

Strategie der gleitenden Scala im Rhythmus der Konjunktur- und Kurszyklen (Entwurf am 8.6.24)

Konjunkturzyklen und Kurszyklen sind wichtige wirtschaftliche Konzepte, insbesondere wenn man sie im Kontext von wichtigen Indizes wie dem DAX betrachtet. Der DAX (Deutscher Aktienindex) ist ein Index, der die 40 größten und liquidesten Unternehmen, die an der Frankfurter Wertpapierbörse gelistet sind, umfasst. Er ist ein bedeutender Indikator für die gesamtwirtschaftliche Lage in Deutschland.

Konjunkturzyklen

Konjunkturzyklen beziehen sich auf die natürlichen Schwankungen in der wirtschaftlichen Aktivität eines Landes über einen gewissen Zeitraum. Diese Zyklen bestehen typischerweise aus vier Phasen:

- 1. Expansion: Wachstum der Wirtschaft, steigende Beschäftigung und Produktion.**
- 2. Hochkonjunktur (Boom): Höhepunkt des wirtschaftlichen Wachstums und der Aktivitäten.**
- 3. Rezession: Rückgang der wirtschaftlichen Aktivität, sinkende Beschäftigung und Produktion.**
- 4. Tiefstand (Depression): Niedrigster Punkt der wirtschaftlichen Aktivität.**

Kurszyklen

Kurszyklen beziehen sich auf die Schwankungen auf den Finanzmärkten, insbesondere in den Preisen von Aktien, Anleihen und anderen Wertpapieren. Diese Zyklen können durch eine Vielzahl von Faktoren beeinflusst werden, einschließlich, aber nicht beschränkt auf, Konjunkturzyklen, Zinsänderungen, politische Ereignisse und internationale Entwicklungen.

Die Beziehung zwischen Konjunkturzyklen und Kurszyklen ist oft eng verknüpft, da die allgemeine wirtschaftliche Lage direkt die Ertragsaussichten der Unternehmen beeinflusst und damit auch ihre Aktienkurse. Wenn die Wirtschaft wächst, tendieren die Unternehmensgewinne und damit auch die Aktienkurse dazu, zu steigen. In einer Rezession können die Unternehmensgewinne und Aktienkurse fallen.

DAX und Zyklen

Der DAX reagiert empfindlich auf Veränderungen in den wirtschaftlichen Bedingungen Deutschlands und weltweit. Während Perioden der wirtschaftlichen Expansion kann der DAX steigen, während er in Zeiten der Rezession tendenziell fällt. Daher ist der DAX nicht nur ein Spiegelbild der aktuellen wirtschaftlichen Bedingungen in Deutschland, sondern auch ein Frühindikator für die Erwartungen der Investoren an die zukünftige wirtschaftliche Entwicklung.

Für Investoren, die sich für den DAX interessieren, ist es wichtig, sowohl die makroökonomischen Indikatoren zu beobachten, die Aufschluss über den Zustand der Konjunktur geben, als auch die spezifischen Unternehmensdaten und globalen Ereignisse, die die Kursentwicklung beeinflussen könnten.

Der nachfolgende Handelsansatz setzt zum korrekten Verstehen das Studium folgender Strategien und Berichte voraus.

<https://www.vtad.de/fa/fdax-trading-strategie/>

<https://www.vtad.de/fa/baeume-wachsen-nicht-in-den-himmel-strategie/>

<https://www.vtad.de/fdax-trading-strategie-27-05-31-05-2024/>



Der Handelsansatz hat zum Ziel von konjunkturellen Kursentwicklungen zu profitieren. Weiterhin den Händler von der FOBO zu befreien und ihn in die Lage zu versetzen, Positionen laufen zu lassen und die Performance langfristig zu messen.

FOMO und das zu frühe Schließen von Gewinnen

FOMO kann aus mehreren Gründen dazu führen, dass Händler profitable Trades vorzeitig beenden:

- 1. Angst vor dem Verlust unrealisierter Gewinne: Wenn Händler von FOMO getrieben werden, könnten sie befürchten, dass der Markt sich umkehrt und ihre aktuellen Gewinne zunichtemacht. Diese Angst kann sie dazu veranlassen, eine Position beim ersten Anzeichen von Profit zu schließen, anstatt auf ihr geplantes Ziel zu warten.**
- 2. Überreaktion auf kleinere Marktschwankungen: Händler, die FOMO erleben, sind möglicherweise überempfindlich gegenüber kleinen Marktbewegungen gegen ihre Positionen. Diese Empfindlichkeit kann sie eher dazu bringen, Trades frühzeitig zu beenden und so größere potenzielle Gewinne zu verpassen.**
- 3. Vergleiche mit anderen Händlern: Manchmal schließen Händler Gewinne kurz, weil sie sehen oder hören, wie andere kleine Gewinne sichern. Dieser soziale Vergleich, verstärkt durch FOMO, kann Händler unter Druck setzen, die Handlungen anderer nachzuahmen, unabhängig von ihren eigenen Handelsplänen.**

Strategien zur Verwaltung von FOMO und zur Vermeidung des vorzeitigen Schließens von Gewinnen

- 1. Vordefinierte Ausstiegsstrategien: Legen Sie klare Ausstiegskriterien fest, bevor Sie einen Trade eingehen. Dies umfasst sowohl einen Stop-Loss zur Begrenzung von Verlusten als auch ein Gewinnziel, um Gewinne zu realisieren. Halten Sie sich an diese Ebenen, es sei denn, grundlegende Änderungen der Marktbedingungen rechtfertigen eine Anpassung der Strategie.**
- 2. Einsatz von dynamischen Stop-Loss-Orders (Trailing Stops): Ein dynamischer Stop-Loss-Auftrag, der sich mit dem Marktpreis in die Richtung des Trades bewegt. Dies ermöglicht es, Gewinne zu sichern und gleichzeitig der**

Position Raum zum Wachsen zu geben, was hilft, den Impuls zu mindern, zu früh auszusteigen.

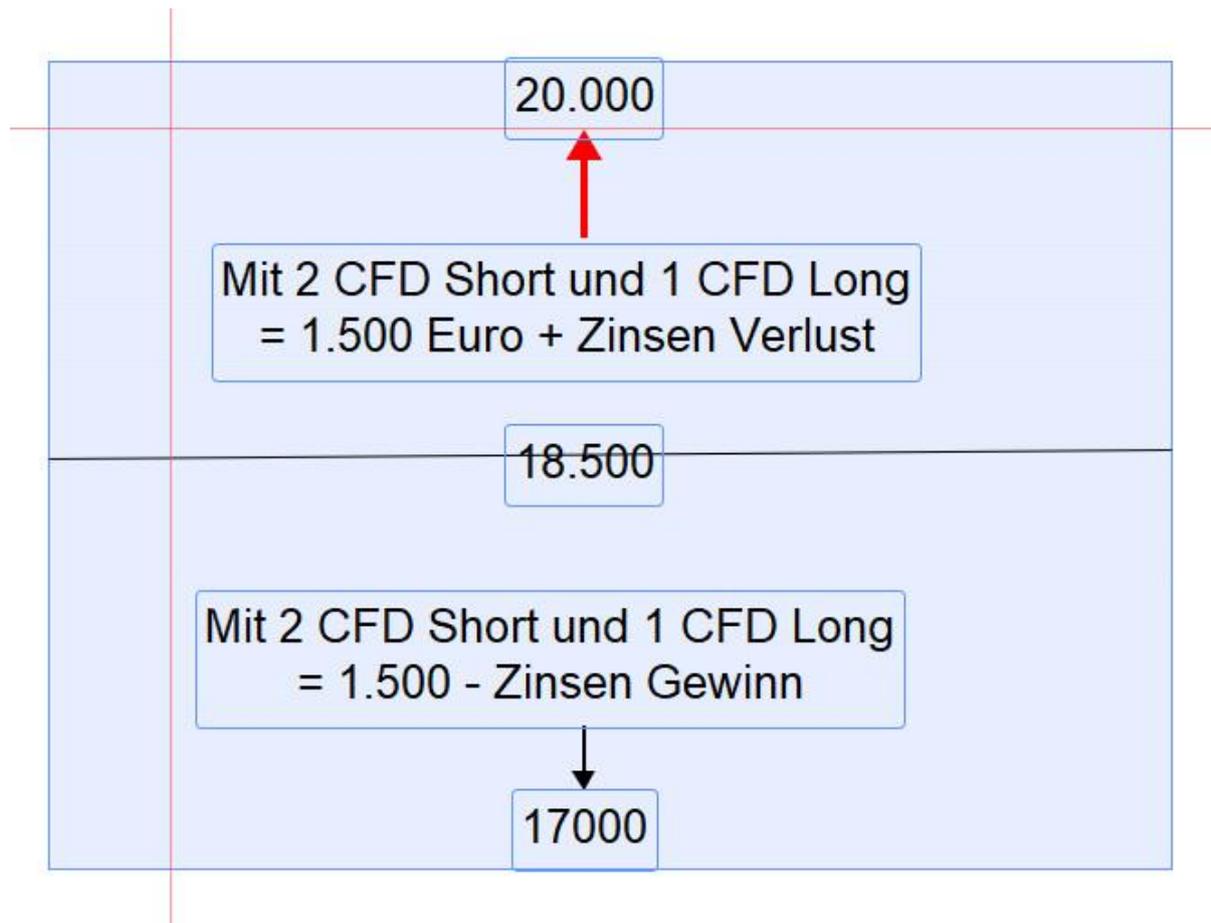
- 3. Training zur emotionalen Disziplin: Üben Sie regelmäßig Techniken zur emotionalen Disziplin, wie Meditation, Atemübungen oder jede Methode, die dabei hilft, Ruhe zu bewahren und die Auswirkungen emotionaler Entscheidungen auf den Handel zu reduzieren.**
- 4. Regelmäßige Überprüfung und Anpassung der Risikotoleranz: Überprüfen Sie regelmäßig Ihre Risikotoleranz, da diese sich basierend auf den allgemeinen Marktbedingungen, persönlichen finanziellen Veränderungen oder vergangenen Handelserfahrungen ändern kann. Passen Sie Ihren Handelsansatz entsprechend an, um Ihrem Komfortniveau mit Risiken gerecht zu werden, was den Drang reduzieren kann, profitable Trades vorzeitig zu beenden.**
- 5. Begrenzung der Exposition gegenüber hyperaktiven Handelsumgebungen: Umgebungen (wie bestimmte Online-Foren oder Daytrading-Chatrooms), die schnellen Handel fördern, können FOMO erhöhen. Begrenzen Sie die Zeit, die Sie in diesen Umgebungen verbringen, um sich mehr auf Ihre eigene Analyse und Strategie zu konzentrieren.**
- 6. Stufenweise Gewinnmitnahme: Erwägen Sie, Gewinne schrittweise zu sichern. Sie könnten zum Beispiel die Hälfte Ihrer Position beim ersten Gewinnziel schließen und dann Ihren Stop-Loss bei der verbleibenden Position auf den Break-Even-Punkt anpassen, was dem Trade Raum gibt zu laufen, ohne Ihr anfängliches Kapital zu riskieren.**

Durch die Integration dieser Strategien können Händler den psychologischen Druck, der durch FOMO entsteht, besser managen und ihre Fähigkeit verbessern, Gewinne voll auslaufen zu lassen, was besser mit ihren gesamten Handelszielen und -strategien übereinstimmt.

Neben dem Handel der Setups der FDAX-DAX-HANDELSTRATEGIE werden zusätzlich flexible Fixpositionen eingesetzt, wobei wir davon ausgehen, dass der Kurs zurzeit eher fällt als steigt. Nach einer wesentlichen Korrektur werden die Fixpositionen gedreht. Als Anhaltspunkt kann auch der 200 Tage Moving Average dienen.

Dazu eine Darstellung über Gewinn/Verlust. Ausgangspunkt DAX/Kurs 18.500.

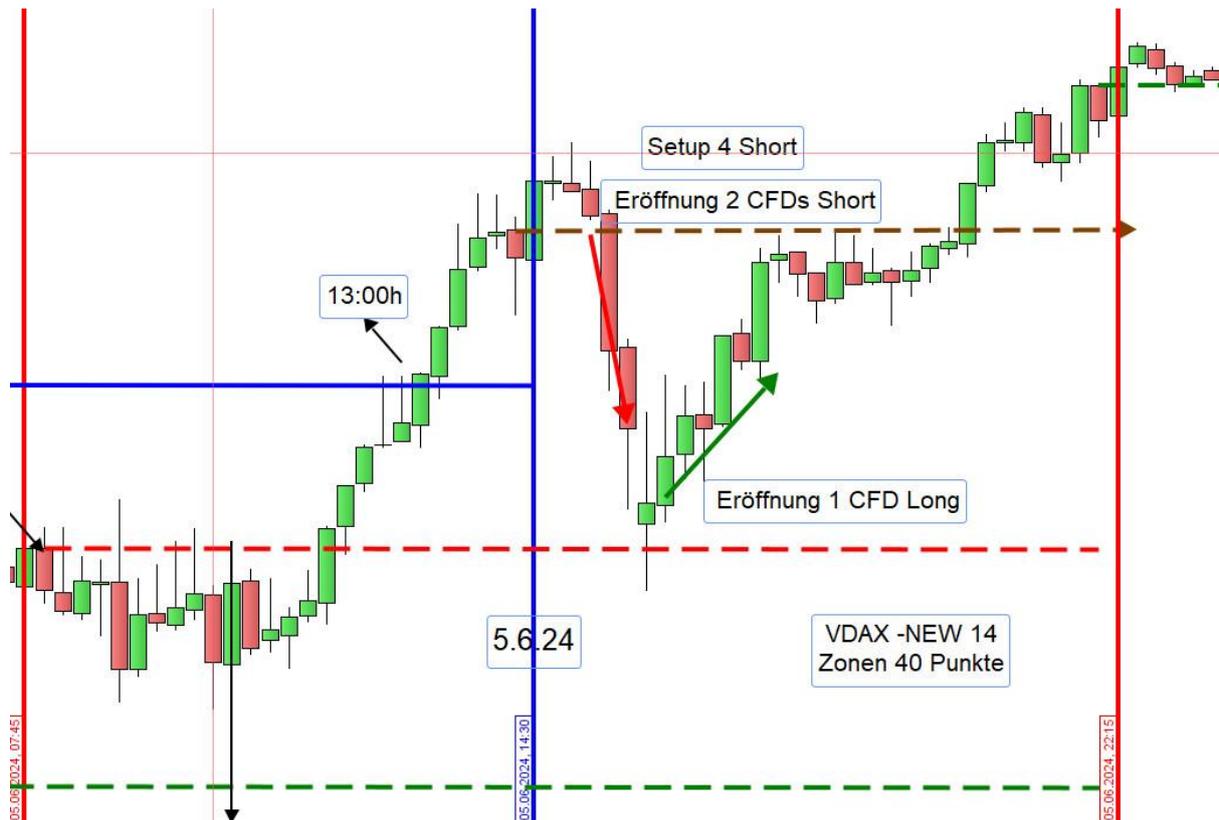
Als Referenz dienen immer 2 CFDs und 1CFD.



Die erste Eröffnung der flexiblen Fixpositionen von 2 CFDs Short erfolgt am wirkungsvollsten am Nachmittag mit einem Setup 2 Short, Setup 1 Short oder Setup 4 Short.

Die Eröffnung der flexiblen Fixposition von 1 CFD Long darunter.

Beispiel: (Alle Beispiele aus der Handelswoche vom 3-7-6.24)



Was bedeutet gleitende Scala und flexible Fixpositionen?

Die Hälfte der Short Position von 2 CFDs, also 1 CFD, wird am Tagestief geschlossen und höher wieder eröffnet.

Die Hälfte der Long Position von 1 CFD, also 0,5 CFD, wird am Tageshoch geschlossen und weiter unten wieder eröffnet.



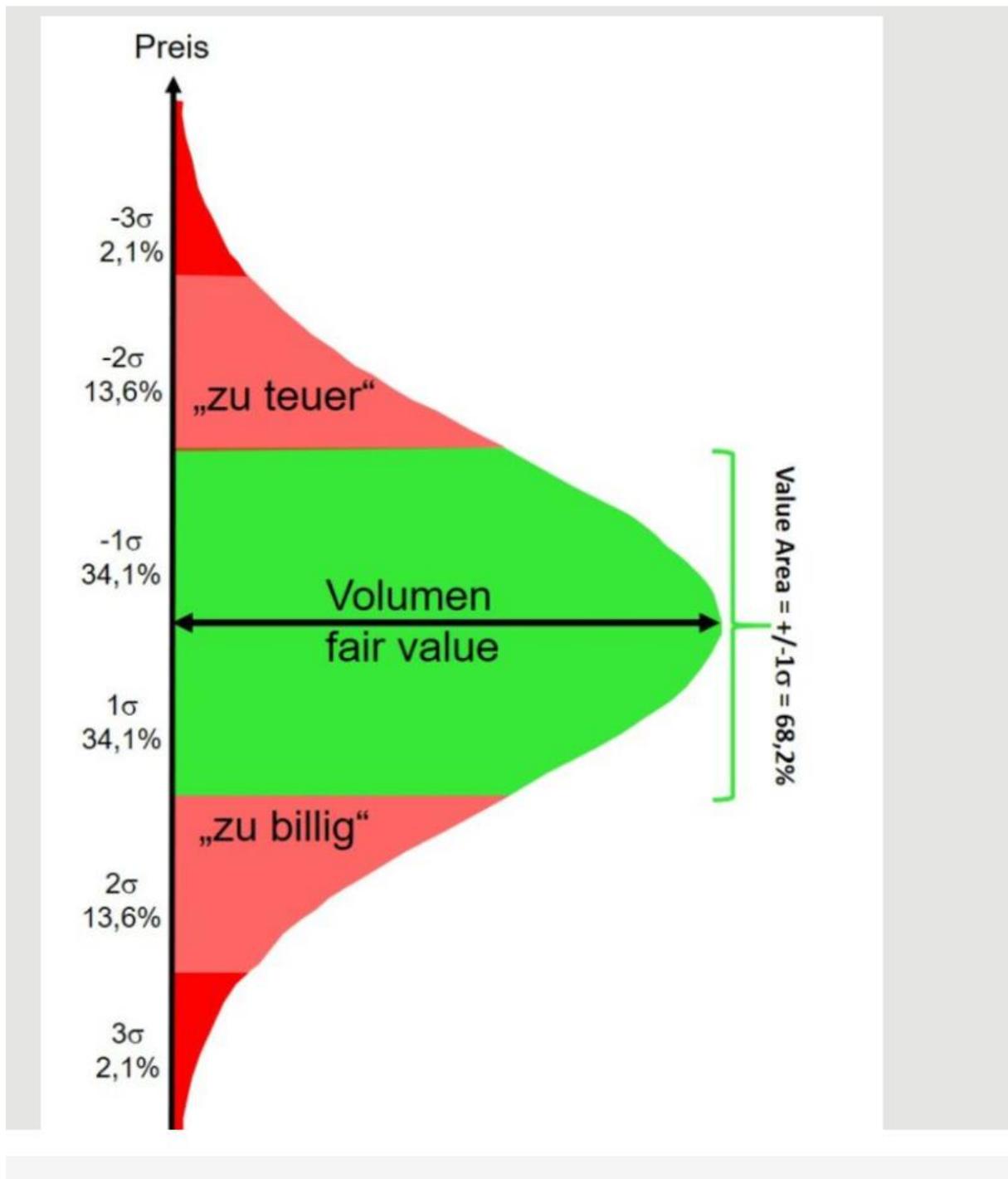
Beispiel:



Wichtiger Hinweis:

Schließungen einer Teilposition bedeutet nicht, dass diese insgesamt im Gewinn notiert, sondern nur gemäß dem Tageschart.

Alle Schließungen einer Position und Wiedereröffnung soll nach folgendem Prinzip erfolgen:



Weiterhin nach den Wahrscheinlichkeiten unserer Statistik.

Statistische Erfassung seit dem 8. Januar bis zum 7.6.2024

Handel am Morgen	Gewinn-Trades	Verlust-Trades
Erste Zone Long	55	6
Zweite Zone Long	11	
Stopp Loss Long erreicht	1	
Erste Zone Short	47	9
Zweite Zone Short	8	2
Stopp Loss Short erreicht	4	
Reversals	7	
Handel am Nachmittag	Gewinn-Trades	Verlust-Trades
Setup 1 Long	2	
Setup 1 Short	4	
Setup 2 Long	8	1
Setup 2 Short	15	
Setup 3 Long	20	
Setup 4 Long	21	
Setup 4 Short	20	1
Verluste		
Tages-Gesamtverlust	1	
Teilverlust	5	

Nach der Schließung einer Teilposition kommt es nicht immer vor, dass trotz aller Sorgfalt der Kurs in die gewünschte Richtung läuft. Wir nutzen keinen Stopp-Loss sondern eine Wiederherstellung der Teilposition wenn der Kurs entgegen gesetzt läuft und zwar nach 50 Punkten.

Beispiel:



Insgesamt tritt dann kein Gesamtverlust ein, da 1 CFD Short noch geöffnet.

Sehr geschickte Trader können auch die gesamte flexible Fixpositionen schließen und wieder eröffnen.

Der Handel mit gleitender Scala hat auch bei einer Seitwärtsbewegung ein hohes Gewinnpotenzial.

Zusammen mit dem Handel der täglichen Setups und nach dem Gewinn durch eine Erhöhung der Positionen gemäß dem Compound Effect second to none !

Der Dax notiert jetzt bei 18.500. Es ist davon auszugehen, dass er um 2000 Punkte korrigiert. Mit einer Shortposition von 1 CFD, der Pro Punkt 1€ verdient, würde man bei einer DAX-Korrektur von 2000 Punkten somit 2000€ verdienen. Angenommen ich setze 2 CFDs Shortposition ein und bei angenommenen 200 Handelstagen bis zur vollständigen Korrektur von 2000 Punkten würde ich im Tagesverlauf ein CFD mit Gewinn Gattstellen und es gelänge mir

diese dann immer 30 Punkte höher wieder zu eröffnen. Wie hoch wäre dann der Gesamtgewinn?

Natürlich, hier ist eine kompaktere Darstellung der Berechnung deines Gewinns:

Basisgewinn durch Korrektur:

$2 \text{ CFDs} \times 2000 \text{ Punkte} \times 1 \text{ €/Punkt} = 4000 \text{ €}$

Zusätzlicher Gewinn durch tägliches Neupositionieren:

Täglicher Gewinn: $30 \text{ Punkte} \times 1 \text{ €/Punkt} = 30 \text{ €}$

Über 200 Handelstage: $30 \text{ €/Tag} \times 200 \text{ Tage} = 6000 \text{ €}$

Gesamtgewinn:

$4000 \text{ €} + 6000 \text{ €} = 10000 \text{ €}$

Diese Berechnung zeigt den Gesamtgewinn unter der Annahme, dass die täglichen Neupositionierungen konsequent 30 Punkte günstiger erfolgen und der Markt entsprechend deinen Erwartungen agiert.

Angenommen wir haben 2 CFDs Short bei einem Kurs von 18500 und gleichzeitig 1 CFd Long. Der Kurs steigt um 2000 Punkte und der Gesamtverlust beträgt somit 2000€. Wenn wir jedoch jeden Handelstag 0,5 CFD mit Gewinn verkaufen und 0,5CFD 30 Punkte darunter wieder kaufen wie hoch wäre denn dann das Ergebnis wenn der Anstieg um 2000 Punkt innerhalb 200 Handelstage geschieht?

Klar, hier ist eine kompaktere Darstellung der Berechnung des Gesamtergebnisses:

Direkte Gewinne und Verluste:

Short-Positionen: $2 \text{ CFDs} \times 2000 \text{ Punkte Anstieg} \times 1 \text{ €/Punkt} = 4000 \text{ € Verlust}$

Long-Position: $1 \text{ CFD} \times 2000 \text{ Punkte Anstieg} \times 1 \text{ €/Punkt} = 2000 \text{ € Gewinn}$

Nettoverlust aus Positionen: $4000 \text{ €} - 2000 \text{ €} = 2000 \text{ €}$

Zusätzlicher Gewinn durch Neupositionieren:

Täglicher Gewinn: $0,5 \text{ CFDs} \times 30 \text{ Punkte} \times 1 \text{ €/Punkt} = 15 \text{ €/Tag}$

Gesamt über 200 Tage: $15 \text{ €/Tag} \times 200 \text{ Tage} = 3000 \text{ €}$

Gesamtergebnis:

Nettogewinn gesamt: $3000 \text{ €} - 2000 \text{ €} = 1000 \text{ € Nettogewinn}$

Somit ergibt sich trotz des anfänglichen Verlustes ein Nettogewinn von 1000 € durch das tägliche Neupositionieren.