AUFBAU (D)EINES HANDELSPORTFOLIOS

Schritt für Schritt zur professionellen Vorgehensweise

www.realmoneytrader.com

Zielformulierung

- Dauerhaft Vermögen aufbauen mit Zielrendite x (m.E. muss die zwischen 25 und 50% p.a. liegen, auch wenn wir die natürlich nicht in jedem Jahr haben werden)
- Möglichst zeitschonend und umsetzbar
- Unter erträglichen Schwankungen einerseits…
- Aber auch ohne ewige Stagnationsphasen in der Kapitalkurve/Performance

Angenommen…

- Ich habe für mich das Ziel formuliert, Kaffeefarmer zu werden…
- Wenn ich das angehen würde, wie die meisten ihr Trading, dann kaufe ich mir ein paar Kaffeesamen, werfe sie auf eine kleine Fläche in meinem Garten, gieße, und schaue mal, was draus wird.
- Für wie aussichtsreich haltet Ihr diesen „Businessplan“?

- Und wie müsste ich nach Eurer Ansicht eigentlich vorgehen?

Zwingend notwendig ist…

- Ich muss wissen wo Kaffee überhaupt das richtige Klima hat, um zu wachsen
- Ich muss kalkulieren, wie viel „Ackerland“ ich benötige für einen LOHNENDEN Anbau
- Ich brauche die Infrastruktur (Wasser, Ackerland, Erntehelfer etc.)

- Ich muss wissen, wie viel Wasser die Kaffeepflanze braucht, und welche Pflege
- Ich muss wissen, wann ich die Kaffeebeeren ernte
- Ich muss auch wissen, was der Kaffeepflanze schadet, um sie davor zu schützen

Auf Trading gemünzt…

- Ich muss wissen, welche Märkte sich wie verhalten, und mit welchen Handelstechniken traden lassen
- Ich muss die Kontokapitalisierung durchdenken und planen
- Ich brauche einen passenden Broker, der MEINEN Bedürfnissen entspricht, die Produkte (CFD, Futures oder Hebelzertis) Und muss die technischen Aspekte (Kontraktlaufzeiten, Orderarten etc.) kennen
- Die Einsatzhöhe pro Trade
- Der Ausstieg aus einem Trade
- Stop-Loss im Trading und Filter für einen Trade

Es ist illusorisch, eine Strategie auf alle Märkte anzuwenden…

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	630
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	491
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	440
3	Sample: Parabolic strategy	CT-067	Daily	16.02.1970	End of Data		57.675 €	(38.010 €)	118,7%	**1,09**	3,2%	1.026	56 €	1,80	37,7%	(11.245 €)	(990 €)	1.783 €	18.645 €	387	639
15	Sample: Parabolic strategy	GF-067	Daily	16.02.1970	End of Data		38.118 €	(30.883 €)	110,2%	**1,07**	2,6%	988	39 €	1,73	38,4%	(4.728 €)	(845 €)	1.458 €	9.160 €	379	609
29	Sample: Parabolic strategy	QM-067	Daily	16.02.1970	End of Data		18.860 €	(41.275 €)	42,8%	**1,06**	2,2%	346	55 €	1,84	36,7%	(4.728 €)	(1.336 €)	2.452 €	15.948 €	127	219
30	Sample: Parabolic strategy	RB3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		51.651 €	(88.627 €)	55,3%	**1,05**	1,8%	786	66 €	1,65	38,8%	(14.043 €)	(2.207 €)	3.649 €	42.220 €	305	481
4	Sample: Parabolic strategy	EBI-067	Daily	16.02.1970	End of Data		9.700 €	(31.905 €)	27,9%	**1,03**	1,2%	668	15 €	1,45	41,5%	(3.935 €)	(821 €)	1.194 €	6.925 €	277	391
39	Sample: Parabolic strategy	ZM-067	Daily	16.02.1970	End of Data		9.810 €	(56.675 €)	16,6%	**1,02**	0,7%	1.088	9 €	1,73	37,0%	(5.035 €)	(744 €)	1.289 €	9.965 €	403	685
25	Sample: Parabolic strategy	NG3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-4.040 €	(120.855 €)	-3,2%	1,00	-0,1%	710	-6 €	1,60	38,3%	(19.715 €)	(2.399 €)	3.848 €	44.175 €	272	438
23	Sample: Parabolic strategy	LE-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-4.480 €	(79.510 €)	-5,5%	0,99	-0,4%	1.170	-4 €	1,53	39,3%	(2.245 €)	(600 €)	917 €	7.025 €	460	710
10	Sample: Parabolic strategy	G6E-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-8.831 €	(46.441 €)	-17,5%	0,98	-0,6%	490	-18 €	1,61	38,0%	(6.015 €)	(1.815 €)	2.919 €	16.985 €	186	304
35	Sample: Parabolic strategy	ZB-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-14.560 €	(78.275 €)	-17,3%	0,98	-0,7%	954	-15 €	1,47	40,0%	(7.578 €)	(1.449 €)	2.131 €	15.688 €	382	572
18	Sample: Parabolic strategy	HG3-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-19.238 €	(99.738 €)	-18,3%	0,98	-0,9%	1.035	-19 €	1,58	38,3%	(12.153 €)	(1.280 €)	2.017 €	35.523 €	396	639
44	Sample: Parabolic strategy	ZW-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-12.750 €	(52.200 €)	-22,7%	0,97	-1,1%	1.090	-12 €	1,43	40,5%	(11.978 €)	(770 €)	1.104 €	13.173 €	441	649
24	Sample: Parabolic strategy	MDX-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-9.175 €	(62.860 €)	-11,3%	0,97	-1,2%	330	-28 €	1,61	37,6%	(8.935 €)	(1.488 €)	2.398 €	12.255 €	124	206
34	Sample: Parabolic strategy	YM-067	Daily	16.02.1970	End of Data		-19.430 €	(63.695 €)	-28,6%	0,94	-2,5%	430	-45 €	1,64	36,3%	(6.735 €)	(1.113 €)	1.830 €	7.355 €	156	274
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

Warum Bauchgefühl und diskretionäres Trading keine Option sein kann

- Stell Dir vor, Du hast eine Herz-OP vor Dir und der Chirurg ist gar kein ausgebildeter Herzspezialist, versichert Dir aber, dass er meist intuitiv gute Entscheidungen im Leben trifft, und sich bei der OP auf sein Bauchgefühl verlässt. Lässt Du Dich von ihm operieren?
- Das Problem mit „Meinungstrades“ ist folgendes:

Die Meinung mag langfristig (früher oder später) sogar richtig sein. Du hast aber keine 10 Millionen als Handelskapital, um riesige vorübergehende Schwankungen gegen Dich aushalten zu können, und bist mental auf das gar nicht trainiert. Zudem bindest Du (wenn Du doch 10 Mio hast und mental trainiert auf das bist) unverhältnismäßig lange Kapital in ein noch nicht lohnendes Investment, welches in der Zeit anderweitig (mit zig weiteren Setups und Trades) bereits verzinst würde.

- Dir fehlt also der Rahmen für die Verwaltung eines Trades! Und der Rahmen ist extrem wichtig, wie Du gleich sehen wirst. (Rahmen meint Stopp, Haltedauer, Ausstieg im Gewinnfall…)

It´s all about time AND price

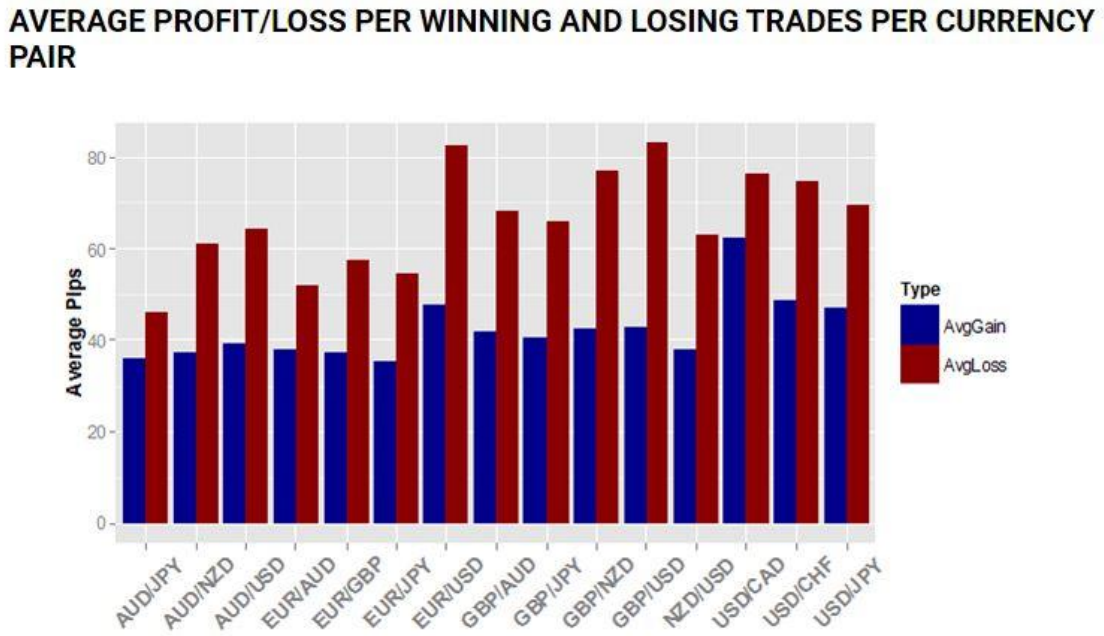
- Ein klassischer (und m.E. der größte Fehler) ist, sich rein auf die Frage „zu welchem Preis“ zu fokussieren
- Der Faktor Zeit spielt im Trading (und zwar egal, welches Produkt Du handelst) eine viel größere Rolle

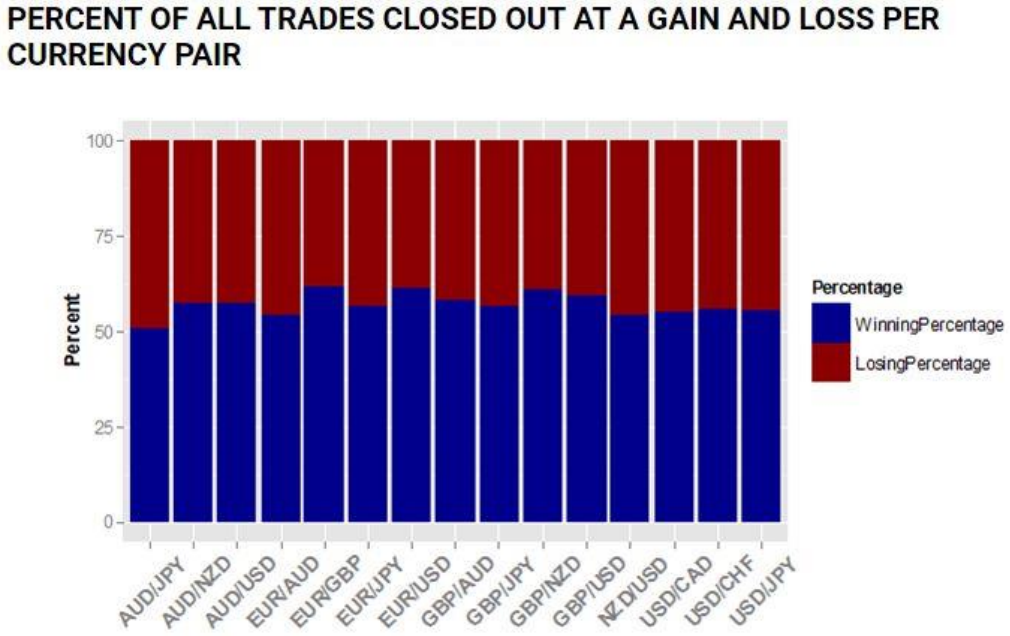
Stopps und Haltedauern unterliegen absolut keiner Willkür

Wie Du einen Trade verwaltest, ist hochsensibel, genauso, wie es sensibel ist, wie viel Wasser Du an eine Pflanze gibst oder wie lange Du sie starker Sonneneinstrahlung aussetzt.

STOP & AUSSTIEG

Was wir verstanden haben müssen über den Ausstieg/die Haltedauer



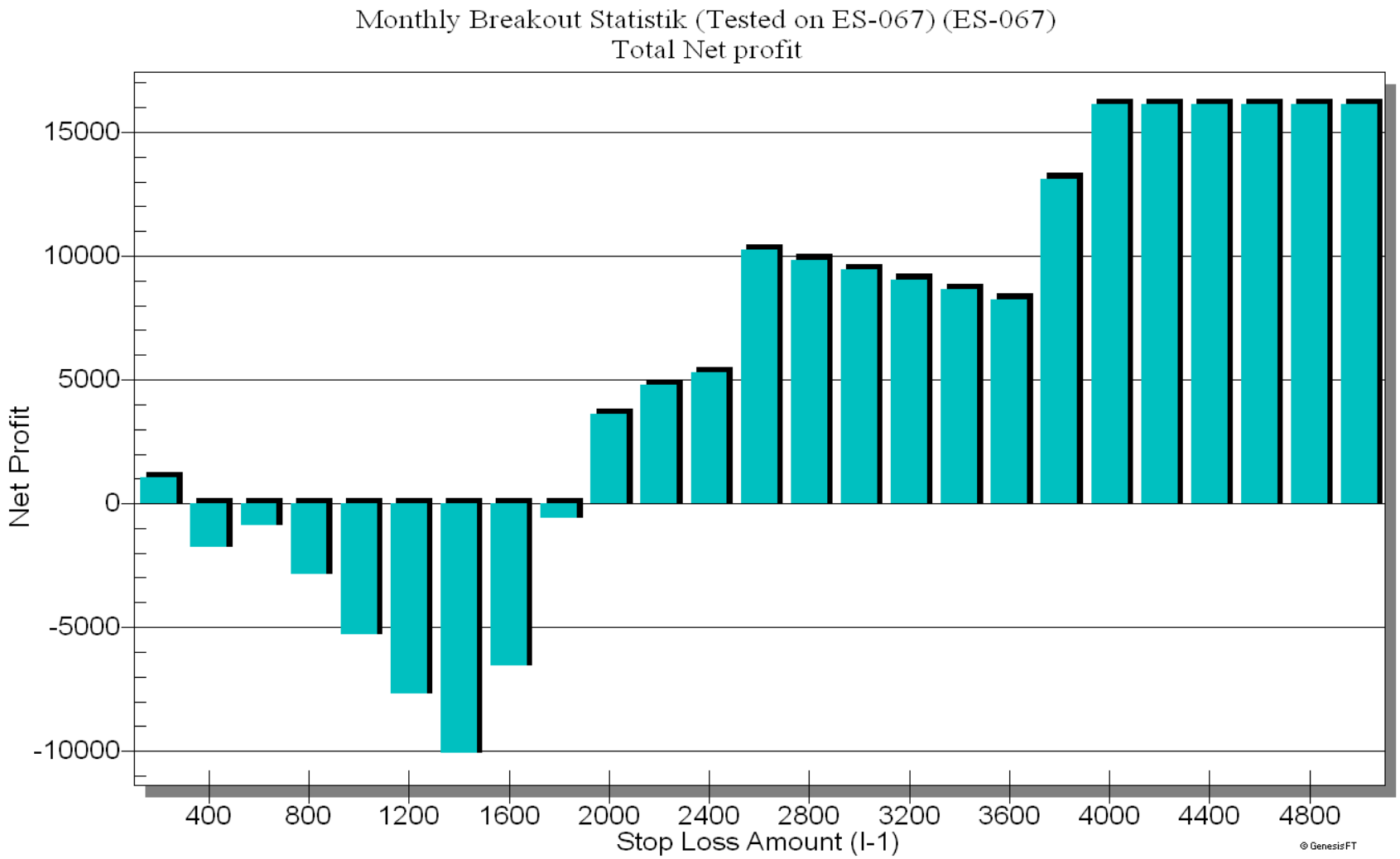


Den Markt musst Du Dir vorstellen, wie eine Kuh, die Milch gibt. Und wir sind die Farmer, die sie melken können. Sie (der Markt) gibt aber nicht unendlich und auch nicht immer Milch. Also muss ich meinen Eimer (Trades/investiert sein) zur rechten Zeit und lange genug unter den Euter halten. Habe ich 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.

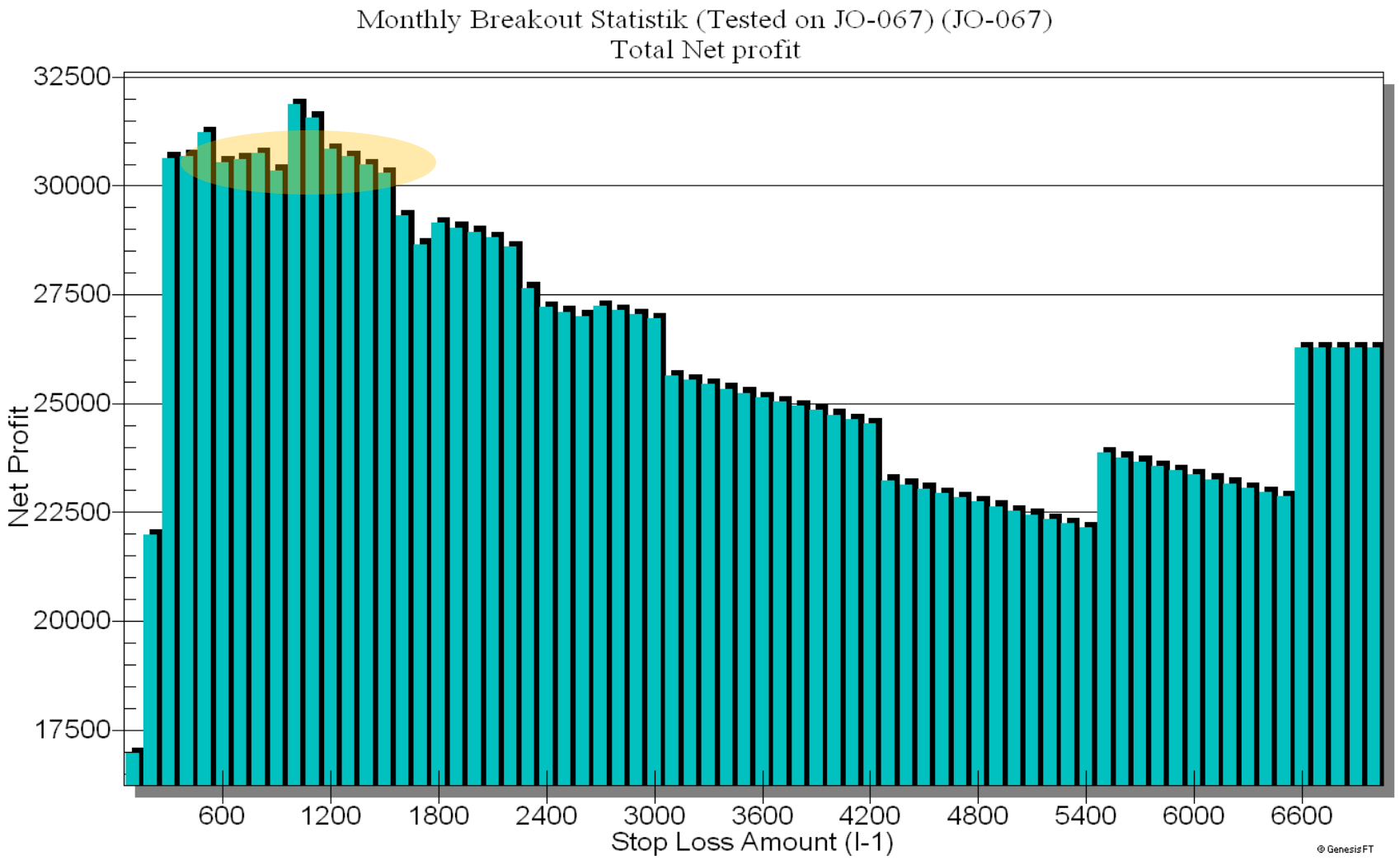
S&P 500 Long [redacted] Stopp [redacted]S (92 Pkt)

Beispiel-Trade



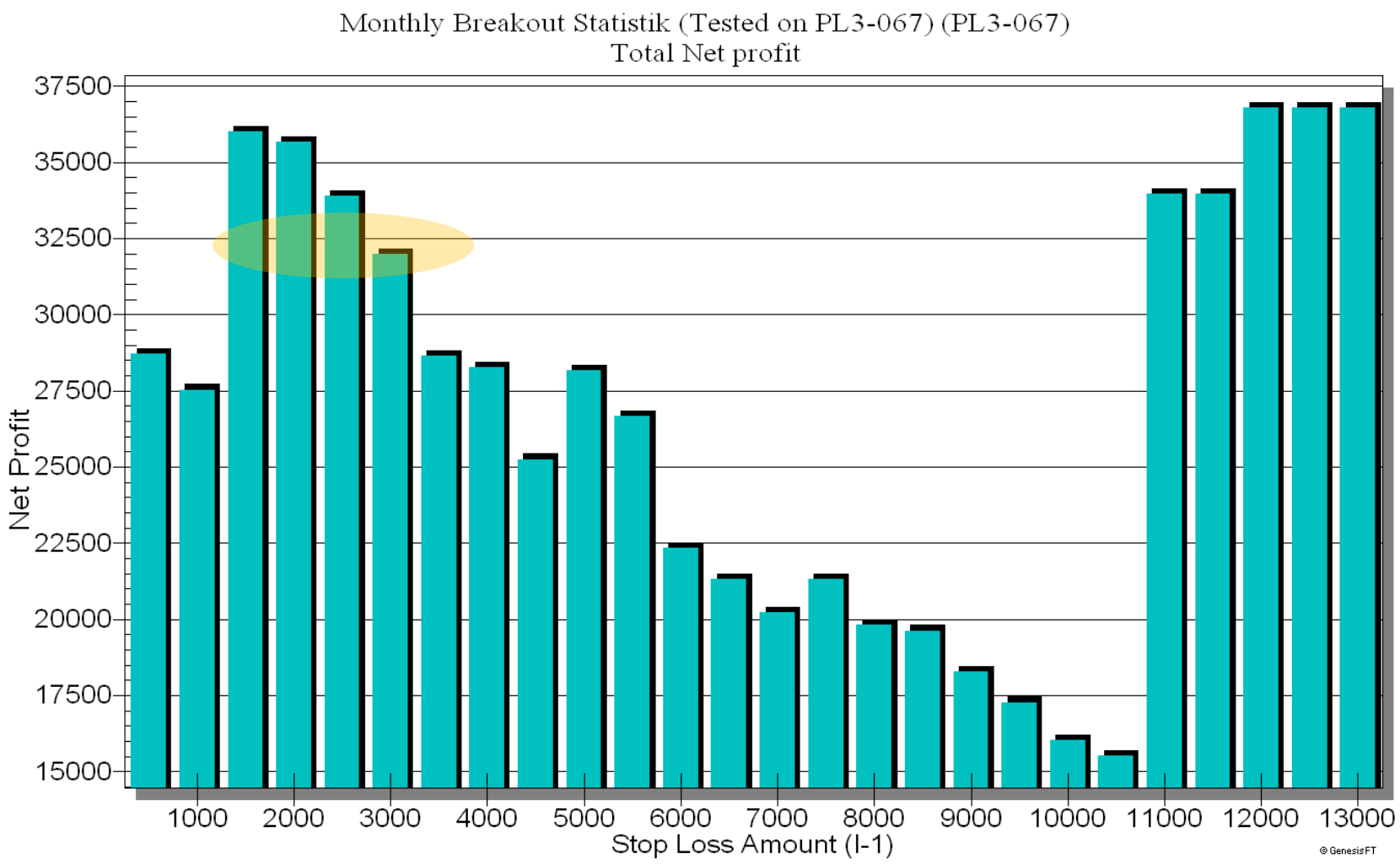
Der Stopp, wie auch der Ausstieg sind hochsensible Punkte. Ein zu eng gewählter Stopp (siehe Grafik) würde Verluste bringen, den eigentlichen Gewinnvorteil zerstören und sogar negieren…

Orange Juice



Gewichtungs-Kategorie: 4/4

Platin Short

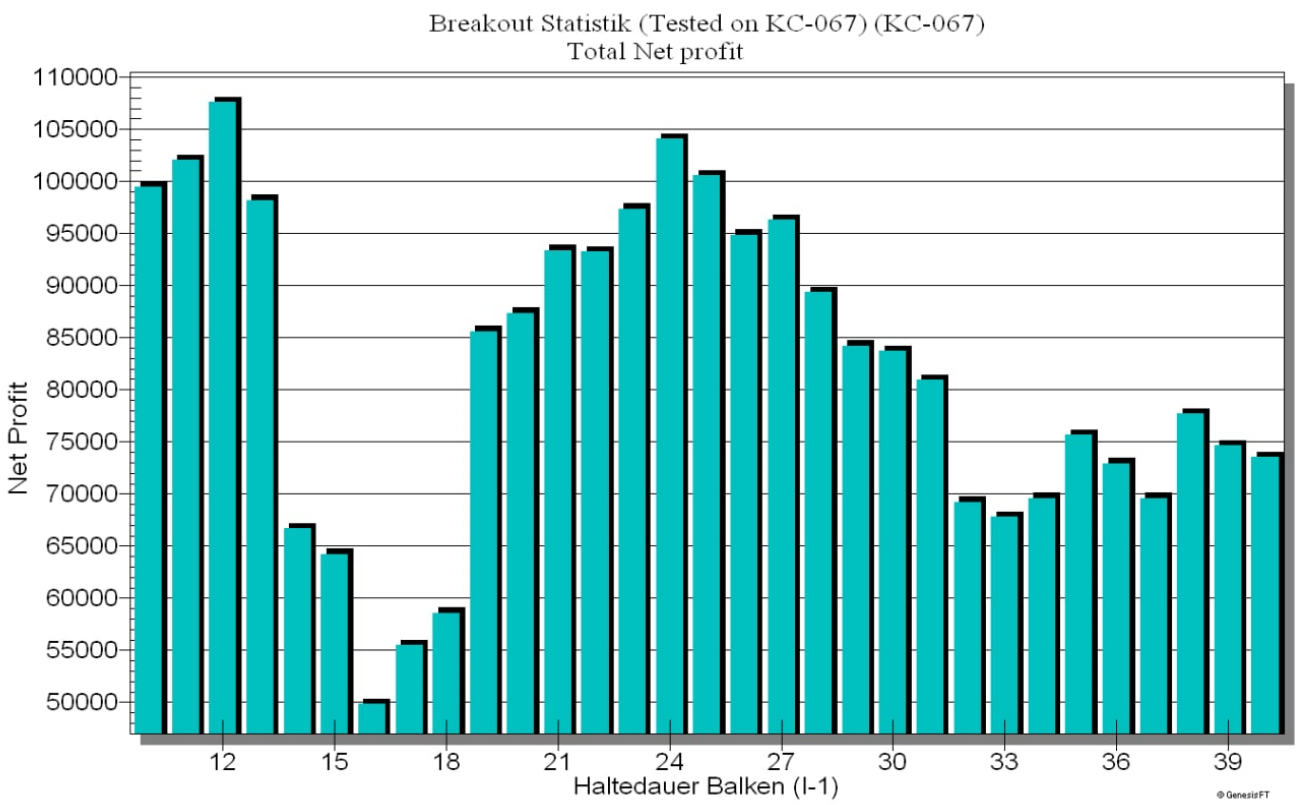


Merke: Ein zu enger Stopp nimmt Dir Trades raus, die eigentlich profitabel enden würden. Ein zu weit entfernter Stopp lässt wiederum zu, dass einzelne Trades zu viel verlieren, was dann die „guten Trades“ nur schwer aufholen können. Es braucht zwingend eine fundierte Ausarbeitung des Stopps.

Gewichtungs-Kategorie: 2/4

Haltedauer unterliegt auf gar keinen Fall Willkür oder Bauchgefühl

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)

Merke: Es ist wichtig, dass jeder Trade die Chance hat, eine große Trendbewegung abzugreifen und auszuschöpfen. Die profitabelsten Strategien arbeiten daher nicht mit Gewinnzielen, sondern haben zeitbasierte Ausstiege. Wie lange die Haltedauer sein sollte, kann und muss (m.E.) zwingend fundiert untersucht und ausgewertet werden.

Institutionelle Addressen benötigen meist eine gewisse Zeit, um ihre Pakete am Markt zu platzieren, da sie stückeln. Darum ist diese Vorgehensweise auch absolut sinnvoll. Trends haben eine begrenzte Dauer!

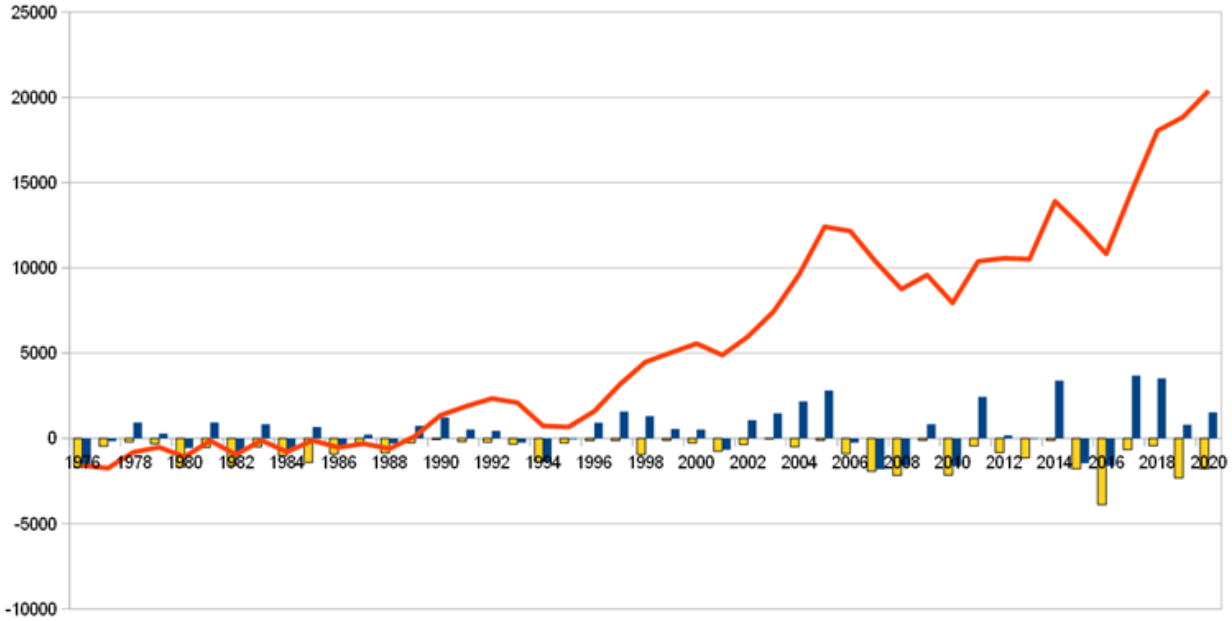
Einfachheit (K.I.S.S-Prinzip)

- Der Vorteil von 25 Jahren Erfahrung am Markt ist, dass man so ziemlich alles einmal probiert hat, und empirisch erfahren hat, was funktioniert, und was nicht funktioniert
- Ich hatte Phasen ohne getestete und entwickelte Strategie und ich hatte Zeiten, in denen ich Strategien handelte, die viele Parameter/Bedingungen im Regelwerk hatten.
- Je komplexer ein Regelwerk ist, desto spezifischer auf EINE einzelne Marktphase (Trend, Seitwärtsmarkt, hohe Vola, niedrige Vola) ist der Ansatz ausgelegt, und umso anfälliger ist er für ein „nicht mehr funktionieren“.
- Einfachheit erhält den Basiseffekt* und ist über Dekaden stabil, wie man an meinen drei Bausteinen sehen kann (PowerBreakouts, Saisonal-Zyklische Setups und starke kurzfristige fundamentale Effekte)
- Vor allem sind einfache Regelwerke wenig anfällig dafür, dass Du Fehler in der Umsetzung (dem Ablesen eines Signals) machst

*(Basiseffekt ist z.B., dass ein Markt in einem spezifischen Zeitfenster zur Stärke neigt)

Streuung ist DER „Verstetiger Deiner Kapitalkurve“

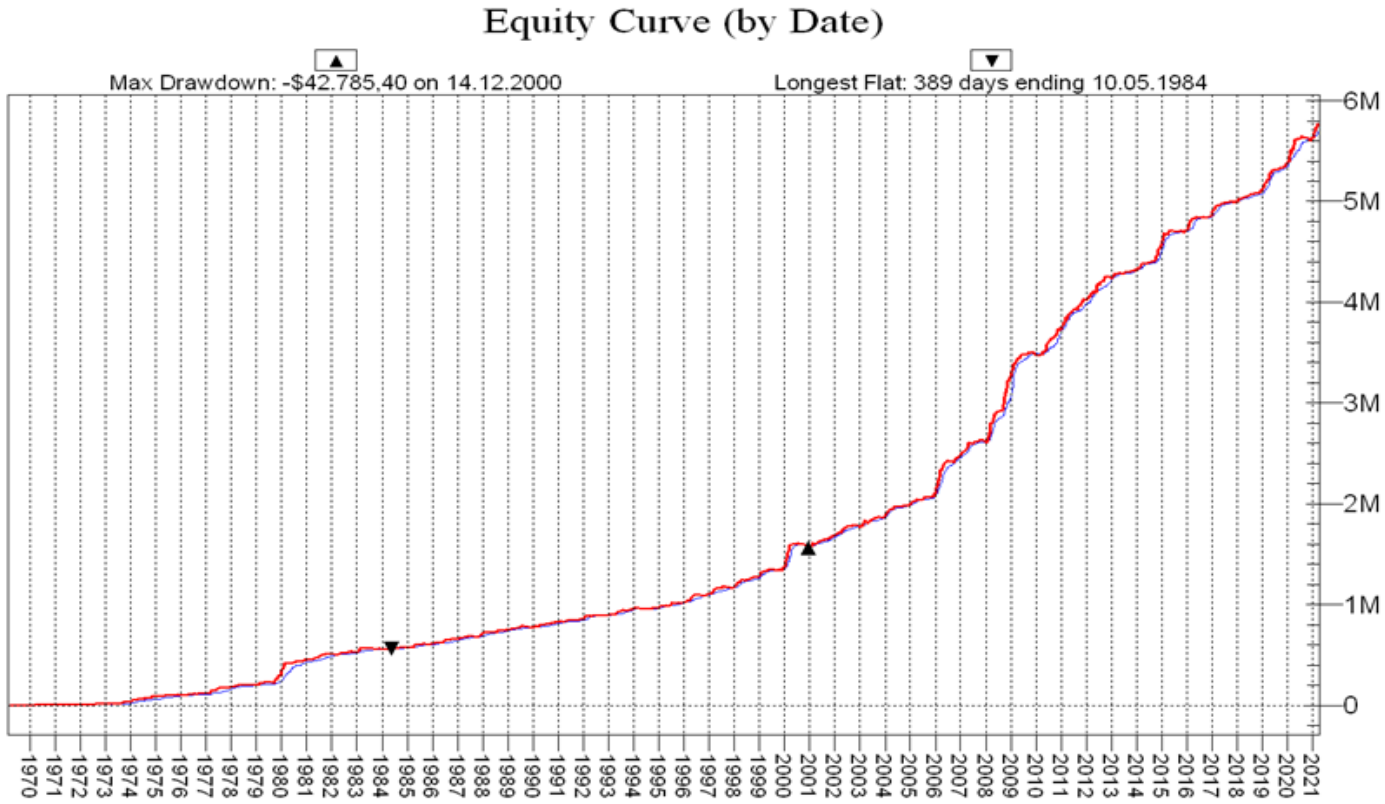
- Eine einzelne Strategie wird immer mehr oder weniger unrund im Auszahlungsprofil laufen
- Denn, WENN wir Einfachheit voraussetzen, dann wird unsere Strategie im einzelnen Markt in vielen Zeiten auf ein nicht optimales Umfeld treffen (z.B. ein Trendansatz auf einen Seitwärtsmarkt oder auf Trends, die aber schnell abbrechen und nur kurz verweilen)
- Die Kapitalkurve schaut dann so aus:



Steigend zwar, aber dazwischen mit Phasen, in denen es Draw Downs gibt oder nicht voran geht…

Streuung ist DER „Verstetiger Deiner Kapitalkurve“

- Wenn ich aber 45, 118 oder 141 solcher Strategien/Trades/Setups in einem Portfolio zusammenfasse, dann erhalte ich eine solche Kapitalkurve:



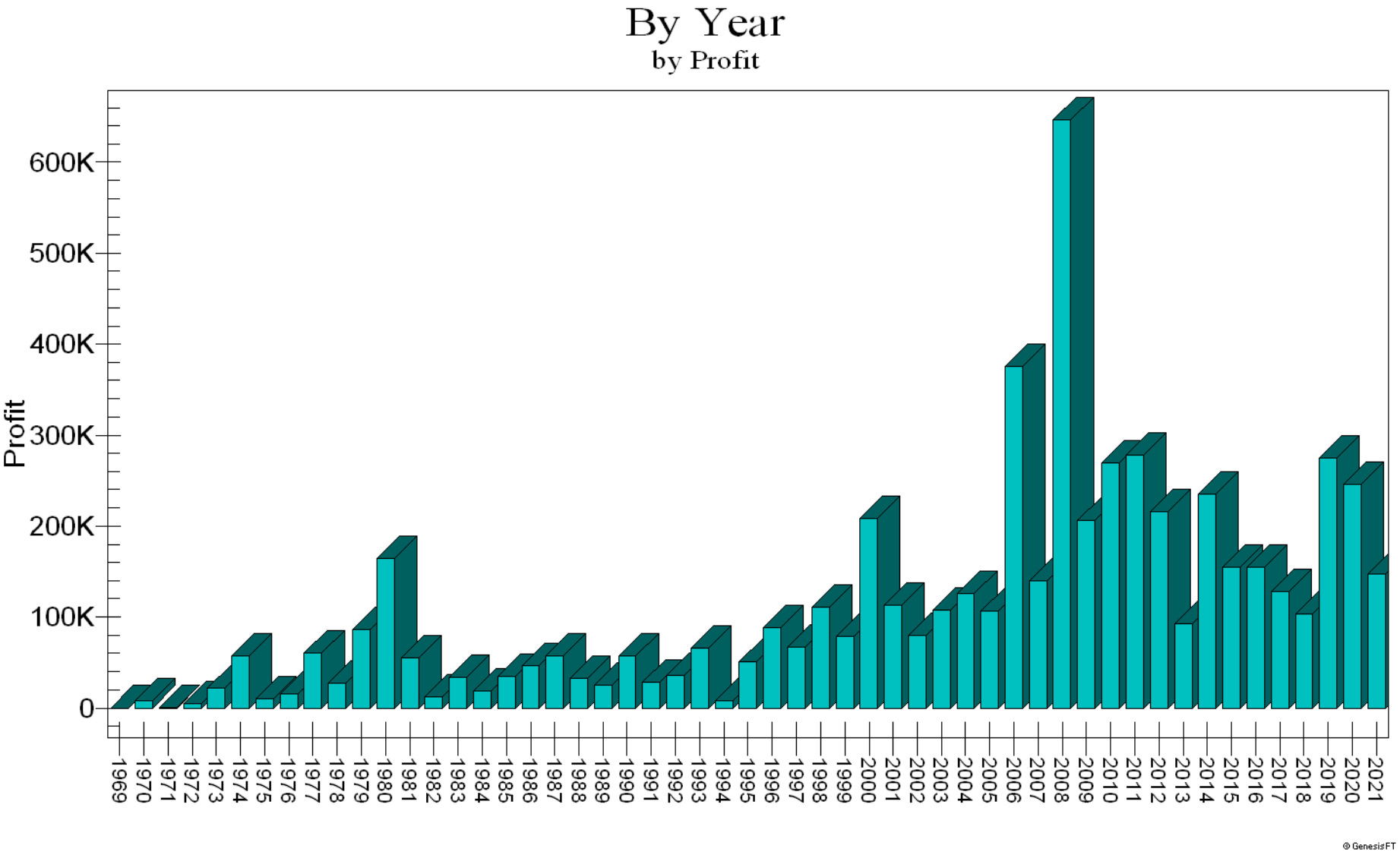
Summary - All Trades

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.

Jahresergebnisse der PowerBreakout-Performance seit 1970

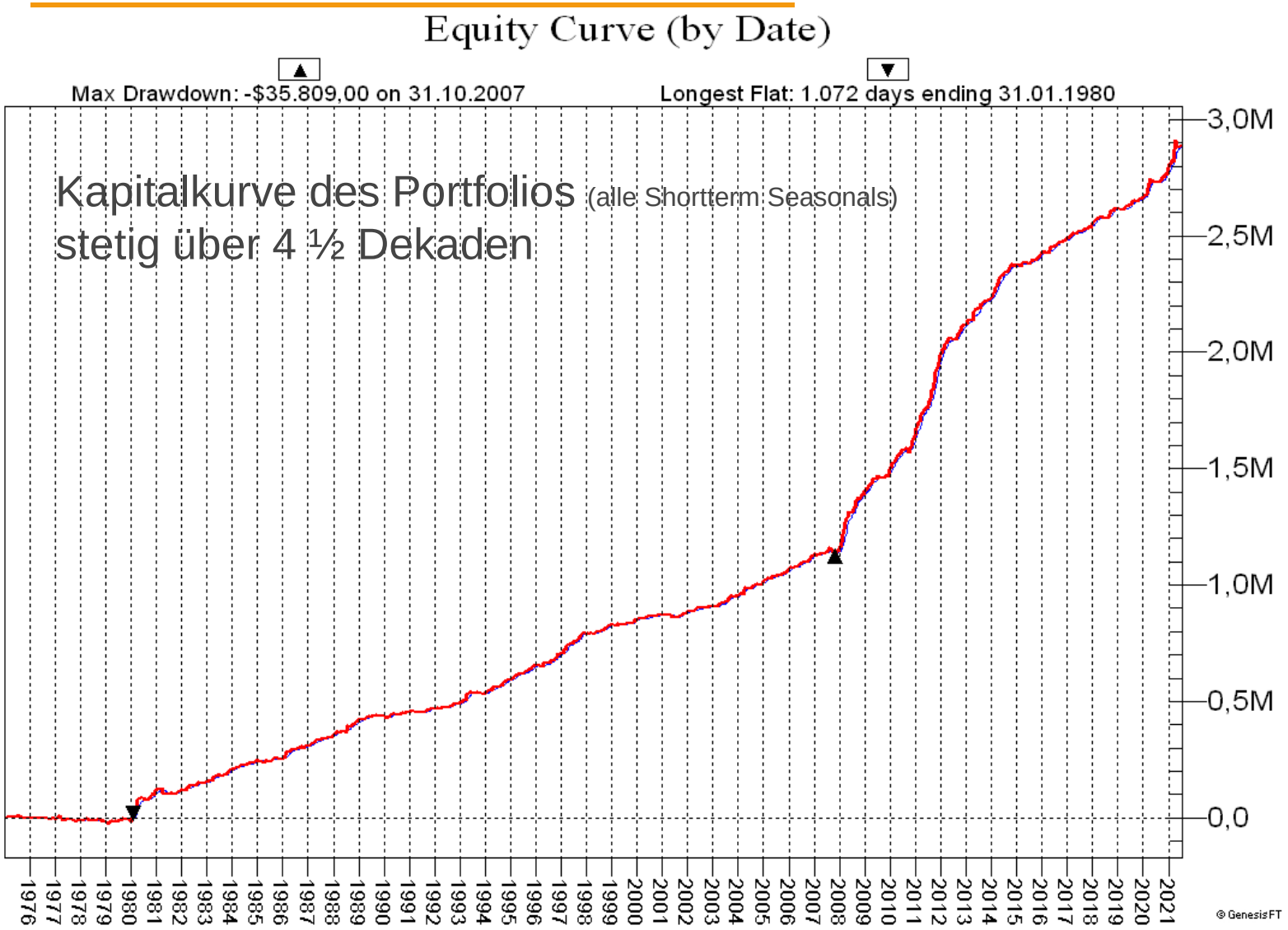


Die Aufschlüsselung der Jahresergebnisse seit 1970 zeigt, dass außer in zwei Jahren, die nahezu plus/minus Null endeten (1969 und 1971, letzteres verlor -110$) in jedem Jahr mit dem Portfolio Geld verdient werden konnte.

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.

Oder solch eine Kapitalkurve



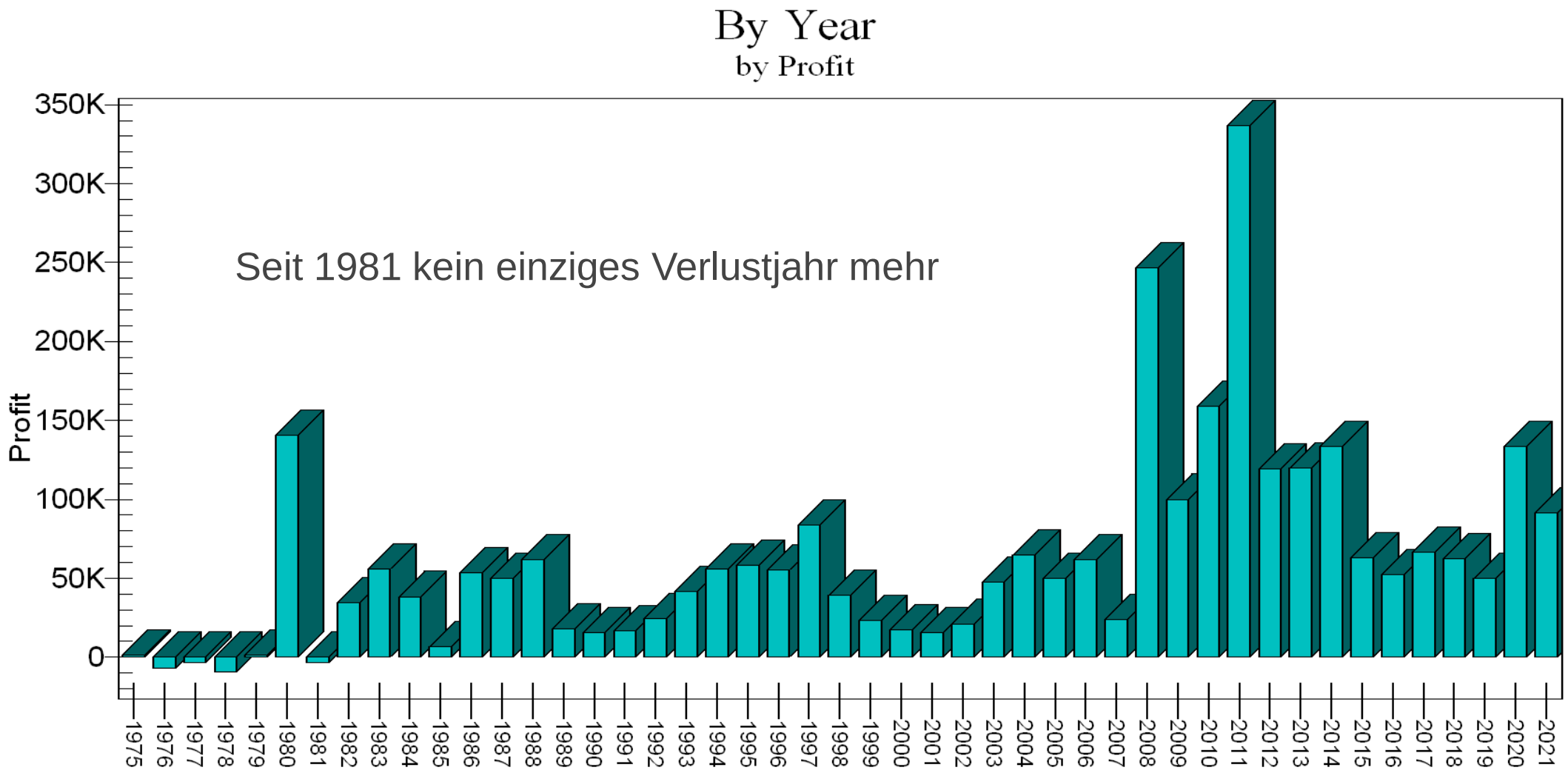
Summary - All Trades

Overall			
Total Net Profit:	$2.889.710	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**2,58**
Total Trades:	5.229	Winning Percentage:	61,8%
Average Trade:	$553	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	1,60
Max Closed-out Drawdown:	-$35.809	CPC Index (PF x Win% x PR):	2,54
Max Intra-trade Drawdown:	-$63.588	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	60,26%
Account Size Required:	N/A for baskets	Return Pct:	N/A for baskets
Open Equity:	$29	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	37,77%
Percent in the Market:	3,9%	Optimal f:	0,99
Avg # of Bars in Trade:	3,83	Z-Score (W/L Predictability):	-6,7
Avg # of Trades per Year:	112,4	Current Streak:	1 Wins
Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$5.169	Monthly Sharpe Ratio:	0,51
Std Dev of Monthly Profits:	$10.098	Annualized Sharpe Ratio:	1,77
		Calmar Ratio:	0,98
Winning Trades		**Losing Trades**	
Total Winners:	3.229	Total Losers:	2.000
Gross Profit:	$4.723.949	Gross Loss:	-$1.834.239
Average Win:	$1.463	Average Loss:	-$917
Largest Win:	$78.068	Largest Loss:	-$31.998
Largest Drawdown in Win:	-$34.660	Largest Peak in Loss:	$11.375
Avg Drawdown in Win:	-$527	Avg Peak in Loss:	$471
Avg Run Up in Win:	$2.020	Avg Run Up in Loss:	$471
Avg Run Down in Win:	-$527	Avg Run Down in Loss:	-$1.455
Most Consec Wins:	30	Most Consec Losses:	9
Avg # of Consec Wins:	2,88	Avg # of Consec Losses:	1,79
Avg # of Bars in Wins:	9,92	Avg # of Bars in Losses:	9,84

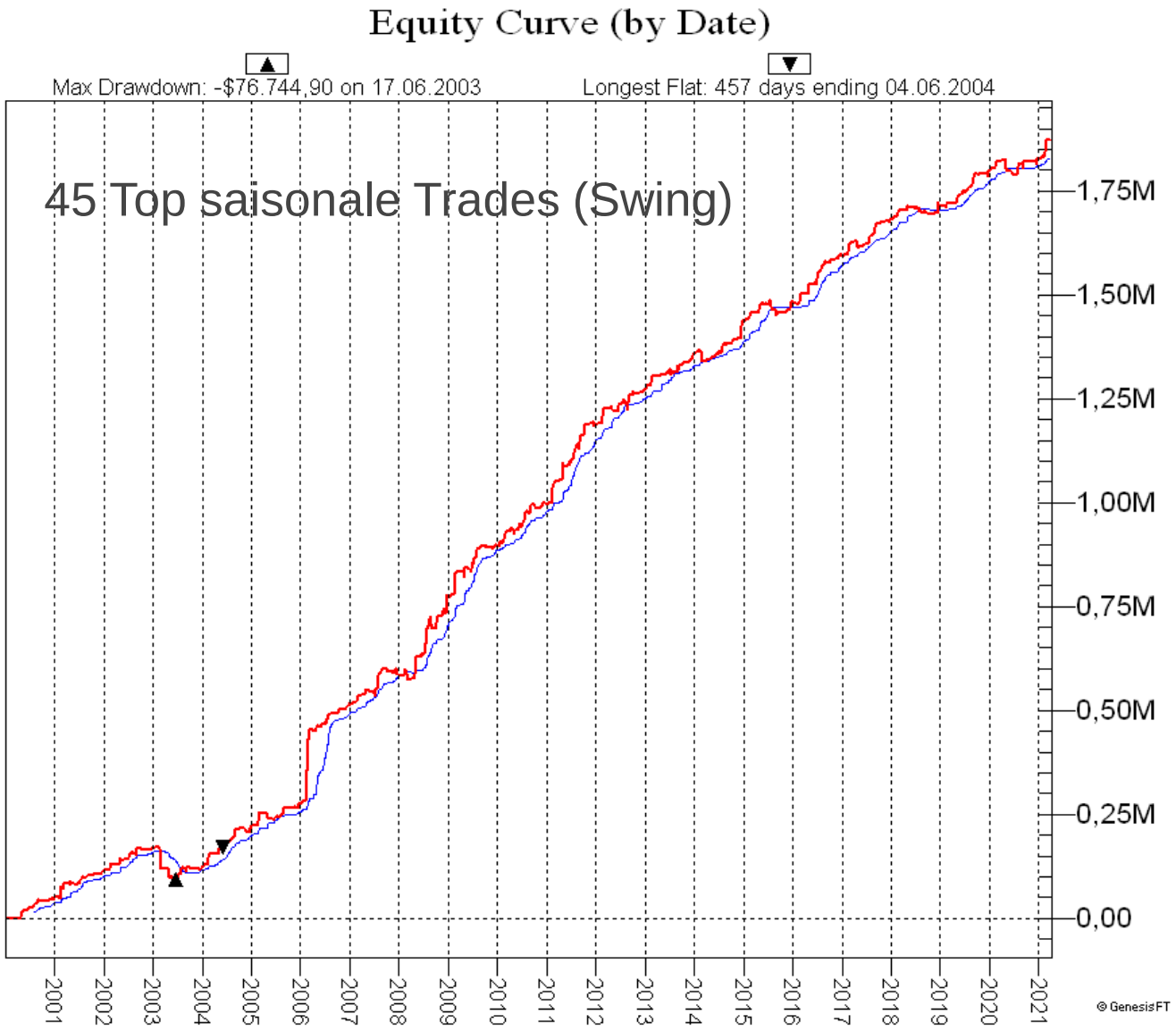
© GenesisFT

P.a. wurden im Schnitt 64.215 $ verdient.

Jahresergebnisse des Shortterm Seasonal Portfolios



Oder solch eine…



Summary - All Trades

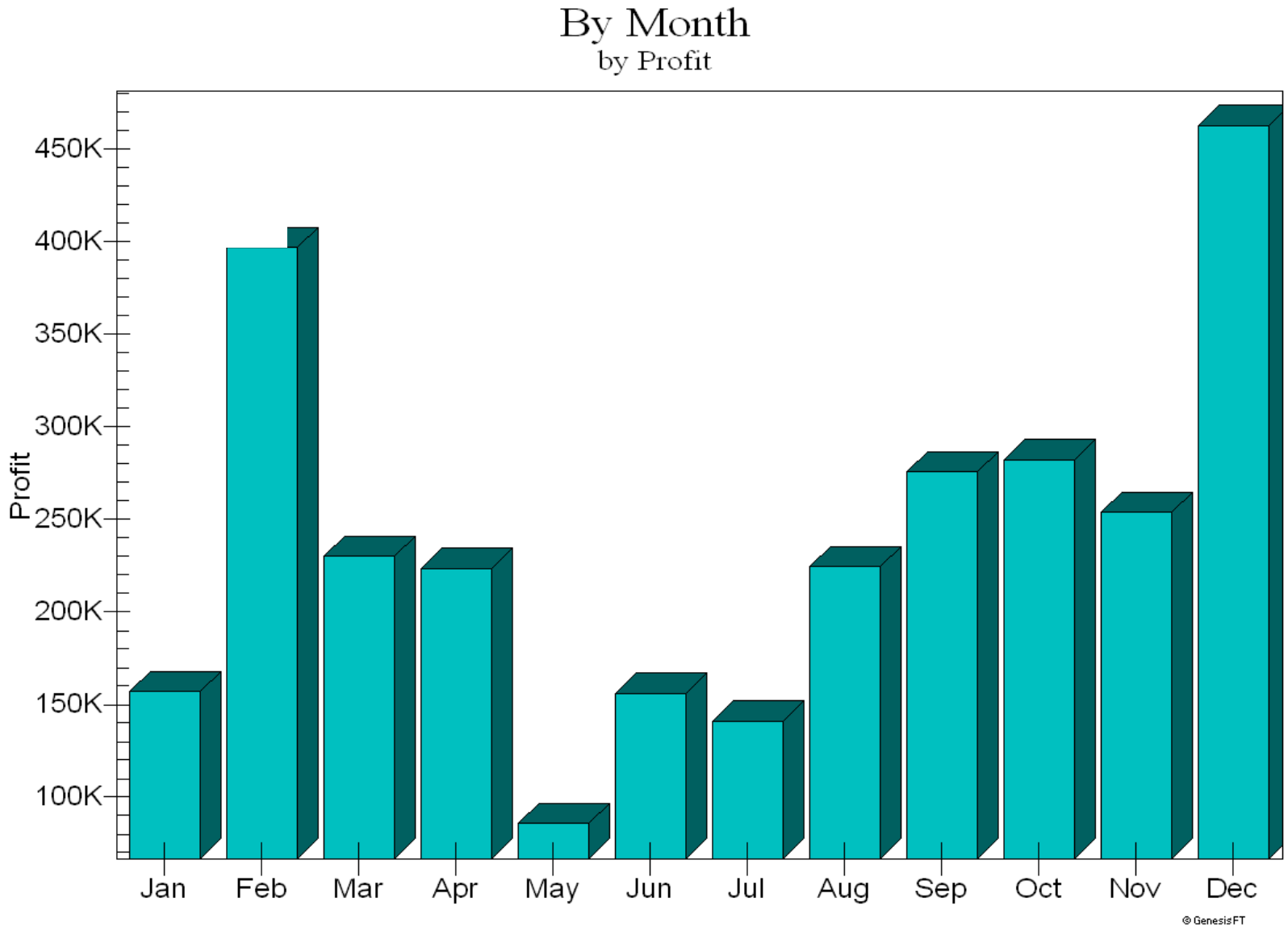
Overall			
Total Net Profit:	$1.872.489	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**2,85**
Total Trades:	989	Winning Percentage:	66,4%
Average Trade:	$1.893	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	1,44
Max Closed-out Drawdown:	-$76.745	CPC Index (PF x Win% x PR):	2,72
Max Intra-trade Drawdown:	-$78.407	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	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

Jahresergebnisse des Shortterm Seasonal Portfolios



Das Sommerloch ist auch hier zu erkennen. Mai, Juni und Juli sind die 3 zusammenhängenden Monate mit dem geringsten Anteil an der Gesamt-Performance.

Die vier Monate vor und nach dem Jahreswechsel machen fast die gesamte Performance aus.

Stetigkeit und erträgliche Schwankungen kommen durch Streuung!!!

Der Fehler ist also meist schon in der Planung. Man erarbeitet zu wenige Strategien/Trades, und sobald diese dann unliebsame Draw Downs oder Nicht-Performance-Phasen haben, versucht man, diese durch zusätzliche Bedingungen im Regelwerk zu optimieren, statt sie robust zu belassen, und einfach breiter zu streuen.

Eine Nationalmannschaft im Fussball macht ja genau das:
Aus verschiedenen Mannschaften die besten zusammen bündeln zu einem Top-Team. Dort sagt man nicht „Wir spielen mit zwei Top-Spielern, das genügt“ und man sagt auch nicht „ok, machen wir durch Training die beiden noch besser“.

Doe Kombination von Preis & zeit: PowerBreakouts

- Zeitlich konditionierte Ausbruchs- und Trendtrades
- Sie funktionieren, weil sie eben die zeitliche Komponente enthalten
- Zu spezifischen Zeiten innerhalb eines Jahres ist die Wahrscheinlichkeit für Preisschocks/Trends höher, als zu anderen
- Begründet liegt dies stets in den fundamentalen Begebenheiten für den jeweiligen Markt
- Ich kombiniere also Preis und Zeit, und habe auch einen klaren Rahmen für die Haltedauer
- Diese ist über 5 Dekaden so optimal gewesen und extrem stabil
- Im Portfolio werden insgesamt 26 Märkte gehandelt und es gibt 141 Orders pro Jahr
- Orderzeit ist immer am Monatsbeginn
- Ausstieg planbar nach fest definiertem Zeitintervall (kein situatives Trading!)
- Über 85% der Performance kommt dabei aus den Trades, die zwischen August und bis einschließlich März erfolgen

S&P 500 emini (2 Monate Haltedauer)

Ausbrüche handeln, hat für jeden Markt zu verschiedenen Zeiten völlig unterschiedliche Erwartungswerte!

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

..und für manche Märkte, spezifische Richtungen und Haltedauern sogar negative Erwartungswerte!!!

LIMITIERENDE FAKTOREN

Gratis Informationen für Trader im Livewebinar

Aus Deinen limitierenden Faktoren die Strategien herleiten

- Kapitaldecke limitiert Produktauswahl (Futures, CFD´s, Hebelzertifikate)
- Mentale Belastbarkeit UND Kapitaldecke limitieren den Einsatz je Trade
- Die Marginanforderungen der Börse limitieren die Strategieauswahl
- Die Produktauswahl der Emittenten limitiert die Strategieauswahl

- Bei einem jedem (aber besonders bei einem kleinen) Konto stehst Du zunächst vor der Entscheidung, ob Du das gesamte Kapital als Risikokapital siehst, und bereit bist bis zu 90% zu verlieren bei Draw Downs (dann kannst Du aggressiver handeln und mehr Rendite erwarten) oder ob Du nur mit einem gewissen Prozentsatz ok bist (meist 20, maximal 50% zwischenzeitlicher Verlust)
- Du wirst Märkte mit hoher Marginanforderung und Schwankungen nicht handeln können
- Ich habe ein Gewichtungsranking, das mir hilft, die effizienten (wenig Schwankungen, hoher Ertrag) zu identifizieren. Genau solche Strategien muss man für sich zum Start zusammenstellen (ich mache das mit den Tradern, die ich ausbilde zusammen)

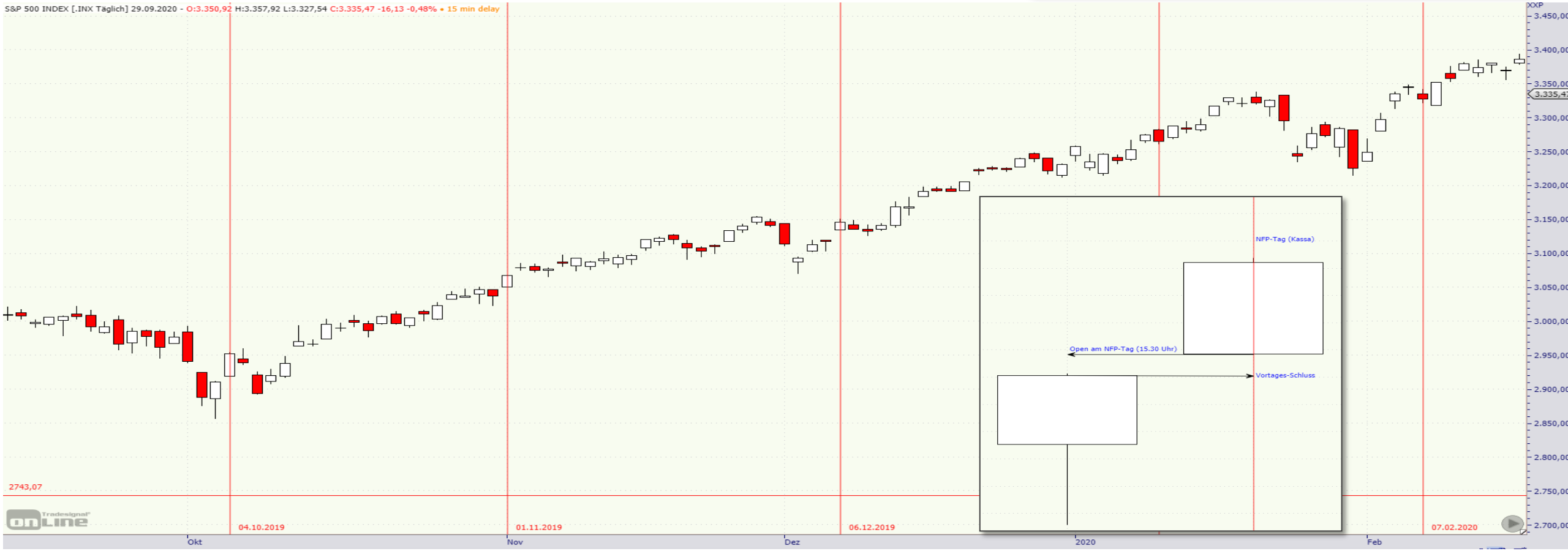
Einsatz je Trade terminieren

- Kapitaldecke, die Anzahl der gehandelten Strategien, das Auszahlungsprofil der Strategie und die mentale Belastbarkeit terminieren den maximal zulässigen Einsatz für die einzelne Strategie.
- In jeder Strategie, in jedem Setup ist der notwendige Abstand zum Stopp vorgegeben, und er wurde fundiert ausgearbeitet durch Auswertung des Marktverhaltens (siehe weiter vorne)
- Wen ich also 3% Risiko pro Trade einzugehen bereit bin, und ich muss einen Stopp mit 50 Punkten Abstand im S&P 500 setzen bei einem spezifischen Trade/Setup, dann ergibt sich daraus die Einsatzhöhe (3% = wieviel Dollar?; Was ist der Punktwert im S&P 500?; Wieviele „Stücke kann ich mir leisten“)

Intermarkets (fundamentale Forecasts)

RW Forecast Bitcoin

NFP TRADING

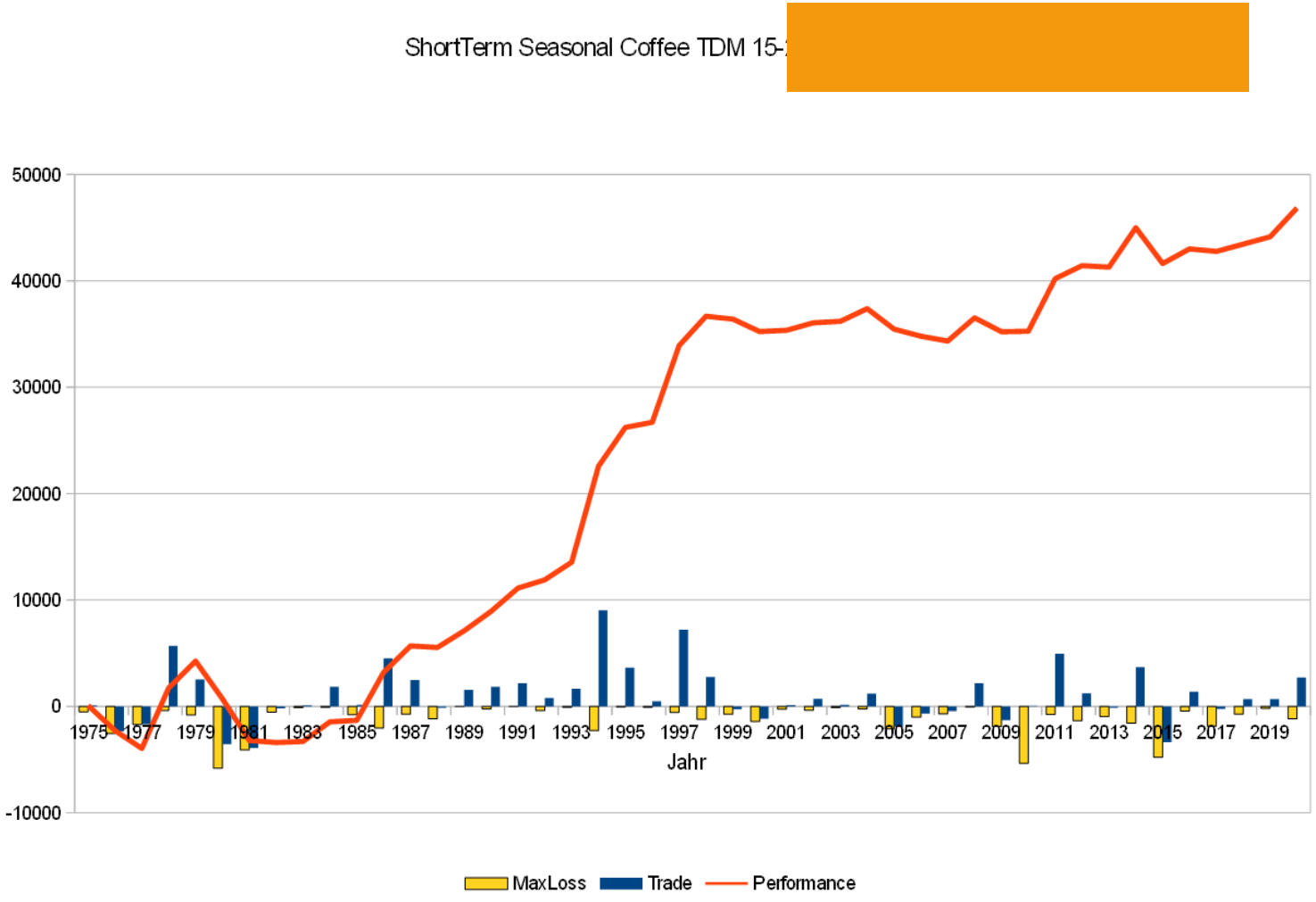


Markiert sind die NFP-Tage (Kassa). Man sieht, dass der Preisversatz zum Vortagesschluss indikativ ist. In der Mehrzahl der Fälle bewegt sich der Markt in diese Richtung. Zudem ist wichtig, zu wissen, dass der Markt an NFP-Tagen zu Intradaytrends neigt. Bei den profitablen, wie auch unprofitablen Situationen sehr hilfreich für das Trade-Management.

KONKRETE TRADES

Aktuell

Coffee Long TDM 15 bis



Summary - All Trades

Overall

Total Net Profit:	$46.846	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**3,19**
Total Trades:	46	Winning Percentage:	67,4%
Average Trade:	$1.018	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	1,54
Max Closed-out Drawdown:	-$7.661	CPC Index (PF x Win% x PR):	3,32
Max Intra-trade Drawdown:	-$9.855	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	71,47%
Account Size Required:	$14.310	Return Pct:	**327,4%**
Open Equity:	$0	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	46,28%
Percent in the Market:	2,0%	Optimal f:	0,65
Avg # of Bars in Trade:	5,00	Z-Score (W/L Predictability):	-0,6
Avg # of Trades per Year:	1,0	Current Streak:	3 Wins

Monthly Profit Analysis

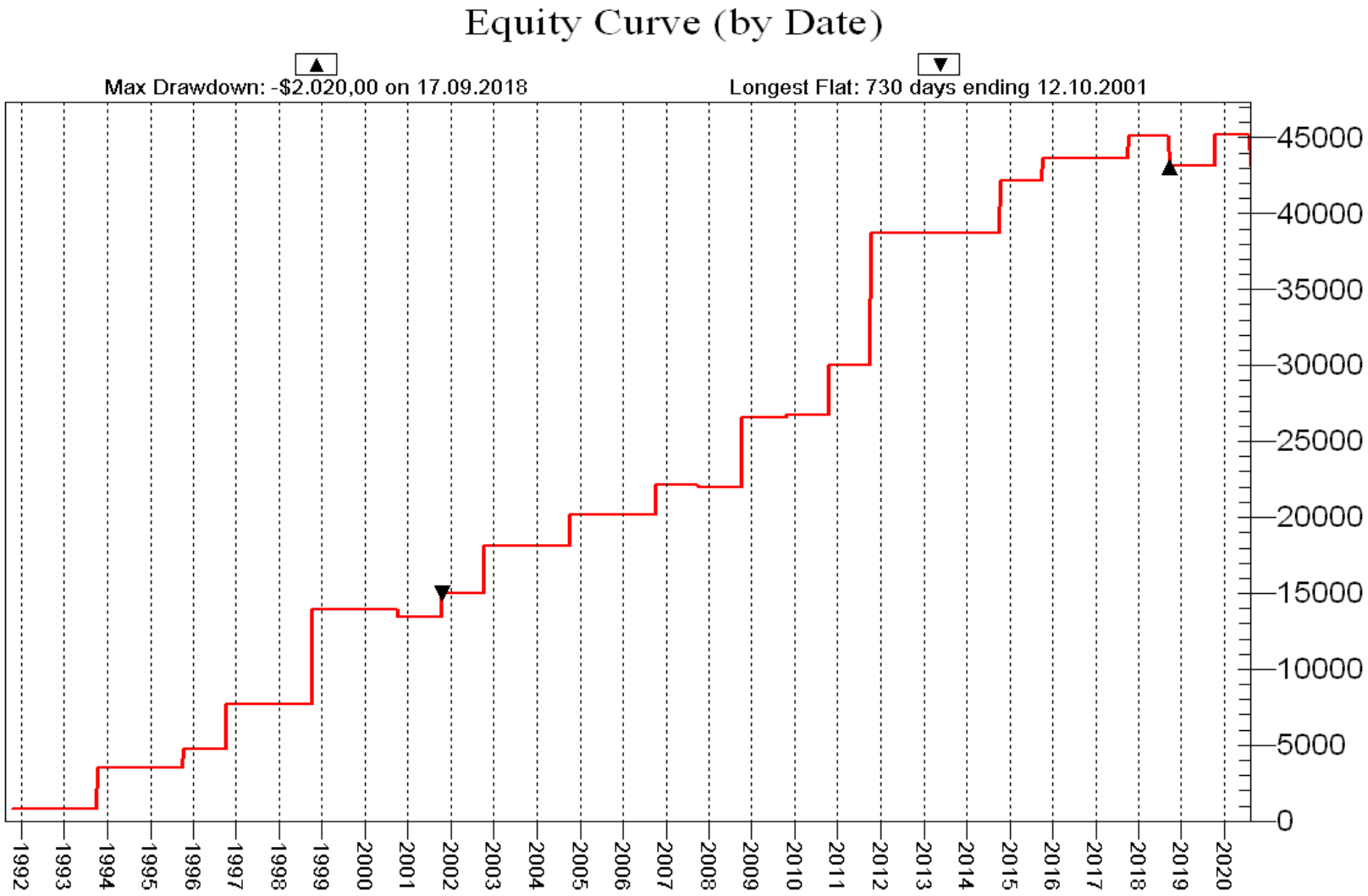
Average Monthly Profit:	$87	Monthly Sharpe Ratio:	0,07
Std Dev of Monthly Profits:	$799	Annualized Sharpe Ratio:	0,26
		Calmar Ratio:	0,11

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	31	Total Losers:	15
Gross Profit:	$68.221	Gross Loss:	-$21.375
Average Win:	$2.201	Average Loss:	-$1.425
Largest Win:	$9.028	Largest Loss:	-$3.910
Largest Drawdown in Win:	-$5.335	Largest Peak in Loss:	$2.803
Avg Drawdown in Win:	-$741	Avg Peak in Loss:	$836
Avg Run Up in Win:	$2.991	Avg Run Up in Loss:	$836
Avg Run Down in Win:	-$741	Avg Run Down in Loss:	-$2.090
Most Consec Wins:	10	Most Consec Losses:	3
Avg # of Consec Wins:	3,10	Avg # of Consec Losses:	1,67
Avg # of Bars in Wins:	5,00	Avg # of Bars in Losses:	5,00

© GenesisFT

Stop-Loss: 5000$ (13,35 Punkte)

Bund Future Long (8) – Stopp 2.000 € (2 Pkt) - 2 Monate



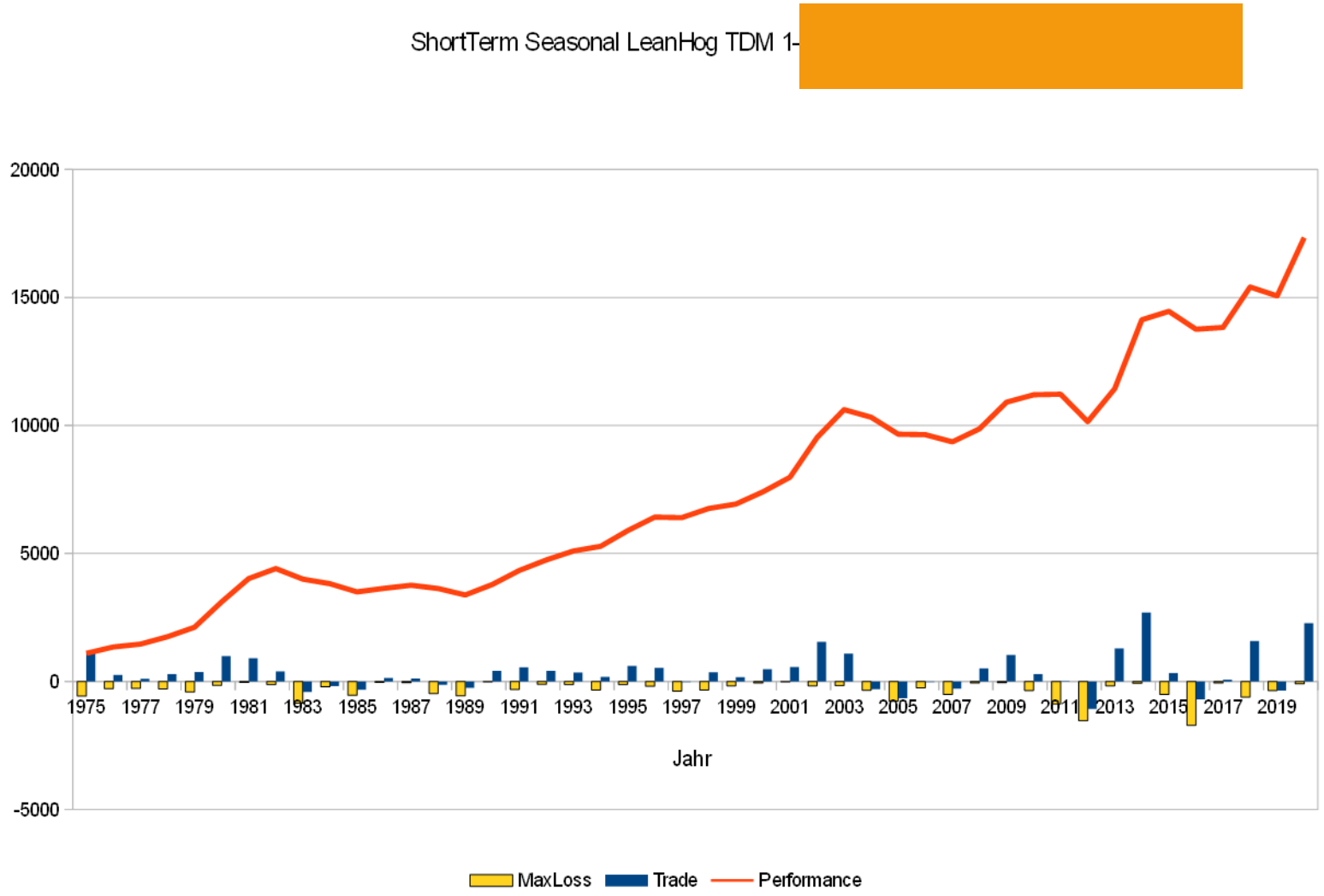
Gehandelt wird Long im Bund Future, WENN das Juli-Ho[redacted]

Der Stopp liegt bei 2.000 € im Future, was 2 Punkten im Future entspricht. Wenn der Trade z.B. bei 171 EUR ausgelöst wird, muss der Stopp bei 169 EUR liegen.

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

Gewichtungs-Kategorie: 4/4

Lean Hogs Long TDM 1 bis [redacted] September



Summary - All Trades

Overall			
Total Net Profit:	$17.340	Profit Factor ($Wins/$Losses):	**4,70**
Total Trades:	46	Winning Percentage:	71,7%
Average Trade:	$377	Payout Ratio (AvgWin/AvgLoss):	1,85
Max Closed-out Drawdown:	-$1.260	CPC Index (PF x Win% x PR):	6,24
Max Intra-trade Drawdown:	-$2.780	Expectancy (AvgTrade/AvgLoss):	104,49%
Account Size Required:	$4.760	Return Pct:	**364,3%**
Open Equity:	$0	Kelly Pct (AvgTrade/AvgWin):	56,47%
Percent in the Market:	1,2%	Optimal f:	0,83
Avg # of Bars in Trade:	3,00	Z-Score (W/L Predictability):	-1,5
Avg # of Trades per Year:	1,0	Current Streak:	1 Wins

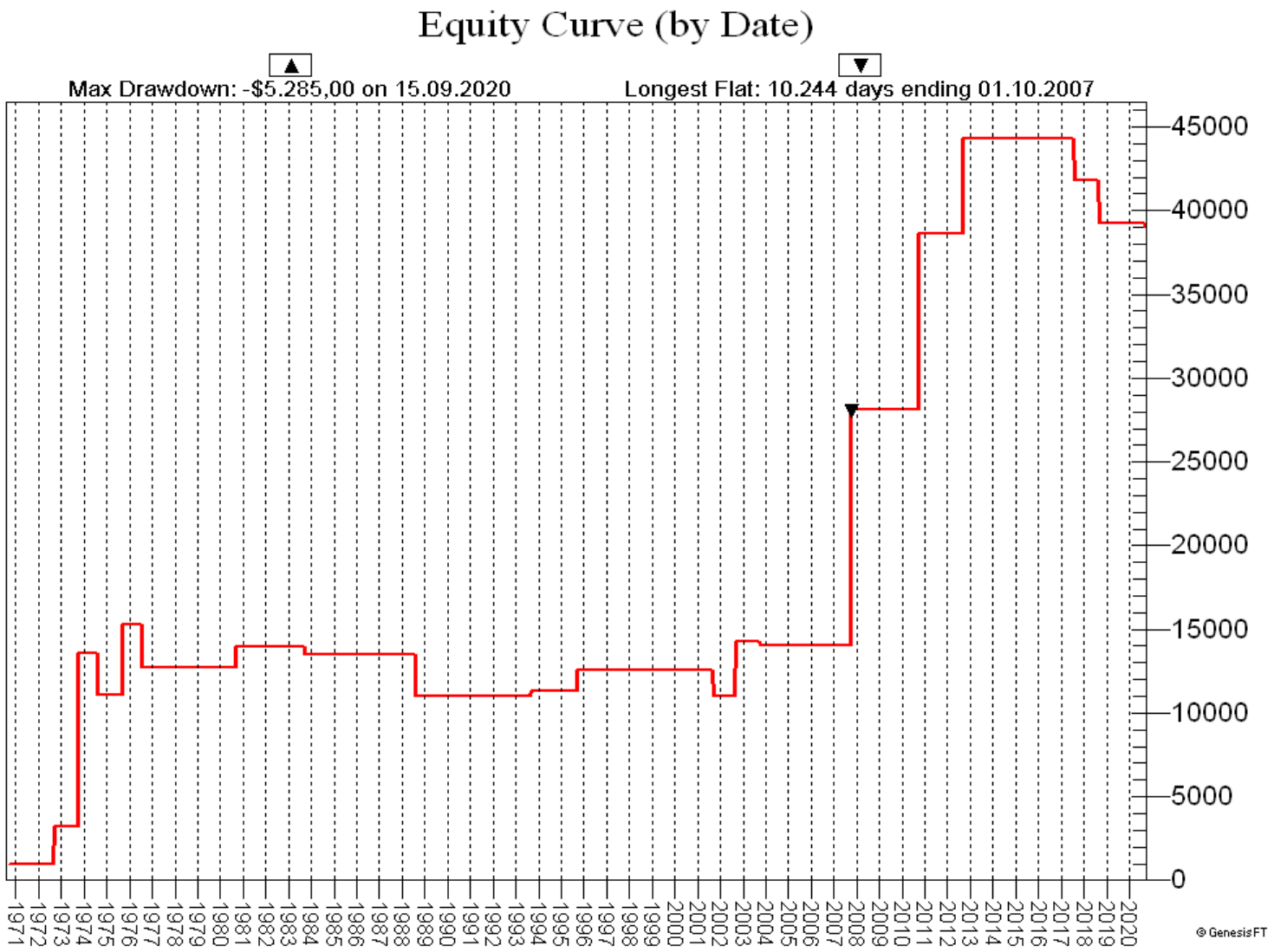
Monthly Profit Analysis			
Average Monthly Profit:	$32	Monthly Sharpe Ratio:	0,10
Std Dev of Monthly Profits:	$234	Annualized Sharpe Ratio:	0,34
		Calmar Ratio:	0,14

Winning Trades		Losing Trades	
Total Winners:	33	Total Losers:	13
Gross Profit:	$22.030	Gross Loss:	-$4.690
Average Win:	$668	Average Loss:	-$361
Largest Win:	$2.690	Largest Loss:	-$1.070
Largest Drawdown in Win:	-$880	Largest Peak in Loss:	$1.530
Avg Drawdown in Win:	-$217	Avg Peak in Loss:	$385
Avg Run Up in Win:	$928	Avg Run Up in Loss:	$385
Avg Run Down in Win:	-$217	Avg Run Down in Loss:	-$652
Most Consec Wins:	8	Most Consec Losses:	4
Avg # of Consec Wins:	4,13	Avg # of Consec Losses:	1,86
Avg # of Bars in Wins:	3,00	Avg # of Bars in Losses:	3,00

© GenesisFT

Stop-Loss: 2000$ (5 Punkte)

Wheat Long (7) – [redacted] (50 Pkt) - 2 Monate



Gel[redacted]NN
das[redacted]ird.

Der[redacted] was
50 [redacted]nn
der[redacted]t
wir[redacted]
lieg[redacted]

Na[redacted]
Kal[redacted]
glat[redacted]

Gewichtungs-Kategorie: 2/4

Du möchtest in einem persönlichen Gespräch Deine Möglichkeiten ausloten?

Uns sind ein persönlicher Kontakt und eine maßgeschneiderte Lösung wichtig. Um herauszufinden, wie Dein Handel professionalisiert werden könnte, biete ich Dir ein persönliches Telefonat an. Trage Deinen Wunschtermin gerne hier ein, und ich rufe Dich an: https://www.survio.com/survey/d/V6R7U2T5A1U8N1Q3L?preview=1

TRADING Class ´21 mit 12 Monaten Live-Orders

- Erfahrungsgemäß reicht es nicht aus, nur ein Bündel von Trading-Setups zu erlernen
- Häufig fehlt besonders am Anfang bei einem neu erlernten Ansatz die **Führung in der Praxis**
- **Fehlerquelle 1: Methodische Umsetzungsfehler**
- **Fehlerquelle 2: Produktauswahl**
- **Fehlerquelle 3: 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
- Seit **01.08. gibt es die„Trading Class 2021“, um** 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 30-60 Minuten) zur immer gleichen Zeit (Monatsbeginn)
- Nach den 12 Monaten kannst Du die Trades eigenständig absetzen und hast wahrscheinlich bereits ein ordentliches Gewinnpolster
- Nur 1 Jahr mit leichten Verlusten überhaupt (-110 $)
- Im Schnitt 80% auf das Startkapital p.a. in der Historie (kein Versprechen, sondern ein **Durchschnittswert!)**

TRADING CLASS 2021