

Handelsstrategie für CFDs auf den German 40 (DAX-basiert)

Grundidee und Aufbau des Handelsrahmens

Diese Strategie basiert auf dem Prinzip der **Mean Reversion** im German 40 Index (abgeleitet vom DAX). Täglich wird ein strukturierter **Handelsrahmen** erstellt, der als Grundlage für alle Entscheidungen dient. Dieser Rahmen besteht aus:

1. Benchmark-Kurse

- **Schlusskurs vom Vortag um 22:00 Uhr**
- **Eröffnungskurs des aktuellen Handelstags um 8:00 Uhr**
→ Beide Kurse werden im Chart eingezeichnet und **sind Bestandteil des Handelsrahmens**.

Hinweis: Je nach Kursentwicklung über Nacht kann der Eröffnungskurs deutlich über oder unter dem Schlusskurs vom Vortag liegen. Es entsteht dann eine **Kurslücke (Gap)**, die bei der Markteinschätzung zu berücksichtigen ist.

2. Erste Aktionszonen (primäre Einstiegsbereiche)

- Standardmäßig werden die Zonen im Abstand von **75 Punkten oberhalb und unterhalb** der Benchmark-Kurse eingezeichnet.
- **Notiert der VDAX-NEW jedoch über 20**, wird der Abstand zur Anpassung an die erhöhte Volatilität auf **100 Punkte** erweitert.

→ Diese Zonen markieren die ersten potenziellen Einstiegsbereiche für Long- oder Short-Positionen.

3. Zweite Aktionszonen (erweiterte Einstiegsbereiche)

- Im Abstand von **50 Punkten hinter den ersten Aktionszonen** wird jeweils eine **zweite Zone** definiert – zur Erweiterung der Einstiegslogik bei überdehnten Bewegungen.

4. Stopp-Loss-Zonen

- Der **Stopp-Loss** liegt jeweils **35 Punkte hinter der zweiten Aktionszone**, um ausreichend Spielraum für Volatilität zu lassen und unnötige Ausstopper zu vermeiden.

Strategischer Ansatz und Positionseröffnung

Die Strategie verfolgt eine **Mean-Reversion-Logik**: Wird eine Aktionszone erreicht, wird eine Gegenbewegung in Richtung des Mittelwerts zwischen den Benchmarks erwartet. Der Einstieg erfolgt kontrolliert nach folgendem Ablauf:

1. Einzeichnen der Zonen

Nach dem Eröffnungskurs um 8:00 Uhr werden die Aktionszonen – je nach aktueller Volatilität – im Abstand von 75 oder 100 Punkten in den Chart eingezeichnet.

2. Alarmplatzierung

Direkt auf jeder Aktionszone wird ein **Alarm** gesetzt. Sobald der Kurs diese Linie erreicht, wird der **vorher platzierte Alarm** ausgelöst.

3. Limit-Order nach Alarm

Nach dem Alarm wird eine vorbereitete **Limit-Order** platziert:

- **Für Long-Positionen: 10 Punkte oberhalb** der Long-Zone
- **Für Short-Positionen: 10 Punkte unterhalb** der Short-Zone

Die Order wird **nur ausgeführt**, wenn der Kurs nach Berührung der Zone in den jeweiligen Limitbereich zurückläuft. Das vermeidet impulsive Einstiege bei hohem Momentum und ermöglicht einen kontrollierten Entry im Sinne der Mean Reversion.

Flexible Einstiege für erfahrene Trader

In einigen Fällen wird die Aktionszone knapp verfehlt. Erfahrene Trader können auch dann eine Position eröffnen, wenn:

- sich auf dem **5-Minuten-Chart eine deutliche Umkehrkerze** (Reversal Candle) gebildet hat,
- und der Kurs sich **nicht bereits zu nahe an einem der Benchmarks** (Schluss- oder Eröffnungskurs) befindet.

Diese Entscheidung erfordert fundierte Erfahrung in der Chartanalyse und sollte nur bei klaren Reversals und ausreichendem Abstand zum Mittelwert getroffen werden.

Zweite Aktionszonen und Positionsmanagement

Kommt es nach Erreichen der ersten Zone zu keiner Umkehr, sondern setzt sich die Bewegung fort, kommen die **zweiten Aktionszonen** zum Einsatz. Sie befinden sich:

- **Long-Szenario: 50 Punkte unterhalb** der ersten Long-Zone
- **Short-Szenario: 50 Punkte oberhalb** der ersten Short-Zone

Diese Zonen bieten eine zusätzliche Einstiegsmöglichkeit bei **stärker überdehnten Kursbewegungen**, ohne die Logik der Mean Reversion aufzugeben.

Es kommt regelmäßig vor, dass eine Position, die an der ersten Zone eröffnet wurde, **zunächst in den Verlust läuft** – und der Kurs bis zur zweiten Zone oder sogar darüber hinaus gehandelt wird.

Daher gelten an der zweiten Zone folgende Regeln:

An der zweiten Aktionszone wird nur dann eine neue Position eröffnet, wenn der Kurs die Zone **mit einer abgeschlossenen 5-Minuten-Umkehrkerze** durchkreuzt –

- **von oben nach unten** für einen **Short-Einstieg**
- **von unten nach oben** für einen **Long-Einstieg**

Diese Bedingung schützt davor, gegen einen laufenden Trend „nachzufassen“, und stellt sicher, dass ein Einstieg nur bei deutlich erkennbarem Reversal erfolgt.

Wird die erste Eröffnungsposition mit Verlust in die zweite Zone gehandelt, erfolgt dort eine einmalige Positionsverdopplung.

Hier sei ausdrücklich angemerkt, dass diese **Verbilligung an der zweiten Zone wesentlich zum langfristigen Erfolg beiträgt** – vor allem deshalb, weil sich der Kurs an diesem Punkt deutlich vom mittleren Preisniveau (Mean) entfernt hat und die Wahrscheinlichkeit einer **Rückkehrbewegung (Reversal)** entsprechend steigt.

Stopp-Loss-Regel

Der **Stopp-Loss** wird jeweils **35 Punkte hinter der zweiten Aktionszone** gesetzt:

- Bei **Long-Positionen**: 35 Punkte **unterhalb** der zweiten Long-Zone
- Bei **Short-Positionen**: 35 Punkte **oberhalb** der zweiten Short-Zone

Diese Platzierung lässt dem Markt genügend Raum zur Entfaltung, begrenzt gleichzeitig aber das Risiko klar und transparent.
