



Risiko Cheat Sheet

Das Wichtigste im Trading ist das Risiko Management. Hier ein einfaches Beispiel, welches es auf den Punkt bringt: Du kannst der konstanteste Trader auf der Welt sein und 180 Tage in Folge gewinnen. Am nächsten Tag verlierst Du alle Gewinne in nur einem Trade. Was eventuell "unrealistisch" klingt, passiert vielen Tradern zu häufig. Die Ursache liegt nicht darin, dass sie keine guten Trader sind, sondern schlichtweg die Wichtigkeit des Risiko Managements und entsprechender Maßnahmen nicht verstanden haben.

Im Folgenden findest Du einige Hilfestellungen, die wir in unserem Trading nutzen.

Für die Bestimmung des Risikos musst Du in folgender Reihenfolge vorgehen.

Kontogröße -> Maximaler Drawdown -> Erfahrungen -> R-Limits (Aus der Kontogröße leiten wir den maximalen Drawdown ab. Anhand der Daten können wir nun die einzelnen Risiko-Limits aufstellen.)

Auf [Seite 3](#) kannst Du deine eigenen Werte in unserer Vorlage eintragen.

Beispiel der Vorgehensweise

Kontogröße (Schritt 1)

10.000\$ Konto

Maximaler Drawdown (Schritt 2)

Stelle Dir die folgende Frage: Wie viel möchte ich maximal von meinem Konto riskieren, bevor ich Dinge ändern muss? Gemeint ist der kumulative Drawdown deines Kontos. 1000\$ (10% vom Konto)

Erfahrungen (Schritt 3)

Hier schauen wir, wie wir im Demotrading / Backtesting gewonnen und verloren haben. Wenn wir beispielsweise maximal 3 Tage in Folge verloren haben, nehmen wir diesen Wert für die Berechnung der R-Limits.



R-Limits (Schritt 4)

Gehen wir einen Schritt weiter: Wir wissen nun, dass wir das maximal 1000\$ von unserem 10.000\$ Konto verlieren wollen (kumulativ). Daher dividieren wir die 1000\$ durch den historischen Drawdown von 3 Tagen. Zusätzlich packen wir einen kleinen Puffer hinzu.

Worst-Case wären in diesem Beispiel also 4 Verlierertage in Folge.

$1000\$ / 4 = 250\$$ tägliches Risiko.

Tägliches Risiko = Daily Max

- 250\$ pro Tag = 3R
- Stelle dieses tägliche Risiko beim Broker als Schutz ein (mit TradeZero direkt aus deinem Dashboard möglich)
- Trading für den Tag beenden, wenn Daily Max erreicht. Dies ist deine Lebensversicherung!

Risiko pro Trade

- In der Regel solltest Du nicht mehr als 3 Trades pro Tag machen. (Hast Du im Demotrading immer 5 gemacht, so teile das Tagesrisiko durch 5).
- Hieraus ergibt sich ein Risiko pro Trade von 80\$ ($250/3 = 1 R$)
- Solltest Du in Positionen reinskalieren, dann kannst Du mit mit 40\$ (0.5R) starten und bei Bestätigung die andere Hälfte hinzufügen.

Risiko pro Symbol / Ticker

- Wenn Dinge nicht direkt funktionieren, hat dies oft einen Grund. Daher sollten wir niemals unser ganzes Tagesrisiko in nur einem Trade oder nur einem Wert riskieren.
- Es ist möglich einen Trade und damit 1R in einer Aktie zu verlieren. Später findest Du ein neues Setup in der gleichen Aktie. Nun hast Du wieder die Möglichkeit 1 R zu riskieren.
- 2R pro Symbol / Ticker, also maximal 2 ganze Verlierertrades als Faustregel.
- Danach besser auf andere Aktie fokussieren. 1R verbleibend.

Faustregel in Drawdowns

Was ist, wenn Du beispielsweise montags und dienstags jeweils dein maximales Tagesrisiko ausschöpfst? In diesen Phasen wollen wir schnell unser Risiko minimieren, um Vertrauen zu bekommen.



Es gilt:

- Wenn 2 * Daily Max in kurzer Folge, dann Daily Max / 2.
- Zurück zum normalen Daily Max, wenn wieder 2 Tage in Folge gewonnen wurden und das Vertrauen zurück ist.

Vorlage

Kontogröße

_____ \$

Tagesverlust-Limit (Daily Max)

_____ \$ = _R

Regel: 2 max Daily Risk -> Daily Risk / 2 (Zurück zum normalen Daily Max, wenn wieder 2 Tage in Folge gewonnen wurden und das Vertrauen zurück ist).

R / Symbol

Maximal 2R / Symbol

R / Trade

1R = ___ \$

0.5R = ___ \$