom Autor kostenlos abgerufen werden.

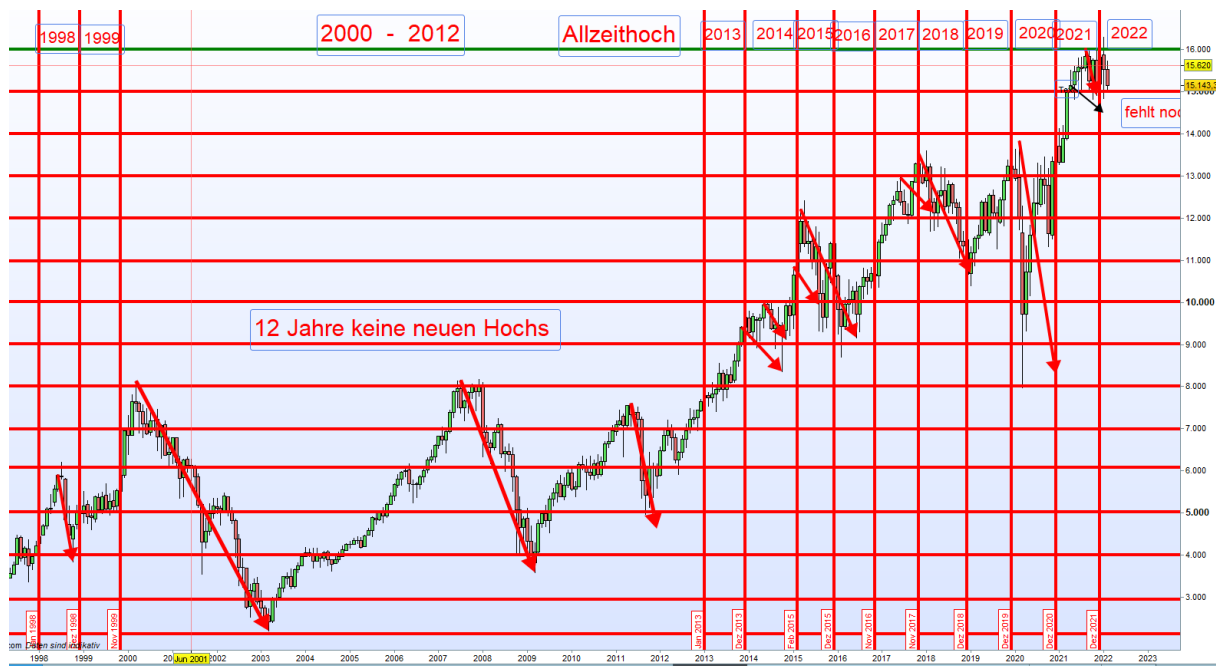
Worum geht es? Es ist der Handel von Intraday Short- oder Long Positionen gegen eine fixe Position Short oder Long je nach dem Konjunkturzyklus.

Die tägliche Handelsspanne des DAX-Future (FDAX) beträgt im Durchschnitt rund 1+ Prozent. In Wirklichkeit legt der Kurs aufgrund des täglichen Hin und Her deutlich weitere Strecken zurück. Genau davon profitiert der hier vorgestellte Handelsansatz. Statistische Untersuchungen des Autors zeigen, dass an bis zu 90 Prozent aller Handelstage der Kurs über den Vortagschlusskurs ansteigt, aber nur in 55 Prozent der Fälle

tatsächlich darüber schließt. Umgekehrt fällt der Kurs an rund 90 Prozent aller Handelstage unter den Vortagsschlusskurs, aber schließt in weniger als der Hälfte der Fälle auch darunter.

Dazu betrachten wir die Kursentwicklung seit Gründung des DAX 1988.





Jedes Allzeithoch von 1000 Punkten wurde um ein mehrfaches korrigiert.



Der Dax hat also seit der Gründung 1988 bis zum Allzeithoch 2021 im Durchschnitt nur 1,7 Punkte/Handelstag zugelegt.

Während der DAX seit 1988 von 1.000 bis zum Allzeithoch 16.300 um 15.300 Punkte gestiegen ist ergaben die ganz großen Korrekturen in der Zwischenzeit 26.000 Punkte.

Auf der niedrigeren Betrachtungsebene Monate, Wochen und Tage finden ständig Impulse und satte Korrekturen statt.



Statistik der Kursbewegungen und ihre Wahrscheinlichkeiten.

Sieben Monate Tageschart. Für diese nehmen wir den Mittelkurs 15500 bis zum Allzeithoch 16300.

Acht rote Pfeile bilden jeweils ein neues Allzeithoch von jeweils 100 Punkten. Wir stellen fest, dass diese 100 Punkte schnell, oft am Folgetag, wieder einkassiert wurden

Zweiundzwanzig blaue Pfeile beginnen aufsteigend wenn der Mittelkurs von 15500 wieder erreicht wurde. alle Pfeile haben das Gewinn-Ziel von 100 Punkten am Folgetag erreicht.

Zehn Braune Pfeile haben das Ziel von 100 Punkten am Folgetag nicht erreicht jedoch danach.

Beispiel der täglichen Bewegungsdynamik FDAX



Grob betrachtet hat sich der F-DAX Kurs an diesem Handelstag insgesamt, mit Impulsen und Korrekturen, 640 Punkte bewegt.

WIE WIRD GELD VERDIENT ?

Durch Nutzung der lang-mittel-kurzfristigen Kursentwicklung des FDAX Kurses

1. Langfristig durch Festlegung eines Endloskontrakt Short oder Long. Short in Nähe eines neuen Allzeithochs zur Zeit bei 16.000 und nach Korrektur von 3.000 bis 4.000 Punkte vom Allzeithoch (Long). Den besten Zeitpunkt kann niemand erwischen.

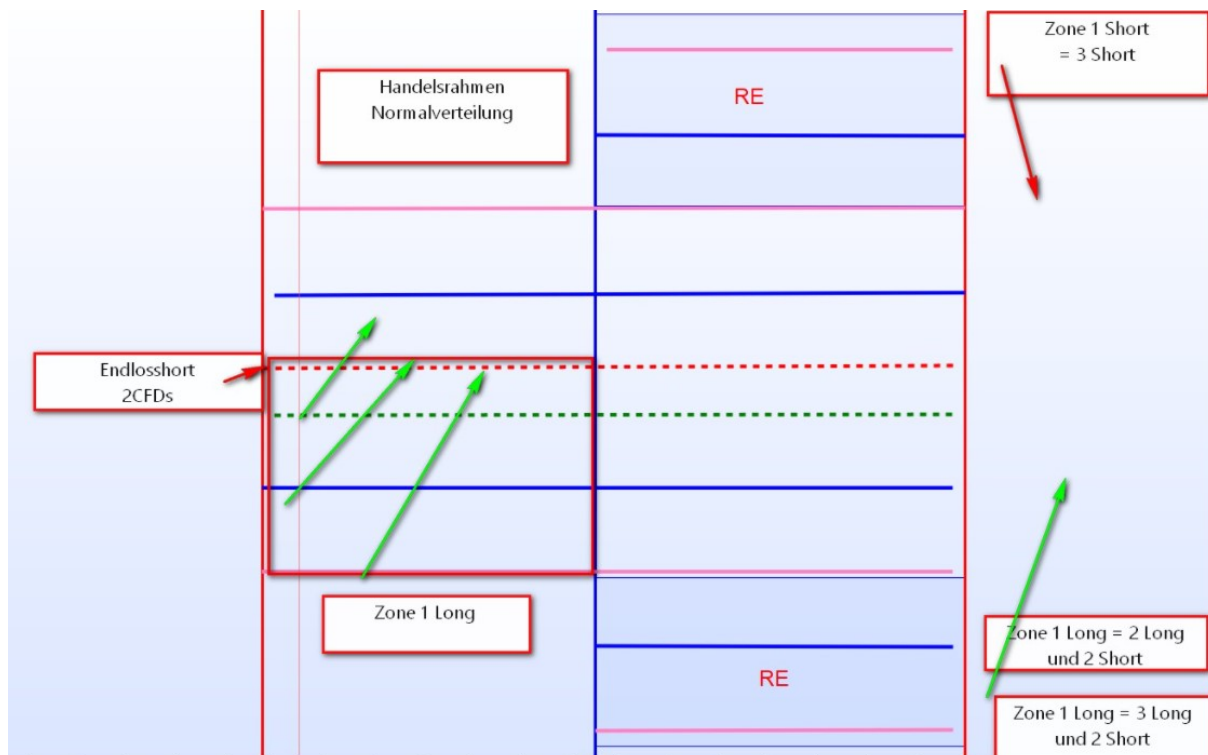
2. Kurzfristig durch den Intradayhandel neben dem langfristigen Endloskontrakt Short oder Long.
3. Positionserhöhungen erfolgen nach einer positiven Kapitalkurve in Etappen.

Bei einer Handelspanne von 100 – 150 Punkten, mit Impulsen und Korrekturen innerhalb dieser, sind mit kurzfristigen Positionen, Long und Short, durchschnittlich 40 Punkte zu erzielen.

Der Intraday Handel findet analog zu der FDAX-TRADING-STRATEGIE statt. Ohne gutes Verständnis dieser sollte diese Strategie nicht umgesetzt werden.

Besonderheiten bei einem Endloskontrakt Short.

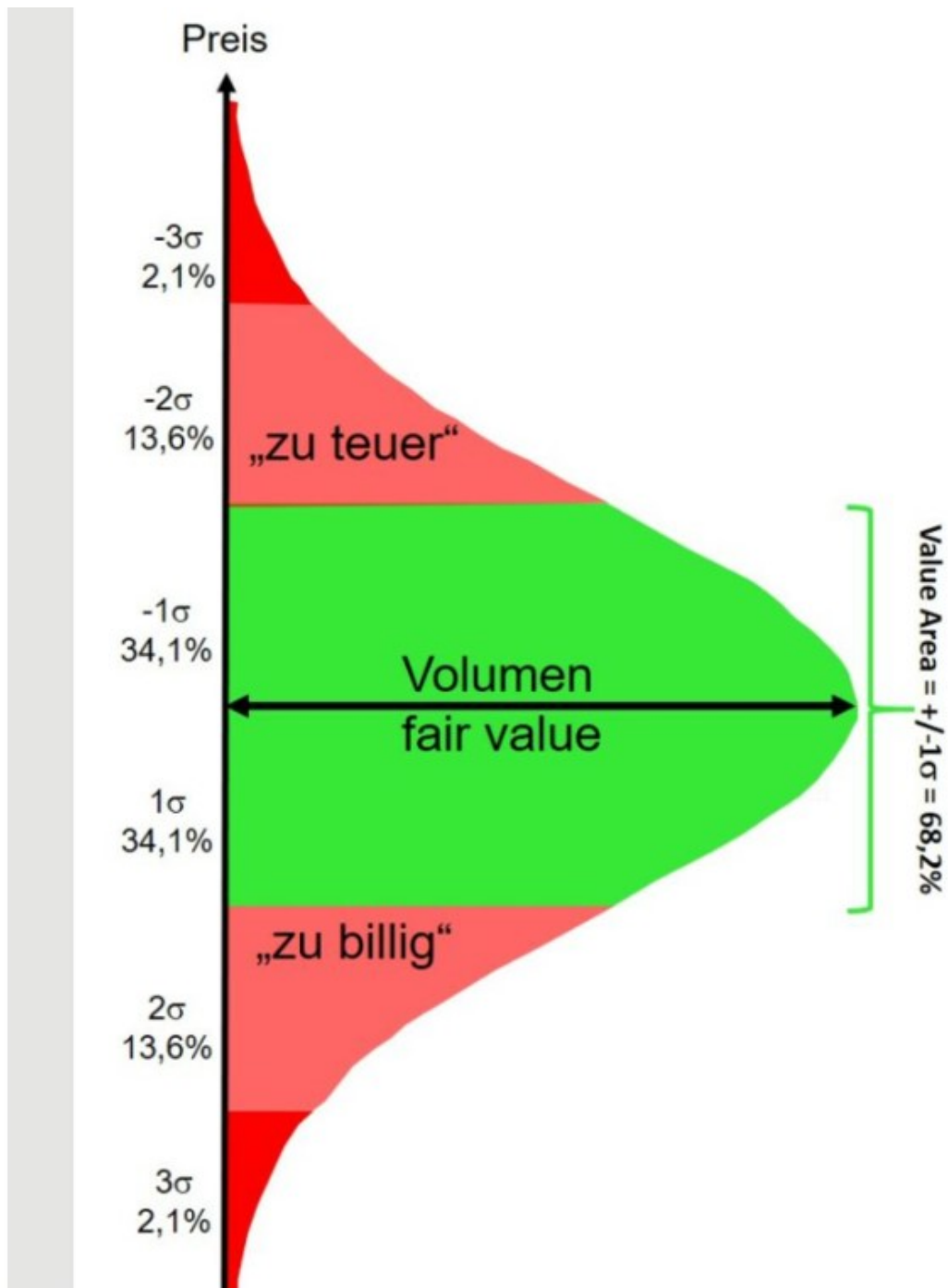
Der Handel mit einer zusätzlichen Intraday - Shortposition mit kurzfristigen Gewinnmitnahmen findet normalerweise vormittags am Tageshoch ab der zweiten Zone oder nachmittags nach einer Range-Erweiterung (RE) statt. Invers für Long Positionen bei einem Endloskontrakt Long.



Handelsrahmen Normalverteilung für Intraday Short und Long Positionen.

Grundsätzlich gelten für den Intraday-Handel Long und Short Positionen nur in der unfair Value Area zu billig oder zu teuer.

Wurde Intraday zum Beispiel Long mit Gewinn glatt gestellt dann muss der nächste Einstieg **unter** dem vorigen Einstieg stattfinden. Umgekehrt mit der Short Position.



Um einen konkreten Überblick hinsichtlich der Gewinnchancen zu erhalten betrachten wir zunächst die DAX Kursentwicklung seit 2015 und stellen den maximalen Verlust für eine Shortposition von 1 CFD Short fest

.

Im angefügten Monatschart von 2016 bis 2021 ist ein Anstieg des DAX von 10.000 auf 15.600 sichtbar. Angenommen der Handel besteht aus einer Dauer Short-Position von 1 CFD. Damit wäre ein Verlust von 5.600 Euro entstanden. Außerdem wäre für die gesamte Berichtszeit pro Kalendertag circa 1 EURO an Zinsen fällig = Verlust 2500 Euro. Verluste: 5.600 + 2.500 insgesamt 8.100€ oder 1.160€ pro Jahr oder durchschnittlich 97€ per Monat.



Wäre in dieser Handelsperiode pro Tag mit dem kurzfristigen Handel mit einer Gegenposition Long und zuweilen auch Short ein Ertrag von 40 Punkten erwirtschaftet worden, dann betrüge das Ergebnis bereits ein Gewinn von 1750 Tage mal 40 Euro 70.000 minus 8.100€ = 61.900€

Obwohl zweitrangig, werden durch die periodischen Korrekturen natürlich auch mit der Dauer Short-Long Position Geld verdient.

Viel wichtiger ist Intraday der psychologische Effekt.

Das oberste Ziel sind allerdings periodische Positionserhöhungen durch angefallenen Gewinn. Damit kann auf Zeit ein ordentliches Kapital erwirtschaftet werden, dass es erlaubt den FDAX zu handeln.

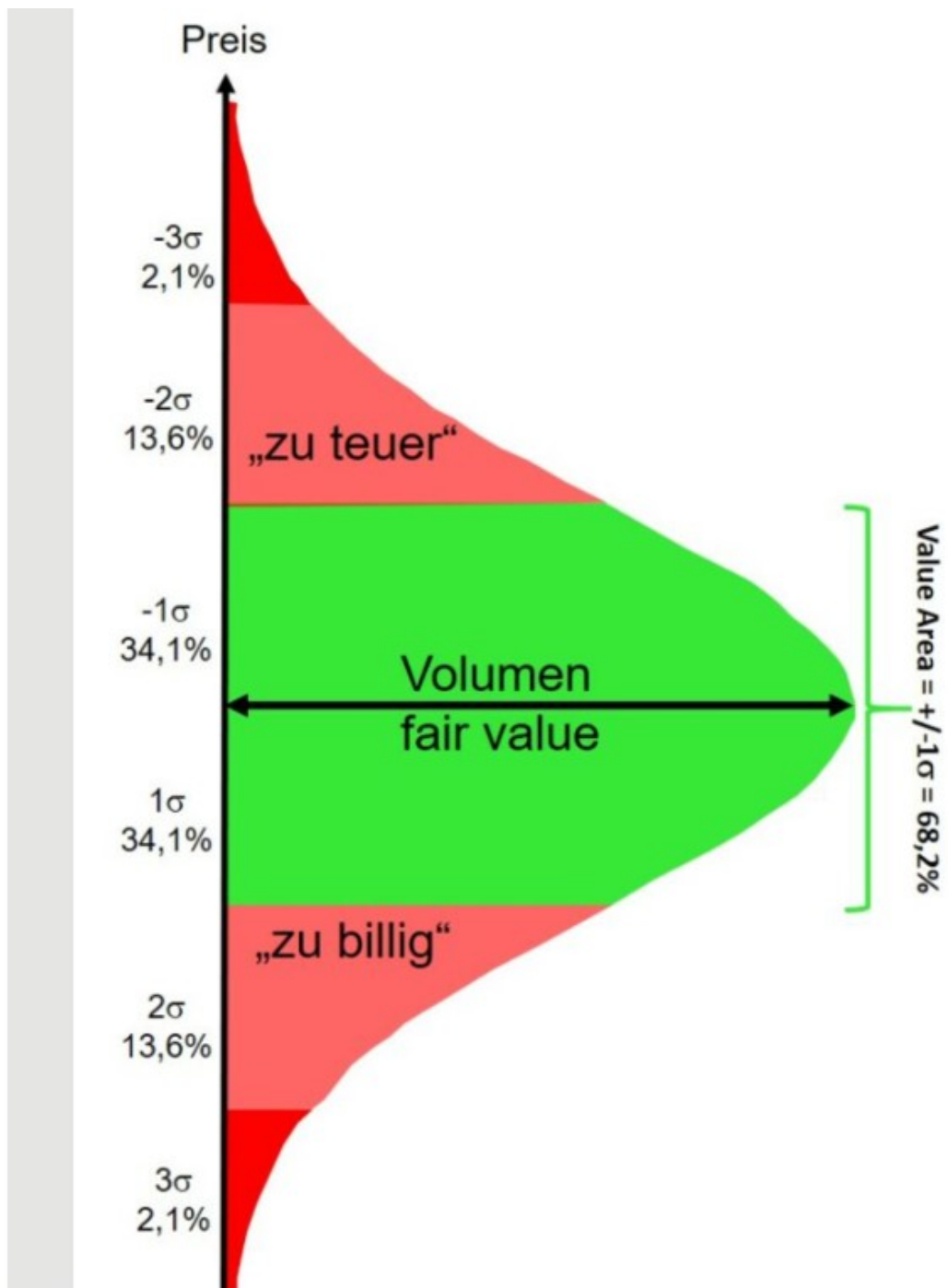


Beispiel: Intraday Trading 3 Handelstage in Folge mit gutem Ergebnis

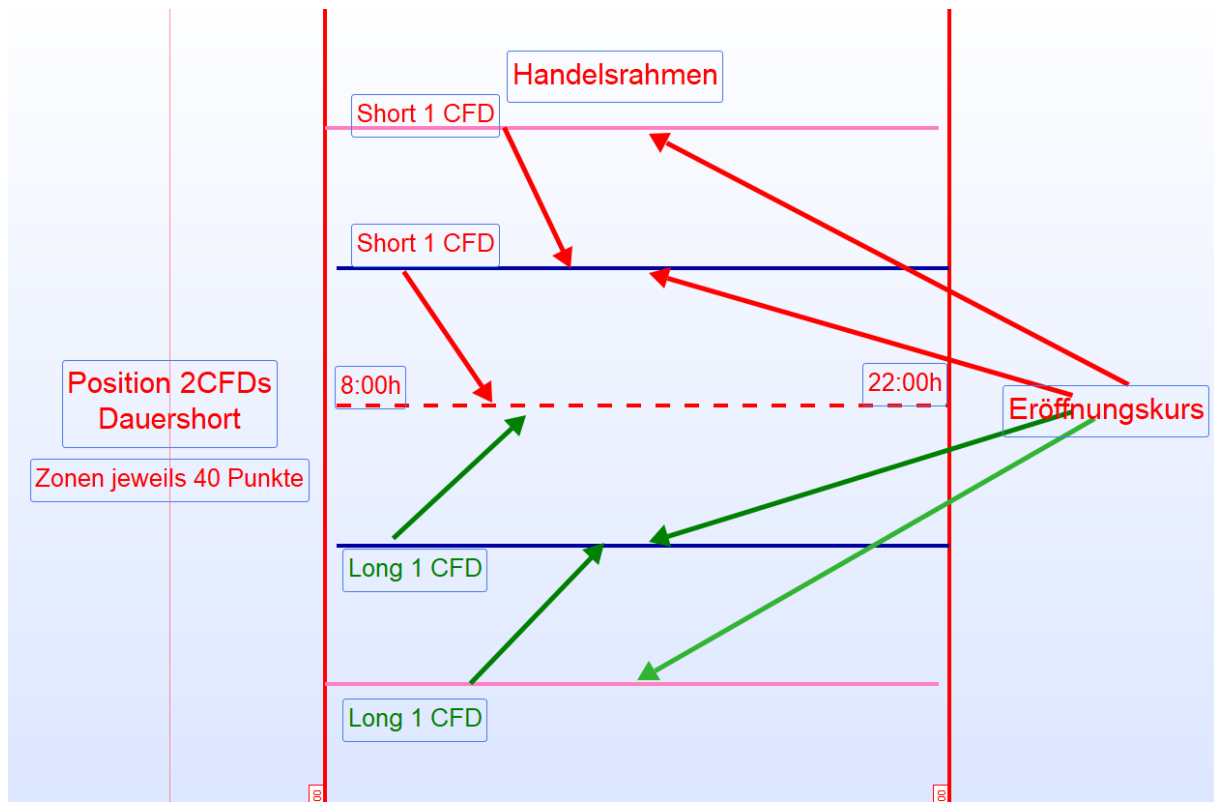
Es besteht allerdings auch die Möglichkeit, dass

1. Intraday durch eine unüberlegte Long Position bei fallenden Kursen zwar für die Festposition Short ein Gewinn anfällt dieser aber durch den Verlust der Gegenposition Long gekürzt wird.
2. Eine zusätzliche Intraday Shortposition diese zusammen mit der Festposition Short in den Verlust läuft.

Daher der Grundsatz für den Intraday Handel wie mit folgendem Bild dargestellt.



Intraday Handelsrahmen



Während für Intraday Long Positionen bei einer Dauer Short Position kein Stopp Loss vorgesehen ist, invers bei einer Dauer Long Position, kann ein Stopp Loss für eine Intraday Short Position ein Stopp Loss analog zur FDAX-TRADING-STRATEGIE greifen. Ansonsten werden die Intraday Positionen spätestens um 22:00h glatt gestellt.

Für die Festposition Short oder Long gilt das Prinzip Sliding Scale.

Es wird an einem neuen Allzeithoch die Festposition erhöht und nach einer Korrektur wieder auf den normalen Einsatz heruntergefahren. Nach einer großen Korrektur, beispielsweise bis 8000 Punkte, umgekehrt mit Long.

CFDs (Contract for Difference) eignen sich aufgrund niedriger Sicherheitsleistungen (Margin) und daher Zugang zur flexiblen

Stückelung der Trading-Einheiten ausgezeichnet für den Einstieg in den Handel.