Trading-Plan

von

Max Mustermann

| **VERSION** | **DATUM** | **AUTOR** | **Grund** |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.0 | 1. März 2021 | M. Mustermann | Entwurf |
|  |  |  |  |

Inhalt

[1. Vision und Motivation 4](#_Toc31542209)

[1.1. Zielsetzung 4](#_Toc31542210)

[1.2. Motivation 4](#_Toc31542211)

[2. Wirtschaftlichkeitsanalyse 4](#_Toc31542212)

[2.1. Implizite und explizite Kosten 4](#_Toc31542213)

[2.2. Vorhersage mit Meilensteinen 4](#_Toc31542214)

[3. Trading-Ressourcen 5](#_Toc31542215)

[3.1. Geldkapital 5](#_Toc31542216)

[3.2. Intellektuelles Kapital 5](#_Toc31542217)

[3.2.1. Persönliche Stärken und Schwächen 5](#_Toc31542218)

[3.2.2. Methoden und Maßnahmen zur Selbstkontrolle 5](#_Toc31542219)

[3.3. Technische Ausrüstung und Tools 6](#_Toc31542220)

[4. Produktauswahl 6](#_Toc31542221)

[4.1. Liquidität 6](#_Toc31542222)

[4.2. Volatilität 6](#_Toc31542223)

[4.3. Tradingkosten 6](#_Toc31542224)

[5. Handelszeiten und -ort 6](#_Toc31542225)

[5.1. Handelszeiten 6](#_Toc31542226)

[5.2. Handelsort 7](#_Toc31542227)

[6. Trading-Prozess 7](#_Toc31542228)

[6.1. Tagesroutine 7](#_Toc31542229)

[6.2. Risikokontrolle 8](#_Toc31542230)

[6.2.1. Risiko pro Trade 8](#_Toc31542231)

[6.2.2. Gesamtrisiko-Limits 8](#_Toc31542232)

[6.3. Kapitaloptimierung 9](#_Toc31542233)

[6.3.1. Positionsgrößen 9](#_Toc31542234)

[7. Tradingstrategie und Umsetzung 11](#_Toc31542235)

[7.1. Allgemeine Trading-Strategie 11](#_Toc31542236)

[7.1.1. Wettbewerbsanalyse 11](#_Toc31542237)

[7.2. Einstiegs- und Ausstiegskriterien 11](#_Toc31542238)

[7.2.1. Einstieg 11](#_Toc31542239)

[7.2.2. Ausstieg 11](#_Toc31542240)

[7.3. Denkweise und Disziplin 12](#_Toc31542241)

[8. APPENDIX 13](#_Toc31542242)

[8.1. Glossar 13](#_Toc31542243)

# Vision und Motivation

## Zielsetzung

Mein Hauptziel ist als Trader eine Summe von EUR xxx zu verdienen, um meinen unabhängigen Lebensstil zu finanzieren bzw. um mein anderes Einkommen zu ergänzen. Durch die frei Wahl der Örtlichkeit kann ich meine Lebensunterhaltskosten entsprechend meiner Performance anpassen sowie steuerlich optimieren.

## Motivation

Mich als Trader weiterzuentwickeln eröffnet mir Möglichkeiten der Selbstverwirklichung, die mir sonst nicht offen stehen würden. Diese Motivation hilft mir dabei meinen Trading-Plan konsistent und diszipliniert umzusetzen.

# Wirtschaftlichkeitsanalyse

## Implizite und explizite Kosten

* Implizite Kosten:

Meine Opportunitätskosten für Trading betragen einen Zeitaufwand von 5 Stunden pro Handelstag. Bei einem Stundensatz von EUR xx beträgt das EUR pro Monat/Jahr.

* Explizite Kosten:

Meine Fix-Kosten für Marktdaten und Software sind

Monatlich Jährlich

Sierra Chart USD 60 USD 720

EUREX USD 21 USD 252

CME-Bundle USD 4 USD 48

Gesamt USD 85 USD 1020

Weitere Kosten für Büroraum, Computer, Monitore, Internet, Steuerberatung etc. betragen:

…

## Prognose mit Meilensteinen

* Jahr 1
* Jahr 2
* Jahr 3
* …

# Trading-Ressourcen

## Geldkapital

Mein verfügbares Risikokapital beträgt EUR xxxxx. Ich handle ausschließlich mit meinem eigenen/Fremdkapital.

## Intellektuelles Kapital

Ich vertraue in meine Fähigkeiten diesen Trading-Plan umzusetzen. Ich habe eine Methode, die es mir erlaubt risiko-optimierte Rendite zu liefern. Die Einzelheiten der Strategie sind in Abschnitt *7. Trading-Strategie und Umsetzung* detailliert.

Ich akzeptiere, dass ich die Zukunft nicht vorhersehen und die Finanzmärkte nicht kontrollieren kann. Gleichwohl bin ich in der Lage bzw. arbeite kontinuierlich daran meine Emotionen zu kontrollieren und verpflichte mich diesen spezifischen und detaillierten Trading-Plan gewissenhaft umzusetzen.

## Persönliche Stärken und Schwächen

Subjektive Selbstwahrnehmung von Erfahrung, Fähigkeiten, etc. und objektive Beurteilung durch Persönlichkeitstest.

* Meine Stärken sind…
* Meine Schwächen sind…

Ich werde folgendes unternehmen, um an meinen Schwächen zu arbeiten bzw. folgende Hilfsmittel verwenden, um diese zu kompensieren:

…

## Methoden und Maßnahmen zur Selbstkontrolle

…

## Technische Ausrüstung und Tools

Der Broker meiner Wahl ist XYZ weil…

Der Marktdatenanbieter meiner Wahl ist… weil…

Die Handelssoftware meiner Wahl ist… weil…

Ich verwende eine mobile Handelsplattform XYZ, um Positionen im Falle von technischen Störungen oder Problemen mit der Internetverbindung sofort glattzustellen.

# Produktauswahl

## Liquidität

## Volatilität

## Trading-Kosten

# Handelszeiten und -ort

## Handelszeiten

Definiere die Handelszeiten für jedes Produkt:

* Ich handle EUREX-Kontrakte von 8:00 bis 17:00 MEZ. Ich schließe offene Positionen vor dem Handelsbeginn der US-Session und eröffne keine neuen Positionen vor 15:45 MEZ, um die Handelsspanne nach der US-Eröffnung in meine Entscheidungen einfließen zu lassen.

Kontrakte die ich während der EU-Session handle (8:00-18:00 MEZ):

* EURO Bund, Mini-Dax, WTI Rohöl, EUR/USD, E-mini NASDAQ 100 Index

Kontrakte die ich während der US-Session handle (15:45-22:00 MEZ):

* E-mini S&P 500 Index, E-mini NASDAQ 100 Index, WTI Crude Oil

Wirtschaftsnachrichten:

* Ich schließe offene Positionen vor der Veröffentlichung von Nachrichten, die auf www.econoday.com als marktbewegend designiert sind (“Market Moving Indicator”). Ich eröffne keine neuen Positionen bis die Volatilität und Liquidität im Orderbuch auf ein Niveau innerhalb meiner Risikoparameter zurückkehrt.

Weiterhin, handle ich nur an Tagen an denen ich erholt und entspannt bin und/oder nicht durch Familie oder Freunde abgelenkt werde. Der Trading-Plan ist der Leitfaden für meine Trading-Entscheidungen und ich werde mich strikt daran halten. Der Zweck des Trading-Plans s ist mich vor Trades zu bewahren, die nicht meinen in diesem Trading-Plan festgelegten Kriterien entsprechen.

Insbesondere werde ich an Tagen an denen ich mich krank fühle, verkatert bin oder anderweitig von externen Einflüssen abgelenkt werde nicht handeln.

## Handelsort

Beschreibe deine Handelsumgebung und wie du dich vor externen schützt. Dies kann ein privates Home-Office, ein öffentliches Shared-Office bzw. ein Handelsbüro sein. Beschreib was du im Laufe deiner Trader-Entwicklung verändern bzw. verbessern würdest.

Trading im öffentlichen Raum kannst du für dich einschränken, indem du mobile Handelsplattformen z. B. nur zum Glattstellen von offenen Positionen oder im „Notfall“ verwendest.

# Trading-Prozess

## Tagesroutine

* + 1. **Tagesroutine vor Handelsbeginn:**
* Aufstehen um x:00 Uhr, Spaziergang/Joggen/Fitnessstudio und gesundes Frühstück
* Analyse des Vortages und Nachbetrachtung der gestrigen Trades (Trading Log)
* Bewertung von Marktbewegung/Volatilität relevanter Märkte in der Asien-Session.
* Überblick über marktbewegende Nachrichten auf econoday.com und talkingforex.com, etc.
  + 1. **Tagesroutine nach Handelsschluss:**

Überprüfung ob alle Trades gemäß dem Trading-Plan ausgeführt wurden. Wenn nicht, dann prüfen ob Fehler im Plan vorliegen oder Disziplinlosigkeit der Grund war und entsprechende Maßnahmen gemäß *Abschnitt 7.3* ergreifen.

## Risikokontrolle

Die Vermeidung des Totalverlusts von Trading-Kapital steht hier im Vordergrund. Risikolimits pro Trade und Zeiteinheit dienen zur Umsetzung.

### Risiko pro Trade

Für jeden Trade den ich eingehe riskiere ich nicht mehr als x% (oder EURxxx) meines Eigenkapitals. Meine Stopps setze ich basierend auf…

### Gesamtrisiko-Limits

Mein Tagesverlustlimit ist x% meines Eigenkapitals bzw. EUR xxx, das Wochenverlustlimit beträgt …

## Kapitaloptimierung

Das Ziel von Money Management ist die Risiko-optimierte Maximierung des Kontowachstums.

Gemäß der Kelly-Formel werde ich mein Risiko der tatsächlichen Performance meiner Strategie anpassen. Das Risiko pro Trade kann nur erhöht werden wenn sich der Erwartungswert über eine ausreichend große Anzahl von xxx Trades signifikant erhöht. Der Ausgangswert des Risikos pro Trade beträgt x% des verfügbaren Risikokapitals.

Um monatliche Kosten zu decken, ziehe ich xx% des Nettogewinns von meinen Handelskonto ab insofern diese Summe EUR xxx im jeweiligen Monat oder einem der Folgemonate übersteigt. Insofern mein Handelskapital eine Summe übersteigt, die ich für meine Strategie benötige werde ich diesen Überschuss Daytrading-Handelskonto abziehen und anderen langfristigen Investments zuteilen.

### Positionsgrößen

Die Einstiegsgröße für jeden beträgt …

Die maximale Gesamtposition beträgt ... Die Positionsgrößen werde ich gemäß Abschnitt 8.2. in regelmäßigen Abständen anpassen und jede Änderung wird in diesem Trading-Plan festgehalten.

# Trading-Strategie und Umsetzung

## Allgemeine Trading-Strategie

### Wettbewerbsanalyse

Mein allgemeiner Handelsansatz basiert auf den Erkenntnissen der Marktstrukturanalyse aus dem CEED.accelerator Kursmodul.

Konkret heißt das…

## Einstiegs- und Ausstiegskriterien

### Einstieg

Für den Einstieg in eine Position verwende ich folgende Kriterien:

…

### Ausstieg

Negative Trades:

Ich werde negative Trades entweder mit einem festen Stopp-Loss oder falls die Kriterien für den Einstieg negiert wurden glattstellen.

…

Positive Trades:

Als Profitziel für einen Trade verwende ich folgende Anhaltspunkte, um mein Chance-Risiko-Verhältnis zu maximieren.

…

## Denkweise und Disziplin

Nach einem positiven Trade werde ich sicherstellen, dass ich nicht überheblich werde und meine Einstellung konstant bleibt. Weiterhin prüfe ich nochmals ob ich nach besten Wissen und Gewissen und gemäß dem Trading-Plan gehandelt habe. Dem Trading-Prozess treu zu bleiben ist wichtiger als das Ergebnis eines einzelnen Trades.

Das gleiche gilt für einen negativen Trade. Weiterhin werde ich in diesem Fall sicherstellen, dass ich ruhig und entspannt bleibe. Sollte ich einen Gemütszustand feststellen, der zu impulsiven Handlungen führen könnte, stehe ich auf und verlasse den Raum bzw. das Haus bis ich mich beruhigt habe. Danach kann ich dem Markt wieder emotionslos und mit einer professionellen Einstellung gegenüber treten.

Die folgenden Punkte regeln die Maßnahmen nach etwaiger Disziplinlosigkeit:

1. Wenn ich **1** Regel in meinem Trading-Plan verletze, setze ich **1 vollen Handelstag** aus und analysiere den Grund für diesen Regelbruch.
2. Wenn ich **2** Regeln in meinem Trading-Plan verletze, setze ich **2 volle Handelstage** aus und analysiere den Grund bzw. die Gründe für den jeweiligen Regelbruch.
3. Wenn ich **3** Regeln in meinem Trading-Plan verletze, setze ich das Trading bis auf weiteres - aber **nicht weniger als 1 volle Handelswoche** - aus, bis ich die Gründe für die anhaltende Verletzung meiner Regeln ausgeräumt habe.

Ich verpflichte mich hiermit diesen Trading-Plan im vollen Umfang und mit höchster Gewissenhaftigkeit umzusetzen.

Datum, Ort Unterschrift