

Entwicklung der Ergebnisse seit dem 1. August 2022 (Wochen-Berichte unter Artikel und Analyse)

Money- und Risk-Management der FDAX-TRADING-STRATEGIE

Neben den Einkommen wird eine langfristige Kapitalbildung in Etappen angestrebt und zwar durch Positionserhöhungen erst nach einer positiven Kapitalbildung. Positionskürzung nach einem Rücksetzer.

Sobald der Verlust die Hälfte der letzten Erhöhungsebene erreicht, wird die Positionsgröße um eine Stufe zurückversetzt.

Somit findet das Verlust Management auf zwei Ebenen statt

1. Intraday durch festgelegten Verlust Stopp 35 Punkte unter und über der zweiten Aktionszone. Weiterhin durch drei Aktionstopps, siehe Regelwerk, und durch Einschränkungen zum Beispiel keine neue Eröffnung von Positionen zwischen 13:00h und 14:45h oder kein Handel am Nachmittag wenn die DOW FUTURES (DJIA FUT) über/unter 1% notieren

2. Im übergeordneten Zeitrahmen Gewinnabsicherung durch das Money Management.

Der folgende Chart gibt einen Überblick über die Entwicklung der konservativ möglichen Ergebnisse des CFD Handel seit Anfang August.

Die Strategie hat sich in einem politisch und ökonomisch

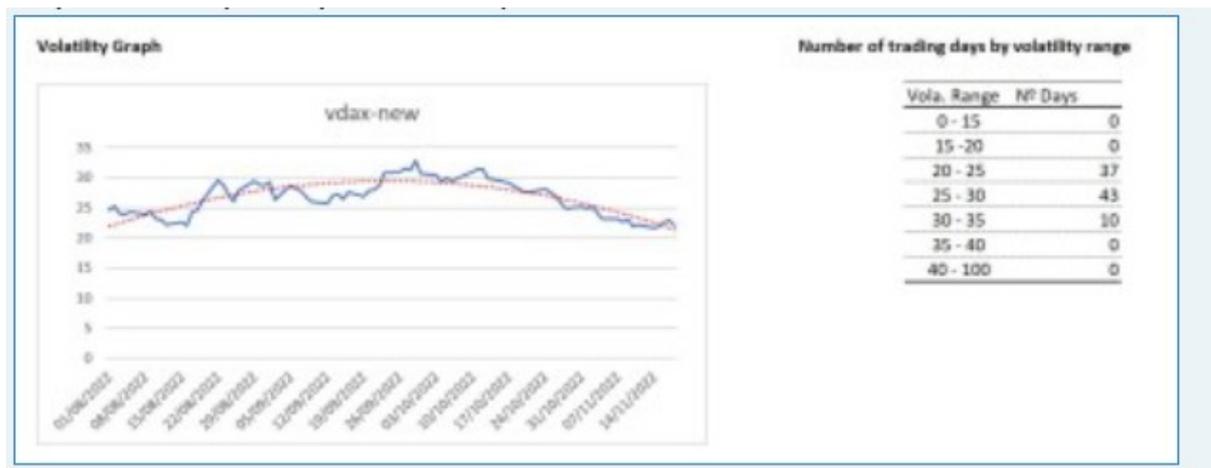
schwierigeren Umfeld mit hoher Volatilität und rasant fallender und steigender Kurse äußerst robust erwiesen.



Der fortgeschrittene Trader strebt an jedem Handelstag 50-70% der möglichen Punktgewinne an und baut damit ein Kapital auf.

Analyse der Ergebnisse.

1) Volatilität: Die Breite der Aktionszonen mit Eröffnung von Positionen richten sich nach der Volatilität des VIX-NEW.



Handel am Morgen und Ausführungen.

Morning Session

Trade	Num. of cases	Profits	Breakevens	Losses	Exceptions	Win ratio
Short 2nd Zone	12	10	0	1	1	90.9%
Short 1st Zone	33	23	3	5	2	74.2%
Long 1st Zone	37	26	3	8	0	70.3%
Long 2nd Zone	16	12	2	2	0	75.0%
Double GAP	15	15	0	0	0	100.0%
Wide GAP	13	3	1	1	8	60.0%

Exceptions/Ausnahmen sind Tage, in denen der Preis eine Zone kreuzt ohne das nach dem Regelwerk eine Position eröffnet wurde und andere nicht regebasierte Bewegungen. Insbesondere wurde bei Wide Gaps die Einstiegszonen nicht erreicht .

Handel am Nachmittag und Anzahl der verschiedenen Setups.

Das bedeutet praktisch, dass wir fast jeden Tag mindestens einen Tag haben, an dem eine Einstieg möglich war. Der am häufigsten vorkommende Einstieg ist

der Setup 4 mit mehr als der Hälfte der Tage und einer Wirksamkeitsrate von 93 %.

Setup 1

Trade	Num. of cases	Profits	Breakevens	Losses	Exceptions	Win ratio
Short 2nd Zone	6	4	0	2	0	67%
Short 1st Zone	5	4	0	1	0	80%
Long 1st Zone	1	1	0	0	0	100%
Long 2nd Zone	7	5	0	1	1	83%
Setup1	19	14	0	4	1	78%

Setup 2, 3 and 4

Trade	Num. of cases	Profits	Breakevens	Losses	Exceptions	Win ratio
Setup 2	5	5	0	0	0	100%
Setup 3	18	15	1	2	0	83%
Setup 4	47	39	0	2	5	93%