René Wolfram

3. Platz Robbins Worldcup Trading Championship 2013

PROFESSIONELL & ZEITSCHONEND TRADEN

realmoneytrader.com

PROFESSIONELL & ZEITSCHONEND TRADEN mit diesen 3 BAUSTEINEN

www.realmoneytrader.com

Schritt 1: Dein Handelskonto, die Produkte und Märkte

1. Kapitalisiere Dein Konto ausreichend! Je mehr Kapital, desto geringer das Risiko, und desto größer die Chancen. Du kannst sämtliche Instrumente der Mathematik FÜR DICH spielen lassen
2. Da für die meisten die Kapitaldecke gerade beim Start nicht beliebig nach oben dehnbar ist, sondern einen massiv limitierender Faktor darstellt, musst Du (wenn Du die Kapitaldecke nicht dehnen kannst), im ersten Schritt darauf achten, dass Du skalierbare Produkte und Märkte handelst

D.h.: - CFD´s (anständigen Broker, keinen „alles kostet nix“-Broker)
- Hebelzertifikate/Optionsscheine
- wenn Futures, dann ausschließlich Märkte, für die es auch Micro-Kontrakte gibt

Schritt 2: Kontrolle und Kalkulierbarkeit zu jeder Zeit

Es gibt zwei Arten des Tradings: diskretionär und systematisch/strategiebasiert

Wenn Du ein kleines Konto hast („klein“ bedeutet **<30.000 €**), dann **sollte der Anteil diskretionärer Trades gleich Null sein**! Du handelst beim diskretionären Trading Meinungen, subjektive Wahrnehmungen, aber kannst dafür gar **keine statistische Basis** haben. Und **wenn diese fehlt**, **kannst Du Risiken** (Einsatzhöhe, notwendiger Abstand des Stopps) **weder kalkulieren, noch managen**. Mit einem großen Konto kannst Du eine temporäre Übertreibung eines Marktes aushalten und ggf den Einstand durch einen Zukauf verbessern. Bei einem kleinen Konto MUSST Du schnell richtig liegen, ohne Umwege. Sonst geht Dein ohnehin geringes Kapital zur Neige.

Ergo: Besonders mit einem kleinen bis mittleren Konto (mittleres Konto = 30.000 bis 100.000 €) **brauchst Du STRATEGIEN**, und zwar nicht ausgedachte Strategien, die nie getestet wurden, sondern fundiert ausgearbeitete Setups, **die nachweislich einen <u>großen</u> statistischen Vorteil haben**.

Denn genau diese **geben Dir eine Kalkulierbarkeit** für Deine Einsätze und die Portfolio-Struktur, und damit **zu jeder Zeit die Kontrolle** über Dein Trading.

Schritt 3: Umsetzbarkeit (eigene limitierende Faktoren)

- Aus Angst wählen unerfahrene Trader oder Trader, die schlechte Erfahrungen (meist weil ohne Strategien agierend) gemacht haben, häufig sehr kurzfristige Ansätze mit hoher diskretionärer Komponente. Was Risikokontrolle als Motiv hat, bringt das genaue Gegenteil: volles Risiko! Doch da sie schnell ausstoppen, sind die Einzelverluste nicht groß. So bemerken es die wenigsten, dass sie einen schleichenden Tod sterben.
- Je kürzer die Haltedauer, und je niedriger die Zeitebene, desto größer die Zufallskomponente, und damit das Risiko
- Aufgrund fehlender zeitlicher Flexibilität, ist eine lückenlose Umsetzung (viele Wdh.) selbst bei einer fundierten Strategie nicht realistisch. Es entstehen Lücken, und durch negativen Abgleich (was hätte ich eigentlich verdient mit dem verpassten Trade) wird Frust aufgebaut, der sich dann in willkürlichen Kompensationshandlungen entlädt (Long hab ich verpasst, jetzt probiere ich Short. Ist ja stark gestiegen)
- Du bist wahrscheinlich nicht auf Stresssituationen trainiert und hast nicht unbegrenzt Zeit, da es vernünftig ist, in diesem Stadium noch ein anderes Einkommen zu generieren (Beruf).
- Also brauchst Du STRATEGIEN, mit großen Gewinnvorteilen und absolut zeitschonender Umsetzung

Schritt 4: Überzeugung

- Unser Gehirn füllt Wissenslücken mit unseren Glaubenssätzen und daraus resultierenden Projektionen
- Wenn Du also ängstlich bist und bislang dachtest, Börse sei Zockerei, dann wird Dein Gehirn bei jeder Handlung, die Du an der Börse vollführst, nach der Bestätigung suchen, dass es nicht funktioniert
- Da Börsenhandel immer zwei Elemente hat, nämlich Gewinne und Verluste, wird jeder Verlust Dir bestätigen: es funktioniert nicht. Und dann wirst Du nie auf die (mathematisch) notwendige Anzahl von Wiederholungen in einem Portfolio von Strategien kommen. Du wirst früh kapitulieren.
- Überzeugung, dass es funktioniert, gewinnst Du durch Visualisierung der langfristigen Kapitalkurven eines Ansatzes (Portfolio aus Strategien)

Der Faktor Zeit…

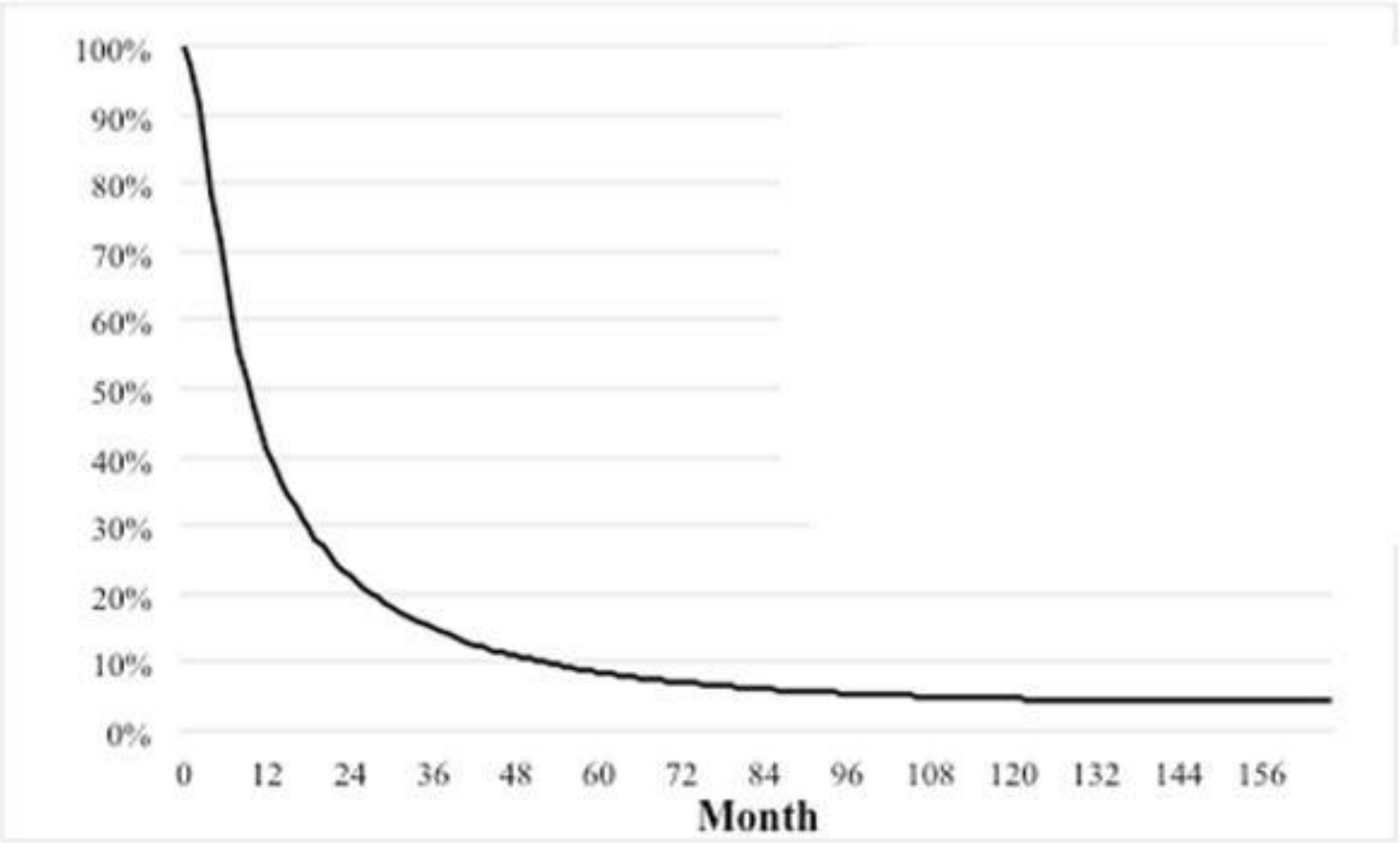


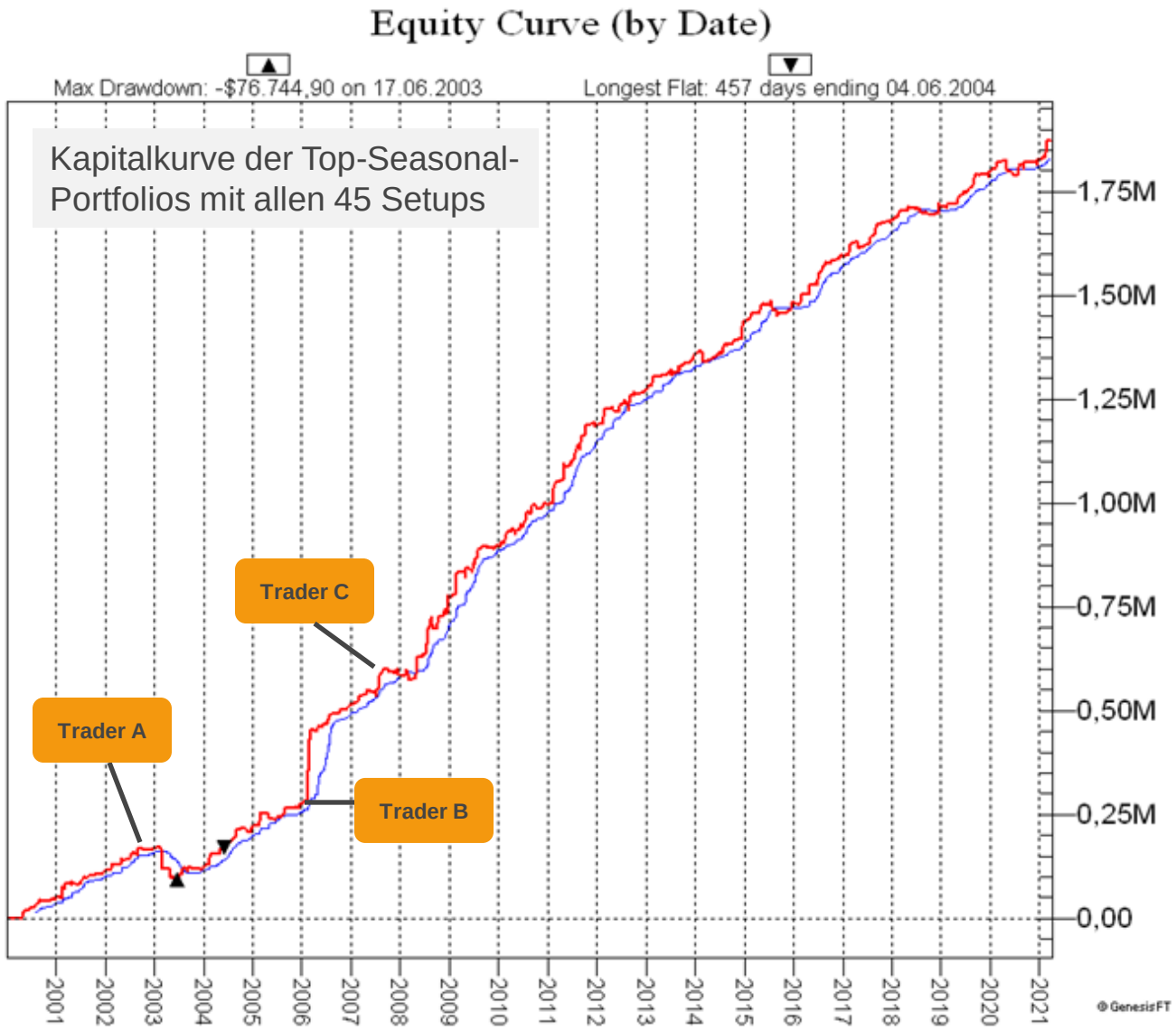
Figure 3: Day Trading Survival Function for Traders with 10 or more Days of Day Trading Experience.

Studien belegen, dass die meisten Trader binnen der ersten zwei Jahre wieder vom Markt verschwinden. Sie zeigen auch, dass jene, die zwischen 8 und 10 Jahren am Markt überleben, dann auch erfolgreich sind und bleiben.

Durch langfristige Planung wird die Zufallskomponente minimiert, und die statistischen Vorteile kommen zum Tragen. Völlig gleich, ob Du beim Start Glück oder Pech hattest.

Zudem wirkt langfristig der Zinseszins-Effekt gewaltig, WENN man es zulässt. Das tun aber die allerwenigsten!

Der Faktor Zeit…



180.000 / 275000 / 600000

	Trader A	Trader B	Trader C
Nach 6 Monaten	-90000$	+220.000$	0$
Nach 2 Jahren	10000$	315000$	290000$
Nach 5 Jahren	420000$	625000$	650000$
Nach 10 Jahren	1.070.000$	1.200.000$	1.050.000$

Die meisten Trader und Investoren kapieren nicht, dass der Faktor Zeit für uns spielt, wenn wir es zulassen! Stattdessen fokussieren sie sich auf den optimalen Start und auf den Ausgang einzelner Spekulationen, und damit auf Dinge, die nahezu vollkommen zufällig und für den langfristigen Erfolg unbedeutend sind.

Schritt 5: Gesetz der großen Zahlen

- Mit einem auf Deine Möglichkeiten abgestimmten Strategie-Portfolio hast Du den Grundfeiler für langfristigen Erfolg an der Börse gesetzt
- Nun musst Du „nur“ das Gesetz der großen Zahlen nutzen, indem Du möglichst viele Wiederholungen (Trades) der statistischen Vorteile hast
- Um diese zu haben, sind die Einsätze je Trade klein genug zu halten
- Zunächst MUSS der Fokus stark auf das ÜBERLEBEN gerichtet sein
- Die Performance kommt dann früher oder später (fast) automatisch
- Wenn Du überhebelst wirst Du von einem einzelnen oder wenigen Trades ausradiert werden
- Es ist allerdings auch schlecht, wenn Du zu defensiv agierst
- Darum ist die Akzeptanz für ein gewisses Grundrisiko zwingend erforderlich!

Pareto-Prinzip

Die einen verstehen es nicht, und die, die es verstehen, wollen es nicht akzeptieren. In 20% der Zeit und mit 20% der Aktionen werden 80% der Performance gemacht. NIEMAND weiß, wann welche Performance-Phase kommt. Darum müssen wir fortwährend die Kugel ins Spiel bringen, und die statistischen Vorteile nutzen.

Wir werden die Physik der Märkte nicht ändern! Also bleiben uns genau zwei Optionen:

1. Sie zu akzeptieren, und geduldig/beharrlich mit Strategien agieren, die einen stat. Vorteil haben
2. Es nicht zu akzeptieren, und solange einer Fata morgana (es muss auch schneller gehen) nachzujagen, bis uns der Kontostand anzeigt, dass dies ein gravierender Irrglaube war

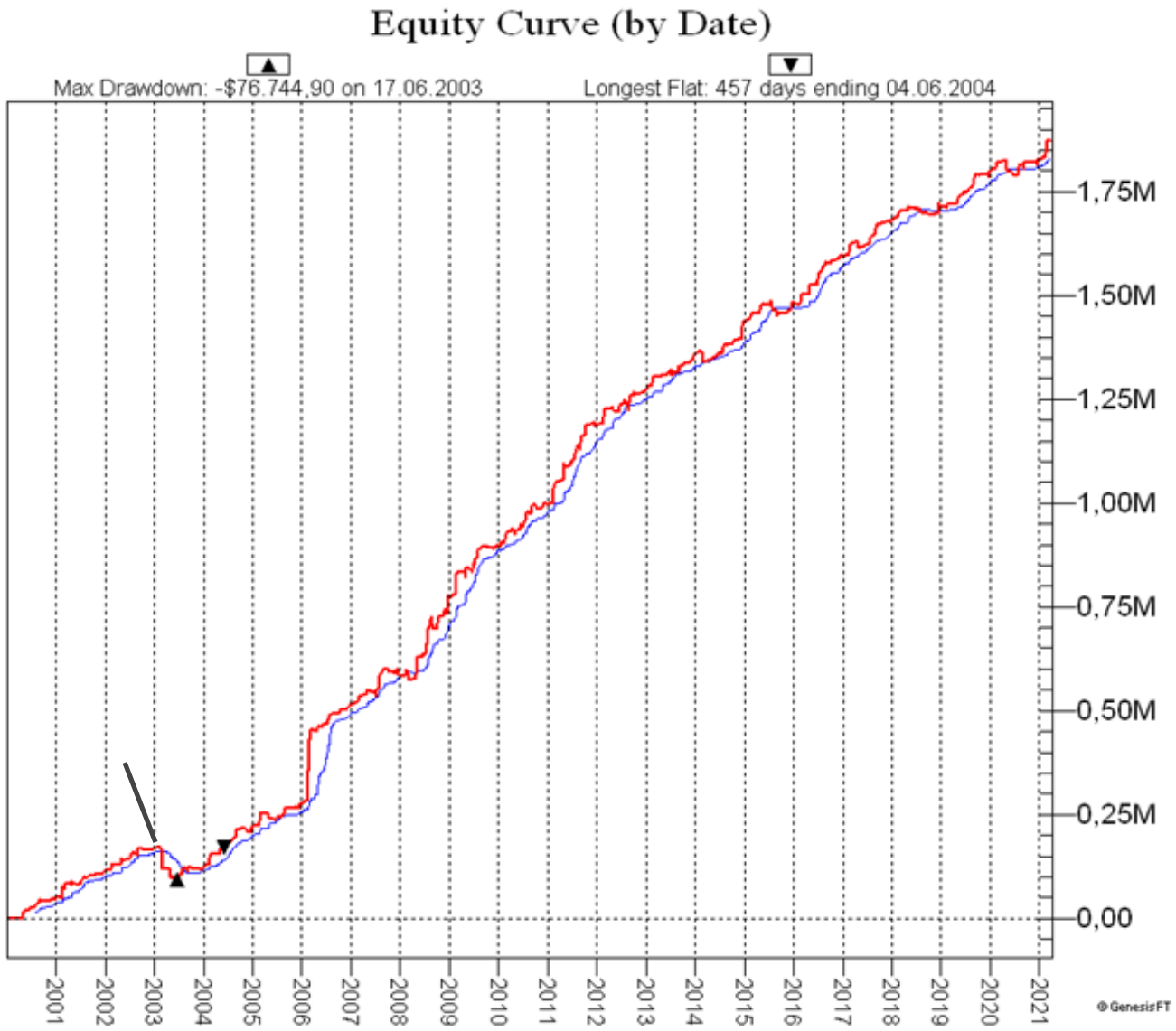
Mit anderen Worten: Der Startzeitpunkt ist zufällig, und wird bei einigen gut, bei anderen super und bei wiederum anderen total besch… sein. Entscheidend ist das

WEITERMACHEN

90% der Trader glauben, die Spitze der Pyramide reiche aus

Performance der Top-Seasonals (45 Trades p.a.)

ZEITSCHONEND



Summary - All Trades

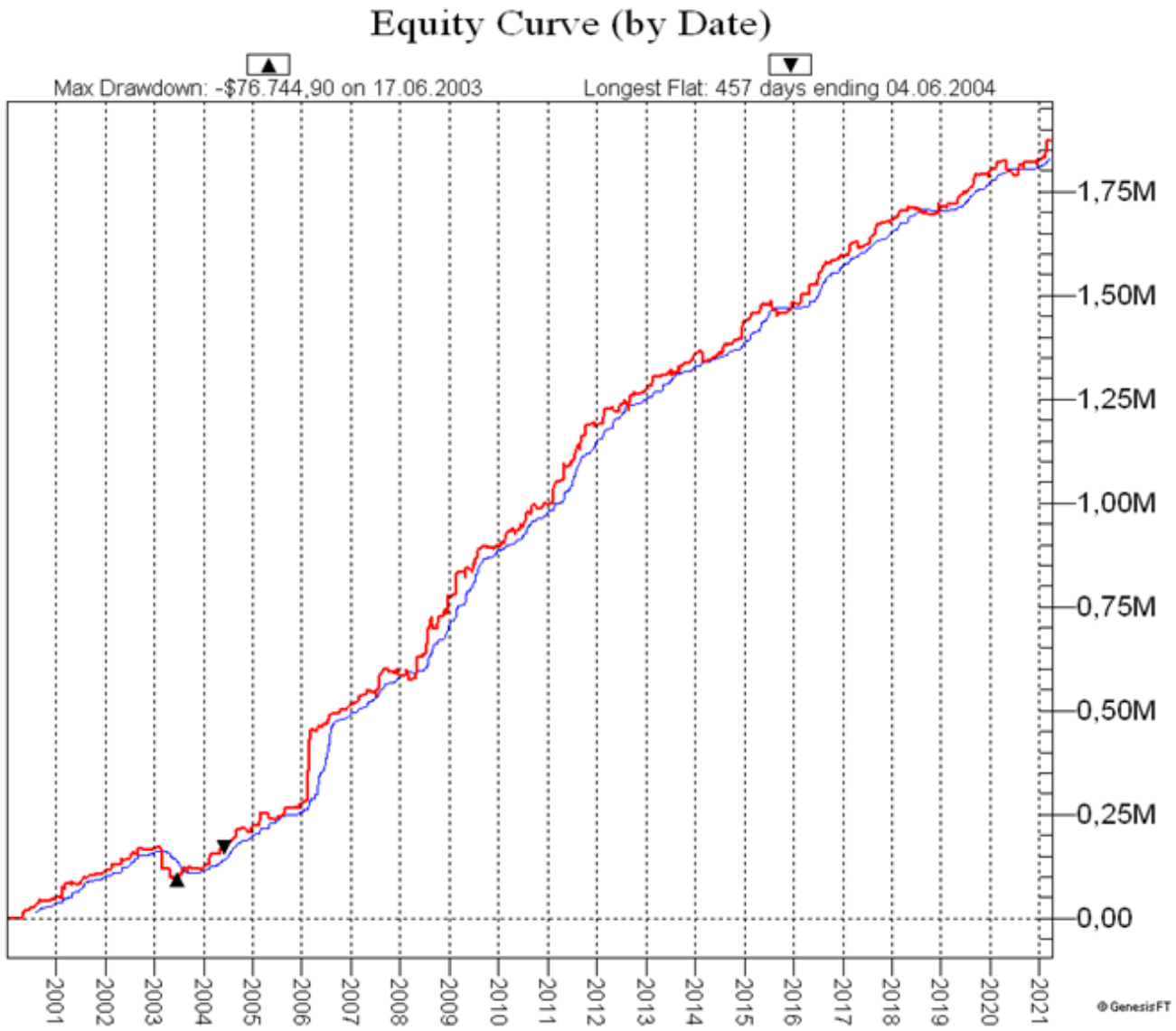
Overall			
Total Net Profit:	$1.872.489	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**2,85**
Total Trades:	989	Winning Percentage:	66,4%
Average Trade:	$1.893	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	1,44
Max Closed-out Drawdown:	-$76.745	CPC Index (PF x Win% x PR):	2,72
Max Intra-trade Drawdown:	-$78.407	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	61,99%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$5.482	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	43,09%
Percent in the Market:	13,5%	Optimal f:	0,96
Avg # of Bars in Trade:	34,38	Z-Score (W/L Predictability):	-1,1
Avg # of Trades per Year:	46,6	Current Streak:	1 Losses

Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$7.343	Monthly Sharpe Ratio:	0,49
Std Dev of Monthly Profits:	$14.943	Annualized Sharpe Ratio:	1,70
		Calmar Ratio:	1,12

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	657	Total Losers:	332
Gross Profit:	$2.886.503	Gross Loss:	-$1.014.014
Average Win:	$4.393	Average Loss:	-$3.054
Largest Win:	$74.390	Largest Loss:	-$40.030
Largest Drawdown in Win:	-$20.700	Largest Peak in Loss:	$14.340
Avg Drawdown in Win:	-$1.565	Avg Peak in Loss:	$1.725
Avg Run Up in Win:	$5.948	Avg Run Up in Loss:	$1.725
Avg Run Down in Win:	-$1.565	Avg Run Down in Loss:	-$4.902
Most Consec Wins:	14	Most Consec Losses:	7
Avg # of Consec Wins:	3,08	Avg # of Consec Losses:	1,56
Avg # of Bars in Wins:	34,70	Avg # of Bars in Losses:	33,75

© GenesisFT

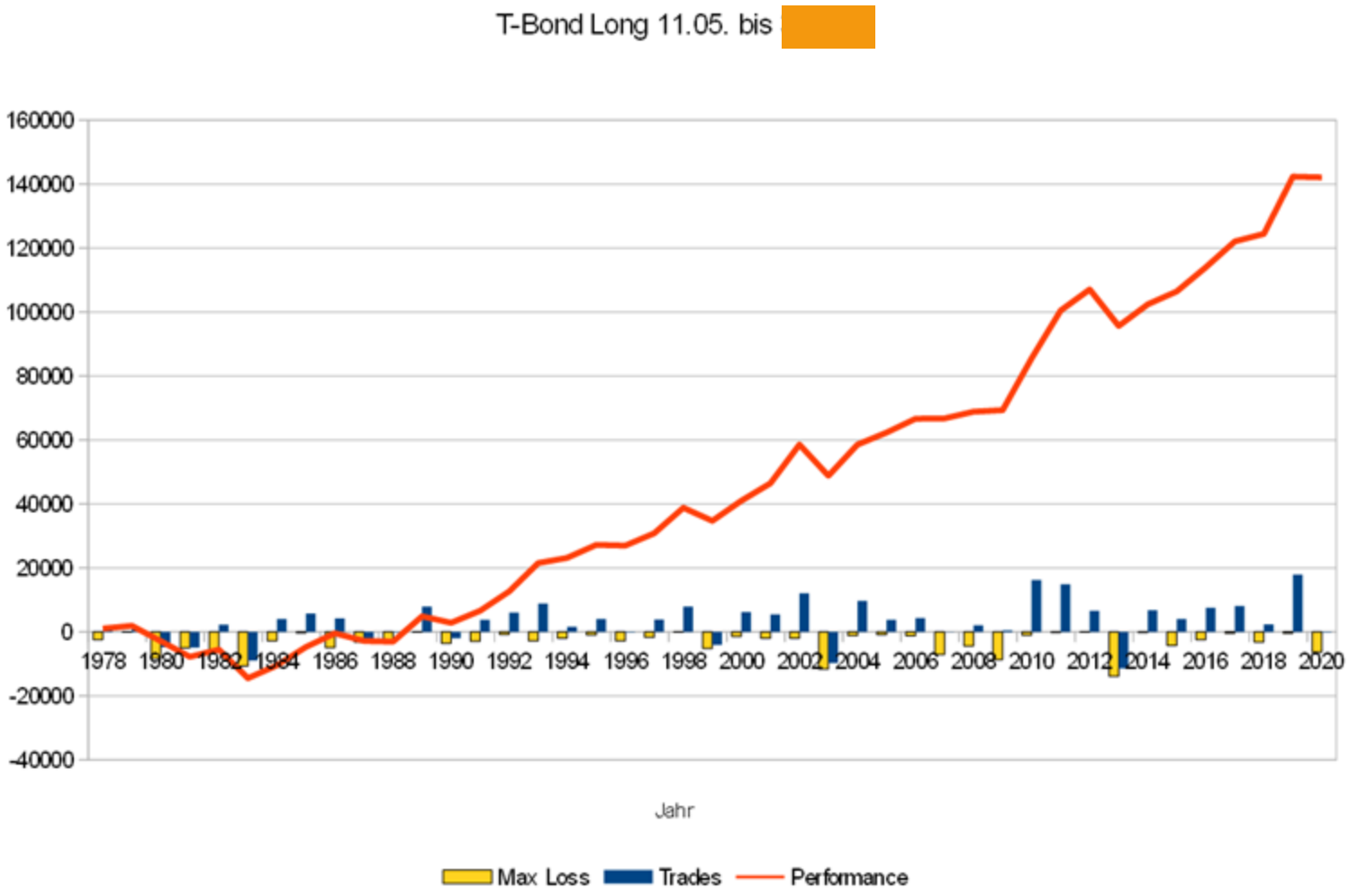
Baustein 1: Top-Seasonals (45 Trades p.a.)



Baustein 1 – meine **45 Top-Seasonal Trades** sind 45 Trades auf insgesamt 27 Märkte (alle Assetklassen vertreten), die pro Trade mit 5 Minuten Zeitaufwand und klaren Vorgaben für Einstieg, Ausstieg und Stopp umsetzbar sind.

Die **Haltedauer** geht bei allen Trades über **mehrere Wochen, teils Monate**. Jedem Trade gründet auf **sehr starken, fundamentalen Basiseffekten** des jeweiligen Marktes und ist somit auch nachvollziehbar. Das ist **wichtig**, **denn Du brauchst Überzeugung und Vertrauen**, **um dauerhaft diszipliniert** gemäß Strategie(n) zu handeln.

Beispiel für einen Top-Seasonal-Trade



Summary - All Trades

Overall

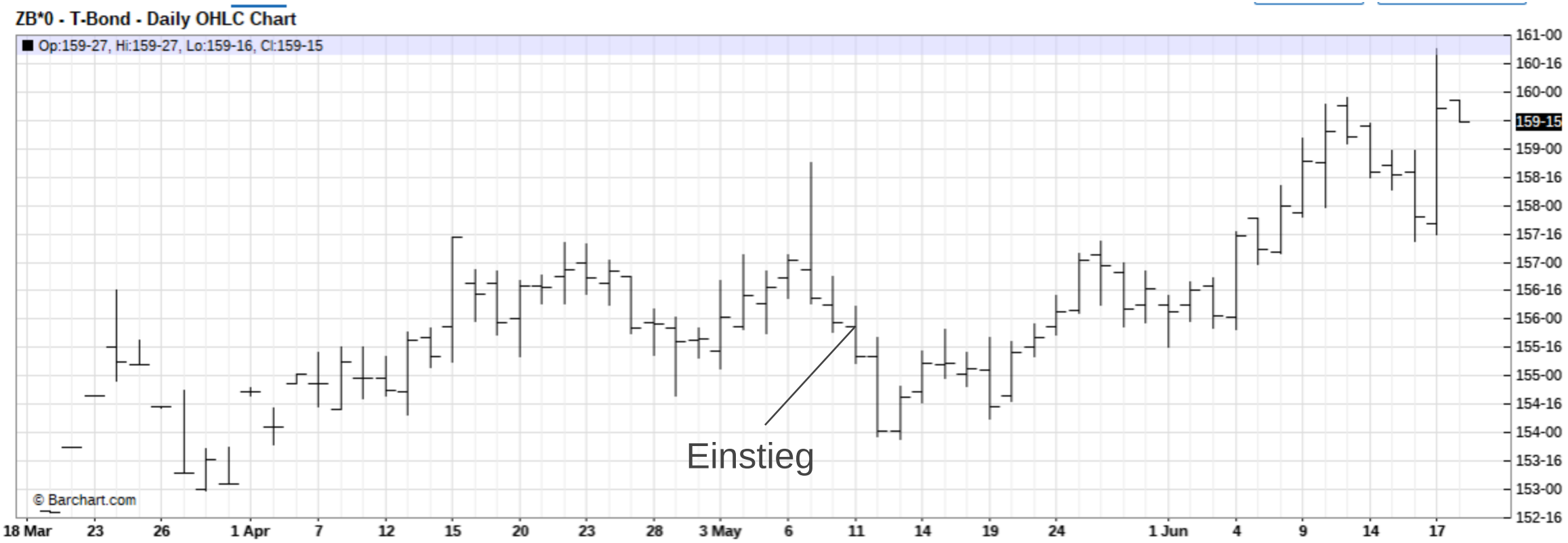
Total Net Profit:	$142.117	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**3,90**
Total Trades:	43	Winning Percentage:	74,4%
Average Trade:	$3.305	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	1,34
Max Closed-out Drawdown:	-$16.415	CPC Index (PF x Win% x PR):	3,90
Max Intra-trade Drawdown:	-$23.583	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	74,31%
Account Size Required:	$27.543	Return Pct:	**516,0%**
Open Equity:	$0	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	55,36%
Percent in the Market:	31,8%	Optimal f:	0,76
Avg # of Bars in Trade:	79,28	Z-Score (W/L Predictability):	0,5
Avg # of Trades per Year:	1,0	Current Streak:	1 Losses

Monthly Profit Analysis

Average Monthly Profit:	$281	Monthly Sharpe Ratio:	0,11
Std Dev of Monthly Profits:	$2.035	Annualized Sharpe Ratio:	0,39
		Calmar Ratio:	0,14

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	32	Total Losers:	11
Gross Profit:	$191.039	Gross Loss:	-$48.923
Average Win:	$5.970	Average Loss:	-$4.448
Largest Win:	$17.896	Largest Loss:	-$11.416
Largest Drawdown in Win:	-$8.713	Largest Peak in Loss:	$7.646
Avg Drawdown in Win:	-$2.143	Avg Peak in Loss:	$4.192
Avg Run Up in Win:	$7.820	Avg Run Up in Loss:	$4.192
Avg Run Down in Win:	-$2.143	Avg Run Down in Loss:	-$6.626
Most Consec Wins:	9	Most Consec Losses:	2
Avg # of Consec Wins:	3,56	Avg # of Consec Losses:	1,22
Avg # of Bars in Wins:	79,41	Avg # of Bars in Losses:	78,91

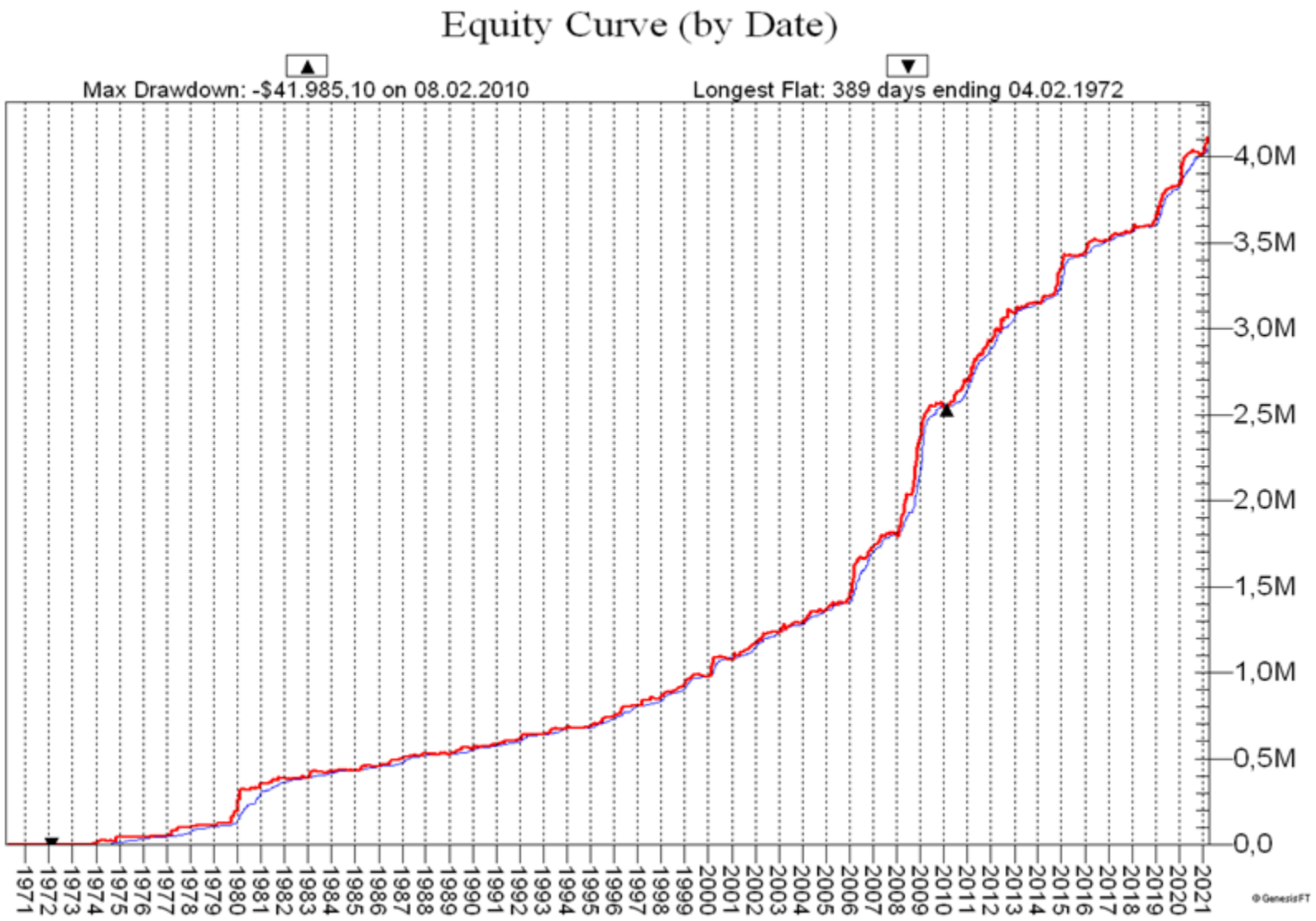
Beispiel für einen Top-Seasonal-Trade im T-Bond



Der Trade läuft noch bis in den Spätsommer (August) hinein…

Baustein 2: Die PowerBreakouts (97 Trades p.a.)

ZEITSCHONEND



Summary - All Trades

Overall			
Total Net Profit:	$4.110.279	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**3,82**
Total Trades:	1.899	Winning Percentage:	65,0%
Average Trade:	$2.164	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	2,05
Max Closed-out Drawdown:	-$41.985	CPC Index (PF x Win% x PR):	5,09
Max Intra-trade Drawdown:	-$51.040	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	98,48%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$11.505	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	47,99%
Percent in the Market:	5,7%	Optimal f:	0,97
Avg # of Bars in Trade:	28,82	Z-Score (W/L Predictability):	-8,5
Avg # of Trades per Year:	37,2	Current Streak:	1 Losses

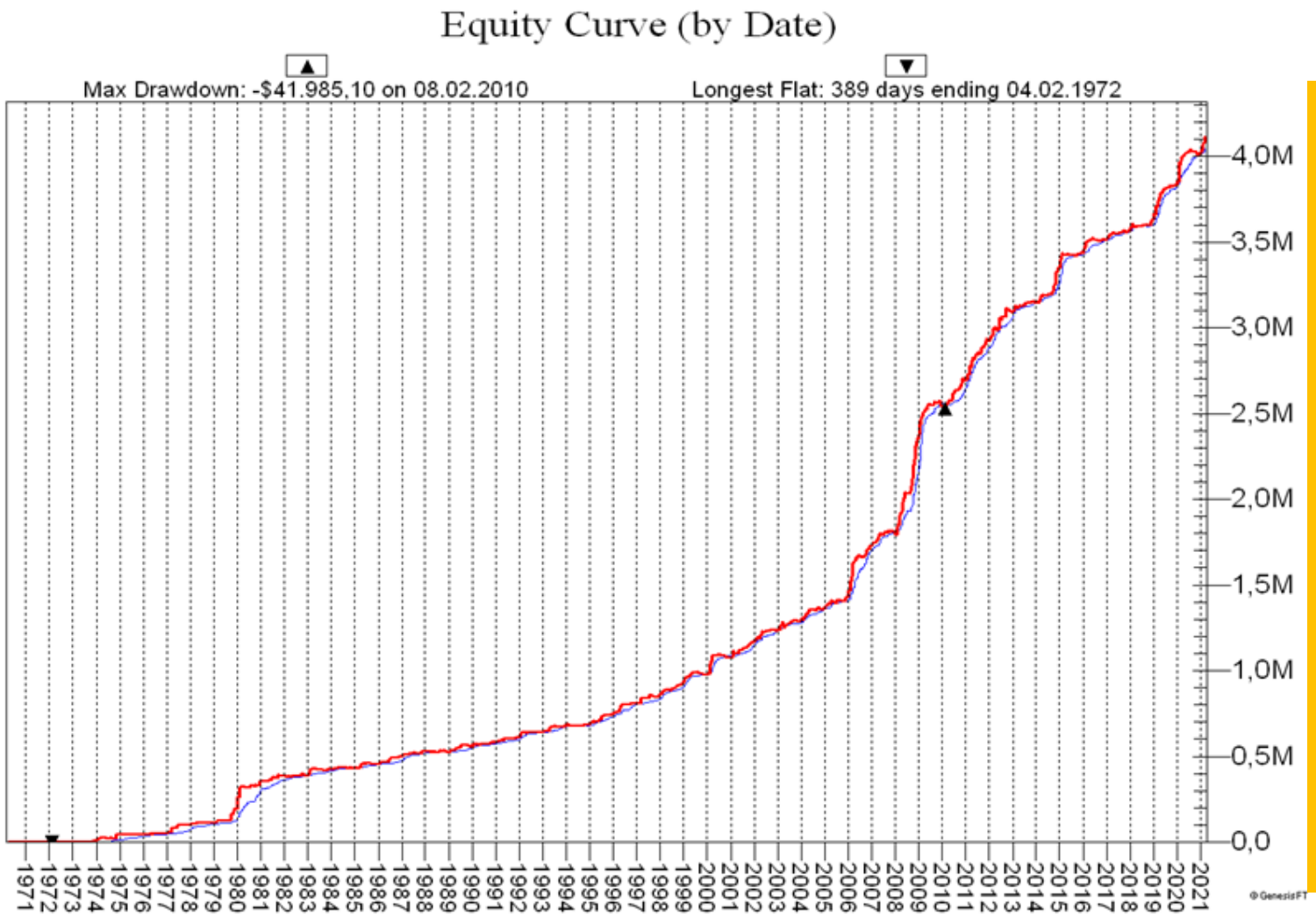
Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$6.716	Monthly Sharpe Ratio:	0,43
Std Dev of Monthly Profits:	$15.607	Annualized Sharpe Ratio:	1,49
		Calmar Ratio:	1,58

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	1.235	Total Losers:	664
Gross Profit:	$5.569.631	Gross Loss:	-$1.459.352
Average Win:	$4.510	Average Loss:	-$2.198
Largest Win:	$60.580	Largest Loss:	-$13.023
Largest Drawdown in Win:	-$29.850	Largest Peak in Loss:	$30.360
Avg Drawdown in Win:	-$1.335	Avg Peak in Loss:	$1.706
Avg Run Up in Win:	$6.257	Avg Run Up in Loss:	$1.706
Avg Run Down in Win:	-$1.335	Avg Run Down in Loss:	-$3.020
Most Consec Wins:	26	Most Consec Losses:	9
Avg # of Consec Wins:	3,55	Avg # of Consec Losses:	1,91
Avg # of Bars in Wins:	31,25	Avg # of Bars in Losses:	24,31

© GenesisFT

Baustein 2: Die PowerBreakouts (97 Trades p.a.)

ZEITSCHONEND

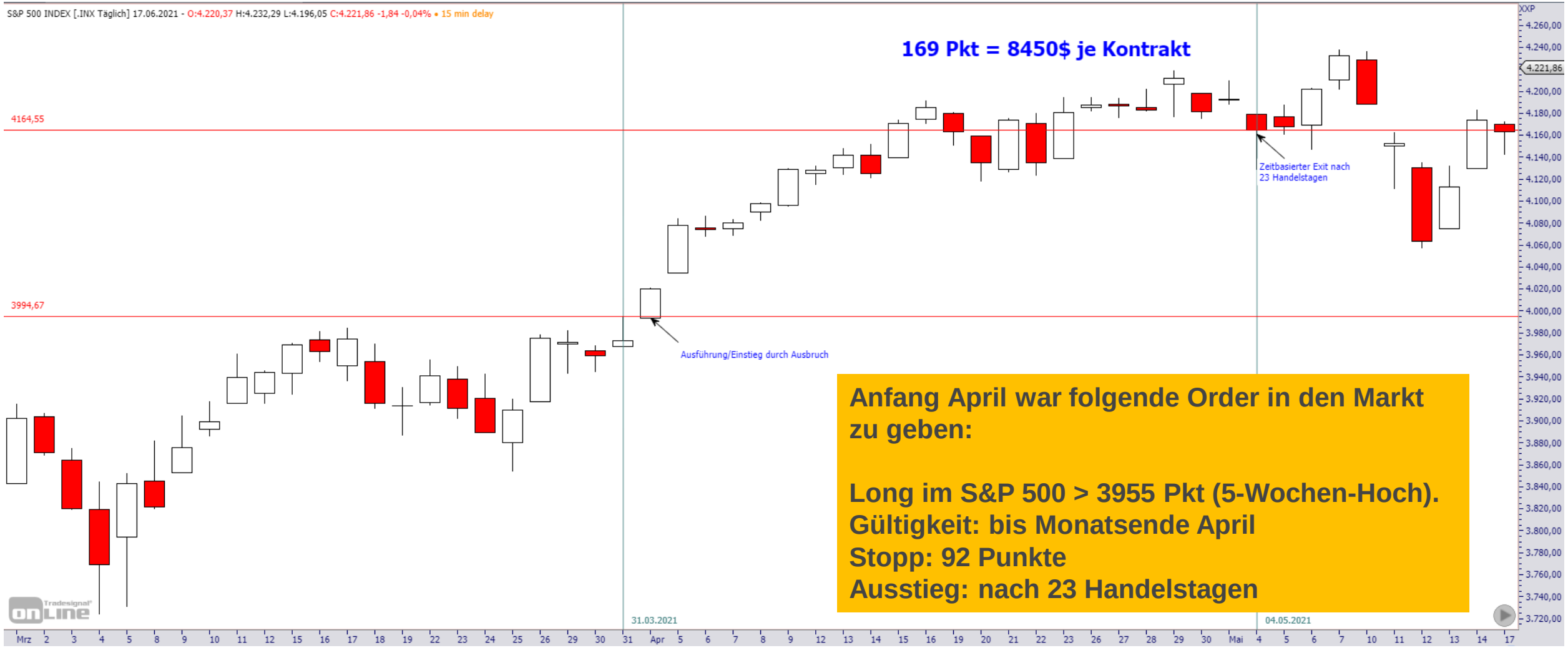


Baustein 2 – meine **97 PowerBreakout Trades** sind 97 Trades auf insgesamt 16 Märkte (alle Assetklassen vertreten), die pro Trade mit 5 Minuten Zeitaufwand und klaren Vorgaben für Einstieg, Ausstieg und Stopp umsetzbar sind.

Die Orders werden immer (und NUR) am ersten Handelstag des (Kalender)Monats aufgegeben. Es sind zeitlich konditionierte Ausbruchs-Trades mit einem klar definierten Zeitfenster für die Haltedauer und einem klar vorgegebenen Stopp.

© GenesisFT

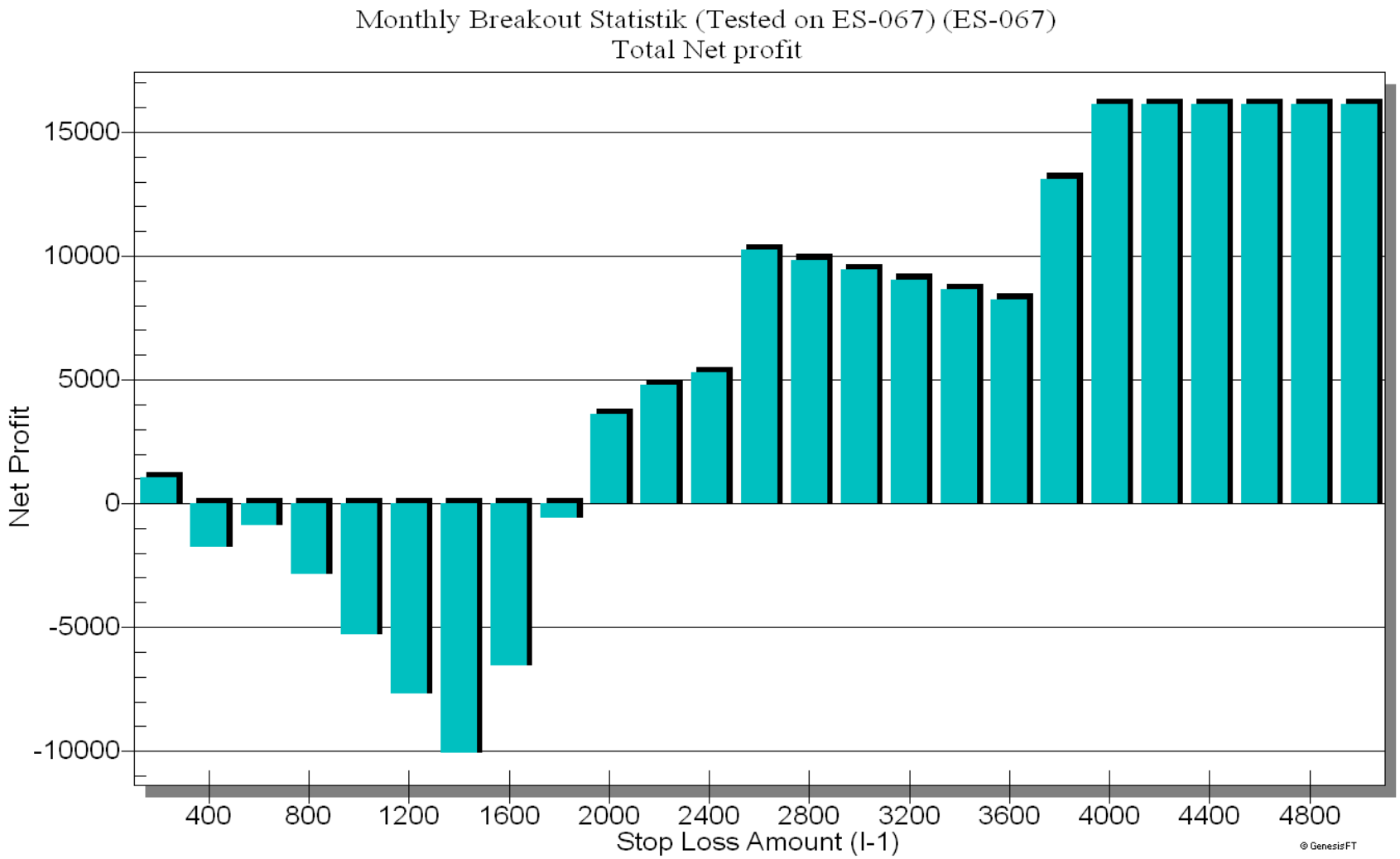
Beispiel für einen PowerBreakout-Trade



Anfang April war folgende Order in den Markt zu geben:

Long im S&P 500 > 3955 Pkt (5-Wochen-Hoch).
Gültigkeit: bis Monatsende April
Stopp: 92 Punkte
Ausstieg: nach 23 Handelstagen

S&P 500 Long (4) – Stopp 4600$ (92 Pkt)



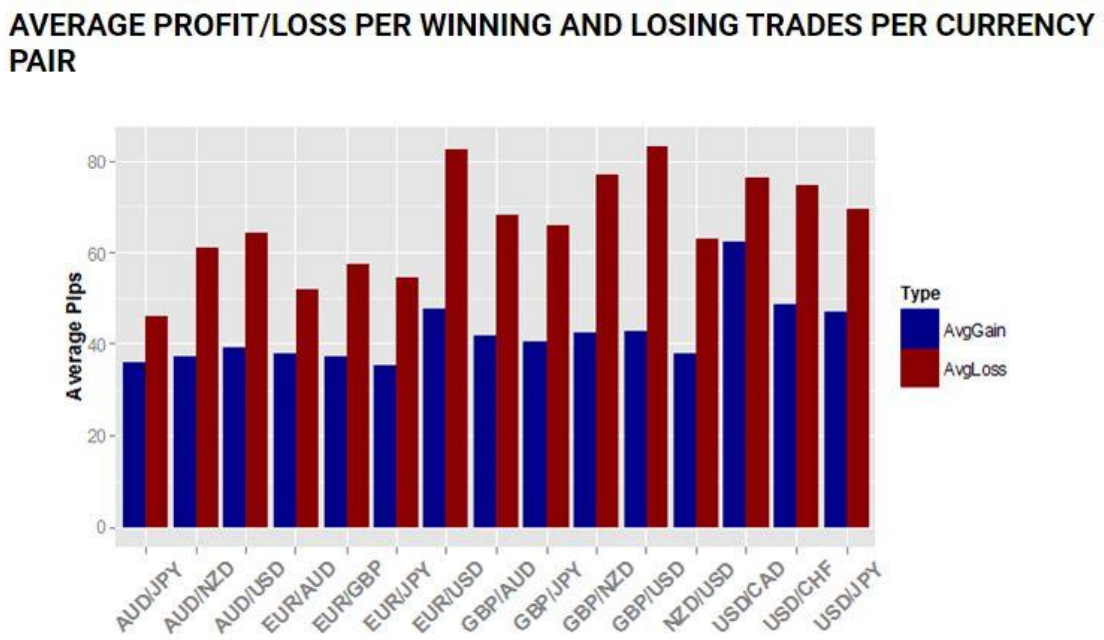
Gehandelt wird LONG im S&P 500, WENN das März-Hoch im April überschritten wird.

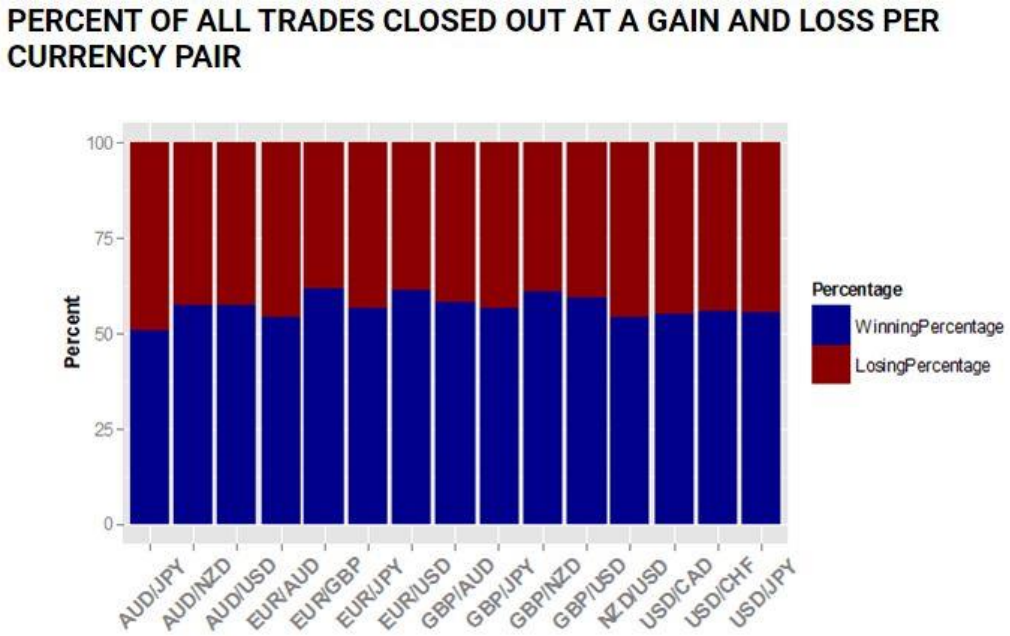
Der Stopp liegt bei 4600$ im Future, was 92 Punkten im S&P 500 entspricht. Wenn der Trade z.B. bei 4000 Pkt ausgelöst wird, muss der Stopp bei 3908 Pkt liegen.

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

Gewichtungs-Kategorie: 4/4

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.

Was wir verstanden haben müssen über den Ausstieg/die Haltedauer

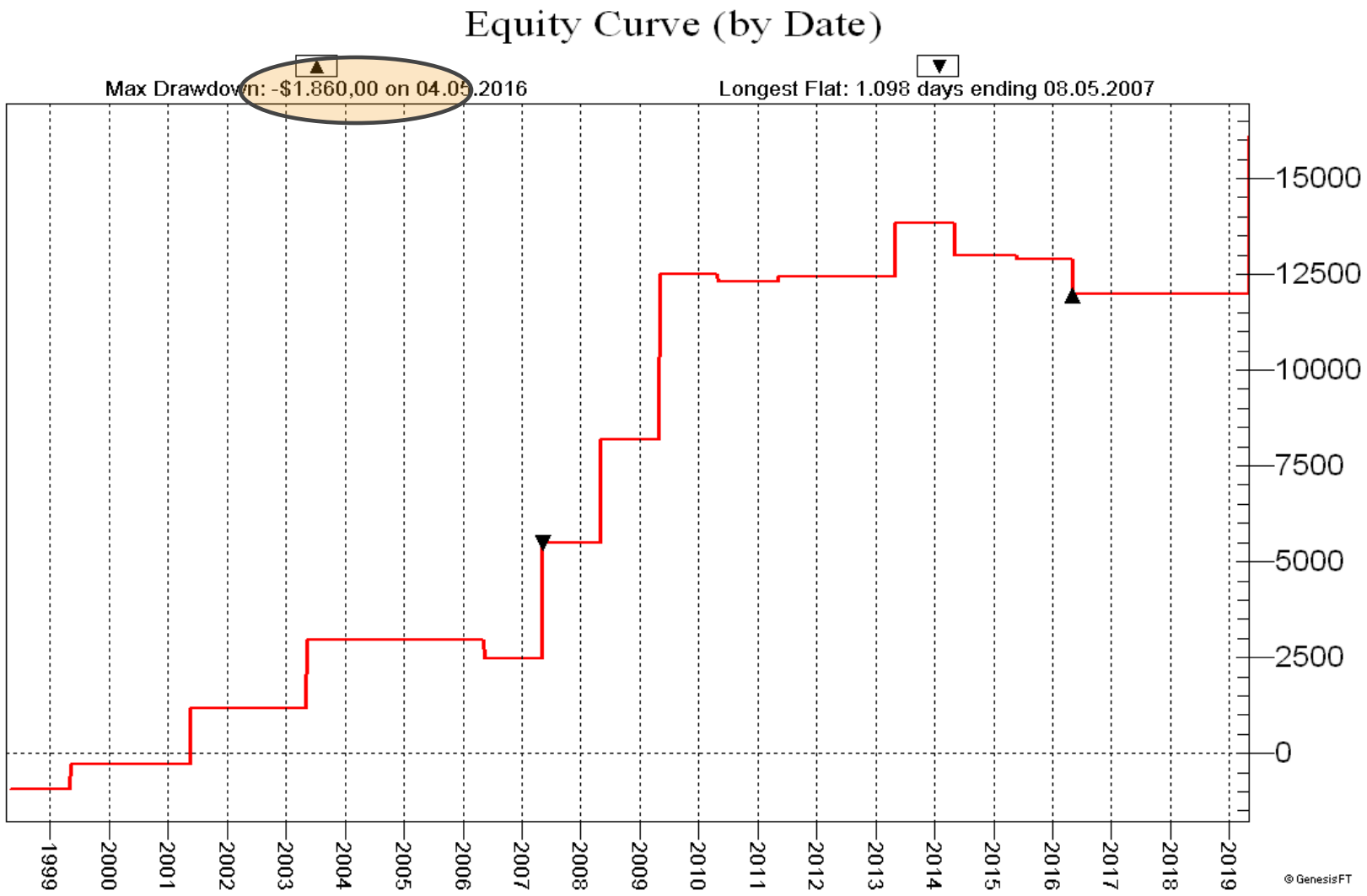
Es gibt eine mathematisch notwendige Mischung/Kombination aus notwendigem Stopp und sinnvollem Ausstieg. Aus ANGST handhaben Trader beides falsch, und bewegen sich damit weg von einem statistischen Vorteil.

Meine persönliche Erfahrung ist, dass immer dann, wenn ich das getan habe, es richtig blutige Nasen gab!

Wer zu schnell ausstoppt, dem Trade nicht den statistisch notwendigen Raum gibt, nimmt seine besten Spieler zu früh vom Feld.

Und wer Gewinne verfrüht, unsystematisch mitnimmt, der „isst seinen Teller nicht leer“, und lässt Potenziale liegen

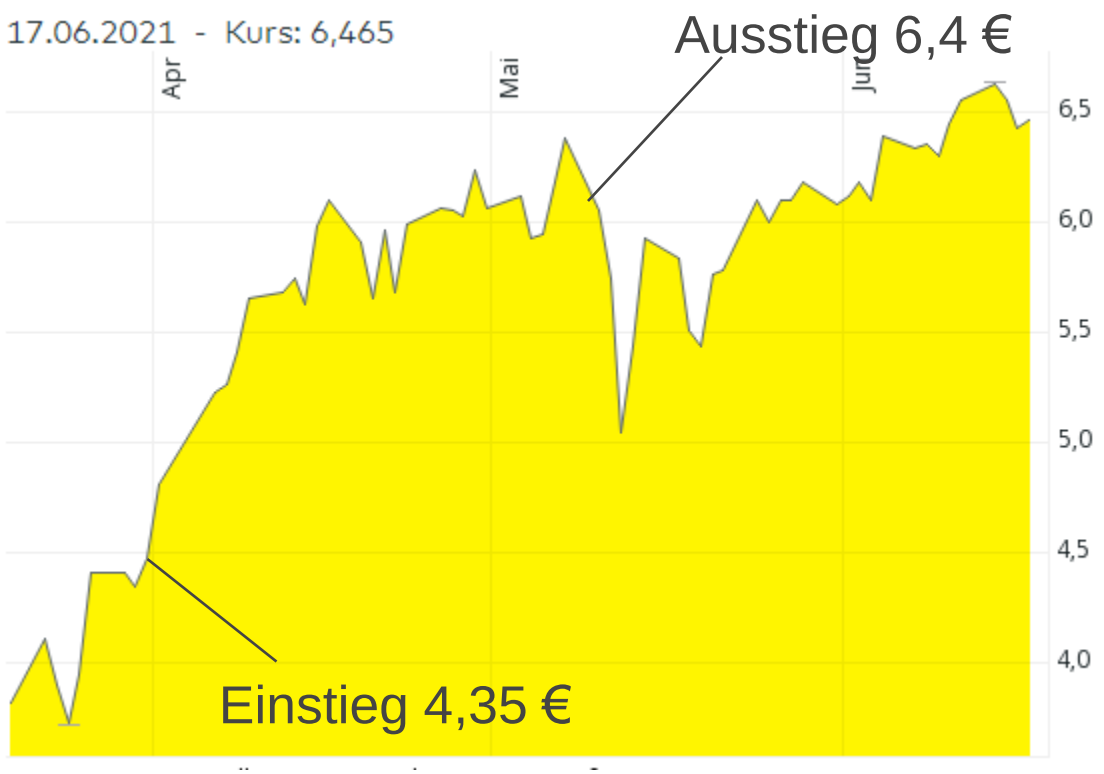
S&P 500 Long (4) – Stopp (92 Pkt)



Die Kapitalkurve zeigt nur geringe Schwankungen (37,2 Pkt maximal), so dass ich diesen Trade voll gewichte. Voll bedeutet für mich bei einem Hebelzertifikate-Portfolio 3,33% Risiko (damit fühle ich mich wohl). Bei einem 15k-Konto sind das 500 Euro Einsatz.

Die Produktauswahl ergibt sich aus dem notwendigen Stopp gemäß Strategie. Hier liegt der Stopp 92 Pkt entfernt. Also muss ich mindestens einen Schein wählen, dessen K.O. 100 Pkt entfernt ist.

S&P 500 Long (4) – WKN: MA3HGN



Binnen 23 Handelstagen Haltedauer legte der Schein um 47% zu.

Der Gewinn auf den Einsatz von seinerzeit 652 € betrug 307 €.

Im Micro-Future waren es 845 Dollar Gewinn, im S&P emini Futures 8450 Dollar.

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

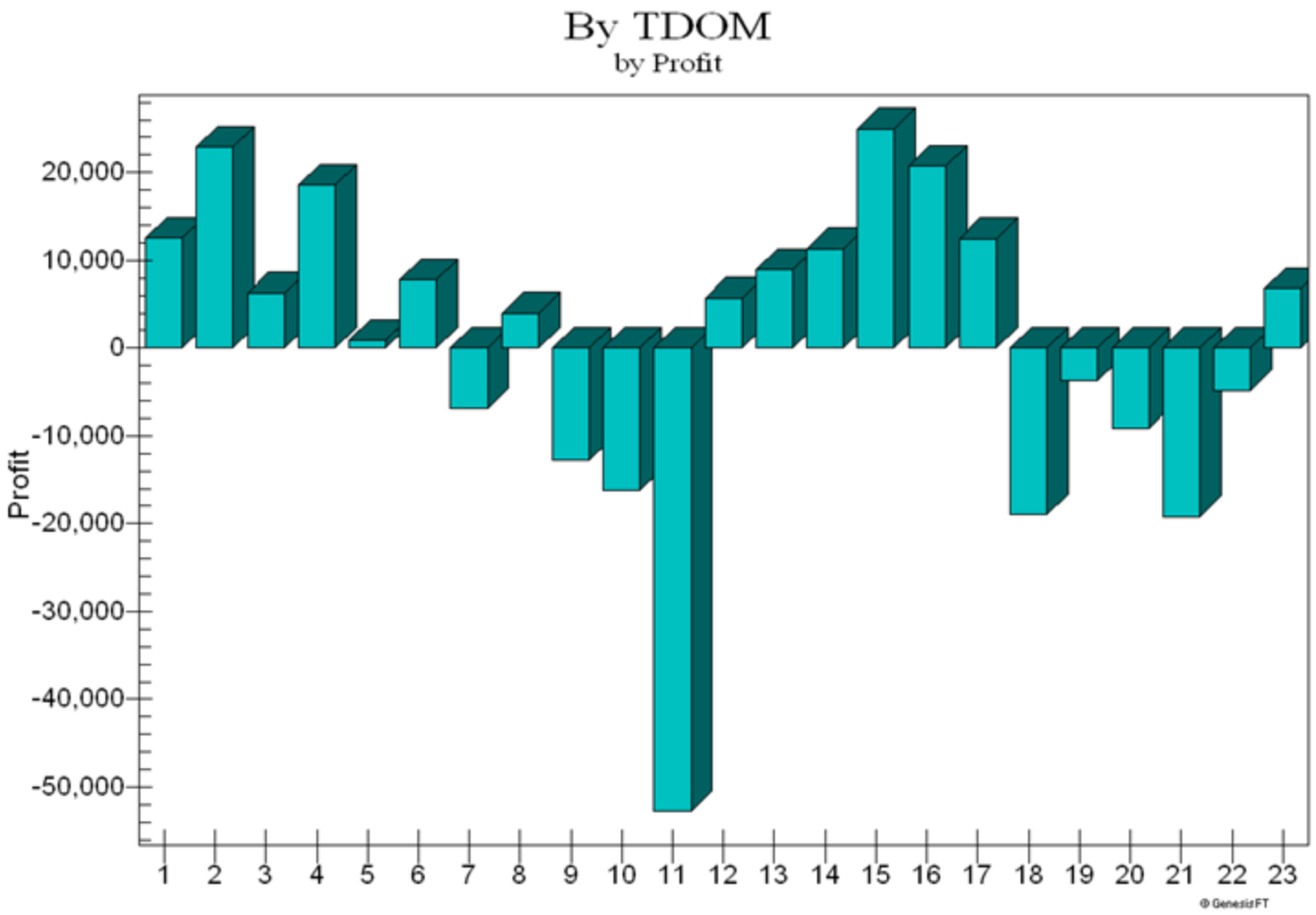
© GenesisFT

Short

Baustein 3: Kurzfristige Systemtrades

- FOMC-Effekt
- Nonfarm Payrolls Effekt
- BestDays of the Month in Gold, WTI, S&P 500, DAX
- 1 Outside-Pattern
- MegaCandle im Kaffee und Zucker

Die besten & schlechtesten Handelstage bei Gold

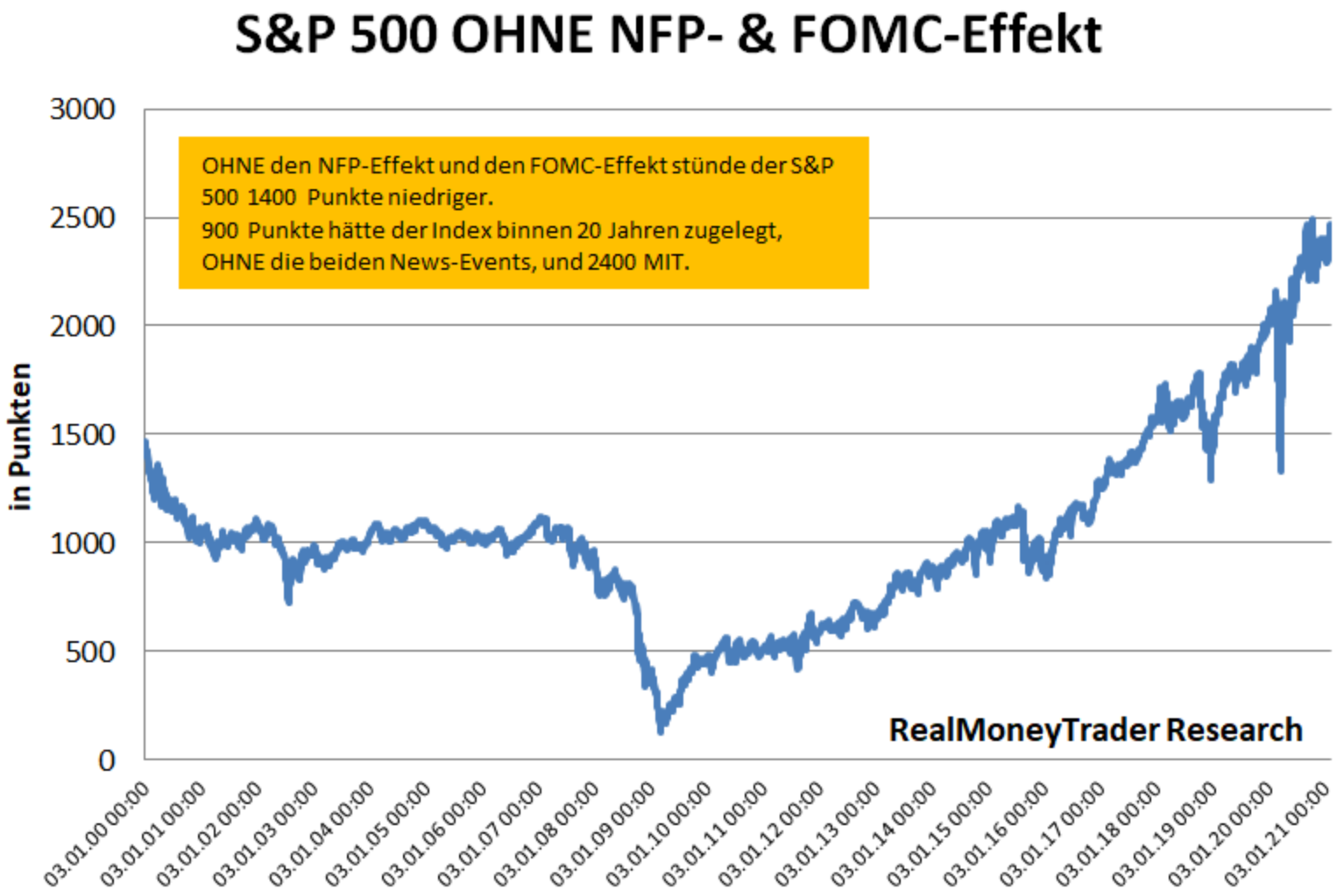


Institutionelles Geld, aber auch die kommerziellen Adressen agieren schematisch im Markt. Darum ergeben sich spezifische Zeitfenster innerhalb eines Monats, in dem ein Markt eher schwächelt oder zur Stärke neigt.
Dies liegt in folgenden fundamentalen Begebenheiten begründet:

- Lieferperioden des Kontraktes
- Sparpläne
- Roll-Termine
- (relevante) Wirtschaftsdaten

Der Goldpreis ist **zwischen Handelstag 23 und 4 im Schnitt positiv, ebenso zwischen Handelstag 12 und 17**, während er **zwischen Handelstag 9 und 11 am meisten eingebüßt** hat. Als aktiver Trader können wir dieses Wissen nutzen.

NFP & FOMC haben einen riesigen Effekt für den Aktienmarkt



Bei den FED-Sitzungen (FOMC) neigt der S&P 500 im Durchschnitt dazu, deutlich zuzulegen an den beiden Sitzungstagen.

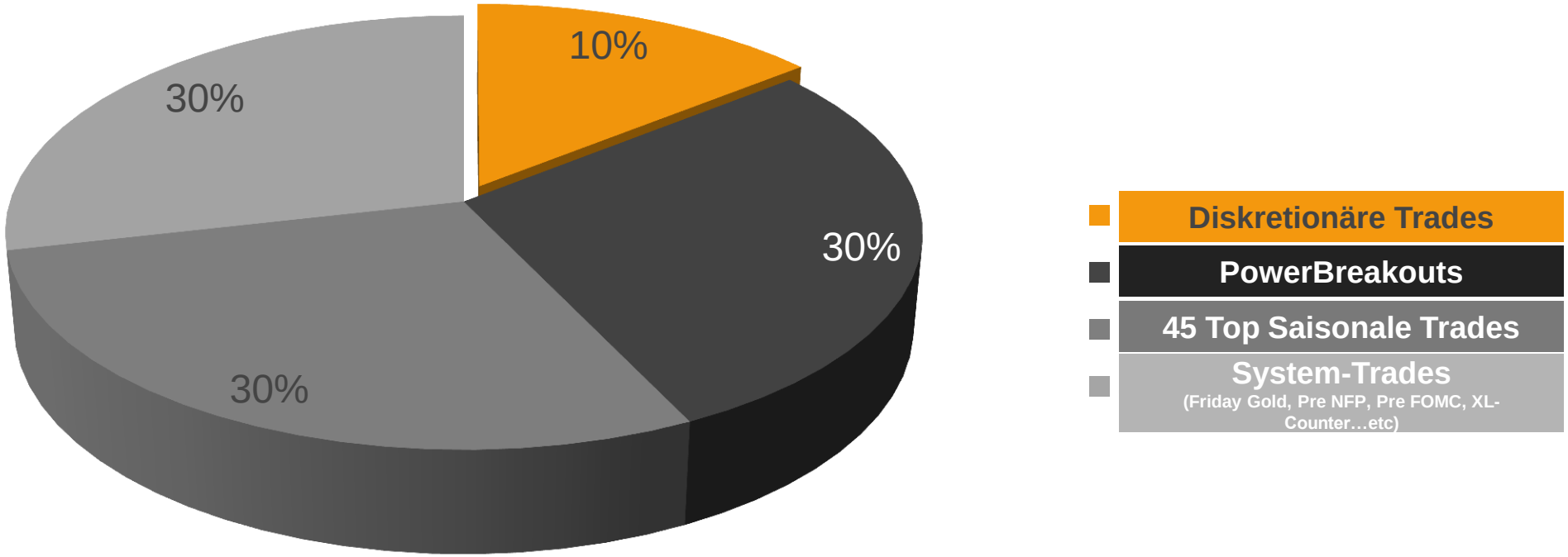
Bei den Nonfarm Payrolls (US-Arbeitsmarktbericht ohne Landwirtschaft) ist der Effekt, in 73% der Fälle steigend von Mittwoch vor bis Freitag .

Wenn man diese beiden „News-Effekte“ ausblenden würde, stünde der S&P 500 nur bei 2450 Punkten, und damit fast 1400 Zähler niedriger, als er es tatsächlich tut. Der Anteil dieser beiden News-Events an der Performance des S&P 500 ist also beträchtlich. Für Dich als Trader muss dies bedeuten, dass es sinnvoll ist, sich auf diese News-Events zu fokussieren.

Ich tue dies mit dafür eigens ausgearbeiteten News-Strategien, die speziell für die FOMC-Meetings und die Nonfarm Payrolls ausgelegt sind.

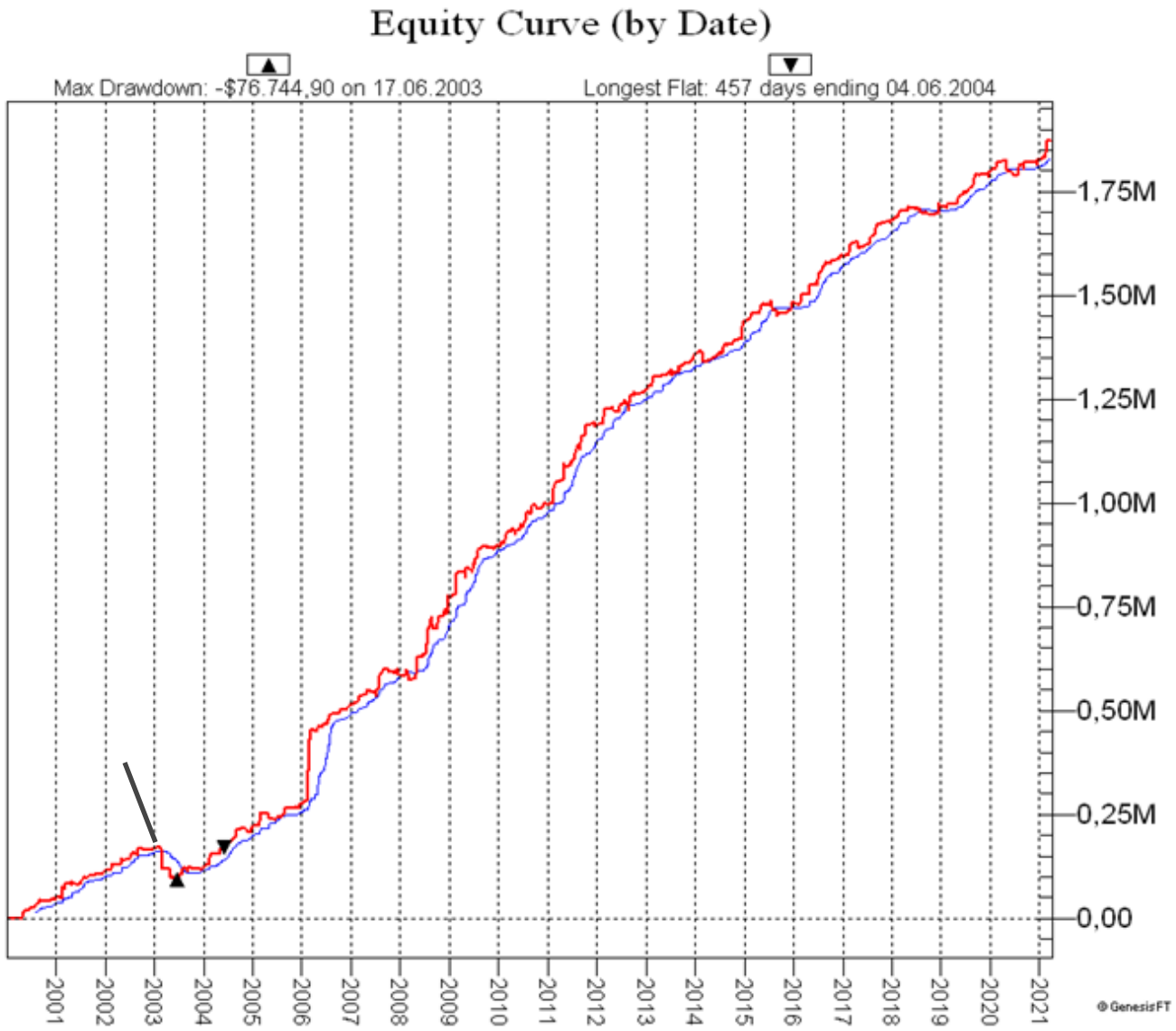
Eine gesunde Mischung aus Strategien in einem Portfolio

Akzentuierung im Portfolio



Performance der Top-Seasonals (45 Trades p.a.)

ZEITSCHONEND



Summary - All Trades

Overall			
Total Net Profit:	$1.872.489	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**2,85**
Total Trades:	989	Winning Percentage:	66,4%
Average Trade:	$1.893	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	1,44
Max Closed-out Drawdown:	-$76.745	CPC Index (PF x Win% x PR):	2,72
Max Intra-trade Drawdown:	-$78.407	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	61,99%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$5.482	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	43,09%
Percent in the Market:	13,5%	Optimal f:	0,96
Avg # of Bars in Trade:	34,38	Z-Score (W/L Predictability):	-1,1
Avg # of Trades per Year:	46,6	Current Streak:	1 Losses

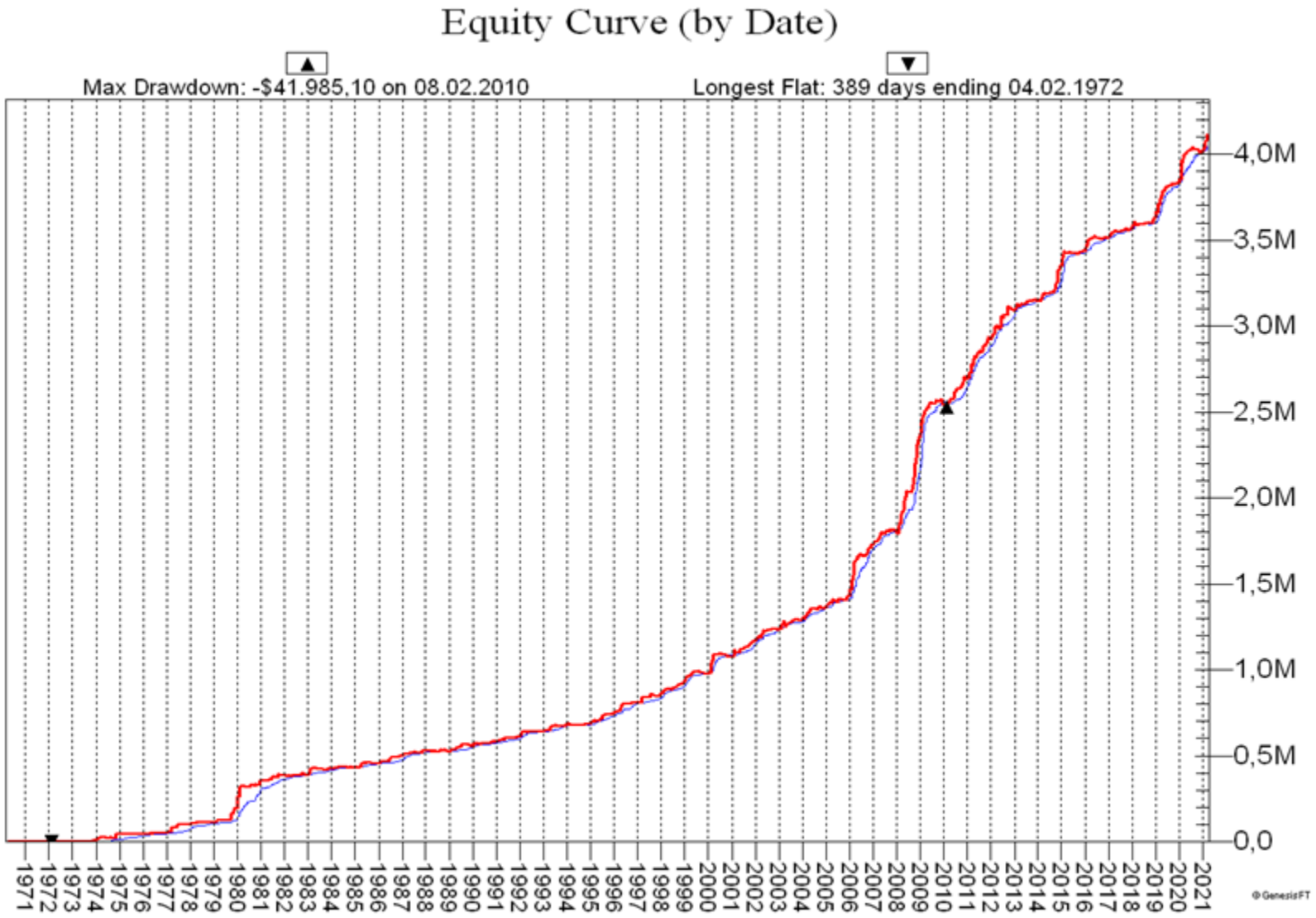
Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$7.343	Monthly Sharpe Ratio:	0,49
Std Dev of Monthly Profits:	$14.943	Annualized Sharpe Ratio:	1,70
		Calmar Ratio:	1,12

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	657	Total Losers:	332
Gross Profit:	$2.886.503	Gross Loss:	-$1.014.014
Average Win:	$4.393	Average Loss:	-$3.054
Largest Win:	$74.390	Largest Loss:	-$40.030
Largest Drawdown in Win:	-$20.700	Largest Peak in Loss:	$14.340
Avg Drawdown in Win:	-$1.565	Avg Peak in Loss:	$1.725
Avg Run Up in Win:	$5.948	Avg Run Up in Loss:	$1.725
Avg Run Down in Win:	-$1.565	Avg Run Down in Loss:	-$4.902
Most Consec Wins:	14	Most Consec Losses:	7
Avg # of Consec Wins:	3,08	Avg # of Consec Losses:	1,56
Avg # of Bars in Wins:	34,70	Avg # of Bars in Losses:	33,75

© GenesisFT

Performance der PowerBreakouts (97 Trades p.a.)

ZEITSCHONEND



Summary - All Trades

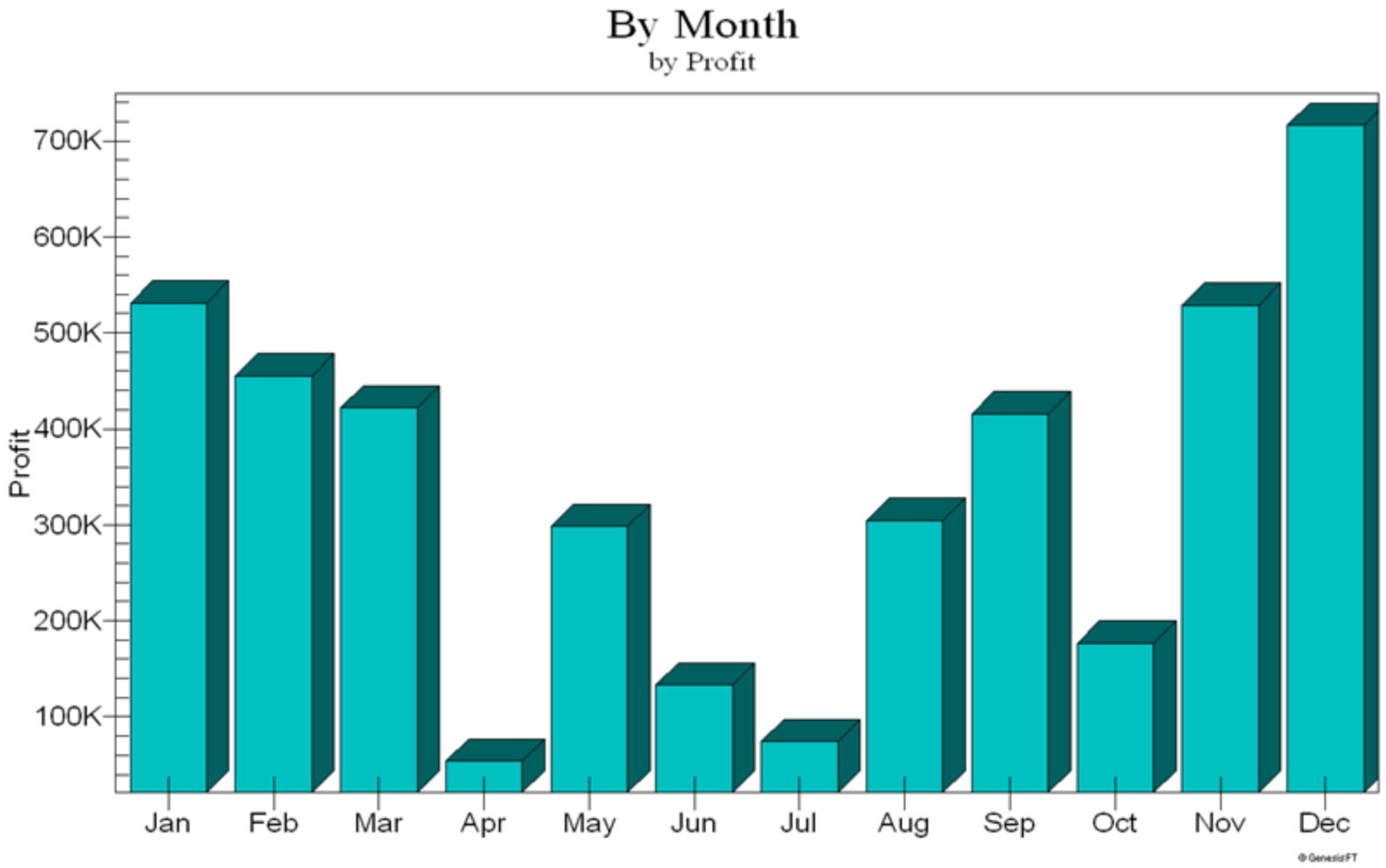
Overall			
Total Net Profit:	$4.110.279	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**3,82**
Total Trades:	1.899	Winning Percentage:	65,0%
Average Trade:	$2.164	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	2,05
Max Closed-out Drawdown:	-$41.985	CPC Index (PF x Win% x PR):	5,09
Max Intra-trade Drawdown:	-$51.040	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	98,48%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$11.505	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	47,99%
Percent in the Market:	5,7%	Optimal f:	0,97
Avg # of Bars in Trade:	28,82	Z-Score (W/L Predictability):	-8,5
Avg # of Trades per Year:	37,2	Current Streak:	1 Losses

Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$6.716	Monthly Sharpe Ratio:	0,43
Std Dev of Monthly Profits:	$15.607	Annualized Sharpe Ratio:	1,49
		Calmar Ratio:	1,58

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	1.235	Total Losers:	664
Gross Profit:	$5.569.631	Gross Loss:	-$1.459.352
Average Win:	$4.510	Average Loss:	-$2.198
Largest Win:	$60.580	Largest Loss:	-$13.023
Largest Drawdown in Win:	-$29.850	Largest Peak in Loss:	$30.360
Avg Drawdown in Win:	-$1.335	Avg Peak in Loss:	$1.706
Avg Run Up in Win:	$6.257	Avg Run Up in Loss:	$1.706
Avg Run Down in Win:	-$1.335	Avg Run Down in Loss:	-$3.020
Most Consec Wins:	26	Most Consec Losses:	9
Avg # of Consec Wins:	3,55	Avg # of Consec Losses:	1,91
Avg # of Bars in Wins:	31,25	Avg # of Bars in Losses:	24,31

© GenesisFT

Monatsverteilung der PowerBreakout-Performance



Die Monatsverteilung der PowerBreakout-Ergebnisse zeigt sehr deutlich, dass die wesentliche Performance-Zeit von August bis einschließlich März ist.

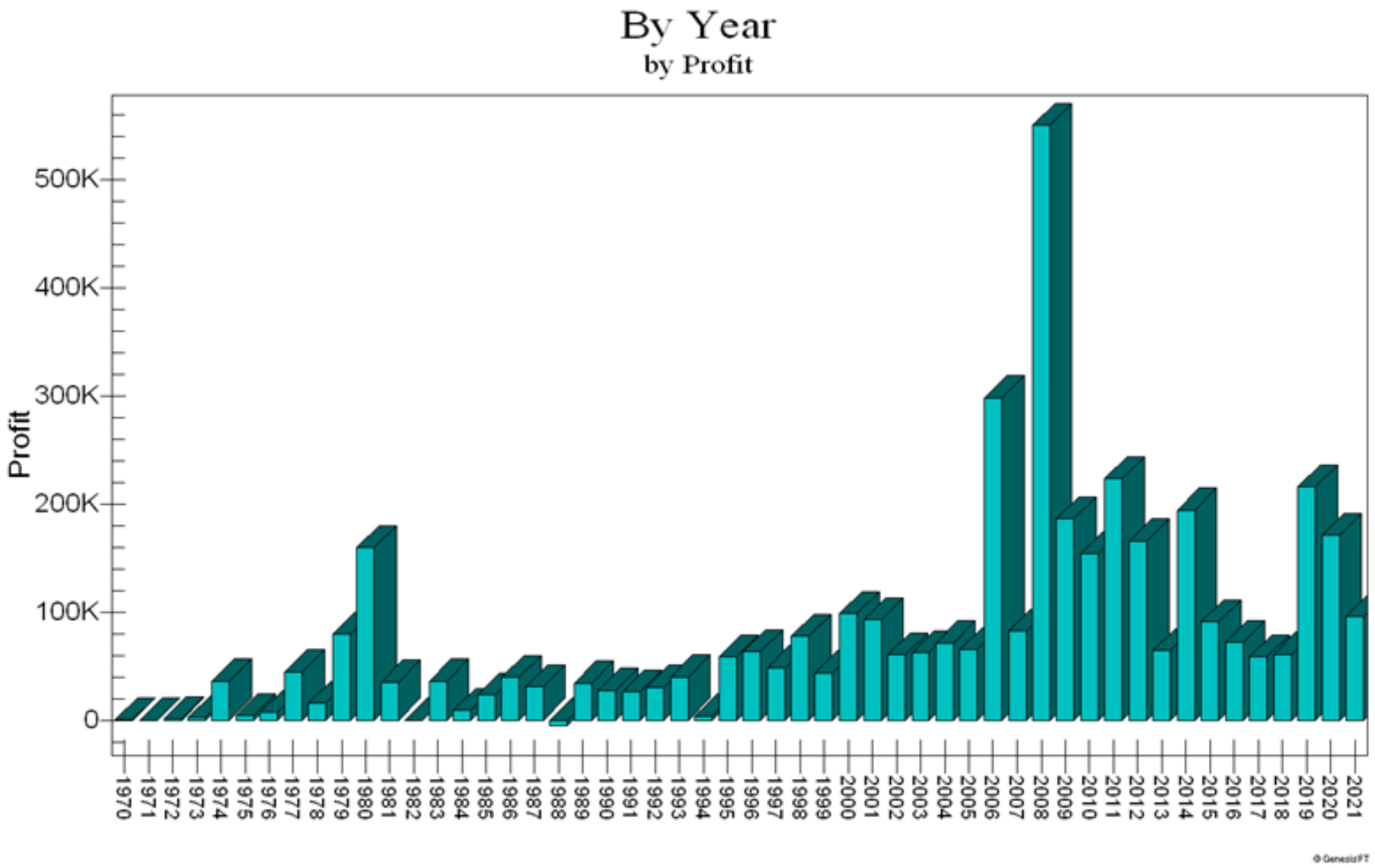
Hier wird der Löwenanteil der Performance erzielt.

Seit 1970 hat das Portfolio, bestehend aus 97 Orders p.a. 4.1 Millionen Dollar bei einem Startkapital von 50.000 Dollar erzielt. Wir raten dazu, mit 100.000 Dollar zu starten oder entsprechend zu skalieren mit Hebelzertifikaten oder CFD´s. Bei beidem helfen wir in den Live-Webinaren und den Trainings. Durchschnittlich sind das 80.593 Dollar Gewinn p.a.

August: 8 Trades
September: 9 Trades
Oktober: 5 Trades

November: 9 Trades
Dezember: 14 Trades

Jahres-Performance des PowerBreakout Portfolios seit 1970



PowerBreakouts sind an Zeitfenster gekoppelte Ausbruchs-Trades im „Wenn, dann…"-Modus. Es gibt 97 Orderplatzierungen pro Jahr, jedoch gibt es nicht immer eine Preisbestätigung. Also ist die Anzahl von Trades per anno deutlich unter 97.

In der gesamten Historie seit 1970 gab es nur zwei Verlustjahre. Im Jahr 1971 betrug der Jahresverlust -110 US-Dollar, und anno 1988 lag der Jahresverlust bei -5173 US-Dollar.

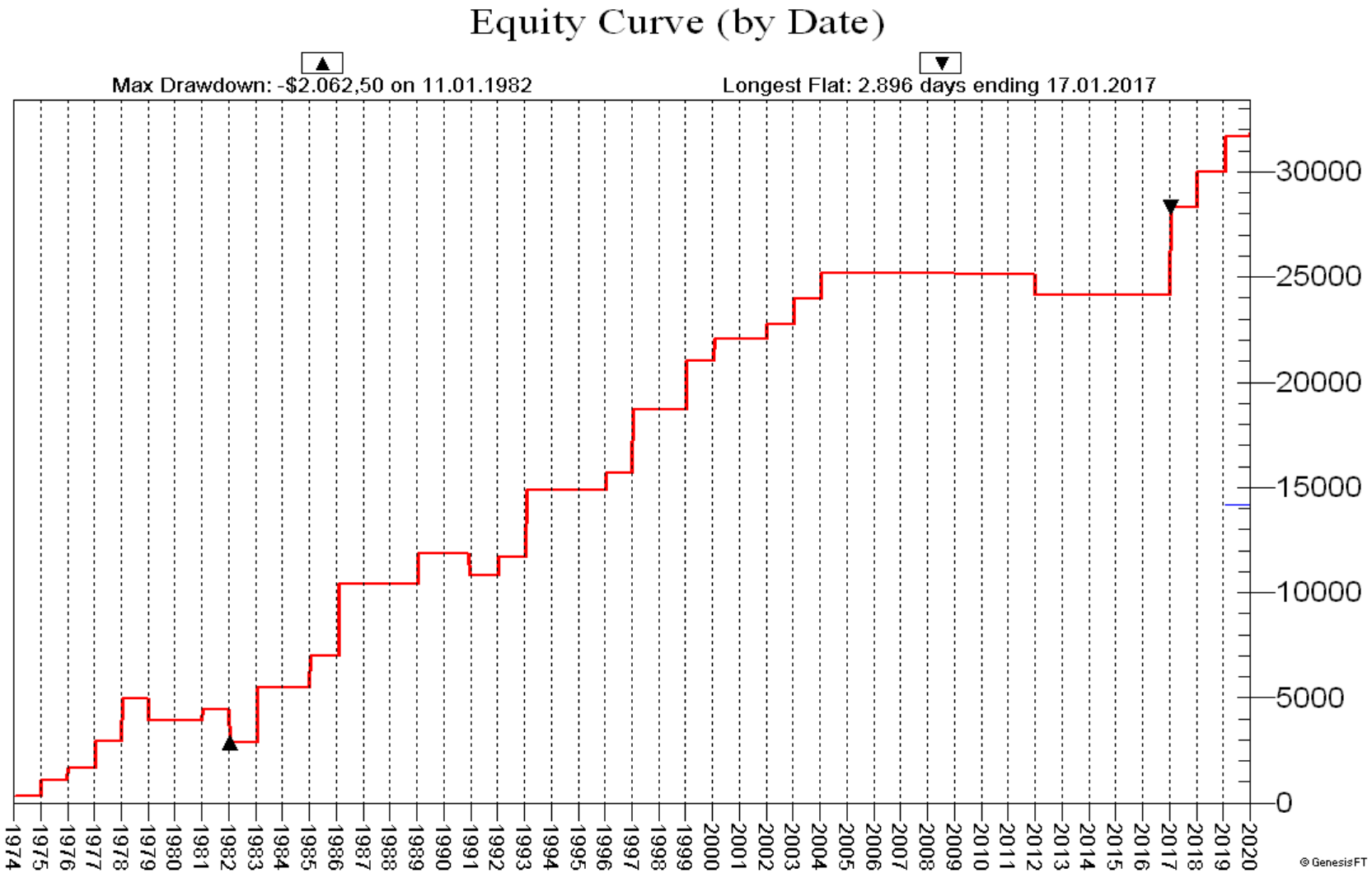
In den letzten 20 Jahren betrug der Jahreszugewinn niemals weniger, als 60.000 Dollar.

Die Ergebnisse sind netto nach Kosten (20 Dollar pro Trade wurden veranschlagt) und vor Steuern.

Struktur (D)eines Tradingplans

I. §1 Überleben sichern (Kapitaldecke, in Frage kommende Märkte, Produkte, persönliche Ziele)
II. §2 Zeitliche Kapazitäten und mentale Belastbarkeit
III. §3 Portfolio-Struktur (Day-, Swingtrading, diskretionäres Trading)
IV. §4 Strategien (Beste saisonale Trades, PowerBreakouts, News-Setups, Shortterm-Strategien uvm.)
V. §5 Einsätze pro Trade, je Setup

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.

Trend- und Kontermärkte

Cancel | Close | Edit Strategy | Reports | Merged Reports | Settings | Print | Export | Colored

Test#	Strategy	Symbol	Period	FromDate	ToDate	Custom Inputs	Net Profit	Max Drawdown	Return%	Profit Factor	Kelly%	Trades	Avg Trade	Payout	Win%	Large Loss	Avg Loss	Avg Win	Large Win	Wins	Losses
22	Sample: Parabolic strategy	KC-067	Daily	16.02.1970	End of Data		501.259 €	(47.539 €)	892,1%	**1,51**	14,0%	979	512 €	2,14	41,4%	(11.321 €)	(1.709 €)	3.660 €	34.841 €	405	574
32	Sample: Parabolic strategy	SI3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		496.620 €	(45.545 €)	862,5%	**1,46**	12,7%	982	506 €	2,13	40,6%	(22.765 €)	(1.864 €)	3.968 €	110.110 €	399	583
21	Sample: Parabolic strategy	JO-067	Daily	16.02.1970	End of Data		101.880 €	(15.000 €)	610,2%	**1,32**	10,2%	910	112 €	1,80	42,3%	(4.118 €)	(607 €)	1.093 €	9.390 €	385	525
13	Sample: Parabolic strategy	GC3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		194.050 €	(34.865 €)	454,9%	**1,29**	9,8%	862	225 €	1,71	43,0%	(11.215 €)	(1.342 €)	2.299 €	32.045 €	371	491
28	Sample: Parabolic strategy	PL3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		145.165 €	(28.290 €)	440,6%	**1,26**	8,4%	954	152 €	1,87	40,3%	(7.155 €)	(973 €)	1.822 €	28.230 €	384	570
14	Sample: Parabolic strategy	GE-067	Daily	16.02.1970	End of Data		34.249 €	(8.670 €)	372,3%	**1,26**	7,3%	778	44 €	2,28	35,6%	(2.690 €)	(263 €)	599 €	7.704 €	277	501
20	Sample: Parabolic strategy	IC-067	Daily	16.02.1970	End of Data		156.120 €	(57.970 €)	259,9%	**1,23**	7,7%	640	244 €	1,73	41,6%	(10.085 €)	(1.826 €)	3.154 €	29.745 €	266	374
8	Sample: Parabolic strategy	G6B-067	Daily	16.02.1970	End of Data		153.975 €	(41.860 €)	350,7%	**1,23**	7,7%	930	166 €	1,73	41,5%	(4.740 €)	(1.249 €)	2.159 €	12.541 €	386	544
31	Sample: Parabolic strategy	SB-067	Daily	16.02.1970	End of Data		82.880 €	(21.227 €)	339,9%	**1,20**	6,7%	1.008	82 €	1,84	39,6%	(4.943 €)	(670 €)	1.230 €	19.081 €	399	609
11	Sample: Parabolic strategy	G6J-067	Daily	16.02.1970	End of Data		137.485 €	(41.618 €)	282,8%	**1,20**	6,5%	866	159 €	1,81	39,8%	(6.303 €)	(1.343 €)	2.427 €	15.510 €	345	521
26	Sample: Parabolic strategy	NK3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		61.885 €	(34.525 €)	155,6%	**1,18**	6,0%	326	190 €	1,83	39,3%	(7.240 €)	(1.727 €)	3.155 €	14.410 €	128	198
36	Sample: Parabolic strategy	ZC-067	Daily	16.02.1970	End of Data		44.735 €	(13.300 €)	309,8%	**1,16**	5,1%	1.046	43 €	1,94	37,4%	(3.140 €)	(430 €)	835 €	8.098 €	391	655
12	Sample: Parabolic strategy	G6N-067	Daily	16.02.1970	End of Data		32.520 €	(33.120 €)	89,9%	**1,16**	5,5%	332	98 €	1,69	40,7%	(3.815 €)	(1.050 €)	1.773 €	8.085 €	135	197
42	Sample: Parabolic strategy	ZS-067	Daily	16.02.1970	End of Data		96.083 €	(59.510 €)	154,9%	**1,14**	4,5%	1.087	88 €	1,86	37,9%	(7.078 €)	(1.052 €)	1.956 €	15.260 €	412	675
41	Sample: Parabolic strategy	ZO-067	Daily	16.02.1970	End of Data		26.755 €	(12.800 €)	187,8%	**1,13**	4,5%	908	29 €	1,78	38,9%	(1.490 €)	(370 €)	658 €	8.998 €	353	555
19	Sample: Parabolic strategy	HO3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		128.281 €	(70.276 €)	165,7%	**1,13**	4,2%	901	142 €	1,89	37,3%	(13.043 €)	(1.808 €)	3.423 €	29.335 €	336	565
17	Sample: Parabolic strategy	HE-067	Daily	16.02.1970	End of Data		56.000 €	(27.510 €)	194,1%	**1,13**	4,4%	1.112	50 €	1,70	39,8%	(3.035 €)	(669 €)	1.137 €	10.135 €	443	669
38	Sample: Parabolic strategy	ZL-067	Daily	16.02.1970	End of Data		42.657 €	(17.463 €)	225,1%	**1,12**	4,1%	1.077	40 €	1,88	37,4%	(3.945 €)	(508 €)	956 €	10.365 €	403	674
1	Sample: Parabolic strategy	CC-067	Daily	16.02.1970	End of Data		49.055 €	(45.315 €)	104,2%	**1,11**	3,9%	1.041	47 €	1,70	39,5%	(4.355 €)	(708 €)	1.205 €	8.095 €	411	
2	Sample: Parabolic strategy	CL3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		88.130 €	(84.655 €)	94,3%	**1,11**	3,8%	808	109 €	1,71	39,2%	(9.395 €)	(1.684 €)	2.887 €	31.065 €	317	
7	Sample: Parabolic strategy	G6A-067	Daily	16.02.1970	End of Data		42.140 €	(38.895 €)	102,4%	**1,09**	3,3%	716	59 €	1,74	38,5%	(3.445 €)	(1.015 €)	1.771 €	12.865 €	276	
3	Sample: Parabolic strategy	CT-067	Daily	16.02.1970	End of Data		57.675 €	(38.01													
15	Sample: Parabolic strategy	GF-067	Daily	16.02.1970	End of Data		38.118 €	(30.88													
29	Sample: Parabolic strategy	QM-067	Daily	16.02.1970	End of Data		18.860 €	(41.27													
30	Sample: Parabolic strategy	RB3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		51.651 €	(88.62													
4	Sample: Parabolic strategy	EBI-067	Daily	16.02.1970	End of Data		9.700 €	(31.90													
39	Sample: Parabolic strategy	ZM-067	Daily	16.02.1970	End of Data		9.810 €	(56.67													
25	Sample: Parabolic strategy	NG3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-4.040 €	(120.85													
23	Sample: Parabolic strategy	LE-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-4.480 €	(79.51													
10	Sample: Parabolic strategy	G6E-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-8.831 €	(46.44													
35	Sample: Parabolic strategy	ZB-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-14.560 €	(78.27													
18	Sample: Parabolic strategy	HG3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-19.238 €	(99.73													
44	Sample: Parabolic strategy	ZW-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-12.750 €	(52.20													
24	Sample: Parabolic strategy	MDX-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-9.175 €	(62.86													
34	Sample: Parabolic strategy	YM-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-19.430 €	(63.69													
9	Sample: Parabolic strategy	G6C-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-27.565 €	(62.065 €)	-43,1%	0,93	-2,9%	960	-29 €	1,42	39,7%	(5.045 €)	(710 €)	1.006 €	14.805 €	381	579
16	Sample: Parabolic strategy	GX-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-142.818 €	(196.130 €)	-65,9%	0,91	-4,0%	702	-203 €	1,43	38,9%	(17.915 €)	(3.604 €)	5.141 €	33.960 €	273	429
40	Sample: Parabolic strategy	ZN-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-56.778 €	(81.273 €)	-68,3%	0,88	-4,9%	856	-66 €	1,49	37,3%	(3.109 €)	(910 €)	1.353 €	8.173 €	319	537
43	Sample: Parabolic strategy	ZT-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-21.696 €	(44.578 €)	-48,6%	0,88	-5,0%	650	-33 €	1,61	35,2%	(1.734 €)	(415 €)	669 €	3.860 €	229	421
37	Sample: Parabolic strategy	ZF-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-34.848 €	(47.568 €)	-71,5%	0,87	-5,6%	718	-49 €	1,46	37,3%	(2.632 €)	(590 €)	860 €	4.305 €	268	450
27	Sample: Parabolic strategy	NQ-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-64.640 €	(113.825 €)	-52,5%	0,86	-5,7%	532	-122 €	1,56	35,5%	(8.465 €)	(1.364 €)	2.133 €	14.965 €	189	343
45	Sample: Parabolic strategy	ZX-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-90.865 €	(109.930 €)	-81,1%	0,82	-8,4%	836	-109 €	1,40	36,8%	(4.920 €)	(930 €)	1.300 €	8.405 €	308	528
33	Sample: Parabolic strategy	UB-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-105.484 €	(119.009 €)	-87,0%	0,70	-16,2%	226	-467 €	1,13	38,5%	(11.015 €)	(2.566 €)	2.887 €	14.329 €	87	139
5	Sample: Parabolic strategy	ES-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-170.508 €	(190.475 €)	-86,6%	0,69	-14,5%	588	-290 €	1,45	32,3%	(9.365 €)	(1.384 €)	2.001 €	10.398 €	190	398
6	Sample: Parabolic strategy	EX-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-82.020 €	(94.665 €)	-83,9%	0,66	-18,5%	460	-178 €	1,19	35,7%	(3.685 €)	(811 €)	964 €	5.995 €	164	296

Die Tabelle zeigt einen historischen Backtest sämtlicher Futures-Märkte von 1970 bis 2019 für eine simple (nullkommanull optimierte oder gefilterte) Parabolic Trendstrategie. **Sinn ist** NICHT, diese Strategie zu handeln, sondern **zu unterscheiden, WELCHE Märkte sich für Trendhandel eignen** (oben in der Liste) und welche für Konterhandel in Frage kommen. Es wird schnell klar: Unter den **Rohstoffe**n gibt es **eine ganze Reihe** von Märkten, **die sich für Trendhandel eignen**.

Kürzel Bedeutung

SI	Silber
GC	Gold
PL	Platin
ZC	Corn (Mais)
ZS	Soybeans
ZO	Oats (Hafer)
HE	Lean Hogs
HO	Heating Oil
CL	Crude Oil WTI

PowerBreakouts als Performance-Garant

- Zeitlich konditionierte Breakout-Trades
- 97 Trades p.a. (potenziell)
- „Wenn in der Zeit von X bis Y der Markt über/unter Z ausbricht, dann….“
- Fester Stop
- Klar definierter, zeitbasierter Ausstieg
- Umfassende statistische Grundlage
- Hinter allen Zeiträumen stehen fundamentale Effekte

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

KEINE Gewinnziele und voreilige Ausstiege

PowerBreakouts

Top-Seasonals

Shortterm System-Trades
(Friday Gold, Pre NFP, FOMC, Sparplan-Strategien, BestDays, Worst Days, MegaCandle, XL-Counter, Huge Range Open, GBP Early Plunge)

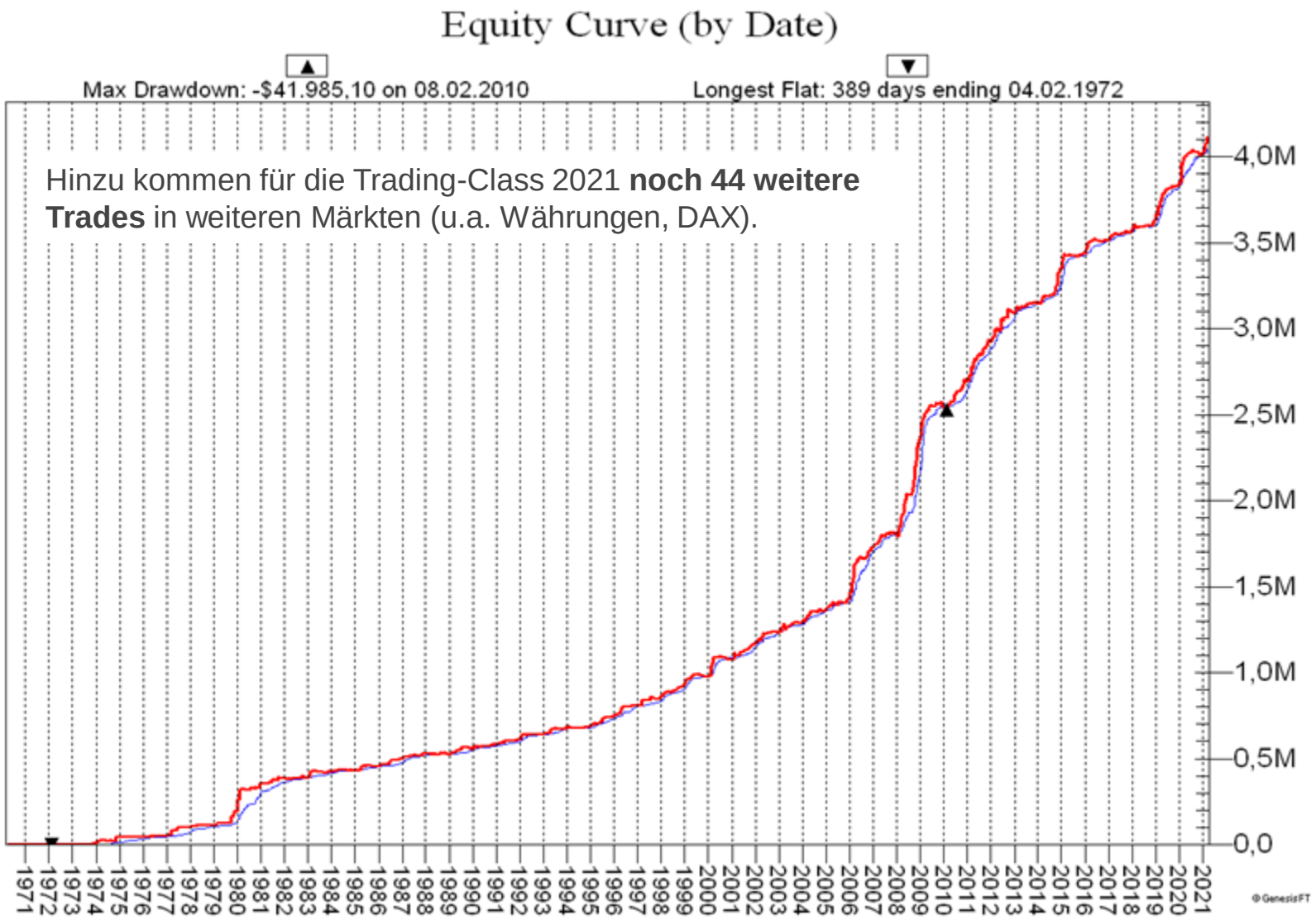
Diskretionäre Trades

Praktisch alle Trades haben eine zeitliche Koppelung bei Ein- und Ausstieg, aber keine vordefinierten Gewinnziele

- Verlierer lassen sich nicht vermeiden
- Wir müssen sie gegenfinanzieren
- Pareto-Prinzip (80/20): ich darf die wenigen großen Trades NICHT vorzeitig kappen!
- Wir schaffen in nahezu keinem einzigen Trade ein perfektes Timing!
- Also sind etwaige Barrieren, die ich einbaue (Ziele sind Barrieren) Gewinnkiller
- Es wird zeitbasiert ausgestiegen nach x Perioden…

Performance der PowerBreakouts (97 Trades p.a.)

ZEITSCHONEND



Summary - All Trades

Overall			
Total Net Profit:	$4.110.279	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**3,82**
Total Trades:	1.899	Winning Percentage:	65,0%
Average Trade:	$2.164	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	2,05
Max Closed-out Drawdown:	-$41.985	CPC Index (PF x Win% x PR):	5,09
Max Intra-trade Drawdown:	-$51.040	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	98,48%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$11.505	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	47,99%
Percent in the Market:	5,7%	Optimal f:	0,97
Avg # of Bars in Trade:	28,82	Z-Score (W/L Predictability):	-8,5
Avg # of Trades per Year:	37,2	Current Streak:	1 Losses
Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$6.716	Monthly Sharpe Ratio:	0,43
Std Dev of Monthly Profits:	$15.607	Annualized Sharpe Ratio:	1,49
		Calmar Ratio:	1,58

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	1.235	Total Losers:	664
Gross Profit:	$5.569.631	Gross Loss:	-$1.459.352
Average Win:	$4.510	Average Loss:	-$2.198
Largest Win:	$60.580	Largest Loss:	-$13.023
Largest Drawdown in Win:	-$29.850	Largest Peak in Loss:	$30.360
Avg Drawdown in Win:	-$1.335	Avg Peak in Loss:	$1.706
Avg Run Up in Win:	$6.257	Avg Run Up in Loss:	$1.706
Avg Run Down in Win:	-$1.335	Avg Run Down in Loss:	-$3.020
Most Consec Wins:	26	Most Consec Losses:	9
Avg # of Consec Wins:	3,55	Avg # of Consec Losses:	1,91
Avg # of Bars in Wins:	31,25	Avg # of Bars in Losses:	24,31

© GenesisFT

TRADING Class ´21 mit 12 Monaten Live-Orders

- Erfahrungsgemäß reicht es bei vielen Tradern nicht aus, nur ein Bündel von Trading-Setups zu erlernen
- Häufig fehlt die **Führung in der Praxis**
- Keine **Umsetzungsfehler**
- **Produktauswahl**
- **Einsatzhöhe**
- All das muss trainiert werden, damit es in Fleisch und Blut übergeht
- **Ab August** ist naturgemäß die **performanceträchtige Zeit bei den PowerBreakouts**, wie man gesehen hat
- Darum **starten wir zum 01.07. mit unserer „Trading Class 2021“** und **drei vorbereitenden Schulungen**, um **ab 01. August** dann alle meine **Orderplatzierungen LIVE** zu sehen (und zwar für Futures/CFD´s und Hebelzertifikate (inkl. Produktauswahl live)
- **Du erhältst** als Teilnehmer das **gesamte PowerBreakout Paket mit der Schulung aller 141!!! Trades** (Folien als PDF & Excel)
- Und **ich platziere ein Jahr lang alle Orders live in gemeinsamen Kurzwebinaren zum Monatsbeginn**, so dass Du nicht nur 141 Top-Setups erlernst, sondern auch deren praktische Anwendung live verfolgst und trainierst
- Zeitaufwand pro Monat für die Orderplatzierung (maximal 30 Minuten) zur immer gleichen Zeit (Monatsbeginn)
- Nach den 12 Monaten kannst Du die Trades eigenständig professionell absetzen
- Nur 2 Jahre mit leichten Verlusten überhaupt
- Im Schnitt 80% auf das Startkapital p.a. in der Historie (kein Versprechen, sondern ein Durchschnittswert!

Max. 30 Teilnehmer

TRADING CLASS 2021 (Start 01.07.): Interesse an mehr Infos?

https://www.survio.com/survey/d/D0H6G3V8E0X7C4U6Q