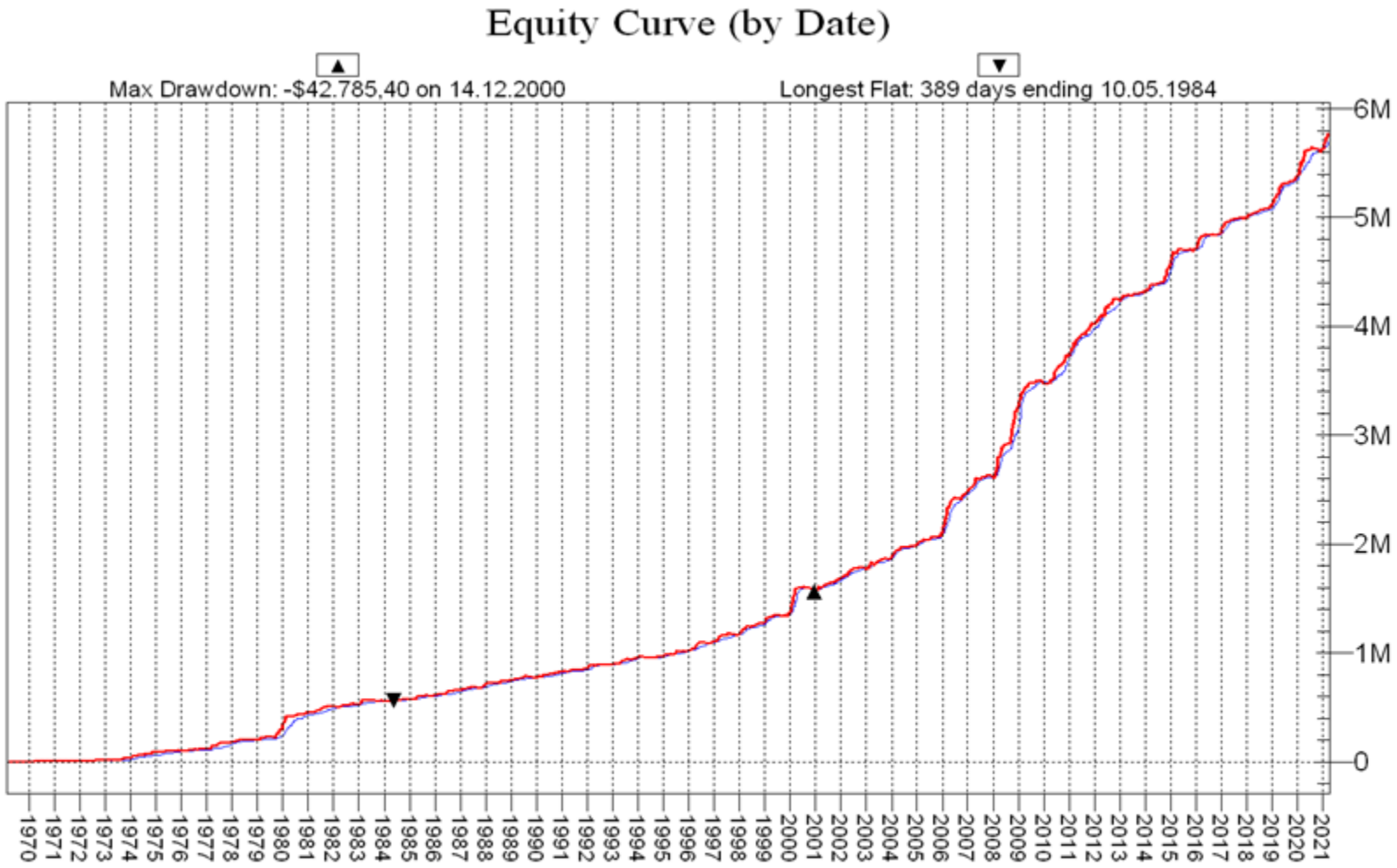
POWER BREAKOUTS

Ausbruchs-Handel mit 66 bis 94% Trefferquote

EINFÜHRUNGS-SEMINAR

by RealMoneyTrader.com

Equity ALLER PowerBreakout-Setups als Portfolio seit 1970



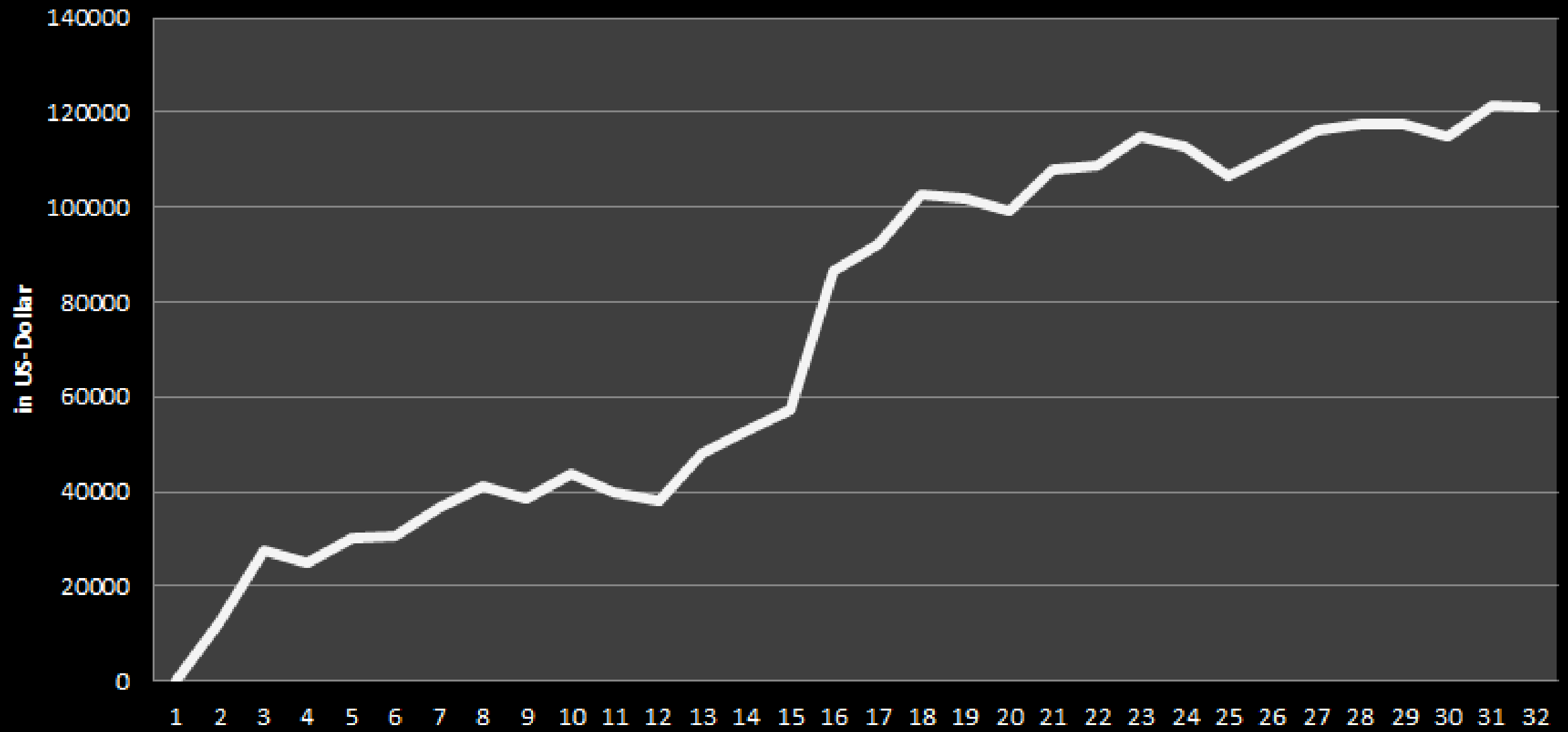
Summary - All Trades

Overall			
Total Net Profit:	$5.771.713	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**3,76**
Total Trades:	2.747	Winning Percentage:	64,7%
Average Trade:	$2.101	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	2,05
Max Closed-out Drawdown:	-$42.785	CPC Index (PF x Win% x PR):	4,99
Max Intra-trade Drawdown:	-$50.874	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	97,40%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$50.296	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	47,52%
Percent in the Market:	5,6%	Optimal f:	0,98
Avg # of Bars in Trade:	29,03	Z-Score (W/L Predictability):	-10,0
Avg # of Trades per Year:	52,7	Current Streak:	1 Losses
Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$9.235	Monthly Sharpe Ratio:	0,50
Std Dev of Monthly Profits:	$18.462	Annualized Sharpe Ratio:	1,73
		Calmar Ratio:	2,18
Winning Trades		**Losing Trades**	
Total Winners:	1.778	Total Losers:	969
Gross Profit:	$7.862.012	Gross Loss:	-$2.090.300
Average Win:	$4.422	Average Loss:	-$2.157
Largest Win:	$67.318	Largest Loss:	-$15.020
Largest Drawdown in Win:	-$29.850	Largest Peak in Loss:	$30.360
Avg Drawdown in Win:	-$1.347	Avg Peak in Loss:	$1.608
Avg Run Up in Win:	$6.172	Avg Run Up in Loss:	$1.608
Avg Run Down in Win:	-$1.347	Avg Run Down in Loss:	-$2.957
Most Consec Wins:	30	Most Consec Losses:	10
Avg # of Consec Wins:	3,51	Avg # of Consec Losses:	1,91
Avg # of Bars in Wins:	31,69	Avg # of Bars in Losses:	24,14

© GenesisFT

Binnen 5 Dekaden wurde im Future **OHNE** Wiedereinsatz des Kapitals (es wurde fortwährend mit einem Kontrakt) gehnadelt. Mit Zinseszins würde man ein Vielfaches verdient haben, da dann beispielsweise bei einem Kontostand von 1 Million auch das Zehnfache an Stücken gehandelt werden würde. Du siehst in der Equity also den reinen Effekt des Ansatzes, ohne Zinseszins.

Equity PowerBreakout-Trades 2021



Es gibt im wesentlichen zwei Arten von Tradingansätzen

Starre Methoden

- Saisonal
- Value/Fundamental
- Statistisch

Dynamische Methoden

- Trendhandel
- Tape-Reading
- Volumentrading

Mögliche Schwachstellen verschiedener Trading-Methoden können sein

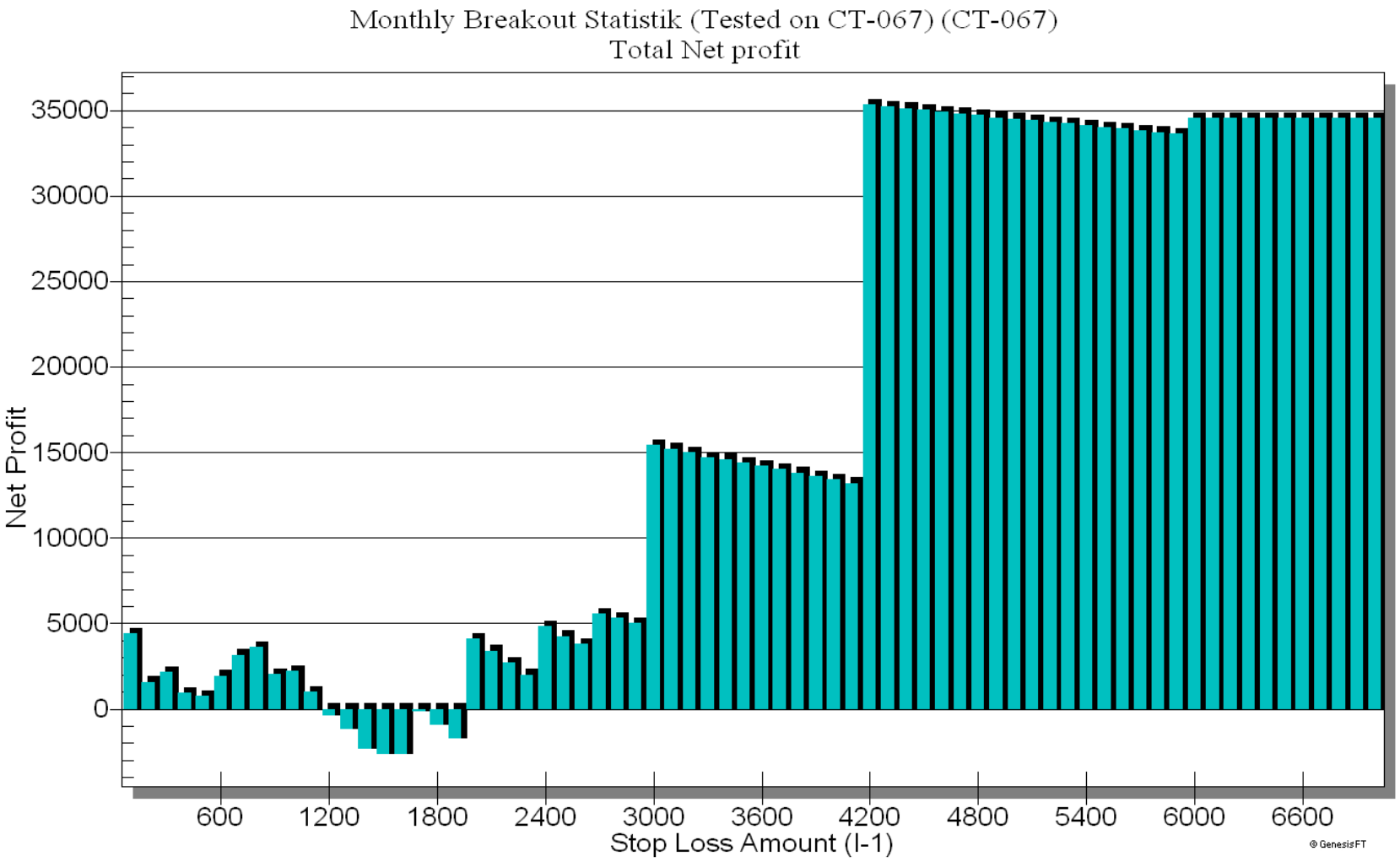
- (zu hohe) Zeitintensität
- Realtimekurse benötigt (Kosten)
- Software benötigt für z.B. Orderbuchauslesen (Kosten)
- Verfügbarkeit von Informationen (speziell bei fundamental basierter Vorgehensweise) (Kosten)
- Interpretationsspielraum (bei Formationen, Wirtschaftsdaten)
- Fehlende statistische Ausarbeitung von Stopp, Haltedauer und Exit (man ist voll im Zufall)

Exkurs Stopps und Ausstiege

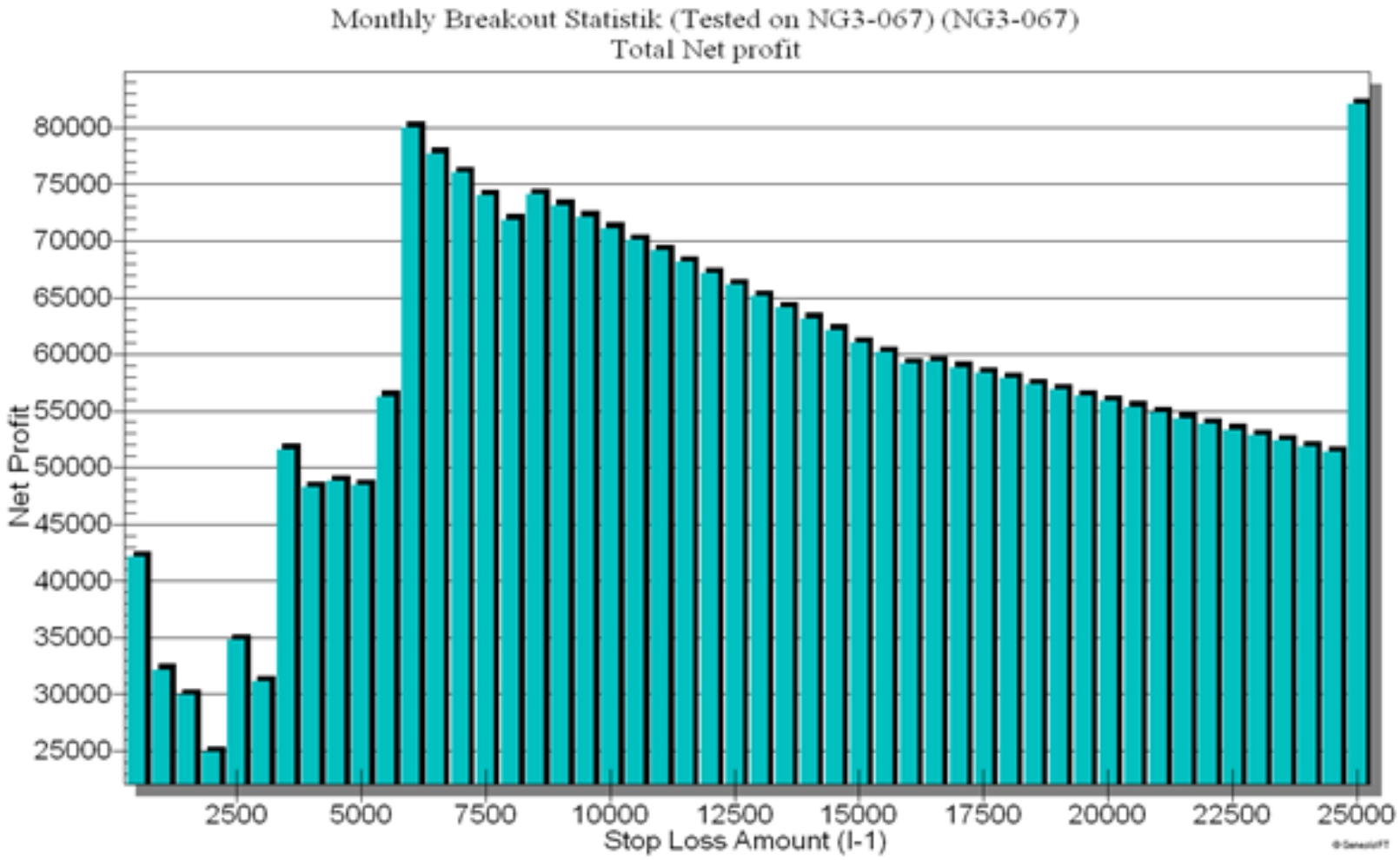
Wer niemals selbst ein Backtesting, und damit eine statistische Untersuchung von Marktverhalten und den darauf angewandten (möglichen) Strategien gemacht hat, kann gar nicht wissen, wie sensibel und eben nicht egal die Komponenten des Stopps und des Ausstiegs sind.

Trading muss man sich im Grunde mathematisch vorstellen, wie zwei Lostöpfe, die man zusammen kippt in einen dritten Topf, aus dem man dann zieht. Es sind zwingend auch Nieten dabei. Und die Kunst besteht darin, a) nicht noch mehr Nieten in den Topf hinein zu kippen, als ohnehin schon darin vorhanden sind, und b) nicht von den Gewinnerlosen einen Großteil versehentlich zu zerreißen

Cotton Long (2) – Stopp 4.800 $ (9,6 Pkt) - 1 Monat



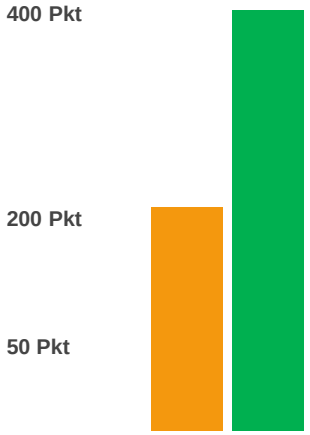
Es gibt bei einer wirklichen Strategie immer sinnvolle, notwendige Stopps



Die Grafik links zeigt, wie sich die Ergebnisse eines Ansatzes (z.B. Ausbruch über Hoch X, gehalten über Y Tage) bei verschiedenen Stopp-Größen verändern. Auf Deutsch: Was kommt raus, wenn ich in meinem Trading-Setup mit einem Stopp von ….. arbeite?

Du siehst sofort, dass es nicht nur nicht egal ist, mit welchem Stopp Du arbeitest, sondern dass es sogar riesige Unterschiede ausmacht. Zu enge Stopps sind Performance-Killer, da man sich so auch die eigentlich guten Trades mit Verlust vom Tisch nimmt. Doch wer glaubt, die Lösung sei dann, einfach weite Stopps oder gar keine zu verwenden, irrt auch gewaltig. Denn Du siehst, dass ein zu weiter Stopp die Ergebnisse auch wieder verschlechtert. Warum?

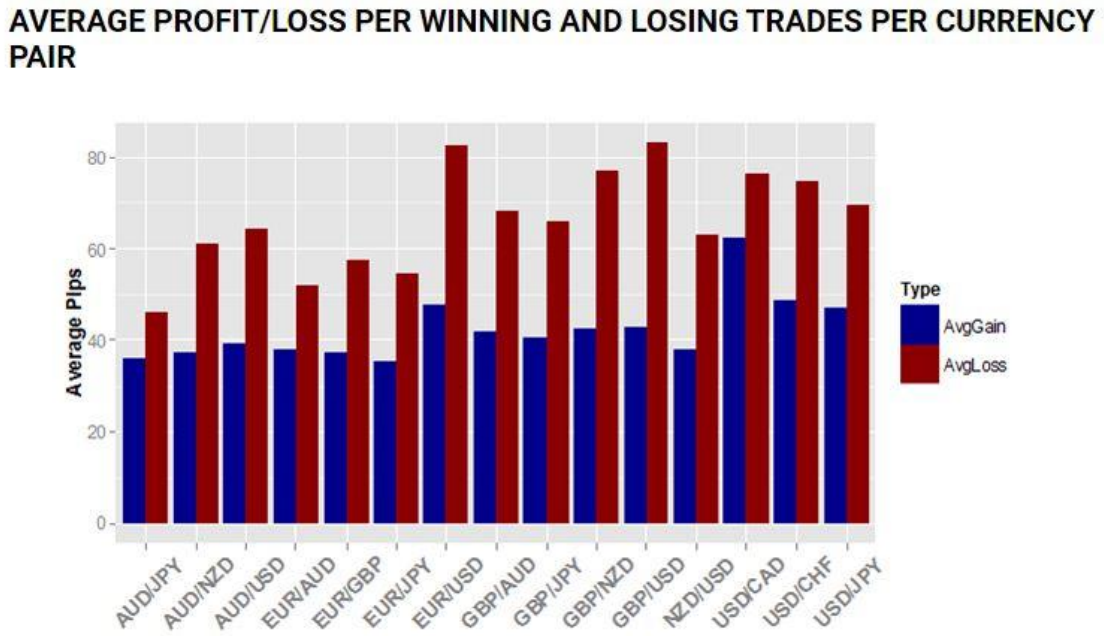
Es gibt bei einer wirklichen Strategie immer sinnvolle, notwendige Stopps

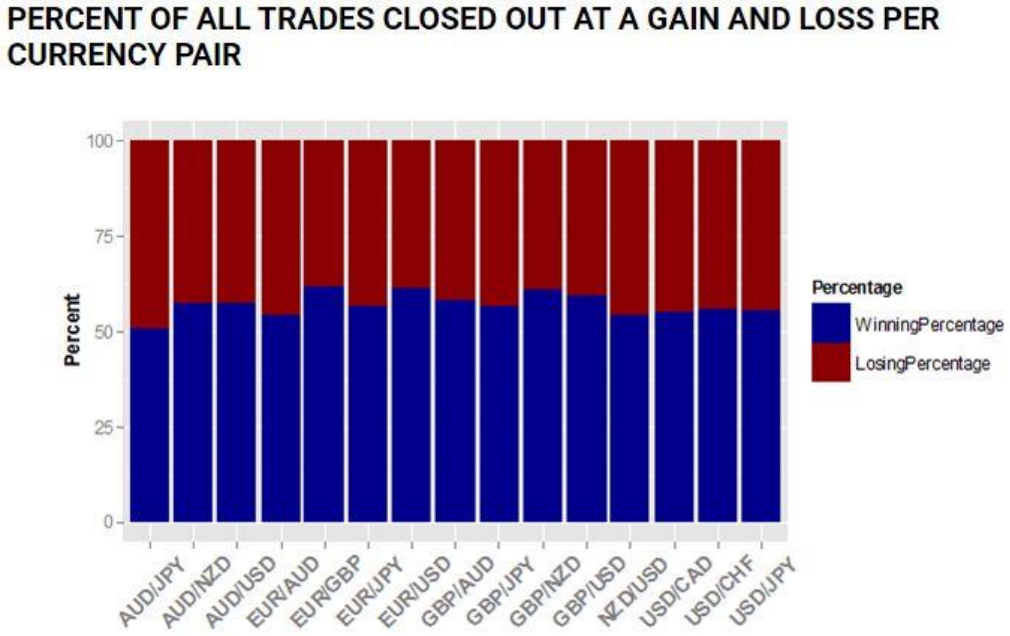


Warum?
Jeder potenziellen Handlung, die durch ein Regelwerk definiert und messbar gemacht wird, ist mathematisch betrachtet ein Potenzial zugeordnet.

Wenn wir z.B. sagen „Dienstags handeln wir Long im DAX“, weil wir gesehen haben, dass der Markt an diesem Tag historisch am meisten zulegt, dann können (und sollten) wir messen, wie viel der DAX an Dienstagen im Schnitt und maximal zulegt. Wenn dabei rauskommt, dass er noch nie mehr als 400 Punkte zulegte, macht es kein Sinn, ein Exitziel von 500 Punkten zu setzen. Und wenn wir sehen, dass er im Schnitt um 200 Pkt zulegt, dann ist es fatal, wenn wir ein Gewinnziel bei 50 Punkten setzen. Wir schreddern damit den Erwartungswert/das Potenzial.

Was wir verstanden haben müssen über den Ausstieg/die Haltedauer





Den Markt musst Du Dir vorstellen, wie eine Kuh, die Milch gibt. Und wir sind die Farmer, die sie melken können. Sie (der Markt) gibt aber nicht unendlich und auch nicht immer Milch. Also muss ich meinen Eimer (Trades/investiert sein) zur rechten Zeit und lange genug unter den Euter halten. Habe ich keinen Eimer (pausieren), kriege ich keine Milch (Gewinne). Ziehe ich den Eimer nach den ersten Tropfen weg, reicht die Menge nicht aus, um sich davon zu ernähren.

Bei der Haltedauer ist keinerlei Platz für Willkür. Genau das denken aber viele. Das wäre nur so, wenn wir ständig Treffer haben und diese endlos Potenzial hätten. Ansonsten muss ich aber verstehen, dass jeder gute Trade gewisse Opportunitätskosten (Verluste, Kommissionen) hat, die gegenfinanziert sein wollen. Schließe ich also einen der Gewinner viel zu früh, reicht es nicht aus, um ein System profitabel zu machen. Ich muss also meine Regeln so ansetzen, dass ich am Ende einer großen Anzahl von Trades ein deutlich positives Ergebnis haben kann. Die Verluste kann ich nicht vermeiden. Und ich muss die Stopps an der Markt-Vola ausrichten, kann sie also nicht zu klein wählen, da ich sonst bei potenzialträchtigen Trades im Verlust rausfliege. Also MUSS ich die Gewinner groß genug werden lassen. Das impliziert aber auch, dass Trades, die im Plus waren auch den Buchgewinn wieder abgeben werden. Damit muss ich OK sein.

Es gibt im wesentlichen zwei Arten von Auszahlungsprofilen

- **Hohe Trefferquoten,**
  dafür aber kleine(re) Einzelgewinne

Frustpotenzial, da einzelne größere Verlierer/Serien einen gefühlt weit zurückwerfen

Gefühl, dass es sich kaum lohnt

- **Geringe Trefferquoten,**
  dafür aber hohe Einzelgewinne

Für die wenigsten umsetzbar, da man relativ oft falsch liegt, es sich lange nicht lohnt, und die wenigen großen Gewinner dann das Ruder herumreißen

Gefühl, nicht voran zu kommen

Du kannst **Deinen Tradingansatz** (also das Regelwerk) **NICHT losgelöst** von der **Exekutive** sehen!

Was Du **machen musst** (gemäß Regelwerk/Ansatz) und was Du **machen kannst** (zeitlich, mentale Belastbarkeit, Kontogröße) **muss zwingend kongruent sein!**

Wir tragen die Erfolgsfaktoren verschiedener Ansätze zusammen

- Gutes Timing
- Trend
- Längere Haltedauern
- Gewinne laufen lassen
- Geringe Fixkosten (Realtimedaten, teure Softwares, relativ wenig Ordergebühren)
- Streuung
- Fundamentale Effekte von Preisschocks
- Zeitschonende, planbare Umsetzung
- Dauerhafte Anwendung (Gesetz der großen Zahlen)
- Lückenlose, disziplinierte Umsetzung
- Einfachheit und daraus resultierende Stabilität
- Kalkulierbarkeit von Risiken
- Skalierbarkeit

Vor- und Nachteile saisonal-zyklischer Ansätze

- Fundamentale Basis
- Nutzt Regelmäßigkeiten
- Planbar
- Klarer Rahmen für einen Trade

- Starres Konzept
- Entwicklung der Vergangenheit als alleinige Grundlage
- Keine Berücksichtigung des aktuellen Preises
- Relativ seltener Handel (1x per anno)

Vor- und Nachteile von Trend/Breakouthandel

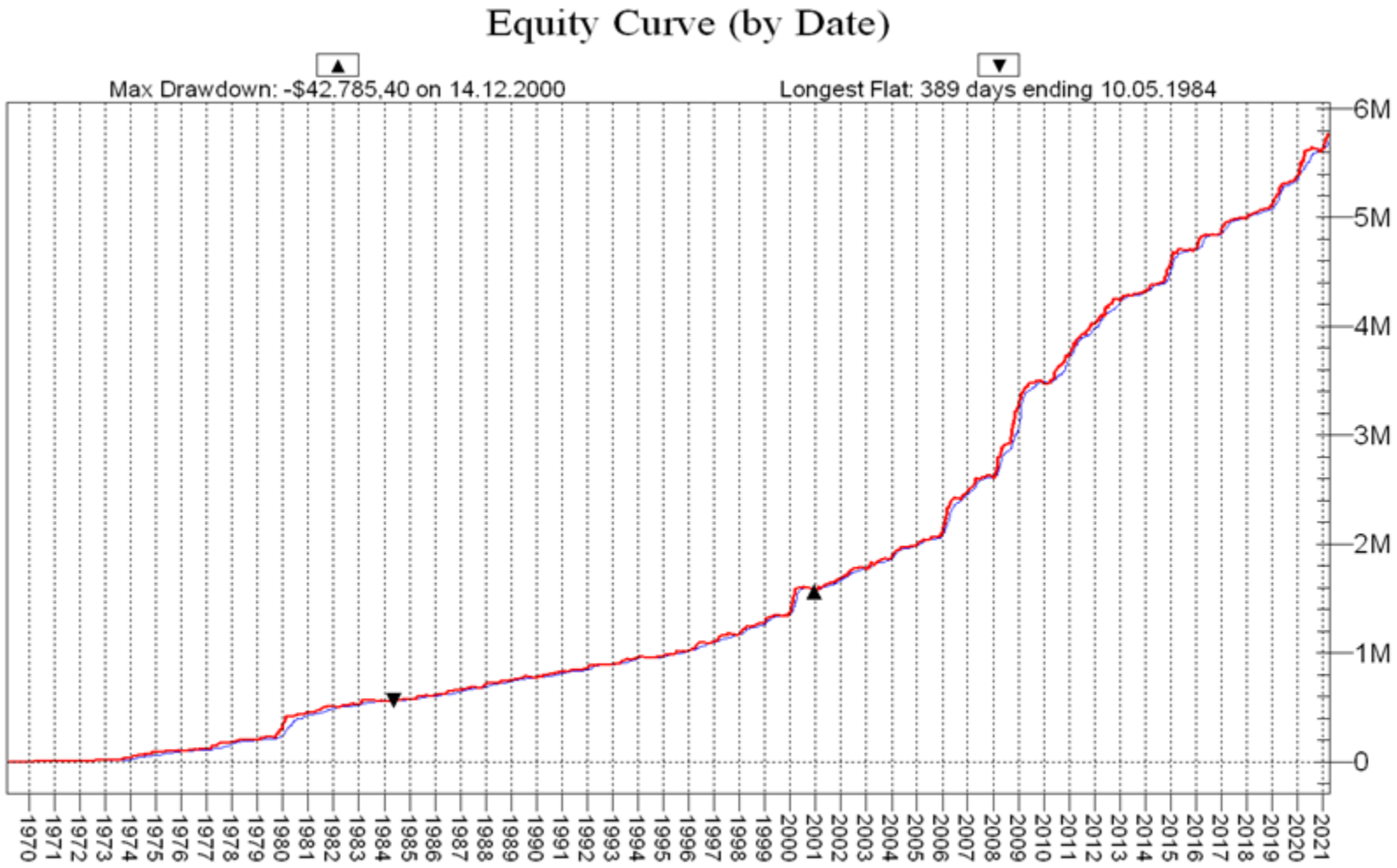
- Dynamisches Konzept
- Berücksichtigt den aktuellen Preis
- Längere Haltedauern
- Einzelne Gewinne werden sehr groß

- Kein Zeitfilter
- Viele Fehlversuche mangels weiterer Filter (nur 30% Treffer)
- Pareto-Prinzip (20% der Trades machen 80% d. Performance)
- Zeitintensiv, da adhoc Signale auftreten können

Es braucht:

✓ Die Kenntnis, WANN überhaupt Ausbrüche einen klar positiven Erwartungswert haben
✓ In welche Richtung sie diesen pos. Erwartungswert haben (das ist zwingend notwendig)
✓ Wo der Stopp zu sitzen hat, um den Vorteil zu schützen, und ihn nicht zu zerstören
✓ Wie lange man halten sollte (da kann viel falsch gemacht werden, wenn es nicht statistisch basiert ist)
✓ Breite Streuung, um stetig Geld zu verdienen (sonst befeuert das Undiszipliniertheit!)

Equity ALLER PowerBreakout-Setups als Portfolio seit 1970



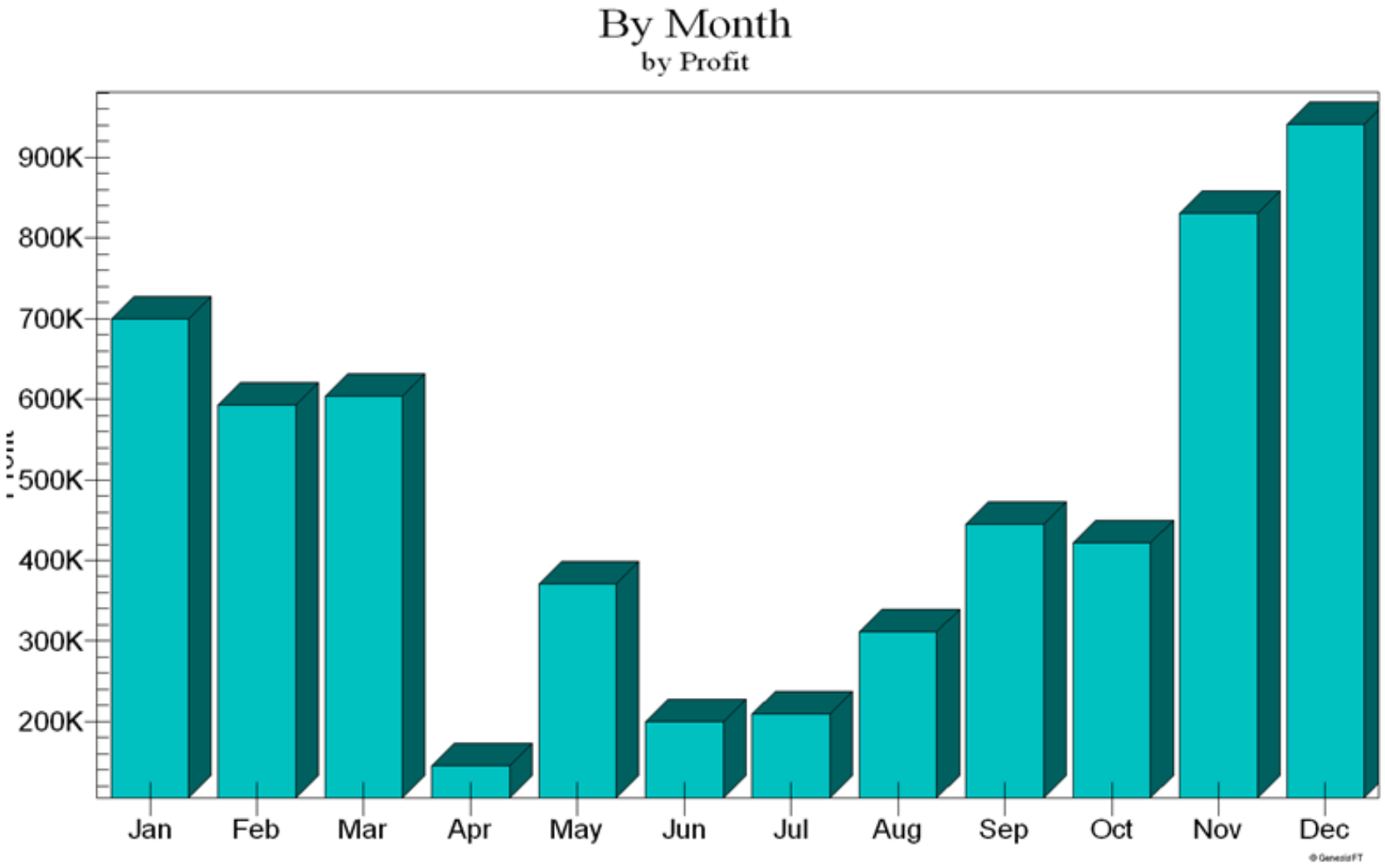
Summary - All Trades

Overall			
Total Net Profit:	$5.771.713	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**3,76**
Total Trades:	2.747	Winning Percentage:	64,7%
Average Trade:	$2.101	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	2,05
Max Closed-out Drawdown:	-$42.785	CPC Index (PF x Win% x PR):	4,99
Max Intra-trade Drawdown:	-$50.874	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	97,40%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$50.296	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	47,52%
Percent in the Market:	5,6%	Optimal f:	0,98
Avg # of Bars in Trade:	29,03	Z-Score (W/L Predictability):	-10,0
Avg # of Trades per Year:	52,7	Current Streak:	1 Losses
Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$9.235	Monthly Sharpe Ratio:	0,50
Std Dev of Monthly Profits:	$18.462	Annualized Sharpe Ratio:	1,73
		Calmar Ratio:	2,18
Winning Trades		**Losing Trades**	
Total Winners:	1.778	Total Losers:	969
Gross Profit:	$7.862.012	Gross Loss:	-$2.090.300
Average Win:	$4.422	Average Loss:	-$2.157
Largest Win:	$67.318	Largest Loss:	-$15.020
Largest Drawdown in Win:	-$29.850	Largest Peak in Loss:	$30.360
Avg Drawdown in Win:	-$1.347	Avg Peak in Loss:	$1.608
Avg Run Up in Win:	$6.172	Avg Run Up in Loss:	$1.608
Avg Run Down in Win:	-$1.347	Avg Run Down in Loss:	-$2.957
Most Consec Wins:	30	Most Consec Losses:	10
Avg # of Consec Wins:	3,51	Avg # of Consec Losses:	1,91
Avg # of Bars in Wins:	31,69	Avg # of Bars in Losses:	24,14

© GenesisFT

Binnen 5 Dekaden wurde im Future **OHNE** Wiedereinsatz des Kapitals (es wurde fortwährend mit einem Kontrakt) gehnadelt. Mit Zinseszins würde man ein Vielfaches verdient haben, da dann beispielsweise bei einem Kontostand von 1 Million auch das Zehnfache an Stücken gehandelt werden würde. Du siehst in der Equity also den reinen Effekt des Ansatzes, ohne Zinseszins.

Monatsverteilung der PowerBreakout-Performance



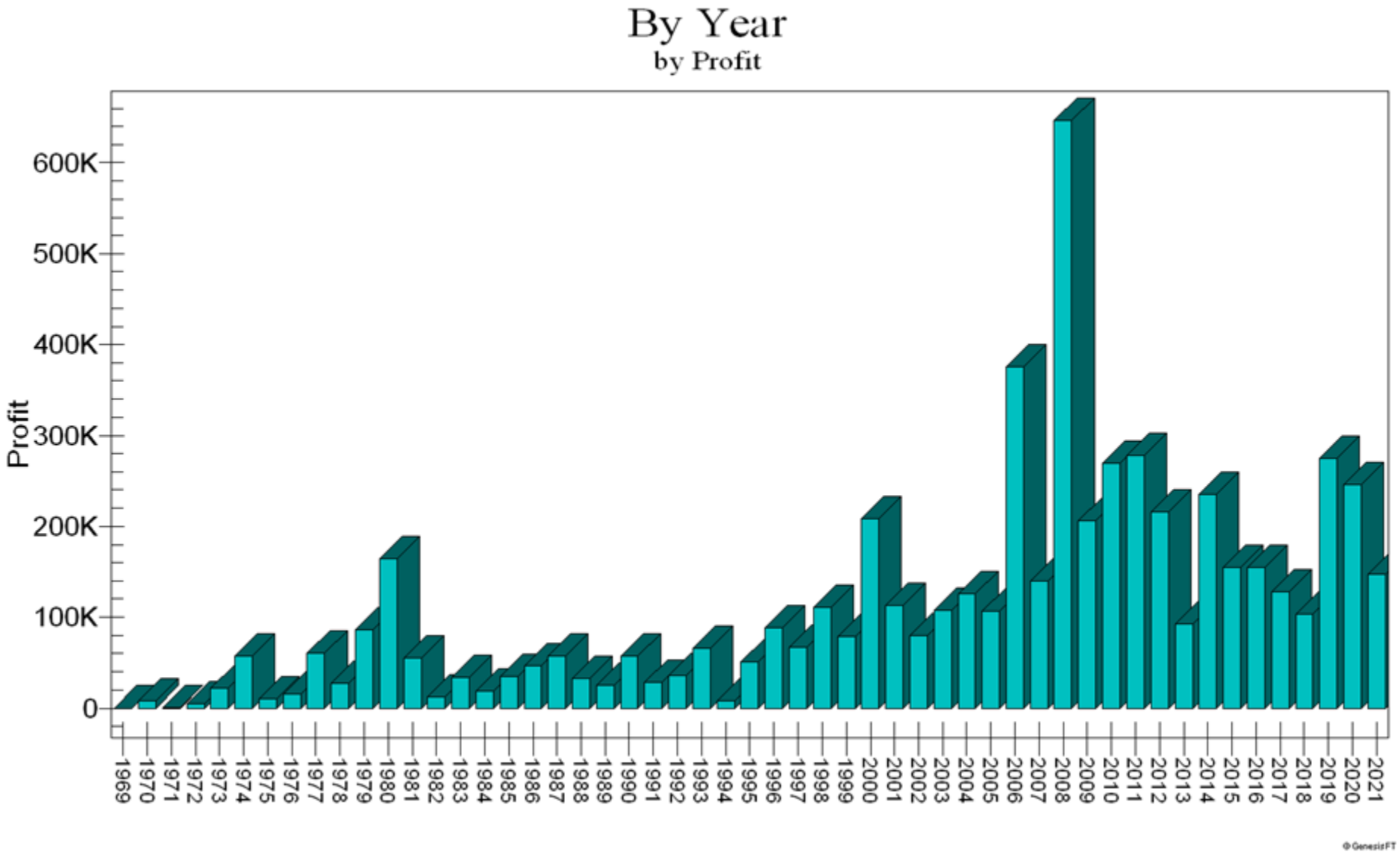
Binnen 5 Dekaden verteilten sich die Anteile der einzelnen Monate an der Gesamt-Performance des PowerBreakout-Portfolios wie in der Grafik dargestellt.

Bei über 140 Orders per anno erwirtschaftete der Ansatz (ohne Wiedereinsatz der Gewinne) durchschnittlich 115.434 $ pro Jahr.

Wer mit Futures handelt, sollte unserer Erfahrung nach mit 100.000 $ starten, auch, wenn 50.000 $ gemäß Historie ausgereicht hätten.

Wer mit skalierbaren Produkten (Hebelzertifikate/ CFD´s) agiert, kann bereits mit 10.000 $ starten.

Equity ALLER PowerBreakout-Setups als Portfolio seit 1970



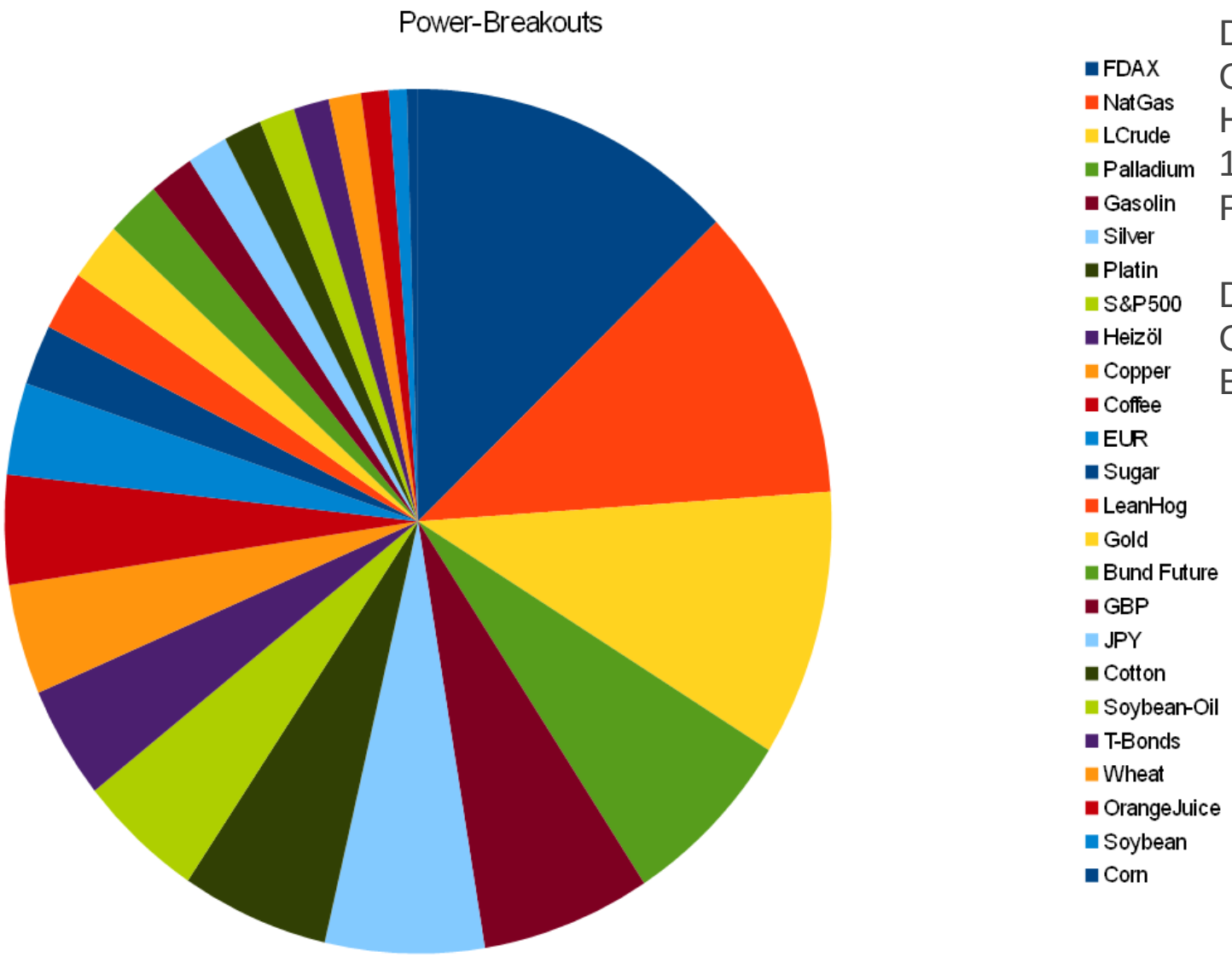
Die Aufschlüsselung der Jahresergebnisse seit 1970 zeigt, dass außer in zwei Jahren, die nahezu plus/minus Null endeten (1969 und 1971, letzteres verlor -110$) in jedem Jahr mit dem Portfolio Geld verdient werden konnte.

Eine solche Stetigkeit kennt man von anderen Systematiken nicht. Hier kommen aber starke fundamentale Logik und eine breite Streuung positiv zum Tragen.

Im Durchschnitt machte das Portfolio pro Jahr 115.000$ Gewinn.

Anteil der versch. Märkte an der Performance seit 1970

FDAX	740149
NatGas	639530
LCrude	575820
Palladium	398680
Gasolin	382302
Silver	358805
Platin	332810
S&P500	282819
Heizöl	243370
Copper	238529
Coffee	236101
EUR	198275
Sugar	130263
LeanHog	128280
Gold	125960
Bund Future	122540
GBP	100589
JPY	91432
Cotton	85250
Soybean-Oil	80112
T-Bonds	79638
Wheat	73018
OrangeJuice	62136
Soybean	40400
Corn	24915



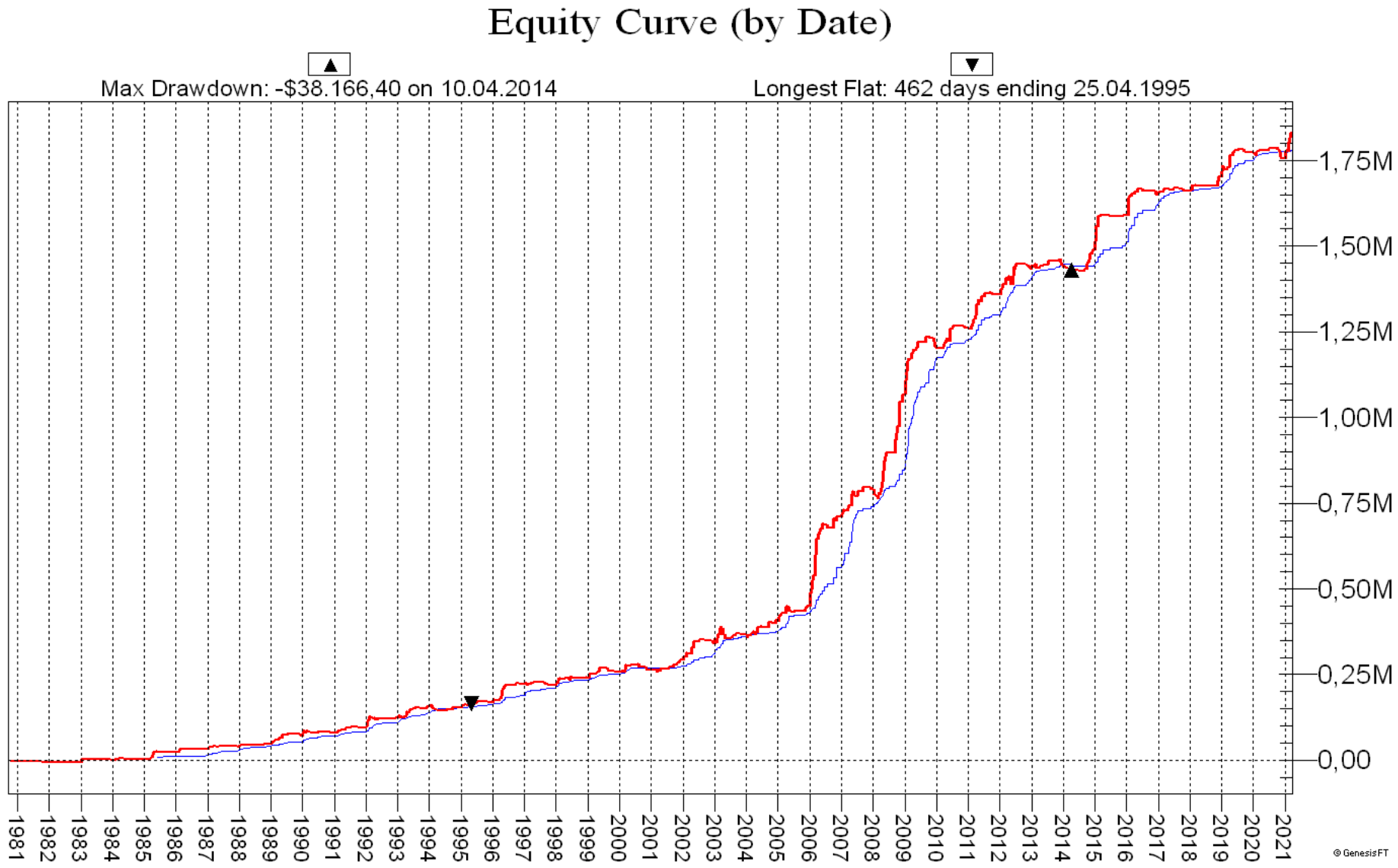
Den größten Anteil an der Gesamt-Performance in der Historie der PowerBreakouts seit 1970 haben der DAX, Erdgas, Rohöl und Palladium.

Den geringsten Anteil haben die Getreide, Orangensaft und der T-Bond.

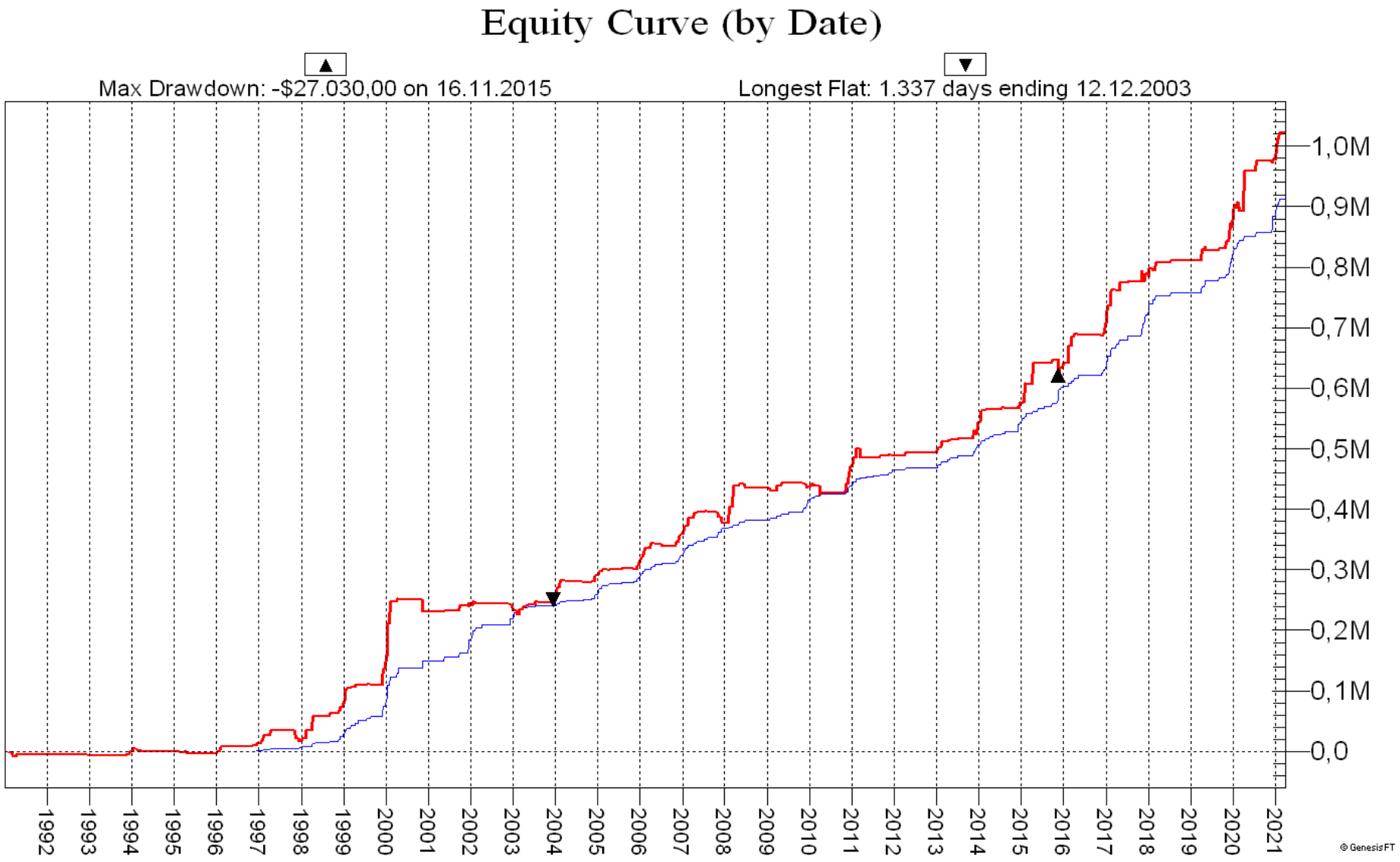
Anteil der versch. Märkte an der Performance seit 1970

FDAX	740149	skalierbar
NatGas	639530	Skalierbar
LCrude	575820	Skalierbar
Palladium	398680	
Gasolin	382302	
Silver	358805	Skalierbar
Platin	332810	
S&P500	282819	Skalierbar
Heizöl	243370	
Copper	238529	Skalierbar
Coffee	236101	
EUR	198275	Skalierbar
Sugar	130263	Keine Skalierung notwendig
LeanHog	128280	Keine Skalierung notwendig
Gold	125960	Skalierbar
Bund Future	122540	
GBP	100589	Skalierbar
JPY	91432	Skalierbar
Cotton	85250	
Soybean-Oil	80112	
T-Bonds	79638	
Wheat	73018	Skalierbar
OrangeJuice	62136	Keine Skalierung notwendig
Soybean	40400	Skalierbar
Corn	24915	skalierbar

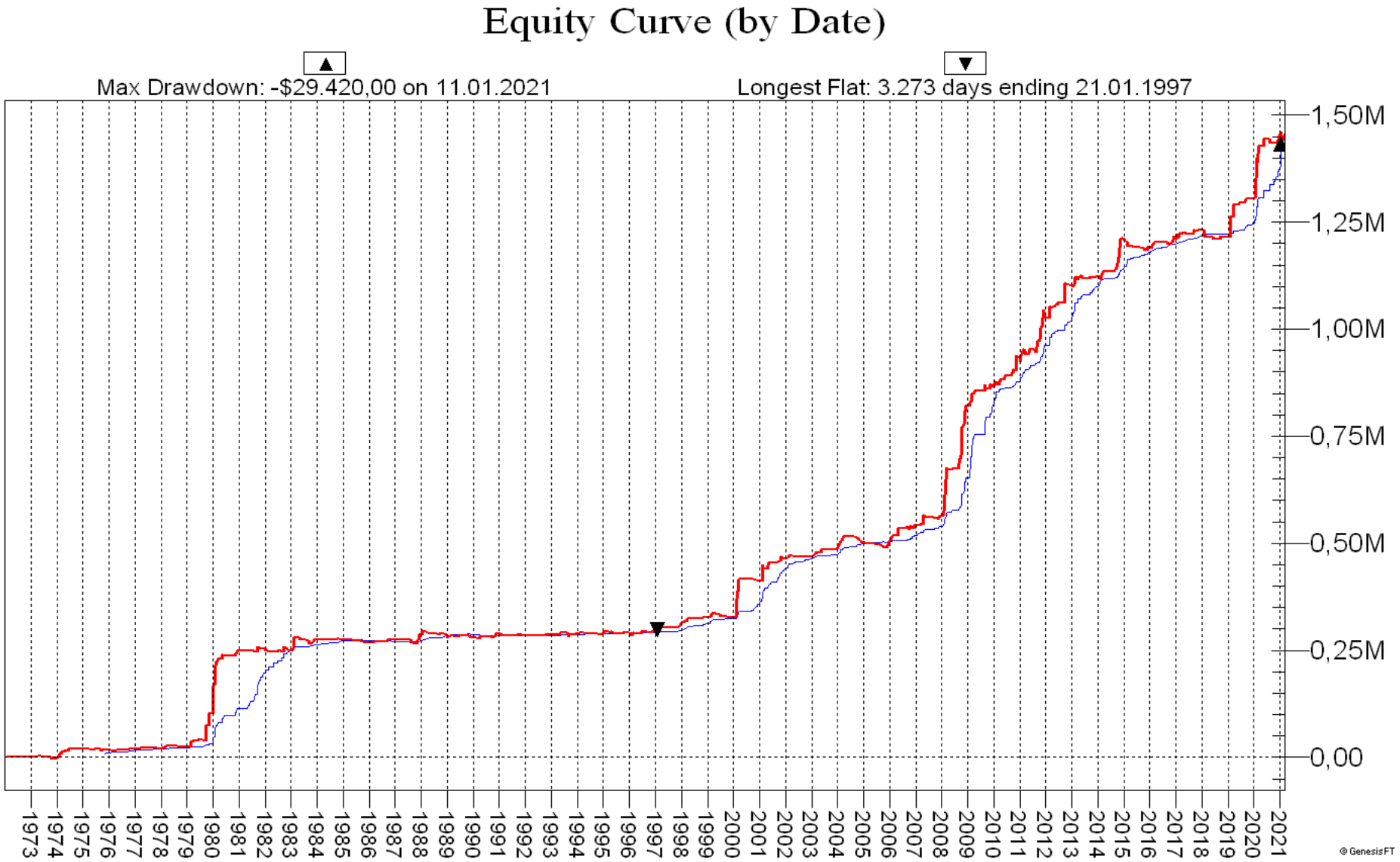
Energies only Equity



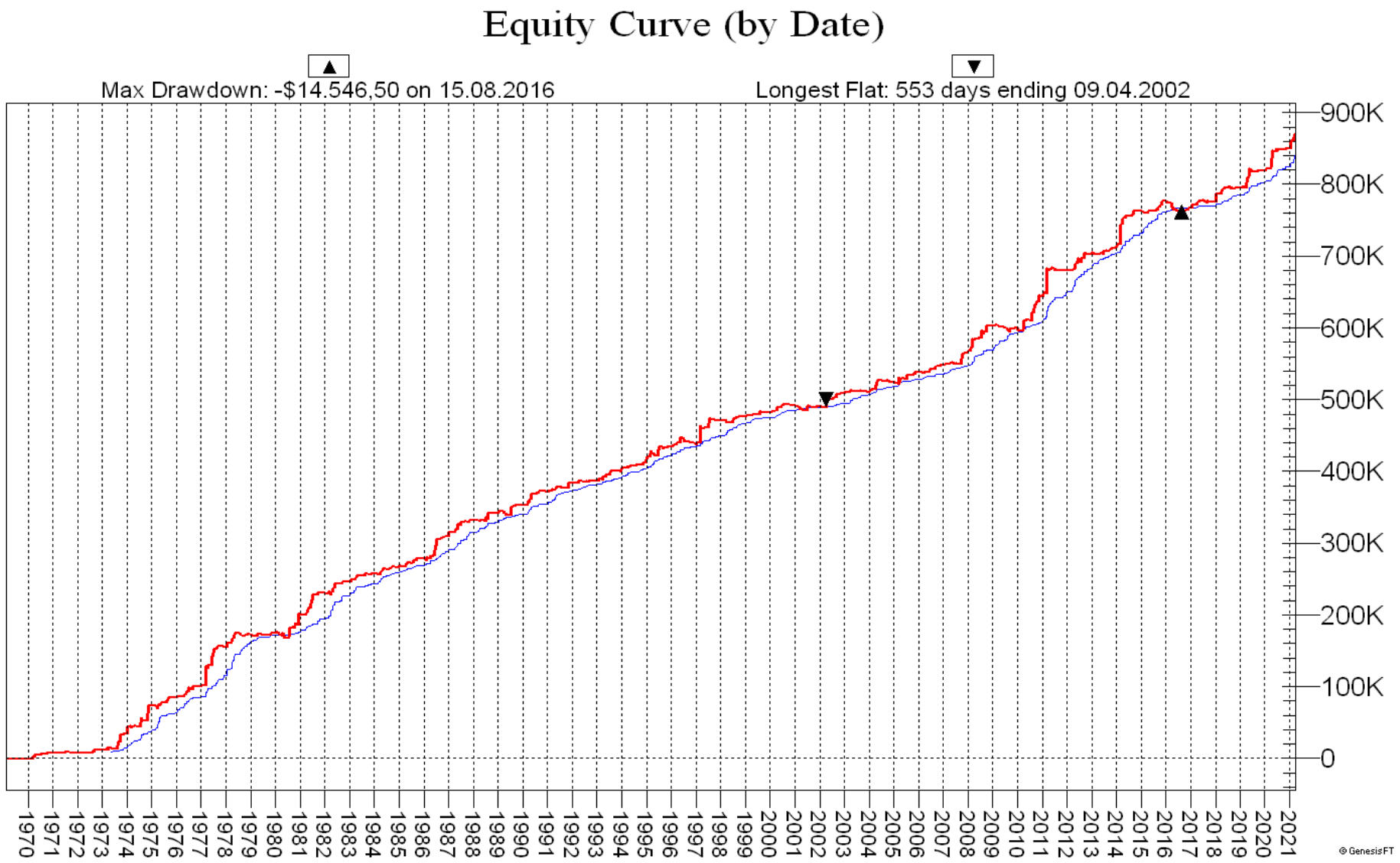
Indizes only Equity



Metalle only Equity



Agrar-Rohstoffe only Equity



Der Anteil der Agrar-Rohstoffe an der Gesamt-Performance ist nominal zwar am kleinsten. Doch das liegt vor allem daran, dass die Energies, aber auch die Indizes (unskaliert) sehr wuchtig sind.

Ggü. Den Metallen performen die Agrar-Rohstoffe viel stetiger UND verursachen weniger Schwankungen (siehe Max Draw Down). Es kann sich anbieten, hier die Gewichtung etwas zu erhöhen.

Warum Ausbruchs- und Trendhandel in der Praxis meist scheitert

- Kapitaldecke begrenzt
- Die mentale Belastbarkeit (Frusttoleranz) des Traders ist sehr limitiert
- Klassisch angewendet erwischt der Trader zu viel Rauschen, sprich Phasen, in denen es gar keinen Trend gibt
- Fehlerquote naturgemäß 66-70%
- Zu kleine Zeitebenen (damit keine Signifikanz) wegen Kontrollwahn
- Faktor Zeit: Es ist gar nicht realisierbar, nebenberuflich aktives Breakout-Trading zu betreiben auf 60min-Ebene z.B.

Wie lösen wir dieses Problem?

- ✓ Es braucht Wissen, WANN Breakouts und infolge derer Trends sehr wahrscheinlich sind
- ✓ Dazu müssen wir verstehen, dass die Chancen am Markt nicht ständig gleich sind
- ✓ Im Gegenteil: JEDER!!! Markt hat Zeiten, in denen er aus fundamentalen Gründen sensibler für Preisschocks (Trends) ist.
- ✓ Erntephasen, Wetter, Pflanzzeiten (für Rohstoffe)
- ✓ Steuerstichtage, Carry-Trades, Wirtschaftszyklen (saisonal typische Nachfrage) für Indizes, Währungen, Anleihen

Warum Ausbruchs- und Trendhandel in der Praxis meist scheitert

Für mich ist dieses Konzept revolutionär. Denn mit diesem Konzept gelingt es, aus einer Fehlerquote von 66-70% eine Trefferquote von 66 bis 75% zu machen – und das beim Breakout-Handel!

Das WANN ist entscheidend!

Um das Breakout-Trading **effizient und damit lohnend** zu gestalten, muss ich wissen, **WANN** ich die Technik anwende. Andernfalls wäre es so, wie wenn sie wissen „ich muss mit dem Zug fahren, um von Frankfurt nach Köln zu gelangen“, aber wissen nicht, welchen Zug sie nehmen, und **WANN** dieser fährt.

Ein paar Tipps

Die hier ausgearbeiteten Stopps sind sorgfältig ausgearbeitet und auf Robustheit getrimmt, wie Du selbst sehen wirst. Aber es schadet nicht, ein bisschen aufzurunden, wenn Du die Setups aktiv nutzt. Zum Beispiel, wenn ein Stopp bei 52 Punkten liegen soll, mache ich daraus eher 60. Es geht grundsätzlich darum, den statistisch-fundamentalen Vorteil zu schützen. Also lieber etwas mehr Leine lassen, als hier vorgegeben.

Respektiere die Zeitfenster, und fang nicht an, sie zu dehnen!

Wenn Du mit Derivaten handelst, nimm etwas mehr Puffer beim Einstieg, damit Du auch sicher erst bei einem Ausbruch einsteigst. Idealerweise nimm es manuell vor.

Achte bei den vorgestellten Auswertungen und Strategien auch auf elementare Aussagen, die Du aus den Ergebnissen ziehen kannst. Zum Beispiel, welche Seite in welchem Markt sauberer läuft, und welche Haltedauern ggf. für eine spezifische Handelsrichtung nur sehr kurz geeignet ist. So kannst Du auch in Deinem Trading außerhalb dieser PowerBreakouts die Fehlerquote reduzieren.

Informationen

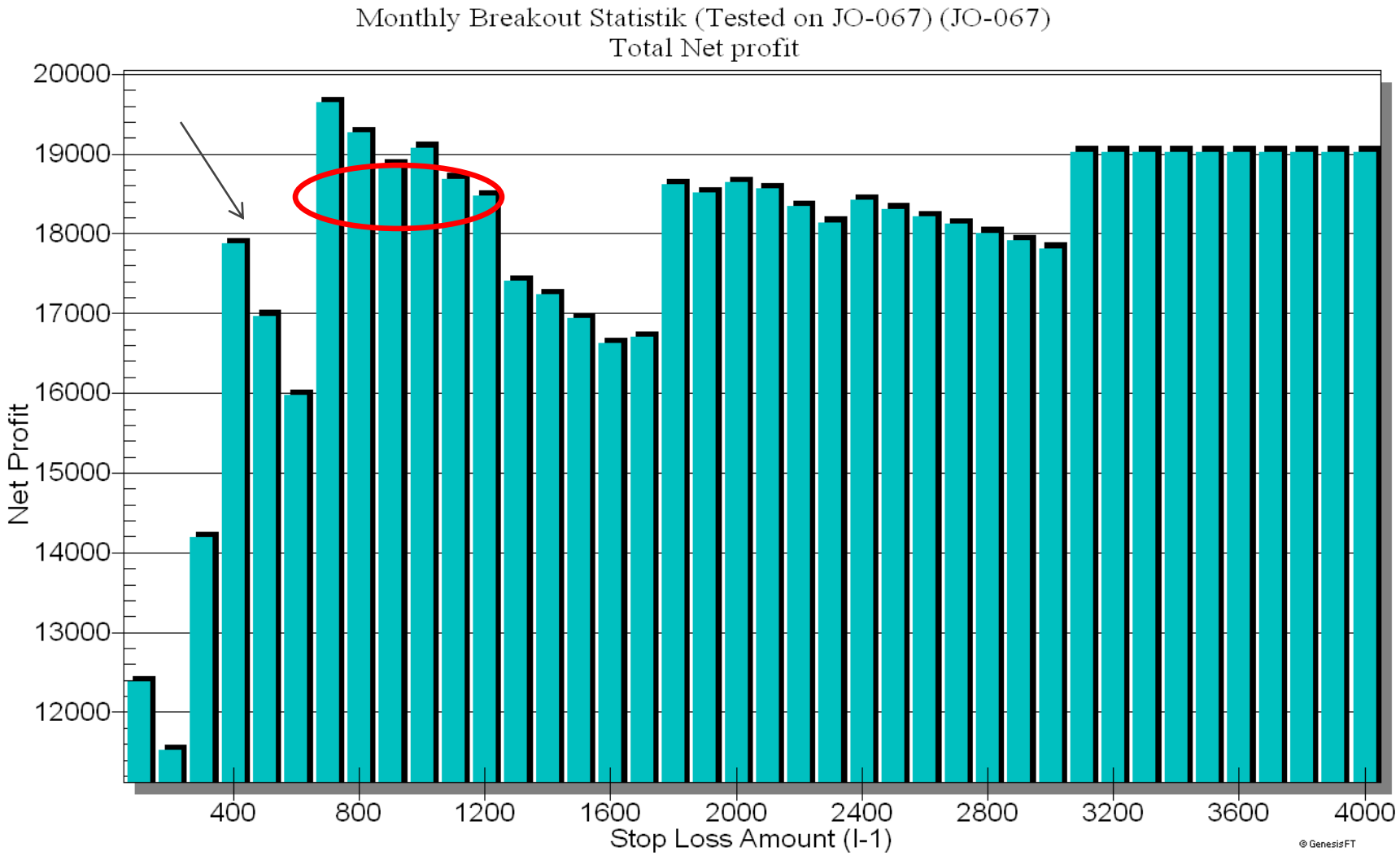
Bei 1 Monat Haltedauer erfolgt der Ausstieg nach 23 Handelstagen. Exit immer zum Handelsende des x-ten Tages.
Bei 2 Monaten Haltedauer entsprechend nach 46 Handelstagen. Exit immer zum Handelsende des x-ten Tages.

Bitte beachte und verstehe, dass diese Haltedauern die systematische Vorgehensweise abbilden. In diesen Zeitfenstern sind die Trends stark und stabil, sehr zuverlässig also. Es kommt immer wieder vor, dass der eingeschlagene Trend sich danach aber fortsetzt. Jedoch ist das nicht so stabil, und passiert auch oft genug nicht. WENN Du erfahren genug in der Anwendung der Strategien bist, DANN kannst Du hier z.B. eine leicht diskretionäre Note einfließen lassen, indem Du am systematischen Ausstiegstermin lediglich ¾ der Position schließt, den verbleibenden Teil am Einstand absicherst, und versuchst, den Trend weiter zu reiten. Wo Du dann aussteigst ist aber komplett Dir und Deiner Entscheidung überlassen. Hierfür gibt es kein Regelwerk, keine Regelmäßigkeit, nichts, was man systematisch nutzen könnte. Entscheide also selbst, ob Du so vorgehst, und wie Du den Ausstieg dann terminierst. Wichtig ist, dass der überwiegende Teil der Position streng nach Regelwerk gehandelt wird. Denn darauf basiert der statistische Vorteil!

Ausbrüche MÜSSEN im unmittelbar folgenden Monat des relevanten Monats erfolgen. Wenn also der Monat Februar die relevante Range bringt, dann muss der Ausbruch im März erfolgen. Und nur in die Richtung, die hier vorgegeben ist. Tut er dies nicht, wird NICHT gehandelt. Ein späterer Ausbruch hat keine Signalrelevanz. Bedenke dabei, dass diesen Breakouts potenzielle Preisschocks zugrunde liegen, die einen fundamentalen Grund haben (Ernteschäden, Nachfrage-Effekt, Steuerstichtage etc.). Diese Gründe sind an spezifische Zeiten gekoppelt. Damit hätte ein Ausbruch über ein spezifisches Monatshoch/tief 3 oder 4 Monate später überhaupt keinen Sinn!

Orange Juice Long (10)

Die Zahl bezeichnet den Monat, in dem der Ausbruch erfolgt. Ausbrüche erfolgen immer im Folgemonat der Signifikanz-Kerze. Wenn hier also eine 10 steht, handeln wir den Ausbruch aus dem September IM Oktober, und nur im Oktober.



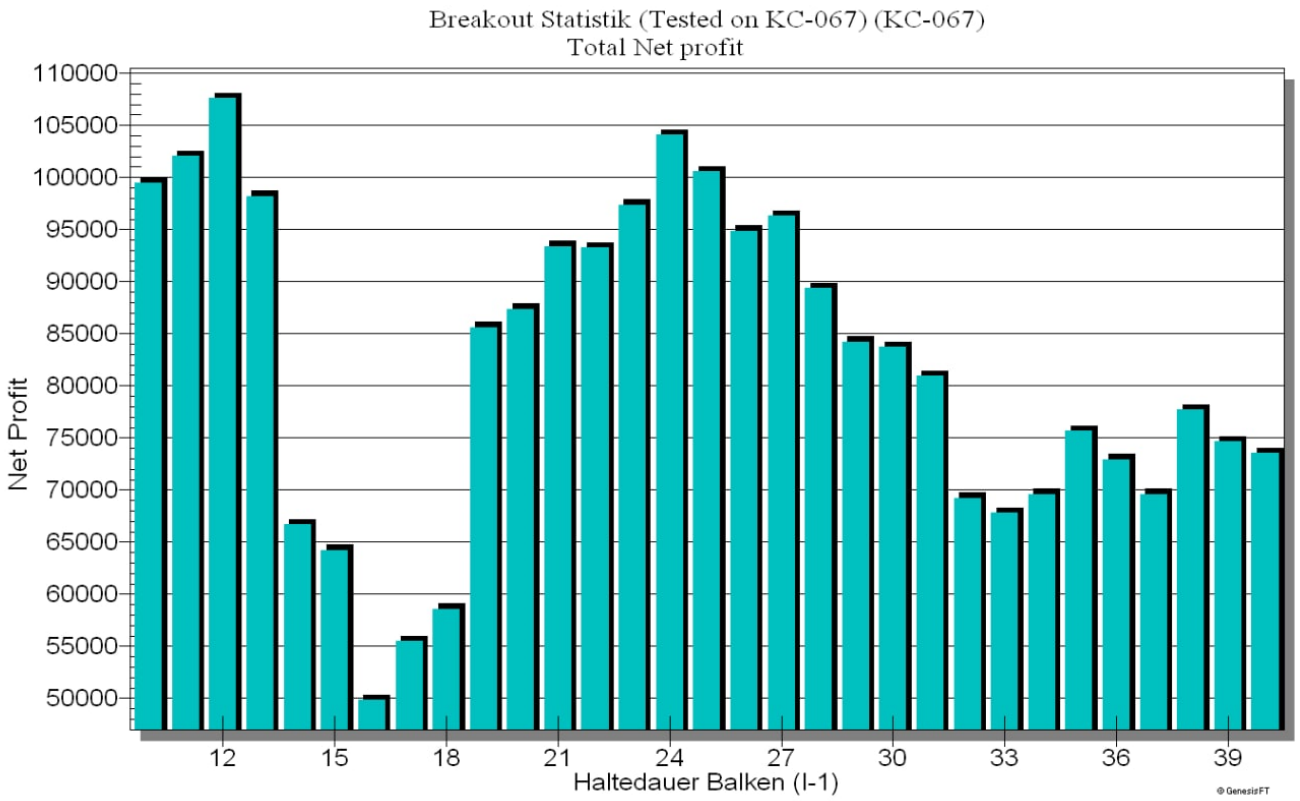
Gehandelt wird LONG im Orange Juice, WENN das Septemberhoch im Oktober überwunden wird.

Der Stopp liegt bei 1000$ im Future, was 6,70 Punkten im Orange Juice entspricht. Wenn der Trade z.B. bei 113,00 ausgelöst wird, muss der Stopp bei 106,30 liegen.

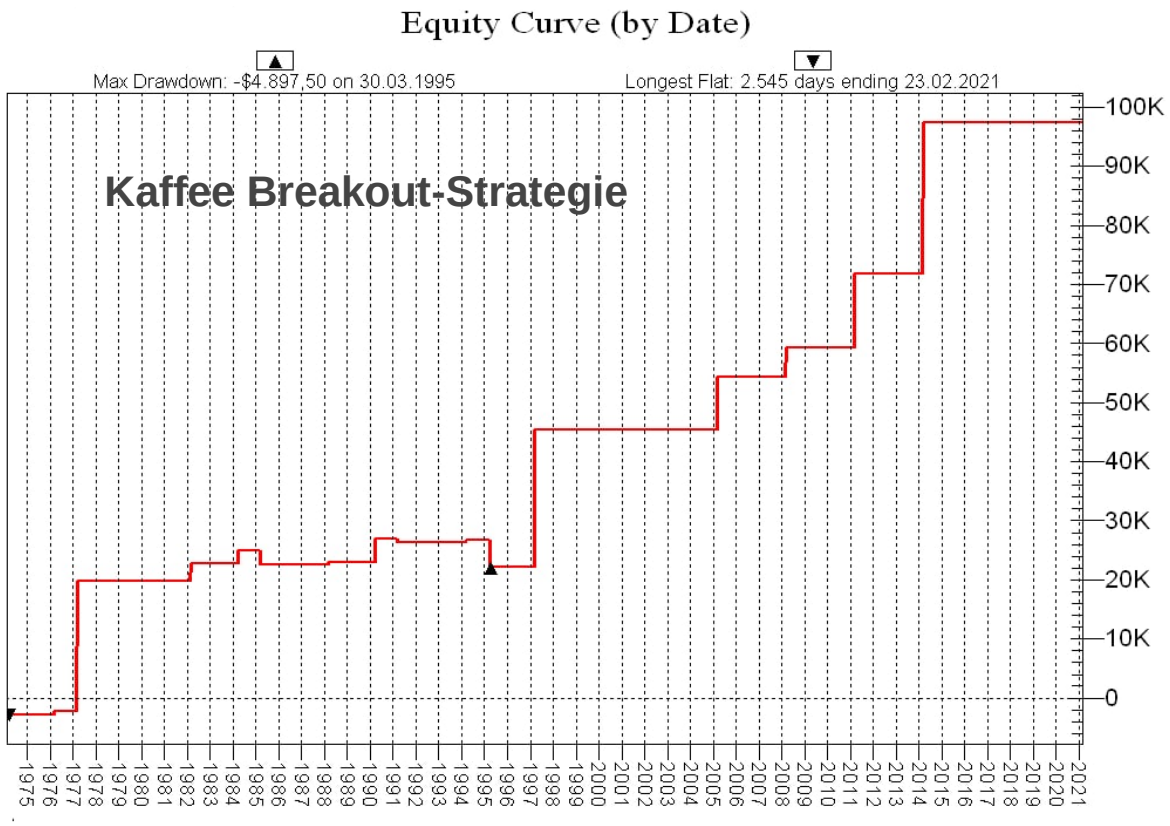
Nach 23 Handelstagen (NICHT Kalendertage!) wird der Trade glattgestellt.

Signifikanz einzelner Ausbruchszeiten innerhalb eines Jahres

Beim Breakout-Trading ist es ganz wichtig, zu wissen, **WANN** man einen Breakout handelt (und es in der restlichen Zeit zu unterlassen). Zu bestimmten Phasen innerhalb eines Jahres ist ein Rohstoff anfälliger/sensibler. Zu wissen, **WANN** man Ausbrüche handelt, ist die **halbe Miete**. Du musst aber auch wissen, **wie lange** Du halten musst (siehe linke Grafik)



Ergebnisse bei verschiedenen Haltedauern (in Handelstagen)

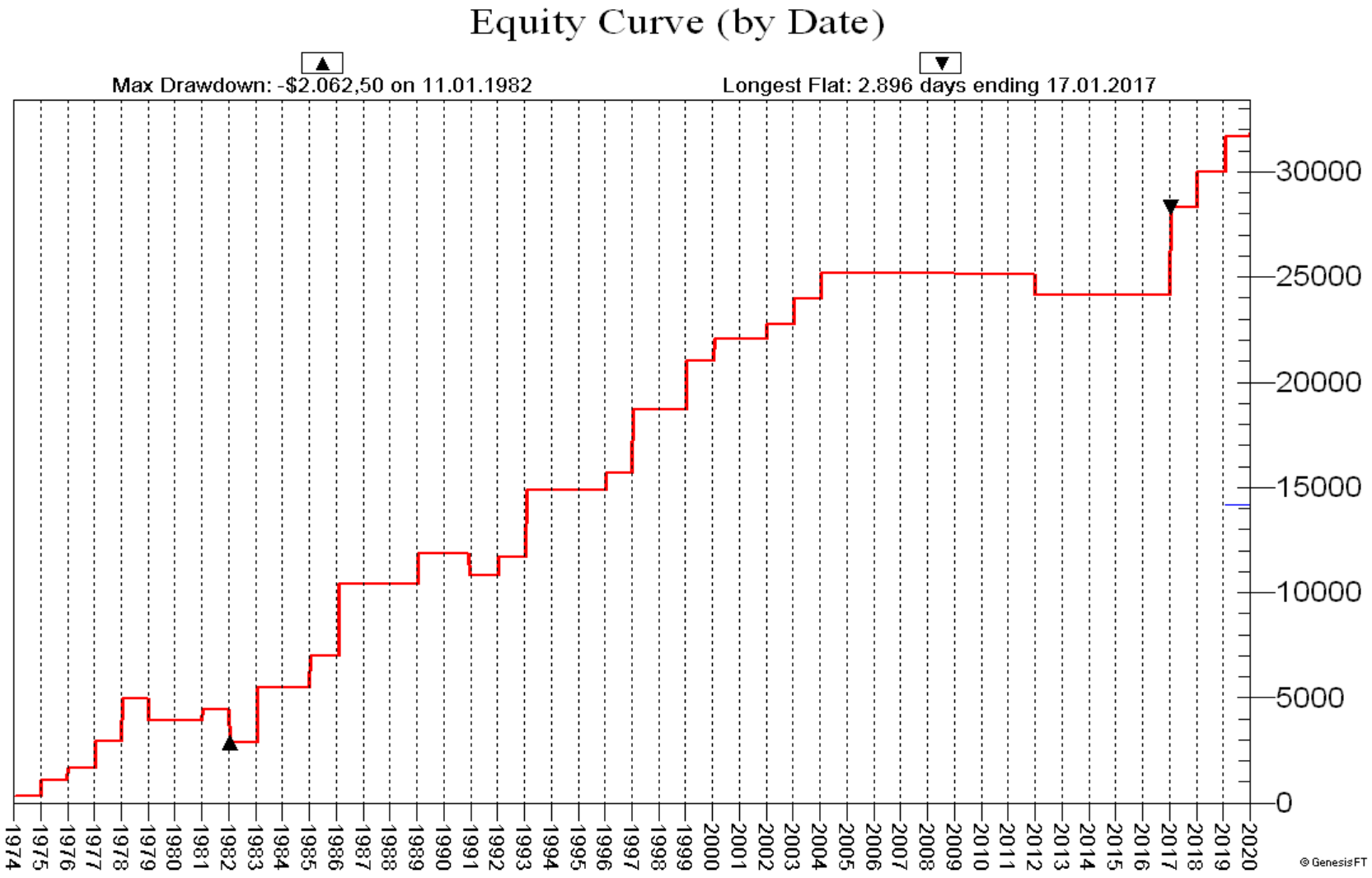


Faktor Zeit als elementarer Filter

- Wir haben gesehen, dass ein und dieselbe Handlung (Ausbruch über/unter Preishoch/-tief) zu unterschiedlichen Zeiten völlig andere Erfolgschancen und Erwartungswerte hat
- Wir MÜSSEN also die guten von den schlechten Zeiten separieren
- Weniger potenzielle Trades im einzelnen Markt
- Wegen der benötigten Preisbestätigung auch manchmal gar kein Trade im einzelnen Markt
- Um stetig zu performen und Risiken zu reduzieren streuen, sprich in 2 Dutzend Märkten
- So gibt es „immer ´was zu tun“ und man muss nie faule Kompromisse eingehen, hält die Qualität hoch

- Haltedauer: Auch hier gibt es eine klar statistische Grundlage, die über 5 Dekaden stabil ist
- Effekte werden binnen 1 und 2 Monaten schnell eingepreist
- Vorteil: Bei verbrieften Produkten schlagen Finanzierungskosten nur moderat zu Buche
- Vorteil: Klarer und einfacher Rahmen für den Trade
- Keine Limitierung der Gewinne durch Gewinnziele (ein fataler Fehler von Tradern naturgemäß)

Gewichtungssteuerung



Eine stetige Equity führt dazu, dass ich die Strategie voller gewichte gegenüber anderen.

Meine Gewichtungskategorien reichen von ¼ bis 4/4, wobei 4/4 eine volle Positionierung bedeutet, während ¼ eine Viertel-Position der normalen Size bedeutet, und 2/4 logischerweise eine halbe Position.

S&P 500 (2 Monate Haltedauer)

Test#/	I-1	Net Profit	Max Drawdown	Return%	Profit Factor	Kelly%	Trades	Avg Trade	Payout	Win%	Large Loss	Avg Loss	Avg Win	Large Win	Wins	Losses
1	1	-7.580 €	(14.858 €)	-25,8%	0,75	-21,9%	14	-541 €	0,41	64,3%	(14.533 €)	(5.963 €)	2.470 €	5.055 €	9	5
		-1.083 €	(26.920 €)	-1,6%	0,96	-2,9%	11	-98 €	0,36	72,7%	(26.920 €)	(9.433 €)	3.402 €	9.043 €	8	3
		8.663 €	(12.195 €)	43,9%	**1,48**	19,5%	15	578 €	0,99	60,0%	(4.395 €)	(3.005 €)	2.966 €	5.043 €	9	6
		3.725 €	(7.903 €)	22,5%	**1,19**	7,5%	15	248 €	1,36	46,7%	(5.545 €)	(2.420 €)	3.298 €	5.393 €	7	8
		26.138 €	(10.350 €)	117,4%	**3,28**	51,0%	15	1.743 €	1,19	73,3%	(7.220 €)	(2.867 €)	3.419 €	15.605 €	11	4
		9.760 €	(15.750 €)	38,0%	**1,45**	15,6%	12	813 €	1,45	50,0%	(9.795 €)	(3.587 €)	5.213 €	13.130 €	6	6
		-8.758 €	(23.758 €)	-24,3%	0,78	-16,3%	16	-547 €	0,60	56,3%	(9.233 €)	(5.561 €)	3.352 €	9.243 €	9	7
		2.418 €	(13.983 €)	8,1%	**1,14**	7,9%	11	220 €	0,65	63,6%	(13.983 €)	(4.286 €)	2.794 €	3.643 €	7	4
		-2.750 €	(14.708 €)	-8,5%	0,92	-5,5%	15	-183 €	0,61	60,0%	(14.708 €)	(5.422 €)	3.309 €	5.118 €	9	6
		38.688 €	(4.458 €)	255,0%	**9,68**	83,7%	15	2.579 €	0,69	93,3%	(4.458 €)	(4.458 €)	3.082 €	10.355 €	14	1
		61.610 €	(7.645 €)	377,5%	**9,06**	83,7%	17	3.624 €	0,57	94,1%	(7.645 €)	(7.645 €)	4.328 €	12.805 €	16	1
		29.203 €	(10.185 €)	158,7%	**2,63**	37,9%	18	1.622 €	1,67	61,1%	(5.570 €)	(2.558 €)	4.282 €	11.205 €	11	7

© Genesis FT

Long

Pyramidisieren (sprich, im Gewinn die Einheiten erhöhen) ist ein Performance-Pusher, lässt sich aber nur anwenden, wenn man eine hochprofitable Grundlage hat, und die wenigen sehr starken Trend-Situationen herauszufiltern vermag. Und genau das ist hiermit auch gegeben.

S&P 500 emini (2 Monate Haltedauer)

Test#	I-1	Net Profit	Max Drawdown	Return%	Profit Factor	Kelly%	Trades	Avg Trade	Payout	Win%	Large Loss	Avg Loss	Avg Win	Large Win	Wins	Losses
1	1	-7.580 €	(14.858 €)	-25,8%	0,75	-21,9%	14	-541 €	0,41	64,3%	(14.533 €)	(5.963 €)	2.470 €	5.055 €	9	5
2	2	-1.083 €	(26.920 €)	-1,6%	0,96	-2,9%	11	-98 €	0,36	72,7%	(26.920 €)	(9.433 €)	3.402 €	9.043 €	8	3
3	3	8.663 €	(12.195 €)	43,9%	**1,48**	19,5%	15	578 €	0,99	60,0%	(4.395 €)	(3.005 €)	2.966 €	5.043 €	9	6
4	4	3.725 €	(7.903 €)	22,5%	**1,19**	7,5%	15	248 €	1,36	46,7%	(5.545 €)	(2.420 €)	3.298 €	5.393 €	7	8
5	5	26.138 €	(10.350 €)	117,4%	**3,28**	51,0%	15	1.743 €	1,19	73,3%	(7.220 €)	(2.867 €)	3.419 €	15.605 €	11	4
6	6	9.760 €	(15.750 €)	38,0%	**1,45**	15,6%	12	813 €	1,45	50,0%	(9.795 €)	(3.587 €)	5.213 €	13.130 €	6	6
7	7	-8.758 €	(23.758 €)	-24,3%	0,78	-16,3%	16	-547 €	0,60	56,3%	(9.233 €)	(5.561 €)	3.352 €	9.243 €	9	7
8	8	2.418 €	(13.983 €)	8,1%	**1,14**	7,9%	11	220 €	0,65	63,6%	(13.983 €)	(4.286 €)	2.794 €	3.643 €	7	4
9	9	-2.750 €	(14.708 €)	-8,5%	0,92	-5,5%	15	-183 €	0,61	60,0%	(14.708 €)	(5.422 €)	3.309 €	5.118 €	9	6
10	10	38.688 €	(4.458 €)	255,0%	**9,68**	83,7%	15	2.579 €	0,69	93,3%	(4.458 €)	(4.458 €)	3.082 €	10.355 €	14	1
11	11	61.610 €	(7.645 €)	377,5%	**9,06**	83,7%	17	3.624 €	0,57	94,1%	(7.645 €)	(7.645 €)	4.328 €	12.805 €	16	1
12	12	29.203 €	(10.185 €)	158,7%	**2,63**	37,9%	18	1.622 €	1,67	61,1%	(5.570 €)	(2.558 €)	4.282 €	11.205 €	11	7

© GenesisFT

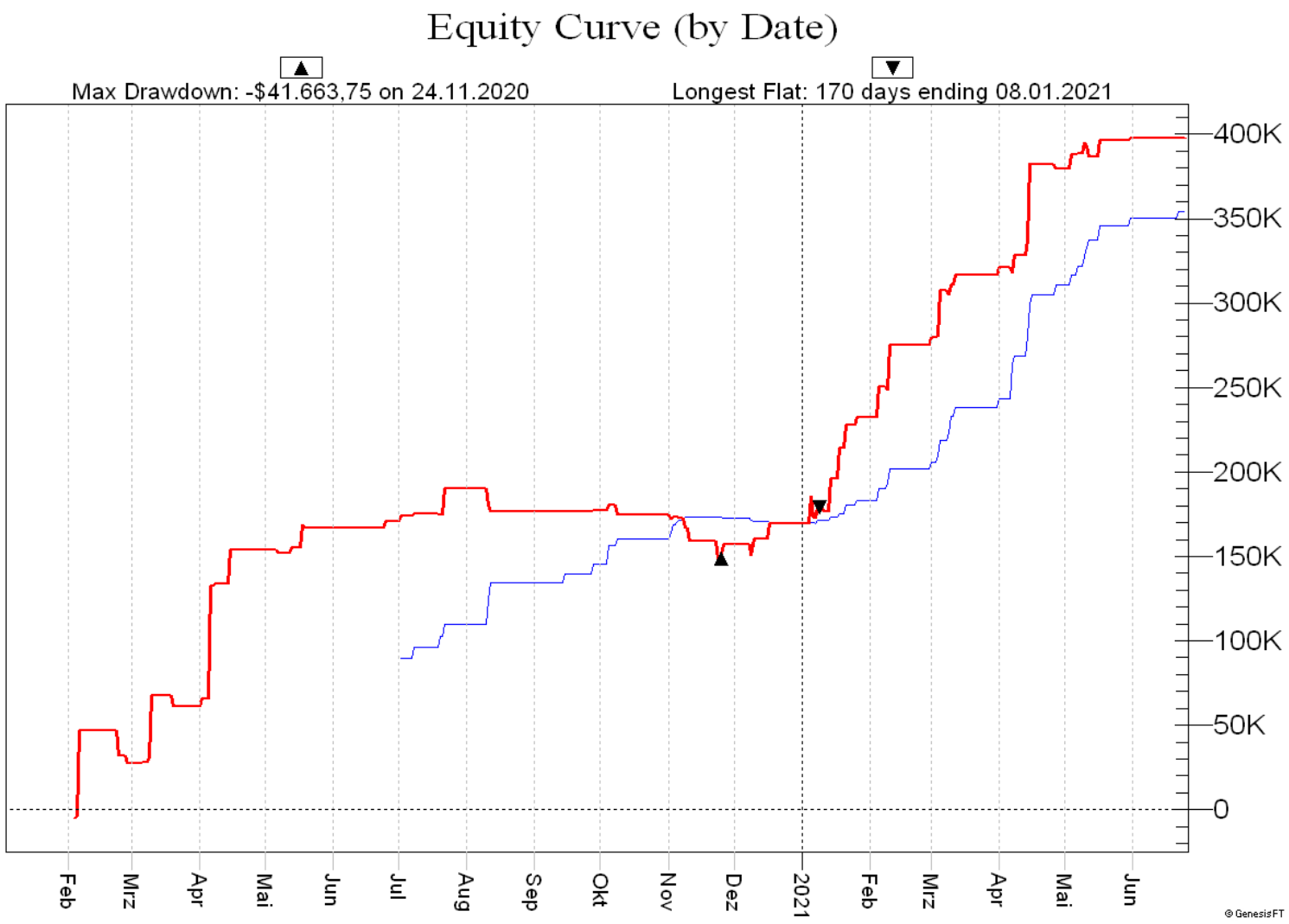
Long

Test#	I-1	Net Profit	Max Drawdown	Return%	Profit Factor	Kelly%	Trades	Avg Trade	Payout	Win%	Large Loss	Avg Loss	Avg Win	Large Win	Wins	Losses
1	1	-1.968 €	(7.245 €)	-10,8%	0,84	-12,4%	9	-219 €	0,42	66,7%	(7.245 €)	(4.191 €)	1.768 €	8.493 €	6	3
2	2	-21.833 €	(37.930 €)	-42,6%	0,47	-31,2%	11	-1.985 €	1,24	27,3%	(14.608 €)	(5.117 €)	6.368 €	14.280 €	3	8
3	3	-29.280 €	(30.348 €)	-67,3%	0,07	-277,2%	9	-3.253 €	0,26	22,2%	(9.570 €)	(4.518 €)	1.174 €	1.280 €	2	7
4	4	-18.500 €	(18.500 €)	-72,5%	0,16	-101,6%	5	-3.700 €	0,66	20,0%	(8.283 €)	(5.536 €)	3.643 €	3.643 €	1	4
5	5	-5.155 €	(15.828 €)	-22,5%	0,74	-15,3%	9	-573 €	0,93	44,4%	(8.283 €)	(4.033 €)	3.752 €	6.855 €	4	5
6	6	4.258 €	(17.825 €)	13,1%	**1,14**	5,4%	14	304 €	1,53	42,9%	(8.370 €)	(3.700 €)	5.643 €	9.255 €	6	8
7	7	-6.445 €	(19.215 €)	-21,1%	0,66	-18,4%	11	-586 €	1,16	36,4%	(7.058 €)	(2.745 €)	3.193 €	5.530 €	4	7
8	8	5.263 €	(10.498 €)	29,5%	**1,36**	13,4%	10	526 €	1,36	50,0%	(4.220 €)	(2.888 €)	3.940 €	7.943 €	5	5
9	9	-19.660 €	(21.065 €)	-66,7%	0,52	-23,5%	8	-2.458 €	1,55	25,0%	(19.733 €)	(6.766 €)	10.468 €	15.543 €	2	6
10	10	-31.828 €	(32.338 €)	-78,0%	0,46	-29,4%	12	-2.652 €	1,38	25,0%	(11.370 €)	(6.546 €)	9.030 €	11.880 €	3	9
11	11	-8.875 €	(12.353 €)	-45,3%	0,36	-70,9%	5	-1.775 €	0,54	40,0%	(8.433 €)	(4.628 €)	2.505 €	4.105 €	2	3
12	12	-1.650 €	(7.535 €)	-10,0%	0,85	-10,4%	5	-330 €	0,57	60,0%	(5.745 €)	(5.570 €)	3.163 €	3.868 €	3	2

© GenesisFT

Short

PowerBreakouts 2020/21



Summary - All Trades

Overall

Total Net Profit:	$397.491	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**3,64**
Total Trades:	110	Winning Percentage:	63,6%
Average Trade:	$3.614	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	2,08
Max Closed-out Drawdown:	-$41.664	CPC Index (PF x Win% x PR):	4,83
Max Intra-trade Drawdown:	-$50.874	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	96,17%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$3.606	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	46,18%
Percent in the Market:	5,3%	Optimal f:	0,86
Avg # of Bars in Trade:	25,80	Z-Score (W/L Predictability):	-2,4
Avg # of Trades per Year:	74,4	Current Streak:	2 Losses

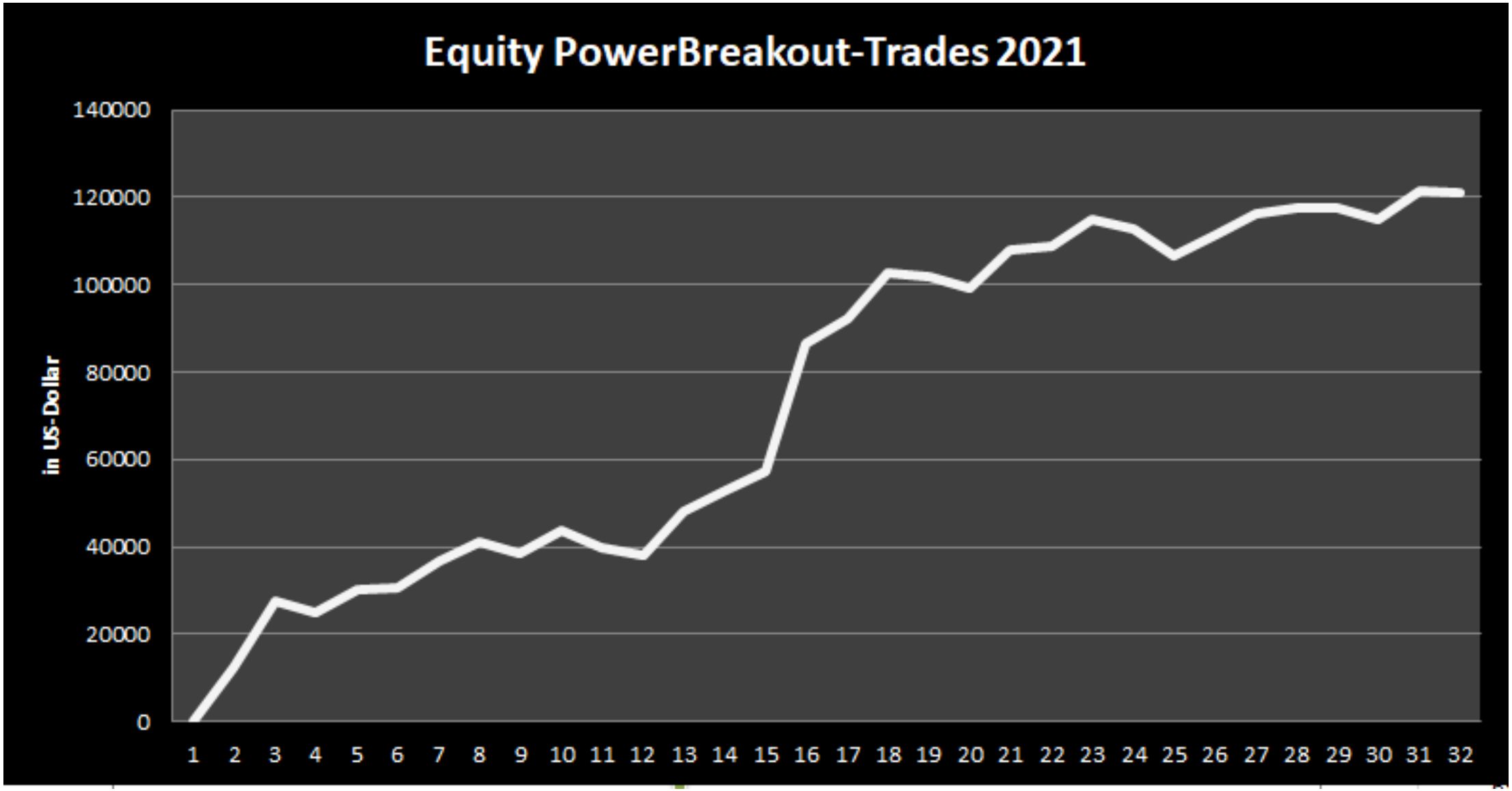
Monthly Profit Analysis

Average Monthly Profit:	$23.382	Monthly Sharpe Ratio:	0,79
Std Dev of Monthly Profits:	$29.720	Annualized Sharpe Ratio:	2,73
		Calmar Ratio:	5,52

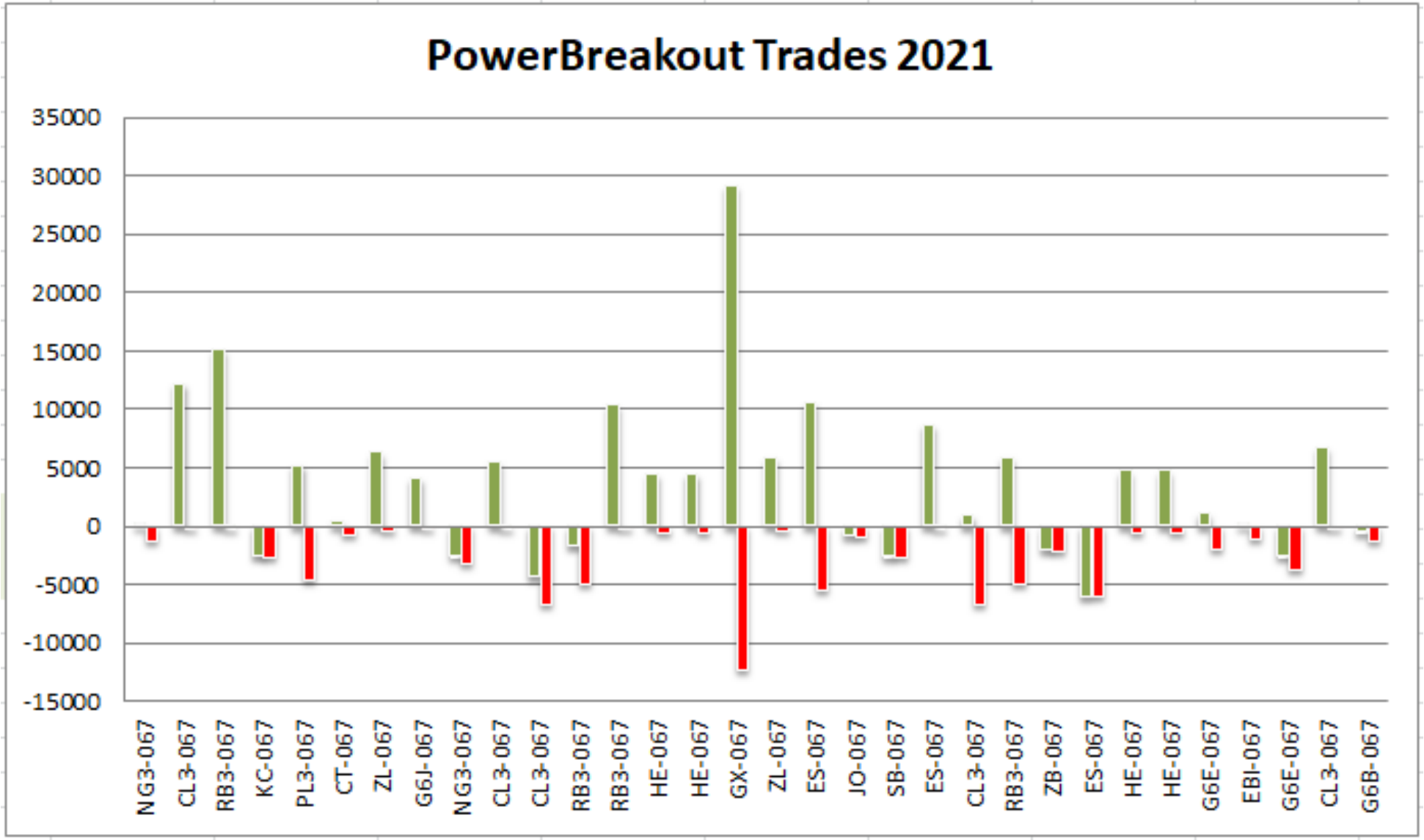
Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	70	Total Losers:	40
Gross Profit:	$547.785	Gross Loss:	-$150.294
Average Win:	$7.825	Average Loss:	-$3.757
Largest Win:	$67.318	Largest Loss:	-$15.020
Largest Drawdown in Win:	-$23.245	Largest Peak in Loss:	$18.105
Avg Drawdown in Win:	-$2.569	Avg Peak in Loss:	$2.734
Avg Run Up in Win:	$12.859	Avg Run Up in Loss:	$2.734
Avg Run Down in Win:	-$2.569	Avg Run Down in Loss:	-$4.186
Most Consec Wins:	13	Most Consec Losses:	5
Avg # of Consec Wins:	3,50	Avg # of Consec Losses:	2,00
Avg # of Bars in Wins:	33,16	Avg # of Bars in Losses:	12,93

© GenesisFT

PowerBreakouts 2021



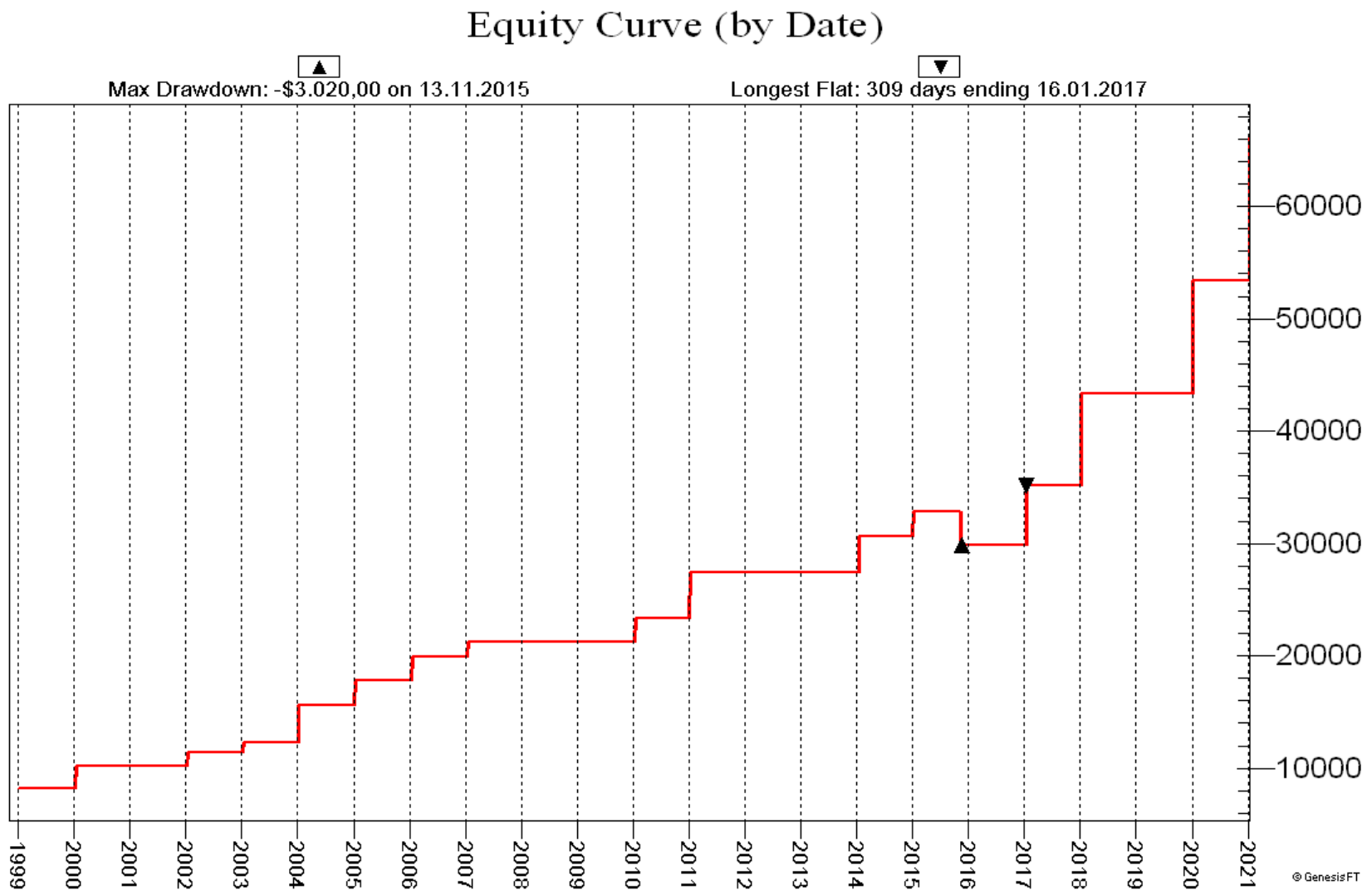
PowerBreakouts 2021



PowerBreakouts

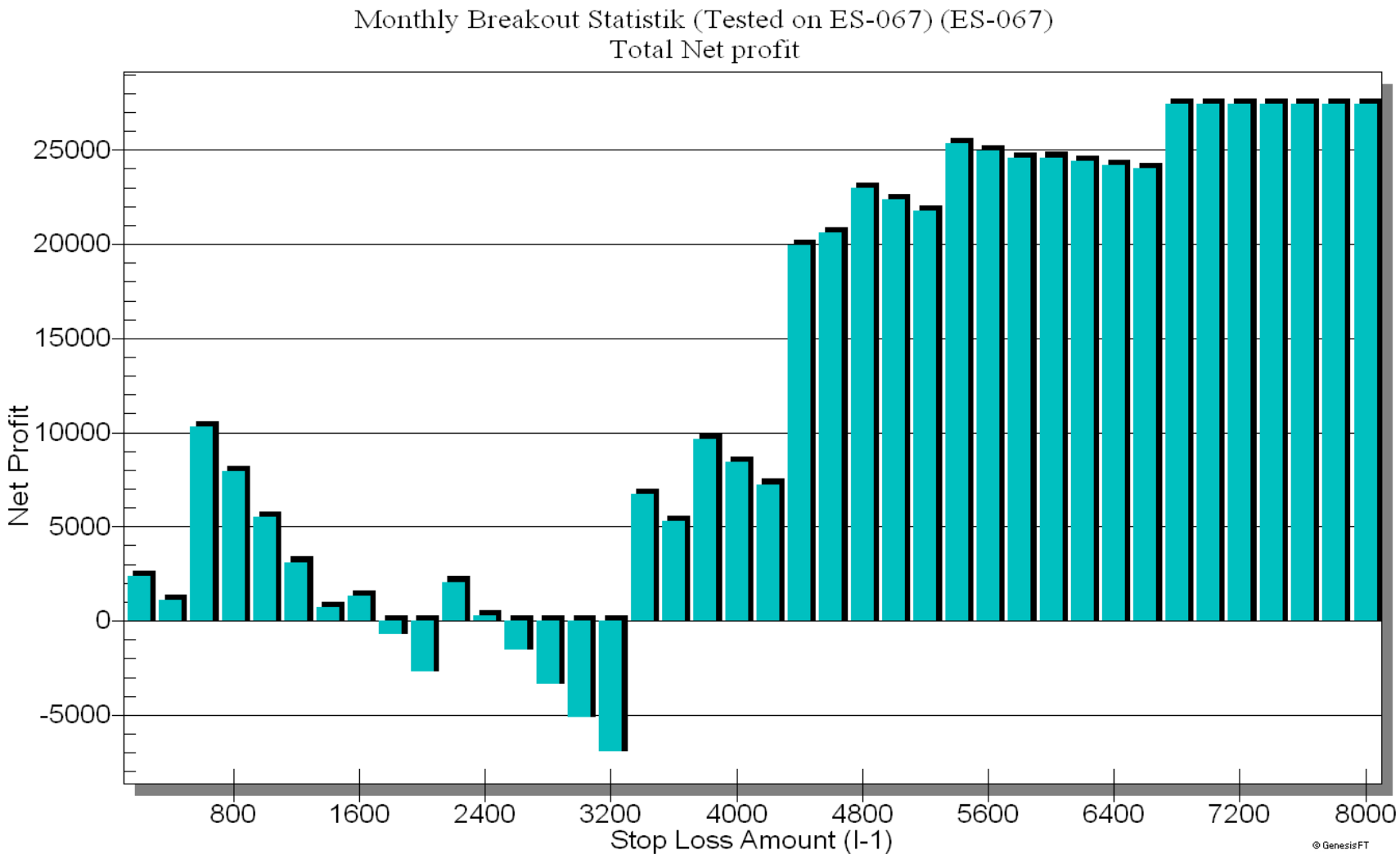
Einige Beispiel-Equities einzelner Setups

S&P 500 Long (11)



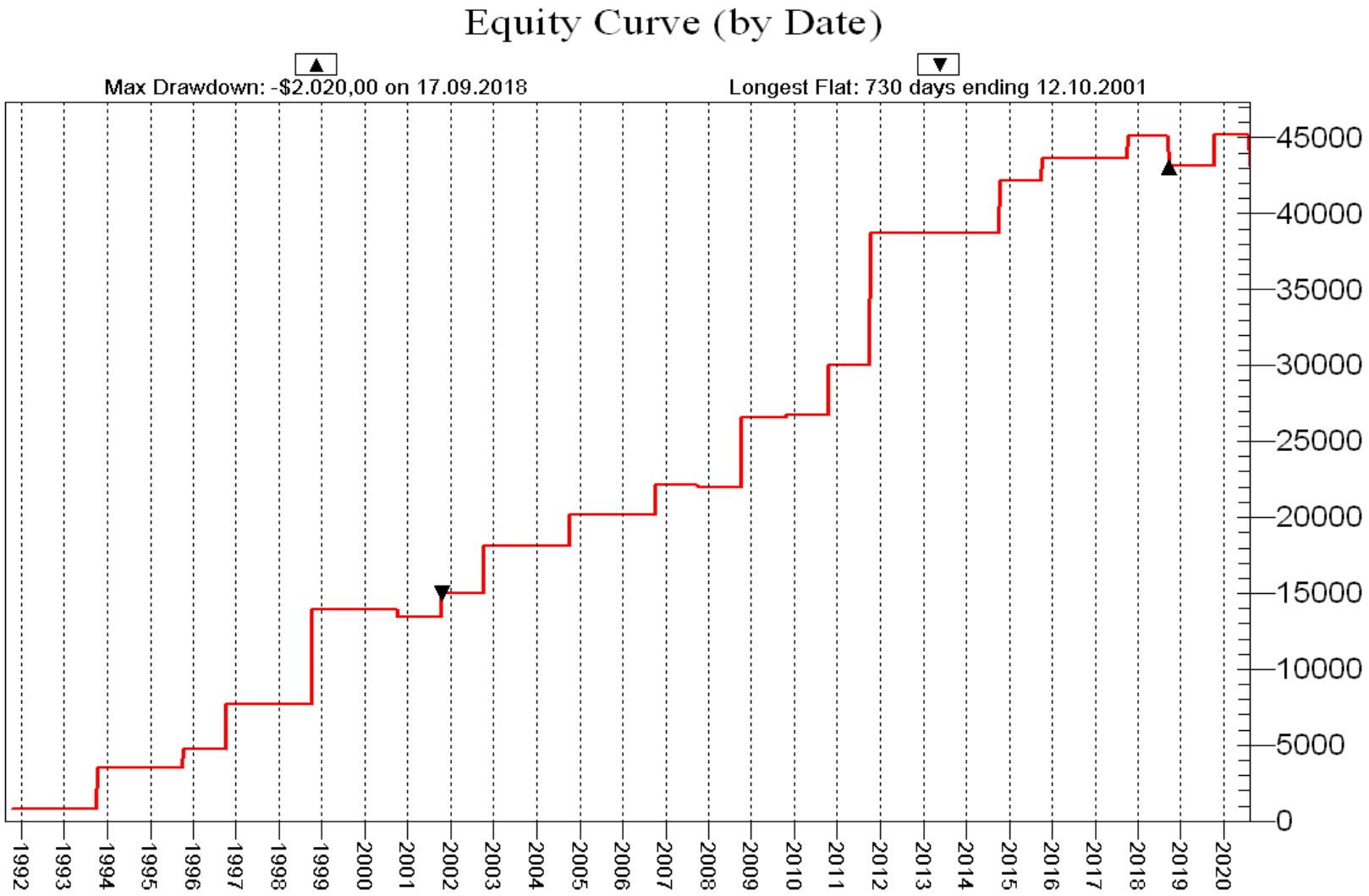
Gewichtungs-Kategorie: 4/4

S&P 500 Long (12)



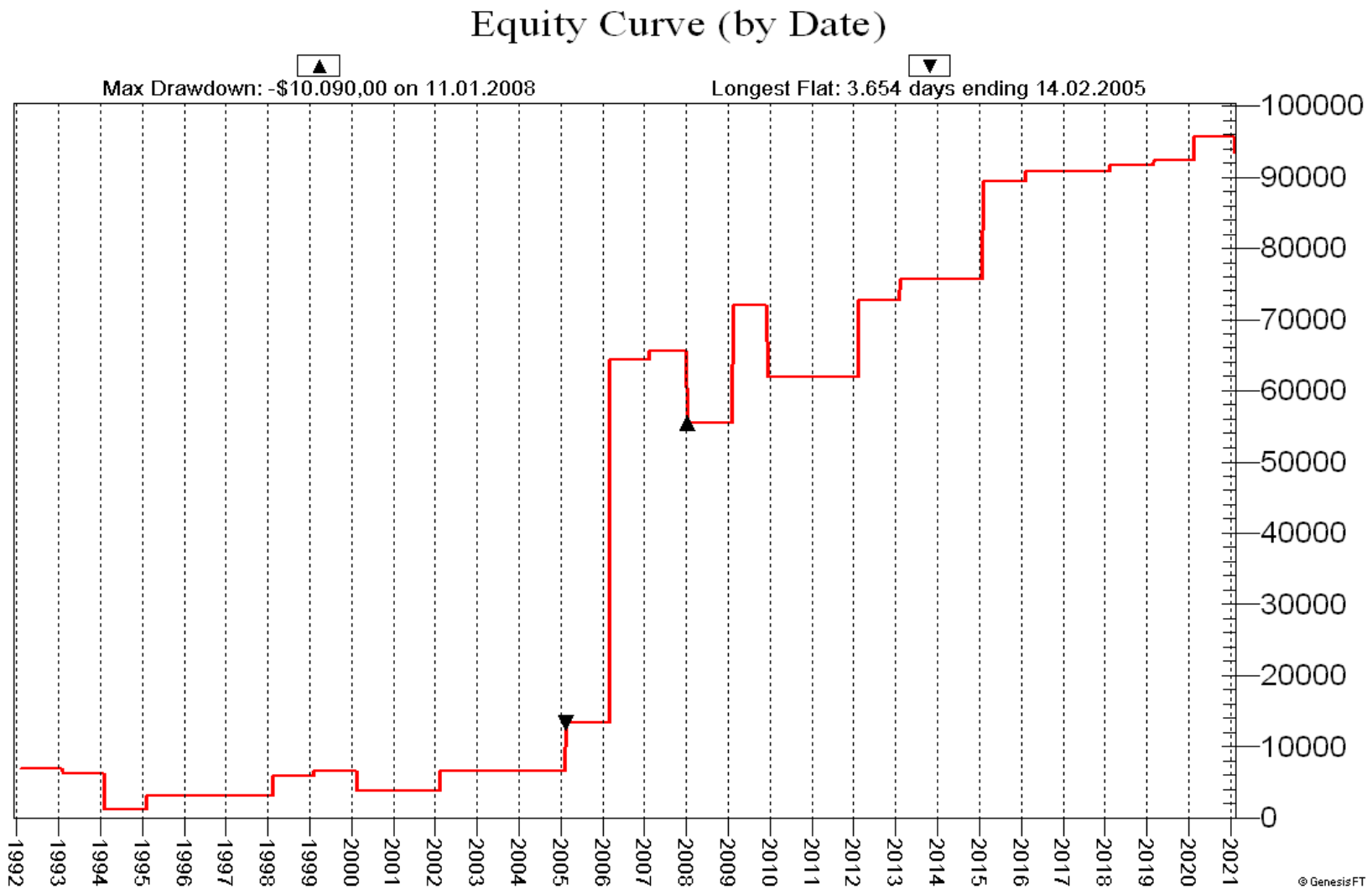
Gewichtungs-Kategorie: 4/4

Bund Future Long [redacted] - 2 Monate



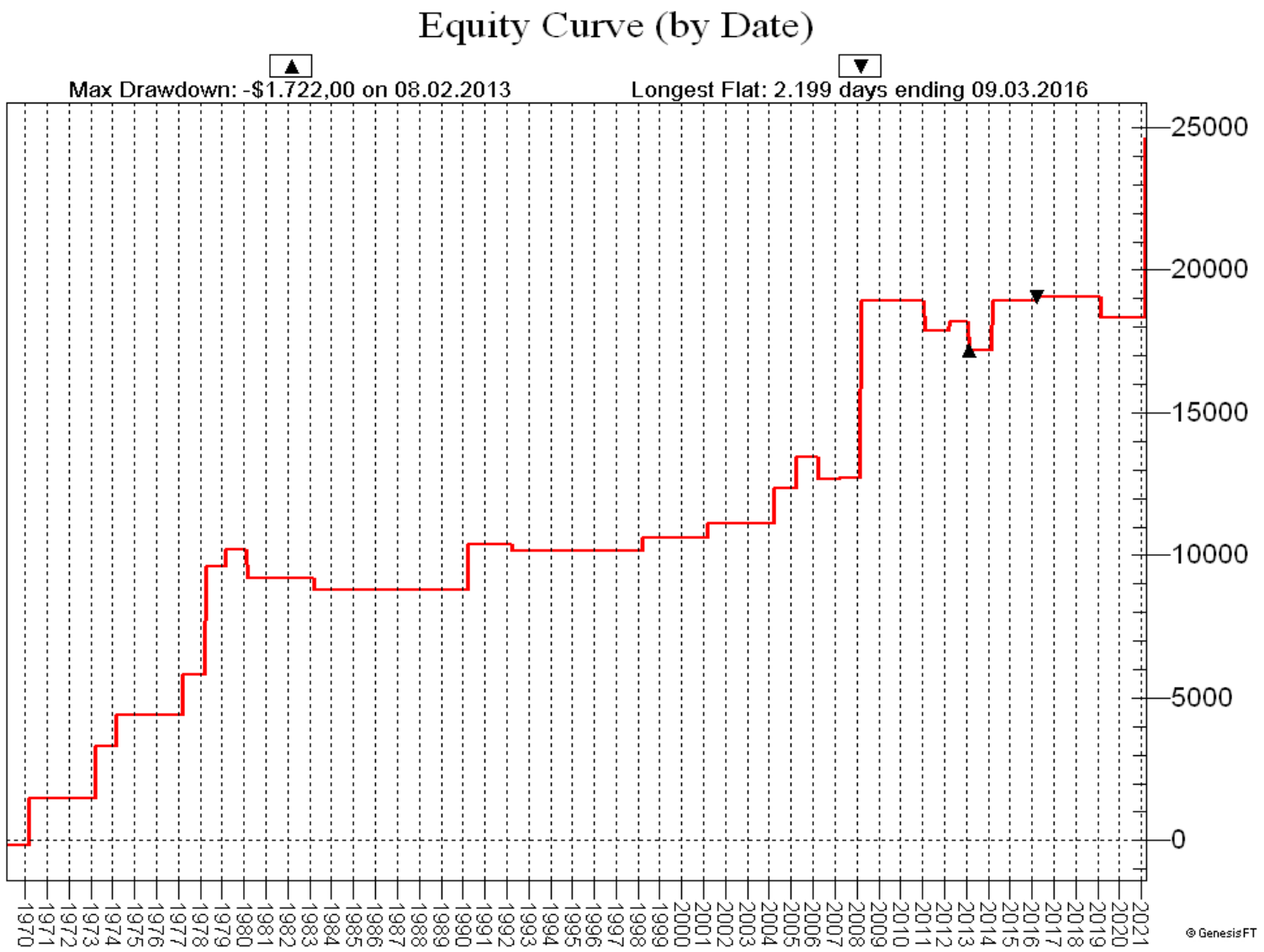
Gewichtungs-Kategorie: 4/4

Natural Gas Short [redacted] Pkt) - 2 Monate



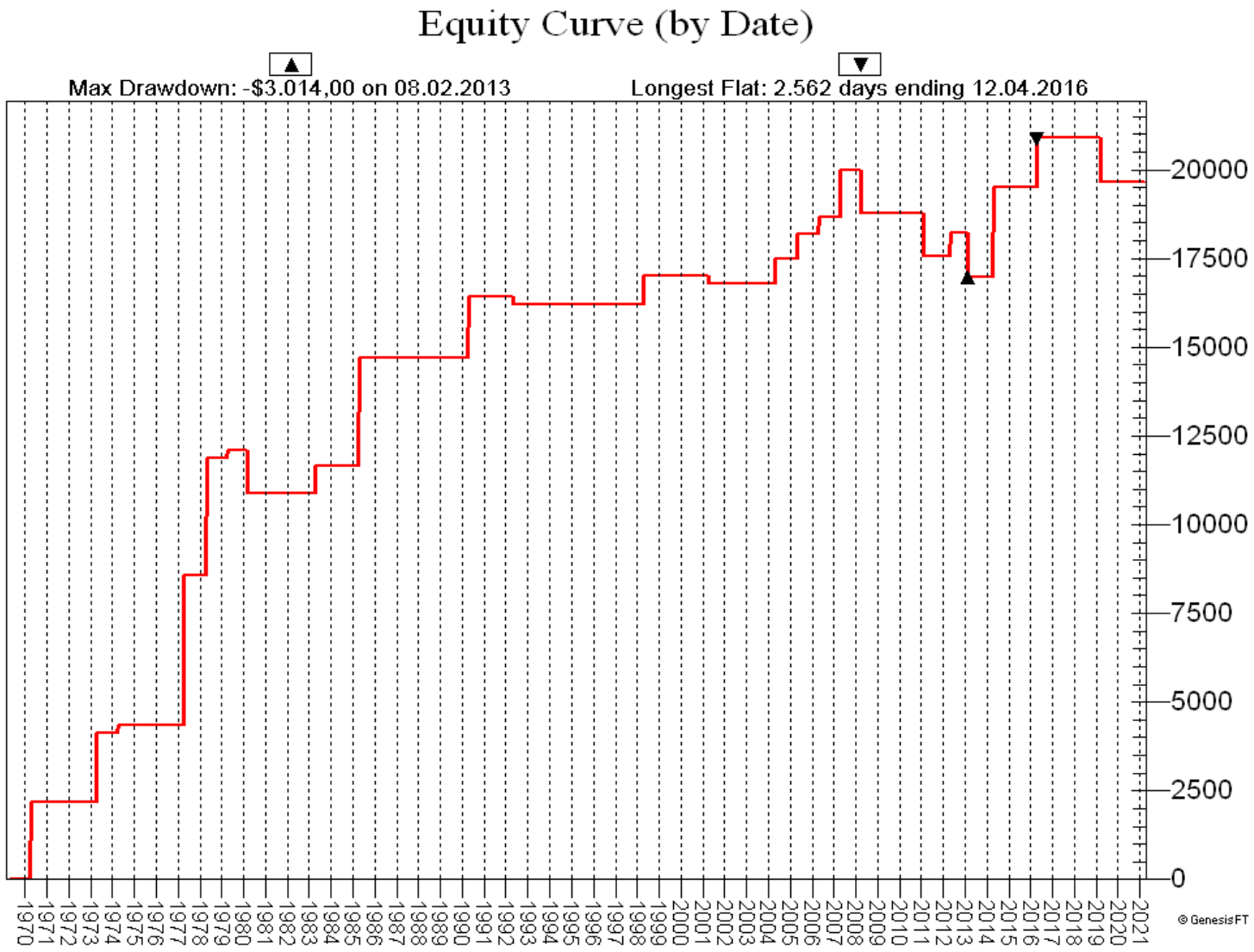
Gewichtungs-Kategorie: 4/4

Soybean Oil Long [redacted]t) - 1 Monat



Gewichtungs-Kategorie: 4/4

Soybean Oil Long [redacted] - 2 Monate



Gewichtungs-Kategorie: 4/4

NATURAL GAS

Ein Beispiel-Trade,
welcher kommende Woche gehandelt/geordert wird

Natural Gas Short (7) – Stopp 7.500 $ (75 Pkt) - 2 Monate

Test#	I-1	Net Profit	Max Drawdown	Return%	Profit Factor	Kelly%	Trades	Avg Trade	Payout	Win%	Large Loss	Avg Loss	Avg Win	Large Win	Wins	Losses
1	500	42.090 €	(6.240 €)	389,4%	**5,24**	11,0%	22	1.913 €	33,21	13,6%	(560 €)	(522 €)	17.337 €	40.040 €	3	19
2	1000	32.180 €	(12.690 €)	181,2%	**2,62**	8,4%	22	1.463 €	16,61	13,6%	(1.470 €)	(1.044 €)	17.337 €	40.040 €	3	19
3	1500	29.910 €	(15.440 €)	142,4%	**2,08**	9,5%	22	1.360 €	9,38	18,2%	(1.760 €)	(1.533 €)	14.378 €	40.040 €	4	18
4	2000	24.900 €	(20.250 €)	94,6%	**1,76**	9,8%	22	1.132 €	5,99	22,7%	(2.070 €)	(1.923 €)	11.518 €	40.040 €	5	17
5	2500	34.810 €	(17.840 €)	145,6%	**1,95**	13,3%	22	1.582 €	5,20	27,3%	(2.720 €)	(2.294 €)	11.918 €	40.040 €	6	16
6	3000	31.140 €	(21.350 €)	113,6%	**1,77**	13,8%	22	1.415 €	3,78	31,8%	(3.190 €)	(2.713 €)	10.261 €	40.040 €	7	15
7	3500	51.600 €	(21.370 €)	180,8%	**2,28**	23,0%	22	2.345 €	3,30	40,9%	(3.770 €)	(3.092 €)	10.199 €	40.040 €	9	13
8	4000	48.240 €	(22.080 €)	164,9%	**2,11**	21,5%	22	2.193 €	3,04	40,9%	(4.170 €)	(3.350 €)	10.199 €	40.040 €	9	13
9	4500	48.820 €	(25.700 €)	148,5%	**2,08**	23,7%	22	2.219 €	2,50	45,5%	(5.080 €)	(3.750 €)	9.382 €	40.040 €	10	12
10	5000	48.470 €	(27.200 €)	141,0%	**2,07**	23,5%	22	2.203 €	2,48	45,5%	(5.080 €)	(3.779 €)	9.382 €	40.040 €	10	12
11	5500	56.280 €	(18.730 €)	200,6%	**2,27**	28,0%	22	2.558 €	2,27	50,0%	(5.780 €)	(4.015 €)	9.131 €	40.040 €	11	11
12	6000	80.020 €	(20.040 €)	272,5%	**3,49**	38,9%	22	3.637 €	2,91	54,5%	(6.020 €)	(3.208 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
13	6500	77.730 €	(21.830 €)	249,5%	**3,26**	37,8%	22	3.533 €	2,72	54,5%	(6.810 €)	(3.437 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
14	7000	76.020 €	(23.040 €)	234,8%	**3,11**	37,0%	22	3.455 €	2,59	54,5%	(7.020 €)	(3.608 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
15	7500	74.020 €	(24.540 €)	218,5%	**2,94**	36,0%	22	3.365 €	2,45	54,5%	(7.520 €)	(3.808 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
16	8000	71.860 €	(26.200 €)	202,3%	**2,79**	35,0%	22	3.266 €	2,32	54,5%	(8.180 €)	(4.024 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
17	8500	74.140 €	(23.420 €)	226,4%	**2,95**	36,1%	22	3.370 €	2,46	54,5%	(8.520 €)	(3.796 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
18	9000	73.140 €	(23.920 €)	220,0%	**2,88**	35,6%	22	3.325 €	2,40	54,5%	(9.020 €)	(3.896 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
19	9500	72.140 €	(24.420 €)	213,7%	**2,81**	35,1%	22	3.279 €	2,34	54,5%	(9.520 €)	(3.996 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
20	10000	71.140 €	(24.920 €)	207,7%	**2,74**	34,6%	22	3.234 €	2,28	54,5%	(10.020 €)	(4.096 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
21	10500	70.100 €	(25.460 €)	201,5%	**2,67**	34,1%	22	3.186 €	2,22	54,5%	(10.560 €)	(4.200 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
22	11000	69.140 €	(25.920 €)	196,1%	**2,61**	33,6%	22	3.143 €	2,17	54,5%	(11.020 €)	(4.296 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
23	11500	68.140 €	(26.420 €)	190,6%	**2,55**	33,2%	22	3.097 €	2,13	54,5%	(11.520 €)	(4.396 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
24	12000	67.140 €	(26.920 €)	185,2%	**2,49**	32,7%	22	3.052 €	2,08	54,5%	(12.020 €)	(4.496 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
25	12500	66.140 €	(27.420 €)	180,0%	**2,44**	32,2%	22	3.006 €	2,03	54,5%	(12.520 €)	(4.596 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
26	13000	65.140 €	(27.920 €)	174,9%	**2,39**	31,7%	22	2.961 €	1,99	54,5%	(13.020 €)	(4.696 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
27	13500	64.140 €	(28.420 €)	169,9%	**2,34**	31,2%	22	2.915 €	1,95	54,5%	(13.520 €)	(4.796 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
28	14000	63.140 €	(28.920 €)	165,1%	**2,29**	30,7%	22	2.870 €	1,91	54,5%	(14.020 €)	(4.896 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
29	14500	62.140 €	(29.420 €)	160,4%	**2,24**	30,2%	22	2.825 €	1,87	54,5%	(14.520 €)	(4.996 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
30	15000	61.030 €	(30.030 €)	155,1%	**2,20**	29,7%	22	2.774 €	1,83	54,5%	(15.130 €)	(5.107 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
31	15500	60.140 €	(30.420 €)	151,3%	**2,16**	29,3%	22	2.734 €	1,80	54,5%	(15.520 €)	(5.196 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
32	16000	59.140 €	(30.920 €)	146,9%	**2,12**	28,8%	22	2.688 €	1,76	54,5%	(16.020 €)	(5.296 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
33	16500	59.360 €	(30.200 €)	150,2%	**2,13**	28,9%	22	2.698 €	1,77	54,5%	(16.520 €)	(5.274 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
34	17000	58.860 €	(30.200 €)	148,9%	**2,11**	28,6%	22	2.675 €	1,75	54,5%	(17.020 €)	(5.324 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
35	17500	58.360 €	(30.200 €)	147,6%	**2,09**	28,4%	22	2.653 €	1,74	54,5%	(17.520 €)	(5.374 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
36	18000	57.860 €	(30.200 €)	146,4%	**2,07**	28,2%	22	2.630 €	1,72	54,5%	(18.020 €)	(5.424 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
37	18500	57.360 €	(30.200 €)	145,1%	**2,05**	27,9%	22	2.607 €	1,71	54,5%	(18.520 €)	(5.474 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
38	19000	56.860 €	(30.200 €)	143,8%	**2,03**	27,7%	22	2.585 €	1,69	54,5%	(19.020 €)	(5.524 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
39	19500	56.360 €	(30.200 €)	142,6%	**2,01**	27,4%	22	2.562 €	1,68	54,5%	(19.520 €)	(5.574 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
40	20000	55.860 €	(30.200 €)	141,3%	**1,99**	27,2%	22	2.539 €	1,66	54,5%	(20.020 €)	(5.624 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
41	20500	55.360 €	(30.200 €)	140,0%	**1,98**	26,9%	22	2.516 €	1,65	54,5%	(20.520 €)	(5.674 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
42	21000	54.860 €	(30.200 €)	138,8%	**1,96**	26,7%	22	2.494 €	1,63	54,5%	(21.020 €)	(5.724 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
43	21500	54.360 €	(30.200 €)	137,5%	**1,94**	26,5%	22	2.471 €	1,62	54,5%	(21.520 €)	(5.774 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
44	22000	53.860 €	(30.200 €)	136,3%	**1,92**	26,2%	22	2.448 €	1,60	54,5%	(22.020 €)	(5.824 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
45	22500	53.360 €	(30.200 €)	135,0%	**1,91**	26,0%	22	2.425 €	1,59	54,5%	(22.520 €)	(5.874 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
46	23000	52.860 €	(30.200 €)	133,7%	**1,89**	25,7%	22	2.403 €	1,58	54,5%	(23.020 €)	(5.924 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
47	23500	52.360 €	(30.200 €)	132,5%	**1,88**	25,5%	22	2.380 €	1,56	54,5%	(23.520 €)	(5.974 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
48	24000	51.860 €	(30.200 €)	131,2%	**1,86**	25,2%	22	2.357 €	1,55	54,5%	(24.020 €)	(6.024 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
49	24500	51.360 €	(30.200 €)	128,9%	**1,85**	25,0%	22	2.335 €	1,54	54,5%	(24.520 €)	(6.074 €)	9.342 €	40.040 €	12	10
50	25000	82.050 €	(30.200 €)	170,2%	**3,27**	41,0%	22	3.730 €	2,26	59,1%	(15.300 €)	(4.024 €)	9.098 €	40.040 €	13	9

© GenesisFT

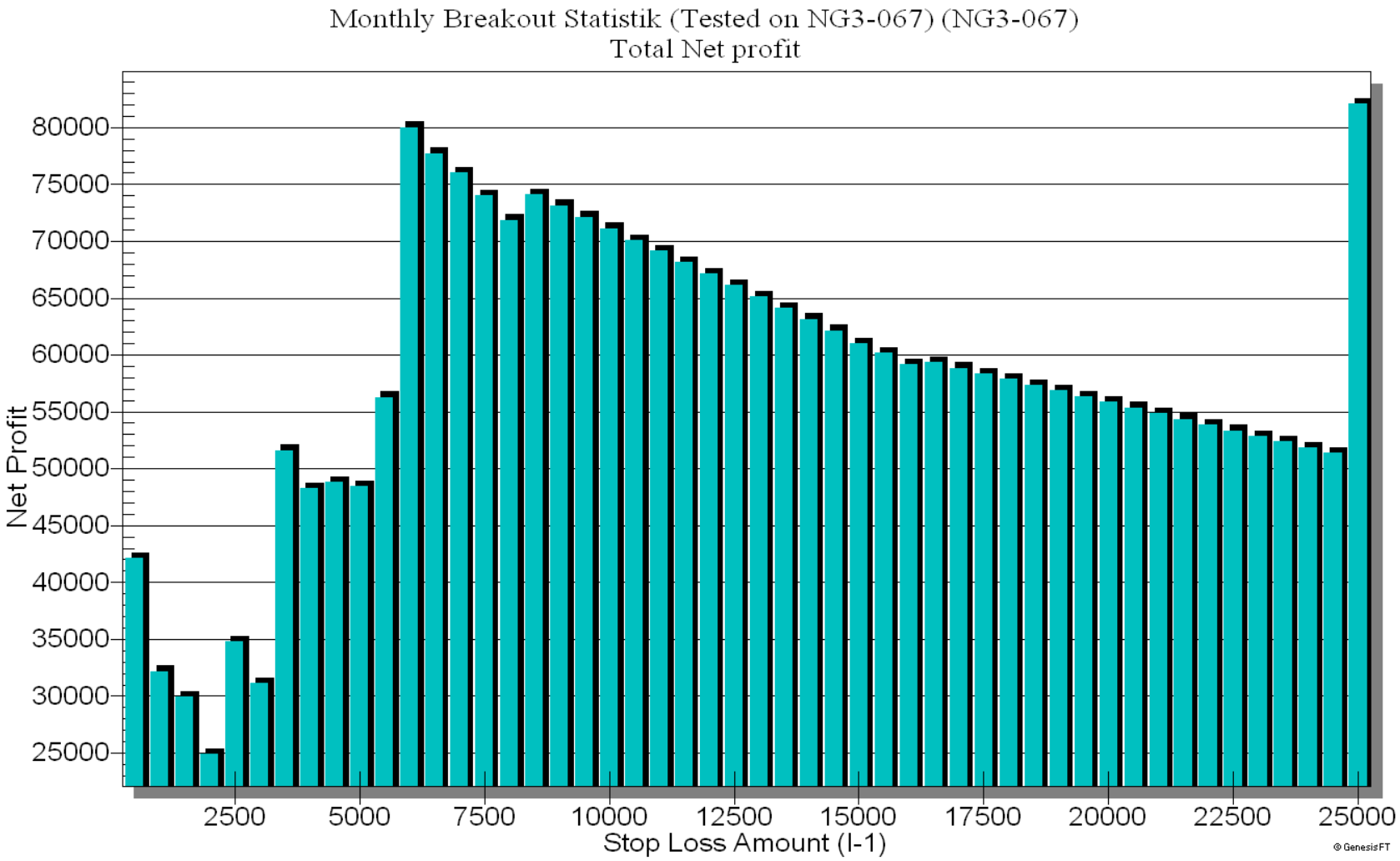
Gehandelt wird Short im Natural Gas, WENN das Juni-Tief im Juli unterschritten wird.

Der Stopp liegt bei 7.500 $ im Future, was 75 Punkten im Future entspricht. Wenn der Trade z.B. bei 3,0 USD ausgelöst wird, muss der Stopp bei 3,75 USD liegen.

Nach 46 Handelstagen (NICHT Kalendertage!) wird der Trade glattgestellt.

Gewichtungs-Kategorie: 2/4

Natural Gas Short (7) – Stopp 7.500 $ (75 Pkt) - 2 Monate



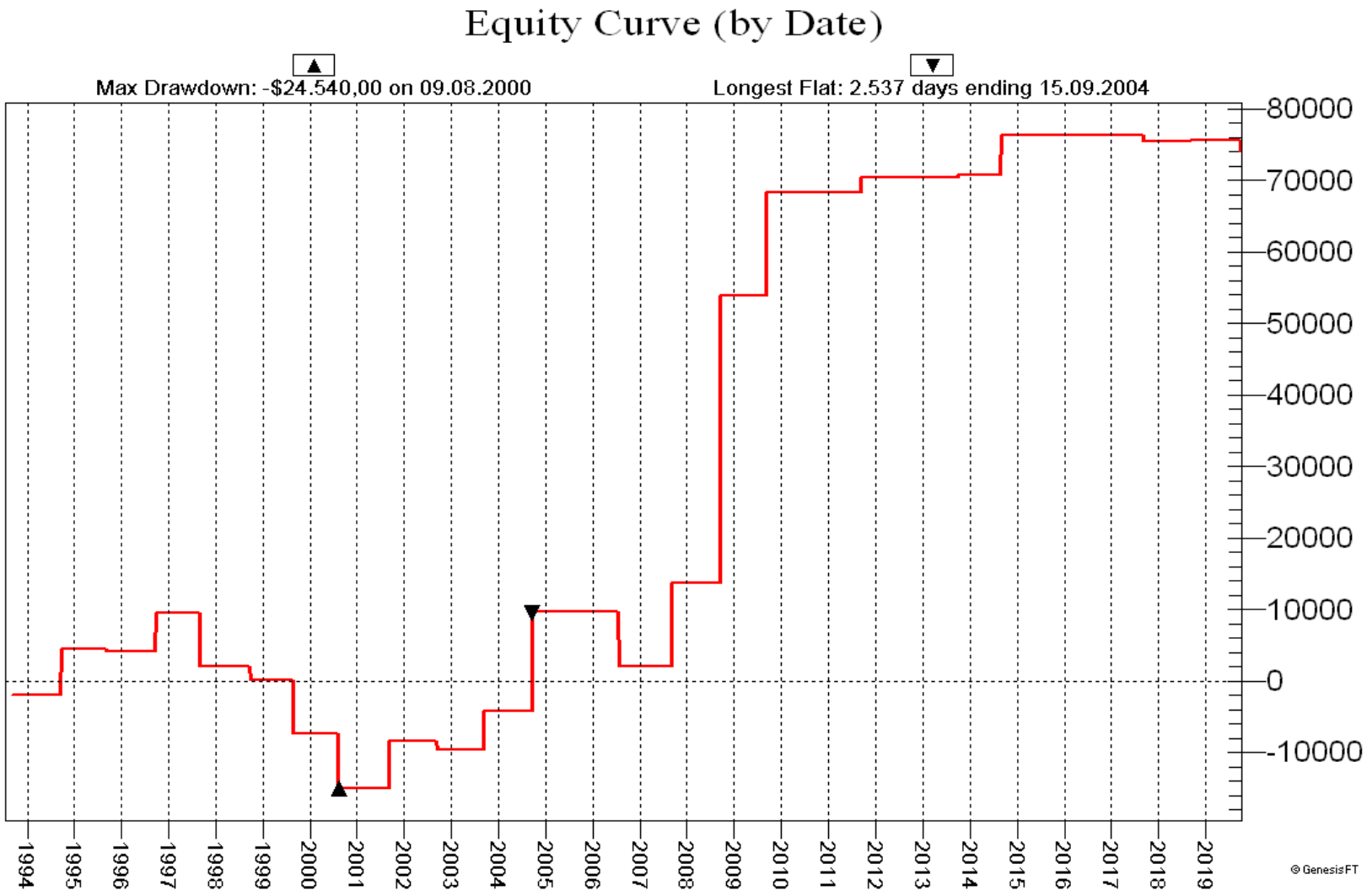
Gehandelt wird Short im Natural Gas, WENN das Juni-Tief im Juli unterschritten wird.

Der Stopp liegt bei 7.500 $ im Future, was 75 Punkten im Future entspricht. Wenn der Trade z.B. bei 3,0 USD ausgelöst wird, muss der Stopp bei 3,75 USD liegen.

Nach 46 Handelstagen (NICHT Kalendertage!) wird der Trade glattgestellt.

Gewichtungs-Kategorie: 2/4

Natural Gas Short (7) – Stopp 7.500 $ (75 Pkt) - 2 Monate



Gehandelt wird Short im Natural Gas, WENN das Juni-Tief im Juli unterschritten wird.

Der Stopp liegt bei 7.500 $ im Future, was 75 Punkten im Future entspricht. Wenn der Trade z.B. bei 3,0 USD ausgelöst wird, muss der Stopp bei 3,75 USD liegen.

Nach 46 Handelstagen (NICHT Kalendertage!) wird der Trade glattgestellt.

Gewichtungs-Kategorie: 2/4

Orangensaft (1 Monat Haltedauer)

Test#	I-1	Net Profit	Max Drawdown	Return%	Profit Factor	Kelly%	Trades	Avg Trade	Payout	Win%	Large Loss	Avg Loss	Avg Win	Large Win	Wins	Losses
1	1	13.545 €	(3.403 €)	226,2%	**3,19**	32,0%	15	903 €	3,64	46,7%	(1.880 €)	(775 €)	2.820 €	6.730 €	7	8
2	2	-5.363 €	(8.630 €)	-46,3%	0,49	-55,8%	15	-358 €	0,43	53,3%	(2.578 €)	(1.499 €)	641 €	1.375 €	8	7
3	3	-1.288 €	(7.968 €)	-13,2%	0,93	-3,8%	25	-52 €	1,00	48,0%	(2.615 €)	(1.354 €)	1.359 €	4.210 €	12	13
4	4	2.195 €	(5.603 €)	24,2%	**1,21**	8,0%	20	110 €	1,48	45,0%	(2.630 €)	(929 €)	1.379 €	3.348 €	9	11
5	5	4.570 €	(6.448 €)	51,4%	**1,46**	15,8%	22	208 €	1,46	50,0%	(3.628 €)	(900 €)	1.315 €	3.228 €	11	11
6	6	2.750 €	(3.775 €)	39,4%	**1,23**	9,1%	23	120 €	1,35	47,8%	(2.623 €)	(976 €)	1.314 €	3.888 €	11	12
7	7	-8.453 €	(13.258 €)	-50,8%	0,47	-52,5%	24	-352 €	0,55	45,8%	(3.643 €)	(1.218 €)	671 €	1.930 €	11	13
8	8	-5.728 €	(6.703 €)	-57,7%	0,58	-37,3%	25	-229 €	0,54	52,0%	(2.773 €)	(1.143 €)	614 €	1.750 €	13	12
9	9	7.870 €	(3.645 €)	134,4%	**1,63**	18,5%	25	315 €	1,76	48,0%	(2.068 €)	(963 €)	1.699 €	6.768 €	12	13
10	10	18.675 €	(5.138 €)	231,8%	**2,97**	41,7%	27	692 €	1,75	63,0%	(1.970 €)	(949 €)	1.657 €	7.263 €	17	10
11	11	2.305 €	(3.453 €)	34,3%	**1,18**	7,4%	25	92 €	1,28	48,0%	(2.990 €)	(968 €)	1.241 €	3.325 €	12	13
12	12	-3.903 €	(7.698 €)	-36,1%	0,82	-7,8%	23	-170 €	1,53	34,8%	(3.268 €)	(1.414 €)	2.163 €	7.053 €	8	15

© GenesisFT

Long

Test#	I-1	Net Profit	Max Drawdown	Return%	Profit Factor	Kelly%	Trades	Avg Trade	Payout	Win%	Large Loss	Avg Loss	Avg Win	Large Win	Wins	Losses
1	1	9.105 €	(6.968 €)	103,0%	**1,58**	24,6%	33	276 €	0,79	66,7%	(4.385 €)	(1.417 €)	1.122 €	3.213 €	22	11
2	2	-2.490 €	(6.455 €)	-28,2%	0,77	-14,5%	21	-119 €	0,84	47,6%	(1.880 €)	(968 €)	816 €	2.350 €	10	11
3	3	158 €	(6.045 €)	1,6%	**1,01**	0,8%	21	8 €	0,62	61,9%	(3.245 €)	(1.529 €)	953 €	4.705 €	13	8
4	4	11.615 €	(2.130 €)	251,7%	**4,96**	47,9%	20	581 €	3,30	60,0%	(1.288 €)	(367 €)	1.213 €	5.538 €	12	8
5	5	-345 €	(4.578 €)	-4,5%	0,97	-1,3%	21	-16 €	1,07	47,6%	(3.425 €)	(1.165 €)	1.248 €	3.940 €	10	11
6	6	-850 €	(5.963 €)	-11,1%	0,93	-3,5%	23	-37 €	1,20	43,5%	(2.330 €)	(876 €)	1.054 €	3.115 €	10	13
7	7	-5.945 €	(6.375 €)	-67,7%	0,45	-55,2%	22	-270 €	0,54	45,5%	(2.210 €)	(903 €)	489 €	1.405 €	10	12
8	8	-5.940 €	(8.620 €)	-51,9%	0,57	-39,9%	21	-283 €	0,52	52,4%	(3.403 €)	(1.373 €)	708 €	2.583 €	11	10
9	9	-7.590 €	(8.715 €)	-66,6%	0,59	-33,1%	21	-361 €	0,65	47,6%	(3.463 €)	(1.684 €)	1.093 €	3.438 €	10	11
10	10	-4.175 €	(11.810 €)	-29,8%	0,76	-14,8%	28	-149 €	0,87	46,4%	(4.753 €)	(1.152 €)	1.008 €	1.803 €	13	15
11	11	-418 €	(2.643 €)	-7,7%	0,92	-5,1%	13	-32 €	0,58	61,5%	(2.315 €)	(1.096 €)	633 €	1.675 €	8	5
12	12	26.283 €	(4.253 €)	316,5%	**3,58**	59,2%	28	939 €	0,78	82,1%	(3.598 €)	(2.039 €)	1.586 €	4.195 €	23	5

© GenesisFT

Short

TRADING CLASS ´21

- Alle 141 PowerBreakout-Setups als Video-Schulung + Unterlagen werden Dir als Teilnehmer der TRADING CLASS ´21 ausgehändigt.
- Ab 01.08. werden alle PowerBreakout-Trades live von René in einem monatlichen LIVE-Webinar platziert für Futures, CFD´s und Hebelzertifikate (inkl. Produktauswahl)
- Ab 01. Juli 3 vorbereitende Schulungen, um organisatorische und Umsetzungsfaktoren zu besprechen
- Direkter Kontakt (WhatsApp, Telefon) zu René für dringende Fragen

Wir haben einen **Gutschein-Code für Frühbucher**, mit dem Du **599 € Ermäßigung** erhältst. Der Code lautet **rmt21** und ist bis zum 04. Juli gültig. Zur Anmeldung:

https://www.realmoneytrader.com/shop/ausbildung/trading-class-2021/

Fazit

Trading ist ein Business, welches einer Planung bedarf. Damit bereitet man sich auf die unliebsamen Elemente vor, stellt sein Überleben sicher, und macht es wahrscheinlich, dass man am langen Ende Geld verdient. Wichtig ist dabei aber, eine realistische Erwartung zu haben, langfristig zu planen und zu agieren, und nicht zu glauben, man sei binnen eines Jahres Millionär, ohne dafür einen Handschlag getan zu haben.

Wir arbeiten mit Wahrscheinlichkeiten, nicht mit Gewissheiten.

Ein statistischer Vorteil ist die Basis. Durch Streuung wirken wir der Sorge entgegen, dass einzelne Strategien länger oder gar nicht mehr funktionieren. Durch eine kalkuliert niedrige Einsatzhöhe verhindern wir, dass einzelne Trades oder Serien von Trades uns aus dem Spiel nehmen

Dies impliziert aber auch, dass wir auf der Performance-Seite etwas mehr Geduld einplanen sollten. Denn Gewinne und Verluste gehen Hand in Hand. Wenn ich das eine erhöhe, geht zwangsläufig auch das andere mit rauf.