



Strategie Entwicklung

STRATEGIE ENTWICKLUNG

Einleitung

Die Strategie Entwicklung stellt die finale Etappe für ein profitables Trading dar. Umso wichtiger ist es, diesen Vorgang mit der korrekten strategischen Vorgehensweise durchzuführen. Im Folgenden stellen wir Dir den Workflow dar, welcher Dir zusätzlich zu den Videos alle Fragen beantworten sollte.

1. Der Auftrag

Dein erster Auftrag für das Backtesting lautet:

Teste ein Pattern in einem Währungspaar (oder Deinem favorisierten Handelsinstrument) auf einer Zeitebene! Kurz: 1-1-1

Beispiel: Backtestingrunde Nr. 1: Ich teste das Gartley Pattern im 240 min Chart im \$EURUSD.

Dadurch vermeidest Du unnötige Irritationen, welche sich beispielsweise bei einer Multi-Time-Frame Analyse ergeben. Die Störvariablen sind geringer, was Dir helfen wird, das Backtesting korrekt durchzuführen.

Zusätzlich solltest Du zu diesem Zeitpunkt natürlich auch schon sehr gut einschätzen können, welche Zeitebene sich optimal mit Deinem Alltag kombinieren lässt. Für die meisten unserer Studenten ist dies der 240 min Chart.

Wichtig: Die folgenden Regeln für das Gartley Pattern sind bis auf Ausnahmen fix. Du kannst (in Abhängigkeit Deiner Verfügbarkeit etc.) den Stop Loss und das Stop Management anpassen! Genügend Beispiele werden in den Videos genannt.

Die Ziele sollten ebenfalls, wie in den Videos gezeigt, getestet und ausgewertet werden. So lassen sich später die Ergebnisse der Alternativstrategien besser analysieren.

Pattern Regeln: Stop Loss und Stop Management sind wählbar. (Beispiel für Gartley)

- ▶ 1. XA: Impuls und damit Beginn des Patterns

- ▶ 2. Punkt B: Muss 61,8 % (XA)-, darf nicht 78,6% erreichen/berühren
- ▶ 3. Punkt C: Muss 61,8 % (AB)-, darf nicht einen 1 Pip über/unter A
- ▶ 4. Punkt D: Wenn alle Regeln in chronologischer Reihenfolge erfüllt, **dann:** 127,2 % Extension (AB)
- ★**Einstieg:** Wenn 1,2,3 & 4 erfüllt, dann Limitorder \pm 2 Pips (**fixer Puffer**, siehe Erklärung) über/unter Punkt D
- ★**Stop Loss:** Beispiel 15 Pips über/unter X | oder 113 % Fib Inversion
- ★**Ziele:** 38,2 % & 61,8 % Retracements (AD)
- ★**Stop Management:** Wenn Ziel 1 getroffen, dann Stop auf Einstand (+2 Pips)

2. Vorgehensweise

Der Auftrag steht, Du weißt was Du testen musst. Starte Deine erste Backtestingrunde und trage wirklich jeden Trade ein. Egal ob Verlierer oder Gewinner. Dementsprechend solltest du eine Bias vermeiden, gehe also Klick für Klick in dem Chart voran und schau nicht erst, ob ein Pattern profitabel war. Klar, man möchte für seine Arbeit auch belohnt werden, dies machen wir aber genau dann, wenn wir wissen, welche Merkmale Verlierer mit sich bringen! Schule auch Dein Vertrauen indem Du die Beispiele feierst, wenn der Stop Loss beinahe berührt wurde, der Markt dann aber dennoch die Ziele erreicht. Hierdurch vertraust Du später Deiner Strategie, emotionales Handeln gehört der Vergangenheit an.

3. Monitoring

Achte besonders darauf, dass die Eingaben in das Trading Journal fehlerfrei sind. Zahlendreher sind leider sehr schnell passiert, das Instrument verwechselt. Konzentriere Dich, damit Du die Arbeit nicht zweimal machen musst.

4. Zeitraum/ Anzahl an Patterns

Für die Zeitebenen 240 min und 60 min empfehlen wir mindestens im Jahr 2011 zu starten, damit wir genug Patterns als statistische Grundlage haben. Die Grund-gesamtheit wird später

durch die Anwendung natürlich immer kleiner, deshalb ist es enorm wichtig, hier gegebenenfalls später den Zeitraum zu erhöhen. Natürlich kannst Du die Daten später nach dem Datum sortieren, indem Du auf das kleine Dreieck (unten rechts) im Datumsfeld anklickst und sortierst. Eine optimale Anzahl von Patterns gibt es natürlich nicht, dennoch sollten wir versuchen uns den 100 Trades pro Währungspaar und Zeitebene zu nähern.

5. Monitoring

Deine erste Backtestingrunde ist beendet. Jetzt solltest Du die Einträge nochmal auf Fehler untersuchen. Beispiele hierfür findest Du in den Videos.

6. Starte die zweite Backtestingrunde

Starte oben bei Punkt 1 und führe die zweite Backtestingrunde mit einem anderen Pattern durch. Das Handelsinstrument und die Zeitebene sollten gleich bleiben. So kannst Du später in einem Chart drei potentielle Setups handeln.

7. Endlich

Nachdem Du diesen Prozess dreimal wiederholt hast, sollte Dein Trading Journal ca 500 Zeilen umfassen. Zwei Zeilen sind ein Trade. Daraus ergeben sich 250 unabhängige Trades geteilt durch drei, also ungefähr 80 für jedes Pattern. Damit lässt sich arbeiten.

8. Die Auswertung

Die Auswertung steht an. Bis hierhin ist eine Menge Arbeit vergangen, hierfür willst Du dich belohnen. Dennoch ist es wichtig, objektiv zu bleiben. Wie oft haben wir monatelang getestet um zu erfahren, dass das Währungspaar nicht profitabel ist? Oft. Dennoch zeigt dies eindeutig: Annahmen lassen sich per se nicht einfach übertragen. Dies war wahrscheinlich einer der Gründe, weshalb Du in der Vergangenheit nicht erfolgreich warst.

Zur Auswertung sollte auf jeden Fall das zugehörige Video studiert werden, damit die Abläufe und der Sinn dahinter deutlich nachvollzogen werden können. Hier die einzelnen Arbeitsvorgänge, welche im Video abgearbeitet werden:

a) Monitoring -> Fehler aufdecken

Beispiele für Fehler innerhalb des Journals: Zahlendreher, gerade Anzahl von erster und zweiter Position muss gegeben sein, Fehler in der Anzahl d e s Instruments etc.

Pips prüfen (realistisch?)

b) Ausschlusskriterien (oder Überarbeitungsbedarf)

Anzahl (N) der Trades pro Pattern/Instrument zu klein: N sollte mind. 60-100 Trades betragen.

Unrealistische Trefferwahrscheinlichkeit: grobe Richtwerte (für Paare, bei denen es funktioniert): Bat + Gartley 50-65 % Gewinner, Cypher 50-80% Gewinner

c) Auswertung anhand des Trichterprinzips

Ziel ist es ohne Filter profitable Strategien zu erhalten. Je mehr Filter angewendet werden, desto geringer ist das N und damit die statistische Aussagekraft

d) Patterns zuerst einzeln prüfen

Es macht keinen Sinn unterschiedliche Ziele zu prüfen, wenn wir alle Patterns betrachten. Die einzelnen Patterns sind unsere Grundlage, dementsprechend müssen wir alle einzeln analysieren.

e) Alternativstrategien (Ziele) prüfen

9. Das Portfolio

Im Optimalfall konntest Du profitable Patterns finden und für diese die besten Ziele festlegen. Diese Regeln müssen folglich in Deinem Tradingplan aufgenommen werden. Für die Risikokalkulation müssen wir im Journal alle Patterns auswählen, welche wir später exakt so traden werden. Danach können wir im Journal unseren maximalen Drawdown ablesen und unser Risiko pro Trade berechnen.

Das Ziel sollte es natürlich sein, den Prozess später für andere Währungspaare zu wiederholen, um ein Portfolio von 3-5 Instrumenten zu erhalten. Fügt Du also neue Paare zu Deinem Portfolio hinzu, musst Du den maximalen Drawdown immer wieder neu berechnen, da sonst Dein Risiko pro Trade zu groß sein könnte!

10. Risikomanagement

Angenommen Du hast maximal 10 Verlierer in Folge, so fügen wir direkt ein Sicherheitspuffer hinzu. Fakt ist, man wird Fehler machen. Wichtig ist, hieraus zu lernen und nicht emotional

abhängig zu werden. Dementsprechend gestatten wir uns ein wenig mehr Freiraum als im Teststadium.

Wir sagen also, dass unser maximaler Drawdown 13 Trades (statt 10 getesteten) aushalten soll.

Rechnung

Startkonto: 10.000 €

Maximaler Drawdown: 13 Trades

Sollwert: Maximaler in Prozent: Diese Wert hängt von Dir ab, dennoch sollte Dir folgende Grafik verdeutlichen, wie viel Performance benötigt wird, um anfängliche Verluste zurückzuholen.

Drawdown	Nötiger Gewinn zur Erholung
10 %	11 %
20 %	25 %
30 %	43 %
40 %	67 %
50 %	100 %
60 %	150 %

Werte über 10 % sind einfach unrealistisch, daher wenden wir exemplarisch die Schwelle von 10 % maximalem Drawdown an.

Rechnung

Startkonto: 10.000 €

Maximaler Drawdown: 13 Trades

Sollwert maximaler Drawdown in Prozent: 10 %

$10\% / 13 \text{ Trades} = 0,77\% / \text{Trade}$ -> geteilt durch Anzahl der Positionen

$0,77\% / 2 = 0,38\%$ pro Position (Bei zwei Positionen)

Erhöht sich also beispielsweise durch die Hinzunahme weiterer Instrumente in das Portfolio der maximale Drawdown in Trades, so muss das Risiko pro Trade verringert werden, damit der Sollwert des maximalen Drawdowns nicht überschritten wird.

12. Berechnung der korrekten Positionsgröße

Damit Du, wie in Abschnitt (11) erläutert, Deine Positionsgröße beim Trade auch richtig bestimmst, haben wir eine Excel-Vorlage für Dich erstellt, welche Du in der Lektion Strategie Entwicklung -> Risikomanagement zum Download findest.

Die Tabelle ist so programmiert, dass wir eher zu wenig als zu viele Kontrakte aufnehmen. Sie rundet also immer ab, damit Du deinen Drawdown nicht schon von Anfang an strapazierst. Weiterhin zeigt die Tabelle die Positionsgröße für in EUR und USD geführte Konten an.

a) Einstellungsreiter: Auf dem ersten Tabellenblatt "Einstellungen" findest Du die "Konto & Risikoeinstellungen", sowie die "Kurseinstellungen".

Fülle die entsprechenden Felder für Dein persönliches Konto aus. Ist es in USD geführt, so trage alle blau hinterlegten Felder ein. Ist Dein Konto in EUR geführt, so trage die grünen Felder ein. Die Kommentare geben Dir noch einige Tipps.

Aktualisiere die Kurse unter "Kurseinstellungen" regelmäßig (täglich/wöchentlich).

b) Nachdem Du a) korrekt erledigt hast, kannst Du auf dem Tabellenblatt "Rechner" die Positionsgröße berechnen. Wichtig: Fülle nur die in roter Schrift gekennzeichneten Felder aus. Aus dem geplanten Stop Loss und Einstieg lässt sich das Risiko in Pips berechnen. Diese musst Du folglich ausfüllen und zudem die Endung des Währungspaares eingeben (per Dropdown). Du erhältst die gewünschte Positionsgröße.

13. Der Ausblick

Du solltest Deinen persönlichen Plan über einen Zeitraum von zwei bis drei Monaten im Demokonto zu testen. Wenn es Dir in dieser Zeit gelingt, Dich an Deine Regeln zu halten und keinen Trade zu verpassen, dann bist Du bereit für den Echtgeldhandel. Auch hier ist es wichtig, jeden Trade wie gehabt zu in unserem Journal einzutragen, um eine Soll-Ist Wert Analyse vornehmen zu können. Du bist folglich auf Dich alleine gestellt. Du haftest für Deine Fehler. Es liegt also in Deiner Verantwortung, ob Du die kennengelernten Prozesse wirklich aufnimmst, oder lieber Abkürzungen suchst, welche es in der Branche nicht gibt. Vielleicht doch? Nein! Diese abstruse Vorstellung hatten wir auch, aber ein einfaches Beispiel verdeutlicht, dass es nicht geht. Man stelle sich die Gegenseite vor: John ist 30 Jahre und muss seine hohen Kosten in London decken. Dafür arbeitet er jeden Tag zwischen 12-16 Stunden. John arbeitet bei Goldman Sachs. Erzielt John die erwarteten Ziele nicht, dann wird er entlassen. Er könnte seine Familie nicht mehr versorgen und das in dieser teuren Stadt. Dazu soll und will John es nicht kommen lassen. Er nutzt jegliche verfügbare Technologie und arbeitet die besagten Stunden pro Tag. Du willst ohne Backtesting erfolgreich sein? No way. Dies ist arrogant und fahrlässig. Es ist das mindeste, was wir als Trader tun können, um auf den Weg der Profitabilität zu kommen. Diesen Weg teilen wir mit Dir. Wir sind eventuell schon ein Stück weiter als Du, dennoch müssen wir auch täglich arbeiten, um immer besser zu werden und in der Branche bestehen zu können. Sollte Dir dieser Prozess nach Beendigung des Kurses schwer fallen, so laden wir Dich herzlich zu einer unserer Mitgliedschaften ein. Hier treffen sich Gleichgesinnte, welche das Verlangen haben, gemeinsam mehr zu erreichen und John die Stirn zu bieten.