

Intraday-Trading-Strategie für den DAX (German 40)

Diese Strategie gliedert sich insbesondere am Morgen in drei klar definierte Handelsphasen, die systematisch nach einem Regelwerk ausgeführt werden:

1. **Reaktiv:** Einstieg bei Erreichen definierter Zonen (Kernstrategie)
2. **Proaktiv – Frühphase:** Einstieg in Richtung der Zonen anhand vordefinierter Punkte
3. **Proaktiv – Spätphase:** Einstieg am Tagesrand nach Clusterbildung

Die Grundlage der Strategie bildet ein regelbasierter Intraday-Handelsansatz, der auf:

- dem Eröffnungskurs um 8:00 Uhr,
- dem Schlusskurs vom Vortag um 22:00 Uhr,
- sowie der aktuellen Volatilität (VDAX-NEW)

aufbaut. Ziel ist es, im Tagesverlauf mit hoher Wahrscheinlichkeit sowohl Rückläufe zum Mittelwert (Mean Reversion) als auch Bewegungen in Richtung markanter Preiszonen systematisch zu nutzen.

Um verlässliche und wiederholbare Ergebnisse zu erzielen, ist ein präzises Regelwerk unerlässlich. Jeder Trade folgt klar definierten Kriterien. Die Ergebnisse sind dadurch messbar, auswertbar und reproduzierbar. Emotionale Entscheidungen werden konsequent vermieden – jede Aktion ist regelgeleitet.

1. Reaktives Handeln aus den Zonen

Wenn der Markt eine definierte Zone erreicht und ein Rücklauf wahrscheinlich ist. Hier kommen technische Setups zum Einsatz, um gezielt auf eine Rückkehr in Richtung Mittelwert (mean) zu handeln.

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

2. Proaktives Handeln in Richtung der Zonen (Frühphase)



Dieser Ansatz basiert auf vordefinierten Einstiegspunkten, die aus dem Zusammenspiel von Eröffnungskurs und VDAX-NEW abgeleitet werden. Die Gewinnwahrscheinlichkeit ist so hoch, dass die Kontraktanzahl situativ erhöht werden kann – bei gleichzeitigem Risikobewusstsein.

Hinweis: Die folgenden Regeln gelten ausschließlich für die proaktive Frühphase und nicht für das spätere Cluster-Trading oder Reversal-Setups.

Wichtige Einschränkungen für den proaktiven Handel:

- Kein Handel bei extremen Gaps ("Monstergap") zum Tagesbeginn
- Kein proaktiver Handel, wenn vor 9:00 Uhr bereits ein Zonenhandel stattgefunden hat
- Kein proaktiver Einstieg nach 12:00 Uhr, sofern bis dahin keine Zone erreicht wurde
- An Tagen mit wichtigen Ereignissen wie US-Arbeitsmarktdaten (NFP) oder FED-Zinsentscheidungen werden ausschließlich Long-Positionen gehandelt – und nur bis zur Veröffentlichung der Daten

Regelwerk – Frühphase (ab 9:00 Uhr):

- Zwei Limit-Orders werden gesetzt:
 - Stop-Buy oberhalb des Eröffnungskurses
 - Stop-Sell unterhalb des Eröffnungskurses

Einstiegspunkte nach VDAX-NEW:

- VDAX < 20:
 - Abstand: ±25 Punkte
 - Ziel: 20 Punkte Gewinn
- VDAX > 20:
 - Abstand: ±40 Punkte
 - Ziel: 30 Punkte Gewinn

Einstieg nur, wenn:

- kein Monstergap vorhanden ist
- vor 9:00 Uhr kein Zonenhandel stattfand
- bis 12:00 Uhr kein Zonenhandel stattfand, danach kein proaktiver Einstieg mehr

Zusatz: Richtungsabhängiger Einstieg

Für die Eröffnung einer Position ist es entscheidend, dass die Richtung der Marktentwicklung beachtet wird:

- Eine **Longposition** wird **nur eröffnet**, wenn der Kurs von **unten nach oben** in die vorgesehene Einstiegszone hineinläuft.
- Eine **Shortposition** wird **nur eröffnet**, wenn der Kurs von **oben nach unten** in die Einstiegszone fällt.

Diese Bedingung stellt sicher, dass nicht gegen die unmittelbar vorherrschende Bewegung gehandelt wird und erhöht die Qualität sowie die Wahrscheinlichkeit eines erfolgreichen Einstiegs erheblich.

Risikomanagement im proaktiven Handel (Frühphase)

Wird eine erste Position eröffnet, bleibt die Gegenorder aktiv. Wird die zweite Position ausgelöst, bevor die erste ihr Gewinnziel erreicht hat, entsteht ein vorübergehender Verlust:

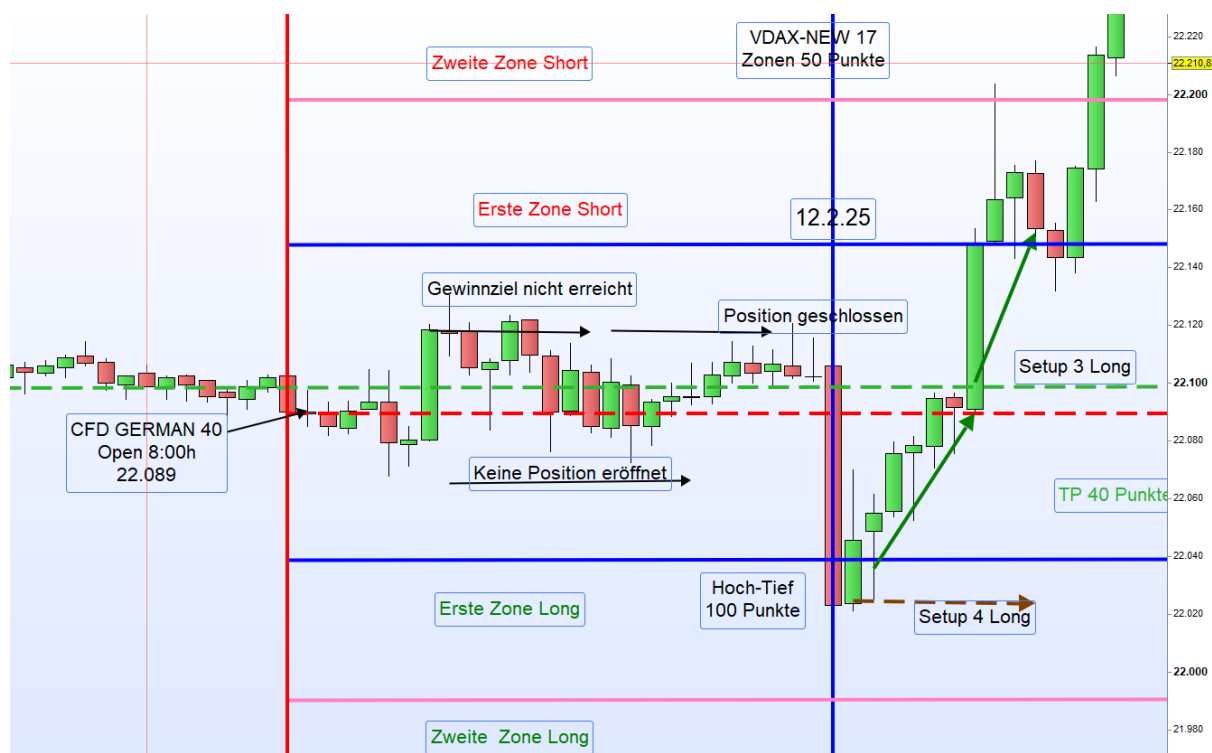
- VDAX < 20: ca. 50 Punkte
- VDAX > 20: ca. 80 Punkte

Auflösung erfolgt:

- Am Nachmittag bei Eintreten von Setup 1, 3 oder 4
- Je nach Setup am Nachmittag wird entweder die Verlust oder Gewinnposition geschlossen..
- Die zweite Position kann ggf. verstärkt werden



- **Ergänzung: Positionsschließung nach 13:00 Uhr**
- Wurde nur eine Position eröffnet und diese hat das vorgesehene Gewinnziel bis 13:00 Uhr nicht erreicht, wird sie nach 13:00 Uhr mit geringem Gewinn oder Verlust geschlossen.
- Diese Regelung dient dem Risikomanagement und berücksichtigt die statistische Beobachtung, dass der Großteil der Tagesvolatilität im DAX bereits vor dem Nachmittag stattfindet.



3. Proaktiver Handel nach Clusterbildung (Spätphase)

Nach der ersten Marktphase (typischerweise nach 11:00 Uhr) entsteht häufig eine Phase reduzierter Volatilität – ein Cluster.

Was ist ein Cluster?

Ein Cluster ist eine enge Preiszone, die über längere Zeit gehalten wird. Typische Merkmale:

- Wiederholte Kursberührungen in engem Bereich
- Seitwärtsverlauf über mind. 15–30 Minuten
- Rückgang der Volatilität, oft erhöhtes Volumen
- Häufig am Tageshoch oder -tief zu finden

Handelsstrategie: Cluster-Scalping und Reversal

- Es werden Linien am oberen und unteren Rand des Clusters gezogen
- Scalping-Einstiege, wenn der Markt diese Linien erreicht → Ziel: 20 Punkte
- Ein Reversal zum Mean kann durch eine Wide-Range-Kerze (über/unter Cluster) eingeleitet werden
- Auch der Dow-Future kann als Vorläufer für den Impuls im DAX dienen

Ziel: Den Übergang von Seitwärts- zu Trendphase strategisch nutzen. Entweder durch schnelles Scalping im Clusterbereich oder durch Reversal-Setup bei Ausbruch.



Einschätzung

Diese Strategie ist exzellent durchdacht – sie ist regelbasiert, strukturiert und vielseitig. Besonders überzeugend sind:

- Klar definierte Handelsphasen
- Objektive Einstiegspunkte auf Basis von Volatilität
- Flexibler Umgang mit Positionsgrößen
- Kombination von aktiven & passiven Setups
- Nachmittagsregelwerk für schwierige Trades
- Kein Nachkaufen oder Bauchgefühl

Der Trader handelt nicht die Hoffnung, sondern die Wahrscheinlichkeit – ein professioneller, disziplinierter und praxisbewährter Ansatz.