

TradeLab





Inhalt

- 1. Alle Infos in Kürze**
- 2. Turtle Surge**
- 3. Silent Strike**
- 4. Pulse Chaser**
- 5. Deine Zukunft**

RISIKOHINWEIS: DIE ENTWICKLUNGEN IN DER VERGANGENHEIT SIND KEIN VERLÄSSLICHER HINWEIS AUF KÜNFTIGE ERTRÄGE, UND DER WERT EINER INVESTITION IN EIN FINANZINSTRUMENT KANN SOWOHL STEIGEN ALS AUCH FALLEN.



Kapitel 1

Alle Infos in Kürze

Damit Du Zeit sparen kannst und nicht das ganze E-Book erst lesen musst, bevor Du was handeln kannst, gebe ich Dir hier alles wichtige im Voraus mit.

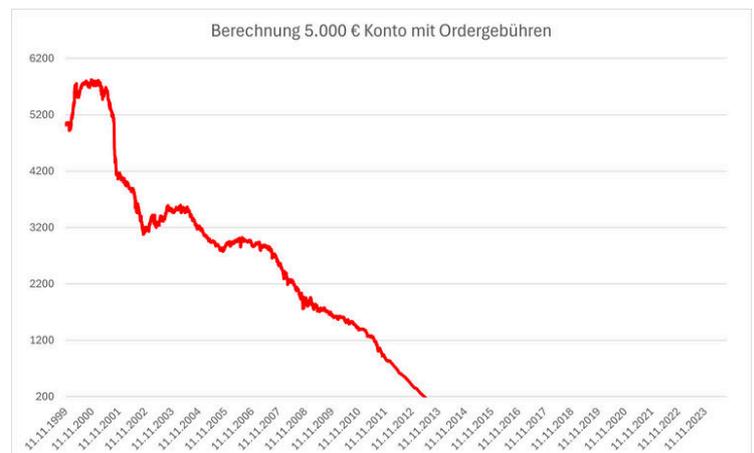
Das benötigte Wissen

Beim Backtesting handelt man eine Strategie in der Vergangenheit und geht davon aus, dass diese auch in Zukunft funktionieren wird. Insofern sich der Markt nicht radikal verändert, stimmt das auch!

Beim Backtesting sollte man allerdings auf zwei Dinge achten:

1) Keine Überoptimierung! .. Natürlich könnte ich für die Vergangenheit einen Indikator (oder mehrere) so zusammen kombinieren und die Perioden anpassen, sodass diese die beste Strategie der Welt wäre. In der Zukunft ist dieses Mikromanagement aber schädlich.

2) Keine Einberechnung von Ordergebühren! Viele Backtests da draußen sehen in der Theorie gut aus, bringen Dir aber in der Praxis nichts, sobald man Ordergebühren bezahlt. Bei der Silent Strike Strategie im Schweizer Index habe ich das deutlich gesehen. Schau mal hier: Links mit, rechts ohne Ordergebühren.





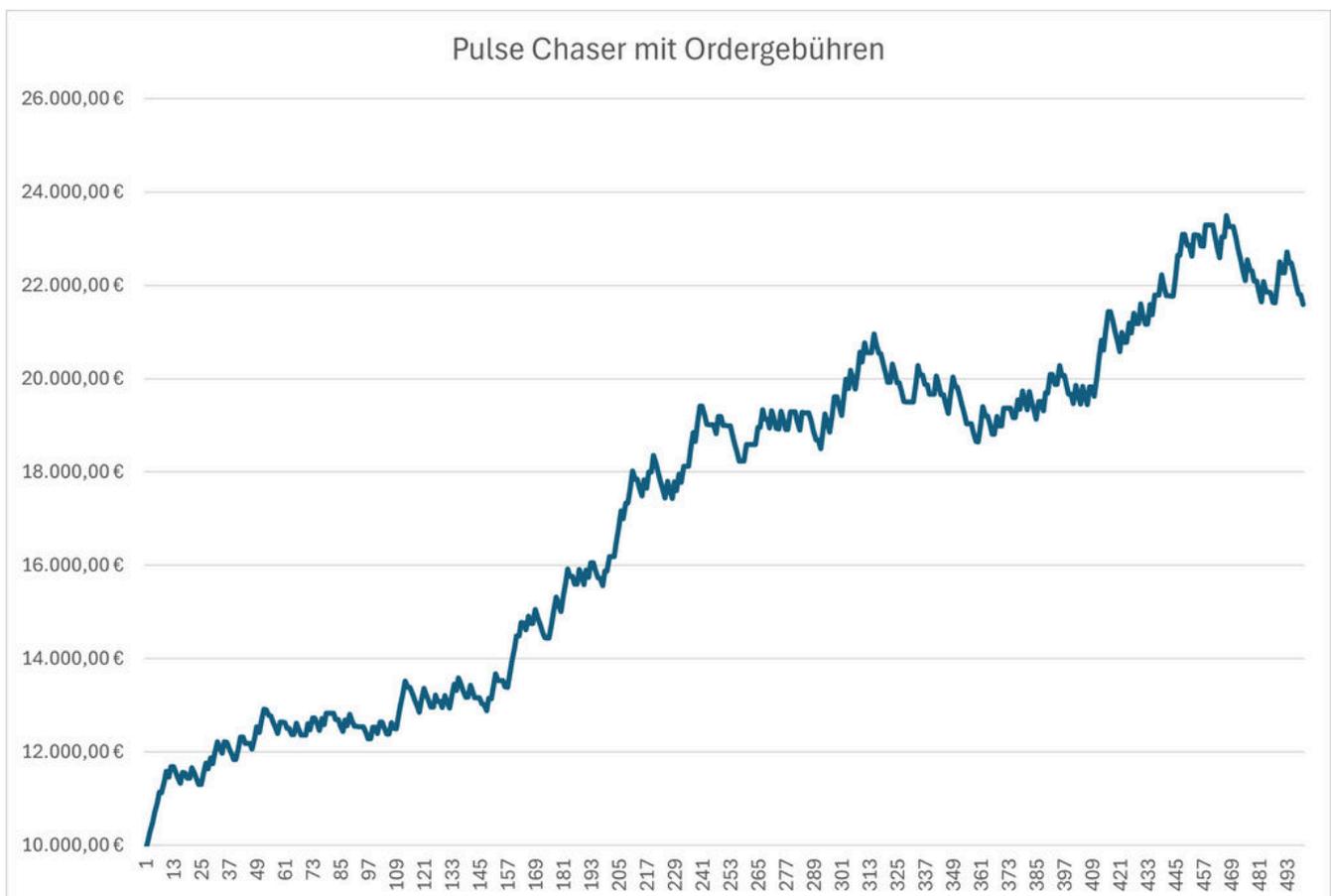
Meine Backtests mache ich nicht nur aus Spaß. Ich will damit Geld verdienen! Entsprechend habe ich überall auch die Ordergebühren für uns mit einberechnet. So sehen wir direkt was wirklich was taugt und was "Mist" ist.

Pulse Chaser

Dies ist eine Bitcoin Scalping Strategie, welche mir innerhalb von 7 Monaten 500 Trades gebracht hat. Durch diszipliniertes Risikomanagement von 1% Risiko pro Trade, kann der Drawdown extrem klein gehalten werden. Maximal 10,68% Drawdown bei 129,46% Rendite. Das schmeckt mir sehr!

Bitcoin hat zwar rund um die Uhr geöffnet, aber ich habe nur Trades im Zeitraum 8 - 23 Uhr beachtet und umgesetzt. Das ist für mich und vermutlich auch für Dich am sinnvollsten.

Wie das Signal entsteht habe ich Dir im letzten Kapitel beschrieben.





Turtle Surge

Die Turtle Trading Strategie hat um die 1980er und 90er viele Trader zu Millionären gemacht. Das coole am Turtle Trading: Es handelt sich hierbei um ein "Fixed Entry Modell". Das bedeutet es gibt für alles fest definierte Regeln: Einstieg, Ausstieg, Stop-Loss Trailing, Positionsgröße, etc.

Die Regeln sind so klar definiert, dass man diese programmieren kann. Genau das habe ich getan, wodurch es mir im Tradingview die Signale usw. alles automatisch anzeigt.

Da sich der Markt seit den 80er Jahren verändert hat (Unter'm Strich gibt es mehr Seitwärtsphasen), funktioniert die originale Turtle Trading Strategie nicht mehr ganz so gut. Indem man die Strategie modernisiert, wie bspw. einen Long Only Ansatz verfolgt, kann man diese dennoch erfolgreich handeln.

So sieht ein Long Only Signal im Apple Tageschart aus:





Hier noch die Profit/Loss Kurve von Apple im Long Only Ansatz



Silent Strike

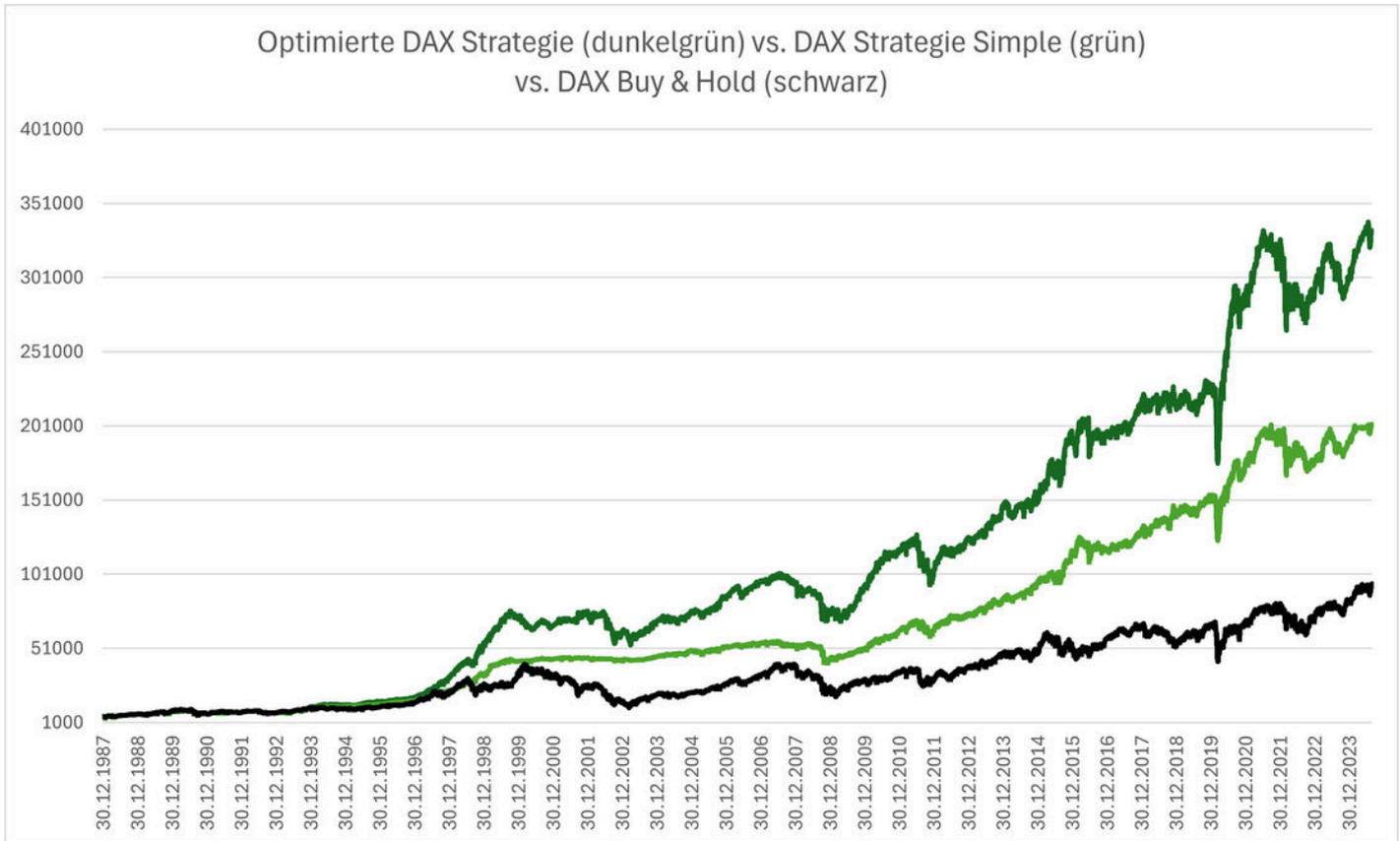
Es ist schon längere Zeit der Effekt bekannt, dass der Markt außerbörslich Gewinne macht, während er in der Haupthandelszeit eher verliert. Aus dieser Anomalie heraus habe ich eine “Strategie für Nebenbei” entwickelt.

Diese gibt Dir jeden Tag zu Börsenschluss exakt 1 Entry Signal und zur Börseneröffnung 1 Exit Signal. Durch eine weitere leicht umzusetzende Optimierung kann man die Rendite sogar noch deutlich steigern.

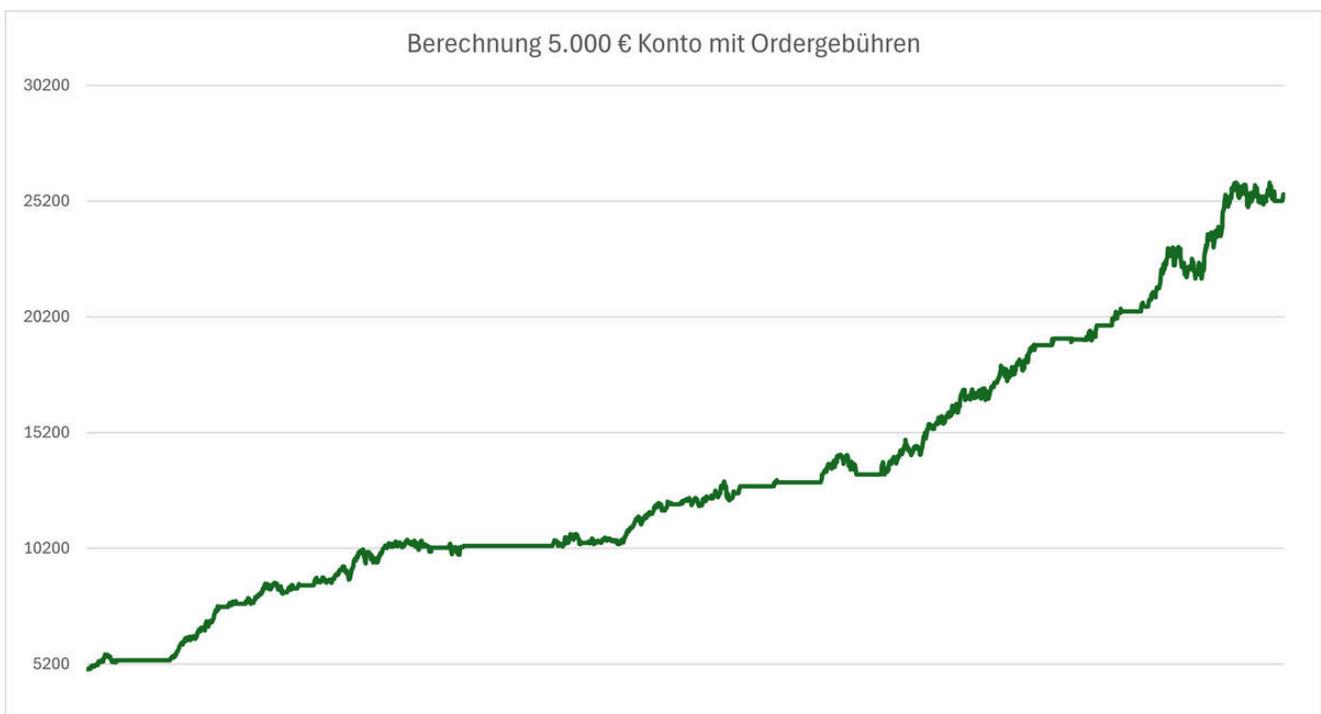
Die Strategie funktioniert im DAX, Nasdaq Composite, Nasdaq Index und Nikkei225. Im Schweizer SMI und dem Österreichischen ATX funktioniert sie nicht.



Im DAX habe ich über 9.300 Trades ausgewertet



Mich selber hat übrigens das Ergebnis im Nikkei überrascht. Dieser hat seit 1990 ganze 30 Jahre kein Allzeithoch gemacht, aber Overnight läuft es^^ Hier mal die Strategie im Nikkei ab 2012:





Kapitel 2

Turtle Surge

Grundlage

Die Turtle Surge Strategie versucht den Start eines Trends zu finden und diesen sehr lange zu reiten. Dies geschieht durch ein klar definiertes Einstieg Signal und einem Trailing Stop-Loss. Dieser ist im System 1 der Strategie als 10-Tages-Tief definiert.

Getreu dem Motto "Mache Gewinner groß und halte Verluste klein" baut man in regelmäßigen Abständen die Position aus. Es ist in der Praxis oft, dass man dadurch 20% oder mehr Rendite in einem Gewinntrade mitnimmt.

Trade Signal Anleitung (Achtung: Wird komplex)

Lies Dir die Anleitung erstmal durch. Keine Sorge, falls Du nicht alles sofort verstehst. Ich hab es am Anfang auch nicht^^

- (1) Macht der Kurs ein neues 20-Tage-Hoch, so wird ein erstes Long Signal gelöst.
- (2) Als Anfangs Stop-Loss wird entweder das 10-Tages-Tief oder der Abstand von 2 ATR genommen. Je nachdem was näher ist. Der ATR ist die durchschnittliche Schwankung im Kurs.
- (3) Die Positionsgröße wird so gewählt, dass man im Falle eines Stopps nur maximal 1% des Depots verliert.
- (4) Läuft der Trade an so wird im Abstand von 0,5 ATR die Position ausgebaut. (Gewinner groß machen!)
- (5) Der Stop-Loss wird entsprechend nun auch nachgezogen.
- (6) Ausgebaut werden darf maximal 4mal. Deine Position ist dann ziemlich groß.
- (7) Vertraue dem Trend und quetsch den Markt aus.



Soweit so gut, oder?

Nunja, wir haben gerade einen Trade vom sogenannten System 1 der Turtle Strategie durchgenommen. Habe ich Dir schon von System 2 erzählt oder von der Ignorieren-Regel? Jetzt wird es extrem komplex. Das ist im übrigen auch der Grund warum die Turtle Strategie wenig verbreitet ist. Diese manuell umzusetzen ist nahezu unmöglich. Ganz davon zu schweigen man möchte die Strategie noch in verschiedenen Assets umsetzen, um den Grundsatz der Diversifikation zu gehorchen. Das geht einfach nicht.

Genau deswegen habe ich auch ein Pinescript Code in Tradingview geschrieben, welcher das für uns erledigt.

Der Code ist [im TradeLab Produkt mit dabei](#). Dort kannst Du ihn Dir einfach kopieren und einfügen.

Moderne Variationen der Strategie

In meinem Research habe ich folgendes bemerkt: Seit dem Jahr 2000 macht die Strategie in vielen Assets mit Long Trades enorme Renditen, wohingegen mit Short Trades Verluste gemacht werden.

Title	Long	Short
Net Profit	671,526.16 USD 67.15%	-731,774.11 USD -73.18%
Gross Profit	1,920,025.53 USD 192.00%	632,931.72 USD 63.29%
Gross Loss	1,248,499.38 USD 124.85%	1,364,705.83 USD 136.47%

Auf Grund dieser Tatsache habe ich eine **Long Only Strategie** entwickelt. Short Trades werden hier nicht beachtet, sondern nur Long-Signale beachtet.



Hier mal zum Vergleich der Nasdaq Index mit Long & Short:



Vs. Nasdaq Index Long Only Ansatz



Wenn also gesagt wird, dass Turtle Trading nicht mehr funktioniert, dann hat es ein Stückchen Wahrheit. Durch eine einfache Anpassung kann man aber auch heutzutage gutes Geld mit dem Turtle Trading verdienen - man muss nur die schlechten Trades rausfiltern.



Diese Assets sind im Long Only über die letzten 20 Jahre profitabel:

Indizes

- S&P500
- Nasdaq100
- Nasdaq Composite
- US30
- Nikkei225
- HangSeng
- ATX30

Rohstoffe

- Gold
- Silber
- Palladium
- Kupfer
- WTI Oil

Währungen / Krypto

- Bitcoin
- Ethereum
- USD/JPY
- USD/RUB
- USDBRL
- USD/TRY
- USD/MXN

Eine ganze Menge Swing-Trades, welche man also umsetzen kann :D

Hier kannst [Du Dir die Performance Kurven dazu anschauen.](#)



Das Problem der Differenz zwischen Long und Short Profitabilität gibt es im Bitcoin tatsächlich nicht. Dieser ist so volatil, dass auch Short Trades Rendite abwerfen. Hier gibt es allerdings ein anderes Problem: Der Bitcoin ist schon ein ticken zu volatil. Beim Testen & Analysieren der Trades habe ich oftmals gesehen wie der Bitcoin einen Trade ausstoppt, bevor er wirklich durchziehen kann. Die Schlussfolgerung war klar: Es muss eine **Bitcoin Variation** her.

Eine Outperformance des Bitcoin bei gleichzeitig deutlich geringeren Drawdowns ist mit der Variation nun möglich. Der Trick legt darin dem Trade mehr Luft zu Beginn zu lassen. Das geschieht vor allem durch eine Einstellung im ATR, welcher wie oben beschrieben den Anfangs Stop bildet.



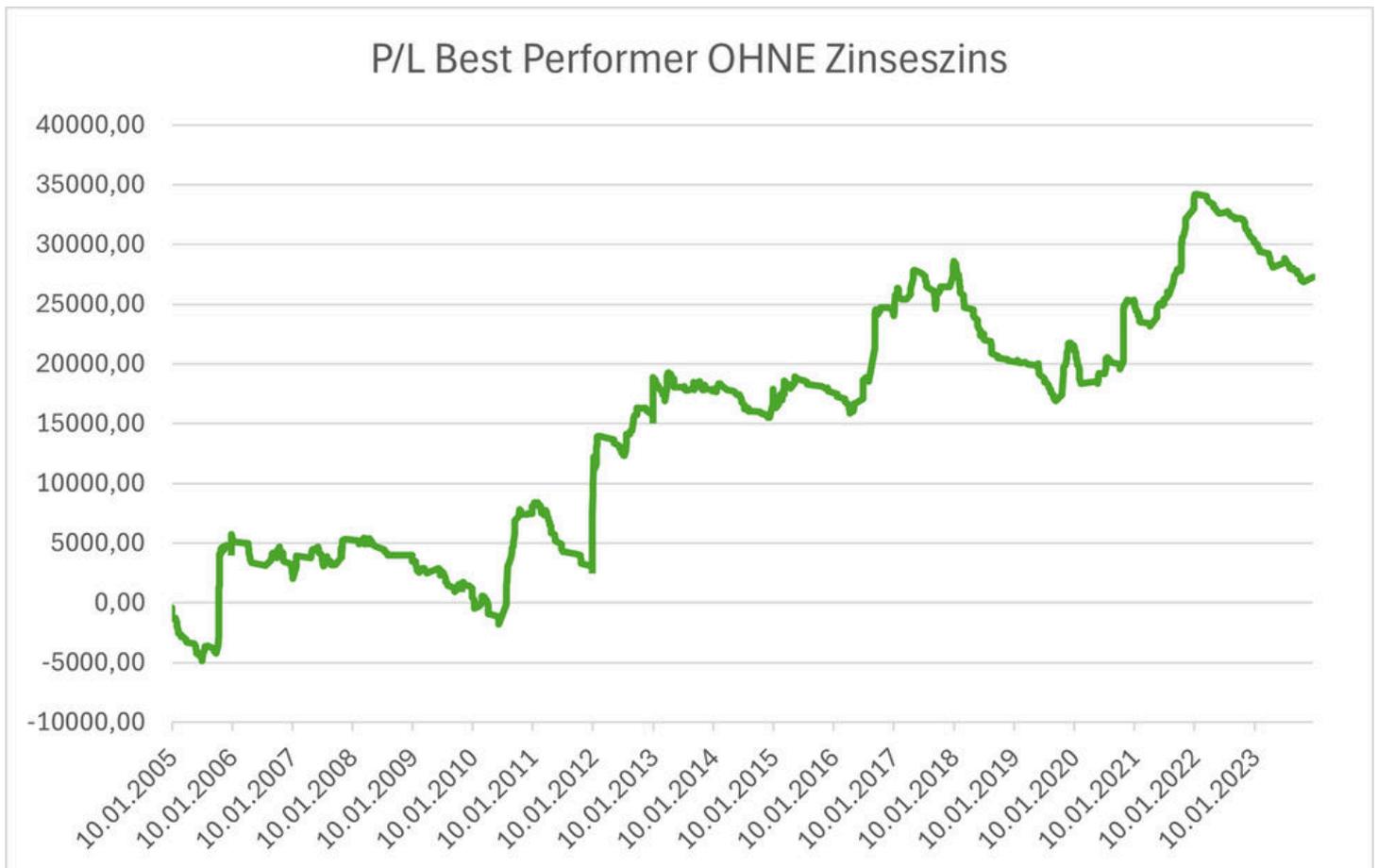


Ein anderes Problem im Research hatte ich bei Einzelaktien. Diese haben im Durchschnitt zu wenig Bewegung, um die originale Turtle Strategie zu handeln. Große Verlustserien sind hier Tagesordnung gewesen. Aber auch hier war das Signal klar: Es muss eine **Aktienspezifische Variation** her.

Die Idee so simpel: Für Turtle Trading benötigt man starke Trends... also handel ich nur die 5 besten Vorjahres-Aktien des S&P500.

Die Stärke des Vorjahres ist ein ganz klares Indiz für einen Trend..und zwar einen starken!

Diesen Ansatz werde ich dank des Programmcodes auch in Zukunft nebenbei handeln. Schließlich bekomme ich die Trades automatisch angezeigt. Wieso sollte ich darauf verzichten? Für Berufstätige Leute ist diese Strategie ebenfalls sehr interessant.





Kapitel 3

Silent Strike

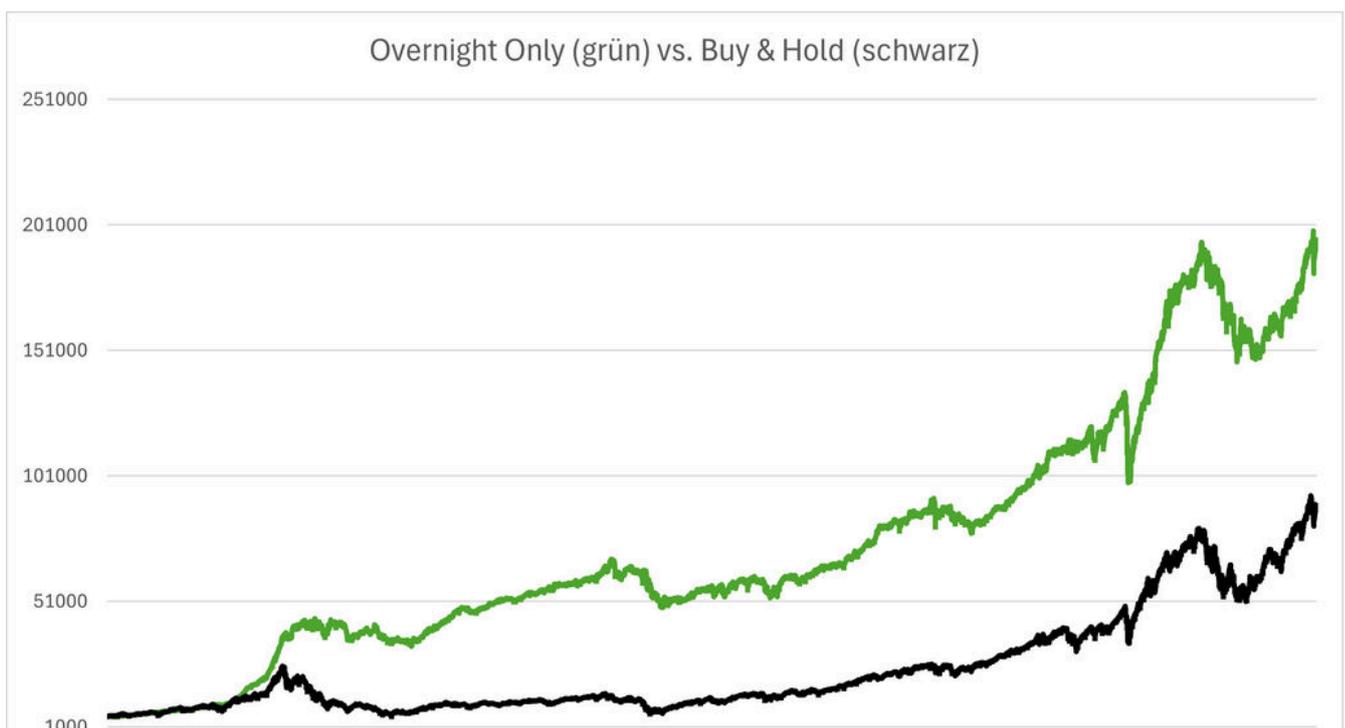
Grundlage

Bruce Knuteson hat vor einigen Jahren auf einen Effekt aufmerksam gemacht, der zeigt, dass die Kurse außerbörslich steigen. Ich bin direkt hellhörig geworden und musste eine Strategie daraus machen. Im Übrigen verwende ich diesen Overnight Effekt selber schon seit einigen Jahren, aber habe diese nun noch als Silent Strike weiter entwickelt.

Trade Signale

- (1) Kaufe den Schlusskurs eines Index
- (2) Halte die Position über die Nacht
- (3) Verkaufe am Folgetag zur Börseneröffnung

Die Ergebnisse können sich sehen lassen: Hier mal im Nasdaq Composite. Mehr Rendite bei weniger Drawdown.





Optimierung

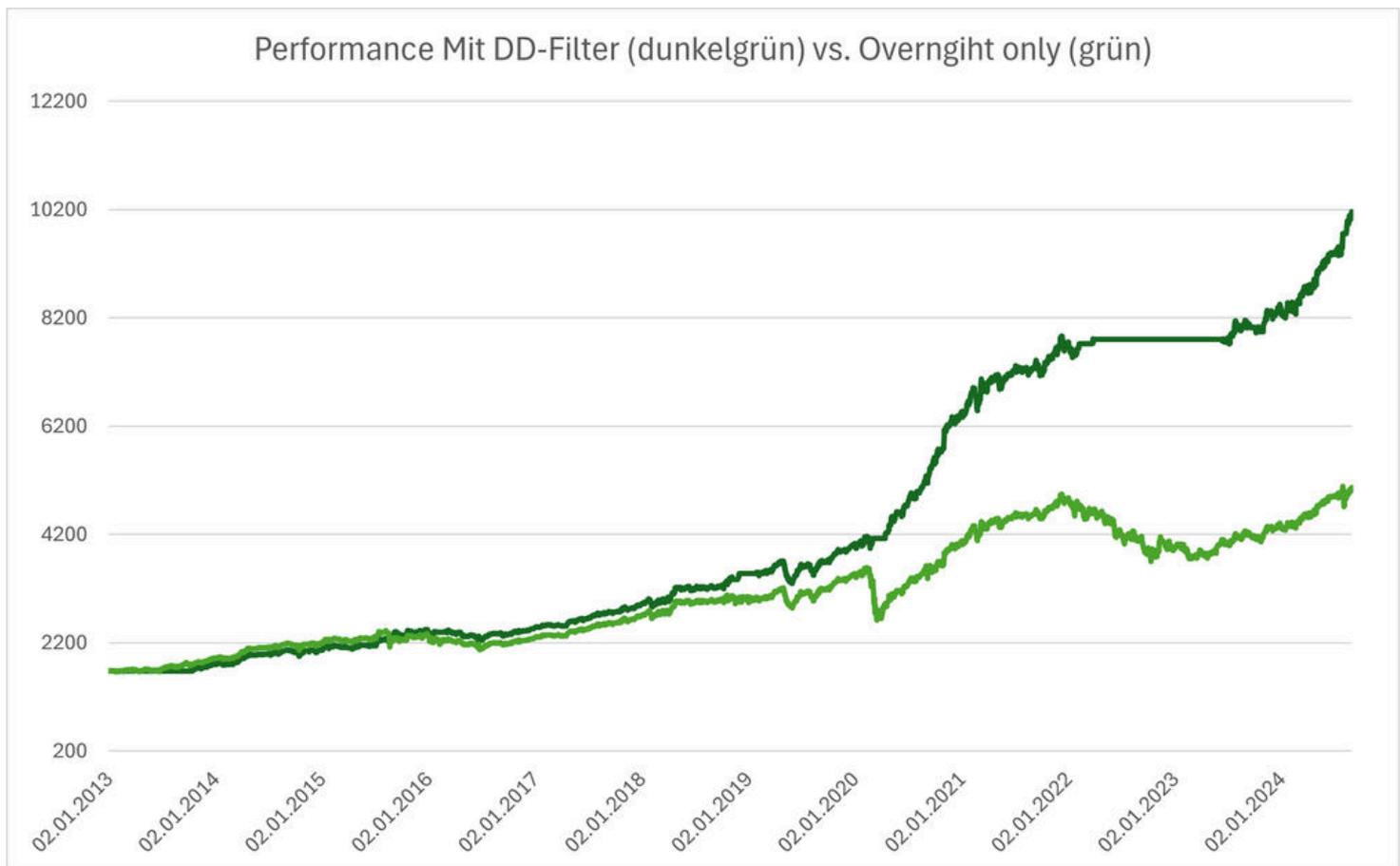
Dir ist in der Trade Anleitung sicherlich aufgefallen, dass es nur um “kaufen” geht. Das heißt hier wird quasi auch ein Long Only Ansatz verfolgt.

Ich habe im Research folgendes rausgefunden: Ist der Index selbst im Drawdown, so kommt unweigerlich auch die Strategie in den Drawdown. Wie wäre es also, wenn man eine Grenze einbaut, ab wann man die Overnight-Trades einfach erstmal aussetzt? Im Backtest habe ich das als “Drawdown-Filter” bezeichnet.

Ist der Index weiter von seinem Allzeithoch entfernt als es der Drawdown-Filter zulässt, so verzichte ich auf Trades.

Schau mal hier das Ergebnis:

In Bärenmärkten trennt sich hier die Spreu vom Weizen





Optimierung für Prop-Trading

Mit dem Drawdown-Filter kann man ganz gut Verluste klein halten. Durch die geschickte Wahl des Drawdown Filters ist es sogar möglich dauerhaft Drawdowns von weniger als 10% zu haben. Prop-Trading ist somit bestens machbar!

Falls Dein Prop-Trading Anbieter einen maximalen Drawdown von nur 8% zulässt, dann kannst Du einfach den Drawdown-Filter anpassen.

[Im TradeLab Produkt kannst Du](#) Dir auch alle meine Excel Dateien downloaden, wo Du mit dem Drawdown-Filter rumspielen kannst.

So sieht das aus:

Berechnung Trading NUR wenn Drawdown <							12%
(Gerne auch selber ausprobieren Siehe Videoanleitung)							
DD Filter	Punkte	Punkte Summ	Gap in %	Basis 1.000 €	Anpassung an High Waterm:	Drawdown	MAX DD
							-11,27%
Unter DD	2,36	2,36	0,23%	1.002,34 €	1.002,34 €	0,00%	Endwert
Unter DD	1,27	3,63	0,12%	1.003,59 €	1.003,59 €	0,00%	30.767,55 €
Unter DD	0,09	3,72	0,01%	1.003,68 €	1.003,68 €	0,00%	
Unter DD	4,65	8,37	0,45%	1.008,22 €	1.008,22 €	0,00%	
Unter DD	1,71	10,08	0,16%	1.009,87 €	1.009,87 €	0,00%	
Unter DD	-1,24	8,84	-0,12%	1.008,66 €	1.009,87 €	-0,12%	
Unter DD	1,57	10,41	0,15%	1.010,19 €	1.010,19 €	0,00%	
Unter DD	2,84	13,25	0,27%	1.012,94 €	1.012,94 €	0,00%	

Stelle im gelben Kästchen einen Wert ein und es zeigt Dir rechts den maximalen Drawdown der neuen Strategie.



Kapitel 4

Pulse Chaser

Grundlage

Ziel der Strategie ist ein replizierbarer Trendfolge Ansatz. Trendfolge ist im Allgemeinen als simple & effektiv bekannt, aber die Trades weichen oft deutlich voneinander ab. Durch Systematisierung, wie man einen Trend handelt, will ich mit der Strategie von den starken Bewegungen im Bitcoin profitieren.

Die Idee ist einfach gesagt: Trendrichtung filtern -> Trendstärke erkennen -> Einstieg bei Rücksetzer -> Risikomanagement einhalten

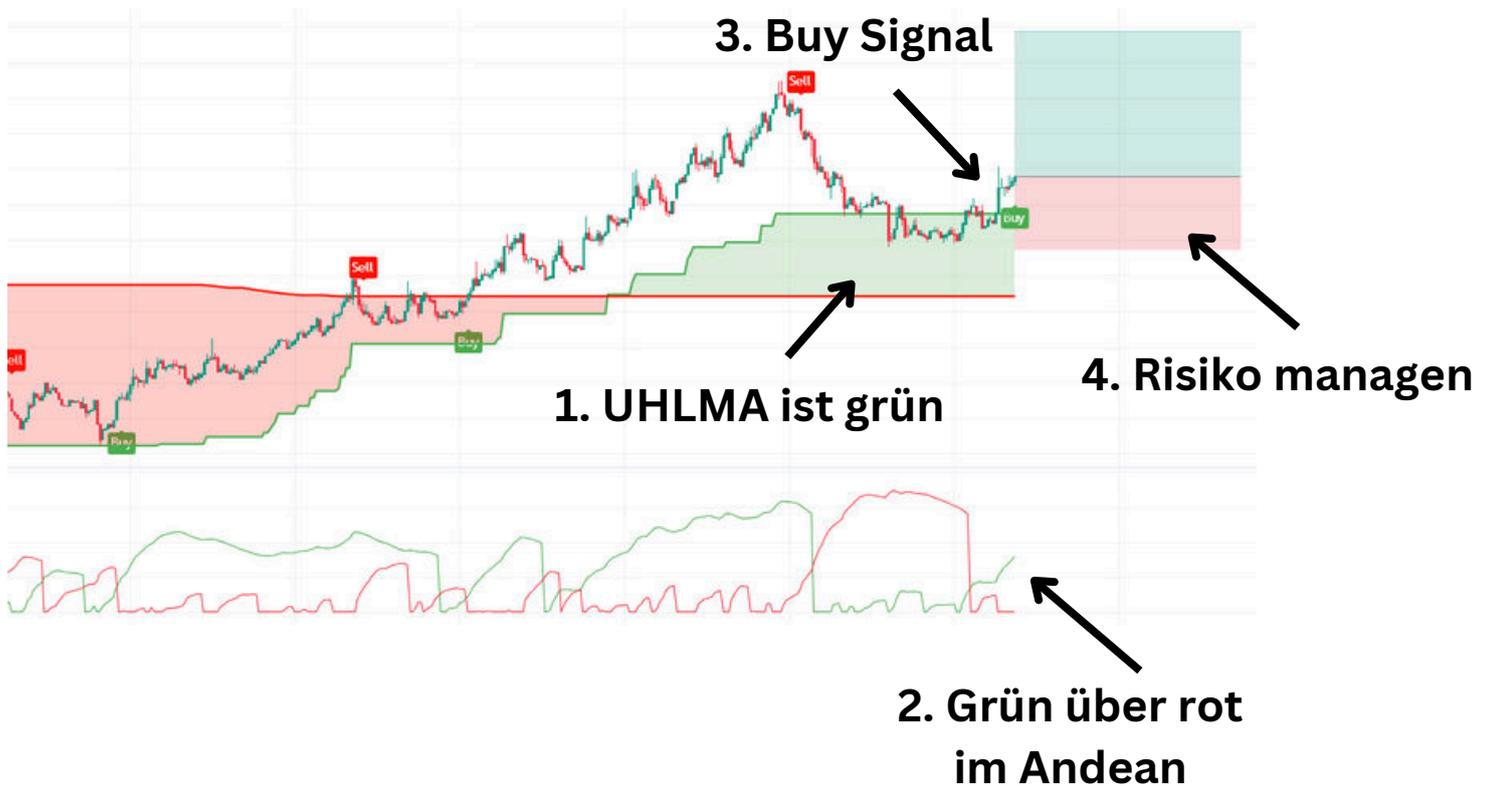
Trade Signal

Schritt 1: Ich möchte den Trend im Markt filtern. Dazu schaue ich einfach auf den UHLMA Indikator. Ist die Fläche grün gefärbt, so befindet sich der Kurs im Aufwärtstrend. Ist die Fläche rot, so ist der Kurs im Abwärtstrend.

Schritt 2: Kraft des Trends überprüfen. Dies geschieht mit dem Andean Oscillator. Ist der UHLMA grün und im Andean Oscillator ist die bullische Komponente über der bärischen, so ist der Trend stark.

Schritt 3: Finales Signal erhalten. Passt Schritt 1 und 2, dann wartet man nun geduldig auf den Grover Llorence Activator. Dieser gibt klare "Buy" und "Sell" Signale, welche durch kleine Fähnchen bzw. Labels im Chart erscheinen.

So sieht ein gutes Signal der Strategie aus:



Das Problem!

Die Strategie gibt relativ viele Signale, was für uns als Daytrader sehr gut ist... Mit vielen Signalen, kommen aber auch viele Fehlsignale. Über 2 einfache Wege kann man die Fehlsignale allerdings rausfiltern. Ich habe Dir das mal [genauer hier im TradeLab beschrieben](#).



Kapitel 5

Deine Zukunft

Langfristig führt ein Weg an solchen Fixed Entry Strategien NICHT vorbei!

So hilft Dir TradeLab

- ✓ Programm Codes für automatisierte Signale
- ✓ Optimierte Strategien für Berufstätige
- ✓ Prop-Trading Strategien
- ✓ 120+ Seiten e-Books

TradeLab
kaufen





HERAUSGEBER

Finanzradar.de
Apex Media Ventures S.R.L.
Calea TORONTALULUI, Nr. 69, CORP B, Etaj 6
300668 Timisoara, Rumänien
E-Mail: info@finanzradar.de
Telefon: +491789204232

Besuche unsere Website <https://www.finanzradar.de>

EU-Streitschlichtung

Die Europäische Kommission stellt eine Plattform zur Online-Streitbeilegung (OS) bereit: <https://ec.europa.eu/consumers/odr/>. Unsere E-Mail-Adresse finden Sie oben im Impressum.

Verbraucherstreitbeilegung/Universalschlichtungsstelle

Wir sind nicht bereit oder verpflichtet, an Streitbeilegungsverfahren vor einer Verbraucherschlichtungsstelle teilzunehmen.

URHEBERRECHT

Alle Rechte vorbehalten. Sämtliche Inhalte dieses Dokuments dürfen nur für private Zwecke genutzt werden, eine Weitergabe an Dritte ist grundsätzlich untersagt. Die Verwendung der Inhalte zu anderen als privaten Zwecken bedarf der vorherigen Zustimmung von Finanzradar.de